

长城创业板指数增强型发起式证券投资基金

2021 年中期报告

2021 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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2021 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 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 2021 年 01 月 01 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	6
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	8
§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	14
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	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
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	15
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
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	16
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	16
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	17
6.1 资产负债表	17
6.2 利润表	18
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	19

6.4 报表附注.....	20
§7 投资组合报告.....	47
7.1 期末基金资产组合情况.....	47
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	47
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.....	49
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	51
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	53
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.....	53
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.....	54
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.....	54
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.....	54
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	54
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	55
7.12 投资组合报告附注.....	55
§8 基金份额持有人信息.....	57
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	57
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	57
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
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....	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.....	61
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	63

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	63
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	63
§12 备查文件目录.....	64
12.1 备查文件目录.....	64
12.2 存放地点.....	64
12.3 查阅方式.....	64

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	长城创业板指数增强型发起式证券投资基金	
基金简称	长城创业板指数增强发起式	
基金主代码	001879	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019 年 1 月 29 日	
基金管理人	长城基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	437,539,140.37 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	长城创业板指数增强发起式 A	长城创业板指数增强发起式 C
下属分级基金的交易代码:	001879	006928
报告期末下属分级基金的份额总额	270,793,665.08 份	166,745,475.29 份

2.2 基金产品说明

投资目标	以增强指数化投资方法跟踪目标指数，在严格控制与目标指数偏离风险的前提下，力争获得超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。本基金力争使日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 7.75%。	
投资策略	本基金为增强型指数基金，股票投资以创业板指数作为目标指数。除非因为分红或基金持有人赎回或申购等原因，本基金将保持相对稳定的股票投资比例，通过运用深入的基本面研究及先进的数量化投资技术，控制与目标指数的跟踪误差，追求适度超越目标指数的收益。	
业绩比较基准	创业板指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%	
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。	
	长城创业板指数增强发起式 A	长城创业板指数增强发起式 C

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	车君	郭明
	联系电话	0755-23982338	010-66105799
	电子邮箱	chejun@ccfund.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-8868-666	95588
传真		0755-23982328	010-66105798
注册地址		深圳市福田区益田路 6009 号新世界商务中心 41 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		深圳市福田区益田路 6009	北京市西城区复兴门内大街 55

	号新世界商务中心 40、41 层	号
邮政编码	518026	100140
法定代表人	王军	陈四清

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

基金级别	长城创业板指数增强发起式 A	长城创业板指数增强发起式 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021 年 1 月 1 日 – 2021 年 6 月 30 日)	报告期(2021 年 1 月 1 日 – 2021 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	83,813,710.32	52,949,195.79
本期利润	128,414,263.96	91,557,300.82
加权平均基金份额本期利润	0.4700	0.4536
本期加权平均净值利润率	19.73%	19.43%
本期基金份额净值增长率	17.97%	17.80%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	249,374,126.86	130,553,635.26
期末可供分配基金份额利润	0.9209	0.7830
期末基金资产净值	747,101,889.33	454,178,900.40
期末基金份额净值	2.7589	2.7238
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	217.48%	213.44%

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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

长城创业板指数增强发起式 A

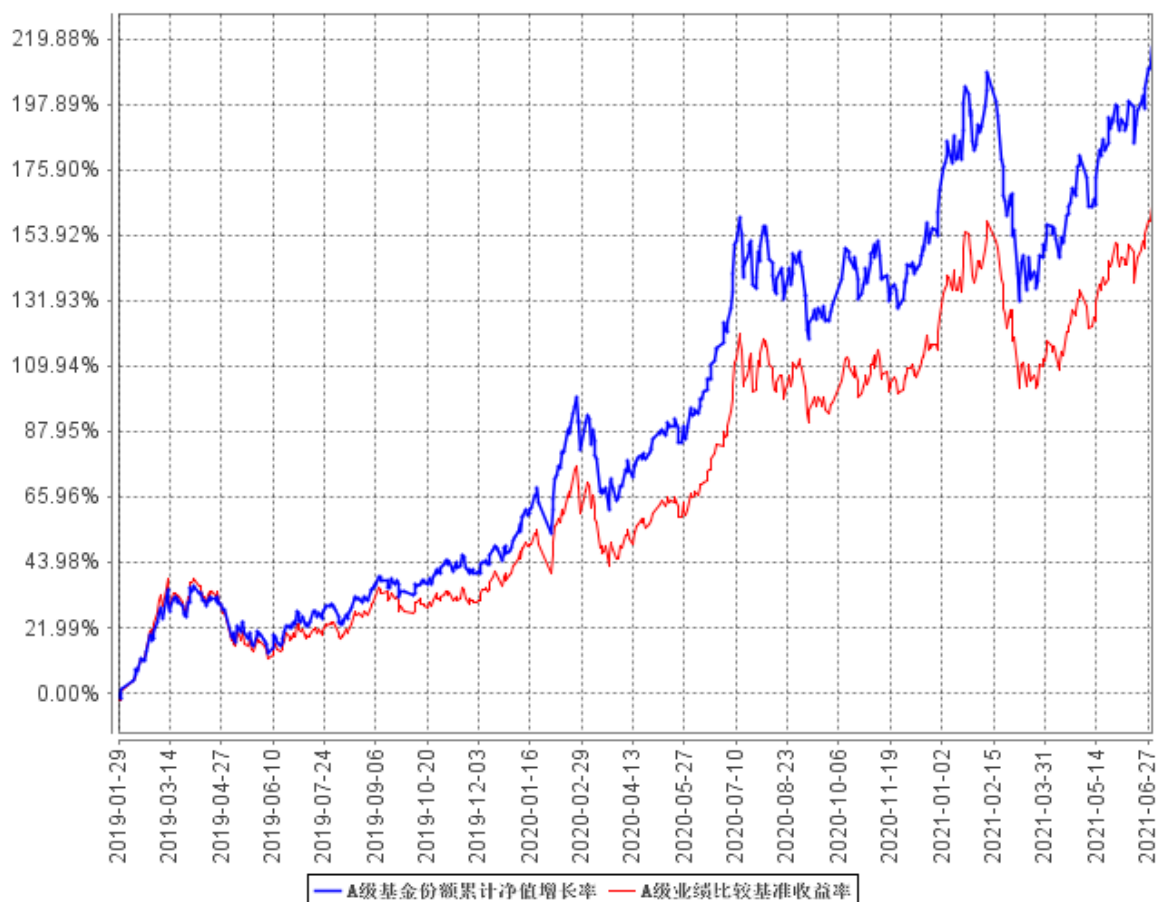
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	6.52%	1.65%	4.84%	1.55%	1.68%	0.10%
过去三个月	27.53%	1.66%	24.65%	1.52%	2.88%	0.14%
过去六个月	17.97%	2.04%	16.43%	1.85%	1.54%	0.19%
过去一年	41.47%	1.96%	40.43%	1.81%	1.04%	0.15%
过去三年	—	—	—	—	—	—
自基金合同生效起至今	217.48%	1.81%	163.74%	1.76%	53.74%	0.05%

