长信沪深300指数增强型证券投资基金（原长信量化价值精选混合型证券投资基金转型）
2019年年度报告

2019年12月31日

基金管理人：长信基金管理有限责任公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2020年4月27日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

长信沪深 300 指数增强型证券投资基金由长信量化价值精选混合型证券投资基金转型而来。基金管理人于 2019 年 4 月 29 日 0:00 起至 2019 年 5 月 13 日 17:00 止以通讯方式召开了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，审议《关于长信量化价值精选混合型证券投资基金变更注册的议案》，并由参加大会的基金份额持有人及代理人对本次会议议案表决通过，决议于 2019 年 5 月 14 日生效。自基金份额持有人大会决议生效公告之日（2019 年 5 月 16 日）起，《长信沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》生效，《长信量化价值精选混合型证券投资基金基金合同》同时失效。

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人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 4 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自 2019 年 1 月 1 日起至 2019 年 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录.....2
1.1 重要提示.....2
1.2 目录.....3
§2 基金简介.....6
2.1 基金基本情况（转型后）.....6
2.1 基金基本情况（转型前）.....6
2.2 基金产品说明（转型后）.....6
2.2 基金产品说明（转型前）.....7
2.3 基金管理人和基金托管人.....7
2.4 信息披露方式.....7
2.5 其他相关资料.....8
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况.....9
3.1 主要会计数据和财务指标（转型后）.....9
3.1 主要会计数据和财务指标（转型前）.....9
3.2 基金净值表现（转型后）.....10
3.2 基金净值表现（转型前）.....13
3.3 过去三年基金的利润分配情况（转型前）.....14
3.3 过去三年基金的利润分配情况（转型后）.....14
§4 管理人报告.....15
4.1 基金管理人及基金经理情况.....15
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....19
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....19
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.....21
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....21
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....22
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....22
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....23
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....23
§5 托管人报告.....24
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....24
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.....24
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....24
§6 审计报告（转型后）.....25
6.1 审计报告基本信息.....25
6.2 审计报告的基本内容.....25
§6 审计报告（转型前）.....27
6.1 审计报告基本信息.....27
6.2 审计报告的基本内容.....27
§7 年度财务报表（转型后）.....29
7.1 资产负债表（转型后）.....29
7.2 利润表.....30
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....31
7.4 报表附注.....32

§7 年度财务报表（转型前）.....58
7.1 资产负债表（转型前）.....58
7.2 利润表.....59
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....60
7.4 报表附注.....61
§8 投资组合报告（转型后）.....88
8.1 期末基金资产组合情况.....88
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....88
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....90
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....92
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....94
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....94
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....95
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....95
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....95
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....95
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....95
8.12 投资组合报告附注.....95
§8 投资组合报告（转型前）.....97
8.1 期末基金资产组合情况.....97
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....97
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....98
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....99
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....101
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....101
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....101
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....101
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....101
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....102
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....102
8.12 投资组合报告附注.....102
§9 基金份额持有人信息（转型后）.....104
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....104
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....104
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....104
§9 基金份额持有人信息（转型前）.....105
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....105
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....105
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....105
§10 开放式基金份额变动(转型后).....106
§10 开放式基金份额变动(转型前).....107
§11 重大事件揭示.....108
11.1 基金份额持有人大会决议.....108
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....108
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....108

11.4 基金投资策略的改变.....108
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....109
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....109
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型后）.....109
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型前）.....110
11.9 其他重大事件（转型后）.....110
11.9 其他重大事件（转型前）.....113
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....115
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况.....115
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....116
§13 备查文件目录.....117
13.1 备查文件目录.....117
13.2 存放地点.....117
13.3 查阅方式.....117

§2 基金简介

2.1 基金基本情况（转型后）

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	105,083,283.31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	10,479,109.35份	94,604,173.96份

2.1 基金基本情况（转型前）

基金名称	长信量化价值精选混合型证券投资基金
基金简称	长信量化价值精选混合
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	2018年4月19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	997,837.56份
基金合同存续期	不定期

注：上表中“报告期期末”为2019年5月15日。

2.2 基金产品说明（转型后）

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。

2.2 基金产品说明（转型前）

投资目标	本基金通过数量化的方法在严格控制风险的前提下，追求基金资产的长期持续增值。
投资策略	本基金采用数量化投资策略建立投资模型，将投资思想通过具体指标、参数的确定体现在模型中，在投资过程中充分发挥数量化投资纪律严格、投资视野宽阔、风险水平可控等优势，切实贯彻自上而下的资产配置和自下而上的个股精选的投资策略，以保证在控制风险的前提下实现收益最大化。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*75% +中债综合指数收益率*25%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。

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	张燕
	联系电话	021-61009999	0755—83199084
	电子邮箱	zhouyg@cxfund.com.cn	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		4007005566	95555
传真		021-61009800	0755—83195201
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区银城中路 68 号 9 楼	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址		上海市浦东新区银城中路 68 号 9 楼	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码		200120	518040
法定代表人		成善栋	李建红

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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.cxfund.com.cn

基金年度报告备置地点	上海市浦东新区银城中路 68 号 9 楼、深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市浦东新区世纪大道 100 号 50 楼
注册登记机构	长信基金管理有限责任公司	上海市浦东新区银城中路 68 号 9 楼

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标（转型后）

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2019年5月16日(基金转型起始日)至2019年12月31日	
	长信沪深300指数A	长信沪深300指数C
本期已实现收益	185,802.36	4,564,540.04
本期利润	337,621.89	10,367,707.33
加权平均基金份额本期利润	0.3157	0.1542
本期加权平均净值利润率	31.36%	15.14%
本期基金份额净值增长率	15.57%	15.08%
3.1.2 期末数据和指标	2019年12月31日	
期末可供分配利润	358,332.50	-1,830,974.28
期末可供分配基金份额利润	0.0342	-0.0194
期末基金资产净值	11,435,819.64	102,808,561.13
期末基金份额净值	1.0913	1.0867
3.1.3 累计期末指标	2019年12月31日	
基金份额累计净值增长率	15.57%	15.08%

注：1、转型后的本基金基金合同生效日为2019年5月16日，截至本报告期末，本基金运作未满一年。

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

3、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。

4、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。

3.1 主要会计数据和财务指标（转型前）

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2019年1月1日至2019年5月15日	2018年4月19日(基金合同生效日)-2018年12月31日
本期已实现收益	429,755.16	-5,974,790.77
本期利润	1,381,664.34	-6,911,762.60
加权平均基金份额本期利润	0.2041	-0.1112
本期加权平均净值利润率	23.04%	-11.70%
本期基金份额净值增长率	12.55%	-16.10%
3.1.2 期末数据和指标	2019年5月15日	2018年末
期末可供分配利润	-55,571.56	-5,821,410.08

期末可供分配基金份额利润	-0.0557	-0.1611
期末基金资产净值	942,266.00	30,325,222.86
期末基金份额净值	0.9443	0.8390
3.1.3 累计期末指标	2019年5月15日	2018年末
基金份额累计净值增长率	-5.57%	-16.10%

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

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

3、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（转型后）

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

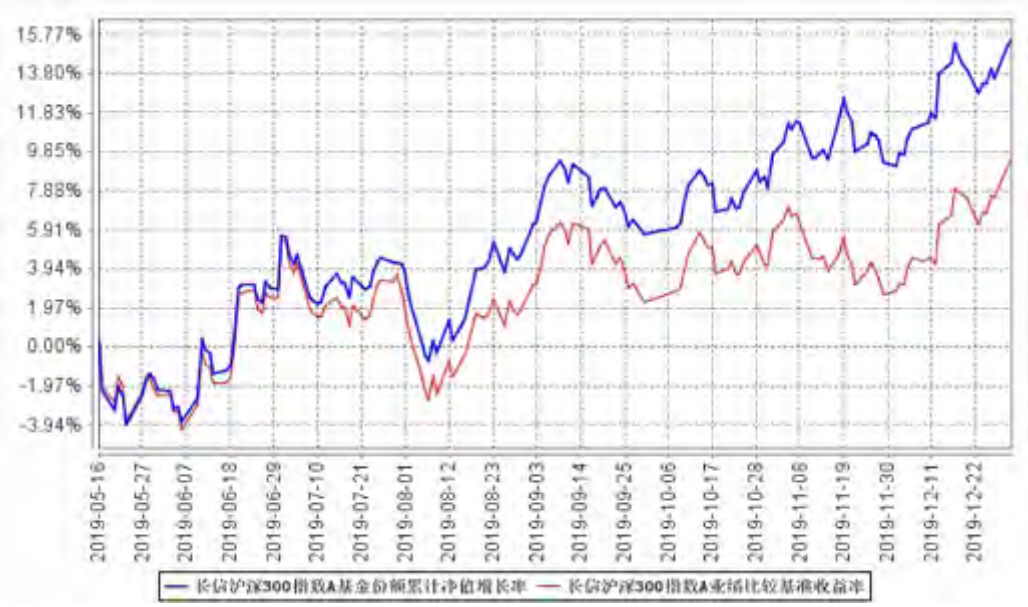
长信沪深300指数A

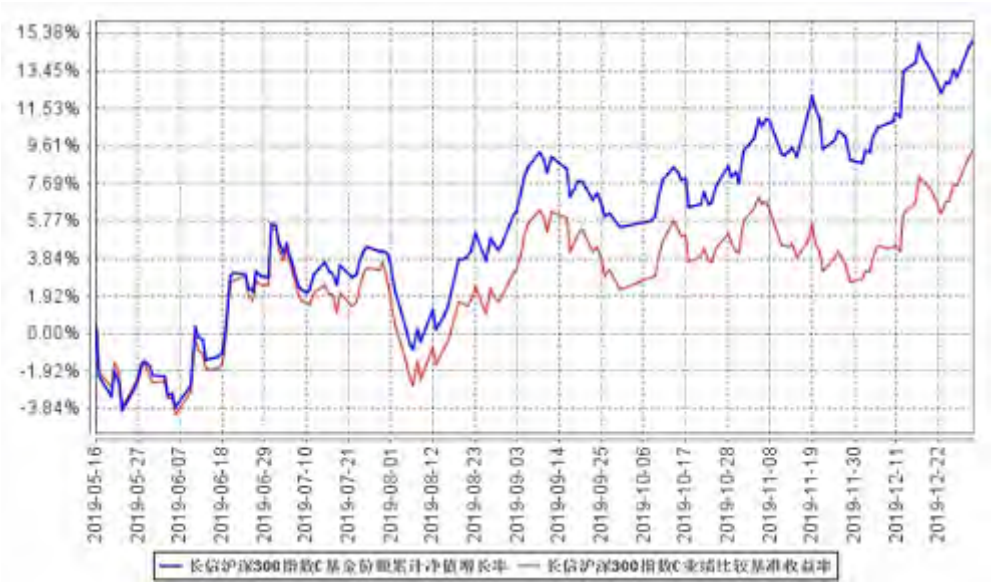
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	9.32%	0.72%	7.03%	0.70%	2.29%	0.02%
过去六个月	12.29%	0.80%	6.75%	0.81%	5.54%	-0.01%
自转型生效日起至今（2019年5月16日-2019年12月31日）	15.57%	0.87%	9.44%	0.88%	6.13%	-0.01%

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
过去三个月	9.15%	0.72%	7.03%	0.70%	2.12%	0.02%
过去六个月	11.86%	0.80%	6.75%	0.81%	5.11%	-0.01%
自转型生效日起至今（2019年5月16日-2019年12月31日）	15.08%	0.87%	9.44%	0.88%	5.64%	-0.01%

