

长盛中证金融地产指数证券投资基金（LOF）  
（原长盛中证金融地产指数分级证券投资  
基金转型）  
2020 年年度报告

2020 年 12 月 31 日

基金管理人：长盛基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2021 年 3 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 3 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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。

长盛中证金融地产指数证券投资基金（LOF）由长盛中证金融地产指数分级证券投资基金转型而来。《长盛中证金融地产指数分级证券投资基金基金合同》于 2015 年 6 月 16 日起正式生效。长盛中证金融地产指数分级证券投资基金于 2020 年 9 月 28 日起至 2020 年 10 月 28 日间以通讯方式召开基金持有人大会，并于 2020 年 10 月 29 日审议通过了《关于长盛中证金融地产指数分级证券投资基金转型有关事项的议案》，内容包括取消分级运作机制、调整运作方式等，并同意将转型后基金更名为“长盛中证金融地产指数证券投资基金（LOF）”。自 2020 年 12 月 1 日起，长盛中证金融地产指数分级证券投资基金转型为长盛中证金融地产指数证券投资基金（LOF）。《长盛中证金融地产指数证券投资基金（LOF）基金合同》生效，《长盛中证金融地产指数分级证券投资基金基金合同》同时失效。

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及其更新。

本年度报告财务资料已经审计，安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告。

本报告期自 2020 年 12 月 1 日（基金合同生效日）起至 12 月 31 日止（转型前报告期自 2020 年 1 月 1 日起至 2020 年 11 月 30 日止）。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>6</b>
2.1 基金基本情况（转型后）.....	6
2.1 基金基本情况（转型前）.....	6
2.2 基金产品说明（转型后）.....	6
2.2 基金产品说明（转型前）.....	7
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	8
2.5 其他相关资料（转型后）.....	8
2.5 其他相关资料（转型前）.....	8
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>9</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	9
3.2 基金净值表现（转型后）.....	10
3.2 基金净值表现（转型前）.....	12
3.3 其他指标.....	14
3.4 过去三年基金的利润分配情况.....	14
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>15</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	15
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	16
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	17
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	18
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	18
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	19
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	20
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	21
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	21
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>22</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	22
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	22
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	22
<b>§6 审计报告（转型后）</b> .....	<b>23</b>
6.1 审计报告基本信息.....	23
6.2 审计报告的基本内容.....	23
<b>§6 审计报告（转型前）</b> .....	<b>25</b>
6.1 审计报告基本信息.....	25
6.2 审计报告的基本内容.....	25
<b>§7 年度财务报表（转型后）</b> .....	<b>27</b>
7.1 资产负债表（转型后）.....	27
7.2 利润表.....	28
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	29
7.4 报表附注.....	30

<b>§7 年度财务报表 (转型前)</b> .....	<b>51</b>
7.1 资产负债表 (转型前) .....	51
7.2 利润表 .....	52
7.3 所有者权益 (基金净值) 变动表 .....	53
7.4 报表附注 .....	54
<b>§8 投资组合报告 (转型后)</b> .....	<b>79</b>
8.1 期末基金资产组合情况 .....	79
8.2 期末按行业分类的股票投资组合 .....	79
8.2 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 .....	81
8.3 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	85
8.4 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	86
8.5 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 .....	86
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	86
8.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	86
8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	86
8.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	87
8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	87
8.12 投资组合报告附注 .....	87
<b>§8 投资组合报告 (转型前)</b> .....	<b>90</b>
8.1 期末基金资产组合情况 .....	90
8.2 期末按行业分类的股票投资组合 .....	90
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 .....	91
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	96
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	97
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 .....	97
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	97
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	97
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	97
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	97
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	98
8.12 市场中性策略执行情况 .....	98
8.13 投资组合报告附注 .....	98
<b>§9 基金份额持有人信息 (转型后)</b> .....	<b>102</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	102
9.2 期末上市基金前十名持有人 .....	102
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	102
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 .....	102
<b>§9 基金份额持有人信息 (转型前)</b> .....	<b>103</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	103
9.2 期末上市基金前十名持有人 .....	103
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	103
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 .....	104
<b>§10 开放式基金份额变动 (转型后)</b> .....	<b>105</b>
<b>§10 开放式基金份额变动 (转型前)</b> .....	<b>106</b>
<b>§11 重大事件揭示</b> .....	<b>107</b>

11.1 基金份额持有人大会决议 .....	107
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	107
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	107
11.4 基金投资策略的改变 .....	107
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	107
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	107
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型后） .....	108
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况（转型前） .....	110
11.9 其他重大事件（转型后） .....	113
11.9 其他重大事件（转型前） .....	113
<b>§12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>118</b>
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况 .....	118
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	118
<b>§13 备查文件目录 .....</b>	<b>119</b>
13.1 备查文件目录 .....	119
13.2 存放地点 .....	119
13.3 查阅方式 .....	119

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况（转型后）

基金名称	长盛中证金融地产指数证券投资基金（LOF）
基金简称	长盛中证金融地产指数（LOF）
场内简称	金融地产
基金主代码	160814
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020年12月1日
基金管理人	长盛基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	98,277,641.92份
基金合同存续期	不定期

### 2.1 基金基本情况（转型前）

基金名称	长盛中证金融地产指数分级证券投资基金		
基金简称	长盛中证金融地产分级		
场内简称	金融地产		
基金主代码	160814		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2015年6月16日		
基金管理人	长盛基金管理有限公司		
基金托管人	中国银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	120,501,953.12份		
基金合同存续期（若有）	于2020年12月1日失效		
基金份额上市的证券交易所（若有）	深圳证券交易所		
上市日期（若有）	2015年6月26日		
下属分级基金的基金简称	长盛中证金融地产 分级A	长盛中证金融地 产分级B	长盛中证金融地 产分级
下属分级基金的场内简称	金融地A	金融地B	金融地产
下属分级基金的交易代码	150281	150282	160814
报告期末下属分级基金份额总额	0.00份	0.00份	120,501,953.12 份

### 2.2 基金产品说明（转型后）

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%，年跟踪误差不得超过4%，实现对中证金融地产指数的有效跟踪。
投资策略	本基金主要采取完全复制法，即按照标的指数成份股组成及其权重构建股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应的调整。但因特殊情况（如成份股长期停牌、成份股发生变更、成份股权重由于自由流通量发生变化、成份股公司行为、市场

	流动性不足等）导致本基金管理人无法按照标的指数构成及权重进行同步调整时，基金管理人将对投资组合进行优化，尽量降低跟踪误差。
业绩比较基准	中证金融地产指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为股票型指数基金，风险和预期收益均高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

## 2.2 基金产品说明（转型前）

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%，实现对中证金融地产指数的有效跟踪。		
投资策略	本基金主要采取完全复制法，即按照标的指数成份股组成及其权重构建股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应的调整。但因特殊情况（如成份股长期停牌、成份股发生变更、成份股权重由于自由流通量发生变化、成份股公司行为、市场流动性不足等）导致本基金管理人无法按照标的指数构成及权重进行同步调整时，基金管理人将对投资组合进行优化，尽量降低跟踪误差。		
业绩比较基准（若有）	中证金融地产指数收益率*95%+银行活期存款利率（税后）*5%		
风险收益特征（若有）	本基金为股票型指数基金，风险和预期收益均高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金，由于采取了基金份额分级的结构设计，不同的基金份额具有不同的风险收益特征。		
下属分级基金的风险收益特征	低风险、收益相对稳定	高风险、高预期收益	较高风险、较高预期收益

## 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		长盛基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张利宁	许俊
	联系电话	010-86497608	010-66594319
	电子邮箱	zhangln@csfunds.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-888-2666、010-86497888	95566
传真		010-86497999	010-66594942
注册地址		深圳市福田区中心区福中三路诺德金融中心主楼 10D	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址		北京市朝阳区安定路 5 号院 3 号楼中建财富国际中心 3-5 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码		100029	100818
法定代表人		周兵	刘连舸

**2.4 信息披露方式**

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.csfunds.com.cn">http://www.csfunds.com.cn</a>
基金年度报告备置地点	基金管理人的办公地址及基金托管人住所

**2.5 其他相关资料（转型后）**

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	中国北京市东城区东长安街 1 号东方广场东方经贸城安永大楼 16 层
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

**2.5 其他相关资料（转型前）**

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	中国北京市东城区东长安街 1 号东方广场东方经贸城安永大楼 16 层
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

### § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

转型后

金额单位：人民币元

<b>3.1.1 期间数据和指标</b>	2020年12月1日(基金合同生效日)至2020年12月31日
本期已实现收益	5,677,204.37
本期利润	-2,381,945.42
加权平均基金份额本期利润	-0.0234
本期加权平均净值利润率	-2.28%
本期基金份额净值增长率	-2.59%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	2020年12月31日
期末可供分配利润	15,366,042.78
期末可供分配基金份额利润	0.1564
期末基金资产净值	101,001,954.50
期末基金份额净值	1.0277
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	2020年12月31日
基金份额累计净值增长率	-2.59%

注：1、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，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、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。

3、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。表中的“期末”均指本报告期最后一日，即12月31日。

4、长盛中证金融地产指数证券投资基金（LOF）由长盛中证金融地产指数分级证券投资基金转型而来，转型日期为2020年12月1日（即基金合同生效日）。

转型前

金额单位：人民币元

<b>3.1.1 期间数据和指标</b>	2020年1月1日至 2020年11月30日	2019年	2018年
本期已实现收益	46,819,580.55	18,201,869.50	10,142,984.88
本期利润	30,222,863.24	63,063,545.75	-31,986,345.97
加权平均基金份额本期利润	0.1283	0.2695	-0.1298
本期加权平均净值利润率	14.30%	32.21%	-16.95%
本期基金份额净值增长率	17.09%	39.72%	-16.98%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	2020年11月30日	2019年末	2018年末
期末可供分配利润	12,137,412.34	-33,602,212.61	-54,667,757.65
期末可供分配基金份额利润	0.1007	-0.1201	-0.2265

期末基金资产净值	127,070,086.48	252,080,585.10	160,244,289.99
期末基金份额净值	1.055	0.901	0.664
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	2020年11月30日	2019年末	2018年末
基金份额累计净值增长率	22.02%	4.21%	-25.42%

注：1、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，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、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。

3、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。表中的“期末”均指本报告期最后一日。

## 3.2 基金净值表现（转型后）

### 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

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
自基金转型起至今	-2.59%	1.15%	-2.72%	1.20%	0.13%	-0.05%

注：本基金业绩比较基准的构建及再平衡过程：

本基金业绩比较基准：中证金融地产指数收益率\*95%+银行活期存款利率（税后）\*5%

再平衡：由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合基金合同要求，业绩比较基准中中证金融地产指数、银行活期存款利率每日按照 95%、5%的比例采取再平衡，再用连锁计算的方式得到基准指数的时间序列。

### 3.2.2 自基金转型以来基金份额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

基金份额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

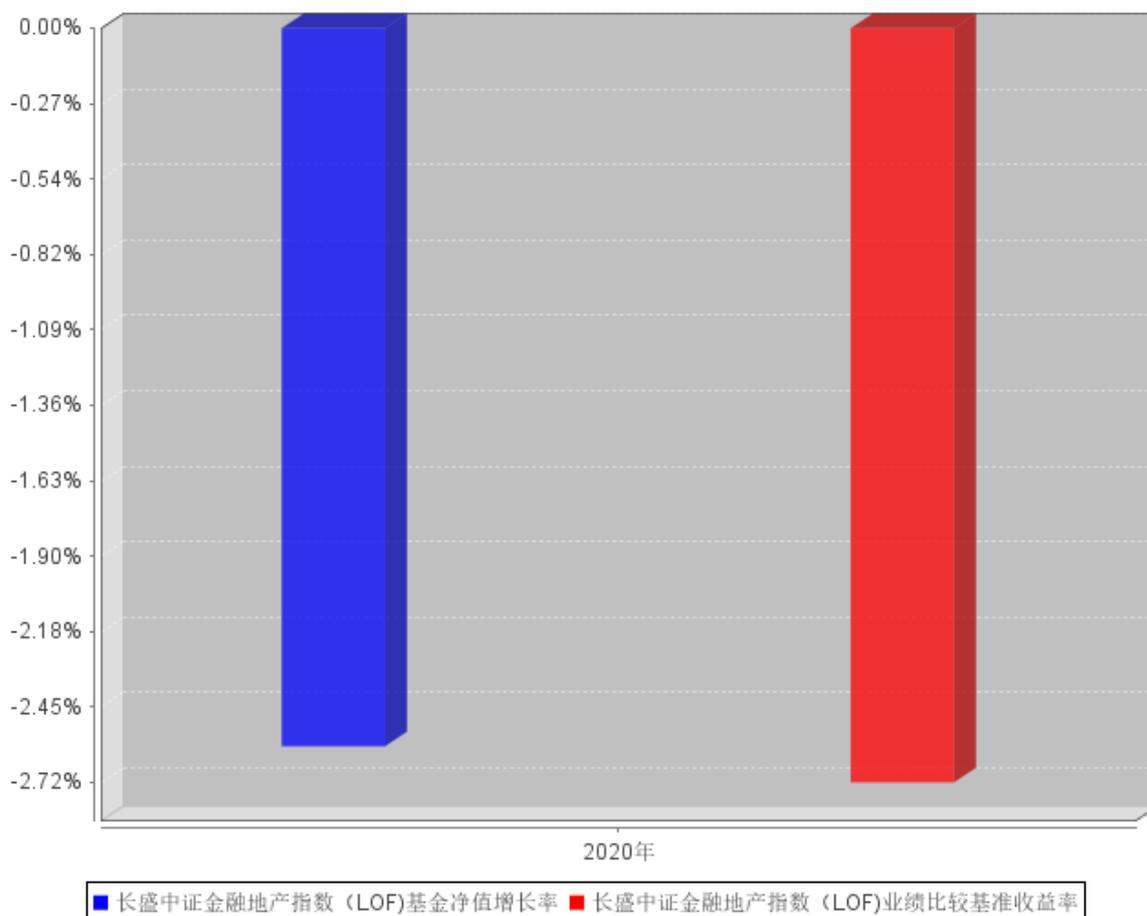


注：1、长盛中证金融地产指数证券投资基金（LOF）由长盛中证金融地产指数分级证券投资基金转型而来，转型日期为2020年12月1日（即基金合同生效日）。截至本报告期末本基金自合同生效未满一年。

2、按照本基金合同规定，本基金基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。截至报告日，本基金的各项资产配置比例符合基金合同的有关约定。

### 3.2.3 自基金转型以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

长盛中证金融地产指数（LOF）自基金转型以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：长盛中证金融地产指数证券投资基金（LOF）由长盛中证金融地产指数分级证券投资基金转型而来，转型日期为2020年12月1日（即基金合同生效日），合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

## 3.2 基金净值表现（转型前）

### 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

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	9.33%	1.06%	7.83%	1.08%	1.50%	-0.02%
过去六个月	25.45%	1.60%	16.47%	1.67%	8.98%	-0.07%
过去一年	17.09%	1.51%	3.23%	1.55%	13.86%	-0.04%
过去三年	35.82%	1.37%	8.23%	1.40%	27.59%	-0.03%
过去五年	46.65%	1.25%	11.85%	1.26%	34.80%	-0.01%
自基金合同生效起至今	22.02%	1.42%	-9.38%	1.45%	31.40%	-0.03%

