

# 长信中证 500 指数增强型证券投资基金 2020 年中期报告

2020 年 6 月 30 日

基金管理人：长信基金管理有限责任公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2020 年 8 月 29 日

## §1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金基金合同的规定，于 2020 年 8 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

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

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>6</b>
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	14
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>15</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	15
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	15
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>16</b>
6.1 资产负债表.....	16
6.2 利润表.....	17
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18

6.4 报表附注.....	19
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>39</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	39
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	39
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	47
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	47
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	47
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	47
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	48
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	48
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	48
7.12 投资组合报告附注.....	48
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>50</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	50
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	50
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	50
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>51</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>52</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	52
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	52
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	52
10.4 基金投资策略的改变.....	52
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	52
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	52
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	52
10.8 其他重大事件.....	54
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>56</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况.....	56

11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	56
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>57</b>
12.1 备查文件目录.....	57
12.2 存放地点.....	57
12.3 查阅方式.....	57

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	长信中证 500 指数增强型证券投资基金
基金简称	长信中证 500 指数
基金主代码	004945
交易代码	004945
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017 年 8 月 30 日
基金管理人	长信基金管理有限责任公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	110,509,138.61 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为增强型股票指数基金，通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段，追求基金净值增长率与业绩比较基准之间跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年跟踪误差不得超过 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%；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% 的现金或到期日在一年以内的政府债券。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	中证 500 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，具有较高预期风险、较高预期收益的特征，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。

## 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	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	周永刚	李申
	联系电话	021-61009999	021-60637102
	电子邮箱	zhouyg@cxfund.com.cn	<a href="mailto:lishen.zh@ccb.com">lishen.zh@ccb.com</a>
客户服务电话		4007005566	021-60637111
传真		021-61009800	021-60635778
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区银城中路 68 号 9 楼	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		上海市浦东新区银城中路 68 号 9 楼	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		200120	100033
法定代表人		成善栋	田国立

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.cxfund.com.cn">www.cxfund.com.cn</a>
基金中期报告备置地点	上海市浦东新区银城中路 68 号 9 楼、北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

### §3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2020年1月1日 - 2020年6月30日)
本期已实现收益	10,056,191.80
本期利润	17,938,515.44
加权平均基金份额本期利润	0.3106
本期加权平均净值利润率	27.69%
本期基金份额净值增长率	27.88%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020年6月30日)
期末可供分配利润	14,500,662.94
期末可供分配基金份额利润	0.1312
期末基金资产净值	140,926,087.66
期末基金份额净值	1.2752
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020年6月30日)
基金份额累计净值增长率	27.52%

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。

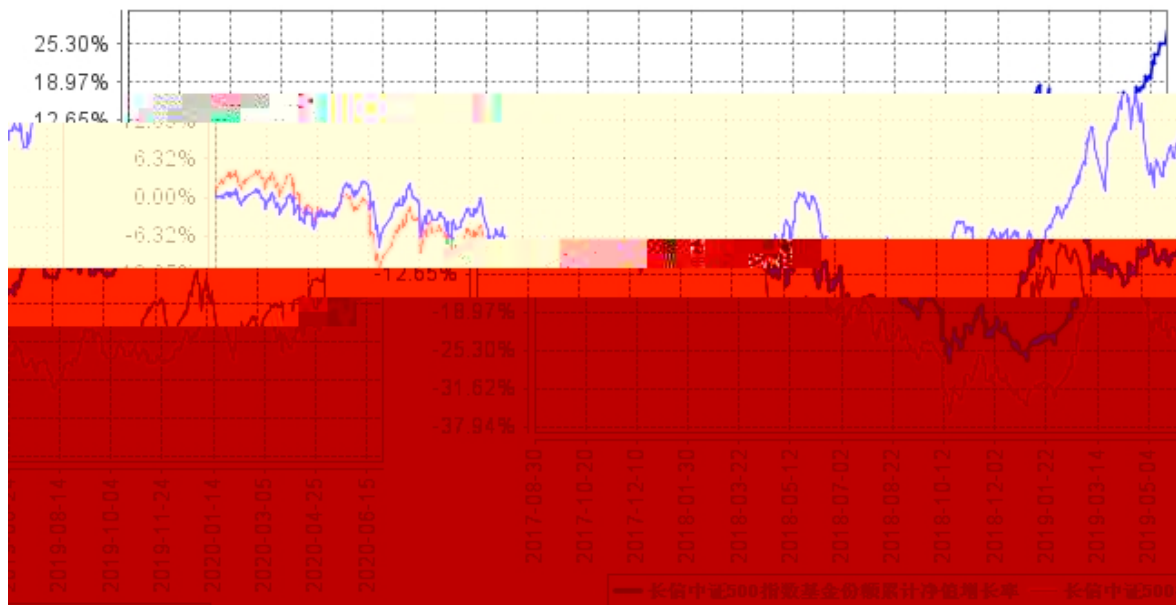
#### 3.2 基金净值表现

##### 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
过去一个月	10.68%	0.87%	8.04%	0.84%	2.64%	0.03%
过去三个月	22.84%	1.04%	15.47%	1.08%	7.37%	-0.04%
过去六个月	27.88%	1.63%	10.84%	1.70%	17.04%	-0.07%
过去一年	40.78%	1.33%	17.63%	1.39%	23.15%	-0.06%
自基金合同生效起至今	27.52%	1.36%	-7.69%	1.41%	35.21%	-0.05%

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

长信中证500指数基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



1、图示日期为 2017 年 8 月 30 日至 2020 年 6 月 30 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。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。

## §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 2020 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 68 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、长信颐天平平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）、长信易进混合型证券投资基金、长信中证可转债及可交换债券 50 指数证券投资基金、长信先锐混合型证券投资基金、长信中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理） 期限		证券从业 年限	说明
		任职日期	离任日期		
宋海岸	长信中证 500 指数增强型证券投资基金、长信国防军工量化灵活配置混合型证券投资基金、长信沪深 300 指数增强型证券投资基金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	2018 年 2 月 13 日	-	6 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

					资基金(LOF)的基金经理。
--	--	--	--	--	----------------

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

2、证券从业的含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

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

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2020 年上半年，新冠疫情席卷全球，各国的经济发展前景上影。为了应对危机，主要经济体均选异常的货币政策进行对冲，全球风险资产在受挫性后强反弹并数回高位。除了疫情之外，今年见的行情中国带来了较大的损害，影响了国内复工复产的进度，但随着政策的加码和持续推进，制造业已经正增长，但社会复尚需时日。

整个上半年，A 股的表现非常优秀，尤其是创业板指大涨 35.6%。上半年，医药、消费者服务、食品饮料、新能源、有色等周期行业表现出明显领先其他行业，计算机、通信、建筑、金融、地产、钢铁等强周期行业则表现相对落后。新冠疫情公共卫生危机的高效控制和处理将提升中国市场的相对吸引力，有助于加速中国的经济结构转型和产业升级，从北上资金持续流入可以看出，A 股的国际化进程比较顺利，A 股市场优质资产的吸引力在提高。

