

长信沪深 300 指数增强型证券投资基金 2020 年中期报告

2020 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：2020 年 8 月 29 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 2020 年 8 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2020 年 1 月 1 日起至 2020 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
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.....	13
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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
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.....	15
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
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 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	16
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	17
6.1 资产负债表.....	17
6.2 利润表.....	18
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	19

6.4 报表附注.....	21
§7 投资组合报告.....	44
7.1 期末基金资产组合情况.....	44
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	44
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小 序的所有股票投资明细.....	46
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	48
7.5 期末按债券品 分类的债券投资组合.....	52
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小 序的前 债券投资明细.....	52
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小 序的所有资产 持证券投资明细.....	52
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小 序的前 金 投资明细.....	53
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小 序的前 权证投资明细.....	53
7.10 报告期末本基金投资的股指期货 交易情况说明.....	53
7.11 报告期末本基金投资的 债期 交易情况说明.....	53
7.12 投资组合报告附注.....	53
§8 基金份 持有人信息.....	55
8.1 期末基金份 持有人 数及持有人	55
8.2 期末基金管理人的 业人 持有本基金的情况.....	55
8.3 期末基金管理人的 业人 持有本 式基金份 的情况.....	55
§9 式基金份 变动.....	56
§10 重大事 示.....	57
10.1 基金份 持有人大会决	57
10.2 基金管理人、基金托管人的专 基金托管 的重大人事变动.....	57
10.3 及基金管理人、基金财产、基金托管业务的	57
10.4 基金投资策略的 变.....	57
10.5 基金 行审计的会计 事务所情况.....	57
10.6 管理人、托管人及其 管理人 或 等情况.....	57
10.7 基金 用证券公司交易 的有关情况.....	57
10.8 其他重大事	58
§11 投资者决策的其他重要信息.....	61
11.1 报告期内 一投资者持有基金份 比例 或 过 20%的情况	61

11.2	投资者决策的其他重要信息.....	61
§12	目录.....	62
12.1	目录.....	62
12.2	存.....	62
12.3	阅方式.....	62

§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	00 13	
基金运作方式	型 式	
基金合同生效日	2019 年 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	
报告期末基金份数	16 891 06 00 份	
基金合同存续期	不定期	
下分基金的基金简称:	长信沪深 300 指数 A	长信沪深 300 指数
下分基金的基金代码:	00 13	00 8
报告期末下分基金的份数	3 6 6 61 份	108 3 29 39 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金 增强型股票指数基金， 过的投资 律 和数 风险管理， 基金净值增长 业绩比 基准之 度和 误 的小， 日 度的 对值不 过 0， 年 误 不 过， 同 实现 标的指数的业绩表现， 基金资产的长期增值。
投资策略	本基金在指数 投资的基 上 过数 型 行投资组合， 在 业 绩比 基准 风险的前提下， 标的指数的投资 益。 本基金 股票指数增强型证券投资基金， 投资股票的资产不 于基金资产的 80， 其中， 投资于标的指数 分股及其 分股的比例不 于 现金基金 资产的 80。 大类资产配 不作 本基金的核 策略， 一 情况下 保持 类 资产配 的基本 定。 在 合 性风险、 类资产 益风险比值、 股票 资产估值、 动性要、 以及分 等， 对基金资产配 出合 整。
业绩比 基准	沪深 300 指数 益 9 银行 期存 利
风险 益	本基金 股票型基金， 其预期风险和预期 益 于 合型基金、 债券型基金 和 市场基金。 本基金 指数型基金， 有 标的指数以及标的指数所代表 的股票市场相 的风险 益。

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
称	长信基金管理有限责任公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	021 61009999	0 8319908
务	00 00 66	9

真	021 61009800	0 8319 201
注	中 (上) 自由 易 银 中 68 9	深 市深 大 088 招商 银行大
公	上 市 新 银 中 68 9	深 市深 大 088 招商 银行大
	200120	180 0
法定代表人		

2.4 信息披露方式

本基金 定的信息披露报 称	证 券 报
载基金中期报告 的管理人	
基金中期报告	上 市 新 银 中 68 9 、深 市 深 大 088 招商银行大

2.5 其他相关资料

项目	称	公
注 记	长信基金管理有限责任公司	上 市 新 银 中 68 9

§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

基金 别	长信沪深 300 指数 A	长信沪深 300 指数
3.1.1 期 数据 and 指标	报告期 2020 年 1 月 1 日 至 2020 年 6 月 30 日	报告期 2020 年 1 月 1 日 至 2020 年 6 月 30 日
本期已实现 益	3 293 086.2	061.02
本期利润	9 236.236	1 160.9386
权平 基金份 本期利润	0.1838	0.1326
本期 权平 净值利润	16.3	12.01
本期基金份 净值增长	12.08	11.8
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 2020 年 6 月 30 日	
期末 分配利润	363.1	8 181.19
期末 分配基金份 利润	0.100	0.06
期末基金资产净值	0 136.0	131 928 220.88
期末基金份 净值	1 2231	1.21
3.1.3 计期末指标	报告期末 2020 年 6 月 30 日	
基金份 计净值增长	29.2	28.2

注：1、本期已实现 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） 相关 费用 的 净额，本期利润 本期已实现 益 上本期公允价值变动 收益。

2、所述基金业绩指标不 考虑持有人 认购或交易基金的 费用（例 如， 式基金交易 金、 式基金的 申购费、 赎回费、基金 销售费等），计 算用 实 益 平要 于所 列数字。

3、期末 分配利润 期末资产负债表中未分配利润 未分配利润中已实现 分的 数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份 净值增长 及其 同期业绩比 基准 益 的比

长信沪深 300 指数 A

	份 净值增 长	份 净值增 长 标 准	业绩比 基准 益	业绩比 基准 益 标准		
过 一个月	10.88	0.8	29	0.8	3.9	0.0
过 三个月	1.12	0.8	12.29	0.8	2.83	0.00
过 六个月	12.08	1	1.6	1	10	0.00
过 一年	2.8	1.16	8.0	1.16	1.3	0.00
自基金合同	29.2	1.1	11.23	1.1	18.29	0.00

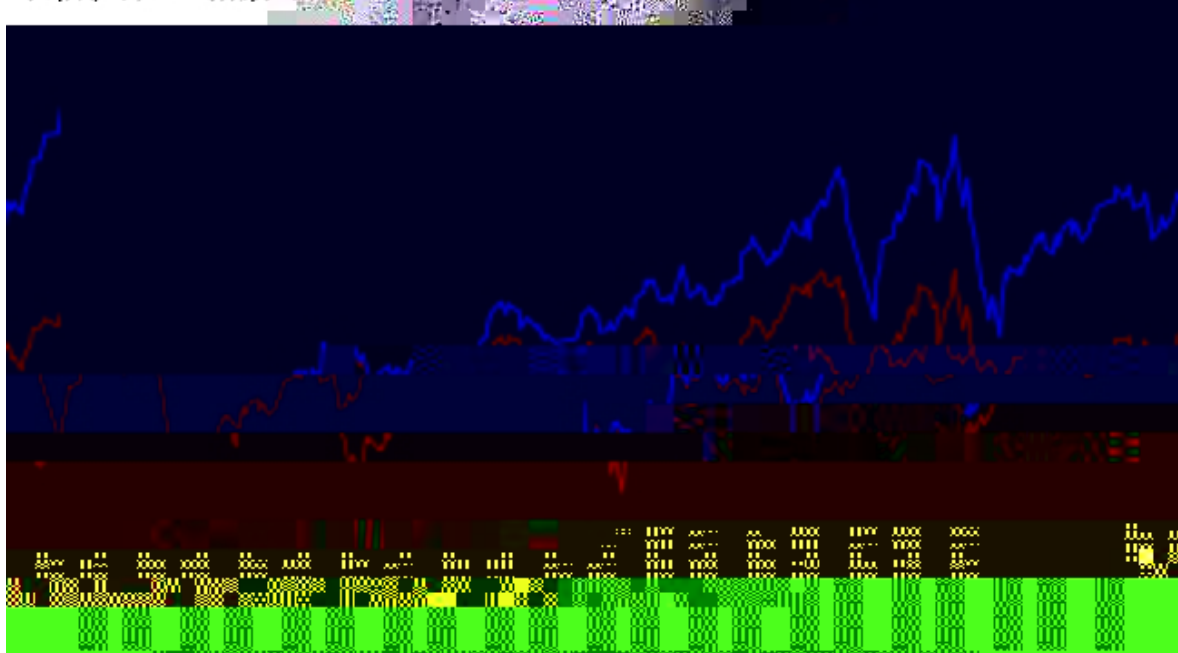
起至						
----	--	--	--	--	--	--

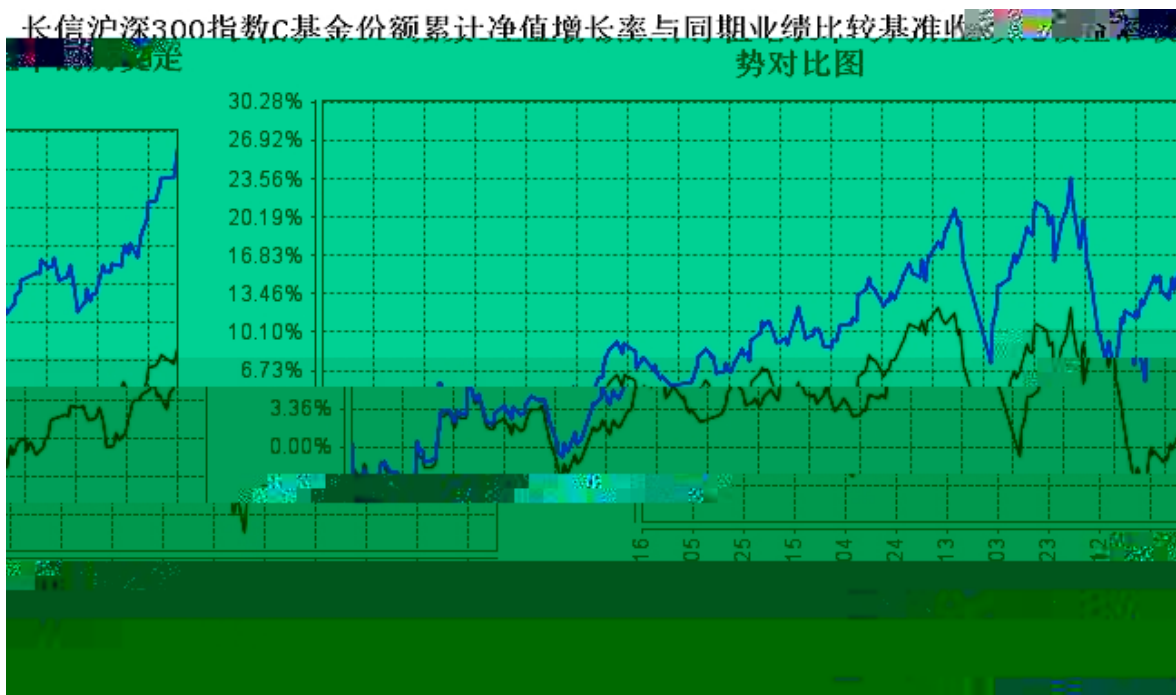
长信沪深 300 指数

	份 净值增 长	份 净值 增长 标 准	业绩比 基准 益	业绩比 基准 益 标准		
过 一个月	10.8	0.8	29	0.8	3	0.0
过 三个月	1.01	0.8	12.29	0.8	2.2	0.00
过 六个月	11.8	1	1.6	1	10.21	0.00
过 一年	2.12	1.16	8.0	1.16	16.62	0.00
自基金合同 起至	28.2	1.1	11.23	1.1	1.9	0.00