3.2.2 自基金转型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

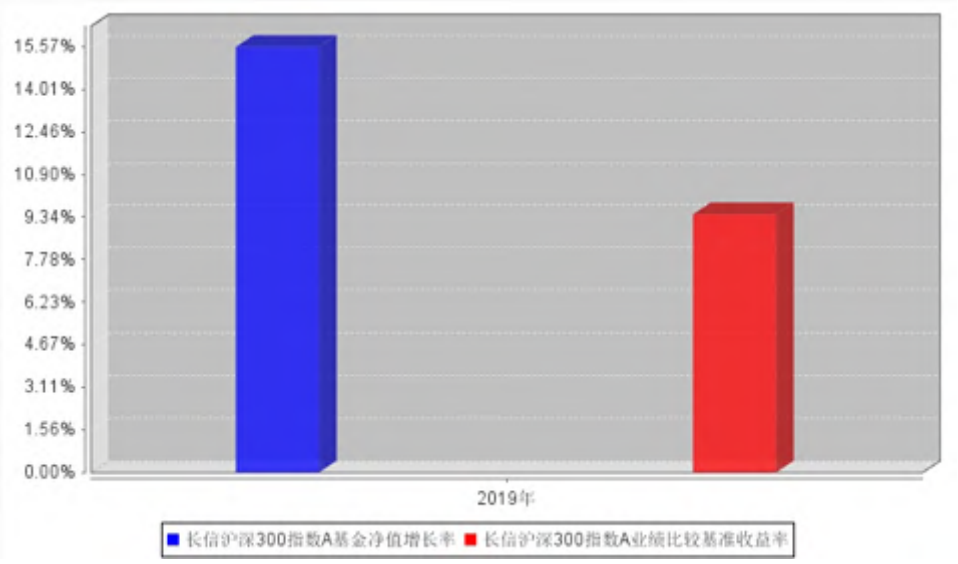


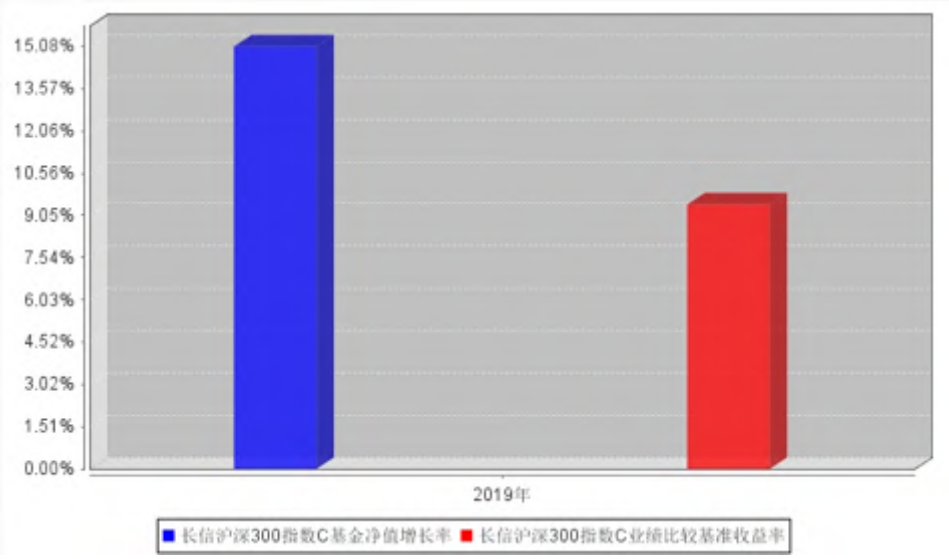


注：1、转型后的本基金合同生效日为 2019 年 5 月 16 日，基金合同生效日至本报告期末，本基金运作时间未满一年。图示日期为 2019 年 5 月 16 日至 2019 年 12 月 31 日。

2、按基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起 6 个月内为建仓期，报告期末已完成建仓但报告期末距建仓结束不满一年；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。

3.2.3 自基金转型以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较





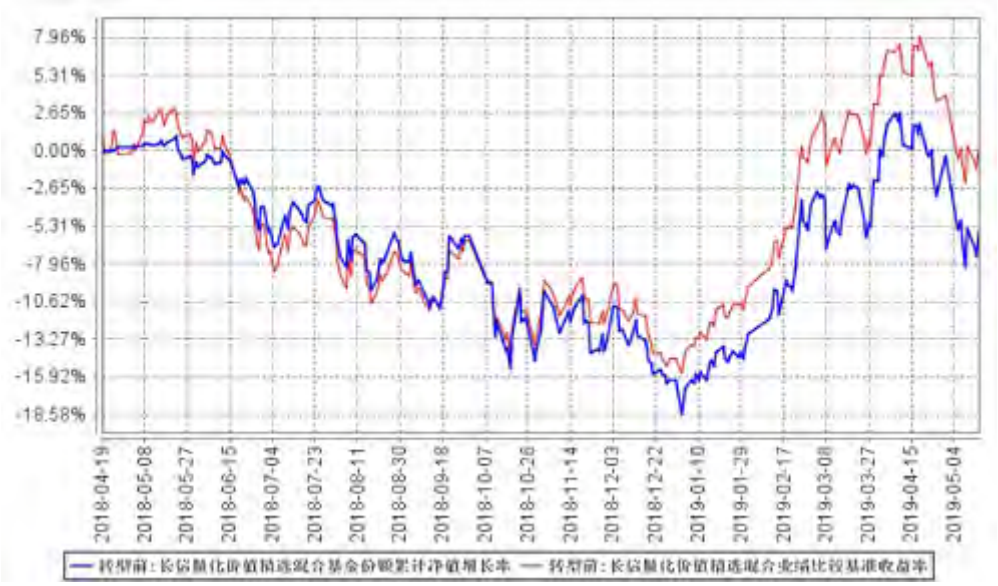
注：本基金基金合同生效日为 2019 年 5 月 16 日，2019 年净值增长率按当年实际存续期计算。

3.2 基金净值表现（转型前）

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

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
过去一年(2019 年 1 月 1 日至 2019 年 5 月 15 日)	12.55%	1.50%	17.62%	1.25%	-5.07%	0.25%
自基金合同生效起至基金合同失效前日（2018 年 4 月 19 日至 2019 年 5 月 15 日）	-5.57%	1.23%	0.37%	1.13%	-5.94%	0.10%

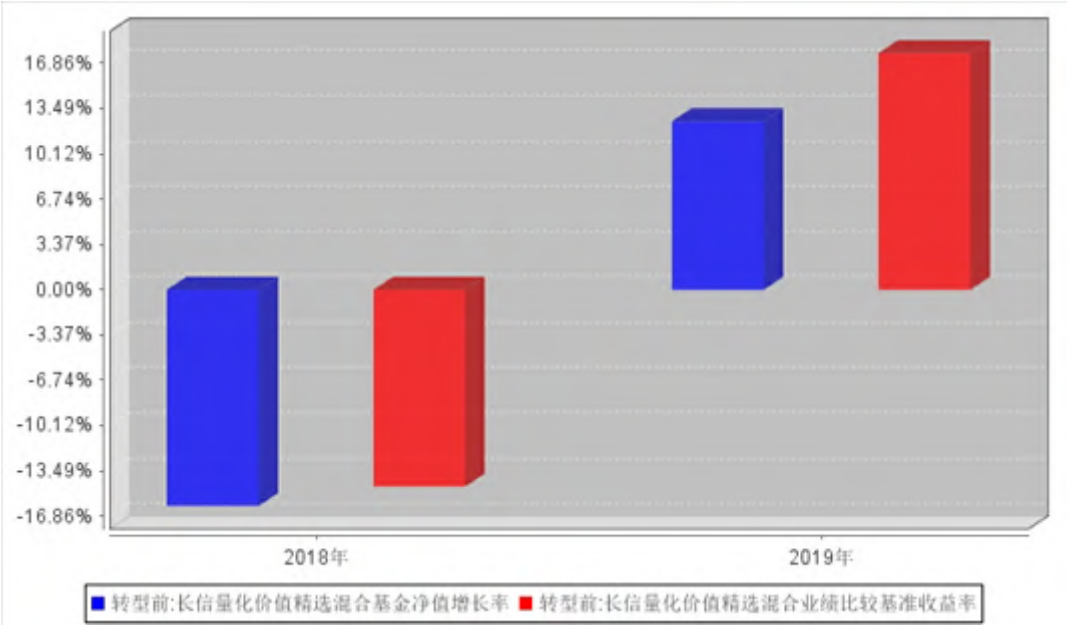
3.2.2 自基金合同生效至转型前基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、图示日期为 2018 年 4 月 19 日至 2019 年 5 月 15 日（基金合同失效前日）。

2、按基金合同规定，本基金自基金合同生效日起 6 个月内为建仓期。报告期末已完成建仓但报告期末距建仓结束不满一年；建仓期结束时，本基金的各项投资比例已符合基金合同的约定。

3.2.3 自基金合同生效至转型前每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：本基金基金合同生效日为 2018 年 4 月 19 日，本基金基金合同失效前日为 2019 年 5 月 15 日,2018 年和 2019 年净值增长率按当年实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况（转型前）

注：本基金基金合同生效日为 2018 年 4 月 19 日，本基金基金合同生效日起至 2019 年 5 月 15 日（基金合同失效前日）未进行利润分配。

3.3 过去三年基金的利润分配情况（转型后）

注：本基金基金合同生效日为 2019 年 5 月 16 日，本基金基金合同生效日起至本报告期末未进行利润分配。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

长信基金管理有限责任公司是经中国证监会证监基金字【2003】63号文批准，由长江证券股份有限公司、上海海欣集团股份有限公司、武汉钢铁股份有限公司共同发起设立。注册资本1.65亿元人民币。目前股权结构为：长江证券股份有限公司占44.55%、上海海欣集团股份有限公司占31.21%、武汉钢铁有限公司占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2019年12月31日，本基金管理人共管理66只开放式基金，即长信利息收益开放式证券投资基金、长信银利精选混合型证券投资基金、长信金利趋势混合型证券投资基金、长信增利动态策略混合型证券投资基金、长信利丰债券型证券投资基金、长信恒利优势混合型证券投资基金、长信量化先锋混合型证券投资基金、长信美国标准普尔100等权重指数增强型证券投资基金、长信利鑫债券型证券投资基金(LOF)、长信内需成长混合型证券投资基金、长信可转债债券型证券投资基金、长信利众债券型证券投资基金(LOF)、长信纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信纯债壹号债券型证券投资基金、长信改革红利灵活配置混合型证券投资基金、长信量化中小盘股票型证券投资基金、长信新利灵活配置混合型证券投资基金、长信利富债券型证券投资基金、长信利盈灵活配置混合型证券投资基金、长信利广灵活配置混合型证券投资基金、长信多利灵活配置混合型证券投资基金、长信睿进灵活配置混合型证券投资基金、长信量化多策略股票型证券投资基金、长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、长信富民纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信富海纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信利保债券型证券投资基金、长信金葵纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信富全纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信利泰灵活配置混合型证券投资基金、长信先锐债券型证券投资基金、长信利发债券型证券投资基金、长信电子信息行业量化灵活配置混合型证券投资基金、长信富平纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信先利半年定期开放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、长信利尚一年定期开放混合型证券投资基金、长信乐信灵活配置混合型证券投资基金、长信全球债券证券投资基金、长信稳鑫三个月定期开放债券型发起式

证券投资基金、长信先机两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、长信消费精选行业量化股票型证券投资基金、长信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、长信价值蓝筹两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、长信稳裕三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长信稳进资产配置混合型基金中基金（FOF）、长信价值优选混合型证券投资基金、长信利率债债券型证券投资基金、长信沪深 300 指数增强型证券投资基金、长信富安纯债半年定期开放债券型证券投资基金、长信合利混合型证券投资基金、长信双利优选混合型证券投资基金、长信富瑞两年定期开放债券型证券投资基金、长信颐天平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。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介（转型后）

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	2019 年 5 月 16 日	-	5 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。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、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和长信先优债券型证券投资基金的基金经理，现任长信中证 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。

左金保	长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、长信量化先锋混合型证券投资基金、长信量化中小盘股票型证券投资基金、长信电子信息行业量化灵活配置混合型证券投资基金、长信低碳环保行业量化股票型证券投资基金、长信消费精选行业量化股票型证券投资基金、长信沪深 300 指数增强型证券投资基金、长信量化价值驱动混合型证券投资基金和长信量化多策略股票型证券投资基金的基金经理、量化投资部总监兼量化研究部总监、投资决策委员会执行委员	2019 年 5 月 16 日	-	9 年	经济学硕士，武汉大学金融工程专业研究生毕业。2010 年 7 月加入长信基金管理有限责任公司，从事量化投资研究和风险绩效分析工作。历任公司数量分析研究员和风险与绩效评估研究员、长信中证中央企业 100 指数证券投资基金（LOF）、长信量化多策略股票型证券投资基金、长信中证一带一路主题指数分级证券投资基金、长信中证上海改革发展主题指数型证券投资基金（LOF）、长信量化优选混合型证券投资基金（LOF）、长信利泰灵活配置混合型证券投资基金、长信国防军工量化灵活配置混合型证券投资基金、长信利发债券型证券投资基金、长信先锐债券型证券投资基金、长信量化价值精选混合型证券投资基金、长信先机两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金和长信先利半年定期开放混合型证券投资基金的基金经理。现任量化投资部兼量化研究部总监和投资决策委员会执行委员、长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、长信量化先锋混合型证券投资基金、长信量化中小盘股票型证券投资基金、长信电子信息行业量化灵活配置混合型证券投资基金、长信低碳环保行业量化股票型证券投资基金、长信消费精选行业量化股票型证券投资基金、长信量化价值驱动混合型证券投资基金、长信量化多策

					略股票型证券投资基金和长信沪深 300 指数增强型证券投资基金的基金经理。

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

2、证券从业的含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定；

3、自 2019 年 5 月 16 日起，长信量化价值精选混合型证券投资基金转型为长信沪深 300 指数增强型证券投资基金，左金保仍担任该基金的基金经理；

4、自 2020 年 4 月 22 日起，左金保不再担任该基金的基金经理。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介（转型前）

