

长信沪深 300 指数增强型证券投资基金 2020 年第 1 季度报告

2020 年 3 月 31 日

基金管理人：长信基金管理有限责任公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

报告送出日期：2020 年 4 月 22 日

§1 重要提示

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

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金基金合同规定，于 2020 年 4 月 20 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2020 年 1 月 1 日起至 2020 年 3 月 31 日止。

§2 基金产品概况

| | |
|------------|--|
| 基金简称 | 长信沪深 300 指数 |
| 基金主代码 | 005137 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2019 年 5 月 16 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 119,961,643.53 份 |
| 投资目标 | 本基金为增强型股票指数基金，通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段，追求基金净值增长率与业绩比较基准之间跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 7.75%，同时力求实现超越标的指数的业绩表现，谋求基金资产的长期增值。 |
| 投资策略 | <p>本基金在指数化投资的基础上通过数量化模型进行投资组合优化，在控制与业绩比较基准偏离风险的前提下，力争获得超越标的指数的投资收益。</p> <p>本基金为股票指数增强型证券投资基金，投资股票的资产不低于基金资产的 80%，其中，投资于标的指数成分股及其备选成分股的比例不低于非现金基金资产的 80%。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</p> |

| | | |
|-----------------|---|-----------------|
| | 出合适调整。 | |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 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，其预期风险和预期收益均高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金为指数型基金，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。 | |
| 基金管理人 | 长信基金管理有限责任公司 | |
| 基金托管人 | 招商银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 长信沪深 300 指数 A | 长信沪深 300 指数 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 005137 | 007448 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 31,083,336.99 份 | 88,878,306.54 份 |

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期（2020年1月1日—2020年3月31日） | |
|-----------------|---------------------------|---------------|
| | 长信沪深 300 指数 A | 长信沪深 300 指数 C |
| 1. 本期已实现收益 | 621,068.50 | 2,891,567.93 |
| 2. 本期利润 | -1,554,948.32 | -3,595,078.73 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.0637 | -0.0376 |
| 4. 期末基金资产净值 | 33,025,184.43 | 93,938,862.05 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.0625 | 1.0569 |

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、所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（例如，封闭式基金交易佣金、开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等），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 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

长信沪深 300 指数 A

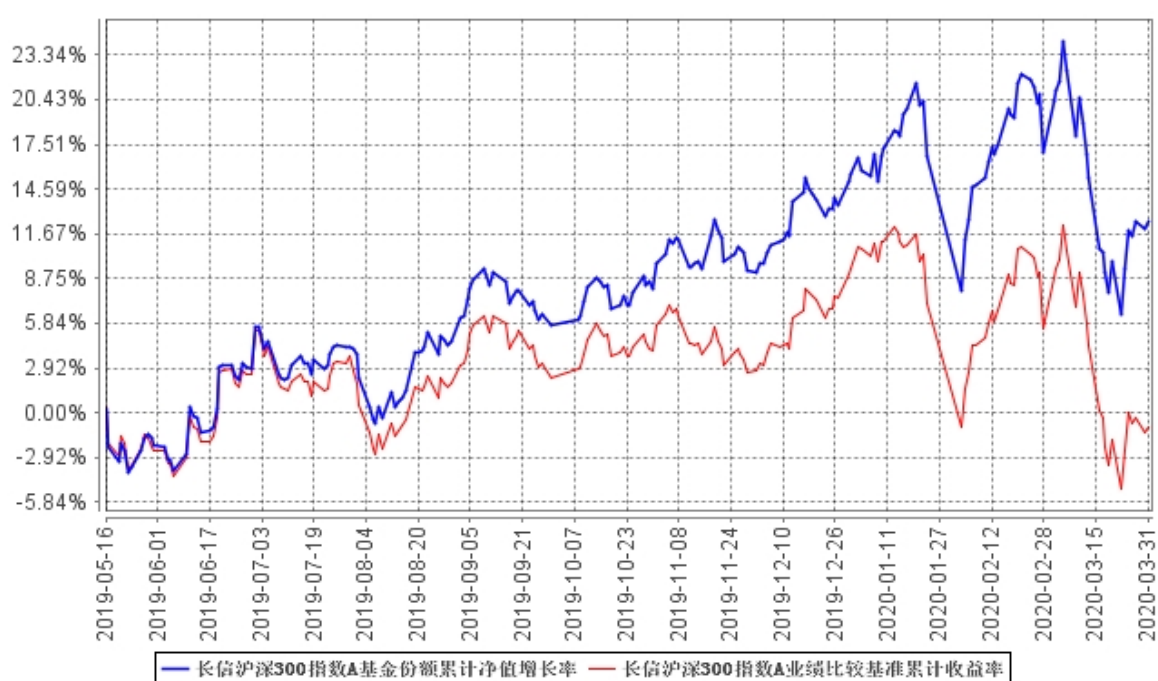
| 阶段 | 净值增长率 ① | 净值增长率 标准差② | 业绩比较基 准收益率③ | 业绩比较基 准收益率标 | ①—③ | ②—④ |
|----|------------|---------------|----------------|----------------|-----|-----|
|----|------------|---------------|----------------|----------------|-----|-----|

