

长信电子信息行业量化灵活配置混合型证
券投资基金
2021 年第 2 季度报告

2021 年 6 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：2021 年 7 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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 7 月 19 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 月 1 日 2021 年 6 月 30 日。

§2 基金产

基金	长信电子信息量化混合
内	信息量化
基金代	19929
交代	19929
基金运作	型
基金合同日	2016 年 7 月 27 日
报告期 基金份	107 3 2 1 30 份
投资标	本基金通过量化的行的组合管理风险，并电子信息行业的业行投资，业绩基准的投资报。
投资策	<p>1、资产配置策</p> <p>本基金利用信息、行业信息以及的信息资，基于本基金的投资标和投资理，和个度行，资产配置，通过资产配置基金资产组合，实现组合内别资产的化配置，并对资产的配置行定期或不定期整。</p> <p>2、股投资策</p> <p>本基金合基金管理人量化年定量投资的，并不对、对组合产的的子，并利用定量，别不同股未来的性，并有期的股的投资组合，在组合风险的基，基准的投资报。</p>

	<p>3、 券投资策略</p> <p>本基金在 券资产的投资过 中， 用 的 投资策略， 合 策 、 期 、 期和中长期利 、 化等 来配置 券 ，在 的同 ，有 基金资产的整 风险。在个券的 ，本基金 合 运用 值策 、 期管理策 、利 期策 等 ， 合 券的 性、信用风险 等 ， 对个券 行 的管理。</p> <p>、其 型资产投资策略</p> <p>在 规或 管 的 ，本基金 在 投资风险 的基 证、资产 证 券、股指期 等金 的投资。</p>
业绩 基准	中证 产业 指 60 中证 合 指 0
风险	本基金 混合型基金， 于 风险、 的投资 ，其 期风险和 期 于股 型基金，但 于 券型基金和 基金。
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

§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	2021 年 月 1 日	2021 年 6 月 30 日
1 本期 实现			9 326 20
2 本期利			2 791 19 02
3 基金份 本期利			0 2169
期 基金资产净值			161 901 10 06
期 基金份 净值			1 0

：1、本期 实现 指基金本期利息 、投资 、其 不 公 值 用的 ，本期利 本期 实现 本期公 值

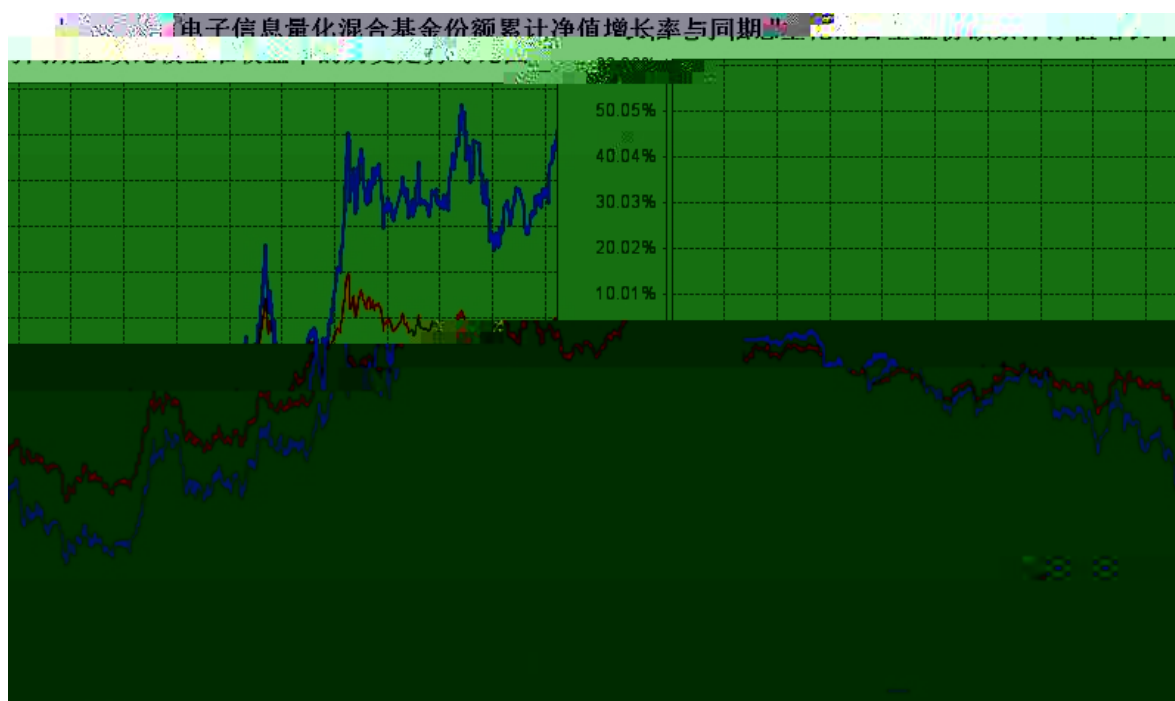
2、所述基金业绩指标不 有人 或交 基金的 用 ， 基金交 金、 基金的 、利 投资 、基金 等 ， 用 实 要 于所 。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增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	16.1	1.0	7.7	0.70	9.3	0.0
过 个月	7.33	1.71	2.92	0.0	1	0.91
过 一年	21.03	1.7	1.63	0.90	19.0	0
过 年	110.61	1.97	3.67	1.12	7.9	0
基金合同	0.0	1.71	10.10	1.00	0.70	0.71