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
左金保	长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、长信量化先锋混合型证券投资基金、长信量化中小盘股票型证券投资基金、长信电子信息行业量化灵活配置混合型证券投资基金、长信先利半年定期开放混合型证券投资基金、长信低碳环保行业量化股票型证券投资基金、长信先机两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、长信消费精选行业量化股票型证券投资基金、长信量化	2018 年 4 月 19 日	2019 年 5 月 15 日	9 年	经济学硕士，武汉大学金融工程专业研究生毕业。2010 年 7 月加入长信基金管理有限责任公司，从事量化投资研究和风险绩效分析工作。历任公司数量分析研究员和风险与绩效评估研究员、长信中证中央企业 100 指数证券投资基金（LOF）、长信量化多策略股票型证券投资基金、长信中证一带一路主题指数分级证券投资基金、上海改革发展主题指数型证券投资基金（LOF）、长信量化优选混合型证券投资基金（LOF）、长信利泰灵活配置混合型证券投资基金、长信国防军工量化灵活配置混合型证券投资基金、长信利发债券型证券投资基金和长信先锐债券型证券投资基金的基金经理。现任量化投资部兼量化研究部总监和投资决策委员会执行委员、长信医疗保健行业灵活配置混合

	价值精选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和长信量化多策略股票型证券投资基金的基金经理、量化投资部总监兼量化研究部总监、投资决策委员会执行委员				型证券投资基金（LOF）、长信量化先锋混合型证券投资基金、长信量化中小盘股票型证券投资基金、长信电子信息行业量化灵活配置混合型证券投资基金、长信先利半年定期开放混合型证券投资基金、长信低碳环保行业量化股票型证券投资基金、长信先机两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、长信消费精选行业量化股票型证券投资基金、长信量化价值驱动混合型证券投资基金、长信量化多策略股票型证券投资基金和长信量化价值精选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遵规守信情况的说明

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 公平交易制度和控制方法

1、所有投资对象的投资指令必须经由交易部门总监或其授权人审核分配至交易人员执行。进行投资指令分配的人员必须保证投资指令得到公平对待。

2、公司使用的交易执行软件系统必须具备如下功能：

（1）严格按照时间顺序发送委托指令；

（2）对于多个投资组合在同一时点就同一证券下达的相同方向的投资指令，并且市价在限价范围内的，系统能够将交易员针对该证券下达的每笔委托自动按照指令数量比例分拆为各投资组合的委托指令。对于不同投资组合针对交易所同一证券的同一方向竞价交易指令，指令数量比例达到5：1或以上的，可豁免启动公平交易开关。

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

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

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

4.3.3 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2019年中国经济整体运行平稳，货币政策实施稳健。从结构上看，CPI由于猪价等原因大幅上行，造成了CPI-PPI剪刀差持续走阔。国际关系角度，中美贸易战已经进入持久战状态，短期冲击变弱，长期影响变强。A股市场在经历了2018年系统性下跌后，在2019年迎来了全面反弹，各大宽基指数全线上涨，整体涨幅大致在30%~50%之间，其中创业板表现最出色，可见投资者风险偏好明显提升。从整体风格上看，靠近下游消费的行业表现更优异，如食品饮料、家电等，而靠近上游资源的行业表现相对较差，如钢铁、煤炭等。同时由于风险偏好提升，诸如高股息等低风险策略吸引力下降，表现不佳，而诸如成长股等高风险策略吸引力提升，表现优异。

本基金根据股票的基本面情况和市场面情况构建Alpha模型，寻找质地优异、被市场低估的投资标的。综合Alpha模型得分、风险模型、交易成本模型，定期优化组合权重，在控制组合跟踪误差的基础上提升组合的收益率。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，长信沪深300指数A份额净值为1.0913元，份额累计单位净值为1.0913元，转型后长信沪深300指数A份额净值增长率为15.57%；长信沪深300指数C份额净值为1.0867元,份额累计单位净值为1.0867元,转型后长信沪深300指数C份额净值增长率为15.08%，同期业绩比较基准收益率为9.44%。

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2020年，新冠疫情给宏观经济增加了新的挑战，全球经济均存在失速风险，所以未来货币政策和财政政策的走向至关重要。当前全球主要经济体都选择降息来对冲经济潜在下行风险，接下来中国或在货币供应和财政扶持两端发力，届时企稳反弹的政府投资和民间投资也将给中国经济和资本市场注入新的动力。放眼国际，中美贸易冲突将长期存在，全球经济下滑的局面也使得各国政府谨慎看待紧缩型政策，未来几年将是中国经济结构转型和产业升级的重要窗口期。此外，A股加速国际化也在催生资本市场的变革，长远来看未来的投资环境将更加多元化和专业化，市场风格将更加分散，我们对A股保持谨慎乐观。

我们将保持稳定的仓位，定期评估基本面和技术面选股因子的表现，继续坚持已有的量化选股模型，结合严格的风险控制，追求持续且稳健的超额收益。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

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

本年度内，监察稽核部以组合压力测试为主要方式，定期对投资组合的风险状况进行检测的机制，对投资组合整体流动性情况进行分析，并适时召集各业务部门的沟通会议就各项可能面临的风险进行沟通、讨论，防范系统性风险事件的发生。

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

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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”）制订了健全、有效的估值政策和估值程序，成立了估值委员会，估值委员会是公司基金估值的主要决策机构，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，健全公司估值决策体系，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。基金经理不直接参与估值决策，估值决策由与会估值工作小组成员 1/2 以上多数票通过。对于估值政策和估值原则，公司与基金托管人充分沟通，达成一致意见。审计本基金的会计师事务所认可公司基金估值政策和程序的适当性。

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

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

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

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

4、基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去该类每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

自2018年7月4日至2018年9月26日，本基金资产净值已连续六十个工作日低于五千万元，本基金管理人已向中国证监会报送了解决方案。截至2019年5月15日长信量化价值精选混合型证券投资基金基金合同失效前日，本基金资产净值仍低于五千万元。自2019年5月16日长信沪深300指数增强型证券投资基金合同生效日至2019年6月13日，本基金资产净值已连续二十个工作日低于五千万元。自2019年7月30日起至报告期末，本基金资产净值高于五千万元。

§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

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

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

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

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

本年度报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本年度报告中财务指标、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 审计报告（转型后）

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2020）审字第 61399737_B07 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	长信沪深 300 指数增强型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了长信沪深 300 指数增强型证券投资基金的财务报表，包括 2019 年 12 月 31 日的资产负债表，2019 年 5 月 16 日（基金合同转型日）至 2019 年 12 月 31 日止期间的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的长信沪深 300 指数增强型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了长信沪深 300 指数增强型证券投资基金 2019 年 12 月 31 日的财务状况以及 2019 年 5 月 16 日（基金合同转型日）至 2019 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于长信沪深 300 指数增强型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	长信沪深 300 指数增强型证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。 我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。 结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。 基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。
管理层和治理层对财务报表的责任	管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。 在编制财务报表时，管理层负责评估长信沪深 300 指数增强型证券

	投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。 治理层负责监督长信沪深 300 指数增强型证券投资基金的财务报告过程。	
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。 在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作： (1)识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。 (2)了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。 (3)评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。 (4)对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对长信沪深 300 指数增强型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致长信沪深 300 指数增强型证券投资基金不能持续经营。 (5)评价财务报表的总体列报、结构和内容（包括披露），并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	蒋燕华	夏秉雯
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层	
审计报告日期	2020 年 4 月 22 日	

§6 审计报告（转型前）

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2020）审字第 61399737_B06 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	长信量化价值精选混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了长信量化价值精选混合型证券投资基金的财务报表，包括 2019 年 5 月 15 日的资产负债表，2019 年 1 月 1 日至 2019 年 5 月 15 日止期间的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的长信量化价值精选混合型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了长信量化价值精选混合型证券投资基金 2019 年 5 月 15 日的财务状况以及 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 5 月 15 日止期间的经营成果和净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于长信量化价值精选混合型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	长信量化价值精选混合型证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。 我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。 结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。 基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。
管理层和治理层对财务报表的责任	管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。 在编制财务报表时，管理层负责评估长信量化价值精选混合型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用）， 第 27 页 共 117 页

	并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。 治理层负责监督长信量化价值精选混合型证券投资基金的财务报告过程。	
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。 在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作： (1)识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。 (2)了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。 (3)评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。 (4)对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对长信量化价值精选混合型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致长信量化价值精选混合型证券投资基金不能持续经营。 (5)评价财务报表的总体列报、结构和内容（包括披露），并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	蒋燕华	夏秉雯
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层	
审计报告日期	2020年4月22日	

§7 年度财务报表（转型后）

7.1 资产负债表（转型后）

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： 2019年12月31日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2019年12月31日
资 产：		
银行存款	7.4.7.1	27,122,054.32
结算备付金		4,122.59
存出保证金		35,332.17
交易性金融资产	7.4.7.2	105,019,015.62
其中：股票投资		105,019,015.62
基金投资		-
债券投资		-
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
应收证券清算款		-
应收利息	7.4.7.5	5,491.83
应收股利		-
应收申购款		3,501,751.85
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		135,687,768.38
负债和所有者权益	**附注号**	**本期末** 2019年12月31日
负 债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		1,168,382.25
应付赎回款		19,862,940.00
应付管理人报酬		95,719.61
应付托管费		14,357.91
应付销售服务费		37,748.37
应付交易费用	7.4.7.7	164,239.47
应交税费		-
应付利息		-

应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	100,000.00
负债合计		21,443,387.61
所有者权益：		
实收基金	7.4.7.9	105,083,283.31
未分配利润	7.4.7.10	9,161,097.46
所有者权益合计		114,244,380.77
负债和所有者权益总计		135,687,768.38

注：1、报告截止日2019年12月31日，长信沪深300指数A份额净值1.0913元，长信沪深300指数C份额净值1.0867元。基金份额总额为105,083,283.31份，其中长信沪深300指数A份额10,479,109.35份；长信沪深300指数C份额94,604,173.96份。

2、本基金本报告期为2019年5月16日至2019年12月31日，转型后的基金基金合同于2019年5月16日正式生效，为报告期内合同生效的基金，本报告期的财务报表和报表附注均无同期对比数据。

7.2 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：2019年5月16日(基金转型起始日)至2019年12月31日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2019年5月16日(基金转型起始日)至 2019年12月31日
一、收入		12,004,192.97
1.利息收入		35,072.87
其中：存款利息收入	7.4.7.11	35,072.87
债券利息收入		0.00
资产支持证券利息收入		0.00
买入返售金融资产收入		0.00
证券出借利息收入		-
其他利息收入		0.00
2.投资收益（损失以“-”填列）		5,985,611.69
其中：股票投资收益	7.4.7.12	5,704,709.45
基金投资收益		0.00
债券投资收益	7.4.7.13	0.00
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	0.00
贵金属投资收益	7.4.7.14	0.00
衍生工具收益	7.4.7.15	0.00
股利收益	7.4.7.16	280,902.24

3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	5,954,986.82
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		0.00
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	28,521.59
减：二、费用		1,298,863.75
1．管理人报酬	7.4.10.2.1	446,001.50
2．托管费	7.4.10.2.2	66,900.23
3．销售服务费	7.4.10.2.3	175,746.27
4．交易费用	7.4.7.19	492,555.02
5．利息支出		0.00
其中：卖出回购金融资产支出		0.00
6．税金及附加		0.00
7．其他费用	7.4.7.20	117,660.73
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		10,705,329.22
减：所得税费用		0.00
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		10,705,329.22

注：本基金本报告期为2019年5月16日至2019年12月31日，转型后的基金基金合同于2019年5月16日正式生效，为报告期内合同生效的基金，本报告期的财务报表和报表附注均无同期对比数据。

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长信沪深300指数增强型证券投资基金

本报告期：2019年5月16日(基金转型起始日)至2019年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2019年5月16日(基金转型起始日)至2019年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	997,837.56	-55,571.56	942,266.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	10,705,329.22	10,705,329.22
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 （净值减少以“-”号填列）	104,085,445.75	-1,488,660.20	102,596,785.55
其中：1.基金申购款	181,618,651.54	3,727,056.87	185,345,708.41
2.基金赎回款（以“-”号填列）	-77,533,205.79	-5,215,717.07	-82,748,922.86
四、本期向基金份额持有人分配	-	-	-

利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)			
五、期末所有者权益(基金净值)	105,083,283.31	9,161,097.46	114,244,380.77

注：本基金本报告期为2019年5月16日至2019年12月31日，转型后的基金基金合同于2019年5月16日正式生效，为报告期内合同生效的基金，本报告期的财务报表和报表附注均无同期对比数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

