

# 长信中证 1000 指数增强型证券投资基金 2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：长信基金管理有限责任公司

基金托管人：国信证券股份有限公司

送出日期：2024 年 8 月 30 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人国信证券股份有限公司根据本基金基金合同的规定，于 2024 年 8 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 1 月 1 日起至 2024 年 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	13
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>14</b>
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	19
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>35</b>
7.1 期末基金资产组合情况	35
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	36
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	41
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	43
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	43

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	43
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	43
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	43
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	43
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	43
7.12 投资组合报告附注 .....	43
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>44</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	44
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	44
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	45
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>45</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>45</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	45
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	45
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	46
10.4 基金投资策略的改变 .....	46
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	46
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	46
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	46
10.8 其他重大事件 .....	47
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>48</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	48
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	48
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>48</b>
12.1 备查文件目录 .....	48
12.2 存放地点 .....	49
12.3 查阅方式 .....	49

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	长信中证 1000 指数增强型证券投资基金	
基金简称	长信中证 1000 指数增强	
基金主代码	018013	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2023 年 4 月 20 日	
基金管理人	长信基金管理有限责任公司	
基金托管人	国信证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	121,976,100.11 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	长信中证 1000 指数增强 A	长信中证 1000 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	018013	018014
报告期末下属分级基金的份额总额	49,871,119.96 份	72,104,980.15 份

### 2.2 基金产品说明

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 8%，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	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。
业绩比较基准	中证 1000 指数收益率×95%+中国人民银行人民币活期存款利率(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。本基金为指数增强型基金，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。本基金若投资香港联合交易所上市的股票，将面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	长信基金管理有限责任公司	国信证券股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	周永刚
	联系电话	薛璐
	电子邮箱	0755-22940163
客户服务电话	zhouyg@cxfund.com.cn	03339@guosen.com.cn
传真	4007005566	0755-61897778
注册地址	021-61009800	0755-22940165
办公地址	中国（上海）自由贸易试验区银城中路 68 号 37 楼	深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层
邮政编码	上海市浦东新区银城中路 68 号 9 楼、37 楼、38 楼	深圳市福田区福华一路 125 号国信金融大厦 19 楼
法定代表人	200120	518000
	刘元瑞	张纳沙

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.cxfund.com.cn
基金中期报告备置地点	上海市浦东新区银城中路 68 号 38 楼、深圳市福田区福华一路 125 号国信金融大厦 19 楼

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	长信基金管理有限责任公司	上海市浦东新区银城中路 68 号 9 楼、37 楼、38 楼

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2024年1月1日-2024年6月30日)	
	长信中证 1000 指数增强 A	长信中证 1000 指数增强 C
本期已实现收益	-1,260,620.23	-1,461,880.61
本期利润	-3,062,611.47	-3,292,503.80
加权平均基金份额本期利润	-0.0720	-0.0901
本期加权平均净值利润率	-8.05%	-10.13%
本期基金份额净值增长率	-7.18%	-7.36%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024年6月30日)	
期末可供分配利润	-6,183,042.45	-9,236,383.58
期末可供分配基金份额利润	-0.1240	-0.1281
期末基金资产净值	43,688,077.51	62,868,596.57
期末基金份额净值	0.8760	0.8719
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	-12.40%	-12.81%

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、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、期末可供分配利润为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。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

长信中证 1000 指数增强 A

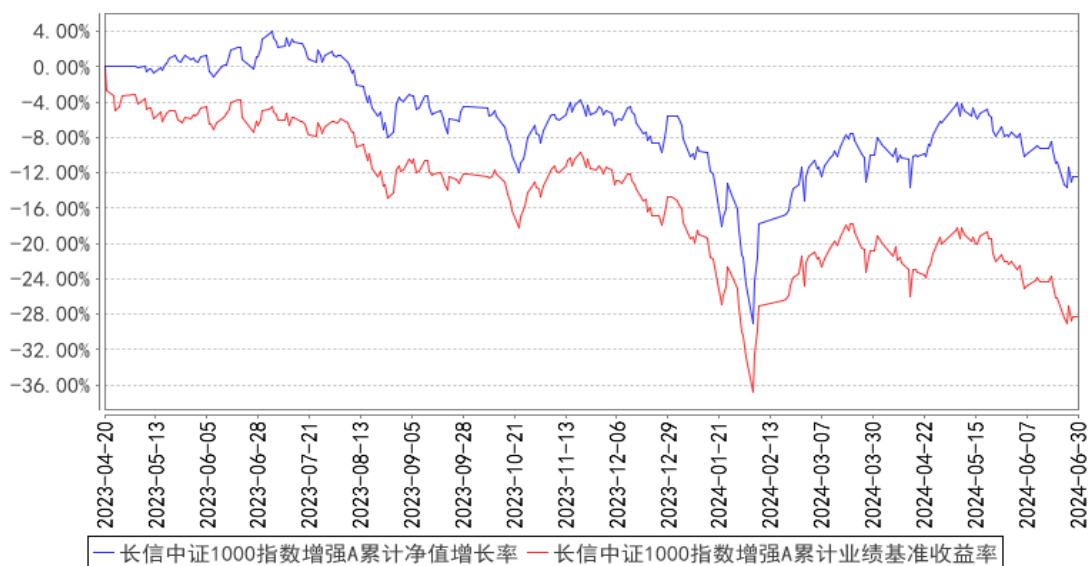
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-5.44%	1.22%	-8.15%	1.36%	2.71%	-0.14%
过去三个月	-2.73%	1.29%	-9.51%	1.42%	6.78%	-0.13%
过去六个月	-7.18%	1.82%	-15.97%	1.87%	8.79%	-0.05%
过去一年	-15.08%	1.44%	-24.61%	1.47%	9.53%	-0.03%
自基金合同生效起至今	-12.40%	1.34%	-28.34%	1.39%	15.94%	-0.05%

