

景顺长城量化小盘股票型证券投资基金

2024 年年度报告

2024 年 12 月 31 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：2025 年 3 月 28 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 2025 年 3 月 26 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。

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，基金管理人在本报告中对相关事项亦有详细说明，请投资者注意阅读。

本报告期自 2024 年 1 月 1 日起至 2024 年 12 月 31 日止。

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	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
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	9
3.4 过去三年基金的利润分配情况	9
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	15
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	15
§ 6 审计报告	15
6.1 审计报告基本信息	15
6.2 审计报告的基本内容	15
§ 7 年度财务报表	17
7.1 资产负债表	17
7.2 利润表	18
7.3 净资产变动表	19
7.4 报表附注	22

§ 8 投资组合报告	50
8.1 期末基金资产组合情况	50
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	51
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	52
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	70
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	71
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	71
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	71
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	72
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	72
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	72
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	72
8.12 投资组合报告附注	72
§ 9 基金份额持有人信息	73
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	73
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	73
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	73
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	73
§ 10 开放式基金份额变动	73
§ 11 重大事件揭示	74
11.1 基金份额持有人大会决议	74
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	74
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	74
11.4 基金投资策略的改变	74
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	74
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	74
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	74
11.8 其他重大事件	79
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	82
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	82
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	82
§ 13 备查文件目录	83
13.1 备查文件目录	83
13.2 存放地点	83
13.3 查阅方式	83

§ 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	134,241,911.59 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：</p> <p>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：</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>3、债券投资策略：</p> <p>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@igwfmc.com
		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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www. igwfmc. com
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室
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、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	2024 年	2023 年	2022 年
本期已实现收益	-148,015,285.84	-97,495,803.07	-153,152,782.37
本期利润	-123,659,593.87	-91,089,041.74	-192,848,570.78
加权平均基金份额本期利润	-0.3759	-0.1061	-0.3963
本期加权平均净值利润率	-33.64%	-7.61%	-24.56%
本期基金份额净值增长率	8.27%	-2.90%	-17.50%
3.1.2 期末数据和指标	2024 年末	2023 年末	2022 年末
期末可供分配利润	33,486,061.24	223,668,980.97	172,774,137.11

期末可供分配基金份额利润	0.2494	0.2058	0.5149
期末基金资产净值	175,253,259.90	1,310,391,384.02	508,350,941.26
期末基金份额净值	1.3055	1.2058	1.5148
3.1.3 累计期末指标	2024 年末	2023 年末	2022 年末
基金份额累计净值增长率	59.25%	47.09%	51.48%

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。

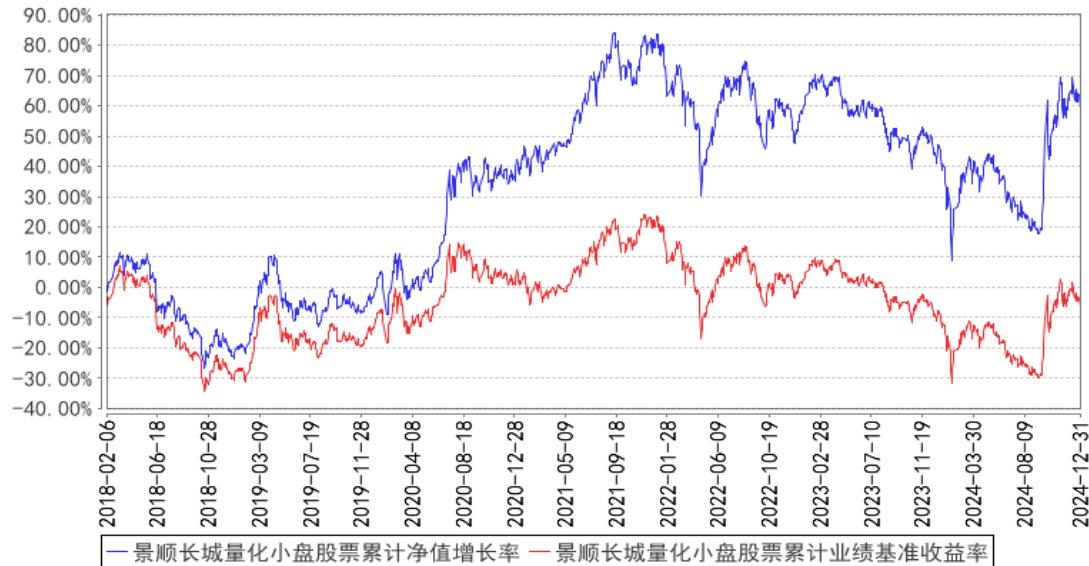
3.2 基金净值表现

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
过去三个月	6.61%	2.23%	4.23%	2.28%	2.38%	-0.05%
过去六个月	22.62%	2.10%	20.68%	2.13%	1.94%	-0.03%
过去一年	8.27%	1.99%	1.41%	2.01%	6.86%	-0.02%
过去三年	-13.27%	1.51%	-24.13%	1.54%	10.86%	-0.03%
过去五年	63.05%	1.47%	7.51%	1.49%	55.54%	-0.02%
自基金合同生效起至今	59.25%	1.48%	-6.38%	1.50%	65.63%	-0.02%

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

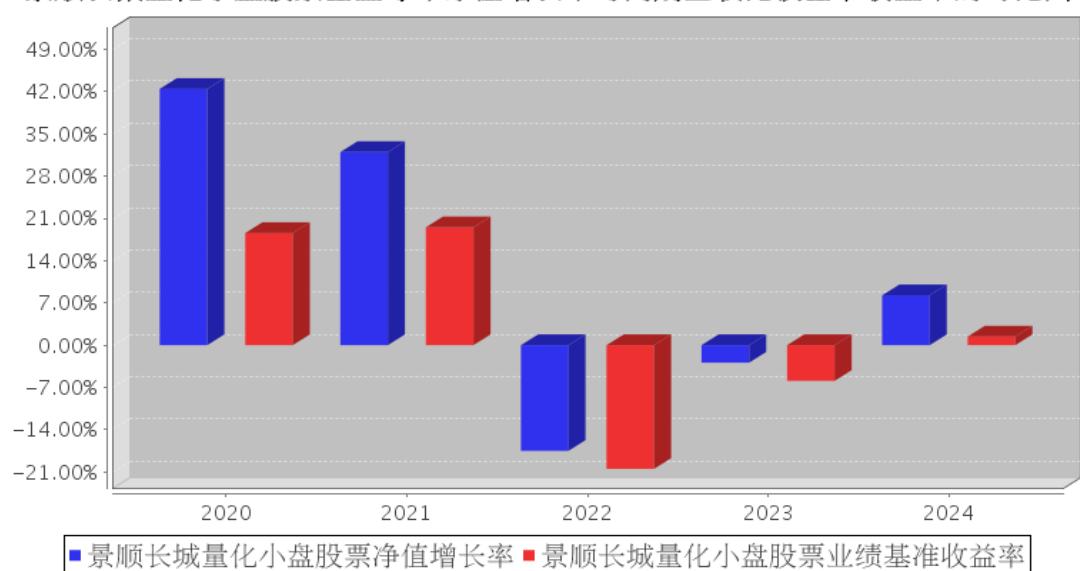
景顺长城量化小盘股票累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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。

3.2.3 过去五年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

景顺长城量化小盘股票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



3.3 其他指标

无。

3.4 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每 10 份基金份额分 红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总 额	年度利润分配合计	备注
2024 年	—	—	—	—	—
2023 年	2.8000	261,448,879.02	44,756,772.20	306,205,651.22	—
2022 年	—	—	—	—	—
合计	2.8000	261,448,879.02	44,756,772.20	306,205,651.22	—

§ 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12月31日，本公司旗下共管理191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。

4.1.4 基金经理薪酬机制

本报告期内，本基金的基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《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 公平交易制度和控制方法

为了进一步规范和完善本基金管理人（以下简称“本公司”）投资和交易管理，严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见（2011 年修订）》、《基金经理兼任私募资产管理计划投资经理工作指引（试行）》等法律法规，本公司制定了《景顺长城基金管理有限公司公平交易指引》，该《指引》涵盖了境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，同时对授权、研究分析与投资决策、交易执行的内部控制、交易指令的分配执行、公平交易监控、报告措施及信息披露、利益冲突的防范和异常交易的监控等方面进行了全面规范。具体控制措施如下：

1、授权、研究分析与投资决策的内部控制

建立投资授权制度，明确各投资决策主体的职责和权限划分；建立客观的研究方法，任何投

资分析和建议均应有充分的事实和数据支持，避免主观臆断，严禁利用内幕信息作为投资依据；确保所有投资组合平等地享有研究成果；根据不同投资组合的投资目标、投资风格、投资范围和投资限制等，建立不同投资组合的投资主题库和交易对手备选库，投资组合经理在此基础上根据投资授权构建具体的投资组合并独立进行投资决策。

2、交易执行的内部控制

本公司实行集中交易制度，将投资管理职能和交易执行职能相隔离；建立公平的交易分配机制，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。同时严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。

3、交易指令分配的控制

所有投资对象的投资指令必须经由交易管理部总监或其授权人审核后分配至交易员执行。

交易员对于接收到的交易指令依照时间优先、价格优先的顺序执行。在执行多个投资组合在同一时点就同一证券下达的相同方向的投资指令时，需根据价格优先、比例分配的原则，经过公平性审核，公平对待多个不同投资组合的投资指令。

4、公平交易监控

本公司建立异常交易行为日常监控和分析评估制度。交易管理部负责异常交易的日常实时监控，风险管理部于每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行分析，对连续四个季度期间内、不同时间窗内（如 1 日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合的同向交易的交易价差进行分析，对不同投资组合临近交易日的反向交易的交易价差进行分析。相关投资组合经理应对异常交易情况进行合理性解释，由投资组合经理、督察长、总经理签署后，妥善保存分析报告备查。如果在上述分析期间内，公司管理的所有投资组合同向交易价差出现异常情况，应重新核查公司投资决策和交易执行环节的内部控制，针对潜在问题完善公平交易制度，并在监察稽核季度报告和年度报告中对此做专项说明。

4.3.2 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执行，公平对待旗下管理的所有投资组合。本报告期内本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见（2011 年修订）》及《景顺长城基金管理有限公司公平交易指引》对本年度同向交易价差进行了专项分析，未发现不公平交易的情况。

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

本报告期内，本基金的基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.3.3 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 26 次，均为指数量化投资组合因投资策略需要而发生的同日反向交易。

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

回顾 2024 年，全年经济运行呈现“前高、中低、后扬”的走势，9 月份以来，存量和增量政策精准发力，四季度经济明显回升。从数据来看，2024 年全年 GDP 增长 5.0%，其中四季度 GDP 当季同比增长 5.4%，显示出我国第四季度的刺激政策取得了显著成效。2024 年 10 月至 12 月国内制造业 PMI 依次为 50.1、50.3、50.1，连续三个月处于扩张区间，2025 年 1 月 PMI 有所回落，显示出新的增量政策依然有一定必要性。2025 年 1 月 CPI 同比上涨 0.50%，环比上涨 0.70%，价格水平持续改善。2024 年 12 月 M2 同比增长 7.3%，M1 同比下降 1.4%，M1 环比持续回升。从资产价格的表现来看，2024 年 A 股市场波动加剧，大盘风格显著优于小盘风格，价值风格优于成长风格，沪深 300、中证 500 和中证 1000 指数全年分别上涨 14.68%、5.46% 和 1.2%。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金份额净值增长率为 8.27%，业绩比较基准收益率为 1.41%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，宏观经济层面，海外市场的冲击依然存在，关税仍然是较大的不确定因素，但国内稳增长的政策方向已经逐步明朗，国内科技企业的快速崛起将系统性提升我国科技公司的估值水平，市场的机遇要大于风险。随着经济数据的不断验证以及市场风险偏好水平的逐步改善，权益类资产在低利率环境下的风险收益比将进一步凸显。在经济新旧动能转换的过程中，A 股市场仍然将以结构性机会为主，这将给我们的量化模型带来较大的发挥空间。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。

