

基金管理人:长盛基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
送出日期:2012年8月25日

§1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人、基金保证人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的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事同意,并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司(以下简称:中国工商银行)根据本基金合同约定,于2012年8月24日复核了本报告中的财务指标、净值信息、利润分配情况、财务会计报告、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,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本半年度报告所载内容截止至报告期末,投资者欲了解详细情况,应阅读半年度报告正文。本报告财务数据未经审计。

本报告期自2012年1月1日起至6月30日止。

§ 2 基金简介

基金简称	长盛量化红利股票
基金代码	080005
交易场所	深圳证券交易所
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年11月25日
基金管理人	长盛基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	275,687,906.41份
基金合同存续期	不定期

2.1 基金基本情况

基金名称	长盛量化红利股票
基金代码	080005
交易场所	深圳证券交易所
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年11月25日
基金管理人	长盛基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	275,687,906.41份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金以获取中国股票市场红利回报及长期资产增值为投资目标,并追求风险调整为收益最大化,满足投资人长期稳健的投资收益需求。
投资策略	本基金采用严谨的数量化股票选择方法选取红利回报股票,在此基础上构建核心股票组合和卫星投资组合,从而形成其核心-卫星投资组合的股票资产组合,其中,大类资产配置策略综合考虑宏观经济、政策导向和市场环境(市场估值水平、资金供求)等因素,股票投资中以长红利股票投资为主导,以价值型企业业及分红能力作为选择投资对象的核心标准。
业绩比较基准	75%×中证红利指数+25%×中证综合指数
风险收益特征	本基金为股票型证券投资基金,风险高于混合型基金、债券基金、货币市场基金,属于较高风险、较高回报的基金产品。

2.3 基金管理人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	长盛基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名 叶金松 联系电话 010-82019988 电子邮箱 yej@csfund.com.cn 客户服务热线 400-888-2666	姓名 魏金安 010-66105799 custody@icbc.com.cn
传真	010-82255988	010-66105798

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.csfund.com.cn
基金半年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人的办公地址

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

3.1.1 期间数据和指标	报告期末(2012年1月1日至2012年6月30日)	金额单位:人民币元
本期已实现收益	-7,295,311.57	
本期利润	10,761,875.27	
加权平均基金份额本期利润	0.0379	
本期基金份额净值增长率	4.35%	
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2012年6月30日)	金额单位:人民币元
期末可供分配基金份额利润	-0.1369	
期末基金份额净值	237.932,764.38	
期末基金份额净值增长率	0.863	

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、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、期末可供分配利润,采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数(期末未余额,不是当期发生数)。表中的“期末”均指本报告期最后一日,即6月30日。

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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	-4.00%	0.89%	-5.38%	0.78%	1.38%	0.11%
过去三个月	0.23%	0.91%	-1.54%	0.79%	1.77%	0.12%
过去六个月	4.35%	1.06%	1.39%	0.93%	2.76%	0.13%
过去一年	-11.94%	1.05%	-15.04%	0.95%	3.10%	0.10%
自基金合同生效起至今	-10.13%	1.14%	-22.02%	1.05%	11.89%	0.09%

注:本基金业绩比较基准=75%×中证红利指数+25%×中证综合指数

其中,中证红利指数挑选在上海证券交易所和深圳证券交易所上市、股息率高、分红比较稳定、具有一定规模及流动性的100只股票作为样本,以反映A股市场高红利股票的整体状况和走势。比较起来,该指数具有较好的权威性、市场代表性,作为衡量本基金业绩的基准较为合适。

中证综合指数数是在中证全指指数样本的基础上,增加了央行票据、短期债券及一年期以下的国债、金融债和企业债,以更加全面地反映中国股票市场整体价格变动趋势。

由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中,需要采取再平衡来使资产的配置比例符合基金合同要求,基准净值数每日按照75%、25%的比例来取再平衡,再用连销计算的方式得到该指数的时间序列。

3.2.2 自基金合同生效以来基金业绩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

基金业绩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本基金成立六个月内,使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。建仓期结束后,本基金的各项资产配置比例符合本基金合同第一部分投资范围、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 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及基金经理的经验

本基金管理人经中国证监会证监基金字[1999]6号文件批准,于1999年3月成立,注册资本为人民币15000万元。目前,本公司股东及出资比例分别为:国元证券股份有限公司(以下简称“国元证券”)占注册资本的41%;新加坡星展有限公司占注册资本的33%;安徽省信用担保集团有限公司占注册资本的13%;安徽省投资集团有限责任公司占注册资本的13%。截止2012年6月30日,基金管理人共管理两支封闭式基金、十八支开放式基金,并于2002年12月,首批取得了全国社保基金资产管理资格。基金管理人于2007年9月,取得合格境内机构投资者资格,并于2008年2月,取得从事特定客户资产管理业务资格。

