

长城优选回报六个月持有期混合型证券投资
基金
2021 年第 4 季度报告

2021 年 12 月 31 日

基金管理人：长城基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：2022 年 1 月 24 日

§ 1 重要提示

本基金管理人的董事会及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责任。

本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 2022 年 01 月 21 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 10 月 01 日起至 2021 年 12 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

| | |
|------------|---|
| 基金简称 | 长城优选回报六个月混合 |
| 基金主代码 | 010797 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2021 年 1 月 20 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 556,566,459.16 份 |
| 投资目标 | 本基金在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，通过积极主动的管理，追求基金资产的长期稳健回报。 |
| 投资策略 | <p>1、资产配置策略</p> <p>本基金通过对宏观经济环境、政策形势、证券市场走势的综合分析，主动判断市场时机，进行积极的资产配置，合理确定基金在股票、债券等各类资产类别上的投资比例，并随着各类资产风险收益特征的相对变化，适时进行动态调整。</p> <p>2、债券投资策略</p> <p>本基金通过对国内外宏观经济态势、利率走势、收益率曲线变化趋势和信用风险变化等因素进行综合分析，构建和调整固定收益证券投资组合，同时保持高流动性，为组合提供现金增强收益。</p> <p>3、股票投资策略</p> <p>(1) 个股精选策略</p> <p>本基金将主要遵循“自上而下”的分析框架，采用定性分析和定量分析相结合的方法精选景气度向上行业中具有竞争优势、估值合理的上市公司股票进行投资，以</p> |

| | | |
|-----------------|--|-----------------|
| | <p>此构建股票组合。</p> <p>(2) 港股通标的投资策略</p> <p>本基金同时关注互联互通机制下港股市场优质标的的投资机会：</p> <p>1) 行业研究员重点覆盖的行业中，精选港股通中有代表性的行业优质公司； 2) 与 A 股公司相比具有差异化及估值优势的公司； 3) 港股通综合指数成分股中，筛选市值权重较高的公司进行配置。</p> <p>对于存托凭证投资，本基金将在深入研究的基础上，通过定性分析和定量分析相结合的方式，精选出具有比较优势的存托凭证。</p> <p>4、股指期货投资策略</p> <p>本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。</p> <p>5、国债期货投资策略</p> <p>本基金投资于国债期货，以套期保值为目的，以合理管理债券组合的久期、流动性和风险水平。</p> <p>6、资产支持证券投资策略</p> <p>本基金将通过资产支持证券基础资产及结构设计的研究，结合多种定价模型，根据基金资产组合情况适度进行资产支持证券的投资。</p> | |
| 业绩比较基准 | 中债综合财富指数收益率×75%+中证 700 指数收益率×20%+恒生指数收益率（使用估值汇率折算）×5% | |
| 风险收益特征 | <p>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。具体风险请查阅本基金招募说明书的“风险揭示”章节的具体内容。</p> | |
| 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 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 长城优选回报六个月混合 A | 长城优选回报六个月混合 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 010797 | 010798 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 510,521,846.13 份 | 46,044,613.03 份 |

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期（2021 年 10 月 1 日-2021 年 12 月 31 日） | |
|--------|---------------------------------------|---------------|
| | 长城优选回报六个月混合 A | 长城优选回报六个月混合 C |

| | | |
|-----------------|----------------|---------------|
| 1. 本期已实现收益 | 4,288,264.52 | 334,954.61 |
| 2. 本期利润 | 8,704,223.03 | 686,522.88 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0136 | 0.0129 |
| 4. 期末基金资产净值 | 530,300,361.47 | 47,647,159.35 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.0387 | 1.0348 |

注：①本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

②上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 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

长城优选回报六个月混合 A

| 阶段 | 净值增长率① | 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 | 1.38% | 0.18% | 1.15% | 0.17% | 0.23% | 0.01% |
| 过去六个月 | 2.65% | 0.18% | 1.82% | 0.24% | 0.83% | -0.06% |
| 过去一年 | - | - | - | - | - | - |
| 过去三年 | - | - | - | - | - | - |
| 过去五年 | - | - | - | - | - | - |
| 自基金合同生效起至今 | 3.87% | 0.14% | 3.94% | 0.26% | -0.07% | -0.12% |