在组合构建层面，我们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成长稳健的公司，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，本基金管理人继续完善内部控制体系和内部控制制度，健全管理制度和业务规

章，依据国家相关法律法规、内部控制制度、内部管理制度和业务规章、基金合同以及基金招募说明书对本基金的投资、销售、运营等业务中的内部控制完善程度和执行情况进行持续的监察稽核，对监察稽核中发现的问题及时提示，督促改进并跟踪改进效果。定期编制监察稽核报告，及时报送上级监管部门（如需）。

为提高防范和化解经营风险的能力，确保经营业务稳健运行和受托资产安全完整，保障基金份额持有人利益，本基金管理人采取的主要措施包括：

1、进一步完善内部控制体系和内部控制制度。本公司已经建立了科学合理的层次分明的包括内控组织架构、控制程序和控制措施以及控制职责在内的运行高效、严密的内部控制体系。

2、进一步健全管理制度和业务规章。在已建立的基本管理制度、业务流程、规章等基础上，根据公司的业务发展和法律法规的颁布情况，对相关管理制度和业务流程规章进行全面修订及更新，从管理制度和业务流程上进行风险控制，进一步强化内部制度的执行力度。

3、坚持岗位分离、相互制衡的内控机制。在岗位设置上继续采取严格的分离制度，形成不同岗位之间的相互制衡机制，从岗位设置上减少和防范操作及操守风险。

4、持续地对基金经营业务的合法合规性进行监控。采取了实时监控、常规稽核、专项稽核和临时稽核等方式，对发现的问题及时提示并督促改进，防范各种违法违规行为的发生，切实保护基金份额持有人的合法权益。

5、执行以 KPI (Key Performance Indicator 主要绩效指标) 为风险控制主要手段和评估标准的风险评估、预警、报告、控制以及监督程序。并通过适当的控制流程，定期或实时对风险进行评估、预警和监督，从而确认、评估和预警与公司管理及基金运作有关的风险。通过顺畅的报告渠道，对风险问题进行层层监督、管理和控制，使部门和管理层及时把握风险状况并快速做出风险控制决策。

6、采用自动化监督控制系统。采用电子化投资交易系统，对投资比例进行限制，有效地防止合规性运作风险和操作风险。

7、按照法律法规的要求，认真做好旗下各只基金的信息披露工作，确保有关信息披露的真实、完整、准确、及时。

8、定期不定期地组织合规培训。通过结合外部律师培训、内部合规培训以及证券业协会的后续教育课程，进一步加强对员工的合规教育，健全公司合规文化。

本基金管理人承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范和控制各种风险，充分保障基金份额持有人的合法权益。

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，控制执行中可能产生的风险。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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。

截至本报告期末，根据相关法律法规和基金合同的要求以及本基金的实际运作情况，经基金管理人研究决定暂不实施利润分配。

4.9 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 (2025) 审字第 70015711_H122 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	景顺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	<p>我们审计了景顺长城量化小盘股票型证券投资基金的财务报表，包括 2024 年 12 月 31 日的资产负债表，2024 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的景顺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，公允反映了景顺长城量化小盘股票型证券投资基金 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年度的经营成果和净资产变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>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，我们独立于景顺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。</p>
其他信息	<p>景顺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。</p> <p>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</p>

	<p>对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>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。</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>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。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估景顺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。</p> <p>治理层负责监督景顺长城量化小盘股票型证券投资基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>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。</p> <p>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：</p> <p>（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。</p> <p>（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。</p> <p>（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。</p> <p>（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，就可能导致对景顺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景顺长城量化小盘股票型证券投资基金不能持续经营。</p> <p>（5）评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，</p>

	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	胡莲莲
会计师事务所的地址	中国 北京	
审计报告日期	2025 年 3 月 26 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 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 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	7. 4. 7. 1	10,734,762.23	85,365,489.72
结算备付金		1,008,159.18	31,032,622.31
存出保证金		71,398.86	4,224,180.16
交易性金融资产	7. 4. 7. 2	164,247,536.90	1,205,831,923.67
其中：股票投资		164,247,536.90	1,204,657,343.66
基金投资		—	—
债券投资		—	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	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		70,068.21	—
应收股利		—	—
应收申购款		88,398.49	86,042.14
递延所得税资产		—	—
其他资产	7. 4. 7. 8	—	—
资产总计		176,220,323.87	1,326,540,258.00
负债和净资产	附注号	本期末	上年度末

		2024 年 12 月 31 日	2023 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		—	9,787,675.00
应付赎回款		257,741.47	245,958.94
应付管理人报酬		185,527.10	1,391,377.54
应付托管费		30,921.19	231,896.27
应付销售服务费		—	—
应付投资顾问费		—	—
应交税费		0.69	2.78
应付利润		—	—
递延所得税负债		—	—
其他负债	7. 4. 7. 9	492,873.52	4,491,963.45
负债合计		967,063.97	16,148,873.98
净资产:			
实收基金	7. 4. 7. 10	134,241,911.59	1,086,722,403.05
其他综合收益	7. 4. 7. 11	—	—
未分配利润	7. 4. 7. 12	41,011,348.31	223,668,980.97
净资产合计		175,253,259.90	1,310,391,384.02
负债和净资产总计		176,220,323.87	1,326,540,258.00

注： 报告截止日 2024 年 12 月 31 日，基金份额净值人民币 1.3055 元，基金份额总额 134,241,911.59 份。

7.2 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
一、营业收入		-118,379,144.64	-71,829,345.70
1. 利息收入		274,864.91	753,237.54
其中：存款利息收入	7. 4. 7. 13	274,864.91	753,237.54
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“-”号填列）		-144,240,573.90	-79,483,102.73
其中：股票投资收益	7.4.7.14	-151,687,868.13	-93,253,478.78
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	184,261.13	1,730,006.34
资产支持证券投资收益	7.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	2,064,745.62	-4,618,098.49
股利收益	7.4.7.19	5,198,287.48	16,658,468.20
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	24,355,691.97	6,406,761.33
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	1,230,872.38	493,758.16
减：二、营业总支出		5,280,449.23	19,259,696.04
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	4,384,925.75	16,322,969.98
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	730,821.02	2,720,494.95
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
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	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		13,187.72	100.19
8. 其他费用	7.4.7.23	151,514.74	216,130.92
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-123,659,593.87	-91,089,041.74
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-123,659,593.87	-91,089,041.74
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-123,659,593.87	-91,089,041.74

7.3 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024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	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)	-952,480,491.46	—	-182,657,632.66	-1,135,138,124.12
(一)、综合收益总额	—	—	-123,659,593.87	-123,659,593.87
(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)	-952,480,491.46	—	-58,998,038.79	-1,011,478,530.25
其中：1.基金申购款	29,175,606.05	—	3,937,272.08	33,112,878.13
2.基金赎回款	-981,656,097.51	—	-62,935,310.87	-1,044,591,408.38
(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	134,241,911.59	—	41,011,348.31	175,253,259.90
项目	上年度可比期间 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	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)	751,145,598.90	-	50,894,843.86	802,040,442.76
(一)、综合收益总额	-	-	-91,089,041.74	-91,089,041.74
(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)	751,145,598.90	-	448,189,536.82	1,199,335,135.72
其中：1. 基金申购款	937,425,732.34	-	533,867,808.26	1,471,293,540.60
2. 基金赎回款	-186,280,133.44	-	-85,678,271.44	-271,958,404.88
(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)	-	-	-306,205,651.22	-306,205,651.22
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	1,086,722,403.05	-	223,668,980.97	1,310,391,384.02

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：

康乐

吴建军

邵媛媛

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

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×95%+银行活期存款利率(税后)×5%。

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 2025 年 3 月 26 日批准报出。

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、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 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 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

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

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。

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务工具投资的, 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) 本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本基金; 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

本基金每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。基金收益分配后基金份额净值不能低于面值。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

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

无。

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

无。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

7.4.5.3 差错更正的说明

无。

7.4.6 税项

(1) 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征增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自2016年5月1日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140号文《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对证券投资基金在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。增值税应税行为的销售额根据财政部、国家税务总局财税[2017]90号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定确定。

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加，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附加。

（2）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[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。

（3）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，（如有）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，（如有）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。

（4）印花税（如适用）

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰ 调整为 1‰，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；根据财政部、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》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

（5）境外投资

本基金运作过程中如有涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监

会财税[2014]81 号文《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[2016]127 号文《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》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

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 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
活期存款	10,734,762.23	85,365,489.72
等于： 本金	10,733,737.76	85,356,114.15
加： 应计利息	1,024.47	9,375.57
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	—	—
存款期限 3 个月（含） 至 1 年	—	—
存款期限 1 年（含）以 上	—	—
其他存款	—	—
等于： 本金	—	—
加： 应计利息	—	—
减： 坏账准备	—	—
合计	10,734,762.23	85,365,489.72

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	162,997,800.05	—	164,247,536.90	1,249,736.85
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	162,997,800.05	-	164,247,536.90	1,249,736.85	
项目		上年度末 2023 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	1,228,457,470.54	-	1,204,657,343.66	-23,800,126.88	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	-
债券	交易所市场	1,096,000.00	88.25	1,174,580.01	78,491.76
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	1,096,000.00	88.25	1,174,580.01	78,491.76
资产支持证券	-	-	-	-	-
基金	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	1,229,553,470.54	88.25	1,205,831,923.67	-23,721,635.12	

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 2024 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	-	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-	-	-	-
项目	上年度末 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	32,161,680.00	-	-	-
其中：股指期货投资	32,161,680.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	32,161,680.00	-	-	-

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

无。

7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

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

本基金本报告期末及上年度末的买入返售金融资产余额为零。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末买断式逆回购交易中取得的债券余额为零。

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

本基金本报告期末及上年度末的债权投资余额为零。

7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期末及上年度末的债权投资余额为零。

7.4.7.6 其他债权投资

7.4.7.6.1 其他债权投资情况

本基金本报告期末及上年度末的其他债权投资余额为零。

7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期末及上年度末的其他债权投资余额为零。

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

本基金本报告期末及上年度末的其他权益工具投资余额为零。

7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

本基金本报告期末及上年度末的其他权益工具投资余额为零。

7.4.7.8 其他资产

本基金本报告期末及上年度末的其他资产余额为零。

7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	—	—
应付赎回费	379.06	369.50
应付证券出借违约金	—	—
应付交易费用	348,494.46	4,281,593.95
其中：交易所市场	348,494.46	4,281,593.95
银行间市场	—	—
应付利息	—	—
预提费用	144,000.00	210,000.00
合计	492,873.52	4,491,963.45

7.4.7.10 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 12 月 31 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	29,175,606.05	29,175,606.05
本期赎回 (以“-”号填列)	-981,656,097.51	-981,656,097.51
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	134,241,911.59	134,241,911.59

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

7.4.7.11 其他综合收益

无。

7.4.7.12 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	-148,015,285.84	24,355,691.97	-123,659,593.87
本期基金份额交易产生的变动数	-112,175,443.66	53,177,404.87	-58,998,038.79
其中：基金申购款	995,772.98	2,941,499.10	3,937,272.08
基金赎回款	-113,171,216.64	50,235,905.77	-62,935,310.87
本期已分配利润	-	-	-
本期末	33,486,061.24	7,525,287.07	41,011,348.31

