

长城安心回报混合型证券投资基金 2022 年中期报告

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：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2022 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 08 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

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

为了更好地为投资者提供理财服务，经与本基金基金托管人中国农业银行股份有限公司协商一致，并报中国证监会备案，本基金管理人自 2022 年 6 月 14 日起为本基金增设 C 类基金份额。同时，本基金管理人对基金合同进行了相应的修改，修改的具体内容详见本管理人于 2022 年 6 月 13 日发布的《长城安心回报混合型证券投资基金增设基金份额并相应修改基金合同部分条款的公告》。

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 | 5 |
| 2.4 信息披露方式 | 6 |
| 2.5 其他相关资料 | 6 |
| § 3 主要财务指标和基金净值表现 | 6 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标 | 6 |
| 3.2 基金净值表现 | 7 |
| § 4 管理人报告 | 9 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况 | 9 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 | 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 | 12 |
| 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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 | 13 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 | 14 |
| 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 | 14 |
| § 5 托管人报告 | 14 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 | 14 |
| 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 | 14 |
| 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见 | 14 |
| § 6 半年度财务会计报告（未经审计） | 14 |
| 6.1 资产负债表 | 14 |
| 6.2 利润表 | 16 |
| 6.3 净资产（基金净值）变动表 | 17 |
| 6.4 报表附注 | 21 |
| § 7 投资组合报告 | 48 |
| 7.1 期末基金资产组合情况 | 48 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 | 48 |
| 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 | 49 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 | 50 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 | 52 |
| 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 | 52 |

| | |
|--|-----------|
| 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细..... | 52 |
| 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细..... | 52 |
| 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细..... | 52 |
| 7.10 本基金投资股指期货的投资政策..... | 52 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明..... | 53 |
| 7.12 投资组合报告附注..... | 53 |
| § 8 基金份额持有人信息 | 54 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构..... | 54 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况..... | 54 |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况..... | 54 |
| § 9 开放式基金份额变动 | 55 |
| § 10 重大事件揭示 | 55 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议..... | 55 |
| 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动..... | 55 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼..... | 55 |
| 10.4 基金投资策略的改变..... | 56 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况..... | 56 |
| 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况..... | 56 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况..... | 56 |
| 10.8 其他重大事件..... | 59 |
| § 11 影响投资者决策的其他重要信息 | 59 |
| 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 | 59 |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息..... | 59 |
| § 12 备查文件目录 | 60 |
| 12.1 备查文件目录..... | 60 |
| 12.2 存放地点..... | 60 |
| 12.3 查阅方式..... | 60 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | | |
|-----------------|------------------|------------|
| 基金名称 | 长城安心回报混合型证券投资基金 | |
| 基金简称 | 长城安心回报混合 | |
| 基金主代码 | 200007 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2006 年 8 月 22 日 | |
| 基金管理人 | 长城基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 中国农业银行股份有限公司 | |
| 报告期末基金份额总额 | 710,550,191.74 份 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 长城安心回报混合 A | 长城安心回报混合 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 200007 | 015965 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 710,543,682.70 份 | 6,509.04 份 |

注：自 2022 年 6 月 14 日，增设长城安心回报混合 C 类基金份额。

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|--|
| 投资目标 | 以获取高于银行一年期定期存款（税前）利率 2 倍的回报为目标，通过动态的资产配置平衡当期收益与长期资本增值，争取为投资人实现长期稳定的绝对回报。 |
| 投资策略 | 分析上市公司股息率、固定收益品种当期收益率、上市公司持续成长潜力，动态配置基金资产。采用“注重收益、关注成长、精选个股”的投资策略，通过把握上市公司股息率预期、持续成长潜力，选择具有持续分红能力或持续成长潜力的企业作为主要投资对象。 |
| 业绩比较基准 | 银行一年期定期存款（税前）利率的 2 倍。 |
| 风险收益特征 | 本基金是绝对回报产品，其预期收益与风险低于股票型基金，高于债券基金与货币市场基金。 |

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 | 中国农业银行股份有限公司 |
| 信息披露 负责人 | 姓名 | 车君 | 秦一楠 |
| | 联系电话 | 0755-29279005 | 010-66060069 |
| | 电子邮箱 | chejun@ccfund.com.cn | tgxxpl@abchina.com |
| 客户服务电话 | | 400-8868-666 | 95599 |
| 传真 | | 0755-29279000 | 010-68121816 |
| 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 | 北京市东城区建国门内大街 69 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 | 北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座F9 |
| 邮政编码 | 518046 | 100031 |
| 法定代表人 | 王军 | 谷澍 |

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2022年01月01日-2022年06月30日) | 2022年06月14日(基金合同生效日)-2022年06月30日 |
|---------------|------------------------------|----------------------------------|
| | 长城安心回报混合 A | 长城安心回报混合 C |
| 本期已实现收益 | -233,034,883.54 | 15.06 |
| 本期利润 | -174,494,422.27 | 213.78 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.2425 | 0.1302 |
| 本期加权平均净值利润率 | -14.72% | 7.69% |
| 本期基金份额净值增长率 | -12.15% | 5.53% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2022年6月30日) | |
| 期末可供分配利润 | 903,515,692.39 | 4,658.39 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 1.2716 | 0.7157 |

| | | |
|--------------|------------------|-----------|
| 期末基金资产净值 | 1,219,140,829.70 | 11,167.43 |
| 期末基金份额净值 | 1.7158 | 1.7157 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2022年6月30日) | |
| 基金份额累计净值增长率 | 425.53% | 5.53% |

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。

④本基金自 2022 年 6 月 14 日起增设 C 类基金份额。

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

长城安心回报混合 A

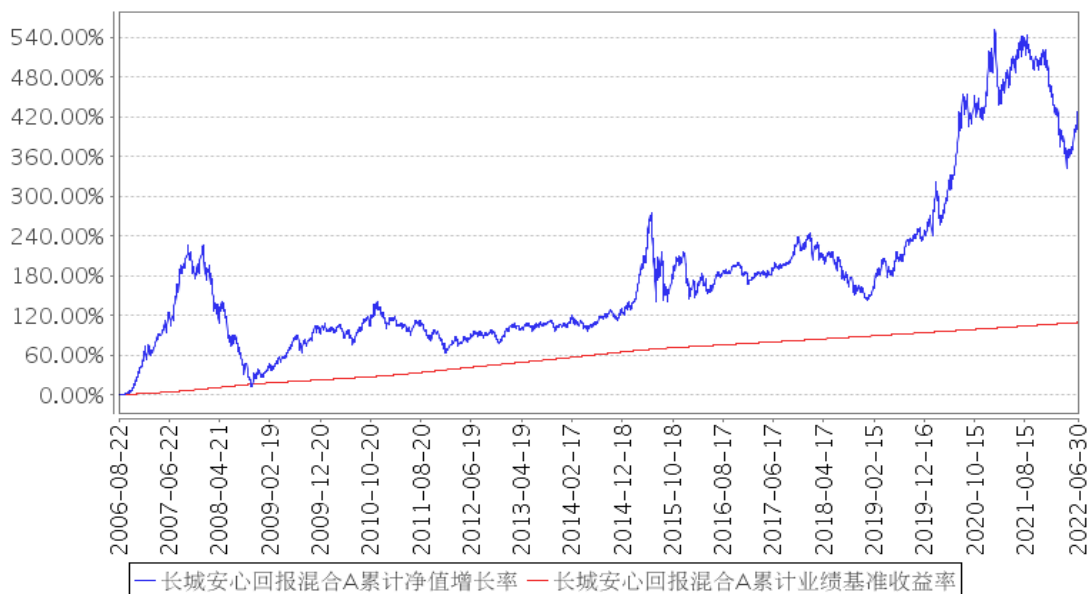
| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|---------|-------|
| 过去一个月 | 9.61% | 1.16% | 0.25% | 0.01% | 9.36% | 1.15% |
| 过去三个月 | 7.95% | 1.29% | 0.75% | 0.01% | 7.20% | 1.28% |
| 过去六个月 | -12.15% | 1.28% | 1.50% | 0.01% | -13.65% | 1.27% |
| 过去一年 | -15.50% | 1.21% | 3.05% | 0.01% | -18.55% | 1.20% |
| 过去三年 | 70.21% | 1.32% | 9.43% | 0.01% | 60.78% | 1.31% |
| 自基金合同生效起至今 | 425.53% | 1.42% | 109.46% | 0.02% | 316.07% | 1.40% |

