

# 长城安心回报混合型证券投资基金 2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 日

基金管理人：长城基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2024 年 3 月 29 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 03 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自 2023 年 01 月 01 日起至 2023 年 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	10
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>11</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	14
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	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	16
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	17
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明	17
4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	17
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>17</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	17
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	17
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	18
<b>§ 6 审计报告</b>	<b>18</b>
6.1 审计报告基本信息	18
6.2 审计报告的基本内容	18
<b>§ 7 年度财务报表</b>	<b>20</b>
7.1 资产负债表	20
7.2 利润表	21
7.3 净资产变动表	22
7.4 报表附注	25

<b>§ 8 投资组合报告</b> .....	<b>58</b>
8.1 期末基金资产组合情况 .....	58
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	58
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 .....	59
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	62
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	65
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 .....	66
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	66
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	66
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	66
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	66
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	66
8.12 投资组合报告附注 .....	66
<b>§ 9 基金份额持有人信息</b> .....	<b>67</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	67
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	67
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	68
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况 .....	68
<b>§ 10 开放式基金份额变动</b> .....	<b>68</b>
<b>§ 11 重大事件揭示</b> .....	<b>69</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	69
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	69
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	69
11.4 基金投资策略的改变 .....	69
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	69
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	69
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	70
11.8 其他重大事件 .....	73
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>74</b>
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	74
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	74
<b>§ 13 备查文件目录</b> .....	<b>74</b>
13.1 备查文件目录 .....	74
13.2 存放地点 .....	74
13.3 查阅方式 .....	74

## § 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	674,202,642.14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	666,966,850.07份	7,235,792.07份

### 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	祝函
	联系电话	0755-29279006
	电子邮箱	zhuhan@ccfund.com.cn
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	北京市西城区复兴门内大街 28

	鹏程一路 9 号广电金融中心 36 层 DEF 单元、38 层、39 层	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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.ccfund.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	中国北京市东城区东长安街 1 号东方广场经贸城安永大楼（即东三办公楼）17 层
注册登记机构	长城基金管理有限公司	深圳市福田区莲花街道福新社区鹏程一路 9 号广电金融中心 36 层 DEF 单元、38 层、39 层

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2023 年		2022 年		2021 年	
	长城安心回报混合 A	长城安心回报混合 C	长城安心回报混合 A	长城安心回报混合 C	长城安心回报混合 A	长城安心回报混合 C
本期已实现收	-66,678,840.41	-2,474,779.00	-314,595,717.82	-5,302.22	278,185,745.47	-

益						
本期利润	-116,814,039.67	-2,766,081.46	-351,031,144.62	-10,544.01	48,136,877.65	-
加权平均基金份额本期利润	-0.1676	-0.2965	-0.4942	-0.2865	0.0595	-
本期加权平均净值利润率	-12.28%	-22.39%	-30.47%	-18.01%	2.94%	-
本期基金份额净值增长率	-11.27%	-11.79%	-25.05%	-10.24%	3.41%	-
3.1.2 期末数据和指标	2023 年末		2022 年末		2021 年末	
期末可供分配利润	570,016,999.12	2,077,956.56	708,041,874.21	18,566.90	1,103,062,676.76	-
期末可供分配基金份额利润	0.8546	0.2872	1.0196	0.4593	1.5088	-
期末基金资产净值	866,285,308.93	9,313,748.63	1,016,522,980.77	58,987.26	1,427,806,014.71	-
期末基金份额净值	1.2988	1.2872	1.4638	1.4593	1.9530	-
3.1.	2023 年末		2022 年末		2021 年末	

3 累 计期 末指 标						
基金 份额 累计 净值 增长 率	297.80%	-20.83%	348.34%	-10.24%	498.18%	-

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
过去三个月	-1.17%	0.71%	0.76%	0.01%	-1.93%	0.70%
过去六个月	-4.27%	0.69%	1.52%	0.01%	-5.79%	0.68%
过去一年	-11.27%	0.78%	3.05%	0.01%	-14.32%	0.77%
过去三年	-31.23%	1.09%	9.42%	0.01%	-40.65%	1.08%
过去五年	61.48%	1.19%	16.19%	0.01%	45.29%	1.18%
自基金合同生效 起至今	297.80%	1.38%	119.12%	0.02%	178.68%	1.36%

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
----	--------------	---------------------	--------------------	-----------------------	-----	-----



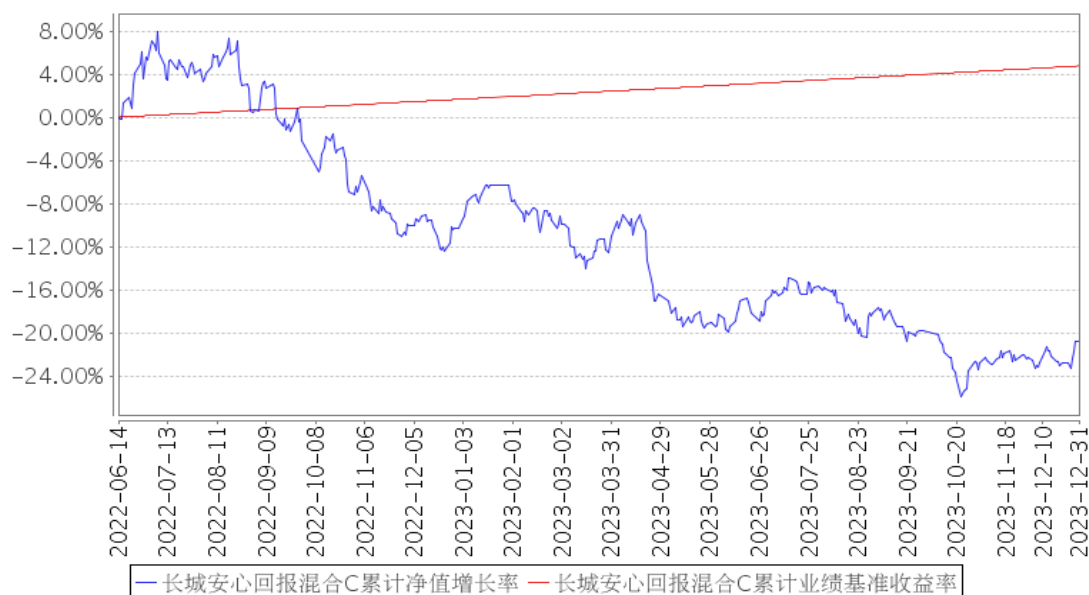
过去三个月	-1.32%	0.71%	0.76%	0.01%	-2.08%	0.70%
过去六个月	-4.57%	0.69%	1.52%	0.01%	-6.09%	0.68%
过去一年	-11.79%	0.78%	3.05%	0.01%	-14.84%	0.77%
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	-20.83%	0.84%	4.76%	0.01%	-25.59%	0.83%

### 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

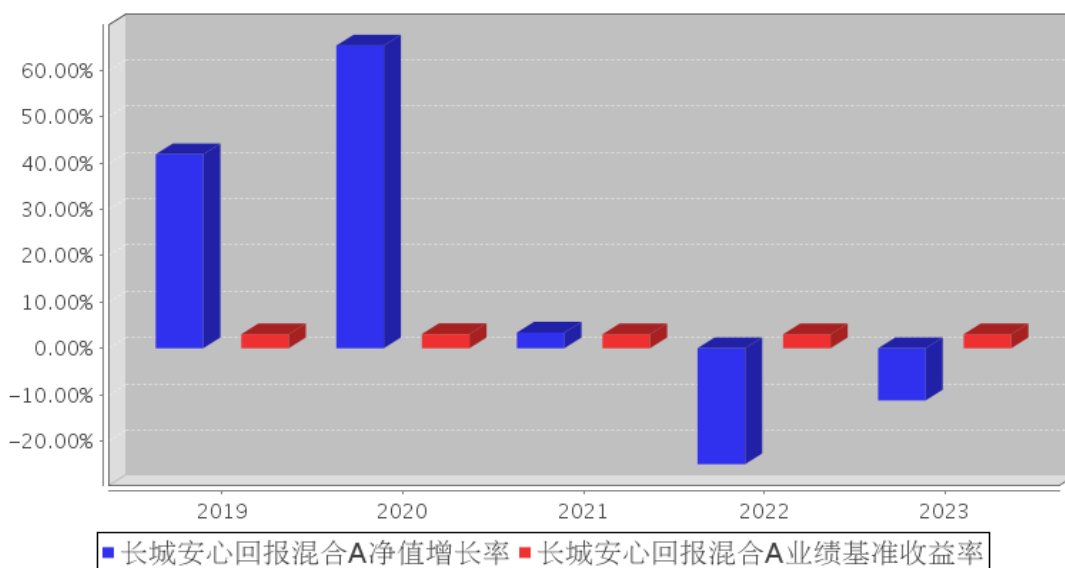


注：①本基金合同规定本基金投资组合为：股票资产 10%-85%，权证投资 0%-3%，债券 10%-85%，本基金保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中，现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款。

