

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）
2023 年中期报告

2023 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

送出日期：2023 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 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 2023 年 01 月 01 日起至 2023 年 06 月 30 日止。

1.2 目录

| | |
|---|-----------|
| § 1 重要提示及目录 | 2 |
| 1.1 重要提示 | 2 |
| 1.2 目录 | 3 |
| § 2 基金简介 | 5 |
| 2.1 基金基本情况 | 5 |
| 2.2 基金产品说明 | 5 |
| 2.3 基金管理人和基金托管人 | 6 |
| 2.4 信息披露方式 | 6 |
| 2.5 其他相关资料 | 6 |
| § 3 主要财务指标和基金净值表现 | 6 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标 | 6 |
| 3.2 基金净值表现 | 7 |
| § 4 管理人报告 | 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 | 13 |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 | 13 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 | 14 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 | 14 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 | 15 |
| 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 | 15 |
| § 5 托管人报告 | 15 |
| 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 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见 | 15 |
| § 6 半年度财务会计报告（未经审计） | 15 |
| 6.1 资产负债表 | 15 |
| 6.2 利润表 | 17 |
| 6.3 净资产（基金净值）变动表 | 18 |
| 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 | 49 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 | 50 |
| 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 | 50 |

| | |
|---|-----------|
| 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 | 50 |
| 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 | 51 |
| 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 | 51 |
| 7.10 本基金投资股指期货的投资政策 | 51 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 | 51 |
| 7.12 本报告期投资基金情况 | 51 |
| 7.13 投资组合报告附注 | 56 |
| § 8 基金份额持有人信息 | 57 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 | 57 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 | 57 |
| 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 | 57 |
| 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况 | 58 |
| § 9 开放式基金份额变动 | 58 |
| § 10 重大事件揭示 | 59 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 | 59 |
| 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 | 59 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 | 59 |
| 10.4 基金投资策略的改变 | 59 |
| 10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件 | 59 |
| 10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况 | 59 |
| 10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 | 59 |
| 10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况 | 59 |
| 10.9 其他重大事件 | 66 |
| § 11 影响投资者决策的其他重要信息 | 67 |
| 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 | 67 |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 | 68 |
| § 12 备查文件目录 | 68 |
| 12.1 备查文件目录 | 68 |
| 12.2 存放地点 | 68 |
| 12.3 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） | |
| 基金简称 | 长城恒康稳健养老一年混合 FOF | |
| 基金主代码 | 007705 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2020 年 6 月 3 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 | |
| 报告期末基金份 额总额 | 209,298,677.27 份 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |
| 下属分级基金的基 金简称 | 长城恒康稳健养老一年混合（FOF）A | 长城恒康稳健养老一年混合（FOF）Y |
| 下属分级基金的交 易代码 | 007705 | 017295 |
| 报告期末下属分级 基金的份额总额 | 206,162,602.61 份 | 3,136,074.66 份 |

2.2 基金产品说明

| | |
|------|--|
| 投资目标 | 本基金通过运用目标风险策略对大类资产进行配置，在控制组合波动风险的前提下，追求资产的长期稳健增值。 |
| 投资策略 | <p>1、大类资产配置策略</p> <p>本基金为目标风险策略基金，根据基金合同约定的权益类资产的战略配置比例进行资产配置。本基金战略配置于权益类资产的比例为 25%，同时结合各类资产的实际市场情况，在基金合同约定的范围内对大类资产配置比例进行一定动态调整，高配当前被低估的资产、低配被高估的资产。</p> <p>2、基金投资策略</p> <p>在确定各类资产配置比例后，本基金将通过科学的基金筛选流程，精选基金作为本基金的投资标的。采用严谨的分析方法对基金进行研究，综合考察基金的指数代表性、业绩、风险、流动性、投资组合等多方面因素，并结合对基金管理公司、基金经理的评价对基金进行筛选，挑选出符合该投资策略的基金。</p> <p>3、股票投资策略</p> <p>本基金将充分发挥“自下而上”的主动选股能力，构建股票投资组合，同时通过选择流动性高、风险低、具备中期上涨潜力的股票进行分散化组合投资。</p> <p>4、债券投资策略</p> <p>本基金将根据“自上而下”对宏观经济形势、财政与货币政策，以及债券市场资金供求等因素的分析，重点参考基金的流动性管理需要，选取流动性较好的债券进行配置。</p> <p>5、资产支持证券投资策略</p> |

| | |
|--------|--|
| | 本基金将在国内资产证券化产品具体政策框架下，通过宏观经济、提前偿还率、资产池结构及资产池资产所在行业景气变化等因素的研究，对个券进行风险分析和价值评估后选择风险调整后收益高的品种进行投资。 |
| 业绩比较基准 | 中证 800 指数收益率×25%+中债综合财富指数收益率×75% |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金中基金，在通常情况下其预期收益及预期风险水平高于债券型基金、货币市场基金、债券型基金中基金和货币型基金中基金，低于股票型基金和股票型基金中基金。 |

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 | 中国建设银行股份有限公司 |
| 信息披露 负责人 | 姓名 | 车君 | 王小飞 |
| | 联系电话 | 0755-29279005 | 021-60637103 |
| | 电子邮箱 | chejun@ccfund.com.cn | wangxiaofei.zh@ccb.com |
| 客户服务电话 | | 400-8868-666 | 021-60637228 |
| 传真 | | 0755-29279000 | 021-60635778 |
| 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 | 北京市西城区金融大街 25 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 | 北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼 |
| 邮政编码 | | 518046 | 100033 |
| 法定代表人 | | 王军 | 田国立 |

2.4 信息披露方式

| | |
|---------------------|-------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 证券日报 |
| 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 | 报告期(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日) | |
|------------|-------------------------------------|----------------------|
| 和指标 | 长城恒康稳健养老一年混合 (FOF) A | 长城恒康稳健养老一年混合 (FOF) Y |
| 本期已实现收益 | 1, 715, 300. 36 | 31, 353. 86 |

| | | |
|---------------|------------------|--------------|
| 本期利润 | 1,349,064.50 | 14,003.54 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0092 | 0.0051 |
| 本期加权平均净值利润率 | 0.93% | 0.51% |
| 本期基金份额净值增长率 | 0.74% | 0.90% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2023年6月30日) | |
| 期末可供分配利润 | -1,430,371.27 | -18,897.81 |
| 期末可供分配基金份额利润 | -0.0069 | -0.0060 |
| 期末基金资产净值 | 204,732,231.34 | 3,117,176.85 |
| 期末基金份额净值 | 0.9931 | 0.9940 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2023年6月30日) | |
| 基金份额累计净值增长率 | -0.69% | 1.14% |

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

长城恒康稳健养老一年混合（FOF）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 | 1.15% | 0.27% | 0.49% | 0.21% | 0.66% | 0.06% |

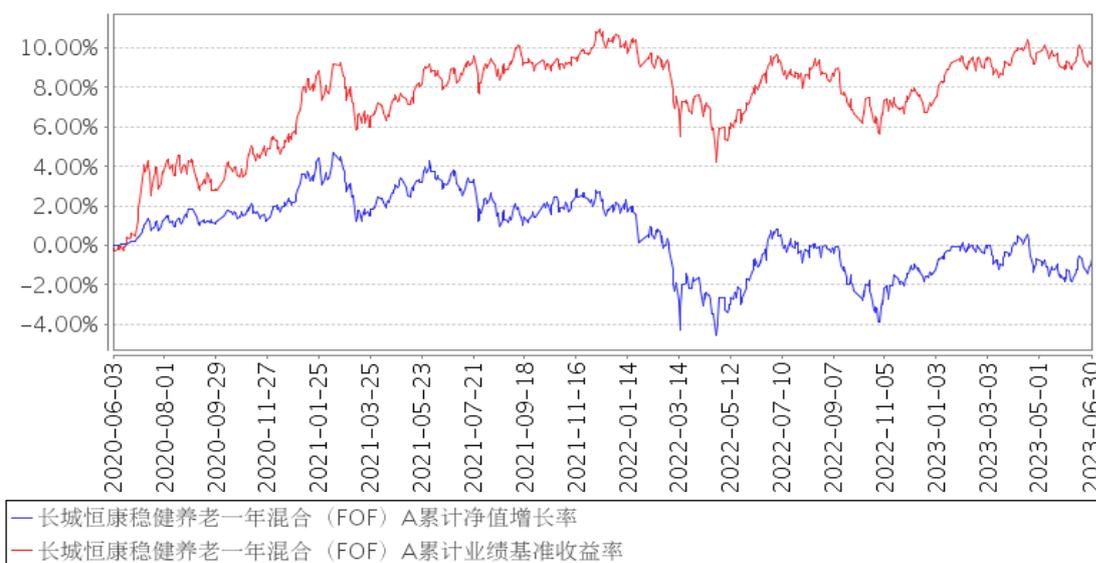
| | | | | | | |
|------------|--------|-------|--------|-------|---------|--------|
| 过去三个月 | -0.56% | 0.25% | -0.06% | 0.20% | -0.50% | 0.05% |
| 过去六个月 | 0.74% | 0.23% | 2.05% | 0.20% | -1.31% | 0.03% |
| 过去一年 | -1.36% | 0.26% | -0.12% | 0.23% | -1.24% | 0.03% |
| 过去三年 | -1.00% | 0.28% | 8.44% | 0.29% | -9.44% | -0.01% |
| 自基金合同生效起至今 | -0.69% | 0.28% | 9.42% | 0.28% | -10.11% | 0.00% |