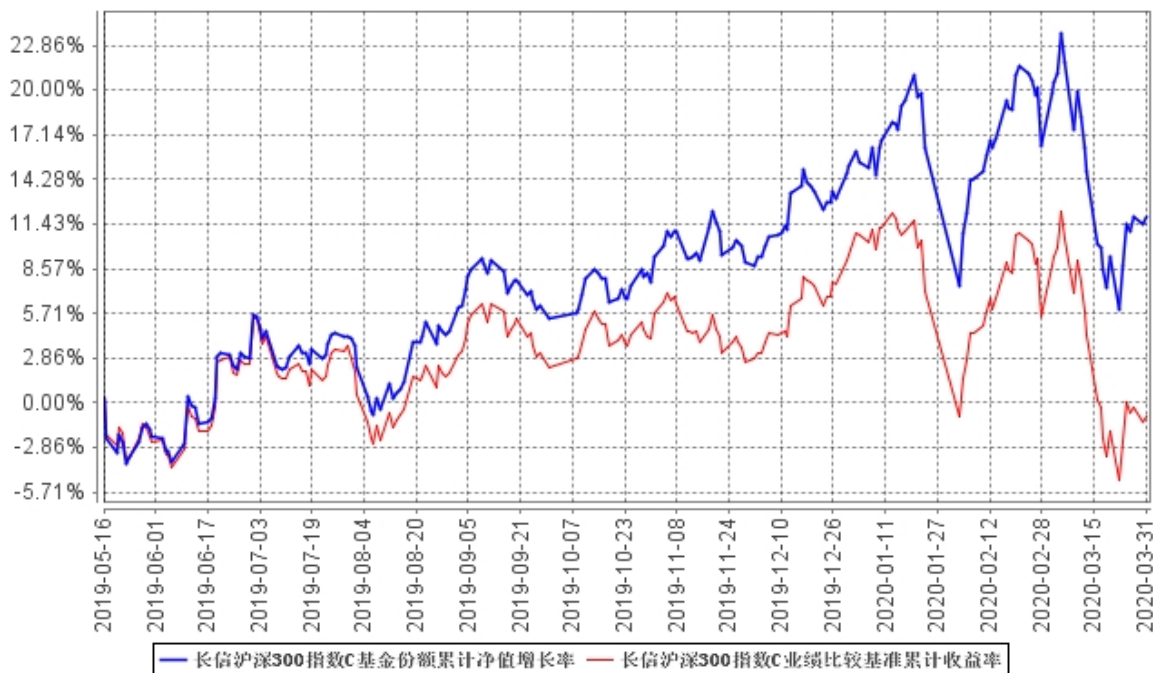
| | | | | | | |
|-------|--------|-------|--------|-------|-------|-------|
| | | | | 准差④ | | |
| 过去三个月 | -2.64% | 1.87% | -9.49% | 1.86% | 6.85% | 0.01% |