长信中证 1000 指数增强 C

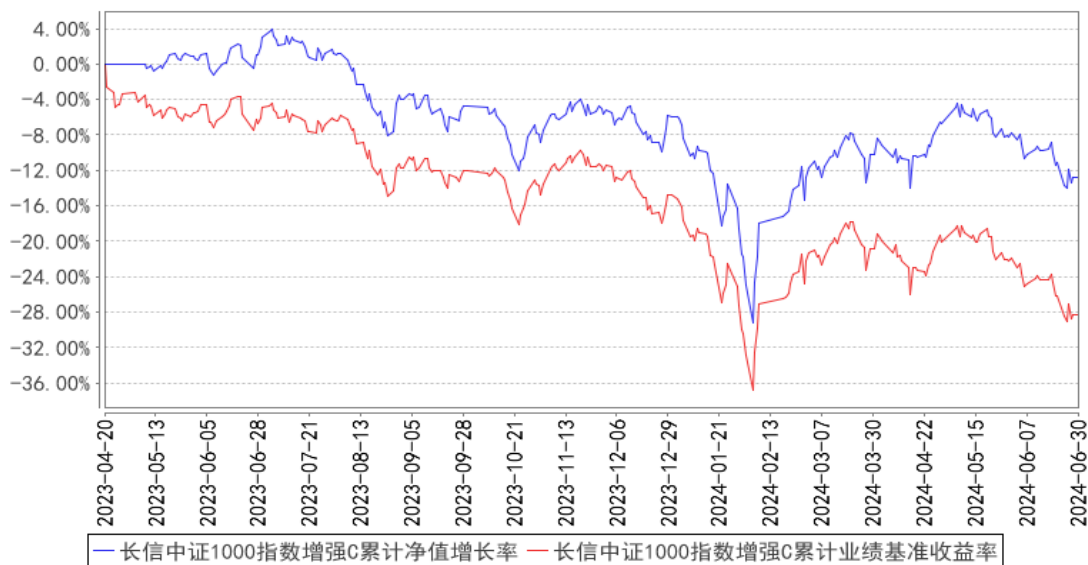
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-5.47%	1.22%	-8.15%	1.36%	2.68%	-0.14%
过去三个月	-2.82%	1.29%	-9.51%	1.42%	6.69%	-0.13%
过去六个月	-7.36%	1.82%	-15.97%	1.87%	8.61%	-0.05%
过去一年	-15.42%	1.44%	-24.61%	1.47%	9.19%	-0.03%
自基金合同生效起至今	-12.81%	1.34%	-28.34%	1.39%	15.53%	-0.05%

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

长信中证1000指数增强A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



长信中证1000指数增强C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、图示日期为 2023 年 4 月 20 日至 2024 年 6 月 30 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 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

长信基金管理有限责任公司是经中国证监会证监基金字【2003】63 号文批准，由长江证券股



份有限公司、上海海欣集团股份有限公司、武汉钢铁股份有限公司共同发起设立。注册资本 1.65 亿元人民币。目前股权结构为：长江证券股份有限公司占 44.55%、上海海欣集团股份有限公司占 31.21%、武汉钢铁有限公司占 15.15%、上海彤胜投资管理中心（有限合伙）占 4.55%、上海彤骏投资管理中心（有限合伙）占 4.54%。

截至 2024 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 88 只开放式基金，即长信利息收益开放式证券投资基金、长信银利精选混合型证券投资基金、长信金利趋势混合型证券投资基金、长信增利动态策略混合型证券投资基金、长信利丰债券型证券投资基金、长信量化先锋混合型证券投资基金、长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金、长信利鑫债券型证券投资基金 (LOF)、长信内需成长混合型证券投资基金、长信可转债债券型证券投资基金、长信利众债券型证券投资基金 (LOF)、长信纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信纯债壹号债券型证券投资基金、长信改革红利灵活配置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、长信利富债券型证券投资基金、长信利盈灵活配置混合型证券投资基金、长信利广灵活配置混合型证券投资基金、长信多利灵活配置混合型证券投资基金、长信睿进灵活配置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、长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)、长信富海纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信利保债券型证券投资基金、长信金葵纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信富全纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信利泰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、长信电子信息行业量化灵活配置混合型证券投资基金、长信富平纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信创新驱动股票型证券投资基金、长信稳益纯债债券型证券投资基金、长信利信灵活配置混合型证券投资基金、长信稳健纯债债券型证券投资基金、长信国防军工量化灵活配置混合型证券投资基金、长信先优债券型证券投资基金、长信稳势纯债债券型证券投资基金、长信中证 500 指数增强型证券投资基金、长信长金货币基金、长信稳通三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长信低碳环保行业量化股票型证券投资基金、长信利尚一年定期开放混合型证券投资基金、长信乐信灵活配置混合型证券投资基金、长信全球债券证券投资基金、长信稳鑫三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长信消费精选行业量化股票型证券投资基金、长信企业精选两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、长信量化价值驱动混合型证券投资基金、长信稳裕三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长信稳进资产配置混合型基金中基金 (FOF)、长信利率债债券型证券投资基金、长信沪深 300 指数增强型证券投资基金、长信富安纯债半年定期开放债券型证券投资基金、长信双利优选混合型证券投资基金、长信富瑞两年定期开放债券型证券投资基金、长信颐天平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金 (FOF)、长信易进混合型证券投资基金、长信先锐混合型证券投资基金、

长信稳健精选混合型证券投资基金、长信浦瑞 87 个月定期开放债券型证券投资基金、长信消费升级混合型证券投资基金、长信企业优选一年持有期灵活配置混合型证券投资基金、长信稳健均衡 6 个月持有期混合型证券投资基金、长信优质企业混合型证券投资基金、长信内需均衡混合型证券投资基金、长信 30 天滚动持有短债债券型证券投资基金、长信稳惠债券型证券投资基金、长信稳丰债券型证券投资基金、长信先进装备三个月持有期混合型证券投资基金、长信颐和平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）、长信颐年平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）、长信稳健增长一年持有期混合型证券投资基金、长信稳健成长混合型证券投资基金、长信企业成长三年持有期混合型证券投资基金、长信稳兴三个月定期开放债券型证券投资基金、长信稳航 30 天持有期中短债债券型证券投资基金、长信稳恒债券型证券投资基金、长信中证科创创业 50 指数增强型证券投资基金、长信均衡策略一年持有期混合型证券投资基金、长信中证 1000 指数增强型证券投资基金、长信均衡优选混合型证券投资基金、长信 90 天滚动持有债券型证券投资基金、长信稳固 60 天滚动持有债券型证券投资基金、长信汇智量化选股混合型证券投资基金、长信 120 天滚动持有债券型证券投资基金、长信中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、长信优势行业混合型证券投资基金、长信 180 天持有期债券型证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
左金保	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、长信量化多策略股票型证券投资基金、长信中证科创创业 50 指数增强型证券投资基金	2023 年 4 月 20 日	-	14 年	经济学硕士，武汉大学金融工程专业研究生毕业，具有基金从业资格，中国国籍。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、量化研究部总监、总经理助理、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

	金、长信中证 1000 指数增强型证券投资基金和长信汇智量化选股混合型证券投资基金的基金经理、量化投资管理中心总经理、量化投资部总监			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、长信先利半年定期开放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、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。现任量化投资管理中心总经理、量化投资部总监、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、长信量化多策略股票型证券投资基金、长信中证科创业 50 指数增强型证券投资基金、长信中证 1000 指数增强型证券投资基金和长信汇智量化选股混合型证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--

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遵规守信情况的说明

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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，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 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

