

# 长信沪深 300 指数增强型证券投资基金 2023 年中期报告

2023 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：招商银行股份有限公司

送出日期：2023 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，并由董事长签发。

基金托管人招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”，下同）根据本基金基金合同的规定，于 2023 年 8 月 29 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 2023 年 1 月 1 日起至 2023 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>9</b>
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	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>13</b>
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	18
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>38</b>
7.1 期末基金资产组合情况	38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	39
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	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	46
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	46

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 .....	46
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 .....	46
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 .....	46
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	47
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	47
7.12 投资组合报告附注 .....	47
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>48</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	48
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	48
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 .....	48
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>49</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>49</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	49
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 .....	49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	49
10.4 基金投资策略的改变 .....	49
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	49
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 .....	50
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	50
10.8 其他重大事件 .....	51
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>52</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 .....	52
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	52
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>52</b>
12.1 备查文件目录 .....	52
12.2 存放地点 .....	52
12.3 查阅方式 .....	52

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	长信沪深 300 指数增强型证券投资基金	
基金简称	长信沪深 300 指数	
基金主代码	005137	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019 年 5 月 16 日	
基金管理人	长信基金管理有限责任公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	282,456,936.61 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 A	长信沪深 300 指数 C
下属分级基金的交易代码	005137	007448
报告期末下属分级基金的份额总额	118,578,000.95 份	163,878,935.66 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 7.75%，同时力求实现超越标的指数的业绩表现，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	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。 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%+银行活期存款利率(税后)*5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期风险和预期收益均高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金为指数型基金，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

### 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	招商银行股份有限公司
信息披露 姓名	周永刚	张姗

负责人	联系电话	021-61009999	0755-83077987
	电子邮箱	zhouyg@cxfund.com.cn	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		4007005566	95555
传真		021-61009800	0755-83195201
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区银城中路 68 号 9 楼	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址		上海市浦东新区银城中路 68 号 9 楼	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码		200120	518040
法定代表人		刘元瑞	缪建民

## 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 9 楼、深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

## 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

## § 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(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日)	
	长信沪深 300 指数 A	长信沪深 300 指数 C
本期已实现收益	5,621,858.69	5,054,310.34
本期利润	3,651,667.17	4,249,026.42
加权平均基金份额本期利润	0.0323	0.0391
本期加权平均净值利润率	2.88%	3.55%
本期基金份额净值增长率	3.61%	3.41%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利	4,445,934.34	-5,216,966.02

润		
期末可供分配基金份额利润	0.0375	-0.0318
期末基金资产净值	130,669,114.96	177,334,756.99
期末基金份额净值	1.1020	1.0821
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	41.26%	38.70%

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 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	2.22%	0.86%	1.10%	0.83%	1.12%	0.03%
过去三个月	-3.55%	0.79%	-4.88%	0.79%	1.33%	0.00%
过去六个月	3.61%	0.82%	-0.69%	0.80%	4.30%	0.02%
过去一年	-11.51%	0.93%	-13.60%	0.94%	2.09%	-0.01%
过去三年	9.06%	1.17%	-7.42%	1.14%	16.48%	0.03%
自基金合同生效起至今	41.26%	1.17%	3.37%	1.14%	37.89%	0.03%

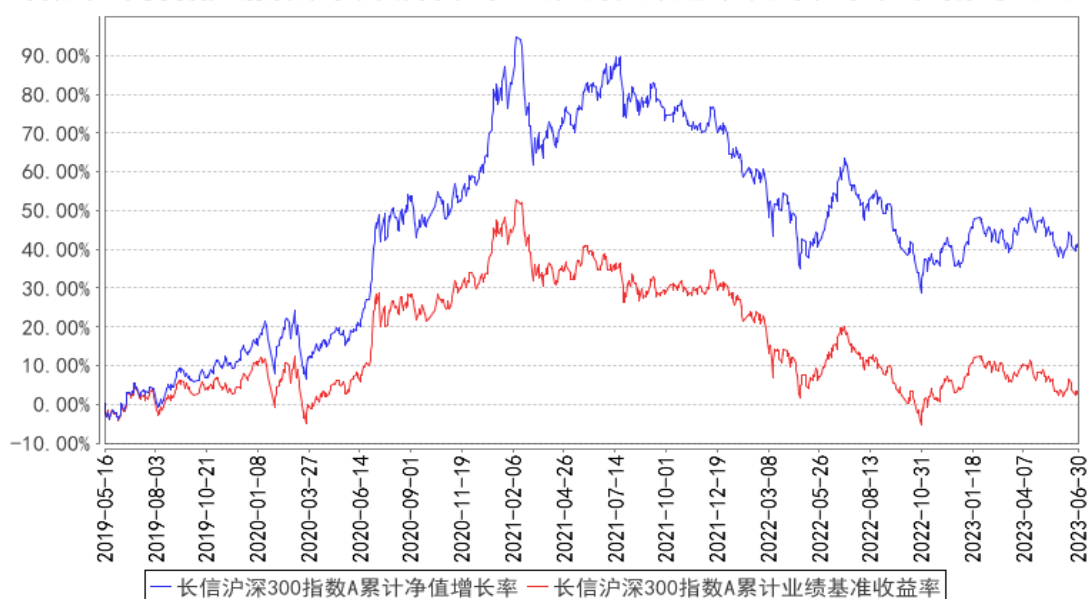
长信沪深 300 指数 C

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	2.18%	0.86%	1.10%	0.83%	1.08%	0.03%

