

长城创业板指数增强型发起式证券投资基金

2022 年第 2 季度报告

2022 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

报告送出日期：2022 年 7 月 21 日

§ 1 重要提示

本基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

本基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 07 月 19 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 04 月 01 日起至 2022 年 06 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

| | | |
|-------------|---|--------------|
| 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 | |
| 报告期末基金份额总额 | 545,212,804.22 份 | |
| 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。 | |
| 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 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 长城创业板指数增强发起式 | 长城创业板指数增强发起式 |

| | | |
|-----------------|------------------|------------------|
| | A | 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 | 300,114,880.65 份 | 245,097,923.57 份 |

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期（2022 年 4 月 1 日-2022 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 |
| 1. 本期已实现收益 | -41,268,600.25 | -48,337,895.96 |
| 2. 本期利润 | 57,226,659.65 | 46,230,820.71 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.1898 | 0.1508 |
| 4. 期末基金资产净值 | 705,707,856.82 | 567,293,281.10 |
| 5. 期末基金份额净值 | 2.3515 | 2.3146 |

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

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

3.2 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

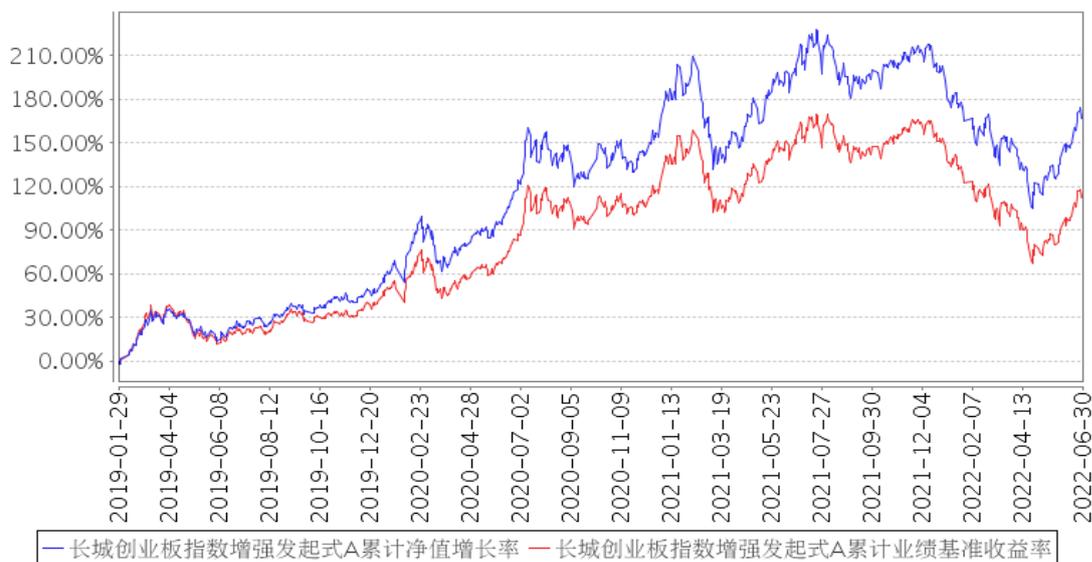
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|---------|-----------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去三个月 | 8.61% | 1.99% | 5.46% | 2.00% | 3.15% | -0.01% |
| 过去六个月 | -10.54% | 1.99% | -14.59% | 1.95% | 4.05% | 0.04% |
| 过去一年 | -14.77% | 1.79% | -18.14% | 1.71% | 3.37% | 0.08% |
| 过去三年 | 119.85% | 1.79% | 81.38% | 1.71% | 38.47% | 0.08% |
| 过去五年 | - | - | - | - | - | - |
| 自基金合同生效起至今 | 170.60% | 1.81% | 115.90% | 1.75% | 54.70% | 0.06% |

