

景顺长城养老目标日期 2035 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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
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	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	7
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
§ 4 管理人报告	9
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
§ 5 托管人报告	13
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
§ 6 半年度财务会计报告 (未经审计)	13
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
§ 7 投资组合报告	41
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	51
§ 8 基金份额持有人信息	52
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	52
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	52
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	52
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	53
§ 9 开放式基金份额变动	53
§ 10 重大事件揭示	53
10.1 基金份额持有人大会决议	53
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	53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	54
10.4 基金投资策略的改变	54
10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件	54
10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况	54
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	54
10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况	54
10.9 其他重大事件	58
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	61
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
§ 12 备查文件目录	61
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	景顺长城养老目标日期 2035 三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF)	
基金简称	景顺长城养老 2035 三年持有混合 (FOF)	
基金主代码	013904	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022 年 1 月 25 日	
基金管理人	景顺长城基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	186,556,191.39 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	景顺长城养老 2035 三年持有混合 (FOF) A	景顺长城养老 2035 三年持有混合 (FOF) Y
下属分级基金的交易代码	013904	021048
报告期末下属分级基金的份额总额	186,522,646.52 份	33,544.87 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金的目标日期为 2035 年 12 月 31 日, 本基金采用成熟的资产配置策略, 随着投资者目标时间期限的接近, 通过调整投资于多种具有不同风险收益特征的基金和其他资产的比例, 控制基金下行风险, 追求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	<p>1、大类资产配置策略</p> <p>本基金的大类资产配置采用战略资产配置和战术资产配置相结合的方式。本基金的资产配置策略, 随着投资者生命周期的延续和目标日期期限的临近, 基金的权益类资产配置比例逐步下降, 而非权益类资产配置比例逐步上升。</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、子基金投资组合风险控制策略</p> <p>基金管理人每日跟踪子基金投资组合, 每月对子基金投资组合表现进行回顾分析, 并定期对子基金投资组合中单只子基金根据公开披露的信息进行持仓分析, 并估算子基金投资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。</p> <p>6、存托凭证投资策略 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 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，并通过研究标的的证券发行条款，预测提前偿还率变化对标的的证券的久期与收益率的影响。</p>
业绩比较基准	中证目标日期 2035 指数收益率
风险收益特征	<p>本基金是一只养老目标日期基金，目标日期为 2035 年 12 月 31 日。本基金的风险与收益水平会随着投资者目标日期期限的临近而逐步降低。在前期，本基金的权益类资产配置比例较高，属于预期风险及预期收益水平较高的投资品种。随后，本基金将逐步降低权益类资产配置比例，相应预期风险及收益水平将逐步降低。本基金的预期风险收益水平低于股票型基金、股票型基金中基金，但高于货币市场基金、货币型基金中基金、债券型基金、债券型基金中基金。本基金可投资港股通标的股票，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	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	杨皞阳
	联系电话	(010) 66105799
	电子邮箱	investor@igwfm.com
客户服务热线	4008888606	95588
传真	0755-22381339	(010) 66105798
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	北京市西城区复兴门内大街 55 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 55 号
邮政编码	518048	100140
法定代表人	李进	廖林

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.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)	2024年3月29日(Y类份额首个估值日)-2024年6月30日
	景顺长城养老 2035 三年持有混合 (FOF) A	景顺长城养老 2035 三年持有混合 (FOF) Y
本期已实现收益	-11,396,275.53	-157.34
本期利润	-6,389,499.31	-417.65
加权平均基金份额本期利润	-0.0361	-0.0427
本期加权平均净值利润率	-4.14%	-4.85%
本期基金份额净值增长率	-3.91%	-0.68%
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	-24,943,163.18	-4,454.10
期末可供分配基金份额利润	-0.1337	-0.1328
期末基金资产净值	161,579,483.34	29,090.77
期末基金份额净值	0.8662	0.8672
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	-13.38%	-0.68%

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。

5、本基金自 2024 年 3 月 27 日起增设 Y 类基金份额，并于 2024 年 3 月 29 日开始对 Y 类份额进行估值。

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

景顺长城养老 2035 三年持有混合 (FOF) A

阶段	份额净值增长	份额净值增长率标	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标	①—③	②—④
----	--------	----------	------------	------------	-----	-----

	率①	准差②		准差④		
过去一个月	-1.58%	0.43%	0.17%	0.17%	-1.75%	0.26%
过去三个月	-1.18%	0.53%	0.76%	0.27%	-1.94%	0.26%
过去六个月	-3.91%	0.73%	3.47%	0.34%	-7.38%	0.39%
过去一年	-10.64%	0.65%	0.88%	0.35%	-11.52%	0.30%
自基金合同生效起至今	-13.38%	0.60%	-5.13%	0.48%	-8.25%	0.12%

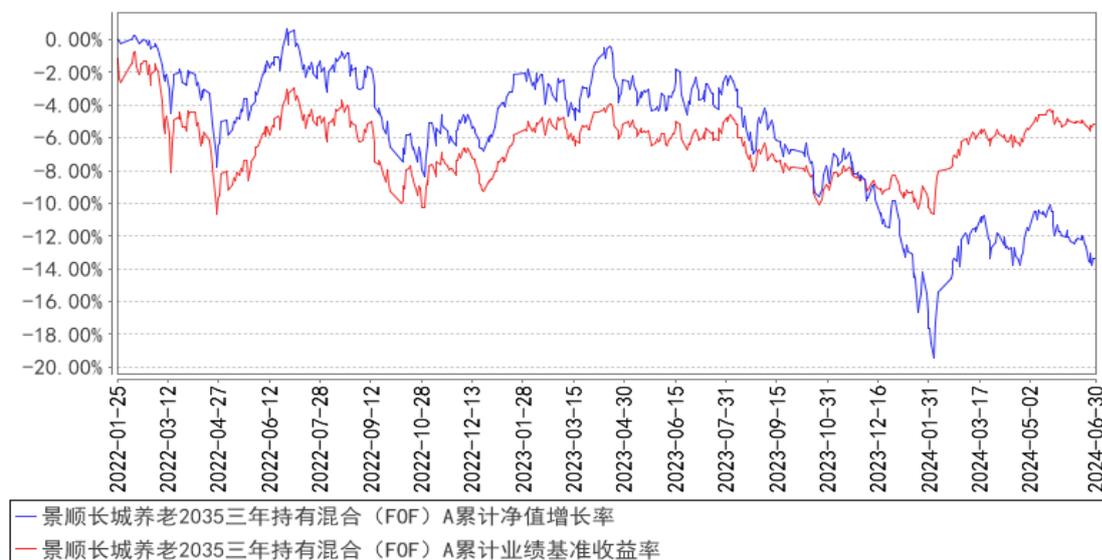
景顺长城养老 2035 三年持有混合 (FOF) Y

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	-1.54%	0.43%	0.17%	0.17%	-1.71%	0.26%
过去三个月	-1.09%	0.53%	0.76%	0.27%	-1.85%	0.26%
自基金合同生效起至今	-0.68%	0.53%	0.96%	0.27%	-1.64%	0.26%

