

# 长城量化小盘股票型证券投资基金 2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：长城基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2024 年 8 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 08 月 30 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 2024 年 01 月 01 日起至 2024 年 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
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
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>14</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	14
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>14</b>
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	19
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>42</b>
7.1 期末基金资产组合情况	42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	42
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	43
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	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	52

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	52
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	53
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	53
7.10	本基金投资股指期货的投资政策	53
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	53
7.12	投资组合报告附注	53
<b>§ 8</b>	<b>基金份额持有人信息</b>	<b>54</b>
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	54
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	55
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情况	55
<b>§ 9</b>	<b>开放式基金份额变动</b>	<b>55</b>
<b>§ 10</b>	<b>重大事件揭示</b>	<b>56</b>
10.1	基金份额持有人大会决议	56
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	56
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	56
10.4	基金投资策略的改变	56
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	56
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	56
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	56
10.8	其他重大事件	61
<b>§ 11</b>	<b>影响投资者决策的其他重要信息</b>	<b>61</b>
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	61
11.2	影响投资者决策的其他重要信息	62
<b>§ 12</b>	<b>备查文件目录</b>	<b>62</b>
12.1	备查文件目录	62
12.2	存放地点	62
12.3	查阅方式	62

## § 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	
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	160,643,827.38 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	长城量化小盘股票 A	长城量化小盘股票 C
下属分级基金的交易代码	007903	019272
报告期末下属分级基金的份额总额	157,274,952.15 份	3,368,875.23 份

### 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。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；高管增减持（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在目标范围内。</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。</p>
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	祝函	王小飞
	联系电话	0755-29279006	021-60637103
	电子邮箱	zhuhan@ccfund.com.cn	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		400-8868-666	021-60637228
传真		0755-29279000	021-60635778
注册地址		深圳市福田区莲花街道福新社区 鹏程一路9号广电金融中心36层 DEF单元、38层、39层	北京市西城区金融大街25号
办公地址		深圳市福田区莲花街道福新社区 鹏程一路9号广电金融中心36层 DEF单元、38层、39层	北京市西城区闹市口大街1号院 1号楼
邮政编码		518046	100033
法定代表人		王军	张金良

### 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	基金管理人及基金托管人住所

### 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	深圳市福田区莲花街道福新社区 鹏程一路9号广电金融中心 36层DEF单元、38层、39层

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数 据和指标	报告期(2024年1月1日-2024年6月30日)	
	长城量化小盘股票 A	长城量化小盘股票 C
本期已实现收益	-71,377,716.10	-28,462,019.14
本期利润	-65,814,960.94	-38,668,472.76
加权平均基金份 额本期利润	-0.3406	-0.6502
本期加权平均净 值利润率	-29.61%	-55.39%

本期基金份额净值增长率	-19.24%	-19.50%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024年6月30日)	
期末可供分配利润	11,457,523.66	234,951.73
期末可供分配基金份额利润	0.0729	0.0697
期末基金资产净值	168,732,475.81	3,603,826.96
期末基金份额净值	1.0729	1.0697
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	7.29%	-17.92%

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“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

长城量化小盘股票 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	-6.88%	1.04%	-7.73%	1.29%	0.85%	-0.25%
过去三个月	-6.11%	1.18%	-9.00%	1.34%	2.89%	-0.16%
过去六个月	-19.24%	1.96%	-15.10%	1.77%	-4.14%	0.19%
过去一年	-18.92%	1.50%	-23.36%	1.39%	4.44%	0.11%
过去三年	-17.50%	1.35%	-27.72%	1.29%	10.22%	0.06%
自基金合同生效起	7.29%	1.38%	-13.94%	1.33%	21.23%	0.05%



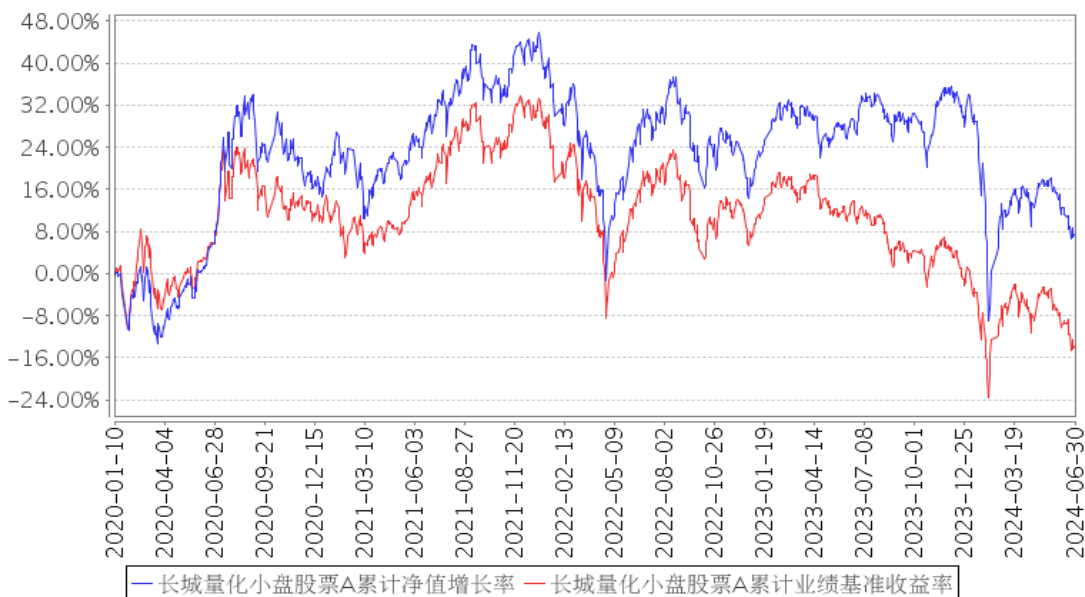
至今						
----	--	--	--	--	--	--

长城量化小盘股票 C

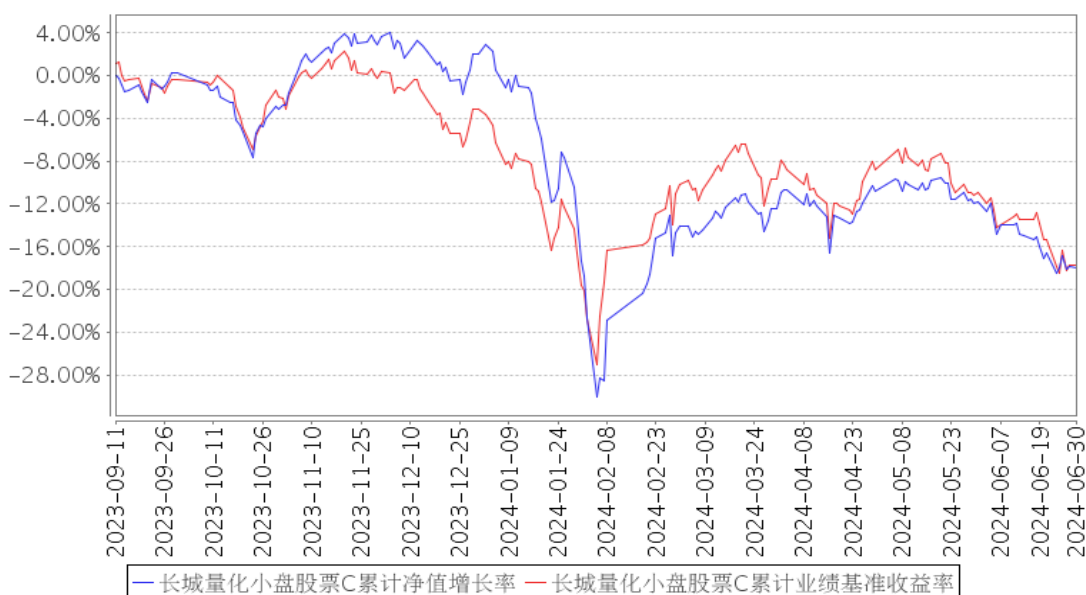
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-6.93%	1.03%	-7.73%	1.29%	0.80%	-0.26%
过去三个月	-6.27%	1.18%	-9.00%	1.34%	2.73%	-0.16%
过去六个月	-19.50%	1.96%	-15.10%	1.77%	-4.40%	0.19%
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	-17.92%	1.63%	-17.76%	1.49%	-0.16%	0.14%

