

# 长盛中证金融地产指数分级证券投资基金 2020 年中期报告

2020 年 6 月 30 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：2020 年 8 月 29 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。本中期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 2020 年 8 月 28 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。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2020 年 01 月 01 日起至 06 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.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
4.8 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.....	13
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>14</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
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.....	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	14
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>15</b>
6.1 资产负债表.....	15
6.2 利润表.....	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17

6.4 报表附注.....	18
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>38</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	38
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	38
7.3 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.....	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	45
7.6 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.....	45
7.7 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.....	45
7.8 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.....	46
7.9 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.....	46
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	46
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	46
7.12 投资组合报告附注.....	46
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>50</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	50
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	50
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	51
8.4 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.....	51
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>53</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>54</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	54
10.2 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.....	54
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	54
10.4 基金投资策略的改变.....	54
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	54
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	54
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	54
10.8 其他重大事件.....	56
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>58</b>

11.1 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 .....	58
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	58
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>59</b>
12.1 备查文件目录.....	59
12.2 存放地点.....	59
12.3 查阅方式.....	59

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

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		
交易代码	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	242,643,403.36 份		
基金合同存续期	不定期		
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所		
上市日期	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	13,075,251.00 份	13,075,251.00 份	216,492,901.36 份

### 2.2 基金产品说明

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	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，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	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:

	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》
登载基金中期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>
基金中期报告备置地点	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

项目	名称	办公地址
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 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2020年1月1日 - 2020年6月30日)
本期已实现收益	14,979,286.81
本期利润	-16,251,730.24
加权平均基金份额本期利润	-0.0640
本期加权平均净值利润率	-7.67%
本期基金份额净值增长率	-6.66%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020年6月30日)
期末可供分配利润	-14,904,165.54
期末可供分配基金份额利润	-0.0614
期末基金资产净值	204,069,718.44
期末基金份额净值	0.841
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-2.73%

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（为期末余额，不是当期发生数）。表中的“期末”均指本报告期最后一日，即6月30日。

#### 3.2 基金净值表现

##### 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
过去一个月	4.34%	0.88%	3.35%	0.88%	0.99%	0.00%
过去三个月	7.00%	0.86%	3.84%	0.85%	3.16%	0.01%
过去六个月	-6.66%	1.41%	-11.37%	1.42%	4.71%	-0.01%
过去一年	0.93%	1.16%	-8.91%	1.18%	9.84%	-0.02%
过去三年	18.79%	1.26%	-0.03%	1.27%	18.82%	-0.01%
自基金合同生效起至今	-2.73%	1.41%	-22.19%	1.43%	19.46%	-0.02%

