

长城富盈 3 号集合资产管理计划
2024 年年度资产管理报告

管理人：长城证券股份有限公司

托管人：招商银行股份有限公司深圳分行

报告期：2024 年 1 月 1 日 - 2024 年 12 月 31 日

重要提示

本报告依据《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》、《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》及其他有关规定制作。

本报告由集合资产管理计划管理人编制。管理人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。

本集合资产管理计划托管人招商银行股份有限公司深圳分行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。

管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用集合资产管理计划资产，但不保证集合资产管理计划一定盈利。集合资产管理计划的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本集合资产管理计划说明书。

本报告期由2024年1月1日起，至2024年12月31日止。

本报告相关财务资料已经立信会计师事务所（特殊普通合伙）审计。

本报告中的内容由管理人负责解释。

第一部分 集合资产管理计划概况

名称	长城富盈3号集合资产管理计划
代码	C81269
类型(运作方式)	契约型开放式
投资目标	在控制和分散投资组合风险的前提下，实现组合资产长期稳健增值。
投资策略	1、大类资产配置策略 本集合计划通过定性与定量研究相结合的方法，确定投资组合权益类资产、固定收益类资产配置比例。 本集合计划通过动态跟踪海内外主要经济体的宏观经济指标以及估值水平、盈利预期、流动性、投资者心态等市场指标，确定未来市场变动趋势。本集合计划通过全面评估上述各种关键指标的变动趋势，对权益类、固定收益类资产的风险和收益特征进行预测。根据上述定性和定量指标的分析结果，运用资产配置优化模型，在合同框架下以相同的目标收益为约束，追求风险最小化，最终确定大类资产的投资权重，实现资产的合理配置。 2、固定收益类资产投资策略 “固收+”策略，以固定收益资产为核心资产，打造收益安全垫。通过一定仓位参与主板和科创板打新，提升收益弹性。在打新策略有效性降低的情况下，转变为量化策略增强收益，从而实现资产的稳步增值。 根据对未来债券市场的判断，组合采用战略性配置与战术性交易结合的方法，将核心资产重点持有，并结合市场上出现的机会进行战术配置调整。在具体操作中，组合将根据具体的市场情况和新品种发行的情况，控制并调整建仓和配置的过程。 “核心存量资产”为组合的主要部分，买入并战略性持有中短期限的国债、金融债、优质的信用债等，确保总体组合取得一定的收益。核心资产投资主要采取买入持有策略，在稳定投资组合收

	益率、锁定下行风险方面起到重要作用。 在核心存量资产保证投资策略稳定的同时,根据市场和风险情况,灵活配置一部分为战术交易资产,采用多种固定收益投资策略,对流动性较高的债券资产进行交易,在严格控制下行风险的基础上获得增值收益。交易性资产选择以流动性良好为首要原则,另外还要为投资提供积极管理的机会。战略资产与战术交易资产比例根据各种类别固定收益投资工具的收益率和波动性来确定,用风险预算的原理保障使组合有很大的把握达到一定的最低收益水平。其中核心资产采用战略性持有策略,主要在选择市场切入点上追求增值,在利率走势无方向性变化时基本持有到期,可以不考虑收益率的波动性。 债券组合管理的策略应该是多元化的,其中心是在保持风险在相对低的情况下从全方位的债券投资策略中选取最优的投资想法,其中包括利率方向性判断、相对价值判断、信用利差分析的合理运用。其中主要包括: (1) 买入持有策略 以简单、低成本为原则,挑选符合投资目标要求的债券买入持有,并在到期后滚动投资于新发行的符合目标要求的债券。对执行买入持有策略的债券,应根据评估持有期的总回报水平评估能否满足组合在货币市场投资上的长期期望收益率。 (2) 债券类属配置策略 根据国债、企业债等不同债券板块之间的相对投资价值分析,增持价值被相对低估的债券板块,减持价值被相对高估的债券板块,借以取得较高收益。 (3) 期限配置策略 根据对流动性的要求、市场收益率的波动情况决定采用子弹型策略(BulletStrategy)、哑铃型策略(BarbellStrategy)或梯形策略(StairStrategy),在各期限债券间进行配置。 期限配置尽量选择在预期市场利率的高点或流动性需求较大的时
--	--