上半年 A 股市场一季度在主流宽基指数 ETF 大幅净流入和各项利好政策不断出台的情况下市场触底反弹，但五月下旬后又震荡加剧。一季度 PMI 读数超预期显示国内经济逐步企稳，内需消费逐步复苏，投资情绪回暖，出口链、AI 产业链和高股息板块等均有不错表现。然而，二季度中后期，四五月的社融数据出炉，表明国内有效需求仍显不足，导致指数上行受阻。同时，“退市新规”出台引发市场对小微企业财务状况的关注，叠加美元走强导致外资持续流出，市场指数在五月下旬以后出现较大调整。在风格方面，大市值、低估值板块始终较为强势，显示出在存量市场下，资金更青睐业绩确定性强、现金流良好的大公司。行业方面，以光模块为代表的 AI 算力大模型再度崛起，以煤炭、银行、石化和家电为代表的低估值高股息板块表现突出。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2024 年 6 月 30 日，长信中证 1000 指数增强 A 基金份额净值为 0.8760 元，份额累计净值为 0.8760 元，本报告期内长信中证 1000 指数增强 A 净值增长率为-7.18%；长信中证 1000 指数增强 C 基金份额净值为 0.8719 元，份额累计净值为 0.8719 元，本报告期内长信中证 1000 指数增强 C 净值增长率为-7.36%，同期业绩比较基准收益率为-15.97%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，我们认为积极因素正在不断增加，可以对后续走势抱有更多信心。首先，政策稳中求进，倡导新质生产力兼顾房地产业稳健发展，在低空经济、AI、房地产等板块利好政策不断，体现了监管呵护资本市场的信心。其次，A 股基本面已进入逐步明朗阶段，对于业绩确定性高、现金流充裕、成长空间较大的板块会受到更多市场关注和更多资金追捧。我们将坚持基本面为主，综合考虑短期交易情绪，中期景气度、长期竞争格局，自下而上精选景气度边际改善的优质个股，综合 alpha 模型、风险模型、交易成本模型构建投资组合，力争为投资者获取长期稳健超额收益。

## 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人严格按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金持有的投资品种进行估值。基金托管人根据法律法规要求对基金管理公司采用的估值政策和

程序进行核查，并对估值结果及净值计算进行复核。

根据相关法律法规，本基金管理人制订了健全、有效的估值政策和估值程序，设立了估值委员会，估值委员会是公司基金估值的主要决策机构，其主要职责是负责拟定公司的估值政策、估值方法及采用的估值程序和技术，对公司现有程序和技术进行复核和审阅，当发生了影响估值程序和技术的有效性及适用性的情况及时修订估值程序；估值委员会成员由基金事务部、投资、研究、交易等相关业务部门负责人以及基金事务部至少一名业务骨干共同组成，相关参与人员都具有丰富的证券行业工作经验，熟悉相关法规和估值方法，均具备估值业务所需的专业胜任能力。对于基金的估值政策和估值原则，公司已与基金托管人充分沟通，并达成一致意见。审计本基金的会计师事务所认可公司基金估值政策和程序的适当性。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定分别提供银行间同业市场及交易所交易的债券品种的估值数据以及流通受限股票的折扣率。参与估值流程各方不存在任何重大利益冲突。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规和本基金基金合同规定的基金收益分配原则以及基金实际运作情况，本基金本报告期末未进行利润分配。

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

无。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

报告期内，国信证券股份有限公司（以下称“托管人”）严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规的规定及基金合同的约定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

### 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

报告期内，托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益分配的情况等方面进行了必要的监督、复核和审查。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

托管人认真复核了本报告中的财务指标、净值表现等财务信息相关内容，认为其不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

## 6.1 资产负债表

会计主体：长信中证 1000 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	5,933,482.90	4,927,876.74
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	93,075,573.09	72,782,267.31
其中：股票投资		93,075,573.09	72,782,267.31
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		7,936,218.50	227,177.22
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		106,945,274.49	77,937,321.27
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2023 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		193,075.37	46,607.39

应付管理人报酬		66,299.36	64,825.59
应付托管费		6,629.92	6,482.52
应付销售服务费		12,904.82	12,924.21
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	109,690.94	150,001.83
负债合计		388,600.41	280,841.54
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	121,976,100.11	82,388,491.73
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-15,419,426.03	-4,732,012.00
净资产合计		106,556,674.08	77,656,479.73
负债和净资产总计		106,945,274.49	77,937,321.27

注：1、报告截止日 2024 年 6 月 30 日，长信中证 1000 指数增强 A 份额净值 0.8760 元；长信中证 1000 指数增强 C 份额净值 0.8719 元；基金份额总额为 121,976,100.11 份，其中长信中证 1000 指数增强 A 份额 49,871,119.96 份。长信中证 1000 指数增强 C 份额 72,104,980.15 份。

2、本基金基金合同于 2023 年 4 月 20 日正式生效，上年度可比期间为 2023 年 4 月 20 日至 2023 年 6 月 30 日。

## 6.2 利润表

会计主体：长信中证 1000 指数增强型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 4 月 20 日（基金 合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		-5,845,802.05	11,668,873.58
1. 利息收入		11,876.79	248,113.20
其中：存款利息收入	6.4.7.13	11,876.79	190,393.77
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		-	57,719.43
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-” 填列）		-2,296,838.67	10,771,856.81
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-3,249,787.05	8,244,030.55

基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	-
资产支持证券投资 收益	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	952,948.38	2,527,826.26
以摊余成本计量的 金融资产终止确认产生的 收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	6.4.7.20	-3,632,614.43	648,903.57
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-” 号填列）	6.4.7.21	71,774.26	-
<b>减：二、营业总支出</b>		509,313.22	957,654.01
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	350,291.85	672,385.30
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	35,029.15	67,238.53
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	64,319.88	174,834.72
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产 支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	207.78
8. 其他费用	6.4.7.23	59,672.34	42,987.68
<b>三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）</b>		-6,355,115.27	10,711,219.57
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-” 号填列）</b>		-6,355,115.27	10,711,219.57
<b>五、其他综合收益的税后 净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-6,355,115.27	10,711,219.57

注：本基金基金合同于 2023 年 4 月 20 日正式生效，上年度可比期间为 2023 年 4 月 20 日至 2023 年 6 月 30 日。

### 6.3 净资产变动表

会计主体：长信中证 1000 指数增强型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日



单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	82,388,491.73	-	-4,732,012.00	77,656,479.73
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	82,388,491.73	-	-4,732,012.00	77,656,479.73
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	39,587,608.38	-	-10,687,414.03	28,900,194.35
(一)、综合收益总额	-	-	-6,355,115.27	-6,355,115.27
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	39,587,608.38	-	-4,332,298.76	35,255,309.62
其中：1. 基金申购款	81,851,255.79	-	-8,892,597.11	72,958,658.68
2. 基金赎回款	-42,263,647.41	-	4,560,298.35	-37,703,349.06
(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	121,976,100.11	-	-15,419,426.03	106,556,674.08
项目	上年度可比期间 2023 年 4 月 20 日(基金合同生效日)至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	-	-	-	-