3.2.2 自基金合同 以来基金份 计净值增长 变动及其 同期业绩比 基准 益 变动的比

长信沪深300指数A基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走





注：1、 示日期 2019 年 月 16 日至 2020 年 6 月 30 日。

2、按基金合同规定，本基金自基金合同 之日起 6 个月内 期，报告期末已完
但报告期末 不 一年 期 ，本基金 项投资比例已 合基金合同中的 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

长信基金管理有限责任公司 经中 证 会证 基金字 2003 63 准，由长 证 券 股 份 有 限 公 司、上 证 股 份 有 限 公 司、 证 券 股 份 有 限 公 司 共 同 发 起 立。注 资 本 1 6 人。目前股权：长 证 券 股 份 有 限 公 司 占、上 证 股 份 有 限 公 司 占 31 21、 证 券 股 份 有 限 公 司 占 1 1、上 证 股 份 有 限 公 司 占、上 证 股 份 有 限 公 司 占。

至 2020 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 68 式基金，长信利息 益 式 证 券 投 资 基 金、长 信 银 利 合 型 证 券 投 资 基 金、长 信 金 利 势 合 型 证 券 投 资 基 金、长 信 增 利 动 策 略 合 型 证 券 投 资 基 金、长 信 利 债 券 型 证 券 投 资 基 金、长 信 利 势 合 型 证 券 投 资 基 金、长 信 合 型 证 券 投 资 基 金、长 信 标 准 100 等 权 重 指 数 增 强 型 证 券 投 资 基 金、长 信 利 债 券 型 证 券 投 资 基 金、长 信 内 长 合 型 证 券 投 资 基 金、长 信 债 券 型 证 券 投 资 基 金、长 信 利 债 券 型 证 券 投 资 基 金、长 信 债 一 年 定 期 债 券 型 证 券 投 资 基 金、长 信 债 券 型 证 券 投 资 基 金、长 信 利 配 合 型 证 券 投 资 基 金、长 信 中 小 股 票 型 证 券 投 资 基 金、长 信 新 利 配 合 型 证 券 投 资 基 金、长 信 利 债 券 型 证 券 投 资 基 金、长 信 利 盈 配 合 型 证 券 投 资 基 金、长 信 利 配 合 型 证 券 投 资 基 金、长 信 利 配 合 型 证 券 投 资 基 金、长 信 策 略 股 票 型 证 券 投 资 基 金、长 信 保 行 业 配 合 型 证 券 投 资 基 金（）、长 信 债 一 年 定 期 债 券 型 证 券 投 资 基 金、长 信 债 一 年 定 期 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 债 一 年 定 期 债 券 型 证 券 投 资 基 金、长 信 债 一 年 定 期 债 券 型 证 券 投 资 基 金、长 信 利 配 合 型 证 券 投 资 基 金、长 信 利 发 债 券 型 证 券 投 资 基 金、长 信 信 息 行 业 配 合 型 证 券 投 资 基 金、长 信 平 债 一 年 定 期 债 券 型 证 券 投 资 基 金、长 信 利 半 年 定 期 合 型 证 券 投 资 基 金、长 信 新 动 股 票 型 证 券 投 资 基 金、长 信 益 债 券 型 证 券 投 资 基 金、长 信 利 信 配 合 型 证 券 投 资 基 金、长 信 债 券 型 证 券 投 资 基 金、长 信 势 债 券 型 证 券 投 资 基 金、长 信 中 证 00 指 数 增 强 型 证 券 投 资 基 金、长 信 长 金 市 场 基 金、长 信 三 个 月 定 期 债 券 型 发 起 式 证 券 投 资 基 金、长 信 保 行 业 股 票 型 证 券 投 资 基 金、长 信 利 一 年 定 期 合 型 证 券 投 资 基 金、长 信 信 配 合 型 证 券 投 资 基 金、长 信

债券证券投资基金、长信 三个月定期 债券型发起式证券投资基金、长信 年定期
 配 合型证券投资基金、长信 行业 股票型证券投资基金、长信 业
 年定期 配 合型证券投资基金、长信 价值 动 合型证券投资基金、长信价值
 年定期 配 合型证券投资基金、长信 三个月定期 债券型发起式证券投资
 基金、长信 资产配 合型基金中基金（ ）、长信价值 合型证券投资基金、长信利
 利 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 债半年定期
 债券型证券投资基金、长信合利 合型证券投资基金、长信 利 合型证券投资基金、长信
 年定期 债券型证券投资基金、长信 平 目标三年持有期 合型基金中基金
 （ ）、长信易 合型证券投资基金、长信中证 债及 交 债券 0 指数证券投资基金、长
 信 合型证券投资基金、长信中债 1 3 年 策性金 债指数证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理 理简介

	务	任本基金的基金经理（理） 期限		证券 业年限	说明
		任 日期	任日期		
金保	任本基金的 的基金经理	2019 年 月 16 日	2020 年 月 22 日	10 年	任本基金的基金经理
	长信中证 00 指数增 强型证券投 资基金、长信 配 合型证券 投资基金、长 信沪深 300 指数增强型 证券投资基 金和长信 保 行业 配 合型证券投 资基金（ ） 的基金经理	2019 年 月 16 日		6 年	理 ，上 交 大 应用数 业， 有基金 业资 。担任 期 股份有限公司 、前 基金管理 有限公司投资经理 理和 证券股份有限公司 。2016 年 9 月 长 信基金管理有限责任公司， 任 投资 、 基金经理 理、长信中证 一带一 主 指数分 证 券投资基金、长信中证 主 指数型证券 投资基金（ ）、长信价 值 合型证券投资基 金和长信 债券型证券 投资基金的基金经理，现 任长信中证 00 指数增强 型证券投资基金、长信 配 合 型证券投资基金、长信沪 深 300 指数增强型证券投

					资基金和长信 保 行 业 配 合 型 证 券 投 资 基 金 () 的 基 金 经 理。
--	--	--	--	--	---

注：1、任基金经理任 日期以本基金 立之日 准 新增或变更基金经理的日期根据对 披露的公告日期

2、证券 业的 遵 证券业 业人 资 管理 法 的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本基金管理人在报告期内， 遵守了 中 人 共和 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 基金份 持有人 利益，不存在 基金份 持有人利益的行 。

本基金 以 信于市场、 信于 会投资公 ，承诺 一 往 本 诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，在规 基金运作和 投资风险的前提下， 基金份 持有人 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 度的 行情况

本报告期内，公司已实行公平交易 度，并 立公平交易 度 ，已 立投资决策 ，强交易 行 的内 ，并 过 作 度、 程和 保证公平交易原则的实现。同 ，公司已 过对投资交易行 的 、分 估和信息披露来 强对公平交易过程和 的 。

4.3.2 交易行 的专项说明

本报告期内， 完 按 有关指数的 比例 行投资的组合 ，其 投资组合未发 交易所公 价同日 交易 交 的 交易 过 证券 日 交 的 的情形，未发 交易行 。

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

2020 年上半年，新 情 ， 的经济发展前 上 。 了应对 ，主要经济 的 策 行对 ， 风险资产在 性 强 并 数 。 了 情之 ， 年 见的 情 中 带来了 大的 ， 了 内复 复

产的程度，但政策的和持，业已经增长，但会复日。整个上半年，A股的表现，其业指大36。上，、者务、品料、新、等期表现出大其他行业，、、、金、产、等强期则表现相对。新情公共的和理提中市场的相对，有于中的经济型和产业，上资金持以出，A股的程比利，A股市场资产的在提。

本基金根据股票的基本情况和市场情况A型，、市场估的投资标的。合A型分、风险型、交易本型，定期组合权重，在组合误的基上提组合的益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

至本报告期末，长信沪深300指数A份净值1.2231，份计净值1.2231，份净值增长12.08%长信沪深300指数份净值1.21，份计净值1.21，份净值增长11.8%同期业绩比基准益1.6%。

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，风险共存。在于，在中经济型的前提下，、等或来的投资会，中强大的市场，A股有望走出一持上的行情。风险在于，的下，中易存在持发的，别年的大或增势的不确定性，同要关注的策发的至。A股的和，投资者在，对资本市场产。宏观经济在内复复产的动下带动上市公司盈利，市场行情在的宏观经济策下。

保持定的，定期估基本和股的表现，持已有的股型，合的风险，持的益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据相关法律法规，长信基金管理有限责任公司（以下简称“公司”）了、有的估值策和估值程序，立了估值会，估值会公司基金估值的主要决策，负责定公司的估值策、估值方法及用的估值程序和，公司估值决策，对公司现有程序

和 行复核和审阅， 发 了 估值程序和 的有 性及 用性的情况及 估值程
序 估值 会 由基金事务 、投资、 、交易等相关业务 负责人以及基金事务 至
一 业务 共同组 。相关 人 有 的证券行业 作经 ， 相关法规和估值
方法， 估值业务所 的专业 任 。基金经理不 估值决策，估值决策由 会估
值 作小组 1 2 以上 数票 过。对于估值 策和估值原则，公司 基金托管人 分 ，
一 意见。审计本基金的会计 事务所 公司基金估值 策和程序的 性。
本基金管理人已 中 债 记 算有限责任公司及中证指数有限公司签 务 ，由其
按 定分别提 银行 同业市场及交易所交易的债券品 的估值数据以及 限股票的 。
估值 程 方不存在任 重大利益 。

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 益分配原则以及基金实 运作情况，本基
金本报告期 有 行利润分配。本基金 益分配原则 下：