本基金根据股票的基本情况和市场环境构建 Alpha 模型，有效地识别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，本基金份额净值为 1.2752 元，份额累计净值为 1.2752 元，本报告期基金份额净值增长率为 27.88%，同期业绩比较基准收益率为 10.84%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，机遇与风险共存。机遇在于，在中国加速经济转型与升级的前提下，如科技、消费等领域或带来较好的投资机会，加之中国强大的消费市场，A 股有望走出一轮持续向上的行情。风险在于，全球化的背景下，中美贸易存在持续发展的可能，特别是年内美国总统大选或增加局势的不确定性，同时需要关注的货币政策可能引发的通缩。随着 A 股的机构化和国际化，投资者正在成长，将对资本市场产生正面影响。如果后续宏观经济在国内复工复产的带动下企稳反弹带动上市公司盈利改善，市场行情将在宽松的宏观经济政策支持下。

将保持稳定的仓位，定期评估基本和技术选股因子的表现，继续持有已有的量化选股模型，结合严格的风险控制，追求持续稳健的超额收益。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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”）制定了健全、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，负责制定公司的估值政策、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其适用性的情况及时启动估值程序；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 共同组成。相关参与人员 具有丰富的证券行业工作经验， 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 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 分 通，达成一 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 国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签 服务 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 扣率。参与估值流程各方不存在任 重大利益 。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规和本基金基金合同规定的基金收益分配原则以及基金实际运作情况，本基金本报告期 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 件的前提下可进行收益分配，具体分红方 见基金管理人根据基金运作情况 时不定期发 的相关分红公告，《基金合同》生效不 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 现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资； 投资者不选 ，本基金 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 值；即基金收益分配基准日的基金份额净值 去 每单位基金份额收益分配金额后不能低于 值；

4、每一基金份额 有同等分配权；

5、法律法规或监管机关 有规定的，从其规定。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

。

## §5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

### 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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

## §6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：长信中证 500 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.6.1	21,739,951.79	4,708,729.54
结算备 金		285,757.63	67,396.02
存出保证金		40,501.88	5,335.99
交易性金融资产	6.4.6.2	112,740,895.45	57,624,165.17
其中：股票投资		112,708,980.25	57,624,165.17
基金投资		-	-
债券投资		31,915.20	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
生金融资产	6.4.6.3	-	-
入 金融资产	6.4.6.4	-	-
应收证券 算款		-	47,007.32
应收利息	6.4.6.5	4,323.19	1,582.48
应收股利		-	-
应收申购款		21,994,810.70	65,386.53
所得税资产		-	-
其他资产	6.4.6.6	-	-
资产总计		156,806,240.64	62,519,603.05
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2020 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2019 年 12 月 31 日</b>
<b>负 债：</b>			
期 款		-	-
交易性金融负债		-	-
生金融负债	6.4.6.3	-	-
出回购金融资产款		-	-
应 证券 算款		14,649,137.54	-
应 赎回款		911,081.12	435,943.69
应 管理人报		54,981.79	22,217.01
应 托管费		10,309.07	4,165.69
应 服务费		-	-
应 交易费用	6.4.6.7	137,805.60	60,374.42
应交税费		0.33	-

应 利息		-	-
应 利润		-	-
所得税负债		-	-
其他负债	6.4.6.8	116,837.53	180,913.61
负债合计		15,880,152.98	703,614.42
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.6.9	110,509,138.61	61,989,529.63
未分配利润	6.4.6.10	30,416,949.05	-173,541.00
所有者权益合计		140,926,087.66	61,815,988.63
负债和所有者权益总计		156,806,240.64	62,519,603.05

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.2752 元，基金份额总额 110,509,138.61 份。

## 6.2 利润表

会计主体：长信中证 500 指数增强型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		18,798,854.73	4,303,150.01
1.利息收入		30,214.70	6,426.98
其中：存款利息收入	6.4.6.11	27,309.84	6,426.98
债券利息收入		2,904.86	-
资产支持证券利息收入		-	-
入 金融资产收入		-	-
证券出 利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损 以 - 填列）		10,780,984.95	3,427,589.58
其中：股票投资收益	6.4.6.12	10,040,856.44	3,255,782.80
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.6.13	858.53	-
资产支持证券投资收益	6.4.6.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.6.14	-	-
生工具收益	6.4.6.15	-	-
股利收益	6.4.6.16	739,269.98	171,806.78
3.公允价值变动收益（损 以 - 号填列）	6.4.6.17	7,882,323.64	851,742.51
4. 收益（损 以 - 号填列）		-	-
5.其他收入（损 以 - 号填列）	6.4.6.18	105,331.44	17,390.94

<b>：二、费用</b>		860,339.29	322,555.68
1 管理人报	6.4.9.2.1	256,085.27	75,690.07
2 托管费	6.4.9.2.2	48,015.98	14,191.89
3 服务费		-	-
4 交易费用	6.4.6.19	438,784.89	117,097.89
5 利息支出		-	-
其中：出回购金融资产支出		-	-
6 税金及附加		0.04	-
7 其他费用	6.4.6.20	117,453.11	115,575.83
<b>三、利润总额（损总额以 - 号填列）</b>		17,938,515.44	3,980,594.33
：所得税费用		-	-
<b>、净利润（净 损以 - 号填列）</b>		17,938,515.44	3,980,594.33

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长信中证 500 指数增强型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期 所有者权益（基金净值）	61,989,529.63	-173,541.00	61,815,988.63
二、本期经 活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	17,938,515.44	17,938,515.44
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值 少以 - 号填列）	48,519,608.98	12,651,974.61	61,171,583.59
其中：1.基金申购款	130,066,895.53	20,537,362.87	150,604,258.40
2.基金赎回款	-81,547,286.55	-7,885,388.26	-89,432,674.81
、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变	-	-	-



基金合同》(以下简称“基金合同”)及其他有关法律法规的规定,经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)以证监可[2017]1119号文批准公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限为不定期,首次设立募集基金份额为 210,352,867.81 份,经毕华会计师事务所(普通合伙)验证,并出具了编号为毕华验字第 1700030 号的验资报告。基金合同于 2017 年 8 月 30 日正式生效。本基金的基金管理人为长信基金管理有限责任公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、截至报告期末最新公告的基金合同及《长信中证 500 指数增强型证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金的投资范围为具有流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(含中小板、创业板及其他中国证监会核准发行的股票)、衍生工具(权证、股指期货等)、债券(国债、金融债、企业债、公司债、可转债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、地方政府债、短期融资券、超短期融资券等)、债券回购、银行存款、资产支持证券、同业存单等,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,投资于标的指数成分股及其备选成分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。本基金的业绩比较基准为:中证 500 指数收益率 95%+银行活期存款利率(税后) 5%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的企业会计准则及相关规定(以下简称“企业会计准则”)以及中国证监会颁布的关于基金行业实务操作的有关规定编制,同时在具体会计核算和信息披露方面参考了中国证券投资基金业协会颁布的基金行业实务操作。

