

长城集利债券型发起式证券投资基金 2024 年年度报告

2024 年 12 月 31 日

基金管理人：长城基金管理有限公司

基金托管人：中信银行股份有限公司

送出日期：2025 年 3 月 29 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。本年度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。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 3 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。

本报告期自 2024 年 01 月 01 日起至 2024 年 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.4 过去三年基金的利润分配情况	10
§ 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	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明	16
4.10 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	16
§ 5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
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	16
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	16
§ 6 审计报告	16
6.1 审计报告基本信息	16
6.2 审计报告的基本内容	16
§ 7 年度财务报表	18
7.1 资产负债表	18
7.2 利润表	20
7.3 净资产变动表	21
7.4 报表附注	23
§ 8 投资组合报告	54
8.1 期末基金资产组合情况	54

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	55
8.3 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	56
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	62
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	63
8.6 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	63
8.7 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	64
8.8 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	64
8.9 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	64
8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	64
8.14 投资组合报告附注	64
§ 9 基金份额持有人信息	65
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	65
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	66
9.3 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	66
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况	66
9.5 发起式基金发起资金持有份额情况	66
§ 10 开放式基金份额变动	67
§ 11 重大事件揭示	67
11.1 基金份额持有人大会决议	67
11.2 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	67
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	68
11.4 基金投资策略的改变	68
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	68
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	68
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	68
11.8 其他重大事件	69
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	70
12.1 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	70
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	71
§ 13 备查文件目录	71
13.1 备查文件目录	71
13.2 存放地点	71
13.3 查阅方式	72

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	长城集利债券型发起式证券投资基金	
基金简称	长城集利债券发起式	
基金主代码	018601	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2023 年 9 月 22 日	
基金管理人	长城基金管理有限公司	
基金托管人	中信银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	68,012,970.89 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	长城集利债券发起式 A	长城集利债券发起式 C
下属分级基金的交易代码	018601	018602
报告期末下属分级基金的份额总额	20,764,501.43 份	47,248,469.46 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>本基金通过传统的定性分析手段，关注上市公司的竞争优势，筛选业绩可持续增长的公司。定量分析中，本基金将结合 PE、PB、PS、PEG 等相对估值指标以及自由现金流贴现等绝对估值方法来考察企业的估值水平，以判断当前股价高估或低估。本基金在关注估值指标的同时，还会关注营业收入增长率、盈利增长率、现金流量增长率、及净资产收益率等指标，来评估企业的成长性及未来价值。</p> <p>同时，本基金股票组合配置适度分散，并考察企业的流动性和换手率指标，降低股票资产的流动性风险。</p> <p>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</p>

	的，以合理管理债券组合的久期、流动性和风险水平。
业绩比较基准	中债综合财富指数收益率×90%+沪深 300 指数收益率×8%+中证港股通综合指数（人民币）收益率×2%
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期风险与预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。本基金可投资港股通标的股票，需承担因港股市场投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		长城基金管理有限公司	中信银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	祝函	滕菲菲
	联系电话	0755-29279006	4006800000
	电子邮箱	zhuhan@ccfund.com.cn	tengfeifei@citicbank.com
客户服务电话		400-8868-666	95558
传真		0755-29279000	010-85230024
注册地址		深圳市福田区莲花街道福新社区鹏程一路 9 号广电金融中心 36 层 DEF 单元、38 层、39 层	北京市朝阳区光华路 10 号院 1 号楼 6-30 层、32-42 层
办公地址		深圳市福田区莲花街道福新社区鹏程一路 9 号广电金融中心 36 层 DEF 单元、38 层、39 层	北京市朝阳区光华路 10 号院 1 号楼 6-30 层、32-42 层
邮政编码		518046	100020
法定代表人		王军	方合英

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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.ccfund.com.cn
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市延安东路 222 号外滩中心 30 楼
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、基金净值表现及利润分配情况

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	2024 年	2023 年 9 月 22 日(基金合同生效日)-2023 年 12 月 31 日
---------------	--------	---

	长城集利债券发 起式 A	长城集利债券发 起式 C	长城集利债券发 起式 A	长城集利债券发 起式 C
本期已实现收益	643,788.58	891,274.71	83,381.48	247,072.49
本期利润	813,704.51	1,050,033.26	104,837.12	268,603.89
加权平均基金份额 本期利润	0.0544	0.0489	0.0069	0.0054
本期加权平均净 值利润率	5.26%	4.73%	0.69%	0.54%
本期基金份额净 值增长率	5.54%	5.21%	0.70%	0.61%
3.1.2 期末数据 和指标	2024 年末		2023 年末	
期末可供分配利 润	970,371.32	2,018,125.75	80,713.36	148,319.84
期末可供分配基 金份额利润	0.0467	0.0427	0.0055	0.0046
期末基金资产净 值	22,068,909.03	50,010,274.33	14,849,415.77	32,109,412.67
期末基金份额净 值	1.0628	1.0585	1.0070	1.0061
3.1.3 累计期末 指标	2024 年末		2023 年末	
基金份额累计净 值增长率	6.28%	5.85%	0.70%	0.61%

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

长城集利债券发起式 A

阶段	份额净值增 长率①	份额净值增 长率标准差 ②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.31%	0.12%	2.39%	0.17%	-1.08%	-0.05%

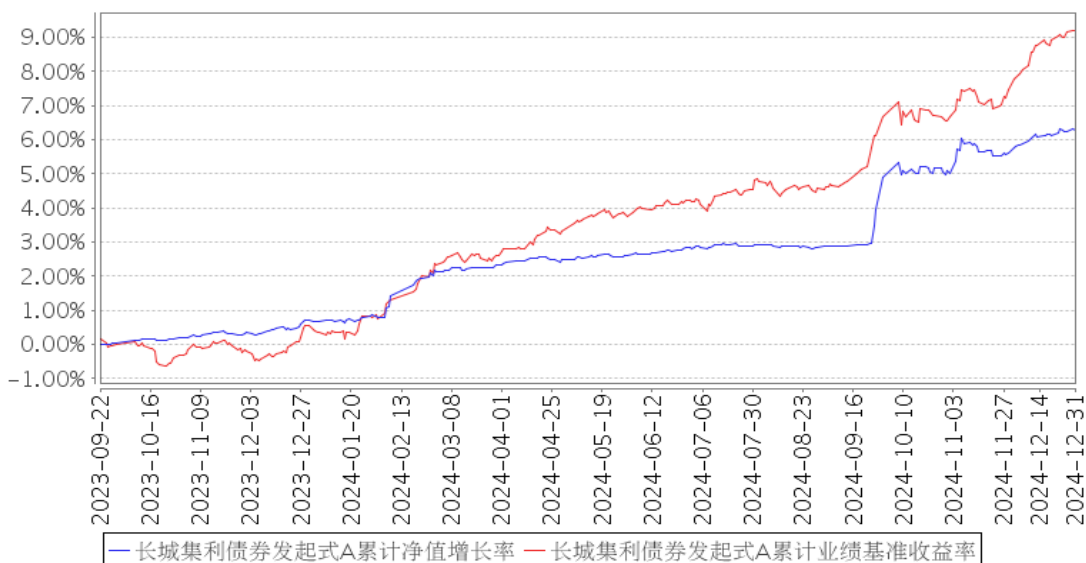
过去六个月	3.35%	0.13%	4.79%	0.14%	-1.44%	-0.01%
过去一年	5.54%	0.10%	8.60%	0.12%	-3.06%	-0.02%
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同 生效起至今	6.28%	0.09%	9.21%	0.12%	-2.93%	-0.03%

长城集利债券发起式 C

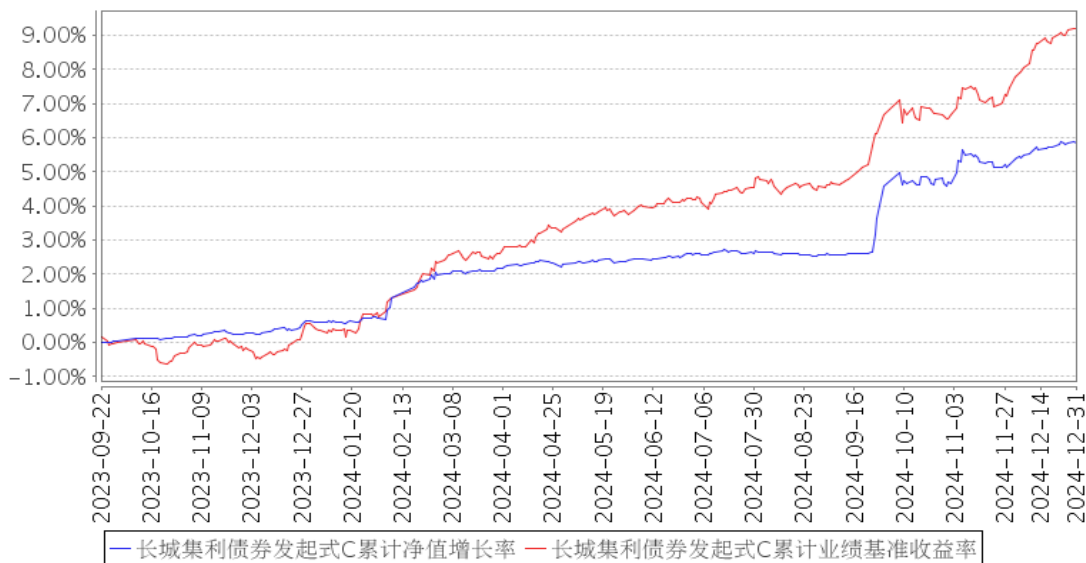
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.20%	0.12%	2.39%	0.17%	-1.19%	-0.05%
过去六个月	3.17%	0.13%	4.79%	0.14%	-1.62%	-0.01%
过去一年	5.21%	0.10%	8.60%	0.12%	-3.39%	-0.02%
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同 生效起至今	5.85%	0.09%	9.21%	0.12%	-3.36%	-0.03%

