

# 长盛积极配置债券型证券投资基金

## 2025年第1季度报告

2025年3月31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：2025年4月22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规定，于 2025 年 04 月 21 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 2025 年 01 月 01 日起至 03 月 31 日止。

## §2 基金产品概况

|            |  |
|------------|--|
| 基金简称       | 长盛积极配置债券   |
| 基金主代码      | 080003   |
| 基金运作方式     | 契约型开放式   |
| 基金合同生效日    | 2008 年 10 月 8 日  |
| 报告期末基金份额总额 | 14,683,962.98 份  |
| 投资目标       | 在控制风险和保持资产流动性的基础上，通过积极主动的投资管理，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       | 本基金为积极投资策略的债券型基金，不同于传统债券型基金的投资策略特点，本基金在债券类资产配置上更强调积极主动管理。在债券类资产配置上，本基金通过积极投资配置相对收益率较高的企业债、公司债、可转换债、可分离交易可转债、资产支持证券等创新债券品种，并灵活运用组合久期调整、收益率曲线调整、信用利差和相对价值等策略积极把握固定收益证券市场中投资机会，以获取各类债券的超额投资收益。在股票类资产投资上，通过积极投资于一级市场和二级市场高成长性和具有高投资价值的股票，来获取股票市场的积极收益。此外，本基金还积极通过债券回购等手段提高基金资产的流动性和杠杆性用于短期投资于高收益的金融工具。 |
| 业绩比较基准     | 中证全债指数收益率*90%+沪深 300 指数收益率*10%   |
| 风险收益特征     | 本基金为债券型基金，其长期平均风险和预期收益率低于混合型基金，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   |

### §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（2025年1月1日-2025年3月31日） |
|----------------|---------------------------|
| 1.本期已实现收益      | 5,492,629.16              |
| 2.本期利润         | -555,888.71               |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0086                   |
| 4.期末基金资产净值     | 17,642,923.70             |
| 5.期末基金份额净值     | 1.2015                    |

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 2025 年 03 月 31 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。

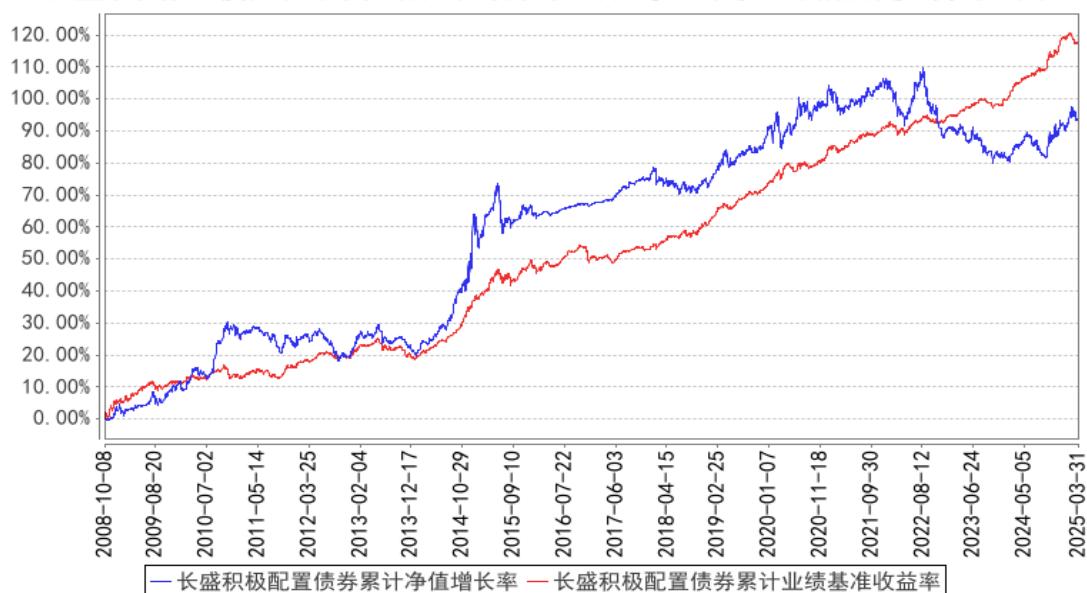
#### 3.2 基金净值表现

##### 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

| 阶段             | 净值增长率<br>① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①-③     | ②-④   |
|----------------|------------|---------------|----------------|-----------------------|---------|-------|
| 过去三个月          | 0.59%      | 0.38%         | -0.81%         | 0.13%                 | 1.40%   | 0.25% |
| 过去六个月          | 3.04%      | 0.41%         | 1.78%          | 0.17%                 | 1.26%   | 0.24% |
| 过去一年           | 4.39%      | 0.34%         | 6.14%          | 0.14%                 | -1.75%  | 0.20% |
| 过去三年           | -1.22%     | 0.33%         | 14.42%         | 0.12%                 | -15.64% | 0.21% |
| 过去五年           | 3.98%      | 0.34%         | 23.28%         | 0.13%                 | -19.30% | 0.21% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 93.47%     | 0.35%         | 117.51%        | 0.17%                 | -24.04% | 0.18% |