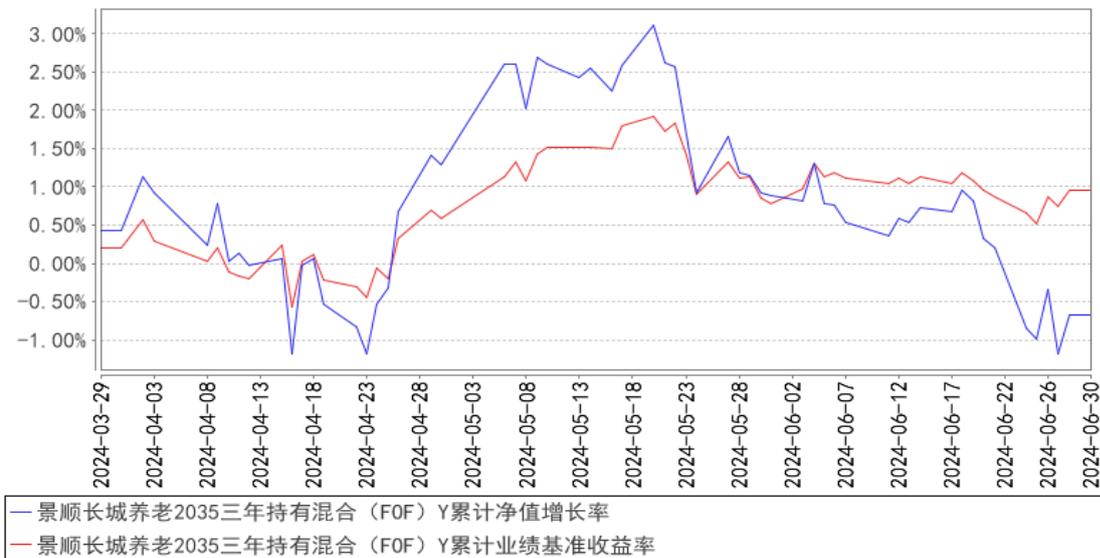
注：本基金自 2024 年 3 月 27 日起增设 Y 类基金份额，并于 2024 年 3 月 29 日开始对 Y 类份额进行估值。

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

景顺长城养老 2035 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



景顺长城养老2035三年持有混合（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：本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）等品种的比例合计原则上不超过 60%；其中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。本基金不得持有具有复杂、衍生品性质的基金份额，包括中国证监会认定的其他基金份额。本基金投资于港股通标的股票不超过股票资产的 50%。权益类资产指股票、股票型基金和混合型基金，其中混合型基金指根据定期报告披露情况，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。本基金的建仓期为自 2022 年 1 月 25 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 2024 年 3 月 27 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 1 月 25 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。
江虹	本基金的基金经理	2022 年 12 月 23 日	-	14 年	工商管理硕士。曾任华泰人寿保险股份有限公司精算部产品精算专员，光大证券股份有限公司销售交易部高级经理，海通证券股份有限公司研究所高级经理，中信保诚人寿保险有限公司基金投资部投资经理，中信保诚资产管理有限责任公司基金投资部投资经理。2021 年 7 月加入本公司，自 2021 年 9 月起担任养老及资产配置部基金经理。具有 14 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、《景顺长城养老目标日期 2035 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《证券投资基金管理人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

2024 年上半年, A 股权益市场波动大, 市场先后经历了从下跌到上涨的周期。在经历下跌后, 主要指数 2 月迎来估值修复, 情绪逐步回暖, 北向资金的流入和两融余额的稳步回升也为市场带来了新的流动性。从经济基本面来看, 宏观经济增速修复虽有一定压力, 但是大家的担忧情绪已经释放较为充分。整体上看, 小盘成长板块波动最大, 价值红利及 AI 相关的科技板块表现亮眼。海外权益市场方面, 美股稳定性较高, 欧洲、日本及一些新兴市场因汇率等因素波动加大。

债市方面, 整个上半年延续积极情绪, 债市收益率保持下行走势。我们判断长期利率中枢可能仍会震荡下行, 但空间相对有限。

基金操作上, 上半年我们结合市场周期定位, 主要采用“更多的红利”和“更多的科技”这个主要配置思路, 构建偏离两端的哑铃型结构, 在保证红利基本盘的情况下, 在市场回暖的过程中, 积极把握科技及其他方向的机会。固收基金选择方面, 主要依靠精选自适应市场能力强, 能跟随市场灵活调整久期的资深基金经理的基金产品进行底仓配置, 力争获取稳定收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2024 年上半年, 景顺长城养老 2035 三年持有混合 (FOF) A 类份额净值增长率为-3.91%, 业绩

比较基准收益率为 3.47%。

2024 年 3 月 29 日 (Y 类份额首个估值日) 至本报告期末, 景顺长城养老 2035 三年持有混合 (FOF) Y 类份额净值增长率为-0.68%, 业绩比较基准收益率为 0.96%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市, 在海外市场滞胀压力仍高、AH 股性价比凸显以及压力阶段性出清背景下, 权益资产投资性价比较高。随着国内经济逐步复苏回升, 海外大选带来海外宏观不确定性上升, 我们对国内权益市场的表现保持积极乐观。

本基金将在紧密跟踪下滑曲线的基础上根据市场环境动态调整资产及子基金的配置, 以期获得长期资本增值。

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及适用性的情况时, 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

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

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本基金的管理人——景顺长城基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现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

本托管人依法对景顺长城基金管理有限公司编制和披露的本基金 2024 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：景顺长城养老目标日期 2035 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
资产：			
货币资金	6.4.7.1	1,817,482.39	3,522,464.74
结算备付金		320,830.37	366,032.25
存出保证金		28,512.61	15,865.65
交易性金融资产	6.4.7.2	162,546,890.21	155,883,575.00
其中：股票投资		22,129,042.56	20,398,870.15
基金投资		130,690,066.87	127,550,021.94