长信沪深 300 指数 C

| 阶段 | 净值增长率 ① | 净值增长率 标准差② | 业绩比较基 准收益率③ | 业绩比较基 准收益率标 准差④ | ①-③ | ②-④ |
|-------|------------|---------------|----------------|-----------------------|-------|-------|
| 过去三个月 | -2.74% | 1.87% | -9.49% | 1.86% | 6.75% | 0.01% |

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





注：1、转型后的本基金合同生效日为 2019 年 5 月 16 日，基金合同生效日至本报告期末，本基金运作时间未满一年。图示日期为 2019 年 5 月 16 日至 2020 年 3 月 31 日。

2、按基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起 6 个月内为建仓期，报告期末已完成建仓但报告期末距建仓结束不满一年，建仓期结束时，本基金各项投资比例已符合基金合同中的约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|-----|--|-----------------|------|--------|--|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 左金保 | 长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、长信量化先锋混合型证券投资基金、长信量化中小盘股票型证券投资基金、长信电子信息行业量化灵活配置混合型证券投资基金、长信低碳环保行业量化股票型证券投资基金、长信消费精选行业量化股票型证券投资基金、长信沪深 300 指数增强型证券投资基金、长信量化价值驱动混合型证券投资基金和长信量化多策略股票型证券投资基金的基金经理、量化投资部总监兼量化研究部总监、投资决策委员会执行委员 | 2019 年 5 月 16 日 | - | 10 年 | 经济学硕士，武汉大学金融工程专业研究生毕业。2010 年 7 月加入长信基金管理有限责任公司，从事量化投资研究和风险绩效分析工作。历任公司数量分析研究员和风险与绩效评估研究员、长信中证中央企业 100 指数证券投资基金（LOF）、长信量化多策略股票型证券投资基金、长信中证一带一路主题指数分级证券投资基金、长信中证上海改革发展主题指数型证券投资基金（LOF）、长信量化优选混合型证券投资基金（LOF）、长信利泰灵活配置混合型证券投资基金、长信国防军工量化灵活配置混合型证券投资基金、长信利发债券型证券投资基金、长信先锐债券型证券投资基金、长信量化价值精选混合型证券投资基金、长信先机两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金和长信先利半年定期开放混合型证券投资基金的基金经理。现任量化投资部兼量化研究部总监和投资决策委员会执行委员、长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、长信量化先锋混合型证券投资基金、长信量化中小盘股票型证券投资基金、长信电子 |

| | | | | | |
|-----|---|-----------------|---|-----|--|
| | | | | | 信息行业量化灵活配置混合型证券投资基金、长信低碳环保行业量化股票型证券投资基金、长信消费精选行业量化股票型证券投资基金、长信量化价值驱动混合型证券投资基金、长信量化多策略股票型证券投资基金和长信沪深 300 指数增强型证券投资基金的基金经理。 |
| 宋海岸 | 长信中证 500 指数增强型证券投资基金、长信国防军工量化灵活配置混合型证券投资基金、长信沪深 300 指数增强型证券投资基金和长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) 的基金经理 | 2019 年 5 月 16 日 | - | 6 年 | 理学硕士，上海交通大学应用数学研究生毕业，具有基金从业资格。曾担任海通期货股份有限公司研究员、前海开源基金管理有限公司投资经理助理和西部证券股份有限公司研究员。2016 年 9 月加入长信基金管理有限公司，历任量化投资部研究员、基金经理助理、长信中证一带一路主题指数分级证券投资基金、长信中证能源互联网主题指数型证券投资基金 (LOF)、长信价值优选混合型证券投资基金和长信先优债券型证券投资基金的基金经理，现任长信中证 500 指数增强型证券投资基金、长信国防军工量化灵活配置混合型证券投资基金、长信沪深 300 指数增强型证券投资基金和长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金 (LOF) 的基金经理。 |

注：1、首任基金经理任职日期以本基金成立之日为准；新增或变更基金经理的日期根据对外披露的公告日期填写；

2、证券从业的含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本基金管理人在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律