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

长城集利债券发起式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



长城集利债券发起式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

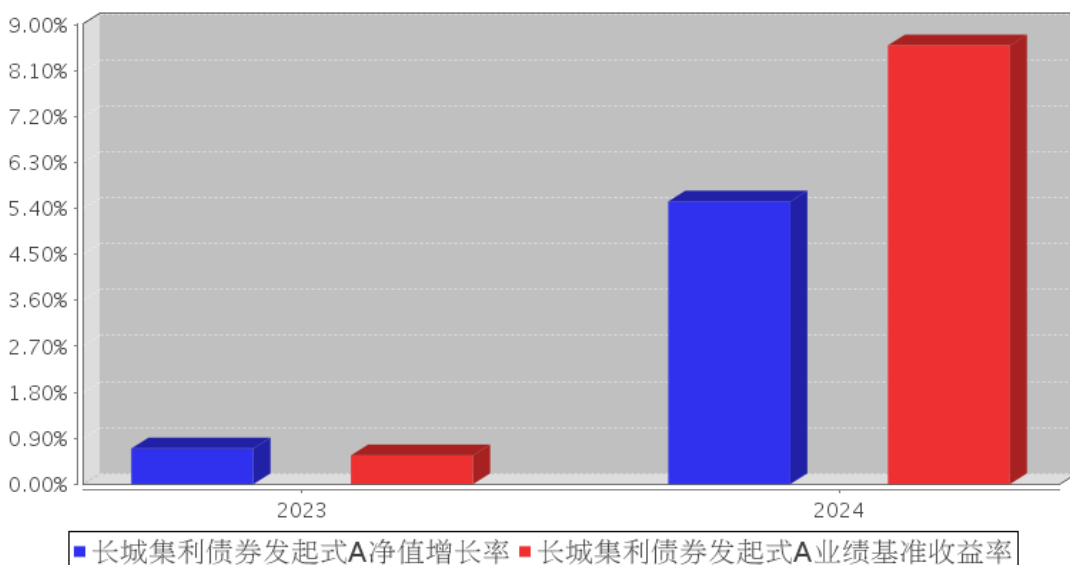


注：①本基金合同规定本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%，投资于股票、可转换债券、可交换债券的比例合计不超过基金资产的 20%，其中港股通标的股票的投资比例为股票资产的 0%-50%。本基金每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

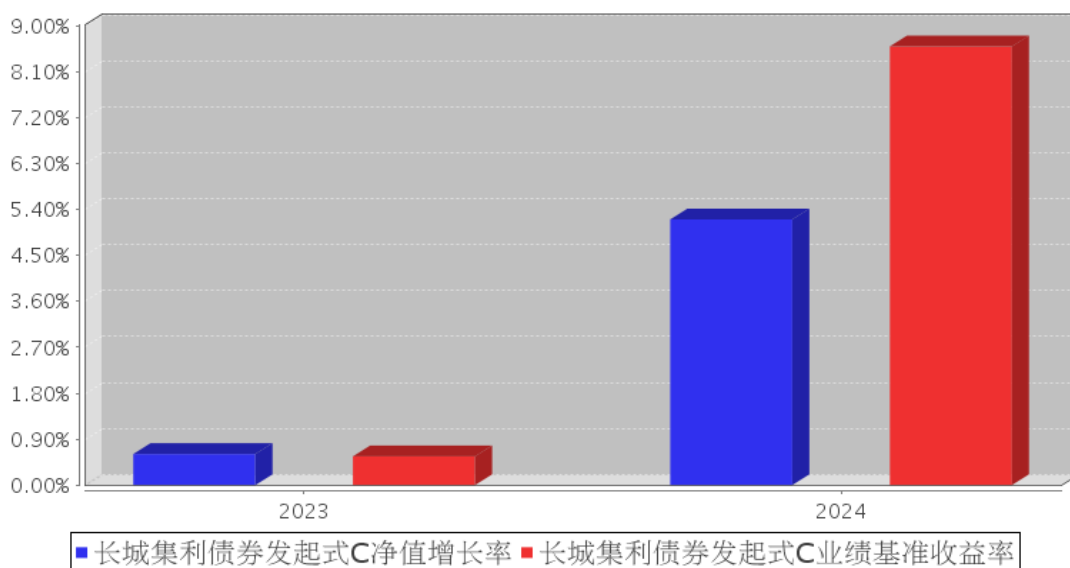
②本基金的建仓期为自基金合同生效之日起六个月内，建仓期满时，各项资产配置比例符合基金合同约定。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

长城集利债券发起式A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



长城集利债券发起式C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：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

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，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，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 12 月 31 日，公司旗下共管理 109 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		
马强	公司总经理助理、多元资产投资部总经理、基金组合投资部总经理、本基金的基金经理	2023年9月22日	-	12年	男，中国籍，硕士、特许金融分析师(CFA)。2007年7月-2012年2月曾就职于招商银行股份有限公司，2012年2月-2012年9月曾就职于中国国际金融有限公司。2012年9月加入长城基金管理有限公司，历任产品研发部产品经理、固定收益部总经理、“长城积极增利债券型证券投资基金”、“长城保本混合型证券投资基金”、“长城增强收益定期开放债券型证券投资基金”及“长城久恒平衡型证券投资基金”基金经理助理。现任公司总经理助理、多元资产投资部总经理、基金组合投资部总经理、投委会委员兼基金经理。自2015年6月至2017年3月任“长城久恒灵活配置混合型证券投资基金”基金经理，自2015年12月至2018年6月任“长城久鑫保本混合型证券投资基金”基金经理，自2017年7月至2018年9月任“长城保本混合型证券投资基金”基金经理，自2016年4月至2018年11月任“长城久益保本混合型证券投资基金”，自2016年5月至2019年1月任“长城久安保本混合型证券投资基金”基金经理，自2016年11月至2019年1月任“长城久盛安稳纯债两年定期开放债券型证券投资基金”基金经理，自2015年12月至2019年1月任“长城新策略灵活配置混合型证券投资基金”基金经理，自2017年7月至2019年1月任“长城新视野混合型证券投资基金”基金经理，自2016年5月至2019年5月任“长城久润保本混合型证券投资基金”基金经理，自2016年7月至2019年7月任“长城久鼎保本混合型证券投资基金”基金经理，自2017年7月至2020年7月任“长城积极增利债券型证券投资基金”基金经理，自2019年2月至2020年7月任“长城久悦债券型证券投资基金”基金经理，自2018年8月至2021年10月任“长城久惠灵活配置混合型证券投资基金”基金经理，自2018年11月至2024年6月任“长城久益灵活配置混合型证券

					<p>投资基金”基金经理。自 2016 年 4 月至今任“长城新优选混合型证券投资基金”，自 2020 年 11 月至今任“长城优选增强六个月持有期混合型证券投资基金”基金经理，自 2021 年 1 月至今任“长城优选回报六个月持有期混合型证券投资基金”基金经理，自 2021 年 3 月至今任“长城优选添瑞六个月持有期混合型证券投资基金”基金经理，自 2021 年 4 月至今任“长城优选稳进六个月持有期混合型证券投资基金”基金经理，自 2021 年 7 月至今任“长城优选添利一年持有期混合型证券投资基金”基金经理，自 2022 年 1 月至今任“长城优选招益一年持有期混合型证券投资基金”基金经理，自 2023 年 7 月至今任“长城久惠灵活配置混合型证券投资基金”基金经理，自 2023 年 9 月至今任“长城集利债券型发起式证券投资基金”基金经理。</p>
--	--	--	--	--	---

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 公平交易制度和控制方法

根据相关法律法规的规定，本基金管理人制定并实施了《长城基金管理有限公司公平交易管理制度》。

本基金管理人通过信息系统以及人工控制等方法，严格保证公平交易制度的执行。在投资决策环节，本基金管理人制定和完善投资授权制度、投资对象库和交易对手库管理制度、投资信息保密措施，保证各投资组合投资决策的独立性。在交易执行环节，本基金管理人建立和完善公平的交易分配制度，按照价格优先、时间优先、综合平衡、比例分配的原则，保证了交易在各投资

组合间的公平。在风险监控环节，本基金管理人内控等相关部门进行事前、事中、事后的监控。

4.3.2 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。

4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

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，同一组合经理管理的多个投资组合的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同一组合经理管理的多个投资组合的同日反向交易，对同向交易的价差进行强化的监测和事后分析，对不同时间窗的（同日、3 日内、5 日内、7 日内、9 日内、11 日内、13 日内）同向交易和临近交易日的反向交易价差进行监控分析，并结成交顺序、价格偏差、产品规模、成交量等因素对是否存在不公平对待的情形进行分析，定期出具公平交易稽核报告。本报告期报告认为，本基金管理人旗下同一组合经理管理的多个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。

