

长城量化小盘股票型证券投资基金 2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 日

基金管理人：长城基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2024 年 3 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 03 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。

本报告期自 2023 年 01 月 01 日起至 2023 年 12 月 31 日止。

为了更好地为投资者提供理财服务，经与本基金基金托管人中国建设银行股份有限公司协商一致，并报中国证监会备案，本基金管理人自 2023 年 9 月 11 日起为本基金增设 C 类基金份额。同时，本基金管理人对基金合同进行了相应的修改，修改的具体内容详见本基金管理人于 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》。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	7
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	9
3.3 过去三年基金的利润分配情况	11
§ 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	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	14
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	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	16
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	16
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	17
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	18
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明	18
4.10 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	18
§ 5 托管人报告	18
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	18
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	18
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	18
§ 6 审计报告	18
6.1 审计报告基本信息	18
6.2 审计报告的基本内容	18
§ 7 年度财务报表	20
7.1 资产负债表	20
7.2 利润表	21
7.3 净资产变动表	23
7.4 报表附注	25

§ 8 投资组合报告	59
8.1 期末基金资产组合情况	59
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	59
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	60
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	68
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	80
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	80
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	80
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	80
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	80
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	80
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	80
8.12 投资组合报告附注	81
§ 9 基金份额持有人信息	82
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	82
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	82
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	82
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况	83
§ 10 开放式基金份额变动	83
§ 11 重大事件揭示	83
11.1 基金份额持有人大会决议	83
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	83
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	84
11.4 基金投资策略的改变	84
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	84
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	84
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	84
11.8 其他重大事件	89
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	89
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	89
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	89
§ 13 备查文件目录	89
13.1 备查文件目录	89
13.2 存放地点	90
13.3 查阅方式	90

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	长城量化小盘股票型证券投资基金	
基金简称	长城量化小盘股票	
基金主代码	007903	
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	370,227,721.35 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	223,508,602.02 份	146,719,119.33 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	田国立

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.ccfund.com.cn
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	中国北京市东城区东长安街1号东方广场经贸城安永大楼（即东三办公楼）17层
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、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间 数据和指标	2023 年	2023 年 9 月 11 日(基金合同生 效日)-2023 年 12 月 31 日	2022 年		2021 年	
	长城量化小盘股 票 A	长城量化小盘股 票 C	长城量化小盘股 票 A	长 城 量 化 小	长 城 量 化 小	长 城 量 化 小

				盘 股 票 C		盘 股 票 C
本期已实现收益	8,399,709.62	2,396,583.52	-20,745,574.43	-	32,300,865.69	-
本期利润	14,566,929.16	-1,285,253.83	-36,575,755.82	-	46,238,187.42	-
加权平均基金份额本期利润	0.0983	-0.0198	-0.4290	-	0.2959	-
本期加权平均净值利润率	7.57%	-1.49%	-34.07%	-	23.15%	-
本期基金份额净值增长率	13.52%	1.96%	-19.68%	-	24.43%	-
3.1.2 期末数据和指标	2023 年末		2022 年末		2021 年末	
期末可供分配利润	73,423,830.54	48,240,455.00	12,179,494.46	-	50,522,421.16	-
期末可供分配基金份额利润	0.3285	0.3288	0.1703	-	0.4570	-
期末基金资产净值	296,932,432.56	194,959,574.33	83,691,482.78	-	161,081,982.88	-
期末基金份额净值	1.3285	1.3288	1.1703	-	1.4570	-
3.1.3 累计期末指标	2023 年末		2022 年末		2021 年末	
基金份额累计净值增长率	32.85%	1.96%	17.03%	-	45.70%	-

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。

④本基金自 2023 年 9 月 11 日起增设 C 类基金份额。

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

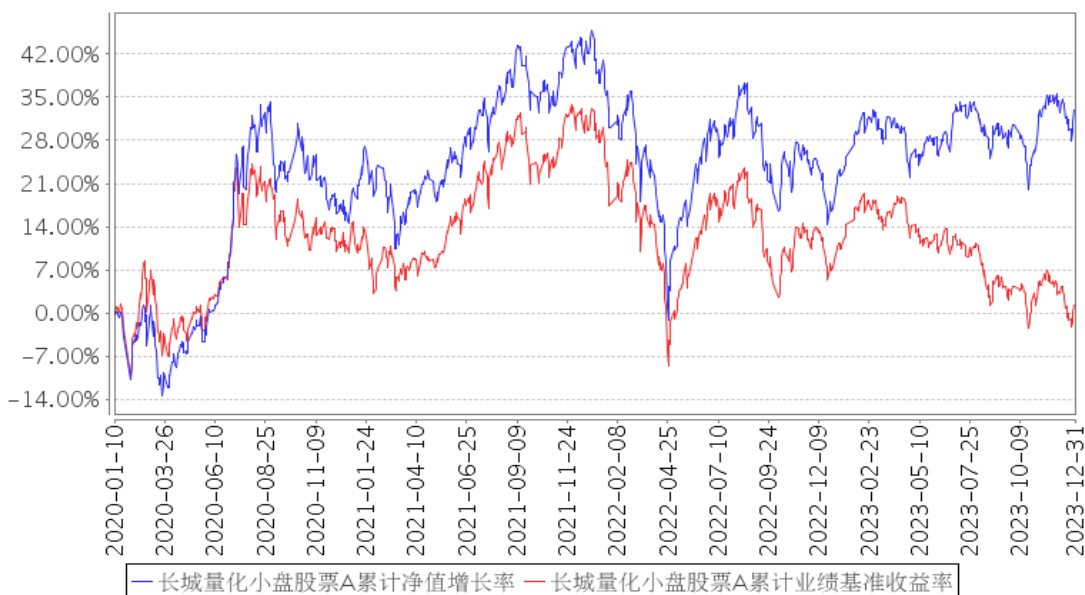
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.83%	0.94%	-2.81%	0.93%	4.64%	0.01%
过去六个月	0.39%	0.88%	-9.73%	0.90%	10.12%	-0.02%
过去一年	13.52%	0.87%	-5.54%	0.85%	19.06%	0.02%
过去三年	13.46%	1.19%	-9.76%	1.15%	23.22%	0.04%
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	32.85%	1.29%	1.37%	1.26%	31.48%	0.03%

长城量化小盘股票 C

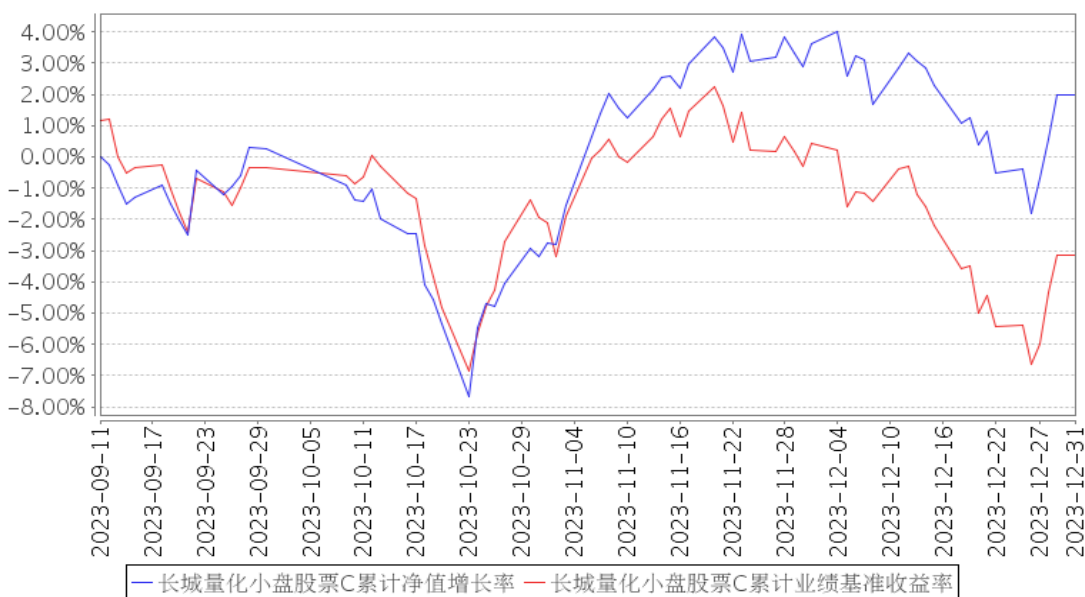
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.69%	0.94%	-2.81%	0.93%	4.50%	0.01%
过去六个月	-	-	-	-	-	-
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	1.96%	0.91%	-3.14%	0.90%	5.10%	0.01%

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

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



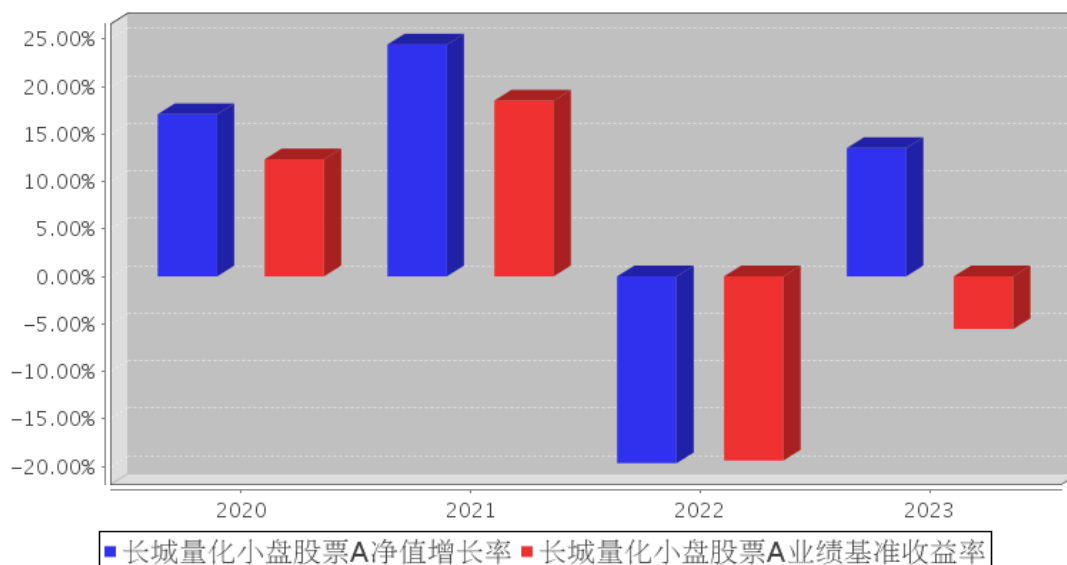
注：①本基金合同规定本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的 80%-95%，其中，投资于本基金界定的小盘股票的比例不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计不低于基金资产净值的 5%，本基金所指的现金范围不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等资金类别。

②本基金的建仓期为自基金合同生效之日起六个月内，建仓期满时，各项资产配置比例符合基金合同约定。

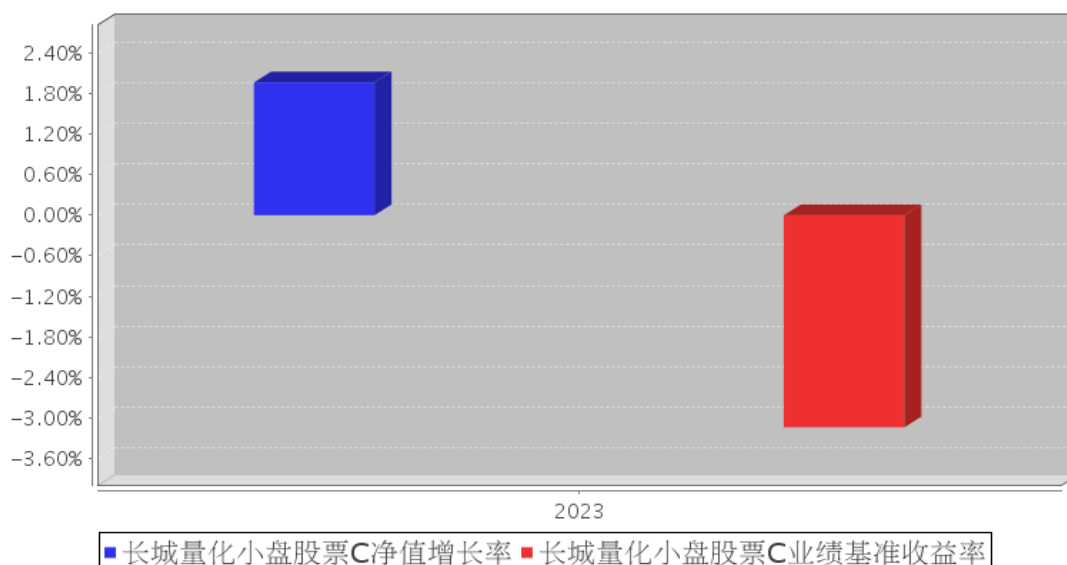
③本基金自 2023 年 9 月 11 日起增设 C 类基金份额。

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

长城量化小盘股票A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



长城量化小盘股票C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金过去三年未发生过利润分配的情况。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

