

长城量化小盘股票型证券投资基金 2020 年中期报告

2020 年 6 月 30 日

基金管理人：长城基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2020 年 8 月 31 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 08 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2020 年 01 月 10 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	6
2.1 基金基本情况	6
2.2 基金产品说明	6
2.3 基金管理人和基金托管人	8
2.4 信息披露方式	8
2.5 其他相关资料	8
§3 主要财务指标和基金净值表现	9
3.1 主要会计数据和财务指标	9
3.2 基金净值表现	9
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	15
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	15
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表	16
6.2 利润表	17
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	18

6.4 报表附注.....	19
§7 投资组合报告.....	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境内股票投资组合.....	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.....	52
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	54
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.....	54
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.....	55
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.....	55
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.....	55
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	55
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	56
7.12 投资组合报告附注.....	56
§8 基金份额持有人信息.....	58
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	58
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	58
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的情况.....	58
§9 开放式基金份额变动.....	59
§10 重大事件揭示.....	60
10.1 基金份额持有人大会决议.....	60
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.....	60
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	60
10.4 基金投资策略的改变.....	60
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	60
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.....	60
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	60
10.8 其他重大事件.....	63
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	65
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.....	65

11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	65
§12 备查文件目录.....	66
12.1 备查文件目录.....	66
12.2 存放地点.....	66
12.3 查阅方式.....	66

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	长城量化小盘股票型证券投资基金
基金简称	长城量化小盘股票
基金主代码	007903
交易代码	007903
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020 年 1 月 10 日
基金管理人	长城基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,153,316,904.51 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金利用定量投资模型，在有效控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	1、大类资产配置策略 本基金通过定量与定性相结合的方法分析宏观经济和证券市场发展趋势，评估市场的系统性风险和各类资产的预期收益与风险，据此合理制定和调整股票、债券等各类资产的比例，在保持总体风险水平相对稳定的基础上，力争投资组合的稳定增值。此外，本基金将持续地进行定期与不定期的资产配置风险监控，适时地做出相应的调整。 2、股票投资策略 （1）小盘股票的定义 本基金每半年对中国 A 股市场中的股票按流通市值从小到大排序并相加，累计流通市值占比达到总流通市值 40% 的股票为小盘股票。 在此期间，对于未纳入最近一次排序范围的股票（如新股上市、恢复上市股票等），如果其流通市值或预计流通市值（如对于未上市新股）能够满足以上标准，也将纳入小盘股票的备选投资范围。排序时遇到停牌或暂停交易的股票，本基金将根据市场情况，取停牌前收盘价或最能体现投资者利益最大化原则的公允价值计算其流通市值。 （2）个股投资策略 本基金主要采用三大类量化模型分别用以评估资产定价、控制风险和优化交易。基于模型结果，基金管理人结合市场环境和股票特性，精选个股产出投资组合，以追求超越业绩比较基准表现的业绩水平。 1) 多因子模型

	通过对股票之间的横向比较，多维度对股票打分，力求全方位评价股票的预期收益水平，根据综合汇总得分构建投资组合。多因子模型的因子来源主要包括基本面因子、市场交易型因子、预期性因子等。 2) 事件驱动模型 事件性投资主要是指研究股票发生事件前后的股价表现，利用科学工具对事件的历史样本分布、超额收益表现、统计显著性进行分析提供投资决策建议。可以更加科学、有效地捕获事件冲击所带来的超额收益，以更加直观、明确的模式刻画超额收益的持续性，从而使事件性投资的操作和执行也更具针对性和纪律性，确保了超额收益的渐进式稳定增长。 a、财务事件。主要是研究公司经营层面的业绩变化对股价的影响。如业绩预告、业绩快报、正式财报披露、业绩超预期等。 b、公司行为。公司的增发扩股、分红、送股、配股、拆股、重组、吸收合并、限售股解禁等，其信息披露与事件发生等各个时点对股价均会产生影响。通过低配负向影响事件、超配正向影响事件可以大概率获取超额收益。 c、其他事件。指数成分股调整：该事件会带来追踪该指数投资组合变化，调入的股票有资金流入、调出股票有资金流出，对相关股票股价带来影响；高管增持（股票激励等）：可以根据上市公司管理层对于企业基本面的信心变化寻找投资机会。 3) 风险模型： 风险模型控制投资组合对各类风险因子的敞口，包括规模、资产波动率、行业集中度等，力求主动将风险控制目标在目标范围内。 3、债券投资策略 本基金将根据“自上而下”对宏观经济形势、财政与货币政策，以及债券市场资金供求等因素的分析，重点参考基金的流动性管理需要，选取流动性较好的债券进行配置。 4、资产支持证券投资策略 本基金将在国内资产证券化产品具体政策框架下，通过宏观经济、提前偿还率、资产池结构及资产池资产所在行业景气变化等因素的研究，对个券进行风险分析和价值评估后选择风险调整后收益高的品种进行投资。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资，以降低流动性风险。 5、股指期货投资策略 本基金在进行股指期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，采用流动性好、交易活跃的
--	--

	期货合约，通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。法律法规对于基金投资股指期货的投资策略另有规定的，本基金将按法律法规的规定执行。
业绩比较基准	中证 1000 指数收益率×90%+活期存款利率×10%
风险收益特征	本基金为股票型基金，其风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		长城基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	车君	李申
	联系电话	0755-23982338	021-60637102
	电子邮箱	chejun@ccfund.com.cn	lishen.zh@ccb.com
客户服务电话		400-8868-666	010-67595096
传真		0755-23982328	010-66275853
注册地址		深圳市福田区益田路 6009 号新世界商务中心 41 层	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		深圳市福田区益田路 6009 号新世界商务中心 40、41 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		518026	100033
法定代表人		王军	田国立

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
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	深圳市福田区益田路 6009 号新世界商务中心 41 层

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	深圳市福田区益田路 6009 号新世界商务中心 40、41 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(2020 年 1 月 10 日 - 2020 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	18,733,761.86
本期利润	111,120,481.84
加权平均基金份额本期利润	0.0570
本期加权平均净值利润率	5.91%
本期基金份额净值增长率	8.16%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	31,902,624.16
期末可供分配基金份额利润	0.0277
期末基金资产净值	1,247,455,347.82
期末基金份额净值	1.0816
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	8.16%

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“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。

