

长盛中证金融地产指数证券投资基金（LOF）

清算报告

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

清算报告出具日期：2023年10月13日

清算报告公告日期：2023年10月20日

一、重要提示

长盛中证金融地产指数证券投资基金（LOF）（以下简称“本基金”）由长盛基金管理有限公司（以下简称“长盛基金”）担任基金管理人，由中国银行股份有限公司（以下简称“中国银行”）担任基金托管人。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于2015年4月27日获中国证监会证监许可〔2015〕759号文注册募集。经向中国证监会备案，《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日正式生效。

长盛中证金融地产指数分级证券投资基金经中国证监会2020年8月12日证监许可【2020】1795号文准予变更注册。自2020年9月28日至2020年10月28日，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，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》，内容包括调整基金名称、运作方式等。上述基金份额持有人大会决议事项自表决通过之日起生效。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。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》（以下简称“《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》同日失效。

根据《基金合同》“第五部分 基金的存续”中“二、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模”的约定：“《基金合同》生效后，连续20个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续60个工作日出现前述情形的，基金管理人与基金托管人协商一致的，可直接终止《基金合同》，且无需召开基金份额持有人大会。”截至2023年9月18日日终，本基金已连续60个工作日出现基金资产净值低于5000万元的情形，触发《基金合同》约定的终止情形，为维护基金份额持有人利益，本基金管理人与基金托管人协商一致，确定2023年9月25日为本基金最后运作日，自最后运

作日的下一日（即2023年9月26日）起本基金进入基金财产清算程序。《基金合同》终止及基金财产清算安排详见2023年9月19日刊登在《上海证券报》和本基金管理人网站（www.csfunds.com.cn）上的《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）基金合同终止及基金财产清算的公告》。

本基金最后运作日为2023年9月25日，自2023年9月26日起进入清算期，由基金管理人长盛基金、基金托管人中国银行、安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）和上海市海华永泰律师事务所于2023年9月26日组成基金财产清算小组履行基金财产清算程序，并由安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）对清算报告进行审计，上海市海华永泰律师事务所对清算报告出具法律意见。

二、基金概况

基金名称	长盛中证金融地产指数证券投资基金（LOF）
基金场外简称	长盛中证金融地产指数（LOF）
基金场内简称	金融地产
基金代码	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
基金最后运作日（2023年9月25日）基金份额总额	32,130,337.65份
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。
投资范围	本基金的标的指数为中证金融地产指数。 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

	<p>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。</p> <p>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。</p>
主要投资策略	<p>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。</p>
业绩比较基准	<p>中证金融地产指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%</p>
风险收益特征	<p>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。</p>
基金管理人	<p>长盛基金管理有限公司</p>
基金托管人	<p>中国银行股份有限公司</p>

注:本基金由“长盛中证金融地产指数分级证券投资基金”转型而来，上述基金合同生效日为《长盛中证金融地产指数证券投资基金（LOF）基金合同》生效日。

三、基金运作情况概述

长盛中证金融地产指数证券投资基金（LOF）由长盛基金管理有限公司担任基金管理人，由中国银行股份有限公司担任基金托管人。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于2015年4月27日经中国证监会证监许可(2015)759号文准予注册，由长盛基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《长盛中证金融地产指数分级证券投资基金基金合同》公开募集，募集资金及其产生的利息共计726,147,822.87元，折合基金份额726,147,822.87份。经向中国证监会备案，《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日正式生效。

长盛中证金融地产指数分级证券投资基金经中国证监会2020年8月12日证监许可【2020】1795号文准予变更注册。自2020年9月28日至2020年10月28日，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，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》，内容包括调整基金名称、运作方式等。上述基金份额持有人大会决议事项自表决通过之日起生效。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。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》（以下简称“《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》同日失效。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《长盛中证金融地产指数证券投资基金（LOF）基金合同》的有关规定，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。