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

长城量化小盘股票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



长城量化小盘股票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：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本基金基金合同生效日起六个月内，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（以下简称“公司”）成立于 2001 年 12 月 27 日，是经中国证监会批准设立的第十五家公募基金管理公司，由长城证券有限责任公司（现长城证券股份有限公司）、东方证券有限责任公司（现东方证券股份有限公司）、中原信托投资有限公司（现中原信托有限公司）、西北证券有限责任公司和天津北方国际信托投资公司（现北方国际信托股份有限公司）共同出资设立，初始注册资本为人民币壹亿元。

2007 年 5 月 21 日，经中国证监会批准，公司股权结构变更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%），该股权结构稳定不变至今。2007 年 10 月 12 日，经中国证监会批准，公司注册资本增至人民币壹亿伍仟万元。

公司具有基金管理资格证书、特定（定向）客户资产管理业务资格、受托管理保险资金业务

资格、合格境内机构投资者（QDII）资格、公募 REITs 业务资质等。截至 2024 年 6 月 30 日，公司旗下共管理 106 只开放式基金，产品线涵盖货币型、债券型、混合型、股票型、指数型、养老 FOF 以及 QDII 等各个类型，曾多次获得金牛奖、英华奖、明星基金奖等业内大奖。

#### 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、本基金的基金经理	2020 年 1 月 10 日	-	16 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兼基金经理。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 2022 年 6 月至 2023 年 9 月任“长城中证医药卫生指数增强型证券投资基金”基金经理，自 2021 年 4 月至 2023 年 7 月兼任专户投资经理。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 2023 年 12 月至今任“长城智盈添益债券型发起式证券投资基金”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。

#### 4.1.3 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：无。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守了《证券投资基金法》、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相关法律法规和公司制度的规定，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，并对基金经理兼任投资经理的组合执行更长周期的交易价差分析，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

上半年权益市场波动较大，债券市场相对表现更好。A 股主要指数有所分化，沪深 300 上涨，中证 500、中证 1000、创业板等小盘成长性指数下跌；风格方面，市场广度效应消失，基于确定性逻辑的“缩圈”行情下，微小市值个股流动性风险凸显，微观交易上出现了不同于过去三年的统计规律甚至是三倍标准差之外的现象，这些尾部风险极大影响了市场参与者的交易结构和交易行为，这对部分交易性数据产生因子为主的量化策略带来了较大负面贡献。风格上看，红利与价值类因子较为抗跌；二季度相比一季度随着个股波动逐渐降低，市场从尾部风险交易回归到常态化的市场参与结构，交易性数据产生的因子有效性逐渐回归。

报告期内，本基金主要通过深度学习等神经网络方法广泛挖掘市场有效因子，并充分利用人工智能等算法进行多因子组合；考虑“国九条”和退市新规影响微小市值个股流动性风险，模型在股票池的基础构建中优化了价值性的筛选因子，量化算法在因子挖掘中利用了不同风险下数据的学习提高因子稳健性；得益于市场交易结构恢复正常，人工智能算法因子表现有所回归。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末长城量化小盘股票 A 的基金份额净值为 1.0729 元，本报告期基金份额净值增长率为-19.24%，同期业绩比较基准收益率为-15.10%；截至本报告期末长城量化小盘股票 C 的基金份额净值为 1.0697 元，本报告期基金份额净值增长率为-19.50%，同期业绩比较基准收益率为-15.10%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年以来，由于经济修复长期不达预期，股票市场显著承压，叠加从年初开始，参与者结构显著波动情况，量化因子的表现明显偏弱；随着近期三中全会的成功召开，提纲挈领的规划了未来深化改革的方向和蓝图，预计下半年货币、财政等相关经济政策会逐步出台，用以应对当前的经济下行压力。

从各行业与指数估值来看，大多数都处于过去 5 年的底部区域，已经较大程度的反映了对于未来经济悲观的预期，大盘指数进一步下跌空间不大；另一方面，小盘股风险已经在逐渐出清，一旦全球宏观流动性与利率转向，小盘贝塔有可能出现成长弹性；从微观层面看下半年的市场交易结构预计会回归到常态化运行机制，量化多因子的表现有望回归到正常水平。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末未进行利润分配，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，本基金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，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

#### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

### § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

#### 6.1 资产负债表

会计主体：长城量化小盘股票型证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	5,011,354.58	59,195,347.28
结算备付金		1,259,193.26	6,002,826.88
存出保证金		209,022.45	1,011,991.08
交易性金融资产	6.4.7.2	166,278,385.75	459,481,254.11
其中：股票投资		157,040,613.86	446,483,120.43
基金投资		-	-
债券投资		9,237,771.89	12,998,133.68
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-

衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		30,438.91	11,560,289.16
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		172,788,394.95	537,251,708.51
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024年6月30日</b>	<b>上年度末 2023年12月31日</b>
<b>负 债：</b>			
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		-	-
应付清算款		-	26,249,822.14
应付赎回款		19,170.79	18,020,121.41
应付管理人报酬		177,218.26	483,086.87
应付托管费		29,536.37	80,514.47
应付销售服务费		2,037.03	101,527.96
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	224,129.73	424,628.77
负债合计		452,092.18	45,359,701.62
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	160,643,827.38	370,227,721.35
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	11,692,475.39	121,664,285.54
净资产合计		172,336,302.77	491,892,006.89
负债和净资产总计		172,788,394.95	537,251,708.51

注： 报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额总额 160,643,827.38 份，其中长城量化小盘股票 A 基金份额总额 157,274,952.15 份，基金份额净值 1.0729 元；长城量化小盘股票 C 基金份额总额 3,368,875.23 份，基金份额净值 1.0697 元。

## 6.2 利润表

会计主体：长城量化小盘股票型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		-102,173,330.41	15,757,783.93
1. 利息收入		46,727.73	23,527.56
其中：存款利息收入	6.4.7.13	46,727.73	23,527.56
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-98,255,690.95	7,865,119.77
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-100,723,893.54	6,180,471.55
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	142,495.61	77,258.90
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-576,243.12	-70,973.06
股利收益	6.4.7.19	2,901,950.10	1,678,362.38
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	-4,643,698.46	7,862,949.90
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	679,331.27	6,186.70
<b>减：二、营业总支出</b>		2,310,103.29	1,057,763.63
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,726,586.95	856,722.07
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	287,764.48	142,787.04
3. 销售服务费		205,905.40	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		4,791.10	610.90



其中：卖出回购金融资产支出		4,791.10	610.90
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	115.95
8. 其他费用	6.4.7.23	85,055.36	57,527.67
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-104,483,433.70	14,700,020.30
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-104,483,433.70	14,700,020.30
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-104,483,433.70	14,700,020.30

### 6.3 净资产变动表

会计主体：长城量化小盘股票型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	370,227,721.35	-	121,664,285.54	491,892,006.89
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	370,227,721.35	-	121,664,285.54	491,892,006.89
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-209,583,893.97	-	-109,971,810.15	-319,555,704.12
（一）、综合收益总额	-	-	-104,483,433.70	-104,483,433.70
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-209,583,893.97	-	-5,488,376.45	-215,072,270.42
其中：1. 基金申购款	209,825,183.89	-	38,308,123.44	248,133,307.33

