# 长盛盛琪一年期定期开放债券型证券投资基金
# 2026 年中期报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：长盛基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2026 年 8 月 29 日

# §1 重要提示及目录

## 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 08 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

**§1 重要提示及目录 ..... 2**

1.1 重要提示 ..... 2
1.2 目录 ..... 3

**§2 基金简介 ..... 5**

2.1 基金基本情况 ..... 5
2.2 基金产品说明 ..... 5
2.3 基金管理人和基金托管人 ..... 5
2.4 信息披露方式 ..... 6
2.5 其他相关资料 ..... 6

**§3 主要财务指标和基金净值表现 ..... 6**

3.1 主要会计数据和财务指标 ..... 6
3.2 基金净值表现 ..... 7

**§4 管理人报告 ..... 9**

4.1 基金管理人及基金经理情况 ..... 9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 ..... 10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 ..... 10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 ..... 11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 ..... 12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 ..... 12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 ..... 12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 ..... 13

**§5 托管人报告 ..... 13**

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 ..... 13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 ..... 13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 ..... 13

**§6 半年度财务会计报告（未经审计） ..... 13**

6.1 资产负债表 ..... 13
6.2 利润表 ..... 15
6.3 净资产变动表 ..... 16
6.4 报表附注 ..... 17

**§7 投资组合报告 ..... 35**

7.1 期末基金资产组合情况 ..... 35
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 ..... 35
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 ..... 35
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 ..... 35
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 ..... 36
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 ..... 36

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 ..... 36
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 ..... 36
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 ..... 36
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 ..... 36
7.11 投资组合报告附注 ..... 36

**§8 基金份额持有人信息 ..... 37**

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 ..... 37
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 ..... 38
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 ..... 38

**§9 开放式基金份额变动 ..... 38**

**§10 重大事件揭示 ..... 39**

10.1 基金份额持有人大会决议 ..... 39
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 ..... 39
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 ..... 39
10.4 基金投资策略的改变 ..... 39
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 ..... 39
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 ..... 39
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况 ..... 40
10.8 其他重大事件 ..... 41

**§11 影响投资者决策的其他重要信息 ..... 42**

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 ..... 42
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 ..... 42

**§12 备查文件目录 ..... 42**

12.1 备查文件目录 ..... 42
12.2 存放地点 ..... 42
12.3 查阅方式 ..... 42

# §2 基金简介

## 2.1 基金基本情况

| | | |
|---|---|---|
| 基金名称 | 长盛盛琪一年期定期开放债券型证券投资基金 | |
| 基金简称 | 长盛盛琪一年债券 | |
| 基金主代码 | 003199 | |
| 基金运作方式 | 契约型定期开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2016 年 9 月 27 日 | |
| 基金管理人 | 长盛基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 中国银行股份有限公司 | |
| 报告期末基金份额总额 | 60,132,149.24 份 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 长盛盛琪一年债券 A | 长盛盛琪一年债券 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 003199 | 003200 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 59,787,333.25 份 | 344,815.99 份 |

## 2.2 基金产品说明

| | |
|---|---|
| 投资目标 | 本基金在控制风险和保持资产流动性的基础上，积极主动调整投资组合，追求基金资产的长期稳定增值，并力争获得超过业绩比较基准的投资业绩。 |
| 投资策略 | 本基金主要投资于固定收益类金融工具，不直接买入股票、权证等权益类金融工具。本基金封闭期的投资组合久期与封闭期剩余期限进行适当匹配。本基金的投资策略包括：<br>（一）大类资产配置策略：本基金将在综合判断宏观经济周期、市场资金供需状况、大类资产估值水平对比的基础上，结合政策分析，确定不同投资期限内的大类金融资产配置和债券类属配置。<br>（二）债券组合管理策略：本基金的债券组合策略包括：利率策略、类属配置策略、信用策略、相对价值策略、债券选择策略、中小企业私募债投资策略、资产支持证券等品种投资策略。<br>（三）期限管理策略：由于本基金封闭期为一年，基金规模相对稳定，但在开放期内本基金规模的不确定性增强。本基金将采用期限管理策略，分散化投资于不同剩余期限标的，临近开放期时，在最大限度保证收益的同时将组合剩余期限降低，保证开放期内具备足够流动性应对可能发生的组合规模变化。 |
| 业绩比较基准 | 中债综合指数（全价）收益率 |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金，属证券投资基金中的较低风险品种，其长期平均预期风险和预期收益率低于股票型基金和混合型基金，高于货币市场基金。 |

## 2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目 | 基金管理人 | 基金托管人 |
|---|---|---|

| 名称 | | 长盛基金管理有限公司 | 中国银行股份有限公司 |
|---|---|---|---|
| 信息披露负责人 | 姓名 | 张利宁 | 许俊 |
| | 联系电话 | 010-86497608 | 010-66596688 |
| | 电子邮箱 | zhangln@csfunds.com.cn | fxjd_hq@bank-of-china.com |
| 客户服务电话 | | 400-888-2666、010-86497888 | 95566 |
| 传真 | | 010-86497999 | 010-66594942 |
| 注册地址 | | 深圳市福田中心区福中三路诺德金融中心主楼 10D | 北京市西城区复兴门内大街 1 号 |
| 办公地址 | | 北京市朝阳区安定路 5 号院 3 号楼中建财富国际中心 3-5 层 | 北京市西城区复兴门内大街 1 号 |
| 邮政编码 | | 100029 | 100818 |
| 法定代表人 | | 胡甲 | 葛海蛟 |

## 2.4 信息披露方式

| | |
|---|---|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 《上海证券报》 |
| 登载基金中期报告的管理人互联网网址 | http://www.csfunds.com.cn |
| 基金中期报告置备地点 | 基金管理人的办公地址及基金托管人住所 |

## 2.5 其他相关资料

| 项目 | 名称 | 办公地址 |
|---|---|---|
| 注册登记机构 | 长盛基金管理有限公司 | 北京市朝阳区安定路 5 号院 3 号楼中建财富国际中心 3-5 层 |

# §3 主要财务指标和基金净值表现

## 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2026 年 1 月 1 日-2026 年 6 月 30 日) | |
|---|---|---|
| | 长盛盛琪一年债券 A | 长盛盛琪一年债券 C |
| 本期已实现收益 | 6,644,010.26 | 4,884.59 |
| 本期利润 | 4,796,892.78 | 5,442.97 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0159 | 0.0157 |
| 本期加权平均净值利润率 | 1.52% | 1.50% |
| 本期基金份额净值增长率 | 1.69% | 1.51% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2026 年 6 月 30 日) | |

| | | |
|---|---|---|
| 期末可供分配利润 | 2,118,259.07 | 12,527.73 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0354 | 0.0363 |
| 期末基金资产净值 | 62,337,132.95 | 359,811.21 |
| 期末基金份额净值 | 1.0426 | 1.0435 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2026 年 6 月 30 日) | |
| 基金份额累计净值增长率 | 33.57% | 29.62% |

注：1、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。表中的“期末”均指本报告期最后一日，即 6 月 30 日。