法规、基金合同的规定，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

本基金将继续以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，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财产，在规范基金运作和严格控制投资风险的前提下，努力为基金份额持有人谋求最大利益。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，公司已实行公平交易制度，并建立公平交易制度体系，已建立投资决策体系，加强交易执行环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时，公司已通过对投资交易行为的监控、分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，除完全按照有关指数的构成比例进行投资的组合外，其余各投资组合未发生参与交易所公开竞价同日反向交易且成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情形，未发现异常交易行为。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

4.4.1 报告期内基金的投资策略和运作分析

一季度以来，全球新冠疫情的持续发酵使得各国的宏观经济大幅下行，且最终损害程度尚无法估量，即便各经济体均释放强有力的货币政策与财政政策进行对冲，但全球风险资产仍遭受了严重抛售。随着资本市场和实体经济的流动性危机逐步缓解，风险资产将迎来重新定价，届时或蕴含较佳的投资机会。相较亚太市场与欧美市场，A 股一季度的表现十分突出，延续了 2019 年的强势，其中创业板上涨 4.1%，其他宽基指数的跌幅也均在 10% 以内，板块上看，农林牧渔、医药、计算机、通信等板块表现出色且录得绝对正收益，而石化、家电、非银、煤炭等板块则受油价大跌和疫情直接冲击等原因造成表现不够理想且跌幅相对较大。

本基金根据股票的基本面情况和市场面情况构建 Alpha 模型，寻找质地优异、被市场低估的投资标的。综合 Alpha 模型得分、风险模型、交易成本模型，定期优化组合权重。

4.4.2 2020 年二季度市场展望和投资策略

展望二季度，新冠疫情给宏观经济带来的挑战不容忽视，全球经济均存在失速风险，所以未

来货币政策和财政政策的走向至关重要。当前全球主要经济体都选择释放流动性来对冲经济潜在下行风险，接下来中国或在货币供应和财政扶持两端发力，但流动性的释放需要把握节奏并更具针对性，以免引发通胀造成滞涨。随着 A 股的机构化和国际化，投资者正在逐渐成熟，这都将对资本市场产生正面影响。一季度以来，主要指数表现相对强势，估值水平维持在合理水平，如果后续宏观与中观行业表现出韧劲，那将给市场上涨创造新的条件并打开新的空间。因此我们对 A 股持乐观的观点。

我们将自下而上精选有业绩支撑、估值合理的个股，结合数量化组合管理和风险控制，追求超越业绩比较基准的投资回报。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，长信沪深 300 指数 A 份额净值为 1.0625 元，份额累计单位净值为 1.0625 元，长信沪深 300 指数 A 份额净值增长率为-2.64%；长信沪深 300 指数 C 份额净值为 1.0569 元，份额累计单位净值为 1.0569 元，长信沪深 300 指数 C 份额净值增长率为-2.74%，同期业绩比较基准收益率为-9.49%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额（元） | 占基金总资产的比例（%） |
|----|---------------|----------------|--------------|
| 1 | 权益投资 | 115,869,258.36 | 90.91 |
| | 其中：股票 | 115,869,258.36 | 90.91 |
| 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 | 9,050,095.77 | 7.10 |
| 8 | 其他资产 | 2,531,873.69 | 1.99 |
| 9 | 合计 | 127,451,227.82 | 100.00 |

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资港股。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|---------------|--------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | 4,148,695.00 | 3.27 |
| B | 采矿业 | 1,646,218.08 | 1.30 |
| C | 制造业 | 42,570,105.93 | 33.53 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 909,924.00 | 0.72 |
| E | 建筑业 | 4,969,973.00 | 3.91 |
| F | 批发和零售业 | 3,612.00 | 0.00 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 51,038.00 | 0.04 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 2,989,122.00 | 2.35 |
| J | 金融业 | 32,702,361.87 | 25.76 |
| K | 房地产业 | 2,816,879.00 | 2.22 |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | - | - |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | 2,685,789.81 | 2.12 |
| Q | 卫生和社会工作 | 6,405.00 | 0.01 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 95,500,123.69 | 75.22 |