4.3.3 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

2024 年国内经济展现较强韧性，虽有结构调整等压力，但仍实现了预期增长目标，同比增长 5.0%，四季度增速回升至 5.4%。经济增长的主要驱动力包括出口的阶段性高增、高技术制造业的快速扩张，以及四季度政策发力下内需的边际改善。9 月下旬，针对经济发展过程中遇到的痛点和难题，政策层面做了一系列改革和部署，对房地产政策、地方债务问题、资本市场等领域采取了一系列有力的刺激政策，国内经济触底反弹，资本市场和投资者重拾信心。在货币政策和财政政策方面，2024 年全年保持稳健偏宽松的货币政策以及积极的财政政策。在经济面临改革期的背景下，12 月召开的政治局会议强调，要实施更加积极的财政政策和适度宽松的货币政策，充实完善政策工具箱，加强超常规逆周期调节。央行全年下调了包括存款准备金率及 OMO、MLF、LPR、房贷

利率等，债券市场收益率大幅下行，10 年期国债收益率年内下行至历史低位。

股票市场方面，A 股全年走势先抑后扬，分化较大：年初，小微盘暴跌导致市场向下波动，随后在 5 月中下旬反弹，之后一直处于下跌状态直至 9 月中下旬。9 月 24 日资本市场改革后，A 股暴力反弹，一周之内各主要指数均上涨 20% 以上，其中引领市场上涨的主要为超跌反弹及高贝塔板块，市场成交量也迅速放大。进入四季度，成交量仍旧维持在 1.2 万亿之上，市场投资机会增加。

2024 年，本基金的债券持仓继续以高等级、中短久期的债券为主；股票方面，我们积极动态调整了组合的仓位和结构，组合净值表现较好。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末长城集利债券发起式 A 基金份额净值为 1.0628 元，本报告期基金份额净值增长率为 5.54%，同期业绩比较基准收益率为 8.60%；

截至本报告期末长城集利债券发起式 C 基金份额净值为 1.0585 元，本报告期基金份额净值增长率为 5.21%，同期业绩比较基准收益率为 8.60%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2025 年，我们对中国经济和资本市场持积极乐观态度：首先，经济的改革持续加速和升温，一系列促进经济增长的政策将会持续出台，产业升级及高质量发展稳健前行；其次，资本市场改革持续深化，投融资关系得以更加理顺；最后，尽管外部面临全球化的逆风，但部分国内公司凭借自身竞争力，仍将在全球市场快速拓展。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人根据健全、独立、有效、相互制约和成本效益原则，进一步完善了各项基本管理制度、业务规则和工作流程，认真执行了各项管理制度，有效实施了三层风险防范和控制措施，建立了比较完善的内部控制体系。

本报告期内公司督察长、监察稽核人员根据法律法规和公司相关制度的规定，认真履行了工作职责，结合公司实际运作需要，进一步完善了监察稽核程序、方法和制度。督察长、监察稽核部独立地开展工作，实时监控关键业务风险点，每季进行定期稽核，监察稽核内容涵盖了基金投资、基金交易、研究策划、产品创新、基金销售等各项业务的每个环节和公司信息技术、运作保障、综合管理等工作。监察稽核人员在历次监察稽核工作中，认真、有效地提出了各部门工作中存在的问题及改进意见，督促各部门及时进行了整改，防范和化解了业务风险。

监察稽核和内部控制的重点是确保公司经营及所管理基金运作的合法合规，保障基金份额持有人的利益，建立健全投资监控体系和风险评价体系，加强投资决策流程的内部控制和风险管理，

严格防范操纵市场行为、内幕交易行为和其他有损基金持有人利益的关联交易，严格防范基金销售业务中的违规行为，严格履行信息披露义务，保证履行基金合同的承诺。本报告期内，本基金运作合法合规，无操纵市场、内幕交易和不当关联交易行为，维护了基金持有人的利益。

本基金管理人将坚持“规范、专业、高效、拼搏”的经营理念，继续完善法人治理结构和内部控制制度，不断提高公司员工的守法意识和风险防范意识，加强实时监督和控制，完善电子监控手段，使内部控制的全面性、及时性和有效性不断得到提高。本基金管理人将本着“取信于市场，取信于社会”的宗旨，诚实信用，勤勉尽责，为基金持有人谋求最佳利益并使本基金管理公司稳步健康发展。

4.7 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、投资总监、固收投资总监、分管估值业务副总经理、督察长、运行保障部负责人、风险管理部负责人、相关基金经理及研究员、基金会计等岗位资深人员组成，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、适用性的情况后及时修订估值方法，以保证其持续适用。受托资产估值委员会的相关人员均具有一定年限的专业从业经验，具有良好的专业能力，并能在相关工作中保持独立性。基金经理作为估值委员会成员，凭借其丰富的专业技能和对市场产品的长期深入的跟踪研究，向受托资产估值委员会建议应采用的估值方法及合理的估值区间。基金经理有权出席估值委员会会议，但不得干涉估值委员会作出的决定及估值政策的执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无。

4.10 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

作为本基金的托管人，中信银行严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对长城集利债券型发起式证券投资基金报告期的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，履行了托管人的义务，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

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

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	德师报(审)字(25)第 P01717 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	长城集利债券型发起式证券投资基金全体持有人
审计意见	我们审计了长城集利债券型发起式证券投资基金的财务报表，包括 2024 年 12 月 31 日的资产负债表，2024 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。

	<p>我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，公允反映了长城集利债券型发起式证券投资基金 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于长城集利债券型发起式证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	不适用
其他事项	不适用
其他信息	<p>长城基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层对其他信息负责。其他信息包括长城集利债券型发起式证券投资基金年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>基金管理人管理层负责按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估长城集利债券型发起式证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算长城集利债券型发起式证券投资基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督长城集利债券型发起式证券投资基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决</p>

	<p>策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对导致对长城集利债券型发起式证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致长城集利债券型发起式证券投资基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	陈晓莹 宋冠男
会计师事务所的地址	中国上海市延安东路 222 号外滩中心 30 楼
审计报告日期	2025 年 3 月 27 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：长城集利债券型发起式证券投资基金

报告截止日：2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	7.4.7.1	2,299,848.96	14,046.36

结算备付金		1,480,029.21	347,497.63
存出保证金		6,129.41	5,092.42
交易性金融资产	7.4.7.2	66,083,736.61	44,723,675.57
其中：股票投资		3,857,522.02	207,875.90
基金投资		-	-
债券投资		62,226,214.59	44,515,799.67
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	811,775.20	1,899,757.78
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		100,450.70	200,968.88
应收股利		-	-
应收申购款		4,813,511.64	999.20
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	-
资产总计		75,595,481.73	47,192,037.84
负债和净资产	附注号	本期末 2024年12月31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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		1,230,401.15	-
应付赎回款		2,228,983.90	163,946.57
应付管理人报酬		21,293.60	18,220.32
应付托管费		5,323.40	4,555.08
应付销售服务费		10,081.05	9,862.84
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	20,215.27	36,624.59
负债合计		3,516,298.37	233,209.40
净资产：			
实收基金	7.4.7.10	68,012,970.89	46,659,764.32
其他综合收益	7.4.7.11	-	-

未分配利润	7.4.7.12	4,066,212.47	299,064.12
净资产合计		72,079,183.36	46,958,828.44
负债和净资产总计		75,595,481.73	47,192,037.84

注：(1) 报告截止日 2024 年 12 月 31 日，基金份额总额 68,012,970.89 份，其中，下属 A 类基金份额净值人民币 1.0628 元，基金份额总额 20,764,501.43 份；下属 C 类基金份额净值人民币 1.0585 元，基金份额总额 47,248,469.46 份。

(2) 本基金基金合同于 2023 年 9 月 22 日生效，本基金上年度可比期间财务报表的实际编制期间系自 2023 年 9 月 22 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日止。

7.2 利润表

会计主体：长城集利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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 9 月 22 日(基 金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日
一、营业总收入		2,148,346.14	558,992.08
1. 利息收入		45,165.85	184,921.54
其中：存款利息收入	7.4.7.13	16,963.90	13,905.02
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		28,201.95	171,016.52
其他利息收入		-	-
2. 投资收益(损失以 “-”填列)		1,772,672.07	330,918.43
其中：股票投资收益	7.4.7.14	750,154.34	7,891.17
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	1,005,797.14	323,027.26
资产支持证券投 资收益	7.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-	-
股利收益	7.4.7.19	16,720.59	-
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)	7.4.7.20	328,674.48	42,987.04
4. 汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5. 其他收入(损失以“-”号填列)	7.4.7.21	1,833.74	165.07
减：二、营业总支出		284,608.37	185,551.07
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	149,115.47	71,874.93
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	37,278.83	17,968.71
3. 销售服务费		65,855.65	41,401.47
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		1,303.17	5,258.14
其中：卖出回购金融资产支出		1,303.17	5,258.14
6. 信用减值损失	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	7.4.7.23	31,055.25	49,047.82
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		1,863,737.77	373,441.01
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		1,863,737.77	373,441.01
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		1,863,737.77	373,441.01

