

长信沪深 300 指数增强型证券投资基金 2025 年中期报告

2025 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：2025 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根据本基金合同规定，于 2025 年 8 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2025 年 1 月 1 日起至 2025 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
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	12
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	39
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	39
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	43
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	46
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	47

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	47
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	47
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	47
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	47
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	47
7.12 投资组合报告附注	47
§ 8 基金份额持有人信息	48
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	48
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	48
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	49
§ 9 开放式基金份额变动	49
§ 10 重大事件揭示	49
10.1 基金份额持有人大会决议	49
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	49
10.4 基金投资策略的改变	50
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	50
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	50
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	50
10.8 其他重大事件	51
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	52
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	52
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	52
§ 12 备查文件目录	52
12.1 备查文件目录	52
12.2 存放地点	53
12.3 查阅方式	53

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	长信沪深 300 指数增强型证券投资基金	
基金简称	长信沪深 300 指数	
基金主代码	005137	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019 年 5 月 16 日	
基金管理人	长信基金管理有限责任公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	582,326,602.17 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	长信沪深 300 指数 A	长信沪深 300 指数 C
下属分级基金的交易代码	005137	007448
报告期末下属分级基金的份额总额	296,989,701.00 份	285,336,901.17 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为增强型股票指数基金，通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段，追求基金净值增长率与业绩比较基准之间跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 7.75%，同时力求实现超越标的指数的业绩表现，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金在指数化投资的基础上通过数量化模型进行投资组合优化，在控制与业绩比较基准偏离风险的前提下，力争获得超越标的指数的投资收益。本基金为股票指数增强型证券投资基金，投资股票的资产不低于基金资产的 80%，其中，投资于标的指数成分股及其备选成分股的比例不低于非现金基金资产的 80%。大类资产配置不作为本基金的核心策略，一般情况下将保持各类资产配置的基本稳定。在综合考量系统性风险、各类资产收益风险比值、股票资产估值、流动性要求、申购赎回以及分红等因素后，对基金资产配置做出合适调整。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*95%+银行活期存款利率(税后)*5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期风险和预期收益均高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金为指数型基金，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		长信基金管理有限责任公司	招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	周永刚	张姗
	联系电话	021-61009999	400-61-95555
	电子邮箱	zhouyg@cxfund.com.cn	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		4007005566	400-61-95555
传真		021-61009800	0755-83195201
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区银城中路 68 号 37 层	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

办公地址	上海市浦东新区银城中路 68 号 9 楼、37 楼、38 楼	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码	200120	518040
法定代表人	刘元瑞	缪建民

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.cxfund.com.cn
基金中期报告备置地点	上海市浦东新区银城中路 68 号 38 楼、深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	长信基金管理有限责任公司	上海市浦东新区银城中路 68 号 9 楼、37 楼、38 楼

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2025 年 1 月 1 日-2025 年 6 月 30 日)	
	长信沪深 300 指数 A	长信沪深 300 指数 C
本期已实现收益	17,498,483.46	20,625,429.23
本期利润	13,533,254.89	14,407,277.90
加权平均基金份额本期利润	0.0787	0.0702
本期加权平均净值利润率	6.64%	6.06%
本期基金份额净值增长率	5.04%	4.83%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	60,048,465.82	34,219,827.47
期末可供分配基金份额利润	0.2022	0.1199
期末基金资产净值	364,858,195.11	341,507,734.44
期末基金份额净值	1.2285	1.1969
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	57.47%	53.42%

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

2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，封闭式基金交易佣金、

开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等)，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

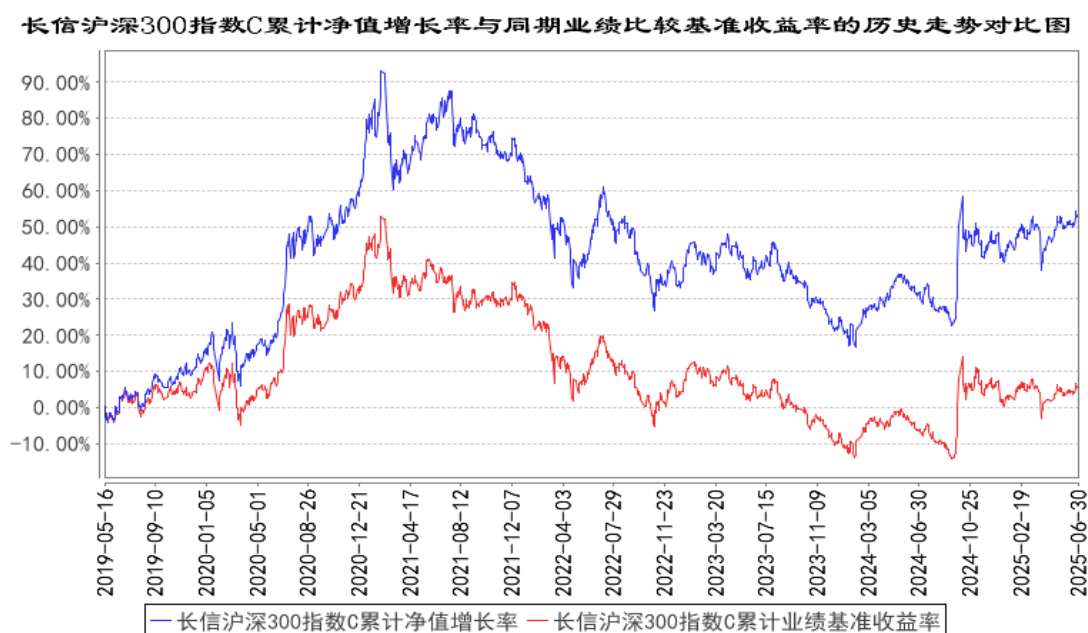
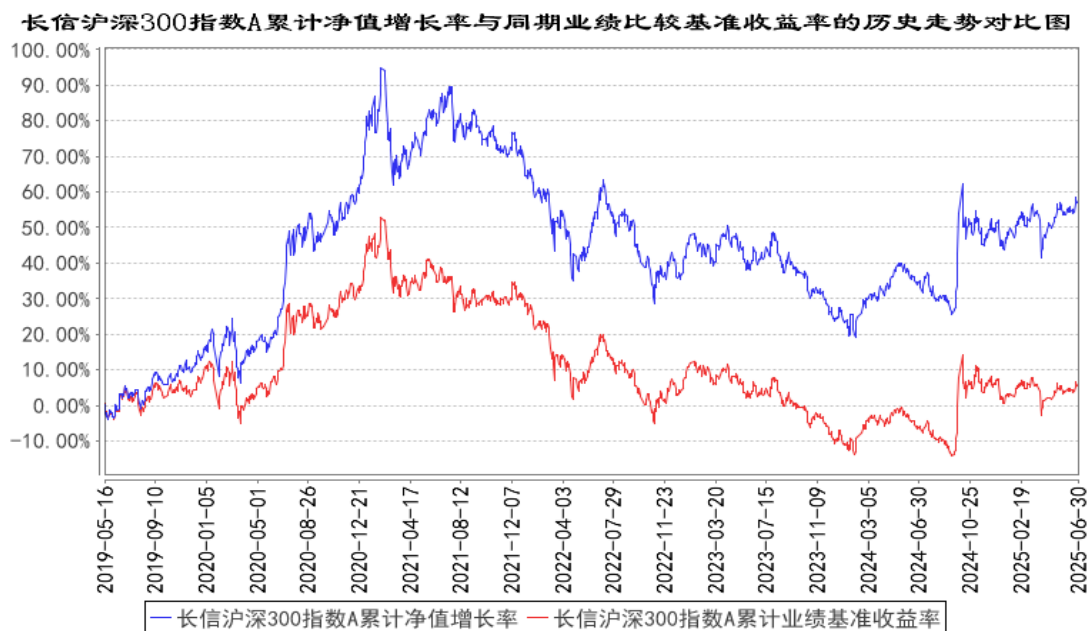
长信沪深 300 指数 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	2.55%	0.57%	2.37%	0.55%	0.18%	0.02%
过去三个月	2.50%	1.11%	1.21%	1.04%	1.29%	0.07%
过去六个月	5.04%	1.01%	0.07%	0.97%	4.97%	0.04%
过去一年	17.10%	1.29%	13.12%	1.32%	3.98%	-0.03%
过去三年	-1.36%	1.03%	-11.43%	1.05%	10.07%	-0.02%
自基金合同生效起至今	57.47%	1.14%	5.96%	1.13%	51.51%	0.01%