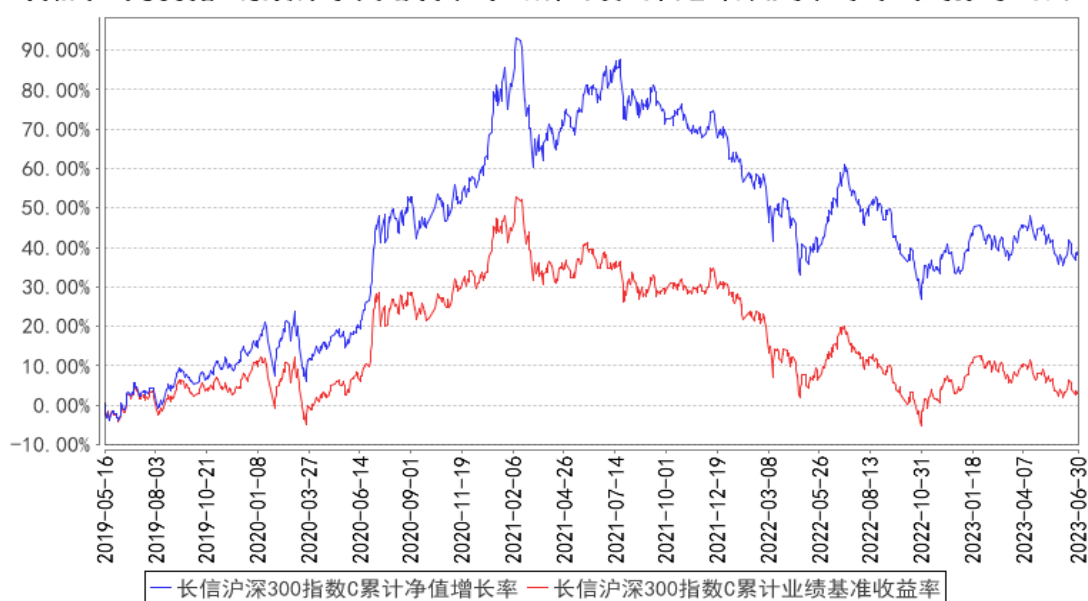
过去三个月	-3.65%	0.79%	-4.88%	0.79%	1.23%	0.00%
过去六个月	3.41%	0.82%	-0.69%	0.80%	4.10%	0.02%
过去一年	-11.87%	0.93%	-13.60%	0.94%	1.73%	-0.01%
过去三年	7.76%	1.18%	-7.42%	1.14%	15.18%	0.04%
自基金合同生效起 至今	38.70%	1.17%	3.37%	1.14%	35.33%	0.03%

### 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 2019 年 5 月 16 日至 2023 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；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 2023 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 86 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、长信恒利优势混合型证券投资基金、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、长信新利灵活配置混合型证券投资基金、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)、长信富民纯债一年定期开放债券型证券投资基金、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、长信长金通货币市场基金、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）、长信价值优选混合型证券投资基金、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、长信合利混合型证券投资基金、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、长信稳利资产配置一年持有期混合型基金中基金（FOF）、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 个月持有期混合型基金中基金、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基金中基金、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基金中基金、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基金中基金、长信中证 1000 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		
宋海岸	长信中证 500 指数增强型证券投资基金、长信国防军工量化灵活配置混合型证券投资基金、长信沪深 300 指数增强型证券投资	2019 年 5 月 16 日	-	9 年	理学硕士，上海交通大学应用数学研究生毕业，具有基金从业资格，中国国籍。曾担任海通期货股份有限公司研究员、前海开源基金管理有限公司投资经理助理和西部证券股份有限公司研究员。2016 年 9 月加入长信基金管理有限责任公司，历任量化投资部研究员、基金经理助理、量化投资部副总监、长信中证一带一路主题指数分级证券投资

	资基金、长信先进装备三个月持有期混合型证券投资基金和长信电子信息行业量化灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、量化研究部总监			基金、长信中证能源互联网主题指数型证券投资基金（LOF）、长信价值优选混合型证券投资基金、长信先优债券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，现任量化研究部总监、长信中证 500 指数增强型证券投资基金、长信国防军工量化灵活配置混合型证券投资基金、长信沪深 300 指数增强型证券投资基金、长信先进装备三个月持有期混合型证券投资基金和长信电子信息行业量化灵活配置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合规守信情况的说明

本基金管理人在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同的规定，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

本基金将继续以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，在规范基金运作和严格控制投资风险的前提下，努力为基金份额持有人谋求最大利益。

#### 4.3 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

上半年主要指数涨跌互现，板块内细分赛道分化较大且轮动迅速，赚钱效应较弱。因子层面，估值因子年初以来表现亮眼且持续，同时在年报、一季报披露窗口下，与基本面契合度更高的分析师因子、成长因子也有阶段性反弹；行业层面，受益于 AI 加速发展的通信行业领跑市场，部分顺周期板块在“中特估”驱动下表现同样不错，而消费板块则调整居多。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2023 年 6 月 30 日，长信沪深 300 指数 A 基金份额净值为 1.1020 元，份额累计净值为 1.3826 元，本报告期内长信沪深 300 指数 A 净值增长率为 3.61%；长信沪深 300 指数 C 基金份额净值为 1.0821 元，份额累计净值为 1.3593 元，本报告期内长信沪深 300 指数 C 净值增长率为 3.41%，同期业绩比较基准收益率为-0.69%。

## 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，我们认为更多的积极因素正在演绎。伴随着更多的稳经济、稳市场、稳信心的宏观政策加码和落地，会更有助于投资信心筑底和投资情绪回暖。我们认为在这一阶段可以关注三个投资方向：一是有望受益于政策发力的顺周期行业投资机会，包括银行、地产、新老基建等板块；第二关注产业趋势变革带来的主题型投资机会，包括数字经济、人工智能、机器人等；第三估值大幅调整后已具备高安全边际的行业如新能源、医药、大消费等。届时我们将运用量化模型从基本面、情绪面、交易面等多维度自下而上精选个股，力争获取稳健的超额收益。

## 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

托管人声明：

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

### 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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

### 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

本年度中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，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：长信沪深 300 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			

