长盛嘉鑫30天持有期纯债债券型证券投资基金
2026年第3季度报告

2026年9月30日

基金管理人：长盛基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：2026年10月27日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 10 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 07 月 01 日起至 09 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	长盛嘉鑫 30 天持有纯债
基金主代码	021007
基金运作方式	契约型开放式，但本基金对每份基金份额设置 30 天的最短持有期限
基金合同生效日	2024 年 5 月 29 日
报告期末基金份额总额	40,941,571.16 份
投资目标	在严格控制风险和保持较高流动性的基础上，力求获得超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	（一）大类资产配置 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。同时通过严格风险评估，及时调整资产组合比例，保持资产配置风险、收益平衡，以稳健提升投资组合回报。 （二）债券组合管理策略 1、利率策略：利率策略主要是从组合久期及组合期限结构两个方向制定针对市场利率因素的投资策略。 2、类属配置策略：债券类属策略主要是通过研究国民经济运行状况，货币市场及资本市场资金供求关系，以及不同时期市场投资热点，分析国债、金融债、企业债、公司债等不同债券种类的利差水平，评定不同债券类属的相对投资价值，确定组合资产在不同债券类属之间配置比例。

	3、信用策略：信用品种的选择采取以利率研究和发行人偿债能力研究为核心的分析方式，在对宏观经济、利率走势、发行人经营及财务状况进行分析的基础上，结合信用品种的发行条款，建立信用债备选库，并以此为基础拟定信用品种的投资方法。 4、相对价值策略：本基金认为市场存在着失效的现象，短期因素的影响被过分夸大。债券市场的参与者众多，投资行为、风险偏好、财务与税收处理等各不相同，发掘存在于这些不同因素之间的相对价值，也是本基金发现投资机会的重要方面。 5、债券选择策略：根据单个债券到期收益率相对于市场收益率曲线的偏离程度，结合其信用等级、流动性、选择权条款、税赋特点等因素，确定其投资价值，选择那些定价合理或价值被低估的债券进行投资。 （三）国债期货投资策略 本基金在进行国债期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对债券交易市场和期货市场运行趋势的研究，结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人将充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险性特征，运用国债期货对冲系统风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。	
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，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。	
基金管理人	长盛基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	长盛嘉鑫 30 天持有纯债 A	长盛嘉鑫 30 天持有纯债 C
下属分级基金的交易代码	021007	021008
报告期末下属分级基金的份额总额	11,257,725.11 份	29,683,846.05 份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2026 年 7 月 1 日-2026 年 9 月 30 日）	
	长盛嘉鑫 30 天持有纯债 A	长盛嘉鑫 30 天持有纯债 C
1.本期已实现收益	2,163.19	-2,574.35
2.本期利润	56,431.31	157,085.05
3.加权平均基金份额本期利润	0.0050	0.0043

4.期末基金资产净值	11,784,890.98	30,929,500.34
5.期末基金份额净值	1.0468	1.0420

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、所列数据截止到 2026 年 09 月 30 日。

3、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。

3.2 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

长盛嘉鑫 30 天持有纯债 A

阶段	净值增长率①	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	0.47%	0.02%	0.52%	0.03%	-0.05%	-0.01%
过去六个月	1.21%	0.03%	1.15%	0.03%	0.06%	0.00%
过去一年	2.69%	0.03%	1.48%	0.04%	1.21%	-0.01%
自基金合同生效起至今	4.68%	0.04%	3.03%	0.08%	1.65%	-0.04%

长盛嘉鑫 30 天持有纯债 C

阶段	净值增长率①	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	0.43%	0.02%	0.52%	0.03%	-0.09%	-0.01%
过去六个月	1.12%	0.03%	1.15%	0.03%	-0.03%	0.00%
过去一年	2.49%	0.03%	1.48%	0.04%	1.01%	-0.01%
自基金合同生效起至今	4.20%	0.04%	3.03%	0.08%	1.17%	-0.04%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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：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。截至报告日，本基金的各项资产配置比例符合基金合同的有关约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张建	本基金基金经理，长盛安鑫中短	2024 年 5 月	-	13 年	张建先生，硕士。曾任