7.4.7.13 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12月31 日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年 12月31日
活期存款利息收入	93,216.52	291,992.96
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	178,818.06	455,179.28
其他	2,830.33	6,065.30
合计	274,864.91	753,237.54

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 2024年1月1日至2024年12月31 日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月 31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-151,687,868.13	-93,253,478.78
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	-151,687,868.13	-93,253,478.78
----	-----------------	----------------

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 2024年1月1日至2024年12月31 日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12 月31日
卖出股票成交总额	3,854,861,700.62	8,344,487,285.38
减：卖出股票成本总额	3,998,526,744.42	8,413,259,757.55
减：交易费用	8,022,824.33	24,481,006.61
买卖股票差价收入	-151,687,868.13	-93,253,478.78

7.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

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 2024年1月1日至2024年12月31 日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31 日
债券投资收益——利息收入	284.44	1,297.81
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	183,976.69	1,728,708.53
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	184,261.13	1,730,006.34

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 2024年1月1日至2024年12月31 日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月 31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,280,284.24	9,052,919.71
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本	1,096,000.00	7,322,600.00

总额		
减: 应计利息总额	256.50	1,248.38
减: 交易费用	51.05	362.80
买卖债券差价收入	183,976.69	1,728,708.53

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

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

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

无。

7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

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

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
股指期货投资收益	2,064,745.62	-4,618,098.49

7.4.7.19 股利收益

单位: 人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	5,198,287.48	16,658,468.20
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	5,198,287.48	16,658,468.20

7.4.7.20 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	24,971,371.97	5,791,081.33
股票投资	25,049,863.73	5,712,589.57
债券投资	-78,491.76	78,491.76
资产支持证券投资	-	-
基金投资	-	-
贵金属投资	-	-
其他	-	-
2. 衍生工具	-615,680.00	615,680.00
权证投资	-	-
期货投资	-615,680.00	615,680.00
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	24,355,691.97	6,406,761.33

7.4.7.21 其他收入

单位: 人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	819,223.17	477,635.69
基金转换费收入	411,649.21	16,122.47
合计	1,230,872.38	493,758.16

7.4.7.22 信用减值损失

无。

7.4.7.23 其他费用

单位: 人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
审计费用	24,000.00	90,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行划款手续费	7,154.74	5,770.92
其他	360.00	360.00
合计	151,514.74	216,130.92

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, 本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 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。

7.4.9 关联方关系

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
景顺资产管理有限公司	基金管理人的股东
开滦(集团)有限责任公司	基金管理人的股东
大连实德集团有限公司	基金管理人的股东
景顺长城资产管理(深圳)有限公司	基金管理人的子公司

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。

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 2024年1月1日至2024年12月31日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023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	384,263,855.86	5.66	54,301,490.41	0.31

7.4.10.1.2 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。

7.4.10.1.3 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	334,082.94	5.90	27,244.93	7.82
关联方名称	上年度可比期间 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	50,990.59	0.31	27,170.75	0.63

注：（1）上述佣金按协议约定的佣金费率计算，佣金费率由协议签订方参考市场价格确定。

(2) 本报告期内 1-6 月该类佣金协议的服务范围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等 (上年度可比期间: 同)。

(3) 根据《公开募集证券投资基金管理交易费用管理规定》，自 2024 年 7 月 1 日起，被动股票型基金不再通过股票交易佣金支付研究服务等其他费用，其他类型基金可以通过股票交易佣金支付研究服务费用。

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	4,384,925.75	16,322,969.98
其中: 应支付销售机构的客户维护费	1,079,632.36	2,128,486.43
应支付基金管理人的净管理费	3,305,293.39	14,194,483.55

注: 支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.20%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:

日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.20%/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, 本基金的管理费年费率由 1.50% 调整为 1.20%。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位: 人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	730,821.02	2,720,494.95

注: 支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.20%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:

日托管费=前一日基金资产净值×0.20%/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, 本基金的托管费年费率由 0.25% 调整为 0.20%。

7.4.10.2.3 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。

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

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。

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

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。

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

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。

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固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均未运用固有资金投资本基金。

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

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。

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 2024年1月1日至2024年12月 31日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023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- 活期	10,734,762.23	93,216.52	85,365,489.72	291,992.96

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。

7.4.10.7 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。

7.4.10.8 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。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配。

7.4.12 期末（2024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
001391	国货航	2024 年 12 月 23 日	6 个月	新股流通受限	2.30	6.80	1,365	3,139.50	9,282.00	-
301552	科力装备	2024 年 7 月 15 日	6 个月	新股流通受限	30.00	56.87	143	4,290.00	8,132.41	-
301571	国科天成	2024 年 8 月 14 日	6 个月	新股流通受限	11.14	40.83	350	3,899.00	14,290.50	-
301585	蓝宇股份	2024 年 12 月 10 日	6 个月	新股流通受限	23.95	35.85	210	5,029.50	7,528.50	-
301586	佳力奇	2024 年 8 月 21 日	6 个月	新股流通受限	18.09	53.14	215	3,889.35	11,425.10	-
301603	乔峰智能	2024 年 7 月 3 日	6 个月	新股流通受限	26.50	41.98	233	6,174.50	9,781.34	-
301606	绿联科技	2024 年 7 月 17 日	6 个月	新股流通受限	21.21	36.49	396	8,399.16	14,450.04	-
301607	富特科技	2024 年 8 月 28 日	6 个月	新股流通受限	14.00	36.14	257	3,598.00	9,287.98	-
301608	博实结	2024 年 7 月 25 日	6 个月	新股流通受限	44.50	65.38	184	8,188.00	12,029.92	-
301611	珂玛科技	2024 年 8 月 7 日	6 个月	新股流通受限	8.00	56.10	804	6,432.00	45,104.40	-
301617	博苑	2024 年 12	6 个月	新股流通	27.76	39.79	179	4,969.04	7,122.41	-

	股 份	月 3 日		受限						
301622	英 思 特	2024 年 11 月 26 日	6 个 月	新股 流通 受限	22.36	44.92	258	5,768.88	11,589.36	-
301631	壹 连 科 技	2024 年 11 月 12 日	6 个 月	新股 流通 受限	72.99	101.96	82	5,985.18	8,360.72	-
603072	天 和 磁 材	2024 年 12 月 24 日	1 个 月 内 (含)	新股 流通 受限	12.30	12.30	1,470	18,081.00	18,081.00	-
603072	天 和 磁 材	2024 年 12 月 24 日	6 个 月	新股 流通 受限	12.30	12.30	164	2,017.20	2,017.20	-
603207	小 方 制 药	2024 年 8 月 19 日	6 个 月	新股 流通 受限	12.47	26.65	185	2,306.95	4,930.25	-
603285	键 邦 股 份	2024 年 6 月 28 日	6 个 月	新股 流通 受限	18.65	22.61	129	2,405.85	2,916.69	-
603310	巍 华 新 材	2024 年 8 月 7 日	6 个 月	新股 流通 受限	17.39	17.95	181	3,147.59	3,248.95	-
603350	安 乃 达	2024 年 6 月 26 日	6 个 月	新股 流通 受限	20.56	36.17	106	2,179.36	3,834.02	-
603391	力 聚 热 能	2024 年 7 月 24 日	6 个 月	新股 流通 受限	40.00	41.35	100	4,000.00	4,135.00	-
688449	联 芸 科 技	2024 年 11 月 20 日	6 个 月	新股 流通 受限	11.25	29.44	798	8,977.50	23,493.12	-
688605	先 锋 精	2024 年 12 月 4 日	6 个 月	新股 流通 受限	11.29	53.68	744	8,399.76	39,937.92	-

	科									
688708	佳驰科技	2024 年 11 月 27 日	6 个月	新股流通受限	27.08	48.95	338	9,153.04	16,545.10	-
688710	益诺思	2024 年 8 月 27 日	6 个月	新股流通受限	19.06	33.58	332	6,327.92	11,148.56	-
688721	龙图光罩	2024 年 7 月 30 日	6 个月	新股流通受限	18.50	56.85	279	5,161.50	15,861.15	-

7.4.12.2 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。

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 2024 年 12 月 31 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。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 12 月 31 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。

7.4.12.4 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。

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。

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公司发行的证券，不得超过该证券余额的 10%。

于本报告期末，本基金未持有债券和资产支持证券（上年度末：0.09%）。

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。

7.4.13.3.1 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、流通受限的投资品种比例以及组合在短时间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管理人管理的其他基金共同持有一家公司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 7.4.12。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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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，并按照合约规定的重新定价日或到期日进行了分类。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本周末 2024 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	10,734,762.23	-	-	-	-	-	10,734,762.23
结算备付 金	1,008,159.18	-	-	-	-	-	1,008,159.18
存出保证 金	71,398.86	-	-	-	-	-	71,398.86
交易性金 融资产		-	-	-	-	164,247,536.90	164,247,536.90
应收申购 款		-	-	-	-	88,398.49	88,398.49
应收清算 款		-	-	-	-	70,068.21	70,068.21
资产总计	11,814,320.27	-	-	-	-	164,406,003.60	176,220,323.87
负债							
应付赎回 款		-	-	-	-	257,741.47	257,741.47
应付管理 人报酬		-	-	-	-	185,527.10	185,527.10
应付托管 费		-	-	-	-	30,921.19	30,921.19
应交税费		-	-	-	-	0.69	0.69
其他负债		-	-	-	-	492,873.52	492,873.52
负债总计		-	-	-	-	967,063.97	967,063.97
利率敏感 度缺口	11,814,320.27	-	-	-	-	-	-
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 金	31,032,622.31	-	-	-	-	-	31,032,622.31
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		-	-	-	-	86,042.14	86,042.14

款							
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		-	-

7.4.13.4.1.2 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 0.00%（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）。

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。

7.4.13.4.3 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。

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 2024 年 12 月 31 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	164,247,536.90	93.72	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	164,247,536.90	93.72	1,204,657,343.66	91.93

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 (2024 年 12 月 31 日)	上年度末 (2023 年 12 月 31 日)
	沪深 300 指数上升 5%	9,475,861.12	59,989,528.39
	沪深 300 指数下降 5%	-9,475,861.12	-59,989,528.39

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 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	163,933,003.26	1,203,732,616.15
第二层次	20,098.20	977,522.49
第三层次	294,435.44	1,121,785.03
合计	164,247,536.90	1,205,831,923.67

7.4.14.2.2 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。

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		
	2024年1月1日至2024年12月31日		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	1,121,785.03	1,121,785.03
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	121,821.58	121,821.58
转出第三层次	-	1,121,785.03	1,121,785.03
当期利得或损失总额	-	172,613.86	172,613.86
其中：计入损益的利得或损失	-	172,613.86	172,613.86
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	294,435.44	294,435.44
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	-	172,613.86	172,613.86
项目	上年度可比期间		
	2023年1月1日至2023年12月31日		
	债券投资	股票投资	合计
期初余额	-	1,665,239.99	1,665,239.99
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	956,613.79	956,613.79
转出第三层次	-	1,665,239.99	1,665,239.99
当期利得或损失总额	-	165,171.24	165,171.24

其中：计入损益的利得或损失	-	165,171.24	165,171.24
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	1,121,785.03	1,121,785.03
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	-	165,171.24	165,171.24

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	294,435.44	平均价格 亚式期权 模型	预期波动率	0.2665–2.8129	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
限售股票	1,121,785.03	平均价格 亚式期权 模型	预期波动率	0.1962–2.1988	负相关

