长盛中证全指证券公司指数证券投资基金（LOF）
2026 年第 3 季度报告

2026 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：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：2026 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 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 2026 年 07 月 01 日起至 09 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	长盛中证证券公司指数（LOF）
场内简称	券商 LOF
基金主代码	502053
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021 年 1 月 1 日
报告期末基金份额总额	301,160,268.74 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%，实现对中证全指证券公司指数的有效跟踪。
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。 在正常市场情况下，本基金的风险控制目标是追求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%。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。
业绩比较基准	中证全指证券公司指数收益率×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	中国农业银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	长盛中证证券公司指数（LOF)A	长盛中证证券公司指数 C
下属分级基金的场内简称	券商 LOF	-
下属分级基金的交易代码	502053	021556
报告期末下属分级基金的份额总额	237,156,736.00 份	64,003,532.74 份

注：本基金由“长盛中证全指证券公司指数分级证券投资基金”终止分级运作转型而来，上述基金合同生效日为《长盛中证全指证券公司指数证券投资基金（LOF）基金合同》生效日。

§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（2026 年 7 月 1 日-2026 年 9 月 30 日）	
	长盛中证证券公司指数（LOF)A	长盛中证证券公司指数 C
1.本期已实现收益	1,768,827.36	481,823.23
2.本期利润	-20,880,946.37	-5,983,290.75
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0881	-0.0879
4.期末基金资产净值	243,956,565.50	65,565,550.68
5.期末基金份额净值	1.0287	1.0244

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、所列数据截止到 2026 年 09 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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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、长盛中证全指证券公司指数证券投资基金（LOF）由长盛中证全指证券公司指数分级证券投资基金转型而来，转型日期为 2021 年 1 月 1 日（即基金合同生效日）。