长城创业板指数增强发起式 C

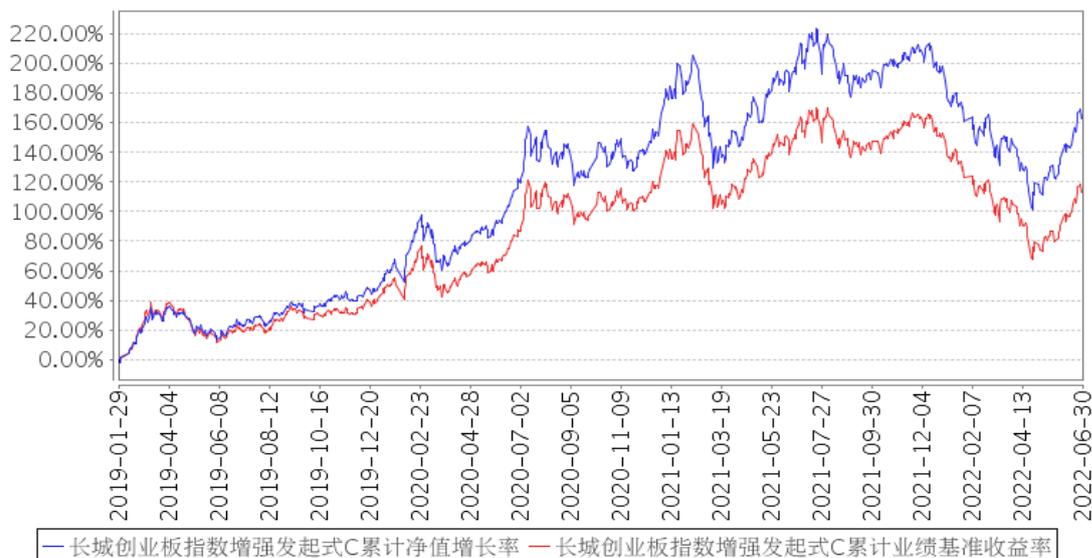
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准 差② | 业绩比较基准 收益率③ | 业绩比较基准 收益率标准差 ④ | ①—③ | ②—④ |
|----------------|---------|---------------|----------------|-----------------------|--------|--------|
| 过去三个月 | 8.53% | 1.99% | 5.46% | 2.00% | 3.07% | -0.01% |
| 过去六个月 | -10.67% | 1.99% | -14.59% | 1.95% | 3.92% | 0.04% |
| 过去一年 | -15.02% | 1.79% | -18.14% | 1.71% | 3.12% | 0.08% |
| 过去三年 | 117.17% | 1.79% | 81.38% | 1.71% | 35.79% | 0.08% |
| 过去五年 | - | - | - | - | - | - |
| 自基金合同 生效起至今 | 166.35% | 1.81% | 115.90% | 1.75% | 50.45% | 0.06% |

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

长城创业板指数增强发起式A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



长城创业板指数增强发起式C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：①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。

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 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|----|-------------------------------------|-------------|------|--------|--|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 雷俊 | 公司总经理助理、量化与指数投资部总经理、本基金的基金经理、兼任投资经理 | 2019年1月29日 | - | 14年 | 男，中国籍，硕士。2008年7月-2017年11月曾就职于南方基金管理有限公司，历任研究员、基金经理。2017年11月加入长城基金管理有限公司，现任公司总经理助理、量化与指数投资部总经理、基金经理兼投资经理。自2019年5月至2021年10月任“长城核心优选灵活配置混合型证券投资基金”基金经理，自2018年11月至今任“长城中证500指数增强型证券投资基金”、“长城久泰沪深300指数证券投资基金”基金经理，自2019年1月至今任“长城创业板指数增强型发 |