7.4.14.3 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。

7.4.14.4 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。

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	164,247,536.90	93.21

	其中：股票	164,247,536.90	93.21
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	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	11,742,921.41	6.66
8	其他各项资产	229,865.56	0.13
9	合计	176,220,323.87	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	557,158.00	0.32
B	采矿业	1,858,019.00	1.06
C	制造业	110,240,759.55	62.90
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,869,249.20	1.07
E	建筑业	1,570,323.06	0.90
F	批发和零售业	6,808,087.00	3.88
G	交通运输、仓储和邮政业	3,207,629.00	1.83
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	23,002,969.21	13.13
J	金融业	2,625,080.00	1.50
K	房地产业	3,940,393.00	2.25
L	租赁和商务服务业	2,655,089.00	1.52
M	科学研究和技术服务业	2,196,017.88	1.25
N	水利、环境和公共设施管理业	1,242,726.00	0.71
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	678,730.00	0.39
R	文化、体育和娱乐业	1,743,005.00	0.99
S	综合	52,302.00	0.03
	合计	164,247,536.90	93.72

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

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	000686	东北证券	157,100	1,247,374.00	0.71
2	600037	歌华有线	160,600	1,198,076.00	0.68
3	000528	柳工	99,000	1,193,940.00	0.68
4	002249	大洋电机	198,200	1,163,434.00	0.66
5	600420	国药现代	95,500	1,140,270.00	0.65
6	601137	博威合金	52,800	1,071,840.00	0.61
7	002212	天融信	165,400	1,066,830.00	0.61
8	002705	新宝股份	70,900	1,063,500.00	0.61
9	000951	中国重汽	61,000	1,035,780.00	0.59
10	300113	顺网科技	61,500	1,033,815.00	0.59
11	600320	振华重工	250,900	983,528.00	0.56
12	300772	运达股份	74,200	982,408.00	0.56
13	300346	南大光电	24,900	960,891.00	0.55
14	600718	东软集团	86,000	926,220.00	0.53
15	600602	云赛智联	56,800	898,576.00	0.51
16	603612	索通发展	66,100	893,011.00	0.51
17	300627	华测导航	19,400	810,920.00	0.46
18	002023	海特高新	78,300	794,745.00	0.45
19	300323	华灿光电	95,700	792,396.00	0.45
20	600428	中远海特	107,300	783,290.00	0.45
21	002550	千红制药	125,600	778,720.00	0.44
22	301327	华宝新能	10,100	774,771.00	0.44
23	000682	东方电子	72,200	773,262.00	0.44
24	002139	拓邦股份	55,500	755,355.00	0.43
25	603766	隆鑫通用	81,500	741,650.00	0.42
26	688372	伟测科技	12,291	719,269.32	0.41
27	002745	木林森	82,300	717,656.00	0.41
28	600850	电科数字	29,071	694,796.90	0.40
29	300079	数码视讯	127,000	687,070.00	0.39
30	002668	TCL 智家	52,100	683,552.00	0.39
31	002906	华阳集团	22,200	682,650.00	0.39
32	300244	迪安诊断	59,800	678,730.00	0.39
33	002534	西子洁能	60,800	675,488.00	0.39
34	000550	江铃汽车	27,800	651,910.00	0.37
35	300770	新媒股份	15,802	638,558.82	0.36
36	300409	道氏技术	46,600	634,226.00	0.36
37	300672	国科微	9,500	634,125.00	0.36

38	002091	江苏国泰	86,300	631,716.00	0.36
39	688209	英集芯	35,700	630,819.00	0.36
40	603267	鸿远电子	17,400	630,402.00	0.36
41	000848	承德露露	70,000	627,900.00	0.36
42	002967	广电计量	38,200	626,480.00	0.36
43	600216	浙江医药	39,000	618,540.00	0.35
44	300525	博思软件	39,700	618,526.00	0.35
45	605111	新洁能	18,040	611,736.40	0.35
46	600531	豫光金铅	95,000	609,900.00	0.35
47	688208	道通科技	15,552	609,016.32	0.35
48	300674	宇信科技	30,600	597,312.00	0.34
49	300236	上海新阳	15,900	594,183.00	0.34
50	300083	创世纪	88,500	576,135.00	0.33
51	301050	雷电微力	11,120	573,569.60	0.33
52	603025	大豪科技	37,240	567,910.00	0.32
53	603308	应流股份	40,100	565,410.00	0.32
54	300682	朗新集团	46,200	563,640.00	0.32
55	301175	中科环保	104,100	562,140.00	0.32
56	300777	中简科技	19,800	560,142.00	0.32
57	000415	渤海租赁	148,100	558,337.00	0.32
58	688019	安集科技	3,978	554,374.08	0.32
59	002928	华夏航空	71,300	553,288.00	0.32
60	002626	金达威	36,400	549,640.00	0.31
61	300415	伊之密	27,200	545,632.00	0.31
62	600641	万业企业	37,100	542,402.00	0.31
63	300620	光库科技	11,100	539,460.00	0.31
64	300432	富临精工	34,800	535,224.00	0.31
65	300679	电连技术	8,900	531,330.00	0.30
66	601126	四方股份	31,000	525,760.00	0.30
67	600993	马应龙	20,000	522,200.00	0.30
68	688185	康希诺	8,377	511,415.85	0.29
69	603118	共进股份	57,400	510,860.00	0.29
70	002948	青岛银行	130,700	507,116.00	0.29
71	600649	城投控股	113,000	502,850.00	0.29
72	300034	钢研高纳	32,100	500,760.00	0.29
73	601369	陕鼓动力	55,900	486,330.00	0.28
74	603100	川仪股份	22,320	480,996.00	0.27
75	605589	圣泉集团	20,300	478,674.00	0.27
76	600633	浙数文化	45,400	474,884.00	0.27
77	002226	江南化工	87,300	473,166.00	0.27
78	000680	山推股份	48,600	471,420.00	0.27
79	300866	安克创新	4,800	468,672.00	0.27
80	300724	捷佳伟创	7,400	467,754.00	0.27

81	000417	合百集团	73,100	466,378.00	0.27
82	600639	浦东金桥	41,800	463,980.00	0.26
83	600559	老白干酒	22,100	463,879.00	0.26
84	300456	赛微电子	26,900	462,142.00	0.26
85	300181	佐力药业	30,000	460,800.00	0.26
86	002043	兔宝宝	38,300	455,004.00	0.26
87	600248	陕建股份	101,400	454,272.00	0.26
88	603477	巨星农牧	25,500	452,625.00	0.26
89	600648	外高桥	38,000	452,580.00	0.26
90	002497	雅化集团	38,600	451,620.00	0.26
91	300475	香农芯创	15,700	447,293.00	0.26
92	688233	神工股份	18,800	440,860.00	0.25
93	600064	南京高科	56,700	440,559.00	0.25
94	301029	怡合达	17,800	440,016.00	0.25
95	000970	中科三环	42,300	438,651.00	0.25
96	002174	游族网络	46,800	437,580.00	0.25
97	600210	紫江企业	65,600	433,616.00	0.25
98	002773	康弘药业	22,100	433,160.00	0.25
99	600266	城建发展	84,900	432,990.00	0.25
100	300850	新强联	22,600	431,886.00	0.25
101	603383	顶点软件	11,500	431,250.00	0.25
102	300482	万孚生物	19,200	430,272.00	0.25
103	002237	恒邦股份	42,600	430,260.00	0.25
104	600710	苏美达	46,200	429,660.00	0.25
105	600729	重庆百货	14,500	424,125.00	0.24
106	000966	长源电力	88,900	422,275.00	0.24
107	688388	嘉元科技	28,555	420,615.15	0.24
108	600728	佳都科技	89,700	419,796.00	0.24
109	000029	深深房 A	27,800	418,668.00	0.24
110	300570	太辰光	5,700	414,390.00	0.24
111	688270	臻镭科技	11,800	413,000.00	0.24
112	002456	欧菲光	34,300	410,914.00	0.23
113	603005	晶方科技	14,460	408,495.00	0.23
114	603197	保隆科技	10,700	403,925.00	0.23
115	300666	江丰电子	5,800	402,810.00	0.23
116	002545	东方铁塔	57,200	402,116.00	0.23
117	002020	京新药业	31,300	400,640.00	0.23
118	002036	联创电子	42,200	396,680.00	0.23
119	300170	汉得信息	31,700	393,080.00	0.22
120	600662	外服控股	77,500	392,925.00	0.22
121	601168	西部矿业	24,400	392,108.00	0.22
122	603083	剑桥科技	9,600	389,760.00	0.22
123	300416	苏试试验	33,000	388,080.00	0.22

124	002461	珠江啤酒	39,200	387,688.00	0.22
125	002895	川恒股份	15,700	386,220.00	0.22
126	000049	德赛电池	16,400	385,564.00	0.22
127	301031	中熔电气	3,700	384,874.00	0.22
128	002405	四维图新	39,700	382,708.00	0.22
129	300151	昌红科技	22,500	382,500.00	0.22
130	688048	长光华芯	9,731	379,411.69	0.22
131	688123	聚辰股份	6,481	379,268.12	0.22
132	002446	盛路通信	57,600	377,280.00	0.22
133	600446	金证股份	21,800	375,832.00	0.21
134	300303	聚飞光电	54,600	372,372.00	0.21
135	002151	北斗星通	14,000	371,560.00	0.21
136	002396	星网锐捷	19,457	369,488.43	0.21
137	002558	巨人网络	29,100	369,279.00	0.21
138	688063	派能科技	9,150	366,457.50	0.21
139	603158	腾龙股份	44,900	362,792.00	0.21
140	603530	神马电力	14,600	360,766.00	0.21
141	603283	赛腾股份	5,200	359,632.00	0.21
142	000917	电广传媒	50,300	355,621.00	0.20
143	000603	盛达资源	29,600	354,904.00	0.20
144	001270	铖昌科技	9,300	354,330.00	0.20
145	600861	北京人力	18,200	352,170.00	0.20
146	603888	新华网	15,700	350,738.00	0.20
147	002651	利君股份	47,800	350,374.00	0.20
148	601311	骆驼股份	41,800	346,522.00	0.20
149	600640	国脉文化	29,000	346,260.00	0.20
150	688066	航天宏图	16,925	345,270.00	0.20
151	688200	华峰测控	3,300	344,850.00	0.20
152	603368	柳药集团	19,300	344,698.00	0.20
153	002250	联化科技	62,000	341,620.00	0.19
154	601222	林洋能源	48,300	341,481.00	0.19
155	603920	世运电路	11,600	341,040.00	0.19
156	601811	新华文轩	21,400	339,190.00	0.19
157	300476	胜宏科技	8,000	336,720.00	0.19
158	600478	科力远	81,400	336,182.00	0.19
159	688550	瑞联新材	10,700	334,803.00	0.19
160	600096	云天化	15,000	334,500.00	0.19
161	002701	奥瑞金	58,900	333,963.00	0.19
162	601127	赛力斯	2,500	333,475.00	0.19
163	000423	东阿阿胶	5,300	332,416.00	0.19
164	688127	蓝特光学	12,042	326,338.20	0.19
165	605333	沪光股份	10,000	326,300.00	0.19
166	600211	西藏药业	8,800	325,072.00	0.19

