

# 长城悦享回报债券型证券投资基金 2022 年中期报告

2022 年 6 月 30 日

基金管理人：长城基金管理有限公司

基金托管人：北京银行股份有限公司

送出日期：2022 年 8 月 31 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，并由董事长签发。

基金托管人北京银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 08 月 29 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 2022 年 01 月 01 日起至 2022 年 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
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	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	7
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
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	15
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>15</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	15
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	16
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>16</b>
6.1 资产负债表	16
6.2 利润表	17
6.3 净资产（基金净值）变动表	19
6.4 报表附注	22
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>50</b>
7.1 期末基金资产组合情况	50
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	50
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	51
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	52
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	54
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	54

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.....	54
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.....	54
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.....	54
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	55
7.11 投资组合报告附注.....	55
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>57</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	57
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	57
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.....	57
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>58</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>58</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	58
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.....	58
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	58
10.4 基金投资策略的改变.....	59
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	59
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.....	59
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	59
10.8 其他重大事件.....	60
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>61</b>
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 .....	61
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	61
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>61</b>
12.1 备查文件目录.....	61
12.2 存放地点.....	61
12.3 查阅方式.....	61

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	长城悦享回报债券型证券投资基金	
基金简称	长城悦享回报债券	
基金主代码	011897	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 6 月 22 日	
基金管理人	长城基金管理有限公司	
基金托管人	北京银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1, 111, 996, 931. 53 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	长城悦享回报债券 A	长城悦享回报债券 C
下属分级基金的交易代码	011897	011898
报告期末下属分级基金的份额总额	1, 102, 332, 366. 78 份	9, 664, 564. 75 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在控制风险的前提下，通过组合管理，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	<p>1、资产配置策略</p> <p>本基金通过对宏观经济环境、政策形势、证券市场走势的综合分析，主动判断市场时机，进行积极的资产配置，合理确定基金在股票、债券等各类资产类别上的投资比例，并随着各类资产风险收益特征的相对变化，适时进行动态调整。</p> <p>2、债券投资策略</p> <p>本基金通过对国内外宏观经济态势、利率走势、收益率曲线变化趋势和信用风险变化等因素进行综合分析，构建和调整固定收益证券投资组合，力求获得稳健的投资收益。</p> <p>3、股票投资策略</p> <p>(1) 个股精选策略</p> <p>本基金通过传统的定性分析手段，关注上市公司的竞争优势，筛选业绩可持续增长的公司。定量分析中，本基金将结合 PE、PB、PS、PEG 等相对估值指标以及自由现金流贴现等绝对估值方法来考察企业的估值水平，以判断当前股价高估或低估。本基金在关注估值指标的同时，还会关注营业收入增长率、盈利增长率、现金流量增长率、及净资产收益率等指标，来评估企业的成长性及未来价值。同时，本基金股票组合配置适度分散，并考察企业的流动性和换手率指标，降低股票资产的流动性风险。</p> <p>(2) 港股通标的投资策略</p> <p>本基金同时关注互联互通机制下港股市场优质标的的投资机会：</p>

	<p>1) 行业研究员重点覆盖的行业中，精选港股通中有代表性的行业优质公司； 2) 与 A 股公司相比具有差异化及估值优势的公司； 3) 港股通综合指数成分股中，筛选市值权重较高的公司进行配置。</p> <p>(3) 存托凭证投资策略</p> <p>对于存托凭证投资，本基金将在深入研究的基础上，通过定性分析和定量分析相结合的方式，精选出具有比较优势的存托凭证。</p> <p>4、国债期货投资策略</p> <p>本基金投资于国债期货，以套期保值为目的，以合理管理债券组合的久期、流动性和风险水平。</p> <p>5、资产支持证券投资策略</p> <p>本基金将通过资产支持证券基础资产及结构设计的研究，结合多种定价模型，根据基金资产组合情况适度进行资产支持证券的投资。</p>
业绩比较基准	中债综合财富指数收益率×90%+沪深 300 指数收益率×8%+恒生指数收益率（使用估值汇率折算）×2%
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期风险与预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。本基金可投资港股通标的股票，需承担因港股市场投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

### 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		长城基金管理有限公司	北京银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	车君	琚泽钧
	联系电话	0755-29279005	010-66225928
	电子邮箱	chejun@ccfund.com.cn	juzejun@bankofbeijing.com.cn
客户服务电话		400-8868-666	95526
传真		0755-29279000	010-66225309
注册地址		深圳市福田区莲花街道福新社区鹏程一路9号广电金融中心36层DEF单元、38层、39层	北京市西城区金融大街甲17号首层
办公地址		深圳市福田区莲花街道福新社区鹏程一路9号广电金融中心36层DEF单元、38层、39层	北京市西城区金融大街丙17号
邮政编码		518046	100033
法定代表人		王军	霍学文

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.ccfund.com.cn
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	长城基金管理有限公司	深圳市福田区莲花街道福新社区鹏程一路9号广电金融中心

36 层 DEF 单元、38 层、39 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(2022年01月01日-2022年06月30日)	
	长城悦享回报债券 A	长城悦享回报债券 C
本期已实现收益	-91,776,920.02	-791,446.75
本期利润	-99,300,353.02	-858,766.51
加权平均基金份额本期利润	-0.0836	-0.0839
本期加权平均净值利润率	-8.99%	-9.05%
本期基金份额净值增长率	-7.91%	-8.09%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022年6月30日)	
期末可供分配利润	-91,463,238.41	-838,195.88
期末可供分配基金份额利润	-0.0830	-0.0867
期末基金资产净值	1,010,869,128.37	8,826,368.87
期末基金份额净值	0.9170	0.9133
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	-8.30%	-8.67%

注：①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。

②上述基金业绩指标不包括持有人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。

③“期末可供分配利润”的计算方法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。

### 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

长城悦享回报债券 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
过去一个月	2.01%	0.23%	0.80%	0.11%	1.21%	0.12%
过去三个月	0.79%	0.41%	1.59%	0.14%	-0.80%	0.27%
过去六个月	-7.91%	0.45%	0.95%	0.16%	-8.86%	0.29%
过去一年	-8.33%	0.35%	2.72%	0.13%	-11.05%	0.22%
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	-8.30%	0.34%	3.15%	0.13%	-11.45%	0.21%

长城悦享回报债券 C

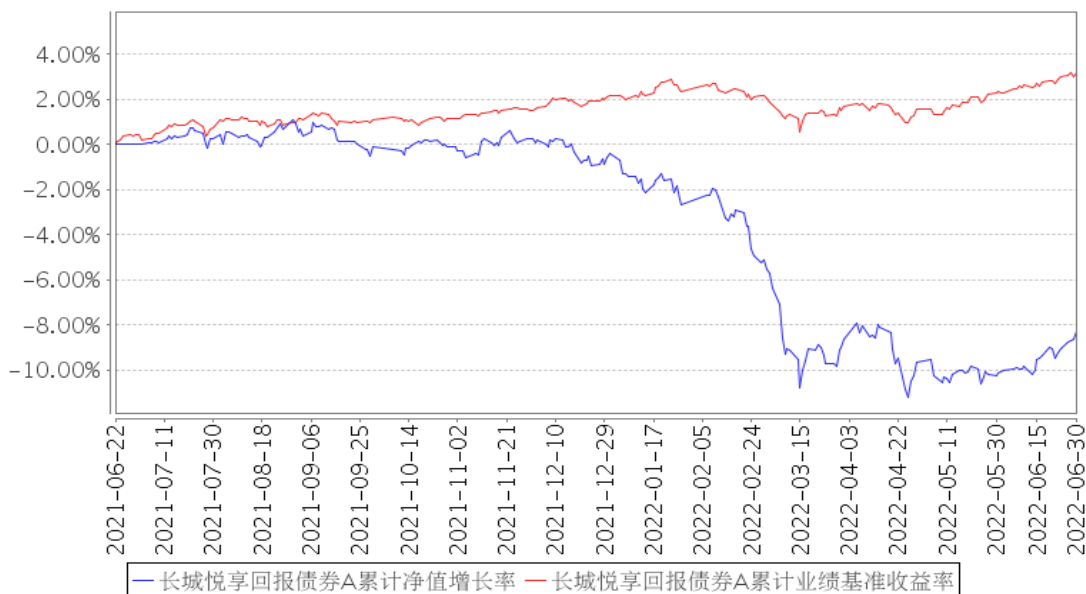
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	1.99%	0.23%	0.80%	0.11%	1.19%	0.12%
过去三个月	0.69%	0.41%	1.59%	0.14%	-0.90%	0.27%
过去六个月	-8.09%	0.45%	0.95%	0.16%	-9.04%	0.29%
过去一年	-8.69%	0.35%	2.72%	0.13%	-11.41%	0.22%
过去三年	-	-	-	-	-	-