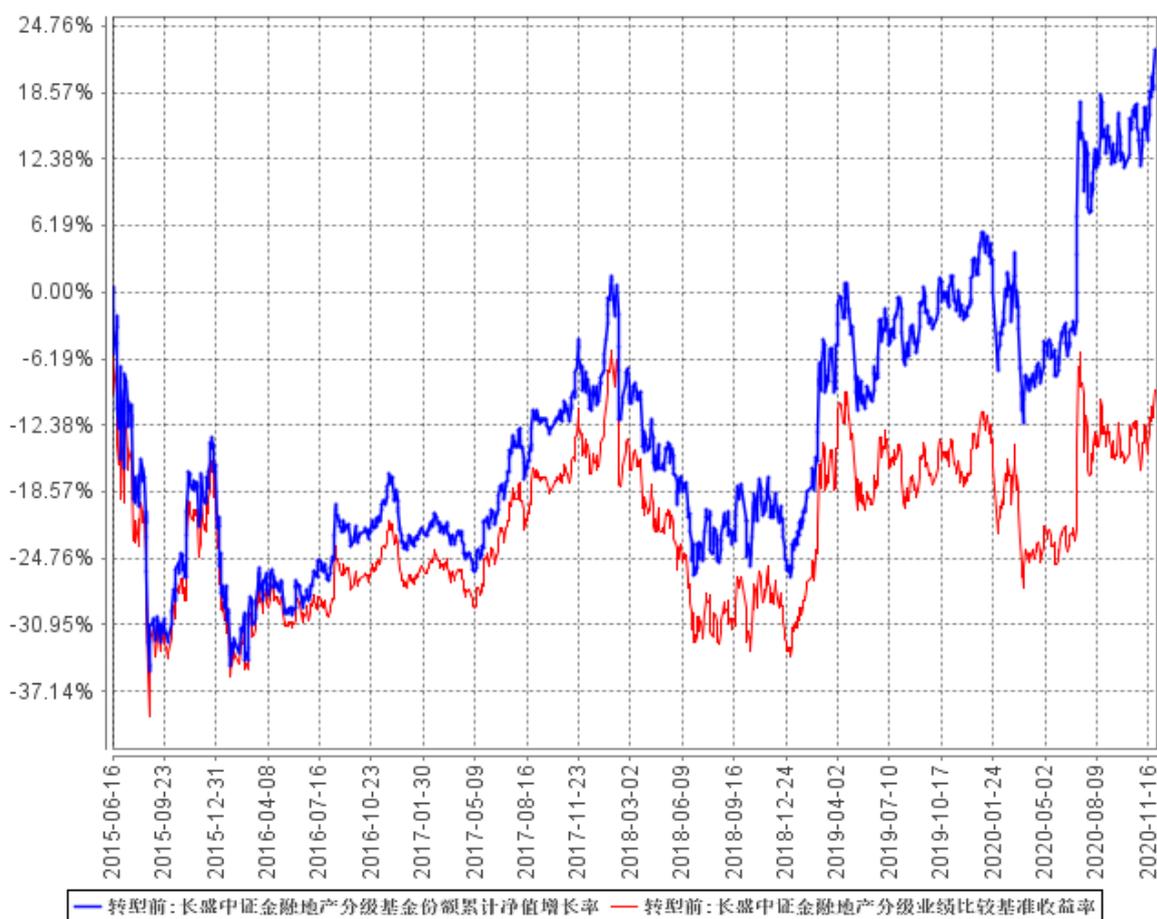
注：本基金业绩比较基准的构建及再平衡过程：

本基金业绩比较基准：中证金融地产指数收益率\*95%+银行活期存款利率(税后)\*5%

再平衡：由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合基金合同要求，业绩比较基准中中证金融地产指数、银行活期存款利率每日按照 95%、5%的比例采取再平衡，再用连锁计算的方式得到基准指数的时间序列。

### 3.2.2 自合同生效以来基金份额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

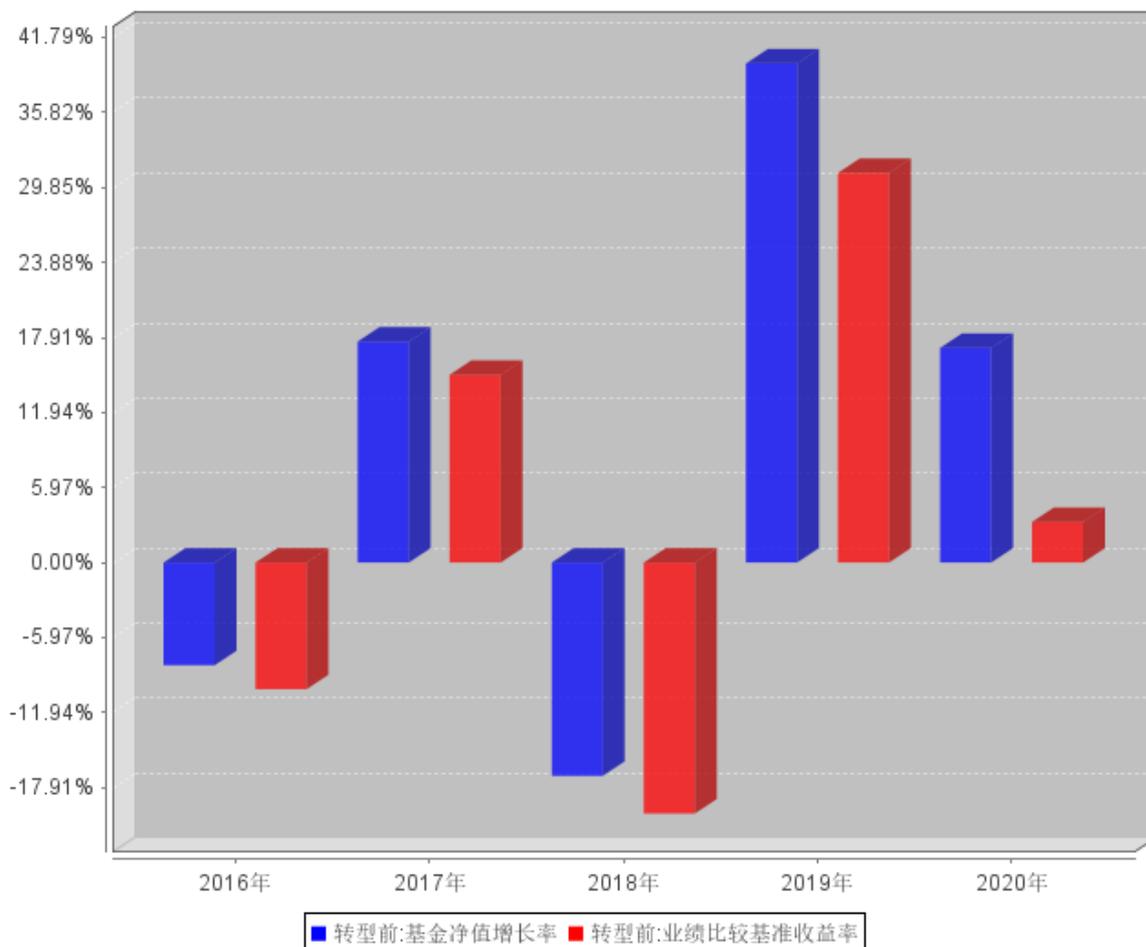
长盛中证金融地产分级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：按照本基金合同规定，本基金基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。截至报告日，本基金的各项资产配置比例符合基金合同的有关约定。

### 3.2.3 自合同生效以来每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：长盛中证金融地产指数分级证券投资基金已于 2020 年 12 月 1 日完成转型，2020 年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 其他指标

#### 3.4 过去三年基金的利润分配情况

转型前

注：本基金于过去三年未进行利润分配。

转型后

注：长盛中证金融地产指数证券投资基金（LOF）由长盛中证金融地产指数分级证券投资基金转型而来，转型日期为 2020 年 12 月 1 日（即基金合同生效日）。截至本报告期末本基金未进行利润分配。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为长盛基金管理有限公司（以下简称公司），成立于 1999 年 3 月 26 日，是国内最早成立的十家基金管理公司之一，公司注册资本为人民币 2.06 亿元。长盛基金总部办公地位于北京，在北京、上海、成都、深圳等地设有分支机构，并拥有全资子公司长盛基金（香港）有限公司和长盛创富资产管理有限公司。目前，公司股东及其出资比例为：国元证券股份有限公司占注册资本的 41%，新加坡星展银行有限公司占注册资本的 33%，安徽省信用担保集团有限公司占注册资本的 13%，安徽省投资集团控股有限公司占注册资本的 13%。公司拥有公募基金、全国社保基金、特定客户资产管理、合格境内机构投资者（QDII）、合格境外机构投资者（QFII）、保险资产管理人等业务资格。截至 2020 年 12 月 31 日，基金管理人共管理六十六只开放式基金，并管理多个全国社保基金组合和专户产品。公司同时兼任境外 QFII 基金和专户理财产品的投资顾问。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介（转型后）

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陈亘斯	本基金基金经理，长盛中小盘精选混合型证券投资基金基金经理，长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF) 基金经理，长盛上证 50 指数证券投资基金 (LOF) 基金经理，长盛中证 100 指数证券投资基金基金经理，长盛沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 基金经理，长盛中证申万一带一路主题指数分级证券投资基金基金经理，长盛中证全指证券公司指数分级证券投资基金基金经理，长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金基金经理。	2020 年 12 月 1 日	-	11 年	陈亘斯先生，硕士。曾任 PineRiver 资产管理公司量化分析师，国元期货有限公司金融工程部研究员、部门经理，北京长安德瑞威投资有限责任公司投资经理。2017 年 2 月加入长盛基金管理有限公司，曾任基金经理助理。

注：1、上表基金经理的任职日期和离任日期均指公司决定确定的聘任日期和解聘日期；

2、“证券从业年限”中“证券从业”的含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

**4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介（转型前）**

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陈亘斯	本基金基金经理，长盛中小盘精选混合型证券投资基金基金经理，长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金（LOF）基金经理，长盛上证 50 指数证券投资基金（LOF）基金经理，长盛中证 100 指数证券投资基金基金经理，长盛沪深 300 指数证券投资基金（LOF）基金经理，长盛中证申万一带一路主题指数分级证券投资基金基金经理，长盛中证全指证券公司指数分级证券投资基金基金经理，长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金基金经理。	2019 年 5 月 30 日	2020 年 11 月 30 日	11 年	陈亘斯先生，硕士。曾任 PineRiver 资产管理公司量化分析师，国元期货有限公司金融工程部研究员、部门经理，北京长安德瑞威投资有限责任公司投资经理。2017 年 2 月加入长盛基金管理有限公司，曾任基金经理助理。

注：1、上表基金经理的任职日期和离任日期均指公司决定确定的聘任日期和解聘日期；

2、“证券从业年限”中“证券从业”的含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

**4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况（转型后）**

本基金本报告期内无基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

**期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况（转型前）**

本基金本报告期内无基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

**4.1.4 基金经理薪酬机制（转型后）**

本基金基金经理薪酬激励不存在与私募资产管理计划浮动管理费或产品业绩表现挂钩的情况。

**基金经理薪酬机制（转型前）**

本基金基金经理薪酬激励不存在与私募资产管理计划浮动管理费或产品业绩表现挂钩的情况。

**4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明**

本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其各项实施准则、本基金的基金

合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规制定了《公司公平交易细则》，从投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等环节严格把关，通过系统和人工等方式在各个环节严格控制交易公平执行，确保公平对待不同投资组合，包括公募基金、社保组合、私募资产管理计划等，切实防范利益输送，保护投资者的合法权益。具体如下：

研究支持，公司旗下所有投资组合共享公司研究部门研究成果，所有投资组合经理在公司研究平台上拥有同等权限。

投资授权与决策，公司实行投资决策委员会领导下的投资组合经理负责制，各投资组合经理在投资决策委员会的授权范围内，独立完成投资组合的管理工作。各投资组合经理遵守投资信息隔离墙制度。

交易执行，公司实行集中交易制度，所有投资组合的投资指令均由交易部统一执行委托交易。交易部依照《公司公平交易细则》的规定，场内交易，强制开启恒生交易系统公平交易程序；场外交易，严格遵守相关工作流程，保证交易执行的公平性。

投资管理行为的监控与分析评估，公司风险管理部、监察稽核部持续、动态监督公司投资管理全过程，并进行分析评估，及时向公司管理层报告发现问题，保障公司旗下所有投资组合均被公平对待。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司相关制度等规定，通过系统和人工等方式在各个环节严格控制交易公平执行，确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送，保护投资者的合法权益。

公司对管理的不同投资组合过去 4 个季度的同向交易行为进行数量分析，计算溢价率、贡献率、占优比等指标，使用双边 90%置信水平对 1 日、3 日、5 日的交易片段进行 T 检验，未发现违反公平交易原则及利益输送的行为。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，未发现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的交易。

本报告期内，本基金未发生可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2020 年以社会融资为代表的流动性前高后低，但总体仍然显著高于历史平均水平，而在以 PPI 为代表的实体经济则呈现前低后高，但其总体水平呈逐年下降的趋势。年初国内经历了新型冠状病毒的重大疫情的爆发，社会经济活动急剧下降，而在二季度由于国家管控措施快速有力，经济生产活动逐步恢复。但国外疫情始终未得到有效控制，进入三季度又出现二次爆发形势，疫苗的大规模使用落后于计划进度，使得海外大部分国家的产能利用率始终受到抑制，而欧美日等发达国家的超大规模的货币释放或直接财政刺激又使得可贸易部门的商品需求维持在较高水平，而非可贸易部门的服务需求始终低迷。国内由于货币和财政政策的快速应对，使得经济在二季度逐步有效恢复，受益于供需两头国内循环以及补充海外产能缺口的行业逐步显现出超额收益。大科技、大消费、顺周期板块从年初到年末依次轮动。受国内外充裕的流动性和低利率水平影响，A 股市场的风险溢价由高位逐步回落，市场估值得到有效提升，尤其对于部分预期业绩高增长的公司形成“戴维斯双击”，市场总体以结构性上涨为主，但部分板块估值已处于历史高位。成长因子、财务质量因子的超额收益贯穿全年，也是我们配置组合的长期偏好。由于机构投资者的资金占比今年大幅提升，市值因子由年初偏向中小盘转为年末高度偏向大市值，风格切换较剧烈。

在操作中，我们严格遵守基金合同，在指数权重调整和基金申赎变动时，应用指数复制和数量化手段降低交易成本和减少跟踪误差。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2020 年 12 月 31 日，长盛中证金融地产指数（LOF）基金份额净值为 1.0277 元，本报告期（2020 年 12 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日）基金份额净值增长率为-2.59%；同期业绩比较基准收益率为-2.72%。

截至 2020 年 11 月 30 日，长盛中证金融地产分级基金份额净值为 1.055 元，本报告期（2020 年 1 月 1 日至 2020 年 11 月 30 日）基金份额净值增长率为 17.09%；同期业绩比较基准收益率为 3.23%。

自 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日，本基金日均跟踪偏离度为 0.0518%，年度化跟踪误差为 2.5571%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

随着年末全球主要大国的新冠疫苗研发和生产的快速推进，以及疫苗分发和注射的速度进一步提升，全球主要国家的经济活动有望在二季度之后得到显著修复。尤其是美国新政府对于积极

处理国内疫情和修复产能拉动经济的政策的转向，使得全球经济复苏前景转好。对于 A 股而言，国内外两方面的经济形势向好的预期使得人民币和美元的利率曲线变得陡峭化。此外大宗商品自 2020 年下半年普涨，通胀预期显著上升，中美两国的债券利差可能进一步收窄，使得离岸和在岸流动性可能在二季度以后边际上收紧。因此股市的估值继续提升的空间不大，甚至存在反转的可能性，对于已处于高估值的板块和行业形成相当压力，更需要关注上市公司的估值是否与业绩增长速度相匹配以及业绩增长的现金流质地和其可持续性，尤其是金融板块在 2020 年的利润压缩要求释放后，目前的低估值匹配合适的增速值得关注。价值因子、PEG 因子在 2021 年有望获得市场重新认可和定价。对于市场较有利的一面是美国新政府上任后短期更关注解决其本土问题，中美关系有望缓和，叠加 RCEP 和中欧 BIT 的签订，对于中国的对外贸易和投资环境有所改善。能充分利用好海外市场扩张机会的上市公司有可能带来持续的业绩改善并形成自我的护城河，这一板块值得重点关注。另外 A 股上市公司能扎实自主研发、做好国产替代，本质上也是通过技术和产品实力与海外企业在中国市场竞争，同样有望获得业绩支撑。总体而言，值得投资的优质公司需要具有参与到国内和国外其中至少一个市场和全球化对手同台竞技的竞争力。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人遵循合规运作、保护基金投资者利益的原则，结合监管要求、市场形势及自身业务发展需要，由独立于业务部门的监察稽核部对公司经营、受托资产的运作及员工行为的合规性进行监督、检查，发现问题及时督促相关部门改进，并定期制作检查报告报送公司管理层。具体工作情况如下：

1、加强合规宣导与培训，持续推动公司合规文化建设。报告期内，监察稽核部通过外请专业机构、内部自学、岗前培训、基金经理合规谈话、合规考试等多种形式，有重点、有针对性地开展合规培训工作，及时组织学习法律法规与监管文件，深化员工合规理念，提升员工合规工作技能。

