

长城价值甄选一年持有期混合型证券投资
基金
2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 日

基金管理人：长城基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2024 年 3 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 03 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自 2023 年 01 月 01 日起至 2023 年 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	10
§ 4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	14
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	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	16
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	16
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	17
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	17
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明	17
4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	17
§ 5 托管人报告	18
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	18
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	18
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	18
§ 6 审计报告	18
6.1 审计报告基本信息	18
6.2 审计报告的基本内容	18
§ 7 年度财务报表	20
7.1 资产负债表	20
7.2 利润表	21
7.3 净资产变动表	23
7.4 报表附注	25

§ 8 投资组合报告	56
8.1 期末基金资产组合情况	56
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	56
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	57
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	59
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	62
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	62
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	63
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	63
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	63
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	63
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	63
8.12 投资组合报告附注	63
§ 9 基金份额持有人信息	64
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	64
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	64
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	65
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况	65
§ 10 开放式基金份额变动	65
§ 11 重大事件揭示	66
11.1 基金份额持有人大会决议	66
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	66
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	66
11.4 基金投资策略的改变	66
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	66
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	66
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	66
11.8 其他重大事件	70
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	71
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	71
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	71
§ 13 备查文件目录	71
13.1 备查文件目录	71
13.2 存放地点	71
13.3 查阅方式	71

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	长城价值甄选一年持有期混合型证券投资基金	
基金简称	长城价值甄选一年持有混合	
基金主代码	013674	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022 年 4 月 7 日	
基金管理人	长城基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	162,509,239.61 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	长城价值甄选一年持有混合 A	长城价值甄选一年持有混合 C
下属分级基金的交易代码	013674	013675
报告期末下属分级基金的份额总额	143,586,861.41 份	18,922,378.20 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金坚守价值投资理念，挑选具有长期增长潜力的优质公司，力争为投资者带来长期财富回报，实现基金资产稳健增长。
投资策略	<p>1、资产配置策略</p> <p>本基金通过对宏观经济环境、政策形势、证券市场走势的综合分析，主动判断市场时机，进行积极的资产配置，合理确定基金在股票、债券等各类资产类别上的投资比例，并随着各类资产风险收益特征的相对变化，适时进行动态调整。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>本基金通过积极主动的研究，发现那些基本面优良的公司，以好的价格买入好公司，长期投资这些优秀的公司，同时考虑宏观经济趋势及行业景气变化，优化投资组合配置，力争实现长期稳健收益。</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>本基金通过对国内外宏观经济态势、利率走势、收益率曲线变化趋势和信用风险变化等因素进行综合分析，构建和调整固定收益证券投资组合，同时保持高流动性，为组合提供现金增强收益。</p> <p>4、股指期货投资策略</p> <p>本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。</p> <p>5、国债期货投资策略</p> <p>本基金投资国债期货将根据风险管理的原则，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，在追求基金资产安全的基础上，力求实现基金资产的中长期稳定增值。国债期货相</p>

	关投资遵循法律法规及中国证监会的规定。 6、资产支持证券投资策略 本基金将通过对资产支持证券基础资产及结构设计的研究，结合多种定价模型，根据基金资产组合情况适度进行资产支持证券的投资。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率*70%+中证港股通综合指数（人民币）收益率*10%+中债综合全价指数收益率*20%
风险收益特征	本基金是混合型基金，其预期收益及风险水平低于股票型基金，高于债券型基金与货币市场基金。本基金可投资港股通标的股票，需承担因港股市场投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		长城基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	祝函	许俊
	联系电话	0755-29279006	010-66596688
	电子邮箱	zhuhan@ccfund.com.cn	fxjd_hq@bank-of-china.com
客户服务电话		400-8868-666	95566
传真		0755-29279000	010-66594942
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	北京市西城区复兴门内大街 1 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	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码		518046	100818
法定代表人		王军	葛海蛟

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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.ccfund.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼
注册登记机构	长城基金管理有限公司	深圳市福田区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、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间	2023 年	2022 年 4 月 7 日 (基金合同生效日)-2022
----------	--------	-------------------------------

数据和指标	年 12 月 31 日			
	长城价值甄选一年 持有混合 A	长城价值甄选一 年持有混合 C	长城价值甄选一年 持有混合 A	长城价值甄选一 年持有混合 C
本期已实现收益	-27,316,397.86	-3,778,906.61	-20,952,863.58	-2,636,136.25
本期利润	-27,322,800.03	-3,663,028.23	-18,409,003.74	-2,336,286.92
加权平均基金份额本期利润	-0.1542	-0.1615	-0.0820	-0.0874
本期加权平均净值利润率	-18.18%	-19.30%	-8.42%	-9.00%
本期基金份额净值增长率	-16.92%	-17.58%	-8.19%	-8.72%
3.1.2 期末数据和指标	2023 年末		2022 年末	
期末可供分配利润	-37,434,313.10	-5,125,450.55	-20,968,524.05	-2,637,731.46
期末可供分配基金份额利润	-0.2607	-0.2709	-0.0932	-0.0984
期末基金资产净值	109,534,201.97	14,235,997.74	206,648,073.09	24,455,140.06
期末基金份额净值	0.7628	0.7523	0.9181	0.9128
3.1.3 累计期末指标	2023 年末		2022 年末	
基金份额累计净值增长率	-23.72%	-24.77%	-8.19%	-8.72%

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

长城价值甄选一年持有混合 A

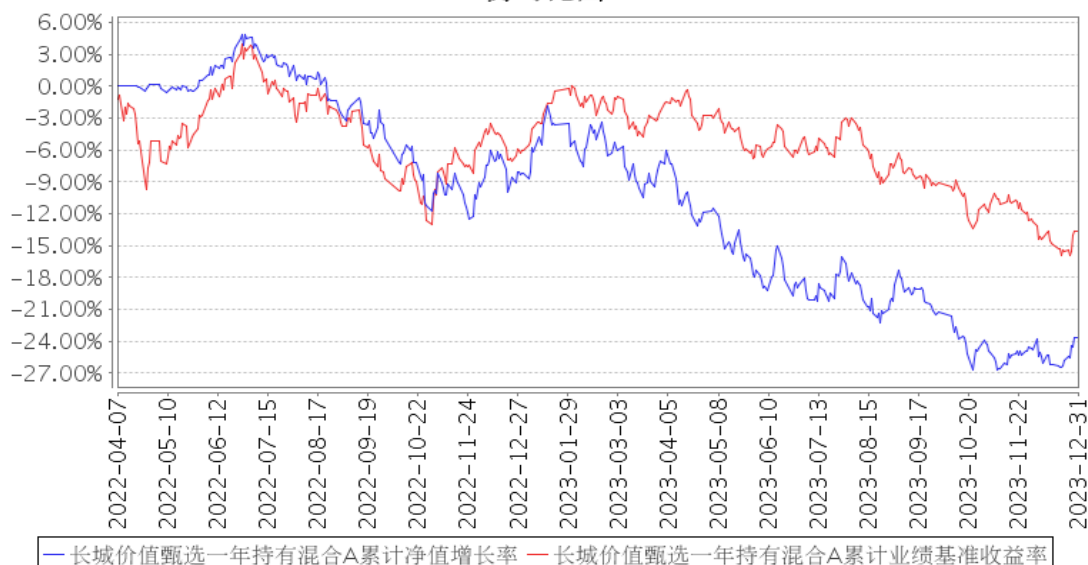
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-3.10%	0.77%	-4.97%	0.63%	1.87%	0.14%
过去六个月	-6.13%	0.84%	-8.28%	0.67%	2.15%	0.17%
过去一年	-16.92%	0.90%	-8.08%	0.65%	-8.84%	0.25%
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	-23.72%	0.83%	-13.67%	0.80%	-10.05%	0.03%

长城价值甄选一年持有混合 C

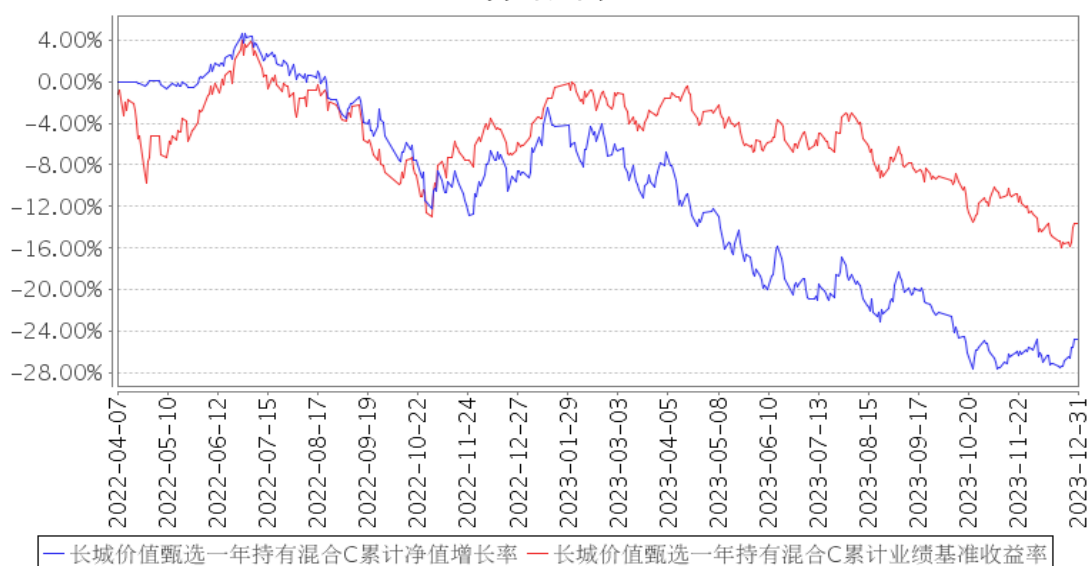
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-3.29%	0.77%	-4.97%	0.63%	1.68%	0.14%
过去六个月	-6.51%	0.83%	-8.28%	0.67%	1.77%	0.16%
过去一年	-17.58%	0.90%	-8.08%	0.65%	-9.50%	0.25%
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	-24.77%	0.83%	-13.67%	0.80%	-11.10%	0.03%