注：本基金业绩比较基准的构建及再平衡过程：

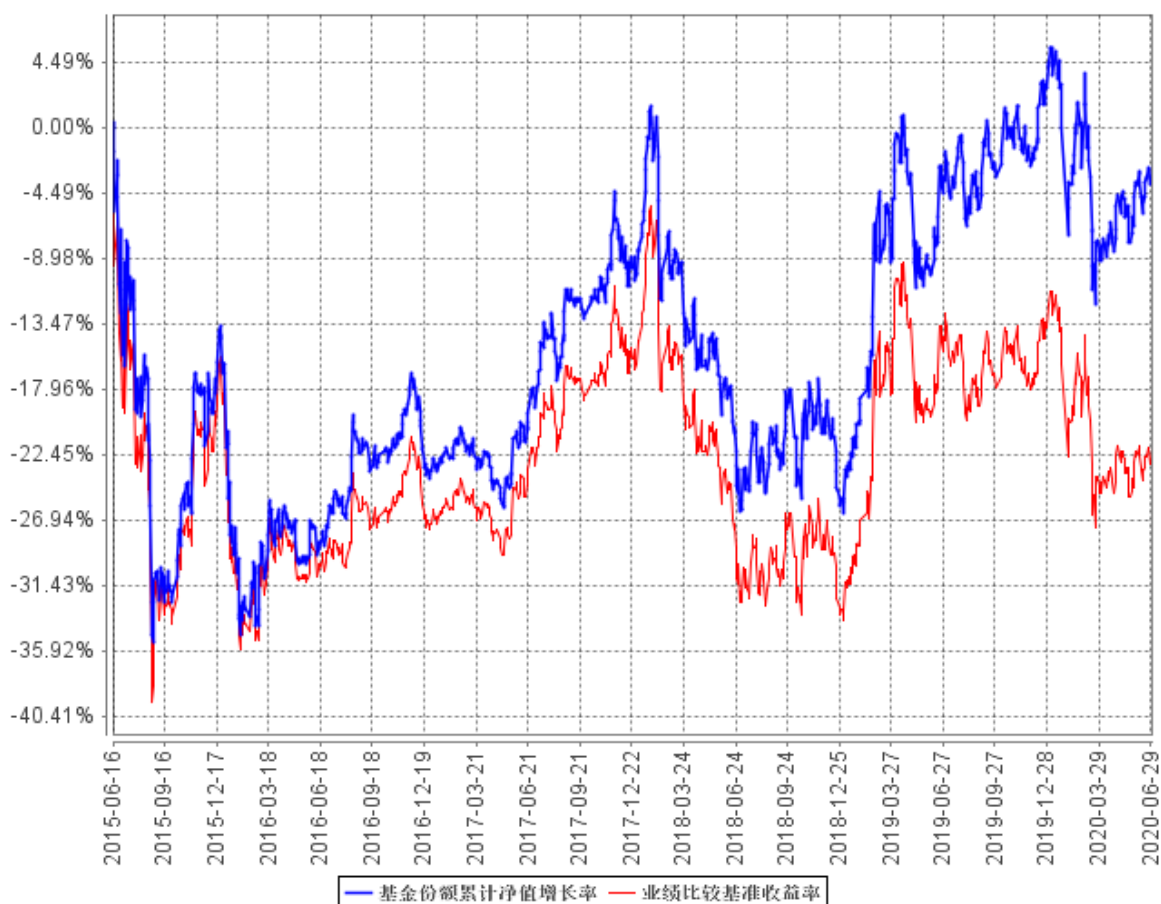


本基金业绩比较基准：中证金融地产指数收益率\*95%+银行活期存款利率(税后)\*5%

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

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



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约定。

## §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址位于北京，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、私募资产管理、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 6 月 30 日，基金管理人共管理六十三只开放式基金，并管理多个全国社保基金组合和私募资产管理计划。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

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，长盛同瑞中证 200 指数分级证券投资基金基金经理，长盛上证 50 指数分级证券投资基金基金经理，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	-	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

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。

#### 4.2 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 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司严格执行《公司公平交易细则》各项规定，在研究、投资授权与决策、交易执行等各个环节，公平对待旗下所有投资组合，包括公募基金、社保组合、私募资产管理计划等。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，依照《公司公平交易细则》的规定，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。

公司对过去 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及利益输送的行为。

### 4.3.2 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，未发现本基金有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 年一季度，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。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。然而，国外疫情扩散势头始终未得到有效控制，叠加主要产油国的减产协议破裂，同期国际金融市场经历了二战以来前所未有的冲击。国内受益于货币和财政政策的快速应对，A 股在经历一季度两次急跌调整后得到快速修复、受益于国内市场和政策的行业逐步持续显现出超额收益。特别是直接受益于疫情的医药生物、医疗设备和用品等板块表现持续领先。伴随对支持经济的政策预期以及 PPI 下跌趋势得以扭转，新基建相关的半导体、计算机和促进内需的食品饮料、商贸零售、休闲服务等表现也较为突出。在充裕的流动性和低利率水平影响下，A 股市场的风险溢价由高位逐步回落、市场估值有效提升、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。在多因子选股方面，受益于国内流动性释放而表现最为突出的动量因子，根据历史统计规律下半年大概率将逐步褪色。成长因子、财务质量因子和合理的利润增速与估值比值是我们持之以恒的因子选股依据。

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

截至本报告期末本基金份额净值为 0.841 元；本报告期基金份额净值增长率为-6.66%，业绩比较基准收益率为-11.37%。本报告期内日均跟踪误差为 0.1230%，年度化跟踪误差为 1.9455%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

二季度末长端利率出现快速上行，股市风险溢价的下行空间相对去年底今年初的高位有所下降。对于已处于高估值的板块和行业形成一定压力。随着特别国债发行、财政政策到位、金融政策推动资金进入实体，PPI 大概率修复向上。走势落后的低估值、强周期和高股息股票的利润有望得到提振，进而估值得到修复。价值股与成长股的估值差有望分阶段逐步收敛。

当前社会就业形势较为严峻，政府有动力加速推进新基建和部分传统基建项目。尤其值得关注的是单位资本投入对应更多新增就业的行业，如 5G 建设、轨道交通、环保水利等。流动性充裕的背景下，大宗商品已出现整体性地反弹，尤其是黄金价格持续上涨。我们将密切跟踪年底前

通胀的变化以及汇率、利率的走势，尤其是流动性的高增速可能扭转对高估值股票的冲击。此外，美国大选前后国际形势的变化对于国内经济商贸政策和企业的供应链的影响的不确定性可能持续升高。以上的情形如若发生，投资者需要及时跟踪不同资产类别的相对强弱变化而调整相应的配置策略。

#### 4.6 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并出具报告。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。

#### 4.7 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，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。

#### **4.8 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分级证券投资基金（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 托管人对本中期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”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 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

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 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	11,893,067.97	15,613,599.48
结算备付金		49,547.44	-
存出保证金		29,913.86	35,875.22
交易性金融资产	6.4.7.2	192,324,437.26	237,795,515.45
其中：股票投资		192,324,437.26	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	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		407,655.04	-
应收利息	6.4.7.5	1,123.19	3,430.56
应收股利		-	-
应收申购款		251,094.96	41,807.74
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		204,956,839.72	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 6 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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		372,254.37	854,680.62
应付管理人报酬		166,889.09	211,908.05
应付托管费		36,715.60	46,619.76
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	16,683.43	75,252.66
应交税费		-	-



应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	294,578.79	221,182.26
负债合计		887,121.28	1,409,643.35
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	209,802,424.55	241,825,092.37
未分配利润	6.4.7.10	-5,732,706.11	10,255,492.73
所有者权益合计		204,069,718.44	252,080,585.10
负债和所有者权益总计		204,956,839.72	253,490,228.45

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，长盛中证金融地产份额净值为人民币 0.841 元，长盛中证金融地产 A 份额参考净值为人民币 1.029 元，长盛中证金融地产 B 份额参考净值为人民币 0.653 元。基金份额总额为 242,643,403.36 份，其中长盛中证金融地产份额为 216,492,901.36 份，长盛中证金融地产 A 份额总额为 13,075,251.00 份，长盛中证金融地产 B 份额总额为 13,075,251.00 份。

