

长信中证 1000 指数增强型证券投资基金 2024 年年度报告

2024 年 12 月 31 日

基金管理人：长信基金管理有限责任公司

基金托管人：国信证券股份有限公司

送出日期：2025 年 3 月 28 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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人国信证券股份有限公司（以下简称“国信证券”，下同）根据本基金基金合同的规定，于 2025 年 3 月 26 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。

本报告期自 2024 年 1 月 1 日起至 2024 年 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	9
§ 4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.9 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	15
§ 5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	16
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	16
§ 6 审计报告	16
6.1 审计报告基本信息	16
6.2 审计报告的基本内容	16
§ 7 年度财务报表	18
7.1 资产负债表	18
7.2 利润表	19
7.3 净资产变动表	20
7.4 报表附注	22
§ 8 投资组合报告	48

8.1 期末基金资产组合情况	48
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	48
8.3 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	49
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	54
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	57
8.6 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	57
8.7 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	58
8.8 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	58
8.9 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	58
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	58
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	58
8.12 投资组合报告附注	58
§ 9 基金份额持有人信息	59
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	59
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	59
9.3 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	60
§ 10 开放式基金份额变动	60
§ 11 重大事件揭示	60
11.1 基金份额持有人大会决议	60
11.2 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	60
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	60
11.4 基金投资策略的改变	60
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	61
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	61
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	61
11.8 其他重大事件	62
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	65
12.1 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	65
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	65
§ 13 备查文件目录	65
13.1 备查文件目录	65
13.2 存放地点	65
13.3 查阅方式	65

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	长信中证 1000 指数增强型证券投资基金	
基金简称	长信中证 1000 指数增强	
基金主代码	018013	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2023 年 4 月 20 日	
基金管理人	长信基金管理有限责任公司	
基金托管人	国信证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	190,133,422.53 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	长信中证 1000 指数增强 A	长信中证 1000 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	018013	018014
报告期末下属分级基金的份额总额	91,204,901.94 份	98,928,520.59 份

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		长信基金管理有限责任公司	国信证券股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	周永刚	薛璐
	联系电话	021-61009999	0755-22940163
	电子邮箱	zhouyg@cxfund.com.cn	03339@guosen.com.cn
客户服务电话		4007005566	0755-61897778
传真		021-61009800	0755-22940165
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区银城中路 68 号 37 层	深圳市罗湖区红岭中路 1012 号 国信证券大厦十六层至二十六层

办公地址	上海市浦东新区银城中路 68 号 9 楼、37 楼、38 楼	深圳市福田区福华一路 125 号国信金融大厦 19 楼
邮政编码	200120	518000
法定代表人	刘元瑞	张纳沙

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	立信会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市黄浦区汉口路 99 号 11 楼
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、基金净值表现及利润分配情况

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	2024 年		2023 年 4 月 20 日(基金合同生效日)-2023 年 12 月 31 日	
	长信中证 1000 指数增强 A	长信中证 1000 指数增强 C	长信中证 1000 指数增强 A	长信中证 1000 指数增强 C
本期已实现收益	4,523,743.61	5,176,786.91	1,316,411.11	4,014,952.05
本期利润	2,181,895.57	3,548,996.90	386,232.78	3,993,778.17
加权平均基金份额本期利润	0.0486	0.0816	0.0059	0.0411
本期加权平均净值利润率	5.39%	9.11%	0.60%	4.15%
本期基金份额净值增长率	7.75%	7.31%	-5.62%	-5.88%
3.1.2 期末数据和指标	2024 年末		2023 年末	
期末可供分配利润	1,538,895.49	994,057.85	-2,395,101.71	-2,336,910.29
期末可供分配基金份额利润	0.0169	0.0100	-0.0562	-0.0588
期末基金资产净值	92,743,797.43	99,922,578.44	40,232,824.22	37,423,655.51
期末基金份额净值	1.0169	1.0100	0.9438	0.9412
3.1.3 累计期末指标	2024 年末		2023 年末	
基金份额累计净值增长率	1.69%	1.00%	-5.62%	-5.88%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣

除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

3、期末可供分配利润为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

长信中证 1000 指数增强 A

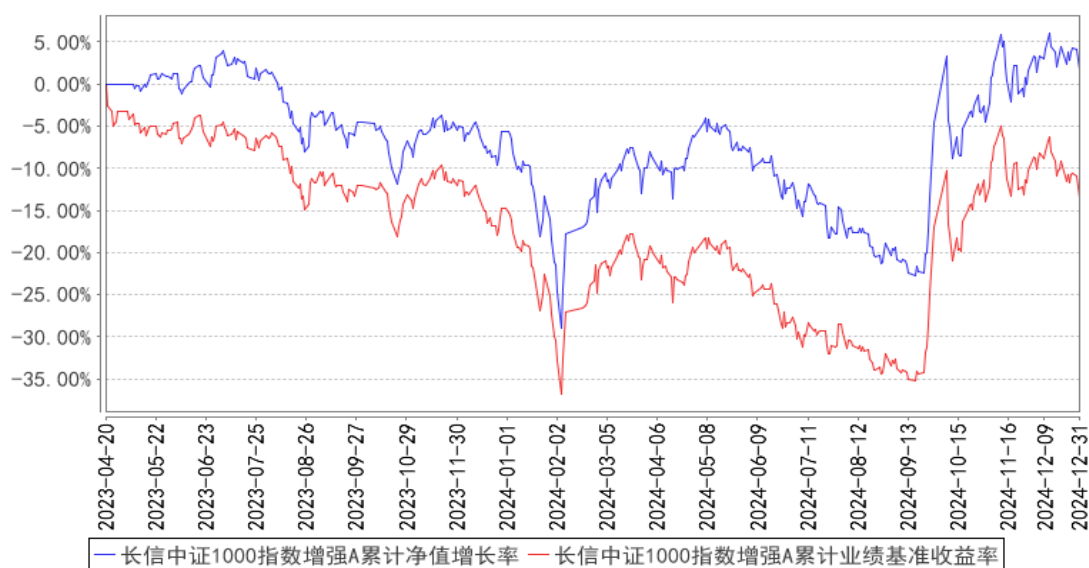
阶段	份额净值 增长率①	份额净值增 长率标准差 ②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①－③	②－④
过去三个月	6.66%	2.19%	4.23%	2.28%	2.43%	-0.09%
过去六个月	16.08%	2.06%	20.68%	2.13%	-4.60%	-0.07%
过去一年	7.75%	1.95%	1.41%	2.01%	6.34%	-0.06%
自基金合同生效 起至今	1.69%	1.59%	-13.52%	1.65%	15.21%	-0.06%

长信中证 1000 指数增强 C

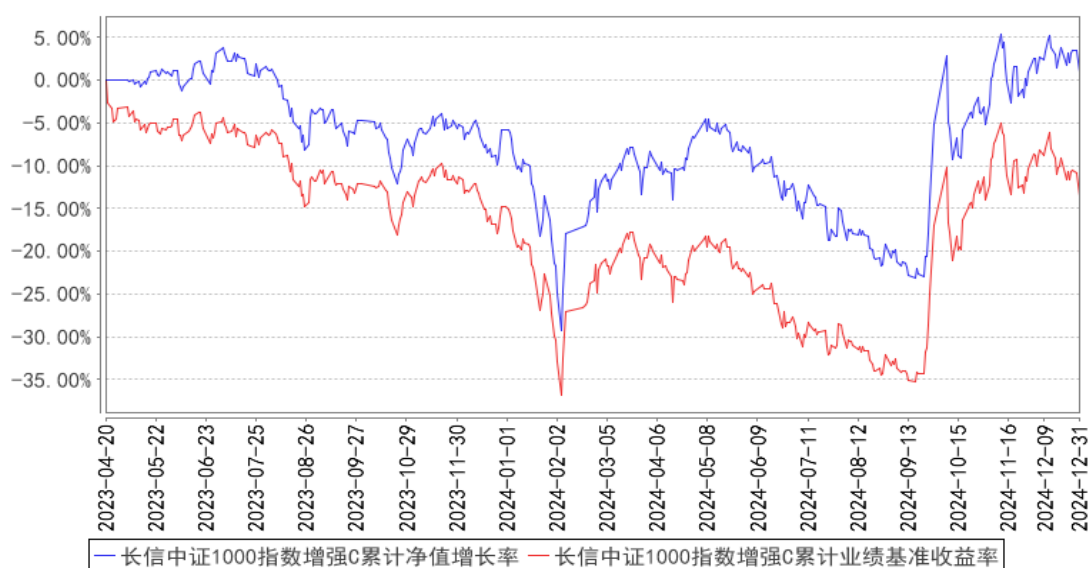
阶段	份额净值 增长率①	份额净值增 长率标准差 ②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①－③	②－④
过去三个月	6.54%	2.19%	4.23%	2.28%	2.31%	-0.09%
过去六个月	15.84%	2.06%	20.68%	2.13%	-4.84%	-0.07%
过去一年	7.31%	1.95%	1.41%	2.01%	5.90%	-0.06%
自基金合同生效 起至今	1.00%	1.59%	-13.52%	1.65%	14.52%	-0.06%