银行存款	6.4.7.1	13,975,765.32	13,408,787.66
结算备付金		9,426,753.77	2,282,750.85
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	283,053,670.66	211,016,942.45
其中：股票投资		283,053,670.66	211,016,942.45
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		3,112,132.40	142,647.02
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		309,568,322.15	226,851,127.98
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023年6月30日</b>	<b>上年度末 2022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		830,903.42	145,770.15
应付管理人报酬		224,284.80	195,701.50
应付托管费		33,642.73	29,355.23
应付销售服务费		46,586.93	39,107.81
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	429,032.32	270,137.57
负债合计		1,564,450.20	680,072.26
<b>净资产：</b>			

实收基金	6.4.7.10	282,456,936.61	214,391,256.77
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	25,546,935.34	11,779,798.95
净资产合计		308,003,871.95	226,171,055.72
负债和净资产总计		309,568,322.15	226,851,127.98

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，长信沪深 300 指数 A 份额净值 1.1020 元，长信沪深 300 指数 C 份额净值 1.0821 元，基金份额总额为 282,456,936.61 份，其中长信沪深 300 指数 A 份额 118,578,000.95 份。长信沪深 300 指数 C 份额 163,878,935.66 份。

## 6.2 利润表

会计主体：长信沪深 300 指数增强型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		9,731,006.78	-60,784,902.12
1. 利息收入		37,793.57	105,030.73
其中：存款利息收入	6.4.7.13	37,793.57	105,030.73
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		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		12,456,133.54	-78,243,148.77
其中：股票投资收益	6.4.7.14	8,478,416.50	-83,052,127.80
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	591.82
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	3,977,717.04	4,808,387.21
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	-2,775,475.44	17,311,299.90

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	12, 555. 11	41, 916. 02
<b>减：二、营业总支出</b>		1, 830, 313. 19	3, 274, 270. 05
1. 管理人报酬	6. 4. 10. 2. 1	1, 223, 281. 26	2, 172, 781. 93
2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	183, 492. 23	325, 917. 29
3. 销售服务费	6. 4. 10. 2. 3	237, 527. 31	581, 545. 69
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		-	2. 12
8. 其他费用	6. 4. 7. 23	186, 012. 39	194, 023. 02
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		7, 900, 693. 59	-64, 059, 172. 17
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		7, 900, 693. 59	-64, 059, 172. 17
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		7, 900, 693. 59	-64, 059, 172. 17

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：长信沪深 300 指数增强型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	214, 391, 256. 77	-	11, 779, 798. 95	226, 171, 055. 72
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	214, 391, 256. 77	-	11, 779, 798. 95	226, 171, 055. 72
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	68, 065, 679. 84	-	13, 767, 136. 39	81, 832, 816. 23



(一)、综合收益总额	-	-	7,900,693.59	7,900,693.59
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	68,065,679.84	-	5,866,442.80	73,932,122.64
其中：1. 基金申购款	99,255,757.66	-	9,310,783.50	108,566,541.16
2. 基金赎回款	-31,190,077.82	-	-3,444,340.70	-34,634,418.52
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	282,456,936.61	-	25,546,935.34	308,003,871.95
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 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(基金净值)	440,174,931.76	-	144,048,503.55	584,223,435.31
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	440,174,931.76	-	144,048,503.55	584,223,435.31
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-189,281,756.28	-	-84,800,356.96	-274,082,113.24
(一)、综合收益总额	-	-	-64,059,172.17	-64,059,172.17
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-189,281,756.28	-	-20,741,184.79	-210,022,941.07

其中：1. 基金申购款	115,980,404.87	-	29,598,235.35	145,578,640.22
2. 基金赎回款	-305,262,161.15	-	-50,339,420.14	-355,601,581.29
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	250,893,175.48	-	59,248,146.59	310,141,322.07

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

长信沪深 300 指数增强型证券投资基金（以下简称“本基金”）由长信量化价值精选混合型证券投资基金转型而成，长信量化价值精选混合型证券投资基金系经中国证券监督管理委员会（“中国证监会”）证监许可[2017]1548 号《关于准予长信量化价值精选混合型证券投资基金注册的批复》的注册，由长信基金管理有限责任公司作为管理人向社会公开发行募集。基金合同于 2018 年 4 月 19 日生效。首次设立募集规模为 220,607,762.64 份基金份额。根据《长信沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》及《关于长信量化价值精选混合型证券投资基金基金份额持有人大会决议生效公告》，本基金自 2019 年 5 月 16 日起转型并更名为长信沪深 300 指数增强型证券投资基金。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，基金托管人为招商银行股份有限公司。

《长信沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》生效后，原长信量化价值精选混合型证券投资基金份额将全部自动转换为长信沪深 300 指数增强型证券投资基金 A 类基金份额，且基金

份额持有时间持续计算。新增长信沪深 300 指数增强型证券投资基金 C 类基金份额。

本基金的投资范围主要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、其他股票（含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、存托凭证、权证、股指期货、债券（包括国内依法发行上市的国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、中小企业私募债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券以及经法律法规或中国证监会允许投资的其他债券）、债券回购、资产支持证券、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的相关规定）。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：本基金持有的股票资产占基金资产的比例为不低于 80%，其中，投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%。每个交易日日终在扣除股指期货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）或到期日在一年以内的政府债券。本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%。如果法律法规对该比例要求有变更的，以变更后的比例为准，本基金的投资比例会做相应调整。

本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率\*95%+银行活期存款利率（税后）\*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 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及 2023 年度（2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日止期间）的经营成果和基金净值变动情况。

#### 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。

(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 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	13,975,765.32
等于：本金	13,974,740.07
加：应计利息	1,025.25
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	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	13,975,765.32

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	297,214,316.85	-	283,053,670.66	-14,160,646.19
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	297,214,316.85	-	283,053,670.66	-14,160,646.19