2、持续完善公司制度规章体系建设。根据新法规、新监管要求，以及公司业务发展实际，及时督促、提示业务部门进行相关制度、流程的新订、修订与完善，保证公司制度规章的合法合规、全面、适时、有效。报告期内，公司除完成有关制度的新订、修订工作外，还要求业务部门就制度、流程变化内容与其他相关执行部门进行沟通，确保各相关部门对新订、修订内容的理解保持一致，保证制度、流程被严格执行。

3、加强合规监督，确保受托资产投资运作合法合规。紧密跟踪与投资运作相关的法律、法规、受托资产合同及公司制度等的规定，全面把控受托资产投资运作风险点，并以前述风险点为依据，检查、监督各受托资产投资运作合规情况。根据《公司公平交易细则》的规定，通过量化分析、

日常合规监督及事后专项检查评估等，确保公司旗下各受托资产被公平对待，防范非公平交易和利益输送。

4、加强专项稽核与检查力度，完善发现问题与改进情况的跟踪、落实机制，保障公司运营及受托资产投资运作合规。报告期内，公司监察稽核部开展定期、临时专项稽核，内容涵盖受托资产投资、研究、交易、销售、清算、产品开发、员工行为等。此外，根据业务发展需要、监管机构通报的业内问题，以及公司在日常监督中发现的问题，临时增加多个检查项目。稽核、检查工作中，监察稽核部重视对发现问题改进完成情况的跟踪，强调问题改进效率与效果，合理保障公司及受托资产合规、稳健运作。

5、参与新产品设计、新业务、新流程的合规论证工作，提供合规意见或建议，确保依法合规开展相关业务。

本基金管理人承诺：在今后的工作中，我们将继续以保护基金投资者的利益为宗旨，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，保障公司、受托资产合规运作。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及本基金合同约定，本基金管理人严格按照《企业会计准则》、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持投资品种进行估值。本基金管理人制订了证券投资基金估值政策与估值程序，设立基金估值小组，参考行业协会估值意见和独立第三方机构估值数据，确保基金估值的公平、合理。

本基金管理人制订的证券投资基金估值政策与估值程序确定了估值目的、估值日、估值对象、估值程序、估值方法以及估值差错处理、暂停估值和特殊情形处理等事项。本基金管理人设立了由公司总经理（担任估值工作小组组长）、公司督察长（担任估值工作小组副组长）、公司相关投资、研究部门分管领导、公司运营部分管领导、相关研究部门、相关投资部门、监察稽核部、风险管理部、信息技术部及业务运营部总监或指定人员组成的估值工作小组，负责研究、指导并执行基金估值业务。小组成员均具有多年证券、基金从业经验，具备基金估值运作、行业研究、风险管理或法律合规等领域的专业胜任能力。

基金经理参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

参与估值流程的各方还包括本基金托管人和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任，当存有异议时，托管人有责任要求基金管理公司作出合理解释，通过积极商讨达成一致意见。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已分别与中债金融估值中心有限公司和中证指数有限公司签署服务协议，由其分别按约定提供在银行间同业市场交易的债券品种和在交易所市场交易或挂牌的部分债券品种的估值数据。

#### **4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

根据本基金基金合同对基金利润分配原则的约定，2020 年度未实施利润分配。

本基金截至 2020 年 12 月 31 日，期末可分配利润为 15,366,042.78 元，其中，未分配利润已实现部分为 15,366,042.78 元，未分配利润未实现部分为 675,908.81 元。

本基金截至 2020 年 11 月 30 日（基金转型前一日），期末可分配利润为 12,137,412.34 元，其中，未分配利润已实现部分为 12,137,412.34 元，未分配利润未实现部分为 10,760,159.20 元。

#### **4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明**

本基金本报告期内不存在连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在长盛中证金融地产指数证券投资基金（LOF）（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

## § 6 审计报告（转型后）

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2021）审字第 60468688_A13 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	长盛中证金融地产指数证券投资基金（LOF）全体基金份额持有人
审计意见	<p>我们审计了长盛中证金融地产指数证券投资基金（LOF）的财务报表，包括 2020 年 12 月 31 日的资产负债表，2020 年 12 月 1 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日止期间的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的长盛中证金融地产指数证券投资基金（LOF）的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了长盛中证金融地产指数证券投资基金（LOF）2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年 12 月 1 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于长盛中证金融地产指数证券投资基金（LOF），并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
其他事项	<p>长盛中证金融地产指数证券投资基金（LOF）管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估长盛中证金融地产指数证券投资基金（LOF）的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督长盛中证金融地产指数证券投资基金（LOF）的财务报告过程。</p>

注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>（2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>（3）评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>（4）对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对长盛中证金融地产指数证券投资基金（LOF）持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致长盛中证金融地产指数证券投资基金（LOF）不能持续经营。</p> <p>（5）评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	王珊珊   王海彦
会计师事务所的地址	中国北京
审计报告日期	2021年3月26日

## § 6 审计报告（转型前）

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2021）审字第 60468688_A33 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	长盛中证金融地产指数分级证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>我们审计了长盛中证金融地产指数分级证券投资基金的财务报表，包括 2020 年 11 月 30 日的资产负债表，2020 年 1 月 1 日至 2020 年 11 月 30 日止期间的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的长盛中证金融地产指数分级证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了长盛中证金融地产指数分级证券投资基金 2020 年 11 月 30 日的财务状况以及 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 11 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于长盛中证金融地产指数分级证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
其他事项	<p>长盛中证金融地产指数分级证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估长盛中证金融地产指数分级证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督长盛中证金融地产指数分级证券投资基金的财务报告过程。</p>

注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对长盛中证金融地产指数分级证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致长盛中证金融地产指数分级证券投资基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	王珊珊   王海彦
会计师事务所的地址	中国北京
审计报告日期	2021 年 3 月 26 日

## § 7 年度财务报表 (转型后)

## 7.1 资产负债表 (转型后)

会计主体: 长盛中证金融地产指数证券投资基金 (LOF)

报告截止日: 2020 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 日
<b>资产:</b>		
银行存款	7.4.7.1	14,797,228.71
结算备付金		13,135.92
存出保证金		57,545.57
交易性金融资产	7.4.7.2	95,344,427.27
其中: 股票投资		95,344,427.27
基金投资		-
债券投资		-
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
应收证券清算款		-
应收利息	7.4.7.5	674.01
应收股利		-
应收申购款		155,319.78
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		110,368,331.26
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2020 年 12 月 31 日</b>
<b>负债:</b>		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		6,377,050.85
应付赎回款		2,517,349.81
应付管理人报酬		88,275.77
应付托管费		19,420.67
应付销售服务费		-
应付交易费用	7.4.7.7	117,830.35
应交税费		158.53
应付利息		-

应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	246,290.78
负债合计		9,366,376.76
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	7.4.7.9	84,960,002.91
未分配利润	7.4.7.10	16,041,951.59
所有者权益合计		101,001,954.50
负债和所有者权益总计		110,368,331.26

注：1、自2020年12月1日起，原长盛中证金融地产指数分级证券投资基金转型为长盛中证金融地产指数证券投资基金（LOF），本报告期自2020年12月1日至2020年12月31日。

2、报告截止日2020年12月31日，基金份额净值1.0277元，基金份额总额98,277,641.92份。

## 7.2 利润表

会计主体：长盛中证金融地产指数证券投资基金（LOF）

本报告期：2020年12月1日（基金合同生效日）至2020年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期
		2020年12月1日（基金合同生效日）至2020年12月31日
<b>一、收入</b>		-2,106,422.04
1. 利息收入		7,195.42
其中：存款利息收入	7.4.7.11	2,472.87
债券利息收入		2.03
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		-
证券出借利息收入		4,720.52
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		5,905,527.09
其中：股票投资收益	7.4.7.12	5,881,185.84
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13	2,690.77
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-
股利收益	7.4.7.16	21,650.48
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-8,059,149.79
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	40,005.24
<b>减：二、费用</b>		275,523.38

1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	88,275.77
2. 托管费	7.4.10.2.2	19,420.67
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	7.4.7.19	79,483.11
5. 利息支出		-
其中: 卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		16.99
7. 其他费用	7.4.7.20	88,326.84
<b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b>		<b>-2,381,945.42</b>
减: 所得税费用		-
<b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>		<b>-2,381,945.42</b>

注: 自 2020 年 12 月 1 日起, 原长盛中证金融地产指数分级证券投资基金转型为长盛中证金融地产指数证券投资基金 (LOF), 本报告期自 2020 年 12 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日。

### 7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体: 长盛中证金融地产指数证券投资基金 (LOF)

本报告期: 2020 年 12 月 1 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

项目	本期 2020 年 12 月 1 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	104,172,514.94	22,897,571.54	127,070,086.48
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-2,381,945.42	-2,381,945.42
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)	-19,212,512.03	-4,473,674.53	-23,686,186.56
其中: 1. 基金申购款	12,769,813.21	2,242,538.64	15,012,351.85
2. 基金赎回款(以“-”号填列)	-31,982,325.24	-6,716,213.17	-38,698,538.41
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	84,960,002.91	16,041,951.59	101,001,954.50

注: 自 2020 年 12 月 1 日起, 原长盛中证金融地产指数分级证券投资基金转型为长盛中证金融地产指数证券投资基金 (LOF), 本报告期自 2020 年 12 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>林培富</u>	<u>刁俊东</u>	<u>龚珉</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

根据原长盛中证金融地产指数分级证券投资基金基金份额持有人大会审议通过的《关于长盛中证金融地产指数分级证券投资基金转型有关事项的议案》以及相关法律法规的规定，并向中国证券监督管理委员会备案，长盛中证金融地产指数分级证券投资基金于 2020 年 12 月 1 日转型为长盛中证金融地产指数证券投资基金（LOF）（以下简称“本基金”），原长盛中证金融地产指数分级证券投资基金基金份额持有人持有的长盛中证金融地产份额、长盛中证金融地产 A 份额、长盛中证金融地产 B 份额均转换成长盛中证金融地产指数证券投资基金（LOF）基金份额。本基金为上市契约型开放式（LOF），存续期限为不定期。本基金的基金管理人为长盛基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数成份股及其备选成份股、债券、债券回购、股指期货、货币市场工具、资产支持证券以及中国证监会允许基金投资的其它金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%且不低于非现金基金资产的 80%。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的业绩比较基准为：中证金融地产指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%。

### 7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定及参考意见。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年 12 月 1 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净值变动情况。

### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

#### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间系 2020 年 12 月 1 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日止。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

##### (1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括股票投资、债券投资和衍生工具等；

##### (2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券等，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债

的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债；

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

#### (1) 股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资，股票投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账；

卖出股票于成交日确认股票投资收益，卖出股票的成本按移动加权平均法于成交日结转；

#### (2) 债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

#### (3) 权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账；

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益，卖出权证的成本按移动加权平均法于成交日结转；

#### (4) 分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本；

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算；

#### (5) 回购协议

本基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的股票投资、债券投资和权证投资等投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述估值原则仍不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能适当反映公允价值的方法估值；

(4)如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

#### 7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

(1)存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2)债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3)资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4)买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5)股票投资收益/（损失）于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6)债券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 衍生工具收益/（损失）于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(8) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(9) 公允价值变动收益/（损失）系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(10) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

#### **7.4.4.10 费用的确认和计量**

本基金的管理人报酬和托管费等在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### **7.4.4.11 基金的收益分配政策**

(1) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每份基金份额每年收益分配次数最多为 4 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 20%，具体分配方案以公告为准，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

(2) 本基金场外份额收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金场外份额默认的收益分配方式是现金分红。本基金场内份额的收益分配方式仅为现金分红，具体权益分配程序等有关事项遵循深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定；

(3) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

(4) 投资者的现金红利保留到小数点后第 2 位，由此误差产生的收益或损失由基金资产承担；

(5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可对基金收益分配原则进行调整，不需召开基金份额持有人大会。

#### **7.4.4.12 分部报告**

无。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

无。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

无。

#### 7.4.6 税项

##### 7.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变。

##### 7.4.6.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入免征增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入免征增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规

定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额；

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按规定的比例缴纳。

#### 7.4.6.3 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

#### 7.4.6.4 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号《财政部国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额

计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日
活期存款	14,797,228.71
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计：	14,797,228.71

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	估值增值
股票	84,757,424.68	95,344,427.27	10,587,002.59
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	84,757,424.68	95,344,427.27	10,587,002.59

##### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：无。

##### 7.4.7.4 买入返售金融资产

注：无。

**7.4.7.5 应收利息**

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日
应收活期存款利息	642.21
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	5.90
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	25.90
合计	674.01

**7.4.7.6 其他资产**

注：无。

**7.4.7.7 应付交易费用**

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日
交易所市场应付交易费用	117,830.35
银行间市场应付交易费用	-
合计	117,830.35

**7.4.7.8 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	6,290.78
应付证券出借违约金	-
预提费用	190,000.00
指数使用费	50,000.00
合计	246,290.78

**7.4.7.9 实收基金**

金额单位：人民币元

项目	本期 2020年12月1日(基金合同生效日)至2020年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额

基金合同生效日	120,501,953.12	104,172,514.94
基金份额折算调整	-	-
未领取红利份额折算调整	-	-
集中申购募集资金本金及利息	-	-
基金拆分和集中申购完成后	-	-
本期申购	14,771,514.50	12,769,813.21
本期赎回 (以“-”号填列)	-36,995,825.70	-31,982,325.24
本期末	98,277,641.92	84,960,002.91

注：申购含转换入份额及金额，赎回含转换出份额及金额。

#### 7.4.7.10 未分配利润

金额单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	12,137,412.34	10,760,159.20	22,897,571.54
本期利润	5,677,204.37	-8,059,149.79	-2,381,945.42
本期基金份额交易产生的变动数	-2,448,573.93	-2,025,100.60	-4,473,674.53
其中：基金申购款	2,160,696.96	81,841.68	2,242,538.64
基金赎回款	-4,609,270.89	-2,106,942.28	-6,716,213.17
本期已分配利润	-	-	-
本期末	15,366,042.78	675,908.81	16,041,951.59

#### 7.4.7.11 存款利息收入

项目	本期 2020年12月1日(基金合同生效日)至2020年12月31日
活期存款利息收入	2,378.74
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	17.13
其他	77.00
合计	2,472.87

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年12月1日(基金合同生效日)至2020年12月31日
卖出股票成交总额	35,253,728.24
减：卖出股票成本总额	29,372,542.40
买卖股票差价收入	5,881,185.84

**7.4.7.13 债券投资收益****7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2020年12月1日(基金合同生效日)至2020年 12月31日
债券投资收益——买卖债券(、债转股及债券到期兑付)差价收入	2,690.77
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	2,690.77

**7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2020年12月1日(基金合同生效日)至2020年 12月31日
卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成交总额	24,692.80
减：卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成本总额	22,000.00
减：应收利息总额	2.03
买卖债券差价收入	2,690.77

**7.4.7.14 贵金属投资收益**

注：无。

**7.4.7.15 衍生工具收益**

注：无。

**7.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2020年12月1日(基金合同生效日)至2020年12 月31日
股票投资产生的股利收益	21,650.48
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	21,650.48

**7.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年12月1日(基金合同生效日)至2020 年12月31日
------	---

1. 交易性金融资产	-8,059,149.79
——股票投资	-8,059,149.79
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-8,059,149.79

#### 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年12月1日(基金合同生效日)至2020年 12月31日
基金赎回费收入	39,909.28
基金转换费收入	95.96
合计	40,005.24

#### 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年12月1日(基金合同生效日)至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月 31日
交易所市场交易费用	79,483.11	-
银行间市场交易费用	-	-
交易基金产生的费用	-	-
其中：申购费	-	-
赎回费	-	-
合计	79,483.11	-

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年12月1日(基金合同生效日)至2020 年12月31日
审计费用	15,083.45
信息披露费	10,163.55
证券出借违约金	-
银行汇划费	246.94
律师费	11,625.00

指数使用费	43,827.10
公证费	7,380.80
合计	88,326.84

#### 7.4.7.21 分部报告

无。

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

无。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要说明的重大资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
长盛基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人、基金代销机构
国元证券股份有限公司（“国元证券”）	基金管理人股东、基金代销机构
新加坡星展银行有限公司	基金管理人股东
安徽省信用担保集团有限公司	基金管理人股东
安徽省投资集团控股有限公司	基金管理人股东
长盛创富资产管理有限公司	基金管理人子公司
长盛基金（香港）有限公司	基金管理人子公司

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年12月1日(基金合同生效日)至2020年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
国元证券	8,044,638.38	17.12%

