

# 长城新优选混合型证券投资基金

## 2025 年中期报告

2025 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：中国民生银行股份有限公司

送出日期：2025 年 8 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。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 08 月 28 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 2025 年 01 月 01 日起至 2025 年 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	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
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
<b>§ 4 管理人报告</b>	9
4.1 基金经理及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
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	13
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	13
<b>§ 5 托管人报告</b>	13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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等内容的真实、准确和完整发表意见	14
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	19
<b>§ 7 投资组合报告</b>	44
7.1 期末基金资产组合情况	44
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	44
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	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	51
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	52
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	52
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	53
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	53

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 .....	53
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	53
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	53
7.12 投资组合报告附注 .....	53
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>54</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	54
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	55
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 .....	55
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>55</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>56</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	56
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 .....	56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	56
10.4 基金投资策略的改变 .....	56
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	56
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 .....	56
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	56
10.8 其他重大事件 .....	58
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>58</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况 .....	58
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	59
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>59</b>
12.1 备查文件目录 .....	59
12.2 存放地点 .....	59
12.3 查阅方式 .....	59

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	长城新优选混合型证券投资基金	
基金简称	长城新优选混合	
基金主代码	002227	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 3 月 22 日	
基金管理人	长城基金管理有限公司	
基金托管人	中国民生银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	312,991,915.30 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	长城新优选混合 A	长城新优选混合 C
下属分级基金的交易代码	002227	002228
报告期末下属分级基金的份额总额	161,060,107.86 份	151,931,807.44 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险的前提下，通过灵活的资产配置策略和积极主动的投资管理，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	<p>1、资产配置策略 本基金为混合型证券投资基金，将依据市场情况灵活进行基金的大类资产配置。在资本市场深入分析的基础上，本基金将参考基金流动性要求，以使基金资产的风险和收益在股票、债券及短期金融工具中实现最佳匹配。</p> <p>2、债券投资策略 在大类资产配置基础上，本基金通过综合分析宏观经济形势、财政政策、货币政策、债券市场券种供求关系及资金供求关系，主动判断市场利率变化趋势，确定和动态调整固定收益类资产的平均久期及债券资产配置。本基金具体债券投资策略包括久期管理策略、收益率曲线策略、个券选择策略、可转换债券投资策略、中小企业私募债投资策略、债券回购杠杆策略等。</p> <p>3、股票投资策略 本基金将主要遵循“自下而上”的分析框架，采用定性分析和定量分析相结合的方法精选具有持续竞争优势和增长潜力、估值合理的上市公司股票进行投资，以此构建股票组合。</p>
业绩比较基准	15%×中证 800 指数收益率+85%×中债综合财富指数收益率
风险收益特征	本基金的长期平均风险和预期收益率低于股票型基金，高于债券型基金、货币市场基金，属于中等风险、中等收益的基金产品。

## 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	中国民生银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	祝函	林盛
	联系电话	0755-29279006	010-58560666
	电子邮箱	zuhuan@ccfund.com.cn	tgxxpl@cmbc.com.cn
客户服务电话		400-8868-666	95568
传真		0755-29279000	010-57093382
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 2 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、38 层、39 层	北京市西城区复兴门内大街 2 号
邮政编码	518046	100031	
法定代表人	王军	高迎欣	

## 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、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(2025年1月1日-2025年6月30日)	
	长城新优选混合 A	长城新优选混合 C
本期已实现收益	2,304,116.90	1,448,466.90
本期利润	1,102,278.89	475,446.49
加权平均基金份额本期利润	0.0058	0.0030
本期加权平均净值利润率	0.47%	0.25%

本期基金份额净值增长率	0.54%	0.29%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2025年6月30日)	
期末可供分配利润	33,590,455.33	28,657,042.25
期末可供分配基金份额利润	0.2086	0.1886
期末基金资产净值	198,257,008.35	184,279,766.25
期末基金份额净值	1.2310	1.2129
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	49.64%	46.94%

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

长城新优选混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率为标准差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	0.56%	0.09%	0.87%	0.08%	-0.31%	0.01%
过去三个月	0.69%	0.14%	1.66%	0.14%	-0.97%	0.00%
过去六个月	0.54%	0.13%	1.12%	0.15%	-0.58%	-0.02%
过去一年	3.50%	0.19%	6.66%	0.20%	-3.16%	-0.01%
过去三年	2.97%	0.18%	11.77%	0.16%	-8.80%	0.02%
自基金合同生效	49.64%	0.19%	43.27%	0.17%	6.37%	0.02%

