

长信量化多策略股票型证券投资基金 2022 年第 2 季度报告

2022 年 6 月 30 日

基金管理人：长信基金管理有限责任公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：2022 年 7 月 21 日

§ 1 重要提示

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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金基金合同的规定，于 2022 年 7 月 20 日复核了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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 4 月 1 日起至 2022 年 6 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	长信量化多策略股票
基金主代码	519965
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 7 月 14 日
报告期末基金份额总额	112,640,252.99 份
投资目标	本基金通过数量化的方法进行积极的组合管理与风险控制，力争实现超越业绩比较基准的投资收益，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金采用数量化投资策略建立投资模型，将投资思想通过具体指标、参数的确定体现在模型中，在投资过程中充分发挥数量化投资纪律严格、投资视野宽阔、风险水平可控等优势，切实贯彻自上而下的资产配置和自下而上的个股精选的投资策略，以保证在控制风险的前提下实现收益最大化。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*70%+中证综合债券指数收益率*20%+恒生指数收益率（使用估值汇率折算）*10%
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期收益和预期风险高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金可投资香港联合交易所上市的股票，将面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。
基金管理人	长信基金管理有限责任公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

下属分级基金的基金简称	长信量化多策略股票 A	长信量化多策略股票 C
下属分级基金的场内简称	量化策略 A	量化策略 C
下属分级基金的交易代码	519965	004858
报告期末下属分级基金的份额总额	87,736,559.21 份	24,903,693.78 份

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2022 年 4 月 1 日-2022 年 6 月 30 日）	
	长信量化多策略股票 A	长信量化多策略股票 C
1. 本期已实现收益	-8,510,676.36	-1,801,689.89
2. 本期利润	11,128,922.19	2,614,029.96
3. 加权平均基金份额本期利润	0.1345	0.1382
4. 期末基金资产净值	169,427,462.19	46,466,250.69
5. 期末基金份额净值	1.9311	1.8658

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

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

3.2 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

长信量化多策略股票 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	6.45%	1.60%	5.17%	1.13%	1.28%	0.47%
过去六个月	-3.22%	1.52%	-6.13%	1.18%	2.91%	0.34%
过去一年	-10.53%	1.33%	-11.08%	1.00%	0.55%	0.33%
过去三年	71.96%	1.35%	16.35%	1.01%	55.61%	0.34%

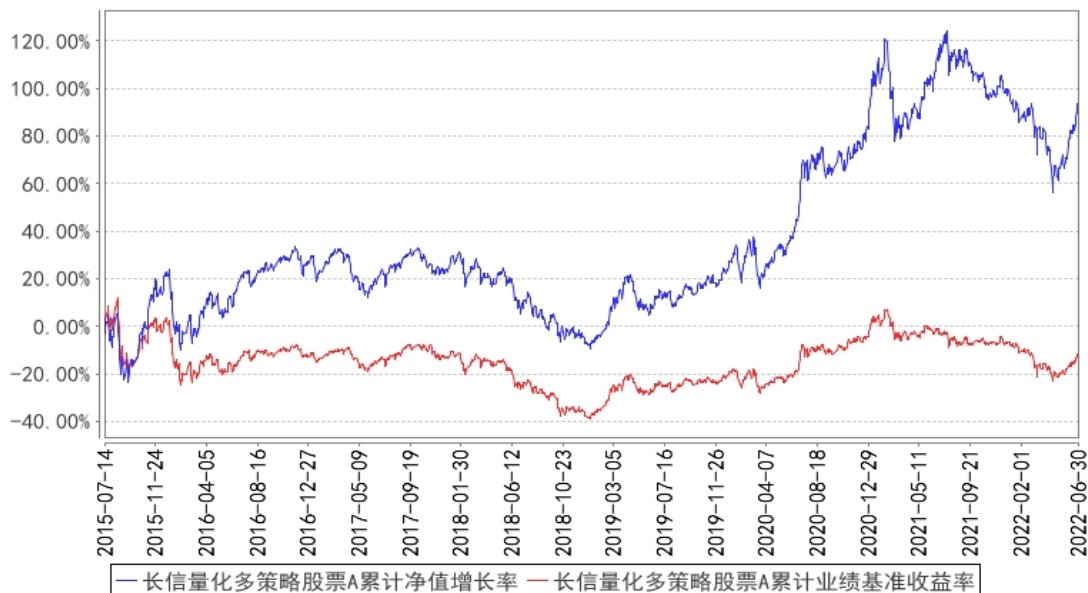
过去五年	59.46%	1.32%	2.13%	1.05%	57.33%	0.27%
自基金合同生效起至今	93.11%	1.52%	-12.22%	1.25%	105.33%	0.27%

