长盛安鑫中短债债券型证券投资基金 2019年半年度报告摘要

基金管理人:长盛基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
送出日期:2019年8月27日

§1 重要提示

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。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年8月26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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计 。

本报告期自2019年2月20日(基金合同生效日)起至06月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	长盛安鑫中短债	
基金主代码	006902	
交易代码	006902	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019年2月20日	
基金管理人	长盛基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	673,812,607.87份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	长盛安鑫中短债A	长盛安鑫中短债C
下属分级基金的交易代码:	006902	006903
报告期末下属分级基金的份额总额	423,417,537.05份	250,395,070.82份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险和保持良好流动性的前提下,重点投资中短债,力争获得持续稳定的投资收益。
投资策略	(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。同时通过严格风险评估,及时调整投资组合比例,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。通过全面研究国民经济运行状况,分析宏观经济运行的可能情景,预测财政政策、货币政策等政府宏观经济政策取向,分析金融市场资金供求状况变化趋势及结构,在此基础上预测金融市场利率水平变动趋势,以及金融市场收益率曲线斜度变化趋势。 通过预测收益率曲线形态及趋势的变化,制定相应的债券组合期限结构策略,并根据收益率曲线不同位置显示的收益特征,优化组合结构。 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、企业债券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拟定信用品种的投资方法。 4、相对价值策略 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。本基金密切关注国家法律法规、制度的变动,通过深入分析市场参与者的立场和观点,充分利用因市场分割、市场投资者不同风险偏好或者税收待遇等因素带来的投资机会,形成相对价值投资策略,为本基金的投资带来增加价值。 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。 6、中小企业私募债投资策略 本基金将在严格控制信用风险的基础上,通过严密的投资决策流程、投资授权审批机制、集中交易制度等保障审慎投资于中小企业私募债券,并通过组合管理、分散化投资、合理谨慎地评估、预测和控制相关风险,实现投资收益的最大化。本基金依靠内部信用评级系统持续跟踪研究发债主体的经营状况、财务指标等情况,对其信用风险进行评估并作出及时反应。 7、资产支持证券等品种投资策略 包括资产抵押贷款支持证券(ABS)、住房抵押贷款支持证券(MBS)等在内的资产支持证券,其定价受多种因素影响,包括市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率等。本基金将在基本面分析和债券市场宏观分析的基础上,结合蒙特卡洛模拟等数量化方法,对资产支持证券进行定价,评估资产支持证券的信用水平,确保基金资产的相对安全和保持较好的流动性。 8、证券公司短期公司债券投资策略 本基金将通过对证券公司发行的短期公司债券进行筛选分析,综合研究和分析发行主体的股权结构、公司治理、行业竞争实力、资产负债结构、盈利能力及现金流、偿债能力等要素,并综合考虑债券的增信情况以及收益率等因素确定投资策略。本基金将对所投资的证券公司短期公司债券进行独立、审慎的分析,进而对相关债券进行流动性分析和风险跟踪。 9、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	中债综合财富(1-3年)指数收益率*80%+一年期定期存款利率(税后)*20%
风险收益特征	本基金为债券型证券投资基金,属于证券投资基金中预期较低风险、较低收益的品种,其预期收益和风险水平低于股票型基金、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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张利宁	郭明
	联系电话	010-86497608	010-66105799
	电子邮箱	zhangln@csfunds.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-888-2666、010-86497888	95588
传真		010-86497999	010-66105798

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.csfunds.com.cn
基金半年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的办公地址

§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

基金级别	长盛安鑫中短债A	长盛安鑫中短债C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2019年2月20日 - 2019年6月30日)	报告期(2019年2月20日 - 2019年6月30日)
本期已实现收益	7,118,092.15	4,161,051.20
本期利润	7,498,698.94	3,999,192.69
加权平均基金份额本期利润	0.0087	0.0064
本期基金份额净值增长率	1.14%	1.00%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)	
期末可供分配基金份额利润	0.0090	0.0075
期末基金资产净值	428,237,283.40	252,887,821.38
期末基金份额净值	1.0114	1.0100