1、本基金在 合基金法定分 的前提下 行 益分配， 分 方 见基金管理人根
据基金运作情况 不定期发 的相关分 公告， 基金合同 不 3 个月 不 行 益
分配

2、由于本基金 A 类基金份 不 务 ， 类基金份 务 ， 基金份
类别对应的 分配利润 有所不同。本基金同一类别的 一基金份 有同等分配权

3、本基金 益分配方式分 ：现金分 利 投资，投资者 现金 利或 现金
利自动 相应类别的基金份 行 投资 投资者不 ，本基金 的 益分配方式 现
金分

、基金 益分配 类基金份 净值不 于 值 基金 益分配基准日的 类基金份
净值 类 基金份 益分配金 不 于 值

、法律法规或 管 关 有规定的， 其规定。

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

。

§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

招商银行 完 的公司 理 、内 核 度和风险 度， 行在 行托管 责中， 遵守有关法律法规、托管 的规定，尽 尽责 行托管 务并 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 定的投资 ，对托管产品的投资行 行 ， 并根据 管要 行报告 务。

招商银行按 托管 定的一记 方法和会计 理原则，独立 、 录和保管本产 品的 ， 行会计核算和资产估值并 管理人 立对 。

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：2020 年 6 月 30 日

：人

资产	附注	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资产：			
银行存	6.4.6.1	13 11 18 9	2 122 0 32
算 金		211 8 90	122 9
存出保证金		69 12 03	3 332 1
交易性金 资产	6.4.6.2	189 61 1 33	10 019 01 62
其中：股票投资		189 61 1 33	10 019 01 62
基金投资			
债券投资			
资产 持证券投资			
金 投资			
金 资产	6.4.6.3		
金 资产	6.4.6.4		
应 证券 算		2 60 9	
应 利息	6.4.6.5	1 9 6 39	91 83
应 股利			
应		99 3 6 83	3 01 1 8
所 资产			
其他资产	6.4.6.6		
资产 计		203 139 822 9	13 68 68 38
负债和所有者权益	附注	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
负 债：			
期			
交易性金 负债			
金 负债	6.4.6.3		
出 金 资产			
应 证券 算			1 168 382 2
应		28 00 1	19 862 9 0 00
应 管理人报		1 1 8 8 6	9 19 61
应 托管		2 32	1 3 91
应 务		3 2 1	3 8 3
应 交易 用	6.4.6.7	39 2 2 91	16 239
应交			

应 利息			
应 利润			
所 负债			
其他负债	6.4.6.8	13 900 80	100 000 00
负债合计		1 0 928 01	21 3 38 61
所有者权益：			
实 基金	6.4.6.9	16 891 06 00	10 083 283 31
未分配利润	6.4.6.10	36 190 388 93	9 161 09 6
所有者权益合计		202 081 89 93	11 2 380
负债和所有者权益 计		203 139 822 9	13 68 68 38

注：报告 止日 2020 年 6 月 30 日，长信沪深 300 指数 A 基金份 净值 1 2231 ，基金份
3 6 6 61 份 长信沪深 300 指数 基金份 净值 1 21 ，基金份 108 3 29 39
份。长信沪深 300 指数份 合计 16 891 06 00 份。

6.2 利润表

会计主 ：长信沪深 300 指数增强型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

：人

项 目	附注	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度 比期 2019 年 月 16 日 基金 合同 日至 2019 年 6 月 30 日
一、		2 30 629 23	39 82 16
1.利息		9 08 99	126 91
其中：存 利息	6.4.6.11	3 069 3	126 91
债券利息		6 39 6	
资产 持证券利息			
金 资产			
证券出 利息			
其他利息			
2.投资 益（ 以“-” ）		12 9 29 82	3 92 68
其中：股票投资 益	6.4.6.12	10 826 99 0	2 266 8
基金投资 益			
债券投资 益	6.4.6.13	3 09 6	
资产 持证券投资 益	6.4.6.13.5		
金 投资 益	6.4.6.14		
益	6.4.6.15		
股利 益	6.4.6.16	1 6 336 86	10 22 90
3.公允价值变动 益（ 以“-” ）	6.4.6.17	13 0 3 8 0	9 3 0

4. 益 (以 “-”)			
5.其他 (以 “-”)	6.4.6.18	3 1 2 02	9 0
：二、用		2 332 9 0 01	12 30 6
1 管理人报	6.4.9.2.1	862 12 2	1 16 89
2 托管	6.4.9.2.2	129 318 60	1 3
3 务	6.4.9.2.3	23 288 91	0 3
4 交易用	6.4.6.19	91 9	8 8
5 利息出			
其中：出 金 资产 出			
6 金及附			
7 其他用	6.4.6.20	189 80 6	10 382 18
三、利润 (以 “ ”)		23 39 6 9 22	2 2 1
：所 用			
、净利润 (净 以 “ ”)		23 39 6 9 22	2 2 1

注：本基金本报告期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日，本基金基金合同于 2019 年 月 16 日起式，上年度比期 2019 年 月 16 日至 2019 年 6 月 30 日。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主：长信沪深 300 指数增强型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

：人

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	实 基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期 所有者权益 (基金净值)	10 083 283 31	9 161 09 6	11 2 380
二、本期经 动产 的基金净值变动数(本期利润)		23 39 6 9 22	23 39 6 9 22
三、本期基金份额交易产 的基金净值变动数 (净值 以“-”)	60 808 222 69	3 631 632 2	6 39 8 9

其中：1.基金	1 6 816 969 91	12 1 1 1 9	169 368 121 0
2 基金	96 008 22	8 919 19	10 928 266 6
、本期 基金份 持有人分配利 润产 的基金净 值变动(净值 以“-”)			
、期末所有者权 益（基金净值）	16 891 06 00	36 190 388 93	202 081 89 93
项目	上年度 比期 2019年 月 16 日 基金合同 日 至 2019年 6 月 30 日		
	实 基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期 所有者权 益（基金净值）	99 83 6	1 6	9 2 266 00
二、本期经 动 产 的基金净值 变动数(本期利润)		2 2 1	2 2 1
三、本期基金份 交易产 的基金 净值变动数 (净值 以“-”)	23 811 20	9 1 68	22 8 9 2
其中：1.基金	3 90	316 86	21 0
2 基金	28 9 10	1 268	2 280 6
、本期 基金份 持有人分配利 润产 的基金净 值变动(净值 以“-”)			
、期末所有者权 益（基金净值）	9 026 36	2 3 3	9 6 680 99

注：本基金本报告期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日，本基金基金合同于 2019 年 月 16 日起式，上年度 比期 2019 年 月 16 日至 2019 年 6 月 30 日。

报表附注 财务报表的组 分。

本报告 6 1 至 6 财务报表由下 负责人签 ；

第 20 页 共 62 页

基金管理人负责人 主管会计 作负责人 会计 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”）由长信价值 合型证券投资基金 型，长信价值 合型证券投资基金 经中 证 管理 会（“中 证 会”）证 201 1 8 关于准 长信价值 合型证券投资基金注 的复 的核准，由长信基金管理有限责任公司作 管理人 会公 发行募 。基金合同于 2018 年 月 19 日 。 立募 规 220 60 62 6 份基金份 。根据 长信沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同 及 关于长信价值 合型证券投资基金基金份 持有人大会决 公告，本基金自 2019 年 月 16 日起 型并更 长信沪深 300 指数增强型证券投资基金。本基金 型 式，存 期限不定。本基金的基金管理人和注 记 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。

长信沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同 ，原长信价值 合型证券投资基金份 自动 长信沪深 300 指数增强型证券投资基金 A 类基金份 ，基金份 持有 持 计算。新增长信沪深 300 指数增强型证券投资基金 类基金份 。

本基金的投资 主要 有 动性的金 ， 标的指数 份股及其 份股、其他股票（ 中小 、 业 及其他经中 证 会核准上市的股票）、权证、股指期货 、债券（ 内 法发行上市的 债、 方 债、金 债、 业债、公司债、 债、 债券、 债券、分 交易 债、中小 业 募债、 行票据、中期票据、 期 资券、 期 资券以及经法律法规或中 证 会允 投资的其他债券）、债券 、资产 持证券、银行存

存 、定期存 及其他银行存 、同业存 、 市场 以及法律法规或中 证 会允 基金投资的其他金 （但 合中 证 会的相关规定）。法律法规或 管 以 允 基金投资其他品 ，基金管理人在 行 程序 ， 以 其 投资 。

基金的投资组合比例 ：本基金持有的股票资产占基金资产的比例 不 于 80，其中，投资于标的指数 份股及其 份股的比例不 于 现金基金资产的 80。 个交易日日 在 股指期货 合 的交易保证金 ，应 保持不 于基金资产净值 的现金（不 算 金、存出保证金、应 等）或 期日在一年以内的 债券。本基金持有的 权证，其市值不 过基金资产净值的 3。 法律法规对 比例要 有变更的，以变更 的比例 准，

本基金的投资比例会相应调整。

本基金的业绩比较基准：沪深 300 指数收益率 90% 加上银行活期存款利率（税后）。

6.4.2 会计报表的编制

本财务报表按照财政部颁布的企业会计准则基本准则以及其制定及发布的会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”），同时，对于在会计核算和信息披露方面，遵循了中国证券投资基金业协会编发的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第 2 号—年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露规则》第 3 号—会计报表附注及披露、《证券投资基金信息披露第 3 号—年度报告和中期报告》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2020 年 6 月 30 日的财务状况、2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与上期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与上期年度报告相一致。

6.4.4.2 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错更正的内容和金额。

6.4.5 重要事项

6.4.5.1

经业务管理委员会、投资决策委员会决定，自 2008 年 1 月 2 日起，调整证券（股票）交易佣金，由原的 3‰ 调整至 1‰。

经业务管理委员会、投资决策委员会决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出方按

证券（股票）交易，方不，不变
 根据财、务财 200 103 关于股权分 有关 策
 的 的规定，股权分 过程中 股股 股股 对价 发 的股权，
 。

6.4.5.2 增值

根据财、务财 2016 36 关于 业 增值 的
 的规定，经 务 准，自 2016 年 月 1 日起在 内 业 增值，金
 业，由 业 增值。对证券投资基金（式证券投资基金，
 式证券投资基金）管理人运用基金 股票、债券的 增值 债、方 债
 利息 以及金 同业往来利息 增值 存 利息 不 增值

根据财、务财 2016 6 关于 一 明确 增 金 业
 有关 策的 的规定，金 展的 式 金 商品业务及持有 策性金 债券
 的利息 于金 同业往来利息

根据财、务财 2016 0 关于金 同业往来等增值 策的
 的规定，金 展的 式 金 商品业务、同业存、同业存 以及持有金
 债券 的利息 于金 同业往来利息

根据财、务财 2016 1 0 关于明确金、产 发、
 务等增值 策的 的规定，本基金运 过程中发 的增值 应 行，以本基金的基金管
 理人 增值 人

根据财、务财 201 6 关于资管产品增值 有关的 的规
 定，自 2018 年 1 月 1 日起，本基金的基金管理人运 本基金过程中发 的增值 应 行，
 用简易计 方法，按 3 的 增值。