长城恒康稳健养老一年混合 (FOF) Y

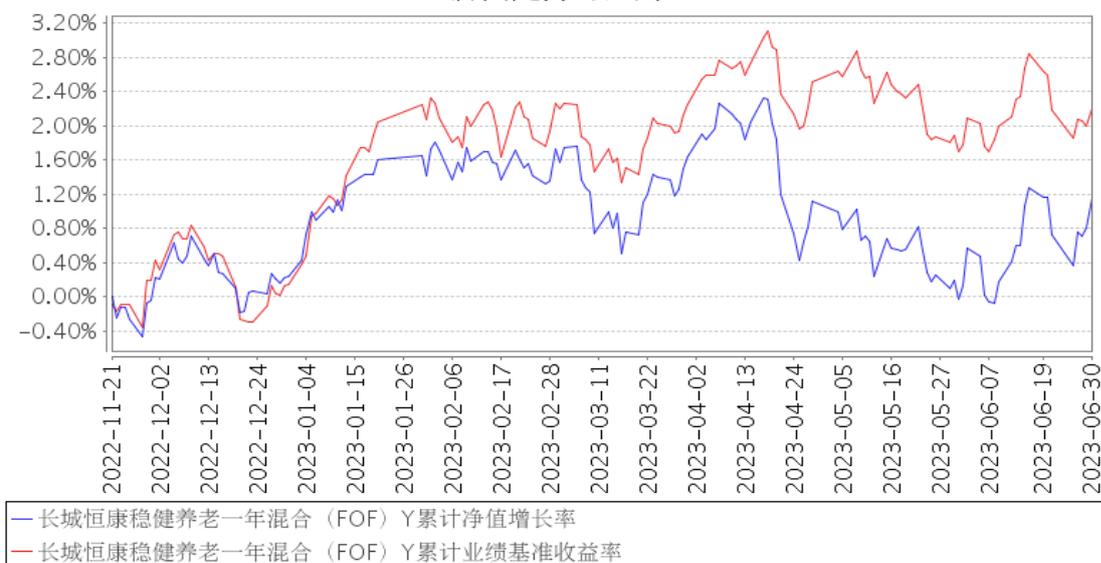
| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去一个月 | 1.17% | 0.27% | 0.49% | 0.21% | 0.68% | 0.06% |
| 过去三个月 | -0.49% | 0.25% | -0.06% | 0.20% | -0.43% | 0.05% |
| 过去六个月 | 0.90% | 0.23% | 2.05% | 0.20% | -1.15% | 0.03% |
| 过去一年 | - | - | - | - | - | - |
| 过去三年 | - | - | - | - | - | - |
| 自基金合同生效起至今 | 1.14% | 0.22% | 2.19% | 0.20% | -1.05% | 0.02% |

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

长城恒康稳健养老一年混合 (FOF) 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



长城恒康稳健养老一年混合（FOF）Y 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基金的投资组合比例为：本基金投资于经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金份额的资产占基金资产的比例不低于 80%，本基金投资于股票、股票型基金、混合型基金和商品基金（含商品期货基金和黄金 ETF）等品种的比例合计原则上不超过 30%。本基金投资于权益类资产的战略配置比例为 25%，投资比例范围为 15%-30%。权益类资产包括股票、股票型基金以及符合以下两种情况之一的混合型基金：一是基金合同约定股票资产投资比例不低于基金资产的 50%，二是最近 4 个季度末，每季度定期报告披露的股票资产占基金资产的比例不低于 50%。权益类资产中投资于医药、消费、信息技术大类行业的指数基金的资产净值占比不低于权益类资产的 80%。现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

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是经中国证监会批准设立的第 15 家基金管理公司，由长城证券股份有限公司（40%）、东方证券股份有限公司（15%）、西北证券有限责任公司（15%）、北方国际信托股份有限公司（15%）、中原信托有限公司（15%）于 2001 年 12 月 27 日共同出资设立，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，将注册资本增加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、长城久鑫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证券投资基金、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、长城嘉裕六个月定期开放债券型证券投资基金、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、长城鑫享 90 天滚动持有中短债债券型证券投资基金、长城产业趋势混合型证券投资基金、长城远见成长混合型证券投资基金、长城聚利纯债债券型证券投资基金、长城中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、长城永利债券型证券投资基金、长城数字经济混合型证券投资基金、长城鑫利 30 天滚动持有中短债债券型证券投资基金、长城产业臻选混合型证券投资基金、长城鼎利一年定期开放债券型发起式证券投资基金、长城全球新能源汽车股票型发起式证券投资基金（QDII-LOF）、长城创新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 | | |
| 徐力恒 | 本基金的基金经理 | 2023 年 2 月 28 日 | - | 6 年 | 男，中国籍，博士。2022 年 7 月加入长城基金管理有限公司。2017 年 6 月至 2022 年 7 月曾就职于鹏华基金管理有限公司，历任研究员、专户投资经理（2018 年 12 月至 2022 年 6 月）。自 2023 年 2 月至今任“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）”基金经理。 |
| 蔡旻 | 本基金的基金经理 | 2020 年 8 月 28 日 | 2023 年 2 月 28 日 | 13 年 | 男，中国籍，硕士，金融风险管理师（FRM）。2010 年 4 月加入长城基金管理有限公司，历任固定收益部债券研究员，“长城货币市场证券投资基金”基金经理助理。自 2015 年 1 月至 2016 年 11 月任“长城岁岁金理财债券型证券投资基金”基金经理。自 2015 年 1 月至 2016 年 11 月任“长城淘金一年期理财债券型证券投资基金”基金经理，自 2016 年 3 月至 2017 年 7 月任“长城新 |

| | | | | |
|--|--|--|--|--|
| | | | | <p>优选混合型证券投资基金”基金经理，自 2015 年 12 月至 2017 年 7 月任“长城保本混合型证券投资基金”，自 2016 年 4 月至 2017 年 7 月任“长城新视野混合型证券投资基金”基金经理，自 2016 年 5 月至 2018 年 8 月任“长城久惠保本混合型证券投资基金”基金经理，自 2015 年 12 月至 2018 年 11 月任“长城久祥保本混合型证券投资基金”基金经理，自 2017 年 7 月至 2019 年 5 月任“长城久利保本混合型证券投资基金”的基金经理，自 2016 年 6 月至 2019 年 6 月任“长城久源保本混合型证券投资基金”基金经理，自 2016 年 5 月至 2019 年 6 月任“长城久盈纯债债券型证券投资基金”基金经理，自 2017 年 7 月至 2020 年 7 月任“长城久信债券型证券投资基金”基金经理，自 2015 年 5 月至 2020 年 7 月任“长城稳健增利债券型证券投资基金”基金经理，自 2016 年 11 月至 2020 年 7 月任“长城久稳债券型证券投资基金”基金经理，自 2017 年 7 月至 2020 年 7 月任“长城稳固收益债券型证券投资基金”、“长城增强收益定期开放债券型证券投资基金”基金经理，自 2018 年 6 月至 2020 年 7 月任“长城久荣纯债定期开放债券型发起式证券投资基金”基金经理。自 2020 年 8 月至 2023 年 2 月任“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）”基金经理，自 2020 年 10 月至今任“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）”基金经理。</p> |
|--|--|--|--|--|

注：①上述任职日期、离任日期根据公司做出决定的任免日期填写。

②证券从业年限的计算方式遵从从业人员的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2023 上半年对于管理人来说比较意外的是，经济复苏的节奏并未达到此前的预期。因此，无风险利率与信用利差的下行幅度超出预期，而股市并未演绎持续的“复苏交易”。组合在这个阶段，债券端始终保持了较短久期，因此阶段性不受益；股票端 Q2 随着其性价比的提升提高了仓位，阶段性也承受了一定的回撤压力，但逐步调整节奏，稳定了净值。

