

长信沪深 300 指数量化增强型证券投资基金

2026 年中期报告

2026 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：交通银行股份有限公司

送出日期：2026 年 8 月 31 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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 8 月 27 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 2026 年 1 月 1 日起至 2026 年 6 月 30 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 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 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	11
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	13
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
§ 5 托管人报告	13
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等内容真实、准确和完整发表意见	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
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	18
§ 7 投资组合报告	37
7.1 期末基金资产组合情况	37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	38
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	43
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	44
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	45

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	45
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	45
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	45
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	45
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	45
7.12 投资组合报告附注	45
§ 8 基金份额持有人信息	46
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	46
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	46
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	47
§ 9 开放式基金份额变动	47
§ 10 重大事件揭示	47
10.1 基金份额持有人大会决议	47
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	47
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	48
10.4 基金投资策略的改变	48
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	48
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	48
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	48
10.8 其他重大事件	49
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	50
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	50
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	50
§ 12 备查文件目录	51
12.1 备查文件目录	51
12.2 存放地点	51
12.3 查阅方式	51

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	长信沪深 300 指数量化增强型证券投资基金	
基金简称	长信沪深 300 指数量化增强	
基金主代码	024415	
基金运作方式	契约型、开放式	
基金合同生效日	2025 年 8 月 22 日	
基金管理人	长信基金管理有限责任公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	243,614,930.95 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	长信沪深 300 指数量化增强 A	长信沪深 300 指数量化增强 C
下属分级基金的交易代码	024415	024416
报告期末下属分级基金的份额总额	176,254,189.63 份	67,360,741.32 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段，力争在控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的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%的基础上，追求获得超越标的指数的回报。
投资策略	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，对基金资产配置做出合适调整。
业绩比较基准	沪深 300 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。本基金若投资港股通标的股票，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	交通银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	周永刚	方圆
	联系电话	021-61009999	95559
	电子邮箱	zhouyg@cxfund.com.cn	fangy_20@bankcomm.com
客户服务电话		4007005566	95559
传真		021-61009800	021-62701216
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区银城中路 68 号 37 层	中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 号
办公地址		上海市浦东新区银城中路 68 号 9	中国（上海）长宁区仙霞路 18

	楼、37 楼、38 楼	号
邮政编码	200120	200336
法定代表人	肖剑	任德奇

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.cxfund.com.cn
基金中期报告置备地点	上海市浦东新区银城中路 68 号 38 楼、上海市仙霞路 18 号

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(2026 年 1 月 1 日-2026 年 6 月 30 日)	
	长信沪深 300 指数量化增强 A	长信沪深 300 指数量化增强 C
本期已实现收益	23,144,897.50	8,624,471.75
本期利润	31,014,958.64	12,091,395.30
加权平均基金份额本期利润	0.1038	0.1006
本期加权平均净值利润率	9.94%	9.67%
本期基金份额净值增长率	9.81%	9.59%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	17,131,012.60	6,291,219.52
期末可供分配基金份额利润	0.0972	0.0934
期末基金资产净值	197,030,037.37	75,039,622.57
期末基金份额净值	1.1179	1.1140
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	11.79%	11.40%

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

长信沪深 300 指数量化增强 A

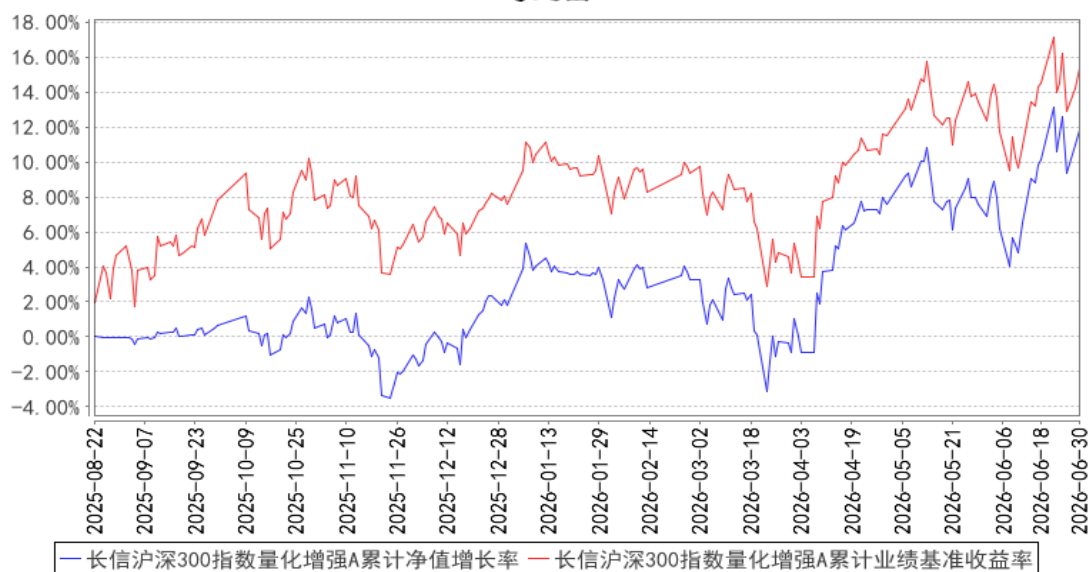
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	12.76%	1.22%	11.30%	1.19%	1.46%	0.03%
过去六个月	9.81%	1.10%	7.20%	1.07%	2.61%	0.03%
自基金合同生效起至今	11.79%	0.92%	15.34%	1.03%	-3.55%	-0.11%