自本基金《基金合同》生效日至最后运作日期间，本基金正常运作。

根据《长盛中证金融地产指数证券投资基金（LOF）基金合同》（以下简称“《基金合同》”）“第五部分 基金的存续”中“二、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模”的约定：“《基金合同》生效后，连续20个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续60个工作日出现前述情形的，基金管理人与基金托管人协商一致的，可直接终止《基金合同》，且无需召开基金份额持有人大会。”

截至2023年9月18日日终，本基金已连续60个工作日出现基金资产净值低于5000万元的情形。为维护基金份额持有人利益，根据《基金合同》约定，本基金管理人

与基金托管人协商一致，决定终止《基金合同》并进行基金财产清算，无需召开基金份额持有人大会。本基金管理人与基金托管人协商一致，确定2023年9月25日为本基金最后运作日，自最后运作日的下一日（即2023年9月26日）起本基金进入基金财产清算程序。

四、财务会计报告

资产负债表（已经审计）

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：2023年9月25日（基金最后运作日）

金额单位：人民币元

科目名称	最后运作日 (2023年9月25日)
资产：	
银行存款	2,659,248.30
结算备付金	-
存出保证金	5,473.81
交易性金融资产	26,208,740.00
应收证券清算款	166,208.90
资产总计	29,039,671.01
负债和所有者权益	
负债：	
应付赎回款	1,169,523.26
应付管理人报酬	23,293.47
应付托管费	4,658.71
应付销售服务费	-
其他负债	126,566.62
负债合计	1,324,042.06
所有者权益：	
实收基金	27,776,376.97
未分配利润	-60,748.02
所有者权益合计	27,715,628.95
负债和所有者权益总计	29,039,671.01

注：截至2023年9月25日(基金最后运作日)，基金份额总额32,130,337.65份，基金份额净值0.8626元。

五、清算情况

自2023年9月26日至2023年10月13日止清算期间，基金财产清算小组对本基金的资产、负债进行清算，全部清算工作按清算原则和清算手续进行。具体清算情况如下：

1、清算费用

按照《基金合同》“第二十部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算”的约定，清算费用是指基金财产清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。

考虑到本基金清算的实际情况，并从保护基金份额持有人利益的角度出发，本基金清算费用中的律师费部分由基金管理人承担，不从基金财产中支付。其他清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。

2、资产处置情况

(1) 本基金最后运作日银行存款为人民币2,659,248.30元，其中应计利息为人民币130.73元。清算期间银行存款变动金额为人民币24,162,530.37元，其中包含新增银行存款应计利息为人民币1,040.27元。截至清算期结束日，银行存款余额为人民币26,821,778.67元，其中银行存款应计利息余额为人民币1,171.00元。

(2) 本基金最后运作日存出保证金为人民币5,473.81元，其中上海存出保证金为人民币5,076.09元，深圳存出保证金为人民币396.72元，应计利息共计人民币1.00元。清算期间新增存出保证金应计利息为人民币5.04元，2023年10月10日存出保证金调整人民币4,022.67元。截至清算期结束日，存出保证金余额为人民币9,501.52元，其中存出保证金利息余额为人民币6.04元。

(3) 本基金最后运作日应收证券清算款为人民币166,208.90元，该款项已于清算期间内划入托管账户。

(4) 本基金最后运作日持有的交易性金融资产为人民币26,208,740.00元，包括股票投资和债券投资。自2023年9月26日至2023年10月13日止清算期间，股票投资和债券投资均于清算期间内处置变现，处置损益为人民币-549,015.41元。