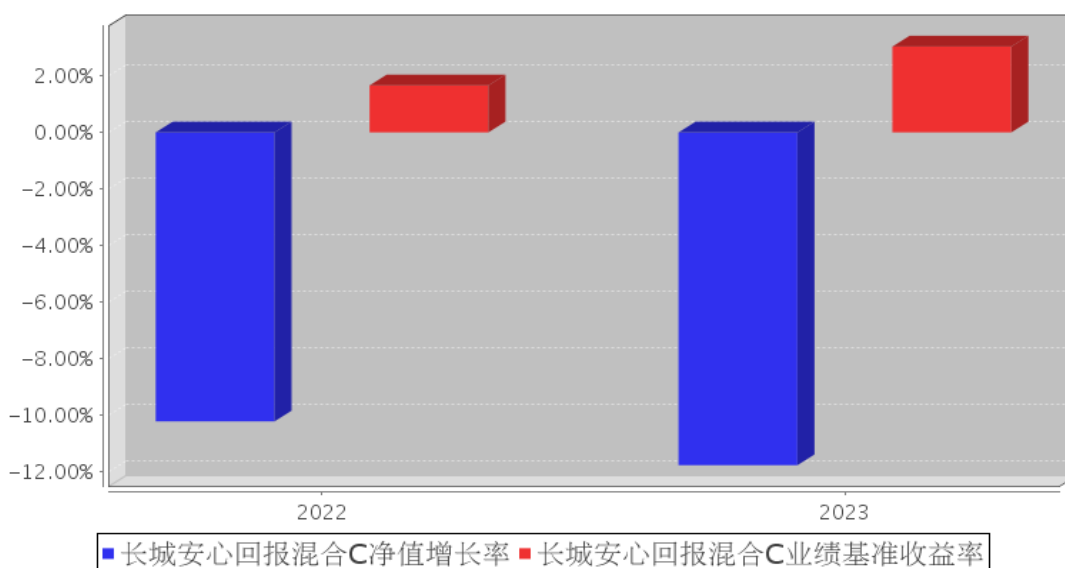
②本基金的建仓期为自本基金基金合同生效日起 6 个月，建仓期满时，各项资产配置比例符合基金合同约定。

### 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

长城安心回报混合A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



长城安心回报混合C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

长城安心回报混合 A

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2021 年	1.0000	56,657,863.17	39,341,834.54	95,999,697.71	-
合计	1.0000	56,657,863.17	39,341,834.54	95,999,697.71	-

## § 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、长城锦利三个月定期开放债券型证券投资基金、长城裕利纯债债券型发起式证券投资基金、长城景气成长混合型证券投资基金、长城集利债券型发起式证券投资基金、长城国企优选混合型发起式证券投资基金、长城精选进取 3 个月持有期混合型发起式基金中基金

(FOF)、长城均衡成长混合型证券投资基金、长城智盈添益债券型发起式证券投资基金。

#### 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		
韩林	本基金的基金经理	2023年2月10日	-	13年	男，中国籍，硕士。2010年6月-2013年8月曾就职于兴业证券股份有限公司任研究员，2013年9月-2021年7月曾就职于农银汇理基金管理有限公司，历任研究员（2013年9月-2015年7月）、基金经理（2015年7月-2021年7月），2021年8月加入长城基金管理有限公司。自2021年11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，自2023年1月至今任“长城数字经济混合型证券投资基金”基金经理，自2023年2月至今任“长城安心回报混合型证券投资基金”基金经理，自2023年5月至今任“长城创新成长混合型证券投资基金”基金经理。
唐然	本基金的基金经理	2023年2月10日	-	8年	男，中国籍，硕士，注册金融分析师（CFA）。2015年7月-2016年8月曾就职于融通基金管理有限公司，任职行业研究员；2016年8月-2017年6月曾就职于国鑫基金管理有限公司，任职行业研究员。2017年6月加入长城基金管理有限公司，历任行业研究员、基金经理助理。自2022年9月至今任“长城优选回报六个月持有期混合型证券投资基金”基金经理，自2023年2月至今任“长城安心回报混合型证券投资基金”基金经理。
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	2023年2月10日	12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。曾任公司总经理助理、研究部总经理、投委会委员、基金经理、基金经理助理、行业研究员，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2021年3月至2022年10月任“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。自2015年6月至2023年2月

					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 2023 年 2 月任“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 2023 年 2 月任“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 2023 年 2 月任“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 2023 年 2 月任“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 2023 年 2 月任“长城品质成长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 公平交易制度和控制方法

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

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

##### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

本基金管理人严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，对同向交易的价差进行事后分析，

并对基金经理兼任投资经理的组合执行更长周期的交易价差分析，定期出具公平交易稽核报告。本报告期报告认为，本基金管理人旗下投资组合的同向交易价差均在合理范围内，结果符合相关政策法规和公司制度的规定。

#### 4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

报告期内，本基金管理人严格执行了相关法律法规和公司制度的规定，同一组合经理管理的多个投资组合的不同投资者的利益得到了公平对待。

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

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

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

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2023 年全年经济呈现底部弱复苏态势，但宏观预期波动较大，造成了市场整体和风格的大幅波动，顺周期、AI、高股息交替表现，总体看 AI 和高股息全年表现较好，顺周期交易在一季度和三季度表现较好，二季度出现了较大回撤，相对不依赖经济状态的新能源和军工，分别由于行业供需的逆转和订单节奏的错位，实际并没有起到对冲的作用。

资产配置主要集中在化工、电子、机械、军工、新能源等方向，其中电子、机械、军工给组合净值造成了较大拖累。

#### 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 基金份额净值为 1.2988 元，本报告期基金份额净值增长率为-11.27%，同期业绩比较基准收益率为 3.05%；

截至本报告期末长城安心回报混合 C 基金份额净值为 1.2872 元，本报告期基金份额净值增长率为-11.79%，同期业绩比较基准收益率为 3.05%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 24 年，预计经济维持弱复苏状态。地产销售和新开工有望逐步探底，但竣工存在负增长

的可能性；对出口的判断存在分歧，预计在正负之间，关注美国终端需求变化和库存回补的节奏，以及总统选举对贸易政策预期的影响。在对需求端不抱高增长假设的前提下，我们重点关注两类机会：1) 供给端增长有限的行业；2) 行业盈利和估值处在底部、未来一到两年存在反转可能、同时正在开拓第二增长曲线的公司。此外，也试图发掘一些细分板块或个股的成长性机会。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

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

监察稽核和内部控制的重点是确保公司经营及所管理基金运作的合法合规，保障基金份额持有人的利益，建立健全投资监控体系和风险评价体系，加强投资决策流程的内部控制和风险管理，严格防范操纵市场行为、内幕交易行为和其他有损基金持有人利益的关联交易，严格防范基金销售业务中的违规行为，严格履行信息披露义务，保证履行基金合同的承诺。本报告期内，本基金运作合法合规，无操纵市场、内幕交易和不当关联交易行为，维护了基金持有人的利益。

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

本基金管理人成立了受托资产估值委员会，为基金估值业务的最高决策机构，由公司总经理、



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应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，并能的相关工作中保持独立性。基金经理作为估值委员会成员，凭借其丰富的专业技能和对市场产品的长期深入的跟踪研究，向受托资产估值委员会建议应采用的估值方法及合理的估值区间。基金经理有权出席估值委员会会议，但不得干涉估值委员会作出的决定及估值政策的执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