长信沪深 300 指数量化增强 C

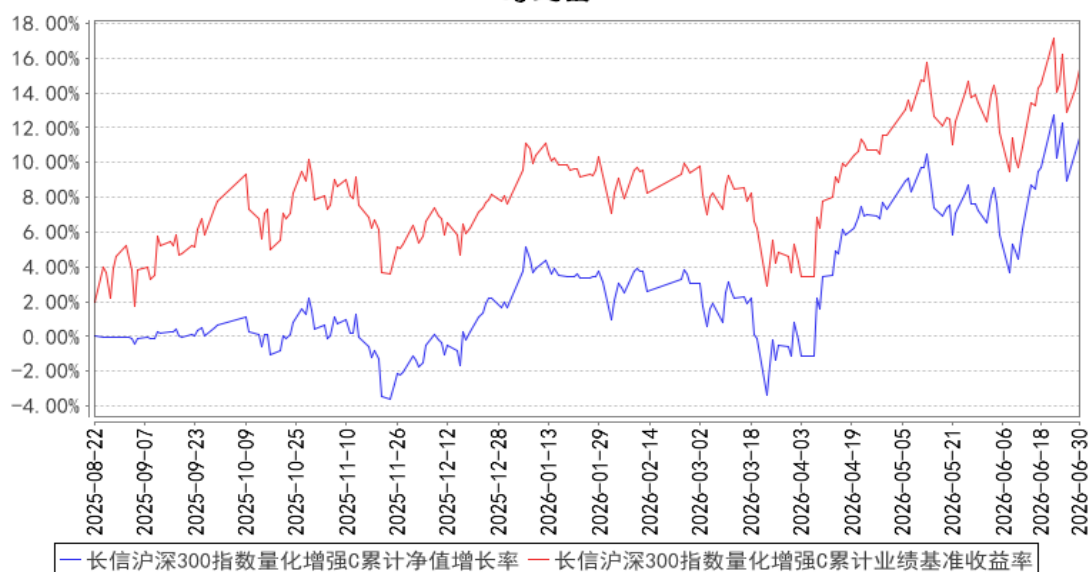
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	12.64%	1.22%	11.30%	1.19%	1.34%	0.03%
过去六个月	9.59%	1.10%	7.20%	1.07%	2.39%	0.03%
自基金合同生效起至今	11.40%	0.92%	15.34%	1.03%	-3.94%	-0.11%

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

长信沪深300指数量化增强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



长信沪深300指数量化增强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、本基金基金合同生效日为 2025 年 8 月 22 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 2025 年 8 月 22 日至 2026 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%、武汉钢铁股份有限公司占 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 2026 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 92 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、长信长金货币市场基金、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、长信富安纯债 180 天持有期债券型证券投资基金、长信中证 A500 指数增强型证券投资基金、长信稳瑞纯债债券型证券投资基金、长信沪深 300 指数量化增强型证券投资基金、长信盈安资产配置三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、长信稳健添益债券型证券投资基金、长信上证科创板综合指数增强型证券投资基金、长信均衡配置混合型证券投资基金、长信稳健汇利 90 天持有期债券型证券投资基金、长信汇众量化选股混合型证券投资基金、长信北证 50 成份指数增强型证券投资基金。

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		
姚奕帆	长信量化价值驱动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、长信中证科创创业 50 指数增强型证券投资基金、长	2025 年 8 月 22 日	-	11 年	华威大学金融数学硕士，具有基金从业资格，中国国籍。2015 年 7 月加入长信基金管理有限责任公司，历任量化研究员、量化专户投资经理、基金经理助理、长信消费精选行业量化股票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。现任长信量化价值驱动混合型证券投资基金、长信低碳环保行业量化股

	信中证 A500 指数增强型证券投资基金、长信沪深 300 指数量化增强型证券投资基金和长信汇众量化选股混合型证券投资基金的基金经理				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、长信中证 A500 指数增强型证券投资基金、长信沪深 300 指数量化增强型证券投资基金和长信汇众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

2026 年上半年，A 股市场呈高位宽幅震荡格局，走势先扬后抑、震荡修复。年初市场交投活

跃，沪深两市成交额创历史同期新高；一季度末中东地缘冲突骤然升级，国际油价大幅冲高并一度突破每桶 100 美元关口，全球风险偏好明显回落，市场随之阶段性调整；二季度以来，随着地缘局势边际缓和，市场重新聚焦科技创新主线，主要宽基指数普遍收复前期失地，部分成长类指数创出历史新高。报告期内市场结构性分化尤为显著，赚钱效应高度集中，市场宽度明显收窄；风格层面，大盘成长、高动量风格相对占优，大盘蓝筹整体表现稳健。本基金为跟踪沪深 300 指数的指数增强型基金，报告期内以标的指数为基准，在有效控制跟踪误差的前提下追求超越业绩比较基准的投资回报。管理人基于股票基本面和市场面情况构建多因子 Alpha 模型，综合风险模型与交易成本模型定期优化组合权重，自下而上精选质地优良、具备业绩支撑且估值合理的投资标的。面对行情集中度高、个股分化的市场环境，管理人坚持组合构建的纪律性，持续迭代因子体系与风险模型，严格控制行业和风格暴露，保持组合适度分散，整体运作平稳，风险可控。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2026 年 6 月 30 日，长信沪深 300 指数量化增强 A 基金份额净值为 1.1179 元，份额累计净值为 1.1179 元，本报告期内长信沪深 300 指数量化增强 A 净值增长率为 9.81%；长信沪深 300 指数量化增强 C 基金份额净值为 1.1140 元，份额累计净值为 1.1140 元，本报告期内长信沪深 300 指数量化增强 C 净值增长率为 9.59%，同期业绩比较基准收益率为 7.20%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，国内经济有望延续稳中有进、稳中提质的态势。尽管外部环境更趋复杂严峻，我国经济运行仍具备较强韧性：宏观政策保持连续性稳定性，货币政策维持适度宽松基调，为经济平稳运行和资本市场稳定提供有力支撑；经济增长动能加快切换，科技创新与新质生产力培育持续深化，新一轮以技术进步为牵引的资本开支周期正在展开，经济长期向好的基本面没有改变。证券市场方面，我们对 A 股中期走势保持乐观。上市公司盈利已进入稳步修复通道，盈利兑现有望成为下半年行情的核心支撑；市场整体估值处于合理区间，局部拥挤尚不构成系统性风险；中长期资金持续入市、居民资产配置向权益迁移的趋势未改，流动性环境依然友好。我们认为，本轮市场上行的核心驱动力并未发生根本性动摇，结构性行情有望延续，市场中期向好趋势不变；同时需关注地缘局势、海外货币政策等外部不确定性带来的阶段性波动。就本基金而言，沪深 300 指数由沪深两市规模最大、流动性最好的 300 只证券组成，汇聚了国民经济各领域的核心龙头企业，是 A 股核心资产的代表性指数。其成份股盈利基础扎实、估值水平合理，与经济基本面关联度高，在盈利修复行情中有望充分受益，具备较高的中长期配置价值。管理人将继续恪守指数增强投资策略，依托严谨的量化模型和严格的风险控制纪律化运作，在紧密跟踪标的指数的基础上，力争为基金份额持有人创造持续、稳定的超额回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人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，本基金本报告期没有进行利润分配。

