

# 长信金利趋势混合型证券投资基金 2023 年年度报告

2023 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：上海浦东发展银行股份有限公司

送出日期：2024 年 3 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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 3 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 2023 年 12 月 31 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>5</b>
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
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>6</b>
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
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>11</b>
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 .....	16
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
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>16</b>
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 .....	17
<b>§ 6 审计报告</b> .....	<b>17</b>
6.1 审计报告基本信息 .....	17
6.2 审计报告的基本内容 .....	17
<b>§ 7 年度财务报表</b> .....	<b>19</b>
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
<b>§ 8 投资组合报告</b> .....	<b>52</b>

8.1 期末基金资产组合情况 .....	52
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	53
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 .....	53
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	56
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	59
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 .....	60
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 .....	60
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 .....	60
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 .....	60
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	60
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	60
8.12 投资组合报告附注 .....	60
<b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>61</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	61
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	61
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 .....	62
<b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>62</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>62</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	62
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 .....	62
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	63
11.4 基金投资策略的改变 .....	63
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	63
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	63
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	63
11.8 其他重大事件 .....	64
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>66</b>
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 .....	66
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	67
<b>§ 13 备查文件目录 .....</b>	<b>67</b>
13.1 备查文件目录 .....	67
13.2 存放地点 .....	67
13.3 查阅方式 .....	67

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	长信金利趋势混合型证券投资基金	
基金简称	长信金利趋势混合	
场内简称	长信金利	
基金主代码	519994	
前端交易代码	519995	
后端交易代码	519994	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2006 年 4 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	上海浦东发展银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	14,552,896,029.34 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	长信金利趋势混合 A	长信金利趋势混合 C
下属分级基金的交易代码	519994	015039
报告期末下属分级基金的份额总额	11,176,217,470.36 份	3,376,678,558.98 份

#### 基金产品说明

投资目标	本基金在有效控制风险的前提下精选受益于城市化、工业化和老龄化各个中国趋势点的持续增长的上市公司股票主动投资，谋求基金资产的长期稳定增值。本基金选择投资的上市公司股票包括价值股和成长股，股票选择是基于中国趋势点分析、品质分析和持续增长分析等方面的深入分析论证。
投资策略	本基金采用“自上而下”的主动投资管理策略，在充分研判中国经济增长趋势、中国趋势点和资本市场发展趋势的基础上，深入研究受益于中国趋势点的持续增长的上市公司证券，以期在风险可控的前提下实现投资组合的长期增值。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率*80%+中债综合指数收益率*20%
风险收益特征	本基金为混合型基金，属于中等风险、中等收益的基金品种，其预期风险和预期收益高于债券基金和货币市场基金，低于股票型基金。

### 2.2

### 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	上海浦东发展银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	周永刚	朱萍
	联系电话	021-61009999	021-31888888
	电子邮箱	zhouyg@cxfund.com.cn	zhup02@spdb.com.cn
客户服务电话		4007005566	95528
传真		021-61009800	021-63602540
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区银	上海市中山东一路 12 号

	城中路 68 号 9 楼	
办公地址	上海市浦东新区银城中路 68 号 9 楼、37 楼、38 楼	上海市博成路 1388 号浦银中心 A 栋
邮政编码	200120	200126
法定代表人	刘元瑞	张为忠

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
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，上海市中山东一路 12 号

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市浦东新区世纪大道 100 号 50 楼
注册登记机构	A 类份额：中国证券登记结算有限责任公司；C 类份额：长信基金管理有限责任公司	A 类份额：北京市西城区太平桥大街 17 号；C 类份额：中国（上海）自由贸易试验区银城中路 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

	2023 年		2022 年	2022 年 2 月 15 日 (基金份额增加日)-2022 年 12 月 31 日	2021 年	长信金利趋势混合 C
	长信金利趋势混合 A	长信金利趋势混合 C	长信金利趋势混合 A	长信金利趋势混合 C	长信金利趋势混合 A	
3.1.1 期间数据和指标						
本期已实现收益	-423,755,784.90	-139,123,815.63	-581,131,084.62	-103,297,960.70	578,580,335.71	-
本期利息	-372,863,214.00	-124,511,069.82	-765,771,663.36	-122,930,880.17	457,778,039.05	-

润						
加权平均基金份额本期利润	-0.0341	-0.0346	-0.0902	-0.0626	0.1959	-
本期加权平均净值利润率	-8.15%	-8.27%	-18.44%	-13.53%	28.82%	-
本期基金份额净值增长率	-7.99%	-8.55%	-14.99%	-6.02%	35.13%	-
3.1.2 期末数据和指标	2023 年末		2022 年末		2021 年末	
期末可供分配利润	-306,840,298.79	-98,219,722.86	193,989,388.35	62,201,269.81	873,939,093.58	-
期末可供分配基金份额利润	-0.0275	-0.0291	0.0191	0.0178	0.3096	-
期末基金资产净值	4,301,879,931.13	1,294,253,611.83	4,388,622,195.55	1,503,002,458.54	2,094,731,607.86	-
期末基金份额净值	0.3849	0.3833	0.4314	0.4302	0.7421	-
3.1.3 累计期末指标	2023 年末		2022 年末		2021 年末	
基金份额累计净值增长率	439.32%	-14.05%	486.18%	-6.02%	589.52%	-

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

长信金利趋势混合 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	-3.36%	0.79%	-4.95%	0.63%	1.59%	0.16%
过去六个月	-8.66%	0.80%	-8.19%	0.66%	-0.47%	0.14%
过去一年	-7.99%	0.80%	-7.89%	0.65%	-0.10%	0.15%
过去三年	5.69%	1.14%	-22.49%	0.81%	28.18%	0.33%
过去五年	132.75%	1.21%	0.83%	0.82%	131.92%	0.39%
自基金合同生效 起至今	439.32%	1.61%	88.53%	1.08%	350.79%	0.53%

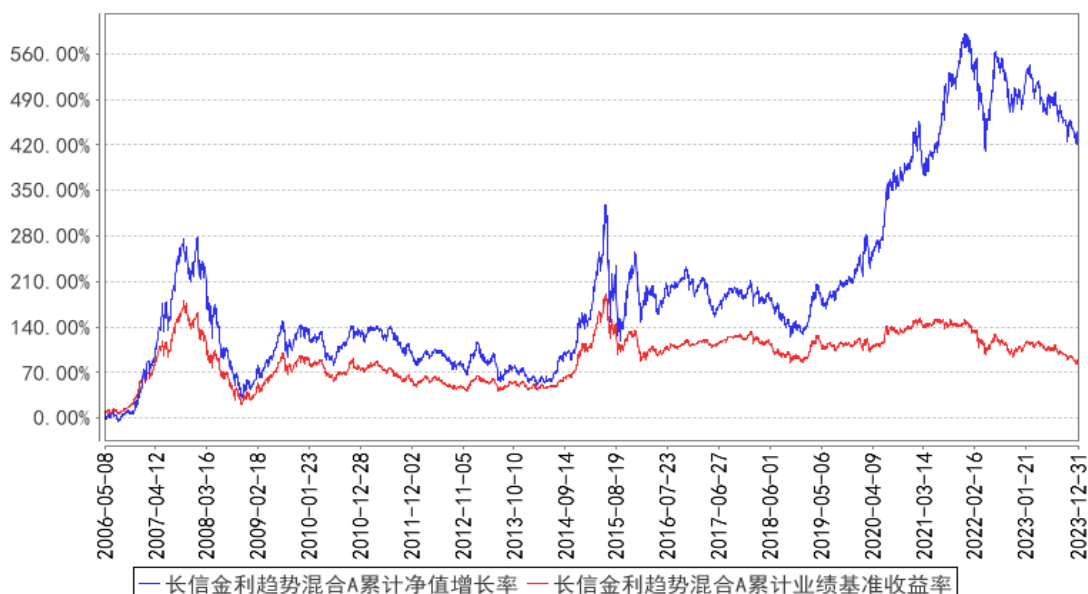
长信金利趋势混合 C

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	-3.52%	0.79%	-4.95%	0.63%	1.43%	0.16%
过去六个月	-8.93%	0.80%	-8.19%	0.66%	-0.74%	0.14%
过去一年	-8.55%	0.80%	-7.89%	0.65%	-0.66%	0.15%
自份额增加日起 至今	-14.05%	1.06%	-18.36%	0.85%	4.31%	0.21%

