# 长盛安逸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 | 长盛安逸纯债 | | | |
| 基金主代码 | 007744 | | | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | | | |
| 基金合同生效日 | 2020 年 1 月 20 日 | | | |
| 报告期末基金份额总额 | 9,331,779,307.38 份 | | | |
| 投资目标 | 在控制风险和保持资产流动性的基础上，追求基金资产的长期稳健增值，并力争获得超过业绩比较基准的投资业绩。 | | | |
| 投资策略 | （一）大类资产配置策略<br>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。<br>（二）债券组合管理策略<br>本基金的债券组合管理策略包含：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、资产支持证券等品种投资策略、国债期货投资策略。 | | | |
| 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。 | | | |
| 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 | | | |
| 下属分级基金的基金简称 | 长盛安逸纯债 A | 长盛安逸纯债 C | 长盛安 | 长盛安逸纯债 E |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | | | 逸纯债 D | |
| 下属分级基金的交易代码 | 007744 | 007745 | 013456 | 015439 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 1,490,794,382.85 份 | 466,368,215.09 份 | 0.00 份 | 7,374,616,709.44 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） | | | |
|---|---|---|---|---|
| | 长盛安逸纯债 A | 长盛安逸纯债 C | 长盛安逸纯债 D | 长盛安逸纯债 E |
| 1.本期已实现收益 | 10,737,564.87 | 2,904,893.30 | - | 49,088,376.21 |
| 2.本期利润 | 13,452,810.70 | 3,745,857.73 | - | 62,385,793.80 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0095 | 0.0083 | - | 0.0096 |
| 4.期末基金资产净值 | 1,949,435,617.82 | 596,218,115.86 | - | 9,642,115,733.56 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.3076 | 1.2784 | 1.3076 | 1.3075 |

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。

4、本基金自 2021 年 09 月 02 日起增加 D 类基金份额，并自该日起接受投资者对 D 类基金份额的申购和赎回。自 2021 年 09 月 02 日至 2026 年 09 月 30 日期间 D 类基金份额未发生申购业务，D 类基金份额为 0，D 类基金份额净值参考 A 类基金份额净值披露。

5、本基金自 2022 年 03 月 18 日起增加 E 类基金份额，并自该日起接受投资者对 E 类基金份额的申购和赎回。

## 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

长盛安逸纯债 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 | 0.72% | 0.02% | 0.52% | 0.03% | 0.20% | -0.01% |

| | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去六个月 | 1.72% | 0.03% | 1.15% | 0.03% | 0.57% | 0.00% |
| 过去一年 | 3.84% | 0.03% | 1.48% | 0.04% | 2.36% | -0.01% |
| 过去三年 | 10.93% | 0.05% | 5.66% | 0.07% | 5.27% | -0.02% |
| 过去五年 | 22.61% | 0.04% | 8.15% | 0.07% | 14.46% | -0.03% |
| 自基金合同生效起至今 | 30.76% | 0.07% | 9.50% | 0.07% | 21.26% | 0.00% |

长盛安逸纯债 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 | 0.65% | 0.02% | 0.52% | 0.03% | 0.13% | -0.01% |
| 过去六个月 | 1.57% | 0.03% | 1.15% | 0.03% | 0.42% | 0.00% |
| 过去一年 | 3.53% | 0.03% | 1.48% | 0.04% | 2.05% | -0.01% |
| 过去三年 | 9.93% | 0.05% | 5.66% | 0.07% | 4.27% | -0.02% |
| 过去五年 | 20.77% | 0.04% | 8.15% | 0.07% | 12.62% | -0.03% |
| 自基金合同生效起至今 | 27.84% | 0.07% | 9.50% | 0.07% | 18.34% | 0.00% |

