

长信消费精选行业量化股票型证券投资基金

2021 年第 4 季度报告

2021 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：2022 年 1 月 24 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 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 2021 年 10 月 1 日 2021 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	
基金运作	型	
基金合同日	201 年 3 月 日	
报告期 基金份	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	
基金的基金	长信消费精选量化股票 A	长信消费精选量化股票

基金的代	004 0	0131 2
报告期	1 3 0 份	241 4 0 份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

：人

主要财务指标	报告期	2021 年 10 月 1 日	2021 年 12 月 31 日
	长信消费精选量化股票 A		长信消费精选量化股票
1 本期实现		4 0 3	2 22 03
2 本期利		2 132 0	3 11
3 基金份 本期利		0 0 00	0 223
4 期 基金资产净值		14 0 32	43 0 0
期 基金份 净值		1 212	1 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

长信消费精选量化股票 A

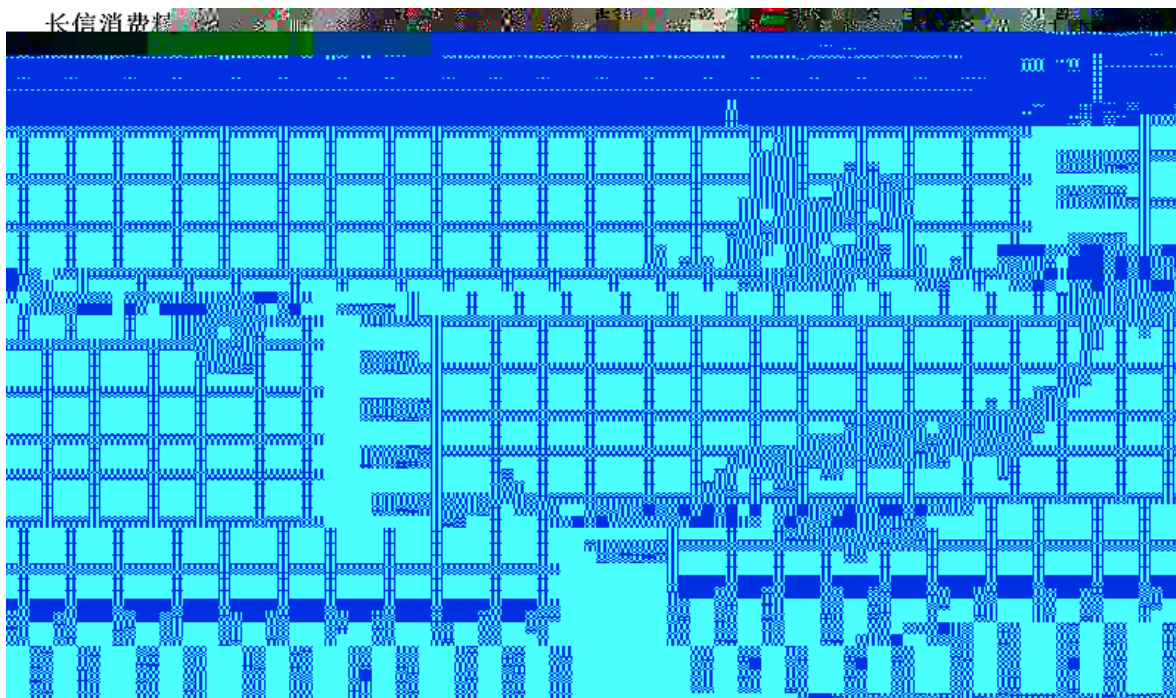
	净值 长	净值 长 标准	业绩 基准	业绩 基准 标准		
过 个月	3 4	1 4		1 0	10 14	0 3
过 个月	1	1 3	2	1 41	14 2	0 42
过 一年	1 22	1 4	4	1 4	10 2	0 4
过 年	113 4	1 4	122 43	1 3		0 2
基金合同	2 12	1 3	1	1 3		0 14