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|---------------|--------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | 101,695.00 | 0.08 |
| B | 采矿业 | 2,165,313.00 | 1.71 |
| C | 制造业 | 11,526,048.32 | 9.08 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | 178,339.31 | 0.14 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 5,094,825.32 | 4.01 |

| | | | |
|---|-----------------|---------------|-------|
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 327,211.74 | 0.26 |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | 967,717.98 | 0.76 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 7,984.00 | 0.01 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 20,369,134.67 | 16.04 |

5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资港股。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|---------|--------------|--------------|
| 1 | 601318 | 中国平安 | 87,975 | 6,085,230.75 | 4.79 |
| 2 | 600276 | 恒瑞医药 | 60,107 | 5,531,647.21 | 4.36 |
| 3 | 601166 | 兴业银行 | 287,300 | 4,570,943.00 | 3.60 |
| 4 | 600016 | 民生银行 | 691,500 | 3,948,465.00 | 3.11 |
| 5 | 300498 | 温氏股份 | 115,200 | 3,720,960.00 | 2.93 |
| 6 | 600031 | 三一重工 | 201,700 | 3,489,410.00 | 2.75 |
| 7 | 000895 | 双汇发展 | 85,000 | 3,340,500.00 | 2.63 |
| 8 | 601012 | 隆基股份 | 131,400 | 3,263,976.00 | 2.57 |
| 9 | 601211 | 国泰君安 | 199,900 | 3,254,372.00 | 2.56 |
| 10 | 000661 | 长春高新 | 5,900 | 3,233,200.00 | 2.55 |

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|---------|--------------|--------------|
| 1 | 601816 | 京沪高铁 | 906,551 | 5,094,825.32 | 4.01 |
| 2 | 002557 | 洽洽食品 | 54,100 | 2,440,451.00 | 1.92 |

| | | | | | |
|---|--------|------|---------|--------------|------|
| 3 | 603658 | 安图生物 | 20,600 | 2,399,694.00 | 1.89 |
| 4 | 600985 | 淮北矿业 | 263,100 | 2,165,313.00 | 1.71 |
| 5 | 000708 | 中信特钢 | 81,500 | 2,046,465.00 | 1.61 |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未投资股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金本报告期末未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

报告期内本基金投资的前十名证券中，发行主体中国民生银行股份有限公司于 2019 年 12 月 14 日收到北京银保监局行政处罚决定书文（京银保监罚决字（2019）56 号），根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条、第四十八条，经查，中国民生银行股份有限公司违规事项如下：民生银行总行同业票据业务管理失控（该违规事实下具体违法行为已由属地监管部门处罚）；民生银行总行违反内控指引要求计量转贴现卖断业务信用风险加权资产；民生银行总行案件风险信息报送管理不到位；民生银行总行未有效管理承兑业务；民生银行总行办理无真实贸易背景承兑业务；民生银行总行承兑业务质押资金来源为本行贷款；民生银行银川分行为已注销法人公司办理票据贴现业务；民生银行杭州分行为票据中介办理票据贴现业务；民生银行上海自贸区分行为票据中介办理票据贴现业务；民生银行福州分行转贴现卖断业务担保情况数据严重失实；民生银行苏州分行转贴现卖断业务担保情况数据严重失实；民生银行郑州分行转贴现卖断业务担保情况数据严重失实。综上，北京银保监局责令民生银行股份有限公司改正，并给予合计 700 万元罚款的行政处罚。对顾立辉给予警告并处 5 万元罚款的行政处罚。

发行主体中国民生银行股份有限公司于 2019 年 4 月 2 日收到中国银行保险监督管理委员会大连监管局行政处罚决定书文（大银保监罚决字（2019）76 号），根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条，经查，中国民生银行股份有限公司以贷收贷，掩盖资产真实质量；以贷转存，虚增存贷款规模。综上，中国银行保险监督管理委员会大连监管局对中国民生银行股份有限公司罚款人民币 100 万元。