## 6.2 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 6 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 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		-14,597,929.04	47,540,969.07
1.利息收入		38,360.33	41,548.51
其中：存款利息收入	6.4.7.11	38,360.33	41,382.80
债券利息收入		-	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		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		16,577,131.88	6,779,694.61
其中：股票投资收益	6.4.7.12	14,509,096.43	4,996,880.99
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	125,016.27
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	2,068,035.45	1,657,797.35

3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-31,231,017.05	40,686,337.64
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	17,595.80	33,388.31
<b>减：二、费用</b>		<b>1,653,801.20</b>	<b>1,356,415.64</b>
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,057,654.13	889,150.67
2. 托管费	6.4.10.2.2	232,683.87	195,613.21
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	142,967.95	57,270.86
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.20	220,495.25	214,380.90
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-16,251,730.24</b>	<b>46,184,553.43</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-16,251,730.24</b>	<b>46,184,553.43</b>

### 6.3 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6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6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）	-	-16,251,730.24	-16,251,730.24
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）	-32,022,667.82	263,531.40	-31,759,136.42
其中：1.基金申购款	8,895,329.48	-278,701.02	8,616,628.46
2.基金赎回款	-40,917,997.30	542,232.42	-40,375,764.88

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）	209,802,424.55	-5,732,706.11	204,069,718.44
项目	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6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）	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）	-	46,184,553.43	46,184,553.43
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）	-28,424,272.82	1,719,523.40	-26,704,749.42
其中：1.基金申购款	19,470,101.08	-1,113,821.08	18,356,280.00
2.基金赎回款	-47,894,373.90	2,833,344.48	-45,061,029.42
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）	186,487,774.82	-6,763,680.82	179,724,094.00

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 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%。

#### 6.4.2 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。

#### 6.4.3 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 2020 年 6 月 30 日的财务状况以及 2020 年 1 月 1 日至 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

## 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

无。

## 6.4.6 税项

### 6.4.6.1 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。

### 6.4.6.2 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。

#### 6.4.6.3 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。

#### 6.4.6.4 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。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
活期存款	11,893,067.97
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：	11,893,067.97

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	188,312,584.62	192,324,437.26	4,011,852.64
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	188,312,584.62	192,324,437.26	4,011,852.64



**6.4.7.3 衍生金融资产/负债**

无。

**6.4.7.4 买入返售金融资产**

无。

**6.4.7.5 应收利息**

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
应收活期存款利息	1,090.97
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	20.07
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	12.15
合计	1,123.19

**6.4.7.6 其他资产**

无。

**6.4.7.7 应付交易费用**

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
交易所市场应付交易费用	16,683.43
银行间市场应付交易费用	-
合计	16,683.43

**6.4.7.8 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2020 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	294.49
应付证券出借违约金	-
其他	4,941.44
预提费用	239,342.86
指数使用费	50,000.00
合计	294,578.79

#### 6.4.7.9 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 6 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	10,286,760.18	8,895,329.48
本期赎回(以“-”号填列)	-47,317,802.86	-40,917,997.30
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	242,643,403.36	209,802,424.55

注：申购含转换入份额及金额，赎回含转换出份额及金额。

#### 6.4.7.10 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	14,979,286.81	-31,231,017.05	-16,251,730.24
本期基金份额交易产生的变动数	3,718,760.26	-3,455,228.86	263,531.40
其中：基金申购款	-967,937.51	689,236.49	-278,701.02
基金赎回款	4,686,697.77	-4,144,465.35	542,232.42
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-14,904,165.54	9,171,459.43	-5,732,706.11

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	37,939.97
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	236.64
其他	183.72
合计	38,360.33

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 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 6 月 30 日
卖出股票成交总额	51,769,369.34
减：卖出股票成本总额	37,260,272.91
买卖股票差价收入	14,509,096.43

#### 6.4.7.13 债券投资收益

无。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

无。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

无。

#### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	2,068,035.45
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	2,068,035.45

## 6.4.7.17 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6月30日
1. 交易性金融资产	-31,231,017.05
——股票投资	-31,231,017.05
——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	-31,231,017.05

## 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
基金赎回费收入	17,577.05
基金转换费收入	18.75
合计	17,595.80

## 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
交易所市场交易费用	142,967.95
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	142,967.95

**6.4.7.20 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
审计费用	29,835.26
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
上市费	29,835.26
银行汇划费	1,152.39
指数使用费	100,000.00
合计	220,495.25

**6.4.7.21 分部报告**

无。

**6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明****6.4.8.1 或有事项**

无。

**6.4.8.2 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。

**6.4.9 关联方关系****6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况**

本报告期内，未存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

**6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方**

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

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。

## 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.10.1.1 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6月30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30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	33.05%	-	-

#### 6.4.10.1.2 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6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	34.04%	11,654.62	69.86%
关联方名称	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6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	-	-	-	-

注：1、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。

2、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。

### 6.4.10.2 关联方报酬

#### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年 6月30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月 30日
	当期发生的基金应支付的管理费	1,057,654.13
其中：支付销售机构的	230,904.25	453,216.73

客户维护费		
-------	--	--

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

#### 6.4.10.2.2 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 6 月 30 日	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	232,683.87	195,613.21

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

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

#### 6.4.10.4 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

##### 6.4.10.4.1 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

无。

##### 6.4.10.4.2 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

无。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

无。

**6.4.10.5.2 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**

无。

**6.4.10.6 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6月30日		2019年1月1日至2019年6月30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	11,893,067.97	37,939.97	10,699,527.23	41,262.02