7.3 净资产变动表

会计主体：长城集利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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 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	46,659,764.32	-	299,064.12	46,958,828.44
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	46,659,764.32	-	299,064.12	46,958,828.44

三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	21,353,206.57	-	3,767,148.35	25,120,354.92
(一)、综合收益总额	-	-	1,863,737.77	1,863,737.77
(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)	21,353,206.57	-	1,903,410.58	23,256,617.15
其中：1. 基金申购款	82,157,947.34	-	4,230,230.39	86,388,177.73
2. 基金赎回款	-60,804,740.77	-	-2,326,819.81	-63,131,560.58
(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	68,012,970.89	-	4,066,212.47	72,079,183.36
项目	上年度可比期间			
	2023 年 9 月 22 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 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	-	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	71,394,320.08	-	-	71,394,320.08
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-24,734,555.76	-	299,064.12	-24,435,491.64
(一)、综合收益总额	-	-	373,441.01	373,441.01
(二)、本期基金份额交易产生的	-24,734,555.76	-	-74,376.89	-24,808,932.65

净资产变动数 (净资产减少以 “-”号填列)				
其中：1. 基金申 购款	26,549.24	-	86.73	26,635.97
2. 基金赎 回款	-24,761,105.00	-	-74,463.62	-24,835,568.62
(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	46,659,764.32	-	299,064.12	46,958,828.44

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

邱春杨

何小乐

李志朋

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

长城集利债券型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)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]1086号《关于准予长城集利债券型发起式证券投资基金注册的批复》核准,由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《长城集利债券型发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定。首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币71,383,807.99元,业经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)安永华明(2023)第60737541_H11号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《长城集利债券型发起式证券投资基金基金合同》于2023年9月22日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为71,394,320.08份基金份额,其中认购资金利息折合10,512.09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,基金托管人为中信银行股份有限公司。

本基金为发起式基金,发起资金认购部分为10,000,200.02基金份额,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《长城集利债券型发起式证券投资基金招募说明书》，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类别：在投资者认购/申购基金时收取认购/申购费用，但不从本类别基金资产中计提销售服务费的为 A 类基金份额；在投资者认购、申购基金时不收取认购/申购费用，而本类别基金资产中计提销售服务费的为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类两种收费模式并存，由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别计算基金份额净值和两类基金份额累计净值。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《长城集利债券型发起式证券投资基金合同》的有关规定，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(包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、政府支持债券、政府支持机构债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债、可转换债券(含可分离交易可转债)、可交换债券及其他中国证监会允许基金投资的债券)、股票(包括主板、创业板及其他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、同业存单、银行存款、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)。本基金的投资组合比例为：本基金对债券的投资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%，本基金投资信用债(含资产支持证券，下同)的信用评级在 AA+(含)以上；本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金的业绩比较基准为：中债综合财富指数收益率×90%+沪深 300 指数收益率×8%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×2%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《长城集利债券型发起式证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金编制的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 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。比较财务报表的实际编制期间为 2023 年 9 月 22 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产、金融负债或权益工具。

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金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。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。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主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益,在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债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。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

(3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益,在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。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,相关交易费用计入当期损益;对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息,确认为应计利息,包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债,相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,按照公允价值进行后续计量;对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法,以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产,以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息,以发生违约的风险为权重,计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额,确认预期信用损失。

于每个资产负债表日,本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的,处于第一阶段,本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备;金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的,处于第二阶段,本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备;金融工具自初始确认后已经发生信用减值的,处于第三阶段,本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具,本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加,认定为处于第一阶段的金融工具,按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准

备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金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；或者(3) 该金融资产已转移，虽然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，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和资产支持证券投资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其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，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) 当金融工具不存在活跃市场，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。采用估值技术时，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，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。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认列。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。

本基金发行的份额作为可回售工具具备以下特征：(1) 赋予基金份额持有人在基金清算时按比例份额获得该基金净资产的权利，这里所指基金净资产是扣除所有优先于该基金份额对基金资产要求权之后的剩余资产；这里所指按比例份额是清算时将基金的净资产分拆为金额相等的单位，并且将单位金额乘以基金份额持有人所持有的单位数量；(2) 该工具所属的类别次于其他所有工具类别，即本基金份额在归属于该类别前无须转换为另一种工具，且在清算时对基金资产没有优先于其他工具的要求权；(3) 该工具所属的类别中(该类别次于其他所有工具类别)，所有工具具有相同的特征(例如它们必须都具有可回售特征，并且用于计算回购或赎回价格的公式或其他方法都相同)；(4) 除了发行方应当以现金或其他金融资产回购或赎回该基金份额的合同义务外，该工具不满足金融负债定义中的任何其他特征；(5) 该工具在存续期内的预计现金流量总额，应当实质上基于该基金存续期内基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括本基金的任何影响)。

可回售工具，是指根据合同约定，持有方有权将该工具回售给发行方以获取现金或其他金融资产的权利，或者在未来某一不确定事项发生或者持有方死亡或退休时，自动回售给发行方的金融工具。

本基金没有同时具备下列特征的其他金融工具或合同：(1) 现金流量总额实质上基于基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括该基金或合同的任何影响)；(2) 实质上限制或固定了上述工具持有方所获得的剩余回报。

本基金将实收基金分类为权益工具，列报于净资产。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现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损益占净资产比例计算的金额。未实现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损益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认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

1) 利息收入

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

买入返售金融资产利息收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提。

2) 投资收益

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息及在适用情况下公允价值变动产生的预估增值税后的净额确认为公允价值变动损益;于处置时,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由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益,其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法确认。

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。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配,但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数,包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分;若期末未分配利润的未实现部分为负数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润,即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

7.4.4.12 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入账。

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。

7.4.4.13 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。

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566号《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财税[2008]1号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《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》、财税[2014]81号《财政部国家税务总局证监会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[2015]101号《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》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《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》、财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2021]33号《关于北京证券交易所税收政策适用问题的公告》、财税[2024]8号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2016]127号《财政部国家税务总局证监会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》、财税[2016]140号《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》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2023]39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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、债券免征增值税;2018年1月1日起,公开募集证券投资基金管理人运营公开募集证券投资基金过程中发生的资管产品运营业务,以基金管理人为增值税纳税人,暂适用简易计税方法,按照3%的征收率缴纳增值税。

(2) 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,暂不计缴企业所得税。

(3) 对基金取得的股票股息红利所得,由上市公司代扣代缴个人所得税;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，股息红利所得暂免征收个人所得税。其中，对基金持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所挂牌交易的上市公司限售股，解禁后取得的股息红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%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。对基金通过港股通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20%的税率代扣个人所得税。基金通过港股通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20%的税率代扣个人所得税。

(4)对于基金从事 A 股买卖，出让方按 0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税，受让方不再缴纳印花税；自 2023 年 8 月 28 日起，出让方减按 0.05%的税率缴纳证券(股票)交易印花税。对于基金通过港股通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(5)本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
活期存款	2,299,848.96	14,046.36
等于：本金	2,299,306.79	13,641.83
加：应计利息	542.17	404.53
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	2,299,848.96	14,046.36
----	--------------	-----------

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2024年12月31日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		3,608,607.60	-	3,857,522.02	248,914.42
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	34,943,701.85	326,564.79	35,339,534.79	69,268.15
	银行间市场	26,435,721.05	397,479.80	26,886,679.80	53,478.95
	合计	61,379,422.90	724,044.59	62,226,214.59	122,747.10
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		64,988,030.50	724,044.59	66,083,736.61	371,661.52
项目		上年度末 2023年12月31日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		217,039.40	-	207,875.90	-9,163.50
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	43,755,749.46	707,899.67	44,515,799.67	52,150.54
	合计	43,755,749.46	707,899.67	44,515,799.67	52,150.54
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		43,972,788.86	707,899.67	44,723,675.57	42,987.04

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：无。

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：无。

7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：无。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 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 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	811,775.20	-
银行间市场	-	-
合计	811,775.20	-
项目	上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	1,899,757.78	-
银行间市场	-	-
合计	1,899,757.78	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

7.4.7.5 债权投资

7.4.7.5.1 债权投资情况

注：无。

7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：无。

7.4.7.6 其他债权投资

7.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：无。

7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：无。

7.4.7.7 其他权益工具投资

7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：无。

7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：无。

7.4.7.8 其他资产

注：无。

7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年12月31日	上年度末 2023年12月31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	7,715.27	8,624.59
其中：交易所市场	7,540.27	5,190.59
银行间市场	175.00	3,434.00
应付利息	-	-
预提审计费	8,000.00	25,000.00
预提中债登债券账户维护费	4,500.00	3,000.00
合计	20,215.27	36,624.59

7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

长城集利债券发起式 A

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	14,746,554.12	14,746,554.12
本期申购	12,348,332.70	12,348,332.70
本期赎回（以“-”号填列）	-6,330,385.39	-6,330,385.39
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	20,764,501.43	20,764,501.43

长城集利债券发起式 C

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	31,913,210.20	31,913,210.20
本期申购	69,809,614.64	69,809,614.64
本期赎回（以“-”号填列）	-54,474,355.38	-54,474,355.38
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	47,248,469.46	47,248,469.46