	点到期的债券，以减少因流动性不足导致的可能损失。 通过分析不同期限债券的收益率绝对差额和相对差额，利用均值回归策略或收益率差额预期策略选择合适期限品种投资。 (4) 久期偏离策略 根据对利率水平的预期，在预期利率下降时，增加组合久期，以较多地获得债券价格上升带来的收益，在预期利率上升时，减小组合久期，以规避债券价格下降的风险。管理人对债券市场收益率变动具有较高把握的预期的情况下，交易头寸投资过程中可以主动采用久期偏离策略，使组合久期较为明显的偏离基准。 (5) 信用利差策略 相同资信等级的公司债在利差期限结构上服从凸性回归均衡的规律。内外部评级的差别与信用等级的变动会造成相对利差的波动，另外在经济上升或下降的周期中公司债利差将缩小或扩大。管理人可以通过对内外部评级、利差曲线研究和经济周期的判断主动采用相对利差交易策略。 (6) 收益率曲线策略 在确定组合或类属久期后，进一步确定同一债券发行者不同期限债券的相对价值。确定采用哑铃型策略、梯形策略和子弹型策略等，在长期、中期和短期债券间进行配置，以从其相对价格变化中获利。 (7) 债券型和货币型基金投资策略 投资基金考虑资产配置策略、收益率、收益波动幅度、基金规模、划款周期和管理费率等主要因素。本计划根据安全性、流动性和成本等因素筛选基金进行投资。 3、股票投资策略 主要通过对上市公司基本面、证券市场、宏观经济环境等进行深入研究，灵活运用多种股票投资策略，在风险可控的原则下，获取持续、稳定、合理的绝对投资收益。 4、套期保值策略
--	--

	管理人认为符合移动条件的市场环境中，有必要审慎灵活的综合运用股指期货进行套期保值交易来对冲系统性风险、降低投资组合波动性并提高资金管理效率。产品参与股指期货套期保值时将综合考虑股指期货交易品种的流动性、股指期货交易品种与现货市场的相关度、通过股指期货进行套期保值交易的必要性、股指期货套期保值交易的综合成本来判断是否进行套期保值交易或套期保值的合理对冲比率。 5、新股申购策略 本计划基于对宏观经济、资本市场的深入分析和理解，通过对拟发行新股的深入研究，精选具有估值优势和成长优势的股票进行投资，追求产品资产的长期稳定增值。通过对股票所属行业公司的估值指标、成长指标、现金流指标和其他财务指标的分析，从中选出价值相对低估、成长性确定、现金流状态好、盈利能力和偿债能力能力强的公司，作为本产品的备选配售股票；再通过与市场整体估值水平、行业估值水平、主要竞争对手估值水平的比较，确定拟参与申购的价格和数量。
风险收益特征	本计划属于中等风险固定收益类产品，具有中等风险，中等收益的特点。
成立日	2020年11月13日
成立规模	88,870,000.00份
报告期末份额总额	7,831,169.60 份
管理人	长城证券股份有限公司 地址: 深圳市福田区福田街道金田路2026号能源大厦南塔楼10-19层 邮编: 518031 电话: 4006666888 传真: (0755) 83531612 网址: www.cgws.com
托管人	招商银行股份有限公司深圳分行

	地址：深圳市福田区深南大道2016号招商银行深圳分行大厦10楼 邮编：518000 电话：（0755）88025932 网址：www.cmbchina.com
会计师事务所	立信会计师事务所（特殊普通合伙） 地址：北京市朝阳区安定路5号院7号楼中海国际中心A座17层 邮编：100029 电话：（010）56730088 传真：（010）56730000 网址：www.bdo.com.cn

