长信沪深300指数增强型证券投资基金

（原长信量化价值精选混合型证券投资基金）

2019 第二季度 报告

2019年6月30日

基金管理人:长信基金管理有限责任公司
基金托管人:招商银行股份有限公司
报告送出日期:2019年7月18日

§1 重要提示

长信沪深300指数增强型证券投资基金应长信量化价值精选混合型证券投资基金转型而来。基金管理人于2019年4月25日起至2019年5月13日期间召开长信量化价值精选混合型证券投资基金分期持有人大会，审议《关于长信量化价值精选混合型证券投资基金变更投资范围、调整投资比例及相关配套人员变更人员变更的议案》，并以书面方式向基金份额持有人及代理人对本次会议议案表决通过，决议于2019年4月30日生效，自基金份额持有人大会决议生效公告之日（2019年5月16日）起，长信沪深300指数增强型证券投资基金基金合同生效，长信量化价值精选混合型证券投资基金基金合同于同日终止。

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人根据《证券投资基金托管业务管理办法》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号——托管人报告》的规定，对本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告期自2019年4月1日起至2019年6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	长信沪深300指数
基金主代码	519127
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年4月29日
报告期末基金份额总额	974,106.36亿
投资目标	本基金为增强型指数基金，通过严格的投资纪律严谨和数量风险控制手段，追求基金净值增长率与业绩比较基准之间的较稳定的超额收益，力争在控制风险的前提下，实现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精细化跟踪误差优化技术，在控制主动风险和基础指数风险的前提下，力争获得超越标的指数的超额收益。本基金将根据市场状况、指数成分股的流动性、市场规模、成交活跃度、估值水平、盈利能力、财务状况、成长性、公司治理结构、行业景气度、宏观经济、国家政策、投资者情绪、市场趋势等因素，对指数成分股进行定期调整，以期获得超额收益。本基金将根据市场状况、指数成分股的流动性、市场规模、成交活跃度、估值水平、盈利能力、财务状况、成长性、公司治理结构、行业景气度、宏观经济、国家政策、投资者情绪、市场趋势等因素，对指数成分股进行定期调整，以期获得超额收益。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×95%+银行活期存款税后利率×5%。
风险收益特征	本基金为增强型指数基金，其预期风险和预期收益高于被作为基准组合的指数基金，低于股票型基金。
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

注:上表中“报告期末”为2019年5月15日。

3.1 主要财务指标(转型日)

主要财务指标	报告期(2019年5月16日 — 2019年6月30日)
1.本期已实现收益	25,987.49
2.本期利润	37,189.42
3.加权平均基金份额本期利润	0.0278
4.期末基金资产净值	945,996.96
5.期末基金份额净值	0.9710

注:1.转型日的本基金期末份额总额为2019年5月16日,期末基金份额期末、本基金期末净值一个季度。
2.本期已实现收益为本基金期间总收入扣除费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
3.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用(例如,封闭式基金交易费用、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。

3.1 主要财务指标(转型前)

主要财务指标	报告期(2019年4月1日 — 2019年5月15日)
1.本期已实现收益	24,899.82
2.本期利润	-74,281.01
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0383
4.期末基金资产净值	942,266.00
5.期末基金份额净值	0.9463

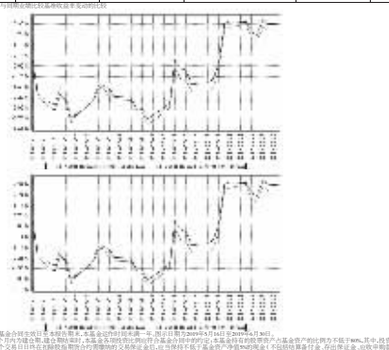
注:1.在长信量化价值精选混合型证券投资基金(其他投资)转型为长信沪深300指数增强型证券投资基金,金额单位:人民币元
2.本期已实现收益为本期基金投资收益、公允价值变动收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
3.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用(例如,封闭式基金交易费,开放式基金的申购赎回费,红利再投资费,基金转换费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 本期利润及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	净值增长率①	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	0.41%	1.08%	-0.54%	0.75%	0.95%	0.33%

	长信沪深300指数C					
阶段	净值增长率①	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	0.41%	1.08%	-0.54%	0.75%	0.95%	0.33%

3.2.2 份额净值以长期业绩计价情况长期业绩计价及相关比较基准收益率变动的比较



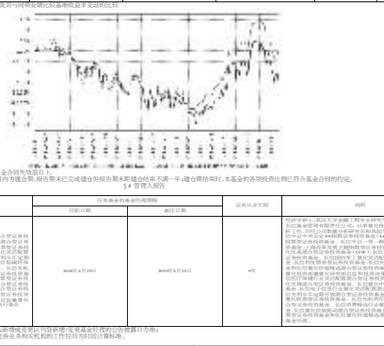
注:1.转型日的本基金合同生效日为2010年4月29日,基金合同生效日至报告期末一年,按长信基金管理有限责任公司旗下基金客户号(Account)计算。
2.根据合同规定,本基金日基金日持有现金资产的比例不低于基金资产净值的5%,每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于基金资产净值5%的现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或到期日在一年以内的政府债券。本基金持有的股票市值,在指数成分股范围内,股票市值与沪深300指数成分股市值之比,应当保持在90%-95%之间。

截至本报告期末,本基金尚未建仓。

3.2 基金净值表现(转型前)

阶段	净值增长率①	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
2019年4月1日—2019年5月15日(基金合同生效日)	-3.52%	1.48%	-2.87%	1.39%	-0.65%	0.29%

3.2.2 份额净值增长率与业绩比较基准收益率变动的比较



注:1.图示日期为2010年4月29日至2019年5月15日(基金合同生效日)。
2.根据合同规定,本基金日基金日持有现金资产的比例不低于基金资产净值的5%。

§4 管理人报告

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
赵宏宇	长信沪深300指数增强型证券投资基金、长信量化价值精选混合型证券投资基金、长信量化先锋混合型证券投资基金、长信金利趋势灵活配置混合型证券投资基金、长信利率债债券型证券投资基金、长信利率债债券A型证券投资基金、长信利率债债券C型证券投资基金、长信利率债债券E型证券投资基金、长信利率债债券H型证券投资基金、长信利率债债券Y型证券投资基金、长信利率债债券Z型证券投资基金、长信利率债债券F型证券投资基金、长信利率债债券I型证券投资基金、长信利率债债券J型证券投资基金、长信利率债债券K型证券投资基金、长信利率债债券L型证券投资基金、长信利率债债券M型证券投资基金、长信利率债债券N型证券投资基金、长信利率债债券O型证券投资基金、长信利率债债券P型证券投资基金、长信利率债债券Q型证券投资基金、长信利率债债券R型证券投资基金、长信利率债债券S型证券投资基金、长信利率债债券T型证券投资基金、长信利率债债券U型证券投资基金、长信利率债债券V型证券投资基金、长信利率债债券W型证券投资基金、长信利率债债券X