

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

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

报告送出日期：2020 年 7 月 21 日

§ 1 重要提示

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

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 7 月 20 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 2020 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

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
报告期末基金份额总额	242,643,403.36 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，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。
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

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的份额总额	13,075,251.00 份	13,075,251.00 份	216,492,901.36 份
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

§ 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（2020年4月1日—2020年6月30日）
1. 本期已实现收益	8,715,941.31
2. 本期利润	13,738,406.53
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0554
4. 期末基金资产净值	204,069,718.44
5. 期末基金份额净值	0.841

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 2020 年 6 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。

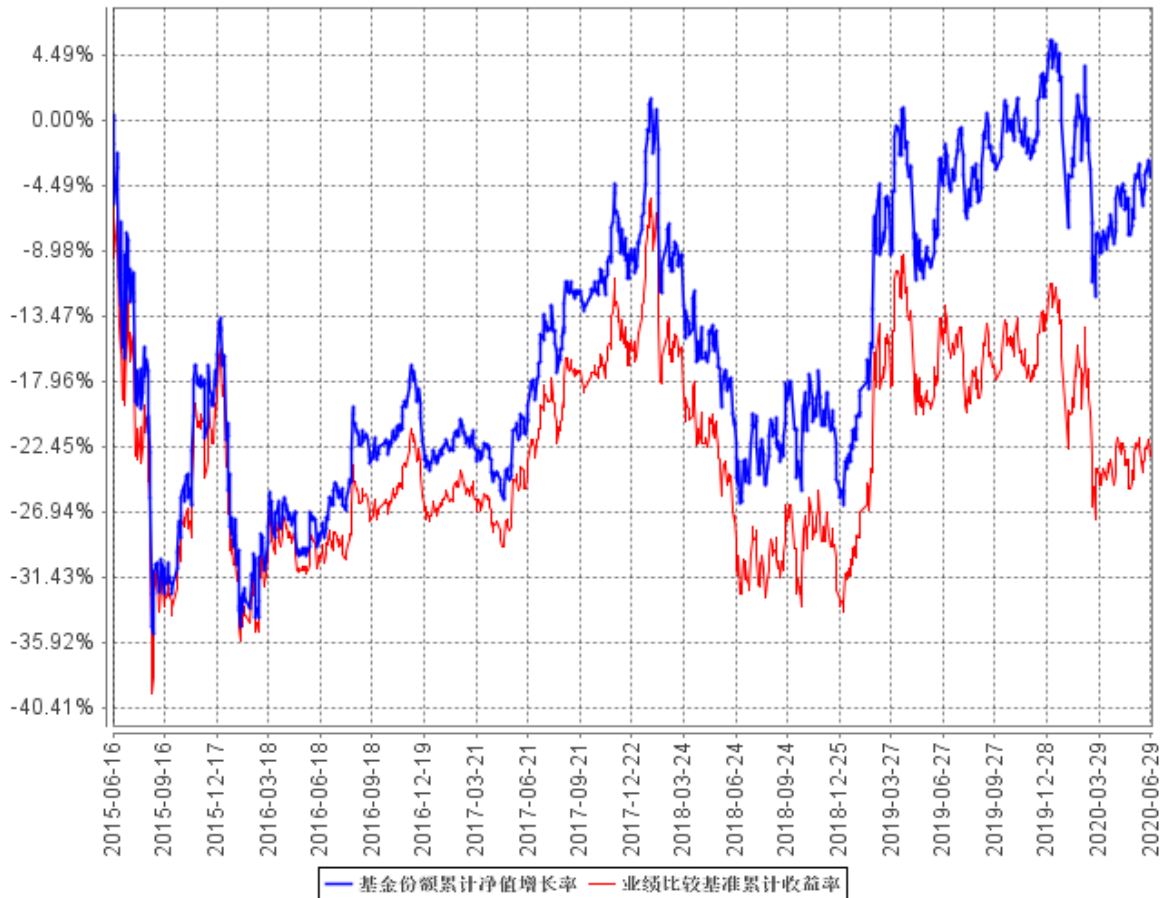
3.2 基金净值表现

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	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%
过去五年	4.59%	1.38%	-13.22%	1.39%	17.81%	-0.01%
自基金合同生效起至今	-2.73%	1.41%	-22.19%	1.43%	19.46%	-0.02%

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



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	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	2019年5月	-	11年	陈亘斯先生，硕士。曾任PineRiver 资产管理公司量化

斯	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。	月 30 日		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。

4.2 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 报告期内基金投资策略和运作分析

2020 年二季度由于货币政策对于经济托底的支持，社会融资维持高增速，债券利率总体下行使得 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速增长的公司形成“戴维斯双击”，市场总体以结构性上涨为主。此外，由于新型冠状病毒疫情在国内得到有效遏制，复工复产有序进展，部分低接触风险的以内需为主的消费行业，包括医疗医药、食品饮料、消费电子预期大幅修复，表现突出。而受 PPI 的低迷影响，相关重资产周期行业走势平平。但由于二季度末长期利率出现快速上行，股市风险溢价的下行空间有限，对于已处于高估值的板块和行业形成一定压力。而随着特别国债发行、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、强周期和高股息行业的利润有望得到提振、估值得到修复、与成长股的估值差开始收敛。在个股选择方面，成长因子、财务质量在行业内选股始终表现稳定的超额收益，是我们持之以恒的重要判断标准。

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 0.841 元；本报告期基金份额净值增长率为 7.00%，业绩比较基准收益率为 3.84%。本报告期内日均跟踪误差为 0.1074%，年度化跟踪误差为 1.6988%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期内无基金持有人数或基金资产净值预警说明。

§ 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	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	其他资产	689,787.05	0.34
9	合计	204,956,839.72	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	-	-
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	-	-
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	187,540,599.22	91.90

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	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	-	-
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	4,783,838.04	2.34

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前十名股票投资明细

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	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

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	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

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、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。

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	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

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	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

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

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
报告期期初基金份额总额	13,262,751.00	13,262,751.00	224,392,132.31
报告期期间基金总申购份额	-	-	3,613,486.35
减：报告期期间基金总赎回份额	-	-	11,887,717.30
报告期期间基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列)	-187,500.00	-187,500.00	375,000.00
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。

§ 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、中国证监会核准基金募集的文件；
- 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。

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

2020 年 7 月 21 日