167	000881	中广核技	44,300	324,719.00	0.19
168	000969	安泰科技	29,100	324,465.00	0.19
169	600596	新安股份	36,900	323,982.00	0.18
170	300811	铂科新材	6,000	323,460.00	0.18
171	688183	生益电子	8,228	323,031.28	0.18
172	002532	天山铝业	41,000	322,670.00	0.18
173	600894	广日股份	22,000	321,200.00	0.18
174	002270	华明装备	18,900	319,221.00	0.18
175	600269	赣粤高速	56,500	316,965.00	0.18
176	300373	扬杰科技	7,200	313,344.00	0.18
177	601619	嘉泽新能	93,900	311,748.00	0.18
178	002706	良信股份	40,500	311,040.00	0.18
179	603301	振德医疗	14,100	310,059.00	0.18
180	300031	宝通科技	16,900	309,608.00	0.18
181	600563	法拉电子	2,600	309,192.00	0.18
182	601677	明泰铝业	25,700	309,171.00	0.18
183	300130	新国都	14,100	305,406.00	0.17
184	002222	福晶科技	9,400	304,560.00	0.17
185	000975	山金国际	19,800	304,326.00	0.17
186	000035	中国天楹	62,100	302,427.00	0.17
187	688037	芯源微	3,609	301,820.67	0.17
188	300869	康泰医学	21,600	301,104.00	0.17
189	002332	仙琚制药	30,100	299,194.00	0.17
190	000039	中集集团	38,400	298,368.00	0.17
191	003012	东鹏控股	45,000	297,450.00	0.17
192	001309	德明利	3,400	296,480.00	0.17
193	600458	时代新材	23,100	295,911.00	0.17
194	300684	中石科技	13,000	291,590.00	0.17
195	002273	水晶光电	13,100	291,082.00	0.17
196	688403	汇成股份	32,469	290,922.24	0.17
197	300363	博腾股份	18,400	290,168.00	0.17
198	600380	健康元	25,700	289,639.00	0.17
199	002739	万达电影	23,600	286,504.00	0.16
200	301511	德福科技	22,800	286,368.00	0.16
201	300598	诚迈科技	5,900	285,560.00	0.16
202	600331	宏达股份	37,100	282,702.00	0.16
203	300253	卫宁健康	39,400	282,104.00	0.16
204	000061	农产品	40,200	281,802.00	0.16
205	603169	兰石重装	51,500	280,675.00	0.16
206	688568	中科星图	5,478	279,542.34	0.16
207	601702	华峰铝业	15,200	278,464.00	0.16
208	603565	中谷物流	28,400	278,320.00	0.16
209	603678	火炬电子	9,100	277,550.00	0.16

210	002837	英维克	6,870	277,548.00	0.16
211	002911	佛燃能源	21,930	277,195.20	0.16
212	300232	洲明科技	40,300	276,861.00	0.16
213	600664	哈药股份	66,400	274,232.00	0.16
214	002517	恺英网络	20,100	273,561.00	0.16
215	600810	神马股份	33,800	273,442.00	0.16
216	688007	光峰科技	18,387	271,943.73	0.16
217	600869	远东股份	57,200	271,700.00	0.16
218	300035	中科电气	18,000	269,100.00	0.15
219	000429	粤高速 A	18,300	269,010.00	0.15
219	601869	长飞光纤	9,000	269,010.00	0.15
220	300741	华宝股份	15,400	267,806.00	0.15
221	603013	亚普股份	17,800	266,644.00	0.15
222	301078	孩子王	23,400	266,292.00	0.15
223	002167	东方锆业	36,100	264,974.00	0.15
224	603338	浙江鼎力	4,100	264,532.00	0.15
225	301558	三态股份	30,100	263,676.00	0.15
226	301120	新特电气	26,500	262,615.00	0.15
227	601886	江河集团	48,400	261,360.00	0.15
228	600827	百联股份	23,900	261,227.00	0.15
229	002635	安洁科技	16,300	259,496.00	0.15
230	000050	深天马 A	28,700	259,161.00	0.15
231	300048	合康新能	51,400	259,056.00	0.15
232	300286	安科瑞	12,600	258,930.00	0.15
233	000758	中色股份	52,200	257,868.00	0.15
234	605009	豪悦护理	6,449	257,702.04	0.15
235	603055	台华新材	23,175	256,779.00	0.15
236	300101	振芯科技	11,800	255,588.00	0.15
237	600704	物产中大	50,500	255,530.00	0.15
238	300036	超图软件	15,000	254,700.00	0.15
239	688739	成大生物	9,871	254,474.38	0.15
240	000921	海信家电	8,800	254,320.00	0.15
241	603075	热威股份	13,600	253,368.00	0.14
242	300327	中颖电子	10,300	252,041.00	0.14
243	300265	通光线缆	30,600	251,532.00	0.14
244	688578	艾力斯	4,183	250,561.70	0.14
245	600335	国机汽车	40,200	250,446.00	0.14
246	300263	隆华科技	34,300	250,390.00	0.14
247	688596	正帆科技	7,020	249,561.00	0.14
248	300463	迈克生物	18,900	249,480.00	0.14
249	300390	天华新能	10,800	248,940.00	0.14
250	600557	康缘药业	18,200	247,884.00	0.14
251	601607	上海医药	11,800	247,800.00	0.14

252	601107	四川成渝	47,200	246,856.00	0.14
253	603939	益丰药房	10,200	246,126.00	0.14
254	600363	联创光电	5,100	244,188.00	0.14
255	300677	英科医疗	9,600	242,688.00	0.14
256	002073	软控股份	29,300	242,018.00	0.14
257	300634	彩讯股份	11,100	241,980.00	0.14
258	603317	天味食品	18,100	241,454.00	0.14
259	000025	特力 A	14,600	241,192.00	0.14
260	300443	金雷股份	12,100	241,032.00	0.14
261	600572	康恩贝	51,700	240,922.00	0.14
262	600550	保变电气	30,100	236,285.00	0.13
263	688700	东威科技	8,000	235,680.00	0.13
264	002004	华邦健康	51,900	234,588.00	0.13
265	300696	爱乐达	15,100	234,503.00	0.13
266	600623	华谊集团	33,300	233,100.00	0.13
267	002567	唐人神	45,400	231,540.00	0.13
268	301171	易点天下	8,200	231,158.00	0.13
269	002123	梦网科技	21,300	230,253.00	0.13
270	600100	同方股份	32,300	229,653.00	0.13
271	301217	铜冠铜箔	20,700	229,356.00	0.13
272	000099	中信海直	8,700	229,332.00	0.13
273	300663	科蓝软件	13,200	229,152.00	0.13
274	688380	中微半导	7,600	227,240.00	0.13
275	600330	天通股份	32,000	227,200.00	0.13
276	601515	东峰集团	56,700	225,666.00	0.13
277	000902	新洋丰	17,300	225,592.00	0.13
278	688235	百济神州	1,400	225,428.00	0.13
279	688131	皓元医药	6,300	224,910.00	0.13
280	002011	盾安环境	20,700	223,767.00	0.13
281	300379	东方通	14,800	223,332.00	0.13
282	600487	亨通光电	12,900	222,138.00	0.13
283	002649	博彦科技	18,300	221,796.00	0.13
284	600981	汇鸿集团	85,300	220,074.00	0.13
285	603229	奥翔药业	22,000	219,780.00	0.13
286	300502	新易盛	1,900	219,602.00	0.13
287	300602	飞荣达	11,400	219,108.00	0.13
288	002891	中宠股份	6,060	216,342.00	0.12
289	603185	弘元绿能	13,300	216,125.00	0.12
290	300560	中富通	13,900	215,172.00	0.12
291	688608	恒玄科技	661	215,069.57	0.12
292	600707	彩虹股份	26,000	213,720.00	0.12
293	000885	城发环境	16,300	213,693.00	0.12
294	600246	万通发展	28,500	212,325.00	0.12

295	600366	宁波韵升	28,700	211,232.00	0.12
296	600066	宇通客车	8,000	211,040.00	0.12
297	300458	全志科技	5,400	209,304.00	0.12
298	688484	南芯科技	5,802	209,104.08	0.12
299	603690	至纯科技	8,300	208,413.00	0.12
300	300298	三诺生物	8,000	206,480.00	0.12
301	002194	武汉凡谷	18,300	205,326.00	0.12
302	300726	宏达电子	6,600	205,260.00	0.12
303	603730	岱美股份	22,600	203,174.00	0.12
304	300002	神州泰岳	17,500	202,825.00	0.12
305	300045	华力创通	9,700	202,633.00	0.12
306	600548	深高速	15,000	202,200.00	0.12
307	300624	万兴科技	3,200	202,080.00	0.12
308	300241	瑞丰光电	36,800	202,032.00	0.12
309	688515	裕太微	2,038	201,762.00	0.12
310	601595	上海电影	8,100	200,070.00	0.11
311	300115	长盈精密	12,300	199,752.00	0.11
312	002130	沃尔核材	7,900	199,475.00	0.11
313	000997	新大陆	9,900	197,505.00	0.11
314	600237	铜峰电子	30,100	197,155.00	0.11
315	002003	伟星股份	13,900	196,963.00	0.11
316	002697	红旗连锁	33,300	196,803.00	0.11
317	002010	传化智联	43,400	196,602.00	0.11
318	002747	埃斯顿	10,600	196,100.00	0.11
319	300319	麦捷科技	15,700	195,936.00	0.11
320	600153	建发股份	18,600	195,672.00	0.11
321	002498	汉缆股份	57,600	195,264.00	0.11
322	688498	源杰科技	1,440	193,248.00	0.11
323	000756	新华制药	12,300	193,233.00	0.11
324	002847	盐津铺子	3,049	190,867.40	0.11
325	300428	立中集团	11,700	190,710.00	0.11
326	002960	青鸟消防	16,280	189,987.60	0.11
327	603171	税友股份	6,200	189,100.00	0.11
328	600120	浙江东方	40,500	188,730.00	0.11
329	000766	通化金马	12,000	188,400.00	0.11
330	002612	朗姿股份	11,500	188,140.00	0.11
331	300643	万通智控	15,700	187,772.00	0.11
332	000513	丽珠集团	4,900	186,200.00	0.11
333	002216	三全食品	15,500	186,000.00	0.11
334	600055	万东医疗	12,300	185,730.00	0.11
335	600160	巨化股份	7,700	185,724.00	0.11
336	600618	氯碱化工	18,700	184,382.00	0.11
337	605365	立达信	11,700	183,690.00	0.10

338	300660	江苏雷利	4,800	183,456.00	0.10
339	601002	晋亿实业	42,000	182,700.00	0.10
340	300685	艾德生物	8,000	182,400.00	0.10
341	603966	法兰泰克	23,600	182,192.00	0.10
342	601528	瑞丰银行	32,200	181,286.00	0.10
343	002030	达安基因	31,800	180,624.00	0.10
344	002466	天齐锂业	5,400	178,200.00	0.10
345	300073	当升科技	4,400	177,232.00	0.10
346	002859	洁美科技	8,500	176,375.00	0.10
347	300366	创意信息	18,900	175,770.00	0.10
348	000923	河钢资源	12,600	175,140.00	0.10
349	002791	坚朗五金	7,700	175,098.00	0.10
350	000090	天健集团	42,500	174,675.00	0.10
351	002127	南极电商	39,500	173,800.00	0.10
352	300451	创业慧康	38,300	171,584.00	0.10
353	000957	中通客车	15,500	170,500.00	0.10
354	300131	英唐智控	21,000	170,310.00	0.10
355	600062	华润双鹤	8,600	170,280.00	0.10
356	601609	金田股份	28,600	168,740.00	0.10
357	002061	浙江交科	41,300	168,504.00	0.10
358	002215	诺普信	15,000	168,450.00	0.10
359	688083	中望软件	1,939	165,920.23	0.09
360	000913	钱江摩托	9,200	165,692.00	0.09
361	688322	奥比中光	3,532	164,238.00	0.09
362	300133	华策影视	22,600	163,172.00	0.09
363	000685	中山公用	17,600	162,448.00	0.09
364	600875	东方电气	10,200	162,078.00	0.09
365	688027	国盾量子	542	161,711.12	0.09
366	688095	福昕软件	2,400	161,184.00	0.09
367	600750	江中药业	7,062	160,307.40	0.09
368	688352	颀中科技	13,200	160,116.00	0.09
369	688150	莱特光电	7,100	159,892.00	0.09
370	002961	瑞达期货	11,100	159,507.00	0.09
371	600757	长江传媒	16,600	158,862.00	0.09
372	688588	凌志软件	11,500	158,700.00	0.09
373	603466	风语筑	17,000	158,440.00	0.09
374	300111	向日葵	48,900	158,436.00	0.09
375	000498	山东路桥	26,400	157,080.00	0.09
376	002106	莱宝高科	14,200	154,922.00	0.09
377	002334	英威腾	20,400	153,408.00	0.09
378	600133	东湖高新	16,400	153,340.00	0.09
379	603533	掌阅科技	7,500	152,325.00	0.09
380	688598	金博股份	7,200	151,632.00	0.09

