

长城智盈添益债券型发起式证券投资基金 2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：长城基金管理有限公司

基金托管人：上海银行股份有限公司

送出日期：2024 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人上海银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 08 月 30 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	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
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	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	45
7.1 期末基金资产组合情况	45
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	46
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	46
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	52
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	53
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	53

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	53
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	54
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	54
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	54
7.11 投资组合报告附注	54
§ 8 基金份额持有人信息	55
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	55
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	55
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	55
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	56
§ 9 开放式基金份额变动	56
§ 10 重大事件揭示	57
10.1 基金份额持有人大会决议	57
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	57
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	57
10.4 基金投资策略的改变	57
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	57
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	57
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	57
10.8 其他重大事件	58
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	59
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	59
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	59
§ 12 备查文件目录	60
12.1 备查文件目录	60
12.2 存放地点	60
12.3 查阅方式	60

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	长城智盈添益债券型发起式证券投资基金	
基金简称	长城智盈添益债券发起式	
基金主代码	020181	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2023 年 12 月 26 日	
基金管理人	长城基金管理有限公司	
基金托管人	上海银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	34,490,922.35 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	长城智盈添益债券发起式 A	长城智盈添益债券发起式 C
下属分级基金的交易代码	020181	020182
报告期末下属分级基金的份额总额	34,481,185.59 份	9,736.76 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在保持流动性和控制风险的前提下，通过积极主动的组合管理，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	<p>1、资产配置策略</p> <p>本基金通过对宏观经济环境、政策形势、证券市场走势的综合分析，主动判断市场时机，进行积极的资产配置，合理确定基金在股票、债券等各类资产类别上的投资比例，并随着各类资产风险收益特征的相对变化，适时进行动态调整。</p> <p>2、债券投资策略</p> <p>本基金通过对国内外宏观经济态势、利率走势、收益率曲线变化趋势和信用风险变化等因素进行综合分析，构建和调整固定收益证券投资组合，力求获得稳健的投资收益。</p> <p>3、股票投资策略</p> <p>(1) A 股投资策略</p> <p>本基金在考虑大类资产配置的基础上，通过定量和定性相结合的方式进行个股精选。</p> <p>(2) 港股通标的投资策略</p> <p>本基金同时关注互联互通机制下港股市场优质标的的投资机会。</p> <p>(3) 存托凭证投资策略</p> <p>对于存托凭证投资，本基金将在深入研究的基础上，通过定性分析和定量分析相结合的方式，精选出具有比较优势的存托凭证。</p> <p>4、国债期货投资策略</p> <p>本基金投资于国债期货，将根据风险管理原则，以套期保值为目的，以合理管理债券组合的久期、流动性和风险水平。</p>

业绩比较基准	中债总全价（总值）指数收益率×80%+银行活期存款利率（税后）×10%+中证 800 指数收益率×8%+中证港股通综合指数收益率（人民币）×2%
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期风险与预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。本基金可投资港股通标的股票，需承担因港股市场投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

注：本基金业绩比较基准自 2024 年 5 月 29 日起变更为“中债总全价（总值）指数收益率×80%+银行活期存款利率（税后）×10%+中证 800 指数收益率×8%+中证港股通综合指数收益率（人民币）×2%”。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	长城基金管理有限公司	上海银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	祝函
	联系电话	0755-29279006
	电子邮箱	zhuhan@ccfund.com.cn
客户服务电话	400-8868-666	95594
传真	0755-29279000	021-68476901
注册地址	深圳市福田区莲花街道福新社区鹏程一路 9 号广电金融中心 36 层 DEF 单元、38 层、39 层	中国（上海）自由贸易试验区银城中路 168 号
办公地址	深圳市福田区莲花街道福新社区鹏程一路 9 号广电金融中心 36 层 DEF 单元、38 层、39 层	中国（上海）自由贸易试验区银城中路 168 号 27 层
邮政编码	518046	200120
法定代表人	王军	金煜

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	长城基金管理有限公司	深圳市福田区莲花街道福新社区鹏程一路 9 号广电金融中心 36 层 DEF 单元、38 层、39 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数 据和指标	报告期(2024年1月1日-2024年6月30日)	
	长城智盈添益债券发起式 A	长城智盈添益债券发起式 C
本期已实现收益	122,815.93	628.51
本期利润	278,154.20	859.96
加权平均基金份额 本期利润	0.0251	0.0156
本期加权平均净 值利润率	2.48%	1.54%
本期基金份额净 值增长率	2.47%	2.28%
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	399,802.42	93.16
期末可供分配基 金份额利润	0.0116	0.0096
期末基金资产净 值	35,346,639.06	9,961.40
期末基金份额净 值	1.0251	1.0231
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	2.51%	2.31%

注：①本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

②上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

③“期末可供分配利润”的计算方法采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

长城智盈添益债券发起式 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
----	-----	------	-------	--------	-----	-----

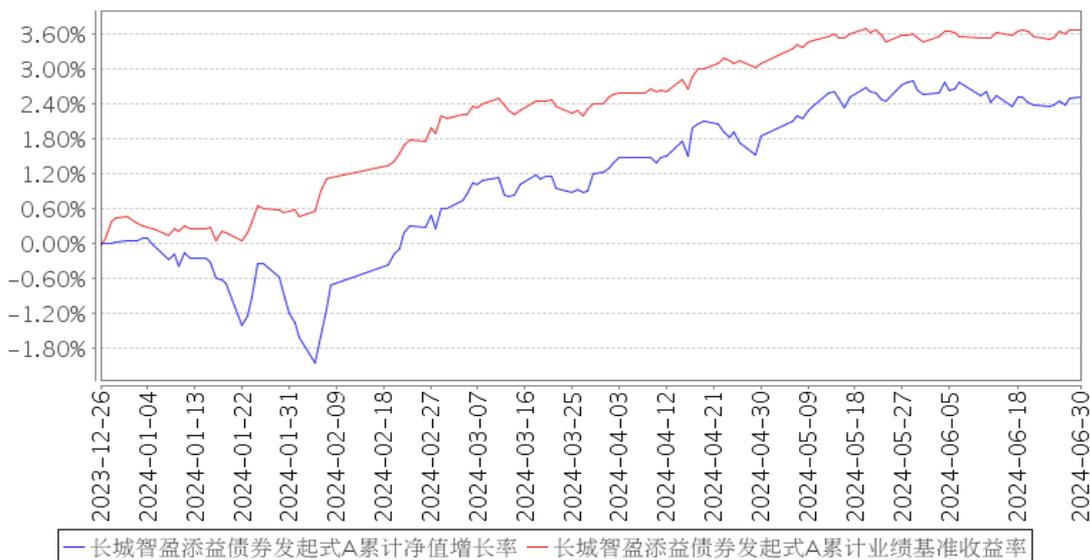
	值增长率①	增长率标准差②	准收益率③	收益率标准差④		
过去一个月	-0.05%	0.11%	0.20%	0.06%	-0.25%	0.05%
过去三个月	1.27%	0.14%	1.24%	0.08%	0.03%	0.06%
过去六个月	2.47%	0.19%	3.19%	0.10%	-0.72%	0.09%
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	2.51%	0.19%	3.67%	0.10%	-1.16%	0.09%