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

长城价值甄选一年持有混合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



长城价值甄选一年持有混合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

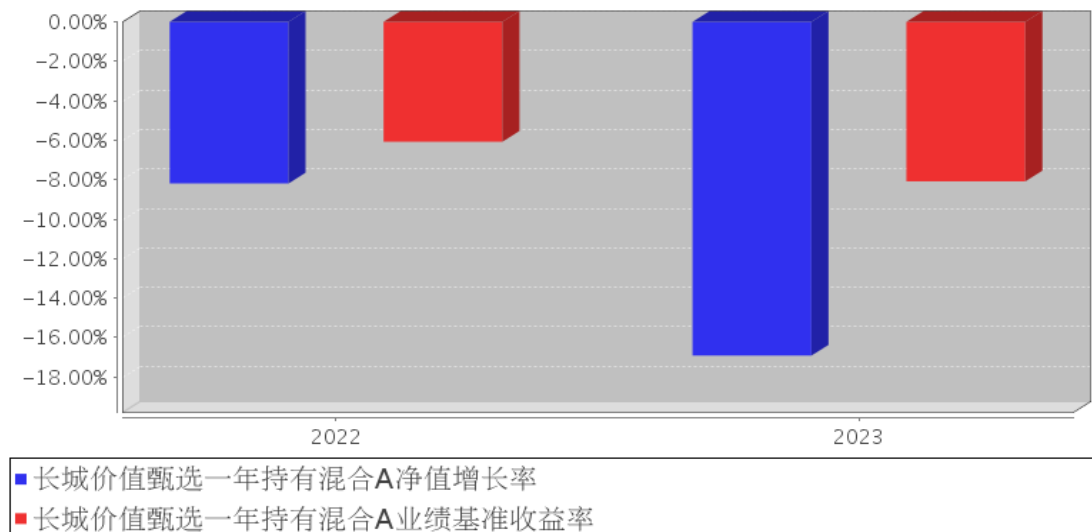


注：①本基金合同规定本基金的投资组合比例为：本基金股票投资占基金资产的比例为 60%–95%，其中投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%；每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不得包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等；股指期货、国债期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

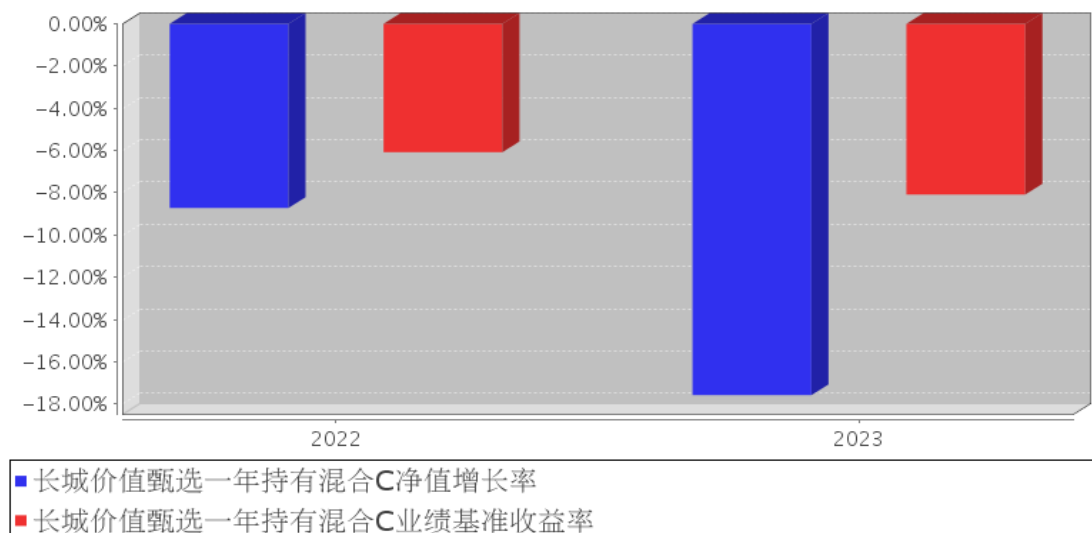
②本基金的建仓期为自基金合同生效之日起六个月内，建仓期满时，各项资产配置比例符合基金合同约定。

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

长城价值甄选一年持有混合A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



长城价值甄选一年持有混合C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金基金合同于2022年04月07日生效，自基金合同生效以来未进行利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

长城基金管理有限公司是经中国证监会批准设立的第 15 家基金管理公司，由长城证券股份有

限公司（40%）、东方证券股份有限公司（15%）、西北证券有限责任公司（15%）、北方国际信托股份有限公司（15%）、中原信托有限公司（15%）于 2001 年 12 月 27 日共同出资设立，当时注册资本为壹亿元人民币。2007 年 5 月 21 日，经中国证监会批准，公司完成股权结构调整，现有股东为长城证券股份有限公司（47.059%）、东方证券股份有限公司（17.647%）、北方国际信托股份有限公司（17.647%）和中原信托有限公司（17.647%）。2007 年 10 月 12 日，经中国证监会批准，将注册资本增加至壹亿伍仟万元人民币。公司经营范围是基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其他业务。截至本报告期末，公司管理的基金有：长城久恒灵活配置混合型证券投资基金、长城久泰沪深 300 指数证券投资基金、长城货币市场证券投资基金、长城消费增值混合型证券投资基金、长城安心回报混合型证券投资基金、长城久富核心成长混合型证券投资基金（LOF）、长城品牌优选混合型证券投资基金、长城稳健增利债券型证券投资基金、长城双动力混合型证券投资基金、长城中小盘成长混合型证券投资基金、长城积极增利债券型证券投资基金、长城优化升级混合型证券投资基金、长城稳健成长灵活配置混合型证券投资基金、长城核心优选灵活配置混合型证券投资基金、长城增强收益定期开放债券型证券投资基金、长城医疗保健混合型证券投资基金、长城工资宝货币市场基金、长城久鑫灵活配置混合型证券投资基金、长城稳固收益债券型证券投资基金、长城新兴产业灵活配置混合型证券投资基金、长城环保主题灵活配置混合型证券投资基金、长城改革红利灵活配置混合型证券投资基金、长城久惠灵活配置混合型证券投资基金、长城久祥灵活配置混合型证券投资基金、长城行业轮动灵活配置混合型证券投资基金、长城新优选混合型证券投资基金、长城久润灵活配置混合型证券投资基金、长城久益灵活配置混合型证券投资基金、长城久源灵活配置混合型证券投资基金、长城久鼎灵活配置混合型证券投资基金、长城久稳债券型证券投资基金、长城中国智造灵活配置混合型证券投资基金、长城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、长城锦利三个月定期开放债券型证券投资基金、长城裕利纯债债券型发起式证券投资基金、长城景气成长混合型证券投资基金、长城集利债券型发起式证券投资基金、长城国企优选混合型发起式证券投资基金、长城精选进取 3 个月持有期混合型发起式基金中基金 (FOF)、长城均衡成长混合型证券投资基金、长城智盈添益债券型发起式证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
杨建华	公司副总经理、投资总监、权益投资一部总经理、本基金的基金	2022 年 4 月 7 日	-	23 年	男，中国籍，硕士，注册会计师（CPA）。1991 年 7 月-1996 年 8 月曾就职于大庆石油管理局，1998 年 6 月-1999 年 10 月曾就职于华为技术有限公司，1999 年 10 月-2000 年 5 月曾就职于深圳市和君创业投资公司，2000 年 5 月-2001 年 9 月曾就职于长城证券有限责任公司投资银行部。