④本基金合同于 2020 年 01 月 10 日生效，截止本报告期末，基金合同生效未满一年。

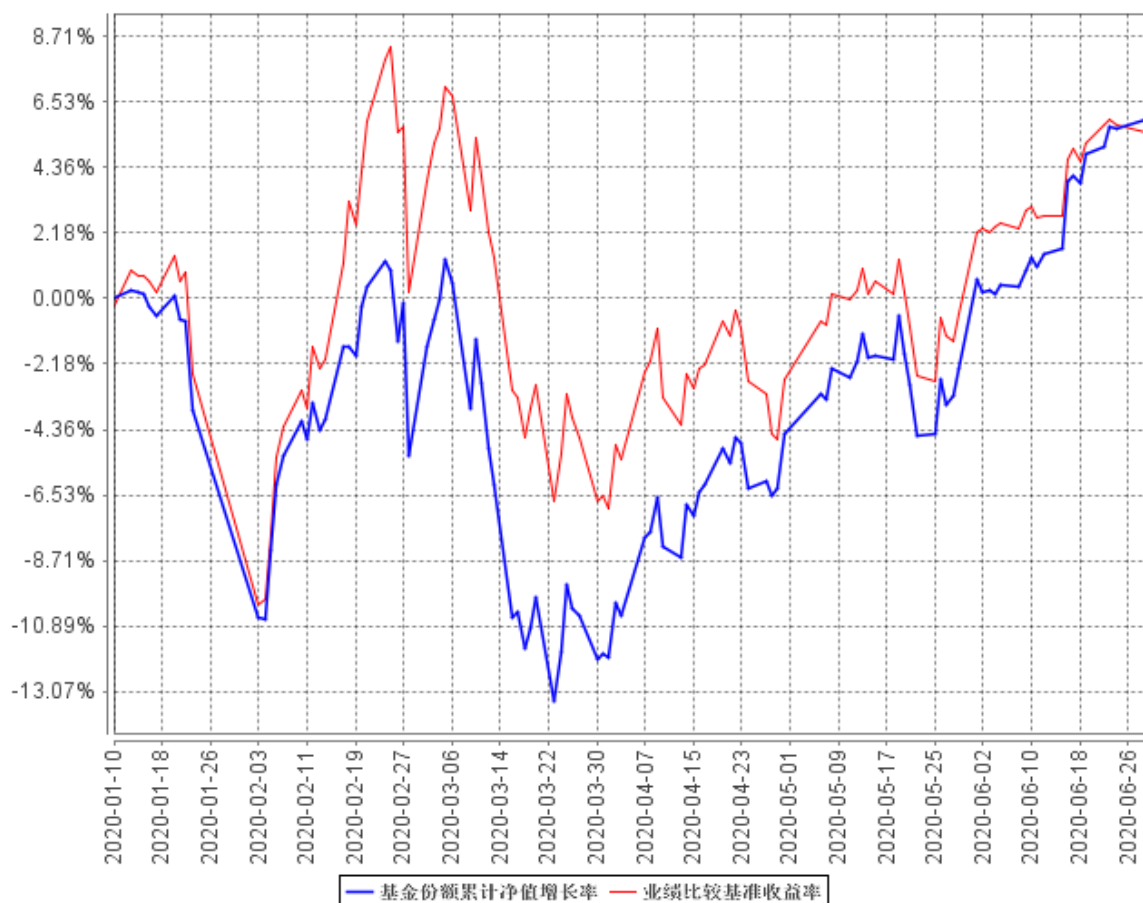
3.2 基金净值表现

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

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	10.72%	0.90%	7.76%	0.80%	2.96%	0.10%
过去三个月	22.64%	1.05%	14.74%	1.11%	7.90%	-0.06%
过去六个月	-	-	-	-	-	-
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	8.16%	1.64%	7.18%	1.72%	0.98%	-0.08%

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

基金份额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基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的 80%–95%，其中，投资于本基金界定的小盘股票的比例不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或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%，本基金所指的现金范围不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等资金类别。

②本基金的建仓期为自基金合同生效之日起六个月内，截止本报告期末，本基金尚处于建仓期内。

③本基金合同于 2020 年 1 月 10 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，公司管理的基金包括：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、长城景气行业龙头灵活配置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、长城久信债券型证券投资基金（《长城久信债券型证券投资基金基金合同》自 2020 年 7 月 15 日起终止）、长城中国智造灵活配置混合型证券投资基金、长城转型成长灵活配置混合型证券投资基金、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、长城久鑫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、长城久惠灵活配置混合型证券投资基金、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、长城嘉鑫两年定期开放债券型证券投资基金、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、长城创新驱动混合型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
雷俊	量化与指数投资部总经理，长城中证 500 指数增强型、长城久泰沪深 300 指数、长城创业板指数、长城核心优势混合、长城量化精选股票、长城量化小盘股票、长城中国智造混合的基金经理	2020 年 1 月 10 日	-	12 年	男，北京大学理学学士、工学硕士。曾就职于南方基金管理有限公司，2017 年 11 月进入长城基金管理有限公司，现任量化与指数投资部总经理。

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。

4.1.3 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

本报告期，无基金经理兼任投资经理情况。

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》、《长城量化小盘股票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 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《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 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，突如其来的“新冠”疫情给宏观经济和股市带来深远影响，总体来看呈现先降后升的特征。一季度 GDP 出现罕见的负增长，股市也持续大幅地回调。随着疫情边际上得到有效控制，经济活动的复苏，二季度 GDP 同比实现 3.2% 的正增长，股市在宏观政策和经济复苏预期的影响下强势反弹，医药食品饮料等许多板块个股创历史新高，金融地产受政策和经济影响表现相对较弱。市场风格方面，成长风格占优，盈利质量好增速高的公司显著跑赢市场平均。市场总体呈现动量特征，前期表现较好的板块和个股，后期大概率继续表现较好。报告期内因子表现优异，宏观市场环境对于因子的影响降低，因子的有效性逐渐得到修复，基本面驱动的因子相对业绩基准超额收益明显。

本基金基于长城基金量化投资研究平台的研究成果，采用量化多因子模型，基于上市公司的历史数据，借助数量化的技术手段，寻找对股票收益有预测性的指标作为因子；在组合层面上，根据基准指数的特点优化控制行业偏离以及个股偏离，并在综合考虑预期风险和收益水平基础上进行组合权重优化，力争有效跟踪基准指数的同时获取超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金份额净值增长率为 8.16%，本基金比较基准收益率为 7.18%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们对未来市场保持谨慎乐观态度，一方面对“新冠”疫情、中美关系等宏观外部风险保持警惕，另一方面对经济复苏充满信心，通过系统化的行业配置和个股选择方式来抵御股市的上下行波动。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金无需要说明的情况。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

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

报告期内，本基金实施利润分配的金额为 0.00 元，符合基金合同的规定。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：长城量化小盘股票型证券投资基金

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日
资 产：		
银行存款	6.4.7.1	48,345,305.62
结算备付金		91,127,669.74
存出保证金		13,310,784.34
交易性金融资产	6.4.7.2	1,108,783,124.13
其中：股票投资		1,047,747,328.63
基金投资		-
债券投资		61,035,795.50
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	40,000,000.00
应收证券清算款		42,061,979.93
应收利息	6.4.7.5	912,912.82
应收股利		-
应收申购款		147,047.68
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
资产总计		1,344,688,824.26
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日
负 债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	6.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		16,104,915.28
应付赎回款		76,945,366.39
应付管理人报酬		1,967,634.13
应付托管费		327,939.02
应付销售服务费		-
应付交易费用	6.4.7.7	1,188,180.89
应交税费		453,654.51

应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	245,786.22
负债合计		97,233,476.44
所有者权益：		
实收基金	6.4.7.9	1,153,316,904.51
未分配利润	6.4.7.10	94,138,443.31
所有者权益合计		1,247,455,347.82
负债和所有者权益总计		1,344,688,824.26

注：1) 报告截止日 2020 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0816 元，基金份额总额 1,153,316,904.51 份。

