

长信中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证
券投资基金
2024 年第 3 季度报告

2024 年 9 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

报告送出日期：2024 年 10 月 25 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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金基金合同规定，于 2024 年 10 月 23 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 2024 年 7 月 1 日起至 2024 年 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	长信中证同业存单 AAA 指数 7 天持有
基金主代码	018809
交易代码	018809
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2023 年 12 月 13 日
报告期末基金份额总额	11,230,609.20 份
投资目标	本基金通过指数化投资，争取在扣除各项费用之前获得与标的指数相似的总回报，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。
投资策略	<p>本基金为被动式指数基金，主要采用抽样复制和动态最优化的方法跟踪标的指数，即主要按照标的指数的成份券组成及其权重构建基金投资组合，并根据标的指数成份券及其权重的变动进行相应调整，构造与标的指数风险收益特征相似的资产组合，以实现对标指数的有效跟踪。</p> <p>在正常市场情况下，力争本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。如因指数编制规则或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。指数成份券发生明显负面事件面临违约风险，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人将按照基金份额持有人利益优先的原则，综合考虑成份券违约风险、其在指数中的权重以及对跟踪误差的影响，据此制定成份券替代策略，及时对投资组合进行相应调整。</p>
业绩比较基准	中证同业存单 AAA 指数收益率×95%+一年期定期存款基准利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金风险与收益低于股票型基金、偏股混合型基金，高于货币市场

	基金。本基金主要投资于标的指数成份券及备选成份券，具有与标的指数相似的风险收益特征。
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

§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（2024 年 7 月 1 日-2024 年 9 月 30 日）
1. 本期已实现收益	53,160.34
2. 本期利润	11,752.34
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0007
4. 期末基金资产净值	11,358,810.61
5. 期末基金份额净值	1.0114

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。

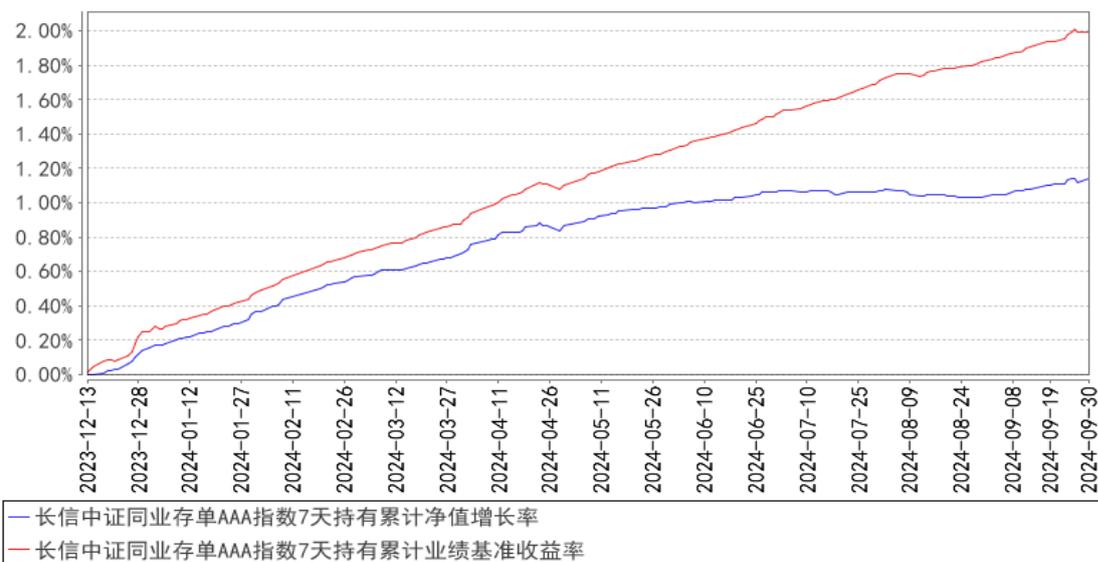
3.2 基金净值表现

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

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	0.08%	0.01%	0.49%	0.01%	-0.41%	0.00%
过去六个月	0.44%	0.01%	1.11%	0.01%	-0.67%	0.00%
自基金合同 生效起至今	1.14%	0.01%	1.99%	0.01%	-0.85%	0.00%