2. 基金赎回款	-419,409,077.86	-	-43,796,499.89	-463,205,577.75
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	160,643,827.38	-	11,692,475.39	172,336,302.77
项目	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	71,511,988.32	-	12,179,494.46	83,691,482.78
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	71,511,988.32	-	12,179,494.46	83,691,482.78
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	86,875,873.32	-	39,024,712.59	125,900,585.91
(一)、综合收益总额	-	-	14,700,020.30	14,700,020.30
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	86,875,873.32	-	24,324,692.29	111,200,565.61
其中：1. 基金申购款	91,644,139.56	-	25,671,890.50	117,316,030.06
2. 基金赎回款	-4,768,266.24	-	-1,347,198.21	-6,115,464.45
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产	-	-	-	-

产减少以“-”号填列)				
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	158,387,861.64	-	51,204,207.05	209,592,068.69

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：

<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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

长城量化小盘股票型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2019]1417 号文“关于准予长城量化小盘股票型证券投资基金注册的批复”的核准，由长城基金管理有限公司自 2019 年 12 月 26 日至 2020 年 1 月 8 日向社会公开募集，募集期结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具安永华明（2020）验字第 60737541\_H01 号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2020 年 1 月 10 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。设立时募集的有效认购资金（本金）为人民币 2,190,584,099.95 元，在首次募集期间有效认购资金产生的利息为人民币 249,082.67 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 2,190,833,182.62 元，折合 2,190,833,182.62 份基金份额。本基金的基金管理人为长城基金管理有限公司，注册登记机构为长城基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司（以下简称“中国建设银行”）。

根据基金管理人长城基金管理有限公司于 2023 年 9 月 8 日发布的《关于长城量化小盘股票型证券投资基金增设基金份额并相应修改基金合同及托管协议的公告》及《长城量化小盘股票型证券投资基金基金合同》，本基金自 2023 年 9 月 11 日起增设 C 类基金份额，原基金份额转为 A 类基金份额。本基金根据申购费用、赎回费用、销售服务费用收取方式的不同将本基金基金份额分为不同的类别。在投资人申购时收取申购费用但不从本类别基金资产中计提销售服务费、赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额类别，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、赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额类别，称为 C 类基金份额。本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别设置基金代码，分别计算和公告基金

份额净值。

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）。

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。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：中证 1000 指数收益率×90%+活期存款利率×10%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《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〉》以及中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

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 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2024 年 1 月 1 日起至 2024 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

#### 6.4.4 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的说明

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

证券（股票）交易印花税税率为 1%，由出让方缴纳。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

### (2) 增值税及附加

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，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金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，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对证券投资基金在 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，已纳税额从证券投资基金的基

金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。增值税应税行为的销售额根据财政部、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》的规定确定。

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按 7%、3%和 2%的比例缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

### （3）企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，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、债券的差价收入，继续免征企业所得税。

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，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。

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。

### （4）个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，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。

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《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》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

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。

### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
活期存款	5,011,354.58
等于：本金	5,010,946.98
加：应计利息	407.60
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
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	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	5,011,354.58

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	166,342,188.33	-	157,040,613.86	-9,301,574.47	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	9,117,920.00	112,291.89	9,237,771.89	7,560.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	9,117,920.00	112,291.89	9,237,771.89	7,560.00
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	175,460,108.33	112,291.89	166,278,385.75	-9,294,014.47	

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

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。

#### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：无。

#### 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：无。

#### 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：无。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

##### 6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。
----

#### 6.4.7.5 债权投资

##### 6.4.7.5.1 债权投资情况

注：无。

##### 6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：无。

#### 6.4.7.6 其他债权投资

##### 6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：无。

##### 6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：无。

#### 6.4.7.7 其他权益工具投资

##### 6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：无。

##### 6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：无。

#### 6.4.7.8 其他资产

注：无。



### 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	29.79
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	139,564.58
其中：交易所市场	139,564.58
银行间市场	-
应付利息	-
预提审计费	24,863.02
预提信息披露费	59,672.34
合计	224,129.73

### 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

#### 长城量化小盘股票 A

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	223,508,602.02	223,508,602.02
本期申购	121,837,038.91	121,837,038.91
本期赎回（以“-”号填列）	-188,070,688.78	-188,070,688.78
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	157,274,952.15	157,274,952.15

#### 长城量化小盘股票 C

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	146,719,119.33	146,719,119.33
本期申购	87,988,144.98	87,988,144.98
本期赎回（以“-”号填列）	-231,338,389.08	-231,338,389.08
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	3,368,875.23	3,368,875.23

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。

### 6.4.7.11 其他综合收益

注：无。

### 6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

长城量化小盘股票 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	112,471,666.67	-39,047,836.13	73,423,830.54
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	112,471,666.67	-39,047,836.13	73,423,830.54
本期利润	-71,377,716.10	5,562,755.16	-65,814,960.94
本期基金份额交易产生的变动数	-16,304,328.52	20,152,982.58	3,848,654.06
其中：基金申购款	50,072,642.36	-29,731,095.40	20,341,546.96
基金赎回款	-66,376,970.88	49,884,077.98	-16,492,892.90
本期已分配利润	-	-	-
本期末	24,789,622.05	-13,332,098.39	11,457,523.66

长城量化小盘股票 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	73,790,020.00	-25,549,565.00	48,240,455.00
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	73,790,020.00	-25,549,565.00	48,240,455.00
本期利润	-28,462,019.14	-10,206,453.62	-38,668,472.76
本期基金份额交易产生的变动数	-44,809,002.73	35,471,972.22	-9,337,030.51
其中：基金申购款	36,823,865.17	-18,857,288.69	17,966,576.48
基金赎回款	-81,632,867.90	54,329,260.91	-27,303,606.99
本期已分配利润	-	-	-
本期末	518,998.13	-284,046.40	234,951.73

### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
活期存款利息收入	28,572.06
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	16,531.25
其他	1,624.42
合计	46,727.73

### 6.4.7.14 股票投资收益

#### 6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-100,723,893.54
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-100,723,893.54

#### 6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出股票成交总额	963,068,997.19
减：卖出股票成本总额	1,062,771,736.21
减：交易费用	1,021,154.52
买卖股票差价收入	-100,723,893.54

#### 6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

### 6.4.7.15 债券投资收益

#### 6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
债券投资收益——利息收入	124,274.61
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	18,221.00
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	142,495.61

#### 6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	24,031,695.49
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成	23,726,799.00

本总额	
减：应计利息总额	286,675.49
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	18,221.00

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：无。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：无。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：无。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：无。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	-576,243.12

#### 6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	2,901,950.10
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	2,901,950.10

#### 6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-4,423,006.15
股票投资	-4,427,427.15
债券投资	4,421.00
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-220,692.31
权证投资	-
期货投资	-220,692.31
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	0.00
合计	-4,643,698.46

#### 6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	679,331.27
合计	679,331.27

#### 6.4.7.22 信用减值损失

注：无。

#### 6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
----	---------------------------------------

审计费用	24,863.02
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行费用	520.00
合计	85,055.36

#### 6.4.7.24 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（“长城基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“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”）	基金管理人的股东、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 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023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 (%)
长城证券	663,032,340.05	38.10	595,711,168.76	100.00

#### 6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023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 (%)
长城证券	24,858,854.00	71.26	6,652,071.71	100.00

#### 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 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)
长城证券	44,900,000.00	81.05	16,200,000.00	100.00