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

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



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

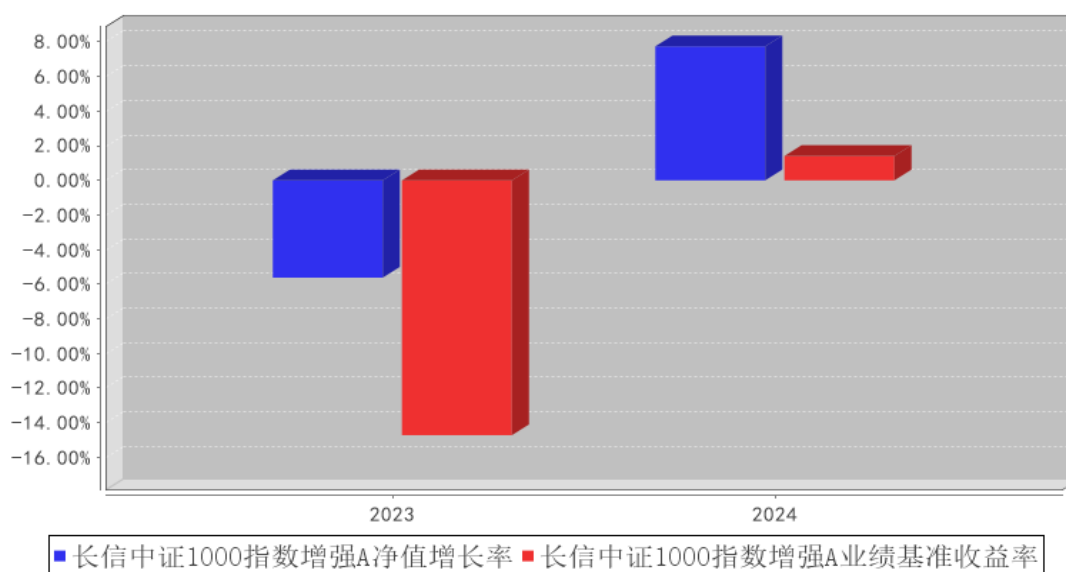


注：1、图示日期为 2023 年 4 月 20 日至 2024 年 12 月 31 日。

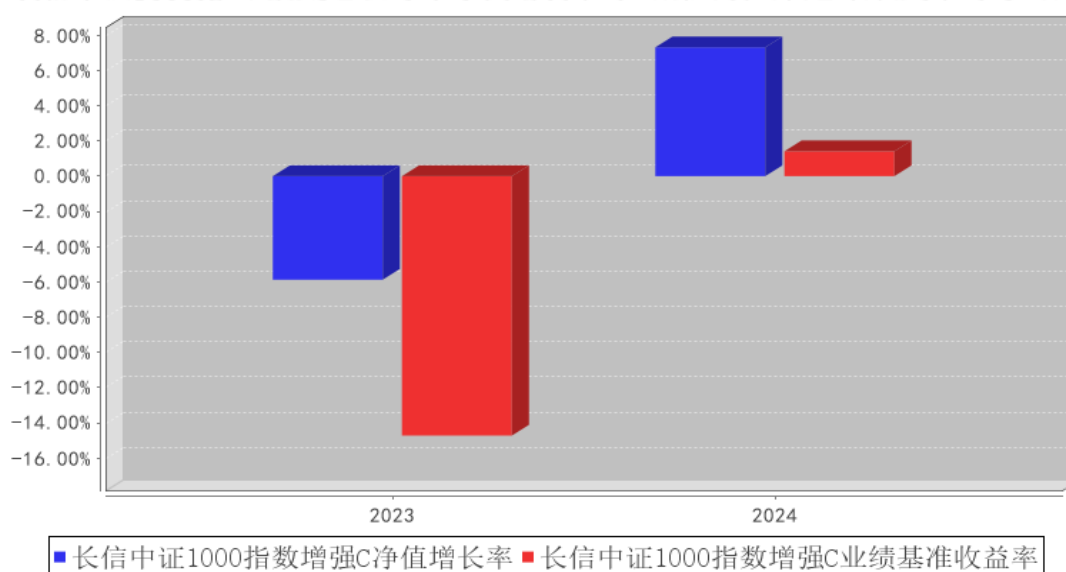
2、按基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起 6 个月内为建仓期；建仓期结束时，本基金的各项投资比例已符合基金合同的约定。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年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基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



长信中证1000指数增强C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金基金合同生效日为 2023 年 4 月 20 日，2023 年净值增长率按当年实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金基金合同生效日为2023年4月20日，本基金基金合同生效日起至本报告期末未进行利润分配。

§ 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 2024 年 12 月 31 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、长信量化先锋混合型证券投资基金、长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金、长信利鑫债券型证券投资基金 (LOF)、长信内需成长混合型证券投资基金、长信可转债债券型证券投资基金、长信利众债券型证券投资基金 (LOF)、长信纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信纯债壹号债券型证券投资基金、长信改革红利灵活配置混合型证券投资基金、长信量化中小盘股票型证券投资基金、长信利富债券型证券投资基金、长信利盈灵活配置混合型证券投资基金、长信多利灵活配置混合型证券投资基金、长信睿进灵活配置混合型证券投资基金、长信量化多策略股票型证券投资基金、长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)、长信富海纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信利保债券型证券投资基金、长信金葵纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信富全纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信利泰灵活配置混合型证券投资基金、长信利发债券型证券投资基金、长信电子信息行业量化灵活配置混合型证券投资基金、长信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、长信利尚一年定期开放混合型证券投资基金、长信乐信灵活配置混合型证券投资基金、长信全球债券证券投资基金、长信稳鑫三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长信消费精选行业量化股票型证券投资基金、长信企业精选两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、长信量化价值驱动混合型证券投资基金、长信稳裕三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长信稳进资产配置混合型基金中基金 (FOF)、长信利率债债券型证券投资基金、

长信沪深 300 指数增强型证券投资基金、长信双利优选混合型证券投资基金、长信富瑞两年定期开放债券型证券投资基金、长信颐天平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）、长信易进混合型证券投资基金、长信先锐混合型证券投资基金、长信稳健精选混合型证券投资基金、长信浦瑞 87 个月定期开放债券型证券投资基金、长信消费升级混合型证券投资基金、长信企业优选一年持有期灵活配置混合型证券投资基金、长信稳健均衡 6 个月持有期混合型证券投资基金、长信优质企业混合型证券投资基金、长信内需均衡混合型证券投资基金、长信 30 天滚动持有短债债券型证券投资基金、长信稳惠债券型证券投资基金、长信稳丰债券型证券投资基金、长信先进装备三个月持有期混合型证券投资基金、长信颐和平平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）、长信颐年平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）、长信稳健增长一年持有期混合型证券投资基金、长信稳健成长混合型证券投资基金、长信企业成长三年持有期混合型证券投资基金、长信稳兴三个月定期开放债券型证券投资基金、长信稳航 30 天持有期中短债债券型证券投资基金、长信稳恒债券型证券投资基金、长信中证科创创业 50 指数增强型证券投资基金、长信均衡策略一年持有期混合型证券投资基金、长信中证 1000 指数增强型证券投资基金、长信均衡优选混合型证券投资基金、长信 90 天滚动持有债券型证券投资基金、长信稳固 60 天滚动持有债券型证券投资基金、长信汇智量化选股混合型证券投资基金、长信 120 天滚动持有债券型证券投资基金、长信中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、长信优势行业混合型证券投资基金、长信 180 天持有期债券型证券投资基金、长信富安纯债 180 天持有期债券型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
左金保	长信量化先锋混合型证券投资基金、长信量化中小盘股票型证券投资基金、长信电子信息行业量化灵活配置混合型证券投资基金、长信低碳环保行业量化股票型证券投资	2023 年 4 月 20 日	-	14 年	经济学硕士，武汉大学金融工程专业研究生毕业，具有基金从业资格，中国国籍。2010 年 7 月加入长信基金管理有限公司，从事量化投资研究和风险绩效分析工作。历任公司数量分析研究员和风险与绩效评估研究员、量化研究部总监、总经理助理、长信中证中央企业 100 指数证券投资基金（LOF）、长信量化多策略股票型证券投资基金、长信中证一带一路主题指数分级证券投资基金、长信中证上海改革发展主题指数型证券投资基金（LOF）、长信量化优选混合型证券投资基金（LOF）、长信利泰灵活配置混合型

