

# 长城智盈添益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：上海银行股份有限公司

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。

基金托管人上海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

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b>	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
3.4 过去三年基金的利润分配情况	10
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	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	13
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	14
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	15
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	15
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>15</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	15
5.3 托管人对本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
<b>§ 6 审计报告</b>	<b>16</b>
6.1 审计报告基本信息	16
6.2 审计报告的基本内容	16
<b>§ 7 年度财务报表</b>	<b>18</b>
7.1 资产负债表	18
7.2 利润表	19
7.3 净资产变动表	20
7.4 报表附注	23
<b>§ 8 投资组合报告</b>	<b>53</b>
8.1 期末基金资产组合情况	53

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	53
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 .....	54
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	59
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	60
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 .....	60
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 .....	61
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 .....	61
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 .....	61
8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	61
8.14 投资组合报告附注 .....	61
<b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>62</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	62
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	62
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 .....	63
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 .....	63
9.5 发起式基金发起资金持有份额情况 .....	63
<b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>63</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>64</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	64
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 .....	64
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	64
11.4 基金投资策略的改变 .....	64
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	64
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 .....	64
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	65
11.8 其他重大事件 .....	66
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>67</b>
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 .....	67
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	68
<b>§ 13 备查文件目录 .....</b>	<b>68</b>
13.1 备查文件目录 .....	68
13.2 存放地点 .....	68
13.3 查阅方式 .....	68

## § 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	10,527,647.68 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	10,085,323.80 份	442,323.88 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对个股进行精选。</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	周直毅
	联系电话	0755-29279006	021-68475608
	电子邮箱	zhuhan@ccfund.com.cn	custody@bosc.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	上海市黄浦区中山南路 688 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 37 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	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	中国北京市东城区东长安街 1 号东方广场经贸城安永大楼（即东三办公楼）17 层
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 12 月 26 日(基金合同生效日)-2023 年 12 月 31 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	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	1,516,231.55	32,382.96	3,774.71	16.13
本期利润	1,768,910.28	3,583.44	3,774.71	16.13
加权平均基金份额本期利润	0.0770	0.0264	0.0004	0.0003
本期加权平均净值利润率	7.47%	2.54%	0.04%	0.03%
本期基金份额净值增长率	6.68%	6.49%	0.04%	0.03%
3.1.2 期末数据和指标	2024 年末		2023 年末	
期末可供分配利润	677,588.39	28,819.08	3,774.71	16.13
期末可供分配基金份额利润	0.0672	0.0652	0.0004	0.0003
期末基金资产净值	10,762,912.19	471,142.96	10,067,904.51	48,354.76
期末基金份额净值	1.0672	1.0652	1.0004	1.0003
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	6.72%	6.52%	0.04%	0.03%

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	1.68%	0.27%	2.06%	0.17%	-0.38%	0.10%
过去六个月	4.11%	0.24%	4.00%	0.15%	0.11%	0.09%
过去一年	6.68%	0.22%	7.32%	0.13%	-0.64%	0.09%
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	6.72%	0.22%	7.82%	0.13%	-1.10%	0.09%

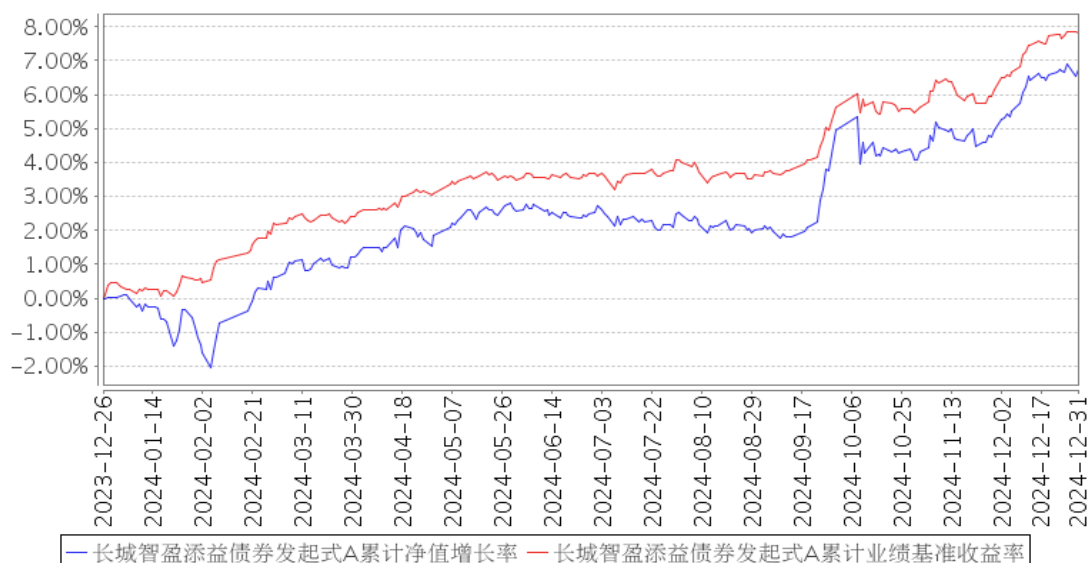
长城智盈添益债券发起式 C

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
过去三个月	1.59%	0.27%	2.06%	0.17%	-0.47%	0.10%
过去六个月	4.11%	0.25%	4.00%	0.15%	0.11%	0.10%
过去一年	6.49%	0.22%	7.32%	0.13%	-0.83%	0.09%
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	6.52%	0.22%	7.82%	0.13%	-1.30%	0.09%