#### 6.4.3 遵 企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会颁布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求,真实、完整地反映了本基金 2020 年 6 月 30 日的财务状况以及 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

## 6.4.4 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 6.4.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最上一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最上一期年度报告相一致。

### 6.4.4.2 差错更正的说明

本基金本报告期内无需说明的重大会计差错更正。

## 6.4.5 税项

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》、财税 2008 1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税优惠政策的通知》、2008 年 9 月 18 日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税 2012 85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统上市公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税 2015 101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税 2016 36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税 2016 140 号《关于明确金融房地产开发辅助服务等增值税政策的通知》、财税 2017 56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税 2017 90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

1) 证券投资基金(封闭式证券投资基金, 开放式证券投资基金)管理人运用基金股票、债券 征增值税; 公开募集证券投资基金运营过程中发生的资管产品运营业务, 以基金管理人为增值税纳税人, 适用简易计税方法, 按照 3% 的征收率缴纳增值税。

2) 对证券投资基金从证券市场中取得的收入, 包括股票、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, 不缴纳企业所得税。

3) 对基金取得的股票股息、红利收入, 由上市公司在收到相关扣收税款当月的法定申报期内向主管税务机关申报缴纳; 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, 按 50% 计入应纳税所得额; 持股期限超过 1 年的, 股息红利所得 征收个人所得税。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

4) 对于基金从事 A 股, 出 方按 0.10% 的税率缴纳证券(股票)交易 税, 对受 方不再缴纳 税。

## 6.4.6 重要财务报表项目的说明

### 6.4.6.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
活期存款	21,739,951.79
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：	21,739,951.79

### 6.4.6.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	102,318,353.62	112,708,980.25	10,390,626.63
贵金属投资-金交所 金合约	-	-	-
债券	交易所市场	31,915.20	7,915.20
	银行间市场	-	-
	合计	31,915.20	7,915.20
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	102,342,353.62	112,740,895.45	10,398,541.83

### 6.4.6.3 生金融资产/负债

注：本基金本报告期末未持有 生金融资产 负债。

### 6.4.6.4 入 金融资产

#### 6.4.6.4.1 各项 入 金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有 入 金融资产。

#### 6.4.6.4.2 期末 式 回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末 式 回购交易中取得的债券。

**6.4.6.5 应收利息**

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	1,970.49
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备 金利息	128.40
应收债券利息	6.31
应收资产支持证券利息	-
应 收 入 证 券 利 息	-
应收申购款利息	2,199.79
应 收 金 合 约 息	-
应收出 证 券 利 息	-
其他	18.20
合计	4,323.19

注：其他为应收保证金利息。

**6.4.6.6 其他资产**

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

**6.4.6.7 应 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
交易所市场应 交易费用	137,805.60
银行间市场应 交易费用	-
合计	137,805.60

**6.4.6.8 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
应 券 交 易 单 元 保 证 金	-
应 赎 回 费	1,918.99
应 证 券 出 约 金	-
预 提 户 费	-
预 提 审 计 费	14,918.54
预 提 信 息 披 露 费	-
应 指 数 可 用 费	100,000.00

合计	116,837.53
----	------------

#### 6.4.6.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	
	基金份额（份）	金额
上年度末	61,989,529.63	61,989,529.63
本期申购	130,066,895.53	130,066,895.53
本期赎回(以“-”号填列)	-81,547,286.55	-81,547,286.55
- 基金分/份额算前	-	-
基金分/份额算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	110,509,138.61	110,509,138.61

注：本期申购含红利再投、转换入份(金额)，本期赎回含转换出份(金额)。

#### 6.4.6.10 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	-3,762,498.51	3,588,957.51	-173,541.00
本期利润	10,056,191.80	7,882,323.64	17,938,515.44
本期基金份额交易产生的变动数	8,206,969.65	4,445,004.96	12,651,974.61
其中：基金申购款	10,474,397.15	10,062,965.72	20,537,362.87
基金赎回款	-2,267,427.50	-5,617,960.76	-7,885,388.26
本期已分配利润	-	-	-
本期末	14,500,662.94	15,916,286.11	30,416,949.05

#### 6.4.6.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
	活期存款利息收入
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备金利息收入	2,156.76
其他	3,999.10
合计	27,309.84

注：其他为申购款利息收入。

**6.4.6.12 股票投资收益****6.4.6.12.1 股票投资收益 股票差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
出股票成交总额	159,963,865.59
：出股票成本总额	149,923,009.15
股票差价收入	10,040,856.44

**6.4.6.13 债券投资收益****6.4.6.13.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
债券投资收益 债券（、债转股及债券到期）差价收入	858.53
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	858.53

**6.4.6.13.2 债券投资收益 债券差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
出债券（、债转股及债券到期）成交总额	2,070,228.60
：出债券（、债转股及债券到期）成本总额	2,009,560.00
：应收利息总额	59,810.07
债券差价收入	858.53

**6.4.6.13.3 债券投资收益 赎回差价收入**

注：本基金本报告期 债券赎回差价收入。

**6.4.6.13.4 债券投资收益 申购差价收入**

注：本基金本报告期 债券申购差价收入。

**6.4.6.13.5 资产支持证券投资收益**

注：本基金本报告期 资产支持证券投资收益。

**6.4.6.14 贵金属投资收益****6.4.6.14.1 贵金属投资收益项目构成**

注：本基金本报告期 贵金属投资收益。

**6.4.6.15 生工具收益****6.4.6.15.1 生工具收益 权证差价收入**

注：本基金本报告期 生工具 权证差价收入。

**6.4.6.15.2 生工具收益 其他投资收益**

注：本基金本报告期 生工具收益。

**6.4.6.16 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	739,269.98
其中：证券出 权益 收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	739,269.98

**6.4.6.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	7,882,323.64
股票投资	7,874,408.44
债券投资	7,915.20
资产支持证券投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 生工具	-
权证投资	-
股指期货投资	-
3. 其他	-
应税金融 品公允价值变动产生的预估增 值税	-
合计	7,882,323.64

**6.4.6.18 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	105,246.77
转换费收入	84.67
合计	105,331.44

注：本基金赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回时收取。其中，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% 应计入基金财产。

**6.4.6.19 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	438,784.89
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	-
期货交易费用	-
合计	438,784.89