#### 6.4.10.1.4 权证交易

注：无。

#### 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 2024年1月1日至2024年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
长城证券	163,031.26	38.09	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
长城证券	137,773.61	100.00	91,361.20	100.00

注：(1) 上述佣金费率由本基金的基金管理人在正常业务范围内按一般商业条款与对方签订的席

位租用协议进行约定，并扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费及证券结算风险基金后的净额列示，其中债券、回购及权证交易不计佣金。

(2) 该类席位租用协议服务范围还包括佣金收取方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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,726,586.95	856,722.07
其中：应支付销售机构的客户维护费	354,122.12	267,909.94
应支付基金管理人的净管理费	1,372,464.83	588,812.13

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

$$H = E \times \text{管理费费率} \div \text{当年天数}$$

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

(2) 自 2023 年 8 月 21 日起，本基金的管理费费率由 1.50%/年调整为 1.20%/年。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	287,764.48	142,787.04

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

$$H = E \times \text{托管费费率} \div \text{当年天数}$$

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

(2) 自 2023 年 8 月 21 日起，本基金的托管费费率由 0.25%/年调整为 0.20%/年。

#### 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	本期



方名称	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	长城量化小盘股票 A	长城量化小盘股票 C	合计
长城基金管理有限公司	-	85,625.80	85,625.80
合计	-	85,625.80	85,625.80
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	长城量化小盘股票 A	长城量化小盘股票 C	合计
合计	-	-	-

注：基金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 类基金份额销售服务费按前一日基金资产净值的 0.60% 年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times \text{该类基金份额的年销售服务费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日该类基金份额应计提的基金销售服务费

E 为前一日该类基金份额的基金资产净值

#### 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：无。

#### 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：无。

##### 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：无。

#### 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自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
		长城量化小盘股票 A
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	10,426,485.92	-
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	10,426,485.92	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	6.4904%	-
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 -
	长城量化小盘股票 A	长城量化小盘股票 C
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	10,426,485.92	-
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	10,426,485.92	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	6.5829%	-

#### 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 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
中国建设银行	5,011,354.58	28,572.06	11,691,801.13	10,760.91

注: 本基金的活期银行存款由基金托管人中国建设银行保管, 按银行同业利率计息。

#### 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: 无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金于本期未进行利润分配。

本基金于资产负债表日后、本财务报表批准报出日之前的利润分配情况，请参阅本财务报表

6.4.8.2 资产负债表日后事项。

6.4.12 期末（2024 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	受限期	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
001387	雪祺电气	2024 年 1 月 4 日	6 个月	新股锁定	15.38	15.25	133	2,045.54	2,028.25	-
001387	雪祺电气	2024 年 6 月 3 日	1 个月	新股锁定-送股	-	15.25	40	-	610.00	-
001389	广合科技	2024 年 3 月 26 日	6 个月	新股锁定	17.43	34.56	222	3,869.46	7,672.32	-
301536	星辰科技	2024 年 3 月 20 日	6 个月	新股锁定	16.16	32.27	481	7,772.96	15,521.87	-
301580	爱迪特	2024 年 6 月 19 日	6 个月	新股锁定	44.95	65.93	113	5,079.35	7,450.09	-
301591	肯特股份	2024 年 2 月 20 日	6 个月	新股锁定	19.43	36.98	219	4,255.17	8,098.62	-
603285	键邦股份	2024 年 6 月 28 日	1-6 个月(含)	新股未上市	18.65	18.65	869	16,206.85	16,206.85	-

603312	西典新能	2024年1月4日	6个月	新股锁定	29.02	25.36	130	3,772.60	3,296.80	-
603350	安乃达	2024年6月26日	1-6个月(含)	新股未上市	20.56	20.56	882	18,133.92	18,133.92	-
688691	灿芯股份	2024年4月2日	6个月	新股锁定	19.86	42.51	247	4,905.42	10,499.97	-
688692	达梦数据	2024年6月4日	6个月	新股锁定	86.96	174.93	67	5,826.32	11,720.31	-
688695	中创股份	2024年3月6日	6个月	新股锁定	22.43	31.55	186	4,171.98	5,868.30	-

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 06 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为人民币 0.00 元，无质押债券。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 06 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为人民币 0.00 元，无质押债券。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：无。

#### 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%。

本公司在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在基金管理人制定的银行可投资名单内的已进行充分内部研究的信用等级较高的商业银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。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“期末本基金持有的流通受限证券”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“期末债券正回购交易中作为抵押的债券”中列示的卖出

回购金融资产款余额（如有）将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

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

下表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合同约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 2024 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
<b>资产</b>							
货币资金	5,011,354.58	-	-	-	-	-	5,011,354.58
结算备付金	1,259,193.26	-	-	-	-	-	1,259,193.26
存出保证金	209,022.45	-	-	-	-	-	209,022.45
交易性金融资产	-	-	9,237,771.89	-	-	157,040,613.86	166,278,385.75
应收申购款	-	-	-	-	-	30,438.91	30,438.91
资产总计	6,479,570.29	-	9,237,771.89	-	-	157,071,052.77	172,788,394.95
<b>负债</b>							
应付赎回款	-	-	-	-	-	19,170.79	19,170.79
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	177,218.26	177,218.26
应付托管费	-	-	-	-	-	29,536.37	29,536.37
应付销售服务费	-	-	-	-	-	2,037.03	2,037.03
其他负债	-	-	-	-	-	224,129.73	224,129.73
负债总计	-	-	-	-	-	452,092.18	452,092.18
利率敏感度缺口	6,479,570.29	-	9,237,771.89	-	-	-	-

上年度末 2023 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							
货币资金	59,195,347.28	-	-	-	-	-	59,195,347.28
结算备付金	6,002,826.88	-	-	-	-	-	6,002,826.88
存出保证金	1,011,991.08	-	-	-	-	-	1,011,991.08
交易性金融资产	9,073,808.47	-3,924,325.21	-	-	-	-446,483,120.43	459,481,254.11
应收申购款	-	-	-	-	-	11,560,289.16	11,560,289.16
资产总计	75,283,973.71	-3,924,325.21	-	-	-	-458,043,409.59	537,251,708.51
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	18,020,121.41	18,020,121.41
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	483,086.87	483,086.87
应付托管费	-	-	-	-	-	80,514.47	80,514.47
应付清算款	-	-	-	-	-	26,249,822.14	26,249,822.14
应付销售服务费	-	-	-	-	-	101,527.96	101,527.96
其他负债	-	-	-	-	-	424,628.77	424,628.77
负债总计	-	-	-	-	-	45,359,701.62	45,359,701.62
利率敏感度缺口	75,283,973.71	-3,924,325.21	-	-	-		

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
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（2024 年 6 月 30 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	市场利率下降 25 个基点	10,215.32	8,769.50
	市场利率上升 25 个基点	-10,190.92	-8,738.99

#### 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。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

注：无。

#### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

注：无。

#### 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市场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证券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

本基金投资组合的资产配置为：本基金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。

本基金于本期末及上年度末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 2024年6月30日		上年度末 2023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	157,040,613.86	91.12	446,483,120.43	90.77
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	9,237,771.89	5.36	12,998,133.68	2.64
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	166,278,385.75	96.48	459,481,254.11	93.41

##### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）



	动	本期末 (2024 年 6 月 30 日)	上年度末 (2023 年 12 月 31 日)
	沪深 300 指数上升 5%		8,629,381.73
沪深 300 指数下降 5%		-8,629,381.73	-15,274,187.55

注：本基金管理人运用定量分析方法对本基金的其他价格风险进行分析。上表为其他价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。正数表示可能增加基金资产净值，负数表示可能减少基金资产净值。