2) 本基金基金合同于 2020 年 01 月 10 日生效，无上年度期末数据。

6.2 利润表

会计主体：长城量化小盘股票型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 10 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2020 年 1 月 10 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		136,393,025.68
1.利息收入		2,455,768.74
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,112,342.78
债券利息收入		426,633.11
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		916,792.85
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		38,267,801.50
其中：股票投资收益	6.4.7.12	3,575,245.11
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	110,372.72
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.1	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-
衍生工具收益	6.4.7.15	24,382,097.09
股利收益	6.4.7.16	10,200,086.58
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	92,394,115.15
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	3,275,340.29

减：二、费用		25,272,543.84
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	13,237,992.37
2. 托管费	6.4.10.2.2	2,206,332.06
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	6.4.7.19	9,669,487.98
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		95,172.21
7. 其他费用	6.4.7.20	63,559.22
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		111,120,481.84
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		111,120,481.84

注：本基金基金合同于 2020 年 01 月 10 日生效，无上年度可比期间数据。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长城量化小盘股票型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 10 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 10 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	2,190,833,182.62	-	2,190,833,182.62
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	111,120,481.84	111,120,481.84
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-1,037,516,278.11	-16,982,038.53	-1,054,498,316.64
其中：1.基金申购款	62,379,885.19	-2,937,283.88	59,442,601.31
2. 基金赎回款	-1,099,896,163.30	-14,044,754.65	-1,113,940,917.95
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基	1,153,316,904.51	94,138,443.31	1,247,455,347.82

金净值)			
------	--	--	--

注：本基金基金合同于 2020 年 01 月 10 日生效，无上年度可比期间数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

_____ 王军	_____ 邱春杨	_____ 赵永强
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

长城量化小盘股票型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2019]1417 号文“关于准予长城量化小盘股票型证券投资基金注册的批复”的核准，由长城基金管理有限公司自 2019 年 12 月 26 日至 2020 年 1 月 8 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（2020）验字第 60737541_H01 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 2020 年 1 月 10 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 2,190,584,099.95 元，在首次募集期间有效认购资金产生的利息为人民币 249,082.67 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 2,190,833,182.62 元，折合 2,190,833,182.62 份基金份额。本基金的基金管理人为长城基金管理有限公司，注册登记机构为长城基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司（以下简称“中国建设银行”）。

本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（包括主板、创业板、中小板以及其他经中国证监会允许基金投资的股票）、债券（包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券（含可分离交易可转换债）、可交换债券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款等）、同业存单、股指期货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资产的比例为基金资产的 80%-95%，其中，投资于本基金界定的小盘股票的比例不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，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%，本基金所指的现金范围不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等资金类别。

本基金的业绩比较基准为：中证 1000 指数收益率×90%+活期存款利率×10%。

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、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

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 2020 年 06 月 30 日的财务状况以及自 2020 年 01 月 10 日（基金合同生效日）起至 2020 年 06 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息根据下列依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本会计期间为 2020 年 01 月 10 日（基金合同生效日）至 6 月 30 日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及贷款和应收款项；

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包括股票、债券、基金和衍生工具等投资。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、结算备付金、买入返售金融资产和各类应收款项等。

(2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。

本基金持有的金融负债均划分为其他金融负债，主要包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

初始确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额。划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产取得时发生的相关交易费用计入当期损益；应收款项及其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

后续计量

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产采用公允价值进行后续计量。在持有该类金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；应收款项及其他金融负债采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量，其摊销或减值产生的利得或损失，均计入当期损益。

终止确认

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益。

金融资产转移

本基金已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的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；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的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其

继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场(或最有利市场)是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的股票、债券、基金和衍生工具等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照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，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) 不存在活跃市场的金融工具，应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。采用估值技术确定公允价值时，应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，才使用不可观察输入值。

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值。

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金同时满足下列条件时，金融资产和金融负债以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。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。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益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收益/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现损益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利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/(累计亏损)”。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益/(损失)于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/(损失)于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 衍生工具收益/(损失)于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入

账；

(8) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(9) 公允价值变动收益/(损失)系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(10) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

6.4.4.10 费用的确认和计量

(1) 基金管理费按前一日基金资产净值的 1.50% 的年费率逐日计提；

(2) 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率逐日计提；

(3) 卖出回购金融资产支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在回购期内逐日计提；

(4) 其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第四位的，则采用待摊或预提的方法。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

1、在符合有关基金分红条件的前提下，具体分红方案见基金管理人根据基金运作情况届时不定期发布的相关分红公告，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4、每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

6.4.4.12 分部报告

截至本期末，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。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无需要说明的其他重要会计政策和会计估计事项。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无需要说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

1. 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，证券(股票)交易印花税税率为 1%，由出让方缴纳。

股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

2. 增值税、企业所得税

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

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

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规

定，自 2018 年 1 月 1 日起，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（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在 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，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

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。

股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税。

3. 个人所得税

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

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

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

股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征

收流通股股东应缴纳的个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
活期存款	48,345,305.62
定期存款	—
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	—
合计：	48,345,305.62

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	957,411,709.27	1,047,747,328.63	90,335,619.36
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—
债券	交易所市场	30,970,103.30	30,993,795.50
	银行间市场	30,061,410.00	30,042,000.00
	合计	61,031,513.30	61,035,795.50
资产支持证券	—	—	—
基金	—	—	—
其他	—	—	—
合计	1,018,443,222.57	1,108,783,124.13	90,339,901.56

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	—	—	—	

货币衍生工具	-	-	-	
权益衍生工具	96,473,960.00	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	96,473,960.00	-	-	

衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资/国债期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为 0。

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 2020 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	40,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	40,000,000.00	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金于本期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	11,431.94
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	373,115.90
应收债券利息	527,714.68
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	650.30
合计	912,912.82

注：其他为应收交易所结算保证金利息。

6.4.7.6 其他资产

本基金于本期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	1,188,180.89
银行间市场应付交易费用	-
合计	1,188,180.89

注：应付交易所市场交易费用均为应付佣金。

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	192,827.19
应付证券出借违约金	-
预提费用	52,959.03
合计	245,786.22

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 10 日 (基金合同生效日) 至 2020 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
基金合同生效日	2,190,833,182.62	2,190,833,182.62
本期申购	62,379,885.19	62,379,885.19
本期赎回(以“-”号填列)	-1,099,896,163.30	-1,099,896,163.30
本期末	1,153,316,904.51	1,153,316,904.51

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	18,733,761.86	92,386,719.98	111,120,481.84

本期基金份额交易产生的变动数	13,168,862.30	-30,150,900.83	-16,982,038.53
其中：基金申购款	-999,771.77	-1,937,512.11	-2,937,283.88
基金赎回款	14,168,634.07	-28,213,388.72	-14,044,754.65
本期已分配利润	-	-	-
本期末	31,902,624.16	62,235,819.15	94,138,443.31

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 10 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	370,406.82
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	734,753.43
其他	7,182.53
合计	1,112,342.78

注：其他为结算保证金利息收入。

6.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 10 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	5,666,124,703.31
减：卖出股票成本总额	5,662,549,458.20
买卖股票差价收入	3,575,245.11

6.4.7.13 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月10日(基金合同生效日)至2020年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	604,327.19
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	493,800.00
减：应收利息总额	154.47