##### 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 2023年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	437.76
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	-
应付指数使用费	100,000.00
预提审计费	74,795.19
预提信息披露费	59,507.37
其他	194,292.00
合计	429,032.32

注：其他为预收股利。

#### 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

## 长信沪深 300 指数 A

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	106,522,318.30	106,522,318.30
本期申购	25,703,041.94	25,703,041.94
本期赎回 (以“-”号填列)	-13,647,359.29	-13,647,359.29
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	118,578,000.95	118,578,000.95

## 长信沪深 300 指数 C

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	107,868,938.47	107,868,938.47
本期申购	73,552,715.72	73,552,715.72
本期赎回 (以“-”号填列)	-17,542,718.53	-17,542,718.53
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	163,878,935.66	163,878,935.66

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 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-1,286,320.51	8,056,156.88	6,769,836.37
本期利润	5,621,858.69	-1,970,191.52	3,651,667.17
本期基金份额交易产生的变动数	110,396.16	1,559,214.31	1,669,610.47
其中：基金申购款	295,126.26	3,056,814.36	3,351,940.62
基金赎回款	-184,730.10	-1,497,600.05	-1,682,330.15
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,445,934.34	7,645,179.67	12,091,114.01

## 长信沪深 300 指数 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
----	-------	-------	---------

上年度末	-8,455,606.60	13,465,569.18	5,009,962.58
本期利润	5,054,310.34	-805,283.92	4,249,026.42
本期基金份额交易产生的变动数	-1,815,669.76	6,012,502.09	4,196,832.33
其中：基金申购款	-2,864,492.78	8,823,335.66	5,958,842.88
基金赎回款	1,048,823.02	-2,810,833.57	-1,762,010.55
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-5,216,966.02	18,672,787.35	13,455,821.33

#### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
活期存款利息收入	19,657.12	
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	18,136.45	
其他	-	
合计	37,793.57	

#### 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	
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
卖出股票成交总额	466,483,786.38	
减：卖出股票成本总额	457,039,154.77	
减：交易费用	966,215.11	
买卖股票差价收入	8,478,416.50	

#### 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。

#### 6.4.7.16 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
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	3,977,717.04
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	3,977,717.04

#### 6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-2,775,475.44
股票投资	-2,775,475.44
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	-2,775,475.44

#### 6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	12,547.79
基金转换费收入	7.32
合计	12,555.11

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	24,795.19
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
指数使用费_基点费	100,000.00
其他费用	1,709.83
合计	186,012.39

注：其他费用为银行手续费。

#### 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
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	基金托管人、基金销售机构
长江证券股份有限公司（“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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
-------	---------------------------------------	--

	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例 (%)
长江证券	995,542,745.50	100.00	1,594,824,804.68	100.00

#### 6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

#### 6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

#### 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的权证交易。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
长江证券	420,656.51	100.00	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
长江证券	675,665.18	100.00	-	-

注：上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6 月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,223,281.26	2,172,781.93
其中：支付销售机构的客户维护费	377,496.32	429,123.35

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.00% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{基金管理费率} / \text{当年天数}$$

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	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	183,492.23	325,917.29

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.15% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{基金托管费年费率} / \text{当年天数}$$

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		
	2023 年 1 月 1 日至 2023 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 A	长信沪深 300 指数 C	合计
长信基金	-	56,722.10	56,722.10
招商银行	-	44,976.40	44,976.40
长江证券	-	38,946.80	38,946.80
合计	-	140,645.30	140,645.30
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2022 年 1 月 1 日至 2022 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 A	长信沪深 300 指数 C	合计
长信基金	-	350,951.98	350,951.98
招商银行	-	43,164.70	43,164.70
长江证券	-	71,254.93	71,254.93
合计	-	465,371.61	465,371.61

注：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。计算方法如下：

$$H = E \times \text{C 类基金份额的销售服务费年费率} / \text{当年天数}$$

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

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

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

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

本基金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

份额单位：份

项目	本期	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
	长信沪深 300 指数 A	长信沪深 300 指数 C
基金合同生效日（2019 年 5 月 16 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	52,162.71	56,812.64
报告期内申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期内因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期内赎回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	52,162.71	56,812.64
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.02%	0.02%
项目	上年度可比期间	上年度可比期间
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

	长信沪深 300 指数 A	长信沪深 300 指数 C
基金合同生效日（2019 年 5 月 16 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期内申购/买入总份额	52,162.71	56,812.64
报告期内因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期内赎回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	52,162.71	56,812.64
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.02%	0.02%

注：基金管理人运用固有资金投资本基金费率按本基金招募说明书中公布的费率执行。

#### 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行	13,975,765.32	19,657.12	7,120,780.62	15,562.57

#### 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均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

本基金本报告期末存放于长江证券的券商保证金金额为人民币 9,422,523.75 元（2022 年 6 月 30 日：人民币 10,471,562.14 元），相关余额在资产负债表中的“结算备付金”科目中单独列示。

#### 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（2023 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	证券	成功	受限期	流通受	认购	期末估	数量	期末	期末估值总	备注