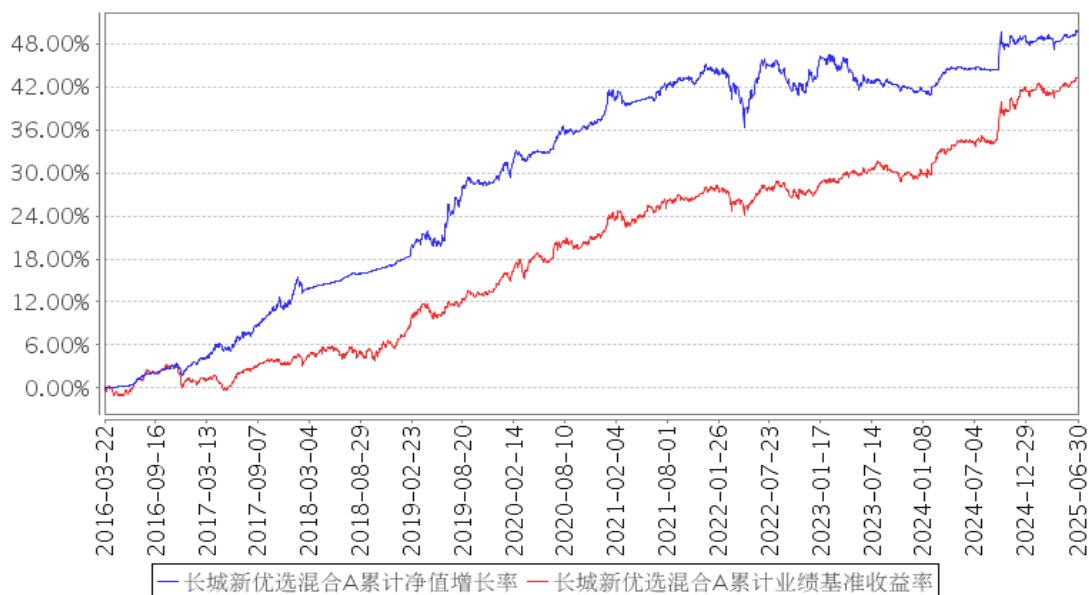
起至今						
-----	--	--	--	--	--	--

## 长城新优选混合 C

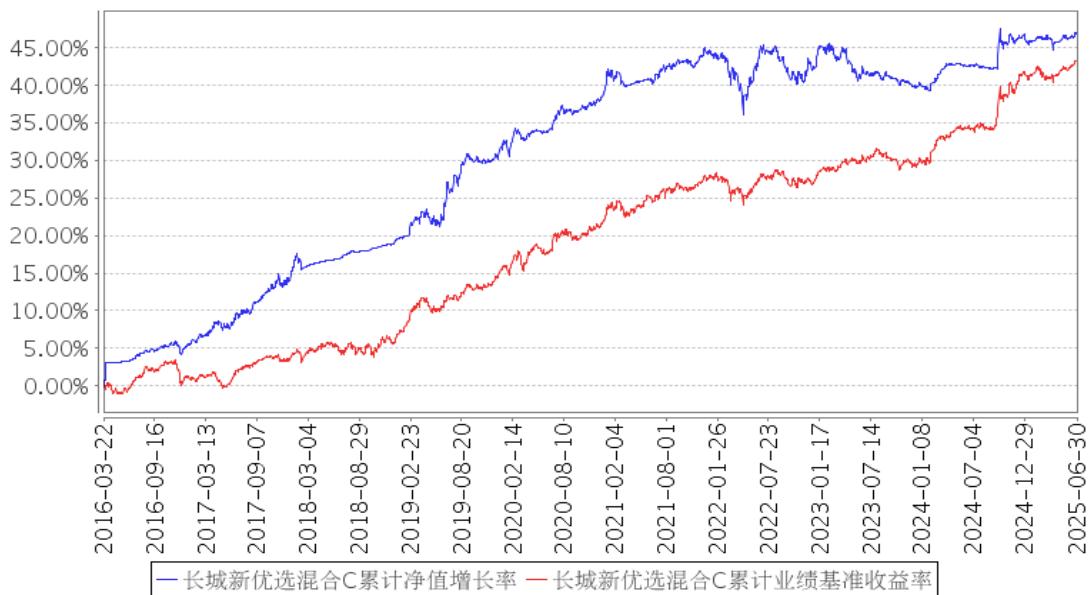
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.51%	0.09%	0.87%	0.08%	-0.36%	0.01%
过去三个月	0.56%	0.14%	1.66%	0.14%	-1.10%	0.00%
过去六个月	0.29%	0.13%	1.12%	0.15%	-0.83%	-0.02%
过去一年	2.97%	0.19%	6.66%	0.20%	-3.69%	-0.01%
过去三年	1.43%	0.18%	11.77%	0.16%	— 10.34%	0.02%
自基金合同生效起至今	46.94%	0.19%	43.27%	0.17%	3.67%	0.02%

### 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

长城新优选混合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



### 长城新优选混合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投资组合中股票投资比例为基金资产的 0%-30%；本基金现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计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。

## § 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 2025 年 6 月 30 日，公

司旗下共管理 114 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		
马强	公司总经理助理、多元资产投资部总经理、基金组合投资部总经理、本基金的基金经理	2016年4月15日	-	13年	男，中国籍，硕士、特许金融分析师(CFA)。2007年7月-2012年2月曾就职于招商银行股份有限公司，2012年2月-2012年9月曾就职于中国国际金融有限公司。2012年9月加入长城基金管理有限公司，历任产品研发部产品经理、固定收益部总经理、“长城积极增利债券型证券投资基金”、“长城保本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”及“长城久恒平衡型证券投资基金”基金经理助理。现任公司总经理助理、多元资产投资部总经理、基金组合投资部总经理、投委会委员兼基金经理。自2015年6月至2017年3月任“长城久恒灵活配置混合型证券投资基金”基金经理，自2015年12月至2018年6月任“长城久鑫保本混合型证券投资基金”基金经理，自2017年7月至2018年9月任“长城保本混合型证券投资基金”基金经理，自2016年4月至2018年11月任“长城久益保本混合型证券投资基金”，自2016年5月至2019年1月任“长城久安保本混合型证券投资基金”基金经理，自2016年11月至2019年1月任“长城久盛安稳纯债两年定期开放债券型证券投资基金”基金经理，自2015年12月至2019年1月任“长城新策略灵活配置混合型证券投资基金”基金经理，自2017年7月至2019年1月任“长城新视野混合型证券投资基金”基金经理，自2016年5月至2019年5月任“长城久润保本混合型证券投资基金”基金经理，自2016年7月至2019年7月任“长城久鼎保本混合型证券投资基金”基金经理，自2017年7月至2020年7月任“长城积极增利债券型证券投资基金”基金经理，自2019年2月至2020年7月任“长城久悦债券型证券投资基金”

					基金经理，自 2018 年 8 月至 2021 年 10 月任“长城久惠灵活配置混合型证券投资基金”基金经理，自 2018 年 11 月至 2024 年 6 月任“长城久益灵活配置混合型证券投资基金”基金经理，自 2021 年 4 月至 2025 年 5 月任“长城优选稳健六个月持有期混合型证券投资基金”基金经理。自 2016 年 4 月至今任“长城新优选混合型证券投资基金”，自 2020 年 11 月至今任“长城优选增强六个月持有期混合型证券投资基金”基金经理，自 2021 年 1 月至今任“长城优选回报六个月持有期混合型证券投资基金”基金经理，自 2021 年 3 月至今任“长城优选添瑞六个月持有期混合型证券投资基金”基金经理，自 2021 年 7 月至今任“长城优选添利一年持有期混合型证券投资基金”基金经理，自 2022 年 1 月至今任“长城优选招益一年持有期混合型证券投资基金”基金经理，自 2023 年 7 月至今任“长城久惠灵活配置混合型证券投资基金”基金经理，自 2023 年 9 月至今任“长城集利债券型发起式证券投资基金”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遵规守信情况的说明

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

上半年，我国经济运行总体稳中向好，GDP 同比增长 5.3%，实现预期目标。生产端和需求端稳定增长，社会消费品零售总额增速回稳，进出口贸易增速超预期，有效对冲了房地产开发投资持续下行的影响。货币政策方面，央行继续维持适度宽松的货币政策，小幅降息降准。贸易方面在二季度初遭遇美国发起的关税冲突扰动，但中美谈判很快取得进展。

上半年，人民币震荡升值，美元兑人民币汇率回落至 7.15，黄金价格持续上涨并创历史新高，国内债券市场收益率先上后下，股票市场震荡走高，风险偏好持续改善，各大指数均收涨，但板块分化显著，有色金属、国防军工、银行等板块领涨，煤炭、食品饮料、房地产板块相对跌幅较大。

本基金上半年债券部分的持仓以高等级、中短久期的债券为主，同时增持了部分低价转债，股票仓位维持中枢水平，组合结构进行了小幅微调。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期长城新优选混合 A 基金份额净值增长率为 0.54%，同期业绩比较基准收益率为 1.12%；长城新优选混合 C 基金份额净值增长率为 0.29%，同期业绩比较基准收益率为 1.12%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

自去年三季度末的政策组合拳发力以来，预期大幅反转，市场经历了一段强预期弱现实的阶段，股票市场快速拉升后进入到一段较长的震荡期，来消化预期与现实的分歧。展望下半年，我们认为国内经济将继续稳健运行，随着科技、制造、消费等多个细分行业中的龙头竞争力进一步增强，预计全球市场份额将进一步提升，企业盈利水平将继续改善，股票市场将逐步过渡到强预期强现实的阶段。货币政策将延续适度宽松的定位，在政策与基本面的相互配合下，预计资本市场整体将延续向好态势。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人改变估值技术，导致基金资产净值的变化在 0.25%以上的，则及时就所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性等咨询会计师事务所的专业意见。

