

长信沪深 300 指数增强型证券投资基金 2025 年年度报告

2025 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：2026 年 3 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同的规定，于 2026 年 3 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自 2025 年 1 月 1 日起至 2025 年 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	10
§ 4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
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	16
§ 5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	16
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	16
§ 6 审计报告	17
6.1 审计报告基本信息	17
6.2 审计报告的基本内容	17
§ 7 年度财务报表	19
7.1 资产负债表	19
7.2 利润表	20
7.3 净资产变动表	21
7.4 报表附注	23
§ 8 投资组合报告	55

8.1 期末基金资产组合情况	55
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	56
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	57
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	60
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	69
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	69
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	69
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	69
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	69
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	69
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	69
8.12 投资组合报告附注	70
§ 9 基金份额持有人信息	71
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	71
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	72
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	72
§ 10 开放式基金份额变动	72
§ 11 重大事件揭示	72
11.1 基金份额持有人大会决议	72
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	73
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	73
11.4 基金投资策略的改变	73
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	73
11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	73
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	73
11.8 其他重大事件	74
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	77
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	77
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	77
§ 13 备查文件目录	77
13.1 备查文件目录	77
13.2 存放地点	77
13.3 查阅方式	77

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	长信沪深 300 指数增强型证券投资基金	
基金简称	长信沪深 300 指数	
基金主代码	005137	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019 年 5 月 16 日	
基金管理人	长信基金管理有限责任公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,015,249,452.31 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	246,865,229.26 份	768,384,223.05 份

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	长信基金管理有限责任公司	招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	周永刚
	联系电话	021-61009999
	电子邮箱	zhouyg@cxfund.com.cn
客户服务电话	4007005566	400-61-95555
传真	021-61009800	0755-83195201

注册地址	中国（上海）自由贸易试验区银城中路 68 号 37 层	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址	上海市浦东新区银城中路 68 号 9 楼、37 楼、38 楼	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码	200120	518040
法定代表人	刘元瑞	缪建民

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.cxfund.com.cn
基金年度报告备置地点	上海市浦东新区银城中路 68 号 38 楼、深圳市深南大道 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）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层
注册登记机构	长信基金管理有限责任公司	上海市浦东新区银城中路 68 号 9 楼、37 楼、38 楼

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2025 年		2024 年		2023 年	
	长信沪深 300 指数 A	长信沪深 300 指数 C	长信沪深 300 指数 A	长信沪深 300 指数 C	长信沪深 300 指数 A	长信沪深 300 指数 C
本期已实现收益	67,073,351.30	105,540,885.88	29,613,485.43	64,015,907.36	-13,096,832.07	-14,936,246.06
本期利润	75,680,220.86	117,086,506.81	51,248,507.67	75,591,760.94	-15,954,124.27	-17,319,915.37
加权平均基金份额本期利润	0.3181	0.2706	0.2720	0.3403	-0.1163	-0.1185
本期加权平均净值	24.75%	21.03%	25.76%	32.14%	-10.77%	-11.16%

利润率						
本期基金份额净值增长率	21.61%	21.14%	17.69%	17.23%	-6.56%	-6.93%
3.1.2 期末数据和指标	2025 年末		2024 年末		2023 年末	
期末可供分配利润	38,083,974.95	50,202,380.71	13,499,242.89	3,402,588.97	-13,211,635.46	-17,984,642.37
期末可供分配基金份额利润	0.1543	0.0653	0.1025	0.0250	-0.0684	-0.1378
期末基金资产净值	301,187,432.95	907,223,225.39	154,052,599.86	155,686,989.95	191,855,782.16	127,085,514.32
期末基金份额净值	1.2200	1.1807	1.1696	1.1417	0.9938	0.9739
3.1.3 累计期末指标	2025 年末		2024 年末		2023 年末	
基金份额累计净值增长率	82.33%	77.28%	49.92%	46.34%	27.39%	24.84%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

长信沪深 300 指数 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.44%	0.84%	-0.20%	0.90%	0.64%	-0.06%
过去六个月	15.78%	0.78%	16.72%	0.86%	-0.94%	-0.08%
过去一年	21.61%	0.90%	16.79%	0.91%	4.82%	-0.01%
过去三年	33.73%	0.99%	18.82%	1.02%	14.91%	-0.03%
过去五年	7.38%	1.08%	-10.22%	1.08%	17.60%	0.00%
自基金合同生效起至今	82.33%	1.11%	23.67%	1.11%	58.66%	0.00%

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	0.35%	0.84%	-0.20%	0.90%	0.55%	-0.06%
过去六个月	15.55%	0.78%	16.72%	0.86%	-1.17%	-0.08%
过去一年	21.14%	0.90%	16.79%	0.91%	4.35%	-0.01%
过去三年	32.17%	0.99%	18.82%	1.02%	13.35%	-0.03%
过去五年	5.26%	1.08%	-10.22%	1.08%	15.48%	0.00%
自基金合同生效起至今	77.28%	1.11%	23.67%	1.11%	53.61%	0.00%

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

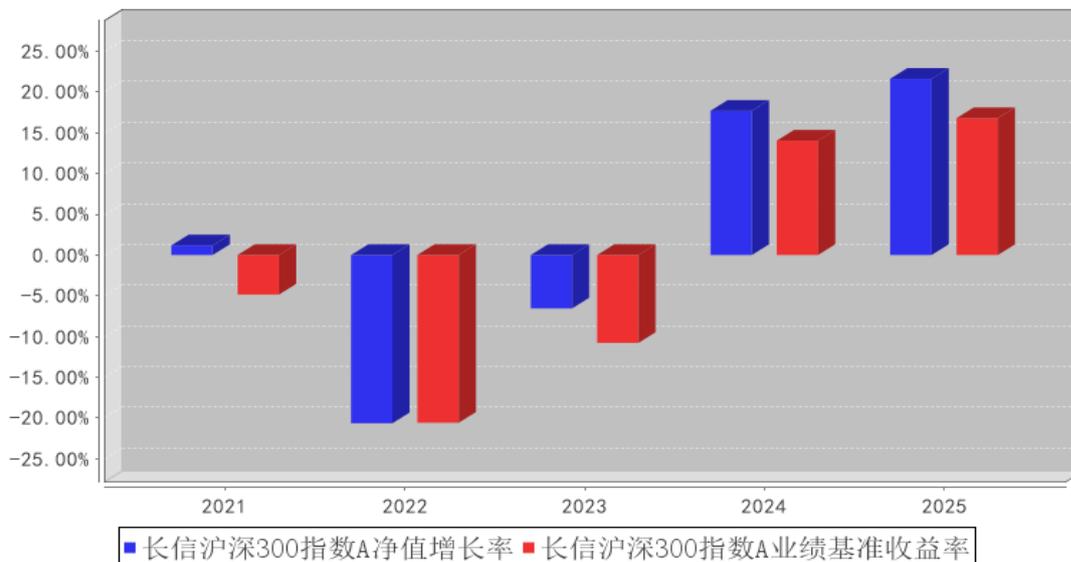


注：1、图示日期为 2019 年 5 月 16 日至 2025 年 12 月 31 日。

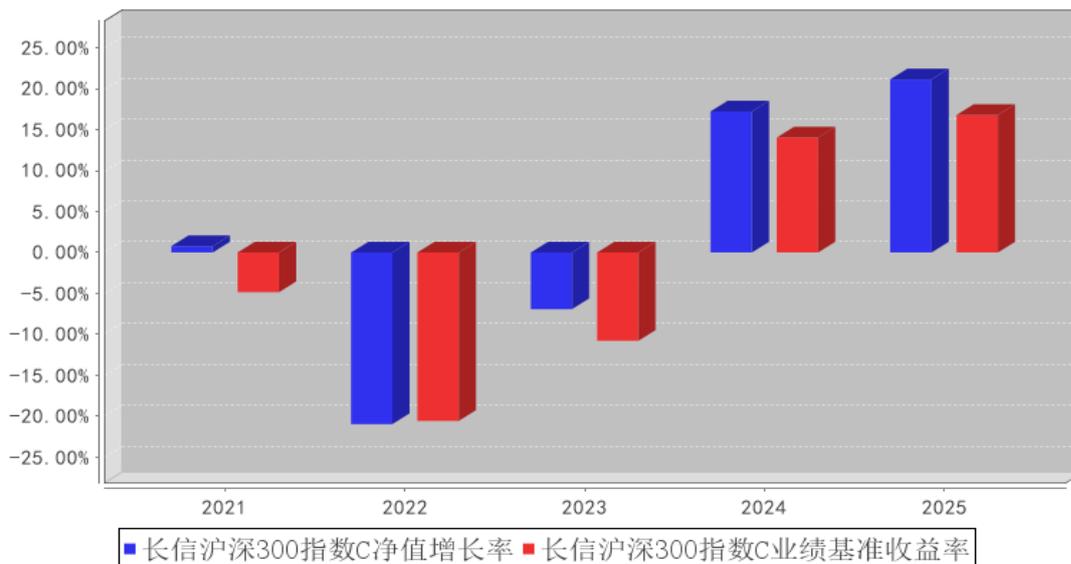
2、按基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起 6 个月内为建仓期；建仓期结束时，本基金各项投资比例已符合基金合同中的约定。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

长信沪深300指数A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



长信沪深300指数C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

长信沪深 300 指数 A

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2025 年	2.000	39,933,697.55	8,383,243.99	48,316,941.54	-
2024 年	-	-	-	-	-
2023 年	-	-	-	-	-
合计	2.000	39,933,697.55	8,383,243.99	48,316,941.54	-

长信沪深 300 指数 C

年度	每 10 份基金	现金形式发放总	再投资形式发放	年度利润分配合	备注
----	----------	---------	---------	---------	----

	份额分红数	额	总额	计	
2025 年	2.000	140,059,394.73	18,896,924.16	158,956,318.89	-
2024 年	-	-	-	-	-
2023 年	-	-	-	-	-
合计	2.000	140,059,394.73	18,896,924.16	158,956,318.89	-