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。

**6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

无。

**6.4.10.8 其他关联交易事项的说明**

无。

**6.4.11 利润分配情况**

无。

**6.4.12 期末（2020年6月30日）本基金持有的流通受限证券****6.4.12.1 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

6.4.12.1.1 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	备注
688568	中科星图	2020年6月30日	2020年7月8日	新股未上市	16.21	16.21	7,989	129,501.69	129,501.69	-
688528	秦川物联	2020年6月19日	2020年7月1日	新股未上市	11.33	11.33	8,337	94,458.21	94,458.21	-
688377	迪威尔	2020年6月29日	2020年7月8日	新股未上市	16.42	16.42	5,603	92,001.26	92,001.26	-
688600	皖仪	2020	2020	新股未上市	15.50	15.50	5,468	84,754.00	84,754.00	-



	科技	年 6 月 23 日	年 7 月 3 日	上市							
300845	捷安 高科	2020 年 6 月 24 日	2020 年 7 月 3 日	新股未 上市	17.63	17.63	470	8,286.10	8,286.10		-
300843	胜蓝 股份	2020 年 6 月 23 日	2020 年 7 月 2 日	新股未 上市	10.01	10.01	751	7,517.51	7,517.51		-
300840	酷特 智能	2020 年 6 月 30 日	2020 年 7 月 8 日	新股未 上市	5.94	5.94	1,185	7,038.90	7,038.90		-
300846	首都 在线	2020 年 6 月 22 日	2020 年 7 月 1 日	新股未 上市	3.37	3.37	1,131	3,811.47	3,811.47		-
688298	东方 生物	2020 年 1 月 20 日	2020 年 8 月 5 日	新股流 通受限	21.25	143.98	5,286	112,327.50	761,078.28		-
688200	华峰 测控	2020 年 2 月 11 日	2020 年 8 月 18 日	新股流 通受限	107.41	269.85	1,428	153,381.48	385,345.80		-
688233	神工 股份	2020 年 2 月 13 日	2020 年 8 月 21 日	新股流 通受限	21.67	49.19	7,115	154,182.05	349,986.85		-
688505	复旦 张江	2020 年 6 月 10 日	2020 年 12 月 21 日	新股流 通受限	8.95	32.25	10,031	89,777.45	323,499.75		-
688599	天合 光能	2020 年 6 月 2 日	2020 年 12 月 10 日	新股流 通受限	8.16	15.89	17,231	140,604.96	273,800.59		-
688360	德马 科技	2020 年 5 月 25 日	2020 年 12 月 2 日	新股流 通受限	25.12	56.58	4,276	107,413.12	241,936.08		-
688090	瑞松	2020	2020	新股流	27.55	59.43	3,013	83,008.15	179,062.59		-

	科技	年 2 月 7 日	年 8 月 17 日	通受限						
688096	京源 环保	2020 年 3 月 31 日	2020 年 10 月 9 日	新股流 通受限	14.34	24.22	4,485	64,314.90	108,626.70	-
002500	山西 证券	2020 年 6 月 29 日	2020 年 7 月 10 日	配股未 上市	5.00	6.54	17,586	87,930.00	115,012.44	-

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。

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。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 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。

#### 6.4.13.2 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。

#### 6.4.13.3 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。

##### 6.4.13.3.1 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 6.4.12 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 6.4.12.3 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。

#### 6.4.13.4 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。

##### 6.4.13.4.1 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。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020 年 6 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	11,893,067.97	-	-	-	11,893,067.97
结算备付金	49,547.44	-	-	-	49,547.44
存出保证金	29,913.86	-	-	-	29,913.86
交易性金融资产	-	-	-	192,324,437.26	192,324,437.26
应收证券清算款	-	-	-	407,655.04	407,655.04
应收利息	-	-	-	1,123.19	1,123.19
应收申购款	-	-	-	251,094.96	251,094.96
资产总计	11,972,529.27	-	-	192,984,310.45	204,956,839.72
负债					
应付赎回款	-	-	-	372,254.37	372,254.37
应付管理人报酬	-	-	-	166,889.09	166,889.09
应付托管费	-	-	-	36,715.60	36,715.60
应付交易费用	-	-	-	16,683.43	16,683.43
其他负债	-	-	-	294,578.79	294,578.79
负债总计	-	-	-	887,121.28	887,121.28

利率敏感度缺口	11,972,529.27	-	-	192,097,189.17	204,069,718.44
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进行了分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本报告期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。

#### 6.4.13.4.2 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。

#### 6.4.13.4.3 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。

## 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020年6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	192,324,437.26	94.24	237,795,515.45	94.33
合计	192,324,437.26	94.24	237,795,515.45	94.33

## 6.4.13.4.3.2 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6月30日）	上年度末（2019年12月31日）
	+5%	9,913,521.22	12,252,167.61
	-5%	-9,913,521.22	-12,252,167.61

## 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

## 6.4.14.1 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 189,158,719.04 元，属于第二层次的余额为人民币 3,165,718.22 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（2019 年上半年度：本基金持有的以公允价值计量的金融工具转出第三层次公允价值金额为人民币 679,486.50 元）。

#### 6.4.14.2 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。

#### 6.4.14.3 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 投资组合报告

### 7.1 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	192,324,437.26	93.84
	其中：股票	192,324,437.26	93.84
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	11,942,615.41	5.83
8	其他各项资产	689,787.05	0.34
9	合计	204,956,839.72	100.00