**7.4.10.1.2 债券交易**

注：无。

**7.4.10.1.3 债券回购交易**

注：无。

**7.4.10.1.4 权证交易**

注：无。

**7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年12月1日(基金合同生效日)至2020年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国元证券	7,490.81	19.64%	7,490.81	6.36%

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

**7.4.10.2 关联方报酬****7.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2020年12月1日(基金合同生效日)至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	88,275.77
其中：支付销售机构的客户维护费	29,217.26

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的1.00%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.00\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

**7.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2020 年 12 月 1 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	19,420.67

注：基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.22% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.22\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

#### 7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

##### 7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

注：无。

##### 7.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

注：无。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：无。

##### 7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：无。

#### 7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期	
	2020 年 12 月 1 日(基金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入
中国银行	14,797,228.71	2,378.74

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无。

### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

### 7.4.11 利润分配情况

注：无。

### 7.4.12 期末（2020 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

#### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	说明
600919	江苏银行	2020 年 12 月 17 日	2021 年 1 月 14 日	配股未上市	4.59	5.46	41,160	188,924.40	224,733.60	-
605277	新亚电子	2020 年 12 月 25 日	2021 年 1 月 6 日	新股未上市	16.95	16.95	507	8,593.65	8,593.65	-
003030	祖名股份	2020 年 12 月 25 日	2021 年 1 月 6 日	新股未上市	15.18	15.18	480	7,286.40	7,286.40	-
003031	中瓷电子	2020 年 12 月 24 日	2021 年 1 月 4 日	新股未上市	15.27	15.27	387	5,909.49	5,909.49	-
688408	中信博	2020 年 8 月 20 日	2021 年 3 月 1 日	限售期锁定	42.19	160.48	2,225	93,872.75	357,068.00	-
688185	康希诺	2020 年 8 月 4 日	2021 年 2 月 18 日	限售期锁定	209.71	355.44	933	195,659.43	331,625.52	-
688595	芯海科技	2020 年 9 月 18 日	2021 年 3 月 29 日	限售期锁定	22.82	60.56	3,190	72,795.80	193,186.40	-
688559	海目星	2020 年 8 月 28 日	2021 年 3 月 9 日	限售期锁定	14.56	30.95	5,529	80,502.24	171,122.55	-
688060	云涌科技	2020 年 7 月 3 日	2021 年 1 月 11 日	限售期锁定	44.47	81.62	2,016	89,651.52	164,545.92	-
688229	博睿数据	2020 年 8 月 7 日	2021 年 2 月 18 日	限售期锁定	65.82	101.20	1,414	93,069.48	143,096.80	-
688335	复洁环保	2020 年 8 月 7 日	2021 年 2 月 18 日	限售期锁定	46.22	36.68	2,242	103,625.24	82,236.56	-
688571	杭华股份	2020 年 12 月 2 日	2021 年 6 月 11 日	限售期锁定	5.33	9.43	6,757	36,014.81	63,718.51	-

注：1、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

2、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：无。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了以董事会风险控制委员会为核心的，由董事会风险控制委员会、经营管理层及各具体业务部门组成的三道风险监控防线；并在后两道监控防线中，由独立于公司管理层和其他业务部门的督察长和监察稽核部对公司合规风险状况及各部门风险控制措施进行检查、监督及报告。

#### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

#### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

##### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控

制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控流动性受限资产比例、流动性资产比例及压力测试等方式防范流动性风险，并对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易。因此，除在附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。除附注 7.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额一般为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

#### 7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的公允价值和未来现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

金额单位：人民币元

本期末 2020 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	14,797,228.71	-	-	-	14,797,228.71
结算备付金	13,135.92	-	-	-	13,135.92
存出保证金	57,545.57	-	-	-	57,545.57
交易性金融资产	-	-	-	95,344,427.27	95,344,427.27

应收利息	-	-	674.01	674.01
应收申购款	-	-	155,319.78	155,319.78
资产总计	14,867,910.20	-	95,500,421.06	110,368,331.26
负债				
应付证券清算款	-	-	6,377,050.85	6,377,050.85
应付赎回款	-	-	2,517,349.81	2,517,349.81
应付管理人报酬	-	-	88,275.77	88,275.77
应付托管费	-	-	19,420.67	19,420.67
应付交易费用	-	-	117,830.35	117,830.35
应交税费	-	-	158.53	158.53
其他负债	-	-	246,290.78	246,290.78
负债总计	-	-	9,366,376.76	9,366,376.76
利率敏感度缺口	14,867,910.20	-	86,134,044.30	101,001,954.50

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：本基金本报告期末未持有债券投资或持有的债券投资占比并不重大，因而市场利率的变动对本基金资产净值无重大影响。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要为市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于上市交易的证券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。并且，基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，动态、及时地跟踪和控制其他价格风险。

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日

	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	95,344,427.27	94.40
合计	95,344,427.27	94.40

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定本基金的业绩比较基准变化 5%，其他变量不变；	
	用期末时点比较基准浮动 5%基金资产净值相应变化来估测组合市场价格风险；	
	Beta 系数是根据组合在过去一个年度的基金资产净值和基准指数数据回归得出，反映了基金和基准的相关性。	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） 本期末（2020 年 12 月 31 日）
	5%	4,878,053.02
	-5%	-4,878,053.02

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 7.4.14.1 公允价值

本基金非以公允价值计量的金融工具，因其剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

##### (1) 各层次金融工具公允价值

本基金本报告期末持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为人民币 93,816,037.47 元，属于第二层次的余额为人民币 1,528,389.80 元，无属于第三层次的余额。

##### (2) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和可转换债券等，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关股票和可转换债券的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。本基金持有的以公允价值计量的金融工具第三层次公允价值金额本期未发生变动。

##### 7.4.14.2 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

##### 7.4.14.3 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

##### 7.4.14.4 财务报表的批准

本财务报表已于 2021 年 3 月 26 日经本基金的基金管理人批准。

## § 7 年度财务报表 (转型前)

## 7.1 资产负债表 (转型前)

会计主体: 长盛中证金融地产指数分级证券投资基金

报告截止日: 2020 年 11 月 30 日

单位: 人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 11 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
<b>资产:</b>			
银行存款	7.4.7.1	19,020,339.10	15,613,599.48
结算备付金		-	-
存出保证金		23,690.97	35,875.22
交易性金融资产	7.4.7.2	120,339,810.98	237,795,515.45
其中: 股票投资		120,339,810.98	237,795,515.45
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	13,028.31	3,430.56
应收股利		-	-
应收申购款		-	41,807.74
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	19,005.80	-
资产总计		139,415,875.16	253,490,228.45
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2020 年 11 月 30 日</b>	<b>上年度末 2019 年 12 月 31 日</b>
<b>负债:</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		868.78	-
应付赎回款		11,922,748.70	854,680.62
应付管理人报酬		133,804.13	211,908.05
应付托管费		29,436.90	46,619.76
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	79,686.80	75,252.66
应交税费		158.53	-
应付利息		-	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	179,084.84	221,182.26
负债合计		12,345,788.68	1,409,643.35
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	104,172,514.94	241,825,092.37
未分配利润	7.4.7.10	22,897,571.54	10,255,492.73
所有者权益合计		127,070,086.48	252,080,585.10
负债和所有者权益总计		139,415,875.16	253,490,228.45

注：1、自2020年12月1日起，长盛中证金融地产指数分级证券投资基金转型为长盛中证金融地产指数证券投资基金（LOF），本报告期自2020年1月1日至2020年11月30日。

2、报告截止日2020年11月30日，基金份额总额120,501,953.12份，其中长盛金融地产分级基金份额净值1.055元，份额总额120,501,953.12份。

## 7.2 利润表

会计主体：长盛中证金融地产指数分级证券投资基金

本报告期：2020年1月1日至2020年11月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020年1月1日至2020 年11月30日	上年度可比期间 2019年1月1日至 2019年12月31日
<b>一、收入</b>		33,469,536.19	66,141,205.06
1. 利息收入		78,231.84	98,682.74
其中：存款利息收入	7.4.7.11	58,816.30	98,517.03
债券利息收入		17.66	165.71
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		19,397.88	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		49,750,779.01	21,132,339.12
其中：股票投资收益	7.4.7.12	42,900,920.91	16,428,778.55
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	20,761.74	125,016.27
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	6,829,096.36	4,578,544.30
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-16,596,717.31	44,861,676.25
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-

5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	237,242.65	48,506.95
<b>减：二、费用</b>		3,246,672.95	3,077,659.31
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,933,623.87	1,951,602.46
2. 托管费	7.4.10.2.2	425,397.29	429,352.56
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	483,111.01	264,327.42
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		69.86	-
7. 其他费用	7.4.7.20	404,470.92	432,376.87
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		30,222,863.24	63,063,545.75
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		30,222,863.24	63,063,545.75

注：自2020年12月1日起，长盛中证金融地产指数分级证券投资基金转型为长盛中证金融地产指数证券投资基金（LOF），本报告期自2020年1月1日至2020年11月30日。

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长盛中证金融地产指数分级证券投资基金

本报告期：2020年1月1日至2020年11月30日

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年11月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	241,825,092.37	10,255,492.73	252,080,585.10
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	30,222,863.24	30,222,863.24
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-137,652,577.43	-17,580,784.43	-155,233,361.86
其中：1. 基金申购款	75,399,298.61	8,814,823.13	84,214,121.74
2. 基金赎回款	-213,051,876.04	-26,395,607.56	-239,447,483.60
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	104,172,514.94	22,897,571.54	127,070,086.48

项目	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	214,912,047.64	-54,667,757.65	160,244,289.99
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	63,063,545.75	63,063,545.75
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	26,913,044.73	1,859,704.63	28,772,749.36
其中：1. 基金申购款	112,429,612.83	-1,090,218.32	111,339,394.51
2. 基金赎回款	-85,516,568.10	2,949,922.95	-82,566,645.15
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	241,825,092.37	10,255,492.73	252,080,585.10

注：自 2020 年 12 月 1 日起，长盛中证金融地产指数分级证券投资基金转型为长盛中证金融地产指数证券投资基金 (LOF)，本报告期自 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 11 月 30 日。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>林培富</u>	<u>刁俊东</u>	<u>龚珉</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

长盛中证金融地产指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2015]759 号文《关于准予长盛中证金融地产指数分级证券投资基金注册的批复》的注册，由长盛基金管理有限公司向社会公开募集，基金合同于 2015 年 6 月 16 日正式生效，于基金合同生效日，本基金规模为 726,147,822.87 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为长盛基金管理有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

本基金的基金份额包括长盛中证金融地产指数分级证券投资基金的基础份额（简称“长盛中证金融地产份额”）、长盛中证金融地产指数分级证券投资基金的稳健收益类份额（简称“长盛中证金融地产 A 份额”）和长盛中证金融地产指数分级证券投资基金的积极收益类份额（简称“长

盛中证金融地产 B 份额”）。其中，长盛中证金融地产 A 份额和长盛中证金融地产 B 份额的基金份额配比始终保持 1:1 的比例不变。

基金合同生效后，本基金将根据基金合同约定，办理场内的长盛中证金融地产份额与长盛中证金融地产 A 份额、长盛中证金融地产 B 份额之间的场内份额配对转换业务，即：基金份额持有人可将其场内的长盛中证金融地产份额，按 1:1 的基金份额配比，申请分拆为长盛中证金融地产 A 份额和长盛中证金融地产 B 份额；或基金份额持有人可将其持有的长盛中证金融地产 A 份额和长盛中证金融地产 B 份额，按 1:1 的基金份额配比，申请合并为长盛中证金融地产份额的场内份额。场外的长盛中证金融地产份额不进行份额配对转换。场外的长盛中证金融地产份额通过跨系统转托管至场内后，可按照场内的长盛中证金融地产份额配对转换规则进行操作。长盛中证金融地产份额设置单独的基金代码，只可以进行场内与场外的申购和赎回，不上市交易。长盛中证金融地产 A 份额和长盛中证金融地产 B 份额交易代码不同，在深圳证券交易所上市交易，不接受申购或赎回。

在本基金存续期内，每个会计年度（基金合同生效不足六个月的除外）11 月份的最后一个交易日，本基金将对于基金份额折算基准日登记在册的长盛中证金融地产份额、长盛中证金融地产 A 份额进行定期折算。在折算基准日，本基金将按照以下规则进行基金的折算：长盛中证金融地产份额和长盛中证金融地产 A 份额根据基金合同规定的份额参考净值计算规则进行计算；对于长盛中证金融地产 A 份额参考净值超出人民币 1.000 元部分，将折算为场内长盛中证金融地产份额。每两份长盛中证金融地产份额将按一份长盛中证金融地产 A 份额获得新增长盛中证金融地产份额的分配，场内长盛中证金融地产份额持有人折算后获得新增场内长盛中证金融地产份额，场外长盛中证金融地产份额持有人折算后获得新增场外长盛中证金融地产份额。折算后长盛中证金融地产 A 份额和长盛中证金融地产 B 份额的比例仍为 1:1，长盛中证金融地产 A 份额参考净值调整为人民币 1.000 元。

除以上的定期份额折算外，在以下两种情况下也会进行不定期份额折算，即：当长盛中证金融地产份额的基金份额净值大于或等于人民币 1.500 元时；当长盛中证金融地产 B 份额的基金份额参考净值达到或跌破人民币 0.250 元时。折算后本基金将确保长盛中证金融地产 A 份额和长盛中证金融地产 B 份额的比例为 1:1；折算后长盛中证金融地产份额的净值以及长盛中证金融地产 A 份额、长盛中证金融地产 B 份额的参考净值均调整为人民币 1.000 元。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数成份股及其备选成份股、债券、债券回购、权证、股指期货、货币市场工具、资产支持证券以及中国证监会允许基金投资的其它金融工具，（但须符合中国证监会相关规定）。本基金投资于股票的资产占基金资产的比例为

85%以上，其中标的指数成份股及其备选成份股的投资比例不低于非现金基金资产的 80%，现金、债券资产及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产比例为 5%—10%，其中每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等，权证投资不高于基金资产净值的 3%。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的业绩比较基准为：中证金融地产指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定及参考意见。

根据《关于长盛中证金融地产指数分级证券投资基金实施转型的公告》，长盛中证金融地产指数分级证券投资基金于 2020 年 12 月 1 日转型为长盛中证金融地产指数证券投资基金（LOF），存续期不定，因此本财务报表仍以本基金持续经营为基础列报。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2020 年 11 月 30 日的财务状况以及 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 11 月 30 日的经营成果和净值变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间系 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 11 月 30 日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

#### (1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括股票投资、债券投资和衍生工具等；

#### (2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券等，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债；

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

#### (1) 股票投资

买入股票于交易日确认为股票投资，股票投资成本，按交易日应支付的全部价款扣除交易费用入账；

卖出股票于交易日确认股票投资收益，卖出股票的成本按移动加权平均法于交易日结转；

#### (2) 债券投资

买入债券于交易日确认为债券投资。债券投资成本，按交易日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于交易日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

#### (3) 权证投资

买入权证于交易日确认为权证投资。权证投资成本按交易日应支付的全部价款扣除交易费用后入账；

卖出权证于交易日确认衍生工具投资收益，卖出权证的成本按移动加权平均法于交易日结转；

#### (4) 分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本；

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算；

#### (5) 回购协议

本基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同

资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的股票投资、债券投资和权证投资等投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述估值原则仍不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能适当反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### **7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销**

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### **7.4.4.7 实收基金**

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益/（损失）于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 衍生工具收益/（损失）于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(8) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(9) 公允价值变动收益/（损失）系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(10) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

在长盛中证金融地产份额、长盛中证金融地产 A 份额、长盛中证金融地产 B 份额的运作期内，本基金（包括长盛中证金融地产份额、长盛中证金融地产 A 份额、长盛中证金融地产 B 份额）不进行收益分配。经基金份额持有人大会决议通过，如果终止长盛中证金融地产份额、长盛中证金融地产 A 份额、长盛中证金融地产 B 份额的运作，本基金将根据基金份额持有人大会决议调整基金的收益分配。

#### 7.4.4.12 分部报告

无。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

无。

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

无。

### 7.4.6 税项

#### 7.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变。

#### 7.4.6.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入免征增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入免征增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额；

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加，以实际缴纳的增值税税

额为计税依据，分别按规定的比例缴纳。

#### 7.4.6.3 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自2004年1月1日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

