

长信中证 500 指数增强型证券投资基金 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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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 500 指数 |
| 基金主代码 | 004945 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2017 年 8 月 30 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 126,398,237.26 份 |
| 投资目标 | 本基金为增强型股票指数基金，通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段，追求基金净值增长率与业绩比较基准之间跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 7.75%，同时力求实现超越标的指数的业绩表现，谋求基金资产的长期增值。 |
| 投资策略 | 本基金在指数化投资的基础上通过数量化模型进行投资组合优化，在控制与业绩比较基准偏离风险的前提下，力争获得超越标的指数的投资收益。 本基金为股票指数增强型证券投资基金，投资股票的资产不低于基金资产的 80%，其中，投资于标的指数成分股及其备选成分股的比例不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券。大类资产配置不作为本基金的核心策略，一般情况下将保持各类资产配置的基本稳定。在综合考量系统性风险、各类资产收益风险比值、股票资产估值、流动性要求、申购赎回以及分红等因素后，对基金资产配置做出合适调整。 |

| | | |
|-----------------|--|----------------|
| 业绩比较基准 | 中证 500 指数收益率*95%+银行活期存款利率(税后)*5% | |
| 风险收益特征 | 本基金为股票型基金，具有较高预期风险、较高预期收益的特征，其预期风险和预期收益均高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金 | |
| 基金管理人 | 长信基金管理有限责任公司 | |
| 基金托管人 | 中国建设银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 长信中证 500 指数 A | 长信中证 500 指数 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 004945 | 013881 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 124,859,365.03 份 | 1,538,872.23 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（2024 年 7 月 1 日-2024 年 9 月 30 日） | |
|-----------------|-------------------------------------|---------------|
| | 长信中证 500 指数 A | 长信中证 500 指数 C |
| 1. 本期已实现收益 | -12,790,622.26 | -163,953.97 |
| 2. 本期利润 | 20,013,731.88 | 229,469.57 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.1610 | 0.1475 |
| 4. 期末基金资产净值 | 176,896,148.24 | 2,153,389.08 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.4168 | 1.3993 |

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

长信中证 500 指数 A

| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|-------|--------|-----------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去三个月 | 12.78% | 1.75% | 15.40% | 1.90% | -2.62% | -0.15% |
| 过去六个月 | 11.30% | 1.43% | 8.29% | 1.56% | 3.01% | -0.13% |
| 过去一年 | 6.29% | 1.38% | 1.03% | 1.50% | 5.26% | -0.12% |

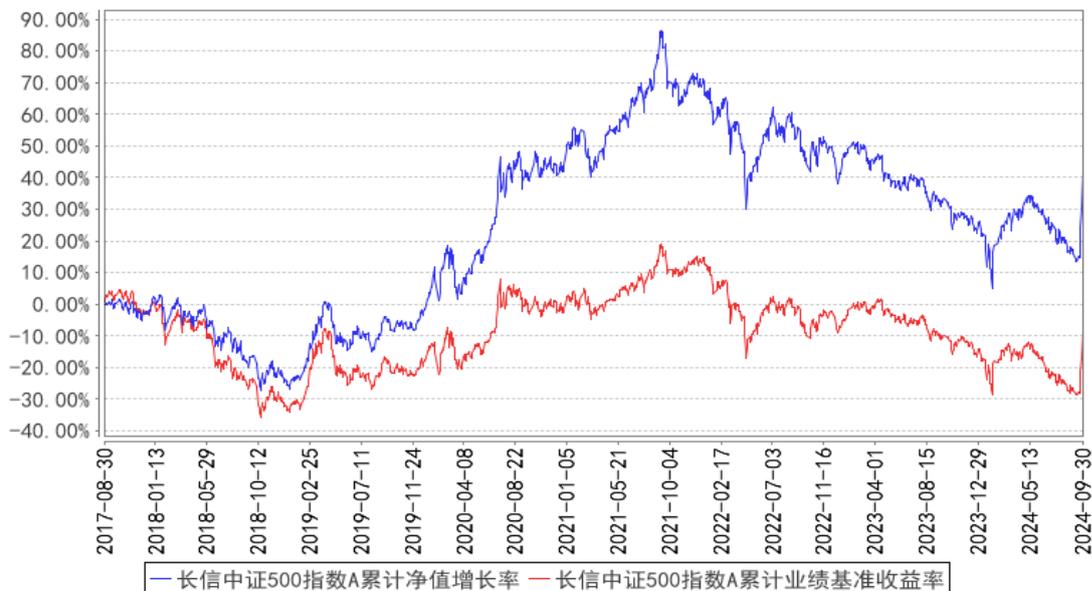
| | | | | | | |
|------------|---------|-------|---------|-------|--------|--------|
| 过去三年 | -16.92% | 1.17% | -18.01% | 1.23% | 1.09% | -0.06% |
| 过去五年 | 54.60% | 1.21% | 16.05% | 1.25% | 38.55% | -0.04% |
| 自基金合同生效起至今 | 41.68% | 1.25% | -9.08% | 1.29% | 50.76% | -0.04% |

