

长盛同庆中证 800 指数型证券投资基金 (LOF)

基金产品资料概要 (更新)

编制日期: 2021 年 3 月 29 日

送出日期: 2021 年 3 月 30 日

本概要提供本基金的重要信息, 是招募说明书的一部分。

作出投资决定前, 请阅读完整的招募说明书等销售文件。

一、产品概况

| | | | |
|---------|-------------------|----------------|------------------------|
| 基金简称 | 长盛同庆中证800指数 (LOF) | 基金代码 | 160806 |
| 基金管理人 | 长盛基金管理有限公司 | 基金托管人 | 中国建设银行股份有限公司 |
| 基金合同生效日 | 2015-05-22 | 上市交易所及上市日期 | 深圳证 券交易所 2015-08-06 |
| 基金类型 | 股票型 | 交易币种 | 人民币 |
| 运作方式 | 普通开放式 | 开放频率 | 每个开放日 |
| 基金经理 | 陈亘斯 | 开始担任本基金基金经理的日期 | 2019-05-30 |
| | | 证券从业日期 | 2009-03-31 |

二、基金投资与净值表现

(一) 投资目标与投资策略

投资者阅读《招募说明书》第十二章了解详细情况

| | |
|--------|--|
| 投资目标 | 本基金运用指数化投资方式, 通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段, 力争将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控制在0.35%以内, 年跟踪误差控制在4%以内, 以实现中证800 指数的有效跟踪。 |
| 投资范围 | <p>本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具, 包括国内依法发行上市的股票 (包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、权证、债券、货币市场工具、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具 (但须符合中国证监会的相关规定)。</p> <p>本基金投资于股票的资产占基金资产的比例为90%—95%, 其中投资于中证800指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的90%; 其余资产投资于现金、债券资产及中国证监会允许基金投资的其他证券品种, 其中权证资产占基金资产净值的比例为0-3%; 现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%, 其中, 现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。</p> <p>如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种, 基金管理人在履行适当程序后, 可以将其纳入投资范围。</p> <p>本基金的标的指数是中证800 指数。</p> |
| 主要投资策略 | 本基金原则上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 |

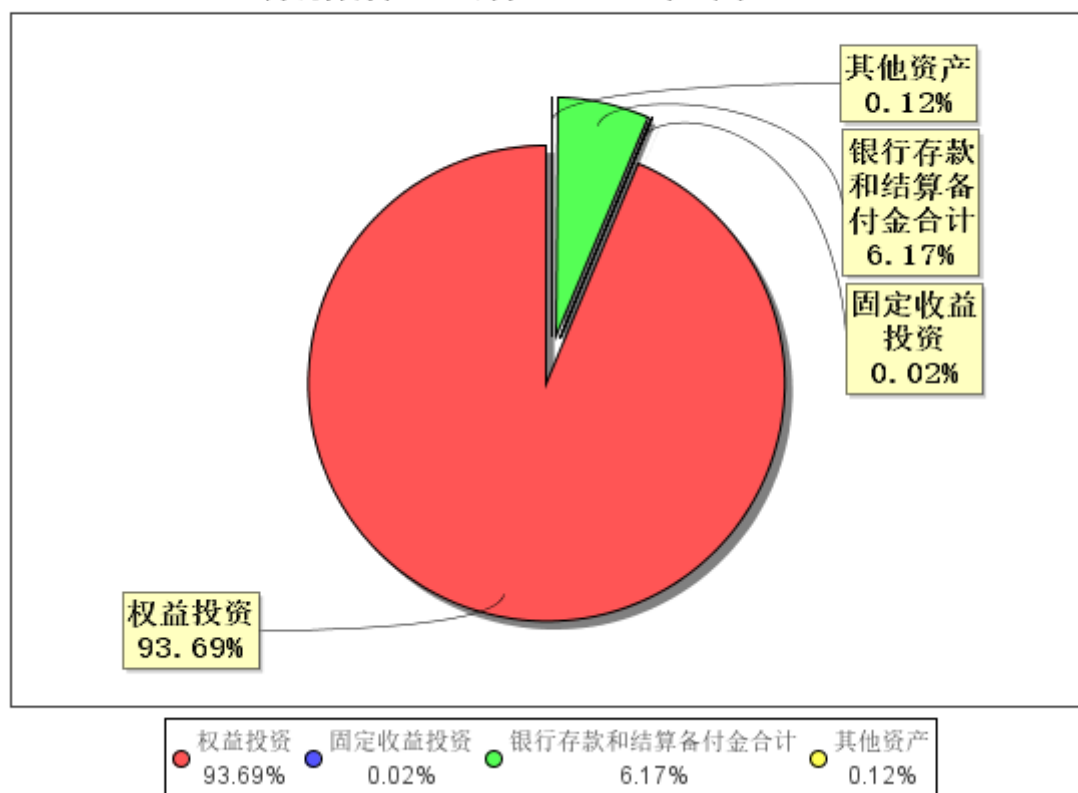
构建基金股票投资组合, 并优化确定投资组合中的个股权重, 以实现基金净值增长率与业绩比较基准之间的日平均跟踪误差小于 0.35%, 且年化跟踪误差小于 4% 的投资目标。

