

# 景顺长城量化小盘股票型证券投资基金 2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：景顺长城基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2024 年 8 月 30 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 08 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 01 月 01 日起至 2024 年 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	8
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
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	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	11
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>11</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
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	11
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	11
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>11</b>
6.1 资产负债表	11
6.2 利润表	13
6.3 净资产变动表	14
6.4 报表附注	16
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>37</b>
7.1 期末基金资产组合情况	37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	38
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	52
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	53

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 .....	53
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	53
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	54
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	54
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	54
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	54
7.12 投资组合报告附注 .....	54
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>55</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	55
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	55
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	55
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>55</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>56</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	56
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	56
10.4 基金投资策略的改变 .....	56
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	56
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	56
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	56
10.8 其他重大事件 .....	61
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>62</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	62
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	63
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>63</b>
12.1 备查文件目录 .....	63
12.2 存放地点 .....	63
12.3 查阅方式 .....	63

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	景顺长城量化小盘股票型证券投资基金
基金简称	景顺长城量化小盘股票
场内简称	无
基金主代码	005457
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018 年 2 月 6 日
基金管理人	景顺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	292,081,905.16 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过量化模型精选股票，在严格控制风险的前提下，力争获取超越业绩比较基准的投资回报，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	<p>1、资产配置策略： 本基金股票资产占基金资产的比例为 80%-95%，大类资产配置不作为本基金的核心策略。一般情况下将保持各类资产配置的基本稳定。在综合考量系统性风险、各类资产收益风险比值、股票资产估值、流动性要求、申购赎回以及分红等因素后，对基金资产配置做出合适调整。</p> <p>2、股票投资策略： 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>3、债券投资策略： 出于对流动性、跟踪误差、有效利用基金资产的考量，本基金适时对债券进行投资。通过研究国内外宏观经济、货币和财政政策、市场结构变化、资金流动情况，采取自上而下的策略判断未来利率变化和收益率曲线变动的趋势及幅度，确定组合久期。进而根据各类资产的预期收益率，确定债券资产配置。</p>
业绩比较基准	中证 1000 指数收益率*95%+银行活期存款利率(税后)*5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种，其预期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	景顺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	杨皞阳
	联系电话	0755-82370388
	电子邮箱	investor@igwfm.com
		王小飞
		021-60637103
		wangxiaofei.zh@ccb.com

客户服务电话	4008888606	021-60637228
传真	0755-22381339	021-60635778
注册地址	深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 层	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址	深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码	518048	100033
法定代表人	李进	张金良

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.igwfm.com
基金中期报告备置地点	基金管理人的办公场所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	景顺长城基金管理有限公司	深圳市福田区中心四路 1 号嘉里建设广场第一座 21 层

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2024 年 1 月 1 日-2024 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-178,227,889.45
本期利润	-174,482,958.42
加权平均基金份额本期利润	-0.3930
本期加权平均净值利润率	-35.14%
本期基金份额净值增长率	-11.70%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	3,253,053.45
期末可供分配基金份额利润	0.0111
期末基金资产净值	310,980,887.17
期末基金份额净值	1.0647
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	29.87%

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、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3、基金份额净值的计算精确到小数点后四位，小数点后第五位舍去，由此产生的误差计入基金资产。

4、上述基金业绩指标不包括持有人认购或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。

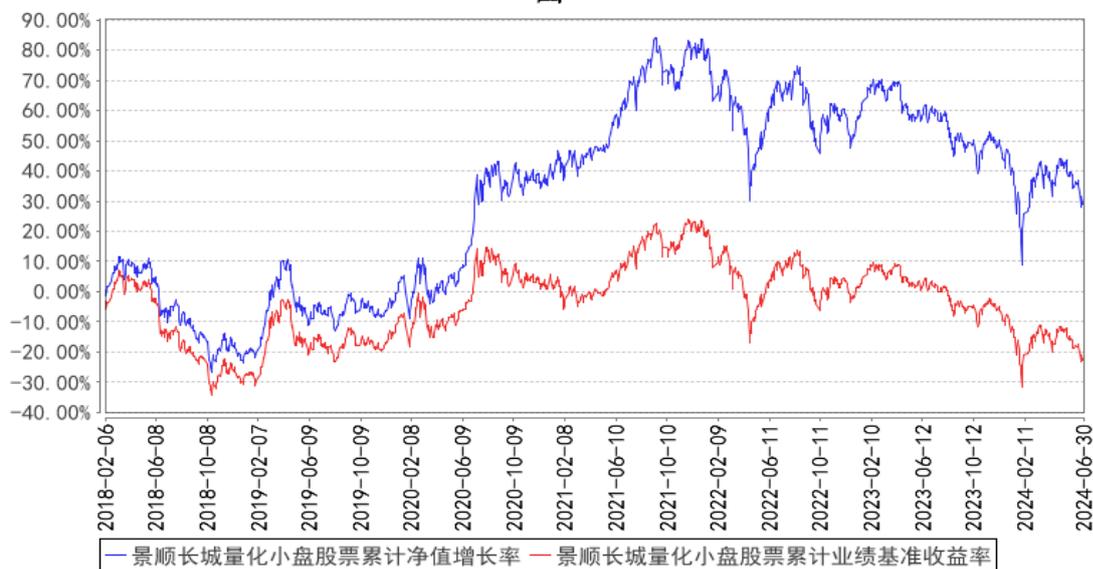
### 3.2 基金净值表现

#### 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

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-6.91%	1.31%	-8.15%	1.36%	1.24%	-0.05%
过去三个月	-6.24%	1.35%	-9.51%	1.42%	3.27%	-0.07%
过去六个月	-11.70%	1.86%	-15.97%	1.87%	4.27%	-0.01%
过去一年	-19.09%	1.46%	-24.61%	1.47%	5.52%	-0.01%
过去三年	-20.75%	1.33%	-29.31%	1.36%	8.56%	-0.03%
自基金合同生效起至今	29.87%	1.42%	-22.43%	1.43%	52.30%	-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

景顺长城量化小盘股票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：基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 80%–95%，投资于小盘股票的比例不低于非现金基金资产的 80%，除股票外的其他资产占基金资产的比例范围为 5%–20%，每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本基金的建仓期为自 2018 年 2 月 6 日基金合同生效日起 6 个月。建仓期结束时，本基金投资组合达到上述投资组合比例的要求。

### 3.3 其他指标

无。

## § 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

本基金管理人景顺长城基金管理有限公司（以下简称“本公司”）是经中国证监会证监基金字[2003]76号文批准设立的证券投资基金管理公司，由长城证券股份有限公司、景顺资产管理有限公司、开滦（集团）有限责任公司、大连实德集团有限公司共同发起设立，并于2003年6月9日获得开业批文，注册资本1.3亿元人民币，目前，各家出资比例分别为49%、49%、1%、1%。总部设在深圳，在北京、上海、广州设有分公司，并设立全资子公司——景顺长城资产管理（深圳）有限公司。

本公司拥有公募、特定客户资产管理、QDII等业务资格，截至2024年6月30日，本公司旗下共管理184只开放式基金，在主动权益、固定收益、指数投资、量化投资、海外投资、资产配置等多个领域布局。

本公司采用团队投资方式，即通过整个投资部门全体人员的共同努力，争取良好投资业绩。

#### 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		
黎海威	本基金的基金经理	2018年2月6日	-	21年	经济学硕士，CFA。曾任美国穆迪KMV公司研究员，美国贝莱德集团（原巴克莱国际投资管理有限公司）基金经理、主动股票部副总裁，香港海通国际资产管理有限公司（海通国际投资管理有限公司）量化总监。2012年8月加入本公司，自2013年10月起担任量化及指数投资部基金经理，现任公司副总经理、量化及指数投资部总经理、基金经理。具有21年证券、基金行业从业经验。

注：1、对基金的首任基金经理，其“任职日期”按基金合同生效日填写，“离任日期”为根据公司决定的解聘日期（公告前一日）；对此后的非首任基金经理，“任职日期”指根据公司决定聘任后的公告日期，“离任日期”指根据公司决定的解聘日期（公告前一日）；

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

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《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》和《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则、《景顺长城量化小盘股票型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，未发现损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见（2011年修订）》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本管理人管理的所有投资组合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% 的交易共有 9 次，为投资组合的投资策略需要而发生的同日反向交易，按规定履行了审批程序。

本报告期内，未发现有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

#### 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

2024 年上半年，国内经济在经历了一季度的亮眼开局之后出现一定的边际走弱，较强的出口数据带动工业生产保持韧性，内需在地产持续下行、居民预期偏弱的背景下仍旧疲弱。从数据来看，4-6 月国内制造业 PMI 依次为 50.4、49.5、49.5，5、6 两月 PMI 重新跌入收缩区间。今年前 6 个月工业增加值累计同比增长 6.0%，其中 6 月份工业增加值当月同比增长 5.3%，经济延续弱复苏的格局。6 月 CPI 同比上升 0.2%，环比下降 0.2%；PPI 同比下降 0.8%，环比下降 0.2%，价格类指标依旧偏弱。6 月 M2 同比增长 6.2%，M1 同比下降 5.0%，信贷需求仍然偏弱；6 月末外汇储备 3.22 万亿美元，汇率短期承压。整体而言，国内经济依然处于弱复苏的态势，“稳增长”政策的效果正在逐步显现。上半年 A 股市场震荡调整，结构有所分化，上证指数下跌 0.25%，沪深 300

指数上涨 0.89%，创业板指数下跌 10.99%。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2024 年上半年，本基金份额净值增长率为-11.70%，业绩比较基准收益率为-15.97%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2024 年下半年，海外方面，美联储的货币政策依然是市场关注的热点，但其对国内资本市场的边际影响明显降低。国内方面，我们认为三季度国内经济环比二季度大概率能够边际回升，前期政策的累积效应以及新的“稳增长”政策对经济形成一定支撑；新“国九条”的推出将会改善股市微观供需结构，并进一步提升 A 股市场的投资价值。长期来看，改革创新是保持经济增长的根本动力，在科学技术带动产业升级的大背景下，我们对经济的长期健康发展持较为乐观的态度。目前 A 股市场整体估值已进入长期价值配置区间，具有较高成长性的行业和较强竞争力的公司，将具备较高的投资价值。我们的投资组合仍然会维持价值和成长之间的平衡，同时关注现金流良好和内生长稳健的公司，在股市波动中以自下而上选股为主以期产生长期投资回报。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人成立基金估值委员会对基金财产的估值方法及程序作决策，基金估值委员会在遵守法律法规的前提下，通过参考行业协会的估值指引及独立第三方估值服务机构的估值数据等方式，谨慎合理地制定高效可行的估值方法，及时准确地进行份额净值的计量，保护基金份额持有人的合法权益。

