

# 长信消费精选行业量化股票型证券投资基金

## 2020 年第 4 季度报告

2020 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：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：2021 年 1 月 22 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 2021 年 1 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

本报告中财务资料未

本报告期 2020 年 10 月 1 日 2020 年 12 月 31 日

## §2 基金产

基金	长信消费精选量化股票
基金代	004 0
代	004 0
基金运作	型
基金合同 日	201 年 3 月 日
报告期 基金份	0 2 12 3 份
投资 标	本基金 过 量化的 行 的组合管理 风 险 ， 并精选消费行业的 业 行投资， 业绩 基准的投资 报。
投资策	本基金 利用 信 、 、行业信 以及 的 等信 资 ， 基于本基金的 投资 标和投资理 ， 和 个 度 行 ， 资产 ， 过 资产 基金资产组合，实现组合内 别资产的 化 ， 并对 资产的 行定期或不定期 整。
业绩 基准	中证 要消费指 0 中证 合 指 20
风险	本基金 股票型基金，其 期 和 期风险 于 合型基金、 券型基金和 基金， 于 期 和 期风险的基金 。
基金管理人	长信基金管理有限责任公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

### §3 要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 要财务指标

：人

要财务指标	报告期	2020 年 10 月 1 日	2020 年 12 月 31 日
1 本期 实现			13 024 4
2 本期利			2 23 2 2
3 基金份 本期利			0 32
4 期 基金资产净值			1 3 2 0
期 基金份 净值			2 14 1

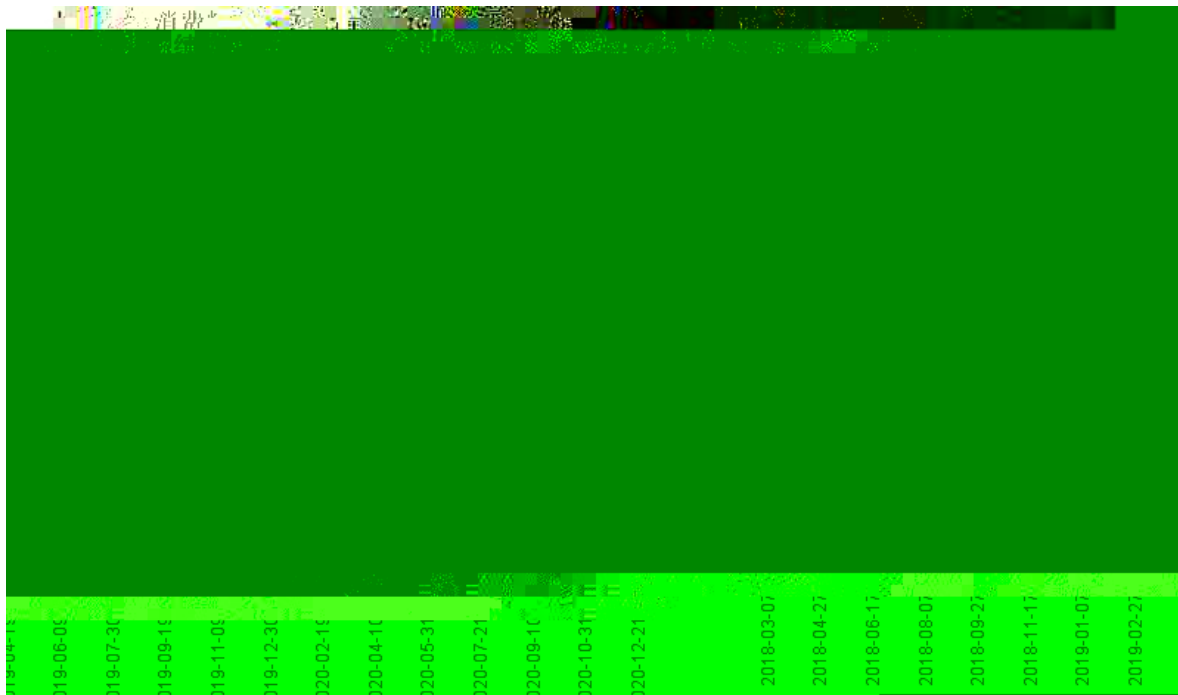
- ：1、本期 实现 指基金本期利 、投资 、其 不 公 值  
 费用 的 ，本期利 本期 实现 本期公 值  
 2、所述基金业绩指标不 有人 或 基金的 费用 ， 基金 金、  
 基金的 费、 利 投资费、基金 费等 ， 费用 实 要 于所  
 。