6.4.5.3 市、附、方 附

根据 中 人 共和 市 行 例（2011 年）、 附 的行
 规定（2011 年）及相关 方 附 的 规定，、增值、业的
 和个人，应 规定 市、附（按 相关规定 事业
 附 的）及 方 附。

6.4.5.4 业所

根据财、务财 200 8 关于证券投资基金 策的 的规定，

自 200 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（式证券投资基金，式证券投资基金）管理人运用基金股票、债券的价格，业所

根据财、务财 200 103 关于股权分有关策
的规定，股权分中股股过对价方式股股的股份、现金等
，股股应的业所

根据财、务财 2008 1 关于业所策的规
定，对证券投资基金证券市场中，股票、债券的价格，股权的股息、
利，债券的利息及其他，不业所。

6.4.5.5 个人所

根据财、务财 200 103 关于股权分有关策
的规定，股权分中股股过对价方式股股的股份、现金等
，股股应的个人所

根据财、务财 2008 132 财、务关于存利息
所有关个人所策的的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对存利息所
个人所

根据财、务、中证会财 2012 8 关于实上市公司股息利
别个人所策有关的的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金公发行
和市场 的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（1 个月）的，其股息利所
计应所 持股期限在 1 个月以上至 1 年（1 年）的，按 0 计应所
持股期限 过 1 年的，按 2 计应所。上述所一用 20 的计个人所

根据财、务、中证会财 201 101 关于上市公司股息利别
个人所策有关的的规定，自 201 年 9 月 8 日起，证券投资基金公发行和
市场 的上市公司股票，持股期限 过 1 年的，股息利所个人所。

6.4.6 重要财务报表项目的说明

6.4.6.1 银行存

: 人

项目	本期末
----	-----

	2020 年 6 月 30 日
期存	13 11 18 9
定期存	
其中：存 期限 1 个月以内	
存 期限 1 3 个月	
存 期限 3 个月以上	
其他存	
合计：	13 11 18 9

6.4.6.2 交易性金 资产

：人

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日		
	本	公允价值	公允价值变动
股票	1 0 603 9 1 6	189 61 1 33	19 013 2
金 投资 金交所 金合			
债券	交易所市场		
	银行 市场		
	合计		
资产 持证券			
基金			
其他			
合计	1 0 603 9 1 6	189 61 1 33	19 013 2

6.4.6.3 金 资产/负债

本基金本报告期末未持有 金 资产 负债。

6.4.6.4 金 资产

6.4.6.4.1 项 金 资产期末

本基金本报告期末未持有 金 资产。

6.4.6.4.2 期末 式 交易中 的债券

本基金本报告期末未持有 式 交易中 的债券。

6.4.6.5 应 利息

：人

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
应 期存 利息	1 830 89

应 定期存 利息	
应 其他存 利息	
应 算 金利息	9 30
应 债券利息	
应 资产 持证券利息	
应 证券利息	
应 利息	
应 金合 息	
应 出 证券利息	
其他	31 20
合计	1 9 6 39

注：其他 应 算保证金利息。

6.4.6.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.6.7 应 交易 用

：人

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
交易所市场应 交易 用	39 2 2 91
银行 市场应 交易 用	
合计	39 2 2 91

6.4.6.8 其他负债

：人

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
应 券商交易 保证金	
应	36
应 证券出 金	
预提	
预提审计	2 863 02
预提信息披露	9 6 2 3
指数 用	0 000 00
合计	13 900 80

6.4.6.9 实 基金

金 ：人

长信沪深 300 指数 A

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	基金份 (份)	金
上年度末	10 9 109 3	10 9 109 3
本期	93 6 6	93 6 6
本期 (以"-")	6 9 910 39	6 9 910 39
基金 分/份 算前		
基金 分/份 算变动份		
本期		
本期 (以"-")		
本期末	3 6 6 61	3 6 6 61

金 : 人

长信沪深 300 指数		
项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	基金份 (份)	金
上年度末	9 60 1 3 96	9 60 1 3 96
本期	63 1 1 392 26	63 1 1 392 26
本期 (以"-")	9 210 836 83	9 210 836 83
基金 分/份 算前		
基金 分/份 算变动份		
本期		
本期 (以"-")		
本期末	108 3 29 39	108 3 29 39

注: 利投、份 出份。

6.4.6.10 未分配利润

: 人

长信沪深 300 指数 A			
项目	已实现 分	未实现 分	未分配利润合计
上年度末	3 8 332 0	98 3 9	9 6 10 29
本期利润	3 293 086 2	9 3 638 09	9 236 2 36
本期基金份 交易 产的变动数	2 12 9 38	18 1	2 603 62 9
其中: 基金	6 180	2 2 688 8	8 128 869 3
基金	3 0 236 09	2 0 1 0 6	2 06
本期已分配利润			
本期末	363 1	019 3 29	12 96 89

: 人

长信沪深 300 指数			
项目	已实现 分	未实现 分	未分配利润合计

上年度末	1 830 9 28	10 03 361	8 20 38 1
本期利润	061 02	099 910 31	1 160 93 86
本期基金份额交易 产的变动数	388 236 08	1 16 0	1 028 169 6
其中：基金	63 9 93	3 8 86 2	22 282
基金	1 022 32 01	2 3 1 380 98	3 39 112 99
本期已分配利润			
本期末	8 1 81 19	18 1 6 30	23 393 91 9

6.4.6.11 存 利息

：人

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
期存 利息	36 326 82
定期存 利息	
其他存 利息	
算 金利息	3 32 8
其他	3 009 9
合计	3 069 3

注：其他 算保证金利息 。

6.4.6.12 股票投资 益

6.4.6.12.1 股票投资 益 股票 价

：人

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
出股票 交	300 2 19
： 出股票 本	289 61 9
股票 价	10 826 99 0

6.4.6.13 债券投资 益

6.4.6.13.1 债券投资 益项目

：人

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
债券投资 益 债券（、债 股及债 券 期 ） 价	3 09 6
债券投资 益 价	
债券投资 益 价	
合计	3 09 6

6.4.6.13.2 债券投资 益 债券 价

：人

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
出债券（、债 股及债券 期 ） 交	233 866 6
： 出债券（、债 股及债券 期 ） 本	01 10 13
： 应 利息	216 666 0
债券 价	3 09 6

6.4.6.13.3 债券投资 益 价

本基金本报告期 债券 价 。

6.4.6.13.4 债券投资 益 价

本基金本报告期 债券 价 。

6.4.6.13.5 资产 持证券投资 益

本基金本报告期 资产 持证券投资 益。

6.4.6.14 金 投资 益**6.4.6.14.1 金 投资 益项目**

本基金本报告期 金 投资 益。

6.4.6.15 益**6.4.6.15.1 益 权证 价**

本基金本报告期 权证 价 。

6.4.6.15.2 益 其他投资 益

本基金本报告期 其他 投资 益。

6.4.6.16 股利 益

：人

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
股票投资资产 的股利 益	1 6 336 86
其中：证券出 权益	
基金投资资产 的股利 益	

合计	1 6 336 86
----	------------

6.4.6.17 公允价值变动 益

：人

项目 称	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
1 交易性金 资产	13 0 3 8 0
股票投资	13 0 3 8 0
债券投资	
资产 持证券投资	
金 投资	
其他	
2	
权证投资	
3 其他	
应 金 商品公允价值变动产 的预估 增值	
合计	13 0 3 8 0

6.4.6.18 其他

：人

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
基金	3 03 68
	8 38 3
合计	3 1 2 02

注：对持 持有期 于 日的投资者 的 计 基金财产 其 的 2 应
基金财产。

6.4.6.19 交易 用

：人

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
交易所市场交易 用	91 9
银行 市场交易 用	
交易基金产 的 用	
其中：	
合计	91 9

6.4.6.20 其他 用

：人

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
审计 用	2 863 02
信息披露	9 6 2 3
证券出 金	
指数 用	100 000 00
其他 用	2 28
合计	189 80 6

注：其他 用 银行 。

6.4.7 或有事项、资产负债表日 事项的说明**6.4.7.1 或有事项**

至资产负债表日，本基金 要说明的重大或有事项。

6.4.7.2 资产负债表日 事项

至本财务报告 准报出口，本基金未发 要披露的资产负债表日 事项。

6.4.8 关 方关**6.4.8.1 本报告期存在 关 或其他重大利 关 的关 方发 变 的情况**

本报告期存在 关 或其他重大利 关 的关 方 变 。

6.4.8.2 本报告期 基金发 关 交易的 关 方

关 方 称	本基金的关
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 记 、基金
招商银行股份有限公司	基金托管人、基金
长 证券股份有限公司(以下简称“长证券”)	基金管理人的股 、基金

6.4.9 本报告期及上年度 比期 的关 方交易

6.4.9.1 过关 方交易 行的交易

6.4.9.1.1 股票交易

金 : 人

关 方 称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度 比期 2019年 月16日 基金合同 日至 2019年6月30日	
	交金	占 期股票 交 的比例	交金	占 期股票 交 的比例
长 证券	6 0 6 01 0	100 00	03 216 00	100 00

6.4.9.1.2 债券交易

金 : 人

关 方 称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度 比期 2019年 月16日 基金合同 日至 2019年6月30日	
	交金	占 期债券 交 的比例	交金	占 期债券 交 的比例
长 证券	1 031 30 82	100 00		

6.4.9.1.3 债券 交易

本基金本报告期及上年度 比期 未 过关 方交易 行债券 交易。

6.4.9.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度 比期 未 过关 方交易 行 行权证交易。

6.4.9.1.5 应 关 方的 金

金 : 人

关 方 称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日			
	期 金	占 期 金 的 比例	期末应 金	占期末应 金 的 比例
长 证券	0 8 91	100 00	39 2 2 91	100 00
关 方 称	上年度 比期 2019年 月16日 基金合同 日至2019年6月30日			
	期 金	占 期 金 的 比例	期末应 金	占期末应 金 的 比例
长 证券	33 2	100 00	2 300 3	100 00

注: 上述 金 市场价 经本基金的基金管理人 对方 商确定, 以 由中 证券 记 算

有限责任公司 的证管 和经 的净 示。 类 金 的 务 金 方
本基金提 的证券投资 和市场信息 务。

6.4.9.2 关 方报

6.4.9.2.1 基金管理

: 人

项目	本期 2020年1月1日至2020年6 月30日	上年度 比期 2019年 月16日 基金合同 日 至2019年6月30日
期发 的基金应 的管理	862 12 2	1 16 89
其中: 的	81 8 13	8 66