长信量化多策略股票 C

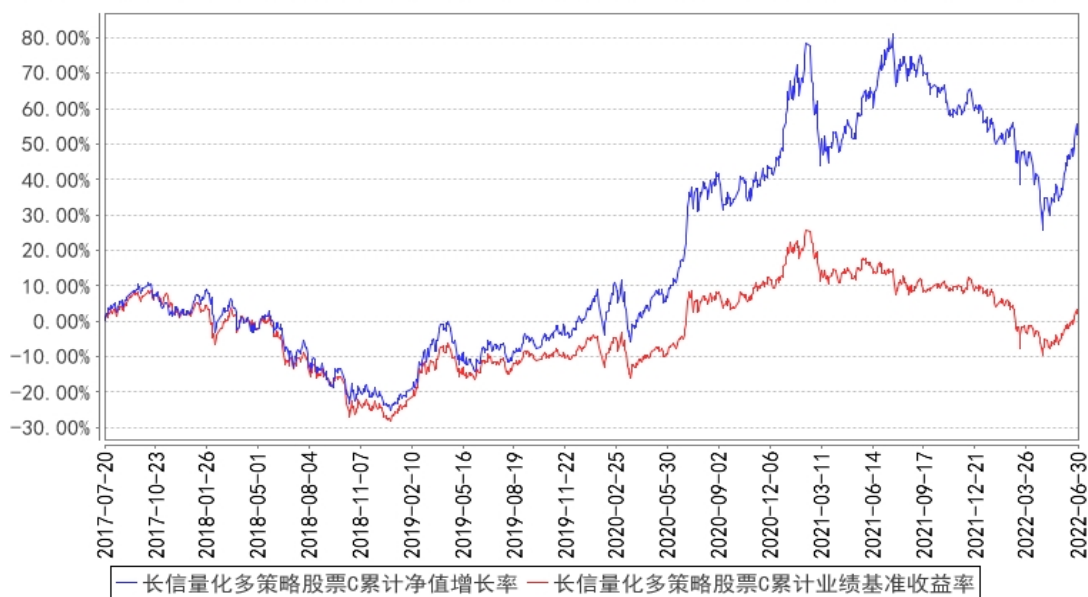
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	6.34%	1.60%	5.17%	1.13%	1.17%	0.47%
过去六个月	-3.41%	1.52%	-6.13%	1.18%	2.72%	0.34%
过去一年	-10.89%	1.33%	-11.08%	1.00%	0.19%	0.33%
过去三年	68.85%	1.35%	16.35%	1.01%	52.50%	0.34%
自份额增加日起至今	55.35%	1.32%	3.11%	1.05%	52.24%	0.27%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

长信量化多策略股票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



长信量化多策略股票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 2017 年 7 月 20 日起对长信量化多策略股票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、长信量化多策略股票 A 图示日期为 2015 年 7 月 14 日至 2022 年 6 月 30 日，长信量化多策略股票 C 图示日期为 2017 年 7 月 20 日（份额增加日）至 2022 年 6 月 30 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。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

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		
左金保	长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、长信量化先锋混合型证券投资基金、长信量化中小盘股票型证券投资基金、长信电子信息行业	2018 年 8 月 31 日	-	12 年	经济学硕士，武汉大学金融工程专业研究生毕业。2010 年 7 月加入长信基金管理有限责任公司，从事量化投资研究和风险绩效分析工作。历任公司数量分析研究员和风险与绩效评估研究员、量化研究部总监、长信中证中央企业 100 指数证券投资基金（LOF）、长信量化多策略股票型证券投资基金、长信中证一带一路主题指数分级证券投资基金、长信中证上海改革发展主题指数型证券投资基金（LOF）、长信量化优选混合型证券投资基金（LOF）、长信利泰灵活配置混合型证券投资

	量化灵活配置混合型证券投资基金、长信低碳环保行业量化股票型证券投资基金和长信量化多策略股票型证券投资基金的基金经理、总经理助理、量化投资部总监、投资决策委员会执行委员		资基金、长信国防军工量化灵活配置混合型证券投资基金、长信利发债券型证券投资基金、长信先锐债券型证券投资基金、长信量化价值精选混合型证券投资基金、长信先机两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、长信先利半年定期开放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、长信消费精选行业量化股票型证券投资基金和长信量化价值驱动混合型证券投资基金的基金经理。现任总经理助理、量化投资部总监、投资决策委员会执行委员、长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、长信量化先锋混合型证券投资基金、长信量化中小盘股票型证券投资基金、长信电子信息行业量化灵活配置混合型证券投资基金、长信低碳环保行业量化股票型证券投资基金和长信量化多策略股票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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