	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、长信中证 1000 指数增强型证券投资基金和长信汇智量化选股混合型证券投资基金的基金经理、量化投资管理中心总经理、量化投资部总监				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、长信量化价值驱动混合型证券投资基金和长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金（LOF）的基金经理。现任量化投资管理中心总经理、量化投资部总监、长信量化先锋混合型证券投资基金、长信量化中小盘股票型证券投资基金、长信电子信息行业量化灵活配置混合型证券投资基金、长信低碳环保行业量化股票型证券投资基金、长信量化多策略股票型证券投资基金、长信中证科创创业 50 指数增强型证券投资基金、长信中证 1000 指数增强型证券投资基金和长信汇智量化选股混合型证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--	---

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

2、证券从业的含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作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、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 公平交易制度和控制方法

1、所有投资对象的投资指令必须经由交易部门总监或其授权人审核分配至交易人员执行。进

行投资指令分配的人员必须保证投资指令得到公平对待。

2、公司使用的交易执行软件系统必须具备如下功能：

(1) 严格按照时间顺序发送委托指令；

(2) 对于多个投资组合在同一时点就同一证券下达的相同方向的投资指令，并且市价在限价范围内的，系统自动将交易员针对该证券下达的每笔委托自动按照指令数量比例分拆为各投资组合的委托指令。对于不同投资组合且不同投资经理针对交易所同一证券的同一方向竞价交易指令，指令数量比例达到 5:1 或以上的，根据市场情况审核后通过人工分发给不同交易员豁免公平交易。

3、交易人员对于接收到的交易指令依照价格优先、时间优先的顺序执行。在执行多个投资组合在同一时点就同一证券下达的相同方向的交易所投资指令时，除制度规定的例外指令外，系统已强制开启公平交易开关。

4、对于不同投资组合均进行债券一级市场申购、非公开发行股票申购等非集中竞价交易的投资对象，交易部门必须严格独立接收各投资组合的投资指令，在申购结果产生前，不得以任何形式向任何人泄露各投资指令的内容，包括指令价格及数量等要素。

5、对于各投资组合以独立账户名义进行申购的投资对象，除需经过公平性审核的例外指令外，申购获配的证券数量由投资管理系统接收各类证券登记结算机构发送的数据进行分配。交易部门根据证券发行人在指定公开披露媒体上披露的申购结果对系统内分配数量进行核准，数量不符的，应当第一时间告知各投资管理部门的总监及监察稽核部总监。对于以公司名义进行申购的投资对象，公司在获配额度确定后，严格按照价格优先的原则在各投资组合间进行分配。申购价格相同的投资组合则根据投资指令的数量按比例进行分配。确因特殊原因不能按照上述原则进行分配的，应启动异常交易识别流程，审核通过的，可以进行相应分配。

4.3.2 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。

4.3.3 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。同时，对本年度同向交易价差进行专项分析，未发现异常情况。

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

2024 年 A 股市场呈现出显著的波动性和结构性特征。年初，市值因子对市场形成明显扰动，小微盘股因流动性压力遭遇大幅调整，但春节后迅速反弹，市场表现出较强的修复能力。宏观层面，尽管 PMI 数据超预期，但地产和消费数据显示内需恢复仍面临挑战。四月底中央政治局会议释放积极信号，提振了市场情绪，然而，社融增速放缓以及海外快速降息预期落空等因素对市场形成新的压力，导致市场重心下移，银行、煤炭等高分红板块获得资金青睐，大盘价值风格占据主导地位。进入三季度，经济增速压力加大，9 月政治局会议的积极信号为市场注入信心，催化了市场的快速反弹，并推动主要股指创下年内新高，科技类核心资产表现尤为突出。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2024 年 12 月 31 日，长信中证 1000 指数增强 A 基金份额净值为 1.0169 元，份额累计净值为 1.0169 元，本报告期内长信中证 1000 指数增强 A 净值增长率为 7.75%；长信中证 1000 指数增强 C 基金份额净值为 1.0100 元，份额累计净值为 1.0100 元，本报告期内长信中证 1000 指数增强 C 净值增长率为 7.31%，同期业绩比较基准收益率为 1.41%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，在更加积极有为的宏观政策基调下，我们认为“适度宽松”或将是 2025 年政策主旋律，随着经济基本面趋于改善，上市公司业绩也有望迎来边际好转，我们对 A 股市场的展望仍积极乐观。我们将坚持基本面为主，综合考虑短期交易情绪，中期景气度、长期竞争格局，自下而上精选景气度边际改善的优质个股，综合 alpha 模型、风险模型、交易成本模型构建投资组合，力争为投资者获取长期稳健超额收益。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本年度内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及配套法律法规，时刻以合规运作、防范风险为核心，以维护基金持有人利益为宗旨，保证基金合同得到严格履行。公司监察稽核部独立地开展工作，对基金运作进行事前、事中与事后的监督检查，发现问题及时提出改进建议并督促业务部门进行整改。

本年度内，为确保监管要求的有效实施，公司监察稽核部根据各项法律法规监管政策性要求以及公司内部控制执行情况，积极开展公司业务流程及风险梳理的工作，适时组织召开内部控制委员会会议，对各项监管要求进行解读，并对各业务部门业务流程及制度规范的调整进行深入探讨，加强对关键业务岗位合规传导及培训工作。

本年度内，监察稽核部以组合压力测试为主要方式，定期对投资组合的风险状况进行检测，

对投资组合整体流动性情况进行分析，并适时召集各业务部门的沟通会议就各项可能面临的风险进行沟通、讨论，防范组合风险事件发生。

本基金管理人承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则，秉持风控优先、内控从严的理念，不断提高内部监察稽核工作的科学性和实效性、并完善内部控制体系，做好各项内控工作，努力防范和控制各种风险，确保基金资产的规范运作，充分保障基金持有人的合法权益。

4.7 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、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。

4.8 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。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

报告期内，国信证券股份有限公司（以下称“托管人”）严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规的规定及基金合同的约定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，

不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

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

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	信会师报字[2025]第 ZA30479 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	长信中证 1000 指数增强型证券投资基金全体持有人
审计意见	我们审计了长信中证 1000 指数增强型证券投资基金的财务报表，包括 2024 年 12 月 31 日的资产负债表，2024 年度的利润表和净资产变动表以及财务报表附注。 我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）、中国证券投资基金业协会（以下简称“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，公允反映了长信中证 1000 指数增强型证券投资基金 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年度的经营成果和净资产变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于长信中证 1000 指数增强型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	—
其他事项	—
其他信息	—
管理层和治理层对财务报表的责任	长信中证 1000 指数增强型证券投资基金的基金管理人长信基金管理有限责任公司（以下简称“基金管理人”）管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

	在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估长信中证 1000 指数增强型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算长信中证 1000 指数增强型证券投资基金、终止运营或别无其他现实的选择。 基金管理人治理层负责监督长信中证 1000 指数增强型证券投资基金的财务报告过程。	
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。 在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作： (一)识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。 (二)了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。 (三)评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。 (四)对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对长信中证 1000 指数增强型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致长信中证 1000 指数增强型证券投资基金不能持续经营。 (五)评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	立信会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	吴凌志	刘乐君
会计师事务所的地址	上海市黄浦区南京东路 61 号 4 楼	
审计报告日期	2025 年 3 月 26 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：长信中证 1000 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	7.4.7.1	9,807,425.96	4,927,876.74
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	167,643,582.37	72,782,267.31
其中：股票投资		167,643,582.37	72,782,267.31
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		27,618,026.95	227,177.22
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	-
资产总计		205,069,035.28	77,937,321.27
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		12,184,642.88	46,607.39

应付管理人报酬		93,603.77	64,825.59
应付托管费		9,360.40	6,482.52
应付销售服务费		18,633.25	12,924.21
应付投资顾问费		—	—
应交税费		—	—
应付利润		—	—
递延所得税负债		—	—
其他负债	7.4.7.9	96,419.11	150,001.83
负债合计		12,402,659.41	280,841.54
净资产：			
实收基金	7.4.7.10	190,133,422.53	82,388,491.73
其他综合收益	7.4.7.11	—	—
未分配利润	7.4.7.12	2,532,953.34	-4,732,012.00
净资产合计		192,666,375.87	77,656,479.73
负债和净资产总计		205,069,035.28	77,937,321.27

注：1、报告截止日 2024 年 12 月 31 日，长信中证 1000 指数增强 A 份额净值 1.0169 元；长信中证 1000 指数增强 C 份额净值 1.0100 元；基金份额总额为 190,133,422.53 份，其中长信中证 1000 指数增强 A 份额 91,204,901.94 份。长信中证 1000 指数增强 C 份额 98,928,520.59 份。

2、本基金的基金合同于 2023 年 4 月 20 日正式生效，上年度可比期间为 2023 年 4 月 20 日至 2023 年 12 月 31 日，上年度可比期间不满一个会计年度。