注: 基金管理人长信基金管理有限责任公司的基金管理人报 按前一日基金资产净值的1 0
年 计提, 日 计至 月月 , 按月 。

管理 的计算方法 下: 1 0 年 数

日应计提的基金管理

前一日的基金资产净值

6.4.9.2.2 基金托管

: 人

项目	本期 2020年1月1日至2020年6 月30日	上年度 比期 2019年 月16日 基金合同 日 至2019年6月30日
期发 的基金应 的托管	129 318 60	1 3

注: 基金托管人招商银行的基金托管 按前一日基金资产净值0 1 的年 确 , 日
计至 月月 , 按月 。

托管 的计算方法 下: 0 1 年 数

日应计提的基金托管

前一日的基金资产净值

6.4.9.2.3 务

: 人

务 的 关 方 称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日

	期发 的基金应 的 务		
	长信沪深 300 指数 A	长信沪深 300 指数	合计
长信基金		221 2 0 9	221 2 0 9
合计		221 2 0 9	221 2 0 9
务 的 关 方 称	上年度 比期 2019 年 月 16 日 基金合同 日 至 2019 年 6 月 30 日		
	期发 的基金应 的 务		
	长信沪深 300 指数 A	长信沪深 300 指数	合计
长信基金		0 3	0 3
合计		0 3	0 3

注：本基金 A 类基金份额 不 务 ， 类基金份额 的 务 年 0 0 。 类基金份额 的基金 务 按前一日 类基金资产净值的 0 0 年 计提。计算方法 下：

类基金份额 的 务 年 年 数

类基金份额 日应计提的 务

类基金份额 前一日的基金资产净值

基金 务 日计提， 日 计至 月月末，按月 。

6.4.9.3 关 方 行银行 同业市场的债券()交易

本基金在本报告期及上年度 比期 未 关 方 过银行 同业市场 行债券 交易。

6.4.9.4 报告期内 证券出 业务发 重大关 交易事项的说明

6.4.9.4.1 关 方 过 定 报方式 行的 用 定期限 的证券出 业务的情况

本基金本报告期及上年度 比期 未 关 方 过 定 报方式 行 用 定期限 的证券出 业务。

6.4.9.4.2 关 方 过 定 报方式 行的 用市场 期限 的证券出 业务的情况

本基金本报告期及上年度 比期 未 关 方 过 定 报方式 行 用市场 期限 的证券出 业务。

6.4.9.5 关联方投资本基金的情况

6.4.9.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

基金管理人在本报告期及上年度比期未运用自有资金投资本基金。

6.4.9.5.2 报告期末基金管理人及其他关联方投资本基金的情况

基金管理人及其他关联方在本报告期末及上年度末未持有本基金。

6.4.9.6 由关联方保管的银行存款及期产的利息

：人

关联方称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度比期 2019年1月16日基金合同日至 2019年6月30日	
	期末	期利息	期末	期利息
招商银行	13 11 18 9	36 326 82	82 91 20	90

注：本基金用于证券交易结算的资金过本基金托管人的基金托管人资金专用存款账户存于中证券登记结算有限责任公司，按银行同业利率计息。于2020年6月30日的相关项目在资产负债表中的“结算金”目中独立示（2019年12月31日：同）。

6.4.9.7 本基金在承期内关联方承证券的情况

本基金在本报告期及上年度比期未在承期内由关联方承的证券。

6.4.9.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度比期其他关联交易事项

6.4.10 利润分配情况

本基金本报告期末行利润分配。

6.4.11 期末（2020年6月30日）本基金持有的有限证券

6.4.11.1 新发/增发证券于期末持有的有限证券

金：人

6.4.11.1.1 限证券类别：股票										
证券代	证券称	日	日	限类型	价	期末估 值 价	数 (：股)	期末 本	期末估值	注
601816	沪	2020	2020	新股	88	6 1	906 36	23 89 68	93 32 12	

		年 1 月 8 日	年 16 月 16 日	限						
688396	润	2020 年 2 月 1 日	2020 年 8 月 2 日	新股 限	12 80	1	9 62	123 18 20	398 91 80	
688 99	合	2020 年 6 月 2 日	2020 年 12 月 10 日	新股 限	8 16	13 91	2 9	199 89 2	3 0 3 2	
688318	财 势	2020 年 月 1 日	2020 年 10 月 2 日	新股 限	10 1	23 93	8	8 209	186 3 12	
68800		2020 年 6 月 日	2020 年 12 月 1 日	新股 限	28	1 90	2 00	1 92 00	1 9 0 00	
688 66	金	2020 年 月 2 日	2020 年 11 月 9 日	新股 限	2 61	36 9	3 2	92 336 2	13 28 68	
688 68	中	2020 年 6 月 30 日	2020 年 月 8 日	新股 限	16 21	16 21	0	121 688	121 688	
6882		2020 年 6 月 2 日	2020 年 月 日	新股 限	12 0	12 0	8 810	106 0 2 0	106 0 2 0	
6883		2020 年 6 月 29 日	2020 年 月 8 日	新股 限	16 2	16 2		89 603 9	89 603 9	
68802		2020 年 6 月 30 日	2020 年 月 9 日	新股 限	36 18	36 18	2 3 8	8 312	8 312	
688181		2019 年 12 月 2 日	2020 年 月 6 日	新股 限	3 98	61 09	1 3	60 2 0	83 998	
688 28		2020	2020	新股	11 33	11 33	399	83 830 6	83 830 6	

		年 6 月 19 日	年 1 月 1 日	限						
688600		2020 年 6 月 23 日	2021 年 1 月 3 日	新股 限	1 0	1 0	8 6	8 00	8 00	
3008	中	2020 年 6 月 29 日	2020 年 月 9 日	新股 限	6 9	6 9	1 21	9 861	9 861	
3008 3	股份	2020 年 6 月 23 日	2020 年 月 2 日	新股 限	10 01	10 01	1	1 1	1 1	
3008 0		2020 年 6 月 30 日	2020 年 月 8 日	新股 限	9	9	1 18	038 90	038 90	
3008 6	在	2020 年 6 月 22 日	2020 年 月 1 日	新股 限	3 3	3 3	1 131	3 811	3 811	

6.4.11.2 期末持有的 等 限股票

本基金本报告期末未持有 等 限股票。

6.4.11.3 期末债券 交易中作 的债券

6.4.11.3.1 银行 市场债券

本基金本报告期末未持有 银行 市场债券 交易 作 的债券。

6.4.11.3.2 交易所市场债券

本基金本报告期末未持有 交易所市场债券 交易 作 的债券。

6.4.11.4 期末 证券出 业务的证券

本基金本报告期末 证券出 业务的 出证券。

6.4.12 金融 风险及管理

6.4.12.1 风险管理 策略和组

本基金在日常运作中面临的主要金融风险，主要包括：信用风险、流动性风险和市场风险。本基金在以下方面主要描述上述风险及其形成原因、风险管理目标、策略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。基于风险管理目标，本基金的基金管理人已制定了策略和程序来识别和分类风险，并确定相应的风险限额并制定相应的内部控制程序，通过有效的管理及信息披露来持续监控上述各类风险。

本基金管理人实行全面风险管理，建立了以风险为导向的、由董事长、总经理和相关业务部门共同参与的全面风险管理体系。在董事会下设立风险管理委员会，负责对公司经营管理及基金业务运作的合法性、合规性和有效性进行监督和评估等。在管理层下设立风险管理部，主要负责审核公司内部风险管理制度及对公司经营管理及投资组合运作中的风险进行识别、评估并制定有效的风险控制措施。在业务运作中，风险管理职责主要由各业务部门负责，并与合作完成运作风险管理相关工作，策略产品发展部负责进行投资风险绩效评估。风险管理部由总经理负责，并定期向董事会报告风险管理事务。

6.4.12.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中交易对手未能履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、到期本息，导致基金资产和收益变动的风险。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程序，本基金投资于有良好信用等级的证券，通过分散投资以分散信用风险。本基金投资于同一公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，本基金由本基金管理人管理的其他基金共同持有同一公司发行的证券，不超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易中，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，与交易所交易对手相关的信用风险较小。本基金在银行间同业市场交易前对交易对手进行信用评估并用券对交方式以分散相应的信用风险。

6.4.12.2.1 按 期信用 显示的债券投资

注：本基金本报告期末及上年度末按 期信用 显示的债券投资。

6.4.12.2.2 按 期信用 示的资产 持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末 按 期信用 示的资产 持证券投资。

6.4.12.2.3 按 期信用 示的同业存 投资

注：本基金本报告期末及上年度末 按 期信用 示的同业存 投资。

6.4.12.2.4 按长期信用 示的债券投资

注：本基金本报告期末及上年度末 按长期信用 示的债券投资。

6.4.12.2.5 按长期信用 示的资产 持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末 按长期信用 示的资产 持证券投资。

6.4.12.2.6 按长期信用 示的同业存 投资

注：本基金本报告期末及上年度末 按长期信用 示的同业存 投资。

6.4.12.3 动性风险

动性风险 指基金管理人未 以合理价 及 变现基金资产以 投资者 项的风险。本基金 动性风险来 于 式基金 日 资金的 动性风险，以及 分投资品 交易不 出现的变现风险和 投资 中 法在市场出现 动的情况下以合理价 变现投资的风险。

6.4.12.3.1 报告期内本基金组合资产的 动性风险分

本基金的基金管理人 按 公 募 证券投资基金运作管理 法 及 公 募 式 证券投资基金 动性风险管理规定 等有关法规的要 立 式基金 动性风险管理的内 ， 审 估 类资产的 动性， 对性 定 动性风险管理 ， 对本基金组合资产的 动性风险 行管理。本基金 持组合管理、分 投资的原则 展投资 动，所持证券 在证券交易所或银行 同业市场交易，并 遵守基金管理人 动性相关交易限 本期末本基金未持有有重大 动性风险的投资品 。本基金 过 出 金 资产方式 期资金应对 动性 。

对 资金的 动性风险，本基金的基金管理人在基金合同中 定了 ， 定了发 资金的 理 式， 式 产的 动性风险。本基金的基金管理人 对 动性指标 行持 的 和分 。

