

# 长信量化多策略股票型证券投资基金 2020 年第 2 季度报告

2020 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：2020 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 2020 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，投资者在做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 2020 年 4 月 1 日起至 2020 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  | 133,552,381.39 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*80%+中证综合债券指数收益率*20%  |             |
| 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和债券型基金，属于较高预期收益和较高预期风险的基金品种。   |             |
| 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 | 73,118,984.92 份 | 60,433,396.47 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（2020年4月1日—2020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      | 5,150,525.14              | 3,876,021.17  |
| 2. 本期利润         | 19,370,814.99             | 14,884,383.78 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.2487                    | 0.2444        |
| 4. 期末基金资产净值     | 107,436,069.48            | 86,469,098.80 |
| 5. 期末基金份额净值     | 1.469                     | 1.431         |

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 本报告期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

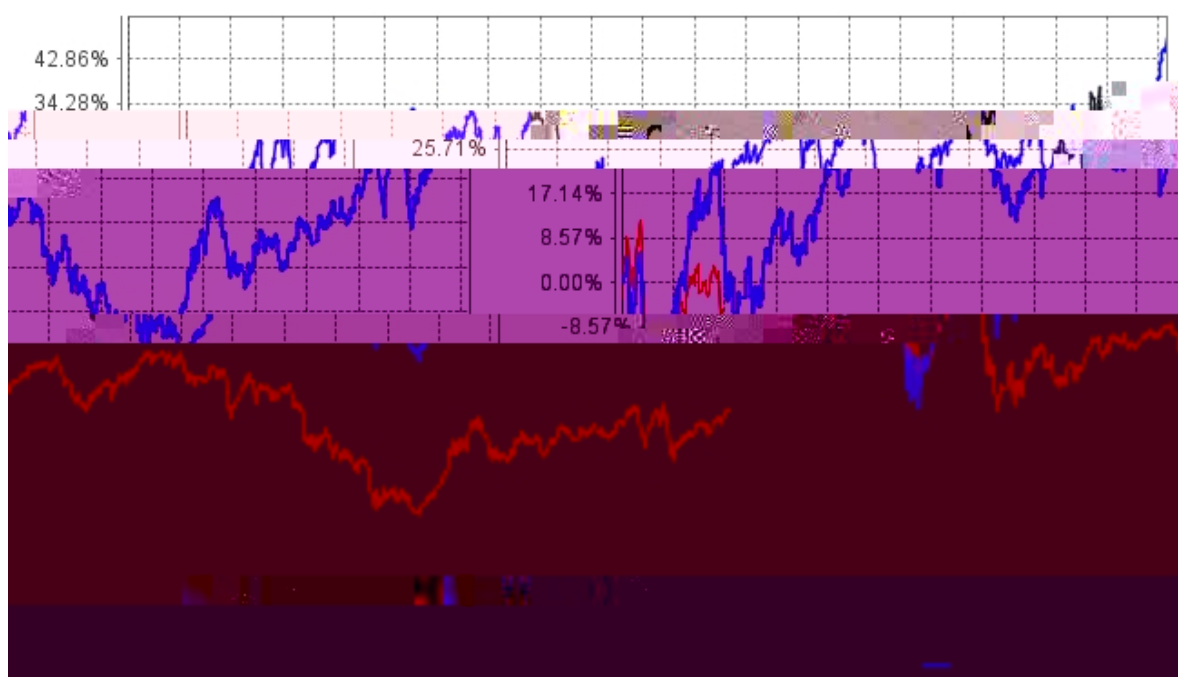
| 阶段         | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③    | ②—④   |
|------------|--------|-----------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月      | 20.61% | 0.96%     | 10.23%     | 0.72%         | 10.38% | 0.24% |
| 过去六个月      | 16.87% | 1.57%     | 2.02%      | 1.21%         | 14.85% | 0.36% |
| 过去一年       | 30.81% | 1.26%     | 8.40%      | 0.97%         | 22.41% | 0.29% |
| 过去三年       | 21.30% | 1.27%     | -4.85%     | 1.07%         | 26.15% | 0.20% |
| 自基金合同生效起至今 | 46.90% | 1.57%     | -18.22%    | 1.33%         | 65.12% | 0.24% |