长信沪深 300 指数 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	2.52%	0.57%	2.37%	0.55%	0.15%	0.02%
过去三个月	2.40%	1.11%	1.21%	1.04%	1.19%	0.07%
过去六个月	4.83%	1.01%	0.07%	0.97%	4.76%	0.04%
过去一年	16.65%	1.29%	13.12%	1.32%	3.53%	-0.03%
过去三年	-2.52%	1.02%	-11.43%	1.05%	8.91%	-0.03%
自基金合同生效起至今	53.42%	1.14%	5.96%	1.13%	47.46%	0.01%

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



注：1、图示日期为 2019 年 5 月 16 日至 2025 年 6 月 30 日。

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

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

长信基金管理有限责任公司是经中国证监会证监基金字【2003】63 号文批准，由长江证券股

份有限公司、上海海欣集团股份有限公司、武汉钢铁股份有限公司共同发起设立。注册资本 1.65 亿元人民币。目前股权结构为：长江证券股份有限公司占 44.55%、上海海欣集团股份有限公司占 31.21%、武汉钢铁有限公司占 15.15%、上海彤胜投资管理中心（有限合伙）占 4.55%、上海彤骏投资管理中心（有限合伙）占 4.54%。

截至 2025 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 85 只开放式基金，即长信利息收益开放式证券投资基金、长信银利精选混合型证券投资基金、长信金利趋势混合型证券投资基金、长信增利动态策略混合型证券投资基金、长信利丰债券型证券投资基金、长信量化先锋混合型证券投资基金、长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金、长信利鑫债券型证券投资基金（LOF）、长信内需成长混合型证券投资基金、长信可转债债券型证券投资基金、长信利众债券型证券投资基金（LOF）、长信纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信纯债壹号债券型证券投资基金、长信改革红利灵活配置混合型证券投资基金、长信量化中小盘股票型证券投资基金、长信利富债券型证券投资基金、长信多利灵活配置混合型证券投资基金、长信睿进灵活配置混合型证券投资基金、长信量化多策略股票型证券投资基金、长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、长信利保债券型证券投资基金、长信金葵纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信富全纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信利泰灵活配置混合型证券投资基金、长信利发债券型证券投资基金、长信电子信息行业量化灵活配置混合型证券投资基金、长信创新驱动股票型证券投资基金、长信稳益纯债债券型证券投资基金、长信利信灵活配置混合型证券投资基金、长信稳健纯债债券型证券投资基金、长信国防军工量化灵活配置混合型证券投资基金、长信先优债券型证券投资基金、长信稳势纯债债券型证券投资基金、长信中证 500 指数增强型证券投资基金、长信长金通货币市场基金、长信稳通三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长信低碳环保行业量化股票型证券投资基金、长信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、长信中证 A500 指数增强型证券投资基金、长信稳瑞纯债债券型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
宋海岸	长信中证 500 指数增强型证券投资基金、长信国防军工量化灵活配置混合型证券投资基金、长信沪深 300 指数增强型证券投资基金、长信先进装备三个月持有期混合型基金和长信电子信息行业量化灵活配置混合型基金 的 基 金 经 理、量化研究部总监	2019 年 5 月 16 日	-	11 年	理学硕士，上海交通大学应用数学研究生毕业，具有基金从业资格，中国国籍。曾担任海通期货股份有限公司研究员、前海开源基金管理有限公司投资经理助理和西部证券股份有限公司研究员。2016 年 9 月加入长信基金管理有限责任公司，历任量化投资部研究员、基金经理助理、量化投资部副总监、长信中证一带一路主题指数分级证券投资基金、长信中证能源互联网主题指数型证券投资基金（LOF）、长信价值优选混合型证券投资基金、长信先优债券型证券投资基金和长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金（LOF）的基金经理，现任量化研究部总监、长信中证 500 指数增强型证券投资基金、长信国防军工量化灵活配置混合型证券投资基金、长信沪深 300 指数增强型证券投资基金、长信先进装备三个月持

					有期混合型证券投资基金和长信电子信息行业量化灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--	---

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

2、证券从业的含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

今年上半年，市场整体震荡上行，沪深两市日均成交额维持在 1-2 万亿元区间，市场活跃度较高。宏观上来看，CPI 和 PPI 总体下行，同时受海外复杂形势影响，内需、出海、军工等行业均有所表现。市场风格上，小微盘、高贝塔风格相对占优，哑铃型配置成为市场主流。行业层面，以银行为代表的金融红利和以 AI 为代表的 TMT 板块涨幅居前。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2025 年 6 月 30 日，长信沪深 300 指数 A 基金份额净值为 1.2285 元，份额累计净值为

1.5091 元，本报告期内长信沪深 300 指数 A 净值增长率为 5.04%；长信沪深 300 指数 C 基金份额净值为 1.1969 元，份额累计净值为 1.4741 元，本报告期内长信沪深 300 指数 C 净值增长率为 4.83%，同期业绩比较基准收益率为 0.07%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我们将坚持基本面为主，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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人严格按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金持有的投资品种进行估值。基金托管人根据法律法规要求对基金管理公司采用的估值政策和程序进行核查，并对估值结果及净值计算进行复核。