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

本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期未进行利润分配，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遵规守信情况声明

本报告期内，中国民生银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规的规定和基金合同、托管协议的约定，依法安全保管了基金财产，不存在损害基金份额持有人利益的行为，尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，按照相关法律法规规定和基金合同、托管协议的有关约定，本托管人对本基金的投资运作方面进行了监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为，

在各重要方面的运作严格按照基金合同的约定进行。

### 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

本托管人复核审查的本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确和完整。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：长城新优选混合型证券投资基金

报告截止日：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025年6月30日	上年度末 2024年12月31日
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	626,425.15	505,855.85
结算备付金		867,773.87	1,979,660.39
存出保证金		3,824.34	44,072.11
交易性金融资产	6.4.7.2	361,020,774.42	442,883,585.26
其中：股票投资		59,605,797.50	57,798,835.40
基金投资		—	—
债券投资		301,414,976.92	385,084,749.86
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	34,239,000.00	14,899,894.46
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		158,763.93	386,211.09
应收股利		—	—
应收申购款		7,802.98	24,998.08
递延所得税资产		—	—
其他资产	6.4.7.8	—	—
资产总计		396,924,364.69	460,724,277.24
<b>负债和净资产</b>	附注号	<b>本期末 2025年6月30日</b>	<b>上年度末 2024年12月31日</b>
<b>负债：</b>			

短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6. 4. 7. 3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		13,971,256.18	760,339.69
应付管理人报酬		196,661.54	235,366.96
应付托管费		49,165.41	58,841.74
应付销售服务费		75,807.57	86,003.05
应付投资顾问费		-	-
应交税费		88.70	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6. 4. 7. 9	94,610.69	74,018.50
负债合计		14,387,590.09	1,214,569.94
<b>净资产：</b>			
实收基金	6. 4. 7. 10	312,991,915.30	377,334,321.16
其他综合收益	6. 4. 7. 11	-	-
未分配利润	6. 4. 7. 12	69,544,859.30	82,175,386.14
净资产合计		382,536,774.60	459,509,707.30
负债和净资产总计		396,924,364.69	460,724,277.24

注： 报告截止日 2025 年 06 月 30 日，基金份额总额 312,991,915.30 份，其中长城新优选混合 A 基金份额总额 161,060,107.86 份，基金份额净值 1.2310 元；长城新优选混合 C 基金份额总额 151,931,807.44 份，基金份额净值 1.2129 元。

## 6.2 利润表

会计主体：长城新优选混合型证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
<b>一、营业收入</b>		3,739,899.06	15,602,772.51
1. 利息收入		177,069.62	1,364,836.40
其中：存款利息收入	6. 4. 7. 13	8,637.97	189,916.88
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		168,431.65	1,174,919.52
其他利息收入		-	-

2. 投资收益（损失以“-”填列）		5,734,322.13	7,139,353.32
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-321,458.43	-487,878.02
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	5,223,311.07	7,262,996.17
资产支持证券投 资收益	6.4.7.16	-	-
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	832,469.49	364,235.17
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	-2,174,858.42	7,092,880.86
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	3,365.73	5,701.93
<b>减：二、营业总支出</b>		2,162,173.68	3,126,160.82
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,264,241.07	1,950,747.72
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	316,060.33	487,686.94
3. 销售服务费		475,208.14	577,645.26
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		1,296.45	-
其中：卖出回购金融资 产支出		1,296.45	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		24.20	2,382.88
8. 其他费用	6.4.7.23	105,343.49	107,698.02
<b>三、利润总额（亏损总 额以“-”号填列）</b>		1,577,725.38	12,476,611.69
<b>减：所得税费用</b>		-	-
<b>四、净利润（净亏损以 “-”号填列）</b>		1,577,725.38	12,476,611.69
<b>五、其他综合收益的税 后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		1,577,725.38	12,476,611.69

### 6.3 净资产变动表

会计主体：长城新优选混合型证券投资基金管理人

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025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	377,334,321.16	-	82,175,386.14	459,509,707.30
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	377,334,321.16	-	82,175,386.14	459,509,707.30
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-64,342,405.86	-	-12,630,526.84	-76,972,932.70
(一)、综合收益总额	-	-	1,577,725.38	1,577,725.38
(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)	-64,342,405.86	-	-14,208,252.22	-78,550,658.08
其中：1. 基金申购款	2,534,886.29	-	539,531.71	3,074,418.00
2. 基金赎回款	-66,877,292.15	-	-14,747,783.93	-81,625,076.08
(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	312,991,915.30	-	69,544,859.30	382,536,774.60
项目	上年度可比期间 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	682,190,237.08	-	112,258,609.23	794,448,846.31

<b>资产</b>				
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
<b>二、本期期初净资产</b>	682,190,237.08	-	112,258,609.23	794,448,846.31
<b>三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)</b>	- 227,981,718.84	-	-28,265,551.22 -256,247,270.06	
(一)、综合收益总额	-	-	12,476,611.69	12,476,611.69
(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)	- 227,981,718.84	-	-40,742,162.91 -268,723,881.75	
其中：1.基金申购款	5,644,802.84	-	977,276.61	6,622,079.45
2.基金赎回款	- 233,626,521.68	-	-41,719,439.52 -275,345,961.20	
(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	-	-	-	-
<b>四、本期期末净资产</b>	454,208,518.24	-	83,993,058.01	538,201,576.25

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：

邱春杨

刘沛

李志朋

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

长城新优选混合型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2015]2672号文“关于准予长城新优选混合型证券投资基金注册的批复”的核准，由长城基金管理有限公司自2016年2月22日至2016年3月17日向社会公开募集，募集期结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具安永华明（2016）验字第60737541\_H02号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于2016年3月22日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集的有效认购资金（本金）为人民币200,939,869.72元，在首次募集期间有效认购资金产生的利息为人民币569.49元，以上实收基金（本息）合计为人民币200,940,439.21元，折合200,940,439.21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，注册登记机构为长城基金管理有限公司，基金托管人中国民生银行股份有限公司（以下简称“民生银行”）。

本基金根据销售服务费及赎回费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别，其中，不从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；从基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为C类基金份额。

本基金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（含国家债券、金融债券、次级债券、中央银行票据、企业债券、中小企业私募债券、公司债券、中期票据、短期融资券、可转换债券、分离交易可转债纯债、资产支持证券等）、权证、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金投资组合中股票投资比例为基金资产的0%-30%；本基金现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计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：15%×中证800指数收益率+85%×中债综合财富指数收益率。

### 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管理业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金管理办法》、

《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>》以及中国证监会和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 2025 年 06 月 30 日的财务状况以及自 2025 年 01 月 01 日起至 2025 年 06 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

#### 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) 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征增值税试点的通知》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、地方政府债券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管理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扣除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附加。

## （2）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[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。

## （3）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，（如有）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，（如有）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。

