

# 长城积极增利债券型证券投资基金 2022 年第 2 季度报告

2022 年 6 月 30 日

基金管理人：长城基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：2022 年 7 月 21 日

## § 1 重要提示

本基金管理人的董事会及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责任。

本基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 07 月 19 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 04 月 01 日起至 2022 年 06 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

|                 |  |                 |
|-----------------|--|-----------------|
| 基金简称            | 长城积极增利债券   |                 |
| 基金主代码           | 200013   |                 |
| 基金运作方式          | 契约型开放式   |                 |
| 基金合同生效日         | 2011 年 4 月 12 日  |                 |
| 报告期末基金份额总额      | 58,830,525.36 份  |                 |
| 投资目标            | 本基金将在控制组合风险和保持资产流动性的前提下，力争获得超越业绩比较基准的收益，实现基金资产的长期增值。   |                 |
| 投资策略            | 本基金将采用“自上而下”的策略进行基金的大类资产配置，通过综合分析宏观经济形势、财政政策、货币政策、债券市场券种供求关系及资金供求关系，主动判断市场利率变化趋势，确定和动态调整固定收益类资产的平均久期及债券资产配置。 |                 |
| 业绩比较基准          | 中债综合财富指数   |                 |
| 风险收益特征          | 本基金为债券型基金，其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。本基金为中低风险、中低收益的基金产品。  |                 |
| 基金管理人           | 长城基金管理有限公司   |                 |
| 基金托管人           | 中国建设银行股份有限公司   |                 |
| 下属分级基金的基金简称     | 长城积极增利 A   | 长城积极增利 C        |
| 下属分级基金的交易代码     | 200013   | 200113          |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 38,262,656.06 份  | 20,567,869.30 份 |

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标          | 报告期（2022 年 4 月 1 日-2022 年 6 月 30 日） |               |
|-----------------|-------------------------------------|---------------|
|                 | 长城积极增利 A                            | 长城积极增利 C      |
| 1. 本期已实现收益      | 298,874.42                          | 244,612.69    |
| 2. 本期利润         | 639,602.82                          | 508,918.71    |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0162                              | 0.0131        |
| 4. 期末基金资产净值     | 47,022,506.41                       | 29,915,723.75 |
| 5. 期末基金份额净值     | 1.2289                              | 1.4545        |

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。

#### 3.2 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

长城积极增利 A

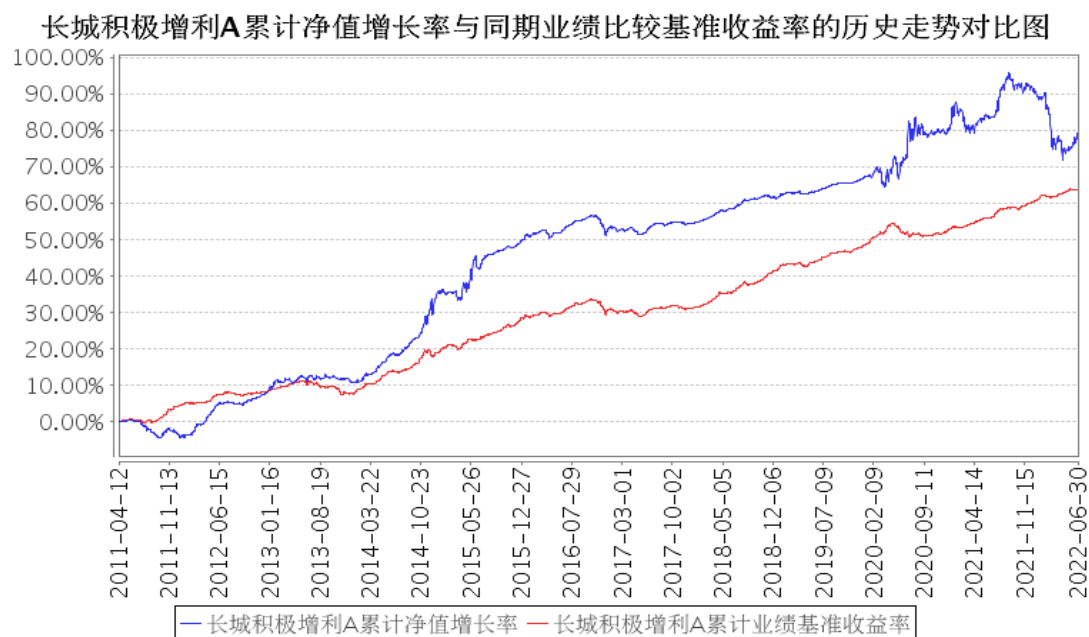
| 阶段         | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③    | ②-④   |
|------------|--------|-----------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月      | 1.42%  | 0.38%     | 1.05%      | 0.04%         | 0.37%  | 0.34% |
| 过去六个月      | -6.05% | 0.45%     | 1.83%      | 0.05%         | -7.88% | 0.40% |
| 过去一年       | -2.40% | 0.40%     | 4.78%      | 0.05%         | -7.18% | 0.35% |
| 过去三年       | 9.36%  | 0.38%     | 13.20%     | 0.07%         | -3.84% | 0.31% |
| 过去五年       | 16.60% | 0.29%     | 25.19%     | 0.06%         | -8.59% | 0.23% |
| 自基金合同生效起至今 | 79.24% | 0.25%     | 63.77%     | 0.08%         | 15.47% | 0.17% |