	经理				2001 年 10 月加入长城基金管理有限公司，历任基金管理部基金经理助理、总经理助理、研究部总经理，现任公司副总经理、投资总监、权益投资一部总经理、投委会委员兼基金经理。自 2007 年 9 月至 2009 年 1 月任“长城安心回报混合型证券投资基金”基金经理，自 2011 年 1 月至 2013 年 6 月任“长城中小盘成长股票型证券投资基金”基金经理，自 2009 年 9 月至 2016 年 9 月任“长城久富核心成长混合型证券投资基金（LOF）”基金经理，自 2017 年 6 月至 2018 年 8 月任“长城久兆中小板 300 指数分级证券投资基金”基金经理，自 2018 年 8 月至 2018 年 11 月任“长城中证 500 指数增强型证券投资基金”基金经理，自 2017 年 8 月至 2019 年 2 月任“长城久嘉创新成长灵活配置混合型证券投资基金”基金经理，自 2019 年 4 月至 2022 年 10 月任“长城核心优势混合型证券投资基金”基金经理。自 2004 年 5 月至今任“长城久泰沪深 300 指数证券投资基金”基金经理，自 2013 年 6 月至今任“长城品牌优选混合型证券投资基金”基金经理，自 2020 年 3 月至今任“长城价值优选混合型证券投资基金”基金经理，自 2021 年 5 月至今任“长城消费 30 股票型证券投资基金”基金经理，自 2021 年 10 月至今任“长城兴华优选一年定期开放混合型证券投资基金”基金经理，自 2021 年 12 月至今任“长城价值领航混合型证券投资基金”基金经理，自 2022 年 4 月至今任“长城价值甄选一年持有期混合型证券投资基金”基金经理，自 2023 年 2 月至今任“长城品质成长混合型证券投资基金”基金经理。
陈子扬	本基金的基金经理	2023 年 8 月 14 日	-	6 年	男，中国籍，硕士。2017 年 7 月毕业加入长城基金管理有限公司，历任行业研究员、权益基金经理助理。自 2023 年 8 月至今任“长城价值甄选一年持有期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 公平交易制度和控制方法

根据相关法律法规的规定，本基金管理人制定并实施了《长城基金管理有限公司公平交易管理制度》。

本基金管理人通过信息系统以及人工控制等方法，严格保证公平交易制度的执行。在投资决策环节，本基金管理人制定和完善投资授权制度、投资对象库和交易对手库管理制度、投资信息保密措施，保证各投资组合投资决策的独立性。在交易执行环节，本基金管理人建立和完善公平的交易分配制度，按照价格优先、时间优先、综合平衡、比例分配的原则，保证了交易在各投资组合间的公平。在风险监控环节，本基金管理人内控等相关部门进行事前、事中、事后的监控。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格执行了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。

4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

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，同一组合经理管理的多个投资组合的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同一组合经理管理的多个投资组合的同日反向交易，对同向交易的价差进行强化的监测和事后分析，对不同时间窗的（同日、3日内、5日内、7日内、9日内、11日内、13日内）同向交易和临近交易日的反向交易价差进行监控分析，并结合成交顺序、价格偏差、产品规模、成交量等因素对是否存在不公平对待的情形进行分析，定期出具公平交易稽核报告。本报告期报告认为，本基金管理人旗下同一组合经理管理的多个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。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2023 年股票市场震荡下行，上证指数、沪深 300、创业板指分别跌 3.7%、11.38%、19.41%。在人工智能、人形机器人创新浪潮下，通信、传媒、计算机等板块录得良好收益，煤炭、家电、石油石化为代表的红利低估值资产表现也相当出色。而地产链、产能过剩的电力设备及新能源、基础化工则下跌幅度较大。

2023 年上半年本基金一方面加大对消费场景修复带来的大众消费品、医疗服务的配置，一方面关注到人工智能领域的新变化，适当配置了估值安全边际高、在技术变革中有望受益于降本增效的个股。下半年持仓结构变化较大，提升了兼具安全性和盈利弹性的能源、资本开支克制的有色金属板块的配置比例。阶段性受宏观经济转弱的影响，消费和顺周期板块估值承压，给本基金净值造成损失。

由于下半年组合结构发生较大变化，有必要在此和投资者就我们的投资框架进行沟通。股票投资回报由分红和资本利得组成，决定投资回报的关键是企业长期价值创造能力以及我们付出的成本。我们分析企业价值创造能力的落脚点和常见的基本面投资分析维度大同小异，包括企业的商业模式、竞争优势、成长潜力、股东回报等。如何用相对低估的价格买到有价值企业？我们的答案是利用好周期。马拉松资本在《资本回报》中开宗明义写道：“资本流动带来新的投资，随着时间的推移会增加产能并将最终压低回报。相反，当回报较低时，资本撤离，产能下降；然后，随着时间的推移，利润又会回升”。行业的供给变化会影响公司的竞争态势和盈利状况，在产能周期顶部，行业竞争导致盈利下降，也会给投资低价买入优质公司的机会。随着产能周期见底，盈利逐步修复，投资者可以获取盈利修复甚至估值提升带来的投资收益。简而言之，我们力求在周期低位买入景气改善的优质企业。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末长城价值甄选一年持有混合 A 基金份额净值为 0.7628 元，本报告期基金份额净值增长率为-16.92%，同期业绩比较基准收益率为-8.08%；

截至本报告期末长城价值甄选一年持有混合 C 基金份额净值为 0.7523 元，本报告期基金份额净值增长率为-17.58%，同期业绩比较基准收益率为-8.08%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我国经济处在从高速增长向高质量发展切换的过程中，叠加国际政治环境动荡，难免出现阵痛，要认识到国内居民收入、消费支出仍有很大的提升潜力，中国的制造业已经从中低端到中高端建立了全球竞争力，具备输出全球市场的能力。2023 年我们已经观察到出行链、汽车家电等耐用消费渐次复苏，地方债务、地产风险释放，2024 年经济稳中向好基调不变。股票市场经过两年的调整，很多优质公司的分红和回购带来的回报已经远超无风险利率，一方面我们观察到企业更加注重投资者回报，另一方面是很多公司的估值风险大幅度释放，投资者无需支付溢价就可以买到公司的成长期权。毫无疑问，我们当前时点对投资回报率是乐观的。从中观行业角度，我们看好以下投资线索：

1) 部分资源品，包括金属和能源。供给干扰增加、缺乏资本开支是过去几年资源品领域的普遍现象，能源结构转型、供应链重构等提振资源品需求，预计资源品领域能提供持续的较高投资回报。和海外优质资源品企业相比，国内资源品龙头企业具备更大成长潜力和显著的估值优势。

2) 养殖。动物蛋白是刚性需求，行业巨亏导致养殖户退出，供需格局出现根本性变化，股票资产的赔率较高。

3) 部分化工品。随着资本开支接近尾声，部分领域龙头定价能力提升，盈利有较大修复空间。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人根据健全、独立、有效、相互制约和成本效益原则，进一步完善了各项基本管理制度、业务规则和工作流程，认真执行了各项管理制度，有效实施了三层风险防范和控制措施，建立了比较完善的内部控制体系。

本报告期内公司督察长、监察稽核人员根据法律法规和公司相关制度的规定，认真履行了工作职责，结合公司实际运作需要，进一步完善了监察稽核程序、方法和制度。督察长、监察稽核部独立地开展工作，实时监控关键业务风险点，每季进行定期稽核，监察稽核内容涵盖了基金投资、基金交易、研究策划、产品创新、基金销售等各项业务的每个环节和公司信息技术、运作保障、综合管理等工作。监察稽核人员在历次监察稽核工作中，认真、有效地提出了各部门工作中存在的问题及改进意见，督促各部门及时进行了整改，防范和化解了业务风险。

监察稽核和内部控制的重点是确保公司经营及所管理基金运作的合法合规，保障基金份额持有人的利益，建立健全投资监控体系和风险评价体系，加强投资决策流程的内部控制和风险管理，严格防范操纵市场行为、内幕交易行为和其他有损基金持有人利益的关联交易，严格防范基金销售业务中的违规行为，严格履行信息披露义务，保证履行基金合同的承诺。本报告期内，本基金运作合法合规，无操纵市场、内幕交易和不当关联交易行为，维护了基金持有人的利益。

本基金管理人将坚持“规范、专业、高效、拼搏”的经营理念，继续完善法人治理结构和内部控制制度，不断提高公司员工的守法意识和风险防范意识，加强实时监督和控制，完善电子监控手段，使内部控制的全面性、及时性和有效性不断得到提高。本基金管理人将本着“取信于市场，取信于社会”的宗旨，诚实信用，勤勉尽责，为基金持有人谋求最佳利益并使本基金管理公司稳步健康发展。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无。

4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金无需要说明的情况。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对长城价值甄选一年持有期混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《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，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2024)第 27659 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	长城价值甄选一年持有期混合型证券投资基金全体基金份额持有人：
审计意见	<p>我们审计了长城价值甄选一年持有期混合型证券投资基金（以下简称“长城价值甄选一年混合基金”）的财务报表，包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表，2023 年度的利润表和净资产变动表以及财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了长城价值甄选一年混合基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和</p>

	净资产变动情况。
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于长城价值甄选一年混合基金，并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	不适用
其他事项	不适用
其他信息	不适用
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>长城价值甄选一年混合基金的基金管理人长城基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估长城价值甄选一年混合基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算长城价值甄选一年混合基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督长城价值甄选一年混合基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对长城价值甄选一年混合基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或</p>