4.1.2 基金经理 或基金经理小组及基金经理助理简介

姓名	职务	在本基金中的基金经理(聘任)期限	证券从业年限	说明
刘斌	本基金基金经理、金融工程执行总监	2009年11月25日至今	6年	男,1979年6月出生,中国国籍,清华大学工学学士,中国科学院工学博士。2006年5月加入长盛基金管理有限公司,在公司期间历任金融工程研究员、高级金融工程研究员、基金经理助理、长盛沪深300指数证券投资基金基金经理等职务。现任金融工程与量化投资部执行总监。

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、证券从业年限指“证券从业资格”的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定年限。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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、《长盛量化红利策略股票型证券投资基金合同》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,在认真执行投资决策程序的基础上,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 管理人对报告期内基金资产情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内,公司严格执行《上市公司公平交易细则》各项规定,在研究、投资决策与决策、交易执行各个环节,公平对待旗下所有投资交易,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有同等权限。投资决策与决策:公司实行投资决策委员会领导下的投资组合经理负责制,投资组合经理在投资决策委员会授权范围内,独立完成投资组合的管理工作。各投资组合投资经理均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,所有投资指令均由交易部统一执行委托交易。交易部按照《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。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事项,保障公司旗下所有投资组合均保持公平对待。

此外,公司公平交易管理流程发现事项,保障公司旗下所有投资组合均保持公平对待。公司对于过去4个季度的公平交易行为进行了数量分析,计算组合间、单资产、占优比等指标,使用双双90%置信水平的1日、3日、5日的交易片段进行检验,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,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%的交易共有14次,其中1次为指数基金被动跟踪的指数基金其他组合产生的反向交易,其余13次交易为长盛同庆基金定期调仓和其他组合发生的反向交易。具体原因如下:

长盛同庆于2012年5月11日结束三年封闭期,转型为开放式证券投资基金(以下简称“开放式基金”)。为确保转型后的开放式基金保持高流动性,以保障基金份额持有人利益,基金制定了《长盛同庆开放式基金投资策略及决策委员会授权书》,并经过公司投资决策委员会批准,打开公开竞价交易的数量控制,因此产生一笔报告公司公开竞价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交易。

在此期间内,长盛同庆严格执行规定数量化投资组合交易策略,批量下达投资指令,公司交易部对上述指令严格执行,在持仓分发后,通过恒生交易系统自动委托交易程序执行,以确保公司旗下投资组合在可能发生的反向交易中保持公平,杜绝交易执行中可能发生的利益输送行为。

4.3.3 公平交易制度的执行情况

报告期内,公司严格执行《上市公司公平交易细则》各项规定,在研究、投资决策与决策、交易执行各个环节,公平对待旗下所有投资交易,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有同等权限。投资决策与决策:公司实行投资决策委员会领导下的投资组合经理负责制,投资组合经理在投资决策委员会授权范围内,独立完成投资组合的管理工作。各投资组合投资经理均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,所有投资指令均由交易部统一执行委托交易。交易部按照《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。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事项,保障公司旗下所有投资组合均保持公平对待。

此外,公司公平交易管理流程发现事项,保障公司旗下所有投资组合均保持公平对待。公司对于过去4个季度的公平交易行为进行了数量分析,计算组合间、单资产、占优比等指标,使用双双90%置信水平的1日、3日、5日的交易片段进行检验,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,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%的交易共有14次,其中1次为指数基金被动跟踪的指数基金其他组合产生的反向交易,其余13次交易为长盛同庆基金定期调仓和其他组合发生的反向交易。具体原因如下:

长盛同庆于2012年5月11日结束三年封闭期,转型为开放式证券投资基金(以下简称“开放式基金”)。为确保转型后的开放式基金保持高流动性,以保障基金份额持有人利益,基金制定了《长盛同庆开放式基金投资策略及决策委员会授权书》,并经过公司投资决策委员会批准,打开公开竞价交易的数量控制,因此产生一笔报告公司公开竞价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交易。

在此期间内,长盛同庆严格执行规定数量化投资组合交易策略,批量下达投资指令,公司交易部对上述指令严格执行,在持仓分发后,通过恒生交易系统自动委托交易程序执行,以确保公司旗下投资组合在可能发生的反向交易中保持公平,杜绝交易执行中可能发生的利益输送行为。