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 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	161,669,048.89	79.22
K	房地产业	25,871,550.33	12.68
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		
0	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	187,540,599.22	91.90

### 7.2.2 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	3,329,452.73	1.63
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,766.32	0.01
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	403,558.21	0.20
J	金融业	109,821.92	0.05
K	房地产业	928,238.86	0.45
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	-	-
0	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	4,783,838.04	2.34

### 7.2.3 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。

### 7.3 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

#### 7.3.1 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	430,757	30,756,049.80	15.07
2	600036	招商银行	436,202	14,708,731.44	7.21
3	601166	兴业银行	544,688	8,595,176.64	4.21
4	600030	中信证券	318,306	7,674,357.66	3.76
5	600016	民生银行	1,132,994	6,424,075.98	3.15
6	601328	交通银行	1,164,850	5,975,680.50	2.93
7	601288	农业银行	1,667,534	5,636,264.92	2.76
8	000002	万科A	214,908	5,617,695.12	2.75
9	600000	浦发银行	471,079	4,984,015.82	2.44
10	000001	平安银行	376,976	4,825,292.80	2.36
11	601398	工商银行	914,049	4,551,964.02	2.23
12	600048	保利地产	293,533	4,338,417.74	2.13
13	600837	海通证券	332,563	4,183,642.54	2.05
14	601601	中国太保	129,724	3,534,979.00	1.73
15	601211	国泰君安	202,733	3,499,171.58	1.71
16	601688	华泰证券	157,323	2,957,672.40	1.45
17	601169	北京银行	602,779	2,953,617.10	1.45
18	002142	宁波银行	110,719	2,908,588.13	1.43
19	600999	招商证券	120,233	2,639,114.35	1.29
20	601818	光大银行	655,794	2,347,742.52	1.15
21	601229	上海银行	268,930	2,232,119.00	1.09
22	600383	金地集团	147,740	2,024,038.00	0.99
23	300059	东方财富	100,160	2,023,232.00	0.99
24	601628	中国人寿	69,093	1,880,020.53	0.92
25	601939	建设银行	295,647	1,865,532.57	0.91
26	001979	招商蛇口	113,473	1,865,496.12	0.91
27	600919	江苏银行	322,500	1,828,575.00	0.90
28	000776	广发证券	122,300	1,726,876.00	0.85
29	601009	南京银行	226,550	1,660,611.50	0.81
30	600015	华夏银行	258,747	1,583,531.64	0.78
31	601336	新华保险	35,220	1,559,541.60	0.76
32	000166	申万宏源	307,160	1,551,158.00	0.76
33	601788	光大证券	81,426	1,307,701.56	0.64

34	600958	东方证券	137,331	1,303,271.19	0.64
35	601377	兴业证券	185,527	1,270,859.95	0.62
36	601658	邮储银行	265,526	1,213,453.82	0.59
37	601901	方正证券	170,100	1,204,308.00	0.59
38	002736	国信证券	104,951	1,185,946.30	0.58
39	600109	国金证券	93,700	1,069,117.00	0.52
40	000656	金科股份	128,483	1,048,421.28	0.51
41	000069	华侨城 A	164,500	996,870.00	0.49
42	600340	华夏幸福	43,600	996,696.00	0.49
43	000783	长江证券	147,633	995,046.42	0.49
44	601555	东吴证券	121,151	988,592.16	0.48
45	600705	中航资本	201,802	799,135.92	0.39
46	601066	中信建投	19,590	771,454.20	0.38
47	600606	绿地控股	124,315	768,266.70	0.38
48	600061	国投资本	57,700	734,521.00	0.36
49	600895	张江高科	32,700	666,099.00	0.33
50	601998	中信银行	126,788	652,958.20	0.32
51	000750	国海证券	143,810	624,135.40	0.31
52	601198	东兴证券	51,500	561,350.00	0.28
53	601155	新城控股	17,700	552,948.00	0.27
54	600369	西南证券	116,822	536,212.98	0.26
55	000961	中南建设	59,700	531,330.00	0.26
56	002146	荣盛发展	62,900	509,490.00	0.25
57	002500	山西证券	76,204	498,374.16	0.24
58	601108	财通证券	48,500	497,125.00	0.24
59	000686	东北证券	58,810	496,944.50	0.24
60	600926	杭州银行	52,420	467,586.40	0.23
61	600208	新湖中宝	156,597	466,659.06	0.23
62	600643	爱建集团	57,200	454,740.00	0.22
63	601881	中国银河	39,400	451,918.00	0.22
64	600325	华发股份	61,220	432,213.20	0.21
65	000671	阳光城	67,045	425,065.30	0.21
66	601099	太平洋	131,400	416,538.00	0.20
67	601128	常熟银行	53,000	398,030.00	0.20
68	600064	南京高科	36,762	357,326.64	0.18
69	601997	贵阳银行	49,700	355,852.00	0.17
70	000627	天茂集团	67,400	351,154.00	0.17
71	002797	第一创业	50,242	347,674.64	0.17
72	600094	大名城	56,600	336,770.00	0.17