长信中证 500 指数 C

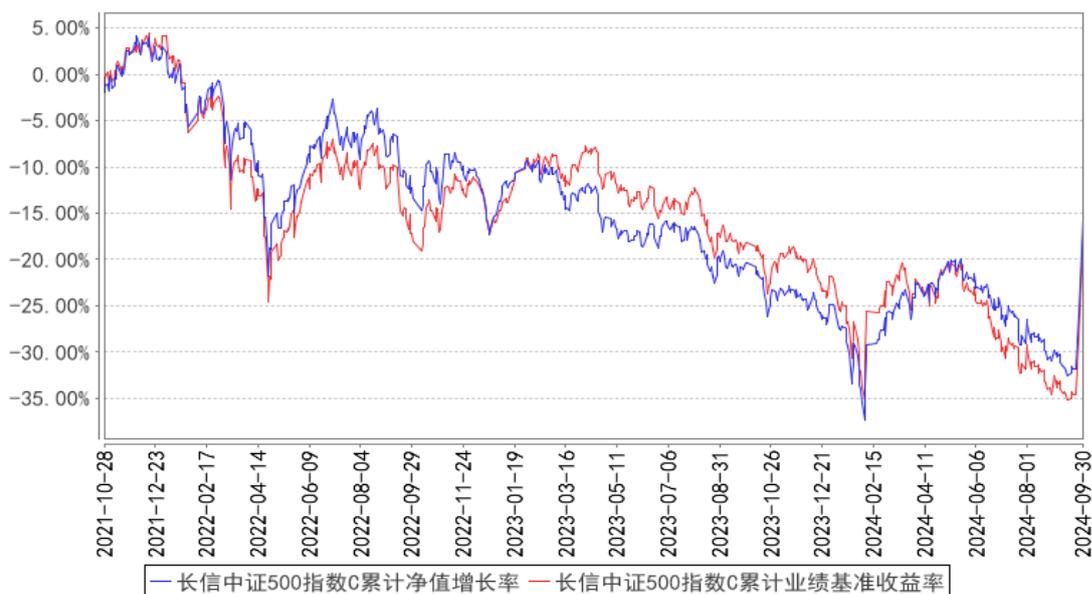
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|-----------|---------|-----------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去三个月 | 12.66% | 1.75% | 15.40% | 1.90% | -2.74% | -0.15% |
| 过去六个月 | 11.06% | 1.43% | 8.29% | 1.56% | 2.77% | -0.13% |
| 过去一年 | 5.85% | 1.38% | 1.03% | 1.50% | 4.82% | -0.12% |
| 自份额增加日起至今 | -15.76% | 1.17% | -17.40% | 1.24% | 1.64% | -0.07% |

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500指数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



长信中证500指数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 2021 年 10 月 28 日起对长信中证 500 指数增强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、长信中证 500 指数增强 A 图示日期为 2017 年 8 月 30 日至 2024 年 9 月 30 日，长信中证 500 指数增强 C 图示日期为 2021 年 10 月 28 日（份额增加日）至 2024 年 9 月 30 日。

