

长城兴华优选一年定期开放混合型证券投资 基金 2021 年年度报告

2021 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：兴业银行股份有限公司

送出日期：2022 年 3 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 03 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自 2021 年 10 月 11 日（基金合同生效日）起至 2021 年 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	11
§ 4 管理人报告	11
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	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	15
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	16
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
§ 5 托管人报告	17
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	17
§ 6 审计报告	17
6.1 审计报告基本信息	17
6.2 审计报告的基本内容	17
§ 7 年度财务报表	19
7.1 资产负债表	19
7.2 利润表	20
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	21
7.4 报表附注	22

§ 8 投资组合报告	45
8.1 期末基金资产组合情况	45
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	45
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	46
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	47
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	49
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	49
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	49
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	49
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	49
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	49
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	49
8.12 投资组合报告附注	49
§ 9 基金份额持有人信息	50
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	50
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	51
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	51
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	52
§ 10 开放式基金份额变动	52
§ 11 重大事件揭示	52
11.1 基金份额持有人大会决议	52
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	52
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	53
11.4 基金投资策略的改变	53
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	53
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	53
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	53
11.8 其他重大事件	54
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	54
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	54
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	54
§ 13 备查文件目录	54
13.1 备查文件目录	54
13.2 存放地点	55
13.3 查阅方式	55

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	长城兴华优选一年定期开放混合型证券投资基金	
基金简称	长城兴华优选一年定开混合	
基金主代码	012312	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 10 月 11 日	
基金管理人	长城基金管理有限公司	
基金托管人	兴业银行股份有限公司	
报告期末基金份 额总额	476,434,480.27 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基 金简称	长城兴华优选一年定开混合 A	长城兴华优选一年定开混合 C
下属分级基金的交 易代码	012312	012313
报告期末下属分级 基金的份额总额	332,906,412.59 份	143,528,067.68 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金精选具有长期价值及成长性突出的优质企业进行投资，在控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	<p>1、资产配置策略</p> <p>本基金通过对宏观经济环境、政策形势、证券市场走势的综合分析，主动判断市场时机，进行积极的资产配置，合理确定基金在股票、债券等各类资产类别上的投资比例，并随着各类资产风险收益特征的相对变化，适时进行动态调整。</p> <p>2、债券投资策略</p> <p>本基金通过对国内外宏观经济态势、利率走势、收益率曲线变化趋势和信用风险变化等因素进行综合分析，构建和调整固定收益证券投资组合，力求获得稳健的投资收益。</p> <p>3、股票投资策略</p> <p>本基金注重企业的长期投资价值分析，通过个股精选构建投资组合。本基金根据个股深入研究寻找投资机会，同时注重根据宏观经济走势和各行业的景气度变化发现投资机会。</p> <p>4、股指期货投资策略</p> <p>本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。</p> <p>5、国债期货投资策略</p> <p>本基金投资于国债期货，以套期保值为目的，以合理管理债券组合的久期、流动性和风险水平。</p> <p>6、资产支持证券投资策略</p>

	<p>本基金将通过对资产支持证券基础资产及结构设计的研究，结合多种定价模型，根据基金资产组合情况适度进行资产支持证券的投资。</p> <p>7、融资及转融通证券出借投资策略</p> <p>为了更好地实现投资目标，在综合考虑预期风险、收益、流动性等因素的基础上，本基金可根据相关法律法规，参与融资业务。</p> <p>8、开放期投资策略</p> <p>本基金在开放期将保持资产适当的流动性，以应付当时市场条件下的赎回要求，并降低资产的流动性风险，做好流动性管理。</p>
业绩比较基准	中证 800 指数收益率×70%+中证港股通综合指数收益率（使用估值汇率折算）×10%+中债综合财富指数收益率×20%
风险收益特征	本基金是混合型基金，其预期收益及风险水平低于股票型基金，高于债券型基金与货币市场基金。本基金可投资港股通标的股票，需承担因港股市场投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

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	兴业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	车君	林兴盛
	联系电话	0755-23982338	021-52629999-213707
	电子邮箱	chejun@ccfund.com.cn	linxingsheng@cib.com.cn
客户服务电话		400-8868-666	95561
传真		0755-23982328	021-62159217
注册地址		深圳市福田区益田路 6009 号新世界商务中心 41 层	福州市湖东路 154 号
办公地址		深圳市福田区益田路 6009 号新世界商务中心 40、41 层	上海市银城路 167 号兴业大厦 4 楼
邮政编码		518026	200120
法定代表人		王军	吕家进

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
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	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼
注册登记机构	长城基金管理有限公司	深圳市福田区益田路 6009 号新世界商务中心 41 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	2021 年 10 月 11 日(基金合同生效日)-2021 年 12 月 31 日	
	长城兴华优选一年定开混合 A	长城兴华优选一年定开混合 C
本期已实现收益	-3,440,742.44	-1,672,150.40
本期利润	-3,313,488.91	-1,617,673.36
加权平均基金份额本期利润	-0.0100	-0.0113
本期加权平均净值利润率	-1.00%	-1.13%
本期基金份额净值增长率	-1.00%	-1.13%
3.1.2 期末数据和指标	2021 年末	
期末可供分配利润	-3,440,742.44	-1,672,150.40
期末可供分配基金份额利润	-0.0103	-0.0117
期末基金资产净值	329,592,923.68	141,910,394.32
期末基金份额净值	0.9900	0.9887
3.1.3 累计期末指标	2021 年末	
基金份额累计净值增长率	-1.00%	-1.13%

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。

④本基金合同于 2021 年 10 月 11 日生效，截止本报告期末，基金合同生效未满一年。

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

长城兴华优选一年定开混合 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	-	-	-	-	-	-
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	-1.00%	0.45%	0.35%	0.57%	-1.35%	-0.12%