加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	343,759,176.31	-	-	343,759,176.31
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	1,363,737.87	-	10,723,334.92	12,087,072.79
(一)、综合收益总额	-	-	10,711,219.57	10,711,219.57
(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)	1,363,737.87	-	12,115.35	1,375,853.22
其中：1. 基金申购款	1,363,737.87	-	12,115.35	1,375,853.22
2. 基金赎回款	-	-	-	-
(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	345,122,914.18	-	10,723,334.92	355,846,249.10

注：本基金基金合同于 2023 年 4 月 20 日正式生效，上年度可比期间为 2023 年 4 月 20 日至 2023 年 6 月 30 日。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

刘元瑞

覃波

孙红辉

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

长信中证 1000 指数增强型证券投资基金(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[2023]349 号《关于准予长信中证 1000 指数增强型证券投资基金注册的批复》注册,由长信基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《长信中证 1000 指数增强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 343,716,122.89 元,经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)德师报(验)字(23)第 00111 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《长信中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同》于 2023 年 4 月 20 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 343,759,176.31 份基金份额,其中认购资金利息折合 43,053.42 份基金份额。本基金的基金管理人为长信基金管理有限责任公司,基金托管人为国信证券股份有限公司。

根据《长信中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同》,本基金根据认购/申购费用、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资者认购、申购时收取认购、申购费用,而不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为 A 类基金份额;从本类别基金资产中计提销售服务费,在投资者认购、申购基金份额时不收取认购/申购费用的基金份额,而是从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额称为 C 类基金份额。本基金 A 类和 C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同,本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算并公告基金份额净值,计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《长信中证 1000 指数增强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,包括标的指数成份股及其备选成份股、国内依法发行或上市的其他股票(包括主板、创业板和其他经中国证监会核准或注册上市的股票)、存托凭证、港股通标的股票、债券(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、地方政府债券、政府支持机构债券、可转换债券、可交换债券、可分离交易可转债及其他经中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单、货币市场工具、国债期货、股指期货、股票期权以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金可以根据有关法律法规规定进行融资及转融通证券出借业务。基金的投资组合比例为:本基金股票资产占基金资产的比例不低于基金资产的 80%,投资于港股通标的股票的比例不高于股票资产的 50%。投资于标的指数成份股及其备选成份股的

资产不低于非现金基金资产的 80%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货及股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者到期日在一年以内的政府债券。国债期货、股指期货、股票期权及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准为：中证 1000 指数收益率 $\times$ 95%+中国人民银行人民币活期存款利率（税后） $\times$ 5%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《长信中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同》及中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税

[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

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

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	887,918.48
等于：本金	887,548.32
加：应计利息	370.16
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-

加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	5,045,564.42
等于：本金	5,045,378.47
加：应计利息	185.95
减：坏账准备	-
合计	5,933,482.90

注：其他存款本期末余额为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	97,659,539.73	-	93,075,573.09	-4,583,966.64
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	97,659,539.73	-	93,075,573.09	-4,583,966.64

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 债权投资

##### 6.4.7.5.1 债权投资情况

本基金本报告期末无债权投资。

## 6.4.7.6 其他债权投资

## 6.4.7.6.1 其他债权投资情况

本基金本报告期末无其他债权投资。

## 6.4.7.7 其他权益工具投资

## 6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

本基金本报告期末无其他权益投资工具。

## 6.4.7.8 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

## 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提审计费	69,890.78
预提信息披露费	39,781.56
其他	18.60
合计	109,690.94

## 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

## 长信中证 1000 指数增强 A

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	42,627,925.93	42,627,925.93
本期申购	38,116,286.88	38,116,286.88
本期赎回（以“-”号填列）	-30,873,092.85	-30,873,092.85
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	49,871,119.96	49,871,119.96

## 长信中证 1000 指数增强 C

项目	本期
----	----

	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	39,760,565.80	39,760,565.80
本期申购	43,734,968.91	43,734,968.91
本期赎回 (以“-”号填列)	-11,390,554.56	-11,390,554.56
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	72,104,980.15	72,104,980.15

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.11 其他综合收益

本基金本报告期无其他综合收益。

#### 6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

长信中证 1000 指数增强 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-1,365,784.85	-1,029,316.86	-2,395,101.71
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-1,365,784.85	-1,029,316.86	-2,395,101.71
本期利润	-1,260,620.23	-1,801,991.24	-3,062,611.47
本期基金份额交易产生的变动数	-621,482.07	-103,847.20	-725,329.27
其中：基金申购款	-2,866,809.04	-1,060,404.42	-3,927,213.46
基金赎回款	2,245,326.97	956,557.22	3,201,884.19
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-3,247,887.15	-2,935,155.30	-6,183,042.45

长信中证 1000 指数增强 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-1,376,053.16	-960,857.13	-2,336,910.29
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-1,376,053.16	-960,857.13	-2,336,910.29
本期利润	-1,461,880.61	-1,830,623.19	-3,292,503.80
本期基金份额交易产生的变动数	-2,163,233.33	-1,443,736.16	-3,606,969.49
其中：基金申购款	-2,932,189.48	-2,033,194.17	-4,965,383.65
基金赎回款	768,956.15	589,458.01	1,358,414.16



本期已分配利润	-	-	-
本期末	-5,001,167.10	-4,235,216.48	-9,236,383.58

#### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
活期存款利息收入		8,708.91
定期存款利息收入		-
其他存款利息收入		3,166.68
结算备付金利息收入		-
其他		1.20
合计		11,876.79

注：1、其他为保证金利息收入和申购款利息收入。

2、其他存款利息收入为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金产生的利息收入。

#### 6.4.7.14 股票投资收益

##### 6.4.7.14.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
卖出股票成交总额		200,860,260.79
减：卖出股票成本总额		203,667,695.61
减：交易费用		442,352.23
买卖股票差价收入		-3,249,787.05

#### 6.4.7.15 债券投资收益

##### 6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

本基金本报告期无债券投资收益。

##### 6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期无买卖债券差价收入。

##### 6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无债券投资赎回差价收入。

##### 6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无债券投资申购差价收入。

#### 6.4.7.16 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.17 贵金属投资收益

##### 6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.18 衍生工具收益

##### 6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期无衍生工具收益。

##### 6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

#### 6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	952,948.38
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	952,948.38

#### 6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-3,632,614.43
股票投资	-3,632,614.43
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-3,632,614.43

#### 6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	71,748.69
基金转换费收入	25.57

合计	71,774.26
----	-----------

注：对持续持有期少于 7 日的投资者收取的赎回费全额计入基金财产；其余赎回费总额的 25% 应归基金财产。

#### 6.4.7.22 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

#### 6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
审计费用	19,890.78
信息披露费	39,781.56
证券出借违约金	-
合计	59,672.34

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方无变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
长信基金管理有限责任公司（“长信基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
国信证券股份有限公司（“国信证券”）	基金托管人、基金销售机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的股票交易。

###### 6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券交易。

### 6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

### 6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均未无应支付关联方的佣金。

## 6.4.10.2 关联方报酬

### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 4 月 20 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	350,291.85	672,385.30
其中：应支付销售机构的客户维护费	171,401.27	325,867.51
应支付基金管理人的净管理费	178,890.58	346,517.79