基金日常估值由基金管理人同基金托管人一同进行。基金份额净值由基金管理人完成估值后，将估值结果以双方认可的方式报送给基金托管人，基金托管人按基金合同规定的估值方法、时间、程序进行复核，无误后返回给基金管理人，由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

当发生了影响估值方法和程序的有效性及适用性的情况时，通过会议方式启动估值委员会的运作。研究人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，综合宏观经济、行业发展及个券状况等各方面因素，从价值投资的角度进行理论分析，并根据分析的结果向基金估值委员会提出有关估值方法或估值模型的建议。风险管理人员根据研究人员提出的估值方法或估值模型进行计算及验证，并根据计算和验证的结果与投资人员共同确定估值方法并提交估值委员会。基金事务部基金会计负责与基金托管人沟通，必要时应就所采用的估值技术、假设及输入值得适当性等咨询会计师事务所的专业意见。法律、监察稽核部相关人员负责监察执行估值政策及程序的合规性，控制执行中可能发生的风险。估值委员会共同讨论通过后，基金事务部基金会计根据估值委员会确认的估值方法对各基金进行估值核算并与基金托管行核对，法律、监察稽核部

负责对外进行信息披露。

截止本报告期末，本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司、中证指数有限公司合作，由其提供相关债券品种、流通受限股票的估值参考数据。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

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

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

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：景顺长城量化小盘股票型证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	22,524,139.24	85,365,489.72
结算备付金		8,877,878.74	31,032,622.31
存出保证金		1,394,326.80	4,224,180.16

交易性金融资产	6.4.7.2	280,301,352.70	1,205,831,923.67
其中：股票投资		280,221,867.64	1,204,657,343.66
基金投资		-	-
债券投资		79,485.06	1,174,580.01
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		59,229.38	86,042.14
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		313,156,926.86	1,326,540,258.00
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024年6月30日</b>	<b>上年度末 2023年12月31日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	9,787,675.00
应付赎回款		314,369.16	245,958.94
应付管理人报酬		317,155.03	1,391,377.54
应付托管费		52,859.17	231,896.27
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		45,144.37	2.78
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	1,446,511.96	4,491,963.45
负债合计		2,176,039.69	16,148,873.98
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	292,081,905.16	1,086,722,403.05
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	18,898,982.01	223,668,980.97
净资产合计		310,980,887.17	1,310,391,384.02

负债和净资产总计		313,156,926.86	1,326,540,258.00
----------	--	----------------	------------------

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，基金份额净值人民币 1.0647 元，基金份额总额 292,081,905.16 份。

## 6.2 利润表

会计主体：景顺长城量化小盘股票型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		-170,978,602.79	45,116,810.83
1. 利息收入		206,852.68	271,593.89
其中：存款利息收入	6.4.7.13	206,852.68	271,593.89
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）		-176,009,726.34	18,449,980.33
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-183,821,028.60	8,428,242.45
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	179,413.10	762,762.21
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	3,651,941.94	-2,719,014.86
股利收益	6.4.7.19	3,979,947.22	11,977,990.53
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	3,744,931.03	26,039,806.45
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	1,079,339.84	355,430.16
<b>减：二、营业总支出</b>		3,504,355.63	8,468,943.08
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,898,889.62	7,179,804.77
其中：暂估管理人报酬		-	-

2. 托管费	6.4.10.2.2	483,148.32	1,196,634.11
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		13,187.36	98.09
8. 其他费用	6.4.7.23	109,130.33	92,406.11
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-174,482,958.42	36,647,867.75
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-174,482,958.42	36,647,867.75
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-174,482,958.42	36,647,867.75

### 6.3 净资产变动表

会计主体：景顺长城量化小盘股票型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	1,086,722,403.05	-	223,668,980.97	1,310,391,384.02
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	1,086,722,403.05	-	223,668,980.97	1,310,391,384.02
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-794,640,497.89	-	-204,769,998.96	-999,410,496.85
（一）、综合收益总额	-	-	-174,482,958.42	-174,482,958.42
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数	-794,640,497.89	-	-30,287,040.54	-824,927,538.43

(净资产减少以“-”号填列)				
其中：1. 基金申购款	10,897,740.09	-	1,096,185.47	11,993,925.56
2. 基金赎回款	-805,538,237.98	-	-31,383,226.01	-836,921,463.99
(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	292,081,905.16	-	18,898,982.01	310,980,887.17
项目	上年度可比期间			
	2023年1月1日至2023年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	335,576,804.15	-	172,774,137.11	508,350,941.26
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	335,576,804.15	-	172,774,137.11	508,350,941.26
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	782,123,468.89	-	233,355,667.30	1,015,479,136.19
(一)、综合收益总额	-	-	36,647,867.75	36,647,867.75
(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)	782,123,468.89	-	457,918,629.91	1,240,042,098.80
其中：1. 基金申购款	880,328,147.02	-	519,938,922.81	1,400,267,069.83
2. 基金赎回款	-98,204,678.13	-	-62,020,292.90	-160,224,971.03

(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)	-	-	-261,210,830.36	-261,210,830.36
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	1,117,700,273.04	-	406,129,804.41	1,523,830,077.45

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>康乐</u>	<u>吴建军</u>	<u>邵媛媛</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

景顺长城量化小盘股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)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[2017]第 2169 号《关于准予景顺长城量化小盘股票型证券投资基金注册的批复》核准,由景顺长城基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城量化小盘股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 1,783,703,963.03 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2018)第 0090 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《景顺长城量化小盘股票型证券投资基金基金合同》于 2018 年 2 月 6 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,784,551,427.10 份基金份额,其中认购资金利息折合 847,464.07 份基金份额。本基金的基金管理人为景顺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。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《景顺长城量化小盘股票型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票及存托凭证)、债券(包括国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、可交换公司债券、可转换公司债券(含可分离交易可转债)、中小企业私募债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债等)、

债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货、国债期货以及法律法规允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。基金的投资组合比例为:股票投资占基金资产的比例范围为 80-95%,投资于小盘股票的比例不低于非现金基金资产的 80%,除股票外的其他资产占基金资产的比例范围为 5%-20%,每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需要缴纳的交易保证金后,现金或到期日在一年以内的政府证券不低于基金净资产净值的 5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为:中证 1000 指数收益率 X95%+银行活期存款利率(税后)X5%。

本财务报表由本基金的基金管理人景顺长城基金管理有限公司于 2024 年 8 月 28 日批准报出。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》和在财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2024 年半年度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 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策和会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

无。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《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》、财税[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101号《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》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《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》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140号《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》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2023]39号《关于减半征收交易印花税的公告》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前(如适用)运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对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，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起(如适用)产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对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，股票的股息、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。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，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，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%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。

对基金通过沪港通或深港通(如有)投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利, H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请, 由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册, H 股公司按照 20%的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通或深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利, 由中国结算按照 20%的税率代扣个人所得税。

(4)基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税, 买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》, 自 2023 年 8 月 28 日起, 证券交易印花税实施减半征收。基金通过沪港通或深港通(如有)买卖、继承、赠与联交所上市股票, 按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(5)本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 货币资金

单位: 人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	22,524,139.24
等于: 本金	22,522,221.73
加: 应计利息	1,917.51
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 个月(含)-3 个月	-
其他存款	-
等于: 本金	-
加: 应计利息	-
减: 坏账准备	-
合计	22,524,139.24

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位: 人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	298,968,666.13	-	280,221,867.64	-18,746,798.49

贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	73,600.00	70.66	79,485.06
	银行间市场	-	-	-
	合计	73,600.00	70.66	79,485.06
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	299,042,266.13	70.66	280,301,352.70	-18,740,984.09

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	10,336,040.00	-	-	-
其中：股指期货投资	10,336,040.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	10,336,040.00	-	-	-

##### 6.4.7.3.2 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
IM2407	IM2407	10.00	9,716,000.00	-620,040.00
合计				-620,040.00
减：可抵销期货暂收款				-620,040.00
净额				-

注：（1）衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，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。

**6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况**

无。

**6.4.7.4 买入返售金融资产****6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

本基金本报告期末的买入返售金融资产余额为零。

**6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券**

本基金本报告期末买断式逆回购交易中取得的债券余额为零。

**6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明**

无。

**6.4.7.5 债权投资****6.4.7.5.1 债权投资情况**

本基金本报告期末债权投资余额为零。

**6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况**

本基金本报告期末债权投资余额为零。

**6.4.7.6 其他债权投资****6.4.7.6.1 其他债权投资情况**

本基金本报告期末其他债权投资余额为零。

**6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况**

本基金本报告期末其他债权投资余额为零。

**6.4.7.7 其他权益工具投资****6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况**

本基金本报告期末其他权益工具投资余额为零。

**6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况**

本基金本报告期末其他权益工具投资余额为零。

**6.4.7.8 其他资产**

本基金本报告期末其他资产余额为零。

**6.4.7.9 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	52.55

应付证券出借违约金	-
应付交易费用	1,342,033.27
其中：交易所市场	1,342,033.27
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	104,426.14
合计	1,446,511.96

#### 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,086,722,403.05	1,086,722,403.05
本期申购	10,897,740.09	10,897,740.09
本期赎回（以“-”号填列）	-805,538,237.98	-805,538,237.98
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	292,081,905.16	292,081,905.16