长城创业板指数增强发起式 C

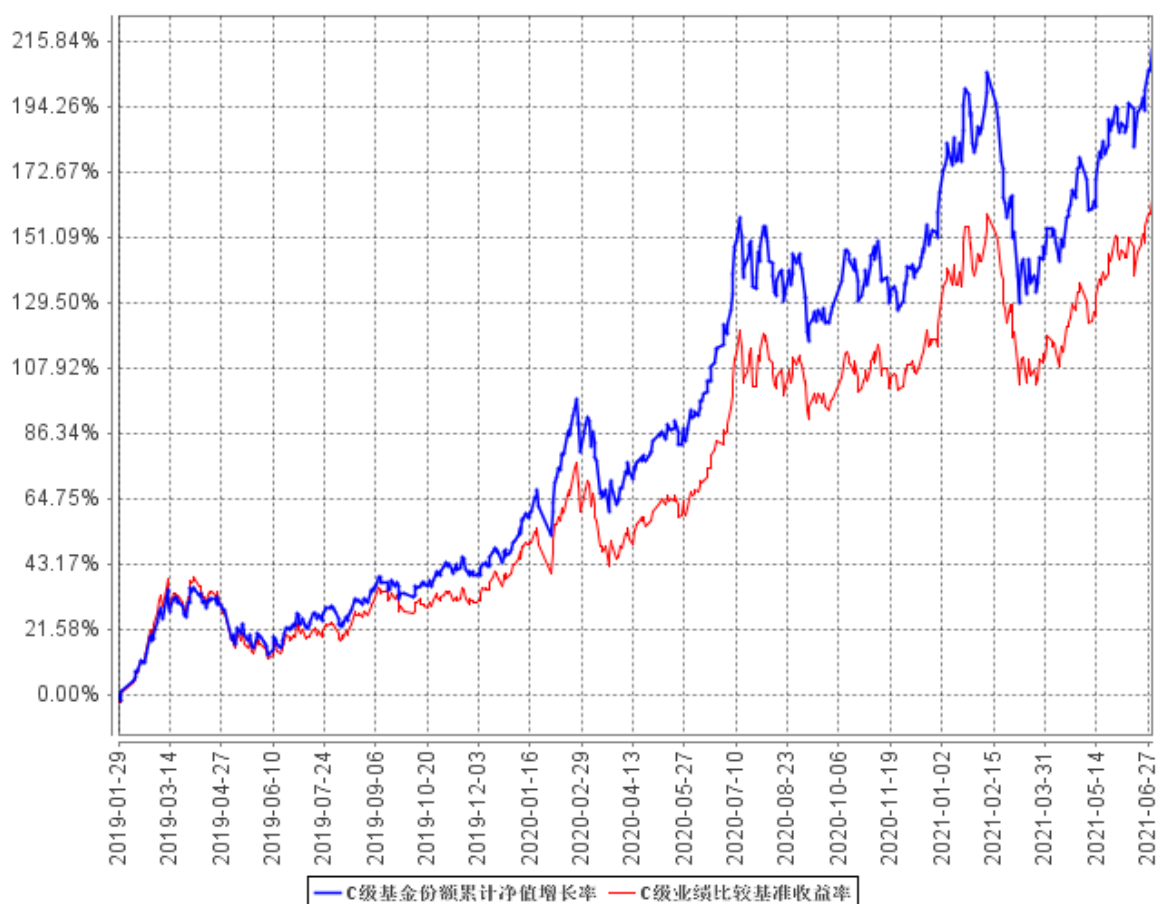
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	6.50%	1.65%	4.84%	1.55%	1.66%	0.10%
过去三个月	27.44%	1.66%	24.65%	1.52%	2.79%	0.14%
过去六个月	17.80%	2.04%	16.43%	1.85%	1.37%	0.19%
过去一年	41.04%	1.96%	40.43%	1.81%	0.61%	0.15%
过去三年	—	—	—	—	—	—
自基金合同生效起至今	213.44%	1.81%	163.74%	1.76%	49.70%	0.05%

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

A级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



C级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本基金的股票资产投资比例不低于基金资产的 80%，其中投资于创业板指数成份股和备选成份股的资产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。

§ 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、长城中小盘成长混合型证券投资基金、长城积极增利债券型证券投资基金、长城优化升级混合型证券投资基金、长城稳健成长灵活配置混合型证券投资基金、长城核心优选灵活配置混合型证券投资基金、长城增强收益定期开放债券型证券投资基金、长城医疗保健混合型证券投资基金、长城工资宝货币市场基金、长城久鑫灵活配置混合型证券投资基金、长城稳固收益债券型证券投资基金、长城新兴产业灵活配置混合型证券投资基金、长城环保主题灵活配置混合型证券投资基金、长城改革红利灵活配置混合型证券投资基金、长城久惠灵活配置混合型证券投资基金、长城久祥灵活配置混合型证券投资基金、长城行业轮动灵活配置混合型证券投资基金、长城新优选混合型证券投资基金、长城久润灵活配置混合型证券投资基金、长城久益灵活配置混合型证券投资基金、长城久源灵活配置混合型证券投资基金、长城久鼎灵活配置混合型证券投资基金、长城久稳债券型证券投资基金、长城中国智造灵活配置混合型证券投资基金、长城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、长城久荣纯债定期开放债券型发起式证券投资基金、长城中证 500 指数增强型证券投资基金、长城久悦债券型证券投资基金、长城核心优势混合型证券投资基金、长城量化精选股票型证券投资基金、长城港股通价值精选多策略混合型证券投资基金、长城研究精选混合型证