	<p>情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致长城价值甄选一年混合基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	张炯 肖菊
会计师事务所的地址	中国 上海
审计报告日期	2024 年 3 月 27 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：长城价值甄选一年持有期混合型证券投资基金

报告截止日：2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	7.4.7.1	14,250,113.75	41,821,123.79
结算备付金		602,681.27	894,756.69
存出保证金		37,580.32	119,419.15
交易性金融资产	7.4.7.2	112,366,674.16	189,182,360.33
其中：股票投资		112,366,674.16	189,182,360.33
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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-

应收清算款		1,264,192.32	-
应收股利		-	-
应收申购款		510.00	20.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	-
资产总计		128,521,751.82	232,017,679.96
负债和净资产	附注号	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		3,077,057.74	-
应付赎回款		1,036,362.42	-
应付管理人报酬		124,991.27	294,991.16
应付托管费		20,831.87	49,165.17
应付销售服务费		9,513.54	16,651.69
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	7.4.7.9	482,795.27	553,658.79
负债合计		4,751,552.11	914,466.81
净资产:			
实收基金	7.4.7.10	162,509,239.61	251,866,759.01
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	-38,739,039.90	-20,763,545.86
净资产合计		123,770,199.71	231,103,213.15
负债和净资产总计		128,521,751.82	232,017,679.96

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额总额 162,509,239.61 份，其中长城价值甄选一年持有混合 A 类基金份额净值 0.7628 元，基金份额 143,586,861.41 份；长城价值甄选一年持有混合 C 类基金份额净值 0.7523 元，基金份额 18,922,378.20 份。

7.2 利润表

会计主体：长城价值甄选一年持有期混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 4 月 7 日（基金合 同生效日）至 2022 年 12 月 31 日

一、营业总收入		-27,842,086.69	-17,318,714.17
1. 利息收入		81,369.60	1,344,857.83
其中：存款利息收入	7.4.7.13	81,369.60	1,090,201.65
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		-	254,656.18
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-28,032,932.50	-21,507,281.17
其中：股票投资收益	7.4.7.14	-30,198,098.71	-22,719,482.25
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	-	17,361.58
资产支持证券投资	7.4.7.16	-	-
收益		-	-
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-	-
股利收益	7.4.7.19	2,165,166.21	1,194,839.50
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）	7.4.7.20	109,476.21	2,843,709.17
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.21	-	-
减：二、营业总支出		3,143,741.57	3,426,576.49
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	2,415,475.57	2,695,413.48
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	402,579.33	449,235.57
3. 销售服务费		152,731.51	152,571.52
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	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	7.4.7.23	172,955.16	129,355.92
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-30,985,828.26	-20,745,290.66
减：所得税费用		-	-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-30,985,828.26	-20,745,290.66
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-30,985,828.26	-20,745,290.66

7.3 净资产变动表

会计主体：长城价值甄选一年持有期混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 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	251,866,759.01	-	-20,763,545.86	231,103,213.15
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	251,866,759.01	-	-20,763,545.86	231,103,213.15
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-89,357,519.40	-	-17,975,494.04	-107,333,013.44
（一）、综合收益总额	-	-	-30,985,828.26	-30,985,828.26
（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）	-89,357,519.40	-	13,010,334.22	-76,347,185.18
其中：1. 基金申购款	516,579.32	-	-51,666.35	464,912.97
2. 基金赎回款	-89,874,098.72	-	13,062,000.57	-76,812,098.15
（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	162,509,239.61	-	-38,739,039.90	123,770,199.71
项目	上年度可比期间			
	2022 年 4 月 7 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 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	-	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	250,616,520.55	-	-	250,616,520.55
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	1,250,238.46	-	-20,763,545.86	-19,513,307.40
（一）、综合收益总额	-	-	-20,745,290.66	-20,745,290.66
（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）	1,250,238.46	-	-18,255.20	1,231,983.26
其中：1. 基金申购款	1,250,238.46	-	-18,255.20	1,231,983.26
2. 基金赎回款	-	-	-	-
（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	251,866,759.01	-	-20,763,545.86	231,103,213.15

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

王军

基金管理人负责人

邱春杨

主管会计工作负责人

赵永强

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

长城价值甄选一年持有期混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2021]2929号《关于准予长城价值甄选一年持有期混合型证券投资基金注册的批复》核准,由长城基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《长城价值甄选一年持有期混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 250,465,173.34 元,业经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)安永华明(2022)验字第 60737541-H03 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《长城价值甄选一年持有期混合型证券投资基金基金合同》于 2022 年 4 月 7 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 250,616,520.55 份,其中认购资金利息折合 151,347.21 份基金份额。本基金的基金管理人为长城基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司(“中国银行”)。

本基金设置基金份额持有人最短持有期限。本基金每份基金份额设定最短持有期限为一年,在最短持有期限内该份基金份额不可赎回,自最短持有期限届满后的下一工作日起(含该日)可赎回。对于每笔认购的基金份额而言,最短持有期限指自基金合同生效之日起(含基金合同生效之日)至该日一年后的年度对日(含当日)的期间;对于每笔申购的基金份额而言,最短持有期限指自该笔申购份额确认日起(含当日)至该日一年后的年度对日(含当日)的期间。若该年实际不存在对应日期的,则顺延至下一日。

根据《长城价值甄选一年持有期混合型证券投资基金招募说明书》,本基金根据认购/申购费用与销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取认购/申购费用的基金份额,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;从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取认购/申购费用的基金份额,称为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同,本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值,计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《长城价值甄选一年持有期混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上

市的股票(包括主板、创业板及其他经中国证监会允许上市的股票、存托凭证)、港股通标的股票、债券(包括国内依法发行和上市交易的国债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、可转换债券、可交换债券、可分离交易可转债、政府支持债券、政府支持机构债券、地方政府债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。

本基金的投资组合比例为：本基金股票投资占基金资产的比例范围为 60%-95%，投资于港股通标的股票的比例不得超过股票资产的 50%。每个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，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；股指期货、国债期货及其他金融工具的投资比例按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：中证 800 指数收益率×70%+中证港股通综合指数收益率(人民币)×10%+中债综合全价指数收益率×20%。

本财务报表由本基金的基金管理人长城基金管理有限公司于 2024 年 3 月 27 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《长城价值甄选一年持有期混合型证券投资基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2023 年度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 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。比较财务报表的实际编制期间为 2022 年 4 月 7 日(基金合同生效日)至 2022 年 12 月 31 日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产、金融负债或权益工具。

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的商业模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项

等。

(3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

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

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风

险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和资产支持证券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

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

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

本基金发行的份额作为可回售工具具备以下特征：(1) 赋予基金份额持有人在基金清算时按比例份额获得该基金净资产的权利，这里所指基金净资产是扣除所有优先于该基金份额对基金资产要求权之后的剩余资产；这里所指按比例份额是清算时将基金的净资产分拆为金额相等的单位，并且将单位金额乘以基金份额持有人所持有的单位数量；(2) 该工具所属的类别次于其他所有工

具类别，即本基金份额在归属于该类别前无须转换为另一种工具，且在清算时对基金资产没有优先于其他工具的要求权；(3) 该工具所属的类别中(该类别次于其他所有工具类别)，所有工具具有相同的特征(例如它们必须都具有可回售特征，并且用于计算回购或赎回价格的公式或其他方法都相同)；(4) 除了发行方应当以现金或其他金融资产回购或赎回该基金份额的合同义务外，该工具不满足金融负债定义中的任何其他特征；(5) 该工具在存续期内的预计现金流量总额，应当实质上基于该基金存续期内基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括本基金的任何影响)。

可回售工具，是指根据合同约定，持有方有权将该工具回售给发行方以获取现金或其他金融资产的权利，或者在未来某一不确定事项发生或者持有方死亡或退休时，自动回售给发行方的金融工具。

本基金没有同时具备下列特征的其他金融工具或合同：(1) 现金流量总额实质上基于基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括该基金或合同的任何影响)；(2) 实质上限制或固定了上述工具持有方所获得的剩余回报。

本基金将实收基金分类为权益工具，列报于净资产。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息及在适用情况下公允价值变动产生的预估增值税后的净额确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

7.4.4.13 分部报告

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

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

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

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

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566号《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

根据中国证监会于2024年颁布的修订后的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号〈年度报告和中期报告〉》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市

公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81号《财政部国家税务总局证监会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[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127号《财政部国家税务总局证监会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》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、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。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

对基金通过沪港通或深港通投资香港联交所上市H股取得的股息红利，H股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向H股公司提供内地个人投资者名册，H股公司按照20%的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通或深港通投资香港联交所上市的非H股取得的股息红利，由中国结算按照20%的税率代扣个人所得税。

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

根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

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

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
活期存款	14,250,113.75	41,821,123.79
等于：本金	14,248,856.47	41,817,608.63
加：应计利息	1,257.28	3,515.16
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	14,250,113.75	41,821,123.79