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

长信中证同业存单AAA指数7天持有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、本基金基金合同生效日为 2023 年 12 月 13 日，基金合同生效日至本报告期末，本基金运作时间未满一年。图示日期为 2023 年 12 月 13 日至 2024 年 9 月 30 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，报告期末已完成建仓但报告期末距建仓结束不满一年；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。

§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		
杜国昊	长信富瑞两年定期开放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 30 天滚动持有短债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 90 天滚动持有债券型证券投资基金、长信稳固 60	2023 年 12 月 13 日	-	10 年	上海财经大学经济学硕士，具有基金从业资格，中国国籍。曾任职于德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙），2014 年 6 月加入长信基金管理有限责任公司，历任基金会计、债券交易员、基金经理助理、长信易进混合型证券投资基金、长信稳丰债券型证券投资基金、长信长金货币市场基金和长信稳通三个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理，现任现金理财部副总监、长信富瑞两年定期开放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 30 天滚动持有短债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

	天滚动持有债券型证券投资基金、长信 120 天滚动持有债券型证券投资基金和长信中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金的基金经理、现金理财部副总监				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 120 天滚动持有债券型证券投资基金和长信中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金的基金经理。
陆莹	长信利息收益开放式证券投资基金、长信长金货币市场基金、长信稳鑫三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长信浦瑞 87 个月定期开放债券型证券投资基金、长信稳惠债券型证券投资基金和长信中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金的基金经理、现金理财部副总监	2023 年 12 月 21 日	-	14 年	管理学学士，毕业于上海交通大学，具有基金从业资格，中国国籍。2010 年 7 月加入长信基金管理有限责任公司，曾任基金事务部基金会计，交易管理部债券交易员、交易主管，债券交易部副总监、总监、现金理财部总监、长信稳裕三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长信纯债半年债券型证券投资基金、长信稳通三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长信易进混合型证券投资基金、长信稳健纯债债券型证券投资基金、长信富瑞两年定期开放债券型证券投资基金和长信中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金的基金经理。现任现金理财部副总监、长信利息收益开放式证券投资基金、长信长金货币市场基金、长信稳鑫三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长信浦瑞 87 个月定期开放债券型证券投资基金、长信稳惠债券型证券投资基金和长信中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期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遵规守信情况的说明

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

回顾三季度，债券收益率先下后上，利率与信用品种走势分化，与季初相比利率债收益基本持平，5Y 以内国债和 10Y 以上超长期利率债收益有所下行，而信用债收益率在 8 月央行提升债券风险之后由于市场成交量逐步萎缩，信用利差走阔，低等级信用上行幅度更大。三季度 OMO 累计降息 30bp，MLF 降息 50bp，降准 50bp，且年内大概率还有一次降准，8 月和 9 月央行公告净买入国债 1000 亿和 2000 亿，因此利率债表现较好。存单方面，年内到期存单受季末资金利率偏高影响收益率大幅上行，1Y 存单收益率与季初持平。在三季度中，组合以配置同业存单为主，维持中性杠杆和久期水平。

展望未来，货币和财政政策的陆续推出助力经济企稳回升，市场风险偏好抬升，股市情绪明显转强，债市可能延续分化行情，利率债由于大行买债需求支撑收益率预计维持低位，回购利率中枢受年末时点因素影响可能略有抬升，资金面维持紧平衡状态，存单利率在银行缺少中长期负债的背景下可能保持在相对较高位置，信用债受流动性冲击后利差或难修复，密切关注消费及地产政策的效果持续性。未来我们将严格控制信用风险，合理配置各类资产，灵活运用杠杆，把握债券市场调整带来的投资机会，为投资者争取更好的组合收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2024 年 9 月 30 日，长信中证同业存单 AAA 指数 7 天持有份额净值为 1.0114 元，份额累计净值为 1.0114 元，本报告期内长信中证同业存单 AAA 指数 7 天持有净值增长率为 0.08%，同期业绩比较基准收益率为 0.49%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内，本基金存在连续六十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形，出现该情况的时间范围为 2024 年 6 月 6 日至 2024 年 9 月 30 日。本基金管理人已经向中国证监会报告并提出解决方案。报告期内，本基金存在连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形，出现该情况的时间范围为 2024 年 8 月 5 日至 2024 年 9 月 12 日。

