

基金管理人:长盛基金管理有限公司
基金托管人:招商银行股份有限公司
送出日期:2017年8月24日

长盛沪深 300 指数证券投资基金(LOF)

2017 半年度 报告摘要

2017年6月30日

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法律责任...

2.1 基金基本情况
基金名称:长盛沪深300指数LOF
场内简称:长盛300
基金代码:160807

2.2 基金产品说明
基金的投资目标:本基金跟踪标的指数,跟踪沪深300指数,通过严格的投资程序和数量化风险管理手段,力求实现基金净值增长率与跟踪标的指数收益率之间的跟踪误差最小化...

2.3 基金管理人及基金托管人
名称:长盛基金管理有限公司
基金托管人:招商银行股份有限公司
法定代表人:杨顺成

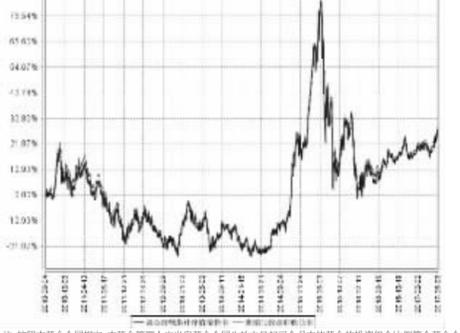
3.1 主要会计数据和财务指标
3.2 基金业绩表现
3.3 基金净值表现
3.4 基金持有人户数及持有人结构

注:1.上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可能低于所列数据...

3.5 基金业绩表现
基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较
基金名称:长盛沪深300指数证券投资基金(LOF)

注:1.本基金业绩比较基准为95%×沪深300指数收益率+5%×一年期银行定期存款利率(税后)...

沪深300指数是上海证券交易所和深圳证券交易所共同编制并由中证指数有限公司发布的中国A股市场指数,它的样本覆盖了大部分流通市值,其成份股为中国A股市场代表性最强、流动性最好的股票...



注:按照本基金合同规定,本基金管理人应当自基金合同生效之日起三个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定...

4.1 基金管理人及基金托管人
4.1.1 基金管理人及基金托管人的基本情况
4.1.2 基金管理人及基金托管人的主要人员情况

Table with columns: 姓名, 性别, 任职日期, 离任日期, 基金从业年限, 简历

注:1.上述基金管理人任职日期和离任日期均以基金公告中披露的聘任日期和解聘日期为准...

4.2 报告期内基金投资策略和运作分析
报告期内,本基金管理人严格执行《基金合同》,跟踪标的指数,力求实现基金净值增长率与跟踪标的指数收益率之间的跟踪误差最小化...

4.3 报告期内基金业绩比较基准执行情况
报告期内,本基金管理人严格执行《基金合同》,跟踪标的指数,力求实现基金净值增长率与跟踪标的指数收益率之间的跟踪误差最小化...

4.4 报告期内基金投资组合资产配置情况
报告期内,本基金管理人严格执行《基金合同》,跟踪标的指数,力求实现基金净值增长率与跟踪标的指数收益率之间的跟踪误差最小化...

4.5 报告期内基金持有人户数及持有人结构
报告期内,本基金管理人严格执行《基金合同》,跟踪标的指数,力求实现基金净值增长率与跟踪标的指数收益率之间的跟踪误差最小化...

4.6 报告期内基金管理人及基金托管人
4.6.1 基金管理人及基金托管人的基本情况
4.6.2 基金管理人及基金托管人的主要人员情况

Table with columns: 基金名称, 基金代码, 基金净值, 基金份额, 基金净值增长率

注:1.上述数据按照招商基金费率计算,并按照中国证券登记结算有限责任公司公布的估值费率计算,仅供参考,不作为交易依据...

2. 清算佣金按约定的服务范围还包括佣金收取方为基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务...

Table with columns: 项目, 本期, 上期, 上年度可比期间

注:1. 清算佣金按约定的服务范围还包括佣金收取方为基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务...

注:2. 清算佣金按约定的服务范围还包括佣金收取方为基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务...

注:3. 清算佣金按约定的服务范围还包括佣金收取方为基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务...

Table with columns: 基金名称, 基金代码, 基金净值, 基金份额, 基金净值增长率

注:1. 清算佣金按约定的服务范围还包括佣金收取方为基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务...

注:2. 清算佣金按约定的服务范围还包括佣金收取方为基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务...

注:3. 清算佣金按约定的服务范围还包括佣金收取方为基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务...

注:4. 清算佣金按约定的服务范围还包括佣金收取方为基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务...

注:5. 清算佣金按约定的服务范围还包括佣金收取方为基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务...

注:6. 清算佣金按约定的服务范围还包括佣金收取方为基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务...

注:7. 清算佣金按约定的服务范围还包括佣金收取方为基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务...

注:8. 清算佣金按约定的服务范围还包括佣金收取方为基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务...

注:9. 清算佣金按约定的服务范围还包括佣金收取方为基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务...

注:10. 清算佣金按约定的服务范围还包括佣金收取方为基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务...

注:11. 清算佣金按约定的服务范围还包括佣金收取方为基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务...

注:12. 清算佣金按约定的服务范围还包括佣金收取方为基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务...

注:13. 清算佣金按约定的服务范围还包括佣金收取方为基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务...

注:14. 清算佣金按约定的服务范围还包括佣金收取方为基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务...

注:15. 清算佣金按约定的服务范围还包括佣金收取方为基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务...

注:16. 清算佣金按约定的服务范围还包括佣金收取方为基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务...

注:17. 清算佣金按约定的服务范围还包括佣金收取方为基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务...

注:18. 清算佣金按约定的服务范围还包括佣金收取方为基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务...

