

长盛中证金融地产指数证券投资基金
(LOF)
2021 年第 3 季度报告

2021 年 9 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

报告送出日期：2021 年 10 月 27 日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 10 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	长盛中证金融地产指数（LOF）
场内简称	长盛金融地产 LOF
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	2020 年 12 月 1 日
报告期末基金份额总额	62,306,053.90 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。
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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2021年7月1日—2021年9月30日）
1. 本期已实现收益	539,150.53
2. 本期利润	-3,247,211.52
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0490
4. 期末基金资产净值	58,247,434.02
5. 期末基金份额净值	0.9349

注：1、所述基金业绩指标不包括基金份额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、所列数据截止到2021年9月30日。

3、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。

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）。

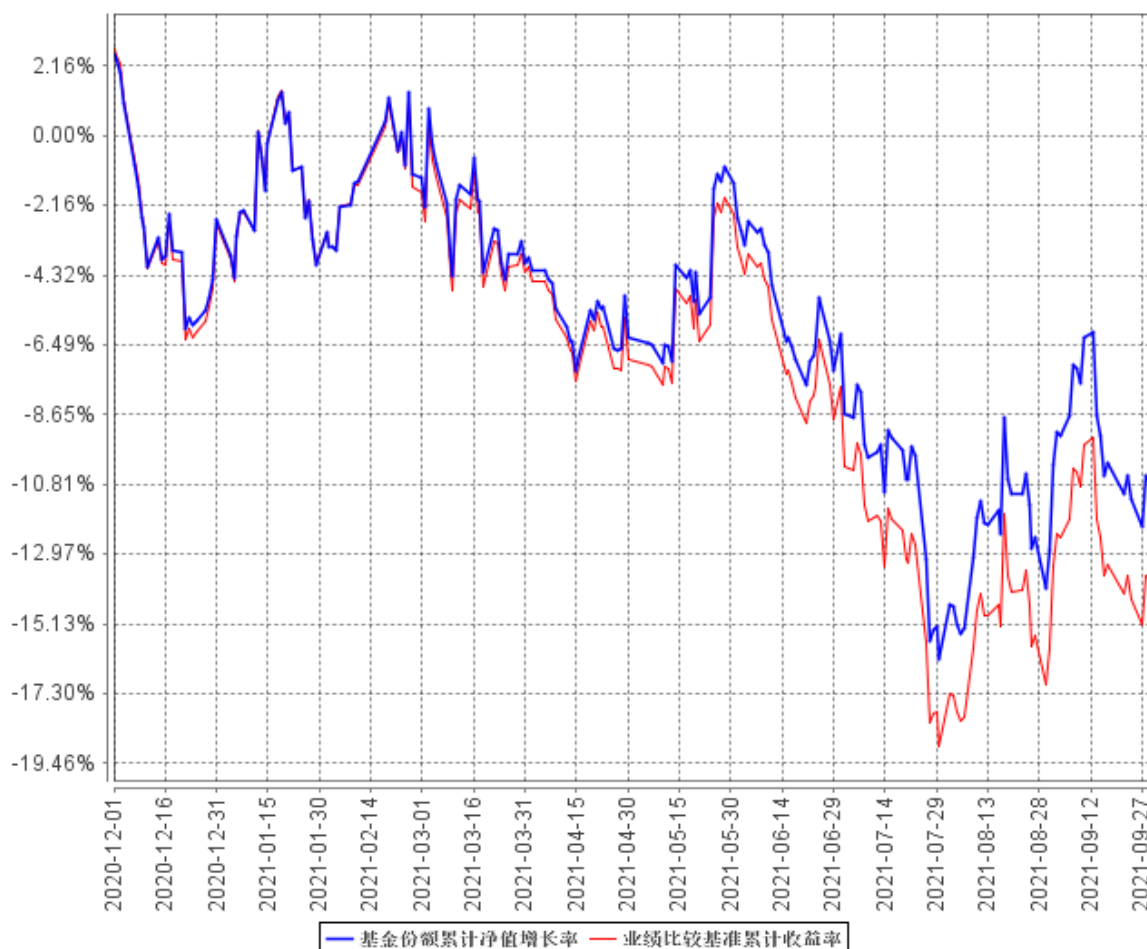
3.2 基金净值表现

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	净值增长率 ①	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	-5.00%	1.40%	-6.58%	1.40%	1.58%	0.00%
过去六个月	-7.73%	1.21%	-10.49%	1.21%	2.76%	0.00%
自基金转型 起至今	-11.38%	1.21%	-14.31%	1.21%	2.93%	0.00%