	债债券型证券投资基金基金经理，长盛恒盛利率债债券型证券投资基金基金经理，长盛盛远债券型证券投资基金基金经理，长盛盛康纯债债券型证券投资基金基金经理，长盛元赢四个月定期开放债券型证券投资基金基金经理，长盛聚益债券型证券投资基金基金经理。	29 日			中国银河证券股份有限公司交易员/投资助理、银河金汇证券资产管理有限公司投资助理/投资主办人。2021 年 11 月加入长盛基金管理有限公司。

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。

4.1.1 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 公平交易专项说明

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 报告期内基金的投资策略和运作分析

1、报告期内行情回顾

三季度，国内经济延续年初以来“外需强、内需弱”的特征，经济增长呈现韧性。投资和消费继续拖累经济增长，8 月份，固定资产投资完成额累计同比下降 7.2%，降幅走阔，其中房地产投资累计同比下降 19.9%，制造业投资累计同比下降 2.3%，基建投资累计同比下降 5.37%，降幅均有所走阔；8 月份，社零当月同比增长 0.4%，累计同比增长 1.1%，弱于去年同期。进出口贸易延续强劲走势，8 月份，出口当月同比增长 25%，累计同比增长 19.3%，出口对经济基本面形成较好支撑。三季度，物价小幅回落，保持稳定，8 月份 CPI 当月同比增长 0.8%，PPI 当月同比增长 3.8%。9 月份，经济景气度回升，PMI 为 50.1%，重回扩张区间。

政策层面，央行坚持适度宽松的货币政策，以促进经济稳定增长和物价合理回升。央行通过 MLF、买断式逆回购及 OMO 等多种方式及时投放资金，平抑资金面波动，并通过结构性降息，降低实体融资成本。三季度，资金面整体维持宽松。

市场层面，债券市场维持强劲走势，在新增摊余债基配置预期的影响下，信用表现强势，收益率普遍创新低，信用债期限利差触及历史低位。利率债收益率整体下行，尤其超长债，收益率明显下行。

在此背景下，债券收益率普遍下行。以 AA+中短期票据为例，1 年期收益率下行 1.29BP 至 1.52%，3 年期收益率下行 0.83BP 至 1.672%，5 年期收益率下行 11.23BP 至 1.7407%，收益率曲线呈平坦化趋势。

2、报告期内本基金投资策略分析

报告期内，本基金采用票息+息差收益策略，追求收益确定性，根据市场情况，积极调整组合结构，动态调整杠杆水平和组合久期，规避市场风险。在防范信用风险、保障基金流动性合理充裕的情况下，努力为投资人创造长期稳健的投资收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末长盛嘉鑫 30 天持有纯债 A 的基金份额净值为 1.0468 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.47%，同期业绩比较基准收益率为 0.52%；截至本报告期末长盛嘉鑫 30 天持有纯债 C 的基金份额净值为 1.0420 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.43%，同期业绩比较基准收益率为 0.52%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金自 2026 年 8 月 26 日至 2026 年 9 月 30 日期间出现连续 20 个工作日基金资产净值低于 5000 万元的情形。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	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	42,118,127.31	98.23
	其中：债券	42,118,127.31	98.23
	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	757,012.64	1.77
8	其他资产	1,000.00	0.00
9	合计	42,876,139.95	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 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。

5.2.2 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。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	28,146,912.91	65.90
	其中：政策性金融债	4,046,054.79	9.47
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	13,971,214.40	32.71
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	42,118,127.31	98.60

5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	242580038	25 兴业银行永续债 02BC	40,000	4,074,727.67	9.54
2	260401	26 农发 01	40,000	4,046,054.79	9.47
3	102483605	24 河钢集 MTN012	30,000	3,027,729.21	7.09
4	242680002	26 招商银行永续债 01	29,000	2,956,661.23	6.92
5	232680019	26 工行二级资本债 04BC	25,000	2,520,991.10	5.90