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.11 其他综合收益

无。

#### 6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	293,676,790.74	-70,007,809.77	223,668,980.97
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	293,676,790.74	-70,007,809.77	223,668,980.97
本期利润	-178,227,889.45	3,744,931.03	-174,482,958.42
本期基金份额交易产生的变动数	-112,195,847.84	81,908,807.30	-30,287,040.54
其中：基金申购款	522,068.63	574,116.84	1,096,185.47
基金赎回款	-112,717,916.47	81,334,690.46	-31,383,226.01
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,253,053.45	15,645,928.56	18,898,982.01

## 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
活期存款利息收入	63,943.42
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	140,793.53
其他	2,115.73
合计	206,852.68

## 6.4.7.14 股票投资收益

## 6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-183,821,028.60
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	-183,821,028.60

## 6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
卖出股票成交总额	2,996,993,551.71
减：卖出股票成本总额	3,174,022,944.48
减：交易费用	6,791,635.83
买卖股票差价收入	-183,821,028.60

## 6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

## 6.4.7.15 债券投资收益

## 6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
债券投资收益——利息收入	198.31
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	179,214.79
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	179,413.10

#### 6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,201,884.67
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,022,400.00
减：应计利息总额	221.96
减：交易费用	47.92
买卖债券差价收入	179,214.79

#### 6.4.7.16 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

##### 6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

#### 6.4.7.17 贵金属投资收益

##### 6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

##### 6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

#### 6.4.7.18 衍生工具收益

##### 6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

##### 6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
股指期货投资收益	3,651,941.94

#### 6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日

股票投资产生的股利收益	3,979,947.22
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	3,979,947.22

#### 6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
1. 交易性金融资产	4,980,651.03
股票投资	5,053,328.39
债券投资	-72,677.36
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-1,235,720.00
权证投资	-
期货投资	-1,235,720.00
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	3,744,931.03

#### 6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
基金赎回费收入	686,609.88
基金转换费收入	392,729.96
合计	1,079,339.84

#### 6.4.7.22 信用减值损失

无。

#### 6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
审计费用	44,753.80
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行划款手续费	4,344.19
其他	360.00

合计	109,130.33
----	------------

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期，与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
景顺长城基金管理有限公司	基金管理人、登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人、基金销售机构
长城证券股份有限公司（“长城证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）
长城证券	324,385,912.96	6.19	25,576,562.31	0.30

###### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

###### 6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例（%）
长城证券	306,838.01	6.19	300,385.54	22.38

关联方名称	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
长城证券	23,819.84	0.30	23,819.84	0.45

注：1. 上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6 月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,898,889.62	7,179,804.77
其中：应支付销售机构的客户维护费	567,865.61	1,251,922.93
应支付基金管理人的净管理费	2,331,024.01	5,927,881.84

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.5\% / \text{当年天数}。$$

根据《景顺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》，自 2023 年 8 月 22 日起，支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.2% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.2\% / \text{当年天数}。$$

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6 月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年 6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	483,148.32	1,196,634.11

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.25\% / \text{当年天数}。$$

根据《景顺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》，自

2023 年 8 月 22 日起，支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.2% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.2\% / \text{当年天数}。$$

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

本基金本报告期及上年度可比期间无支付给各关联方的销售服务费。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金于本报告期及上年度可比期间未与关联方发生转融通证券出借业务交易。

##### 6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金于本报告期及上年度可比期间未与关联方发生转融通证券出借业务交易。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人于本报告期及上年度可比期间未运用自有资金投资本基金。

##### 6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金的其他关联方于本报告期末及上年度末均未持有本基金份额。

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行-活期	22,524,139.24	63,943.42	99,033,917.71	138,418.09

注：本基金的活期银行存款由基金托管人保管，并按银行间同业利率计息。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无其他关联交易事项。

## 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配。

## 6.4.12 期末（2024 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

## 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
001359	平安电工	2024年3月19日	6个月	新股流通受限	17.39	20.60	184	3,199.76	3,790.40	-
001379	腾达科技	2024年1月11日	6个月	新股流通受限	16.98	13.48	213	3,616.74	2,871.24	-
001387	雪祺电气	2024年1月4日	6个月	新股流通受限	15.38	15.25	133	2,045.54	2,028.25	-
001387	雪祺电气	2024年6月3日	1-6个月(含)	新股流通受限	-	15.25	40	-	610.00	转增股
001389	广合科技	2024年3月26日	6个月	新股流通受限	17.43	34.56	222	3,869.46	7,672.32	-
301392	汇成真空	2024年5月28日	6个月	新股流通受限	12.20	41.66	219	2,671.80	9,123.54	-
301502	华阳智能	2024年1月26日	6个月	新股流通受限	28.01	37.83	138	3,865.38	5,220.54	-
301536	星辰科技	2024年3月20日	6个月	新股流通受限	16.16	32.27	481	7,772.96	15,521.87	-
301538	骏鼎达	2024年3月13日	6个月	新股流通受限	55.82	91.24	107	5,972.74	9,762.68	-
301538	骏鼎达	2024年5月22日	1-6个月(含)	新股流通受限	-	91.24	43	-	3,923.32	转增股
301539	宏鑫科技	2024年4月3日	6个月	新股流通	10.64	19.82	361	3,841.04	7,155.02	-

		日		受限						
301565	中仑新材	2024年6月13日	6个月	新股流通受限	11.88	18.98	711	8,446.68	13,494.78	-
301566	达利凯普	2023年12月22日	6个月以上	新股流通受限	8.90	16.97	576	5,126.40	9,774.72	-
301580	爱迪特	2024年6月19日	6个月	新股流通受限	44.95	65.93	202	9,079.90	13,317.86	-
301587	中瑞股份	2024年3月27日	6个月	新股流通受限	21.73	25.26	306	6,649.38	7,729.56	-
301588	美新科技	2024年3月6日	6个月	新股流通受限	14.50	21.25	257	3,726.50	5,461.25	-
603082	北自科技	2024年1月23日	6个月	新股流通受限	21.28	29.49	107	2,276.96	3,155.43	-
603285	键邦股份	2024年6月28日	1个月内(含)	新股流通受限	18.65	18.65	1,158	21,596.70	21,596.70	-
603285	键邦股份	2024年6月28日	6个月	新股流通受限	18.65	18.65	129	2,405.85	2,405.85	-
603312	西典新能	2024年1月4日	6个月	新股流通受限	29.02	25.36	130	3,772.60	3,296.80	-
603325	博隆技术	2024年1月3日	6个月	新股流通受限	72.46	68.06	66	4,782.36	4,491.96	-
603341	龙旗科技	2024年2月23日	6个月	新股流通受限	26.00	37.49	204	5,304.00	7,647.96	-
603344	星德胜	2024年3月13日	6个月	新股流通受限	19.18	22.66	182	3,490.76	4,124.12	-
603350	安乃达	2024年6月26日	1个月内(含)	新股流通受限	20.56	20.56	945	19,429.20	19,429.20	-
603350	安乃达	2024年6月26日	6个月	新股流通受限	20.56	20.56	106	2,179.36	2,179.36	-
603375	盛景	2024年	6个月	新股	38.18	38.90	72	2,748.96	2,800.80	-

	微	1月17日		流通受限						
603381	永臻股份	2024年6月19日	6个月	新股流通受限	23.35	25.13	149	3,479.15	3,744.37	-
688530	欧莱新材	2024年4月29日	6个月	新股流通受限	9.60	16.10	344	3,302.40	5,538.40	-
688691	灿芯股份	2024年4月2日	6个月	新股流通受限	19.86	42.51	247	4,905.42	10,499.97	-
688692	达梦数据	2024年6月4日	6个月	新股流通受限	86.96	174.93	137	11,913.52	23,965.41	-
688695	中创股份	2024年3月6日	6个月	新股流通受限	22.43	31.55	186	4,171.98	5,868.30	-
688709	成都华微	2024年1月31日	6个月	新股流通受限	15.69	18.79	1,045	16,396.05	19,635.55	-

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金于本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 6 月 30 日止，本基金无因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。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 6 月 30 日止，本基金无因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。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金管理人秉承全面风险管理的理念，将风险管理融入业务中，建立了以风险管理委员会为核心，由风险管理委员会、督察长、法律监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。各业务部门负责人为其所在部门的风险管理第一责任人，对本部门业务范围内的风险负有管控和及时报告的义务。员工在其岗位职责范围内承担相应风险管理责任。本基金管理人配备的风险管理人员对投资风险进行独立的监控并及时向管理层汇报。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息等导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的投资范围及投资比例符合相关法律法规的要求、相关监管机构的相关规定及本基金的合同要求。本基金管理人通过建立和完善内部信用评级体系和交易对手库，对发行人及债券投资进行内部评级，对交易对手的资信状况进行充分评估、设定授信额度，以控制可能出现的信用风险。本基金的活期银行存款存放在具有托管资格的银行；本基金存放定期存款前，均对交易对手进行信用评估以控制相应的信用风险，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；本基金在银行间同业市场仅与达到本基金管理人既定信用政策标准的交易对手进行交易，以控制相应的信用风险。

本基金管理人还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，不得超过该证券余额的 10%。

于本报告期末，本基金持有除国债、央行票据、政策性金融债及地方政府债券之外的债券和资产支持证券的账面价值占基金净资产的比例为 0.03%（上年度末：0.09%）。

#### 6.4.13.3 流动性风险

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

本基金的基金管理人专业审慎、勤勉尽责地管控本基金的流动性风险，全覆盖、多维度的建立以压力测试为核心的流动性风险监测与预警制度，确保本基金组合的资产变现能力与投资者赎回需求匹配与平衡。

##### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《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》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理,通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

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的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的 10%。由本基金的基金管理人管理的所有开放式基金于开放期内共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%,由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票,不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市,其余亦可在银行间同业市场交易,部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。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投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人对其管理的所有开放式基金于开放期内,对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算,确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时,本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度;按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理,以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外,本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度:根据质押品的资质确定质押率水平;持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额;并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时,可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因市场价格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。本基金管理人通过对不同类型的风险分别设定风险限制,并由独立于投资部门的风险管理人员监控、报告以及定期风险回顾的方法管理投资组合的市场风险。

#### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。

本基金管理人通过风险管理人员定期监控组合中债券投资部分的利率风险，及时调整投资组合久期等方法管理利率风险。

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账面价值，并按照合同约定的重新定价日或到期日进行了分类。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024年6 月30日	1个月以内	1-3 个月	3个 月-1 年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	22,524,139.24	-	-	-	-	-	22,524,139.24
结算备付金	8,877,878.74	-	-	-	-	-	8,877,878.74
存出保证金	228,406.80	-	-	-	-	1,165,920.00	1,394,326.80
交易性金融资产	-	-	-	-	79,485.06	280,221,867.64	280,301,352.70
应收申购款	-	-	-	-	-	59,229.38	59,229.38
资产总计	31,630,424.78	-	-	-	79,485.06	281,447,017.02	313,156,926.86
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	314,369.16	314,369.16
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	317,155.03	317,155.03
应付托管费	-	-	-	-	-	52,859.17	52,859.17
应交税费	-	-	-	-	-	45,144.37	45,144.37
其他负债	-	-	-	-	-	1,446,511.96	1,446,511.96
负债总计	-	-	-	-	-	2,176,039.69	2,176,039.69
利率敏感度缺口	31,630,424.78	-	-	-	79,485.06	-	-
上年度末 2023年 12月31 日	1个月以内	1-3 个月	3个 月-1 年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	85,365,489.72	-	-	-	-	-	85,365,489.72
结算备付	31,032,622.31	-	-	-	-	-	31,032,622.31

金							
存出保证金	290,896.96	-	-	-	-	3,933,283.20	4,224,180.16
交易性金融资产	-	-	-696,045.76	478,534.25	1,204,657,343.66	1,205,831,923.67	
应收申购款	-	-	-	-	-	86,042.14	86,042.14
资产总计	116,689,008.99	-	-696,045.76	478,534.25	1,208,676,669.00	1,326,540,258.00	
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	245,958.94	245,958.94
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,391,377.54	1,391,377.54
应付托管费	-	-	-	-	-	231,896.27	231,896.27
应付清算款	-	-	-	-	-	9,787,675.00	9,787,675.00
应交税费	-	-	-	-	-	2.78	2.78
其他负债	-	-	-	-	-	4,491,963.45	4,491,963.45
负债总计	-	-	-	-	-	16,148,873.98	16,148,873.98
利率敏感度缺口	116,689,008.99	-	-696,045.76	478,534.25	-	-	-

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本报告期末，本基金持有的债券资产的账面价值占资产净值比例为 0.03%（上年度末：0.09%），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（上年度末：同）。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因除外汇风险和利率风险以外的市场价格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它价格风险，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。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
----	-------------------	---------------------

	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	280,221,867.64	90.11	1,204,657,343.66	91.93
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
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	280,221,867.64	90.11	1,204,657,343.66	91.93

注：其他包含在期货交易所交易的期货投资（附注：6.4.7.3）。在当日无负债结算制度下，期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为 0。

#### 6.4.13.4.3.2 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（2024 年 6 月 30 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数上升 5%	24,561,577.19	59,989,528.39
	沪深 300 指数下降 5%	-24,561,577.19	-59,989,528.39

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	280,043,515.17	1,203,732,616.15
第二层次	55,385.83	977,522.49
第三层次	202,451.70	1,121,785.03
合计	280,301,352.70	1,205,831,923.67

#### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的证券等投资，若出现交易不活跃、非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	280,221,867.64	89.48
	其中：股票	280,221,867.64	89.48
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	79,485.06	0.03
	其中：债券	79,485.06	0.03
	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	-	-

	产		
7	银行存款和结算备付金合计	31,402,017.98	10.03
8	其他各项资产	1,453,556.18	0.46
9	合计	313,156,926.86	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	238,702.00	0.08
B	采矿业	8,739,669.48	2.81
C	制造业	183,456,607.82	58.99
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,704,780.00	2.80
E	建筑业	4,086,456.10	1.31
F	批发和零售业	14,063,894.52	4.52
G	交通运输、仓储和邮政业	5,000,877.40	1.61
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	29,713,656.74	9.55
J	金融业	4,210,374.31	1.35
K	房地产业	6,319,134.00	2.03
L	租赁和商务服务业	4,557,172.00	1.47
M	科学研究和技术服务业	2,895,200.47	0.93
N	水利、环境和公共设施管理业	1,179,353.00	0.38
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	2,140,746.00	0.69
R	文化、体育和娱乐业	4,915,243.80	1.58
S	综合	-	-
	合计	280,221,867.64	90.11

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600718	东软集团	310,900	2,571,143.00	0.83
2	688018	乐鑫科技	23,561	2,324,999.48	0.75
3	300679	电连技术	57,500	2,313,225.00	0.74
4	002318	久立特材	97,900	2,284,007.00	0.73

5	605589	圣泉集团	112,000	2,272,480.00	0.73
6	002237	恒邦股份	186,900	2,151,219.00	0.69
7	002249	大洋电机	451,900	2,137,487.00	0.69
8	002100	天康生物	303,500	2,103,255.00	0.68
9	002139	拓邦股份	195,900	2,080,458.00	0.67
10	002550	千红制药	383,700	2,068,143.00	0.67
11	002020	京新药业	192,800	2,018,616.00	0.65
12	300482	万孚生物	82,500	2,013,000.00	0.65
13	000034	神州数码	86,400	1,977,696.00	0.64
14	002351	漫步者	150,200	1,975,130.00	0.64
15	300379	东方通	241,600	1,952,128.00	0.63
16	603583	捷昌驱动	94,600	1,927,948.00	0.62
17	601126	四方股份	98,500	1,893,170.00	0.61
18	600285	羚锐制药	78,100	1,890,801.00	0.61
19	002706	良信股份	275,200	1,887,872.00	0.61
20	605111	新洁能	61,640	1,885,567.60	0.61
21	000758	中色股份	360,300	1,830,324.00	0.59
22	002773	康弘药业	83,600	1,809,940.00	0.58
23	603368	柳药集团	102,600	1,795,500.00	0.58
24	000951	中国重汽	122,200	1,749,904.00	0.56
25	300638	广和通	101,500	1,735,650.00	0.56
26	603025	大豪科技	121,940	1,685,210.80	0.54
27	000690	宝新能源	327,500	1,670,250.00	0.54
28	300451	创业慧康	480,000	1,660,800.00	0.53
29	300323	华灿光电	380,300	1,654,305.00	0.53
30	002061	浙江交科	453,200	1,654,180.00	0.53
31	688578	艾力斯	25,900	1,650,866.00	0.53
32	301050	雷电微力	33,500	1,613,360.00	0.52
33	002158	汉钟精机	95,922	1,603,815.84	0.52
34	300130	新国都	96,300	1,602,432.00	0.52
35	000415	渤海租赁	628,400	1,602,420.00	0.52
36	000550	江铃汽车	72,800	1,580,488.00	0.51
37	300034	钢研高纳	99,400	1,579,466.00	0.51
38	300244	迪安诊断	130,700	1,568,400.00	0.50
39	603348	文灿股份	56,300	1,558,947.00	0.50
40	688158	优刻得	150,743	1,542,100.89	0.50
41	002332	仙琚制药	133,500	1,523,235.00	0.49
42	300458	全志科技	63,700	1,497,587.00	0.48
43	600312	平高电气	75,900	1,476,255.00	0.47
44	600459	贵研铂业	109,266	1,476,183.66	0.47
45	603267	鸿远电子	43,200	1,473,120.00	0.47
46	300226	上海钢联	85,900	1,455,146.00	0.47
47	002245	蔚蓝锂芯	185,300	1,436,075.00	0.46

48	002583	海能达	351,900	1,432,233.00	0.46
49	600320	振华重工	418,400	1,430,928.00	0.46
50	000600	建投能源	225,500	1,420,650.00	0.46
51	600685	中船防务	50,800	1,417,320.00	0.46
52	600916	中国黄金	144,800	1,392,976.00	0.45
53	002276	万马股份	191,300	1,371,621.00	0.44
54	002215	诺普信	184,100	1,371,545.00	0.44
55	300113	顺网科技	133,900	1,371,136.00	0.44
56	600037	歌华有线	228,100	1,364,038.00	0.44
57	603328	依顿电子	173,400	1,362,924.00	0.44
58	600649	城投控股	407,200	1,351,904.00	0.43
59	688016	心脉医疗	13,744	1,347,599.20	0.43
60	002204	大连重工	311,900	1,331,813.00	0.43
61	600933	爱柯迪	89,700	1,326,663.00	0.43
62	002928	华夏航空	206,900	1,311,746.00	0.42
63	601369	陕鼓动力	162,800	1,305,656.00	0.42
64	688123	聚辰股份	21,330	1,297,503.90	0.42
65	300573	兴齐眼药	7,880	1,292,320.00	0.42
66	601975	招商南油	355,500	1,276,245.00	0.41
67	002212	天融信	262,000	1,275,940.00	0.41
68	603393	新天然气	36,500	1,268,010.00	0.41
69	688798	艾为电子	22,342	1,265,004.04	0.41
70	000821	京山轻机	111,500	1,263,295.00	0.41
71	002705	新宝股份	88,600	1,246,602.00	0.40
72	002635	安洁科技	79,800	1,232,112.00	0.40
73	300783	三只松鼠	56,200	1,229,094.00	0.40
74	300841	康华生物	24,200	1,225,488.00	0.39
75	300773	拉卡拉	97,685	1,214,224.55	0.39
76	002948	青岛银行	356,500	1,201,405.00	0.39
77	300973	立高食品	41,800	1,174,162.00	0.38
78	600641	万业企业	99,100	1,164,425.00	0.37
79	600729	重庆百货	51,700	1,156,012.00	0.37
80	300298	三诺生物	44,600	1,130,164.00	0.36
81	301308	江波龙	11,900	1,127,406.00	0.36
82	000029	深深房 A	103,700	1,102,331.00	0.35
83	301219	腾远钴业	28,400	1,086,584.00	0.35
84	301171	易点天下	73,200	1,076,040.00	0.35
85	300446	航天智造	89,300	1,062,670.00	0.34
86	603920	世运电路	53,700	1,060,038.00	0.34
87	002456	欧菲光	132,400	1,034,044.00	0.33
88	603533	掌阅科技	55,200	1,030,584.00	0.33
89	600480	凌云股份	102,400	1,006,592.00	0.32
90	002782	可立克	87,200	966,176.00	0.31