买卖债券差价收入	110,372.72
----------	------------

6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益/损失。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益/损失。

6.4.7.15 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2020 年 1 月 10 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日
国债期货投资收益	-
股指期货-投资收益	24,382,097.09

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 10 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	10,200,086.58
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	10,200,086.58

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020 年 1 月 10 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	90,339,901.56
——股票投资	90,335,619.36
——债券投资	4,282.20
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-

2. 衍生工具	2,115,840.00
——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	61,626.41
合计	92,394,115.15

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 10 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	3,040,769.94
其他	92,502.35
转出基金补偿收入	142,068.00
合计	3,275,340.29

注：其他为募集期结束后至产品成立前利息金额。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 10 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	9,669,262.98
银行间市场交易费用	225.00
交易基金产生的费用	—
其中：申购费	—
赎回费	—
合计	9,669,487.98

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 10 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日
审计费用	48,459.03
信息披露费	—

证券出借违约金	-
银行间债券账户服务费	6,000.00
银行费用	9,100.19
合计	63,559.22

6.4.7.21 分部报告

截至本期末，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。

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	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行	基金托管人、基金销售机构
长城证券股份有限公司（“长城证券”）	基金管理人股东、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 2020年1月10日(基金合同生效日)至2020年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
长城证券	12,268,544,426.29	100.00%

注：本基金合同于 2020 年 01 月 10 日生效，无上年度可比数据。

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月10日(基金合同生效日)至2020年6月30日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例
长城证券	30,586,630.49	100.00%

注：本基金合同于 2020 年 01 月 10 日生效，无上年度可比数据。

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 2020年1月10日(基金合同生效日)至2020年6月30日	
	回购成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例
长城证券	8,019,700,000.00	100.00%

注：本基金合同于 2020 年 01 月 10 日生效，无上年度可比数据。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本期未通过关联方交易单元进行权证交易。本基金合同于 2020 年 01 月 10 日生效，无上年度可比数据。

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 2020年1月10日(基金合同生效日)至2020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	2,837,725.57	100.00%	1,188,180.89	100.00%

注：①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。

②本基金基金合同于 2020 年 01 月 10 日生效，无上年度可比数据。

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
	2020 年 1 月 10 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	13,237,992.37
其中：支付销售机构的客户维护费	6,759,684.85

注：1) 基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.50% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

2) 本基金合同于 2020 年 1 月 10 日生效，无上年度可比期间数据。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2020 年 1 月 10 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	2,206,332.06

注：1) 基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

2) 本基金合同于 2020 年 01 月 10 日生效，无上年度可比期间数据。

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

本基金于本期末与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。本基金合同于 2020 年 01 月 10 日生效，无上年度可比数据。

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

本基金本期无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。

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

本基金本期无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。

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 2020 年 1 月 10 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日
基金合同生效日（2020 年 1 月 10 日）持有的基金份额	—
报告期初持有的基金份额	—
报告期间申购/买入总份额	10,426,485.92
报告期间因拆分变动份额	—
减：报告期间赎回/卖出总份额	—
报告期末持有的基金份额	10,426,485.92
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	0.9040%

注：1）基金管理人本期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并支付。

2）本基金于 2020 年 1 月 10 日成立，无上年度可比期间数据。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

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

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方 名称	本期 2020 年 1 月 10 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	48,345,305.62	370,406.82

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。本基金合同于 2020 年 01 月 10 日生效，无上年度可比数据。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金于本期末在承销期内直接购入关联方承销的证券。本基金合同于 2020 年 01 月 10 日生效，

无上年度可比数据。

6.4.11 利润分配情况

本基金合同于 2020 年 01 月 10 日生效，本基金本报告期末进行利润分配。

6.4.12 期末（2020 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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	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
600984	建设机械	2020 年 4 月 27 日	2020 年 10 月 23 日	非公开发行流通受限	10.82	23.12	785,725	8,501,544.50	18,165,962.00	-
688598	金博股份	2020 年 5 月 8 日	2020 年 11 月 18 日	新股锁定	47.20	77.94	7,645	360,844.00	595,851.30	-
688566	吉贝尔	2020 年 5 月 8 日	2020 年 11 月 18 日	新股锁定	23.69	38.43	9,882	234,104.58	379,765.26	-
688568	中科星图	2020 年 6 月 30 日	2020 年 7 月 8 日	新股未上市	16.21	16.21	11,020	178,634.20	178,634.20	-
688027	国盾量子	2020 年 6 月 30 日	2020 年 7 月 9 日	新股未上市	36.18	36.18	2,830	102,389.40	102,389.40	-
300847	中船汉光	2020 年 6 月 29 日	2020 年 7 月 9 日	新股未上市	6.94	6.94	1,421	9,861.74	9,861.74	-
300845	捷安高科	2020 年 6 月 24 日	2020 年 7 月 3 日	新股未上市	17.63	17.63	470	8,286.10	8,286.10	-
300843	胜蓝	2020	2020	新股	10.01	10.01	751	7,517.51	7,517.51	-

	股份	年 6 月 23 日	年 7 月 2 日	未上市						
300840	酷特智能	2020 年 6 月 30 日	2020 年 7 月 8 日	新股未上市	5.94	5.94	1,185	7,038.90	7,038.90	-
300846	首都在线	2020 年 6 月 22 日	2020 年 7 月 1 日	新股未上市	3.37	3.37	1,131	3,811.47	3,811.47	-
688169	石头科技	2020 年 2 月 13 日	2020 年 8 月 21 日	新股锁定	271.12	365.14	5,382	1,459,167.84	1,965,183.48	-
688222	成都先导	2020 年 4 月 3 日	2020 年 10 月 16 日	新股锁定	20.52	43.70	9,201	188,804.52	402,083.70	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
601880	大连港	2020 年 6 月 22 日	重大事项	1.72	2020 年 7 月 8 日	1.89	1,133,452	1,967,913.19	1,949,537.44	-

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 2020 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 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 2020 年 6 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 0.00 元，无质押证券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金于本期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

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%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

6.4.13.3 流动性风险

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交

易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020 年 6 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	48,345,305.62	-	-	-	-	-	48,345,305.62
结算备付金	91,127,669.74	-	-	-	-	-	91,127,669.74
存出保证金	13,310,784.34	-	-	-	-	-	13,310,784.34
交易性金融	-	-	61,035,795.50	-	-	1,047,747,328.63	1,108,783,124.13

资产							
买入返售金融资产	40,000,000.00	-	-	-	-	-	40,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	42,061,979.93	42,061,979.93
应收利息	-	-	-	-	-	912,912.82	912,912.82
应收申购款	-	-	-	-	-	147,047.68	147,047.68
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	192,783,759.70	-	-61,035,795.50	-	-	-1,090,869,269.06	1,344,688,824.26
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	16,104,915.28	16,104,915.28
应付赎回款	-	-	-	-	-	76,945,366.39	76,945,366.39
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,967,634.13	1,967,634.13
应付托管费	-	-	-	-	-	327,939.02	327,939.02
应付交易费用	-	-	-	-	-	1,188,180.89	1,188,180.89
应交税费	-	-	-	-	-	453,654.51	453,654.51
其他负债	-	-	-	-	-	245,786.22	245,786.22
负债总计	-	-	-	-	-	97,233,476.44	97,233,476.44
利率敏感度缺口	192,783,759.70	-	-61,035,795.50	-	-		