长城基金管理有限公司是经中国证监会批准设立的第 15 家基金管理公司，由长城证券股份有

限公司（40%）、东方证券股份有限公司（15%）、西北证券有限责任公司（15%）、北方国际信托股份有限公司（15%）、中原信托有限公司（15%）于 2001 年 12 月 27 日共同出资设立，当时注册资本为壹亿元人民币。2007 年 5 月 21 日，经中国证监会批准，公司完成股权结构调整，现有股东为长城证券股份有限公司（47.059%）、东方证券股份有限公司（17.647%）、北方国际信托股份有限公司（17.647%）和中原信托有限公司（17.647%）。2007 年 10 月 12 日，经中国证监会批准，将注册资本增加至壹亿伍仟万元人民币。公司经营范围是基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其他业务。截至本报告期末，公司管理的基金有：长城久恒灵活配置混合型证券投资基金、长城久泰沪深 300 指数证券投资基金、长城货币市场证券投资基金、长城消费增值混合型证券投资基金、长城安心回报混合型证券投资基金、长城久富核心成长混合型证券投资基金（LOF）、长城品牌优选混合型证券投资基金、长城稳健增利债券型证券投资基金、长城双动力混合型证券投资基金、长城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、长城悦享增利债券型证券投资基金、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、长城中债 5-10 年国开行债券指数证券投资基金、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、长城竞争优势六个月持有期混合型证券投资基金、长城优选添利一年持有期混合型证券投资基金、长城科创板两年定期开放混合型证券投资基金、长城兴华优选一年定期开放混合型证券投资基金、长城健康消费混合型证券投资基金、长城恒利纯债债券型证券投资基金、长城大健康混合型证券投资基金、长城价值领航混合型证券投资基金、长城信利一年定期开放债券型发起式证券投资基金、长城新能源股票型发起式证券投资基金、长城优选招益一年持有期混合型证券投资基金、长城价值甄选一年持有期混合型证券投资基金、长城中证医药卫生指数增强型证券投资基金、长城瑞利纯债债券型证券投资基金、长城产业成长混合型证券投资基金、长城产业趋势混合型证券投资基金、长城远见成长混合型证券投资基金、长城聚利纯债债券型证券投资基金、长城中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、长城永利债券型证券投资基金、长城数字经济混合型证券投资基金、长城鑫利 30 天滚动持有中短债债券型证券投资基金、长城产业臻选混合型证券投资基金、长城鼎利一年定期开放债券型发起式证券投资基金、长城全球新能源汽车股票型发起式证券投资基金 (QDII-LOF)、长城创新成长混合型证券投资基金、长城锦利三个月定期开放债券型证券投资基金、长城裕利纯债债券型发起式证券投资基金、长城景气成长混合型证券投资基金、长城集利债券型发起式证券投资基金、长城国企优选混合型发起式证券投资基金、长城精选进取 3 个月持有期混合型发起式基金中基金 (FOF)、长城均衡成长混合型证券投资基金、长城智盈添益债券型发起式证券投资基金。

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、本基金的基金经理	2020 年 1 月 10 日	-	15 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

					<p>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。</p>
--	--	--	--	--	---

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 公平交易制度和控制方法

根据相关法律法规的规定，本基金管理人制定并实施了《长城基金管理有限公司公平交易管理制度》。

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格执行了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。

4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

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，同一组合经理管理的多个投资组合的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同一组合经理管理的多个投资组合的同日反向交易，对同向交易的价差进行强化的监测和事后分析，对不同时间窗的（同日、3日内、5日内、7日内、9日内、11日内、13日内）同向交易和临近交易日的反向交易价差进行监控分析，并结成交顺序、价格偏差、产品规模、成交量等因素对是否存在不公平对待的情形进行分析，定期出具公平交易稽核报告。本报告期报告认为，本基金管理人旗下同一组合经理管理的多个投资组合的同向交易价差均在合理范围内，结果符合相关政策法规和公司制度的规定。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2023 年 A 股市场总体较弱，多数大型宽基指数表现不佳。受预期波动影响，蓝筹指数沪深 300 在年初快速反弹后持续下跌，全年下跌超 10%，弱势下中证 1000 等小市值指数相对较好。风格来看，小微市值、红利、价值、低波动因子表现突出，成长性指数跌幅较大；与之对应的低估值行业表现较好，银行、煤炭、电力等传统行业获得资金持续关注，以人工智能为主要投资标签的 TMT 产业链上下半年波动巨大，难有稳定赚钱效应，消费类行业受经济修复预期影响资金流出。资金面看，外资在年初快速流入后持续流出，全年北向资金流动对市场扰动较大，影响了交易情绪。

报告期内，市场以存量博弈为主，缺乏持续的增量资金，在少部分缺乏基本面支撑的个股上资金比较聚集，基本面因子动能不够，使得增强指数的超额收益因子较往年变化巨大。报告期内组合对于中小市值股票加大了价量因子的研究权重，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，寻找对股票收益有预测性的指标作为因子；组合主体充分利用了量化因子的预测能力，在行业和风格上尽可能的最大化收益为目标，虽然阶段性波动较大，但总体上看，风格上利用了低估值、低波动、小市值因子超额收益更好的优势，获得了显著的超额收益回报。

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 基金份额净值为 1.3285 元，本报告期基金份额净值增长率为 13.52%，同期业绩比较基准收益率为-5.54%；

截至本报告期末长城量化小盘股票 C 基金份额净值为 1.3288 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.96%，同期业绩比较基准收益率为-3.14%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

市场未来的波动主要从估值、盈利、流动性三方面考虑。估值面总体估值仍然处在过去十年中枢以下位置，下行风险预计较小，从大类资产比较的角度，权益市场已经进入价值区间；盈利的角度看，宏观经济复苏偏弱带来的问题已经充分反映在股价上，进一步的利空事件较为有限，当前的政策环境积极正面，预计降息会大幅降低居民与企业的负债成本，但微观层面个股的盈利修复扭转仍然需要一些时间；流动性部分受全球地缘政治博弈和信心影响较大，不排除少数时点存在尾部交易风险，但这部分变量更多来自于对未来预期判断，无法线性外推，辩证来看一旦风险释放也将对市场形成较好的底部支撑。

从上市公司个体角度层面，市场可能会关注盈利稳定性强的个股；更加成熟的市场环境的建立对于各个风险因子风险定价将更为充分，传统因子挖掘超额收益的难度将会继续增大，但深度学习与人工智能等新的复杂算法对于中小市值选股因子仍有较大的潜力空间，有利于在均衡行业配置的基础上在抓住阶段性的价差投资机会。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

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

存在的问题及改进意见，督促各部门及时进行了整改，防范和化解了业务风险。

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

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

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无。

4.10 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 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2024）审字第 70015735_H32 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	长城量化小盘股票型证券投资基金全体基金份额持有人：
审计意见	我们审计了长城量化小盘股票型证券投资基金财务报表，包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表，2023 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的长城量化小盘股票型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公

	允反映了长城量化小盘股票型证券投资基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于长城量化小盘股票型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	不适用
其他事项	不适用
其他信息	长城量化小盘股票型证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。
管理层和治理层对财务报表的责任	管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。在编制财务报表时，管理层负责评估长城量化小盘股票型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。治理层负责监督长城量化小盘股票型证券投资基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。（2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。（3）评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。（4）对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结

	论。同时，根据获取的审计证据，就可能对导致对长城量化小盘股票型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致长城量化小盘股票型证券投资基金不能持续经营。（5）评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	吴翠蓉	黄拥璇
会计师事务所的地址	中国 北京	
审计报告日期	2024 年 3 月 27 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：长城量化小盘股票型证券投资基金

报告截止日：2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	7.4.7.1	59,195,347.28	5,662,454.48
结算备付金		6,002,826.88	2,565,514.69
存出保证金		1,011,991.08	466,060.18
交易性金融资产	7.4.7.2	459,481,254.11	75,290,168.49
其中：股票投资		446,483,120.43	75,290,168.49
基金投资		-	-
债券投资		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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-

其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		11,560,289.16	4,360.80
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	-
资产总计		537,251,708.51	83,988,558.64
负债和净资产	附注号	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		26,249,822.14	-
应付赎回款		18,020,121.41	672.81
应付管理人报酬		483,086.87	110,303.12
应付托管费		80,514.47	18,383.84
应付销售服务费		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	7.4.7.9	424,628.77	167,716.09
负债合计		45,359,701.62	297,075.86
净资产：			
实收基金	7.4.7.10	370,227,721.35	71,511,988.32
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	121,664,285.54	12,179,494.46
净资产合计		491,892,006.89	83,691,482.78
负债和净资产总计		537,251,708.51	83,988,558.64

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额总额 370,227,721.35 份，其中长城量化小盘股票 A 基金份额总额 223,508,602.02 份，基金份额净值 1.3285 元；长城量化小盘股票 C 基金份额总额 146,719,119.33 份，基金份额净值 1.3288 元。

7.2 利润表

会计主体：长城量化小盘股票型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023年1月1日至2023 年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022 年12月31日
----	-----	---------------------------------	--------------------------------------

一、营业总收入		16,928,262.69	-34,571,953.55
1. 利息收入		68,213.79	72,231.85
其中：存款利息收入	7.4.7.13	68,213.79	72,231.85
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）		13,946,793.26	-18,863,739.14
其中：股票投资收益	7.4.7.14	11,369,742.47	-17,885,832.91
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	516,252.73	93,096.64
资产支持证券投资	7.4.7.16	-	-
收益		-	-
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-210,748.21	-1,923,995.17
股利收益	7.4.7.19	2,271,546.27	852,992.30
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）	7.4.7.20	2,485,382.19	-15,830,556.22
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.21	427,873.45	50,109.96
减：二、营业总支出		3,646,587.36	2,003,802.27
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	2,856,220.12	1,618,732.98
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	476,036.72	269,788.83
3. 销售服务费		151,160.70	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		7,345.37	-
其中：卖出回购金融资产支出		7,345.37	-
6. 信用减值损失	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		189.45	-374.54
8. 其他费用	7.4.7.23	155,635.00	115,655.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		13,281,675.33	-36,575,755.82
减：所得税费用		-	-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		13,281,675.33	-36,575,755.82
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		13,281,675.33	-36,575,755.82