3、按基金合同规定，本基金自基金合同生效日起 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 | | |
| 宋海岸 | 长信中证 500 指数增强型证券投资基金、长信国防军工量化灵活配置混合型证券投资基金、长信沪深 300 指数增强型证券投资基金、长信先进装备 | 2018 年 2 月 13 日 | - | 10 年 | 理学硕士，上海交通大学应用数学研究生毕业，具有基金从业资格，中国国籍。曾担任海通期货股份有限公司研究员、前海开源基金管理有限公司投资经理助理和西部证券股份有限公司研究员。2016 年 9 月加入长信基金管理有限责任公司，历任量化投资部研究员、基金经理助理、量化投资部副总监、长信中证一带一路主题指数分级证券投资基金、长信中证能源互联网主题指数型证券投资基金（LOF）、长信价值优选混合型证券投资基金、长信先优债券型证券投资基金和长信医疗保健行 |

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|--|
| 三个月持有期混合型证券投资基金和长信电子信息行业量化灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、量化研究部总监 | | | | | 业灵活配置混合型证券投资基金（LOF）的基金经理，现任量化研究部总监、长信中证 500 指数增强型证券投资基金、长信国防军工量化灵活配置混合型证券投资基金、长信沪深 300 指数增强型证券投资基金、长信先进装备三个月持有期混合型证券投资基金和长信电子信息行业量化灵活配置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 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

自二季度起，国内经济面临增速下行压力。然而，9 月底召开的“金融支持经济会”和政治局会议为市场注入了强心剂：一方面，政治局会议在非传统月份讨论经济问题，显示出中央对当前问题的深切关注。会议表述较 7 月更为积极，彰显了中央对资本市场和房地产市场的坚定支持，以及扭转下行趋势的强烈意愿。会议极大提振了市场信心，修复了投资情绪，投资意愿显著回暖，成交量迭创新高，主要市场指数迅速收复三季度以来的调整，甚至创下年内新高。另一方面，会议明确表示将陆续出台货币、财政、地产等政策组合拳，包括降息降准、调降存量房贷利率、降低购房门槛和首付比例等，这些政策无疑有助于市场流动性恢复和需求回暖。直至国庆节前，相应货币、地产政策已落地实施，市场对后续财政政策出台充满期待。

在当前政策多管齐下、力度不断加码、民众信心逐步恢复、市场投资情绪持续升温的背景下，我们预计后续资本市场走势大概率整体向上，重点关注受益于政策和情绪抬升的顺周期板块、产业趋势向上的科技板块，以及经济修复基本面边际改善的核心资产板块等。我们将坚持基本面为主，综合考虑短期交易情绪，中期景气度、长期竞争格局，自下而上精选景气度边际改善的优质个股，综合 alpha 模型、风险模型、交易成本模型构建投资组合，力争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 2024 年 9 月 30 日，长信中证 500 指数 A 基金份额净值为 1.4168 元，份额累计净值为 1.4168 元，本报告期内长信中证 500 指数 A 净值增长率为 12.78%；长信中证 500 指数 C 基金份额净值为 1.3993 元，份额累计净值为 1.3993 元，本报告期内长信中证 500 指数 C 净值增长率为 12.66%，同期业绩比较基准收益率为 15.40%。

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 | 168,786,987.22 | 93.88 |
| | 其中：股票 | 168,786,987.22 | 93.88 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中：债券 | - | - |
| | 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 | 10,074,905.92 | 5.60 |
| 8 | 其他资产 | 929,486.93 | 0.52 |
| 9 | 合计 | 179,791,380.07 | 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 报告期末指数投资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 | 2,573,424.00 | 1.44 |
| B | 采矿业 | 7,911,388.00 | 4.42 |
| C | 制造业 | 89,952,543.16 | 50.24 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 2,401,083.00 | 1.34 |
| E | 建筑业 | 4,375,527.00 | 2.44 |
| F | 批发和零售业 | 2,846,364.00 | 1.59 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 2,568,720.00 | 1.43 |
| H | 住宿和餐饮业 | 2,757,040.00 | 1.54 |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 11,132,603.00 | 6.22 |
| J | 金融业 | 14,175,051.00 | 7.92 |
| 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 | - | - |
| 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 | 173,382.00 | 0.10 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 140,867,125.16 | 78.67 |