成善栋	覃波	孙红辉
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

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

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

本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数成份股及其备选成份股、其他股票（含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、权证、股指期货、债券（包括国内依法发行上市的国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、中小企业私募债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资

券以及经法律法规或中国证监会允许投资的其他债券)、债券回购、资产支持证券、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

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

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

7.4.2 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、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《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 2 号《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>》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 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 2019 年 12 月 31 日的财务状况以及自 2019 年 5 月 16 日（基金转型起始日）起至 2019 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年自1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间系自2019年5月16日（基金转型起始日）起至2019年12月31日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

(1)金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括股票投资、债券投资和衍生工具等；

(2)金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券等，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

(1)股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资，股票投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账；

卖出股票于成交日确认股票投资收益，卖出股票的成本按移动加权平均法于成交日结转；

(2)债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

(3)权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账；

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益，卖出权证的成本按移动加权平均法于成交日结转；

(4)股指期货投资

买入或卖出股指期货投资于成交日确认为股指期货投资。股指期货初始合约价值按成交金额确认；

股指期货平仓于成交日确认衍生工具投资收益，股指期货的初始合约价值按移动加权平均法于成交日结转；

(5)分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本；

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算；

(6)回购协议

本基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1)存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

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

(3)如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4)如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1)存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2)债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3)资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4)买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5)股票投资收益/（损失）于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6)债券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7)资产支持证券投资收益/(损失)于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(8)股指期货投资收益/（损失）于平仓日确认，并按平仓成交金额与其初始合约价值的差额入账；

(9)权证收益/（损失）于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(10)股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(11)公允价值变动收益/（损失）系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(12)其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

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

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

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

(4)基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去该类每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(5)法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 分部报告

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

(1)该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；

(2)能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；

(3)能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。

如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

（1）对于在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，根据《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》(中基协发[2017]6号)，在估值日按照该通知规定的流通受限股票公允价值计算模型进行估值。

（2）对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，根据《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》(中国证监会公告[2017]13号)及《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》(中基协发[2013]13号)相关规定，本基金根据情况决定使用指数收益法、可比公司法、市场价格模型法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

（3）根据《关于发布<中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准>的通知》(中基协发[2014]24号)，在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外)，采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 税项

7.4.6.1 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‰；

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；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

7.4.6.2 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，自2018年1月1日起，本基金的基金管理人运营本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。

7.4.6.3 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暂行条例（2011年修订）》、《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）及地方教育费附加。

7.4.6.4 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[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

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。

7.4.6.5 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日
活期存款	27,122,054.32
定期存款	-
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	-
合计：	27,122,054.32

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2019年12月31日		
		成本	公允价值	估值增值
股票		99,049,091.45	105,019,015.62	5,969,924.17
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		99,049,091.45	105,019,015.62	5,969,924.17

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	3,806.63
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	0.88
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	1,666.83
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	17.49
合计	5,491.83

注：其他为应收保证金利息。

7.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	164,239.47
银行间市场应付交易费用	-
合计	164,239.47

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
预提账户维护费	-
预提审计费	50,000.00
预提指数使用费	50,000.00
合计	100,000.00

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

长信沪深 300 指数 A

项目	本期 2019年5月16日(基金转型起始日)至2019年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金转型起始日	997,837.56	997,837.56
基金份额折算调整	0.00	-
未领取红利份额折算调整	0.00	-
集中申购募集资金本金及利息	0.00	-
基金拆分和集中申购完成后	0.00	-
本期申购	10,554,802.84	10,554,802.84
本期赎回(以"-"号填列)	-1,073,531.05	-1,073,531.05
本期末	10,479,109.35	10,479,109.35

金额单位：人民币元

长信沪深300指数C		
项目	本期 2019年5月16日(基金转型起始日)至2019年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金转型起始日	-	-
基金份额折算调整	-	-
未领取红利份额折算调整	-	-
集中申购募集资金本金及利息	-	-
基金拆分和集中申购完成后	-	-
本期申购	171,063,848.70	171,063,848.70
本期赎回(以"-"号填列)	-76,459,674.74	-76,459,674.74
本期末	94,604,173.96	94,604,173.96

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

7.4.7.10 未分配利润

金额单位：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
基金转型起始日	-40,492.44	-15,079.12	-55,571.56
本期利润	185,802.36	151,819.53	337,621.89
本期基金份额交易产生的变动数	213,022.58	461,637.38	674,659.96
其中：基金申购款	204,102.42	496,033.94	700,136.36
基金赎回款	8,920.16	-34,396.56	-25,476.40
本期已分配利润	-	-	0.00
本期末	358,332.50	598,377.79	956,710.29

金额单位：人民币元

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
基金转型起始日	-	-	-
本期利润	4,564,540.04	5,803,167.29	10,367,707.33

本期基金份额交易产生的变动数	-6,395,514.32	4,232,194.16	-2,163,320.16
其中：基金申购款	-8,663,419.60	11,690,340.11	3,026,920.51
基金赎回款	2,267,905.28	-7,458,145.95	-5,190,240.67
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-1,830,974.28	10,035,361.45	8,204,387.17

7.4.7.11 存款利息收入

项目	本期 2019年5月16日(基金转型起始日)至2019年12月31日
活期存款利息收入	28,589.77
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	2,546.81
其他	3,936.29
合计	35,072.87

注：其他为保证金利息收入。

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年5月16日(基金转型起始日)至2019年12月31日
卖出股票成交总额	136,679,374.35
减：卖出股票成本总额	130,974,664.90
买卖股票差价收入	5,704,709.45

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

注：本基金本报告期无债券投资收益。

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本基金本报告期无买卖债券差价收入。

7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期无债券投资赎回差价收入。

7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期无债券投资申购差价收入。

7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益

7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

7.4.7.15 衍生工具收益

7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期无衍生工具收益。

7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期无衍生工具收益。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年5月16日(基金转型起始日)至2019年12月31日
股票投资产生的股利收益	280,902.24
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	280,902.24

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2019年5月16日(基金转型起始日)至2019年12月31日
1.交易性金融资产	5,954,986.82
——股票投资	5,954,986.82
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
合计	5,954,986.82

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年5月16日(基金转型起始日)至2019年12月31日
基金赎回费收入	1,778.15

其他收入	26,742.24
转换费收入	1.20
合计	28,521.59

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

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年5月16日(基金转型起始日)至2019年12月31日
交易所市场交易费用	492,555.02
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	492,555.02

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年5月16日(基金转型起始日)至 2019年12月31日
审计费用	31,506.35
信息披露费	-18,128.30
证券出借违约金	-
帐户维护费	2,274.75
指数使用费	100,000.00
其他费用	2,007.93
合计	117,660.73

注：其他费用为银行划款手续费。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

注：截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

注：截至本财务报告批准报出日，本基金未发生需要披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
长信基金管理有限责任公司（以下简称“长信基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
招商银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
长江证券股份有限公司（以下简称“长江证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
上海海欣集团股份有限公司（以下简称“海欣集团”）	基金管理人的股东
武汉钢铁有限公司（以下简称“武钢有限”）	基金管理人的股东
上海彤胜投资管理中心(有限合伙)（以下简称“彤胜投资”）	基金管理人的股东
上海彤骏投资管理中心(有限合伙)（以下简称“彤骏投资”）	基金管理人的股东
上海长江财富资产管理有限公司（以下简称“长江财富”）	基金管理人的子公司
长江期货股份有限公司（以下简称“长江期货”）	基金管理人的股东的子公司

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019 年 5 月 16 日(基金转型起始日)至 2019 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
长江证券	360,606,623.28	100.00%

注：转型后的本基金基金合同于 2019 年 5 月 16 日起正式生效，无上年度可比期间数据。

7.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行的债券交易。

7.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

7.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年5月16日(基金转型起始日)至2019年12月31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	299,777.09	100.00%	164,239.47	100.00%

注：1、转型后的本基金基金合同于2019年5月16日起正式生效，无上年度可比期间数据。

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

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019年5月16日(基金转型起始日)至2019年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	446,001.50
其中：支付销售机构的客户维护费	4,282.97

注：1、转型后的本基金基金合同于2019年5月16日起正式生效，无上年度可比期间数据。

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

H=E×基金管理费年费率/当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019年5月16日(基金转型起始日)至2019年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	66,900.23

注：1、转型后的本基金基金合同于2019年5月16日起正式生效，无上年度可比期间数据。

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

H=E×基金托管费年费率/当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2019年5月16日(基金转型起始日)至2019年12月31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	-	175,741.76	175,741.76
合计	-	175,741.76	175,741.76

注：1、转型后的本基金基金合同于2019年5月16日起正式生效，无上年度可比期间数据。

2、本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额的销售服务费年费率为0.40%。C类基金份额的基金销售服务费按前一日C类基金资产净值的0.40%年费率计提。计算方法如下：

H=E×C类基金份额的销售服务费年费率/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。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

注：本基金本报告期未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

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

注：本基金本报告期未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：基金管理人在本报告期内未运用固有资金投资本基金。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本报告期末除基金管理人之外的其他关联方未持有本基金。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年5月16日(基金转型起始日)至2019年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
招商银行	27,122,054.32	28,589.77

注：本基金用于证券交易结算的资金通过本基金托管人的基金托管结算资金专用存款账户转存于中国证券登记结算有限责任公司，按银行同业利率计息。于2019年12月31日的相关余额在资产负债表中的“结算备付金”科目中单独列示。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金在本报告期未在承销期内购入过由关联方承销的证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

注：本基金本报告期内无其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

7.4.11.1 利润分配情况——按摊余成本法核算的货币市场基金之外的基金

注：本基金本报告期未进行利润分配。

7.4.12 期末（2019年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股	期末成本总额	期末估值总额	说明
688181	八亿时空	2019年12月27日	2020年7月6日	新股限售	43.98	43.98	1,375	60,472.50	60,472.50	-
688081	兴图新科	2019年12月26日	2020年1月6日	认购新发证券	28.21	28.21	1,892	53,373.32	53,373.32	-
002973	侨银环保	2019年12月27	2020年1月6	认购新发证券	5.74	5.74	1,146	6,578.04	6,578.04	-

		日	日							
688058	宝兰德	2019年10月25日	2020年5月6日	新股限售	79.30	90.65	1,338	106,103.40	121,289.70	-
688068	热景生物	2019年9月20日	2020年3月30日	新股限售	29.46	44.59	2,641	77,803.86	117,762.19	-
688299	长阳科技	2019年10月28日	2020年5月6日	新股限售	13.71	15.74	11,341	155,485.11	178,507.34	-
688357	建龙微纳	2019年11月26日	2020年6月4日	新股限售	43.28	45.83	2,332	100,928.96	106,875.56	-
688369	致远互联	2019年10月23日	2020年5月6日	新股限售	49.39	52.08	2,970	146,688.30	154,677.60	-

注：以上“可流通日”是根据上市公司公告估算的流通日期，最终日期以上市公司公告为准。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：本基金本报告期末未持有因银行间市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注：本基金本报告期末未持有因交易所市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的融出证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

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

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

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，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发行的证券，不得超过该证券的10%。

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

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末无按短期信用评级列示的债券投资。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末无按长期信用评级列示的债券投资。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

7.4.13.3 流动性风险

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

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金坚持组合管理、分散投资的原则开展投资活动，所持证券均在证券交易所或银行间同业市场交易，并严格遵守基金管理人流动性相关交易限制；本期末本基金未持有有重大流动性风险的投资品种。本基金可通过卖出回购金融资产方式融入短期资金应对流动性需求。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的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。本基金的基金管理人对流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金本报告期末无重大流动性风险。

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

金额单位：人民币元

本期末 2019年12月31日	6个月以内	6个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产						
银行存款	27,122,054.32	-	-	-	-	27,122,054.32
结算备付金	4,122.59	-	-	-	-	4,122.59
存出保证金	35,332.17	-	-	-	-	35,332.17
交易性金融资产	-	-	-	-	105,019,015.62	105,019,015.62
应收利息	-	-	-	-	5,491.83	5,491.83
应收申购款	3,500,000.00	-	-	-	1,751.85	3,501,751.85
资产总计	30,661,509.08	-	-	-	105,026,259.30	135,687,768.38
负债						
应付证券清算款	-	-	-	-	1,168,382.25	1,168,382.25
应付赎回款	-	-	-	-	19,862,940.00	19,862,940.00
应付管理人报酬	-	-	-	-	95,719.61	95,719.61
应付托管费	-	-	-	-	14,357.91	14,357.91
应付销售服务费	-	-	-	-	37,748.37	37,748.37
应付交易费用	-	-	-	-	164,239.47	164,239.47
其他负债	-	-	-	-	100,000.00	100,000.00
负债总计	-	-	-	-	21,443,387.61	21,443,387.61
利率敏感度缺口	30,661,509.08	-	-	-	83,582,871.69	114,244,380.77