根据相关法律法规，本基金管理人制订了健全、有效的估值政策和估值程序，设立了估值委员会，估值委员会是公司基金估值的主要决策机构，其主要职责是负责拟定公司的估值政策、估值方法及采用的估值程序和技术，对公司现有程序和技术进行复核和审阅，当发生了影响估值程序和技术的有效性及适用性的情况及时修订估值程序；估值委员会成员由基金事务部、投资、研究、交易等相关业务部门负责人以及基金事务部至少一名业务骨干共同组成，相关参与人员都具有丰富的证券行业工作经验，熟悉相关法规和估值方法，均具备估值业务所需的专业胜任能力。对于基金的估值政策和估值原则，公司已与基金托管人充分沟通，并达成一致意见。审计本基金的会计师事务所认可公司基金估值政策和程序的适当性。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定分别提供银行间同业市场及交易所交易的债券品种的估值数据以及流通受限股票的折扣率。参与估值流程各方不存在任何重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规和本基金基金合同规定的基金收益分配原则以及基金实际运作情况，本基金本报告期没有进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

托管人声明：

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

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

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

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

本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：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	51,235,070.95	29,855,297.08
结算备付金		4,292.35	4,276.86
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	666,493,696.21	290,158,822.24
其中：股票投资		666,493,696.21	290,158,822.24
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-

债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		3,513,357.59	3,180,171.05
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		721,246,417.10	323,198,567.23
负债和净资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		14,129,326.85	12,734,617.71
应付管理人报酬		477,535.09	359,284.03
应付托管费		71,630.27	53,892.61
应付销售服务费		111,343.12	86,422.47
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	90,652.22	224,760.60
负债合计		14,880,487.55	13,458,977.42
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	582,326,602.17	268,078,840.43
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	124,039,327.38	41,660,749.38
净资产合计		706,365,929.55	309,739,589.81
负债和净资产总计		721,246,417.10	323,198,567.23

注：报告截止日 2025 年 6 月 30 日，长信沪深 300 指数 A 份额净值 1.2285 元，长信沪深 300 指数 C 份额净值 1.1969 元，基金份额总额为 582,326,602.17 份，其中长信沪深 300 指数 A 份额 296,989,701.00 份。长信沪深 300 指数 C 份额 285,336,901.17 份。

6.2 利润表

会计主体：长信沪深 300 指数增强型证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
一、营业总收入		31,045,677.14	18,967,205.92
1. 利息收入		63,367.83	52,227.26
其中：存款利息收入	6.4.7.13	63,367.83	52,227.26
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		41,098,318.31	8,506,863.91
其中：股票投资收益	6.4.7.14	34,237,067.59	4,717,140.41
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	-7,584.48
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	6,861,250.72	3,797,307.98
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	-10,183,379.90	10,367,393.47
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	67,370.90	40,721.28
减：二、营业总支出		3,105,144.35	2,268,839.64
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,175,297.01	1,602,202.93
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	326,294.50	240,330.37
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	466,399.01	239,816.53
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-

6. 信用减值损失	6. 4. 7. 22	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6. 4. 7. 23	137, 153. 83	186, 489. 81
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		27, 940, 532. 79	16, 698, 366. 28
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		27, 940, 532. 79	16, 698, 366. 28
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		27, 940, 532. 79	16, 698, 366. 28

6.3 净资产变动表

会计主体：长信沪深 300 指数增强型证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	268, 078, 840. 43	-	41, 660, 749. 38	309, 739, 589. 81
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	268, 078, 840. 43	-	41, 660, 749. 38	309, 739, 589. 81
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	314, 247, 761. 74	-	82, 378, 578. 00	396, 626, 339. 74
（一）、综合收益总额	-	-	27, 940, 532. 79	27, 940, 532. 79
（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）	314, 247, 761. 74	-	54, 438, 045. 21	368, 685, 806. 95
其中：1. 基金申购款	477, 458, 822. 66	-	82, 695, 908. 49	560, 154, 731. 15
2. 基金赎回款	-163, 211, 060. 92	-	-28, 257, 863. 28	-191, 468, 924. 20

(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	582,326,602.17	-	124,039,327.38	706,365,929.55
项目	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	323,549,925.44	-	-4,608,628.96	318,941,296.48
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	323,549,925.44	-	-4,608,628.96	318,941,296.48
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	31,572,472.17	-	18,436,319.88	50,008,792.05
(一)、综合收益总额	-	-	16,698,366.28	16,698,366.28
(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)	31,572,472.17	-	1,737,953.60	33,310,425.77
其中：1. 基金申购款	93,797,975.38	-	1,942,291.62	95,740,267.00
2. 基金赎回款	-62,225,503.21	-	-204,338.02	-62,429,841.23
(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	355,122,397.61	-	13,827,690.92	368,950,088.53

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

刘元瑞

基金管理人负责人

覃波

主管会计工作负责人

孙红辉

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

长信沪深 300 指数增强型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2017]1548 号《关于准予长信量化价值精选混合型证券投资基金注册的批复》的核准，由基金管理人长信基金管理有限责任公司向社会公开发行募集，基金合同于 2018 年 4 月 19 日生效，首次设立募集规模为 220,607,762.64 份基金份额。根据《长信沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》及《关于长信量化价值精选混合型证券投资基金基金份额持有人大会决议生效公告》，本基金自 2019 年 5 月 16 日起转型并更名为长信沪深 300 指数增强型证券投资基金。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人及注册登记机构为长信基金管理有限责任公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

《长信沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》生效后，原长信量化价值精选混合型证券投资基金份额全部自动转换为长信沪深 300 指数增强型证券投资基金 A 类基金份额，且基金份额持有时间持续计算。新增长信沪深 300 指数增强型证券投资基金 C 类基金份额。

本基金的标的指数为沪深 300 指数。

本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数成份股及其备选成份股、其他股票（含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、存托凭证、权证、股指期货、债券（包括国内依法发行上市的国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、中小企业私募债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券以及经法律法规或中国证监会允许投资的其他债券）、债券回购、资产支持证券、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。如法律法规或监管机构

以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：本基金持有的股票资产占基金资产的比例为不低于 80%，其中，投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或到期日在一年以内的政府债券。本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%。

如果法律法规对该比例要求有变更的，以变更后的比例为准，本基金的投资比例会做相应调整。

本基金业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率*95%+银行活期存款利率（税后）*5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集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 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《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〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2025 年 6 月 30 日的财务状况以及 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

6.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰ 调整为 1‰；根据财政部、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》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变。

6.4.6.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《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》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金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。对证券投资基金在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。增值税应税行为的销售额根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定确定。

6.4.6.3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税法》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育附加。

6.4.6.4 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，

自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资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，股权的股息、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。

6.4.6.5 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《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》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，暂减按 25%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；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《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》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日
活期存款	19,735,869.05
等于：本金	19,734,418.61
加：应计利息	1,450.44
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	31,499,201.90
等于：本金	31,496,389.00
加：应计利息	2,812.90
减：坏账准备	—
合计	51,235,070.95

注：其他存款为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2025 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		660,092,332.55	—	666,493,696.21	6,401,363.66
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		660,092,332.55	—	666,493,696.21	6,401,363.66