券投资基金、长城短债债券型证券投资基金、长城久瑞三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长城嘉裕六个月定期开放债券型证券投资基金、长城嘉鑫两年定期开放债券型证券投资基金、长城量化小盘股票型证券投资基金、长城泰利纯债债券型证券投资基金、长城价值优选混合型证券投资基金、长城恒康稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、长城创新驱动混合型证券投资基金、长城中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金、长城健康生活灵活配置混合型证券投资基金、长城成长先锋混合型证券投资基金、长城恒泰养老目标日期 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、长城优选回报六个月持有期混合型证券投资基金、长城稳利纯债债券型证券投资基金、长城价值成长六个月持有期混合型证券投资基金、长城优选添瑞六个月持有期混合型证券投资基金、长城优选稳进六个月持有期混合型证券投资基金、长城消费 30 股票型证券投资基金、长城医药科技六个月持有期混合型证券投资基金、长城悦享回报债券型证券投资基金。

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	公司总经理助理、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	2019 年 1 月 29 日	-	13 年	男，中国籍，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。

	盘股票、长城中国智造混合的基金经理,兼任长城量化 1 号投资经理				
王卫林	长城创业板指数、长城核心优选混合基金经理	2019 年 12 月 20 日	-	5 年	男, 中国籍, 硕士。曾就职于南方基金管理有限公司(2016 年 7 月至 2017 年 12 月)。2018 年 1 月进入长城基金管理有限公司, 曾任量化与指数投资部研究员、基金经理助理。

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

姓名	产品类型	产品数量(只)	资产净值(元)	任职时间
雷俊	公募基金	7	3,140,850,402.16	2014-12-23
	私募资产管理计划	1	30,240,411.58	2021-04-07
	其他组合	0	0.00	-
	合计	8	3,171,090,813.74	-

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》、《长城创业板指数增强型发起式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

上半年的行情市场风格切换明显，核心资产的波动率显著放大，由前期的“大盘动量成长”风格切换到“中小盘价值”风格，报告期内动量成长因子表现出现较大波动，在医药、新能源等核心赛道优异表现的驱动下，创业板指数上半年领跑 A 股主要宽基指数。本基金产品运作坚持指数增强的投资思路，针对基准指数的特点有的放矢，相对基准适度暴露成长风格，上半年超额收益止跌回升，小幅跑赢业绩基准。

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严格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

截至本报告期末长城创业板指数增强发起式 A 基金份额净值为 2.7589 元，本报告期基金份额净值增长率为 17.97%；截至本报告期末长城创业板指数增强发起式 C 基金份额净值为 2.7238 元，本报告期基金份额净值增长率为 17.80%；同期业绩比较基准收益率为 16.43%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

总体来看，当前 A 股市场的估值处在近年来偏中枢位置，当前估值较春节高点已经回落明显，处在相对合理的区间，估值波动带来的下行空间预计较为有限；从上半年的上市公司整理盈利来看，盈利增长对估值消化显著，各个大型指数一致预期今年同比增幅较高，基本面数据依然强劲，下半年成长性驱动股价有望更为显著；从全球横向比较来看，中国股市估值不贵，长周期配置逻辑没有改变，预期权益市场仍旧是最有吸引力的资产配置方向。

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、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

本基金本报告期末未进行利润分配，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

本报告期内，中国工商银行股份有限公司在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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

本报告期内，长城创业板指数增强型发起式证券投资基金的管理人——长城基金管理有限公司在长城创业板指数增强型发起式证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

本报告期内，本基金未实施利润分配。

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

本托管人依法对长城基金管理有限公司编制和披露的长城创业板指数增强型发起式证券投资基金 2021 年中期报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：长城创业板指数增强型发起式证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	48,850,592.14	19,600,662.08
结算备付金		41,713,927.26	12,092,975.66
存出保证金		6,432,883.94	2,267,109.68
交易性金融资产	6.4.7.2	1,129,726,924.09	1,111,543,539.67
其中：股票投资		1,099,509,277.69	1,065,317,980.97
基金投资		-	-
债券投资		30,217,646.40	46,225,558.70
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	-	-
应收证券清算款		14,460,861.04	37,738,522.46
应收利息	6.4.7.5	670,088.38	1,045,293.64
应收股利		-	-
应收申购款		9,924,458.64	4,299,243.45
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,251,779,735.49	1,188,587,346.64
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		48,527,393.73	50,962,033.98
应付管理人报酬		970,346.80	1,057,862.22
应付托管费		145,552.02	158,679.32
应付销售服务费		114,891.10	143,926.48
应付交易费用	6.4.7.7	369,882.01	565,906.22
应交税费		55,742.61	-

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	315,137.49	289,501.25
负债合计		50,498,945.76	53,177,909.47
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	437,539,140.37	487,819,097.61
未分配利润	6.4.7.10	763,741,649.36	647,590,339.56
所有者权益合计		1,201,280,789.73	1,135,409,437.17
负债和所有者权益总计		1,251,779,735.49	1,188,587,346.64

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，长城创业板指数增强发起式 A 基金份额净值 2.7589 元，基金份额总额 270,793,665.08 份；长城创业板指数增强发起式 C 基金份额净值 2.7238 元，基金份额总额 166,745,475.29 份。长城创业板指数增强发起式份额总额合计为 437,539,140.37 份。

6.2 利润表

会计主体：长城创业板指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		230,081,442.59	114,670,697.55
1.利息收入		689,406.01	189,515.24
其中：存款利息收入	6.4.7.11	266,465.21	74,198.36
债券利息收入		422,940.80	115,316.88
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		144,192,404.14	37,226,149.58
其中：股票投资收益	6.4.7.12	135,855,834.49	34,159,768.25
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	1,919,216.48	115,391.23
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	3,780,774.66	1,165,242.72
股利收益	6.4.7.16	2,636,578.51	1,785,747.38
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	83,212,654.32	75,676,215.32
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	1,986,978.12	1,578,817.41
减：二、费用		10,109,877.81	3,072,461.75
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	5,572,681.22	1,561,839.98
2. 托管费	6.4.10.2.2	835,902.20	234,276.01
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	700,149.66	202,913.38
4. 交易费用	6.4.7.19	2,754,356.56	961,477.91
5. 利息支出		22,418.39	16,901.98
其中：卖出回购金融资产支出		22,418.39	16,901.98
6. 税金及附加		17,608.60	4,907.81
7. 其他费用	6.4.7.20	206,761.18	90,144.68
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		219,971,564.78	111,598,235.80
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		219,971,564.78	111,598,235.80