业绩比较基准 95%×中证800 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 本基金为抽样复制指数的股票型基金, 具有高风险、高预期收益的特征, 其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。

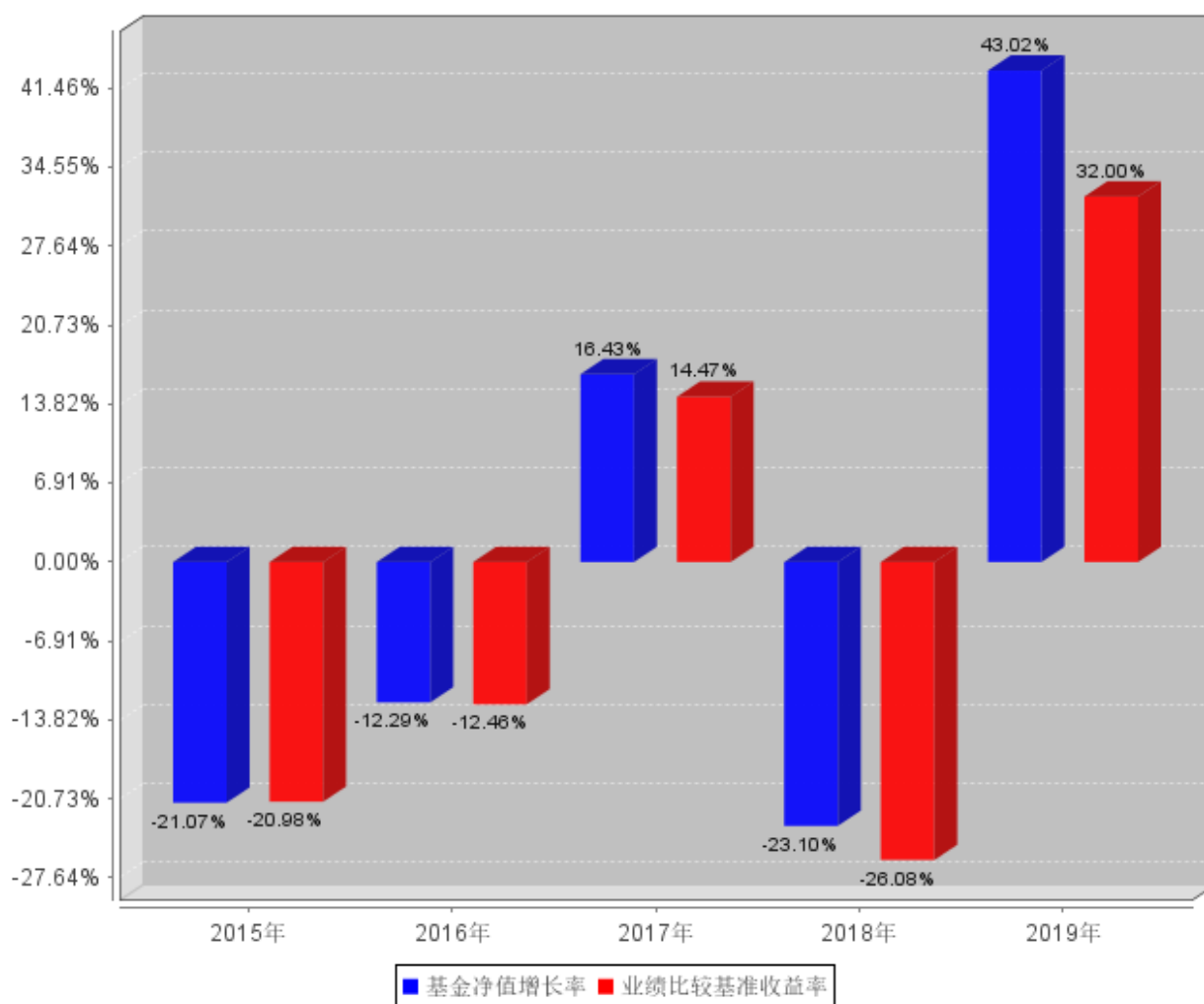
(二) 投资组合资产配置图表/区域配置图表

投资组合资产配置图表
数据截止日期: 2020年6月30日



(三) 自基金合同生效以来/最近十年 (孰短) 基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图

自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：业绩表现截止日期2019年12月31日。基金过往业绩不代表未来表现。

三、投资本基金涉及的费用

(一) 基金销售相关费用

以下费用在认购/申购/赎回基金过程中收取：

| 费用类型 | 份额 (S) 或金额 (M) / 持有期限 (N) | 收费方式/费率 | 备注 |
|-----------|---------------------------|---------|----|
| 申购费 (前收费) | M < 500,000 | 1.2% | - |
| | 500,000 ≤ M < 2,000,000 | 0.8% | - |
| | 2,000,000 ≤ M < 5,000,000 | 0.4% | - |
| | M ≥ 5,000,000 | 1000元/笔 | - |
| 赎回费 | N < 7天 | 1.5% | - |
| | 7天 ≤ N < 365天 | 0.5% | - |
| | 365天 ≤ N < 730天 | 0.25% | - |
| | N ≥ 730天 | 0 | - |

注：养老金费率等相关内容详见本基金招募说明书。

申购费：上表申购费为场内场外申购费。

赎回费：上表为场外赎回费，本基金场内赎回费率为：持有期 < 7天，收取1.5%的赎回费；持有期 ≥ 7天，