长城智盈添益债券发起式 C

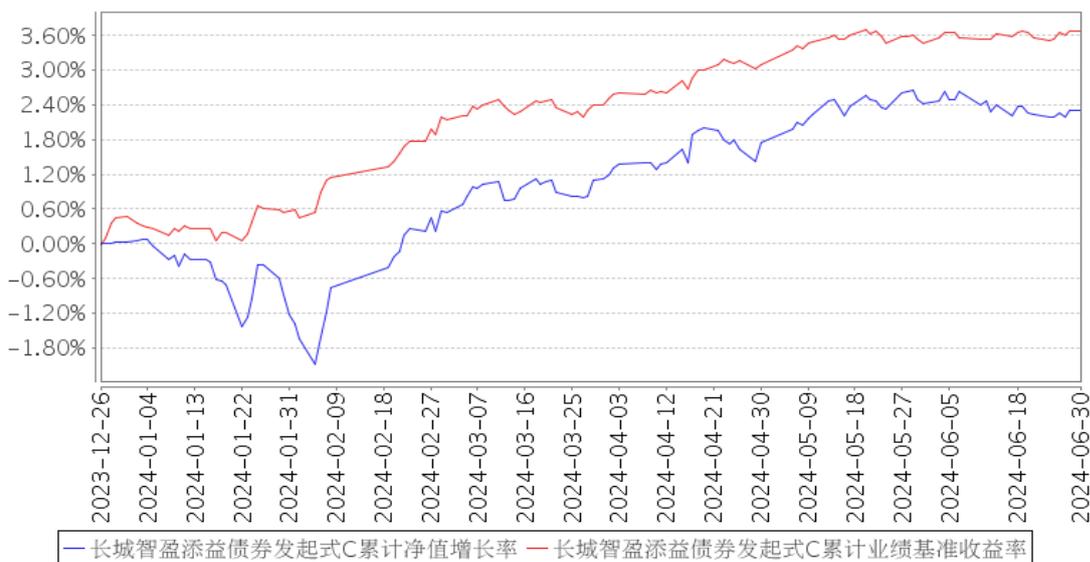
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-0.11%	0.11%	0.20%	0.06%	-0.31%	0.05%
过去三个月	1.18%	0.14%	1.24%	0.08%	-0.06%	0.06%
过去六个月	2.28%	0.19%	3.19%	0.10%	-0.91%	0.09%
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	2.31%	0.19%	3.67%	0.10%	-1.36%	0.09%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

长城智盈添益债券发起式A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



长城智盈添益债券发起式C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：①本基金合同规定本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%，投资于股票、可转换债券、可交换债券的比例合计不超过基金资产的 20%，其中港股通标的股票的投资比例为股票资产的 0%-50%。本基金每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

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

③本基金合同于 2023 年 12 月 26 日生效，截止本报告期末，基金合同生效未满一年。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

长城基金管理有限公司（以下简称“公司”）成立于 2001 年 12 月 27 日，是经中国证监会批准设立的第十五家公募基金管理公司，由长城证券有限责任公司（现长城证券股份有限公司）、东方证券有限责任公司（现东方证券股份有限公司）、中原信托投资有限公司（现中原信托有限公司）、西北证券有限责任公司和天津北方国际信托投资公司（现北方国际信托股份有限公司）共同出资设立，初始注册资本为人民币壹亿元。

2007 年 5 月 21 日，经中国证监会批准，公司股权结构变更为长城证券股份有限公司（47.059%）、东方证券股份有限公司（17.647%）、北方国际信托股份有限公司（17.647%）和中原信托有限公司（17.647%），该股权结构稳定不变至今。2007 年 10 月 12 日，经中国证监会批准，公司注册资本增至人民币壹亿伍仟万元。

公司具有基金管理资格证书、特定（定向）客户资产管理业务资格、受托管理保险资金业务资格、合格境内机构投资者（QDII）资格、公募 REITs 业务资质等。截至 2024 年 6 月 30 日，公司旗下共管理 106 只开放式基金，产品线涵盖货币型、债券型、混合型、股票型、指数型、养老 FOF 以及 QDII 等各个类型，曾多次获得金牛奖、英华奖、明星基金奖等业内大奖。

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		
雷俊	公司总经理助理、量化与指数投资部总经理、本基金的基金经理	2023 年 12 月 26 日	-	16 年	男，中国籍，硕士。2008 年 7 月-2017 年 11 月曾就职于南方基金管理有限公司，历任研究员、基金经理。2017 年 11 月加入长城基金管理有限公司，现任公司总经理助理、量化与指数投资部总经理兼基金经理。自 2019 年 5 月至 2021 年 10 月任“长城核心优选灵活配置混合型证券投资基金”基金经理，自 2022 年 6 月至 2023 年 9 月任“长城中证医药卫生指数增强型证券投资基金”基金经理，自 2021 年 4 月至 2023 年 7 月兼任专户投资经理。自 2018 年 11 月至今任“长城中证 500 指数增强型证券投资基金”、“长城久泰沪深 300 指数证券投资基金”基金经理，自 2019 年 1 月

					至今任“长城创业板指数增强型发起式证券投资基金”基金经理，自 2019 年 5 月至今任“长城量化精选股票型证券投资基金”基金经理，自 2020 年 1 月至今任“长城量化小盘股票型证券投资基金”、“长城中国智造灵活配置混合型证券投资基金”基金经理，自 2023 年 12 月至今任“长城智盈添益债券型发起式证券投资基金”基金经理。
--	--	--	--	--	------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

注：①上述任职日期、离任日期根据公司做出决定的任免日期填写。

②证券从业年限的计算方式遵从从业人员的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同和其他有关法律法规的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制和防范风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大的利益，未出现投资违反法律法规、基金合同约定和相关规定的情况，无因公司未勤勉尽责或操作不当而导致基金财产损失的情况，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格执行了相关法律法规和公司制度的规定，不同投资者的利益得到了公平对待。

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为，没有出现基金参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的现象。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年权益市场波动较大，债券市场相对表现更好。A 股主要指数有所分化，沪深 300 上涨，中证 500、中证 1000、创业板等小盘成长性指数下跌；国内无风险收益率逐渐下行，市场资金对

