

长城量化小盘股票型证券投资基金 2020 年年度报告

2020 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：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2021 年 3 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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 03 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自 2020 年 01 月 10 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	10
§4 管理人报告	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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
4.9 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.....	16
§5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	17
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.....	17
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	17
§6 审计报告	18
6.1 审计报告基本信息.....	18
6.2 审计报告的基本内容.....	18
§7 年度财务报表	21
7.1 资产负债表.....	21
7.2 利润表.....	22
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	23
7.4 报表附注.....	24
§8 投资组合报告	48
8.1 期末基金资产组合情况.....	48
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	48
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	49
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	52
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	77
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	77
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	77

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	77
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	77
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	77
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	78
8.12 投资组合报告附注.....	78
§9 基金份额持有人信息.....	80
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	80
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	80
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	80
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况.....	80
§10 开放式基金份额变动.....	81
§11 重大事件揭示.....	82
11.1 基金份额持有人大会决议.....	82
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	82
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	82
11.4 基金投资策略的改变.....	82
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	82
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	83
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	83
11.8 其他重大事件.....	86
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	89
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况.....	89
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	89
§13 备查文件目录.....	90
13.1 备查文件目录.....	90
13.2 存放地点.....	90
13.3 查阅方式.....	90

§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	264,991,987.82 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	<p>1、大类资产配置策略</p> <p>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。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>(1) 小盘股票的定义</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>(2) 个股投资策略</p> <p>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。</p> <p>1) 多因子模型</p>

	<p>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。</p> <p>2) 事件驱动模型</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>3) 风险模型：</p> <p>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范围内。</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>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。</p> <p>4、资产支持证券投资策略</p> <p>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。</p> <p>5、股指期货投资策略</p> <p>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</p>
--	--

	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	021-60637111
传真		0755-23982328	021-60635778
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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.ccfund.com.cn
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	中国北京市东城区东长安街 1 号东方广场经贸城安永大楼（即东三办公楼）16 层
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 41 层

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2020年1月10日(基金合同生效日)-2020年12月31日
本期已实现收益	222,424,397.37
本期利润	217,181,558.83
加权平均基金份额本期利润	0.1937
本期加权平均净值利润率	19.14%
本期基金份额净值增长率	17.09%
3.1.2 期末数据和指标	2020年末
期末可供分配利润	45,280,851.92
期末可供分配基金份额利润	0.1709
期末基金资产净值	310,272,839.74
期末基金份额净值	1.1709
3.1.3 累计期末指标	2020年末
基金份额累计净值增长率	17.09%

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1月10日生效，截止本报告期末，基金合同生效未满一年。

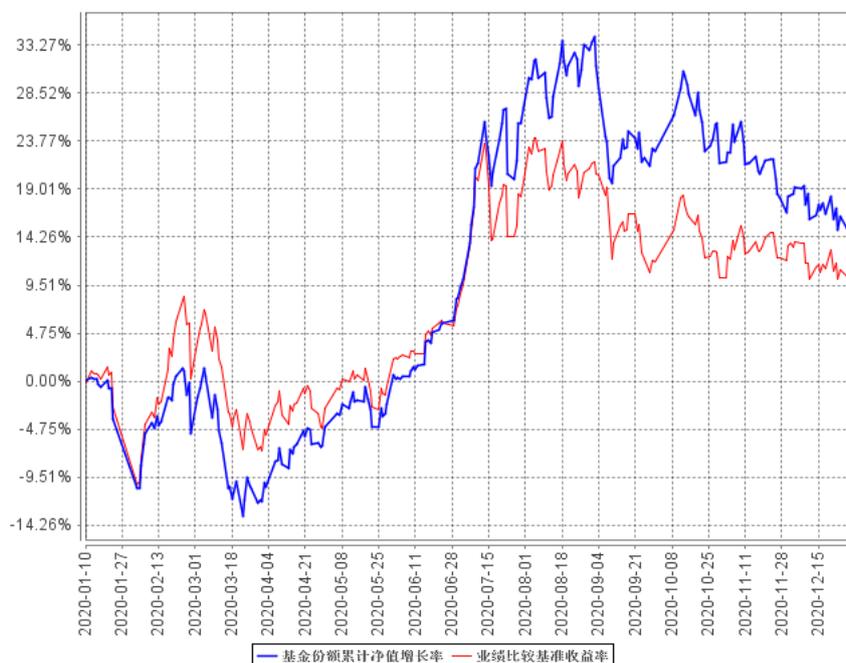
3.2 基金净值表现

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
过去三个月	-4.65%	1.25%	0.45%	1.11%	-5.10%	0.14%
过去六个月	8.26%	1.50%	4.81%	1.42%	3.45%	0.08%
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	17.09%	1.57%	12.34%	1.56%	4.75%	0.01%

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



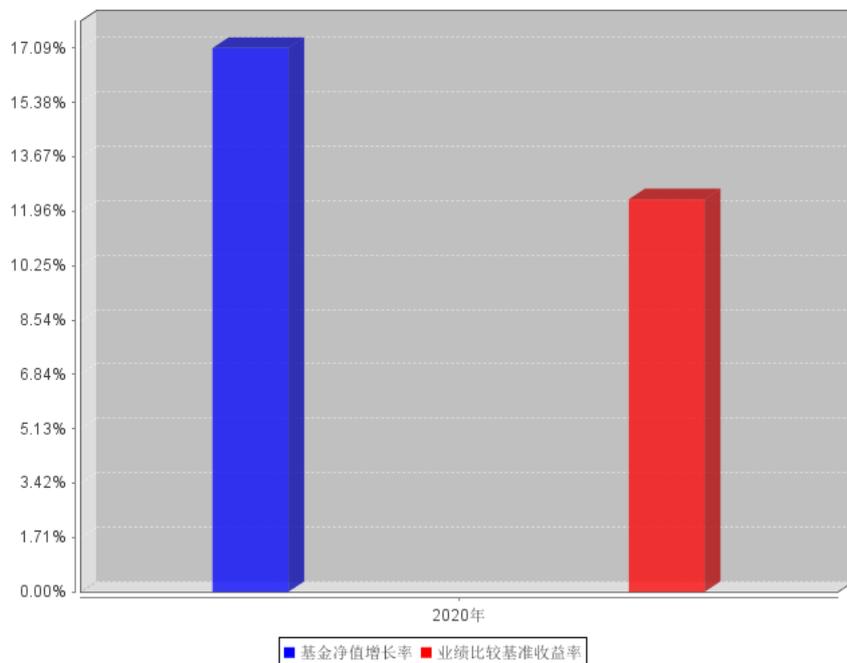
注：①本基金合同规定本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的 80%–95%，其中，投资于本基金界定的小盘股票的比例不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计不低于基金资产净值的 5%，本基金所指的现金范围不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等资金类别。

②本基金的建仓期为自基金合同生效之日起六个月内，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 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。

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

自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金基金合同于 2020 年 1 月 10 日生效，自基金合同生效以来未进行利润分配。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

长城基金管理有限公司是经中国证监会批准设立的第 15 家基金管理公司，由长城证券股份有限公司（40%）、东方证券股份有限公司（15%）、西北证券有限责任公司（15%）、北方国际信托股份有限公司（15%）、中原信托有限公司（15%）于 2001 年 12 月 27 日共同出资设立，当时注册资本为壹亿元人民币。2007 年 5 月 21 日，经中国证监会批准，公司完成股权结构调整，现有股东为长城证券股份有限公司（47.059%）、东方证券股份有限公司（17.647%）、北方国际信托股份有限公司（17.647%）和中原信托有限公司（17.647%）。2007 年 10 月 12 日，经中国证监会批准，将注册资本增加至壹亿伍仟万元人民币。公司经营范围是基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其他业务。截至本报告期末，公司管理的基金有：长城久恒灵活配置混合型证券投资基金、长城久泰沪深 300 指数证券投资基金、长城货币市场证券投资基金、长城消费增值混合型证券投资基金、长城安心回报混合型证券投资基金、长城久富核心成长混合型证券投资基金(LOF)、长城品牌优选混合型证券投资基金、长城稳健增利债券型证券投资基金、长城双动力混合型证券投资基金、长城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（FOF）、长城创新驱动混合型证券投资基金、长城泰丰纯债债券型证券投资基金、长城中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金、长城健康生活灵活配置混合型证券投资基金、长城成长先锋混合型证券投资基金、长城恒泰养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、长城优选增强六个月持有期混合型证券投资基金、长城中债 3-5 年国开行债券指数证券投资基金、长城均衡优选混合型证券投资基金、长城品质成长混合型证券投资基金。

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、长城核心优选混合、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。

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

注：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》、《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 公平交易制度和控制方法

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司管理办法》和《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的规定，本基金管理人制定并实施了《长城基金管理有限公司公平交易管理制度》。

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格执行了《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。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2020 年 A 股市场“欲扬先抑”，年初突如其来的“新冠疫情”极大扰动了全球资本市场，美

股罕见地连续出现熔断，原油期货价格出现负数，各种极端事件不断刷新投资者对市场的认知，但是二季度以后，A股市场强势反转，半导体、生物医药、白酒、光伏等板块轮番阶段性地领涨市场，A股全年“动量”效应显著，呈现强者恒强特征，公募基金收益率高企，爆款基金频现。基金在运作中将逐渐平衡行业比例，在控制行业主要风险下获取选股超额回报。

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 17.09%，同期业绩比较基准为 12.34%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

对于后市，我们认为应该要乐观一点。各项宏观数据和经济预测数据均表明，宏观经济表现正在变好。我们对“新冠”疫情的处理也积累了一定的经验，疫情对经济活动的边际影响正在减弱。随着美国总统的顺利换届，国外环境的不确定性也在逐渐消失。因此虽大盘指数在高位震荡，但整体上我们认为对 A 股可以相对乐观一点。

以白酒、光伏为代表的高成长行业虽然估值水平相对较高，但是行业景气度很好。以金融地产为代表低估值的行业，股价表现虽然相对较弱，但是估值优势愈加明显。我们预计今年的行业分化不会那么严重，行业表现会更加均衡，每个行业都有阶段性的行情。我们的量化模型会根据产品的风险偏好特征，在行业偏离上会做适度地约束调整。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

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

监察稽核和内部控制的重点是确保公司经营及所管理基金运作的合法合规，保障基金份额持

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

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

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.9 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，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遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

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

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本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 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2021）审字第 60737541_H32 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	长城量化小盘股票型证券投资基金全体基金份额持有人：
审计意见	<p>我们审计了长城量化小盘股票型证券投资基金财务报表，包括 2020 年 12 月 31 日的资产负债表，自 2020 年 1 月 10 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日止期间的利润表及所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的长城量化小盘股票型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了长城量化小盘股票型证券投资基金 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及自 2020 年 1 月 10 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于长城量化小盘股票型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	不适用
其他事项	不适用
其他信息	<p>长城量化小盘股票型证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p>