381	002987	京北方	10,600	150,838.00	0.09
382	601975	招商南油	47,900	149,927.00	0.09
383	601890	亚星锚链	19,200	149,568.00	0.09
384	300185	通裕重工	58,000	149,060.00	0.09
385	002946	新乳业	10,200	148,002.00	0.08
386	603919	金徽酒	7,538	147,744.80	0.08
387	300132	青松股份	29,900	147,407.00	0.08
388	600422	昆药集团	9,300	147,405.00	0.08
389	300855	图南股份	6,700	146,864.00	0.08
390	002637	赞宇科技	14,900	146,765.00	0.08
391	688088	虹软科技	3,795	146,335.20	0.08
392	000903	云内动力	42,400	145,856.00	0.08
393	603393	新天然气	4,800	145,296.00	0.08
394	600459	贵研铂业	10,566	145,071.18	0.08
395	002402	和而泰	8,000	144,880.00	0.08
396	603214	爱婴室	6,400	144,384.00	0.08
397	600619	海立股份	11,800	143,960.00	0.08
398	300747	锐科激光	7,500	143,700.00	0.08
399	300093	金刚光伏	10,400	143,624.00	0.08
400	603258	电魂网络	7,200	143,208.00	0.08
401	002400	省广集团	17,900	143,021.00	0.08
402	600058	五矿发展	20,000	142,400.00	0.08
403	600533	栖霞建设	60,800	142,272.00	0.08
404	601500	通用股份	26,500	141,245.00	0.08
405	301039	中集车辆	15,500	140,275.00	0.08
406	300027	华谊兄弟	53,500	140,170.00	0.08
407	300735	光弘科技	5,000	139,950.00	0.08
408	688326	经纬恒润	1,664	139,942.40	0.08
409	002546	新联电子	32,300	139,859.00	0.08
410	688321	微芯生物	7,517	139,665.86	0.08
411	300183	东软载波	7,200	139,320.00	0.08
412	688023	安恒信息	3,409	139,087.20	0.08
413	002101	广东鸿图	11,600	138,968.00	0.08
414	000543	皖能电力	17,400	137,634.00	0.08
415	301268	铭利达	8,300	137,614.00	0.08
416	300662	科锐国际	6,500	136,890.00	0.08
417	600621	华鑫股份	8,200	135,136.00	0.08
418	002643	万润股份	11,200	134,400.00	0.08
419	600651	飞乐音响	32,400	134,136.00	0.08
420	688268	华特气体	2,880	132,249.60	0.08
421	600163	中闽能源	21,600	131,544.00	0.08
422	301180	万祥科技	8,400	129,948.00	0.07
423	003009	中天火箭	3,300	128,700.00	0.07

424	002384	东山精密	4,400	128,480.00	0.07
425	300470	中密控股	3,400	128,180.00	0.07
426	603299	苏盐井神	11,500	128,110.00	0.07
427	002605	姚记科技	4,800	127,968.00	0.07
428	688279	峰峩科技	804	126,790.80	0.07
429	601058	赛轮轮胎	8,800	126,104.00	0.07
430	301153	中科江南	4,500	125,730.00	0.07
431	601777	力帆科技	16,400	125,460.00	0.07
432	600151	航天机电	15,600	124,488.00	0.07
433	605376	博迁新材	4,300	124,485.00	0.07
434	603093	南华期货	10,400	123,760.00	0.07
435	300623	捷捷微电	3,600	122,976.00	0.07
436	300223	北京君正	1,800	122,760.00	0.07
437	300661	圣邦股份	1,500	122,670.00	0.07
438	600206	有研新材	7,800	122,226.00	0.07
439	688348	昱能科技	2,500	122,000.00	0.07
440	688289	圣湘生物	5,350	121,445.00	0.07
441	301205	联特科技	1,600	121,104.00	0.07
442	300369	绿盟科技	16,600	119,354.00	0.07
443	000560	我爱我家	38,500	117,425.00	0.07
444	600866	星湖科技	18,100	117,107.00	0.07
445	002851	麦格米特	1,900	116,774.00	0.07
446	002315	焦点科技	2,800	116,704.00	0.07
447	002724	海洋王	21,900	116,508.00	0.07
448	688408	中信博	1,613	116,136.00	0.07
449	300762	上海瀚讯	5,500	115,665.00	0.07
450	603899	晨光股份	3,800	114,950.00	0.07
451	002185	华天科技	9,900	114,939.00	0.07
452	601567	三星医疗	3,700	113,812.00	0.06
453	002624	完美世界	11,000	113,630.00	0.06
454	300757	罗博特科	500	112,660.00	0.06
455	300134	大富科技	9,600	112,608.00	0.06
456	603508	思维列控	4,700	111,766.00	0.06
457	000042	中洲控股	25,000	111,750.00	0.06
458	300633	开立医疗	3,800	111,682.00	0.06
459	300418	昆仑万维	2,900	111,592.00	0.06
460	603801	志邦家居	8,700	111,447.00	0.06
461	600389	江山股份	7,700	111,265.00	0.06
462	300315	掌趣科技	20,200	111,100.00	0.06
463	603328	依顿电子	11,200	110,432.00	0.06
464	000027	深圳能源	17,000	110,160.00	0.06
465	300226	上海钢联	4,800	109,776.00	0.06
466	600502	安徽建工	22,777	108,874.06	0.06

467	600141	兴发集团	5,000	108,500.00	0.06
468	301381	赛维时代	4,700	106,972.00	0.06
469	300324	旋极信息	32,300	106,913.00	0.06
470	000572	海马汽车	25,400	106,172.00	0.06
471	002128	电投能源	5,400	105,732.00	0.06
472	300972	万辰集团	1,300	104,533.00	0.06
473	600575	淮河能源	26,300	104,411.00	0.06
474	600990	四创电子	4,900	104,272.00	0.06
475	000988	华工科技	2,400	103,920.00	0.06
476	000503	国新健康	9,400	103,212.00	0.06
477	603279	景津装备	5,700	101,916.00	0.06
478	688206	概伦电子	5,385	101,830.35	0.06
479	300596	利安隆	3,300	100,650.00	0.06
480	600285	羚锐制药	4,500	99,720.00	0.06
481	301090	华润材料	14,300	99,242.00	0.06
482	300406	九强生物	7,400	98,864.00	0.06
482	600208	衢州发展	33,400	98,864.00	0.06
483	603439	贵州三力	7,600	98,800.00	0.06
484	002614	奥佳华	14,900	98,638.00	0.06
485	300188	国投智能	7,100	97,909.00	0.06
486	002351	漫步者	5,800	95,700.00	0.05
487	002389	航天彩虹	5,300	95,665.00	0.05
488	688508	芯朋微	2,213	95,092.61	0.05
489	600094	大名城	25,800	93,912.00	0.05
490	688110	东芯股份	3,763	93,698.70	0.05
491	301339	通行宝	4,600	93,564.00	0.05
492	002305	南国置业	46,800	93,132.00	0.05
493	300655	晶瑞电材	9,900	92,664.00	0.05
494	301262	海看股份	3,700	92,019.00	0.05
495	600060	海信视像	4,600	91,724.00	0.05
496	300705	九典制药	5,100	91,545.00	0.05
497	300219	鸿利智汇	12,200	91,378.00	0.05
498	300618	寒锐钴业	2,700	91,179.00	0.05
499	301363	美好医疗	2,800	90,776.00	0.05
500	600737	中粮糖业	8,800	89,848.00	0.05
501	000521	长虹美菱	11,000	89,760.00	0.05
502	603609	禾丰股份	10,400	89,648.00	0.05
503	688559	海目星	2,600	89,440.00	0.05
504	601699	潞安环能	6,200	89,032.00	0.05
505	300222	科大智能	8,900	88,733.00	0.05
506	300779	惠城环保	900	87,840.00	0.05
507	002726	龙大美食	11,000	87,120.00	0.05
508	002597	金禾实业	3,800	86,754.00	0.05

509	688378	奥来德	3,800	86,678.00	0.05
510	300576	容大感光	1,900	85,842.00	0.05
511	002970	锐明技术	1,800	85,734.00	0.05
512	002717	岭南股份	26,300	84,949.00	0.05
513	688166	博瑞医药	2,805	84,711.00	0.05
514	000933	神火股份	5,000	84,500.00	0.05
515	300251	光线传媒	8,900	84,016.00	0.05
516	000753	漳州发展	19,500	83,850.00	0.05
517	603039	泛微网络	1,700	83,300.00	0.05
518	000062	深圳华强	3,700	82,880.00	0.05
519	300578	会畅通讯	4,300	82,775.00	0.05
520	300928	华安鑫创	2,500	82,225.00	0.05
521	688261	东微半导	1,928	80,956.72	0.05
522	002284	亚太股份	10,200	78,948.00	0.05
523	601801	皖新传媒	10,700	78,538.00	0.04
524	603983	丸美生物	2,400	77,424.00	0.04
525	002294	信立泰	2,500	77,325.00	0.04
526	300768	迪普科技	4,400	77,000.00	0.04
527	002925	盈趣科技	4,900	76,734.00	0.04
528	300529	健帆生物	2,600	76,284.00	0.04
529	002245	蔚蓝锂芯	7,000	74,830.00	0.04
530	300973	立高食品	1,900	74,157.00	0.04
531	002176	江特电机	10,000	74,100.00	0.04
532	600562	国睿科技	3,700	73,741.00	0.04
533	600765	中航重机	3,600	73,692.00	0.04
534	001914	招商积余	6,900	72,933.00	0.04
535	600419	天润乳业	7,800	72,618.00	0.04
536	002008	大族激光	2,900	72,500.00	0.04
537	002356	赫美集团	21,800	71,722.00	0.04
538	000700	模塑科技	10,200	71,604.00	0.04
539	300081	恒信东方	9,900	71,082.00	0.04
540	300341	麦克奥迪	4,000	70,040.00	0.04
541	002145	中核钛白	16,200	68,688.00	0.04
542	300573	兴齐眼药	980	68,384.40	0.04
543	000901	航天科技	6,200	68,014.00	0.04
544	000926	福星股份	26,600	67,830.00	0.04
545	000928	中钢国际	10,600	67,522.00	0.04
546	300978	东箭科技	6,200	67,518.00	0.04
547	688798	艾为电子	957	66,817.74	0.04
548	688789	宏华数科	1,005	66,711.90	0.04
549	002483	润邦股份	12,800	66,688.00	0.04
550	300261	雅本化学	9,700	66,445.00	0.04
551	002991	甘源食品	700	65,464.00	0.04

