

长城核心优选灵活配置混合型证券投资基金
2024 年中期报告

2024 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：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2024 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 08 月 30 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 2024 年 01 月 01 日起至 2024 年 06 月 30 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 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	9
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	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
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	12
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
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	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	38
7.1 期末基金资产组合情况	38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	39
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	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	45
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	47

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	47
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	47
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	47
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	47
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
§ 8 基金份额持有人信息	48
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	49
§ 9 开放式基金份额变动	49
§ 10 重大事件揭示	50
10.1 基金份额持有人大会决议	50
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	50
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	50
10.4 基金投资策略的改变	50
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	50
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	55
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	55
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	55
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	56
§ 12 备查文件目录	56
12.1 备查文件目录	56
12.2 存放地点	56
12.3 查阅方式	56

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	长城核心优选灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	长城核心优选混合	
基金主代码	000030	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019 年 5 月 24 日	
基金管理人	长城基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	105,827,848.33 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	长城核心优选混合 A	长城核心优选混合 C
下属分级基金的交易代码	000030	019274
报告期末下属分级基金的份额总额	105,826,949.09 份	899.24 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用“核心—卫星”投资策略，在控制风险的前提下，把握中国经济成长带来的投资机遇，力求实现基金资产长期稳定的增值。
投资策略	<p>1. 大类资产配置策略</p> <p>在大类资产配置中，本基金将采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济运行周期、财政及货币政策、利率走势、资金供需情况、证券市场估值水平等可能影响证券市场的重要因素进行研究和预测，分析股票市场、债券市场、货币市场三大类资产的预期风险和收益，适时动态地调整基金资产在股票、债券、现金大类资产的投资比例，以规避市场系统性风险及提高基金收益的目的。</p> <p>2. 股票投资策略</p> <p>本基金股票投资策略采用“核心—卫星”投资策略，同时，将采用“优化动态技术”对核心组合和卫星组合的配置比例进行辅助决策。优化动态技术是固定比例组合保险策略(CPPI)的发展，主要根据卫星组合相对于核心组合的表现来确定股票资产在核心组合和卫星组合之间的投资比例。其中投资核心组合的市值不低于本基金股票市值的 60%。</p> <p>3. 债券投资策略</p> <p>当股票市场投资风险和不确定性增大时，本基金将择机把部分资产转换为债券资产，或通过参与一级债券市场交易获取低风险收益，以此降低基金组合资产风险水平。本投资组合对于债券的投资以久期管理策略为基础，在此基础上结合收益率曲线策略、个券选择策略、跨市场套利策略对债券资产进行动态调整，并择机把握市场低效或失效情况下的交易机会。</p>

业绩比较基准	55%×沪深 300 指数收益率+45%×中债总财富指数收益率
风险收益特征	本基金是混合型证券投资基金，其长期平均风险和预期收益率高于债券型基金、货币市场基金，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	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	祝函	王小飞
	联系电话	0755-29279006	021-60637103
	电子邮箱	zhuhan@ccfund.com.cn	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		400-8868-666	021-60637228
传真		0755-29279000	021-60635778
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 25 号
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	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		518046	100033
法定代表人		王军	张金良

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金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(2024 年 1 月 1 日-2024 年 6 月 30 日)	
	长城核心优选混合 A	长城核心优选混合 C
本期已实现收益	-1,801,385.34	-73.39
本期利润	-1,613,360.68	-33.82
加权平均基金份 额本期利润	-0.0144	-0.0367

本期加权平均净 值利润率	-1.44%	-3.74%
本期基金份额净 值增长率	-1.35%	-1.65%
3.1.2 期末数 据和指标	报告期末(2024年6月30日)	
期末可供分配利 润	48,689,782.87	-4.01
期末可供分配基 金份额利润	0.4601	-0.0045
期末基金资产净 值	105,857,257.45	895.23
期末基金份额净 值	1.0003	0.9955
3.1.3 累计期 末指标	报告期末(2024年6月30日)	
基金份额累计净 值增长率	-4.59%	-5.83%

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

长城核心优选混合 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	-1.95%	0.61%	-1.41%	0.26%	-0.54%	0.35%
过去三个月	-0.64%	0.71%	-0.36%	0.40%	-0.28%	0.31%
过去六个月	-1.35%	1.02%	2.33%	0.48%	-3.68%	0.54%
过去一年	-10.85%	0.89%	-2.84%	0.47%	-8.01%	0.42%

过去三年	-42.74%	1.33%	-13.77%	0.57%	-28.97%	0.76%
自基金合同生效起至今	-4.59%	1.35%	11.52%	0.62%	-16.11%	0.73%

长城核心优选混合 C

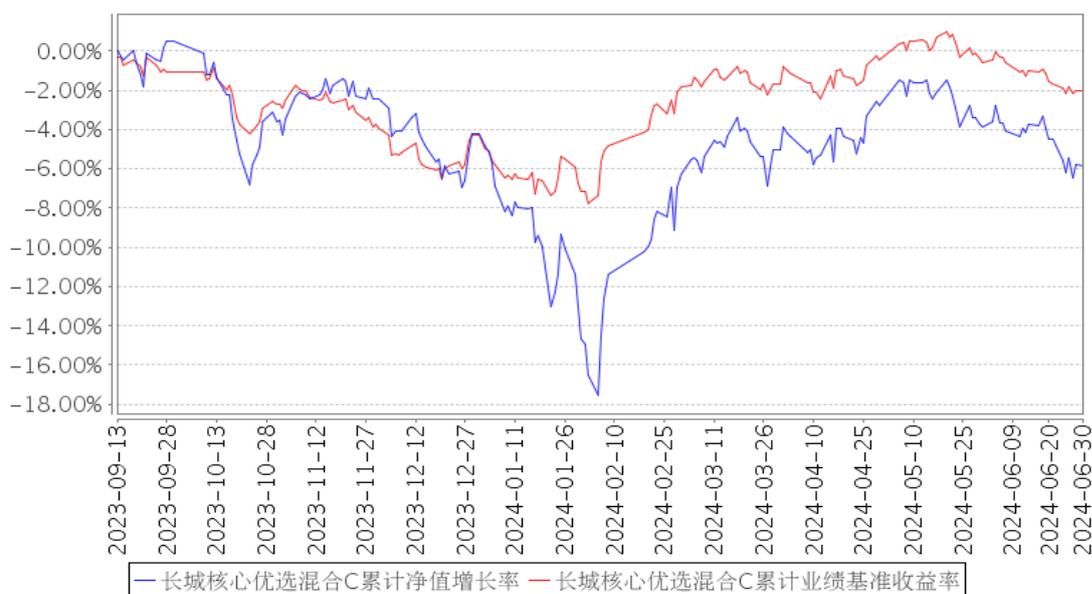
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-2.00%	0.61%	-1.41%	0.26%	-0.59%	0.35%
过去三个月	-0.80%	0.70%	-0.36%	0.40%	-0.44%	0.30%
过去六个月	-1.65%	1.02%	2.33%	0.48%	-3.98%	0.54%
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	-5.83%	0.91%	-2.03%	0.46%	-3.80%	0.45%