第二部分 主要财务指标和集合资产管理计划净值表现

一、 主要财务指标

单位：人民币元

期初单位净值	1.1022
期末单位净值	0.9909
期末累计单位净值	1.0223
本期已实现收益	-991,379.41
期末资产净值	7,759,983.10

二、收益分配情况

本报告期内，本集合计划未进行收益分配。

三、开放期情况

本计划自成立之日起每周四开放参与，如果周四为节假日，则顺延至周四之后的第一个工作日。本计划为已锁定9个月（自份额确认之日起算）的份额，设立固定赎回开放日，即该份额可选择于每季度第3个月的10日（即每年3月、6月、9月、12月的10日）办理退出，如果固定赎回开放日为节假日，则顺延至下一工作日。本报告期内本集合计划具体开放期已在管理人官网公告。

因合同变更而设置的临时开放期，管理人已在公司官网进行公告。

四、管理费、托管费、管理人提取业绩报酬情况

1、本计划年管理费率为1%，按前一日的资产净值的年费率计提，每日计提，按季支付。

2、本计划的年托管费率为0.02%，按计提日前一日的资产净值的年费率计提，每日计提，按季支付。

3、管理人对本计划年化收益率超过业绩报酬计提基准以上的部分收取60%的业绩报酬。管理人已在网站公告业绩报酬计提基准（年化）。本计划2024年度计提业绩报酬157元。

第三部分 管理人报告

一、业绩表现

截至2024年12月31日，本集合计划单位净值为0.9909元。

二、投资经理简介

冯文高先生，清华大学金融硕士，取得中国证券业协会认证的投资经理资格，7年固定收益投资研究从业经验。曾在商业银行从事债券投资研究工作，历任债券交易员、债券投资经理、部门副经理。现任长城证券股份有限公司资产管理部执行董事、投资经理。

冯媛女士，暨南大学金融学硕士，8年证券从业经历。2016年加入长城证券资产管理部，现任长城证券资产管理投资管理部投资经理。曾从事宏观和信用研究、量化和期货策略开发等工作，对于固定收益账户的配置和运作具有较深理解。

三、投资策略回顾

2024年债市走出了波澜壮阔的牛市行情。如果以10年国债衡量，下行幅度是2014年以来最大的一年，全年下行88bps。融资需求不足与居民资产配置偏好下降共同形成极致的资产荒，是驱动利率大幅下行的主要原因。央行适时进行货币宽松，并且改变货币投放方式，进一步推动了利率下行。资产荒和信用风险的改善，导致信用利差同样大幅压缩，信用债开始越来越多的向久期要收益。期间监管提示长债风险和稳增长政策发力阶段性带来债市调整，但都未改变债市总体趋势。截至2024年12月31日，1年国债、国开和AAA中票利率仅有1.08%、1.20%和

1.68%，10年国债也只有1.68%。

转债方面，开年后受权益市场尤其是小微盘股大跌影响，转债大跌，至2月初，万德可转债加权指数下跌5.48%，随后跟随权益市场开始一波大幅反弹至5月中旬的年内高点，指数上涨9.52%，之后一路下跌至6月中下旬，下行近7%，随后在微盘股的修复带动下，指数有3.5%左右的反弹，之后跟随权益市场继续下行至9月中旬，9月24日及26日重要会议后，转债指数震荡上行至12月初中央经济工作会议通稿公布，上涨约20%，之后自高点小幅回落约2%。

在投资运作中，我们保持中性久期、适度杠杆，同时动态调整了转债仓位，产品净值稳健增长。

四、投资展望

债市方面，目前来看，货币宽松的趋势延续，同时，融资需求偏弱以及居民增加低风险偏好资产配置趋势不变，整体资产荒延续，因而利率依然处于下行趋势中。

但随着利率进入到低水平阶段，能够给投资者提供稳定收益的空间受限，固收产品规模也可能随之下降。而随着交易行为加剧以及市场久期拉长，市场波动性也将进一步加大，这会增加相应的投资难度。