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

长盛盛琪一年债券 A

| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①－③ | ②－④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | 0.82% | 0.05% | 0.62% | 0.04% | 0.20% | 0.01% |
| 过去六个月 | 1.69% | 0.04% | 0.91% | 0.04% | 0.78% | 0.00% |
| 过去一年 | 2.19% | 0.03% | -0.56% | 0.06% | 2.75% | -0.03% |
| 过去三年 | 10.44% | 0.04% | 5.12% | 0.08% | 5.32% | -0.04% |
| 过去五年 | 19.60% | 0.05% | 8.48% | 0.07% | 11.12% | -0.02% |
| 过去七年 | 26.50% | 0.05% | 10.29% | 0.07% | 16.21% | -0.02% |
| 自基金合同生效起至今 | 33.57% | 0.08% | 9.36% | 0.07% | 24.21% | 0.01% |

长盛盛琪一年债券 C

| 阶段 | 份额净值增长 | 份额净值增长率标 | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差 | ①－③ | ②－④ |
|---|---|---|---|---|---|---|

| | 率① | 准差② | | ④ | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | 0.75% | 0.05% | 0.62% | 0.04% | 0.13% | 0.01% |
| 过去六个月 | 1.51% | 0.04% | 0.91% | 0.04% | 0.60% | 0.00% |
| 过去一年 | 1.85% | 0.03% | -0.56% | 0.06% | 2.41% | -0.03% |
| 过去三年 | 9.42% | 0.04% | 5.12% | 0.08% | 4.30% | -0.04% |
| 过去五年 | 17.76% | 0.05% | 8.48% | 0.07% | 9.28% | -0.02% |
| 过去七年 | 23.80% | 0.05% | 10.29% | 0.07% | 13.51% | -0.02% |
| 自基金合同生效起至今 | 29.62% | 0.08% | 9.36% | 0.07% | 20.26% | 0.01% |

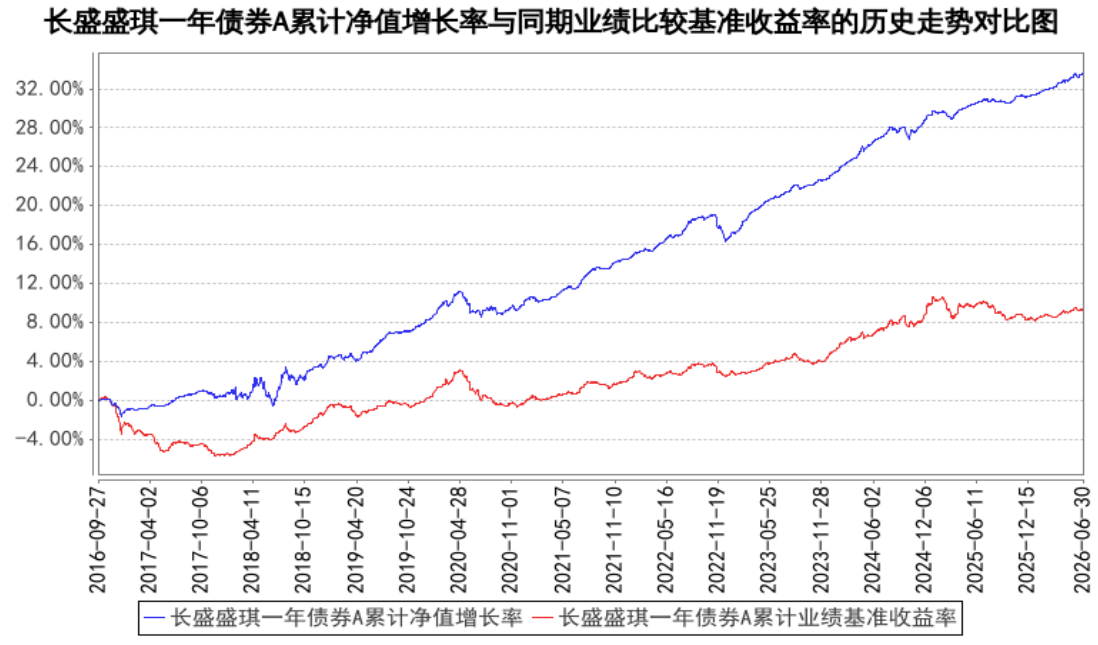
注：本基金业绩比较基准的构建：

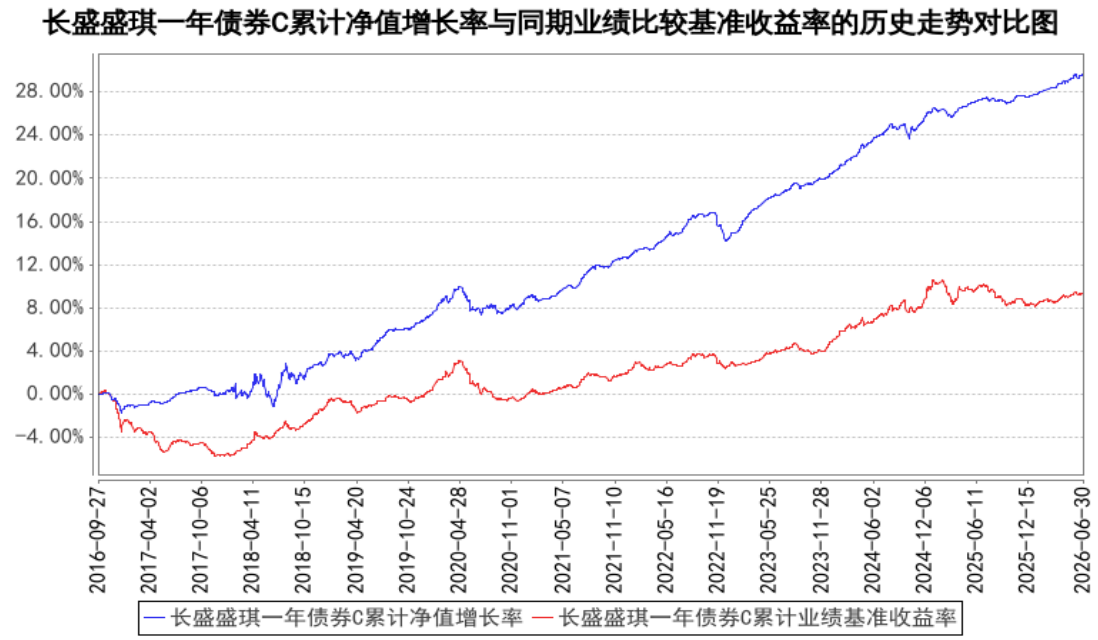
本基金业绩比较基准为中债综合指数（全价）收益率

中债综合指数（全价）由中央国债登记结算有限责任公司编制并发布，该指数样本具有广泛的市场代表性，涵盖了主要交易市场（银行间市场、交易所市场等）、不同发行主体（政府、企业等）和期限（长期、中期、短期等）。

本基金为债券型基金，投资范围为固定收益类金融工具，且本基金不直接从二级市场买入股票、权证等权益类资产，也不参与一级市场新股申购和新股增发，可转换债券仅投资可分离交易可转债的纯债部分。鉴于中债综合指数(全价)能够反映债券全市场的整体价格和投资回报情况，所以以其收益率作为本基金的业绩比较基准。