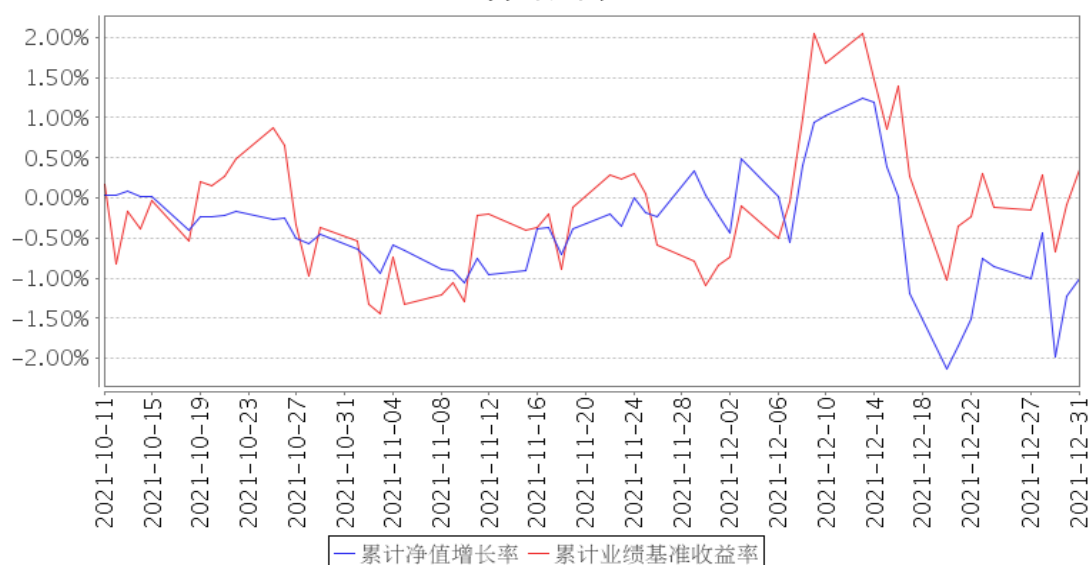
长城兴华优选一年定开混合 C

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	-	-	-	-	-	-
过去六个月	-	-	-	-	-	-
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-

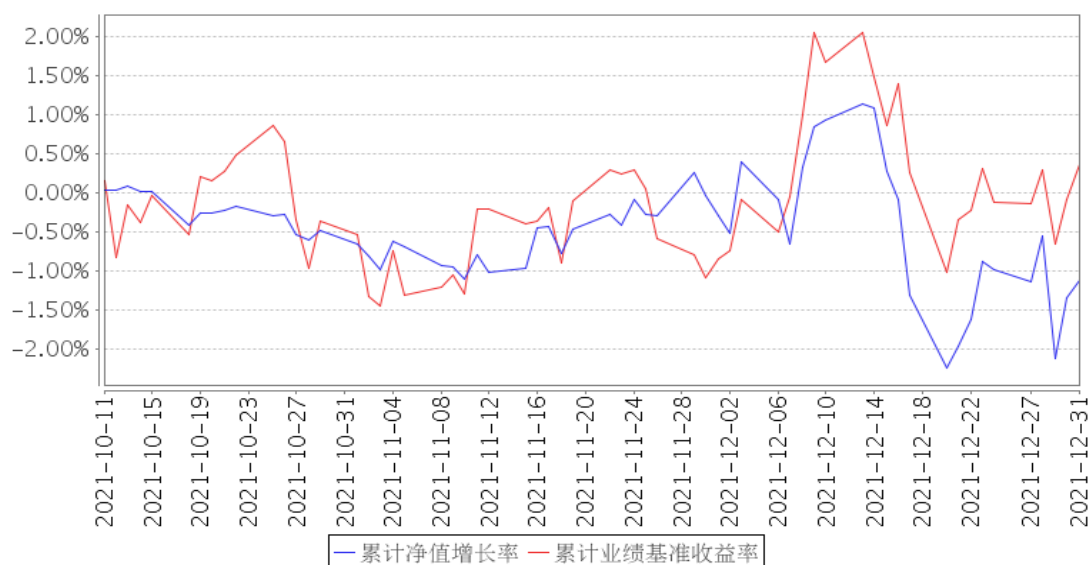
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	-1.13%	0.45%	0.35%	0.57%	-1.48%	-0.12%

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

长城兴华优选一年定开混合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



长城兴华优选一年定开混合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封闭期内，本基金投资于股票的资产占基金资产的比例为 60%-100%，投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%，每个封闭期结束前的一个月至开放期结束后一个月内不受上述比例限制。在开放期内，每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货需缴纳的交易保证金后，现

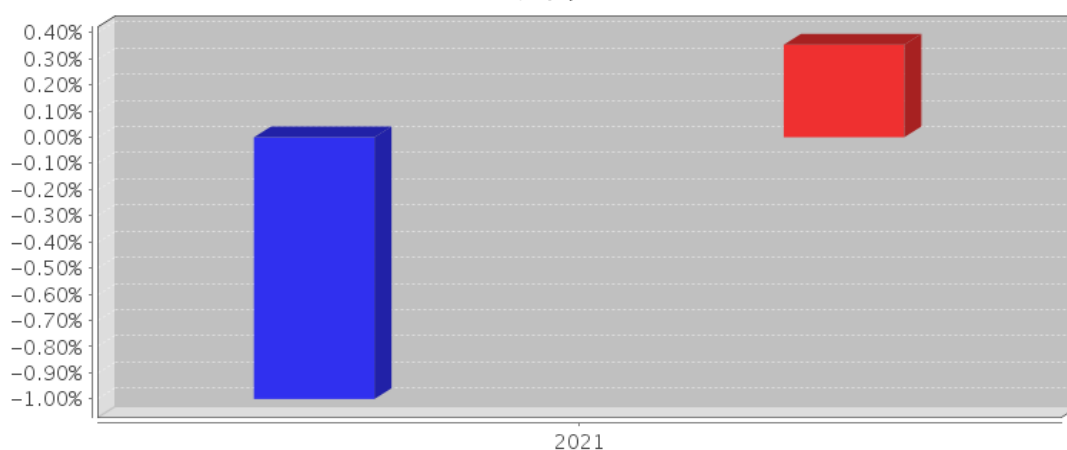
金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，在封闭期内，本基金不受前述 5% 的限制，但每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