7.2 利润表

会计主体：长信中证 1000 指数增强型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 4 月 20 日（基金 合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
一、营业总收入		6,844,893.12	6,057,604.39
1. 利息收入		23,893.70	274,376.47
其中：存款利息收入	7.4.7.13	23,893.70	216,657.04
债券利息收入		—	—
资产支持证券利息 收入		—	—
买入返售金融资产 收入		—	57,719.43
其他利息收入		—	—
2. 投资收益（损失以“-” 填列）		10,644,734.01	6,548,734.76
其中：股票投资收益	7.4.7.14	9,217,216.63	3,853,072.15

基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	-54.12	-
资产支持证券投资 收益	7.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-	-
股利收益	7.4.7.19	1,427,571.50	2,695,662.61
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）	7.4.7.20	-3,969,638.05	-951,352.21
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-” 号填列）	7.4.7.21	145,903.46	185,845.37
减：二、营业总支出		1,114,000.65	1,677,593.44
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	794,102.54	1,138,725.36
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	79,410.26	113,872.46
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	155,467.63	273,987.84
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	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	207.78
8. 其他费用	7.4.7.23	85,020.22	150,800.00
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		5,730,892.47	4,380,010.95
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-” 号填列）		5,730,892.47	4,380,010.95
五、其他综合收益的税后 净额		-	-
六、综合收益总额		5,730,892.47	4,380,010.95

注：本基金的基金合同于 2023 年 4 月 20 日正式生效，上年度可比期间为 2023 年 4 月 20 日至 2023 年 12 月 31 日，上年度可比期间不满一个会计年度。

7.3 净资产变动表

会计主体：长信中证 1000 指数增强型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合 收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	82,388,491.73	-	-4,732,012.00	77,656,479.73
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	82,388,491.73	-	-4,732,012.00	77,656,479.73
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	107,744,930.80	-	7,264,965.34	115,009,896.14
（一）、综合收益总额	-	-	5,730,892.47	5,730,892.47
（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）	107,744,930.80	-	1,534,072.87	109,279,003.67
其中：1. 基金申购款	259,729,102.02	-	-7,823,001.43	251,906,100.59
2. 基金赎回款	-151,984,171.22	-	9,357,074.30	-142,627,096.92
（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	190,133,422.53	-	2,532,953.34	192,666,375.87
项目	上年度可比期间 2023 年 4 月 20 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合 收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	-	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	343,759,176.31	-	-	343,759,176.31

三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-261,370,684.58	-	-4,732,012.00	-266,102,696.58
(一)、综合收益总额	-	-	4,380,010.95	4,380,010.95
(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)	-261,370,684.58	-	-9,112,022.95	-270,482,707.53
其中：1. 基金申购款	42,713,479.81	-	-2,370,304.15	40,343,175.66
2. 基金赎回款	-304,084,164.39	-	-6,741,718.80	-310,825,883.19
(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	82,388,491.73	-	-4,732,012.00	77,656,479.73

注：本基金的基金合同于 2023 年 4 月 20 日正式生效，上年度可比期间为 2023 年 4 月 20 日至 2023 年 12 月 31 日，上年度可比期间不满一个会计年度。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

长信中证 1000 指数增强型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2023]349 号《关于准予长信中证 1000 指数增强型证券投资基金注册的批复》注册，由长信基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《长信中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 343,716,122.89 元，经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)德师报(验)字(23)第 00111 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《长信中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同》于 2023 年 4 月 20 日正式生效，基金合

同生效日的基金份额总额为 343,759,176.31 份基金份额,其中认购资金利息折合 43,053.42 份基金份额。本基金的基金管理人为长信基金管理有限责任公司,基金托管人为国信证券股份有限公司。

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《长信中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括标的指数成份股及其备选成份股、国内依法发行或上市的其他股票(包括主板、创业板和其他经中国证监会核准或注册上市的股票)、存托凭证、港股通标的股票、债券(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、地方政府债券、政府支持机构债券、可转换债券、可交换债券、可分离交易可转债及其他经中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单、货币市场工具、国债期货、股指期货、股票期权以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金可以根据有关法律法规规定进行融资及转融通证券出借业务。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:中证 1000 指数收益率 $\times$ 95%+中国人民银行人民币活期存款利率(税后) $\times$ 5%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本

准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《长信中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2024 年度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 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。比较财务报表的实际编制期间为 2023 年 4 月 20 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具,是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时,确认相关的金融资产、金融负债或权益工具。

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为:以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具,分别采用以下两种方式进行计量:

以摊余成本计量:

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标,且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致,即在特定日期产生的现金流量,仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产

主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

(3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期

信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2)该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3)该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1)存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2)当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

本基金发行的份额作为可回售工具具备以下特征：(1) 赋予基金份额持有人在基金清算时按比例份额获得该基金净资产的权利，这里所指基金净资产是扣除所有优先于该基金份额对基金资产要求权之后的剩余资产；这里所指按比例份额是清算时将基金的净资产分拆为金额相等的单位，并且将单位金额乘以基金份额持有人所持有的单位数量；(2) 该工具所属的类别次于其他所有工具类别，即本基金份额在归属于该类别前无须转换为另一种工具，且在清算时对基金资产没有优先于其他工具的要求权；(3) 该工具所属的类别中(该类别次于其他所有工具类别)，所有工具具有相同的特征(例如它们必须都具有可回售特征，并且用于计算回购或赎回价格的公式或其他方法都相同)；(4) 除了发行方应当以现金或其他金融资产回购或赎回该基金份额的合同义务外，该工具不满足金融负债定义中的任何其他特征；(5) 该工具在存续期内的预计现金流量总额，应当实质上基于该基金存续期内基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括本基金的任何影响)。

可回售工具，是指根据合同约定，持有方有权将该工具回售给发行方以获取现金或其他金融资产的权利，或者在未来某一不确定事项发生或者持有方死亡或退休时，自动回售给发行方的金融工具。

本基金没有同时具备下列特征的其他金融工具或合同：(1) 现金流量总额实质上基于基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括该基金或合同的任何影响)；(2) 实质上限制或固定了上述工具持有方所获得的剩余回报。

本基金将实收基金分类为权益工具，列报于净资产。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，

申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 本基金在符合基金有关分红条件的前提下可进行收益分配，具体分红方案见基金管理人根据基金运作情况届时不定期发布的相关分红公告，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

(2) 由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，而 C 类基金份额收取销售服务费，各类别基金份额对应的可供分配利润将有所不同。本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

(3) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

(4) 基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的各类基金份额

净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在符合法律法规及基金合同约定，并对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可对基金收益分配原则和支付方式进行调整，不需召开基金份额持有人大会。

7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

7.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6 号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市

场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566 号《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 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。

7.4.6 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[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》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。

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。

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

(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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
活期存款	861,833.91	1,562,738.72
等于：本金	861,714.92	1,562,512.62
加：应计利息	118.99	226.10
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	8,945,592.05	3,365,138.02
等于：本金	8,945,400.47	3,364,907.79
加：应计利息	191.58	230.23
减：坏账准备	-	-
合计	9,807,425.96	4,927,876.74

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。

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2024 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		172,564,572.63	-	167,643,582.37	-4,920,990.26
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		172,564,572.63	-	167,643,582.37	-4,920,990.26
项目		上年度末 2023 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		73,733,619.52	-	72,782,267.31	-951,352.21
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		73,733,619.52	-	72,782,267.31	-951,352.21

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末及上年度末均未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末均无买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 债权投资

7.4.7.5.1 债权投资情况

本基金本报告期末及上年度末均无债权投资。

7.4.7.6 其他债权投资

7.4.7.6.1 其他债权投资情况

本基金本报告期末及上年度末未持有其他债权投资。

7.4.7.7 其他权益工具投资

7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

本基金本报告期末及上年度末未持有其他权益工具投资。

7.4.7.8 其他资产

本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	1,419.11	1.83
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	15,000.00	50,000.00
预提信息披露费	80,000.00	100,000.00
合计	96,419.11	150,001.83

7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

长信中证 1000 指数增强 A

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额

上年度末	42,627,925.93	42,627,925.93
本期申购	120,633,361.03	120,633,361.03
本期赎回（以“-”号填列）	-72,056,385.02	-72,056,385.02
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	91,204,901.94	91,204,901.94

长信中证 1000 指数增强 C

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	39,760,565.80	39,760,565.80
本期申购	139,095,740.99	139,095,740.99
本期赎回（以“-”号填列）	-79,927,786.20	-79,927,786.20
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	98,928,520.59	98,928,520.59

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

7.4.7.11 其他综合收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无其他综合收益。

7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

长信中证 1000 指数增强 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-1,365,784.85	-1,029,316.86	-2,395,101.71
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-1,365,784.85	-1,029,316.86	-2,395,101.71
本期利润	4,523,743.61	-2,341,848.04	2,181,895.57
本期基金份额交易产生的变动数	6,573,764.54	-4,821,662.91	1,752,101.63
其中：基金申购款	2,115,426.45	-4,746,725.66	-2,631,299.21
基金赎回款	4,458,338.09	-74,937.25	4,383,400.84
本期已分配利润	-	-	-
本期末	9,731,723.30	-8,192,827.81	1,538,895.49