权益方面，从9月份中央政治局工作会议政策的调整以来，当前市场发生了两个变化：一是政策预期的改变，二是流动性的极大改善。流动性的极大改善，以及整个政策预期的托底，市场在当前这个位置，机会远大于风险。但在这个过程中，基本面是远远没有跟上股价的涨幅的。结合整个政策流动性和基本面来看，目前整个市场就是一个政策预期转变带来的水牛，基本面是没有跟上的，仅靠政策和流动性支撑的话，市场的波动从未来来看会较大。一旦在政策预期上出现一些波动，比如像最近说国9条落地之后会有一大批退市，整个市场就疯狂的杀跌；或者说流动性可能出现阶段性的利空时，可能整个市场也会波动较大。

从10月8日之后，每一波调整的底其实都是在往上抬升的。对于权益市场还是比较乐观的，从历史的结构来看，2008年4万亿、2014年信贷资金入市以及2019年贸易战和国内政策转向预期带来的流动性的修复来看，市场在经历一个季度的普涨之后，接下来虽然没有基本面的支撑，但市场会在这个位置上去找产业趋势最确定的行业方向。

我们认为，2025年科技依然是主线，AI赋能多行业技术革新，看好核心产业链标的，重点关注消费电子、机器人、低空经济等；主题机会也将频现，持续不断提供机会，如化债、家电消费、并购重组等相关标的。

对转债来说，从价格、纯债溢价率、百元溢价、期权定价偏离度等多个视角观察，转债整体已经明显修复，部分已经回归到中枢水平；10月以来转债估值修复存在结构性差异，低价转债修复速度较快，高价转债由于赎回、正股波动等原因修复相对滞后，高低价转债估值斜率达到历史高位。

转债估值核心在权益。基本面弱改善、货币宽松政策下，利率持续下行，助推资金更多流向权益，我们认为明年权益市场将会上演宽幅震荡向上，主题行情频现。转债作为类固收资产，我们预计险资保险类机构明年会持续加配转债来增强收益，转债估值仍有弹性空间。

我们将继续坚持稳健的投资思路，针对客观因素积极调整久期和杠杆，积极参与市场波动带来的交易性机会，同时择机投资估值合理、正股成长性好的可转债。

我们必将珍惜投资者的每一份信任，本产品将继续奉行规范运作，审慎投资，勤勉尽责的原则，为投资者谋求长期、稳定的回报。

五、集合计划运作合规性声明

本报告期内，集合计划管理人严格遵守《中华人民共和国证券法》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》、《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》及其他法律法规的规定，本着诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用本集合计划资产，在严格控制风险的基础上，为集合计划持有人谋求最大利益。本集合计划运作合法合规，无损害集合计划持有人利益的行为，本集合计划的投资管理符合有关法规的规定。

六、风险控制报告

本报告期内，集合计划管理人通过独立的风险控制部门，加强对集合资产管理业务风险的事前分析、事中监控和事后评估，并提出风险控制措施。本次风险控制报告综合了集合计划管理人全面自查和合规、风险控制部门日常监控、重点检查的结果。

公司设立资产管理内控部、风险管理部和法律合规部，通过系统监控和现场

检查，对集合资产管理计划的投资风险、契约风险、操作风险、道德风险等进行全面的监督和检查。同时在交易系统中设置各类风控指标进行投资约束，实现交易事前控制，确保集合资产管理计划投资交易行为的合法合规。对日常集合资产管理计划出现的各类问题，风险控制部门及时进行风险提示，提出管理建议，并督促相关部门及时整改。

公司风险管理部、法律合规部对公司各类重要规章制度进行风险评审并参与其业务流程梳理，提出建议，保证业务制度及业务流程的科学、合理，进而规范有序的开展业务。

公司在实行严格的内部风险控制的同时，也接受托管银行、上级监管机构、中介审计机构以及委托人的监督。

在本报告期内，本集合计划管理人对集合计划的管理始终都能按照有关法律法规、公司相关制度和本集合计划说明书的要求进行。本集合计划的投资决策、投资交易程序、投资权限等各方面均符合规定的要求；交易行为合法合规，未出现异常交易、操纵市场的现象；未发现内幕交易的情况；相关的信息披露和财务数据皆真实、完整、准确、及时。