**6.4.6.20 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
审计费用	14,918.54
信息披露费	-
证券出 约金	-
指数 用费 基点费	100,000.00
其他费用	2,534.57
银行间 户 费	-
合计	117,453.11

注：（1）按照国 有关规定和基金合同约定，本基金的指数 可 用费从基金财产中列支，按前 一日的基金资产净值 0.016%的年费率计提， 日累计至每 末，按 支 。其计算公式为：

日指数可用费前一日基金资产净值 0.016% 当年天数。自基金合同生效之日所在度的下一个度起，指数可用费的收取下限为每度 5 元。

(2) 其他费用为银行手续费。

## 6.4.7 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 6.4.7.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金需要说明的重大或有事项。

### 6.4.7.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金未发生需要披露的资产负债表日后事项。

## 6.4.8 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方变化。

### 6.4.8.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
长信基金管理有限责任公司(以下简称 长信基金 )	基金管理人、基金 机构
中国建设银行股份有限公司(以下简称 中国建设银行 )	基金托管人
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

## 6.4.9 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.9.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.9.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

#### 6.4.9.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

#### 6.4.9.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

#### 6.4.9.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 6.4.9.1.5 应支 关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均 应 关联方交易单元的佣金。

### 6.4.9.2 关联方报

#### 6.4.9.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支 的管理费	256,085.27	75,690.07
其中：支 机构的客 户 费	99,157.59	16,840.00

注：支 基金管理人长信基金的基金管理人报 按前一日基金资产净值 0.80%的年费率计提，日累计至每月月末，按月支 。其计算公式为：日基金管理人报 前一日基金资产净值 0.80% 当年天数。

#### 6.4.9.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支 的托管费	48,015.98	14,191.89

注：支 基金托管人中国建设银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.15%的年费率计提，日累计至每月月末，按月支 。其计算公式为：日基金托管费 前一日基金资产净值 0.15% 当年天数。

#### 6.4.9.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金在本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过银行间同业市场进行债券(含回购)交易。

#### 6.4.9.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

#### 6.4.9.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.9.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

基金管理人在本报告期及上年度可比期间均未运用自有资金投资本基金。

##### 6.4.9.5.2 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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2020年6月30日		上年度末 2019年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金 份额 占基金总份 额的比例	持有的 基金份额	持有的基金 份额 占基金总份 额的比例
上海长江财富 资产管理有限 公司	8,160,057.62	7.38%	3,683,875.67	5.94%

注：除基金管理人之外的其他关联方投资本基金费率按本基金招募说明书公布的费率执行。

##### 6.4.9.6 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 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
建设银行	21,739,951.79	21,153.98	1,382,690.73	5,692.92

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 2020 年 6 月 30 日的相关余额在资产负债表中的“结算备金”科目中单独列示（2019 年 12 月 31 日：同）。

#### 6.4.9.7 本基金在承 期内参与关联方承 证券的情况

本基金在本报告期及上年度可比期间均未在承 期内购入由关联方承 的证券。

#### 6.4.9.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间 其他关联交易事项。

#### 6.4.10 利润分配情况

本基金本报告期末未进行利润分配。

#### 6.4.11 期末（2020 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.11.1 因认购新发/增发证券 于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.11.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成 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	备注
601816	京沪 高铁	2020 年 1 月 8 日	2020 年 7 月 16 日	新股 流通 受限	4.88	6.17	691,425	3,374,154.00	4,266,092.25	-
300843	胜蓝 股份	2020 年 6 月 23 日	2020 年 7 月 2 日	新股 流通 受限	10.01	10.01	751	7,517.51	7,517.51	-
300840	特 能	2020 年 6 月 30 日	2020 年 7 月 8 日	新股 流通 受限	5.94	5.94	1,185	7,038.90	7,038.90	-
300846	首 在	2020 年 6 月 22 日	2020 年 7 月 1 日	新股 流通 受限	3.37	3.37	1,131	3,811.47	3,811.47	-

##### 6.4.11.2 期末持有的 时 等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	日期	原因	期末估值单价	复日期	复开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
002470	*金正	2020年6月30日	时	2.27	2020年7月1日	3.66	2,600	6,794.10	5,902.00	-

#### 6.4.11.3 期末债券正回购交易中作为 的债券

##### 6.4.11.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有因银行间市场债券正回购交易 作为 的债券。

##### 6.4.11.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有因交易所市场债券正回购交易 作为 的债券。

#### 6.4.11.4 期末参与转融通证券出 业务的证券

本基金本报告期末 参与转融通证券出 业务的融出证券。

### 6.4.12 金融工具风险及管理

#### 6.4.12.1 风险管理政策和组 构

本基金在日常活动中 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 述上述风险 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 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 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 别和分析 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 的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人 行全 风险管理体系理 ，建立了以风险控制 员会为核心的、由督 长、监 稽核部和相关业务部门构成的风险管理 构体系。在董事会下设立风险控制 员会，负责对公司经 管理和基金业务运作的合法性、合规性进行全 的 查和评估等；在管理 设立内部控制 员会，主要职责是 审议公司内部控制制度及 对公司在经 管理和投资组合运作中的风险进行 别、评估并研究制 有效的防范 ；在业务 作 风险管理职责主要由监 稽核部负责 调并与各部门合作完成运作风险管理工作， 略与产品研发部负责进行投资风险分析与绩效评估。监 稽核部向督 长负责，并向总经理 报日常行政事务。

### 6.4.12.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、绝支到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的银行存款由本基金的托管人中国建设银行，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，本基金投资于具有信用等级的证券，通过分散化投资以分散信用风险。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，因违约风险发生的可能性小；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用券款交割方式以控制相应的信用风险。

#### 6.4.12.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末及上年度末按短期信用评级列示的债券投资。

#### 6.4.12.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 6.4.12.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末按短期信用评级列示的同业存单投资。

#### 6.4.12.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	31,915.20	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	31,915.20	0.00

注：未评级债券为国债、银行票据及政策性金融债等信用评级债券。

#### 6.4.12.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 6.4.12.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末按长期信用评级列示的同业存单投资。

### 6.4.12.3 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 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 赎回资金的流动性风险，以及因部分投资品种交易不活 出现的变现风险和因投资集中 法在市场出现 动的情况下以合理价格变现投资的风险。

#### 6.4.12.3.1 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 评估各类资产的流动性， 对性制定流动性风险管理 ，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金 持组合管理、分 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 出回购金融资产方式融入 期资金应对流动性需求。

对 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 额赎回 款，制定了发生 额赎回时资金的处理模式，控制因开放模式 产生的流动性风险。本基金的基金管理人流动性指标进行持续的监 和分析。

本基金本报告期末及上年度末均 重大流动性风险。

### 6.4.12.4 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 发生 动的风险，包括利率风险、外 风险和其他价格风险。

#### 6.4.12.4.1 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 发生 动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备 金、存出保证金及债券投资等。