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较






注：1、按照本基金合同规定，本基金基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。本报告期末，本基金的各项资产配置比例符合基金合同的约定。

2、本基金投资于债券的比例不低于基金资产的 80%，但在每次开放期前一个月、开放期及开放期结束后一个月的期间内，基金投资不受上述比例限制。在开放期，本基金扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%，在封闭期，本基金不受该比例的限制。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，其投资比例遵循届时有效法律法规或相关规定。

# §4 管理人报告

## 4.1 基金管理人及基金经理情况

### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为长盛基金管理有限公司（以下简称公司），成立于 1999 年 3 月 26 日，是国内首批成立的十家基金管理公司之一，公司注册资本为人民币 2.06 亿元。长盛基金注册地为深圳，总部办公地位于北京，在北京、上海、成都等地设有分支机构，拥有全资子公司长盛基金（香港）有限公司和长盛创富资产管理有限公司。目前，公司股东及其出资比例为：国元证券股份有限公司占注册资本的 41%，新加坡星展银行有限公司（DBS Bank Ltd.）占注册资本的 33%，安徽省信用融资担保集团有限公司占注册资本的 13%，安徽省投资集团控股有限公司占注册资本的 13%。公司拥有公募基金、全国社保基金、特定客户资产管理、合格境内机构投资者（QDII）、合格境外机构投资者（QFII）、保险资产管理人等业务资格，同时可担任私募资产管理计划和境外 QFII 基

金的投资顾问。截至 2026 年 6 月 30 日，基金管理人共管理七十八只开放式基金，并管理多个全国社保基金组合和私募资产管理计划。

### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理（助理）期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 王赛飞 | 本基金基金经理，长盛添利宝货币市场基金基金经理，长盛盛华一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理，长盛元增利货币市场基金基金经理。 | 2021 年 11 月 2 日 | - | 14 年 | 王赛飞女士，硕士。曾任大公国际资信评估有限公司分析师、信用评审委员会委员。2015 年 7 月加入长盛基金管理有限公司，曾任信用研究员、基金经理助理等职务。 |
| 李琪 | 本基金基金经理，长盛盛辉混合型证券投资基金基金经理，长盛盛启债券型证券投资基金基金经理，长盛盛华一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理，长盛元赢六个月定期开放债券型证券投资基金基金经理，长盛元赢 30 天持有期债券型证券投资基金基金经理。 | 2025 年 11 月 21 日 | - | 21 年 | 李琪先生，博士。曾任大公国际资信评估有限公司信用分析师、信用评审委员会委员，泰康资产管理有限责任公司信用研究员。2011 年 3 月加入长盛基金管理有限公司，历任信用研究员、基金经理助理等职务。 |

注：1、上表基金经理的任职日期和离任日期均指公司决定确定的聘任日期和解聘日期；

2、“证券从业年限”中“证券从业”的含义遵从《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本基金本报告期内无基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其各项实施准则、本基金基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司严格执行《公司公平交易细则》各项规定，在研究、投资授权与决策、交易

执行等各个环节，公平对待旗下所有投资组合，包括公募基金、社保组合、私募资产管理计划等。具体如下：

研究支持，公司旗下所有投资组合共享公司研究部门研究成果，所有投资组合经理在公司研究平台上拥有同等权限。

投资授权与决策，公司实行投资决策委员会领导下的投资组合经理负责制，各投资组合经理在投资决策委员会的授权范围内，独立完成投资组合的管理工作。各投资组合经理遵守投资信息隔离墙制度。

交易执行，公司实行集中交易制度，所有投资组合的投资指令均由交易部统一执行委托交易。交易部依照《公司公平交易细则》的规定，场内交易，强制开启恒生交易系统公平交易程序；场外交易，严格遵守相关工作流程，保证交易执行的公平性。

投资管理行为的监控与分析评估，公司风险管理部、监察稽核部，依照《公司公平交易细则》的规定，持续、动态监督公司投资管理全过程，并进行分析评估，及时向公司管理层报告发现问题，保障公司旗下所有投资组合均被公平对待。

公司对过去 4 个季度的同向交易行为进行数量分析，计算溢价率、贡献率、占优比等指标，使用双边 90%置信水平对 1 日、3 日、5 日的交易片段进行 T 检验，未发现违反公平交易及利益输送的行为。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，未发现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的交易。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年，债市表现偏强。1 月上旬，权益和商品表现亮眼，叠加超长债供给担忧，长端利率走升，10 年期国债收益率由 1.84%上行 6bp 至 1.90%的上半年高点。1 月中旬至 2 月底，供需担忧逐步缓解，长端利率逐步回落，10 年期国债收益率下行至 1.77%的一季度低点。进入 3 月，美伊冲突引发通胀担忧，长端利率承压上行。4 月以来，美伊地缘冲突缓和，国内基本面走弱，通胀担忧缓解，流动性持续宽松，多重利好因素推动下债市走强，10 年国债收益率于 6 月 1 日触及 1.70%的上半年新低。之后，资金面持续收敛，资金利率中枢上移，债市随之震荡调整。

报告期内，本基金坚持稳健操作，根据基本面和政策、市场形势变化以及基金规模变动调整信用债和利率债等品种的配置比例，组合久期保持中性水平，寻求在控制回撤的基础上提升组合

收益。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末长盛盛琪一年债券 A 的基金份额净值为 1.0426 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.69%，同期业绩比较基准收益率为 0.91%；截至本报告期末长盛盛琪一年债券 C 的基金份额净值为 1.0435 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.51%，同期业绩比较基准收益率为 0.91%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我国经济将延续“动能向新、结构向优”的发展态势，外需保持韧性，内需温和修复。新旧动能转换持续推进，逆周期调节力度有望加大。央行将保持货币政策适度宽松，综合运用并适时调整货币政策工具，利率型工具相机抉择，结构性工具有望进一步扩容和优化，流动性维持合理充裕。对债市而言，基本面和政策面环境总体友好，债市表现有望获得支撑。

## 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照《企业会计准则》、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持投资品种进行估值。

本基金管理人设有估值工作小组，负责制定、评估、复核和修订基金估值程序和技术，适时更新估值相关制度，指导并监督各类投资品种的估值程序，评估会计政策变更的影响，对证券投资基金估值方法进行最终决策等。估值工作小组由总经理担任组长，督察长担任副组长，小组成员均具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备投资、研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

参与估值流程的各方还包括本基金托管人和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任，当存有异议时，托管人有责任要求基金管理公司作出合理解释，通过积极商讨达成一致意见。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已分别与中债金融估值中心有限公司和中证指数有限公司签署服务协议，由中债金融估值中心有限公司按约定提供银行间同业市场的估值数据和流通受限股票的折扣率数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据。

## 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内，本基金实施了利润分配，符合法律法规和基金合同的相关约定。具体参见本报告“6.4.11 利润分配情况”。

### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内不存在连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

## §5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在长盛盛琪一年期定期开放债券型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责的履行了应尽的义务。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真的复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“ 关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等财务数据真实、准确和完整。