长城积极增利 C

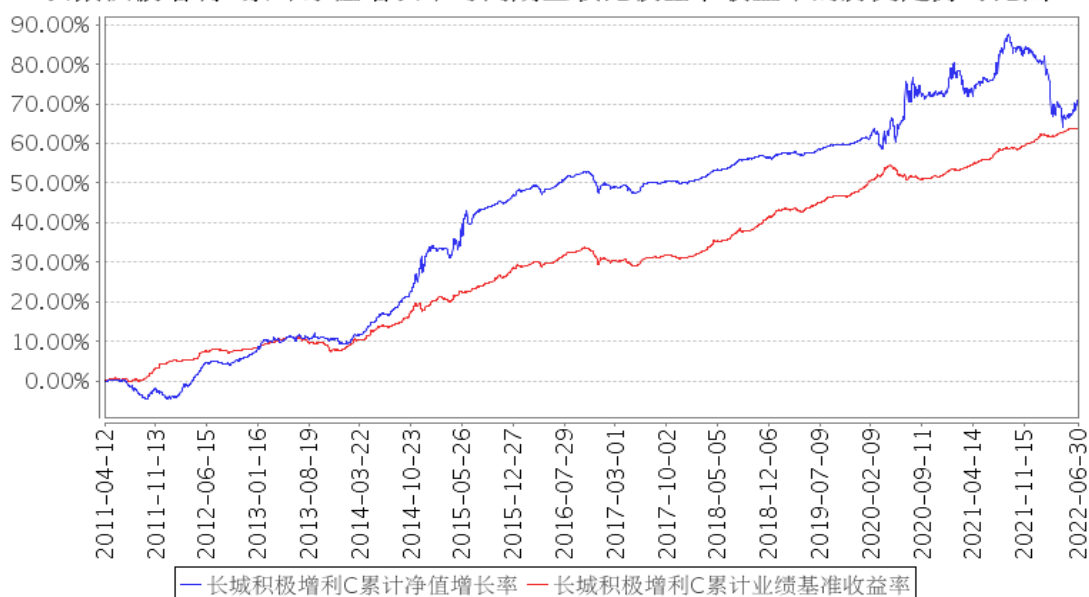
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|----|--------|-----------|------------|---------------|-----|-----|
|----|--------|-----------|------------|---------------|-----|-----|

|            |        |       |        | ④     |         |       |
|------------|--------|-------|--------|-------|---------|-------|
| 过去三个月      | 1.32%  | 0.38% | 1.05%  | 0.04% | 0.27%   | 0.34% |
| 过去六个月      | -6.24% | 0.45% | 1.83%  | 0.05% | -8.07%  | 0.40% |
| 过去一年       | -2.79% | 0.39% | 4.78%  | 0.05% | -7.57%  | 0.34% |
| 过去三年       | 8.04%  | 0.38% | 13.20% | 0.07% | -5.16%  | 0.31% |
| 过去五年       | 14.26% | 0.29% | 25.19% | 0.06% | -10.93% | 0.23% |
| 自基金合同生效起至今 | 71.04% | 0.25% | 63.77% | 0.08% | 7.27%   | 0.17% |