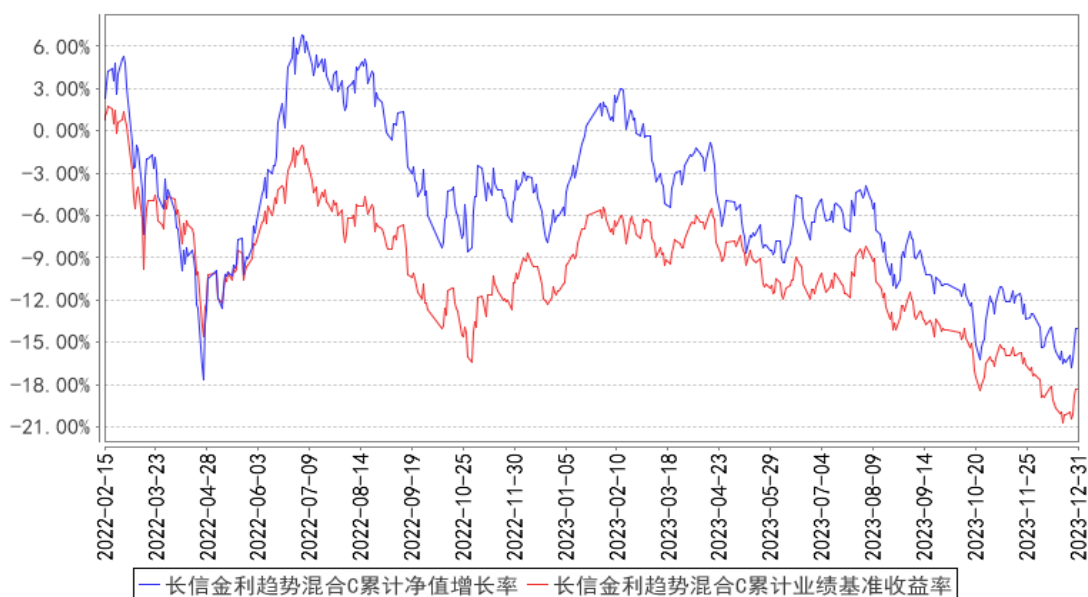


### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

长信金利趋势混合A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



长信金利趋势混合C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



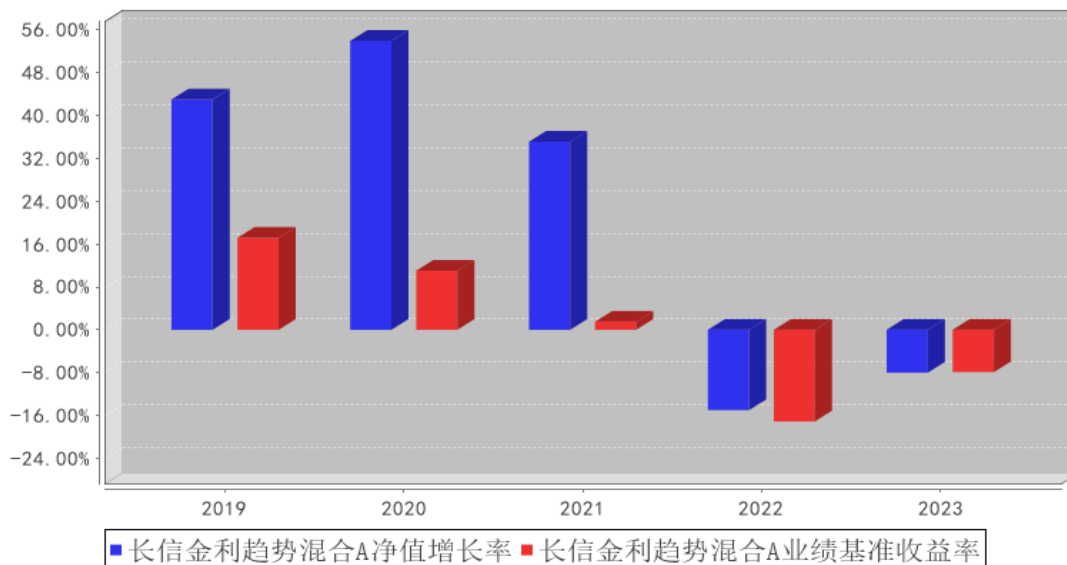
注：1、基金管理人自 2022 年 2 月 15 日起对长信金利趋势混合型证券投资基金进行份额分类，原有基金份额为 A 类份额，增设 C 类份额。

2、长信金利趋势混合 A 图示日期为 2006 年 4 月 30 日至 2023 年 12 月 31 日，长信金利趋势混合 C 图示日期为 2022 年 2 月 15 日（份额增加日）至 2023 年 12 月 31 日。

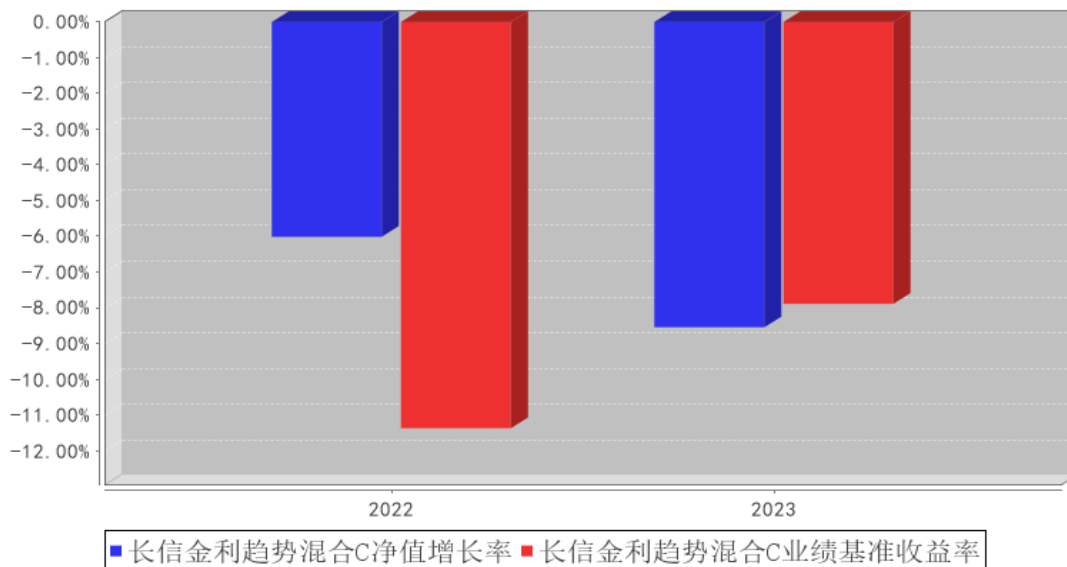
3、按基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起 6 个月内为建仓期；建仓期结束时，本基金的各项投资比例已符合基金合同的约定。

### 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

长信金利趋势混合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



长信金利趋势混合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



注：长信金利趋势混合 C 图示份额计算期间为自份额增加日 2022 年 2 月 15 日至 2023 年 12 月 31 日，2022 年净值增长率按长信金利趋势混合 C 份额实际存续期计算。

长信金利趋势混合 A 份额过去五年计算期间为 2019 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

长信金利趋势混合 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

2023 年	0.130	74,799,801.64	46,001,730.81	120,801,532.45	-
2022 年	1.740	1,032,338,897.21	287,048,696.87	1,319,387,594.08	-
2021 年	2.200	340,386,205.98	194,593,764.09	534,979,970.07	-
合计	4.070	1,447,524,904.83	527,644,191.77	1,975,169,096.60	-

长信金利趋势混合 C

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
2023 年	0.110	18,858,856.36	13,869,734.07	32,728,590.43	-
2022 年	1.730	205,279,197.84	15,622,371.69	220,901,569.53	-
合计	1.840	224,138,054.20	29,492,105.76	253,630,159.96	-