于确定性的追求更高，更为偏好长债与高股息资产。

风格方面，市场广度效应消失，基于确定性逻辑的“缩圈”行情下，微小市值个股流动性风险凸显，微观交易上出现了不同于过去三年的统计规律甚至是三倍标准差之外的现象，这些尾部风险极大影响了市场参与者的交易结构和交易行为，这对部分交易性数据产生因子为主的量化策略带来了较大负面贡献。风格上看，红利与价值类因子较为抗跌；二季度相比一季度随着个股波动逐渐降低，市场从尾部风险交易回归到常态化的市场参与结构，交易性数据产生的因子有效性逐渐回归。

报告期内，基于产品通过资产配置实现绝对收益的定位，投资策略主要从战略和战术上分级构成。战略上尽可能的在股票、债券方面寻求量化风险收益均衡的配置比例，战术上尽量在不同资产子策略上寻求低相关或是负相关的投资组合，力求在控制绝对波动下追求绝对回报。在年初快速平稳完成了组合建仓后，产品净值表现稳健，在较好回撤控制下实现了绝对收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末长城智盈添益债券发起式 A 的基金份额净值为 1.0251 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.47%，同期业绩比较基准收益率为 3.19%；截至本报告期末长城智盈添益债券发起式 C 的基金份额净值为 1.0231 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.28%，同期业绩比较基准收益率为 3.19%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年以来，由于经济修复长期不达预期，股票市场显著承压，叠加从年初开始，参与者结构显著波动情况，量化因子的表现明显偏弱；随着近期三中全会的成功召开，提纲挈领的规划了未来深化改革的方向和蓝图，预计下半年货币、财政等相关经济政策会逐步出台，用以应对当前的经济下行压力。

从各行业与指数估值来看，大多数都处于过去 5 年的底部区域，已经较大程度的反映了对于未来经济悲观的预期，大盘指数进一步下跌的空间不大；另一方面，从微观层面看下半年的市场交易结构预计会回归到常态化运行机制，量化多因子的表现有望回归到正常水平。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。本基金管理人改变估值技术，导致基金资产净值的变化在 0.25%以上的，则及时就所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性等咨询会计师事务所的专业意见。

本基金管理人成立了受托资产估值委员会，为基金估值业务的最高决策机构，由公司总经理、

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

本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金无需要说明的情况。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同以及托管协议的有关约定，诚实、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本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

本报告期，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。报告期内，本基金的利润分配情况符合有关法律法规和基金合同的相关约定。

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，认为复核内容真实、准确、完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：长城智盈添益债券型发起式证券投资基金

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	2,892,186.08	112,669.43
结算备付金		100,497.83	-
存出保证金		24,244.52	-
交易性金融资产	6.4.7.2	21,154,920.10	-
其中：股票投资		4,144,612.32	-
基金投资		-	-
债券投资		17,010,307.78	-
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	14,004,149.30	10,004,561.64
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		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		50.00	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		38,176,047.83	10,117,231.07
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		-	-
应付清算款		2,775,247.22	-
应付赎回款		5,043.25	-
应付管理人报酬		7,585.67	831.25
应付托管费		1,264.27	138.55
应付销售服务费		23.61	2.00
应付投资顾问费		-	-
应交税费		495.84	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	29,787.51	-
负债合计		2,819,447.37	971.80
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	34,490,922.35	10,112,468.43
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	865,678.11	3,790.84
净资产合计		35,356,600.46	10,116,259.27
负债和净资产总计		38,176,047.83	10,117,231.07

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额总额 34,490,922.35 份，其中长城智盈添益债券发起式 A 基金份额总额 34,481,185.59 份，基金份额净值 1.0251 元；长城智盈添益债券发起式 C 基金份额总额 9,736.76 份，基金份额净值 1.0231 元。

6.2 利润表

会计主体：长城智盈添益债券型发起式证券投资基金

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
一、营业总收入		341,590.12
1. 利息收入		11,252.51
其中：存款利息收入	6.4.7.13	1,648.16
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		9,604.35
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		174,714.26
其中：股票投资收益	6.4.7.14	38,801.01
基金投资收益		-

债券投资收益	6.4.7.15	87,789.94
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-3.60
股利收益	6.4.7.19	48,126.91
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-
其他投资收益		-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	155,622.84
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	0.51
减：二、营业总支出		62,575.96
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	32,986.38
其中：暂估管理人报酬		-
2. 托管费	6.4.10.2.2	5,497.78
3. 销售服务费		82.14
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	6.4.7.22	-
7. 税金及附加		53.12
8. 其他费用	6.4.7.23	23,956.54
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		279,014.16
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		279,014.16
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		279,014.16

6.3 净资产变动表

会计主体：长城智盈添益债券型发起式证券投资基金

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	10,112,468.43	-	3,790.84	10,116,259.27
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-

其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	10,112,468.43	-	3,790.84	10,116,259.27
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	24,378,453.92	-	861,887.27	25,240,341.19
(一)、综合收益总额	-	-	279,014.16	279,014.16
(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)	24,378,453.92	-	582,873.11	24,961,327.03
其中：1. 基金申购款	24,760,919.84	-	591,085.93	25,352,005.77
2. 基金赎回款	-382,465.92	-	-8,212.82	-390,678.74
(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	34,490,922.35	-	865,678.11	35,356,600.46

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：

王军

邱春杨

赵永强

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

长城智盈添益债券型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可【2023】2560 号文“关于准予长城智盈添益债券型发起式证券投资基金注册的批复”的核准，由长城基金管理有限公司作为管理人自 2023 年 12 月 11

日至 2023 年 12 月 22 日止期间向社会公开募集，募集期结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具安永华明（2023）验字第 70015735_H04 号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2023 年 12 月 26 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集的有效认购资金（本金）为人民币 10,110,569.52 元，在首次募集期间有效认购资金产生的利息为人民币 1,898.91 元，以上收到的实收基金（本息）共计人民币 10,112,468.43 元，折合 10,112,468.43 份基金份额。本基金的基金管理人为长城基金管理有限公司，注册登记机构为长城基金管理有限公司，基金托管人为上海银行股份有限公司（以下简称“上海银行”）。

本基金根据认购费、申购费、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购时收取认购费或申购费、但不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 A 类基金份额；在投资者认购/申购时不收取认购费或申购费，而从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类基金份额分别设置代码，分别计算和公告两类基金份额净值和两类基金份额累计净值。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括债券（国内依法发行和上市交易的国债、金融债、地方政府债、企业债、公司债、政府支持债券、政府支持机构债、次级债、可转换债券（含可分离交易可转债）、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券及其他中国证监会允许基金投资的债券）、股票（包括创业板及其他经中国证监会允许基金投资的股票、存托凭证）、港股通标的股票、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%，投资于股票、可转换债券、可交换债券的比例合计不超过基金资产的 20%，其中港股通标的股票的投资比例为股票资产的 0%-50%。本基金每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如果法律法规或监管机构对该比例要求有变更的，基金管理人在履行适当程序后，本基金的投资组合比例可相应进行调整。