组合在配置上始终坚持：第一，回归稳健养老、稳健理财的定位，以扎扎实实为投资者获取盈利为目标，通过提升组合的性价比不断增强投资者持有的信心；第二，通过 FOF 保证股债两端的高专业度，买基金是以低成本获取专业化能力的途径，因此有理由进一步提升股、债管理的专业度，并将主动基金、被动基金与个股等多种投资工具置于平等地位进行考量，最终选择性价比更高的投资工具；第三，坚持均衡的原则，做有限偏离，资产配置首先是要承认自身的局限性，要确定合理的基准，坚持均衡配置，基于“底线思维”而非“强者思维”在极端位置形成偏离的决策，尽可能不做似是而非的判断。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末长城恒康稳健养老一年混合（FOF）A 的基金份额净值为 0.9931 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.74%，同期业绩比较基准收益率为 2.05%；截至本报告期末长城恒康稳健养老一年混合（FOF）Y 的基金份额净值为 0.9940 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.90%，同期业绩比较基准收益率为 2.05%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

由于市场的变化每每超出一致预期，使得管理人对未来市场的判断始终心存敬畏。管理人认为，中期战略层面还是要回归全球竞争力的视角，这样才能够找到当前中国最具备全球竞争力的环节，以此作为战略配置的重点，这样的视角也能够让我们更加客观的看待海外资产的投资机会，归根到底是由比较优势决定的。当前中国部分高端制造，例如新能源、汽车、工程机械、化工等领域，已经具备很强的竞争力，且未来仍有望持续提升，当然，其中我们更加关注供给格局的变化，关注那些真正可能脱颖而出的环节或者竞争者。基于这些中长期线索，管理人能够把投资的久期拉长，最终让投资者实现稳健收益。

当然战术层面，如果后续复苏能够持续，将带来市场信心的改善，预期会发生扭转，市场整体估值或有一定的提升空间，这样的环境或类似 2019-2020 年，如果是这样的话，长坡厚雪、周期成长是我们下一步关注的方向。

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、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

本基金本报告期末进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金无需要说明的情况。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，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，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

§ 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）

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2023 年 6 月 30 日 | 上年度末 2022 年 12 月 31 日 |
|------------|---------|------------------------|--------------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 3,386,828.44 | 5,365,138.32 |
| 结算备付金 | | 544,542.16 | 72,382.02 |
| 存出保证金 | | 25,631.99 | 6,734.61 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 206,724,827.18 | 120,659,074.96 |
| 其中：股票投资 | | 3,427,695.94 | - |
| 基金投资 | | 177,598,727.43 | 104,389,726.42 |
| 债券投资 | | 25,698,403.81 | 16,269,348.54 |

| | | | |
|---------------|------------|---------------------------|-----------------------------|
| 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 | | 1,023,980.89 | - |
| 应收股利 | | 1,366.92 | 302,878.80 |
| 应收申购款 | | 12,273.21 | 952,411.05 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.8 | 107.89 | - |
| 资产总计 | | 211,719,558.68 | 127,358,619.76 |
| 负债和净资产 | 附注号 | 本期末 2023年6月30日 | 上年度末 2022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 | | 3,450,752.84 | - |
| 应付赎回款 | | 195,222.19 | 156,104.42 |
| 应付管理人报酬 | | 73,653.62 | 64,098.19 |
| 应付托管费 | | 21,745.38 | 13,593.21 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付投资顾问费 | | - | - |
| 应交税费 | | 143.94 | 227.47 |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.9 | 128,632.52 | 129,000.00 |
| 负债合计 | | 3,870,150.49 | 363,023.29 |
| 净资产： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.10 | 209,298,677.27 | 128,830,565.56 |
| 其他综合收益 | 6.4.7.11 | - | - |
| 未分配利润 | 6.4.7.12 | -1,449,269.08 | -1,834,969.09 |
| 净资产合计 | | 207,849,408.19 | 126,995,596.47 |
| 负债和净资产总计 | | 211,719,558.68 | 127,358,619.76 |

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额总额 209,298,677.27 份，其中长城恒康稳健养老一年混合（FOF）A 基金份额总额 206,162,602.61 份，基金份额净值 0.9931 元；长城恒康稳健养

老一年混合（FOF）Y 基金份额总额 3,136,074.66 份，基金份额净值 0.9940 元。

6.2 利润表

会计主体：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）

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
|------------------------|------------|--|---|
| 一、营业总收入 | | 1,947,531.54 | -1,263,368.19 |
| 1. 利息收入 | | 18,276.32 | 3,221.87 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.13 | 13,342.30 | 3,178.36 |
| 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 | | 4,934.02 | 43.51 |
| 证券出借利息收入 | | - | - |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） | | 2,312,550.85 | -2,876,067.05 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.14 | 77,846.79 | - |
| 基金投资收益 | 6.4.7.15 | -452,562.81 | -3,716,929.15 |
| 债券投资收益 | 6.4.7.16 | 403,559.79 | 221,969.62 |
| 资产支持证券投资 | 6.4.7.17 | - | - |
| 收益 | | | |
| 贵金属投资收益 | 6.4.7.18 | - | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.19 | - | - |
| 股利收益 | 6.4.7.20 | 2,283,707.08 | 618,892.48 |
| 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） | 6.4.7.21 | -383,586.18 | 1,609,476.99 |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - | - |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列） | 6.4.7.22 | 290.55 | - |
| 减：二、营业总支出 | | 584,463.50 | 433,295.28 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 373,255.63 | 275,683.17 |
| 2. 托管费 | 6.4.10.2.2 | 92,612.88 | 59,441.22 |
| 3. 销售服务费 | | - | - |

| | | | |
|----------------------------|----------|---------------------|----------------------|
| 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 | 6.4.7.24 | - | - |
| 7. 税金及附加 | | 365.27 | 107.73 |
| 8. 其他费用 | 6.4.7.25 | 118,229.72 | 98,063.16 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 1,363,068.04 | -1,696,663.47 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 1,363,068.04 | -1,696,663.47 |
| 五、其他综合收益的税后净额 | | - | - |
| 六、综合收益总额 | | 1,363,068.04 | -1,696,663.47 |

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：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）

本报告期：2023年1月1日至2023年6月30日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023年1月1日至2023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) | 128,830,565.56 | - | -1,834,969.09 | 126,995,596.47 |
| 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) | 128,830,565.56 | - | -1,834,969.09 | 126,995,596.47 |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列) | 80,468,111.71 | - | 385,700.01 | 80,853,811.72 |

| | | | | |
|--|----------------------|--------|---------------|----------------|
| (一)、综合收益总额 | - | - | 1,363,068.04 | 1,363,068.04 |
| (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) | 80,468,111.71 | - | -977,368.03 | 79,490,743.68 |
| 其中:1.基金申购款 | 89,647,410.72 | - | -1,018,882.75 | 88,628,527.97 |
| 2.基金赎回款 | -9,179,299.01 | - | 41,514.72 | -9,137,784.29 |
| (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) | 209,298,677.27 | - | -1,449,269.08 | 207,849,408.19 |
| 项目 | 上年度可比期间 | | | |
| | 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) | 104,640,236.26 | - | 2,282,729.41 | 106,922,965.67 |
| 加:会计政策变更 | - | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 二、本期初净资产(基金净值) | 104,640,236.26 | - | 2,282,729.41 | 106,922,965.67 |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列) | -17,003,751.87 | - | -1,687,820.13 | -18,691,572.00 |
| (一)、综合收益总额 | - | - | -1,696,663.47 | -1,696,663.47 |
| (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) | -17,003,751.87 | - | 8,843.34 | -16,994,908.53 |
| 其中:1.基金申购款 | 27,693.10 | - | -124.05 | 27,569.05 |
| 2.基金赎回款 | -17,031,444.97 | - | 8,967.39 | -17,022,477.58 |
| (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) | 87,636,484.39 | - | 594,909.28 | 88,231,393.67 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

王军

邱春杨

赵永强

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

长城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）（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【2019】1103 号文“关于准予长城恒康稳健养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）注册的批复”及【2020】189 号文“关于准予长城恒康稳健养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）变更注册的批复”的核准，由长城基金管理有限公司自 2020 年 5 月 18 日至 2020 年 5 月 29 日向社会公开募集，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（2020）验字第 60737541_H05 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 2020 年 6 月 3 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 572,622,542.03 元，在首次募集期间有效认购资金产生的利息为人民币 99,799.14 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 572,722,341.17 元，折合 572,722,341.17 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，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

司（以下简称“中国建设银行”）。

根据基金管理人长城基金管理有限公司于 2022 年 11 月 17 日发布的《关于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）增设基金份额并相应修改基金合同、托管协议部分条款的公告》及《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）基金合同》，本基金自 2022 年 11 月 17 日起增设 Y 类基金份额，本基金原有基金份额自动转为 A 类基金份额。本基金根据《个人养老金投资公开募集证券投资基金业务管理暂行规定》要求，针对个人养老金投资基金业务设立单独的份额类别，从而将基金份额分为不同的类别。供非个人养老金客户申购的一类基金份额，称为 A 类基金份额。针对个人养老金投资基金业务单独设立的一类基金份额，称为 Y 类基金份额。两类基金份额分别设置对应的基金代码并分别计算基金份额净值。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金份额（包括 QDII 基金、商品基金（含商品期货基金和黄金 ETF）、香港互认基金及其他经中国证监会核准或注册的公开募集证券投资基金），国内依法公开发行上市交易的股票（包括主板、中小板、创业板、存托凭证及其他中国证监会核准或注册上市的股票）、债券（国债、央行票据、金融债券、地方政府债券、企业债券、公司债券、次级债券、可转换债券、可交换债券、可分离交易可转债、短期融资券（含超短期融资券）、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括定期存款、协议存款、通知存款等）、同业存单以及法律法规或中国证监会允许投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