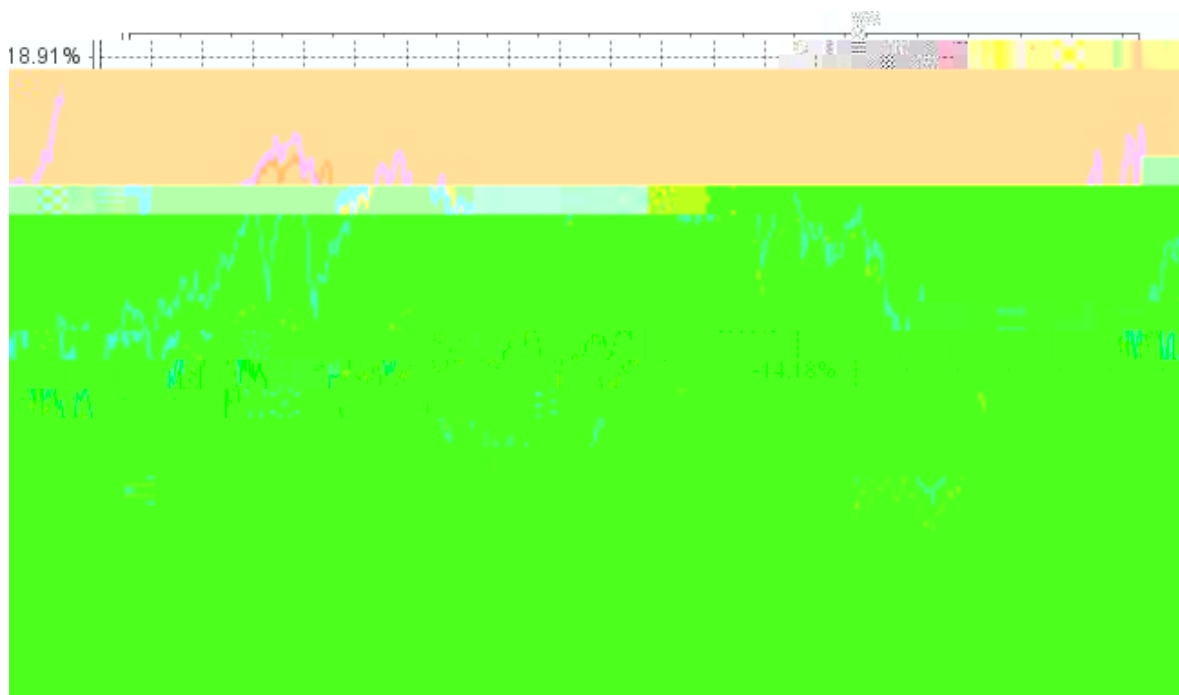
长信量化多策略股票 C

| 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      | 20.56% | 0.96% | 10.23% | 0.72% | 10.33% | 0.24% |
| 过去六个月      | 16.53% | 1.57% | 2.02%  | 1.21% | 14.51% | 0.36% |
| 过去一年       | 29.50% | 1.26% | 8.40%  | 0.97% | 21.10% | 0.29% |
| 自基金合同生效起至今 | 18.76% | 1.27% | -3.94% | 1.07% | 22.70% | 0.20% |

### 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





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 2020 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 2020 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 | 2018 年 8 月 31 日 | -    | 10 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、长信中证中央企业 100 指数证券投资基金（LOF）、 |

|  |  |  |  |   |
|--|--|--|--|---|
|  | <p>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、长信消费精选行业量化股票型证券投资基金、长信量化价值驱动混合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、量化投资部总监兼量化研究部总监、投资决策委员会执行委员</p> |  |  | <p>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和长信沪深 300 指数增强型证券投资基金的基金经理。现任量化投资部兼量化研究部总监和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、长信消费精选行业量化股票型证券投资基金、长信量化价值驱动混合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。</p> |
|--|--|--|--|---|

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

2、证券从业的含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本基金管理人在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同的规定，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