552	688392	骄成超声	1,600	65,280.00	0.04
553	300378	鼎捷数智	2,500	64,675.00	0.04
554	601717	郑煤机	4,900	63,602.00	0.04
555	301219	腾远钴业	1,400	63,294.00	0.04
556	300986	志特新材	5,200	63,128.00	0.04
557	688158	优刻得	4,478	62,602.44	0.04
558	600386	北巴传媒	13,900	62,133.00	0.04
559	002803	吉宏股份	4,900	62,132.00	0.04
560	000600	建投能源	10,900	61,694.00	0.04
561	301291	明阳电气	1,400	61,488.00	0.04
562	301060	兰卫医学	6,700	61,037.00	0.03
563	600675	中华企业	21,500	60,415.00	0.03
564	688336	三生国健	2,813	60,254.46	0.03
565	003006	百亚股份	2,500	59,975.00	0.03
566	000690	宝新能源	13,100	58,688.00	0.03
567	002153	石基信息	8,200	58,548.00	0.03
568	300513	恒实科技	6,300	57,519.00	0.03
569	300827	上能电气	1,300	57,070.00	0.03
570	688300	联瑞新材	884	56,929.60	0.03
571	605305	中际联合	2,000	56,660.00	0.03
572	002317	众生药业	4,600	55,890.00	0.03
573	600577	精达股份	7,500	54,675.00	0.03
574	000829	天音控股	4,100	54,038.00	0.03
575	600186	莲花控股	9,400	53,580.00	0.03
576	688586	江航装备	5,584	53,438.88	0.03
577	603386	骏亚科技	4,800	53,376.00	0.03
578	300613	富瀚微	900	52,650.00	0.03
579	000833	粤桂股份	4,600	52,302.00	0.03
580	688658	悦康药业	3,600	51,876.00	0.03
581	002465	海格通信	4,700	51,606.00	0.03
582	002674	兴业科技	5,400	51,246.00	0.03
583	002912	中新赛克	2,000	51,180.00	0.03
584	300438	鹏辉能源	1,800	50,598.00	0.03
585	002125	湘潭电化	5,000	50,400.00	0.03
586	300459	汤姆猫	8,700	49,938.00	0.03
587	002088	鲁阳节能	3,900	49,881.00	0.03
588	002031	巨轮智能	10,000	49,700.00	0.03
589	000999	华润三九	1,100	48,774.00	0.03
590	605286	同力日升	1,600	48,256.00	0.03
591	000681	视觉中国	2,300	47,886.00	0.03
592	603112	华翔股份	3,800	47,500.00	0.03
593	603306	华懋科技	1,500	47,415.00	0.03
594	300579	数字认证	1,500	47,130.00	0.03

595	603129	春风动力	300	47,121.00	0.03
596	003005	竞业达	1,700	46,104.00	0.03
597	301015	百洋医药	1,900	45,999.00	0.03
598	002206	海利得	10,700	45,903.00	0.03
599	603337	杰克股份	1,500	45,690.00	0.03
600	301611	珂玛科技	804	45,104.40	0.03
601	600498	烽火通信	2,300	44,758.00	0.03
602	600552	凯盛科技	3,900	44,499.00	0.03
603	300820	英杰电气	800	44,200.00	0.03
604	300766	每日互动	3,000	43,830.00	0.03
605	603927	中科软	2,000	43,400.00	0.02
606	603808	歌力思	6,200	43,338.00	0.02
607	000156	华数传媒	6,000	43,200.00	0.02
608	300486	东杰智能	6,300	43,092.00	0.02
609	300857	协创数据	400	42,756.00	0.02
610	688025	杰普特	900	42,750.00	0.02
611	600761	安徽合力	2,400	42,360.00	0.02
612	000719	中原传媒	3,700	42,032.00	0.02
613	601226	华电科工	6,200	41,912.00	0.02
614	688152	麒麟信安	803	41,788.12	0.02
615	000718	苏宁环球	17,700	41,772.00	0.02
616	300180	华峰超纤	6,600	41,580.00	0.02
617	002777	久远银海	2,400	41,328.00	0.02
618	600418	江淮汽车	1,100	41,250.00	0.02
619	001301	尚太科技	600	41,130.00	0.02
620	688239	航宇科技	1,100	41,030.00	0.02
621	600874	创业环保	6,800	40,596.00	0.02
622	688680	海优新材	1,200	40,536.00	0.02
623	300077	国民技术	1,700	40,528.00	0.02
624	688605	先锋精科	744	39,937.92	0.02
625	300568	星源材质	4,100	39,852.00	0.02
626	603733	仙鹤股份	1,900	39,197.00	0.02
627	002866	传艺科技	2,400	38,832.00	0.02
628	600312	平高电气	2,000	38,400.00	0.02
629	301297	富乐德	900	38,250.00	0.02
630	688167	炬光科技	600	38,220.00	0.02
631	000676	智度股份	4,500	38,070.00	0.02
632	000547	航天发展	5,200	38,012.00	0.02
633	600475	华光环能	4,200	37,842.00	0.02
634	605123	派克新材	700	37,632.00	0.02
635	002158	汉钟精机	2,022	37,447.44	0.02
636	300752	隆利科技	2,200	37,400.00	0.02
637	600223	福瑞达	4,900	37,044.00	0.02

638	601899	紫金矿业	2,400	36,288.00	0.02
639	600171	上海贝岭	900	35,712.00	0.02
640	002488	金固股份	3,400	35,496.00	0.02
641	688177	百奥泰	1,828	35,426.64	0.02
642	301526	国际复材	9,500	35,150.00	0.02
643	000034	神州数码	1,000	35,050.00	0.02
644	688630	芯碁微装	602	34,747.44	0.02
645	688005	容百科技	1,100	34,705.00	0.02
646	600449	宁夏建材	2,300	34,546.00	0.02
647	300085	银之杰	900	34,425.00	0.02
648	301030	仕净科技	1,400	33,796.00	0.02
649	600057	厦门象屿	5,200	33,748.00	0.02
650	000728	国元证券	4,000	33,440.00	0.02
651	600987	航民股份	4,800	33,312.00	0.02
652	002265	建设工业	1,400	32,578.00	0.02
653	300182	捷成股份	5,500	32,285.00	0.02
654	600143	金发科技	3,700	31,968.00	0.02
655	688146	中船特气	1,084	31,479.36	0.02
656	688337	普源精电	800	31,200.00	0.02
657	601858	中国科传	1,500	30,570.00	0.02
658	300065	海兰信	3,700	30,340.00	0.02
659	000990	诚志股份	3,900	30,225.00	0.02
660	002583	海能达	2,100	29,841.00	0.02
661	300769	德方纳米	800	29,504.00	0.02
662	300802	矩子科技	1,600	29,232.00	0.02
663	601921	浙版传媒	3,700	29,156.00	0.02
664	300492	华图山鼎	400	29,120.00	0.02
665	603699	纽威股份	1,300	28,821.00	0.02
666	002292	奥飞娱乐	3,300	28,545.00	0.02
667	603123	翠微股份	3,500	28,175.00	0.02
668	300326	凯利泰	4,300	27,950.00	0.02
669	600682	南京新百	4,000	27,360.00	0.02
670	688116	天奈科技	700	27,167.00	0.02
671	300773	拉卡拉	1,500	26,550.00	0.02
672	000517	荣安地产	11,800	26,314.00	0.02
673	603906	龙蟠科技	2,500	25,900.00	0.01
674	000657	中钨高新	2,800	25,788.00	0.01
675	002812	恩捷股份	800	25,592.00	0.01
676	600650	锦江在线	1,800	25,164.00	0.01
677	603166	福达股份	3,400	24,718.00	0.01
678	002542	中化岩土	6,300	24,696.00	0.01
679	603063	禾望电气	1,200	23,952.00	0.01
680	600033	福建高速	6,100	23,668.00	0.01

681	688449	联芸科技	798	23,493.12	0.01
682	688636	智明达	800	22,480.00	0.01
683	002063	远光软件	3,900	22,464.00	0.01
684	603132	金徽股份	2,000	22,460.00	0.01
685	603583	捷昌驱动	900	22,239.00	0.01
686	600073	光明肉业	3,200	22,208.00	0.01
687	003021	兆威机电	300	22,173.00	0.01
688	300841	康华生物	400	21,808.00	0.01
689	688100	威胜信息	600	21,720.00	0.01
690	603728	鸣志电器	400	21,600.00	0.01
691	300558	贝达药业	400	21,572.00	0.01
692	000762	西藏矿业	1,000	21,500.00	0.01
693	603588	高能环境	4,100	21,484.00	0.01
694	688076	诺泰生物	400	20,768.00	0.01
695	002723	小崧股份	2,900	20,155.00	0.01
696	300785	值得买	600	20,100.00	0.01
697	603072	天和磁材	1,634	20,098.20	0.01
698	300257	开山股份	2,200	20,064.00	0.01
699	000712	锦龙股份	1,300	19,656.00	0.01
700	002214	大立科技	1,700	18,955.00	0.01
701	301238	瑞泰新材	1,200	18,792.00	0.01
702	002274	华昌化工	2,400	18,648.00	0.01
703	301047	义翘神州	300	18,555.00	0.01
704	600800	渤海化学	6,100	18,544.00	0.01
705	688383	新益昌	400	17,948.00	0.01
706	301236	软通动力	300	17,613.00	0.01
707	603358	华达科技	500	16,700.00	0.01
708	688708	佳驰科技	338	16,545.10	0.01
709	600843	上工申贝	1,300	16,354.00	0.01
710	002600	领益智造	2,000	16,000.00	0.01
711	688721	龙图光罩	279	15,861.15	0.01
712	600864	哈投股份	2,100	15,435.00	0.01
713	603990	麦迪科技	1,500	15,420.00	0.01
714	603379	三美股份	400	15,352.00	0.01
715	002183	怡亚通	3,400	15,266.00	0.01
716	300344	立方数科	3,400	15,130.00	0.01
717	002378	章源钨业	2,300	14,881.00	0.01
718	688107	安路科技	500	14,790.00	0.01
719	301606	绿联科技	396	14,450.04	0.01
720	301571	国科天成	350	14,290.50	0.01
721	002949	华阳国际	800	14,256.00	0.01
722	600537	亿晶光电	4,500	13,815.00	0.01
723	002065	东华软件	1,900	13,794.00	0.01

724	000783	长江证券	2,000	13,640.00	0.01
725	000021	深科技	700	13,342.00	0.01
726	300604	长川科技	300	13,239.00	0.01
727	002428	云南锗业	700	13,230.00	0.01
728	300653	正海生物	600	12,780.00	0.01
729	002559	亚威股份	1,400	12,558.00	0.01
730	002100	天康生物	1,900	12,445.00	0.01
731	600415	小商品城	900	12,069.00	0.01
732	301608	博实结	184	12,029.92	0.01
733	301622	英思特	258	11,589.36	0.01
734	301586	佳力奇	215	11,425.10	0.01
735	002416	爱施德	700	11,389.00	0.01
736	601121	宝地矿业	1,600	11,200.00	0.01
737	688710	益诺思	332	11,148.56	0.01
738	300352	北信源	2,100	11,088.00	0.01
739	688409	富创精密	200	10,314.00	0.01
740	300021	大禹节水	2,500	10,175.00	0.01
741	301603	乔峰智能	233	9,781.34	0.01
742	002126	银轮股份	500	9,360.00	0.01
743	301607	富特科技	257	9,287.98	0.01
744	001391	国货航	1,365	9,282.00	0.01
745	600012	皖通高速	500	8,825.00	0.01
746	002654	万润科技	700	8,491.00	0.00
747	301631	壹连科技	82	8,360.72	0.00
748	002475	立讯精密	200	8,152.00	0.00
749	301552	科力装备	143	8,132.41	0.00
750	000727	冠捷科技	2,900	8,062.00	0.00
751	601969	海南矿业	1,100	7,799.00	0.00
752	301585	蓝宇股份	210	7,528.50	0.00
753	002097	山河智能	1,000	7,500.00	0.00
754	300738	奥飞数据	500	7,250.00	0.00
755	002734	利民股份	900	7,173.00	0.00
756	301617	博苑股份	179	7,122.41	0.00
757	002468	申通快递	700	7,091.00	0.00
758	300061	旗天科技	500	6,450.00	0.00
759	300567	精测电子	100	6,430.00	0.00
760	000791	甘肃能源	1,000	6,030.00	0.00
761	600259	广晟有色	200	5,562.00	0.00
762	000888	峨眉山 A	400	5,292.00	0.00
763	600741	华域汽车	300	5,283.00	0.00
764	603207	小方制药	185	4,930.25	0.00
765	600323	瀚蓝环境	200	4,724.00	0.00
766	600536	中国软件	100	4,669.00	0.00