#### (4) 印花税（如适用）

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税率，由原先的 3‰ 调整为 1‰，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；根据财政部、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》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

#### (5) 境外投资

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

### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日
活期存款	626,425.15
等于：本金	626,370.47
加：应计利息	54.68
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	626,425.15

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动

股票		52,116,890.72	-	59,605,797.50	7,488,906.78
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	16,195,549.60	93,302.09	16,641,615.99	352,764.30
	银行间市场	277,977,766.76	6,423,760.93	284,773,360.93	371,833.24
	合计	294,173,316.36	6,517,063.02	301,414,976.92	724,597.54
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		346,290,207.08	6,517,063.02	361,020,774.42	8,213,504.32

### 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

单位：人民币元

项目	本期末 2025年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	34,239,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	34,239,000.00	-

#### 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 2025年6月30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	1,308.13
其中：交易所市场	545.63
银行间市场	762.50
应付利息	-
预提审计费	24,795.19
预提信息披露费	59,507.37
预提中债登债券账户维护费	4,500.00
预提上清所债券账户维护费	4,500.00
合计	94,610.69

**6.4.7.10 实收基金**

金额单位：人民币元

长城新优选混合 A

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	210,866,639.03	210,866,639.03

本期申购	961,614.78	961,614.78
本期赎回(以“-”号填列)	-50,768,145.95	-50,768,145.95
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	161,060,107.86	161,060,107.86

## 长城新优选混合 C

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	166,467,682.13	166,467,682.13
本期申购	1,573,271.51	1,573,271.51
本期赎回(以“-”号填列)	-16,109,146.20	-16,109,146.20
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	151,931,807.44	151,931,807.44

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

## 长城新优选混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	41,361,289.99	5,949,771.52	47,311,061.51
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	41,361,289.99	5,949,771.52	47,311,061.51
本期利润	2,304,116.90	-1,201,838.01	1,102,278.89
本期基金份额交易产生的变动数	-10,074,951.56	-1,141,488.35	-11,216,439.91
其中：基金申购款	192,659.01	21,666.49	214,325.50
基金赎回款	-10,267,610.57	-1,163,154.84	-11,430,765.41
本期已分配利润	-	-	-
本期末	33,590,455.33	3,606,445.16	37,196,900.49

## 长城新优选混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	29,862,358.99	5,001,965.64	34,864,324.63

加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	29,862,358.99	5,001,965.64	34,864,324.63
本期利润	1,448,466.90	-973,020.41	475,446.49
本期基金份额交易产生的变动数	-2,653,783.64	-338,028.67	-2,991,812.31
其中：基金申购款	286,970.47	38,235.74	325,206.21
基金赎回款	-2,940,754.11	-376,264.41	-3,317,018.52
本期已分配利润	-	-	-
本期末	28,657,042.25	3,690,916.56	32,347,958.81

#### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2025年1月1日至2025年6月30日
活期存款利息收入	5,537.42
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	3,056.70
其他	43.85
合计	8,637.97

#### 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
	2025年1月1日至2025年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-321,458.43
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	-321,458.43

##### 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
	2025年1月1日至2025年6月30日
卖出股票成交总额	5,554,571.00
减：卖出股票成本总额	5,866,761.03
减：交易费用	9,268.40
买卖股票差价收入	-321,458.43

**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 2025年1月1日至2025年6月30日
债券投资收益——利息收入	5,434,854.31
债券投资收益——买卖债券(债转股及债券到期兑付)差价收入	-211,543.24
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	5,223,311.07

**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 2025年1月1日至2025年6月30日
卖出债券(债转股及债券到期兑付)成交总额	100,010,392.80
减：卖出债券(债转股及债券到期兑付)成本总额	97,443,687.63
减：应计利息总额	2,777,237.31
减：交易费用	1,011.10
买卖债券差价收入	-211,543.24

**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 2025年1月1日至2025年6月30日
股票投资产生的股利收益	832,469.49
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	832,469.49

**6.4.7.20 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
1. 交易性金融资产	-2,174,858.42
股票投资	745,051.13
债券投资	-2,919,909.55
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	-2,174,858.42

#### 6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2025年1月1日至2025年6月30日
基金赎回费收入	3,365.73
合计	3,365.73

#### 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
	2025年1月1日至2025年6月30日
审计费用	24,795.19
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	2,440.93
中债登债券账户服务费	9,000.00
上清所债券账户服务费	9,000.00
上清所查询费	600.00
合计	105,343.49

#### 6.4.7.24 分部报告

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) 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) 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。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### 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
中国民生银行股份有限公司（“中国民生银行”）	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 2025年1月1日至2025年6月30日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024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	12,483,243.00	100.00	-	-

##### 6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年1月1日至2025年6月 30日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024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	10,270,907.27	100.00	-	-

##### 6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年1月1日至2025年6月 30日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024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 (%)

	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比 例 (%)	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比 例 (%)
长城证券	1,949,599,000.00	100.00	-	-

#### 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 2025年1月1日至2025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	5,691.31	100.00	545.63	100.00
上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月30日				
关联方名称	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：(1) 上述佣金按协议约定的佣金费率计算，佣金费率由协议签订方参考市场价格确定。

(2) 本基金 2024 年 1-6 月佣金协议的服务范围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等。

(3) 本报告期，本基金的交易佣金费率不超过中国基金业协会对外通报的市场平均股票交易佣金费率的两倍，佣金包含佣金收取方为基金提供证券研究服务而收取的费用。

#### 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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,264,241.07	1,950,747.72
其中：应支付销售机构的客户维 护费	536,276.95	733,166.66
应支付基金管理人的净管理费	727,964.12	1,217,581.06

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.60%的年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times 0.60\% \div \text{当年天数}$

$H$  为每日应计提的基金管理费

$E$  为前一日的基金资产净值

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2025年1月1日至2025年6月30日	2024年1月1日至2024年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	316,060.33	487,686.94

注：基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.15%的年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$

$H$  为每日应计提的基金托管费

$E$  为前一日的基金资产净值

#### 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		
	2025年1月1日至2025年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费	长城新优选混合 A	长城新优选混合 C
长城基金管理有限公司	-	34.77	34.77
长城证券	-	295.09	295.09
中国民生银行	-	20,649.18	20,649.18
合计	-	20,979.04	20,979.04
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	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		
	长城新优选混合 A	长城新优选混合 C	合计
长城基金管理有限公司	-	2.09	2.09
长城证券	-	317.00	317.00
中国民生银行	-	28,522.05	28,522.05
合计	-	28,841.14	28,841.14

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 0.50%。销售服务费按该类基金份额前一日资产净值的销售服务费年费率

计提。计算公式如下：

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

H 为该类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为该类基金份额前一日的基金资产净值

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

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

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

注：无。

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

注：无。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

份额单位：份

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月 30日	本期 2025年1月1日至2025年 6月30日
	长城新优选混合 A	长城新优选混合 C
基金合同生效日（2016年3月22日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期内申购/买入总份额	-	-
报告期内因拆分变动份额	-	-
减：报告期内赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-
项目	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月 30日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年 6月30日
	长城新优选混合 A	长城新优选混合 C