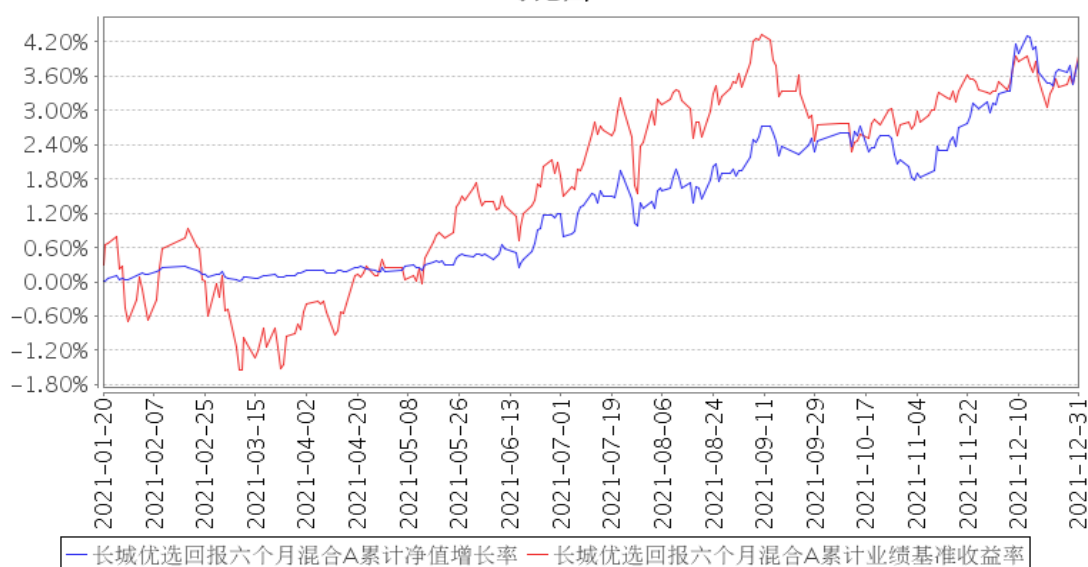
长城优选回报六个月混合 C

| 阶段 | 净值增长率① | 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 | 1.28% | 0.19% | 1.15% | 0.17% | 0.13% | 0.02% |
| 过去六个月 | 2.45% | 0.18% | 1.82% | 0.24% | 0.63% | -0.06% |
| 过去一年 | - | - | - | - | - | - |
| 过去三年 | - | - | - | - | - | - |

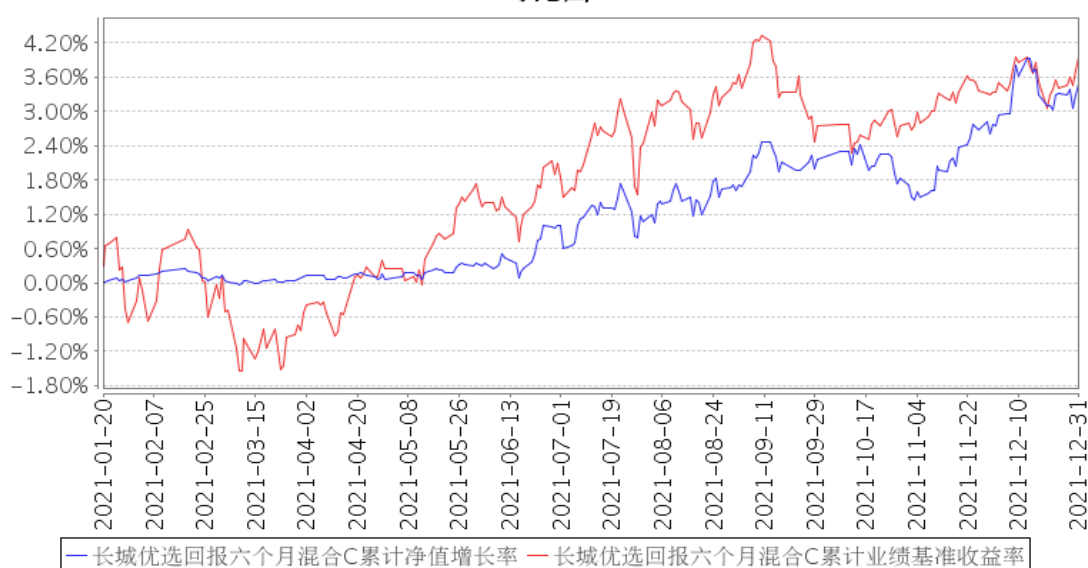
| | | | | | | |
|------------|-------|-------|-------|-------|--------|--------|
| 过去五年 | - | - | - | - | - | - |
| 自基金合同生效起至今 | 3.48% | 0.14% | 3.94% | 0.26% | -0.46% | -0.12% |

