

景顺长城隽丰平衡养老目标三年持有期混  
合型发起式基金中基金（FOF）  
2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：景顺长城基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2024 年 8 月 30 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。本中期报告已经全部独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 08 月 28 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 2024 年 01 月 01 日起至 2024 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	7
3.3 其他指标	9
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	13
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
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	13
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>13</b>
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	18
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>41</b>
7.1 期末基金资产组合情况	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	41
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	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	43
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	44

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 .....	45
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 .....	45
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 .....	45
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 .....	45
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	45
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	45
7.12 本报告期投资基金情况 .....	45
7.13 投资组合报告附注 .....	49
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>50</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	50
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	51
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 .....	51
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况 .....	51
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>51</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>52</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	52
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 .....	52
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	52
10.4 基金投资策略的改变 .....	52
10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件 .....	52
10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	52
10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	53
10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	53
10.9 其他重大事件 .....	56
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>58</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 .....	58
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	58
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>58</b>
12.1 备查文件目录 .....	58
12.2 存放地点 .....	58
12.3 查阅方式 .....	58

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	景顺长城隽丰平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF)	
基金简称	景顺长城隽丰平衡养老三年持有混合 FOF	
基金主代码	014374	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022 年 7 月 27 日	
基金管理人	景顺长城基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	110,730,321.07 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	景顺长城隽丰平衡养老三年持有混合 (FOF) A	景顺长城隽丰平衡养老三年持有混合 (FOF) Y
下属分级基金的交易代码	014374	019652
报告期末下属分级基金的份额总额	110,495,575.12 份	234,745.95 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	以追求养老资产的长期稳健增值为目标，通过相对平衡的大类资产配置策略及基金精选策略构建投资组合，在严格控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的收益表现。
投资策略	<p>1、大类资产配置策略</p> <p>本基金定位为“目标风险策略基金”，且为目标风险系列基金中基金中风险收益特征相对平衡的基金。“风险”的定义主要为基金资产净值的长期波动率。风险主要来源于资产价格的波动，波动越高的资产风险也会越高。本基金平衡目标风险的含义是指基金资产净值的长期波动率尽量贴近本基金的基准，并与投资目标基本一致。</p> <p>本基金的核心是通过资产配置将本基金资产风险控制在目标波动率范围内，并追求超越业绩比较基准的收益表现。本基金的资产配置通过在战略资产配置策略模型的基础上，根据市场环境的变化引入战术资产配置对大类资产配置比例进行调整，使得组合的风险特征尽量趋近平衡的目标风险。</p> <p>2、基金投资策略</p> <p>基金管理人依托专业的研究能力，综合采用定量分析及定性研究相结合的方法，首先初步筛选满足养老目标基金的子基金；再根据七大指标对子基金进行定量及定性的分析，从而综合评价及打分并纳入基金库；最后精选出各类别基金中适合做各类资产配置标的的基金。</p> <p>3、基金组合风险控制策略</p> <p>基金管理人每日跟踪基金组合，每月对基金组合表现进行回顾分析，并定期对基金组合中单只子基金根据公开披露的信息进行持仓分析，并估算基金组合中整体的个股和行业持仓情况。</p>

	<p>4、债券投资策略</p> <p>出于对流动性、跟踪误差、有效利用基金资产的考量，本基金适时对债券进行投资。</p> <p>5、股票及港股通标的股票投资策略</p> <p>本基金在进行国内依法发行上市的股票及港股通标的股票投资时，主要采用三大类量化模型分别用以评估资产定价、控制风险和优化交易。基于模型结果，基金管理人结合市场环境和股票特性，精选个股产出投资组合。</p> <p>6、存托凭证投资策略</p> <p>本基金投资存托凭证的策略依照上述境内上市交易的股票投资策略执行。</p> <p>7、资产支持证券的投资策略</p> <p>本基金将通过对宏观经济、提前偿还率、资产池结构以及资产池资产所在行业景气变化等因素的研究，预测资产池未来现金流变化，并通过研究标的证券发行条款，预测提前偿还率变化对标的证券的久期与收益率的影响。</p>
业绩比较基准	中证 800 指数收益率×50%+恒生指数收益率（使用估值汇率折算）×5%+上海黄金交易所 Au99.99 现货实盘合约收益率×5%+中证全债指数收益率×35%+商业银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	<p>本基金属于混合型发起式基金中基金（FOF），是养老目标风险系列基金中基金（FOF）中风险收益特征相对平衡的基金。本基金以风险控制为主要导向，通过限制权益类资产配置比例在 45%-60%之间以控制风险，定位为较为平衡的养老目标风险 FOF 产品，适合风险偏好较为均衡的投资者。本基金长期平均风险和预期收益率低于股票型基金、股票型基金中基金，高于货币市场基金。</p> <p>本基金若投资港股通标的股票的，本基金还面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。</p>

### 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	景顺长城基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	杨崑阳
	联系电话	0755-82370388
	电子邮箱	investor@igwfm.com
客户服务电话	4008888606	95599
传真	0755-22381339	010-68121816
注册地址	深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 层	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址	深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 层	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码	518048	100031
法定代表人	李进	谷澍

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
----------------	------

登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.igwfm.com
基金中期报告备置地点	基金管理人的办公场所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	景顺长城基金管理有限公司	深圳市福田区中心四路1号嘉里建设广场第一座21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(2024年1月1日-2024年6月30日)	
	景顺长城隽丰平衡养老三年持有混合 (FOF) A	景顺长城隽丰平衡养老三年持有混合 (FOF) Y
本期已实现收益	-3,038,691.04	-456.10
本期利润	1,014,138.68	-45.27
加权平均基金份额本期利润	0.0092	-0.0004
本期加权平均净值利润率	0.98%	-0.04%
本期基金份额净值增长率	0.99%	1.15%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024年6月30日)	
期末可供分配利润	-7,267,430.62	-14,310.00
期末可供分配基金份额利润	-0.0658	-0.0610
期末基金资产净值	104,037,890.92	222,125.03
期末基金份额净值	0.9415	0.9462
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	-5.85%	-1.01%

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、期末可供分配利润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、基金份额净值的计算精确到小数点后四位，小数点后第五位舍去，由此产生的误差计入基金资产。

4、上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。

### 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

景顺长城隽丰平衡养老三年持有混合 (FOF) A

阶段	份额净	份额净值	业绩比较基	业绩比较基准	①—③	②—④
----	-----	------	-------	--------	-----	-----

	值增长率①	增长率标准差②	准收益率③	收益率标准差④		
过去一个月	-1.92%	0.33%	-1.89%	0.30%	-0.03%	0.03%
过去三个月	0.43%	0.46%	-0.32%	0.44%	0.75%	0.02%
过去六个月	0.99%	0.60%	1.74%	0.56%	-0.75%	0.04%
过去一年	-4.22%	0.51%	-3.06%	0.51%	-1.16%	0.00%
自基金合同生效起至今	-5.85%	0.43%	-4.91%	0.52%	-0.94%	-0.09%

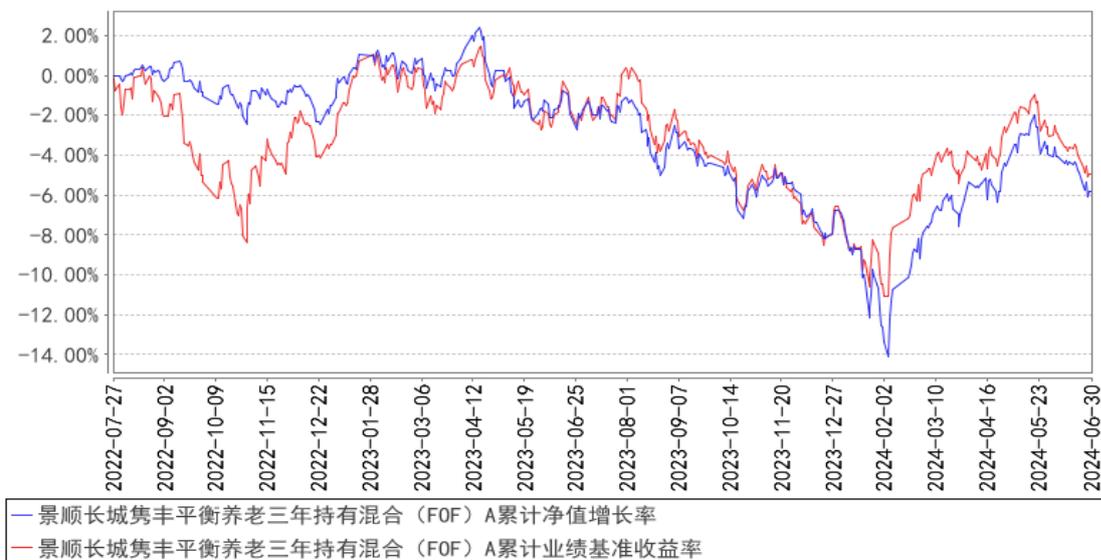
景顺长城隽丰平衡养老三年持有混合 (FOF) Y

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	-1.89%	0.32%	-1.89%	0.30%	0.00%	0.02%
过去三个月	0.51%	0.46%	-0.32%	0.44%	0.83%	0.02%
过去六个月	1.15%	0.60%	1.74%	0.56%	-0.59%	0.04%
自基金合同生效起至今	-1.01%	0.53%	-0.92%	0.52%	-0.09%	0.01%