注：本基金本报告期的利润分配情况，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 2023 年 12 月 31 日，本基金管理人共管理 90 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、长信双利优选混合型证券投资基金、长信富瑞两年定期开放债券型证券投资基金、长信颐天平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）、长信易进混合型证券投资基金、长信先锐混合型证券投资基金、长信稳健精选混合型证券投资基金、长信浦瑞 87 个月定期开放债券型证券投资基金、长信消费升级混合型证券投资基金、长信企业优选一年持有期灵活配置混合型证券投资基金、长信稳健均衡 6 个月持有期混合型证券投资基金、长信优质企业混合型证券投资基金、长信内需均衡混合型证券投资基金、长信 30 天滚动持有短债债券型证券投资基金、长信稳惠债券型证券投资基金、长信稳丰债券型证券投资基金、长信先进装备三个月持有期混合型证券投资基金、长信颐和平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）、长信颐年平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）、长信稳健增长一年持有期混合型证券投资基金、长信稳健成长混合型证券投资基金、长信企业成长三年持有期混合型证券投资基金、长信稳兴三个月定期开放债券型证券投资基金、长信稳航 30 天持有期中短债债券型证券投资基金、长信稳恒债券型证券投资基金、长信中证科创创业 50 指数增强型证券投资基金、长信均衡策略一年持有期混合型证券投资基金、长信中证 1000 指数增强型证券投资基金、长信均衡优选混合型证券投资基金、长信 90 天滚动持有债券型证券投资基金、长信稳固 60 天滚动持有债券型证券投资基金、长信汇智量化选股混合型证券投资基金、长信 120 天滚动持有债券型证券投资基金、长信中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金。

#### 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		
高远	长信金利趋势混合型证券投资基金、长信均衡策略一年持有期混合型证券投资基金和长信均衡优选混合型证券投资基金的基金经理、研究发展部总监	2018年8月31日	-	13年	复旦大学经济学博士，具有基金从业资格，中国国籍。2014年加入长信基金管理有限责任公司，历任长信银利精选混合型证券投资基金的基金经理，现任研究发展部总监、长信金利趋势混合型证券投资基金、长信均衡策略一年持有期混合型证券投资基金和长信均衡优选混合型证券投资基金的基金经理。

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

2、证券从业的含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作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门的总监及监察稽核部总监。对于以公司名义进行申购的投资对象，公司在获配额度确定后，严格按照价格优先的原则在各投资组合间进行分配。申购价格相同的投资组合则根据投资指令的数量按比例进行分配。确因特殊原因不能按照上述原则进行分配的，应启动异常交易识别流程，审核通过的，可以进行相应分配。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，除完全按照有关指数的构成比例进行投资的组合外，其余各投资组合未发生参与交易所公开竞价同日反向交易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

整体看，2023 年 A 股市场呈现调整的走势，期间上证指数收益率为-3.7%，沪深 300 指数收益率为-11.38%，中小板指数收益率为-17.98%，创业板指数收益率为-19.41%。2023 年本基金股

票持仓比例保持较高仓位。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2023 年 12 月 31 日,长信金利趋势混合 A 基金份额净值为 0.3849 元,份额累计净值为 3.6415 元,本报告期内长信金利趋势混合 A 净值增长率为-7.99%;长信金利趋势混合 C 基金份额净值为 0.3833 元,份额累计净值为 0.5673 元,本报告期内长信金利趋势混合 C 净值增长率为-8.55%,同期业绩比较基准收益率为-7.89%。

#### 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 2024 年,我们认为:

- 1) 从外部环境来看,美联储将从加息周期逐步转入降息周期,会打开我们的货币政策空间。
- 2) 可以期待财政发力。
- 3) 全年维度来看,我们认为在经济预期的拐点发生之前,成长风格或占优。对经济的预期提升之后,与经济关联度高的价值风格将可能会有一定弹性,会迎来业绩预期和估值的双重修复。过去几年表现较好的红利风格,高股息率持续性强的标的可能仍然会有机会。

我们对市场的中期表现保持偏乐观态度。今年我们会优选有中长期逻辑,估值合理,业绩靠谱度高的标的。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

本年度内,为确保监管要求的有效实施,公司监察稽核部根据各项法律法规监管政策性要求以及公司内部控制执行情况,积极开展公司业务流程及风险梳理的工作,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、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 2023 年 5 月 23 日进行了利润分配，A 类份额每 10 份基金份额派发红利 0.130 元，C 类份额每 10 份基金份额派发红利 0.110 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

本报告期内，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对长信金利趋势混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《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、托管协议的规定，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

本报告期内，本托管人依照《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、托管协议的规定，对长信金利趋势混合型证券投资基金的投资运作进行了监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支以及利润分配等方面进行了认真的



复核，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

### 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

本报告期内，由长信基金管理有限责任公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

## § 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（2024）审字第 70031471_B20 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	长信金利趋势混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了长信金利趋势混合型证券投资基金的财务报表，包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表，2023 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的长信金利趋势混合型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了长信金利趋势混合型证券投资基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于长信金利趋势混合型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	—
其他事项	—
其他信息	长信金利趋势混合型证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。 我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。 结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。
管理层和治理层对财务报表的责任	管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其真实公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财

	<p>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金利趋势混合型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），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金利趋势混合型证券投资基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<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，就可能对长信金利趋势混合型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致长信金利趋势混合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>
<p>会计师事务所的名称</p>	<p>安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）</p>
<p>注册会计师的姓名</p>	<p>王珊珊   骆文慧</p>
<p>会计师事务所的地址</p>	<p>北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层</p>
<p>审计报告日期</p>	<p>2024年3月27日</p>

## § 7 年度财务报表

## 7.1 资产负债表

会计主体：长信金利趋势混合型证券投资基金

报告截止日：2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	7.4.7.1	787,960,186.87	262,518,113.04
结算备付金		-	230,126,076.34
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	4,836,983,049.36	5,371,579,341.02
其中：股票投资		4,834,051,037.04	5,108,383,831.13
基金投资		-	-
债券投资		2,932,012.32	263,195,509.89
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		217,770.09	79,935,149.23
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	-
资产总计		5,625,161,006.32	5,944,158,679.63
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2022 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
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		21,308,959.67	42,857,535.61

应付管理人报酬		5,693,547.67	7,429,365.58
应付托管费		948,924.63	1,238,227.59
应付销售服务费		657,655.14	647,559.08
应付投资顾问费		-	-
应交税费		12.16	198.69
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	418,364.09	361,138.99
负债合计		29,027,463.36	52,534,025.54
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.10	6,001,193,564.61	5,635,433,995.93
未分配利润	7.4.7.12	-405,060,021.65	256,190,658.16
净资产合计		5,596,133,542.96	5,891,624,654.09
负债和净资产总计		5,625,161,006.32	5,944,158,679.63

注：1、报告截止日 2023 年 12 月 31 日，长信金利趋势混合 A 份额净值 0.3849 元，长信金利趋势混合 C 份额净值 0.3833 元，基金份额总额为 14,552,896,029.34 份，其中长信金利趋势混合 A 份额 11,176,217,470.36 份。长信金利趋势混合 C 份额 3,376,678,558.98 份。

2、货币资金本期末余额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：长信金利趋势混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		-388,784,350.12	-797,673,402.62
1. 利息收入		2,486,323.70	2,153,818.73
其中：存款利息收入	7.4.7.13	2,486,323.70	2,153,818.73
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）		-458,775,947.71	-598,728,812.46
其中：股票投资收益	7.4.7.14	-534,435,425.35	-641,253,876.28
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	-70,960.85	4,221,035.62
资产支持证券投	7.4.7.16	-	-

资收益			
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-	-
股利收益	7.4.7.19	75,730,438.49	38,304,028.20
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	65,505,316.71	-204,273,498.21
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	1,999,957.18	3,175,089.32
<b>减：二、营业总支出</b>		108,589,933.70	91,029,140.91
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	85,098,675.18	73,728,777.49
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	14,183,112.63	12,288,129.61
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	9,047,137.54	4,746,611.25
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		54.39	127.85
8. 其他费用	7.4.7.23	260,953.96	265,494.71
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-497,374,283.82	-888,702,543.53
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-497,374,283.82	-888,702,543.53
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-497,374,283.82	-888,702,543.53

### 7.3 净资产变动表

会计主体：长信金利趋势混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 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	5,635,433,995.93	-	256,190,658.16	5,891,624,654.09
二、本期期初净	5,635,433,995.93	-	256,190,658.16	5,891,624,654.09