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

长城优选回报六个月混合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



长城优选回报六个月混合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本基金股票投资占基金资产的比例为 0%-50%，其中投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%；投资于同业存单的比例不超过基金资产的 20%；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本基金合同于 2021 年 1 月 20 日生效，截止本报告期末，基金合同生效未满一年。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 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、本基金的基金经理 | 2021 年 1 月 20 日 | - | 9 年 | 男，中国籍，硕士、特许金融分析师（CFA）。曾就职于招商银行股份有限公司、中国国际金融有限公司。2012 年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、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 5 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 2016 年 4 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 2016 年 4 月至今任“长城新优选混合型证券投资基金”，自 2018 年 11 月至今任“长城久益灵活配置混合型证券投资基金”基金经理，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 4 月至今任“长城优选稳进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。 |
|--|--|--|--|---|

注：①上述任职日期、离任日期根据公司做出决定的任免日期填写。

②证券从业年限的计算方式遵从证券业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守了《证券投资基金法》、《长城优选回报六个月持有期混合型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制和防范风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大的利益，未出现投资违反法律法规、基金合同约定和相关规定的情况，无因公司未勤勉尽责或操作不当而导致基金财产损失的情况，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

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《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《长城基金管理有限公司公平交易管理制度》的规定，不同投资者的利益得到了公平对待。

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

期出具公平交易稽核报告。本报告期报告认为，本基金管理人旗下投资组合的同向交易价差均在合理范围内，结果符合相关政策法规和公司制度的规定。

4.3.2 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 报告期内基金的投资策略和运作分析

四季度，国内经济整体运行平稳，但在 2020 年四季度高基数的基础上，部分核心经济及金融指标有所回落，稳增长重新成为政策的出发点和着力点。随着疫苗接种人数的持续增加，全球经济延续了此前的复苏态势。尽管有新病毒变种的出现，但大概率不会改变全球重新开放的大趋势。通胀方面，受供需两方面的影响，四季度国内外主要工业品价格仍处于高位，对经济复苏带来一定压力。高通胀难题有望在 2022 年得到逐步解决，国内 PPI 也将高位回落。

随着全球主要经济体的经济活动逐渐恢复正常，货币政策重新成为市场的焦点。美联储 12 月份的议息会议明确加速 Taper，且 2022 年加息次数有可能超出市场预期，对其他经济体的货币政策带来一定挑战。四季度，国内货币政策继续保持稳健偏宽松的状态，且降低了准备金率和 1Y 的 LPR 利率，表明国内货币政策仍然“以我为主”，且 2022 年仍存在进一步调控的可能性和空间。四季度，10Y 以内的债券收益率均有所下行，其中：1Y 和 10Y 国债收益率均下行 10bp 左右，分别收至 2.24% 和 2.77%。

四季度，国内股票市场整体呈现震荡走势，板块之间进一步分化：传媒、军工、汽车、通信和消费板块涨幅居前，尤其是部分小市值公司期间涨幅巨大；而三季度涨幅较大的周期板块，如钢铁、煤炭和石油石化跌幅居前。在流动性较为充裕的大背景下，市场不断寻找超预期的公司及板块。

四季度，本基金债券部分的持仓继续以高等级、中短久期的债券为主，为组合贡献确定性收益；股票操作方面，我们在底部提升了股票仓位，并优化了持仓结构，在低回撤的约束下，四季度净值继续保持稳健的增长。同时，本基金也积极参与转债和新股的打新，增厚了部分组合业绩。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末长城优选回报六个月混合 A 基金份额净值为 1.0387 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.38%；截至本报告期末长城优选回报六个月混合 C 基金份额净值为 1.0348 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.28%；同期业绩比较基准收益率为 1.15%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内，本基金无需要说明的情况。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额（元） | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------------------|----------------|--------------|
| 1 | 权益投资 | 111,244,390.02 | 19.02 |
| | 其中：股票 | 111,244,390.02 | 19.02 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 453,584,300.00 | 77.54 |
| | 其中：债券 | 453,584,300.00 | 77.54 |
| | 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 | 4,600,000.00 | 0.79 |
| | 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 | 5,937,593.16 | 1.02 |
| 8 | 其他资产 | 9,570,402.32 | 1.64 |
| 9 | 合计 | 584,936,685.50 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|---------------|--------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | 3,548,260.00 | 0.61 |
| C | 制造业 | 60,096,752.98 | 10.40 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 5,308,381.13 | 0.92 |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | - | - |
| J | 金融业 | 28,081,491.00 | 4.86 |
| K | 房地产业 | 5,422,047.00 | 0.94 |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | 5,770,102.80 | 1.00 |
| 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 | 29,517.67 | 0.01 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 108,256,552.58 | 18.73 |