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。

7.4.7.11 其他综合收益

注：无。

7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

长城集利债券发起式 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	80,713.36	22,148.29	102,861.65
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	80,713.36	22,148.29	102,861.65
本期利润	643,788.58	169,915.93	813,704.51
本期基金份额交易产生的变动数	245,869.38	141,972.06	387,841.44
其中：基金申购款	443,970.79	198,855.11	642,825.90
基金赎回款	-198,101.41	-56,883.05	-254,984.46
本期已分配利润	-	-	-
本期末	970,371.32	334,036.28	1,304,407.60

长城集利债券发起式 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	148,319.84	47,882.63	196,202.47
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	148,319.84	47,882.63	196,202.47
本期利润	891,274.71	158,758.55	1,050,033.26
本期基金份额交易产生的变动数	978,531.20	537,037.94	1,515,569.14
其中：基金申购款	2,504,302.30	1,083,102.19	3,587,404.49
基金赎回款	-1,525,771.10	-546,064.25	-2,071,835.35
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,018,125.75	743,679.12	2,761,804.87

7.4.7.13 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12月31日	上年度可比期间 2023年9月22日（基金合同生效日）至2023年12月31日
活期存款利息收入	11,669.65	8,083.20
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	5,215.91	5,811.61
其他	78.34	10.21
合计	16,963.90	13,905.02

7.4.7.14 股票投资收益

7.4.7.14.1 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12月 31日	上年度可比期间 2023年9月22日（基金合同 生效日）至2023年12月31 日
股票投资收益——买卖 股票差价收入	750,154.34	7,891.17
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	750,154.34	7,891.17

7.4.7.14.2 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12月 31日	上年度可比期间 2023年9月22日（基金合 同生效日）至2023年12月31 日
卖出股票成交总 额	14,628,603.40	2,744,356.19
减：卖出股票成本 总额	13,847,194.75	2,729,345.14
减：交易费用	31,254.31	7,119.88
买卖股票差价收 入	750,154.34	7,891.17

7.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

7.4.7.15 债券投资收益

7.4.7.15.1 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12月 31日	上年度可比期间 2023年9月22日（基金合同生 效日）至2023年12月31日
债券投资收益——利息收入	1,016,011.84	349,729.44
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-10,214.70	-26,702.18
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	1,005,797.14	323,027.26

7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月 31日	上年度可比期间 2023年9月22日（基金合同生 效日）至2023年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	55,214,613.14	56,493,610.39
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	54,380,007.56	55,990,414.85
减：应计利息总额	842,782.56	526,960.22
减：交易费用	2,037.72	2,937.50
买卖债券差价收入	-10,214.70	-26,702.18

7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

7.4.7.16 资产支持证券投资收益

7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：无。

7.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：无。

7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：无。

7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：无。

7.4.7.17 贵金属投资收益

7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：无。

7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

7.4.7.18 衍生工具收益

7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：无。

7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无。

7.4.7.19 股利收益

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12月31日	2023年9月22日（基金合同生效日）至2023年12月31日
股票投资产生的股利收益	16,720.59	-
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	16,720.59	-

7.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2024年1月1日至2024年12月31日	

		2023 年 9 月 22 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	328,674.48	42,987.04
股票投资	258,077.92	-9,163.50
债券投资	70,596.56	52,150.54
资产支持证券投资	-	-
基金投资	-	-
贵金属投资	-	-
其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
权证投资	-	-
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	328,674.48	42,987.04

7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 9 月 22 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	1,833.74	165.07
合计	1,833.74	165.07

7.4.7.22 信用减值损失

注：无。

7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 9 月 22 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
审计费用	8,000.00	25,000.00
信息披露费	-	20,000.00
证券出借违约金	-	-
银行费用	3,546.70	1,047.82
深港通_证券组合费	8.55	-
中债登债券账户服务费	19,500.00	3,000.00
合计	31,055.25	49,047.82

7.4.7.24 分部报告

截至本报告期末，本基金仅在中国大陆境内从事证券投资单一业务，因此，无需作披露的分

部报告。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 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。

7.4.8.2 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。

7.4.9 关联方关系

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
中信银行股份有限公司（“中信银行”）	基金托管人、基金销售机构
东方证券股份有限公司（“东方证券”）	基金管理人的股东
长城证券股份有限公司（“长城证券”）	基金管理人的股东
北方国际信托股份有限公司（“北方国际”）	基金管理人的股东
中原信托有限公司（“中原信托”）	基金管理人的股东
长城嘉信资产管理有限公司（“长城嘉信”）	基金管理人的控股子公司

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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 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12月31日		上年度可比期间 2023年9月22日（基金合同生效日）至2023年12月31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	31,867,366.35	100.00	5,690,740.73	100.00

7.4.10.1.2 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12月31日		上年度可比期间 2023年9月22日（基金合同生效日）至2023年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例（%）	成交金额	占当期债券成交总额的比例（%）
长城证券	80,805,157.01	100.00	59,751,981.00	100.00

7.4.10.1.3 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12月 31日		上年度可比期间 2023年9月22日（基金合同生效 日）至2023年12月31日	
	成交金额	占当期债券回 购 成交总额的比 例（%）	成交金额	占当期债券回 购 成交总额的比 例（%）
长城证券	364,107,000.00	100.00	783,034,000.00	100.00

7.4.10.1.4 权证交易

注：无。

7.4.10.1.5 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12月31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	20,309.15	100.00	7,540.27	100.00
关联方名称	上年度可比期间 2023年9月22日（基金合同生效日）至2023年12月31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	5,382.94	100.00	5,190.59	100.00

注：（1）上述佣金按协议约定的佣金费率计算，佣金费率由协议签订方参考市场价格确定。

（2）本基金本报告期内 1-6 月佣金协议的服务范围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等（上年度可比期间：同）。

（3）自 2024 年 7 月 1 日起，本基金的交易佣金费率不超过中国证券业协会对外通报的市场平均股票交易佣金费率的两倍，佣金包含佣金收取方为基金提供证券研究服务而收取的费用。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年 12月31日	上年度可比期间 2023年9月22日（基金 合同生效日）至2023年 12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	149,115.47	71,874.93

其中:应支付销售机构的客户维护费	53,701.88	30,322.08
应支付基金管理人的净管理费	95,413.59	41,552.85

注: 基金管理费每日计提, 按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.40% 的年费率计提。计算方法如下:

$$H = E \times 0.40\% / \text{当年天数}$$

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

7.4.10.2.2 基金托管费

单位: 人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 9 月 22 日 (基金 合同生效日) 至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	37,278.83	17,968.71

注: 基金托管费每日计提, 按月支付。基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。计算方法如下:

$$H = E \times 0.10\% / \text{当年天数}$$

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

7.4.10.2.3 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 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	长城集利债券发起式 A	长城集利债券发起式 C	合计
长城基金管理有限公司	-	32.00	32.00
中信银行	-	45,089.93	45,089.93
合计	-	45,121.93	45,121.93
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2023 年 9 月 22 日 (基金合同生效日) 至 2023 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		

	长城集利债券发起式 A	长城集利债券发起式 C	合计
长城基金管理有限公司	-	0.25	0.25
中信银行	-	40,524.12	40,524.12
合计	-	40,524.37	40,524.37

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年费率为 0.3%。销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.3% 年费率计提。计算公式如下：

$$H = E \times 0.3\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

7.4.10.4 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

7.4.10.4.1 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。

7.4.10.4.2 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。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 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 12 月 31 日	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
	长城集利债券发起式 A	长城集利债券发起式 C
基金合同生效日（2023 年 9 月 22 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	10,000,200.02	-
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	10,000,200.02	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	14.7034%	-
项目	上年度可比期间 2023年9月22日（基金合同生效日）至2023年12月31日	上年度可比期间 2023年9月22日（基金合同生效日）至2023年12月31日
	长城集利债券发起式 A	长城集利债券发起式 C
基金合同生效日（2023年9月22日）持有的基金份额	10,000,200.02	-
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期内申购/买入总份额	-	-
报告期内因拆分变动份额	-	-
减：报告期内赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	10,000,200.02	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	21.4322%	-

7.4.10.5.2 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。

7.4.10.6 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12月31日		上年度可比期间 2023年9月22日（基金合同生效日）至 2023年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中信银行	2,299,848.96	11,669.65	14,046.36	8,083.20

注：本基金的银行存款由基金托管人中信银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 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

7.4.8.2 资产负债表日后事项。

7.4.12 期末（2024 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：无。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
002252	上海莱士	2024 年 12 月 23 日	重大事项停牌	7.22	2025 年 1 月 7 日	6.93	500	3,505.00	3,610.00	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 12 月 31 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为人民币 0.00 元，无质押债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 12 月 31 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。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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。

7.4.13.2 信用风险

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

证券，不得超过该证券市值的 10%。

本基金的基金管理人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以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行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。

7.4.13.3 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。

7.4.13.3.1 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 7.4.12 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 7.4.12.3 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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

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公允价值，并按照合同约定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 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	2,299,848.96	-	-	-	-	-	2,299,848.96
结算备付金	1,480,029.21	-	-	-	-	-	1,480,029.21
存出保证金	6,129.41	-	-	-	-	-	6,129.41
交易性金融资产	8,560,534.36	-35,924,710.85	16,580,908.17	1,160,061.21	3,857,522.02	-	66,083,736.61
买入返售金融资产	811,775.20	-	-	-	-	-	811,775.20
应收申购款	-	-	-	-	-	4,813,511.64	4,813,511.64
应收清算款	-	-	-	-	-	100,450.70	100,450.70