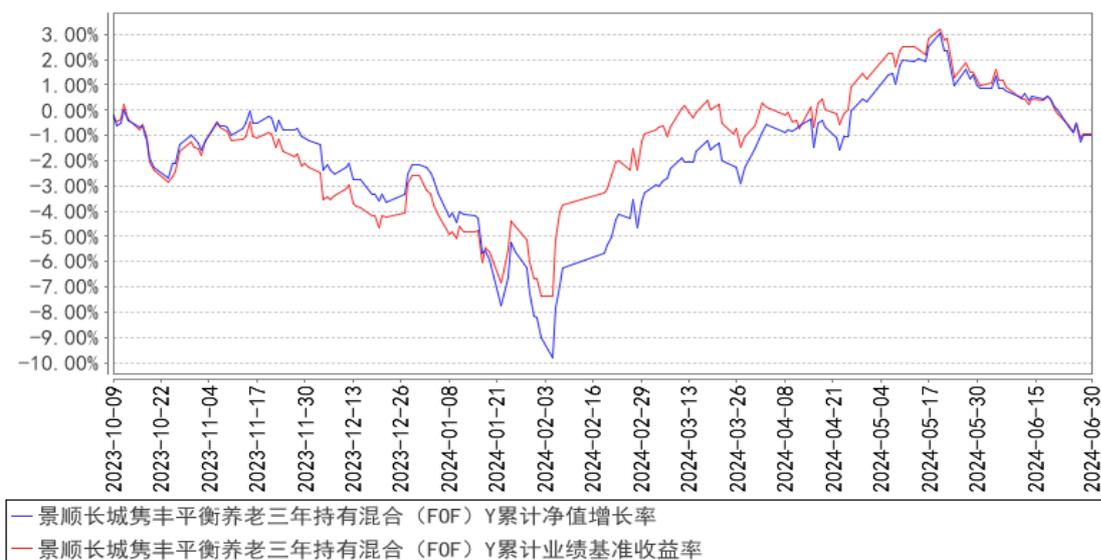
注：本基金自 2023 年 9 月 28 日起增设 Y 类基金份额，并于 2023 年 10 月 9 日开始对 Y 类份额进行估值。

### 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

景顺长城隽丰平衡养老三年持有混合 (FOF) 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



景顺长城隽丰平衡养老三年持有混合（FOF）Y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：基金的投资组合比例为：投资经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金的比例不低于本基金资产的 80%。本基金投资于股票、股票型基金、混合型基金和商品基金（含商品期货基金和黄金 ETF）的比例不超过 60%。本基金权益类资产（包括股票、股票型基金、最近连续四个季度季末股票资产占基金资产的比例均在 60%以上的混合型基金）的战略配置比例为 55%，非权益类资产的战略配置比例为 45%；权益类资产的战术配置调整，最低可调整到 45%，最高不超过 60%。本基金商品基金投资占基金资产比例不超过 10%；投资单只基金的比例不高于本基金资产净值的 20%。本基金保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本基金不得持有中国证监会认定的具有复杂、衍生品性质的基金份额。本基金投资于港股通标的股票不超过股票资产的 50%。本基金的建仓期为自 2022 年 7 月 27 日基金合同生效日起 6 个月。建仓期结束时，本基金投资组合达到上述投资组合比例的要求。本基金自 2023 年 9 月 28 日起增设 Y 类基金份额。

### 3.3 其他指标

无。

## § 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

本基金管理人景顺长城基金管理有限公司（以下简称“本公司”）是经中国证监会证监基金字[2003]76号文批准设立的证券投资基金管理公司，由长城证券股份有限公司、景顺资产管理有限公司、开滦（集团）有限责任公司、大连实德集团有限公司共同发起设立，并于 2003 年 6

月 9 日获得开业批文，注册资本 1.3 亿元人民币，目前，各家出资比例分别为 49%、49%、1%、1%。总部设在深圳，在北京、上海、广州设有分公司，并设立全资子公司——景顺长城资产管理（深圳）有限公司。

本公司拥有公募、特定客户资产管理、QDII 等业务资格，截至 2024 年 6 月 30 日，本公司旗下共管理 184 只开放式基金，在主动权益、固定收益、指数投资、量化投资、海外投资、资产配置等多个领域布局。

本公司采用团队投资方式，即通过整个投资部门全体人员的共同努力，争取良好投资业绩。

#### 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		
薛显志	本基金的基金经理	2022 年 7 月 27 日	-	13 年	经济学硕士，CFA，FRM。2011 年 7 月加入本公司，历任总经理办公室风险管理助理、风险管理专员、量化及 ETF 投资部量化及 ETF 专员，自 2015 年 2 月起先后担任量化及 ETF 投资部基金经理、专户投资部投资经理，现任养老及资产配置部基金经理。具有 13 年证券、基金行业从业经验。
赵思轩	本基金的基金经理	2023 年 7 月 26 日	-	6 年	工学博士。曾任新加坡国立大学风险管理研究所信用评级研究员，招商银行总行市场风险管理部市场风险研究员、资产管理部权益投资岗，招银理财多资产投资部组合投资岗，招商证券资产管理公司权益投资部投资岗（拟任）。2023 年 4 月加入本公司，自 2023 年 7 月起担任养老及资产配置部基金经理。具有 6 年证券、基金行业从业经验。

注：1、对基金的首任基金经理，其“任职日期”按基金合同生效日填写，“离任日期”为根据公司决定的解聘日期（公告前一日）；对此后的非首任基金经理，“任职日期”指根据公司决定聘任后的公告日期，“离任日期”指根据公司决定的解聘日期（公告前一日）；

2、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。

4.1.3 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  
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《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》和《公开募集证券投资

基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则、《景顺长城隽丰平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，未发现损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

### 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

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见（2011年修订）》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本管理人管理的所有投资组合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% 的交易共有 9 次，为投资组合的投资策略需要而发生的同日反向交易，按规定履行了审批程序。

本报告期内，未发现有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

### 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

截至 2024 年上半年，宏观经济与权益市场整体呈现了与去年相同的趋势，即在“数据有所改善—预期上行—数据走弱—预期向数据靠拢”的循环中再次重复。本基金二季度在情绪较高的位置兑现了部分上涨较快的标的，并对组合行业及风格配置进行再平衡以减小潜在波动，同时持续关注资源品的投资机会。红利资产方面，在债券收益率未进一步打开显著下行空间之前，相较 A 股红利资产我们更偏好股息安全边际较高、AH 溢价有望修复、潜在复苏/政策信号出现时空间更大的港股红利资产。

债券方面，组合整体维持中性仓位。今年以来持续的债市行情除了资产荒、风险偏好持续下行等因素外，央行打击手工补息等操作在二季度带来的一次性配置资金亦有较大贡献。结合考虑到财政在上半年的疲软及下半年的相对发力空间，目前对债券久期维持中性，同时关注近期受到小盘股流动性冲击后补跌明显、但短期信用形势未发生剧烈变化的可转债投资机会。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2024 年上半年，景顺长城隽丰平衡养老三年持有混合 A 份额净值增长率为 0.99%，业绩比较基准收益率为 1.74%。

2024 年上半年，景顺长城隽丰平衡养老三年持有混合 Y 份额净值增长率为 1.15%，业绩比较基准收益率为 1.74%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

相较于去年同期，我们认为有三点积极的因素：第一，经济的韧性已初步出现，虽然地产基建的下行对于名义增长率拖累较为明显，但库存周期、出口链等其它因子对经济仍形成了正向贡献，内需不足外需来补；第二，尽管内需偏软，但政策因子已在逐步矫正（如地产新政的出台），随基数效应的消退和价格环比的企稳，有望逐步降低对经济的负向拖累；第三，当前市场情绪定价和外资流出已相对充分，整体预期低于去年同期，在估值层面也给出了更多安全边际。

因此，尽管不可否认的是经济仍在逐步磨底探寻向上方向的过程中，同时海外大选带来的政治博弈仍会提升全球风险资产的潜在波动率，但较多板块及公司的估值已逐步给出了更多的安全边际。在当前位置，我们在谨慎中保持乐观，逐步寻找更能具备上行趋势的结构性机会。