7.3 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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 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）	298,715,733.03	-	109,484,791.08	408,200,524.11
（一）、综合收益总额	-	-	13,281,675.33	13,281,675.33
（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）	298,715,733.03	-	96,203,115.75	394,918,848.78
其中：1. 基金申购款	431,099,057.91	-	135,795,646.53	566,894,704.44
2. 基金赎回款	-132,383,324.88	-	-39,592,530.78	-171,975,855.66
（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	370,227,721.35	-	121,664,285.54	491,892,006.89
项目	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31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	110,559,561.72	-	50,522,421.16	161,081,982.88
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	110,559,561.72	-	50,522,421.16	161,081,982.88
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-39,047,573.40	-	-38,342,926.70	-77,390,500.10
(一)、综合收益总额	-	-	-36,575,755.82	-36,575,755.82
(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)	-39,047,573.40	-	-1,767,170.88	-40,814,744.28
其中：1. 基金申购款	8,713,242.94	-	2,445,766.27	11,159,009.21
2. 基金赎回款	-47,760,816.34	-	-4,212,937.15	-51,973,753.49
(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	71,511,988.32	-	12,179,494.46	83,691,482.78

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

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

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%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《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 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》以及中国证监会和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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

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

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特

征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

(2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益。

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益。

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益。

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况。

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即

可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息。

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产。

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额。

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

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

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

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

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

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占净资产比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

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

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法计算的利息扣除在适用情况下的相关税费后的净额确认利息收入，计入当期损益。处置时，其处置价格扣除相关交易费用后的净额与账面价值之间的差额确认为投资收益。

(2) 对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用直接计入投资收益。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产为债权投资的，在持有期间将按票面或合同利率计算的利息收入扣除在适用情况下的相关税费后的净额计入投资收益，扣除该部分利息后的公允价值变动额计入公允价值变动损益；除上述之外的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债的公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失扣除在适用情况下预估的增值税费后的净额计入公允价值变动损益。处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益。

本基金在同时符合下列条件时确认股利收入并计入当期损益：1) 基金收取股利的权利已经确立；2) 与股利相关的经济利益很可能流入企业；3) 股利的金额能够可靠计量。

(3) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

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

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

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

(4) 本基金各类基金份额在费用收取上不同，其对应的可供分配利润可能有所不同。本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

(5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币金额。

外币货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

7.4.4.13 分部报告

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) 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) 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。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无需要说明的其他重要的会计政策和会计估计事项。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无需要说明的重大会计差错更正。

7.4.6 税项

(1) 印花税

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、地方政府债券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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
活期存款	59,195,347.28	5,662,454.48
等于：本金	59,191,352.96	5,661,816.21
加：应计利息	3,994.32	638.27
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	59,195,347.28	5,662,454.48
----	---------------	--------------

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2023年12月31日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		451,357,267.75	-	446,483,120.43	-4,874,147.32
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	12,804,781.00	190,213.68	12,998,133.68	3,139.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	12,804,781.00	190,213.68	12,998,133.68	3,139.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		464,162,048.75	190,213.68	459,481,254.11	-4,871,008.32
项目		上年度末 2022年12月31日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		82,273,146.69	-	75,290,168.49	-6,982,978.20
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		82,273,146.69	-	75,290,168.49	-6,982,978.20

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31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	5,667,307.69	-	-	-
其中：股指期货投资	5,667,307.69	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	5,667,307.69	-	-	-
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 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	2,650,000.00	-	-	-
其中：股指期货投资	2,650,000.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	2,650,000.00	-	-	-

注：衍生金融资产项下的股指期货投资期末合同/名义金额为初始合约价值。

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IM2401	中证1000股指期货	5.00	5,888,000.00	220,692.31
合计				220,692.31
减：可抵销期货暂收款				220,692.31
净额				-

注：（1）衍生金融资产项下的股指期货投资净额为 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。

（2）买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：无。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：无。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

7.4.7.5 债权投资

7.4.7.5.1 债权投资情况

注：无。

7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：无。

7.4.7.6 其他债权投资

7.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：无。

7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：无。

7.4.7.7 其他权益工具投资

7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：无。

7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：无。

7.4.7.8 其他资产

注：无。

7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	7,540.20	1.20

应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	262,088.57	52,714.89
其中：交易所市场	262,088.57	52,714.89
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提审计费	35,000.00	35,000.00
预提信息披露费	120,000.00	80,000.00
合计	424,628.77	167,716.09

7.4.7.10 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	
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	71,511,988.32	71,511,988.32
本期申购	254,466,521.17	254,466,521.17
本期赎回（以“-”号填列）	-102,469,907.47	-102,469,907.47
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	223,508,602.02	223,508,602.02

长城量化小盘股票 C

项目	本期	
	2023 年 9 月 11 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	-	-
本期申购	176,632,536.74	176,632,536.74
本期赎回（以“-”号填列）	-29,913,417.41	-29,913,417.41
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	146,719,119.33	146,719,119.33

注：（1）本基金申购包含红利再投及基金转入的份额及金额；赎回包含基金转出的份额及金额。

（2）本基金于 2023 年 9 月 11 日起，增加长城量化小盘股票型证券投资基金 C 类基金份额类别，原基金份额转为 A 类基金份额。

7.4.7.11 其他综合收益

注：无。

7.4.7.12 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	30,424,331.78	-18,244,837.32	12,179,494.46
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	30,424,331.78	-18,244,837.32	12,179,494.46
本期利润	8,399,709.62	6,167,219.54	14,566,929.16
本期基金份额交易产生的变动数	73,647,625.27	-26,970,218.35	46,677,406.92
其中：基金申购款	123,913,603.62	-46,644,864.54	77,268,739.08
基金赎回款	-50,265,978.35	19,674,646.19	-30,591,332.16
本期已分配利润	-	-	-
本期末	112,471,666.67	-39,047,836.13	73,423,830.54

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	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	2,396,583.52	-3,681,837.35	-1,285,253.83
本期基金份额交易产生的变动数	71,393,436.48	-21,867,727.65	49,525,708.83
其中：基金申购款	86,561,305.18	-28,034,397.73	58,526,907.45
基金赎回款	-15,167,868.70	6,166,670.08	-9,001,198.62
本期已分配利润	-	-	-
本期末	73,790,020.00	-25,549,565.00	48,240,455.00

7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
活期存款利息收入	37,718.46	17,625.53
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	29,628.04	54,104.87
其他	867.29	501.45
合计	68,213.79	72,231.85

7.4.7.14 股票投资收益

7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	11,369,742.47	-17,885,832.91
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	11,369,742.47	-17,885,832.91

7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
卖出股票成交总额	1,033,890,535.18	593,745,138.96
减：卖出股票成本总额	1,021,045,674.33	610,671,881.44
减：交易费用	1,475,118.38	959,090.43
买卖股票差价收入	11,369,742.47	-17,885,832.91

7.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

7.4.7.15 债券投资收益

7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
债券投资收益——利息收入	111,794.81	46,535.36
债券投资收益——买卖债券（债转股及债	404,457.92	46,561.28

券到期兑付) 差价收入		
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	516,252.73	93,096.64

7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,771,386.63	7,045,349.98
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,358,380.00	6,845,927.86
减：应计利息总额	8,498.16	152,844.12
减：交易费用	50.55	16.72
买卖债券差价收入	404,457.92	46,561.28

7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

7.4.7.16 资产支持证券投资收益

7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：无。

7.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：无。

7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：无。

7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：无。

7.4.7.17 贵金属投资收益

7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：无。

7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

7.4.7.18 衍生工具收益

7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：无。

7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月 31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12 月31日
股指期货投资收益	-210,748.21	-1,923,995.17

7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月 31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月 31日
股票投资产生的股利收益	2,271,546.27	852,992.30
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	2,271,546.27	852,992.30

7.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年1月1日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022 年12月31日
1. 交易性金融资产	2,111,969.88	-15,573,719.72
股票投资	2,108,830.88	-15,585,227.28

债券投资	3,139.00	11,507.56
资产支持证券投资	-	-
基金投资	-	-
贵金属投资	-	-
其他	-	-
2. 衍生工具	373,412.31	-259,960.00
权证投资	-	-
期货投资	373,412.31	-259,960.00
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	-3,123.50
合计	2,485,382.19	-15,830,556.22

7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
基金赎回费收入	427,873.45	50,109.96
合计	427,873.45	50,109.96

7.4.7.22 信用减值损失

注：无。

7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
审计费用	35,000.00	35,000.00
信息披露费	120,000.00	80,000.00
证券出借违约金	-	-
银行费用	635.00	655.00
合计	155,635.00	115,655.00

7.4.7.24 分部报告

截至本报告期末，本基金仅在中国大陆境内从事证券投资单一业务，因此，无需作披露的分部报告。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准日，本基金无需作披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

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

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31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	2,421,280,292.58	100.00	1,156,229,150.01	100.00

7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31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	14,566,597.63	100.00	419,587.18	100.00

7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31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	75,581,000.00	100.00	-	-

7.4.10.1.4 权证交易

注：无。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
长城证券	580,541.78	100.00	262,088.57	100.00
关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
长城证券	267,436.06	100.00	52,714.89	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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12 月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 12月31日
	当期发生的基金应支付的管理费	2,856,220.12
其中：应支付销售机构的客户维护 费	715,055.43	548,457.08
应支付基金管理人的净管理费	2,141,164.69	1,070,275.90

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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	476,036.72	269,788.83

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。

7.4.10.2.3 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		
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 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	-	65,695.72	65,695.72
合计	-	65,695.72	65,695.72
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 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 类基金份额的销售服务费年费率为 0.6%。销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.6% 年费率计提。计算公式如下：

$$H = E \times 0.6\% \div \text{当年天数}$$

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

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

7.4.10.4.1 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。

7.4.10.4.2 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。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	本期 2023 年 9 月 11 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
	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	2.8162%	-
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 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	14.5801%	-

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

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

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31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	59,195,347.28	37,718.46	5,662,454.48	17,625.53

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 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

7.4.8.2 资产负债表日后事项。

7.4.12 期末（2023年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	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
001239	永达	2023年12	6个月	新股锁定	12.05	19.92	189	2,277.45	3,764.88	-

	股份	月4日								
001306	夏厦精密	2023年11月9日	6个月	新股锁定	53.63	75.36	52	2,788.76	3,918.72	-
001358	兴欣新材	2023年12月14日	6个月	新股锁定	41.00	44.16	87	3,567.00	3,841.92	-
001378	德冠新材	2023年10月23日	6个月	新股锁定	31.68	31.27	162	5,132.16	5,065.74	-
301202	朗威股份	2023年6月28日	6个月	新股锁定	25.82	31.80	165	4,260.30	5,247.00	-
301251	威尔高	2023年8月30日	6个月	新股锁定	28.88	34.59	263	7,595.44	9,097.17	-
301272	英华特	2023年7月6日	6个月	新股锁定	51.39	53.38	108	5,550.12	5,765.04	-
301292	海科新源	2023年6月29日	6个月	新股锁定	19.99	19.35	319	6,376.81	6,172.65	-
301418	协昌科技	2023年8月10日	6个月	新股锁定	51.88	50.20	114	5,914.32	5,722.80	-
301421	波长光电	2023年8月16日	6个月	新股锁定	29.38	59.37	264	7,756.32	15,673.68	-
301456	盘古智能	2023年7月6日	6个月	新股锁定	37.96	30.39	152	5,769.92	4,619.28	-
301500	飞南资源	2023年9月13日	6个月	新股锁定	23.97	20.89	304	7,286.88	6,350.56	-

301507	民生健康	2023年8月24日	6个月	新股锁定	10.00	15.85	630	6,300.00	9,985.50	-
301508	中机认检	2023年11月23日	6个月	新股锁定	16.82	26.68	374	6,290.68	9,978.32	-
301510	固高科技	2023年8月4日	6个月	新股锁定	12.00	35.01	396	4,752.00	13,863.96	-
301516	中远通	2023年12月1日	6个月	新股锁定	6.87	15.51	604	4,149.48	9,368.04	-
301517	陕西华达	2023年10月9日	6个月	新股锁定	26.87	43.69	180	4,836.60	7,864.20	-
301520	万邦医药	2023年9月18日	6个月	新股锁定	67.88	52.74	106	7,195.28	5,590.44	-
301526	国际复材	2023年12月19日	6个月	新股锁定	2.66	4.45	6,653	17,696.98	29,605.85	-
301529	福赛科技	2023年8月31日	6个月	新股锁定	36.60	37.88	179	6,551.40	6,780.52	-
301533	威马农机	2023年8月7日	6个月	新股锁定	29.50	33.16	218	6,431.00	7,228.88	-
301550	斯菱股份	2023年9月6日	6个月	新股锁定	37.56	43.57	182	6,835.92	7,929.74	-
301555	惠柏新材	2023年10月24日	6个月	新股锁定	22.88	32.44	224	5,125.12	7,266.56	-
301568	思	2023	6个月	新股	23.23	35.58	246	5,714.58	8,752.68	-