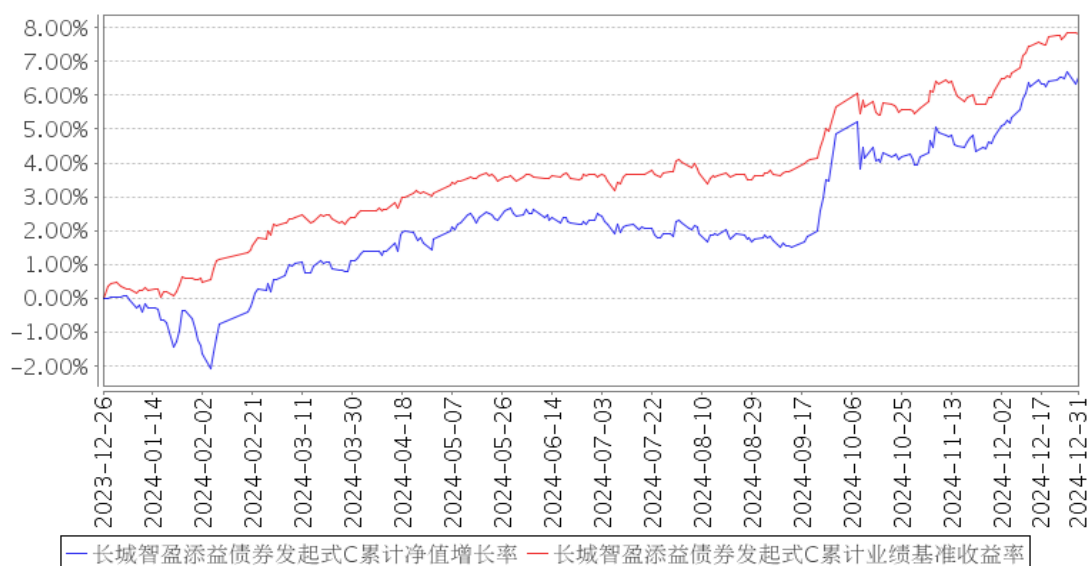


### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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

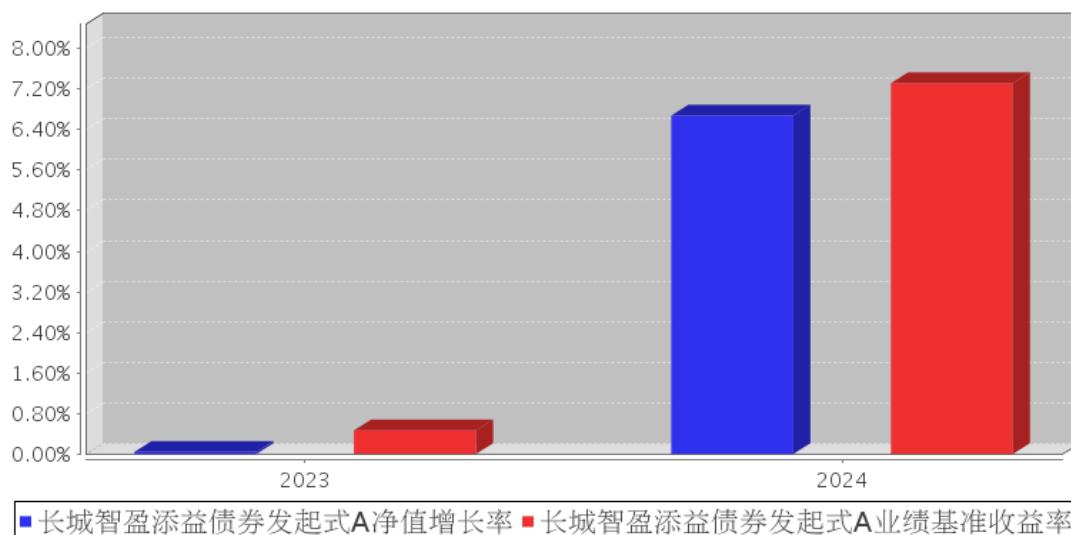


注：①本基金合同规定本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%，投资于股票、可转换债券、可交换债券的比例合计不超过基金资产的 20%，其中港股通标的股票的投资比例为股票资产的 0%-50%。本基金每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

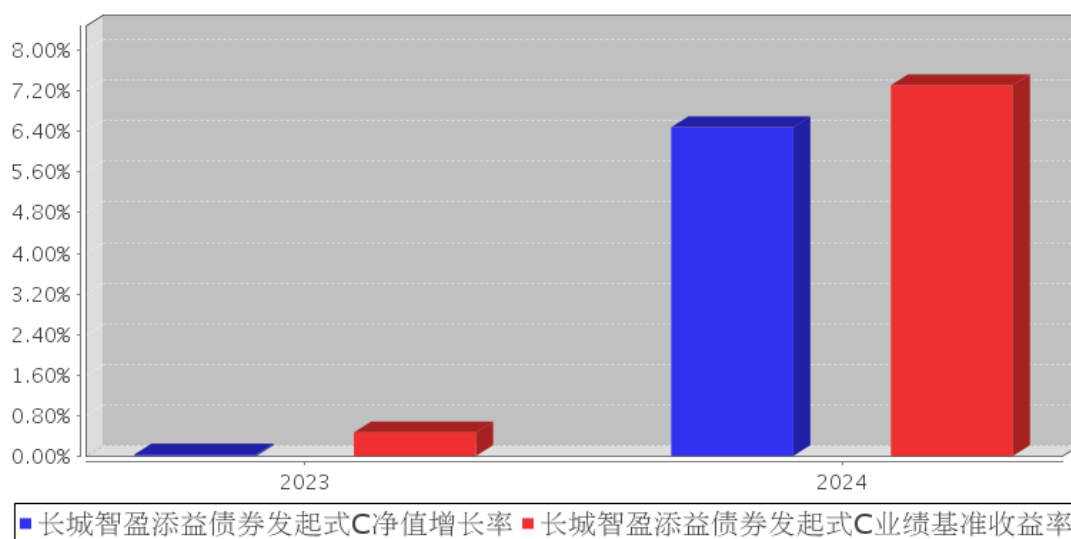
②本基金的建仓期为自基金合同生效之日起六个月内，建仓期满时，各项资产配置比例符合基金合同约定。

