

长盛沪深 300 指数证券投资基金 (LOF) 2017 年第 3 季度报告

2017 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：招商银行股份有限公司

报告送出日期：2017 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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 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 2017 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	长盛沪深 300 指数 (LOF)
场内简称	长盛 300
基金主代码	160807
交易代码	160807
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010 年 8 月 4 日
报告期末基金份额总额	46,843,649.48 份
投资目标	本基金采取指数化投资，跟踪沪深 300 指数，通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段，力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值误差小于 0.35%，且年化跟踪误差小于 4%，以实现有效跟踪。
投资策略	本基金采用抽样复制指数的投资策略，综合考虑标的指数样本中个股的自由流通市值规模、流动性、行业代表性、波动性与标的指数整体的相关性，通过抽样方式构建基金股票投资组合，并优化确定投资组合中的个股权重，以实现基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值误差小于 0.35%，且年化跟踪误差小于 4% 的投资目标。
业绩比较基准	95%×沪深 300 指数收益率+5%×一年期银行定期存款利率（税后）
风险收益特征	本基金是股票指数型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种，其预期风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

基金管理人	长盛基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司

§ 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（2017年7月1日—2017年9月30日）
1. 本期已实现收益	2,952,309.76
2. 本期利润	2,859,831.71
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0617
4. 期末基金资产净值	59,781,982.32
5. 期末基金份额净值	1.276

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 2017 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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	5.11%	0.56%	4.42%	0.56%	0.69%	0.00%

3.2.2 自基金合同生效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：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。建仓期结束时，本基金的各项资产配置比例符合本基金合同第十三条（二）投资范围、（七）投资限制的有关约定。本报告期内，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		
冯雨生	本基金基金经理，长盛中证 100 指数证券投资基金基金经理，长盛高端装备制造灵活配置混合型证券	2011 年 12 月 20 日	-	9 年	冯雨生先生，1983 年 11 月出生。毕业于光华管理学院金融系，北京大

	<p>投资基金基金经理，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，长盛成长价值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，长盛战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理，长盛盛世灵活配置混合型证券投资基金基金经理，长盛积极配置债券型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，长盛信息安全主题量化灵活配置混合型证券投资基金基金经理，量化投资部负责人。</p>				<p>学经济学硕士，CFA（特许金融分析师）。2007 年 7 月加入长盛基金管理有限公司，曾任金融工程研究员，同盛基金经理助理等职务。</p>
--	--	--	--	--	--

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”的含义遵从行业协会《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、特定客户资产管理组合等。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

三季度股票市场小幅上涨，不同市场表现差异较大，上证综指震荡中上行，深证成指调整后上行，中小板指一路上涨，创业板指数经历下跌后反弹的行情。不同概念板块分化严重，小金属、稀土永磁、5G、芯片国产化、锂电池等相关概念股大幅上涨，粤港澳自贸区、乙醇汽油、环保概念板块逆市领跌。行业上，有色金属、钢铁、食品饮料、采掘、通信等行业大幅上涨，公用事业、传媒、纺织服装等行业表现最差。风格上，小盘成长股跑赢大盘价值股。

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 1.276 元；本报告期基金份额净值增长率为 5.11%，业绩比较基准收益率为 4.42%。本报告期内日均跟踪误差为 0.1624%，年度化跟踪误差为 2.5678%

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	56,059,346.00	93.39
	其中：股票	56,059,346.00	93.39
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	3,922,283.05	6.53
8	其他资产	43,128.14	0.07
9	合计	60,024,757.19	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	150,374.92	0.25
B	采矿业	1,982,554.49	3.32
C	制造业	20,422,620.30	34.16
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,470,467.34	2.46
E	建筑业	2,468,763.65	4.13
F	批发和零售业	1,198,154.57	2.00
G	交通运输、仓储和邮政业	1,665,472.79	2.79
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,218,123.01	5.38
J	金融业	18,667,322.31	31.23
K	房地产业	2,862,366.86	4.79
L	租赁和商务服务业	480,811.38	0.80
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	410,436.50	0.69
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-

Q	卫生和社会工作	107,163.00	0.18
R	文化、体育和娱乐业	634,325.23	1.06
S	综合	157,894.79	0.26
	合计	55,896,851.14	93.50

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	采掘业	-	-
C	制造业	162,494.86	0.27
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	162,494.86	0.27