#### 7.4.6.4 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号《财政部国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自2008年10月9日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自2013年1月1日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂减按25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自2015年9月8日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020年11月30日	上年度末 2019年12月31日
活期存款	19,020,339.10	15,613,599.48
定期存款	-	-
其中：存款期限1个月以内	-	-
存款期限1-3个月	-	-
存款期限3个月以上	-	-
其他存款	-	-

合计:	19,020,339.10	15,613,599.48
-----	---------------	---------------

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位: 人民币元

项目	本期末 2020年11月30日		
	成本	公允价值	估值增值
股票	101,693,658.60	120,339,810.98	18,646,152.38
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	101,693,658.60	120,339,810.98	18,646,152.38
项目	上年度末 2019年12月31日		
	成本	公允价值	估值增值
股票	202,552,645.76	237,795,515.45	35,242,869.69
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	202,552,645.76	237,795,515.45	35,242,869.69

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注: 无。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

注: 无。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位: 人民币元

项目	本期末 2020年11月30日	上年度末 2019年12月31日
应收活期存款利息	8,092.73	3,414.46
应收定期存款利息	-	-

应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	-	-
应收债券利息	-	-
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	4,862.20	-
其他	73.38	16.10
合计	13,028.31	3,430.56

#### 7.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020年11月30日	上年度末 2019年12月31日
其他应收款	-	-
待摊费用	19,005.80	-
合计	19,005.80	-

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020年11月30日	上年度末 2019年12月31日
交易所市场应付交易费用	79,686.80	75,252.66
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	79,686.80	75,252.66

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年11月30日	上年度末 2019年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	733.38	1,182.26
应付证券出借违约金	-	-
其他	7,425.56	-
预提费用	164,753.00	170,000.00
指数使用费	6,172.90	50,000.00
合计	179,084.84	221,182.26

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年11月30日

	基金份额（份）	账面金额
上年度末	279,674,446.04	241,825,092.37
本期申购	87,208,738.61	75,399,298.61
本期赎回（以“-”号填列）	-246,381,230.53	-213,051,876.04
2020年11月27日 基金拆分/ 份额折算前	120,501,954.12	104,172,514.94
基金拆分/份额折算变动份额	-1.00	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	120,501,953.12	104,172,514.94

注：（1）申购含转换入份额及金额，赎回含转换出份额及金额。

（2）根据本基金于2020年11月24日发布《关于长盛中证金融地产指数分级证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》及《关于长盛中证金融地产指数分级证券投资基金实施转型的公告》，本基金以2020年11月27日作为份额转换基准日，将长盛中证金融地产A份额和长盛中证金融地产B份额转换为长盛中证金融地产份额的场内份额，在保持基金资产净值总额不变的前提下，将长盛中证金融地产份额的场内份额和场外份额统一转换为长盛中证金融地产指数证券投资基金（LOF）的场内份额和场外份额。转换完成后减少长盛中证金融地产份额1.00份。

（3）根据本基金基金合同规定，投资者可申购、赎回长盛中证金融地产份额，长盛中证金融地产A份额和长盛中证金融地产B份额交只可在上海证券交易所上市交易，因此上表不再单独披露长盛中证金融地产A份额和长盛中证金融地产B份额的情况。

#### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-33,602,212.61	43,857,705.34	10,255,492.73
本期利润	46,819,580.55	-16,596,717.31	30,222,863.24
本期基金份额交易产生的变动数	-1,079,955.60	-16,500,828.83	-17,580,784.43
其中：基金申购款	-3,371,122.48	12,185,945.61	8,814,823.13
基金赎回款	2,291,166.88	-28,686,774.44	-26,395,607.56
本期已分配利润	-	-	-
本期末	12,137,412.34	10,760,159.20	22,897,571.54

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020年1月1日至2020年11月30日	2019年1月1日至2019年12月31日

活期存款利息收入	57,952.72	97,043.43
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	475.31	1,169.33
其他	388.27	304.27
合计	58,816.30	98,517.03

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020 年11月30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年 12月31日
卖出股票成交总额	199,011,372.48	69,268,795.18
减：卖出股票成本总额	156,110,451.57	52,840,016.63
买卖股票差价收入	42,900,920.91	16,428,778.55

#### 7.4.7.13 债券投资收益

##### 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年 11月30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月 31日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	20,761.74	125,016.27
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	20,761.74	125,016.27

##### 7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年 11月30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月 31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	170,079.70	636,381.98
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	149,300.00	511,200.00
减：应收利息总额	17.96	165.71
买卖债券差价收入	20,761.74	125,016.27

**7.4.7.14 贵金属投资收益**

注：无。

**7.4.7.15 衍生工具收益**

注：无。

**7.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年11 月30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月 31日
股票投资产生的股利收益	6,829,096.36	4,578,544.30
其中：证券出借权益补偿收入	1,870.00	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	6,829,096.36	4,578,544.30

**7.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年1月1日至2020年11 月30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年 12月31日
1. 交易性金融资产	-16,596,717.31	44,861,676.25
——股票投资	-16,596,717.31	44,861,676.25
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值 变动产生的预估增值税	-	-
合计	-16,596,717.31	44,861,676.25

**7.4.7.18 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年11 月30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12 月31日
基金赎回费收入	200,955.49	48,324.91
基金转换费收入	36,287.16	182.04
合计	237,242.65	48,506.95

**7.4.7.19 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年11月30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
交易所市场交易费用	483,111.01	264,327.42
银行间市场交易费用	-	-
交易基金产生的费用	-	-
其中：申购费	-	-
赎回费	-	-
合计	483,111.01	264,327.42

**7.4.7.20 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年11月30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
审计费用	54,916.55	50,000.00
信息披露费	109,836.45	120,000.00
证券出借违约金	-	-
上市费	55,000.00	60,000.00
银行汇划费	2,550.82	2,376.87
指数使用费	156,172.90	200,000.00
律师费	18,375.00	-
公证费	7,619.20	-
合计	404,470.92	432,376.87

**7.4.7.21 分部报告**

无。

**7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明****7.4.8.1 或有事项**

无。

**7.4.8.2 资产负债表日后事项**

根据《关于长盛中证金融地产指数分级证券投资基金实施转型的公告》，长盛中证金融地产指数分级证券投资基金于2020年12月1日转型为长盛中证金融地产指数证券投资基金（LOF）。

**7.4.9 关联方关系**

关联方名称	与本基金的关系
-------	---------

长盛基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人、基金代销机构
国元证券股份有限公司（“国元证券”）	基金管理人股东、基金代销机构
新加坡星展银行有限公司	基金管理人股东
安徽省信用担保集团有限公司	基金管理人股东
安徽省投资集团控股有限公司	基金管理人股东
长盛创富资产管理有限公司	基金管理人子公司
长盛基金（香港）有限公司	基金管理人子公司

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年11月30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例
国元证券	22,943,145.55	9.53%	-	-

#### 7.4.10.1.2 债券交易

注：无。

#### 7.4.10.1.3 债券回购交易

注：无。

#### 7.4.10.1.4 权证交易

注：无。

#### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年11月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
国元证券	21,366.83	10.26%	-	-

关联方名称	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付 佣金总额的 比例
国元证券	-	-	-	-

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

## 7.4.10.2 关联方报酬

### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020年1月1日至2020年11月30日	2019年1月1日至2019年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,933,623.87	1,951,602.46
其中：支付销售机构的客户维护费 <sup>1</sup>	410,678.56	891,015.18

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.00% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.00\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020年1月1日至2020年11月30日	2019年1月1日至2019年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	425,397.29	429,352.56

注：基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.22% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.22\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

**7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易**

注：无。

**7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明****7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况**

单位：人民币元

本期 2020年1月1日至2020年11月30日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
国元证券	1,825,480.00	1,206.85	-	-
上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
国元证券	-	-	-	-

**7.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况**

单位：人民币元

本期 2020年1月1日至2020年11月30日										
关联方名称	合约编号	证券名称	成交时间	交易金额	交易数量(单位:张)	出借期限(单位:天)	费率	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
国元证券	2020072200000603	东方财富	2020年7月22	1,067,600.00	40,000	14	-	705.80	-	-
上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日										
关联方名称	合约编号	证券名称	成交时间	交易金额	交易数量(单位:张)	出借期限(单位:天)	费率	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
国元证券	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

**7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况****7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

注：无。

**7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况**

注：无。

**7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入**

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2020年1月1日至2020年11月30日		2019年1月1日至2019年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	19,020,339.10	57,952.72	15,613,599.48	97,043.43

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

**7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

注：无。

**7.4.10.8 其他关联交易事项的说明**

无。

**7.4.11 利润分配情况**

注：无。

**7.4.12 期末（2020年11月30日）本基金持有的流通受限证券****7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	说明
688578	艾力斯	2020年11月23日	2020年12月2日	新股未上市	22.73	22.73	1,863	42,345.99	42,345.99	-
688557	兰剑智能	2020年11月25日	2020年12月2日	新股未上市	27.70	27.70	1,389	38,475.30	38,475.30	-
003021	兆威机电	2020年11月26日	2020年12月4日	新股未上市	75.12	75.12	425	31,926.00	31,926.00	-
601686	友发集团	2020年11月26日	2020年12月4日	新股未上市	12.86	12.86	2,374	30,529.64	30,529.64	-
003022	联泓新科	2020年11月27日	2020年12月8日	新股未上市	11.46	11.46	2,304	26,403.84	26,403.84	-
605376	博迁新材	2020年11月30日	2020年12月8日	新股未上市	11.69	11.69	1,421	16,611.49	16,611.49	-
605183	确成股份	2020年11月27日	2020年12月7日	新股未上市	14.38	14.38	741	10,655.58	10,655.58	-
605258	协和电子	2020年11月23日	2020年12月3日	新股未上市	26.56	26.56	340	9,030.40	9,030.40	-
688599	天合光能	2020年6月2日	2020年12月10日	限售期锁定	8.16	21.20	17,231	140,604.96	365,297.20	-
688185	康希诺	2020年8月4日	2021年2月18日	限售期锁定	209.71	349.46	933	195,659.43	326,046.18	-

688408	中信博	2020年8月20日	2021年3月1日	限售期锁定	42.19	126.07	2,225	93,872.75	280,505.75	-
688595	芯海科技	2020年9月18日	2021年3月29日	限售期锁定	22.82	68.72	3,190	72,795.80	219,216.80	-
688060	云涌科技	2020年7月3日	2021年1月11日	限售期锁定	44.47	106.32	2,016	89,651.52	214,341.12	-
688505	复旦张江	2020年6月10日	2020年12月21日	限售期锁定	8.95	20.02	10,031	89,777.45	200,820.62	-
688360	德马科技	2020年5月25日	2020年12月2日	限售期锁定	25.12	38.06	4,276	107,413.12	162,744.56	-
688229	博睿数据	2020年8月7日	2021年2月18日	限售期锁定	65.82	97.59	1,414	93,069.48	137,992.26	-
688559	海目星	2020年8月28日	2021年3月9日	限售期锁定	14.56	21.05	5,529	80,502.24	116,385.45	-
688335	复洁环保	2020年8月7日	2021年2月18日	限售期锁定	46.22	41.44	2,242	103,625.24	92,908.48	-

注：1、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起6个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后6个月内不得转让。

2、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌股票

无。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

金额单位：人民币元

合约编号	证券代码	证券名称	成交时间	出借到期日	期末估值单价	数量 (单位:张)	期末估值总额
2020111600000933	601318	中国平安	2020年11月16日	2020年12月14日	90.03	80,000	7,202,400.00
2020111600001249	601555	东吴证券	2020年11月16日	2020年12月14日	10.12	30,000	303,600.00
合计						110,000	7,506,000.00

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基

金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了以董事会风险控制委员会为核心的，由董事会风险控制委员会、经营管理层及各具体业务部门组成的三道风险监控防线；并在后两道监控防线中，由独立于公司管理层和其他业务部门的督察长和监察稽核部对公司合规风险状况及各部门风险控制措施进行检查、监督及报告。

#### **7.4.13.2 信用风险**

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

#### **7.4.13.3 流动性风险**

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

##### **7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析**

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控流动性受限资产比例、流动性资产比例及压力测试等方式防范流动性风险，并对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易。因此，除在附注

7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外,其余均能及时变现。此外,本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求,其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。除附注 7.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额(如有)将在 1 个月内到期且计息外,本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息,可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息,因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内,本基金未发生重大流动性风险事件。

#### 7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险,包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的公允价值和未来现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险,其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控,并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

金额单位:人民币元

本期末 2020 年 11 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	19,020,339.10	-	-	-	19,020,339.10
存出保证金	23,690.97	-	-	-	23,690.97
交易性金融资产	-	-	-	120,339,810.98	120,339,810.98
应收利息	-	-	-	13,028.31	13,028.31
其他资产	-	-	-	19,005.80	19,005.80
资产总计	19,044,030.07	-	-	120,371,845.09	139,415,875.16
负债					
应付证券清算款	-	-	-	868.78	868.78
应付赎回款	-	-	-	11,922,748.70	11,922,748.70
应付管理人报酬	-	-	-	133,804.13	133,804.13
应付托管费	-	-	-	29,436.90	29,436.90
应付交易费用	-	-	-	79,686.80	79,686.80
应交税费	-	-	-	158.53	158.53
其他负债	-	-	-	179,084.84	179,084.84

负债总计	-	-	-	-	12,345,788.68	12,345,788.68
利率敏感度缺口	19,044,030.07	-	-	-	-108,026,056.41	127,070,086.48
上年度末 2019年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计	
资产						
银行存款	15,613,599.48	-	-	-	-	15,613,599.48
存出保证金	35,875.22	-	-	-	-	35,875.22
交易性金融资产	-	-	-	-	-237,795,515.45	237,795,515.45
应收利息	-	-	-	-	3,430.56	3,430.56
应收申购款	-	-	-	-	41,807.74	41,807.74
资产总计	15,649,474.70	-	-	-	-237,840,753.75	253,490,228.45
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	854,680.62	854,680.62
应付管理人报酬	-	-	-	-	211,908.05	211,908.05
应付托管费	-	-	-	-	46,619.76	46,619.76
应付交易费用	-	-	-	-	75,252.66	75,252.66
其他负债	-	-	-	-	221,182.26	221,182.26
负债总计	-	-	-	-	1,409,643.35	1,409,643.35
利率敏感度缺口	15,649,474.70	-	-	-	-236,431,110.40	252,080,585.10

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：本基金本报告期末及上年度末未持有债券投资或持有的债券投资占比并不重大，因而市场利率的变动对本基金资产净值无重大影响。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要为市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于上市交易的证券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。并且，基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，动态、及时地跟踪和控制其他价格风险。

## 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020年11月30日		上年度末 2019年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	120,339,810.98	94.70	237,795,515.45	94.33
合计	120,339,810.98	94.70	237,795,515.45	94.33

## 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定本基金的业绩比较基准变化 5%，其他变量不变；		
	用期末时点比较基准浮动 5%基金资产净值相应变化来估测组合市场价格风险；		
	Beta 系数是根据组合在过去一个年度的基金资产净值和基准指数数据回归得出，反映了基金和基准的相关性。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2020年11月30日）	上年度末（2019年12月31日）
	5%	6,099,364.15	12,252,167.61
	-5%	-6,099,364.15	-12,252,167.61

## 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

## 7.4.14.1 公允价值

本基金非以公允价值计量的金融工具，因其剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

## (1) 各层次金融工具公允价值

本基金本报告期末持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为人民币 118,017,574.32 元，属于第二层次的余额为人民币 2,322,236.66 元，无属于第三层次的余额（2019 年 12 月 31 日：第一层次的余额为人民币 231,512,693.57 元，属于第二层次的余额为人民币 6,282,821.88 元，无属于第三层次的余额）。

## (2) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和可转换债券等，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关股票和可转换债券的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。本基金持有的以公允价值计量的金融工具第三层次公允价值本期未发生变动。

## 7.4.14.2 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

## 7.4.14.3 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

## 7.4.14.4 财务报表的批准

本财务报表已于2021年3月26日经本基金的基金管理人批准。

## § 8 投资组合报告（转型后）

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	95,344,427.27	86.39
	其中：股票	95,344,427.27	86.39
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	14,810,364.63	13.42
8	其他各项资产	213,539.36	0.19
9	合计	110,368,331.26	100.00

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	-	-
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-

G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	81,815,460.10	81.00
K	房地产业	11,718,688.29	11.60
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	93,534,148.39	92.61