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

2026 年上半年度，基金托管人在长信沪深 300 指数量化增强型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

2026 年上半年度，长信基金管理有限责任公司在长信沪深 300 指数量化增强型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，长信基金管理有限责任公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§ 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：长信沪深 300 指数量化增强型证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	19,660,945.79	76,433,745.58
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	253,447,732.17	731,540,690.45
其中：股票投资		253,447,732.17	731,540,690.45
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		24,897.55	384,237.01
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		273,133,575.51	808,358,673.04
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日

负 债：			
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		756,240.21	19,397,542.92
应付管理人报酬		186,519.75	594,256.57
应付托管费		23,314.95	74,282.11
应付销售服务费		25,665.55	82,755.87
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	72,175.11	90,000.00
负债合计		1,063,915.57	20,238,837.47
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	243,614,930.95	774,531,480.59
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	28,454,728.99	13,588,354.98
净资产合计		272,069,659.94	788,119,835.57
负债和净资产总计		273,133,575.51	808,358,673.04

注：1、报告截止日 2026 年 6 月 30 日，长信沪深 300 指数量化增强 A 份额净值 1.1179 元；长信沪深 300 指数量化增强 C 份额净值 1.1140 元；基金份额总额为 243,614,930.95 份，其中长信沪深 300 指数量化增强 A 份额 176,254,189.63 份。长信沪深 300 指数量化增强 C 份额 67,360,741.32 份。

2、本基金基金合同于 2025 年 8 月 22 日正式生效，本报告期的财务报表和报表附注均无同期对比数据。

6.2 利润表

会计主体：长信沪深 300 指数量化增强型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
一、营业总收入		45,402,922.48
1. 利息收入		37,140.52
其中：存款利息收入	6.4.7.13	37,140.52
债券利息收入		-

资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		34,005,190.57
其中：股票投资收益	6.4.7.14	29,914,410.55
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	4,090,780.02
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	11,336,984.69
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	23,606.70
减：二、营业总支出		2,296,568.54
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,754,639.95
其中：暂估管理人报酬		-
2. 托管费	6.4.10.2.2	219,329.97
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	250,586.24
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		-
8. 其他费用	6.4.7.23	72,012.38
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		43,106,353.94
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		43,106,353.94
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		43,106,353.94

注：本基金基金合同于 2025 年 8 月 22 日正式生效，本报告期的财务报表和报表附注均无同期对比数据。

6.3 净资产变动表

会计主体：长信沪深 300 指数量化增强型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期			
	2026 年 1 月 1 日至 2026 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	774,531,480.59	-	13,588,354.98	788,119,835.57
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	774,531,480.59	-	13,588,354.98	788,119,835.57
三、本期增减变动额 （减少以“-”号填列）	-530,916,549.64	-	14,866,374.01	-516,050,175.63
（一）、综合收益总额	-	-	43,106,353.94	43,106,353.94
（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）	-530,916,549.64	-	-28,239,979.93	-559,156,529.57
其中：1. 基金申购款	54,870,056.99	-	1,817,571.60	56,687,628.59
2. 基金赎回款	-585,786,606.63	-	-30,057,551.53	-615,844,158.16
（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	243,614,930.95	-	28,454,728.99	272,069,659.94

注：本基金基金合同于 2025 年 8 月 22 日正式生效，本报告期的财务报表和报表附注均无同期对比数据。

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：

肖剑

基金管理人负责人

覃波

主管会计工作负责人

孙红辉

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

长信沪深 300 指数量化增强型证券投资基金(以下简称“本基金”),系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[2025]1050 号《关于准予长信沪深 300 指数量化增强型证券投资基金注册的批复》的注册,由基金管理人长信基金管理有限责任公司向社会公开发行募集。基金合同于 2025 年 8 月 22 日生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,237,111,299.83 份基金份额,其中认购资金利息折合 390,750.19 份基金份额,经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)德师报(验)字(25)第 00269 号验资报告予以验证。本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人和注册登记机构为长信基金管理有限责任公司,基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《长信沪深 300 指数量化增强型证券投资基金招募说明书》的有关规定,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、申购基金时收取认购、申购费用,而不从本类别基金资产中计提销售服务费的称为 A 类基金份额;在投资者认购、申购基金份额时不收取认购、申购费用,而从本类别基金资产中计提销售服务费的称为 C 类基金份额。本基金 A 类、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该类别基金份额总数。

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、科创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(含可分离交易可转债)、可交换债券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、信用衍生品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。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。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、信用衍生品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。如果法律法规或中国证监会对该比例要求有变更的,在履行适当程序后,可以调整上述投资品种的投资比例。

本基金的业绩比较基准为: 沪深 300 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》、《长信沪深 300 指数量化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 2026 年 6 月 30 日的财务状况以及 2026 年 1 月 1 日至 2026 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

本基金本报告期内无需说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据中华人民共和国主席令第 41 号《中华人民共和国增值税法》、中华人民共和国国务院令 第 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》、财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等

增值税政策的补充通知》、财税[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财政部 税务总局公告 2025 年第 4 号《财政部 税务总局关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、财政部 税务总局公告 2026 年第 10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》、财政部 税务总局公告 2026 年第 12 号《关于明确增值税应税交易销售额计算口径的公告》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，公开募集证券投资基金管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，以基金管理人为增值税纳税人，可以选择适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。对公募证券投资基金(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、债券取得的收入以及金融同业往来利息收入免征增值税。