3.2.2 自基金转型以来基金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。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		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证券投资基金 (LOF) 基金经理，长盛中证全指证券公司指数证券投资基金 (LOF) 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，长盛环球景气行业大盘精选混合型证券投资基金基金经理。	2020 年 12 月 1 日	-	12 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。

4.1.1 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

注：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遵规守信情况的说明

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 公平交易专项说明

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 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内 A 股市场总体保持平稳，依然以结构性行情为主。央行于 7 月初降低存款准备金率，维持了流动性和利差的相对稳定，对市场形成支撑。三季度内 PPI 同比增速持续处于高位，叠加能耗双控等政策对于上游行业产能的限制，资源和能源类周期行业显著跑赢市场。而中游行业受上游的成本压制，表现平平；消费类行业受社会零售品销售数据走势影响进行了较为充分的调整，估值水平回到历史均值附近。在三季度末市场开始关注美联储 taper 政策可能带来的外部流动性收紧而进行了一定风格的切换，造成 A 股的波动显著放大，对流动性敏感的成长类因子的收益快速回调。周期上游板块的供需矛盾依然比较突出，但由于本年度的业绩增长预期被充分交易，未来的风险收益比价的吸引力大幅下降，市场开始关注估值合理且 ROE 稳定的核心资产，以此作为规避流动性变化的对策。

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。

4.5 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 0.9349 元；本报告期基金份额净值增长率为-5.00%，业绩比较基准收益率为-6.58%。本报告期内日均跟踪偏离度为 0.0262%，年度化跟踪误差为 1.1203%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	55,117,134.24	93.80
	其中：股票	55,117,134.24	93.80
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	3,440,849.17	5.86
8	其他资产	204,703.14	0.35
9	合计	58,762,686.55	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

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	49,628.00	0.09
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	49,108,992.58	84.31
K	房地产业	5,930,515.83	10.18
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	55,089,136.41	94.58

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

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	27,997.83	0.05
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	-	-
K	房地产业	-	-
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	27,997.83	0.05

5.2.3 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。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告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前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	600036	招商银行	126,602	6,387,070.90	10.97
2	601318	中国平安	110,157	5,327,192.52	9.15
3	300059	东方财富	78,012	2,681,272.44	4.60
4	601166	兴业银行	136,900	2,505,270.00	4.30
5	600030	中信证券	85,906	2,171,703.68	3.73
6	601398	工商银行	356,149	1,659,654.34	2.85
7	000001	平安银行	91,876	1,647,336.68	2.83
8	000002	万科 A	64,108	1,366,141.48	2.35
9	601328	交通银行	280,150	1,260,675.00	2.16
10	600837	海通证券	98,963	1,201,410.82	2.06

5.3.2 报告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前五名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	001218	丽臣实业	350	15,928.50	0.03
2	605567	春雪食品	617	7,280.60	0.01
3	001217	华尔泰	289	4,788.73	0.01

5.4 报告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。

5.5 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债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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，配置了成分股平安银行。

2020 年 10 月 27 日，甬银保监罚决字〔2020〕66 号显示，平安银行股份有限公司存在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法违规行为，被处罚款 100 万元。2021 年 6 月 8 日，云银保监罚决字〔2021〕34 号显示，该行存在利用来源于本行授信的固定资产贷款和黄金租赁融资的资金发放委托贷款，用于承接处置本行其他贷款风险等多项违法违规行为，被处罚款 210 万元。对以上事件，本基金判断，平安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、海通证券：本基金跟踪的标的指数为中证金融地产指数，配置了成分股海通证券。

2021 年 9 月 28 日，海通证券收到了中国证监会重庆监管局（以下简称“重庆证监局”）《行政处罚事先告知书》（处罚字〔2021〕5 号），主要内容如下：公司涉嫌奥瑞德光电股份有限公司（以下简称“奥瑞德”）持续督导未勤勉尽责一案，重庆证监局已调查完毕，依法拟对公司及相关人员作出行政处罚。根据海通证券违法行为的事实、性质、情节与社会危害程度，依据 2005 年《证券法》第二百二十三条的规定，重庆证监局拟作出以下决定：“一、责令海通证券改正，没收财务顾问业务收入 100 万元，并处以 300 万元罚款；二、对李春、贾文静给予警告，并分别处以 5 万元罚款。”

2021年3月31日，海通证券股份有限公司（以下简称“公司”）及子公司上海海通证券资产管理有限公司（以下简称“海通资管”）分别收到了中国证券监督管理委员会上海监管局（以下简称“上海证监局”）出具的行政监管措施决定书。