### 3.2.3 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

长城智盈添益债券发起式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



长城智盈添益债券发起式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		
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，自 2024 年 11 月至今任“长城中证红利低波动 100 指数型证券投资基金”基金经理。
--	--	--	--	--	---

注：①上述任职日期、离任日期根据公司做出决定的任免日期填写。

②证券从业年限的计算方式遵从从业人员的相关规定。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：无。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

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 年权益股票波动率明显放大，债券市场表现更好。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。A 股主要指数大致分为三个阶段：一是年初市场全面下跌导致微小市值个股流动性风险凸显；二是春节后市场阶段修复到持续走低；三是三季度末政策驱动下显著反弹到年底振荡。风格方面，以沪深 300 为代表的大市值指数显著优于中证 1000 等小盘指数。

报告期内债券配置以场内利率债为主，辅以部分国债期货配置；权益部分仓位维持相对较高，主要由指数增强组合、红利组合、港股组合构成。组合总体延续了资产配置、策略配置、因子配置的三层绝对收益配置策略，期间逐渐增加了港股、黄金类的相关个股配置；总体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；全年产品净值表现稳健，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 基金份额净值为 1.0672 元，本报告期基金份额净值增长率为 6.68%，同期业绩比较基准收益率为 7.32%；

截至本报告期末长城智盈添益债券发起式 C 基金份额净值为 1.0652 元，本报告期基金份额净值增长率为 6.49%，同期业绩比较基准收益率为 7.32%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

近年来出台了新“国九条”等一系列的政策，对于资本市场而言，这些政策更多着眼于长期制度建设与高质量发展，需要一定时间消化与吸收。总体来看，A 股市场定价效率提升、机构投资者参与度提高大趋势已经形成，作为量化投资策略，从构建层面未来需要综合考虑长期政策与交

易结构的变化，引入更多锚定市场长逻辑的有效因子。

资产类别看，A股、债券、港股等各个大类资产的对冲效果不错，在单一资产波动率上升的情况下可以投资组合分散实现较好的风险控制。作为绝对收益导向的产品，未来组合将继续关注大类资产上的量化配置规律研究，淡化仓位择时，力求在多元化投资组合下更好的风险收益比。

#### 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，实时监察关键业务风险点，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

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 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	安永华明（2025）审字第 70015735_H87 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	长城智盈添益债券型发起式证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>我们审计了长城智盈添益债券型发起式证券投资基金财务报表，包括 2024 年 12 月 31 日和 2023 年 12 月 31 日的资产负债表，2024 年度和自 2023 年 12 月 26 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日止期间的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的长城智盈添益债券型发起式证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了长城智盈添益债券型发起式证券投资基金 2024 年 12 月 31 日和 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年度和自 2023 年 12 月 26 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净资产变动情况。</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，我们独立于长城智盈添益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>
其他信息	<p>长城智盈添益债券型发起式证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括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</p>



	<p>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>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，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，管理层负责评估长城智盈添益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，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督长城智盈添益债券型发起式证券投资基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<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，就可能对长城智盈添益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智盈添益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	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	贺耀	黄拥璇
会计师事务所的地址	中国 北京	
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：长城智盈添益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
<b>资产：</b>			
货币资金	7.4.7.1	19,343,567.45	112,669.43
结算备付金		20,463.43	-
存出保证金		50,002.36	-
交易性金融资产	7.4.7.2	11,195,044.65	-
其中：股票投资		2,025,225.26	-
基金投资		-	-
债券投资		9,169,819.39	-
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	-276.16	10,004,561.64
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		7,662,813.12	-
应收股利		3,993.60	-
应收申购款		220,421.04	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	-
资产总计		38,496,029.49	10,117,231.07
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2023 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-

衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		1,100,000.00	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		26,114,782.90	-
应付管理人报酬		18,235.46	831.25
应付托管费		3,039.26	138.55
应付销售服务费		24.93	2.00
应付投资顾问费		-	-
应交税费		5,225.94	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	20,665.85	-
负债合计		27,261,974.34	971.80
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.10	10,527,647.68	10,112,468.43
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	706,407.47	3,790.84
净资产合计		11,234,055.15	10,116,259.27
负债和净资产总计		38,496,029.49	10,117,231.07

注：（1）报告截止日 2024 年 12 月 31 日，基金份额总额 10,527,647.68 份，其中，下属 A 类基金份额净值人民币 1.0672 元，基金份额总额 10,085,323.8 份；下属 C 类基金份额净值人民币 1.0652 元，基金份额总额 442,323.88 份。

（2）本基金基金合同于 2023 年 12 月 26 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 12 月 26 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 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 12 月 26 日 (基金合同生效日) 至 2023 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		1,956,755.54	4,762.64
1. 利息收入		14,386.54	4,762.64
其中：存款利息收入	7.4.7.13	2,774.64	201.00
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		11,611.90	4,561.64