5.2.2 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 | - | - |
| B 消费者非必需品 | - | - |
| C 消费者常用品 | - | - |
| D 能源 | - | - |
| E 金融 | - | - |
| F 医疗保健 | - | - |
| G 工业 | - | - |
| H 信息技术 | - | - |
| I 电信服务 | 2,987,837.44 | 0.52 |
| J 公用事业 | - | - |
| K 房地产 | - | - |
| 合计 | 2,987,837.44 | 0.52 |

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 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 | 300059 | 东方财富 | 531,600 | 19,727,676.00 | 3.41 |
| 2 | 600519 | 贵州茅台 | 5,000 | 10,250,000.00 | 1.77 |
| 3 | 002271 | 东方雨虹 | 185,000 | 9,745,800.00 | 1.69 |
| 4 | 000059 | 华锦股份 | 802,900 | 5,845,112.00 | 1.01 |
| 5 | 002475 | 立讯精密 | 118,400 | 5,825,280.00 | 1.01 |
| 6 | 603259 | 药明康德 | 48,660 | 5,770,102.80 | 1.00 |
| 7 | 600048 | 保利发展 | 346,900 | 5,422,047.00 | 0.94 |
| 8 | 688608 | 恒玄科技 | 16,187 | 4,937,035.00 | 0.85 |
| 9 | 002371 | 北方华创 | 11,700 | 4,060,134.00 | 0.70 |
| 10 | 601899 | 紫金矿业 | 365,800 | 3,548,260.00 | 0.61 |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|----------------|--------------|
| 1 | 国家债券 | 37,011,100.00 | 6.40 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 229,645,000.00 | 39.73 |
| | 其中：政策性金融债 | 199,225,000.00 | 34.47 |
| 4 | 企业债券 | 172,334,000.00 | 29.82 |

| | | | |
|----|-----------|----------------|-------|
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债（可交换债） | 14,594,200.00 | 2.53 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 453,584,300.00 | 78.48 |

5.5 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债券投资明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|----------|-----------|----------------|--------------|
| 1 | 200202 | 20 国开 02 | 1,500,000 | 149,025,000.00 | 25.79 |
| 2 | 210302 | 21 进出 02 | 500,000 | 50,200,000.00 | 8.69 |
| 3 | 019649 | 21 国债 01 | 370,000 | 37,011,100.00 | 6.40 |
| 4 | 175797 | GC 三峡 01 | 300,000 | 30,450,000.00 | 5.27 |
| 5 | 175631 | 21 光证 G1 | 300,000 | 30,420,000.00 | 5.26 |

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资 明细

注：无。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

注：无。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：无。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

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

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：无。

5.10.3 本期国债期货投资评价

无。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本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中国进出口银行主体外，其他证券的发行主体未出现被监管部门立案调查、或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

根据中国银行保险监督管理委员会（简称银保监会）公布的行政处罚信息公开表：

中国进出口银行因违规投资企业股权等案由，于 2021 年 7 月 13 日被中国银保监会处以罚款。

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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|----|---------|--------------|
| 1 | 存出保证金 | 45,869.96 |
| 2 | 应收证券清算款 | 1,268,662.85 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 8,250,157.11 |
| 5 | 应收申购款 | 5,712.40 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 9,570,402.32 |

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|----------|--------------|--------------|
| 1 | 132009 | 17 中油 EB | 8,358,400.00 | 1.45 |
| 2 | 132015 | 18 中油 EB | 6,235,800.00 | 1.08 |

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：无。

5.11.6 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。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 长城优选回报六个月混合 A | 长城优选回报六个月混合 C |
|---------------------------|------------------|------------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 744,577,684.36 | 61,818,709.88 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 533,077.82 | 78,773.38 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 234,588,916.05 | 15,852,870.23 |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 510,521,846.13 | 46,044,613.03 |

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注：本报告期基金管理人持有本基金的份额情况无变动，于本报告期期初及期末均未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：本报告期本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- （一）中国证监会准予长城优选回报六个月持有期混合型证券投资基金注册的文件
- （二）《长城优选回报六个月持有期混合型证券投资基金基金合同》

- (三) 《长城优选回报六个月持有期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

9.2 存放地点

基金管理人及基金托管人住所

9.3 查阅方式

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

咨询电话：0755-23982338

客户服务电话：400-8868-666

网站：www.ccfund.com.cn