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

本基金本报告期末无债权投资。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

本基金本报告期末无其他债权投资。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

本基金本报告期末无其他权益投资工具。

6.4.7.8 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1,392.07
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	29,752.78
预提信息披露费	59,507.37
合计	90,652.22

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

长信沪深 300 指数 A

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	131,712,359.47	131,712,359.47
本期申购	208,087,577.60	208,087,577.60
本期赎回（以“-”号填列）	-42,810,236.07	-42,810,236.07
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	296,989,701.00	296,989,701.00

长信沪深 300 指数 C

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	136,366,480.96	136,366,480.96
本期申购	269,371,245.06	269,371,245.06
本期赎回（以“-”号填列）	-120,400,824.85	-120,400,824.85

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	285,336,901.17	285,336,901.17

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.11 其他综合收益

本基金本报告期无其他综合收益。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

长信沪深 300 指数 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	13,499,242.89	8,840,997.50	22,340,240.39
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	13,499,242.89	8,840,997.50	22,340,240.39
本期利润	17,498,483.46	-3,965,228.57	13,533,254.89
本期基金份额交易产生的变动数	29,050,739.47	2,944,259.36	31,994,998.83
其中：基金申购款	35,303,534.23	4,717,569.93	40,021,104.16
基金赎回款	-6,252,794.76	-1,773,310.57	-8,026,105.33
本期已分配利润	-	-	-
本期末	60,048,465.82	7,820,028.29	67,868,494.11

长信沪深 300 指数 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	3,402,588.97	15,917,920.02	19,320,508.99
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	3,402,588.97	15,917,920.02	19,320,508.99
本期利润	20,625,429.23	-6,218,151.33	14,407,277.90
本期基金份额交易产生的变动数	10,191,809.27	12,251,237.11	22,443,046.38
其中：基金申购款	19,472,360.02	23,202,444.31	42,674,804.33
基金赎回款	-9,280,550.75	-10,951,207.20	-20,231,757.95
本期已分配利润	-	-	-
本期末	34,219,827.47	21,951,005.80	56,170,833.27

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	29,532.15
定期存款利息收入	—
其他存款利息收入	26,893.00
结算备付金利息收入	15.49
其他	6,927.19
合计	63,367.83

注：1、其他为申购款利息收入。

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。

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	1,020,793,379.51
减：卖出股票成本总额	985,400,028.23
减：交易费用	1,156,283.69
买卖股票差价收入	34,237,067.59

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期无买卖债券差价收入。

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无债券投资赎回差价收入。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无债券投资申购差价收入。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	6,861,250.72
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	6,861,250.72

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-10,183,379.90
股票投资	-10,183,379.90
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	-10,183,379.90

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	49,112.14
基金转换费收入	18,258.76
合计	67,370.90

注：对持续持有期少于 7 日的投资者收取的赎回费全额计入基金财产；其余赎回费总额的 25%应归基金财产。

6.4.7.22 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
审计费用	29,752.78
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
指数使用费_基点费	43,888.89
其他费用	4,004.79
合计	137,153.83

注：1、其他费用为银行手续费。

2、自 2025 年 3 月 21 日起，本基金指数使用费由基金管理人承担。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方无变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
长信基金管理有限责任公司（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
招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”）	基金托管人、基金销售机构
长江证券股份有限公司（以下简称“长江证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
-------	---------------------------------------	--

	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)
长江证券	2,392,079,766.59	100.00	1,541,109,511.11	100.00

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年1月1日至2025年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
长江证券	492,538.17	100.00	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
长江证券	651,840.11	100.00	-	-

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，本基金与关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

2. 根据《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，基金管理人管理的被动股票型基金的股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率，且不得通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；其他类型基金可以通过交易佣金支付研究服务费用，但股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍，且不得通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。相关佣金协议已根据此规定完成了更新。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年
----	--------------------------------	-----------------------------------

	月 30 日	6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	2,175,297.01	1,602,202.93
其中：应支付销售机构的客户维护费	640,334.90	378,477.11
应支付基金管理人的净管理费	1,534,962.11	1,223,725.82

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

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times \text{管理费率} / \text{当年天数}。$$

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	326,294.50	240,330.37

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.15%的年费率计提，支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值×年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times \text{托管费率} / \text{当年天数}。$$

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	长信沪深 300 指数 A	长信沪深 300 指数 C	合计
长信基金	—	90,732.50	90,732.50
招商银行	—	30,418.95	30,418.95
长江证券	—	34,743.11	34,743.11
合计	—	155,894.56	155,894.56
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	长信沪深 300 指数 A	长信沪深 300 指数 C	合计
长信基金	—	80,301.86	80,301.86
招商银行	—	13,897.48	13,897.48
长江证券	—	31,011.87	31,011.87
合计	—	125,211.21	125,211.21

注：根据基金合同的规定，本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费

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。其计算公式为：

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

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

基金销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	长信沪深 300 指数 A	长信沪深 300 指数 C
基金合同生效日（2019 年 5 月 16 日）持有的基金份额	—	—
报告期初持有的基金份额	52,162.71	56,812.64
报告期内申购/买入总份额	—	—
报告期内因拆分变动份额	—	—
减：报告期内赎回/卖出总份额	—	—
报告期末持有的基金份额	52,162.71	56,812.64
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.01%	0.01%
项目	上年度可比期间	

	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	长信沪深 300 指数 A	长信沪深 300 指数 C
基金合同生效日（2019 年 5 月 16 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	52,162.71	56,812.64
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	52,162.71	56,812.64
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.01%	0.02%

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

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

除基金管理人之外的其他关联方在本报告期末及上年度末均未投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行	19,735,869.05	29,532.15	12,895,904.60	14,205.23

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期及上年度可比期间均未在承销期内购入过由关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期末存放于长江证券的结算备付金金额为人民币 31,499,201.90 元（2024 年 6 月 30 日：人民币 11,893,652.06 元）；本报告期存放于长江证券的结算备付金产生的利息收入为人民币 26,893.00 元（2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日：人民币 36,986.46 元）。

6.4.11 利润分配情况

本报告期本基金未进行利润分配。

6.4.12 期末（2025 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券	证券	成功	受限	流通	认购	期末	数量	期末	期末估值	备注