本基金投资于经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金份额的资产占基金资产的比例不低于 80%，本基金投资于股票、股票型基金、混合型基金和商品基金（含商品期货基金和黄金 ETF）等品种的比例合计原则上不超过 30%。本基金投资于权益类资产的战略配置比例为 25%，投资比例范围为 15%-30%。权益类资产包括股票、股票型基金以及符合以下两种情况之一的混合型基金：一是基金合同约定股票资产投资比例不低于基金资产的 50%，二是最近 4 个季度末，每季度定期报告披露的股票资产占基金资产的比例不低于 50%。权益类资产中投资于医药、消费、信息技术大类行业的指数基金的资产净值占比不低于权益类资产的 80%。现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金的业绩比较基准为：中证 800 指数收益率×25%+中债综合财富指数收益率×75%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督

管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》以及中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金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 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及 2023 年 1 月 1 日至 6 月 30 日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

本基金本报告期无会计政策变更说明。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无需要说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

6.4.6.1 印花税

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

6.4.6.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》

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

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

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

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

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

6.4.6.3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

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

6.4.6.4 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税。

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等

收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税。

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

6.4.6.5 个人所得税

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

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税。

6.4.6.6 境外投资

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2023 年 6 月 30 日 |
|--------|------------------------|
| 活期存款 | 3,386,828.44 |
| 等于：本金 | 3,386,476.04 |
| 加：应计利息 | 352.40 |

| | |
|----------------|--------------|
| 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 | 3,386,828.44 |

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2023 年 6 月 30 日 | | | | |
|---------------|------------------------|---------------|----------------|---------------|------------|
| | 成本 | 应计利息 | 公允价值 | 公允价值变动 | |
| 股票 | 3,266,858.53 | - | 3,427,695.94 | 160,837.41 | |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | - | - | - | - | |
| 债券 | 交易所市场 | 25,580,077.66 | 143,320.11 | 25,698,403.81 | -24,993.96 |
| | 银行间市场 | - | - | - | - |
| | 合计 | 25,580,077.66 | 143,320.11 | 25,698,403.81 | -24,993.96 |
| 资产支持证券 | - | - | - | - | |
| 基金 | 179,124,100.35 | - | 177,598,727.43 | -1,525,372.92 | |
| 其他 | - | - | - | - | |
| 合计 | 207,971,036.54 | 143,320.11 | 206,724,827.18 | -1,389,529.47 | |

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

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2023年6月30日 |
|-------|-------------------|
| 应收利息 | - |
| 其他应收款 | 107.89 |
| 待摊费用 | - |
| 合计 | 107.89 |

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 |
|----|-----|
|----|-----|

| | 2023 年 6 月 30 日 |
|--------------|-----------------|
| 应付券商交易单元保证金 | - |
| 应付赎回费 | - |
| 应付证券出借违约金 | - |
| 应付交易费用 | 20,887.80 |
| 其中：交易所市场 | 20,887.80 |
| 银行间市场 | - |
| 应付利息 | - |
| 公证费 | 8,571.48 |
| 律师费 | 15,789.48 |
| 预提审计费 | 14,876.39 |
| 预提信息披露费 | 59,507.37 |
| 预提上清所债券账户维护费 | 4,500.00 |
| 预提中债登债券账户维护费 | 4,500.00 |
| 合计 | 128,632.52 |

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

长城恒康稳健养老一年混合（FOF）A

| 项目 | 本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 | |
|---------------|---------------------------------------|----------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 127,159,748.32 | 127,159,748.32 |
| 本期申购 | 88,182,153.30 | 88,182,153.30 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -9,179,299.01 | -9,179,299.01 |
| 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 | 206,162,602.61 | 206,162,602.61 |

长城恒康稳健养老一年混合（FOF）Y

| 项目 | 本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 | |
|---------------|---------------------------------------|--------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 1,670,817.24 | 1,670,817.24 |
| 本期申购 | 1,465,257.42 | 1,465,257.42 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | - | - |
| 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 | 3,136,074.66 | 3,136,074.66 |

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

长城恒康稳健养老一年混合（FOF）A

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----------------|---------------|---------------|---------------|
| 上年度末 | -1,395,065.79 | -414,999.66 | -1,810,065.45 |
| 本期利润 | 1,715,300.36 | -366,235.86 | 1,349,064.50 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -573,175.69 | -396,194.63 | -969,370.32 |
| 其中：基金申购款 | -633,197.39 | -377,687.65 | -1,010,885.04 |
| 基金赎回款 | 60,021.70 | -18,506.98 | 41,514.72 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | -252,941.12 | -1,177,430.15 | -1,430,371.27 |

长城恒康稳健养老一年混合（FOF）Y

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----------------|------------|------------|------------|
| 上年度末 | -12,042.77 | -12,860.87 | -24,903.64 |
| 本期利润 | 31,353.86 | -17,350.32 | 14,003.54 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -6,355.43 | -1,642.28 | -7,997.71 |
| 其中：基金申购款 | -6,355.43 | -1,642.28 | -7,997.71 |
| 基金赎回款 | - | - | - |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 12,955.66 | -31,853.47 | -18,897.81 |

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023年1月1日至2023年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 活期存款利息收入 | 11,756.19 |
| 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 | 1,478.54 |
| 其他 | 107.57 |
| 合计 | 13,342.30 |

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 2023年1月1日至2023年6月30日 |
|------------------|----------------------------|
| 股票投资收益——买卖股票差价收入 | 77,846.79 |
| 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 | 77,846.79 |

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 |
|------------|----------------------|
| | 2023年1月1日至2023年6月30日 |
| 卖出股票成交总额 | 9,635,890.00 |
| 减：卖出股票成本总额 | 9,525,754.56 |
| 减：交易费用 | 32,288.65 |
| 买卖股票差价收入 | 77,846.79 |

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 基金投资收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|-------------------|----------------------|
| | 2023年1月1日至2023年6月30日 |
| 卖出/赎回基金成交总额 | 216,700,580.98 |
| 减：卖出/赎回基金成本总额 | 217,131,898.13 |
| 减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额 | 1,713.67 |
| 减：交易费用 | 19,531.99 |
| 基金投资收益 | -452,562.81 |

6.4.7.16 债券投资收益

6.4.7.16.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|------------------------------|----------------------|
| | 2023年1月1日至2023年6月30日 |
| 债券投资收益——利息收入 | 121,898.74 |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | 281,661.05 |
| 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 | 403,559.79 |

6.4.7.16.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|----|----------------------|
| | 2023年1月1日至2023年6月30日 |

| | |
|------------------------|---------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额 | 47,827,970.91 |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 47,114,042.42 |
| 减：应计利息总额 | 429,698.44 |
| 减：交易费用 | 2,569.00 |
| 买卖债券差价收入 | 281,661.05 |

6.4.7.16.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.16.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.17 资产支持证券投资收益

6.4.7.17.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：无。

6.4.7.17.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：无。

6.4.7.17.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.17.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.18 贵金属投资收益

6.4.7.18.1 贵金属投资收益项目构成

注：无。

6.4.7.18.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

6.4.7.18.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.18.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.19 衍生工具收益

6.4.7.19.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：无。

6.4.7.19.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无。

6.4.7.20 股利收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023年1月1日至2023年6月30日 |
|---------------|----------------------------|
| 股票投资产生的股利收益 | 20,369.60 |
| 其中：证券出借权益补偿收入 | - |
| 基金投资产生的股利收益 | 2,263,337.48 |
| 合计 | 2,283,707.08 |

6.4.7.21 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 2023年1月1日至2023年6月30日 |
|------------------------|----------------------------|
| 1. 交易性金融资产 | -383,586.18 |
| 股票投资 | 160,837.41 |
| 债券投资 | -3,548.63 |
| 资产支持证券投资 | - |
| 基金投资 | -540,874.96 |
| 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 | -383,586.18 |

6.4.7.22 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023年1月1日至2023年6月30日 |
|---------|----------------------------|
| 基金赎回费收入 | - |
| 销售服务费返还 | 290.55 |
| 合计 | 290.55 |

6.4.7.23 持有基金产生的费用

| 项目 | 本期费用 2023年1月1日至2023年6月30日 |
|----------------------|------------------------------|
| 当期持有基金产生的应支付销售服务费（元） | 37,046.10 |
| 当期持有基金产生的应支付管理费（元） | 232,579.36 |
| 当期持有基金产生的应支付托管费（元） | 61,157.24 |