73	000402	金融街	50,257	333,706.48	0.16
74	601838	成都银行	41,699	331,924.04	0.16
75	600848	上海临港	15,400	330,638.00	0.16
76	600649	城投控股	54,671	324,745.74	0.16
77	600466	蓝光发展	57,960	312,404.40	0.15
78	000563	陕国投 A	82,929	307,666.59	0.15
79	002670	国盛金控	32,252	295,105.80	0.14
80	600266	城建发展	56,784	287,894.88	0.14
81	000031	大悦城	56,400	287,076.00	0.14
82	600376	首开股份	48,200	282,452.00	0.14
83	601236	红塔证券	14,389	279,146.60	0.14
84	002673	西部证券	33,900	276,624.00	0.14
85	002926	华西证券	25,400	270,002.00	0.13
86	601878	浙商证券	25,900	256,669.00	0.13
87	000712	锦龙股份	19,600	245,000.00	0.12
88	600909	华安证券	35,100	239,733.00	0.12
89	600639	浦东金桥	14,900	238,102.00	0.12
90	002244	滨江集团	45,400	193,858.00	0.09
91	600291	西水股份	20,731	187,615.55	0.09
92	002807	江阴银行	47,160	185,338.80	0.09
93	000718	苏宁环球	58,350	180,301.50	0.09
94	600155	华创阳安	13,600	163,064.00	0.08
95	600901	江苏租赁	31,135	162,213.35	0.08
96	601577	长沙银行	20,100	159,594.00	0.08
97	600565	迪马股份	57,200	159,588.00	0.08
98	600515	海航基础	30,500	158,600.00	0.08
99	600748	上实发展	30,975	158,282.25	0.08
100	600657	信达地产	36,911	152,073.32	0.07
101	601319	中国人保	20,800	133,952.00	0.07
102	600823	世茂股份	29,300	130,971.00	0.06
103	002936	郑州银行	37,510	129,034.40	0.06
104	000987	越秀金控	10,900	127,094.00	0.06
105	002839	张家港行	21,900	126,144.00	0.06
106	600908	无锡银行	25,100	123,241.00	0.06
107	002285	世联行	42,840	119,523.60	0.06
108	600928	西安银行	20,677	108,761.02	0.05
109	600158	中体产业	13,200	107,976.00	0.05
110	000732	泰禾集团	19,500	99,255.00	0.05
111	002939	长城证券	6,900	85,008.00	0.04

112	601162	天风证券	13,330	80,779.80	0.04
113	000537	广宇发展	11,000	80,300.00	0.04
114	002945	华林证券	5,500	75,955.00	0.04
115	601860	紫金银行	17,370	73,475.10	0.04
116	600390	五矿资本	9,800	69,188.00	0.03
117	002958	青农商行	15,400	68,222.00	0.03
118	002948	青岛银行	10,800	54,972.00	0.03
119	002423	中粮资本	3,700	32,190.00	0.02

### 7.3.2 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	688298	东方生物	5,286	761,078.28	0.37
2	688200	华峰测控	1,428	385,345.80	0.19
3	688233	神工股份	7,115	349,986.85	0.17
4	688299	长阳科技	11,341	325,373.29	0.16
5	688505	复旦张江	10,031	323,499.75	0.16
6	000006	深振业A	44,900	305,769.00	0.15
7	688599	天合光能	17,231	273,800.59	0.13
8	688039	当虹科技	2,805	261,958.95	0.13
9	688360	德马科技	4,276	241,936.08	0.12
10	600663	陆家嘴	17,200	192,812.00	0.09
11	688090	瑞松科技	3,013	179,062.59	0.09
12	600503	华丽家族	35,800	157,878.00	0.08
13	000667	美好置业	56,682	156,442.32	0.08
14	688568	中科星图	7,989	129,501.69	0.06
15	601990	南京证券	7,696	109,821.92	0.05
16	688096	京源环保	4,485	108,626.70	0.05
17	688528	秦川物联	8,337	94,458.21	0.05
18	688377	迪威尔	5,603	92,001.26	0.05
19	688600	皖仪科技	5,468	84,754.00	0.04
20	000926	福星股份	15,000	78,750.00	0.04
21	603087	甘李药业	645	64,693.50	0.03
22	600743	华远地产	17,506	36,587.54	0.02
23	300842	帝科股份	455	18,527.60	0.01
24	600956	新天绿能	2,533	12,766.32	0.01
25	300839	博汇股份	502	11,751.82	0.01

26	300845	捷安高科	470	8,286.10	0.00
27	300843	胜蓝股份	751	7,517.51	0.00
28	300840	酷特智能	1,185	7,038.90	0.00
29	300846	首都在线	1,131	3,811.47	0.00

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 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	300059	东方财富	1,823,456.00	0.72
2	601155	新城控股	739,771.00	0.29
3	601166	兴业银行	611,902.00	0.24
4	601108	财通证券	601,586.00	0.24
5	601099	太平洋	546,035.00	0.22
6	000002	万科 A	528,684.00	0.21
7	601128	常熟银行	526,750.00	0.21
8	601997	贵阳银行	520,150.00	0.21
9	600036	招商银行	484,088.00	0.19
10	601688	华泰证券	370,192.00	0.15
11	002673	西部证券	361,664.00	0.14
12	688169	石头科技	340,255.60	0.13
13	600919	江苏银行	319,857.00	0.13
14	601878	浙商证券	319,232.00	0.13
15	002926	华西证券	304,033.00	0.12
16	002797	第一创业	284,515.00	0.11
17	600926	杭州银行	281,090.00	0.11
18	600909	华安证券	280,782.00	0.11
19	601838	成都银行	280,446.00	0.11
20	688126	沪硅产业	271,654.26	0.11