| | | | | | |
|-----|----------|------------------|---|-----|--|
| | | | | | 起式证券投资基金”基金经理，自 2019 年 5 月至今任“长城量化精选股票型证券投资基金”基金经理，自 2020 年 1 月至今任“长城量化小盘股票型证券投资基金”、“长城中国智造灵活配置混合型证券投资基金”基金经理，自 2021 年 4 月至今任“长城基金-量化 1 号单一资产管理计划”投资经理，自 2022 年 6 月至今任“长城中证医药卫生指数增强型证券投资基金”基金经理。 |
| 王卫林 | 本基金的基金经理 | 2019 年 12 月 20 日 | - | 6 年 | 男，中国籍，硕士。2016 年 7 月-2018 年 1 月曾就职于南方基金管理有限公司，2018 年 1 月加入长城基金管理有限公司，历任量化与指数投资部研究员、基金经理助理。自 2019 年 12 月至今任“长城创业板指数增强型发起式证券投资基金”、“长城核心优选灵活配置混合型证券投资基金”基金经理。 |

注：①上述任职日期、离任日期根据公司做出决定的任免日期填写。

②证券从业年限的计算方式遵从从业人员的相关规定。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

| 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 | 3,374,703,398.25 | 2014 年 12 月 23 日 |
| | 私募资产管理计划 | 1 | 203,238,023.96 | 2021 年 4 月 7 日 |
| | 其他组合 | - | - | - |
| | 合计 | 8 | 3,577,941,422.21 | - |

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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

本基金管理人严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，对同向交易的价差进行事后分析，定期出具公平交易稽核报告。本报告期报告认为，本基金管理人旗下投资组合的同向交易价差均在合理范围内，结果符合相关政策法规和公司制度的规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

二季度市场触底反弹，大盘指数显著回升。目前各大指数走势稳健，但 5 月以来市场反弹幅度较大，后市不排除震荡整理的可能性，未来走势将更多取决于对经济基本面的预期。国内流动性环境宽松大概率延续，宽货币可能逐渐转化为宽信用，居民消费和经济数据有望得到进一步修复。从经济基本面看，5 月下旬以来复工复产、经济复苏趋势逐渐明确，对应到市场上，投资者信心有所恢复，交投热度上升。从量化风格看，盈利、成长和动量因子超额收益显著提升。报告期内，产品行业上较为均衡，行业、风格上基本相对业绩基准偏离较小，但受局部阶段性个股行情影响，组合超额收益波动略大，整体季度内超额收益符合预期。

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。

4.5 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 的基金份额净值为 2.3515 元，本报告期基金份额净值增长率为 8.61%；截至本报告期末长城创业板指数增强发起式 C 的基金份额净值为 2.3146 元，本报告期基金份额净值增长率为 8.53%。同期业绩比较基准收益率为 5.46%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内，本基金无需要说明的情况。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额（元） | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------------------|------------------|--------------|
| 1 | 权益投资 | 1,189,416,810.36 | 91.33 |
| | 其中：股票 | 1,189,416,810.36 | 91.33 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 14,252,461.27 | 1.09 |
| | 其中：债券 | 14,252,461.27 | 1.09 |
| | 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 | 85,531,956.23 | 6.57 |
| 8 | 其他资产 | 13,197,769.19 | 1.01 |
| 9 | 合计 | 1,302,398,997.05 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|------------------|--------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | 7,300,341.00 | 0.57 |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 899,793,542.55 | 70.68 |
| 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 | - | - |
| 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 | 37,452,070.00 | 2.94 |
| J | 金融业 | 91,396,439.00 | 7.18 |
| 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 | 25,146,725.40 | 1.98 |
| 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 | 19,575,592.96 | 1.54 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 2,001.60 | 0.00 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 1,080,666,712.51 | 84.89 |

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|----------------|--------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 99,202,904.32 | 7.79 |
| 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 | 4,257,550.51 | 0.33 |
| 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 | 507,021.98 | 0.04 |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | 4,701,234.00 | 0.37 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 23,441.56 | 0.00 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 41,711.34 | 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 | 16,234.14 | 0.00 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 108,750,097.85 | 8.54 |