注：上述费用为根据所投资基金的招募说明书列明的计算方法对销售服务费、管理费和托管费进行的估算；上述费用已在本基金所持有基金的净值中体现，不构成本基金的费用项目。

6.4.7.24 信用减值损失

注：无。

6.4.7.25 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023年1月1日至2023年6月30日 |
|------------|----------------------------|
| 审计费用 | 14,876.39 |
| 信息披露费 | 59,507.37 |
| 证券出借违约金 | - |
| 银行费用 | 885.00 |
| 公证费 | 8,571.48 |
| 律师费 | 15,789.48 |
| 上清所债券账户服务费 | 9,000.00 |
| 中债登债券账户服务费 | 9,000.00 |
| 上清所查询费 | 600.00 |
| 合计 | 118,229.72 |

6.4.7.26 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 |
| 中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”) | 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 |
| 东方证券股份有限公司(“东方证券”) | 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 2023年1月1日至2023年6月30日 | | 上年度可比期间 2022年1月1日至2022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 | 12,920,301.90 | 57.61 | - | - |
| 东方证券 | 9,508,201.19 | 42.39 | - | - |

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2023年1月1日至2023年6月30日 | | 上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30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 | 15,007,830.15 | 17.91 | - | - |
| 东方证券 | 68,790,481.28 | 82.09 | 22,607,784.13 | 100.00 |

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2023年1月1日至2023年6月30日 | | 上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30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(%) |
| 东方证券 | 19,200,000.00 | 100.00 | 800,000.00 | 100.00 |

6.4.10.1.4 基金交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2023年1月1日至2023年6月30日 | | 上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日 | |
|-------|----------------------------|------------------|---------------------------------|------------------|
| | 成交金额 | 占当期基金成交总额的比例 (%) | 成交金额 | 占当期基金成交总额的比例 (%) |
| 长城证券 | 38,928,552.20 | 13.73 | 18,655,518.30 | 38.24 |
| 东方证券 | 244,693,554.82 | 86.27 | 30,130,576.60 | 61.76 |

6.4.10.1.5 权证交易

注：无。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2023年1月1日至2023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 (%) |
| 东方证券 | 8,855.17 | 42.39 | 8,855.17 | 42.39 |
| 长城证券 | 12,032.63 | 57.61 | 12,032.63 | 57.61 |
| 关联方名称 | 上年度可比期间 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 (%) |
| - | - | - | - | - |

注：(1) 上述佣金费率由本基金的基金管理人在正常业务范围内按一般商业条款与对方签订的席位租用协议进行约定，并扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费及证券结算风险基金后的净额列示，其中债券、回购及权证交易不计佣金。

(2) 该类席位租用协议服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和 market 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 2023年1月1日至2023年6月30日 | 上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日 |
|-----------------|----------------------------|---------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 373,255.63 | 275,683.17 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 122,098.12 | 120,642.50 |

注：基金管理费每日计提，按月支付。本基金投资于本基金管理人所管理的基金的部分不收取管理费。本基金 A 类基金份额的管理费按前一日 A 类基金份额的基金资产净值扣除前一日所持有本

基金管理人管理的其他基金份额所对应的资产净值后的余额（若为负数，则取 0）的 0.60%年费率计提。本基金 Y 类基金份额管理费按前一日 Y 类基金份额的基金资产净值扣除前一日所持有本基金管理人管理的其他基金份额所对应的资产净值后的余额（若为负数，则取 0）的 0.30%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{该类基金份额管理费年费率} / \text{当年天数}$$

H 为该类基金份额每日应计提的基金管理费

E 为该类基金份额前一日的基金资产净值减去前一日所持有本基金管理人管理的其他基金份额所对应的基金资产（若为负数，则取 0）

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
|----------------|--|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 92,612.88 | 59,441.22 |

注：基金托管费每日计提，按月支付。本基金投资于本基金托管人所托管的基金的部分不收取托管费。本基金 A 类基金份额托管费按前一日 A 类基金份额基金资产净值扣除前一日所持有基金托管人托管的其他基金份额所对应的资产净值后的余额（若为负数，则取 0）的 0.15%年费率计提。本基金 Y 类基金份额托管费按前一日 Y 类基金份额基金资产净值扣除前一日所持有基金托管人托管的其他基金份额所对应的资产净值后的余额（若为负数，则取 0）的 0.075%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{该类基金份额托管费年费率} / \text{当年天数}$$

H 为该类基金份额每日应计提的基金托管费

E 为该类基金份额前一日的基金资产净值减去前一日所持有本基金托管人托管的其他基金份额所对应的基金资产（若为负数，则取 0）

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自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

| 项目 | 本期 2023年1月1日至2023年6月30日 | 本期 2023年1月1日至2023年6月30日 |
|---------------------------|---------------------------------|----------------------------|
| | | 长城恒康稳健养老一年混合(FOF) A |
| 基金合同生效日(2020年6月3日)持有的基金份额 | - | - |
| 报告期初持有的基金份额 | 10,000,000.00 | - |
| 报告期间申购/买入总份额 | 57,892,931.80 | - |
| 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 | 67,892,931.80 | - |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 32.4383% | - |
| 项目 | 上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日 | 上年度可比期间 - |
| | | 长城恒康稳健养老一年混合(FOF) A |
| 基金合同生效日(2020年6月3日)持有的基金份额 | - | - |
| 报告期初持有的基金份额 | 10,000,000.00 | - |
| 报告期间申购/买入总份额 | - | - |
| 报告期间因拆分变动份额 | - | - |
| 减:报告期间赎回/卖出总份额 | - | - |
| 报告期末持有的基金份额 | 10,000,000.00 | - |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 11.4108% | - |

注：基金管理人本期持有本基金份额变动相关的交易费用按基金合同及招募说明书的有关规定计算。

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

份额单位：份

长城恒康稳健养老一年混合（FOF）A

| 关联方名称 | 本期末 2023年6月30日 | | 上年度末 2022年12月31日 | |
|--------------------|-------------------|-----------------------------|---------------------|-----------------------------|
| | 持有的 基金份额 | 持有的基金份额 占基金总份额的比 例（%） | 持有的 基金份额 | 持有的基金份额 占基金总份额的比 例（%） |
| 长城证券 股份有限 公司 | 4,048,519.48 | 1.9343 | 4,048,519.48 | 3.1425 |

份额单位：份

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 2023年1月1日至2023年6月30日 | | 上年度可比期间 2022年1月1日至2022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 |
| 中国建设银行 | 3,386,828.44 | 11,756.19 | 1,940,325.05 | 2,786.58 |

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.10.8.2 当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用

| 项目 | 本期费用 2023年1月1日至2023年6月30日 | 上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日 |
|----------------------|------------------------------|---------------------------------|
| 当期交易基金产生的申购费（元） | - | - |
| 当期交易基金产生的赎回费（元） | - | - |
| 当期持有基金产生的应支付销售服务费（元） | 290.55 | - |
| 当期持有基金产生的应支付管理费（元） | 20,002.66 | - |
| 当期持有基金产生的应支付托管费（元） | 5,327.68 | - |

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（2023 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：截至本报告期末 2023 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 2023 年 06 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为人民币 0.00 元，无质押债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

本公司在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在基金管

理人制定的银行可投资名单内的已进行充分内部研究的信用等级较高的商业银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

6.4.13.3 流动性风险

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息

资产主要为银行存款、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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本 期 末 202 3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 | 3,386,828.44 | - | - | - | - | - | 3,386,828.44 |
| 结算备付金 | 544,542.16 | - | - | - | - | - | 544,542.16 |
| 存出保证金 | 25,631.99 | - | - | - | - | - | 25,631.99 |
| 交易性金融资产 | - | - | 10,619,622.33 | 9,477,897.08 | 5,600,884.40 | 181,026,423.37 | 206,724,827.18 |
| 应收股利 | - | - | - | - | - | 1,366.92 | 1,366.92 |
| 应 | - | - | - | - | - | 12,273.21 | 12,273.21 |

| | | | | | | | |
|---------|--------------|---|---------------|--------------|--------------|----------------|----------------|
| 收申购款 | | | | | | | |
| 应收清算款 | | - | - | - | - | 1,023,980.89 | 1,023,980.89 |
| 其他资产 | | - | - | - | - | 107.89 | 107.89 |
| 资产总计 | 3,957,002.59 | | 10,619,622.33 | 9,477,897.08 | 5,600,884.40 | 182,064,152.28 | 211,719,558.68 |
| 负债 | | | | | | | |
| 应付赎回款 | | - | - | - | - | 195,222.19 | 195,222.19 |
| 应付管理人报酬 | | - | - | - | - | 73,653.62 | 73,653.62 |
| 应付托管费 | | - | - | - | - | 21,745.38 | 21,745.38 |
| 应付清算款 | | - | - | - | - | 3,450,752.84 | 3,450,752.84 |
| 应交税费 | | - | - | - | - | 143.94 | 143.94 |