长信中证 1000 指数增强 C

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

上年度末	-1,376,053.16	-960,857.13	-2,336,910.29
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-1,376,053.16	-960,857.13	-2,336,910.29
本期利润	5,176,786.91	-1,627,790.01	3,548,996.90
本期基金份额交易产生的变动数	6,041,487.09	-6,259,515.85	-218,028.76
其中：基金申购款	1,998,649.13	-7,190,351.35	-5,191,702.22
基金赎回款	4,042,837.96	930,835.50	4,973,673.46
本期已分配利润	-	-	-
本期末	9,842,220.84	-8,848,162.99	994,057.85

7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 4 月 20 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	17,199.06	172,791.34
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	6,693.35	43,847.90
结算备付金利息收入	-	-
其他	1.29	17.80
合计	23,893.70	216,657.04

注：1、其他为保证金利息收入和申购款利息收入。

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

7.4.7.14 股票投资收益

7.4.7.14.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 4 月 20 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	504,279,320.05	808,177,054.64
减：卖出股票成本总额	494,286,197.96	802,259,012.79
减：交易费用	775,905.46	2,064,969.70
买卖股票差价收入	9,217,216.63	3,853,072.15

7.4.7.15 债券投资收益

7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日 至2024年12月 31日	上年度可比期间 2023年4月20日（基金 合同生效日）至2023 年12月31日
债券投资收益——利息收入	6.08	—
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-60.20	—
债券投资收益——赎回差价收入	—	—
债券投资收益——申购差价收入	—	—
合计	-54.12	—

7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日 至2024年12月 31日	上年度可比期间 2023年4月20日（基金 合同生效日）至2023 年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	101,134.41	—
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	100,720.00	—
减：应计利息总额	474.41	—
减：交易费用	0.20	—
买卖债券差价收入	-60.20	—

7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均无债券投资赎回差价收入。

7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均无债券投资申购差价收入。

7.4.7.16 资产支持证券投资收益

7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

7.4.7.17 贵金属投资收益

7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

7.4.7.18 衍生工具收益

7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益。

7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益。

7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 4 月 20 日（基金合同生效 日）至 2023 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	1,427,571.50	2,695,662.61
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	1,427,571.50	2,695,662.61

7.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 4 月 20 日（基金合 同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	-3,969,638.05	-951,352.21
股票投资	-3,969,638.05	-951,352.21
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
基金投资	-	-
贵金属投资	-	-
其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
权证投资	-	-
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值 变动产生的预估增值税	-	-
合计	-3,969,638.05	-951,352.21

7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 4 月 20 日（基金 合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	145,844.82	185,782.71
基金转换费收入	58.64	62.66
合计	145,903.46	185,845.37

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。

7.4.7.22 信用减值损失

本基金本报告期及上年度可比期间无信用减值损失。

7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 4 月 20 日（基金合同生效日） 至 2023 年 12 月 31 日
审计费用	5,000.00	50,000.00
信息披露费	80,000.00	100,000.00
证券出借违约金	-	-
其他费用	20.22	800.00
合计	85,020.22	150,800.00

注：其他费用为证券账户开户费、存托服务费。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 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。

7.4.8.2 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。

7.4.9 关联方关系

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
国信证券股份有限公司(以下简称“国信证券”)	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
上海海欣集团股份有限公司(以下简称“海欣集团”)	基金管理人的股东
武汉钢铁有限公司(以下简称“武钢有限”)	基金管理人的股东
上海彤胜投资管理中心(有限合伙)(以下简称“彤胜投资”)	基金管理人的股东
上海彤骏投资管理中心(有限合伙)(以下简称“彤骏投资”)	基金管理人的股东
上海长江财富资产管理有限公司(以下简称“长江财富”)	基金管理人的子公司
长江期货股份有限公司(以下简称“长江期货”)	基金管理人的股东的子公司

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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的股票交易。

7.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的债券交易。

7.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

7.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 4 月 20 日（基金合 同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	794,102.54	1,138,725.36
其中：应支付销售机构的客户维护费	372,589.83	551,712.51
应支付基金管理人的净管理费	421,512.71	587,012.85

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值×1.00%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值×管理费率/当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 4 月 20 日（基金合 同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	79,410.26	113,872.46

注：支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值×0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值×托管费率/当年天数。

7.4.10.2.3 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	长信中证 1000 指数增强 A	长信中证 1000 指数增强 C	合计
国信证券	-	5,545.50	5,545.50

合计	-	5,545.50	5,545.50
获得销售服务费的 各关联方名称	上年度可比期间 2023 年 4 月 20 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	长信中证 1000 指数增强 A	长信中证 1000 指数增强 C	合计
国信证券	-	-	-
合计	-	-	-

注：根据基金合同的规定，本基金 A 类份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费率年费率为 0.40%。C 类基金份额的基金销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.40% 年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日基金销售服务费=前一日基金资产净值×0.40%÷当年天数。

7.4.10.3 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。

7.4.10.4 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

7.4.10.4.1 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。

7.4.10.4.2 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。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 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及上年度可比期间内均未运用固有资金投资本基金。

7.4.10.5.2 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年末及上年度末均未持有本基金。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

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

7.4.10.7 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。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金在本报告期及上年度可比期间均无其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

本报告期本基金未进行利润分配。

7.4.12 期末（2024 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未因认购新发/增发证券而持有流通受限证券。

7.4.12.2 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。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 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。

7.4.12.3.2 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。

7.4.12.4 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。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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。

7.4.13.2 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同责任，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。本基金的银行存款由本基金的托管人国信证券股份有限公司转存于交通银行股份有限公司，与该银行存款相关的信用风险不重大。

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

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估并采用券款对付交割方式以控制相应的信用风险。

7.4.13.2.1 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。

7.4.13.2.2 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。

7.4.13.2.3 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。

7.4.13.2.4 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。

7.4.13.2.5 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。

7.4.13.2.6 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。

7.4.13.3 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。

7.4.13.3.1 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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 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	9,807,425.96	-	-	-	-	9,807,425.96
交易性金融资产	-	-	-	-	167,643,582.37	167,643,582.37
应收申购款	-	-	-	-	27,618,026.95	27,618,026.95
资产总计	9,807,425.96	-	-	-	195,261,609.32	205,069,035.28
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	12,184,642.88	12,184,642.88
应付管理人报酬	-	-	-	-	93,603.77	93,603.77
应付托管费	-	-	-	-	9,360.40	9,360.40
应付销售服务费	-	-	-	-	18,633.25	18,633.25

其他负债	-	-	-	-	96,419.11	96,419.11
负债总计	-	-	-	-	12,402,659.41	12,402,659.41
利率敏感度缺口	9,807,425.96	-	-	-	182,858,949.91	192,666,375.87
上年度末 2023 年 12 月 31 日	6 个月以内	6 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产						
货币资金	4,927,876.74	-	-	-	-	4,927,876.74
交易性金融资产	-	-	-	-	72,782,267.31	72,782,267.31
应收申购款	-	-	-	-	227,177.22	227,177.22
资产总计	4,927,876.74	-	-	-	73,009,444.53	77,937,321.27
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	46,607.39	46,607.39
应付管理人报酬	-	-	-	-	64,825.59	64,825.59
应付托管费	-	-	-	-	6,482.52	6,482.52
应付销售服务费	-	-	-	-	12,924.21	12,924.21
其他负债	-	-	-	-	150,001.83	150,001.83
负债总计	-	-	-	-	280,841.54	280,841.54
利率敏感度缺口	4,927,876.74	-	-	-	72,728,602.99	77,656,479.73

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金于本报告期末未持有债券，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。

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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 12 月 31 日，本基金面临的其他市场价格风险列示如下：

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日		上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	167,643,582.37	87.01	72,782,267.31	93.72
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	167,643,582.37	87.01	72,782,267.31	93.72

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	在 95%的置信区间内，基金资产组合的市场价格风险		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024 年 12 月 31 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	VaR 值为 4.52% (2023 年 12 月 31 日 VaR 值为 3.48%)	-8,703,276.98	-2,700,646.66

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

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	167,643,582.37	72,754,607.78
第二层次	-	-
第三层次	-	27,659.53
合计	167,643,582.37	72,782,267.31

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	27,659.53	27,659.53
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	-27,659.53	-27,659.53
其中：计入损益的利得或损失	-	-27,659.53	-27,659.53
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-

期末余额	-	-	-
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-	-
项目	上年度可比期间 2023年4月20日（基金合同生效日）至2023年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	30,748.67	30,748.67
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	-3,089.14	-3,089.14
其中：计入损益的利得或损失	-	-3,089.14	-3,089.14
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	27,659.53	27,659.53
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-3,089.14	-3,089.14

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
-	-	-	-	-	-
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
流通受限股票	27,659.53	平均价格亚式期权模型	预期波动率	19.69%-37.46%	负相关