91	300183	东软载波	83,200	963,456.00	0.31
92	002171	楚江新材	145,100	956,209.00	0.31
93	300633	开立医疗	24,100	953,878.00	0.31
94	300170	汉得信息	153,600	943,104.00	0.30
95	002068	黑猫股份	132,600	941,460.00	0.30
96	603132	金徽股份	67,000	921,920.00	0.30
97	002154	报喜鸟	167,200	909,568.00	0.29
98	688596	正帆科技	27,519	908,127.00	0.29
99	000065	北方国际	87,200	904,264.00	0.29
100	688556	高测股份	75,500	897,695.00	0.29
101	000403	派林生物	33,600	895,776.00	0.29
102	002126	银轮股份	49,600	863,536.00	0.28
103	603505	金石资源	30,760	859,126.80	0.28
104	600007	中国国贸	39,100	858,636.00	0.28
105	002727	一心堂	56,800	857,112.00	0.28
106	601068	中铝国际	201,000	846,210.00	0.27
107	300133	华策影视	137,800	846,092.00	0.27
108	002151	北斗星通	33,800	817,284.00	0.26
109	600100	同方股份	160,000	814,400.00	0.26
110	600323	瀚蓝环境	38,800	810,920.00	0.26
111	002906	华阳集团	30,200	808,152.00	0.26
112	002088	鲁阳节能	66,700	806,403.00	0.26
113	688372	伟测科技	20,389	801,899.37	0.26
114	000528	柳工	70,800	792,252.00	0.25
115	300294	博雅生物	24,000	792,000.00	0.25
116	688630	芯碁微装	12,540	784,627.80	0.25
117	000503	国新健康	117,400	783,058.00	0.25
118	002312	川发龙蟒	115,200	775,296.00	0.25
119	603565	中谷物流	88,700	775,238.00	0.25
120	601137	博威合金	50,700	772,668.00	0.25
121	600559	老白干酒	42,300	769,014.00	0.25
122	605090	九丰能源	26,200	759,800.00	0.24
123	601886	江河集团	154,900	755,912.00	0.24
124	600648	外高桥	85,000	753,100.00	0.24
125	300811	铂科新材	17,140	752,446.00	0.24
126	002123	梦网科技	106,300	747,289.00	0.24
127	600461	洪城环境	64,500	746,910.00	0.24
128	000650	仁和药业	126,500	746,350.00	0.24
129	600158	中体产业	96,300	740,547.00	0.24
130	601222	林洋能源	117,800	738,606.00	0.24
131	002048	宁波华翔	56,900	736,286.00	0.24
132	000712	锦龙股份	97,500	731,250.00	0.24
133	002993	奥海科技	19,500	725,400.00	0.23

134	002544	普天科技	38,800	725,172.00	0.23
135	002127	南极电商	278,800	724,880.00	0.23
136	600452	涪陵电力	57,200	724,724.00	0.23
137	002416	爱施德	81,700	723,045.00	0.23
138	300624	万兴科技	13,600	721,752.00	0.23
139	688518	联赢激光	42,900	716,430.00	0.23
140	601969	海南矿业	112,602	713,896.68	0.23
141	600123	兰花科创	79,000	707,050.00	0.23
142	601811	新华文轩	50,400	706,104.00	0.23
143	002192	融捷股份	23,500	705,470.00	0.23
144	601127	赛力斯	7,700	701,624.00	0.23
145	601163	三角轮胎	45,500	692,510.00	0.22
146	688019	安集科技	5,500	691,900.00	0.22
147	600395	盘江股份	114,800	689,948.00	0.22
148	300236	上海新阳	22,100	688,194.00	0.22
149	600295	鄂尔多斯	69,200	686,464.00	0.22
150	688380	中微半导	41,045	686,272.40	0.22
151	002053	云南能投	56,400	681,876.00	0.22
152	001338	永顺泰	69,500	681,100.00	0.22
153	000028	国药一致	21,100	680,053.00	0.22
154	600645	中源协和	42,200	679,420.00	0.22
155	002335	科华数据	31,900	674,047.00	0.22
156	300772	运达股份	69,700	669,120.00	0.22
157	300366	创意信息	92,200	667,528.00	0.21
158	688185	康希诺	16,088	661,055.92	0.21
159	000915	华特达因	21,800	657,488.00	0.21
160	000810	创维数字	76,000	652,080.00	0.21
161	000923	河钢资源	37,800	650,916.00	0.21
162	002737	葵花药业	27,700	647,626.00	0.21
163	688235	百济神州	5,579	646,271.36	0.21
164	600757	长江传媒	80,000	644,800.00	0.21
165	688167	炬光科技	11,660	641,300.00	0.21
166	600874	创业环保	114,600	640,614.00	0.21
167	600773	西藏城投	61,800	637,776.00	0.21
168	002498	汉缆股份	193,800	637,602.00	0.21
169	603730	岱美股份	63,900	635,166.00	0.20
170	603466	风语筑	74,200	633,668.00	0.20
171	002320	海峡股份	122,500	632,100.00	0.20
172	300416	苏试试验	49,100	631,426.00	0.20
173	000567	海德股份	112,220	629,554.20	0.20
174	688598	金博股份	22,200	628,260.00	0.20
175	002534	西子洁能	62,400	624,624.00	0.20
176	600602	云赛智联	56,400	622,656.00	0.20

177	002967	广电计量	52,700	621,860.00	0.20
178	300850	新强联	41,400	621,828.00	0.20
179	301238	瑞泰新材	41,500	621,255.00	0.20
180	300085	银之杰	76,400	617,312.00	0.20
181	000030	富奥股份	125,600	616,696.00	0.20
182	603008	喜临门	35,400	613,482.00	0.20
183	600835	上海机电	53,100	611,181.00	0.20
184	000719	中原传媒	60,100	607,611.00	0.20
185	300363	博腾股份	50,600	604,670.00	0.19
186	600643	爱建集团	160,143	603,739.11	0.19
187	688033	天宜上佳	100,500	603,000.00	0.19
188	603123	翠微股份	101,508	602,957.52	0.19
189	600618	氯碱化工	68,600	602,308.00	0.19
190	000062	深圳华强	67,500	600,750.00	0.19
191	301268	铭利达	38,200	594,010.00	0.19
192	002847	盐津铺子	13,849	592,321.73	0.19
193	300735	光弘科技	27,200	587,520.00	0.19
194	300856	科思股份	18,300	585,783.00	0.19
195	002275	桂林三金	46,700	579,547.00	0.19
196	603055	台华新材	57,000	577,410.00	0.19
197	603906	龙蟠科技	73,500	572,565.00	0.18
198	301239	普瑞眼科	16,200	572,346.00	0.18
199	600993	马应龙	21,200	565,404.00	0.18
200	300587	天铁股份	139,700	564,388.00	0.18
201	688127	蓝特光学	30,300	557,217.00	0.18
202	002125	湘潭电化	57,000	554,610.00	0.18
203	000682	东方电子	49,400	545,376.00	0.18
204	603281	江瀚新材	24,200	543,290.00	0.17
205	301316	慧博云通	36,800	540,224.00	0.17
206	000913	钱江摩托	34,200	538,992.00	0.17
207	300887	谱尼测试	72,400	535,760.00	0.17
208	301217	铜冠铜箔	55,500	532,800.00	0.17
209	600710	苏美达	64,800	528,120.00	0.17
210	001914	招商积余	52,200	523,044.00	0.17
211	002978	安宁股份	18,600	518,196.00	0.17
212	600057	厦门象屿	76,200	518,160.00	0.17
213	002292	奥飞娱乐	85,800	513,084.00	0.16
214	601609	金田股份	90,300	511,098.00	0.16
215	688166	博瑞医药	14,400	504,000.00	0.16
216	300369	绿盟科技	97,400	497,714.00	0.16
217	600639	浦东金桥	48,300	493,143.00	0.16
218	300627	华测导航	16,500	492,525.00	0.16
219	603915	国茂股份	47,400	487,746.00	0.16

220	002745	木林森	59,600	480,376.00	0.15
221	002837	英维克	22,370	478,494.30	0.15
222	600586	金晶科技	81,400	472,120.00	0.15
223	603606	东方电缆	9,600	468,576.00	0.15
224	600877	电科芯片	43,600	467,392.00	0.15
225	002453	华软科技	107,900	462,891.00	0.15
226	600810	神马股份	73,000	452,600.00	0.15
227	300409	道氏技术	52,100	445,976.00	0.14
228	002283	天润工业	103,400	443,586.00	0.14
229	600409	三友化工	86,900	436,238.00	0.14
230	300470	中密控股	12,800	432,768.00	0.14
231	002545	东方铁塔	63,300	431,073.00	0.14
232	603013	亚普股份	31,900	429,693.00	0.14
233	002267	陕天然气	56,500	427,140.00	0.14
234	300346	南大光电	14,900	425,991.00	0.14
235	688707	振华新材	43,400	422,716.00	0.14
236	603919	金徽酒	23,238	422,234.46	0.14
237	002091	江苏国泰	61,900	421,539.00	0.14
238	002405	四维图新	67,400	419,228.00	0.13
239	300741	华宝股份	27,500	419,100.00	0.13
240	600216	浙江医药	38,100	418,338.00	0.13
241	600391	航发科技	27,300	416,325.00	0.13
242	002941	新疆交建	41,000	409,180.00	0.13
243	601801	皖新传媒	58,860	407,899.80	0.13
244	603678	火炬电子	16,500	407,385.00	0.13
245	300687	赛意信息	29,100	405,072.00	0.13
246	000630	铜陵有色	111,800	403,598.00	0.13
247	600483	福能股份	33,800	394,108.00	0.13
248	301155	海力风电	9,700	390,231.00	0.13
249	000935	四川双马	32,400	389,124.00	0.13
250	002239	奥特佳	167,600	385,480.00	0.12
251	600120	浙江东方	115,300	385,102.00	0.12
252	600210	紫江企业	72,300	384,636.00	0.12
253	600596	新安股份	50,600	384,560.00	0.12
254	603129	春风动力	2,700	384,318.00	0.12
255	600750	江中药业	16,462	380,436.82	0.12
256	600577	精达股份	95,600	379,532.00	0.12
257	600929	雪天盐业	71,600	379,480.00	0.12
258	000429	粤高速 A	36,200	376,842.00	0.12
259	600330	天通股份	55,400	376,720.00	0.12
260	300620	光库科技	10,100	371,478.00	0.12
261	300233	金城医药	24,800	370,016.00	0.12
262	603595	东尼电子	17,900	368,561.00	0.12