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	109,413,488.78	-	112,366,674.16	2,953,185.38
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	109,413,488.78	-	112,366,674.16	2,953,185.38
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	186,338,651.16	-	189,182,360.33	2,843,709.17
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	186,338,651.16	-	189,182,360.33	2,843,709.17

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：无。

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：无。

7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：无。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：无。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

7.4.7.5 债权投资

7.4.7.5.1 债权投资情况

注：无。

7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：无。

7.4.7.6 其他债权投资

7.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：无。

7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：无。

7.4.7.7 其他权益工具投资

7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：无。

7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：无。

7.4.7.8 其他资产

注：无。

7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	322,795.27	435,658.79
其中：交易所市场	322,795.27	435,658.79
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提审计费	40,000.00	38,000.00
预提信息披露费	120,000.00	80,000.00
合计	482,795.27	553,658.79

7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

长城价值甄选一年持有混合 A

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	225,074,077.72	225,074,077.72
本期申购	414,136.22	414,136.22
本期赎回（以“-”号填列）	-81,901,352.53	-81,901,352.53
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-

本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	143,586,861.41	143,586,861.41

长城价值甄选一年持有混合 C

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	26,792,681.29	26,792,681.29
本期申购	102,443.10	102,443.10
本期赎回（以“-”号填列）	-7,972,746.19	-7,972,746.19
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	18,922,378.20	18,922,378.20

注：本基金申购包含红利再投及基金转入的份额及金额；赎回包含基金转出的份额及金额。

7.4.7.11 其他综合收益

注：无。

7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

长城价值甄选一年持有混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-20,968,524.05	2,542,519.42	-18,426,004.63
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-20,968,524.05	2,542,519.42	-18,426,004.63
本期利润	-27,316,397.86	-6,402.17	-27,322,800.03
本期基金份额交易产生的变动数	10,850,608.81	845,536.41	11,696,145.22
其中：基金申购款	-54,985.13	19,631.78	-35,353.35
基金赎回款	10,905,593.94	825,904.63	11,731,498.57
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-37,434,313.10	3,381,653.66	-34,052,659.44

长城价值甄选一年持有混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-2,637,731.46	300,190.23	-2,337,541.23
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-2,637,731.46	300,190.23	-2,337,541.23
本期利润	-3,778,906.61	115,878.38	-3,663,028.23

本期基金份额交易产生的变动数	1,291,187.52	23,001.48	1,314,189.00
其中：基金申购款	-15,904.42	-408.58	-16,313.00
基金赎回款	1,307,091.94	23,410.06	1,330,502.00
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-5,125,450.55	439,070.09	-4,686,380.46

7.4.7.13 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12月31日	上年度可比期间 2022年4月7日（基金合同生效日）至2022年12月31日
活期存款利息收入	67,828.85	169,125.34
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	12,267.85	920,308.84
其他	1,272.90	767.47
合计	81,369.60	1,090,201.65

7.4.7.14 股票投资收益

7.4.7.14.1 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12月31日	上年度可比期间 2022年4月7日（基金合同生效日）至2022年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-30,198,098.71	-22,719,482.25
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	-30,198,098.71	-22,719,482.25

7.4.7.14.2 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12月31日	上年度可比期间 2022年4月7日（基金合同生效日）至2022年12月31日
卖出股票成交总额	813,796,931.73	431,024,979.16

减：卖出股票成本总额	841,680,536.53	452,229,518.89
减：交易费用	2,314,493.91	1,514,942.52
买卖股票差价收入	-30,198,098.71	-22,719,482.25

7.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

7.4.7.15 债券投资收益

7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年4月7日（基金合同生效日）至2022年12月31日
债券投资收益——利息收入	-	4.92
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-	17,356.66
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	-	17,361.58

7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年4月7日（基金合同生效日）至2022年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	-	50,363.60
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	-	33,000.00
减：应计利息总额	-	4.92
减：交易费用	-	2.02
买卖债券差价收入	-	17,356.66

7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

7.4.7.16 资产支持证券投资收益

7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：无。

7.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：无。

7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：无。

7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：无。

7.4.7.17 贵金属投资收益

7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：无。

7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

7.4.7.18 衍生工具收益

7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：无。

7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无。

7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 4 月 7 日（基金合同生效 日）至 2022 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利 收益	2,165,166.21	1,194,839.50

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	2,165,166.21	1,194,839.50

7.4.7.20 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 12月31日	上年度可比期间 2022年4月7日（基金合 同生效日）至2022年12月31 日
1. 交易性金融资产	109,476.21	2,843,709.17
股票投资	109,476.21	2,843,709.17
债券投资	0.00	-
资产支持证券投资	0.00	-
基金投资	0.00	-
贵金属投资	0.00	-
其他	-	-
2. 衍生工具	0.00	-
权证投资	0.00	-
3. 其他	0.00	-
减：应税金融商品公允价值 变动产生的预估增值税	-	-
合计	109,476.21	2,843,709.17

7.4.7.21 其他收入

注：无。

7.4.7.22 信用减值损失

注：无。

7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12 月31日	上年度可比期间 2022年4月7日（基金合同生效日） 至2022年12月31日
审计费用	40,000.00	38,000.00
信息披露费	120,000.00	80,000.00
证券出借违约金	-	-
银行费用	12,626.34	11,355.92
深港通_证券组合费	328.82	-
合计	172,955.16	129,355.92

7.4.7.24 分部报告

截至本报告期末，本基金仅在中国大陆境内从事证券投资单一业务，因此，无需作披露的分部报告。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准日，本基金无需作披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
长城基金管理有限公司（“长城基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人、基金销售机构
东方证券股份有限公司（“东方证券”）	基金管理人的股东
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
北方国际信托股份有限公司（“北方国际”）	基金管理人的股东
中原信托有限公司（“中原信托”）	基金管理人的股东
长城嘉信资产管理有限公司（“长城嘉信”）	基金管理人的控股子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年4月7日（基金合同生效日） 至2022年12月31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	166,347,747.35	10.55	-	-
东方证券	58,024,722.69	3.68	-	-

7.4.10.1.2 债券交易

注：无。

7.4.10.1.3 债券回购交易

注：无。

7.4.10.1.4 权证交易

注：无。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
东方证券	54,885.05	3.73	54,885.05	17.00
长城证券	151,659.90	10.31	84,695.16	26.24
关联方名称	上年度可比期间 2022年4月7日（基金合同生效日）至2022年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
-	-	-	-	-

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

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

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12 月31日	上年度可比期间 2022年4月7日（基金合同 生效日）至2022年12月31 日
当期发生的基金应支付的管理费	2,415,475.57	2,695,413.48
其中：应支付销售机构的客户维护 费	1,111,883.24	1,136,671.31
应支付基金管理人的净管理费	1,303,592.33	1,558,742.17

注：自2023年1月1日至2023年8月20日，支付基金管理人长城基金的管理人报酬按前一日基金资产净值1.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.50\% / \text{当年天数}。$$

根据本基金的基金管理人于2023年8月18日发布的《长城基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告》，自2023年8月21日起，支付基金管理人长城基金的管理人报酬按前一日基金资产净值1.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.20%/当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年4月7日（基金合同生效日）至2022年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	402,579.33	449,235.57

注：自2023年1月1日至2023年8月20日，支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

根据本基金的基金管理人于2023年8月18日发布的《长城基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告》，自2023年8月21日起，支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值×0.20%/当年天数。

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	长城价值甄选一年持有混合 A	长城价值甄选一年持有混合 C	合计
长城基金管理有限公司	-	2,362.46	2,362.46
长城证券	-	13,820.21	13,820.21
中国银行	-	115,106.96	115,106.96
合计	-	131,289.63	131,289.63
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2022年4月7日（基金合同生效日）至2022年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	长城价值甄选一年持有混合 A	长城价值甄选一年持有混合 C	合计
长城基金管理有限公司	-	2,048.71	2,048.71
长城证券	-	16,057.55	16,057.55
中国银行	-	114,043.85	114,043.85
合计	-	132,150.11	132,150.11

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 0.8%。销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.8% 年费率计提。计算公式如下：

$$H = E \times 0.8\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

注：无。

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

注：无。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金的基金管理人于本期及上年度可比期间均未运用固有资金投资于本基金，于本期末及上年度末亦均未持有本基金份额。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：除基金管理人之外的本基金其他关联方于本期末及上年度末均未持有本基金份额。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2022 年 4 月 7 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	14,250,113.75	67,828.85	41,821,123.79	169,125.34

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

注：本基金于本期未进行利润分配。

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

7.4.8.2 资产负债表日后事项。

7.4.12 期末（2023 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
301251	威尔高	2023年8月30日	6个月	新股锁定	28.88	34.59	129	3,725.52	4,462.11	-
301418	协昌科技	2023年8月10日	6个月	新股锁定	51.88	50.20	79	4,098.52	3,965.80	-
301507	民生健康	2023年8月24日	6个月	新股锁定	10.00	15.85	315	3,150.00	4,992.75	-
301510	固高科技	2023年8月4日	6个月	新股锁定	12.00	35.01	332	3,984.00	11,623.32	-
301529	福赛科技	2023年8月31日	6个月	新股锁定	36.60	37.88	90	3,294.00	3,409.20	-
301533	威马农机	2023年8月7日	6个月	新股锁定	29.50	33.16	151	4,454.50	5,007.16	-
603004	鼎龙科技	2023年12月20日	6个月	新股锁定	16.80	31.19	66	1,108.80	2,058.54	-
603075	热威股份	2023年9月1日	6个月	新股锁定	23.10	23.31	64	1,478.40	1,491.84	-
603119	浙江荣泰	2023年7月	6个月	新股锁定	15.32	23.87	79	1,210.28	1,885.73	-