##### 6.4.12.4.1.1 利率风险 口

单位：人民币元

本期末 2020年6月30 日	6个月以内	6个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产						
银行存款	21,739,951.79	-	-	-	-	21,739,951.79

结算备 金	285,757.63	-	-	-	-	285,757.63
存出保证金	40,501.88	-	-	-	-	40,501.88
交易性金融资 产	-	31,915.20	-	-	112,708,980.25	112,740,895.45
应收利息	-	-	-	-	4,323.19	4,323.19
应收申购款	19,999,198.81	-	-	-	1,995,611.89	21,994,810.70
资产总计	42,065,410.11	31,915.20	-	-	114,708,915.33	156,806,240.64
负债						
应 证 券 算 款	-	-	-	-	14,649,137.54	14,649,137.54
应 赎 回 款	-	-	-	-	911,081.12	911,081.12
应 管 理 人 报	-	-	-	-	54,981.79	54,981.79
应 托 管 费	-	-	-	-	10,309.07	10,309.07
应 交 易 费 用	-	-	-	-	137,805.60	137,805.60
应交税费	-	-	-	-	0.33	0.33
其他负债	-	-	-	-	116,837.53	116,837.53
负债总计	-	-	-	-	15,880,152.98	15,880,152.98
利率 度 口	42,065,410.11	31,915.20	-	-	98,828,762.35	140,926,087.66
上年度末 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	4,708,729.54	-	-	-	-	4,708,729.54
结算备 金	67,396.02	-	-	-	-	67,396.02
存出保证金	5,335.99	-	-	-	-	5,335.99
交易性金融资 产	-	-	-	-	57,624,165.17	57,624,165.17
应收证 券 算 款	-	-	-	-	47,007.32	47,007.32
应收利息	-	-	-	-	1,582.48	1,582.48
应收申购款	-	-	-	-	65,386.53	65,386.53
资产总计	4,781,461.55	-	-	-	57,738,141.50	62,519,603.05
负债						
应 赎 回 款	-	-	-	-	435,943.69	435,943.69
应 管 理 人 报	-	-	-	-	22,217.01	22,217.01
应 托 管 费	-	-	-	-	4,165.69	4,165.69
应 交 易 费 用	-	-	-	-	60,374.42	60,374.42
其他负债	-	-	-	-	180,913.61	180,913.61
负债总计	-	-	-	-	703,614.42	703,614.42
利率 度	4,781,461.55	-	-	-	57,034,527.08	61,815,988.63

□						
---	--	--	--	--	--	--

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 者进行了分类。

#### 6.4.12.4.1.2 利率风险的 性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
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（2020年6月30日）	上年度末（2019年12月31日）
	市场利率下 27 个基点	514.39	0.00
	市场利率上 27 个基点	-514.39	0.00

#### 6.4.12.4.2 外 风险

外 风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外 率变动 发生 动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因 重大外 风险。

#### 6.4.12.4.3 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 率以外的市场价格因素变动 发生 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 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 化 低其他价格风险，并 定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 （ lue is ） 等指标来 试本基金 的 在价格风险，及时可 地对风险进行跟踪和控制。

于 6 月 30 日，本基金 的其他市场价格风险列示如下：

#### 6.4.12.4.3.1 其他价格风险 □

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日		上年度末 2019年12月31日	
	公允价值	占基金 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	112,708,980.25	79.98	57,624,165.17	93.22
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-

交易性金融资产—债券投资	31,915.20	0.02	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	112,740,895.45	80.00	57,624,165.17	93.22

#### 6.4.12.4.3.2 其他价格风险的 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（2020年6月30日）	上年度末（2019年12月31日）
	值为 3.61%（2019年12月31日 值为 3.79%）	-5,087,075.09	-2,343,210.50

注：上述风险价值的分析是基于资产负债表日所持证券过去一年市场价格变动情况有可能发生的最大损失，变动适用于本基金所有的生金融工具及非生金融工具。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。2019 年的分析同基于该假设。

#### 6.4.13 有助于理和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### ( ) 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应收款项和其他金融负债，其价值与公允价值相差小。

##### (b) 以公允价值计量的金融工具

##### (i) 各金融工具公允价值

于 2020 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量其变动计入当期损益的金融资产中属于第一的余额为人民币 108,450,533.32 元，属于第二的余额为人民币 24,269.88 元，属于第三余额为人民币 4,266,092.25 元。

##### (ii) 公允价值所属间的重大变动

对于本基金投资的证券，出现重大事项、交易不活（包括时的交易不活）、或属于非公开发行等情况，本基金分别于日至交易复活日期间、交易不活期间及限期间根据估值调整中用的不可观入值对于公允价值的影响程度，确定相关证券公允价值应属第二或第三。

(iii)第三 公允价值计量的金融工具

上年度末余额为人民币 0.00 元，本期转入第三 金额为人民币 0.00 元，转出第三 金额为人民币 0.00 元，当期计入损益的利得或损 总额为人民币 891,938.25 元，本期购 金额为人民币 3,374,154.00 元，出 金额为人民币 0.00 元，本期末余额为人民币 4,266,092.25 元，本期末持有的资产计入损益的当期未实现利得或损 的变动金额为人民币 891,938.25 元。

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金 需要说明的其他重要事项。

## §7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	112,708,980.25	71.88
	其中：股票	112,708,980.25	71.88
2	基金投资	-	-
3	定收益投资	31,915.20	0.02
	其中：债券	31,915.20	0.02
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入金融资产	-	-
	其中：买入式回购的买入金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	22,025,709.42	14.05
8	其他各项资产	22,039,635.77	14.06
9	合计	156,806,240.64	100.00

注：本基金本报告期末通过股通交易机制投资股。

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 期末指数投资按行业分类的内股票投资组合

金额单位：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	、 、 、 业	-	-
	业	3,864,806.00	2.74
	制造业	59,093,338.52	41.93
	电力、力、及水生产和供应业	1,248,000.00	0.89
	建筑业	1,352,618.68	0.96
F	批发和业	2,481,886.00	1.76
	交通运输、仓和邮政业	-	-
	和业	-	-
	信息传、件和信息技术服务业	10,471,545.92	7.43
	金融业	4,472,365.00	3.17
	地产业	1,845,296.20	1.31
L	租和务服务业	2,961,850.00	2.10
	学研究和务服务业	-	-

	水利、环 和公共设 管理业	1,274,376.00	0.90
0	民服务、 理和其他服务业	-	-
		-	-
	生和社会工作	1,449,900.00	1.03
	文化、体 和 乐业	1,457,250.00	1.03
	综合	-	-
	合计	91,973,232.32	65.26