长城安心回报混合 C

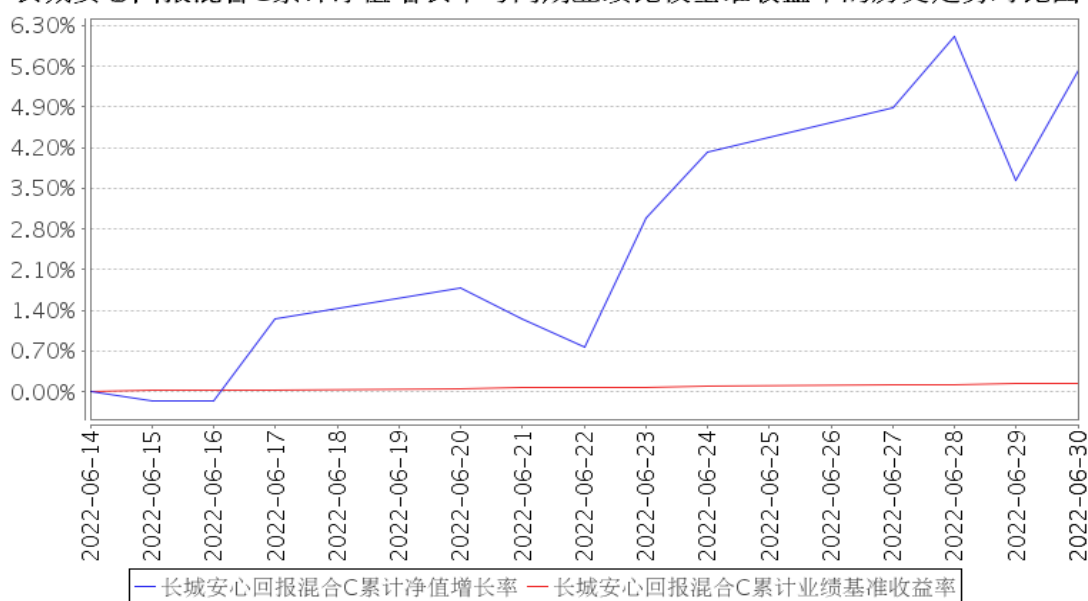
| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③ | ②—④ |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|-------|-------|
| 过去一个月 | - | - | - | - | - | - |
| 过去三个月 | - | - | - | - | - | - |
| 过去六个月 | - | - | - | - | - | - |
| 过去一年 | - | - | - | - | - | - |
| 过去三年 | - | - | - | - | - | - |
| 自基金合同生效起至今 | 5.53% | 1.20% | 0.14% | 0.01% | 5.39% | 1.19% |

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

长城安心回报混合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



长城安心回报混合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：股票投资比例为基金净资产的 10%—85%；权证投资比例为基金净资产的 0%—3%；债券投资比例为基金净资产的 10%—85%；现金或者到期日在一年以内的政府债券为基金净资产的 5%以上，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。

③本基金自 2022 年 6 月 14 日起增设 C 类基金份额。

§ 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成立于 2001 年，是经中国证监会批准设立的公募基金管理公司，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，当时注册资本为壹亿元人民币。

2007 年 5 月 21 日，经中国证监会批准，公司完成股权结构调整，现有股东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%）。

2007 年 10 月 12 日，经中国证监会批准，公司注册资本增至壹亿伍仟万元人民币。

公司经营范围是基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其他业务。

截至本报告期末，公司管理的基金有：长城久恒灵活配置混合型证券投资基金、长城久泰沪深 300 指数证券投资基金、长城货币市场证券投资基金、长城消费增值混合型证券投资基金、长城安心回报混合型证券投资基金、长城久富核心成长混合型证券投资基金(LOF)、长城品牌优选混合型证券投资基金、长城稳健增利债券型证券投资基金、长城双动力混合型证券投资基金、长城中小盘成长混合型证券投资基金、长城积极增利债券型证券投资基金、长城优化升级混合型证券投资基金、长城稳健成长灵活配置混合型证券投资基金、长城核心优选灵活配置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、长城医疗保健混合型证券投资基金、长城工资宝货币市场基金、长城久鼎灵活配置混合型证券投资基金、长城稳固收益债券型证券投资基金、长城新兴产业灵活配置混合型证券投资基金、长城环保主题灵活配置混合型证券投资基金、长城改革红利灵活配置混合型证券投资基金、长城久惠灵活配置混合型证券投资基金、长城久祥灵活配置混合型证券投资基金、长城行业轮动灵活配置混合型证券投资基金、长城新优选混合型证券投资基金、长城久润灵活配置混合型证券投资基金、长城久益灵活配置混合型证券投资基金、长城久源灵活配置混合型证券投资基金、长城久鼎灵活配置混合型证券投资基金、长城久稳债券型证券投资基金、长城中国智造灵活配置混合型证券投资基金、长城悦享增利债券型基金、长城创业板指数增强型发起式证券投资基金、长城久嘉创新成长灵活配置混合型证券投资基金、长城收益宝货币市场基金、长城智能产业灵活配置混合型证券投资基金、长城久荣纯债定期开放债券型发起式证券投资基金、长城中证 500 指数增强型证券投资基金、长城久悦债券型证券投资基金、长城核心优势混合型证券投资基金、长城量化精选股票型证券投资基金、长城港股通价值精选多策略混合型证券投资基金、长城研究精选混合型证券投资基金、长城短债债券型证券投资基金、长城久瑞三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长城嘉鑫两年定期开放债券型证券投资基金、长城量化小盘股票型证券投资基金、长城泰利纯债债券型证券投资基金、长城价值优选混合型证券投资基金、长城恒康稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、长城创新驱动混合型证券投资基金、长城中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金、长城健康生活灵活配置混合型证券投资基金、长城成长先锋混合型证券投资基金、长城恒泰养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、长城优选增强六个月持有期混合型证券投资基金、长城中债 3-5 年国开行债券指数证券投资基金、长城均衡优选混合型证券投资基金、长城品质成长混合型证券投资基金、长城优选回报六个月持有期混合型证券投资基金、长城稳利纯债债券型证券投资基金、长城价值成长六个月持有期混合型证券投资基金、长城优选添瑞六个月持有期混合型证券投资基金、长城优选稳进六个月持有期混合型证券投资基金、长城消费 30 股票型证券投资基

金、长城中债 5-10 年国开行债券指数证券投资基金、长城医药科技六个月持有期混合型证券投资基金、长城悦享回报债券型证券投资基金、长城竞争优势六个月持有期混合型证券投资基金、长城优选添利一年持有期混合型证券投资基金、长城科创板两年定期开放混合型证券投资基金、长城兴华优选一年定期开放混合型证券投资基金、长城中债 1-5 年国开行债券指数证券投资基金、长城健康消费混合型证券投资基金、长城恒利纯债债券型证券投资基金、长城大健康混合型证券投资基金、长城价值领航混合型证券投资基金、长城信利一年定期开放债券型发起式证券投资基金、长城新能源股票型发起式证券投资基金、长城优选招益一年持有期混合型证券投资基金、长城价值甄选一年持有期混合型证券投资基金、长城中证医药卫生指数增强型证券投资基金、长城瑞利纯债债券型证券投资基金、长城产业成长混合型证券投资基金。

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 | | |
| 何以广 | 公司总经理助理、研究部总经理、本基金的基金经理 | 2017 年 3 月 16 日 | - | 11 年 | 男，中国籍，博士，注册金融分析师（CFA）、注册会计师（CPA）。2011 年 6 月加入长城基金管理有限公司，历任行业研究员、“长城消费增值股票型证券投资基金”基金经理助理。现任公司总经理助理、研究部总经理、投委会委员兼基金经理，自 2015 年 5 月至 2016 年 7 月任“长城优化升级混合型证券投资基金”基金经理，自 2017 年 8 月至 2018 年 12 月任“长城环保主题灵活配置混合型证券投资基金”，自 2016 年 9 月至 2018 年 12 月任“长城久富核心成长混合型证券投资基金(LOF)”基金经理。自 2015 年 6 月至今任“长城中小盘成长混合型证券投资基金”基金经理，自 2017 年 3 月至今任“长城安心回报混合型证券投资基金”基金经理，自 2018 年 6 月至今任“长城智能产业灵活配置混合型证券投资基金”基金经理，自 2019 年 8 月至今任“长城研究精选混合型证券投资基金”基金经理，自 2020 年 12 月至今任“长城均衡优选混合型证券投资基金”基金经理，自 2020 年 12 月至今任“长城品质成长混合型证券投资基金”基金经理，自 2021 年 3 月至今任“长城价值成长六个月持有期混合型证券投资基金”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，并对基金经理兼任投资经理的组合执行更长周期的交易价差分析，定期出具公平交易稽核报告。本报告期报告认为，本基金管理人旗下投资组合的同向交易价差均在合理范围内，结果符合相关政策法规和公司制度的规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2022 年上半年，市场行情波动较大，行业间分化较严重，前 4 月市场跌幅较大，5 月之后市场反弹较多。在运作过程中，本基金行业配置较为均衡，主要配置食品饮料、电子、军工、新能源、TMT 等行业，其中消费表现较差，新能源表现较好。我们加大了汽车的配置，减少了化工、食品饮料及医药的配置。截止 6 月底，本基金主要配置军工、光伏、汽车、食品饮料、计算机这五个行业。

如何持续的为投资者获取超越市场的回报？这个问题一直以来都是我们探寻的目标。市场风格变化是永恒的，公司的发展也具有阶段性的特征，因此在不同的市场环境和风格下，我们的基金业绩如何穿越市场，将是我们孜孜不倦探寻的课题。从战略上看，我们相信，具有巨大成长空