	<p>在编制财务报表时,管理层负责评估长城量化小盘股票型证券投资基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督长城量化小盘股票型证券投资基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作:</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险,设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上,未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时,根据获取的审计证据,就可能导致对长城量化小盘股票型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性,审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露,如果披露不充分,我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而,未来的事项或情况可能导致长城</p>

	<p>量化小盘股票型证券投资基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容, 并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通, 包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	吴翠蓉 陈小青
会计师事务所的地址	中国 北京
审计报告日期	2021 年 3 月 29 日

§7 年度财务报表

7.1 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 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	7.4.7.1	16,871,722.51
结算备付金		29,810,670.91
存出保证金		5,200,394.26
交易性金融资产	7.4.7.2	262,911,315.28
其中：股票投资		262,911,315.28
基金投资		-
债券投资		-
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
应收证券清算款		1,009,148.19
应收利息	7.4.7.5	116,558.30
应收股利		-
应收申购款		28,023.55
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		315,947,833.00
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 日
负债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		-
应付赎回款		4,819,431.62
应付管理人报酬		419,242.05
应付托管费		69,873.66
应付销售服务费		-
应付交易费用	7.4.7.7	256,128.28
应交税费		-
应付利息		-

应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	110,317.65
负债合计		5,674,993.26
所有者权益：		
实收基金	7.4.7.9	264,991,987.82
未分配利润	7.4.7.10	45,280,851.92
所有者权益合计		310,272,839.74
负债和所有者权益总计		315,947,833.00

注：1. 报告截止日 2020 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.1709 元，基金份额总额 264,991,987.82 份。

2. 本基金合同于 2020 年 1 月 10 日生效，本基金本期财务报表的实际编制期间系自 2020 年 1 月 10 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日止。因此，无上年度末财务数据。

7.2 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 12 月 31 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 12 月 31 日
一、收入		250,189,254.57
1. 利息收入		2,933,937.31
其中：存款利息收入	7.4.7.11	1,443,067.98
债券利息收入		529,051.28
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		961,818.05
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		247,197,876.92
其中：股票投资收益	7.4.7.12	196,718,250.72
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13	722,068.02
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.2	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-
衍生工具收益	7.4.7.15	38,501,517.95
股利收益	7.4.7.16	11,256,040.23
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-5,242,838.54
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	5,300,278.88

减：二、费用		33,007,695.74
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	16,810,141.75
2. 托管费	7.4.10.2.2	2,801,690.13
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	7.4.7.19	13,132,180.08
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		140,095.33
7. 其他费用	7.4.7.20	123,588.45
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		217,181,558.83
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		217,181,558.83

注：本基金合同于 2020 年 1 月 10 日生效，本基金本期财务报表的实际编制期间系自 2020 年 1 月 10 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日止。因此，无上年度可比期间财务数据。

7.3 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 12 月 31 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 12 月 31 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）	-	217,181,558.83	217,181,558.83
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）	-1,925,841,194.80	-171,900,706.91	-2,097,741,901.71
其中：1. 基金申购款	130,557,324.96	13,111,081.28	143,668,406.24
2. 基金赎回款	-2,056,398,519.76	-185,011,788.19	-2,241,410,307.95
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（基金净值）	264,991,987.82	45,280,851.92	310,272,839.74

注：本基金合同于 2020 年 1 月 10 日生效，本基金本期财务报表的实际编制期间系自 2020 年 1 月 10 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日止。因此，无上年度可比期间财务数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

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

7.4 报表附注

7.4.1 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、存托凭证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%。

7.4.2 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 2 号《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。

7.4.3 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 12 月 31 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 12 月 31 日止期间的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 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。

7.4.4.1 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 12 月 31 日。

7.4.4.2 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。

7.4.4.3 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。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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。

7.4.4.5 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。

7.4.4.6 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。

7.4.4.7 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。

7.4.4.8 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)”。

7.4.4.9 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及应由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认，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及应由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认，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)于卖出债券成交日确认,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扣除应由基金管理人缴纳的增值税后的净额入账;

(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。

7.4.4.10 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。

7.4.4.11 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》生效不满三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。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部,以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分:(1) 该组

成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 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。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计政策变更。

7.4.5.2 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。

7.4.5.3 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。

7.4.6 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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日
活期存款	16,871,722.51
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：	16,871,722.51

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	268,468,454.62	262,911,315.28	-5,557,139.34
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	268,468,454.62	262,911,315.28	-5,557,139.34

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日			备注
	合同/名义金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
权益衍生工具	27,598,419.20	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	27,598,419.20	-	-	

注：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。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金于本期末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金于本期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	1,754.15
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	114,578.76
应收债券利息	-
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	225.39
合计	116,558.30

注：其他为应收结算保证金利息。

7.4.7.6 其他资产

注：本基金于本期末未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	256,128.28
银行间市场应付交易费用	-
合计	256,128.28

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	8,948.17
应付证券出借违约金	-
预提审计费	100,000.00
预提中债登债券账户服务费	1,369.48
合计	110,317.65

7.4.7.9 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 12 月 31 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	130,557,324.96	130,557,324.96
本期赎回(以“-”号填列)	-2,056,398,519.76	-2,056,398,519.76
本期末	264,991,987.82	264,991,987.82

注：1) 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。

2) 本基金合同于 2020 年 1 月 10 日生效。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。

7.4.7.10 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	222,424,397.37	-5,242,838.54	217,181,558.83
本期基金份额交易产生的变动数	-115,793,291.48	-56,107,415.43	-171,900,706.91
其中：基金申购款	23,696,626.93	-10,585,545.65	13,111,081.28
基金赎回款	-139,489,918.41	-45,521,869.78	-185,011,788.19
本期已分配利润	-	-	-
本期末	106,631,105.89	-61,350,253.97	45,280,851.92

7.4.7.11 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12月31日
活期存款利息收入	424,998.87
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	1,003,665.93
其他	14,403.18
合计	1,443,067.98

注：其他为结算保证金利息收入。

7.4.7.12 股票投资收益**7.4.7.12.1 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12月31日
卖出股票成交总额	7,874,088,147.35
减：卖出股票成本总额	7,677,369,896.63
买卖股票差价收入	196,718,250.72

7.4.7.13 债券投资收益**7.4.7.13.1 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12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	63,910,076.13
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	62,557,713.30
减：应收利息总额	630,294.81
买卖债券差价收入	722,068.02

7.4.7.13.2 资产支持证券投资收益

注：本基金于本期无资产支持证券投资产生的收益/损失。

7.4.7.14 贵金属投资收益

注：本基金于本期无贵金属投资收益。

7.4.7.15 衍生工具收益**7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注：本基金于本期无衍生工具收益/损失。

7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

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12月31日
国债期货投资收益	-
股指期货-投资收益	38,501,517.95

7.4.7.16 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12月31日
股票投资产生的股利收益	11,256,040.23
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	11,256,040.23

7.4.7.17 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12月31日
1. 交易性金融资产	-5,557,139.34
——股票投资	-5,557,139.34
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	314,300.80
——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	-5,242,838.54

7.4.7.18 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12月31日
基金赎回费收入	5,058,094.38
其他	92,591.98
转出基金补偿收入	149,592.52
合计	5,300,278.88

注：其他为募集后利息和蚂蚁集团上市失败退款利息。

7.4.7.19 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12月31日
交易所市场交易费用	13,131,580.08
银行间市场交易费用	600.00
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	13,132,180.08

7.4.7.20 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12月31日
审计费用	100,000.00
信息披露费	-
证券出借违约金	-
银行间债券账户服务费	10,369.48
银行费用	13,218.97
合计	123,588.45

7.4.7.21 分部报告

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
长城基金管理有限公司	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
东方证券股份有限公司（“东方证券”）	基金管理人股东
中原信托有限公司	基金管理人股东
北方国际信托股份有限公司	基金管理人股东
长城嘉信资产管理有限公司	基金管理人控股子公司

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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月10日(基金合同生效日)至2020年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
长城证券	15,786,068,577.25	100.00%

7.4.10.1.2 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12月31日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例
长城证券	63,280,753.58	100.00%

7.4.10.1.3 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12月31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	8,429,700,000.00	100.00%

7.4.10.1.4 权证交易

注：本基金于本期无通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月10日(基金合同生效日)至2020年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
长城证券	3,651,330.93	100.00%	256,128.28	100.00%

注：上述佣金按市场佣金率计算，扣除券商需承担的费用(包括但不限于买(卖)经手费、证券结算

风险基金和证券交易所买(卖)证管费等)。

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

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2020年1月10日(基金合同生效日)至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	16,810,141.75
其中：支付销售机构的客户维护费	8,360,930.14

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

7.4.10.2.2 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12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	2,801,690.13

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0.25%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

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金于本期未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

注：本基金于本报告期内未与关联方进行转融通证券出借业务。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

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 12 月 31 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	3.9346%	

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。

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

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：除基金管理人之外的本基金其他关联方于本期末未持有本基金份额。本基金基金合同于 2020 年 1 月 10 日生效，无上年度可比期间数据。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2020 年 1 月 10 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	16,871,722.51	424,998.87

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金于本期末在承销期内直接购入关联方承销证券。

7.4.11 利润分配情况

注：本基金于本期末未进行利润分配。

7.4.12 期末（2020 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	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
688256	寒武纪	2020年7月10日	2021年1月20日	新股锁定	64.39	143.54	8,962	577,063.18	1,286,405.48	-
688185	康希诺	2020年8月4日	2021年2月18日	新股锁定	209.71	355.68	2,333	489,253.43	829,801.44	-
300869	康泰医学	2020年8月12日	2021年2月24日	新股锁定	10.16	110.88	862	8,757.92	95,578.56	-
300896	爱美客	2020年9月21日	2021年3月29日	新股锁定	118.27	603.36	152	17,977.04	91,710.72	-
688585	上纬新材	2020年9月21日	2021年3月29日	新股锁定	2.49	12.51	4,922	12,255.78	61,574.22	-
688056	莱伯泰科	2020年8月25日	2021年3月2日	新股锁定	24.80	30.56	2,010	49,848.00	61,425.60	-
300867	圣元环保	2020年8月12日	2021年3月3日	新股锁定	19.34	31.97	1,498	28,971.32	47,891.06	-
300877	金春股份	2020年8月17日	2021年3月3日	新股锁定	30.54	50.85	569	17,377.26	28,933.65	-
300887	谱尼测试	2020年9月9日	2021年3月16日	新股锁定	44.47	74.52	210	9,338.70	15,649.20	-