§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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	12,945,637.27	99.60
	其中：债券	12,945,637.27	99.60
	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	52,260.27	0.40
8	其他资产	10.00	0.00
9	合计	12,997,907.54	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

本基金本报告期末未持有股票。

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未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

本基金本报告期末未持有股票。

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,005,650.00	8.85
	其中：政策性金融债	1,005,650.00	8.85
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	11,939,987.27	105.12
9	其他	-	-
10	合计	12,945,637.27	113.97

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	220217	22 国开 17	10,000	1,005,650.00	8.85
2	112419257	24 恒丰银行 CD257	10,000	999,503.39	8.80
3	112310319	23 兴业银行 CD319	10,000	998,420.72	8.79
4	112313191	23 浙商银行 CD191	10,000	998,219.75	8.79
5	112302053	23 工商银行 CD053	10,000	998,191.48	8.79

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，发行主体兴业银行股份有限公司于 2024 年 7 月 17 日收到国家金融监督管理总局福建监管局行政处罚信息公开表（闽金罚决字（2024）12 号），经查，兴业银行股份有限公司存在以下情况：一、未严格按照公布的收费价目名录收费；二、向小微企业贷款客户转嫁抵押评估费；三、企业划型管理不到位。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、第四十八条及相关审慎经营规则，以及《中华人民共和国商业银行法》第七十三条，国家金融监督管理总局福建监管局决定对兴业银行股份有限公司合计处以 190 万元罚款并对相关人员进行警告。

报告期内本基金投资的前十名证券中，发行主体浙商银行股份有限公司于 2024 年 2 月 2 日收到国家金融监督管理总局浙江监管局行政处罚信息公开表（浙金罚决字（2024）4 号），经查，浙商银行股份有限公司存在以下情况：向小微企业客户转嫁成本，违规要求客户承担抵押评估费；向小微企业客户转嫁成本，违规要求客户承担抵押登记费。综上，根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条及相关审慎经营规则，国家金融监督管理总局浙江监管局决定对浙商银行处以罚款 55 万元。

报告期内本基金投资的前十名证券中，发行主体中国农业银行股份有限公司于 2023 年 11 月 16 日收到国家金融监督管理总局行政处罚信息公开表（金罚决字（2023）21 号），经查，中国农业银行股份有限公司存在以下情况：一、流动资金贷款被用于固定资产投资；二、贷款受托支付问题整改不到位；三、贷款风险分类不准确；四、个别精准扶贫贷款被挪用；五、不良资产转让流程问题整改不到位；六、小微企业划型不准确；七、贷款资金转存银承汇票保证金问题整改不到位；八、个人贷款违规流入房地产市场问题整改不到位；九、审计人员配备不足问题未整改；十、非现场数据报送不准确，整改不到位；十一、人员内部问责不到位；十二、向关系人发放信用贷款；十三、个人贷款管理不到位，部分贷款资金被挪用。综上，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，《中华人民共和国商业银行法》第四十条、第七十四条及相关审慎经营规则，国家金融监督管理总局决定对农业银行没收违法所得并处罚款合计 2710.9738 万元。其中，总行 570.9738 万元，分支机构 2140 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 2023 年 12 月 12 日收到国家金融监督管理总局深圳监管局行政处罚信息公开表深金罚决字（2023）69 号，经查，平安银行股份有限公司存在考评机制不当，贷款业务操作不规范，小微企业划型不准确的问题，根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条及相关审慎经营规则，国家金融监督管理总局深圳监管局决定对平安银行处以罚款 170 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 2024 年 5 月 14 日收到国家金融监督管理总局行政处罚信息公开表（金罚决字（2024）6 号），经查，平安银行股份有限公司存在以下问题：一、公司治理与内部控制方面。包括：个别高管人员未经任职资格核准实际履职，同一股东实质提名董事超比例，部分岗位绩效薪酬延期支付比例低于监管要求，未按监管规定审查审批重大关联交易等；二、信贷业务方面。包括：向关系人发放信用贷款，违规发放并购贷款、流动资金贷款、个人贷款，流动资金贷款、个人贷款用途不合规，授信责任认定后问责不到位等；三、同业业务方面。包括：违规接受第三方金融机构信用担保，分支机构承担非标投资信用风险，通过同业投资掩盖资产损失、延缓风险暴露、提供土地储备融资，违规垫付某产品赎回资金，同业非标投资业务未计足风险加权资产，以贵金属产业基金模式融出资金违规用于股权投资等；四、理财业务方面。包括：违规向理财产品提供融资、虚构风险缓释品、未计提风险加权资产，代客理财资金用于本行自营业务，理财产品相互交易，理财产品信息披露不合规，理财投资“名股实债”类资产未计入非标债权类资产投资统计，结构性存款业务实质是“假结构”等；五、其他方面。包括：部分非现场监管统计数据与事实不符，银行承兑汇票保证金来源于贷款资金，未对投保人进行需求分析与风险承受能力测评等。依据《中华人民共和国银行业监督管