债券投资		9,727,780.78	7,934,682.91
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		853,634.12	2,347,997.35
应收股利		-	47,462.00
应收申购款		11,998.57	480,006.02
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	6,973.02	4,498.58
资产总计		165,586,321.29	162,667,901.59
负债和净资产	附注号	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
负 债：			
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		2,800,544.14	4,001,232.88
应付清算款		943,437.98	1,243,853.66
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		70,226.06	70,117.42
应付托管费		17,627.07	16,029.49
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		57.57	32.16
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	145,854.36	206,734.88
负债合计		3,977,747.18	5,538,000.49
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	186,556,191.39	174,308,647.97
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-24,947,617.28	-17,178,746.87
净资产合计		161,608,574.11	157,129,901.10
负债和净资产总计		165,586,321.29	162,667,901.59

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，基金份额总额 186,556,191.39 份，其中本基金 A 类份额净

值人民币 0.8662 元, 基金份额 186,522,646.52 份; 本基金 Y 类份额净值人民币 0.8672 元, 基金份额 33,544.87 份。

6.2 利润表

会计主体: 景顺长城养老目标日期 2035 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
一、营业总收入		-5,754,946.01	1,210,642.83
1. 利息收入		11,075.80	4,714.28
其中: 存款利息收入	6.4.7.13	11,075.80	4,544.41
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		-	169.87
其他利息收入		-	-
2. 投资收益 (损失以“-”填列)		-10,806,590.62	2,000,977.64
其中: 股票投资收益	6.4.7.14	-4,813,330.66	1,128,474.07
基金投资收益	6.4.7.15	-6,958,247.64	707,488.53
债券投资收益	6.4.7.16	198.33	19,716.83
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	964,789.35	145,298.21
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	5,006,515.91	-806,522.95
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	34,052.90	11,473.86
减: 二、营业总支出		634,970.95	288,519.93
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	429,598.59	166,342.56
其中: 暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	101,609.83	37,201.94

3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		28,854.04	12,738.23
其中：卖出回购金融资产支出		28,854.04	12,738.23
6. 信用减值损失	6.4.7.24	-	-
7. 税金及附加		26.99	2,592.66
8. 其他费用	6.4.7.25	74,881.50	69,644.54
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-6,389,916.96	922,122.90
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-6,389,916.96	922,122.90
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-6,389,916.96	922,122.90

6.3 净资产变动表

会计主体：景顺长城养老目标日期 2035 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	174,308,647.97	-	-17,178,746.87	157,129,901.10
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	174,308,647.97	-	-17,178,746.87	157,129,901.10
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	12,247,543.42	-	-7,768,870.41	4,478,673.01
（一）、综合收益总额	-	-	-6,389,916.96	-6,389,916.96
（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）	12,247,543.42	-	-1,378,953.45	10,868,589.97

其中：1. 基金申购款	12,814,721.98	-	-1,447,865.65	11,366,856.33
2. 基金赎回款	-567,178.56	-	68,912.20	-498,266.36
(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	186,556,191.39	-	-24,947,617.28	161,608,574.11
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	31,293,291.92	-	-1,833,828.38	29,459,463.54
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	31,293,291.92	-	-1,833,828.38	29,459,463.54
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	49,847,798.21	-	-651,029.61	49,196,768.60
(一)、综合收益总额	-	-	922,122.90	922,122.90
(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)	49,847,798.21	-	-1,573,152.51	48,274,645.70
其中：1. 基金申购款	49,847,798.21	-	-1,573,152.51	48,274,645.70
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	81,141,090.13	-	-2,484,857.99	78,656,232.14

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

景顺长城养老目标日期 2035 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]3160 号文《关于准予景顺长城养老目标日期 2035 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《景顺长城养老目标日期 2035 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 1 月 25 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币 13,549,542.95 元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币 2,460.29 元 以上实收基金(本息)合计为人民币 13,552,003.24 元 折合 13,552,003.24 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，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

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《景顺长城养老目标日期 2035 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金合同》和《景顺长城养老目标日期 2035 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工商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 2024 年 3 月 27 日起对景顺长城养老目标日期 2035 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、创业板以及其他中国证监会允许上市的股票和存托凭证）、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）、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、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。

本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）等品种的比例合计原则上不超过 60%；其中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。本基金不得持有具有复杂、衍生品性质的基金份额，包括中国证监会认定的其他基金份额。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：中证目标日期 2035 指数收益率。

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	1,817,482.39
等于：本金	1,817,174.41
加：应计利息	307.98
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	1,817,482.39

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	22,689,052.77	-	22,129,042.56	-560,010.21	
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	9,789,810.15	104,188.78	9,727,780.78	-166,218.15
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	9,789,810.15	104,188.78	9,727,780.78	-166,218.15
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	132,677,457.58	-	130,690,066.87	-1,987,390.71	
其他	-	-	-	-	
合计	165,156,320.50	104,188.78	162,546,890.21	-2,713,619.07	

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	6,973.02
待摊费用	-
合计	6,973.02

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	71,263.48
其中：交易所市场	71,263.48
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	74,590.88
合计	145,854.36

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

景顺长城养老 2035 三年持有混合 (F0F) 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	174,308,647.97	174,308,647.97

本期申购	12,781,177.11	12,781,177.11
本期赎回(以“-”号填列)	-567,178.56	-567,178.56
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	186,522,646.52	186,522,646.52

景顺长城养老 2035 三年持有混合 (FOF) Y

项目	本期 2024 年 3 月 29 日 (Y 类份额首个估值日) 至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
基金合同生效日	-	-
本期申购	33,544.87	33,544.87
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	33,544.87	33,544.87

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

景顺长城养老 2035 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	-622,049.02	-16,556,697.85	-17,178,746.87
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-622,049.02	-16,556,697.85	-17,178,746.87
本期利润	-11,396,275.53	5,006,776.22	-6,389,499.31
本期基金份额交易产生的变动数	-718,940.04	-655,976.96	-1,374,917.00
其中：基金申购款	-753,409.27	-690,419.93	-1,443,829.20
基金赎回款	34,469.23	34,442.97	68,912.20
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-12,737,264.59	-12,205,898.59	-24,943,163.18

景顺长城养老 2035 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	-	-	-

加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	-157.34	-260.31	-417.65
本期基金份额交易产生的变动数	-2,103.13	-1,933.32	-4,036.45
其中：基金申购款	-2,103.13	-1,933.32	-4,036.45
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-2,260.47	-2,193.63	-4,454.10

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	8,240.95	
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	2,620.69	
其他	214.16	
合计	11,075.80	

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	-4,813,330.66	
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	-4,813,330.66	

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	67,967,958.40	
减：卖出股票成本总额	72,598,516.71	
减：交易费用	182,772.35	
买卖股票差价收入	-4,813,330.66	

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	85,749,972.08
减：卖出/赎回基金成本总额	92,687,511.98
减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额	-
减：交易费用	20,707.74
基金投资收益	-6,958,247.64

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	61,124.53
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-60,926.20
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	198.33