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

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

#### 4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无。

#### 4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金无需要说明的情况。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 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 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，长城基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金年度报告中的财务指标、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 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2024）审字第 70015735_H06 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	长城安心回报混合型证券投资基金全体基金份额持有人：
审计意见	我们审计了长城安心回报混合型证券投资基金财务报表，包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表，2023 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的长城安心回报混合型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了长城安心回报混合型证券投资基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于长城安心回报混合型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	不适用
其他事项	不适用
其他信息	长城安心回报混合型证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基

	<p>于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>	
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。在编制财务报表时，管理层负责评估长城安心回报混合型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。治理层负责监督长城安心回报混合型证券投资基金的财务报告过程。</p>	
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。（2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。（3）评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。（4）对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对长城安心回报混合型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致长城安心回报混合型证券投资基金不能持续经营。（5）评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>	
<p>会计师事务所的名称</p>	<p>安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）</p>	
<p>注册会计师的姓名</p>	<p>吴翠蓉</p>	<p>黄拥璇</p>
<p>会计师事务所的地址</p>	<p>中国 北京</p>	
<p>审计报告日期</p>	<p>2024 年 3 月 27 日</p>	

## § 7 年度财务报表

## 7.1 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：2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	7.4.7.1	156,336,244.61	62,095,511.80
结算备付金		3,446,761.61	2,320,993.38
存出保证金		308,827.88	280,694.01
交易性金融资产	7.4.7.2	734,191,884.35	965,090,004.34
其中：股票投资		620,752,357.14	853,799,171.46
基金投资		-	-
债券投资		113,439,527.21	111,290,832.88
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		9,781.92	9,643.10
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	-
资产总计		894,293,500.37	1,029,796,846.63
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2022 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		14,335,081.05	9,136,073.25
应付赎回款		442,713.63	266,102.80

应付管理人报酬		877,283.34	1,293,504.13
应付托管费		146,213.90	215,584.01
应付销售服务费		4,652.90	30.55
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	7.4.7.9	2,681,867.86	2,096,953.73
负债合计		18,694,442.81	13,214,878.60
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.10	303,504,101.88	308,521,526.92
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	572,094,955.68	708,060,441.11
净资产合计		875,599,057.56	1,016,581,968.03
负债和净资产总计		894,293,500.37	1,029,796,846.63

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额总额 674,202,642.14 份，其中长城安心回报混合 A 基金份额总额 666,966,850.07 份，基金份额净值 1.2988 元；长城安心回报混合 C 基金份额总额 7,235,792.07 份，基金份额净值 1.2872 元。

## 7.2 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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		-103,514,354.44	-330,595,407.70
1. 利息收入		891,471.18	1,070,952.51
其中：存款利息收入	7.4.7.13	833,431.80	1,070,952.51
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		58,039.38	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-54,016,496.52	-295,238,295.25
其中：股票投资收益	7.4.7.14	-61,711,691.09	-304,609,358.84
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	1,120,725.59	3,023,071.93
资产支持证券投资	7.4.7.16	-	-
投资收益		-	-

贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-	-
股利收益	7.4.7.19	6,574,468.98	6,347,991.66
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.20	-50,426,501.72	-36,440,668.59
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.21	37,172.62	12,603.63
<b>减：二、营业总支出</b>		16,065,766.69	20,446,280.93
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	13,503,994.06	17,323,523.63
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	2,250,665.60	2,887,253.91
3. 销售服务费		73,950.92	195.34
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		446.99	-
8. 其他费用	7.4.7.23	236,709.12	235,308.05
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-119,580,121.13	-351,041,688.63
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-119,580,121.13	-351,041,688.63
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-119,580,121.13	-351,041,688.63

### 7.3 净资产变动表

会计主体：长城安心回报混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	308,521,526.92	-	708,060,441.11	1,016,581,968.0

				3
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	308,521,526.92	-	708,060,441.11	1,016,581,968.03
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-5,017,425.04	-	-135,965,485.43	-140,982,910.47
(一)、综合收益总额	-	-	-119,580,121.13	-119,580,121.13
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-5,017,425.04	-	-16,385,364.30	-21,402,789.34
其中：1. 基金申购款	31,378,309.06	-	44,182,328.70	75,560,637.76
2. 基金赎回款	-36,395,734.10	-	-60,567,693.00	-96,963,427.10
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	303,504,101.88	-	572,094,955.68	875,599,057.56
项目	上年度可比期间			
	2022年1月1日至2022年12月31日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	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	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)	-16,221,811.03	-	-395,002,235.65	-411,224,046.68
(一)、综合收益总额	-	-	-351,041,688.63	-351,041,688.63
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-16,221,811.03	-	-43,960,547.02	-60,182,358.05
其中：1. 基金申购款	3,728,110.26	-	9,780,930.37	13,509,040.63
2. 基金赎回款	-19,949,921.29	-	-53,741,477.39	-73,691,398.68
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	308,521,526.92	-	708,060,441.11	1,016,581,968.03

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

王军

基金管理人负责人

邱春杨

主管会计工作负责人

赵永强

会计机构负责人



## 7.4 报表附注

### 7.4.1 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。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

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。

## 7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、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 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

## 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况。

## 7.4.4 重要会计政策和会计估计

### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

### 7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

#### （1）金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

#### （2）金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期

工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益。

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益。

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益。

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况。

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息。

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产。

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额。

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认。

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量

持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占净资产比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

#### 7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

(1) 对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法计算的利息扣除在适用情况下的相关税费后的净额确认利息收入，计入当期损益。处置时，其处置价格扣除相关交易费用后的净额与账面价值之间的差额确认为投资收益。

(2) 对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用直接计入投资收益。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产为债权投资的，在持有期间将按票面或合同利率计算的利息收入扣除在适用情况下的相关税费后的净额计入投资收益，扣除该

部分利息后的公允价值变动额计入公允价值变动损益；除上述之外的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债的公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失扣除在适用情况下预估的增值税费后的净额计入公允价值变动损益。处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益。

本基金在同时符合下列条件时确认股利收入并计入当期损益：1) 基金收取股利的权利已经确立；2) 与股利相关的经济利益很可能流入企业；3) 股利的金额能够可靠计量。

(3) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时确认。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 本基金各类基金份额在费用收取上不同，其对应的可供分配利润可能有所不同。本基金同一类别每份基金份额享有同等分配权；

(2) 基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(3) 基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金登记机构可将基金份额持有人的现金红利自动转为相应类别的基金份额。红利再投资的计算方法，依照《业务规则》执行；

(4) 本基金收益每年最多分配 12 次，年度收益分配比例不低于基金可分配收益的 60%；

(5) 本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可以事先选择将所获分配的现金收益，按照基金合同有关基金份额申购的约定转为相应类别的基金份额；基金份额持有人事先未做出选择的，基金管理人应当支付现金；

(6) 法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

#### 7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币金额。

外币货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为

人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

#### 7.4.4.13 分部报告

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

- (1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；
- (2) 能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；
- (3) 能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。

如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### 7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无需要说明的其他重要的会计政策和会计估计事项。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计估计变更。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无需要说明的重大会计差错更正。

#### 7.4.6 税项

##### (1) 印花税

证券（股票）交易印花税税率为 1‰，由出让方缴纳。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

##### (2) 增值税及附加

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

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

取得的利息收入属于金融同业往来利息收入。

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

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

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

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

### （3）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。

### （4）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。

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息



所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

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

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
活期存款	156,336,244.61	62,095,511.80
等于：本金	156,316,690.01	62,080,699.03
加：应计利息	19,554.60	14,812.77
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	156,336,244.61	62,095,511.80

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日

		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		604,343,424.65	-	620,752,357.14	16,408,932.49
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	111,850,622.00	1,474,547.21	113,439,527.21	114,358.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	111,850,622.00	1,474,547.21	113,439,527.21	114,358.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		716,194,046.65	1,474,547.21	734,191,884.35	16,523,290.49
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日				
			成本	应计利息	公允价值
股票		786,699,716.23	-	853,799,171.46	67,099,455.23
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	109,916,663.02	1,523,832.88	111,290,832.88	-149,663.02
	合计	109,916,663.02	1,523,832.88	111,290,832.88	-149,663.02
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		896,616,379.25	1,523,832.88	965,090,004.34	66,949,792.21

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：无。

##### 7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：无。

##### 7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：无。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：无。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。
----