长盛安逸纯债 D

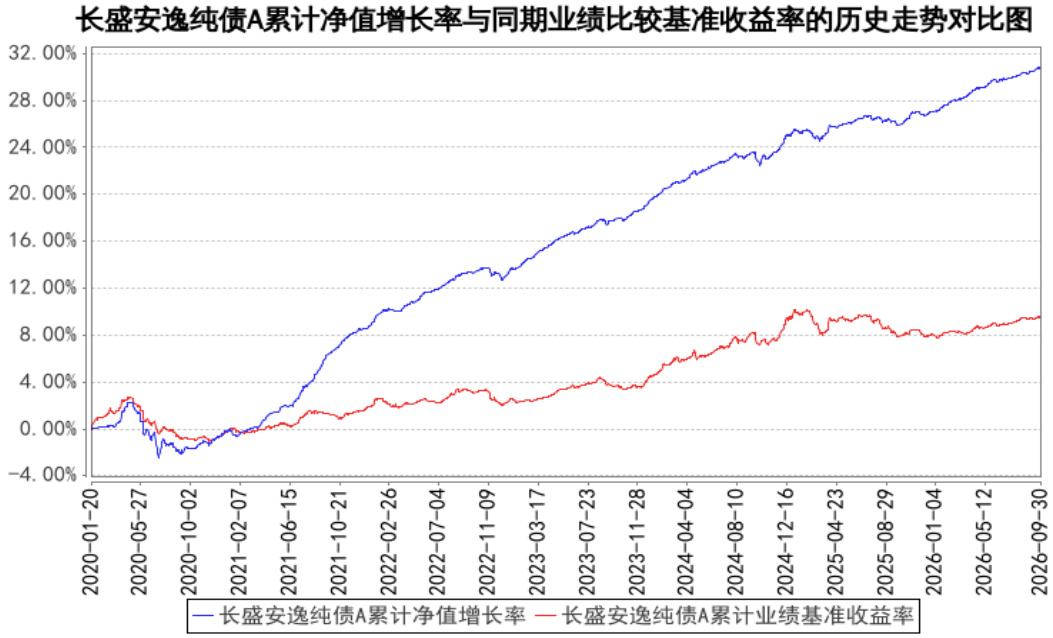
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①－③ | ②－④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | 0.72% | 0.02% | 0.52% | 0.03% | 0.20% | -0.01% |
| 过去六个月 | 1.72% | 0.03% | 1.15% | 0.03% | 0.57% | 0.00% |
| 过去一年 | 3.84% | 0.03% | 1.48% | 0.04% | 2.36% | -0.01% |
| 过去三年 | 10.93% | 0.05% | 5.66% | 0.07% | 5.27% | -0.02% |
| 过去五年 | 22.61% | 0.04% | 8.15% | 0.07% | 14.46% | -0.03% |
| 自基金新增本类份额起至今 | 24.27% | 0.04% | 7.90% | 0.07% | 16.37% | -0.03% |