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时		
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（2020年6月30日）	上年度末（2019年12月31日）
	利率上升 25 个基点	-89,921.69	-
	利率下降 25 个基点	90,194.94	

注：上表为利率风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动将对基金资产净值产生的影响。正数表示可能增加基金资产净值，负数表示可能减少基金资产净值。

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。

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金投资组合中股票资产的比例为基金资产的 80%-95%，其中，投资于本基金界定的小盘股票的比例不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，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%，本基金所指的现金范围不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等资金类别。

于本期末，本基金面临的整体其他价格风险列示如下：

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	1,047,747,328.63	83.99
交易性金融资产—基金投资	—	—
交易性金融资产—债券投资	61,035,795.50	4.89
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	1,108,783,124.13	88.88

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	在其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时		
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（2020 年 6 月 30 日）	上年度末（2019 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数上升 5%	51,769,195.51	—
	沪深 300 指数下降 5%	-51,769,195.51	—

注：本基金管理人运用定量分析方法对本基金的其他价格风险进行分析。上表为其他价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时，将对基

金资产净值产生的影响。正数表示可能增加基金资产净值，负数表示可能减少基金资产净值。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

本基金管理人已经评估了银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、其他应收款项类投资以及其他金融负债因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

各层次金融工具公允价值

于 2020 年 06 月 30 日，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中划分为第一层次的余额为人民币 1,024,959,206.13 元，划分为第二层次的余额为人民币 83,823,918.00 元，无划分为第三层次的余额。

公允价值所属层次间重大变动

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等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间及交易不活跃期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

第三层次公允价值期初金额和本期变动金额

本基金于本报告期初未持有公允价值划分为第三层次的金融工具，本基金本报告期末发生第三层次公允价值转入转出情况。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§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	1,047,747,328.63	77.92
	其中：股票	1,047,747,328.63	77.92
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	61,035,795.50	4.54
	其中：债券	61,035,795.50	4.54
	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	40,000,000.00	2.97
	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	139,472,975.36	10.37
8	其他各项资产	56,432,724.77	4.20
9	合计	1,344,688,824.26	100.00

7.2 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	76,980.00	0.01
B	采矿业	2,203,478.10	0.18
C	制造业	648,864,976.77	52.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	36,241,020.12	2.91
E	建筑业	47,948,589.53	3.84
F	批发和零售业	57,443,755.02	4.60
G	交通运输、仓储和邮政业	32,040,478.44	2.57
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	111,626,666.53	8.95
J	金融业	11,077,536.11	0.89
K	房地产业	37,328,007.73	2.99
L	租赁和商务服务业	1,909.37	0.00
M	科学研究和技术服务业	36,951,446.95	2.96
N	水利、环境和公共设施管理业	21,301,404.48	1.71
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—

Q	卫生和社会工作	9,271.08	0.00
R	文化、体育和娱乐业	115,860.40	0.01
S	综合	4,515,948.00	0.36
	合计	1,047,747,328.63	83.99

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	占基金资产净值比例（%）
1	600984	建设机械	785,725	18,165,962.00	1.46
2	300559	佳发教育	714,211	15,155,557.42	1.21
3	600845	宝信软件	232,057	13,709,927.56	1.10
4	603713	密尔克卫	129,500	13,470,590.00	1.08
5	603233	大参林	165,220	13,419,168.40	1.08
6	002705	新宝股份	366,023	13,352,519.04	1.07
7	603127	昭衍新药	126,200	13,267,406.00	1.06
8	603606	东方电缆	906,975	13,187,416.50	1.06
9	000961	中南建设	1,475,800	13,134,620.00	1.05
10	603228	景旺电子	371,360	13,068,158.40	1.05
11	300394	天孚通信	219,062	13,045,142.10	1.05
12	300739	明阳电路	623,025	13,027,452.75	1.04
13	601137	博威合金	832,747	13,024,163.08	1.04
14	300770	新媒股份	58,200	13,017,012.00	1.04
15	603218	日月股份	708,520	12,965,916.00	1.04
16	002912	中新赛克	78,389	12,823,656.51	1.03
17	300482	万孚生物	123,100	12,802,400.00	1.03
18	603707	健友股份	196,934	12,716,028.38	1.02
19	002847	盐津铺子	132,900	12,654,738.00	1.01
20	002531	天顺风能	2,113,392	12,638,084.16	1.01
21	300607	拓斯达	310,240	12,623,665.60	1.01
22	002511	中顺洁柔	565,400	12,608,420.00	1.01
23	000977	浪潮信息	321,560	12,598,720.80	1.01
24	603380	易德龙	711,600	12,588,204.00	1.01
25	603416	信捷电气	315,800	12,587,788.00	1.01
26	300690	双一科技	501,467	12,541,689.67	1.01
27	300256	星星科技	1,973,250	12,510,405.00	1.00
28	603776	永安行	696,215	12,483,134.95	1.00
29	002698	博实股份	973,336	12,410,034.00	0.99

30	300031	宝通科技	495,100	12,397,304.00	0.99
31	601615	明阳智能	991,100	12,339,195.00	0.99
32	600731	湖南海利	1,735,400	12,321,340.00	0.99
33	600998	九州通	658,900	12,268,718.00	0.98
34	600496	精工钢构	3,659,936	12,260,785.60	0.98
35	300179	四方达	2,157,502	12,233,036.34	0.98
36	600372	中航电子	917,100	12,215,772.00	0.98
37	002697	红旗连锁	1,118,000	12,208,560.00	0.98
38	603700	宁水集团	410,412	12,197,444.64	0.98
39	603611	诺力股份	568,052	12,190,395.92	0.98
40	600027	华电国际	3,563,923	12,188,616.66	0.98
41	000065	北方国际	1,647,374	12,042,303.94	0.97
42	603297	永新光学	268,892	12,011,405.64	0.96
43	603345	安井食品	101,756	12,007,208.00	0.96
44	603111	康尼机电	1,918,200	11,873,658.00	0.95
45	300231	银信科技	1,331,524	11,863,878.84	0.95
46	002216	三全食品	495,005	11,830,619.50	0.95
47	600163	中闽能源	3,377,483	11,618,541.52	0.93
48	600760	中航沈飞	341,300	11,201,466.00	0.90
49	000488	晨鸣纸业	2,264,500	11,186,630.00	0.90
50	300759	康龙化成	109,700	10,794,480.00	0.87
51	002727	一心堂	287,115	10,654,837.65	0.85
52	300033	同花顺	80,044	10,652,255.52	0.85
53	603327	福蓉科技	393,800	10,171,854.00	0.82
54	603566	普莱柯	362,300	10,032,087.00	0.80
55	600026	中远海能	1,521,000	9,825,660.00	0.79
56	002394	联发股份	1,099,373	9,784,419.70	0.78
57	300214	日科化学	1,201,330	9,778,826.20	0.78
58	002133	广宇集团	3,202,801	9,736,515.04	0.78
59	600055	万东医疗	600,900	9,620,409.00	0.77
60	300638	广和通	155,560	9,349,156.00	0.75
61	002060	粤水电	3,187,800	9,212,742.00	0.74
62	600389	江山股份	497,400	9,097,446.00	0.73
63	600461	洪城水业	1,394,345	8,881,977.65	0.71
64	002214	大立科技	313,900	8,845,702.00	0.71
65	300496	中科创达	112,800	8,764,560.00	0.70
66	300041	回天新材	539,700	8,187,249.00	0.66
67	603444	吉比特	14,893	8,176,405.93	0.66
68	600284	浦东建设	1,303,600	8,017,140.00	0.64