本基金将继续以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，在规范基金运作和严格控制投资风险的前提下，努力为基金份额持有人谋求最大利益。

## 4.3 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 报告期内基金投资策略和运作分析

### 4.4.1 报告期内基金的投资策略和运作分析

二季度以来，新冠疫情在海外肆虐，全球经济增长断崖式下滑。为了应对危机对经济造成的重创，各经济体选择了异常宽松的货币政策进行对冲，全球风险资产再遭受恐慌性抛售后强劲反弹。在国内疫情得到有效控制并有序复工复产的背景下，随着海外资本市场流动性危机逐步缓解，A 股市场风险偏好也显著提升。二季度，全球股市迎来了一波明显的上涨行情，A 股赚钱效应也非常明显，尤其创业板约上涨 30%，其他宽基指数的涨幅也都超过 10%。板块上看，消费者服务、医药、食品饮料、新能源、TMT 等弱周期板块表现出色且大幅领先其他行业，而石化、煤炭、建筑、金融、地产等强周期板块则表现相对落后。新冠疫情公共卫生危机的高效控制和处理将提升中国市场的相对吸引力，有助于加速中国的经济结构转型和产业升级，从北上资金持续流入可以看出，A 股的国际化进程也比较顺利，A 股市场优质资产的吸引力在提高。从量化投资的视角来看，二季

度成长和质量因子表现优异，估值因子仍然低迷，市场给予了成长性好盈利能力强的个股的估值容忍度非常高。我们通过量化选股模型综合分析全市场个股的多个维度的表现，精选优质个股构建投资组合，在二季度获取了较高的绝对收益和相对收益。

#### 4.4.2 2020 年三季度市场展望和投资策略

展望三季度，新冠疫情给全球经济带来的挑战不容忽视，海外疫情的持续扩散使得全球经济均存在失速风险，所以未来货币政策和财政政策的走向至关重要。当前全球主要经济体都选择释放流动性来对冲经济潜在下行风险，接下来中国或在货币政策和财政政策两端发力，但流动性的释放需要把握节奏并更具针对性，以免引发通胀造成滞涨。随着 A 股的机构化和国际化，投资者正在逐渐成熟，这都将对资本市场产生正面影响。年初以来，主要指数表现与海外市场比较相对强势，这与 A 股市场估值相对较低且国内疫情快速有效控制有关，如果后续宏观经济在国内加速复工复产的推动下企稳反弹带动上市公司盈利显著改善，市场行情将在宽松的宏观经济政策背景下积极演绎。我们将利用涵盖宏观、流动性、市场结构、交易特征等多个层面的模型，来监测市场可能存在的运行规律及发生的变动，从而捕捉市场中有效投资机会。通过量化选股模型精选估值合理且盈利改善的优质个股构建投资组合，以期投资者获取长期稳健的相对收益。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，长信量化多策略股票 A 基金份额净值为 1.469 元，份额累计净值为 1.469 元，份额净值增长率为 20.61%；截至本报告期末长信量化多策略股票 C 基金份额净值为 1.431 元，份额累计净值为 1.431 元，份额净值增长率为 20.56%；同期业绩比较基准收益率为 10.23%。

#### 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   | 180,862,813.81 | 92.58        |
|    | 其中：股票  | 180,862,813.81 | 92.58        |
| 2  | 基金投资   | -              | -            |
| 3  | 固定收益投资 | 88,335.00      | 0.05         |
|    | 其中：债券  | 88,335.00      | 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       | 11,325,960.76  | 5.80   |
| 8 | 其他资产               | 3,085,389.38   | 1.58   |
| 9 | 合计                 | 195,362,498.95 | 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。

