

长信消费精选行业量化股票型证券投资基金
2023 年第 1 季度报告

2023 年 3 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：2023 年 4 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 2023 年 4 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 2023 年 1 月 1 日 2023 年 3 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	32 04 30 份	
投资标	本基金过量化的行组合管理风险，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、行业信以及的信资，基于本基金的投目标和投资理，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 基金的份	12 04 14 份	1 4 0 份

§ 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 2023 年 1 月 1 日 2023 年 3 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	1 3 230	4 34
2 本期利	1 44 0 1	3 0
3 基金份 本期利	0 13 0	0 12
4 期 基金资产净值	21 1 3 2	31 4 4 24
期 基金份 净值	1 411	1 301

：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	业绩 基准	业绩 基准		
过 个月	10 34%	1 4 %	2 2 %	0 3%	0 %	0 %
过 个月	1 %	1 %	2 32%	1 20%	14 33%	0 %
过 一年	1 1%	1 %	4 %	1 12%	12 0 %	0 3%
过 年	3 2%	1 %	31 4 %	1 30%	4 2 %	0 4 %
过 年	3 %	1 2%	00%	1 3 %	14 2 %	0 2 %
基金合同	4 11%	1 0%	1 33%	1 3 %	22%	0 2 %

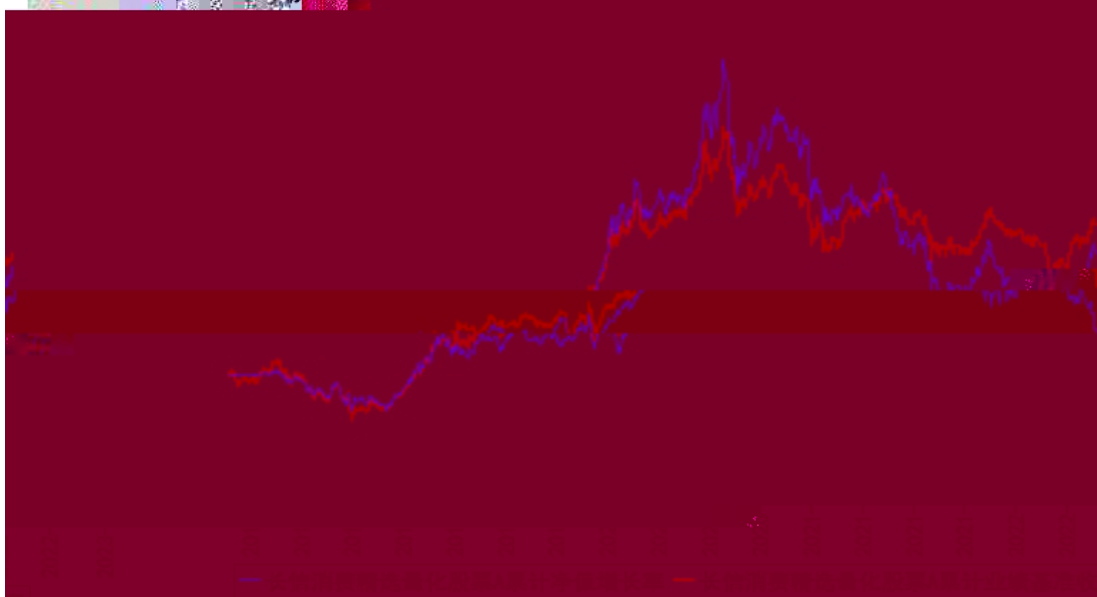
长信消费精选量化股票

	净值 长	净值 长 标	业绩 基准	业绩 基准		
--	------	--------	-------	-------	--	--

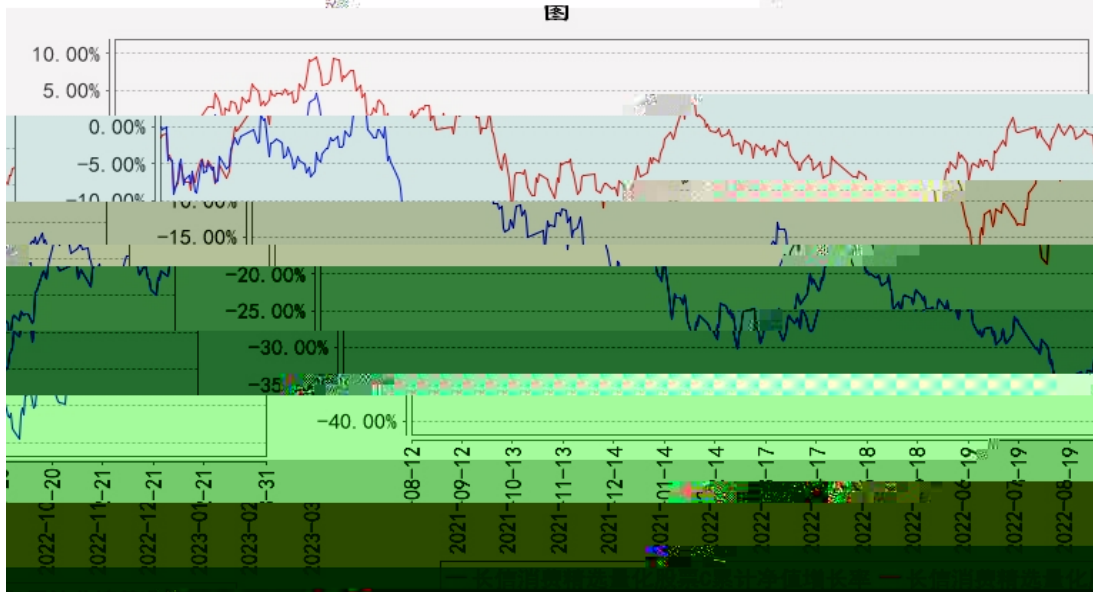
		准		标准		
过 个月	10.23%	1.4%	2.2%	0.3%	%	0%
过 个月	1.42%	1%	2.32%	1.20%	14.10%	0%
过 一年	1.04%	1%	4%	1.12%	11%	0.3%
份 日	14%	1%	2.4%	1.21%	12.1%	0%