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值×1.00%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×管理费率/当年天数。

### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 4 月 20 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	35,029.15	67,238.53

注：支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值×0.10%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 X 托管费率 / 当年天数。

### 6.4.10.2.3 销售服务费

本基金本报告期及上年度可比期间无关联方销售服务费，本基金本报告期末及上年度可比期间末无未支付关联方销售服务费余额。

注：1、根据基金合同的规定，本基金 A 类份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.40%。C 类基金份额的基金销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.40% 年费率计

提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日基金销售服务费=前一日基金资产净值×0.40%÷当年天数。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

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

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

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

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

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

基金管理人在本报告期及上年度可比期间均未运用自有资金投资本基金。

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

除基金管理人之外的其他关联方在本报告期末及上年度末均未投资本基金。

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

本基金的银行存款存放在托管人国信证券在交通银行股份有限公司开立的托管账户中；本基金本报告期及上年度可比期间均无源自本基金托管人国信证券的银行存款及利息收入。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期及上年度可比期间未在承销期内购入过由关联方承销的证券。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

本报告期本基金未进行利润分配。

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

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未因认购新发/增发证券而持有流通受限证券。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无因交易所市场债券正回购交易而抵押的债券。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的融出证券。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常活动中面临各种金融工具的风险，主要包括：信用风险、流动性风险和市场风险。

本基金在下文主要论述上述风险敞口及其形成原因、风险管理目标、政策和过程以及计量风险的方法等。

本基金的基金管理人从事风险管理的目标是使本基金在风险和收益之间取得适当的平衡，以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。基于该风险管理目标，本基金的基金管理人已制定了政策和程序来辨别和分析这些风险，设定适当的风险限额并设计相应的内部控制程序，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人奉行全面风险管理体系理念，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。在董事会下设立风险控制委员会，负责对公司经营管理和基金业务运作的合法性、合规性进行全面的检查和评估等；在管理层层面设立内部控制委员会，主要职责是讨论审议公司内部控制制度及针对公司在经营管理和投资组合运作中的风险进行识别、评估并研究制订有效的防范措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部负责协调并与各部门合作完成运作风险管理工作，战略与产品研发部负责进行投资风险分析与绩效评估。监察稽核部向督察长负责，并向总经理汇报日常行政事务。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的银行存款由本基金的托管人国信证券股份有限公司转存于交通银行股份有限公司，与该银行存款相关的信

用风险不重大。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，本基金投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的 10%。

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；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估并采用券款对付交割方式以控制相应的信用风险。

#### **6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的债券投资。

#### **6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资**

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### **6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

#### **6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资**

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的债券投资。

#### **6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资**

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### **6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资**

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

### **6.4.13.3 流动性风险**

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金流动性风险来源于开放式基金每日兑付赎回资金的流动性风险，以及因部分投资品种交易不活跃而出现的变现风险和因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理价格变现投资的风险。

#### **6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析**

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金坚持组合管理、分散投资的原则开展投资活动，所持证券均在证

券交易所或银行间同业市场交易，并严格遵守基金管理人流动性相关交易限制。

本基金主要投资于基金合同约定的具有良好流动性的金融工具，基金管理人对流动性指标进行持续的监测和分析，定期开展压力测试，评估在不同的压力情境下资产变现情况的变化。

基金管理人持续监测本基金开放期内的赎回情况，当市场环境或投资者结构发生变化时，及时调整投资组合资产结构及比例，保持基金资产可变现规模和期限与负债赎回规模和期限的匹配。

同时，针对兑付赎回资金的流动性风险，基金管理人在基金合同中约定了巨额赎回条款，制定了发生巨额赎回时资金的处理模式，控制因开放模式而产生的流动性风险。

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 年 6 月 30 日	6 个月以内	6 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产						
货币资金	5,933,482.90	-	-	-	-	5,933,482.90
交易性金融资产	-	-	-	-	93,075,573.09	93,075,573.09
应收申购款	-	-	-	-	7,936,218.50	7,936,218.50
资产总计	5,933,482.90	-	-	-	101,011,791.59	106,945,274.49
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	193,075.37	193,075.37
应付管理人报酬	-	-	-	-	66,299.36	66,299.36
应付托管费	-	-	-	-	6,629.92	6,629.92
应付销售服务费	-	-	-	-	12,904.82	12,904.82
其他负债	-	-	-	-	109,690.94	109,690.94
负债总计	-	-	-	-	388,600.41	388,600.41
利率敏感度缺口	5,933,482.90	-	-	-	100,623,191.18	106,556,674.08
上年度末 2023 年 12 月 31 日	6 个月以内	6 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产						
货币资金	4,927,876.74	-	-	-	-	4,927,876.74
交易性金融资产	-	-	-	-	72,782,267.31	72,782,267.31
应收申购款	-	-	-	-	227,177.22	227,177.22
资产总计	4,927,876.74	-	-	-	73,009,444.53	77,937,321.27



负债						
应付赎回款	-	-	-	-	46,607.39	46,607.39
应付管理人报酬	-	-	-	-	64,825.59	64,825.59
应付托管费	-	-	-	-	6,482.52	6,482.52
应付销售服务费	-	-	-	-	12,924.21	12,924.21
其他负债	-	-	-	-	150,001.83	150,001.83
负债总计	-	-	-	-	280,841.54	280,841.54
利率敏感度缺口	4,927,876.74	-	-	-	72,728,602.99	77,656,479.73

注：表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金于本报告期末及上年度末均未持有债券，无重大利率风险，因而未进行敏感性分析。银行存款及结算备付金之浮动利率根据中国人民银行的基准利率和相关机构的相关政策浮动。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票和债券以及银行间同业市场交易的债券，所面临的最大其他价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR (Value at Risk) 等指标来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

于 6 月 30 日，本基金面临的其他市场价格风险列示如下：

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	93,075,573.09	87.35	72,782,267.31	93.72
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	93,075,573.09	87.35	72,782,267.31	93.72

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	在 95% 的置信区间内，基金资产组合的市场价格风险		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024 年 6 月 30 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	VaR 值为 3.64%（2023 年 12 月 31 日 VaR 值为 3.48%）	-3,879,389.64	-2,700,646.66

注：上述风险价值 VaR 的分析是基于资产负债表日所持证券过去一年市场价格波动情况而有可能发生的最大损失，且此变动适用于本基金所有的衍生金融工具及非衍生金融工具。取 95% 的置信度是基于本基金所持有的金融工具风险度量的要求。2023 年的分析同样基于该假设。

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	93,075,573.09	72,754,607.78
第二层次	-	-

第三层次	-	27,659.53
合计	93,075,573.09	72,782,267.31

#### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换事项发生的当期期初为确认各层次之间的转换时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2024 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产（2023 年 12 月 31 日：同）。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	93,075,573.09	87.03
	其中：股票	93,075,573.09	87.03
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	5,933,482.90	5.55