		21 日								
603193	润本股份	2023 年 10 月 9 日	6 个月	新股锁定	17.38	16.66	109	1,894.42	1,815.94	-
603273	天元智能	2023 年 10 月 16 日	6 个月	新股锁定	9.50	18.97	141	1,339.50	2,674.77	-
688548	广钢气体	2023 年 8 月 8 日	6 个月	新股锁定	9.87	12.75	590	5,823.30	7,522.50	-
688549	中巨芯	2023 年 8 月 30 日	6 个月	新股锁定	5.18	8.09	829	4,294.22	6,706.61	-
688602	康鹏科技	2023 年 7 月 13 日	6 个月	新股锁定	8.66	11.06	447	3,871.02	4,943.82	-
688651	盛邦安全	2023 年 7 月 19 日	6 个月	新股锁定	39.90	46.05	107	4,269.30	4,927.35	-
688693	锆威特	2023 年 8 月 10 日	6 个月	新股锁定	40.83	43.41	95	3,878.85	4,123.95	-

注：1、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股中需要限售的部分或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

2、基金参与上市公司向特定对象发行股票所获得的股票，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。

3、基金作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

4、基金通过询价转让受让的科创板股份，在受让后 6 个月内不得转让。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 12 月 31 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回

购证券款余额为人民币 0.00 元，无质押债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 12 月 31 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为人民币 0.00 元，无质押债券。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券市值的 10%。

本基金的基金管理人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以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估以控制相应的信用风险。

于 2023 年 12 月 31 日，本基金无债券投资(2022 年 12 月 31 日：同)。

7.4.13.3 流动性风险

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

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2023 年 12 月 31 日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为 0.0579%。本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于 2023 年 12 月 31 日，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现

金流量在很大程度上独立于市场利率变化。

本基金的生息资产主要为货币资金、结算备付金和存出保证金等。

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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	14,250,113.75	-	-	-	-	-	14,250,113.75
结算备付金	602,681.27	-	-	-	-	-	602,681.27
存出保证金	37,580.32	-	-	-	-	-	37,580.32
交易性金融资产	-	-	-	-	-	112,366,674.16	112,366,674.16
应收申购款	-	-	-	-	-	510.00	510.00
应收清算款	-	-	-	-	-	1,264,192.32	1,264,192.32
资产总计	14,890,375.34	-	-	-	-	113,631,376.48	128,521,751.82
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,036,362.42	1,036,362.42
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	124,991.27	124,991.27
应付托管费	-	-	-	-	-	20,831.87	20,831.87
应付清算款	-	-	-	-	-	3,077,057.74	3,077,057.74
应付销售服务费	-	-	-	-	-	9,513.54	9,513.54
其他负债	-	-	-	-	-	482,795.27	482,795.27
负债总计	-	-	-	-	-	4,751,552.11	4,751,552.11
利率敏感度缺口	14,890,375.34	-	-	-	-	-	-
上年度末 2022年12月31日							
资产							
货币资金	41,821,123.79	-	-	-	-	-	41,821,123.79
结算备付金	894,756.69	-	-	-	-	-	894,756.69
存出保证金	119,419.15	-	-	-	-	-	119,419.15
交易性金融资产	-	-	-	-	-	189,182,360.33	189,182,360.33
应收申购款	-	-	-	-	-	20.00	20.00
资产总计	42,835,299.63	-	-	-	-	189,182,380.33	232,017,679.96
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	294,991.16	294,991.16
应付托管费	-	-	-	-	-	49,165.17	49,165.17
应付销售服务费	-	-	-	-	-	16,651.69	16,651.69
其他负债	-	-	-	-	-	553,658.79	553,658.79

负债总计	-	-	-	-	-	914,466.81	914,466.81
利率敏感度缺口	42,835,299.63	-	-	-	-		

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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。

7.4.13.4.2 外汇风险

本基金的投资范围包括内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的香港证券市场股票，如果港币资产相对于人民币贬值，将对基金收益产生不利影响；港币对人民币的汇率大幅波动也将加大基金净值波动的幅度。本基金持有不以记账本位币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2023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	-	8,201,630.29	-	8,201,630.29
资产合计	-	8,201,630.29	-	8,201,630.29
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	-	8,201,630.29	-	8,201,630.29
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				
资产合计	-	-	-	-

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	-	-	-	-

7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇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（2023 年 12 月 31 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	所有外币均相对人民币升值 5%	410,081.51	-
	所有外币均相对人民币贬值 5%	-410,081.51	-

7.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金的投资组合比例为：本基金股票投资占基金资产的比例为 60%-95%，其中投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%；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；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。

本基金于本期末及上年度末面临的整体其他价格风险列示如下：

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 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	112,366,674.16	90.79	189,182,360.33	81.86
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	112,366,674.16	90.79	189,182,360.33	81.86

7.4.13.4.3.2 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（2023 年 12 月 31 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数上升 5%	4,372,749.12	9,704,109.17
	沪深 300 指数下降 5%	-4,372,749.12	-9,704,109.17

7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

注：无。

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 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 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
---------------	-------------------------	--------------------------

第一层次	112,295,062.77	188,723,973.33
第二层次	-	-
第三层次	71,611.39	458,387.00
合计	112,366,674.16	189,182,360.33

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

<p>本基金调整公允价值计量层次转换时点的相关会计政策在前后各会计期间保持一致。</p> <p>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。</p>

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	458,387.00	458,387.00
当期购买	-	0.00	0.00
当期出售/结算	-	0.00	0.00
转入第三层次	-	126,007.50	126,007.50
转出第三层次	-	604,049.75	604,049.75
当期利得或损失总额	-	91,266.64	91,266.64
其中：计入损益的利得或损失	-	91,266.64	91,266.64
计入其他综合收益的利得或损失	-	0.00	0.00
期末余额	-	71,611.39	71,611.39
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	19,736.76	19,736.76
项目	上年度可比期间 2022年4月7日（基金合同生效日）至2022年12月31日		
	交易性金融资产		合计

	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	438,254.18	438,254.18
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	20,132.82	20,132.82
其中：计入损益的利得或损失	-	20,132.82	20,132.82
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	458,387.00	458,387.00
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	20,132.82	20,132.82

注：于 2023 年 12 月 31 日，本基金持有的第三层次的交易性金融资产均为证券交易所上市交易但尚在限售期内的股票投资。于 2023 年度，本基金从第三层次转出的交易性金融资产均为限售期结束可正常交易的股票投资。

计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
流通受限股票	71,611.39	平均价格亚式期权模型	预期波动率	0.1962-2.1988	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
流通受限股票	458,387.00	平均价格亚式期权模型	预期波动率	0.2127-0.6989	负相关

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

无。

7.4.14.4 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。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	112,366,674.16	87.43
	其中：股票	112,366,674.16	87.43
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	14,852,795.02	11.56
8	其他各项资产	1,302,282.64	1.01
9	合计	128,521,751.82	100.00

注：权益投资中通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 8,201,630.29 元，占基金资产净值的比例为 6.63%。

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	10,131,319.00	8.19
B	采矿业	40,707,342.00	32.89
C	制造业	49,016,993.11	39.60
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,089,240.04	2.50
E	建筑业	3,542.73	0.00
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	1,197,000.00	0.97

H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	19,606.99	0.02
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	104,165,043.87	84.16

8.2.2 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	2,749,811.31	2.22
B 消费者非必需品	-	-
C 消费者常用品	-	-
D 能源	1,286,541.87	1.04
E 金融	-	-
F 医疗保健	-	-
G 工业	2,911,974.85	2.35
H 信息科技	1,253,302.26	1.01
I 电信服务	-	-
J 公用事业	-	-
K 房地产	-	-
合计	8,201,630.29	6.63

注：以上分类采用财汇大智慧提供的国际通用行业分类标准。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	601899	紫金矿业	720,200	8,973,692.00	7.25
2	000975	银泰黄金	430,500	6,457,500.00	5.22
3	601233	桐昆股份	309,900	4,688,787.00	3.79
4	603979	金诚信	116,400	4,395,264.00	3.55
5	000630	铜陵有色	1,267,700	4,158,056.00	3.36
6	603225	新凤鸣	285,600	4,055,520.00	3.28
7	601168	西部矿业	274,200	3,912,834.00	3.16
8	601702	华峰铝业	215,400	3,866,430.00	3.12
9	002714	牧原股份	93,100	3,833,858.00	3.10