注：本基金本报告期内进行的利润分配情况，详见4.8

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

长信基金管理有限责任公司是经中国证监会证监基金字【2003】63号文批准，由长江证券股份有限公司、上海海欣集团股份有限公司、武汉钢铁股份有限公司共同发起设立。注册资本 1.65 亿元人民币。目前股权结构为：长江证券股份有限公司占 44.55%、上海海欣集团股份有限公司占 31.21%、武汉钢铁有限公司占 15.15%、上海彤胜投资管理中心（有限合伙）占 4.55%、上海彤骏投资管理中心（有限合伙）占 4.54%。

截至 2025 年 12 月 31 日，本基金管理人共管理 89 只开放式基金，即长信利息收益开放式证券投资基金、长信银利精选混合型证券投资基金、长信金利趋势混合型证券投资基金、长信增利动态策略混合型证券投资基金、长信利丰债券型证券投资基金、长信量化先锋混合型证券投资基金、长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金、长信利鑫债券型证券投资基金(LOF)、长信内需成长混合型证券投资基金、长信可转债债券型证券投资基金、长信利众债券型证券投资基金(LOF)、长信纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信纯债壹号债券型证券投资基金、长信改革红利灵活配置混合型证券投资基金、长信量化中小盘股票型证券投资基金、长信利富债券型证券投资基金、长信多利灵活配置混合型证券投资基金、长信睿进灵活配置混合型证券投资基金、长信量化多策略股票型证券投资基金、长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金(LOF)、长信利保债券型证券投资基金、长信金葵纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信富全纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信利泰灵活配置混合型证券投资基金、长信利发债券型证券投资基金、长信电子信息行业量化灵活配置混合型证券投资基金、长信创新驱动股票型证券投资基金、长信稳益纯债债券型证券投资基金、长信利信灵活配置混合型证券投资基金、长信稳健纯债债券型证券投资基金、长信国防军工量化灵活配置混合型证券投资基金、长信先优债券型证券投资基金、长信稳势纯债债券型证券投资基金、长信中证 500 指数增强型证券投资基金、长信长金通货币市场基金、长信稳通三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长信低碳环保行业量化股票型证券投资基金、长信乐信灵活配置混合型证券投资基金、长信全球债券证券投资基金、

长信稳鑫三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长信消费精选行业量化股票型证券投资基金、长信企业精选两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、长信量化价值驱动混合型证券投资基金、长信稳裕三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长信稳进资产配置混合型基金中基金（FOF）、长信利率债债券型证券投资基金、长信沪深 300 指数增强型证券投资基金、长信双利优选混合型证券投资基金、长信富瑞两年定期开放债券型证券投资基金、长信颐天平养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）、长信易进混合型证券投资基金、长信先锐混合型证券投资基金、长信稳健精选混合型证券投资基金、长信浦瑞 87 个月定期开放债券型证券投资基金、长信消费升级混合型证券投资基金、长信企业优选一年持有期灵活配置混合型证券投资基金、长信稳健均衡 6 个月持有期混合型证券投资基金、长信优质企业混合型证券投资基金、长信内需均衡混合型证券投资基金、长信 30 天滚动持有短债债券型证券投资基金、长信稳惠债券型证券投资基金、长信稳丰债券型证券投资基金、长信先进装备三个月持有期混合型证券投资基金、长信颐和平养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）、长信颐年平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）、长信稳健增长一年持有期混合型证券投资基金、长信稳健成长混合型证券投资基金、长信企业成长三年持有期混合型证券投资基金、长信稳兴三个月定期开放债券型证券投资基金、长信稳航 30 天持有期中短债债券型证券投资基金、长信稳恒债券型证券投资基金、长信中证科创创业 50 指数增强型证券投资基金、长信均衡策略一年持有期混合型证券投资基金、长信中证 1000 指数增强型证券投资基金、长信均衡优选混合型证券投资基金、长信 90 天滚动持有债券型证券投资基金、长信稳固 60 天滚动持有债券型证券投资基金、长信汇智量化选股混合型证券投资基金、长信 120 天滚动持有债券型证券投资基金、长信中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、长信优势行业混合型证券投资基金、长信 180 天持有期债券型证券投资基金、长信富安纯债 180 天持有期债券型证券投资基金、长信中证 A500 指数增强型证券投资基金、长信稳瑞纯债债券型证券投资基金、长信沪深 300 指数量化增强型证券投资基金、长信盈安资产配置三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、长信稳健添益债券型证券投资基金、长信上证科创板综合指数增强型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
宋海岸	长信中证 500 指数增强型证券投资基金、长信国防军工	2019 年 5 月 16 日	-	11 年	理学硕士，上海交通大学应用数学研究生毕业，具有基金从业资格，中国国籍。曾担任海通期货股份有限公司研究员、前海开源基金管理

	<p>量化灵活配置混合型证券投资基金、长信沪深 300 指数增强型证券投资基金、长信先进装备三个月持有期混合型证券投资基金和长信电子信息行业量化灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、量化研究部总监</p>			<p>有限公司投资经理助理和西部证券股份有限公司研究员。2016 年 9 月加入长信基金管理有限责任公司，历任量化投资部研究员、基金经理助理、量化投资部副总监、长信中证一带一路主题指数分级证券投资基金、长信中证能源互联网主题指数型证券投资基金（LOF）、长信价值优选混合型证券投资基金、长信先优债券型证券投资基金和长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金（LOF）的基金经理，现任量化研究部总监、长信中证 500 指数增强型证券投资基金、长信国防军工量化灵活配置混合型证券投资基金、长信沪深 300 指数增强型证券投资基金、长信先进装备三个月持有期混合型证券投资基金和长信电子信息行业量化灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。</p>
--	--	--	--	--

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 公平交易制度和控制方法

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

2、公司使用的交易执行软件系统必须具备如下功能：

(1) 严格按照时间顺序发送委托指令；

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

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

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

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

4.3.3 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2025 年，中国经济复苏前行，GDP 同比增长 5.0%，顺利完成增长目标，通胀方面，CPI 同比维持低位，PPI 同比下降 2.6%；政策层面，财政与货币政策协同发力，通过“两重”、“两新”等

举措对冲内需不足压力，为经济韧性提供关键支撑。市场风格层面，全年高贝塔、高成长风格占优，分析师和成长因子表现较好。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2025 年 12 月 31 日，长信沪深 300 指数 A 基金份额净值为 1.2200 元，份额累计净值为 1.7006 元，本报告期内长信沪深 300 指数 A 净值增长率为 21.61%；长信沪深 300 指数 C 基金份额净值为 1.1807 元，份额累计净值为 1.6579 元，本报告期内长信沪深 300 指数 C 净值增长率为 21.14%，同期业绩比较基准收益率为 16.79%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

投资策略上，本基金根据股票的基本面情况和市场面情况构建 Alpha 模型，综合 Alpha 模型、风险模型、交易成本模型，定期优化组合权重，追求超越业绩比较基准的投资回报。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

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

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

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

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

根据相关法律法规，本基金管理人制订了健全、有效的估值政策和估值程序，设立了估值委

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

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金管理人根据相关法律法规和本基金基金合同约定已于 2025 年 12 月 22 日进行了利润分配，A 类份额每 10 份基金份额派发红利 2.000 元，C 类份额每 10 份基金份额派发红利 2.000 元。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

托管人声明：

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

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

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

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

本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

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（2026）审字第 70031471_B03 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	<p>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 2025 年 12 月 31 日的资产负债表，2025 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>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 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及 2025 年度的经营成果和净资产变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>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《中国注册会计师独立性准则第 1 号——财务报表审计和审阅业务对独立性的要求》和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。我们在审计中遵循了对公众利益实体审计的独立性要求。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。</p>
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>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。</p> <p>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</p>

	<p>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。</p> <p>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。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>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。</p> <p>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：</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>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。</p>
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	费泽旭 骆文慧
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	2026 年 3 月 26 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：长信沪深 300 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	7.4.7.1	86,532,846.64	29,855,297.08
结算备付金		6,923.21	4,276.86
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	1,136,860,613.14	290,158,822.24
其中：股票投资		1,136,860,613.14	290,158,822.24
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		364,395.90	3,180,171.05
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	-
资产总计		1,223,764,778.89	323,198,567.23
负债和净资产	附注号	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		13,476,623.31	12,734,617.71

应付管理人报酬		1,166,459.89	359,284.03
应付托管费		174,968.99	53,892.61
应付销售服务费		355,338.61	86,422.47
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	180,729.75	224,760.60
负债合计		15,354,120.55	13,458,977.42
净资产：			
实收基金	7.4.7.10	1,015,249,452.31	268,078,840.43
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	193,161,206.03	41,660,749.38
净资产合计		1,208,410,658.34	309,739,589.81
负债和净资产总计		1,223,764,778.89	323,198,567.23

注：1、报告截止日 2025 年 12 月 31 日，长信沪深 300 指数 A 份额净值 1.2200 元，长信沪深 300 指数 C 份额净值 1.1807 元，基金份额总额为 1,015,249,452.31 份，其中长信沪深 300 指数 A 份额 246,865,229.26 份。长信沪深 300 指数 C 份额 768,384,223.05 份。

2、货币资金中包含存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

7.2 利润表

会计主体：长信沪深 300 指数增强型证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
一、营业总收入		205,010,584.81	133,230,615.75
1. 利息收入		251,946.89	190,797.53
其中：存款利息收入	7.4.7.13	251,946.89	190,797.53
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		184,076,666.86	99,574,964.81
其中：股票投资收益	7.4.7.14	167,043,184.22	88,739,622.66
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	-	-7,584.48

资产支持证券投资 收益	7.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-178,828.02	-
股利收益	7.4.7.19	17,212,310.66	10,842,926.63
以摊余成本计量的 金融资产终止确认产生的 收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	7.4.7.20	20,152,490.49	33,210,875.82
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-” 号填列）	7.4.7.21	529,480.57	253,977.59
减：二、营业总支出		12,243,857.14	6,390,347.14
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	8,527,761.93	4,399,742.14
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	1,279,164.22	659,961.23
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	2,203,541.26	955,153.51
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产 支出		-	-
6. 信用减值损失	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	7.4.7.23	233,389.73	375,490.26
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		192,766,727.67	126,840,268.61
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-” 号填列）		192,766,727.67	126,840,268.61
五、其他综合收益的税后 净额		-	-
六、综合收益总额		192,766,727.67	126,840,268.61