#### 6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

注：无。

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：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：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	156,933,506.56	446,165,670.95
第二层次	9,272,112.66	12,998,133.68
第三层次	72,766.53	317,449.48
合计	166,278,385.75	459,481,254.11

###### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金调整公允价值计量层次转换时点的相关会计政策在前后各会计期间保持一致。

对于公开市场交易的证券等投资，若出现交易不活跃、非公开发行等情况，本基金不会于

交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

无。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

注：无。

## § 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	157,040,613.86	90.89
	其中：股票	157,040,613.86	90.89
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	9,237,771.89	5.35
	其中：债券	9,237,771.89	5.35
	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	6,270,547.84	3.63
8	其他各项资产	239,461.36	0.14
9	合计	172,788,394.95	100.00

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 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 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	1,385,568.00	0.80
B	采矿业	1,980,531.86	1.15
C	制造业	94,514,759.24	54.84

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	14,587,588.92	8.46
E	建筑业	216.60	0.00
F	批发和零售业	4,489,418.00	2.61
G	交通运输、仓储和邮政业	13,591,118.99	7.89
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	72,695.59	0.04
J	金融业	14,139,087.92	8.20
K	房地产业	304,428.00	0.18
L	租赁和商务服务业	2,057,077.60	1.19
M	科学研究和技术服务业	1,571,384.46	0.91
N	水利、环境和公共设施管理业	5,163,337.68	3.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	252.00	0.00
R	文化、体育和娱乐业	3,183,149.00	1.85
S	综合	-	-
	合计	157,040,613.86	91.12

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：无。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600483	福能股份	180,050	2,099,383.00	1.22
2	600323	瀚蓝环境	96,400	2,014,760.00	1.17
3	002807	江阴银行	520,100	1,960,777.00	1.14
4	300294	博雅生物	59,100	1,950,300.00	1.13
5	600908	无锡银行	365,906	1,946,619.92	1.13
6	603323	苏农银行	402,400	1,935,544.00	1.12
7	002839	张家港行	472,520	1,899,530.40	1.10
8	002948	青岛银行	556,380	1,875,000.60	1.09
9	600717	天津港	438,800	1,873,676.00	1.09
10	002332	仙琚制药	163,400	1,864,394.00	1.08
11	000685	中山公用	258,200	1,861,622.00	1.08
12	688575	亚辉龙	79,263	1,848,413.16	1.07
13	600420	国药现代	172,700	1,844,436.00	1.07
14	600688	上海石化	702,500	1,833,525.00	1.06
15	002773	康弘药业	84,400	1,827,260.00	1.06
16	601019	山东出版	154,200	1,822,644.00	1.06
17	601200	上海环境	213,600	1,815,600.00	1.05

18	002100	天康生物	260,000	1,801,800.00	1.05
19	600452	涪陵电力	142,200	1,801,674.00	1.05
20	601101	昊华能源	191,370	1,758,690.30	1.02
21	002171	楚江新材	266,200	1,754,258.00	1.02
22	000828	东莞控股	193,900	1,747,039.00	1.01
23	603889	新澳股份	225,200	1,743,048.00	1.01
24	600458	时代新材	172,000	1,737,200.00	1.01
25	002567	唐人神	323,300	1,732,888.00	1.01
26	601860	紫金银行	692,200	1,730,500.00	1.00
27	000028	国药一致	53,400	1,721,082.00	1.00
28	600587	新华医疗	108,260	1,704,012.40	0.99
29	000550	江铃汽车	78,400	1,702,064.00	0.99
30	600548	深高速	159,826	1,698,950.38	0.99
31	605333	沪光股份	60,800	1,693,280.00	0.98
32	002053	云南能投	139,400	1,685,346.00	0.98
33	600368	五洲交通	471,525	1,683,344.25	0.98
34	603053	成都燃气	171,900	1,660,554.00	0.96
35	000900	现代投资	449,200	1,644,072.00	0.95
36	300673	佩蒂股份	125,200	1,642,624.00	0.95
37	600694	大商股份	97,600	1,640,656.00	0.95
38	002083	孚日股份	387,800	1,640,394.00	0.95
39	603277	银都股份	54,600	1,640,184.00	0.95
40	600035	楚天高速	382,200	1,639,638.00	0.95
41	601686	友发集团	325,500	1,637,265.00	0.95
42	603699	纽威股份	95,400	1,633,248.00	0.95
43	000544	中原环保	207,100	1,629,877.00	0.95
44	002469	三维化学	285,500	1,627,350.00	0.94
45	300181	佐力药业	107,400	1,623,888.00	0.94
46	600033	福建高速	484,000	1,621,400.00	0.94
47	002014	永新股份	171,000	1,621,080.00	0.94
48	603855	华荣股份	73,000	1,614,030.00	0.94
49	603043	广州酒家	100,700	1,608,179.00	0.93
50	000919	金陵药业	255,400	1,598,804.00	0.93
51	600488	津药药业	460,600	1,579,858.00	0.92
52	603515	欧普照明	91,000	1,577,940.00	0.92
53	600300	维维股份	655,780	1,573,872.00	0.91
54	688578	艾力斯	24,600	1,568,004.00	0.91
55	300384	三联虹普	119,336	1,565,688.32	0.91
56	688625	呈和科技	42,635	1,550,208.60	0.90
57	603408	建霖家居	117,300	1,547,187.00	0.90
58	002818	富森美	126,100	1,545,986.00	0.90
59	600609	金杯汽车	442,000	1,533,740.00	0.89
60	605016	百龙创园	75,148	1,530,764.76	0.89

61	600477	杭萧钢构	656,400	1,529,412.00	0.89
62	600120	浙江东方	457,700	1,528,718.00	0.89
63	600305	恒顺醋业	205,328	1,484,521.44	0.86
64	300298	三诺生物	58,400	1,479,856.00	0.86
65	000921	海信家电	45,900	1,479,816.00	0.86
66	002035	华帝股份	235,700	1,468,411.00	0.85
67	000429	粤高速 A	140,700	1,464,687.00	0.85
68	600618	氯碱化工	165,000	1,448,700.00	0.84
69	600461	洪城环境	125,067	1,448,275.86	0.84
70	600894	广日股份	123,500	1,420,250.00	0.82
71	300761	立华股份	61,200	1,385,568.00	0.80
72	002540	亚太科技	261,580	1,383,758.20	0.80
73	002489	浙江永强	574,000	1,360,380.00	0.79
74	300109	新开源	117,250	1,357,755.00	0.79
75	002043	兔宝宝	130,700	1,355,359.00	0.79
76	603299	苏盐井神	142,200	1,350,900.00	0.78
77	601827	三峰环境	156,800	1,331,232.00	0.77
78	603693	江苏新能	108,980	1,266,347.60	0.73
79	688087	英科再生	48,483	1,254,740.04	0.73
80	605183	确成股份	81,000	1,252,260.00	0.73
81	000030	富奥股份	253,500	1,244,685.00	0.72
82	300218	安利股份	81,300	1,226,004.00	0.71
83	000686	东北证券	219,300	1,223,694.00	0.71
84	603050	科林电气	50,100	1,215,426.00	0.71
85	000012	南玻 A	235,400	1,186,416.00	0.69
86	600635	大众公用	421,000	1,128,280.00	0.65
87	000026	飞亚达	128,000	1,127,680.00	0.65
88	002545	东方铁塔	164,800	1,122,288.00	0.65
89	002034	旺能环境	82,200	1,069,422.00	0.62
90	003006	百亚股份	44,800	1,061,760.00	0.62
91	600993	马应龙	38,000	1,013,460.00	0.59
92	002543	万和电气	99,000	986,040.00	0.57
93	002106	莱宝高科	83,200	906,880.00	0.53
94	600779	水井坊	22,900	861,727.00	0.50
95	600757	长江传媒	105,700	851,942.00	0.49
96	603583	捷昌驱动	30,100	613,438.00	0.36
97	300573	兴齐眼药	3,700	606,800.00	0.35
98	600057	厦门象屿	75,100	510,680.00	0.30
99	601811	新华文轩	36,300	508,563.00	0.30
100	002984	森麒麟	20,300	489,027.00	0.28
101	688510	航亚科技	25,412	467,834.92	0.27
102	002393	力生制药	26,480	418,648.80	0.24
103	603689	皖天然气	49,900	410,178.00	0.24