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

长城核心优选混合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



长城核心优选混合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股票等权益类投资占基金资产的比例范围为 0-95%，债券等固定收益类投资占基金资产的比例范围为 0-95%；权证投资占基金资产净值的比例范围为 0-3%；现金或者到期日在 1 年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款。

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

§ 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（以下简称“公司”）成立于 2001 年 12 月 27 日，是经中国证监会批准设立的第十五家公募基金管理公司，由长城证券有限责任公司（现长城证券股份有限公司）、东方证券有限责任公司（现东方证券股份有限公司）、中原信托投资有限公司（现中原信托有限公司）、西北证券有限责任公司和天津北方国际信托投资公司（现北方国际信托股份有限公司）共同出资设立，初始注册资本为人民币壹亿元。

2007 年 5 月 21 日，经中国证监会批准，公司股权结构变更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%），该股权结构稳定不变至今。2007 年 10 月 12 日，经中国证监会批准，公司注册资本增至人民币壹亿伍仟万元。

公司具有基金管理资格证书、特定（定向）客户资产管理业务资格、受托管理保险资金业务

资格、合格境内机构投资者（QDII）资格、公募 REITs 业务资质等。截至 2024 年 6 月 30 日，公司旗下共管理 106 只开放式基金，产品线涵盖货币型、债券型、混合型、股票型、指数型、养老 FOF 以及 QDII 等各个类型，曾多次获得金牛奖、英华奖、明星基金奖等业内大奖。

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		
向晨	本基金的基金经理	2022 年 10 月 28 日	-	5 年	男，中国籍，硕士，2019 年 8 月毕业后加入长城基金管理有限公司，历任量化研究员、投资经理助理。自 2023 年 9 月至今任“长城中证医药卫生指数增强型证券投资基金”基金经理。自 2022 年 10 月至今任“长城核心优选灵活配置混合型证券投资基金”基金经理。

注：①上述任职日期、离任日期根据公司做出决定的任免日期填写。

②证券从业年限的计算方式遵从从业人员的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同和其他有关法律法规的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制和防范风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大的利益，未出现投资违反法律法规、基金合同约定和相关规定的情况，无因公司未勤勉尽责或操作不当而导致基金财产损失的情况，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

市场行情方面：上半年市场表现一波三折，整体呈现宽幅波动的状态。同时市场赚钱效应比较集中，主要集中在大盘价值板块，其余个股整体表现较弱，但部分个股在年后有一波较大幅度的反弹。宽基方面：偏大盘股的上证 50、沪深 300 收正；中证 500、中证 1000 等中小市值宽基整体有较大幅度的调整。资金层面：北向资金一季度净流入，但二季度净流出，整体上半年呈现小幅净流入状态。风格上看：偏防御性的资产仍然表现较好，低估值、低波动标的仍然保持较为显著的超额收益；市值方面，大市值股票表现明显优于小市值股票，基本面相对稳健的股票上半年表现占优。

本基金上半年跟住了市场主要趋势，相对偏股混合型基金指数、灵活配置型基金指数有一定超额收益。

具体运作上，本基金基于长城基金量化投资研究平台的研究成果，在上半年采用“核心-卫星”投资策略，同时动态优化调整核心组合及卫星配置比例。基金持仓整体风格、行业分布较为均衡，主要以各行业市值较大的公司构成的股票池为锚，通过结合量化投资技术手段与主动逻辑分析，寻找基本面与技术面相互共振且估值处于相对合理位置的行业与个股，在预期收益高的行业和个股上进行适度偏离，力争在波动、最大回撤可控的前提下，为投资者提供可持续的超额收益以及同仓位产品中较高的收益风险比。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末长城核心优选混合 A 的基金份额净值为 1.0003 元，本报告期基金份额净值增长率为-1.35%，同期业绩比较基准收益率为 2.33%；截至本报告期末长城核心优选混合 C 的基金份额净值为 0.9955 元，本报告期基金份额净值增长率为-1.65%，同期业绩比较基准收益率为 2.33%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年由于投资者对确定性的极致追求以及增量资金的投资审美，防御类资产关注度空前，低估值高股息风格与景气成长等风格短期收益分化度达到历史较高水平。展望下半年，随着上半年悲观情绪一定程度的释放、成交量与市场点位短期磨底以及新国九条后 A 股整体质量的提升，预计不同风格间会产生一定程度的均值回复效应。考虑到下半年 A 股上市公司盈利能力有一定程度修复以及全球降息周期的开启，结构上预计将从抱团防御类资产扩散到高景气、高盈利能力的方向。

在具体模型构建以及风险模型的设计上，我们将延续多策略配置的框架，继续维持均衡配置，组合层面控制波动和收益的平衡。

具体产品运作上，我们继续采用“核心-卫星”投资策略，同时根据市场运行情况动态优化调整核心组合及卫星配置比例。预计后续基金持仓将继续保持均衡，投资标的上主要以各行业市值较大的公司构成的股票池为锚，在预期收益高的行业和个股上进行适度偏离，力争在波动可控的前提下，实现一定超额收益并提升产品收益风险比。

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、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

本基金本报告期末未进行利润分配，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合规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人按照国家有关规定、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、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

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

本托管人复核审查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。

§ 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：长城核心优选灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	9,784,573.93	21,374,541.86
结算备付金		460,896.05	682,741.36
存出保证金		27,492.19	45,598.40
交易性金融资产	6.4.7.2	94,303,393.47	99,403,296.78
其中：股票投资		89,286,300.32	99,403,296.78
基金投资		-	-
债券投资		5,017,093.15	-
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		1,957,459.58	-
应收股利		-	-
应收申购款		2,515.26	9,135.56
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		106,536,330.48	121,515,313.96
负债和净资产	附注号	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
负 债：			
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		-	2,547,045.36
应付赎回款		68,171.09	68,320.38
应付管理人报酬		106,398.97	120,141.59
应付托管费		17,733.18	20,023.60
应付销售服务费		0.30	0.51
应付投资顾问费		-	-
应交税费		94,932.32	94,932.32
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	390,941.94	631,967.21
负债合计		678,177.80	3,482,430.97
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	57,168,373.82	62,881,446.42
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	48,689,778.86	55,151,436.57
净资产合计		105,858,152.68	118,032,882.99
负债和净资产总计		106,536,330.48	121,515,313.96