注:19. 清算佣金按约定的服务范围还包括佣金收取方为基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务...

注:20. 清算佣金按约定的服务范围还包括佣金收取方为基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务...

注:21. 清算佣金按约定的服务范围还包括佣金收取方为基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务...

注:22. 清算佣金按约定的服务范围还包括佣金收取方为基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务...

注:23. 清算佣金按约定的服务范围还包括佣金收取方为基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务...

注:24. 清算佣金按约定的服务范围还包括佣金收取方为基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务...

注:25. 清算佣金按约定的服务范围还包括佣金收取方为基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务...

注:26. 清算佣金按约定的服务范围还包括佣金收取方为基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务...

注:27. 清算佣金按约定的服务范围还包括佣金收取方为基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务...

注:28. 清算佣金按约定的服务范围还包括佣金收取方为基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务...

注:29. 清算佣金按约定的服务范围还包括佣金收取方为基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务...

注:30. 清算佣金按约定的服务范围还包括佣金收取方为基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务...

注:31. 清算佣金按约定的服务范围还包括佣金收取方为基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务...

注:32. 清算佣金按约定的服务范围还包括佣金收取方为基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务...

注:33. 清算佣金按约定的服务范围还包括佣金收取方为基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务...

注:34. 清算佣金按约定的服务范围还包括佣金收取方为基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务...

注:35. 清算佣金按约定的服务范围还包括佣金收取方为基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务...

注:36. 清算佣金按约定的服务范围还包括佣金收取方为基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务...

注:37. 清算佣金按约定的服务范围还包括佣金收取方为基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务...

注:38. 清算佣金按约定的服务范围还包括佣金收取方为基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务...

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额, 占期末基金资产净值比例

7.4.2 累计买入金额超前期基金资产净值2%或前20名的股票明细

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计买入金额, 占期末基金资产净值比例

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

注:1. 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额,是指买卖股票成交金额(成交价款乘以成交数量)的总和,不考虑相关交易费用...

7.5 期末按持仓品种分类的债券投资组合
本基金本报告期末持有债券投资情况如下:

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细
本基金本报告期末持有债券投资情况如下:

7.7 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
本基金本报告期末持有资产支持证券投资情况如下:

7.8 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
本基金本报告期末持有贵金属投资情况如下:

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
本基金本报告期末持有权证投资情况如下:

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
注:本基金本报告期末未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
注:本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注
7.12.1 本基金投资的股票公允价值变动情况说明

7.12.2 本基金投资的股票公允价值变动情况说明
7.12.3 本基金投资的股票公允价值变动情况说明

7.12.4 本基金投资的股票公允价值变动情况说明
7.12.5 本基金投资的股票公允价值变动情况说明

7.12.6 本基金投资的股票公允价值变动情况说明
7.12.7 本基金投资的股票公允价值变动情况说明

7.12.8 本基金投资的股票公允价值变动情况说明
7.12.9 本基金投资的股票公允价值变动情况说明

7.12.10 本基金投资的股票公允价值变动情况说明
7.12.11 本基金投资的股票公允价值变动情况说明

7.12.12 本基金投资的股票公允价值变动情况说明
7.12.13 本基金投资的股票公允价值变动情况说明

7.12.14 本基金投资的股票公允价值变动情况说明
7.12.15 本基金投资的股票公允价值变动情况说明

7.12.16 本基金投资的股票公允价值变动情况说明
7.12.17 本基金投资的股票公允价值变动情况说明

7.12.18 本基金投资的股票公允价值变动情况说明
7.12.19 本基金投资的股票公允价值变动情况说明

7.12.20 本基金投资的股票公允价值变动情况说明
7.12.21 本基金投资的股票公允价值变动情况说明

7.12.22 本基金投资的股票公允价值变动情况说明
7.12.23 本基金投资的股票公允价值变动情况说明

7.12.24 本基金投资的股票公允价值变动情况说明
7.12.25 本基金投资的股票公允价值变动情况说明

7.12.26 本基金投资的股票公允价值变动情况说明
7.12.27 本基金投资的股票公允价值变动情况说明

7.12.28 本基金投资的股票公允价值变动情况说明
7.12.29 本基金投资的股票公允价值变动情况说明

7.12.30 本基金投资的股票公允价值变动情况说明
7.12.31 本基金投资的股票公允价值变动情况说明

7.12.32 本基金投资的股票公允价值变动情况说明
7.12.33 本基金投资的股票公允价值变动情况说明

7.12.34 本基金投资的股票公允价值变动情况说明
7.12.35 本基金投资的股票公允价值变动情况说明

7.12.36 本基金投资的股票公允价值变动情况说明
7.12.37 本基金投资的股票公允价值变动情况说明

7.12.38 本基金投资的股票公允价值变动情况说明
7.12.39 本基金投资的股票公允价值变动情况说明

7.12.40 本基金投资的股票公允价值变动情况说明
7.12.41 本基金投资的股票公允价值变动情况说明

7.12.42 本基金投资的股票公允价值变动情况说明
7.12.43 本基金投资的股票公允价值变动情况说明

7.12.44 本基金投资的股票公允价值变动情况说明
7.12.45 本基金投资的股票公允价值变动情况说明

7.12.46 本基金投资的股票公允价值变动情况说明
7.12.47 本基金投资的股票公允价值变动情况说明

7.12.48 本基金投资的股票公允价值变动情况说明
7.12.49 本基金投资的股票公允价值变动情况说明

7.12.50 本基金投资的股票公允价值变动情况说明
7.12.51 本基金投资的股票公允价值变动情况说明

7.12.52 本基金投资的股票公允价值变动情况说明
7.12.53 本基金投资的股票公允价值变动情况说明