第四部分 集合计划审计报告

信会师报字[2025]第 ZG ZG30426 号

长城富盈 3 号集合资产管理计划全体持有人：

一、审计意见

我们审计了长城富盈 3 号集合资产管理计划（以下简称“长城富盈 3 号”）财务报表，包括 2024 年 12 月 31 日的资产负债表，2024 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，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》（财会〔2022〕14 号）的规定编制，公允反映了长城富盈 3 号 2024 年 12 月 31 日的财务状况和 2024 年度的经营成果。

二、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，我们独立于长城富盈 3 号及其管理人长城证券股份有限公司（以下简称“管理人”），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。

三、管理人对财务报表的责任

管理人负责按照企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》（财会〔2022〕14 号）的有关规定编制财务报表，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，管理人负责评估长城富盈 3 号的持续经营能力，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。

四、注册会计师对财务报表审计的责任

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：

（一）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。

（二）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。

（三）评价管理人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。

（四）对管理人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，就可能导致对长城富盈3号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富盈3号不能持续经营。

（五）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。

我们与管理人就计划的审计范围、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。

立信会计师事务所
（特殊普通合伙）

中国注册会计师：谢东良

中国注册会计师：王兴超

中国·上海

2025 年 4 月 15 日

第五部分 集合计划财务报表

一、资产负债表

编制单位：长城证券

2024 年 12 月 31 日

单位：元

资产	期末余额	上年年末余额	负债和所有者权益	期末余额	上年年末余额
资 产：			负 债：		
货币资金	90,825.84	538,880.43	短期借款	0.00	0.00
结算备付金	792,169.38	161,954.00	交易性金融负债	0.00	0.00
存出保证金	4,541.48	209,674.37	衍生金融负债	0.00	0.00
衍生金融资产	0.00	0.00	卖出回购金融资产款	0.00	0.00
交易性金融资产	1,009,551.74	11,097,209.24	应付清算款	558,744.53	23,168.75
买入返售金融资产	5,899,666.03	0.00	应付赎回款	0.00	0.00
发放贷款和垫款	0.00	0.00	应付管理人报酬	20,013.47	57,782.06
债权投资	0.00	0.00	应付托管费	400.22	597.42
其他债权投资	0.00	0.00	应付销售服务费	0.00	0.00
应收清算款	551,597.16	20,129.39	应付投资顾问费	0.00	0.00
应收利息	0.00	0.00	应交税费	286.26	3,075.06
应收股利	0.00	191.10	应付利息	0.00	0.00
应收申购款	0.00	0.00	应付利润	0.00	0.00
其他资产	0.00	0.00	其他负债	8,924.05	7,519.10
			负债合计	588,368.53	92,142.39
			所有者权益		
			实收资金	7,831,169.60	10,829,594.39
			其他综合收益	0.00	0.00
			未分配利润	-71,186.50	1,106,301.75
			所有者权益合计	7,759,983.10	11,935,896.14
资产总计	8,348,351.63	12,028,038.53	负债和所有者权益总计	8,348,351.63	12,028,038.53