	泰克	年 11 月 21 日		锁定						
601083	锦江航运	2023 年 11 月 28 日	6 个月	新股锁定	11.25	11.07	445	5,006.25	4,926.15	-
601096	宏盛华源	2023 年 12 月 15 日	6 个月	新股锁定	1.70	4.06	3,363	5,717.10	13,653.78	-
603004	鼎龙科技	2023 年 12 月 20 日	6 个月	新股锁定	16.80	31.19	195	3,276.00	6,082.05	-
603075	热威股份	2023 年 9 月 1 日	6 个月	新股锁定	23.10	23.31	126	2,910.60	2,937.06	-
603107	上海汽配	2023 年 10 月 25 日	6 个月	新股锁定	14.23	18.19	203	2,888.69	3,692.57	-
603119	浙江荣泰	2023 年 7 月 21 日	6 个月	新股锁定	15.32	23.87	114	1,746.48	2,721.18	-
603193	润本股份	2023 年 10 月 9 日	6 个月	新股锁定	17.38	16.66	203	3,528.14	3,381.98	-
603231	索宝蛋白	2023 年 12 月 6 日	6 个月	新股锁定	21.29	21.53	128	2,725.12	2,755.84	-
603273	天元智能	2023 年 10 月 16 日	6 个月	新股锁定	9.50	18.97	178	1,691.00	3,376.66	-
603276	恒兴新材	2023 年 9 月 18 日	6 个月	新股锁定	25.73	24.88	119	3,061.87	2,960.72	-
603373	安	2023	6 个月	新股	19.10	34.75	88	1,680.80	3,058.00	-

	邦 护 卫	年 12 月 13 日		锁定							
688548	广 钢 气 体	2023 年 8 月 8 日	6 个月	新股 锁定	9.87	12.75	837	8,261.19	10,671.75	-	
688549	中 巨 芯	2023 年 8 月 30 日	6 个月	新股 锁定	5.18	8.09	1,658	8,588.44	13,413.22	-	
688602	康 鹏 科 技	2023 年 7 月 13 日	6 个月	新股 锁定	8.66	11.06	628	5,438.48	6,945.68	-	
688651	盛 邦 安 全	2023 年 7 月 19 日	6 个月	新股 锁定	39.90	46.05	152	6,064.80	6,999.60	-	
688652	京 仪 装 备	2023 年 11 月 22 日	6 个月	新股 锁定	31.95	52.25	228	7,284.60	11,913.00	-	
688657	浩 辰 软 件	2023 年 9 月 25 日	6 个月	新股 锁定	103.40	78.23	65	6,721.00	5,084.95	-	
688693	锆 威 特	2023 年 8 月 10 日	6 个月	新股 锁定	40.83	43.41	139	5,675.37	6,033.99	-	
688716	中 研 股 份	2023 年 9 月 13 日	6 个月	新股 锁定	29.66	36.39	203	6,020.98	7,387.17	-	

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 12 月 31 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为人民币 0.00 元，无质押债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 12 月 31 日止,本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为人民币 0.00 元,无质押债券。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注:无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中由金融工具产生的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险,并设定适当的风险限额及内部控制流程,通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

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

7.4.13.2 信用风险

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

7.4.13.3 流动性风险

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

7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注:无。

7.4.13.3.2 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。

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。本基金的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，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 12 月 31	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
-----------------------	--------	--------	----------	-------	-------	-----	----

目							
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	-	-	-	-	-
上年度末 2022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	5,662,454.48	-	-	-	-	-	5,662,454.48
结算备付金	2,565,514.69	-	-	-	-	-	2,565,514.69
存出保证金	466,060.18	-	-	-	-	-	466,060.18
交易性金融资产	-	-	-	-	-	75,290,168.49	75,290,168.49
应收申购款	-	-	-	-	-	4,360.80	4,360.80
资产总计	8,694,029.35	-	-	-	-	75,294,529.29	83,988,558.64
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	672.81	672.81
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	110,303.12	110,303.12
应付托管费	-	-	-	-	-	18,383.84	18,383.84
其他负债	-	-	-	-	-	167,716.09	167,716.09
负债总计	-	-	-	-	-	297,075.86	297,075.86
利率敏感度缺口	8,694,029.35	-	-	-	-	-	-

7.4.13.4.1.2 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（2023 年 12 月 31 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	市场利率下降 25 个基点	8,769.50	-
	市场利率上升 25 个基点	-8,738.99	-

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

注：无。

7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

注：无。

7.4.13.4.3 其他价格风险

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

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日		上年度末 2022 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	446,483,120.43	90.77	75,290,168.49	89.96
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	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	459,481,254.11	93.41	75,290,168.49	89.96

7.4.13.4.3.2 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（2023 年 12 月 31 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数上升 5%	15,274,187.55	3,531,108.90
	沪深 300 指数下降 5%	-15,274,187.55	-3,531,108.90

7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

注：无。

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 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 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	446,165,670.95	75,290,168.49
第二层次	12,998,133.68	-
第三层次	317,449.48	-
合计	459,481,254.11	75,290,168.49

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

<p>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。</p> <p>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。</p>

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	0.00	0.00
当期购买	-	0.00	0.00
当期出售/结算	-	0.00	0.00
转入第三层次	-	109,509.15	109,509.15
转出第三层次	-	23,296.60	23,296.60
当期利得或损失总额	-	231,236.93	231,236.93
其中：计入损益的利得或损失	-	231,236.93	231,236.93
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	317,449.48	317,449.48
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	83,008.05	83,008.05

项目	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	59,909.08	59,909.08
转出第三层次	-	178,398.55	178,398.55
当期利得或损失总额	-	118,489.47	118,489.47
其中：计入损益的利得或损失	-	118,489.47	118,489.47
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	-	-
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-	-

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	317,449.48	平均价格亚式期权模型	预期波动率	0.1962~2.1988	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
-	-	-	-	-	-

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

无。

7.4.14.4 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。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	446,483,120.43	83.11
	其中：股票	446,483,120.43	83.11
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	12,998,133.68	2.42
	其中：债券	12,998,133.68	2.42
	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	65,198,174.16	12.14
8	其他各项资产	12,572,280.24	2.34
9	合计	537,251,708.51	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	5,006,513.52	1.02
C	制造业	319,902,231.43	65.04
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,857,909.74	0.99
E	建筑业	12,365,906.40	2.51
F	批发和零售业	31,319,727.20	6.37
G	交通运输、仓储和邮政业	4,293,863.67	0.87
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	38,049,186.67	7.74
J	金融业	3,807,121.90	0.77
K	房地产业	5,964,332.00	1.21
L	租赁和商务服务业	4,162,909.00	0.85
M	科学研究和技术服务业	4,441,790.08	0.90

N	水利、环境和公共设施管理业	3,945,636.81	0.80
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	500.01	0.00
R	文化、体育和娱乐业	3,301,252.00	0.67
S	综合	5,064,240.00	1.03
	合计	446,483,120.43	90.77

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：无。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	002923	润都股份	615,244	7,592,110.96	1.54
2	000090	天健集团	1,649,600	7,588,160.00	1.54
3	600693	东百集团	1,892,300	7,588,123.00	1.54
4	603530	神马电力	319,700	6,630,578.00	1.35
5	600266	城建发展	1,232,300	5,964,332.00	1.21
6	000030	富奥股份	1,045,000	5,580,300.00	1.13
7	603033	三维股份	329,590	5,210,817.90	1.06
8	000597	东北制药	971,600	5,198,060.00	1.06
9	600523	贵航股份	375,900	5,176,143.00	1.05
10	600812	华北制药	897,400	5,115,180.00	1.04
11	002488	金固股份	710,600	5,102,108.00	1.04
12	603123	翠微股份	476,000	5,069,400.00	1.03
13	002215	诺普信	611,100	5,047,686.00	1.03
14	300952	恒辉安防	227,600	4,957,128.00	1.01
15	002664	信质集团	298,000	4,955,740.00	1.01
16	300846	首都在线	346,100	4,945,769.00	1.01
17	600986	浙文互联	898,600	4,906,356.00	1.00
18	601616	广电电气	1,346,000	4,885,980.00	0.99
19	300102	乾照光电	664,700	4,885,545.00	0.99
20	605388	均瑶健康	382,879	4,801,302.66	0.98
21	300228	富瑞特装	675,000	4,792,500.00	0.97
22	002689	远大智能	1,076,400	4,789,980.00	0.97
23	603131	上海沪工	322,700	4,763,052.00	0.97
24	601886	江河集团	712,700	4,746,582.00	0.96
25	002730	电光科技	498,900	4,729,572.00	0.96
26	002296	辉煌科技	573,100	4,728,075.00	0.96
27	603928	兴业股份	353,400	4,724,958.00	0.96
28	000551	创元科技	448,800	4,698,936.00	0.96
29	600841	动力新科	791,200	4,675,992.00	0.95

30	300076	GQY 视讯	854,800	4,667,208.00	0.95
31	000541	佛山照明	701,400	4,664,310.00	0.95
32	688768	容知日新	126,632	4,661,323.92	0.95
33	600080	金花股份	623,800	4,647,310.00	0.94
34	000990	诚志股份	564,800	4,637,008.00	0.94
35	600300	维维股份	1,479,100	4,600,001.00	0.94
36	600558	大西洋	1,127,300	4,588,111.00	0.93
37	603602	纵横通信	310,300	4,573,822.00	0.93
38	300440	运达科技	612,300	4,561,635.00	0.93
39	600965	福成股份	720,800	4,548,248.00	0.92
40	603321	梅轮电梯	529,000	4,517,660.00	0.92
41	600609	金杯汽车	928,300	4,511,538.00	0.92
42	000919	金陵药业	572,500	4,505,575.00	0.92
43	605066	天正电气	486,000	4,461,480.00	0.91
44	601918	新集能源	845,080	4,453,571.60	0.91
45	002662	京威股份	1,263,600	4,435,236.00	0.90
46	300215	电科院	834,300	4,413,447.00	0.90
47	603980	吉华集团	940,680	4,392,975.60	0.89
48	600135	乐凯胶片	542,800	4,380,396.00	0.89
49	002171	楚江新材	582,500	4,357,100.00	0.89
50	600526	菲达环保	880,600	4,350,164.00	0.88
51	603045	福达合金	275,402	4,348,597.58	0.88
52	000078	海王生物	1,366,500	4,290,810.00	0.87
53	300893	松原股份	144,700	4,229,581.00	0.86
54	000533	顺钠股份	896,800	4,205,992.00	0.86
55	301017	漱玉平民	203,600	4,159,548.00	0.85
56	603528	多伦科技	456,100	4,141,388.00	0.84
57	002038	双鹭药业	404,600	4,122,874.00	0.84
58	000811	冰轮环境	288,700	3,917,659.00	0.80
59	002997	瑞鹄模具	115,400	3,845,128.00	0.78
60	000823	超声电子	400,700	3,834,699.00	0.78
61	601333	广深铁路	1,473,000	3,815,070.00	0.78
62	000686	东北证券	534,800	3,797,080.00	0.77
63	688096	京源环保	396,547	3,715,645.39	0.76
64	301028	东亚机械	306,000	3,589,380.00	0.73
65	000949	新乡化纤	1,077,900	3,481,617.00	0.71
66	688098	申联生物	452,211	3,382,538.28	0.69
67	300281	金明精机	546,900	3,275,931.00	0.67
68	002472	双环传动	125,400	3,262,908.00	0.66
69	002381	双箭股份	426,100	3,229,838.00	0.66
70	002282	博深股份	396,700	3,213,270.00	0.65
71	300673	佩蒂股份	241,000	3,205,300.00	0.65
72	300172	中电环保	588,900	3,162,393.00	0.64