资产总计	13,158,317.14	-35,924,710.85	16,580,908.17	1,160,061.21	18,771,484.36	75,595,481.73
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	-2,228,983.90	2,228,983.90
应付管理人报酬	-	-	-	-	21,293.60	21,293.60
应付托管费	-	-	-	-	5,323.40	5,323.40
应付清算款	-	-	-	-	-1,230,401.15	1,230,401.15
应付销售服务费	-	-	-	-	10,081.05	10,081.05
其他负债	-	-	-	-	20,215.27	20,215.27
负债总计	-	-	-	-	-3,516,298.37	3,516,298.37
利率敏感度缺口	13,158,317.14	-35,924,710.85	16,580,908.17	1,160,061.21		
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	14,046.36	-	-	-	-	14,046.36
结算备付金	347,497.63	-	-	-	-	347,497.63
存出保证金	5,092.42	-	-	-	-	5,092.42
交易	-	-16,343,668.97	28,172,130.70	-	207,875.90	44,723,675.57

性金融资产						
买入返售金融资产	1,899,757.78	-	-	-	-	1,899,757.78
应收申购款					999.20	999.20
应收清算款					200,968.88	200,968.88
资产总计	2,266,394.19	-16,343,668.97	28,172,130.70		409,843.98	47,192,037.84
负债						
应付赎回款					163,946.57	163,946.57
应付管理人报酬					18,220.32	18,220.32
应付托管费					4,555.08	4,555.08
应付销售服务费					9,862.84	9,862.84
其他负债					36,624.59	36,624.59
负债总计					233,209.40	233,209.40
利率敏感度缺口	2,266,394.19	-16,343,668.97	28,172,130.70			

7.4.13.4.1.2 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12月31日）	上年度末（2023年12月31日）

		日)	31 日)
	市场利率下降 25 个基点	131,967.47	149,530.18
	市场利率上升 25 个基点	-130,907.17	-148,569.87

7.4.13.4.2 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，本基金面临的外汇风险敞口及外汇风险敏感性分析列示如下：

7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民 币元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的 资产				
交易性金融资 产	-	534,501.02	-	534,501.02
资产合计	-	534,501.02	-	534,501.02
以外币计价的 负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外 外汇风险敞口净 额	-	534,501.02	-	534,501.02
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 外汇风险敞口净额	-	-	-	-

7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇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12月31日）	上年度末（2023年12月31日）
	所有外币均相对人民币升值 5%	26,725.05	-
	所有外币均相对人民币贬值 5%	-26,725.05	-

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

本基金投资组合比例为：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。

本基金于本期末及上年度末面临的整体其他价格风险列示如下：

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024年12月31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	3,857,522.02	5.35	207,875.90	0.44
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	62,226,214.59	86.33	44,515,799.67	94.80
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	66,083,736.61	91.68	44,723,675.57	95.24

7.4.13.4.3.2 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 12 月 31 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数上升 5%	154,011.57	14,072.16
沪深 300 指数下降 5%	-154,011.57	-14,072.16	

7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

注：无。

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 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 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	3,853,912.02	207,875.90
第二层次	62,229,824.59	44,515,799.67
第三层次	-	-
合计	66,083,736.61	44,723,675.57

7.4.14.2.2 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，若出现重大事项、新发未上市等原因导致不存在活跃市场未经调整的报价，本基金不会于在此期间将相关证券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。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

注：本基金于本期初及上年度期初均未持有公允价值划分为第三层次的金融工具，本基金于本期及上年度可比期间均未发生第三层次公允价值转入转出情况。

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

注：无。

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

无。

7.4.14.4 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。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	3,857,522.02	5.10
	其中：股票	3,857,522.02	5.10
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	62,226,214.59	82.31
	其中：债券	62,226,214.59	82.31
	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	811,775.20	1.07
	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	3,779,878.17	5.00
8	其他各项资产	4,920,091.75	6.51
9	合计	75,595,481.73	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 534,501.02 元，占基金资产净值的比例为 0.74%。

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	15,943.00	0.02
B	采矿业	712,500.00	0.99
C	制造业	1,885,866.00	2.62
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	69,550.00	0.10
E	建筑业	37,323.00	0.05
F	批发和零售业	5,560.00	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	56,938.00	0.08
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	65,635.00	0.09
J	金融业	430,132.00	0.60
K	房地产业	14,286.00	0.02
L	租赁和商务服务业	15,710.00	0.02
M	科学研究和技术服务业	13,578.00	0.02
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-

R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	3,323,021.00	4.61

8.2.2 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（%）
基础材料	-	-
消费者非必需品	203,812.14	0.28
消费者常用品	-	-
能源	-	-
金融	-	-
医疗保健	-	-
工业	-	-
信息技术	153,352.22	0.21
电信服务	177,336.66	0.25
公用事业	-	-
房地产	-	-
合计	534,501.02	0.74

注：以上分类采用财汇大智慧提供的国际通用行业分类标准。

8.3 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	000651	格力电器	7,600	345,420.00	0.48
2	600690	海尔智家	11,700	333,099.00	0.46
3	601088	中国神华	7,300	317,404.00	0.44
4	601225	陕西煤业	12,000	279,120.00	0.39
5	00941	中国移动	2,500	177,336.66	0.25
5	600941	中国移动	100	11,816.00	0.02
6	300750	宁德时代	700	186,200.00	0.26
7	09988	阿里巴巴-SW	2,100	160,241.96	0.22
8	01810	小米集团-W	4,800	153,352.22	0.21
9	600036	招商银行	3,800	149,340.00	0.21
10	605499	东鹏饮料	600	149,112.00	0.21
11	002096	易普力	8,800	104,544.00	0.15
12	002371	北方华创	200	78,200.00	0.11
13	601899	紫金矿业	4,600	69,552.00	0.10
14	603977	国泰集团	3,900	50,505.00	0.07
15	09896	名创优品	1,000	43,570.18	0.06
16	600900	长江电力	1,100	32,505.00	0.05
17	000333	美的集团	400	30,088.00	0.04
18	002594	比亚迪	100	28,266.00	0.04

19	000858	五粮液	200	28,008.00	0.04
20	600030	中信证券	900	26,253.00	0.04
21	300760	迈瑞医疗	100	25,500.00	0.04
22	601166	兴业银行	1,300	24,908.00	0.03
23	601398	工商银行	3,100	21,452.00	0.03
24	601318	中国平安	400	21,060.00	0.03
25	688981	中芯国际	200	18,924.00	0.03
26	601328	交通银行	2,400	18,648.00	0.03
27	600276	恒瑞医药	400	18,360.00	0.03
28	600887	伊利股份	500	15,090.00	0.02
29	601288	农业银行	2,800	14,952.00	0.02
30	000725	京东方 A	3,300	14,487.00	0.02
31	600309	万华化学	200	14,270.00	0.02
32	688008	澜起科技	200	13,580.00	0.02
33	601816	京沪高铁	2,200	13,552.00	0.02
34	600919	江苏银行	1,300	12,766.00	0.02
35	000568	泸州老窖	100	12,520.00	0.02
36	000063	中兴通讯	300	12,120.00	0.02
37	300124	汇川技术	200	11,716.00	0.02
38	601668	中国建筑	1,900	11,400.00	0.02
39	603259	药明康德	200	11,008.00	0.02
40	603986	兆易创新	100	10,680.00	0.01
41	601988	中国银行	1,900	10,469.00	0.01
42	603501	韦尔股份	100	10,441.00	0.01
43	600000	浦发银行	1,000	10,290.00	0.01
44	601728	中国电信	1,400	10,108.00	0.01
45	601857	中国石油	1,100	9,834.00	0.01
46	002230	科大讯飞	200	9,664.00	0.01
47	601985	中国核电	900	9,387.00	0.01
48	000001	平安银行	800	9,360.00	0.01
49	002415	海康威视	300	9,210.00	0.01
50	600050	中国联通	1,700	9,027.00	0.01
51	600028	中国石化	1,300	8,684.00	0.01
52	000100	TCL 科技	1,700	8,551.00	0.01
53	601766	中国中车	1,000	8,380.00	0.01
54	600104	上汽集团	400	8,304.00	0.01
55	300498	温氏股份	500	8,255.00	0.01
56	600031	三一重工	500	8,240.00	0.01
57	601229	上海银行	900	8,235.00	0.01
58	000792	盐湖股份	500	8,230.00	0.01
59	002352	顺丰控股	200	8,060.00	0.01
60	601169	北京银行	1,300	7,995.00	0.01
61	601012	隆基绿能	500	7,855.00	0.01