8	其他各项资产	7,936,218.50	7.42
9	合计	106,945,274.49	100.00

注：本基金本报告期末未通过港股通交易机制投资港股。本基金本报告期末未参与转融通证券出借业务。

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末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	-	-
B	采矿业	3,363,331.00	3.16
C	制造业	57,492,024.81	53.95
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,410,864.00	1.32
E	建筑业	1,507,982.00	1.42
F	批发和零售业	4,041,402.00	3.79
G	交通运输、仓储和邮政业	1,130,200.00	1.06
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,496,781.32	6.10
J	金融业	-	-
K	房地产业	220,704.00	0.21
L	租赁和商务服务业	477,190.00	0.45
M	科学研究和技术服务业	1,180.00	-
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	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	1,348,068.00	1.27
S	综合	-	-
	合计	77,489,727.13	72.72

### 7.2.2 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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	12,190,638.56	11.44
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	950,219.40	0.89
E	建筑业	313,100.00	0.29
F	批发和零售业	410,164.00	0.38
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,269,874.00	1.19
J	金融业	250,740.00	0.24
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	-	-
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	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	201,110.00	0.19
S	综合	-	-
	合计	15,585,845.96	14.63

### 7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未通过港股通交易机制投资港股。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

#### 7.3.1 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	002318	久立特材	40,000	933,200.00	0.88
2	688018	乐鑫科技	9,301	917,822.68	0.86
3	000902	新洋丰	74,400	883,128.00	0.83
4	002139	拓邦股份	83,100	882,522.00	0.83
5	600285	羚锐制药	35,700	864,297.00	0.81
6	300679	电连技术	20,800	836,784.00	0.79
7	002402	和而泰	77,400	828,954.00	0.78
8	688019	安集科技	6,500	817,700.00	0.77
9	002332	仙琚制药	70,700	806,687.00	0.76
10	603733	仙鹤股份	45,600	801,648.00	0.75
11	002245	蔚蓝锂芯	102,700	795,925.00	0.75
12	603267	鸿远电子	23,300	794,530.00	0.75
13	000923	河钢资源	46,100	793,842.00	0.74
14	002745	木林森	98,300	792,298.00	0.74
15	300045	华力创通	44,800	790,720.00	0.74
16	688088	虹软科技	26,974	778,469.64	0.73
17	300773	拉卡拉	62,600	778,118.00	0.73
18	002773	康弘药业	35,900	777,235.00	0.73
19	601311	骆驼股份	96,900	777,138.00	0.73
20	002048	宁波华翔	59,400	768,636.00	0.72
21	688408	中信博	8,346	768,499.68	0.72
22	600718	东软集团	92,900	768,283.00	0.72
23	002270	华明装备	34,400	765,056.00	0.72
24	300841	康华生物	15,100	764,664.00	0.72
25	600210	紫江企业	143,400	762,888.00	0.72
26	002351	漫步者	57,900	761,385.00	0.71
27	688123	聚辰股份	12,512	761,104.96	0.71

28	300747	锐科激光	42,500	754,375.00	0.71
29	688208	道通科技	31,100	750,754.00	0.70
30	300034	钢研高纳	47,000	746,830.00	0.70
31	688383	新益昌	14,273	743,766.03	0.70
32	301071	力量钻石	26,800	742,628.00	0.70
33	600933	爱柯迪	50,200	742,458.00	0.70
34	002635	安洁科技	48,000	741,120.00	0.70
35	000049	德赛电池	31,600	741,020.00	0.70
36	300482	万孚生物	30,300	739,320.00	0.69
37	600835	上海机电	64,000	736,640.00	0.69
38	688800	瑞可达	26,131	733,758.48	0.69
39	002215	诺普信	97,700	727,865.00	0.68
40	601163	三角轮胎	47,800	727,516.00	0.68
41	300783	三只松鼠	33,100	723,897.00	0.68
42	301219	腾远钴业	18,900	723,114.00	0.68
43	000848	承德露露	91,700	720,762.00	0.68
44	002020	京新药业	68,600	718,242.00	0.67
45	300857	协创数据	12,600	718,200.00	0.67
46	003006	百亚股份	30,300	718,110.00	0.67
47	688321	微芯生物	40,760	717,376.00	0.67
48	603299	苏盐井神	75,400	716,300.00	0.67
49	688586	江航装备	76,893	715,104.90	0.67
50	002267	陕天然气	94,400	713,664.00	0.67
51	300470	中密控股	21,100	713,391.00	0.67
52	601921	浙版传媒	93,300	712,812.00	0.67
53	001337	四川黄金	30,600	710,226.00	0.67
54	002011	盾安环境	71,900	706,777.00	0.66
55	002053	云南能投	58,200	703,638.00	0.66
56	002697	红旗连锁	151,700	702,371.00	0.66
57	605507	国邦医药	42,000	699,300.00	0.66
58	001338	永顺泰	71,300	698,740.00	0.66
59	603039	ST 泛微	22,000	698,720.00	0.66
60	603693	江苏新能	60,000	697,200.00	0.65
61	002534	西子洁能	69,600	696,696.00	0.65
62	603025	大豪科技	50,200	693,764.00	0.65
63	603229	奥翔药业	69,000	693,450.00	0.65
64	603995	甬金股份	39,300	688,536.00	0.65
65	002646	天佑德酒	67,000	685,410.00	0.64
66	600125	铁龙物流	114,700	684,759.00	0.64
67	603368	柳药集团	39,100	684,250.00	0.64
68	688690	纳微科技	38,939	676,370.43	0.63
69	603983	丸美股份	24,100	663,473.00	0.62
70	601001	晋控煤业	39,800	657,496.00	0.62