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长城创业板指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 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）	487,819,097.61	647,590,339.56	1,135,409,437.17
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	219,971,564.78	219,971,564.78
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）	-50,279,957.24	-103,820,254.98	-154,100,212.22
其中：1.基金申购款	670,910,918.82	903,640,936.95	1,574,551,855.77
2. 基金赎回款	-721,190,876.06	-1,007,461,191.93	-1,728,652,067.99
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)	437,539,140.37	763,741,649.36	1,201,280,789.73
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 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)	76,818,413.16	22,568,736.26	99,387,149.42
二、本期经营活动产生的 基金净值变动数(本 期利润)	-	111,598,235.80	111,598,235.80
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)	219,207,690.78	144,451,072.87	363,658,763.65
其中: 1.基金申购款	681,131,443.66	412,720,173.35	1,093,851,617.01
2. 基金赎回款	-461,923,752.88	-268,269,100.48	-730,192,853.36
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)	296,026,103.94	278,618,044.93	574,644,148.87

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

长城创业板指数增强型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”),是根据中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)2018 年 11 月 16 日证监许可[2018]1896 号文“关于准予长城创新动力灵活配置混合型证券投资基金变更注册的批复”及长城创新动力灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会于 2019 年 1 月 17 日决议通过的《关于长城创新动力灵活配置混合型证券投资基金转型有关事项的议案》,由长城创新动力灵活配置混合型证券投资基金转型而来。长

城创新动力灵活配置混合型证券投资基金经中国证监会证监许可[2015]2048 号文“关于准予长城创新动力灵活配置混合型证券投资基金注册的批复”以及中国证监会机构部函[2017]878 号文“关于长城创新动力灵活配置混合型证券投资基金延期募集备案的回函”的核准，由长城基金管理有限公司自 2017 年 4 月 27 日至 2017 年 5 月 25 日向社会公开募集，并向中国证监会报送基金备案材料。首次设立募集的规模为 398,108,405.90 份基金份额。长城创新动力灵活配置混合型证券投资基金为契约型开放式基金，存续期限不定，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，基金托管人为中国工商银行股份有限公司（以下简称“中国工商银行”）。

长城创新动力灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会于 2019 年 1 月 17 日表决通过了《关于长城创新动力灵活配置混合型证券投资基金转型有关事项的议案》。根据《长城创新动力灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效公告》及《关于长城创新动力灵活配置混合型证券投资基金转型为长城创业板指数增强型发起式证券投资基金的公告》，自 2019 年 1 月 29 日起，“长城创新动力灵活配置混合型证券投资基金”正式转型为“长城创业板指数增强型发起式证券投资基金”，转型后的《长城创业板指数增强型发起式证券投资基金基金合同》自该日起生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。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，基金托管人为中国工商银行。

本基金根据申购费用、销售服务费用收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别，其中，在投资者申购时收取申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用、但不计提销售服务费的基金份额，称为 A 类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费而在投资者申购时不收取申购费用、在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额，称为 C 类基金份额。转型后，原长城创新动力灵活配置混合型证券投资基金基金份额转为长城创业板指数增强型发起式证券投资基金 A 类基金份额。

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、中小企业私募债、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、定期存款及其他银行存款）、同业存单、权证、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）。

基金的投资组合比例为：本基金的股票资产投资比例不低于基金资产的 80%，其中投资于创业板指数成份股和备选成份股的资产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。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金的业绩比较基准为：创业板指数收益率 $\times$ 95%+银行活期存款利率(税后) $\times$ 5%。

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 2021 年 06 月 30 日的财务状况以及自 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无需要说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

1. 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 2021 年 6 月 30 日
活期存款	48,850,592.14
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：	48,850,592.14
-----	---------------

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	828,200,359.54	1,099,509,277.69	271,308,918.15
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	30,295,196.60	30,217,646.40
	银行间市场	-	-
	合计	30,295,196.60	30,217,646.40
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	858,495,556.14	1,129,726,924.09	271,231,367.95

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 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	39,460,000.00	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	39,460,000.00	-	-	

注：（1）衍生金融资产项下的股指期货投资期末合同/名义金额为期末的合约价值。

（2）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

注：本基金本期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 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。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	3,789.39
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	1,477.40
应收债券利息	529,023.93
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	135,797.66
合计	670,088.38

注：其他为应收结算保证金利息。

6.4.7.6 其他资产

注：本基金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 2021 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	369,882.01
银行间市场应付交易费用	—
合计	369,882.01

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 2021 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	39,381.36
应付证券出借违约金	—

预提费用	164,302.56
应付指数使用费	111,453.57
合计	315,137.49

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

长城创业板指数增强发起式 A		
项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	281,480,696.31	281,480,696.31
本期申购	222,926,360.21	222,926,360.21
本期赎回(以“-”号填列)	-233,613,391.44	-233,613,391.44
— 基金拆分/份额折算前	—	—
基金拆分/份额折算变动份额	—	—
本期申购	—	—
本期赎回(以“-”号填列)	—	—
本期末	270,793,665.08	270,793,665.08

金额单位：人民币元

长城创业板指数增强发起式 C		
项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	206,338,401.30	206,338,401.30
本期申购	447,984,558.61	447,984,558.61
本期赎回(以“-”号填列)	-487,577,484.62	-487,577,484.62
— 基金拆分/份额折算前	—	—
基金拆分/份额折算变动份额	—	—
本期申购	—	—
本期赎回(以“-”号填列)	—	—
本期末	166,745,475.29	166,745,475.29

注：本期申购包含基金转入份额及金额，本期赎回包含基金转出份额及金额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

长城创业板指数增强发起式 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	169,002,962.26	207,802,683.99	376,805,646.25

本期利润	83,813,710.32	44,600,553.64	128,414,263.96
本期基金份额交易产生的变动数	-3,442,545.72	-25,469,140.24	-28,911,685.96
其中：基金申购款	173,088,763.02	134,642,405.75	307,731,168.77
基金赎回款	-176,531,308.74	-160,111,545.99	-336,642,854.73
本期已分配利润	-	-	-
本期末	249,374,126.86	226,934,097.39	476,308,224.25

单位：人民币元

长城创业板指数增强发起式 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	96,947,015.25	173,837,678.06	270,784,693.31
本期利润	52,949,195.79	38,608,105.03	91,557,300.82
本期基金份额交易产生的变动数	-19,342,575.78	-55,565,993.24	-74,908,569.02
其中：基金申购款	288,827,702.01	307,082,066.17	595,909,768.18
基金赎回款	-308,170,277.79	-362,648,059.41	-670,818,337.20
本期已分配利润	-	-	-
本期末	130,553,635.26	156,879,789.85	287,433,425.11

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	67,540.48
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	195,883.76
其他	3,040.97
合计	266,465.21