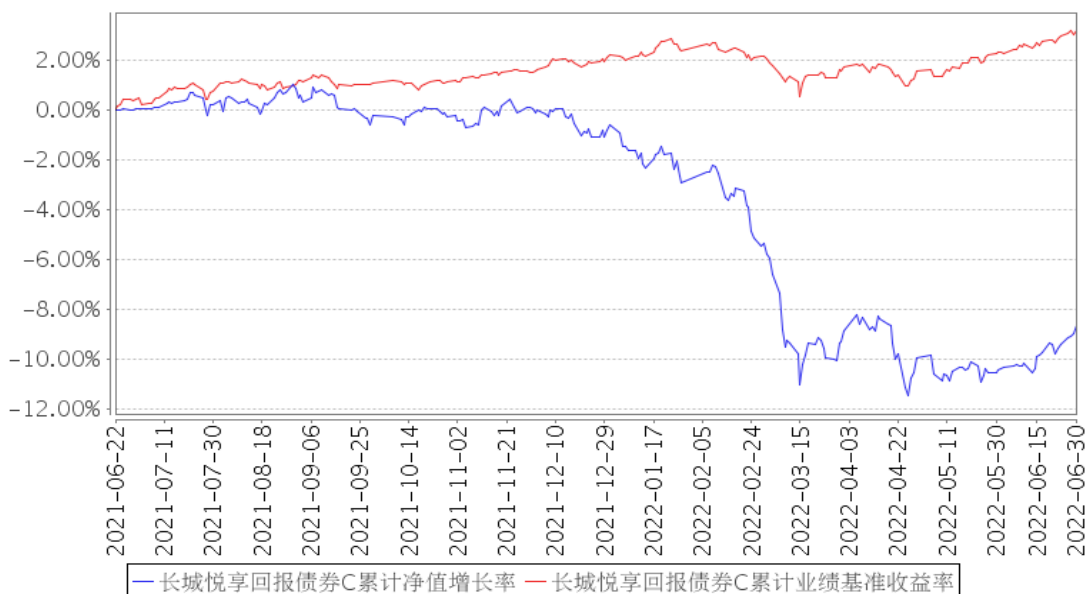
自基金合同生效起 至今	-8.67%	0.34%	3.15%	0.13%	-11.82%	0.21%
----------------	--------	-------	-------	-------	---------	-------

### 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

长城悦享回报债券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



长城悦享回报债券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



注：①本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%，投资于股票等权益类资产的比例不超过基金资产的 20%，其中港股通标的股票的投资比例为股票资产的 0%-50%。本基金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，保持现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计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。

②本基金的建仓期为自基金合同生效之日起六个月内，建仓期满时，各项资产配置比例符合基金合同约定。

## § 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

长城基金管理有限公司成立于 2001 年，是经中国证监会批准设立的公募基金管理公司，由长城证券有限责任公司（现长城证券股份有限公司）、东方证券有限责任公司（现东方证券股份有限公司）、中原信托投资有限公司（现中原信托有限公司）、西北证券有限责任公司和天津北方国际信托投资公司（现北方国际信托股份有限公司）共同出资设立，当时注册资本为壹亿元人民币。

2007 年 5 月 21 日，经中国证监会批准，公司完成股权结构调整，现有股东为长城证券股份有限公司（47.059%）、东方证券股份有限公司（17.647%）、北方国际信托股份有限公司（17.647%）和中原信托有限公司（17.647%）。

2007 年 10 月 12 日，经中国证监会批准，公司注册资本增至壹亿伍仟万元人民币。

公司经营范围是基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其他业务。

截至本报告期末，公司管理的基金有：长城久恒灵活配置混合型证券投资基金、长城久泰沪深 300 指数证券投资基金、长城货币市场证券投资基金、长城消费增值混合型证券投资基金、长城安心回报混合型证券投资基金、长城久富核心成长混合型证券投资基金(LOF)、长城品牌优选混合型证券投资基金、长城稳健增利债券型证券投资基金、长城双动力混合型证券投资基金、长城中小盘成长混合型证券投资基金、长城积极增利债券型证券投资基金、长城优化升级混合型证券投资基金、长城稳健成长灵活配置混合型证券投资基金、长城核心优选灵活配置混合型证券投资基金、长城增强收益定期开放债券型证券投资基金、长城医疗保健混合型证券投资基金、长城工资宝货币市场基金、长城久鼎灵活配置混合型证券投资基金、长城稳固收益债券型证券投资基金、长城新兴产业灵活配置混合型证券投资基金、长城环保主题灵活配置混合型证券投资基金、长城改革红利灵活配置混合型证券投资基金、长城久惠灵活配置混合型证券投资基金、长城久祥灵活配置混合型证券投资基金、长城行业轮动灵活配置混合型证券投资基金、长城新优选混合型证券投资基金、长城久润灵活配置混合型证券投资基金、长城久益灵活配置混合型证券投资基金、长城久源灵活配置混合型证券投资基金、长城久鼎灵活配置混合型证券投资基金、长城久稳债券型证券投资基金、长城中国智造灵活配置混合型证券投资基金、长城悦享增利债券型基金、长城创

业板指数增强型发起式证券投资基金、长城久嘉创新成长灵活配置混合型证券投资基金、长城收益宝货币市场基金、长城智能产业灵活配置混合型证券投资基金、长城久荣纯债定期开放债券型发起式证券投资基金、长城中证 500 指数增强型证券投资基金、长城久悦债券型证券投资基金、长城核心优势混合型证券投资基金、长城量化精选股票型证券投资基金、长城港股通价值精选多策略混合型证券投资基金、长城研究精选混合型证券投资基金、长城短债债券型证券投资基金、长城久瑞三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长城嘉鑫两年定期开放债券型证券投资基金、长城量化小盘股票型证券投资基金、长城泰利纯债债券型证券投资基金、长城价值优选混合型证券投资基金、长城恒康稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、长城创新驱动混合型证券投资基金、长城中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金、长城健康生活灵活配置混合型证券投资基金、长城成长先锋混合型证券投资基金、长城恒泰养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、长城优选增强六个月持有期混合型证券投资基金、长城中债 3-5 年国开行债券指数证券投资基金、长城均衡优选混合型证券投资基金、长城品质成长混合型证券投资基金、长城优选回报六个月持有期混合型证券投资基金、长城稳利纯债债券型证券投资基金、长城价值成长六个月持有期混合型证券投资基金、长城优选添瑞六个月持有期混合型证券投资基金、长城优选稳进六个月持有期混合型证券投资基金、长城消费 30 股票型证券投资基金、长城中债 5-10 年国开行债券指数证券投资基金、长城医药科技六个月持有期混合型证券投资基金、长城悦享回报债券型证券投资基金、长城竞争优势六个月持有期混合型证券投资基金、长城优选添利一年持有期混合型证券投资基金、长城科创板两年定期开放混合型证券投资基金、长城兴华优选一年定期开放混合型证券投资基金、长城中债 1-5 年国开行债券指数证券投资基金、长城健康消费混合型证券投资基金、长城恒利纯债债券型证券投资基金、长城大健康混合型证券投资基金、长城价值领航混合型证券投资基金、长城信利一年定期开放债券型发起式证券投资基金、长城新能源股票型发起式证券投资基金、长城优选招益一年持有期混合型证券投资基金、长城价值甄选一年持有期混合型证券投资基金、长城中证医药卫生指数增强型证券投资基金、长城瑞利纯债债券型证券投资基金、长城产业成长混合型证券投资基金。