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额总额 105,827,848.33 份，其中长城核心优选混合 A 基金份额总额 105,826,949.09 份，基金份额净值 1.0003 元；长城核心优选混合 C 基金份额总额 899.24 份，基金份额净值 0.9955 元。

6.2 利润表

会计主体：长城核心优选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024年1月1日至2024 年6月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023 年6月30日
一、营业总收入		-758,902.14	-2,968,690.97
1. 利息收入		29,835.93	36,877.52
其中：存款利息收入	6.4.7.13	28,232.36	36,877.52
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		1,603.57	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-977,925.70	-7,738,978.91
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-2,432,614.66	-9,118,760.37
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	58,248.40	-
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	1,396,440.56	1,379,781.46
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	188,064.23	4,730,099.67
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	1,123.40	3,310.75
减：二、营业总支出		854,492.36	1,357,507.77
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	665,805.16	1,097,227.96
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	110,967.54	182,871.35
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	2.66	-
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	77, 717. 00	77, 408. 46
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-1, 613, 394. 50	-4, 326, 198. 74
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-1, 613, 394. 50	-4, 326, 198. 74
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-1, 613, 394. 50	-4, 326, 198. 74

6.3 净资产变动表

会计主体：长城核心优选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	62, 881, 446. 42	-	55, 151, 436. 57	118, 032, 882. 99
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	62, 881, 446. 42	-	55, 151, 436. 57	118, 032, 882. 99
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-5, 713, 072. 60	-	-6, 461, 657. 71	-12, 174, 730. 31
（一）、综合收益总额	-	-	-1, 613, 394. 50	-1, 613, 394. 50
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-5, 713, 072. 60	-	-4, 848, 263. 21	-10, 561, 335. 81
其中：1. 基金申购款	770, 573. 70	-	649, 151. 62	1, 419, 725. 32
2. 基金赎回款	-6, 483, 646. 30	-	-5, 497, 414. 83	-11, 981, 061. 13
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净	-	-	-	-

资产变动（净资产减少以“-”号填列）				
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	57,168,373.82	-	48,689,778.86	105,858,152.68
项目	上年度可比期间			
	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	69,770,143.45	-	79,575,766.48	149,345,909.93
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	69,770,143.45	-	79,575,766.48	149,345,909.93
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-2,512,094.02	-	-7,128,535.08	-9,640,629.10
（一）、综合收益总额	-	-	-4,326,198.74	-4,326,198.74
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-2,512,094.02	-	-2,802,336.34	-5,314,430.36
其中：1. 基金申购款	1,026,249.65	-	1,192,222.68	2,218,472.33
2. 基金赎回款	-3,538,343.67	-	-3,994,559.02	-7,532,902.69
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-

四、本期期末净资产	67,258,049.43	-	72,447,231.40	139,705,280.83
-----------	---------------	---	---------------	----------------

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：

<u>王军</u>	<u>邱春杨</u>	<u>赵永强</u>
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

长城核心优选灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)由长城久利保本混合型证券投资基金于 2019 年 5 月 24 日转型而来。长城久利保本混合型证券投资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[2012]1706 号文“关于核准长城久利保本混合型证券投资基金募集的批复”的核准,由长城基金管理有限公司作为发起人向社会公开募集,并向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2013 年 4 月 18 日生效,长城久利保本混合型证券投资基金首次设立募集的规模为 937,036,422.41 份基金份额。长城久利保本混合型证券投资基金为契约型开放式,存续期限不定。基金管理人为长城基金管理有限公司,注册登记机构为长城基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司(以下简称“中国建设银行”)。

根据《长城久利保本混合型证券投资基金基金合同》的有关约定,长城久利保本混合型证券投资基金保本周期最长为 3 年,2019 年 5 月 20 日为本基金第二个保本周期到期日,长城久利保本混合型证券投资基金第二个保本周期到期时,由于未能符合避险策略基金存续条件,根据《长城久利保本混合型证券投资基金基金合同》的约定转型为长城核心优选灵活配置混合型证券投资基金。在长城久利保本混合型证券投资基金的到期期间内,即自 2019 年 5 月 20 日(含)起至 2019 年 5 月 23 日(含)止,基金接受赎回、转换转出申请,不接受申购和转换转入申请。自 2019 年 5 月 24 日起,长城久利保本混合型证券投资基金转型为长城核心优选灵活配置混合型证券投资基金。转型后的《长城核心优选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》自该日起生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定。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,基金托管人为中国建设银行。

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)、债券、权证、银行存款、货币市场工具以及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的相关规定。

本基金股票等权益类投资占基金资产的比例范围为 0-95%，债券等固定收益类投资占基金资产的比例范围为 0-95%；权证投资占基金资产净值的比例范围为 0-3%；现金或者到期日在 1 年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。其中，现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金的业绩比较基准为：55%×沪深 300 指数收益率+45%×中债总财富指数收益率。

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 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2024 年 1 月 1 日起至 2024 年 6 月 30 日止期间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

本基金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。

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

本基金本报告期无需要说明的会计政策变更。

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

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

(2) 增值税及附加 根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税。 根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入。 根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入。 根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人。 根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对证券投资基金在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。增值税应税行为的销售额根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定确定。 增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按 7%、3% 和 2% 的比例缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

(3) 企业所得税 根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税。 根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税。根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(4) 个人所得税 根据财政部、

国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税。根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	9,784,573.93
等于：本金	9,783,508.74
加：应计利息	1,065.19
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	9,784,573.93

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	89,503,253.33	-	89,286,300.32	-216,953.01	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	5,002,120.00	14,593.15	5,017,093.15	380.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	5,002,120.00	14,593.15	5,017,093.15	380.00
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	94,505,373.33	14,593.15	94,303,393.47	-216,573.01	

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 2024年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	8.53
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	313,856.41
其中：交易所市场	313,856.41
银行间市场	-
应付利息	-
预提审计费	17,404.66
预提信息披露费	59,672.34
合计	390,941.94

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

长城核心优选混合 A

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	116,401,316.45	62,879,857.72
本期申购	1,425,494.02	770,050.33
本期赎回（以“-”号填列）	-11,999,861.38	-6,482,433.47
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	105,826,949.09	57,167,474.58