注：其他为交易所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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	1,705,198,544.84
减：卖出股票成本总额	1,569,342,710.35
买卖股票差价收入	135,855,834.49

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 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	55,841,097.68
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	52,885,826.86
减：应收利息总额	1,036,054.34
买卖债券差价收入	1,919,216.48

6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

注：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

注：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

6.4.7.15.1 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 2021年1月1日至2021年6月30日
国债期货投资收益	-
股指期货-投资收益	3,780,774.66

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	2,636,578.51
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,636,578.51

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	82,244,309.30
——股票投资	82,338,891.34
——债券投资	-94,582.04
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	1,001,642.11
——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	33,297.09
合计	83,212,654.32

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	1,965,412.44
转出基金补偿收入 A001879	20,812.40
转出基金补偿收入 C006928	753.28
合计	1,986,978.12

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	2,754,356.56
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	2,754,356.56

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
审计费用	24,795.19
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	11,005.05
指数使用费	111,453.57
合计	206,761.18

6.4.7.21 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。

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
中国工商银行	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、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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
东方证券	626,824,905.08	19.44%	456,931,303.93	33.45%
长城证券	-	-	3,548,751.43	0.26%

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例	成交金额	占当期债券 成交总额的比例
东方证券	-	-	6,536,639.23	33.43%
长城证券	-	-	6,999,772.00	35.80%

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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2020 年 1 月 1 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	回购成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例
东方证券	-	-	24,600,000.00	19.79%

长城证券	-	-	65,700,000.00	52.86%
------	---	---	---------------	--------

6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金于本期未通过关联交易单元进行权证交易。

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 2021年1月1日至2021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
东方证券	144,986.60	19.45%	144,986.60	39.20%
长城证券	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2020年1月1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
东方证券	105,688.64	33.19%	-	-
长城证券	3,304.97	1.04%	-	-

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。

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 2021年1月1日至2021年6月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	5,572,681.22	1,561,839.98
其中：支付销售机构的客户维护费	2,237,351.82	706,914.16

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.00% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.00\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	835,902.20	234,276.01

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.15% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	长城创业板指数增强发起式 A	长城创业板指数增强发起式 C	合计
长城基金	-	1,393.14	1,393.14
长城证券	-	515.07	515.07
合计	-	1,908.21	1,908.21
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	长城创业板指数增强发起式 A	长城创业板指数增强发起式 C	合计
长城基金	-	687.86	687.86
长城证券	-	0.04	0.04
合计	-	687.90	687.90

注：销售服务费每日计提，按月支付。本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.3%。计算方法如下：

$$H = E \times 0.30\% / \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：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。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

注：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

注：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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	长城创业板指数增强发起式 A	长城创业板指数增强发起式 C
基金合同生效日（2019 年 1 月 29 日）持有的基金份额	—	—
报告期初持有的基金份额	11,534,202.33	—
报告期间申购/买入总份额	—	—
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	11,534,202.33	—
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	2.6362%	—

项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	长城创业板指数增强发起式 A	长城创业板指数增强发起式 C
基金合同生效日（2019 年 1 月 29 日）持有的基金份额	—	—
报告期初持有的基金份额	11,534,202.33	—
报告期间申购/买入总份额	—	—
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	11,534,202.33	-
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	3.8963%	-

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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	48,850,592.14	67,540.48	30,186,264.11	42,372.80

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本期及上年度可比期间未有在承销期内直接购入关联方承销的证券。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期末进行利润分配。

6.4.12 期末（2021 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
688316	青云科技	2021 年 3 月 5 日	2021 年 9 月 16 日	新股锁 定	63.70	65.00	1,428	90,963.60	92,820.00	-
688456	有研粉材	2021 年 3 月 10 日	2021 年 9 月 17 日	新股锁 定	10.62	26.50	3,396	36,065.52	89,994.00	-
301018	申菱	2021 年	2021	新股未	8.29	8.29	7,811	64,753.19	64,753.19	-

	环境	6 月 28 日	年 7 月 7 日	上市						
301020	密封科技	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 6 日	新股未上市	10.64	10.64	4,210	44,794.40	44,794.40	-
301017	漱玉平民	2021 年 6 月 23 日	2021 年 7 月 5 日	新股未上市	8.86	8.86	4,995	44,255.70	44,255.70	-
300973	立高食品	2021 年 4 月 8 日	2021 年 10 月 15 日	新股锁定	28.28	115.71	360	10,180.80	41,655.60	-
300941	创识科技	2021 年 2 月 2 日	2021 年 8 月 9 日	新股锁定	21.31	49.94	399	8,502.69	19,926.06	-
301015	百洋医药	2021 年 6 月 22 日	2021 年 12 月 30 日	新股锁定	7.64	38.83	462	3,529.68	17,939.46	-
300982	苏文电能	2021 年 4 月 19 日	2021 年 10 月 27 日	新股锁定	15.83	45.29	317	5,018.11	14,356.93	-
300968	格林精密	2021 年 4 月 6 日	2021 年 10 月 15 日	新股锁定	6.87	12.07	1,162	7,982.94	14,025.34	-
300614	百川畅银	2021 年 5 月 18 日	2021 年 11 月 25 日	新股锁定	9.19	40.38	329	3,023.51	13,285.02	-
301013	C 利和兴	2021 年 6 月 21 日	2021 年 12 月 29 日	新股锁定	8.72	27.11	471	4,107.12	12,768.81	-
301002	崧盛股份	2021 年 5 月 27 日	2021 年 12 月 7 日	新股锁定	18.71	57.62	201	3,760.71	11,581.62	-
300996	普联软件	2021 年 5 月 26 日	2021 年 12 月 3 日	新股锁定	20.81	42.23	241	5,015.21	10,177.43	-
300956	英力股份	2021 年 3 月 16 日	2021 年 9 月	新股锁定	12.85	25.80	371	4,767.35	9,571.80	-