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无国债期货投资。

5.9.3 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。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 本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

1、25 兴业银行永续债 02BC

2025 年 12 月 5 日，国家金融监督管理总局行政处罚信息公示列表显示，兴业银行股份有限公司存在外包机构管理不到位、企业划型不准确等违法违规事实，被处罚款 720 万元。2026 年 10 月 16 日，中国人民银行行政处罚列表显示，兴业银行股份有限公司存在未按规定履行客户身份识别义务，未按规定报送大额交易报告或者可疑交易报告违法行为，被处罚款 106 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。

2、26 农发 01

2026 年 7 月 21 日，京汇罚(2026)24 号显示，中国农业发展银行存在办理经常项目资金收付，未对交易单证的真实性及其与外汇收支的一致性进行合理审查等违法违规事实，被处警告、罚款、没收违法所得，罚没合计 176.19 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。

3、26 招商银行永续债 01

2026 年 7 月 17 日，国家金融监督管理总局行政处罚信息公示列表显示，招商银行股份有限公司存在部分机构未纳入并表管理范围、未从银行集团层面对同一客户统一授信等违法违规事实，被处罚款 650 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。

4、26 工行二级资本债 04BC

2025 年 12 月 18 日，京汇罚(2025)49 号显示，中国工商银行股份有限公司存在未经批准办理跨境资产转让业务等违法违规事实，被处警告，罚款，没收违法所得，罚没合计 1,142.59 万元。2025 年 12 月 19 日，银罚决字(2025)110 号显示，中国工商银行股份有限公司存在违反金融统计

相关规定等违法违规事实，被处警告，没收违法所得 434.570857 万元，罚款 3,961.5 万元。2026 年 6 月 5 日，国家金融监督管理总局行政处罚信息公示列表显示，中国工商银行股份有限公司存在重要信息系统投产变更风险管控不到位、未按规定报告重要信息系统突发事件等违法违规事实，被处罚款 105 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。

5、26 农行二级资本债 02BC

2025 年 10 月 31 日，国家金融监督管理总局行政处罚信息公示列表显示，中国农业银行股份有限公司存在相关产品销售、服务收费不合规，信贷资金流向管理不审慎等违法违规事实，被处罚款 2,720 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。

6、25 华夏银行永续债 01

2025 年 11 月 28 日，银罚决字(2025)75 号显示，华夏银行股份有限公司存在违反账户管理规定等违法违规事实，被处警告，没收违法所得 15.456791 万元，罚款 1,365.5 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。

7、26 中信银行永续债 01BC

2026 年 6 月 5 日，国家金融监督管理总局行政处罚信息公示列表显示，中信银行股份有限公司存在相关贷款、信用卡等业务管理不审慎的违法违规事实，被处罚款 1,140 万元。2026 年 6 月 17 日，云南金融监管局行政处罚信息公示列表显示，中信银行股份有限公司存在违规发放流动资金贷款、违规办理真实贸易背景的银行承兑汇票的违法违规事实，被处罚款 80 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，本报告期内本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，无在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

5.10.2 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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,000.00

6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	1,000.00

5.10.4 报告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。

5.10.5 报告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。

5.10.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	长盛嘉鑫 30 天持有纯债 A	长盛嘉鑫 30 天持有纯债 C
报告期期初基金份额总额	11,333,285.70	39,540,412.06
报告期期间基金总申购份额	498,504.45	5,065,293.04
减:报告期期间基金总赎回份额	574,065.04	14,921,859.05
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	11,257,725.11	29,683,846.05

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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

本基金报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

8.2 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。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、长盛嘉鑫 30 天持有期纯债债券型证券投资基金相关批准文件；

2、《长盛嘉鑫 30 天持有期纯债债券型证券投资基金基金合同》；

3、《长盛嘉鑫 30 天持有期纯债债券型证券投资基金托管协议》；

4、《长盛嘉鑫 30 天持有期纯债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。

9.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的办公地址。

9.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的办公地址和/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 10 月 27 日