7.3 净资产变动表

会计主体：长信沪深 300 指数增强型证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期			
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计

一、上期期末净资产	268,078,840.43	-	41,660,749.38	309,739,589.81
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	268,078,840.43	-	41,660,749.38	309,739,589.81
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	747,170,611.88	-	151,500,456.65	898,671,068.53
(一)、综合收益总额	-	-	192,766,727.67	192,766,727.67
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	747,170,611.88	-	166,006,989.41	913,177,601.29
其中：1. 基金申购款	1,701,204,099.27	-	452,024,315.99	2,153,228,415.26
2. 基金赎回款	-954,033,487.39	-	-286,017,326.58	-1,240,050,813.97
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-207,273,260.43	-207,273,260.43
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	1,015,249,452.31	-	193,161,206.03	1,208,410,658.34
项目	上年度可比期间			
	2024年1月1日至2024年12月31日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	323,549,925.44	-	-4,608,628.96	318,941,296.48
加：会计政策变更	-	-	-	-

前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	323,549,925.44	-	-4,608,628.96	318,941,296.48
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-55,471,085.01	-	46,269,378.34	-9,201,706.67
(一)、综合收益总额	-	-	126,840,268.61	126,840,268.61
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-55,471,085.01	-	-80,570,890.27	-136,041,975.28
其中：1. 基金申购款	661,508,903.61	-	20,684,894.11	682,193,797.72
2. 基金赎回款	-716,979,988.62	-	-101,255,784.38	-818,235,773.00
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	268,078,840.43	-	41,660,749.38	309,739,589.81

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：

肖剑

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”），系经中国证券监督管理委员会

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

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

在投资者认购、申购基金时收取认购、申购费用，而不计提销售服务费的基金份额，称为 A 类基金份额；在投资者认购、申购基金份额时不收取认购、申购费用，而是从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 C 类基金份额。本基金的标的指数为沪深 300 指数。

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

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

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

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

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、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 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〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

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 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及 2025 年度的经营成果和净资产变动情况。

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。

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根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

(2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

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和金融负债，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；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额；

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；

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。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

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。

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债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）占基金净资产比例计算的金额。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）占基金净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

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) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或内含票面利率或合同

利率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(3) 股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

(4) 处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(5) 买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

(6) 公允价值变动收益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；

(7) 其他收入在本基金履行了基金合同中的履约义务，即在客户取得服务控制权时确认收入。

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费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 本基金在符合基金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

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

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‰；根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收；

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

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

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对证券投资基金在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。增值税应税行为的销售额根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定确定；

根据财政部、国家税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》，自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。

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

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[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[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 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
活期存款	28,866,044.06	21,694,947.64
等于：本金	28,858,654.20	21,691,018.54
加：应计利息	7,389.86	3,929.10
减：坏账准备	-	-
定期存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	57,666,802.58	8,160,349.44
等于：本金	57,661,923.33	8,158,165.37
加：应计利息	4,879.25	2,184.07
减：坏账准备	-	-
合计	86,532,846.64	29,855,297.08

注：其他存款为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	1,100,123,379.09	-	1,136,860,613.14	36,737,234.05
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	1,100,123,379.09	-	1,136,860,613.14	36,737,234.05
项目	上年度末 2024 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	273,574,078.68	-	290,158,822.24	16,584,743.56
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	273,574,078.68	-	290,158,822.24	16,584,743.56

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末及上年度末均未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末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

本基金本报告期末及上年度末均未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 债权投资

7.4.7.5.1 债权投资情况

本基金本报告期末及上年度末均无债权投资。

7.4.7.6 其他债权投资

7.4.7.6.1 其他债权投资情况

本基金本报告期末及上年度末均无其他债权投资。

7.4.7.7 其他权益工具投资

7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

本基金本报告期末及上年度末均无其他权益工具投资。

7.4.7.8 其他资产

本基金本报告期末及上年度末均未持有其他资产。

7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	729.75	4,760.60
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	-	-
其中：交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提审计费	60,000.00	50,000.00
预提信息披露费	120,000.00	120,000.00
预提指数使用费	-	50,000.00
合计	180,729.75	224,760.60

7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

长信沪深 300 指数 A

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	131,712,359.47	131,712,359.47
本期申购	444,901,719.61	444,901,719.61
本期赎回（以“-”号填列）	-329,748,849.82	-329,748,849.82
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-

本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	246,865,229.26	246,865,229.26

长信沪深 300 指数 C

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	136,366,480.96	136,366,480.96
本期申购	1,256,302,379.66	1,256,302,379.66
本期赎回（以“-”号填列）	-624,284,637.57	-624,284,637.57
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	768,384,223.05	768,384,223.05

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.11 其他综合收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无其他综合收益。

7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

长信沪深 300 指数 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	13,499,242.89	8,840,997.50	22,340,240.39
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	13,499,242.89	8,840,997.50	22,340,240.39
本期利润	67,073,351.30	8,606,869.56	75,680,220.86
本期基金份额交易产生的变动数	5,828,322.30	-1,209,638.32	4,618,683.98
其中：基金申购款	88,844,193.12	16,729,594.14	105,573,787.26
基金赎回款	-83,015,870.82	-17,939,232.46	-100,955,103.28
本期已分配利润	-48,316,941.54	-	-48,316,941.54
本期末	38,083,974.95	16,238,228.74	54,322,203.69

长信沪深 300 指数 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	3,402,588.97	15,917,920.02	19,320,508.99
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	3,402,588.97	15,917,920.02	19,320,508.99
本期利润	105,540,885.88	11,545,620.93	117,086,506.81

本期基金份额交易产生的变动数	100,215,224.75	61,173,080.68	161,388,305.43
其中：基金申购款	217,066,757.97	129,383,770.76	346,450,528.73
基金赎回款	-116,851,533.22	-68,210,690.08	-185,062,223.30
本期已分配利润	-158,956,318.89	-	-158,956,318.89
本期末	50,202,380.71	88,636,621.63	138,839,002.34

7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日
活期存款利息收入	95,449.11	53,197.88
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	125,305.44	97,769.03
结算备付金利息收入	1,474.37	31.27
其他	29,717.97	39,799.35
合计	251,946.89	190,797.53

注：1、其他为申购款利息收入。

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

7.4.7.14 股票投资收益

7.4.7.14.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日
卖出股票成交总额	4,594,963,373.69	2,530,399,174.88
减：卖出股票成本总额	4,422,982,625.53	2,438,729,795.05
减：交易费用	4,937,563.94	2,929,757.17
买卖股票差价收入	167,043,184.22	88,739,622.66

7.4.7.15 债券投资收益

7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日
债券投资收益——利息收入	-	5,782.19
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-	-13,366.67
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	-	-7,584.48

7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31 日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	-	7,650,750.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	-	7,513,366.67
减：应计利息总额	-	150,750.00
减：交易费用	-	-
买卖债券差价收入	-	-13,366.67

7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均无债券投资赎回差价收入。

7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均无债券投资申购差价收入。

7.4.7.16 资产支持证券投资收益

7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

7.4.7.17 贵金属投资收益

7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

7.4.7.18 衍生工具收益

7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均无买卖权证价差收入。

7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月 31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12 月31日
股指期货投资收益	-178,828.02	-

7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利 收益	17,212,310.66	10,842,926.63
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	17,212,310.66	10,842,926.63

7.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	20,152,490.49	33,210,875.82
股票投资	20,152,490.49	33,198,259.15
债券投资	-	12,616.67
资产支持证券投资	-	-
基金投资	-	-
贵金属投资	-	-
其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
权证投资	-	-
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值 变动产生的预估增值税	-	-
合计	20,152,490.49	33,210,875.82

7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	286,080.25	253,949.47
基金转换费收入	243,400.32	28.12
合计	529,480.57	253,977.59

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。

7.4.7.22 信用减值损失

本基金本报告期及上年度可比期间均无信用减值损失。

7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
审计费用	60,000.00	50,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
指数使用费	43,888.89	200,000.00
其他费用	8,965.45	5,273.10
存托服务费	535.39	217.16
合计	233,389.73	375,490.26

注：1、其他费用为银行手续费。

2、自 2025 年 3 月 21 日起，指数使用费由基金管理人承担。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
长信基金管理有限责任公司(以下简称“长信基金”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
招商银行股份有限公司(以下简称“招商银行”)	基金托管人、基金销售机构
长江证券股份有限公司(以下简称“长江证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
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 2025年1月1日至2025年12月31日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024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	9,805,915,201.01	100.00	4,925,599,825.78	100.00

7.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均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 2025年1月1日至2025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	2,020,705.53	100.00	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2024年1月1日至2024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	1,348,941.41	100.00	-	-

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

2、根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，自2024年7月1日起，基金管理人管理的被动股票型基金的股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率，且不得通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；其他类型基金可以通过交易佣金支付研究服务费用，但股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍，且不得通

过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。相关佣金协议已根据此规定完成了更新。

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	上年度可比期间
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	8,527,761.93	4,399,742.14
其中：应支付销售机构的客户维护费	2,277,595.13	819,652.57
应支付基金管理人的净管理费	6,250,166.80	3,580,089.57

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

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

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,279,164.22	659,961.23

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

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

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		
	2025 年 1 月 1 日至 2025 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	-	497,444.09	497,444.09
招商银行	-	583,295.62	583,295.62
长江证券	-	71,834.45	71,834.45
合计	-	1,152,574.16	1,152,574.16
获得销售服务费的各关联方	上年度可比期间		
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		

名称	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	-	617,702.06	617,702.06
招商银行	-	36,373.88	36,373.88
长江证券	-	65,080.28	65,080.28
合计	-	719,156.22	719,156.22

注：根据基金合同的规定，本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.40%。C 类基金份额的基金销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.40% 年费率计提。

其计算公式为：

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

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

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

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

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	
	长信沪深 300 指数 A	长信沪深 300 指数 C
基金合同生效日（2019 年 5 月 16 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	52,162.71	56,812.64
报告期间申购/买入总份额	8,594.94	9,671.88