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票和债券以及银行间同业市场交易的债券，所面临的最大其他价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括VaR（Value at Risk）等指标来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产-股票投资	105,019,015.62	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－贵金属投资	-	-
衍生金融资产－权证投资	-	-
其他	-	-
合计	105,019,015.62	91.92

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	在95%的置信区间内，基金资产组合的市场价格风险	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末（ 2019年12月31日 ）
	VaR值为3.16%	-3,604,810.17

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。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.14.1 公允价值

7.4.14.1.1 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括贷款和应收款项以及其他金融负债，其因剩余

期限不长，公允价值与账面价值相若。

7.4.14.1.2 以公允价值计量的金融工具

7.4.14.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于2019年12月31日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为人民币104,219,479.37元，属于第二层次的余额为人民币59,951.36元，属于第三层次的余额为人民币739,584.89元。

7.4.14.1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和可转换债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别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不将相关股票和可转换债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。

7.4.14.1.2.3 第三层次公允价值余额和本期变动金额

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具第三层次公允价值本期变动情况如下：

基金合同转型日余额为人民币0.00元，本期转入第三层次金额为人民币0.00元，转出第三层次金额为人民币0.00元，当期计入损益的利得或损失总额为人民币92,102.76元，本期购买金额为人民币647,482.13元，出售金额为人民币0.00元，本期末余额为人民币739,584.89元，本期末持有的资产计入损益的当期未实现利得或损失的变动金额为人民币92,102.76元。

7.4.14.2 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。

7.4.14.3 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 年度财务报表（转型前）

7.1 资产负债表（转型前）

会计主体：长信量化价值精选混合型证券投资基金

报告截止日： 2019年5月15日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2019年5月15日	上年度末 2018年12月31日
资 产：			
银行存款	7.4.7.1	102,060.90	2,687,112.55
结算备付金		13,339.50	1,230,277.12
存出保证金		18,328.18	14,617.68
交易性金融资产	7.4.7.2	890,409.00	19,909,600.35
其中：股票投资		890,409.00	19,909,600.35
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	6,795,612.80
应收利息	7.4.7.5	551.97	4,083.67
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		1,024,689.55	30,641,304.17
负债和所有者权益	**附注号**	**本期末 2019年5月15日**	**上年度末 2018年12月31日**
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		9.19	8.28
应付管理人报酬		593.60	40,729.24
应付托管费		98.95	6,788.23
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	42,874.60	94,055.53
应交税费		-	-
应付利息		-	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	38,847.21	174,500.03
负债合计		82,423.55	316,081.31
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	997,837.56	36,146,632.94
未分配利润	7.4.7.10	-55,571.56	-5,821,410.08
所有者权益合计		942,266.00	30,325,222.86
负债和所有者权益总计		1,024,689.55	30,641,304.17

注：1、报告截止日2019年5月15日，基金份额净值0.9443元，基金份额总额997,837.56份。

2、本基金本报告期为2019年1月1日至2019年5月15日（基金合同失效前日），本基金基金合同于2018年4月19日起正式生效，上年度可比期间为2018年4月19日至2018年12月31日，不满一个会计年度。

7.2 利润表

会计主体：长信量化价值精选混合型证券投资基金

本报告期：2019年1月1日至2019年5月15日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2019年1月1日至 2019年5月15日	上年度可比期间 2018年4月19日(基金合同生效日)至 2018年12月31日
一、收入		1,549,679.31	-5,545,651.45
1.利息收入		6,335.82	253,083.48
其中：存款利息收入	7.4.7.11	4,074.03	180,280.06
债券利息收入		2,261.79	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	72,803.42
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		544,201.66	-5,784,704.00
其中：股票投资收益	7.4.7.12	547,607.19	-6,190,137.17
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-1,020.10	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	-2,385.43	405,433.17
3.公允价值变动收益（损失以	7.4.7.17	951,909.18	-936,971.83

“-”号填列）			
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	47,232.65	922,940.90
减：二、费用		168,014.97	1,366,111.15
1．管理人报酬	7.4.10.2.1	34,121.05	622,263.80
2．托管费	7.4.10.2.2	5,686.86	103,710.65
3．销售服务费		-	-
4．交易费用	7.4.7.19	83,499.58	455,257.83
5．利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6．税金及附加		-	-
7．其他费用	7.4.7.20	44,707.48	184,878.87
三、利润总额 （亏损总额以“-”号填列）		1,381,664.34	-6,911,762.60
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,381,664.34	-6,911,762.60

注：本基金本报告期为2019年1月1日至2019年5月15日（基金合同失效前日），本基金基金合同于2018年4月19日起正式生效，上年度可比期间为2018年4月19日至2018年12月31日，不满一个会计年度。

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长信量化价值精选混合型证券投资基金

本报告期：2019年1月1日至2019年5月15日

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年5月15日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	36,146,632.94	-5,821,410.08	30,325,222.86
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,381,664.34	1,381,664.34
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-35,148,795.38	4,384,174.18	-30,764,621.20
其中：1.基金申购款	1,251,885.57	3,563.41	1,255,448.98
2.基金赎回款	-36,400,680.95	4,380,610.77	-32,020,070.18

四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	997,837.56	-55,571.56	942,266.00
项目	**上年度可比期间 2018年4月19日(基金合同生效日)至2018年12月31日**		
	实收基金	**未分配利润**	**所有者权益合计**
一、期初所有者权益（基金净值）	220,607,762.64	-	220,607,762.64
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-6,911,762.60	-6,911,762.60
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-184,461,129.70	1,090,352.52	-183,370,777.18
其中：1.基金申购款	72,980.04	-3,480.50	69,499.54
2.基金赎回款	-184,534,109.74	1,093,833.02	-183,440,276.72
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	36,146,632.94	-5,821,410.08	30,325,222.86

注：本基金本报告期为2019年1月1日至2019年5月15日（基金合同失效前日），本基金基金合同于2018年4月19日起正式生效，上年度可比期间为2018年4月19日至2018年12月31日，不满一个会计年度。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

成善栋	覃波	孙红辉
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

长信量化价值精选混合型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（“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，由长信基金管理有限责任公司作为管理人向社会公开发行募集，基金合同于2018年4月19日生效，首次设立募集规模为220,607,762.64份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人和注册登记机构为长信基金管理有限责任公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据《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。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、权证，债券（包括国债、央行票据、金融债、地方政府债、企业债、公司债、短期融资券、超级短期融资券、中期票据、次级债券、可转债及分离交易可转债的纯债部分及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具、国债期货、股指期货、股票期权以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

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：股票投资占基金资产的比例为60-95%，权证投资占基金资产净值的比例为0%-3%，本基金每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货及股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值5%的现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者到期日在一年以内的政府债券。

本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率*75%+中债综合指数收益率*25%。

7.4.2 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、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《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2号《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>》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

根据《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继续运作，故本财务报表仍以持续经营为基础列报。

7.4.3 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2019年5月15日的财务状况以及自2019年1月1日起至2019年5月15日(基金合同失效前日)止期间的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年自1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间系自2019年1月1日起至2019年5月15日(基金合同失效前日)止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

(1)金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括股票投资、债券投资和衍生工具等；

(2)金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券等，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

(1)股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资，股票投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账；

卖出股票于成交日确认股票投资收益，卖出股票的成本按移动加权平均法于成交日结转；

(2)债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

(3)权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账；

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益，卖出权证的成本按移动加权平均法于成交日结转；

(4)股指期货投资

买入或卖出股指期货投资于成交日确认为股指期货投资。股指期货初始合约价值按成交金额确认；

股指期货平仓于成交日确认衍生工具投资收益，股指期货的初始合约价值按移动加权平均法于成交日结转；

(5)国债期货投资

买入或卖出国债期货投资于成交日确认为国债期货投资。国债期货初始合约价值按成交金额确认；

国债期货平仓于成交日确认衍生工具投资收益，国债期货的初始合约价值按移动加权平均法于成交日结转；

(6)分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本；

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算；

(7)回购协议

本基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重

新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1)存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

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

(3)如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4)如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现

利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1)存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2)债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3)资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4)买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5)股票投资收益/（损失）于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6)债券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7)资产支持证券投资收益/(损失)于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(8)股指期货投资收益/（损失）于平仓日确认，并按平仓成交金额与其初始合约价值的差额入账；

(9)国债期货投资收益/(损失)于平仓日确认，并按平仓成交金额与其初始合约价值的差额入账；

(10)权证收益/（损失）于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(11)股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(12)公允价值变动收益/（损失）系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(13)其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

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

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

(3)基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(4)每一基金份额享有同等分配权；

(5)法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 分部报告

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

(1)该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；

(2)能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；

(3)能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。

如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

1)对于在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，根据《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估

值指引(试行)>的通知》(中基协发[2017]6号)，在估值日按照该通知规定的流通受限股票公允价值计算模型进行估值。

2)对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，根据《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》(中国证监会公告[2017]13号)及《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》(中基协发[2013]13号)相关规定，本基金根据情况决定使用指数收益法、可比公司法、市场价格模型法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

3)根据《关于发布<中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准>的通知》(中基协发[2014]24号)，在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外)，采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 税项

7.4.6.1 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‰；

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；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

7.4.6.2 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，自2018年1月1日起，本基金的基金管理人运营本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。

7.4.6.3 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暂行条例（2011年修订）》、《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）及地方教育费附加。

7.4.6.4 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[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

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。

7.4.6.5 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019年5月15日	上年度末 2018年12月31日
活期存款	102,060.90	2,687,112.55
定期存款	-	-
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	-	-
合计：	102,060.90	2,687,112.55

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2019年5月15日		
		成本	公允价值	估值增值
股票		875,471.65	890,409.00	14,937.35
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		875,471.65	890,409.00	14,937.35
项目		上年度末 2018年12月31日		
		成本	公允价值	估值增值
股票		20,846,572.18	19,909,600.35	-936,971.83
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		20,846,572.18	19,909,600.35	-936,971.83

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末及上年度末均无买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末

	2019年5月15日	2018年12月31日
应收活期存款利息	447.97	722.45
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	54.13	3,354.07
应收债券利息	-	-
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	49.87	7.15
合计	551.97	4,083.67

注：其他为保证金利息。

7.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019年5月15日	上年度末 2018年12月31日
交易所市场应付交易费用	42,874.60	94,055.53
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	42,874.60	94,055.53

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年5月15日	上年度末 2018年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	0.01	0.03
应付证券出借违约金	-	-
预提账户维护费	2,225.25	4,500.00
预提审计费	18,493.65	50,000.00
预提信息披露费	18,128.3	120,000.00
合计	38,847.21	174,500.03

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年5月15日

	基金份额（份）	账面金额
上年度末	36,146,632.94	36,146,632.94
本期申购	1,251,885.57	1,251,885.57
本期赎回（以“-”号填列）	-36,400,680.95	-36,400,680.95
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	997,837.56	997,837.56

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-5,028,432.83	-792,977.25	-5,821,410.08
本期利润	429,755.16	951,909.18	1,381,664.34
本期基金份额交易产生的变动数	4,558,185.23	-174,011.05	4,384,174.18
其中：基金申购款	-69,359.01	72,922.42	3,563.41
基金赎回款	4,627,544.24	-246,933.47	4,380,610.77
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-40,492.44	-15,079.12	-55,571.56

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年5月15日	上年度可比期间 2018年4月19日(基金合同生效日)至2018年12月31日
活期存款利息收入	2,578.53	172,314.33
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	1,385.49	7,797.76
其他	110.01	167.97
合计	4,074.03	180,280.06

注：其他为保证金利息收入。

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年5月15日	上年度可比期间 2018年4月19日(基金合同生效日)至2018年12月31日

卖出股票成交总额	36,046,986.20	151,541,825.65
减：卖出股票成本总额	35,499,379.01	157,731,962.82
买卖股票差价收入	547,607.19	-6,190,137.17

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年5月15日	上年度可比期间 2018年4月19日(基金合同生效日)至2018年12月31日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-1,020.10	-
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	-1,020.10	-

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年5月15日	上年度可比期间 2018年4月19日(基金合同生效日)至2018年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	538,560.44	-
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	521,540.10	-
减：应收利息总额	18,040.44	-
买卖债券差价收入	-1,020.10	-

7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无债券投资赎回差价收入。

7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无债券投资申购差价收入。

7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益

7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

7.4.7.15 衍生工具收益

7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益。

7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年5月15日	上年度可比期间 2018年4月19日(基金合同生效日)至2018年12月31日
股票投资产生的股利收益	-2,385.43	405,433.17
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	-2,385.43	405,433.17

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2019年1月1日至2019年5月15日	上年度可比期间 2018年4月19日(基金合同生效日)至2018年12月31日
1.交易性金融资产	951,909.18	-936,971.83
——股票投资	951,909.18	-936,971.83
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——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	951,909.18	-936,971.83