间的行业中的最具竞争力的公司，是获取良好投资回报最重要的投资对象。从战术上看，需要关注时代的发展，关注新兴行业，关注具有独特竞争力的优秀公司。

行业选择和个股选择是获取超额收益的关键。首先，选择行业，行业的长期成长空间是最重要的因素；第二，选择公司时，龙头公司较为关键，其中最重要的关注因素是公司的竞争力，包括横向和纵向竞争力，优先选择竞争力最强的公司；第三，何时持有长期成长行业中最有竞争力的公司，需要研究公司当下和未来的成长性，尽量在公司业绩高速成长的阶段持有公司。以上三点是我们投资体系中最重要要点。

在行业选择和个股选择后，在构建基金组合的过程中，我们会选择 3-5 个行业中约 25 家公司构成基金主要仓位，然后在其他非整体性机会的行业中，选择约 10 家公司作为单独性机会构建组合。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末长城安心回报混合 A 的基金份额净值为 1.7158 元，本报告期基金份额净值增长率为-12.15%，同期业绩比较基准收益率为 1.50%；截至本报告期末长城安心回报混合 C 的基金份额净值为 1.7157 元，本报告期基金份额净值增长率为 5.53%，同期业绩比较基准收益率为 0.14%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2022 年下半年，资本市场仍具备较大的不确定性。一是疫情如何演绎。二是中美关系如何发展。我们预计，市场仍将演绎分化行情。本基金将选择长期成长行业中最有竞争力的公司，力争获取超额收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

本基金管理人成立了受托资产估值委员会，为基金估值业务的最高决策机构，由公司总经理、分管估值业务副总经理、督察长、投资总监、研究部总经理、运行保障部总经理、基金会计、基金经理和行业研究员、金融工程研究员等组成，公司监察稽核人员列席受托资产估值委员会。受托资产估值委员会负责制定、修订和完善基金估值政策和程序，定期对估值政策和程序进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性及其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。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金无需要说明的情况。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—长城基金管理有限公司 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事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本基金的投资运作、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 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，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本基金中期报告中的财务指标、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，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：长城安心回报混合型证券投资基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2022 年 6 月 30 日 | 上年度末 2021 年 12 月 31 日 |
|---------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 151,666,347.82 | 118,891,095.59 |
| 结算备付金 | | 1,863,844.58 | 4,477,977.78 |
| 存出保证金 | | 477,619.38 | 714,226.66 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 1,063,441,638.98 | 1,300,727,678.71 |
| 其中：股票投资 | | 936,006,102.60 | 1,080,631,678.71 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 127,435,536.38 | 220,096,000.00 |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 贵金属投资 | | - | - |
| 其他投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | 6.4.7.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 6.4.7.4 | - | - |
| 债权投资 | 6.4.7.5 | - | - |
| 其中：债券投资 | | - | - |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 其他投资 | | - | - |
| 其他债权投资 | 6.4.7.6 | - | - |
| 其他权益工具投资 | 6.4.7.7 | - | - |
| 应收清算款 | | 13,199,403.68 | 5,749,788.10 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 13,389.66 | 182,199.53 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.8 | - | 3,410,586.11 |
| 资产总计 | | 1,230,662,244.10 | 1,434,153,552.48 |
| 负债和净资产 | 附注号 | 本期末 2022 年 6 月 30 日 | 上年度末 2021 年 12 月 31 日 |
| 负债： | | | |
| 短期借款 | | - | - |
| 交易性金融负债 | | - | - |
| 衍生金融负债 | 6.4.7.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | - | - |
| 应付清算款 | | 7,326,716.22 | - |
| 应付赎回款 | | 389,193.04 | 971,657.53 |

| | | | |
|-------------|----------|------------------|------------------|
| 应付管理人报酬 | | 1,433,539.83 | 1,855,198.46 |
| 应付托管费 | | 238,923.32 | 309,199.75 |
| 应付销售服务费 | | 0.66 | - |
| 应付投资顾问费 | | - | - |
| 应交税费 | | 206,630.13 | 206,630.13 |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.9 | 1,915,243.77 | 3,004,851.90 |
| 负债合计 | | 11,510,246.97 | 6,347,537.77 |
| 净资产： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.10 | 315,631,646.35 | 324,743,337.95 |
| 其他综合收益 | 6.4.7.11 | - | - |
| 未分配利润 | 6.4.7.12 | 903,520,350.78 | 1,103,062,676.76 |
| 净资产合计 | | 1,219,151,997.13 | 1,427,806,014.71 |
| 负债和净资产总计 | | 1,230,662,244.10 | 1,434,153,552.48 |

注：（1）报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额总额 710,550,191.74 份，其中长城安心回报混合 A 基金份额总额 710,543,682.70 份，基金份额净值 1.7158 元；长城安心回报混合 C 基金份额总额 6,509.04 份，基金份额净值 1.7157 元。

（2）比较数据已根据本年《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〉》中的资产负债表格式的要求进行列示。上年末资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表中“其他资产”项目的“上年度末”余额，上年末资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额。

6.2 利润表

会计主体：长城安心回报混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 | 上年度可比期间 |
|----------------|----------|---------------------------------|---------------------------------|
| | | 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 | 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
| 一、营业总收入 | | -164,059,161.79 | 147,301,061.84 |
| 1. 利息收入 | | 544,757.20 | 2,544,605.54 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.13 | 544,757.20 | 560,121.48 |
| 债券利息收入 | | - | 1,981,693.15 |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | - | 2,790.91 |
| 证券出借利息收入 | | - | - |

| | | | |
|-------------------------------|------------|-----------------|----------------|
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） | | -223,153,079.79 | 237,911,237.46 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.14 | -228,981,884.91 | 232,766,138.73 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.15 | 1,766,979.50 | 148,840.00 |
| 资产支持证券投资 收益 | 6.4.7.16 | - | - |
| 贵金属投资收益 | 6.4.7.17 | - | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.18 | - | - |
| 股利收益 | 6.4.7.19 | 4,061,825.62 | 4,996,258.73 |
| 以摊余成本计量的 金融资产终止确认产生的 收益 | | - | - |
| 其他投资收益 | | - | - |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.20 | 58,540,659.99 | -93,182,025.44 |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - | - |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列） | 6.4.7.21 | 8,500.81 | 27,244.28 |
| 减：二、营业总支出 | | 10,435,046.70 | 24,975,777.03 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 8,842,957.40 | 12,138,935.83 |
| 2. 托管费 | 6.4.10.2.2 | 1,473,826.21 | 2,023,155.97 |
| 3. 销售服务费 | | 0.66 | - |
| 4. 投资顾问费 | | - | - |
| 5. 利息支出 | | - | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | - | - |
| 6. 信用减值损失 | 6.4.7.22 | - | - |
| 7. 税金及附加 | | - | - |
| 8. 其他费用 | 6.4.7.23 | 118,262.43 | 10,813,685.23 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | -174,494,208.49 | 122,325,284.81 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | -174,494,208.49 | 122,325,284.81 |
| 五、其他综合收益的税后净额 | | - | - |
| 六、综合收益总额 | | -174,494,208.49 | 122,325,284.81 |

注：比较数据已根据本年《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〉》中的利润表格式的要求进行列示。上年度可比期间利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在本期利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：长城安心回报混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 | | | |
|-------------------------------------|---------------------------------------|--------|------------------|------------------|
| | 实收基金 | 其他综合收益 | 未分配利润 | 净资产合计 |
| 一、上期期末净资产(基金净值) | 324,743,337.95 | - | 1,103,062,676.76 | 1,427,806,014.71 |
| 加：会计政策变更 | - | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 二、本期期初净资产(基金净值) | 324,743,337.95 | - | 1,103,062,676.76 | 1,427,806,014.71 |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列) | -9,111,691.60 | - | -199,542,325.98 | -208,654,017.58 |
| (一)、综合收益总额 | - | - | -174,494,208.49 | -174,494,208.49 |
| (二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列) | -9,111,691.60 | - | -25,048,117.49 | -34,159,809.09 |

| | | | | |
|--|----------------------|--------|------------------|------------------|
| 其中：1. 基金申购款 | 2,388,110.01 | - | 6,590,294.48 | 8,978,404.49 |
| 2. 基金赎回款 | -11,499,801.61 | - | -31,638,411.97 | -43,138,213.58 |
| (三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列) | - | - | - | - |
| (四)、其他综合收益结转留存收益 | - | - | - | - |
| 四、本期末净资产(基金净值) | 315,631,646.35 | - | 903,520,350.78 | 1,219,151,997.13 |
| 项目 | 上年度可比期间 | | | |
| | 2021年1月1日至2021年6月30日 | | | |
| | 实收基金 | 其他综合收益 | 未分配利润 | 净资产合计 |
| 一、上期期末净资产(基金净值) | 392,938,530.50 | - | 1,357,688,578.85 | 1,750,627,109.35 |
| 加：会计政策变更 | - | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 二、本期初净 | 392,938,530.50 | - | 1,357,688,578.85 | 1,750,627,109.35 |

| | | | | |
|--|----------------|---|-----------------|-----------------|
| 资产(基金净值) | | | | |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列) | -49,770,877.12 | - | -57,168,793.55 | -106,939,670.67 |
| (一)、综合收益总额 | - | - | 122,325,284.81 | 122,325,284.81 |
| (二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列) | -49,770,877.12 | - | -179,494,078.36 | -229,264,955.48 |
| 其中：1. 基金申购款 | 5,875,589.92 | - | 20,991,095.61 | 26,866,685.53 |
| 2. 基金赎回款 | -55,646,467.04 | - | -200,485,173.97 | -256,131,641.01 |
| (三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列) | - | - | - | - |
| (四)、其他综合收益结转留存收益 | - | - | - | - |

| | | | | |
|----------------|----------------|---|------------------|------------------|
| 四、本期末净资产(基金净值) | 343,167,653.38 | - | 1,300,519,785.30 | 1,643,687,438.68 |
|----------------|----------------|---|------------------|------------------|