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

长盛安鑫中短债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
过去一个月	0.52%	0.02%	0.33%	0.02%	0.19%	0.00%
过去三个月	1.02%	0.03%	0.65%	0.02%	0.37%	0.01%
自基金合同生效起至今	1.14%	0.02%	0.85%	0.02%	0.29%	0.00%

长盛安鑫中短债C

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
过去一个月	0.49%	0.03%	0.33%	0.02%	0.16%	0.01%
过去三个月	0.92%	0.03%	0.65%	0.02%	0.27%	0.01%
自基金合同生效起至今	1.00%	0.02%	0.85%	0.02%	0.15%	0.00%

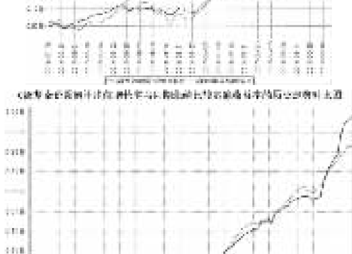
注:本基金业绩比较基准的构建及再平衡过程:

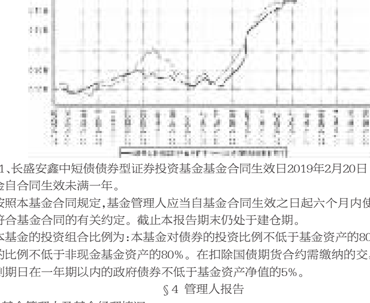
本基金业绩比较基准为中债综合财富(1-3年)指数收益率*80%+一年期定期存款利率(税后)*20%。

本基金为债券型证券投资基金,重点投资中短债,所以本基金选取中债综合财富(1-3年)指数收益率作为业绩比较基准。中债综合财富(1-3年)指数对中短期债券价格变动趋势有较强的代表性,能较为科学、合理的评价本基金的业绩表现。

再平衡:由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中,需要通过再平衡来使资产的配置比例符合基金合同要求,业绩比较基准中中债综合财富(1-3年)指数、一年期定期存款利率(税后)每日按照80%、20%的比例采取再平衡,再用连锁计算的方式得到基准指数的时间序列。

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、长盛安鑫中短债债券型证券投资基金基金合同生效日2019年2月20日,截至本报告期末本基金自合同生效未满一年。

2、按照本基金合同规定,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有关约定。截止本报告期末仍处于建仓期。

3、本基金的投资组合比例为:本基金对债券的投资比例不低于基金资产的80%;其中投资于中短债的比例不低于非现金基金资产的80%。在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金以后,现金或到期日在一年期以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

§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,是国内最早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。长盛基金总部办公地位于北京,在北京、上海、成都、深圳等地设有分支机构,并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占注册资本的33%,安徽省信用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。截至2019年6月30日,基金管理人共管理五十七只开放式基金,并管理多个全国社保基金组合和专户产品。公司同时兼任境外QFII基金和专户理财产品的投资顾问。

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		
葛鹤军	本基金基金经理,长盛盛琪一年期定期开放债券型证券投资基金基金经理,固定收益部执行总监。	2019年2月20日	-	11年	葛鹤军先生,博士。曾就职于中诚信证券评估有限公司,中诚信国际信用评级有限公司。曾任银华基金管理股份有限公司研究员、基金经理助理、基金经理。2018年7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”的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

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、本基金的基金合同和其他有关法律法规的规定,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、特定客户资产管理组合等。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,未发生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

1、报告期内行情回顾

2019年上半年,宏观经济稳中略缓,整体上保持平稳。一季度GDP增长6.4%,上半年GDP增长6.3%。

投资方面,房地产投资上半年累计增速维持在11%左右,成为稳定固定资产投资增速的主要力量,制造业投资增速略微下行,基础设施投资(不含电力、热力、燃气及水生产和供应业)同比增速稳定在4%略高的水平。消费领域,上半年社会商品零售总额累计增速8.4%,较去年底有所下行,主要是汽车销售不断下滑;但6月份开始,汽车销售有所好转,也使得当月消费增速有所恢复。物价方面,CPI在上半年不断升至2.7%,处于阶段性高位附近;PPI则不断回落至0.0%。