本基金的业绩比较基准为：中债总全价（总值）指数收益率×80%+银行活期存款利率（税后）×10%+中证 800 指数收益率×8%+中证港股通综合指数收益率（人民币）×2%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体

会计准则、应用指南、解释以及《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〉》以及中国证监会及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值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金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。

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间系自 2024 年 1 月 1 日起至 2024 年 6 月 30 日止。

6.4.4.2 记账本位币

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

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

（1）金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

（2）金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益。划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益。

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益。

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况。

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息。

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产。

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额。

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

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

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

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

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：

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

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

相关资产或负债所产生的溢价或折价；

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

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

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

6.4.4.7 实收基金

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

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占净资产比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

(1) 对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法计算的利息扣除在适用情况下的相关税费后的净额确认利息收入，计入当期损益。处置时，其处置价格扣除相关交易费用后的净额与账面价值之间的差额确认为投资收益。

(2) 对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用直接计入投资收益。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产为债权投资的，在持有期间将按票面或合同利率计算的利息收入扣除在适用情况下的相关税费后的净额计入投资收益，扣除该部分

利息后的公允价值变动额计入公允价值变动损益；除上述之外的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债的公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失扣除在适用情况下预估的增值税费后的净额计入公允价值变动损益。处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益。

本基金在同时符合下列条件时确认股利收入并计入当期损益：1) 基金收取股利的权利已经确立；2) 与股利相关的经济利益很可能流入企业；3) 股利的金额能够可靠计量。

(3) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时确认。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 在符合有关基金分红条件的前提下，具体分红方案见基金管理人根据基金运作情况届时不定期发布的相关分红公告，若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配；

(2) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

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

(4) 本基金各类基金份额在费用收取上不同，其对应的可供分配利润可能有所不同。同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

(5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

6.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币金额。

外币货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

6.4.4.13 分部报告

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

- (1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；
- (2) 能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；
- (3) 能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。

如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无需要说明的其他重要的会计政策和会计估计事项。

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

本基金本报告期无需要说明的会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无需要说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

6.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰。

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变。

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

6.4.6.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债

利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税。

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，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。

6.4.6.3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

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

6.4.6.4 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。

6.4.6.5 个人所得税

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

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

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

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。

6.4.6.6 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	2,892,186.08
等于：本金	2,891,718.88
加：应计利息	467.20
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-

减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	2,892,186.08

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	4,139,611.76	-	4,144,612.32	5,000.56	
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	16,710,595.00	163,847.78	17,010,307.78	135,865.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	16,710,595.00	163,847.78	17,010,307.78	135,865.00
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	20,850,206.76	163,847.78	21,154,920.10	140,865.56	

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

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			备注
	合同/名义 金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	1,038,400.00	-	-	-
其中：国债期货 投资	1,038,400.00	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-	-	-	-
其他衍	-	-	-	-

生工具				
合计	1,038,400.00	-	-	-

注：衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为 0。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
T2409	10 年期国债 2409	1.00	1,053,600.00	15,200.00
合计				15,200.00
减：可抵销期货 暂收款				15,200.00
净额				-

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	14,004,149.30	-
银行间市场	-	-
合计	14,004,149.30	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：无。

6.4.7.8 其他资产

注：无。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 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	5,868.97
其中：交易所市场	5,868.97
银行间市场	-
应付利息	-
预提审计费	14,918.54
预提上清所债券账户维护费	4,500.00
预提中债登债券账户维护费	4,500.00
合计	29,787.51

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

长城智盈添益债券发起式 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	10,064,129.80	10,064,129.80
本期申购	24,422,075.44	24,422,075.44
本期赎回（以“-”号填列）	-5,019.65	-5,019.65
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	34,481,185.59	34,481,185.59

长城智盈添益债券发起式 C

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	48,338.63	48,338.63
本期申购	338,844.40	338,844.40
本期赎回（以“-”号填列）	-377,446.27	-377,446.27
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	9,736.76	9,736.76

注：本基金申购包含红利再投及基金转入的份额及金额；赎回包含基金转出的份额及金额。

6.4.7.11 其他综合收益

注：无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

长城智盈添益债券发起式 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	3,774.71	-	3,774.71
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	3,774.71	-	3,774.71
本期利润	122,815.93	155,338.27	278,154.20
本期基金份额交易产生的变动数	273,211.78	310,312.78	583,524.56
其中：基金申购款	273,267.76	310,379.44	583,647.20
基金赎回款	-55.98	-66.66	-122.64
本期已分配利润	-	-	-
本期末	399,802.42	465,651.05	865,453.47

长城智盈添益债券发起式 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	16.13	-	16.13
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	16.13	-	16.13

本期利润	628.51	231.45	859.96
本期基金份额交易产生的变动数	-551.48	-99.97	-651.45
其中：基金申购款	1,408.41	6,030.32	7,438.73
基金赎回款	-1,959.89	-6,130.29	-8,090.18
本期已分配利润	-	-	-
本期末	93.16	131.48	224.64

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		1,392.76
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		237.08
其他		18.32
合计		1,648.16

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		38,801.01
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		38,801.01

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		3,179,743.86
减：卖出股票成本总额		3,128,797.24
减：交易费用		12,145.61
买卖股票差价收入		38,801.01

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
债券投资收益——利息收入	87,789.94
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-
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	87,789.94

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：无。

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：无。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：无。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：无。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：无。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
国债期货投资收益	-3.60

6.4.7.19 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	48,126.91
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	48,126.91

6.4.7.20 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	140,865.56
股票投资	5,000.56
债券投资	135,865.00
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	15,200.00
权证投资	-
期货投资	15,200.00
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	442.72
合计	155,622.84

6.4.7.21 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	0.51
合计	0.51

6.4.7.22 信用减值损失

注：无。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	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	-
证券出借违约金	-
银行费用	38.00
上清所债券账户服务费	4,500.00
中债登债券账户服务费	4,500.00
合计	23,956.54

6.4.7.24 分部报告

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期无与对本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
-------	---------

长城基金管理有限公司(“长城基金”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
上海银行股份有限公司(“上海银行”)	基金托管人
长城证券股份有限公司(“长城证券”)	基金管理人的股东

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例(%)
长城证券	10,448,152.86	100.00

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例(%)
长城证券	16,710,595.00	100.00

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例(%)
长城证券	29,300,000.00	100.00

6.4.10.1.4 权证交易

注：无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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	9,881.88	100.00	5,868.97	100.00