300876	蒙泰高新	2020年8月14日	2021年2月25日	新股锁定	20.09	36.62	350	7,031.50	12,817.00	-
300917	特发服务	2020年12月14日	2021年6月21日	新股锁定	18.78	31.94	281	5,277.18	8,975.14	-
605277	新亚电子	2020年12月25日	2021年1月6日	新股未上市	16.95	16.95	507	8,593.65	8,593.65	-
003030	祖名股份	2020年12月25日	2021年1月6日	新股未上市	15.18	15.18	480	7,286.40	7,286.40	-
003031	中瓷电子	2020年12月24日	2021年1月4日	新股未上市	15.27	15.27	387	5,909.49	5,909.49	-

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金于本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2020 年 12 月 31 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为人民币 0.00 元，无质押债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2020 年 12 月 31 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为人民币 0.00 元，无质押债券。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金于本期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中由金融工具产生的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。

本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

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

7.4.13.2 信用风险

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

本基金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。

7.4.13.3 流动性风险

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

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险，并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 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制外(如有)，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金

融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。除附注 7.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额(如有)将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指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。本基金的收入及经营活动的现金流量在一定程度上受市场利率变化的影响。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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020 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							
银行存款	16,871,722.51	-	-	-	-	-	16,871,722.51
结算备付金	29,810,670.91	-	-	-	-	-	29,810,670.91
存出保证金	5,200,394.26	-	-	-	-	-	5,200,394.26
交易性金融资产	-	-	-	-	-	262,911,315.28	262,911,315.28
应收证券清算款	-	-	-	-	-	1,009,148.19	1,009,148.19
应收利息	-	-	-	-	-	116,558.30	116,558.30
应收申购款	-	-	-	-	-	28,023.55	28,023.55
资产总计	51,882,787.68	-	-	-	-	264,065,045.32	315,947,833.00
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	4,819,431.62	4,819,431.62

应付管理人报酬	-	-	-	-	419,242.05	419,242.05
应付托管费	-	-	-	-	69,873.66	69,873.66
应付交易费用	-	-	-	-	256,128.28	256,128.28
其他负债	-	-	-	-	110,317.65	110,317.65
负债总计	-	-	-	-	5,674,993.26	5,674,993.26
利率敏感度缺口	51,882,787.68	-	-	-	-	-

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：本基金于本期末未持有交易性债券投资。因此在其它变量不变的假设下，利率发生合理、可能变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动对本期末基金资产净值无重大影响。本基金基金合同于 2020 年 1 月 10 日生效，无上年度末比较数据。

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于股票市场，所面临的最大的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。

本基金所持有的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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 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	262,911,315.28	84.74
交易性金融资产—基金投资	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-

交易性金融资产—贵金属投资		-
衍生金融资产—权证投资		-
其他		-
合计	262,911,315.28	84.74

7.4.13.4.3.2 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12月31日）
	沪深300指数上升5%	13,258,617.63
	沪深300指数下降5%	-13,258,617.63

7.4.14 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、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12月31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260,348,763.67元，划分为第二层次的余额为人民币2,562,551.61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，本基金本报告期未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。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	262,911,315.28	83.21
	其中：股票	262,911,315.28	83.21
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	46,682,393.42	14.78
8	其他各项资产	6,354,124.30	2.01
9	合计	315,947,833.00	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	7,643,450.00	2.46
C	制造业	225,983,475.41	72.83
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,616,437.60	2.13
E	建筑业	738.54	0.00
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	14,561,251.30	4.69
J	金融业	5,455.12	0.00
K	房地产业	9,105.65	0.00
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	15,649.20	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	48,649.46	0.02

0	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	797,451.00	0.26
Q	卫生和社会工作	7,229,652.00	2.33
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	262,911,315.28	84.74

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	603218	日月股份	298,800	9,038,700.00	2.91
2	300207	欣旺达	274,835	8,440,182.85	2.72
3	603486	科沃斯	87,451	7,738,538.99	2.49
4	300763	锦浪科技	51,600	7,688,400.00	2.48
5	603505	金石资源	259,100	7,643,450.00	2.46
6	300775	三角防务	193,800	7,639,596.00	2.46
7	600507	方大特钢	1,088,900	7,556,966.00	2.44
8	002810	山东赫达	211,100	7,261,840.00	2.34
9	300244	迪安诊断	210,900	7,229,652.00	2.33
10	002867	周大生	262,900	7,006,285.00	2.26
11	000902	新洋丰	429,730	6,875,680.00	2.22
12	600612	老凤祥	148,000	6,708,840.00	2.16
13	002039	黔源电力	429,360	6,616,437.60	2.13
14	002845	同兴达	241,600	6,528,032.00	2.10
15	002335	科华恒盛	292,200	6,527,748.00	2.10
16	603197	保隆科技	230,400	6,481,152.00	2.09
17	300653	正海生物	113,150	6,407,684.50	2.07
18	002970	锐明技术	120,700	6,398,307.00	2.06
19	000951	中国重汽	203,000	6,386,380.00	2.06
20	002641	永高股份	997,200	6,362,136.00	2.05
21	603043	广州酒家	161,200	6,243,276.00	2.01
22	688002	睿创微纳	54,224	6,018,864.00	1.94
23	603238	诺邦股份	179,664	5,704,332.00	1.84
24	002100	天康生物	531,200	5,625,408.00	1.81
25	300394	天孚通信	104,962	5,597,623.46	1.80

26	300415	伊之密	409,200	5,479,188.00	1.77
27	603208	江山欧派	51,100	5,378,275.00	1.73
28	603236	移远通信	28,600	5,346,484.00	1.72
29	300638	广和通	88,500	5,296,725.00	1.71
30	603601	再升科技	374,900	5,117,385.00	1.65
31	600966	博汇纸业	330,500	4,967,415.00	1.60
32	300348	长亮科技	261,100	4,960,900.00	1.60
33	300573	兴齐眼药	50,800	4,837,684.00	1.56
34	000004	国华网安	215,100	4,452,570.00	1.44
35	603180	金牌厨柜	87,749	4,383,062.55	1.41
36	300639	凯普生物	113,951	4,282,278.58	1.38
37	002105	信隆健康	575,900	4,186,793.00	1.35
38	603912	佳力图	278,100	3,982,392.00	1.28
39	300673	佩蒂股份	125,000	3,911,250.00	1.26
40	002832	比音勒芬	233,900	3,798,536.00	1.22
41	688208	道通科技	54,842	3,757,225.42	1.21
42	300188	美亚柏科	132,800	2,860,512.00	0.92
43	688122	西部超导	29,904	2,377,667.04	0.77
44	688023	安恒信息	8,681	2,257,928.10	0.73
45	603369	今世缘	37,500	2,151,750.00	0.69
46	002695	煌上煌	81,900	1,875,510.00	0.60
47	688598	金博股份	7,645	1,653,460.60	0.53
48	688256	寒武纪	8,962	1,286,405.48	0.41
49	688185	康希诺	2,333	829,801.44	0.27
50	002607	中公教育	22,700	797,451.00	0.26
51	688566	吉贝尔	9,882	257,722.56	0.08
52	603877	太平鸟	3,933	117,990.00	0.04
53	300869	康泰医学	862	95,578.56	0.03
54	300896	爱美客	152	91,710.72	0.03
55	688585	上纬新材	4,922	61,574.22	0.02
56	688056	莱伯泰科	2,010	61,425.60	0.02
57	300867	圣元环保	1,498	47,891.06	0.02
58	300877	金春股份	569	28,933.65	0.01
59	003026	中晶科技	460	21,693.60	0.01
60	003029	吉大正元	716	18,716.24	0.01
61	003028	振邦智能	432	18,010.08	0.01
62	605179	一鸣食品	939	16,582.74	0.01
63	300887	谱尼测试	210	15,649.20	0.01
64	300876	蒙泰高新	350	12,817.00	0.00

65	300917	特发服务	281	8,975.14	0.00
66	605277	新亚电子	507	8,593.65	0.00
67	002568	百润股份	74	7,717.46	0.00
68	003030	祖名股份	480	7,286.40	0.00
69	003031	中瓷电子	387	5,909.49	0.00
70	300033	同花顺	44	5,455.12	0.00
71	300770	新媒股份	54	3,796.20	0.00
72	002912	中新赛克	62	3,593.52	0.00
73	300308	中际旭创	68	3,458.48	0.00
74	603027	千禾味业	90	3,364.20	0.00
75	002831	裕同科技	97	2,970.14	0.00
76	603317	天味食品	35	2,878.40	0.00
77	002353	杰瑞股份	70	2,450.00	0.00
78	300598	诚迈科技	20	2,397.60	0.00
79	002801	微光股份	50	1,781.00	0.00
80	300739	明阳电路	75	1,461.00	0.00
81	002216	三全食品	55	1,427.25	0.00
82	601231	环旭电子	67	1,295.78	0.00
83	601100	恒立液压	11	1,243.00	0.00
84	002916	深南电路	11	1,188.66	0.00
85	300502	新易盛	20	1,109.60	0.00
86	300607	拓斯达	29	1,007.75	0.00
87	002394	联发股份	99	984.06	0.00
88	300474	景嘉微	13	908.83	0.00
89	603809	豪能股份	41	848.29	0.00
90	002531	天顺风能	92	774.64	0.00
91	603797	联泰环保	96	758.40	0.00
92	300765	新诺威	40	748.40	0.00
93	000065	北方国际	99	738.54	0.00
94	000938	紫光股份	36	736.20	0.00
95	300476	胜宏科技	27	582.39	0.00
96	300695	兆丰股份	10	564.10	0.00
97	603305	旭升股份	18	563.22	0.00
98	002444	巨星科技	16	497.76	0.00
99	300231	银信科技	54	483.30	0.00
100	300056	中创环保	77	462.00	0.00
101	603733	仙鹤股份	15	375.00	0.00
102	603638	艾迪精密	5	344.70	0.00
103	300214	日科化学	30	251.70	0.00