本基金将继续坚持以兼顾平衡攻守为主要目标，在跟踪业绩比较基准的基础上根据市场环境动态调整资产及子基金的配置，控制回撤基础上为投资实现长期资本增值。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人成立基金估值委员会对基金财产的估值方法及程序作决策，基金估值委员会在遵守法律法规的前提下，通过参考行业协会的估值指引及独立第三方估值服务机构的估值数据等方式，谨慎合理地制定高效可行的估值方法，及时准确地进行份额净值的计量，保护基金份额持有人的合法权益。

基金日常估值由基金管理人同基金托管人一同进行。基金份额净值由基金管理人完成估值后，将估值结果以双方认可的方式报送给基金托管人，基金托管人按基金合同规定的估值方法、时间、程序进行复核，无误后返回给基金管理人，由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

当发生了影响估值方法和程序的有效性、适用性的情况时，通过会议方式启动估值委员会的运作。研究人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，综合宏观经济、行业发展及个券状况等各方面因素，从价值投资的角度进行理论分析，并根据分析的结果向基金估值委员会提出有关估值方法或估值模型的建议。风险管理人员根据研究人员提出的估值方法或估值模型进行计算及验证，并根据计算和验证的结果与投资人员共同确定估值方法并提交估值委员会。基金事务部基金会计负责与基金托管人沟通，必要时应就所采用的估值技术、假设及输入值得适当性等咨询会计师事务所的专业意见。法律、监察稽核部相关人员负责监察执行估值政策及程序的合规性，控制执行中可能发生的风险。估值委员会共同讨论通过后，基金事务部基金会计

根据估值委员会确认的估值方法对各基金进行估值核算并与基金托管行核对，法律、监察稽核部负责对外进行信息披露。

截止本报告期末，本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司、中证指数有限公司合作，由其提供相关债券品种、流通受限股票的估值参考数据。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。

#### 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

本基金为发起式基金，在本报告期内未触及《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条规定的条件。

## § 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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—景顺长城基金管理有限公司 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

### 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

本托管人认为，景顺长城基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，景顺长城基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

## § 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：景顺长城隽丰平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	4,726,142.56	3,094,764.44
结算备付金		30,384.73	72,008.34
存出保证金		13,724.71	8,483.04
交易性金融资产	6.4.7.2	99,705,200.04	100,809,865.99
其中：股票投资		4,716,457.21	5,509,628.28
基金投资		89,261,854.87	90,432,090.86
债券投资		5,726,887.96	4,868,146.85
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	-	-
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		-	550,000.00
应收股利		32,098.99	25,100.17
应收申购款		157.25	15,958.65
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	10,228.47	6,956.59
资产总计		104,517,936.75	104,583,137.22
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2023 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		-	-
应付清算款		105,792.61	1,328,408.38
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		49,164.69	54,567.86
应付托管费		11,816.11	11,733.52
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		3.37	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	91,144.02	161,326.23
负债合计		257,920.80	1,556,035.99
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	110,730,321.07	110,499,026.13
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-6,470,305.12	-7,471,924.90
净资产合计		104,260,015.95	103,027,101.23
负债和净资产总计		104,517,936.75	104,583,137.22

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，基金份额总额 110,730,321.07 份，其中本基金 A 类份额净值人民币 0.9415 元，基金份额 110,495,575.12 份；本基金 Y 类份额净值人民币 0.9462 元，基金份额 234,745.95 份。

## 6.2 利润表

会计主体：景顺长城隼丰平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		1,458,487.82	374,780.57
1. 利息收入		5,504.54	5,009.94
其中：存款利息收入	6.4.7.13	5,504.54	5,009.94
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-2,657,093.03	322,505.35
其中：股票投资收益	6.4.7.14	604,112.36	-74,719.02
基金投资收益	6.4.7.15	-3,635,095.03	-286,306.56
债券投资收益	6.4.7.16	61,056.36	32,408.11
资产支持证券投资	6.4.7.17	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.18	-	-
衍生工具收益	6.4.7.19	-	-
股利收益	6.4.7.20	312,833.28	651,122.82
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)	6.4.7.21	4,053,240.55	29,820.10
4. 汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5. 其他收入(损失以“-”号填列)	6.4.7.22	56,835.76	17,445.18
<b>减：二、营业总支出</b>		444,394.41	554,641.62
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	293,940.46	400,593.02
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	70,133.31	72,690.55
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.24	-	-
7. 税金及附加		1.87	1,061.71
8. 其他费用	6.4.7.25	80,318.77	80,296.34
<b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b>		1,014,093.41	-179,861.05
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>		1,014,093.41	-179,861.05
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		1,014,093.41	-179,861.05

### 6.3 净资产变动表

会计主体：景顺长城隽丰平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）

本报告期：2024年1月1日至2024年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024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	110,499,026.13	-	-7,471,924.90	103,027,101.23
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-

二、本期期初净资产	110,499,026.13	-	-7,471,924.90	103,027,101.23
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	231,294.94	-	1,001,619.78	1,232,914.72
(一)、综合收益总额	-	-	1,014,093.41	1,014,093.41
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	231,294.94	-	-12,473.63	218,821.31
其中：1.基金申购款	231,294.94	-	-12,473.63	218,821.31
2.基金赎回款	-	-	-	-
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	110,730,321.07	-	-6,470,305.12	104,260,015.95
项目	上年度可比期间			
	2023年1月1日至2023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	110,287,715.06	-	-1,691,084.45	108,596,630.61
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	110,287,715.06	-	-1,691,084.45	108,596,630.61
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	62,180.22	-	-179,712.05	-117,531.83
(一)、综合收益总额	-	-	-179,861.05	-179,861.05
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	62,180.22	-	149.00	62,329.22
其中：1.基金申购款	62,180.22	-	149.00	62,329.22
2.基金赎回款	-	-	-	-
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减	-	-	-	-

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	110,349,895.28	-	-1,870,796.50	108,479,098.78

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：

<u>康乐</u>	<u>吴建军</u>	<u>邵媛媛</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

景顺长城隽丰平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）（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]3628号文《关于准予景顺长城隽丰平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）注册的批复》的核准，由景顺长城基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城隽丰平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金合同》作为发起人向社会公开募集，基金合同于 2022 年 7 月 27 日正式生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币 110,220,545.51 元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币 18,632.83 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 110,239,178.34 元，折合 110,239,178.34 份基金份额。本基金的基金管理人为景顺长城基金管理有限公司，登记机构为本基金管理人，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

本基金为发起式基金，发起资金认购方认购本基金的总额不少于人民币 1,000 万元，且发起资金认购方承诺使用发起资金认购的基金份额持有期限不少于 3 年。

根据法律法规的规定及《景顺长城隽丰平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金合同》和《景顺长城隽丰平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）招募说明书》的约定，经与基金托管人中国农业银行股份有限公司协商一致，并报中国证监会备案，景顺长城基金管理有限公司决定自 2023 年 9 月 28 日起对景顺长城隽丰平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）在现有份额的基础上增设 Y 类基金份额，原基金份额转为 A 类基金份额。A 类基金份额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；Y 类基金份额是针对个人养老金投资基金业务单独设立，可对销售费用、管理费和托管费实施一定费率优惠的一类基金份额。Y 类基金份额也不从本类别基金资产中计提销售服务费。由

于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 Y 类基金份额分别计算基金份额净值。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括经中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金（含商品基金（包括但不限于商品期货基金和黄金 ETF）、香港互认基金、QDII 基金及其他经中国证监会核准或注册的基金）、国内依法发行上市的股票（包括主板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票及存托凭证）、港股通标的股票、债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券（含可分离交易可转债的纯债部分）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具以及中国证监会允许基金中基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会相关规定。

基金的投资组合比例为：投资经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金的比例不低于本基金资产的 80%。本基金投资于股票、股票型基金、混合型基金和商品基金（含商品期货基金和黄金 ETF）的比例不超过 60%。本基金权益类资产（包括股票、股票型基金、最近连续四个季度季末股票资产占基金资产的比例均在 60%以上的混合型基金）的战略配置比例为 55%，非权益类资产的战略配置比例为 45%；权益类资产的战术配置调整，最低可调整到 45%，最高不超过 60%。本基金商品基金投资占基金资产比例不超过 10%；投资单只基金的比例不高于本基金资产净值的 20%。本基金保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本基金不得持有中国证监会认定的具有复杂、衍生品性质的基金份额。本基金投资于港股通标的股票不超过股票资产的 50%。