4.3.3 公平交易制度的执行情况

报告期内,公司严格执行《上市公司公平交易细则》各项规定,在研究、投资决策与决策、交易执行各个环节,公平对待旗下所有投资交易,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有同等权限。投资决策与决策:公司实行投资决策委员会领导下的投资组合经理负责制,投资组合经理在投资决策委员会授权范围内,独立完成投资组合的管理工作。各投资组合投资经理均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,所有投资指令均由交易部统一执行委托交易。交易部按照《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。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事项,保障公司旗下所有投资组合均保持公平对待。

此外,公司公平交易管理流程发现事项,保障公司旗下所有投资组合均保持公平对待。公司对于过去4个季度的公平交易行为进行了数量分析,计算组合间、单资产、占优比等指标,使用双双90%置信水平的1日、3日、5日的交易片段进行检验,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,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%的交易共有14次,其中1次为指数基金被动跟踪的指数基金其他组合产生的反向交易,其余13次交易为长盛同庆基金定期调仓和其他组合发生的反向交易。具体原因如下:

长盛同庆于2012年5月11日结束三年封闭期,转型为开放式证券投资基金(以下简称“开放式基金”)。为确保转型后的开放式基金保持高流动性,以保障基金份额持有人利益,基金制定了《长盛同庆开放式基金投资策略及决策委员会授权书》,并经过公司投资决策委员会批准,打开公开竞价交易的数量控制,因此产生一笔报告公司公开竞价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交易。

在此期间内,长盛同庆严格执行规定数量化投资组合交易策略,批量下达投资指令,公司交易部对上述指令严格执行,在持仓分发后,通过恒生交易系统自动委托交易程序执行,以确保公司旗下投资组合在可能发生的反向交易中保持公平,杜绝交易执行中可能发生的利益输送行为。

4.3.3 公平交易制度的执行情况

报告期内,公司严格执行《上市公司公平交易细则》各项规定,在研究、投资决策与决策、交易执行各个环节,公平对待旗下所有投资交易,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有同等权限。投资决策与决策:公司实行投资决策委员会领导下的投资组合经理负责制,投资组合经理在投资决策委员会授权范围内,独立完成投资组合的管理工作。各投资组合投资经理均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,所有投资指令均由交易部统一执行委托交易。交易部按照《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。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事项,保障公司旗下所有投资组合均保持公平对待。

此外,公司公平交易管理流程发现事项,保障公司旗下所有投资组合均保持公平对待。公司对于过去4个季度的公平交易行为进行了数量分析,计算组合间、单资产、占优比等指标,使用双双90%置信水平的1日、3日、5日的交易片段进行检验,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,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%的交易共有14次,其中1次为指数基金被动跟踪的指数基金其他组合产生的反向交易,其余13次交易为长盛同庆基金定期调仓和其他组合发生的反向交易。具体原因如下:

长盛同庆于2012年5月11日结束三年封闭期,转型为开放式证券投资基金(以下简称“开放式基金”)。为确保转型后的开放式基金保持高流动性,以保障基金份额持有人利益,基金制定了《长盛同庆开放式基金投资策略及决策委员会授权书》,并经过公司投资决策委员会批准,打开公开竞价交易的数量控制,因此产生一笔报告公司公开竞价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交易。

在此期间内,长盛同庆严格执行规定数量化投资组合交易策略,批量下达投资指令,公司交易部对上述指令严格执行,在持仓分发后,通过恒生交易系统自动委托交易程序执行,以确保公司旗下投资组合在可能发生的反向交易中保持公平,杜绝交易执行中可能发生的利益输送行为。

4.3.3 公平交易制度的执行情况

报告期内,公司严格执行《上市公司公平交易细则》各项规定,在研究、投资决策与决策、交易执行各个环节,公平对待旗下所有投资交易,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有同等权限。投资决策与决策:公司实行投资决策委员会领导下的投资组合经理负责制,投资组合经理在投资决策委员会授权范围内,独立完成投资组合的管理工作。各投资组合投资经理均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,所有投资指令均由交易部统一执行委托交易。交易部按照《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。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事项,保障公司旗下所有投资组合均保持公平对待。

此外,公司公平交易管理流程发现事项,保障公司旗下所有投资组合均保持公平对待。公司对于过去4个季度的公平交易行为进行了数量分析,计算组合间、单资产、占优比等指标,使用双双90%置信水平的1日、3日、5日的交易片段进行检验,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,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%的交易共有14次,其中1次为指数基金被动跟踪的指数基金其他组合产生的反向交易,其余13次交易为长盛同庆基金定期调仓和其他组合发生的反向交易。具体原因如下:

长盛同庆于2012年5月11日结束三年封闭期,转型为开放式证券投资基金(以下简称“开放式基金”)。为确保转型后的开放式基金保持高流动性,以保障基金份额持有人利益,基金制定了《长盛同庆开放式基金投资策略及决策委员会授权书》,并经过公司投资决策委员会批准,打开公开竞价交易的数量控制,因此产生一笔报告公司公开竞价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交易。

在此期间内,长盛同庆严格执行规定数量化投资组合交易策略,批量下达投资指令,公司交易部对上述指令严格执行,在持仓分发后,通过恒生交易系统自动委托交易程序执行,以确保公司旗下投资组合在可能发生的反向交易中保持公平,杜绝交易执行中可能发生的利益输送行为。

4.3.3 公平交易制度的执行情况

报告期内,公司严格执行《上市公司公平交易细则》各项规定,在研究、投资决策与决策、交易执行各个环节,公平对待旗下所有投资交易,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有同等权限。投资决策与决策:公司实行投资决策委员会领导下的投资组合经理负责制,投资组合经理在投资决策委员会授权范围内,独立完成投资组合的管理工作。各投资组合投资经理均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,所有投资指令均由交易部统一执行委托交易。交易部按照《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。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事项,保障公司旗下所有投资组合均保持公平对待。

此外,公司公平交易管理流程发现事项,保障公司旗下所有投资组合均保持公平对待。公司对于过去4个季度的公平交易行为进行了数量分析,计算组合间、单资产、占优比等指标,使用双双90%置信水平的1日、3日、5日的交易片段进行检验,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,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%的交易共有14次,其中1次为指数基金被动跟踪的指数基金其他组合产生的反向交易,其余13次交易为长盛同庆基金定期调仓和其他组合发生的反向交易。具体原因如下:

长盛同庆于2012年5月11日结束三年封闭期,转型为开放式证券投资基金(以下简称“开放式基金”)。为确保转型后的开放式基金保持高流动性,以保障基金份额持有人利益,基金制定了《长盛同庆开放式基金投资策略及决策委员会授权书》,并经过公司投资决策委员会批准,打开公开竞价交易的数量控制,因此产生一笔报告公司公开竞价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交易。

在此期间内,长盛同庆严格执行规定数量化投资组合交易策略,批量下达投资指令,公司交易部对上述指令严格执行,在持仓分发后,通过恒生交易系统自动委托交易程序执行,以确保公司旗下投资组合在可能发生的反向交易中保持公平,杜绝交易执行中可能发生的利益输送行为。

4.3.3 公平交易制度的执行情况

报告期内,公司严格执行《上市公司公平交易细则》各项规定,在研究、投资决策与决策、交易执行各个环节,公平对待旗下所有投资交易,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有同等权限。投资决策与决策:公司实行投资决策委员会领导下的投资组合经理负责制,投资组合经理在投资决策委员会授权范围内,独立完成投资组合的管理工作。各投资组合投资经理均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,所有投资指令均由交易部统一执行委托交易。交易部按照《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。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事项,保障公司旗下所有投资组合均保持公平对待。

此外,公司公平交易管理流程发现事项,保障公司旗下所有投资组合均保持公平对待。公司对于过去4个季度的公平交易行为进行了数量分析,计算组合间、单资产、占优比等指标,使用双双90%置信水平的1日、3日、5日的交易片段进行检验,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,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%的交易共有14次,其中1次为指数基金被动跟踪的指数基金其他组合产生的反向交易,其余13次交易为长盛同庆基金定期调仓和其他组合发生的反向交易。具体原因如下:

长盛同庆于2012年5月11日结束三年封闭期,转型为开放式证券投资基金(以下简称“开放式基金”)。为确保转型后的开放式基金保持高流动性,以保障基金份额持有人利益,基金制定了《长盛同庆开放式基金投资策略及决策委员会授权书》,并经过公司投资决策委员会批准,打开公开竞价交易的数量控制,因此产生一笔报告公司公开竞价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交易。

在此期间内,长盛同庆严格执行规定数量化投资组合交易策略,批量下达投资指令,公司交易部对上述指令严格执行,在持仓分发后,通过恒生交易系统自动委托交易程序执行,以确保公司旗下投资组合在可能发生的反向交易中保持公平,杜绝交易执行中可能发生的利益输送行为。

4.3.3 公平交易制度的执行情况

报告期内,公司严格执行《上市公司公平交易细则》各项规定,在研究、投资决策与决策、交易执行各个环节,公平对待旗下所有投资交易,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有同等权限。投资决策与决策:公司实行投资决策委员会领导下的投资组合经理负责制,投资组合经理在投资决策委员会授权范围内,独立完成投资组合的管理工作。各投资组合投资经理均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,所有投资指令均由交易部统一执行委托交易。交易部按照《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。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事项,保障公司旗下所有投资组合均保持公平对待。