### 8.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,266,007.90	1.25
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	326,358.96	0.32
J	金融业	-	-
K	房地产业	217,912.02	0.22
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,810,278.88	1.79

### 8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

## 8.2 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

### 8.2.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	165,157	14,365,355.86	14.22
2	600036	招商银行	185,602	8,157,207.90	8.08
3	601166	兴业银行	220,700	4,606,009.00	4.56
4	600030	中信证券	132,106	3,883,916.40	3.85
5	000002	万科 A	105,208	3,019,469.60	2.99
6	000001	平安银行	147,976	2,861,855.84	2.83
7	300059	东方财富	89,960	2,788,760.00	2.76
8	601398	工商银行	554,649	2,767,698.51	2.74
9	601601	中国太保	54,824	2,105,241.60	2.08
10	601328	交通银行	423,450	1,897,056.00	1.88
11	600048	保利地产	118,533	1,875,192.06	1.86
12	600000	浦发银行	188,979	1,829,316.72	1.81
13	600016	民生银行	347,194	1,805,408.80	1.79
14	600837	海通证券	134,263	1,726,622.18	1.71
15	002142	宁波银行	47,419	1,675,787.46	1.66
16	600999	招商证券	66,443	1,550,779.62	1.54
17	601288	农业银行	489,834	1,538,078.76	1.52
18	601688	华泰证券	79,223	1,426,806.23	1.41
19	601211	国泰君安	76,833	1,346,882.49	1.33
20	601169	北京银行	241,879	1,170,694.36	1.16
21	601628	中国人寿	29,293	1,124,558.27	1.11
22	600919	江苏银行	191,160	1,043,733.60	1.03
23	601818	光大银行	256,694	1,024,209.06	1.01
24	601229	上海银行	125,230	981,803.20	0.97
25	600383	金地集团	61,940	836,190.00	0.83
26	601336	新华保险	14,120	818,536.40	0.81
27	000776	广发证券	48,400	787,952.00	0.78
28	601009	南京银行	96,150	776,892.00	0.77
29	000166	申万宏源	141,060	744,796.80	0.74
30	601377	兴业证券	85,627	743,242.36	0.74
31	600958	东方证券	63,331	736,539.53	0.73

32	601939	建设银行	112,947	709,307.16	0.70
33	001979	招商蛇口	52,273	694,708.17	0.69
34	600015	华夏银行	106,847	667,793.75	0.66
35	600109	国金证券	40,800	663,816.00	0.66
36	601901	方正证券	63,003	653,341.11	0.65
37	600926	杭州银行	43,020	641,858.40	0.64
38	601788	光大证券	34,226	633,865.52	0.63
39	002736	国信证券	45,151	615,859.64	0.61
40	601066	中信建投	14,590	612,780.00	0.61
41	601555	东吴证券	59,051	582,242.86	0.58
42	000783	长江证券	63,133	530,317.20	0.53
43	000069	华侨城 A	68,100	482,829.00	0.48
44	601108	财通证券	35,300	446,545.00	0.44
45	600705	中航资本	92,302	404,282.76	0.40
46	000656	金科股份	54,583	386,993.47	0.38
47	002797	第一创业	38,842	386,477.90	0.38
48	000750	国海证券	63,810	373,926.60	0.37
49	600061	国投资本	26,900	372,027.00	0.37
50	600606	绿地控股	59,215	345,223.45	0.34
51	600340	华夏幸福	26,350	340,705.50	0.34
52	601838	成都银行	31,099	331,826.33	0.33
53	601878	浙商证券	21,400	327,420.00	0.32
54	601155	新城控股	9,200	320,436.00	0.32
55	601198	东兴证券	23,900	318,348.00	0.32
56	002500	山西证券	35,304	315,970.80	0.31
57	600369	西南证券	54,022	290,638.36	0.29
58	601658	邮储银行	59,126	282,622.28	0.28
59	601998	中信银行	54,088	276,389.68	0.27
60	601099	太平洋	63,600	259,488.00	0.26
61	600895	张江高科	14,700	250,488.00	0.25
62	000961	中南建设	28,200	249,006.00	0.25
63	000686	东北证券	24,610	241,670.20	0.24
64	002926	华西证券	19,300	240,864.00	0.24
65	002670	国盛金控	17,252	237,215.00	0.23
66	601881	中国银河	18,700	233,937.00	0.23
67	600909	华安证券	28,500	228,000.00	0.23
68	600208	新潮中宝	71,897	222,880.70	0.22
69	601997	贵阳银行	24,600	195,570.00	0.19
70	601128	常熟银行	26,200	193,356.00	0.19

71	002146	荣盛发展	29,300	191,329.00	0.19
72	000671	阳光城	28,845	188,069.40	0.19
73	600643	爱建集团	24,500	184,240.00	0.18
74	600155	华创阳安	13,600	179,384.00	0.18
75	600325	华发股份	28,520	177,109.20	0.18
76	300033	同花顺	1,400	173,572.00	0.17
77	002673	西部证券	17,000	172,380.00	0.17
78	600064	南京高科	16,462	169,064.74	0.17
79	600848	上海临港	8,000	160,160.00	0.16
80	601162	天风证券	25,730	156,953.00	0.16
81	601990	南京证券	12,696	155,779.92	0.15
82	000627	天茂集团	31,500	153,405.00	0.15
83	601319	中国人保	21,900	143,883.00	0.14
84	601236	红塔证券	7,689	142,938.51	0.14
85	000402	金融街	21,857	140,977.65	0.14
86	600649	城投控股	25,171	136,678.53	0.14
87	000563	陕国投 A	35,429	133,567.33	0.13
88	600266	城建发展	26,284	133,522.72	0.13
89	600376	首开股份	22,700	133,249.00	0.13
90	600390	五矿资本	18,000	125,640.00	0.12
91	600466	蓝光发展	26,860	124,361.80	0.12
92	002958	青农商行	23,500	119,615.00	0.12
93	002939	长城证券	9,100	117,117.00	0.12
94	000031	大悦城	24,300	106,920.00	0.11
95	600094	大名城	26,400	106,128.00	0.11
96	600515	海航基础	15,300	103,275.00	0.10
97	002807	江阴银行	23,260	99,552.80	0.10
98	002244	滨江集团	21,600	99,144.00	0.10
99	601577	长沙银行	10,400	99,008.00	0.10
100	600639	浦东金桥	7,600	94,240.00	0.09
101	000718	苏宁环球	27,050	92,781.50	0.09
102	600158	中体产业	7,400	90,724.00	0.09
103	600901	江苏租赁	15,235	83,944.85	0.08
104	002936	郑州银行	18,410	82,108.60	0.08
105	600918	中泰证券	4,400	81,400.00	0.08
106	601916	浙商银行	19,400	79,152.00	0.08
107	601860	紫金银行	18,770	79,021.70	0.08
108	000540	中天金融	24,500	77,175.00	0.08
109	600908	无锡银行	12,400	75,392.00	0.07

110	002966	苏州银行	9,600	73,728.00	0.07
111	600748	上实发展	14,875	73,036.25	0.07
112	600657	信达地产	17,411	70,514.55	0.07
113	601456	国联证券	3,300	70,389.00	0.07
114	002839	张家港行	11,300	68,930.00	0.07
115	600823	世茂股份	14,300	65,923.00	0.07
116	600928	西安银行	10,977	61,032.12	0.06
117	600291	西水股份	10,431	59,143.77	0.06
118	001914	招商积余	2,400	51,672.00	0.05
119	601696	中银证券	1,700	47,056.00	0.05
120	002945	华林证券	3,100	46,717.00	0.05
121	600120	浙江东方	7,700	45,969.00	0.05
122	601077	渝农商行	10,200	45,900.00	0.05
123	002948	青岛银行	7,000	41,510.00	0.04
124	000537	广宇发展	6,200	38,874.00	0.04
125	600675	中华企业	10,600	35,616.00	0.04
126	000732	泰禾集团	10,100	33,027.00	0.03
127	000046	泛海控股	9,000	29,520.00	0.03
128	002423	中粮资本	2,100	20,328.00	0.02
129	600053	九鼎投资	700	13,685.00	0.01
130	601512	中新集团	100	994.00	0.00

### 8.2.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	688408	中信博	2,225	357,068.00	0.35
2	688185	康希诺	933	331,625.52	0.33
3	688595	芯海科技	3,190	193,186.40	0.19
4	688559	海目星	5,529	171,122.55	0.17
5	688060	云涌科技	2,016	164,545.92	0.16
6	688229	博睿数据	1,414	143,096.80	0.14
7	000006	深振业 A	19,800	111,078.00	0.11
8	600663	陆家嘴	8,300	88,810.00	0.09
9	688335	复洁环保	2,242	82,236.56	0.08
10	688571	杭华股份	6,757	63,718.51	0.06
11	003029	吉大正元	716	18,716.24	0.02
12	600743	华远地产	8,306	18,024.02	0.02
13	003028	振邦智能	432	18,010.08	0.02

14	605179	一鸣食品	939	16,582.74	0.02
15	605155	西大门	350	10,668.00	0.01
16	605277	新亚电子	507	8,593.65	0.01
17	003030	祖名股份	480	7,286.40	0.01
18	003031	中瓷电子	387	5,909.49	0.01

### 8.3 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 8.3.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	300059	东方财富	1,289,989.00	1.28
2	601398	工商银行	1,191,880.00	1.18
3	600036	招商银行	1,089,548.00	1.08
4	601318	中国平安	1,003,670.00	0.99
5	000002	万科 A	391,172.00	0.39
6	601166	兴业银行	329,167.00	0.33
7	600926	杭州银行	290,733.00	0.29
8	600030	中信证券	265,817.00	0.26
9	600919	江苏银行	258,864.40	0.26
10	601066	中信建投	230,081.00	0.23
11	601688	华泰证券	215,125.00	0.21
12	000001	平安银行	200,104.99	0.20
13	300033	同花顺	190,771.00	0.19
14	601108	财通证券	186,864.00	0.19
15	002797	第一创业	172,343.00	0.17
16	601878	浙商证券	158,407.00	0.16
17	601838	成都银行	133,385.00	0.13
18	601601	中国太保	133,068.00	0.13
19	601328	交通银行	132,245.00	0.13
20	600000	浦发银行	120,600.00	0.12

#### 8.3.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	601318	中国平安	6,583,273.68	6.52

2	600036	招商银行	2,611,525.00	2.59
3	601166	兴业银行	1,647,042.00	1.63
4	600016	民生银行	1,386,689.00	1.37
5	601288	农业银行	1,308,046.00	1.30
6	600030	中信证券	1,292,429.00	1.28
7	000001	平安银行	1,139,587.74	1.13
8	601328	交通银行	977,381.00	0.97
9	601398	工商银行	821,072.00	0.81
10	601601	中国太保	793,474.17	0.79
11	600048	保利地产	710,312.00	0.70
12	600000	浦发银行	685,165.00	0.68
13	000002	万科 A	630,561.00	0.62
14	600837	海通证券	627,772.00	0.62
15	601211	国泰君安	625,929.00	0.62
16	600999	招商证券	534,006.00	0.53
17	002142	宁波银行	513,567.00	0.51
18	601169	北京银行	434,154.00	0.43
19	601818	光大银行	424,527.00	0.42
20	601628	中国人寿	399,699.00	0.40

### 8.3.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	12,436,308.48
卖出股票收入（成交）总额	35,253,728.24

注：本项中 8.4.1、8.4.2、8.4.3 表中的“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 8.4 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

### 8.5 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

### 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 8.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

### 8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

## 8.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 8.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末无股指期货投资。

### 8.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内未投资股指期货。

## 8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期内未投资国债期货。

### 8.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末无国债期货投资。

### 8.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

## 8.11 市场中性策略执行情况

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

1、平安银行：本基金跟踪的标的指数为中证金融地产指数，配置了中证金融地产指数成分股平安银行。

根据中国银保监会深圳监管局 2020 年 2 月 3 日公布的《中国银保监会深圳监管局行政处罚信息公开表-深银保监罚决字〔2020〕7 号》的公告，平安银行因汽车金融事业部将贷款调查的核心事项委托第三方完成；代理保险销售的人员为非商业银行人员；汽车消费贷款风险分类结果不能反映真实风险水平；个人消费贷款风险分类结果不能反映真实风险水平；个人经营性贷款分类结果不能反映真实风险水平；汽车消费贷款和汽车抵押贷款贷前调查存在缺失；汽车消费及经营贷款审查不到位；个人汽车贷款和汽车抵押贷款业务存在同一抵押物重复抵押；个别汽车消费贷款和汽车抵押贷款用途管控不力，贷款资金被挪用；个人消费贷款及个人经营性贷款用途管控不力，贷款资金被挪用；部分个人消费贷款未按要求进行受托支付；信用卡现金分期用途管控不力；代销产品风险评级结果与合作机构评级结果不一致，未采用较高风险评级的评级结果；代销产品底层资产涉及本行非标资产，没有实现代销业务与其他业务的风险隔离；“双录”管理审慎性不足，理财销售人员销售话术不当十五项违规事实，依据《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条，平安银行被罚款合计 720 万元。

根据宁波银保监局 2020 年 10 月 27 日公布的《宁波银保监局行政处罚信息公开表-甬银保

监罚决字[2020]66号》的公告，平安银行因贷款资金用途管控不到位、借贷搭售、对房地产开发贷及预售资金监管不力等违规事实，依据《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条，平安银行被罚款合计100万元。对以上事件，本基金做出如下说明：

平安银行是中国最优秀的银行之一，基本面良好，公司高度重视内部控制建设，并围绕内部环境、风险评估、控制活动、信息与沟通、内部监督等方面不断加强和完善内部控制机制。基于相关研究，本基金判断，上述处罚对公司影响极小。今后，我们将继续加强与该公司的沟通，密切关注其制度建设与执行等公司基础性建设问题的合规性以及企业的经营状况。

2、交通银行：本基金跟踪的标的指数为中证金融地产指数，配置了中证金融地产指数成分股交通银行。

2020年1月8日，银保监罚决字（2019）24号显示，交通银行股份有限公司（一）授信审批不审慎；（二）总行对分支机构管控不力承担管理责任，中国银行保险监督管理委员会对其罚款合计150万元。2020年4月20日，银保监罚决字（2020）6号显示，交通银行股份有限公司因在监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在（一）理财产品数量漏报；（二）资金交易信息漏报严重；（三）贸易融资业务漏报；（四）信贷业务担保合同漏报；（五）分户账明细记录应报未报；（六）分户账账户数据应报未报；（七）关键且应报字段漏报或填报错误等违法违规行为，被罚款合计260万元。

对以上事件，本基金判断，交通银行作为大型国有银行，经营稳健，上述处罚对公司影响小。后续关注其制度建设与执行等公司基础性建设问题的合规性以及企业的经营状况。

除上述事项外，本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体无被监管部门立案调查记录，无在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

### 8.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

基金投资的前十名股票，均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

### 8.12.3 其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	57,545.57
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	674.01
5	应收申购款	155,319.78
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	213,539.36
---	----	------------

#### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券（可交换债券）。

#### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

##### 8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：报告期末指数投资前十名股票不存在流通受限情况。

##### 8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	688408	中信博	357,068.00	0.35	限售期锁定
2	688185	康希诺	331,625.52	0.33	限售期锁定
3	688595	芯海科技	193,186.40	0.19	限售期锁定
4	688559	海目星	171,122.55	0.17	限售期锁定
5	688060	云涌科技	164,545.92	0.16	限售期锁定

#### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 8 投资组合报告 (转型前)

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	120,339,810.98	86.32
	其中：股票	120,339,810.98	86.32
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	19,020,339.10	13.64
8	其他资产	55,725.08	0.04
9	合计	139,415,875.16	100.00

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	-	-
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	101,698,260.03	80.03
K	房地产业	14,772,937.49	11.63
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-

Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	116,471,197.52	91.66

### 8.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	2,781,482.68	2.19
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	509,797.32	0.40
J	金融业	62,539.84	0.05
K	房地产业	514,793.62	0.41
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	3,868,613.46	3.04

### 8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

## 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

### 8.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	227,657	20,495,959.71	16.13
2	600036	招商银行	219,402	9,697,568.40	7.63