其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		1,718,278.59	-
其中：股票投资收益	7.4.7.14	473,706.82	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	943,800.00	-
资产支持证券投资	7.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	145,577.07	-
股利收益	7.4.7.19	155,194.70	-
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	224,082.45	-
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	7.96	-
<b>减：二、营业总支出</b>		184,261.82	971.80
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	141,083.82	831.25
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	23,514.04	138.55
3. 销售服务费		407.53	2.00
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	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		727.51	-
8. 其他费用	7.4.7.23	18,528.92	-
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		1,772,493.72	3,790.84
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		1,772,493.72	3,790.84
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		1,772,493.72	3,790.84

### 7.3 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 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	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)	415,179.25	-	702,616.63	1,117,795.88
(一)、综合收益总额	-	-	1,772,493.72	1,772,493.72
(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)	415,179.25	-	-1,069,877.09	-654,697.84
其中：1. 基金申购款	27,262,411.08	-	703,846.38	27,966,257.46
2. 基金赎回款	-26,847,231.83	-	-1,773,723.47	-28,620,955.30
(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	10,527,647.68	-	706,407.47	11,234,055.15
项目	上年度可比期间 2023 年 12 月 26 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	10,112,468.43	-	-	10,112,468.43
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-	-	3,790.84	3,790.84
(一)、综合收益总额	-	-	3,790.84	3,790.84
(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)	-	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-	-
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(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	10,112,468.43	-	3,790.84	10,116,259.27

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》准予注册，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%。

#### 7.4.2 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、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 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 7.4.3 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 12 月 31 日和 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年度和自 2023 年 12 月 26 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。惟上年度可比期间财务报表的实际编制期间系自 2023 年 12 月 26 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 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。

##### 7.4.4.3 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。

#### 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

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。

#### 7.4.4.5 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。

#### 7.4.4.6 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。

#### 7.4.4.7 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。

#### 7.4.4.8 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）”。

#### 7.4.4.9 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务工具投资的，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) 本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本基金；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。

#### 7.4.4.10 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。

#### 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。基金收益分配后任一类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的任一类基金份额净值减去该类每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

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。

#### 7.4.4.13 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。

#### 7.4.4.14 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。

#### 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

本基金本报告期无需要说明的会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计估计变更。

##### 7.4.5.3 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。

#### 7.4.6 税项

##### (1) 增值税及附加

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充

通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入。

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

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。对证券投资基金在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。增值税应税行为的销售额根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定确定。

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按 7%、3%和 2%的比例缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

## （2）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[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。

## （3）个人所得税

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

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，（如有）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，（如有）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。

#### （4）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%，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、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

#### （5）境外投资

本基金运作过程中如有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。

### 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	19,343,567.45	112,669.43
等于：本金	19,343,352.50	112,468.43
加：应计利息	214.95	201.00
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	19,343,567.45	112,669.43

## 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		2,012,419.87	-	2,025,225.26	12,805.39
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	8,883,539.25	131,459.39	9,169,819.39	154,820.75
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	8,883,539.25	131,459.39	9,169,819.39	154,820.75
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		10,895,959.12	131,459.39	11,195,044.65	167,626.14
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		-	-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		-	-	-	-

## 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

单位：人民币元

项目	本期末 2024年12月31日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	1,126,250.00	-	-	-
	1,126,250.00	-	-	-



其中： 国债期 货投资				
货币衍 生工具	-	-	-	-
权益衍 生工具	-	-	-	-
其他衍 生工具	-	-	-	-
合计	1,126,250.00	-	-	-
项目	上年度末 2023 年 12 月 31 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍 生工具	-	-	-	-
货币衍 生工具	-	-	-	-
权益衍 生工具	-	-	-	-
其他衍 生工具	-	-	-	-
合计	-	-	-	-

注：衍生金融资产项下的股指期货投资期末合同/名义金额为初始合约价值。

#### 7.4.7.3.2 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
TL2506	30 年期国债 2506	1.00	1,184,400.00	58,150.00
合计				58,150.00
减：可抵销期货 暂收款				58,150.00
净额				-

注：注：（1）衍生金融资产项下的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。

（2）买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

#### 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	-276.16	-
银行间市场	-	-
合计	-276.16	-
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	10,004,561.64	-
银行间市场	-	-
合计	10,004,561.64	-

## 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

## 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	2,665.85	-
其中：交易所市场	2,665.85	-
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提审计费	18,000.00	-
合计	20,665.85	-

#### 7.4.7.10 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12月31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	24,462,837.21	24,462,837.21
本期赎回（以“-”号填列）	-24,441,643.21	-24,441,643.21
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	10,085,323.80	10,085,323.80

##### 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12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	48,338.63	48,338.63
本期申购	2,799,573.87	2,799,573.87
本期赎回（以“-”号填列）	-2,405,588.62	-2,405,588.62
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	442,323.88	442,323.88

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	1,516,231.55	252,678.73	1,768,910.28
本期基金份额交易产生的变动数	-319,234.64	-775,861.96	-1,095,096.60
其中：基金申购款	274,065.14	311,703.96	585,769.10
基金赎回款	-593,299.78	-1,087,565.92	-1,680,865.70
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,200,771.62	-523,183.23	677,588.39

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	32,382.96	-28,799.52	3,583.44
本期基金份额交易产生的变动数	18,554.68	6,664.83	25,219.51
其中：基金申购款	51,374.40	66,702.88	118,077.28
基金赎回款	-32,819.72	-60,038.05	-92,857.77
本期已分配利润	-	-	-
本期末	50,953.77	-22,134.69	28,819.08

## 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12月26日（基金合同生效日）至2023年12月31日
活期存款利息收入	2,011.30	201.00
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	689.11	-

其他	74.23	-
合计	2,774.64	201.00

#### 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12月26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	473,706.82	-
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	473,706.82	-