基金合同生效日（2016年3月22日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	27,682,015.32	-
报告期内申购/买入总份额	-	-
报告期内因拆分变动份额	-	-
减：报告期内赎回/卖出总份额	27,682,015.32	-
报告期末持有的基金份额	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.0000%	-

注：基金管理人持有本基金份额变动相关的交易费用按基金合同及招募说明书的有关规定计算。

#### 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：无。

#### 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 2025年1月1日至2025年6月 30日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024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
中国民生银行	626,425.15	5,537.42	107,037,234.26	68,883.01

注：本基金的银行存款由基金托管人中国民生银行保管，并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（2025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 2025 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人民币 0.00 元，无质押债券。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2025 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发行的证券，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“期末本基金持有的流通受限证券”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“期末债券正回购交易中作为抵押的债券”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约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货币资金、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 2025 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	626,425.15	-	-	-	-	-	626,425.15
结算备付金	867,773.87	-	-	-	-	-	867,773.87
存出保证金	3,824.34	-	-	-	-	-	3,824.34
交易性金融资产	154,936,561.64	33,265,036.72	85,764,400.18	16,725,265.67	10,723,712.71	59,605,797.50	361,020,774.42
买入返售金融资产	34,239,000.00	-	-	-	-	-	34,239,000.00
应收申购	-	-	-	-	-	7,802.98	7,802.98

款							
应收 清算 款	-	-	-	-	-	158,763.93	158,763.93
资产 总计	190,673,585 .00	33,265,036. 72	85,764,400. 18	16,725,265. 67	10,723,712. 71	59,772,364. 41	396,924,364 .69
负债							
应付 赎回 款	-	-	-	-	-	13,971,256. 18	13,971,256. 18
应付 管理人 报酬	-	-	-	-	-	196,661.54	196,661.54
应付 托管 费	-	-	-	-	-	49,165.41	49,165.41
应付 销售 服务 费	-	-	-	-	-	75,807.57	75,807.57
应 交 税 费	-	-	-	-	-	88.70	88.70
其 他 负 债	-	-	-	-	-	94,610.69	94,610.69
负	-	-	-	-	-	14,387,590.	14,387,590.

债 总 计						09	09
利 率 敏 感 度 缺 口	190,673,585 .00	33,265,036. 72	85,764,400. 18	16,725,265. 67	10,723,712. 71		
上 年 度 末 202 4 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	505,855.85	-	-	-	-	-	505,855.85
结 算 备 付 金	1,979,660.3 9	-	-	-	-	-	1,979,660.3 9
存 出 保 证 金	44,072.11	-	-	-	-	-	44,072.11
交 易 性 金 融 资 产	30,966,172. 13	-	246,652,620 .72	96,714,620. 05	10,751,336. 96	57,798,835. 40	442,883,585 .26
买	14,899,894.	-	-	-	-	-	14,899,894.

入返售金融资产	46						46
应收申购款						24,998.08	24,998.08
应收清算款						386,211.09	386,211.09
资产总计	48,395,654. 94		246,652,620 .72	96,714,620. 05	10,751,336. 96	58,210,044. 57	460,724,277 .24
负债							
应付赎回款						760,339.69	760,339.69
应付管理人报酬						235,366.96	235,366.96
应付托管费						58,841.74	58,841.74
应付销售服						86,003.05	86,003.05

务费							
其他负债						74,018.50	74,018.50
负债总计						1,214,569.94	1,214,569.94
利率敏感度缺口	48,395,654.94	246,652,620.72	96,714,620.05	10,751,336.96			

#### 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（2025年6月30日）	上年度末（2024年12月31日）	
	市场利率下降 25 个基点	465,875.84		869,753.98
	市场利率上升 25 个基点	-460,523.09		-862,357.22

#### 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

外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

本基金的投资组合比例为：本基金投资组合中股票投资比例为基金资产的 0%-30%；本基金现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计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。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：

#### 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 2025年6月30日		上年度末 2024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	59,605,797.50	15.58	57,798,835.40	12.58
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	301,414,976.92	78.79	385,084,749.86	83.80
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	361,020,774.42	94.38	442,883,585.26	96.38

注：“交易性金融资产—债券投资”含资产支持证券投资。

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	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（2025年6月30日）	上年度末（2024年12月 31日）
	沪深 300 指数上升 5%	2,757,960.25	2,784,169.90

	沪深 300 指数下降 5%	-2,757,960.25	-2,784,169.90
--	-------------------	---------------	---------------

#### 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 2025年6月30日	上年度末 2024年12月31日
第一层次	66,118,329.38	57,677,539.40
第二层次	294,902,445.04	385,206,045.86
第三层次	-	-
合计	361,020,774.42	442,883,585.26

##### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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。  
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	59,605,797.50	15.02
	其中：股票	59,605,797.50	15.02
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	301,414,976.92	75.94
	其中：债券	301,414,976.92	75.94
	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	34,239,000.00	8.63
	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	1,494,199.02	0.38
8	其他各项资产	170,391.25	0.04
9	合计	396,924,364.69	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	632,211.00	0.17
B	采矿业	5,412,738.00	1.41
C	制造业	26,901,865.50	7.03
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,264,518.00	0.59
E	建筑业	1,194,663.00	0.31
F	批发和零售业	167,976.00	0.04
G	交通运输、仓储和邮政业	2,025,963.00	0.53
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,534,486.00	0.66

J	金融业	16,842,284.00	4.40
K	房地产业	447,946.00	0.12
L	租赁和商务服务业	566,877.00	0.15
M	科学研究和技术服务业	614,270.00	0.16
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	59,605,797.50	15.58

### 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	600036	招商银行	95,100	4,369,845.00	1.14
2	601318	中国平安	67,600	3,750,448.00	0.98
3	300750	宁德时代	11,900	3,001,418.00	0.78
4	601899	紫金矿业	116,500	2,271,750.00	0.59
5	600519	贵州茅台	900	1,268,568.00	0.33
6	002683	广东宏大	36,100	1,225,234.00	0.32
7	600900	长江电力	38,400	1,157,376.00	0.30
8	000333	美的集团	14,200	1,025,240.00	0.27
9	601166	兴业银行	42,400	989,616.00	0.26
10	002594	比亚迪	2,600	862,966.00	0.23
11	601398	工商银行	105,400	799,986.00	0.21
12	600276	恒瑞医药	13,600	705,840.00	0.18
13	000858	五粮液	5,800	689,620.00	0.18
14	601328	交通银行	82,700	661,600.00	0.17
15	000651	格力电器	13,200	592,944.00	0.16
16	601288	农业银行	94,800	557,424.00	0.15
17	688981	中芯国际	6,300	555,471.00	0.15
18	600919	江苏银行	44,800	534,912.00	0.14
19	600887	伊利股份	18,000	501,840.00	0.13
20	603259	药明康德	6,800	472,940.00	0.12
21	600000	浦发银行	32,900	456,652.00	0.12
22	000725	京东方A	110,900	442,491.00	0.12
23	002371	北方华创	1,000	442,210.00	0.12
24	300760	迈瑞医疗	1,900	427,025.00	0.11