104	002550	千红制药	75,200	405,328.00	0.24
105	002533	金杯电工	40,200	399,990.00	0.23
106	002498	汉缆股份	120,300	395,787.00	0.23
107	002048	宁波华翔	29,500	381,730.00	0.22
108	300453	三鑫医疗	47,300	302,247.00	0.18
109	605222	起帆电缆	19,600	300,664.00	0.17
110	002978	安宁股份	7,800	217,308.00	0.13
111	000690	宝新能源	41,000	209,100.00	0.12
112	605007	五洲特纸	15,100	190,713.00	0.11
113	000902	新洋丰	16,000	189,920.00	0.11
114	600575	淮河能源	48,200	187,498.00	0.11
115	002895	川恒股份	9,800	179,438.00	0.10
116	002016	世荣兆业	29,100	179,256.00	0.10
117	000848	承德露露	22,800	179,208.00	0.10
118	603008	喜临门	10,300	178,499.00	0.10
119	605009	豪悦护理	4,300	169,592.00	0.10
120	300911	亿田智能	6,600	167,904.00	0.10
121	002833	弘亚数控	9,100	165,984.00	0.10
122	603878	武进不锈	24,100	157,614.00	0.09
123	300320	海达股份	19,100	155,856.00	0.09
124	002884	凌霄泵业	7,700	147,840.00	0.09
125	600007	中国国贸	5,700	125,172.00	0.07
126	600997	开滦股份	7,300	50,078.00	0.03
127	601528	瑞丰银行	8,200	38,704.00	0.02
128	600269	赣粤高速	5,700	29,469.00	0.02
129	688301	奕瑞科技	172	19,819.56	0.01
130	603350	安乃达	882	18,133.92	0.01
131	603285	键邦股份	869	16,206.85	0.01
132	301536	星辰科技	481	15,521.87	0.01
133	688188	柏楚电子	84	15,502.20	0.01
134	688018	乐鑫科技	126	12,433.68	0.01
135	688692	达梦数据	67	11,720.31	0.01
136	688691	灿芯股份	247	10,499.97	0.01
137	688050	爱博医疗	135	9,898.20	0.01
138	301591	肯特股份	219	8,098.62	0.00
139	001389	广合科技	222	7,672.32	0.00
140	301580	爱迪特	113	7,450.09	0.00
141	688017	绿的谐波	90	7,389.00	0.00
142	688366	昊海生科	97	5,982.96	0.00
143	688695	中创股份	186	5,868.30	0.00
144	688776	国光电气	105	5,817.00	0.00
145	688123	聚辰股份	95	5,778.85	0.00
146	688356	键凯科技	92	5,407.76	0.00

147	688019	安集科技	39	4,906.20	0.00
148	688686	奥普特	76	4,866.28	0.00
149	688099	晶晨股份	77	4,567.64	0.00
150	688399	硕世生物	67	4,530.54	0.00
151	688300	联瑞新材	93	4,473.30	0.00
152	688777	中控技术	106	3,996.20	0.00
153	688059	华锐精密	85	3,857.30	0.00
154	300751	迈为股份	32	3,823.36	0.00
155	688693	锆威特	100	3,592.00	0.00
156	688202	美迪西	137	3,568.85	0.00
157	688799	华纳药厂	81	3,436.83	0.00
158	688778	厦钨新能	106	3,311.44	0.00
159	603312	西典新能	130	3,296.80	0.00
160	688617	惠泰医疗	7	3,192.70	0.00
161	688160	步科股份	77	3,079.23	0.00
162	001387	雪祺电气	173	2,638.25	0.00
163	688559	海目星	80	2,631.20	0.00
164	603979	金诚信	52	2,627.56	0.00
165	301529	福赛科技	79	2,591.99	0.00
166	002422	科伦药业	84	2,547.72	0.00
167	300855	图南股份	95	2,511.80	0.00
168	688195	腾景科技	98	2,401.98	0.00
169	688668	鼎通科技	59	2,318.11	0.00
170	300893	松原股份	80	2,285.60	0.00
171	301251	威尔高	63	2,169.09	0.00
172	688636	智明达	95	2,166.00	0.00
173	688663	新风光	88	2,047.76	0.00
174	688700	东威科技	77	2,018.17	0.00
175	688519	南亚新材	78	1,994.46	0.00
176	688002	睿创微纳	71	1,985.87	0.00
177	688511	天微电子	90	1,959.30	0.00
178	688303	大全能源	95	1,937.05	0.00
179	688122	西部超导	49	1,877.68	0.00
180	688508	芯朋微	49	1,782.13	0.00
181	300765	新诺威	70	1,766.10	0.00
182	688233	神工股份	91	1,753.57	0.00
183	688789	宏华数科	16	1,724.80	0.00
184	688768	容知日新	71	1,662.11	0.00
185	301067	显盈科技	80	1,576.80	0.00
186	688166	博瑞医药	40	1,400.00	0.00
187	688529	豪森智能	97	1,303.68	0.00
188	688330	宏力达	63	1,284.57	0.00
189	603327	福蓉科技	99	1,276.11	0.00

190	688065	凯赛生物	28	1,270.92	0.00
191	688007	光峰科技	78	1,255.80	0.00
192	688095	福昕软件	26	1,191.06	0.00
193	688689	银河微电	54	1,146.42	0.00
194	300031	宝通科技	78	1,120.86	0.00
195	603319	湘油泵	69	1,103.31	0.00
196	605180	华生科技	91	1,078.35	0.00
197	603033	三维股份	90	1,053.00	0.00
198	603788	宁波高发	84	1,031.52	0.00
199	688683	莱尔科技	63	1,008.63	0.00
200	002983	芯瑞达	60	999.00	0.00
201	603386	骏亚科技	80	998.40	0.00
202	688733	壹石通	66	986.70	0.00
203	688335	复洁环保	119	969.85	0.00
204	688358	祥生医疗	37	960.89	0.00
205	688516	奥特维	22	919.82	0.00
206	603037	凯众股份	70	909.30	0.00
207	688310	迈得医疗	69	906.66	0.00
208	688557	兰剑智能	39	904.02	0.00
209	300480	光力科技	56	886.48	0.00
210	688670	金迪克	74	871.72	0.00
211	688357	建龙微纳	37	862.10	0.00
212	688665	四方光电	31	859.94	0.00
213	603203	快克智能	36	848.88	0.00
214	688021	奥福环保	92	846.40	0.00
215	300901	中胤时尚	99	834.57	0.00
216	605368	蓝天燃气	60	818.40	0.00
217	688101	三达膜	70	796.60	0.00
218	300836	佰奥智能	20	795.80	0.00
219	601918	新集能源	80	780.00	0.00
220	688118	普元信息	54	779.22	0.00
221	002923	润都股份	84	777.84	0.00
222	688178	万德斯	75	773.25	0.00
223	601020	华钰矿业	60	768.00	0.00
224	688067	爱威科技	53	760.55	0.00
225	688389	普门科技	46	747.96	0.00
226	688528	秦川物联	93	743.07	0.00
227	688621	阳光诺和	17	725.90	0.00
228	002039	黔源电力	40	704.00	0.00
229	688655	迅捷兴	66	693.00	0.00
230	688558	国盛智科	37	683.76	0.00
231	688038	中科通达	71	675.92	0.00
232	688006	杭可科技	38	663.10	0.00