## 7.2.2 期末 投资按行业分类的 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	、 、 、 业	-	-
	业	-	-
	制 业	9,472,693.81	6.72
	电力、 力、 及水生产 和供应业	11,234.16	0.01
	建 业	-	-
F	批发和 业	1,127,106.40	0.80
	交通运 、仓 和邮政业	4,266,092.25	3.03
	和 业	-	-
	信息传 、 件和信息技术 服务业	4,308,853.11	3.06
	金融业	612,440.00	0.43
	地产业	-	-
L	租 和 务服务业	-	-
	学研究和 务服务业	887,297.20	0.63
	水利、环 和公共设 管理 业	-	-
0	民服务、 理和其他服务 业	-	-
		-	-
	生和社会工作	50,031.00	0.04
	文化、体 和 乐业	-	-
	综合	-	-
	合计	20,735,747.93	14.71

## 7.2.3 报告期末按行业分类的 股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末通过 股通交易机制投资 股。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	002920	西	29,800	1,827,634.00	1.30
2	600380	健元	104,000	1,688,960.00	1.20
3	002709	天料	48,220	1,629,353.80	1.16
4	600298	安	31,300	1,548,724.00	1.10
5	600195	中股份	94,500	1,533,735.00	1.09
6	300558	达业	10,900	1,525,782.00	1.08
7	603707	健股份	23,600	1,523,852.00	1.08
8	002511	中	68,285	1,522,755.50	1.08
9	300474		22,600	1,520,980.00	1.08
10	000563	国投A	408,800	1,516,648.00	1.08
11	300482	生	14,500	1,508,000.00	1.07
12	002414	高红外	51,370	1,504,113.60	1.07
13	002127	电	71,000	1,503,070.00	1.07
14	002273	水电	87,600	1,501,464.00	1.07
15	002223	医疗	41,100	1,496,040.00	1.06
16	603444	比特	2,700	1,482,327.00	1.05
17	600862	中高	87,490	1,480,330.80	1.05
18	002439	明	35,156	1,479,012.92	1.05
19	603866	李包	28,900	1,470,721.00	1.04
20	601958	金股份	236,500	1,461,570.00	1.04
21	600845	信件	24,700	1,459,276.00	1.04
22	002818	富美	118,600	1,458,780.00	1.04
23	300133	华策影	201,000	1,457,250.00	1.03
24	600060	海信	119,700	1,454,355.00	1.03
25	603228	电子	41,260	1,451,939.40	1.03
26	603882	金医学	16,200	1,449,900.00	1.03
27	300285	国料	43,200	1,447,632.00	1.03
28	600022	东钢铁	1,118,000	1,442,220.00	1.02
29	000513	集团	30,020	1,441,260.20	1.02
30	603486		47,600	1,437,996.00	1.02
31	000932	华钢铁	381,200	1,437,124.00	1.02
32	002557	品	26,500	1,436,035.00	1.02
33	601003	钢股份	323,500	1,433,105.00	1.02
34	600486	化工	17,300	1,427,250.00	1.01
35	600633	数文化	145,600	1,423,968.00	1.01
36	002233	集团	118,200	1,421,946.00	1.01
37	002465	海格通信	109,500	1,416,930.00	1.01

38	000975	银泰 金	90,200	1,414,336.00	1.00
39	603939	益丰	15,540	1,414,140.00	1.00
40	002028	源电	68,400	1,399,464.00	0.99
41	601717	机	233,076	1,372,817.64	0.97
42	603338	江 力	18,000	1,363,860.00	0.97
43	000090	天健集团	195,748	1,352,618.68	0.96
44	300166	东方国信	106,600	1,322,906.00	0.94
45	002174	网	50,200	1,309,216.00	0.93
46	601799	股份	10,200	1,295,400.00	0.92
47	600291	西水股份	142,300	1,287,815.00	0.91
48	603568	明环保	54,930	1,274,376.00	0.90
49	600216	江医	65,400	1,259,604.00	0.89
50	601139	深	192,000	1,248,000.00	0.89
51	601615	明 能	96,000	1,195,200.00	0.85
52	000581	高	57,700	1,193,236.00	0.85
53	002372	新	99,170	1,153,347.10	0.82
54	300115	长盈精	49,400	1,128,790.00	0.80
55	002387	信诺	76,800	1,096,704.00	0.78
56	300496	中 创达	13,600	1,056,720.00	0.75
57	603233	大参	12,900	1,047,738.00	0.74
58	600266	城建发展	197,160	999,601.20	0.71
59	002128	露天 业	127,600	988,900.00	0.70
60	002507		27,400	986,674.00	0.70
61	300459	金 文化	267,300	922,185.00	0.65
62	002244	江集团	196,500	839,055.00	0.60
63	300316	机电	33,400	826,316.00	0.59
64	002839	行	134,400	774,144.00	0.55
65	600143	金发 技	55,400	729,618.00	0.52
66	002382	蓝 医疗	22,600	680,486.00	0.48
67	002583	海能达	88,500	671,715.00	0.48
68	603659	泰来	5,100	525,402.00	0.37
69	603605		2,900	522,058.00	0.37
70	603198		20,400	444,108.00	0.32
71	600908	银行	75,000	368,250.00	0.26
72	603025	大 技	43,124	313,511.48	0.22
73	300630	普利制	4,200	310,590.00	0.22
74	600053	投资	9,300	277,512.00	0.20
75	600901	江 租	47,600	247,996.00	0.18
76	603883	老 姓	200	20,008.00	0.01

77	600885	宏发股份	400	16,048.00	0.01
78	603712	一二	400	15,352.00	0.01
79	603816		300	13,503.00	0.01
80	002281	技	300	9,858.00	0.01
81	002368	太 股份	200	8,738.00	0.01
82	601689	普集团	300	8,370.00	0.01
83	002831	裕同 技	300	8,253.00	0.01
84	002373	方 技	300	7,197.00	0.01
85	002019	亿 医	300	6,891.00	0.00
86	000402	金融街	1,000	6,640.00	0.00
87	600779	水	100	6,242.00	0.00
88	002470	* 金正	2,600	5,902.00	0.00
89	300207	欣 达	200	3,780.00	0.00

### 7.3.2 期末 投资按公允价值占基金资产净值比例大小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	601816	京沪高铁	691,425	4,266,092.25	3.03
2	002555	三 互	22,600	1,057,680.00	0.75
3	300206	理	54,000	984,960.00	0.70
4	002912	中新	5,946	972,706.14	0.69
5	002697	红 连	87,970	960,632.40	0.68
6	300394	天 通信	16,000	952,800.00	0.68
7	300502	新易	14,580	920,289.60	0.65
8	300607	达	22,520	916,338.80	0.65
9	002214	大立 技	31,900	898,942.00	0.64
10	603127	新	8,440	887,297.20	0.63
11	603609	丰 业	57,700	859,730.00	0.61
12	603345	安 品	7,200	849,600.00	0.60
13	603238	诺 股份	19,400	818,680.00	0.58
14	300624	技	9,200	740,600.00	0.53
15	300119	瑞普生	33,000	737,550.00	0.52
16	300451	创业	37,250	688,752.50	0.49
17	000416	民生控股	122,000	612,440.00	0.43
18	300687	意信息	26,400	604,560.00	0.43
19	002531	天 风能	85,800	513,084.00	0.36
20	300019	技	37,900	445,325.00	0.32
21	300770	新 股份	995	222,541.70	0.16