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	8,887,908.61
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	8,843,705.44
减：应计利息总额	104,842.26
减：交易费用	287.11
买卖债券差价收入	-60,926.20

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	222,376.30
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	742,413.05
合计	964,789.35

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	5,006,515.91
股票投资	291,196.36
债券投资	-44,687.69
资产支持证券投资	-
基金投资	4,760,007.24
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	5,006,515.91

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	34,052.90
合计	34,052.90

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)	48,053.06
当期持有基金产生的应支付管理费 (元)	325,075.33
当期持有基金产生的应支付托管费 (元)	71,406.07

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	14,918.54
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行划款手续费	269.00
证券组合费	13.80
存托服务费	7.82
合计	74,881.50

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
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	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		上年度可比期间	
	2024年1月1日至2024年6月30日		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	3,061,022.45	2.16	1,570,396.80	2.93

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	2,895.29	2.17	-	-
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	1,462.59	2.98	1,462.59	5.88

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	上年度可比期间
	2024年1月1日至2024年6月30日	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	429,598.59	166,342.56
其中：应支付销售机构的客户维护费	166,248.23	68,800.78
应支付基金管理人的净管理费	263,350.36	97,541.78

注：自 2024 年 3 月 27 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 0.80% 和 0.40%。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	101,609.83	37,201.94

注：自 2024 年 3 月 27 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	本期 2024年3月29日(基金合同生效日)至2024年6月30日
	景顺长城养老 2035 三年持有混合 (FOF) A	景顺长城养老 2035 三年持有混合 (FOF) Y
基金合同生效日(2022年1月25日)持有的基金份额	10,001,889.08	-
报告期初持有的基金份额	10,001,889.08	-
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	10,001,889.08	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	5.3600%	-
项目	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	上年度可比期间 -
	景顺长城养老 2035 三年持有混合 (FOF) A	景顺长城养老 2035 三年持有混合 (FOF) Y
基金合同生效日(2022年1月25日)持有的基金份额	10,001,889.08	-
报告期初持有的基金份额	10,001,889.08	-
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	10,001,889.08	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	12.3300%	-

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
中国工商银行-活期	1,817,482.39	8,240.95	1,453,216.28	3,056.69

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 57,559,002.83 元，占本基金资产净值的比例为 35.62%。（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 47,895,738.07 元，占本基金资产净值的比例为 30.48%。）

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）	125.82	-
当期交易基金产生的赎回费（元）	970.74	262.75
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	34,052.90	11,473.86
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	114,552.16	51,954.09
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	26,995.61	10,843.48

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 2,800,544.14 元，于 2024 年 7 月 4 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.12.4 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发行的证券，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 1.31%（上年度末：1.94%）。

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的组合持仓集中度指标、流通受限制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，并按照合约规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	1,817,482.39	-	-	-	-	-	1,817,482.39
结算备付金	320,830.37	-	-	-	-	-	320,830.37
存出保证金	28,512.61	-	-	-	-	-	28,512.61
交易性金融资产	-	-7,606,884.52	1,720,352.16	400,544.10	152,819,109.43	162,546,890.21	
应收申购款	1.02	-	-	-	-	11,997.55	11,998.57
应收清算款	-	-	-	-	-	853,634.12	853,634.12
其他资产	-	-	-	-	-	6,973.02	6,973.02
资产总计	2,166,826.39	-7,606,884.52	1,720,352.16	400,544.10	153,691,714.12	165,586,321.29	
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	70,226.06	70,226.06
应付托管费	-	-	-	-	-	17,627.07	17,627.07
应付清算款	-	-	-	-	-	943,437.98	943,437.98
卖出回购金融资产款	2,800,544.14	-	-	-	-	-	2,800,544.14
应交税费	-	-	-	-	-	57.57	57.57
其他负债	-	-	-	-	-	145,854.36	145,854.36
负债总计	2,800,544.14	-	-	-	-	1,177,203.04	3,977,747.18
利率敏感度缺口	-633,717.75	-7,606,884.52	1,720,352.16	400,544.10	-	-	-
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	3,522,464.74	-	-	-	-	-	3,522,464.74
结算备付金	366,032.25	-	-	-	-	-	366,032.25
存出保证金	15,865.65	-	-	-	-	-	15,865.65
交易性金融资产	4,893,259.40	-	-2,560,749.16	480,674.35	147,948,892.09	155,883,575.00	
应收股利	-	-	-	-	-	47,462.00	47,462.00
应收申购款	1.02	-	-	-	-	480,005.00	480,006.02
应收清算款	-	-	-	-	-	2,347,997.35	2,347,997.35
其他资产	-	-	-	-	-	4,498.58	4,498.58
资产总计	8,797,623.06	-	-2,560,749.16	480,674.35	150,828,855.02	162,667,901.59	
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	70,117.42	70,117.42
应付托管费	-	-	-	-	-	16,029.49	16,029.49
应付清算款	-	-	-	-	-	1,243,853.66	1,243,853.66
卖出回购金融资产款	4,001,232.88	-	-	-	-	-	4,001,232.88
应交税费	-	-	-	-	-	32.16	32.16
其他负债	-	-	-	-	-	206,734.88	206,734.88
负债总计	4,001,232.88	-	-	-	-	1,536,767.61	5,538,000.49

利率敏感度缺口	4,796,390.18	-	-2,560,749.16	480,674.35	-	-
---------	--------------	---	---------------	------------	---	---

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	-8,565.37	-559.92
	市场利率下降 25 个基点	8,581.87	560.64

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	-	4,145,319.56	-	4,145,319.56
资产合计	-	4,145,319.56	-	4,145,319.56
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	-	4,145,319.56	-	4,145,319.56
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				
资产合计	-	-	-	-
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				
-------	--	--	--	--

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%	207,265.98	-
	所有外币相对人民币贬值 5%	-207,265.98	-

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	22,129,042.56	13.69	20,398,870.15	12.98
交易性金融资产—基金投资	130,690,066.87	80.87	127,550,021.94	81.17
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	152,819,109.43	94.56	147,948,892.09	94.16

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%	5,565,412.93	4,349,741.15
沪深 300 指数下降 5%	-5,565,412.93	-4,349,741.15

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	154,940,005.69	150,881,308.43
第二层次	7,606,884.52	5,002,266.57
第三层次	-	-
合计	162,546,890.21	155,883,575.00

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	22,129,042.56	13.36
	其中：股票	22,129,042.56	13.36
2	基金投资	130,690,066.87	78.93
3	固定收益投资	9,727,780.78	5.87
	其中：债券	9,727,780.78	5.87
	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	2,138,312.76	1.29
8	其他各项资产	901,118.32	0.54
9	合计	165,586,321.29	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 4,145,319.56 元，占基金资产净值的比例为 2.57%。