代码	名称	认购日		限类型	价格	值单价	(单位:股)	成本总额	额	
001286	陕西能源	2023年3月31日	6个月	新股流通受限	9.60	9.41	3,767	36,163.20	35,447.47	-
001287	中电港	2023年3月30日	6个月	新股流通受限	11.88	21.02	318	3,777.84	6,684.36	-
001360	南矿集团	2023年3月31日	6个月	新股流通受限	15.38	14.87	128	1,968.64	1,903.36	-
301170	锡南科技	2023年6月16日	6个月	新股流通受限	34.00	34.93	163	5,542.00	5,693.59	-
301203	国泰环保	2023年3月28日	6个月	新股流通受限	46.13	34.40	154	7,104.02	5,297.60	-
301210	金杨股份	2023年6月21日	6个月	新股流通受限	57.88	49.17	150	8,682.00	7,375.50	-
301225	恒勃股份	2023年6月8日	6个月	新股流通受限	35.66	33.26	235	8,380.10	7,816.10	-
301261	恒工精密	2023年6月29日	1-6个月(含)	新股未上市	36.90	36.90	1,494	55,128.60	55,128.60	-
301281	科源制药	2023年3月28日	6个月	新股流通受限	44.18	25.10	200	6,317.74	5,020.00	-
301291	明阳电气	2023年6月21日	6个月	新股流通受限	38.13	31.03	288	10,981.44	8,936.64	-
301303	真兰仪表	2023年2月13日	6个月	新股流通受限	26.80	22.32	376	10,076.80	8,392.32	-
301305	朗坤环境	2023年5月15日	6个月	新股流通受限	25.25	19.69	335	8,458.75	6,596.15	-
301317	鑫磊股份	2023年1月12日	6个月	新股流通受限	20.67	26.17	406	8,392.02	10,625.02	-
301325	曼恩斯特	2023年5月4日	6个月	新股流通受限	76.80	107.95	123	9,446.40	13,277.85	-

301386	未来 电器	2023 年 3 月 21 日	6 个月	新股流 通受限	29.99	23.79	220	6,597.80	5,233.80	-
301395	仁信 新材	2023 年 6 月 21 日	1-6 个 月(含)	新股未 上市	26.68	26.68	3,117	83,161.56	83,161.56	-
601065	江盐 集团	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股流 通受限	10.36	11.84	240	2,486.40	2,841.60	-
601916	浙商 银行	2023 年 6 月 27 日	1-6 个 月(含)	配股流 通受限	2.02	2.64	250,230	505,464.60	660,607.20	-
603125	常青 科技	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股流 通受限	25.98	24.53	74	1,922.52	1,815.22	-
603172	万丰 股份	2023 年 4 月 28 日	6 个月	新股流 通受限	14.58	16.13	122	1,778.76	1,967.86	-
688146	中船 特气	2023 年 4 月 13 日	6 个月	新股流 通受限	36.15	38.13	219	7,916.85	8,350.47	-
688429	时创 能源	2023 年 6 月 20 日	6 个月	新股流 通受限	19.20	25.53	278	5,337.60	7,097.34	-
688479	友车 科技	2023 年 5 月 4 日	6 个月	新股流 通受限	33.99	29.49	169	5,744.31	4,983.81	-
688543	国科 军工	2023 年 6 月 14 日	6 个月	新股流 通受限	43.67	53.05	174	7,598.58	9,230.70	-
688562	航天 软件	2023 年 5 月 15 日	6 个月	新股流 通受限	12.68	22.31	494	6,263.92	11,021.14	-
688581	安杰 思	2023 年 5 月 12 日	6 个月	新股流 通受限	125.80	118.03	61	7,673.80	7,199.83	-
688603	天承 科技	2023 年 6 月 30 日	1-6 个 月(含)	新股未 上市	55.00	55.00	1,286	70,730.00	70,730.00	-
688631	莱斯 信息	2023 年 6 月 19 日	6 个月	新股流 通受限	25.28	29.87	194	4,904.32	5,794.78	-



#### 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。本基金的银行存款存放在本基金的托管人招商银行股份有限公司，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 2023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						
银行存款	13,975,765.32	-	-	-	-	13,975,765.32
结算备付金	9,426,753.77	-	-	-	-	9,426,753.77
交易性金融资产	-	-	-	-	283,053,670.66	283,053,670.66
应收申购款	-	-	-	-	3,112,132.40	3,112,132.40
资产总计	23,402,519.09	-	-	-	286,165,803.06	309,568,322.15
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	830,903.42	830,903.42
应付管理人报酬	-	-	-	-	224,284.80	224,284.80
应付托管费	-	-	-	-	33,642.73	33,642.73
应付销售服务费	-	-	-	-	46,586.93	46,586.93
其他负债	-	-	-	-	429,032.32	429,032.32
负债总计	-	-	-	-	1,564,450.20	1,564,450.20
利率敏感度缺口	23,402,519.09	-	-	-	284,601,352.86	308,003,871.95
上年度末 2022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						
银行存款	13,408,787.66	-	-	-	-	13,408,787.66
结算备付金	2,282,750.85	-	-	-	-	2,282,750.85
交易性金融资产	-	-	-	-	211,016,942.45	211,016,942.45
应收申购款	-	-	-	-	142,647.02	142,647.02
资产总计	15,691,538.51	-	-	-	211,159,589.47	226,851,127.98
负债						

应付赎回款	-	-	-	-	145,770.15	145,770.15
应付管理人报酬	-	-	-	-	195,701.50	195,701.50
应付托管费	-	-	-	-	29,355.23	29,355.23
应付销售服务费	-	-	-	-	39,107.81	39,107.81
其他负债	-	-	-	-	270,137.57	270,137.57
负债总计	-	-	-	-	680,072.26	680,072.26
利率敏感度缺口	15,691,538.51	-	-	-	-210,479,517.21	226,171,055.72

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 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 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	283,053,670.66	91.90	211,016,942.45	93.30
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	283,053,670.66	91.90	211,016,942.45	93.30

#### 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（2023 年 6 月 30 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	VaR 值为 3.22% (2022 年 12 月 31 日 VaR 值为 3.60%)	-9,929,272.01	-8,150,844.92

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。2022 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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	282,656,047.99	210,065,443.57
第二层次	209,020.16	-

第三层次	188,602.51	951,498.88
合计	283,053,670.66	211,016,942.45

#### 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的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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 2023 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（2022 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	283,053,670.66	91.43
	其中：股票	283,053,670.66	91.43
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	23,402,519.09	7.56