(2)自 2025 年 8 月 8 日起，对基金取得的在该日期之后(含当日)新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税；对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券(包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分)的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。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。

(3)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。

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

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

(5)基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根

据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(6) 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 2026 年 6 月 30 日
活期存款	5,055,422.22
等于：本金	5,054,801.26
加：应计利息	620.96
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	14,605,523.57
等于：本金	14,605,205.16
加：应计利息	318.42
减：坏账准备	-
合计	19,660,945.79

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 2026 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		236,325,781.28	-	253,447,732.17	17,121,950.89
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	236,325,781.28	-	253,447,732.17	17,121,950.89

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 2026 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	12,396.69
预提信息披露费	59,507.37

其他	271.05
合计	72,175.11

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

长信沪深 300 指数量化增强 A

项目	本期	
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	563,547,472.05	563,547,472.05
本期申购	20,450,851.32	20,450,851.32
本期赎回（以“-”号填列）	-407,744,133.74	-407,744,133.74
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	176,254,189.63	176,254,189.63

长信沪深 300 指数量化增强 C

项目	本期	
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	210,984,008.54	210,984,008.54
本期申购	34,419,205.67	34,419,205.67
本期赎回（以“-”号填列）	-178,042,472.89	-178,042,472.89
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	67,360,741.32	67,360,741.32

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

长信沪深 300 指数量化增强 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	8,564,145.71	1,552,018.71	10,116,164.42
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	8,564,145.71	1,552,018.71	10,116,164.42
本期利润	23,144,897.50	7,870,061.14	31,014,958.64

本期基金份额交易产生的变动数	-14,578,030.61	-5,777,244.71	-20,355,275.32
其中：基金申购款	883,440.29	-95,924.09	787,516.20
基金赎回款	-15,461,470.90	-5,681,320.62	-21,142,791.52
本期已分配利润	-	-	-
本期末	17,131,012.60	3,644,835.14	20,775,847.74

长信沪深 300 指数量化增强 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,892,304.35	579,886.21	3,472,190.56
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	2,892,304.35	579,886.21	3,472,190.56
本期利润	8,624,471.75	3,466,923.55	12,091,395.30
本期基金份额交易产生的变动数	-5,225,556.58	-2,659,148.03	-7,884,704.61
其中：基金申购款	1,372,868.48	-342,813.08	1,030,055.40
基金赎回款	-6,598,425.06	-2,316,334.95	-8,914,760.01
本期已分配利润	-	-	-
本期末	6,291,219.52	1,387,661.73	7,678,881.25

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	26,736.19
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	10,026.14
其他	378.19
合计	37,140.52

注：其他为直销申购款利息收入。

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	1,714,084,240.58
减：卖出股票成本总额	1,682,568,589.19
减：交易费用	1,601,240.84
买卖股票差价收入	29,914,410.55

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	4,090,780.02
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	4,090,780.02

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	11,336,984.69
股票投资	11,336,984.69

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	11,336,984.69

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	23,606.70
合计	23,606.70

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，未归入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	12,396.69
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
存托服务费	108.32
合计	72,012.38

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、关联关系

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(以下简称“长信基金”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
交通银行股份有限公司(以下简称“交通银行”)	基金托管人、基金销售机构
长江证券股份有限公司(以下简称“长江证券”)	基金管理人的股东、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

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,754,639.95
其中：应支付销售机构的客户维护费	781,823.81
应支付基金管理人的净管理费	972,816.14

注：1、本基金基金合同于 2025 年 8 月 22 日起正式生效，无上年度可比期间数据。

2、本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.8%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E\times 0.8\%\div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	219,329.97

注：1、本基金基金合同于 2025 年 8 月 22 日起正式生效，无上年度可比期间数据。

2、本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.1%年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E\times 0.1\%\div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	长信沪深 300 指数量化增强 A	长信沪深 300 指数量化增强 C	合计
长信基金	-	5.43	5.43
交通银行	-	151,237.36	151,237.36
长江证券	-	191.03	191.03
合计	-	151,433.82	151,433.82

注：1、本基金基金合同于 2025 年 8 月 22 日起正式生效，无上年度可比期间数据。

2、根据基金合同的规定，本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额基金资产净值的 0.4%年费率计提。本基金销售服务费将专门用于本基金的销售与基金份额持有人服务。计算方法如下：

$$H=E\times 0.4\%\div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

基金销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

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

本基金本报告期末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

本基金本报告期末与关联方通过约定申报的方式进行适用固定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

本基金本报告期末与关联方通过约定申报的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固有资金投资本基金的情况

基金管理人在本报告期末运用固有资金投资本基金。

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

单位：人民币元

关联方名称	本期	
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
交通银行	5,055,422.22	26,736.19

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期末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（2026 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限	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

				类型						
001220	世盟股份	2026 年 1 月 27 日	6 个月	新股锁定	28.00	27.78	57	1,596.00	1,583.46	-
001257	盛龙股份	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股锁定	7.82	20.74	1,743	13,630.26	36,149.82	-
001312	福恩股份	2026 年 4 月 14 日	6 个月	新股锁定	18.38	16.78	134	2,462.92	2,248.52	-
301513	尚水智能	2026 年 4 月 10 日	6 个月	新股锁定	26.66	50.96	138	3,679.08	7,032.48	-
301666	大普微	2026 年 4 月 8 日	6 个月	新股锁定	46.08	463.33	645	29,721.60	298,847.85	-
301680	固德电材	2026 年 2 月 27 日	6 个月	新股锁定	58.00	112.16	117	6,786.00	13,122.72	-
301682	宏明电子	2026 年 3 月 18 日	6 个月	新股锁定	69.66	160.06	410	28,560.60	65,624.60	-
301683	慧谷新材	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股锁定	78.38	121.77	96	7,524.48	11,689.92	-
301687	新广益	2025 年 12 月 24 日	6 个月	新股锁定	21.93	77.78	195	4,276.35	15,167.10	-
301696	三瑞智能	2026 年 3 月 31 日	6 个月	新股锁定	24.68	86.80	216	5,330.88	18,748.80	-
601112	振石	2026 年 1	6 个月	新股	11.18	17.59	601	6,719.18	10,571.59	-