本基金本报告期末及上年度末 重大 动性风险。

6.4.12.4 市场风险

市场风险 指基金所持金 的公允价值或未来现金 所 市场 类价 的变动 发 动的风险， 利 风险、 风险和其他价 风险。

6.4.12.4.1 利 风险

利 风险 指金 的公允价值或现金 市场利 变动 发 动的风险。本基金的 息资产主要 银行存 、 算 金、存出保证金及债券投资等。

6.4.12.4.1.1 利 风险

：人

本期末 2020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	13 11 18 9					13 11 18 9
算 金	211 8 90					211 8 90
存出保证金	69 12 03					69 12 03
交易性金 资产					189 61 1 33	189 61 1 33
应 证券 算					2 60 9	2 60 9
应 利息					1 9 6 39	1 9 6 39
应					99 3 6 83	99 3 6 83
其他资产						
资产 计	13 39 90 90				189 332 0	203 139 822 9
负债						
应					28 00 1	28 00 1
应 管理人报					1 1 8 8 6	1 1 8 8 6
应 托管					2 32	2 32
应 务					3 2 1	3 2 1
应 交易 用					39 2 2 91	39 2 2 91
其他负债					13 900 80	13 900 80
负债 计					1 0 928 01	1 0 928 01
利 度	13 39 90 90				188 686 0 03	202 081 89 93
上年度末 2019年12月31日	6个月以内	6个月-1年	1年	年以上	不计息	合计
资产						
银行存	2 122 0 32					2 122 0 32
算 金	122 9					122 9
存出保证金	3 332 1					3 332 1
交易性金 资产					10 019 01 62	10 019 01 62
应 利息					91 83	91 83

应	3 00 000 00				1 1 8	3 01 1 8
资产 计	30 661 09 08				10 026 2 9 30	13 68 68 38
负债						
应 证券 算					1 168 382 2	1 168 382 2
应					19 862 9 0 00	19 862 9 0 00
应 管理人报					9 19 61	9 19 61
应 托管					1 3 91	1 3 91
应 务					3 8 3	3 8 3
应 交易 用					16 239	16 239
其他负债					100 000 00	100 000 00
负债 计					21 3 38 61	21 3 38 61
利 度	30 661 09 08				83 82 8 1 69	11 2 380

注：表中所示 本基金资产及交易形 负债的公允价值，并按 合 规定的利 重新定价日或 期日 者 行了分类。

6.4.12.4.1.2 利 风险的 性分

本基金于本报告期末及上年度末 未持有债券， 重大利 风险， 未 行 性分 。 银行存 及 算 金之 动利 根据中 人 银行的基准利 和相关 的相关 策 动。

6.4.12.4.2 风险

风险 指金 的公允价值或未来现金 变动 发 动的风险。本基 金的所有资产及负债以人 计价， 重大 风险。

6.4.12.4.3 其他价 风险

其他价 风险 指基金所持金 的公允价值或未来现金 市场利 和 以 的市场价 变动 发 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 同业市场交易的债券，所 的 大其他价 风险由所持有的金 的公允价值决定。 本基金 过投资组合的分 其他价 风险，并 定期运用 定 方法对基金 行风险度 ， 等指标来 本基金 的 在价 风险，及 对风险 行 和 。

于 6 月 30 日，本基金 的其他市场价 风险 示 下：

6.4.12.4.3.1 其他价 风险

金 人

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日		上年度末 2019 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金	公允价值	占基金资

		资产净 值比例 (%)		产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	189 61 1 33	93 83	10 019 01 62	91 92
交易性金融资产-基金投资				
交易性金融资产-债券投资				
交易性金融资产-其他				
其他				
合计	189 61 1 33	93 83	10 019 01 62	91 92

6.4.12.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	在 9 的 信 内，基金资产组合的市场价 风险		
分	相关风险变 的变动	对资产负债表日基金资产净值的 金 (: 人)	
		本期末 (2020 年 6 月 30 日)	上年度末 (2019 年 12 月 31 日)
	值 3 6 (2019 年 12 月 31 日 值 3 16	3 6 00 9	3 60 810 1

注：上述风险价值 的分 基于资产负债表日所持证券过 一年市场价 动情况 有发 的大 ， 变动 用于本基金所有的 金 及 金 。 9 的 信 度 基于本基金所持有的金 风险度 的要 。 2019 年的分 同 基于 假 。

6.4.13 有 于理 和分 会计报表 要说明的其他事项

6.4.13.1 公允价值

6.4.13.1.1 不以公允价值计 的金

不以公允价值计 的金 资产和负债主要 和应 项以及其他金 负债，其 期限不长，公允价值 价值相 。

6.4.13.1.2 以公允价值计 的金

6.4.13.1.2.1 金 公允价值

于 2020 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计 其变动计 期 益的金 资产中 于第一 的 人 182 106 32 0 ， 于第二 的 人 90 31 ， 于第三 人 6 920 66 。

6.4.13.1.2.2 公允价值所 的重大变动

对于证券交易所上市的股票和 债券， 出现重大事项 、交易不 、或 于 公 发行等情况，本基金分别于 日至交易 复 日期 、交易不 期 及限 期 不 相 关股票和 债券的公允价值 第一 并根据估值 整中 用的不 观 值对于公 允价值的 程度，确定相关股票和 债券公允价值应 第二 或第三 。

6.4.13.1.2.3 第三 公允价值 和本期变动金

本基金持有的以公允价值计 其变动计 期 益的金 第三 公允价值本期变动 情况 下：

上年度末 人 39 8 89 ，本期 第三 金 人 0 00 ， 出第三 金 人 8 92 21 ， 期计 益的利 或 人 2 033 0 ， 本期 金 人 99 9 6 ，出 金 人 0 00 ，本期末 人 6 920 66 ，本期末持有的资产计 益的 期末实现利 或 的变动金 人 1 86 6 68 。

6.4.13.2 承诺事项

至资产负债表日，本基金 要说明的承诺事项。

6.4.13.3 其他事项

至资产负债表日，本基金 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 人

序	项目	金	占基金 资产的比例 (%)
1	权益投资	189 61 1 33	93 3
	其中：股票	189 61 1 33	93 3
2	基金投资		
3	定 益投资		
	其中：债券		
	资产 持证券		
4	金 投资		
5	金 品投资		
6	金 资产		
	其中： 式 的 金 资产		
7	银行存 和 算 金合计	13 326 366 8	6 6
8	其他 项资产	196 0 1	0 10
9	合计	203 139 822 9	100 00

注：本基金本报告期末 过 股 交易 投资 股。

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 期末指数投资按行业分类的 内股票投资组合

金 人

代	行业类别	公允价值 ()	占基金资产净值比例
A	、 、 、 业	3 836 8 00	1 90
	业	3 1 3	0 00
	业	2 813 86 08	36 03
	、 、 及 产和 应业		
	业	8 8 68 00	2 1
	发和 业		
	交 运 、 和 业	610 2 6	2 8
	和 业		
	信息 、 和信息 务业	11 9 9 831 30	92
	金 业	0 622 0 0	2 0
	产业	3 8 20 00	1 1
	和商务 务业	1 663 2 00	0 82

	和 务业		
	利、 和公共 管理业		
	务、 理和其他 务业		
		1 3 0	2 2
	和 会 作	10 188 00	0 01
	、 和 业		
	合		
	合计	1 9 398 0 1 11	8 88

7.2.2 期末 投资按行业分类的 内股票投资组合

金 人

代	行业类别	公允价值 ()	占基金资产净值比例
A	、 、 、 业	800 00	0 00
	业		
	业	26 63 9 1 16	13 10
	、 、 及 产		
	和 应业	12 66 32	0 01
	业		
	发和 业		
	交 运 、 和 业		
	和 业		
	信息 、 和信息		
	务业	2 69 9 06	1 33
	金 业	893 23 00	0
	产业		
	和商务 务业		
	和 务业	1 9 6 00	0 00
	利、 和公共 管理		
	业	1 6 03 68	0 0
	务、 理和其他 务		
	业		
	和 会 作		
	、 和 业		
	合		
	合计	30 219 363 22	1 9

7.2.3 报告期末按行业分类的 股 投资股票投资组合

注：本基金本报告期末 过 股 交易 投资 股。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小 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 序的所有股票投资明细

金 人

序	股票代码	股票名称	数 (股)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	60019		900	1389360.00	6.88
2	601318	中平	1269	906601.00	9
3	002	立	1966	6829	3.80
	601166	业银行	1200	6962136.00	3
	60026		668	623910.00	3.09
6	6000		6819	61190630	3.03
	600000	发银行	3000	60623000	3.00
8	600016	银行	106000	982000	2.96
9	002	三	12000	80320000	2.8
10	600031	三一重	3000	393200	2.8
11	000063	中	12100	02300	2.82
12	6008		10100	66666100	2.80
13	0029	比	8300	6219000	2.8
1	601816	沪	9061	9320	2
1	00089	发展	120900	228100	2.6
16	601211		3222	102	2.6
1	6013	业证券	9900	66100	2.0
18	002001	新和	13000	0330000	2.9
19	601939	银行	8100	96660100	2.6
20	601390	中中	91800	883600	2.1
21	00260	中公	16363	130	2.2
22	30033		10000	20600000	2.08
23	0021	原股份	6660	382612000	1.89
2	60008	保利产	23000	382000	1.1
2	601169	银行	6300	23338000	1.1
26	601012	基股份	200	22829600	1.11
2	601881	中银	190000	21930000	1.08
28	002311	大	00	2122300	1.0
29	601601	中保	3036	199023100	0.98
30	603288	业	162	1910880	0.96
31	601888	中中	10800	1663200	0.82
32	600183	益	36000	1032000	0.2
33	300033	同	200	2661600	0.01
3	30009	方财	86	1280	0.01

3	603986	易新	63	1 862 33	0 01
36	600009	上 场	200	1 1 00	0 01
3	000 68		1 0	13 668 00	0 01
38	600		100	12 9 00	0 01
39	300 98	股份	80	10 6 00	0 01
0	3003		100	10 188 00	0 01
1	0008 6	新 望	3 1	10 161 80	0 01
2	600 06		00	10 12 00	0 01
3	601818	大银行	2 20	8 663 60	0 00
	601688	证券	2	8 9 60	0 00
	600 60	中	200	6 6 00	0 00
6	600690		300	310 00	0 00
	000 08	中信	300	12 00	0 00
8	601 66	中 中	00	2 8 00	0 00
9	601808	中	131	1 21 3	0 00
0	601 88	大证券	100	1 606 00	0 00
1	601088	中	100	1 36 00	0 00
2	601006	大	200	1 08 00	0 00
3	600029	方	200	1 03 00	0 00
	601633	长	100	2 00	0 00
	601988	中 银行	200	696 00	0 00
6	6000 0	中	100	8 00	0 00
	000 2	方 A	100	6 00	0 00
8	601998	中信银行	89	8 3	0 00
9	601618	中 中	100	2 1 00	0 00