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 基金份 净值 长 及其 同期业绩 基准 的

	净值 长	净值 长 标准	业绩 基 准	业绩 基准 标准		
过 个月	1 22	1 34	1 11	1 1	2 11	0 1
过 个月	3 42	1	31 43	1 3		0 21
过 一年	3	1 0	4 3	1 3	21 10	0 22
基金合同	114 1	1 3	4	1 3	1 33	0 00

### 3.2.2 基金合同 以来基金 净值 长 及其 同期业绩 基准 的



：1、 示日期 201 年 3 月 日 2020 年 12 月 31 日。

2、 基金合同规定，本基金 基金合同 日 个月内 期 期 ，本基 金 投资 合基金合同中的 定。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金 理 或基金 理 组

	务	任本基金的基金 理期限		证券 业年限	
		任 日期	任日期		
金保	长信 保 行业 合型证券投资 基金 、 长信量化 合型证券投资 基金、长信 量化中 股 票型证券投资 基金、长信	201 年 3 月 日		10 年	， 大 金 工 业 业。2010 年 月 长信基金管 理 有 限 责 任 公 司 ， 事 量 化 投 资 和 风 险 绩 工 作 。 任 公 司 量 和 风 险 绩 、 长 信 中 证 中 业 100 指 证 券 投 资 基 金 、 长 信 量 化 策 股 票 型 证

	<p>信 行业量 化 合型证券投资 基金、长信 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 值 合型证 券投资基金和 长信量化 策 股票型证券 投资基金的基 金 理、量化 投资 量化 、投资决策 会 行</p>			<p>券投资基金、长信中证一带 一 指 证券投资 基金、长信中证 指 型证券投资 基金 、长信量化 选 合型证券投资基 金、长信利 合型证券投资基金、长信 国 工量化 合型证券投资基金、长信利 券型证券投资基金、长 信 券型证券投资基 金、长信量化 值精选 合 型证券投资基金、长信 年定期 合型证券投资基金、长信 利 年定期 合型证 券投资基金和长信 300 指 型证券投资基金 的基金 理。现任量化投资 量化 和投 资决策 会 行 、长 信 保 行业 合型证券投资基 金、长信量化 合 型证券投资基金、长信量化 中 股票型证券投资基 金、长信 信 行业量化 合型证券投资 基金、长信 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 值 合型证券投资 基金和长信量化 策 股 票型证券投资基金的基金 理。</p>
--	---	--	--	--

：1、 任基金 理任 日期以本基金 日 准 或 基金 理的日期根据对  
的公告日期

2、证券 业的 证券业 业人 资 管理 的 规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作 规 信 的

本基金管理人在报告期内， 了 中 人 共和国证券投资基金 及其 有

规、基金合同的规定，勤勉尽责 基金份 有人 利 ，不存在 基金份 有人利 的行 。

本基金 以 信于 、 信于 会投资公 ，承诺 一 往 本 诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，在规 基金运作和 投资风险的前提 ， 基 金份 有人 大利 。

## 4.3 公

### 4.3.1 公 度的 行

本报告期内，公司 实行公 度，并 公 度 ， 投资决策 ， 行 的内 ，并 过工作 度、 和 保证公 原则的实现。同 ，公司 过对投资 行 的 、 和信 来 对公 过 和 的 。