71	002550	千红制药	118,000	636,020.00	0.60
72	603583	捷昌驱动	31,200	635,856.00	0.60
73	603103	横店影视	45,900	635,256.00	0.60
74	300031	宝通科技	43,100	619,347.00	0.58
75	002249	大洋电机	130,500	617,265.00	0.58
76	600776	东方通信	62,200	611,426.00	0.57
77	601101	昊华能源	66,500	611,135.00	0.57
78	605333	沪光股份	21,500	598,775.00	0.56
79	000928	中钢国际	107,000	593,850.00	0.56
80	300953	震裕科技	10,900	590,780.00	0.55
81	002978	安宁股份	21,200	590,632.00	0.55
82	600420	国药现代	55,300	590,604.00	0.55
83	603100	川仪股份	25,100	590,101.00	0.55
84	688076	诺泰生物	7,400	579,272.00	0.54
85	603730	岱美股份	57,900	575,526.00	0.54
86	600586	金晶科技	98,300	570,140.00	0.54
87	600861	北京人力	34,800	567,936.00	0.53
88	603348	文灿股份	20,100	556,569.00	0.52
89	688776	国光电气	9,921	549,623.40	0.52
90	000915	华特达因	18,100	545,896.00	0.51
91	600729	重庆百货	24,300	543,348.00	0.51
92	688166	博瑞医药	15,200	532,000.00	0.50
93	603489	八方股份	19,700	531,506.00	0.50
94	601886	江河集团	108,900	531,432.00	0.50
95	600916	中国黄金	55,100	530,062.00	0.50
96	002315	焦点科技	19,600	528,416.00	0.50
97	002171	楚江新材	80,100	527,859.00	0.50
98	600618	氯碱化工	59,300	520,654.00	0.49
99	688239	航宇科技	14,950	520,260.00	0.49
100	603699	纽威股份	30,100	515,312.00	0.48
101	600458	时代新材	50,100	506,010.00	0.47
102	301316	慧博云通	32,600	478,568.00	0.45
103	600662	外服控股	119,000	477,190.00	0.45
104	002990	盛视科技	22,700	456,951.00	0.43
105	600459	贵研铂业	33,600	453,936.00	0.43
106	603919	金徽酒	24,400	443,348.00	0.42
107	600502	安徽建工	89,000	382,700.00	0.36
108	002782	可立克	34,400	381,152.00	0.36
109	600993	马应龙	13,700	365,379.00	0.34
110	002194	武汉凡谷	44,600	359,030.00	0.34
111	600602	云赛智联	32,400	357,696.00	0.34
112	688147	微导纳米	12,660	315,234.00	0.30
113	688289	圣湘生物	17,000	298,860.00	0.28

114	000065	北方国际	27,700	287,249.00	0.27
115	003021	兆威机电	6,200	286,130.00	0.27
116	002985	北摩高科	12,600	277,578.00	0.26
117	600639	浦东金桥	21,600	220,536.00	0.21
118	000030	富奥股份	43,600	214,076.00	0.20
119	000990	诚志股份	27,300	203,112.00	0.19
120	603197	保隆科技	5,500	173,250.00	0.16
121	603162	海通发展	17,000	158,100.00	0.15
122	603713	密尔克卫	2,900	155,208.00	0.15
123	688139	海尔生物	4,000	148,800.00	0.14
124	603128	华贸物流	22,900	132,133.00	0.12
125	603236	移远通信	2,500	116,825.00	0.11
126	603881	数据港	9,000	114,390.00	0.11
127	600562	国睿科技	7,500	102,450.00	0.10
128	300233	金城医药	600	8,952.00	0.01
129	000951	中国重汽	600	8,592.00	0.01
130	688518	联赢激光	151	2,521.70	0.00
131	000034	神州数码	100	2,289.00	0.00
132	002967	广电计量	100	1,180.00	0.00
133	002626	金达威	57	823.65	0.00
134	300638	广和通	40	684.00	0.00
135	000718	苏宁环球	100	168.00	0.00
136	600211	西藏药业	1	32.58	0.00

### 7.3.2 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	688543	国科军工	15,000	616,050.00	0.58
2	600872	中炬高新	22,700	515,063.00	0.48
3	600114	东睦股份	34,500	496,455.00	0.47
4	002519	银河电子	93,700	460,067.00	0.43
5	688234	天岳先进	9,600	450,432.00	0.42
6	300724	捷佳伟创	8,300	448,283.00	0.42
7	603501	韦尔股份	4,500	447,165.00	0.42
8	600183	生益科技	20,700	435,942.00	0.41
9	300566	激智科技	30,900	432,291.00	0.41
10	301185	鸥玛软件	30,000	429,900.00	0.40
11	603629	利通电子	23,200	428,272.00	0.40
12	603444	吉比特	2,400	427,224.00	0.40
13	002017	东信和平	51,100	425,663.00	0.40
14	002729	好利科技	45,800	425,024.00	0.40
15	688378	奥来德	17,700	415,242.00	0.39
16	300529	健帆生物	15,200	413,592.00	0.39
17	000155	川能动力	38,100	410,337.00	0.39



18	600694	大商股份	24,400	410,164.00	0.38
19	603239	浙江仙通	29,700	407,187.00	0.38
20	603160	汇顶科技	5,900	405,625.00	0.38
21	603223	恒通股份	61,800	402,936.00	0.38
22	300743	天地数码	27,200	368,288.00	0.35
23	300054	鼎龙股份	16,100	365,148.00	0.34
24	603738	泰晶科技	26,700	364,188.00	0.34
25	688510	航亚科技	19,600	360,836.00	0.34
26	603605	珀莱雅	3,200	355,168.00	0.33
27	003025	思进智能	27,800	342,218.00	0.32
28	603897	长城科技	19,400	340,470.00	0.32
29	002469	三维化学	58,600	334,020.00	0.31
30	605389	长龄液压	15,700	329,543.00	0.31
31	002140	东华科技	40,400	313,100.00	0.29
32	002897	意华股份	8,300	312,578.00	0.29
33	000551	创元科技	35,100	306,423.00	0.29
34	001207	联科科技	21,100	306,372.00	0.29
35	300453	三鑫医疗	43,800	279,882.00	0.26
36	002912	中新赛克	15,600	276,432.00	0.26
37	600161	天坛生物	10,800	263,520.00	0.25
38	601601	中国太保	9,000	250,740.00	0.24
39	300218	安利股份	14,600	220,168.00	0.21
40	603096	新经典	11,900	201,110.00	0.19
41	001210	金房能源	10,320	136,946.40	0.13
42	000997	新大陆	9,800	136,318.00	0.13
43	605007	五洲特纸	7,600	95,988.00	0.09
44	300701	森霸传感	800	6,728.00	0.01
45	688212	澳华内镜	104	4,161.04	0.00
46	600737	中粮糖业	400	3,836.00	0.00
47	688599	天合光能	199	3,367.08	0.00
48	688006	杭可科技	159	2,774.55	0.00
49	688231	隆达股份	155	2,210.30	0.00
50	301518	长华化学	23	398.59	0.00

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601001	晋控煤业	2,230,913.00	2.87
2	002194	武汉凡谷	1,620,977.00	2.09
3	600872	中炬高新	1,479,881.00	1.91
4	600602	云赛智联	1,415,865.00	1.82
5	002011	盾安环境	1,359,874.00	1.75
6	300841	康华生物	1,329,083.00	1.71

7	300458	全志科技	1,329,049.00	1.71
8	000049	德赛电池	1,327,288.60	1.71
9	601921	浙版传媒	1,323,948.00	1.70
10	300482	万孚生物	1,307,656.00	1.68
11	603171	税友股份	1,274,661.00	1.64
12	000032	深桑达 A	1,265,307.00	1.63
13	002635	安洁科技	1,263,528.00	1.63
14	001337	四川黄金	1,258,072.00	1.62
15	002020	京新药业	1,235,951.00	1.59
16	301219	腾远钴业	1,234,353.00	1.59
17	603983	丸美股份	1,214,782.00	1.56
18	688575	亚辉龙	1,198,223.02	1.54
19	000928	中钢国际	1,197,262.00	1.54
20	603678	火炬电子	1,196,071.00	1.54