资产				
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	365,759,568.68	-	-661,250,679.81	-295,491,111.13
(一)、综合收益总额	-	-	-497,374,283.82	-497,374,283.82
(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)	365,759,568.68	-	-10,346,273.11	355,413,295.57
其中：1.基金申购款	3,056,625,032.71	-	80,885,163.60	3,137,510,196.31
2.基金赎回款	-2,690,865,464.03	-	-91,231,436.71	-2,782,096,900.74
(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)	-	-	-153,530,122.88	-153,530,122.88
四、本期期末净资产	6,001,193,564.61	-	-405,060,021.65	5,596,133,542.96
项目	上年度可比期间			
	2022年1月1日至2022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	1,163,960,742.47	-	930,770,865.39	2,094,731,607.86
二、本期期初净资产	1,163,960,742.47	-	930,770,865.39	2,094,731,607.86
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	4,471,473,253.46	-	-674,580,207.23	3,796,893,046.23
(一)、综合收益总额	-	-	-888,702,543.53	-888,702,543.53
(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)	4,471,473,253.46	-	1,754,411,499.91	6,225,884,753.37
其中：1.基金申购款	6,222,371,375.04	-	1,978,145,555.33	8,200,516,930.37
2.基金赎回款	-1,750,898,121.58	-	-223,734,055.42	-1,974,632,177.00

回款				
(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)	-	-	-1,540,289,163.61	-1,540,289,163.61
四、本期期末净资产	5,635,433,995.93	-	256,190,658.16	5,891,624,654.09

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：

<u>刘元瑞</u>	<u>覃波</u>	<u>孙红辉</u>
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

长信金利趋势混合型证券投资基金(以下简称“本基金”),系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2005]168号文《关于同意长信金利趋势价值股票型证券投资基金募集申请的批复》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2006年4月30日正式生效,首次设立募集规模为613,254,516.24份基金份额。本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人为长信基金管理有限责任公司,注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司,基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

根据自2014年8月8日起实施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》的有关规定,经与基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司协商一致,并报中国证监会备案,自2015年8月7日起本基金更名为长信金利趋势混合型证券投资基金。经本基金的基金管理人和基金托管人协商一致,并报中国证监会备案后,自2022年2月15日起对本基金进行份额分类,原有基金份额归为A类份额,A类基金份额的登记机构为中国证券登记结算有限责任公司,同时增设C类份额,C类基金份额的登记机构为长信基金管理有限责任公司。

注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司,且收取申购费用而不计提销售服务费,在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额,称为A类基金份额;注册登记机构为长信基金管理有限责任公司,且投资者申购基金份额时不收取申购费用而是从本类别基金资产中计提销售服务费,在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额,称为C类基金份额。

本基金的投资范围为:具有良好流动性的金融工具,包括国内依法公开发行、上市的股票、

存托凭证、债券以及中国证监会允许基金投资的其它金融工具。其中债券包括国债、金融债、公司债券、企业债券、可转换债券等。

本基金投资组合的比例范围为：股票类资产投资比例为 60-95%，债券类资产投资比例为 0-35%，货币市场工具投资比例为 5-15%。

本基金业绩比较基准为：中证 800 指数收益率×80%+中债综合指数收益率×20%。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《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 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 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）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

#### 7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按

协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 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) 基金收益分配比例按有关规定制定；

(2) 本基金每年收益分配次数最多为 6 次，年度收益分配比例不低于基金年度已实现收益的 80%；

(3) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利按除息日的基金份额净值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) 基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配；

(5) 基金当年收益应先弥补上一年度亏损后，才可进行当年收益分配；

(6)在符合有关基金分红条件的前提下,本基金收益每年至少分配一次,但若成立不满 3 个月则不进行收益分配;

(7)基金收益分配后各类基金份额的份额净值不能低于面值;

(8)同一类别每一基金份额享有同等分配权;

(9)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;

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题

的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

#### **7.4.6.2 增值税**

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

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

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，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。

#### **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事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

#### **7.4.6.4 企业所得税**

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

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

#### 7.4.6.5 个人所得税

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

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

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；

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

### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
活期存款	70,210,937.45	262,518,113.04
等于：本金	70,188,411.23	262,492,316.00
加：应计利息	22,526.22	25,797.04

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	717,749,249.42	-
等于：本金	717,704,193.60	-
加：应计利息	45,055.82	-
减：坏账准备	-	-
合计	787,960,186.87	262,518,113.04

注：其他存款本期末余额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 2023 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	4,801,891,353.86	-	4,834,051,037.04	32,159,683.18
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	1,777.92	2,932,012.32	152,234.40
	银行间市场	-	-	-
	合计	1,777.92	2,932,012.32	152,234.40
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	4,804,669,353.86	1,777.92	4,836,983,049.36	32,311,917.58
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	5,140,932,395.33	-	5,108,383,831.13	-32,548,564.20
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	55,187.32	27,946,526.32	-298,614.93
	银行间市场	5,112,983.57	235,248,983.57	-346,220.00
	合计	5,168,170.89	263,195,509.89	-644,834.93
资产支持证券	-	-	-	-



基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	5,399,604,569.26	5,168,170.89	5,371,579,341.02	-33,193,399.13

#### 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无衍生金融资产/负债余额。

#### 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 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	79,064.09	11,838.99
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	-	-

预提账户维护费	9,300.00	9,300.00
预提审计费	90,000.00	100,000.00
预提信息披露费	240,000.00	240,000.00
合计	418,364.09	361,138.99

注：应付赎回费中含应付转出费。

#### 7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

##### 长信金利趋势混合 A

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	10,172,100,388.19	4,194,632,807.20
本期申购	4,648,630,623.00	1,916,965,978.41
本期赎回（以“-”号填列）	-3,644,513,540.83	-1,502,878,555.69
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	11,176,217,470.36	4,608,720,229.92

##### 长信金利趋势混合 C

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	3,493,764,108.34	1,440,801,188.73
本期申购	2,763,651,595.97	1,139,659,054.30
本期赎回（以“-”号填列）	-2,880,737,145.33	-1,187,986,908.34
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	3,376,678,558.98	1,392,473,334.69

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

##### 长信金利趋势混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	553,389,289.16	-359,399,900.81	193,989,388.35
本期期初	553,389,289.16	-359,399,900.81	193,989,388.35

本期利润	-423,755,784.90	50,892,570.90	-372,863,214.00
本期基金份额交易产生的变动数	41,485,489.41	-48,650,430.10	-7,164,940.69
其中：基金申购款	202,555,586.07	-152,836,875.34	49,718,710.73
基金赎回款	-161,070,096.66	104,186,445.24	-56,883,651.42
本期已分配利润	-120,801,532.45	-	-120,801,532.45
本期末	50,317,461.22	-357,157,760.01	-306,840,298.79

## 长信金利趋势混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	99,737,379.95	-37,536,110.14	62,201,269.81
本期期初	99,737,379.95	-37,536,110.14	62,201,269.81
本期利润	-139,123,815.63	14,612,745.81	-124,511,069.82
本期基金份额交易产生的变动数	-1,385,292.53	-1,796,039.89	-3,181,332.42
其中：基金申购款	49,856,035.44	-18,689,582.57	31,166,452.87
基金赎回款	-51,241,327.97	16,893,542.68	-34,347,785.29
本期已分配利润	-32,728,590.43	-	-32,728,590.43
本期末	-73,500,318.64	-24,719,404.22	-98,219,722.86

## 7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
活期存款利息收入	837,628.17	1,293,974.96
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	1,599,201.45	-
结算备付金利息收入	-	676,490.27
其他	49,494.08	183,353.50
合计	2,486,323.70	2,153,818.73

注：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	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
卖出股票成交总额	26,541,338,724.40	22,139,183,384.42
减：卖出股票成本总额	27,010,542,283.86	22,718,417,650.29
减：交易费用	65,231,865.89	62,019,610.41
买卖股票差价收入	-534,435,425.35	-641,253,876.28

#### 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 2023年1月1日至2023 年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31 日
债券投资收益——利息收入	474,706.99	3,814,303.16
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-545,667.84	406,732.46
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	-70,960.85	4,221,035.62

