

长城量化小盘股票型证券投资基金 2023 年第 4 季度报告

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

报告送出日期：2024 年 1 月 19 日

§ 1 重要提示

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

本基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 01 月 17 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 10 月 01 日起至 2023 年 12 月 31 日止。

§2 基金产品概况

| | |
|------------|--|
| 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 |
| 报告期末基金份额总额 | 370,227,721.35 份 |
| 投资目标 | 本基金利用定量投资模型，在有效控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳健增值。 |
| 投资策略 | <p>1、大类资产配置策略</p> <p>本基金通过定量与定性相结合的方法分析宏观经济和证券市场发展趋势，评估市场的系统性风险和各类资产的预期收益与风险，据此合理制定和调整股票、债券等各类资产的比例，在保持总体风险水平相对稳定的基础上，力争投资组合的稳定增值。此外，本基金将持续地进行定期与不定期的资产配置风险监控，适时地做出相应的调整。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>(1) 小盘股票的定义</p> <p>本基金每半年对中国 A 股市场中的股票按流通市值从小到大排序并相加，累计流通市值占比达到总流通市值 40% 的股票为小盘股票。</p> <p>在此期间，对于未纳入最近一次排序范围的股票(如新股上市、恢复上市股票等)，如果其流通市值或预计流通市值(如对于未上市新股)能够满足以上标准，也将纳入小</p> |

| | |
|--|--|
| | <p>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</p> |
|--|--|

| | | |
|-----------------|---|---------------------|
| | 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。 | |
| | 5、股指期货投资策略 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。 | |
| 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。 | |
| 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 | |
| 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 |

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期（2023 年 10 月 1 日-2023 年 12 月 31 日） | |
|-----------------|---------------------------------------|-------------------|
| | 长城量化小盘股票 A | 长城量化小盘股票 C |
| 1. 本期已实现收益 | 3, 622, 417. 17 | 2, 442, 052. 00 |
| 2. 本期利润 | 4, 487, 621. 34 | -1, 371, 973. 24 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0. 0219 | -0. 0170 |
| 4. 期末基金资产净值 | 296, 932, 432. 56 | 194, 959, 574. 33 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1. 3285 | 1. 3288 |

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

长城量化小盘股票 A

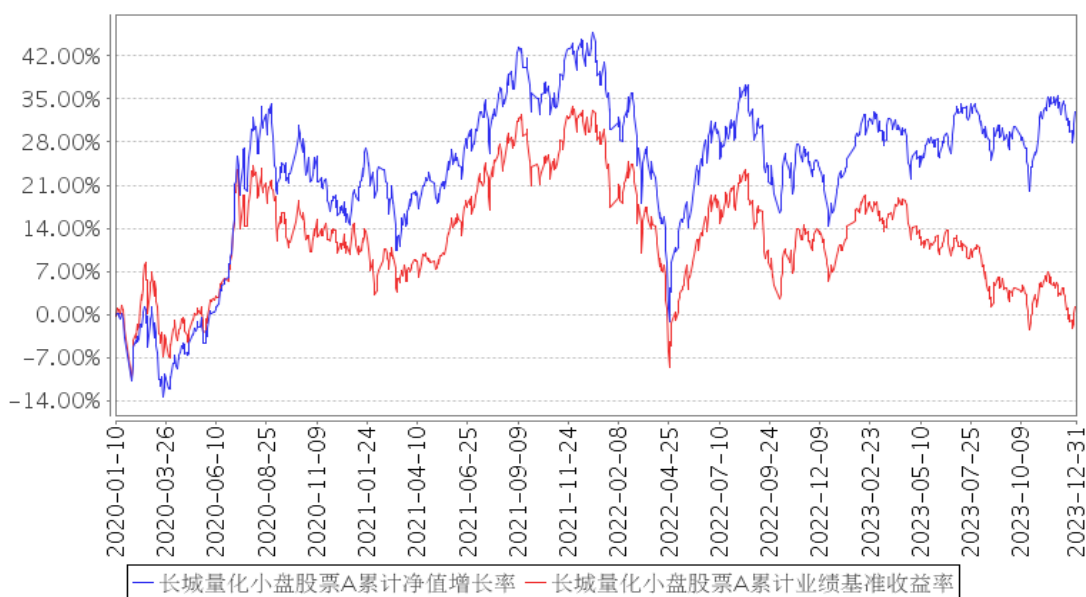
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|--------|-----------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去三个月 | 1.83% | 0.94% | -2.81% | 0.93% | 4.64% | 0.01% |
| 过去六个月 | 0.39% | 0.88% | -9.73% | 0.90% | 10.12% | -0.02% |
| 过去一年 | 13.52% | 0.87% | -5.54% | 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

