

长信中证 1000 指数增强型证券投资基金 2023 年第 3 季度报告

2023 年 9 月 30 日

基金管理人：长信基金管理有限责任公司

基金托管人：国信证券股份有限公司

报告送出日期：2023 年 10 月 25 日

§ 1 重要提示

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

基金托管人国信证券股份有限公司根据本基金基金合同的规定，于 2023 年 10 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 7 月 1 日起至 2023 年 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	长信中证 1000 指数增强
基金主代码	018013
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2023 年 4 月 20 日
报告期末基金份额总额	87,709,469.12 份
投资目标	本基金为增强型股票指数基金，通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段，追求基金净值增长率与业绩比较基准之间跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 8%，同时力求实现超越标的指数的业绩表现，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金在指数化投资的基础上通过数量化模型进行投资组合优化，在控制与业绩比较基准偏离风险的前提下，力争获得超越标的指数的投资收益。
业绩比较基准	中证 1000 指数收益率×95%+中国人民银行人民币活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期风险和预期收益均高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金为指数增强型基金，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。本基金若投资香港联合交易所上市的股票，将面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。
基金管理人	长信基金管理有限责任公司
基金托管人	国信证券股份有限公司

下属分级基金的基金简称	长信中证 1000 指数增强 A	长信中证 1000 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	018013	018014
报告期末下属分级基金的份额总额	43, 274, 163. 57 份	44, 435, 305. 55 份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2023 年 7 月 1 日-2023 年 9 月 30 日）	
	长信中证 1000 指数增强 A	长信中证 1000 指数增强 C
1. 本期已实现收益	-1, 264, 445. 64	-1, 056, 938. 47
2. 本期利润	-2, 968, 608. 05	-2, 739, 824. 65
3. 加权平均基金份额本期利润	-0. 0629	-0. 0503
4. 期末基金资产净值	41, 319, 431. 34	42, 353, 791. 64
5. 期末基金份额净值	0. 9548	0. 9532

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，封闭式基金交易佣金、开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

长信中证 1000 指数增强 A

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-7. 44%	0. 92%	-7. 52%	0. 93%	0. 08%	-0. 01%
自基金合同生效起至今	-4. 52%	0. 80%	-12. 10%	0. 92%	7. 58%	-0. 12%