73	000589	贵州轮胎	504,300	3,086,316.00	0.63
74	002479	富春环保	630,900	3,009,393.00	0.61
75	300671	富满微	92,200	2,980,826.00	0.61
76	300221	银禧科技	493,200	2,959,200.00	0.60
77	300762	上海瀚讯	195,400	2,946,632.00	0.60
78	300717	华信新材	175,300	2,943,287.00	0.60
79	300382	斯莱克	290,500	2,884,665.00	0.59
80	002540	亚太科技	392,280	2,592,970.80	0.53
81	003041	真爱美家	155,100	2,582,415.00	0.52
82	601609	金田股份	378,100	2,559,737.00	0.52
83	688367	工大高科	142,810	2,547,730.40	0.52
84	600488	津药药业	512,800	2,512,720.00	0.51
85	002066	瑞泰科技	225,010	2,499,861.10	0.51
86	603278	大业股份	194,500	2,450,700.00	0.50
87	001696	宗申动力	366,900	2,432,547.00	0.49
88	300605	恒锋信息	160,219	2,398,478.43	0.49
89	300061	旗天科技	400,300	2,345,758.00	0.48
90	300543	朗科智能	199,400	2,177,448.00	0.44
91	002688	金河生物	445,600	2,143,336.00	0.44
92	300292	吴通控股	574,200	2,136,024.00	0.43
93	600052	东望时代	421,800	2,104,782.00	0.43
94	600865	百大集团	248,300	2,026,128.00	0.41
95	300311	任子行	322,200	1,968,642.00	0.40
96	600037	歌华有线	254,500	1,967,285.00	0.40
97	300412	迦南科技	345,000	1,963,050.00	0.40
98	000026	飞亚达	178,800	1,959,648.00	0.40
99	000028	国药一致	67,300	1,951,027.00	0.40
100	002214	大立科技	162,400	1,862,728.00	0.38
101	600987	航民股份	206,700	1,810,692.00	0.37
102	300123	亚光科技	243,500	1,784,855.00	0.36
103	605399	晨光新材	129,490	1,755,884.40	0.36
104	300145	中金环境	581,400	1,755,828.00	0.36
105	000061	农产品	269,900	1,746,253.00	0.36
106	300287	飞利信	419,200	1,685,184.00	0.34
107	300230	永利股份	395,700	1,594,671.00	0.32
108	600824	益民集团	400,500	1,533,915.00	0.31
109	300193	佳士科技	194,300	1,509,711.00	0.31
110	601366	利群股份	266,400	1,454,544.00	0.30
111	300380	安硕信息	68,300	1,448,643.00	0.29
112	600883	博闻科技	167,300	1,422,050.00	0.29
113	002039	黔源电力	93,740	1,292,674.60	0.26
114	000698	沈阳化工	302,100	1,274,862.00	0.26
115	600128	苏豪弘业	129,300	1,264,554.00	0.26

116	600218	全柴动力	128,400	1,228,788.00	0.25
117	600757	长江传媒	160,600	1,196,470.00	0.24
118	300829	金丹科技	56,800	1,185,984.00	0.24
119	600410	华胜天成	169,600	1,139,712.00	0.23
120	300459	汤姆猫	219,900	1,086,306.00	0.22
121	688095	福昕软件	15,474	1,080,858.90	0.22
122	300188	国投智能	64,320	1,030,406.40	0.21
123	603115	海星股份	66,700	976,488.00	0.20
124	002774	快意电梯	117,100	971,930.00	0.20
125	603333	尚纬股份	157,200	897,612.00	0.18
126	000931	中关村	146,600	860,542.00	0.17
127	002083	孚日股份	150,900	760,536.00	0.15
128	300206	理邦仪器	73,500	750,435.00	0.15
129	300462	华铭智能	61,500	725,085.00	0.15
130	688655	迅捷兴	46,899	708,174.90	0.14
131	600983	惠而浦	70,400	625,856.00	0.13
132	002570	贝因美	150,205	593,309.75	0.12
133	002161	远望谷	104,200	573,100.00	0.12
134	600461	洪城环境	60,467	552,668.38	0.11
135	601001	晋控煤业	44,600	549,918.00	0.11
136	605058	澳弘电子	23,400	536,094.00	0.11
137	688701	卓锦股份	56,967	515,551.35	0.10
138	300272	开能健康	80,000	496,000.00	0.10
139	300128	锦富技术	106,300	490,043.00	0.10
140	002627	三峡旅游	88,500	472,590.00	0.10
141	605088	冠盛股份	18,100	416,300.00	0.08
142	605189	富春染织	24,700	400,140.00	0.08
143	600770	综艺股份	74,400	365,304.00	0.07
144	600746	江苏索普	49,800	364,536.00	0.07
145	002308	威创股份	89,300	289,332.00	0.06
146	603681	永冠新材	18,100	273,310.00	0.06
147	688178	万德斯	14,715	266,047.20	0.05
148	002263	大东南	93,100	234,612.00	0.05
149	600531	豫光金铅	37,700	228,085.00	0.05
150	002330	得利斯	23,800	132,328.00	0.03
151	300241	瑞丰光电	21,400	120,482.00	0.02
152	300168	万达信息	9,900	83,952.00	0.02
153	002515	金字火腿	14,300	80,652.00	0.02
154	603300	华铁应急	10,600	67,840.00	0.01
155	002376	新北洋	7,100	54,102.00	0.01
156	002084	海鸥住工	12,908	51,373.84	0.01
157	688301	奕瑞科技	123	40,006.98	0.01
158	688617	惠泰医疗	83	32,245.50	0.01

159	603717	天域生态	4,000	30,760.00	0.01
160	301526	国际复材	6,653	29,605.85	0.01
161	601010	文峰股份	6,600	16,104.00	0.00
162	301421	波长光电	264	15,673.68	0.00
163	688188	柏楚电子	60	15,186.60	0.00
164	301510	固高科技	396	13,863.96	0.00
165	688017	绿的谐波	90	13,815.00	0.00
166	601096	宏盛华源	3,363	13,653.78	0.00
167	688549	中巨芯	1,658	13,413.22	0.00
168	688050	爱博医疗	75	12,903.00	0.00
169	688652	京仪装备	228	11,913.00	0.00
170	688548	广钢气体	837	10,671.75	0.00
171	688776	国光电气	105	10,225.95	0.00
172	301507	民生健康	630	9,985.50	0.00
173	301508	中机认检	374	9,978.32	0.00
174	600643	爱建集团	1,900	9,690.00	0.00
175	688202	美迪西	137	9,368.06	0.00
176	301516	中远通	604	9,368.04	0.00
177	688018	乐鑫科技	90	9,265.50	0.00
178	301251	威尔高	263	9,097.17	0.00
179	301568	思泰克	246	8,752.68	0.00
180	688686	奥普特	76	8,512.00	0.00
181	301550	斯菱股份	182	7,929.74	0.00
182	301517	陕西华达	180	7,864.20	0.00
183	688366	昊海生科	69	7,472.01	0.00
184	688716	中研股份	203	7,387.17	0.00
185	301555	惠柏新材	224	7,266.56	0.00
186	301533	威马农机	218	7,228.88	0.00
187	688356	键凯科技	66	7,022.40	0.00
188	688651	盛邦安全	152	6,999.60	0.00
189	688602	康鹏科技	628	6,945.68	0.00
190	301529	福赛科技	179	6,780.52	0.00
191	688059	华锐精密	85	6,690.35	0.00
192	301500	飞南资源	304	6,350.56	0.00
193	301292	海科新源	319	6,172.65	0.00
194	600557	康缘药业	300	6,156.00	0.00
195	603004	鼎龙科技	195	6,082.05	0.00
196	688693	锆威特	139	6,033.99	0.00
197	688123	聚辰股份	95	5,816.85	0.00
198	301272	英华特	108	5,765.04	0.00
199	688310	迈得医疗	192	5,740.80	0.00
200	301418	协昌科技	114	5,722.80	0.00
201	301520	万邦医药	106	5,590.44	0.00

202	002416	爱施德	600	5,574.00	0.00
203	301202	朗威股份	165	5,247.00	0.00
204	688657	浩辰软件	65	5,084.95	0.00
205	001378	德冠新材	162	5,065.74	0.00
206	601083	锦江航运	445	4,926.15	0.00
207	688099	晶晨股份	77	4,822.51	0.00
208	688777	中控技术	106	4,807.10	0.00
209	301456	盘古智能	152	4,619.28	0.00
210	688160	步科股份	77	4,479.86	0.00
211	688778	厦钨新能	106	4,201.84	0.00
212	688636	智明达	64	4,172.80	0.00
213	300751	迈为股份	32	4,144.32	0.00
214	688799	华纳药厂	81	3,964.14	0.00
215	001306	夏厦精密	52	3,918.72	0.00
216	001358	兴欣新材	87	3,841.92	0.00
217	001239	永达股份	189	3,764.88	0.00
218	603107	上海汽配	203	3,692.57	0.00
219	688399	硕世生物	67	3,655.52	0.00
220	688195	腾景科技	98	3,527.02	0.00
221	603193	润本股份	203	3,381.98	0.00
222	603273	天元智能	178	3,376.66	0.00
223	688002	睿创微纳	71	3,139.62	0.00
224	603373	安邦护卫	88	3,058.00	0.00
225	603276	恒兴新材	119	2,960.72	0.00
226	603075	热威股份	126	2,937.06	0.00
227	300855	图南股份	95	2,869.00	0.00
228	688559	海目星	80	2,856.00	0.00
229	688511	天微电子	90	2,832.30	0.00
230	688303	大全能源	95	2,809.15	0.00
231	603231	索宝蛋白	128	2,755.84	0.00
232	603119	浙江荣泰	114	2,721.18	0.00
233	301067	显盈科技	80	2,688.80	0.00
234	688122	西部超导	49	2,608.27	0.00
235	002422	科伦药业	84	2,440.20	0.00
236	688508	芯朋微	49	2,411.29	0.00
237	688668	鼎通科技	42	2,323.44	0.00
238	688529	豪森智能	97	2,237.79	0.00
239	300765	新诺威	58	2,123.96	0.00
240	688670	金迪克	74	2,106.04	0.00
241	688519	南亚新材	78	2,009.28	0.00
242	688087	英科再生	83	1,998.64	0.00
243	603979	金诚信	52	1,963.52	0.00
244	688021	奥福环保	92	1,918.20	0.00

245	688330	宏力达	63	1,789.83	0.00
246	688665	四方光电	22	1,622.72	0.00
247	688683	莱尔科技	63	1,611.54	0.00
248	688357	建龙微纳	31	1,602.39	0.00
249	002983	芯瑞达	50	1,543.00	0.00
250	688065	凯赛生物	28	1,539.44	0.00
251	688335	复洁环保	119	1,526.77	0.00
252	688689	银河微电	54	1,504.98	0.00
253	688516	奥特维	16	1,448.00	0.00
254	300031	宝通科技	78	1,446.12	0.00
255	688023	安恒信息	12	1,330.68	0.00
256	605180	华生科技	91	1,274.00	0.00
257	688067	爱威科技	53	1,261.93	0.00
258	688388	嘉元科技	62	1,257.36	0.00
259	688625	呈和科技	32	1,255.04	0.00
260	603788	宁波高发	84	1,254.12	0.00
261	688575	亚辉龙	54	1,234.98	0.00
262	603319	湘油泵	69	1,210.26	0.00
263	603327	福蓉科技	90	1,199.70	0.00
264	688621	阳光诺和	17	1,185.75	0.00
265	688118	普元信息	38	1,136.96	0.00
266	603386	骏亚科技	80	1,104.00	0.00
267	688358	祥生医疗	29	1,095.62	0.00
268	603037	凯众股份	50	1,040.50	0.00
269	688528	秦川物联	93	1,027.65	0.00
270	688038	中科通达	71	1,023.11	0.00
271	300901	中胤时尚	99	1,013.76	0.00
272	603693	江苏新能	90	1,008.90	0.00
273	688133	泰坦科技	21	973.35	0.00
274	688101	三达膜	70	942.20	0.00
275	688078	龙软科技	23	927.36	0.00
276	688121	卓然股份	45	910.35	0.00
277	688006	杭可科技	38	892.24	0.00
278	688800	瑞可达	22	883.96	0.00
279	688707	振华新材	43	881.50	0.00
280	002802	洪汇新材	63	807.03	0.00
281	688135	利扬芯片	35	780.85	0.00
282	688057	金达莱	55	778.80	0.00
283	688077	大地熊	32	763.20	0.00
284	603967	中创物流	70	723.80	0.00
285	300789	唐源电气	30	676.20	0.00
286	688718	唯赛勃	45	672.30	0.00
287	002068	黑猫股份	57	661.20	0.00