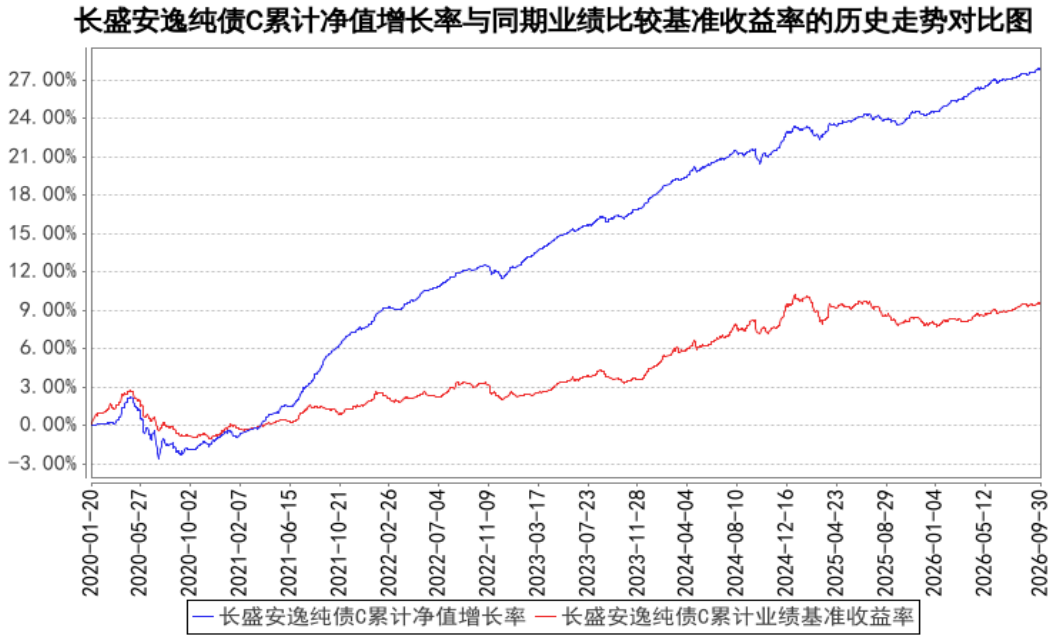
长盛安逸纯债 E

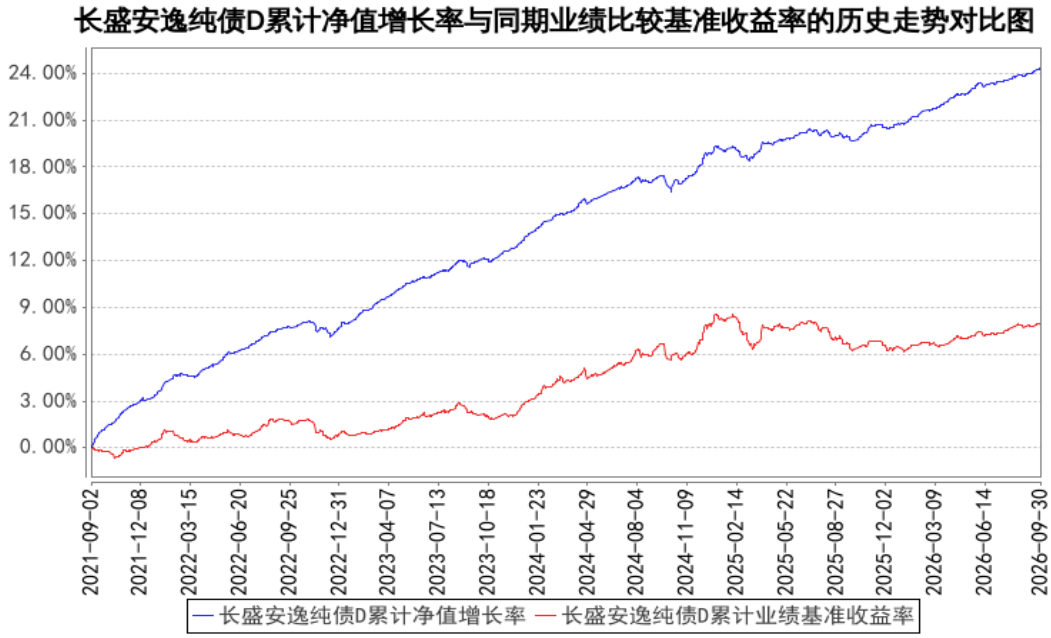
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①－③ | ②－④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | 0.72% | 0.02% | 0.52% | 0.03% | 0.20% | -0.01% |
| 过去六个月 | 1.72% | 0.03% | 1.15% | 0.03% | 0.57% | 0.00% |
| 过去一年 | 3.84% | 0.03% | 1.48% | 0.04% | 2.36% | -0.01% |
| 过去三年 | 10.93% | 0.05% | 5.66% | 0.07% | 5.27% | -0.02% |
| 自基金新增本类份额起至今 | 18.81% | 0.04% | 7.48% | 0.07% | 11.33% | -0.03% |