理法》第二十条、第二十一条、第三十四条、第四十六条，《中华人民共和国商业银行法》第四十条、第七十四条及相关审慎经营规则，国家金融监督管理总局深圳监管局决定对平安银行股份有限公司没收违法所得并处罚款合计 6723.98 万元。

报告期内本基金投资的前十名证券中，发行主体中国建设银行股份有限公司于 2023 年 11 月 22 日收到国家金融监督管理总局行政处罚信息公开表（金罚决字（2023）29 号），经查，中国建设银行股份有限公司存在以下情况：一、单个网点在同一会计年度内与超过 3 家保险公司开展保险业务合作；二、违规通过储蓄柜台销售投资连结型保险产品；三、代销利益不确定的保险产品未按规定提供完整合同材料；四、未将超过规定年龄客户的保单材料转至保险公司核保并出单，且销售的部分保险产品属于保单利益不确定型；五、向客户销售高于其风险承受能力的保险产品；六、代销公募基金产品违规采用低风险评级；七、无资格人员销售基金产品；八、违规代销非持牌机构发行的私募基金产品；九、违规代销开发商或其控股股东不具备二级及以上房地产开发资质的房地产信托产品；十、资金用途监控不到位，信贷资金违规购买建设银行代销的基金、信托、资管及自营理财产品；十一、违规为风险承受能力不达标的客户办理代理上海金交所交易业务；十二、未按规定提前公示即调高代理上海金交所现货延期业务手续费；十三、个人账户贵金属业务不符合客户适当性要求；十四、违规收取个人客户唯一账户年费和小额账户管理费；十五、对分支机构执行小微企业查询与补单费优惠政策管控不到位；十六、内部控制不力，导致部分分支机构对总行减免优惠措施执行不到位；十七、对部分分支机构违规收取小微企业财务顾问费管控不到位；十八、违反质价相符原则收取财务顾问费。综上，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，《中华人民共和国商业银行法》第五十条、第七十三条及相关审慎经营规则，国家金融监督管理总局决定对中国建设银行没收违法所得并处罚款合计 3791.879382 万元。其中，总行 2041.879382 万元，分支机构 1750 万元。

报告期内本基金投资的前十名证券中，发行主体中国建设银行股份有限公司于 2023 年 12 月 27 日收到国家金融监督管理总局行政处罚信息公开表（金罚决字（2023）41 号），经查，中国建设银行股份有限公司存在以下情况：一、并表管理内部审计存在不足；二、母行对境外机构案件管理不到位；三、未及时报告境外子行高级管理人员任职情况；四、监管检查发现问题整改不力。综上，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，国家金融监督管理总局决定对中国建设银行处罚款 170 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

本基金本报告期末未投资股票，不存在投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库的情形。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	10.00
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	10.00

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

本基金本报告期末未持有股票。

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

报告期期初基金份额总额	32,041,791.08
报告期期间基金总申购份额	1,113,965.20
减：报告期期间基金总赎回份额	21,925,147.08
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	11,230,609.20

§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

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§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	2024 年 9 月 27 日至 2024 年 9 月 30 日	2,602,933.33	0.00	0.00	2,602,933.33	23.18
个人	1	2024 年 7 月 1 日至 2024 年 7 月 2 日	10,004,444.44	0.00	10,004,444.44	0.00	0.00
	2	2024 年 8 月 5 日至 2024 年 9 月 30 日	3,201,422.22	0.00	0.00	3,201,422.22	28.51
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>							

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、《长信中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金基金合同》；
- 3、《长信中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金招募说明书》；
- 4、《长信中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期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

2024 年 10 月 25 日