7.3.2 期末 投资按公允价值占基金资产净值比例大小 序的所有股票投资明细

金 人

序	股票代码	股票名称	数 (股)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	300 8	业	29 299	101 2 02	2 03
2	600298		8 13	3 8 9 8 2	1 92
3	002 1		132 220	3 8 1 01 60	1 92
	002 11	中	169 893	3 88 613 90	1 8
	002 0	新 股份	99 909	3 6 680 32	1 80
6	000 13		9 0	3 98 3 9 0	1 8
	603	比	000	2 196 0 0 00	1 09
8	600060	信	1 1 00	1 19 22 00	0 8
9	600291	股份	98 00	893 23 00	0
10	600 9	业	1 00	29 26 00	0 21

11	688396	润	9 62	398 91 80	0 20
12	688 99	合	2 9	3 0 3 2	0 1
13	688318	财 势	8	186 3 12	0 09
1	68800		2 00	1 9 0 00	0 09
1	688 66	金	3 2	13 28 68	0 0
16	688 68	中	0	121 688	0 06
1	6882		8 810	106 0 2 0	0 0
18	6883			89 603 9	0 0
19	68802		2 3 8	8 312	0 0
20	688181		1 3	83 998	0 0
21	688 28		399	83 830 6	0 0
22	688600		8 6	8 00	0 0
23	60308	业	10	1 213 00	0 0
2	30082	股份	1 9	26 89 3	0 01
2	3008 2	股份		18 2 60	0 01
26	6009 6	新	2 33	12 66 32	0 01
2	300839	股份	02	11 1 82	0 01
28	3008	中	1 21	9 861	0 00
29	600323		00	8 2 00	0 00
30	300 96	中	100	0 00	0 00
31	3008 3	股份	1	1 1	0 00
32	3008 0		1 18	038 90	0 00
33	002299	发展	200	800 00	0 00
3	603686		220	361 0	0 00
3	002216	三 品	200	80 00	0 00
36	603606	方	300	362 00	0 00
3	3008 6	在	1 131	3 811	0 00
38	300012		100	1 9 6 00	0 00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

1 计 金 出期 基金资产净值 2 或前 20 的股票明细

金 : 人

序	股票代码	股票 称	本期 计 金	占期 基金资产净值比例 ()
1	600 19		10 6 9 09	9 1
2	600 0		10 039 8 1 08	8 9
3	002	立	8 19 13 00	1
	000 2	方 A	8 1 63 00	16

	601012	基股份	0 6 23	6 8
6	6002 6		0 39 00	6 60
	600031	三一重	3 2 0 1 0	6 3
8	000063	中	269 1 00	6 36
9	601318	中 平	6 69 669 92	93
10	601169	银行	6 1 032 00	90
11	601390	中 中	6 608 82 00	8
12	600 06		6 3 9 00	63
13	601816	沪	6 319 8 8 88	3
1	600 8		6 2 0 826 0	9
1	00230	股份	6 1 66 60	39
16	600000	发银行	6 00 3 3 99	26
1	601166	业银行	98 9 00	2
18	300 33		90 2 91	1
19	00089	发展	868 33 00	1
20	00260	中公	89 103 3	0
21	002	三	11 260 00	00
22	600219	业	8 131 00	89
23	002001	新和	8 6 00	80
2	002311	大	30 662 0	6
2	300 8	业	16 6	2
26	002 0	新 股份	1 236 02	1
2	60199	银行	0 1 9 1 00	
28	002 9	比	8 392 1	2
29	600016	银行	6 33 00	0
30	6013	业证券	3 688 00	3 9
31	002 11	中	9 9 3	3 9
32	601 66	中 中	32 916 00	3 9
33	6033	品	309 0 0 00	3
3	000661	长 新	30 0 00	3
3	300 98	股份	2 2 036 00	3 2
36	601211		1 2 20	3 66
3	601939	银行	1 3 00	3 6
38	002	品	1 6 362 1	3 6
39	002216	三 品	3 9 3 29 0	3
0	002 1		3 916 80 30	3 3

1	600919	银行	3 8 9 8 6 00	3 0
2	6000 8	保利 产	3 8 22 00	3 39
3	601618	中 中	3 36 988 00	3 2
	002 06	信	3 31 80 0	3 2
	601688	证券	3 6 0 01 09	3 19
6	002 1	原股份	3 619 88 12	3 1
	600298		3 2 988 6	3 09
8	0008 6	新 望	3 03 21 08	3 0
9	000 13		3 310 0	3 0
0	00202	易	3 31 303 00	3 00
1	6003 6		3 19 22 00	2 99
2	600690		3 3 0 111 8	2 92
3	601998	中信银行	3 068 263 90	2 69
	30001		3 032 8 9 00	2 6
	603986	易 新	2 996 000 00	2 62
6	603160		2 962 8 32	2 9
	601186	中	2 80 9 00	2 6
8	601808	中	2 3 8 0 26	2 39
9	002832	比	2 6 0 3 3 10	2 3
60	601288	业银行	2 8 293 00	2 26
61	600060	信	2 6 802 00	2 2
62	603288	业	2 0 0 00	2 1
63	60098	业	2 66 08	2 16
6	600		2 383 3 2 00	2 09
6	000333	的	2 3 36 00	2 06
66	300 96	中	2 32 916 00	2 0
6	603686		2 31 2 20	2 03

注：本项“ 金 ” 按 交金 （ 交 价 以 交 数 ） ， 不 其 交 易 用。

2 计 出 金 出 期 基 金 资 产 净 值 2 或 前 20 的 股 票 明 细

金 人

序	股票代	股票 称	本期 计 出 金	占 期 基 金 资 产 净 值 比 例 ()
1	000 2	方 A	8 108 00	10
2	00230	股份	6 6 1 3	82
3	601012	基 股份	6 339 3 00	
	600919	银行	6 338 293 00	

	600 06		6 2 6 022 00	9
6	600690		6 21 280 00	
	300 98	股份	6 12 226 90	36
8	603160		6 00 6 2 60	26
9	30001		96 096 00	22
10	600219	业	923 363 00	18
11	00202	易	33 320 00	02
12	600 0		660 813 28	96
13	6002 6		632 93 00	93
1	000661	长 新	81 688 00	80
1	601998	中信银行	1 091 00	6
16	002	品	289 191 00	63
1	60199	银行	283 2 2 00	62
18	6033	品	2 2 012 00	61
19	000 08	中信	1 862 30	3
20	60088	利股份	1 3 8 00	1
21	6000 0	中	6 8 00	00
22	0009	信息	38 03 20	3 8
23	601169	银行	2 00	3 2
2	0008 8		181 09 00	3 66
2	601 66	中 中	139 2 00	3 62
26	6036 8		3 896 6	3 1
2	300012		3 893 660 00	3 1
28	002 06	信	3 81 8 3 00	3 3
29	300 33		3 01 199 00	3 2
30	601618	中 中	3 682 68 00	3 22
31	002216	三 品	3 680 336 00	3 22
32	3000 9	方财	3 6 6 008 00	3 19
33	601688	证券	3 99 0 2 2	3 1
3	601186	中	3 26 00	3 02
3	600 8		3 33 2 00	2 92
36	601318	中 平	3 299 69 00	2 89
3	002 0	新 股份	3 262 2 00	2 86
38	000333	的	3 239 60 00	2 8
39	601088	中	3 20 2 1 00	2 80
0	002311	大	3 1 0 9 8 00	2 8
1	0008 6	新 望	3 13 1 21	2
2	002	立	3 069 369 0	2 69

3	6003 6		2 880 611 00	2 2
	300 8	业	2 0 9 00	2 1
	601233	股份	2 23 192 00	2 38
6	6000 8	保利 产	2 69 66 00	2 36
	603686		2 686 191 60	2 3
8	0028 1	股份	2 683 83 00	2 3
9	603986	易 新	2 626 8 20	2 30
0	601166	业银行	2 62 819 00	2 30
1	601288	业银行	2 61 906 00	2 29
2	601816	沪	2 28 616 00	2 21
3	300 96	中	2 88 889 00	2 18
	002832	比	2 6 320 00	2 16
	00260	中公	2 30 809 00	2 13
6	601633	长	2 28 093 00	2 13
	60098	业	2 3 99 00	2 08
8	000 38		2 3 6 89 00	2 08
9	601808	中	2 333 086 00	2 0

注：本项“ 出金 ” 按 交金 （ 交 价 以 交数 ） ， 不 其 交易 用。

7.4.3 股票的本 及 出股票的本

： 人

股票 本 （ 交 ）	361 1 0 628 10
出股票 （ 交 ）	300 2 19

注：本项“ 股票的本 （ 交 ） ” 和 “ 出股票的本 （ 交 ） ” 按 交金 （ 交 价 以 交数 ） ， 不 相关交易 用。

7.5 期末按债券品 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 序的前 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 序的所有资产 持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产 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 序的前 金 投资明细

本基金本报告期末未持有 金 。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小 序的前 权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货 交易情况说明**7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货 持 和 益明细**

本基金本报告期末未持有股指期货 。

7.10.2 本基金投资股指期货 的投资 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 债期 交易情况说明**7.11.1 本期 债期 投资 策**

本基金本报告期末未投资 债期 。

7.11.2 报告期末本基金投资的 债期 持 和 益明细

本基金本报告期末未投资 债期 。

7.11.3 本期 债期 投资 价

本基金本报告期末未投资 债期 。

7.12 投资组合报告附注**7.12.1 本基金投资的前 证券的发行主 本期 以及 的情况的说明**

报告期内本基金投资的前 证券的发行主 未出现 管 立 或在报告 日前 一年内 公 责、 的情形。

12 2 基金投资的前 股票 出基金合同规定的 股票 情况的说明

报告期内本基金投资的前 股票中，不存在 出基金合同规定 股票 的情形。

7.12.3 期末其他 项资产

: 人

序	称	金
1	存出保证金	69 12 03

2	应 证 券 算	2 60 9
3	应 股 利	
4	应 利 息	1 9 6 39
5	应	99 3 6 83
6	其他应	
7	用	
8	其他	
9	合计	196 0 1

7.12.4 期末持有的 于 股期的 债券明细

本基金本报告期末未持有 于 股期的 债券。

7.12.5 期末前 股票中存在 限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前 股票中存在 限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前 股票中不存在 限的情况。

7.12.5.2 期末 投资前 股票中存在 限情况的说明

本基金本报告期末 投资前 股票中不存在 限的情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他 字 述 分

由于 的原 ，分项之和 合计项 存在 。

§8 基金份额 持有人信息

8.1 期末基金份额 持有人 数及持有人

份 : 份

份 别	持有人 数()	持有的 基金份	持有人			
			投资者		个人投资者	
			持有份	占 份 比 例	持有份	占 份 比例
长信沪深 300 指数 A	12	112 02 9	1 30 698 60	2 01	16 0 2 0 8 01	2 99
长信沪深 300 指数	60	1 2 808 8	102 8 1 692 09	9	693 03 30	2
合计	1 2 2	130 1 8	1 1 6 390 69	86 89	21 11 31	13 11