		日	27 日							
300962	中金辐照	2021 年 3 月 29 日	2021 年 10 月 11 日	新股锁定	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12	-
300961	深水海纳	2021 年 3 月 23 日	2021 年 9 月 30 日	新股锁定	8.48	22.07	394	3,341.12	8,695.58	-
300950	德固特	2021 年 2 月 24 日	2021 年 9 月 3 日	新股锁定	8.41	39.13	219	1,841.79	8,569.47	-
300986	志特新材	2021 年 4 月 21 日	2021 年 11 月 1 日	新股锁定	14.79	30.57	264	3,904.56	8,070.48	-
300978	东箭科技	2021 年 4 月 15 日	2021 年 10 月 26 日	新股锁定	8.42	13.60	593	4,993.06	8,064.80	-
300993	玉马遮阳	2021 年 5 月 17 日	2021 年 11 月 24 日	新股锁定	12.10	19.29	410	4,961.00	7,908.90	-
301004	C 嘉益	2021 年 6 月 18 日	2021 年 12 月 27 日	新股锁定	7.81	21.94	312	2,436.72	6,845.28	-
300991	创益通	2021 年 5 月 12 日	2021 年 11 月 22 日	新股锁定	13.06	26.51	254	3,317.24	6,733.54	-
301011	华立科技	2021 年 6 月 9 日	2021 年 12 月 17 日	新股锁定	14.20	33.84	175	2,485.00	5,922.00	-
300943	春晖智控	2021 年 2 月 3 日	2021 年 8 月 10 日	新股锁定	9.79	23.01	255	2,496.45	5,867.55	-
300960	通业科技	2021 年 3 月 22 日	2021 年 9 月 29 日	新股锁定	12.08	23.06	234	2,826.72	5,396.04	-
301017	漱玉平民	2021 年 6 月 23 日	2022 年 1 月 5 日	新股锁定	8.86	8.86	555	4,917.30	4,917.30	-

300995	奇德新材	2021 年 5 月 17 日	2021 年 11 月 26 日	新股锁定	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	-
301007	德迈仕	2021 年 6 月 4 日	2021 年 12 月 16 日	新股锁定	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	-
300992	泰福泵业	2021 年 5 月 17 日	2021 年 11 月 25 日	新股锁定	9.36	20.32	200	1,872.00	4,064.00	-

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
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：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
123117	健帆转债	2021 年 6 月 23 日	2021 年 7 月 12 日	配债未上市	100.00	100.00	2,952	295,200.00	295,200.00	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有因暂时停牌等流通受限的股票。

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

截止本报告期末，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，无质押证券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，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

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。

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约约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受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 2021 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	48,850,592.14	-	-	-	-	-	48,850,592.14
结算备付金	41,713,927.26	-	-	-	-	-	41,713,927.26
存出	6,432,883.94	-	-	-	-	-	6,432,883.94

保证金							
交易性金融资产	-	-30,217,646.40	-	-	1,099,509,277.69	1,129,726,924.09	
应收证券清算款	-	-	-	-	14,460,861.04	14,460,861.04	
应收利息	-	-	-	-	670,088.38	670,088.38	
应收申购款	-	-	-	-	9,924,458.64	9,924,458.64	
资产总计	96,997,403.34	-30,217,646.40	-	-	1,124,564,685.75	1,251,779,735.49	
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	
应付赎回款	-	-	-	-	48,527,393.73	48,527,393.73	
应付管理人报酬	-	-	-	-	970,346.80	970,346.80	
应付托管费	-	-	-	-	145,552.02	145,552.02	
应付销售服务费	-	-	-	-	114,891.10	114,891.10	
应付交易费用	-	-	-	-	369,882.01	369,882.01	
应交税费	-	-	-	-	55,742.61	55,742.61	
其他负债	-	-	-	-	315,137.49	315,137.49	
负债	-	-	-	-	50,498,945.76	50,498,945.76	

总计							
利率敏感 度缺口	96,997,403.34	-30,217,646.40	-	-			
上年度末 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	19,600,662.08	-	-	-	-	-	19,600,662.08
结算备付金	12,092,975.66	-	-	-	-	-	12,092,975.66
存出保证金	2,267,109.68	-	-	-	-	-	2,267,109.68
交易性金融资产	44,408,558.70	1,817,000.00	-	-	-	1,065,317,980.97	1,111,543,539.67
应收证券清算款	-	-	-	-	-	37,738,522.46	37,738,522.46
应收利息	-	-	-	-	-	1,045,293.64	1,045,293.64
应收申购款	-	-	-	-	-	4,299,243.45	4,299,243.45
资产总计	78,369,306.12	1,817,000.00	-	-	-	1,108,401,040.52	1,188,587,346.64
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	50,962,033.98	50,962,033.98
应付	-	-	-	-	-	1,057,862.22	1,057,862.22

管理人报酬							
应付托管费	-	-	-	-	-	158,679.32	158,679.32
应付销售服务费	-	-	-	-	-	143,926.48	143,926.48
应付交易费用	-	-	-	-	-	565,906.22	565,906.22
其他负债	-	-	-	-	-	289,501.25	289,501.25
负债总计	-	-	-	-	-	53,177,909.47	53,177,909.47
利率敏感度缺口	78,369,306.12	1,817,000.00	-	-	-		

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（2021 年 6 月 30 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
	利率上升 25 个基点	-28,845.09	-4,113.50
	利率下降 25 个基点	28,900.83	4,114.65

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。

本基金的投资组合比例为：本基金股票资产投资比例不低于基金资产的 80%，其中投资于创业板指数成份股和备选成份股的资产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。

于本期末及上年度末，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 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产—股票投资	1,099,509,277.69	91.53	1,065,317,980.97	93.83
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	30,217,646.40	2.52	46,225,558.70	4.07
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	1,129,726,924.09	94.04	1,111,543,539.67	97.90

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（2021 年 6 月 30 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数上升 5%	63,656,089.63	55,002,367.36
	沪深 300 指数下降 5%	-63,656,089.63	-55,002,367.36

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. 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

2. 其他事项

(1) 公允价值

管理层已经评估了银行存款、结算备付金、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 2021 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 1,098,908,058.83 元，划分为第二层次的余额为人民币 30,818,865.26 元，无划分为第三层次余额。

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归属于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。

§ 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	1,099,509,277.69	87.84
	其中：股票	1,099,509,277.69	87.84
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	30,217,646.40	2.41
	其中：债券	30,217,646.40	2.41
	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	90,564,519.40	7.23
8	其他各项资产	31,488,292.00	2.52
9	合计	1,251,779,735.49	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	10,238,116.00	0.85
B	采矿业	—	—
C	制造业	733,108,869.50	61.03
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	4,664,960.00	0.39
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	46,591,915.80	3.88
J	金融业	105,053,290.59	8.75
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	—	—

M	科学研究和技术服务业	26,638,249.72	2.22
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	95,891,910.72	7.98
R	文化、体育和娱乐业	40,347,716.77	3.36
S	综合	-	-
	合计	1,062,535,029.10	88.45

