

长城港股通价值精选多策略混合型证券投资  
基金  
2023 年中期报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：长城基金管理有限公司

基金托管人：北京银行股份有限公司

送出日期：2023 年 8 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人北京银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 08 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 01 月 01 日起至 2023 年 06 月 30 日止。

为了更好地为投资者提供理财服务，经与本基金基金托管人北京银行股份有限公司协商一致，并报中国证监会备案，本基金管理人自 2023 年 1 月 18 日起为本基金增设 C 类基金份额。同时，本基金管理人对基金合同进行了相应的修改，修改的具体内容详见本基金管理人于 2023 年 1 月 16 日发布的《关于长城港股通价值精选多策略混合型证券投资基金增设基金份额并相应修改基金合同及托管协议的公告》。

## 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	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</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	7
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>14</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	14
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>14</b>
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 净资产（基金净值）变动表	17
6.4 报表附注	20
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>42</b>
7.1 期末基金资产组合情况	42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	43
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	46
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	46

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	46
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	46
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	46
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	46
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	47
7.12 投资组合报告附注 .....	47
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>48</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	48
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	48
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	48
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>49</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>49</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	49
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	49
10.4 基金投资策略的改变 .....	49
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	49
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	50
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	50
10.8 其他重大事件 .....	51
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>51</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	51
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	51
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>51</b>
12.1 备查文件目录 .....	51
12.2 存放地点 .....	52
12.3 查阅方式 .....	52

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	长城港股通价值精选多策略混合型证券投资基金	
基金简称	长城港股通价值精选混合	
基金主代码	007132	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019 年 6 月 26 日	
基金管理人	长城基金管理有限公司	
基金托管人	北京银行股份有限公司	
报告期末基金份 额总额	92,571,638.79 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基 金简称	长城港股通价值精选混合 A	长城港股通价值精选混合 C
下属分级基金的交 易代码	007132	017627
报告期末下属分级 基金的份额总额	92,417,524.80 份	154,113.99 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金以港股通标的股票为主，筛选基本面良好、价值被低估的公司，并通过多种策略组合配置，追求长期稳定投资回报。
投资策略	<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>本基金将在宏观经济分析、行业分析的基础上，考察公司在同业中的地位、核心产品的竞争力、市场需求状况及公司的决策体系及其开拓精神等，根据公司的基本面以及财务报表信息灵活运用各类估值方法评估公司的价值，筛选出由于经济周期原因或市场情绪原因造成的低估值股票以及壁垒明确、具有持续盈利增长前景、价格合理且具有吸引力的股票进行投资。在港股通投资标的的筛选上，注重对基本面良好、相对 A 股市场估值合理、具备优质成长性、注重现金分红的股票进行投资。</p> <p>本基金灵活运用多种策略构建股票投资组合，多维度分析股票的投资价值，包括：①高股息稳健增长策略；②行业龙头稳健增长策略；③高增长策略；④A-H 股价差策略；⑤戴维斯双击策略等。通过合理搭配各个子策略的投资比重，提高组合收益的稳定性，获取稳健投资回报。</p>
业绩比较基准	恒生指数收益率（使用估值汇率折算）×60%+沪深 300 指数收益率×15%+中证全债指数收益率×25%
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高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。

### 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	北京银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	车君	史学通
	联系电话	0755-29279005	010-66223413
	电子邮箱	chejun@ccfund.com.cn	shixuetong@bankofbeijing.com.cn
客户服务电话		400-8868-666	95526
传真		0755-29279000	010-89661115
注册地址		深圳市福田区莲花街道福新社区鹏程一路9号广电金融中心36层DEF单元、38层、39层	北京市西城区金融大街甲17号首层
办公地址		深圳市福田区莲花街道福新社区鹏程一路9号广电金融中心36层DEF单元、38层、39层	北京市西城区金融大街丙17号
邮政编码		518046	100033
法定代表人		王军	霍学文

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.ccfund.com.cn
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	长城基金管理有限公司	深圳市福田区莲花街道福新社区鹏程一路9号广电金融中心36层DEF单元、38层、39层

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2023年1月1日-2023年6月30日)	2023年1月18日(基金合同生效日)-2023年6月30日
	长城港股通价值精选混合 A	长城港股通价值精选混合 C
本期已实现收益	-5,800,637.26	-12,232.57
本期利润	-3,991,427.33	-15,617.70
加权平均基金份额本期利润	-0.0418	-0.0959
本期加权平均净值利润率	-5.08%	-11.99%

本期基金份额净值增长率	-4.92%	-10.36%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023年6月30日)	
期末可供分配利润	-20,443,065.00	-34,319.68
期末可供分配基金份额利润	-0.2212	-0.2227
期末基金资产净值	73,406,002.71	122,222.71
期末基金份额净值	0.7943	0.7931
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	-19.05%	-10.36%

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

长城港股通价值精选混合 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
过去一个月	6.85%	1.57%	3.82%	0.93%	3.03%	0.64%
过去三个月	-1.65%	1.32%	-1.62%	0.81%	-0.03%	0.51%
过去六个月	-4.92%	1.55%	0.06%	0.88%	-4.98%	0.67%
过去一年	-24.58%	1.84%	-4.59%	1.09%	-19.99%	0.75%
过去三年	-34.50%	1.90%	-10.40%	1.03%	-24.10%	0.87%