长城核心优选混合 C

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,588.70	1,588.70
本期申购	523.37	523.37
本期赎回（以“-”号填列）	-1,212.83	-1,212.83
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	899.24	899.24

注：本期申购包含基金转入份额及金额，本期赎回包含基金转出份额及金额。

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

长城核心优选混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	65,204,584.55	-10,053,167.42	55,151,417.13
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	65,204,584.55	-10,053,167.42	55,151,417.13
本期利润	-1,801,385.34	188,024.66	-1,613,360.68
本期基金份额交易产生的变动数	-5,537,619.27	689,345.69	-4,848,273.58
其中：基金申购款	737,100.50	-87,950.72	649,149.78
基金赎回款	-6,274,719.77	777,296.41	-5,497,423.36
本期已分配利润	-	-	-
本期末	57,865,579.94	-9,175,797.07	48,689,782.87

长城核心优选混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	156.68	-137.24	19.44
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	156.68	-137.24	19.44
本期利润	-73.39	39.57	-33.82

本期基金份额交易产生的变动数	-9.39	19.76	10.37
其中：基金申购款	38.95	-37.11	1.84
基金赎回款	-48.34	56.87	8.53
本期已分配利润	-	-	-
本期末	73.90	-77.91	-4.01

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
活期存款利息收入	23,570.24	
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	4,390.73	
其他	271.39	
合计	28,232.36	

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	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
股票投资收益——买卖股票差价收入	-2,432,614.66	
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	-2,432,614.66	

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	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
卖出股票成交总额	362,395,889.63	
减：卖出股票成本总额	363,924,096.61	
减：交易费用	904,407.68	
买卖股票差价收入	-2,432,614.66	

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

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
债券投资收益——利息收入	65,367.40
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-7,119.00
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	58,248.40

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	7,771,103.57
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	7,668,239.00
减：应计利息总额	109,983.57
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	-7,119.00

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
	2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,396,440.56
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	1,396,440.56

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
1. 交易性金融资产	188,064.23
股票投资	187,684.23
债券投资	380.00
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	188,064.23

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	1,123.40
合计	1,123.40

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
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
审计费用	17,404.66
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行费用	280.00
其他	360.00
合计	77,717.00

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
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	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 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023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	87,677,018.54	12.25	421,945,329.55	26.93

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比 例（%）	成交金额	占当期债券 成交总额的比 例（%）
长城证券	2,058,100.00	10.12	-	-

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 2024年1月1日至2024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	82,932.55	12.24	24,998.10	7.96

关联方名称	上年度可比期间 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	392,959.85	26.93	-	-

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

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

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 2024年1月1日至2024年6 月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	665,805.16	1,097,227.96
其中：应支付销售机构的客户维护 费	217,622.73	368,026.88
应支付基金管理人的净管理费	448,182.43	729,201.08

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

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6 月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年 6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	110,967.54	182,871.35

注：

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

$$H = E \times \text{托管费率} \div \text{当年天数}$$
H 为每日应计提的基金托管费 E 为前一日的基金资产净值

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

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		
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	长城核心优选混合 A	长城核心优选混合 C	合计
长城基金管理有限公司	-	1.32	1.32
合计	-	1.32	1.32
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	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		
	长城核心优选混合 A	长城核心优选混合 C	合计
合计	-	-	-

注: 基金销售服务费每日计提, 按月支付。本基金 A 类基金份额不收取销售服务费, C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.6%。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 0.6%年费率计提。计算方法如下:

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

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为前一日 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

注: 本基金的基金管理人于本期及上年度可比期间未运用固有资金投资于本基金份额, 于本期末

及上年度可比期末亦未持有本基金份额。

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 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023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
中国建设银行	9,784,573.93	23,570.24	12,096,747.25	28,284.84

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，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（2024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

截至本报告期末 2024 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 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 2024 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。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券市值的 10%。

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

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，并按照合约规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 2024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							
货币资金	9,784,573.93	-	-	-	-	-	9,784,573.93
结算备付金	460,896.05	-	-	-	-	-	460,896.05
存出保证金	27,492.19	-	-	-	-	-	27,492.19
交易性金融资产	-	-5,017,093.15	-	-	-89,286,300.32	-	94,303,393.47
应收申购款	-	-	-	-	-	2,515.26	2,515.26
应收清算款	-	-	-	-	-	1,957,459.58	1,957,459.58
资产总计	10,272,962.17	-5,017,093.15	-	-	-91,246,275.16	-	106,536,330.48

负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	68,171.09	68,171.09
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	106,398.97	106,398.97
应付托管费	-	-	-	-	-	17,733.18	17,733.18
应付销售服务费	-	-	-	-	-	0.30	0.30
应交税费	-	-	-	-	-	94,932.32	94,932.32
其他负债	-	-	-	-	-	390,941.94	390,941.94
负债总计	-	-	-	-	-	678,177.80	678,177.80
利率敏感度缺口	10,272,962.17		-5,017,093.15				
上年度末 2023 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	21,374,541.86	-	-	-	-	-	21,374,541.86
结算备付金	682,741.36	-	-	-	-	-	682,741.36
存出保证金	45,598.40	-	-	-	-	-	45,598.40
交易性金融资产	-	-	-	-	-	99,403,296.78	99,403,296.78
应收申购款	-	-	-	-	-	9,135.56	9,135.56
资产总计	22,102,881.62	-	-	-	-	99,412,432.34	121,515,313.96
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	68,320.38	68,320.38
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	120,141.59	120,141.59
应付托管费	-	-	-	-	-	20,023.60	20,023.60
应付清算款	-	-	-	-	-	2,547,045.36	2,547,045.36
应付销售服务费	-	-	-	-	-	0.51	0.51
应交税费	-	-	-	-	-	94,932.32	94,932.32
其他负债	-	-	-	-	-	631,967.21	631,967.21
负债总计	-	-	-	-	-	3,482,430.97	3,482,430.97
利率敏感度缺口	22,102,881.62	-	-	-	-		

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024 年 6 月 30 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）

	市场利率下降 25 个基点	10,235.60	-
	市场利率上升 25 个基点	-10,194.00	-
	市场利率上升 25 个基点	-10,194.00	-

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。本基金持有的金融工具以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

注：无。

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

注：无。

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其他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和债券，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：本基金股票等权益类投资占基金资产的比例范围为 0-95%，债券等固定收益类投资占基金资产的比例范围为 0-95%；权证投资占基金资产净值的比例范围为 0-3%；现金或者到期日在 1 年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款。