69	300502	新易盛	125,280	7,907,673.60	0.63
70	002895	川恒股份	641,803	7,855,668.72	0.63
71	603733	仙鹤股份	463,873	7,454,439.11	0.60
72	300172	中电环保	1,493,000	7,121,610.00	0.57
73	000656	金科股份	867,678	7,080,252.48	0.57
74	002034	旺能环境	401,695	7,005,560.80	0.56
75	300363	博腾股份	200,500	6,929,280.00	0.56
76	000965	天保基建	2,125,042	6,906,386.50	0.55
77	300119	瑞普生物	306,400	6,848,040.00	0.55
78	601872	招商轮船	1,165,400	6,794,282.00	0.54
79	603368	柳药股份	290,004	6,655,591.80	0.53
80	603609	禾丰牧业	433,200	6,454,680.00	0.52
81	600846	同济科技	701,100	5,959,350.00	0.48
82	603937	丽岛新材	383,300	5,768,665.00	0.46
83	000529	广弘控股	766,470	5,641,219.20	0.45
84	603601	再升科技	425,900	5,579,290.00	0.45
85	300037	新宙邦	101,200	5,572,072.00	0.45
86	600529	山东药玻	95,936	5,564,288.00	0.45
87	603058	永吉股份	570,000	5,380,800.00	0.43
88	601881	中国银河	466,000	5,345,020.00	0.43
89	300695	兆丰股份	69,210	5,291,104.50	0.42
90	000657	中钨高新	880,227	5,246,152.92	0.42
91	002839	张家港行	898,400	5,174,784.00	0.41
92	002734	利民股份	344,600	5,158,662.00	0.41
93	002028	思源电气	243,600	4,984,056.00	0.40
94	300371	汇中股份	344,328	4,793,045.76	0.38
95	300166	东方国信	385,800	4,787,778.00	0.38
96	603612	索通发展	401,200	4,581,704.00	0.37
97	600603	广汇物流	958,800	4,515,948.00	0.36
98	600486	扬农化工	54,000	4,455,000.00	0.36
99	300628	亿联网络	64,916	4,431,166.16	0.36
100	002568	百润股份	97,074	4,399,393.68	0.35
101	300715	凯伦股份	117,200	4,369,216.00	0.35
102	603797	联泰环保	375,640	4,316,103.60	0.35
103	002392	北京利尔	999,200	3,996,800.00	0.32
104	300457	赢合科技	113,550	3,619,974.00	0.29
105	688396	华润微	81,911	3,558,213.84	0.29
106	600578	京能电力	1,019,421	2,986,903.53	0.24
107	300623	捷捷微电	97,492	2,929,634.60	0.23

108	603903	中持股份	156,980	2,852,326.60	0.23
109	002916	深南电路	15,411	2,581,650.72	0.21
110	002801	微光股份	53,500	2,244,325.00	0.18
111	601001	大同煤业	531,700	2,084,264.00	0.17
112	603338	浙江鼎力	26,800	2,030,636.00	0.16
113	688169	石头科技	5,382	1,965,183.48	0.16
114	601880	大连港	1,133,452	1,949,537.44	0.16
115	002001	新 和 成	65,500	1,906,050.00	0.15
116	600734	*ST 实达	758,858	1,669,487.60	0.13
117	603966	法兰泰克	152,900	1,510,652.00	0.12
118	002080	中材科技	86,968	1,348,004.00	0.11
119	002416	爱施德	166,800	1,197,624.00	0.10
120	600693	东百集团	212,094	1,028,655.90	0.08
121	002557	洽洽食品	18,267	989,888.73	0.08
122	002838	道恩股份	26,400	770,616.00	0.06
123	688598	金博股份	7,645	595,851.30	0.05
124	601016	节能风电	260,400	552,048.00	0.04
125	600015	华夏银行	85,907	525,750.84	0.04
126	600549	厦门钨业	37,898	448,712.32	0.04
127	000628	高新发展	51,523	439,491.19	0.04
128	688222	成都先导	9,201	402,083.70	0.03
129	688566	吉贝尔	9,882	379,765.26	0.03
130	000751	锌业股份	136,559	352,322.22	0.03
131	300373	扬杰科技	9,700	325,144.00	0.03
132	300625	三雄极光	20,784	293,885.76	0.02
133	600077	宋都股份	101,200	284,372.00	0.02
134	600183	生益科技	9,306	272,386.62	0.02
135	000667	美好置业	66,700	184,092.00	0.01
136	688568	中科星图	11,020	178,634.20	0.01
137	300413	芒果超媒	1,777	115,860.40	0.01
138	000975	银泰黄金	7,300	114,464.00	0.01
139	688027	国盾量子	2,830	102,389.40	0.01
140	603877	太平鸟	6,000	85,200.00	0.01
141	002019	亿帆医药	3,636	83,518.92	0.01
142	300511	雪榕生物	6,000	76,980.00	0.01
143	600531	豫光金铅	11,226	44,005.92	0.00
144	603208	江山欧派	451	43,927.40	0.00
145	300546	雄帝科技	1,406	33,645.58	0.00
146	600109	国金证券	2,700	30,807.00	0.00

147	603113	金能科技	2,490	29,606.10	0.00
148	002106	莱宝高科	2,200	28,908.00	0.00
149	300824	北鼎股份	1,954	26,789.34	0.00
150	002587	奥拓电子	3,914	22,309.80	0.00
151	002616	长青集团	1,900	21,565.00	0.00
152	300842	帝科股份	455	18,527.60	0.00
153	600436	片仔癀	100	17,025.00	0.00
154	600170	上海建工	5,388	16,541.16	0.00
155	300699	光威复材	261	16,372.53	0.00
156	600570	恒生电子	140	15,078.00	0.00
157	603197	保隆科技	500	14,790.00	0.00
158	300533	冰川网络	400	14,472.00	0.00
159	600956	新天绿能	2,533	12,766.32	0.00
160	600563	法拉电子	200	12,360.00	0.00
161	002901	大博医疗	100	11,929.00	0.00
162	603520	司太立	140	11,768.40	0.00
163	300839	博汇股份	502	11,751.82	0.00
164	300213	佳讯飞鸿	1,778	11,468.10	0.00
165	603258	电魂网络	200	11,112.00	0.00
166	002947	恒铭达	173	11,072.00	0.00
167	300847	中船汉光	1,421	9,861.74	0.00
168	300369	绿盟科技	400	9,316.00	0.00
169	300347	泰格医药	91	9,271.08	0.00
170	002942	新农股份	300	8,766.00	0.00
171	300232	洲明科技	1,044	8,445.96	0.00
172	603636	南威软件	694	8,397.40	0.00
173	300845	捷安高科	470	8,286.10	0.00
174	603716	塞力斯	537	7,818.72	0.00
175	603661	恒林股份	153	7,695.90	0.00
176	300474	景嘉微	113	7,604.90	0.00
177	300843	胜蓝股份	751	7,517.51	0.00
178	300840	酷特智能	1,185	7,038.90	0.00
179	300724	捷佳伟创	79	6,993.87	0.00
180	300572	安车检测	104	6,609.20	0.00
181	300433	蓝思科技	228	6,393.12	0.00
182	603005	晶方科技	80	6,292.80	0.00
183	600602	云赛智联	852	6,185.52	0.00
184	300114	中航电测	500	5,705.00	0.00
185	603638	艾迪精密	107	5,606.80	0.00