### 7.4.2 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	6,030,676.00	2.39
2	688111	金山办公	4,157,647.40	1.65
3	600036	招商银行	3,116,646.00	1.24
4	600016	民生银行	1,851,754.00	0.73
5	601288	农业银行	1,329,392.00	0.53
6	601328	交通银行	1,246,629.00	0.49
7	688002	睿创微纳	1,241,643.99	0.49
8	600383	金地集团	1,135,963.00	0.45
9	600030	中信证券	1,128,191.00	0.45
10	601398	工商银行	1,019,366.00	0.40
11	601166	兴业银行	930,899.00	0.37
12	601211	国泰君安	905,624.00	0.36
13	688588	凌志软件	805,018.57	0.32
14	600837	海通证券	801,598.00	0.32
15	600000	浦发银行	763,719.00	0.30
16	601601	中国太保	762,649.00	0.30
17	600048	保利地产	732,102.00	0.29
18	688396	华润微	721,818.92	0.29
19	688126	沪硅产业	663,423.00	0.26
20	688169	石头科技	623,717.14	0.25

### 7.4.3 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	23,020,211.77
卖出股票收入（成交）总额	51,769,369.34

注：本项中 7.4.1、7.4.2、7.4.3 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。

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

### 7.6 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

本基金本报告期末未持有债券。

### 7.7 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 7.8 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

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 7.9 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

本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无股指期货投资。

### 7.10.2 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。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 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。

### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无国债期货投资。

### 7.11.3 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。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1 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、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。根据北京银保监局 2019 年 12 月 20 日公布的《北京银保监局行政处罚信息公开表-京银保监罚决字（2019）56 号》的公告，民生银行因总行同业票据业务管理失控（该违规事实下具体违法行为已由属地监管部门处罚。）、总行违反内控指引要求计量转贴现卖断业务信用风险加权资产、行总行案件风险信息报送管理不到位、总行未有效管理承兑业务、总行办理无真实贸易背景承兑业务、总行承兑业务质押资金来源为本行贷款、银川分行为已注销法人公司办理票据贴现业务、杭州分行为票据中介办理票据贴现业务、上海自贸区分行为票据中介办理票据贴现业务、福州分行转贴现卖断业务担保情况数据严重失实、苏州分行转贴现卖断业务担保情况数据严重失实、郑州分行转贴现卖断业务担保情况数据严重失实十二项违规事实，依据《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条、第四十八条，北京银保监局责令民生银行股份有限公司改正，并给予合计 700 万元罚款的行政处罚。对顾立辉给予警告并处 5 万元罚款的行政处罚。

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。对以上事件，本基金做出如下说明：民生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。

3、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。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，实力雄厚，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、浦发银行：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浦发银行。2019 年 10 月 12 日，银保监罚决字（2019）7 号显示，上海浦东发展银行股份有限公司（一）对成都分行授信业务及整改情况严重失察；（二）重大审计发现未向监管部门报告；（三）轮岗制度执行不力，中国银行保险监督管理委员会对其罚款合计 130 万元。对以上事件，本基金判断，浦发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。

5、招商银行：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

股招商银行。根据全国银行间同业拆借中心 2019 年 7 月 8 日公布的《全国银行间同业拆借中心关于通报批评平安银行和招商银行的公告》，2019 年 7 月 2 日，平安银行和招商银行在银行间债券回购市场达成 DR001 为 0.09% 的异常利率交易。经两家银行自查，为交易员操作失误所致。全国银行间同业拆借中心对平安银行和招商银行进行通报批评，要求两家机构加强风险控制和内部管理，并依据《银行间本币市场交易员管理办法（试行）》（中汇交发〔2014〕196 号），暂停平安银行和招商银行相关交易员的银行间本币市场交易员资格 1 年。对以上事件，本基金做出如下说明：招商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。

6、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。根据全国银行间同业拆借中心 2019 年 7 月 8 日公布的《全国银行间同业拆借中心关于通报批评平安银行和招商银行的公告》，2019 年 7 月 2 日，平安银行和招商银行在银行间债券回购市场达成 DR001 为 0.09% 的异常利率交易。经两家银行自查，为交易员操作失误所致。全国银行间同业拆借中心对平安银行和招商银行进行通报批评，要求两家机构加强风险控制和内部管理，并依据《银行间本币市场交易员管理办法（试行）》（中汇交发〔2014〕196 号），暂停平安银行和招商银行相关交易员的银行间本币市场交易员资格 1 年。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。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。

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。

### 7.12.2 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。

### 7.12.3 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	29,913.86
2	应收证券清算款	407,655.04
3	应收股利	-
4	应收利息	1,123.19
5	应收申购款	251,094.96
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	689,787.05

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

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）。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末指数投资前十名股票不存在流通受限情况。

#### 7.12.5.2 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	688298	东方生物	761,078.28	0.37	新股流通受限
2	688200	华峰测控	385,345.80	0.19	新股流通受限
3	688233	神工股份	349,986.85	0.17	新股流通受限
4	688505	复旦张江	323,499.75	0.16	新股流通受限

### 7.12.6 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 基金份额持有人信息

### 8.1 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	152	86,021.39	7,938,941.00	60.72%	5,136,310.00	39.28%
长盛中证金融地产分级 B	680	19,228.31	-	-	13,075,251.00	100.00%
长盛中证金融地产分级	3,500	61,855.11	102,891,552.84	47.53%	113,601,348.52	52.47%
合计	4,332	56,011.87	110,830,493.84	45.68%	131,812,909.52	54.32%

