

长城睿达多元稳健配置 3 个月持有期混合
型发起式基金中基金（FOF）
2026 年第 1 季度报告

2026 年 3 月 31 日

基金管理人：长城基金管理有限公司

基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司

报告送出日期：2026 年 4 月 22 日

§1 重要提示

本基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

本基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2026 年 04 月 21 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 01 月 01 日起至 2026 年 03 月 31 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	长城睿达多元稳健 3 个月持有混合发起（FOF）
基金主代码	024506
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2025 年 10 月 23 日
报告期末基金份额总额	106,032,930.97 份
投资目标	本基金以稳健的投资风格进行长期投资，主要通过大类资产配置策略灵活投资于不同风险收益特征的资产，在严格控制风险的前提下，力争实现基金资产的持续稳健增值。
投资策略	1、资产配置策略 （1）战略资产配置策略（SAA） 本基金将采用风险预算（Risk Budgeting）方法作为制定大类资产战略配置层面的核心策略。该方法是基于各类资产对投资组合的风险贡献进行资产配置，并利用各类资产的风险度量值制定资产配置决策。 在具体操作中，本基金通过对资产长期风险收益特征的研究，在权衡本基金的风险与收益的条件下设定基金的风险水平，之后结合权益类资产、固定收益类资产、商品类资产等各类境内外资产的风险收益水平设定各个大类资产的风险权重，计算各类资产之间的相关性，最后得出满足风险水平及各类资产风险权重条件下的资产配置比例，并随着各类资产的相关性、风险收益比的相对变化，动态调整各类资产的风险预算

	和资产比例。 （2）战术资产配置策略（TAA） 在通过战略资产配置获得各大类资产的配置比例后，本基金将结合市场环境进一步对各类资产的特性辅以跟踪和定性研究、并将灵活运用多种数量化策略分散组合风险，以期提升组合经风险调整后的超额回报。 2、基金投资策略 本基金将通过科学的基金筛选流程，采用严谨的分析方法对可投资基金进行研究并结合对基金管理公司、基金经理的评价对基金进行评价，挑选出符合该投资策略的基金。 （1）基金维度 首先，排除不满足基金中基金投资要求的基金，以及因封闭等原因不便投资的基金。其次，将基金做出细化分类，针对不同类型的基金，从不同侧重点进行挑选。 主动管理型基金：对于主动股票型和偏股混合型基金，主要关注基金在不同市场情形下的业绩表现、业绩来源、超额收益及其稳定性、投资风格特征及稳定性、回撤控制能力、风险收益特征、择时/选股能力等；对于主动管理的债券型基金和偏债混合型基金，主要关注其业绩表现、收益来源、超额收益及其稳定性、回撤控制能力等。 被动管理型基金：从指数代表性、基金规模、跟踪误差、超额收益、流动性、交易成本等角度，筛选优秀的指数型基金，产品类型包括但不限于境内外股票、境内外债券、商品等标准资产和另类资产等，产品风格包括但不限于宽基指数、行业主题指数、风格指数等。 货币市场基金：主要考察货币基金的规模、收益、流动性、整体费用等指标。 公募 REITs：本基金将综合考量宏观经济运行情况、基金资产配置策略、底层资产运营情况、流动性及估值水平等因素，对公募 REITs 的投资价值进行深入研究，精选出具有较高投资价值的公募 REITs 进行投资。本基金根据投资策略需要或市场环境变化，可选择将部分基金资产投资于公募 REITs，但本基金并非必然投资公募 REITs。 （2）基金经理维度 从定量和定性分析两个角度评价基金经理。定量分析方面，基于对所管理基金的深入分析，了解基金经理的业绩情况、风险控制情况及投资风格等。定性分析方面，分析基金经理的性格特征、逻辑思维和投资思路等因素，长期跟踪和了解基金经理的想法及组合操作方法，比较挑选优秀的基金经理。
--	--