7.2.2 期末积极投资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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	31,267,161.56	2.60
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	173,982.28	0.01
F	批发和零售业	67,112.46	0.01
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	122,923.49	0.01
J	金融业	34,721.10	0.00
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	5,286,367.10	0.44
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	21,980.60	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	36,974,248.59	3.08

7.2.3 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。

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

7.3.1 期末指数投资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	300750	宁德时代	224,300	119,955,640.00	9.99
2	300059	东方财富	3,203,821	105,053,290.59	8.75
3	300014	亿纬锂能	853,600	88,714,648.00	7.39
4	300760	迈瑞医疗	176,954	84,946,767.70	7.07
5	300015	爱尔眼科	1,128,664	80,112,570.72	6.67
6	300124	汇川技术	863,168	64,098,855.68	5.34
7	300661	圣邦股份	214,049	54,096,603.77	4.50
8	300122	智飞生物	233,228	43,550,664.44	3.63
9	300782	卓胜微	72,560	39,001,000.00	3.25
10	300316	晶盛机电	649,600	32,804,800.00	2.73
11	300413	芒果超媒	433,460	29,735,356.00	2.48
12	300408	三环集团	654,182	27,750,400.44	2.31
13	300454	深信服	96,300	24,987,924.00	2.08
14	300450	先导智能	396,110	23,822,055.40	1.98
15	300529	健帆生物	228,900	19,767,804.00	1.65
16	300759	康龙化成	84,300	18,292,257.00	1.52
17	300037	新宙邦	163,517	16,368,051.70	1.36
18	300482	万孚生物	228,024	14,750,872.56	1.23
19	300347	泰格医药	72,200	13,956,260.00	1.16
20	300496	中科创达	79,500	12,486,270.00	1.04
21	300595	欧普康视	110,000	11,390,500.00	0.95
22	300463	迈克生物	264,700	11,141,223.00	0.93
23	300558	贝达药业	100,478	10,875,738.72	0.91
24	300699	光威复材	143,180	10,874,521.00	0.91
25	300251	光线传媒	981,717	10,612,360.77	0.88
26	300628	亿联网络	121,088	10,147,174.40	0.84
27	300285	国瓷材料	207,400	10,110,750.00	0.84
28	300274	阳光电源	86,700	9,975,702.00	0.83
29	300357	我武生物	146,600	9,399,992.00	0.78
30	300761	立华股份	275,500	9,127,315.00	0.76
31	300012	华测检测	261,794	8,345,992.72	0.69
32	300616	尚品宅配	81,800	7,240,118.00	0.60
33	300896	爱美客	7,680	6,058,598.40	0.50

34	300783	三只松鼠	98,500	4,664,960.00	0.39
35	300369	绿盟科技	233,192	3,719,412.40	0.31
36	300601	康泰生物	18,087	2,694,963.00	0.22
37	300383	光环新网	182,200	2,621,858.00	0.22
38	300253	卫宁健康	132,500	2,155,775.00	0.18
39	300244	迪安诊断	47,600	1,823,080.00	0.15
40	300751	迈为股份	3,600	1,636,920.00	0.14
41	300498	温氏股份	77,300	1,110,801.00	0.09
42	300725	药石科技	6,600	1,048,806.00	0.09
43	300188	美亚柏科	34,837	606,163.80	0.05
44	300832	新产业	9,200	566,720.00	0.05
45	300433	蓝思科技	10,680	314,098.80	0.03
46	300770	新媒股份	298	14,512.60	0.00
47	300207	欣旺达	74	2,409.44	0.00
48	300502	新易盛	56	1,750.00	0.00
49	300476	胜宏科技	33	721.05	0.00

7.3.2 期末积极投资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	300685	艾德生物	152,600	15,882,608.00	1.32
2	300363	博腾股份	76,600	6,443,592.00	0.54
3	300662	科锐国际	87,205	5,286,367.10	0.44
4	300957	贝泰妮	11,000	2,988,590.00	0.25
5	300593	新雷能	65,000	2,824,250.00	0.24
6	300395	菲利华	23,700	1,142,814.00	0.10
7	300394	天孚通信	35,570	900,632.40	0.07
8	603392	万泰生物	1,097	284,320.46	0.02
9	300705	九典制药	4,900	186,445.00	0.02
10	300982	苏文电能	3,170	173,982.28	0.01
11	300978	东箭科技	5,930	105,678.53	0.01
12	300956	英力股份	3,707	100,044.12	0.01
13	688316	青云科技	1,428	92,820.00	0.01
14	688456	有研粉材	3,396	89,994.00	0.01
15	301018	申菱环境	7,811	64,753.19	0.01
16	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.00
17	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.00

18	300973	立高食品	360	41,655.60	0.00
19	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.00
20	001207	联科科技	682	22,581.02	0.00
21	300941	创识科技	399	19,926.06	0.00
22	301015	百洋医药	462	17,939.46	0.00
23	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.00
24	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
25	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
26	301013	C利和兴	471	12,768.81	0.00
27	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
28	688016	心脉医疗	24	10,910.64	0.00
29	300996	普联软件	241	10,177.43	0.00
30	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
31	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
32	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
33	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
34	300993	玉马遮阳	410	7,908.90	0.00
35	301004	C嘉益	312	6,845.28	0.00
36	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
37	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
38	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
39	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
40	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
41	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
42	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
43	300639	凯普生物	119	3,928.19	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	300014	亿纬锂能	73,466,060.09	6.47
2	300454	深信服	71,913,877.91	6.33
3	300347	泰格医药	61,380,523.68	5.41
4	300529	健帆生物	51,596,911.84	4.54
5	300274	阳光电源	50,761,667.80	4.47

6	300015	爱尔眼科	49,413,510.00	4.35
7	300661	圣邦股份	45,918,983.45	4.04
8	300496	中科创达	39,838,827.67	3.51
9	300059	东方财富	38,470,494.60	3.39
10	300408	三环集团	35,187,581.93	3.10
11	300316	晶盛机电	34,826,549.14	3.07
12	300037	新宙邦	34,633,142.37	3.05
13	300595	欧普康视	33,781,625.44	2.98
14	300699	光威复材	32,308,123.57	2.85
15	300124	汇川技术	27,070,444.79	2.38
16	300782	卓胜微	26,965,161.40	2.37
17	300558	贝达药业	25,648,429.70	2.26
18	300750	宁德时代	22,977,194.00	2.02
19	300760	迈瑞医疗	22,883,918.00	2.02
20	300482	万孚生物	22,738,721.42	2.00