## §6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：长盛盛琪一年期定期开放债券型证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资 产 | 附注号 | 本期末<br>2026 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2025 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|---|
| **资 产：** | | | |
| 货币资金 | 6.4.7.1 | 8,686,717.66 | 330,501.82 |
| 结算备付金 | | 52,226.81 | - |
| 存出保证金 | | 11,524.08 | 3,449.74 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 54,060,753.42 | 750,565,425.81 |
| 其中：股票投资 | | - | - |
| 基金投资 | | - | - |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 债券投资 | | 54,060,753.42 | 676,037,304.13 |
| 资产支持证券投资 | | - | 74,528,121.68 |
| 贵金属投资 | | - | - |
| 其他投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | 6.4.7.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 6.4.7.4 | - | - |
| 债权投资 | 6.4.7.5 | - | - |
| 其中：债券投资 | | - | - |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 其他投资 | | - | - |
| 其他债权投资 | 6.4.7.6 | - | - |
| 其他权益工具投资 | 6.4.7.7 | - | - |
| 应收清算款 | | - | - |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | - | - |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.8 | - | - |
| 资产总计 | | 62,811,221.97 | 750,899,377.37 |
| **负债和净资产** | **附注号** | **本期末<br>2026 年 6 月 30 日** | **上年度末<br>2025 年 12 月 31 日** |
| **负 债：** | | | |
| 短期借款 | | - | - |
| 交易性金融负债 | | - | - |
| 衍生金融负债 | 6.4.7.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | - | 123,993,610.32 |
| 应付清算款 | | - | - |
| 应付赎回款 | | - | - |
| 应付管理人报酬 | | 15,573.66 | 159,706.07 |
| 应付托管费 | | 5,191.22 | 53,235.37 |
| 应付销售服务费 | | 88.87 | 93.00 |
| 应付投资顾问费 | | - | - |
| 应交税费 | | - | 57,026.90 |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.9 | 93,424.06 | 186,534.66 |
| 负债合计 | | 114,277.81 | 124,450,206.32 |
| **净资产：** | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.10 | 60,132,149.24 | 598,185,532.26 |
| 其他综合收益 | 6.4.7.11 | - | - |
| 未分配利润 | 6.4.7.12 | 2,564,794.92 | 28,263,638.79 |
| 净资产合计 | | 62,696,944.16 | 626,449,171.05 |
| 负债和净资产总计 | | 62,811,221.97 | 750,899,377.37 |

注： 报告截止日 2026 年 06 月 30 日，长盛盛琪一年债券 A 的基金份额净值为 1.0426 元，份额总

额为 59,787,333.25 份;长盛盛琪一年债券 C 的基金份额净值为 1.0435 元,份额总额为 344,815.99 份。基金份额总额 60,132,149.24 份。

## 6.2 利润表

会计主体：长盛盛琪一年期定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项 目 | 附注号 | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |
|---|---|---|---|
| **一、营业总收入** | | 5,706,583.87 | 8,935,483.57 |
| 1.利息收入 | | 162,773.24 | 8,243.29 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.13 | 64,191.67 | 2,249.65 |
| 债券利息收入 | | - | - |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 98,581.57 | 5,993.64 |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | 7,390,369.73 | 14,199,798.00 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.14 | - | - |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.15 | 6,800,562.41 | 13,052,132.86 |
| 资产支持证券投资收益 | 6.4.7.16 | 589,807.32 | 1,147,665.14 |
| 贵金属投资收益 | 6.4.7.17 | - | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.18 | - | - |
| 股利收益 | 6.4.7.19 | - | - |
| 其他投资收益 | | - | - |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.20 | -1,846,559.10 | -5,272,557.72 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - | - |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | 6.4.7.21 | - | - |
| **减：二、营业总支出** | | 904,248.12 | 2,724,746.81 |
| 1．管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 484,007.96 | 943,851.27 |
| 2．托管费 | 6.4.10.2.2 | 161,335.98 | 314,617.02 |
| 3．销售服务费 | 6.4.10.2.3 | 539.49 | 641.66 |
| 4．投资顾问费 | | - | - |
| 5．利息支出 | | 141,620.29 | 1,321,103.08 |
| 其中：卖出回购金融资产 | | 141,620.29 | 1,321,103.08 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 支出 | | | |
| 6．信用减值损失 | 6.4.7.22 | - | - |
| 7．税金及附加 | | 11,061.72 | 37,772.53 |
| 8．其他费用 | 6.4.7.23 | 105,682.68 | 106,761.25 |
| **三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）** | | 4,802,335.75 | 6,210,736.76 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| **四、净利润（净亏损以“-”号填列）** | | 4,802,335.75 | 6,210,736.76 |
| **五、其他综合收益的税后净额** | | - | - |
| **六、综合收益总额** | | 4,802,335.75 | 6,210,736.76 |

## 6.3 净资产变动表

会计主体：长盛盛琪一年期定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 | | |
|---|---|---|---|
| | 实收基金 | 未分配利润 | 净资产合计 |
| 一、上期期末净资产 | 598,185,532.26 | 28,263,638.79 | 626,449,171.05 |
| 二、本期期初净资产 | 598,185,532.26 | 28,263,638.79 | 626,449,171.05 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | -538,053,383.02 | -25,698,843.87 | -563,752,226.89 |
| （一）、综合收益总额 | - | 4,802,335.75 | 4,802,335.75 |
| （二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列） | -538,053,383.02 | -25,127,130.57 | -563,180,513.59 |
| 其中：1.基金申购款 | 81,945.20 | 3,797.24 | 85,742.44 |
| 2.基金赎回款 | -538,135,328.22 | -25,130,927.81 | -563,266,256.03 |
| （三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列） | - | -5,374,049.05 | -5,374,049.05 |
| 四、本期期末净资产 | 60,132,149.24 | 2,564,794.92 | 62,696,944.16 |
| 项目 | 上年度可比期间 | | |

| | 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 | | |
|---|---|---|---|
| | 实收基金 | 未分配利润 | 净资产合计 |
| 一、上期期末净资产 | 601,987,297.44 | 36,304,686.75 | 638,291,984.19 |
| 二、本期期初净资产 | 601,987,297.44 | 36,304,686.75 | 638,291,984.19 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | -3,802,874.17 | -4,414,045.47 | -8,216,919.64 |
| （一）、综合收益总额 | - | 6,210,736.76 | 6,210,736.76 |
| （二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列） | -3,802,874.17 | -185,108.23 | -3,987,982.40 |
| 其中：1.基金申购款 | 39,805.56 | 1,942.28 | 41,747.84 |
| 2.基金赎回款 | -3,842,679.73 | -187,050.51 | -4,029,730.24 |
| （三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列） | - | -10,439,674.00 | -10,439,674.00 |
| 四、本期期末净资产 | 598,184,423.27 | 31,890,641.28 | 630,075,064.55 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

| 胡甲 | 张壬午 | 龚珉 |
|---|---|---|
| 基金管理人负责人 | 主管会计工作负责人 | 会计机构负责人 |

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

长盛盛琪一年期定期开放债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2016]1560 号《关于准予长盛盛琪一年期定期开放债券型证券投资基金注册的批复》注册，由长盛基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《长盛盛琪一年期定期开放债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 2,203,702,306.50 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2016)第 1240 号验资报告予以