#### 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		
魏建	本基金的基金经理	2021 年 6 月 22 日	-	14 年	男，中国籍，硕士。2008 年 7 月-2020 年 2 月曾就职于博时基金管理有限公司。2020 年 3 月加入长城基金管理有限公司，历任固定收益部研究员，自 2021 年 6 月至 2021

					年 11 月任“长城转型成长灵活配置混合型证券投资基金”基金经理。自 2020 年 7 月至今任“长城稳健增利债券型证券投资基金”、“长城久稳债券型证券投资基金”、“长城久荣纯债定期开放债券型发起式证券投资基金”、“长城积极增利债券型证券投资基金”基金经理，自 2021 年 6 月至今任“长城悦享回报债券型证券投资基金”基金经理，自 2021 年 11 月至今任“长城恒利纯债债券型证券投资基金”、“长城悦享增利债券型证券投资基金”基金经理，自 2021 年 12 月至今任“长城信利一年定期开放债券型发起式证券投资基金”基金经理，自 2022 年 6 月至今任“长城瑞利纯债债券型证券投资基金”基金经理。
张勇	公司总经理助理、固定收益投资总监、本基金的基金经理	2022 年 4 月 13 日	-	19 年	男，中国籍，硕士。2001 年 8 月-2003 年 12 月曾任南京银行资金营运中心债券交易员，2003 年 12 月-2015 年 6 月曾就职于博时基金管理有限公司历任交易员、基金经理，2015 年 6 月-2019 年 5 月曾就职于九泰基金管理有限公司任绝对收益部负责人，具有 21 年债券投资管理经历。2019 年 5 月加入长城基金管理有限公司，历任固定收益部总经理，现任公司总经理助理、固定收益投资总监、投委会委员兼基金经理。自 2020 年 9 月至今任“长城积极增利债券型证券投资基金”、“长城久悦债券型证券投资基金”基金经理，自 2022 年 4 月至今任“长城悦享回报债券型证券投资基金”基金经理。

注：①上述任职日期、离任日期根据公司做出决定的任免日期填写。

②证券从业年限的计算方式遵从从业人员的相关规定。

#### 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

注：无。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同和其他有关法律法规的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制和防范风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大的利益，未出现投资违反法律法规、基金合同约定和相关规定的情况，无因公司未勤勉尽责或操作不当而导致基金财产损失的情况，不存在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，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《长城基金管理有限公司公平交易管理制度》的规定，不同投资者的利益得到了公平对待。

本基金管理人严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，对同向交易的价差进行事后分析，并对基金经理兼任投资经理的组合执行更长周期的交易价差分析，定期出具公平交易稽核报告。本报告期报告认为，本基金管理人旗下投资组合的同向交易价差均在合理范围内，结果符合相关政策法规和公司制度的规定。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为，没有出现基金参与的交易所公开竞价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% 的现象。

### 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

2022 年一季度，年初经济增速企稳向好，但疫情冲击下基本面承压。继中央经济工作会议后，政府工作报告再次退出稳增长的政策取向，并提出 5.5% 的经济增速目标。在稳增长政策的推动下，一季度经济开局较好，1-2 月经济数据大超预期，生产、消费、投资均大幅好于去年 12 月，经济基本面企稳向好。但 3 月疫情多点扩散，全国的生产、消费和物流都受到严重影响。

二季度，受疫情反复影响，国内经济增速放缓。二季度上半 PMI、社融、进出口等经济数据整体低于市场预期，经济基本面承压，宽货币及宽信用政策并行，LPR 超预期下调，宽信用再度加码，降准进一步释放流动性，资金面整体维持宽松。二季度下旬以来，疫情冲击减弱，经济探底修复，整体修复力度温和，制造业投资改善，地产销售环比增速拐点出现，出口增速超预期回升，城镇调查失业率小幅回落。随着复工复产持续推进，经济继续爬坡，宽信用政策继续加码，社融增速有望继续回升。

2022 年一季度，债券市场先涨后跌，而后维持震荡，整体震荡。1 月份在前期央行降准和月中央行下调 MLF 操作利率的带动下，市场被宽货币预期主导，收益率下行至低点，十年期国债一度下降到 2.67%。2 月，美国通胀大超预期，节后在美联储紧缩预期下美债利率上行，叠加 1 月社融数据超预期带来宽信用担忧，收益率逐步上行，2 月下旬在俄乌冲突、广州房贷利率下调等因素影响下，收益率冲高回落。3 月央行上缴结存利润、重点领域项目建设、多地放宽购房政策等宽信用政策频频落地，2 月社融数据低于预期，而经济数据大超预期，市场在宽信用和宽货币之间反复摇摆，叠加疫情和地缘冲突的扰动，利率整体呈现震荡走势。二季度，债券市场窄幅震荡，

整体小幅下跌。4 月市场宽松预期增强，中旬降准幅度不及预期，中央政治局会议后稳增长政策措施加快落地，长端收益率先下后上，整体上行；5 月份经济基本面承压，资金面持续宽松，市场宽货币预期再起，长端收益率有所下行；6 月高频数据显示生产需求进一步修复，经济基本面边际改善，受跨季等因素影响，资金利率小幅上行，债券收益率震荡调整。

一季度权益市场指数层面整体重现震荡下跌态势，上证指数下跌 10.65%，创业板指下跌 19.96%。从行业表现来看，市场风格从新能源等赛道股重新回到价值股，稳增长标的有所表现。从细分领域看，煤炭以及房地产、银行、建筑等与稳增长相关的标的表现良好。4 月份在上海疫情爆发的影响下，股市再次大幅调整。4 月底开始，疫情逐渐好转叠加促汽车、家电消费等政策密集出台，风险偏好回升，权益市场大幅反弹，反弹行业一开始集中在风光储和电动车，后来消费和医药也有所表现。

一季度，基于对市场风格变化的预判和基金净值稳健增长角度考虑，我们对权益仓位做了一定的交易操作，同时减持了成长标的，增配了稳增长相关的价值和周期标的，纯债方面持有为主。二季度，考虑到权益资产超跌后的价值，我们在市场调整过程中适当提升了权益相关资产的仓位，持仓结构依然保持偏价值和周期的方向。纯债持仓主要以票息资产为主。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末长城悦享回报债券 A 的基金份额净值为 0.9170 元，本报告期基金份额净值增长率为-7.91%，同期业绩比较基准收益率为 0.95%；截至本报告期末长城悦享回报债券 C 的基金份额净值为 0.9133 元，本报告期基金份额净值增长率为-8.09%，同期业绩比较基准收益率为 0.95%。

#### 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，国内经济方面，货币政策预计将继续保持宽松，财政政策会继续发力，重点关注几个方面：地产销售能否起来，地方基建能否明显上量，疫情对消费的负向扰动能否缓解。海外宏观方面，在通胀没有明显缓解的情况下，预计各国央行还会继续收缩流动性，欧美经济是否会很快进入衰退也取决于美联储收紧的力度和节奏。基准情形下，假设没有突发疫情或其他特殊因素的影响，我们预计下半年国内经济将触底回升，但复苏的力度可能不会太强，企业盈利也会见到改善。大类资产配置上，我们认为权益、商品等资产可能好于债券和货币类资产。

#### 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和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。本基金管理人改变估值技术，导致基金资产净值的变化在 0.25%以上的，则及时就所采用的相关