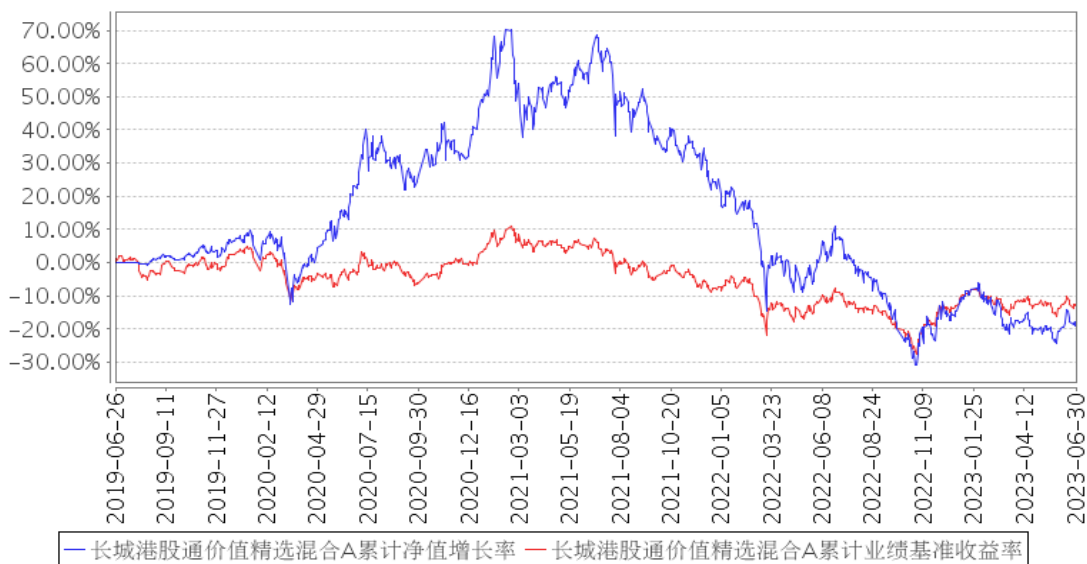
					%	
自基金合同生效起 至今	-19.05%	1.77%	-13.13%	1.03%	-5.92%	0.74%

长城港股通价值精选混合 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
过去一个月	6.86%	1.57%	3.82%	0.93%	3.04%	0.64%
过去三个月	-1.72%	1.32%	-1.62%	0.81%	-0.10%	0.51%
过去六个月	-	-	-	-	-	-
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起 至今	-10.36%	1.56%	-3.88%	0.90%	-6.48%	0.66%

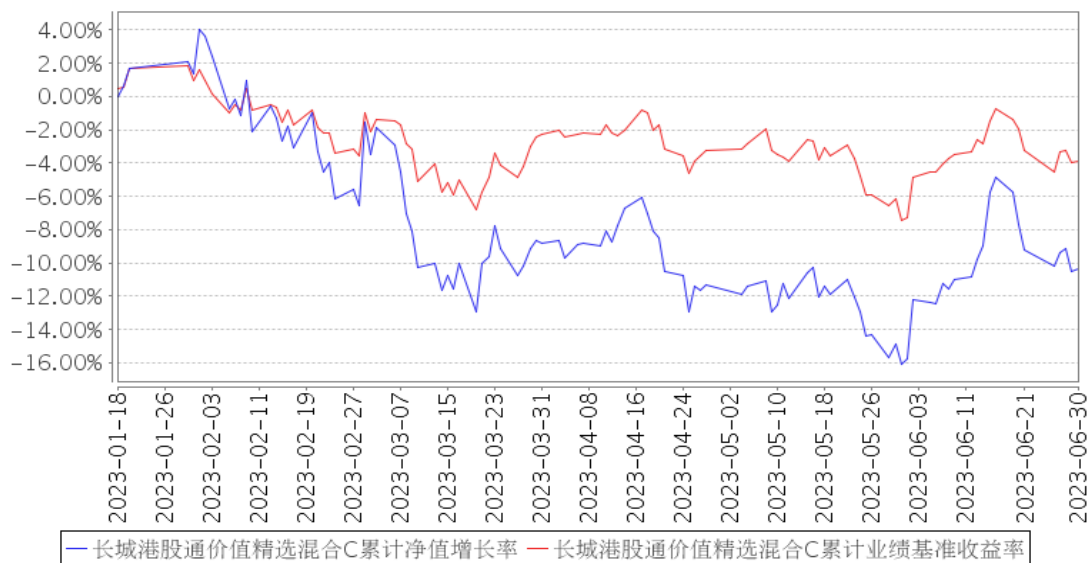
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

长城港股通价值精选混合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





长城港股通价值精选混合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中股票投资比例为基金资产的 60%-95%，其中投资于港股通标的股票的比例不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持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%，其中现金不得包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等；权证、股指期货、国债期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

②本基金的建仓期为自基金合同生效之日起六个月内，建仓期满时，各项资产配置比例符合基金合同约定。

③本基金自 2023 年 1 月 18 日起增设 C 类基金份额。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

长城基金管理有限公司是经中国证监会批准设立的第 15 家基金管理公司，由长城证券股份有限公司（40%）、东方证券股份有限公司（15%）、西北证券有限责任公司（15%）、北方国际信托股份有限公司（15%）、中原信托有限公司（15%）于 2001 年 12 月 27 日共同出资设立，当时注册资本为壹亿元人民币。2007 年 5 月 21 日，经中国证监会批准，公司完成股权结构调整，现有股东为长城证券股份有限公司（47.059%）、东方证券股份有限公司（17.647%）、北方国际信托股份有限公司（17.647%）和中原信托有限公司（17.647%）。2007 年 10 月 12 日，经中国证监会批准，将注册资本增加至壹亿伍仟万元人民币。公司经营范围是基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其他业务。截至本报告期末，公司管理的基金有：长城久恒灵活配置混合型证