代码	名称	认购 日	期	受限 类型	价格	估值 单价	(单 位: 股)	成本总额	总额	
001388	信通 电子	2025 年 6 月 24 日	1-6 个 月(含)	新股 未上 市	16.42	16.42	937	15,385.54	15,385.54	-
001390	古麒 绒材	2025 年 5 月 21 日	6 个月	新股 限售	12.08	18.12	178	2,150.24	3,225.36	-
301590	优优 绿能	2025 年 5 月 28 日	6 个月	新股 限售	89.60	139.48	73	6,540.80	10,182.04	-
301595	太力 科技	2025 年 5 月 12 日	6 个月	新股 限售	17.05	29.10	196	3,341.80	5,703.60	-
301636	泽润 新能	2025 年 4 月 30 日	6 个月	新股 限售	33.06	47.46	128	4,231.68	6,074.88	-
301678	新恒 汇	2025 年 6 月 13 日	6 个月	新股 限售	12.80	44.54	382	4,889.60	17,014.28	-
603014	威高 血净	2025 年 5 月 12 日	6 个月	新股 限售	26.50	32.68	205	5,432.50	6,699.40	-
603049	中策 橡胶	2025 年 5 月 27 日	6 个月	新股 限售	46.50	42.85	213	9,904.50	9,127.05	-
603382	海阳 科技	2025 年 6 月 5 日	6 个月	新股 限售	11.50	22.39	105	1,207.50	2,350.95	-
603400	华之 杰	2025 年 6 月 12 日	6 个月	新股 限售	19.88	43.81	57	1,133.16	2,497.17	-
688755	汉邦	2025	6 个月	新股	22.77	39.33	203	4,622.31	7,983.99	-

	科技	年 5 月 9 日		限售						
688775	影石创新	2025 年 6 月 4 日	6 个月	新股限售	47.27	124.16	388	18,340.76	48,174.08	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688313	仕佳光子	2025 年 6 月 30 日	重大事项停牌	38.05	2025 年 7 月 11 日	39.98	28,600	1,044,072.72	1,088,230.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无因交易所市场债券正回购交易而抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的融出证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常活动中面临各种金融工具的风险，主要包括：信用风险、流动性风险和市场风险。

本基金在下文主要论述上述风险敞口及其形成原因、风险管理目标、政策和过程以及计量风险的方法等。

本基金的基金管理人从事风险管理的目标是使本基金在风险和收益之间取得适当的平衡，以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。基于该风险管理目标，本基金的基金管理人已制定了政策和程序来辨别和分析这些风险，设定适当的风险限额并设计相应的内部控制程序，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人奉行全面风险管理体系理念，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、

监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。在董事会下设立风险控制委员会，负责对公司经营管理和基金业务运作的合法性、合规性进行全面的检查和评估等；在管理层层面设立内部控制委员会，主要职责是讨论审议公司内部控制制度及针对公司在经营管理和投资组合运作中的风险进行识别、评估并研究制订有效的防范措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部负责协调并与各部门合作完成运作风险管理工作，战略与产品研发部负责进行投资风险分析与绩效评估。监察稽核部向督察长负责，并向总经理汇报日常行政事务。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的银行存款存放在本基金的托管人招商银行股份有限公司，与该银行存款相关的信用风险不重大。

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

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金流动性风险来源于开放式基金每日兑付赎回资金的流动性风险，以及因部分投资品种交易不活跃而出现的变现风险和因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理价格变现投资的风险。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金坚持组合管理、分散投资的原则开展投资活动，所持证券均在证券交易所或银行间同业市场交易，并严格遵守基金管理人流动性相关交易限制。

本基金主要投资于基金合同约定的具有良好流动性的金融工具，基金管理人流动性指标进行持续的监测和分析，定期开展压力测试，评估在不同的压力情境下资产变现情况的变化。

基金管理人持续监测本基金开放期内的赎回情况，当市场环境或投资者结构发生变化时，及时调整投资组合资产结构及比例，保持基金资产可变现规模和期限与负债赎回规模和期限的匹配。

同时，针对兑付赎回资金的流动性风险，基金管理人在基金合同中约定了巨额赎回条款，制定了发生巨额赎回时资金的处理模式，控制因开放模式而产生的流动性风险。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金及存出保证金等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025 年 6 月 30 日	6 个月以内	6 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产						
货币资金	51,235,070.95	-	-	-	-	51,235,070.95
结算备付金	4,292.35	-	-	-	-	4,292.35
交易性金融资产	-	-	-	-	666,493,696.21	666,493,696.21
应收申购款	-	-	-	-	3,513,357.59	3,513,357.59
资产总计	51,239,363.30	-	-	-	670,007,053.80	721,246,417.10

负债						
应付赎回款	-	-	-	-	14,129,326.85	14,129,326.85
应付管理人报酬	-	-	-	-	477,535.09	477,535.09
应付托管费	-	-	-	-	71,630.27	71,630.27
应付销售服务费	-	-	-	-	111,343.12	111,343.12
其他负债	-	-	-	-	90,652.22	90,652.22
负债总计	-	-	-	-	14,880,487.55	14,880,487.55
利率敏感度缺口	51,239,363.30	-	-	-	655,126,566.25	706,365,929.55
上年度末 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	29,855,297.08	-	-	-	-	29,855,297.08
结算备付金	4,276.86	-	-	-	-	4,276.86
交易性金融资产	-	-	-	-	290,158,822.24	290,158,822.24
应收申购款	-	-	-	-	3,180,171.05	3,180,171.05
资产总计	29,859,573.94	-	-	-	293,338,993.29	323,198,567.23
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	12,734,617.71	12,734,617.71
应付管理人报酬	-	-	-	-	359,284.03	359,284.03
应付托管费	-	-	-	-	53,892.61	53,892.61
应付销售服务费	-	-	-	-	86,422.47	86,422.47
其他负债	-	-	-	-	224,760.60	224,760.60
负债总计	-	-	-	-	13,458,977.42	13,458,977.42
利率敏感度缺口	29,859,573.94	-	-	-	279,880,015.87	309,739,589.81

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金于本报告期末及上年度末均未持有债券，无重大利率风险，因而未进行敏感性分析。银行存款及结算备付金之浮动利率根据中国人民银行的基准利率和相关机构的相关政策浮动。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票和债券以及银行间同业市场交易的债券，所面临的重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(ValueatRisk)等指标来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

于 6 月 30 日，本基金面临的其他市场价格风险列示如下：

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日		上年度末 2024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	666,493,696.21	94.36	290,158,822.24	93.68
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	666,493,696.21	94.36	290,158,822.24	93.68

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	在 95%的置信区间内，基金资产组合的市场价格风险		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2025 年 6 月 30 日）	上年度末（2024 年 12 月 31 日）
	VaR 值为 3.48%(2024 年 12 月 31 日 VaR 值为 3.39%)	-24,558,357.56	-10,508,313.71

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。2024 年的分析同样基于该假设。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一

层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	665,271,047.87	290,130,189.95
第二层次	1,103,615.54	-
第三层次	119,032.80	28,632.29
合计	666,493,696.21	290,158,822.24

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。对于公开市场交易的股票、债券等投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，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投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的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，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.15.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

6.4.15.2 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	666,493,696.21	92.41
	其中：股票	666,493,696.21	92.41
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	51,239,363.30	7.10
8	其他各项资产	3,513,357.59	0.49
9	合计	721,246,417.10	100.00

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

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	13,775,079.00	1.95
B	采矿业	18,645,510.00	2.64
C	制造业	294,190,263.60	41.65
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,062,504.00	0.58
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	—	—
G	交通运输、仓储和邮政业	11,108,544.00	1.57
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	62,086,424.20	8.79
J	金融业	149,462,956.76	21.16
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	—	—
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	—	—