估值技术、假设及输入值的适当性等咨询会计师事务所的专业意见。

本基金管理人成立了受托资产估值委员会，为基金估值业务的最高决策机构，由公司总经理、分管估值业务副总经理、督察长、投资总监、研究部总经理、运行保障部总经理、基金会计、基金经理和行业研究员、金融工程研究员等组成，公司监察稽核人员列席受托资产估值委员会。受托资产估值委员会负责制定、修订和完善基金估值政策和程序，定期对估值政策和程序进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性及其适用性的情况后及时修订估值方法，以保证其持续适用。受托资产估值委员会的相关人员均具有一定年限的专业从业经验，具有良好的专业能力，并能在相关工作中保持独立性。基金经理作为估值委员会成员，凭借其丰富的专业技能和对市场产品的长期深入的跟踪研究，向受托资产估值委员会建议应采用的估值方法及合理的估值区间。基金经理有权出席估值委员会会议，但不得干涉估值委员会作出的决定及估值政策的执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署债券估值数据服务协议、流通受限股票流动性折扣委托计算协议，由其按约定提供债券品种的估值数据及流通受限股票流动性折扣数据。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

#### 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

本报告期内，本基金无需要说明的情况。

## § 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

在本报告期内，本基金托管人在托管长城悦享回报债券型证券投资基金过程中，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》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，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

在本报告期内，本基金托管人按照相关法律法规、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支以及利润分配等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作进行了监督，未发现基金管理人有关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

本基金托管人复核了本中期报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容，复核内容真实、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：长城悦享回报债券型证券投资基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	781,540.43	10,249,628.45
结算备付金		14,285,221.82	26,526,349.61
存出保证金		882,797.58	929,832.09
交易性金融资产	6.4.7.2	1,073,293,862.30	1,614,150,423.76
其中：股票投资		201,510,927.08	253,792,129.02
基金投资		-	-
债券投资		871,782,935.22	1,360,358,294.74
资产支持证券投资		-	-
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	23,700,000.00	-
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		22,308,996.60	5,587,159.50
应收股利		-	-
应收申购款		26,413.28	10,513.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	20,072,949.58
资产总计		1,135,278,832.01	1,677,526,855.99
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2021 年 12 月 31 日</b>



<b>负债：</b>			
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		90,176,000.00	363,000,000.00
应付清算款		21,058,897.84	1,854,290.98
应付赎回款		2,748,588.32	5,145,410.74
应付管理人报酬		670,835.71	904,567.04
应付托管费		167,708.93	226,141.75
应付销售服务费		2,885.37	4,023.59
应付投资顾问费		-	-
应交税费		47,604.17	95,766.95
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	710,814.43	1,348,345.09
负债合计		115,583,334.77	372,578,546.14
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	1,111,996,931.53	1,310,491,037.79
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-92,301,434.29	-5,542,727.94
净资产合计		1,019,695,497.24	1,304,948,309.85
负债和净资产总计		1,135,278,832.01	1,677,526,855.99

注：①报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额总额 1,111,996,931.53 份，其中长城悦享回报债券 A 基金份额总额 1,102,332,366.78 份，基金份额净值 0.9170 元；长城悦享回报债券 C 基金份额总额 9,664,564.75 份，基金份额净值 0.9133 元。

②比较数据已根据本年《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>》中的资产负债表格式的要求进行列示：上年末资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表中“其他资产”项目的“上年度末”余额，上年末资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额。

## 6.2 利润表

会计主体：长城悦享回报债券型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	2021 年 6 月 22 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-92,335,051.96	795,816.87

1. 利息收入		324,894.88	1,080,009.19
其中：存款利息收入	6.4.7.13	231,482.64	205,605.22
债券利息收入		-	49,319.31
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		93,412.24	825,084.66
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-85,069,197.87	-
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-48,679,572.11	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-39,177,388.77	-
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益		-	-
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	2,787,763.01	-
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
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	-7,590,752.76	-284,192.32
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	3.79	-
<b>减：二、营业总支出</b>		7,824,067.57	337,912.10
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	4,437,817.76	267,880.98
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,109,454.38	66,970.24
3. 销售服务费		18,892.95	1,325.14
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		2,106,015.81	-
其中：卖出回购金融资产支出		2,106,015.81	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		39,265.64	177.55
8. 其他费用	6.4.7.23	112,621.03	1,558.19
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-100,159,119.53	457,904.77
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-100,159,119.53	457,904.77

五、其他综合收益的税后净额			
六、综合收益总额		-100,159,119.53	457,904.77

注：比较数据已根据本年《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〉》中的利润表格式的要求进行列示。上年度可比期间利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在本期利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：长城悦享回报债券型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	1,310,491,037.79	-	-5,542,727.94	1,304,948,309.85
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	1,310,491,037.79	-	-5,542,727.94	1,304,948,309.85
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)				
(一)、综合收益总额	-	-	-100,159,119.53	-100,159,119.53
(二)、本期基金份额	-198,494,106.26	-	13,400,413.18	-185,093,693.08

交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）				
其中：1. 基金申购款	3,342,989.42	-	-209,014.37	3,133,975.05
2. 基金赎回款	-201,837,095.68	-	13,609,427.55	-188,227,668.13
（三）、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)	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	1,111,996,931.53	-	-92,301,434.29	1,019,695,497.24
项目	上年度可比期间			
	2021年6月22日（基金合同生效日）至2021年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	-	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-	-

前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期末期初净资产(基金净值)	1,527,499,546.08	-	-	1,527,499,546.08
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-	-	457,904.77	457,904.77
(一)、综合收益总额	-	-	457,904.77	457,904.77
(二)、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)	-	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-	-
(三)、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)				
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期末净资产(基金净值)	1,527,499,546.08	-	457,904.77	1,527,957,450.85

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：

<u>王军</u>	<u>邱春杨</u>	<u>赵永强</u>
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

长城悦享回报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【2021】814 号文“关于准予长城悦享回报债券型证券投资基金注册的批复”的核准，由长城基金管理有限公司作为管理人自 2021 年 6 月 8 日至 2021 年 6 月 18 日向社会公开发售募集，募集期结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具安永华明（2021）验字第 60737541\_H09 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 2021 年 6 月 22 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集的有效认购资金（本金）为人民币 1,527,202,581.40 元，在首次募集期间有效认购资金产生的利息为人民币 296,964.68 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 1,527,499,546.08 元，折合 1,527,499,546.08 份基金份额。本基金的基金管理人为长城基金管理有限公司，注册登记机构为长城基金管理有限公司，基金托管人为北京银行股份有限公司（以下简称“北京银行”）。

本基金根据认购/申购费用、销售服务费用收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取认购/申购费，但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；在投资人认购/申购时不收取认购/申购费，而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。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括债券（国内依法发行和上市交易的国

债、金融债、企业债、公司债、政府支持债券、次级债、可转换债券、可交换债券、可分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券）、股票（包括中小板、创业板、存托凭证及其他经中国证监会允许基金投资的股票）、港股通标的股票、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、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金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。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。

本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%，投资于股票等权益类资产的比例不超过基金资产的 20%，其中港股通标的股票的投资比例为股票资产的 0%-50%。本基金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，保持现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计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。

本基金的业绩比较基准为：中债综合财富指数收益率×90%+沪深 300 指数收益率×8%+恒生指数收益率（使用估值汇率折算）×2%。

#### 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（以下合称“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》、《公开募集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 3 号《半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〈年度报告和中期报告〉》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。

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 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2022 年 1 月 1 日起至 2022 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

#### 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

除下文 6.4.5.1 会计政策变更的说明中涉及的变更外，本基金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

#### 新金融工具准则

根据《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》、《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（统称“新金融工具准则”）、《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》的规定和相关法律法规的要求，本基金自 2022 年 1 月 1 日开始按照新金融工具准则进行会计处理，根据衔接规定，对可比期间信息不予调整，首日执行新金融工具准则与现行准则的差异追溯调整本报告期期初未分配利润。

新金融工具准则改变了金融资产的分类和计量方式，确定了三个主要的计量类别：摊余成本；以公允价值计量且其变动计入其他综合收益；以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金考虑自身业务模式，以及金融资产的合同现金流特征进行上述分类。