104	002223	鱼跃医疗	8	225.68	0.00
105	600845	宝信软件	3	206.94	0.00
106	300559	佳发教育	11	147.40	0.00
107	000965	天保基建	36	127.44	0.00
108	002734	利民股份	5	63.55	0.00
109	000657	中钨高新	7	50.75	0.00
110	000513	丽珠集团	1	40.50	0.00
111	300179	四方达	2	12.74	0.00
112	002133	广宇集团	1	3.07	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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	59,208,091.98	19.08
2	002705	新宝股份	42,873,103.07	13.82
3	300559	佳发教育	38,603,755.73	12.44
4	300699	光威复材	38,439,839.35	12.39
5	603707	健友股份	37,380,110.74	12.05
6	002111	威海广泰	37,305,258.00	12.02
7	002810	山东赫达	36,953,716.79	11.91
8	603233	大参林	36,327,214.24	11.71
9	002367	康力电梯	35,798,537.44	11.54
10	600183	生益科技	35,585,293.48	11.47
11	603218	日月股份	35,505,283.46	11.44
12	603208	江山欧派	34,961,135.72	11.27
13	603606	东方电缆	34,479,236.55	11.11
14	300770	新媒股份	34,363,412.61	11.08
15	002895	川恒股份	34,134,764.23	11.00
16	300690	双一科技	33,566,279.01	10.82
17	601615	明阳智能	33,163,426.14	10.69
18	603568	伟明环保	33,134,820.25	10.68
19	603638	艾迪精密	32,641,704.66	10.52
20	300235	方直科技	32,467,913.40	10.46
21	300476	胜宏科技	31,876,700.93	10.27

22	002916	深南电路	31,851,449.67	10.27
23	300719	安达维尔	31,445,090.10	10.13
24	002697	红旗连锁	30,853,242.95	9.94
25	002706	良信股份	30,707,739.10	9.90
26	300231	银信科技	30,640,658.09	9.88
27	002273	水晶光电	30,360,957.72	9.79
28	300256	星星科技	30,226,215.00	9.74
29	300502	新易盛	30,172,551.52	9.72
30	300702	天宇股份	30,162,769.92	9.72
31	002832	比音勒芬	30,040,569.46	9.68
32	002912	中新赛克	29,874,802.60	9.63
33	002045	国光电器	29,646,790.60	9.56
34	603313	梦百合	29,255,562.78	9.43
35	002324	普利特	29,250,407.00	9.43
36	300628	亿联网络	29,229,968.09	9.42
37	002396	星网锐捷	29,165,198.47	9.40
38	600079	人福医药	29,139,227.00	9.39
39	600531	豫光金铅	29,112,596.57	9.38
40	300033	同花顺	28,188,170.66	9.08
41	603345	安井食品	28,022,086.32	9.03
42	300457	赢合科技	26,776,615.06	8.63
43	002847	盐津铺子	26,464,977.29	8.53
44	002568	百润股份	26,400,346.49	8.51
45	002065	东华软件	26,359,732.05	8.50
46	000851	高鸿股份	26,355,962.58	8.49
47	603197	保隆科技	26,339,809.40	8.49
48	600845	宝信软件	25,950,650.56	8.36
49	000895	双汇发展	25,912,075.87	8.35
50	603258	电魂网络	25,730,846.20	8.29
51	002801	微光股份	25,692,608.95	8.28
52	601918	新集能源	25,459,966.36	8.21
53	603666	亿嘉和	25,451,380.64	8.20
54	600731	湖南海利	25,218,444.22	8.13
55	000923	河钢资源	25,131,858.00	8.10
56	601865	福莱特	25,104,212.36	8.09
57	600612	老凤祥	25,083,831.70	8.08

58	300058	蓝色光标	24,905,804.00	8.03
59	600486	扬农化工	24,765,822.90	7.98
60	000034	神州数码	24,728,255.00	7.97
61	300759	康龙化成	24,643,044.00	7.94
62	002557	洽洽食品	24,623,054.76	7.94
63	300371	汇中股份	24,132,954.07	7.78
64	002660	茂硕电源	24,123,932.50	7.78
65	300394	天孚通信	24,093,672.20	7.77
66	002039	黔源电力	24,049,433.48	7.75
67	603505	金石资源	24,003,129.90	7.74
68	000802	北京文化	23,755,528.00	7.66
69	600570	恒生电子	23,670,518.00	7.63
70	601001	晋控煤业	23,519,780.00	7.58
71	300638	广和通	23,447,466.14	7.56
72	002788	鹭燕医药	23,285,547.79	7.50
73	002216	三全食品	23,150,369.66	7.46
74	002587	奥拓电子	22,856,705.88	7.37
75	300474	景嘉微	22,744,773.62	7.33
76	600496	精工钢构	22,706,500.89	7.32
77	603416	信捷电气	22,607,923.71	7.29
78	603713	密尔克卫	22,587,607.00	7.28
79	002942	新农股份	22,450,769.00	7.24
80	300209	天泽信息	22,315,580.00	7.19
81	002869	金溢科技	22,176,361.00	7.15
82	603018	华设集团	22,072,510.47	7.11
83	002353	杰瑞股份	22,054,457.62	7.11
84	300751	迈为股份	21,927,180.26	7.07
85	600993	马应龙	21,909,910.38	7.06
86	300248	新开普	21,755,811.74	7.01
87	000739	普洛药业	21,622,874.77	6.97
88	002734	利民股份	21,581,060.83	6.96
89	000961	中南建设	21,555,695.05	6.95
90	300213	佳讯飞鸿	21,495,731.68	6.93
91	603380	易德龙	21,485,608.28	6.92
92	300601	康泰生物	21,470,895.70	6.92
93	300454	深信服	21,381,671.68	6.89

94	300036	超图软件	21,333,944.50	6.88
95	300440	运达科技	21,319,661.00	6.87
96	000977	浪潮信息	21,286,109.39	6.86
97	300413	芒果超媒	21,165,632.32	6.82
98	300697	电工合金	21,103,775.34	6.80
99	300271	华宇软件	21,097,180.60	6.80
100	002241	歌尔股份	21,034,308.76	6.78
101	300661	圣邦股份	20,908,773.77	6.74
102	300114	中航电测	20,898,306.50	6.74
103	300014	亿纬锂能	20,777,280.29	6.70
104	603127	昭衍新药	20,755,215.66	6.69
105	601058	赛轮轮胎	20,657,277.75	6.66
106	002947	恒铭达	20,583,511.11	6.63
107	300360	炬华科技	20,541,782.60	6.62
108	603609	禾丰牧业	20,538,988.00	6.62
109	600420	现代制药	20,533,177.00	6.62
110	603458	勘设股份	20,486,690.31	6.60
111	000736	中交地产	20,444,934.11	6.59
112	300347	泰格医药	20,423,552.61	6.58
113	002332	仙琚制药	20,392,259.72	6.57
114	603013	亚普股份	20,333,530.41	6.55
115	300179	四方达	20,316,900.46	6.55
116	000751	锌业股份	20,277,676.06	6.54
117	002463	沪电股份	20,259,055.12	6.53
118	300043	星辉娱乐	20,166,642.61	6.50
119	300253	卫宁健康	20,124,663.56	6.49
120	002511	中顺洁柔	20,116,418.49	6.48
121	600368	五洲交通	20,090,977.45	6.48
122	002128	露天煤业	20,004,952.31	6.45
123	300596	利安隆	19,910,047.00	6.42
124	300433	蓝思科技	19,907,748.25	6.42
125	300572	安车检测	19,905,073.00	6.42
126	600846	同济科技	19,857,198.40	6.40
127	300190	维尔利	19,850,740.54	6.40
128	603351	威尔药业	19,809,281.30	6.38
129	600720	祁连山	19,803,832.32	6.38

130	002457	青龙管业	19,782,767.27	6.38
131	300625	三雄极光	19,746,894.00	6.36
132	600779	水井坊	19,701,363.24	6.35
133	002602	世纪华通	19,685,825.20	6.34
134	300308	中际旭创	19,603,293.44	6.32
135	002798	帝欧家居	19,574,360.97	6.31
136	300496	中科创达	19,562,069.73	6.30
137	601117	中国化学	19,516,035.64	6.29
138	300546	雄帝科技	19,510,694.63	6.29
139	300724	捷佳伟创	19,472,839.00	6.28
140	600602	云赛智联	19,454,259.00	6.27
141	000157	中联重科	19,434,580.13	6.26
142	300569	天能重工	19,375,346.10	6.24
143	002106	莱宝高科	19,278,172.00	6.21
144	600063	皖维高新	19,237,323.24	6.20
145	603659	璞泰来	19,175,704.00	6.18
146	603700	宁水集团	19,115,633.93	6.16
147	002901	大博医疗	19,100,058.00	6.16
148	002191	劲嘉股份	19,071,747.00	6.15
149	000402	金融街	18,989,637.16	6.12
150	600693	东百集团	18,962,402.58	6.11
151	300595	欧普康视	18,743,336.98	6.04
152	000573	粤宏远 A	18,689,350.74	6.02
153	603303	得邦照明	18,565,648.48	5.98
154	300119	瑞普生物	18,511,679.00	5.97
155	300070	碧水源	18,495,943.23	5.96
156	300695	兆丰股份	18,495,052.00	5.96
157	601997	贵阳银行	18,427,862.60	5.94
158	002851	麦格米特	18,391,301.76	5.93
159	002157	正邦科技	18,178,452.17	5.86
160	002244	滨江集团	18,123,769.60	5.84
161	000567	海德股份	18,004,229.26	5.80
162	600027	华电国际	17,831,389.02	5.75
163	603596	伯特利	17,827,611.00	5.75
164	002755	奥赛康	17,785,975.60	5.73
165	002434	万里扬	17,782,370.00	5.73

166	300607	拓斯达	17,701,063.62	5.70
167	300577	开润股份	17,695,473.14	5.70
168	603776	永安行	17,636,710.80	5.68
169	300723	一品红	17,634,479.00	5.68
170	600436	片仔癀	17,611,003.77	5.68
171	603538	美诺华	17,586,296.40	5.67
172	300034	钢研高纳	17,525,976.82	5.65
173	600132	重庆啤酒	17,247,645.00	5.56
174	603466	风语筑	17,141,028.00	5.52
175	600323	瀚蓝环境	17,043,353.68	5.49
176	002818	富森美	17,033,401.59	5.49
177	300543	朗科智能	16,879,698.00	5.44
178	002745	木林森	16,864,936.94	5.44
179	603520	司太立	16,855,084.80	5.43
180	603081	大丰实业	16,804,386.00	5.42
181	002258	利尔化学	16,644,693.90	5.36
182	002080	中材科技	16,592,077.13	5.35
183	603661	恒林股份	16,572,228.79	5.34
184	002126	银轮股份	16,554,055.51	5.34
185	300417	南华仪器	16,524,191.28	5.33
186	603806	福斯特	16,451,271.00	5.30
187	600170	上海建工	16,450,388.05	5.30
188	002641	永高股份	16,437,803.93	5.30
189	600389	江山股份	16,403,193.21	5.29
190	000400	许继电气	16,368,371.23	5.28
191	600901	江苏租赁	16,359,089.54	5.27
192	002555	三七互娱	16,332,592.83	5.26
193	000661	长春高新	16,172,746.00	5.21
194	300623	捷捷微电	16,127,923.10	5.20
195	603385	惠达卫浴	16,111,234.60	5.19
196	002600	领益智造	16,095,373.00	5.19
197	000488	晨鸣纸业	16,060,454.00	5.18
198	000049	德赛电池	16,057,416.00	5.18
199	600339	中油工程	15,777,876.00	5.09
200	300451	创业慧康	15,768,375.45	5.08
201	002694	顾地科技	15,718,222.60	5.07