	(3) 基金管理人维度 从公司的基金规模和数量、历史经营情况、管理水平和人员素质、投资管理制度、风险控制安排、研发和创新能力等角度，对基金公司进行定性分析。 通过基金、基金经理、基金管理人三个维度的分析，本基金将选择中长期业绩优秀、超额收益稳定、风险控制能力强等特征的稳健绩优基金，具有稳定、明确投资风格的基金，规模大、流动性好、具备稳定超额收益等特征的指数型及指数增强型基金，以及其他适合投资的基金，作为本基金的投资标的。 3、股票投资策略 (1) A股投资策略 本基金可适度投资股票，以更好实现本基金的投资目标。在行业配置层面，主要采用“自上而下”方法，结合价值理念与成长理念来对行业进行筛选。在个股选择层面，主要采用“自下而上”方法通过定量与定性相结合的方式选筛选个股，精选价值被低估的个股，对公司的历史沿革、财务状况、盈利能力及前景、资产及权益价值等进行全面深入的研究分析，选择具有投资价值的股票。 (2) 港股通标的股票的投资策略 本基金可通过港股通机制投资港股通标的股票。对于港股通标的股票，本基金主要采用“自下而上”个股研究方式，精选出具有投资价值的优质标的。 (3) 存托凭证的投资策略 对于存托凭证的投资，本基金将依照境内上市交易的股票，通过定性分析和定量分析相结合的方式，精选优质上市公司；并最大限度避免由于存托凭证在交易规则、上市公司治理结构等方面的差异而或有的负面影响。 4、债券投资策略 本基金通过综合分析宏观经济形势、财政政策、货币政策、债券市场券种供求关系及资金供求关系，主动判断市场利率变化趋势，确定和动态调整固定收益类资产的平均久期及债券资产配置。本基金具体债券投资策略包括久期管理策略、收益率曲线策略、个券选择策略、可转换债券投资策略、债券回购杠杆策略等。 5、可转换债券及可交换债券投资策略 可转换债券和可交换债券的价值主要取决于其股权价值、债券价值和内嵌期权价值，本基金管理人将对可转换债券和可交换债券的价值进行评估，选择具有较高投资价值的可转换债券、可交换债券进行投资。 6、资产支持证券投资策略 本基金通过对资产支持证券资产池结构和质量的跟踪
--	---

	考察、分析资产支持证券的发行条款、预估提前偿还率变化对资产支持证券未来现金流的影响，谨慎投资资产支持证券。	
业绩比较基准	中债综合全价指数收益率×90%+中证 800 指数收益率×6%+上海黄金交易所 Au99.99 现货实盘合约收益率×3%+恒生指数收益率(经汇率估值调整) ×1%	
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。 本基金如投资于港股通标的证券、QDII 基金和香港互认基金，需承担汇率风险以及境外市场的风险。	
基金管理人	长城基金管理有限公司	
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	长城睿达多元稳健 3 个月持有混合发起（FOF）A	长城睿达多元稳健 3 个月持有混合发起（FOF）C
下属分级基金的交易代码	024506	024507
报告期末下属分级基金的份额总额	65,847,800.74 份	40,185,130.23 份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2026 年 1 月 1 日-2026 年 3 月 31 日）	
	长城睿达多元稳健 3 个月持有混合发起（FOF）A	长城睿达多元稳健 3 个月持有混合发起（FOF）C
1. 本期已实现收益	402,340.96	536,443.34
2. 本期利润	470,801.84	803,612.56
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0063	0.0121
4. 期末基金资产净值	65,957,495.71	40,199,466.77
5. 期末基金份额净值	1.0017	1.0004

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认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