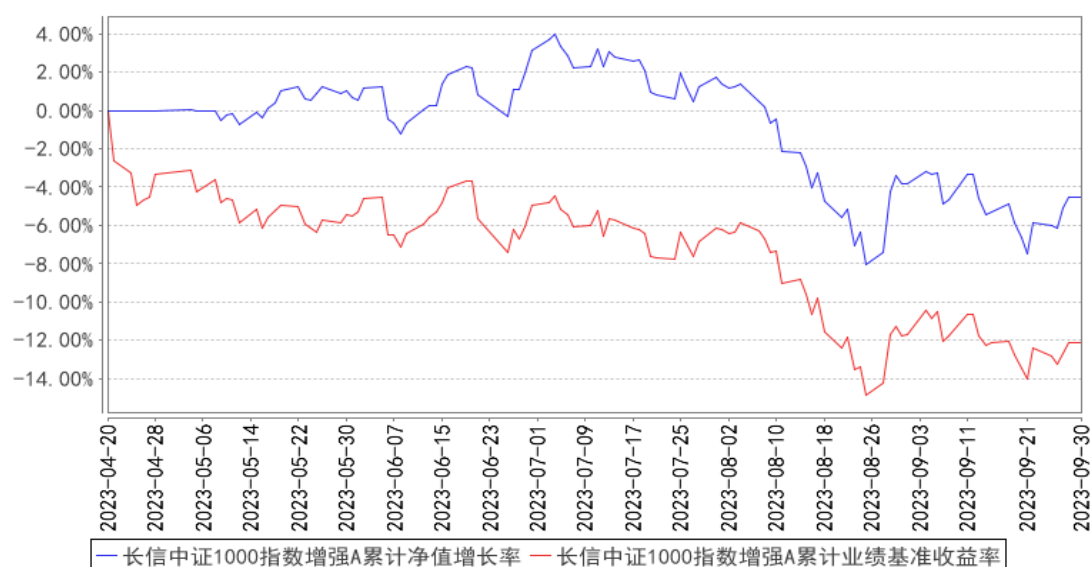
长信中证 1000 指数增强 C

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

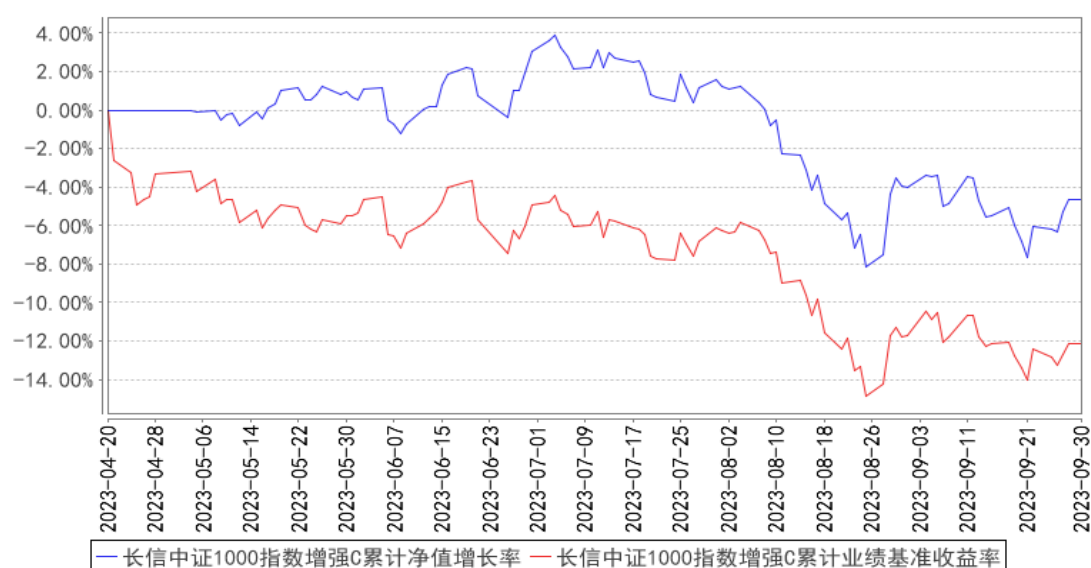
过去三个月	-7.53%	0.92%	-7.52%	0.93%	-0.01%	-0.01%
自基金合同生效起至今	-4.68%	0.80%	-12.10%	0.92%	7.42%	-0.12%

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

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



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



注：1、本基金基金合同生效日为2023年4月20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2023年4月20日至2023年9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

金各项投资比例应符合基金合同中的约定：本基金股票资产占基金资产的比例不低于基金资产的 80%，投资于港股通标的股票的比例不高于股票资产的 50%。投资于标的指数成份股及其备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货及股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者到期日在一年以内的政府债券。国债期货、股指期货、股票期权及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

截至本报告期末，本基金尚未完成建仓。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
左金保	长信量化先锋混合型证券投资基金、长信量化中小盘股票型证券投资基金、长信电子信息行业量化灵活配置混合型证券投资基金、长信低碳环保行业量化股票型证券投资基金、长信量化多策略股票型证券投资基金、长信中证科创创业 50 指数增强型证券投资基金和长信中证 1000 指数增强型证券投资基金的基金经理、总经理助理、量化投资部总监、投资决策委员会执行委员	2023 年 4 月 20 日	-	13 年	经济学硕士，武汉大学金融工程专业研究生毕业，具有基金从业资格，中国国籍。2010 年 7 月加入长信基金管理有限责任公司，从事量化投资研究和风险绩效分析工作。历任公司数量分析研究员和风险与绩效评估研究员、量化研究部总监、长信中证中央企业 100 指数证券投资基金（LOF）、长信量化多策略股票型证券投资基金、长信中证一带一路主题指数分级证券投资基金、长信中证上海改革发展主题指数型证券投资基金（LOF）、长信量化优选混合型证券投资基金（LOF）、长信利泰灵活配置混合型证券投资基金、长信国防军工量化灵活配置混合型证券投资基金、长信利发债券型证券投资基金、长信先锐债券型证券投资基金、长信量化价值精选混合型证券投资基金、长信先机两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、长信先利半年定期开放混合型证券投资基金、长信沪深 300 指数增强型证券投资基金、长信消费精选行业量化股票型证券投资基金和、长信量化价值驱动混合型证券投资基金和长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金（LOF）的基金经理。现任总

				经理助理、量化投资部总监、投资决策委员会执行委员、长信量化先锋混合型证券投资基金、长信量化中小盘股票型证券投资基金、长信电子信息行业量化灵活配置混合型证券投资基金、长信低碳环保行业量化股票型证券投资基金、长信量化多策略股票型证券投资基金、长信中证科创创业 50 指数增强型证券投资基金和长信中证 1000 指数增强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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