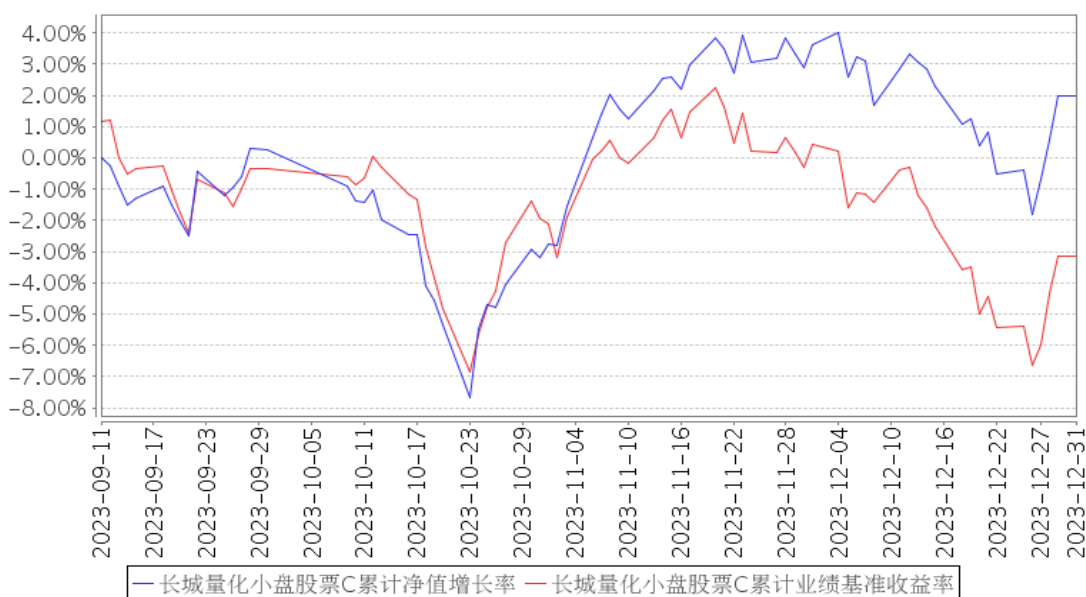
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|--------|-----------|------------|---------------|-------|-------|
| 过去三个月 | 1.69% | 0.94% | -2.81% | 0.93% | 4.50% | 0.01% |
| 过去六个月 | - | - | - | - | - | - |
| 过去一年 | - | - | - | - | - | - |
| 过去三年 | - | - | - | - | - | - |
| 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。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|----|------------------------------|-------------|------|--------|--|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 雷俊 | 公司总经理助理、量化与指数投资部总经理、本基金的基金经理 | 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。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格执行了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 报告期内基金的投资策略和运作分析

四季度市场震荡下行，以陆股通为代表的北向净流入显著为负，大盘指数影响较大，中小型宽基指数跌幅略小，市场总体还是存量资金博弈为主。受资金流向影响，传统机构持仓的白马成长股承压较大，低价股、小微市值型股票延续了全年的强势风格，红利、低波、流动性因子有显著超额收益，盈利性因子仍然表现不佳。行业上看，顺周期相关的板块表现较差，红利行业如电力、煤炭等表现强劲，TMT 板块居中，震荡比较剧烈。报告期内，本基金较好的利用了中小市值因子和广度投资选股优势，超额收益明显。

本基金基于长城基金量化投资研究平台的研究成果，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；利用投资广度分散个股与行业风险，根据多因子得分进行组合权重优化，力争最大化的获取超额收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末长城量化小盘股票 A 的基金份额净值为 1.3285 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.83%；截至本报告期末长城量化小盘股票 C 的基金份额净值为 1.3288 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.69%。同期业绩比较基准收益率为-2.81%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内，本基金无需要说明的情况。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额（元） | 占基金总资产的比例（%） |
|----|----|-------|--------------|
|----|----|-------|--------------|

| | | | |
|---|-------------------|----------------|--------|
| 1 | 权益投资 | 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 | 其他资产 | 12,572,280.24 | 2.34 |
| 9 | 合计 | 537,251,708.51 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|----------------|--------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | 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 |

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：无。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|-----------|--------------|--------------|
| 1 | 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 |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|---------------|--------------|
| 1 | 国家债券 | 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 |

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|----------|--------|--------------|--------------|
| 1 | 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 |

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

注：无。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：无。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：无。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

| 代码 | 名称 | 持仓量（买/卖） | 合约市值(元) | 公允价值变动（元） | 风险说明 |
|-------------------|--------|----------|--------------|------------|--|
| IM2401 | IM2401 | 5 | 5,888,000.00 | 220,692.31 | 本基金在进行股指期货投资时,遵守法律法规的规定和基金合同的约定,符合既定的投资策略和投资目标。采用流动性好、交易活跃的期货合约,对现货资产进行部分对冲,以增厚整个组合的风险调整后的收益。基金管理人将充分考虑股指期货的收益特征、流动性以及风险特征,运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险,如大额申购赎回等。 |
| 公允价值变动总额合计（元） | | | | | 220,692.31 |
| 股指期货投资本期收益（元） | | | | | -247,498.83 |
| 股指期货投资本期公允价值变动（元） | | | | | 220,692.31 |

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

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

国债期货交易。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：无。

5.10.3 本期国债期货投资评价

无。

5.11 投资组合报告附注

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

本报告期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。

5.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中，未有投资于超出基金合同规定备选股票库之外股票。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|----|---------|---------------|
| 1 | 存出保证金 | 1,011,991.08 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 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 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 12,572,280.24 |

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：无。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：无。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 长城量化小盘股票 A | 长城量化小盘股票 C |
|---------------------------|----------------|----------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 200,692,152.90 | 7,722,832.98 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 73,576,238.14 | 168,909,703.76 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 50,759,789.02 | 29,913,417.41 |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 223,508,602.02 | 146,719,119.33 |

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

| 项目 | 长城量化小盘股票 A | 长城量化小盘股票 C |
|--------------------------|---------------|------------|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额 | 10,426,485.92 | - |
| 报告期期间买入/申购总份额 | - | - |
| 报告期期间卖出/赎回总份额 | - | - |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额 | 10,426,485.92 | - |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%） | 2.82 | - |

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：本报告期本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

注：无。

§9 备查文件目录

9.1 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

9.2 存放地点

基金管理人及基金托管人住所

9.3 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