报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	60,757.65	66,484.52
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	0.01%	0.01%
项目	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日	
	长信沪深 300 指数 A	长信沪深 300 指数 C
基金合同生效日（2019年5月16日） 持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	52,162.71	56,812.64
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	52,162.71	56,812.64
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	0.02%	0.02%

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

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

除基金管理人之外的其他关联方在本报告期末及上年度末均未投资本基金。

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 2025年1月1日至2025年12月 31日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024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	28,866,044.06	95,449.11	21,694,947.64	53,197.88

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期及上年度可比期间均未在承销期内购入过由关联方承销的证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期末存放于长江证券的结算备付金金额为人民币 57,666,802.58 元（2024 年：人民币 8,160,349.44 元）；本报告期存放于长江证券的结算备付金产生的利息收入为人民币 125,305.44 元（2024 年：人民币 97,769.03 元）。

本基金本报告期末存放于长江期货的结算备付金金额为人民币 2,615.05 元（2024 年 12 月 31 日：人民币 0 元），当期利息收入为 1,443.07 元（2024 年度：0.00 元）。本基金本报告期通过长江期货买卖期货成交额 117,179,100.00 元（2024 年度：0 元），当期发生应支付给长江期货的交易费

用 2,728.02 元 (2024 年度: 0 元), 本报告期末无应付长江期货的交易费用余额 (2024 年 12 月 31 日: 无)。

7.4.11 利润分配情况

单位: 人民币元

长信沪深 300 指数 A								
序号	权益登记日	除息日		每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
		场内	场外					
1	2025 年 12 月 22 日	-	2025 年 12 月 22 日	2.000	39,933,697.55	8,383,243.99	48,316,941.54	-
合计	-	-	-	2.000	39,933,697.55	8,383,243.99	48,316,941.54	-
长信沪深 300 指数 C								
序号	权益登记日	除息日		每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
		场内	场外					
1	2025 年 12 月 22 日	-	2025 年 12 月 22 日	2.000	140,059,394.73	18,896,924.16	158,956,318.89	-
合计	-	-	-	2.000	140,059,394.73	18,896,924.16	158,956,318.89	-

7.4.12 期末 (2025 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	受限期	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
001221	悍高集团	2025 年 7 月 23 日	6 个月	新股限售	15.43	56.94	160	2,468.80	9,110.40	-
001233	海安集团	2025 年 11 月 18 日	6 个月	新股限售	48.00	51.88	370	17,760.00	19,195.60	-
001280	中国铝业	2025 年 11 月 25 日	6 个月	新股限售	17.89	45.36	2,277	40,735.53	103,284.72	-

001285	瑞立科密	2025年9月23日	6个月	新股限售	42.28	56.08	137	5,792.36	7,682.96	-
001369	双欣环保	2025年12月23日	6个月	新股限售	6.85	12.89	897	6,144.45	11,562.33	-
001386	马可波罗	2025年10月15日	6个月	新股限售	13.75	18.53	1,626	22,357.50	30,129.78	-
001388	信通电子	2025年6月24日	6个月	新股限售	16.42	42.94	94	1,543.48	4,036.36	-
001396	誉帆科技	2025年12月23日	6个月	新股限售	22.29	35.39	69	1,538.01	2,441.91	-
301449	天溯计量	2025年12月16日	6个月	新股限售	36.80	65.23	112	4,121.60	7,305.76	-
301491	汉桑科技	2025年7月29日	6个月	新股限售	28.91	55.11	245	7,082.95	13,501.95	-
301563	云汉芯城	2025年9月23日	6个月	新股限售	27.00	133.69	110	2,970.00	14,705.90	-
301575	艾芬达	2025年9月3日	6个月	新股限售	27.69	49.55	126	3,488.94	6,243.30	-
301584	建发致新	2025年9月18日	6个月	新股限售	7.05	26.82	447	3,151.35	11,988.54	-
301609	山大电力	2025年7月16日	6个月	新股限售	14.66	40.99	277	4,060.82	11,354.23	-

301632	广东建科	2025年8月5日	6个月	新股限售	6.56	23.68	656	4,303.36	15,534.08	-
301638	南网数字	2025年11月11日	6个月	新股限售	5.69	14.21	2,322	13,212.18	32,995.62	-
301656	联合动力	2025年9月17日	6个月	新股限售	12.48	25.46	7,395	92,289.60	188,276.70	-
301667	纳百川	2025年12月10日	6个月	新股限售	22.63	57.07	151	3,417.13	8,617.57	-
301687	新广益	2025年12月24日	6个月	新股限售	21.93	54.39	195	4,276.35	10,606.05	-
600930	华电新能	2025年7月9日	6个月	新股限售	3.18	6.24	84,513	268,751.34	527,361.12	-
601026	道生天合	2025年10月9日	6个月	新股限售	5.98	14.28	451	2,696.98	6,440.28	-
603092	德力佳	2025年10月30日	6个月	新股限售	46.68	55.66	146	6,815.28	8,126.36	-
603175	超颖电子	2025年10月17日	6个月	新股限售	17.08	48.56	169	2,886.52	8,206.64	-
603248	锡华科技	2025年12月16日	6个月	新股限售	10.10	16.30	260	2,626.00	4,238.00	-
603262	技源集团	2025年7月16日	6个月	新股限售	10.88	28.10	155	1,686.40	4,355.50	-

603334	丰倍生物	2025年10月29日	6个月	新股限售	24.49	32.82	88	2,155.12	2,888.16	-
603370	华新精科	2025年8月27日	6个月	新股限售	18.60	46.35	82	1,525.20	3,800.70	-
603376	大明电子	2025年10月28日	6个月	新股限售	12.55	26.21	111	1,393.05	2,909.31	-
603406	天富龙	2025年7月30日	6个月	新股限售	23.60	40.16	153	3,610.80	6,144.48	-
603418	友升股份	2025年9月16日	6个月	新股限售	46.36	59.06	139	6,444.04	8,209.34	-
688727	恒坤新材	2025年11月11日	6个月	新股限售	14.99	34.87	563	8,439.37	19,631.81	-
688729	屹唐股份	2025年7月1日	6个月	新股限售	8.45	24.28	2,394	20,229.30	58,126.32	-
688759	必贝特	2025年10月21日	6个月	新股限售	17.78	25.11	465	8,267.70	11,676.15	-
688783	西安奕材	2025年10月20日	6个月	新股限售	8.62	18.36	2,054	17,705.48	37,711.44	-
688795	摩尔线程	2025年11月26日	9个月	新股限售	114.28	416.02	4,627	528,773.56	1,924,924.54	-
688796	百奥赛图	2025年12月2日	6个月	新股限售	26.68	42.25	423	11,285.64	17,871.75	-

688802	沐曦股份	2025年12月9日	9个月	新股限售	104.66	399.40	3,627	379,601.82	1,448,623.80	-
688805	健信超导	2025年12月17日	6个月	新股限售	18.58	32.37	265	4,923.70	8,578.05	-
688807	优迅股份	2025年12月10日	6个月	新股限售	51.66	135.56	131	6,767.46	17,758.36	-
688809	强一股份	2025年12月23日	6个月	新股限售	85.09	203.31	259	22,038.31	52,657.29	-

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688012	中微公司	2025年12月19日	重大事项停牌	272.72	2026年1月5日	278.00	80	11,946.19	21,817.60	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无因交易所市场债券正回购交易而抵押的债券。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的融出证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

险的方法等。

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

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

7.4.13.2 信用风险

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

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

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

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的债券投资。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的债券投资。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

7.4.13.3 流动性风险

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

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

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

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025 年 12 月 31 日	6 个月以内	6 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产						
货币资金	86,532,846.64	-	-	-	-	86,532,846.64
结算备付金	6,923.21	-	-	-	-	6,923.21
交易性金融资产	-	-	-	-	1,136,860,613.14	1,136,860,613.14
应收申购款	-	-	-	-	364,395.90	364,395.90
资产总计	86,539,769.85	-	-	-	1,137,225,009.04	1,223,764,778.89
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	13,476,623.31	13,476,623.31
应付管理人报酬	-	-	-	-	1,166,459.89	1,166,459.89
应付托管费	-	-	-	-	174,968.99	174,968.99
应付销售服务费	-	-	-	-	355,338.61	355,338.61
其他负债	-	-	-	-	180,729.75	180,729.75
负债总计	-	-	-	-	15,354,120.55	15,354,120.55
利率敏感度缺口	86,539,769.85	-	-	-	1,121,870,888.49	1,208,410,658.34
上年度末 2024 年 12 月 31 日	6 个月以内	6 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产						
货币资金	29,855,297.08	-	-	-	-	29,855,297.08
结算备付金	4,276.86	-	-	-	-	4,276.86
交易性金融资产	-	-	-	-	290,158,822.24	290,158,822.24
应收申购款	-	-	-	-	3,180,171.05	3,180,171.05
资产总计	29,859,573.94	-	-	-	293,338,993.29	323,198,567.23
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	12,734,617.71	12,734,617.71
应付管理人报酬	-	-	-	-	359,284.03	359,284.03
应付托管费	-	-	-	-	53,892.61	53,892.61
应付销售服务费	-	-	-	-	86,422.47	86,422.47
其他负债	-	-	-	-	224,760.60	224,760.60
负债总计	-	-	-	-	13,458,977.42	13,458,977.42
利率敏感度缺口	29,859,573.94	-	-	-	279,880,015.87	309,739,589.81

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金于本报告期末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，所面临的重大其他价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(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 2025年12月31日		上年度末 2024年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	1,136,860,613.14	94.08	290,158,822.24	93.68
交易性金融资产—债券投资				
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,136,860,613.14	94.08	290,158,822.24	93.68

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（2025年12月31日）	上年度末（2024年12月31日）
	VaR 值为 4.09% (2024 年 12 月 31 日 VaR 值为 3.39%)	-49,468,472.06	-10,508,313.71

注：上述风险价值 VaR 的分析是基于资产负债表日所持证券过去一年市场价格波动情况而有可能

发生的最大损失，且此变动适用于本基金所有的衍生金融工具及非衍生金融工具。取 95%的置信度是基于本基金所持有的金融工具风险度量的要求。2024 年的分析同样基于该假设。