新金融工具准则要求金融资产减值计量由“已发生损失模型”改为“预期信用损失模型”，适用于以摊余成本计量的金融资产。金融资产减值计量的变更对于本基金的影响不重大。

本基金将基于实际利率法计提的金融工具的利息包含在相应金融工具的账面余额中，并反映在相关“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等项目中，不单独列示“应收利息”项目或“应付利息”项目。

“信用减值损失”项目，反映本基金计提金融工具信用损失准备所确认的信用损失。本基金将分类为以摊余成本计量的金融资产按照实际利率法计算的利息收入反映在“利息收入”项目中，其他项目的利息收入从“利息收入”项目调整至“投资收益”项目列示。

于首次执行日，原金融资产和金融负债账面价值调整为按照修订后金融工具确认和计量准则的规定进行分类和计量的新金融资产和金融负债账面价值的调节如下所述：

#### 以摊余成本计量的金融资产：

银行存款于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 10,249,628.45 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 918.33 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，银行存款于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 10,250,546.78 元。

结算备付金于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 26,526,349.61 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 13,130.59 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，结算备付金于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则



列示的账面价值为人民币 26,539,480.20 元。

存出保证金于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 929,832.09 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 460.35 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，存出保证金于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 930,292.44 元。

买入返售金融资产于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 0.00 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 0.00 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，买入返售金融资产于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 0.00 元。

应收利息于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 20,072,949.58 元，转出至银行存款的重分类金额为人民币 918.33 元，转出至结算备付金的重分类金额为人民币 13,130.59 元，转出至存出保证金的重分类金额为人民币 460.35 元，转出至交易性金融资产的重分类金额为人民币 20,058,440.31 元，转出至买入返售金融资产的重分类金额为人民币 0.00 元，转出至应收申购款的重分类金额为人民币 0.00 元，转出至其他资产的重分类金额为人民币 0.00 元。经上述重分类后，应收利息不再作为财务报表项目单独列报。

应收申购款于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 10,513.00 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 0.00 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，应收申购款于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 10,513.00 元。

其他资产于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 0.00 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 0.00 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，其他资产于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 0.00 元。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产：

交易性金融资产于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 1,614,150,423.76 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 20,058,440.31 元。经上述重分类后，交易性金融资产于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 1,634,208,864.07 元。

以摊余成本计量的金融负债：

卖出回购金融资产款于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币

363,000,000.00 元，自应付利息转入的重分类金额为人民币-162,061.63 元。经上述重分类后，卖出回购金融资产款于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 362,837,938.37 元。

应付利息于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币-162,061.63 元，转出至卖出回购金融资产款的重分类金额为人民币-162,061.63 元。经上述重分类后，应付利息不再作为财务报表项目单独列报。

除上述财务报表项目外，于首次执行日，新金融工具准则的执行对财务报表其他金融资产及金融负债项目无影响。

于首次执行日，新金融工具准则的执行对本基金金融资产计提的减值准备金额无重大影响。上述会计政策变更未导致本基金本期期初未分配利润的变化。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无需要说明的重大会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

##### (1) 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，证券（股票）交易印花税税率为 1%，由出让方缴纳。

股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

##### (2) 增值税、企业所得税

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，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。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》，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供贷款服务，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。

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。

股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税。

### (3) 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011 年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个体，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业发展费附加的单位外）及地方教育费附加。

### (4) 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号《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》，自2008年10月9日起暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《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》的规定，自2013年1月1日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，暂减按25%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。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101号文《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》的规定，自2015年9月8日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税。

#### (5) 境外投资

本基金运作过程中涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日
活期存款	781,540.43
等于：本金	781,413.05
加：应计利息	127.38
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	781,540.43

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	198,500,967.68	-	201,510,927.08	3,009,959.40	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	803,012,892.34	12,874,348.54	799,689,609.74	-16,197,631.14
	银行间市场	71,397,558.10	1,146,325.48	72,093,325.48	-450,558.10
	合计	874,410,450.44	14,020,674.02	871,782,935.22	-16,648,189.24
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	1,072,911,418.12	14,020,674.02	1,073,293,862.30	-13,638,229.84	

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：无。

##### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：无。

##### 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：无。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	23,700,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	23,700,000.00	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：无。

6.4.7.8 其他资产

注：无。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 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	612,554.28
其中：交易所市场	610,511.78
银行间市场	2,042.50
应付利息	-
预提费用	98,260.15
合计	710,814.43

## 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

## 长城悦享回报债券 A

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,299,586,306.44	1,299,586,306.44
本期申购	1,951,773.87	1,951,773.87
本期赎回（以“-”号填列）	-199,205,713.53	-199,205,713.53
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	1,102,332,366.78	1,102,332,366.78

## 长城悦享回报债券 C

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	10,904,731.35	10,904,731.35
本期申购	1,391,215.55	1,391,215.55
本期赎回（以“-”号填列）	-2,631,382.15	-2,631,382.15
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	9,664,564.75	9,664,564.75

注：本期申购包含基金转入份额及金额，本期赎回包含基金转出份额及金额。

## 6.4.7.11 其他综合收益

注：无。

## 6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

## 长城悦享回报债券 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	502,326.73	-5,976,145.76	-5,473,819.03
本期利润	-91,776,920.02	-7,523,433.00	-99,300,353.02
本期基金份额交易产生的变动数	8,069,713.53	5,241,220.11	13,310,933.64
其中：基金申购款	-113,212.59	-58,965.01	-172,177.60
基金赎回款	8,182,926.12	5,300,185.12	13,483,111.24
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-83,204,879.76	-8,258,358.65	-91,463,238.41

## 长城悦享回报债券 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-18,848.24	-50,060.67	-68,908.91
本期利润	-791,446.75	-67,319.76	-858,766.51
本期基金份额交易产生的变动数	44,649.23	44,830.31	89,479.54
其中：基金申购款	-16,706.68	-20,130.09	-36,836.77
基金赎回款	61,355.91	64,960.40	126,316.31
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-765,645.76	-72,550.12	-838,195.88

## 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
活期存款利息收入	37,517.83
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	185,464.23
其他	8,500.58
合计	231,482.64

注：其他为结算保证金利息收入。

## 6.4.7.14 股票投资收益

## 6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-48,679,572.11
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-48,679,572.11

## 6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出股票成交总额	977,663,819.74
减：卖出股票成本总额	1,023,390,602.86
减：交易费用	2,952,788.99
买卖股票差价收入	-48,679,572.11



**6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入**

注：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 2022年1月1日至2022年6月30日
债券投资收益——利息收入	12,789,407.42
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-51,966,796.19
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	-39,177,388.77

**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 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,755,902,697.90
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,783,175,923.06
减：应计利息总额	24,670,186.03
减：交易费用	23,385.00
买卖债券差价收入	-51,966,796.19

**6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入**

注：无。

**6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入**

注：无。

**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**

注：无。

**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**

注：无。

**6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入**

注：无。

## 6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：无。

## 6.4.7.17 贵金属投资收益

## 6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：无。

## 6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

## 6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

## 6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

## 6.4.7.18 衍生工具收益

## 6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：无。

## 6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无。

## 6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	2,787,763.01
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,787,763.01

## 6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-7,590,752.76
股票投资	1,269,471.54
债券投资	-8,860,224.30
资产支持证券投资	-
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	-7,590,752.76

#### 6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
基金赎回费收入	3.79
合计	3.79

#### 6.4.7.22 信用减值损失

注：无。

#### 6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
审计费用	29,752.78
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	4,760.88
账户维护费	18,000.00
上交所查询费	600.00
合计	112,621.03

#### 6.4.7.24 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 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

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

#### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 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

本基金本报告期无与对本基金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
长城基金管理有限公司（“长城基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
北京银行股份有限公司（“北京银行”）	基金托管人、基金销售机构
长城证券股份有限公司（“长城证券”）	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。

#### 6.4.10 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

###### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年6月22日（基金合同生效日） 至2021年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 （%）	成交金额	占当期股票 成交总额的比例（%）
长城证券	1,939,751,360.92	100.00	-	-