股票明细如下：

金额单位：人民币元

序号	股票名称	股票代码	数量 (单位：股)	最后运 作日估 值单价	最后运作日 成本总额	最后运作日 估值总额
1	浦发银行	600000	63,279.00	7.16	632,277.38	453,077.64
2	华夏银行	600015	34,347.00	5.73	227,657.13	196,808.31
3	民生银行	600016	133,594.00	3.85	737,940.68	514,336.90
4	中信证券	600030	52,377.00	21.90	1,098,204.14	1,147,056.30
5	招商银行	600036	67,402.00	33.00	2,104,629.12	2,224,266.00
6	保利发展	600048	39,433.00	12.90	516,982.87	508,685.70
7	国投资本	600061	13,872.00	6.98	131,144.33	96,826.56
8	湘财股份	600095	4,500.00	7.83	41,518.81	35,235.00
9	国金证券	600109	14,000.00	9.23	167,117.42	129,220.00
10	华创云信	600155	7,100.00	8.53	76,985.32	60,563.00
11	新湖中宝	600208	21,897.00	2.50	80,467.71	54,742.50
12	华发股份	600325	9,220.00	9.45	68,059.22	87,129.00
13	西南证券	600369	17,622.00	4.11	94,249.33	72,426.42
14	金地集团	600383	16,540.00	6.90	190,384.19	114,126.00
15	五矿资本	600390	12,000.00	5.39	83,487.20	64,680.00
16	绿地控股	600606	22,296.00	2.74	136,379.50	61,091.04
17	陆家嘴	600663	4,000.00	9.71	51,154.60	38,840.00
18	中航产融	600705	28,902.00	3.57	173,565.06	103,180.14
19	海通证券	600837	52,563.00	9.89	707,325.83	519,848.07
20	上海临港	600848	5,040.00	11.39	90,755.20	57,405.60
21	张江高科	600895	4,200.00	22.76	76,927.24	95,592.00
22	江苏金租	600901	8,969.00	4.69	37,668.58	42,064.61
23	财达证券	600906	6,700.00	7.96	66,278.87	53,332.00

24	华安证券	600909	14,960.00	4.83	91,657.68	72,256.80
25	中泰证券	600918	15,000.00	7.13	163,546.64	106,950.00
26	江苏银行	600919	66,860.00	7.25	406,249.96	484,735.00
27	杭州银行	600926	16,120.00	11.23	198,310.06	181,027.60
28	永安期货	600927	1,600.00	16.22	30,231.04	25,952.00
29	西安银行	600928	6,977.00	3.72	35,234.72	25,954.44
30	东方证券	600958	28,520.00	9.65	376,416.52	275,218.00
31	招商证券	600999	20,443.00	14.02	336,068.46	286,610.86
32	南京银行	601009	28,250.00	8.12	227,207.10	229,390.00
33	中信建投	601066	6,790.00	24.73	179,269.05	167,916.70
34	渝农商行	601077	33,800.00	4.00	134,676.87	135,200.00
35	财通证券	601108	17,550.00	7.92	174,341.74	138,996.00
36	常熟银行	601128	14,700.00	7.43	123,181.53	109,221.00
37	首创证券	601136	1,600.00	21.81	23,140.56	34,896.00
38	新城控股	601155	4,700.00	13.37	190,985.95	62,839.00
39	天风证券	601162	37,730.00	3.30	154,352.95	124,509.00
40	兴业银行	601166	79,800.00	16.37	1,375,074.01	1,306,326.00
41	北京银行	601169	81,279.00	4.66	475,392.93	378,760.14
42	厦门银行	601187	6,800.00	5.67	44,404.04	38,556.00
43	东兴证券	601198	10,100.00	8.18	128,547.74	82,618.00
44	国泰君安	601211	24,233.00	14.78	441,001.41	358,163.74
45	上海银行	601229	54,130.00	6.21	446,164.44	336,147.30
46	红塔证券	601236	4,916.00	7.61	49,903.20	37,410.76
47	农业银行	601288	166,434.00	3.62	521,939.27	602,491.08
48	中国平安	601318	58,127.00	49.06	3,232,146.87	2,851,710.62
49	中国人保	601319	17,200.00	6.02	89,579.61	103,544.00