8.2 期末基金管理人的 业人 持有本基金的情况

项目	份 别	持有份 数 (份)	占基金 份 比例
基金管理人所有 业 人 持有本基金	长信沪深 300 指数 A	0 00	0 00
	长信沪深 300 指数	0 00	0 00
	合计	0 00	0 00

8.3 期末基金管理人的 业人 持有本 式基金份 的情况

项目	份 别	持有基金份 的数 (份)
本公司 管理人 、基金 投资和 负责人持 有本 式基金	长信沪深 300 指数 A	0
	长信沪深 300 指数	0
	合计	0
本基金基金经理持有本 式基金	长信沪深 300 指数 A	0
	长信沪深 300 指数	0
	合计	0

§9 式基金份 变动

：份

项目	长信沪深 300 指数 A	长信沪深 300 指数
基金合同 日 (2019 年 月 16 日) 基金份	99 1 0	
本报告期期 基金份	10 9 109 3	9 60 1 3 96
本报告期基金 份	93 6 6	63 1 1 392 26
本报告期基金 份	6 9 910 39	9 210 836 83
本报告期基金 分变动份 (份 以)		
本报告期期末基金份	3 6 6 61	108 3 29 39

§10 重大事 示

10.1 基金份 持有人大会决

报告期内本基金未 基金份 持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专 基金托管 的重大人事变动

10 2 1 基金管理人的重大人事变动

本报告期基金管理人未发 重大人事变动。

10 2 2 基金托管人的专 基金托管 的重大人事变动

本报告期基金托管人的专 基金托管 未发 重大人事变动。

10.3 及基金管理人、基金财产、基金托管业务的

本报告期 及基金管理人、基金财产、基金托管业务的 。

10.4 基金投资策略的 变

本报告期本基金投资策略未 变。

10.5 基金 行审计的会计 事务所情况

本报告期本基金未 会计 事务所。

10.6 管理人、托管人及其 管理人 或 等情况

本报告期，基金管理人、托管人及其 管理人 有 管 或 的情形。

10.7 基金 用证券公司交易 的有关情况

10.7.1 基金 用证券公司交易 行股票投资及 金 情况

金 : 人

券商 称	交易 数	股票交易		应 券商的 金		注
		交金	占 期股票 交 的比例	金	占 期 金 的比例	
长 证券	2	6 0 6 01 0	100 00	0 8 91	100 00	

注：1、本期 用证券公司交易 的变更情况

本报告期内本基金 用证券公司交易 有变更。

2、专用交易 的 标准和程序

根据中 证 会 关于 强证券投资基金 管有关 的 (证 基字 1998 29)

和关于完善证券投资基金交易制度有关的规定，（证基金字〔2008〕）的有关规定，本公司制定了用证券公司专用交易的标准和程序。

(1) 标准：

- 1) 券商基本价（财务状况、经营情况）
- 2) 券商报价（报告、及时性、数量和）
- 3) 券商日信息价（及时性、有价性）
- 4) 券商操作表现价。

(2) 程序：

根据用证券公司专用交易的标准形式券商报价表，根据分行基金专用交易。

10.7.2 基金用证券公司交易行其他证券投资的情况

金：人

券商名称	债券交易		债券交易		权证交易	
	交易金	占期债券交易的比例	交易金	占期债券交易的比例	交易金	占期权证交易的比例
长证券	1 031 30 82	100 00				

10.8 其他重大事

序	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增 中信证券股份有限公司等 下分式基金代 并 定期定 投资、业务及 、 （定投） 动的公告	上证报、中证报、证券报、证券日报、中证会披露、公司	2020 年 1 月 8 日
2	长信沪深 300 指数增强型证券投资基金 2019 年第 度报告	中证会披露、公司	2020 年 1 月 1 日
3	长信基金管理有限责任公司 下 基金 2019 年第 度报告提示性公告	上证报、中证报、证券报、证券日报、中证会披露、公司	2020 年 1 月 1 日
	长信基金管理有限责任公司关于增 保险 有限公司 下分式基金代 并 业务及 动的公告	上证报、中证报、证券报、证券日报、中证会披露、公司	2020 年 1 月 1 日
	长信基金管理有限责任公司关于 2020 年 假期 长期 整公司 下基金 、 算交 等事 的提示性公告	中证会披露、公司	2020 年 1 月 31 日

6	长信基金管理有限责任公司关于 下分式基金增 中信 投证券股份有限公司代 并 、定期定 投资业务及 (定投) 动的公告	上证报、证券 报、中 证 会 披露 、公司	2020 年 2 月 3 日
	长信基金管理有限责任公司关于 下基金持有的长期 股票 整估值方法的公告	上证报、中 证 会 披露 、公司	2020 年 3 月 13 日
8	长信基金管理有限责任公司关于 下基金持有的长期 股票 整估值方法的公告	上证报、中 证 会 披露 、公司	2020 年 3 月 1 日
9	长信基金管理有限责任公司关于增 上基金 有限公司 下分式基金代 并 定期定 投资、 业务及 (定投) 动的公告	中证报、证券 报、中 证 会 披露 、公司	2020 年 3 月 18 日
10	长信基金管理有限责任公司关于 披露 下公募基金 2019 年年度报告的公告	上证报、中 证 会 披露 、公司	2020 年 3 月 2 日
11	长信基金管理有限责任公司关于长信沪深 300 指数增强型证券投资基金 大 (、定期定 投资) 业务的公告	证券 报、中 证 会 披露 、公 司	2020 年 月 20 日
12	长信沪深 300 指数增强型证券投资基金 2020 年第 1 度报告	中 证 会 披露 、公司	2020 年 月 22 日
13	长信基金管理有限责任公司 下 基金 2020 年第一 度报告提示性公告	上证报、中证报、证 券 报、证券日报、中 证 会 披露 、公司	2020 年 月 22 日
1	长信基金管理有限责任公司关于长信沪深 300 指数增强型证券投资基金基金经理变更的公告	证券 报、中 证 会 披露 、公 司	2020 年 月 23 日
1	长信沪深 300 指数增强型证券投资基金(原长信 价值 合型证券投资基金型) 2019 年年度报告	中 证 会 披露 、公司	2020 年 月 2 日
16	长信基金管理有限责任公司 下 基金 2019 年年度报告提示性公告	上证报、中证报、证 券 报、证券日报、中 证 会 披露 、公司	2020 年 月 2 日
1	长信沪深 300 指数增强型证券投资基金更新的招募说明书及 要 (要见报)	证券 报、中 证 会 披露 、公 司	2020 年 月 2 日
18	长信基金管理有限责任公司关于增 中信 证券股份有限公司 下分式基金代 并 定期定 投资、 业务及 (定投) 动的公告	上证报、中证报、证 券 报、证券日报、中 证 会 披露 、公司	2020 年 月 日
19	长信基金管理有限责任公司关于增 中 人 保险股份有限公司 下分式基金代 并 定期定 投资、 业	上证报、中证报、证 券 报、证券日报、中 证 会 披露	2020 年 月 21 日

	务及 的公告	（ 定投 ）	动	、公司	
20	长信沪深 300 指数增强型证券投资基金更新的招募说明书（2020 年第 1 ）及 要（ 要见报）			证券 报、中 证 会 披露 、公 司	2020 年 月 29 日
21	长信基金管理有限责任公司关于下分 式基金 宏 证券有限公司基 金 （ 定期定 投资 ） 动的公告			上证报、中 证 会 披露 、公司	2020 年 6 月 3 日
22	长信基金管理有限责任公司关于增 商 基金 （上 ）有限公司 下分 式基金代 并 业务及 动的公告			上证报、中证报、证 券 报、证券日报、 中 证 会 披露 、公司	2020 年 6 月 3 日
23	长信基金管理有限责任公司关于增 益基金 有限公司 下分 式 基金代 并 、定期定 投资业 务及 （ 定投 ） 动 的公告			上证报、中证报、证 券 报、证券日报、 中 证 会 披露 、公司	2020 年 6 月 10 日
2	长信基金管理有限责任公司关于增 证券股份有限公司 下分 式基金 代 并 、定期定 投资业务及 （ 定期定 投资 ） 动的公告			上证报、中证报、证 券 报、证券日报、 中 证 会 披露 、公司	2020 年 6 月 1 日
2	长信基金管理有限责任公司关于增 深 市金 基金 有限公司 下分 式基金代 并 、定期定 投资业务及 （ 定投 ） 动的公告			上证报、中证报、证 券 报、证券日报、 中 证 会 披露 、公司	2020 年 6 月 1 日
26	长信基金管理有限责任公司关于下分 式基金 交 银行股份有限公司 银行基金 （ 定期定 投资 ） 动的公告			上证报、中 证 会 披露 、公司	2020 年 6 月 29 日
2	长信基金管理有限责任公司关于长信沪深 300 指数增强型证券投资基金 复大 （ 、定期定 投资）业务的公 告			证券 报、中 证 会 披露 、公 司	2020 年 6 月 30 日

§11 投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内 一投资者持有基金份额 比例 或 过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额 变 情况					报告期末持有基金情况	
	序	持有基金份额 比例 或者 过 20 的	期 份	份	份	持有份	份 占 比
	1	2020 年 1 月 1 日 至 2020 年 1 月 20 日	23 63 162 83	0 00	900 000 00	22 63 162 83	13 60
	2	2020 年 1 月 1 日 至 2020 年 2 月 9 日	1 991 068	33 219 898 13	0 00	210 966 8	3
个人							
产品 有风险							
<p>1、基金净值大 动的风险 一持有基金比例过 的投资者连 大 ， 会 基金投资的持 性和 定性，增 变现本。同 ， 按 净值计算 理规则 起基金份额 净值 上 或下 。</p> <p>2、 期 理的风险 一持有基金比例过 的投资者大 发本基金 ， 导 同期中小投资者小 分 期 理的情况。</p> <p>3、基金投资策略 以实现的风险 一持有基金比例过 的投资者大 ， 起基金资产 净值 ， 基金在投资 限 ， 导 基金投资策略 以实现。</p>							

11.2 投资者决策的其他重要信息

注：本基金本报告期未发 投资者决策的其他重要信息。

§12 目录

12.1 目录

- 1、中 证 会 准 立基金的
- 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
、长信沪深 300 指数增强型证券投资基金托管
、报告期内在指定报 上披露的 公告的原
- 6、长信基金管理有限责任公司 业 、公司 程及相关资 复 。

12.2 存

基金管理人的 公场所。

12.3 阅方式

长信基金管理有限责任公司 :

长信基金管理有限责任公司

2020 年 8 月 29 日