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 2024年6月30日		上年度末 2023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	89,286,300.32	84.35	99,403,296.78	84.22

交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	5,017,093.15	4.74	-	-
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	94,303,393.47	89.08	99,403,296.78	84.22

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024 年 6 月 30 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数上升 5%	4,997,800.66	4,455,255.76
	沪深 300 指数下降 5%	-4,997,800.66	-4,455,255.76

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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
---------------	------------------------	--------------------------

第一层次	89,286,300.32	99,341,556.83
第二层次	5,017,093.15	-
第三层次	-	61,739.95
合计	94,303,393.47	99,403,296.78

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	89,286,300.32	83.81
	其中：股票	89,286,300.32	83.81
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	5,017,093.15	4.71
	其中：债券	5,017,093.15	4.71
	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	10,245,469.98	9.62
8	其他各项资产	1,987,467.03	1.87

9	合计	106,536,330.48	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	481,602.00	0.45
B	采矿业	8,089,286.00	7.64
C	制造业	61,990,182.06	58.56
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,904,578.00	5.58
E	建筑业	1,043,435.00	0.99
F	批发和零售业	1,302,540.00	1.23
G	交通运输、仓储和邮政业	1,206,420.00	1.14
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,218,129.26	3.98
J	金融业	3,036,323.00	2.87
K	房地产业	154,176.00	0.15
L	租赁和商务服务业	745,380.00	0.70
M	科学研究和技术服务业	310,860.00	0.29
N	水利、环境和公共设施管理业	298,102.00	0.28
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	129,360.00	0.12
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	375,927.00	0.36
S	综合	-	-
	合计	89,286,300.32	84.35

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：无。

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	600900	长江电力	66,000	1,908,720.00	1.80
2	300750	宁德时代	9,680	1,742,690.40	1.65
3	002475	立讯精密	41,500	1,631,365.00	1.54
4	600519	贵州茅台	1,100	1,614,129.00	1.52
5	600276	恒瑞医药	39,100	1,503,786.00	1.42
6	300308	中际旭创	10,820	1,491,861.60	1.41
7	600886	国投电力	75,100	1,369,824.00	1.29

8	601899	紫金矿业	71,700	1,259,769.00	1.19
9	601985	中国核电	106,800	1,138,488.00	1.08
10	601225	陕西煤业	42,000	1,082,340.00	1.02
11	000568	泸州老窖	7,000	1,004,430.00	0.95
12	600660	福耀玻璃	20,500	981,950.00	0.93
13	002463	沪电股份	26,500	967,250.00	0.91
14	601088	中国神华	21,600	958,392.00	0.91
15	603993	洛阳钼业	112,700	957,950.00	0.90
16	600887	伊利股份	36,900	953,496.00	0.90
17	600150	中国船舶	23,400	952,614.00	0.90
18	002078	太阳纸业	68,100	949,995.00	0.90
19	600398	海澜之家	95,500	882,420.00	0.83
20	600066	宇通客车	32,300	833,340.00	0.79
21	600566	济川药业	26,000	824,460.00	0.78
22	002422	科伦药业	27,100	821,943.00	0.78
23	600809	山西汾酒	3,700	780,256.00	0.74
24	600938	中国海油	23,500	775,500.00	0.73
25	002027	分众传媒	123,000	745,380.00	0.70
26	601138	工业富联	26,900	737,060.00	0.70
27	000975	银泰黄金	44,500	724,905.00	0.68
28	002371	北方华创	2,100	671,769.00	0.63
29	300705	九典制药	24,720	661,012.80	0.62
30	300274	阳光电源	10,640	659,999.20	0.62
31	300002	神州泰岳	79,300	643,916.00	0.61
32	601766	中国中车	83,700	628,587.00	0.59
33	601717	郑煤机	41,800	618,640.00	0.58
34	600795	国电电力	102,800	615,772.00	0.58
35	688111	金山办公	2,697	613,567.50	0.58
36	000423	东阿阿胶	9,700	607,220.00	0.57
37	601601	中国太保	20,900	582,274.00	0.55
38	300760	迈瑞医疗	2,000	581,820.00	0.55
39	002947	恒铭达	16,200	570,240.00	0.54
40	300679	电连技术	14,100	567,243.00	0.54
41	002833	弘亚数控	30,800	561,792.00	0.53
42	002273	水晶光电	32,700	555,246.00	0.52
43	688016	心脉医疗	5,595	548,589.75	0.52
44	300866	安克创新	7,640	544,044.40	0.51
45	300115	长盈精密	44,700	535,953.00	0.51
46	688100	威胜信息	13,824	527,385.60	0.50
47	300394	天孚通信	5,960	526,983.20	0.50
48	603225	新凤鸣	33,800	526,942.00	0.50
49	600642	申能股份	58,600	517,438.00	0.49
50	600761	安徽合力	23,700	512,868.00	0.48

51	603556	海兴电力	10,800	505,764.00	0.48
52	000589	贵州轮胎	99,600	504,972.00	0.48
53	601398	工商银行	87,000	495,900.00	0.47
54	601288	农业银行	113,600	495,296.00	0.47
55	300735	光弘科技	22,900	494,640.00	0.47
56	601126	四方股份	25,700	493,954.00	0.47
57	688253	英诺特	12,900	491,619.00	0.46
58	688036	传音控股	6,409	490,544.86	0.46
59	002519	银河电子	99,500	488,545.00	0.46
60	000651	格力电器	12,400	486,328.00	0.46
61	000333	美的集团	7,500	483,750.00	0.46
62	000933	神火股份	23,000	465,290.00	0.44
63	601058	赛轮轮胎	33,100	463,400.00	0.44
64	000581	威孚高科	28,400	462,352.00	0.44
65	002032	苏泊尔	9,000	450,900.00	0.43
66	300017	网宿科技	56,400	445,560.00	0.42
67	300502	新易盛	4,200	443,310.00	0.42
68	600256	广汇能源	66,100	442,870.00	0.42
69	000429	粤高速 A	42,100	438,261.00	0.41
70	601668	中国建筑	81,100	430,641.00	0.41
71	601567	三星医疗	12,200	427,000.00	0.40
72	603201	常润股份	17,600	425,920.00	0.40
73	605599	菜百股份	31,000	394,630.00	0.37
74	002215	诺普信	52,900	394,105.00	0.37
75	002601	龙佰集团	21,200	393,684.00	0.37
76	601168	西部矿业	21,300	382,335.00	0.36
77	600489	中金黄金	25,800	381,840.00	0.36
78	300251	光线传媒	44,700	375,927.00	0.36
79	002541	鸿路钢构	22,000	373,340.00	0.35
80	600690	海尔智家	13,100	371,778.00	0.35
81	000858	五粮液	2,900	371,316.00	0.35
82	600941	中国移动	3,400	365,500.00	0.35
83	300476	胜宏科技	11,200	361,312.00	0.34
84	600585	海螺水泥	15,200	358,568.00	0.34
85	600219	南山铝业	93,900	357,759.00	0.34
86	600132	重庆啤酒	5,800	352,060.00	0.33
87	600970	中材国际	28,800	347,328.00	0.33
88	002035	华帝股份	54,800	341,404.00	0.32
89	002296	辉煌科技	32,800	338,168.00	0.32
90	688188	柏楚电子	1,828	337,357.40	0.32
91	601919	中远海控	21,600	334,584.00	0.32
92	605377	华旺科技	24,720	327,540.00	0.31
93	300638	广和通	19,100	326,610.00	0.31