##### 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

### 长盛积极配置债券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



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 |        |  |
| 杨哲 | 本基金基金经理，长盛可转债债券型证券投资基金管理人，长盛稳怡添利债券型证券投资基金基金经理。 | 2021年11月2日  | -    | 15年    | 杨哲先生，硕士。曾任大公国际资信评估有限公司公司信用分析师、信用评审委员会委员。2013年9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

报告期内，经济延续了去年以来的改善态势，PMI 连续两个月处于荣枯线以上，生产和投资好于预期，房地产成交有所改善。但物价仍偏弱，CPI 处于较低水平，PPI 延续负增长。政策方面，

财政政策更加积极，赤字率提升至 4%，货币政策重视与财政政策的协同配合，将根据国内外形势，择机降准降息。

报告期内，债市呈现为震荡行情。1月初至2月中旬，资金面收紧，短端利率上行，长端利率回调幅度较小；2月下旬至3月中旬，降息预期有所修正，机构降杠杆降久期，长端利率加速回调；3月下旬至3月底，随着央行呵护市场流动性、并关注银行负债端压力，长端利率再次下行。

报告期内，A股呈现明显的结构性行情，上证指数下跌 0.48%，而中证 1000 指数上涨 1.21%。从申万一级行业指数看，有色金属、汽车、机械、计算机、钢铁、家电等行业涨幅较大，而煤炭、商贸、石油石化、建筑、房地产等行业跌幅较大。

可转债方面，随着权益市场风险偏好提升，整体呈现上涨行情。1月至3月中旬，中证转债指数震荡上涨，创出历史新高，转股溢价率抬升至较高水平；之后，随权益市场调整而回调。

## 2、报告期内本基金投资策略分析

债券投资方面，在基本面有所改善、市场流动性偏紧、债券收益率较低的环境下，适度降低了债券久期和组合杠杆。权益资产方面，行业配置适度分散化，个股选择更重视估值安全边际。

## 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末基金份额净值为 1.2015 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.59%，同期业绩比较基准收益率为 -0.81%。

## 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 2025 年 1 月 23 日至 2025 年 3 月 31 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    | 3,315,007.88  | 17.44        |
|    | 其中：股票   | 3,315,007.88  | 17.44        |
| 2  | 基金投资    | -             | -            |
| 3  | 固定收益投资  | 14,807,026.02 | 77.89        |
|    | 其中：债券   | 14,807,026.02 | 77.89        |
|    | 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          | 420,000.00    | 2.21   |
|   | 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      | 423,904.26    | 2.23   |
| 8 | 其他资产              | 43,364.53     | 0.23   |
| 9 | 合计                | 19,009,302.69 | 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

| 代码 | 行业类别             | 公允价值(元)      | 占基金资产净值比例(%) |
|----|------------------|--------------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | 42,603.00    | 0.24         |
| B  | 采矿业              | 224,657.00   | 1.27         |
| C  | 制造业              | 2,078,649.16 | 11.78        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 153,732.00   | 0.87         |
| E  | 建筑业              | 15,381.00    | 0.09         |
| F  | 批发和零售业           | -            | -            |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 17,812.00    | 0.10         |
| H  | 住宿和餐饮业           | -            | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 326,664.72   | 1.85         |
| J  | 金融业              | 455,509.00   | 2.58         |
| K  | 房地产业             | -            | -            |
| L  | 租赁和商务服务业         | -            | -            |
| M  | 科学研究和技术服务业       | -            | -            |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | -            | -            |
| O  | 居民服务、修理和其他服务业    | -            | -            |
| P  | 教育               | -            | -            |
| Q  | 卫生和社会工作          | -            | -            |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | -            | -            |
| S  | 综合               | -            | -            |
|    | 合计               | 3,315,007.88 | 18.79        |