验证。经向中国证监会备案，《长盛盛琪一年期定期开放债券型证券投资基金基金合同》于 2016 年 9 月 27 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 2,204,781,151.29 份基金份额，其中认购资金利息折合 1,078,844.79 份基金份额。本基金的基金管理人为长盛基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

本基金为定期开放式基金，自基金合同生效之日(含)起或自每一开放期结束之日次日(含)起一年的期间封闭运作。自封闭期结束之后第一个工作日(含)起进入 5 至 20 个工作日的开放期，开放期的具体时间以基金管理人届时公告为准。本基金封闭期内不办理申购与赎回业务，也不上市交易。

根据《长盛盛琪一年期定期开放债券型证券投资基金基金合同》和《长盛盛琪一年期定期开放债券型证券投资基金招募说明书》，本基金根据认购费用、申购费用与销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购、申购基金时收取认购费、申购费，不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 A 类基金份额；不收取认购费、申购费，而是从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 C 类基金份额。A 类基金份额与 C 类基金份额分别设置基金代码，并且由于基金费用的不同，分别计算和公告基金份额净值。投资人可自由选择申购某一类别的基金份额，但各类别基金份额之间不能相互转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《长盛盛琪一年期定期开放债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为固定收益类金融工具，包括国内依法发行上市的国债、央行票据、地方政府债、金融债、公司债、企业债、同业存单、可转换债券(含可分离交易可转债)、债券回购、次级债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可交换债券、资产支持证券、中小企业私募债、银行存款、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他固定收益类金融工具。本基金不直接从二级市场买入股票、权证等权益类资产，也不参与一级市场新股申购和新股增发。本基金投资于债券的比例不低于基金资产的 80%，但在每次开放期前一个月、开放期及开放期结束后一个月的期间内，基金投资不受上述比例限制。在开放期，本基金扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等，在封闭期，本基金不受该比例的限制。本基金的业绩比较基准为中债综合指数(全价)收益率。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则－基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）发布的《公开募集证券

投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》《证券投资基金会计核算业务指引》《长盛盛琪一年期定期开放债券型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日止期间的财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2026 年 6 月 30 日的财务状况以及 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无须说明的会计差错更正。

### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财政部、国家税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、国务院令第 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》、财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号《财政部　税务总局关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。2027 年 12 月 31 日前，资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中

发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

2027 年 12 月 31 日前，对证券投资基金管理人运用基金资产买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对除持有金融债券外的金融同业往来利息收入亦免征增值税。自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后(含当日)新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券(包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分)的利息收入，免征增值税直至债券到期。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2)对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

(4)基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

(5)本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2026 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 活期存款 | 8,686,717.66 |
| 等于：本金 | 8,685,940.39 |
| 加：应计利息 | 777.27 |
| 减：坏账准备 | - |
| 定期存款 | - |
| 等于：本金 | - |

| | |
|---|---|
| 加：应计利息 | - |
| 减：坏账准备 | - |
| 其中：存款期限 1 个月以内 | - |
| 存款期限 1-3 个月 | - |
| 存款期限 3 个月以上 | - |
| 其他存款 | - |
| 等于：本金 | - |
| 加：应计利息 | - |
| 减：坏账准备 | - |
| 合计 | 8,686,717.66 |

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | | 本期末 2026 年 6 月 30 日 | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 成本 | 应计利息 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | | - | - | - | - |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | | - | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | - | - | - | - |
| | 银行间市场 | 53,308,800.00 | 285,753.42 | 54,060,753.42 | 466,200.00 |
| | 合计 | 53,308,800.00 | 285,753.42 | 54,060,753.42 | 466,200.00 |
| 资产支持证券 | | - | - | - | - |
| 基金 | | - | - | - | - |
| 其他 | | - | - | - | - |
| 合计 | | 53,308,800.00 | 285,753.42 | 54,060,753.42 | 466,200.00 |

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

无。

### 6.4.7.5 债权投资

无。

### 6.4.7.6 其他债权投资

无。

### 6.4.7.7 其他权益工具投资

无。

### 6.4.7.8 其他资产

无。

## 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2026 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 应付券商交易单元保证金 | - |
| 应付赎回费 | - |
| 应付证券出借违约金 | - |
| 应付交易费用 | 121.50 |
| 其中：交易所市场 | - |
| 银行间市场 | 121.50 |
| 应付利息 | - |
| 预提费用 | 93,302.56 |
| 合计 | 93,424.06 |

## 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

长盛盛琪一年债券 A

| 项目 | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 | |
|---|---|---|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 597,835,883.75 | 597,835,883.75 |
| 本期申购 | 69,641.68 | 69,641.68 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -538,118,192.18 | -538,118,192.18 |
| 基金拆分/份额折算前 | - | - |
| 基金拆分/份额折算调整 | - | - |
| 本期申购 | - | - |
| 本期赎回（以“-”号填列） | - | - |
| 本期末 | 59,787,333.25 | 59,787,333.25 |

长盛盛琪一年债券 C

| 项目 | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 | |
|---|---|---|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 349,648.51 | 349,648.51 |
| 本期申购 | 12,303.52 | 12,303.52 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -17,136.04 | -17,136.04 |
| 基金拆分/份额折算前 | - | - |
| 基金拆分/份额折算调整 | - | - |
| 本期申购 | - | - |
| 本期赎回（以“-”号填列） | - | - |
| 本期末 | 344,815.99 | 344,815.99 |

注：1. 若本基金有分红及转换业务，申购含红利再投、转换入；赎回含转换出。

2.根据《长盛盛琪一年期定期开放债券型证券投资基金基金合同》和《长盛盛琪一年期定期开放债券型证券投资基金招募说明书》的相关规定，本基金的封闭期为自基金合同生效之日起(含)

或自每一开放期结束之日次日起(含)一年的期间。本基金的第一个封闭期为自基金合同生效之日起一年。下一个封闭期为首个开放期结束之日次日起的一年，以此类推。本基金封闭期内不办理申购与赎回业务，也不上市交易。本基金办理申购与赎回业务的开放期为本基金每个封闭期结束之后第一个工作日(含)起 5 至 20 个工作日的期间，以基金管理人届时公告为准。

### 6.4.7.11 其他综合收益

无。

### 6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

长盛盛琪一年债券 A

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|---|---|---|---|
| 上年度末 | 24,950,008.38 | 3,298,434.85 | 28,248,443.23 |
| 本期期初 | 24,950,008.38 | 3,298,434.85 | 28,248,443.23 |
| 本期利润 | 6,644,010.26 | -1,847,117.48 | 4,796,892.78 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -24,107,146.07 | -1,019,776.74 | -25,126,922.81 |
| 其中：基金申购款 | 3,132.92 | 136.96 | 3,269.88 |
| 基金赎回款 | -24,110,278.99 | -1,019,913.70 | -25,130,192.69 |
| 本期已分配利润 | -5,368,613.50 | - | -5,368,613.50 |
| 本期末 | 2,118,259.07 | 431,540.63 | 2,549,799.70 |