8	其他各项资产	3,112,132.40	1.01
9	合计	309,568,322.15	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	5,058.00	0.00
B	采矿业	12,797,082.00	4.15
C	制造业	141,929,080.92	46.08
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,771,388.00	0.90
E	建筑业	10,405,357.20	3.38
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	619,126.00	0.20
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	18,375,594.08	5.97
J	金融业	52,104,043.11	16.92
K	房地产业	5,608.00	-
L	租赁和商务服务业	4,725,459.00	1.53
M	科学研究和技术服务业	4,906,289.40	1.59
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	248,644,085.71	80.73

### 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	2,590,019.00	0.84
B	采矿业	2,406,456.00	0.78
C	制造业	22,419,244.28	7.28

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	41,611.47	0.01
E	建筑业	1,384,503.16	0.45
F	批发和零售业	2,659,996.36	0.86
G	交通运输、仓储和邮政业	1,264.00	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	25,177.73	0.01
J	金融业	2,862,990.20	0.93
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	5,097.00	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	11,893.75	0.00
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	1,332.00	0.00
S	综合	-	-
	合计	34,409,584.95	11.17

### 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	600519	贵州茅台	10,600	17,924,600.00	5.82
2	601318	中国平安	248,586	11,534,390.40	3.74
3	000858	五粮液	53,400	8,734,638.00	2.84
4	000333	美的集团	133,700	7,877,604.00	2.56
5	300750	宁德时代	33,457	7,654,627.03	2.49
6	601012	隆基绿能	230,600	6,611,302.00	2.15
7	002415	海康威视	192,100	6,360,431.00	2.07
8	600309	万华化学	71,700	6,298,128.00	2.04
9	300760	迈瑞医疗	21,000	6,295,800.00	2.04



10	600028	中国石化	938,100	5,966,316.00	1.94
11	601668	中国建筑	1,006,480	5,777,195.20	1.88
12	000001	平安银行	510,900	5,737,407.00	1.86
13	600438	通威股份	160,600	5,510,186.00	1.79
14	600919	江苏银行	743,000	5,461,050.00	1.77
15	601728	中国电信	968,700	5,453,781.00	1.77
16	600050	中国联通	1,117,400	5,363,520.00	1.74
17	601601	中国太保	204,238	5,306,103.24	1.72
18	002304	洋河股份	39,700	5,214,595.00	1.69
19	000338	潍柴动力	416,200	5,185,852.00	1.68
20	000651	格力电器	138,800	5,067,588.00	1.65
21	300450	先导智能	137,899	4,987,806.83	1.62
22	603259	药明康德	78,740	4,906,289.40	1.59
23	688599	天合光能	114,356	4,872,709.16	1.58
24	002459	晶澳科技	116,060	4,839,702.00	1.57
25	601939	建设银行	770,000	4,820,200.00	1.56
26	002142	宁波银行	190,500	4,819,650.00	1.56
27	002236	大华股份	241,200	4,763,700.00	1.55
28	600809	山西汾酒	25,600	4,737,792.00	1.54
29	002027	分众传媒	693,900	4,725,459.00	1.53
30	601336	新华保险	127,500	4,688,175.00	1.52
31	601669	中国电建	806,300	4,628,162.00	1.50
32	000625	长安汽车	357,650	4,624,414.50	1.50
33	600741	华域汽车	249,800	4,611,308.00	1.50
34	600875	东方电气	244,500	4,559,925.00	1.48
35	601319	中国人保	765,800	4,472,272.00	1.45
36	600570	恒生电子	100,552	4,453,448.08	1.45
37	600760	中航沈飞	95,620	4,302,900.00	1.40
38	002049	紫光国微	46,100	4,298,825.00	1.40
39	601857	中国石油	554,600	4,142,862.00	1.35
40	600926	杭州银行	348,300	4,092,525.00	1.33
41	000425	徐工机械	547,100	3,703,867.00	1.20
42	002410	广联达	95,500	3,102,795.00	1.01
43	600803	新奥股份	145,900	2,769,182.00	0.90
44	601699	潞安环能	164,700	2,687,904.00	0.87
45	600031	三一重工	83,500	1,388,605.00	0.45
46	600016	民生银行	248,500	931,875.00	0.30
47	000063	中兴通讯	19,400	883,476.00	0.29
48	002202	金风科技	38,200	405,684.00	0.13
49	600018	上港集团	71,000	372,750.00	0.12
50	600233	圆通速递	16,200	235,872.00	0.08
51	601009	南京银行	25,600	204,800.00	0.07
52	002371	北方华创	400	127,060.00	0.04

53	688012	中微公司	91	14,236.95	0.00
54	002466	天齐锂业	200	13,982.00	0.00
55	300014	亿纬锂能	213	12,886.50	0.00
56	600196	复星医药	400	12,360.00	0.00
57	002352	顺丰控股	200	9,018.00	0.00
58	002709	天赐材料	200	8,238.00	0.00
59	601628	中国人寿	200	6,992.00	0.00
60	600660	福耀玻璃	193	6,919.05	0.00
61	600030	中信证券	325	6,428.50	0.00
62	000002	万科 A	400	5,608.00	0.00
63	601688	华泰证券	400	5,508.00	0.00
64	002714	牧原股份	120	5,058.00	0.00
65	601838	成都银行	400	4,884.00	0.00
66	688981	中芯国际	70	3,536.40	0.00
67	601615	明阳智能	200	3,376.00	0.00
68	002414	高德红外	390	3,030.30	0.00
69	600958	东方证券	300	2,910.00	0.00
70	601211	国泰君安	203	2,839.97	0.00
71	601766	中国中车	400	2,600.00	0.00
72	601138	工业富联	100	2,520.00	0.00
73	600900	长江电力	100	2,206.00	0.00
74	600588	用友网络	100	2,050.00	0.00
75	601006	大秦铁路	200	1,486.00	0.00
76	000776	广发证券	100	1,471.00	0.00
77	601658	邮储银行	300	1,467.00	0.00
78	688303	大全能源	36	1,456.20	0.00
79	601398	工商银行	300	1,446.00	0.00
80	601169	北京银行	200	926.00	0.00
81	000877	天山股份	100	814.00	0.00
82	000617	中油资本	100	723.00	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	601137	博威合金	187,800	2,922,168.00	0.95
2	002056	横店东磁	157,800	2,873,538.00	0.93
3	603688	石英股份	25,200	2,868,768.00	0.93
4	601916	浙商银行	1,084,330	2,862,631.20	0.93
5	000048	京基智农	145,975	2,849,432.00	0.93
6	601717	郑煤机	225,600	2,808,720.00	0.91
7	002603	以岭药业	109,100	2,802,779.00	0.91
8	600153	建发股份	243,200	2,653,312.00	0.86
9	600598	北大荒	194,300	2,590,019.00	0.84
10	600549	厦门钨业	127,500	2,426,325.00	0.79