本基金的业绩比较基准为：中证 800 指数收益率×50%+恒生指数收益率（使用估值汇率折算）×5%+上海黄金交易所 Au99.99 现货实盘合约收益率×5%+中证全债指数收益率×35%+商业银行活期存款利率（税后）×5%。

本财务报表由本基金的基金管理人景顺长城基金管理有限公司于 2024 年 8 月 28 日批准报出。

#### 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《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《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〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

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 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2024 年 1 月 1 日起至 2024 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

#### 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

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会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

#### 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

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

##### (1) 印花税

证券（股票）交易印花税税率为 1%，由出让方缴纳。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

##### (2) 增值税及附加

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，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金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，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对证券投资基金在 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，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。增值税应税行为的销售额根据财政部、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》的规定确定。

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 7%、3% 和 2% 的比例缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

### （3）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[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，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；

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。

### （4）个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，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；

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；

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。

#### （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 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
活期存款	4,726,142.56
等于：本金	4,725,899.01
加：应计利息	243.55
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个月（含）-3个月	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	4,726,142.56

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	4,678,929.01	-	4,716,457.21	37,528.20
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	45,341.51	5,726,887.96	-10,253.26
	银行间市场	-	-	-
	合计	45,341.51	5,726,887.96	-10,253.26
资产支持证券	-	-	-	-
基金	88,477,687.00	-	89,261,854.87	784,167.87
其他	-	-	-	-
合计	98,848,415.72	45,341.51	99,705,200.04	811,442.81

#### 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

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

##### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

##### 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

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

本基金本报告期末的买入返售金融资产余额为零。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末的买断式逆回购交易中取得的债券余额为零。

##### 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

本基金本报告期末的债权投资余额为零。

##### 6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期末的债权投资余额为零。

## 6.4.7.6 其他债权投资

## 6.4.7.6.1 其他债权投资情况

本基金本报告期末的其他债权投资余额为零。

## 6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期末的其他债权投资余额为零。

## 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

本基金本报告期末的其他权益工具投资余额为零。

## 6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

本基金本报告期末的其他权益工具投资余额为零。

## 6.4.7.8 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
应收利息	-
其他应收款	10,228.47
待摊费用	-
合计	10,228.47

## 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024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	14,067.02
其中：交易所市场	14,067.02
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	77,077.00
合计	91,144.02

## 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

景顺长城隽丰平衡养老三年持有混合（FOF）A

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	110,479,711.68	110,479,711.68

本期申购	15,863.44	15,863.44
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
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	110,495,575.12	110,495,575.12

景顺长城隽丰平衡养老三年持有混合 (FOF) Y

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	19,314.45	19,314.45
本期申购	215,431.50	215,431.50
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
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	234,745.95	234,745.95

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.11 其他综合收益

无。

#### 6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

景顺长城隽丰平衡养老三年持有混合 (FOF) A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-4,227,668.84	-3,243,008.95	-7,470,677.79
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-4,227,668.84	-3,243,008.95	-7,470,677.79
本期利润	-3,038,691.04	4,052,829.72	1,014,138.68
本期基金份额交易产生的变动数	-1,070.74	-74.35	-1,145.09
其中：基金申购款	-1,070.74	-74.35	-1,145.09
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-7,267,430.62	809,746.42	-6,457,684.20

景顺长城隽丰平衡养老三年持有混合 (FOF) Y

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-675.10	-572.01	-1,247.11

加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-675.10	-572.01	-1,247.11
本期利润	-456.10	410.83	-45.27
本期基金份额交易产生的变动数	-13,178.80	1,850.26	-11,328.54
其中：基金申购款	-13,178.80	1,850.26	-11,328.54
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-14,310.00	1,689.08	-12,620.92

#### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
活期存款利息收入		4,523.13
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		877.41
其他		104.00
合计		5,504.54

#### 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	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
股票投资收益——买卖股票差价收入		604,112.36
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		604,112.36

##### 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	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
卖出股票成交总额		16,706,059.01
减：卖出股票成本总额		16,056,577.47
减：交易费用		45,369.18
买卖股票差价收入		604,112.36

##### 6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

## 6.4.7.15 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出/赎回基金成交总额	54,483,520.49
减：卖出/赎回基金成本总额	58,103,456.35
减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额	-
减：交易费用	15,159.17
基金投资收益	-3,635,095.03

## 6.4.7.16 债券投资收益

## 6.4.7.16.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
债券投资收益——利息收入	48,496.61
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	12,559.75
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	61,056.36

## 6.4.7.16.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	5,424,359.34
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	5,312,557.91
减：应计利息总额	99,178.53
减：交易费用	63.15
买卖债券差价收入	12,559.75

## 6.4.7.17 资产支持证券投资收益

## 6.4.7.17.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

## 6.4.7.17.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

## 6.4.7.18 贵金属投资收益

## 6.4.7.18.1 贵金属投资收益项目构成

无。

## 6.4.7.18.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

## 6.4.7.19 衍生工具收益

## 6.4.7.19.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

## 6.4.7.19.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

## 6.4.7.20 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	97,206.49
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	215,626.79
合计	312,833.28

## 6.4.7.21 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
1. 交易性金融资产	4,053,240.55
股票投资	381,434.93
债券投资	2,850.74
资产支持证券投资	-
基金投资	3,668,954.88
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	4,053,240.55

## 6.4.7.22 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
销售服务费返还	56,835.76
合计	56,835.76

#### 6.4.7.23 持有基金产生的费用

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	80,945.14
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	271,760.44
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	56,233.72

注：上述费用按照被投资基金的基金合同约定已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，该披露金额按照本基金对被投资基金的实际持仓情况根据被投资基金的基金合同约定的费率和计算方法估算得出，不构成本基金的费用项目。

#### 6.4.7.24 信用减值损失

无。

#### 6.4.7.25 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
审计费用	17,404.66
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行划款手续费	3,200.95
证券组合费	40.82
合计	80,318.77

#### 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，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作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

本报告期，与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 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
景顺长城基金管理有限公司	基金管理人、登记机构、基金销售机构

中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”）	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：下述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 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023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	405,654.71	1.28	-	-

###### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

###### 6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024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	369.45	1.27	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2023年1月1日至2023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，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方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 2024年1月1日至2024年6 月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	293,940.46	400,593.02

其中：应支付销售机构的客户维护费	232,196.50	247,957.16
应支付基金管理人的净管理费	61,743.96	152,635.86

注：自 2023 年 9 月 28 日起，本基金在现有基金份额的基础上增设 Y 类基金份额，原基金份额转为 A 类基金份额。本基金投资于基金管理人管理的其他基金部分不收取管理费。支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值扣除本基金持有的基金管理人管理的其他基金部分后的余额的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。A 类基金份额和 Y 类基金份额约定的管理费年费率分别为 1.00% 和 0.50%。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值扣除本基金持有的基金管理人管理的其他基金部分后的余额×对应类别约定年费率/当年天数。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	70,133.31	72,690.55

注：自 2023 年 9 月 28 日起，本基金在现有基金份额的基础上增设 Y 类基金份额，原基金份额转为 A 类基金份额。本基金投资于基金托管人所托管的其他基金部分不收取托管费。支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值扣除本基金持有的基金托管人托管的其他基金部分后的余额的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。A 类基金份额和 Y 类基金份额约定的托管费年费率分别为 0.15% 和 0.075%。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值扣除本基金持有的基金托管人托管的其他基金部分后的余额×对应类别约定年费率/当年天数。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

本基金本报告期及上年度可比期间无支付给各关联方的销售服务费。

#### 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

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 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

本基金于本报告期及上年度可比期间未与关联方发生转融通证券出借业务交易。

#### 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

本基金于本报告期及上年度可比期间未与关联方发生转融通证券出借业务交易。

#### 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固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	景顺长城隽丰平衡养老三年持有混合（FOF）A	景顺长城隽丰平衡养老三年持有混合（FOF）Y
基金合同生效日（2022年7月27日）持有的基金份额	10,001,777.96	-
报告期初持有的基金份额	10,001,777.96	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	10,001,777.96	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	9.0500%	-
项目	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	
	景顺长城隽丰平衡养老三年持有混合（FOF）A	景顺长城隽丰平衡养老三年持有混合（FOF）Y
基金合同生效日（2022年7月27日）持有的基金份额	10,001,777.96	-
报告期初持有的基金份额	10,001,777.96	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	10,001,777.96	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	9.0600%	-

注：基金管理人本报告期末持有的本基金份额为A类基金份额，持有的基金份额占比为占A类基金总份额的比例（比例实际为保留两位小数）。

**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**

本基金的其他关联方于本报告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 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023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
中国农业银行-活期	4,726,142.56	4,523.13	1,858,278.28	4,564.09