22	601100	恒立	2,500	200,500.00	0.14
23	600605	通能源	15,400	166,474.00	0.12
24	603686	环	6,800	165,716.00	0.12
25	600763	通策医疗	300	50,031.00	0.04
26	603160	技	100	22,290.00	0.02
27	600276	恒瑞医	240	22,152.00	0.02
28	603087	李业	215	21,564.50	0.02
29	300529	健生	310	21,545.00	0.02
30	600570	恒生电子	169	18,201.30	0.01
31	300014	亿能	380	18,183.00	0.01
32	002371	北方华创	100	17,091.00	0.01
33	300842	股份	319	12,989.68	0.01
34	300839	股份	502	11,751.82	0.01
35	600956	新天能	2,229	11,234.16	0.01
36	002362	汉技	600	10,698.00	0.01
37	300433	蓝技	300	8,412.00	0.01
38	300843	胜蓝股份	751	7,517.51	0.01
39	002049	国	100	7,275.00	0.01
40	300840	特能	1,185	7,038.90	0.00
41	300596	利安	200	6,966.00	0.00
42	002829	网达	200	6,958.00	0.00
43	002100	天生	400	6,440.00	0.00
44	300846	首在	1,131	3,811.47	0.00
45	000980	* 众泰	200	306.00	0.00

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计 入金额超出期 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 入金额	占期 基金资产净 值比例 ( )
1	601816	京沪高铁	4,820,220.00	7.80
2	600195	中 股份	2,714,199.60	4.39
3	002557	品	2,537,014.00	4.10
4	002387	信诺	2,308,440.00	3.73
5	000090	天健集团	2,083,520.72	3.37
6	601003	钢股份	2,055,455.00	3.33
7	000932	华 钢铁	1,993,913.00	3.23

8	601139	深	1,964,423.80	3.18
9	600862	中 高	1,878,893.20	3.04
10	601958	金 股份	1,833,139.00	2.97
11	002174	网	1,817,245.00	2.94
12	600298	安	1,737,899.43	2.81
13	002273	水 电	1,731,647.00	2.80
14	002583	海能达	1,663,632.00	2.69
15	002233	集团	1,620,117.00	2.62
16	603939	益丰	1,585,027.60	2.56
17	300133	华策影	1,567,178.00	2.54
18	300558	达 业	1,561,471.00	2.53
19	300115	长盈精	1,551,531.00	2.51
20	603228	电子	1,547,958.60	2.50
21	600633	数文化	1,547,296.00	2.50
22	600022	东钢铁	1,525,500.00	2.47
23	603866	李 包	1,496,536.55	2.42
24	002223	医疗	1,456,307.00	2.36
25	300166	东方国信	1,454,700.00	2.35
26	603707	健 股份	1,447,239.00	2.34
27	002475	立 精	1,437,780.80	2.33
28	002818	富 美	1,437,412.30	2.33
29	002709	天 料	1,435,453.00	2.32
30	600291	西水股份	1,425,236.00	2.31
31	002465	海格通信	1,419,287.00	2.30
32	002511	中	1,418,725.25	2.30
33	300474		1,412,762.00	2.29
34	000975	银泰 金	1,411,444.00	2.28
35	300482	生	1,403,949.50	2.27
36	603000	人民网	1,377,474.00	2.23
37	603127	新	1,372,128.00	2.22
38	603486		1,364,907.00	2.21
39	002382	蓝 医疗	1,361,224.00	2.20
40	002028	源电	1,333,244.00	2.16
41	603338	江 力	1,325,471.00	2.14
42	600060	海信	1,303,263.00	2.11
43	600845	信 件	1,285,986.00	2.08

44	000581	高	1,274,428.00	2.06
45	603882	金 医学	1,240,698.00	2.01

注：本项 入金额 均按 成交金额（成交单价 以成交数量）填列，不考 其 交易费用。

#### 7.4.2 累计 出金额超出期 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 出金额	占期 基金资产净 值比例（ ）
1	601816	京沪高铁	1,922,926.50	3.11
2	000090	天健集团	1,909,502.10	3.09
3	002583	海能达	1,881,542.00	3.04
4	603806	特	1,717,472.30	2.78
5	002049	国	1,600,444.00	2.59
6	300253	健	1,548,364.00	2.50
7	000937	中能源	1,536,283.10	2.49
8	002463	沪电股份	1,528,605.00	2.47
9	600195	中 股份	1,468,714.00	2.38
10	603000	人民网	1,456,865.00	2.36
11	600143	金发 技	1,412,715.00	2.29
12	002013	中 机电	1,399,260.00	2.26
13	300014	亿 能	1,376,205.00	2.23
14	002475	立 精	1,369,310.00	2.22
15	002387	信诺	1,358,133.00	2.20
16	600298	安	1,338,169.00	2.16
17	300251	传	1,337,016.00	2.16
18	002821		1,329,774.00	2.15
19	600779	水	1,318,361.00	2.13
20	002191	股份	1,306,895.00	2.11
21	000547	天发展	1,306,397.00	2.11
22	600967	内 一机	1,301,318.00	2.11
23	002048	华	1,283,728.00	2.08
24	601966		1,275,518.00	2.06
25	600557	业	1,272,724.68	2.06
26	300529	健 生	1,262,855.00	2.04
27	002544	技	1,258,392.00	2.04

注：本项 出金额 均按 成交金额（成交单价 以成交数量）填列，不考 其 交易费用。

**7.4.3 入股票的成本总额及 出股票的收入总额**

单位：人民币元

入股票成本（成交）总额	197,133,415.79
出股票收入（成交）总额	159,963,865.59

注：本项 入股票的成本（成交）总额 和 出股票的收入（成交）总额 均按 成交金额（成交单价 以成交数量）填列，不考 相关交易费用。

**7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合**

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国 债券	-	-
2	行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业 期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	31,915.20	0.02
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	31,915.20	0.02

**7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细**

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	113583	益丰转债	240	31,915.20	0.02

**7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细**

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

**7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细**

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

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

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

### 7.12.2 基金投资的前 名股票超出基金合同规定的备选股票 情况的说明

报告期内本基金投资的前 名股票中, 不存在超出基金合同规定备选股票 的情形。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位: 人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	40,501.88
2	应收证券 算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	4,323.19
5	应收申购款	21,994,810.70
6	其他应收款	-