62	600016	民生银行	1,900	7,847.00	0.01
63	601919	中远海控	500	7,750.00	0.01
64	002714	牧原股份	200	7,688.00	0.01
65	600406	国电南瑞	300	7,566.00	0.01
66	603019	中科曙光	100	7,232.00	0.01
67	600150	中国船舶	200	7,192.00	0.01
68	000338	潍柴动力	500	6,850.00	0.01
69	601888	中国中免	100	6,701.00	0.01
70	002049	紫光国微	100	6,437.00	0.01
71	002027	分众传媒	900	6,327.00	0.01
72	600660	福耀玻璃	100	6,240.00	0.01
73	601818	光大银行	1,600	6,192.00	0.01
74	000538	云南白药	100	5,995.00	0.01
75	600938	中国海油	200	5,902.00	0.01
76	601390	中国中铁	900	5,751.00	0.01
77	600999	招商证券	300	5,748.00	0.01
78	600905	三峡能源	1,300	5,681.00	0.01
79	601658	邮储银行	1,000	5,680.00	0.01
80	600019	宝钢股份	800	5,600.00	0.01
81	000938	紫光股份	200	5,566.00	0.01
82	601006	大秦铁路	800	5,424.00	0.01
83	000625	长安汽车	400	5,344.00	0.01
84	601009	南京银行	500	5,325.00	0.01
85	600048	保利发展	600	5,316.00	0.01
86	601989	中国重工	1,100	5,291.00	0.01
87	601939	建设银行	600	5,274.00	0.01
88	000977	浪潮信息	100	5,188.00	0.01
89	002241	歌尔股份	200	5,162.00	0.01
90	601600	中国铝业	700	5,145.00	0.01
91	600089	特变电工	400	5,096.00	0.01
92	600760	中航沈飞	100	5,072.00	0.01
93	600886	国投电力	300	4,986.00	0.01
94	601336	新华保险	100	4,970.00	0.01
95	002311	海大集团	100	4,905.00	0.01
96	601689	拓普集团	100	4,900.00	0.01
97	688303	大全能源	200	4,828.00	0.01
98	000425	徐工机械	600	4,758.00	0.01
99	600585	海螺水泥	200	4,756.00	0.01
100	002050	三花智控	200	4,702.00	0.01
101	300014	亿纬锂能	100	4,674.00	0.01
102	603288	海天味业	100	4,590.00	0.01
103	600547	山东黄金	200	4,526.00	0.01
104	603369	今世缘	100	4,523.00	0.01

105	000999	华润三九	100	4,434.00	0.01
106	600438	通威股份	200	4,422.00	0.01
107	002001	新 和 成	200	4,394.00	0.01
108	600926	杭州银行	300	4,383.00	0.01
109	300433	蓝思科技	200	4,380.00	0.01
110	601669	中国电建	800	4,368.00	0.01
111	600111	北方稀土	200	4,244.00	0.01
112	601628	中国人寿	100	4,192.00	0.01
113	600893	航发动力	100	4,145.00	0.01
114	600795	国电电力	900	4,122.00	0.01
115	600584	长电科技	100	4,086.00	0.01
116	600085	同仁堂	100	4,059.00	0.01
117	600015	华夏银行	500	4,005.00	0.01
118	603993	洛阳钼业	600	3,990.00	0.01
119	002179	中航光电	100	3,930.00	0.01
120	600745	闻泰科技	100	3,878.00	0.01
121	688599	天合光能	200	3,860.00	0.01
122	300408	三环集团	100	3,851.00	0.01
123	300418	昆仑万维	100	3,848.00	0.01
124	601916	浙商银行	1,300	3,783.00	0.01
125	688126	沪硅产业	200	3,764.00	0.01
126	002648	卫星化学	200	3,758.00	0.01
127	601377	兴业证券	600	3,756.00	0.01
128	600010	包钢股份	2,000	3,720.00	0.01
129	601186	中国铁建	400	3,668.00	0.01
130	002938	鹏鼎控股	100	3,648.00	0.01
131	000002	万 科 A	500	3,630.00	0.01
132	601788	光大证券	200	3,622.00	0.01
133	002252	上海莱士	500	3,610.00	0.01
134	600489	中金黄金	300	3,609.00	0.01
135	002460	赣锋锂业	100	3,501.00	0.00
136	000963	华东医药	100	3,460.00	0.00
137	600674	川投能源	200	3,450.00	0.00
138	601838	成都银行	200	3,422.00	0.00
139	600009	上海机场	100	3,415.00	0.00
140	601995	中金公司	100	3,369.00	0.00
141	600989	宝丰能源	200	3,368.00	0.00
142	601901	方正证券	400	3,332.00	0.00
143	003816	中国广核	800	3,304.00	0.00
144	002466	天齐锂业	100	3,300.00	0.00
145	300999	金龙鱼	100	3,261.00	0.00
146	600029	南方航空	500	3,245.00	0.00
147	000776	广发证券	200	3,242.00	0.00

148	002236	大华股份	200	3,200.00	0.00
148	600115	中国东航	800	3,200.00	0.00
149	002812	恩捷股份	100	3,199.00	0.00
150	300316	晶盛机电	100	3,190.00	0.00
151	601111	中国国航	400	3,164.00	0.00
152	601800	中国交建	300	3,135.00	0.00
153	601360	三六零	300	3,105.00	0.00
154	001979	招商蛇口	300	3,072.00	0.00
155	600346	恒力石化	200	3,070.00	0.00
156	601881	中国银河	200	3,046.00	0.00
157	000786	北新建材	100	3,031.00	0.00
158	600845	宝信软件	100	2,926.00	0.00
158	603799	华友钴业	100	2,926.00	0.00
159	000157	中联重科	400	2,892.00	0.00
160	688223	晶科能源	400	2,844.00	0.00
161	600332	白云山	100	2,842.00	0.00
162	600188	兖矿能源	200	2,834.00	0.00
163	002180	纳思达	100	2,817.00	0.00
164	001965	招商公路	200	2,790.00	0.00
165	000408	藏格矿业	100	2,773.00	0.00
166	002459	晶澳科技	200	2,750.00	0.00
167	601868	中国能建	1,200	2,748.00	0.00
168	002493	荣盛石化	300	2,715.00	0.00
169	000807	云铝股份	200	2,706.00	0.00
170	300413	芒果超媒	100	2,689.00	0.00
171	600415	小商品城	200	2,682.00	0.00
172	002129	TCL 中环	300	2,661.00	0.00
173	601633	长城汽车	100	2,633.00	0.00
174	300122	智飞生物	100	2,630.00	0.00
175	600460	士兰微	100	2,602.00	0.00
176	000895	双汇发展	100	2,596.00	0.00
176	002271	东方雨虹	200	2,596.00	0.00
177	601066	中信建投	100	2,575.00	0.00
178	300759	康龙化成	100	2,570.00	0.00
179	601117	中国化学	300	2,487.00	0.00
180	600196	复星医药	100	2,485.00	0.00
181	600372	中航机载	200	2,466.00	0.00
182	601878	浙商证券	200	2,448.00	0.00
183	601898	中煤能源	200	2,436.00	0.00
184	600183	生益科技	100	2,405.00	0.00
185	600219	南山铝业	600	2,346.00	0.00
186	601877	正泰电器	100	2,341.00	0.00
187	601618	中国中冶	700	2,310.00	0.00

188	601319	中国人保	300	2,286.00	0.00
189	600176	中国巨石	200	2,278.00	0.00
190	600515	海南机场	600	2,268.00	0.00
191	600023	浙能电力	400	2,264.00	0.00
192	002736	国信证券	200	2,240.00	0.00
193	600803	新奥股份	100	2,168.00	0.00
194	600426	华鲁恒升	100	2,161.00	0.00
195	600588	用友网络	200	2,146.00	0.00
196	601607	上海医药	100	2,100.00	0.00
197	600362	江西铜业	100	2,064.00	0.00
198	600161	天坛生物	100	2,050.00	0.00
199	300450	先导智能	100	2,002.00	0.00
200	002709	天赐材料	100	1,972.00	0.00
201	601865	福莱特	100	1,969.00	0.00
202	601872	招商轮船	300	1,923.00	0.00
203	601238	广汽集团	200	1,868.00	0.00
204	600018	上港集团	300	1,836.00	0.00
205	000876	新希望	200	1,796.00	0.00
206	002601	龙佰集团	100	1,767.00	0.00
207	600741	华域汽车	100	1,761.00	0.00
208	002007	华兰生物	100	1,685.00	0.00
209	600027	华电国际	300	1,683.00	0.00
210	000983	山西焦煤	200	1,648.00	0.00
211	000301	东方盛虹	200	1,642.00	0.00
212	002603	以岭药业	100	1,601.00	0.00
213	603659	璞泰来	100	1,591.00	0.00
214	600875	东方电气	100	1,589.00	0.00
215	002555	三七互娱	100	1,564.00	0.00
216	601808	中海油服	100	1,525.00	0.00
217	600061	国投资本	200	1,504.00	0.00
218	603806	福斯特	100	1,480.00	0.00
219	600039	四川路桥	200	1,456.00	0.00
220	601699	潞安环能	100	1,436.00	0.00
221	600233	圆通速递	100	1,419.00	0.00
222	600918	中泰证券	200	1,314.00	0.00
223	688009	中国通号	200	1,252.00	0.00
224	002410	广联达	100	1,176.00	0.00
225	600026	中远海能	100	1,160.00	0.00
226	000708	中信特钢	100	1,141.00	0.00
227	600732	爱旭股份	100	1,102.00	0.00
228	601236	红塔证券	100	849.00	0.00
229	000800	一汽解放	100	820.00	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	600519	贵州茅台	1,069,824.00	2.28
2	001979	招商蛇口	851,637.00	1.81
3	600030	中信证券	829,876.00	1.77
4	300308	中际旭创	609,255.00	1.30
5	000651	格力电器	586,541.00	1.25
6	600048	保利发展	474,624.00	1.01
7	688072	拓荆科技	442,438.19	0.94
8	000858	五粮液	435,699.00	0.93
9	601688	华泰证券	433,253.00	0.92
10	301015	百洋医药	366,751.00	0.78
11	688012	中微公司	351,959.84	0.75
12	600690	海尔智家	336,369.00	0.72
13	601088	中国神华	298,230.00	0.64
14	601225	陕西煤业	291,705.00	0.62
15	300033	同花顺	276,391.00	0.59
16	600036	招商银行	273,223.00	0.58
17	688206	概伦电子	269,138.75	0.57
18	688111	金山办公	268,937.55	0.57
19	603383	顶点软件	266,435.00	0.57
20	300705	九典制药	265,595.80	0.57