3	601166	兴业银行	283,800	5,965,476.00	4.69
4	600030	中信证券	166,106	5,033,011.80	3.96
5	000001	平安银行	196,876	3,886,332.24	3.06
6	000002	万科A	112,008	3,438,645.60	2.71
7	600016	民生银行	588,894	3,121,138.20	2.46
8	601328	交通银行	606,050	2,854,495.50	2.25
9	601288	农业银行	866,034	2,849,251.86	2.24
10	601601	中国太保	72,024	2,783,727.60	2.19
11	600048	保利地产	153,233	2,638,672.26	2.08
12	601398	工商银行	475,449	2,529,388.68	1.99
13	600000	浦发银行	245,279	2,467,506.74	1.94
14	600837	海通证券	173,463	2,341,750.50	1.84
15	002142	宁波银行	58,219	2,148,281.10	1.69
16	601211	国泰君安	106,133	1,986,809.76	1.56
17	600999	招商证券	85,543	1,881,946.00	1.48
18	601688	华泰证券	82,523	1,592,693.90	1.25
19	601628	中国人寿	37,393	1,585,837.13	1.25
20	601169	北京银行	314,279	1,533,681.52	1.21
21	601818	光大银行	341,194	1,480,781.96	1.17
22	300059	东方财富	53,060	1,459,150.00	1.15
23	600383	金地集团	77,440	1,171,667.20	0.92
24	601336	新华保险	18,920	1,158,471.60	0.91
25	601229	上海银行	140,430	1,133,270.10	0.89
26	601939	建设银行	153,847	1,100,006.05	0.87
27	000776	广发证券	64,000	1,083,520.00	0.85
28	600919	江苏银行	168,400	1,049,132.00	0.83
29	601009	南京银行	118,250	1,019,315.00	0.80
30	600109	国金证券	50,100	901,299.00	0.71
31	600015	华夏银行	135,347	883,815.91	0.70
32	601377	兴业证券	97,727	880,520.27	0.69
33	001979	招商蛇口	59,573	873,340.18	0.69
34	000166	申万宏源	160,860	868,644.00	0.68
35	601788	光大证券	44,626	856,819.20	0.67
36	600958	东方证券	71,831	833,957.91	0.66
37	601901	方正证券	89,000	802,780.00	0.63
38	002736	国信证券	55,251	759,148.74	0.60
39	601555	东吴证券	68,751	695,760.12	0.55
40	000783	长江证券	77,333	683,623.72	0.54
41	000069	华侨城A	83,700	609,336.00	0.48

42	000656	金科股份	67,483	538,514.34	0.42
43	600705	中航资本	105,902	492,444.30	0.39
44	601066	中信建投	10,890	476,001.90	0.37
45	600061	国投资本	30,500	450,180.00	0.35
46	600340	华夏幸福	30,150	447,727.50	0.35
47	600606	绿地控股	67,615	435,440.60	0.34
48	000750	国海证券	78,210	430,937.10	0.34
49	600926	杭州银行	27,920	424,384.00	0.33
50	601198	东兴证券	27,300	360,906.00	0.28
51	601658	邮储银行	67,826	354,729.98	0.28
52	601155	新城控股	9,900	350,658.00	0.28
53	601998	中信银行	66,788	349,969.12	0.28
54	601108	财通证券	25,200	334,908.00	0.26
55	600369	西南证券	61,622	330,910.14	0.26
56	600895	张江高科	17,500	326,200.00	0.26
57	002500	山西证券	40,304	323,641.12	0.25
58	000686	东北证券	32,010	318,499.50	0.25
59	000961	中南建设	31,700	313,513.00	0.25
60	002797	第一创业	26,342	278,698.36	0.22
61	601881	中国银河	21,200	273,268.00	0.22
62	601099	太平洋	69,000	271,860.00	0.21
63	600208	新湖中宝	82,097	268,457.19	0.21
64	601838	成都银行	22,399	254,900.62	0.20
65	000671	阳光城	35,445	254,495.10	0.20
66	600643	爱建集团	30,400	251,104.00	0.20
67	002146	荣盛发展	33,500	244,885.00	0.19
68	601128	常熟银行	28,300	220,174.00	0.17
69	601997	贵阳银行	26,600	218,652.00	0.17
70	601878	浙商证券	13,100	216,019.00	0.17
71	002670	国盛金控	17,352	214,817.76	0.17
72	600325	华发股份	32,420	210,405.80	0.17
73	600064	南京高科	19,862	208,948.24	0.16
74	600848	上海临港	8,700	188,007.00	0.15
75	000402	金融街	26,957	187,620.72	0.15
76	000627	天茂集团	35,700	187,425.00	0.15
77	002926	华西证券	14,000	175,840.00	0.14
78	002673	西部证券	18,300	175,680.00	0.14
79	600266	城建发展	30,284	171,407.44	0.13
80	000563	陕国投 A	43,629	164,045.04	0.13

81	600649	城投控股	29,071	162,506.89	0.13
82	600376	首开股份	25,900	162,393.00	0.13
83	600466	蓝光发展	30,660	158,205.60	0.12
84	000712	锦龙股份	10,900	157,287.00	0.12
85	600909	华安证券	19,000	154,660.00	0.12
86	000031	大悦城	30,000	142,800.00	0.11
87	600094	大名城	30,100	142,072.00	0.11
88	601236	红塔证券	8,189	138,394.10	0.11
89	002285	世联行	23,440	124,232.00	0.10
90	002244	滨江集团	24,300	121,986.00	0.10
91	600515	海航基础	16,400	114,636.00	0.09
92	600158	中体产业	7,900	108,467.00	0.09
93	600639	浦东金桥	8,600	108,188.00	0.09
94	601577	长沙银行	11,100	108,003.00	0.09
95	002807	江阴银行	25,360	106,512.00	0.08
96	000987	越秀金控	6,500	106,275.00	0.08
97	000718	苏宁环球	30,950	102,444.50	0.08
98	600901	江苏租赁	16,835	97,811.35	0.08
99	600155	华创阳安	7,800	95,238.00	0.07
100	600657	信达地产	20,011	90,649.83	0.07
101	600565	迪马股份	30,300	90,294.00	0.07
102	600748	上实发展	16,775	89,578.50	0.07
103	600823	世茂股份	15,800	88,006.00	0.07
104	601319	中国人保	11,400	79,002.00	0.06
105	600908	无锡银行	13,100	78,600.00	0.06
106	002936	郑州银行	20,210	76,595.90	0.06
107	002839	张家港行	12,000	76,560.00	0.06
108	600291	西水股份	11,631	69,204.45	0.05
109	600928	西安银行	11,377	61,549.57	0.05
110	002939	长城证券	4,400	57,596.00	0.05
111	002945	华林证券	3,400	50,014.00	0.04
112	601162	天风证券	7,630	46,237.80	0.04
113	000732	泰禾集团	10,900	44,581.00	0.04
114	000537	广宇发展	6,600	43,956.00	0.03
115	002958	青农商行	8,700	43,413.00	0.03
116	601860	紫金银行	9,770	41,131.70	0.03
117	600390	五矿资本	5,700	41,097.00	0.03
118	002948	青岛银行	6,500	35,165.00	0.03
119	002423	中粮资本	2,300	23,046.00	0.02

## 8.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	688599	天合光能	17,231	365,297.20	0.29
2	688185	康希诺	933	326,046.18	0.26
3	688200	华峰测控	1,004	281,220.40	0.22
4	688408	中信博	2,225	280,505.75	0.22
5	688595	芯海科技	3,190	219,216.80	0.17
6	688060	云涌科技	2,016	214,341.12	0.17
7	688505	复旦张江	10,031	200,820.62	0.16
8	688233	神工股份	4,237	189,351.53	0.15
9	688360	德马科技	4,276	162,744.56	0.13
10	688299	长阳科技	6,767	147,858.95	0.12
11	688039	当虹科技	2,026	146,662.14	0.12
12	688229	博睿数据	1,414	137,992.26	0.11
13	000006	深振业 A	24,000	137,520.00	0.11
14	688559	海目星	5,529	116,385.45	0.09
15	000667	美好集团	30,282	115,980.06	0.09
16	600663	陆家嘴	9,900	115,335.00	0.09
17	688090	瑞松科技	2,121	104,586.51	0.08
18	688335	复洁环保	2,242	92,908.48	0.07
19	600503	华丽家族	19,300	77,200.00	0.06
20	688096	京源环保	2,795	65,738.40	0.05
21	601990	南京证券	4,796	62,539.84	0.05
22	000926	福星股份	8,700	46,371.00	0.04
23	688578	艾力斯	1,863	42,345.99	0.03
24	688557	兰剑智能	1,389	38,475.30	0.03
25	003021	兆威机电	425	31,926.00	0.03
26	601686	友发集团	2,374	30,529.64	0.02
27	003022	联泓新科	2,304	26,403.84	0.02
28	605177	东亚药业	439	22,823.61	0.02
29	600743	华远地产	9,906	22,387.56	0.02
30	605376	博迁新材	1,421	16,611.49	0.01
31	003004	声迅股份	306	10,801.80	0.01
32	605183	确成股份	741	10,655.58	0.01
33	605258	协和电子	340	9,030.40	0.01

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601318	中国平安	3,745,630.16	1.49
2	600036	招商银行	2,460,835.09	0.98
3	300059	东方财富	2,091,948.00	0.83
4	601166	兴业银行	1,728,803.00	0.69
5	688981	中芯国际	1,438,354.80	0.57
6	600030	中信证券	1,370,878.00	0.54
7	000002	万科 A	1,242,596.00	0.49
8	600016	民生银行	1,021,340.00	0.41
9	601328	交通银行	918,437.00	0.36
10	601288	农业银行	870,981.00	0.35
11	000001	平安银行	822,035.00	0.33
12	601155	新城控股	806,326.00	0.32
13	600000	浦发银行	787,204.00	0.31
14	601688	华泰证券	776,520.00	0.31
15	600999	招商证券	731,706.60	0.29
16	600837	海通证券	723,087.00	0.29
17	600048	保利地产	722,633.00	0.29
18	601398	工商银行	713,105.00	0.28
19	688688	蚂蚁集团	643,761.60	0.26
20	601108	财通证券	631,868.00	0.25

### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601318	中国平安	26,489,098.88	10.51
2	600036	招商银行	14,193,998.00	5.63
3	601166	兴业银行	6,793,340.03	2.69
4	600030	中信证券	6,790,177.00	2.69
5	600016	民生银行	5,450,080.00	2.16
6	601288	农业银行	4,530,075.00	1.80

7	601328	交通银行	4,484,443.00	1.78
8	688981	中芯国际	4,450,985.15	1.77
9	000001	平安银行	4,422,584.17	1.75
10	000002	万科 A	4,326,939.00	1.72
11	688111	金山办公	4,157,647.40	1.65
12	601398	工商银行	3,762,799.00	1.49
13	600837	海通证券	3,654,002.00	1.45
14	600048	保利地产	3,600,084.00	1.43
15	600000	浦发银行	3,544,323.00	1.41
16	601601	中国太保	3,217,828.00	1.28
17	601211	国泰君安	3,174,151.00	1.26
18	002142	宁波银行	2,559,109.00	1.02
19	600383	金地集团	2,415,085.00	0.96
20	600999	招商证券	2,301,321.00	0.91

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	55,895,226.01
卖出股票收入（成交）总额	199,011,372.48

注：本项中 8.4.1、8.4.2、8.4.3 表中的“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

#### 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

#### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

#### 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末无股指期货投资。

## 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内未投资股指期货。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期内未投资国债期货。

### 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末无国债期货投资。

### 8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

## 8.12 市场中性策略执行情况

## 8.13 投资组合报告附注

### 8.13.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

1、民生银行：本基金跟踪的标的指数为中证金融地产指数，配置了中证金融地产指数成分股民生银行。

2020年2月14日，银罚字（2020）1号显示，中国民生银行股份有限公司存在未按规定履行客户身份识别义务，未按规定保存客户身份资料和交易记录，未按规定报送大额交易报告和可疑交易报告，与身份不明的客户进行交易等问题，中国人民银行对其罚款合计2,360万元。2020年9月4日，银保监罚决字（2020）43号显示，中国民生银行股份有限公司存在“违反宏观调控政策，违规为房地产企业缴纳土地出让金提供融资”等30项问题，对其没收违法所得296.47万元，罚款10486.47万元。

对以上事件，本基金判断，民生银行作为大型股份制银行，经营稳健，上述处罚对公司影响小。后续关注其制度建设与执行等公司基础性建设问题的合规性以及企业的经营状况。

2、平安银行：本基金跟踪的标的指数为中证金融地产指数，配置了中证金融地产指数成分股平安银行。

根据中国银保监会深圳监管局2020年2月3日公布的《中国银保监会深圳监管局行政处罚信息公开表-深银保监罚决字（2020）7号》的公告，平安银行因汽车金融事业部将贷款调查的核心事项委托第三方完成；代理保险销售的人员为非商业银行人员；汽车消费贷款风险分类结果不能反映真实风险水平；个人消费贷款风险分类结果不能反映真实风险水平；个人经营性贷款分类结果不能反映真实风险水平；汽车消费贷款和汽车抵押贷款贷前调查存在缺失；汽车消费及经营贷款审查不到位；个人汽车贷款和汽车抵押贷款业务存在同一抵押物重复抵押；个别汽车消费贷款

和汽车抵押贷款用途管控不力，贷款资金被挪用；个人消费贷款及个人经营性贷款用途管控不力，贷款资金被挪用；部分个人消费贷款未按要求进行受托支付；信用卡现金分期用途管控不力；代销产品风险评级结果与合作机构评级结果不一致，未采用较高风险评级的评级结果；代销产品底层资产涉及本行非标资产，没有实现代销业务与其他业务的风险隔离；“双录”管理审慎性不足，理财销售人员销售话术不当十五项违规事实，依据《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条，平安银行被罚款合计 720 万元。

根据宁波银保监局 2020 年 10 月 27 日公布的《宁波银保监局行政处罚信息公开表-甬银保监罚决字[2020]66 号》的公告，平安银行因贷款资金用途管控不到位、借贷搭售、对房地产开发贷及预售资金监管不力等违规事实，依据《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条，平安银行被罚款合计 100 万元。对以上事件，本基金做出如下说明：

平安银行是中国最优秀的银行之一，基本面良好，公司高度重视内部控制建设，并围绕内部环境、风险评估、控制活动、信息与沟通、内部监督等方面不断加强和完善内部控制机制。基于相关研究，本基金判断，上述处罚对公司影响极小。今后，我们将继续加强与该公司的沟通，密切关注其制度建设与执行等公司基础性建设问题的合规性以及企业的经营状况。

3、交通银行：本基金跟踪的标的指数为中证金融地产指数，配置了中证金融地产指数成分股交通银行。

2020 年 1 月 8 日，银保监罚决字〔2019〕24 号显示，交通银行股份有限公司（一）授信审批不审慎；（二）总行对分支机构管控不力承担管理责任，中国银行保险监督管理委员会对其罚款合计 150 万元。2020 年 4 月 20 日，银保监罚决字〔2020〕6 号显示，交通银行股份有限公司因在监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在（一）理财产品数量漏报；（二）资金交易信息漏报严重；（三）贸易融资业务漏报；（四）信贷业务担保合同漏报；（五）分户账明细记录应报未报；（六）分户账账户数据应报未报；（七）关键且应报字段漏报或填报错误等违法违规行，被罚款合计 260 万元。

对以上事件，本基金判断，交通银行作为大型国有银行，经营稳健，上述处罚对公司影响小。后续关注其制度建设与执行等公司基础性建设问题的合规性以及企业的经营状况。

4、农业银行：本基金跟踪的标的指数为中证金融地产指数，配置了中证金融地产指数成分股农业银行。

2020 年 3 月 18 日，银保监罚决字〔2020〕3 号显示，中国农业银行股份有限公司存在违反审慎经营规则，虚假代理业务等违法违规行为，中国银行保险监督管理委员会决定对农业银行总行罚款 50 万元。

2020年8月28日,银保监罚决字〔2020〕36号显示,中国农业银行股份有限公司因存在向关系人发放信用贷款等二十四项违法违规行为,中国银行保险监督管理委员会对其罚没合计5,315.6万元。

对以上事件,本基金判断,农业银行作为大型国有银行,经营稳健,上述处罚对公司影响小。后续关注其制度建设与执行等公司基础性建设问题的合规性以及企业的经营状况。

除上述事项外,本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体无被监管部门立案调查记录,无在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

### 8.13.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

基金投资的前十名股票,均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

### 8.13.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	23,690.97
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	13,028.31
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	19,005.80
8	其他	-
9	合计	55,725.08