7.4.7.5 债权投资

7.4.7.5.1 债权投资情况

注：无。

7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：无。

7.4.7.6 其他债权投资

7.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：无。

7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：无。

7.4.7.7 其他权益工具投资

7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：无。

7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：无。

7.4.7.8 其他资产

注：无。

7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	500,000.00	500,000.00
应付赎回费	11.17	24.88
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	1,992,856.69	1,407,928.85
其中：交易所市场	1,992,856.69	1,407,653.85
银行间市场	-	275.00
应付利息	-	-
预提审计费	60,000.00	60,000.00
预提信息披露费	120,000.00	120,000.00

预提中债登债券账户维护费	4,500.00	4,500.00
预提上清所债券账户维护费	4,500.00	4,500.00
合计	2,681,867.86	2,096,953.73

#### 7.4.7.10 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 2023年1月1日至2023年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	694,460,835.88	308,481,106.56
本期申购	38,376,686.26	17,047,098.85
本期赎回（以“-”号填列）	-65,870,672.07	-29,259,895.60
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	666,966,850.07	296,268,309.81

##### 长城安心回报混合 C

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	40,420.36	40,420.36
本期申购	14,331,210.21	14,331,210.21
本期赎回（以“-”号填列）	-7,135,838.50	-7,135,838.50
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	7,235,792.07	7,235,792.07

注：本基金申购包含红利再投及基金转入的份额及金额；赎回包含基金转出的份额及金额。

#### 7.4.7.11 其他综合收益

注：无。

#### 7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

##### 长城安心回报混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	912,647,867.27	-204,605,993.06	708,041,874.21
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	912,647,867.27	-204,605,993.06	708,041,874.21

本期利润	-66,678,840.41	-50,135,199.26	-116,814,039.67
本期基金份额交易产生的变动数	-32,542,602.03	11,331,766.61	-21,210,835.42
其中：基金申购款	54,189,417.92	-16,668,985.17	37,520,432.75
基金赎回款	-86,732,019.95	28,000,751.78	-58,731,268.17
本期已分配利润	-	-	-
本期末	813,426,424.83	-243,409,425.71	570,016,999.12

## 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
上年度末	30,469.10	-11,902.20	18,566.90
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	30,469.10	-11,902.20	18,566.90
本期利润	-2,474,779.00	-291,302.46	-2,766,081.46
本期基金份额交易产生的变动数	7,162,157.66	-2,336,686.54	4,825,471.12
其中：基金申购款	12,299,891.01	-5,637,995.06	6,661,895.95
基金赎回款	-5,137,733.35	3,301,308.52	-1,836,424.83
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,717,847.76	-2,639,891.20	2,077,956.56

## 7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
活期存款利息收入	784,310.89	1,024,535.06
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	43,638.90	38,737.53
其他	5,482.01	7,679.92
合计	833,431.80	1,070,952.51

## 7.4.7.14 股票投资收益

## 7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-61,711,691.09	-304,609,358.84
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	-61,711,691.09	-304,609,358.84

#### 7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31 日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12 月31日
卖出股票成交总 额	4,200,188,170.71	3,017,665,508.39
减：卖出股票成本 总额	4,250,012,214.03	3,313,007,896.91
减：交易费用	11,887,647.77	9,266,970.32
买卖股票差价收 入	-61,711,691.09	-304,609,358.84

#### 7.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

#### 7.4.7.15 债券投资收益

##### 7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31 日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31 日
债券投资收益——利 息收入	1,609,665.64	3,147,631.76
债券投资收益——买 卖债券（债转股及债 券到期兑付）差价收 入	-488,940.05	-124,559.83
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	1,120,725.59	3,023,071.93

## 7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	242,620,497.34	321,526,730.08
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	240,725,906.50	315,777,104.89
减：应计利息总额	2,376,426.19	5,872,318.85
减：交易费用	7,104.70	1,866.17
买卖债券差价收入	-488,940.05	-124,559.83

## 7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

## 7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

## 7.4.7.16 资产支持证券投资收益

## 7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：无。

## 7.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：无。

## 7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：无。

## 7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：无。

## 7.4.7.17 贵金属投资收益

## 7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：无。

## 7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

## 7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

## 7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

## 7.4.7.18 衍生工具收益

## 7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：无。

## 7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无。

## 7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月 31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月 31日
股票投资产生的股利收益	6,574,468.98	6,347,991.66
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	6,574,468.98	6,347,991.66

## 7.4.7.20 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 12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022 年12月31日
1. 交易性金融资产	-50,426,501.72	-36,440,668.59
股票投资	-50,690,522.74	-36,369,477.38
债券投资	264,021.02	-71,191.21
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	-50,426,501.72	-36,440,668.59

## 7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------



	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	37,172.62	12,603.63
合计	37,172.62	12,603.63

#### 7.4.7.22 信用减值损失

注：无。

#### 7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
审计费用	60,000.00	60,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行费用	19,509.12	18,108.05
上清所债券账户服务费	18,000.00	18,000.00
中债登债券账户服务费	18,000.00	18,000.00
上清所查询费	1,200.00	1,200.00
合计	236,709.12	235,308.05

#### 7.4.7.24 分部报告

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

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准日，本基金无需作披露的资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
长城基金管理有限公司（“长城基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
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
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
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
北方国际信托股份有限公司（“北方国际”）	基金管理人的股东
中原信托有限公司（“中原信托”）	基金管理人的股东
长城嘉信资产管理有限公司（“长城嘉信”）	基金管理人的控股子公司

信”)	
-----	--

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)
长城证券	181,688,226.83	2.20	107,394,783.08	1.75
东方证券	60,740,663.29	0.74	-	-

##### 7.4.10.1.2 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12月31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)
长城证券	11,295,795.94	3.51	-	-
东方证券	4,810,530.00	1.49	-	-

##### 7.4.10.1.3 债券回购交易

注：无。

##### 7.4.10.1.4 权证交易

注：无。

##### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
东方证券	56,568.62	0.73	-	-
长城证券	169,976.51	2.20	11,373.59	0.57
关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日			

	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
长城证券	100,016.97	1.75	-	-

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市场信息服务。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	13,503,994.06	17,323,523.63
其中：应支付销售机构的客户维护费	3,136,661.40	4,111,564.79
应支付基金管理人的净管理费	10,367,332.66	13,211,958.84

注：(1) 基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{管理费费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

(2) 自 2023 年 8 月 21 日起，本基金的管理费率由 1.50%/年调整为 1.20%/年。

##### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	2,250,665.60	2,887,253.91

注：(1) 基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{托管费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

(2) 自 2023 年 8 月 21 日起, 本基金的托管费率由 0.25%/年调整为 0.20%/年。

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

单位: 人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	长城安心回报混合 A	长城安心回报混合 C	合计
长城基金管理有限公司	-	73,730.15	73,730.15
合计	-	73,730.15	73,730.15
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 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	-	2.18	2.18
合计	-	2.18	2.18

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 0.6%。销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.6% 年费率计提。计算公式如下:

$$H = E \times 0.6\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注: 无。

#### 7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

注: 无。

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

注: 无。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

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

##### 7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

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

#### 7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	156,336,244.61	784,310.89	62,095,511.80	1,024,535.06

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，按银行同业利率计息。

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.4.11 利润分配情况

注：本基金于本期未进行利润分配。

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

7.4.8.2 资产负债表日后事项。

#### 7.4.12 期末（2023年12月31日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 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
001239	永达股份	2023年12月4日	6个月	新股锁定	12.05	19.92	189	2,277.45	3,764.88	-
001306	夏厦	2023年11	6个月	新股锁定	53.63	75.36	64	3,432.32	4,823.04	-

	精密	月9日									
001358	兴欣新材	2023年12月14日	6个月	新股锁定	41.00	44.16	87	3,567.00	3,841.92	-	
001378	德冠新材	2023年10月23日	6个月	新股锁定	31.68	31.27	205	6,494.40	6,410.35	-	
301202	朗威股份	2023年6月28日	6个月	新股锁定	25.82	31.80	306	7,900.92	9,730.80	-	
301251	威尔高	2023年8月30日	6个月	新股锁定	28.88	34.59	321	9,270.48	11,103.39	-	
301272	英华特	2023年7月6日	6个月	新股锁定	51.39	53.38	173	8,890.47	9,234.74	-	
301292	海科新源	2023年6月29日	6个月	新股锁定	19.99	19.35	583	11,654.17	11,281.05	-	
301329	信音电子	2023年7月5日	6个月	新股锁定	21.00	22.23	458	9,618.00	10,181.34	-	
301418	协昌科技	2023年8月10日	6个月	新股锁定	51.88	50.20	189	9,805.32	9,487.80	-	
301421	波长光电	2023年8月16日	6个月	新股锁定	29.38	59.37	332	9,754.16	19,710.84	-	
301456	盘古智能	2023年7月6日	6个月	新股锁定	37.96	30.39	407	15,449.72	12,368.73	-	
301500	飞南资源	2023年9月13日	6个月	新股锁定	23.97	20.89	455	10,906.35	9,504.95	-	