督。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

二季度 A 股市场先抑后扬，恐慌情绪充分释放后，全面加快复工复产的使得经济运行逐步走向正常轨道，在宏观政策和产业政策的有力支撑下，市场走出探底回升的态势，一季报业绩超预期增长的上市公司股价表现出色，产业链高景气的军工、新能源板块反弹期间尤为受到资金关注。国内宏观产业政策积极，经济增长的预期好转，有助于稳定投资者风险偏好。

尽管二季度市场整体较为震荡，基本面向好的公司仍然容易受市场青睐，各类因子普遍能获得超额收益。成长因子、分析师一致预期因子在反弹期间超额收益显著。展望未来我们仍将坚持基本面为主，综合考虑短期交易情绪，中期景气度、长期竞争格局，自下而上精选估值合理且景气度环比改善的优质个股，综合选股模型、风险模型、交易成本模型构建组合，力求为投资者获取长期稳健超额收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2022 年 6 月 30 日，长信量化多策略股票 A 基金份额净值为 1.9311 元，份额累计净值为 1.9311 元，本报告期内长信量化多策略股票 A 净值增长率为 6.45%；长信量化多策略股票 C 基金份额净值为 1.8658 元，份额累计净值为 1.8658 元，本报告期内长信量化多策略股票 C 净值增长率为 6.34%，同期业绩比较基准收益率为 5.17%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	202,572,436.65	92.27
	其中：股票	202,572,436.65	92.27
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	10,395,375.40	4.74
	其中：债券	10,395,375.40	4.74
	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	2,400,610.86	1.09
8	其他资产	4,167,680.63	1.90
9	合计	219,536,103.54	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。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末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	20,438,205.00	9.47
C	制造业	116,373,931.45	53.90
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,244,968.00	1.97
E	建筑业	4,994,416.00	2.31
F	批发和零售业	808,064.00	0.37
G	交通运输、仓储和邮政业	9,279,824.00	4.30
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,474,740.18	3.46
J	金融业	32,629,878.78	15.11
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	6,328,409.24	2.93
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	202,572,436.65	93.83

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末通过港股通交易机制投资港股。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	5,205	10,644,225.00	4.93
2	000568	泸州老窖	26,800	6,607,272.00	3.06
3	603259	药明康德	60,800	6,322,592.00	2.93
4	600809	山西汾酒	18,801	6,106,564.80	2.83
5	000001	平安银行	368,800	5,524,624.00	2.56
6	600030	中信证券	240,120	5,200,999.20	2.41
7	600438	通威股份	85,800	5,135,988.00	2.38
8	601668	中国建筑	938,800	4,994,416.00	2.31
9	601658	邮储银行	888,800	4,790,632.00	2.22
10	002821	凯莱英	15,800	4,566,200.00	2.12

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	10,395,375.40	4.82
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）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	10,395,375.40	4.82

5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	019666	22 国债 01	102,800	10,395,375.40	4.82

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本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，发行主体中信证券股份有限公司于 2022 年 6 月 2 日收到中国证监会关于对中信证券股份有限公司采取责令改正措施的决定（行政监管措施（2022）29 号），经查，中信证券存在以下行为：一是 2015 年设立中信证券海外投资有限公司，未按照当时《证券法》第一百二十九条的规定报我会批准。二是未按期完成境外子公司股权架构调整工作，存在控股平台下设控股平台、专业子公司下设专业子公司、特殊目的实体（SPV）下设子公司、股权架构层级多达 8 层等问题。三是存在境外子公司从事房地产基金管理非金融相关业务和返程子公司从事咨询、研究等业务的问题。上述情况违反了《证券公司和证券投资基金管理公司境外设立、收购、参股经营机构管理办法》（以下简称《境外办法》）第十一条、第十二条、第十三条第一款、第二十七条、第三十七条第一款等规定，反映出公司合规管理、内部控制存在一定缺失。按照《证券公司监督管理条例》第七十条、《境外办法》第三十二条的规定，中国证监会做出以下决定：“责令中信证券改正，并于收到本决定之日起 3 个月内向深圳证监局提交整改报告。”