94	000915	华特达因	10,700	322,712.00	0.30
95	600346	恒力石化	23,100	322,245.00	0.30
96	300708	聚灿光电	35,600	320,400.00	0.30
97	002984	森麒麟	13,300	320,397.00	0.30
98	300428	立中集团	17,000	316,030.00	0.30
99	600862	中航高科	16,700	313,626.00	0.30
100	600480	凌云股份	31,700	311,611.00	0.29
101	300492	华图山鼎	3,300	310,860.00	0.29
102	601566	九牧王	36,900	310,698.00	0.29
103	601857	中国石油	30,000	309,600.00	0.29
104	300130	新国都	18,500	307,840.00	0.29
105	300529	健帆生物	11,300	307,473.00	0.29
106	300783	三只松鼠	14,000	306,180.00	0.29
107	603733	仙鹤股份	17,400	305,892.00	0.29
108	601500	通用股份	56,900	303,846.00	0.29
109	300857	协创数据	5,300	302,100.00	0.29
110	603368	柳药集团	17,200	301,000.00	0.28
111	000065	北方国际	29,000	300,730.00	0.28
112	002532	天山铝业	36,900	299,259.00	0.28
113	688480	赛恩斯	10,700	298,102.00	0.28
114	688012	中微公司	2,100	296,646.00	0.28
115	688581	安杰思	6,060	296,515.80	0.28
116	002128	电投能源	14,000	295,400.00	0.28
117	300396	迪瑞医疗	14,400	292,464.00	0.28
118	300842	帝科股份	7,500	291,000.00	0.27
119	000100	TCL 科技	67,100	289,872.00	0.27
120	688169	石头科技	734	288,168.40	0.27
121	000999	华润三九	6,740	286,989.20	0.27
122	600036	招商银行	8,300	283,777.00	0.27
123	600309	万华化学	3,500	283,010.00	0.27
124	002415	海康威视	9,100	281,281.00	0.27
125	002230	科大讯飞	6,400	274,880.00	0.26
126	601728	中国电信	44,400	273,060.00	0.26
127	600845	宝信软件	8,520	272,043.60	0.26
128	603518	锦泓集团	30,700	270,160.00	0.26
129	001309	德明利	3,100	267,840.00	0.25
130	002714	牧原股份	6,000	261,600.00	0.25
131	000338	潍柴动力	15,800	256,592.00	0.24
132	002997	瑞鹄模具	7,900	252,563.00	0.24
133	300872	天阳科技	18,900	250,425.00	0.24
134	001206	依依股份	19,200	249,984.00	0.24
135	601688	华泰证券	20,100	249,039.00	0.24
136	688138	清溢光电	11,300	242,950.00	0.23

137	002304	洋河股份	3,000	242,220.00	0.23
138	300870	欧陆通	5,500	238,590.00	0.23
139	601319	中国人保	45,500	234,325.00	0.22
140	000543	皖能电力	26,300	232,755.00	0.22
141	300673	佩蒂股份	17,600	230,912.00	0.22
142	688510	航亚科技	12,400	228,284.00	0.22
143	002594	比亚迪	900	225,225.00	0.21
144	000550	江铃汽车	10,200	221,442.00	0.21
145	002648	卫星化学	12,300	221,154.00	0.21
146	300498	温氏股份	11,100	220,002.00	0.21
147	688533	上声电子	8,500	219,895.00	0.21
148	603408	建霖家居	16,400	216,316.00	0.20
149	600989	宝丰能源	12,400	214,892.00	0.20
150	601838	成都银行	13,900	211,141.00	0.20
151	002595	豪迈科技	5,500	209,935.00	0.20
152	603501	韦尔股份	2,100	208,677.00	0.20
153	000786	北新建材	7,000	207,620.00	0.20
154	600031	三一重工	12,300	202,950.00	0.19
155	300841	康华生物	4,000	202,560.00	0.19
156	600183	生益科技	9,600	202,176.00	0.19
157	688187	时代电气	3,900	192,582.00	0.18
158	002340	格林美	30,000	191,100.00	0.18
159	688008	澜起科技	3,174	181,425.84	0.17
160	688506	百利天恒	1,000	181,400.00	0.17
161	601163	三角轮胎	11,900	181,118.00	0.17
162	688777	中控技术	4,800	180,960.00	0.17
163	688122	西部超导	4,600	176,272.00	0.17
164	688728	格科微	14,519	175,825.09	0.17
165	688041	海光信息	2,500	175,800.00	0.17
166	002020	京新药业	16,600	173,802.00	0.16
167	002533	金杯电工	17,400	173,130.00	0.16
168	688396	华润微	4,600	172,224.00	0.16
169	000400	许继电气	5,000	172,050.00	0.16
170	688032	禾迈股份	1,492	171,251.76	0.16
171	601021	春秋航空	3,000	168,990.00	0.16
172	688126	沪硅产业	12,200	168,482.00	0.16
173	688390	固德威	3,000	168,360.00	0.16
174	688072	拓荆科技	1,400	168,154.00	0.16
175	002028	思源电气	2,500	167,250.00	0.16
176	688047	龙芯中科	1,900	167,067.00	0.16
177	003000	劲仔食品	13,800	166,290.00	0.16
178	688521	芯原股份	6,000	160,500.00	0.15
179	600426	华鲁恒升	5,900	157,176.00	0.15