在此背景下,上半年央行整体上维持了资金的合理充裕,但因为季节性因素4月份资金价格波动较大。随后个别银行爆发信用风险事件,央行采取维稳措施,保障了金融市场的资金供给。

2019年上半年,债券收益率整体变动水平不大,10年期国债、10年期国开收益率分别下行0.1BP和3.2BP,但是各月之间的波动较大。一季度,债券收益率走势相对平稳,4月份受资金价格季节性波动以及一季度社融数据超预期等因素的影响,债券收益率明显上行,5月份开始资金价格有所回落带动市场情绪有所好转,债券收益率不断下行,基本回到了年初的水平。

2、报告期内本基金投资策略分析

报告期内,本基金陆续完成了建仓操作,资产配置以中短债券为主。在防范信用风险的前提下根据市场情况调整、优化了组合结构。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末长盛安鑫中短债A基金份额净值为1.0114元,本报告期基金份额净值增长率为1.14%;截至本报告期末长盛安鑫中短债C基金份额净值为1.0100元,本报告期基金份额净值增长率为1.00%;同期业绩比较基准收益率为0.85%。

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,主要经济体的经济增长可能继续下行,全球贸易摩擦仍将存在,中国对外出口可能仍将面临一定压力。国内经济增速仍可能有一定程度放缓,但全年经济增长有望维持在6.0%-6.5%的区间,在全球看仍是较高的经济增速。具体看,地产投资在土地成交放缓等因素的带动下有望小幅下滑;基建投资将扮演托底经济的角色,但在防控地方政府债务的背景下,基建大幅增长的概率较低。

货币政策方面,通胀因素的影响逐渐减小,央行有望保持流动性合理充裕。整体上看,经济环境和货币政策对债券市场可能会相对友好,但是随着收益率不断下行,需要密切关注债券市场的波动性;此外,需要密切关注债券市场信用风险事件。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及本基金合同约定,本基金管理人严格按照《企业会计准则》、中国证监会相关规定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。本基金管理人制订了证券投资基金估值政策与估值程序,设立基金估值小组,参考行业协会估值意见和独立第三方机构估值数据,确保基金估值的公平、合理。

本基金管理人制订的证券投资基金估值政策与估值程序确定了估值目的、估值日、估值对象、估值程序、估值方法以及估值差错处理、暂停估值和特殊情形处理等事项。本基金管理人设立了由公司总经理(担任估值工作小组组长)、公司督察长(担任估值工作小组副组长)、公司相关投资、研究部门分管领导、公司运营部分管领导、相关研究部门、相关投资部门、监察稽核部、风险管理部、信息技术部及业务运营部总监或指定人员组成的估值工作小组,负责研究、指导并执行基金估值业务。小组成员均具有多年证券、基金从业经验,具备基金估值运作、行业研究、风险管理或法律合规等领域的专业胜任能力。

基金经理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并出具报告。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,由其分别按约定提供在银行间同业市场交易的债券品种和在交易所市场交易或挂牌的部分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

根据本基金基金合同对基金利润分配原则的约定,本报告期内未实施利润分配。

本基金截至2019年6月30日,期末可供分配利润为5,681,941.18元,其中:长盛安鑫中短债A期末可供分配利润为3,794,932.70元(长盛安鑫中短债A的未分配利润已实现部分为3,794,932.70元,未分配利润未实现部分为1,024,813.65元),长盛安鑫中短债C期末可供分配利润为1,887,008.48元(长盛安鑫中短债C的未分配利润已实现部分为1,887,008.48元,未分配利润未实现部分为605,742.08元)。