##### 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12月26日（基金 合同生效日）至2023年12月31 日
卖出股票成交总 额	13,165,628.32	-
减：卖出股票成本 总额	12,667,831.41	-
减：交易费用	24,090.09	-
买卖股票差价收 入	473,706.82	-

##### 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	上年度可比期间
----	----	---------

	2024年1月1日至2024年12月31日	2023年12月26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	403,182.75	-
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	540,617.25	-
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	943,800.00	-

#### 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12月26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	25,660,197.75	-
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	24,813,918.75	-
减：应计利息总额	305,661.75	-
减：交易费用	-	-
买卖债券差价收入	540,617.25	-

#### 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

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12月26日（基金合 同生效日）至2023年12月 31日
国债期货投资收益	145,577.07	-

## 7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月 31日	上年度可比期间 2023年12月26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	155,194.70	-
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	155,194.70	-

## 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 12 月 26 日（基 金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	167,626.14	-
股票投资	12,805.39	-
债券投资	154,820.75	-
资产支持证券投资	-	-
基金投资	-	-
贵金属投资	-	-
其他	-	-
2. 衍生工具	58,150.00	-
权证投资	-	-
期货投资	58,150.00	-
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价 值变动产生的预估增值税	1,693.69	-
合计	224,082.45	-

#### 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 12 月 26 日（基 金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	7.96	-
合计	7.96	-

#### 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 12 月 26 日（基金合同生效 日）至 2023 年 12 月 31 日
审计费用	18,000.00	-
信息披露费	-	-
证券出借违约金	-	-
银行费用	504.00	-
深港通_证券组合费	24.92	-
合计	18,528.92	-

#### 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，本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准日，本基金无需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
上海银行股份有限公司（“上海银行”）	基金托管人
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：以下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12月26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	27,845,879.60	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12月26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	58,651,994.00	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12月26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	34,400,000.00	100.00	10,000,000.00	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	14,098.39	100.00	2,665.85	100.00
关联方名称	上年度可比期间 2023年12月26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（%）
-	-	-	-	-

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：无）。

（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12月26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	141,083.82	831.25
其中：应支付销售机构的客户维护费	48,490.95	248.27

应支付基金管理人的净管理费	92,592.87	582.98
---------------	-----------	--------

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：

$$H = E \times 0.60\% \div \text{当年天数}$$

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

#### 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 12 月 26 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	23,514.04	138.55

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：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

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

#### 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	-	200.93	200.93
合计	-	200.93	200.93
获得销售服务费的各关 联方名称	上年度可比期间 2023 年 12 月 26 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	-	0.35	0.35
合计	-	0.35	0.35

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	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 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	95.0059%	-
项目	上年度可比期间 2023 年 12 月 26 日（基金合同生	上年度可比期间 2023 年 12 月 26 日（基金合

	效日)至 2023 年 12 月 31 日	同生效日)至 2023 年 12 月 31 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	10,001,889.08	-
报告期初持有的基金份额	-	-
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	98.9065%	-

#### 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 12 月 26 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
上海银行	19,343,567.45	2,011.30	112,669.43	201.00

注:本基金的活期银行存款由基金托管人上海银行保管,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

#### 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

注：无。

#### 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 1,100,000.00 元，于 2025 年 01 月 02 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

#### 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。本基金持有一家公司发行的证券（同一家公司在内地和香港同时上市的 A 股和 H 股合并计算），其市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券（同一家公司在内地和香港同时上市的 A+H 股合并计算），不超过该证券的 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。

#### 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“期末本基金持有的流通受限证券”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“期末债券正回购交易中作为抵押的债券”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

利率风险是指基金的财务状况和现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金、债券投资及买入返售金融资产等。本基金管理

人每日对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

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

#### 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	19,343,567.45	-	-	-	-	-	19,343,567.45
结算备付金	20,463.43	-	-	-	-	-	20,463.43
存出保证金	50,002.36	-	-	-	-	-	50,002.36
交易性金融 资产	-	-1,506,566.71	17,663,252.68	-	-	2,025,225.26	11,195,044.65
买入返售金 融资产	-276.16	-	-	-	-	-	-276.16
应收股利	-	-	-	-	-	3,993.60	3,993.60
应收申购款	-	-	-	-	-	220,421.04	220,421.04
应收清算款	-	-	-	-	-	7,662,813.12	7,662,813.12
资产总计	19,413,757.08	-1,506,566.71	17,663,252.68	-	-	9,912,453.02	38,496,029.49
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	26,114,782.90	26,114,782.90
应付管理人 报酬	-	-	-	-	-	18,235.46	18,235.46
应付托管费	-	-	-	-	-	3,039.26	3,039.26
卖出回购金 融资产款	1,100,000.00	-	-	-	-	-	1,100,000.00
应付销售服 务费	-	-	-	-	-	24.93	24.93
应交税费	-	-	-	-	-	5,225.94	5,225.94
其他负债	-	-	-	-	-	20,665.85	20,665.85
负债总计	1,100,000.00	-	-	-	-	26,161,974.34	27,261,974.34
利率敏感度 缺口	18,313,757.08	-1,506,566.71	17,663,252.68	-	-	-	-
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	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	-	-	-	-		

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）
	市场利率下降 25 个基点	73,197.80	-
	市场利率上升 25 个基点	-72,331.82	-

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，将对净资产产生不利影响；港币对人民币的汇率大幅波动也将加大净资产波动的幅度。

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	-	672,249.48	-	672,249.48

资产合计	-	672,249.48	-	672,249.48
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	672,249.48	-	672,249.48
项目	上年度末 2023 年 12 月 31 日			
	美元折合人民币元	港币折合人民币元	其他币种折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
资产合计	-	-	-	-
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	-	-	-