券投资基金、长城久泰沪深 300 指数证券投资基金、长城货币市场证券投资基金、长城消费增值混合型证券投资基金、长城安心回报混合型证券投资基金、长城久富核心成长混合型证券投资基金 (LOF)、长城品牌优选混合型证券投资基金、长城稳健增利债券型证券投资基金、长城双动力混合型证券投资基金、长城中小盘成长混合型证券投资基金、长城积极增利债券型证券投资基金、长城优化升级混合型证券投资基金、长城稳健成长灵活配置混合型证券投资基金、长城核心优选灵活配置混合型证券投资基金、长城增强收益定期开放债券型证券投资基金、长城医疗保健混合型证券投资基金、长城工资宝货币市场基金、长城久鑫灵活配置混合型证券投资基金、长城稳固收益债券型证券投资基金、长城新兴产业灵活配置混合型证券投资基金、长城环保主题灵活配置混合型证券投资基金、长城改革红利灵活配置混合型证券投资基金、长城久惠灵活配置混合型证券投资基金、长城久祥灵活配置混合型证券投资基金、长城行业轮动灵活配置混合型证券投资基金、长城新优选混合型证券投资基金、长城久润灵活配置混合型证券投资基金、长城久益灵活配置混合型证券投资基金、长城久源灵活配置混合型证券投资基金、长城久鼎灵活配置混合型证券投资基金、长城久稳债券型证券投资基金、长城中国智造灵活配置混合型证券投资基金、长城悦享增利债券型证券投资基金、长城创业板指数增强型发起式证券投资基金、长城久嘉创新成长灵活配置混合型证券投资基金、长城收益宝货币市场基金、长城智能产业灵活配置混合型证券投资基金、长城久荣纯债定期开放债券型发起式证券投资基金、长城中证 500 指数增强型证券投资基金、长城久悦债券型证券投资基金、长城核心优势混合型证券投资基金、长城量化精选股票型证券投资基金、长城港股通价值精选多策略混合型证券投资基金、长城研究精选混合型证券投资基金、长城短债债券型证券投资基金、长城久瑞三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长城嘉裕六个月定期开放债券型证券投资基金、长城嘉鑫两年定期开放债券型证券投资基金、长城量化小盘股票型证券投资基金、长城泰利纯债债券型证券投资基金、长城价值优选混合型证券投资基金、长城恒康稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF)、长城创新驱动混合型证券投资基金、长城中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金、长城健康生活灵活配置混合型证券投资基金、长城成长先锋混合型证券投资基金、长城恒泰养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF)、长城优选增强六个月持有期混合型证券投资基金、长城中债 3-5 年国开行债券指数证券投资基金、长城均衡优选混合型证券投资基金、长城品质成长混合型证券投资基金、长城优选回报六个月持有期混合型证券投资基金、长城稳利纯债债券型证券投资基金、长城价值成长六个月持有期混合型证券投资基金、长城优选添瑞六个月持有期混合型证券投资基金、长城优选稳进六个月持有期混合型证券投资基金、长城消费 30 股票型证券投资基金、长城中债 5-10 年国开行债券指数证券投资基金、长城医药科技六个月持有期混合型证券投资基金、长城

悦享回报债券型证券投资基金、长城竞争优势六个月持有期混合型证券投资基金、长城优选添利一年持有期混合型证券投资基金、长城科创板两年定期开放混合型证券投资基金、长城兴华优选一年定期开放混合型证券投资基金、长城健康消费混合型证券投资基金、长城恒利纯债债券型证券投资基金、长城大健康混合型证券投资基金、长城价值领航混合型证券投资基金、长城信利一年定期开放债券型发起式证券投资基金、长城新能源股票型发起式证券投资基金、长城优选招益一年持有期混合型证券投资基金、长城价值甄选一年持有期混合型证券投资基金、长城中证医药卫生指数增强型证券投资基金、长城瑞利纯债债券型证券投资基金、长城产业成长混合型证券投资基金、长城鑫享 90 天滚动持有中短债债券型证券投资基金、长城产业趋势混合型证券投资基金、长城远见成长混合型证券投资基金、长城聚利纯债债券型证券投资基金、长城中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、长城永利债券型证券投资基金、长城数字经济混合型证券投资基金、长城鑫利 30 天滚动持有中短债债券型证券投资基金、长城产业臻选混合型证券投资基金、长城鼎利一年定期开放债券型发起式证券投资基金、长城全球新能源汽车股票型发起式证券投资基金（QDII-LOF）、长城创新成长混合型证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
曲少杰	国际业务部总经理助理（主持工作）、本基金的基金经理	2019 年 6 月 26 日	-	17 年	男，中国籍，硕士，特许金融分析师（CFA）。2006 年 6 月-2012 年 6 月曾就职于易方达基金管理有限公司任 QDII 交易经理，2014 年 4 月-2015 年 4 月曾就职于 YGD 资产管理公司（香港）任港股投资经理，2015 年 4 月-2016 年 10 月曾就职于深圳道朴资本管理有限公司任投资经理，2016 年 10 月-2018 年 3 月曾就职于生命保险资产管理有限公司任港股投资经理。2018 年 3 月加入长城基金管理有限公司，历任港股研究员，现任国际业务部总经理助理（主持工作）。自 2019 年 6 月至今任“长城港股通价值精选多策略混合型证券投资基金”基金经理，自 2023 年 4 月至今任“长城全球新能源汽车股票型发起式证券投资基金（QDII-LOF）”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 公平交易制度的执行情况

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

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

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

今年上半年，国内经济温和复苏，人工智能领域受到市场关注，生产端 PPI 略有压力，存款利率和 LPR 不同幅度下行，地产恢复不及预期，消费服务表现稍好。美联储仍然面对高通胀和超出预期的就业数据，加息预期迟迟无法消退，降息时间推后，但是科技股受到人工智能的发展影响表现较好；港股市场估值中枢没有大的变化，外资仍处于观望状态。本基金所投资的新能源车板块表现突出，互联网、消费、医药等多个行业表现一般。