5.2.2 报告期末积极投资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 | - | - |
| C | 制造业 | 23,371,421.66 | 13.05 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和 | 200,214.00 | 0.11 |

| | | | |
|---|-----------------|---------------|-------|
| | 供应业 | | |
| E | 建筑业 | 313,973.00 | 0.18 |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 1,646,142.40 | 0.92 |
| J | 金融业 | 2,388,111.00 | 1.33 |
| 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 | - | - |
| 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 | 27,919,862.06 | 15.59 |

5.2.3 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 报告期末指数投资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 | 300724 | 捷佳伟创 | 47,500 | 3,227,150.00 | 1.80 |
| 2 | 300390 | 天华新能 | 125,500 | 3,097,340.00 | 1.73 |
| 3 | 002500 | 山西证券 | 435,900 | 2,876,940.00 | 1.61 |
| 4 | 601555 | 东吴证券 | 340,000 | 2,862,800.00 | 1.60 |
| 5 | 300383 | 光环新网 | 271,100 | 2,851,972.00 | 1.59 |
| 6 | 600739 | 辽宁成大 | 245,800 | 2,846,364.00 | 1.59 |
| 7 | 002797 | 第一创业 | 394,600 | 2,801,660.00 | 1.56 |
| 8 | 300002 | 神州泰岳 | 223,600 | 2,788,292.00 | 1.56 |
| 9 | 300529 | 健帆生物 | 85,100 | 2,786,174.00 | 1.56 |
| 10 | 688819 | 天能股份 | 81,478 | 2,762,104.20 | 1.54 |

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

| 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 | 601336 | 新华保险 | 40,500 | 1,880,010.00 | 1.05 |

| | | | | | |
|---|--------|------|---------|--------------|------|
| 2 | 688314 | 康拓医疗 | 62,500 | 1,745,000.00 | 0.97 |
| 3 | 300743 | 天地数码 | 120,600 | 1,722,168.00 | 0.96 |
| 4 | 002209 | 达意隆 | 184,300 | 1,651,328.00 | 0.92 |
| 5 | 600718 | 东软集团 | 160,400 | 1,644,100.00 | 0.92 |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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持有股指期货。

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持有股指期货。

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，发行主体东吴证券股份有限公司于 2024 年 4 月 16 日收到中国证券监督管理委员会《立案告知书》（证监立案字 0382024051 号），因公司涉嫌国美通讯、紫鑫药业非公开发行股票保荐业务未勤勉尽责，根据《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国行政处罚法》等法律法规，中国证监会决定于 2024 年 4 月 8 日对东吴证券股份有限公司进行立案。

报告期内本基金投资的前十名证券中，发行主体东吴证券股份有限公司于 2024 年 5 月 14 日收到深圳证券交易所《关于对东吴证券股份有限公司及相关当事人给予通报批评处分决定》（深证会〔2024〕148 号），经查，东吴证券在金通灵 2021 年非公开发行公司债券项目中未勤勉尽责，存在内核意见跟踪落实不充分、工作底稿不完善等情况，上述行为违反深圳证券交易所《非公开发行公司债券挂牌转让规则》第五条、第十五条以及《公司债券发行上市审核业务指引第 1 号——公司债券审核重点关注事项》第三十五条的规定，深圳证券交易所决定对东吴证券股份有限公司给予通报批评的处分。

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 | 24,868.63 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |

| | | |
|---|-------|------------|
| 5 | 应收申购款 | 904,618.30 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 929,486.93 |

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

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五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 | 长信中证 500 指数 A | 长信中证 500 指数 C |
|---------------------------|----------------|---------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 124,638,982.07 | 1,348,989.74 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 3,497,197.19 | 665,915.70 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 3,276,814.23 | 476,033.21 |
| 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 | 124,859,365.03 | 1,538,872.23 |

§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 | 长信中证 500 指数 A | 长信中证 500 指数 C |
|--------------------------|---------------|---------------|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额 | 204,288.75 | - |
| 报告期期间买入/申购总份额 | - | - |
| 报告期期间卖出/赎回总份额 | - | - |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额 | 204,288.75 | - |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%） | 0.16 | - |

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

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

本基金本报告期内未有单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

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 500 指数增强型证券投资基金基金合同》；
- 3、《长信中证 500 指数增强型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《长信中证 500 指数增强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

2024 年 10 月 25 日