二、利润表

编制单位：长城证券

2024 年 1 月-2024 年 12 月

单位：元

项目	本期金额	上期金额
一、营业总收入	-834,527.85	3,765,449.53
利息收入	34,242.22	35,171.52
投资收益（损失以“-”号填列）	-886,478.96	1,564,263.55
其中：以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益	0.00	0.00
公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	17,708.89	2,166,014.46
汇兑收益（损失以“-”号填列）	0.00	0.00
其他业务收入（损失以“-”号填列）	0.00	0.00
减：二、营业总支出	139,142.67	607,842.06
管理人报酬	94,550.36	287,248.51
托管费	1,887.88	5,744.93
销售服务费	0.00	0.00
投资顾问费	0.00	0.00
利息支出	0.00	260,931.13
其中：卖出回购金融资产支出	0.00	260,931.13
信用减值损失	0.00	0.00
税金及附加	147.17	5,506.58
其他费用	42,557.26	48,410.91
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-973,670.52	3,157,607.47
减：所得税费用	0.00	0.00
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-973,670.52	3,157,607.47
五、其他综合收益的税后净额	0.00	0.00
六、综合收益总额	-973,670.52	3,157,607.47

注：本计划本报告期利润表未体现的暂估管理人业绩报酬金额为 0 元。暂估管理人业绩报酬是本计划根据财政部发布的《资产管理产品相关会计处理规定》，虚拟计算的截止本报告期末由资产管理计划委托人承担的暂估业绩报酬。资产管理计划委托人实际承担的管理人业绩报酬将根据本计划合同等法律文件约定计算并支付，可能与上述暂估管理人业绩报酬存在差异。

三、净资产变动表

编制单位：长城证券

2024 年 1 月-2024 年 12 月

单位：元

项 目	本期金额				上期金额			
	实收资金	其他综合收益	未分配利润	所有者权益合计	实收资金	其他综合收益	未分配利润	所有者权益合计
一、上期期末余额	10,829,594.39	0.00	1,106,301.75	11,935,896.14	70,991,605.67	0.00	2,216,833.67	73,208,439.34
加：								
会计政策变更	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
前期差错更正	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
其他	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
二、本期期初余额	10,829,594.39	0.00	1,106,301.75	11,935,896.14	70,991,605.67	0.00	2,216,833.67	73,208,439.34
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-2,998,424.79	0.00	-1,177,488.25	-4,175,913.04	-60,162,011.28	0.00	-1,110,531.92	-61,272,543.20
（一）综合收益总额	0.00	0.00	-973,670.52	-973,670.52	0.00	0.00	3,157,607.47	3,157,607.47
（二）产品持有人申购和赎回：	-2,998,424.79	0.00	-203,817.73	-3,202,242.52	-60,162,011.28	0.00	-4,268,139.39	-64,430,150.67
其中：产品申购	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
产品赎回	-2,998,424.79	0.00	-203,817.73	-3,202,242.52	-60,162,011.28	0.00	-4,268,139.39	-64,430,150.67
（三）利润分配	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
（四）其他综合收益结转留存收益	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
四、本期期末余额	7,831,169.60	0.00	-71,186.50	7,759,983.10	10,829,594.39	0.00	1,106,301.75	11,935,896.14

四、会计报表的编制基础

本计划财务报表以持续经营假设为基础，根据实际发生的交易事项，按照企业会计准则的有关规定进行确认和计量，基于主要会计政策和会计估计进行财务报表编制。

五、遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本计划基于上述编制基础编制的财务报表符合财政部已颁布的资产管理产品相关会计处理规定，最新企业会计准则及其应用指南、解释以及其他相关规定

(统称“企业会计准则”)的要求,真实完整地反映了本计划的财务状况、经营成果和净资产变动情况等有关信息。

六、会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

1、会计政策的变更

本报告期本计划会计政策未发生变更。

2、会计估计的变更

本报告期本计划无会计估计变更事项。

3、前期会计差错更正

本年度本计划无前期会计差错调整事项。

七、或有和承诺事项、资产负债表日后非调整事项

1、或有事项

长城证券股份有限公司(以下简称公司)于 2023 年 4 月 28 日收到中国证券监督管理委员会《关于核准长城证券股份有限公司设立资产管理子公司的批复》(证监许可[2023]978 号),核准公司通过设立长城证券资产管理有限公司从事证券资产管理业务。本报告期内,管理人 2024 年 11 月 20 日发布《关于长城证券资产管理有限公司取得经营证券期货业务许可证的公告》,管理人的资产管理子公司长城证券资产管理有限公司领取了《经营证券期货业务许可证》,证券期货业务范围为:证券资产管理,待资产管理子公司长城证券资产管理有限公司公告展业后开展经营活动。