### 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

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量(股) | 公允价值(元)    | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|-------|------------|--------------|
| 1  | 300750 | 宁德时代 | 960   | 242,822.40 | 1.38         |
| 2  | 600036 | 招商银行 | 4,100 | 177,489.00 | 1.01         |

|    |        |      |       |            |      |
|----|--------|------|-------|------------|------|
| 3  | 000333 | 美的集团 | 2,100 | 164,850.00 | 0.93 |
| 4  | 600519 | 贵州茅台 | 100   | 156,100.00 | 0.88 |
| 5  | 002594 | 比亚迪  | 400   | 149,960.00 | 0.85 |
| 6  | 600900 | 长江电力 | 5,200 | 144,612.00 | 0.82 |
| 7  | 601899 | 紫金矿业 | 7,500 | 135,900.00 | 0.77 |
| 8  | 300059 | 东方财富 | 5,000 | 112,900.00 | 0.64 |
| 9  | 601166 | 兴业银行 | 5,000 | 108,000.00 | 0.61 |
| 10 | 002475 | 立讯精密 | 2,500 | 102,225.00 | 0.58 |

#### 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      | 9,776,323.76  | 55.41        |
| 2  | 央行票据      | -             | -            |
| 3  | 金融债券      | 2,564,078.79  | 14.53        |
|    | 其中：政策性金融债 | 2,564,078.79  | 14.53        |
| 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） | 2,466,623.47  | 13.98        |
| 8  | 同业存单      | -             | -            |
| 9  | 其他        | -             | -            |
| 10 | 合计        | 14,807,026.02 | 83.93        |

#### 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  | 019706 | 23 国债 13 | 27,970 | 2,843,962.78 | 16.12        |
| 2  | 018003 | 国开 1401  | 21,080 | 2,564,078.79 | 14.53        |
| 3  | 019758 | 24 国债 21 | 17,000 | 1,707,407.34 | 9.68         |
| 4  | 102278 | 国债 2417  | 15,000 | 1,536,184.93 | 8.71         |
| 5  | 019749 | 24 国债 15 | 12,000 | 1,210,338.08 | 6.86         |

#### 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

本基金本报告期内无国债期货投资。

### 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

国开 1401

2024 年 12 月 27 日，京金罚决字(2024)43 号显示，国家开发银行存在贷款支付管理不到位、向未取得行政许可的项目发放贷款等违法违规事实，被处罚款 60 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规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票，均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

### 5.10.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额（元）     |
|----|---------|-----------|
| 1  | 存出保证金   | 30,200.34 |
| 2  | 应收证券清算款 | 10,972.62 |
| 3  | 应收股利    | -         |
| 4  | 应收利息    | -         |
| 5  | 应收申购款   | 2,191.57  |
| 6  | 其他应收款   | -         |
| 7  | 其他      | -         |
| 8  | 合计      | 43,364.53 |

### 5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码   | 债券名称 | 公允价值（元）    | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|------------|--------------|
| 1  | 110062 | 烽火转债 | 218,746.85 | 1.24         |
| 2  | 118024 | 冠宇转债 | 159,499.89 | 0.90         |