注：(1) 上述佣金费率由本基金的基金管理人在正常业务范围内按一般商业条款与对方签订的席位租用协议进行约定，并扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费及证券结

算风险基金后的净额列示，其中债券、回购及权证交易不计佣金。

(2) 该类席位租用协议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	
	当期发生的基金应支付的管理费	32,986.38
其中：应支付销售机构的客户维护费	10,357.17	
应支付基金管理人的净管理费	22,629.21	

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日基金资产净值的 0.60% 年费率计提。

计算方法如下：

$$H = E \times \text{管理费费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	当期发生的基金应支付的托管费	5,497.78

注：基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 年费率计提。

计算方法如下：

$$H = E \times \text{托管费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	长城智盈添益债券发起式 A	长城智盈添益债券发起式 C	合计

长城基金管理有限公司	-	12.28	12.28
合计	-	12.28	12.28

注：基金销售服务费每日计提，按月支付。本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额基金资产净值的 0.30% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.30\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

注：无。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

注：无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
	长城智盈添益债券发起式 A	长城智盈添益债券发起式 C
基金合同生效日(2023 年 12 月 26 日)持有的基金份额	-	-
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	28.9986%	-

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

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

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期	
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
上海银行	2,892,186.08	1,392.76

注：

本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金于本期未进行利润分配。

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

6.4.8.2 资产负债表日后事项。

6.4.12 期末（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

注：无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 06 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额人民币 0.00 元，无质押债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 06 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为人民币 0.00 元，无质押债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券市值的 10%。

本公司在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在基金管理人制定的银行可投资名单内的已进行充分内部研究的信用等级较高的商业银行，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；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金所持有证券均在证券交易所上市交易，或在银行间同业市场交易，除在附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制外(如有)，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。除附注 6.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额(如有)将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	2,892,186.08	-	-	-	-	-	2,892,186.08
结算备付金	100,497.83	-	-	-	-	-	100,497.83
存出保证金	24,244.52	-	-	-	-	-	24,244.52

交易性金融资产			-3,719,121.92	10,326,513.28	2,964,672.58	4,144,612.32	21,154,920.10
买入返售金融资产	14,004,149.30	-	-	-	-	-	-14,004,149.30
应收申购款	-	-	-	-	-	50.00	50.00
资产总计	17,021,077.73	-	-3,719,121.92	10,326,513.28	2,964,672.58	4,144,662.32	38,176,047.83
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	5,043.25	5,043.25
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	7,585.67	7,585.67
应付托管费	-	-	-	-	-	1,264.27	1,264.27
应付清算款	-	-	-	-	-	-2,775,247.22	2,775,247.22
应付销售服务费	-	-	-	-	-	23.61	23.61
应交税费	-	-	-	-	-	495.84	495.84
其他负债	-	-	-	-	-	29,787.51	29,787.51
负债总计	-	-	-	-	-	-2,819,447.37	2,819,447.37
利率敏感度缺口	17,021,077.73	-	-3,719,121.92	10,326,513.28	2,964,672.58		
上年度末 2023	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

年 12 月 31 日							
资产							
货币资金	112,669.43	-	-	-	-	-	112,669.43
买入返售金融资产	10,004,561.64	-	-	-	-	-	-10,004,561.64
资产总计	10,117,231.07	-	-	-	-	-	-10,117,231.07
负债							
应付管理人报酬		-	-	-	-	831.25	831.25
应付托管费		-	-	-	-	138.55	138.55
应付销售服务费		-	-	-	-	2.00	2.00
负债总计		-	-	-	-	971.80	971.80
利率敏感度缺口	10,117,231.07	-	-	-	-	-	-

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）
	市场利率下降 25 个基点	142,628.03	-
	市场利率上升 25 个基点	-139,292.30	-

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。本基金的投资范围包括内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的香港证券市场股票，如果港币资产相对于人民币贬值，将对基金收益产生不利影响；港币对人民币的汇率大幅波动也将加大基金净值波动的幅度。于本期末及上年度末，本基金无以外币计价的资产和负债，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

注：无。

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

注：无。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券，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他价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

本基金投资组合的资产配置为：本基金投资组合中股票投资比例为基金资产的 60%-95%，其中投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%；每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金于本期末面临的整体其他价格风险列示如下：

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 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	4,144,612.32	11.72	-	-
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	17,010,307.78	48.11	-	-

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	21,154,920.10	59.83	-	-

注：“交易性金融资产—债券投资”含资产支持证券投资。

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%	164,810.51	-
沪深 300 指数下降 5%	-164,810.51	-	

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

注：无。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	4,144,612.32	-

第二层次	17,010,307.78	-
第三层次	-	-
合计	21,154,920.10	-

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的证券等投资，若出现交易不活跃、非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

无。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

注：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	4,144,612.32	10.86
	其中：股票	4,144,612.32	10.86
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	17,010,307.78	44.56
	其中：债券	17,010,307.78	44.56
	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	14,004,149.30	36.68
	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	2,992,683.91	7.84
8	其他各项资产	24,294.52	0.06
9	合计	38,176,047.83	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	21,233.00	0.06
B	采矿业	510,986.00	1.45
C	制造业	2,086,381.60	5.90
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	400,845.80	1.13
E	建筑业	112,342.00	0.32
F	批发和零售业	144,149.32	0.41
G	交通运输、仓储和邮政业	365,613.00	1.03
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	33,185.00	0.09
J	金融业	353,727.20	1.00
K	房地产业	14,413.00	0.04
L	租赁和商务服务业	62,818.40	0.18
M	科学研究和技术服务业	5,995.00	0.02
N	水利、环境和公共设施管理业	10,465.00	0.03
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	22,458.00	0.06
S	综合	-	-
	合计	4,144,612.32	11.72

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：无。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	601088	中国神华	2,300	102,051.00	0.29
2	601919	中远海控	6,400	99,136.00	0.28
3	000937	冀中能源	13,600	91,120.00	0.26
4	600039	四川路桥	11,200	88,368.00	0.25
5	600348	华阳股份	7,100	70,716.00	0.20
6	600096	云天化	3,500	67,970.00	0.19
7	600398	海澜之家	7,000	64,680.00	0.18
8	600887	伊利股份	2,100	54,264.00	0.15
9	601225	陕西煤业	2,100	54,117.00	0.15