长城睿达多元稳健 3 个月持有混合发起（FOF）A

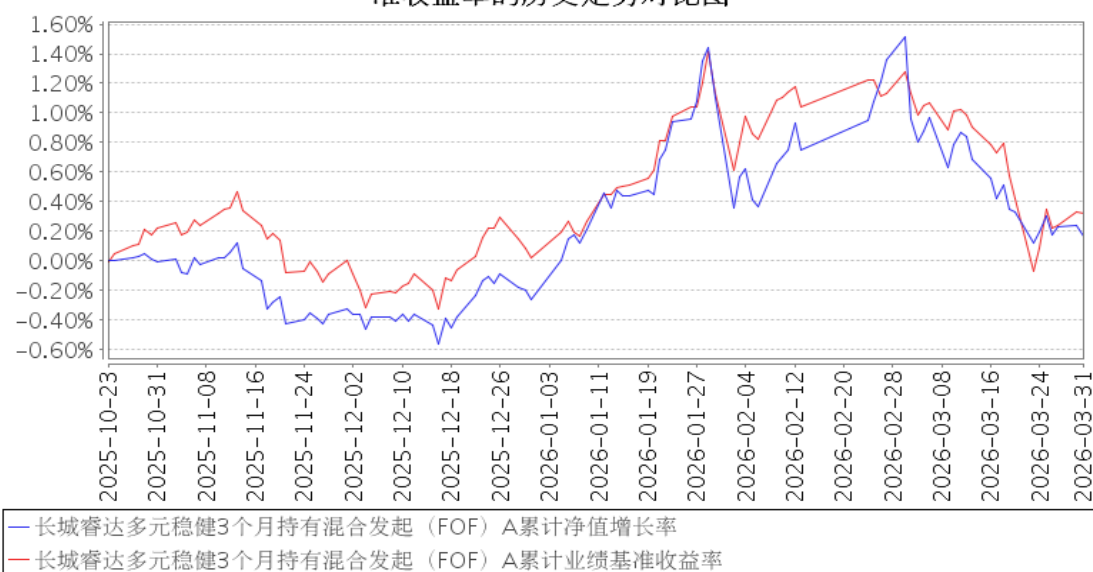
阶段	净值增长率①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去三个月	0.43%	0.19%	0.29%	0.16%	0.14%	0.03%
过去六个月	—	—	—	—	—	—
过去一年	—	—	—	—	—	—
过去三年	—	—	—	—	—	—
过去五年	—	—	—	—	—	—
自基金合同 生效起至今	0.17%	0.15%	0.32%	0.13%	-0.15%	0.02%

长城睿达多元稳健 3 个月持有混合发起（FOF）C

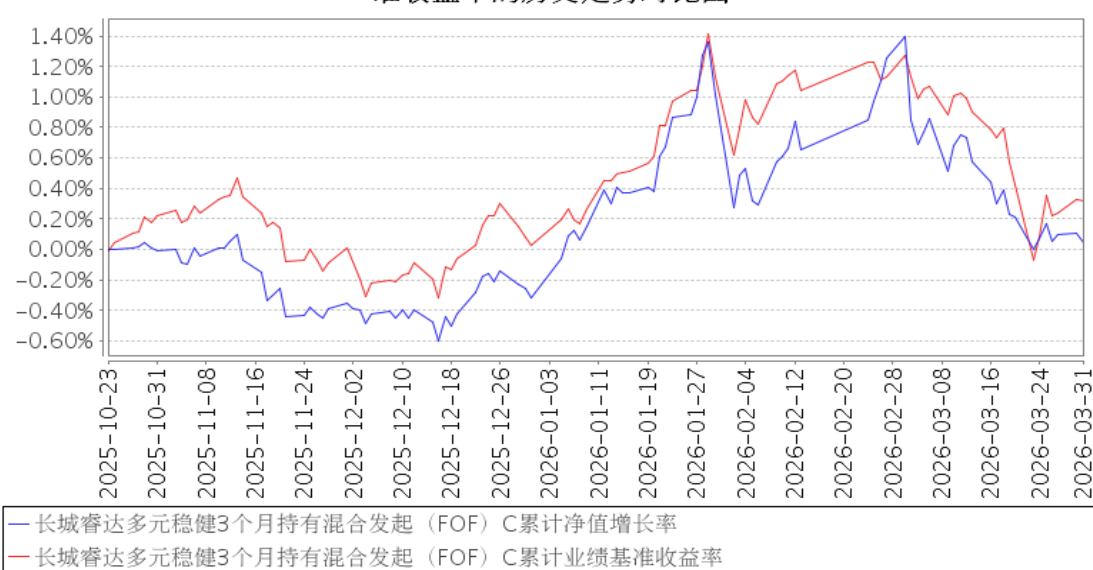
阶段	净值增长率①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去三个月	0.36%	0.19%	0.29%	0.16%	0.07%	0.03%
过去六个月	—	—	—	—	—	—
过去一年	—	—	—	—	—	—
过去三年	—	—	—	—	—	—
过去五年	—	—	—	—	—	—
自基金合同 生效起至今	0.04%	0.15%	0.32%	0.13%	-0.28%	0.02%