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	300015	爱尔眼科	80,538,941.44	7.09
2	300059	东方财富	72,050,238.20	6.35
3	300750	宁德时代	66,782,787.82	5.88
4	300433	蓝思科技	57,457,835.93	5.06
5	300308	中际旭创	56,359,906.07	4.96
6	300347	泰格医药	49,825,829.70	4.39
7	300760	迈瑞医疗	49,620,719.88	4.37
8	300454	深信服	44,440,709.44	3.91
9	300274	阳光电源	43,138,813.99	3.80
10	300124	汇川技术	42,405,736.29	3.73
11	300122	智飞生物	40,950,738.00	3.61
12	300699	光威复材	39,196,738.00	3.45
13	300661	圣邦股份	36,337,064.52	3.20
14	300413	芒果超媒	34,490,076.58	3.04
15	300450	先导智能	34,486,675.00	3.04
16	300529	健帆生物	34,329,294.60	3.02

17	300558	贝达药业	32,618,387.84	2.87
18	300363	博腾股份	30,038,985.86	2.65
19	300496	中科创达	27,928,725.36	2.46
20	300285	国瓷材料	26,586,427.58	2.34
21	300188	美亚柏科	26,442,001.85	2.33
22	300724	捷佳伟创	25,600,218.65	2.25
23	300037	新宙邦	25,053,251.99	2.21
24	300595	欧普康视	23,193,669.76	2.04

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	1,521,195,115.73
卖出股票收入（成交）总额	1,705,198,544.84

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	29,922,446.40	2.49
2	央行票据	—	—
3	金融债券	—	—
	其中：政策性金融债	—	—
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）	295,200.00	0.02
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	30,217,646.40	2.52

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

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	019645	20 国债 15	298,270	29,922,446.40	2.49
2	123117	健帆转债	2,952	295,200.00	0.02

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：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

注：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

注：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
IC2107	IC2107	30	40,603,200.00	1,143,200.00	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）					1,143,200.00
股指期货投资本期收益（元）					3,780,774.66
股指期货投资本期公允价值变动（元）					1,001,642.11

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。

多头套期保值策略

本基金为指数增强基金，当指数期货大幅贴水时，可采用多头套期保值策略，即卖出部分股票持仓并买入指数期货的期货替代现货策略。持有至基差收敛，赚取期货与现货指数的价差，增强指数。

基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征，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；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。

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

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。

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	6,432,883.94
2	应收证券清算款	14,460,861.04
3	应收股利	—
4	应收利息	670,088.38
5	应收申购款	9,924,458.64
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	31,488,292.00

7.12.4 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。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

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

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
长城创业板指数增强发起式 A	44,435	6,094.15	50,513,873.67	18.65%	220,279,791.41	81.35%
长城创业板指数增强发起式 C	75,927	2,196.13	6,880,798.04	4.13%	159,864,677.25	95.87%
合计	120,362	3,635.19	57,394,671.71	13.12%	380,144,468.66	86.88%

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

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	长城创业板指数增强发起式 A	307,494.50	0.1136%
	长城创业板指数增强发起式 C	125,738.02	0.0754%
	合计	433,232.52	0.0990%

注：上述基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	长城创业板指数增强发起式 A	0~10
	长城创业板指数增强发起式 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	长城创业板指数增强发起式 A	0
	长城创业板指数增强发起式 C	0
	合计	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。

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例（%）	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例（%）	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	11,534,202.33	2.64	11,534,202.33	2.64	3 年
基金管理人高级管理人员	—	—	—	—	—
基金经理等人员	—	—	—	—	—
基金管理人股东	—	—	—	—	—
其他	—	—	—	—	—
合计	11,534,202.33	2.64	11,534,202.33	2.64	3 年

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	长城创业板指数增强发起式 A	长城创业板指数增强发起式 C
基金合同生效日（2019 年 1 月 29 日）基金份额总额	33,883,058.75	—
本报告期期初基金份额总额	281,480,696.31	206,338,401.30
本报告期基金总申购份额	222,926,360.21	447,984,558.61
减：本报告期基金总赎回份额	233,613,391.44	487,577,484.62
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	—	—
本报告期期末基金份额总额	270,793,665.08	166,745,475.29

§ 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 2021 年 4 月 13 日起，许明波先生不再担任公司董事，由曾晓玲女士担任公司董事。

2、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

中国工商银行股份有限公司（以下简称“本公司”）根据工作需要，任命刘彤女士担任本公司资产托管部总经理，全面主持资产托管部相关工作。刘彤女士的托管人高级管理人员任职信息已经在中国证券投资基金业协会备案。李勇先生不再担任本公司资产托管部总经理职务。

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

报告期内为基金进行审计的会计师事务所无变更。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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	
东方财富证券	2	2,596,765,543.59	80.56%	600,634.44	80.55%	—
东方证券	1	626,824,905.08	19.44%	144,986.60	19.45%	—
长城证券	1	—	—	—	—	—

注：1、报告期内租用证券公司席位的变更情况：本报告期内无变化。截止本报告期末共计 4 个交易单元。

2、专用席位的选择标准和程序 本基金管理人负责选择代理本基金证券买卖的证券经营机构，使用其席位作为基金的专用交易席位，选择的标准是：

- (1) 实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币；
- (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- (3) 经营行为规范，能满足基金运作的合法、合规需求；
- (4) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- (5) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要，并能为本基金提供全面的信息服务；
- (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
东方财富证券	38,710,257.23	100.00%	273,200,000.00	100.00%	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	长城基金管理有限公司关于参加宁波银行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	2021 年 1 月 27 日
2	关于终止包商银行股份有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	本基金管理人网站	2021 年 2 月 8 日
3	长城基金管理有限公司关于	中国证券报、上海证	2021 年 2 月 23 日

	调整旗下基金所持停牌股票估值方法的公告(盛达资源)	券报、证券时报、证券日报及本基金管理人网站	
4	关于长城创业板指数增强型发起式证券投资基金根据《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号—指数基金指引》修改基金合同部分条款的公告	上海证券报及本基金管理人网站	2021 年 3 月 30 日
5	长城基金管理有限公司关于调整旗下部分基金最低申购金额限制的公告	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	2021 年 4 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

1. 中国证监会准予长城创业板指数增强型发起式证券投资基金注册的文件
- 2、《长城创业板指数增强型发起式证券投资基金基金合同》
- 3、《长城创业板指数增强型发起式证券投资基金托管协议》
- 4、法律意见书
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照
- 7、中国证监会规定的其他备查文件。

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