3.2.2 基金合同成立以来基金净值增长及其同期业绩基准的

长信消费精选量化股票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



长信消费精选量化股票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



- 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
，原有基金份额 A 份 ， 份 。
- 2、长信消费精选量化股票 A 示日期 201 年 3 月 日 2023 年 3 月 31 日，长信消费精
选量化股票 示日期 2021 年 月 12 日 份 日 2023 年 3 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	
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、长信 保行业量化股 票型证券投资基 金、长信 保 行业 合型证券投资 基金 和长	2022 年 1 月 2 日		年

	信中证 业 0 指 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 报告期内基金的投资策 和运作

年以来，在 对国内 复 共 的 ， 行业 、 存、信 指标
有 ， 在 A 股 对大 指 。 来 ， 年行业 国
行 、 资 出、 等 ，消费 重 ， 存 。
、消费、 产等利 策出 ，基本出行 复、消费 重 、消费 ，
。 季期 ， 和 选 以 量消化 存，

，。2月以，、复期、前期利
 盈等重，1个月的，前期行，股
 基本，风险，但不的，基本，年复不。
 前一季报期整对，整值。
 ，季度化，有来一性行。一4月来
 2023会，会以来会，规和值期，有化行。一
 ，季不选，中有，行业在季度来
 行。对行业度，量化型精选业绩确定性
 的，。

4 报告期内基金的业绩表现

2023年3月31日长信消费精选量化股票A基金份额净值1.411份净值
 1.411本报告期内长信消费精选量化股票A净值长10.34长信消费精选量化股票
 基金份额净值1.301份净值1.301本报告期内长信消费精选量化股票净
 值长10.23同期业绩基准2.2。

4 报告期内基金 有人 或基金资产净值

报告期内，本基金存在连个工作日基金资产净值于的，出现的
 201年3月2日至2023年3月2日。本基金管理人中国证 会报告并提出
 决。

§ 投资组合报告

1 报告期 基金资产组合

		金	基金 资产的
1	投资	4 4	0
	其中：股票	4 4	0
2	基金投资		
3	定 投资	404 1	0 4
	其中： 券	404 1	0 4
	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	4 2 30	3
	其 资产	4	1 3
	合	4 11 0 2	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。

2 报告期 行业 的股票投资组合

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	4 4 3 20 0	3
	、 、 及 产和 应		
	业	2 02 2	0 01
	和 业	1 02 103 00	1 4
	运 、 和 业		
	和 业		
	信 、 和信 务业		
	金 业		
	产业		
	和商务 务业		
	和 务业	2 3 4 0 00	0 1
	利、 和公共 管理业		
	务、 理和其 务业		
	和 会工作		
	化、 和 业		
	合		
	合	4 4	1 3

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 未 过 股 投资 股。

3 期 公 值 基金资产净值 大 的股票投资 细

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	00		10 100	4 043 24 00	1
2	033		0 00	3 4 3 00	43

3	002304	股份	23 00	3 3 4 00	41
4	000		1 2 0	3 0 43 30	32
	000		13 000	3 4 000 00	24
	00 0		14 120	3 4 2 00	24
	00 02	业	1 00	3 41 00 00	23
	031		100	3 03 431 00	1
	03		3 00	3 400 00	0
10	000		1 00	3 3 00 00	3

4 报告期 券 的 券投资组合

	券	公 值	基金资产净值
1	国 券	404 1	0
2	行票据		
3	金 券		
	其中： 策性金		
4	业 券		
	业 期 资券		
	中期票据		
	同业存		
	其		
10	合	404 1	0

报告期 公 值 基金资产净值 大 的前 券投资 细

	券代	券	量	公 值	基金资产净值
1	01	22 国 14	4 000	404 1	0

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。

报告期 公 值 基金资产净值 大 的前 金 投资 细

本基金本报告期 未 有 金 。

报告期 公 值 基金资产净值 大 的前 证投资 细

本基金本报告期 未 有 证。

报告期 本基金投资的股指期货

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 。

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 。

10 报告期 本基金投资的国 期

10 1 本期国 期 投资 策

本基金本报告期 未投资国 期 。

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 。

10 3 本期国 期 投资

本基金本报告期 未投资国 期 。

11 投资组合报告

11 1 本基金投资的前 证券的 行 本期 出现 管 ， 或
在报告 日前一年内 公 责、 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 。

11 2 基金投资的前 股票 出基金合同规定的 选股票

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 。

11 3 其 资产

		金
1	存出保证金	4 0 4
2	应 证券	
3	应 股利	
4	应 利	
	应	0 3 22
	其 应	
	其	
	合	4

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。

11 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 。

11 投资组合报告 的其 述

于 的原 ， 和 合 存在 。

§ 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	12 24 1 3	2 2 30
报告期期 基金 份	1 1 2 1	2 4 1 3
报告期期 基金 份	34 3 0 4	12 3 1 04 23
报告期期 基金 份 份 以		
报告期期 基金份	12 04 14	1 4 0

§ 基金管理人运用 有资金投资本基金

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。

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。

§ 投资者决策的其 重要信

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 。

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 。

§

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 。

2 存

基金管理人的 公 所。

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

2023 年 4 月 21 日