后续投资策略上，基金坚持价值投资为理念，专注于基本面研究，以龙头股投资为导向，主要投资各行业龙头股票和高股息率股票。选择投资标的时更看重企业长期稳健业绩增长能力而不过分追求短期高业绩增长；挖掘不同行业内绩优股，分散投资降低风险。希望可以在一定程度上分散风险的情况下，取得所投资的一揽子企业良好业绩带来的收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末长城港股通价值精选混合 A 的基金份额净值为 0.7943 元,本报告期基金份额净值增长率为-4.92%,同期业绩比较基准收益率为 0.06%;截至本报告期末长城港股通价值精选混合 C 的基金份额净值为 0.7931 元,本报告期基金份额净值增长率为-10.36%,同期业绩比较基准收益率为-3.88%。

#### 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 2023 年下半年,国家层面对经济形式有了新的判断,政治局会议刺激性政策明显增多,在需求不足的背景下政策的对冲力度明显加强,我们判断中国经济的判断是 3 季度将会是产量、PPI 价格调整的结束,从 3 季度开始,产量与价格将同步向上攀升,上市企业的 ROE 将进入提升阶段,消费、服务和出行持续复苏,地产销售稳住并好转,经济活力回升,整体经济触底回升,资本市场将受到提振。海外方面,美国通胀比预期更强,就业数据强劲,美联储继续加息的空间又一次打开,港股市场流动性未见明显好转;俄乌冲突持续仍然是欧洲不稳定因素。当前港股估值已处于历史底部区间,国内经济恢复势头向上,并有可能在未来走出较长时间估值修复和上市公司业绩提振的温和趋势。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

本基金管理人成立了受托资产估值委员会,为基金估值业务的最高决策机构,由公司总经理、分管估值业务副总经理、督察长、投资总监、研究部总经理、运行保障部总经理、基金会计、基金经理和行业研究员、金融工程研究员等组成,公司监察稽核人员列席受托资产估值委员会。受托资产估值委员会负责制定、修订和完善基金估值政策和程序,定期对估值政策和程序进行评价,在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况后及时修订估值方法,以保证其持续适用。受托资产估值委员会的相关人员均具有一定年限的专业从业经验,具有良好的专业能力,并能在相关工作中保持独立性。基金经理作为估值委员会成员,凭借其丰富的专业技能和对市场产品的长期深入的跟踪研究,向受托资产估值委员会建议应采用的估值方法及合理的估值区间。基金经理有权出席估值委员会会议,但不得干涉估值委员会作出的决定及估值政策的执行。

本报告期内,参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署债券估值数据服

务协议、流通受限股票流动性折扣委托计算协议，由其按约定提供债券品种的估值数据及流通受限股票流动性折扣数据。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

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

本报告期内，本基金无需要说明的情况。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在本报告期内，本基金托管人在托管长城港股通价值精选多策略混合型证券投资基金过程中，严格遵守了《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有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

#### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

在本报告期内，本基金托管人按照相关法律法规、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支以及利润分配等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

#### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本基金托管人复核了本中期报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容，复核内容真实、准确和完整。

### § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

#### 6.1 资产负债表

会计主体：长城港股通价值精选多策略混合型证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	11,694,270.32	9,995,556.54
结算备付金		630.68	541,445.23
存出保证金		149,115.66	20,525.54
交易性金融资产	6.4.7.2	60,335,637.29	72,262,916.95

其中：股票投资		60,335,637.29	72,262,916.95
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		2,006,613.02	-
应收股利		126,825.27	9,689.11
应收申购款		85,183.66	161,407.04
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		74,398,275.90	82,991,540.41
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023年6月30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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	1,507,126.73
应付赎回款		616,136.31	97,324.46
应付管理人报酬		91,420.69	102,352.00
应付托管费		15,236.78	17,058.68
应付销售服务费		64.35	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	147,192.35	182,993.12
负债合计		870,050.48	1,906,854.99
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	92,571,638.79	97,062,581.49
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-19,043,413.37	-15,977,896.07
净资产合计		73,528,225.42	81,084,685.42
负债和净资产总计		74,398,275.90	82,991,540.41

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额总额 92,571,638.79 份，其中长城港股通价值精选混合 A 基金份额总额 92,417,524.80 份，基金份额净值 0.7943 元；长城港股通价值精选混合 C 基金份额总额 154,113.99 份，基金份额净值 0.7931 元。

## 6.2 利润表

会计主体：长城港股通价值精选多策略混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		-3,261,370.47	-17,361,394.87
1. 利息收入		24,631.15	34,481.20
其中：存款利息收入	6.4.7.13	24,631.15	34,481.20
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		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-5,113,780.50	-19,583,259.44
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-5,388,187.32	-20,411,517.23
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	-
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	274,406.82	828,257.79
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	1,805,824.80	2,174,889.91
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	21,954.08	12,493.46
<b>减：二、营业总支出</b>		745,674.56	959,190.67



1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	586,956.24	750,160.53
2. 托管费	6.4.10.2.2	97,826.03	125,026.73
3. 销售服务费		283.34	-
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	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.23	60,608.95	84,003.41
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-4,007,045.03	-18,320,585.54
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-4,007,045.03	-18,320,585.54
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-4,007,045.03	-18,320,585.54

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：长城港股通价值精选多策略混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	97,062,581.49	-	-15,977,896.07	81,084,685.42
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	97,062,581.49	-	-15,977,896.07	81,084,685.42
三、本期增减变	-4,490,942.70	-	-3,065,517.30	-7,556,460.00

动额(减少以“-”号填列)				
(一)、综合收益总额	-	-	-4,007,045.03	-4,007,045.03
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-4,490,942.70	-	941,527.73	-3,549,414.97
其中:1.基金申购款	9,060,427.16	-	-1,504,608.22	7,555,818.94
2.基金赎回款	-13,551,369.86	-	2,446,135.95	-11,105,233.91
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期末净资产(基金净值)	92,571,638.79	-	-19,043,413.37	73,528,225.42
项目	上年度可比期间			