#### 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%	33,612.47	-
	所有外币均相对人民币贬值 5%	-33,612.47	-

#### 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	2,025,225.26	18.03	-	-
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	9,169,819.39	81.63	-	-
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	11,195,044.65	99.65	-	-

#### 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%	80,249.55	-
	沪深 300 指数下降 5%	-80,249.55	-

#### 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	2,025,225.26	-
第二层次	9,169,819.39	-
第三层次	-	-
合计	11,195,044.65	-

###### 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。

###### 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	2,025,225.26	5.26
	其中：股票	2,025,225.26	5.26
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	9,169,819.39	23.82
	其中：债券	9,169,819.39	23.82
	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	-276.16	-0.00
	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	19,364,030.88	50.30
8	其他各项资产	7,937,230.12	20.62
9	合计	38,496,029.49	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 672,249.48 元，占基金资产净值的比例为 5.98%。

## 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	28,025.00	0.25
B	采矿业	61,830.00	0.55
C	制造业	808,048.80	7.19

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	152,804.80	1.36
E	建筑业	22,529.00	0.20
F	批发和零售业	75,425.28	0.67
G	交通运输、仓储和邮政业	98,140.40	0.87
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	16,148.00	0.14
J	金融业	85,103.50	0.76
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	4,921.00	0.04
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,352,975.78	12.04

### 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	253,734.96	2.26
消费者非必需品	38,152.85	0.34
消费者常用品	-	-
能源	62,229.89	0.55
金融	86,436.57	0.77
医疗保健	-	-
工业	-	-
信息科技	-	-
电信服务	231,695.21	2.06
公用事业	-	-
房地产	-	-
合计	672,249.48	5.98

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	01818	招金矿业	25,000	253,734.96	2.26
2	00700	腾讯控股	600	231,695.21	2.06
3	01088	中国神华	2,000	62,229.89	0.55

3	601088	中国神华	200	8,696.00	0.08
4	603587	地素时尚	4,200	52,920.00	0.47
5	600251	冠农股份	7,200	52,488.00	0.47
6	02328	中国财险	4,000	45,413.00	0.40
7	600821	金开新能	8,300	44,820.00	0.40
8	01288	农业银行	10,000	41,023.57	0.37
9	09988	阿里巴巴-SW	500	38,152.85	0.34
10	600710	苏美达	3,800	35,340.00	0.31
11	603757	大元泵业	1,600	32,080.00	0.29
12	002275	桂林三金	2,100	31,689.00	0.28
13	601216	君正集团	5,600	29,456.00	0.26
14	000088	盐田港	5,800	28,246.00	0.25
15	600598	北大荒	1,900	28,025.00	0.25
16	600987	航民股份	4,000	27,760.00	0.25
17	000708	中信特钢	2,400	27,384.00	0.24
18	603299	苏盐井神	2,400	26,736.00	0.24
19	600916	中国黄金	3,100	26,722.00	0.24
20	600196	复星医药	1,000	24,850.00	0.22
21	000848	承德露露	2,700	24,219.00	0.22
22	002216	三全食品	2,000	24,000.00	0.21
23	600572	康恩贝	4,800	22,368.00	0.20
24	601186	中国铁建	2,300	21,091.00	0.19
25	600905	三峡能源	4,600	20,102.00	0.18
26	600886	国投电力	1,200	19,944.00	0.18
27	600479	千金药业	1,800	19,224.00	0.17
28	002831	裕同科技	700	18,970.00	0.17
29	000538	云南白药	300	17,985.00	0.16
30	603195	公牛集团	245	17,208.80	0.15
31	600575	淮河能源	4,300	17,071.00	0.15
32	002352	顺丰控股	400	16,120.00	0.14
33	002032	苏泊尔	300	15,963.00	0.14
34	600309	万华化学	200	14,270.00	0.13
35	601601	中国太保	400	13,632.00	0.12
36	000895	双汇发展	500	12,980.00	0.12
37	600660	福耀玻璃	200	12,480.00	0.11
38	600941	中国移动	100	11,816.00	0.11
39	601225	陕西煤业	500	11,630.00	0.10
40	601166	兴业银行	600	11,496.00	0.10
41	002978	安宁股份	400	11,368.00	0.10
42	601318	中国平安	200	10,530.00	0.09
43	000581	威孚高科	500	9,440.00	0.08
44	002294	信立泰	300	9,279.00	0.08
45	002415	海康威视	300	9,210.00	0.08