288	300932	三友联众	40	651.20	0.00
289	605368	蓝天燃气	60	646.20	0.00
290	688616	西力科技	47	641.08	0.00
291	688518	联赢激光	31	634.88	0.00
292	001206	依依股份	40	631.20	0.00
293	601020	华钰矿业	60	618.00	0.00
294	688385	复旦微电	15	579.45	0.00
295	688379	华光新材	29	573.33	0.00
296	300836	佰奥智能	20	568.40	0.00
297	688696	极米科技	5	564.90	0.00
298	603291	联合水务	36	546.84	0.00
299	300385	雪浪环境	80	537.60	0.00
300	688233	神工股份	15	529.35	0.00
301	688550	瑞联新材	13	515.84	0.00
302	300244	迪安诊断	21	500.01	0.00
303	300639	凯普生物	50	467.00	0.00
304	300864	南大环境	21	460.11	0.00
305	600874	创业环保	82	455.10	0.00
306	601101	昊华能源	70	442.40	0.00
307	688312	燕麦科技	21	433.65	0.00
308	300629	新劲刚	20	432.60	0.00
309	603599	广信股份	28	406.00	0.00
310	603316	诚邦股份	60	404.40	0.00
311	688517	金冠电气	25	394.75	0.00
312	603798	康普顿	40	386.80	0.00
313	688092	爱科科技	12	369.12	0.00
314	603565	中谷物流	44	362.12	0.00
315	000851	高鸿股份	60	352.20	0.00
316	002887	绿茵生态	40	347.20	0.00
317	002233	塔牌集团	49	346.92	0.00
318	600483	福能股份	40	330.80	0.00
319	300806	斯迪克	20	281.40	0.00
320	688005	容百科技	7	278.60	0.00
321	601279	英利汽车	43	250.69	0.00
322	002948	青岛银行	80	244.00	0.00
323	002258	利尔化学	20	239.40	0.00
324	688315	诺禾致源	10	233.40	0.00
325	688199	久日新材	8	216.24	0.00
326	300644	南京聚隆	10	207.50	0.00
327	688569	铁科轨道	7	193.27	0.00
328	601919	中远海控	20	191.60	0.00
329	603088	宁波精达	22	189.64	0.00
330	605580	恒盛能源	16	185.92	0.00

331	688066	航天宏图	4	168.96	0.00
332	603150	万朗磁塑	5	145.25	0.00
333	600590	泰豪科技	20	133.60	0.00
334	688313	仕佳光子	9	114.39	0.00
335	300973	立高食品	2	97.10	0.00
336	002839	张家港行	20	77.60	0.00
337	688565	力源科技	7	59.15	0.00
338	000901	航天科技	6	55.92	0.00
339	688033	天宜上佳	3	50.70	0.00
340	688722	同益中	2	30.60	0.00
341	600908	无锡银行	6	30.30	0.00
342	002394	联发股份	3	24.93	0.00
343	688425	铁建重工	2	7.94	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 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	688120	华海清科	17,638,152.25	21.08
2	002923	润都股份	9,219,862.92	11.02
3	300502	新易盛	8,522,162.02	10.18
4	000090	天健集团	8,395,435.00	10.03
5	603530	神马电力	8,081,643.00	9.66
6	600693	东百集团	7,799,596.00	9.32
7	000030	富奥股份	6,874,121.00	8.21
8	300232	洲明科技	6,814,474.00	8.14
9	600812	华北制药	6,572,123.00	7.85
10	300605	恒锋信息	6,493,845.45	7.76
11	300380	安硕信息	6,434,091.00	7.69
12	002488	金固股份	6,376,493.00	7.62
13	601616	广电电气	6,304,098.00	7.53
14	600266	城建发展	6,251,897.00	7.47
15	300228	富瑞特装	6,103,842.00	7.29
16	002730	电光科技	6,037,887.00	7.21
17	000028	国药一致	6,018,702.00	7.19
18	300952	恒辉安防	5,967,802.00	7.13
19	000919	金陵药业	5,890,035.00	7.04
20	600526	菲达环保	5,857,478.00	7.00
21	603033	三维股份	5,815,671.50	6.95
22	000503	国新健康	5,737,438.00	6.86
23	603928	兴业股份	5,719,580.00	6.83
24	300076	GQY 视讯	5,632,900.00	6.73
25	605388	均瑶健康	5,576,903.93	6.66

26	002296	辉煌科技	5,559,399.00	6.64
27	002558	巨人网络	5,446,423.00	6.51
28	600841	动力新科	5,434,392.00	6.49
29	002171	楚江新材	5,428,921.00	6.49
30	600770	综艺股份	5,413,987.00	6.47
31	600523	贵航股份	5,333,015.00	6.37
32	000597	东北制药	5,284,653.00	6.31
33	002664	信质集团	5,255,386.00	6.28
34	000551	创元科技	5,233,058.00	6.25
35	002689	远大智能	5,208,088.00	6.22
36	600552	凯盛科技	5,192,694.00	6.20
37	300102	乾照光电	5,185,524.00	6.20
38	002472	双环传动	5,174,299.00	6.18
39	000541	佛山照明	5,158,857.00	6.16
40	002038	双鹭药业	5,155,223.00	6.16
41	603123	翠微股份	5,150,319.00	6.15
42	000533	顺钠股份	5,084,134.00	6.07
43	601886	江河集团	5,077,282.00	6.07
44	002984	森麒麟	5,040,288.00	6.02
45	600629	华建集团	4,970,129.00	5.94
46	002215	诺普信	4,966,724.00	5.93
47	600986	浙文互联	4,902,492.00	5.86
48	688768	容知日新	4,890,530.88	5.84
49	600908	无锡银行	4,886,415.48	5.84
50	688096	京源环保	4,871,174.46	5.82
51	301028	东亚机械	4,870,890.00	5.82
52	300846	首都在线	4,826,811.00	5.77
53	600609	金杯汽车	4,806,778.00	5.74
54	603131	上海沪工	4,785,844.00	5.72
55	600080	金花股份	4,767,463.00	5.70
56	002635	安洁科技	4,757,623.00	5.68
57	600557	康缘药业	4,718,237.00	5.64
58	002662	京威股份	4,705,757.00	5.62
59	600965	福成股份	4,703,999.00	5.62
60	300893	松原股份	4,693,746.00	5.61
61	000990	诚志股份	4,689,066.00	5.60
62	600300	维维股份	4,665,268.00	5.57
63	300973	立高食品	4,652,583.92	5.56
64	603602	纵横通信	4,646,163.00	5.55
65	300440	运达科技	4,641,735.00	5.55
66	600558	大西洋	4,621,372.00	5.52
67	002479	富春环保	4,584,927.00	5.48
68	000686	东北证券	4,516,684.00	5.40

69	000811	冰轮环境	4,471,607.00	5.34
70	603681	永冠新材	4,461,238.00	5.33
71	603045	福达合金	4,424,355.86	5.29
72	603980	吉华集团	4,410,523.40	5.27
73	605066	天正电气	4,403,457.00	5.26
74	300215	电科院	4,369,384.00	5.22
75	603300	华铁应急	4,303,745.00	5.14
76	600135	乐凯胶片	4,281,920.00	5.12
77	601918	新集能源	4,245,695.40	5.07
78	603528	多伦科技	4,215,887.00	5.04
79	000078	海王生物	4,204,489.00	5.02
80	300221	银禧科技	4,171,328.00	4.98
81	603386	骏亚科技	4,031,824.60	4.82
82	688095	福昕软件	4,028,077.21	4.81
83	300647	超频三	3,998,241.00	4.78
84	603979	金诚信	3,989,435.00	4.77
85	603321	梅轮电梯	3,979,982.00	4.76
86	300459	汤姆猫	3,947,756.00	4.72
87	600531	豫光金铅	3,936,917.00	4.70
88	300519	新光药业	3,933,575.00	4.70
89	601333	广深铁路	3,933,206.00	4.70
90	300188	国投智能	3,930,851.00	4.70
91	301017	漱玉平民	3,911,338.00	4.67
92	000823	超声电子	3,901,476.00	4.66
93	300061	旗天科技	3,893,888.00	4.65
94	000888	峨眉山 A	3,886,734.00	4.64
95	603619	中曼石油	3,883,154.00	4.64
96	002517	恺英网络	3,879,933.00	4.64
97	600761	安徽合力	3,874,678.00	4.63
98	688195	腾景科技	3,850,383.11	4.60
99	002997	瑞鹄模具	3,822,106.00	4.57
100	300241	瑞丰光电	3,819,948.00	4.56
101	000061	农产品	3,772,641.00	4.51
102	300002	神州泰岳	3,752,087.00	4.48
103	002544	普天科技	3,730,687.00	4.46
104	605399	晨光新材	3,718,964.70	4.44
105	002174	游族网络	3,702,772.00	4.42
106	600310	广西能源	3,667,406.00	4.38
107	002376	新北洋	3,652,852.00	4.36
108	600708	光明地产	3,633,034.00	4.34
109	300406	九强生物	3,611,036.00	4.31
110	000949	新乡化纤	3,600,152.00	4.30
111	002233	塔牌集团	3,589,681.62	4.29

112	300206	理邦仪器	3,582,154.00	4.28
113	300382	斯莱克	3,573,049.00	4.27
114	601200	上海环境	3,557,712.00	4.25
115	002570	贝因美	3,556,136.00	4.25
116	600072	中船科技	3,539,292.00	4.23
117	002919	名臣健康	3,489,920.00	4.17
118	688367	工大高科	3,452,928.53	4.13
119	300172	中电环保	3,446,195.00	4.12
120	688098	申联生物	3,427,185.75	4.10
121	000589	贵州轮胎	3,404,580.00	4.07
122	000417	合肥百货	3,386,588.00	4.05
123	600771	广誉远	3,381,346.00	4.04
124	603258	电魂网络	3,370,658.00	4.03
125	600129	太极集团	3,335,528.00	3.99
126	001696	宗申动力	3,317,034.00	3.96
127	600697	欧亚集团	3,313,739.00	3.96
128	600133	东湖高新	3,300,041.00	3.94
129	002858	力盛体育	3,295,251.00	3.94
130	002515	金字火腿	3,276,295.00	3.91
131	002381	双箭股份	3,257,457.00	3.89
132	000802	北京文化	3,247,394.00	3.88
133	002605	姚记科技	3,238,707.00	3.87
134	000517	荣安地产	3,235,642.00	3.87
135	300673	佩蒂股份	3,208,543.00	3.83
136	600750	江中药业	3,188,876.90	3.81
137	600162	香江控股	3,174,838.00	3.79
138	300462	华铭智能	3,166,947.00	3.78
139	300031	宝通科技	3,163,505.00	3.78
140	002068	黑猫股份	3,161,519.00	3.78
141	002416	爱施德	3,143,665.00	3.76
142	300543	朗科智能	3,130,922.50	3.74
143	000901	航天科技	3,128,844.13	3.74
144	002085	万丰奥威	3,126,480.00	3.74
145	300671	富满微	3,111,085.00	3.72
146	002401	中远海科	3,097,004.00	3.70
147	300281	金明精机	3,083,551.00	3.68
148	601567	三星医疗	3,074,117.00	3.67
149	002747	埃斯顿	3,068,981.00	3.67
150	002928	华夏航空	3,059,827.00	3.66
151	605088	冠盛股份	3,050,449.00	3.64
152	300192	科德教育	3,044,766.00	3.64
153	300655	晶瑞电材	3,028,358.00	3.62
154	600643	爱建集团	3,026,841.00	3.62