注：本基金的活期银行存款由基金托管人保管，并按银行间同业利率计息。

**6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

**6.4.10.8 其他关联交易事项的说明****6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明**

于2024年6月30日，本基金持有基金管理人景顺长城基金管理有限公司所管理的公开募集证券投资基金合计人民币45,878,892.81元，占本基金资产净值的比例为44.00%。（于2023年12月31日，本基金持有基金管理人景顺长城基金管理有限公司所管理的公开募集证券投资基金合计人民币42,322,744.39元，占本基金资产净值的比例为41.08%。）

**6.4.10.8.2 当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用**

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日
当期交易基金产生的申购费（元）	27.98	-
当期交易基金产生的赎回费（元）	1,304.54	12,725.45
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	56,835.76	17,445.18
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	118,131.94	75,039.34
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	27,103.82	18,527.05

注：当期持有基金产生的应支付销售服务费、应支付管理费、应支付托管费按照被投资基金基金合同约定已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，上表列示金额为按照本基金对被投资基金的实际持仓情况根据被投资基金基金合同约定的相应费率和计算方法计算得出。

根据相关法律法规及本基金合同的约定，基金管理人不得对基金中基金财产中持有的自身管理的基金部分收取基金中基金的管理费，基金托管人不得对基金中基金财产中持有的自身托管的基金部分收取基金中基金的托管费。基金管理人运用本基金财产申购自身管理的其他基金（ETF

除外），应当通过直销渠道申购且不得收取申购费、赎回费（按照相关法规、基金招募说明书约定应当收取，并记入基金财产的赎回费用除外）、销售服务费等销售费用。其中申购费、赎回费在实际申购、赎回时按上述规定执行，销售服务费由本基金管理人从被投资基金收取后返还至本基金基金资产。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配。

#### 6.4.12 期末（2024 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

本基金于本报告期末未持有因认购新发/增发而流通受限证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金于本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 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

截至本报告期末 2024 年 6 月 30 日止，本基金无因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。

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 6 月 30 日止，本基金无因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。

##### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

#### 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。

本基金管理人秉承全面风险管理的理念，将风险管理融入业务中，建立了以风险管理委员会为核心，由风险管理委员会、督察长、法律监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。各业务部门负责人为其所在部门的风险管理第一责任人，对本部门业务范围内的风险负有管控和及时报告的义务。员工在其岗位职责范围内承担相应风险管理责任。本基金管理人配备的风险管理人员对投资风险进行独立的监控并及时向管理层汇报。

### 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的发行人出现违约、拒绝支付到期本息等导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的投资范围及投资比例符合相关法律法规的要求、相关监管机构的相关规定及本基金的合同要求。本基金管理人通过建立和完善内部信用评级体系和交易对手库，对发行人及债券投资进行内部评级，对交易对手的资信状况进行充分评估、设定授信额度，以控制可能出现的信用风险。本基金的活期银行存款存放在具有托管资格的银行；本基金存放定期存款前，均对交易对手进行信用评估以控制相应的信用风险，因而与银行存款相关的信用风险不重大。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；本基金在银行间同业市场仅与达到本基金管理人既定信用政策标准的交易对手进行交易，以控制相应的信用风险。

本基金管理人还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，不得超过该证券余额的 10%。

于本报告期末，本基金持有除国债、央行票据、政策性金融债及地方政府债券之外的债券和资产支持证券的账面价值占基金净资产的比例为 0.51%（上年度末：0.00%）。

### 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投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难，另一方面来自于基金份额持有人可依据基金合同约定要求赎回其持有的基金份额。

本基金的基金管理人专业审慎、勤勉尽责地管控本基金的流动性风险，全覆盖、多维度的建立以压力测试为核心的流动性风险监测与预警制度，确保本基金组合的资产变现能力与投资者赎回需求匹配与平衡。

#### 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在基金运作过程中严格按照《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》（自 2017 年 10 月 1 日起施行）等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

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的

基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的 10%。由本基金的基金管理人管理的所有开放式基金于开放期内共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制）。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。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投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人对其管理的所有开放式基金于开放期内，对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因市场价格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。本基金管理人通过对不同类型的风险分别设定风险限制，并由独立于投资部门的风险管理人员监控、报告以及定期风险回顾的方法管理投资组合的市场风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。

本基金管理人通过风险管理人员定期监控组合中债券投资部分的利率风险，及时调整投资组合久期等方法管理利率风险。

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账面价值，并按照合同约定的重新定价日或到期日进行了分类。

## 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024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							
货币资金	4,726,142.56	-	-	-	-	-	4,726,142.56
结算备付金	30,384.73	-	-	-	-	-	30,384.73
存出保证金	13,724.71	-	-	-	-	-	13,724.71
交易性金融资产	-	-	-5,193,134.26	533,753.70	-	-93,978,312.08	99,705,200.04
应收股利	-	-	-	-	-	32,098.99	32,098.99
应收申购款	-	-	-	-	-	157.25	157.25
其他资产	-	-	-	-	-	10,228.47	10,228.47
资产总计	4,770,252.00	-	-5,193,134.26	533,753.70	-	-94,020,796.79	104,517,936.75
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	49,164.69	49,164.69
应付托管费	-	-	-	-	-	11,816.11	11,816.11
应付清算款	-	-	-	-	-	105,792.61	105,792.61
应交税费	-	-	-	-	-	3.37	3.37
其他负债	-	-	-	-	-	91,144.02	91,144.02
负债总计	-	-	-	-	-	257,920.80	257,920.80
利率敏感度缺口	4,770,252.00	-	-5,193,134.26	533,753.70	-	-	-
上年度末 2023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							
货币资金	3,094,764.44	-	-	-	-	-	3,094,764.44
结算备付金	72,008.34	-	-	-	-	-	72,008.34
存出保证金	8,483.04	-	-	-	-	-	8,483.04
交易性金融资产	-	-	-4,868,146.85	-	-	-95,941,719.14	100,809,865.99
应收股利	-	-	-	-	-	25,100.17	25,100.17
应收申购款	-	-	-	-	-	15,958.65	15,958.65
应收清算款	-	-	-	-	-	550,000.00	550,000.00
其他资产	-	-	-	-	-	6,956.59	6,956.59
资产总计	3,175,255.82	-	-4,868,146.85	-	-	-96,539,734.55	104,583,137.22
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	54,567.86	54,567.86
应付托管费	-	-	-	-	-	11,733.52	11,733.52
应付清算款	-	-	-	-	-	1,328,408.38	1,328,408.38

其他负债	-	-	-	-	161,326.23	161,326.23
负债总计	-	-	-	-	1,556,035.99	1,556,035.99
利率敏感度缺口	3,175,255.82	-4,868,146.85	-	-	-	-

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	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（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月31日）
	市场利率上升25个基点	-7,385.25	-3,822.05
	市场利率下降25个基点	7,399.61	3,828.24

#### 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。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日			
	美元 折合人民币元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	1,469,579.09	-	1,469,579.09
资产合计	-	1,469,579.09	-	1,469,579.09
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	1,469,579.09	-	1,469,579.09
项目	上年度末 2023年12月31日			
	美元 折合人民币元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	1,313,040.28	-	1,313,040.28
资产合计	-	1,313,040.28	-	1,313,040.28

以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	1,313,040.28	-	1,313,040.28

#### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率外的其他市场变量保持不变		
分析	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（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月31日）
	所有外币相对人民币升值5%	73,478.95	65,652.01
	所有外币相对人民币贬值5%	-73,478.95	-65,652.01

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因除外汇风险和利率风险以外的市场价格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证券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金通过投资组合的分散化降低其它价格风险，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。

#### 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 2024年6月30日		上年度末 2023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	4,716,457.21	4.52	5,509,628.28	5.35
交易性金融资产—基金投资	89,261,854.87	85.61	90,432,090.86	87.78
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	93,978,312.08	90.13	95,941,719.14	93.12

## 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	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（2024 年 6 月 30 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数上升 5%	3,185,808.85	2,050,705.96
沪深 300 指数下降 5%	-3,185,808.85	-2,050,705.96	

## 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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	94,512,065.78	95,941,719.14
第二层次	5,193,134.26	4,868,146.85
第三层次	-	-
合计	99,705,200.04	100,809,865.99

## 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金调整公允价值计量层次转换时点的相关会计政策在前后各会计期间保持一致。

对于公开市场交易的证券、基金等投资，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**

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

**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	4,716,457.21	4.51
	其中：股票	4,716,457.21	4.51
2	基金投资	89,261,854.87	85.40
3	固定收益投资	5,726,887.96	5.48
	其中：债券	5,726,887.96	5.48
	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	4,756,527.29	4.55
8	其他各项资产	56,209.42	0.05
9	合计	104,517,936.75	100.00