202	002929	润建股份	15,716,903.00	5.07
203	300255	常山药业	15,645,398.00	5.04
204	002831	裕同科技	15,542,112.64	5.01
205	603111	康尼机电	15,535,414.00	5.01
206	002326	永太科技	15,487,932.57	4.99
207	000952	广济药业	15,483,584.48	4.99
208	603027	千禾味业	15,420,648.36	4.97
209	603368	柳药股份	15,396,701.22	4.96
210	000547	航天发展	15,354,910.00	4.95
211	300533	冰川网络	15,322,399.00	4.94
212	000006	深振业 A	15,318,612.88	4.94
213	600195	中牧股份	15,310,188.56	4.93
214	000065	北方国际	15,069,735.04	4.86
215	600466	蓝光发展	15,042,263.70	4.85
216	603712	七一二	15,024,010.06	4.84
217	300037	新宙邦	14,999,482.00	4.83
218	603877	太平鸟	14,981,829.31	4.83
219	002053	云南能投	14,981,145.40	4.83
220	600713	南京医药	14,854,680.00	4.79
221	300418	昆仑万维	14,841,993.10	4.78
222	002487	大金重工	14,833,143.45	4.78
223	300031	宝通科技	14,830,207.00	4.78
224	600372	中航电子	14,818,442.00	4.78
225	603708	家家悦	14,739,540.16	4.75
226	300739	明阳电路	14,725,780.20	4.75
227	000657	中钨高新	14,716,876.54	4.74
228	300130	新国都	14,703,654.00	4.74
229	603228	景旺电子	14,697,696.43	4.74
230	300214	日科化学	14,600,998.76	4.71
231	002034	旺能环境	14,540,620.36	4.69
232	600461	洪城水业	14,523,645.80	4.68
233	000628	高新发展	14,497,735.00	4.67
234	002959	小熊电器	14,489,273.40	4.67
235	603611	诺力股份	14,416,637.52	4.65
236	600998	九州通	14,350,748.00	4.63
237	002019	亿帆医药	14,306,649.10	4.61

238	002698	博实股份	14,291,089.46	4.61
239	300443	金雷股份	14,256,983.24	4.59
240	000425	徐工机械	14,176,702.87	4.57
241	002414	高德红外	14,148,540.00	4.56
242	600340	华夏幸福	14,115,032.49	4.55
243	300639	凯普生物	14,044,987.34	4.53
244	002534	杭锅股份	14,042,740.78	4.53
245	300662	科锐国际	14,029,455.00	4.52
246	002214	大立科技	13,990,664.87	4.51
247	603297	永新光学	13,941,591.70	4.49
248	601137	博威合金	13,928,566.42	4.49
249	600549	厦门钨业	13,895,781.40	4.48
250	002531	天顺风能	13,864,341.62	4.47
251	300012	华测检测	13,814,742.14	4.45
252	600062	华润双鹤	13,564,110.73	4.37
253	603444	吉比特	13,502,939.00	4.35
254	002423	中粮资本	13,502,396.60	4.35
255	002884	凌霄泵业	13,498,503.32	4.35
256	300482	万孚生物	13,489,913.40	4.35
257	603601	再升科技	13,477,463.38	4.34
258	603227	雪峰科技	13,457,927.53	4.34
259	002518	科士达	13,356,180.45	4.30
260	603566	普莱柯	13,239,616.00	4.27
261	601880	大连港	13,178,114.48	4.25
262	002360	同德化工	13,145,313.60	4.24
263	600880	博瑞传播	13,023,821.34	4.20
264	300041	回天新材	13,019,598.20	4.20
265	300232	洲明科技	12,993,783.17	4.19
266	002001	新和成	12,993,413.35	4.19
267	600760	中航沈飞	12,993,193.13	4.19
268	000656	金科股份	12,990,503.84	4.19
269	002709	天赐材料	12,978,937.20	4.18
270	603716	塞力医疗	12,975,513.66	4.18
271	000513	丽珠集团	12,918,103.75	4.16
272	600346	恒力石化	12,885,795.76	4.15
273	600452	涪陵电力	12,843,584.51	4.14

274	600060	海信视像	12,631,230.05	4.07
275	600984	建设机械	12,597,167.24	4.06
276	300092	科新机电	12,583,466.06	4.06
277	002616	长青集团	12,518,881.84	4.03
278	300573	兴齐眼药	12,508,385.00	4.03
279	603728	鸣志电器	12,493,726.24	4.03
280	600055	万东医疗	12,186,281.00	3.93
281	600529	山东药玻	12,154,823.92	3.92
282	002410	广联达	12,052,282.36	3.88
283	002060	粤水电	12,015,687.00	3.87
284	600887	伊利股份	11,864,543.00	3.82
285	300384	三联虹普	11,834,832.39	3.81
286	300363	博腾股份	11,792,224.00	3.80
287	603327	福蓉科技	11,731,488.00	3.78
288	300687	赛意信息	11,654,207.10	3.76
289	002727	一心堂	11,639,187.58	3.75
290	300166	东方国信	11,570,534.62	3.73
291	600987	航民股份	11,509,003.63	3.71
292	600026	中远海能	11,447,468.00	3.69
293	600163	中闽能源	11,407,731.45	3.68
294	002223	鱼跃医疗	11,404,111.96	3.68
295	300056	中创环保	11,355,129.26	3.66
296	300150	世纪瑞尔	11,247,345.17	3.62
297	600077	宋都股份	11,231,042.00	3.62
298	300760	迈瑞医疗	11,214,673.53	3.61
299	002133	广宇集团	11,210,689.10	3.61
300	603238	诺邦股份	11,195,344.57	3.61
301	300207	欣旺达	11,188,700.11	3.61
302	002352	顺丰控股	11,177,626.00	3.60
303	000938	紫光股份	11,163,241.95	3.60
304	002054	德美化工	11,007,579.00	3.55
305	600233	圆通速递	10,974,287.19	3.54
306	603393	新天然气	10,963,860.00	3.53
307	603378	亚士创能	10,950,317.95	3.53
308	300129	泰胜风能	10,942,528.00	3.53
309	002791	坚朗五金	10,919,045.11	3.52

310	603317	天味食品	10,878,311.70	3.51
311	601100	恒立液压	10,853,614.00	3.50
312	002475	立讯精密	10,824,559.00	3.49
313	002458	益生股份	10,776,837.00	3.47
314	300500	启迪设计	10,743,054.22	3.46
315	600298	安琪酵母	10,693,898.00	3.45
316	002394	联发股份	10,668,356.76	3.44
317	601231	环旭电子	10,592,210.19	3.41
318	000027	深圳能源	10,555,719.55	3.40
319	000973	佛塑科技	10,506,611.63	3.39
320	002606	大连电瓷	10,435,988.08	3.36
321	603058	永吉股份	10,266,218.00	3.31
322	600459	贵研铂业	10,244,299.53	3.30
323	300763	锦浪科技	10,213,403.39	3.29
324	600109	国金证券	10,102,848.26	3.26
325	002811	郑中设计	10,014,990.00	3.23
326	300188	美亚柏科	9,995,297.60	3.22
327	300326	凯利泰	9,977,668.00	3.22
328	002016	世荣兆业	9,956,628.91	3.21
329	300295	三六五网	9,898,832.00	3.19
330	000042	中洲控股	9,891,109.32	3.19
331	600866	星湖科技	9,859,324.00	3.18
332	002105	信隆健康	9,858,069.89	3.18
333	000529	广弘控股	9,840,641.90	3.17
334	300218	安利股份	9,834,759.71	3.17
335	002347	泰尔股份	9,828,241.96	3.17
336	002249	大洋电机	9,720,493.00	3.13
337	603113	金能科技	9,682,315.89	3.12
338	002036	联创电子	9,647,943.00	3.11
339	002202	金风科技	9,553,511.18	3.08
340	300415	伊之密	9,552,434.10	3.08
341	000719	中原传媒	9,502,104.61	3.06
342	600966	博汇纸业	9,486,354.03	3.06
343	603008	喜临门	9,484,803.00	3.06
344	002949	华阳国际	9,432,261.00	3.04
345	600510	黑牡丹	9,234,378.28	2.98

346	603129	春风动力	9,188,647.77	2.96
347	002296	辉煌科技	9,153,723.00	2.95
348	603043	广州酒家	9,143,105.32	2.95
349	002335	科华恒盛	9,141,080.50	2.95
350	300659	中孚信息	9,104,283.00	2.93
351	300684	中石科技	9,103,110.00	2.93
352	002286	保龄宝	9,084,084.92	2.93
353	600284	浦东建设	9,021,473.14	2.91
354	688981	中芯国际	9,010,861.70	2.90
355	300244	迪安诊断	8,970,790.66	2.89
356	300558	贝达药业	8,946,438.89	2.88
357	002409	雅克科技	8,930,887.00	2.88
358	601899	紫金矿业	8,898,380.00	2.87
359	603809	豪能股份	8,895,111.76	2.87
360	002661	克明面业	8,888,908.00	2.86
361	603757	大元泵业	8,880,414.50	2.86
362	000902	新洋丰	8,834,962.18	2.85
363	002669	康达新材	8,782,304.00	2.83
364	002028	思源电气	8,749,882.97	2.82
365	300715	凯伦股份	8,746,142.17	2.82
366	000965	天保基建	8,743,193.44	2.82
367	001896	豫能控股	8,710,354.46	2.81
368	000011	深物业 A	8,692,374.00	2.80
369	000023	深天地 A	8,636,355.61	2.78
370	002234	民和股份	8,588,747.88	2.77
371	300019	硅宝科技	8,433,831.00	2.72
372	603960	克来机电	8,401,170.80	2.71
373	002607	中公教育	8,337,759.15	2.69
374	600616	金枫酒业	8,313,028.60	2.68
375	002100	天康生物	8,304,216.00	2.68
376	300598	诚迈科技	8,262,623.60	2.66
377	002357	富临运业	8,205,497.60	2.64
378	300172	中电环保	8,140,145.00	2.62
379	000848	承德露露	8,094,860.17	2.61
380	000975	银泰黄金	8,089,791.02	2.61
381	002392	北京利尔	8,036,156.00	2.59

