

长信电子信息行业量化灵活配置混合型证  
券投资基金  
2023 年第 2 季度报告

2023 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：2023 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 2023 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 2023 年 月 1 日 2023 年 6 月 30 日。

## § 2 基金产

基金	长信电子信息量化混合
基金代	19929
基金运作	型
基金合同日	2016 年 7 月 27 日
报告期 基金份	01 03 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 等信息资 ，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 的 性， 并有 期 的 股 投资组合，在 组合风险的基 ， 基准的投资 报。</p> <p>3、 券投资策</p> <p>本基金在 券资产的投资过 中， 用</p>

	<p>的投资策 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>、其型资产投资策略在规或管的，本基金在投资风险的基础证、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	
基金的基金	长信电子信息量化混合 A	长信电子信息量化混合
基金的 内	信息量化	
基金的交 代	19929	0131 3
报告期 基金的份	2 6 66 99 份	326 1 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 月 1 日	2023 年 6 月 30 日
	长信电子信息量化混合 A	长信电子信息量化混合
1 本期 实现	7 7 3 9	1 6 1 1 32
2 本期利	2 233 20 32	70 0 00
3 基金份 本期利	0 0262	0 102
期 基金资产净值	71 000 01	1 001 2
期 基金份 净值	1 037	1 029

：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 基金份额净值长及其同期业绩基准的

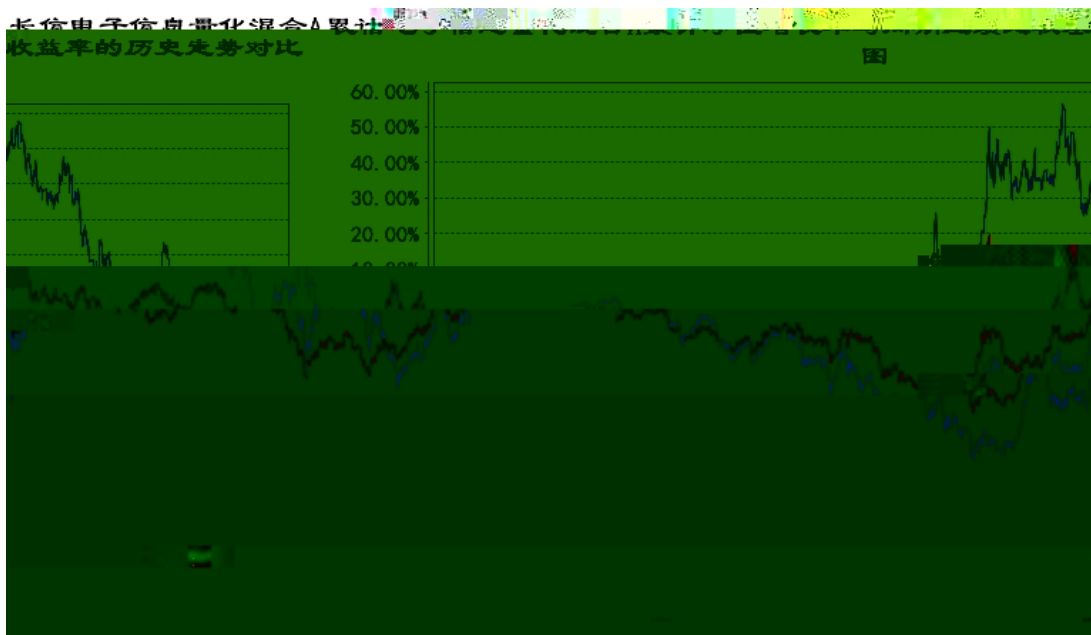
长信电子信息量化混合 A

	净值长	净值长标准	业绩基准	业绩基准标准		
过一个月	2.27%	1.2%	2.00%	1.17%	27%	0.6%
过两个月	20.6%	1.66%	1.00%	1.0%	6%	0.61%
过一年	7.7%	1.76%	%	0.96%	16.29%	0.0%
过半年	16.77%	1.79%	2.60%	0.93%	1.17%	0.6%
过半年	3%	1.90%	29.06%	1.0%	1.77%	0.0%
基金合同	3.70%	1.7%	1%	0.99%	1.1%	0.7%

长信电子信息量化混合

	净值长	净值长标准	业绩基准	业绩基准标准		
过一个月	2.1%	1.1%	2.00%	1.17%	1%	0.6%
过两个月	20.9%	1.6%	1.00%	1.0%	9%	0.60%
过一年	21%	1.76%	%	0.96%	16.76%	0.0%
份日	31.99%	1.1%	23%	0.96%	27.76%	0.0%

## 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 对长信电子信息量化灵活配置混合型证券投资基金 行份 ，原有基金份额 A 份 ， 份 。

2、长信电子信息量化混合 A 示日期 2016 年 7 月 27 日 2023 年 6 月 30 日，长信电子信息量化混合 示日期 2021 年 月 12 日 份 日 2023 年 6 月 30 日。

3、 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。

## § 管理人报告

### 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、长信量化 策 股 型证券投资基金、长信中证 业 0 指 型证券投资基金和长信中证 1000 指 型证券投资基金的基金 理、 理 理、量化投资 、投资决策 会 行	2016 年 7 月 27 日		13 年	， 大 金 业 业， 有基金 业资 ， 中 。 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 、量化 、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、长信 300 指 型证券投资 基金、长信 行业量化股 型证 券投资基金和长信量化 值 混合型 证券投资基金的基金 理。现任 理 理、量化投资 、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 量化 策 股 型证券投资 基金、长信 中证 业 0 指 型证券投资 基金和长信中证 1000 指 型证券投资 基金的基金 理。
	长信中证 00 指 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 300 指 型证券投资 基	2023 年 1 月 30 日		9 年	理 ， 交通大 应用 业， 有基金 业资 ， 中 。 担任 通期 股份有限公司 、前 基金管理有限公司投资 理 理和 证券股份有 限公司 。2016 年 9 月 长信基金管理 有限责任公司， 任 量化投资 、基金 理 理、量化 投资 、长信中证一带一 指