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

本基金本报告期内无基金持有人数或基金资产净值预警说明。

§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,本基金托管人在对长盛安鑫中短债债券型证券投资基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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,长盛安鑫中短债债券型证券投资基金的管理人——长盛基金管理有限公司在长盛安鑫中短债债券型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对长盛基金管理有限公司编制和披露的长盛安鑫中短债债券型证券投资基金2019年半年度报告中财务指标、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进行了核查,以上内容真实、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:长盛安鑫中短债债券型证券投资基金

报告截止日:2019年6月30日

单位:人民币元

资 产	本期末 2019年6月30日
资 产:	
银行存款	2,504,149.16
结算备付金	30,768,254.81
存出保证金	109,763.66
交易性金融资产	803,296,450.00
其中:股票投资	-
基金投资	-
债券投资	803,296,450.00
资产支持证券投资	-
贵金属投资	-
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	-
应收证券清算款	12,961,053.15
应收利息	12,707,963.46
应收股利	-
应收申购款	32,275.08
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	862,379,909.32
负债和所有者权益	本期末 2019年6月30日
负 债:	
短期借款	-
交易性金融负债	-
衍生金融负债	-
卖出回购金融资产款	165,000,000.00
应付证券清算款	-
应付赎回款	15,705,473.65
应付管理人报酬	201,834.74
应付托管费	53,822.59
应付销售服务费	102,711.14
应付交易费用	8,250.00
应交税费	78,794.15
应付利息	62,328.76
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	41,589.51
负债合计	181,254,804.54
所有者权益:	
实收基金	673,812,607.87
未分配利润	7,312,496.91
所有者权益合计	681,125,104.78
负债和所有者权益总计	862,379,909.32

注:1、报告截止日2019年6月30日,长盛安鑫中短债A基金份额净值1.0114元,基金份额总额423,417,537.05份;长盛安鑫中短债C基金份额净值1.0100元,基金份额总额250,395,070.82份。长盛安鑫中短债份额总额合计为673,812,607.87份。

2、本财务报表的实际编制期间为2019年2月20日(基金合同生效日)至2019年6月30日止期间。

6.2 利润表

会计主体:长盛安鑫中短债债券型证券投资基金

本报告期:2019年2月20日(基金合同生效日)至2019年6月30日

单位:人民币元

项 目	本期 2019年2月20日(基金合同生效日)至2019年6月30日
一、收入	15,737,740.70
1.利息收入	15,655,320.86
其中:存款利息收入	496,771.78
债券利息收入	9,838,072.87
资产支持证券利息收入	-
买入返售金融资产收入	5,320,476.21
其他利息收入	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	-137,204.31
其中:股票投资收益	-
基金投资收益	-
债券投资收益	-137,204.31
资产支持证券投资收益	-
贵金属投资收益	-
衍生工具收益	-
股利收益	-
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	218,748.28
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	875.87
减:二、费用	4,239,849.07
1. 管理人报酬	1,569,207.55
2. 托管费	418,455.33
3. 销售服务费	875,832.58
4. 交易费用	12,825.03
5. 利息支出	1,276,351.46
其中:卖出回购金融资产支出	1,276,351.46
6. 税金及附加	30,253.39
7. 其他费用	56,923.73
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	11,497,891.63
减:所得税费用	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	11,497,891.63

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:长盛安鑫中短债债券型证券投资基金

本报告期:2019年2月20日(基金合同生效日)至2019年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2019年2月20日(基金合同生效日)至2019年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、基金合同生效日所有者权益(基金净值)	2,326,716,092.07	-	2,326,716,092.07
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	11,497,891.63	11,497,891.63
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-1,652,903,484.20	-4,185,394.72	-1,657,088,878.92
其中:1.基金申购款	7,889,349.82	24,014.73	7,913,364.55
2.基金赎回款	-1,660,792,834.02	-4,209,409.45	-1,665,002,243.47
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	673,812,607.87	7,312,496.91	681,125,104.78

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:

______林培富______ ______刁俊东______ ____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

长盛安鑫中短债债券型证券投资基金(以下简称“本基金”),系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[2019]12号《关于准予长盛安鑫中短债债券型证券投资基金注册的批复》的注册,由长盛基金管理有限公司于2019年1月21日至2019年2月15日向社会公开募集,募集期结束经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)验资并出具(2019)验字60468688_A01号验资报告后,向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于2019年2月20日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定。截至2019年2月19日止,长盛安鑫中短债A类基金份额已收到首次募集扣除认购费后的有效净认购金额为人民币1,276,820,424.07元,折合1,276,820,424.07份长盛安鑫中短债A类基金份额;有效认购款项在募集期间产生的利息为人民币383,208.40元,折合383,208.40份长盛安鑫中短债A类基金份额;以上收到的实收基金共计人民币1,277,203,632.47元,折合1,277,203,632.47份长盛安鑫中短债A类基金份额。长盛安鑫中短债C类基金份额已收到首次募集扣除认购费后的有效净认购金额为人民币1,049,129,806.42元,折合1,049,129,806.42份长盛安鑫中短债C类基金份额;有效认购款项在募集期间产生的利息为人民币382,653.18元,折合382,653.18份长盛安鑫中短债C类基金份额;以上收到的实收基金共计人民币1,049,512,459.60元,折合1,049,512,459.60份长盛安鑫中短债C类基金份额。长盛安鑫中短债A类基金份额和C类基金份额收到的实收基金合计人民币2,326,716,092.07元,分别折合成A类及C类基金份额,合计折合2,326,716,092.07份长盛安鑫中短债基金份额。本基金的基金管理人和注册登记机构为长盛基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金根据申购费、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资者申购时收取申购费用、但不从本类别基金资产中计提销售服务费的,称为A类基金份额;在投资者申购时不收取申购费用、而是从本类别基金资产中计提销售服务费的,称为C类基金份额。本基金A类和C类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同,本基金A类基金份额和C类基金份额将分别计算并公告基金份额净值。

本基金投资于具有良好流动性的金融工具,包括国债、地方政府债、央行票据、金融债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可分离交易可转债的纯债部分、次级债、中小企业私募债、证券公司短期公司债券、政府支持机构债券及政府支持债、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款、通知存款及其他银行存款)、同业存单、国债期货等法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金不投资于股票、权证等权益类资产,也不投资于可转换债券(可分离交易可转债的纯债部分除外)、可交换债券。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。本基金债券资产的投资比例不低于基金资产的80%,其中投资于中短债的比例不低于非现金基金资产的80%。每个交易日日终,在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后,本基金持有现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不得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。本基金所指的中短债是指剩余期限不超过三年的债券资产,主要包括国债、地方政府债、央行票据、金融债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可分离交易可转债的纯债部分、次级债、中小企业私募债、证券公司短期公司债券、政府支持机构债券及政府支持债等债券。当法律法规的相关规定变更时,基金管理人在履行适当程序后可对上述资产配置比例进行适当调整。本基金业绩比较基准:中债综合财富(1-3年)指数收益率*80%+一年期定期存款利率(税后)*20%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定(以下统称“企业会计准则”)编制,同时,对于在具体会计核算和信息披露方面,也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号〈年度报告和半年度报告〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定及参考意见。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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于2019年6月30日的财务状况以及2019年2月20日(基金合同生效日)至2019年6月30日的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度,即每年1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间系2019年2月20日(基金合同生效日)至2019年6月30日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外,均以人民币元为单位表示。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产(或负债),并形成其他单位的金融负债(或资产)或权益工具的合同。

(1)金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项;

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资;

(2)金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的债券等,以及不作为有效套期工具的衍生工具,按照取得时的公允价值作为初始确认金额,相关的交易费用在发生时计入当期损益;

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息,应当确认为当期收益。每日,本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益;

处置该金融资产或金融负债时,其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益,同时调整公允价值变动收益;

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止,或该收取金融资产现金流量的权利已转移,且符合金融资产转移的终止确认条件的,金融资产将终止确认;

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的,该金融负债或其一部分将终止确认;

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的,终止确认该金融资产;保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的,不终止确认该金融资产;本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的,分别下列情况处理:放弃了对该金融资产控制的,终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债;未放弃对该金融资产控制的,按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产,并相应确认有关负债;