长盛盛琪一年债券 C

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|---|---|---|---|
| 上年度末 | 13,284.79 | 1,910.77 | 15,195.56 |
| 本期期初 | 13,284.79 | 1,910.77 | 15,195.56 |
| 本期利润 | 4,884.59 | 558.38 | 5,442.97 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -206.10 | -1.66 | -207.76 |
| 其中：基金申购款 | 497.14 | 30.22 | 527.36 |
| 基金赎回款 | -703.24 | -31.88 | -735.12 |
| 本期已分配利润 | -5,435.55 | - | -5,435.55 |
| 本期末 | 12,527.73 | 2,467.49 | 14,995.22 |

### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 活期存款利息收入 | 64,103.08 |
| 定期存款利息收入 | - |
| 其他存款利息收入 | - |
| 结算备付金利息收入 | 76.78 |
| 其他 | 11.81 |
| 合计 | 64,191.67 |

### 6.4.7.14 股票投资收益

无。

### 6.4.7.15 债券投资收益

#### 6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2026年1月1日至2026年6月30日 |
|---|---|
| 债券投资收益——利息收入 | 3,564,591.90 |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | 3,235,970.51 |
| 债券投资收益——赎回差价收入 | - |
| 债券投资收益——申购差价收入 | - |
| 合计 | 6,800,562.41 |

#### 6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2026年1月1日至2026年6月30日 |
|---|---|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额 | 678,122,962.21 |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 664,539,440.96 |
| 减：应计利息总额 | 10,342,625.74 |
| 减：交易费用 | 4,925.00 |
| 买卖债券差价收入 | 3,235,970.51 |

### 6.4.7.16 资产支持证券投资收益

#### 6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2026年1月1日至2026年6月30日 |
|---|---|
| 资产支持证券投资收益——利息收入 | 293,130.93 |
| 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入 | 296,676.39 |
| 资产支持证券投资收益——赎回差价收入 | - |
| 资产支持证券投资收益——申购差价收入 | - |
| 合计 | 589,807.32 |

#### 6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2026年1月1日至2026年6月30日 |
|---|---|
| 卖出资产支持证券成交总额 | 74,894,846.18 |

| | |
|---|---|
| 减：卖出资产支持证券成本总额 | 74,136,899.94 |
| 减：应计利息总额 | 461,269.85 |
| 减：交易费用 | - |
| 资产支持证券投资收益 | 296,676.39 |

### 6.4.7.17 贵金属投资收益

无。

### 6.4.7.18 衍生工具收益

无。

### 6.4.7.19 股利收益

无。

### 6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 1.交易性金融资产 | -1,846,559.10 |
| 股票投资 | - |
| 债券投资 | -1,778,359.04 |
| 资产支持证券投资 | -68,200.06 |
| 基金投资 | - |
| 贵金属投资 | - |
| 其他 | - |
| 2.衍生工具 | - |
| 权证投资 | - |
| 3.其他 | - |
| 减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税 | - |
| 合计 | -1,846,559.10 |

### 6.4.7.21 其他收入

无。

### 6.4.7.22 信用减值损失

无。

### 6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 审计费用 | 24,795.19 |
| 信息披露费 | 59,507.37 |
| 证券出借违约金 | - |

| | |
|---|---|
| 银行费用 | 2,780.12 |
| 账户维护费 | 18,000.00 |
| 其他 | 600.00 |
| 合计 | 105,682.68 |

## 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 6.4.8.1 或有事项

无。

### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

## 6.4.9 关联方、关联关系

### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内，未存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|---|---|
| 长盛基金管理有限公司（“长盛基金公司”） | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构 |
| 中国银行股份有限公司（“中国银行”） | 基金托管人、基金销售机构 |

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

### 6.4.10.2 关联方报酬

### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 484,007.96 | 943,851.27 |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 8,161.31 | 9,849.08 |
| 应支付基金管理人的净管理费 | 475,846.65 | 934,002.19 |

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.30%的年管理费率计提。计算方法如下：

H=E×年管理费率/当年天数

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 161,335.98 | 314,617.02 |

注：基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.10%的年托管费率计提。计算方法如下：

H=E×年托管费率/当年天数

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 | | |
|---|---|---|---|
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 长盛盛琪一年债券 A | 长盛盛琪一年债券 C | 合计 |
| 中国银行 | - | 192.91 | 192.91 |
| 合计 | - | 192.91 | 192.91 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 | | |
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 长盛盛琪一年债券 A | 长盛盛琪一年债券 C | 合计 |
| 中国银行 | - | 194.42 | 194.42 |
| 合计 | - | 194.42 | 194.42 |

注：基金销售服务费每日计提，按月支付。本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的年销售服务费费率为 0.30%。销售服务费计提的计算公式如下：

H=E×年销售服务费率/当年天数

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

### 6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

无。

### 6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

无。

### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

### 6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 | | 上年度可比期间<br>2025年1月1日至2025年6月30日 | |
|---|---|---|---|---|
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 中国银行 | 8,686,717.66 | 64,103.08 | 609,950.79 | 2,227.89 |
| 合计 | 8,686,717.66 | 64,103.08 | 609,950.79 | 2,227.89 |

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行约定利率计息。

### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

### 6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

| 长盛盛琪一年债券 A | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 序号 | 权益登记日 | 除息日 | | 每 10 份基金份额分红数 | 现金形式发放总额 | 再投资形式发放总额 | 本期利润分配合计 | 备注 |
| | | 场内 | 场外 | | | | | |
| 1 | 2026 年 3 月 13 日 | - | 2026 年 3 月 13 日 | 0.0750 | 4,483,148.89 | 620.39 | 4,483,769.28 | - |
| 2 | 2026 年 6 月 18 日 | - | 2026 年 6 月 18 日 | 0.1480 | 884,268.27 | 575.95 | 884,844.22 | - |

| | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 合计 | - | - | - | 0.2230 | 5,367,417.16 | 1,196.34 | 5,368,613.50 | - |

长盛盛琪一年债券 C

| 序号 | 权益登记日 | 除息日 | | 每 10 份基金份额分红数 | 现金形式发放总额 | 再投资形式发放总额 | 本期利润分配合计 | 备注 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | | 场内 | 场外 | | | | | |
| 1 | 2026 年 3 月 13 日 | - | 2026 年 3 月 13 日 | 0.0680 | 1,377.41 | 1,000.17 | 2,377.58 | - |
| 2 | 2026 年 6 月 18 日 | - | 2026 年 6 月 18 日 | 0.0890 | 1,782.26 | 1,275.71 | 3,057.97 | - |
| 合计 | - | - | - | 0.1570 | 3,159.67 | 2,275.88 | 5,435.55 | - |

### 6.4.12 期末（2026 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

#### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制管理委员会为核心的、由风险控制管理委员会、风险控制委员会、监察稽核部与风险管理部、相关业务部门构成的四级风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立风险控制管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部与风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去

估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。 本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在托管人和其他拥有相关资质的银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

#### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末<br>2026 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2025 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| AAA | - | 142,004,838.36 |
| AAA 以下 | - | 93,353,016.44 |
| 未评级 | 54,060,753.42 | 440,679,449.33 |
| 合计 | 54,060,753.42 | 676,037,304.13 |

注：上述评级均取自第三方评级机构。

### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末<br>2026 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2025 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| AAA | - | 62,270,914.01 |
| AAA 以下 | - | 12,257,207.67 |
| 未评级 | - | - |
| 合计 | - | 74,528,121.68 |