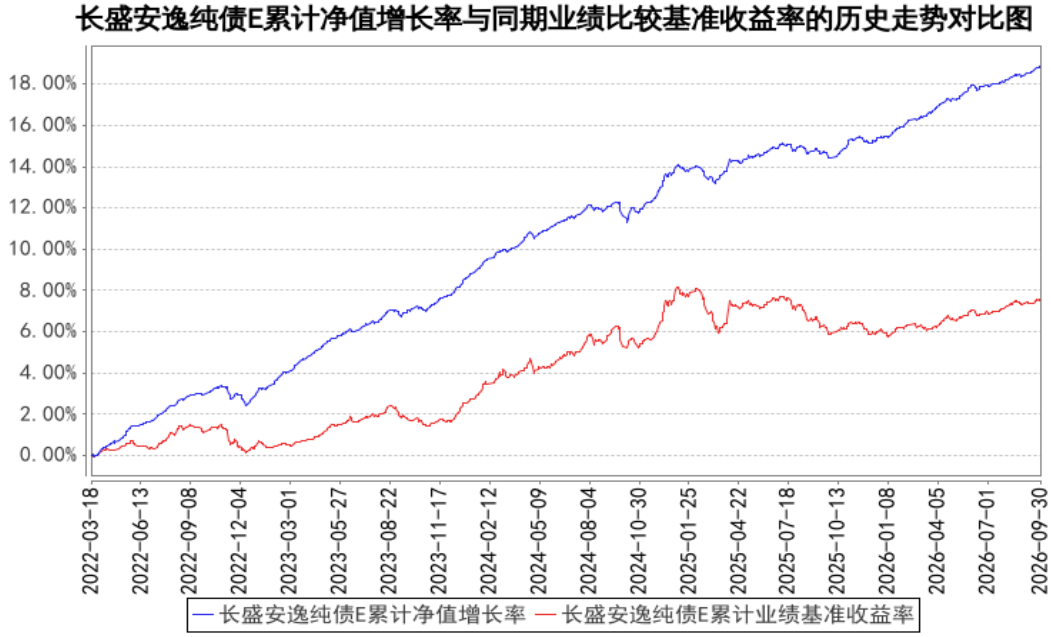
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益

率变动的比较


长盛安逸纯债A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
32.00%
28.00%
24.00%
20.00%
16.00%
12.00%
8.00%
4.00%
0.00%
-4.00%
2020-01-20
2020-05-27
2020-10-02
2021-02-07
2021-06-15
2021-10-21
2022-02-26
2022-07-04
2022-11-09
2023-03-17
2023-07-23
2023-11-28
2024-04-04
2024-08-10
2024-12-16
2025-04-23
2025-08-29
2026-01-04
2026-05-12
2026-09-30
长盛安逸纯债A累计净值增长率
长盛安逸纯债A累计业绩基准收益率


长盛安逸纯债C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
27.00%
24.00%
21.00%
18.00%
15.00%
12.00%
9.00%
6.00%
3.00%
0.00%
-3.00%
2020-01-20
2020-05-27
2020-10-02
2021-02-07
2021-06-15
2021-10-21
2022-02-26
2022-07-04
2022-11-09
2023-03-17
2023-07-23
2023-11-28
2024-04-04
2024-08-10
2024-12-16
2025-04-23
2025-08-29
2026-01-04
2026-05-12
2026-09-30
长盛安逸纯债C累计净值增长率
长盛安逸纯债C累计业绩基准收益率




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本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 | 说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 任职 | 离 | | |

| | | 日期 | 任日期 | 年限 | |
|---|---|---|---|---|---|
| 王贵君 | 本基金基金经理，长盛盛裕纯债债券型证券投资基金基金经理，长盛盛和纯债债券型证券投资基金基金经理，长盛全债指数增强型债券投资基金基金经理，长盛盛逸 9 个月持有期债券型证券投资基金基金经理，公司总经理助理、固定收益部总经理。 | 2021 年 1 月 13 日 | - | 14 年 | 王贵君先生，硕士。曾任中债资信评估有限责任公司评级分析师，上投摩根基金管理有限公司债券研究员，2017 年 6 月加入长盛基金管理有限公司，历任投资经理、专户理财部副总监、固定收益部副总经理等。 |
| 刘欣 | 本基金基金经理，长盛稳鑫 63 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理。 | 2024 年 9 月 20 日 | - | 11 年 | 刘欣女士，硕士。曾任中债资信评估有限责任公司评级分析、产品设计、信用信息分析岗位。2018 年 12 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。 |

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

三季度基本面延续生产与外需偏强，但地产与消费为代表的内需偏弱的格局；通胀方面 CPI 平稳偏弱，PPI 上行主要受上游涨价驱动，向中下游传导不畅，终端需求对物价的拉动有限。因此，债市收益率下行的基本面支撑较强。政策方面，9 月底稳增长政策加码，市场博弈政策见效预期。资金面而言，央行采用 “削峰填谷” 思路呵护资金面，7-8 月资金平稳宽松，银行配置盘持续增配利率债；9 月政府债供给迎来年内高峰，央行通过 MLF 加量续作、买断式逆回购等工具对冲供给冲击，资金小幅波动但整体平稳偏松。行情来看，三季度债券收益率整体下行，超长端创年内新低，曲线平坦化。