##### 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 2023年1月1日至2023年12月31 日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	293,769,637.17	1,925,659.12
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	288,672,173.93	1,517,200.00
减：应计利息总额	5,641,552.98	796.69
减：交易费用	1,578.10	929.97
买卖债券差价收入	-545,667.84	406,732.46

##### 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衍生工具收益。

##### 7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益。

#### 7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023 年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月 31日
股票投资产生的股利收益	75,730,438.49	38,304,028.20
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	75,730,438.49	38,304,028.20

#### 7.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年1月1日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022 年12月31日
1. 交易性金融资产	65,505,316.71	-204,273,498.21
股票投资	64,708,247.38	-203,291,183.28
债券投资	797,069.33	-982,314.93
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	65,505,316.71	-204,273,498.21

#### 7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月 31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022 年12月31日
基金赎回费收入	1,953,900.51	2,950,972.36
基金转换费收入	46,056.67	224,116.96
合计	1,999,957.18	3,175,089.32

注：本基金的赎回费用在投资人赎回本基金份额时收取，其中对持续持有期少于 7 日的 A 类基金份额的投资者收取的赎回费应全额计入基金财产，其余赎回费扣除注册登记费和其他手续费后的余额为赎回费总额的 25%，归入基金财产。对于持续持有期少于 30 日的 C 类基金份额的赎回费全部归基金财产。

#### 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
审计费用	90,000.00	100,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
账户维护费	37,200.00	37,200.00
其他	13,753.96	8,294.71
合计	260,953.96	265,494.71

注：其他费用为银行手续费。

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金未发生需要披露的资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
长信基金管理有限责任公司(以下简称“长信基金”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
上海浦东发展银行股份有限公司(以下简称“浦发银行”)	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 2023年1月1日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022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	21,715,153,074.66	40.81	15,451,099,302.76	32.01

###### 7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的 比例（%）	成交金额	占当期债券 成交总额的 比例（%）
长江证券	30,000,000.00	51.55	28,209,328.20	93.61

###### 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均未通过关联方交易单元进行回购交易。

###### 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 2023年1月1日至2023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	15,880,662.66	40.84	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022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	13,331,862.66	37.17	-	-

注：上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算

有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	85,098,675.18	73,728,777.49
其中：应支付销售机构的客户维护费	10,437,837.65	10,171,523.73
应支付基金管理人的净管理费	74,660,837.53	63,557,253.76

注：1、根据《长信基金管理有限责任公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告》，自2023年8月28日起，本基金的年管理费率由1.50%年费率调整为1.20%年费率。支付基金管理人的基金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。

2、其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值×管理费率/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
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	14,183,112.63	12,288,129.61

注：1、根据《长信基金管理有限责任公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告》，自2023年8月28日起，本基金的基金托管费由0.25%年费率调整为0.20%年费率。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。

2、其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值×托管费率/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		
	2023年1月1日至2023年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	长信金利趋势混合A	长信金利趋势混合C	合计
长信基金	-	7,345,263.74	7,345,263.74



长江证券	-	127,425.72	127,425.72
合计	-	7,472,689.46	7,472,689.46
获得销售服务费的各关联方 名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	长信金利趋势混合 A	长信金利趋势混合 C	合计
长信基金	-	3,340,645.66	3,340,645.66
长江证券	-	102,434.18	102,434.18
合计	-	3,443,079.84	3,443,079.84

注：自 2022 年 2 月 15 日起，本基金增加收取销售服务费的 C 类份额。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 0.60%。销售服务费的计算方法如下：

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

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

销售服务费每日计提，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

单位：人民币元

本期 2023年1月1日至2023年12月31日						
银行间市场交易的 各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
浦发银行	-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日						
银行间市场交易的 各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
浦发银行	30,379,364.79	-	-	-	-	-

#### 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无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。

##### 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	长信金利趋势混合 A	长信金利趋势混合 C
基金合同生效日（2006 年 4 月 30 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	958,680.97	-
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	958,680.97	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.01%	-
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 2 月 15 日（基金份额增加日）至 2022 年 12 月 31 日
	长信金利趋势混合 A	长信金利趋势混合 C
基金合同生效日（2006 年 4 月 30 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	958,680.97	-
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	958,680.97	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.01%	-

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年末及上年度末均未持有本基金。

## 7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月 31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022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
浦发银行	70,210,937.45	837,628.17	262,518,113.04	1,293,974.96

#### 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证券交易结算资金余额为人民币 115,717,039.34 元（2022 年：人民币 15,966.93 元）；本报告期存放于长江证券的证券交易结算资金产生的利息收入为人民币 406,883.60 元（2022 年：人民币 94,481.92 元）。

#### 7.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

长信金利趋势混合 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	2023 年 5 月 23 日	-	2023 年 5 月 23 日	0.130	74,799,80 1.64	46,001,730 .81	120,801,5 32.45	-
合计	-	-	-	0.130	74,799,80 1.64	46,001,730 .81	120,801,5 32.45	-
长信金利趋势混合 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	2023 年 5 月 23 日	-	2023 年 5 月 23 日	0.110	18,858,85 6.36	13,869,734 .07	32,728,59 0.43	-
合计	-	-	-	0.110	18,858,85 6.36	13,869,734 .07	32,728,59 0.43	-

#### 7.4.12 期末（2023 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
001378	德冠新	2023 年	6 个月	新股限	31.68	31.27	205	6,494.40	6,410.35	-

	材	10月23日		售							
301210	金杨股份	2023年6月21日	6个月	新股限售	57.88	45.48	281	16,264.28	12,779.88		-
301261	恒工精密	2023年6月29日	6个月	新股限售	36.90	50.85	198	7,306.20	10,068.30		-
301291	明阳电气	2023年6月21日	6个月	新股限售	38.13	28.36	1,206	45,984.78	34,202.16		-
301370	国科恒泰	2023年7月3日	6个月	新股限售	13.39	16.01	1,240	16,603.60	19,852.40		-
301395	仁信新材	2023年6月21日	6个月	新股限售	26.68	18.69	520	13,873.60	9,718.80		-
301515	港通医疗	2023年7月13日	6个月	新股限售	31.16	28.27	230	7,166.80	6,502.10		-
301518	长华化学	2023年7月26日	6个月	新股限售	25.75	23.01	385	9,913.75	8,858.85		-
301525	儒竞科技	2023年8月23日	6个月	新股限售	99.57	81.46	266	26,485.62	21,668.36		-
603062	麦加芯彩	2023年10月31日	6个月	新股限售	58.08	57.81	126	7,318.08	7,284.06		-
603273	天元智能	2023年10月16日	6个月	新股限售	9.50	18.97	178	1,691.00	3,376.66		-
603276	恒兴新材	2023年9月18日	6个月	新股限售	25.73	24.88	134	3,447.82	3,333.92		-
688603	天承科技	2023年6月30日	6个月	新股限售	55.00	74.14	140	7,700.00	10,379.60		-
688610	埃科光电	2023年7月10日	6个月	新股限售	73.33	51.00	275	20,165.75	14,025.00		-
688716	中研股份	2023年9月13日	6个月	新股限售	29.66	36.39	267	7,919.22	9,716.13		-

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 12 月 31 日止, 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

截至本报告期末 2023 年 12 月 31 日止, 本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

#### 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上海浦东发展银行股份有限公司，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

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	-	153,031,931.51
合计	-	153,031,931.51

注：未评级债券为国债、央行票据、政策性金融债及超短期融资券等无信用评级债券。

#### 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

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	2,932,012.32	27,946,526.32
未评级	-	82,217,052.06
合计	2,932,012.32	110,163,578.38

注：未评级债券为国债、央行票据及政策性金融债等无信用评级债券。

#### 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、存出保证金及债券投资等。

###### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023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	787,960,186.87	-	-	-	-	787,960,186.87