	股份	月 21 日		锁定						
603284	林平发展	2026 年 2 月 3 日	6 个月	新股锁定	37.88	34.87	46	1,742.48	1,604.02	-
603293	埃泰克	2026 年 4 月 9 日	6 个月	新股锁定	33.49	33.93	72	2,411.28	2,442.96	-
603352	至信股份	2026 年 1 月 8 日	6 个月	新股锁定	21.88	25.52	112	2,450.56	2,858.24	-
688712	北芯生命	2026 年 1 月 28 日	6 个月	新股锁定	17.52	35.92	1,500	26,280.00	53,880.00	-
688781	视涯科技	2026 年 3 月 18 日	9 个月	新股锁定	22.68	42.16	3,960	89,812.80	166,953.60	-
688785	恒运昌	2026 年 1 月 20 日	6 个月	新股锁定	92.18	463.15	116	10,692.88	53,725.40	-
688795	摩尔线程	2025 年 11 月 26 日	9 个月	新股锁定	114.28	676.94	3,347	382,495.16	2,265,718.18	-
688802	沐曦股份	2025 年 12 月 9 日	9 个月	新股锁定	104.66	768.89	2,563	268,243.58	1,970,665.07	-
688808	联讯仪器	2026 年 4 月 16 日	6 个月	新股锁定	81.88	1,584.33	107	8,761.16	169,523.31	-
688811	有研复材	2026 年 4 月 1 日	6 个月	新股锁定	6.41	24.13	834	5,345.94	20,124.42	-
688813	泰金	2026 年 3 月	6 个月	新股	26.28	172.09	234	6,149.52	40,269.06	-

	新能	月 24 日		锁定						
688816	易思维	2026 年 2 月 4 日	6 个月	新股锁定	55.95	57.10	177	9,903.15	10,106.70	-
688818	电科蓝天	2026 年 2 月 3 日	6 个月	新股锁定	9.47	70.14	1,622	15,360.34	113,767.08	-
688820	盛合晶微	2026 年 4 月 13 日	6 个月	新股锁定	19.68	141.49	625	12,300.00	88,431.25	-

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，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的银行存款存放在本基金的托管人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发行的证券，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 2026 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	5,055,422.22	-	-	-	-	5,055,422.22
结算备付金	14,605,523.57	-	-	-	-	14,605,523.57
交易性金融资产	-	-	-	-	253,447,732.17	253,447,732.17
应收申购款	-	-	-	-	24,897.55	24,897.55
资产总计	19,660,945.79	-	-	-	253,472,629.72	273,133,575.51

负债						
应付赎回款	-	-	-	-	756,240.21	756,240.21
应付管理人报酬	-	-	-	-	186,519.75	186,519.75
应付托管费	-	-	-	-	23,314.95	23,314.95
应付销售服务费	-	-	-	-	25,665.55	25,665.55
其他负债	-	-	-	-	72,175.11	72,175.11
负债总计	-	-	-	-	1,063,915.57	1,063,915.57
利率敏感度缺口	19,660,945.79	-	-	-	252,408,714.15	272,069,659.94
上年度末 2025 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	76,433,745.58	-	-	-	-	76,433,745.58
交易性金融资产	-	-	-	-	731,540,690.45	731,540,690.45
应收申购款	-	-	-	-	384,237.01	384,237.01
资产总计	76,433,745.58	-	-	-	731,924,927.46	808,358,673.04
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	19,397,542.92	19,397,542.92
应付管理人报酬	-	-	-	-	594,256.57	594,256.57
应付托管费	-	-	-	-	74,282.11	74,282.11
应付销售服务费	-	-	-	-	82,755.87	82,755.87
其他负债	-	-	-	-	90,000.00	90,000.00
负债总计	-	-	-	-	20,238,837.47	20,238,837.47
利率敏感度缺口	76,433,745.58	-	-	-	711,686,089.99	788,119,835.57

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

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 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025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	253,447,732.17	93.16	731,540,690.45	92.82
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	253,447,732.17	93.16	731,540,690.45	92.82

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（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	VaR 值为 5.90% (2025 年 12 月 31 日 VaR 值为 4.14%)	-16,057,124.21	-32,628,152.22

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。2025 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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	248,006,876.02	728,755,929.88
第二层次	-	7,881.00
第三层次	5,440,856.15	2,776,879.57
合计	253,447,732.17	731,540,690.45

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。

本基金本期持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2026 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。（2025 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	253,447,732.17	92.79
	其中：股票	253,447,732.17	92.79
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	19,660,945.79	7.20
8	其他各项资产	24,897.55	0.01
9	合计	273,133,575.51	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	11,976,113.00	4.40
C	制造业	130,743,222.02	48.06
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,360,558.00	0.50
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	2,437,043.00	0.90
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,687,962.20	4.30
J	金融业	45,992,527.74	16.90
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	4,459,948.20	1.64
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	208,657,374.16	76.69

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	1,103,759.74	0.41
C	制造业	34,635,852.17	12.73
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,036,308.00	0.38
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	3,760,842.00	1.38

G	交通运输、仓储和邮政业	27,711.49	0.01
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	312.65	0.00
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	797,636.96	0.29
N	水利、环境和公共设施管理业	1,556,508.00	0.57
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	278,892.00	0.10
Q	卫生和社会工作	1,592,535.00	0.59
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	44,790,358.01	16.46