R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	553,331,281.56	78.33

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	1,689,050.00	0.24
B	采矿业	-	-
C	制造业	86,538,537.65	12.25
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,721,544.00	0.95
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	5,330,260.00	0.75
J	金融业	1,230,615.00	0.17
K	房地产业	6,567,768.00	0.93
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	5,084,640.00	0.72
S	综合	-	-
	合计	113,162,414.65	16.02

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未通过港股通交易机制投资港股。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300750	宁德时代	124,437	31,385,500.14	4.44
2	600519	贵州茅台	17,250	24,314,220.00	3.44
3	000333	美的集团	295,900	21,363,980.00	3.02
4	002594	比亚迪	57,900	19,217,589.00	2.72
5	601398	工商银行	2,442,500	18,538,575.00	2.62
6	000858	五粮液	146,300	17,395,070.00	2.46
7	601288	农业银行	2,703,000	15,893,640.00	2.25
8	000725	京东方 A	3,730,000	14,882,700.00	2.11
9	688256	寒武纪	23,068	13,875,402.00	1.96
10	002714	牧原股份	327,900	13,775,079.00	1.95

11	002230	科大讯飞	286,600	13,722,408.00	1.94
12	601229	上海银行	1,250,100	13,263,561.00	1.88
13	601211	国泰海通	679,400	13,017,304.00	1.84
14	601766	中国中车	1,817,100	12,792,384.00	1.81
15	000100	TCL 科技	2,935,500	12,710,715.00	1.80
16	600050	中国联通	2,379,200	12,704,928.00	1.80
17	002415	海康威视	455,386	12,627,853.78	1.79
18	601988	中国银行	2,210,100	12,420,762.00	1.76
19	601818	光大银行	2,978,100	12,359,115.00	1.75
20	600089	特变电工	1,021,000	12,180,530.00	1.72
21	601939	建设银行	1,273,300	12,019,952.00	1.70
22	601899	紫金矿业	615,900	12,010,050.00	1.70
23	601628	中国人寿	291,400	12,002,766.00	1.70
24	688111	金山办公	42,324	11,852,836.20	1.68
25	000063	中兴通讯	357,300	11,608,677.00	1.64
26	600219	南山铝业	2,909,800	11,144,534.00	1.58
27	601919	中远海控	738,600	11,108,544.00	1.57
28	600176	中国巨石	970,800	11,067,120.00	1.57
29	002001	新 和 成	519,400	11,047,638.00	1.56
30	600482	中国动力	475,100	10,960,557.00	1.55
31	603799	华友钴业	293,700	10,872,774.00	1.54
32	002648	卫星化学	623,400	10,803,522.00	1.53
33	600031	三一重工	593,600	10,655,120.00	1.51
34	601728	中国电信	1,281,400	9,930,850.00	1.41
35	601318	中国平安	171,187	9,497,454.76	1.34
36	600690	海尔智家	366,800	9,089,304.00	1.29
37	000776	广发证券	528,900	8,890,809.00	1.26
38	600028	中国石化	1,176,500	6,635,460.00	0.94
39	000166	申万宏源	1,095,500	5,499,410.00	0.78
40	600958	东方证券	540,300	5,230,104.00	0.74
41	000651	格力电器	116,200	5,219,704.00	0.74
42	688041	海光信息	33,400	4,719,086.00	0.67
43	603296	华勤技术	48,500	3,912,980.00	0.55
44	000001	平安银行	284,700	3,436,329.00	0.49
45	601166	兴业银行	114,000	2,660,760.00	0.38
46	600030	中信证券	94,800	2,618,376.00	0.37
47	600276	恒瑞医药	44,300	2,299,170.00	0.33
48	601985	中国核电	223,100	2,079,292.00	0.29
49	601377	兴业证券	323,300	2,001,227.00	0.28
50	600900	长江电力	65,800	1,983,212.00	0.28
51	300014	亿纬锂能	28,400	1,301,004.00	0.18
52	000596	古井贡酒	3,500	466,025.00	0.07
53	600460	士兰微	5,200	129,064.00	0.02

54	601077	渝农商行	15,800	112,812.00	0.02
55	688012	中微公司	80	14,584.00	0.00
56	688981	中芯国际	70	6,171.90	0.00
57	600426	华鲁恒升	73	1,581.91	0.00
58	688303	大全能源	36	767.52	0.00
59	688223	晶科能源	65	337.35	0.00

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	000959	首钢股份	1,991,900	6,772,460.00	0.96
2	000893	亚钾国际	224,400	6,763,416.00	0.96
3	002202	金风科技	658,200	6,746,550.00	0.96
4	600143	金发科技	649,200	6,693,252.00	0.95
5	603529	爱玛科技	193,600	6,659,840.00	0.94
6	601233	桐昆股份	625,700	6,632,420.00	0.94
7	601155	新城控股	480,100	6,567,768.00	0.93
8	000528	柳 工	682,800	6,561,708.00	0.93
9	002821	凯莱英	73,900	6,521,675.00	0.92
10	600578	京能电力	1,441,600	6,472,784.00	0.92
11	601609	金田股份	806,600	5,654,266.00	0.80
12	603893	瑞芯微	35,800	5,436,588.00	0.77
13	002970	锐明技术	107,900	5,330,260.00	0.75
14	300573	兴齐眼药	98,300	5,090,957.00	0.72
15	603103	横店影视	316,800	5,084,640.00	0.72
16	688475	萤石网络	140,900	4,441,168.00	0.63
17	688608	恒玄科技	12,206	4,247,443.88	0.60
18	002258	利尔化学	328,800	3,629,952.00	0.51
19	688617	惠泰医疗	10,710	3,180,870.00	0.45
20	300967	晓鸣股份	91,300	1,689,050.00	0.24
21	601456	国联证券	118,900	1,230,615.00	0.17
22	688313	仕佳光子	28,600	1,088,230.00	0.15
23	000600	建投能源	36,000	248,760.00	0.04
24	688667	菱电电控	3,071	163,407.91	0.02
25	600582	天地科技	19,500	116,805.00	0.02
26	688775	影石创新	388	48,174.08	0.01
27	301678	新恒汇	382	17,014.28	0.00
28	001388	信通电子	937	15,385.54	0.00
29	301590	优优绿能	73	10,182.04	0.00
30	603049	中策橡胶	213	9,127.05	0.00
31	688755	汉邦科技	203	7,983.99	0.00
32	603014	威高血净	205	6,699.40	0.00
33	301636	泽润新能	128	6,074.88	0.00
34	301595	太力科技	196	5,703.60	0.00

