

长信低碳环保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：交通银行股份有限公司

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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金基金合同规定，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招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 2023 年 3 月 31 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	329,480,016.10 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 合指数收益率*20%	
风险收益	本基金 股票型基金，其 期收益和 期风险 于 合型基金、 券型基金和 基金， 于较 期收益和较 期风险的基金品 。	
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	
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
基金的交 代码	004925	013151
报告期末 基金的份额总额	275,246,520.85 份	54,233,495.25 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 2023 年 1 月 1 日 2023 年 3 月 31 日	
	长信低碳环保量化股票 A	长信低碳环保量化股票
1. 本期 实现收益	33,080,556.67	5,998,941.04
2. 本期利	42,840,470.32	8,737,735.91
3. 平 基金份额本期利	0.1537	0.1720
4. 期末基金资产净值	493,933,318.20	96,729,244.93
5. 期末基金份额净值	1.7945	1.7836

：1、本期 实现收益指基金本期利息收、投资收益、其收不公 值 收益用后的 额，本期利 本期 实现收益 本期公 值 收益

2、所述基金业绩指标不 有人 或交 基金的各 用例， 式基金交 金、开放式基金的 回、利再投资、基金 等，计 用后实 收益 平要低于所数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值 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

	净值 长率	净值 长率标	业绩比较基准 收益率	业绩比较基准 收益率标准		
过 个月	8.05%	1.27%	2.23%	0.90%	5.82%	0.37%
过 个月	17.30%	1.65%	7.45%	1.17%	9.85%	0.48%
过 一年	22.52%	2.00%	10.47%	1.41%	12.05%	0.59%
过 年	95.37%	2.18%	58.78%	1.49%	36.59%	0.69%
过 年	83.90%	1.93%	25.27%	1.41%	58.63%	0.52%
自基金合同 生效起至	79.45%	1.86%	13.65%	1.39%	65.80%	0.47%