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	300308	中际旭创	11,600	14,732,000.00	5.41
2	300750	宁德时代	29,280	11,507,332.80	4.23
3	603986	兆易创新	8,900	7,253,500.00	2.67
4	601318	中国平安	140,100	6,688,374.00	2.46
5	601899	紫金矿业	226,400	5,691,696.00	2.09
6	300502	新易盛	8,660	5,256,620.00	1.93
7	002384	东山精密	19,700	5,168,295.00	1.90
8	600519	贵州茅台	4,200	4,979,058.00	1.83
9	601138	工业富联	68,000	4,906,200.00	1.80
10	600030	中信证券	166,900	4,795,037.00	1.76
11	000333	美的集团	61,912	4,676,213.36	1.72
12	002371	北方华创	5,200	4,599,712.00	1.69
13	603259	药明康德	35,820	4,459,948.20	1.64
14	688256	寒武纪	2,723	4,344,682.65	1.60
15	002475	立讯精密	56,100	3,949,440.00	1.45
16	601288	农业银行	602,500	3,657,175.00	1.34
17	600150	中国船舶	103,754	3,505,847.66	1.29
18	002415	海康威视	98,100	3,355,020.00	1.23
19	688041	海光信息	9,040	3,347,512.00	1.23
20	300014	亿纬锂能	47,500	3,088,925.00	1.14
21	688396	华润微	31,100	3,033,805.00	1.12

22	601398	工商银行	429,000	3,033,030.00	1.11
23	000938	紫光股份	99,700	2,877,342.00	1.06
24	601601	中国太保	100,100	2,854,852.00	1.05
25	605117	德业股份	26,340	2,796,781.20	1.03
26	002916	深南电路	6,000	2,747,400.00	1.01
27	603799	华友钴业	56,600	2,731,516.00	1.00
28	300033	同花顺	11,300	2,723,300.00	1.00
29	601995	中金公司	74,300	2,685,945.00	0.99
30	601728	中国电信	515,800	2,677,002.00	0.98
31	600346	恒力石化	141,700	2,509,507.00	0.92
32	601766	中国中车	479,800	2,494,960.00	0.92
33	600233	圆通速递	154,700	2,436,525.00	0.90
34	601998	中信银行	345,700	2,395,701.00	0.88
35	601939	建设银行	242,198	2,332,366.74	0.86
36	600887	伊利股份	96,500	2,312,140.00	0.85
37	000807	云铝股份	104,400	2,311,416.00	0.85
38	601009	南京银行	232,300	2,297,447.00	0.84
39	600741	华域汽车	144,900	2,248,848.00	0.83
40	600999	招商证券	106,400	2,245,040.00	0.83
41	600938	中国海油	79,700	2,163,855.00	0.80
42	000792	盐湖股份	70,200	2,119,338.00	0.78
43	000001	平安银行	195,400	1,963,770.00	0.72
44	600036	招商银行	54,600	1,938,300.00	0.71
45	000776	广发证券	81,500	1,907,100.00	0.70
46	601857	中国石油	216,600	1,880,088.00	0.69
47	600460	士兰微	34,000	1,858,440.00	0.68
48	002558	巨人网络	66,100	1,821,716.00	0.67
49	688981	中芯国际	11,200	1,778,784.00	0.65
50	601658	邮储银行	350,600	1,728,458.00	0.64
51	000408	藏格矿业	24,400	1,691,408.00	0.62
52	600809	山西汾酒	15,400	1,684,298.00	0.62
53	600489	中金黄金	91,000	1,642,550.00	0.60
54	600426	华鲁恒升	67,000	1,602,640.00	0.59
55	600309	万华化学	20,500	1,402,405.00	0.52
56	600900	长江电力	51,400	1,360,558.00	0.50
57	600276	恒瑞医药	25,700	1,337,428.00	0.49
58	300408	三环集团	7,000	1,168,300.00	0.43
59	688111	金山办公	5,091	1,084,637.55	0.40
60	600176	中国巨石	13,200	962,016.00	0.35
61	688521	芯原股份	2,400	890,736.00	0.33
62	600000	浦发银行	94,800	816,228.00	0.30
63	601211	国泰海通	44,800	815,360.00	0.30
64	300760	迈瑞医疗	5,600	760,648.00	0.28

65	002460	赣锋锂业	11,200	732,480.00	0.27
66	600941	中国移动	8,400	723,492.00	0.27
67	601988	中国银行	125,200	716,144.00	0.26
68	600482	中国动力	21,200	695,360.00	0.26
69	601100	恒立液压	6,400	688,384.00	0.25
70	000425	徐工机械	82,000	663,380.00	0.24
71	688036	传音控股	11,200	660,240.00	0.24
72	002236	大华股份	40,000	659,600.00	0.24
73	688008	澜起科技	2,000	619,800.00	0.23
74	000338	潍柴动力	21,500	585,875.00	0.22
75	600089	特变电工	23,200	522,000.00	0.19
76	000975	山金国际	30,300	515,100.00	0.19
77	601012	隆基绿能	36,500	478,880.00	0.18
78	601600	中国铝业	50,000	411,000.00	0.15
79	300999	金龙鱼	17,200	400,072.00	0.15
80	601166	兴业银行	23,900	395,784.00	0.15
81	688012	中微公司	600	281,100.00	0.10
82	600989	宝丰能源	8,800	178,904.00	0.07
83	000858	五粮液	2,000	148,000.00	0.05
84	300418	昆仑万维	3,600	145,296.00	0.05
85	000725	京东方 A	12,400	107,632.00	0.04
86	601898	中煤能源	6,800	82,824.00	0.03
87	688126	沪硅产业	2,000	79,780.00	0.03
88	000708	中信特钢	5,200	65,624.00	0.02
89	300124	汇川技术	100	6,633.00	0.00
90	300628	亿联网络	100	3,382.00	0.00
91	300059	东方财富	100	2,038.00	0.00
92	600919	江苏银行	100	1,078.00	0.00
93	600029	南方航空	100	518.00	0.00
94	600050	中国联通	100	400.00	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	688795	摩尔线程	3,347	2,265,718.18	0.83
2	301086	鸿富瀚	10,000	2,092,800.00	0.77
3	688802	沐曦股份	2,563	1,970,665.07	0.72
4	300475	香农芯创	6,100	1,830,000.00	0.67
5	301536	星辰科技	13,600	1,750,456.00	0.64
6	300857	协创数据	5,100	1,733,490.00	0.64
7	603195	公牛集团	43,800	1,714,770.00	0.63
8	002414	高德红外	128,600	1,705,236.00	0.63
9	300438	鹏辉能源	20,100	1,665,285.00	0.61
10	688599	天合光能	117,000	1,652,040.00	0.61