11	601958	金钼股份	215,400	2,401,710.00	0.78
12	600096	云天化	138,200	2,359,074.00	0.77
13	000928	中钢国际	143,300	1,382,845.00	0.45
14	301395	仁信新材	3,117	83,161.56	0.03
15	603639	海利尔	4,600	82,432.00	0.03
16	688581	安杰思	602	73,466.92	0.02
17	688603	天承科技	1,286	70,730.00	0.02
18	301261	恒工精密	1,494	55,128.60	0.02
19	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.01
20	603876	鼎胜新材	720	13,816.80	0.00
21	301325	曼恩斯特	123	13,277.85	0.00
22	688562	航天软件	494	11,021.14	0.00
23	301317	鑫磊股份	406	10,625.02	0.00
24	688063	派能科技	49	9,714.25	0.00
25	600389	江山股份	406	9,642.50	0.00
26	688543	国科军工	174	9,230.70	0.00
27	301291	明阳电气	288	8,936.64	0.00
28	301303	真兰仪表	376	8,392.32	0.00
29	688146	中船特气	219	8,350.47	0.00
30	301225	恒勃股份	235	7,816.10	0.00
31	301210	金杨股份	150	7,375.50	0.00
32	688429	时创能源	278	7,097.34	0.00
33	001287	中电港	318	6,684.36	0.00
34	301305	朗坤环境	335	6,596.15	0.00
35	688631	莱斯信息	194	5,794.78	0.00
36	301170	锡南科技	163	5,693.59	0.00
37	002015	协鑫能科	400	5,372.00	0.00
38	301203	国泰环保	154	5,297.60	0.00
39	301386	未来电器	220	5,233.80	0.00
40	300384	三联虹普	300	5,097.00	0.00
41	301281	科源制药	200	5,020.00	0.00
42	688479	友车科技	169	4,983.81	0.00
43	600348	华阳股份	600	4,746.00	0.00
44	002624	完美世界	200	3,378.00	0.00
45	601065	江盐集团	240	2,841.60	0.00
46	002152	广电运通	174	2,039.28	0.00
47	603172	万丰股份	122	1,967.86	0.00
48	001360	南矿集团	128	1,903.36	0.00
49	603125	常青科技	74	1,815.22	0.00
50	002318	久立特材	100	1,703.00	0.00
51	000090	天健集团	329	1,658.16	0.00
52	600373	中文传媒	100	1,332.00	0.00
53	600026	中远海能	100	1,264.00	0.00

54	000902	新洋丰	100	1,028.00	0.00
55	002267	陕天然气	100	792.00	0.00
56	601077	渝农商行	100	359.00	0.00

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000858	五粮液	13,992,320.00	6.19
2	600519	贵州茅台	13,798,049.64	6.10
3	601318	中国平安	13,018,683.71	5.76
4	002027	分众传媒	10,662,516.00	4.71
5	300750	宁德时代	9,890,978.40	4.37
6	002049	紫光国微	8,699,489.00	3.85
7	002594	比亚迪	8,375,466.00	3.70
8	600809	山西汾酒	7,854,471.00	3.47
9	688599	天合光能	7,524,940.62	3.33
10	600900	长江电力	7,518,036.00	3.32
11	000333	美的集团	7,155,954.44	3.16
12	601668	中国建筑	7,124,968.00	3.15
13	600028	中国石化	7,062,052.00	3.12
14	300014	亿纬锂能	6,976,961.00	3.08
15	002415	海康威视	6,717,499.06	2.97
16	688012	中微公司	6,716,540.24	2.97
17	601288	农业银行	6,669,864.00	2.95
18	300760	迈瑞医疗	6,533,801.00	2.89
19	000001	平安银行	6,246,437.00	2.76
20	601728	中国电信	6,225,228.00	2.75
21	600309	万华化学	6,006,763.00	2.66
22	002938	鹏鼎控股	5,972,044.00	2.64
23	601328	交通银行	5,959,877.00	2.64
24	601169	北京银行	5,906,295.00	2.61
25	002414	高德红外	5,789,961.24	2.56
26	600050	中国联通	5,699,666.00	2.52
27	002475	立讯精密	5,692,763.80	2.52
28	601601	中国太保	5,604,955.00	2.48
29	300450	先导智能	5,505,126.76	2.43
30	600919	江苏银行	5,502,144.00	2.43
31	600570	恒生电子	5,344,667.08	2.36
32	601669	中国电建	5,105,037.00	2.26
33	601699	潞安环能	5,076,198.00	2.24
34	601857	中国石油	5,036,486.00	2.23
35	601939	建设银行	4,987,788.00	2.21