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下:

(1)债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本,按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账,其中所包含的债券应收利息单独核算,不构成债券投资成本;

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券,根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后,按上述会计处理方法核算;

卖出债券于成交日确认债券投资收益,卖出债券的成本按移动加权平均法结转;

(2)回购协议

本基金持有的回购协议(封闭式回购),以成本列示,按实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时,也可以用合同利率)在实际持有期间内逐日计提利息。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值,是指市场参与者在计量日发生的有序交易中,出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债,假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行;不存在主要市场的,本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场(或最有利市场)是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债,根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值,确定所属的公允价值层次:第一层次输入值,在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价;第二层次输入值,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;第三层次输入值,相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日,本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估,以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的债券投资等投资按如下原则确定公允价值并进行估值:

(1)存在活跃市场的金融工具,按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值;估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的,应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的,应对报价进行调整,确定公允价值;

与上述投资品种相同,但具有不同特征的,应以相同资产或负债的公允价值为基础,并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等,如果该限制是针对资产持有者的,那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外,基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价;

(2)不存在活跃市场的金融工具,应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时,应优先使用可观察输入值,只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下,才使用不可观察输入值;

(3)如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的,基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后,按最能反映公允价值的方法估值;

(4)如有新增事项,按国家最新规定估值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利,且该种法定权利现在是可执行的,同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时,金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外,金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示,不予相互抵销。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算,并于期末全额转入“未分配利润/(累计亏损)”。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1)存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款,按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入,并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失,列入利息收入减项,存款利息收入以净额列示;

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认,在债券实际持有期内逐日计提;

(3)资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额,扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认,在证券实际持有期内逐日计提;

(4)买入返售金融资产收入,按买入返售金融资产的成本及实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时,也可以用合同利率),在回购期内逐日计提;

(5)债券投资收益/(损失)于成交日确认,并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账;

(6)公允价值变动收益/(损失)系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失;

(7)其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方,经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

(1)在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每份基金份额每年收益分配次数最多为4次,每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的20%,具体分配方案以公告为准,若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配;

(2)本基金收益分配方式分两种:现金分红与红利再投资,投资者可选择现金红利或将现金红利按除权日经除权后的该类基金份额净值自动转为该类基金份额进行再投资;若投资者不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红;

(3)基金收益分配后任一类基金份额净值不能低于面值;即基金收益分配基准日的任一类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值;

(4)由于基金费用的不同,本基金各类基金份额在可供分配利润上有所不同,本基金同一类别的每份基金份额享有同等分配权;

(5)投资者的现金红利保留到小数点后第2位,由此误差产生的收益或损失由基金资产承担;

(6)法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

在对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下,基金管理人可对基金收益分配原则进行调整,不需召开基金份额持有人大会。

6.4.4.12 分部报告

无。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

无。

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

无。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

6.4.5.3 差错更正的说明

无。

6.4.6 税项

6.4.6.1 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定,对证券投资基金(封闭式证券投资基金,开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税;国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税;存款利息收入不征收增值税;

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定,金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入;

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定,金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入;

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定,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;

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定,自2018年1月1日起,资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为(以下简称“资管产品运营业务”),暂适用简易计税方法,按照3%的征收率缴纳增值税,资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。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;

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定,自2018年1月1日起,资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务,按照以下规定确定销售额:提供贷款服务,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;转让2017年12月31日前取得的股票(不包括限售股)、债券、基金、非货物期货,可以选择按照实际买入价计算销售额,或者以2017年最后一个交易日的股票收盘价(2017年最后一个交易日处于停牌期间的股票,为停牌前最后一个交易日收盘价)、债券估值(中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值)、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额;

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加,以实际缴纳的增值税税额为计税依据,分别按规定的比例缴纳。

6.4.6.2 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定,自2004年1月1日起,对证券投资基金(封闭式证券投资基金,开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入,继续免征企业所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定,对证券投资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,股权的股息、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。

6.4.6.3 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定,自2008年10月9日起,对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 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