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金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



长城积极增利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组合为：债券等固定收益类资产投资比例不低于基金资产净值的 80%，其中信用类固定收益品种的投资比例不低于基金资产净值的 30%；股票等权益类资产投资比例不高于基金资产净值的 20%；现金或者到期日在 1 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，现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款。

②本基金的建仓期为自本基金基金合同生效日起 6 个月，建仓期满时，各项资产配置比例符合基金合同约定。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务       | 任本基金的基金经理期限 |      | 证券从业年限 | 说明   |
|----|----------|-------------|------|--------|--|
|    |          | 任职日期        | 离任日期 |        |  |
| 魏建 | 本基金的基金经理 | 2020年7月20日  | -    | 14年    | 男，中国籍，硕士。2008年7月-2020年2月曾就职于博时基金管理有限公司。2020年3月加入长城基金管理有限公司，历任固定收益部研究员，2021年6月至2021年11月任“长城转型成长灵活配置混合型证券投资基金”基金经理。自2020年7月至今任“长城稳健增利债券型证券投资基金”、“长城久稳债券型证券投资基金”、“长城久荣纯债定期开放债券型发起式证券投资基金”、“长城积极增利债券型证券投资基金”基金经理，自2021年6月至今任“长城悦享回报债券型证券投资基金”基金经理，自2021年11月至今任 |

|    |                           |                |   |      |   |
|----|---------------------------|----------------|---|------|---|
|    |                           |                |   |      | “长城恒利纯债债券型证券投资基金”、“长城悦享增利债券型证券投资基金”基金经理，自 2021 年 12 月至今任“长城信利一年定期开放债券型发起式证券投资基金”基金经理，自 2022 年 6 月至今任“长城瑞利纯债债券型证券投资基金”基金经理。  |
| 张勇 | 公司总经理助理、固定收益投资总监、本基金的基金经理 | 2020 年 9 月 1 日 | - | 19 年 | 男，中国籍，硕士。2001 年 8 月-2003 年 12 月曾任南京银行资金营运中心债券交易员，2003 年 12 月-2015 年 6 月曾就职于博时基金管理有限公司历任交易员、基金经理，2015 年 6 月-2019 年 5 月曾就职于九泰基金管理有限公司任绝对收益部负责人，具有 21 年债券投资管理经历。2019 年 5 月加入长城基金管理有限公司，历任固定收益部总经理，现任公司总经理助理、固定收益投资总监、投委会委员兼基金经理。自 2020 年 9 月至今任“长城积极增利债券型证券投资基金”、“长城久悦债券型证券投资基金”基金经理，自 2022 年 4 月至今任“长城悦享回报债券型证券投资基金”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。

#### 4.1.1 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》、《长城积极增利债券型证券投资基金基金合同》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 公平交易专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《长城基金管理有限公司公平交易管理制度》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，定期出具公平交易稽核报告。本报告期报告认为，本基金管理人旗下投资组合的同向交易价差均在合理范围内，结果符合相关政策法规和公司制度的规定。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

二季度，受疫情反复影响，国内经济增速放缓。二季度上半 PMI、社融、进出口等经济数据整体低于市场预期，经济基本面承压，宽货币及宽信用政策并行，LPR 超预期下调，宽信用再度加码，降准进一步释放流动性，资金面整体维持宽松。二季度下旬以来，疫情冲击减弱，经济探底修复，整体修复力度温和，制造业投资改善，地产销售环比增速拐点出现，出口增速超预期回升，城镇调查失业率小幅回落。随着复工复产持续推进，经济继续爬坡，宽信用政策继续加码，社融增速有望继续回升。

债券市场窄幅震荡，整体小幅下跌。4 月市场宽松预期增强，中旬降准幅度不及预期，中央政治局会议后稳增长政策措施加快落地，长端收益率先下后上，整体上行；5 月份经济基本面承压，资金面持续宽松，市场宽货币预期再起，长端收益率有所下行；6 月高频数据显示生产需求进一步修复，经济基本面边际改善，受跨季等因素影响，资金利率小幅上行，债券收益率震荡调整。