46	002884	凌霄泵业	500	9,135.00	0.08
47	000651	格力电器	200	9,090.00	0.08
48	000429	粤高速 A	600	8,820.00	0.08
49	002287	奇正藏药	400	8,560.00	0.08
50	002304	洋河股份	100	8,353.00	0.07
51	600893	航发动力	200	8,290.00	0.07
52	000983	山西焦煤	1,000	8,240.00	0.07
53	600600	青岛啤酒	100	8,092.00	0.07
54	605368	蓝天燃气	700	8,001.00	0.07
55	603589	口子窖	200	7,848.00	0.07
56	600295	鄂尔多斯	800	7,808.00	0.07
57	600377	宁沪高速	500	7,655.00	0.07
58	000333	美的集团	100	7,522.00	0.07
59	603886	元祖股份	500	7,210.00	0.06
60	600737	中粮糖业	700	7,147.00	0.06
61	002003	伟星股份	500	7,085.00	0.06
62	600096	云天化	300	6,690.00	0.06
63	605377	华旺科技	500	6,675.00	0.06
64	002001	新和成	300	6,591.00	0.06
65	605333	沪光股份	200	6,526.00	0.06
66	000423	东阿阿胶	100	6,272.00	0.06
67	601857	中国石油	700	6,258.00	0.06
68	600023	浙能电力	1,100	6,226.00	0.06
69	600362	江西铜业	300	6,192.00	0.06
70	600346	恒力石化	400	6,140.00	0.05
71	600887	伊利股份	200	6,036.00	0.05
72	600900	长江电力	200	5,910.00	0.05
73	600642	申能股份	600	5,694.00	0.05
74	000768	中航西飞	200	5,648.00	0.05
75	002014	永新股份	500	5,480.00	0.05
76	002601	龙佰集团	300	5,301.00	0.05
77	000026	飞亚达	500	5,185.00	0.05
78	600461	洪城环境	500	4,975.00	0.04
79	002027	分众传媒	700	4,921.00	0.04
80	002142	宁波银行	200	4,862.00	0.04
81	300146	汤臣倍健	400	4,820.00	0.04
82	600273	嘉化能源	600	4,782.00	0.04
83	600585	海螺水泥	200	4,756.00	0.04
84	600901	江苏金租	900	4,698.00	0.04
85	002249	大洋电机	800	4,696.00	0.04
86	601877	正泰电器	200	4,682.00	0.04
87	601899	紫金矿业	300	4,536.00	0.04
88	002705	新宝股份	300	4,500.00	0.04



89	600929	雪天盐业	800	4,472.00	0.04
90	002690	美亚光电	300	4,446.00	0.04
91	600926	杭州银行	300	4,383.00	0.04
92	600803	新奥股份	200	4,336.00	0.04
93	601728	中国电信	600	4,332.00	0.04
94	002508	老板电器	200	4,286.00	0.04
95	601607	上海医药	200	4,200.00	0.04
96	603053	成都燃气	400	4,012.00	0.04
97	000513	丽珠集团	100	3,800.00	0.03
98	600582	天地科技	600	3,708.00	0.03
99	600420	国药现代	300	3,582.00	0.03
100	600741	华域汽车	200	3,522.00	0.03
101	601369	陕鼓动力	400	3,480.00	0.03
102	601398	工商银行	500	3,460.00	0.03
103	600998	九州通	674	3,450.88	0.03
104	600674	川投能源	200	3,450.00	0.03
105	600167	联美控股	600	3,438.00	0.03
106	601838	成都银行	200	3,422.00	0.03
107	600380	健康元	300	3,381.00	0.03
108	002267	陕天然气	400	3,380.00	0.03
109	605183	确成股份	200	3,370.00	0.03
110	600989	宝丰能源	200	3,368.00	0.03
111	601000	唐山港	700	3,297.00	0.03
112	603515	欧普照明	200	3,290.00	0.03
113	600867	通化东宝	400	3,224.00	0.03
114	600795	国电电力	700	3,206.00	0.03
115	002034	旺能环境	200	3,100.00	0.03
115	601919	中远海控	200	3,100.00	0.03
116	601958	金钼股份	300	3,018.00	0.03
117	002422	科伦药业	100	2,993.00	0.03
118	002078	太阳纸业	200	2,974.00	0.03
119	600566	济川药业	100	2,908.00	0.03
120	601222	林洋能源	400	2,828.00	0.03
121	600019	宝钢股份	400	2,800.00	0.02
122	001965	招商公路	200	2,790.00	0.02
123	600548	深高速	200	2,696.00	0.02
124	000902	新洋丰	200	2,608.00	0.02
125	300059	东方财富	100	2,582.00	0.02
126	600016	民生银行	600	2,478.00	0.02
127	000830	鲁西化工	200	2,338.00	0.02
128	601328	交通银行	300	2,331.00	0.02
129	002053	云南能投	200	2,280.00	0.02
130	002911	佛燃能源	170	2,148.80	0.02

131	601009	南京银行	200	2,130.00	0.02
132	600000	浦发银行	200	2,058.00	0.02
133	600350	山东高速	200	2,056.00	0.02
134	002543	万和电气	200	2,048.00	0.02
135	600483	福能股份	200	1,994.00	0.02
136	600919	江苏银行	200	1,964.00	0.02
137	601952	苏垦农发	200	1,958.00	0.02
138	600971	恒源煤电	200	1,882.00	0.02
139	002550	千红制药	300	1,860.00	0.02
140	601816	京沪高铁	300	1,848.00	0.02
141	601169	北京银行	300	1,845.00	0.02
142	603689	皖天然气	200	1,796.00	0.02
143	600177	雅戈尔	200	1,780.00	0.02
144	601939	建设银行	200	1,758.00	0.02
145	000544	中原环保	200	1,746.00	0.02
146	601825	沪农商行	200	1,702.00	0.02
147	601766	中国中车	200	1,676.00	0.01
148	601319	中国人保	200	1,524.00	0.01
149	600820	隧道股份	200	1,438.00	0.01
150	600348	华阳股份	200	1,418.00	0.01
151	601998	中信银行	200	1,396.00	0.01
152	600236	桂冠电力	200	1,360.00	0.01
153	601006	大秦铁路	200	1,356.00	0.01
154	600028	中国石化	200	1,336.00	0.01
155	603993	洛阳钼业	200	1,330.00	0.01
156	600098	广州发展	200	1,284.00	0.01
157	002752	昇兴股份	200	1,270.00	0.01
158	600020	中原高速	300	1,266.00	0.01
159	000937	冀中能源	200	1,264.00	0.01
160	601997	贵阳银行	200	1,200.00	0.01
161	601818	光大银行	300	1,161.00	0.01
162	000650	仁和药业	200	1,152.00	0.01
163	601658	邮储银行	200	1,136.00	0.01
164	601128	常熟银行	150	1,135.50	0.01
165	601665	齐鲁银行	200	1,118.00	0.01
166	601988	中国银行	200	1,102.00	0.01
167	600578	京能电力	300	1,056.00	0.01
168	600368	五洲交通	220	1,049.40	0.01
169	002083	孚日股份	200	978.00	0.01
170	600968	海油发展	200	854.00	0.01
171	003816	中国广核	200	826.00	0.01
172	600219	南山铝业	200	782.00	0.01
173	601018	宁波港	200	770.00	0.01