	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	102,445,341.28	-	23,169,849.83	125,615,191.11
加:会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	102,445,341.28	-	23,169,849.83	125,615,191.11
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-9,976,924.86	-	-18,263,072.78	-28,239,997.64
(一)、综合收益总额	-	-	-18,320,585.54	-18,320,585.54
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-9,976,924.86	-	57,512.76	-9,919,412.10
其中:1.基金申购款	6,622,630.29	-	177,815.71	6,800,446.00
2.基金赎回款	-16,599,555.15	-	-120,302.95	-16,719,858.10
(三)、	-	-	-	-

本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)				
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	92,468,416.42	-	4,906,777.05	97,375,193.47

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

王军

邱春杨

赵永强

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

长城港股通价值精选多策略混合型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2019]344号文“关于准予长城港股通价值精选多策略混合型证券投资基金注册的批复”的核准，由长城基金管理有限公司自2019年5月20日至2019年6月21日向社会公开募集，募集期结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具安永华明（2019）验字第60737541\_H04号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于2019年6月26日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集的有效认购资金（本金）为人民币281,158,934.36元，在首次募集期间有效认购资金产生的利息为人民币43,497.01元，以上实收基金（本息）合计为人民币281,202,431.37元，折合281,202,431.37份基金份额。本基金的基金管理人为长城基金管理有限公司，注册登记机构为长城基金管理有限

公司，基金托管人为北京银行股份有限公司（以下简称“北京银行”）。

根据基金管理人长城基金管理有限公司于 2023 年 1 月 16 日发布的《关于长城港股通价值精选多策略混合型证券投资基金增设基金份额并相应修改基金合同及托管协议的公告》及《长城港股通价值精选多策略混合型证券投资基金基金合同》，本基金自 2023 年 1 月 18 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、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人申购基金份额时收取申购费用，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；在投资人申购基金份额时不收取申购费用，而从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 C 类基金份额。本基金 A 类基金份额和 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、存托凭证及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、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、分离交易可转债、中小企业私募债、央行票据、中期票据、短期融资券以及经法律法规或中国证监会允许投资的其他债券类金融工具）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、权证、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（但须符合中国证监会相关规定）。

本基金投资组合中股票投资比例为基金资产的 60%-95%，其中投资于港股通标的股票的比例不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持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%，其中现金不得包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等；权证、股指期货、国债期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

本基金的业绩比较基准为：恒生指数收益率（使用估值汇率折算）×60%+沪深 300 指数收益率×15%+中证全债指数收益率×25%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL

模板第 3 号<年度报告和中期报告>》以及中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及 2023 年 1 月 1 日至 6 月 30 日的经营成果和净值变动情况。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

除下文 6.4.5.1 会计政策变更的说明中涉及的变更外，本基金报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更说明。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无需要说明的重大会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

##### 6.4.6.1 印花税

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

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

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

##### 6.4.6.2 增值税

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

利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税。

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

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

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

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

#### 6.4.6.3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

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

#### 6.4.6.4 企业所得税

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

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

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

红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

#### 6.4.6.5 个人所得税

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

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

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

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

#### 6.4.6.6 境外投资

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

### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	11,694,270.32
等于：本金	11,693,245.49
加：应计利息	1,024.83
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	11,694,270.32

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	63,763,777.15	-	60,335,637.29	-3,428,139.86
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	63,763,777.15	-	60,335,637.29	-3,428,139.86

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：无。

##### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：无。

##### 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：无。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：无。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

## 6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。
----

## 6.4.7.5 债权投资

## 6.4.7.5.1 债权投资情况

注：无。

## 6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：无。

## 6.4.7.6 其他债权投资

## 6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：无。

## 6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：无。

## 6.4.7.7 其他权益工具投资

## 6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：无。

## 6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：无。

## 6.4.7.8 其他资产

注：无。

## 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1,391.27
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	91,253.11
其中：交易所市场	91,253.11
银行间市场	-
应付利息	-
预提审计费	14,876.39
预提信息披露费	39,671.58
合计	147,192.35

### 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

长城港股通价值精选混合 A

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	97,062,581.49	97,062,581.49
本期申购	8,442,845.50	8,442,845.50
本期赎回（以“-”号填列）	-13,087,902.19	-13,087,902.19
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	92,417,524.80	92,417,524.80

长城港股通价值精选混合 C

项目	本期 2023 年 1 月 18 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	-	-
本期申购	617,581.66	617,581.66
本期赎回（以“-”号填列）	-463,467.67	-463,467.67
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	154,113.99	154,113.99

注：本期申购包含基金转入的份额及金额；本期赎回包含基金转出的份额及金额。

### 6.4.7.11 其他综合收益

注：无。

### 6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

长城港股通价值精选混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-15,523,543.79	-454,352.28	-15,977,896.07
本期利润	-5,800,637.26	1,809,209.93	-3,991,427.33
本期基金份额交易产生的变动数	881,116.05	76,685.26	957,801.31
其中：基金申购款	-1,506,651.15	106,781.26	-1,399,869.89
基金赎回款	2,387,767.20	-30,096.00	2,357,671.20
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-20,443,065.00	1,431,542.91	-19,011,522.09

长城港股通价值精选混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	-12,232.57	-3,385.13	-15,617.70
本期基金份额交易产生的变动数	-22,087.11	5,813.53	-16,273.58
其中：基金申购款	-113,076.64	8,338.31	-104,738.33
基金赎回款	90,989.53	-2,524.78	88,464.75
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-34,319.68	2,428.40	-31,891.28