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	1,132,149,982.38	290,130,189.95
第二层次	21,817.60	-
第三层次	4,688,813.16	28,632.29
合计	1,136,860,613.14	290,158,822.24

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。对于公开市场交易的股票、债券等投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	28,632.29	28,632.29

当期购买	-	1,611,132.33	1,611,132.33
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	222,374.71	222,374.71
当期利得或损失总额	-	3,271,423.25	3,271,423.25
其中：计入损益的利得或损失	-	3,271,423.25	3,271,423.25
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	4,688,813.16	4,688,813.16
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	3,139,475.68	3,139,475.68
项目	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	92,077.51	92,077.51
当期购买	-	20,349.71	20,349.71
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	90,047.11	90,047.11
当期利得或损失总额	-	6,252.18	6,252.18
其中：计入损益的利得或损失	-	6,252.18	6,252.18
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	28,632.29	28,632.29
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	18,438.09	18,438.09

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

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系

限售股票	4,688,813.16	平均价格 亚式期权 模型	股票在剩余限售 期内的股价的预 期年化波动率	0-303.23%	负相关
项目	上年度末公允 价值	采用的估 值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均 值	与公允价值 之间的关系
限售股票	28,632.29	平均价格 亚式期权 模型	股票在剩余限售 期内的股价的预 期年化波动率	35.21%-76.55%	负相关

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.15.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

7.4.15.2 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	1,136,860,613.14	92.90
	其中：股票	1,136,860,613.14	92.90
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	86,539,769.85	7.07
8	其他各项资产	364,395.90	0.03
9	合计	1,223,764,778.89	100.00

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

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	48,033,945.00	3.97
C	制造业	448,504,990.83	37.12
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	19,328,799.12	1.60
E	建筑业	37,014,796.00	3.06
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	21,295,199.00	1.76
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	44,628,082.00	3.69
J	金融业	275,347,178.80	22.79
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	19,811,495.00	1.64
M	科学研究和技术服务业	28,406,576.00	2.35
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	942,371,061.75	77.98

8.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	11,899,508.72	0.98
C	制造业	131,960,725.11	10.92
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	4,209,207.44	0.35
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	28,305,712.62	2.34
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-

L	租赁和商务服务业	11,116,044.00	0.92
M	科学研究和技术服务业	6,998,353.50	0.58
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	194,489,551.39	16.09

8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未通过港股通交易机制投资港股。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300750	宁德时代	175,637	64,504,444.62	5.34
2	601318	中国平安	798,087	54,589,150.80	4.52
3	601899	紫金矿业	1,393,500	48,033,945.00	3.97
4	000333	美的集团	473,100	36,972,765.00	3.06
5	601166	兴业银行	1,664,800	35,060,688.00	2.90
6	600030	中信证券	1,118,700	32,117,877.00	2.66
7	603259	药明康德	313,400	28,406,576.00	2.35
8	600919	江苏银行	2,383,000	24,783,200.00	2.05
9	603799	华友钴业	354,100	24,170,866.00	2.00
10	600660	福耀玻璃	353,000	22,863,810.00	1.89
11	002415	海康威视	764,900	22,824,616.00	1.89
12	000100	TCL 科技	4,922,300	22,347,242.00	1.85
13	600183	生益科技	312,500	22,315,625.00	1.85
14	600519	贵州茅台	16,050	22,103,739.00	1.83
15	601628	中国人寿	485,400	22,085,700.00	1.83
16	002916	深南电路	95,000	22,067,550.00	1.83
17	600160	巨化股份	567,500	21,803,350.00	1.80
18	601728	中国电信	3,440,900	21,677,670.00	1.79
19	688111	金山办公	70,100	21,525,607.00	1.78
20	600276	恒瑞医药	360,200	21,457,114.00	1.78
21	601939	建设银行	2,301,700	21,359,776.00	1.77
22	601111	中国国航	2,272,700	21,295,199.00	1.76
23	300033	同花顺	65,700	21,167,226.00	1.75
24	605499	东鹏饮料	78,130	20,891,180.70	1.73
25	600989	宝丰能源	1,058,000	20,768,540.00	1.72
26	600690	海尔智家	768,400	20,047,556.00	1.66

27	601988	中国银行	3,474,000	19,906,020.00	1.65
28	600415	小商品城	1,242,100	19,811,495.00	1.64
29	002074	国轩高科	501,200	19,601,932.00	1.62
30	600011	华能国际	2,520,300	18,801,438.00	1.56
31	002736	国信证券	1,428,800	18,745,856.00	1.55
32	601138	工业富联	300,330	18,635,476.50	1.54
33	601117	中国化学	2,467,600	18,581,028.00	1.54
34	600039	四川路桥	1,852,640	18,433,768.00	1.53
35	600150	中国船舶	440,430	14,648,701.80	1.21
36	300308	中际旭创	23,100	14,091,000.00	1.17
37	601658	邮储银行	2,349,700	12,805,865.00	1.06
38	300059	东方财富	549,000	12,725,820.00	1.05
39	688041	海光信息	32,400	7,270,884.00	0.60
40	000895	双汇发展	226,000	5,982,220.00	0.50
41	300502	新易盛	7,200	3,102,336.00	0.26
42	600941	中国移动	14,100	1,424,805.00	0.12
43	600930	华电新能	84,513	527,361.12	0.04
44	688012	中微公司	80	21,817.60	0.00
45	688981	中芯国际	70	8,598.10	0.00
46	600426	华鲁恒升	73	2,294.39	0.00
47	688303	大全能源	36	965.52	0.00
48	688223	晶科能源	65	366.60	0.00

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	688002	睿创微纳	138,549	13,965,739.20	1.16
2	603486	科沃斯	149,600	12,069,728.00	1.00
3	002414	高德红外	805,000	11,809,350.00	0.98
4	600988	赤峰黄金	377,600	11,796,224.00	0.98
5	002558	巨人网络	268,200	11,610,378.00	0.96
6	603444	吉比特	27,100	11,486,335.00	0.95
7	603236	移远通信	119,486	11,400,159.26	0.94
8	688700	东威科技	321,473	11,341,567.44	0.94
9	300003	乐普医疗	714,800	11,300,988.00	0.94
10	600057	厦门象屿	1,304,700	11,116,044.00	0.92
11	301606	绿联科技	189,200	11,113,608.00	0.92
12	688772	珠海冠宇	514,578	11,078,864.34	0.92
13	689009	九号公司	198,700	11,045,733.00	0.91
14	002258	利尔化学	729,000	9,513,450.00	0.79
15	301080	百普赛斯	128,800	6,955,200.00	0.58
16	688677	海泰新光	145,100	6,262,516.00	0.52
17	002602	世纪华通	303,400	5,176,004.00	0.43
18	600704	物产中大	750,900	4,182,513.00	0.35

19	003030	祖名股份	188,000	3,795,720.00	0.31
20	688795	摩尔线程	4,627	1,924,924.54	0.16
21	002281	光迅科技	26,700	1,867,665.00	0.15
22	688802	沐曦股份	3,627	1,448,623.80	0.12
23	002008	大族激光	34,800	1,433,412.00	0.12
24	301656	联合动力	7,395	188,276.70	0.02
25	001280	中国铀业	2,277	103,284.72	0.01
26	688729	屹唐股份	2,394	58,126.32	0.00
27	688809	强一股份	259	52,657.29	0.00
28	688783	西安奕材	2,054	37,711.44	0.00
29	301638	南网数字	2,322	32,995.62	0.00
30	001386	马可波罗	1,626	30,129.78	0.00
31	688727	恒坤新材	563	19,631.81	0.00
32	001233	海安集团	370	19,195.60	0.00
33	688796	百奥赛图	423	17,871.75	0.00
34	688807	优迅股份	131	17,758.36	0.00
35	301632	广东建科	656	15,534.08	0.00
36	301563	云汉芯城	110	14,705.90	0.00
37	301491	汉桑科技	245	13,501.95	0.00
38	301584	建发致新	447	11,988.54	0.00
39	688759	必贝特	465	11,676.15	0.00
40	001369	双欣环保	897	11,562.33	0.00
41	301609	山大电力	277	11,354.23	0.00
42	301687	新广益	195	10,606.05	0.00
43	001221	悍高集团	160	9,110.40	0.00
44	301667	纳百川	151	8,617.57	0.00
45	688805	健信超导	265	8,578.05	0.00
46	603418	友升股份	139	8,209.34	0.00
47	603175	超颖电子	169	8,206.64	0.00
48	603092	德力佳	146	8,126.36	0.00
49	001285	瑞立科密	137	7,682.96	0.00
50	301449	天溯计量	112	7,305.76	0.00
51	601026	道生天合	451	6,440.28	0.00
52	301575	艾芬达	126	6,243.30	0.00
53	603406	天富龙	153	6,144.48	0.00
54	603262	技源集团	155	4,355.50	0.00
55	603248	锡华科技	260	4,238.00	0.00
56	001388	信通电子	94	4,036.36	0.00
57	688063	派能科技	69	3,920.58	0.00
58	603370	华新精科	82	3,800.70	0.00
59	603400	华之杰	57	2,980.53	0.00
60	603376	大明电子	111	2,909.31	0.00
61	603334	丰倍生物	88	2,888.16	0.00