交易性金融资产	-2,932,012.32	-	-	-4,834,051,037.04	4,836,983,049.36	
应收申购款	-	-	-	217,770.09	217,770.09	
资产总计	787,960,186.87	2,932,012.32	-	-4,834,268,807.13	5,625,161,006.32	
负债						
应付赎回款	-	-	-	21,308,959.67	21,308,959.67	
应付管理人报酬	-	-	-	5,693,547.67	5,693,547.67	
应付托管费	-	-	-	948,924.63	948,924.63	
应付销售服务费	-	-	-	657,655.14	657,655.14	
应交税费	-	-	-	12.16	12.16	
其他负债	-	-	-	418,364.09	418,364.09	
负债总计	-	-	-	29,027,463.36	29,027,463.36	
利率敏感度缺口	787,960,186.87	2,932,012.32	-	-4,805,241,343.77	5,596,133,542.96	
上年度末 2022 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	262,518,113.04	-	-	-	-	262,518,113.04
结算备付金	230,126,076.34	-	-	-	-	230,126,076.34
交易性金融资产	263,195,509.89	-	-	-	-5,108,383,831.13	5,371,579,341.02
应收申购款	78,000,994.04	-	-	-	1,934,155.19	79,935,149.23
资产总计	833,840,693.31	-	-	-	-5,110,317,986.32	5,944,158,679.63
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	42,857,535.61	42,857,535.61
应付管理人报酬	-	-	-	-	7,429,365.58	7,429,365.58
应付托管费	-	-	-	-	1,238,227.59	1,238,227.59
应付销售服务费	-	-	-	-	647,559.08	647,559.08
应交税费	-	-	-	-	198.69	198.69
其他负债	-	-	-	-	361,138.99	361,138.99
负债总计	-	-	-	-	52,534,025.54	52,534,025.54
利率敏感度缺口	833,840,693.31	-	-	-	-5,057,783,960.78	5,891,624,654.09

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

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（2023 年 12 月 31 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	市场利率上升 27 个基点	-42,990.19	-368,973.30
	市场利率下降 27 个基点	42,990.19	368,973.30



#### 7.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

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

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日		上年度末 2022 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	4,834,051,037.04	86.38	5,108,383,831.13	86.71
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	2,932,012.32	0.05	263,195,509.89	4.47
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	4,836,983,049.36	86.43	5,371,579,341.02	91.17

##### 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（2023 年 12 月 31 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	VaR 值为 3.29% (2022 年 12	-184,276,639.81	-253,481,867.50

月 31 日 VaR 值为 4.30%)		
----------------------	--	--

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。2022 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 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	4,836,851,854.83	5,047,535,289.97
第二层次	-	323,427,983.57
第三层次	131,194.53	616,067.48
合计	4,836,983,049.36	5,371,579,341.02

###### 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
----	----

	2023 年 1 月 1 日至 2023 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	-	616,067.48	616,067.48
当期购买	-	136,085.84	136,085.84
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	763,470.86	763,470.86
当期利得或损失总额	-	142,512.07	142,512.07
其中：计入损益的利得或损失	-	142,512.07	142,512.07
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	131,194.53	131,194.53
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	-	-4,891.31	-4,891.31
项目	上年度可比期间 2022年1月1日至2022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	-	77,636,394.08	77,636,394.08
当期购买	-	718,085.17	718,085.17
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	72,701,897.61	72,701,897.61
当期利得或损失总额	-	-5,036,514.16	-5,036,514.16
其中：计入损益的利得或损失	-	-5,036,514.16	-5,036,514.16
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	616,067.48	616,067.48
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	-	-102,017.69	-102,017.69

## 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	131,194.53	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	0.1969-2.1988	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	616,067.48	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	0.3173-1.1905	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	4,834,051,037.04	85.94
	其中：股票	4,834,051,037.04	85.94
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,932,012.32	0.05
	其中：债券	2,932,012.32	0.05
	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	787,960,186.87	14.01
8	其他各项资产	217,770.09	0.00
9	合计	5,625,161,006.32	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 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	180,459,614.71	3.22
C	制造业	4,117,682,768.42	73.58
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	19,852.40	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	24,992,000.00	0.45
I	信息传输、软件和信息技术服务业	299,411,968.21	5.35
J	金融业	165,176,833.30	2.95
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	21,828,000.00	0.39
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	24,480,000.00	0.44
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	4,834,051,037.04	86.38

### 8.2.2 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

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	600519	贵州茅台	175,000	302,050,000.00	5.40
2	002648	卫星化学	10,803,016	159,344,486.00	2.85
3	002475	立讯精密	4,200,000	144,690,000.00	2.59
4	002463	沪电股份	6,000,000	132,720,000.00	2.37
5	000333	美的集团	2,200,000	120,186,000.00	2.15
6	300037	新宙邦	2,450,059	115,887,790.70	2.07
7	600276	恒瑞医药	2,500,920	113,116,611.60	2.02
8	600030	中信证券	5,500,090	112,036,833.30	2.00
9	688279	峰岬科技	860,000	108,463,200.00	1.94
10	600183	生益科技	5,700,000	104,367,000.00	1.86
11	300130	新国都	4,000,000	96,800,000.00	1.73
12	688518	联赢激光	4,700,000	96,256,000.00	1.72
13	300115	长盈精密	6,799,832	90,097,774.00	1.61
14	600426	华鲁恒升	3,100,000	85,529,000.00	1.53
15	000568	泸州老窖	450,000	80,739,000.00	1.44
16	603501	韦尔股份	700,000	74,697,000.00	1.33
17	600584	长电科技	2,500,000	74,650,000.00	1.33
18	002273	水晶光电	5,400,000	73,116,000.00	1.31
19	600809	山西汾酒	300,000	69,219,000.00	1.24
20	601600	中国铝业	11,562,700	65,213,628.00	1.17
21	002389	航天彩虹	3,500,000	65,100,000.00	1.16
22	688122	西部超导	1,200,000	63,876,000.00	1.14
23	688249	晶合集成	3,700,000	63,825,000.00	1.14
24	002138	顺络电子	2,350,000	63,473,500.00	1.13
25	000768	中航西飞	2,806,817	62,788,496.29	1.12
26	300760	迈瑞医疗	215,700	62,682,420.00	1.12
27	601899	紫金矿业	5,000,000	62,300,000.00	1.11
28	600028	中国石化	11,000,000	61,380,000.00	1.10
29	603538	美诺华	3,200,076	61,185,453.12	1.09
30	301291	明阳电气	2,101,211	59,590,343.96	1.06
31	601728	中国电信	11,000,000	59,510,000.00	1.06
32	000630	铜陵有色	18,000,000	59,040,000.00	1.06
33	300373	扬杰科技	1,600,078	58,722,862.60	1.05
34	688383	新益昌	550,000	57,634,500.00	1.03
35	601126	四方股份	4,000,000	56,640,000.00	1.01
36	300682	朗新集团	3,431,539	56,242,924.21	1.01
37	300627	华测导航	1,800,000	55,836,000.00	1.00
38	600941	中国移动	550,000	54,714,000.00	0.98
39	601233	桐昆股份	3,500,000	52,955,000.00	0.95
40	688513	苑东生物	812,088	51,794,972.64	0.93
41	603986	兆易创新	549,981	50,812,744.59	0.91
42	688331	荣昌生物	800,000	49,648,000.00	0.89