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
活期存款利息收入	19,283.84
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	4,716.65
其他	630.66
合计	24,631.15

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-5,388,187.32
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	-5,388,187.32

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出股票成交总额	126,518,829.92
减：卖出股票成本总额	131,374,411.12
减：交易费用	532,606.12
买卖股票差价收入	-5,388,187.32

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

#### 6.4.7.15 债券投资收益

##### 6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

注：无。

##### 6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：无。

##### 6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

##### 6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

#### 6.4.7.16 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：无。

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

注：无。

##### 6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：无。

##### 6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：无。

#### 6.4.7.17 贵金属投资收益

##### 6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：无。

##### 6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

##### 6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

##### 6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

#### 6.4.7.18 衍生工具收益

##### 6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：无。

## 6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无。

## 6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资产生的股利收益	274,406.82
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	274,406.82

## 6.4.7.20 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6月30日
1. 交易性金融资产	1,805,824.80
股票投资	1,805,824.80
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	1,805,824.80

## 6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
基金赎回费收入	21,954.08
合计	21,954.08

## 6.4.7.22 信用减值损失

注：无。

## 6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
审计费用	14,876.39

信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-
银行费用	3,441.93
深港通_证券组合费	2,619.05
合计	60,608.95

#### 6.4.7.24 分部报告

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期无与对本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
长城基金管理有限公司（“长城基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
北京银行股份有限公司（“北京银行”）	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

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日

	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例 (%)
长城证券	244,160,136.58	100.00	419,767,510.63	100.00

#### 6.4.10.1.2 债券交易

注：无。

#### 6.4.10.1.3 债券回购交易

注：无。

#### 6.4.10.1.4 权证交易

注：无。

#### 6.4.10.1.5 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6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
长城证券	197,102.59	100.00	91,253.11	100.00
关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
长城证券	342,965.66	100.00	136,371.55	100.00

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

(2) 该类席位租用协议服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和 market 信息服务。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6 月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	586,956.24	750,160.53
其中：支付销售机构的客户维护费	262,657.06	324,734.37

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

#### 6.4.10.2.2 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 6 月 30 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	97,826.03	125,026.73

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

#### 6.4.10.2.3 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 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	长城港股通价值精选混合 A	长城港股通价值精选混合 C	合计
长城基金管理有限公司	-	0.52	0.52
合计	-	0.52	0.52
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 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	长城港股通价值精选混合 A	长城港股通价值精选混合 C	合计
合计	-	-	-

注：销售服务费每日计算，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 0.5%。C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额基金资产净值的 0.5% 年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为前一日 C 类基金份额的基金资产净值

**6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易**

注：无。

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

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

注：无。

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

注：无。

**6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况**

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

份额单位：份

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	本期 2023年1月18日（基金合同生效日）至2023年6月30日
	长城港股通价值精选混合 A	长城港股通价值精选混合 C
基金合同生效日（2019年6月26日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	7,352,205.88	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	7,352,205.88	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	7.9422%	-
项目	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	上年度可比期间 -
	长城港股通价值精选混合 A	长城港股通价值精选混合 C
基金合同生效日（2019年6月26日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	7,352,205.88	-

报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	7,352,205.88	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	7.9510%	-

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

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。

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
北京银行	11,694,270.32	19,283.84	8,750,418.43	23,340.13

注：本基金的活期银行存款由基金托管人北京银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

注：本基金于本期未进行利润分配。

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

#### 6.4.8.2 资产负债表日后事项。

#### 6.4.12 期末（2023年6月30日）本基金持有的流通受限证券

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

注：无。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注:无。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任,或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息,导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券,且通过分散化投资以分散信用风险。本基金持有一家上市公司的证券,其市值(同一家公司在内地和香港同时上市的 A+H 股合并计算)不超过基金资产净值的 10%,且本基金管理人管理的全部基金持有一家发行的证券(同一家公司在内地和香港同时上市的 A+H 股合并计算),不超过该证券的 10%。

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

#### 6.4.13.3 流动性风险

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

##### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式

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

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

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金、债券投资及买入返售金融资产等。本基金管理人每日对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

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

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 6 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	11,694,270.32	-	-	-	-	-	11,694,270.32
结算备付金	630.68	-	-	-	-	-	630.68
存出保证金	149,115.66	-	-	-	-	-	149,115.66

交易性金融资产	-	-	-	-	-	-60,335,637.29	60,335,637.29
应收股利	-	-	-	-	-	126,825.27	126,825.27
应收申购款	-	-	-	-	-	85,183.66	85,183.66
应收清算款	-	-	-	-	-	2,006,613.02	2,006,613.02
资产总计	11,844,016.66	-	-	-	-	-62,554,259.24	74,398,275.90
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	616,136.31	616,136.31
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	91,420.69	91,420.69
应付托管费	-	-	-	-	-	15,236.78	15,236.78
应付销售服务费	-	-	-	-	-	64.35	64.35
其他负债	-	-	-	-	-	147,192.35	147,192.35
负债总计	-	-	-	-	-	870,050.48	870,050.48
利率敏感度缺口	11,844,016.66	-	-	-	-	-	-
上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	9,995,556.54	-	-	-	-	-	9,995,556.54
结算备付金	541,445.23	-	-	-	-	-	541,445.23
存出保证金	20,525.54	-	-	-	-	-	20,525.54
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-72,262,916.95	72,262,916.95
应收股利	-	-	-	-	-	9,689.11	9,689.11
应收申购款	-	-	-	-	-	161,407.04	161,407.04
资产总计	10,557,527.31	-	-	-	-	-72,434,013.10	82,991,540.41
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	97,324.46	97,324.46
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	102,352.00	102,352.00
应付托管费	-	-	-	-	-	17,058.68	17,058.68
应付清算款	-	-	-	-	-	1,507,126.73	1,507,126.73
其他负债	-	-	-	-	-	182,993.12	182,993.12
负债总计	-	-	-	-	-	1,906,854.99	1,906,854.99
利率敏感度缺口	10,557,527.31	-	-	-	-	-	-