25	601816	京沪高铁	73,600	423,200.00	0.11
26	688256	寒武纪	700	421,050.00	0.11
27	601088	中国神华	10,000	405,400.00	0.11
28	601668	中国建筑	64,100	369,857.00	0.10
29	601728	中国电信	46,700	361,925.00	0.09
30	601988	中国银行	64,100	360,242.00	0.09
31	002714	牧原股份	8,300	348,683.00	0.09
32	000001	平安银行	28,700	346,409.00	0.09
33	002352	顺丰控股	7,000	341,320.00	0.09
34	603501	豪威集团	2,600	331,890.00	0.09
35	300124	汇川技术	5,100	329,307.00	0.09
36	600031	三一重工	17,700	317,715.00	0.08
37	601857	中国石油	37,100	317,205.00	0.08
38	601229	上海银行	29,700	315,117.00	0.08
39	002415	海康威视	11,300	313,349.00	0.08
40	601169	北京银行	45,200	308,716.00	0.08
41	600050	中国联通	57,100	304,914.00	0.08
42	600941	中国移动	2,700	303,885.00	0.08
43	000063	中兴通讯	9,200	298,908.00	0.08
44	603019	中科曙光	4,100	288,640.00	0.08
45	300498	温氏股份	16,600	283,528.00	0.07
46	601985	中国核电	29,700	276,804.00	0.07
47	600309	万华化学	5,100	276,726.00	0.07
48	601012	隆基绿能	17,900	268,858.00	0.07
49	000792	盐湖股份	15,700	268,156.00	0.07
50	600809	山西汾酒	1,500	264,585.00	0.07
51	600406	国电南瑞	11,700	262,197.00	0.07
52	601919	中远海控	17,400	261,696.00	0.07
53	000568	泸州老窖	2,300	260,820.00	0.07
54	600028	中国石化	45,800	258,312.00	0.07
55	600660	福耀玻璃	4,500	256,545.00	0.07
56	603986	兆易创新	2,000	253,060.00	0.07
57	600690	海尔智家	10,100	250,278.00	0.07
58	002230	科大讯飞	5,200	248,976.00	0.07
59	000100	TCL 科技	57,200	247,676.00	0.06
60	000338	潍柴动力	16,100	247,618.00	0.06
61	601766	中国中车	34,900	245,696.00	0.06
62	688008	澜起科技	2,800	229,600.00	0.06
63	600104	上汽集团	14,000	224,700.00	0.06
64	600150	中国船舶	6,800	221,272.00	0.06
65	601225	陕西煤业	11,500	221,260.00	0.06
66	601818	光大银行	52,800	219,120.00	0.06
67	002027	分众传媒	29,100	212,430.00	0.06

68	600760	中航沈飞	3,500	205,170.00	0.05
69	601628	中国人寿	4,700	193,593.00	0.05
70	600111	北方稀土	7,600	189,240.00	0.05
71	601888	中国中免	3,100	189,007.00	0.05
72	600905	三峡能源	44,200	188,292.00	0.05
73	601939	建设银行	19,900	187,856.00	0.05
74	603288	海天味业	4,800	186,768.00	0.05
75	600926	杭州银行	10,900	183,338.00	0.05
76	600999	招商证券	10,400	182,936.00	0.05
77	000625	长安汽车	14,300	182,468.00	0.05
78	600089	特变电工	15,200	181,336.00	0.05
79	601009	南京银行	15,500	180,110.00	0.05
80	600436	片仔癀	900	180,009.00	0.05
81	601390	中国中铁	31,800	178,398.00	0.05
82	002241	歌尔股份	7,600	177,232.00	0.05
83	601658	邮储银行	32,400	177,228.00	0.05
84	600019	宝钢股份	26,600	175,294.00	0.05
85	601989	中国重工	37,200	172,608.00	0.05
86	601006	大秦铁路	26,100	172,260.00	0.05
87	603993	洛阳钼业	20,400	171,768.00	0.04
88	600048	保利发展	21,000	170,100.00	0.04
89	600547	山东黄金	5,300	169,229.00	0.04
90	600415	小商品城	8,000	165,440.00	0.04
91	300014	亿纬锂能	3,600	164,916.00	0.04
92	300033	同花顺	600	163,806.00	0.04
93	605499	东鹏饮料	520	163,306.00	0.04
94	000938	紫光股份	6,800	163,132.00	0.04
95	000538	云南白药	2,900	161,791.00	0.04
96	002050	三花智控	6,100	160,918.00	0.04
97	600030	中信证券	5,800	160,196.00	0.04
98	601600	中国铝业	22,500	158,400.00	0.04
99	600584	长电科技	4,700	158,343.00	0.04
100	600585	海螺水泥	7,300	156,731.00	0.04
101	000425	徐工机械	19,900	154,623.00	0.04
102	600893	航发动力	4,000	154,160.00	0.04
103	601916	浙商银行	45,000	152,550.00	0.04
104	002311	海大集团	2,600	152,334.00	0.04
105	002179	中航光电	3,700	149,332.00	0.04
106	603799	华友钴业	4,000	148,080.00	0.04
107	000977	浪潮信息	2,900	147,552.00	0.04
108	300433	蓝思科技	6,500	144,950.00	0.04
109	600015	华夏银行	18,300	144,753.00	0.04
110	000776	广发证券	8,400	141,204.00	0.04

111	688271	联影医疗	1,100	140,514.00	0.04
112	600795	国电电力	28,900	139,876.00	0.04
113	600438	通威股份	8,200	137,350.00	0.04
114	300408	三环集团	4,100	136,940.00	0.04
115	601336	新华保险	2,300	134,550.00	0.04
116	002049	紫光国微	2,000	131,720.00	0.03
117	300308	中际旭创	900	131,274.00	0.03
118	600886	国投电力	8,900	131,186.00	0.03
119	688012	中微公司	700	127,610.00	0.03
120	601669	中国电建	26,000	126,620.00	0.03
121	600489	中金黄金	8,600	125,818.00	0.03
122	600010	包钢股份	68,000	121,720.00	0.03
123	601377	兴业证券	19,600	121,324.00	0.03
124	600009	上海机场	3,800	120,726.00	0.03
125	000002	万科 A	18,700	120,054.00	0.03
126	601111	中国国航	15,100	119,139.00	0.03
127	002001	新和成	5,600	119,112.00	0.03
128	002252	上海莱士	16,800	115,416.00	0.03
129	601838	成都银行	5,700	114,570.00	0.03
130	601186	XD 中国铁	14,200	113,742.00	0.03
131	002460	赣锋锂业	3,300	111,441.00	0.03
132	600115	中国东航	27,400	110,422.00	0.03
133	000963	华东医药	2,700	108,972.00	0.03
134	600183	生益科技	3,600	108,540.00	0.03
135	601901	方正证券	13,700	108,367.00	0.03
136	601100	恒立液压	1,500	108,000.00	0.03
137	600989	宝丰能源	6,500	104,910.00	0.03
138	000157	中联重科	14,500	104,835.00	0.03
139	601360	三六零	10,200	104,040.00	0.03
140	600426	华鲁恒升	4,700	101,849.00	0.03
141	601881	中国银河	5,900	101,185.00	0.03
142	601788	光大证券	5,600	100,688.00	0.03
143	601800	中国交建	11,100	98,679.00	0.03
144	003816	中国广核	27,100	98,644.00	0.03
145	000408	藏格矿业	2,300	98,141.00	0.03
146	002916	深南电路	910	98,107.10	0.03
147	600029	南方航空	16,600	97,940.00	0.03
148	002736	国信证券	8,400	96,768.00	0.03
149	688036	传音控股	1,200	95,640.00	0.03
150	600196	复星医药	3,800	95,342.00	0.02
151	688126	沪硅产业	5,000	93,600.00	0.02
152	600674	川投能源	5,800	93,032.00	0.02
153	002466	天齐锂业	2,900	92,916.00	0.02