62	001396	誉帆科技	69	2,441.91	0.00
----	--------	------	----	----------	------

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	603259	药明康德	108,730,814.54	35.10
2	601398	工商银行	95,401,085.00	30.80
3	601899	紫金矿业	91,546,770.00	29.56
4	300059	东方财富	91,232,217.42	29.45
5	601939	建设银行	73,587,946.42	23.76
6	600031	三一重工	73,185,499.00	23.63
7	600276	恒瑞医药	68,179,238.65	22.01
8	600160	巨化股份	66,974,395.00	21.62
9	603799	华友钴业	66,276,914.00	21.40
10	002230	科大讯飞	66,273,889.10	21.40
11	600150	中国船舶	62,148,280.69	20.06
12	600000	浦发银行	58,673,728.00	18.94
13	601318	中国平安	57,262,830.51	18.49
14	600183	生益科技	56,511,057.00	18.24
15	600519	贵州茅台	55,203,452.45	17.82
16	002736	国信证券	54,724,896.15	17.67
17	000333	美的集团	54,326,591.00	17.54
18	600030	中信证券	53,026,954.70	17.12
19	601166	兴业银行	52,652,523.00	17.00
20	601319	中国人保	52,339,143.24	16.90
21	601138	工业富联	51,901,847.08	16.76
22	688256	寒武纪	51,697,459.71	16.69
23	600660	福耀玻璃	50,073,510.48	16.17
24	688111	金山办公	49,545,420.04	16.00
25	601988	中国银行	47,951,990.00	15.48
26	601628	中国人寿	47,732,720.10	15.41
27	689009	九号公司	47,683,121.58	15.39
28	688041	海光信息	47,280,743.57	15.26
29	300033	同花顺	46,873,453.28	15.13
30	601728	中国电信	45,959,417.00	14.84
31	601117	中国化学	45,687,072.00	14.75
32	300750	宁德时代	45,502,392.00	14.69
33	603296	华勤技术	43,582,465.92	14.07
34	000858	五粮液	43,371,341.00	14.00
35	600941	中国移动	40,669,218.54	13.13
36	002415	海康威视	40,659,600.38	13.13
37	605499	东鹏饮料	40,330,768.00	13.02

38	600690	海尔智家	38,977,998.00	12.58
39	000100	TCL 科技	36,511,406.30	11.79
40	600176	中国巨石	36,296,179.53	11.72
41	002202	金风科技	35,794,157.00	11.56
42	002916	深南电路	35,637,152.60	11.51
43	600989	宝丰能源	34,218,652.00	11.05
44	601233	桐昆股份	33,887,205.17	10.94
45	601857	中国石油	33,686,840.00	10.88
46	002080	中材科技	32,824,937.00	10.60
47	300003	乐普医疗	32,177,982.00	10.39
48	600919	江苏银行	31,539,767.00	10.18
49	601633	长城汽车	31,152,131.00	10.06
50	600039	四川路桥	30,035,677.60	9.70
51	600166	福田汽车	29,533,064.00	9.53
52	002475	立讯精密	29,038,332.00	9.38
53	301606	绿联科技	28,927,213.00	9.34
54	300014	亿纬锂能	28,739,959.50	9.28
55	601088	中国神华	28,551,097.07	9.22
56	002714	牧原股份	28,526,889.65	9.21
57	601127	赛力斯	28,393,957.00	9.17
58	600988	赤峰黄金	28,269,659.00	9.13
59	603986	兆易创新	28,134,461.48	9.08
60	601658	邮储银行	28,106,924.00	9.07
61	002558	巨人网络	27,966,717.26	9.03
62	688002	睿创微纳	27,870,736.50	9.00
63	600415	小商品城	27,801,730.00	8.98
64	600547	山东黄金	27,643,988.64	8.92
65	000600	建投能源	27,476,262.00	8.87
66	600063	皖维高新	27,046,665.00	8.73
67	002074	国轩高科	26,568,491.30	8.58
68	300124	汇川技术	26,383,715.05	8.52
69	600057	厦门象屿	26,002,972.00	8.40
70	002648	卫星化学	25,581,935.50	8.26
71	600011	华能国际	25,037,696.16	8.08
72	002594	比亚迪	24,987,354.40	8.07
73	601169	北京银行	24,856,063.00	8.02
74	000800	一汽解放	24,430,556.00	7.89
75	002920	德赛西威	24,313,463.34	7.85
76	601336	新华保险	24,187,412.86	7.81
77	000778	新兴铸管	23,813,628.00	7.69
78	601668	中国建筑	23,480,319.00	7.58
79	002049	紫光国微	23,186,271.00	7.49
80	300347	泰格医药	23,127,187.00	7.47

81	000050	深天马 A	22,878,727.99	7.39
82	002258	利尔化学	22,760,369.00	7.35
83	002236	大华股份	22,583,655.00	7.29
84	601229	上海银行	22,428,812.51	7.24
85	601077	渝农商行	22,389,548.70	7.23
86	601818	光大银行	22,389,221.00	7.23
87	601111	中国国航	22,014,983.00	7.11
88	000408	藏格矿业	21,911,981.00	7.07
89	300308	中际旭创	21,850,609.00	7.05
90	000938	紫光股份	21,577,948.00	6.97
91	601211	国泰海通	21,182,231.00	6.84
92	000166	申万宏源	20,929,065.00	6.76
93	600578	京能电力	20,885,115.00	6.74
94	601766	中国中车	20,383,508.00	6.58
95	688696	极米科技	20,278,684.90	6.55
96	601699	潞安环能	20,113,970.00	6.49
97	002487	大金重工	20,049,199.00	6.47
98	300502	新易盛	19,920,321.00	6.43
99	688772	珠海冠宇	19,889,256.17	6.42
100	603893	瑞芯微	19,729,665.00	6.37
101	600585	海螺水泥	19,661,234.00	6.35
102	000725	京东方 A	19,613,299.00	6.33
103	601009	南京银行	19,408,360.00	6.27
104	601288	农业银行	19,097,413.00	6.17
105	601601	中国太保	19,088,397.00	6.16
106	000895	双汇发展	19,032,997.00	6.14
107	002299	圣农发展	18,907,332.05	6.10
108	601901	方正证券	18,809,708.00	6.07
109	600028	中国石化	18,486,958.00	5.97
110	000625	长安汽车	18,429,072.89	5.95
111	601607	上海医药	18,163,828.00	5.86
112	688313	仕佳光子	18,152,655.59	5.86
113	600050	中国联通	17,090,115.00	5.52
114	601989	中国重工	16,912,305.00	5.46
115	000893	亚钾国际	16,900,031.00	5.46
116	600482	中国动力	16,492,720.00	5.32
117	002938	鹏鼎控股	16,243,027.00	5.24
118	002241	歌尔股份	15,976,115.00	5.16
119	002414	高德红外	15,694,634.80	5.07
120	603486	科沃斯	15,694,516.00	5.07
121	603444	吉比特	15,632,710.00	5.05
122	600219	南山铝业	15,537,116.00	5.02
123	600170	上海建工	15,309,122.00	4.94

124	002008	大族激光	15,195,352.26	4.91
125	600089	特变电工	15,182,937.00	4.90
126	600782	新钢股份	15,096,993.00	4.87
127	600549	厦门钨业	15,026,304.00	4.85
128	601456	国联民生	14,651,621.00	4.73
129	688183	生益电子	14,636,420.84	4.73
130	300274	阳光电源	14,398,453.20	4.65
131	600378	昊华科技	14,242,597.00	4.60
132	000776	广发证券	14,116,536.00	4.56
133	600460	士兰微	13,755,451.00	4.44
134	601880	辽港股份	13,671,728.00	4.41
135	688700	东威科技	13,463,104.20	4.35
136	002281	光迅科技	13,461,687.00	4.35
137	600143	金发科技	13,388,084.00	4.32
138	600298	安琪酵母	13,363,814.00	4.31
139	000729	燕京啤酒	13,156,907.00	4.25
140	603529	爱玛科技	13,154,120.00	4.25
141	600968	海油发展	13,136,408.00	4.24
142	300395	菲利华	13,107,851.00	4.23
143	300888	稳健医疗	13,035,245.00	4.21
144	300454	深信服	12,747,530.00	4.12
145	600395	盘江股份	12,685,913.00	4.10
146	000932	华菱钢铁	12,684,969.00	4.10
147	688019	安集科技	12,652,915.49	4.09
148	301080	百普赛斯	12,629,627.40	4.08
149	300496	中科创达	12,608,628.00	4.07
150	300627	华测导航	12,582,048.00	4.06
151	688372	伟测科技	12,337,354.58	3.98
152	000063	中兴通讯	12,248,603.00	3.95
153	301165	锐捷网络	12,214,539.20	3.94
154	300972	万辰集团	12,150,009.00	3.92
155	300138	晨光生物	12,144,122.00	3.92
156	002244	滨江集团	11,969,351.00	3.86
157	000651	格力电器	11,792,283.00	3.81
158	600958	东方证券	11,673,770.00	3.77
159	603236	移远通信	11,400,478.72	3.68
160	002010	传化智联	11,262,591.00	3.64
161	002821	凯莱英	11,146,195.00	3.60
162	600704	物产中大	10,808,704.00	3.49
163	601919	中远海控	10,705,485.67	3.46
164	002493	荣盛石化	10,450,652.00	3.37
165	601155	新城控股	10,052,354.70	3.25
166	002284	亚太股份	10,013,736.00	3.23

167	000988	华工科技	9,863,815.00	3.18
168	600015	华夏银行	9,756,967.00	3.15
169	688608	恒玄科技	9,228,761.00	2.98
170	000877	天山股份	8,883,941.04	2.87
171	601985	中国核电	8,859,813.00	2.86
172	600582	天地科技	8,801,096.00	2.84
173	601158	重庆水务	8,791,776.00	2.84
174	600027	华电国际	8,667,024.00	2.80
175	002142	宁波银行	8,541,270.20	2.76
176	300433	蓝思科技	8,264,512.00	2.67
177	003816	中国广核	8,207,358.00	2.65
178	300705	九典制药	7,940,413.00	2.56
179	600718	东软集团	7,927,105.00	2.56
180	600282	南钢股份	7,923,023.00	2.56
181	000528	柳工	7,908,290.99	2.55
182	002028	思源电气	7,905,219.92	2.55
183	002128	电投能源	7,815,087.00	2.52
184	000338	潍柴动力	7,601,798.00	2.45
185	601600	中国铝业	7,531,890.00	2.43
186	002463	沪电股份	7,386,512.27	2.38
187	600419	天润乳业	7,257,431.00	2.34
188	000959	首钢股份	7,204,006.00	2.33
189	600066	宇通客车	6,498,902.45	2.10
190	300207	欣旺达	6,457,684.00	2.08
191	688677	海泰新光	6,328,274.82	2.04
192	600196	复星医药	6,209,963.00	2.00