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023 年 6 月 30 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
分析	利率上升 25 个基点	-	-
	利率下降 25 个基点	-	-

注：本基金于本期末及上年度末均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及上年度末基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金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。

于本期末及上年度末，本基金面临的外汇风险敞口及外汇风险敏感性分析列示如下：

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	57,066,127.29	-	57,066,127.29
资产合计	-	57,066,127.29	-	57,066,127.29
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇 风险敞口净额	-	57,066,127.29	-	57,066,127.29
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	72,232,695.71	-	72,232,695.71
资产合计	-	72,232,695.71	-	72,232,695.71
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇	-	72,232,695.71	-	72,232,695.71

风险敞口净额				
--------	--	--	--	--

#### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	在其他变量不变的假设下，汇率发生合理、可能的变动时		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023年6月30日）	上年度末（2022年12月31日）
分析	所有外币均相对人民币升值 5%	2,853,306.36	3,611,634.79
	所有外币均相对人民币贬值 5%	-2,853,306.36	-3,611,634.79

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金投资组合中股票投资比例为基金资产的 60%-95%，其中投资于港股通标的股票的比例不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持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%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等；权证、股指期货、国债期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

于本期末及上年度末，本基金面临的整体其他价格风险列示如下：

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日		上年度末 2022年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	60,335,637.29	82.06	72,262,916.95	89.12
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	60,335,637.29	82.06	72,262,916.95	89.12

注：“交易性金融资产—债券投资”含资产支持证券投资。

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	在其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时		
相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）		上年度末（2022年12月31日）
	本期末（2023年6月30日）		
分析	沪深 300 指数上升 5%	4,002,666.18	5,586,284.79
	沪深 300 指数下降 5%	-4,002,666.18	-5,586,284.79

#### 6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

注：无。

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
第一层次	60,335,637.29	72,262,916.95

第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	60,335,637.29	72,262,916.95

#### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

无。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

注：无。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	60,335,637.29	81.10
	其中：股票	60,335,637.29	81.10
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	11,694,901.00	15.72
8	其他各项资产	2,367,737.61	3.18
9	合计	74,398,275.90	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	3,269,510.00	4.45
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	3,269,510.00	4.45

### 7.2.2 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（%）
A 基础材料	2,587,859.57	3.52
B 消费者非必需品	16,251,916.64	22.10
C 消费者常用品	2,887,641.36	3.93
D 能源	-	-
E 金融	1,312,899.52	1.79
F 医疗保健	10,112,691.54	13.75
G 工业	3,203,788.30	4.36
H 信息科技	11,445,459.72	15.57
I 电信服务	5,503,114.22	7.48
J 公用事业	-	-
K 房地产	3,760,756.42	5.11
合计	57,066,127.29	77.61

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	02015	理想汽车-W	45,000	5,621,773.05	7.65
2	00700	腾讯控股	18,000	5,503,114.22	7.48
3	03690	美团-W	40,300	4,544,153.61	6.18
4	00968	信义光能	430,000	3,587,885.17	4.88
5	01211	比亚迪股份	15,000	3,457,425.00	4.70
6	02273	固生堂	71,000	3,253,390.83	4.42
7	01109	华润置地	100,000	3,060,973.60	4.16
8	00981	中芯国际	160,000	3,009,342.72	4.09
9	02367	巨子生物	90,000	2,887,641.36	3.93
10	01548	金斯瑞生物科技	150,000	2,434,027.20	3.31
11	00669	创科实业	30,000	2,355,197.91	3.20
12	02382	舜宇光学科技	30,000	2,161,582.11	2.94
13	300750	宁德时代	9,000	2,059,110.00	2.80
14	03998	波司登	600,000	1,825,520.40	2.48
15	00013	和黄医药	100,000	1,700,131.12	2.31
16	00992	联想集团	200,000	1,506,515.32	2.05
17	09995	荣昌生物-B	45,000	1,421,001.68	1.93
18	06865	福莱特玻璃	55,000	1,356,463.08	1.84
19	03968	招商银行	40,000	1,312,899.52	1.79
20	01378	中国宏桥	210,000	1,231,396.49	1.67
21	002050	三花智控	40,000	1,210,400.00	1.65
22	01347	华虹半导体	50,000	1,180,134.40	1.61
23	00558	力劲科技	130,000	848,590.39	1.15
24	09992	泡泡玛特	50,000	803,044.58	1.09
25	06049	保利物业	20,000	699,782.82	0.95
26	09926	康方生物	20,000	651,839.86	0.89
27	01789	爱康医疗	100,000	626,946.40	0.85
28	02359	药明康德	440	25,354.45	0.03

### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	00981	中芯国际	8,631,253.63	10.64
2	06098	碧桂园服务	5,181,232.69	6.39
3	03998	波司登	4,916,027.71	6.06
4	02367	巨子生物	4,413,894.50	5.44
5	03690	美团-W	3,853,957.96	4.75