180	688596	正帆科技	4,737	156,321.00	0.15
181	000725	京东方 A	37,700	154,193.00	0.15
182	600048	保利发展	17,600	154,176.00	0.15
183	688009	中国通号	25,641	153,846.00	0.15
184	000625	长安汽车	11,300	151,759.00	0.14
185	688120	华海清科	800	151,664.00	0.14
186	688099	晶晨股份	2,518	149,367.76	0.14
187	688599	天合光能	8,800	148,896.00	0.14
188	600026	中远海能	9,500	148,295.00	0.14
189	688180	君实生物	5,100	148,155.00	0.14
190	601390	中国中铁	22,600	147,352.00	0.14
191	688223	晶科能源	20,700	146,970.00	0.14
192	301004	嘉益股份	1,600	145,600.00	0.14
193	000513	丽珠集团	3,900	145,119.00	0.14
194	688235	百济神州	1,249	144,684.16	0.14
195	605305	中际联合	5,600	144,424.00	0.14
196	600312	平高电气	7,400	143,930.00	0.14
197	300999	金龙鱼	5,200	142,220.00	0.13
198	605183	确成股份	9,100	140,686.00	0.13
199	600348	华阳股份	14,100	140,436.00	0.13
200	600760	中航沈飞	3,500	140,350.00	0.13
201	600547	山东黄金	5,100	139,638.00	0.13
202	601689	拓普集团	2,500	134,025.00	0.13
203	688981	中芯国际	2,900	133,690.00	0.13
204	603605	珀莱雅	1,200	133,188.00	0.13
205	300661	圣邦股份	1,600	132,448.00	0.13
206	002517	恺英网络	13,800	131,790.00	0.12
207	300059	东方财富	12,300	129,888.00	0.12
208	600161	天坛生物	5,320	129,808.00	0.12
209	000526	学大教育	2,100	129,360.00	0.12
210	300124	汇川技术	2,500	128,250.00	0.12
211	000596	古井贡酒	600	126,642.00	0.12
212	603920	世运电路	6,400	126,336.00	0.12
213	002937	兴瑞科技	5,400	125,874.00	0.12
214	603179	新泉股份	3,200	125,568.00	0.12
215	002139	拓邦股份	11,700	124,254.00	0.12
216	002142	宁波银行	5,600	123,536.00	0.12
217	002444	巨星科技	5,000	123,500.00	0.12
218	002001	新和成	6,400	122,880.00	0.12
219	603727	博迈科	9,300	122,388.00	0.12
220	002920	德赛西威	1,400	121,926.00	0.12
221	600023	浙能电力	17,100	121,581.00	0.11
222	601318	中国平安	2,900	119,944.00	0.11

223	688256	寒武纪	600	119,202.00	0.11
224	301187	欧圣电气	4,900	118,825.00	0.11
225	605319	无锡振华	6,700	118,590.00	0.11
226	601611	中国核建	14,600	118,114.00	0.11
227	600282	南钢股份	23,600	117,528.00	0.11
228	301061	匠心家居	2,500	117,400.00	0.11
229	603365	水星家纺	7,500	117,375.00	0.11
230	600115	中国东航	29,000	116,290.00	0.11
231	600188	兖矿能源	5,100	115,923.00	0.11
232	603338	浙江鼎力	1,900	114,798.00	0.11
233	000039	中集集团	12,200	112,972.00	0.11
234	600030	中信证券	6,100	111,203.00	0.11
235	003006	百亚股份	4,600	109,020.00	0.10
236	603606	东方电缆	2,200	107,382.00	0.10

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	600900	长江电力	2,328,080.00	1.97
2	600519	贵州茅台	2,321,446.00	1.97
3	688036	传音控股	1,495,123.04	1.27
4	000661	长春高新	1,429,304.00	1.21
5	300709	精研科技	1,408,566.00	1.19
6	000589	贵州轮胎	1,403,628.00	1.19
7	603993	洛阳钼业	1,401,397.00	1.19
8	600066	宇通客车	1,397,432.00	1.18
9	600660	福耀玻璃	1,396,152.00	1.18
10	603160	汇顶科技	1,388,803.00	1.18
11	300750	宁德时代	1,331,562.00	1.13
12	601006	大秦铁路	1,329,781.00	1.13
13	600522	XD 中天科	1,313,760.00	1.11
14	000975	银泰黄金	1,282,079.00	1.09
15	600312	平高电气	1,269,239.00	1.08
16	000902	新洋丰	1,263,989.00	1.07
17	002078	太阳纸业	1,232,093.00	1.04
18	603368	柳药集团	1,224,856.00	1.04
19	002448	中原内配	1,216,898.00	1.03
20	000915	华特达因	1,202,299.00	1.02

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	601006	大秦铁路	3,206,267.00	2.72
2	600519	贵州茅台	2,674,216.00	2.27
3	600900	长江电力	2,580,683.00	2.19
4	600522	XD 中天科	1,852,675.00	1.57
5	002078	太阳纸业	1,846,513.00	1.56
6	688036	传音控股	1,780,693.37	1.51
7	002273	水晶光电	1,710,683.00	1.45
8	603866	桃李面包	1,645,994.86	1.39
9	600150	中国船舶	1,642,037.00	1.39
10	002311	海大集团	1,531,651.00	1.30
11	603160	汇顶科技	1,431,153.00	1.21
12	601225	陕西煤业	1,396,631.00	1.18
13	000063	中兴通讯	1,348,029.00	1.14
14	002984	森麒麟	1,321,363.00	1.12
15	300622	博士眼镜	1,318,087.00	1.12
16	600487	亨通光电	1,317,085.00	1.12
17	300709	精研科技	1,314,492.00	1.11
18	000661	长春高新	1,309,830.00	1.11
19	002236	大华股份	1,295,666.00	1.10
20	600872	中炬高新	1,282,924.00	1.09

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	353,619,415.92
卖出股票收入（成交）总额	362,395,889.63

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	5,017,093.15	4.74
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-

9	其他	-	-
10	合计	5,017,093.15	4.74

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019740	24 国债 09	50,000	5,017,093.15	4.74

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

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

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

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

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

本报告期本基金投资的前十名证券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。

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	27,492.19
2	应收清算款	1,957,459.58

3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	2,515.26
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,987,467.03

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 (%)
长城核心优选混合 A	3,778	28,011.37	30,218,611.23	28.55	75,608,337.86	71.45
长城核心优选混合 C	7	128.46	-	-	899.24	100.00
合计	3,785	27,959.80	30,218,611.23	28.55	75,609,237.10	71.45

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	长城核心优选混合 A	45,542.23	0.0430
	长城核心优选混合 C	472.99	52.5989