###### 6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年6月22日（基金合同生效日）至 2021年6月30日	
	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 成交总额的比例 （%）
长城证券	2,080,759,936.32	100.00	156,420,192.32	100.00

###### 6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年6月22日（基金合同生效日） 至2021年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 （%）	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 （%）

长城证券	20,014,487,000.00	100.00	3,798,000,000.00	100.00
------	-------------------	--------	------------------	--------

#### 6.4.10.1.4 权证交易

注：无。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
长城证券	1,806,490.64	100.00	610,511.78	100.00
关联方名称	上年度可比期间 2021年6月22日（基金合同生效日）至2021年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
长城证券	-	-	-	-

注：上述佣金按市场佣金率计算，扣除券商需承担的费用（包括但不限于买（卖）经手费、证券结算风险基金和证券交易所买（卖）证管费等）。

管理人因此从关联方获取的其他服务主要包括：为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

#### 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 2022年1月1日至2022年6 月30日	上年度可比期间 2021年6月22日（基金合 同生效日）至2021年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	4,437,817.76	267,880.98
其中：支付销售机构的客户维护费	2,215,104.82	6.16

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0.80%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.80\% / \text{当年天数}$$

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 2022年1月1日至2022年6	上年度可比期间 2021年6月22日（基金合
----	------------------------	---------------------------

	月 30 日	同生效日)至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,109,454.38	66,970.24

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 0.20% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.20\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

#### 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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	长城悦享回报债券 A	长城悦享回报债券 C	合计
北京银行	-	16,801.48	16,801.48
长城基金管理有限公司	-	79.98	79.98
长城证券	-	5.43	5.43
合计	-	16,886.89	16,886.89
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2021 年 6 月 22 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	长城悦享回报债券 A	长城悦享回报债券 C	合计
北京银行	-	1,300.57	1,300.57
长城基金管理有限公司	-	0.01	0.01
长城证券	-	0.24	0.24
合计	-	1,300.82	1,300.82

注：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 类基金份额的销售服务费年费率为 0.4%。销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.4% 年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.4\% / \text{当年天数}$$

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

注：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**

注：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**

注：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自有资金投资本基金的情况**

注：本基金的基金管理人于本期及上年度可比期间未运用自有资金投资于本基金份额，于本期末及上年度可比期末亦未持有本基金份额。

**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**

注：除基金管理人之外的本基金其他关联方于本期末及上年度末均未持有本基金份额。

**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		上年度可比期间	
	2022年1月1日至2022年6月30日		2021年6月22日（基金合同生效日）至2021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
北京银行	781,540.43	37,517.83	590,002.86	205,605.22

注：本基金的银行存款由基金托管人北京银行保管，并按银行同业利率计息。

**6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

注：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**

注：本基金于本期未进行利润分配。

本基金于资产负债表日后、本财务报表批准报出日之前的利润分配情况，请参阅本财务报表

**6.4.8.2 资产负债表日后事项。****6.4.12 期末(2022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**

注：无。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：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

注：截至本报告期末 2022 年 06 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为人民币 0.00 元，无质押债券。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2022 年 06 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 90,176,000.00 元，于 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/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。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：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

本基金在日常经营活动中由金融工具产生的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的，由风险控制委员会，投资决策委员会、监察稽核部和风险管理部，以及相关职能部门构成的三级风险管理架构体系。

##### 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，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。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管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券市值的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。



#### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：无。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

注：无。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时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。

#### 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》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。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。

本基金所持有证券均在证券交易所上市交易，或在银行间同业市场交易，除在附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制外(如有)，其余均能及时变现。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，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。除附注 6.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额(如有)将在 1 个月内到期且计息外，本基

金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

#### 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

利率风险是指基金的财务状况和现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金、债券投资及买入返售金融资产等。本基金管理人每日对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

下表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合同约定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 年 6 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	781,540.43	-	-	-	-	-	781,540.43
结算备付金	14,285,221.82	-	-	-	-	-	14,285,221.82
存出保	882,797.58	-	-	-	-	-	882,797.58

证金							
交易性金融资产	90,738,206.84	66,738,961.10	282,748,317.46	360,712,410.90	70,845,038.92	201,510,927.08	1,073,293,862.30
买入返售金融资产	23,700,000.00	-	-	-	-	-	23,700,000.00
应收申购款	-	-	-	-	-	26,413.28	26,413.28
应收清算款	-	-	-	-	-	22,308,996.60	22,308,996.60
资产总计	130,387,766.67	66,738,961.10	282,748,317.46	360,712,410.90	70,845,038.92	223,846,336.96	1,135,278,832.01
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	2,748,588.32	2,748,588.32
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	670,835.71	670,835.71

应付托管费	-	-	-	-	-	167,708.93	167,708.93
应付清算款	-	-	-	-	-	21,058,897.84	21,058,897.84
卖出回购金融资产款	90,176,000.00	-	-	-	-	-	90,176,000.00
应付销售服务费	-	-	-	-	-	2,885.37	2,885.37
应交税费	-	-	-	-	-	47,604.17	47,604.17
其他负债	-	-	-	-	-	710,814.43	710,814.43
负债总计	90,176,000.00	-	-	-	-	25,407,334.77	115,583,334.77
利率敏感度缺口	40,211,766.67	66,738,961.10	282,748,317.46	360,712,410.90	70,845,038.92	-	-

上 年 度 末 202 1 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行 存款	10,249,628.45	-	-	-	-	-	10,249,628.45
结算 备付 金	26,526,349.61	-	-	-	-	-	26,526,349.61
存出 保证 金	929,832.09	-	-	-	-	-	929,832.09
交易 性金 融资 产	1,715,000.00	10,880,800.00	404,887,935.60	927,438,294.50	15,436,264.64	253,792,129.02	1,614,150,423.76
应收 申购 款	-	-	-	-	-	10,513.00	10,513.00
应收 证券 清算	-	-	-	-	-	5,587,159.50	5,587,159.50

款							
其他资产	-	-	-	-	-	20,072,949.58	20,072,949.58
资产总计	39,420,810.15	10,880,800.00	404,887,935.60	927,438,294.50	15,436,264.64	279,462,751.10	1,677,526,855.99
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	5,145,410.74	5,145,410.74
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	904,567.04	904,567.04
应付托管费	-	-	-	-	-	226,141.75	226,141.75
应付证券清算款	-	-	-	-	-	1,854,290.98	1,854,290.98
卖出回购金融资产款	363,000,000.00	-	-	-	-	-	363,000,000.00
应	-	-	-	-	-	4,023.59	4,023.59

付销售服务费							
应交税费						95,766.95	95,766.95
其他负债						1,348,345.09	1,348,345.09
负债总计	363,000,000.00					9,578,546.14	372,578,546.14
利率敏感度缺口	-323,579,189.85	10,880,800.00	404,887,935.60	927,438,294.50	15,436,264.64		

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时		
	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（2022年6月30日）	上年度末（2021年12月31日）
分析	利率上升25个基点	-1,301,278.79	-4,954,998.39
	利率下降25个基点	1,307,095.76	4,990,581.11

#### 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。本基金持有的金融工具以人民币计价，因此无重大外汇风险。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

注：无。

#### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

注：无。

#### 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其他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股票和债券，所面临的最大其他价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

本基金的投资组合比例为：本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%，投资于股票等权益类资产的比例不超过基金资产的 20%，其中港股通标的股票的投资比例为股票资产的 0%-50%。本基金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，保持现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计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。

于本期末，本基金面临的整体其他价格风险列示如下：

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日		上年度末 2021年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	201,510,927.08	19.76	253,792,129.02	19.45
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	871,782,935.22	85.49	1,360,358,294.74	104.25
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	1,073,293,862.30	105.26	1,614,150,423.76	123.69

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	在其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时	
	相关风险变量的变	对资产负债表日基金资产净值的



	动	影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2022年6月30日）	上年度末（2021年12月31日）
分析	沪深 300 指数上升 5%	9,224,162.69	14,813,846.57
	沪深 300 指数下降 5%	-9,224,162.69	-14,813,846.57