| | | | | | | | |
|---|--------------|--------------|---------------|--------------|--------------|----------------|----------------|
| 其他 负债 | - | - | - | - | - | 128,632.52 | 128,632.52 |
| 负债 总计 | - | - | - | - | - | 3,870,150.49 | 3,870,150.49 |
| 利率 敏 感 度 缺 口 | 3,957,002.59 | - | 10,619,622.33 | 9,477,897.08 | 5,600,884.40 | - | - |
| 上 年 度 末 202 2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 | 5,365,138.32 | - | - | - | - | - | 5,365,138.32 |
| 结 算 备 付 金 | 72,382.02 | - | - | - | - | - | 72,382.02 |
| 存 出 保 证 金 | 6,734.61 | - | - | - | - | - | 6,734.61 |
| 交 易 性 金 | 6,626,910.78 | 9,642,437.76 | - | - | - | 104,389,726.42 | 120,659,074.96 |

| | | | | | | | |
|---------------------------------|---------------|--------------|---|---|---|----------------|----------------|
| 融 资 产 | | | | | | | |
| 应 收 股 利 | - | - | - | - | - | 302,878.80 | 302,878.80 |
| 应 收 申 购 款 | - | - | - | - | - | 952,411.05 | 952,411.05 |
| 资 产 总 计 | 12,071,165.73 | 9,642,437.76 | - | - | - | 105,645,016.27 | 127,358,619.76 |
| 负 债 | | | | | | | |
| 应 付 赎 回 款 | - | - | - | - | - | 156,104.42 | 156,104.42 |
| 应 付 管 理 人 报 酬 | - | - | - | - | - | 64,098.19 | 64,098.19 |
| 应 付 托 管 费 | - | - | - | - | - | 13,593.21 | 13,593.21 |
| 应 交 税 费 | - | - | - | - | - | 227.47 | 227.47 |
| 其 他 负 债 | - | - | - | - | - | 129,000.00 | 129,000.00 |
| 负 债 | - | - | - | - | - | 363,023.29 | 363,023.29 |

| | | | | | | | |
|---------|---------------|--------------|---|---|---|--|--|
| 总计 | | | | | | | |
| 利率敏感度缺口 | 12,071,165.73 | 9,642,437.76 | - | - | - | | |

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（2023年6月30日） | 上年度末（2022年12月31日） |
| 分析 | 利率上升 25 个基点 | -8,409.51 | -630.38 |
| | 利率下降 25 个基点 | 8,422.94 | 630.50 |

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。

本基金投资于经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金份额的资产占基金资产的比例不低于 80%，本基金投资于股票、股票型基金、混合型基金和商品基金（含商品期货基金和黄金 ETF）等品种的比例合计原则上不超过 30%。本基金投资于权益类资产的战略配置比例为 25%，投

资比例范围为 15%-30%。权益类资产包括股票、股票型基金以及符合以下两种情况之一的混合型基金：一是基金合同约定股票资产投资比例不低于基金资产的 50%，二是最近 4 个季度末，每季度定期报告披露的股票资产占基金资产的比例不低于 50%。权益类资产中投资于医药、消费、信息技术大类行业的指数基金的资产净值占比不低于权益类资产的 80%。现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

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 2023 年 6 月 30 日 | | 上年度末 2022 年 12 月 31 日 | |
|---------------|------------------------|-------------------|--------------------------|-------------------|
| | 公允价值 | 占基金资产净值 比例 (%) | 公允价值 | 占基金资产净值 比例 (%) |
| 交易性金融资产—股票投资 | 3,427,695.94 | 1.65 | - | - |
| 交易性金融资产—基金投资 | 177,598,727.43 | 85.45 | 104,389,726.42 | 82.20 |
| 交易性金融资产—债券投资 | 25,698,403.81 | 12.36 | 16,269,348.54 | 12.81 |
| 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 | 206,724,827.18 | 99.46 | 120,659,074.96 | 95.01 |

注：“交易性金融资产—债券投资”含资产支持证券投资。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| 假设 | 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） | | 上年度末（2022 年 12 月 31 日） |
| | 本期末（2023 年 6 月 30 日） | | |
| 分析 | 沪深 300 指数上升 5% | 2,185,941.10 | 1,350,645.88 |
| | 沪深 300 指数下降 5% | -2,185,941.10 | -1,350,645.88 |

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 2023 年 6 月 30 日 | 上年度末 2022 年 12 月 31 日 |
|---------------|------------------------|--------------------------|
| 第一层次 | 196,105,204.85 | 114,032,164.18 |
| 第二层次 | 10,619,622.33 | 6,626,910.78 |
| 第三层次 | - | - |
| 合计 | 206,724,827.18 | 120,659,074.96 |

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

无。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

注：无。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|----------------|---------------|
| 1 | 权益投资 | 3,427,695.94 | 1.62 |
| | 其中：股票 | 3,427,695.94 | 1.62 |
| 2 | 基金投资 | 177,598,727.43 | 83.88 |
| 3 | 固定收益投资 | 25,698,403.81 | 12.14 |
| | 其中：债券 | 25,698,403.81 | 12.14 |
| | 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 | 3,931,370.60 | 1.86 |
| 8 | 其他各项资产 | 1,063,360.90 | 0.50 |
| 9 | 合计 | 211,719,558.68 | 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 | 3,427,695.94 | 1.65 |
| 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 | 3,427,695.94 | 1.65 |

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 | 603985 | 恒润股份 | 51,800 | 1,086,246.00 | 0.52 |
| 2 | 603181 | 皇马科技 | 95,600 | 1,064,984.00 | 0.51 |
| 3 | 688333 | 铂力特 | 6,931 | 732,883.94 | 0.35 |
| 4 | 300034 | 钢研高纳 | 13,800 | 543,582.00 | 0.26 |

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 | 603985 | 恒润股份 | 1,783,404.00 | 1.40 |
| 2 | 300034 | 钢研高纳 | 1,482,788.00 | 1.17 |
| 3 | 600309 | 万华化学 | 1,388,127.00 | 1.09 |
| 4 | 002484 | 江海股份 | 1,290,344.50 | 1.02 |
| 5 | 603181 | 皇马科技 | 1,290,150.00 | 1.02 |
| 6 | 002064 | 华峰化学 | 1,195,620.00 | 0.94 |
| 7 | 688333 | 铂力特 | 698,189.19 | 0.55 |
| 8 | 300459 | 汤姆猫 | 697,842.00 | 0.55 |
| 9 | 002600 | 领益智造 | 696,919.00 | 0.55 |
| 10 | 300769 | 德方纳米 | 685,256.40 | 0.54 |
| 11 | 300413 | 芒果超媒 | 596,990.00 | 0.47 |
| 12 | 600048 | 保利发展 | 594,916.00 | 0.47 |
| 13 | 603986 | 兆易创新 | 392,067.00 | 0.31 |

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 | 002484 | 江海股份 | 1,382,833.00 | 1.09 |
| 2 | 600309 | 万华化学 | 1,340,436.00 | 1.06 |
| 3 | 002064 | 华峰化学 | 1,201,051.00 | 0.95 |
| 4 | 300034 | 钢研高纳 | 987,571.00 | 0.78 |

| | | | | |
|----|--------|------|------------|------|
| 5 | 002600 | 领益智造 | 719,850.00 | 0.57 |
| 6 | 603985 | 恒润股份 | 697,196.00 | 0.55 |
| 7 | 300459 | 汤姆猫 | 696,560.00 | 0.55 |
| 8 | 300769 | 德方纳米 | 661,438.00 | 0.52 |
| 9 | 300413 | 芒果超媒 | 625,239.00 | 0.49 |
| 10 | 600048 | 保利发展 | 607,081.00 | 0.48 |
| 11 | 603986 | 兆易创新 | 416,755.00 | 0.33 |
| 12 | 603181 | 皇马科技 | 299,880.00 | 0.24 |

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

| | |
|--------------|---------------|
| 买入股票成本（成交）总额 | 12,792,613.09 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 9,635,890.00 |

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 | 10,619,622.33 | 5.11 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | - | - |
| | 其中：政策性金融债 | - | - |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债（可交换债） | 15,078,781.48 | 7.25 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 25,698,403.81 | 12.36 |

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 | 019688 | 22 国债 23 | 105,000 | 10,619,622.33 | 5.11 |
| 2 | 118023 | 广大转债 | 20,990 | 2,624,203.73 | 1.26 |
| 3 | 127030 | 盛虹转债 | 11,860 | 1,501,509.47 | 0.72 |
| 4 | 118032 | 建龙转债 | 12,300 | 1,499,931.08 | 0.72 |
| 5 | 127045 | 牧原转债 | 11,050 | 1,305,001.37 | 0.63 |