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

| | | |
|-----------|------------|------------|
| <u>王军</u> | <u>邱春杨</u> | <u>赵永强</u> |
| 基金管理人负责人 | 主管会计工作负责人 | 会计机构负责人 |

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

长城安心回报混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）系由长城基金管理有限公司发起，经中国证券监督管理委员会（中国证监会）“证监基金字[2006]123 号”《关于同意长城安心回报混合型证券投资基金募集的批复》核准，基金合同于 2006 年 8 月 22 日生效的契约型开放式证券投资基金，存续期限不定，首次设立募集规模为 1,416,548,067.74 份基金份额。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，基金托管人为中国农业银行股份有限公司（以下简称“中国农业银行”）。

于 2007 年 9 月 5 日（基金拆分基准日），本基金管理人长城基金管理有限公司对本基金进行了基金份额拆分。拆分前，本基金的基金份额净值为人民币 2.2512 元，根据基金份额拆分公式，计算精确到小数点后第 9 位为人民币 2.251230974 元。本基金管理人于拆分日，按照 1:2.251230974 的拆分比例对本基金进行拆分。拆分后，基金份额净值为人民币 1.0000 元，基金份额面值为人民币 0.4442 元。

根据基金管理人长城基金管理有限公司于 2022 年 6 月 13 日发布的《关于长城安心回报混合型证券投资基金增设基金份额并相应修改基金合同部分条款的公告》及《长城安心回报混合型证券投资基金基金合同》，本基金于 2022 年 6 月 14 日起增设 C 类基金份额，原基金份额转为 A 类基金份额。本基金根据申购费用、赎回费用、销售服务费用收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者申购时收取申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用、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；从本类别基金资产中计提销售服务费而在投资者申购时不收取申购费用、在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额，称为 C 类基金份额。本基金 A 类基金份额、C 类基金份额分别设置基金代码，分别计算和公告基金份额净值。

本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行并上市交易的公司股票（含存托凭证）、债券、权证以及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

本基金投资组合的资产配置为：股票资产 10%—85%，权证投资 0%—3%，债券 10%—85%，本基金保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，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。

本基金的业绩比较基准为：银行一年期定期存款（税前）利率的 2 倍。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2022 年 1 月 1 日起至 2022 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

除下文 6.4.5.1 会计政策变更的说明中涉及的变更外，本基金报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

新金融工具准则

根据《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》、《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（统称“新金融工具准则”）、《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》的规定和相关法律法规的要求，本基金自 2022 年 1 月 1 日开始按照新金融工具准则进行会计处理，

根据衔接规定，对可比期间信息不予调整，首日执行新金融工具准则与现行准则的差异追溯调整本报告期期初未分配利润。

新金融工具准则改变了金融资产的分类和计量方式，确定了三个主要的计量类别：摊余成本；以公允价值计量且其变动计入其他综合收益；以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金考虑自身业务模式，以及金融资产的合同现金流特征进行上述分类。

新金融工具准则要求金融资产减值计量由“已发生损失模型”改为“预期信用损失模型”，适用于以摊余成本计量的金融资产。金融资产减值计量的变更对于本基金的影响不重大。

本基金将基于实际利率法计提的金融工具的利息包含在相应金融工具的账面余额中，并反映在相关“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等项目中，不单独列示“应收利息”项目或“应付利息”项目。

“信用减值损失”项目，反映本基金计提金融工具信用损失准备所确认的信用损失。本基金将分类为以摊余成本计量的金融资产按照实际利率法计算的利息收入反映在“利息收入”项目中，其他项目的利息收入从“利息收入”项目调整至“投资收益”项目列示。

于首次执行日，原金融资产和金融负债账面价值调整为按照修订后金融工具确认和计量准则的规定进行分类和计量的新金融资产和金融负债账面价值的调节如下所述：

以摊余成本计量的金融资产：

银行存款于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 118,891,095.59 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 25,659.80 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，银行存款于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 118,916,755.39 元。

结算备付金于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 4,477,977.78 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 2,216.61 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，结算备付金于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 4,480,194.39 元。

存出保证金于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 714,226.66 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 353.54 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，存出保证金于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 714,580.20 元。

买入返售金融资产于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 0.00 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 0.00 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00

元。经上述重分类和重新计量后，买入返售金融资产于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 0.00 元。

应收利息于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 3,410,586.11 元，转出至银行存款的重分类金额为人民币 25,659.80 元，转出至结算备付金的重分类金额为人民币 2,216.61 元，转出至存出保证金的重分类金额为人民币 353.54 元，转出至交易性金融资产的重分类金额为人民币 3,382,356.16 元，转出至买入返售金融资产的重分类金额为人民币 0.00 元，转出至应收申购款的重分类金额为人民币 0.00 元，转出至其他资产的重分类金额为人民币 0.00 元。经上述重分类后，应收利息不再作为财务报表项目单独列报。

应收申购款于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 182,199.53 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 0.00 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，应收申购款于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 182,199.53 元。

其他资产于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 0.00 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 0.00 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，其他资产于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 0.00 元。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产：

交易性金融资产于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 1,300,727,678.71 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 3,382,356.16 元。经上述重分类后，交易性金融资产于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 1,304,110,034.87 元。

以摊余成本计量的金融负债：

卖出回购金融资产款于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 0.00 元，自应付利息转入的重分类金额为人民币 0.00 元。经上述重分类后，卖出回购金融资产款于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 0.00 元。

应付利息于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 0.00 元，转出至卖出回购金融资产款的重分类金额为人民币 0.00 元。经上述重分类后，应付利息不再作为财务报表项目单独列报。

除上述财务报表项目外，于首次执行日，新金融工具准则的执行对财务报表其他金融资产及金融负债项目无影响。

于首次执行日，新金融工具准则的执行对本基金金融资产计提的减值准备金额无重大影响。上述会计政策变更未导致本基金本期期初未分配利润的变化。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无需要说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

(1) 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，证券（股票）交易印花税税率为 1%，由出让方缴纳。

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

(2) 增值税、企业所得税

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

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

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理

人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在 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，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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》，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

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。

股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税。

(3) 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

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

(4) 个人所得税

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

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

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

股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税。

(5) 境外投资

本基金运作过程中涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81 号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127 号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2022 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款 | 151,666,347.82 |
| 等于：本金 | 151,636,648.79 |
| 加：应计利息 | 29,699.03 |
| 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 | 151,666,347.82 |

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2022 年 6 月 30 日 | | | |
|----|------------------------|------|----------------|----------------|
| | 成本 | 应计利息 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | 774,259,963.89 | - | 936,006,102.60 | 161,746,138.71 |

| | | | | | |
|---------------|----------------|----------------|------------------|----------------|------------|
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | - | - | - | - | |
| 债券 | 交易所市场 | 65,602,146.50 | 980,412.58 | 66,611,254.18 | 28,695.10 |
| | 银行间市场 | 60,013,713.02 | 654,282.20 | 60,824,282.20 | 156,286.98 |
| | 合计 | 125,615,859.52 | 1,634,694.78 | 127,435,536.38 | 184,982.08 |
| 资产支持证券 | - | - | - | - | |
| 基金 | - | - | - | - | |
| 其他 | - | - | - | - | |
| 合计 | 899,875,823.41 | 1,634,694.78 | 1,063,441,638.98 | 161,931,120.79 | |

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：无。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：无。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：无。

6.4.7.8 其他资产

注：无。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2022年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | 500,000.00 |
| 应付赎回费 | 244.83 |
| 应付证券出借违约金 | - |
| 应付交易费用 | 1,316,738.79 |
| 其中：交易所市场 | 1,316,238.79 |
| 银行间市场 | 500.00 |
| 应付利息 | - |
| 预提费用 | 98,260.15 |
| 合计 | 1,915,243.77 |

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

长城安心回报混合 A

| 项目 | 本期 2022年1月1日至2022年6月30日 | |
|---------------|----------------------------|----------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 731,070,787.41 | 324,743,337.95 |
| 本期申购 | 5,361,516.56 | 2,381,595.11 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -25,888,621.27 | -11,499,795.75 |
| 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 | 710,543,682.70 | 315,625,137.31 |