36	002236	大华股份	4,955,535.00	2.19
37	601398	工商银行	4,915,938.00	2.17
38	601658	邮储银行	4,850,073.00	2.14
39	000338	潍柴动力	4,780,579.87	2.11
40	601319	中国人保	4,779,254.00	2.11
41	000063	中兴通讯	4,750,391.34	2.10
42	600741	华域汽车	4,749,462.00	2.10
43	002142	宁波银行	4,715,133.00	2.08
44	000651	格力电器	4,701,833.00	2.08
45	002459	晶澳科技	4,697,061.00	2.08
46	600588	用友网络	4,627,346.00	2.05

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	002938	鹏鼎控股	11,397,703.63	5.04
2	000858	五粮液	10,520,556.00	4.65
3	601138	工业富联	10,188,389.00	4.50
4	688012	中微公司	10,015,466.77	4.43
5	000568	泸州老窖	8,926,073.70	3.95
6	600900	长江电力	8,786,544.00	3.88
7	600050	中国联通	8,298,873.00	3.67
8	000002	万科 A	7,818,256.00	3.46
9	000651	格力电器	7,817,645.00	3.46
10	601288	农业银行	7,809,407.00	3.45
11	000725	京东方 A	7,580,780.00	3.35
12	002594	比亚迪	7,554,342.00	3.34
13	600031	三一重工	7,032,616.00	3.11
14	000100	TCL 科技	6,974,259.00	3.08
15	002714	牧原股份	6,810,010.35	3.01
16	002756	永兴材料	6,783,118.20	3.00
17	601318	中国平安	6,395,838.00	2.83
18	300033	同花顺	6,378,153.20	2.82
19	600016	民生银行	6,310,635.00	2.79
20	300498	温氏股份	6,297,197.00	2.78
21	600660	福耀玻璃	6,293,144.00	2.78
22	601211	国泰君安	6,260,762.00	2.77
23	603259	药明康德	6,225,774.00	2.75
24	601328	交通银行	6,184,066.00	2.73
25	000877	天山股份	6,101,371.82	2.70
26	601818	光大银行	6,014,803.00	2.66
27	000895	双汇发展	5,960,562.00	2.64

28	002414	高德红外	5,875,815.31	2.60
29	601169	北京银行	5,841,774.00	2.58
30	002466	天齐锂业	5,836,119.00	2.58
31	688599	天合光能	5,772,349.10	2.55
32	601390	中国中铁	5,745,018.00	2.54
33	002027	分众传媒	5,636,756.00	2.49
34	601998	中信银行	5,488,175.00	2.43
35	601398	工商银行	5,475,711.00	2.42
36	600089	特变电工	5,315,196.00	2.35
37	300014	亿纬锂能	5,197,190.00	2.30
38	002475	立讯精密	5,149,594.00	2.28
39	600000	浦发银行	5,135,672.00	2.27
40	688303	大全能源	5,104,432.96	2.26
41	600958	东方证券	5,030,127.72	2.22
42	600026	中远海能	5,001,997.00	2.21
43	300384	三联虹普	4,703,710.20	2.08
44	601658	邮储银行	4,696,692.00	2.08
45	601077	渝农商行	4,654,476.00	2.06
46	601688	华泰证券	4,617,838.00	2.04

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	531,851,358.42
卖出股票收入（成交）总额	466,483,786.38

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	3,112,132.40
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,112,132.40

### 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 (%)
长信沪深 300 指数 A	6,613	17,931.05	53,428,195.95	45.06	65,149,805.00	54.94
长信沪深 300 指数 C	10,054	16,299.87	102,477,828.38	62.53	61,401,107.28	37.47
合计	16,667	16,947.08	155,906,024.33	55.20	126,550,912.28	44.80

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	长信沪深 300 指数 A	347,204.74	0.29
	长信沪深 300 指数 C	131,349.32	0.08
	合计	478,554.06	0.17

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 A	0~10
	长信沪深 300 指数 C	0~10
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	长信沪深 300 指数 A	0~10
	长信沪深 300 指数 C	0~10
	合计	10~50



## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	长信沪深 300 指数 A	长信沪深 300 指数 C
基金合同生效日 (2019 年 5 月 16 日) 基金份额总额	997,837.56	-
本报告期期初基金份 额总额	106,522,318.30	107,868,938.47
本报告期基金总申购 份额	25,703,041.94	73,552,715.72
减：本报告期基金总 赎回份额	13,647,359.29	17,542,718.53
本报告期基金拆分变 动份额	-	-
本报告期期末基金份 额总额	118,578,000.95	163,878,935.66

## § 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，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为基金审计的会计师事务所。

## 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

本报告期内，托管人及其高级管理人员在开展基金托管业务过程中未受到相关监管部门稽查或处罚。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
长江证券	2	995,542,745.50	100.00	420,656.51	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《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	债券交易	债券回购交易	权证交易
-----	------	--------	------

称	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
长江证券	-	-	-	-	-	-

### 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	长信沪深 300 指数增强型证券投资基金 2022 年第 4 季度报告	中国证监会电子披露网站、公司网站	2023 年 1 月 20 日
2	长信基金管理有限责任公司旗下全部基金 2022 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	2023 年 1 月 20 日
3	长信基金管理有限责任公司关于增加东方财富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	2023 年 3 月 13 日
4	长信沪深 300 指数增强型证券投资基金 2022 年年度报告	中国证监会电子披露网站、公司网站	2023 年 3 月 31 日
5	长信基金管理有限责任公司旗下全部基金 2022 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	2023 年 3 月 31 日
6	长信基金管理有限责任公司关于增加博时财富基金销售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）、转换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	2023 年 4 月 20 日
7	长信沪深 300 指数增强型证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	中国证监会电子披露网站、公司网站	2023 年 4 月 21 日
8	长信基金管理有限责任公司旗下全部基金 2023 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	2023 年 4 月 21 日
9	长信基金管理有限责任公司关于增加五矿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）、转换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	2023 年 5 月 25 日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

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

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

### 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

2023 年 8 月 31 日