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

无。

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

无。

7.11.2 本期国债期货投资评价

无。

7.12 本报告期投资基金情况

7.12.1 投资政策及风险说明

1、投资政策

本基金为目标风险策略基金，根据基金合同约定的权益类资产的战略配置比例进行资产配置。本基金战略配置于权益类资产的比例为 25%，同时结合各类资产的实际市场情况，在基金合同约定的范围内对大类资产配置比例进行一定动态调整，高配当前被低估的资产、低配被高估的资产。在确定各类资产配置比例后，本基金将通过科学的基金筛选流程，精选基金作为本基金的投资标的。采用严谨的分析方法对基金进行研究，综合考察基金的指数代表性、业绩、风险、流动性、投资组合等多方面因素，并结合对基金管理公司、基金经理的评价对基金进行筛选，挑选出符合该投资策略的基金。

2、风险说明

本基金主要投资于经中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金，在选择基金构建组合的时，在很大程度上依靠了基金的过往信息。但基金的过往业绩和表现并不能代表基金的将来业绩和表现，其中存在一定的风险。

本基金可投资于 QDII 基金、香港互认基金，因此将间接承担 QDII 基金、香港互认基金所面临的海外市场风险、汇率风险、政治风险、法律和政府管制风险、会计核算风险及税务风险等境外投资风险。

本基金除了承担投资其他基金的管理费、托管费和销售费用（其中申购本基金基金管理人自身管理的其他基金不收取申购费、赎回费（不包括按照相关法规、基金招募说明书约定应当收取，并

计入基金财产的赎回费用)、销售服务费等)外, 还须承担本基金本身的管理费、托管费和销售费用(其中不收取基金财产中持有本基金管理人管理的其他基金部分的管理费、本基金托管人托管的其他基金部分的托管费), 因此, 本基金最终获取的回报与直接投资于其他基金获取的回报存在差异。

本基金主动管理风险指的是基金经理对基金的主动性操作导致的风险。本基金为主动管理型的基金中基金, 在精选基金的操作过程中, 基金管理人可能限于知识、技术、经验等因素而影响其对相关信息、经济形势和证券价格走势的判断, 其精选出的基金的业绩表现并不一定持续的优于其他基金。

7.12.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的基金投资明细

| 序号 | 基金代码 | 基金名称 | 运作方式 | 持有份额(份) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) | 是否属于基金管理人及管理人关联方所管理的基金 |
|----|--------|-------------------|--------|---------------|---------------|--------------|------------------------|
| 1 | 007194 | 长城短债债券 A | 契约型开放式 | 23,274,090.75 | 26,183,352.09 | 12.60 | 是 |
| 2 | 008652 | 长城中债 1-3 年政金债指数 A | 契约型开放式 | 14,974,596.01 | 17,256,724.44 | 8.30 | 是 |
| 3 | 004973 | 长城收益宝货币 B | 契约型开放式 | 15,068,813.21 | 15,068,813.21 | 7.25 | 是 |
| 4 | 003638 | 安信永鑫增强债券 C | 契约型开放式 | 11,559,535.26 | 12,256,575.24 | 5.90 | 否 |
| 5 | 000107 | 富国稳健增强债券 A | 契约型开放式 | 9,775,002.93 | 12,111,228.63 | 5.83 | 否 |
| 6 | 217008 | 招商安本增利债券 | 契约型开放式 | 7,889,161.82 | 12,008,093.21 | 5.78 | 否 |

| | | | | | | | |
|----|--------|----------------------|--------------|--------------|---------------|------|---|
| 7 | 002701 | 东方红汇阳债券 A | 契约型开放式 | 9,796,023.68 | 10,801,095.71 | 5.20 | 否 |
| 8 | 511990 | 华宝添益货币 A | 交易型开放式 (ETF) | 65,002.00 | 6,500,200.00 | 3.13 | 否 |
| 9 | 511360 | 海富通中证短融 ETF | 交易型开放式 (ETF) | 55,900.00 | 6,009,082.30 | 2.89 | 否 |
| 10 | 511270 | 海富通上证 10 年期地方政府债 ETF | 交易型开放式 (ETF) | 51,900.00 | 5,664,677.40 | 2.73 | 否 |
| 11 | 372010 | 上投摩根强化回报债券 A | 契约型开放式 | 3,447,318.65 | 5,389,882.71 | 2.59 | 否 |
| 12 | 420102 | 天弘永利债券 B | 契约型开放式 | 4,020,493.77 | 4,751,017.49 | 2.29 | 否 |
| 13 | 008810 | 安信民稳增长混合 C | 契约型开放式 | 3,104,868.11 | 4,037,260.00 | 1.94 | 否 |
| 14 | 512480 | 国联安中证全指半导体 ETF | 交易型开放式 (ETF) | 4,114,800.00 | 3,678,631.20 | 1.77 | 否 |
| 15 | 512660 | 国泰中证军工 ETF | 交易型开放式 (ETF) | 3,204,000.00 | 3,601,296.00 | 1.73 | 否 |
| 16 | 515900 | 博时央企创新驱动 ETF | 交易型开放式 (ETF) | 2,526,500.00 | 3,501,729.00 | 1.68 | 否 |

| | | | | | | | |
|----|--------|---------------------------|--------------|--------------|--------------|------|---|
| 17 | 512290 | 国泰中证生物医药 ETF | 交易型开放式 (ETF) | 2,894,900.00 | 3,207,549.20 | 1.54 | 否 |
| 18 | 516110 | 国泰中证 800 汽车与零部件 ETF | 交易型开放式 (ETF) | 2,925,600.00 | 3,060,177.60 | 1.47 | 否 |
| 19 | 159996 | 家电 ETF | 交易型开放式 (ETF) | 2,357,800.00 | 2,753,910.40 | 1.32 | 否 |
| 20 | 008928 | 泰达消费红利指数 A | 契约型开放式 | 1,598,045.34 | 2,685,515.19 | 1.29 | 否 |
| 21 | 001301 | 大成睿景灵活配置混合 C | 契约型开放式 | 961,149.39 | 1,858,862.92 | 0.89 | 否 |
| 22 | 159745 | 建材 ETF | 交易型开放式 (ETF) | 2,435,700.00 | 1,707,425.70 | 0.82 | 否 |
| 23 | 002236 | 大成中证 360 互联网+大数据 100 指数 A | 契约型开放式 | 693,120.80 | 1,480,506.03 | 0.71 | 否 |
| 24 | 562500 | 华夏中证机器人 ETF | 交易型开放式 (ETF) | 1,685,600.00 | 1,469,843.20 | 0.71 | 否 |
| 25 | 513060 | 博时恒生医疗保健 (QDII-ETF) | 交易型开放式 (ETF) | 2,943,500.00 | 1,442,315.00 | 0.69 | 否 |
| 26 | 513050 | 易中证海外中国互联网 50 (QDII-ETF) | 交易型开放式 (ETF) | 1,333,600.00 | 1,332,266.40 | 0.64 | 否 |

| | | | | | | | |
|----|--------|---------------------|-------------|--------------|--------------|------|---|
| 27 | 515260 | 华宝中证电子50ETF | 交易型开放式(ETF) | 1,725,800.00 | 1,315,059.60 | 0.63 | 否 |
| 28 | 515170 | 华夏中证细分食品饮料产业主题ETF | 交易型开放式(ETF) | 1,796,200.00 | 1,221,416.00 | 0.59 | 否 |
| 29 | 012621 | 诺安先锋混合C | 契约型开放式 | 439,465.85 | 1,218,594.86 | 0.59 | 否 |
| 30 | 518880 | 华安黄金易(ETF) | 交易型开放式(ETF) | 230,000.00 | 1,000,270.00 | 0.48 | 否 |
| 31 | 159997 | 电子ETF | 交易型开放式(ETF) | 993,900.00 | 983,961.00 | 0.47 | 否 |
| 32 | 159930 | 能源ETF | 交易型开放式(ETF) | 662,100.00 | 773,994.90 | 0.37 | 否 |
| 33 | 513330 | 华夏恒生互联网科技业ETF(QDII) | 交易型开放式(ETF) | 1,510,900.00 | 625,512.60 | 0.30 | 否 |
| 34 | 512980 | 广发中证传媒ETF | 交易型开放式(ETF) | 371,300.00 | 331,942.20 | 0.16 | 否 |
| 35 | 515880 | 国泰中证全指通信设备ETF | 交易型开放式(ETF) | 236,600.00 | 309,946.00 | 0.15 | 否 |

7.13 投资组合报告附注

7.13.1 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。

7.13.2 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。

7.13.3 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 | 25,631.99 |
| 2 | 应收清算款 | 1,023,980.89 |
| 3 | 应收股利 | 1,366.92 |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 12,273.21 |
| 6 | 其他应收款 | 107.89 |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 1,063,360.90 |