长城安心回报混合 C

| 项目 | 本期 2022年6月14日（基金合同生效日）至2022年6月30日 |
|----|--------------------------------------|
| | |

| | 基金份额（份） | 账面金额 |
|---------------|----------|----------|
| 上年度末 | - | - |
| 本期申购 | 6,514.90 | 6,514.90 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -5.86 | -5.86 |
| 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 | 6,509.04 | 6,509.04 |

注：本期申购包含基金转入份额及金额；本期赎回包含基金转出份额及金额。

6.4.7.11 其他综合收益

注：无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

长城安心回报混合 A

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----------------|------------------|-----------------|------------------|
| 本期期初 | 1,282,541,873.33 | -179,479,196.57 | 1,103,062,676.76 |
| 本期利润 | -233,034,883.54 | 58,540,461.27 | -174,494,422.27 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -32,687,263.13 | 7,634,701.03 | -25,052,562.10 |
| 其中：基金申购款 | 8,601,134.87 | -2,015,289.01 | 6,585,845.86 |
| 基金赎回款 | -41,288,398.00 | 9,649,990.04 | -31,638,407.96 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 1,016,819,726.66 | -113,304,034.27 | 903,515,692.39 |

长城安心回报混合 C

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----------------|----------|-----------|----------|
| 本期期初 | - | - | - |
| 本期利润 | 15.06 | 198.72 | 213.78 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 5,681.24 | -1,236.63 | 4,444.61 |
| 其中：基金申购款 | 5,686.36 | -1,237.74 | 4,448.62 |
| 基金赎回款 | -5.12 | 1.11 | -4.01 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 5,696.30 | -1,037.91 | 4,658.39 |

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|----------|---------------------------------|
| | 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
| 活期存款利息收入 | 515,690.31 |
| 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 | 24,127.98 |
| 其他 | 4,938.91 |
| 合计 | 544,757.20 |

注：其他为交易所结算保证金利息收入。

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022年1月1日至2022年6月30日 |
|------------------|----------------------------|
| 股票投资收益——买卖股票差价收入 | -228,981,884.91 |
| 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 | -228,981,884.91 |

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022年1月1日至2022年6月30日 |
|------------|----------------------------|
| 卖出股票成交总额 | 1,722,560,558.76 |
| 减：卖出股票成本总额 | 1,946,283,554.16 |
| 减：交易费用 | 5,258,889.51 |
| 买卖股票差价收入 | -228,981,884.91 |

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022年1月1日至2022年6月30日 |
|------------------------------|----------------------------|
| 债券投资收益——利息收入 | 1,815,117.83 |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | -48,138.33 |
| 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 | 1,766,979.50 |

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022年1月1日至2022年6月30日 |
|------------------------|----------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额 | 254,546,052.88 |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 250,174,958.39 |
| 减：应计利息总额 | 4,417,641.65 |
| 减：交易费用 | 1,591.17 |
| 买卖债券差价收入 | -48,138.33 |

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：无。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：无。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：无。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：无。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|---------------|---------------------------------|
| | 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
| 股票投资产生的股利收益 | 4,061,825.62 |
| 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 | 4,061,825.62 |

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 |
|------------------------|---------------------------------|
| | 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
| 1. 交易性金融资产 | 58,540,659.99 |
| 股票投资 | 58,277,206.10 |
| 债券投资 | 263,453.89 |
| 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 | 58,540,659.99 |

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|---------|---------------------------------|
| | 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
| 基金赎回费收入 | 8,500.81 |
| 合计 | 8,500.81 |

6.4.7.22 信用减值损失

注：无。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|---------|---------------------------------|
| | 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
| 审计费用 | 29,752.78 |
| 信息披露费 | 59,507.37 |
| 证券出借违约金 | - |
| 银行费用 | 10,402.28 |
| 账户维护费 | 18,000.00 |
| 上交所查询费 | 600.00 |
| 合计 | 118,262.43 |

6.4.7.24 分部报告

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

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

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|------------------------|---------------------|
| 长城基金管理有限公司（“长城基金”） | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构 |
| 中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”） | 基金托管人、基金销售机构 |
| 长城证券股份有限公司（“长城证券”） | 基金管理人的股东、基金销售机构 |

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2022年1月1日至2022年6月30日 | | 上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日 | |
|-------|----------------------------|-------------------------|---------------------------------|---------------------|
| | 成交金额 | 占当期股票 成交总额的比例 (%) | 成交金额 | 占当期股票 成交总额的比例(%) |
| 长城证券 | 107,394,783.08 | 3.10 | 463,555,692.61 | 6.72 |

6.4.10.1.2 债券交易

注：无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：无。

6.4.10.1.4 权证交易

注：无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2022年1月1日至2022年6月30日 | | | |
|-------|---------------------------------|--------------------|--------------|----------------------|
| | 当期 佣金 | 占当期佣金总量 的比例 (%) | 期末应付佣金余 额 | 占期末应付佣金 总额的比例 (%) |
| 长城证券 | 100,016.97 | 3.10 | 100,016.97 | 7.60 |
| 关联方名称 | 上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日 | | | |
| | 当期 佣金 | 占当期佣金总量 的比例 (%) | 期末应付佣金余 额 | 占期末应付佣金 总额的比例 (%) |
| 长城证券 | 431,710.07 | 6.72 | 110,629.45 | 4.83 |

注：上述佣金按市场佣金率计算，扣除券商需承担的费用(包括但不限于买(卖)经手费、证券结算风险基金和证券交易所买(卖)证管费等)。

管理人因此从关联方获取的其他服务主要包括：为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|----|------------------|-----------------|
| | 2022年1月1日至2022年6 | 2021年1月1日至2021年 |
| | | |

| | 月 30 日 | 6 月 30 日 |
|------------------|--------------|---------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 8,842,957.40 | 12,138,935.83 |
| 其中: 支付销售机构的客户维护费 | 2,069,563.54 | 2,835,094.37 |

注: 基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.5% 的年费率计提。计算方法如下:

$$H = E \times 1.5\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

6.4.10.2.2 基金托管费

单位: 人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|----------------|---------------------------------|---------------------------------|
| | 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 | 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 1,473,826.21 | 2,023,155.97 |

注: 基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。计算方法如下:

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

6.4.10.2.3 销售服务费

单位: 人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期 | | |
|----------------|---------------------------------|------------|------|
| | 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 | | |
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 长城安心回报混合 A | 长城安心回报混合 C | 合计 |
| 长城基金管理有限公司 | - | 0.17 | 0.17 |
| 合计 | - | 0.17 | 0.17 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间 | | |
| | 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 | | |
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 长城安心回报混合 A | 长城安心回报混合 C | 合计 |
| 合计 | - | - | - |

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 0.60%。计算方法如下:

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

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

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

注：无。

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

注：无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金的基金管理人于本期及上年度可比期间未运用固有资金投资于本基金份额，于本期末及上年度可比期末亦未持有本基金份额。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

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

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2022年1月1日至2022年6月30日 | | 上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日 | |
|--------|----------------------------|------------|---------------------------------|------------|
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 中国农业银行 | 151,666,347.82 | 515,690.31 | 222,606,488.97 | 509,197.95 |

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，并按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金于本期未进行利润分配。

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

6.4.8.2 资产负债表日后事项。

6.4.12 期末(2022年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

| 6.4.12.1.1 受限证券类别：股票 | | | | | | | | | | |
|----------------------|------|------------|-----|---------|--------|--------|----------|-----------|-----------|----|
| 证券代码 | 证券名称 | 成功认购日 | 受限期 | 流通受限类型 | 认购价格 | 期末估值单价 | 数量(单位:股) | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
| 301103 | 何氏眼科 | 2022年3月14日 | 6个月 | 新股锁定 | 42.50 | 32.02 | 390 | 16,575.00 | 12,487.80 | - |
| 301103 | 何氏眼科 | 2022年6月1日 | 3个月 | 新股锁定-送股 | - | 32.02 | 117 | - | 3,746.34 | - |
| 301109 | 军信股份 | 2022年4月6日 | 6个月 | 新股锁定 | 34.81 | 16.14 | 1,225 | 42,642.25 | 19,771.50 | - |
| 301109 | 军信股份 | 2022年6月17日 | 4个月 | 新股锁定-送股 | - | 16.14 | 613 | - | 9,893.82 | - |
| 301181 | 标榜股份 | 2022年2月11日 | 6个月 | 新股锁定 | 40.25 | 30.59 | 257 | 10,344.25 | 7,861.63 | - |
| 301201 | 诚达药业 | 2022年1月12日 | 6个月 | 新股锁定 | 72.69 | 71.54 | 353 | 25,659.57 | 25,253.62 | - |
| 301207 | 华兰疫苗 | 2022年2月10日 | 6个月 | 新股锁定 | 56.88 | 56.42 | 569 | 32,364.72 | 32,102.98 | - |
| 301219 | 腾远钴业 | 2022年3月10日 | 6个月 | 新股锁定 | 173.98 | 87.82 | 216 | 37,579.68 | 18,969.12 | - |
| 301219 | 腾远钴业 | 2022年5月24日 | 4个月 | 新股锁定-送股 | - | 87.82 | 173 | - | 15,192.86 | - |
| 301228 | 实朴检测 | 2022年1月21日 | 6个月 | 新股锁定 | 20.08 | 20.34 | 373 | 7,489.84 | 7,586.82 | - |
| 301235 | 华康医疗 | 2022年1月21日 | 6个月 | 新股锁定 | 39.30 | 37.93 | 418 | 16,427.40 | 15,854.74 | - |
| 301248 | 杰创智能 | 2022年4月13日 | 6个月 | 新股锁定 | 39.07 | 29.87 | 472 | 18,441.04 | 14,098.64 | - |
| 301259 | 艾布鲁 | 2022年4月18日 | 6个月 | 新股锁定 | 18.39 | 24.94 | 483 | 8,882.37 | 12,046.02 | - |

| | | | | | | | | | | |
|--|--|---|--|--|--|--|--|--|--|--|
| | | 日 | | | | | | | | |
|--|--|---|--|--|--|--|--|--|--|--|