382	600015	华夏银行	7,999,699.00	2.58
383	002867	周大生	7,995,173.00	2.58
384	000993	闽东电力	7,960,437.04	2.57
385	600507	方大特钢	7,927,229.17	2.55
386	002320	海峡股份	7,919,728.00	2.55
387	300018	中元股份	7,917,191.00	2.55
388	002156	通富微电	7,894,785.30	2.54
389	002182	云海金属	7,846,453.72	2.53
390	000838	财信发展	7,813,886.00	2.52
391	002452	长高集团	7,769,038.79	2.50
392	300066	三川智慧	7,697,695.00	2.48
393	603486	科沃斯	7,682,782.95	2.48
394	600794	保税科技	7,680,048.00	2.48
395	000672	上峰水泥	7,662,800.55	2.47
396	002465	海格通信	7,616,413.70	2.45
397	600449	宁夏建材	7,529,696.00	2.43
398	300403	汉宇集团	7,510,081.20	2.42
399	002688	金河生物	7,407,518.00	2.39
400	600260	凯乐科技	7,405,241.66	2.39
401	002493	荣盛石化	7,387,577.00	2.38
402	002049	紫光国微	7,382,829.00	2.38
403	600415	小商品城	7,381,868.35	2.38
404	300511	雪榕生物	7,342,917.00	2.37
405	603118	共进股份	7,319,972.00	2.36
406	601872	招商轮船	7,306,036.00	2.35
407	603045	福达合金	7,290,726.14	2.35
408	002797	第一创业	7,273,864.00	2.34
409	300673	佩蒂股份	7,236,922.00	2.33
410	300653	正海生物	7,231,420.08	2.33
411	300674	宇信科技	7,217,660.00	2.33
412	603733	仙鹤股份	7,209,493.69	2.32
413	603583	捷昌驱动	7,201,903.60	2.32
414	000951	中国重汽	7,182,996.00	2.32
415	603180	金牌厨柜	7,178,403.81	2.31
416	603912	佳力图	7,144,277.80	2.30
417	601019	山东出版	7,122,931.60	2.30

418	603236	移远通信	7,099,230.47	2.29
419	002845	同兴达	7,061,341.00	2.28
420	300735	光弘科技	7,015,573.56	2.26
421	600033	福建高速	6,999,885.00	2.26
422	300373	扬杰科技	6,997,500.00	2.26
423	002838	道恩股份	6,994,793.00	2.25
424	002439	启明星辰	6,993,953.70	2.25
425	600597	光明乳业	6,993,851.00	2.25
426	603636	南威软件	6,993,685.06	2.25
427	600563	法拉电子	6,992,646.00	2.25
428	002970	锐明技术	6,990,626.00	2.25
429	300775	三角防务	6,987,581.66	2.25
430	600578	京能电力	6,957,202.96	2.24
431	002299	圣农发展	6,932,012.00	2.23
432	000976	华铁股份	6,924,365.00	2.23
433	300016	北陆药业	6,916,905.00	2.23
434	000612	焦作万方	6,911,938.00	2.23
435	300761	立华股份	6,909,161.00	2.23
436	000060	中金岭南	6,907,857.00	2.23
437	603797	联泰环保	6,895,240.00	2.22
438	300703	创源股份	6,854,079.75	2.21
439	603456	九洲药业	6,842,924.00	2.21
440	000967	盈峰环境	6,839,923.61	2.20
441	300432	富临精工	6,820,921.00	2.20
442	002064	华峰氨纶	6,799,678.28	2.19
443	601811	新华文轩	6,796,370.37	2.19
444	601677	明泰铝业	6,794,125.00	2.19
445	603039	泛微网络	6,792,029.40	2.19
446	601163	三角轮胎	6,791,053.00	2.19
447	600798	宁波海运	6,657,771.60	2.15
448	300696	爱乐达	6,657,467.00	2.15
449	600751	海航科技	6,550,256.88	2.11
450	600219	南山铝业	6,539,190.00	2.11
451	603588	高能环境	6,538,540.00	2.11
452	000552	靖远煤电	6,516,317.04	2.10
453	300438	鹏辉能源	6,498,645.00	2.09

454	002429	兆驰股份	6,397,676.00	2.06
455	603686	龙马环卫	6,382,824.00	2.06
456	600675	中华企业	6,357,806.48	2.05
457	000603	盛达资源	6,279,093.31	2.02
458	002254	泰和新材	6,251,534.00	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。

8.4.2 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	63,693,476.14	20.53
2	002705	新宝股份	51,952,506.79	16.74
3	300235	方直科技	51,362,211.44	16.55
4	603208	江山欧派	42,954,269.63	13.84
5	603233	大参林	42,556,558.76	13.72
6	002847	盐津铺子	40,559,852.98	13.07
7	603606	东方电缆	40,022,783.32	12.90
8	603638	艾迪精密	39,579,704.57	12.76
9	603707	健友股份	38,674,922.32	12.46
10	300559	佳发教育	38,235,158.55	12.32
11	002111	威海广泰	37,686,864.17	12.15
12	300699	光威复材	37,520,876.38	12.09
13	300690	双一科技	36,757,217.71	11.85
14	601615	明阳智能	36,653,650.88	11.81
15	002367	康力电梯	34,698,548.29	11.18
16	600183	生益科技	34,572,709.59	11.14
17	300770	新媒股份	34,329,345.00	11.06
18	002895	川恒股份	34,075,870.54	10.98
19	002810	山东赫达	33,772,307.40	10.88
20	002324	普利特	33,027,493.65	10.64
21	002697	红旗连锁	32,965,112.19	10.62
22	603218	日月股份	32,956,754.25	10.62
23	300256	星星科技	32,928,237.00	10.61
24	603568	伟明环保	32,790,373.02	10.57
25	002557	洽洽食品	32,718,899.00	10.55
26	300502	新易盛	32,546,312.28	10.49
27	002706	良信股份	32,381,099.30	10.44

28	002568	百润股份	32,167,921.14	10.37
29	002396	星网锐捷	32,085,236.12	10.34
30	603345	安井食品	31,586,937.26	10.18
31	603258	电魂网络	31,057,494.20	10.01
32	300033	同花顺	30,971,141.39	9.98
33	300759	康龙化成	30,423,999.00	9.81
34	300231	银信科技	30,156,210.01	9.72
35	300457	赢合科技	30,076,419.62	9.69
36	002045	国光电器	29,925,794.20	9.64
37	600845	宝信软件	29,874,656.46	9.63
38	603313	梦百合	29,535,248.96	9.52
39	000034	神州数码	29,354,996.00	9.46
40	300719	安达维尔	28,977,332.30	9.34
41	002912	中新赛克	28,953,217.35	9.33
42	300628	亿联网络	28,671,218.46	9.24
43	600079	人福医药	28,585,208.84	9.21
44	300702	天宇股份	28,578,363.71	9.21
45	300476	胜宏科技	28,189,922.54	9.09
46	600731	湖南海利	27,819,943.01	8.97
47	002916	深南电路	27,609,454.76	8.90
48	600531	豫光金铅	27,345,315.73	8.81
49	300058	蓝色光标	26,942,810.69	8.68
50	300440	运达科技	26,713,937.00	8.61
51	688981	中芯国际	26,230,948.23	8.45
52	002273	水晶光电	26,077,917.61	8.40
53	002216	三全食品	26,019,060.00	8.39
54	002801	微光股份	26,009,850.20	8.38
55	603713	密尔克卫	25,674,010.91	8.27
56	000961	中南建设	25,448,907.00	8.20
57	002065	东华软件	25,415,170.00	8.19
58	000895	双汇发展	25,333,967.97	8.17
59	000736	中交地产	25,312,972.79	8.16
60	603127	昭衍新药	25,199,156.80	8.12
61	603520	司太立	24,856,213.00	8.01
62	600496	精工钢构	24,740,344.38	7.97
63	300413	芒果超媒	24,454,310.50	7.88
64	002942	新农股份	24,236,626.50	7.81
65	000851	高鸿股份	24,150,899.92	7.78

66	603416	信捷电气	24,011,880.60	7.74
67	000923	河钢资源	23,980,074.52	7.73
68	600486	扬农化工	23,834,057.52	7.68
69	603380	易德龙	23,521,353.29	7.58
70	300496	中科创达	23,377,348.71	7.53
71	002798	帝欧家居	23,139,844.99	7.46
72	002869	金溢科技	23,106,316.00	7.45
73	300119	瑞普生物	23,031,367.77	7.42
74	300371	汇中股份	22,976,042.68	7.41
75	603666	亿嘉和	22,945,330.79	7.40
76	002832	比音勒芬	22,910,661.84	7.38
77	601918	新集能源	22,851,743.46	7.37
78	300695	兆丰股份	22,549,130.40	7.27
79	002901	大博医疗	22,547,328.66	7.27
80	600570	恒生电子	22,472,989.27	7.24
81	300601	康泰生物	22,445,794.44	7.23
82	600420	现代制药	22,346,207.33	7.20
83	300253	卫宁健康	22,110,225.40	7.13
84	002660	茂硕电源	22,090,425.32	7.12
85	002788	鹭燕医药	22,083,834.82	7.12
86	002734	利民股份	21,884,100.95	7.05
87	300638	广和通	21,820,785.04	7.03
88	002157	正邦科技	21,802,398.98	7.03
89	603700	宁水集团	21,774,991.66	7.02
90	601865	福莱特	21,711,342.78	7.00
91	603013	亚普股份	21,626,945.90	6.97
92	603877	太平鸟	21,604,642.09	6.96
93	002106	莱宝高科	21,585,814.94	6.96
94	002709	天赐材料	21,414,305.47	6.90
95	300595	欧普康视	21,362,772.06	6.89
96	601001	晋控煤业	21,279,296.65	6.86
97	603303	得邦照明	21,223,234.84	6.84
98	002511	中顺洁柔	21,205,449.55	6.83
99	603609	禾丰牧业	21,182,224.00	6.83
100	002326	永太科技	21,166,855.19	6.82
101	300724	捷佳伟创	21,141,168.20	6.81
102	603018	华设集团	21,110,591.18	6.80
103	603458	勘设股份	20,788,014.06	6.70