注：本项“买入金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑其它交易费用。

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601001	晋控煤业	1,800,162.00	2.32
2	600761	安徽合力	1,523,269.00	1.96
3	300298	三诺生物	1,506,964.00	1.94
4	300458	全志科技	1,473,886.00	1.90
5	601918	新集能源	1,459,588.00	1.88
6	603678	火炬电子	1,393,647.00	1.79
7	688575	亚辉龙	1,362,291.13	1.75
8	002194	武汉凡谷	1,325,242.00	1.71
9	600158	中体产业	1,320,582.00	1.70
10	000032	深桑达 A	1,315,125.00	1.69
11	300428	立中集团	1,305,312.00	1.68
12	000049	德赛电池	1,303,381.40	1.68
13	601606	长城军工	1,277,825.00	1.65
14	002226	江南化工	1,251,995.00	1.61
15	002428	云南锗业	1,249,093.00	1.61
16	603920	世运电路	1,246,400.00	1.61
17	002206	海利得	1,221,394.00	1.57
18	603171	税友股份	1,211,507.00	1.56
19	601567	三星医疗	1,206,562.00	1.55
20	600602	云赛智联	1,186,903.00	1.53

注：本项“卖出金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑其它交易费用。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	227,593,615.82
--------------	----------------

卖出股票收入（成交）总额	200,860,260.79
--------------	----------------

注：本项“买入股票的成本（成交）总额”和“卖出股票的收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.5 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。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

#### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

##### 7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

#### 7.12 投资组合报告附注

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

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

##### 7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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。

##### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-

3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	7,936,218.50
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,936,218.50

#### 7.12.4 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。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

##### 7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

##### 7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

#### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
长信中证 1000 指数增强 A	687	72,592.61	0.00	0.00	49,871,119.96	100.00
长信中证 1000 指数增强 C	910	79,236.24	10,875,995.20	15.08	61,228,984.95	84.92
合计	1,597	76,378.27	10,875,995.20	8.92	111,100,104.91	91.08

注：对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
----	------	------------	--------------

基金管理人所有从业人员持有本基金	长信中证 1000 指数增强 A	730,111.71	1.46
	长信中证 1000 指数增强 C	0.00	0.00
	合计	730,111.71	0.60

注：对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	长信中证 1000 指数增强 A	50~100
	长信中证 1000 指数增强 C	0
	合计	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	长信中证 1000 指数增强 A	50~100
	长信中证 1000 指数增强 C	0
	合计	50~100

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	长信中证 1000 指数增强 A	长信中证 1000 指数增强 C
基金合同生效日(2023 年 4 月 20 日)基金份额总额	120,130,746.49	223,628,429.82
本报告期期初基金份额总额	42,627,925.93	39,760,565.80
本报告期基金总申购份额	38,116,286.88	43,734,968.91
减：本报告期基金总赎回份额	30,873,092.85	11,390,554.56
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	49,871,119.96	72,104,980.15

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

#### 10.2.1 基金管理人的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人无重大人事变动。

#### 10.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略未改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金未改聘会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内未发生基金管理人及高级管理人员受稽查或处罚等情形。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期无托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
长城证券	2	301,371,803.56	70.34	220,389.05	70.09	-
民生证券	2	127,082,073.05	29.66	94,045.36	29.91	-

注：1、本期租用证券公司交易单元的变更情况

本报告期内本基金租用证券公司交易单元没有变更。

2、专用交易单元的选择标准和程序

根据中国证监会《关于加强证券投资基金监管有关问题的通知》（证监基字【1998】29号）和《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字【2007】48号）的有关规定，本公司制定了租用证券公司专用交易单元的选择标准和程序。

（1）选择标准：

- 1) 券商基本面评价（财务状况、经营状况）；
- 2) 券商研究机构评价（报告质量、及时性和数量）；
- 3) 券商每日信息评价（及时性和有效性）；

4) 券商协作表现评价。

(2) 选择程序：

首先根据租用证券公司专用交易单元的选择标准形成《券商服务评价表》，然后根据评分高低进行选择基金专用交易单元。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
长城证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	长信基金管理有限责任公司关于提醒投资者防范不法分子假冒本公司工作人员名义从事诈骗活动的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2024-1-19
2	长信中证 1000 指数增强型证券投资基金 2023 年第 4 季度报告	中国证监会电子披露网站、公司网站	2024-1-22
3	长信基金管理有限责任公司旗下全部基金 2023 年第四季度报告提示性公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2024-1-22
4	长信基金管理有限责任公司关于旗下基金持有的停牌股票调整估值方法的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2024-2-6
5	长信基金管理有限责任公司关于增加华西证券股份有限公司为旗下部分开放式基金代销机构并开通转换、定期定额投资业务及参加申购(含定投申购)费率优惠活动的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2024-3-6
6	长信中证 1000 指数增强型证券投资基金 2023 年年度报告	中国证监会电子披露网站、公司网站	2024-3-29
7	长信基金管理有限责任公司旗下全部基金 2023 年年度报告提示性公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2024-3-29
8	长信基金管理有限责任公司关于增加中航证券有限公司为旗下部分开放式基金代销机构并开通转换、定期定额投资业务及参加申购(含定	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2024-4-1

	投申购) 费率优惠活动的公告		
9	长信中证 1000 指数增强型证券投资基金 2024 年第 1 季度报告	中国证监会电子披露网站、公司网站	2024-4-22
10	长信基金管理有限责任公司旗下全部基金 2024 年第一季度报告提示性公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2024-4-22
11	长信基金管理有限责任公司关于住所变更的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2024-6-15
12	长信基金管理有限责任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	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2024-6-15
13	长信基金管理有限责任公司关于增加德邦证券有限公司为旗下部分开放式基金代销机构并开通转换、定期定额投资业务及参加申购(含定投申购) 费率优惠活动的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2024-6-20
14	长信基金管理有限责任公司关于增加麦高证券有限公司为旗下部分开放式基金代销机构并开通转换、定期定额投资业务及参加申购(含定投申购) 费率优惠活动的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2024-6-24
15	长信基金管理有限责任公司关于增加信达证券股份有限公司为旗下部分开放式基金代销机构并开通转换、定期定额投资业务及参加申购(含定投申购) 费率优惠活动的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2024-6-25
16	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金参加汉口银行股份有限公司申购(含定投申购) 费率优惠活动的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2024-6-26
17	长信中证 1000 指数增强型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会电子披露网站、公司网站	2024-6-28

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

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

本基金本报告期内未有单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期未发生影响投资者决策的其他重要信息。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

1、中国证监会批准设立基金的文件；



- 2、《长信中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同》；
- 3、《长信中证 1000 指数增强型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《长信中证 1000 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。

## 12.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

## 12.3 查阅方式

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

长信基金管理有限责任公司

2024 年 8 月 30 日