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 2021 年 10 月 11 日生效，截止本报告期末，基金合同生效未满一年。

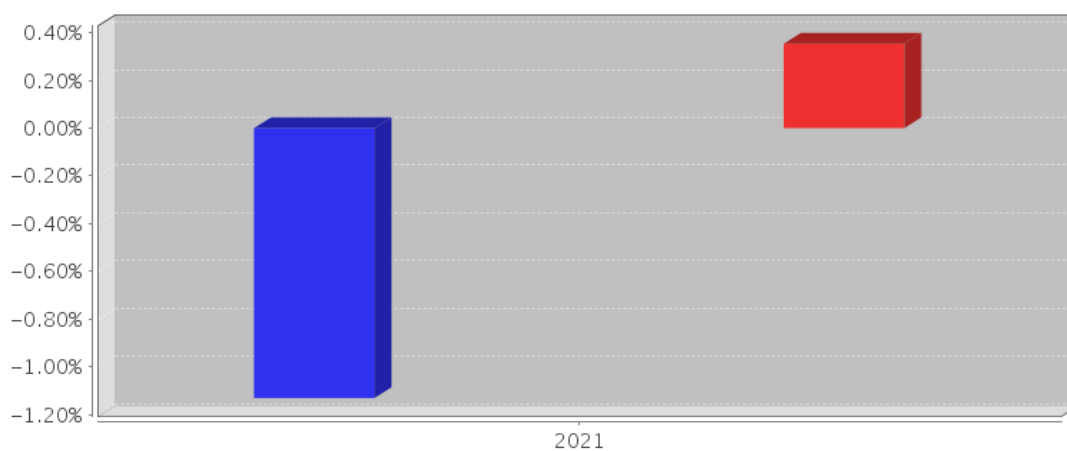
3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

长城兴华优选一年定开混合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



- 长城兴华优选一年定开混合A净值增长率
- 长城兴华优选一年定开混合A业绩基准收益率

长城兴华优选一年定开混合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



- 长城兴华优选一年定开混合C净值增长率
- 长城兴华优选一年定开混合C业绩基准收益率

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

注：本基金合同于2021年10月11日生效，自基金合同生效以来未进行利润分配。

§ 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、长城转型成长灵活配置混合型证券投资基金、长城创业板指数增强型发起式证券投资基金、长城久嘉创新成长灵活配置混合型证券投资基金、长城收益宝货币市场基金、长城智能产业灵活配置混合型证券投资基金、长城久荣纯债定期开放债券型发起式证券投资基金、长城中证 500 指数增强型证券投资基金、长城久悦债券型证券投资基金、长城核心优势混合型证券投资基金、长城量化精选

股票型证券投资基金、长城港股通价值精选多策略混合型证券投资基金、长城研究精选混合型证券投资基金、长城短债债券型证券投资基金、长城久瑞三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长城嘉裕六个月定期开放债券型证券投资基金、长城嘉鑫两年定期开放债券型证券投资基金、长城量化小盘股票型证券投资基金、长城泰利纯债债券型证券投资基金、长城价值优选混合型证券投资基金、长城恒康稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、长城创新驱动混合型证券投资基金、长城中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金、长城健康生活灵活配置混合型证券投资基金、长城成长先锋混合型证券投资基金、长城恒泰养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、长城优选增强六个月持有期混合型证券投资基金、长城中债 3-5 年国开行债券指数证券投资基金、长城均衡优选混合型证券投资基金、长城品质成长混合型证券投资基金、长城优选回报六个月持有期混合型证券投资基金、长城稳利纯债债券型证券投资基金、长城价值成长六个月持有期混合型证券投资基金、长城优选添瑞六个月持有期混合型证券投资基金、长城优选稳进六个月持有期混合型证券投资基金、长城消费 30 股票型证券投资基金、长城中债 5-10 年国开行债券指数证券投资基金、长城医药科技六个月持有期混合型证券投资基金、长城悦享回报债券型证券投资基金、长城竞争优势六个月持有期混合型证券投资基金、长城优选添利一年持有期混合型证券投资基金、长城科创板两年定期开放混合型证券投资基金、长城兴华优选一年定期开放混合型证券投资基金、长城中债 1-5 年国开行债券指数证券投资基金、长城健康消费混合型证券投资基金、长城恒利纯债债券型证券投资基金、长城大健康混合型证券投资基金、长城价值领航混合型证券投资基金、长城信利一年定期开放债券型发起式证券投资基金。

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		
杨建华	公司副总经理、投资总监、权益投资部总经理、本基金的基金经理	2021 年 10 月 11 日	-	21 年	男，中国籍，硕士，注册会计师（CPA）。曾就职于大庆石油管理局、华为技术有限公司、深圳市和君创业投资公司、长城证券有限责任公司投资银行部。2001 年 10 月加入长城基金管理有限公司，历任基金管理部基金经理助理、总经理助理、研究部总经理，现任公司副总经理、投资总监、权益投资部总经理、投委会委员兼基金经理。自 2007 年 9 月至 2009 年 1 月任“长城安心回报混合型证券投资基金”基金经理，自 2011 年 1 月至 2013 年 6 月任“长城中小盘成长股票型证券投资基金”基金经理，自 2009 年 9 月至 2016 年 9 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 2017 年 6 月至 2018 年 8 月任“长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金”基金经理，自 2018 年 8 月至 2018 年 11 月任“长城中证 500 指数增强型证券投资基金”基金经理，自 2017 年 8 月至 2019 年 2 月任“长城久嘉创新成长灵活配置混合型证券投资基金”基金经理。自 2004 年 5 月至今任“长城久泰沪深 300 指数证券投资基金”基金经理，自 2013 年 6 月至今任“长城品牌优选混合型证券投资基金”基金经理，自 2019 年 4 月至今任“长城核心优势混合型证券投资基金”基金经理，自 2020 年 3 月至今任“长城价值优选混合型证券投资基金”基金经理，自 2021 年 5 月至今任“长城消费 30 股票型证券投资基金”基金经理，自 2021 年 10 月至今任“长城兴华优选一年定期开放混合型证券投资基金”基金经理，自 2021 年 12 月至今任“长城价值领航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证券业协会《证券业从业人员资格管理办法》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》、《长城兴华优选一年定期开放混合型证券投资基金基金合同》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《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司管理办法》和《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》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《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《长城基金管理有限公司公平交易管理制度》的规定，不同投资者的利益得到了公平对待。