### 4.3.2 行 的

本报告期内，完 有 指 的 行投资的组合 ，其 投资组合未 所公 同日 的 量 过 证券 日 量的 的 ，未 现 行 。

## 4.4 报告期内基金投资策略 和运作

季度以来，国内 有 ， ， ，其中工业 产的 复 度 于 消费、投资和国 ，同 的 对 。在基本 复 的 ， 季度股票 的表现 ， 大核 指 的 ，其中 300 13 、 证 0 12 3 、 业 1 21 。 ， 期 性 的有 、国 工、 等行业表现 大 其 行业，消费 中的 料和 的表现 。 量化的 ， 风 在 季度 了 于 季度的风 ，大 值、 值、 股 的股票表现 ， 盈利 、盈利 量和 长等 表现一 。 消费 内 ， 行业 的表现 大， 料和消费者 务 于基本 的 复 ，所以表现 。

公共 的 和 理 提 中国 的 对 ，有 于 中国的 型和产业 ， 资金 以 出，A 股的国 化 利，A 股 资产 的 在提 。

一季度，复 的 带来的不确定性 消 ，未来 策和财 策的 重要。前 要 选 性来对 行风险，国内 策和财 策会 对 ，但 性的 要 并 对性。A 股的 化和国 化，投资者 在 ， 对资本 产 。年 以来， 要指 表现 对 ， A 股 值 对 国内 有 有 ， 在国内 复工复产的 带 公司盈利 ， 行 在 的 策 。 消费 ，长期 策 产业 化的 不会 ，产业内的 应会 提 公司的 ，同 的业务 和 业管理会 合理的 值。 利用 、 性、 、 等 个 的 型，来 存在的运行规 及 的 ， 中有 投资 会。过 量化选股 型精选大消费 值合理 盈利 的 个股 投资组合，以期 投资者 长期 的 对 。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期 本基金份 净值 2 14 1 ， 份 净值 2 14 1 ，本报告期基金份 净值 长 1 22 ，同期业绩 基准 1 11 。

#### 4.6 报告期内基金 有人 或基金资产净值

201 年 3 月 2 日 201 年 月 1 日，本基金资产净值 连 个工作日 于 ，本基金管理人 中国证 会报送了 决 。 报告期 ，本基金资产净值 于 。

## §5 投资组合报告

### 5.1 报告期 基金资产组合

		金	基金 资产的
1	投资	1 0 0 2 2	1 2
	其中：股票	1 0 0 2 2	1 2
2	基金投资		
3	定 投资		
	其中： 券		

	资产 证券		
4	金 投资		
	金 投资		
	金 资产		
	其中： 的 金 资产		
	银行存 和 金合	1 303 11	4
	其 资产	12 0	0 3
	合	1 4 24	100 00

：本基金本报告期末 过 股 投资 股。

## 5.2 报告期 行业 的股票投资组合

### 5.2.1 报告期 行业 的内股票投资组合

代	行业 别	公 值	基金资产净值
A	、 、 、 业	044 00	3 3
	业		
	业	11 34 14 2	2
	、 、 及 产和 应 业		
	业		
	和 业		
	运 、 和 业	4 4 00	4
	和 业		
	信 、 和信 务业	2 4 00	4 4
	金 业	1 44 1 1 00	
	产业		
	和商务 务业	32 0 00	3
	和 务业		
	利、 和公共 管理业		
	务、 理和其 务业		
	和 会工作		
	化、 和 业		
	合		
	合	1 0 0 2 2	2 3

### 5.2.2 报告期 行业 的 股 投资股票投资组合

：本基金本报告期末 过 股 投资 股。

**5.3 报告期 公允价值 基金资产净值 大的前 股票投资 细**

	股票代	股票	量 股	公 值	基金资产净值
1	00 0		4 300	1 13 4 00	2
2	000		0	1 32 20	4
3	000333	的	12	1 2 10 32	2
4	032	业	000	1 002 00 00	
	03		11 000	4 1 0 00	0
	01	中国中	3 300	32 0 00	3
	000		3 000	0 00	04
	0023 2	股	00	4 4 00	4
	000 1	长	1 00	2 2 00	4 1
10	002		000	0 220 00	4 4