7 月债市区间震荡为主， 进入 8 月，市场进一步交易基本面偏弱预期，尽管三季度迎来政府债供给高峰，但基本面延续弱现实，出口韧性持续、内需未见明显改善，资金维持宽松，机构持续增配长债与超长债，10 年期国债收益率下破 1.7%， 30 年国债收益率下行幅度更大。

信用方面，7-8 月长端各评级信用利差持续收窄至历史低位，低等级、长久期品种更受配置资金青睐；9 月伴随利率调整，长久期信用债利差有所反弹，短端信用利差小幅分化，高等级短票利差略有走阔，城投债区域分化延续，摊余债基扩容持续带来配置力量。

2、报告期内本基金投资策略分析

报告期内，本基金在操作中严格遵守基金合同要求构建投资组合。三季度，组合持仓以长久期利率债和中端久期信用债为主，进入三季度久期有所提高，资本利得收益增加。

## 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末长盛安逸纯债 A 的基金份额净值为 1.3076 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.72%，同期业绩比较基准收益率为 0.52%；截至本报告期末长盛安逸纯债 C 的基金份额净值为 1.2784 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.65%，同期业绩比较基准收益率为 0.52%；截至本报告期末长盛安逸纯债 D 的基金份额净值为 1.3076 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.72%，同期业绩比较基准收益率为 0.52%；截至本报告期末长盛安逸纯债 E 的基金份额净值为 1.3075 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.72%，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 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 | 13,190,117,696.77 | 99.28 |
| | 其中：债券 | 13,190,117,696.77 | 99.28 |
| | 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 | 60,390,094.99 | 0.45 |
| 8 | 其他资产 | 35,209,388.39 | 0.27 |
| 9 | 合计 | 13,285,717,180.15 | 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 | 3,806,048,064.10 | 31.23 |
| | 其中：政策性金融债 | 1,222,949,709.59 | 10.03 |
| 4 | 企业债券 | 656,869,252.07 | 5.39 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | 8,074,886,485.95 | 66.25 |
| 7 | 可转债（可交换债） | - | - |
| 8 | 同业存单 | 295,782,732.33 | 2.43 |
| 9 | 其他 | 356,531,162.32 | 2.93 |
| 10 | 合计 | 13,190,117,696.77 | 108.22 |

## 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 | 112606170 | 26 交通银行 CD170 | 3,000,000 | 295,782,732.33 | 2.43 |
| 2 | 240205 | 24 国开 05 | 2,500,000 | 271,391,643.84 | 2.23 |
| 3 | 232680002 | 26 民生银行二级资本债 01 | 2,500,000 | 255,739,082.19 | 2.10 |
| 4 | 232580001 | 25 工行二级资本债 01BC | 2,100,000 | 215,297,350.68 | 1.77 |
| 5 | 240310 | 24 进出 10 | 2,000,000 | 213,099,616.44 | 1.75 |

## 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

报告期内，本基金在进行国债期货投资时，根据风险管理原则，本着谨慎原则，适度参与国债期货投资，投资以套期保值为主要目的，参与流动性好、交易活跃的国债期货合约。通过对债券交易市场和期货市场运行趋势的研究，根据基金组合的实际情况及估值水平、基差水平、流动性等因素的分析，结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平，在最大限度保证基金资产安全的基础上，力求实现资产的长期稳定增值。

### 5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

| 代码 | 名称 | 持仓量（买/卖） | 合约市值(元) | 公允价值变动（元） | 风险指标说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| T2612 | 10 年期国债期货 2612 合约 | -200 | -218,820,000.00 | 121,050.00 | 本基金投资国债期货以套期保值为主要目的，从而更有效地进行风险管理，以实现投资目标。 |
| TL2612 | 30 年期国债期货 2612 合约 | 550 | 642,730,000.00 | 2,171,386.08 | 本基金投资国债期货以套期保值为主要目的，从而更有效地进行风险管理，以实现投资目标。 |
| 公允价值变动总额合计（元） | | | | | 2,292,436.08 |
| 国债期货投资本期收益（元） | | | | | 14,509,139.31 |
| 国债期货投资本期公允价值变动（元） | | | | | 2,216,907.51 |