154	600346	恒力石化	6,500	92,690.00	0.02
155	000807	云铝股份	5,800	92,684.00	0.02
156	000661	长春高新	900	89,262.00	0.02
157	002236	大华股份	5,600	88,928.00	0.02
158	002648	卫星化学	5,100	88,383.00	0.02
159	001979	招商蛇口	10,000	87,700.00	0.02
160	601868	中国能建	39,200	87,416.00	0.02
161	600745	闻泰科技	2,600	87,178.00	0.02
162	600372	中航机载	7,200	86,832.00	0.02
163	601995	中金公司	2,400	84,864.00	0.02
164	601066	中信建投	3,500	84,175.00	0.02
165	600176	中国巨石	7,200	82,080.00	0.02
166	300450	先导智能	3,300	82,005.00	0.02
167	601319	中国人保	9,400	81,874.00	0.02
168	002920	德赛西威	800	81,704.00	0.02
169	300418	昆仑万维	2,400	80,712.00	0.02
170	601117	中国化学	10,500	80,535.00	0.02
171	601689	拓普集团	1,700	80,325.00	0.02
172	300347	泰格医药	1,500	79,980.00	0.02
173	002555	三七互娱	4,600	79,534.00	0.02
174	600741	华域汽车	4,500	79,425.00	0.02
175	600085	同仁堂	2,200	79,332.00	0.02
176	300782	卓胜微	1,100	78,507.00	0.02
177	600219	南山铝业	20,400	78,132.00	0.02
178	601021	春秋航空	1,400	77,910.00	0.02
179	600588	用友网络	5,800	77,546.00	0.02
180	601998	中信银行	9,100	77,350.00	0.02
181	000786	北新建材	2,900	76,792.00	0.02
182	600161	天坛生物	4,000	76,760.00	0.02
183	000895	双汇发展	3,100	75,671.00	0.02
184	688396	华润微	1,600	75,456.00	0.02
185	002493	荣盛石化	9,000	74,520.00	0.02
186	600460	士兰微	3,000	74,460.00	0.02
187	001965	招商公路	6,200	74,400.00	0.02
188	300442	润泽科技	1,500	74,295.00	0.02
189	002938	鹏鼎控股	2,300	73,669.00	0.02
190	600039	四川路桥	7,400	73,260.00	0.02
191	000999	华润三九	2,340	73,195.20	0.02
192	601633	长城汽车	3,400	73,032.00	0.02
193	002129	TCL 中环	9,500	72,960.00	0.02
194	601877	正泰电器	3,200	72,544.00	0.02
195	300122	智飞生物	3,700	72,483.00	0.02
196	002601	龙佰集团	4,400	71,324.00	0.02

197	600362	XD江西铜	3,000	70,290.00	0.02
198	600515	海南机场	19,800	70,092.00	0.02
199	603369	今世缘	1,800	70,074.00	0.02
200	600600	青岛啤酒	1,000	69,460.00	0.02
201	300223	北京君正	1,000	69,200.00	0.02
202	688223	晶科能源	13,100	67,989.00	0.02
203	000876	新希望	7,200	67,536.00	0.02
204	000301	东方盛虹	8,100	67,473.00	0.02
205	603392	万泰生物	1,100	67,100.00	0.02
206	600188	兖矿能源	5,500	66,935.00	0.02
207	000596	古井贡酒	500	66,575.00	0.02
208	002180	纳思达	2,900	66,526.00	0.02
209	601618	中国中冶	22,200	66,156.00	0.02
210	600233	圆通速递	5,100	65,739.00	0.02
211	600023	浙能电力	12,300	65,190.00	0.02
212	601872	招商轮船	10,300	64,478.00	0.02
213	002271	东方雨虹	5,900	63,307.00	0.02
214	601898	中煤能源	5,700	62,358.00	0.02
215	002821	凯莱英	700	61,775.00	0.02
216	002709	天赐材料	3,400	61,608.00	0.02
217	600845	宝信软件	2,600	61,412.00	0.02
218	300759	康龙化成	2,500	61,350.00	0.02
219	000733	振华科技	1,200	60,060.00	0.02
220	601607	上海医药	3,300	59,004.00	0.02
221	605117	德业股份	1,120	58,979.20	0.02
222	601878	浙商证券	5,400	58,914.00	0.02
223	603659	璞泰来	3,100	58,218.00	0.02
224	600332	白云山	2,200	57,992.00	0.02
225	300496	中科创达	1,000	57,220.00	0.01
226	600875	东方电气	3,400	56,916.00	0.01
227	600027	华电国际	10,400	56,888.00	0.01
228	002459	晶澳科技	5,500	54,890.00	0.01
229	000983	山西焦煤	8,500	54,400.00	0.01
230	300316	晶盛机电	2,000	54,300.00	0.01
231	600061	国投资本	7,100	53,392.00	0.01
232	002007	华兰生物	3,400	53,278.00	0.01
233	300999	金龙鱼	1,800	53,154.00	0.01
234	600918	中泰证券	8,200	52,726.00	0.01
235	002812	恩捷股份	1,800	52,722.00	0.01
236	603260	合盛硅业	1,100	52,140.00	0.01
237	300832	新产业	900	51,048.00	0.01
238	002410	广联达	3,800	50,958.00	0.01
239	600018	上港集团	8,800	50,248.00	0.01