155	601963	重庆银行	3,022,144.00	3.61
156	600257	大湖股份	3,017,505.00	3.61
157	002282	博深股份	3,016,392.00	3.60
158	000936	华西股份	3,011,955.00	3.60
159	603687	大胜达	3,010,431.00	3.60
160	300364	中文在线	3,003,710.00	3.59
161	002400	省广集团	2,999,318.00	3.58
162	300494	盛天网络	2,986,793.00	3.57
163	600376	首开股份	2,984,872.00	3.57
164	600604	市北高新	2,965,324.00	3.54
165	600273	嘉化能源	2,926,478.00	3.50
166	600361	创新新材	2,917,972.00	3.49
167	601609	金田股份	2,907,243.00	3.47
168	000828	东莞控股	2,903,598.00	3.47
169	600239	云南城投	2,856,990.00	3.41
170	300533	冰川网络	2,854,611.00	3.41
171	600510	黑牡丹	2,846,839.00	3.40
172	002158	汉钟精机	2,840,352.00	3.39
173	601595	上海电影	2,817,655.00	3.37
174	000555	神州信息	2,805,369.43	3.35
175	600218	全柴动力	2,801,176.00	3.35
176	300168	万达信息	2,780,019.00	3.32
177	300426	唐德影视	2,778,858.00	3.32
178	603918	金桥信息	2,772,460.00	3.31
179	002611	东方精工	2,755,721.00	3.29
180	601588	北辰实业	2,711,775.00	3.24
181	600684	珠江股份	2,700,001.00	3.23
182	300762	上海瀚讯	2,677,659.00	3.20
183	600743	华远地产	2,673,412.00	3.19
184	601038	一拖股份	2,671,701.00	3.19
185	300889	爱克股份	2,638,563.31	3.15
186	688121	卓然股份	2,634,794.39	3.15
187	300717	华信新材	2,631,187.00	3.14
188	600797	浙大网新	2,627,785.00	3.14
189	603093	南华期货	2,626,384.00	3.14
190	600488	津药药业	2,623,110.00	3.13
191	002314	南山控股	2,609,157.00	3.12
192	603316	诚邦股份	2,606,615.60	3.11
193	002214	大立科技	2,600,333.00	3.11
194	600172	黄河旋风	2,591,161.00	3.10
195	003041	真爱美家	2,559,026.00	3.06
196	600874	创业环保	2,545,893.74	3.04
197	002066	瑞泰科技	2,537,739.00	3.03

198	600322	津投城开	2,527,990.00	3.02
199	605177	东亚药业	2,527,686.00	3.02
200	603689	皖天然气	2,519,738.00	3.01
201	603028	赛福天	2,503,513.00	2.99
202	000926	福星股份	2,499,792.00	2.99
203	600802	福建水泥	2,499,504.00	2.99
204	002839	张家港行	2,499,135.80	2.99
205	600386	北巴传媒	2,489,889.00	2.98
206	002540	亚太科技	2,425,316.80	2.90
207	600251	冠农股份	2,419,418.00	2.89
208	600461	洪城环境	2,410,679.73	2.88
209	601011	宝泰隆	2,392,708.00	2.86
210	300083	创世纪	2,392,538.00	2.86
211	688425	铁建重工	2,389,065.69	2.85
212	000903	云内动力	2,386,578.00	2.85
213	002402	和而泰	2,383,022.00	2.85
214	603278	大业股份	2,376,530.00	2.84
215	688178	万德斯	2,368,626.68	2.83
216	601827	三峰环境	2,354,687.00	2.81
217	300644	南京聚隆	2,343,907.00	2.80
218	300094	国联水产	2,330,403.00	2.78
219	600681	百川能源	2,295,880.00	2.74
220	002253	川大智胜	2,294,871.00	2.74
221	002161	远望谷	2,285,985.00	2.73
222	000685	中山公用	2,283,481.00	2.73
223	605599	莱百股份	2,276,106.00	2.72
224	600094	大名城	2,274,594.00	2.72
225	600590	泰豪科技	2,274,243.10	2.72
226	300292	吴通控股	2,269,158.00	2.71
227	605033	美邦股份	2,253,783.00	2.69
228	300951	博硕科技	2,214,548.00	2.65
229	002688	金河生物	2,189,502.00	2.62
230	601010	文峰股份	2,187,320.00	2.61
231	688356	键凯科技	2,133,726.44	2.55
232	600163	中闽能源	2,131,263.00	2.55
233	002367	康力电梯	2,122,373.00	2.54
234	300767	震安科技	2,116,613.00	2.53
235	600120	浙江东方	2,112,082.00	2.52
236	300162	雷曼光电	2,110,049.00	2.52
237	601208	东材科技	2,102,173.00	2.51
238	600865	百大集团	2,099,263.00	2.51
239	688799	华纳药厂	2,097,078.49	2.51
240	002774	快意电梯	2,094,816.00	2.50

241	000026	飞亚达	2,094,748.00	2.50
242	600052	东望时代	2,088,152.00	2.50
243	300694	鑫湖股份	2,085,114.00	2.49
244	600037	歌华有线	2,084,707.00	2.49
245	600456	宝钛股份	2,082,063.00	2.49
246	300780	德恩精工	2,077,591.00	2.48
247	300662	科锐国际	2,055,963.00	2.46
248	603717	天域生态	2,047,745.00	2.45
249	300664	鹏鹞环保	2,044,946.00	2.44
250	600716	凤凰股份	2,042,516.00	2.44
251	600987	航民股份	2,035,951.00	2.43
252	600064	南京高科	2,031,970.00	2.43
253	002495	佳隆股份	2,022,393.00	2.42
254	300311	任子行	2,021,956.00	2.42
255	603390	通达电气	2,018,632.00	2.41
256	600458	时代新材	2,014,372.00	2.41
257	002811	郑中设计	1,999,197.00	2.39
258	600789	鲁抗医药	1,980,721.00	2.37
259	300412	迦南科技	1,973,820.00	2.36
260	603648	畅联股份	1,968,818.00	2.35
261	002582	好想你	1,931,703.00	2.31
262	688655	迅捷兴	1,928,922.38	2.30
263	603313	梦百合	1,923,488.00	2.30
264	300740	水羊股份	1,905,828.00	2.28
265	603118	共进股份	1,898,434.00	2.27
266	300123	亚光科技	1,892,848.00	2.26
267	002287	奇正藏药	1,892,799.00	2.26
268	300940	南极光	1,887,161.00	2.25
269	002597	金禾实业	1,853,875.00	2.22
270	002003	伟星股份	1,844,790.00	2.20
271	600391	航发科技	1,839,449.00	2.20
272	002263	大东南	1,808,798.00	2.16
273	688118	普元信息	1,807,967.23	2.16
274	300145	中金环境	1,805,742.00	2.16
275	688701	卓锦股份	1,800,074.40	2.15
276	300118	东方日升	1,779,200.00	2.13
277	300159	新研股份	1,772,539.00	2.12
278	300624	万兴科技	1,763,417.00	2.11
279	688199	久日新材	1,759,183.48	2.10
280	600635	大众公用	1,757,508.00	2.10
281	002338	奥普光电	1,752,741.00	2.09
282	603990	麦迪科技	1,750,786.00	2.09
283	000851	高鸿股份	1,750,726.00	2.09

284	603226	菲林格尔	1,729,593.00	2.07
285	002457	青龙管业	1,714,167.00	2.05
286	300287	飞利信	1,711,739.00	2.05
287	002031	巨轮智能	1,686,560.00	2.02
288	002020	京新药业	1,685,252.00	2.01
289	688528	秦川物联	1,677,729.26	2.00
290	600638	新黄浦	1,674,966.00	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。

8.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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	688120	华海清科	16,497,919.99	19.71
2	300502	新易盛	10,456,879.58	12.49
3	300232	洲明科技	6,651,976.00	7.95
4	000503	国新健康	5,914,026.00	7.07
5	002558	巨人网络	5,645,947.00	6.75
6	600552	凯盛科技	5,460,329.00	6.52
7	600557	康缘药业	5,193,343.00	6.21
8	002635	安洁科技	5,042,103.00	6.02
9	002984	森麒麟	4,848,401.00	5.79
10	002517	恺英网络	4,778,515.00	5.71
11	600770	综艺股份	4,731,539.00	5.65
12	300973	立高食品	4,720,847.00	5.64
13	603386	骏亚科技	4,585,614.20	5.48
14	603619	中曼石油	4,545,631.00	5.43
15	600908	无锡银行	4,532,580.00	5.42
16	600629	华建集团	4,510,515.00	5.39
17	300380	安硕信息	4,449,748.00	5.32
18	688195	腾景科技	4,340,920.31	5.19
19	603300	华铁应急	4,309,285.00	5.15
20	300002	神州泰岳	4,234,941.00	5.06
21	603681	永冠新材	4,195,183.00	5.01
22	002174	游族网络	4,161,364.00	4.97
23	300605	恒锋信息	4,067,812.00	4.86
24	600129	太极集团	4,047,442.90	4.84
25	603979	金诚信	3,955,757.92	4.73
26	002919	名臣健康	3,917,673.00	4.68
27	600310	广西能源	3,899,071.00	4.66
28	300647	超频三	3,792,988.00	4.53
29	300519	新光药业	3,790,842.00	4.53
30	300426	唐德影视	3,752,224.00	4.48
31	300494	盛天网络	3,727,811.80	4.45

32	600072	中船科技	3,693,246.00	4.41
33	002544	普天科技	3,683,291.00	4.40
34	600239	云南城投	3,628,600.00	4.34
35	002401	中远海科	3,585,754.00	4.28
36	002085	万丰奥威	3,549,523.00	4.24
37	300241	瑞丰光电	3,504,131.00	4.19
38	000802	北京文化	3,480,683.00	4.16
39	600133	东湖高新	3,465,282.39	4.14
40	600708	光明地产	3,463,416.00	4.14
41	600697	欧亚集团	3,461,591.00	4.14
42	000888	峨眉山 A	3,449,254.00	4.12
43	601200	上海环境	3,443,743.00	4.11
44	601567	三星医疗	3,441,363.00	4.11
45	605088	冠盛股份	3,400,534.00	4.06
46	002416	爱施德	3,396,110.00	4.06
47	000028	国药一致	3,373,475.00	4.03
48	002858	力盛体育	3,371,562.00	4.03
49	300364	中文在线	3,370,860.00	4.03
50	600531	豫光金铅	3,365,596.00	4.02
51	300406	九强生物	3,365,241.00	4.02
52	688095	福昕软件	3,360,821.58	4.02
53	300031	宝通科技	3,342,007.02	3.99
54	300533	冰川网络	3,332,117.00	3.98
55	002376	新北洋	3,320,669.00	3.97
56	000936	华西股份	3,281,801.00	3.92
57	600761	安徽合力	3,273,426.00	3.91
58	000417	合肥百货	3,241,184.00	3.87
59	300459	汤姆猫	3,236,293.00	3.87
60	002068	黑猫股份	3,220,473.05	3.85
61	002233	塔牌集团	3,220,457.00	3.85
62	600771	广誉远	3,208,142.00	3.83
63	002515	金字火腿	3,193,675.00	3.82
64	600257	大湖股份	3,187,970.00	3.81
65	600750	江中药业	3,185,343.00	3.81
66	603258	电魂网络	3,162,538.00	3.78
67	603918	金桥信息	3,141,751.00	3.75
68	601038	一拖股份	3,138,157.00	3.75
69	002605	姚记科技	3,134,398.00	3.75
70	603687	大胜达	3,114,432.00	3.72
71	300192	科德教育	3,097,468.00	3.70
72	601963	重庆银行	3,093,804.00	3.70
73	000517	荣安地产	3,086,558.00	3.69
74	600162	香江控股	3,045,096.00	3.64