### 8.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券(可交换债券)。

### 8.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 8.13.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:报告期末指数投资前十名股票不存在流通受限情况。

#### 8.13.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	688599	天合光能	365,297.20	0.29	限售期锁定
2	688185	康希诺	326,046.18	0.26	限售期锁定
3	688408	中信博	280,505.75	0.22	限售期锁定
4	688595	芯海科技	219,216.80	0.17	限售期锁定

### 8.13.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 9 基金份额持有人信息 (转型后)

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
12,000	8,189.80	8,833,537.10	8.99%	89,444,104.82	91.01%

### 9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额 比例
1	王武世	3,000,000.00	26.65%
2	刘敏	607,218.00	5.39%
3	刘丽	400,400.00	3.56%
4	孙毅	396,390.00	3.52%
5	李书敏	360,796.00	3.21%
6	杨际华	312,596.00	2.78%
7	史晓雷	231,323.00	2.06%
8	钱艳泓	231,317.00	2.06%
9	傅越千	226,837.00	2.02%
10	叶海靖	195,503.00	1.74%

注：以上信息中持有人为场内持有人，由中国证券登记结算有限责任公司提供。

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员 持有本基金	2,924.33	0.0030%

### 9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## § 9 基金份额持有人信息（转型前）

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
长盛中证金融地产分级 A	-	-	-	-	-	-
长盛中证金融地产分级 B	-	-	-	-	-	-
长盛中证金融地产分级	9,685	12,442.12	14,298,665.00	11.87%	106,203,288.12	88.13%
合计	9,685	12,442.12	14,298,665.00	11.87%	106,203,288.12	88.13%

### 9.2 期末上市基金前十名持有人

长盛中证金融地产分级

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	王武世	6,192,930.00	25.64%
2	陈建燕	1,948,288.00	8.06%
3	尹瑛姬	1,567,777.00	6.49%
4	上海利可资产管理有限公司一利可进取一号私募投资基金	1,288,269.00	5.33%
5	胡永智	1,140,014.00	4.72%
6	李怡名	1,114,199.00	4.61%
7	刘敏	607,218.00	2.51%
8	黄晖	439,072.00	1.82%
9	刘丽	400,482.00	1.66%
10	孙毅	396,390.00	1.64%

注：以上信息中持有人为场内持有人，由中国证券登记结算有限责任公司提供。

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	长盛中证金融地产分级 A	0.00	0.0000%
	长盛中证金融地产分级 B	0.00	0.0000%
	长盛中证金	2,910.85	0.0024%

	融地产分级		
	合计	2,910.85	0.0024%

#### 9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	长盛中证金融地产分级 A	0
	长盛中证金融地产分级 B	0
	长盛中证金融地产分级	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	长盛中证金融地产分级 A	0
	长盛中证金融地产分级 B	0
	长盛中证金融地产分级	0
	合计	0

**§ 10 开放式基金份额变动(转型后)**

单位：份

基金合同生效日基金份额总额	120,501,953.12
本报告期期初基金份额总额	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	14,771,514.50
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	36,995,825.70
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	98,277,641.92

## § 10 开放式基金份额变动(转型前)

单位：份

项目	长盛中证金融地产 分级 A	长盛中证金融地 产分级 B	长盛中证金融地 产分级
基金转型日(2015年6月16日)基金 份额总额	98,009,033.00	98,009,033.00	530,129,756.87
本报告期期初基金份额总额	13,578,593.00	13,578,593.00	252,517,260.04
本报告期基金总申购份额	-	-	87,208,738.61
减:本报告期基金总赎回份额	-	-	246,381,230.53
本报告期基金拆分变动份额(份额减 少以“-”填列)	-13,578,593.00	-13,578,593.00	27,157,185.00
本报告期期末基金份额总额	-	-	120,501,953.12

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本基金于 2020 年 9 月 28 日至 2020 年 10 月 28 日以通讯方式召开基金份额持有人大会，审议《关于长盛中证金融地产指数分级证券投资基金转型有关事项的议案》，并于 2020 年 10 月 29 日大会审议通过了《关于长盛中证金融地产指数分级证券投资基金转型有关事项的议案》，内容包括取消分级运作机制、调整运作方式等，并同意将转型后基金更名为“长盛中证金融地产指数证券投资基金（LOF）”。自 2020 年 12 月 1 日起，长盛中证金融地产指数分级证券投资基金转型为长盛中证金融地产指数证券投资基金（LOF）。《长盛中证金融地产指数证券投资基金（LOF）基金合同》生效，《长盛中证金融地产指数分级证券投资基金基金合同》同时失效。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

#### 11.2.1 本基金管理人的高级管理人员重大人事变动情况

根据公司 2020 年第一次临时股东大会决议，同意陈健元不再担任公司第七届董事会董事，选举钟德兴担任公司第七届董事会董事。该董事人员变更，已向中国证监会北京监管局报备。

#### 11.2.2 基金经理的变动情况

本报告期内本基金基金经理未曾变动。

#### 11.2.3 本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动情况

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略没有改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任的会计师事务所为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）。本报告期内本基金未更换会计师事务所，本报告期内应支付该会计师事务所的报酬为 70,000.00 元，已连续为本基金服务 6 年。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内本基金管理人、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 (转型后)

## 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位: 人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
安信证券	2	19,399,382.31	41.29%	14,187.57	37.20%	-
华安证券	1	10,767,407.87	22.92%	10,025.29	26.28%	-
光大证券	2	8,648,849.31	18.41%	6,325.05	16.58%	-
国元证券	1	8,044,638.38	17.12%	7,490.81	19.64%	-
东北证券	1	123,304.36	0.26%	114.83	0.30%	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
申港证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
德邦证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
西藏东方财富证券	2	-	-	-	-	-

国联证券	1	-	-	-	-	-
------	---	---	---	---	---	---

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
安信证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	24,692.80	100.00%	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
申港证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
西藏东方财富证券	-	-	-	-	-	-

国联证券	-	-	-	-	-	-
------	---	---	---	---	---	---

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 (转型前)

### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信建投	2	60,382,180.25	25.08%	56,232.86	27.01%	-
华安证券	1	51,379,713.39	21.34%	47,847.89	22.98%	-
方正证券	1	27,412,360.25	11.39%	20,047.18	9.63%	-
光大证券	2	23,676,027.84	9.84%	17,314.28	8.32%	-
国元证券	1	22,943,145.55	9.53%	21,366.83	10.26%	-
安信证券	2	19,811,972.70	8.23%	14,554.45	6.99%	-
申万宏源	2	11,181,993.72	4.65%	10,415.38	5.00%	-
长江证券	1	7,855,730.12	3.26%	7,315.90	3.51%	-
西藏东方财富证券	2	5,623,942.11	2.34%	4,112.68	1.98%	-
华融证券	1	4,056,055.11	1.68%	3,777.32	1.81%	-
银河证券	1	1,372,477.95	0.57%	1,003.53	0.48%	-
天风证券	1	1,244,526.64	0.52%	910.16	0.44%	-
东吴证券	1	1,206,096.10	0.50%	881.83	0.42%	-
上海证券	1	1,077,088.82	0.45%	1,003.21	0.48%	-
东兴证券	1	536,821.70	0.22%	500.04	0.24%	-
国信证券	1	365,192.24	0.15%	340.17	0.16%	-
中信证券	2	312,256.20	0.13%	290.77	0.14%	-
招商证券	1	284,480.39	0.12%	265.00	0.13%	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
申港证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-

华泰证券	1	-	-	-	-	-
德邦证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中信建投	155,729.00	91.56%	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
西藏东方财富证券	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	14,350.70	8.44%	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
申港证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-

华泰证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-

注：1、本公司选择证券经营机构的标准

（1）研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时为本公司提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析、个股分析报告等，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告。

（2）资力雄厚，信誉良好。

（3）财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定。

（4）经营行为规范，最近两年未因重大违规行为而受到中国证监会和中国人民银行处罚。

（5）内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求。

（6）具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本公司基金进行证券交易的需要，并能为本公司基金提供全面的信息服务。

2、本公司租用券商交易单元的程序

（1）研究机构提出服务意向，并提供相关研究报告；

（2）研究机构的研究报告需要有一定的试用期。试用期视服务情况和研究服务评价结果而定；

（3）研究发展部、投资管理等部门试用研究机构的研究报告后，按照研究服务评价规定，对研究机构进行综合评价；

（4）试用期满后，评价结果符合条件，双方认为有必要继续合作，经公司领导审批后，我司与研究机构签定《研究服务协议》、《券商交易单元租用协议》，并办理基金专用交易单元租用手续。评价结果如不符合条件则终止试用；

（5）本公司每两个月对签约机构的服务进行一次综合评价。经过评价，若本公司认为签约机构的服务不能满足要求，或签约机构违规受到国家有关部门的处罚，本公司有权终止签署的协议，并撤销租用的交易单元；

（6）交易单元租用协议期限为一年，到期后若双方没有异议可自动延期一年。

3、本基金租用证券公司深圳交易单元为共用交易单元。

4、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

（1）本基金报告期内新增租用交易单元情况：

序号	证券公司名称	交易单元所属市场	数量
1	申港证券	深圳	1
2	西藏东方财富证券	上海	1

3	西藏东方财富证券	深圳	1
4	银河证券	深圳	1
5	兴业证券	深圳	1
6	光大证券	上海	1
7	光大证券	深圳	1
8	天风证券	深圳	1

(2) 本基金报告期内停止租用交易单元情况:

序号	证券公司名称	交易单元所属市场	数量
1	高华证券	上海	1

### 11.9 其他重大事件（转型后）

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	长盛基金管理有限公司关于长盛中证金融地产指数证券投资基金（LOF）基金合同生效的提示性公告	上海证券报、本公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2020年12月1日
2	长盛中证金融地产指数证券投资基金（LOF）基金合同	本公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2020年12月1日
3	长盛中证金融地产指数证券投资基金（LOF）招募说明书	本公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2020年12月1日

### 11.9 其他重大事件（转型前）

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	长盛基金管理有限公司关于长盛中证金融地产指数分级证券投资基金基金份额转换结果的公告	上海证券报、本公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2020年12月1日
2	关于长盛中证金融地产指数分级证券投资基金之 长盛中证金融地产 A 份额、长盛中证金融地产 B 份额终止上市第二次提示性公告	上海证券报、本公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2020年11月26日
3	长盛基金管理有限公司关于长盛中证金融地产指数分级证券	上海证券报、本公司网站、中国证监会基	2020年11月26日

	投资基金转型后基金名称、基金简称变更的公告	金电子披露网站	
4	关于长盛中证金融地产指数分级证券投资基金之长盛中证金融地产 A 份额、长盛中证金融地产 B 份额终止上市第一次提示性公告	上海证券报、本公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2020 年 11 月 25 日
5	关于长盛中证金融地产指数分级证券投资基金实施转型的公告	上海证券报、本公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2020 年 11 月 24 日
6	长盛基金管理有限公司关于旗下部分基金关联交易的公告	上海证券报、本公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2020 年 11 月 4 日
7	关于长盛中证金融地产指数分级证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告	上海证券报、本公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2020 年 10 月 30 日
8	关于长盛中证金融地产指数分级证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会相关事项的提示性公告	上海证券报、本公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2020 年 10 月 29 日
9	长盛中证金融地产指数分级证券投资基金之金融地 A 与金融地 B 基金份额持有人大会会计票日停牌的提示性公告	上海证券报、本公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2020 年 10 月 29 日
10	长盛中证金融地产指数分级证券投资基金 2020 年第 3 季度报告	本公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2020 年 10 月 28 日
11	关于长盛中证金融地产指数分级证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会相关事项的提示性公告	上海证券报、本公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2020 年 10 月 28 日
12	关于长盛中证金融地产指数分级证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会相关事项的提示性公告	上海证券报、本公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2020 年 10 月 27 日
13	关于长盛中证金融地产指数分级证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会相关事项的提示性公告	上海证券报、本公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2020 年 10 月 26 日
14	关于长盛中证金融地产指数分级证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会相关事项的提示性公告	上海证券报、本公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2020 年 10 月 23 日

15	关于长盛中证金融地产指数分级证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会相关事项的提示性公告	上海证券报、本公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2020年10月22日
16	关于长盛中证金融地产指数分级证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会相关事项的提示性公告	上海证券报、本公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2020年10月21日
17	关于长盛中证金融地产指数分级证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会相关事项的提示性公告	上海证券报、本公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2020年10月20日
18	关于长盛中证金融地产指数分级证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会相关事项的提示性公告	上海证券报、本公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2020年10月19日
19	关于长盛中证金融地产指数分级证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会相关事项的提示性公告	上海证券报、本公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2020年10月16日
20	关于长盛中证金融地产指数分级证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会相关事项的提示性公告	上海证券报、本公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2020年10月15日
21	关于长盛中证金融地产指数分级证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会相关事项的提示性公告	上海证券报、本公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2020年10月14日
22	关于长盛中证金融地产指数分级证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会相关事项的提示性公告	上海证券报、本公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2020年10月13日
23	关于长盛中证金融地产指数分级证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会相关事项的提示性公告	上海证券报、本公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2020年10月12日
24	关于长盛中证金融地产指数分级证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会相关事项的提示性公告	上海证券报、本公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2020年10月9日
25	关于以通讯方式召开长盛中证金融地产指数分级证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告	上海证券报、本公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2020年9月30日

26	关于长盛中证金融地产指数分级证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会相关事项的提示性公告	上海证券报、本公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2020年9月30日
27	关于长盛中证金融地产指数分级证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会相关事项的提示性公告	上海证券报、本公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2020年9月29日
28	关于长盛中证金融地产指数分级证券投资基金以通讯方式召开基金份额持有人大会相关事项的提示性公告	上海证券报、本公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2020年9月28日
29	关于以通讯方式召开长盛中证金融地产指数分级证券投资基金基金份额持有人大会的公告	上海证券报、本公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2020年9月28日
30	长盛中证金融地产指数分级证券投资基金基金产品资料概要(更新)	本公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2020年8月27日
31	长盛中证金融地产指数分级证券投资基金2020年第2季度报告	本公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2020年7月21日
32	长盛中证金融地产指数分级证券投资基金招募说明书(更新)摘要	本公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2020年7月16日
33	关于长盛基金管理有限公司直销中心开展旗下部分基金赎回费率优惠活动的公告	上海证券报、本公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2020年6月16日
34	长盛中证金融地产指数分级证券投资基金B类份额溢价风险提示公告	上海证券报、本公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2020年6月16日
35	长盛中证金融地产指数分级证券投资基金2020年第1季度报告	本公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2020年4月22日
36	长盛中证金融地产指数分级证券投资基金2019年度报告	本公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2020年4月21日
37	长盛中证金融地产指数分级证券投资基金B类份额溢价风险提示公告	上海证券报、本公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2020年3月24日
38	长盛中证金融地产指数分级证券投资基金B类份额溢价风险提示公告	上海证券报、本公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2020年3月23日
39	长盛中证金融地产指数分级证券投资基金B类份额溢价风险提示公告	上海证券报、本公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2020年3月20日

	提示公告	金电子披露网站	
40	长盛中证金融地产指数分级证券投资基金 B 类份额溢价风险提示公告	上海证券报、本公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2020 年 3 月 19 日
41	长盛中证金融地产指数分级证券投资基金 B 类份额溢价风险提示公告	上海证券报、本公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2020 年 3 月 16 日
42	长盛中证金融地产指数分级证券投资基金 B 类份额溢价风险提示公告	上海证券报、本公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2020 年 2 月 11 日
43	长盛中证金融地产指数分级证券投资基金 B 类份额溢价风险提示公告	上海证券报、本公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2020 年 2 月 6 日

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注：本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期内无影响投资者决策的其他重要信息。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、长盛中证金融地产指数证券投资基金（LOF）相关批准文件；
- 2、《长盛中证金融地产指数证券投资基金（LOF）基金合同》；
- 3、《长盛中证金融地产指数证券投资基金（LOF）托管协议》；
- 4、《长盛中证金融地产指数证券投资基金（LOF）招募说明书》；
- 5、法律意见书；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、基金托管人业务资格批件、营业执照。

### 13.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公地址和/或基金托管人的住所。

### 13.3 查阅方式

投资者可到基金管理人的办公地址和/或基金托管人的住所和/或基金管理人互联网站免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人长盛基金管理有限公司。

客户服务中心电话：400-888-2666、010-86497888。

网址：<http://www.csfunds.com.cn>。

长盛基金管理有限公司

2021年3月31日