10	600886	国投电力	2,900	52,896.00	0.15
11	600901	江苏金租	10,100	51,005.00	0.14
12	600346	恒力石化	3,600	50,220.00	0.14
13	601318	中国平安	1,200	49,632.00	0.14
14	600295	鄂尔多斯	4,900	48,608.00	0.14
15	002027	分众传媒	8,000	48,480.00	0.14
16	002545	东方铁塔	7,100	48,351.00	0.14
17	000915	华特达因	1,600	48,256.00	0.14
18	002327	富安娜	4,800	48,240.00	0.14
19	600273	嘉化能源	6,700	47,838.00	0.14
20	000429	粤高速 A	4,500	46,845.00	0.13
21	601601	中国太保	1,600	44,576.00	0.13
22	600916	中国黄金	4,600	44,252.00	0.13
23	603299	苏盐井神	4,300	40,850.00	0.12
24	600998	九州通	8,274	40,377.12	0.11
25	002884	凌霄泵业	2,100	40,320.00	0.11
26	002508	老板电器	1,800	39,780.00	0.11
27	000708	中信特钢	2,900	39,353.00	0.11
28	002154	报喜鸟	7,200	39,168.00	0.11
29	600572	康恩贝	8,700	38,889.00	0.11
30	600023	浙能电力	5,300	37,683.00	0.11
31	002249	大洋电机	7,900	37,367.00	0.11
32	300751	迈为股份	300	35,844.00	0.10
33	601006	大秦铁路	5,000	35,800.00	0.10
34	600461	洪城环境	3,000	34,740.00	0.10
35	600710	苏美达	4,100	33,415.00	0.09
36	600938	中国海油	1,000	33,000.00	0.09
37	600350	山东高速	3,700	32,745.00	0.09
38	002532	天山铝业	4,000	32,440.00	0.09
39	600982	宁波能源	9,000	32,130.00	0.09
40	600028	中国石化	5,000	31,600.00	0.09
41	600177	雅戈尔	4,200	29,904.00	0.08
42	002543	万和电气	3,000	29,880.00	0.08
43	601717	郑煤机	2,000	29,600.00	0.08
44	601857	中国石油	2,800	28,896.00	0.08
45	603757	大元泵业	1,500	28,650.00	0.08
46	601369	陕鼓动力	3,500	28,070.00	0.08
47	000651	格力电器	700	27,454.00	0.08
48	000895	双汇发展	1,100	26,147.00	0.07
49	000581	威孚高科	1,600	26,048.00	0.07
49	600362	江西铜业	1,100	26,048.00	0.07
50	000333	美的集团	400	25,800.00	0.07
51	002831	裕同科技	1,000	25,590.00	0.07

52	600929	XD 雪天盐	4,800	25,440.00	0.07
53	000088	盐田港	5,600	25,368.00	0.07
54	002978	安宁股份	900	25,074.00	0.07
55	001965	招商公路	2,100	24,906.00	0.07
56	002142	宁波银行	1,100	24,266.00	0.07
57	600309	万华化学	300	24,258.00	0.07
58	600821	金开新能	4,700	24,158.00	0.07
59	600167	联美控股	4,600	23,966.00	0.07
60	600377	宁沪高速	1,900	23,940.00	0.07
61	603365	水星家纺	1,500	23,475.00	0.07
62	300146	汤臣倍健	1,700	23,035.00	0.07
63	300218	安利股份	1,500	22,620.00	0.06
64	601019	山东出版	1,900	22,458.00	0.06
65	600810	神马股份	3,600	22,320.00	0.06
66	002563	森马服饰	3,800	22,078.00	0.06
66	600487	亨通光电	1,400	22,078.00	0.06
67	002053	云南能投	1,800	21,762.00	0.06
68	000550	江铃汽车	1,000	21,710.00	0.06
69	000768	中航西飞	900	21,627.00	0.06
70	600941	中国移动	200	21,500.00	0.06
71	000902	新洋丰	1,800	21,366.00	0.06
72	600219	南山铝业	5,600	21,336.00	0.06
72	600993	马应龙	800	21,336.00	0.06
73	600598	北大荒	1,700	21,233.00	0.06
74	002267	陕天然气	2,800	21,168.00	0.06
75	601126	四方股份	1,100	21,142.00	0.06
76	600522	XD 中天科	1,300	20,605.00	0.06
77	600795	国电电力	3,400	20,366.00	0.06
78	002293	罗莱生活	2,500	20,200.00	0.06
79	002372	伟星新材	1,300	20,046.00	0.06
80	002032	苏泊尔	400	20,040.00	0.06
81	000830	鲁西化工	1,700	19,703.00	0.06
82	600285	羚锐制药	800	19,368.00	0.05
83	600000	浦发银行	2,300	18,929.00	0.05
84	000690	宝新能源	3,700	18,870.00	0.05
85	600968	海油发展	4,500	18,540.00	0.05
86	300750	宁德时代	100	18,003.00	0.05
87	605368	蓝天燃气	1,300	17,732.00	0.05
88	600900	长江电力	600	17,352.00	0.05
89	601607	上海医药	900	17,199.00	0.05
90	002014	永新股份	1,800	17,064.00	0.05
91	002601	龙佰集团	900	16,713.00	0.05
92	601216	君正集团	4,500	16,605.00	0.05

93	603587	地素时尚	1,300	15,964.00	0.05
94	600548	深高速	1,500	15,945.00	0.05
95	601899	紫金矿业	900	15,813.00	0.04
96	605009	豪悦护理	400	15,776.00	0.04
97	603589	口子窖	400	15,676.00	0.04
98	600926	杭州银行	1,200	15,660.00	0.04
99	601077	渝农商行	3,100	15,562.00	0.04
100	000848	承德露露	1,900	14,934.00	0.04
101	601117	XD 中国化	1,800	14,832.00	0.04
102	601128	常熟银行	1,950	14,761.50	0.04
103	601665	齐鲁银行	3,000	14,730.00	0.04
104	601156	东航物流	700	14,245.00	0.04
105	601838	成都银行	900	13,671.00	0.04
106	600020	中原高速	3,800	13,452.00	0.04
107	000559	万向钱潮	3,000	13,380.00	0.04
108	600971	恒源煤电	1,100	13,134.00	0.04
109	002469	三维化学	2,300	13,110.00	0.04
110	603816	顾家家居	400	12,916.00	0.04
111	600662	外服控股	3,200	12,832.00	0.04
112	600566	济川药业	400	12,684.00	0.04
113	600582	天地科技	1,800	12,402.00	0.04
114	002216	三全食品	1,100	12,078.00	0.03
115	002034	旺能环境	900	11,709.00	0.03
116	601728	中国电信	1,900	11,685.00	0.03
117	601877	正泰电器	600	11,436.00	0.03
118	603317	天味食品	1,000	11,410.00	0.03
119	002557	洽洽食品	400	11,276.00	0.03
120	603195	公牛集团	145	11,182.40	0.03
121	600251	冠农股份	1,500	10,860.00	0.03
122	002035	华帝股份	1,700	10,591.00	0.03
123	301109	军信股份	700	10,465.00	0.03
124	600919	江苏银行	1,400	10,402.00	0.03
125	600578	京能电力	3,200	10,368.00	0.03
126	600036	招商银行	300	10,257.00	0.03
127	600848	上海临港	1,100	10,021.00	0.03
128	601169	北京银行	1,700	9,928.00	0.03
129	003816	中国广核	2,100	9,723.00	0.03
130	603053	成都燃气	1,000	9,660.00	0.03
131	002001	新和成	500	9,600.00	0.03
132	600660	福耀玻璃	200	9,580.00	0.03
133	600233	圆通速递	600	9,390.00	0.03
134	002415	海康威视	300	9,273.00	0.03
135	600820	隧道股份	1,400	9,142.00	0.03