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沪港通投资股票。

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	55,589	3,010,700.24	5.04
2	600519	贵州茅台	2,583	1,337,064.12	2.24
3	601166	兴业银行	77,029	1,331,831.41	2.23
4	000333	美的集团	23,491	1,038,067.29	1.74

5	601328	交通银行	158,990	1,004,816.80	1.68
6	600016	民生银行	122,226	980,252.52	1.64
7	000651	格力电器	24,718	936,812.20	1.57
8	000002	万科A	35,048	920,010.00	1.54
9	600887	伊利股份	31,102	855,305.00	1.43
10	601288	农业银行	199,165	760,810.30	1.27

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	600666	奥瑞德	4,320	85,190.40	0.14
2	002129	中环股份	7,286	77,304.46	0.13

注：本基金本报告期末仅持有上述 2 支积极投资股票。

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

本基金跟踪的标的指数为沪深 300 指数，配置了沪深 300 指数成分股民生银行。根据 2016 年 9 月 14 日民生银行公告《民生银行:关于中国民生银行股份有限公司非公开发行优先股申请文件反馈意见的回复报告》中提到加银资管被证券监管部门和交易所采取监管措施、监管关注及整改情况：2016 年 5 月 17 日，中国证监会向加银资管下发行政监管措施决定书（〔2016〕49 号）《关于对民生加银资产管理有限公司采取暂停办理相关业务措施的决定》，对加银资管部分资产管理计划较高比例投资于非标资产，但却每周开放申购赎回，违反《基金管理公司特定客户资产管理业务试点办法》相关规定的行为，采取责令改正、并暂停办理加银资管特定客户资产管理计划备案 3 个月的行政监管措施。2016 年 7 月 25 日，中国证券投资基金业协会向加银资管下发纪律处分决定书（中基协处分〔2016〕5 号），对加银资管部分资产管理计划违规开展资金池业务，违反中国证监会《关于进一步加强基金管理公司及其子公司从事特定客户资产管理业务风险管理的通知》和《证券期货经营机构落实资产管理业务“八条底线”禁止行为细则（2015 年 3 月版）》相关规定的行为，采取暂停受理加银资管资产管理计划备案 6 个月，并责令清理资金池业务的行政监管措施。上述纪律处分与前述中国证监会暂停受理加银资管特定客户资产管理计划备案 3 个月的行政监管措施合并执行。加银资管针对上述事项，经过与监管部门沟通，已经采取整改措施，目前正在整改过程中，待整改完成后将对整改情况做出书面汇报。”

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。基于相关研究，本基金判断，加银资管受监管部门整改措施对民生银行影响极小。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，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	11,921.85
2	应收证券清算款	21,336.74
3	应收股利	-
4	应收利息	815.00
5	应收申购款	9,054.55
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	43,128.14

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。

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：本基金本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	600666	奥瑞德	85,190.40	0.14	重大事项停牌
2	002129	中环股份	77,304.46	0.13	重大事项停牌

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	57,859,928.44
报告期期间基金总申购份额	10,241,901.72
减：报告期期间基金总赎回份额	21,258,180.68
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	46,843,649.48

§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

报告期期初管理人持有的本基金份额	18,048,971.69
------------------	---------------

报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	18,048,971.69
报告期期末管理人持有的本基金份额	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例 (%)	-

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额 (份)	交易金额 (元)	适用费率
1	赎回	2017 年 7 月 11 日	15,000,000.00	18,208,500.00	0.50%
2	赎回	2017 年 7 月 12 日	3,048,971.69	3,685,978.10	0.50%
合计			18,048,971.69	21,894,478.10	

§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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20170701~20170711	18,048,971.69	-	18,048,971.69	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-

产品特有风险

本基金本报告期存在单一投资者持有基金份额比例超过 20%的情况，当该基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致的风险包括：巨额赎回风险、流动性风险、基金资产净值持续低于 5000 万元的风险、基金份额净值大幅波动风险以及基金收益水平波动风险。本基金管理人将对申购赎回进行审慎的应对，保护中小投资者利益。

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、《长盛沪深 300 指数证券投资基金（LOF）基金合同》；
- 3、《长盛沪深 300 指数证券投资基金（LOF）托管协议》；
- 4、《长盛沪深 300 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场所及/或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、010-62350088。

网址：<http://www.csfunds.com.cn>。

长盛基金管理有限公司

2017 年 10 月 27 日