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

无。

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

本基金于三季度末成立。宏观经济方面，针对三季度末能耗双控政策严格执行下的一刀切，拉闸限电限产等措施在四季度很快得到了纠正。煤炭、钢铁、铝等能源和大宗原材料价格快速回落，中游制造业成本压力得到迅速缓解，生产经营活动恢复良好，PMI 在跌穿荣枯线后连续两个月重回荣枯线上方。出口仍然韧性十足，不断超出预期。同时，国内疫情仍然呈现散点爆发，局部有所扩散的态势，在“动态清零”的防疫政策指引下，疫情对经济的影响逐步弱化。为应对经济下行压力的不断加大，中共中央政治局会议和中央经济工作会议均比往常提前召开研究当前经济形势，稳字当头，稳中求进，稳增长措施提前出台，专项债资金提前下发，降低存款准备金率和引导市场利率走低的措施得到实施。市场资金宽裕，主题投资活跃，元宇宙、自动驾驶等表现活跃。市场投资风格开始向低估值的板块倾斜。中小市值个股依然活跃。

本基金总体上遵循自下而上精选个股的策略，目前处于在建仓期。本基金在食品饮料、医药、家电、轻工、汽车、社会服务、新能源、电子板块中精选具备核心优势的优质公司积极配置。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末长城兴华优选一年定开混合 A 基金份额净值为 0.9900 元，本报告期基金份额

净值增长率为-1.00%；长城兴华优选一年定开混合 C 基金份额净值为 0.9887 元，本报告期基金份额净值增长率为-1.13%，同期业绩比较基准收益率为 0.35%。

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 2022 年，我们认为国内经济面临较大下行压力，中央经济工作会议再提“以经济建设为中心”、“稳字当头、稳中求进”，新的一年稳增长的压力巨大，稳增长的政策措施力度也会加大，跨周期、逆周期的调节政策会陆续落地，时间节点甚至可能提前。短期看来地产政策可能边际放松、传统基建有望提速，长期看，政策仍会聚焦于科技创新、自主可控、低碳环保、新基建等引领经济高质量发展的方向，也存在通过减税降费、降低融资成本等方式刺激消费和制造业投资的可能。疫情防控措施有望更加精准和更加灵活，从而对经济活动的影响逐渐减弱。我们预计 2022 年的宏观流动性较为宽松，财政政策也较往年更加积极。在稳增长政策作用下，经济增速可能会超出投资者的一般预期。证券市场方面，上市公司整体业绩增速预计将较 2021 年有显著回落。尽管市场整体估值水平不高，但是结构性高估的情况仍较为显著，在全球大概率进入加息周期的前提下，过去两三年来业绩和估值双升的局面难以再现。因此我们判断 2022 年市场仍将以震荡整理消化估值为主，投资进入精选个股阶段，选股难度有所增加。受到政策支持、行业景气度向好的科技创新、新能源、碳中和等板块长期前景依然美好，短期需要消化估值压力。消费赛道长期消费升级趋势不改，短期受到疫情影响景气度有所走弱，充分调整后估值普遍进入合理区间，其中定价能力强、竞争格局优、发展势头好的公司值得重点关注。2021 年受到上游原材料价格上涨、运费高企等压力的中游制造业，经营压力有望边际缓解，业绩也会有一定程度的修复。因此，2022 年国内证券市场仍然充满了挑战，也充满了希望。

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日常工作，实时监控关键业务风险点，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“诚信、稳健、规范、创新”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、适用性的情况后及时修订估值方法，以保证其持续适用。受托资产估值委员会的相关人员均具有一定年限的专业从业经验，具有良好的专业能力，并能在相关工作中保持独立性。基金经理作为估值委员会成员，凭借其丰富的专业技能和对市场产品的长期深入的跟踪研究，向受托资产估值委员会建议应采用的估值方法及合理的估值区间。基金经理有权出席估值委员会会议，但不得干涉估值委员会作出的决定及估值政策的执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末未进行利润分配，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

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本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

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《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

本托管人认真复核了本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、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 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	普华永道中天审字(2022)第 21797 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	长城兴华优选一年定期开放混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了长城兴华优选一年定期开放混合型证券投资基金(以下简称“长城兴华优选一年定开基金”)的财务报表,包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表,2021 年 10 月 11 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日止期间的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。 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

	<p>则在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了长城兴华优选一年定开基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年 10 月 11 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>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。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。按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于长城兴华优选一年定开基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	不适用
其他事项	不适用
其他信息	不适用
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>长城兴华优选一年定开基金的基金管理人长城基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,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。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估长城兴华优选一年定开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,除非基金管理人管理层计划清算长城兴华优选一年定开基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督长城兴华优选一年定开基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<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。</p> <p>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:</p> <p>(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。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,</p>

	<p>但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人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。</p> <p>(四) 对基金管理人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，就可能对导致对长城兴华优选一年定开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兴华优选一年定开基金不能持续经营。</p> <p>(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。</p> <p>我们与基金管理人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>	
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	张炯	李隐煜
会计师事务所的地址	中国 上海	
审计报告日期	2022 年 3 月 29 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：长城兴华优选一年定期开放混合型证券投资基金

报告截止日：2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	7.4.7.1	166,124,422.99
结算备付金		7,175,622.03
存出保证金		58,939.88
交易性金融资产	7.4.7.2	304,085,413.41
其中：股票投资		304,085,413.41
基金投资		-
债券投资		-
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
应收证券清算款		-