5、本基金自 2024 年 06 月 18 日起增加 C 类基金份额，并自该日起接受投资者对 C 类基金份额的申购和赎回。

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

长盛中证证券公司指数（LOF)A

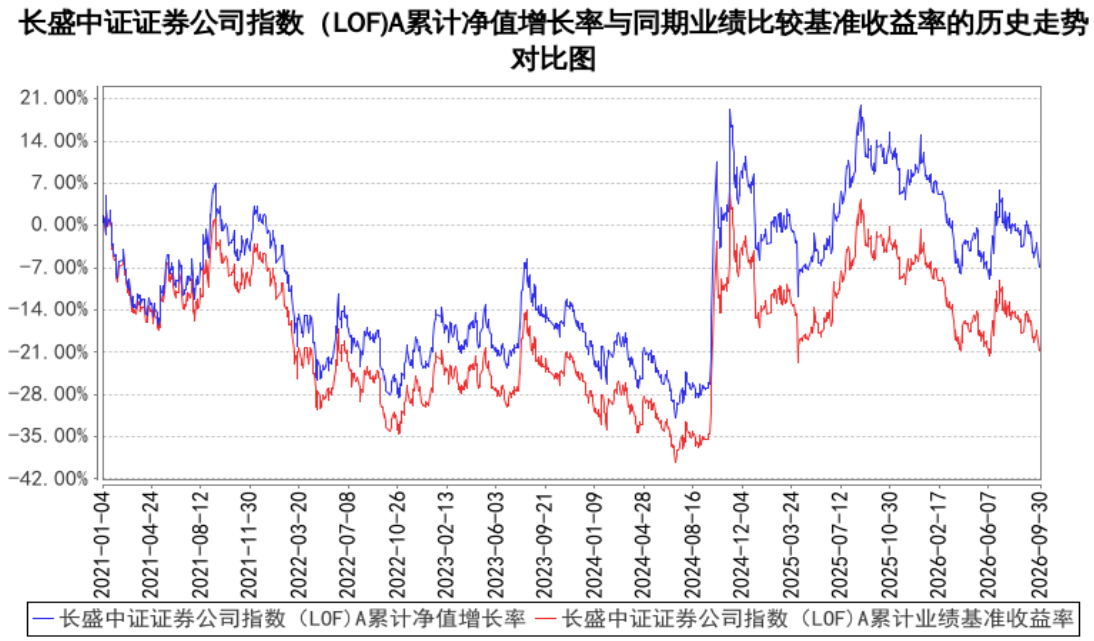
阶段	净值增长率①	净值增长率标	业绩比较基准	业绩比较基准	①－③	②－④

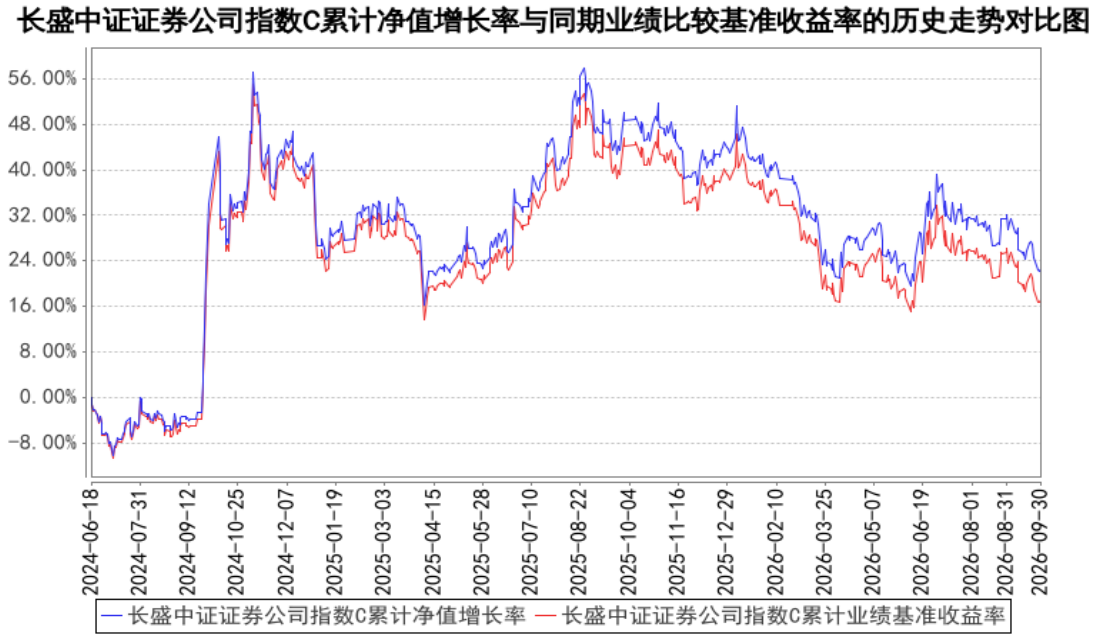
		准差②	收益率③	收益率标准差④		
过去三个月	-7.88%	1.30%	-8.48%	1.33%	0.60%	-0.03%
过去六个月	0.36%	1.51%	-0.90%	1.53%	1.26%	-0.02%
过去一年	-17.21%	1.34%	-18.69%	1.35%	1.48%	-0.01%
过去三年	11.13%	1.62%	5.03%	1.63%	6.10%	-0.01%
过去五年	-5.79%	1.55%	-15.13%	1.57%	9.34%	-0.02%
自基金转型起至今	-6.48%	1.56%	-20.34%	1.57%	13.86%	-0.01%

长盛中证证券公司指数 C

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	-7.93%	1.30%	-8.48%	1.33%	0.55%	-0.03%
过去六个月	0.25%	1.51%	-0.90%	1.53%	1.15%	-0.02%
过去一年	-17.38%	1.34%	-18.69%	1.35%	1.31%	-0.01%
自基金新增本类份额起至今	22.77%	1.71%	17.16%	1.72%	5.61%	-0.01%

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





注：1、长盛中证全指证券公司指数证券投资基金（LOF）由长盛中证全指证券公司指数分级证券投资基金转型而来，转型日期为 2021 年 1 月 1 日（即基金合同生效日）。

2、按照本基金合同规定，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，长盛中证 A100 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，长盛同鑫行业配置混合型证券投资基金基金经理，长盛北证 50 成份指数增强型发起式证券投资基金基金经理，长盛中证红利低波动 100 指数型证券投资基金基金经理，长盛量化红利策略混合型证券投资	2021 年 1 月 1 日	-	17 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。

	基金基金经理，长盛中证A500 指数增强型证券投资基金基金经理，长盛上证科创板芯片指数发起式证券投资基金基金经理，长盛上证科创板综合指数增强型证券投资基金基金经理，长盛聚利债券型证券投资基金基金经理，长盛聚益债券型证券投资基金基金经理，量化投资部总经理助理。				

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《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》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

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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2026 年三季度 A 股市场整体在经历快速下跌后呈宽幅震荡偏弱格局，市场风格轮动加快、结构性博弈特征突出。二季度领涨的科技板块出现显著大幅快速回调，对市场情绪形成明显压制；回调过后，受政策预期等因素带动，市场迎来一轮短暂反弹修复，但修复动能偏弱、持续性有限，在内外部多重因素交织扰动下，市场未能延续反弹态势，再度进入幅度较深的调整阶段，板块分化加剧，资金观望情绪有所上升。红利板块在经历了二季度末的资金抽离后，风险溢价率大幅改善，重获中长期投资者的青睐，其中能源、银行等行业在高股息叠加稳定改善的盈利预期的加持下，走出了较为独立且持续的上行行情。

国内宏观政策与流动性层面，继续较为友好，国内货币政策延续适度宽松基调，市场流动性保持合理充裕；财政政策以托底为主，重点抓政策落地与新质生产力相关产业的扶持，为市场提供了稳定的政策预期。主要冲击可能来自于美联储加息预期发酵以及美债利率上行，对美国 AI 龙头的债务融资进程形成抑制，进而压制了 AI 行业持续资本投入的展望。但我们注意到，美国经济的内生结构开始出现走弱的裂隙，可能在四季度明显回落，进而缓和加息预期。而国内经济政策的托底力度可能随之加大。我们需要耐心等待宏观叙事的改变，保持反转而非趋势思维进行行业和风格的配置。