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	1,851,660.00	1.15
C	制造业	16,132,063.00	9.98
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	-	-
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	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	17,983,723.00	11.13

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	393,784.92	0.24
周期性消费品	-	-
非周期性消费品	543,957.28	0.34
综合	-	-
能源	-	-
金融	1,307,687.91	0.81
基金	-	-
工业	-	-
信息技术	784,503.22	0.49
公用事业	-	-
通讯	1,115,386.23	0.69
合计	4,145,319.56	2.57

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	601766	中国中车	232,000	1,742,320.00	1.08
2	000338	潍柴动力	95,000	1,542,800.00	0.95
3	300577	开润股份	70,000	1,458,100.00	0.90
4	03690	美团-W	11,000	1,115,386.23	0.69
5	603979	金诚信	22,000	1,111,660.00	0.69
6	688139	海尔生物	25,000	930,000.00	0.58
7	601179	中国西电	110,000	884,400.00	0.55
8	600060	海信视像	35,000	865,900.00	0.54
9	600690	海尔智家	30,000	851,400.00	0.53
10	02628	中国人寿	80,000	806,078.98	0.50
11	002705	新宝股份	57,000	801,990.00	0.50

12	00992	联想集团	78,000	784,503.22	0.49
13	300573	兴齐眼药	4,700	770,800.00	0.48
14	600489	中金黄金	50,000	740,000.00	0.46
15	002053	云南能投	57,000	689,130.00	0.43
16	603556	海兴电力	14,700	688,401.00	0.43
17	002028	思源电气	9,500	635,550.00	0.39
18	002351	漫步者	47,000	618,050.00	0.38
19	300627	华测导航	18,500	552,225.00	0.34
20	300502	新易盛	5,200	548,860.00	0.34
21	06198	青岛港	100,000	543,957.28	0.34
22	603279	景津装备	24,000	520,560.00	0.32
23	01658	邮储银行	120,000	501,608.93	0.31
24	605555	德昌股份	25,700	478,277.00	0.30
25	601567	三星医疗	12,000	420,000.00	0.26
26	301345	涛涛车业	7,000	385,700.00	0.24
27	002922	伊戈尔	17,500	382,550.00	0.24
28	688676	金盘科技	7,000	365,050.00	0.23
29	01787	山东黄金	19,000	269,477.90	0.17
30	01258	中国有色矿业	20,000	124,307.02	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	601699	潞安环能	2,269,662.00	1.44
2	601766	中国中车	1,631,310.00	1.04
3	000338	潍柴动力	1,587,622.00	1.01
4	002478	常宝股份	1,586,611.00	1.01
5	001979	招商蛇口	1,436,633.00	0.91
6	688139	海尔生物	1,375,264.85	0.88
7	688566	吉贝尔	1,369,330.46	0.87
8	300573	兴齐眼药	1,356,151.00	0.86
9	600006	东风汽车	1,351,450.00	0.86
10	688687	凯因科技	1,252,360.42	0.80
11	300577	开润股份	1,215,441.00	0.77
12	000829	天音控股	1,211,994.00	0.77
13	000997	新大陆	1,202,399.00	0.77
14	03690	美团-W	1,179,744.45	0.75
15	603979	金诚信	1,172,899.00	0.75
16	600348	华阳股份	1,118,121.00	0.71
17	300559	佳发教育	1,039,110.00	0.66
18	002922	伊戈尔	1,036,614.00	0.66
19	002891	中宠股份	948,460.00	0.60
20	300457	赢合科技	947,902.00	0.60

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	601699	潞安环能	2,321,670.00	1.48
2	002478	常宝股份	1,523,970.00	0.97
3	001979	招商蛇口	1,477,029.00	0.94
4	300811	铂科新材	1,458,174.00	0.93
5	601137	博威合金	1,422,964.00	0.91
6	600006	东风汽车	1,370,621.00	0.87
7	300559	佳发教育	1,306,794.00	0.83
8	600183	生益科技	1,237,210.00	0.79
9	000829	天音控股	1,207,373.00	0.77
10	688566	吉贝尔	1,206,602.48	0.77
11	688687	凯因科技	1,204,032.57	0.77
12	600348	华阳股份	1,166,438.00	0.74
13	000997	新大陆	1,042,962.00	0.66
14	603156	养元饮品	983,075.00	0.63
15	689009	九号公司	950,719.50	0.61
16	002867	周大生	950,695.00	0.61
17	603899	晨光股份	943,437.00	0.60
18	000651	格力电器	938,035.00	0.60
19	600132	重庆啤酒	884,419.00	0.56
20	300308	中际旭创	883,429.00	0.56

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	74,037,492.76
卖出股票收入（成交）总额	67,967,958.40

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	7,606,884.52	4.71
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)	2,120,896.26	1.31
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	9,727,780.78	6.02

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	019727	23 国债 24	55,000	5,600,047.26	3.47
2	019740	24 国债 09	20,000	2,006,837.26	1.24
3	113061	拓普转债	4,000	474,794.41	0.29
4	123216	科顺转债	4,200	400,544.10	0.25
5	123039	开润转债	3,000	345,218.05	0.21

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

本基金的大类资产配置采用战略资产配置和战术资产配置相结合的方式。本基金的资产配置策略，随着投资者生命周期的延续和目标日期期限的临近，基金的权益类资产配置比例逐步下降，而非权益类资产配置比例逐步上升。

在前期，本基金的权益类资产配置比例相对较高，以获得较高的养老资产增值，其对应的风

险收益水平相对较高。往后, 以适应投资者生命周期中, 随着年龄增长或者剩余期限的减少而逐步降低风险偏好的要求, 权益类资产配置比例逐步降低, 而非权益类资产配置比例的逐步增加。

本基金的战略资产配置以业绩比较基准(中证目标日期 2035 指数)的下滑曲线进行战略性资产配置。本业绩比较基准是基于人们在不同年龄段拥有的人力资本与金融财富水平, 设置相应的风险承受水平, 采用马科维茨模型进行不同资产间的优化配置。

2、风险说明

(1) 本基金名称中含有“养老”并不代表收益保障或其他任何形式的收益承诺, 本基金不保本, 可能发生亏损。

(2) 基金是一只养老目标日期基金, 目标日期为 2035 年 12 月 31 日。本基金的风险与收益水平会随着投资者目标日期期限的临近而逐步降低。本基金采用成熟的资产配置策略, 随着投资者目标时间期限的接近, 通过调整投资于多种具有不同风险收益特征的基金和其他资产的比例, 控制基金下行风险, 追求基金资产的长期稳健增值。虽然, 本基金管理人采用严格的风险控制策略, 但是各类资产所在市场如股票市场、债券市场、海外市场等的变化将影响到本基金的业绩表现和投资者长期养老目标的实现。在极端情形下, 本基金可能面临本金亏损的风险。