无。

6.4.7.2 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	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司(“工商银行”)	基金托管人、基金销售机构
国元证券股份有限公司(“国元证券”)	基金管理人的股东、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。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

注:无。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2019年2月20日(基金合同生效日)至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,569,207.55
其中:支付销售机构的客户维护费	937,183.81

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%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.30%/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

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2019年2月20日(基金合同生效日)至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	418,455.33

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0.08%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.08%/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

6.4.8.2.3 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 2019年2月20日(基金合同生效日)至2019年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	长盛安鑫中短债A	长盛安鑫中短债C	合计
长盛基金	-	15,082.46	15,082.46
工商银行	-	816,420.29	816,420.29
国元证券	-	16,371.89	16,371.89
合计	-	847,874.64	847,874.64

注:基金销售服务费每日计提,按月支付。基金销售服务费可用于本基金的市场推广、销售以及基金份额持有人服务等各项费用。本基金分为不同的类别,适用不同的销售服务费率。其中,本基金A类基金份额不收取销售服务费,C类基金份额的销售服务费按前一日C类基金份额资产净值的0.40%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.40%/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类基金份额前一日基金资产净值

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注:无。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注:无。

6.4.8.4.2 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

注:无。

6.4.8.5 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 2019年2月20日(基金合同生效日)至2019年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	2,504,149.16	226,213.57

注:本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管,按银行同业利率计息。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注:无。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.9 期末(2019年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注:无。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注:无。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2019年6月30日止,本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为人民币165,000,000.00元,于2019年7月1日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券,按证券交易所规定的比例折算为标准券后,不低于债券回购交易的余额。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.14.1 公允价值

本基金非以公允价值计量的金融工具,因其剩余期限不长,公允价值与账面价值相若。

(1)各层次金融工具公允价值

本基金本报告期末持有的以公允价值计量的金融工具中无属于第一层次的余额,属于第二层次的余额为人民币803,296,450.00元,无属于第三层次的余额。

(2) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。本基金本报告期持有的以公允价值计量的金融工具,在第一层次和第二层次之间无重大转移。本基金本报告期持有的以公允价值计量的金融工具未发生转入或转出第三层次公允价值的情况。

6.4.14.2 承诺事项

截至资产负债表日,本基金无需要说明的承诺事项。

6.4.14.3 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。

6.4.14.4财务报表的批准

本财务报表已于2019年8月26日经本基金的基金管理人批准。

§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	803,296,450.00	93.15
	其中:债券	803,296,450.00	93.15
	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	33,272,403.97	3.86
8	其他各项资产	25,811,055.35	2.99
9	合计	862,379,909.32	100.00

7.2 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

注:本基金本报告期末未持有股票。

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注: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前十名股票投资明细

注: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末基金资产净值2%或前20名的股票明细

注:本基金本报告期末未持有股票。

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

注:本基金本报告期末未持有股票。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

注:本基金本报告期末未持有股票。

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	40,967,200.00	6.01
2	央行票据	-	-
3	金融债券	20,000,000.00	2.94
	其中:政策性金融债	20,000,000.00	2.94
4	企业债券	227,813,250.00	33.45
5	企业短期融资券	260,804,000.00	38.29
6	中期票据	253,712,000.00	37.25
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	803,296,450.00	117.94

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	101556032	15渝两江MTN001	500,000	51,035,000.00	7.49
2	136796	16中航01	500,000	49,975,000.00	7.34
3	136130	16葛洲01	500,000	49,810,000.00	7.31
4	122514	12金融街	475,000	47,856,250.00	7.03
5	019611	19国债01	410,000	40,967,200.00	6.01

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序前十名资产支持证券投资明细

注: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

注: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

注: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 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末无国债期货投资。

7.10.3 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。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

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超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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	109,763.66
2	应收证券清算款	12,961,053.15
3	应收股利	-
4	应收利息	12,707,963.46
5	应收申购款	32,275.08
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	25,811,055.35