11	301239	普瑞眼科	52,300	1,592,535.00	0.59
12	603708	家家悦	185,100	1,588,158.00	0.58
13	000933	神火股份	74,700	1,583,640.00	0.58
14	300823	建科智能	107,500	1,567,350.00	0.58
15	300073	当升科技	32,500	1,561,300.00	0.57
16	300867	圣元环保	85,900	1,556,508.00	0.57
17	300207	欣旺达	81,700	1,551,483.00	0.57
18	301371	敷尔佳	57,100	1,484,600.00	0.55
19	002998	优彩资源	219,800	1,430,898.00	0.53
20	300223	北京君正	5,000	1,244,500.00	0.46
21	688378	奥来德	20,000	1,240,000.00	0.46
22	002271	东方雨虹	92,000	1,092,040.00	0.40
23	002128	电投能源	46,100	1,065,832.00	0.39
24	001286	陕西能源	102,200	1,036,308.00	0.38
25	688469	芯联集成	82,200	872,142.00	0.32
26	002811	郑中设计	66,300	741,897.00	0.27
27	600801	华新建材	34,000	530,400.00	0.19
28	000810	创维数字	35,600	471,700.00	0.17
29	601231	环旭电子	14,400	466,560.00	0.17
30	300590	移为通信	27,500	394,625.00	0.15
31	300681	英搏尔	13,600	389,232.00	0.14
32	603233	大参林	22,800	342,684.00	0.13
33	301666	大普微	711	342,322.05	0.13
34	600455	博通股份	12,700	278,892.00	0.10
35	688808	联讯仪器	107	169,523.31	0.06
36	688781	视涯科技	3,960	166,953.60	0.06
37	601233	桐昆股份	7,600	164,540.00	0.06
38	688809	强一股份	259	161,357.00	0.06
39	600498	烽火通信	1,600	117,760.00	0.04
40	688818	电科蓝天	1,622	113,767.08	0.04
41	301680	固德电材	868	103,986.21	0.04
42	688712	北芯生命	2,628	95,931.84	0.04
43	301513	尚水智能	1,379	93,244.75	0.03
44	688820	盛合晶微	625	88,431.25	0.03
45	301682	宏明电子	465	75,309.55	0.03
46	002566	益盛药业	10,800	65,232.00	0.02
47	688785	恒运昌	116	53,725.40	0.02
48	688807	优迅股份	131	52,718.33	0.02
49	688796	百奥赛图	423	46,276.20	0.02
50	688727	恒坤新材	563	42,112.40	0.02
51	688813	泰金新能	234	40,269.06	0.01
52	001257	盛龙股份	1,807	37,927.74	0.01
53	301687	新广益	442	34,378.76	0.01

54	601298	青岛港	3,200	25,760.00	0.01
55	001386	马可波罗	1,719	24,341.04	0.01
56	301696	三瑞智能	257	23,593.77	0.01
57	603352	至信股份	815	21,157.33	0.01
58	688811	有研复材	834	20,124.42	0.01
59	301683	慧谷新材	152	19,520.40	0.01
60	001233	海安集团	433	19,355.10	0.01
61	301667	纳百川	201	14,536.32	0.01
62	001369	双欣材料	966	13,060.32	0.00
63	688805	健信超导	265	12,447.05	0.00
64	601112	振石股份	608	10,699.20	0.00
65	688816	易思维	177	10,106.70	0.00
66	603092	德力佳	154	8,311.38	0.00
67	603334	丰倍生物	179	6,359.87	0.00
68	301449	天溯计量	164	6,346.80	0.00
69	603248	锡华科技	260	5,483.40	0.00
70	603376	大明电子	206	5,104.68	0.00
71	001312	福恩股份	233	4,144.37	0.00
72	001396	誉帆科技	88	3,116.96	0.00
73	603293	埃泰克	72	2,442.96	0.00
74	001220	世盟股份	70	1,951.49	0.00
75	603284	林平发展	46	1,604.02	0.00
76	600210	紫江企业	100	620.00	0.00
77	000932	华菱钢铁	100	347.00	0.00
78	301638	南网数字	13	312.65	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	002371	北方华创	26,916,326.00	3.42
2	688041	海光信息	23,614,012.12	3.00
3	002916	深南电路	17,964,876.00	2.28
4	601211	国泰海通	16,391,620.00	2.08
5	601988	中国银行	15,886,907.00	2.02
6	000408	藏格矿业	14,954,754.00	1.90
7	002384	东山精密	14,811,280.31	1.88
8	600028	中国石化	14,595,252.00	1.85
9	002460	赣锋锂业	13,659,372.12	1.73
10	000100	TCL 科技	13,527,254.00	1.72
11	603799	华友钴业	13,304,835.00	1.69
12	600887	伊利股份	12,913,066.50	1.64
13	603986	兆易创新	12,842,654.00	1.63
14	000001	平安银行	12,436,795.00	1.58

15	600150	中国船舶	12,376,327.77	1.57
16	601288	农业银行	12,325,405.00	1.56
17	300438	鹏辉能源	11,965,781.00	1.52
18	600196	复星医药	11,518,672.00	1.46
19	601398	工商银行	11,376,868.00	1.44
20	601998	中信银行	11,190,688.00	1.42