注：1、对于分级基金，比例的分母采用各自级别的份额；对于合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数。

2、以上信息中的上市部分持有人信息由中国证券登记结算有限责任公司提供。

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

长盛中证金融地产分级 A

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	北京磐沣投资管理合伙企业（有限合伙）—磐沣固收增强私募证券投资基金	2,700,000.00	20.65%
2	上海铂绅投资中心（有限合伙）—铂绅八号证券投资私募基金	1,750,546.00	13.39%
3	上海铂绅投资中心（有限合伙）—铂绅四号证券投资基金（私募）	1,652,953.00	12.64%
4	上海铂绅投资中心（有限合伙）—铂绅七号证券投资私募基金	1,544,542.00	11.81%
5	李怡名	1,124,345.00	8.60%
6	苏全胜	305,303.00	2.33%
7	林秀芬	252,100.00	1.93%

8	陈富尧	226,013.00	1.73%
9	缪文法	222,000.00	1.70%
10	长盛基金—东兴证券股份有限公司—长盛—长兴优选 1 号单一资产管理计划	198,000.00	1.51%

## 长盛中证金融地产分级 B

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	王武世	6,167,544.00	47.17%
2	赵高科	561,509.00	4.29%
3	刘丽	396,900.00	3.04%
4	杨际华	309,800.00	2.37%
5	李书敏	276,569.00	2.12%
6	陈富尧	226,013.00	1.73%
7	田海卫	200,000.00	1.53%
8	陈美龄	174,800.00	1.34%
9	李钟力	150,007.00	1.15%
10	李立	131,300.00	1.00%

注：1、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。

2、对于长盛中证金融地产分级 A、长盛中证金融地产分级 B 前十名持有人持有份额比例的分母采用各自级别的份额。

## 8.3 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%
	长盛中证金融地产分级	2,881.91	0.0013%
	合计	2,881.91	0.0012%

对于分级基金，比例的分母采用各自级别的份额；对于合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数。

## 8.4 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、基金投资和研发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

## §9 开放式基金份额变动

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
基金合同生效日（2015 年 6 月 16 日）基 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	-	-	10,286,760.18
减:本报告期基金总赎回份额	-	-	47,317,802.86
本报告期基金拆分变动份额（份额减少 以“-”填列）	-503,342.00	-503,342.00	1,006,684.00
本报告期期末基金份额总额	13,075,251.00	13,075,251.00	216,492,901.36

注：拆分变动份额为本基金三级份额之间的配对转换变动份额。



## §10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 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

10.2.1 本基金管理人的高级管理人员重大人事变动情况

本报告期本基金管理人的高级管理人员无重大人事变动。

10.2.2 基金经理变动情况

本报告期本基金基金经理未曾变动。

10.2.3 本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动情况

本报告期本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 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。

### 10.5 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。

### 10.6 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、基金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。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 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	28,797,440.26	41.49%	26,818.72	42.73%	-
国元证券	1	22,943,145.55	33.05%	21,366.83	34.04%	-
长江证券	1	7,855,730.12	11.32%	7,315.90	11.66%	-
方正证券	1	2,756,790.24	3.97%	2,016.09	3.21%	-
安信证券	2	2,089,199.26	3.01%	1,522.05	2.42%	-
银河证券	1	1,372,477.95	1.98%	1,003.53	1.60%	-

东吴证券	1	1,318,152.85	1.90%	881.83	1.40%	-
上海证券	1	1,077,088.82	1.55%	1,003.21	1.60%	-
光大证券	2	722,869.63	1.04%	392.58	0.63%	-
中信证券	2	312,256.20	0.45%	290.77	0.46%	-
申万宏源	2	146,287.42	0.21%	136.25	0.22%	-
招商证券	1	19,795.19	0.03%	18.44	0.03%	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
德邦证券	1	-	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
申港证券	1	-	-	-	-	-
西藏东方财富证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-

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) 资历雄厚，信誉良好。

(3) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营情况稳定。

(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，并能为本公司基金提供全面的信息服。

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交易单元均为共用交易单元。

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	西藏东方财富证券	上海	1
2	西藏东方财富证券	深圳	1
3	申港证券	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

(2) 本基金报告期内停止租用交易单元情况：无。

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	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
2	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
3	长盛基金管理有限公司关于取消	上海证券报、本公	2020年4月28日

	旗下部分开放式基金在中信证券（华南）申购费率优惠的公告	司网站、中国证监会基金电子披露网站	
4	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
5	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
6	长盛基金管理有限公司关于推迟披露旗下基金 2019 年年度报告的公告	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 3 月 25 日
7	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
8	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
9	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
10	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
11	关于长盛基金管理有限公司直销柜台开展旗下部分基金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 3 月 16 日
12	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
13	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
14	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

		站	
15	长盛中证金融地产指数分级证券投资基金 2019 年第 4 季度报告	本公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2020 年 1 月 18 日

## §11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 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

本基金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。

### 11.2 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。

## §12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、长盛中证金融地产指数分级证券投资基金相关批准文件；
- 2、《长盛中证金融地产指数分级证券投资基金基金合同》；
- 3、《长盛中证金融地产指数分级证券投资基金托管协议》；
- 4、《长盛中证金融地产指数分级证券投资基金招募说明书》；
- 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。

### 12.2 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。

### 12.3 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

2020年8月29日