应收利息	7.4.7.5	23,809.88
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		477,468,208.19
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021年12月31日
负 债:		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		4,624,322.10
应付赎回款		-
应付管理人报酬		604,895.86
应付托管费		100,815.97
应付销售服务费		72,836.70
应付交易费用	7.4.7.7	502,019.56
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	60,000.00
负债合计		5,964,890.19
所有者权益:		
实收基金	7.4.7.9	476,434,480.27
未分配利润	7.4.7.10	-4,931,162.27
所有者权益合计		471,503,318.00
负债和所有者权益总计		477,468,208.19

注：1、报告截止日 2021 年 12 月 31 日，基金份额总额 476,434,480.27 份，其中长城兴华优选一年定开混合 A 基金份额总额 332,906,412.59 份，基金份额净值 0.9900 元；长城兴华优选一年定开混合 C 基金份额总额 143,528,067.68 份，基金份额净值 0.9887 元。

2、本基金合同于 2021 年 10 月 11 日生效，本基金本期财务报表的实际编制期间系自 2021 年 10 月 11 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日止。因此，无上年度末财务数据。

7.2 利润表

会计主体：长城兴华优选一年定期开放混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 10 月 11 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期
-----	-----	----

		2021年10月11日(基金合同生效日)至2021年12月31日
一、收入		-2,168,658.11
1. 利息收入		715,557.04
其中：存款利息收入	7.4.7.11	184,366.97
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		531,190.07
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-3,246,641.65
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-3,246,641.65
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.1	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-
股利收益	7.4.7.16	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	181,730.57
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	180,695.93
减：二、费用		2,762,504.16
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,579,754.23
2. 托管费	7.4.10.2.2	263,292.37
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	190,275.89
4. 交易费用	7.4.7.19	668,746.67
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		-
7. 其他费用	7.4.7.20	60,435.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-4,931,162.27
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-4,931,162.27

注：本基金合同于2021年10月11日生效，本基金本期财务报表的实际编制期间系自2021年10月11日（基金合同生效日）至2021年12月31日止。因此，无上年度可比期间财务数据。

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长城兴华优选一年定期开放混合型证券投资基金

本报告期：2021年10月11日（基金合同生效日）至2021年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 10 月 11 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	476,434,480.27	-	476,434,480.27
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-4,931,162.27	-4,931,162.27
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	476,434,480.27	-4,931,162.27	471,503,318.00

注：本基金合同于 2021 年 10 月 11 日生效，本基金本期财务报表的实际编制期间系自 2021 年 10 月 11 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日止。因此，无上年度可比期间财务数据。

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

邱春杨

赵永强

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

长城兴华优选一年定期开放混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2021]1326号《关于准予长城兴华优选一年定期开放混合型证券投资基金注册的批复》核准，由长城基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投

资基金法》和《长城兴华优选一年定期开放混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型定期开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 476,345,184.97 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2021)第 0913 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《长城兴华优选一年定期开放混合型证券投资基金基金合同》于 2021 年 10 月 11 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 476,434,480.27 份，其中认购资金利息折合 89,295.30 份基金份额。本基金的基金管理人为长城基金管理有限公司，基金托管人为兴业银行股份有限公司。

本基金根据认购/申购费用与销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取认购/申购费用的基金份额，称为 A 类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取认购/申购费用的基金份额，称为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《长城兴华优选一年定期开放混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会允许上市的股票、存托凭证)、港股通标的股票、债券(包括国内依法发行和上市交易的国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、可分离交易可转债、地方政府债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、股指期货、国债期货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(但需符合中国证监会的相关规定)。

本基金的投资组合比例为：封闭期内，本基金股票投资占基金资产的比例范围为 60%-100%，投资于港股通标的股票的比例不得超过股票资产的 50%。每个封闭期结束前 1 个月至开放期结束后 1 个月内不受上述限制。开放期内，每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货需缴纳的交易保证金后，应当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，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。封闭期内，本基金不受上述 5%的限制，但每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金的业绩比较基准为：中证 800 指数收益率×70%+中证港股通综合指数收益率(使用估值汇率折算)×10%+中债综合财富指数收益率×20%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本

准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《长城兴华优选一年定期开放混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

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2021年12月31日的财务状况以及自2021年10月11日(基金合同生效日)至2021年12月31日止期间的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息根据下列依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为2021年10月11日(基金合同生效日)至2021年12月31日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产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资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资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。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

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及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债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。本

基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项

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

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金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；或者(3) 该金融资产已转移，虽然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，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资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其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，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) 当金融工具不存在活跃市场，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。采用估值技术时，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，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。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认列。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平准金和未实现平准金。已实现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损益占基金净值比例计算的金额。未实现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损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，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

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他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

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份

额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

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，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

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

（1）对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

（2）对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》（以下简称“指引”），按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动

性折扣后的价值进行估值。

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

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《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》、财税[2015]101号《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》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《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》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《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》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票的差价收入，股票的股息、红利收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金从上市公司取得的股息红利所得，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，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁

后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 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。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日
活期存款	166,124,422.99
定期存款	-
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	-
合计	166,124,422.99

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	303,903,682.84	304,085,413.41	181,730.57
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	303,903,682.84	304,085,413.41	181,730.57

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

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。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日
应收活期存款利息	20,228.83
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	3,551.90
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	29.15
合计	23,809.88

注：其他为应收交易所结算保证金利息。

7.4.7.6 其他资产

注：无。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日
交易所市场应付交易费用	502,019.56
银行间市场应付交易费用	-
合计	502,019.56

注：交易所市场应付交易费用均为应付佣金。

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
预提审计费	40,000.00
预提信息披露费	20,000.00
合计	60,000.00

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

长城兴华优选一年定开混合 A

项目	本期 2021 年 10 月 11 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	332,906,412.59	332,906,412.59
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
-基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	332,906,412.59	332,906,412.59

长城兴华优选一年定开混合 C

项目	本期 2021 年 10 月 11 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	143,528,067.68	143,528,067.68
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
-基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	143,528,067.68	143,528,067.68