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。

8.4.2 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	600519	贵州茅台	1,106,927.00	2.36
2	600030	中信证券	956,128.00	2.04
3	001979	招商蛇口	876,708.00	1.87
4	300308	中际旭创	728,633.00	1.55
5	688072	拓荆科技	510,216.52	1.09
6	601688	华泰证券	492,819.00	1.05
7	600048	保利发展	489,199.00	1.04
8	688012	中微公司	477,029.28	1.02
9	000858	五粮液	440,711.00	0.94
10	301015	百洋医药	410,617.00	0.87
11	300033	同花顺	377,140.00	0.80
12	300705	九典制药	299,058.00	0.64

13	603383	顶点软件	279,681.00	0.60
14	300866	安克创新	271,005.00	0.58
15	301004	嘉益股份	270,806.00	0.58
16	688206	概伦电子	269,114.81	0.57
17	000651	格力电器	256,193.00	0.55
18	301269	华大九天	243,364.00	0.52
19	688041	海光信息	241,531.72	0.51
20	688111	金山办公	239,290.51	0.51

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。

8.4.3 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	17,238,762.95
卖出股票收入（成交）总额	14,628,603.40

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。

8.5 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	35,339,534.79	49.03
2	央行票据	-	-
3	金融债券	20,703,890.42	28.72
	其中：政策性金融债	14,447,082.20	20.04
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	6,182,789.38	8.58
10	合计	62,226,214.59	86.33

8.6 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	019749	24 国债 15	206,000	20,759,889.86	28.80
2	230207	23 国开 07	100,000	10,246,342.47	14.22
3	019733	24 国债 02	84,000	8,560,534.36	11.88
4	019740	24 国债 09	42,000	4,256,422.68	5.91
5	210203	21 国开 03	40,000	4,200,739.73	5.83

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.10.1 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。

8.10.2 本期国债期货投资评价

无。

8.11 投资组合报告附注

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

本报告期本基金投资的前十名证券除宁波银行、交通银行、邮政储蓄银行和国家开发银行发行主体外，其他证券的发行主体未出现被监管部门立案调查、或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

根据国家金融监督管理总局宁波监管局公布的行政处罚信息公开表：

宁波银行股份有限公司（简称宁波银行）因违规置换已核销贷款及授信准入管理不到位案由，于 2024 年 6 月 14 日被国家金融监督管理总局宁波监管局处以罚款。

宁波银行股份有限公司（简称宁波银行）因异地非持牌机构整改不到位等案由，于 2024 年 11 月 22 日被国家金融监督管理总局宁波监管局处以罚款。

根据国家金融监督管理总局公布的行政处罚信息公开表：

交通银行股份有限公司（简称交通银行）因安全测试存在薄弱环节等案由，于 2024 年 6 月 3 日被国家金融监督管理总局处以罚款。

根据国家外汇管理局北京市分局发布的行政处罚决定书：

中国邮政储蓄银行股份有限公司（简称邮政储蓄银行）因未按照规定进行国际收支统计申报案由，于 2024 年 12 月 2 日被国家外汇管理局北京市分局处以罚款等。

根据国家金融监督管理总局北京监管局公布的行政处罚信息公开表：

国家开发银行因贷款支付管理不到位、向未取得行政许可的项目发放贷款等案由，于 2024 年

12月27日被国家金融监督管理总局北京监管局处以罚款。

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

8.11.2 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。

8.11.3 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	6,129.41
2	应收清算款	100,450.70
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	4,813,511.64
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,920,091.75

8.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：无。

8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：无。

8.11.6 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。

§9 基金份额持有人信息

9.1 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 (%)
长城集利 债券发起 式A	66	314,613.66	10,000,200.02	48.16	10,764,301.41	51.84
长城集利	819	57,690.44	-	-	47,248,469.46	100.00

债券发起 式 C						
合计	885	76,850.81	10,000,200.02	14.70	58,012,770.87	85.30

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）。

9.2 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	长城集利债券发起式 A	76,913.68	0.3704
	长城集利债券发起式 C	599.90	0.0013
	合计	77,513.58	0.1140

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）。

9.3 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、基金投资和相关部门负责人持有本开放式基金	长城集利债券发起式 A	0~10
	长城集利债券发起式 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	长城集利债券发起式 A	0~10
	长城集利债券发起式 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。

9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况

注：本报告期期末无基金经理兼任投资经理的情况。

9.5 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	10,000,200.02	14.70	10,000,200.02	14.70	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	10,000,200.02	14.70	10,000,200.02	14.70	3 年

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	长城集利债券发起式 A	长城集利债券发起式 C
基金合同生效日 (2023 年 9 月 22 日) 基金份额总额	15,330,392.89	56,063,927.19
本报告期期初基金份额总额	14,746,554.12	31,913,210.20
本报告期基金总申购份额	12,348,332.70	69,809,614.64
减：本报告期基金总赎回份额	6,330,385.39	54,474,355.38
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	20,764,501.43	47,248,469.46

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、基金管理人重大人事变动：

自 2024 年 10 月 28 日起，刘沛先生担任公司首席信息官，邱春杨先生继续担任本公司总经理，不再担任首席信息官。

自 2024 年 10 月 28 日起，崔金宝先生担任公司财务负责人。

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。

11.3 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。

11.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略无改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

1、本期负责审计的会计师事务所由普华永道会计师事务所（特殊普通合伙）改聘为德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）。

2、本基金本报告期应支付给会计师事务所的报酬为人民币捌仟元。

3、目前为本基金提供审计服务的会计师事务所为德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙），为本基金提供审计服务从 2024 年起至本报告期。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 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。

11.6.2 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	31,867,366.35	100.00	20,309.15	100.00	-

注：1、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

本报告期内租用的证券公司交易单元无变化，截止报告期末共 2 个交易单元。

2、专用交易单元的选择标准和程序：

公司设立了券商服务评价协调小组，建立了完善的证券公司选择、协议签署、证券公司服务评价、交易佣金分配等的管理机制和流程，并禁止上述业务环节与证券公司的基金销售规模、保有规模挂钩，且基金销售业务人员不得参与上述业务环节。督察长对上述业务环节进行合规性审

查。

2.1 选择标准

公司选择证券公司参与证券交易的标准主要包含以下几方面：

- (1) 财务状况良好，各项财务指标显示证券公司经营状况稳定；
- (2) 经营行为规范，能满足基金运作的合法、合规需求；
- (3) 合规风控能力较强，内部管理规范、严格，具备健全的内控制度和安全的交易环境，能有效保护客户权益；
- (4) 交易服务能力较强，具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件、交易设施和信息服务；
- (5) 研究服务能力较强，能及时为基金提供高质量的研究咨询服务。

2.2 选择程序

公司选择证券公司参与证券交易的程序主要包括：

- (1) 对拟入库证券公司进行审慎调查，经内部审议通过后将证券公司加入公司证券公司库；
- (2) 按照公司审批流程，与证券公司签订交易单元租用或经纪服务等协议；
- (3) 业务部门与证券公司办理完成交易单元租用、交易系统测试和对接等交易前准备工作，通知各相关部门和托管行启用证券公司交易。

3、本部分的数据统计时间区间与本报告的报告期一致，统计范围仅包括本基金；本公司官网披露的本公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2024 年度）的报告期为 2024 年 7 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日，统计范围为报告期间存续过的所有公募基金，包括报告期间成立、清算、转型的公募基金。

11.7.2 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	80,805,157.01	100.00	364,107,000.00	100.00	-	-

11.8 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告	中国证监会规定报刊及网站	2024年4月26日
4	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
5	长城基金管理有限公司关于终止喜鹊财富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7月18日
6	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7月23日
7	长城基金管理有限公司关于终止永鑫保险销售服务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7月26日
8	长城基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024年10月29日
9	长城基金管理有限公司关于旗下部分基金改聘会计师事务所的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024年11月4日
10	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11月16日
11	长城基金管理有限公司关于北京分公司变更营业场所的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024年12月12日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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	20240101-20241008, 20	10,000,200.02	-	-	10,000,200.02	14.7034

		241028- 20241030					
产品特有风险							
<p>如投资者进行大额赎回，可能存在以下的特有风险：</p> <p>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；</p> <p>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；</p> <p>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；</p> <p>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；</p> <p>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。</p>							

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

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

13.2 存放地点

基金管理人及基金托管人住所

13.3 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

2025年3月29日