### 5.9.3 本期国债期货投资评价

报告期内，本基金运用国债期货工具调节组合的期限结构以及久期水平。报告期内，产品根据市场环境，择机通过国债期货交易，管理产品的利率风险，符合既定的投资策略和投资目标。

## 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

26 交通银行 CD170：

2025 年 12 月 19 日，银罚决字(2025)96 号显示，交通银行股份有限公司存在违反账户管理规定等 11 项违法违规事实，被处警告，没收违法所得 23.982116 万元，罚款 6,783.43 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，交通银行股份有限公司存在灾备恢复能力建设不足、重要信息系统应急管理不足等违法违规事实，被处罚款 90 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。

26 民生银行二级资本债 01：

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，中国民生银行股份有限公司存在相关贷款、票据、同业等业务管理不审慎，监管数据报送不合规等违法违规事实，被处罚款 5,865 万元。2025 年 12 月 31 日，国家金融监督管理总局宁波监管局行政处罚信息公开表显示，中国民生银行股份有限公司存在相关贷款、投资业务管理不审慎,相关资产减值计提不审慎等违法违规事实，被处罚款 220 万元。2026 年 9 月 23 日，京汇罚(2026)28 号显示，中国民生银行股份有限公司存在违反规定将外汇汇入境内等违法违规事实，被处警告、罚款、没收违法所得，罚没合计 546.77 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。

25 工行二级资本债 01BC：

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 3,961.50 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。

24 进出 10：

2026 年 3 月 5 日，京汇罚(2026)14 号显示，中国进出口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 221.24 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。

24 建行二级资本债 02A：

2026 年 2 月 14 日，银罚决字(2026)5 号显示，中国建设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 55.097567 万元，罚款 4,295.51 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，中国建设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、重要信息系统应急管理不足等违法违规事实，被处罚款 70 万元。2026 年 9 月 23 日，国家金融监督管理总局行政处罚信息公示列表显示，中国建设银行股份有限公司存在未经批准擅自经营结汇、售汇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 1,577.06 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。

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。

25 农行永续债 01BC：

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。

25 鞍山钢铁 MTN002：

2025 年 10 月 22 日至 2026 年 5 月 22 日，铁路及税务部门处罚信息显示，鞍山钢铁集团有限公司多次因违反交通法规、未按期申报税务等事项被罚款或责令改正。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。

26 农发清发 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。

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。

### 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 | 22,518,885.23 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 12,690,503.16 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 35,209,388.39 |

### 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 | 长盛安逸纯债 A | 长盛安逸纯债 C | 长盛安逸纯债 D | 长盛安逸纯债 E |
|---|---|---|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 1,361,962,137.43 | 438,386,430.89 | - | 5,315,895,114.90 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 187,896,040.22 | 60,916,134.56 | - | 2,159,340,779.75 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 59,063,794.80 | 32,934,350.36 | - | 100,619,185.21 |
| 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 | 1,490,794,382.85 | 466,368,215.09 | - | 7,374,616,709.44 |

## §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

单位：份

| 项目 | 长盛安逸纯债 A | 长盛安逸纯债 C | 长盛安逸纯债 D | 长盛安逸纯债 E |
|---|---|---|---|---|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额 | - | - | - | 8,307,734.79 |
| 报告期期间买入/申购总份额 | - | - | - | - |
| 报告期期间卖出/赎回总份额 | - | - | - | - |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额 | - | - | - | 8,307,734.79 |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%） | - | - | - | 0.11 |

注：对于分级基金，比例的分母采用各自级别的份额。

### 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、长盛安逸纯债债券型证券投资基金相关批准文件；

2、《长盛安逸纯债债券型证券投资基金基金合同》；

3、《长盛安逸纯债债券型证券投资基金托管协议》；

4、《长盛安逸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的办公地址和/或基金托管人的住所。

## 9.3 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 10 月 27 日**