注：1）本基金自 2021 年 9 月 16 日至 2021 年 9 月 30 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金人民币 476,345,184.97 元，折合为 476,345,184.97 份基金份额（其中 A 类基金份额 332,849,406.93 份，C 类基金份额 143,495,778.04 份）。根据《长城兴华优选一年定期开放混合型证券投资基金招募说明书》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入人民币 89,295.30 元在本基金成立后，折合为 89,295.30 份基金份额（其中 A 类基金份额 57,005.66 份，C 类基金份额 32,289.64 份），划入基金份额持有人账户。

2）根据《长城兴华优选一年定期开放混合型证券投资基金基金合同》、《长城兴华优选一年定期开放混合型证券投资基金招募说明书》及《长城兴华优选一年定期开放混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换、定期定额投资、费率优惠等业务公告》的相关规定，本基金于 2021 年 10 月 11 日（基金合同生效日）至 2022 年 10 月 10 日止期间暂不向投资人开放基金交易，申购业务、赎回业务、转换业务和定期定额投资业务自 2022 年 10 月 11 日起开始办理。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

长城兴华优选一年定开混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-3,440,742.44	127,253.53	-3,313,488.91
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-3,440,742.44	127,253.53	-3,313,488.91

长城兴华优选一年定开混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-1,672,150.40	54,477.04	-1,617,673.36
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-1,672,150.40	54,477.04	-1,617,673.36

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年10月11日（基金合同生效日）至2021年12月31日
活期存款利息收入	161,975.25
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	22,286.38
其他	105.34
合计	184,366.97

注：其他为交易所结算保证金利息收入。

7.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年10月11日（基金合同生效日）至2021年12月31日
卖出股票成交总额	116,436,781.75
减：卖出股票成本总额	119,683,423.40
买卖股票差价收入	-3,246,641.65

7.4.7.13 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：无。

7.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

注：无。

7.4.7.14 贵金属投资收益

7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

注：无。

7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

7.4.7.15 衍生工具收益

7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：无。

7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无。

7.4.7.16 股利收益

注：无。

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年10月11日（基金合同生效日）至2021年12月31日
1. 交易性金融资产	181,730.57
股票投资	181,730.57
债券投资	-
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	181,730.57

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年10月11日（基金合同生效日）至2021年12月31日
基金赎回费收入	-
其他	180,695.93
合计	180,695.93

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年10月11日（基金合同生效日）至2021年12月31日
交易所市场交易费用	668,746.67
银行间市场交易费用	-
合计	668,746.67

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年10月11日（基金合同生效日）至2021年12月31日
----	--

审计费用	40,000.00
信息披露费	20,000.00
证券出借违约金	-
银行费用	35.00
其他	400.00
合计	60,435.00

注：其他为证券账户开户费。

7.4.7.21 分部报告

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

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
兴业银行股份有限公司（“兴业银行”）	基金托管人、基金销售机构
长城证券股份有限公司（“长城证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
东方证券股份有限公司（“东方证券”）	基金管理人的股东
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

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 2021年10月11日（基金合同生效日）至2021年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例（%）
长城证券	539,052,120.43	100.00

7.4.10.1.2 债券交易

注：无。

7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年10月11日（基金合同生效日）至2021年12月31日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例（%）
长城证券	2,589,900,000.00	100.00

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 2021年10月11日（基金合同生效日）至2021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	502,019.56	100.00	502,019.56	100.00

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

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

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
	2021 年 10 月 11 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,579,754.23
其中：支付销售机构的客户维护费	631,980.93

注：注：基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.50%的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

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

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 10 月 11 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	263,292.37

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

$$H=E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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		
	2021 年 10 月 11 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	长城兴华优选一年定开混合 A	长城兴华优选一年定开混合 C	合计
长城基金管理有限公司	-	175.19	175.19

长城证券		6,462.11	6,462.11
兴业银行		174,481.37	174,481.37
合计		181,118.67	181,118.67

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 类基金份额的年销售服务费率为 0.6%，计算方法如下：

$$H = E \times \text{该类基金份额的年销售服务费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日该类基金份额应计提的基金销售服务费

E 为前一日该类基金份额的基金资产净值

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末运用固有资金投资于本基金，于本期末亦未持有本基金份额。

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 2021 年 10 月 11 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入
兴业银行	166,124,422.99	161,975.25

注：本基金的活期银行存款由基金托管人保管，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。

7.4.12 期末(2021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	可流通日	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
001234	泰慕士	2021年12月31日	2022年01月11日	新股未上市	16.53	16.53	333	5,504.49	5,504.49	-
301096	百诚医药	2021年12月13日	2022年6月20日	新股锁定	79.60	78.53	190	15,124.00	14,920.70	-
301127	天源环保	2021年12月23日	2022年6月30日	新股锁定	12.03	17.12	1,685	20,270.55	28,847.20	-

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无。

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 2021 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 2021 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。

于 2021 年 12 月 31 日，本基金无债券投资。

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 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制外(如有)，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。除附注 7.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额(如有)将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

于开放期内，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为 0.01%。于开放期内，本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于 2021 年 12 月 31 日，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

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银行存款、结算备付金、存出保证金等。本基金管理人每日对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 年 12	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
------------------	--------	--------	----------	-------	-------	-----	----

月 31 日							
资产							
银行存款	166,124,422.99	-	-	-	-	-	166,124,422.99
结算备付金	7,175,622.03	-	-	-	-	-	7,175,622.03
存出保证金	58,939.88	-	-	-	-	-	58,939.88
交易性金融资产	-	-	-	-	-	304,085,413.41	304,085,413.41
应收利息	-	-	-	-	-	23,809.88	23,809.88
资产总计	173,358,984.90	-	-	-	-	304,109,223.29	477,468,208.19
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	604,895.86	604,895.86
应付托管费	-	-	-	-	-	100,815.97	100,815.97
应付证券清算款	-	-	-	-	-	4,624,322.10	4,624,322.10
应付销售服务费	-	-	-	-	-	72,836.70	72,836.70
应付交易费用	-	-	-	-	-	502,019.56	502,019.56
其他负债	-	-	-	-	-	60,000.00	60,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	5,964,890.19	5,964,890.19
利率敏感度缺口	173,358,984.90	-	-	-	-	-	-