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

长城睿达多元稳健3个月持有混合发起（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



长城睿达多元稳健3个月持有混合发起（FOF）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本基金投资于公开募集证券投资基金的基金份额的资产不低于本基金资产的 80%，其中，对权益类资产（包括股票型基金、混合型基金（此处混合型基金是指基金合同中明确约定股票资产占基金资产的比例为 60%以上或者根据定期报告披露情况最近连续 4 个季度股票资产占基金资产的比例均在 60%以上的混合型基金）、股票（含存托凭证）的投资合计占基金资产的比例为 0-30%；本基金投资于港股通标的股票不超过股票资产的 50%；投资于货币市场基金的比例不超过基金资产的 15%；投资于 QDII 基金和香港互认基金的比例合计不超过基金资产的 20%。本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

②本基金的建仓期为自基金合同生效之日起六个月内，截止本报告期末，本基金尚处于建仓

期内。

③本基金合同于 2025 年 10 月 23 日生效，截止本报告期末，基金合同生效未满一年。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
杨光	本基金的基金经理	2025 年 10 月 23 日	—	13 年	女，中国籍，硕士，金融风险管理师（FRM）。曾就职于美银美林证券、中国中投证券。2015 年 9 月加入长城基金管理有限公司，历任产品经理、ETF 研究员、FOF 研究员、基金经理助理、投资经理。自 2025 年 10 月至今任“长城睿达多元稳健配置 3 个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）”基金经理。

注：

- ①上述任职日期、离任日期根据公司做出决定的任免日期填写。
- ②证券从业年限的计算方式遵从从业人员的相关规定。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格执行了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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2026 年一季度，受全球宏观环境快速切换、地缘冲突扰动升级以及市场风险偏好显著收缩等多重因素的冲击，全球流动性对资产价格产生显著影响，产品净值出现一定波动。在风险加剧的过程中，产品运作以风险控制为主辅以动态的仓位调整。

从资产价格的波动来看，黑天鹅事件暴露尾部风险，导致大类资产相关性发生趋同，具体而言：1、传统避险机制失效：在地缘冲突和通胀压力下，通胀预期飙升引发债券抛售（利率上行），导致股债双杀。同样，黄金在美元走强和实际利率预期上升的背景下，其避险属性也受到挑战；2、风险资产与避险资产同跌：美股（风险资产）与美债（传统避险资产）在季度末同时下跌，相关性转为正。这表明在“通胀冲击”而非“增长冲击”为主导的黑天鹅事件中，所有对利率敏感的资产都会承压；3、相关性趋同的根源：所有资产的定价锚—实际利率预期和全球增长预期—被同一事件（地缘冲突推高油价）剧烈扰动。油价上涨既打击增长（衰退风险），又推高通胀（货币政策紧缩），使得股、债、金等资产的驱动逻辑从分化走向统一。

宏观流动性带来的冲击自 2025 年 10 月起发生过两次：第一次是 2025 年 11 月份美国政府停摆期间美元流动性萎缩；第二次是 2026 年 2 月初黄金加速去杠杆，在这两次冲击后产品净值修复较快。但本次地缘冲突导致市场交易范式发生明显变化。起初市场更多交易的是能源溢价和通胀扰动，随后逐步切换为对衰退风险的担忧。因此在组合管理层面，策略在持续进行适应性调整：逐步降低对经济增长敏感资产的风险暴露，提升对通胀风险、滞涨风险以及防御性资产的配置权重，并通过增加现金、降低整体波动暴露来控制回撤。但于此同时，这也意味着产品净值在早期会承受一定的磨损（在个别交易日因市场的快速反抽而承担一定损耗），但这依然是系统性宏观管理中的必然选择。因为我们不希望组合因单一方向、单一资产或单一市场叙事而遭受不可逆打击。多资产配置策略的核心目标是，在宏观范式不断切换的世界里，始终保有应对多种环境的能力。具体到现阶段而言，在不确定性上升的过程中组合不断降低脆弱性、提升适应力并在波动中逐步完成修复。