186	600987	航民股份	946	5,061.10	0.00
187	300595	欧普康视	71	4,923.14	0.00
188	300659	中孚信息	80	4,801.60	0.00
189	603583	捷昌驱动	70	4,786.60	0.00
190	603568	伟明环保	205	4,756.00	0.00
191	603039	泛微网络	54	4,172.04	0.00
192	000547	航天发展	300	4,101.00	0.00
193	300846	首都在线	1,131	3,811.47	0.00
194	300036	超图软件	149	3,751.82	0.00
195	002851	麦格米特	143	3,706.56	0.00
196	300034	钢研高纳	193	3,620.68	0.00
197	603505	金石资源	140	3,024.00	0.00
198	002414	高德红外	100	2,928.00	0.00
199	002602	世纪华通	180	2,755.80	0.00
200	002798	帝欧家居	82	2,662.54	0.00
201	300476	胜宏科技	107	2,573.35	0.00
202	002463	沪电股份	100	2,498.00	0.00
203	603351	威尔药业	105	2,452.80	0.00
204	300384	三联虹普	137	2,394.76	0.00
205	300451	创业慧康	125	2,311.25	0.00
206	300248	新开普	183	2,261.88	0.00
207	300497	富祥药业	112	2,191.84	0.00
208	002353	杰瑞股份	70	2,170.00	0.00
209	300188	美亚柏科	89	1,764.87	0.00
210	002273	水晶光电	100	1,714.00	0.00
211	002818	富森美	139	1,709.70	0.00
212	603712	七一二	41	1,573.58	0.00
213	600993	马应龙	63	1,527.75	0.00
214	002706	良信电器	85	1,417.80	0.00
215	600346	恒力石化	100	1,400.00	0.00
216	300012	华测检测	70	1,383.20	0.00
217	300735	光弘科技	73	1,346.85	0.00
218	002128	露天煤业	162	1,255.50	0.00
219	002788	鹭燕医药	145	1,252.80	0.00
220	002449	国星光电	100	1,160.00	0.00
221	300070	碧水源	129	1,047.48	0.00
222	002324	普利特	68	1,020.68	0.00
223	002555	三七互娱	21	982.80	0.00
224	300602	飞荣达	29	951.78	0.00

225	300130	新国都	68	935.00	0.00
226	002810	山东赫达	25	844.00	0.00
227	002036	联创电子	60	750.00	0.00
228	002832	比音勒芬	40	684.80	0.00
229	002493	荣盛石化	50	615.00	0.00
230	300016	北陆药业	50	608.00	0.00
231	300255	常山药业	100	577.00	0.00
232	601997	贵阳银行	80	572.80	0.00
233	603018	中设集团	58	564.34	0.00
234	603385	惠达卫浴	40	551.20	0.00
235	002016	世荣兆业	83	542.82	0.00
236	000157	中联重科	79	507.97	0.00
237	603303	得邦照明	46	493.12	0.00
238	002534	杭锅股份	60	487.20	0.00
239	600466	蓝光发展	90	485.10	0.00
240	601918	新集能源	194	461.72	0.00
241	000573	粤宏远 A	173	444.61	0.00
242	002579	中京电子	30	429.00	0.00
243	002641	永高股份	60	402.60	0.00
244	002487	大金重工	67	399.32	0.00
245	601058	赛轮轮胎	99	349.47	0.00
246	300697	电工合金	26	346.06	0.00
247	600779	水井坊	5	312.10	0.00
248	300569	天能重工	38	310.08	0.00
249	002423	中粮资本	35	304.50	0.00
250	600340	华夏幸福	13	297.18	0.00
251	600901	江苏租赁	57	296.97	0.00
252	002053	云南能投	40	283.20	0.00
253	600368	五洲交通	79	276.50	0.00
254	300043	星辉娱乐	59	236.00	0.00
255	601117	中国化学	43	235.64	0.00
256	603313	梦百合	10	235.30	0.00
257	600415	小商品城	41	199.67	0.00
258	601619	嘉泽新能	57	166.44	0.00
259	600033	福建高速	50	132.50	0.00
260	300360	炬华科技	11	106.92	0.00
261	000552	靖远煤电	4	8.88	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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例（%）
1	300497	富祥药业	57,519,887.98	4.61
2	002111	威海广泰	37,305,258.00	2.99
3	600183	生益科技	35,585,293.48	2.85
4	603233	大参林	34,181,955.24	2.74
5	002895	川恒股份	34,134,764.23	2.74
6	300690	双一科技	33,566,279.01	2.69
7	601615	明阳智能	33,163,426.14	2.66
8	603568	伟明环保	33,134,820.25	2.66
9	300235	方直科技	32,467,913.40	2.60
10	603707	健友股份	32,386,178.54	2.60
11	300719	安达维尔	31,445,090.10	2.52
12	002697	红旗连锁	30,853,242.95	2.47
13	300231	银信科技	30,640,658.09	2.46
14	002273	水晶光电	30,360,957.72	2.43
15	300256	星星科技	30,226,215.00	2.42
16	300702	天宇股份	30,162,769.92	2.42
17	002912	中新赛克	29,874,802.60	2.39
18	002916	深南电路	29,793,450.67	2.39
19	002045	国光电器	29,646,790.60	2.38
20	300628	亿联网络	29,229,968.09	2.34
21	002396	星网锐捷	29,165,198.47	2.34
22	600079	人福医药	29,139,227.00	2.34
23	600531	豫光金铅	29,112,596.57	2.33
24	002810	山东赫达	28,969,842.66	2.32
25	300559	佳发教育	28,606,151.00	2.29
26	603606	东方电缆	28,482,836.55	2.28
27	300699	光威复材	28,443,622.95	2.28
28	300033	同花顺	27,588,297.66	2.21
29	002367	康力电梯	27,317,554.00	2.19
30	002847	盐津铺子	26,464,977.29	2.12

31	002065	东华软件	26,359,732.05	2.11
32	000851	高鸿股份	26,355,962.58	2.11
33	002705	新宝股份	25,792,058.46	2.07
34	002706	良信电器	25,710,751.10	2.06
35	603208	江山欧派	25,561,845.72	2.05
36	601918	新集能源	25,459,966.36	2.04
37	603666	亿嘉和	25,451,380.64	2.04
38	600731	湖南海利	25,218,444.22	2.02
39	601865	福莱特	25,104,212.36	2.01