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：本基金于本期末未持有交易性债券投资。因此在其它变量不变的假设下，利率发生合理、可能变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动对本期末基金资产净值无重大影响。本基金基金合同于 2021 年 10 月 11 日生效，无上年度末比较数据。

7.4.13.4.2 外汇风险

本基金的投资范围包括内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的香港证券市场股票，如果港币资产相对于人民币贬值，将对基金收益产生不利影响；港币对人民币的汇率大幅波动也将加大基金净值波动的幅度。

于本期末，本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票，所面临的最大其他价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

本基金的投资组合比例为：封闭期内，股票投资占基金资产的比例范围为 60%-100%，投资于港股通标的股票的比例不得超过股票资产的 50%。每个封闭期结束前 1 个月至开放期结束后 1 个月内不受上述限制。开放期内，每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货需缴纳的交易保证金后，应当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，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。封闭期内，本基金不受上述 5% 的限制，但每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

于本期末，本基金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 2021 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	304,085,413.41	64.49
交易性金融资产—基金投资	—	—
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	304,085,413.41	64.49

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	在其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时	
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末（2021 年 12 月 31 日）
分析	沪深 300 指数上升	19,236,443.25

	5%	
	沪深 300 指数下降	
	5%	-19,236,443.25

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 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。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2021 年 12 月 31 日，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中属于第一层次的余额为 304,036,141.02 元，属于第二层次的余额为 49,272.39 元，无属于第三层次的余额。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2021 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 根据财政部发布的《企业会计准则第 22 号—金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23

号—金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号—套期会计》和《企业会计准则第 37 号—金融工具列报》（以下合称“新金融工具准则”）相关衔接规定，以及财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金应当自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。截至 2021 年 12 月 31 日，本基金已完成了执行新金融工具准则对财务报表潜在影响的评估。鉴于本基金业务的性质，新金融工具准则预期不会对本基金的财务状况和经营成果产生重大影响。

本基金将自 2022 年 1 月 1 日起追溯执行相关新规定，并采用准则允许的实务简便方法，调整期初所有者权益，2021 年的比较数据将不作重述。

(3) 除公允价值和执行新金融工具准则外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 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	304,085,413.41	63.69
	其中：股票	304,085,413.41	63.69
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	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	173,300,045.02	36.30
8	其他各项资产	82,749.76	0.02
9	合计	477,468,208.19	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	—	—
B	采矿业	—	—

C	制造业	259,220,020.47	54.98
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	2,139,600.00	0.45
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	9,086,048.04	1.93
J	金融业	9,329,454.00	1.98
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	2,303,805.00	0.49
M	科学研究和技术服务业	19,732,570.70	4.19
N	水利、环境和公共设施管理业	28,847.20	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	2,245,068.00	0.48
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	304,085,413.41	64.49

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	600519	贵州茅台	14,100	28,905,000.00	6.13
2	000858	五粮液	81,500	18,146,790.00	3.85
3	000568	泸州老窖	70,700	17,948,609.00	3.81
4	603259	药明康德	130,500	15,474,690.00	3.28
5	601012	隆基股份	156,700	13,507,540.00	2.86
6	600809	山西汾酒	42,600	13,452,228.00	2.85
7	603596	伯特利	192,000	13,363,200.00	2.83
8	600702	舍得酒业	57,700	13,115,210.00	2.78
9	300760	迈瑞医疗	31,200	11,880,960.00	2.52
10	600690	海尔智家	396,300	11,845,407.00	2.51
11	603816	顾家家居	148,300	11,442,828.00	2.43
12	600660	福耀玻璃	201,100	9,479,854.00	2.01
13	300059	东方财富	251,400	9,329,454.00	1.98
14	600522	中天科技	516,800	8,764,928.00	1.86

15	000799	酒鬼酒	39,200	8,330,000.00	1.77
16	600765	中航重机	143,600	7,250,364.00	1.54
17	600887	伊利股份	173,800	7,205,748.00	1.53
18	688016	心脉医疗	26,327	6,548,577.98	1.39
19	000887	中鼎股份	299,700	6,536,457.00	1.39
20	688018	乐鑫科技	34,351	6,528,064.04	1.38
21	600129	太极集团	234,200	5,260,132.00	1.12
22	002475	立讯精密	102,500	5,043,000.00	1.07
23	000333	美的集团	66,700	4,923,127.00	1.04
24	603605	珀莱雅	23,200	4,832,792.00	1.02
25	300627	华测导航	101,900	4,687,400.00	0.99
26	600779	水井坊	35,700	4,283,643.00	0.91
27	300347	泰格医药	33,200	4,242,960.00	0.90
28	603896	寿仙谷	65,639	3,807,062.00	0.81
29	300451	创业慧康	228,800	2,557,984.00	0.54
30	600285	羚锐制药	159,700	2,523,260.00	0.54
31	001215	千味央厨	42,500	2,473,925.00	0.52
32	002415	海康威视	45,400	2,375,328.00	0.50
33	603198	迎驾贡酒	34,000	2,361,300.00	0.50
34	002508	老板电器	64,800	2,334,096.00	0.50
35	601888	中国中免	10,500	2,303,805.00	0.49
36	002241	歌尔股份	41,900	2,266,790.00	0.48
37	300015	爱尔眼科	53,100	2,245,068.00	0.48
38	002821	凯莱英	5,000	2,175,000.00	0.46
39	002705	新宝股份	86,800	2,143,960.00	0.45
40	601117	中国化学	178,300	2,139,600.00	0.45
41	301127	天源环保	1,685	28,847.20	0.01
42	301096	百诚医药	190	14,920.70	0.00
43	001234	泰慕士	333	5,504.49	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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	28,335,800.68	6.01
2	601012	隆基股份	18,943,791.86	4.02
3	603259	药明康德	18,805,117.60	3.99
4	000858	五粮液	18,480,540.00	3.92
5	000568	泸州老窖	16,507,967.00	3.50
6	600887	伊利股份	13,792,542.64	2.93
7	603596	伯特利	13,745,307.00	2.92
8	600809	山西汾酒	13,149,392.80	2.79