301507	民生健康	2023年8月24日	6个月	新股锁定	10.00	15.85	851	8,510.00	13,488.35	-
301508	中机认检	2023年11月23日	6个月	新股锁定	16.82	26.68	419	7,047.58	11,178.92	-
301510	固高科技	2023年8月4日	6个月	新股锁定	12.00	35.01	396	4,752.00	13,863.96	-
301516	中远通	2023年12月1日	6个月	新股锁定	6.87	15.51	604	4,149.48	9,368.04	-
301517	陕西华达	2023年10月9日	6个月	新股锁定	26.87	43.69	185	4,970.95	8,082.65	-
301520	万邦医药	2023年9月18日	6个月	新股锁定	67.88	52.74	160	10,860.80	8,438.40	-
301526	国际复材	2023年12月19日	6个月	新股锁定	2.66	4.45	9,723	25,863.18	43,267.35	-
301529	福赛科技	2023年8月31日	6个月	新股锁定	36.60	37.88	182	6,661.20	6,894.16	-
301533	威马农机	2023年8月7日	6个月	新股锁定	29.50	33.16	225	6,637.50	7,461.00	-
301550	斯菱股份	2023年9月6日	6个月	新股锁定	37.56	43.57	260	9,765.60	11,328.20	-
301555	惠柏新材	2023年10月24日	6个月	新股锁定	22.88	32.44	224	5,125.12	7,266.56	-
301568	思	2023	6个月	新股	23.23	35.58	246	5,714.58	8,752.68	-

	泰克	年 11 月 21 日		锁定							
601083	锦江航运	2023 年 11 月 28 日	6 个月	新股锁定	11.25	11.07	1,263	14,208.75	13,981.41	-	
601096	宏盛华源	2023 年 12 月 15 日	6 个月	新股锁定	1.70	4.06	3,918	6,660.60	15,907.08	-	
603004	鼎龙科技	2023 年 12 月 20 日	6 个月	新股锁定	16.80	31.19	195	3,276.00	6,082.05	-	
603075	热威股份	2023 年 9 月 1 日	6 个月	新股锁定	23.10	23.31	182	4,204.20	4,242.42	-	
603107	上海汽配	2023 年 10 月 25 日	6 个月	新股锁定	14.23	18.19	292	4,155.16	5,311.48	-	
603119	浙江荣泰	2023 年 7 月 21 日	6 个月	新股锁定	15.32	23.87	226	3,462.32	5,394.62	-	
603193	润本股份	2023 年 10 月 9 日	6 个月	新股锁定	17.38	16.66	303	5,266.14	5,047.98	-	
603231	索宝蛋白	2023 年 12 月 6 日	6 个月	新股锁定	21.29	21.53	161	3,427.69	3,466.33	-	
603273	天元智能	2023 年 10 月 16 日	6 个月	新股锁定	9.50	18.97	178	1,691.00	3,376.66	-	
603276	恒兴新材	2023 年 9 月 18 日	6 个月	新股锁定	25.73	24.88	134	3,447.82	3,333.92	-	
603373	安	2023	6 个月	新股	19.10	34.75	88	1,680.80	3,058.00	-	



	邦护卫	年12月13日		锁定						
688548	广钢气体	2023年8月8日	6个月	新股锁定	9.87	12.75	3,823	37,733.01	48,743.25	-
688549	中巨芯	2023年8月30日	6个月	新股锁定	5.18	8.09	4,294	22,242.92	34,738.46	-
688602	康鹏科技	2023年7月13日	6个月	新股锁定	8.66	11.06	1,066	9,231.56	11,789.96	-
688651	盛邦安全	2023年7月19日	6个月	新股锁定	39.90	46.05	178	7,102.20	8,196.90	-
688652	京仪装备	2023年11月22日	6个月	新股锁定	31.95	52.25	416	13,291.20	21,736.00	-
688657	浩辰软件	2023年9月25日	6个月	新股锁定	103.40	78.23	101	10,443.40	7,901.23	-
688693	锆威特	2023年8月10日	6个月	新股锁定	40.83	43.41	178	7,267.74	7,726.98	-
688716	中研股份	2023年9月13日	6个月	新股锁定	29.66	36.39	267	7,919.22	9,716.13	-

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688337	普源精电	2023年12月25日	重大事项停牌	43.87	2024年01月09日	41.72	767	38,066.70	33,648.29	-

### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 12 月 31 日止, 本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为人民币 0.00 元, 无质押债券。

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 12 月 31 日止, 本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为人民币 0.00 元, 无质押债券。

### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注: 无。

## 7.4.13 金融工具风险及管理

### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

### 7.4.13.2 信用风险

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

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

### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额, 另一

方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

#### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

#### 7.4.13.4 市场风险

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

##### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为货币资金、结算备付金、存出保证金及债券投资等。本基金管理人每日对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

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

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023年 12月 31日	1个月以内	1-3 个月	3个月-1年	1-5 年	5年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	156,336,244.61	-	-	-	-	-	156,336,244.61
结算备付金	3,446,761.61	-	-	-	-	-	3,446,761.61
存出保证金	308,827.88	-	-	-	-	-	308,827.88
交易性金融资产	14,579,265.29	-98,860,261.92	-	-	-	-620,752,357.14	734,191,884.35
应收申购款	-	-	-	-	-	9,781.92	9,781.92
资产总计	174,671,099.39	-98,860,261.92	-	-	-	-620,762,139.06	894,293,500.37
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	442,713.63	442,713.63
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	877,283.34	877,283.34
应付托管费	-	-	-	-	-	146,213.90	146,213.90
应付清算款	-	-	-	-	-	14,335,081.05	14,335,081.05
应付销售服务费	-	-	-	-	-	4,652.90	4,652.90
应交税费	-	-	-	-	-	206,630.13	206,630.13
其他负债	-	-	-	-	-	2,681,867.86	2,681,867.86
负债总计	-	-	-	-	-	18,694,442.81	18,694,442.81
利率敏感度缺口	174,671,099.39	-98,860,261.92	-	-	-	-	-
上年度末 2022年 12月	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

31 日							
资产							
货币资金	62,095,511.80	-	-	-	-	-	62,095,511.80
结算备付金	2,320,993.38	-	-	-	-	-	2,320,993.38
存出保证金	280,694.01	-	-	-	-	-	280,694.01
交易性金融资产	51,010,643.84	-49,944,178.08	-10,336,010.96	853,799,171.46			965,090,004.34
应收申购款	-	-	-	-	9,643.10		9,643.10
资产总计	115,707,843.03	-49,944,178.08	-10,336,010.96	853,808,814.56			1,029,796,846.63
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	266,102.80		266,102.80
应付管理人报酬	-	-	-	-	1,293,504.13		1,293,504.13
应付托管费	-	-	-	-	215,584.01		215,584.01
应付清算款	-	-	-	-	9,136,073.25		9,136,073.25
应付销售服务费	-	-	-	-	30.55		30.55
应交税费	-	-	-	-	206,630.13		206,630.13
其他负债	-	-	-	-	2,096,953.73		2,096,953.73
负债总计	-	-	-	-	13,214,878.60		13,214,878.60
利率敏感度缺口	115,707,843.03	-49,944,178.08	-10,336,010.96				

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023 年 12 月 31 日）	上年度末（2022 年 12 月

			31 日 )
	市场利率下降 25 个基点	96,749.06	194,781.15
	市场利率上升 25 个基点	-96,551.89	-193,345.63

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

##### 7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

注：无。

##### 7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

注：无。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

本基金投资组合的资产配置为：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。本基金于本期末及上年度末面临的整体其他价格风险列示如下：

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 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	620,752,357.14	70.89	853,799,171.46	83.99
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-

交易性金融资产—债券投资	113,439,527.21	12.96	111,290,832.88	10.95
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	734,191,884.35	83.85	965,090,004.34	94.93