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

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	601398	工商银行	97,371,421.00	31.44
2	603259	药明康德	90,332,178.00	29.16
3	600031	三一重工	82,912,842.52	26.77
4	300059	东方财富	80,795,309.00	26.08
5	601899	紫金矿业	76,530,495.50	24.71
6	002230	科大讯飞	70,510,591.00	22.76
7	600000	浦发银行	66,725,649.00	21.54
8	601939	建设银行	60,618,961.18	19.57
9	601319	中国人保	59,541,473.25	19.22
10	603799	华友钴业	52,156,462.96	16.84
11	600276	恒瑞医药	51,320,289.57	16.57
12	688041	海光信息	49,269,561.75	15.91

13	600183	生益科技	48,817,306.00	15.76
14	600160	巨化股份	48,477,725.50	15.65
15	688256	寒武纪	47,480,027.05	15.33
16	600150	中国船舶	47,068,050.05	15.20
17	002202	金风科技	45,673,506.67	14.75
18	603296	华勤技术	44,592,346.60	14.40
19	000858	五粮液	44,406,117.12	14.34
20	600176	中国巨石	42,245,805.00	13.64
21	600519	贵州茅台	40,435,173.00	13.05
22	601857	中国石油	38,733,605.00	12.51
23	601233	桐昆股份	38,198,941.00	12.33
24	601988	中国银行	37,847,280.00	12.22
25	600941	中国移动	37,659,625.00	12.16
26	002736	国信证券	37,157,005.00	12.00
27	002080	中材科技	35,774,628.55	11.55
28	689009	九号公司	35,677,580.96	11.52
29	601127	赛力斯	35,413,930.87	11.43
30	002594	比亚迪	34,917,105.40	11.27
31	002714	牧原股份	34,041,207.51	10.99
32	601138	工业富联	33,229,780.00	10.73
33	601628	中国人寿	32,009,954.61	10.33
34	000333	美的集团	30,759,775.00	9.93
35	300014	亿纬锂能	30,459,017.94	9.83
36	601633	长城汽车	30,427,728.25	9.82
37	002475	立讯精密	30,163,419.00	9.74
38	601336	新华保险	29,894,497.00	9.65
39	600547	山东黄金	29,888,896.80	9.65
40	603986	兆易创新	29,736,629.16	9.60
41	600660	福耀玻璃	29,179,987.00	9.42
42	000600	建投能源	29,160,176.00	9.41
43	600166	福田汽车	28,813,212.00	9.30
44	601088	中国神华	27,838,156.38	8.99
45	002920	德赛西威	27,577,380.43	8.90
46	600063	皖维高新	26,721,383.00	8.63
47	300124	汇川技术	26,383,975.71	8.52
48	601601	中国太保	26,363,057.28	8.51
49	000725	京东方 A	26,131,222.00	8.44
50	601117	中国化学	26,112,296.00	8.43
51	688111	金山办公	25,893,117.94	8.36
52	002648	卫星化学	25,710,682.02	8.30
53	601318	中国平安	25,585,399.10	8.26
54	601766	中国中车	25,110,334.00	8.11
55	000050	深天马 A	24,263,669.00	7.83

56	601668	中国建筑	24,031,555.00	7.76
57	600050	中国联通	23,604,313.00	7.62
58	000800	一汽解放	23,524,776.00	7.60
59	300347	泰格医药	23,502,136.00	7.59
60	000408	藏格矿业	23,234,454.00	7.50
61	000778	新兴铸管	22,997,026.00	7.42
62	601169	北京银行	22,563,206.00	7.28
63	600585	海螺水泥	22,522,809.00	7.27
64	603893	瑞芯微	22,458,695.00	7.25
65	000166	申万宏源	22,407,738.00	7.23
66	002049	紫光国微	22,358,009.20	7.22
67	601211	国泰海通	22,059,471.06	7.12
68	002236	大华股份	21,949,089.00	7.09
69	605499	东鹏饮料	21,824,841.00	7.05
70	002487	大金重工	21,635,198.00	6.98
71	601288	农业银行	21,475,999.00	6.93
72	600578	京能电力	21,445,035.00	6.92
73	601699	潞安环能	21,051,352.00	6.80
74	002241	歌尔股份	20,982,804.00	6.77
75	000893	亚钾国际	20,963,478.98	6.77
76	600030	中信证券	20,724,766.00	6.69
77	601077	渝农商行	20,628,123.00	6.66
78	002299	圣农发展	20,557,717.00	6.64
79	601009	南京银行	20,370,755.00	6.58
80	688696	极米科技	20,146,106.13	6.50
81	601818	光大银行	20,089,780.00	6.49
82	601658	邮储银行	20,077,964.00	6.48
83	300033	同花顺	20,074,753.52	6.48
84	000938	紫光股份	20,031,673.81	6.47
85	300502	新易盛	19,953,660.60	6.44
86	601728	中国电信	19,912,303.00	6.43
87	300003	乐普医疗	19,889,717.00	6.42
88	600690	海尔智家	19,704,554.00	6.36
89	601229	上海银行	19,555,659.54	6.31
90	600219	南山铝业	19,489,179.00	6.29
91	600143	金发科技	19,436,363.00	6.28
92	300750	宁德时代	19,265,230.00	6.22
93	688313	仕佳光子	19,151,333.09	6.18
94	000625	长安汽车	19,044,401.68	6.15
95	600089	特变电工	19,021,535.20	6.14
96	601901	方正证券	18,949,150.00	6.12
97	002558	巨人网络	18,705,225.00	6.04
98	600028	中国石化	18,423,481.00	5.95

99	601919	中远海控	17,525,644.00	5.66
100	002415	海康威视	17,472,868.39	5.64
101	601607	上海医药	17,398,404.00	5.62
102	600989	宝丰能源	17,154,835.00	5.54
103	600482	中国动力	16,992,153.00	5.49
104	601989	中国重工	16,912,305.00	5.46
105	688002	睿创微纳	16,648,022.17	5.37
106	600988	赤峰黄金	16,488,627.00	5.32
107	688183	生益电子	16,330,467.29	5.27
108	301606	绿联科技	15,802,949.86	5.10
109	002938	鹏鼎控股	15,611,927.00	5.04
110	600057	厦门象屿	15,362,275.00	4.96
111	688019	安集科技	15,114,382.53	4.88
112	002916	深南电路	15,026,928.10	4.85
113	600170	上海建工	14,968,931.00	4.83
114	000776	广发证券	14,955,313.00	4.83
115	688372	伟测科技	14,786,967.56	4.77
116	601456	国联民生	14,740,497.00	4.76
117	601166	兴业银行	14,739,217.00	4.76
118	600549	厦门钨业	14,721,392.43	4.75
119	300395	菲利华	14,620,352.00	4.72
120	300274	阳光电源	14,592,891.00	4.71
121	601880	辽港股份	14,577,949.00	4.71
122	600460	士兰微	14,355,860.00	4.63
123	600782	新钢股份	14,274,166.00	4.61
124	300433	蓝思科技	14,151,497.00	4.57
125	600958	东方证券	13,914,613.00	4.49
126	000100	TCL 科技	13,894,617.00	4.49
127	002258	利尔化学	13,743,703.00	4.44
128	000932	华菱钢铁	13,741,346.00	4.44
129	600378	昊华科技	13,507,368.00	4.36
130	600298	安琪酵母	13,473,680.00	4.35
131	002008	大族激光	13,453,010.00	4.34
132	002281	光迅科技	13,436,873.00	4.34
133	000895	双汇发展	13,325,664.49	4.30
134	300454	深信服	13,220,178.00	4.27
135	603529	爱玛科技	13,057,377.86	4.22
136	600395	盘江股份	13,055,572.00	4.22
137	601328	交通银行	12,895,742.00	4.16
138	000729	燕京啤酒	12,854,325.00	4.15
139	600039	四川路桥	12,810,142.00	4.14
140	002821	凯莱英	12,806,761.00	4.13
141	600968	海油发展	12,734,705.00	4.11

142	301165	锐捷网络	12,700,982.00	4.10
143	000063	中兴通讯	12,577,836.00	4.06
144	002010	传化智联	12,530,405.00	4.05
145	000988	华工科技	12,304,347.00	3.97
146	300496	中科创达	12,052,615.00	3.89
147	300888	稳健医疗	11,770,743.00	3.80
148	300972	万辰集团	11,746,000.00	3.79
149	000651	格力电器	11,612,874.00	3.75
150	002493	荣盛石化	11,546,613.00	3.73
151	600066	宇通客车	11,364,758.00	3.67
152	002001	新和成	11,277,748.00	3.64
153	300627	华测导航	11,191,355.77	3.61
154	002244	滨江集团	11,148,160.00	3.60
155	300138	晨光生物	11,054,401.00	3.57
156	002284	亚太股份	10,925,351.12	3.53
157	601155	新城控股	10,527,483.00	3.40
158	600196	复星医药	10,335,433.00	3.34
159	000877	天山股份	10,157,803.00	3.28
160	600015	华夏银行	9,839,428.00	3.18
161	000528	柳工	9,837,872.00	3.18
162	600419	天润乳业	9,580,602.00	3.09
163	600887	伊利股份	9,214,235.00	2.97
164	600582	天地科技	9,184,676.00	2.97
165	300308	中际旭创	9,144,196.00	2.95
166	002128	电投能源	9,118,290.00	2.94
167	600718	东软集团	9,114,321.00	2.94
168	600875	东方电气	9,057,695.00	2.92
169	601158	重庆水务	8,907,514.00	2.88
170	600027	华电国际	8,812,677.00	2.85
171	601985	中国核电	8,697,744.00	2.81
172	605117	德业股份	8,692,142.95	2.81
173	002028	思源电气	8,569,880.00	2.77
174	688608	恒玄科技	8,535,854.41	2.76
175	002142	宁波银行	8,522,445.00	2.75
176	000959	首钢股份	8,452,210.00	2.73
177	003816	中国广核	8,186,279.00	2.64
178	600216	浙江医药	8,033,251.00	2.59
179	300705	九典制药	8,009,573.00	2.59
180	600282	南钢股份	7,974,419.00	2.57
181	601600	中国铝业	7,779,368.00	2.51
182	000338	潍柴动力	7,314,006.00	2.36
183	601168	西部矿业	7,232,983.00	2.34
184	600938	中国海油	7,198,876.00	2.32