9	600702	舍得酒业	12,272,652.00	2.60
10	600690	海尔智家	11,845,651.38	2.51
11	300760	迈瑞医疗	11,810,556.00	2.50
12	300750	宁德时代	11,305,597.00	2.40
13	603816	顾家家居	11,295,366.60	2.40
14	600765	中航重机	9,497,265.65	2.01
15	000799	酒鬼酒	9,485,949.76	2.01
16	002594	比亚迪	9,482,766.00	2.01
17	600660	福耀玻璃	9,458,856.20	2.01
18	600522	中天科技	9,018,603.38	1.91
19	300059	东方财富	9,009,437.36	1.91
20	688018	乐鑫科技	7,153,279.21	1.52

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	300750	宁德时代	10,370,223.00	2.20
2	002594	比亚迪	9,305,478.00	1.97
3	600887	伊利股份	6,764,888.00	1.43
4	000625	长安汽车	5,796,116.00	1.23
5	601012	隆基股份	5,255,186.46	1.11
6	600276	恒瑞医药	5,007,848.00	1.06
7	000001	平安银行	4,988,187.00	1.06
8	002241	歌尔股份	4,876,225.56	1.03
9	002179	中航光电	4,801,676.00	1.02
10	601888	中国中免	4,554,676.00	0.97
11	600552	凯盛科技	4,501,092.00	0.95
12	300496	中科创达	4,411,523.00	0.94
13	603197	保隆科技	2,704,170.00	0.57
14	002821	凯莱英	2,539,041.00	0.54
15	600422	昆药集团	2,537,120.67	0.54
16	000596	古井贡酒	2,523,289.00	0.54
17	603198	迎驾贡酒	2,519,956.50	0.53
18	600765	中航重机	2,455,513.00	0.52
19	002402	和而泰	2,451,898.00	0.52
20	600406	国电南瑞	2,450,633.00	0.52

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	423,587,106.24
--------------	----------------

卖出股票收入（成交）总额	116,436,781.75
--------------	----------------

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

注：无。

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

注：无。

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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：无。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。

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

本基金投资于国债期货，以套期保值为目的，以合理管理债券组合的久期、流动性和风险水平。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：无。

8.11.3 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

本报告期本基金投资的前十名证券除舍得酒业发行主体外，其他证券的发行主体未出现被监

管部门立案调查、或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

根据上海证券交易所公布的纪律处分决定书：

舍得酒业股份有限公司（简称舍得酒业）因信息披露相关违规情形，于 2021 年 8 月 6 日被上海证券交易所予以通报批评。

以上发行主体涉及证券的投资已执行内部严格的投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

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	58,939.88
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	23,809.88
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	82,749.76

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	户均持有的基金份额	持有人结构	
			机构投资者	个人投资者

	(户)		持有份额	占总份 额比例 (%)	持有份额	占总 份额 比例 (%)
长城兴华 优选一年 定开混合 A	5,876	56,655.28	859,749.05	0.26	332,046,663.54	99.74
长城兴华 优选一年 定开混合 C	3,456	41,530.11	1,000,045.00	0.70	142,528,022.68	99.30
合计	9,332	51,053.84	1,859,794.05	0.39	474,574,686.22	99.61

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 理人所有从业 人员持有本基 金	长城兴华优选一年定开混合 A	992,198.49	0.2980
	长城兴华优选一年定开混合 C	1,031,434.50	0.7186
	合计	2,023,632.99	0.4247

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	长城兴华优选一年定开混合 A	50~100
	长城兴华优选一年定开混合 C	>100
	合计	>100
本基金基金经理持有 本开放式基金	长城兴华优选一年定开混合 A	0
	长城兴华优选一年定开混合 C	>100
	合计	>100

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	长城兴华优选一年定开混合 A	长城兴华优选一年定开混合 C
基金合同生效日 (2021 年 10 月 11 日) 基金份额总额	332,906,412.59	143,528,067.68
基金合同生效日起至 报告期期末基金总申 购份额	-	-
减：基金合同生效日 起至报告期期末基金 总赎回份额	-	-
基金合同生效日起至 报告期期末基金拆分 变动份额（份额减少 以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份 额总额	332,906,412.59	143,528,067.68

§ 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 2021 年 4 月 14 日起，许明波先生不再担任公司董事，由曾晓玲女士担任公司董事。

自 2021 年 7 月 20 日起，赵建兴先生不再担任公司副总经理、首席信息官。

自 2021 年 7 月 30 日起，由邱春杨先生兼任公司首席信息官。

自 2021 年 9 月 30 日起，袁柳生先生不再担任公司职工监事。

自 2021 年 11 月 11 日起，由侯涛先生担任公司职工监事。

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、本基金本报告期应支付给会计师事务所的报酬为人民币四万元。
- 2、目前为本基金提供审计服务的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所(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

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

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	
长城证券	2	539,052,120.43	100.00%	502,019.56	100.00%	-

注：1、本报告期内新增 2 个租用交易单元（长城证券），截止本报告期末共计 2 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
长城证券	-	-	2,589,900,000.00	100.00%	-	-

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	长城兴华优选一年定期开放混合型证券投资基金基金合同生效公告	中国证监会规定报刊及网站	2021年10月12日
2	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	2021年11月9日
3	长城基金管理有限公司关于北京分公司营业场所变更的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021年12月30日

§ 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) 中国证监会准予长城兴华优选一年定期开放混合型证券投资基金注册的文件
- (二) 《长城兴华优选一年定期开放混合型证券投资基金基金合同》
- (三) 《长城兴华优选一年定期开放混合型证券投资基金托管协议》
- (四) 《长城兴华优选一年定期开放混合型证券投资基金招募说明书》
- (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

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：0755-23982338

客户服务电话：400-8868-666

网站：www.ccfund.com.cn