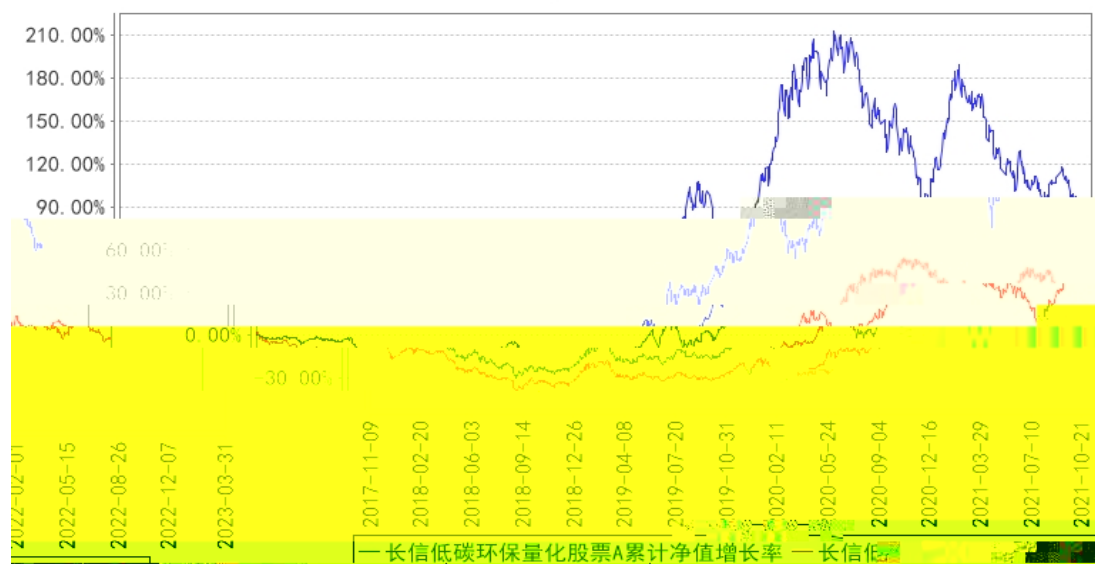
长信低碳环保量化股票

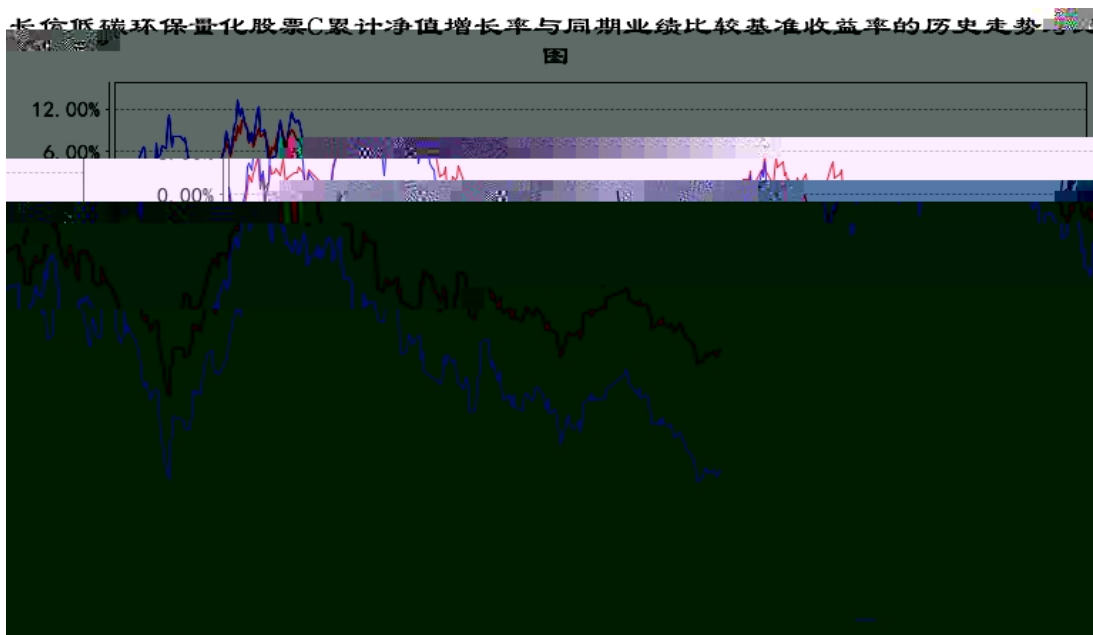
	净值 长率	净值 长率标	业绩比较基准	业绩比较基准		
--	-------	--------	--------	--------	--	--

		准	收益率	收益率标准		
过 个月	8.13%	1.27%	2.23%	0.90%	5.90%	0.37%
过 个月	17.46%	1.65%	7.45%	1.17%	10.01%	0.48%
过 一年	22.83%	2.00%	10.47%	1.41%	12.36%	0.59%
自份额 日起至	35.38%	2.14%	18.57%	1.44%	16.81%	0.70%

3.2.2 自基金合同生效以来基金 计净值 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、基金管理人自 2021 年 8 月 12 日起对长信低碳环保行业量化股票型证券投资基金进行份额类，原有基金份额 A 类份额， 类份额。
- 2、长信低碳环保量化股票 A 示日期 2017 年 11 月 9 日至 2023 年 3 月 31 日，长信低碳环保量化股票 示日期 2021 年 8 月 12 日 份额 日 至 2023 年 3 月 31 日。
- 3、 基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起 6 个月内 期 期 ，本基金的各 投资比例 合基金合同的约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理 或基金经理 组 简

	务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任 日期	任日期		
金保	长信 保 行业配置 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 息行业量化 配置 合型证券投资基金、长信低碳环保行业量化股票型证券投资基金、长信量化 策	2017 年 11 月 9 日		13 年	经 ， 大 金 业 研究生 业， 有基金从业资 ， 中 。2010 年 7 月 长信基金管 理有限责任公司，从事量化投资研究和风险绩效 作。 任公司数量 研究 和风险与绩效 研究 、量化研究部总 、长信中证中 企 业 100 指数证券投资基金 、长 信量化 策略股票型证券投资基金、 长信中证一带一 主 指数 证 券 投 资 基 金、长 信 中 证 展 主 指 数 型 证 券 投 资 基 金 、长 信