#### 6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

注：无。

#### 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 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
第一层次	387,578,020.18	274,478,088.16
第二层次	685,715,842.12	1,339,672,335.60
第三层次	-	-
合计	1,073,293,862.30	1,614,150,423.76

###### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的证券等投资，若出现交易不活跃、非公开发行等情况，本基金不会于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，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

**6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明**

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

**6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明**

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

**6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**

无。

**§ 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	201,510,927.08	17.75
	其中：股票	201,510,927.08	17.75
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	871,782,935.22	76.79
	其中：债券	871,782,935.22	76.79
	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	23,700,000.00	2.09
	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	15,066,762.25	1.33
8	其他各项资产	23,218,207.46	2.05
9	合计	1,135,278,832.01	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**

金额单位：人民币元

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	-	-
B	采矿业	11,820,824.00	1.16
C	制造业	122,354,573.14	12.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	5,338,784.00	0.52
F	批发和零售业	3,863,492.00	0.38
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-

H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	9,104,550.00	0.89
K	房地产业	34,997,048.00	3.43
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	3,649,947.94	0.36
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	4,783,563.00	0.47
R	文化、体育和娱乐业	5,598,145.00	0.55
S	综合	-	-
	合计	201,510,927.08	19.76

### 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：无。

### 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

金额单位：人民币元

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	600048	保利发展	599,100	10,460,286.00	1.03
2	001979	招商蛇口	731,600	9,825,388.00	0.96
3	601318	中国平安	195,000	9,104,550.00	0.89
4	000333	美的集团	133,700	8,074,143.00	0.79
5	002271	东方雨虹	149,300	7,684,471.00	0.75
6	000651	格力电器	203,000	6,845,160.00	0.67
7	603816	顾家家居	106,990	6,058,843.70	0.59
8	601155	新城控股	233,500	5,937,905.00	0.58
9	300144	宋城演艺	364,700	5,598,145.00	0.55
10	002314	南山控股	1,322,100	5,473,494.00	0.54
11	601800	中国交建	575,300	5,338,784.00	0.52
12	000932	华菱钢铁	931,600	4,741,844.00	0.47
13	600887	伊利股份	115,800	4,510,410.00	0.44
14	000423	东阿阿胶	109,100	4,031,245.00	0.40
15	600808	马钢股份	1,056,800	4,005,272.00	0.39
16	601899	紫金矿业	424,400	3,959,652.00	0.39
17	600019	宝钢股份	644,300	3,878,686.00	0.38
18	600153	建发股份	295,600	3,863,492.00	0.38
19	601677	明泰铝业	161,500	3,843,700.00	0.38
20	600256	广汇能源	355,100	3,742,754.00	0.37
21	000999	华润三九	79,800	3,591,000.00	0.35

22	603486	科沃斯	27,100	3,303,219.00	0.32
23	002244	滨江集团	381,500	3,299,975.00	0.32
24	000786	北新建材	92,600	3,205,812.00	0.31
25	601636	旗滨集团	251,000	3,200,250.00	0.31
26	600031	三一重工	162,100	3,089,626.00	0.30
27	605369	拱东医疗	24,800	3,080,160.00	0.30
28	300760	迈瑞医疗	9,700	3,038,040.00	0.30
29	002873	新天药业	178,000	3,027,780.00	0.30
30	002371	北方华创	9,100	2,521,792.00	0.25
31	603609	禾丰股份	257,000	2,474,910.00	0.24
32	300015	爱尔眼科	55,200	2,471,304.00	0.24
33	603392	万泰生物	15,145	2,352,018.50	0.23
34	000516	国际医学	213,900	2,312,259.00	0.23
35	000858	五粮液	11,400	2,302,002.00	0.23
36	600809	山西汾酒	7,000	2,273,600.00	0.22
37	600519	贵州茅台	1,100	2,249,500.00	0.22
38	000568	泸州老窖	9,100	2,243,514.00	0.22
39	601012	隆基绿能	32,800	2,185,464.00	0.21
40	300601	康泰生物	47,600	2,150,568.00	0.21
41	300298	三诺生物	74,700	2,099,070.00	0.21
42	688131	皓元医药	14,746	2,095,259.14	0.21
43	601088	中国神华	62,500	2,081,250.00	0.20
44	002311	海大集团	34,400	2,064,344.00	0.20
45	603583	捷昌驱动	61,600	2,056,824.00	0.20
46	600188	兖矿能源	51,600	2,037,168.00	0.20
47	600085	同仁堂	38,500	2,035,880.00	0.20
48	300775	三角防务	41,500	1,998,225.00	0.20
49	300595	欧普康视	34,900	1,995,931.00	0.20
50	002444	巨星科技	105,500	1,987,620.00	0.19
51	002402	和而泰	104,000	1,982,240.00	0.19
52	600398	海澜之家	381,900	1,814,025.00	0.18
53	300122	智飞生物	16,100	1,787,261.00	0.18
54	688105	诺唯赞	18,312	1,554,688.80	0.15
55	688768	容知日新	19,043	1,439,269.94	0.14
56	605080	浙江自然	17,700	1,130,853.00	0.11

## 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600030	中信证券	37,099,902.89	2.84
2	000001	平安银行	27,085,826.06	2.08

3	601155	新城控股	26,571,930.19	2.04
4	600383	金地集团	22,856,292.36	1.75
5	600048	保利发展	22,775,230.68	1.75
6	601800	中国交建	20,405,447.47	1.56
7	603801	志邦家居	18,224,196.45	1.40
8	000002	万科 A	17,999,336.00	1.38
9	001979	招商蛇口	17,680,884.98	1.35
10	601636	旗滨集团	17,412,574.00	1.33
11	600808	马钢股份	17,148,702.00	1.31
12	000333	美的集团	16,120,815.00	1.24
13	601658	邮储银行	15,979,798.00	1.22
14	002572	索菲亚	14,114,250.00	1.08
15	601668	中国建筑	13,796,906.00	1.06
16	000776	广发证券	13,488,125.00	1.03
17	001914	招商积余	13,483,027.88	1.03
18	601669	中国电建	12,392,960.00	0.95
19	600031	三一重工	11,818,372.79	0.91
20	002791	坚朗五金	11,594,841.88	0.89

注：买入金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600030	中信证券	44,809,275.73	3.43
2	000001	平安银行	28,170,217.46	2.16
3	000776	广发证券	23,934,313.00	1.83
4	600383	金地集团	22,335,828.27	1.71
5	601155	新城控股	19,208,598.66	1.47
6	603801	志邦家居	19,156,177.74	1.47
7	002572	索菲亚	18,523,110.10	1.42
8	600036	招商银行	18,420,559.00	1.41
9	601669	中国电建	17,219,107.00	1.32
10	300059	东方财富	16,824,040.80	1.29
11	000002	万科 A	16,576,919.00	1.27
12	601658	邮储银行	15,639,119.00	1.20
13	601800	中国交建	14,850,826.46	1.14
14	601668	中国建筑	14,662,772.80	1.12
15	002791	坚朗五金	14,035,228.00	1.08
16	601636	旗滨集团	13,575,510.00	1.04
17	600808	马钢股份	13,288,856.00	1.02
18	600048	保利发展	12,793,744.21	0.98
19	601390	中国中铁	12,400,711.00	0.95

20	002541	鸿路钢构	11,186,954.56	0.86
----	--------	------	---------------	------

注：卖出金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	969,839,929.38
卖出股票收入（成交）总额	977,663,819.74

注：买入股票成本和卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 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	54,162,321.57	5.31
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	590,470,471.78	57.91
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	41,083,048.77	4.03
7	可转债（可交换债）	186,067,093.10	18.25
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	871,782,935.22	85.49

#### 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	019674	22 国债 09	539,540	54,162,321.57	5.31
2	163774	20 中证 15	400,000	41,490,187.40	4.07
3	163760	20 京资 01	400,000	41,485,247.12	4.07
4	101901321	19 汇金 MTN015	400,000	41,083,048.77	4.03
5	155842	19 国投 03	400,000	40,943,901.37	4.02