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：截至本报告期末 2022 年 06 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为人民币 0.00 元，无质押债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2022 年 06 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为人民币 0.00 元，无质押债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：无。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

注：无。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

6.4.13.3 流动性风险

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

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

告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款、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，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本 期 末 202 2 年 6 月 30 日 | 1 个月以内 | 1-3 个月 | 3 个月-1 年 | 1-5 年 | 5 年 以 上 | 不计息 | 合计 |
|---|----------------|--------|--------------|-------------|------------------|----------------|----------------|
| 资 产 | | | | | | | |
| 银 行 存 款 | 151,666,347.82 | - | - | - | - | - | 151,666,347.82 |
| 结 算 备 付 金 | 1,863,844.58 | - | - | - | - | - | 1,863,844.58 |
| 存 出 保 证 金 | 477,619.38 | - | - | - | - | - | 477,619.38 |
| 交 | - | - | 117,140,103. | 10,295,432. | - | 936,006,102.60 | 1,063,441,638. |

| | | | | | | |
|---------|----------------|---|----------------|---------------|----------------|------------------|
| 易性金融资产 | | | 50 | 88 | | 98 |
| 应收申购款 | - | - | - | - | 13,389.66 | 13,389.66 |
| 应收清算款 | - | - | - | - | 13,199,403.68 | 13,199,403.68 |
| 资产总计 | 154,007,811.78 | - | 117,140,103.50 | 10,295,432.88 | 949,218,895.94 | 1,230,662,244.10 |
| 负债 | | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | - | 389,193.04 | 389,193.04 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | 1,433,539.83 | 1,433,539.83 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | 238,923.32 | 238,923.32 |
| 应付清算款 | - | - | - | - | 7,326,716.22 | 7,326,716.22 |
| 应 | - | - | - | - | 0.66 | 0.66 |

| | | | | | | | |
|-----------------------|----------------|--------|----------------|---------------|-------|---------------|----------------|
| 付销售服务费 | | | | | | | |
| 应交税费 | - | - | - | - | - | 206,630.13 | 206,630.13 |
| 其他负债 | - | - | - | - | - | 1,915,243.77 | 1,915,243.77 |
| 负债总计 | - | - | - | - | - | 11,510,246.97 | 11,510,246.97 |
| 利率敏感度缺口 | 154,007,811.78 | - | 117,140,103.50 | 10,295,432.88 | - | | |
| 上年度末 2021 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 | | | | | | | |
| 银行存款 | 118,891,095.59 | - | - | - | - | - | 118,891,095.59 |
| 结算备 | 4,477,977.78 | - | - | - | - | - | 4,477,977.78 |

| | | | | | | |
|---------|----------------|----------------|----------------|---|------------------|------------------|
| 付金 | | | | | | |
| 存出保证金 | 714,226.66 | - | - | - | - | 714,226.66 |
| 交易性金融资产 | - | 100,090,000.00 | 120,006,000.00 | - | 1,080,631,678.71 | 1,300,727,678.71 |
| 应收申购款 | - | - | - | - | 182,199.53 | 182,199.53 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | - | 5,749,788.10 | 5,749,788.10 |
| 其他资产 | - | - | - | - | 3,410,586.11 | 3,410,586.11 |
| 资产总计 | 124,083,300.03 | 100,090,000.00 | 120,006,000.00 | - | 1,089,974,252.45 | 1,434,153,552.48 |
| 负债 | | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | - | 971,657.53 | 971,657.53 |
| 应付管理 | - | - | - | - | 1,855,198.46 | 1,855,198.46 |

| | | | | | | |
|---------------------------------|----------------|----------------|----------------|---|---|--------------|
| 人 报 酬 | | | | | | |
| 应 付 托 管 费 | | - | - | - | - | 309,199.75 |
| 应 交 税 费 | | - | - | - | - | 206,630.13 |
| 其 他 负 债 | | - | - | - | - | 3,004,851.90 |
| 负 债 总 计 | | - | - | - | - | 6,347,537.77 |
| 利 率 敏 感 度 缺 口 | 124,083,300.03 | 100,090,000.00 | 120,006,000.00 | | | |

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

| 假设 | 在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时 | | |
|----|---------------------------|-----------------------------|-------------------|
| | 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（2022年6月30日） | 上年度末（2021年12月31日） |
| 分析 | 利率上升 25 个基点 | -378,632.88 | -204,375.92 |
| | 利率下降 25 个基点 | 384,196.24 | 204,892.59 |

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。

本基金持有的金融工具以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

注：无。

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

注：无。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，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。

本基金投资组合的资产配置为：股票资产 10%-85%，权证投资 0%-3%，债券 10%-85%，本基金保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。

于本期末及上年度末，本基金面临的整体其他价格风险列示如下：

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2022年6月30日 | | 上年度末 2021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 | 936,006,102.60 | 76.78 | 1,080,631,678.71 | 75.68 |
| 交易性金融资产—基金投资 | — | — | — | — |
| 交易性金融资产—债券投资 | 127,435,536.38 | 10.45 | 220,096,000.00 | 15.41 |
| 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 | 1,063,441,638.98 | 87.23 | 1,300,727,678.71 | 91.10 |

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| 假设 | 在其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时 | |
|----|-------------------------------|-----------------------------|
| | 相关风险变量的变 | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） |

| | 动 | 本期末 (2022 年 6 月 30 日) | 上年度末 (2021 年 12 月 31 日) |
|----|-------------------|-----------------------|-------------------------|
| 分析 | 沪深 300 指数上升 5% | 51,382,055.00 | 63,703,237.46 |
| | 沪深 300 指数下降 5% | -51,382,055.00 | -63,703,237.46 |

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

注：无。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

| 公允价值计量结果所属的层次 | 本期末 2022 年 6 月 30 日 | 上年度末 2021 年 12 月 31 日 |
|---------------|------------------------|--------------------------|
| 第一层次 | 935,811,236.71 | 1,079,390,587.01 |
| 第二层次 | 127,435,536.38 | 221,337,091.70 |
| 第三层次 | 194,865.89 | 0.00 |
| 合计 | 1,063,441,638.98 | 1,300,727,678.71 |

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

注：无。

§ 7 投资组合报告**7.1 期末基金资产组合情况**

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|------------------|---------------|
| 1 | 权益投资 | 936,006,102.60 | 76.06 |
| | 其中：股票 | 936,006,102.60 | 76.06 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 127,435,536.38 | 10.36 |
| | 其中：债券 | 127,435,536.38 | 10.36 |
| | 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 | 153,530,192.40 | 12.48 |
| 8 | 其他各项资产 | 13,690,412.72 | 1.11 |
| 9 | 合计 | 1,230,662,244.10 | 100.00 |

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合**7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合**

金额单位：人民币元

| 代码 | 行业类别 | 公允价值 (元) | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|------------------|----------------|---------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 845,880,424.52 | 69.38 |
| 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 | 38,819,219.99 | 3.18 |
| J | 金融业 | 41,223,710.00 | 3.38 |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | 6,126,059.00 | 0.50 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 3,879,989.56 | 0.32 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 60,465.39 | 0.00 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 16,234.14 | 0.00 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 936,006,102.60 | 76.78 |

