长信低碳环保行业量化股票型证券投资基金
2022 年第 3 季度报告

2022 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：交通银行股份有限公司

报告送出日期：2022 年 10 月 26 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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金基金合同规定，于 2022 年 10 月 24 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 2022 年 7 月 1 日起至 2022 年 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	长信低碳环保量化股票	
基金主代码	004925	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017 年 11 月 9 日	
报告期末基金份额总额	320,160,563.24 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，并精选低碳环保行业的优质企业进行投资，追求超越业绩比较基准的投资回报。	
投资策略	本基金将利用全球信息平台、外部研究平台、行业信息平台以及自身的研究平台等信息资源，基于本基金的投资目标和投资理念，从宏观和微观两个角度进行研究，开展战略资产配置，之后通过战术资产配置再平衡基金资产组合，实现组合内各类别资产的优化配置，并对各类资产的配置比例进行定期或不定期调整。	
业绩比较基准	中证环保产业指数收益率*80%+中债综合指数收益率*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、债券型基金和货币市场基金，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	交通银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	长信低碳环保量化股票 A	长信低碳环保量化股票 C
下属分级基金的交易代码	004925	013151

报告期末下属分级基金的份额总额	280,211,064.72 份	39,949,498.52 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（2022 年 7 月 1 日-2022 年 9 月 30 日）	
	长信低碳环保量化股票 A	长信低碳环保量化股票 C
1.本期已实现收益	19,058,386.68	3,472,052.40
2.本期利润	-163,207,035.33	-26,000,887.07
3.加权平均基金份额本期利润	-0.5641	-0.5324
4.期末基金资产净值	608,025,887.32	86,328,043.46
5.期末基金份额净值	2.1699	2.1609

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

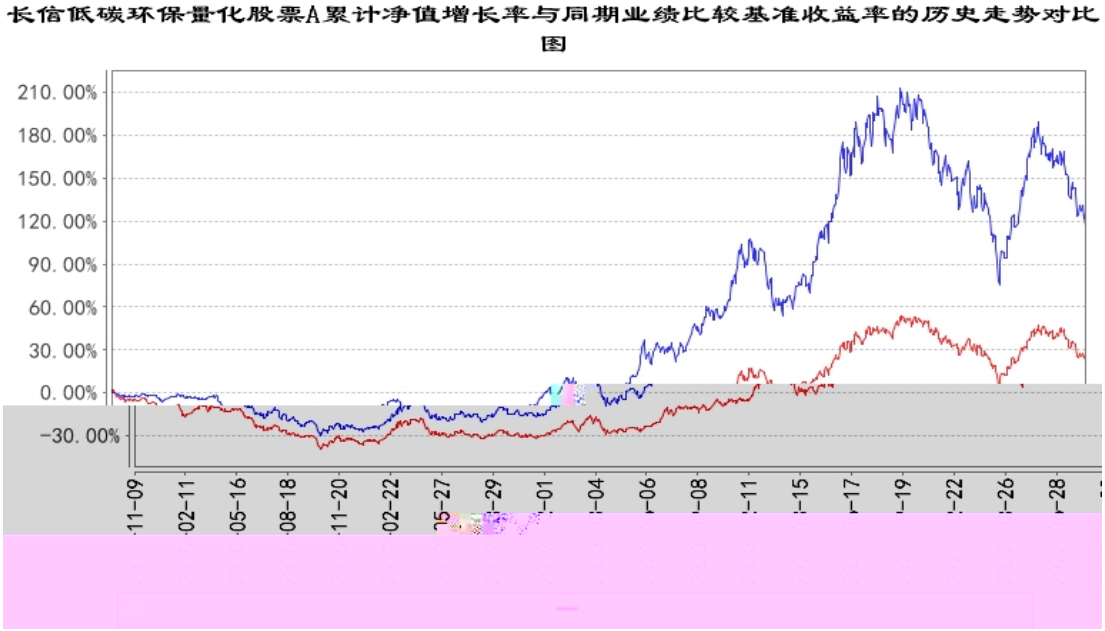
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

长信低碳环保量化股票 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	-21.08%	1.90%	-13.73%	1.39%	-7.35%	0.51%
过去六个月	-6.31%	2.30%	-3.27%	1.62%	-3.04%	0.68%
过去一年	-23.84%	2.29%	-14.97%	1.54%	-8.87%	0.75%
过去三年	154.95%	2.20%	74.33%	1.52%	80.62%	0.68%
自基金合同生效起至今	116.99%	1.88%	22.79%	1.40%	94.20%	0.48%

长信低碳环保量化股票 C

阶段	净值增长率①	净值增长率	业绩比较基	业绩比较基	①－③	②－④

		标准差②	准收益率③	准收益率标准差④		
过去三个月	-21.16%	1.90%	-13.73%	1.39%	-7.43%	0.51%
过去六个月	-6.50%	2.30%	-3.27%	1.62%	-3.23%	0.68%
过去一年	-24.11%	2.29%	-14.97%	1.54%	-9.14%	0.75%
自份额增加日起至今	-22.48%	2.32%	-12.02%	1.54%	-10.46%	0.78%

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