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

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

31 日：同)。

7.4.14.4 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。

7.4.15 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。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	167,643,582.37	81.75
	其中：股票	167,643,582.37	81.75
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	9,807,425.96	4.78
8	其他各项资产	27,618,026.95	13.47
9	合计	205,069,035.28	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。

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	2,186,750.00	1.13
B	采矿业	713,105.00	0.37
C	制造业	108,668,571.46	56.40
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,497,792.00	0.78
E	建筑业	1,482,956.00	0.77
F	批发和零售业	519,063.00	0.27
G	交通运输、仓储和邮政业	3,922,190.00	2.04
H	住宿和餐饮业	-	-

I	信息传输、软件和信息技术服务业	16,657,520.84	8.65
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	2,741,098.72	1.42
N	水利、环境和公共设施管理业	1,371,060.00	0.71
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	1,126,118.00	0.58
S	综合	-	-
	合计	140,886,225.02	73.12

8.2.2 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	392,084.00	0.20
B	采矿业	-	-
C	制造业	22,751,697.35	11.81
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	1,507,012.00	0.78
J	金融业	257,985.00	0.13
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	582,855.00	0.30
M	科学研究和技术服务业	764,556.00	0.40
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	501,168.00	0.26
S	综合	-	-
	合计	26,757,357.35	13.89

8.2.3 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。

8.3 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

8.3.1 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	000528	柳工	151,100	1,822,266.00	0.95

2	002139	拓邦股份	122,800	1,671,308.00	0.87
3	300088	长信科技	251,700	1,646,118.00	0.85
4	688019	安集科技	11,780	1,641,660.80	0.85
5	688200	华峰测控	15,400	1,609,300.00	0.84
6	300035	中科电气	107,600	1,608,620.00	0.83
7	603236	移远通信	23,200	1,587,808.00	0.82
8	300115	长盈精密	97,400	1,581,776.00	0.82
9	300666	江丰电子	22,600	1,569,570.00	0.81
10	002245	蔚蓝锂芯	146,500	1,566,085.00	0.81
11	300627	华测导航	37,300	1,559,140.00	0.81
12	000581	威孚高科	82,500	1,557,600.00	0.81
13	600216	浙江医药	97,700	1,549,522.00	0.80
14	600894	广日股份	105,100	1,534,460.00	0.80
15	600446	金证股份	88,300	1,522,292.00	0.79
16	000682	东方电子	141,700	1,517,607.00	0.79
17	000970	中科三环	146,200	1,516,094.00	0.79
18	300674	宇信科技	77,400	1,510,848.00	0.78
19	601126	四方股份	88,600	1,502,656.00	0.78
20	600428	中远海特	205,800	1,502,340.00	0.78
21	603393	新天然气	49,300	1,492,311.00	0.77
22	300777	中简科技	52,700	1,490,883.00	0.77
23	600667	太极实业	214,300	1,482,956.00	0.77
24	300773	拉卡拉	83,700	1,481,490.00	0.77
25	600273	嘉化能源	185,400	1,477,638.00	0.77
26	002396	星网锐捷	77,800	1,477,422.00	0.77
27	300409	道氏技术	108,200	1,472,602.00	0.76
28	600320	振华重工	375,300	1,471,176.00	0.76
29	600552	凯盛科技	128,800	1,469,608.00	0.76
30	600210	紫江企业	221,500	1,464,115.00	0.76
31	600420	国药现代	122,600	1,463,844.00	0.76
32	002906	华阳集团	47,600	1,463,700.00	0.76
33	300236	上海新阳	38,900	1,453,693.00	0.75
34	300598	诚迈科技	30,000	1,452,000.00	0.75
35	002011	盾安环境	133,800	1,446,378.00	0.75
36	000969	安泰科技	129,300	1,441,695.00	0.75
37	002043	兔宝宝	121,100	1,438,668.00	0.75
38	000727	冠捷科技	515,500	1,433,090.00	0.74
39	002003	伟星股份	101,100	1,432,587.00	0.74
40	300618	寒锐钴业	42,400	1,431,848.00	0.74
41	300079	数码视讯	263,600	1,426,076.00	0.74
42	600063	皖维高新	355,400	1,421,600.00	0.74
43	600366	宁波韵升	193,100	1,421,216.00	0.74
44	002705	新宝股份	93,700	1,405,500.00	0.73

45	002226	江南化工	259,300	1,405,406.00	0.73
46	002204	大连重工	279,800	1,393,404.00	0.72
47	002023	海特高新	136,700	1,387,505.00	0.72
48	600073	上海梅林	199,900	1,387,306.00	0.72
49	002626	金达威	91,657	1,384,020.70	0.72
50	605333	沪光股份	42,400	1,383,512.00	0.72
51	688372	伟测科技	23,636	1,383,178.72	0.72
52	300232	洲明科技	201,000	1,380,870.00	0.72
53	300634	彩讯股份	63,200	1,377,760.00	0.72
54	688007	光峰科技	93,072	1,376,534.88	0.71
55	688798	艾为电子	19,705	1,375,803.10	0.71
56	000550	江铃汽车	58,600	1,374,170.00	0.71
57	301175	中科环保	253,900	1,371,060.00	0.71
58	002550	千红制药	220,700	1,368,340.00	0.71
59	002967	广电计量	82,800	1,357,920.00	0.70
60	002194	武汉凡谷	120,900	1,356,498.00	0.70
61	688232	新点软件	46,716	1,354,296.84	0.70
62	601096	宏盛华源	310,300	1,349,805.00	0.70
63	002987	京北方	94,600	1,346,158.00	0.70
64	002378	章源钨业	206,600	1,336,702.00	0.69
65	688337	普源精电	34,170	1,332,630.00	0.69
66	601083	锦江航运	139,700	1,329,944.00	0.69
67	688586	江航装备	138,940	1,329,655.80	0.69
68	301050	雷电微力	25,700	1,325,606.00	0.69
69	688150	莱特光电	58,600	1,319,672.00	0.68
70	300768	迪普科技	75,400	1,319,500.00	0.68
71	688209	英集芯	73,900	1,305,813.00	0.68
72	688128	中国电研	61,460	1,291,274.60	0.67
73	688183	生益电子	32,668	1,282,545.68	0.67
74	301363	美好医疗	39,100	1,267,622.00	0.66
75	600961	株冶集团	158,800	1,249,756.00	0.65
76	601311	骆驼股份	150,200	1,245,158.00	0.65
77	301327	华宝新能	16,100	1,235,031.00	0.64
78	300726	宏达电子	38,800	1,206,680.00	0.63
79	300623	捷捷微电	35,200	1,202,432.00	0.62
80	600869	远东股份	250,800	1,191,300.00	0.62
81	688289	圣湘生物	51,395	1,166,666.50	0.61
82	000680	山推股份	119,000	1,154,300.00	0.60
83	300463	迈克生物	87,100	1,149,720.00	0.60
84	300357	我武生物	56,400	1,146,048.00	0.59
85	300113	顺网科技	67,700	1,138,037.00	0.59
86	300682	朗新集团	91,100	1,111,420.00	0.58
87	300761	立华股份	57,000	1,109,220.00	0.58

88	603100	川仪股份	51,400	1,107,670.00	0.57
89	603025	大豪科技	71,700	1,093,425.00	0.57
90	600717	天津港	223,800	1,089,906.00	0.57
91	600409	三友化工	201,800	1,089,720.00	0.57
92	605296	神农集团	38,900	1,077,530.00	0.56
93	002004	华邦健康	200,200	904,904.00	0.47
94	605507	国邦医药	43,000	895,690.00	0.46
95	300182	捷成股份	151,900	891,653.00	0.46
96	600718	东软集团	76,800	827,136.00	0.43
97	603132	金徽股份	63,500	713,105.00	0.37
98	600993	马应龙	27,200	710,192.00	0.37
99	300151	昌红科技	40,900	695,300.00	0.36
100	002222	福晶科技	19,200	622,080.00	0.32
101	688336	三生国健	28,888	618,780.96	0.32
102	002249	大洋电机	98,400	577,608.00	0.30
103	300303	聚飞光电	76,300	520,366.00	0.27
104	600648	外高桥	43,500	518,085.00	0.27
105	000795	英洛华	52,000	505,960.00	0.26
106	002275	桂林三金	32,600	491,934.00	0.26
107	300315	掌趣科技	85,600	470,800.00	0.24
108	300685	艾德生物	20,600	469,680.00	0.24
109	600449	宁夏建材	27,600	414,552.00	0.22
110	301087	可孚医疗	8,300	293,488.00	0.15
111	300130	新国都	12,900	279,414.00	0.15
112	300772	运达股份	20,500	271,420.00	0.14
113	603299	苏盐井神	24,200	269,588.00	0.14
114	600757	长江传媒	24,500	234,465.00	0.12
115	002891	中宠股份	6,375	227,587.50	0.12
116	600633	浙数文化	21,400	223,844.00	0.12
117	603337	杰克股份	7,300	222,358.00	0.12
118	601222	林洋能源	24,800	175,336.00	0.09
119	000951	中国重汽	600	10,188.00	0.01
120	600163	中闽能源	900	5,481.00	0.00
121	000990	诚志股份	700	5,425.00	0.00
122	300101	振芯科技	200	4,332.00	0.00
123	688006	杭可科技	159	2,839.74	0.00
124	002985	北摩高科	100	2,350.00	0.00
125	000065	北方国际	100	978.00	0.00
126	300638	广和通	40	806.00	0.00
127	603229	奥翔药业	80	799.20	0.00