发行主体中国民生银行股份有限公司于 2019 年 4 月 2 日收到中国银行保险监督管理委员会大连监管局行政处罚决定书文（大银保监罚决字（2019）78 号），根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条，经查，中国民生银行股份有限公司贷后管理不到位，银行承兑汇票保证金来源审查不严格，贷款回流作银行承兑汇票保证金。综上，中国银行保险监督管理委员会大连监管局对中国民生银行股份有限公司罚款人民币 50 万元。

发行主体中国民生银行股份有限公司于 2019 年 4 月 2 日收到中国银行保险监督管理委员会大连监管局行政处罚决定书文（大银保监罚决字〔2019〕80 号），根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条，经查，中国民生银行股份有限公司贷后管理不到位，以贷收贷，掩盖资产真实质量；贴现资金回流作银行承兑汇票保证金，滚动循环签发银行承兑汇票。综上，中国银行保险监督管理委员会大连监管局对中国民生银行股份有限公司罚款人民币 100 万元。

对如上证券投资决策程序的说明：公司研究部门按照内部研究工作规范对该证券进行分析后将其列入基金投资对象备选库。在此基础上本基金的基金经理根据具体市场情况独立作出投资决策。该事件发生后，本基金管理人对该证券的发行主体进行了进一步了解与分析，认为此事件未对该证券投资价值判断产生重大的实质性影响。本基金投资于该证券的投资决策过程符合制度规定的投资权限范围与投资决策程序。

报告期内本基金投资的前十名证券中其余九名的发行主体未出现被监管部门立案调查或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

报告期内本基金投资的前十名股票中，不存在超出基金合同规定备选股票库的情形。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|----|---------|--------------|
| 1 | 存出保证金 | 33,759.56 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 5,347.30 |
| 5 | 应收申购款 | 2,492,766.83 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 2,531,873.69 |

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) | 流通受限情况说明 |
|----|------|------|----------------|--------------|----------|
|----|------|------|----------------|--------------|----------|

| | | | | | |
|---|--------|------|--------------|------|------|
| 1 | 601816 | 京沪高铁 | 5,094,732.32 | 4.01 | 新股锁定 |
|---|--------|------|--------------|------|------|

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 长信沪深 300 指数 A | 长信沪深 300 指数 C |
|---------------------------|---------------|---------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 10,479,109.35 | 94,604,173.96 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 30,415,027.52 | 21,798,446.88 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 9,810,799.88 | 27,524,314.30 |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 31,083,336.99 | 88,878,306.54 |

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注：本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

| 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 | 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 1 月 20 日； 2020 年 2 月 4 日至 2020 年 2 月 9 日 | 23,463,162.83 | 0.00 | 900,000.00 | 22,563,162.83 | 18.81% |
| | 2 | 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 3 月 31 日 | 41,991,068.45 | 14,794,358.42 | 0.00 | 56,785,426.87 | 47.34% |
| 个人 | - | - | - | - | - | - | - |

产品特有风险

1、基金净值大幅波动的风险

单一持有基金比例过高的投资者连续大量赎回，可能会影响基金投资的持续性和稳定性，增加变现成本。同时，按照净值计算尾差处理规则可能引起基金份额净值异常上涨或下跌。

2、赎回申请延期办理的风险

单一持有基金比例过高的投资者大额赎回后可能触发本基金巨额赎回条件，导致同期中小投资者小额赎回面临部分延期办理的情况。

3、基金投资策略难以实现的风险

单一持有基金比例过高的投资者大额赎回后，可能引起基金资产总净值显著降低，从而使基金在投资时受到限制，导致基金投资策略难以实现。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

注：本基金本报告期未发生影响投资者决策的其他重要信息。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立基金的文件；
- 2、《长信沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》；
- 3、《长信沪深 300 指数增强型证券投资基金招募说明书》；

- 4、《长信沪深 300 指数增强型证券投资基金托管协议》；
- 5、报告期内在指定报刊上披露的各种公告的原稿；
- 6、长信基金管理有限责任公司营业执照、公司章程及相关资格批复文件。

9.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

9.3 查阅方式

长信基金管理有限责任公司网站：<http://www.cxfund.com.cn>。

长信基金管理有限责任公司

2020 年 4 月 22 日