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

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例（%）
1	300497	富祥药业	61,970,599.98	4.97
2	300235	方直科技	51,362,211.44	4.12
3	603208	江山欧派	38,486,424.30	3.09
4	002111	威海广泰	37,686,864.17	3.02
5	600183	生益科技	34,299,898.05	2.75
6	002810	山东赫达	33,272,892.40	2.67
7	603568	伟明环保	32,785,400.57	2.63
8	002396	星网锐捷	32,085,236.12	2.57
9	002557	洽洽食品	31,716,550.00	2.54
10	002045	国光电器	29,925,794.20	2.40
11	000034	神州数码	29,354,996.00	2.35
12	603258	电魂网络	28,983,338.20	2.32
13	300719	安达维尔	28,977,332.30	2.32
14	600079	人福医药	28,585,208.84	2.29
15	300702	天宇股份	28,578,363.71	2.29
16	603233	大参林	27,677,402.56	2.22
17	600531	豫光金铅	27,300,295.37	2.19
18	002847	盐津铺子	27,070,367.00	2.17
19	603638	艾迪精密	27,053,927.30	2.17
20	300058	蓝色光标	26,942,810.69	2.16
21	300699	光威复材	26,907,062.20	2.16
22	300440	运达科技	26,713,937.00	2.14
23	002367	康力电梯	26,410,663.29	2.12

24	002706	良信电器	26,291,259.50	2.11
25	002273	水晶光电	26,076,227.61	2.09
26	002895	川恒股份	25,787,578.34	2.07
27	002065	东华软件	25,415,170.00	2.04
28	000736	中交地产	25,312,972.79	2.03

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	6,619,961,167.47
卖出股票收入（成交）总额	5,666,124,703.31

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	60,047,995.50	4.81
	其中：政策性金融债	60,047,995.50	4.81
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）	987,800.00	0.08
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	61,035,795.50	4.89

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	200201	20 国开 01	300,000	30,042,000.00	2.41
2	018013	国开 2004	300,150	30,005,995.50	2.41
3	123053	宝通转债	9,311	931,100.00	0.07
4	123056	雪榕转债	564	56,400.00	0.00
5	128113	比音转债	3	300.00	0.00

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
IC2007	IC2007	85	98,589,800.00	2,115,840.00	本基金在进行股指期货投资时,遵守法律法规的规定和基金合同的约定,符合既定的投资策略和投资目标。采用流动性好、交易活跃的期货合约,对现货资产进行部分对冲,以增厚整个组合的风险调整后的收益。基金管理人将充分考虑股指期货的收益特征、流动性以及风险特征,运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险,如大额申购赎回等。
公允价值变动总额合计（元）					2,115,840.00
股指期货投资本期收益（元）					24,382,097.09
股指期货投资本期公允价值变动（元）					2,115,840.00

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金在进行股指期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。法律法规对于基金投资股指期货的投资策略另有规定的，本基金将按法律法规的规定执行。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

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

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未进行国债期货投资，期末未持有国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

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。

7.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

基金投资的前十名股票中，未有投资于超出基金合同规定备选股票库之外股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	13,310,784.34
2	应收证券清算款	42,061,979.93
3	应收股利	—
4	应收利息	912,912.82
5	应收申购款	147,047.68
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	56,432,724.77

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	600984	建设机械	18,165,962.00	1.46	非公开发行

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

注：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

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
11,653	98,971.67	13,497,656.93	1.17%	1,139,819,247.58	98.83%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	268,399.75	0.0233%

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的情况

项目	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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

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

基金合同生效日（ 2020 年 1 月 10 日 ）基金份额总额	2,190,833,182.62
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	62,379,885.19
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	1,099,896,163.30
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	1,153,316,904.51

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、基金管理人重大人事变动

自 2020 年 6 月 19 日起，熊科金先生不再担任长城基金管理有限公司总经理，由董事长王军先生代为履职。

自 2020 年 6 月 19 日起，彭洪波先生不再担任长城基金管理有限公司副总经理。

自 2020 年 6 月 19 日起，熊科金先生、金树良先生、杨玉成先生、杨超先生不再担任公司董事，由张文栋先生、朱静女士、韩飞先生担任公司董事。

自 2020 年 6 月 19 日起，鄢维民先生不再担任公司独立董事。

自 2020 年 7 月 14 日起，邱春杨先生担任长城基金管理有限公司总经理，董事长王军先生不再代任。

自 2020 年 7 月 14 日起，邱春杨先生担任公司董事。

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，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本基金本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
长城证券	7	12,268,544,426.29	100.00%	2,837,725.57	100.00%	-

西部证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
首创证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
财通证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	3	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
宏信证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
联讯证券	2	-	-	-	-	-
中金财富证 券	1	-	-	-	-	-
广州证券	2	-	-	-	-	-

注：1、报告期内租用证券公司席位的变更情况：

本报告期内新增 3 个专用交易单元（西部证券新增 1 个交易单元、长城证券新增 2 个交易单元），截止本报告期末共计 61 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，并能为本基金提供全面的信息服；
- (6) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析、个股分析报告及其他专门报告。

根据上述标准考察确定后，基金管理人和被选中的证券经营机构签订委托协议，并通知托管人。基金管理人应根据有关规定，在基金的中期报告和年度报告中将所选证券经营机构的有关情况、基金通过该证券经营机构买卖证券的成交量、支付的佣金等予以披露。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
长城证券	30,586,630.49	100.00%	8,019,700,000.00	100.00%	—	—
西部证券	—	—	—	—	—	—
方正证券	—	—	—	—	—	—
华融证券	—	—	—	—	—	—
华泰证券	—	—	—	—	—	—
中泰证券	—	—	—	—	—	—
兴业证券	—	—	—	—	—	—
国金证券	—	—	—	—	—	—
海通证券	—	—	—	—	—	—
国泰君安	—	—	—	—	—	—
首创证券	—	—	—	—	—	—

华西证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
宏信证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
联讯证券	-	-	-	-	-	-
中金财富证券	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-

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	长城量化小盘股票型证券投资基金基金合同生效公告	上海证券报及本基金管理人网站	2020 年 1 月 11 日
2	长城基金关于旗下基金 2020 年春节假期期间交易确认、清算交收、开放时间等相关安排调整的公告	本基金管理人网站	2020 年 1 月 31 日
3	长城基金管理有限公司及子公司投资旗下基金相关事宜的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管	2020 年 2 月 7 日

		理人网站	
4	长城量化小盘股票型证券投资基金开放日常申购业务的公告	上海证券报及本基金管理人网站	2020 年 2 月 8 日
5	长城量化小盘股票型证券投资基金开放日常赎回、转换、定投业务的公告	上海证券报及本基金管理人网站	2020 年 2 月 12 日
6	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(闻泰科技)	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2020 年 3 月 17 日
7	长城基金管理有限公司关于旗下基金投资非公开发行股票的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2020 年 4 月 28 日
8	长城基金管理有限公司关于取消纸质对账单的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	2020 年 5 月 27 日

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注：本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

注：本报告期内无影响投资者决策的其他重要信息。

§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量化小盘股票型证券投资基金注册的文件
- (二) 《长城量化小盘股票型证券投资基金基金合同》
- (三) 《长城量化小盘股票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

广东省深圳市福田区益田路 6009 号新世界商务中心 41 层

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：0755-23982338

客户服务电话：400-8868-666

网站：www.ccfund.com.cn