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023 年 12 月 31 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数上升 5%	23,467,542.86	39,347,334.82
	沪深 300 指数下降 5%	-23,467,542.86	-39,347,334.82

#### 7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

注：无。

#### 7.4.14 公允价值

##### 7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

##### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	620,228,123.89	853,724,163.22

第二层次	113,473,175.50	111,290,832.88
第三层次	490,584.96	75,008.24
合计	734,191,884.35	965,090,004.34

#### 7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金调整公允价值计量层次转换时点的相关会计政策在前后各会计期间保持一致。

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

#### 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

##### 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	75,008.24	75,008.24
当期购买	-	0.00	0.00
当期出售/结算	-	0.00	0.00
转入第三层次	-	439,272.29	439,272.29
转出第三层次	-	249,747.56	249,747.56
当期利得或损失总额	-	226,051.99	226,051.99
其中：计入损益的利得或损失	-	226,051.99	226,051.99
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	490,584.96	490,584.96
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	114,794.48	114,794.48
项目	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	



期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	321,455.12	321,455.12
转出第三层次	-	667,399.65	667,399.65
当期利得或损失总额	-	420,952.77	420,952.77
其中：计入损益的利得或损失	-	420,952.77	420,952.77
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	75,008.24	75,008.24
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-30,040.76	-30,040.76

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

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	490,584.96	平均价格亚式期权模型	预期波动率	0.1962~2.1988	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	75,008.24	平均价格亚式期权模型	预期波动率	0.2127~0.5680	负相关

**7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明**

无。

**7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明**

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

**7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**

无。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	620,752,357.14	69.41
	其中：股票	620,752,357.14	69.41
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	113,439,527.21	12.68
	其中：债券	113,439,527.21	12.68
	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	159,783,006.22	17.87
8	其他各项资产	318,609.80	0.04
9	合计	894,293,500.37	100.00

### 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	5,284,926.00	0.60
B	采矿业	41,860,600.00	4.78
C	制造业	497,639,628.54	56.83
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,642,784.00	0.99
E	建筑业	6,326,553.78	0.72
F	批发和零售业	6,341,062.00	0.72
G	交通运输、仓储和邮政业	15,423.41	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	25,041,550.59	2.86
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	7,450,098.00	0.85
M	科学研究和技术服务业	14,073,153.82	1.61
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	1,703,979.00	0.19
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	6,372,598.00	0.73
	合计	620,752,357.14	70.89

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：无。

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	603225	新风鸣	5,980,560	84,923,952.00	9.70
2	605589	圣泉集团	3,047,900	68,212,002.00	7.79
3	601233	桐昆股份	4,285,100	64,833,563.00	7.40
4	688332	中科蓝讯	183,330	13,826,748.60	1.58
5	688550	瑞联新材	340,110	13,495,564.80	1.54
6	603993	洛阳钼业	2,380,700	12,379,640.00	1.41
7	300012	华测检测	863,200	12,257,440.00	1.40
8	688008	澜起科技	192,392	11,304,953.92	1.29
9	688123	聚辰股份	159,080	9,740,468.40	1.11
10	688636	智明达	142,244	9,274,308.80	1.06
11	600461	洪城环境	945,600	8,642,784.00	0.99
12	603087	甘李药业	160,300	8,439,795.00	0.96
13	688283	坤恒顺维	122,210	8,387,272.30	0.96
14	688122	西部超导	157,324	8,374,356.52	0.96
15	601666	平煤股份	714,900	8,264,244.00	0.94
16	603300	华铁应急	1,163,600	7,447,040.00	0.85
17	000777	中核科技	511,300	7,434,302.00	0.85
18	605499	东鹏饮料	40,000	7,300,400.00	0.83
19	300900	广联航空	277,400	6,846,232.00	0.78
20	688678	福立旺	367,632	6,768,105.12	0.77
21	688212	澳华内镜	106,888	6,630,262.64	0.76
22	300158	振东制药	949,200	6,407,100.00	0.73
23	300719	安达维尔	478,100	6,373,073.00	0.73
24	600603	广汇物流	819,100	6,372,598.00	0.73
25	601886	江河集团	949,933	6,326,553.78	0.72
26	603712	七一二	194,600	6,131,846.00	0.70
27	300910	瑞丰新材	123,500	5,673,590.00	0.65
28	600114	东睦股份	363,800	5,635,262.00	0.64
29	601702	华峰铝业	311,663	5,594,350.85	0.64
30	688088	虹软科技	131,873	5,412,067.92	0.62
31	002567	唐人神	709,700	5,322,750.00	0.61
32	002840	华统股份	254,400	5,288,976.00	0.60

33	000426	兴业银锡	563,200	5,113,856.00	0.58
34	688205	德科立	96,579	4,778,728.92	0.55
35	688091	上海谊众	73,258	4,688,512.00	0.54
36	300498	温氏股份	219,000	4,393,140.00	0.50
37	002675	东诚药业	236,900	4,342,377.00	0.50
38	301153	中科江南	55,100	4,312,677.00	0.49
39	300559	佳发教育	277,900	4,307,450.00	0.49
40	300085	银之杰	294,200	4,212,944.00	0.48
41	300705	九典制药	124,100	4,123,843.00	0.47
42	603062	麦加芯彩	62,700	3,914,988.00	0.45
43	002955	鸿合科技	111,900	3,615,489.00	0.41
44	688062	迈威生物	108,670	3,552,422.30	0.41
45	688192	迪哲医药	74,102	3,545,780.70	0.40
46	002315	焦点科技	106,400	3,525,032.00	0.40
47	300470	中密控股	93,200	3,522,960.00	0.40
48	002983	芯瑞达	113,950	3,516,497.00	0.40
49	002028	思源电气	67,300	3,502,292.00	0.40
50	688617	惠泰医疗	9,008	3,499,608.00	0.40
51	601918	新集能源	659,500	3,475,565.00	0.40
52	301503	智迪科技	101,600	3,417,824.00	0.39
53	000625	长安汽车	202,800	3,413,124.00	0.39
54	300723	一品红	112,700	3,361,841.00	0.38
55	601699	潞安环能	152,600	3,343,466.00	0.38
56	002294	信立泰	101,900	3,328,054.00	0.38
57	688180	君实生物	78,488	3,283,153.04	0.37
58	603619	中曼石油	168,400	3,118,768.00	0.36
59	300979	华利集团	57,700	3,037,328.00	0.35
60	603181	皇马科技	270,400	2,955,472.00	0.34
61	605599	莱百股份	192,200	2,861,858.00	0.33
62	601001	晋控煤业	223,900	2,760,687.00	0.32
63	002463	沪电股份	122,000	2,698,640.00	0.31
64	301015	百洋医药	72,500	2,599,850.00	0.30
65	688271	联影医疗	18,932	2,593,873.32	0.30
66	688114	华大智造	29,904	2,572,342.08	0.29
67	688200	华峰测控	20,820	2,556,696.00	0.29
68	002007	华兰生物	114,800	2,540,524.00	0.29
69	300122	智飞生物	40,500	2,474,955.00	0.28
70	002390	信邦制药	504,200	2,238,648.00	0.26
71	688351	微电生理	82,570	2,117,920.50	0.24
72	603379	三美股份	59,438	2,020,892.00	0.23
73	688685	迈信林	64,968	1,930,848.96	0.22
74	002241	歌尔股份	90,200	1,895,102.00	0.22
75	301205	联特科技	17,400	1,822,650.00	0.21