185	300207	欣旺达	7,098,816.00	2.29
186	688772	珠海冠宇	6,888,367.22	2.22
187	002970	锐明技术	6,839,499.00	2.21
188	600704	物产中大	6,792,722.00	2.19
189	600011	华能国际	6,589,780.00	2.13
190	300967	晓鸣股份	6,346,311.00	2.05
191	601998	中信银行	6,261,768.00	2.02
192	601179	中国西电	6,231,374.00	2.01
193	002463	沪电股份	6,207,069.00	2.00

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

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	5,249,531,925.94
卖出股票收入（成交）总额	4,594,963,373.69

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

运用股指期货工具应对申购赎回，力争减少申购赎回对仓位的影响，减少跟踪误差。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

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

报告期内本基金投资的前十名证券中，发行主体兴业银行股份有限公司于 2025 年 12 月 5 日收到国家金融监督管理总局行政处罚信息公示列表，经查，兴业银行股份有限公司存在外包机构管理不到位、企业划型不准确等情况，因此，国家金融监督管理总局决定对兴业银行股份有限公司处以罚款 720 万元。

报告期内本基金投资的前十名证券中，发行主体江苏银行股份有限公司于 2025 年 1 月 24 日收到《江苏证监局关于对江苏银行股份有限公司采取责令改正监管措施的决定》，经查，江苏银行股份有限公司基金托管业务存在以下问题：一、内部控制方面，对部分私募股权基金管理人准入的尽职调查不充分；投资监督岗同时承担稽核管理职责；对部分经修订的基金合同和托管协议未及时回收并归档保存；2022 年度，未对基金托管法定业务和增值业务的内部控制制度建设与实施情况开展相关审查与评估。二、人员管理方面，个别核算、监督等核心业务岗位人员缺乏基金从业资质，或不具备托管业务从业经验。三、投资监督方面，未对基金投资监督标准与监督流程制定专门制度规范；投资监督系统岗位功能设定不规范；针对个别所托管基金，未根据基金合同及托管协议约定，对基金的投资范围、投资比例、投资风格、投资限制等实施有效监督。四、估值核算方面，针对个别所托管基金估值对账不一致的情况，未及时处理并向基金管理人提示反馈。五、信息报送方面，2023 年以来未按要求向中国证监会及派出机构报送基金投资运作监督报告、基金托管业务运营情况报告、内部控制年度评估报告等材料；2024 年 3 月，基金托管部门的高级管理人员发生变更未及时向中国证监会或江苏证监局报告。依据《证券投资基金托管业务管理办法》第四十条的规定，中国证券监督管理委员会江苏监管局决定对江苏银行股份有限公司采取责令改正的行政监督管理措施。

对如上证券投资决策程序的说明：公司研究部门按照内部研究工作规范对该证券进行分析后将其列入基金投资对象备选库。在此基础上本基金的基金经理根据具体市场情况独立作出投资决策。该事件发生后，本基金管理人对该证券的发行主体进行了进一步了解与分析，认为此事件未对该证券投资价值判断产生重大的实质性影响。本基金投资于该证券的投资决策过程符合制度规定的投资权限范围与投资决策程序。

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

8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

报告期内本基金投资的前十名股票中，不存在超出基金合同规定备选股票库的情形。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	364,395.90
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	364,395.90

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金 份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份 额比例 (%)	持有份额	占总 份额 比例 (%)
长信沪深 300 指数 A	4,611	53,538.33	188,024,619.25	76.16	58,840,610.01	23.84
长信沪深 300 指数 C	13,041	58,920.65	626,788,771.20	81.57	141,595,451.85	18.43
合计	17,652	57,514.70	814,813,390.45	80.26	200,436,061.86	19.74

注：对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基

金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	长信沪深 300 指数 A	355,891.97	0.14
	长信沪深 300 指数 C	151,174.06	0.02
	合计	507,066.03	0.05

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

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	长信沪深 300 指数 A	长信沪深 300 指数 C
基金合同生效日（2019 年 5 月 16 日）基金份额总额	997,837.56	-
本报告期期初基金份额总额	131,712,359.47	136,366,480.96
本报告期基金总申购份额	444,901,719.61	1,256,302,379.66
减：本报告期基金总赎回份额	329,748,849.82	624,284,637.57
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	246,865,229.26	768,384,223.05

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期末召开本基金的基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

11.2.1 基金管理人的重大人事变动

自 2025 年 1 月 24 日起，邓挺先生不再担任公司副总经理。

自 2025 年 4 月 18 日起，沈伟担任公司首席信息官。

上述重大人事变动情况，本基金管理人均已在规定信息披露媒介发布相关公告。

11.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金托管人无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略未改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金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 60,000.00 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、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

11.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期，基金管理人没有受监管部门调查或处罚的情形。

11.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期，基金管理人相关从业人员没有受监管部门调查或处罚的情形。

11.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人没有受到监管部门调查或处罚。

11.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人相关从业人员没有受到监管部门调查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	

长江证券	2	9,805,915,20 1.01	100.00	2,020,705.53	100.00	-
------	---	----------------------	--------	--------------	--------	---

注：1、本期租用证券公司交易单元的变更情况

本报告期内本基金租用证券公司交易单元没有变更。

2、专用交易单元的选择标准和程序

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

（1）选择标准：

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

（2）选择程序：

依照证券公司专用交易单元的选择标准，拟定备选证券公司，并根据公司要求提交准入评估报告，经证券公司准入审核流程审批通过后，签订相关协议。公司定期对各证券公司提供的服务质量进行综合评价。依照评价结果选择基金证券交易专用交易单元。

3、《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》自 2024 年 7 月 1 日起施行以来，本公司严格遵循法规及公司内部制度要求，未发现存在不符合法规及制度要求的情况。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

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

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	长信基金管理有限责任公司关于旗下基金持有的停牌股票调整估值方法的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2025-1-4
2	长信基金管理有限责任公司关于增加旗下部分开放式基金转换业务的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2025-1-10

3	长信沪深 300 指数增强型证券投资基金 2024 年第 4 季度报告	中国证监会电子披露网站、公司网站	2025-1-22
4	长信基金管理有限责任公司旗下全部基金 2024 年第四季度报告提示性公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2025-1-22
5	长信基金管理有限责任公司关于基金行业高级管理人员变更公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2025-1-25
6	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分指数基金指数使用费调整为基金管理人承担并修订基金合同的公告	上证报、证券时报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2025-3-20
7	长信沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同	中国证监会电子披露网站、公司网站	2025-3-20
8	长信沪深 300 指数增强型证券投资基金托管协议	中国证监会电子披露网站、公司网站	2025-3-20
9	长信沪深 300 指数增强型证券投资基金更新的招募说明书及基金产品资料概要（更新）	中国证监会电子披露网站、公司网站	2025-3-20
10	长信基金管理有限责任公司关于增加旗下部分开放式基金转换业务的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2025-3-21
11	长信沪深 300 指数增强型证券投资基金 2024 年年度报告	中国证监会电子披露网站、公司网站	2025-3-28
12	长信基金管理有限责任公司旗下全部基金 2024 年年度报告提示性公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2025-3-28
13	长信基金管理有限责任公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2024 年度）	中国证监会电子披露网站、公司网站	2025-3-31
14	长信基金管理有限责任公司关于基金行业高级管理人员变更公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2025-4-19
15	长信沪深 300 指数增强型证券投资基金 2025 年第 1 季度报告	中国证监会电子披露网站、公司网站	2025-4-22
16	长信基金管理有限责任公司旗下全部基金 2025 年第一季度报告提示性公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2025-4-22
17	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分基金参加招商银行费率优惠活动的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2025-4-26
18	长信基金管理有限责任公司关于旗下基金持有的停牌股票调整估值方法的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2025-6-6
19	长信沪深 300 指数增强型证券投资基金 2025 年第 2 季度报告	中国证监会电子披露网站、公司网站	2025-7-21
20	长信基金管理有限责任公司旗下全部基金 2025 年第二季度报告提示性公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、中国证监会电子	2025-7-21

		披露网站、公司网站	
21	长信沪深 300 指数增强型证券投资基金 2025 年中期报告	中国证监会电子披露网站、公司网站	2025-8-29
22	长信基金管理有限责任公司旗下全部基金 2025 年中期报告提示性公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2025-8-29
23	长信基金管理有限责任公司关于旗下基金持有的停牌股票调整估值方法的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2025-9-5
24	长信沪深 300 指数增强型证券投资基金 2025 年第 3 季度报告	中国证监会电子披露网站、公司网站	2025-10-28
25	长信基金管理有限责任公司旗下全部基金 2025 年第三季度报告提示性公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2025-10-28
26	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、中国证监会电子披露网站、公司网站	2025-11-18
27	长信基金管理有限责任公司关于增加中原证券股份有限公司为旗下部分开放式基金代销机构并开通转换、定期定额投资业务及参加申购（含定投申购）、转换费率优惠活动的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2025-11-20
28	长信沪深 300 指数增强型证券投资基金更新的招募说明书（2025 年第【1】号）及基金产品资料概要（更新）	中国证监会电子披露网站、公司网站	2025-11-28
29	长信基金管理有限责任公司关于增加贵州省贵文文化基金销售有限公司为旗下部分开放式基金代销机构并开通转换、定期定额投资业务及参加申购（含定投申购）、转换费率优惠活动的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2025-12-1
30	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的分红公告	证券时报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2025-12-19
31	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、中国证监会电子披露网站、公司网站	2025-12-19
32	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	2025-12-22

§ 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	2025 年 8 月 20 日至 2025 年 12 月 31 日	0.00	408,483,243.63	145,783,243.63	262,700,000.00	25.88
产品特有风险							
<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>							

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期未发生影响投资者决策的其他重要信息。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

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

13.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

13.3 查阅方式

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

长信基金管理有限责任公司

2026 年 3 月 30 日