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年5月15日	上年度可比期间 2018年4月19日(基金合同生效日)至2018年12月31日
基金赎回费收入	47,232.65	922,929.34
转换费收入	-	11.56
合计	47,232.65	922,940.90

注：对于持有期少于30日的基金份额所收取的赎回费，全额计入基金财产；对于持有期不少于30日但少于3个月的基金份额所收取的赎回费，其75%计入基金财产；对于持有期不少于3个月但少于6个月的基金份额所收取的赎回费，其50%计入基金财产；对于持有期长于6个月的基金份额所收取的赎回费，其25%计入基金财产。

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年5月15日	上年度可比期间 2018年4月19日(基金合同生效日)至2018年12月31日
交易所市场交易费用	83,499.58	455,257.83
银行间市场交易费用	-	-
交易基金产生的费用	-	-
其中：申购费	-	-
赎回费	-	-
合计	83,499.58	455,257.83

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年5月15日	上年度可比期间 2018年4月19日(基金合同生效日)至2018年12月31日
审计费用	18,493.65	50,000.00
信息披露费	18,128.30	120,000.00
证券出借违约金	-	-
帐户维护费	6,725.25	10,500.00
其他费用	1,360.28	4,378.87
合计	44,707.48	184,878.87

注：其他费用为银行手续费。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
长信基金管理有限责任公司（以下简称“长信基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
招商银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
长江证券股份有限公司（以下简称“长江证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
上海海欣集团股份有限公司（以下简称“海欣集团”）	基金管理人的股东
武汉钢铁有限公司（以下简称“武钢有限”）	基金管理人的股东
上海彤胜投资管理中心（有限合伙）（以下简称“彤胜投资”）	基金管理人的股东
上海彤骏投资管理中心（有限合伙）（以下简称“彤骏投资”）	基金管理人的股东
上海长江财富资产管理有限公司（以下简称“长江财富”）	基金管理人的子公司
长江期货股份有限公司（以下简称“长江期货”）	基金管理人的股东的子公司

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年5月15日		上年度可比期间 2018年4月19日(基金合同生效日)至2018年12月31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	51,575,264.68	100.00%	330,120,360.65	100.00%

7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年5月15日		上年度可比期间 2018年4月19日(基金合同生效日)至2018年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
长江证券	1,042,060.10	100.00%	-	-

7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年5月15日		上年度可比期间 2018年4月19日(基金合同生效日)至2018年12月31日	
	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
长江证券	-	-	366,000,000.00	100.00%

7.4.10.1.4 权证交易

注：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。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年5月15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	42,874.60	100.00%	42,874.60	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2018年4月19日(基金合同生效日)至2018年12月31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	274,429.95	100.00%	94,055.53	100.00%

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

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年5月15日	上年度可比期间 2018年4月19日(基金合同生效日)至2018年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	34,121.05	622,263.80
其中：支付销售机构的客户维护费[1]	3,017.29	6,974.58

注：支付基金管理人长信基金管理有限责任公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值的1.5%年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

管理费的计算方法如下： H＝E×1.5%÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年5月15日	上年度可比期间 2018年4月19日(基金合同生效日)至2018年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	5,686.86	103,710.65

注：支付基金托管人招商银行的基金托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率确认，逐日累计至每月月底，按月支付。

托管费的计算方法如下： H＝E×0.25%÷当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：基金管理人在本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未持有本基金。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年5月15日		上年度可比期间 2018年4月19日(基金合同生效日)至2018年12月31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	102,060.90	2,578.53	2,687,112.55	172,314.33

注：本基金用于证券交易结算的资金通过本基金托管人的基金托管结算资金专用存款账户转存于中国证券登记结算有限责任公司，按银行同业利率计息。于2019年5月15日的相关余额在资产负债表中的“结算备付金”科目中单独列示（2018年12月31日：同）。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金在本报告期及上年度可比期间均未在承销期内购入过由关联方承销的证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

7.4.11.1 利润分配情况——按摊余成本法核算的货币市场基金之外的基金

注：本基金本报告期未进行利润分配。

7.4.12 期末（2019年5月15日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而持有的流通受限证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌股票

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
000333	美的集团	2019年5月8日	临时停牌	50.75	2019年5月22日	50.21	500	24,545.58	25,375.00	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：本基金本报告期末未持有因银行间市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注：本基金本报告期末未持有因交易所市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的融出证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常活动中面临各种金融工具的风险，主要包括：信用风险、流动性风险和市场风险。本基金在下文主要论述上述风险敞口及其形成原因、风险管理目标、政策和过程以及计量风险的方法等。

本基金的基金管理人从事风险管理的目标是使本基金在风险和收益之间取得适当的平衡，以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。基于该风险管理目标，本基金的基金管理人已制定

了政策和程序来辨别和分析这些风险，设定适当的风险限额并设计相应的内部控制程序，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

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

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，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发行的证券，不得超过该证券的10%。

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

7.4.13.2.7 按短期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的债券投资。

7.4.13.2.8 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

7.4.13.2.9 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

7.4.13.2.10 按长期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的债券投资。

7.4.13.2.11 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

7.4.13.2.12 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

7.4.13.3 流动性风险

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

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金坚持组合管理、分散投资的原则开展投资活动，所持证券均在证券交易所或银行间同业市场交易，并严格遵守基金管理人流动性相关交易限制；本期末本基金未持有有重大流动性风险的投资品种。本基金可通过卖出回购金融资产方式融入短期资金应对流动性需求。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的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。本基金的基金管理人对流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金本报告期末及上年度末均无重大流动性风险。

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

金额单位：人民币元

本期末 2019年5月15日	6个月以内	6个月 -1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产						
银行存款	102,060.90	-	-	-	-	102,060.90
结算备付金	13,339.50	-	-	-	-	13,339.50
存出保证金	18,328.18	-	-	-	-	18,328.18
交易性金融资产	-	-	-	-	890,409.00	890,409.00
应收利息	-	-	-	-	551.97	551.97
其他资产	-	-	-	-	-	-
资产总计	133,728.58	-	-	-	890,960.97	1,024,689.55
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	9.19	9.19
应付管理人报酬	-	-	-	-	593.60	593.60
应付托管费	-	-	-	-	98.95	98.95
应付交易费用	-	-	-	-	42,874.60	42,874.60
其他负债	-	-	-	-	38,847.21	38,847.21
负债总计	-	-	-	-	82,423.55	82,423.55
利率敏感度缺口	133,728.58	-	-	-	808,537.42	942,266.00
上年度末 2018年12月31日	6个月以内	6个月 -1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产						
银行存款	2,687,112.55	-	-	-	-	2,687,112.55
结算备付金	1,230,277.12	-	-	-	-	1,230,277.12
存出保证金	14,617.68	-	-	-	-	14,617.68
交易性金融资产	-	-	-	-	19,909,600.35	19,909,600.35
应收证券清算款	-	-	-	-	6,795,612.80	6,795,612.80
应收利息	-	-	-	-	4,083.67	4,083.67
其他资产	-	-	-	-	-	-
资产总计	3,932,007.35	-	-	-	26,709,296.82	30,641,304.17
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	8.28	8.28
应付管理人报酬	-	-	-	-	40,729.24	40,729.24
应付托管费	-	-	-	-	6,788.23	6,788.23
应付交易费用	-	-	-	-	94,055.53	94,055.53
其他负债	-	-	-	-	174,500.03	174,500.03
负债总计	-	-	-	-	316,081.31	316,081.31
利率敏感度缺口	3,932,007.35	-	-	-	26,393,215.51	30,325,222.86

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：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。

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票和债券以及银行间同业市场交易的债券，所面临的最大其他价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括VaR（Value at Risk）等指标来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2019年5月15日		上年度末 2018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	890,409.00	94.50	19,909,600.35	65.65
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－贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产－权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	890,409.00	94.50	19,909,600.35	65.65

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	在95%的置信区间内，基金资产组合的市场价格风险		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（ 2019年5月	上年度末（ 2018年12月

		15日）	31日）
	VaR值为3.45%（2018年12月31日VaR值为2.33%）	-32,463.51	-706,359.01

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。2018年的分析同样基于该假设。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.14.1 公允价值

7.4.14.1.1 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括贷款和应收款项以及其他金融负债，其因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

7.4.14.1.2 以公允价值计量的金融工具

7.4.14.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于2019年5月15日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为人民币865,034.00元，属于第二层次的余额为人民币25,375.00元，属于第三层次的余额为人民币0.00元（于2018年12月31日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为人民币19,909,600.35元，属于第二层次的余额为人民币0.00元，属于第三层次的余额为人民币0.00元）。

7.4.14.1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和可转换债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别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不将相关股票和可转换债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。

7.4.14.1.2.3 第三层次公允价值余额和本期变动金额

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具第三层次公允价值本期未发生变动。

7.4.14.2 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。

7.4.14.3 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告（转型后）

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	105,019,015.62	77.40
	其中：股票	105,019,015.62	77.40
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	27,126,176.91	19.99
8	其他各项资产	3,542,575.85	2.61
9	合计	135,687,768.38	100.00

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资港股。

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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	3,286,066.00	2.88
B	采矿业	3,223,285.00	2.82
C	制造业	32,651,486.94	28.58
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	1,459,620.00	1.28
F	批发和零售业	2,711,502.00	2.37
G	交通运输、仓储和邮政业	1,181,162.00	1.03
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,148,303.00	2.76
J	金融业	36,649,561.70	32.08
K	房地产业	3,277,564.00	2.87
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	1,559,805.00	1.37
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	89,148,355.64	78.03

8.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	12,966,936.64	11.35
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	275,967.30	0.24
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	2,621,178.00	2.29
N	水利、环境和公共设施管理业	6,578.04	0.01
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	15,870,659.98	13.89

8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期未通过港股通交易机制投资港股。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	79,075	6,757,749.50	5.92
2	601166	兴业银行	244,200	4,835,160.00	4.23
3	000858	五粮液	32,700	4,349,427.00	3.81
4	600016	民生银行	607,300	3,832,063.00	3.35
5	600887	伊利股份	116,100	3,592,134.00	3.14
6	600690	海尔智家	181,900	3,547,050.00	3.10
7	601211	国泰君安	180,300	3,333,747.00	2.92
8	300059	东方财富	201,420	3,176,393.40	2.78
9	600585	海螺水泥	57,800	3,167,440.00	2.77
10	300498	温氏股份	94,100	3,161,760.00	2.77
11	600919	江苏银行	431,800	3,126,232.00	2.74
12	600050	中国联通	520,000	3,062,800.00	2.68
13	601088	中国神华	162,100	2,958,325.00	2.59
14	601939	建设银行	394,400	2,851,512.00	2.50
15	603160	汇顶科技	13,384	2,761,119.20	2.42
16	600048	保利地产	170,600	2,760,308.00	2.42
17	601998	中信银行	445,300	2,747,501.00	2.40
18	002841	视源股份	31,800	2,725,260.00	2.39
19	002024	苏宁易购	268,200	2,711,502.00	2.37
20	600276	恒瑞医药	29,907	2,617,460.64	2.29
21	601633	长城汽车	295,300	2,613,405.00	2.29
22	601377	兴业证券	328,100	2,322,948.00	2.03
23	603899	晨光文具	47,400	2,310,276.00	2.02
24	600519	贵州茅台	1,900	2,247,700.00	1.97
25	601601	中国太保	43,290	1,638,093.60	1.43
26	300347	泰格医药	24,700	1,559,805.00	1.37
27	000333	美的集团	21,300	1,240,725.00	1.09
28	601628	中国人寿	31,400	1,094,918.00	0.96
29	601390	中国中铁	164,300	975,942.00	0.85
30	600029	南方航空	135,700	974,326.00	0.85
31	600219	南山铝业	274,000	613,760.00	0.54
32	601997	贵阳银行	56,300	538,228.00	0.47
33	000069	华侨城A	66,400	517,256.00	0.45
34	601186	中国铁建	47,700	483,678.00	0.42

35	000661	长春高新	800	357,600.00	0.31
36	603288	海天味业	2,910	312,854.10	0.27
37	601988	中国银行	79,500	293,355.00	0.26
38	601808	中海油服	13,800	264,960.00	0.23
39	600115	东方航空	35,600	206,836.00	0.18
40	300433	蓝思科技	9,700	134,054.00	0.12
41	002714	牧原股份	1,400	124,306.00	0.11
42	600570	恒生电子	1,100	85,503.00	0.07
43	601788	光大证券	6,400	83,840.00	0.07
44	600031	三一重工	2,400	40,920.00	0.04
45	601818	光大银行	3,120	13,759.20	0.01
46	000568	泸州老窖	150	13,002.00	0.01
47	002475	立讯精密	200	7,300.00	0.01
48	601688	华泰证券	200	4,062.00	0.00