263	600475	华光环能	42,300	368,433.00	0.12
264	002250	联化科技	75,100	360,480.00	0.12
265	002891	中宠股份	17,160	358,129.20	0.12
266	002960	青鸟消防	28,180	356,195.20	0.11
267	000657	中钨高新	38,900	355,546.00	0.11
268	300398	飞凯材料	28,900	355,470.00	0.11
269	002643	万润股份	35,400	354,000.00	0.11
270	300598	诚迈科技	12,500	351,000.00	0.11
271	600572	康恩贝	78,400	350,448.00	0.11
272	600073	光明肉业	63,400	349,334.00	0.11
273	600557	康缘药业	22,100	346,970.00	0.11
274	002034	旺能环境	26,300	342,163.00	0.11
275	603489	八方股份	12,300	331,854.00	0.11
276	002043	兔宝宝	32,000	331,840.00	0.11
277	000837	秦川机床	44,800	329,728.00	0.11
278	000860	顺鑫农业	19,600	328,104.00	0.11
279	600012	皖通高速	23,100	322,707.00	0.10
280	603197	保隆科技	10,200	321,300.00	0.10
281	603323	苏农银行	66,100	317,941.00	0.10
282	002901	大博医疗	12,300	317,709.00	0.10
283	002243	力合科创	57,200	316,316.00	0.10
284	601677	明泰铝业	27,300	315,588.00	0.10
285	300123	亚光科技	66,500	308,560.00	0.10
286	688023	安恒信息	7,562	302,555.62	0.10
287	688110	东芯股份	15,717	299,723.19	0.10
288	688037	芯源微	3,313	294,857.00	0.09
289	300857	协创数据	5,100	290,700.00	0.09
290	600961	株冶集团	30,100	284,144.00	0.09
291	001269	欧晶科技	10,200	283,560.00	0.09
292	688800	瑞可达	10,000	280,800.00	0.09
293	002402	和而泰	26,064	279,145.44	0.09
294	603877	太平鸟	19,700	270,481.00	0.09
295	603033	三维股份	23,011	269,228.70	0.09
296	300666	江丰电子	5,600	266,336.00	0.09
297	300206	理邦仪器	30,300	260,277.00	0.08
298	600587	新华医疗	16,500	259,710.00	0.08
299	688362	甬矽电子	13,300	258,818.00	0.08
300	603100	川仪股份	11,000	258,610.00	0.08
301	601869	长飞光纤	10,600	257,898.00	0.08
302	300663	科蓝软件	25,400	250,698.00	0.08
303	603989	艾华集团	17,600	247,456.00	0.08
304	300618	寒锐钴业	9,300	245,985.00	0.08
305	002270	华明装备	10,900	242,416.00	0.08

306	003040	楚天龙	19,700	242,310.00	0.08
307	000848	承德露露	30,700	241,302.00	0.08
308	600850	电科数字	13,171	238,395.10	0.08
309	688789	宏华数科	2,200	237,160.00	0.08
310	601069	西部黄金	20,100	233,763.00	0.08
311	600601	方正科技	74,500	223,500.00	0.07
312	600971	恒源煤电	18,500	220,890.00	0.07
313	300596	利安隆	8,000	217,040.00	0.07
314	300623	捷捷微电	12,350	213,655.00	0.07
315	300045	华力创通	12,000	211,800.00	0.07
316	300065	海兰信	31,500	208,215.00	0.07
317	600623	华谊集团	35,600	205,768.00	0.07
318	600597	光明乳业	26,400	205,128.00	0.07
319	601606	长城军工	21,400	204,584.00	0.07
320	002777	久远银海	13,500	202,365.00	0.07
321	600328	中盐化工	29,460	202,095.60	0.06
322	001311	多利科技	8,320	201,177.60	0.06
323	002315	焦点科技	7,400	199,504.00	0.06
324	300079	数码视讯	49,000	198,940.00	0.06
325	300820	英杰电气	4,900	192,766.00	0.06
326	000970	中科三环	25,100	192,015.00	0.06
327	603733	仙鹤股份	10,900	191,622.00	0.06
328	300579	数字认证	9,800	191,100.00	0.06
329	603690	至纯科技	8,300	190,983.00	0.06
330	688088	虹软科技	6,534	188,571.24	0.06
331	301205	联特科技	3,000	188,250.00	0.06
332	300910	瑞丰新材	4,300	187,996.00	0.06
333	000426	兴业银锡	13,800	187,404.00	0.06
334	600366	宁波韵升	35,900	187,398.00	0.06
335	002747	埃斯顿	12,900	183,438.00	0.06
336	002946	新乳业	20,900	183,084.00	0.06
337	000869	张裕 A	8,400	179,340.00	0.06
338	300428	立中集团	9,500	176,605.00	0.06
339	688608	恒玄科技	1,200	175,656.00	0.06
340	002467	二六三	51,500	172,010.00	0.06
341	000811	冰轮环境	17,400	167,910.00	0.05
342	300115	长盈精密	13,800	165,462.00	0.05
343	601001	晋控煤业	10,000	165,200.00	0.05
344	603005	晶方科技	8,060	164,262.80	0.05
345	603766	隆鑫通用	24,200	164,076.00	0.05
346	000902	新洋丰	13,800	163,806.00	0.05
347	002597	金禾实业	8,200	163,098.00	0.05
348	601777	力帆科技	42,400	162,816.00	0.05

349	000735	罗牛山	37,400	161,942.00	0.05
350	002925	盈趣科技	12,700	160,909.00	0.05
351	601918	新集能源	16,500	160,875.00	0.05
352	600446	金证股份	16,100	159,873.00	0.05
353	600246	万通发展	23,500	157,920.00	0.05
354	300770	新媒股份	4,702	156,952.76	0.05
355	300894	火星人	12,100	155,122.00	0.05
356	300049	福瑞股份	3,000	151,020.00	0.05
357	002697	红旗连锁	32,200	149,086.00	0.05
358	002701	奥瑞金	35,200	146,432.00	0.05
359	603236	移远通信	3,100	144,863.00	0.05
360	002145	中核钛白	43,900	143,992.00	0.05
361	002023	海特高新	15,500	141,825.00	0.05
362	601778	晶科科技	61,100	139,308.00	0.04
363	000875	吉电股份	26,100	139,113.00	0.04
364	688366	昊海生科	2,240	138,163.20	0.04
365	603160	汇顶科技	2,000	137,500.00	0.04
366	688289	圣湘生物	7,800	137,124.00	0.04
367	000727	冠捷科技	66,200	136,372.00	0.04
368	300109	新开源	11,700	135,486.00	0.04
369	600458	时代新材	13,200	133,320.00	0.04
370	300101	振芯科技	9,000	132,930.00	0.04
371	300660	江苏雷利	5,200	132,704.00	0.04
372	601101	昊华能源	14,400	132,336.00	0.04
373	600363	联创光电	4,800	132,096.00	0.04
374	688339	亿华通	4,400	131,912.00	0.04
375	002851	麦格米特	5,100	131,784.00	0.04
376	600751	海航科技	59,300	131,646.00	0.04
377	300613	富瀚微	4,000	131,640.00	0.04
378	001213	中铁特货	33,000	130,350.00	0.04
379	300456	赛微电子	8,200	130,134.00	0.04
380	300693	盛弘股份	6,200	129,828.00	0.04
381	600502	安徽建工	30,177	129,761.10	0.04
382	300685	艾德生物	7,300	128,772.00	0.04
383	002929	润建股份	4,400	128,084.00	0.04
384	600575	淮河能源	32,400	126,036.00	0.04
385	688586	江航装备	13,500	125,550.00	0.04
386	601595	上海电影	6,300	124,614.00	0.04
387	002626	金达威	8,500	122,825.00	0.04
388	600662	外服控股	30,600	122,706.00	0.04
389	600861	北京人力	7,500	122,400.00	0.04
390	688232	新点软件	6,200	122,264.00	0.04
391	603383	顶点软件	3,800	121,866.00	0.04

392	688177	百奥泰	5,700	120,384.00	0.04
393	688209	英集芯	9,700	120,377.00	0.04
394	688072	拓荆科技	1,000	120,110.00	0.04
395	002174	游族网络	15,800	119,922.00	0.04
396	688381	帝奥微	6,149	119,782.52	0.04
397	002216	三全食品	10,900	119,682.00	0.04
398	603103	横店影视	8,600	119,024.00	0.04
399	603098	森特股份	15,100	118,686.00	0.04
400	688322	奥比中光	4,438	118,538.98	0.04
401	688031	星环科技	3,200	117,472.00	0.04
402	688202	美迪西	4,500	117,225.00	0.04
403	601528	瑞丰银行	24,400	115,168.00	0.04
404	603297	永新光学	1,900	114,931.00	0.04
405	300134	大富科技	16,400	111,848.00	0.04
406	605333	沪光股份	4,000	111,400.00	0.04
407	001696	宗申动力	9,800	104,272.00	0.03
408	000813	德展健康	49,700	103,376.00	0.03
409	300415	伊之密	4,900	101,822.00	0.03
410	603039	泛微网络	3,200	101,632.00	0.03
411	301071	力量钻石	3,600	99,756.00	0.03
412	601038	一拖股份	6,300	99,603.00	0.03
413	300284	苏交科	12,200	98,576.00	0.03
414	688173	希荻微	8,838	97,483.14	0.03
415	300229	拓尔思	7,200	96,696.00	0.03
416	600888	新疆众和	13,400	94,738.00	0.03
417	688776	国光电气	1,700	94,180.00	0.03
418	688408	中信博	1,000	92,080.00	0.03
419	002612	朗姿股份	6,600	91,212.00	0.03
420	600201	生物股份	12,600	90,846.00	0.03
421	600151	航天机电	19,900	89,948.00	0.03
422	688327	云从科技	7,944	89,846.64	0.03
423	000049	德赛电池	3,800	89,110.00	0.03
424	688046	药康生物	8,655	88,454.10	0.03
425	600633	浙数文化	9,800	86,338.00	0.03
426	002214	大立科技	7,600	85,728.00	0.03
427	001236	弘业期货	12,000	85,320.00	0.03
428	601949	中国出版	14,300	84,513.00	0.03
429	600776	东方通信	8,300	81,589.00	0.03
430	600864	哈投股份	16,900	80,275.00	0.03
431	603300	华铁应急	14,600	79,716.00	0.03
432	002041	登海种业	9,500	76,760.00	0.02
433	688278	特宝生物	1,400	74,970.00	0.02
434	000881	中广核技	11,500	74,060.00	0.02