	<p>略股票型证券投资基金和长信中证 业 50 指数 型证 券投资基金的基金经 理、总经理 理、量 化投资部总 、投资 决策 会 行</p>			<p>量化优选 合型证券投资基金 、长信利 配置 合型证券投资 基金、长信 量化 配置 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 两年定期开 放 配置 合型证券投资基金、长 信 利 年定期开放 合型证券投资 基金、长信 300 指数 型证券 投资基金、长信 精选行业量化股 票型证券投资基金和长信量化 值 合型证券投资基金的基金经理。 现任总经理 理、量化投资部总 、 投资决策 会 行 、长信 保 行业 配置 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 信息行业量化 配置 合型证券投资基金、长信 低碳环保行业量化股票型证券投资 基金、长信量化 策略股票型证券投资 基金和长信中证 业 50 指数 型证券投资基金的基金经理。</p>
	<p>长信 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、长信低碳环保行 业量化股票型证券投 资基金、长信 保 行业 配置 合 型证券投资基金 和长信中证 业 50 指数 型证 券投资基金的基金经 理</p>	<p>2022 年 1 月 28 日</p>	<p>8 年</p>	<p>大金数 业， 有基 金从业资 ，中 。2015 年 7 月 长信基金管理有限责任公司， 任量化研究 、量化 投资经理、 基金经理 理，现任长信 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 信低碳环保行业量化股票型证券投资 基金、长信 保 行业 配置 合型证券投资基金 和长信中证 业 50 指数 型证券投资基 金的基金经理。</p>

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

2、证券从业的 从 证券业从业人 资 管理法 的 规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作 规 信 况的说明

本基金管理人在报告期内， 了 中 人 共和 证券投资基金法 及其 有 法

法规、基金合同的规定，勤勉尽责 基金份额 有人 求利益，不存在 基金份额 有人利 益的行 。

本基金将 以 信于 、 信于 会投资公 ，承诺将一 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 控制投资风险的前提 ， 基 金份额 有人 求 大利益。

4.3 公平交 说明

4.3.1 公平交 制度的 行 况

本报告期内，公司 实行公平交 制度，并 公平交 制度 ， 投资决策 ， 交 行环 的内部控制，并通过 作制度、 和 术 保证公平交 原则的实现。同 ，公司 通过对投资交 行的 控、 和信息 来 对公平交 过 和 的 。

4.3.2 交 行的 说明

本报告期内， 完全 有 指数的 比例进行投资的组合外，其 各投资组合未 生 与交 所公开 同日 交 交较 的 交 量超过 证券 日 交量的 5%的 ，未 现 交 行 。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作

年 以来，在复 复产 进，经 和复 的 ， 有所 复，各 基指数 。进 2023 年，在经 复 共 的 ，开年 来 行 ，1 月份 长 表现较 ， 风 等 源细 行业 有所表现。2 月后， 外银行 、 息等事 ， 外 性 ， 风险 回 ，同 ， 进 复 的 。过 中 料 ， 外 策 化， ，产业 存等 事 对 期 ，导 源 2、3 月份 ，同 4 一 经 出， 了 A 业化的 大 ， 起 主 投资 ，对于同 长 码 较 中的 源各 较大 ， 过 中，业绩 较 ， 期较 的标的 值收 明 。

展 未来，对于 ， 策 财 策 中 对 和，经 大 概率 和复 ，同 外 息 ，全球 性有 来 ，对 益资产有 作用， 对后 大 指数 观 度。对于 源 ， 各 在 经 定 ， 整 值 回 较低 ， 较 值 全 。从 求 来 ，