233	603967	中创物流	70	651.00	0.00
234	003041	真爱美家	52	634.92	0.00
235	688800	瑞可达	22	617.76	0.00
236	688388	嘉元科技	62	604.50	0.00
237	688135	利扬芯片	35	560.70	0.00
238	002802	洪汇新材	63	559.44	0.00
239	688121	卓然股份	45	540.90	0.00
240	688057	金达莱	55	539.55	0.00
241	688616	西力科技	47	532.98	0.00
242	688078	龙软科技	23	529.69	0.00
243	688367	工大高科	43	524.60	0.00
244	001206	依依股份	40	520.80	0.00
245	688518	联赢激光	31	517.70	0.00
246	300789	唐源电气	39	516.36	0.00
247	688312	燕麦科技	21	509.25	0.00
248	688077	大地熊	32	506.56	0.00
249	300932	三友联众	52	500.76	0.00
250	688023	安恒信息	12	480.12	0.00
251	688385	复旦微电	15	470.70	0.00
252	301533	威马农机	18	462.42	0.00
253	600874	创业环保	82	458.38	0.00
254	688133	泰坦科技	29	457.62	0.00
255	603291	联合水务	36	441.36	0.00
256	605399	晨光新材	40	430.00	0.00
257	688707	振华新材	43	418.82	0.00
258	300864	南大环境	21	411.60	0.00
259	002068	黑猫股份	57	404.70	0.00
260	688379	华光新材	29	397.59	0.00
261	688550	瑞联新材	17	394.23	0.00
262	688696	极米科技	5	386.20	0.00
263	688718	唯赛勃	45	384.75	0.00
264	603565	中谷物流	44	384.56	0.00
265	301507	民生健康	30	378.60	0.00
266	688092	爱科科技	17	362.95	0.00
267	603636	南威软件	47	361.90	0.00
268	002233	塔牌集团	49	358.19	0.00
269	600123	兰花科创	40	358.00	0.00
270	300629	新劲刚	20	353.20	0.00
271	688517	金冠电气	25	349.50	0.00
272	300507	苏奥传感	60	345.00	0.00
273	603599	广信股份	28	339.64	0.00
274	603798	康普顿	40	336.80	0.00
275	300180	华峰超纤	94	331.82	0.00

276	002911	佛燃能源	34	310.76	0.00
277	601919	中远海控	20	309.80	0.00
278	688098	申联生物	73	304.41	0.00
279	605066	天正电气	50	278.50	0.00
280	300385	雪浪环境	80	269.60	0.00
281	002887	绿茵生态	40	260.40	0.00
282	300244	迪安诊断	21	252.00	0.00
283	300639	凯普生物	50	230.00	0.00
284	603980	吉华集团	60	224.40	0.00
285	300806	斯迪克	20	224.00	0.00
286	300188	国投智能	20	222.20	0.00
287	603316	诚邦股份	60	216.60	0.00
288	688369	致远互联	13	204.49	0.00
289	300644	南京聚隆	10	203.80	0.00
290	688600	皖仪科技	14	187.18	0.00
291	688701	卓锦股份	32	172.48	0.00
292	300605	恒锋信息	19	172.14	0.00
293	000931	中关村	48	169.44	0.00
294	603088	宁波精达	22	165.66	0.00
295	688005	容百科技	7	162.96	0.00
296	000597	东北制药	42	162.54	0.00
297	688199	久日新材	12	160.80	0.00
298	002258	利尔化学	20	160.40	0.00
299	601279	英利汽车	43	160.39	0.00
300	002110	三钢闽光	50	147.50	0.00
301	688569	铁科轨道	7	144.69	0.00
302	605580	恒盛能源	16	142.56	0.00
303	603150	万朗磁塑	5	125.20	0.00
304	688096	京源环保	23	116.15	0.00
305	688315	诺禾致源	10	109.20	0.00
306	002066	瑞泰科技	11	87.45	0.00
307	688313	仕佳光子	9	85.68	0.00
308	600590	泰豪科技	20	76.20	0.00
309	688066	航天宏图	4	71.20	0.00
310	605388	均瑶健康	11	60.28	0.00
311	300973	立高食品	2	56.18	0.00
312	688266	泽璟制药	1	54.22	0.00
313	000901	航天科技	6	52.56	0.00
314	688565	力源科技	7	32.83	0.00
315	688722	同益中	2	22.38	0.00
316	603045	福达合金	2	19.86	0.00
317	002084	海鸥住工	8	19.60	0.00
318	002394	联发股份	3	18.48	0.00

319	688033	天宜上佳	3	18.00	0.00
320	002570	贝因美	5	11.70	0.00
321	688425	铁建重工	2	7.36	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	300294	博雅生物	8,510,077.00	1.73
2	002436	兴森科技	7,311,413.00	1.49
3	600064	南京高科	7,067,799.60	1.44
4	600552	凯盛科技	7,067,280.00	1.44
5	600667	太极实业	6,901,989.00	1.40
6	600100	同方股份	6,750,422.00	1.37
7	300180	华峰超纤	6,669,156.64	1.36
8	688019	安集科技	6,274,780.39	1.28
9	002332	仙琚制药	6,038,792.00	1.23
10	300075	数字政通	6,035,548.40	1.23
11	300260	新莱应材	5,953,833.00	1.21
12	000582	北部湾港	5,928,908.00	1.21
13	603002	宏昌电子	5,912,753.00	1.20
14	600548	深高速	5,859,138.82	1.19
15	300745	欣锐科技	5,851,455.00	1.19
16	002014	永新股份	5,832,059.00	1.19
17	603039	泛微网络	5,809,836.00	1.18
18	688358	祥生医疗	5,773,799.45	1.17
19	603636	南威软件	5,635,592.72	1.15
20	300442	润泽科技	5,566,930.00	1.13

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	000090	天健集团	8,572,154.00	1.74
2	603033	三维股份	7,885,659.96	1.60
3	600693	东百集团	7,565,560.00	1.54
4	600064	南京高科	6,988,726.00	1.42
5	002664	信质集团	6,917,884.00	1.41
6	601918	新集能源	6,807,343.00	1.38
7	603530	神马电力	6,717,516.00	1.37
8	000686	东北证券	6,526,565.00	1.33
9	600552	凯盛科技	6,401,896.00	1.30

10	600667	太极实业	6,376,790.00	1.30
11	002039	黔源电力	6,354,735.00	1.29
12	002436	兴森科技	6,337,788.00	1.29
13	600100	同方股份	6,303,409.00	1.28
14	002923	润都股份	6,080,572.80	1.24
15	000582	北部湾港	6,043,885.00	1.23
16	688019	安集科技	6,039,347.57	1.23
17	600266	城建发展	6,022,414.00	1.22
18	000811	冰轮环境	6,020,541.00	1.22
19	300294	博雅生物	5,968,280.00	1.21
20	002997	瑞鹄模具	5,939,351.00	1.21

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	777,756,656.79
卖出股票收入（成交）总额	963,068,997.19

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	9,237,771.89	5.36
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	9,237,771.89	5.36

### 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	019727	23 国债 24	49,000	4,990,603.01	2.90
2	019733	24 国债 02	42,000	4,247,168.88	2.46