75	002400	省广集团	3,008,491.00	3.59
76	000901	航天科技	3,004,480.00	3.59
77	601595	上海电影	2,962,489.00	3.54
78	300188	国投智能	2,957,324.60	3.53
79	300889	爱克股份	2,929,912.00	3.50
80	300655	晶瑞电材	2,915,391.00	3.48
81	300644	南京聚隆	2,897,068.50	3.46
82	603530	神马电力	2,887,979.00	3.45
83	600386	北巴传媒	2,875,647.00	3.44
84	600361	创新新材	2,875,189.00	3.44
85	600643	爱建集团	2,872,194.00	3.43
86	002158	汉钟精机	2,815,634.00	3.36
87	000828	东莞控股	2,798,982.00	3.34
88	600376	首开股份	2,785,888.00	3.33
89	600684	珠江股份	2,768,316.00	3.31
90	600743	华远地产	2,764,983.00	3.30
91	600604	市北高新	2,745,114.00	3.28
92	002570	贝因美	2,730,706.00	3.26
93	300462	华铭智能	2,692,901.00	3.22
94	603390	通达电气	2,690,957.00	3.22
95	002747	埃斯顿	2,655,498.00	3.17
96	000555	神州信息	2,642,431.00	3.16
97	603689	皖天然气	2,637,643.00	3.15
98	603028	赛福天	2,634,221.00	3.15
99	600273	嘉化能源	2,615,961.00	3.13
100	605599	菜百股份	2,611,932.00	3.12
101	603316	诚邦股份	2,600,257.00	3.11
102	002314	南山控股	2,595,912.00	3.10
103	600172	黄河旋风	2,593,902.00	3.10
104	601588	北辰实业	2,580,802.00	3.08
105	002611	东方精工	2,567,993.00	3.07
106	605177	东亚药业	2,557,543.00	3.06
107	300094	国联水产	2,553,561.00	3.05
108	603093	南华期货	2,551,104.00	3.05
109	000903	云内动力	2,526,785.00	3.02
110	688425	铁建重工	2,525,892.82	3.02
111	688121	卓然股份	2,517,715.70	3.01
112	000926	福星股份	2,516,961.00	3.01
113	002928	华夏航空	2,495,693.00	2.98
114	600322	津投城开	2,488,246.00	2.97
115	600802	福建水泥	2,456,854.00	2.94
116	600874	创业环保	2,433,018.00	2.91
117	600797	浙大网新	2,395,320.00	2.86

118	600510	黑牡丹	2,392,763.00	2.86
119	300694	蠡湖股份	2,374,380.00	2.84
120	300780	德恩精工	2,372,274.00	2.83
121	002495	佳隆股份	2,358,840.00	2.82
122	002839	张家港行	2,357,424.00	2.82
123	601011	宝泰隆	2,353,033.00	2.81
124	601827	三峰环境	2,352,646.00	2.81
125	300083	创世纪	2,346,608.00	2.80
126	002318	久立特材	2,345,490.00	2.80
127	600590	泰豪科技	2,344,424.10	2.80
128	300624	万兴科技	2,296,637.00	2.74
129	600789	鲁抗医药	2,288,374.00	2.73
130	688118	普元信息	2,273,294.20	2.72
131	002597	金禾实业	2,272,396.00	2.72
132	601208	东材科技	2,269,464.00	2.71
133	300168	万达信息	2,251,254.00	2.69
134	600251	冠农股份	2,245,932.00	2.68
135	300662	科锐国际	2,238,323.00	2.67
136	000913	钱江摩托	2,219,850.00	2.65
137	603967	中创物流	2,207,191.02	2.64
138	002253	川大智胜	2,204,913.00	2.63
139	300162	雷曼光电	2,176,682.00	2.60
140	600681	百川能源	2,169,913.00	2.59
141	300740	水羊股份	2,166,699.00	2.59
142	300206	理邦仪器	2,155,099.00	2.58
143	603118	共进股份	2,129,471.00	2.54
144	605033	美邦股份	2,093,758.00	2.50
145	000685	中山公用	2,086,039.00	2.49
146	603648	畅联股份	2,084,642.00	2.49
147	600094	大名城	2,081,582.00	2.49
148	002402	和而泰	2,079,620.00	2.48
149	600461	洪城环境	2,078,644.00	2.48
150	300767	震安科技	2,075,598.00	2.48
151	688356	键凯科技	2,070,791.53	2.47
152	002031	巨轮智能	2,035,873.00	2.43
153	601010	文峰股份	2,030,109.00	2.43
154	000061	农产品	2,029,356.00	2.42
155	603226	菲林格尔	2,029,242.00	2.42
156	688178	万德斯	2,018,806.12	2.41
157	603717	天域生态	2,010,232.00	2.40
158	603313	梦百合	2,006,957.00	2.40
159	600163	中闽能源	2,004,148.00	2.39
160	002811	郑中设计	1,988,740.00	2.38

161	300664	鹏鹞环保	1,981,715.00	2.37
162	688799	华纳药厂	1,980,361.46	2.37
163	301028	东亚机械	1,980,014.00	2.37
164	600064	南京高科	1,961,770.00	2.34
165	300940	南极光	1,958,675.00	2.34
166	600218	全柴动力	1,939,036.00	2.32
167	002367	康力电梯	1,933,256.00	2.31
168	600456	宝钛股份	1,913,513.00	2.29
169	002338	奥普光电	1,907,109.00	2.28
170	600120	浙江东方	1,887,953.00	2.26
171	300107	建新股份	1,885,527.00	2.25
172	300951	博硕科技	1,878,518.00	2.24
173	600458	时代新材	1,874,508.00	2.24
174	000851	高鸿股份	1,871,363.80	2.24
175	603586	金麒麟	1,870,836.00	2.24
176	603906	龙蟠科技	1,858,433.00	2.22
177	002161	远望谷	1,831,516.00	2.19
178	002472	双环传动	1,824,117.00	2.18
179	600391	航发科技	1,822,793.00	2.18
180	600716	凤凰股份	1,818,864.00	2.17
181	002582	好想你	1,818,144.00	2.17
182	002851	麦格米特	1,815,319.00	2.17
183	301067	显盈科技	1,809,195.00	2.16
184	688528	秦川物联	1,808,519.46	2.16
185	600635	大众公用	1,769,535.00	2.11
186	603829	洛凯股份	1,764,629.00	2.11
187	300968	格林精密	1,759,231.00	2.10
188	300118	东方日升	1,733,679.00	2.07
189	603990	麦迪科技	1,728,398.00	2.07
190	300159	新研股份	1,723,192.00	2.06
191	002287	奇正藏药	1,713,180.00	2.05
192	002003	伟星股份	1,697,987.00	2.03
193	002457	青龙管业	1,690,745.00	2.02
194	600638	新黄浦	1,680,308.00	2.01

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

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,390,129,795.39
卖出股票收入（成交）总额	1,033,890,535.18

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

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	12,998,133.68	2.64
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	12,998,133.68	2.64

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

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	019694	23 国债 01	89,000	9,073,808.47	1.84
2	019727	23 国债 24	34,000	3,421,708.77	0.70
3	019709	23 国债 16	5,000	502,616.44	0.10

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：无。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：无。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：无。

8.10 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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

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

8.11.2 本期国债期货投资评价

无。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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东北制药发行主体外，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。

根据辽宁省市场监督管理局发布的行政处罚决定书：

东北制药集团股份有限公司（简称东北制药）因滥用市场支配地位“以不公平的高价销售商品或者以不公平的低价购买商品”案由，于 2023 年 1 月 18 日被辽宁省市场监督管理局处以罚款等。

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。

8.12.2 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。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,011,991.08
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	11,560,289.16
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	12,572,280.24

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：无。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：无。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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	3,102	72,053.06	151,526,009.88	67.79	71,982,592.14	32.21
长城量化 小盘股票 C	1,409	104,129.96	133,218,497.94	90.80	13,500,621.39	9.20
合计	4,511	82,072.21	284,744,507.82	76.91	85,483,213.53	23.09

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）。

9.2 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	406,599.51	0.1819
	长城量化小盘股票 C	7.69	0.0000
	合计	406,607.20	0.1098

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）。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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	长城量化小盘股票 A	10~50

本开放式基金	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。

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

注：本报告期无基金经理兼任投资经理的情况。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

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	71,511,988.32	-
本报告期基金总申购份额	254,466,521.17	176,632,536.74
减：本报告期基金总赎回份额	102,469,907.47	29,913,417.41
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	223,508,602.02	146,719,119.33

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、基金管理人重大人事变动：

自 2023 年 2 月 6 日起，张勇先生担任公司副总经理。

自 2023 年 4 月 10 日起，何小乐女士担任公司副总经理。

自 2023 年 9 月 15 日起，车君女士担任公司副总经理，不再担任公司督察长。

自 2023 年 9 月 15 日起，祝函先生担任公司督察长。

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根据工作需要，任命牛环起、施伟为资产托

管业务部副总经理。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本基金本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略无改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

- 1、本期未有改聘会计师事务所。
- 2、本基金本报告期应支付给会计师事务所的报酬为人民币叁万伍仟元。
- 3、目前为本基金提供审计服务的会计师事务所为安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)，为本基金提供审计服务自本基金合同生效日持续至本报告期。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 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。

11.6.2 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
长城证券	6	2,421,280,292.58	100.00	580,541.78	100.00	-
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	-	-	-	-	-
招商证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
中金财富	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	3	-	-	-	-	-
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 3 个专用交易单元（江海证券、国元证券和西南证券各新增 1 个交易单元），减少 2 个专用交易单元（广州证券减少 2 个交易单元），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。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名 称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债 券 成交总额 的比例 (%)	成交金额	占当期债券 回购成交总 额的比例 (%)	成交金额	占当期权 证 成交总额 的比例 (%)
长城证 券	14,566,597. 63	100.00	75,581,000.0 0	100.00	-	-
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	-	-	-	-	-	-
招商证 券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
中金财 富	-	-	-	-	-	-
中金公 司	-	-	-	-	-	-
中泰证 券	-	-	-	-	-	-
中信建 投	-	-	-	-	-	-
中信证 券	-	-	-	-	-	-

中银国际	-	-	-	-	-	-
------	---	---	---	---	---	---

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	长城基金管理有限公司关于提醒投资者谨防金融诈骗的风险提示公告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 1 月 19 日
2	长城基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 2 月 6 日
3	长城基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 4 月 10 日
4	长城基金管理有限公司关于提醒投资者及时提供或更新身份信息资料的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 7 月 1 日
5	长城基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 8 月 18 日
6	长城基金管理有限公司关于终止凤凰金信（海口）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	2023 年 9 月 4 日
7	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	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 9 月 8 日
8	长城基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 9 月 16 日
9	长城基金管理有限公司关于旗下基金开展线上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	2023 年 11 月 7 日
10	长城基金管理有限公司关于提醒投资者谨防金融诈骗的风险提示公告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 11 月 23 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注：本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

注：无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

(一) 中国证监会准予长城量化小盘股票型证券投资基金注册的文件

(二) 《长城量化小盘股票型证券投资基金基金合同》

(三)《长城量化小盘股票型证券投资基金托管协议》

(四) 法律意见书

(五) 基金管理人业务资格批件、营业执照

(六) 基金托管人业务资格批件、营业执照

(七) 中国证监会规定的其他文件

13.2 存放地点

基金管理人及基金托管人住所

13.3 查阅方式

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

咨询电话：0755-29279188

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 3 月 29 日