展望后续操作，风险模型是长期风控的核心。解决方案在于持续优化：1、引入宏观叙事与压力测试：风险模型不能仅依赖历史数据。须将地缘政治、供应链断裂等宏观叙事纳入情景分析和压力测试中；2、动态评估资产关联性：识别在不同宏观环境（如“增长主导”、“通胀主导”、“滞胀风险”）下，大类资产间相关性的可能变化；3、寻找分散化工具：当传统资产相关性趋同时，需要寻找非线性的风险对冲工具。这可能包括：1）战术性配置于直接受益于危机的资产：如一季度表现突出的能源板块股票；2）关注另类数据：如全球航运价格（VLCC 租金）、关键海峡通航情况等，作为通胀和增长风险的先行指标；3）保留流动性冗余：在市场恐慌导致所有资产流动性收紧时，现金本身成为最佳避险资产；4）贯穿投资流程的长期风控意识：风控不是事后的止损，而是事前的布局。这体现在：资产配置层面：不过度依赖单一风险平价策略，结合宏观判断进行动态调整；个股选择层面：关注企业应对成本冲击（如油价）的能力，这已成为基本面分析的新维度。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期长城睿达多元稳健 3 个月持有混合发起（FOF）A 基金份额净值增长率为 0.43%，同期业绩比较基准收益率为 0.29%；长城睿达多元稳健 3 个月持有混合发起（FOF）C 基金份额净值增长率为 0.36%，同期业绩比较基准收益率为 0.29%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内，本基金无需要说明的情况。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	947,306.64	0.89
	其中：股票	947,306.64	0.89
2	基金投资	93,518,173.63	87.79
3	固定收益投资	5,471,682.41	5.14
	其中：债券	5,471,682.41	5.14
	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	3,453,323.72	3.24

8	其他资产	3,134,819.97	2.94
9	合计	106,525,306.37	100.00

注：权益投资中通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 92,232.96 元，占基金资产净值的比例为 0.09%。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	—	—
C	制造业	753,110.00	0.71
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	101,963.68	0.10
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	855,073.68	0.81

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
基础材料	92,232.96	0.09
消费者非必需品	—	—
消费者常用品	—	—
能源	—	—
金融	—	—
医疗保健	—	—
工业	—	—

信息科技	—	—
电信服务	—	—
公用事业	—	—
房地产	—	—
合计	92,232.96	0.09

注：以上分类采用财汇大智慧提供的国际通用行业分类标准。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600176	中国巨石	6,400	155,584.00	0.15
2	002448	中原内配	11,100	155,067.00	0.15
3	300502	新易盛	300	132,852.00	0.13
4	300308	中际旭创	200	113,882.00	0.11
5	002585	双星新材	15,500	105,245.00	0.10
6	688702	盛科通信	611	101,963.68	0.10
7	02259	紫金黄金国际	600	92,232.96	0.09
8	300394	天孚通信	300	90,480.00	0.09

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	5,471,682.41	5.15
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	5,471,682.41	5.15

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	019773	25 国债 08	54,000	5,471,682.41	5.15

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

注：无。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：无。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：无。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：无。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

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

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：无。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本报告期内，本基金国债期货投资情况符合既定的投资政策和投资目的。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本报告期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。

5.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中，未有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	126,855.38

2	应收证券清算款	3,006,405.59
3	应收股利	529.49
4	应收利息	-
5	应收申购款	33.60
6	其他应收款	995.91
7	其他	-
8	合计	3,134,819.97

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：无。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：无。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 基金中基金