35	001390	古麒绒材	178	3, 225. 36	0. 00
36	688063	派能科技	69	3, 110. 52	0. 00
37	603400	华之杰	57	2, 497. 17	0. 00
38	603382	海阳科技	105	2, 350. 95	0. 00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601899	紫金矿业	35, 960, 639. 00	11. 61
2	000333	美的集团	34, 763, 261. 00	11. 22
3	000858	五粮液	31, 415, 310. 00	10. 14
4	600519	贵州茅台	28, 778, 445. 00	9. 29
5	601728	中国电信	25, 658, 630. 00	8. 28
6	002714	牧原股份	21, 303, 644. 65	6. 88
7	601211	国泰海通	21, 182, 231. 00	6. 84
8	688111	金山办公	19, 282, 728. 26	6. 23
9	002648	卫星化学	18, 982, 485. 50	6. 13
10	601398	工商银行	18, 876, 746. 00	6. 09
11	000100	TCL 科技	18, 142, 454. 30	5. 86
12	601939	建设银行	17, 679, 089. 00	5. 71
13	600690	海尔智家	16, 369, 995. 00	5. 29
14	002938	鹏鼎控股	16, 243, 027. 00	5. 24
15	688041	海光信息	16, 004, 993. 22	5. 17
16	002241	歌尔股份	15, 976, 115. 00	5. 16
17	300750	宁德时代	15, 952, 517. 00	5. 15
18	002230	科大讯飞	15, 434, 780. 10	4. 98
19	601658	邮储银行	15, 247, 102. 00	4. 92
20	688256	寒武纪	15, 200, 377. 77	4. 91
21	300502	新易盛	14, 441, 588. 00	4. 66
22	601288	农业银行	14, 427, 518. 00	4. 66
23	603799	华友钴业	13, 969, 783. 00	4. 51
24	002202	金风科技	13, 575, 284. 00	4. 38
25	601229	上海银行	13, 322, 610. 00	4. 30
26	600219	南山铝业	13, 292, 670. 00	4. 29
27	600089	特变电工	13, 026, 551. 00	4. 21
28	601818	光大银行	12, 557, 259. 00	4. 05
29	002415	海康威视	12, 422, 656. 38	4. 01
30	600585	海螺水泥	12, 352, 599. 00	3. 99
31	600031	三一重工	12, 310, 283. 00	3. 97
32	000063	中兴通讯	12, 248, 603. 00	3. 95
33	600176	中国巨石	12, 178, 498. 00	3. 93
34	000651	格力电器	11, 792, 283. 00	3. 81
35	600143	金发科技	11, 545, 722. 00	3. 73

36	601628	中国人寿	11,502,544.00	3.71
37	600276	恒瑞医药	11,318,983.13	3.65
38	601988	中国银行	11,256,461.00	3.63
39	601633	长城汽车	11,229,433.00	3.63
40	002821	凯莱英	11,146,195.00	3.60
41	603259	药明康德	10,987,508.00	3.55
42	600482	中国动力	10,913,808.00	3.52
43	601766	中国中车	10,673,015.00	3.45
44	600578	京能电力	10,256,780.00	3.31
45	600160	巨化股份	10,062,425.00	3.25
46	002284	亚太股份	10,013,736.00	3.23
47	300014	亿纬锂能	9,976,236.50	3.22
48	688696	极米科技	9,893,296.16	3.19
49	300274	阳光电源	9,672,955.20	3.12
50	000600	建投能源	9,525,277.00	3.08
51	605499	东鹏饮料	9,404,385.70	3.04
52	002594	比亚迪	9,397,785.00	3.03
53	300033	同花顺	9,092,838.00	2.94
54	601318	中国平安	9,039,112.00	2.92
55	600015	华夏银行	8,887,505.00	2.87
56	000776	广发证券	8,748,135.00	2.82
57	600027	华电国际	8,667,024.00	2.80
58	002258	利尔化学	8,357,096.00	2.70
59	000725	京东方 A	8,317,587.00	2.69
60	300433	蓝思科技	8,264,512.00	2.67
61	003816	中国广核	8,207,358.00	2.65
62	600183	生益科技	8,103,552.00	2.62
63	300705	九典制药	7,940,413.00	2.56
64	600718	东软集团	7,927,105.00	2.56
65	002128	电投能源	7,815,087.00	2.52
66	002299	圣农发展	7,685,685.00	2.48
67	000338	潍柴动力	7,601,798.00	2.45
68	000528	柳工	7,547,287.99	2.44
69	601600	中国铝业	7,531,890.00	2.43
70	600063	皖维高新	7,445,854.00	2.40
71	002463	沪电股份	7,386,512.27	2.38
72	601319	中国人保	7,354,808.00	2.37
73	600419	天润乳业	7,257,431.00	2.34
74	603529	爱玛科技	7,126,648.00	2.30
75	600050	中国联通	6,992,314.00	2.26
76	000959	首钢股份	6,879,652.00	2.22
77	601155	新城控股	6,852,433.00	2.21
78	601857	中国石油	6,756,838.00	2.18

79	600028	中国石化	6,648,221.00	2.15
80	000893	亚钾国际	6,546,447.00	2.11
81	600066	宇通客车	6,498,902.45	2.10
82	300207	欣旺达	6,457,684.00	2.08
83	601233	桐昆股份	6,444,174.00	2.08
84	600196	复星医药	6,209,963.00	2.00

注：本项“买入金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑其它交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601899	紫金矿业	35,745,462.50	11.54
2	000333	美的集团	23,604,204.00	7.62
3	002241	歌尔股份	20,982,804.00	6.77
4	601658	邮储银行	19,948,959.00	6.44
5	300502	新易盛	17,751,137.60	5.73
6	601728	中国电信	16,027,768.00	5.17
7	002938	鹏鼎控股	15,611,927.00	5.04
8	600585	海螺水泥	15,183,746.00	4.90
9	300433	蓝思科技	14,151,497.00	4.57
10	605499	东鹏饮料	13,878,589.00	4.48
11	601319	中国人保	13,244,224.00	4.28
12	601318	中国平安	13,182,218.10	4.26
13	000858	五粮液	13,046,520.00	4.21
14	601328	交通银行	12,895,742.00	4.16
15	600519	贵州茅台	12,224,590.00	3.95
16	601857	中国石油	12,143,207.00	3.92
17	600183	生益科技	12,124,432.00	3.91
18	601939	建设银行	12,077,165.00	3.90
19	603259	药明康德	11,717,418.00	3.78
20	601601	中国太保	11,600,236.28	3.75
21	600066	宇通客车	11,364,758.00	3.67
22	601633	长城汽车	11,062,313.00	3.57
23	002284	亚太股份	10,925,351.12	3.53
24	688041	海光信息	10,763,416.88	3.47
25	600160	巨化股份	10,697,593.00	3.45
26	600000	浦发银行	10,444,899.00	3.37
27	600196	复星医药	10,335,433.00	3.34
28	002714	牧原股份	10,163,805.00	3.28
29	300274	阳光电源	10,132,060.00	3.27
30	600276	恒瑞医药	10,077,857.57	3.25
31	000600	建投能源	9,614,738.00	3.10
32	600419	天润乳业	9,580,602.00	3.09
33	002202	金风科技	9,574,166.00	3.09