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券(可交换债券)。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注: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
长盛安鑫中短债A	1,106	382,836.83	124,999,586.31	29.52%	298,417,950.74	70.48%
长盛安鑫中短债C	1,689	148,250.49	-	-	250,395,070.82	100.00%
合计	2,795	241,077.86	124,999,586.31	18.55%	548,813,021.56	81.45%

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。

8.2 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	长盛安鑫中短债A	201,740.07	0.0476%
	长盛安鑫中短债C	5,623.27	0.0022%
	合计	207,363.34	0.0308%

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的情况

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	长盛安鑫中短债A	0
	长盛安鑫中短债C	0
	合计	-
本基金基金经理持有本开放式基金	长盛安鑫中短债A	10~50
	长盛安鑫中短债C	0
	合计	10~50

§9 开放式基金份额变动

单位:份

项目	长盛安鑫中短债A	长盛安鑫中短债C
基金合同生效日(2019年2月20日)基金份额总额	1,277,203,632.47	1,049,512,459.60
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	6,297,120.66	1,592,229.16
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	860,083,216.08	800,709,617.94
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-	-
本报告期期末基金份额总额	423,417,537.05	250,395,070.82

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期末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2019年第一次临时股东会议决议,同意钱力不再担任公司第七届董事会董事,选举严琛担任公司第七届董事会董事。以上董事人员变更,已向中国证监会北京监管局报备。

因个人原因,杨思乐向公司申请辞去副总经理职务,根据公司第七届董事会第十二次会议决议,杨思乐不再担任公司副总经理职务。以上公司高级管理人员变更,已向中国证监会北京监管局报备。

根据公司第七届董事会第十三次会议决议,聘任张壬午担任首席信息官。以上公司高级管理人员变更,已向中国证监会北京监管局报备。

10.2.2 基金经理变动情况

本报告期本基金经理未变动。

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

本报告期内基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、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

报告期内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安永华明会计师事务所(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、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

基金管理人、托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用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	
信达证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	2	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-

10.7.2 基金租用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
信达证券	20,043,871.23	1.09%	-	-	-	-
申万宏源	1,101,402,593.71	59.95%	31,078,700,000.00	77.40%	-	-
平安证券	108,566,836.26	5.91%	-	-	-	-
国元证券	607,080,529.58	33.05%	9,074,900,000.00	22.60%	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-

注:1、本公司选择证券经营机构的标准

(1)研究实力较强,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。

(2)资力雄厚,信誉良好。

(3)财务状况良好,各项财务指标显示公司经营状况稳定。

(4)经营行为规范,最近两年未因重大违规行为而受到中国证监会和中国人民银行处罚。

(5)内部管理规范、严格,具备健全的内控制度,并能满足基金运作高度保密的要求。

(6)具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件,交易设施符合代理本公司基金进行证券交易的需要,并能为本公司基金提供全面的信息服务。

2、本公司租用券商交易单元的程序

(1)研究机构提出服务意向,并提供相关研究报告;

(2)研究机构的研究报告需要有一定的试用期。试用期视服务情况和研究服务评价结果而定;

(3)研究发展部、投资管理等部门试用研究机构的研究报告后,按照研究服务评价规定,对研究机构进行综合评价;

(4)试用期满后,评价结果符合条件,双方认为有必要继续合作,经公司领导审批后,我司与研究机构签定《研究服务协议》、《券商交易单元租用协议》,并办理基金专用交易单元租用手续。评价结果如不符合条件则终止试用;

(5)本公司每两个月对签约机构的服务进行一次综合评价。经过评价,若本公司认为签约机构的服务不能满足要求,或签约机构违规受到国家有关部门的处罚,本公司有权终止签署的协议,并撤销租用的交易单元。

(6)交易单元租用协议期限为一年,到期后若双方没有异议可自动延期一年。

3、本基金租用证券公司交易单元均为共用交易单元。

4、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况:

(1)本基金报告期内新增租用交易单元:无。

(2)本基金报告期内停止租用交易单元:无。

§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

注: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。

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。

长盛基金管理有限公司

2019年8月27日