一、公司收到行政监管措施决定书的情况

公司收到上海证监局《关于对海通证券股份有限公司采取责令增加合规检查次数、责令暂停部分业务措施的决定》（沪证监决〔2021〕40号），原文如下：“海通证券股份有限公司：经查，你公司（海通证券股份有限公司，统一社会信用代码：9131000013220921X6）在业务开展过程中存在以下行为：一是公司在开展部分投资顾问、私募资产管理业务过程中，未按照审慎经营原则，有效控制和防范风险，未能审慎评估公司经营管理行为对证券市场的影响。上述行为违反了《证券公司监督管理条例》（以下简称《条例》）第二十七条第一款、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》（证监会令第151号）第三条第二款和《证券公司和证券投资基金管理公司合规管理办法》（证监会令第133号，经证监会令第166号修正，以下简称《合规办法》）第六条第八项的规定。

二是公司未将相关业务行为纳入全面合规风控体系，合规风控机制存在缺失，违反了《合规办法》第三条和《证券公司风险控制指标管理办法》（证监会令第125号，经证监会令第166号修正）第六条第一款的规定。

三是公司投资银行业务内部控制存在漏洞，债券承销与资产管理等业务缺少有效隔离，利益冲突审查机制存在缺失，不符合《关于规范债券市场参与者债券交易业务的通知》（银发〔2017〕302号）第二条第二项和《证券公司投资银行类业务内部控制指引》（证监会公告〔2018〕6号）第四十五条的规定，违反了《合规办法》第六条第六项的规定。

根据《条例》第七十条第一款第一项、第六项的规定，我局决定对你公司采取如下监督管理措施：

一是责令你公司自本决定作出之日起1年内，每3个月开展一次内部合规检查，并在每次检查后10个工作日内，向我局报送合规检查报告。

二是责令你公司自本决定作出之日起12个月内，暂停为机构投资者提供债券投资顾问业务。

二、海通资管收到行政监管措施决定书的情况

海通资管收到上海证监局《关于对上海海通证券资产管理有限公司采取责令暂停部分业务措施的决定》（沪证监决〔2021〕41号），原文如下：“上海海通证券资产管理有限公司：经查，你公司（上海海通证券资产管理有限公司，统一社会信用代码：91310000599711334G）在开展业务过程中存在以下行为：一是公司在开展部分投资顾问、私募资产管理业务过程中，未按照审慎经营原

则,有效防范和控制风险,未能审慎评估公司经营管理行为对证券市场的影响。上述行为违反了《证券公司监督管理条例》(以下简称《条例》)第二十七条第一款、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》(证监会令第151号,以下简称《私募资管办法》)第三条第二款和《证券公司和证券投资基金管理公司合规管理办法》(证监会令第133号,经证监会令第166号修正,以下简称《合规办法》)第六条第八项的规定。

二是公司在开展投资顾问业务时未制定相关管理制度,未建立涵盖投资顾问业务全流程的风险控制制度,合规风控机制严重缺失。上述行为违反了《合规办法》第三条的规定。

三是债券交易管控存在明显漏洞,交易对手管理有待完善,未对部分固定收益交易对手开展必要的尽职调查,未配备专职合规管理人员负责债券交易合规管理。

上述行为违反了《私募资管办法》第六十一条第二款和《合规办法》第二十三条第二款的规定。根据《条例》第七十条第一款第六项的规定,我局决定对你公司采取如下监督管理措施:责令你公司自本决定作出之日起12个月内暂停为证券期货经营机构私募资管产品提供投资顾问业务、自本决定作出之日起6个月内暂停新增私募资产管理产品备案。

海通证券是中国最优秀的证券公司之一,综合实力强。本基金认为:该处罚对于公司整体经营业绩不构成重大影响。

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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	2,754.02
2	应收证券清算款	172,389.11
3	应收股利	-
4	应收利息	351.86
5	应收申购款	29,208.15
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	204,703.14

5.11.4 报告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)。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告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。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	001218	丽臣实业	15,928.50	0.03	新股未上市
2	605567	春雪食品	7,280.60	0.01	新股未上市

5.11.6 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。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	66,872,059.38
报告期期间基金总申购份额	10,123,249.73
减：报告期期间基金总赎回份额	14,689,255.21
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	62,306,053.90

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注：本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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。

8.2 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。

§ 9 备查文件目录

9.1 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。

9.2 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。

9.3 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 10 月 27 日