### 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：无。

## 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：无。

## 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：无。

## 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

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

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

无。

## 7.12 投资组合报告附注

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

本报告期本基金投资的前十名证券除青岛银行和无锡农村商业银行发行主体外，其他证券的发行主体未出现被监管部门立案调查、或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

根据国家金融监督管理总局青岛监管局公布的行政处罚信息公开表：

青岛银行股份有限公司（简称青岛银行）因个人经营性贷款“三查”不严导致贷款资金被挪用、信用卡中心违规经营案由，于 2023 年 12 月 28 日被国家金融监督管理总局青岛监管局处以罚款。

青岛银行股份有限公司（简称青岛银行）因监管标准化（EAST）数据错报漏报案由，于 2024 年 1 月 2 日被国家金融监督管理总局青岛监管局处以罚款。

根据国家金融监督管理总局无锡监管分局公布的行政处罚信息公开表：

无锡农村商业银行股份有限公司（简称无锡农村商业银行）因票据业务经营不审慎案由，于 2023 年 9 月 15 日被国家金融监督管理总局无锡监管分局处以罚款。

以上发行主体涉及证券的投资已执行内部严格的投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

### 7.12.2 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。

### 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	209,022.45
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	30,438.91
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	239,461.36

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：无。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：无。

### 7.12.6 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。

## § 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 (%)
长城量化小盘股票 A	4,879	32,235.08	90,739,057.13	57.69	66,535,895.02	42.31
长城量化小盘股票 C	1,017	3,312.56	304,924.53	9.05	3,063,950.70	90.95
合计	5,896	27,246.24	91,043,981.66	56.67	69,599,845.72	43.33

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	长城量化小盘股票 A	343,271.05	0.2183
	长城量化小盘股票 C	87.65	0.0026
	合计	343,358.70	0.2137

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	长城量化小盘股票 A	10~50
	长城量化小盘股票 C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	长城量化小盘股票 A	10~50
	长城量化小盘股票 C	0
	合计	10~50

注：同时为基金管理人高级管理人员和基金经理的，分别计算在内。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	长城量化小盘股票 A	长城量化小盘股票 C
基金合同生效日 (2020年1月10日) 基金份额总额	2,190,833,182.62	-
本报告期期初基金份额总额	223,508,602.02	146,719,119.33
本报告期基金总申购份额	121,837,038.91	87,988,144.98
减：本报告期基金总赎回份额	188,070,688.78	231,338,389.08
本报告期基金拆分变	-	-

动份额		
本报告期末基金份 额总额	157,274,952.15	3,368,875.23

## § 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：  
本报告期内基金管理人无重大人事变动。

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。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本基金本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略无改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，本基金管理人及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，本基金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 (%)	
招商证券	4	1,077,343,53	61.90	264,932.45	61.91	-



股份有限 公司		3.14				
长城证券	6	663,032,340. 05	38.10	163,031.26	38.09	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
财通证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
东莞证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
国投证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
宏信证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华福证券	2	-	-	-	-	-
华金证券	2	-	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	2	-	-	-	-	-
华鑫证券	1	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
联讯证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
山西证券	2	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
首创证券	2	-	-	-	-	-
太平洋证 券	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
万和证券	2	-	-	-	-	-
万联证券	2	-	-	-	-	-
五矿证券	2	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-

兴业证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
粤开证券	2	-	-	-	-	-
中金财富	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	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 2 个专用交易单元（招商证券），减少 2 个专用交易单元（中信建投），截止本报告期末共计 84 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
- (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 (%)
招商证 券股份 有限公	10,026,104. 00	28.74	10,500,000.0 0	18.95	-	-

司						
长城证 券	24,858,854. 00	71.26	44,900,000.0 0	81.05	-	-
渤海证 券	-	-	-	-	-	-
财通证 券	-	-	-	-	-	-
长江证 券	-	-	-	-	-	-
东北证 券	-	-	-	-	-	-
东方证 券	-	-	-	-	-	-
东吴证 券	-	-	-	-	-	-
东兴证 券	-	-	-	-	-	-
东莞证 券	-	-	-	-	-	-
方正证 券	-	-	-	-	-	-
广发证 券	-	-	-	-	-	-
国金证 券	-	-	-	-	-	-
国泰君 安	-	-	-	-	-	-
国投证 券	-	-	-	-	-	-
国信证 券	-	-	-	-	-	-
国元证 券	-	-	-	-	-	-
海通证 券	-	-	-	-	-	-
宏信证 券	-	-	-	-	-	-
华创证 券	-	-	-	-	-	-
华福证 券	-	-	-	-	-	-
华金证 券	-	-	-	-	-	-
华融证	-	-	-	-	-	-

券						
华泰证 券	-	-	-	-	-	-
华西证 券	-	-	-	-	-	-
华鑫证 券	-	-	-	-	-	-
江海证 券	-	-	-	-	-	-
联讯证 券	-	-	-	-	-	-
民生证 券	-	-	-	-	-	-
平安证 券	-	-	-	-	-	-
山西证 券	-	-	-	-	-	-
上海证 券	-	-	-	-	-	-
申万宏 源	-	-	-	-	-	-
首创证 券	-	-	-	-	-	-
太平洋 证券	-	-	-	-	-	-
天风证 券	-	-	-	-	-	-
万和证 券	-	-	-	-	-	-
万联证 券	-	-	-	-	-	-
五矿证 券	-	-	-	-	-	-
西部证 券	-	-	-	-	-	-
西南证 券	-	-	-	-	-	-
兴业证 券	-	-	-	-	-	-
银河证 券	-	-	-	-	-	-
粤开证 券	-	-	-	-	-	-
中金财	-	-	-	-	-	-

富						
中金公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-

### 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终止北京增财基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 1 月 19 日
2	长城基金管理有限公司关于关闭网上直销交易平台开户、认申购、转换、赎回及新开定投业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 3 月 2 日
3	长城基金管理有限公司关于旗下基金开展电子直销系统费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 4 月 26 日
4	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	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 5 月 7 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20240314-20240630	-	47,586,370.99	-	47,586,370.99	29.6223

#### 产品特有风险

如投资者进行大额赎回，可能存在以下的特有风险：

#### 1、流动性风险

本基金在短时间内可能无法变现足够的资产来应对大额赎回，基金仓位调整困难，从而可能会面临一定的流动性风险；

#### 2、延期支付赎回款项及暂停赎回风险

若持有基金份额比例达到或超过 20%的单一投资者大额赎回引发了巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定决定部分延期支付赎回款项；如果连续 2 个开放日以上（含本数）发生巨

额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请，对剩余投资者的赎回办理造成影响；

### 3、基金净值波动风险

大额赎回会导致管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的需要，可能使基金资产净值受到不利影响；另一方面，由于基金净值估值四舍五入法或赎回费收入归基金资产的影响，大额赎回可能导致基金净值出现较大波动；

### 4、投资受限风险

大额赎回后若基金资产规模过小，可能导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略；

### 5、基金合同终止或转型风险

大额赎回可能会导致基金资产规模过小，不能满足存续的条件，根据基金合同的约定，将面临合同终止财产清算或转型风险。

## 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- (一) 中国证监会准予长城量化小盘股票型证券投资基金注册的文件
- (二) 《长城量化小盘股票型证券投资基金基金合同》
- (三) 《长城量化小盘股票型证券投资基金托管协议》
- (四) 法律意见书
- (五) 基金管理人业务资格批件、营业执照
- (六) 基金托管人业务资格批件、营业执照
- (七) 中国证监会规定的其他文件

### 12.2 存放地点

基金管理人及基金托管人住所

### 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：0755-29279188

客户服务电话：400-8868-666

网站：www.ccfund.com.cn

长城基金管理有限公司

2024 年 8 月 31 日