7	费用	-
8	其他	-
9	合计	22,039,635.77

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

##### 7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

##### 7.12.5.2 期末投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	601816	京沪高铁	4,266,092.25	3.03	新股定

#### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于五入的原因，分项之和与合计项可能存在差。

## §8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
5,930	18,635.61	65,901,746.80	59.63%	44,607,391.81	40.37%

### 8.2 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	155,560.68	0.14%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（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

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2017 年 8 月 30 日）基金份额总额	210,352,867.81
本报告期期 基金份额总额	61,989,529.63
本报告期基金总申购份额	130,066,895.53
:本报告期基金总赎回份额	81,547,286.55
本报告期基金 分变动份额（份额 少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	110,509,138.61

## §10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

#### 10.2.1 基金管理人的重大人事变动

本报告期基金管理人未发生重大人事变动。

#### 10.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略未改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金未改聘会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期基金管理人、托管人及其高级管理人员无受监管部门稽查或处罚的情形。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支出情况

金额单位：人民币元

券名称	交易单元数量	股票交易		应支该券的佣金		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	
招证券	1	199,218,635.86	56.69%	105,846.82	42.75%	-
大证券	1	96,979,220.32	27.60%	90,314.74	36.48%	-
中信证券	1	55,195,067.51	15.71%	51,405.15	20.76%	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
业证券	1	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-

方正证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
中国国际金 融有限证券	1	-	-	-	-	-

注：1、本期租用证券公司交易单元的变更情况

本报告期内本基金租用证券公司交易单元 有变更。

## 2、专用交易单元的选 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 题的通 》（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 题的通 》（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 标准和程序。

### （1）选 标准：

- 1) 券 基本 评价（财务 况、经 况）；
- 2) 券 研究机构评价（报告 量、及时性和数量）；
- 3) 券 每日信息评价（及时性和有效性）；
- 4) 券 作表现评价。

### （2）选 程序：

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

## 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券 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
招 证券	4,019,978.53	100.00%	-	-	-	-
大证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-
业证券	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
中国国际金	-	-	-	-	-	-

融有限证券					
-------	--	--	--	--	--

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	长信中证 500 指数增强型证券投资基金 2019 年第 4 度报告	中国证监会电子披露网、公司网	2020 年 1 月 17 日
2	长信基金管理有限责任公司 下全部基金 2019 年第 度报告提示性公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、中国证监会电子披露网、公司网	2020 年 1 月 17 日
3	长信基金管理有限责任公司关于 2020 年春节假期 长期间调整公司 下基金申购赎回、 算交收等事 的提示性公告	中国证监会电子披露网、公司网	2020 年 1 月 31 日
4	长信基金管理有限责任公司关于增加中信期货有限公司为 下部分开放式基金代 机构并开通定期定额投资、转换业务及参加申购（含定投申购）费率优 活动的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、中国证监会电子披露网、公司网	2020 年 3 月 4 日
5	长信基金管理有限责任公司关于 下基金持有的长期 股票调整估值方法的公告	上证报、中国证监会电子披露网、公司网	2020 年 3 月 13 日
6	长信基金管理有限责任公司关于 下基金持有的长期 股票调整估值方法的公告	上证报、中国证监会电子披露网、公司网	2020 年 3 月 17 日
7	长信基金管理有限责任公司关于 披露 下公募基金 2019 年年度报告的公告	上证报、中国证监会电子披露网、公司网	2020 年 3 月 25 日
8	长信中证 500 指数增强型证券投资基金 2020 年第 1 度报告	中国证监会电子披露网、公司网	2020 年 4 月 22 日
9	长信基金管理有限责任公司 下全部基金 2020 年第一 度报告提示性公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、中国证监会电子披露网、公司网	2020 年 4 月 22 日
10	长信中证 500 指数增强型证券投资基金 2019 年年度报告	中国证监会电子披露网、公司网	2020 年 4 月 27 日
11	长信基金管理有限责任公司 下全部基金 2019 年年度报告提示性公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、中国证监会电子披露网、公司网	2020 年 4 月 27 日
12	长信基金管理有限责任公司关于增加中信证券华 股份有限公司为 下部分开放式基金代 机构并开通定期定额投资、转换业务及参加申购（含定投申购）费率优 活动的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、中国证监会电子披露网、公司网	2020 年 5 月 7 日
13	长信基金管理有限责任公司关于 下部分开放式基金参加申 宏源证券有限公司基金申购（含定期定额投资申购）费率优 活动的公告	上证报、中国证监会电子披露网、公司网	2020 年 6 月 3 日

14	长信基金管理有限责任公司关于增加民基金（上海）有限公司为下部分开放式基金代机构并开通转换业务及参加申购费率优活动的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、中国证监会电子披露网、公司网	2020 年 6 月 3 日
15	长信基金管理有限责任公司关于增加华普益基金有限公司为下部分开放式基金代机构并开通转换、定期定额投资业务及参加申购（含定投申购）费率优活动的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、中国证监会电子披露网、公司网	2020 年 6 月 10 日
16	长信基金管理有限责任公司关于增加华融证券股份有限公司为下部分开放式基金代机构并开通转换、定期定额投资业务及参加申购（含定期定额投资申购）费率优活动的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、中国证监会电子披露网、公司网	2020 年 6 月 15 日
17	长信基金管理有限责任公司关于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）费率优活动的公告	上证报、中国证监会电子披露网、公司网	2020 年 6 月 29 日

## §11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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	2020 年 1 月 23 日至 2020 年 2 月 2 日	3,683,875.67	4,476,181.95	0.00	8,160,057.62	7.38%
个人	1	2020 年 1 月 15 日至 2020 年 1 月 15 日	8,176,428.50	2,670,409.99	10,846,838.49	0.00	0.00%
产品特有风险							
<p>1、基金净值大 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 差处理规则可能 起基金份额净值异常上 或下 。</p> <p>2、赎回申 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 发本基金 额赎回 件，导 同期中小投资者小额赎回 部分 期办理的情况。</p> <p>3、基金投资策略 以实现的的风险 单一持有基金比例过高的投资者大额赎回后，可能 起基金资产总净值 低，从 基金在投资时受到限制，导 基金投资策略 以实现。</p>							

### 11.2 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。

## §12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立基金的文件；
- 2、《长信中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》；
- 3、《长信中证 500 指数增强型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《长信中证 500 指数增强型证券投资基金托管 议》；
- 5、报告期内在指定报 上披露的各种公告的原 ；
- 6、长信基金管理有限责任公司 业执照、公司 程及相关资格批复文件。

### 12.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

### 12.3 查阅方式

长信基金管理有限责任公司网 ； h [www.cxfund.com.cn](http://www.cxfund.com.cn)。

长信基金管理有限责任公司

2020 年 8 月 29 日