注：权益投资中通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 1,469,579.09 元，占基金资产净值的比例为 1.41%。

**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	806,286.00	0.77
C	制造业	1,852,418.12	1.78
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-

E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	87,822.00	0.08
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	-	-
K	房地产业	290,070.00	0.28
L	租赁和商务服务业	210,282.00	0.20
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	3,246,878.12	3.11

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
原材料	-	-
周期性消费品	-	-
非周期性消费品	-	-
综合	272,161.18	0.26
能源	-	-
金融	471,088.91	0.45
基金	-	-
工业	726,329.00	0.70
信息技术	-	-
公用事业	-	-
通讯	-	-
合计	1,469,579.09	1.41

注：以上行业分类采用彭博行业分类标准。

### 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	601899	紫金矿业	33,800	593,866.00	0.57
2	00257	光大环境	154,000	550,966.66	0.53
3	02628	中国人寿	30,000	302,279.62	0.29
4	001979	招商蛇口	33,000	290,070.00	0.28
5	300274	阳光电源	4,400	272,932.00	0.26
6	00267	中信股份	42,000	272,161.18	0.26

7	300750	宁德时代	1,500	270,045.00	0.26
8	600875	东方电气	13,000	239,850.00	0.23
9	603816	顾家家居	7,000	226,030.00	0.22
10	600988	赤峰黄金	13,000	212,420.00	0.20
11	002027	分众传媒	34,700	210,282.00	0.20
12	002541	鸿路钢构	11,200	190,064.00	0.18
13	002508	老板电器	8,300	183,430.00	0.18
14	00038	第一拖拉机股份	26,000	175,362.34	0.17
15	06049	保利物业	6,400	168,809.29	0.16
16	688012	中微公司	1,012	142,955.12	0.14
17	603606	东方电缆	2,600	126,906.00	0.12
18	600585	海螺水泥	4,300	101,437.00	0.10
19	002984	森麒麟	4,100	98,769.00	0.09
20	601111	中国国航	11,900	87,822.00	0.08

## 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	600988	赤峰黄金	607,450.00	0.59
2	603816	顾家家居	594,529.00	0.58
3	600256	广汇能源	505,506.00	0.49
4	601666	平煤股份	505,168.00	0.49
5	00257	光大环境	446,855.19	0.43
6	688012	中微公司	428,853.82	0.42
7	002508	老板电器	416,943.00	0.40
8	600549	厦门钨业	414,924.00	0.40
9	601899	紫金矿业	406,368.00	0.39
10	01818	招金矿业	378,818.70	0.37
11	002138	顺络电子	331,882.00	0.32
12	00267	中信股份	317,646.51	0.31
13	02628	中国人寿	308,532.71	0.30
14	003816	中国广核	307,796.00	0.30
15	001979	招商蛇口	299,026.00	0.29
16	603225	新凤鸣	297,216.00	0.29
17	300274	阳光电源	296,181.00	0.29
18	601827	三峰环境	293,222.00	0.28
19	300750	宁德时代	281,129.00	0.27
20	600048	保利发展	258,739.00	0.25

注：买入金额为成交金额（成交单价乘以成交数量），未考虑相关交易费用。

### 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	002155	湖南黄金	909,737.00	0.88
2	601666	平煤股份	573,706.00	0.56
3	01787	山东黄金	564,307.80	0.55
4	600256	广汇能源	526,127.00	0.51
5	603993	洛阳钼业	520,156.00	0.50
6	600988	赤峰黄金	519,585.00	0.50
7	600603	广汇物流	508,699.00	0.49
8	01208	五矿资源	482,090.66	0.47
9	000630	铜陵有色	449,665.00	0.44
10	600549	厦门钨业	446,792.00	0.43
11	600019	宝钢股份	435,355.00	0.42
12	601899	紫金矿业	408,265.00	0.40
13	01818	招金矿业	406,472.38	0.39
14	00700	腾讯控股	354,165.11	0.34
15	603816	顾家家居	340,980.00	0.33
16	601827	三峰环境	338,903.00	0.33
17	003816	中国广核	324,436.00	0.31
18	002138	顺络电子	314,954.00	0.31
19	688012	中微公司	306,502.12	0.30
20	603225	新凤鸣	304,689.00	0.30

注：卖出金额为成交金额（成交单价乘以成交数量），未考虑相关交易费用。

#### 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	14,881,971.47
卖出股票收入（成交）总额	16,706,059.01

注：买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额均为买卖股票成交金额（成交单价乘以成交数量），未考虑相关交易费用。

#### 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	5,193,134.26	4.98
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
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）	533,753.70	0.51
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	5,726,887.96	5.49

## 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	019733	24 国债 02	51,380	5,193,134.26	4.98
2	127062	垒知转债	3,083	323,732.32	0.31
3	128135	洽洽转债	1,850	210,021.38	0.20

## 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

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

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

本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

根据本基金基金合同约定，本基金投资范围不包括股指期货。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

根据本基金基金合同约定，本基金投资范围不包括国债期货。

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

根据本基金基金合同约定，本基金投资范围不包括国债期货。

## 7.12 本报告期投资基金情况

### 7.12.1 投资政策及风险说明

#### 1、投资政策

本基金定位为风险策略基金，且为目标风险系列基金中基金中风险收益特征相对平衡的基金。“风险”的定义主要为基金资产净值的长期波动率。风险主要来源于资产价格的波动，波动越高的资产风险也会越高。本基金平衡目标风险的含义是指基金资产净值的长期波动率尽量贴近本基金的基准，并与投资目标基本一致。

本基金的核心是通过资产配置将本基金资产风险控制在目标波动率范围内，并追求超越业绩比较基准的收益表现。本基金的资产配置通过在战略资产配置策略模型的基础上，根据市场环境的变化引入战术资产配置对大类资产配置比例进行调整，使得组合的风险特征尽量趋近平衡的目标风险。

本基金的大类资产配置采用风险预算策略作为战略资产配置，并通过量化模型根据量化指标在战略资产配置基础上对各类资产类别进行战术配置调整基于上述投资策略。本基金战略配置中

权益类资产（包括股票、股票型基金、混合型基金）配置比例的长期中枢为 55%。本基金战术配置调整，最低可调整到 45%，最高不超过 60%。

## 2、风险说明

(1) 投资标的的风险。本基金以经中国证监会核准或注册的公开募集证券投资基金作为主要投资标的，其所投资的公开募集证券投资基金本身面临着市场风险、流动性风险、管理风险、信用风险等。因此，本基金所持有的公开募集证券投资基金的风险可能会间接或直接地成为本基金的风险。

(2) 商品基金的风险。商品基金资产与商品现货价格高度相关，商品现货价格变化将导致商品基金等价格变化的风险。成本、市场需求、市场环境、气候、时间、地域、生产、宗教信仰、文化等众多直接和间接的因素都会影响商品的价格。另外，商品基金还存在 ETF 流动性风险、ETF 跟踪误差风险、期货杠杆风险等。

(3) 沪港深/港股通基金的风险。本基金除可通过港股通机制直接投资香港市场外，还可能通过投资于沪港深/港股通基金投资于香港市场。故而本基金面临着港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

(4) 香港互认基金及 QDII 基金的风险。本基金可投资于香港互认基金、QDII 基金。投资于境外基金面临着海外市场风险、汇率风险、政策风险、税务风险等。

(5) 同一基金公司管理的同类型基金在投资风格、重仓证券、市场判断等方面可能具有相对较高的相似性，因而当本基金持有同一基金公司管理的基金比例较高时，本基金在市场风险、信用风险、流动性风险等方面可能面临较高的集中度，不利于风险分散。

(6) 子基金收益不达预期的风险：基金管理人在构建投资组合的时候，对于基金的选择在很大的程度上依靠了子基金的过往业绩。但是子基金的过往业绩往往不能代表子基金未来的表现。本基金投资目标的实现建立在子基金投资目标实现的基础上。如果由于子基金管理人未能实现投资目标，则本基金存在达不成投资目标的风险。

(7) 子基金风格偏离风险：本基金筛选子基金策略依靠定性及定量的方法对子基金的风格进行研判，并精选适合投资目标的基金。因此当子基金投资风格出现偏离，会使得本基金存在收益不达预期的风险。

(8) 子基金的流动性风险：子基金可能因为暂停估值、基金资产估值存在重大不确定性、连续巨额赎回等情形时实施暂停赎回、延缓支付赎回款项、延期办理赎回申请、对单个投资者赎回比例确认的情形，存在流动性风险。