2、承诺事项

截至 2024 年 12 月 31 日止,本计划无需要披露的重大承诺事项。

3、资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日止,本计划无需要披露的重大资产负债表日后非调整事项。

第六部分 投资组合报告

一、期末集合计划资产组合情况

项目名称	项目公允价值（元）	占总资产比例
股票	0.00	0.00%
债券	1,009,551.74	12.09%
资产支持证券	0.00	0.00%
基金	0.00	0.00%
银行存款及结算备付金合计	882,995.22	10.58%
存出保证金	4,541.48	0.05%
买入返售金融资产	5,899,666.03	70.67%
应收证券清算款	551,597.16	6.61%
应收利息	0.00	0.00%
其他资产	0.00	0.00%
理财产品	0.00	0.00%
应收基金红利	0.00	0.00%
合计	8,348,351.63	100.00%

二、期末公允价值占集合计划资产净值比例大小排序的前十名证券明细

序号	代码	名称	公允价值（元）	占资产净值比例
1	127104	姚记转债	145,666.27	1.88%
2	123157	科蓝转债	130,146.78	1.68%
3	113685	升 24 转债	117,230.14	1.51%
4	113584	家悦转债	117,145.62	1.51%
5	110081	闻泰转债	113,835.21	1.47%
6	113691	和邦转债	110,613.42	1.43%
7	127092	运机转债	88,999.89	1.15%
8	123231	信测转债	64,414.80	0.83%
9	123078	飞凯转债	61,449.80	0.79%
10	123076	强力转债	60,049.81	0.77%

第七部分 集合计划份额变动

单位：份

期初份额总额	10,829,594.39
红利再投资份额	0.00
报告期间总参与份额	0.00
报告期间总退出份额	2,998,424.79
报告期末份额总额	7,831,169.60

第八部分 重大事件揭示

一、集合计划管理人、集合计划托管人的专门托管部门的重大人事变动

本报告期内，本集合计划托管人的专门托管部门未发生重大人事变动。

本报告期内，长城证券股份有限公司第三届董事会第一次会议决定，聘任周钟山为长城证券股份有限公司副总裁、董事会秘书，聘任赵昕倩为长城证券股份有限公司副总裁、合规总监、首席风控官，聘任王振为长城证券股份有限公司副总裁，聘任李丽芳为长城证券股份有限公司副总裁。报告期内，长城证券股份有限公司免去崔学峰和徐浙鸿长城证券股份有限公司副总裁职务，到龄退休。

本报告期内，本集合计划投资经理发生了变更，截至本报告期末投资经理为冯文高先生和冯媛女士。

二、涉及集合计划管理人、集合计划财产、集合计划托管业务的诉讼

本报告期内，本集合计划管理人及托管人没有发生涉及本集合计划管理人、财产、托管业务的诉讼事项。

三、管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本集合计划的管理人、托管人涉及托管业务机构及其高级管理人员没有受到任何处罚。

四、关联交易情况

本报告期内，管理人于 2024 年 3 月 14 日在官网披露了《关于长城富盈 3

号集合资产管理计划自有资金退出的公告》。本集合计划未发生其他关联方交易。

第九部分 备查文件目录

一、备查文件

- 1、《长城富盈3号集合资产管理计划管理合同》；
- 2、《长城富盈3号集合资产管理计划说明书》；
- 3、《长城富盈3号集合资产管理计划风险揭示书》；
- 4、《长城富盈3号集合资产管理计划验资报告》，天职业字【2020】39374号；

- 5、管理人业务资格批件、营业执照；

二、存放地点及查询方式

网址：<http://www.cgws.com>

客户服务电话：400-6666-888

投资者对本报告书如有任何疑问，可咨询管理人长城证券股份有限公司。