3.2.2 基金合同以来基金份额净值增长及其同期业绩基准的



：1、 示日期 2016年7月27日 2021年6月30日。

2、 基金合同规定，本基金 基金合同 日 6个月内 期。 期 ，本基金的 投资 合基金合同的 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 行业灵活配置 混合型证券投资 基金、 长信量化 混合型证券投 资基金、长信 量化中 股 型证券投资 基金、长信电 子信息行业量 化灵活配置混 合型证券投资 基金、长信 保行业量 化股 型证券 投资基金、长 信 行 业量化股 型 证券投资基金、 长信量化 值 混合型证 券投资基金和 长信量化 策 股 型证券 投资基金的基 金 理、量化 投资 量化 、投资决策 会 行	2016 年 7 月 27 日		11 年	， 大 金 业 业。2010 年 7 月 长信基金管理有限责任公司， 事 量化投资 和风险绩 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 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 混 合型证券投资基金、长信利 灵活配置混合型证券投资基金、 长信 量化灵活配置混合 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 混 合型证券投资基金、长信 年 定期 灵活配置混合型证券投 资基金、长信 利 年定期 混 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 行业灵活配 置混合型证券投资基金、长 信量化 混合型证券投资基金、 长信量化中 股 型证券投资 基金、长信电子信息行业量化灵 活配置混合型证券投资基金、长信 保行业量化股 型证券投资 基金、长信 行业量化股 型证券投资基金、长信量化 值 混合型证券投资基金和长信量 化 策 股 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 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 交

4.3.1 公 交 度 的 行

本报告期内，公司 实行公 交 度，并 公 交 度 ， 投资决策 ，
交 行 的内 ，并通过 作 度、 和 保证公 交 原则的实现。同
，公司 通过对投资交 行的 、 和信息 来 对公 交 过 和 的
。

4.3.2 交 行 的

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

4.4 报告期内基金投资策 和运作

的提 ， 复 了 的应对 ， 复 的
对 ， 现在 公司一季报业绩 ， 期大 长的个股 。 年 于
度 ，银行 的 性 A股 季度 长股风 表现 。
， 季度行业 的表现 大， 长、 的 、 导 、 等行业 。
季度 内 表现 大， 、电子表现 前。 的 和
的 复 提 A股 的 对 ，有 于 中 的 型和产业 ，

在 型和产业 的 中 重要的作用， 的投资 会。电子 信息的 资产的 在不 提 ，值 长期配置。

季度， 有 复 ，资本或会 虚 实，所以 要 通 期 策的 和 性的 化， 要 资本在不同大 资产的 。前 的 在 ， 中和 指出了未来的 化 。 A 股的 化和 化的 ， 的整 有 ，财务 量不 的 公司 资金的 。 电子行业中的 和 导 公司 年业绩整 期， 导 过了前期 整 ， 值性 ， 前行业 ，产 ， 产 过了 ，产业 度， 公司业绩 长。 利用 、 性、 、交 等 个 的 型，来 存在的运行规 及 的 ， 中有 投资 会。通过量化 股 型 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

2021 年 6 月 30 日，长信电子信息量化混合份 净值 1 0 ，份 净值 1 0 ，本报告期内长信电子信息量化混合净值 长 16 1 ，同期业绩 基准 7 7 。