34	688696	极米科技	9,564,820.96	3.09
35	600143	金发科技	9,287,070.00	3.00
36	601336	新华保险	9,204,479.00	2.97
37	002128	电投能源	9,118,290.00	2.94
38	600718	东软集团	9,114,321.00	2.94
39	600875	东方电气	9,057,695.00	2.92
40	601211	国泰海通	9,031,394.46	2.92
41	600015	华夏银行	8,939,379.00	2.89
42	300014	亿纬锂能	8,866,334.00	2.86
43	600027	华电国际	8,812,677.00	2.85
44	605117	德业股份	8,692,142.95	2.81
45	002299	圣农发展	8,319,125.00	2.69
46	003816	中国广核	8,186,279.00	2.64
47	600216	浙江医药	8,033,251.00	2.59
48	300705	九典制药	8,009,573.00	2.59
49	300033	同花顺	7,977,000.00	2.58
50	601600	中国铝业	7,779,368.00	2.51
51	600031	三一重工	7,724,952.00	2.49
52	000338	潍柴动力	7,314,006.00	2.36
53	600063	皖维高新	7,291,089.00	2.35
54	601168	西部矿业	7,232,983.00	2.34
55	600938	中国海油	7,198,876.00	2.32
56	600887	伊利股份	7,197,303.00	2.32
57	601127	赛力斯	7,143,259.87	2.31
58	300207	欣旺达	7,098,816.00	2.29
59	002648	卫星化学	7,048,973.00	2.28
60	600690	海尔智家	6,821,467.00	2.20
61	601138	工业富联	6,512,095.00	2.10
62	000651	格力电器	6,282,467.00	2.03
63	601998	中信银行	6,261,768.00	2.02
64	601179	中国西电	6,231,374.00	2.01
65	002463	沪电股份	6,207,069.00	2.00

注：本项“卖出金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑其它交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,371,918,282.10
卖出股票收入（成交）总额	1,020,793,379.51

注：本项“买入股票的成本（成交）总额”和“卖出股票的收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

报告期内本基金投资的前十名股票中，不存在超出基金合同规定备选股票库的情形。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	3,513,357.59
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,513,357.59

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人 户数 (户)	户均持有的基 金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份 额比例 (%)	持有份额	占总 份额 比例 (%)
长信沪深 300 指数 A	5,452	54,473.53	224,136,493.25	75.47	72,853,207.75	24.53
长信沪深 300 指数 C	14,961	19,072.05	155,665,165.18	54.55	129,671,735.99	45.45
合计	20,413	28,527.24	379,801,658.43	65.22	202,524,943.74	34.78

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

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	长信沪深 300 指数 A	347,204.74	0.12
	长信沪深 300 指数 C	127,809.33	0.04
	合计	475,014.07	0.08

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

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	长信沪深 300 指数 A	0~10
	长信沪深 300 指数 C	0~10
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	长信沪深 300 指数 A	0~10
	长信沪深 300 指数 C	0~10
	合计	10~50

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	长信沪深 300 指数 A	长信沪深 300 指数 C
基金合同生效日（2019 年 5 月 16 日）基金份额总额	997,837.56	—
本报告期期初基金份额总额	131,712,359.47	136,366,480.96
本报告期基金总申购份额	208,087,577.60	269,371,245.06
减：本报告期基金总赎回份额	42,810,236.07	120,400,824.85
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	296,989,701.00	285,336,901.17

§ 10 重大事件揭示**10.1 基金份额持有人大会决议**

报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动**10.2.1 基金管理人的重大人事变动**

自 2025 年 1 月 24 日起，邓挺先生不再担任公司副总经理。

自 2025 年 4 月 18 日起，沈伟担任公司首席信息官。

上述重大人事变动情况，本基金管理人均已在规定信息披露媒介发布相关公告。

10.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金托管人无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金未改聘为基金审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，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。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
长江证券	2	2,392,079,766.59	100.00	492,538.17	100.00	-

注：1、本期租用证券公司交易单元的变更情况

本报告期内本基金租用证券公司交易单元没有变更。

2、专用交易单元的选择标准和程序

根据中国证监会《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》（中国证券监督管理委员会公告〔2024〕3号）的有关规定，本公司制定了租用证券公司专用交易单元的选择标准和程序。

（1）选择标准：

- 1) 财务状况良好；
- 2) 经营行为规范；
- 3) 合规风控能力较强；
- 4) 交易能力较强；
- 5) 研究能力较强。

（2）选择程序：

依照证券公司专用交易单元的选择标准，拟定备选证券公司，并根据公司要求提交准入评估报告，经证券公司准入审核流程审批通过后，签订相关协议。公司定期对各证券公司提供的服务

质量进行综合评价。依照评价结果选择基金证券交易专用交易单元。

3、当期周期为 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 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。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

券商名称	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(%)
长江证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	长信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	2025-1-4
2	长信基金管理有限责任公司关于增加旗下部分开放式基金转换业务的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2025-1-10
3	长信沪深 300 指数增强型证券投资基金 2024 年第 4 季度报告	中国证监会电子披露网站、公司网站	2025-1-22
4	长信基金管理有限责任公司旗下全部基金 2024 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	2025-1-22
5	长信基金管理有限责任公司关于基金行业高级管理人员变更公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2025-1-25
6	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分指数基金指数使用费调整为基金管理人承担并修订基金合同的公告	上证报、证券时报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2025-3-20
7	长信沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同	中国证监会电子披露网站、公司网站	2025-3-20
8	长信沪深 300 指数增强型证券投资基金托管协议	中国证监会电子披露网站、公司网站	2025-3-20
9	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	2025-3-20
10	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分基金基金合同、托管协议和招募说明书提示性公告	上证报、证券时报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2025-3-20
11	长信基金管理有限责任公司关于增加旗下	上证报、中证报、证券时报、	2025-3-21

	部分开放式基金转换业务的公告	证券日报、中国证监会电子披露网站、公司网站	
12	长信沪深 300 指数增强型证券投资基金 2024 年年度报告	中国证监会电子披露网站、公司网站	2025-3-28
13	长信基金管理有限责任公司旗下全部基金 2024 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	2025-3-28
14	长信基金管理有限责任公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2024 年度）	中国证监会电子披露网站、公司网站	2025-3-31
15	长信基金管理有限责任公司关于基金行业高级管理人员变更公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2025-4-19
16	长信沪深 300 指数增强型证券投资基金 2025 年第 1 季度报告	中国证监会电子披露网站、公司网站	2025-4-22
17	长信基金管理有限责任公司旗下全部基金 2025 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	2025-4-22
18	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分基金参加招商银行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	2025-4-26
19	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	2025-6-6

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金本报告期内未有单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期未发生影响投资者决策的其他重要信息。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

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

12.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

12.3 查阅方式

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

长信基金管理有限责任公司

2025 年 8 月 29 日