|    |        |         |            |      |
|----|--------|---------|------------|------|
| 3  | 113542 | 好客转债    | 135,594.25 | 0.77 |
| 4  | 113639 | 华正转债    | 125,510.30 | 0.71 |
| 5  | 113685 | 升 24 转债 | 122,997.56 | 0.70 |
| 6  | 110081 | 闻泰转债    | 111,742.05 | 0.63 |
| 7  | 128105 | 长集转债    | 109,699.59 | 0.62 |
| 8  | 110086 | 精工转债    | 107,523.97 | 0.61 |
| 9  | 123240 | 楚天转债    | 103,883.18 | 0.59 |
| 10 | 118023 | 广大转债    | 100,218.08 | 0.57 |
| 11 | 128130 | 景兴转债    | 99,120.26  | 0.56 |
| 12 | 127045 | 牧原转债    | 93,279.74  | 0.53 |
| 13 | 127049 | 希望转 2   | 87,155.62  | 0.49 |
| 14 | 113669 | 景 23 转债 | 77,203.36  | 0.44 |
| 15 | 118034 | 晶能转债    | 63,830.01  | 0.36 |
| 16 | 118008 | 海优转债    | 57,642.23  | 0.33 |
| 17 | 113682 | 益丰转债    | 46,316.27  | 0.26 |
| 18 | 127102 | 浙建转债    | 45,602.02  | 0.26 |
| 19 | 110082 | 宏发转债    | 38,714.88  | 0.22 |
| 20 | 123145 | 药石转债    | 38,195.51  | 0.22 |
| 21 | 113605 | 大参转债    | 36,139.55  | 0.20 |
| 22 | 127026 | 超声转债    | 34,952.93  | 0.20 |
| 23 | 111004 | 明新转债    | 34,615.97  | 0.20 |
| 24 | 123176 | 精测转 2   | 25,979.89  | 0.15 |
| 25 | 127101 | 豪鹏转债    | 25,667.92  | 0.15 |
| 26 | 118041 | 星球转债    | 25,520.78  | 0.14 |
| 27 | 128131 | 崇达转 2   | 24,702.54  | 0.14 |
| 28 | 111016 | 神通转债    | 24,489.84  | 0.14 |
| 29 | 123247 | 万凯转债    | 23,969.98  | 0.14 |
| 30 | 118035 | 国力转债    | 23,366.22  | 0.13 |
| 31 | 110089 | 兴发转债    | 23,325.73  | 0.13 |
| 32 | 127073 | 天赐转债    | 22,626.63  | 0.13 |
| 33 | 123171 | 共同转债    | 21,403.79  | 0.12 |
| 34 | 127068 | 顺博转债    | 20,959.70  | 0.12 |
| 35 | 123210 | 信服转债    | 20,276.61  | 0.11 |
| 36 | 127040 | 国泰转债    | 11,918.11  | 0.07 |
| 37 | 123150 | 九强转债    | 11,830.27  | 0.07 |
| 38 | 127031 | 洋丰转债    | 11,445.76  | 0.06 |
| 39 | 127098 | 欧晶转债    | 10,849.22  | 0.06 |
| 40 | 128101 | 联创转债    | 7,756.81   | 0.04 |
| 41 | 128122 | 兴森转债    | 6,232.23   | 0.04 |
| 42 | 113641 | 华友转债    | 6,072.92   | 0.03 |
| 43 | 113616 | 韦尔转债    | 6,070.04   | 0.03 |
| 44 | 128074 | 游族转债    | 5,958.14   | 0.03 |

|    |        |         |          |      |
|----|--------|---------|----------|------|
| 45 | 127070 | 大中转债    | 5,754.88 | 0.03 |
| 46 | 123216 | 科顺转债    | 5,530.15 | 0.03 |
| 47 | 123104 | 卫宁转债    | 2,406.06 | 0.01 |
| 48 | 127076 | 中宠转 2   | 1,574.98 | 0.01 |
| 49 | 118028 | 会通转债    | 1,415.34 | 0.01 |
| 50 | 123078 | 飞凯转债    | 1,283.03 | 0.01 |
| 51 | 123076 | 强力转债    | 1,232.03 | 0.01 |
| 52 | 113644 | 艾迪转债    | 1,222.49 | 0.01 |
| 53 | 127038 | 国微转债    | 1,205.20 | 0.01 |
| 54 | 118025 | 奕瑞转债    | 1,180.49 | 0.01 |
| 55 | 113064 | 东材转债    | 1,175.98 | 0.01 |
| 56 | 127090 | 兴瑞转债    | 1,174.80 | 0.01 |
| 57 | 123194 | 百洋转债    | 1,167.96 | 0.01 |
| 58 | 113656 | 嘉诚转债    | 1,166.02 | 0.01 |
| 59 | 113643 | 风语转债    | 1,162.83 | 0.01 |
| 60 | 113653 | 永 22 转债 | 1,131.71 | 0.01 |
| 61 | 113049 | 长汽转债    | 1,129.97 | 0.01 |
| 62 | 110085 | 通 22 转债 | 1,116.18 | 0.01 |
| 63 | 118005 | 天奈转债    | 1,106.50 | 0.01 |

### 5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### 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

|                           |                |
|---------------------------|----------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 181,965,018.08 |
| 报告期期间基金总申购份额              | 19,748,245.56  |
| 减： 报告期期间基金总赎回份额           | 187,029,300.66 |
| 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               | 14,683,962.98  |

## §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

| 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              | 20250101~20250122        | 138,618,658.16 | 0.00          | 138,618,658.16 | 0.00       | 0.00     |
|  | 2              | 20250220~20250325        | 0.00           | 14,640,803.37 | 14,640,803.37  | 0.00       | 0.00     |
| 个人   | 1              | 20250214~20250219        | 0.00           | 4,618,186.76  | 4,618,186.76   | 0.00       | 0.00     |
| 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。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。 |                |                          |                |               |                |            |          |

### 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、长盛积极配置债券型证券投资基金相关批准文件；
- 2、《长盛积极配置债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《长盛积极配置债券型证券投资基金托管协议》；
- 4、《长盛积极配置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

2025 年 4 月 22 日