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	603658	安图生物	29,300	2,823,934.00	2.47
2	601233	桐昆股份	185,500	2,780,645.00	2.43
3	000708	中信特钢	116,500	2,671,345.00	2.34
4	300014	亿纬锂能	52,900	2,653,464.00	2.32
5	300012	华测检测	175,800	2,621,178.00	2.29
6	000977	浪潮信息	49,200	1,480,920.00	1.30
7	688299	长阳科技	11,341	178,507.34	0.16
8	688369	致远互联	2,970	154,677.60	0.14
9	688058	宝兰德	1,338	121,289.70	0.11
10	688068	热景生物	2,641	117,762.19	0.10
11	688357	建龙微纳	2,332	106,875.56	0.09
12	688181	八亿时空	1,375	60,472.50	0.05
13	688081	兴图新科	1,892	53,373.32	0.05
14	002972	科安达	1,075	21,532.25	0.02
15	603109	神驰机电	684	18,105.48	0.02
16	002973	侨银环保	1,146	6,578.04	0.01

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	8,882,479.00	7.77
2	601166	兴业银行	7,749,039.00	6.78
3	600016	民生银行	6,608,831.00	5.78
4	000858	五粮液	6,276,436.00	5.49
5	600519	贵州茅台	6,096,624.00	5.34
6	000333	美的集团	5,416,847.00	4.74
7	600887	伊利股份	5,062,000.00	4.43
8	600048	保利地产	4,950,776.00	4.33
9	300014	亿纬锂能	4,760,584.00	4.17
10	000708	中信特钢	4,635,967.00	4.06
11	300498	温氏股份	4,492,842.00	3.93
12	300059	东方财富	4,218,795.00	3.69
13	600276	恒瑞医药	4,215,476.04	3.69
14	601998	中信银行	3,955,617.00	3.46
15	601328	交通银行	3,689,653.00	3.23
16	601377	兴业证券	3,571,455.00	3.13
17	600919	江苏银行	3,384,960.54	2.96
18	600050	中国联通	3,327,405.00	2.91
19	601988	中国银行	3,303,220.00	2.89
20	600585	海螺水泥	3,196,154.00	2.80
21	600031	三一重工	3,176,052.00	2.78
22	601211	国泰君安	3,160,617.00	2.77
23	600690	海尔智家	3,150,684.00	2.76
24	601088	中国神华	3,149,641.00	2.76
25	603658	安图生物	3,110,817.00	2.72
26	603160	汇顶科技	3,105,222.20	2.72
27	601169	北京银行	3,083,209.00	2.70
28	600009	上海机场	2,983,766.00	2.61
29	002024	苏宁易购	2,966,965.00	2.60
30	601688	华泰证券	2,935,604.00	2.57
31	601939	建设银行	2,893,147.00	2.53

32	601229	上海银行	2,885,227.00	2.53
33	601009	南京银行	2,880,547.00	2.52
34	600999	招商证券	2,790,503.00	2.44
35	600570	恒生电子	2,781,076.60	2.43
36	300012	华测检测	2,766,320.00	2.42
37	601888	中国国旅	2,765,239.00	2.42
38	601633	长城汽车	2,762,602.00	2.42
39	600871	石化油服	2,761,538.00	2.42
40	601233	桐昆股份	2,759,426.00	2.42
41	600030	中信证券	2,733,935.00	2.39
42	002841	视源股份	2,714,609.00	2.38
43	601668	中国建筑	2,651,589.85	2.32
44	600023	浙能电力	2,574,255.00	2.25
45	600606	绿地控股	2,547,045.00	2.23
46	000630	铜陵有色	2,538,263.00	2.22
47	603899	晨光文具	2,532,006.76	2.22
48	601997	贵阳银行	2,520,934.00	2.21
49	002465	海格通信	2,496,180.21	2.18
50	002182	云海金属	2,413,809.00	2.11
51	601958	金钼股份	2,391,960.00	2.09
52	601928	凤凰传媒	2,376,705.00	2.08

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

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	5,061,956.00	4.43
2	000333	美的集团	4,392,601.00	3.84
3	601328	交通银行	3,480,336.00	3.05
4	600031	三一重工	3,297,510.00	2.89
5	300014	亿纬锂能	3,127,632.00	2.74
6	601988	中国银行	3,077,168.00	2.69
7	601169	北京银行	3,060,759.00	2.68
8	601009	南京银行	3,033,287.00	2.66
9	600570	恒生电子	2,970,929.00	2.60
10	600016	民生银行	2,963,461.00	2.59
11	601229	上海银行	2,951,904.60	2.58

12	601166	兴业银行	2,946,770.00	2.58
13	601888	中国国旅	2,943,145.90	2.58
14	600009	上海机场	2,937,346.00	2.57
15	600871	石化油服	2,746,755.00	2.40
16	600276	恒瑞医药	2,742,103.00	2.40
17	600999	招商证券	2,715,072.00	2.38
18	600030	中信证券	2,669,663.00	2.34
19	601688	华泰证券	2,651,704.00	2.32
20	601958	金钼股份	2,595,351.00	2.27
21	600048	保利地产	2,591,204.00	2.27
22	600606	绿地控股	2,559,699.82	2.24
23	601668	中国建筑	2,541,363.25	2.22
24	002465	海格通信	2,531,696.54	2.22
25	000708	中信特钢	2,518,297.00	2.20
26	000630	铜陵有色	2,479,239.00	2.17
27	002182	云海金属	2,337,863.00	2.05
28	600023	浙能电力	2,329,730.00	2.04
29	601928	凤凰传媒	2,329,098.00	2.04

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

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	229,169,049.90
卖出股票收入（成交）总额	136,679,374.35

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未投资股指期货。

8.10.1 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金本报告期末未投资股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，在报告编制日前一年内也没有受到公开谴责、处罚。

8.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

报告期内本基金投资的前十名股票中，不存在超出基金合同规定备选股票库的情形。

8.12.3 其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	35,332.17
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	5,491.83
5	应收申购款	3,501,751.85
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,542,575.85

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

§8 投资组合报告（转型前）

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	890,409.00	86.90
	其中：股票	890,409.00	86.90
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	115,400.40	11.26
8	其他资产	18,880.15	1.84
9	合计	1,024,689.55	100.00

注：本基金本报告期未通过港股通交易机制投资港股。

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	18,235.00	1.94
B	采矿业	46,906.00	4.98
C	制造业	353,347.00	37.50
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	38,244.00	4.06
E	建筑业	46,070.00	4.89
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	24,933.00	2.65
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	25,216.00	2.68
J	金融业	296,803.00	31.50
K	房地产业	36,605.00	3.88
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	4,050.00	0.43
S	综合	-	-
	合计	890,409.00	94.50

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期未通过港股通交易机制投资港股。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	100	92,700.00	9.84
2	601318	中国平安	675	54,364.50	5.77
3	601818	光大银行	10,820	42,198.00	4.48
4	601166	兴业银行	2,100	38,976.00	4.14
5	600887	伊利股份	1,200	37,236.00	3.95
6	601668	中国建筑	5,300	30,210.00	3.21
7	601601	中国太保	890	29,859.50	3.17
8	601600	中国铝业	7,200	28,152.00	2.99
9	600900	长江电力	1,700	27,897.00	2.96
10	000895	双汇发展	1,000	26,140.00	2.77
11	600999	招商证券	1,600	25,824.00	2.74
12	600985	淮北矿业	2,200	25,454.00	2.70
13	601211	国泰君安	1,500	25,410.00	2.70
14	000333	美的集团	500	25,375.00	2.69
15	300059	东方财富	1,600	25,216.00	2.68
16	601377	兴业证券	3,800	23,788.00	2.52
17	000338	潍柴动力	1,600	19,312.00	2.05
18	300498	温氏股份	500	18,235.00	1.94
19	600377	宁沪高速	1,800	18,108.00	1.92
20	601169	北京银行	3,000	17,850.00	1.89
21	600873	梅花生物	3,300	16,533.00	1.75
22	600031	三一重工	1,300	15,782.00	1.67
23	002594	比 亚 迪	300	15,387.00	1.63

24	601009	南京银行	1,800	15,210.00	1.61
25	600663	陆家嘴	800	13,648.00	1.45
26	000046	泛海控股	2,000	13,400.00	1.42
27	603160	汇顶科技	100	13,109.00	1.39
28	600276	恒瑞医药	200	13,082.00	1.39
29	600188	兖州煤业	1,200	12,996.00	1.38
30	000568	泸州老窖	150	11,658.00	1.24
31	600170	上海建工	2,400	9,408.00	1.00
32	601229	上海银行	800	9,272.00	0.98
33	600585	海螺水泥	200	7,920.00	0.84
34	002841	视源股份	100	7,868.00	0.84
35	600028	中国石化	1,400	7,560.00	0.80
36	601919	中远海控	1,300	6,825.00	0.72
37	600745	闻泰科技	200	5,988.00	0.64
38	600606	绿地控股	800	5,672.00	0.60
39	601158	重庆水务	900	5,211.00	0.55
40	000001	平安银行	400	5,168.00	0.55
41	601991	大唐发电	1,600	5,136.00	0.55
42	600373	中文传媒	300	4,050.00	0.43
43	601186	中国铁建	400	3,996.00	0.42
44	000921	海信家电	300	3,975.00	0.42
45	600048	保利地产	300	3,885.00	0.41
46	000617	中油资本	300	3,624.00	0.38
47	601727	上海电气	600	3,258.00	0.35
48	601328	交通银行	500	3,000.00	0.32
49	000898	鞍钢股份	500	2,535.00	0.27
50	601117	中国化学	400	2,456.00	0.26
51	601877	正泰电器	100	2,361.00	0.25
52	002142	宁波银行	100	2,259.00	0.24
53	000725	京东方A	600	2,052.00	0.22
54	601766	中国中车	200	1,616.00	0.17
55	300207	欣 旺 达	100	1,308.00	0.14
56	601225	陕西煤业	100	896.00	0.10

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	601166	兴业银行	608,576.00	2.01
2	600031	三一重工	410,895.00	1.35
3	601668	中国建筑	370,423.00	1.22
4	601988	中国银行	364,578.00	1.20
5	002415	海康威视	351,966.00	1.16
6	600028	中国石化	346,016.00	1.14
7	601377	兴业证券	323,069.00	1.07
8	600999	招商证券	314,337.41	1.04
9	601117	中国化学	308,247.00	1.02
10	600276	恒瑞医药	305,154.20	1.01
11	600585	海螺水泥	295,448.00	0.97
12	000001	平安银行	292,412.00	0.96
13	002142	宁波银行	275,360.00	0.91
14	601600	中国铝业	273,829.00	0.90
15	600887	伊利股份	271,899.00	0.90
16	600346	恒力石化	262,066.00	0.86
17	601229	上海银行	261,084.00	0.86
18	600606	绿地控股	260,344.00	0.86
19	601997	贵阳银行	249,204.87	0.82
20	601328	交通银行	246,931.00	0.81

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

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	1,154,564.25	3.81
2	601988	中国银行	984,027.00	3.24
3	600031	三一重工	726,051.05	2.39
4	601601	中国太保	675,086.50	2.23
5	601818	光大银行	673,040.00	2.22
6	601211	国泰君安	667,686.00	2.20
7	601166	兴业银行	639,245.00	2.11
8	601328	交通银行	587,369.60	1.94
9	601006	大秦铁路	586,296.55	1.93
10	000568	泸州老窖	585,525.00	1.93

11	600660	福耀玻璃	579,652.80	1.91
12	601288	农业银行	579,641.10	1.91
13	601607	上海医药	546,961.40	1.80
14	601877	正泰电器	534,792.40	1.76
15	600886	国投电力	533,272.27	1.76
16	002146	荣盛发展	526,002.40	1.73
17	600028	中国石化	514,358.00	1.70
18	601939	建设银行	511,436.80	1.69
19	600519	贵州茅台	502,149.00	1.66
20	600977	中国电影	500,153.00	1.65

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

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	15,528,278.48
卖出股票收入（成交）总额	36,046,986.20

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未投资股指期货。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金本报告期末未投资股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，在报告编制日前一年内也没有受到公开谴责、处罚。

8.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

报告期内本基金投资的前十名股票中，不存在超出基金合同规定备选股票库的情形。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	18,328.18
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	551.97
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	18,880.15

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

§9 基金份额持有人信息（转型后）

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
长信沪深300指数A	260	40,304.27	9,326,065.82	89.00%	1,153,043.53	11.00%
长信沪深300指数C	49	1,930,697.43	93,924,496.89	99.28%	679,677.07	0.72%
合计	309	340,075.35	103,250,562.71	98.26%	1,832,720.60	1.74%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	长信沪深 300 指数 A	0.00	0.00%
	长信沪深 300 指数 C	0.00	0.00%
	合计	0.00	0.00%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