8.3.2 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	603129	春风动力	5,500	863,885.00	0.45
2	600470	六国化工	156,100	852,306.00	0.44
3	000551	创元科技	70,100	838,396.00	0.44
4	002376	新北洋	127,300	829,996.00	0.43
5	600619	海立股份	66,200	807,640.00	0.42
6	600096	云天化	35,400	789,420.00	0.41
7	002970	锐明技术	16,400	781,132.00	0.41
8	300573	兴齐眼药	11,000	767,580.00	0.40
9	601226	华电重工	113,100	764,556.00	0.40
10	600496	精工钢构	252,800	763,456.00	0.40
11	600312	平高电气	39,737	762,950.40	0.40
12	300508	维宏股份	28,100	760,105.00	0.39
13	600482	中国动力	31,000	758,570.00	0.39
14	300758	七彩化学	63,300	758,334.00	0.39
15	600099	林海股份	85,000	748,000.00	0.39
16	002845	同兴达	49,100	744,356.00	0.39
17	300221	银禧科技	127,400	744,016.00	0.39
18	601179	中国西电	98,000	743,820.00	0.39
19	603038	华立股份	44,900	734,115.00	0.38
20	688588	凌志软件	52,600	725,880.00	0.38
21	601127	赛力斯	5,400	720,306.00	0.37
22	301112	信邦智能	29,900	698,763.00	0.36
23	002001	新 和 成	31,700	696,449.00	0.36
24	300054	鼎龙股份	26,400	686,928.00	0.36
25	300505	川金诺	47,300	681,120.00	0.35
26	688122	西部超导	15,100	646,582.00	0.34
27	688550	瑞联新材	20,200	632,058.00	0.33
28	300433	蓝思科技	27,000	591,300.00	0.31
29	603373	安邦护卫	19,500	582,855.00	0.30
30	003015	日久光电	39,600	566,676.00	0.29
31	600268	国电南自	84,000	564,480.00	0.29
32	300514	友讯达	36,100	521,284.00	0.27
33	301052	果麦文化	19,700	501,168.00	0.26
34	300484	蓝海华腾	23,400	483,444.00	0.25
35	601002	晋亿实业	97,700	424,995.00	0.22
36	002284	亚太股份	54,900	424,926.00	0.22
37	002772	众兴菌业	53,200	392,084.00	0.20
38	300360	炬华科技	19,800	332,046.00	0.17
39	000404	长虹华意	41,600	307,840.00	0.16
40	002909	集泰股份	52,300	259,931.00	0.13
41	601318	中国平安	4,900	257,985.00	0.13
42	002073	软控股份	25,500	210,630.00	0.11
43	300701	森霸传感	700	7,175.00	0.00

44	002782	可立克	400	5,060.00	0.00
45	688253	英诺特	123	4,459.98	0.00
46	688212	澳华内镜	104	4,178.72	0.00
47	600737	中粮糖业	400	4,084.00	0.00
48	688599	天合光能	199	3,840.70	0.00
49	688518	联赢激光	151	2,391.84	0.00
50	688231	隆达股份	155	2,204.10	0.00
51	600161	天坛生物	60	1,230.00	0.00
52	301518	长华化学	23	369.61	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	002194	武汉凡谷	4,102,847.00	5.28
2	603556	海兴电力	3,184,387.00	4.10
3	600420	国药现代	2,928,935.00	3.77
4	002396	星网锐捷	2,864,688.00	3.69
5	300409	道氏技术	2,859,736.00	3.68
6	002011	盾安环境	2,844,684.00	3.66
7	002550	千红制药	2,813,206.00	3.62
8	605333	沪光股份	2,796,812.00	3.60
9	002003	伟星股份	2,787,847.00	3.59
10	688019	安集科技	2,785,558.65	3.59
11	300773	拉卡拉	2,730,679.00	3.52
12	300623	捷捷微电	2,681,611.51	3.45
13	002023	海特高新	2,524,477.00	3.25
14	002245	蔚蓝锂芯	2,483,545.00	3.20
15	601311	骆驼股份	2,445,213.00	3.15
16	600409	三友化工	2,420,402.00	3.12
17	600210	紫江企业	2,416,976.00	3.11
18	600320	振华重工	2,376,339.00	3.06
19	688232	新点软件	2,346,788.44	3.02
20	300674	宇信科技	2,330,987.00	3.00
21	300777	中简科技	2,323,017.00	2.99
22	601001	晋控煤业	2,304,021.00	2.97
23	600273	嘉化能源	2,256,537.00	2.91
24	000969	安泰科技	2,255,985.00	2.91
25	688289	圣湘生物	2,249,627.54	2.90
26	301175	中科环保	2,230,017.00	2.87
27	688183	生益电子	2,215,235.36	2.85
28	300113	顺网科技	2,200,866.04	2.83
29	002906	华阳集团	2,192,444.00	2.82
30	605507	国邦医药	2,187,599.00	2.82

31	600602	云赛智联	2,166,134.00	2.79
32	600717	天津港	2,158,997.00	2.78
33	688208	道通科技	2,153,952.73	2.77
34	000682	东方电子	2,150,362.00	2.77
35	600312	平高电气	2,150,043.02	2.77
36	300598	诚迈科技	2,109,871.00	2.72
37	002226	江南化工	2,100,585.00	2.70
38	603171	税友股份	2,087,930.00	2.69
39	300768	迪普科技	2,060,444.00	2.65
40	603236	移远通信	2,050,757.00	2.64
41	300627	华测导航	2,037,902.40	2.62
42	002378	章源钨业	2,034,672.00	2.62
43	603025	大豪科技	2,006,896.60	2.58
44	603083	剑桥科技	1,983,547.00	2.55
45	603678	火炬电子	1,981,592.00	2.55
46	002351	漫步者	1,970,357.00	2.54
47	688798	艾为电子	1,969,960.57	2.54
48	300115	长盈精密	1,967,559.00	2.53
49	601921	浙版传媒	1,941,210.00	2.50
50	300570	太辰光	1,929,693.11	2.48
51	603983	丸美股份	1,917,964.00	2.47
52	688128	中国电研	1,895,493.52	2.44
53	000528	柳工	1,867,661.00	2.41
54	603005	晶方科技	1,855,837.00	2.39
55	002139	拓邦股份	1,852,962.00	2.39
56	002991	甘源食品	1,850,419.83	2.38
57	300953	震裕科技	1,832,222.00	2.36
58	603348	文灿股份	1,817,925.00	2.34
59	000550	江铃汽车	1,817,714.00	2.34
60	600073	上海梅林	1,787,073.00	2.30
61	600718	东软集团	1,759,665.00	2.27
62	688586	江航装备	1,737,339.04	2.24
63	600710	苏美达	1,737,313.00	2.24
64	300088	长信科技	1,717,549.00	2.21
65	600216	浙江医药	1,716,821.00	2.21
66	600366	宁波韵升	1,703,718.00	2.19
67	002270	华明装备	1,702,593.00	2.19
68	600835	上海机电	1,701,019.00	2.19
69	600391	航发科技	1,689,954.00	2.18
70	688200	华峰测控	1,685,455.13	2.17
71	300770	新媒股份	1,677,380.00	2.16
72	300079	数码视讯	1,668,262.00	2.15
73	603100	川仪股份	1,663,044.00	2.14

74	300666	江丰电子	1,659,228.00	2.14
75	600007	中国国贸	1,637,901.00	2.11
76	603699	纽威股份	1,625,599.00	2.09
77	600667	太极实业	1,618,019.00	2.08
78	000970	中科三环	1,609,595.00	2.07
79	600446	金证股份	1,607,356.00	2.07
80	000902	新洋丰	1,604,406.00	2.07
81	000727	冠捷科技	1,594,870.00	2.05
82	300035	中科电气	1,594,206.00	2.05
83	000915	华特达因	1,588,921.00	2.05
84	300618	寒锐钴业	1,583,050.00	2.04
85	601126	四方股份	1,577,395.00	2.03
86	002987	京北方	1,565,259.00	2.02
87	002626	金达威	1,562,784.00	2.01
88	300476	胜宏科技	1,557,372.00	2.01
89	600428	中远海特	1,557,178.00	2.01