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：无。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|--------|-----------|----------------|--------------|
| 1 | 600519 | 贵州茅台 | 52,956 | 108,295,020.00 | 8.88 |
| 2 | 300593 | 新雷能 | 1,371,048 | 56,912,202.48 | 4.67 |
| 3 | 002594 | 比亚迪 | 118,300 | 39,451,867.00 | 3.24 |
| 4 | 688066 | 航天宏图 | 492,298 | 38,793,082.40 | 3.18 |
| 5 | 688063 | 派能科技 | 119,915 | 37,437,463.00 | 3.07 |
| 6 | 603668 | 天马科技 | 1,640,260 | 33,608,927.40 | 2.76 |
| 7 | 601689 | 拓普集团 | 477,903 | 32,702,902.29 | 2.68 |
| 8 | 002129 | TCL 中环 | 501,800 | 29,551,002.00 | 2.42 |
| 9 | 300750 | 宁德时代 | 55,000 | 29,370,000.00 | 2.41 |
| 10 | 002459 | 晶澳科技 | 355,460 | 28,045,794.00 | 2.30 |
| 11 | 600809 | 山西汾酒 | 83,493 | 27,118,526.40 | 2.22 |
| 12 | 603236 | 移远通信 | 199,420 | 26,654,477.20 | 2.19 |
| 13 | 688223 | 晶科能源 | 1,775,782 | 26,512,425.26 | 2.17 |
| 14 | 002812 | 恩捷股份 | 105,200 | 26,347,340.00 | 2.16 |
| 15 | 601127 | 小康股份 | 303,700 | 24,627,033.00 | 2.02 |
| 16 | 600522 | 中天科技 | 1,035,100 | 23,910,810.00 | 1.96 |
| 17 | 002049 | 紫光国微 | 122,748 | 23,287,750.56 | 1.91 |
| 18 | 600873 | 梅花生物 | 1,966,700 | 22,184,376.00 | 1.82 |
| 19 | 688377 | 迪威尔 | 710,952 | 22,003,964.40 | 1.80 |
| 20 | 601838 | 成都银行 | 1,315,400 | 21,809,332.00 | 1.79 |
| 21 | 688122 | 西部超导 | 228,680 | 21,084,296.00 | 1.73 |

| | | | | | |
|----|--------|------|-----------|---------------|------|
| 22 | 000519 | 中兵红箭 | 705,300 | 20,559,495.00 | 1.69 |
| 23 | 600887 | 伊利股份 | 514,400 | 20,035,880.00 | 1.64 |
| 24 | 600206 | 有研新材 | 1,030,100 | 19,922,134.00 | 1.63 |
| 25 | 601012 | 隆基绿能 | 283,920 | 18,917,589.60 | 1.55 |
| 26 | 688385 | 复旦微电 | 269,143 | 17,545,432.17 | 1.44 |
| 27 | 000568 | 泸州老窖 | 65,242 | 16,084,762.68 | 1.32 |
| 28 | 000792 | 盐湖股份 | 493,000 | 14,770,280.00 | 1.21 |
| 29 | 603688 | 石英股份 | 108,400 | 14,374,924.00 | 1.18 |
| 30 | 300059 | 东方财富 | 526,620 | 13,376,148.00 | 1.10 |
| 31 | 603659 | 璞泰来 | 144,700 | 12,212,680.00 | 1.00 |
| 32 | 603868 | 飞科电器 | 145,900 | 11,051,925.00 | 0.91 |
| 33 | 688123 | 聚辰股份 | 103,056 | 10,977,525.12 | 0.90 |
| 34 | 600399 | 抚顺特钢 | 601,300 | 10,763,270.00 | 0.88 |
| 35 | 002025 | 航天电器 | 141,360 | 9,869,755.20 | 0.81 |
| 36 | 601888 | 中国中免 | 26,300 | 6,126,059.00 | 0.50 |
| 37 | 000776 | 广发证券 | 322,900 | 6,038,230.00 | 0.50 |
| 38 | 603198 | 迎驾贡酒 | 70,300 | 4,579,342.00 | 0.38 |
| 39 | 600702 | 舍得酒业 | 21,100 | 4,304,189.00 | 0.35 |
| 40 | 603127 | 昭衍新药 | 33,700 | 3,835,060.00 | 0.31 |
| 41 | 600587 | 新华医疗 | 17,000 | 344,250.00 | 0.03 |
| 42 | 300763 | 锦浪科技 | 1,350 | 287,550.00 | 0.02 |
| 43 | 601089 | 福元医药 | 1,749 | 36,816.45 | 0.00 |
| 44 | 301219 | 腾远钴业 | 389 | 34,161.98 | 0.00 |
| 45 | 301207 | 华兰疫苗 | 569 | 32,102.98 | 0.00 |
| 46 | 301109 | 军信股份 | 1,838 | 29,665.32 | 0.00 |
| 47 | 301201 | 诚达药业 | 353 | 25,253.62 | 0.00 |
| 48 | 301096 | 百诚医药 | 272 | 21,488.00 | 0.00 |
| 49 | 301127 | 天源环保 | 1,685 | 18,754.05 | 0.00 |
| 50 | 301103 | 何氏眼科 | 507 | 16,234.14 | 0.00 |
| 51 | 301235 | 华康医疗 | 418 | 15,854.74 | 0.00 |
| 52 | 301248 | 杰创智能 | 472 | 14,098.64 | 0.00 |
| 53 | 301259 | 艾布鲁 | 483 | 12,046.02 | 0.00 |
| 54 | 301179 | 泽宇智能 | 295 | 12,038.95 | 0.00 |
| 55 | 001268 | 联合精密 | 409 | 11,337.48 | 0.00 |
| 56 | 603272 | 联翔股份 | 443 | 9,723.85 | 0.00 |
| 57 | 301193 | 家联科技 | 297 | 8,063.55 | 0.00 |
| 58 | 301133 | 金钟股份 | 286 | 7,942.22 | 0.00 |
| 59 | 301181 | 标榜股份 | 257 | 7,861.63 | 0.00 |
| 60 | 301228 | 实朴检测 | 373 | 7,586.82 | 0.00 |

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计买入金额 | 占期初基金资产净值比例(%) |
|----|--------|--------|---------------|----------------|
| 1 | 300750 | 宁德时代 | 70,732,483.90 | 4.95 |
| 2 | 601012 | 隆基绿能 | 55,923,981.71 | 3.92 |
| 3 | 601318 | 中国平安 | 47,506,474.00 | 3.33 |
| 4 | 002594 | 比亚迪 | 46,986,674.32 | 3.29 |
| 5 | 002812 | 恩捷股份 | 46,008,604.00 | 3.22 |
| 6 | 002714 | 牧原股份 | 37,956,070.15 | 2.66 |
| 7 | 002304 | 洋河股份 | 37,923,382.00 | 2.66 |
| 8 | 000651 | 格力电器 | 37,903,226.10 | 2.65 |
| 9 | 600030 | 中信证券 | 37,855,785.67 | 2.65 |
| 10 | 000792 | 盐湖股份 | 37,067,368.00 | 2.60 |
| 11 | 601111 | 中国国航 | 33,977,863.96 | 2.38 |
| 12 | 002459 | 晶澳科技 | 33,632,199.00 | 2.36 |
| 13 | 601689 | 拓普集团 | 33,376,360.11 | 2.34 |
| 14 | 600941 | 中国移动 | 31,633,507.61 | 2.22 |
| 15 | 002821 | 凯莱英 | 30,205,223.00 | 2.12 |
| 16 | 002129 | TCL 中环 | 29,764,048.00 | 2.08 |
| 17 | 000799 | 酒鬼酒 | 28,076,737.99 | 1.97 |
| 18 | 600519 | 贵州茅台 | 27,890,409.00 | 1.95 |
| 19 | 601668 | 中国建筑 | 25,854,903.86 | 1.81 |
| 20 | 601816 | 京沪高铁 | 25,764,346.50 | 1.80 |

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计卖出金额 | 占期初基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|---------------|----------------|
| 1 | 300750 | 宁德时代 | 69,483,011.77 | 4.87 |
| 2 | 002304 | 洋河股份 | 58,392,527.60 | 4.09 |
| 3 | 300059 | 东方财富 | 52,676,978.08 | 3.69 |
| 4 | 601318 | 中国平安 | 46,293,345.99 | 3.24 |
| 5 | 601012 | 隆基绿能 | 46,228,260.00 | 3.24 |
| 6 | 000002 | 万科 A | 41,053,043.51 | 2.88 |
| 7 | 002594 | 比亚迪 | 38,773,768.40 | 2.72 |
| 8 | 300661 | 圣邦股份 | 36,957,343.00 | 2.59 |
| 9 | 000651 | 格力电器 | 34,322,590.13 | 2.40 |
| 10 | 600030 | 中信证券 | 32,610,146.33 | 2.28 |
| 11 | 002714 | 牧原股份 | 31,842,541.76 | 2.23 |
| 12 | 600406 | 国电南瑞 | 31,439,247.76 | 2.20 |
| 13 | 600399 | 抚顺特钢 | 30,475,761.50 | 2.13 |

| | | | | |
|----|--------|------|---------------|------|
| 14 | 601111 | 中国国航 | 30,464,938.00 | 2.13 |
| 15 | 600941 | 中国移动 | 30,337,076.17 | 2.12 |
| 16 | 603605 | 珀莱雅 | 29,528,929.34 | 2.07 |
| 17 | 600702 | 舍得酒业 | 29,194,933.00 | 2.04 |
| 18 | 002821 | 凯莱英 | 26,878,243.00 | 1.88 |
| 19 | 002241 | 歌尔股份 | 26,740,333.74 | 1.87 |
| 20 | 002555 | 三七互娱 | 26,289,132.48 | 1.84 |

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

| | |
|--------------|------------------|
| 买入股票成本（成交）总额 | 1,743,380,771.95 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 1,722,560,558.76 |

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种 | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|----------------|--------------|
| 1 | 国家债券 | 66,611,254.18 | 5.46 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 50,528,849.32 | 4.14 |
| | 其中：政策性金融债 | 50,528,849.32 | 4.14 |
| 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 | 10,295,432.88 | 0.84 |
| 10 | 合计 | 127,435,536.38 | 10.45 |