174	600694	大商股份	20	527.40	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	01818	招金矿业	316,593.91	3.13
2	00700	腾讯控股	299,669.10	2.96
3	02328	中国财险	257,867.73	2.55
4	601088	中国神华	118,406.00	1.17
4	01088	中国神华	94,827.20	0.94
5	601919	中远海控	196,522.00	1.94
6	601318	中国平安	167,859.00	1.66
7	601166	兴业银行	158,670.00	1.57
8	601328	交通银行	158,073.00	1.56
9	600295	鄂尔多斯	142,419.00	1.41
10	600900	长江电力	141,907.00	1.40
11	601225	陕西煤业	134,590.00	1.33
12	601816	京沪高铁	131,016.00	1.30
13	601398	工商银行	130,802.00	1.29
14	600039	四川路桥	128,149.00	1.27
15	000937	冀中能源	127,158.00	1.26
16	600519	贵州茅台	126,392.00	1.25
17	000895	双汇发展	118,292.00	1.17
18	600036	招商银行	115,731.00	1.14
19	600887	伊利股份	114,855.00	1.14
20	01816	中广核电力	90,839.70	0.90
20	003816	中国广核	18,560.00	0.18

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	601919	中远海控	237,384.00	2.35
2	02328	中国财险	230,530.61	2.28
3	601318	中国平安	199,659.00	1.97
4	601328	交通银行	161,113.00	1.59
5	601166	兴业银行	156,114.00	1.54
6	600519	贵州茅台	154,199.00	1.52
7	601088	中国神华	115,070.00	1.14
7	01088	中国神华	31,688.54	0.31
8	600039	四川路桥	141,820.00	1.40

9	600900	长江电力	140,061.00	1.38
10	601398	工商银行	139,737.00	1.38
11	601816	京沪高铁	133,264.00	1.32
12	600295	鄂尔多斯	131,326.00	1.30
13	600036	招商银行	126,563.00	1.25
14	600887	伊利股份	122,674.00	1.21
15	000937	冀中能源	118,551.00	1.17
16	600177	雅戈尔	115,297.00	1.14
17	300750	宁德时代	114,439.00	1.13
18	601225	陕西煤业	113,047.00	1.12
19	000895	双汇发展	109,985.00	1.09
20	600273	嘉化能源	103,100.00	1.02

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	14,680,251.28
卖出股票收入（成交）总额	13,165,628.32

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	9,169,819.39	81.63
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	9,169,819.39	81.63

#### 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

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	102257	国债 2401	29,000	3,078,033.78	27.40
2	019739	24 国债 08	25,000	2,606,147.26	23.20
3	019758	24 国债 21	15,000	1,506,566.71	13.41

4	019708	23 国债 15	10,000	1,048,178.08	9.33
5	019736	24 国债 05	5,000	513,910.00	4.57

### 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

本基金投资国债期货以套期保值为目的，选择流动性好、交易活跃的期货合约进行交易。本基金力争通过国债期货，提高利率债交易效率，调控组合久期，控制组合回撤，并取得了一定效果。本报告期内，本基金投资国债期货符合既定的投资政策和投资目标。

## 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

本报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到过公开谴责、处罚。

### 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	50,002.36
2	应收清算款	7,662,813.12
3	应收股利	3,993.60
4	应收利息	-
5	应收申购款	220,421.04
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	7,937,230.12
---	----	--------------

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 (%)
长城智盈添益债券发起式 A	23	438,492.34	10,001,889.08	99.17	83,434.72	0.83
长城智盈添益债券发起式 C	140	3,159.46	-	-	442,323.88	100.00
合计	163	64,586.80	10,001,889.08	95.01	525,758.60	4.99

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	长城智盈添益债券发起式 A	49,880.29	0.4946
	长城智盈添益债券发起式 C	8,000.00	1.8086
	合计	57,880.29	0.5498

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。

### 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	10,001,889.08	95.01	10,001,889.08	95.01	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	95.01	10,001,889.08	95.01	3 年

## § 10 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)	10,064,129.80	48,338.63

日) 基金份额总额		
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	24,462,837.21	2,799,573.87
减: 本报告期基金总赎回份额	24,441,643.21	2,405,588.62
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	10,085,323.80	442,323.88

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 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

### 11.4 基金投资策略的改变

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

1、本期未有改聘会计师事务所。

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壹万捌仟元。

3、目前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),为本基金提供审计服务自本基金合同生效日持续至本报告期。

### 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	27,845,879.60	100.00	14,098.39	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、选择证券公司参与证券交易的标准和程序：

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	58,651,994.00	100.00	34,400,000.00	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告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 4 月 26 日
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
7	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
8	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	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 7 月 23 日

	告		
9	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
10	长城基金管理有限公司关于旗下部分基金新增招商银行股份有限公司为销售机构并参加费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 10 月 14 日
11	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
12	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
13	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	20240101-20241231	10,001,889.08	-	-	10,001,889.08	95.0059
个人	1	20240624-20241229	-	14,648,891.49	14,648,891.49	-	-
	2	20240624-20241229	-	9,765,602.11	9,765,602.11	-	-

#### 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。

## 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) 《长城智盈添益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