6.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

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	019873	长城短债 E	契约型开放式	15,068,317.70	18,647,043.15	17.57	是
2	025477	长城稳健增利债券 F	契约型开放式	14,948,237.09	18,094,841.00	17.05	是
3	004973	长城收益宝货币 B	契约型开放式	13,728,058.18	13,728,058.18	12.93	是
4	511520	富国中债 7-10 年政策性金融债 ETF	交易型开放式 (ETF)	111,600.00	12,979,414.80	12.23	否
5	511360	海富通中证短融 ETF	交易型开放式 (ETF)	113,000.00	12,798,041.00	12.06	否
6	511010	国泰上证 5 年期国债 ETF	交易型开放式 (ETF)	44,500.00	6,252,428.00	5.89	否
7	511260	上证 10 年期国债 ETF	交易型开放式 (ETF)	31,800.00	4,280,089.20	4.03	否

8	510300	华泰柏瑞沪深 300ETF	交易型开放式 (ETF)	303,100.00	1,352,735.30	1.27	否
9	159982	中证 500ETF 鹏华	交易型开放式 (ETF)	604,100.00	1,217,261.50	1.15	否
10	515800	添富中证 800ETF	交易型开放式 (ETF)	870,600.00	1,067,355.60	1.01	否

6.1.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名公开募集基础设施证券投资基金投资明细

注：无。

6.1.2 报告期末基金持有的全部公开募集基础设施证券投资基金情况

注：无。

6.2 当期交易及持有基金产生的费用

项目	本期费用 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 3 月 31 日	其中：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
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）	3,475.13	3,475.13
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	70,876.55	36,140.05
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	20,042.92	9,986.24
当期交易基金产生的交易费用（元）	9,501.99	—

注：当期持有基金产生的应支付销售服务费、应支付管理费、应支付托管费按照被投资基金基金合同约定已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，上表列示金额为按照本基金对被投资基金的实际持仓情况根据被投资基金基金合同约定的相应费率计算得出。

根据相关法律法规及本基金合同的约定，基金管理人不得对基金中基金财产中持有的自身管理的基金部分收取基金中基金的管理费，基金托管人不得对基金中基金财产中持有的自身托管的基金部分收取基金中基金的托管费。基金管理人运用本基金财产申购自身管理的其他基金的（ETF 除外），应当通过直销渠道申购且不收取申购费、赎回费（按照相关法规、基金招募说明书约定应当收取，并计入基金资产的赎回费用除外）、销售服务等销售费用，其中申购费、赎回费在实际

申购、赎回时按上述规定执行，销售服务费由本基金管理人从被投资基金收取后返还至本基金基金资产。

6.3 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

无。

§ 7 开放式基金份额变动

单位：份

项目	长城睿达多元稳健 3 个月持有混合发起（FOF）A	长城睿达多元稳健 3 个月持有混合发起（FOF）C
报告期期初基金份额总额	82,103,454.63	93,166,415.24
报告期期间基金总申购份额	190,081.75	17,422.76
减：报告期期间基金总赎回份额	16,445,735.64	52,998,707.77
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	65,847,800.74	40,185,130.23

§8 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

8.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

项目	长城睿达多元稳健 3 个月持有混合发起（FOF）A	长城睿达多元稳健 3 个月持有混合发起（FOF）C
报告期期初管理人持有的本基金份额	10,000,000.00	-
报告期期间买入/申购总份额	-	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	10,000,000.00	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	9.43	-

8.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：无。

§9 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例(%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例(%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,000.00	9.43	10,000,000.00	9.43	3 年

基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,000,000.00	9.43	10,000,000.00	9.43	3 年

§10 影响投资者决策的其他重要信息

10.1 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。

10.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- （一） 中国证监会准予长城睿达多元稳健配置 3 个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）注册的文件
- （二） 《长城睿达多元稳健配置 3 个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金合同》
- （三） 《长城睿达多元稳健配置 3 个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）托管协议》
- （四） 《长城睿达多元稳健配置 3 个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）招募说明书》
- （五） 法律意见书
- （六） 基金管理人业务资格批件、营业执照
- （七） 基金托管人业务资格批件、营业执照
- （八） 中国证监会规定的其他文件

11.2 存放地点

基金管理人及基金托管人住所

11.3 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

2026 年 4 月 22 日