10	603477	巨星农牧	95,900	3,593,373.00	2.90
11	000923	河钢资源	195,500	3,284,400.00	2.65
12	002567	唐人神	412,000	3,090,000.00	2.50
13	01138	中远海能	436,000	2,911,974.85	2.35
14	601225	陕西煤业	135,300	2,826,417.00	2.28
15	01818	招金矿业	312,500	2,749,811.31	2.22
16	300498	温氏股份	134,800	2,704,088.00	2.18
17	603393	新天然气	81,100	2,479,227.00	2.00
18	601600	中国铝业	438,000	2,470,320.00	2.00
19	000426	兴业银锡	264,000	2,397,120.00	1.94
20	000932	华菱钢铁	396,900	2,044,035.00	1.65
21	000807	云铝股份	155,500	1,900,210.00	1.54
22	002050	三花智控	51,600	1,517,040.00	1.23
23	601699	潞安环能	68,400	1,498,644.00	1.21
24	600985	淮北矿业	86,400	1,436,832.00	1.16
25	603298	杭叉集团	56,700	1,410,696.00	1.14
26	000933	神火股份	83,000	1,394,400.00	1.13
27	688639	华恒生物	10,816	1,361,734.40	1.10
28	600150	中国船舶	45,100	1,327,744.00	1.07
29	600989	宝丰能源	89,000	1,314,530.00	1.06
30	01164	中广核矿业	825,395	1,286,541.87	1.04
31	000893	亚钾国际	48,500	1,272,640.00	1.03
32	01415	高伟电子	60,000	1,253,302.26	1.01
33	600348	华阳股份	128,400	1,253,184.00	1.01
34	688236	春立医疗	47,570	1,251,091.00	1.01
35	600547	山东黄金	54,100	1,237,267.00	1.00
36	300037	新宙邦	26,000	1,229,800.00	0.99
37	600123	兰花科创	110,400	1,218,816.00	0.98
38	603688	石英股份	14,000	1,216,320.00	0.98
39	688017	绿的谐波	7,876	1,208,966.00	0.98
40	601918	新集能源	228,100	1,202,087.00	0.97
41	601975	招商南油	427,500	1,197,000.00	0.97
42	600399	抚顺特钢	118,300	1,149,876.00	0.93
43	300818	耐普矿机	33,600	1,109,136.00	0.90
44	688378	奥来德	17,889	846,865.26	0.68
45	688550	瑞联新材	16,672	661,544.96	0.53
46	688301	奕瑞科技	1,981	644,340.06	0.52
47	688548	广钢气体	48,193	629,217.68	0.51
48	688630	芯碁微装	7,352	627,640.24	0.51
49	002149	西部材料	39,200	616,224.00	0.50
50	688102	斯瑞新材	46,524	613,651.56	0.50
51	600259	广晟有色	17,300	613,285.00	0.50
52	002466	天齐锂业	10,800	602,532.00	0.49

53	300811	铂科新材	11,200	592,144.00	0.48
54	605090	九丰能源	21,200	592,116.00	0.48
55	603004	鼎龙科技	660	23,442.54	0.02
56	001376	百通能源	804	17,897.04	0.01
57	688443	智翔金泰	312	12,464.40	0.01
58	301510	固高科技	332	11,623.32	0.01
59	301307	美利信	302	10,476.38	0.01
60	688472	阿特斯	752	9,497.76	0.01
61	688146	中船特气	239	8,128.39	0.01
62	301315	威士顿	139	7,347.54	0.01
63	688433	华曙高科	233	7,281.25	0.01
64	688549	中巨芯	829	6,706.61	0.01
65	301251	威尔高	182	6,362.16	0.01
66	688570	天玛智控	200	5,442.00	0.00
67	301533	威马农机	151	5,007.16	0.00
68	301507	民生健康	315	4,992.75	0.00
69	688602	康鹏科技	447	4,943.82	0.00
70	688651	盛邦安全	107	4,927.35	0.00
71	688631	莱斯信息	122	4,300.50	0.00
72	688693	锆威特	95	4,123.95	0.00
73	301418	协昌科技	79	3,965.80	0.00
74	688429	时创能源	186	3,941.34	0.00
75	601133	柏诚股份	269	3,542.73	0.00
76	301529	福赛科技	90	3,409.20	0.00
77	688623	双元科技	48	3,407.04	0.00
78	688479	友车科技	130	3,031.60	0.00
79	603273	天元智能	141	2,674.77	0.00
80	001367	海森药业	55	2,417.80	0.00
81	603119	浙江荣泰	79	1,885.73	0.00
82	603193	润本股份	109	1,815.94	0.00
83	603075	热威股份	64	1,491.84	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 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	000858	五粮液	12,857,714.00	5.56
2	600600	青岛啤酒	12,856,462.00	5.56
3	002304	洋河股份	12,849,156.00	5.56
4	601138	工业富联	12,333,250.80	5.34
5	600690	海尔智家	11,950,280.77	5.17
6	300750	宁德时代	11,484,996.80	4.97
7	601899	紫金矿业	11,201,302.00	4.85

8	000063	中兴通讯	10,742,304.00	4.65
9	601600	中国铝业	9,698,483.00	4.20
10	600985	淮北矿业	9,608,703.00	4.16
11	002594	比亚迪	9,525,527.00	4.12
12	600809	山西汾酒	8,589,454.00	3.72
13	000661	长春高新	8,507,212.00	3.68
14	01138	中远海能	6,429,277.70	2.78
14	600026	中远海能	2,072,819.00	0.90
15	000799	酒鬼酒	7,447,358.50	3.22
16	603288	海天味业	7,259,917.47	3.14
17	000651	格力电器	7,256,168.78	3.14
18	600329	达仁堂	7,199,853.00	3.12
19	000932	华菱钢铁	7,192,714.00	3.11
20	000999	华润三九	7,065,746.70	3.06
21	002179	中航光电	7,040,506.68	3.05
22	603198	迎驾贡酒	7,020,206.88	3.04
23	688111	金山办公	6,984,831.05	3.02
24	600276	恒瑞医药	6,795,278.88	2.94
25	000807	云铝股份	6,718,524.00	2.91
26	300979	华利集团	6,633,099.00	2.87
27	600422	昆药集团	6,542,198.70	2.83
28	601186	中国铁建	6,355,276.00	2.75
29	000933	神火股份	6,351,884.00	2.75
30	002271	东方雨虹	6,319,148.35	2.73
31	600547	山东黄金	6,252,684.44	2.71
32	002415	海康威视	6,235,443.00	2.70
33	601702	华峰铝业	6,226,838.00	2.69
34	002384	东山精密	5,987,152.00	2.59
35	600559	老白干酒	5,923,973.73	2.56
36	000975	银泰黄金	5,864,102.06	2.54
37	000923	河钢资源	5,829,097.00	2.52
38	601100	恒立液压	5,799,439.00	2.51
39	600941	中国移动	5,733,260.00	2.48
40	600009	上海机场	5,646,723.00	2.44
41	688981	中芯国际	5,621,311.93	2.43
42	601666	平煤股份	5,568,893.00	2.41
43	01378	中国宏桥	5,539,204.84	2.40
44	600519	贵州茅台	5,521,171.00	2.39
45	601689	拓普集团	5,427,925.00	2.35
46	603688	石英股份	5,338,535.00	2.31
47	603993	洛阳钼业	5,292,263.00	2.29
48	601225	陕西煤业	5,280,633.00	2.28
49	601688	华泰证券	5,280,472.00	2.28

50	000860	顺鑫农业	5,201,379.00	2.25
51	601001	晋控煤业	4,967,715.00	2.15
52	01818	招金矿业	4,861,192.66	2.10
53	603259	药明康德	4,683,125.00	2.03
54	601975	招商南油	4,669,323.49	2.02
55	000333	美的集团	4,627,398.00	2.00

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

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 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	000568	泸州老窖	23,061,443.00	9.98
2	000596	古井贡酒	16,315,576.33	7.06
3	600809	山西汾酒	15,372,032.50	6.65
4	600519	贵州茅台	15,105,272.00	6.54
5	000858	五粮液	13,657,455.00	5.91
6	002304	洋河股份	13,570,584.00	5.87
7	601138	工业富联	13,536,192.00	5.86
8	601888	中国中免	12,349,244.00	5.34
9	600690	海尔智家	11,916,483.41	5.16
10	600600	青岛啤酒	11,556,430.00	5.00
11	600702	舍得酒业	11,076,007.00	4.79
12	002415	海康威视	10,961,807.00	4.74
13	000063	中兴通讯	10,861,559.00	4.70
14	300750	宁德时代	9,912,317.20	4.29
15	600009	上海机场	9,525,938.00	4.12
16	600985	淮北矿业	8,673,130.15	3.75
17	002594	比亚迪	8,497,548.00	3.68
18	000333	美的集团	8,312,440.57	3.60
19	600329	达仁堂	7,903,326.00	3.42
20	600004	白云机场	7,849,561.80	3.40
21	603939	益丰药房	7,811,837.00	3.38
22	002179	中航光电	7,720,689.00	3.34
23	603259	药明康德	7,571,580.00	3.28
24	000661	长春高新	7,476,277.00	3.24
25	600276	恒瑞医药	7,216,002.00	3.12
26	000999	华润三九	7,068,178.72	3.06
27	000963	华东医药	7,019,829.00	3.04
28	000799	酒鬼酒	6,960,402.00	3.01
29	603198	迎驾贡酒	6,880,681.00	2.98
30	002142	宁波银行	6,721,277.70	2.91
31	601600	中国铝业	6,685,481.00	2.89
32	600941	中国移动	6,590,622.40	2.85