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|----|---------|--------------|---------|---------------|--------------|
| 1 | 019664 | 21 国债 16 | 655,260 | 66,611,254.18 | 5.46 |
| 2 | 220201 | 22 国开 01 | 500,000 | 50,528,849.32 | 4.14 |
| 3 | 2228002 | 22 百信银行二级 01 | 100,000 | 10,295,432.88 | 0.84 |

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：无。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：无。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：无。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**7.11.1 本期国债期货投资政策**

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。

7.11.2 本期国债期货投资评价

无。

7.12 投资组合报告附注**7.12.1 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：

国家开发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。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中，未有投资于超出基金合同规定备选股票库之外股票。

7.12.3 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 | 477,619.38 |
| 2 | 应收清算款 | 13,199,403.68 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 13,389.66 |

| | | |
|---|-------|---------------|
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 13,690,412.72 |

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：无。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：无。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 份额级别 | 持有人户数（户） | 户均持有的基金份额 | 持有人结构 | | | |
|------------|----------|-----------|--------------|-----------|----------------|-----------|
| | | | 机构投资者 | | 个人投资者 | |
| | | | 持有份额 | 占总份额比例（%） | 持有份额 | 占总份额比例（%） |
| 长城安心回报混合 A | 65,696 | 10,815.63 | 2,246,784.51 | 0.32 | 708,296,898.19 | 99.68 |
| 长城安心回报混合 C | 11 | 591.73 | - | - | 6,509.04 | 100.00 |
| 合计 | 65,707 | 10,813.92 | 2,246,784.51 | 0.32 | 708,303,407.23 | 99.68 |

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

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 份额级别 | 持有份额总数（份） | 占基金总份额比例（%） |
|------------------|------------|-----------|-------------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 长城安心回报混合 A | 2,494.99 | 0.0004 |
| | 长城安心回报混合 C | 492.07 | 7.5598 |
| | 合计 | 2,987.06 | 0.0004 |

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

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

| 项目 | 份额级别 | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|--------------------------------|------------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金 | 长城安心回报混合 A | 0 |
| | 长城安心回报混合 C | 0 |
| | 合计 | 0 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 长城安心回报混合 A | 0 |
| | 长城安心回报混合 C | 0 |
| | 合计 | 0 |

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 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 长城安心回报混合 A | 长城安心回报混合 C |
|--|------------------|------------|
| 基金合同生效日 (2006 年 8 月 22 日) 基金份额总额 | 1,416,548,067.74 | - |
| 本报告期期初基金份额总额 | 731,070,787.41 | - |
| 本报告期基金总申购份额 | 5,361,516.56 | 6,514.90 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 25,888,621.27 | 5.86 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 710,543,682.70 | 6,509.04 |

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、基金管理人重大人事变动：

自 2022 年 1 月 11 日起，沈阳女士不再担任公司副总经理。

2、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：

2022 年 3 月，中国农业银行总行决定王霄勇任托管业务部总裁。

2022 年 3 月，中国农业银行总行决定王洪滨任托管业务部高级专家。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本基金本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期内投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|------|--------|----------------|------------------|------------|----------------|----|
| | | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 (%) | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 (%) | |
| 中信建投 | 1 | 918,922,562.87 | 26.56 | 855,798.61 | 26.56 | - |
| 国信证券 | 1 | 463,594,874.90 | 13.40 | 431,745.17 | 13.40 | - |
| 国泰君安 | 2 | 447,950,968.33 | 12.95 | 417,179.59 | 12.95 | - |
| 中金公司 | 1 | 427,826,612. | 12.36 | 398,430.30 | 12.36 | - |

| | | | | | | |
|--------------------|---|--------------------|------|------------|------|---|
| | | 74 | | | | |
| 招商证券 股份有限 公司 | 2 | 269,930,755. 49 | 7.80 | 251,387.28 | 7.80 | - |
| 国盛证券 | 1 | 201,610,067. 76 | 5.83 | 187,767.24 | 5.83 | - |
| 西南证券 | 1 | 191,234,024. 78 | 5.53 | 178,096.49 | 5.53 | - |
| 光大证券 | 1 | 188,934,275. 45 | 5.46 | 175,947.23 | 5.46 | - |
| 财信证券 | 2 | 121,730,592. 43 | 3.52 | 113,367.27 | 3.52 | - |
| 中信证券 | 2 | 121,096,534. 29 | 3.50 | 112,776.65 | 3.50 | - |
| 长城证券 | 3 | 107,394,783. 08 | 3.10 | 100,016.97 | 3.10 | - |
| 长江证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 大同证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 德邦证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 东方财富 | 2 | - | - | - | - | - |
| 东方证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 东兴证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 方正证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 国联证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华安证券 股份有限 公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华金证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 华西证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 申万宏源 | 2 | - | - | - | - | - |
| 世纪证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 新时代证 券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 信达证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 银河证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 粤开证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 中泰证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 中银国际 | 1 | - | - | - | - | - |

注：1、报告期内租用证券公司席位的变更情况：

本报告期内新增 10 个专用交易单元（财信证券、德邦证券、华金证券、中泰证券各新增 2 个交易单元，国联证券、华安证券各新增 1 个交易单元），截止本报告期末共，44 个交易单元。

2、专用席位的选择标准和程序

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

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

根据上述标准考察确定后，基金管理人和被选中的证券经营机构签订委托协议，并通知托管人。

基金管理人应根据有关规定，在基金的中期报告和年度报告中将所选证券经营机构的有关情况、基金通过该证券经营机构买卖证券的成交量、支付的佣金等予以披露。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 | | 债券回购交易 | | 权证交易 | |
|------------|---------------|------------------|--------|--------------------|------|------------------|
| | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 (%) | 成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例 (%) | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 (%) |
| 中信建投 | - | - | - | - | - | - |
| 国信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国泰君安 | - | - | - | - | - | - |
| 中金公司 | - | - | - | - | - | - |
| 招商证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 国盛证券 | 60,602,153.70 | 92.38 | - | - | - | - |
| 西南证券 | - | - | - | - | - | - |
| 光大证券 | 4,999,992.80 | 7.62 | - | - | - | - |
| 财信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 长城证券 | - | - | - | - | - | - |
| 长江证券 | - | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|--------------------|---|---|---|---|---|---|
| 大同证券 | - | - | - | - | - | - |
| 德邦证券 | - | - | - | - | - | - |
| 东方财富 | - | - | - | - | - | - |
| 东方证券 | - | - | - | - | - | - |
| 东兴证券 | - | - | - | - | - | - |
| 方正证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国联证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华安证券 股份有限 公司 | - | - | - | - | - | - |
| 华金证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华西证券 | - | - | - | - | - | - |
| 申万宏源 | - | - | - | - | - | - |
| 世纪证券 | - | - | - | - | - | - |
| 新时代证 券 | - | - | - | - | - | - |
| 信达证券 | - | - | - | - | - | - |
| 银河证券 | - | - | - | - | - | - |
| 粤开证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中泰证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中银国际 | - | - | - | - | - | - |

10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项 | 法定披露方式 | 法定披露日期 |
|----|--|--------------|------------|
| 1 | 长城基金管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具相关会计准则的公告 | 中国证监会规定报刊及网站 | 2022年1月4日 |
| 2 | 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 | 2022年1月13日 |
| 3 | 长城基金管理有限公司关于上海分公司营业场所变更的公告 | 中国证监会规定报刊及网站 | 2022年2月12日 |
| 4 | 长城基金管理有限公司关于上海分公司变更负责人的公告 | 中国证监会规定报刊及网站 | 2022年4月20日 |
| 5 | 长城基金管理有限公司关于营业场所变更的公告 | 中国证监会规定报刊及网站 | 2022年4月21日 |
| 6 | 长城基金管理有限公司深圳分公司关于营业场所变更的公告 | 中国证监会规定报刊及网站 | 2022年4月21日 |
| 7 | 长城基金管理有限公司关于北京分公司变更负责人的公告 | 中国证监会规定报刊及网站 | 2022年4月23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告(鲁西化工) | 中国证监会规定报刊及网站 | 2022年4月27日 |

| | | | |
|----|---|--------------|-----------------|
| 9 | 长城基金管理有限公司关于终止北京植信基金销售有限公司、北京唐鼎耀华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 | 2022 年 5 月 18 日 |
| 10 | 长城安心回报混合型证券投资基金增设基金份额并相应修改基金合同部分条款的公告 | 中国证监会规定报刊及网站 | 2022 年 6 月 13 日 |

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注：本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- (一) 中国证监会同意长城安心回报混合型证券投资基金募集的文件
- (二) 《长城安心回报混合型证券投资基金基金合同》
- (三) 《长城安心回报混合型证券投资基金托管协议》
- (四) 《长城安心回报混合型证券投资基金招募说明书》
- (五) 基金管理人业务资格批件、营业执照
- (六) 基金托管人业务资格批件、营业执照
- (七) 中国证监会规定的其他文件

12.2 存放地点

基金管理人及基金托管人住所

12.3 查阅方式

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

咨询电话：0755-29279188

客户服务电话：400-8868-666

网站：www.ccfund.com.cn