## 7.12.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的基金投资明细

序号	基金代码	基金名称	运作方式	持有份额（份）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	是否属于基金管理人及管理人关联方所管理的基金
1	007537	景顺长城景泰盈利纯债债券	契约型开放式	8,242,832.28	9,968,881.36	9.56	是
2	007604	景顺长城中短债债券 C 类	契约型开放式	6,148,132.53	6,911,730.59	6.63	是
3	008409	景顺长城景泰裕利纯债债券 A	契约型开放式	4,146,433.08	4,543,246.73	4.36	是
4	000182	景顺长城四季金利债券 C 类	契约型开放式	3,871,701.60	4,518,275.77	4.33	是
5	015779	景顺长城价值边际灵活配置混合 C	契约型开放式	2,813,309.57	4,517,612.51	4.33	是
6	004719	景顺长城睿成混合 C 类	契约型开放式	3,235,640.93	4,355,496.26	4.18	是
7	017167	景顺长城策略精选灵活配置混合 C	契约型开放式	1,452,419.82	4,001,416.60	3.84	是
8	004475	华泰柏瑞富利混合 A	契约型开放式	1,621,653.89	3,312,228.07	3.18	否
9	003408	景顺长城景泰丰利纯债债券 C 类	契约型开放式	3,027,204.10	3,302,982.39	3.17	是
10	511360	海富通中证短融 ETF	交易型开放式 (ETF)	28,600.00	3,146,314.60	3.02	否
11	000032	易方达信用债债券 A	契约型开放式	2,407,767.95	2,741,966.14	2.63	否
12	017426	国富深化价值混合 C	契约型开放式	1,284,735.69	2,150,647.55	2.06	否
13	166301	华商新趋势优选混合	契约型开放式	228,178.68	2,081,445.92	2.00	否
14	001044	嘉实新消费股票	契约型开放式	854,009.59	2,037,666.88	1.95	否
15	008792	招商安华债券 C	契约型开放式	1,754,129.65	1,990,235.50	1.91	否
16	510300	华泰柏瑞沪深 300ETF	交易型开放式 (ETF)	569,200.00	1,984,800.40	1.90	否
17	002797	景顺长城景盈双利债券 C 类	契约型开放式	1,755,176.44	1,977,908.33	1.90	是
18	159745	国泰中证全指建筑材料 ETF	交易型开放式 (ETF)	3,494,500.00	1,855,579.50	1.78	否

19	518880	华安黄金易 (ETF)	交易型开放式 (ETF)	347,600.00	1,841,237.20	1.77	否
20	510050	华夏上证 50ETF	交易型开放式 (ETF)	732,600.00	1,788,276.60	1.72	否
21	008270	大成睿享混合 C	契约型开放式	1,275,700.37	1,678,694.12	1.61	否
22	510410	博时上证自然资源 ETF	交易型开放式 (ETF)	1,232,400.00	1,518,316.80	1.46	否
23	513010	易方达恒生科技 ETF (QDII)	交易型开放式 (ETF)	2,872,800.00	1,442,145.60	1.38	否
24	017170	景顺长城优势企业混合 C	契约型开放式	437,914.50	1,271,703.71	1.22	是
25	002165	汇添富达欣混合 C	契约型开放式	758,364.16	1,229,308.30	1.18	否
26	016049	华商甄选回报混合 C	契约型开放式	893,528.22	1,177,759.55	1.13	否
27	512000	华宝中证全指证券公司 ETF	交易型开放式 (ETF)	1,504,700.00	1,131,534.40	1.09	否
28	002036	安信优势增长混合 C	契约型开放式	481,422.28	1,053,688.94	1.01	否
29	159949	华安创业板 50ETF	交易型开放式 (ETF)	1,275,600.00	922,258.80	0.88	否
30	016563	金鹰红利价值混合 C	契约型开放式	528,643.22	868,719.40	0.83	否
31	159920	华夏恒生 ETF	交易型开放式 (ETF)	788,400.00	853,048.80	0.82	否
32	588000	华夏上证科创板 50 成份 ETF	交易型开放式 (ETF)	1,120,800.00	834,996.00	0.80	否
33	512480	国联安中证全指半导体 ETF	交易型开放式 (ETF)	1,169,400.00	830,274.00	0.80	否
34	011906	安信价值启航混合 C	契约型开放式	576,316.86	624,785.11	0.60	否
35	513300	华夏纳斯达克 100ETF (QDII)	交易型开放式 (ETF)	314,100.00	596,475.90	0.57	否
36	513060	博时恒生医疗保健 (QDII-ETF)	交易型开放式 (ETF)	1,580,500.00	540,531.00	0.52	否
37	005661	嘉实资源精选股票 C	契约型开放式	191,829.55	530,542.99	0.51	否
38	018998	景顺长城研究精选股票 C	契约型开放式	401,606.43	509,638.56	0.49	是

39	515220	国泰中证煤炭ETF	交易型开放式(ETF)	408,300.00	504,658.80	0.48	否
40	159866	工银瑞信日经ETF	交易型开放式(ETF)	460,000.00	483,920.00	0.46	否
41	515210	国泰中证钢铁ETF	交易型开放式(ETF)	429,100.00	469,435.40	0.45	否
42	159881	国泰中证有色金属ETF	交易型开放式(ETF)	343,700.00	330,983.10	0.32	否
43	159929	汇添富中证医药卫生ETF	交易型开放式(ETF)	228,700.00	267,121.60	0.26	否
44	515790	华泰柏瑞中证光伏ETF	交易型开放式(ETF)	375,900.00	255,612.00	0.25	否
45	159732	华夏国证消费电子主题ETF	交易型开放式(ETF)	245,200.00	164,774.40	0.16	否
46	513690	博时恒生高股息ETF	交易型开放式(ETF)	150,300.00	126,252.00	0.12	否
47	006195	国金量化多因子A	契约型开放式	9,000.00	15,726.60	0.02	否
48	511990	华宝添益	交易型开放式(ETF)	10.00	1,000.09	0.00	否

### 7.12.3 报告期末基金持有的全部公开募集基础设施证券投资基金情况

本基金本报告期末未持有公开募集基础设施证券投资基金。

### 7.13 投资组合报告附注

#### 7.13.1 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

东方电气有限责任公司在报告编制日前一年内曾受到环保部的处罚。

本基金基金经理依据基金合同及公司投资管理制度，在投资授权范围内，经正常投资决策程序对上述主体所发行证券进行了投资。

本基金投资前十名证券的其余发行主体本报告期内没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

#### 7.13.2 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未超出基金合同规定的备选股票库。

#### 7.13.3 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	13,724.71
2	应收清算款	-

3	应收股利	32,098.99
4	应收利息	-
5	应收申购款	157.25
6	其他应收款	10,228.47
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	56,209.42

#### 7.13.4 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	127062	垒知转债	323,732.32	0.31
2	128135	洽洽转债	210,021.38	0.20

#### 7.13.5 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的情况。

#### 7.13.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

## § 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 (%)
景顺长城隽丰平衡养老三年持有混合 (FOF) A	2,843	38,865.84	10,120,595.17	9.16	100,374,979.95	90.84
景顺长城隽丰平衡养老三年持有混合 (FOF) Y	48	4,890.54	0	0.00	234,745.95	100.00
合计	2,891	38,301.74	10,120,595.17	9.14	100,609,725.90	90.86

注：分级基金机构/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	景顺长城隽丰平衡养老三年持有混合 (FOF) A	45,069.51	0.040789
	景顺长城隽丰平衡养老三年持有混合 (FOF) Y	10.46	0.004456
	合计	45,079.97	0.040711

### 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、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	景顺长城隽丰平衡养老三年持有混合 (FOF) A	-
	景顺长城隽丰平衡养老三年持有混合 (FOF) Y	-
	合计	-
本基金基金经理持有本开放式基金	景顺长城隽丰平衡养老三年持有混合 (FOF) A	0~10
	景顺长城隽丰平衡养老三年持有混合 (FOF) Y	-
	合计	0~10

### 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例 (%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例 (%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,001,777.96	9.03	10,000,000.00	9.07	3年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	不适用
基金经理等人员	43,938.18	0.04	-	-	不适用
基金管理人股东	-	-	-	-	不适用
其他	-	-	-	-	不适用
合计	10,045,716.14	9.07	10,000,000.00	9.07	-

注：发起份额总数为不包含利息的认购份额。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	景顺长城隽丰平衡养老三年持有混合 (FOF) A	景顺长城隽丰平衡养老三年持有混合 (FOF) Y
基金合同生效日 (2022 年 7 月 27 日) 基金份额总额	110,239,178.34	-
本报告期期初基金份额总额	110,479,711.68	19,314.45
本报告期基金总申购份额	15,863.44	215,431.50
减: 本报告期基金总赎回份额	-	-
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	110,495,575.12	234,745.95