33	000651	格力电器	6,506,923.00	2.82
34	603288	海天味业	6,344,862.28	2.75
35	603605	珀莱雅	6,300,723.20	2.73
36	600422	昆药集团	6,217,607.48	2.69
37	601186	中国铁建	6,081,243.74	2.63
38	601666	平煤股份	5,973,556.00	2.58
39	688111	金山办公	5,878,914.40	2.54
40	002271	东方雨虹	5,757,086.00	2.49
41	600079	人福医药	5,692,986.58	2.46
42	002384	东山精密	5,419,865.00	2.35
43	600559	老白干酒	5,311,149.87	2.30
44	300979	华利集团	5,300,825.00	2.29
45	600036	招商银行	5,210,967.00	2.25
46	000002	万科 A	5,154,257.00	2.23
47	601100	恒立液压	5,140,612.00	2.22
48	601688	华泰证券	5,103,790.00	2.21
49	601001	晋控煤业	5,101,662.00	2.21
50	601318	中国平安	5,052,411.00	2.19
51	600761	安徽合力	5,052,401.00	2.19
52	01138	中远海能	3,048,243.80	1.32
52	600026	中远海能	1,991,197.00	0.86
53	000932	华菱钢铁	4,879,696.00	2.11
54	000860	顺鑫农业	4,842,038.96	2.10
55	000933	神火股份	4,836,542.00	2.09
56	688981	中芯国际	4,831,938.14	2.09
57	601689	拓普集团	4,804,877.00	2.08
58	603993	洛阳钼业	4,693,090.00	2.03
59	002508	老板电器	4,629,549.00	2.00

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

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	764,755,374.15
卖出股票收入（成交）总额	813,796,931.73

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：无。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：无。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：无。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：无。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：无。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**8.11.1 本期国债期货投资政策**

本基金投资国债期货将根据风险管理的原则，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，在追求基金资产安全的基础上，力求实现基金资产的中长期稳定增值。国债期货相关投资遵循法律法规及中国证监会的规定。

8.11.2 本期国债期货投资评价

无。

8.12 投资组合报告附注**8.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形**

本报告期内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。

8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中，未有投资于超出基金合同规定备选股票库之外股票。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	37,580.32
2	应收清算款	1,264,192.32
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	510.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	1,302,282.64
---	----	--------------

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：无。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：无。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	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 (%)
长城价值甄选一年持有混合 A	1,409	101,906.93	79,127.27	0.06	143,507,734.14	99.94
长城价值甄选一年持有混合 C	563	33,609.91	-	-	18,922,378.20	100.00
合计	1,972	82,408.34	79,127.27	0.05	162,430,112.34	99.95

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

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	长城价值甄选一年持有混合 A	1,751,784.03	1.2200
	长城价值甄选一年持有混合 C	150,099.51	0.7932
	合计	1,901,883.54	1.1703

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）。

分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	长城价值甄选一年持有混合 A	50~100
	长城价值甄选一年持有混合 C	10~50
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	长城价值甄选一年持有混合 A	0~10
	长城价值甄选一年持有混合 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。

9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产情况

注：本报告期无基金经理兼任投资经理的情况。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	长城价值甄选一年持有混合 A	长城价值甄选一年持有混合 C
基金合同生效日 (2022 年 4 月 7 日) 基金份额总额	223,924,275.79	26,692,244.76
本报告期期初基金份额总额	225,074,077.72	26,792,681.29
本报告期基金总申购份额	414,136.22	102,443.10
减：本报告期基金总赎回份额	81,901,352.53	7,972,746.19
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	143,586,861.41	18,922,378.20

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、基金管理人重大人事变动：

自 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。

自 2023 年 9 月 15 日起，车君女士担任公司副总经理，不再担任公司督察长。

自 2023 年 9 月 15 日起，祝函先生担任公司督察长。

2、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：

本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本基金本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略无改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

1、本基金本报告期应支付给会计师事务所的报酬为人民币肆万元。

2、目前为本基金提供审计服务的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙），为本基金提供审计服务自本基金合同生效日持续至本报告期。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 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。

11.6.2 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元	股票交易	应支付该券商的佣金	备注
------	------	------	-----------	----

	数量	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 (%)	
国投证券	2	185,900,639.78	11.79	173,482.84	11.80	-
开源证券	2	170,044,755.31	10.78	158,363.78	10.77	-
长城证券	5	166,347,747.35	10.55	151,659.90	10.31	-
国信证券	2	162,050,345.44	10.28	151,742.53	10.32	-
粤开证券	2	138,624,815.49	8.79	130,287.98	8.86	-
中泰证券	2	122,059,782.64	7.74	113,674.39	7.73	-
中信建投	2	118,778,828.51	7.53	110,618.58	7.52	-
浙商证券	1	117,054,234.43	7.42	109,976.79	7.48	-
海通证券	2	80,569,233.21	5.11	75,527.58	5.14	-
申万宏源	1	76,578,662.00	4.86	71,432.52	4.86	-
平安证券	1	76,357,244.00	4.84	71,111.78	4.84	-
东方证券	1	58,024,722.69	3.68	54,885.05	3.73	-
中信证券	2	57,426,411.62	3.64	53,480.75	3.64	-
光大证券	1	29,498,593.61	1.87	27,903.44	1.90	-
申港证券	2	17,528,453.41	1.11	16,324.17	1.11	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
东方财富	2	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
华福证券	2	-	-	-	-	-
华林证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	2	-	-	-	-	-
华鑫证券	2	-	-	-	-	-
山西证券	2	-	-	-	-	-

上海证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
招商证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
中山证券	1	-	-	-	-	-

注：1、报告期内租用证券公司席位的变更情况：

本报告期内新增 7 个专用交易单元（西部证券、东方证券和广发证券各新增 1 个交易单元；长城证券和华福证券各新增 2 个交易单元），截止本报告期末共计 56 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。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
国投证券	-	-	-	-	-	-

开源证 券	-	-	-	-	-	-
长城证 券	-	-	-	-	-	-
国信证 券	-	-	-	-	-	-
粤开证 券	-	-	-	-	-	-
中泰证 券	-	-	-	-	-	-
中信建 投	-	-	-	-	-	-
浙商证 券	-	-	-	-	-	-
海通证 券	-	-	-	-	-	-
申万宏 源	-	-	-	-	-	-
平安证 券	-	-	-	-	-	-
东方证 券	-	-	-	-	-	-
中信证 券	-	-	-	-	-	-
光大证 券	-	-	-	-	-	-
申港证 券	-	-	-	-	-	-
长江证 券	-	-	-	-	-	-
东北证 券	-	-	-	-	-	-
东方财 富	-	-	-	-	-	-
方正证 券	-	-	-	-	-	-
广发证 券	-	-	-	-	-	-
华福证 券	-	-	-	-	-	-
华林证 券	-	-	-	-	-	-
华泰证 券	-	-	-	-	-	-

华西证 券	-	-	-	-	-	-
华鑫证 券	-	-	-	-	-	-
山西证 券	-	-	-	-	-	-
上海证 券	-	-	-	-	-	-
天风证 券	-	-	-	-	-	-
万联证 券	-	-	-	-	-	-
西部证 券	-	-	-	-	-	-
信达证 券	-	-	-	-	-	-
招商证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
中山证 券	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	长城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
2	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
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 4 月 10 日
4	长城基金管理有限公司关于提醒投资者及时提供或更新身份信息资料的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 7 月 1 日
5	长城价值甄选一年持有期混合型证券投资基金基金经理变更的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 8 月 15 日
6	长城基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 8 月 18 日
7	长城基金管理有限公司关于终止凤凰金信（海口）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	2023 年 9 月 4 日
8	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 9 月 16 日
9	长城基金管理有限公司关于旗下基金开展线上直销系统费率优惠活动的公	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 11 月 7 日

	告		
10	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 11 月 23 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注：本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- (一) 中国证监会准予长城价值甄选一年持有期混合型证券投资基金注册的文件
- (二) 《长城价值甄选一年持有期混合型证券投资基金基金合同》
- (三) 《长城价值甄选一年持有期混合型证券投资基金托管协议》
- (四) 《长城价值甄选一年持有期混合型证券投资基金招募说明书》
- (五) 法律意见书
- (六) 基金管理人业务资格批件、营业执照
- (七) 基金托管人业务资格批件、营业执照
- (八) 中国证监会规定的其他文件

13.2 存放地点

基金管理人及基金托管人住所

13.3 查阅方式

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

咨询电话：0755-29279188

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 3 月 29 日