#### 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

注：无。

#### 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：无。

#### 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：无。

## 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

本基金投资于国债期货，以套期保值为目的，以合理管理债券组合的久期、流动性和风险水平。

### 7.10.2 本期国债期货投资评价

无。

## 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

本报告期本基金投资的前十名证券除中信证券、兴业银行发行主体外，其他证券的发行主体未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。

国家外汇管理局深圳市分局行政处罚信息公示表：

中信证券股份有限公司（简称中信证券）因 QDII 超额度汇出等案由，于 2021 年 11 月 22 日被国家外汇管理局深圳市分局处以罚款。

根据中国人民银行公布的行政处罚信息公开表：

兴业银行股份有限公司（简称兴业银行）因为违反信用信息采集、提供、查询及相关管理规定等相关违法违规行为，于 2021 年 8 月 13 日被中国人民银行处以罚款。

根据中国银行保险监督管理委员会（简称银保监会）公布的行政处罚信息公开表：

兴业银行股份有限公司（简称兴业银行）因监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在违法违规行为案由，于 2022 年 3 月 21 日被中国银保监会处以罚款。

以上发行主体涉及证券的投资已执行内部严格的投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

### 7.11.2 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中，未有投资于超出基金合同规定备选股票库之外股票。

### 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	882,797.58
2	应收清算款	22,308,996.60
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	26,413.28
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	23,218,207.46

#### 7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	127032	苏行转债	37,292,652.97	3.66
2	113052	兴业转债	31,574,009.59	3.10
3	113024	核建转债	10,816,082.31	1.06
4	113043	财通转债	10,083,128.95	0.99
5	113025	明泰转债	6,490,540.82	0.64
6	113050	南银转债	5,136,780.23	0.50
7	123077	汉得转债	5,125,852.97	0.50
8	127019	国城转债	4,585,639.51	0.45
9	128125	华阳转债	4,470,738.97	0.44
10	127018	本钢转债	4,397,732.36	0.43
11	113046	金田转债	4,376,384.15	0.43
12	113585	寿仙转债	4,101,693.68	0.40
13	110083	苏租转债	3,259,922.24	0.32
14	128025	特一转债	2,473,327.82	0.24
15	128119	龙大转债	2,302,949.54	0.23
16	113591	胜达转债	2,071,893.60	0.20
17	127038	国微转债	2,042,138.61	0.20
18	113045	环旭转债	2,036,865.11	0.20
19	113631	皖天转债	1,890,406.45	0.19
20	123113	仙乐转债	1,841,906.08	0.18
21	113622	杭叉转债	1,719,975.67	0.17
22	113616	韦尔转债	1,097,133.63	0.11
23	113637	华翔转债	1,076,535.26	0.11
24	113636	甬金转债	1,030,506.82	0.10
25	113601	塞力转债	1,018,401.53	0.10
26	127044	蒙娜转债	1,012,847.87	0.10
27	127047	帝欧转债	1,006,811.32	0.10
28	113620	傲农转债	897,085.04	0.09
29	110079	杭银转债	843,150.63	0.08

#### 7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：无。

#### 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(%)
长城悦享回报债券 A	6,751	163,284.31	997,413.97	0.09	1,101,334,952.81	99.91
长城悦享回报债券 C	285	33,910.75	-	-	9,664,564.75	100.00
合计	7,036	158,043.91	997,413.97	0.09	1,110,999,517.56	99.91

注：上述机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，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）。

### 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	长城悦享回报债券 A	1,596,469.72	0.1448
	长城悦享回报债券 C	69,809.42	0.7223
	合计	1,666,279.14	0.1498

注：上述基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，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）。

### 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、基金投资和部门负责人持有本开放式基金	长城悦享回报债券 A	10~50
	长城悦享回报债券 C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有	长城悦享回报债券 A	>100

本开放式基金	长城悦享回报债券 C	0
	合计	>100

注：同时为基金管理人高级管理人员和基金经理的，分别计算在内。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	长城悦享回报债券 A	长城悦享回报债券 C
基金合同生效日 (2021 年 6 月 22 日) 基金份额总额	1,512,386,666.90	15,112,879.18
本报告期期初基金份额总额	1,299,586,306.44	10,904,731.35
本报告期基金总申购份额	1,951,773.87	1,391,215.55
减：本报告期基金总赎回份额	199,205,713.53	2,631,382.15
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,102,332,366.78	9,664,564.75

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 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

#### 1、基金管理人重大人事变动：

自 2022 年 1 月 11 日起，沈阳女士不再担任公司副总经理。

#### 2、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：

本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本基金本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

#### 10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略无改变。

#### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

在本报告期内，为本基金提供审计服务的会计师事务所为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）。

#### 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

本基金本报告期基金管理人、基金托管人涉及托管业务机构及其高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

#### 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 (%)	
长城证券	2	1,939,751,360.92	100.00	1,806,490.64	100.00	-

注：1、报告期内租用证券公司席位的变更情况：本报告期内无交易单元增减变化，截止报告期末共 2 个交易单元。

2、专用席位的选择标准和程序 本基金管理人负责选择代理本基金证券买卖的证券经营机构，使用其席位作为基金的专用交易席位，选择的标准是：

- (1) 实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币；
- (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- (3) 经营行为规范，能满足基金运作的合法、合规需求；
- (4) 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；
- (5) 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基金进行证券交易的需  
要，并能为本基金提供全面的信息服务；
- (6) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金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、个股分析报告及其他专门报告。

根据上述标准考察确定后，基金管理人和被选中的证券经营机构签订委托协议，并通知托管

人。

基金管理人应根据有关规定，在基金的中期报告和年度报告中将所选证券经营机构的有关情况、基金通过该证券经营机构买卖证券的成交量、支付的佣金等予以披露。

### 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 (%)
长城证券	2,080,759,936.32	100.00	20,014,487,000.00	100.00	-	-

### 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	长城基金管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具相关会计准则的公告	中国证监会规定报刊及网站	2022年1月4日
2	长城基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会规定报刊及网站	2022年1月13日
3	长城基金管理有限公司关于上海分公司营业场所变更的公告	中国证监会规定报刊及网站	2022年2月12日
4	长城悦享回报债券型证券投资基金基金经理变更公告	中国证监会规定报刊及网站	2022年4月14日
5	长城基金管理有限公司关于上海分公司变更负责人的公告	中国证监会规定报刊及网站	2022年4月20日
6	长城基金管理有限公司关于营业场所变更的公告	中国证监会规定报刊及网站	2022年4月21日
7	长城基金管理有限公司深圳分公司关于营业场所变更的公告	中国证监会规定报刊及网站	2022年4月21日
8	长城基金管理有限公司关于北京分公司变更负责人的公告	中国证监会规定报刊及网站	2022年4月23日
9	长城基金管理有限公司关于调整旗下基金所持停牌股票估值方法的公告(鲁西化工)	中国证监会规定报刊及网站	2022年4月27日
10	长城基金管理有限公司关于终止北京植信基金销售有限公司、北京唐鼎耀华基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2022年5月18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

注：本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

无
---

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- (一) 中国证监会准予长城悦享回报债券型证券投资基金注册的文件
- (二) 《长城悦享回报债券型证券投资基金基金合同》
- (三) 《长城悦享回报债券型证券投资基金托管协议》
- (四) 《长城悦享回报债券型证券投资基金招募说明书》
- (五) 法律意见书
- (六) 基金管理人业务资格批件、营业执照
- (七) 基金托管人业务资格批件、营业执照
- (八) 中国证监会规定的其他文件

### 12.2 存放地点

基金管理人及基金托管人住所

### 12.3 查阅方式

投资者可在办公时间亲临上述存放地点免费查阅，如有疑问，可向本基金管理人长城基金管理有限公司咨询。

咨询电话：0755-29279188

客户服务电话：400-8868-666

网站：www.ccfund.com.cn