50	交通银行	601328	141,750.00	5.82	798,768.49	824,985.00
51	新华保险	601336	4,320.00	37.29	200,967.05	161,092.80
52	兴业证券	601377	37,605.00	6.41	271,851.29	241,048.05
53	工商银行	601398	188,549.00	4.73	926,256.89	891,836.77
54	国联证券	601456	6,300.00	10.69	82,597.63	67,347.00
55	东吴证券	601555	21,526.00	8.63	202,209.12	185,769.38
56	长沙银行	601577	10,700.00	8.17	89,836.19	87,419.00
57	中国太保	601601	18,424.00	29.46	514,107.90	542,771.04
58	中国人寿	601628	8,993.00	37.24	257,159.21	334,899.32
59	邮储银行	601658	57,326.00	5.06	293,893.65	290,069.56
60	齐鲁银行	601665	12,500.00	4.25	56,505.57	53,125.00
61	华泰证券	601688	26,823.00	16.25	447,976.79	435,873.75
62	中银证券	601696	13,100.00	11.35	212,394.88	148,685.00
63	光大证券	601788	10,526.00	16.78	174,961.31	176,626.28
64	光大银行	601818	95,494.00	3.11	387,894.98	296,986.34
65	成都银行	601838	12,299.00	14.07	130,143.53	173,046.93
66	浙商证券	601878	10,100.00	10.09	121,244.70	101,909.00
67	中国银河	601881	7,100.00	11.11	78,764.86	78,881.00
68	方正证券	601901	21,303.00	7.28	169,333.11	155,085.84
69	建设银行	601939	34,547.00	6.30	208,856.76	217,646.10
70	南京证券	601990	12,096.00	8.15	119,797.78	98,582.40
71	中金公司	601995	4,600.00	37.10	203,206.49	170,660.00
72	贵阳银行	601997	15,700.00	5.62	130,666.67	88,234.00
73	中信银行	601998	16,488.00	5.81	94,628.87	95,795.28
74	平安银行	000001	52,776.00	11.22	786,049.90	592,146.72
75	万科A	000002	35,108.00	13.14	795,966.11	461,319.12

76	大悦城	000031	6,600.00	3.73	69,695.01	24,618.00
77	华侨城 A	000069	21,200.00	4.26	143,274.38	90,312.00
78	申万宏源	000166	46,360.00	4.36	270,551.97	202,129.60
79	金融街	000402	6,357.00	4.42	55,522.74	28,097.94
80	陕国投 A	000563	11,129.00	3.03	47,501.63	33,720.87
81	中油资本	000617	13,900.00	6.35	102,254.42	88,265.00
82	国海证券	000750	20,310.00	3.81	116,953.37	77,381.10
83	广发证券	000776	15,900.00	14.80	257,688.43	235,320.00
84	长江证券	000783	20,133.00	5.88	161,080.01	118,382.04
85	电投产融	000958	8,800.00	4.22	38,192.89	37,136.00
86	越秀资本	000987	7,735.00	6.76	50,164.84	52,288.60
87	兰州银行	001227	15,300.00	3.16	51,153.77	48,348.00
88	招商积余	001914	2,300.00	14.52	44,934.47	33,396.00
89	招商蛇口	001979	17,873.00	12.58	329,581.64	224,842.34
90	宁波银行	002142	21,531.00	27.50	571,246.19	592,102.50
91	滨江集团	002244	6,800.00	9.67	39,960.35	65,756.00
92	中粮资本	002423	4,800.00	7.74	37,718.50	37,152.00
93	山西证券	002500	11,704.00	5.80	99,883.61	67,883.20
94	国盛金控	002670	6,152.00	9.42	57,327.61	57,951.84
95	西部证券	002673	13,800.00	6.63	109,111.65	91,494.00
96	国信证券	002736	15,451.00	9.28	204,824.51	143,385.28
97	第一创业	002797	18,042.00	5.91	148,857.39	106,628.22
98	华西证券	002926	8,400.00	8.30	81,936.99	69,720.00
99	郑州银行	002936	30,134.00	2.17	84,271.80	65,390.78
100	长城证券	002939	8,700.00	8.29	94,683.65	72,123.00
101	华林证券	002945	1,500.00	13.88	22,274.32	20,820.00