股市方面，4 月份在上海疫情爆发的影响下，股市再次大幅调整；4 月底开始，疫情逐渐好转叠加促汽车、家电消费等政策密集出台，风险偏好回升，权益市场大幅反弹，反弹行业一开始集中在风光储和电动车，后来消费和医药也有所表现。

资产配置方面，考虑到权益资产可能的超跌，我们在转债市场调整过程中适当提升了转债仓位，持仓结构依然保持偏价值和周期的方向。纯债持仓主要以票息资产为主。

### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末长城积极增利 A 的基金份额净值为 1.2289 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.42%；截至本报告期末长城积极增利 C 的基金份额净值为 1.4545 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.32%。同期业绩比较基准收益率为 1.05%。

### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内，本基金无需要说明的情况。

## § 5 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目                | 金额（元）         | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------------------|---------------|--------------|
| 1  | 权益投资              | 802,605.60    | 0.90         |
|    | 其中：股票             | 802,605.60    | 0.90         |
| 2  | 基金投资              | -             | -            |
| 3  | 固定收益投资            | 76,176,320.38 | 84.99        |
|    | 其中：债券             | 76,176,320.38 | 84.99        |
|    | 资产支持证券            | -             | -            |
| 4  | 贵金属投资             | -             | -            |
| 5  | 金融衍生品投资           | -             | -            |
| 6  | 买入返售金融资产          | -             | -            |
|    | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -             | -            |
| 7  | 银行存款和结算备付金合计      | 1,790,079.49  | 2.00         |
| 8  | 其他资产              | 10,863,926.24 | 12.12        |
| 9  | 合计                | 89,632,931.71 | 100.00       |

### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别             | 公允价值（元）    | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|------------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | -          | -            |
| B  | 采矿业              | -          | -            |
| C  | 制造业              | 802,605.60 | 1.04         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | -          | -            |
| E  | 建筑业              | -          | -            |
| F  | 批发和零售业           | -          | -            |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | -          | -            |
| H  | 住宿和餐饮业           | -          | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | -          | -            |
| J  | 金融业              | -          | -            |
| K  | 房地产业             | -          | -            |
| L  | 租赁和商务服务业         | -          | -            |
| M  | 科学研究和技术服务业       | -          | -            |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | -          | -            |
| O  | 居民服务、修理和其他服务业    | -          | -            |
| P  | 教育               | -          | -            |
| Q  | 卫生和社会工作          | -          | -            |



|   |           |            |      |
|---|-----------|------------|------|
| R | 文化、体育和娱乐业 | -          | -    |
| S | 综合        | -          | -    |
|   | 合计        | 802,605.60 | 1.04 |

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：无。

### 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

#### 5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 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  | 000887 | 中鼎股份 | 27,728 | 505,758.72 | 0.66         |
| 2  | 300568 | 星源材质 | 10,222 | 296,846.88 | 0.39         |

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种      | 公允价值（元）       | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|---------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | 4,015,444.38  | 5.22         |
| 2  | 央行票据      | -             | -            |
| 3  | 金融债券      | -             | -            |
|    | 其中：政策性金融债 | -             | -            |
| 4  | 企业债券      | 23,821,149.83 | 30.96        |
| 5  | 企业短期融资券   | -             | -            |
| 6  | 中期票据      | -             | -            |
| 7  | 可转债（可交换债） | 48,339,726.17 | 62.83        |
| 8  | 同业存单      | -             | -            |
| 9  | 其他        | -             | -            |
| 10 | 合计        | 76,176,320.38 | 99.01        |

### 5.5 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债券投资明细

| 序号 | 债券代码   | 债券名称     | 数量（张）  | 公允价值（元）      | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|----------|--------|--------------|--------------|
| 1  | 113056 | 重银转债     | 56,330 | 5,689,546.06 | 7.39         |
| 2  | 112823 | 19 深投 02 | 50,000 | 5,131,182.47 | 6.67         |
| 3  | 163003 | 19 浙纾 02 | 50,000 | 5,122,818.36 | 6.66         |
| 4  | 155840 | 19 京投 05 | 50,000 | 5,117,739.73 | 6.65         |
| 5  | 163121 | 20 风电 01 | 50,000 | 5,096,426.03 | 6.62         |

### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资 明细

注：无。

### 5.7 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。

## 5.8 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权证投资明细

注：无。

## 5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.9.1 本期国债期货投资政策

本基金尚未在基金合同中明确国债期货的投资策略、比例限制、信息披露方式等，暂不参与国债期货交易。

### 5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：无。

### 5.9.3 本期国债期货投资评价

无。

## 5.10 投资组合报告附注

### 5.10.1 本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重庆银行和兴业银行发行主体外，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。根据重庆银保监局公布的行政处罚信息公开表：

重庆银行股份有限公司（简称重庆银行）因信贷资金被挪用等案由，于 2021 年 12 月 21 日被重庆银保监局处以罚款。

根据重庆银保监局公布的行政处罚信息公开表：

重庆银行股份有限公司（简称重庆银行）因贷前调查不尽职，形成“假按揭”贷款等案由，于 2021 年 12 月 21 日被重庆银保监局处以罚款。

根据重庆银保监局公布的行政处罚信息公开表：

重庆银行股份有限公司（简称重庆银行）因委托贷款资金违规流入房地产企业等案由，于 2022 年 5 月 24 日被重庆银保监局处以罚款。

根据中国人民银行重庆营业管理部行政处罚信息公开表：

重庆银行股份有限公司（简称重庆银行）因未按照规定履行客户身份识别义务等案由，于 2022 年 6 月 8 日被中国人民银行重庆营业管理部处以罚款。

根据中国人民银行公布的行政处罚信息公开表：

兴业银行股份有限公司（简称兴业银行）因为违反信用信息采集、提供、查询及相关管理规定等相关违法违规行为，于 2021 年 8 月 13 日被中国人民银行处以罚款。

根据中国银行保险监督管理委员会（简称银保监会）公布的行政处罚信息公开表：

兴业银行股份有限公司（简称兴业银行）因监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在违法违规行为案由，于 2022 年 3 月 21 日被中国银保监会处以罚款。

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。

### 5.10.2 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

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。

### 5.10.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额（元）         |
|----|---------|---------------|
| 1  | 存出保证金   | 10,889.88     |
| 2  | 应收证券清算款 | 10,849,638.66 |
| 3  | 应收股利    | -             |
| 4  | 应收利息    | -             |
| 5  | 应收申购款   | 3,397.70      |
| 6  | 其他应收款   | -             |
| 7  | 其他      | -             |
| 8  | 合计      | 10,863,926.24 |

### 5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码   | 债券名称 | 公允价值（元）      | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|--------------|--------------|
| 1  | 127032 | 苏行转债 | 3,651,790.00 | 4.75         |
| 2  | 113044 | 大秦转债 | 3,147,416.25 | 4.09         |
| 3  | 113043 | 财通转债 | 3,051,094.09 | 3.97         |
| 4  | 113052 | 兴业转债 | 2,960,412.37 | 3.85         |
| 5  | 127005 | 长证转债 | 2,738,359.14 | 3.56         |
| 6  | 110073 | 国投转债 | 2,734,915.80 | 3.55         |
| 7  | 128125 | 华阳转债 | 2,118,934.73 | 2.75         |
| 8  | 113046 | 金田转债 | 1,655,959.65 | 2.15         |
| 9  | 113024 | 核建转债 | 1,331,799.75 | 1.73         |
| 10 | 110083 | 苏租转债 | 1,281,937.49 | 1.67         |
| 11 | 127044 | 蒙娜转债 | 1,252,547.37 | 1.63         |
| 12 | 123113 | 仙乐转债 | 1,197,844.48 | 1.56         |
| 13 | 127047 | 帝欧转债 | 1,008,935.40 | 1.31         |
| 14 | 113025 | 明泰转债 | 993,799.81   | 1.29         |
| 15 | 123077 | 汉得转债 | 837,697.85   | 1.09         |