## 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         | 4,920.00       | 0.00         |
| B  | 采矿业              | -              | -            |
| C  | 制造业              | 87,292,745.11  | 45.02        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 12,766.32      | 0.01         |
| E  | 建筑业              | -              | -            |
| F  | 批发和零售业           | 3,266,172.00   | 1.68         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 7,033,557.57   | 3.63         |
| H  | 住宿和餐饮业           | -              | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 19,374,943.01  | 9.99         |
| J  | 金融业              | 57,985,880.80  | 29.90        |
| K  | 房地产业             | 1,808,268.00   | 0.93         |
| L  | 租赁和商务服务业         | -              | -            |
| M  | 科学研究和技术服务业       | -              | -            |
| 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               | 3,604,725.00   | 1.86         |
| Q  | 卫生和社会工作          | 478,836.00     | 0.25         |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | -              | -            |
| S  | 综合               | -              | -            |
|    | 合计               | 180,862,813.81 | 93.27        |

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注: 本基金本报告期末未通过港股通交易机制投资港股。

**5.3 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  | 600276 | 恒瑞医药 | 86,160  | 7,952,568.00 | 4.10         |
| 2  | 600519 | 贵州茅台 | 5,405   | 7,906,866.40 | 4.08         |
| 3  | 600036 | 招商银行 | 228,800 | 7,715,136.00 | 3.98         |
| 4  | 002475 | 立讯精密 | 149,236 | 7,663,268.60 | 3.95         |
| 5  | 601318 | 中国平安 | 98,822  | 7,055,890.80 | 3.64         |
| 6  | 000333 | 美的集团 | 103,600 | 6,194,244.00 | 3.19         |
| 7  | 601816 | 京沪高铁 | 906,551 | 5,593,420.57 | 2.88         |
| 8  | 300059 | 东方财富 | 250,560 | 5,061,312.00 | 2.61         |
| 9  | 002555 | 三七互娱 | 95,800  | 4,483,440.00 | 2.31         |
| 10 | 002142 | 宁波银行 | 168,800 | 4,434,376.00 | 2.29         |

**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      | -         | -            |
|    | 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） | 88,335.00 | 0.05         |
| 8  | 同业存单      | -         | -            |
| 9  | 其他        | -         | -            |
| 10 | 合计        | 88,335.00 | 0.05         |

**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  | 128080 | 顺丰转债 | 650   | 88,335.00 | 0.05         |

**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**

注：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**

注：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

注：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

注：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

注：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

注：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

注：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

注：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受到调查以及处罚的情况的说明

报告期内本基金投资的前十名证券中，发行主体宁波银行股份有限公司于 2019 年 12 月 5 日收到宁波银保监局行政处罚决定书文（甬银保监罚决字〔2019〕67 号），根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条、第四十八条，经查，宁波银行股份有限公司销售行为不合规、双录管理不到位。综上，宁波银保监局决定对宁波银行股份有限公司罚款人民币 40 万元，并责令该行对相关直接责任人给予纪律处分。

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九名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超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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   | 42,612.06    |
| 2  | 应收证券清算款 | 2,993,553.31 |
| 3  | 应收股利    | -            |
| 4  | 应收利息    | 1,263.62     |
| 5  | 应收申购款   | 47,960.39    |
| 6  | 其他应收款   | -            |
| 7  | 待摊费用    | -            |
| 8  | 其他      | -            |
| 9  | 合计      | 3,085,389.38 |

### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码   | 债券名称 | 公允价值（元）   | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|-----------|--------------|
| 1  | 128080 | 顺丰转债 | 88,335.00 | 0.05         |

### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|----------------|--------------|----------|
| 1  | 601816 | 京沪高铁 | 5,593,327.12   | 2.88         | 新股锁定     |

### 5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

注：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               | 81,919,789.80 | 68,743,791.32 |
| 报告期期间基金总申购份额              | 4,360,803.21  | 200,239.29    |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | 13,161,608.09 | 8,510,634.14  |
| 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               | 73,118,984.92 | 60,433,396.47 |

## §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

注：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

注：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              | 2020 年 4 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 | 37,223,589.72 | 0.00 | 0.00 | 37,223,589.72 | 27.87% |
| 个人  | -              | -                               | -             | -    | -    | -             | -      |
| 产品特有风险  |                |                                 |               |      |      |               |        |
| <p>1、基金净值大幅波动的风险<br/>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<br/>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<br/>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

注：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：<http://www.cxfund.com.cn>。

长信基金管理有限责任公司

2020 年 7 月 21 日