104	002463	沪电股份	20,680,941.72	6.67
105	300248	新开普	20,599,961.81	6.64
106	300213	佳讯飞鸿	20,593,224.78	6.64
107	600993	马应龙	20,520,039.87	6.61
108	300697	电工合金	20,335,530.08	6.55
109	600760	中航沈飞	20,310,932.13	6.55
110	000977	浪潮信息	20,213,399.73	6.51
111	000567	海德股份	20,179,997.54	6.50
112	600436	片仔癀	20,110,103.50	6.48
113	300569	天能重工	20,078,437.40	6.47
114	603197	保隆科技	20,025,307.97	6.45
115	300209	天泽信息	19,999,256.50	6.45
116	002929	润建股份	19,962,925.96	6.43
117	002457	青龙管业	19,879,473.94	6.41
118	002128	露天煤业	19,873,090.66	6.41
119	600846	同济科技	19,867,607.55	6.40
120	000802	北京文化	19,862,886.00	6.40
121	600720	祁连山	19,845,073.99	6.40
122	603351	威尔药业	19,821,199.63	6.39
123	002332	仙琚制药	19,714,276.20	6.35
124	300394	天孚通信	19,615,868.64	6.32
125	300661	圣邦股份	19,543,390.64	6.30
126	000157	中联重科	19,522,141.43	6.29
127	600063	皖维高新	19,516,222.42	6.29
128	300607	拓斯达	19,494,902.22	6.28
129	603776	永安行	19,443,497.65	6.27
130	300474	景嘉微	19,428,752.14	6.26
131	600779	水井坊	19,371,181.00	6.24
132	300347	泰格医药	19,335,163.15	6.23
133	000739	普洛药业	19,320,051.25	6.23
134	002080	中材科技	19,253,829.48	6.21
135	300418	昆仑万维	19,155,107.00	6.17
136	300454	深信服	19,132,948.29	6.17
137	300308	中际旭创	19,041,221.73	6.14
138	300070	碧水源	19,020,810.91	6.13
139	300036	超图软件	19,005,320.77	6.13
140	300114	中航电测	18,847,941.00	6.07
141	603505	金石资源	18,822,792.49	6.07

142	600027	华电国际	18,770,668.46	6.05
143	002555	三七互娱	18,567,111.23	5.98
144	601997	贵阳银行	18,487,331.00	5.96
145	300360	炬华科技	18,486,789.04	5.96
146	300037	新宙邦	18,419,902.36	5.94
147	002214	大立科技	18,354,142.56	5.92
148	300623	捷捷微电	18,350,687.48	5.91
149	300031	宝通科技	18,318,110.00	5.90
150	300190	维尔利	18,313,398.82	5.90
151	002244	滨江集团	18,193,390.00	5.86
152	002755	奥赛康	18,141,307.27	5.85
153	002602	世纪华通	18,137,945.62	5.85
154	300179	四方达	18,099,804.00	5.83
155	601058	赛轮轮胎	18,085,264.17	5.83
156	600368	五洲交通	17,942,783.06	5.78
157	000049	德赛电池	17,834,941.50	5.75
158	300271	华宇软件	17,721,718.70	5.71
159	000751	锌业股份	17,658,872.28	5.69
160	600984	建设机械	17,621,145.57	5.68
161	002191	劲嘉股份	17,591,713.07	5.67
162	603712	七一二	17,558,093.53	5.66
163	300451	创业慧康	17,545,347.35	5.65
164	300034	钢研高纳	17,520,572.68	5.65
165	000402	金融街	17,456,940.51	5.63
166	300572	安车检测	17,423,968.56	5.62
167	300739	明阳电路	17,394,869.97	5.61
168	600389	江山股份	17,385,026.80	5.60
169	600693	东百集团	17,303,366.78	5.58
170	002698	博实股份	17,285,277.91	5.57
171	603444	吉比特	17,269,882.70	5.57
172	002947	恒铭达	17,192,225.75	5.54
173	300723	一品红	17,129,590.00	5.52
174	000661	长春高新	17,100,204.68	5.51
175	600901	江苏租赁	17,066,246.75	5.50
176	600323	瀚蓝环境	17,059,472.84	5.50
177	002745	木林森	16,964,529.23	5.47
178	002818	富森美	16,943,912.49	5.46
179	000488	晨鸣纸业	16,936,884.00	5.46

180	002241	歌尔股份	16,922,527.00	5.45
181	002587	奥拓电子	16,861,658.28	5.43
182	300751	迈为股份	16,769,281.68	5.40
183	300533	冰川网络	16,708,739.13	5.39
184	603661	恒林股份	16,691,572.16	5.38
185	600602	云赛智联	16,647,996.29	5.37
186	300625	三雄极光	16,641,548.64	5.36
187	600372	中航电子	16,625,054.00	5.36
188	600132	重庆啤酒	16,535,458.36	5.33
189	000952	广济药业	16,529,414.06	5.33
190	601137	博威合金	16,524,916.06	5.33
191	000573	粤宏远 A	16,345,740.92	5.27
192	002487	大金重工	16,269,117.42	5.24
193	300662	科锐国际	16,234,342.00	5.23
194	300012	华测检测	16,231,095.67	5.23
195	603297	永新光学	16,212,592.51	5.23
196	603538	美诺华	16,172,619.99	5.21
197	600170	上海建工	16,145,670.89	5.20
198	000547	航天发展	16,130,609.00	5.20
199	002600	领益智造	16,109,805.31	5.19
200	300596	利安隆	16,091,392.82	5.19
201	603466	风语筑	16,028,641.00	5.17
202	002851	麦格米特	16,010,619.38	5.16
203	601117	中国化学	16,004,907.54	5.16
204	300433	蓝思科技	15,967,947.07	5.15
205	002039	黔源电力	15,918,888.65	5.13
206	002019	亿帆医药	15,872,913.75	5.12
207	300687	赛意信息	15,774,012.02	5.08
208	000065	北方国际	15,734,512.75	5.07
209	002434	万里扬	15,633,157.11	5.04
210	300014	亿纬锂能	15,575,167.00	5.02
211	002353	杰瑞股份	15,554,788.70	5.01
212	603611	诺力股份	15,525,244.54	5.00
213	603081	大丰实业	15,503,508.91	5.00
214	002531	天顺风能	15,464,058.60	4.98
215	300543	朗科智能	15,405,901.00	4.97
216	603368	柳药股份	15,403,463.64	4.96
217	603596	伯特利	15,346,575.76	4.95

218	300214	日科化学	15,249,981.50	4.92
219	002053	云南能投	15,167,717.16	4.89
220	300482	万孚生物	15,073,109.39	4.86
221	600998	九州通	15,065,192.37	4.86
222	603385	惠达卫浴	15,036,683.60	4.85
223	603228	景旺电子	14,999,237.90	4.83
224	600612	老凤祥	14,941,948.27	4.82
225	002034	旺能环境	14,941,704.01	4.82
226	002258	利尔化学	14,872,433.00	4.79
227	600340	华夏幸福	14,829,549.88	4.78
228	603806	福斯特	14,789,203.60	4.77
229	300255	常山药业	14,779,817.00	4.76
230	000657	中钨高新	14,775,328.60	4.76
231	000400	许继电气	14,739,158.00	4.75
232	002884	凌霄泵业	14,722,476.20	4.75
233	000656	金科股份	14,587,383.66	4.70
234	600713	南京医药	14,572,072.00	4.70
235	300363	博腾股份	14,552,474.50	4.69
236	603566	普莱柯	14,497,359.00	4.67
237	600549	厦门钨业	14,482,688.34	4.67
238	603111	康尼机电	14,482,412.00	4.67
239	002126	银轮股份	14,464,899.00	4.66
240	603027	千禾味业	14,459,426.92	4.66
241	002694	顾地科技	14,427,845.18	4.65
242	000425	徐工机械	14,359,023.22	4.63
243	002534	杭锅股份	14,292,131.00	4.61
244	300577	开润股份	14,243,980.20	4.59
245	002001	新和成	14,239,526.60	4.59
246	002414	高德红外	14,198,322.93	4.58
247	300443	金雷股份	14,192,055.92	4.57
248	600062	华润双鹤	14,180,456.80	4.57
249	300546	雄帝科技	14,060,313.94	4.53
250	002959	小熊电器	14,044,103.46	4.53
251	000006	深振业 A	13,844,756.08	4.46
252	600461	洪城水业	13,830,877.45	4.46
253	603659	璞泰来	13,820,630.95	4.45
254	000628	高新发展	13,763,667.34	4.44
255	600339	中油工程	13,727,105.00	4.42

256	002518	科士达	13,706,378.31	4.42
257	300417	南华仪器	13,702,167.84	4.42
258	002727	一心堂	13,658,972.58	4.40
259	600529	山东药玻	13,582,095.20	4.38
260	002060	粤水电	13,563,155.88	4.37
261	300130	新国都	13,533,743.68	4.36
262	002791	坚朗五金	13,357,838.12	4.31
263	601880	大连港	13,305,100.36	4.29
264	600346	恒力石化	13,283,099.00	4.28
265	002423	中粮资本	13,231,812.90	4.26
266	300041	回天新材	13,060,197.00	4.21
267	600060	海信视像	13,021,115.00	4.20
268	002410	广联达	12,978,893.24	4.18
269	600466	蓝光发展	12,915,329.74	4.16
270	002831	裕同科技	12,835,045.16	4.14
271	300043	星辉娱乐	12,754,324.52	4.11
272	600459	贵研铂业	12,746,300.20	4.11
273	600452	涪陵电力	12,688,670.73	4.09
274	603327	福蓉科技	12,687,164.00	4.09
275	600163	中闽能源	12,662,452.38	4.08
276	603716	塞力医疗	12,616,134.14	4.07
277	002616	长青集团	12,568,906.64	4.05
278	600026	中远海能	12,419,018.83	4.00
279	300384	三联虹普	12,343,357.84	3.98
280	600415	小商品城	12,318,477.95	3.97
281	600055	万东医疗	12,248,222.52	3.95
282	002409	雅克科技	12,245,848.61	3.95
283	300232	洲明科技	12,227,021.73	3.94
284	603058	永吉股份	12,160,400.00	3.92
285	002360	同德化工	12,033,759.20	3.88
286	600866	星湖科技	12,019,910.00	3.87
287	300150	世纪瑞尔	12,014,772.69	3.87
288	600195	中牧股份	11,918,075.19	3.84
289	600887	伊利股份	11,755,400.56	3.79
290	000513	丽珠集团	11,746,658.36	3.79
291	002394	联发股份	11,727,837.72	3.78
292	603393	新天然气	11,708,630.21	3.77
293	002133	广宇集团	11,691,378.00	3.77