|    |        |          |            |      |
|----|--------|----------|------------|------|
| 16 | 113633 | 科沃转债     | 831,040.38 | 1.08 |
| 17 | 127018 | 本钢转债     | 781,137.33 | 1.02 |
| 18 | 110045 | 海澜转债     | 772,878.99 | 1.00 |
| 19 | 110063 | 鹰 19 转债  | 764,654.16 | 0.99 |
| 20 | 127019 | 国城转债     | 653,992.21 | 0.85 |
| 21 | 113615 | 金诚转债     | 580,818.74 | 0.75 |
| 22 | 110064 | 建工转债     | 579,678.90 | 0.75 |
| 23 | 128134 | 鸿路转债     | 553,234.56 | 0.72 |
| 24 | 128025 | 特一转债     | 475,382.45 | 0.62 |
| 25 | 128119 | 龙大转债     | 458,304.73 | 0.60 |
| 26 | 110043 | 无锡转债     | 445,711.50 | 0.58 |
| 27 | 113585 | 寿仙转债     | 423,695.81 | 0.55 |
| 28 | 113047 | 旗滨转债     | 393,944.26 | 0.51 |
| 29 | 123119 | 康泰转 2    | 357,898.45 | 0.47 |
| 30 | 123087 | 明电转债     | 336,610.21 | 0.44 |
| 31 | 113606 | 荣泰转债     | 330,908.78 | 0.43 |
| 32 | 123090 | 三诺转债     | 329,757.82 | 0.43 |
| 33 | 113591 | 胜达转债     | 325,861.20 | 0.42 |
| 34 | 128116 | 瑞达转债     | 311,444.62 | 0.40 |
| 35 | 113631 | 皖天转债     | 305,162.35 | 0.40 |
| 36 | 127038 | 国微转债     | 230,996.01 | 0.30 |
| 37 | 113045 | 环旭转债     | 230,852.49 | 0.30 |
| 38 | 127041 | 弘亚转债     | 230,361.97 | 0.30 |
| 39 | 123078 | 飞凯转债     | 223,294.81 | 0.29 |
| 40 | 128140 | 润建转债     | 210,911.18 | 0.27 |
| 41 | 111000 | 起帆转债     | 162,423.07 | 0.21 |
| 42 | 123114 | 三角转债     | 154,093.41 | 0.20 |
| 43 | 113635 | 升 21 转债  | 138,211.36 | 0.18 |
| 44 | 113637 | 华翔转债     | 111,218.21 | 0.14 |
| 45 | 113636 | 甬金转债     | 105,051.67 | 0.14 |
| 46 | 113601 | 塞力转债     | 105,036.93 | 0.14 |
| 47 | 132014 | 18 中化 EB | 73,784.95  | 0.10 |
| 48 | 127049 | 希望转 2    | 982.53     | 0.00 |

### 5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：无。

### 5.10.6 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。

## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                        | 长城积极增利 A      | 长城积极增利 C      |
|---------------------------|---------------|---------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 40,457,892.61 | 41,775,851.53 |
| 报告期期间基金总申购份额              | 340,509.57    | 284,724.78    |
| 减:报告期期间基金总赎回份额            | 2,535,746.12  | 21,492,707.01 |
| 报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列) | -             | -             |
| 报告期期末基金份额总额               | 38,262,656.06 | 20,567,869.30 |

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注：本报告期基金管理人持有本基金的份额情况无变动，于本报告期期初及期末均未持有本基金份额。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：本报告期本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

## § 8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 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              | 20220401-20220615       | 19,522,353.09 | -    | 13,906,433.00 | 5,615,920.09 | 9.5459  |

#### 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。

## 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

注：无。

## § 9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- （一）中国证监会核准长城积极增利债券型证券投资基金募集的文件
- （二）《长城积极增利债券型证券投资基金基金合同》
- （三）《长城积极增利债券型证券投资基金托管协议》
- （四）法律意见书
- （五）基金管理人业务资格批件、营业执照
- （六）基金托管人业务资格批件、营业执照
- （七）中国证监会规定的其他文件

### 9.2 存放地点

基金管理人及基金托管人住所

### 9.3 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](http://www.ccfund.com.cn)