136	600380	健康元	800	8,936.00	0.03
137	601808	中海油服	500	8,600.00	0.02
138	601101	昊华能源	900	8,271.00	0.02
139	600479	千金药业	800	8,136.00	0.02
140	600618	氯碱化工	900	7,902.00	0.02
141	603993	洛阳钼业	900	7,650.00	0.02
142	601288	农业银行	1,700	7,412.00	0.02
143	000887	中鼎股份	600	7,344.00	0.02
144	601009	南京银行	700	7,273.00	0.02
145	000408	藏格矿业	300	7,221.00	0.02
146	603515	欧普照明	400	6,936.00	0.02
147	601398	工商银行	1,200	6,840.00	0.02
148	603323	苏农银行	1,400	6,734.00	0.02
149	601328	交通银行	900	6,723.00	0.02
150	601158	重庆水务	1,400	6,720.00	0.02
151	000958	电投产融	1,800	6,588.00	0.02
152	600368	五洲交通	1,820	6,497.40	0.02
153	002550	千红制药	1,200	6,468.00	0.02
154	600420	国药现代	600	6,408.00	0.02
155	000544	中原环保	800	6,296.00	0.02
156	600997	开滦股份	900	6,174.00	0.02
157	605077	华康股份	400	6,100.00	0.02
158	301047	义翘神州	100	5,995.00	0.02
159	002332	仙琚制药	500	5,705.00	0.02
160	600674	川投能源	300	5,625.00	0.02
161	605333	沪光股份	200	5,570.00	0.02
162	000883	湖北能源	900	5,409.00	0.02
163	605016	百龙创园	260	5,296.20	0.01
164	603408	建霖家居	400	5,276.00	0.01
165	300673	佩蒂股份	400	5,248.00	0.01
166	600704	物产中大	1,200	5,208.00	0.01
167	600989	宝丰能源	300	5,199.00	0.01
167	603008	喜临门	300	5,199.00	0.01
168	603699	纽威股份	300	5,136.00	0.01
169	000538	云南白药	100	5,115.00	0.01
170	000027	深圳能源	700	5,110.00	0.01
171	601988	中国银行	1,100	5,082.00	0.01
172	600452	涪陵电力	400	5,068.00	0.01
173	600033	福建高速	1,500	5,025.00	0.01
174	002003	伟星股份	400	5,020.00	0.01
175	000567	海德股份	870	4,880.70	0.01
176	603050	科林电气	200	4,852.00	0.01
177	003006	百亚股份	200	4,740.00	0.01

178	600483	福能股份	400	4,664.00	0.01
179	605183	确成股份	300	4,638.00	0.01
180	600236	桂冠电力	600	4,602.00	0.01
181	603886	元祖股份	300	4,518.00	0.01
182	600007	中国国贸	200	4,392.00	0.01
183	300910	瑞丰新材	100	4,372.00	0.01
184	002078	太阳纸业	300	4,185.00	0.01
185	600803	新奥股份	200	4,160.00	0.01
186	600104	上汽集团	300	4,158.00	0.01
187	600261	阳光照明	1,500	4,050.00	0.01
188	002752	昇兴股份	800	4,048.00	0.01
189	601975	招商南油	1,100	3,949.00	0.01
190	000157	中联重科	500	3,840.00	0.01
191	002083	孚日股份	900	3,807.00	0.01
192	600016	民生银行	1,000	3,790.00	0.01
193	000513	丽珠集团	100	3,721.00	0.01
194	600694	大商股份	220	3,698.20	0.01
195	601825	沪农商行	500	3,360.00	0.01
196	600019	宝钢股份	500	3,325.00	0.01
197	002690	美亚光电	200	3,300.00	0.01
198	000921	海信家电	100	3,224.00	0.01
199	600210	紫江企业	600	3,192.00	0.01
200	601939	建设银行	400	2,960.00	0.01
201	000900	现代投资	700	2,562.00	0.01
202	600098	广州发展	400	2,560.00	0.01
203	300453	三鑫医疗	400	2,556.00	0.01
204	002275	桂林三金	200	2,482.00	0.01
205	603871	嘉友国际	140	2,476.60	0.01
206	600395	盘江股份	400	2,404.00	0.01
207	601018	宁波港	700	2,380.00	0.01
208	000650	仁和药业	400	2,360.00	0.01
209	002073	软控股份	300	2,217.00	0.01
210	601998	中信银行	300	2,010.00	0.01
211	601952	苏垦农发	200	1,804.00	0.01
212	601166	兴业银行	100	1,762.00	0.00
213	601658	邮储银行	300	1,521.00	0.00
214	600826	兰生股份	280	1,506.40	0.00
215	300145	中金环境	600	1,500.00	0.00
216	002117	东港股份	200	1,416.00	0.00
217	600794	保税科技	300	951.00	0.00
218	600642	申能股份	100	883.00	0.00
219	002911	佛燃能源	70	639.80	0.00

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	601919	中远海控	181,855.00	1.80
2	000937	冀中能源	104,226.00	1.03
3	601088	中国神华	102,442.00	1.01
4	600039	四川路桥	93,780.00	0.93
5	600348	华阳股份	81,055.00	0.80
6	600273	嘉化能源	81,041.00	0.80
7	600295	鄂尔多斯	77,833.00	0.77
8	600096	云天化	69,730.00	0.69
9	601166	兴业银行	67,839.00	0.67
10	600886	国投电力	66,577.00	0.66
11	600398	海澜之家	64,752.00	0.64
12	600887	伊利股份	62,389.00	0.62
13	002545	东方铁塔	60,912.00	0.60
14	601006	大秦铁路	59,036.00	0.58
15	002327	富安娜	58,555.00	0.58
16	601225	陕西煤业	58,547.00	0.58
17	600346	恒力石化	57,457.00	0.57
18	002027	分众传媒	55,643.00	0.55
19	600901	江苏金租	54,172.00	0.54
20	600350	山东高速	54,155.00	0.54

