

# 长盛量化红利策略股票型证券投资基金

## 2012] 第三季度报告

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

报告送出日期:2012年10月25日

重要提示

基金管理人长盛基金管理有限公司的董事会及监事会对本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其中内容的真实性、准确性和完整性承担个别连带责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据基金合同规定，于2012年10月24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，确保本报告不存在虚假记载、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运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

本基金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。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自2012年7月1日至2012年9月30日止。

### 2 基金产品概况

基金简称 长盛量化红利股票

基金主代码 080005

交易代码 080005

基金运作方式 约定型开放式

基金合同生效日 2009年11月25日

报告期末基金份额总额 266,087,317.75份

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，并追求风险调整后的收益最大化，满足投资人长期稳健的投资收益需求。

投资目标

本基金通过严格的数学化股票筛选方法生成红利风格股票池，在此基础上构建核心股票组合和卫星股票组合，从而形成基于核心卫星投资策略的股票资产组合。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、资金流入等)等因素，股票投资中以红利股票投资为主导，以价值型企业和分红能力为支撑投资对象的核心标准。

投资策略

75%×中证红利指数+25%×中证综合债指数

风险收益特征

本基金为股票型基金产品，风险高于混合型基金、债券基金、货币市场基金，风险较低回报的基金产品。

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

### 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(2012年7月1日-2012年9月30日)

1.本期已实现收益 -14,918,118.67

2.本期利润 -11,579,736.59

3.本期平均基金份额本期利润 -0.0425

4.期末基金资产净值 218,457,078.83

5.期末基金份额净值 0.821

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将低于所列数字。

2.所列数据截止到2012年9月30日。

3.本期已实现收益指基金定期利息收入、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 净值增长率标准差② 业绩比较基准收益率③ 标准差④ ①-③ ②-④

过去三个月 -4.87% 0.82% -4.50% 0.85% -0.37% -0.03%

3.2.2 基金合同生效以来基金份额累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

图示:长盛量化红利股票 2009-11-25至2012-9-30 同期业绩比较基准

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。截至报告日本基金的各项投资比例已达基金合同投资组合中规定的各项比例。

### 4 管理人报告

#### 4.1 基金经理小组简介

姓名 职务 在本基金的基金经理期限 证券从业年限 说明

刘斌 本基金基金经理,长盛成量化红利策略股票型证券投资基金基金经理,长盛同智深证100等权重指数分级证券投资基金基金经理。现任基金工程与信息技术部执行总监,长盛成量化红利策略股票型证券投资基金基金经理。担任长盛深300指数证券投资基金基金经理,长盛同智深证100等权重指数分级证券投资基金基金经理。

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.基金从存续年限中“证券从业”的含义指经行业协会、证监会从业人员资格管理办法的相关规定。

4.2 报告期内本基金运作合规情况说明

本基金基金经理严格按照《证券投资基金法》及其他法律法规、监管部门的相关规定,依照诚信原则、勤勉尽责的原则管理运用基金资产,在严格控制投资风险的基础上,为基金份额持有人谋取最大利益,没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易制度的说明

报告期内,本公司严格执行《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:

研究报告,公司旗下所有投资组合共享研究报告,所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:公司执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下,独立完成投资决策工作。各投资组合经理不得泄露投资信息。

交易执行:公司实行集中交易制度,所投资组合的交易指令由长盛交易部统一执行交易。交易部依据公司公开交易规则的规定,在交易时间内,严格执行公平交易制度;场外交易,严格执行相关工作流程,杜绝不公平交易行为。

投资管理行为的监控与分析评估:公司风险管理部、监察核保部,依照公司公平交易细则的规定,持续动态跟踪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的问题,保障公司旗下所有投资组合公平对待。

公司对过去4个季度的场内交易行为进行定量分析,计算溢价率、贡献率、占比优劣等指标,使用双边90%置信水平对日、3日、5日的交易段进行检测,未发现违反公平交易及利益输送的行为。