6	02269	药明生物	3,632,005.12	4.48
7	00968	信义光能	3,560,995.88	4.39
8	02331	李宁	3,489,923.42	4.30
9	09995	荣昌生物-B	3,459,226.50	4.27
10	02273	固生堂	3,390,885.12	4.18
11	01109	华润置地	3,216,662.63	3.97
12	600276	恒瑞医药	3,137,031.35	3.87
13	02020	安踏体育	2,894,799.95	3.57
14	02400	心动公司	2,865,285.55	3.53
15	00941	中国移动	2,594,785.25	3.20
16	01801	信达生物	2,406,265.99	2.97
17	00013	和黄医药	2,281,828.34	2.81
18	00669	创科实业	2,207,968.98	2.72
19	02382	舜宇光学科技	2,138,866.64	2.64
20	600809	山西汾酒	2,064,994.00	2.55
21	300750	宁德时代	2,057,041.00	2.54
22	02096	先声药业	2,018,593.26	2.49
23	01548	金斯瑞生物科技	1,747,269.88	2.15
24	02333	长城汽车	1,720,281.13	2.12
25	09868	小鹏汽车-W	1,714,536.04	2.11
26	09992	泡泡玛特	1,653,217.55	2.04
27	00700	腾讯控股	1,640,591.05	2.02
28	02015	理想汽车-W	1,631,782.56	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。

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	02269	药明生物	6,895,366.87	8.50
2	00981	中芯国际	6,150,114.38	7.58
3	02015	理想汽车-W	5,647,813.02	6.97
4	03968	招商银行	5,061,532.47	6.24
5	02313	申洲国际	4,517,440.09	5.57
6	06098	碧桂园服务	4,328,426.27	5.34
7	02020	安踏体育	4,191,465.81	5.17
8	03998	波司登	4,170,770.22	5.14
9	09995	荣昌生物-B	4,161,453.09	5.13
10	02331	李宁	3,263,930.36	4.03
11	600276	恒瑞医药	3,188,676.00	3.93
12	00700	腾讯控股	3,158,625.43	3.90
13	02359	药明康德	2,937,542.05	3.62
14	02400	心动公司	2,849,336.21	3.51

15	03808	中国重汽	2,835,182.97	3.50
16	00941	中国移动	2,623,986.45	3.24
17	02382	舜宇光学科技	2,459,400.24	3.03
18	03690	美团-W	2,307,292.97	2.85
19	01268	美东汽车	2,286,557.67	2.82
20	01801	信达生物	2,121,667.09	2.62
21	09868	小鹏汽车-W	2,082,776.62	2.57
22	01951	锦欣生殖	2,079,206.53	2.56
23	09922	九毛九	1,973,891.73	2.43
24	06078	海吉亚医疗	1,955,264.26	2.41
25	09992	泡泡玛特	1,954,081.78	2.41
26	600809	山西汾酒	1,904,934.00	2.35
27	00763	中兴通讯	1,817,618.49	2.24
28	02096	先声药业	1,770,768.66	2.18
29	01347	华虹半导体	1,695,484.57	2.09

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

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	117,641,306.66
卖出股票收入（成交）总额	126,518,829.92

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

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：无。

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

注：无。

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

注：无。

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

注：无。

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

注：无。

#### 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

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。

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

无。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1 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。

### 7.12.2 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。

### 7.12.3 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	149,115.66
2	应收清算款	2,006,613.02
3	应收股利	126,825.27
4	应收利息	-
5	应收申购款	85,183.66
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,367,737.61

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：无。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：无。

### 7.12.6 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。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
长城港股通价值精选混合 A	3,785	24,416.78	7,352,205.88	7.96	85,065,318.92	92.04
长城港股通价值精选混合 C	83	1,856.80	5,928.61	3.85	148,185.38	96.15
合计	3,868	23,932.69	7,358,134.49	7.95	85,213,504.30	92.05

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

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	长城港股通价值精选混合 A	1,541,122.75	1.6676
	长城港股通价值精选混合 C	339.06	0.2200
	合计	1,541,461.81	1.6652

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	长城港股通价值精选混合 A	0~10
	长城港股通价值精选混合 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	长城港股通价值精选混合 A	0~10
	长城港股通价值精选混合 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 开放式基金份额变动

单位：份

项目	长城港股通价值精选混合 A	长城港股通价值精选混合 C
基金合同生效日 (2019 年 6 月 26 日) 基金份额总额	281,202,431.37	-
本报告期期初基金份额总额	97,062,581.49	-
本报告期基金总申购份额	8,442,845.50	617,581.66
减：本报告期基金总赎回份额	13,087,902.19	463,467.67
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	92,417,524.80	154,113.99

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

#### 1、基金管理人重大人事变动：

自 2023 年 2 月 6 日起，张勇先生担任公司副总经理。

自 2023 年 4 月 10 日起，何小乐女士担任公司副总经理。

#### 2、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：

本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本基金本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略无改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

在本报告期内，为本基金提供审计服务的会计师事务所为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）。

## 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

### 10.6.1 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。

### 10.6.2 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。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 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	244,160,136.58	100.00	197,102.59	100.00	-

注：1、报告期内租用证券公司席位的变更情况：

本报告期内无交易单元增减变化，截止报告期末共 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。

### 10.7.2 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	-	-	-	-	-	-

## 10.8 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	关于长城港股通价值精选多策略混合型证券投资基金增设基金份额并相应修改基金合同及托管协议的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 1 月 16 日
2	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
3	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
4	关于长城港股通基金 2023 年新增港股通交易日调整申购、赎回、转换、定投业务安排的公告	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

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

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

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。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无
---

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- (一) 中国证监会准予长城港股通价值精选多策略混合型证券投资基金注册的文件
- (二) 《长城港股通价值精选多策略混合型证券投资基金基金合同》
- (三) 《长城港股通价值精选多策略混合型证券投资基金招募说明书》
- (四) 《长城港股通价值精选多策略混合型证券投资基金托管协议》
- (五) 基金管理人业务资格批件、营业执照
- (六) 基金托管人业务资格批件、营业执照
- (七) 中国证监会规定的其他文件

## 12.2 存放地点

基金管理人及基金托管人住所

## 12.3 查阅方式

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

咨询电话：0755-29279188

客户服务电话：400-8868-666

网站：[www.ccfund.com.cn](http://www.ccfund.com.cn)