长信消费精选量化股票

	净值 长	净值 长 标准	业绩 基准	业绩 基准 标准		
过 个月	3 4	1 4		1 0	10 23	0 40

份	日	4	1		1 30	11 4	0 3
---	---	---	---	--	------	------	-----

3.2.2 基金合同 以来基金 净值 长 及其 同期业绩 基准 的



：1、基金管理人 2021 年 月 12 日 对长信消费精选行业量化股票型证券投资基金 行份
，原有基金份 A 份 ， 份 。

2、长信消费精选量化股票 A 示日期 201 年 3 月 日 2021 年 12 月 31 日，长信消费精

选量化股票 示日期 2021 年 月 12 日 份 日 2021 年 12 月 31 日。

3、 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 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	201 年 3 月 日		11 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 、量化 、长信 中证中 业 100 指 证 券投资基金 、长信量 化 策 股票型证 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

	投资基金的 基金 理、 理 理、 量化投资 、投资 决策 会 行			理。现任 理 理、量 化投资 、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。
--	--	--	--	--

：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，于 在，国内 带来的 产限，国
复的 有所。但 原料 的，在 季度，
了的，指 在年 个月 了。产 复不及
期，带了 国出 的。于 的 风险，整 产的 资
，年大 信用 的，年，投资，信用 有所
复。季度的股票，化，度的国 工、，以及 和
等行业 前。料行业整 表现一，于 表现
，一 标的 化 前期 承 利，
化，消费 复，本 导，于 期 出现
行。

2022 年一 在，长 策，带 业 提，消费
有。国 行业 于量 的 长，行业整，中的
不，长期 于消费 的。前 消费 季，整
。于提 行 性的 标的以及 带 国化
的 标的。

4.5 报告期内基金的业绩表现

2021 年 12 月 31 日，长信消费精选量化股票 A 份 净值 1.212，份 净值
1.212，本报告期内长信消费精选量化股票 A 净值 长 3.4 长信消费精选量化股票
份 净值 1.1，份 净值 1.1，本报告期内长信消费精选量化股票 净值
长 3.4，同期业绩 基准。

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	13 2 2 2 30	
	其中：股票	13 2 2 2 30	
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 20 0 4 3	0
	其 资产	4 2 23 1	3 1
	合	14 3 34 1	100 00

：本基金本报告期 未 过 股 投资 股。本基金本报告期 未 证券出 业务。

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		
	业		
	业	11 0 3 0	2
	、 、 及 产和 应业		
	业		
	和 业		
	运 、 和 业		
	和 业		
	信 、 和信 务		
	金 业	1 4 42 0	10 3
	产业		

	和商务 务业		
	和 务业	3 20	0
	利、 和公共 管理业		
	务、 理和其 务业		
	和 会工作		
	化、 和 业		
	合		
	合	13 2 2 2 30	1 0

5.2.2 报告期 行业 的 股 投资股票投资组合

：本基金本报告期未 过 股 投资 股。

5.3 期 公 值 基金资产净值 大 的股票投资 细

5.3.1 报告期 公 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	000		4 0	1 1 2 0	1
2	031		1 00	1 0 310 00	
3	3000	财	2 0	1 0 0 4 0	3
4	000		000	1 0 2 00 00	33
	00 0		3 320	1 04 3 0	23
	03		13 00	00 00	
	000		4 300	43 00	0
	00		00	3 22 00	4
	000		3 00	2 200 00	40
10	033		1 00	13 20 00	30

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 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 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 0
2	应 证券	4
3	应 股利	
4	应 利	113 3
	应	11 414 2

	其 应	
	其	
	合	4 2 23 1

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

	长信消费精选量化股票 A	长信消费精选量化股票
报告期期 基金份	041 031 31	23
报告期期 基金 份	1 4 24	24 3 1
报告期期 基金 份	1 2 422	2 0
报告期期 基金 份 份 以		
报告期期 基金份	1 3 0	241 4 0

§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

：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 或 过 20%的

：本基金本报告期内未有 一投资者 有基金份 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

2022 年 1 月 24 日