**5.4 报告期 券 的 券投资组合**

：本基金本报告期 未 有 券。

**5.5 报告期 公允价值 基金资产净值 大的前 券投资 细**

：本基金本报告期 未 有 券。

**5.6 报告期 公允价值 基金资产净值 大的前 资产 证券投资 细**

：本基金本报告期 未 有资产 证券。

**5.7 报告期 公允价值 基金资产净值 大的前 金 投资 细**

：本基金本报告期 未 有 金 。

**5.8 报告期 公允价值 基金资产净值 大的前 证投资 细**

：本基金本报告期 未 有 证。

**5.9 报告期 本基金投资的股指期货****5.9.1 报告期 本基金投资的股指期货 和 细**

：本基金本报告期 未投资股指期货 。

**5.9.2 本基金投资股指期货 的投资 策**

：本基金本报告期 未投资股指期货 。

## 5.10 报告期 本基金投资的国 期

### 5.10.1 本期国 期 投资 策

：本基金本报告期 未投资国 期 。

### 5.10.2 报告期 本基金投资的国 期 和 细

：本基金本报告期 未投资国 期 。

### 5.10.3 本期国 期 投资

：本基金本报告期 未投资国 期 。

## 5.11 投资组合报告

### 5.11.1 本基金投资的前 证券的 行 本期 以及 的 的

报告期内本基金投资的前 证券的 行 未出现 管 ，或在报告 日 前一年内 公 责、 的 。

### 5.11.2 基金投资的前 股票 出基金合同规定的 选股票 的

报告期内本基金投资的前 股票中，不存在 出基金合同规定 选股票 的 。

### 5.11.3 其 资产

		金
1	存出保证金	1 424 0
2	应 证券	3 01 42
3	应 股利	
4	应 利	124 0
	应	2 4 3
	其 应	
	其	
	合	12 0

### 5.11.4 报告期 有的 于 股期的 券 细

：本基金本报告期 未 有 于 股期的 券。

### 5.11.5 报告期 前 股票中存在 限 的

：本基金本报告期 前 股票中不存在 限 。

### 5.11.6 投资组合报告 的其 述

： 于 的原 ， 和 合 存在 。

## §6 基金份

：份

报告期期 基金份	1 0 4
报告期期 基金 份	1 00 4 1
报告期期 基金 份	1 33 0
报告期期 基金 份 份 以	
报告期期 基金份	0 2 12 3

## §7 基金管理人运用 有资金投资本基金

### 7.1 基金管理人 有本基金份额

：本报告期内基金管理人未运用 有资金投资本基金。

### 7.2 基金管理人运用 有资金投资本基金 细

：本报告期内基金管理人未运用 有资金投资本基金。

## §8 投资者决策的其 重要信

### 8.1 报告期内 一投资者 有基金份额 或 过 20%的

：本基金本报告期内未有 一投资者 有基金份额 或 过 20 的 。

### 8.2 投资者决策的其 重要信

：本基金本报告期末 投资者决策的其 重要信 。

## §9

### 9.1

- 1、中国证 会 准 基金的
  - 2、 长信消费精选行业量化股票型证券投资基金基金合同
  - 3、 长信消费精选行业量化股票型证券投资基金
  - 4、 长信消费精选行业量化股票型证券投资基金托管
- 、报告期内在指定报 的 公告的原

、长信基金管理有限责任公司 业 、公司 及 资 复 。

## 9.2 存

基金管理人的 公 所。

## 9.3 阅

长信基金管理有限责任公司 :

长信基金管理有限责任公司

2021 年 1 月 22 日