今年上半年 GDP 增速符合预期，同时三季度 PMI 读数也有逐步企稳迹象，经济整体呈现恢复向好的态势，但企业信心依然有待提升。在这种背景下，一系列利好政策相继出台。先是政治局会议提出“活跃资本市场、提振投资者信心”，向市场明确传达了鼓励资本市场发展的积极信号，随后央行意外降准、证监会“四箭齐发”回应了此前市场关切。我们观察到，在每一轮政策利好出台后，市场风险偏好出现明显修复，市场情绪得到明显提振，但仍受到中美利差扩大外资持续流出等的影响。国际能源价格大涨，驱动稳定盈利的红利资产相对占优，而创业板、科创板持续走低；行业分化较大，券商、地产、煤炭、医药先后有一轮结构性行情，而 TMT、军工、新能源等震荡走低；偏防守的低估值因子表现相对较好，与企业基本面相关度更高的分析师盈利预测因子、成长因子则持续回撤。

展望四季度，我们认为市场机会大于风险，更多的积极因素正在演绎。一方面，利好政策密集出台，市场投资情绪逐步回暖，政策组合拳有助于股价表现；另一方面，主要宏观指标环比上个季度已有所改善，社融高增，PMI 企稳，为上市公司基本面筑底创造条件。我们将坚持基本面为主，综合考虑短期交易情绪，中期景气度、长期竞争格局，自下而上精选景气度不断提升的优质个股，综合 alpha 模型、风险模型、交易成本模型构建投资组合，力争为投资者获取长期稳健超额收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2023 年 9 月 30 日，长信中证 1000 指数增强 A 基金份额净值为 0.9548 元，份额累计净值为 0.9548 元，本报告期内长信中证 1000 指数增强 A 净值增长率为-7.44%；长信中证 1000 指数增强 C 基金份额净值为 0.9532 元，份额累计净值为 0.9532 元，本报告期内长信中证 1000 指数增强 C 净值增长率为-7.53%，同期业绩比较基准收益率为-7.52%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	77,526,119.30	92.31
	其中：股票	77,526,119.30	92.31
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	6,414,256.42	7.64
8	其他资产	44,362.77	0.05
9	合计	83,984,738.49	100.00

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

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	49,677,836.30	59.37
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	735,648.00	0.88
E	建筑业	674,880.00	0.81
F	批发和零售业	2,117,862.00	2.53
G	交通运输、仓储和邮政业	614,828.00	0.73
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,301,265.54	9.92
J	金融业	-	-
K	房地产业	628,622.00	0.75
L	租赁和商务服务业	690,378.00	0.83
M	科学研究和技术服务业	9,023.68	0.01
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	717,942.00	0.86
S	综合	-	-
	合计	64,168,285.52	76.69

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-

C	制造业	12,533,566.05	14.98
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	824,267.73	0.99
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	-	-
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	13,357,833.78	15.96

5.2.3 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。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	002106	莱宝高科	100,300	948,838.00	1.13
2	002283	天润工业	133,100	917,059.00	1.10
3	601137	博威合金	60,200	912,030.00	1.09
4	002558	巨人网络	68,500	886,390.00	1.06
5	000612	焦作万方	169,900	873,286.00	1.04
6	601609	金田股份	130,500	870,435.00	1.04
7	002158	汉钟精机	34,700	861,948.00	1.03
8	600572	康恩贝	152,400	861,060.00	1.03
9	002367	康力电梯	97,600	855,952.00	1.02
10	688617	惠泰医疗	2,205	844,162.20	1.01

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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	688029	南微医学	7,834	599,222.66	0.72
2	002056	横店东磁	35,700	583,338.00	0.70
3	601717	郑煤机	42,700	558,516.00	0.67
4	603688	石英股份	5,000	533,350.00	0.64
5	002381	双箭股份	65,100	492,807.00	0.59

5.4 报告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。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	44,362.77
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	44,362.77

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

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。

5.11.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	长信中证 1000 指数增强 A	长信中证 1000 指数增强 C
----	------------------	------------------

报告期期初基金份额总额	120,959,749.00	224,163,165.18
报告期期间基金总申购份额	3,066,108.01	13,039,822.55
减:报告期期间基金总赎回份额	80,751,693.44	192,767,682.18
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-	-
报告期期末基金份额总额	43,274,163.57	44,435,305.55

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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。

8.2 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。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立基金的文件；
- 2、《长信中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同》；
- 3、《长信中证 1000 指数增强型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《长信中证 1000 指数增强型证券投资基金托管协议》；
- 5、报告期内在指定报刊上披露的各种公告的原稿；
- 6、长信基金管理有限责任公司营业执照、公司章程及相关资格批复文件。

9.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

9.3 查阅方式

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

长信基金管理有限责任公司

2023 年 10 月 25 日