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601919	中远海控	127,024.00	1.26
2	601166	兴业银行	72,755.00	0.72
3	601899	紫金矿业	41,657.00	0.41
4	000408	藏格矿业	38,356.00	0.38
5	600900	长江电力	36,190.00	0.36
6	300750	宁德时代	34,940.00	0.35
7	600795	国电电力	34,202.00	0.34
8	601985	中国核电	30,403.00	0.30
9	601158	重庆水务	29,112.00	0.29
10	600295	鄂尔多斯	28,813.00	0.28
11	600273	嘉化能源	28,722.00	0.28
12	600183	生益科技	28,119.00	0.28

13	688303	大全能源	27,585.00	0.27
14	600997	开滦股份	26,812.00	0.27
15	000938	紫光股份	26,623.00	0.26
16	600000	浦发银行	26,083.00	0.26
17	601398	工商银行	26,057.00	0.26
18	000977	浪潮信息	25,718.00	0.25
19	000625	长安汽车	24,272.00	0.24
20	600210	紫江企业	24,197.00	0.24

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	7,268,409.00
卖出股票收入（成交）总额	3,179,743.86

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	17,010,307.78	48.11
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）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	17,010,307.78	48.11

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	019710	23 国债 17	45,000	4,627,855.48	13.09
2	019740	24 国债 09	31,000	3,110,597.75	8.80
3	019736	24 国债 05	27,000	2,732,368.19	7.73
4	019729	23 国债 26	23,000	2,389,485.12	6.76
5	019734	24 国债 03	19,000	1,926,110.16	5.45

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

注：无。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：无。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：无。

7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.10.1 本期国债期货投资政策

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

7.10.2 本期国债期货投资评价

无。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本报告期本基金投资的前十名证券发行主体未出现被监管部门立案调查、或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中，未有投资于超出基金合同规定备选股票库之外股票。

7.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	24,244.52
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	50.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	24,294.52

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：无。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：无。

7.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
长城智盈添益债券发起式 A	20	1,724,059.28	10,001,889.08	29.01	24,479,296.51	70.99
长城智盈添益债券发起式 C	11	885.16	-	-	9,736.76	100.00
合计	31	1,112,610.40	10,001,889.08	29.00	24,489,033.27	71.00

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

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	长城智盈添益债券发起式 A	49,880.29	0.1447
	长城智盈添益债券发起式 C	8,000.00	82.1629
	合计	57,880.29	0.1678

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

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和部门负责人持有本开放式基金	长城智盈添益债券发起式 A	0~10
	长城智盈添益债券发起式 C	0

	合计	0~10
本基金基金经理持有 本开放式基金	长城智盈添益债券发起式 A	0~10
	长城智盈添益债券发起式 C	0
	合计	0~10

注：同时为基金管理人高级管理人员和基金经理的，分别计算在内。

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	29.00	10,001,889.08	29.00	3 年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,001,889.08	29.00	10,001,889.08	29.00	3 年

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	长城智盈添益债券发起式 A	长城智盈添益债券发起式 C
基金合同生效日 (2023 年 12 月 26 日) 基金份额总额	10,064,129.80	48,338.63
本报告期期初基金份额总额	10,064,129.80	48,338.63
本报告期基金总申购份额	24,422,075.44	338,844.40
减：本报告期基金总赎回份额	5,019.65	377,446.27
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	34,481,185.59	9,736.76

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、基金管理人重大人事变动：

本报告期内基金管理人无重大人事变动。

2、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：

本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本基金本报告期内无涉及本基金管理人、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

本基金本报告期投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，本基金管理人及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
长城证券	2	10,448,152.86	100.00	9,881.88	100.00	-

注：

1、报告期内租用证券公司席位的变更情况：

本报告期内租用的证券公司交易单元无变化。

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

- (1) 实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币；
- (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- (3) 经营行为规范，能满足基金运作的合法、合规需求；
- (4) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- (5) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需
要，并能为本基金提供全面的信息服务；
- (6) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨
询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析、个股分析报告及其他专门报告。

根据上述标准考察确定后，基金管理人和被选中的证券经营机构签订委托协议，并通知托管人。基金管理人应根据有关规定，在基金的中期报告和年度报告中将所选证券经营机构的有关情况、基金通过该证券经营机构买卖证券的成交量、支付的佣金等予以披露。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
长城证券	16,710,595.00	100.00	29,300,000.00	100.00	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	长城基金管理有限公司关于终止北京增财基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 1 月 19 日
2	长城基金管理有限公司关于关闭网上直销交易平台开户、认申购、转换、赎回及新开通定投业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 3 月 2 日
3	长城智盈添益债券型发起式证券投资基金开放日常申购、赎回、转换、定期定额投资业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 3 月 19 日
4	长城基金管理有限公司关于旗下基金开展电子直销系统费率优惠活动的公	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 4 月 26 日

	告		
5	长城基金管理有限公司关于调整旗下基金所持停牌股票估值方法的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 5 月 7 日
6	关于修改长城智盈添益债券型发起式证券投资基金业绩比较基准的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 5 月 28 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20240101-20240630	10,001,889.08	-	-	10,001,889.08	28.9986
个人	1	20240624-20240630	-	14,648,891.49	-	14,648,891.49	42.4717
	2	20240624-20240630	-	9,765,602.11	-	9,765,602.11	28.3135

产品特有风险

如投资者进行大额赎回，可能存在以下的特有风险：

1、流动性风险

本基金在短时间内可能无法变现足够的资产来应对大额赎回，基金仓位调整困难，从而可能会面临一定的流动性风险；

2、延期支付赎回款项及暂停赎回风险

若持有基金份额比例达到或超过 20%的单一投资者大额赎回引发了巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定决定部分延期支付赎回款项；如果连续 2 个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请，对剩余投资者的赎回办理造成影响；

3、基金净值波动风险

大额赎回会导致管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的需要，可能使基金资产净值受到不利影响；另一方面，由于基金净值估值四舍五入法或赎回费收入归基金资产的影响，大额赎回可能导致基金净值出现较大波动；

4、投资受限风险

大额赎回后若基金资产规模过小，可能导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略；

5、基金合同终止或转型风险

大额赎回可能会导致基金资产规模过小，不能满足存续的条件，根据基金合同的约定，将面临合同终止财产清算或转型风险。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- (一) 中国证监会准予长城智盈添益债券型发起式证券投资基金注册的文件
- (二) 《长城智盈添益债券型发起式证券投资基金基金合同》
- (三) 《长城智盈添益债券型发起式证券投资基金托管协议》
- (四) 法律意见书
- (五) 基金管理人业务资格批件、营业执照
- (六) 基金托管人业务资格批件、营业执照
- (七) 中国证监会规定的其他文件

12.2 存放地点

基金管理人及基金托管人住所

12.3 查阅方式

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

咨询电话：0755-29279188

客户服务电话：400-8868-666

网站：www.ccfund.com.cn

长城基金管理有限公司

2024 年 8 月 31 日