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。

8.4.2 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	603556	海兴电力	3,303,529.00	4.25
2	688208	道通科技	2,950,517.38	3.80
3	002194	武汉凡谷	2,801,667.00	3.61
4	600710	苏美达	2,707,353.00	3.49
5	601001	晋控煤业	2,548,683.00	3.28
6	300570	太辰光	2,513,070.00	3.24
7	688018	乐鑫科技	2,507,260.36	3.23
8	603678	火炬电子	2,395,435.00	3.08
9	002351	漫步者	2,380,111.00	3.06
10	603083	剑桥科技	2,370,491.00	3.05
11	002991	甘源食品	2,322,820.71	2.99
12	600602	云赛智联	2,306,260.00	2.97
13	603171	税友股份	2,248,805.00	2.90
14	600391	航发科技	2,240,353.00	2.88
15	600312	平高电气	2,237,281.00	2.88
16	000600	建投能源	2,159,680.00	2.78
17	000049	德赛电池	2,118,325.80	2.73
18	601921	浙版传媒	2,033,221.00	2.62
19	300623	捷捷微电	2,026,462.00	2.61
20	603983	丸美股份	2,014,357.00	2.59
21	600835	上海机电	1,979,618.00	2.55
22	002649	博彦科技	1,974,149.00	2.54
23	603005	晶方科技	1,969,759.00	2.54

24	002550	千红制药	1,949,742.00	2.51
25	300170	汉得信息	1,919,631.00	2.47
26	002946	新乳业	1,888,523.00	2.43
27	688088	虹软科技	1,878,108.31	2.42
28	002402	和而泰	1,873,439.00	2.41
29	300409	道氏技术	1,861,713.00	2.40
30	300770	新媒股份	1,858,868.00	2.39
31	603881	数据港	1,806,757.50	2.33
32	600007	中国国贸	1,777,160.00	2.29
33	002003	伟星股份	1,725,894.00	2.22
34	600066	宇通客车	1,712,660.00	2.21
35	000928	中钢国际	1,712,367.00	2.21
36	688408	中信博	1,703,460.13	2.19
37	603699	纽威股份	1,701,513.00	2.19
38	300953	震裕科技	1,701,037.56	2.19
39	603098	森特股份	1,699,211.00	2.19
40	301219	腾远钴业	1,685,982.00	2.17
41	002318	久立特材	1,683,316.00	2.17
42	300476	胜宏科技	1,669,325.00	2.15
43	603348	文灿股份	1,666,580.00	2.15
44	300743	天地数码	1,665,862.00	2.15
45	688508	芯朋微	1,657,907.45	2.13
46	603267	鸿远电子	1,651,100.00	2.13
47	000902	新洋丰	1,622,187.00	2.09
48	002020	京新药业	1,616,034.00	2.08
49	688232	新点软件	1,589,092.79	2.05
50	605333	沪光股份	1,586,402.00	2.04
51	688289	圣湘生物	1,584,428.28	2.04
52	601952	苏垦农发	1,560,631.00	2.01

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。

8.4.3 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	593,117,151.07
卖出股票收入（成交）总额	504,279,320.05

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。

8.5 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。

8.6 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。

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**8.11.1 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。

8.11.2 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。

8.12 投资组合报告附注**8.12.1 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。

8.12.2 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。

8.12.3 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	27,618,026.95
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	27,618,026.95

8.12.4 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。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 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。

8.12.5.2 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。

8.12.6 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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人 户数 (户)	户均持有的基 金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份 额比例 (%)	持有份额	占总 份额 比例 (%)
长信中证 1000 指数 增强 A	892	102,247.65	5,543,361.32	6.08	85,661,540.62	93.92
长信中证 1000 指数 增强 C	1,173	84,338.04	4,717,087.39	4.77	94,211,433.20	95.23
合计	2,065	92,074.30	10,260,448.71	5.40	179,872,973.82	94.60

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

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	长信中证 1000 指数增强 A	730,111.71	0.80
	长信中证 1000 指数增强 C	0.00	0.00
	合计	730,111.71	0.38

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）。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	长信中证 1000 指数增强 A	长信中证 1000 指数增强 C
基金合同生效日(2023 年 4 月 20 日)基金份额总额	120,130,746.49	223,628,429.82
本报告期期初基金份额总额	42,627,925.93	39,760,565.80
本报告期基金总申购份额	120,633,361.03	139,095,740.99
减：本报告期基金总赎回份额	72,056,385.02	79,927,786.20
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	91,204,901.94	98,928,520.59

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期未召开本基金的基金份额持有人大会。

11.2 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

11.2.1 基金管理人的重大人事变动

本报告期基金管理人未发生重大人事变动。。

11.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

11.3 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。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略未改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金改聘会计师事务所。报告期应支付给立信会计师事务所（特殊普通合伙）审计的报酬为人民币 15,000.00 元，该审计机构为本基金提供审计服务的连续年限为 1 年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，基金管理人及其高级管理人员没有受监管部门稽查或处罚的情形。

11.6.2 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，基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
长城证券	2	747,914,752.24	68.15	312,351.46	68.89	-
民生证券	2	349,481,718.88	31.85	141,047.89	31.11	-

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、当期周期为 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日，《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。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
长城证券	201,380.00	100.00	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

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

	2024 年第 1 季度报告	站、公司网站	
10	长信基金管理有限责任公司旗下全部基金 2024 年第一季度报告提示性公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2024-4-22
11	长信基金管理有限责任公司关于住所变更的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2024-6-15
12	长信基金管理有限责任公司关于暂停海银基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2024-6-15
13	长信基金管理有限责任公司关于增加德邦证券有限公司为旗下部分开放式基金代销机构并开通转换、定期定额投资业务及参加申购（含定投申购）费率优惠活动的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2024-6-20
14	长信基金管理有限责任公司关于增加麦高证券有限公司为旗下部分开放式基金代销机构并开通转换、定期定额投资业务及参加申购（含定投申购）费率优惠活动的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2024-6-24
15	长信基金管理有限责任公司关于增加信达证券股份有限公司为旗下部分开放式基金代销机构并开通转换、定期定额投资业务及参加申购（含定投申购）费率优惠活动的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2024-6-25
16	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金参加汉口银行股份有限公司申购（含定投申购）费率优惠活动的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2024-6-26
17	长信中证 1000 指数增强型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会电子披露网站、公司网站	2024-6-28
18	长信中证 1000 指数增强型证券投资基金 2024 年第 2 季度报告	中国证监会电子披露网站、公司网站	2024-7-19
19	长信基金管理有限责任公司旗下全部基金 2024 年第二季度报告提示性公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2024-7-19
20	长信基金管理有限责任公司关于终止喜鹊财富基金销售有限公司办理旗下基金相关业务公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2024-7-20
21	长信基金管理有限责任公司关于增加东北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）、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	2024-8-15
22	长信基金管理有限责任公司关于增加阳光人寿保险股份有限公司为旗下部分开放式	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2024-8-29

	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		
23	长信中证 1000 指数增强型证券投资基金 2024 年中期报告	中国证监会电子披露网站、公司网站	2024-8-30
24	长信基金管理有限责任公司旗下全部基金 2024 年中期报告提示性公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2024-8-30
25	长信基金管理有限责任公司关于增加上海大智慧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	2024-9-11
26	长信基金管理有限责任公司关于旗下基金持有的停牌股票调整估值方法的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2024-9-25
27	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金参加中国民生银行股份有限公司申购（含定投申购）费率优惠活动的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2024-10-11
28	长信中证 1000 指数增强型证券投资基金 2024 年第 3 季度报告	中国证监会电子披露网站、公司网站	2024-10-25
29	长信基金管理有限责任公司旗下全部基金 2024 年第三季度报告提示性公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2024-10-25
30	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金参加上海浦东发展银行股份有限公司申购（含定投申购）费率优惠活动的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2024-10-28
31	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金参加中信银行股份有限公司申购（含定投申购）费率优惠活动的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2024-10-29
32	长信基金管理有限责任公司关于旗下基金持有的停牌股票调整估值方法的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2024-11-6
33	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金参加招商银行股份有限公司申购（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	2024-11-7
34	长信基金管理有限责任公司关于旗下基金改聘会计师事务所公告（安永）	证券时报、上证报、证券日报、中证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2024-11-19
35	长信基金管理有限责任公司关于旗下基金改聘会计师事务所公告（立信）	证券时报、上证报、证券日报、中证报、中国	2024-11-19

		证监会电子披露网站、公司网站	
36	长信基金管理有限责任公司关于增加浙商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）、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	2024-12-4
37	长信基金管理有限责任公司关于提醒投资者防范不法分子冒用本公司名义从事诈骗活动的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2024-12-20
38	长信中证 1000 指数增强型证券投资基金更新的招募说明书（2024 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	2024-12-31

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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。

12.2 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。

§ 13 备查文件目录

13.1 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。

13.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

13.3 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

2025 年 3 月 28 日