76	603309	维力医疗	126,900	1,805,787.00	0.21
77	688073	毕得医药	32,231	1,788,820.50	0.20
78	003019	宸展光电	78,600	1,776,360.00	0.20
79	300552	万集科技	59,500	1,761,200.00	0.20
80	002149	西部材料	111,600	1,754,352.00	0.20
81	002318	久立特材	87,900	1,747,452.00	0.20
82	300308	中际旭创	15,300	1,727,523.00	0.20
83	688578	艾力斯	41,377	1,723,765.82	0.20
84	301267	华夏眼科	53,100	1,703,979.00	0.19
85	600985	淮北矿业	102,400	1,702,912.00	0.19
86	600256	广汇能源	238,300	1,701,462.00	0.19
87	688152	麒麟信安	21,137	1,481,069.59	0.17
88	688269	凯立新材	27,735	1,026,472.35	0.12
89	688658	悦康药业	43,384	904,990.24	0.10
90	603179	新泉股份	17,600	892,496.00	0.10
91	600435	北方导航	76,000	892,240.00	0.10
92	603477	巨星农牧	23,800	891,786.00	0.10
93	000951	中国重汽	66,400	887,104.00	0.10
94	605128	上海沿浦	15,200	882,360.00	0.10
95	000034	神州数码	29,400	879,354.00	0.10
96	300289	利德曼	135,900	835,785.00	0.10
97	688331	荣昌生物	12,917	801,629.02	0.09
98	605319	无锡振华	11,600	267,032.00	0.03
99	688443	智翔金泰	1,941	77,542.95	0.01
100	603596	伯特利	1,100	76,230.00	0.01
101	688548	广钢气体	3,823	48,743.25	0.01
102	301526	C 国际复材	9,723	43,267.35	0.00
103	688549	中巨芯	4,294	34,738.46	0.00
104	688337	普源精电	767	33,648.29	0.00
105	688652	京仪装备	416	21,736.00	0.00
106	301421	波长光电	332	19,710.84	0.00
107	601096	宏盛华源	3,918	15,907.08	0.00
108	601083	锦江航运	1,263	13,981.41	0.00
109	301510	固高科技	396	13,863.96	0.00
110	301507	民生健康	851	13,488.35	0.00
111	301456	盘古智能	407	12,368.73	0.00
112	688631	莱斯信息	336	11,844.00	0.00
113	688602	康鹏科技	1,066	11,789.96	0.00
114	301550	斯菱股份	260	11,328.20	0.00
115	301292	海科新源	583	11,281.05	0.00
116	301508	中机认检	419	11,178.92	0.00
117	301251	威尔高	321	11,103.39	0.00
118	301329	信音电子	458	10,181.34	0.00

119	301202	朗威股份	306	9,730.80	0.00
120	688716	中研股份	267	9,716.13	0.00
121	301500	飞南资源	455	9,504.95	0.00
122	301418	协昌科技	189	9,487.80	0.00
123	301516	中远通	604	9,368.04	0.00
124	301272	英华特	173	9,234.74	0.00
125	301568	思泰克	246	8,752.68	0.00
126	301520	万邦医药	160	8,438.40	0.00
127	688651	盛邦安全	178	8,196.90	0.00
128	301517	陕西华达	185	8,082.65	0.00
129	688657	浩辰软件	101	7,901.23	0.00
130	688693	锆威特	178	7,726.98	0.00
131	301533	威马农机	225	7,461.00	0.00
132	603259	药明康德	100	7,276.00	0.00
133	301555	惠柏新材	224	7,266.56	0.00
134	301529	福赛科技	182	6,894.16	0.00
135	001378	德冠新材	205	6,410.35	0.00
136	603004	C 鼎龙	195	6,082.05	0.00
137	603119	浙江荣泰	226	5,394.62	0.00
138	603107	上海汽配	292	5,311.48	0.00
139	603193	润本股份	303	5,047.98	0.00
140	001306	夏厦精密	64	4,823.04	0.00
141	688786	悦安新材	100	4,444.00	0.00
142	603075	热威股份	182	4,242.42	0.00
143	001358	兴欣新材	87	3,841.92	0.00
144	001239	永达股份	189	3,764.88	0.00
145	603231	索宝蛋白	161	3,466.33	0.00
146	603273	天元智能	178	3,376.66	0.00
147	603276	恒兴新材	134	3,333.92	0.00
148	603373	安邦护卫	88	3,058.00	0.00
149	002690	美亚光电	100	1,964.00	0.00
150	601006	大秦铁路	200	1,442.00	0.00
151	688052	纳芯微	7	1,167.95	0.00

#### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	605589	圣泉集团	94,489,139.37	9.29
2	601233	桐昆股份	92,929,414.58	9.14
3	603225	新凤鸣	83,775,171.18	8.24
4	300033	同花顺	51,536,241.00	5.07
5	300012	华测检测	49,668,487.98	4.89

6	688008	澜起科技	46,750,828.33	4.60
7	300750	宁德时代	44,820,458.28	4.41
8	603379	三美股份	44,230,742.32	4.35
9	300661	圣邦股份	42,399,822.50	4.17
10	688550	瑞联新材	42,158,629.59	4.15
11	300979	华利集团	40,899,954.16	4.02
12	603383	顶点软件	39,116,474.60	3.85
13	688332	中科蓝讯	38,741,338.48	3.81
14	002142	宁波银行	37,190,777.93	3.66
15	600026	中远海能	34,807,501.72	3.42
16	300900	广联航空	34,725,047.00	3.42
17	003025	思进智能	33,316,399.85	3.28
18	688052	纳芯微	32,315,121.54	3.18
19	601678	滨化股份	31,725,272.94	3.12
20	603855	华荣股份	31,647,616.00	3.11
21	601601	中国太保	31,252,004.70	3.07
22	603885	吉祥航空	29,590,010.20	2.91
23	300833	浩洋股份	29,244,750.00	2.88
24	600346	恒力石化	29,016,520.00	2.85
25	603259	药明康德	28,729,183.00	2.83
26	688308	欧科亿	27,923,615.68	2.75
27	603738	泰晶科技	27,922,791.20	2.75
28	601886	江河集团	27,812,849.34	2.74
29	600765	中航重机	27,788,371.00	2.73
30	300470	中密控股	27,259,195.00	2.68
31	603606	东方电缆	25,816,324.57	2.54
32	688200	华峰测控	25,692,100.81	2.53
33	600183	生益科技	25,110,009.72	2.47
34	002129	TCL 中环	23,787,108.27	2.34
35	688122	西部超导	23,556,098.99	2.32
36	600862	中航高科	23,438,377.00	2.31
37	600409	三友化工	23,380,319.00	2.30
38	600029	南方航空	22,937,747.00	2.26
39	688279	峰昭科技	22,527,458.75	2.22
40	000661	长春高新	21,862,657.84	2.15
41	688766	普冉股份	21,749,063.29	2.14
42	002865	钧达股份	21,663,051.69	2.13
43	300037	新宙邦	21,597,669.60	2.12
44	688099	晶晨股份	21,497,142.47	2.11
45	688558	国盛智科	21,303,906.09	2.10
46	300719	安达维尔	21,060,682.00	2.07
47	300481	濮阳惠成	21,014,282.40	2.07
48	300408	三环集团	20,578,408.00	2.02

49	605117	德业股份	20,567,569.78	2.02
50	000001	平安银行	20,506,736.80	2.02
51	603583	捷昌驱动	20,442,445.86	2.01

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

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	94,345,081.40	9.28
2	300033	同花顺	64,748,076.20	6.37
3	300750	宁德时代	57,442,373.22	5.65
4	688008	澜起科技	56,025,984.70	5.51
5	300593	新雷能	46,165,989.80	4.54
6	688066	航天宏图	44,594,596.42	4.39
7	000858	五粮液	43,581,986.00	4.29
8	603379	三美股份	42,646,013.10	4.20
9	603383	顶点软件	41,216,972.80	4.05
10	002142	宁波银行	36,927,865.34	3.63
11	000568	泸州老窖	36,320,923.58	3.57
12	600026	中远海能	34,636,176.84	3.41
13	688122	西部超导	34,029,953.14	3.35
14	300979	华利集团	33,229,542.00	3.27
15	601601	中国太保	33,179,670.00	3.26
16	002475	立讯精密	32,420,126.83	3.19
17	605589	圣泉集团	31,930,554.45	3.14
18	603688	石英股份	31,728,428.00	3.12
19	300760	迈瑞医疗	30,503,591.60	3.00
20	300012	华测检测	30,125,936.00	2.96
21	601678	滨化股份	29,752,419.76	2.93
22	000001	平安银行	29,510,383.00	2.90
23	688550	瑞联新材	29,278,299.63	2.88
24	603738	泰晶科技	29,158,611.32	2.87
25	603668	天马科技	29,132,237.28	2.87
26	300661	圣邦股份	29,049,047.36	2.86
27	603259	药明康德	28,654,157.00	2.82
28	003025	思进智能	28,338,862.70	2.79
29	688332	中科蓝讯	28,285,787.09	2.78
30	688052	纳芯微	27,971,281.39	2.75
31	600309	万华化学	27,964,108.00	2.75
32	000002	万科 A	27,795,377.00	2.73
33	300833	浩洋股份	27,443,674.00	2.70
34	601233	桐昆股份	27,284,030.00	2.68
35	600346	恒力石化	27,198,420.26	2.68