注: 申购含红利再投、转换入份额; 赎回含转换出份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

在本报告期内, 本基金未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

基金管理人重大人事变动:

报告期内本基金管理人未发生重大人事变动。

基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动:

报告期内本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

在本报告期内, 本基金投资策略未发生改变。

### 10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《景顺长城四季金利债券型证券投资基金基金合同》的有关规定, 景顺长城四季金利债券型证券投资基金的基金管理人景顺长城基金管理有限公司经与本基金的基金托管人中国农业银行股份有限公司协商一致, 以通讯开会方式召开本基金的基金份额持有人大会, 审议通过了关于调整本基金收益与分配条款的议案, 调整后的收益与分配条款自 2024 年 2 月 7 日起生效。

### 10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期末未更换会计师事务所。

## 10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

## 10.7.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金的管理人及其高级管理人员未受到监管部门的任何稽查和处罚。

## 10.7.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金的托管人及其高级管理人员未受到监管部门的任何稽查和处罚。

## 10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

## 10.8.1 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 (%)	
方正证券股份有限公司	2	5,854,023.25	18.53	5,513.71	19.01	未变更
长江证券股份有限公司	2	4,376,715.82	13.86	4,108.90	14.17	未变更
广发证券股份有限公司	2	2,968,315.18	9.40	2,612.23	9.01	未变更
国金证券股份有限公司	1	2,455,931.40	7.77	2,172.95	7.49	未变更
兴业证券股份有限公司	1	2,402,293.07	7.61	2,243.03	7.73	未变更
民生证券股份有限公司	1	2,354,594.76	7.45	2,031.17	7.00	未变更
招商证券股份有限公司	2	1,813,207.42	5.74	1,714.05	5.91	未变更
申万宏源证券有限公司	1	1,739,146.26	5.51	1,568.32	5.41	未变更
东北证券股份有限公司	2	1,372,118.33	4.34	1,297.97	4.47	未变更
川财证券有限责任公司	1	1,180,667.00	3.74	1,116.93	3.85	未变更
东方证券股份有限公司	2	1,031,374.00	3.27	975.58	3.36	未变更
西南证券股份有限公司	1	871,512.43	2.76	824.23	2.84	未变更
东兴证券股份有限公司	1	742,352.78	2.35	625.14	2.16	未变更
光大证券股份有限公司	2	540,317.20	1.71	511.11	1.76	未变更
平安证券股份有限公司	2	429,526.60	1.36	375.68	1.30	未变更
国盛证券有限责任公司	1	422,058.27	1.34	352.20	1.21	未变更
长城证券股份有限公司	1	405,654.71	1.28	369.45	1.27	未变更
华泰证券股份有限公司	1	350,192.00	1.11	331.19	1.14	未变更
瑞银证券有限责任公司	1	252,089.00	0.80	238.37	0.82	未变更
中国银河证券股份有限公司	2	25,941.00	0.08	24.55	0.08	未变更
诚通证券股份有限公司	1	-	-	-	-	未变更
国泰君安证券股份有限公司	1	-	-	-	-	未变更
国投证券股份有限公司	1	-	-	-	-	未变更
国信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	未变更
海通证券股份有限公司	1	-	-	-	-	未变更

恒泰证券股份有限公司	1	-	-	-	-	未变更
华创证券有限责任公司	1	-	-	-	-	未变更
华福证券有限责任公司	1	-	-	-	-	未变更
天风证券股份有限公司	1	-	-	-	-	未变更
中国国际金融股份有限公司	2	-	-	-	-	未变更
中泰证券股份有限公司	2	-	-	-	-	未变更
中信建投证券股份有限公司	1	-	-	-	-	未变更
中信证券股份有限公司	6	-	-	-	-	未变更

注：基金专用交易单元的选择标准和程序如下：

1) 选择标准

- a、资金实力雄厚，信誉良好；
- b、财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- c、经营行为规范，最近三年未因重大违规行为受到监管机关的处罚；
- d、内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足本基金运作高度保密的要求；
- e、该证券经营机构具有较强的研究能力，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时、全面、定期向基金管理人提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析报告、个股分析报告及其他专门报告以及全面的信息服务。并能根据基金管理人的特定要求，提供专门研究报告。

2) 选择程序

基金管理人根据以上标准进行考察后，确定证券经营机构的选择。基金管理人与被选择的证券经营机构签订协议。

### 10.8.2 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		基金交易	
	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 (%)	成交金额	占当期基金成交总额的比例 (%)
方正证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	23,231,071.70	36.91
长江证券股	-	-	-	-	-	-	7,871,657.10	12.51

份有限公司									
广发证券股 份有限公司	221,000.72	3.19	-	-	-	-	1,357,916.20	2.16	
国金证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-	206,970.30	0.33	
兴业证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-	1,149,880.90	1.83	
民生证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-	2,926,086.00	4.65	
招商证券股 份有限公司	526,542.54	7.61	-	-	-	-	2,136,148.30	3.39	
申万宏源证 券有限公司	314,213.59	4.54	-	-	-	-	2,570,273.30	4.08	
东北证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-	1,586,826.40	2.52	
川财证券有 限责任公司	-	-	-	-	-	-	6,586,526.81	10.46	
东方证券股 份有限公司	5,158,507.34	74.54	-	-	-	-	519,442.60	0.83	
西南证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-	4,319,531.60	6.86	
东兴证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-	498,127.30	0.79	
光大证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-	4,470,002.70	7.10	
平安证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-	
国盛证券有 限责任公司	-	-	-	-	-	-	968,733.50	1.54	
长城证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-	
华泰证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-	497,386.80	0.79	
瑞银证券有 限责任公司	700,111.92	10.12	-	-	-	-	1,498,766.90	2.38	
中国银河证 券股份有限 公司	-	-	-	-	-	-	313,437.30	0.50	
诚通证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-	
国泰君安证 券股份有限 公司	-	-	-	-	-	-	-	-	
国投证券股	-	-	-	-	-	-	232,323.20	0.37	

份有限公司								
国信证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
恒泰证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
华创证券有 限责任公司	-	-	-	-	-	-	-	-
华福证券有 限责任公司	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中国国际金 融股份有限 公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投证 券股份有限 公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-

### 10.9 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	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金 2024 年非港股通交易日暂停申购（含日常申购和定期定额投资）、赎回及转换业务安排的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 1 月 4 日
2	景顺长城基金管理有限公司关于调整适用“养老金客户费率优惠”的养老金客户范围的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 1 月 10 日
3	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2023 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 1 月 22 日
4	景顺长城隽丰平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）2023 年第 4 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 1 月 22 日
5	关于景顺长城隽丰平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）新增浦发银行为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 2 月 27 日
6	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增海通证券为销售机构的	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 3 月 19 日

	公告		
7	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024年3月22日
8	关于警惕假冒景顺长城基金 APP 开展诈骗活动的声明	中国证监会指定报刊及网站	2024年3月27日
9	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金非港股通交易日暂停申购、赎回等业务安排的提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2024年3月28日
10	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2023 年年度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2024年3月29日
11	景顺长城隽丰平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）2023 年年度报告	中国证监会指定报刊及网站	2024年3月29日
12	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增华福证券为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024年4月10日
13	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024年4月13日
14	景顺长城基金管理有限公司关于持续完善客户身份信息的提示	中国证监会指定报刊及网站	2024年4月15日
15	景顺长城隽丰平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）2024 年第 1 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2024年4月22日
16	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2024 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2024年4月22日
17	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增招商银行股份有限公司招赢通平台为销售平台的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024年4月25日
18	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金非港股通交易日暂停申购、赎回等业务安排的提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2024年5月13日
19	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024年5月24日
20	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024年5月31日
21	景顺长城隽丰平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金产品资料概要更新	中国证监会指定报刊及网站	2024年6月14日
22	景顺长城基金管理有限公司旗下基金调整持有停牌股票估值价格的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024年6月21日
23	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金非港股通交易日暂停申购、赎回等业务安排的提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2024年6月27日
24	景顺长城基金管理有限公司关于系统	中国证监会指定报刊及	2024年6月29日

停机维护的公告	网站	
---------	----	--

## § 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

无。

### 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

1、中国证监会准予景顺长城隽丰平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）募集注册的文件；

- 2、《景顺长城隽丰平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金合同》；
- 3、《景顺长城隽丰平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）招募说明书》；
- 4、《景顺长城隽丰平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）托管协议》；
- 5、景顺长城基金管理有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程；
- 6、其他在中国证监会指定报纸上公开披露的基金份额净值、定期报告及临时公告。

### 12.2 存放地点

以上备查文件存放在本基金管理人的办公场所。

### 12.3 查阅方式

投资者可在办公时间免费查阅。

景顺长城基金管理有限公司

2024年8月30日