注：上述评级均取自第三方评级机构。

### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人于约定开放日要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人于开放期内每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于本报告期末，除卖出回购金融资产款余额(计息但该利息金额不重大)以外，本基金承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一年以内且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公

司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2026 年 6 月 30 日 | 1 年以内 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计 |
|---|---|---|---|---|---|
| 资产 | | | | | |
| 货币资金 | 8,685,940.39 | - | - | 777.27 | 8,686,717.66 |
| 结算备付金 | 52,222.22 | - | - | 4.59 | 52,226.81 |
| 存出保证金 | 11,523.09 | - | - | 0.99 | 11,524.08 |
| 交易性金融资产 | - | - | 53,775,000.00 | 285,753.42 | 54,060,753.42 |
| 资产总计 | 8,749,685.70 | - | 53,775,000.00 | 286,536.27 | 62,811,221.97 |
| 负债 | | | | | |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 15,573.66 | 15,573.66 |
| 应付托管费 | - | - | - | 5,191.22 | 5,191.22 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 应付销售服务费 | - | - | - | 88.87 | 88.87 |
| 其他负债 | - | - | - | 93,424.06 | 93,424.06 |
| 负债总计 | - | - | - | 114,277.81 | 114,277.81 |
| 利率敏感度缺口 | 8,749,685.70 | - | 53,775,000.00 | 172,258.46 | 62,696,944.16 |
| 上年度末<br>2025 年 12 月 31 日 | 1 年以内 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计 |
| 资产 | | | | | |
| 货币资金 | 330,396.52 | - | - | 105.30 | 330,501.82 |
| 存出保证金 | 3,449.44 | - | - | 0.30 | 3,449.74 |
| 交易性金融资产 | 252,670,600.00 | 439,298,500.00 | 49,020,000.00 | 9,576,325.81 | 750,565,425.81 |
| 资产总计 | 253,004,445.96 | 439,298,500.00 | 49,020,000.00 | 9,576,431.41 | 750,899,377.37 |
| 负债 | | | | | |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 159,706.07 | 159,706.07 |
| 应付托管费 | - | - | - | 53,235.37 | 53,235.37 |
| 卖出回购金融资产款 | 123,979,374.03 | - | - | 14,236.29 | 123,993,610.32 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 93.00 | 93.00 |
| 应交税费 | - | - | - | 57,026.90 | 57,026.90 |
| 其他负债 | - | - | - | 186,534.66 | 186,534.66 |
| 负债总计 | 123,979,374.03 | - | - | 470,832.29 | 124,450,206.32 |
| 利率敏感度缺口 | 129,025,071.93 | 439,298,500.00 | 49,020,000.00 | 9,105,599.12 | 626,449,171.05 |

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

| 假设 | 除市场利率以外的其他市场变量保持不变 | | |
|---|---|---|---|
| 分析 | 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） | |
| | | 本期末 （2026 年 6 月 30 日） | 上年度末 （2025 年 12 月 31 日 ） |
| | 1.市场利率下降 25 个基点 | 719,778.38 | 3,306,731.06 |
| | 2.市场利率上升 25 个基点 | -719,778.38 | -3,306,731.06 |

### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以

外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

## 6.4.14 公允价值

### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

#### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

| 公允价值计量结果所属的层次 | 本期末<br>2026 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2025 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| 第一层次 | - | - |
| 第二层次 | 54,060,753.42 | 750,565,425.81 |
| 第三层次 | - | - |
| 合计 | 54,060,753.42 | 750,565,425.81 |

#### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的证券等投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关投资的公允价值应属第二层次还是第三层次。

### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本报告期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(上年度末：同)。

### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括以摊余成本计量的金融资产和以摊余成本计量的金融负债等，其账面价值与公允价值相差很小。

### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

# §7 投资组合报告

## 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例（%） |
|---|---|---|---|
| 1 | 权益投资 | - | - |
| | 其中：股票 | - | - |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 54,060,753.42 | 86.07 |
| | 其中：债券 | 54,060,753.42 | 86.07 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 4 | 贵金属投资 | - | - |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 6 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 8,738,944.47 | 13.91 |
| 8 | 其他各项资产 | 11,524.08 | 0.02 |
| 9 | 合计 | 62,811,221.97 | 100.00 |

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有境内投资股票。

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期内未进行股票投资。

### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期内未进行股票投资。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期内未进行股票投资。

## 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种 | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|
| 1 | 国家债券 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 54,060,753.42 | 86.23 |
| | 其中：政策性金融债 | 54,060,753.42 | 86.23 |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债（可交换债） | - | - |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 54,060,753.42 | 86.23 |

## 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 220210 | 22 国开 10 | 500,000 | 54,060,753.42 | 86.23 |

注：本基金本报告期末仅持有上述 1 只债券。

## 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期内未投资国债期货。

### 7.10.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

## 7.11 投资组合报告附注

### 7.11.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

22 国开 10

2025 年 7 月 25 日，京汇罚(2025)30 号显示，国家开发银行存在违规办理内保外贷业务等多

项违法违规事实，被处警告，罚款，没收违法所得，罚没合计 1,394.42 万元。2025 年 9 月 30 日，银罚决字(2025)66 号显示，国家开发银行存在违反金融统计相关规定的违法违规事实，被处警告，罚款 123 万元。本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合法律法规、基金合同和公司投资制度的规定。

除上述事项外，本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体无被监管部门立案调查记录，无在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

### 7.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

本基金本报告期末未持有股票。

### 7.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
| --- | --- | --- |
| 1 | 存出保证金 | 11,524.08 |
| 2 | 应收清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 11,524.08 |

### 7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

### 7.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## §8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 份额级别 | 持有人户数（户） | 户均持有的基金份额 | 持有人结构 | | | |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| | | | 机构投资者 | | 个人投资者 | |
| | | | 持有份额 | 占总份额比例（%） | 持有份额 | 占总份额比例（%） |

| | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 长盛盛琪一年债券 A | 359 | 166,538.53 | 50,000,000.00 | 83.63 | 9,787,333.25 | 16.37 |
| 长盛盛琪一年债券 C | 49 | 7,037.06 | - | - | 344,815.99 | 100.00 |
| 合计 | 408 | 147,382.72 | 50,000,000.00 | 83.15 | 10,132,149.24 | 16.85 |

注：对于分级基金，比例的分母采用各自级别的份额；对于合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额），户均持有的基金份额的合计数=期末基金份额总额/期末持有人户数合计。

## 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 份额级别 | 持有份额总数（份） | 占基金总份额比例（%） |
|---|---|---|---|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 长盛盛琪一年债券 A | 0.00 | 0.0000 |
| | 长盛盛琪一年债券 C | 0.00 | 0.0000 |
| | 合计 | 0.00 | 0.0000 |

注：对于分级基金，比例的分母采用各自级别的份额；对于合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数。

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

| 项目 | 份额级别 | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|---|---|---|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金 | 长盛盛琪一年债券 A | 0 |
| | 长盛盛琪一年债券 C | 0 |
| | 合计 | 0 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 长盛盛琪一年债券 A | 0 |
| | 长盛盛琪一年债券 C | 0 |
| | 合计 | 0 |