294	603728	鸣志电器	11,543,959.00	3.72
295	600880	博瑞传播	11,488,935.86	3.70
296	603227	雪峰科技	11,472,001.37	3.70
297	600987	航民股份	11,323,526.14	3.65
298	300092	科新机电	11,269,998.22	3.63
299	300659	中孚信息	11,039,519.80	3.56
300	300166	东方国信	10,992,234.40	3.54
301	002661	克明面业	10,952,357.00	3.53
302	600077	宋都股份	10,910,864.00	3.52
303	600109	国金证券	10,906,204.11	3.52
304	002475	立讯精密	10,888,236.40	3.51
305	002249	大洋电机	10,843,088.03	3.49
306	000529	广弘控股	10,741,876.10	3.46
307	300760	迈瑞医疗	10,738,478.52	3.46
308	002202	金风科技	10,715,500.59	3.45
309	603708	家家悦	10,627,799.00	3.43
310	002352	顺丰控股	10,617,440.88	3.42
311	002223	鱼跃医疗	10,615,456.70	3.42
312	601100	恒立液压	10,590,988.80	3.41
313	002054	德美化工	10,568,468.00	3.41
314	300558	贝达药业	10,562,082.00	3.40
315	300500	启迪设计	10,420,008.28	3.36
316	300056	中创环保	10,400,191.35	3.35
317	300696	爱乐达	10,312,037.25	3.32
318	002811	郑中设计	10,251,134.00	3.30
319	600233	圆通速递	10,154,686.22	3.27
320	601231	环旭电子	10,144,669.78	3.27
321	603378	亚士创能	10,124,968.00	3.26
322	000973	佛塑科技	10,103,518.60	3.26
323	603113	金能科技	10,065,491.30	3.24
324	002036	联创电子	10,049,517.05	3.24
325	603733	仙鹤股份	10,024,015.52	3.23
326	002458	益生股份	9,943,261.00	3.20
327	300684	中石科技	9,800,907.72	3.16
328	600298	安琪酵母	9,741,556.00	3.14
329	002347	泰尔股份	9,684,779.84	3.12
330	000965	天保基建	9,664,806.18	3.11
331	300295	三六五网	9,661,014.00	3.11

332	002286	保龄宝	9,645,525.35	3.11
333	300129	泰胜风能	9,527,497.00	3.07
334	000027	深圳能源	9,526,544.56	3.07
335	002641	永高股份	9,485,947.40	3.06
336	000011	深物业 A	9,477,397.59	3.05
337	000719	中原传媒	9,386,391.84	3.03
338	002028	思源电气	9,312,851.00	3.00
339	002669	康达新材	9,259,790.00	2.98
340	002606	大连电瓷	9,249,617.38	2.98
341	002016	世荣兆业	9,217,101.74	2.97
342	002949	华阳国际	9,156,339.00	2.95
343	600284	浦东建设	9,089,852.64	2.93
344	300218	安利股份	9,079,354.33	2.93
345	600510	黑牡丹	9,045,666.86	2.92
346	603118	共进股份	8,996,799.77	2.90
347	300326	凯利泰	8,994,062.71	2.90
348	300019	硅宝科技	8,991,276.00	2.90
349	000938	紫光股份	8,918,432.00	2.87
350	002156	通富微电	8,811,137.40	2.84
351	000042	中洲控股	8,747,924.43	2.82
352	603317	天味食品	8,747,602.10	2.82
353	601899	紫金矿业	8,741,779.00	2.82
354	002049	紫光国微	8,728,985.00	2.81
355	603601	再升科技	8,726,868.00	2.81
356	300172	中电环保	8,726,644.00	2.81
357	300715	凯伦股份	8,703,277.27	2.81
358	002392	北京利尔	8,582,148.00	2.77
359	603456	九洲药业	8,483,641.29	2.73
360	002320	海峡股份	8,416,058.28	2.71
361	603809	豪能股份	8,276,291.02	2.67
362	603008	喜临门	8,267,607.00	2.66
363	002296	辉煌科技	8,133,617.00	2.62
364	000975	银泰黄金	8,109,334.00	2.61
365	002182	云海金属	8,107,295.55	2.61
366	603757	大元泵业	8,061,718.92	2.60
367	603797	联泰环保	8,058,455.00	2.60
368	002541	鸿路钢构	8,000,168.00	2.58
369	603583	捷昌驱动	7,985,628.98	2.57

370	601872	招商轮船	7,960,878.00	2.57
371	300674	宇信科技	7,959,244.00	2.57
372	300066	三川智慧	7,941,761.00	2.56
373	300703	创源股份	7,912,807.50	2.55
374	300511	雪榕生物	7,911,424.00	2.55
375	300598	诚迈科技	7,872,339.60	2.54
376	002465	海格通信	7,864,122.00	2.53
377	002688	金河生物	7,863,366.00	2.53
378	600015	华夏银行	7,810,274.14	2.52
379	603298	杭叉集团	7,768,257.00	2.50
380	300403	汉宇集团	7,736,246.80	2.49
381	000967	盈峰环境	7,686,213.50	2.48
382	001896	豫能控股	7,624,766.59	2.46
383	603129	春风动力	7,603,509.00	2.45
384	300018	中元股份	7,599,546.00	2.45
385	300373	扬杰科技	7,592,103.22	2.45
386	000023	深天地 A	7,557,795.32	2.44
387	002429	兆驰股份	7,545,731.12	2.43
388	002607	中公教育	7,500,389.03	2.42
389	002234	民和股份	7,471,944.80	2.41
390	603960	克来机电	7,413,031.00	2.39
391	002493	荣盛石化	7,388,260.50	2.38
392	300438	鹏辉能源	7,369,255.00	2.38
393	600616	金枫酒业	7,359,629.34	2.37
394	000672	上峰水泥	7,291,564.20	2.35
395	002838	道恩股份	7,290,498.00	2.35
396	300188	美亚柏科	7,270,615.67	2.34
397	603636	南威软件	7,166,340.44	2.31
398	002452	长高集团	7,153,867.60	2.31
399	002357	富临运业	7,147,229.20	2.30
400	603039	泛微网络	7,133,848.78	2.30
401	300639	凯普生物	7,103,606.20	2.29
402	002439	启明星辰	7,098,975.00	2.29
403	002797	第一创业	7,068,890.40	2.28
404	000993	闽东电力	7,027,278.16	2.26
405	600798	宁波海运	7,017,001.62	2.26
406	600563	法拉电子	7,016,634.78	2.26
407	600449	宁夏建材	6,993,692.00	2.25

408	000848	承德露露	6,936,337.02	2.24
409	600578	京能电力	6,927,872.20	2.23
410	002064	华峰氨纶	6,924,214.00	2.23
411	600033	福建高速	6,891,020.00	2.22
412	600597	光明乳业	6,869,338.02	2.21
413	603686	龙马环卫	6,867,818.00	2.21
414	002254	泰和新材	6,837,862.60	2.20
415	000060	中金岭南	6,827,107.00	2.20
416	000838	财信发展	6,821,322.04	2.20
417	000976	华铁股份	6,799,591.99	2.19
418	688188	柏楚电子	6,741,509.54	2.17
419	300735	光弘科技	6,714,347.17	2.16
420	600260	凯乐科技	6,673,736.20	2.15
421	600794	保税科技	6,613,110.00	2.13
422	601163	三角轮胎	6,603,061.00	2.13
423	002597	金禾实业	6,563,746.00	2.12
424	603588	高能环境	6,506,913.00	2.10
425	601900	南方传媒	6,489,470.00	2.09
426	600219	南山铝业	6,480,908.00	2.09
427	002444	巨星科技	6,478,406.13	2.09
428	601019	山东出版	6,466,327.40	2.08
429	000552	靖远煤电	6,423,105.08	2.07
430	300016	北陆药业	6,399,242.00	2.06
431	603045	福达合金	6,396,192.90	2.06
432	601811	新华文轩	6,384,298.00	2.06
433	002538	司尔特	6,381,827.00	2.06
434	300761	立华股份	6,282,397.00	2.02
435	600751	海航科技	6,268,891.56	2.02
436	000612	焦作万方	6,246,745.20	2.01
437	601677	明泰铝业	6,231,116.99	2.01

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

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	7,945,838,351.25
卖出股票收入（成交）总额	7,874,088,147.35

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 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
IC2101	IC2101	22	27,912,720.00	314,300.80	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)					314,300.80
股指期货投资本期收益(元)					38,501,517.95
股指期货投资本期公允价值变动(元)					314,300.80

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

注: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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

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。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末进行国债期货投资,期末未持有国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

注:本基金本报告期内未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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

本报告期本基金投资的前十名证券发行主体未出现被监管部门立案调查、或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.12.2 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。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	5,200,394.26
2	应收证券清算款	1,009,148.19
3	应收股利	-
4	应收利息	116,558.30
5	应收申购款	28,023.55
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,354,124.30

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
4,571	57,972.43	43,775,902.30	16.52%	221,216,085.52	83.48%

9.2 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	86,799.11	0.0328%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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。

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

注：本报告期无基金经理兼任投资经理的情况。

§10 开放式基金份额变动

单位：份

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	130,557,324.96
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	2,056,398,519.76
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	264,991,987.82

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、基金管理人重大人事变动

自 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。

自 2020 年 8 月 24 日起，温子健先生担任公司董事。

2、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本基金本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略无改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

1、本期未有改聘会计师事务所。

2、本基金本报告期应支付给会计师事务所的报酬为人民币拾万元。

3、目前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），为本基金提供审计服务自本基金合同生效日持续至本报告期。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金本报告期基金管理人及其高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

本报告期内托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	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	15,786,068,577.25	100.00%	3,651,330.93	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（长城证券增 2 个交易单元、西部证券新增 1 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。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
长城证券	63,280,753.58	100.00%	8,429,700,000.00	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	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	长城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	中国证券报、上海证	2020年2月7日

	投资旗下基金相关事宜的公告	券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	
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
9	长城基金关于旗下部分开放式基金参与交通银行开展的手机银行申购及定期定额投资基金费率优惠活动的公告	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 7 月 1 日
10	长城基金管理有限公司关于提醒网上直销个人投资者及时上传有效身份证件照片并更新、完善身份信息以免影响业务办理的公告	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 7 月 3 日
11	长城基金管理有限公司关于修订	中国证券报、上海证	2020 年 10 月 30 日

	公司旗下部分公开募集证券投资基金基金合同有关条款的公告	券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	
12	长城基金关于旗下部分开放式基金参与交通银行开展的手机银行申购及定期定额投资基金费率优惠活动的公告	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 12 月 31 日

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注：本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

注：本报告期内无影响投资者决策的其他重要信息。

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- (一) 中国证监会准予长城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

13.2 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

13.3 查阅方式

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

咨询电话：0755-23982338

客户服务电话：400-8868-666

网站：www.ccfund.com.cn