240	601799	星宇股份	400	50,000.00	0.01
241	600803	XD 新奥股	2,600	49,140.00	0.01
242	300628	亿联网络	1,400	48,664.00	0.01
243	601238	广汽集团	6,400	47,936.00	0.01
244	688599	天合光能	3,200	46,496.00	0.01
245	600026	中远海能	4,500	46,485.00	0.01
246	300919	中伟股份	1,400	46,032.00	0.01
247	300413	芒果超媒	2,100	45,822.00	0.01
248	002841	视源股份	1,300	44,980.00	0.01
249	600732	爱旭股份	3,300	43,230.00	0.01
250	603806	福斯特	3,300	42,768.00	0.01
251	603195	公牛集团	840	40,530.00	0.01
252	688009	中国通号	7,700	39,578.00	0.01
253	601865	福莱特	2,600	39,546.00	0.01
254	600132	重庆啤酒	700	38,570.00	0.01
255	601699	潞安环能	3,500	36,925.00	0.01
256	688303	大全能源	1,700	36,244.00	0.01
257	000708	中信特钢	3,000	35,280.00	0.01
258	002603	以岭药业	2,500	35,250.00	0.01
259	300751	迈为股份	500	34,780.00	0.01
260	688082	盛美上海	300	34,182.00	0.01
261	688187	时代电气	800	34,120.00	0.01
262	601236	红塔证券	4,000	33,880.00	0.01
263	603899	晨光股份	1,100	31,889.00	0.01
264	300979	华利集团	500	26,285.00	0.01
265	601808	中海油服	1,900	26,144.00	0.01
266	002304	洋河股份	400	25,820.00	0.01
267	603296	华勤技术	300	24,204.00	0.01
268	000800	一汽解放	2,600	17,836.00	0.00
269	001289	龙源电力	500	8,090.00	0.00

## 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	601865	福莱特	2,649,839.00	0.58
2	002865	钧达股份	2,649,631.00	0.58
3	002683	广东宏大	1,196,790.00	0.26
4	601100	恒立液压	432,412.00	0.09

注：买入金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交量）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	601865	福莱特	2,521,833.00	0.55
2	002865	钧达股份	2,452,640.00	0.53
3	601100	恒立液压	411,600.00	0.09
4	600938	中国海油	168,498.00	0.04

注：卖出金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交量）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	6,928,672.00
卖出股票收入（成交）总额	5,554,571.00

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	61,299,262.57	16.02
2	央行票据	-	-
3	金融债券	198,202,874.08	51.81
	其中：政策性金融债	171,303,750.68	44.78
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）	6,512,531.88	1.70
8	同业存单	-	-
9	其他	35,400,308.39	9.25
10	合计	301,414,976.92	78.79

#### 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	200212	20国开12	1,500,000	154,936,561.64	40.50
2	230011	23附息国债11	400,000	40,446,465.75	10.57
3	2128011	21邮储银行永续债01	180,000	18,564,978.08	4.85
4	210203	21国开03	160,000	16,367,189.04	4.28
5	230018	23附息国债18	100,000	10,723,712.71	2.80

**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**

注：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。

**7.11.3 报告期末基金持有的全部公开募集基础设施证券投资基金情况**

注：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除国家开发银行、中国邮政储蓄银行股份有限公司、宁波银行股份有限公司发行主体外，其他证券的发行主体未出现被监管部门立案调查、或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

国家开发银行在报告编制日前一年内曾受到处罚。

中国邮政储蓄银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到处罚。

宁波银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到处罚。

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

**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的股票。

### 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	3,824.34
2	应收清算款	158,763.93
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	7,802.98
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	170,391.25

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	128129	青农转债	1,353,626.77	0.35
2	127073	天赐转债	1,313,909.50	0.34
3	110085	通 22 转债	1,295,030.49	0.34
4	110059	浦发转债	1,285,312.52	0.34
5	127056	中特转债	1,264,652.60	0.33

### 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(%)
长城新优选混合 A	27,514	5,853.75	30,831,863.16	19.14	130,228,244.70	80.86
长城新优选混合 C	14,254	10,658.89	4,427,132.35	2.91	147,504,675.09	97.09
合计	41,768	7,493.58	35,258,995.51	11.27	277,732,919.79	88.73

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

## 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	长城新优选混合 A	75,245.11	0.0467
	长城新优选混合 C	10,258.38	0.0068
	合计	85,503.49	0.0273

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	长城新优选混合 A	0~10
	长城新优选混合 C	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	长城新优选混合 A	0~10
	长城新优选混合 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	长城新优选混合 A	长城新优选混合 C
基金合同生效日 (2016年3月22日)基金份额总额	623,365.61	200,317,073.60
本报告期期初基金份额总额	210,866,639.03	166,467,682.13
本报告期基金总申购份额	961,614.78	1,573,271.51

减：本报告期基金 总赎回份额	50,768,145.95	16,109,146.20
本报告期基金拆分 变动份额	-	-
本报告期期末基金 份额总额	161,060,107.86	151,931,807.44

## § 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

本报告期本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

### 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，托管人及其高级管理人员在开展基金托管业务过程中未受到相关监管部门稽查或处罚。

### 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	股票交易	应支付该券商的佣金	备注

	元数量	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 (%)	
长城证券	2	12,483,243. 00	100.00	5,691.31	100.00	未变 更
华鑫证券	1	-	-	-	-	未变 更
西部证券	1	-	-	-	-	未变 更
招商证券	2	-	-	-	-	未变 更

注：选择证券公司参与证券交易的标准和程序：

公司设立了券商服务评价协调小组，建立了完善的证券公司选择、协议签署、证券公司服务评价、交易佣金分配等的管理机制和流程，并禁止上述业务环节与证券公司的基金销售规模、保有规模挂钩，且基金销售业务人员不得参与上述业务环节。督察长对上述业务环节进行合规性审查。

### 1、选择标准

公司选择证券公司参与证券交易的标准主要包含以下几方面：

- (1) 财务状况良好，各项财务指标显示证券公司经营状况稳定；
- (2) 经营行为规范，能满足基金运作的合法、合规需求；
- (3) 合规风控能力较强，内部管理规范、严格，具备健全的内控制度和安全的交易环境，能有效保护客户权益；
- (4) 交易服务能力较强，具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件、交易设施和信息服务；
- (5) 研究服务能力较强，能及时为基金提供高质量的研究咨询服务。

### 2、选择程序

公司选择证券公司参与证券交易的程序主要包括：

- (1) 对拟入库证券公司进行审慎调查，经内部审议通过后将证券公司加入公司证券公司库；
- (2) 按照公司审批流程，与证券公司签订交易单元租用或经纪服务等协议；
- (3) 业务部门与证券公司办理完成交易单元租用、交易系统测试和对接等交易前准备工作，通知各相关部门和托管行启用证券公司交易。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
长城证券	10,270,907 .27	100.00	1,949,599,00 0.00	100.00	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	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	2025年1月22日
2	长城基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况(2024年度)	中国证监会规定报刊及网站	2025年3月29日
3	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	2025年5月9日
4	长城基金管理有限公司关于终止民商基金销售(上海)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	2025年6月10日
5	长城基金管理有限公司关于旗下基金估值调整情况的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025年6月25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(%)
个人	1	20250101-20250630	83,943,005.84	-	-	83,943,005.84	26.8195
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) 中国证监会准予长城新优选混合型证券投资基金注册的文件
- (二) 《长城新优选混合型证券投资基金基金合同》
- (三) 《长城新优选混合型证券投资基金托管协议》
- (四) 法律意见书
- (五) 基金管理人业务资格批件、营业执照
- (六) 基金托管人业务资格批件、营业执照
- (七) 中国证监会规定的其他文件

### 12.2 存放地点

基金管理人及基金托管人住所

### 12.3 查阅方式

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

咨询电话：0755-29279188

客户服务电话：400-8868-666

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

长城基金管理有限公司

2025 年 8 月 29 日