767	603391	力聚热能	100	4,135.00	0.00
768	600780	通宝能源	700	3,941.00	0.00
769	603350	安乃达	106	3,834.02	0.00
770	300039	上海凯宝	600	3,708.00	0.00
770	600582	天地科技	600	3,708.00	0.00
771	600882	妙可蓝多	200	3,580.00	0.00
772	002903	宇环数控	200	3,250.00	0.00
773	603310	巍华新材	181	3,248.95	0.00
774	603636	南威软件	300	3,150.00	0.00
775	603285	键邦股份	129	2,916.69	0.00
776	300787	海能实业	200	2,684.00	0.00
777	002869	金溢科技	100	2,660.00	0.00
778	300207	欣旺达	100	2,231.00	0.00
779	603357	设计总院	200	1,812.00	0.00
780	300813	泰林生物	100	1,727.00	0.00
781	603890	春秋电子	100	1,175.00	0.00
782	300138	晨光生物	100	872.00	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	300770	新媒股份	12,525,855.36	0.96
2	603005	晶方科技	10,494,349.00	0.80
3	300130	新国都	10,100,670.68	0.77
4	688018	乐鑫科技	10,061,326.23	0.77
5	603087	甘李药业	9,742,509.00	0.74
6	300638	广和通	9,705,017.20	0.74
7	002043	兔宝宝	9,691,247.00	0.74
8	601126	四方股份	9,680,856.00	0.74
9	600201	生物股份	9,632,553.00	0.74
10	002249	大洋电机	9,327,637.00	0.71
11	000034	神州数码	9,198,604.00	0.70
12	300777	中简科技	9,165,962.00	0.70
13	601163	三角轮胎	8,908,191.00	0.68
14	002705	新宝股份	8,774,409.00	0.67
15	300803	指南针	8,728,906.00	0.67
16	603566	普莱柯	8,713,099.81	0.66
17	603025	大豪科技	8,713,040.40	0.66
18	300687	赛意信息	8,615,638.48	0.66
19	002745	木林森	8,595,929.00	0.66
20	000921	海信家电	8,592,641.10	0.66

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。

8.4.2 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	14,278,500.00	1.09
2	688235	百济神州	13,654,750.01	1.04
3	688018	乐鑫科技	12,989,538.94	0.99
4	000034	神州数码	12,959,186.32	0.99
5	000951	中国重汽	12,837,053.40	0.98
6	000543	皖能电力	12,417,965.00	0.95
7	000921	海信家电	12,263,767.00	0.94
8	002249	大洋电机	12,250,460.00	0.93
9	300476	胜宏科技	12,201,355.00	0.93
10	300170	汉得信息	12,111,646.40	0.92
11	002276	万马股份	12,026,151.49	0.92
12	601126	四方股份	11,891,349.00	0.91
13	600312	平高电气	11,873,203.16	0.91
14	601137	博威合金	11,784,200.40	0.90
15	605589	圣泉集团	11,491,378.74	0.88
16	603368	柳药集团	11,428,062.17	0.87
17	603530	神马电力	11,355,823.00	0.87
18	000928	中钢国际	11,335,535.26	0.87
19	300770	新媒股份	11,225,372.30	0.86
20	002130	沃尔核材	11,137,094.60	0.85

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。

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	2,933,067,073.93
卖出股票收入（成交）总额	3,854,861,700.62

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。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

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

本基金本报告期末未持有债券投资。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 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。

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。

8.11.2 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。

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。

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未超出基金合同规定的备选股票库。

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	71,398.86
2	应收清算款	70,068.21
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	88,398.49
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	229,865.56

8. 12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8. 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。

8. 12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§ 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

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 (%)
14, 206	9, 449. 66	147, 393. 45	0. 11	134, 094, 518. 14	99. 89

9. 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	205, 272. 19	0. 152912

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	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	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

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

无。

§ 10 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	29, 175, 606. 05
减： 本报告期基金总赎回份额	981, 656, 097. 51
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	134, 241, 911. 59

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

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

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：

经中国建设银行股份有限公司（以下简称“中国建设银行”）研究决定，蔡亚蓉女士不再担任中国建设银行资产托管业务部总经理职务。

11.3 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。

11.4 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。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

考虑内部控制需要，经基金管理人董事会审议通过，并履行适当程序，本报告期内为本基金提供审计服务的会计师事务所由普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）变更为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）。截至本报告期末，该事务所已向本基金提供 1 年的审计服务。本报告期应支付给会计师事务所的报酬为人民币 24,000.00 元。

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

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。

11.6.2 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。

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	股票交易	应支付该券商的佣金	备注
------	------	------	-----------	----

	数量	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	977,012,050.53	14.40	775,138.33	13.70	未变 更
中信证券 股份有限 公司	4	671,723,589.29	9.90	604,689.04	10.68	未变 更
中信建投 证券股份 有限公司	1	659,083,045.51	9.71	600,945.49	10.62	本期 报告 退租 1个
招商证券 股份有限 公司	1	491,874,199.88	7.25	465,270.46	8.22	未变 更
广发证券 股份有限 公司	1	413,492,992.02	6.09	368,195.88	6.51	未变 更
长城证券 股份有限 公司	2	384,263,855.86	5.66	334,082.94	5.90	未变 更
方正证券 股份有限 公司	1	353,540,342.67	5.21	317,681.80	5.61	未变 更
浙商证券 股份有限 公司	2	351,143,635.66	5.18	246,714.93	4.36	本期 报告 新增 2个
国投证券 股份有限 公司	1	281,199,156.49	4.14	230,881.94	4.08	未变 更
西部证券 股份有限 公司	2	256,484,226.55	3.78	223,260.87	3.94	未变 更
国泰君安 证券股份 有限公司	1	237,630,565.36	3.50	199,280.00	3.52	未变 更
国信证券 股份有限 公司	2	227,195,117.33	3.35	173,905.01	3.07	未变 更
东北证券 股份有限 公司	1	206,160,741.47	3.04	177,263.42	3.13	未变 更

光大证券股份有限公司	2	188,780,890.61	2.78	166,236.78	2.94	未变更
东方证券股份有限公司	1	183,907,590.67	2.71	136,880.36	2.42	未变更
中国国际金融股份有限公司	1	179,794,803.23	2.65	132,629.31	2.34	未变更
华创证券有限责任公司	1	172,877,471.08	2.55	138,526.78	2.45	未变更
天风证券股份有限公司	1	150,272,482.62	2.21	93,038.24	1.64	未变更
民生证券股份有限公司	2	108,833,566.51	1.60	49,520.83	0.87	本期报告新增2个
华金证券股份有限公司	2	100,340,584.57	1.48	94,912.55	1.68	未变更
东方财富证券股份有限公司	2	90,444,692.27	1.33	85,550.93	1.51	未变更
国联证券股份有限公司	1	38,903,621.18	0.57	17,701.94	0.31	本期报告新增1个
中泰证券股份有限公司	1	30,493,062.19	0.45	13,899.94	0.25	未变更
华福证券有限责任公司	1	29,925,382.26	0.44	13,616.09	0.24	本期报告新增1个
汇丰前海证券有限责任公司	1	5,268.94	0.00	2.40	0.00	未变更
渤海证券股份有限公司	1	-	-	-	-	未变更
湘财证券股份有限	2	-	-	-	-	未变更

公司						
中银国际证券股份有限公司	1	-	-	-	-	未变更

注：1、基金管理人选择交易单元的标准为：交易单元所属券商财务状况良好，经营行为规范，合规风控能力和交易、研究等服务能力较强。

2、基金管理人选择交易单元参与证券交易的程序为：基金管理人定期对符合上述标准的券商进行测评，测评结果是决定后期使用各证券公司交易单元参与证券交易的依据。

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(%)
长江证券股份有限公司	300,955.66	23.51	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	26,760.74	2.09	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	38,634.10	3.02	-	-	-	-
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	65.58	-	-	-	-
方正证券股份有限公司	975.56	0.08	-	-	-	-

司						
浙商证券股份有限公司	6,002.13	0.47	-	-	-	-
国投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
西部证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	67,399.56	5.26	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东北证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华创证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
天风证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

司						
民生证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华金证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东方财富证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国联证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华福证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
汇丰前海证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
渤海证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
湘财证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中银国际证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

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	景顺长城基金管理有限公司关于调整	中国证监会指定报刊及	2024 年 1 月 10 日

	适用“养老金客户费率优惠”的养老金客户范围的公告	网站	
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
20	关于景顺长城基金管理有限公司旗下基金调整持有股票估值价格的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 7 月 16 日
21	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2024 年第 2 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 7 月 19 日
22	景顺长城量化小盘股票型证券投资基金	中国证监会指定报刊及	2024 年 7 月 19 日

	金 2024 年第 2 季度报告	网站	
23	景顺长城基金管理有限公司关于终止喜鹊财富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 7 月 26 日
24	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 8 月 23 日
25	景顺长城量化小盘股票型证券投资基金 2024 年中期报告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 8 月 30 日
26	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2024 年中期报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 8 月 30 日
27	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 9 月 6 日
28	景顺长城基金管理有限公司关于终止中民财富基金销售（上海）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 9 月 10 日
29	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 9 月 20 日
30	景顺长城基金管理有限公司旗下基金调整持有股票估值价格的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 9 月 20 日
31	关于景顺长城基金管理有限公司旗下部分基金估值调整情况的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 9 月 28 日
32	景顺长城基金管理有限公司关于暂停海银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 10 月 8 日
33	景顺长城基金管理有限公司关于提请投资者及时更新或完善身份信息的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 10 月 21 日
34	景顺长城基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金综合风险评级变动的通知	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 10 月 23 日
35	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金 2024 年第 3 季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 10 月 25 日
36	景顺长城量化小盘股票型证券投资基金 2024 年第 3 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 10 月 25 日
37	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 11 月 15 日
38	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的通知	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 11 月 22 日
39	景顺长城基金管理有限公司关于旗下基金改聘会计师事务所公告	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 11 月 28 日
40	景顺长城基金管理有限公司关于系统停机维护的通知	中国证监会指定报刊及网站	2024 年 12 月 6 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

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	20240101-202401204	376,402,379.21	0.00	376,402,379.21	0.00	0.00
	3	20240202-202401029	94,074,134.45	0.00	94,074,134.45	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 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> <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；</p> <p>(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；</p> <p>(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；</p> <p>(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。</p> <p>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。</p>							

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 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。

13.2 存放地点

以上备查文件存放在本基金管理人的办公场所。

13.3 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

2025 年 3 月 28 日