(3) 本基金投资于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%。因此, 本基金所持有的基金的业绩表现、持有基金的基金管理人水平等因素将影响到本基金的业绩表现。本基金的预期风险收益水平低于股票型基金、股票型基金中基金, 但高于货币市场基金、货币型基金中基金、债券型基金、债券型基金中基金。

(4) 在目标日期 2035 年 12 月 31 日之前(含), 本基金的最短持有期限为三年, 在基金份额的三年持有期到期日前(不含当日), 基金份额持有人不能对该基金份额提出赎回或转换转出申请; 基金份额的三年持有期到期日起(含当日), 基金份额持有人可对该基金份额提出赎回或转换转出申请。基金份额持有人将面临在三年持有期到期前不能赎回基金份额的风险。

(5) 本基金从目标日期的次日起, 即 2036 年 1 月 1 日起转为每日开放申购赎回模式, 本基金的基金名称相应变更为“景顺长城颐祥混合型基金中基金 (FOF)”, 同时基金的基金类别、基金的投资、运作模式和申购赎回开放时间等相关内容也将按照基金合同的约定相应修改。

(6) 自 2061 年 1 月 1 日起, 本基金自动进入清算程序, 基金合同自动终止, 无需召开基金份额持有人大会。

(7) 本基金为基金中基金, 本基金运作中, 收取管理费、托管费等。本基金资产中投资于本基金管理人管理的基金的部分不收取管理费。本基金资产中投资于基金托管人托管的基金的部分不收取托管费。本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), 基金管理人

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。

本基金资产投资于其他基金管理人管理的基金或其他基金托管人托管的基金，除了本基金管理人对本基金该部分资产收取管理费、托管费等，所投子基金将收取包括但不限于管理费、托管费、申购费、赎回费、销售服务费等。本基金承担的相关费用可能比普通开放式基金高。

(8) 本基金的主要投资范围为公开募集证券投资基金，本基金主要通过申购、二级市场买入或转换入的方式获得基金份额，通过赎回、二级市场卖出或转换出的方式变现基金份额。如占本基金相当比例的被投资基金拒绝或暂停申购/赎回，基金管理人无法找到其他合适的可替代的基金品种时，本基金可能暂停或拒绝申购、暂停或延缓支付赎回款项。

(9) 投资策略的风险

包括 1) 本基金的战略资产配置采用业绩比较基准的下滑曲线规划的权益类资产配置比例进行配置，面临的风险；2) 战术资产配置量化模型的风险；3) 基金投资策略的风险；4) 权益类资产配置的风险。

(10) 发起式基金自动终止风险

本基金为发起式基金，若基金合同生效之日起三年后的对应自然日基金资产规模低于 2 亿元，本基金应当按照《基金合同》约定的程序进行清算并终止，且不得通过召开基金份额持有人大会的方式延续，投资者将面临《基金合同》可能终止的不确定性风险。

(11) 本基金投资其他证券投资基金出现净值计算错误、净值披露延迟或间断等情形时，从而给本基金带来估值风险。

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	6,392,955.69	7,731,640.61	4.78	是
2	518880	华安黄金易 (ETF)	交易型开放式 (ETF)	1,337,000.00	7,082,089.00	4.38	否
3	517180	南方富时中国国企开放共赢 ETF	交易型开放式 (ETF)	4,349,000.00	6,923,608.00	4.28	否
4	002796	景顺长城景盈双利债券 A 类	契约型开放式	5,791,614.50	6,704,952.11	4.15	是

5	000386	景顺长城景颐双利债券 C 类	契约型开放式	3,763,207.71	5,953,394.60	3.68	是
6	003408	景顺长城景泰丰利纯债债券 C 类	契约型开放式	5,019,077.64	5,476,315.61	3.39	是
7	511380	博时可转债 ETF	交易型开放式 (ETF)	433,100.00	4,754,138.70	2.94	否
8	007604	景顺长城中短债债券 C 类	契约型开放式	4,181,647.01	4,701,007.57	2.91	是
9	000182	景顺长城四季金利债券 C 类	契约型开放式	3,430,938.40	4,003,905.11	2.48	是
10	159949	华安创业板 50ETF	交易型开放式 (ETF)	5,500,000.00	3,976,500.00	2.46	否
11	515100	景顺长城中证红利低波动 100ETF	交易型开放式 (ETF)	2,860,000.00	3,798,080.00	2.35	是
12	007562	景顺长城景泰纯利债券 A	契约型开放式	3,172,681.20	3,590,840.58	2.22	是
13	511360	海富通中证短融 ETF	交易型开放式 (ETF)	30,000.00	3,300,330.00	2.04	否
14	164206	天弘添利 (LOF) C	上市契约型开放式 (LOF)	2,502,021.00	3,291,408.63	2.04	否
15	000628	大成高新技术产业股票 A	契约型开放式	689,616.80	2,833,842.32	1.75	否
16	513120	广发中证香港创新药 (QDII-ETF)	交易型开放式 (ETF)	4,600,000.00	2,806,000.00	1.74	否
17	511030	平安中高等级公司债利差因子 ETF	交易型开放式 (ETF)	224,000.00	2,349,536.00	1.45	否
18	515220	国泰中证煤炭 ETF	交易型开放式 (ETF)	1,820,000.00	2,249,520.00	1.39	否
19	513500	博时标普 500ETF	交易型开放式 (ETF)	1,050,000.00	2,069,550.00	1.28	否
20	009100	安信稳健增利混合 A	契约型开放式	1,561,067.55	2,015,182.10	1.25	否
21	008810	安信民稳增长混合 C	契约型开放式	1,325,830.92	1,834,552.24	1.14	否
22	159732	华夏国证消费电子主题 ETF	交易型开放式 (ETF)	2,700,000.00	1,814,400.00	1.12	否
23	159996	国泰中证全指家用电器 ETF	交易型开放式 (ETF)	1,611,000.00	1,810,764.00	1.12	否
24	516970	广发中证基建工程 ETF	交易型开放式 (ETF)	1,680,000.00	1,725,360.00	1.07	否