102	青农商行	002958	20,900.00	2.80	88,787.44	58,520.00
103	苏州银行	002966	19,130.00	7.07	140,769.72	135,249.10
104	东方财富	300059	68,465.00	15.20	992,361.16	1,040,668.00

债券明细如下：

金额单位：人民币元

序号	债券名称	债券代码	数量	最后运作日估值单价	最后运作日成本总额	最后运作日估值总额 (含应计利息)
1	浙 22 转债	113060	240.00	124.52	24,000.00	29,885.08

3、负债清偿情况

(1) 本基金最后运作日应付赎回款为人民币1,169,523.26元，应付管理人报酬为人民币23,293.47元，应付托管费为人民币4,658.71元，上述款项已于清算期间内支付。

(2) 本基金最后运作日其他负债为人民币126,566.62元，其中应付赎回费为人民币343.22元、应付交易费用为人民币9,734.81元，已于清算期间内支付；预提审计费为人民币12,000.00元、预提信息披露费为人民币57,205.98元、指数使用费为人民币47,282.61元，将于完成付款流程后支付。

4、清算期间的清算损益情况

金额单位：人民币元

项目	自2023年9月26日 至2023年10月13日止清算期间
一、清算期间收益（损失以“-”填列）	
利息收入（注1）	1,045.31
处置交易性金融资产产生的净收益（注2）	-549,015.41
清算期间收益小计	-547,970.10
二、清算期间支出	
银行汇划费	310.00

清算期间支出小计	310.00
三、清算期间净收益	-548,280.10

注1：利息收入系计提的2023年9月26日至2023年10月13日止清算期间的银行存款利息和存出保证金利息。

注2：处置交易性金融资产产生的净收益系清算期间卖出证券成交总额减去卖出证券最后运作日估值总额和股息红利税后的差额。

5、资产处置及负债清偿后的剩余资产分配情况

金额单位：人民币元

项目	金额
一、最后运作日2023年9月25日基金净资产	27,715,628.95
加：清算期间净收益	-548,280.10
减：基金净赎回金额（于2023年9月26日确认的投资者赎回、转出申请）	452,787.25
二、清算结束日2023年10月13日基金净资产	26,714,561.60

资产处置及负债清偿后，2023年10月13日本基金剩余财产为人民币26,714,561.60元，根据本基金的《基金合同》约定，基金财产清算小组依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用（由本基金管理人承担的部分除外）、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

自清算起始日（2023年9月26日）至清算结束日（2023年10月13日）的银行存款等产生的利息已计入清算期间净收益，自清算期结束日次日（2023年10月14日）至清算款划出前一日的银行存款等产生的利息亦归基金份额持有人所有。为便于及时向基金份额持有人分配剩余财产，基金管理人以自有资金先行垫付划入托管账户，用以垫付应计利息及存出保证金等。基金管理人所垫付的资金以及垫付资金到账日起孳生的利息归基金管理人所有，将于清算期后返还给基金管理人，基金财产清算完毕之后所产生的其他任何费用亦由基金管理人承担。

6、基金财产清算报告的告知安排

本清算报告已经基金托管人复核，在经会计师事务所审计、律师事务所出具法律意见书后，报中国证券监督管理委员会备案并向基金份额持有人公告。

六、备查文件

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）清算报表审计报告》；
- (2) 《上海市海华永泰律师事务所关于<长盛中证金融地产指数证券投资基金（LOF）清算报告>之法律意见》。

2、存放地点

存放于基金管理人的办公地址。

3、查阅方式

投资者可在营业时间内到基金管理人的办公地址免费查阅。

长盛中证金融地产指数证券投资基金（LOF）基金财产清算小组

2023年10月20日