有本基金			
	合计	46,015.22	0.0435

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）。

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	长城核心优选混合 A	0
	长城核心优选混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	长城核心优选混合 A	0~10
	长城核心优选混合 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	长城核心优选混合 A	长城核心优选混合 C
基金合同生效日 (2019年5月24日) 基金份额总额	454,098,388.29	-
本报告期期初基金份额总额	116,401,316.45	1,588.70
本报告期基金总申购份额	1,425,494.02	523.37
减：本报告期基金总赎回份额	11,999,861.38	1,212.83
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	105,826,949.09	899.24

§ 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：

本报告期内基金管理人无重大人事变动。

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 (%)	
兴业证券	1	274,748,245.11	38.37	259,886.37	38.37	-
国投证券	2	135,270,131.26	18.89	127,950.28	18.89	-

长城证券	6	87,677,018.54	12.25	82,932.55	12.24	-
民生证券	1	81,228,711.64	11.34	76,833.85	11.34	-
华创证券	1	32,331,281.63	4.52	30,582.01	4.52	-
东吴证券	1	27,511,982.60	3.84	26,023.94	3.84	-
天风证券	2	22,411,603.26	3.13	21,198.76	3.13	-
招商证券股份有限公司	4	18,975,153.09	2.65	17,948.32	2.65	-
广发证券	1	15,007,358.30	2.10	14,195.29	2.10	-
中信建投	1	13,047,461.00	1.82	12,341.58	1.82	-
中泰证券	2	6,592,844.12	0.92	6,236.43	0.92	-
国泰君安	2	1,213,515.00	0.17	1,147.91	0.17	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
财通证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
东莞证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
宏信证券	1	-	-	-	-	-
华福证券	2	-	-	-	-	-
华金证券	2	-	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	2	-	-	-	-	-
华鑫证券	1	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
联讯证券	2	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
山西证券	2	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-

首创证券	2	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
万和证券	2	-	-	-	-	-
万联证券	2	-	-	-	-	-
五矿证券	2	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
粤开证券	2	-	-	-	-	-
中金财富	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	2	-	-	-	-	-

注：1、报告期内租用证券公司席位的变更情况：

本报告期内招商证券新增 2 个交易单元，中信建投减少 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
- (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 (%)

兴业证 券	-	-	-	-	-	-
国投证 券	4,045,700.0 0	19.90	-	-	-	-
长城证 券	2,058,100.0 0	10.12	-	-	-	-
民生证 券	5,610,139.0 0	27.59	26,000,000.0 0	100.00	-	-
华创证 券	-	-	-	-	-	-
东吴证 券	-	-	-	-	-	-
天风证 券	8,617,540.0 0	42.39	-	-	-	-
招商证 券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
广发证 券	-	-	-	-	-	-
中信建 投	-	-	-	-	-	-
中泰证 券	-	-	-	-	-	-
国泰君 安	-	-	-	-	-	-
渤海证 券	-	-	-	-	-	-
财通证 券	-	-	-	-	-	-
长江证 券	-	-	-	-	-	-
东北证 券	-	-	-	-	-	-
东方证 券	-	-	-	-	-	-
东兴证 券	-	-	-	-	-	-
东莞证 券	-	-	-	-	-	-
方正证 券	-	-	-	-	-	-
国金证 券	-	-	-	-	-	-

国信证 券	-	-	-	-	-	-
国元证 券	-	-	-	-	-	-
海通证 券	-	-	-	-	-	-
宏信证 券	-	-	-	-	-	-
华福证 券	-	-	-	-	-	-
华金证 券	-	-	-	-	-	-
华融证 券	-	-	-	-	-	-
华泰证 券	-	-	-	-	-	-
华西证 券	-	-	-	-	-	-
华鑫证 券	-	-	-	-	-	-
江海证 券	-	-	-	-	-	-
联讯证 券	-	-	-	-	-	-
平安证 券	-	-	-	-	-	-
山西证 券	-	-	-	-	-	-
上海证 券	-	-	-	-	-	-
申万宏 源	-	-	-	-	-	-
首创证 券	-	-	-	-	-	-
太平洋 证券	-	-	-	-	-	-
万和证 券	-	-	-	-	-	-
万联证 券	-	-	-	-	-	-
五矿证 券	-	-	-	-	-	-
西部证 券	-	-	-	-	-	-

西南证 券	-	-	-	-	-	-
银河证 券	-	-	-	-	-	-
粤开证 券	-	-	-	-	-	-
中金财 富	-	-	-	-	-	-
中金公 司	-	-	-	-	-	-
中信证 券	-	-	-	-	-	-
中银国 际	-	-	-	-	-	-

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	长城基金管理有限公司关于终止北京增财基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 1 月 19 日
2	长城基金管理有限公司关于关闭网上直销交易平台开户、认申购、转换、赎回及新开通定投业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 3 月 2 日
3	长城基金管理有限公司关于旗下基金开展电子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	2024 年 4 月 26 日
4	长城基金管理有限公司关于调整旗下基金所持停牌股票估值方法的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 5 月 7 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20240101-20240603	35,086,037.94	-	5,000,000.00	-	-
	2	20240604-20240630	-	-	-	30,086,037.94	28.4292
产品特有风险							
如投资者进行大额赎回，可能存在以下的特有风险：							
1、流动性风险							

本基金在短时间内可能无法变现足够的资产来应对大额赎回，基金仓位调整困难，从而可能会面临一定的流动性风险；

2、延期支付赎回款项及暂停赎回风险

若持有基金份额比例达到或超过 20% 的单一投资者大额赎回引发了巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定决定部分延期支付赎回款项；如果连续 2 个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请，对剩余投资者的赎回办理造成影响；

3、基金净值波动风险

大额赎回会导致管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的需要，可能使基金资产净值受到不利影响；另一方面，由于基金净值估值四舍五入法或赎回费收入归基金资产的影响，大额赎回可能导致基金净值出现较大波动；

4、投资受限风险

大额赎回后若基金资产规模过小，可能导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略；

5、基金合同终止或转型风险

大额赎回可能会导致基金资产规模过小，不能满足存续的条件，根据基金合同的约定，将面临合同终止财产清算或转型风险。

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）中国证监会核准长城久利保本混合型证券投资基金募集的文件
- （二）《长城久利保本混合型证券投资基金基金合同》
- （三）《长城核心优选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- （四）《长城核心优选灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》
- （五）《长城核心优选灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
- （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

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

长城基金管理有限公司

2024 年 8 月 31 日