435	002077	大港股份	6,200	73,904.00	0.02
436	601952	苏垦农发	8,100	73,062.00	0.02
437	300031	宝通科技	5,000	71,850.00	0.02
438	300821	东岳硅材	10,200	69,768.00	0.02
439	601702	华峰铝业	3,800	69,388.00	0.02
440	600248	陕建股份	18,400	66,792.00	0.02
441	601890	亚星锚链	9,421	66,418.05	0.02
442	000090	天健集团	16,500	66,330.00	0.02
443	688192	迪哲医药	1,800	66,312.00	0.02
444	002011	盾安环境	6,600	64,878.00	0.02
445	000795	英洛华	11,600	64,264.00	0.02
446	603530	神马电力	2,400	63,576.00	0.02
447	002516	旷达科技	16,900	61,516.00	0.02
448	603093	南华期货	7,000	60,620.00	0.02
449	688680	海优新材	2,100	60,354.00	0.02
450	600449	宁夏建材	5,100	59,925.00	0.02
451	002302	西部建设	11,300	58,760.00	0.02
452	600761	安徽合力	2,700	58,428.00	0.02
453	600075	新疆天业	16,900	58,305.00	0.02
454	002488	金固股份	12,800	56,192.00	0.02
455	688116	天奈科技	2,400	55,392.00	0.02
456	603063	禾望电气	3,600	55,188.00	0.02
457	000921	海信家电	1,700	54,808.00	0.02
458	300039	上海凯宝	10,200	54,570.00	0.02
459	300180	华峰超纤	15,400	54,362.00	0.02
460	002010	传化智联	14,100	54,144.00	0.02
461	603439	贵州三力	4,200	53,592.00	0.02
462	300339	润和软件	2,500	51,675.00	0.02
463	002396	星网锐捷	3,657	48,308.97	0.02
464	002097	山河智能	8,000	48,240.00	0.02
465	300151	昌红科技	3,000	47,460.00	0.02
466	300261	雅本化学	8,900	47,170.00	0.02
467	603983	丸美股份	1,700	46,801.00	0.02
468	300674	宇信科技	4,164	46,137.12	0.01
469	002085	万丰奥威	3,400	45,016.00	0.01
470	688083	中望软件	596	43,281.52	0.01
471	000975	银泰黄金	2,600	42,354.00	0.01
472	002079	苏州固锝	4,700	40,044.00	0.01
473	000928	中钢国际	7,100	39,405.00	0.01
474	688106	金宏气体	2,117	37,089.84	0.01
475	688001	华兴源创	1,601	36,150.58	0.01
476	300077	国民技术	3,900	34,047.00	0.01
477	002911	佛燃能源	3,500	31,990.00	0.01

478	000990	诚志股份	4,100	30,504.00	0.01
479	688027	国盾量子	200	30,200.00	0.01
480	603609	禾丰股份	4,200	27,468.00	0.01
481	600966	博汇纸业	5,500	26,290.00	0.01
482	600335	国机汽车	4,400	25,388.00	0.01
483	600675	中华企业	10,200	25,194.00	0.01
484	603187	海容冷链	2,100	24,486.00	0.01
485	600787	中储股份	5,000	24,050.00	0.01
486	603285	键邦股份	1,287	24,002.55	0.01
487	688692	达梦数据	137	23,965.41	0.01
488	002099	海翔药业	4,600	23,506.00	0.01
489	688388	嘉元科技	2,300	22,425.00	0.01
490	603871	嘉友国际	1,260	22,289.40	0.01
491	688351	微电生理	1,000	22,040.00	0.01
492	603350	安乃达	1,051	21,608.56	0.01
493	300002	神州泰岳	2,600	21,112.00	0.01
494	603699	纽威股份	1,200	20,544.00	0.01
495	688050	爱博医疗	280	20,529.60	0.01
496	688709	成都华微	1,045	19,635.55	0.01
497	603936	博敏电子	2,300	19,320.00	0.01
498	688502	茂莱光学	200	18,602.00	0.01
499	688048	长光华芯	594	18,556.56	0.01
500	688200	华峰测控	200	18,350.00	0.01
501	688400	凌云光	1,100	18,348.00	0.01
502	688336	三生国健	900	18,315.00	0.01
503	603170	宝立食品	1,500	17,820.00	0.01
504	600223	福瑞达	2,500	17,675.00	0.01
505	300567	精测电子	300	16,953.00	0.01
506	688082	盛美上海	200	16,902.00	0.01
507	688270	臻镭科技	620	16,182.00	0.01
508	600595	中孚实业	6,400	15,936.00	0.01
509	301536	星辰科技	481	15,521.87	0.00
510	300315	掌趣科技	3,500	14,595.00	0.00
511	002646	天佑德酒	1,415	14,475.45	0.00
512	600252	中恒集团	6,400	13,888.00	0.00
513	301538	骏鼎达	150	13,686.00	0.00
514	301565	中仑新材	711	13,494.78	0.00
515	301580	爱迪特	202	13,317.86	0.00
516	001270	铖昌科技	360	13,219.20	0.00
517	301078	孩子王	2,600	13,156.00	0.00
518	300348	长亮科技	1,900	12,958.00	0.00
519	688686	奥普特	200	12,806.00	0.00
520	002461	珠江啤酒	1,700	12,614.00	0.00

521	300119	瑞普生物	900	12,258.00	0.00
522	002903	宇环数控	700	12,229.00	0.00
523	601311	骆驼股份	1,500	12,030.00	0.00
524	600536	中国软件	400	11,968.00	0.00
525	300303	聚飞光电	2,400	11,664.00	0.00
526	603113	金能科技	2,100	11,487.00	0.00
527	600197	伊力特	600	10,686.00	0.00
528	688691	灿芯股份	247	10,499.97	0.00
529	002004	华邦健康	2,600	9,880.00	0.00
530	301566	达利凯普	576	9,774.72	0.00
531	301392	汇成真空	219	9,123.54	0.00
532	688333	铂力特	185	8,963.25	0.00
533	300394	天孚通信	100	8,842.00	0.00
534	688152	麒麟信安	200	7,744.00	0.00
535	301587	中瑞股份	306	7,729.56	0.00
536	001389	广合科技	222	7,672.32	0.00
537	603341	龙旗科技	204	7,647.96	0.00
538	688484	南芯科技	200	7,420.00	0.00
539	301539	宏鑫科技	361	7,155.02	0.00
540	301262	海看股份	300	6,765.00	0.00
541	301578	辰奕智能	153	6,054.21	0.00
542	301089	拓新药业	200	5,934.00	0.00
543	688695	中创股份	186	5,868.30	0.00
544	688530	欧莱新材	344	5,538.40	0.00
545	301588	美新科技	257	5,461.25	0.00
546	301502	华阳智能	138	5,220.54	0.00
547	688208	道通科技	200	4,828.00	0.00
548	002314	南山控股	2,300	4,761.00	0.00
549	603556	海兴电力	100	4,683.00	0.00
550	600195	中牧股份	600	4,494.00	0.00
551	603325	博隆技术	66	4,491.96	0.00
552	603344	星德胜	182	4,124.12	0.00
553	300432	富临精工	600	3,864.00	0.00
554	001359	平安电工	184	3,790.40	0.00
555	603381	永臻股份	149	3,744.37	0.00
556	002324	普利特	400	3,420.00	0.00
557	603312	西典新能	130	3,296.80	0.00
558	603082	北自科技	107	3,155.43	0.00
559	300602	飞荣达	200	3,022.00	0.00
560	001379	腾达科技	213	2,871.24	0.00
561	603375	盛景微	72	2,800.80	0.00
562	001387	雪祺电气	173	2,638.25	0.00
563	600125	铁龙物流	300	1,791.00	0.00

564	000088	盐田港	200	906.00	0.00
565	000488	晨鸣纸业	200	692.00	0.00
566	603128	华贸物流	100	577.00	0.00
567	300182	捷成股份	100	371.00	0.00

#### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300770	新媒股份	11,770,368.36	0.90
2	603087	甘李药业	9,742,509.00	0.74
3	600201	生物股份	9,448,454.00	0.72
4	300130	新国都	9,158,339.68	0.70
5	601126	四方股份	9,104,085.00	0.69
6	603005	晶方科技	8,939,685.00	0.68
7	601163	三角轮胎	8,798,121.00	0.67
8	300803	指南针	8,728,906.00	0.67
9	002043	兔宝宝	8,496,151.00	0.65
10	688018	乐鑫科技	8,437,599.76	0.64
11	000921	海信家电	8,261,795.10	0.63
12	300638	广和通	8,191,588.20	0.63
13	002171	楚江新材	8,085,993.03	0.62
14	603566	普莱柯	8,077,834.81	0.62
15	300841	康华生物	8,056,084.00	0.61
16	688007	光峰科技	7,999,729.39	0.61
17	000034	神州数码	7,963,690.00	0.61
18	600750	江中药业	7,878,962.00	0.60
19	600225	卓朗科技	7,859,836.00	0.60
20	688016	心脉医疗	7,829,782.44	0.60