# §9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 长盛盛琪一年债券 A | 长盛盛琪一年债券 C |
|---|---|---|
| 基金合同生效日（2016 年 9 月 27 日）基金份额总额 | 2,180,279,164.85 | 24,501,986.44 |

| | | |
|---|---|---|
| 本报告期期初基金份额总额 | 597,835,883.75 | 349,648.51 |
| 本报告期基金总申购份额 | 69,641.68 | 12,303.52 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 538,118,192.18 | 17,136.04 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 59,787,333.25 | 344,815.99 |

# §10 重大事件揭示

## 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

## 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

10.2.1 本基金管理人的高级管理人员重大人事变动情况

根据公司 2026 年 1 月 13 日第九届董事会第十五次会议决议，公司副总经理郭堃同志不再担任公司高级管理人员。郭堃同志目前是公司“首席投研专家”，专注于投研工作。公司已按规定向相关监管机构报告并发布变更公告。

10.2.2 基金经理变动情况

本报告期本基金基金经理未曾变动。

10.2.3 本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动情况

无。

## 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

## 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略没有改变。

## 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任的会计师事务所为容诚会计师事务所（特殊普通合伙），本报告期内本基金未更换会计师事务所。

## 10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

## 10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人未受到调查或处罚。

### 10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人相关从业人员未受到调查或处罚。

### 10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的基金托管业务履职不涉及受调查或处罚等情况。

### 10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人相关从业人员的基金托管业务履职不涉及受调查或处罚等情况。

## 10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

### 10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例(%) | 佣金 | 占当期佣金总量的比例(%) | |
| 长江证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 光大证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国金证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华创证券 | 1 | - | - | - | - | - |

### 10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 | | 债券回购交易 | | 权证交易 | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例(%) | 成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例(%) | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例(%) |
| 长江证券 | - | - | - | - | - | - |
| 光大证券 | 12,013,536.00 | 10.07 | - | - | - | - |
| 国金证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华创证券 | 107,260,970.00 | 89.93 | 59,186,000.00 | 100.00 | - | - |

注：1、交易单元的选择标准

（1）具备监管机构规定的相关资质、财务状况良好、经营行为规范、合规风控能力较强。

（2）具有较强的研究服务能力、有固定的研究机构和专门研究人员，能及时为本公司提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析、个股分析报告等，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告。

（3）具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合证券交易的需要。

2、交易单元的选择程序：

（1）基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单元的证券经营机构。

（2）基金管理人和被选中的证券经营机构签订协议。

3、本报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

（1）报告期内，本基金新增租用：无。

（2）报告期内，本基金停止租用： 无。

## 10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项 | 法定披露方式 | 法定披露日期 |
|---|---|---|---|
| 1 | 长盛基金管理有限公司高级管理人员变更的公告 | 中国证监会指定披露媒介 | 2026 年 1 月 15 日 |
| 2 | 长盛基金管理有限公司旗下基金 2025 年 4 季度报告提示性公告 | 中国证监会指定披露媒介 | 2026 年 1 月 22 日 |
| 3 | 长盛盛琪一年期定期开放债券型证券投资基金 2025 年第 4 季度报告 | 中国证监会指定披露媒介 | 2026 年 1 月 22 日 |
| 4 | 长盛盛琪一年期定期开放债券型证券投资基金（长盛盛琪一年债券 C 份额）基金产品资料概要更新 | 中国证监会指定披露媒介 | 2026 年 2 月 27 日 |
| 5 | 长盛盛琪一年期定期开放债券型证券投资基金（长盛盛琪一年债券 A 份额）基金产品资料概要更新 | 中国证监会指定披露媒介 | 2026 年 2 月 27 日 |
| 6 | 长盛盛琪一年期定期开放债券型证券投资基金招募说明书（更新） | 中国证监会指定披露媒介 | 2026 年 2 月 27 日 |
| 7 | 长盛盛琪一年期定期开放债券型证券投资基金收益分配公告 | 中国证监会指定披露媒介 | 2026 年 3 月 12 日 |
| 8 | 长盛盛琪一年期定期开放债券型证券投资基金开放日常申购赎回转换业务的公告 | 中国证监会指定披露媒介 | 2026 年 3 月 20 日 |
| 9 | 长盛盛琪一年期定期开放债券型证券投资基金 2025 年年度报告 | 中国证监会指定披露媒介 | 2026 年 3 月 28 日 |
| 10 | 长盛基金管理有限公司旗下基金 2025 年年度报告提示性公告 | 中国证监会指定披露媒介 | 2026 年 3 月 28 日 |
| 11 | 长盛基金管理有限公司关于旗下部分基金增加易方达财富为销售机构并参加费率优惠活动的公告 | 中国证监会指定披露媒介 | 2026 年 4 月 15 日 |
| 12 | 长盛基金管理有限公司关于旗下基金增加东莞农商行为销售机构并参加费率优惠的公告 | 中国证监会指定披露媒介 | 2026 年 4 月 22 日 |
| 13 | 长盛盛琪一年期定期开放债券型证券投资基金 2026 年第 1 季度报告 | 中国证监会指定披露媒介 | 2026 年 4 月 22 日 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 14 | 长盛基金管理有限公司旗下基金 2026 年 1 季度报告提示性公告 | 中国证监会指定披露媒介 | 2026 年 4 月 22 日 |
| 15 | 长盛盛琪一年期定期开放债券型证券投资基金收益分配公告 | 中国证监会指定披露媒介 | 2026 年 6 月 17 日 |

# §11 影响投资者决策的其他重要信息

## 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 | | | | | 报告期末持有基金情况 | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 序号 | 持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间 | 期初份额 | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额 | 份额占比（%） |
| 机构 | 1 | 20260101~20260630 | 587,182,079.26 | 0.00 | 537,182,079.26 | 50,000,000.00 | 83.15 |
| 产品特有风险 | | | | | | | |
| 本基金本报告期存在单一投资者持有基金份额比例超过 20%的情况，当该基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致的风险包括：巨额赎回风险、流动性风险、基金资产净值持续低于 5000 万元的风险、基金份额净值大幅波动风险以及基金收益水平波动风险。本基金管理人将对申购赎回进行审慎的应对，保护中小投资者利益。 | | | | | | | |

## 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期内无影响投资者决策的其他重要信息。

# §12 备查文件目录

## 12.1 备查文件目录

1、长盛盛琪一年期定期开放债券型证券投资基金相关批准文件；

2、《长盛盛琪一年期定期开放债券型证券投资基金基金合同》；

3、《长盛盛琪一年期定期开放债券型证券投资基金托管协议》；

4、《长盛盛琪一年期定期开放债券型证券投资基金招募说明书》；

5、法律意见书；

6、基金管理人业务资格批件、营业执照；

7、基金托管人业务资格批件、营业执照。

## 12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公地址和/或基金托管人的住所。

## 12.3 查阅方式

投资者可到基金管理人的办公地址和/或基金托管人的住所和/或基金管理人互联网站免费查

阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人长盛基金管理有限公司。

客户服务中心电话：400-888-2666、010-86497888。

网址：http://www.csfunds.com.cn。

**长盛基金管理有限公司**

**2026 年 8 月 29 日**