36	688377	迪威尔	26,875,790.28	2.64
37	603885	吉祥航空	26,529,413.86	2.61
38	603288	海天味业	25,563,864.50	2.51
39	603855	华荣股份	25,119,502.95	2.47
40	000333	美的集团	24,904,989.00	2.45
41	600183	生益科技	24,608,750.00	2.42
42	600765	中航重机	24,602,214.00	2.42
43	688279	峰昭科技	24,298,573.95	2.39
44	688308	欧科亿	24,070,110.81	2.37
45	603606	东方电缆	23,941,923.57	2.36
46	600919	江苏银行	23,468,366.00	2.31
47	300470	中密控股	23,390,541.00	2.30
48	600409	三友化工	23,312,857.00	2.29
49	688766	普冉股份	23,034,833.68	2.27
50	000661	长春高新	22,689,277.00	2.23
51	600862	中航高科	22,488,920.35	2.21
52	300900	广联航空	22,366,913.00	2.20
53	601688	华泰证券	22,238,697.00	2.19
54	002129	TCL 中环	21,806,731.25	2.15
55	688200	华峰测控	21,186,117.12	2.08
56	300037	新宙邦	20,747,144.87	2.04
57	300274	阳光电源	20,610,426.00	2.03

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

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	4,067,655,922.45
卖出股票收入（成交）总额	4,200,188,170.71

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

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	113,439,527.21	12.96
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-

9	其他	-	-
10	合计	113,439,527.21	12.96

### 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019703	23 国债 10	716,000	72,623,683.84	8.29
2	019709	23 国债 16	261,000	26,236,578.08	3.00
3	019694	23 国债 01	143,000	14,579,265.29	1.67

### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：无。

### 8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：无。

### 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：无。

### 8.10 本基金投资股指期货的投资政策

注：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。

### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 8.11.1 本期国债期货投资政策

注：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。

#### 8.11.2 本期国债期货投资评价

无。

### 8.12 投资组合报告附注

#### 8.12.1 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

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

#### 8.12.2 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。

#### 8.12.3 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	308,827.88
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	9,781.92
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	318,609.80

#### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：无。

#### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：无。

#### 8.12.6 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。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基 金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份 额比例 (%)	持有份额	占总 份额 比例 (%)
长城安心 回报混合 A	59,399	11,228.59	14,734,398.92	2.21	652,232,451.15	97.79
长城安心 回报混合 C	52	139,149.85	7,155,419.13	98.89	80,372.94	1.11
合计	59,451	11,340.48	21,889,818.05	3.25	652,312,824.09	96.75

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

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管	长城安心回报混合 A	112,844.68	0.0169

理人所有从业人员持有本基金	长城安心回报混合 C	492.07	0.0068
	合计	113,336.75	0.0168

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

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和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	0~10
	长城安心回报混合 C	0
	合计	0~10

注：同时为基金管理人高级管理人员和基金经理的，分别计算在内。

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

注：本报告期无基金经理兼任投资经理的情况。

## § 10 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	694,460,835.88	40,420.36
本报告期基金总申购份额	38,376,686.26	14,331,210.21
减：本报告期基金总赎回份额	65,870,672.07	7,135,838.50
本报告期基金拆分变动份额	-	-

本报告期末基金份额总额	666,966,850.07	7,235,792.07
-------------	----------------	--------------

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

#### 1、基金管理人重大人事变动：

自 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。

自 2023 年 9 月 15 日起，车君女士担任公司副总经理，不再担任公司督察长。

自 2023 年 9 月 15 日起，祝函先生担任公司督察长。

#### 2、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：

本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本基金本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期内投资策略无改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

1、本期未有改聘会计师事务所。

2、本基金本报告期应支付给会计师事务所的报酬为人民币陆万元。

3、目前为本基金提供审计服务的会计师事务所为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙），为本基金提供审计服务自本基金合同生效日持续至本报告期。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，本基金管理人及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

#### 11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

## 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
中信建投	1	1,962,361,763.39	23.76	1,834,196.40	23.73	-
西南证券	1	1,499,503,473.43	18.15	1,404,284.47	18.17	-
财信证券	2	814,476,456.98	9.86	760,509.15	9.84	-
华金证券	2	812,262,472.57	9.83	757,440.58	9.80	-
中信证券	2	798,707,540.30	9.67	751,669.37	9.72	-
世纪证券	1	575,553,753.20	6.97	536,018.43	6.93	-
粤开证券	2	310,534,463.28	3.76	290,865.12	3.76	-
中泰证券	2	306,296,729.11	3.71	286,084.69	3.70	-
德邦证券	2	299,522,745.54	3.63	283,319.13	3.67	-
大同证券	1	230,594,883.25	2.79	215,599.76	2.79	-
长城证券	3	181,688,226.83	2.20	169,976.51	2.20	-
方正证券	2	133,908,168.22	1.62	124,709.14	1.61	-
申万宏源	2	107,165,575.80	1.30	101,368.61	1.31	-
国盛证券	1	71,063,789.08	0.86	67,218.56	0.87	-
东方证券	1	60,740,663.29	0.74	56,568.62	0.73	-
银河证券	2	34,042,543.00	0.41	31,704.15	0.41	-
国信证券	1	29,832,918.03	0.36	27,783.87	0.36	-
招商证券 股份有限	2	16,010,581.50	0.19	15,144.40	0.20	-

公司						
中金公司	1	15,994,080.84	0.19	15,128.24	0.20	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
东方财富	2	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
华安证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-

注：1、报告期内租用证券公司席位的变更情况： 本报告期内交易单元无变化，截止本报告期末共计 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。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
中信建	150,277,419	46.66	-	-	-	-

投	.45					
西南证 券	17,051,905. 92	5.29	-	-	-	-
财信证 券	2,623,617.7 0	0.81	-	-	-	-
华金证 券	6,371,698.4 9	1.98	-	-	-	-
中信证 券	83,780,164. 57	26.01	-	-	-	-
世纪证 券	5,484,787.1 1	1.70	-	-	-	-
粤开证 券	9,512,350.0 0	2.95	544,105,000. 00	100.00	-	-
中泰证 券	12,842,511. 89	3.99	-	-	-	-
德邦证 券	-	-	-	-	-	-
大同证 券	-	-	-	-	-	-
长城证 券	11,295,795. 94	3.51	-	-	-	-
方正证 券	15,839,898. 25	4.92	-	-	-	-
申万宏 源	2,162,441.2 8	0.67	-	-	-	-
国盛证 券	-	-	-	-	-	-
东方证 券	4,810,530.0 0	1.49	-	-	-	-
银河证 券	-	-	-	-	-	-
国信证 券	-	-	-	-	-	-
招商证 券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
中金公 司	-	-	-	-	-	-
长江证 券	-	-	-	-	-	-
东方财 富	-	-	-	-	-	-
东兴证	-	-	-	-	-	-



券						
光大证 券	-	-	-	-	-	-
国联证 券	-	-	-	-	-	-
国泰君 安	-	-	-	-	-	-
华安证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
华西证 券	-	-	-	-	-	-
新时代 证券	-	-	-	-	-	-
信达证 券	-	-	-	-	-	-
中银国 际	-	-	-	-	-	-

### 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	长城基金管理有限公司关于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	长城安心回报混合型证券投资基金基金经理变更的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023年2月11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	长城基金管理有限公司关于提醒投资者及时提供或更新身份信息资料的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023年7月1日
6	长城基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023年8月18日
7	长城基金管理有限公司关于终止凤凰金信（海口）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	2023年9月4日
8	长城基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023年9月16日
9	长城基金管理有限公司关于旗下基金开展线上直销系统费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023年11月7日
10	长城基金管理有限公司关于提醒投资	中国证监会规定报刊及	2023年11月23日

者谨防金融诈骗的风险提示公告	网站
----------------	----

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- (一) 中国证监会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

### 13.2 存放地点

基金管理人及基金托管人住所

### 13.3 查阅方式

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

咨询电话：0755-29279188

客户服务电话：400-8868-666

网站：www.ccfund.com.cn

长城基金管理有限公司

2024 年 3 月 29 日