25	000586	景顺长城中小创精选股票 A	契约型开放式	856,412.37	1,701,691.38	1.05	是
26	513310	华泰柏瑞中韩芯片 ETF	交易型开放式 (ETF)	1,250,000.00	1,688,750.00	1.04	否
27	008763	天弘越南市场 A	契约型开放式	1,143,131.20	1,598,326.04	0.99	否
28	512880	国泰中证全指证券公司 ETF	交易型开放式 (ETF)	2,000,000.00	1,566,000.00	0.97	否
29	159994	银华中证 5GETF	交易型开放式 (ETF)	1,861,400.00	1,550,546.20	0.96	否
30	513980	景顺长城中证港股通科技 ETF	交易型开放式 (ETF)	3,600,000.00	1,533,600.00	0.95	是
31	515300	嘉实沪深 300 红利低波动 ETF	交易型开放式 (ETF)	1,040,000.00	1,438,320.00	0.89	否
32	008712	景顺长城品质成长混合 A	契约型开放式	1,302,408.48	1,411,289.83	0.87	是
33	001230	鹏华医药科技股票 A	契约型开放式	1,462,910.35	1,411,123.32	0.87	否
34	562800	嘉实中证稀有金属主题 ETF	交易型开放式 (ETF)	3,200,000.00	1,401,600.00	0.87	否
35	159936	广发中证全指可选消费 ETF	交易型开放式 (ETF)	820,000.00	1,334,960.00	0.83	否
36	512220	景顺长城中证科技传媒通信 150ETF	交易型开放式 (ETF)	990,000.00	1,320,660.00	0.82	是
37	008060	景顺长城价值边际灵活配置混合 A	契约型开放式	776,615.91	1,257,574.14	0.78	是
38	004719	景顺长城睿成混合 C 类	契约型开放式	873,850.56	1,176,290.24	0.73	是
39	007760	景顺长城沪港深红利成长低波指数 C 类	契约型开放式	997,104.38	1,162,922.84	0.72	是
40	010004	景顺长城电子信息产业股票 C 类	契约型开放式	1,246,407.07	1,156,167.20	0.72	是
41	159647	鹏华中证中药 ETF	交易型开放式 (ETF)	1,100,000.00	1,047,200.00	0.65	否
42	010350	景顺长城品质长青混合 A	契约型开放式	1,270,725.25	1,026,491.86	0.64	是
43	019518	富国全球债券 (QDII) 人民币 C	契约型开放式	781,419.32	1,015,532.55	0.63	否
44	513000	易方达日兴资管日经 225ETF (QDII)	交易型开放式 (ETF)	640,000.00	888,320.00	0.55	否

45	000418	景顺长城成长之星股票 A	契约型开放式	218,034.08	885,872.47	0.55	是
46	008657	景顺长城科技创新混合 A	契约型开放式	806,152.11	855,649.85	0.53	是
47	008764	天弘越南市场 C	契约型开放式	593,348.97	819,889.61	0.51	否
48	110025	易方达资源行业混合	契约型开放式	617,388.52	814,952.85	0.50	否
49	007460	华安成长创新混合 A	契约型开放式	481,652.86	797,279.98	0.49	否
50	159981	建信能源化工期货 ETF	交易型开放式 (ETF)	480,000.00	792,000.00	0.49	否
51	000688	景顺长城研究精选股票 A	契约型开放式	612,056.81	780,984.49	0.48	是
52	512040	富国中证价值 ETF	交易型开放式 (ETF)	824,000.00	746,544.00	0.46	否
53	000242	景顺长城策略精选灵活配置混合 A	契约型开放式	246,311.52	684,992.34	0.42	是
54	159985	华夏饲料豆粕期货 ETF	交易型开放式 (ETF)	300,000.00	654,600.00	0.41	否
55	011068	华宝资源优选混合 C	契约型开放式	180,726.96	617,182.57	0.38	否
56	004423	华商研究精选混合 A	契约型开放式	246,503.17	559,562.20	0.35	否
57	004374	华泰保兴吉年丰 A	契约型开放式	292,001.60	485,335.86	0.30	否
58	159650	博时中债 0-3 年国开行 ETF	交易型开放式 (ETF)	4,100.00	428,942.00	0.27	否
59	001975	景顺长城环保优势股票	契约型开放式	159,600.15	387,030.36	0.24	是
60	001822	华商智能生活灵活配置混合 A	契约型开放式	226,381.27	274,600.48	0.17	否
61	000297	鹏华可转债债券 A	契约型开放式	200,000.00	261,780.00	0.16	否
62	004476	景顺长城沪港深领先科技股票	契约型开放式	148,568.34	195,961.64	0.12	是
63	100050	富国全球债券 (QDII) 人民币 A	契约型开放式	77,505.48	100,935.39	0.06	否
64	159682	景顺长城创业板 50ETF	交易型开放式 (ETF)	88,000.00	61,688.00	0.04	是

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

本报告期内未出现基金投资的前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或者在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	28,512.61
2	应收清算款	853,634.12
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	11,998.57
6	其他应收款	6,973.02
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	901,118.32

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	113061	拓普转债	474,794.41	0.29
2	123216	科顺转债	400,544.10	0.25
3	123039	开润转债	345,218.05	0.21
4	113049	长汽转债	335,420.47	0.21
5	113593	沪工转债	298,503.12	0.18
6	128117	道恩转债	266,416.11	0.16

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 (%)
景顺长城养老 2035 三年持有混合 (FOF) A	3,755	49,673.14	13,298,813.26	7.13	173,223,833.26	92.87
景顺长城养老 2035 三年持有混合 (FOF) Y	11	3,049.53	0	0.00	33,544.87	100.00
合计	3,766	49,536.96	13,298,813.26	7.13	173,257,378.13	92.87

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	景顺长城养老 2035 三年持有混合 (FOF) A	507,798.47	0.272245
	景顺长城养老 2035 三年持有混合 (FOF) Y	11.45	0.034133
	合计	507,809.92	0.272202

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	景顺长城养老 2035 三年持有混合 (FOF) A	—
	景顺长城养老 2035 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	景顺长城养老 2035 三年持有混合 (FOF) A	10~50

	景顺长城养老 2035 三年持有混合 (FOF) Y	-
	合计	10~50

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	10,001,889.08	5.36	10,000,000.00	73.79	3年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	不适用
基金经理等人员	102,572.83	0.05	-	-	不适用
基金管理人股东	-	-	-	-	不适用
其他	-	-	-	-	不适用
合计	10,104,461.91	5.42	10,000,000.00	73.79	-

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	景顺长城养老 2035 三年持有混合 (FOF) A	景顺长城养老 2035 三年持有混合 (FOF) Y
基金合同生效日 (2022 年 1 月 25 日) 基金份额总额	13,552,003.24	-
本报告期期初基金份额总额	174,308,647.97	-
本报告期基金总申购份额	12,781,177.11	33,544.87
减：本报告期基金总赎回份额	567,178.56	-
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	186,522,646.52	33,544.87