5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：无。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|-----------|----------------|--------------|
| 1 | 300750 | 宁德时代 | 225,700 | 120,523,800.00 | 9.47 |
| 2 | 300059 | 东方财富 | 3,598,285 | 91,396,439.00 | 7.18 |
| 3 | 300760 | 迈瑞医疗 | 242,654 | 75,999,232.80 | 5.97 |
| 4 | 300124 | 汇川技术 | 1,049,773 | 69,148,547.51 | 5.43 |
| 5 | 300014 | 亿纬锂能 | 667,000 | 65,032,500.00 | 5.11 |
| 6 | 300316 | 晶盛机电 | 951,192 | 64,291,067.28 | 5.05 |
| 7 | 300763 | 锦浪科技 | 283,040 | 60,287,520.00 | 4.74 |
| 8 | 300661 | 圣邦股份 | 295,873 | 53,854,803.46 | 4.23 |
| 9 | 300122 | 智飞生物 | 421,466 | 46,786,940.66 | 3.68 |
| 10 | 300896 | 爱美客 | 51,780 | 31,068,517.80 | 2.44 |

5.3.2 报告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前五名股票投资明细

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|---------|---------------|--------------|
| 1 | 002594 | 比亚迪 | 98,900 | 32,982,161.00 | 2.59 |
| 2 | 300593 | 新雷能 | 765,595 | 31,779,848.45 | 2.50 |
| 3 | 300696 | 爱乐达 | 192,340 | 8,453,343.00 | 0.66 |
| 4 | 300673 | 佩蒂股份 | 338,100 | 5,842,368.00 | 0.46 |
| 5 | 300487 | 蓝晓科技 | 80,100 | 4,886,100.00 | 0.38 |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|---------------|--------------|
| 1 | 国家债券 | 14,252,461.27 | 1.12 |
| 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） | - | - |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 14,252,461.27 | 1.12 |

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|----------|---------|---------------|--------------|
| 1 | 019666 | 22 国债 01 | 130,010 | 13,148,214.06 | 1.03 |
| 2 | 019674 | 22 国债 09 | 11,000 | 1,104,247.21 | 0.09 |

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

注：无。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：无。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：无。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

| 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 |
|-------------------|--------|-----------|---------------|---------------|--|
| IC2207 | IC2207 | 14 | 18,016,880.00 | 101,689.41 | 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) | | | | | 101,689.41 |
| 股指期货投资本期收益(元) | | | | | -819,225.95 |
| 股指期货投资本期公允价值变动(元) | | | | | 932,046.24 |

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金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。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：无。

5.10.3 本期国债期货投资评价

注：无。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本报告期内本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。

5.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中，未有投资于超出基金合同规定备选股票库之外股票。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|----|---------|---------------|
| 1 | 存出保证金 | 3,318,960.29 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 9,878,808.90 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 13,197,769.19 |

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：无。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：无。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：无。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 长城创业板指数增强发起式 A | 长城创业板指数增强发起式 C |
|---------------------------|----------------|----------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 296,969,101.84 | 303,620,582.15 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 47,221,485.30 | 195,873,360.59 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 44,075,706.49 | 254,396,019.17 |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 300,114,880.65 | 245,097,923.57 |

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

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 |
|--------------------------|----------------|----------------|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额 | 11,534,202.33 | - |
| 报告期期间买入/申购总份额 | - | - |
| 报告期期间卖出/赎回总份额 | - | - |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额 | 11,534,202.33 | - |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%） | 2.12 | - |

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：本报告期本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 报告期末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 | 2.12 | 11,534,202.33 | 2.12 | 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 | 2.12 | 11,534,202.33 | 2.12 | 3 年 |

§ 9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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。

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

注：无。

§ 10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

1. 中国证监会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。

10.2 存放地点

基金管理人及基金托管人住所

10.3 查阅方式

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

咨询电话：0755-29279188

客户服务电话：400-8868-666

网站：www.ccfund.com.cn