在操作中，我们严格遵守跟踪误差要求，应用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

截至本报告期末长盛中证证券公司指数（LOF)A 的基金份额净值为 1.0287 元，本报告期基金份额净值增长率为-7.88%，同期业绩比较基准收益率为-8.48%；截至本报告期末长盛中证证券公司指数 C 的基金份额净值为 1.0244 元，本报告期基金份额净值增长率为-7.93%，同期业绩比较基准收益率为-8.48%。本报告期内日均跟踪误差为 0.0288%，年度化跟踪误差为 0.6858%。

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	291,485,148.91	93.54
	其中：股票	291,485,148.91	93.54
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	19,975,524.77	6.41
8	其他资产	168,550.85	0.05
9	合计	311,629,224.53	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	290,884,766.92	93.98

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	290,884,766.92	93.98

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	28,392.04	0.01
C	制造业	469,335.23	0.15
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	102,654.72	0.03
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	600,381.99	0.19

5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

5.3 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	600030	中信证券	1,627,695	42,092,192.70	13.60

2	300059	东方财富	2,128,094	37,858,792.26	12.23
3	601211	国泰海通	1,902,031	32,087,262.97	10.37
4	601688	华泰证券	975,603	17,365,733.40	5.61
5	600999	招商证券	619,448	10,573,977.36	3.42
6	000776	广发证券	481,745	9,577,090.60	3.09
7	600958	东方证券	877,818	7,593,125.70	2.45
8	000166	申万宏源	1,520,363	6,659,189.94	2.15
9	601377	兴业证券	1,158,539	6,626,843.08	2.14
10	601995	中金公司	197,900	6,061,677.00	1.96

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	301666	大普微	436	144,211.36	0.05
2	001246	力勤资源	1,960	125,236.16	0.04
3	001248	华润新能源	9,576	102,654.72	0.03
4	301660	粤芯半导体	7,891	94,770.91	0.03
5	301717	超纯应材	80	24,459.20	0.01

5.4 报告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。

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

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

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

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

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

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

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是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

（一）国泰海通

本基金跟踪的标的指数为中证全指证券公司指数，配置了中证全指证券公司指数成分股国泰海通。

2025 年 12 月 05 日，国泰海通证券因未依法履行职责，公司自身被深圳证券交易所出具警示。

2026 年 03 月 02 日，国泰海通证券因内控制度不完善，公司自身被中国证券监督管理委员会上海监管局出具警示。

2026 年 04 月 03 日，国泰海通证券股份有限公司因违反审慎经营原则、内控制度不完善等原因被监管警示，处理机构中国证券监督管理委员会上海监管局。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合法律法规、基金合同和公司投资制度的规定。

（二）广发证券

本基金跟踪的标的指数为中证全指证券公司指数，配置了中证全指证券公司指数成分股广发证券。

2026 年 07 月 10 日，广发证券因违规收费被监管警示，处理机构中国证券监督管理委员会。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合法律法规、基金合同和公司投资制度的规定。

（三）东方证券

本基金跟踪的标的指数为中证全指证券公司指数，配置了中证全指证券公司指数成分股东方证券。

2026 年 03 月 02 日，东方证券股份有限公司因违反审慎经营原则被监管警示，处理机构中国证券监督管理委员会上海监管局。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合法律法规、基金合同和公司投资制度的规定。

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，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是否超出基金合同约定的备选股票库

本基金投资的前十名股票，均为基金合同约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	13,544.86
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	155,005.99
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	168,550.85

5.11.4 报告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。

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

本基金本报告期末指数投资前十名股票中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	301666	大普微	144,211.36	0.05	限售期锁定
2	001248	华润新能源	102,654.72	0.03	限售期锁定
3	301660	粤芯半导体	94,770.91	0.03	新股未上市

4	001246	力勤资源	35,932.68	0.01	限售期锁定
5	301717	超纯应材	24,459.20	0.01	限售期锁定

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	长盛中证证券公司指数（LOF)A	长盛中证证券公司指数 C
报告期期初基金份额总额	233,427,543.64	60,505,672.67
报告期期间基金总申购份额	27,505,976.88	37,315,487.00
减:报告期期间基金总赎回份额	23,776,784.52	33,817,626.93
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	237,156,736.00	64,003,532.74

§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

单位：份

项目	长盛中证证券公司指数（LOF)A	长盛中证证券公司指数 C
报告期期初管理人持有的本基金份额	16,641,540.04	-
报告期期间买入/申购总份额	-	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	16,641,540.04	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	7.02	-

注：对于分级基金，比例的分母采用各自级别的份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

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

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、长盛中证全指证券公司指数证券投资基金（LOF）相关批准文件；

2、《长盛中证全指证券公司指数证券投资基金（LOF）基金合同》；

3、《长盛中证全指证券公司指数证券投资基金（LOF）托管协议》；

4、《长盛中证全指证券公司指数证券投资基金（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和/或基金托管人的办公地址。

9.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的办公地址和/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

2026 年 10 月 27 日