收取0.5%的赎回费。

（二）基金运作相关费用

以下费用将从基金资产中扣除：

| 费用类别 | 收费方式/年费率 |
|-------|-----------------|
| 管理费 | 1.00% |
| 托管费 | 0.22% |
| 销售服务费 | - |
| 其他费用 | 会计师费、律师费、信息披露费等 |

注：本基金交易证券、基金等产生的费用和税负，按实际发生额从基金资产扣除。本基金的其他费用详见招募说明书。

四、风险揭示与重要提示

（一）风险揭示

本基金不提供任何保证。投资者可能损失投资本金。投资有风险，投资者购买基金时应认真阅读本基金的《招募说明书》等销售文件。

本基金面临的常规风险：市场风险、管理风险、流动性风险（包括但不限于巨额赎回风险、启用侧袋机制等流动性风险管理工具带来的风险等）、信用风险等。

本基金面临的特定风险：

（1）指数投资风险：①系统性风险；②投资替代风险；③标的指数变更风险；④跟踪偏离风险；⑤标的指数回报与股票市场平均回报偏离风险；⑥指数编制机构停止服务的风险等。

（2）基金运作的特有风险：①上市交易风险②折/溢价交易风险。

（二）重要提示

中国证监会对本基金的核准，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

基金投资者自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同的当事人。

基金产品资料概要信息发生重大变更的，基金管理人将在三个工作日内更新，其他信息发生变更的，基金管理人每年更新一次。因此，本文件内容相比基金的实际情况可能存在一定的滞后，如需及时、准确获取基金的相关信息，敬请同时关注基金管理人发布的相关临时公告等。

关于本基金争议解决方式详见本基金基金合同，请投资者务必仔细阅读相关内容。

五、其他资料查询方式

以下资料详见基金管理人网站[网址：www.csfunds.com.cn][客服电话：400-888-2666]

1. 基金合同、托管协议、招募说明书；2. 定期报告，包括基金季度报告、中期报告和年度报告；3. 基金份额净值；4. 基金销售机构及联系方式；5. 其他重要资料。

六、其他情况说明

-