43	000403	派林生物	1,787,715	48,697,356.60	0.87
44	688665	四方光电	650,000	47,944,000.00	0.86
45	600150	中国船舶	1,600,000	47,104,000.00	0.84
46	600456	宝钛股份	1,500,000	47,085,000.00	0.84
47	603225	新凤鸣	3,200,000	45,440,000.00	0.81
48	600595	中孚实业	12,000,000	41,760,000.00	0.75
49	300308	中际旭创	350,000	39,518,500.00	0.71
50	001283	豪鹏科技	750,000	38,925,000.00	0.70
51	002436	兴森科技	2,500,000	36,825,000.00	0.66
52	600482	中国动力	2,000,000	36,020,000.00	0.64
53	688668	鼎通科技	642,684	35,553,278.88	0.64
54	000858	五粮液	250,000	35,077,500.00	0.63
55	301261	恒工精密	633,309	32,691,258.12	0.58
56	300750	宁德时代	200,000	32,652,000.00	0.58
57	603050	科林电气	1,700,000	30,515,000.00	0.55
58	300604	长川科技	800,000	30,392,000.00	0.54
59	688121	卓然股份	1,500,000	30,345,000.00	0.54
60	601555	东吴证券	4,000,000	29,240,000.00	0.52
61	300529	健帆生物	1,300,000	28,899,000.00	0.52
62	688772	珠海冠宇	1,300,000	28,613,000.00	0.51
63	601168	西部矿业	1,999,973	28,539,614.71	0.51
64	601857	中国石油	4,000,000	28,240,000.00	0.50
65	002756	永兴材料	534,730	27,918,253.30	0.50
66	600501	航天晨光	2,000,000	27,360,000.00	0.49
67	002738	中矿资源	728,382	27,175,932.42	0.49
68	002106	莱宝高科	2,500,000	26,600,000.00	0.48
69	000933	神火股份	1,500,000	25,200,000.00	0.45
70	600258	首旅酒店	1,600,000	24,992,000.00	0.45
71	002607	中公教育	6,000,000	24,480,000.00	0.44
72	601398	工商银行	5,000,000	23,900,000.00	0.43
73	600435	北方导航	2,000,000	23,480,000.00	0.42
74	688209	英集芯	1,300,000	23,218,000.00	0.41
75	000039	中集集团	3,000,000	22,950,000.00	0.41
76	600989	宝丰能源	1,500,000	22,155,000.00	0.40
77	300652	雷迪克	800,000	22,120,000.00	0.40
78	603259	药明康德	300,000	21,828,000.00	0.39
79	300809	华辰装备	700,075	20,477,193.75	0.37
80	300634	彩讯股份	1,000,000	20,470,000.00	0.37
81	002655	共达电声	1,500,000	20,295,000.00	0.36
82	600237	铜峰电子	2,500,000	19,350,000.00	0.35
83	001306	夏厦精密	200,000	18,130,000.00	0.32
84	688981	中芯国际	300,000	15,906,000.00	0.28
85	300979	华利集团	300,010	15,792,526.40	0.28

86	688308	欧科亿	560,000	15,624,000.00	0.28
87	300653	正海生物	500,000	14,510,000.00	0.26
88	300617	安靠智电	400,000	12,144,000.00	0.22
89	688008	澜起科技	150,000	8,814,000.00	0.16
90	301525	儒竞科技	266	21,668.36	0.00
91	301370	国科恒泰	1,240	19,852.40	0.00
92	688610	埃科光电	275	14,025.00	0.00
93	301210	金杨股份	281	12,779.88	0.00
94	688631	莱斯信息	336	11,844.00	0.00
95	688603	天承科技	140	10,379.60	0.00
96	301395	仁信新材	520	9,718.80	0.00
97	688716	中研股份	267	9,716.13	0.00
98	301518	长华化学	385	8,858.85	0.00
99	688429	时创能源	346	7,331.74	0.00
100	603062	麦加芯彩	126	7,284.06	0.00
101	301515	港通医疗	230	6,502.10	0.00
102	001378	德冠新材	205	6,410.35	0.00
103	603273	天元智能	178	3,376.66	0.00
104	603276	恒兴新材	134	3,333.92	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	000568	泸州老窖	298,826,961.61	5.07
2	600519	贵州茅台	296,094,737.00	5.03
3	000333	美的集团	292,606,333.87	4.97
4	002271	东方雨虹	286,398,579.93	4.86
5	000858	五粮液	283,303,402.73	4.81
6	600030	中信证券	262,319,256.46	4.45
7	601137	博威合金	250,263,067.96	4.25
8	002463	沪电股份	247,980,231.08	4.21
9	002594	比亚迪	241,445,093.58	4.10
10	603986	兆易创新	240,999,967.57	4.09
11	600809	山西汾酒	239,803,655.85	4.07
12	002648	卫星化学	236,212,560.15	4.01
13	300750	宁德时代	220,604,506.44	3.74
14	601398	工商银行	216,886,046.00	3.68
15	600900	长江电力	209,597,334.60	3.56
16	002380	科远智慧	207,834,316.00	3.53
17	600837	海通证券	207,123,993.15	3.52
18	688249	晶合集成	206,262,119.98	3.50
19	601138	工业富联	203,536,518.06	3.45
20	002475	立讯精密	201,049,515.93	3.41



21	601668	中国建筑	199,702,309.80	3.39
22	300604	长川科技	197,756,123.06	3.36
23	600309	万华化学	197,214,114.41	3.35
24	600028	中国石化	196,743,194.12	3.34
25	600702	舍得酒业	193,914,169.19	3.29
26	600048	保利发展	185,517,150.12	3.15
27	000630	铜陵有色	177,288,454.00	3.01
28	002459	晶澳科技	176,651,305.45	3.00
29	000807	云铝股份	172,220,757.48	2.92
30	002555	三七互娱	170,219,727.24	2.89
31	600941	中国移动	163,922,167.00	2.78
32	300316	晶盛机电	163,215,648.17	2.77
33	600584	长电科技	162,608,167.05	2.76
34	002466	天齐锂业	161,036,621.04	2.73
35	601857	中国石油	158,817,727.00	2.70
36	600276	恒瑞医药	157,346,007.70	2.67
37	601628	中国人寿	154,247,073.33	2.62
38	603993	洛阳钼业	152,662,893.34	2.59
39	300274	阳光电源	149,994,434.00	2.55
40	000651	格力电器	147,782,408.00	2.51
41	688518	联赢激光	146,418,178.41	2.49
42	600131	国网信通	146,050,293.25	2.48
43	002389	航天彩虹	144,608,999.34	2.45
44	000933	神火股份	143,394,968.80	2.43
45	000516	国际医学	142,787,294.88	2.42
46	002049	紫光国微	140,242,109.64	2.38
47	600481	双良节能	136,727,441.22	2.32
48	000921	海信家电	135,440,884.60	2.30
49	600026	中远海能	134,292,756.00	2.28
50	600703	三安光电	134,242,193.71	2.28
51	001979	招商蛇口	133,169,731.00	2.26
52	300059	东方财富	131,452,679.54	2.23
53	601899	紫金矿业	129,067,811.46	2.19
54	300496	中科创达	128,159,504.55	2.18
55	300308	中际旭创	127,453,704.19	2.16
56	601233	桐昆股份	127,110,414.91	2.16
57	688122	西部超导	126,469,702.49	2.15
58	000768	中航西飞	125,735,613.62	2.13
59	600895	张江高科	124,670,597.62	2.12
60	002493	荣盛石化	123,485,949.94	2.10
61	000625	长安汽车	123,368,383.51	2.09
62	002179	中航光电	122,263,499.54	2.08
63	002436	兴森科技	118,344,258.69	2.01

64	000100	TCL 科技	117,920,029.00	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	000858	五粮液	397,429,674.58	6.75
2	600030	中信证券	307,951,851.02	5.23
3	002180	纳思达	306,775,073.64	5.21
4	600309	万华化学	306,139,427.09	5.20
5	002380	科远智慧	303,223,214.52	5.15
6	300750	宁德时代	302,894,593.10	5.14
7	601138	工业富联	268,242,217.11	4.55
8	600481	双良节能	263,228,032.56	4.47
9	002271	东方雨虹	259,350,377.54	4.40
10	300316	晶盛机电	253,652,523.54	4.31
11	600519	贵州茅台	251,850,856.30	4.27
12	002594	比亚迪	234,906,257.44	3.99
13	601137	博威合金	231,944,040.32	3.94
14	600900	长江电力	209,225,899.65	3.55
15	600837	海通证券	205,359,909.17	3.49
16	300496	中科创达	200,032,306.36	3.40
17	600702	舍得酒业	199,994,625.89	3.39
18	601398	工商银行	193,801,416.00	3.29
19	603986	兆易创新	193,212,046.30	3.28
20	601668	中国建筑	186,889,021.00	3.17
21	000630	铜陵有色	184,674,795.90	3.13
22	000568	泸州老窖	181,262,490.76	3.08
23	002050	三花智控	180,716,301.83	3.07
24	600048	保利发展	180,430,342.63	3.06
25	000301	东方盛虹	171,526,131.94	2.91
26	002459	晶澳科技	165,828,019.27	2.81
27	000333	美的集团	165,663,280.35	2.81
28	000807	云铝股份	161,447,418.25	2.74
29	300604	长川科技	159,576,011.14	2.71
30	002555	三七互娱	159,430,759.48	2.71
31	002466	天齐锂业	158,942,419.14	2.70
32	603308	应流股份	158,695,804.17	2.69
33	600809	山西汾酒	157,190,701.00	2.67
34	688518	联赢激光	156,423,777.84	2.66
35	600009	上海机场	152,156,369.49	2.58
36	002384	东山精密	149,134,182.00	2.53
37	600131	国网信通	148,465,526.46	2.52
38	002475	立讯精密	147,201,877.16	2.50