7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|-------|--------------|---------------|
| 1 | 118023 | 广大转债 | 2,624,203.73 | 1.26 |
| 2 | 127030 | 盛虹转债 | 1,501,509.47 | 0.72 |
| 3 | 127045 | 牧原转债 | 1,305,001.37 | 0.63 |
| 4 | 113060 | 浙22转债 | 1,049,888.57 | 0.51 |
| 5 | 123121 | 帝尔转债 | 945,929.79 | 0.46 |
| 6 | 111004 | 明新转债 | 831,865.07 | 0.40 |
| 7 | 113623 | 凤21转债 | 715,133.97 | 0.34 |
| 8 | 127022 | 恒逸转债 | 695,651.76 | 0.33 |
| 9 | 118009 | 华锐转债 | 659,844.51 | 0.32 |
| 10 | 113662 | 豪能转债 | 590,623.98 | 0.28 |
| 11 | 127043 | 川恒转债 | 558,692.33 | 0.27 |
| 12 | 123107 | 温氏转债 | 546,342.72 | 0.26 |
| 13 | 123154 | 火星转债 | 496,083.72 | 0.24 |
| 14 | 123091 | 长海转债 | 443,630.24 | 0.21 |
| 15 | 118013 | 道通转债 | 390,041.89 | 0.19 |
| 16 | 113048 | 晶科转债 | 224,407.28 | 0.11 |

7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：无。

7.13.6 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 (%) |
| 长城恒康稳健养老一年混合 (FOF) A | 3,104 | 66,418.36 | 112,599,601.77 | 54.62 | 93,563,000.84 | 45.38 |
| 长城恒康稳健养老一年混合 (FOF) Y | 675 | 4,646.04 | - | - | 3,136,074.66 | 100.00 |
| 合计 | 3,779 | 55,384.67 | 112,599,601.77 | 53.80 | 96,699,075.50 | 46.20 |

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 | 长城恒康稳健养老一年混合 (FOF) A | 111,157.54 | 0.0539 |
| | 长城恒康稳健养老一年混合 (FOF) Y | 61,354.94 | 1.9564 |
| | 合计 | 172,512.48 | 0.0824 |

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 | 长城恒康稳健养老一年混合 (FOF) A | 0 |
| | 长城恒康稳健养老一年混合 (FOF) Y | 0~10 |
| | 合计 | 0~10 |

| | | |
|---------------------|-------------------------|-------|
| 本基金基金经理持有本 开放式基金 | 长城恒康稳健养老一年混合 (FOF) A | 10~50 |
| | 长城恒康稳健养老一年混合 (FOF) Y | 0~10 |
| | 合计 | 10~50 |

注：同时为基金管理人高级管理人员和基金经理的，分别计算在内。

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

| 项目 | 持有份额总数 | 持有份额 占基金总 份额比例 (%) | 发起份额总数 | 发起份额占 基金总份额 比例(%) | 发起份额承 诺持有期限 |
|-----------------|---------------|-----------------------------|---------------|-------------------------|----------------|
| 基金管理人固有资 金 | 67,892,931.80 | 32.44 | 10,000,000.00 | 4.78 | 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 | 67,892,931.80 | 32.44 | 10,000,000.00 | 4.78 | 3年 |

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 长城恒康稳健养老一年混合 (FOF) A | 长城恒康稳健养老一年混合 (FOF) Y |
|----------------------------------|-------------------------|-------------------------|
| 基金合同生效日 (2020年6月3日) 基金份额总额 | 572,722,341.17 | - |
| 本报告期期初基金份 额总额 | 127,159,748.32 | 1,670,817.24 |
| 本报告期基金总申购 份额 | 88,182,153.30 | 1,465,257.42 |
| 减：本报告期基金总 赎回份额 | 9,179,299.01 | - |
| 本报告期基金拆分变 动份额 | - | - |
| 本报告期期末基金份 额总额 | 206,162,602.61 | 3,136,074.66 |

§ 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 2023 年 2 月 6 日起，张勇先生担任公司副总经理。

自 2023 年 4 月 10 日起，何小乐女士担任公司副总经理。

2、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：

本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本基金本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略无改变。

10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

无

10.6 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）。

10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.7.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，本基金管理人及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.8.1 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 | 6 | 12,920,301.90 | 57.61 | 12,032.63 | 57.61 | - |
| 东方证券 | 2 | 9,508,201.19 | 42.39 | 8,855.17 | 42.39 | - |
| 安信证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 渤海证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 财通证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 长江证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 东北证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 东吴证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 东兴证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 东莞证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 方正证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 广发证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国金证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 国泰君安 | 2 | - | - | - | - | - |
| 国信证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 海通证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 宏信证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华创证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华福证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 华金证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 华融证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华泰证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华西证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 华鑫证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 江海证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 联讯证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 民生证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 平安证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 山西证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 上海证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 申万宏源 | 1 | - | - | - | - | - |
| 首创证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 太平洋证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 天风证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 万和证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 万联证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 五矿证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 西部证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 兴业证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 银河证券 | 2 | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|------------|---|---|---|---|---|---|
| 粤开证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 招商证券股份有限公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 中金财富 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中金公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中泰证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 中信建投 | 3 | - | - | - | - | - |
| 中信证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中银国际 | 2 | - | - | - | - | - |

注：1、报告期内租用证券公司席位的变更情况：

本报告期内共增加 1 个租用交易单元（江海证券增加 1 个交易单元），减少 2 个租用交易单元（广州证券减少 2 个交易单元），截止本报告期末共计 82 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
- (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。

10.8.2 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 | | 基金交易 | |
|------------------|------|------------|--------|----------------|------|-------|------|------------|
| | 成交金额 | 占当期债券成交总额的 | 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 | 成交金额 | 占当期基金成交总额的 |
| | | | | | | | | |

| | | 比例 (%) | | (%) | | 成交 总额 的比例 (%) | | 比例 (%) |
|----------|---------------|-----------|---------------|--------|---|------------------------|----------------|-----------|
| 长城 证券 | 15,007,830.15 | 17.91 | - | - | - | - | 38,928,552.20 | 13.73 |
| 东方 证券 | 68,790,481.28 | 82.09 | 19,200,000.00 | 100.00 | - | - | 244,693,554.82 | 86.27 |
| 安信 证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 渤海 证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 财通 证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 长江 证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 东北 证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 东吴 证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 东兴 证券 | - | - | - | - | - | - | - | - |

| | | | | | | | | | |
|------|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 东莞证券 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 方正证券 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 广发证券 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 国金证券 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 国泰君安 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 国信证券 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 海通证券 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 宏信证券 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 华创证券 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 华福证券 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 华金证券 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |

| | | | | | | | | | |
|------|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 华融证券 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 华泰证券 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 华西证券 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 华鑫证券 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 江海证券 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 联讯证券 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 民生证券 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 平安证券 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 山西证券 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 上海证券 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 申万宏源 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |

| | | | | | | | | | |
|-------|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 首创证券 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 太平洋证券 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 天风证券 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 万和证券 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 万联证券 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 五矿证券 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 西部证券 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 兴业证券 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 银河证券 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 粤开证券 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 招商证券 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |

| | | | | | | | | | |
|--------|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 股份有限公司 | | | | | | | | | |
| 中金财富 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中金公司 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中泰证券 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中信建投 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中信证券 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中银国际 | - | - | - | - | - | - | - | - | - |

10.9 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提醒投资者谨防金融诈骗的风险提示公告 | 中国证监会规定报刊及网站 | 2023年1月19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 | 2023年2月6日 |
| 3 | 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）基金经理变更的公告 | 中国证监会规定报刊及网站 | 2023年3月1日 |
| 4 | 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 | 2023年4月10日 |
| 5 | 关于以通讯方式召开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）基金份额持有人大会的 | 中国证监会规定报刊及网站 | 2023年6月9日 |

| | | | |
|---|--|--------------|------------|
| | 公告 | | |
| 6 | 关于以通讯方式召开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）基金份额持有人大会的第一次提示性公告 | 中国证监会规定报刊及网站 | 2023年6月12日 |
| 7 | 关于以通讯方式召开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）基金份额持有人大会的第二次提示性公告 | 中国证监会规定报刊及网站 | 2023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

| 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 | 20230530-20230630 | 10,000,000.00 | 57,892,931.80 | - | 67,892,931.80 | 32.4383 |
| | 2 | 20230101-20230529 | 36,582,300.76 | - | - | 36,582,300.76 | 17.4785 |

产品特有风险

如投资者进行大额赎回，可能存在以下的特有风险：

1、流动性风险

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

2、延期支付赎回款项及暂停赎回风险

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

3、基金净值波动风险

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

4、投资受限风险

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

5、基金合同终止或转型风险

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

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

(一) 中国证监会准予长城恒康稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金注册的文件

(二) 《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基金合同》

(三) 《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招募说明书》

(四) 《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托管协议》

(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