同 或风 求 未 明 ， 一 季 度 源 产 量 同 比 长 ， 企 存 ， 低 产 业 各 环 的 本 ， 产 复 于 料 一 度 和 的 ， 各 环 有 限 ， 但 求 和 本 低 的 大 不 ， 年 或 将 来 求 的 式 长 基 于 和 组 的 ， 的 本 以 大 ， 目 前 内 各 的 源 配 策 和 外 的 源 长 ， 较 大 的 展 。 目 前 内 源 率 于 型 长 ， 对 于 的 代 有 进 一 展 。 展 未 来 ， 源 产 业 经 中 制 业 的 一 的 ， 在 全 球 的 ， 源 产 业 展 策 ， 求 的 化 来 自 于 型 带 来 的 ， 的 化 来 自 于 规 效 应 的 化 、 术 的 进 以 及 产 业 一 化 的 ， 源 在 、 、 化 、 自 等 各 度 的 不 提 ， 与 的 比 较 优 将 会 明 ， 产 业 长 期 不 。 和 将 在 年 来 式 长 ， 、 、 等 术 的 产 业 化 和 的 业 式 通 ， 将 大 提 源 和 的 经 性 ， 同 原 料 的 将 进 一 提 产 业 环 的 盈 利 。 策 略 ， 将 以 基 本 量 化 主 的 化 投 资 式 ， 求 风 险 控 的 况 超 额 收 益 。

4.5 报告期内基金的业绩表现

至 2023 年 3 月 31 日，长信低碳环保量化股票 A 基金份额净值 1.7945 ，份额 计净值 1.7945 ，本报告期内长信低碳环保量化股票 A 净值 长率 8.05% 长信低碳环保量化股票 基金份额净值 1.7836 ，份额 计净值 1.7836 ，本报告期内长信低碳环保量化股票 净值 长率 8.13%，同期业绩比较基准收益率 2.23%。

4.6 报告期内基金 有人数或基金资产净值 说明

。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合 况

	目	金额	基金总资产的比例 %
1	益投资	549,360,837.17	92.33
	其中：股票	549,360,837.17	92.33
2	基金投资		
3	定收益投资		
	其中： 券		

	资产 证券		
4	金 投资		
5	金 生品投资		
6	金 资产		
	其中： 式回 的 金 资 产		
7	银行存 和 金合计	44,669,454.97	7.51
8	其 资产	945,690.80	0.16
9	合计	594,975,982.94	100.00

：本基金本报告期末未通过 股通交 制投资 股。本基金本报告期末未 与 通证券出
业务。

5.2 报告期末 行业 类的股票投资组合

5.2.1 报告期末 行业 类的 内股票投资组合

代码	行业类别	公 值	基金资产净值比例 %
A	、 、 、 业		
	业	13,509,563.69	2.29
	制 业	535,113,509.31	90.60
	、 、 及 生产和 应 业	368,222.80	0.06
	业		
	和 业	113,043.21	0.02
	交通运 、 和 业	16,118.86	0.00
	和 业		
	信息 、 和信息 术 务业	136,909.71	0.02
	金 业		
	产业		
	和 务 务业		
	研究和 术 务业		
	利、环 和公共 管理业	103,469.59	0.02
	务、 理和其 务业		
	生和 会 作		
	化、 和 业		
	合		
	合计	549,360,837.17	93.01

5.2.2 报告期末 行业 类的 股通投资股票投资组合

本基金本报告期末通过 股通交 制投资 股。

5.3 期末 公 值 基金资产净值比例大 的股票投资明细

5.3.1 报告期末 公 值 基金资产净值比例大 的前 股票投资明细

	股票代码	股票 称	数量 股	公 值	基金资产净值比例 %
1	300750	代	113,500	46,086,675.00	7.80
2	603659	来	577,682	28,832,108.62	4.88
3	002594	比	112,400	28,776,648.00	4.87
4	300014		333,758	23,262,932.60	3.94
5	600699		1,407,400	21,434,702.00	3.63
6	300124	术	270,400	19,009,120.00	3.22
7	002518		375,300	17,526,510.00	2.97
8	300450	导	428,300	17,337,584.00	2.94
9	600732	股份	514,400	17,031,784.00	2.88
10	688559	目	334,400	16,823,664.00	2.85