	金、长信 个月 有期 混合型证券投资 基金和长信电子 信息行业量化灵 活配置混合型证 券投资基金的基 金 理、量化			证券投资基金、长信中证 指 型证券投资基金、长 信 值 混合型证券投资基金、长信 券型证券投资基金和长信 保 行业灵活配置混合型证券投资基金 的基金 理，现任量化 、长信 中证 00 指 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 300 指 型证券投资 基金、长信 个月 有期混合型 证券投资基金和长信电子信息行业量化 灵活配置混合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。

## 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 。

## 3 公 交

### 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  
 。

### 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 。

### 报告期内基金的投资策 和运作

季度 化 ，其中通信和 表现出 ，电子和 于 整 表现 对一 。策 在 中 人 、 导 、信 和 据要 个 ， 在 个 内基于 度 、 值性 等 度 中 ， 的 20 公司 组合。

季度， 要 以 个 ：一 人 ， 于 大 型 用性 ， 大量公司在 大 型公司合作， 的产业 和理 ， 有 出 化的产 ， 提 性或者 ， 实现业绩的提 ， 其 内公司在产 有 的 ，有 复 代的 第 个 导 ， 导 前 于 期 行的 ， 存 不 ， 行业 度有 来复 ， 其 内的 业， 于 限 度 于 期， 标重 ， 产 量和 提 的 ， 公司的产 业绩确定性 第 信 和 据要 ， 化 型 的 ， 业 、应用 有 大的 ， 策 在 实，对 保 。

### 报告期内基金的业绩表现

2023 年 6 月 30 日 长信电子信息量化混合 A 基金份 净值 1 037 份 净值 1 037 本报告期内长信电子信息量化混合 A 净值 长 2 27 长信电子信息量化混合 基金份 净值 1 029 份 净值 1 029 本报告期内长信电子信息量化混合 净值 长 2 1 同期业绩 基准 2 00 。

### 6 报告期内基金 有人 或基金资产净值

。

## § 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	6 171 236 03	93 72
	其中：股	6 171 236 03	93 72
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	702 1 7	6 20
	其 资产	7 16 90	0 0
9	合	91 9 7 0 77	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。

## 2 报告期 行业 的股 投资组合

### 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		
	业		
	业	2 22 6 1 33	7
	电 、 、 及 产和 应 业		
	业		
	和 业		
	交通运 、 和 业		
	和 业		
	信息 、 和信息 务业	29 700 90 70	32 7
	金 业		
	产业		
	和 务 务业		
	和 务业		
	利、 和公共 管理业		
	务、 理和其 务业		
	和 会 作		
	化、 和 业	0 7 6 0 00	
	合		
	合	6 171 236 03	9 9

### 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。

## 3 期 公 值 基金资产净值 大 的股 投资

### 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	6 120		2	6 196 6 9 2	6 79
2	300 2	股份	63 22	0 1 6	6 37

3	000063	中 通	123 700	633 29 00	6 1
	002371		17 600	90 6 0 00	6 13
	300 32		23 00	909 72 00	3
6	300667		23 100	6 1 9 00	1
7	30067	信	2 3 3	96 7 2	93
	6036	股份	37 700	291 76 00	71
9	002236	大 股份	21 00	262 0 0 00	67
10	6 037		2 271	1 9 127	

**报告期 券 的 券投资组合**

本基金本报告期 未 有 券。

**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。

**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。

**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 。

**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。

**9 报告期 本基金投资的股指期货 交**

**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 。

**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 。

**10 报告期 本基金投资的 期 交**

**10 1 本期 期 投资 策**

本基金本报告期 未投资 期 。

**10 2 报告期 本基金投资的 期 和**

本基金本报告期 未投资 期 。

### 10 3 本期 期 投资

本基金本报告期 未投资 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 出基金合同规定的 股

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 。

### 11 3 其 资产

		金
1	存出保证金	30 0 1
2	应 证券	
3	应 股利	
	应 利息	
	应	3 72
6	其 应	
7	其	
	合	7 16 90

### 11 报告期 有的 于 股期的 券

本基金本报告期 未 有 于 股期的 券。

### 11 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 。

### 11 6 投资组合报告 的其 述

于 的原 ， 和 合 存在 。

## § 6 基金份

: 份

	长信电子信息量化混合 A	长信电子信息量化混合
报告期期 基金份	90 72 7 9	2 0 230 0
报告期期 基金 份	6 2 23	13 9 6 29 1

报告期期 基金 份	1 72 326 0	11 69 709 60
报告期期 基金 份 份		
以		
报告期期 基金份	2 6 66 99	326 1 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

: 份

	长信电子信息量化混合 A	长信电子信息量化混合
报告期期 管理人 有的本基金份	12 699 73	
报告期期 份		
报告期期 出 份		
报告期期 管理人 有的本基金份	12 699 73	
报告期期 有的本基金份 基金 份	0 1	

: 基金管理人运用 有资金投资本基金 本基金 中公 的 行。

### 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。

## § 投资者决策的其 重要信息

### 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

2023 年 7 月 21 日