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	688041	海光信息	35,319,194.23	4.48
2	300750	宁德时代	27,191,527.00	3.45
3	002916	深南电路	26,887,061.30	3.41
4	300308	中际旭创	25,060,158.60	3.18
5	601318	中国平安	24,387,361.00	3.09
6	002371	北方华创	23,402,401.00	2.97
7	603986	兆易创新	21,832,983.00	2.77
8	600036	招商银行	20,632,666.00	2.62
9	600519	贵州茅台	20,046,540.00	2.54
10	603993	洛阳钼业	19,032,553.00	2.41
11	600150	中国船舶	18,787,286.16	2.38
12	600276	恒瑞医药	17,754,638.52	2.25
13	600031	三一重工	17,733,460.00	2.25
14	601857	中国石油	17,709,545.00	2.25
15	601899	紫金矿业	17,512,440.80	2.22
16	000100	TCL 科技	17,443,310.00	2.21
17	601138	工业富联	16,903,627.84	2.14
18	601211	国泰海通	16,525,854.48	2.10
19	300059	东方财富	15,797,945.00	2.00
20	601166	兴业银行	15,372,896.00	1.95

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	1,193,138,646.22
卖出股票收入（成交）总额	1,714,084,240.58

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约定的备选股票库

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约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	24,897.55
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	24,897.55

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	688795	摩尔线程	2,265,718.18	0.83	新股锁定
2	688802	沐曦股份	1,970,665.07	0.72	新股锁定

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（%）
长信沪深300指数量化增强A	1,000	176,254.19	4,839,771.52	2.75	171,414,418.11	97.25
长信沪深300指数量化增强C	922	73,059.37	400,140.00	0.59	66,960,601.32	99.41
合计	1,922	126,750.74	5,239,911.52	2.15	238,375,019.43	97.85

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	长信沪深300指数量化增强A	0.00	0.00

人所有从 业人员持 有本基金	长信沪深 300 指数量化增强 C	2,814.06	0.00
	合计	2,814.06	0.00

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	长信沪深 300 指数量化增强 A	0
	长信沪深 300 指数量化增强 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	长信沪深 300 指数量化增强 A	0
	长信沪深 300 指数量化增强 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	长信沪深 300 指数量化增强 A	长信沪深 300 指数量化增强 C
基金合同生效日（2025 年 8 月 22 日）基金份额总额	767,864,387.71	469,246,912.12
本报告期期初基金份额总额	563,547,472.05	210,984,008.54
本报告期基金总申购份额	20,450,851.32	34,419,205.67
减：本报告期基金总赎回份额	407,744,133.74	178,042,472.89
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	176,254,189.63	67,360,741.32

§ 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

自 2026 年 3 月 19 日起，刘元瑞先生不再担任公司董事长，由肖剑先生担任公司董事长。

自 2026 年 4 月 3 日起，经工商行政管理部门核准，公司法定代表人变更为肖剑先生。

上述重大人事变动情况，本基金管理人均已在规定信息披露媒介发布相关公告。

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、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

管理人受调查或处罚等情况	内容
受到调查或处罚等措施的主体	长信基金管理有限责任公司
受到调查或处罚等措施的时间	2026 年 4 月 30 日
采取调查或处罚等措施的机构	上海证券交易所
受到调查或处罚等措施类型	其他（自律监管措施）
受到的具体措施类型	警示
受到调查或处罚等措施的原因	其他问题（新股网下询价）
受到处罚的依据	《上海证券交易所首次公开发行证券发行与承销业务实施细则（2025 年修订）》
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	公司高度重视，已落实优化模型、完善机制等整改措施，完成整改工作。
其他	无

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期，基金管理人相关从业人员没有受监管部门调查或处罚的情形。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内基金托管人的托管业务部门未受到调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内基金托管人相关从业人员未受到调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过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	

			(%)		(%)	
华福证券	2	2,905,692,764.29	100.00	-	-	-

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《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》（中国证券监督管理委员会公告〔2024〕3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) 财务状况良好；
- 2) 经营行为规范；
- 3) 合规风控能力较强；
- 4) 交易能力较强；
- 5) 研究能力较强。

（2）选择程序：

依照证券公司专用交易单元的选择标准，拟定备选证券公司，并根据公司要求提交准入评估报告，经证券公司准入审核流程审批通过后，签订相关协议。公司定期对各证券公司提供的服务质量进行综合评价。依照评价结果选择基金证券交易专用交易单元。

3、《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》自 2024 年 7 月 1 日起施行以来，本公司严格遵循法规及公司内部制度要求，未发现存在不符合法规及制度要求的情况。

10.7.2 基金租用或者通过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(%)
华福证券	-	-	-	-	-	-

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	2026-1-13
2	长信沪深 300 指数量化增强型证券投资基金 2025 年第 4 季度报告	中国证监会电子披露网站、公司网站	2026-1-22

3	长信基金管理有限责任公司旗下全部基金 2025 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	2026-1-22
4	长信基金管理有限责任公司关于董事长变更的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2026-3-21
5	长信基金管理有限责任公司关于董事变更情况的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2026-3-21
6	长信沪深 300 指数量化增强型证券投资基金 2025 年年度报告	中国证监会电子披露网站、公司网站	2026-3-30
7	长信基金管理有限责任公司旗下全部基金 2025 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	2026-3-30
8	长信基金管理有限责任公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025 年度）	中国证监会电子披露网站、公司网站	2026-3-31
9	长信基金管理有限责任公司公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2026-4-3
10	长信沪深 300 指数量化增强型证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	中国证监会电子披露网站、公司网站	2026-4-22
11	长信基金管理有限责任公司旗下全部基金 2026 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	2026-4-22
12	2025 年度公募基金管理人以股东身份（通过公募基金持股）参与股东大会投票信息披露	公司网站	2026-4-30
13	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分基金调整业绩比较基准并修订基金合同等法律文件的公告	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	2026-6-27
14	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分基金的基金合同提示性公告	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	2026-6-27
15	长信沪深 300 指数量化增强型证券投资基金更新的招募说明书（2026 年第【1】号）及基金产品资料概要（更新）	中国证监会电子披露网站、公司网站	2026-6-30

§ 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、《长信沪深 300 指数量化增强型证券投资基金基金合同》；
- 3、《长信沪深 300 指数量化增强型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《长信沪深 300 指数量化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

2026 年 8 月 31 日