5.4 报告期末 券品 类的 券投资组合

本基金本报告期末未 有 券。

5.5 报告期末 公 值 基金资产净值比例大 的前 券投资明细

本基金本报告期末未 有 券。

5.6 报告期末 公 值 基金资产净值比例大 的前 资产 证券投资明 细

本基金本报告期末未 有资产 证券。

5.7 报告期末 公 值 基金资产净值比例大 的前 金 投资明细

本基金本报告期末未 有 金 。

5.8 报告期末 公 值 基金资产净值比例大 的前 证投资明细

本基金本报告期末未 有 证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货 交 况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货 和 益明细

本基金本报告期末未投资股指期货 。

5.9.2 本基金投资股指期货 的投资 策

本基金本报告期末未投资股指期货 。

5.10 报告期末本基金投资的 期 交 况说明

5.10.1 本期 期 投资 策

本基金本报告期末未投资 期 。

5.10.2 报告期末本基金投资的 期 和 益明细

本基金本报告期末未投资 期 。

5.10.3 本期 期 投资

本基金本报告期末未投资 期 。

5.11 投资组合报告

5.11.1 本基金投资的前 证券的 行主 本期 出现 管部 调 ， 或在报告 制日前一年内 公开 责、 的

报告期内本基金投资的前 证券的 行主 未出现 管部 调 ， 或在报告 制日前一年内 公开 责、 的 。

5.11.2 基金投资的前 股票 超出基金合同规定的 选股票

报告期内本基金投资的前 股票中，不存在超出基金合同规定 选股票 的 。

5.11.3 其 资产

	称	金额
1	存出保证金	229,719.95
2	应收证券	
3	应收股利	
4	应收利息	
5	应收	715,970.85
6	其 应收	
7	其	
8	合计	945,690.80

5.11.4 报告期末 有的 于 股期的 券明细

本基金本报告期末未 有 于 股期的 券。

5.11.5 报告期末前 股票中存在 通 限 况的说明

本基金本报告期末前 股票中不存在 通 限 况。

5.11.6 投资组合报告 的其 述部

于 的原 ， 之和与合计 存在 。

§ 6 开放式基金份额

：份

目	长信低碳环保量化股票 A	长信低碳环保量化股票
报告期期 基金份额总额	284,410,826.02	48,526,217.44
报告期期 基金总 份额	28,450,394.51	14,012,299.13
报告期期 基金总 回份额	37,614,699.68	8,305,021.32
报告期期 基金 份额 份额 以		
报告期期末基金份额总额	275,246,520.85	54,233,495.25

§ 7 基金管理人运用 有资金投资本基金 况

7.1 基金管理人 有本基金份额 况

：份

目	长信低碳环保量化股票 A	长信低碳环保量化股票
报告期期 管理人 有的本基金份额	148,231.95	
报告期期 总份额		
报告期期 出 回总份额		
报告期期末管理人 有的本基金份额	148,231.95	
报告期期末 有的本基金份额 基金总 份额比例 %	0.04	

：基金管理人运用 有资金投资本基金 率 本基金招募说明书中公 的 率 行。

7.2 基金管理人运用 有资金投资本基金交 明细

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 重要信息

8.1 报告期内 一投资者 有基金份额比例 或超过 20%的 况

本基金本报告期内未有 一投资者 有基金份额比例 或超过 20%的 况。

8.2 投资者决策的其 重要信息

本基金本报告期末 生 投资者决策的其 重要信息。

§ 9 目

9.1 目

- 1、中 证 会 准 基金的
- 2、长信低碳环保行业量化股票型证券投资基金基金合同

- 3、长信低碳环保行业量化股票型证券投资基金招募说明书
- 4、长信低碳环保行业量化股票型证券投资基金托管
- 5、报告期内在指定报 告的各 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 存放

基金管理人的 公 所。

9.3 阅方式

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