39	603993	洛阳钼业	147,042,500.74	2.50
40	601628	中国人寿	145,544,349.92	2.47
41	000651	格力电器	143,769,538.00	2.44
42	601899	紫金矿业	141,871,491.45	2.41
43	600958	东方证券	140,938,361.97	2.39
44	300274	阳光电源	140,258,223.00	2.38
45	000516	国际医学	139,112,229.61	2.36
46	001979	招商蛇口	137,670,932.41	2.34
47	600703	三安光电	134,795,402.48	2.29
48	600028	中国石化	134,001,868.20	2.27
49	601456	国联证券	133,747,018.22	2.27
50	300015	爱尔眼科	132,683,812.31	2.25
51	600895	张江高科	131,377,719.95	2.23
52	300059	东方财富	128,564,406.87	2.18
53	601857	中国石油	128,125,452.00	2.17
54	002049	紫光国微	128,084,885.51	2.17
55	600026	中远海能	127,962,225.08	2.17
56	002536	飞龙股份	126,935,965.31	2.15
57	300394	天孚通信	125,964,932.12	2.14
58	000933	神火股份	124,893,404.00	2.12
59	002304	洋河股份	124,350,845.48	2.11
60	000921	海信家电	122,705,832.21	2.08
61	002493	荣盛石化	122,421,927.70	2.08
62	002463	沪电股份	122,266,103.05	2.08
63	002028	思源电气	120,643,159.77	2.05
64	000625	长安汽车	119,185,316.96	2.02

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	26,671,501,242.39
卖出股票收入（成交）总额	26,541,338,724.40

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

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	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-

5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	2,932,012.32	0.05
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,932,012.32	0.05

#### 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	110095	双良转债	27,780	2,932,012.32	0.05

#### 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

本基金本报告期末未投资股指期货。

#### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 8.11.1 本期国债期货投资政策

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	217,770.09
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	217,770.09

#### 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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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（%）
长信金利趋势混合 A	87,248	128,097.12	8,147,665,929.25	72.90	3,028,551,541.11	27.10
长信金利趋势混合 C	23,856	141,544.21	3,073,395,720.25	91.02	303,282,838.73	8.98
合计	111,104	130,984.45	11,221,061,649.50	77.11	3,331,834,379.84	22.89

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	长信金利趋势混合 A	1,707,988.58	0.02

人所有从业人员持有本基金	长信金利趋势混合 C	323,681.10	0.01
	合计	2,031,669.68	0.01

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	长信金利趋势混合 A	>100
	长信金利趋势混合 C	10~50
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	长信金利趋势混合 A	>100
	长信金利趋势混合 C	10~50
	合计	>100

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	长信金利趋势混合 A	长信金利趋势混合 C
基金合同生效日（2006 年 4 月 30 日）基金份额总额	613,254,516.24	-
本报告期期初基金份额总额	10,172,100,388.19	3,493,764,108.34
本报告期基金总申购份额	4,648,630,623.00	2,763,651,595.97
减：本报告期基金总赎回份额	3,644,513,540.83	2,880,737,145.33
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	11,176,217,470.36	3,376,678,558.98

## § 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

本报告期基金管理人未发生重大人事变动。

#### 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的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 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 90,000.00 元，该审计机构为本基金提供的审计服务的连续年限为 7 年。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内未发生基金管理人及高级管理人员受稽查或处罚等情形。

#### 11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，未发生基金托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情形。

### 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	3	21,715,153,074.66	40.81	15,880,662.66	40.84	-
国信证券	3	17,396,315,365.17	32.70	12,721,930.31	32.71	-
中信证券	2	14,096,123,489.46	26.49	10,284,744.94	26.45	-

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

##### （1）选择标准：

1) 券商基本面评价（财务状况、经营状况）；

- 2) 券商研究机构评价（报告质量、及时性和数量）；
- 3) 券商每日信息评价（及时性和有效性）；
- 4) 券商协作表现评价。

(2) 选择程序：

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

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
长江证券	30,000,000.00	51.55	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	28,191,678.27	48.45	-	-	-	-

### 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	长信金利趋势混合型证券投资基金 2022 年第 4 季度报告	中国证监会电子披露网站、公司网站	2023-1-20
2	长信基金管理有限责任公司旗下全部基金 2022 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	2023-1-20
3	长信基金管理有限责任公司关于长信金利趋势混合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	中证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2023-1-31
4	长信基金管理有限责任公司关于增加东方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）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	2023-3-13
5	长信金利趋势混合型证券投资基金 2022 年年度报告	中国证监会电子披露网站、公司网站	2023-3-31
6	长信基金管理有限责任公司旗下全部基金 2022 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	2023-3-31
7	长信基金管理有限责任公司关于增加	上证报、中国证监会电子披露	2023-4-20



	博时财富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	网站、公司网站	
8	长信金利趋势混合型证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	中国证监会电子披露网站、公司网站	2023-4-21
9	长信基金管理有限责任公司旗下全部基金 2023 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	2023-4-21
10	长信基金管理有限责任公司关于长信金利趋势混合型证券投资基金分红公告	中证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2023-5-22
11	长信基金管理有限责任公司关于增加五矿证券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	2023-5-25
12	长信金利趋势混合型证券投资基金更新的招募说明书（2023 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	2023-5-31
13	长信金利趋势混合型证券投资基金 2023 年第 2 季度报告	中国证监会电子披露网站、公司网站	2023-7-21
14	长信基金管理有限责任公司旗下全部基金 2023 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、中国证监会电子披露网站、公司网站	2023-7-21
15	长信基金管理有限责任公司关于增加国元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）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	2023-8-11
16	长信基金管理有限责任公司关于增加西南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）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	2023-8-14
17	长信基金管理有限责任公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告	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	2023-8-26
18	长信金利趋势混合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	2023-8-28
19	长信金利趋势混合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	2023-8-28
20	长信金利趋势混合型证券投资基金托	中国证监会电子披露网站、公	2023-8-28

	管协议	司网站	
21	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分基金基金合同、托管协议和招募说明书提示性公告	上证报、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	2023-8-28
22	长信基金管理有限责任公司关于增加江海证券有限公司为旗下部分开放式基金代销机构并开通转换、定期定额投资业务及参加申购（含定投申购）费率优惠活动的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2023-8-29
23	长信金利趋势混合型证券投资基金 2023 年中期报告	中国证监会电子披露网站、公司网站	2023-8-31
24	长信基金管理有限责任公司旗下全部基金 2023 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	2023-8-31
25	长信金利趋势混合型证券投资基金 2023 年第 3 季度报告	中国证监会电子披露网站、公司网站	2023-10-25
26	长信基金管理有限责任公司旗下全部基金 2023 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	2023-10-25
27	长信基金管理有限责任公司关于长信金利趋势混合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	中证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2023-12-26

## § 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	2023 年 6 月 14 日至 2023 年 6 月 15 日; 2023 年 6 月 26 日至 2023 年 6 月 27 日; 2023 年 7 月 12 日至 2023 年 12 月 31 日	890,885,519.35	2,959,911,932.93	150,176,742.52	3,700,620,709.76	25.43
产品特有风险							
1、基金净值大幅波动的风险 单一持有基金比例过高的投资者连续大量赎回，可能会影响基金投资的持续性和稳定性，增加变							

现成本。同时，按照净值计算尾差处理规则可能引起基金份额净值异常上涨或下跌。

#### 2、赎回申请延期办理的风险

单一持有基金比例过高的投资者大额赎回后可能触发本基金巨额赎回条件，导致同期中小投资者小额赎回面临部分延期办理的情况。

#### 3、基金投资策略难以实现的风险

单一持有基金比例过高的投资者大额赎回后，可能引起基金资产总净值显著降低，从而使基金在投资时受到限制，导致基金投资策略难以实现。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

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、《长信金利趋势混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《长信金利趋势混合型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《长信金利趋势混合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、《上海浦东发展银行证券交易资金结算协议》；
- 7、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

2024年3月29日