注：买入金额为成交金额（成交单价乘以成交数量），未考虑相关交易费用。

##### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002456	欧菲光	13,102,552.00	1.00
2	000543	皖能电力	12,228,339.00	0.93
3	000921	海信家电	12,149,381.00	0.93
4	300770	新媒股份	10,928,377.30	0.83
5	600502	安徽建工	10,691,634.00	0.82
6	603530	神马电力	10,636,161.00	0.81
7	300002	神州泰岳	10,575,925.00	0.81
8	300476	胜宏科技	10,404,944.00	0.79

9	000990	诚志股份	10,378,506.16	0.79
10	688235	百济神州	10,369,041.29	0.79
11	601126	四方股份	10,114,767.00	0.77
12	002276	万马股份	9,845,373.49	0.75
13	601137	博威合金	9,733,974.40	0.74
14	600872	中炬高新	9,695,958.00	0.74
15	000928	中钢国际	9,660,493.88	0.74
16	603368	柳药集团	9,641,789.17	0.74
17	000951	中国重汽	9,573,695.40	0.73
18	600266	城建发展	9,494,476.52	0.72
19	603005	晶方科技	9,451,844.08	0.72
20	002130	沃尔核材	9,362,747.60	0.71

注：卖出金额为成交金额（成交单价乘以成交数量），未考虑相关交易费用。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	2,244,534,140.07
卖出股票收入（成交）总额	2,996,993,551.71

注：买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额均为买卖股票成交金额（成交单价乘以成交数量），未考虑相关交易费用。

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
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）	79,485.06	0.03
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	79,485.06	0.03

#### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	127098	欧晶转债	736	79,485.06	0.03

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金可投资股指期货、国债期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。本基金投资股指期货、国债期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要评估期货合约的流动性、交易活跃度等方面。本基金力争利用期货的杠杆作用，降低基金资产调整的频率和交易成本。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金可投资股指期货、国债期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。本基金投资股指期货、国债期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要评估期货合约的流动性、交易活跃度等方面。本基金力争利用期货的杠杆作用，降低基金资产调整的频率和交易成本。

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

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

本报告期内未出现基金投资的前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或者在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

### 7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,394,326.80
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	59,229.38
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,453,556.18

## 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	127098	欧晶转债	79,485.06	0.03

## 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

## 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

## § 8 基金份额持有人信息

## 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

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 (%)
17,681	16,519.54	145,123,129.05	49.69	146,958,776.11	50.31

## 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	57,067.44	0.019538

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

1. 本期末基金管理人的高级管理人员、基金投资和部门负责人未持有本基金。
2. 本期末本基金的基金经理未持有本基金。

## § 9 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2018年2月6日)基金份额总额	1,784,551,427.10
本报告期期初基金份额总额	1,086,722,403.05
本报告期基金总申购份额	10,897,740.09
减:本报告期基金总赎回份额	805,538,237.98
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	292,081,905.16

注:申购含红利再投、转换入份额,赎回含转换出份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

在本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人重大人事变动：

报告期内本基金管理人未发生重大人事变动。

基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：

报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

在本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期末更换会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金的管理人及其高级管理人员未受到监管部门的任何稽查和处罚。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金的托管人及其高级管理人员未受到监管部门的任何稽查和处罚。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
长江证券股份有限公司	1	673,399,726.49	12.85	636,990.55	12.85	-
中信建投证券股份有限公司	2	613,266,816.69	11.70	580,098.20	11.70	-

有限公司						
中信证券股份有限公司	4	609,193,241.58	11.63	576,237.70	11.63	-
招商证券股份有限公司	1	491,874,199.88	9.39	465,270.46	9.39	-
广发证券股份有限公司	1	366,805,829.78	7.00	346,953.21	7.00	-
长城证券股份有限公司	2	324,385,912.96	6.19	306,838.01	6.19	-
方正证券股份有限公司	1	319,444,254.29	6.10	302,167.06	6.10	-
西部证券股份有限公司	2	217,054,281.67	4.14	205,320.23	4.14	-
国投证券股份有限公司	1	209,678,740.51	4.00	198,340.21	4.00	-
国泰君安证券股份有限公司	1	185,678,109.02	3.54	175,639.67	3.54	-
浙商证券股份有限公司	2	177,111,814.55	3.38	167,530.25	3.38	本期报告新增2个
东北证券股份有限公司	1	170,001,077.13	3.24	160,810.69	3.24	-
光大证券股份有限公司	2	163,641,924.27	3.12	154,798.46	3.12	-
国信证券股份有限公司	2	143,690,904.29	2.74	135,908.45	2.74	-
华创证券有限责任公司	1	121,963,919.00	2.33	115,361.19	2.33	-
东方证券股份有限公司	1	108,370,917.69	2.07	102,510.22	2.07	-

中国国际金融股份有限公司	1	103,524,713.44	1.98	97,925.01	1.98	-
华金证券股份有限公司	2	100,340,584.57	1.91	94,912.55	1.91	-
东方财富证券股份有限公司	2	90,444,692.27	1.73	85,550.93	1.73	-
天风证券股份有限公司	1	50,248,002.95	0.96	47,527.05	0.96	-
中泰证券股份有限公司	1	52,105.00	0.00	49.28	0.00	-
渤海证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
汇丰前海证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
湘财证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
中银国际证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-

注：基金专用交易单元的选择标准和程序如下：

1) 选择标准

- a、资金实力雄厚，信誉良好；
- b、财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- c、经营行为规范，最近三年未因重大违规行为受到监管机关的处罚；
- d、内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足本基金运作高度保密的要求；
- e、该证券经营机构具有较强的研究能力，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时、全面、定期向基金管理人提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析报告、个股分析报告及其他专门报告以及全面的信息服务。并能根据基金管理人的特定要求，提供专门研究报告。

2) 选择程序

基金管理人根据以上标准进行考察后，确定证券经营机构的选择。基金管理人与被选择的证

券经营机构签订协议。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
长江证券股份有限公司	300,955.66	25.04	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	34,611.78	2.88	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	26,760.74	2.23	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
长城证券股份有限公司	839,556.49	69.85	-	-	-	-
方正证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
西部证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

司						
国泰君安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
浙商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东北证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华创证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华金证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东方财富证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
天风证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

司						
中泰证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
渤海证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
汇丰前 海证券 有限责 任公司	-	-	-	-	-	-
湘财证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
中银国 际证券 股份有 限公司	-	-	-	-	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	景顺长城基金管理有限公司关于调整适用“养老金客户费率优惠”的养老金客户范围的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024年1月10日
2	景顺长城基金管理有限公司关于终止北京增财基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024年1月19日
3	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金2023年第4季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2024年1月22日
4	景顺长城量化小盘股票型证券投资基金2023年第4季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2024年1月22日
5	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024年3月22日
6	关于警惕假冒景顺长城基金APP开展诈骗活动的声明	中国证监会指定报刊及网站	2024年3月27日
7	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金2023年年度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2024年3月29日
8	景顺长城量化小盘股票型证券投资基金2023年年度报告	中国证监会指定报刊及网站	2024年3月29日
9	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024年4月13日

10	景顺长城基金管理有限公司关于持续完善客户身份信息的提示	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 4 月 15 日
11	景顺长城量化小盘股票型证券投资基金 2024 年第 1 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 4 月 22 日
12	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2024 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 4 月 22 日
13	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 5 月 24 日
14	景顺长城量化小盘股票型证券投资基金 2024 年第 1 号更新招募说明书	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 5 月 25 日
15	景顺长城量化小盘股票型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 5 月 25 日
16	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 5 月 31 日
17	景顺长城量化小盘股票型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 6 月 14 日
18	景顺长城基金管理有限公司旗下基金调整持有停牌股票估值价格的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 6 月 21 日
19	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 6 月 29 日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20240101-20240129	353,805,291.15	0.00	353,805,291.15	0.00	0.00
	2	20240202-20240630	94,074,134.45	0.00	0.00	94,074,134.45	32.21
	3	20240101-20240204	376,402,379.21	0.00	376,402,379.21	0.00	0.00
产品特有风险							
<p>本基金由于存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金份额总份额的 20%的情况，可能会出现如下风险：</p> <p>1、大额申购风险</p> <p>在出现投资者大额申购时，如本基金所投资的标的资产未及时准备，则可能降低基金净值涨幅。</p> <p>2、如面临大额赎回的情况，可能导致以下风险：</p> <p>(1) 基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对，可能会产生基金仓位调整困难，导致流动性风险；</p> <p>(2) 如果持有基金份额比例达到或超过基金份额总额的 20%的单一投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定决定部分延期赎回，如果连续 2 个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请，对剩余投资者的赎回办理造成影响；</p>							

(3)基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要,则可能使基金资产净值受到不利影响,影响基金的投资运作和收益水平;

(4)因基金净值精度计算问题,或因赎回费收入归基金资产,导致基金净值出现较大波动;

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

(6)大额赎回导致基金资产规模过小,不能满足存续的条件,基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。

本基金管理人将建立完善的风险管理机制,以有效防止和化解上述风险,最大限度地保护基金份额持有人的合法权益。投资者在投资本基金前,请认真阅读本风险提示及基金合同等信息披露文件,全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性,充分考虑自身的风险承受能力,理性判断市场,对认购(或申购)基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策,获得基金投资收益,亦自行承担基金投资中出现的各类风险。

## 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予景顺长城量化小盘股票型证券投资基金募集注册的文件;
- 2、《景顺长城量化小盘股票型证券投资基金基金合同》;
- 3、《景顺长城量化小盘股票型证券投资基金招募说明书》;
- 4、《景顺长城量化小盘股票型证券投资基金托管协议》;
- 5、景顺长城基金管理有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程;
- 6、其他在中国证监会指定报纸上公开披露的基金份额净值、定期报告及临时公告。

### 12.2 存放地点

以上备查文件存放在本基金管理人的办公场所。

### 12.3 查阅方式

投资者可在办公时间免费查阅。

景顺长城基金管理有限公司

2024 年 8 月 30 日