此外,公司公平交易管理流程发现事项,保障公司旗下所有投资组合均保持公平对待。公司对于过去4个季度的公平交易行为进行了数量分析,计算组合间、单资产、占优比等指标,使用双双90%置信水平的1日、3日、5日的交易片段进行检验,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,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%的交易共有14次,其中1次为指数基金被动跟踪的指数基金其他组合产生的反向交易,其余13次交易为长盛同庆基金定期调仓和其他组合发生的反向交易。具体原因如下:

长盛同庆于2012年5月11日结束三年封闭期,转型为开放式证券投资基金(以下简称“开放式基金”)。为确保转型后的开放式基金保持高流动性,以保障基金份额持有人利益,基金制定了《长盛同庆开放式基金投资策略及决策委员会授权书》,并经过公司投资决策委员会批准,打开公开竞价交易的数量控制,因此产生一笔报告公司公开竞价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交易。

在此期间内,长盛同庆严格执行规定数量化投资组合交易策略,批量下达投资指令,公司交易部对上述指令严格执行,在持仓分发后,通过恒生交易系统自动委托交易程序执行,以确保公司旗下投资组合在可能发生的反向交易中保持公平,杜绝交易执行中可能发生的利益输送行为。

4.3.3 公平交易制度的执行情况

报告期内,公司严格执行《上市公司公平交易细则》各项规定,在研究、投资决策与决策、交易执行各个环节,公平对待旗下所有投资交易,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有同等权限。投资决策与决策:公司实行投资决策委员会领导下的投资组合经理负责制,投资组合经理在投资决策委员会授权范围内,独立完成投资组合的管理工作。各投资组合投资经理均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,所有投资指令均由交易部统一执行委托交易。交易部按照《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。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事项,保障公司旗下所有投资组合均保持公平对待。

此外,公司公平交易管理流程发现事项,保障公司旗下所有投资组合均保持公平对待。公司对于过去4个季度的公平交易行为进行了数量分析,计算组合间、单资产、占优比等指标,使用双双90%置信水平的1日、3日、5日的交易片段进行检验,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,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%的交易共有14次,其中1次为指数基金被动跟踪的指数基金其他组合产生的反向交易,其余13次交易为长盛同庆基金定期调仓和其他组合发生的反向交易。具体原因如下:

长盛同庆于2012年5月11日结束三年封闭期,转型为开放式证券投资基金(以下简称“开放式基金”)。为确保转型后的开放式基金保持高流动性,以保障基金份额持有人利益,基金制定了《长盛同庆开放式基金投资策略及决策委员会授权书》,并经过公司投资决策委员会批准,打开公开竞价交易的数量控制,因此产生一笔报告公司公开竞价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交易。

在此期间内,长盛同庆严格执行规定数量化投资组合交易策略,批量下达投资指令,公司交易部对上述指令严格执行,在持仓分发后,通过恒生交易系统自动委托交易程序执行,以确保公司旗下投资组合在可能发生的反向交易中保持公平,杜绝交易执行中可能发生的利益输送行为。

4.3.3 公平交易制度的执行情况

报告期内,公司严格执行《上市公司公平交易细则》各项规定,在研究、投资决策与决策、交易执行各个环节,公平对待旗下所有投资交易,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有同等权限。投资决策与决策:公司实行投资决策委员会领导下的投资组合经理负责制,投资组合经理在投资决策委员会授权范围内,独立完成投资组合的管理工作。各投资组合投资经理均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,所有投资指令均由交易部统一执行委托交易。交易部按照《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。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事项,保障公司旗下所有投资组合均保持公平对待。

此外,公司公平交易管理流程发现事项,保障公司旗下所有投资组合均保持公平对待。公司对于过去4个季度的公平交易行为进行了数量分析,计算组合间、单资产、占优比等指标,使用双双90%置信水平的1日、3日、5日的交易片段进行检验,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,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%的交易共有14次,其中1次为指数基金被动跟踪的指数基金其他组合产生的反向交易,其余13次交易为长盛同庆基金定期调仓和其他组合发生的反向交易。具体原因如下:

长盛同庆于2012年5月11日结束三年封闭期,转型为开放式证券投资基金(以下简称“开放式基金”)。为确保转型后的开放式基金保持高流动性,以保障基金份额持有人利益,基金制定了《长盛同庆开放式基金投资策略及决策委员会授权书》,并