§9 基金份额持有人信息（转型前）

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

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
223	4,474.61	1,250.00	0.13%	996,587.56	99.87%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	0.00	0.00%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§10 开放式基金份额变动(转型后)

单位：份

项目	长信沪深300指数A	长信沪深300指数C
基金合同生效日基金份额总额	997,837.56	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	10,554,802.84	171,063,848.70
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	-1,073,531.05	76,459,674.74
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以"-"填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	10,479,109.35	94,604,173.96

注：转型后的本基金合同生效日为2019年5月16日，本报告期为2019年5月16日至2019年12月31日。

§10 开放式基金份额变动(转型前)

单位：份

基金合同生效日基金份额总额	220,607,762.64
本报告期期初基金份额总额	36,146,632.94
本报告期基金总申购份额	1,251,885.57
减:本报告期基金总赎回份额	36,400,680.95
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以"-"填列）	-
本报告期期末基金份额总额	997,837.56

注：上表中“报告期期末”为2019年5月15日。本报告期为2019年1月1日至2019年5月15日。

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

基金管理人自2019年4月29日0:00起至2019年5月13日17：00止，以通讯方式召开长信量化价值精选混合型证券投资基金的基金份额持有人大会，审议《关于长信量化价值精选混合型证券投资基金变更注册的议案》。经统计，有效参加基金份额持有人大会表决的基金份额共计1,192,379.94份，占权益登记日该基金总份额的54.12%，达到法定的基金份额持有人大会召开条件。经表决，同意本次会议议案的基金份额占有效参加本次会议表决的基金份额持有人所持基金份额的100%，本次会议议案于2019年5月14日获得通过，基金管理人已于2019年5月16日在指定报刊及指定网站上就决议生效事项进行了公告。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

11.2.1 基金管理人的重大人事变动

本报告期内自2019年3月2日起，李小羽先生不再担任本基金管理人的副总经理。

上述重大人事变动情况，本基金管理人已在指定信息披露媒体发布相应公告。

11.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

自2019年12月18日起，姜然女士不再担任招商银行股份有限公司总行资产托管部总经理职务。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

自2019年5月16日起，《长信沪深300指数增强型证券投资基金基金合同》正式生效，其投资策略变更为：资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、中小企业私募债投资策略、股指期货投资策略、资产支持证券投资策略、权证投资策略、流通受限证券投资策略。

本基金详细的投资策略可参见《长信沪深300指数增强型证券投资基金基金合同》等法律文件。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金未更换会计师事务所，报告期应支付给安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）审计的报酬为人民币50,000.00元，该审计机构为本基金提供的审计服务的连续年限为2年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期本基金管理人、托管人及其高级管理人员没有受监管部门稽查或处罚的情形。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型后）

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
长江证券	2	360,606,623.28	100.00%	299,777.09	100.00%	-

注：1、本报告期租用证券公司交易单元无变化。

2、专用交易单元的选择标准和程序

根据中国证监会《关于加强证券投资基金监管有关问题的通知》（证监基字<1998>29号）和《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定，本公司制定了租用证券公司专用交易单元的选择标准和程序。

（1）选择标准：

a、券商基本面评价（财务状况、经营状况）；

b、券商研究机构评价（报告质量、及时性和数量）；

c、券商每日信息评价（及时性和有效性）；

d、券商协作表现评价。

（2）选择程序：

首先根据租用证券公司专用交易单元的选择标准形成《券商服务评价表》，然后根据评分高低进行选择基金专用交易单元。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

注：本报告期未租用证券公司交易单元进行其他证券投资。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型前）

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
长江证券	2	51,575,264.68	100.00%	42,874.60	100.00%	-

注：1、本报告期租用证券公司交易单元无变化。

2、专用交易单元的选择标准和程序

根据中国证监会《关于加强证券投资基金监管有关问题的通知》（证监基字<1998>29 号）和《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48 号）的有关规定，本公司制定了租用证券公司专用交易单元的选择标准和程序。

（1）选择标准：

a、券商基本面评价（财务状况、经营状况）；

b、券商研究机构评价（报告质量、及时性和数量）；

c、券商每日信息评价（及时性和有效性）；

d、券商协作表现评价。

（2）选择程序：

首先根据租用证券公司专用交易单元的选择标准形成《券商服务评价表》，然后根据评分高低进行选择基金专用交易单元。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
长江证券	1,042,060.10	100.00%	-	-	-	-

11.9 其他重大事件（转型后）

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	长信沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同及摘要（仅摘要见报）	证券时报、公司网站	2019 年 5 月 16 日
2	长信沪深 300 指数增强型证券投资基金	公司网站	2019 年 5 月 16 日

	托管协议		
3	长信沪深300指数增强型证券投资基金招募说明书	证券时报、公司网站	2019年5月16日
4	长信基金管理有限责任公司关于增聘长信沪深300指数增强型证券投资基金基金经理的公告	证券时报、公司网站	2019年5月16日
5	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C类基金份额净值计算与披露方法的说明	证券时报、公司网站	2019年5月16日
6	长信基金管理有限责任公司关于增加江苏汇林保大基金销售有限公司为旗下部分开放式基金代销机构并开通转换、定期定额投资业务及参加申购（含定投申购）费率优惠活动的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、公司网站	2019年5月17日
7	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金在上海联泰基金销售有限公司调整定期定额投资业务起点金额的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、公司网站	2019年5月22日
8	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分基金参与科创板投资及相关风险揭示的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、公司网站	2019年6月22日
9	长信基金管理有限责任公司关于旗下基金所持证券调整估值价的公告	上证报、公司网站	2019年6月26日
10	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金参加中国银行股份有限公司定期定额投资申购费率优惠活动的公告	上证报、公司网站	2019年6月27日
11	长信基金管理有限责任公司关于旗下基金2019年6月30日资产净值的公告	公司网站	2019年7月1日
12	长信沪深300指数增强型证券投资基金（原长信量化价值精选混合型证券投资基金）2019年第2季度报告	证券时报、公司网站	2019年7月18日
13	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暂停大额申购（含转换转入、定期定额投资）业务的公告	证券时报、公司网站	2019年7月30日
14	长信基金管理有限责任公司关于增加上海基煜基金销售有限公司为旗下部分开放式证券投资基金代销机构并开通转换、定期定额投资业务及参加申购（含定投申购）费率优惠活动的公告	上证报、中证报、证券时报、公司网站	2019年7月30日
15	长信沪深300指数增强型证券投资基金（原长信量化价值精选混合型证券投资基金）2019年半年度报告及摘要（仅摘要	证券时报、公司网站	2019年8月27日

	见报）		
16	长信沪深 300 指数增强型证券投资基金 2019 年第 3 季度报告	中国证监会电子披露网站、公司网站	2019 年 10 月 23 日
17	长信基金管理有限责任公司旗下全部基金 2019 年第三季度报告提示性公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、公司网站	2019 年 10 月 23 日
18	长信基金管理有限责任公司关于增加蚂蚁（杭州）基金销售有限公司为旗下长信沪深 300 指数增强型证券投资基金代销机构并开通定期定额投资业务及参加申购（含定投申购）费率优惠活动的公告	证券时报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2019 年 12 月 11 日
19	长信基金管理有限责任公司关于增加北京汇成基金销售有限公司为旗下部分开放式基金代销机构并开通转换、定期定额投资业务及参加申购（含定投申购）费率优惠活动的公告	中证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2019 年 12 月 19 日
20	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恢复大额申购（含转换转入、定期定额投资）业务的公告	证券时报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2019 年 12 月 23 日
21	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参加“长金通”网上直销平台及直销柜台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	2019 年 12 月 26 日
22	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金参加交通银行股份有限公司手机银行基金申购（含定期定额投资申购）费率优惠活动的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2019 年 12 月 30 日
23	长信基金管理有限责任公司根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》修订旗下 66 只公开募集证券投资基金相关法律文件的公告	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	2019 年 12 月 31 日
24	长信基金管理有限责任公司根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》修订旗下 66 只公开募集证券投资基金基金合同和托管协议并更新招募说明书及摘要的提示性公告	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	2019 年 12 月 31 日
25	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摘要（仅摘要见报）	证券时报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2019 年 12 月 31 日
26	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	2019 年 12 月 31 日
27	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	2019 年 12 月 31 日

11.9 其他重大事件（转型前）

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 2018 年 12 月 31 日资产净值的公告	公司网站	2019 年 1 月 1 日
2	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式证券投资基金参加平安银行股份有限公司申购(含定期定额投资申购)费及转换业务的申购补差费率优惠活动的公告	上证报、中证报、证券时报、公司网站	2019 年 1 月 10 日
3	长信量化价值精选混合型证券投资基金 2018 年第 4 季度报告	证券时报、公司网站	2019 年 1 月 19 日
4	长信基金管理有限责任公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	上证报、公司网站	2019 年 3 月 1 日
5	长信基金管理有限责任公司公告	证券时报、公司网站	2019 年 3 月 2 日
6	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金参加交通银行股份有限公司手机银行基金申购（含定期定额投资申购）费率优惠活动的公告	上证报、公司网站	2019 年 3 月 28 日
7	长信量化价值精选混合型证券投资基金 2018 年年度报告及摘要（仅摘要见报）	证券时报、公司网站	2019 年 3 月 29 日
8	长信基金管理有限责任公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	上证报、公司网站	2019 年 4 月 8 日
9	长信基金管理有限责任公司关于以通讯方式召开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的公告	证券时报、公司网站	2019 年 4 月 12 日
10	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金在上海联泰基金销售有限公司开通转换、定期定额投资业务及参加申购（含定投申购）费率优惠活动的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、公司网站	2019 年 4 月 15 日
11	长信基金管理有限责任公司关于以通讯方式召开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的第一次提示性公告	证券时报、公司网站	2019 年 4 月 15 日
12	长信基金管理有限责任公司关于以通讯方式召开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的第二次提示性公告	证券时报、公司网站	2019 年 4 月 16 日
13	长信量化价值精选混合型证券投资基金 2019 年第 1 季度报告	证券时报、公司网站	2019 年 4 月 22 日
14	长信基金管理有限责任公司关于增加华	上证报、中证报、证券	2019 年 4 月 26 日

	鑫证券有限责任公司为旗下部分开放式证券投资基金代销机构并开通转换、定期定额投资业务及参加申购（含定投申购）费率优惠活动的公告	时报、证券日报、公司网站	
15	长信基金管理有限责任公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	上证报、公司网站	2019年5月7日
16	长信基金管理有限责任公司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	证券时报、公司网站	2019年5月16日

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2019年12月30日至2019年12月31日	0.00	23,463,162.83	0.00	23,463,162.83	22.33%
	2	2019年12月30日至2019年12月31日	0.00	41,991,068.45	0.00	41,991,068.45	39.96%
	3	2019年1月1日至2019年1月1日	20,000,000.00	0.00	20,000,000.00	0.00	0.00%
	4	2019年1月1日至2019年3月6日	14,999,675.00	0.00	14,999,675.00	0.00	0.00%
	5	2019年7月30日至2019年12月29日	0.00	50,828,504.63	38,210,000.00	12,618,504.63	12.01%
	6	2019年7月30日至2019年12月29日	0.00	50,828,504.63	38,210,000.00	12,618,504.63	12.01%
个人	1	2019年4月12日至2019年4月28日	0.00	596,180.07	596,180.07	0.00	0.00%
	2	2019年4月12日至2019年4月28日	0.00	596,180.07	596,180.07	0.00	0.00%

产品特有风险
1、基金净值大幅波动的风险 单一持有基金比例过高的投资者连续大量赎回，可能会影响基金投资的持续性和稳定性，增加变现成本。同时，按照净值计算尾差处理规则可能引起基金份额净值异常上涨或下跌。 2、赎回申请延期办理的风险 单一持有基金比例过高的投资者大额赎回后可能触发本基金巨额赎回条件，导致同期中小投资者小额赎回面临部分延期办理的情况。 3、基金投资策略难以实现的风险 单一持有基金比例过高的投资者大额赎回后，可能引起基金资产总净值显著降低，从而使基金在投资时受到限制，导致基金投资策略难以实现。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

注：本基金本报告期未发生影响投资者决策的其他重要信息。

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

1、中国证监会批准设立基金的文件；

2、《长信量化价值精选混合型证券投资基金基金合同》；

3、《长信量化价值精选混合型证券投资基金招募说明书》；

4、《长信量化价值精选混合型证券投资基金托管协议》；

5、《长信沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》；

6、《长信沪深 300 指数增强型证券投资基金招募说明书》；

7、《长信沪深 300 指数增强型证券投资基金托管协议》；

8、报告期内在指定报刊上披露的各种公告的原稿；

9、长信基金管理有限责任公司营业执照、公司章程及相关资格批复文件。

13.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

13.3 查阅方式

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

长信基金管理有限责任公司

2020 年 4 月 27 日