4.6 报告期内基金 有人 或基金资产净值

。

§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 1 62 1 9	91 2
	其中：股	1 1 62 1 9	91 2
2	基金投资		
3	定 投资		
	其中： 券		
	资产 证券		
	金 投资		
	金 投资		

6	金 资产		
	其中：的 金 资产		
7	银行存 和 金合	11 791 310 06	7 12
	其 资产	2 20 3	1 6
9	合	16 673 9 33	100 00

：本基金本报告期 未通过 股通交 投资 股。本基金本报告期 未 通证券出 业务。

5.2 报告期 行业 的股 投资组合

5.2.1 报告期 行业 的内股 投资组合

代	行业 别	公 值	基金资产净值
A	、 、 、 业	23 1	0 00
	业		
	业	111 2 106 17	6
	电 、 、 及 产和 应 业	662 00	0 00
	业	2 371 37	0 02
	和 业	37 99 13	0 02
	交通运 、 和 业		
	和 业		
	信息 、 和信息 务业	3 2 7 13	23 3
	金 业	3 721 10	0 02
	产业		
	和 务 务业		
	和 务业		
	利、 和公共 管理业	29 132 76	0 02
	务、 理和其 务业		
	和 会 作		
	化、 和 业	1 2 9 6 0 00	0 0
	合		
	合	1 1 62 1 9	93

5.2.2 报告期 行业 的 股通投资股 投资组合

：本基金本报告期未通过 股通交 投资 股。

5.3 期 公 值 基金资产净值 大 的股 投资**5.3.1 报告期 公 值 基金资产净值 大 的前 股 投资**

	股 代	股	量 股	公 值	基金资产净值
1	6 396		1 00	13 3 776 00	37
2	603 01	股份	3 000	11 270 000 00	6 96
3	600	信	1 0 0	9 1 396 00	67
	6 099	股份	7 00	1 360 00	6
	0021		6 00	7 3 32 00	1
6	300 96	中	0 2	7 991 26 92	9
7	002139	股份	3 00	7 9 012 00	
	000063	中 通	22 00	7 603 02 00	70
9	00072	A	1 1 00	7 1 112 00	
10	002230	大	10 00	7 3 2 70 00	

**5.3.2 期 公 值 基金资产净值 大 的 中 业股份
股 投资**

：本基金本报告期 未 有 中 业股份 股 。

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

：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

：本基金本报告期 未 有资产 证券。

5.7 报告期 公 值 基金资产净值 大 的前 金 投资

：本基金本报告期 未 有 金 。

5.8 报告期 公 值 基金资产净值 大 的前 证投资

：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 交**5.9.1 报告期 本基金投资的股指期货 和**

：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 期 交**5.10.1 本期 期 投资 策**

：本基金本报告期 未投资 期 。

5.10.2 报告期 本基金投资的 期 和

：本基金本报告期 未投资 期 。

5.10.3 本期 期 投资

：本基金本报告期 未投资 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 出基金合同规定的 股 的

报告期内本基金投资的前 股 中，不存在 出基金合同规定 股 的 。

5.11.3 其 资产

		金
1	存出保证金	1 323 76
2	应 证券	2 112 191 33
3	应 股利	
	应 利息	2 20 06
	应	2 19 2
6	其 应	
7	其	
	合	2 20 3

5.11.4 报告期 有的 于 股期的 券

：本基金本报告期 未 有 于 股期的 券。

5.11.5 报告期 前 股 中存在 通 限 的

：本基金本报告期 前 股 中不存在 通 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	11 6 1 7 0
报告期期 基金 份	19 779 96 77
报告期期 基金 份	2 091 62 2
报告期期 基金 份 份 以	
报告期期 基金份	107 3 2 1 30

§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 有资金投资本基金交

：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 重要信息**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 重要信息

：本基金本报告期末 投资者决策的其 重要信息。

§9

9.1

- 1、中 证 会 准 基金的
- 2、 长信电子信息行业量化灵活配置混合型证券投资基金基金合同
- 3、 长信电子信息行业量化灵活配置混合型证券投资基金
、 长信电子信息行业量化灵活配置混合型证券投资基金托管
、报告期内在指定报 的 公告的原
- 6、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

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 7 月 21 日