报告期内本基金投资的前十名证券中，发行主体平安银行股份有限公司于 2022 年 3 月 21 日收到中国银行保险监督管理委员会行政处罚信息公开表（银保监罚决字（2022）24 号），根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条和相关审慎经营规则，经查，平安银行监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在以下违法违规行为：一、不良贷款余额 EAST 数据存在偏差；二、逾期 90 天以上贷款余额 EAST 数据存在偏差；三、漏报贸易融资业务 EAST 数据；四、漏报抵押物价值 EAST 数据；五、未报送权益类投资业务 EAST 数据；六、漏报投资资产管理产品业务 EAST 数据；七、漏报委托贷款业务 EAST 数据；八、EAST 系统理财产品销售端与产品端数据核对不一致；九、EAST 系统理财产品底层持仓余额数据存在偏差；十、EAST 系统理财产品非标投向行业余额数据存在偏差；十一、漏报分户账 EAST 数据；十二、EAST 系统《表外授信业务》表错报；十三、EAST 系统《个人信贷业务借据》表错报；十四、EAST 系统《关联关系》表漏报；十五、EAST 系统《对公信贷分户账》表漏报。综上，中国银行保险监督管理委员会决定对平安银行股份有限公司罚款人民币 400 万元。

报告期内本基金投资的前十名证券中，发行主体平安银行股份有限公司于 2021 年 5 月 28 日收到中国银保监会云南监管局行政处罚信息公开表（云银保监罚决字（2021）34 号），根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条第（五）项，经查，平安银行股份有限公司利用来源于本行授信的固定资产贷款和黄金租赁融资的资金发放委托贷款，用于承接处置本行其他贷款

风险;固定资产授信严重不审慎,贷款用途审查监控不到位,贷款资金挪用于借款人母公司归还股票质押融资;流动资金贷款用途审查监控不到位,贷款资金部分回流借款人用作银行承兑汇票质押存单;固定资产贷款用途审查监控不到位,贷款资金部分回流借款人或借款人关联公司用作银行承兑汇票保证金、购买理财产品。综上,中国银保监会云南监管局决定对平安银行股份有限公司罚款人民币 210 万元。

报告期内本基金投资的前十名证券中,发行主体中国邮政储蓄银行股份有限公司于 2022 年 3 月 21 日收到中国银行保险监督管理委员会行政处罚信息公开表(银保监罚决字〔2022〕16 号),根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条和相关审慎经营规则,经查,邮储银行监管标准化数据(EAST)系统数据质量及数据报送存在以下违法违规行为:一、逾期 90 天以上贷款余额 EAST 数据存在偏差;二、漏报贷款核销业务 EAST 数据;三、漏报抵押物价值 EAST 数据;四、漏报信贷资产转让业务 EAST 数据;五、未报送贷款承诺业务 EAST 数据;六、EAST 系统理财产品销售端与产品端数据核对不一致;七、EAST 系统理财产品底层持仓余额数据存在偏差;八、EAST 系统理财产品非标投向行业余额数据存在偏差;九、EAST 系统分户账与总账比对不一致;十、EAST 系统《个人活期存款分户账明细记录》表错报;十一、EAST 系统《表外授信业务》表错报;十二、EAST 系统《对公信贷业务借据》表错报;十三、2018 年行政处罚问题依然存在。综上,中国银行保险监督管理委员会决定对中国邮政储蓄银行股份有限公司罚款人民币 370 万元。

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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	41,655.17
2	应收证券清算款	2,658,175.61
3	应收股利	-
4	应收利息	-

5	应收申购款	1,467,849.85
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	4,167,680.63

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告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。

5.11.6 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。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	长信量化多策略股票 A	长信量化多策略股票 C
报告期期初基金份额总额	79,875,078.68	18,097,530.10
报告期期间基金总申购份额	8,433,877.99	6,925,460.65
减：报告期期间基金总赎回份额	572,397.46	119,296.97
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	87,736,559.21	24,903,693.78

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

项目	长信量化多策略股票 A	长信量化多策略股票 C
报告期期初管理人持有的本基金份额	0.00	0.00
报告期期间买入/申购总份额	134,623.08	0.00
报告期期间卖出/赎回总份额	0.00	0.00
报告期期末管理人持有的本基金份额	134,623.08	0.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	0.12	0.00

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。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率(%)
1	申购	2022-06-01	53,233.54	91,591.59	0.60
2	申购	2022-06-06	81,389.54	140,404.19	0.60
合计			134,623.08	231,995.78	

注：根据本基金招募说明书及 2016 年 1 月 13 日披露的《长信基金管理有限责任公司关于在直销柜台开展旗下部分基金申购（含定期定额投资申购）、转换费率优惠活动的公告》，本报告期基金管理人运用固有资金投资本基金适用费率为 0.60%。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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	2022 年 4 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	37,940,556.03	0.00	0.00	37,940,556.03	33.68

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。

8.2 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。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立基金的文件；
- 2、《长信量化多策略股票型证券投资基金基金合同》；
- 3、《长信量化多策略股票型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《长信量化多策略股票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。

9.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

9.3 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

2022 年 7 月 21 日