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

无。

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 (%)	
申万宏源证券有限公司	1	21,285,624.01	14.99	20,133.38	15.07	-
中信建投证券股份有限公司	2	17,514,417.25	12.33	16,581.03	12.41	-
中信证券股份有限公司	3	12,327,331.79	8.68	11,369.40	8.51	-
开源证券股份有限公司	1	12,290,395.65	8.65	11,579.36	8.67	-
国海证券股份有限公司	1	12,087,039.00	8.51	11,433.41	8.56	-
国投证券股份有限公司	2	9,802,212.74	6.90	9,272.12	6.94	-
兴业证券股份有限公司	2	8,600,294.20	6.06	8,094.84	6.06	-
中国中金财富证券有限	1	6,816,629.52	4.80	6,447.80	4.83	-

公司						
天风证券股份有限公司	1	6,445,970.00	4.54	6,097.33	4.56	-
广发证券股份有限公司	2	4,965,145.19	3.50	4,696.66	3.52	-
海通证券股份有限公司	1	4,943,418.00	3.48	4,675.94	3.50	-
中泰证券股份有限公司	1	4,880,134.67	3.44	4,513.81	3.38	-
国盛证券有限责任公司	1	4,807,840.16	3.39	4,309.80	3.23	-
华创证券有限责任公司	1	4,123,334.00	2.90	3,900.25	2.92	-
瑞银证券有限责任公司	2	3,660,788.00	2.58	3,462.75	2.59	-
长城证券股份有限公司	2	3,061,022.45	2.16	2,895.29	2.17	-
方正证券股份有限公司	1	2,300,646.91	1.62	2,153.52	1.61	-
中国银河证券股份有限公司	1	2,093,207.62	1.47	1,979.97	1.48	-
第一创业证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
东方财富证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
东亚前海证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
高盛(中国)证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国都证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
恒泰证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
平安证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
瑞信证券(中国)有限公司	1	-	-	-	-	-
太平洋证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	3	-	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	2	-	-	-	-	-
中航证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-

注：1、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。

2、本基金本期交易单元未发生变更。

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 (%)
申万宏源证券有限公司	3,633,391.54	24.75	45,140,000.00	34.69	-	-	49,032,491.50	32.93
中信建投证券股份有限公司	2,400,725.21	16.35	32,100,000.00	24.67	-	-	22,189,567.60	14.90
中信证券股份有限公司	1,154,514.01	7.86	22,100,000.00	16.98	-	-	9,715,618.00	6.53
开源证券股份有限公司	1,057,115.88	7.20	-	-	-	-	5,573,441.70	3.74
国海证券股份有限公司	851,216.31	5.80	-	-	-	-	1,944,310.00	1.31
国投证券股份有限公司	362,390.00	2.47	10,269,000.00	7.89	-	-	14,137,819.00	9.50
兴业证券股份有限公司	2,527,535.00	17.22	9,066,000.00	6.97	-	-	3,369,107.40	2.26
中国中金财富证券	1,059,563.06	7.22	11,460,000.00	8.81	-	-	8,874,718.60	5.96

有限公司									
天风证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-	3,247,949.40	2.18	
广发证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-	2,736,482.00	1.84	
海通证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-	1,955,502.80	1.31	
中泰证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-	3,944,623.70	2.65	
国盛证券 有限责任 公司	-	-	-	-	-	-	1,480,040.00	0.99	
华创证券 有限责任 公司	629,708.14	4.29	-	-	-	-	-	-	
瑞银证券 有限责任 公司	-	-	-	-	-	-	1,068,257.20	0.72	
长城证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-	5,832,530.90	3.92	
方正证券 股份有限 公司	1,003,496.62	6.84	-	-	-	-	2,864,401.80	1.92	
中国银河 证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-	10,163,180.00	6.83	
第一创业 证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-	
东方财富 证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-	
东方证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-	-	-	
东亚前海 证券有限 责任公司	-	-	-	-	-	-	-	-	
高盛 (中	-	-	-	-	-	-	749,800.50	0.50	

国) 证券 有限责任 公司									
光大证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-	-	-	-
国都证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-	-	-	-
恒泰证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-	-	-	-
平安证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-	-	-	-
瑞信证券 (中国) 有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-	-
太平洋证 券股份有 限公司	-	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中国国际 金融股份 有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中航证券 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旗下部分基金新增玄元保险为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 1 月 5 日
3	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	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 1 月 10 日

	金客户范围的公告		
4	景顺长城养老目标日期 2035 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	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
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公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 3 月 19 日
7	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增陆享基金为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 3 月 20 日
8	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
9	景顺长城基金管理有限公司关于景顺长城养老目标日期 2035 三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 增设 Y 类基金份额并相应修改基金合同、托管协议部分条款的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 3 月 27 日
10	景顺长城养老目标日期 2035 三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 关于 Y 类基金份额开放日常申购及定期定额投资业务公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 3 月 27 日
11	景顺长城养老目标日期 2035 三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 2024 年第 1 号更新招募说明书	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 3 月 27 日
12	景顺长城养老目标日期 2035 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 3 月 27 日
13	景顺长城养老目标日期 2035 三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 基金合同更新	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 3 月 27 日
14	景顺长城养老目标日期 2035 三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 托管协议更新	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 3 月 27 日
15	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
16	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
17	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
18	景顺长城养老目标日期 2035 三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF)	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 3 月 29 日

	2023 年年度报告		
19	关于景顺长城养老目标日期 2035 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）新增国泰君安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
20	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
21	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
22	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
23	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
24	景顺长城养老目标日期 2035 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
25	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
26	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
27	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增国信证券为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 5 月 21 日
28	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
29	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
30	景顺长城养老目标日期 2035 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
31	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
32	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
33	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 6 月 29 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

无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

为了更好地满足个人养老金投资者的理财需求,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》、《个人养老金投资公开募集证券投资基金业务管理暂行规定》等法律法规的规定和《景顺长城养老目标日期 2035 三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 基金合同》的约定,经与基金托管人中国工商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 2024 年 3 月 27 日起对景顺长城养老目标日期 2035 三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 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,同时对《基金合同》和《托管协议》进行了相应的修改。详情请参阅本基金管理人于 2024 年 3 月 27 日发布的《景顺长城基金管理有限公司关于景顺长城养老目标日期 2035 三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 增设 Y 类基金份额并相应修改基金合同、托管协议部分条款的公告》。

§ 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养老目标日期 2035 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、《景顺长城养老目标日期 2035 三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 基金合同》;
- 3、《景顺长城养老目标日期 2035 三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF) 招募说明书》;
- 4、《景顺长城养老目标日期 2035 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