4.4 报告期内的公平交易和利益输送说明

4.4.1 行情跟踪及买卖分析

三季度GDP增速继续下滑,创下了2009年二季度以来新低,股票和债券市场均呈现下跌格局。市场表现持续分化,信息服务业、餐饮旅游、有色金属、医药生物、采掘等行业跌幅较少,从风格角度看,低下行驱动率、低换手、高成长风格表现相对较好。

4.4.2 报告期内的公平交易和利益输送情况

本基金在报告期未发现组合间的交易行为公开竞价交易中,同日不同向交易成交较少的双边交易量超交易所规定成交量的5%以上,为指数基金被动跟踪的指基和其他组合发生的影响双向交易。

4.4.3 异常交易行为的专项说明

本基金在报告期未发现有明显异常交易行为。

4.4.4 报告期内的公平交易和利益输送情况

本基金在报告期未发现有明显异常交易行为。

4.4.5 报告期内的公平交易和利益输送情况

本基金在报告期未发现有明显异常交易行为。

4.4.6 报告期内的公平交易和利益输送情况

本基金在报告期未发现有明显异常交易行为。

4.4.7 报告期内的公平交易和利益输送情况

本基金在报告期未发现有明显异常交易行为。

4.4.8 报告期内的公平交易和利益输送情况

本基金在报告期未发现有明显异常交易行为。

4.4.9 报告期内的公平交易和利益输送情况

本基金在报告期未发现有明显异常交易行为。

4.4.10 报告期内的公平交易和利益输送情况

本基金在报告期未发现有明显异常交易行为。

4.4.11 报告期内的公平交易和利益输送情况

本基金在报告期未发现有明显异常交易行为。

4.4.12 报告期内的公平交易和利益输送情况

本基金在报告期未发现有明显异常交易行为。

4.4.13 报告期内的公平交易和利益输送情况

本基金在报告期未发现有明显异常交易行为。

4.4.14 报告期内的公平交易和利益输送情况

本基金在报告期未发现有明显异常交易行为。

4.4.15 报告期内的公平交易和利益输送情况

本基金在报告期未发现有明显异常交易行为。

4.4.16 报告期内的公平交易和利益输送情况

本基金在报告期未发现有明显异常交易行为。

4.4.17 报告期内的公平交易和利益输送情况

本基金在报告期未发现有明显异常交易行为。

4.4.18 报告期内的公平交易和利益输送情况

本基金在报告期未发现有明显异常交易行为。

4.4.19 报告期内的公平交易和利益输送情况

本基金在报告期未发现有明显异常交易行为。

4.4.20 报告期内的公平交易和利益输送情况

本基金在报告期未发现有明显异常交易行为。

4.4.21 报告期内的公平交易和利益输送情况

本基金在报告期未发现有明显异常交易行为。

4.4.22 报告期内的公平交易和利益输送情况

本基金在报告期未发现有明显异常交易行为。

4.4.23 报告期内的公平交易和利益输送情况

本基金在报告期未发现有明显异常交易行为。

4.4.24 报告期内的公平交易和利益输送情况

本基金在报告期未发现有明显异常交易行为。

4.4.25 报告期内的公平交易和利益输送情况

本基金在报告期未发现有明显异常交易行为。

4.4.26 报告期内的公平交易和利益输送情况

本基金在报告期未发现有明显异常交易行为。

4.4.27 报告期内的公平交易和利益输送情况

本基金在报告期未发现有明显异常交易行为。

4.4.28 报告期内的公平交易和利益输送情况

本基金在报告期未发现有明显异常交易行为。

4.4.29 报告期内的公平交易和利益输送情况

本基金在报告期未发现有明显异常交易行为。

4.4.30 报告期内的公平交易和利益输送情况

本基金在报告期未发现有明显异常交易行为。

4.4.31 报告期内的公平交易和利益输送情况

本基金在报告期未发现有明显异常交易行为。

4.4.32 报告期内的公平交易和利益输送情况

本基金在报告期未发现有明显异常交易行为。

4.4.33 报告期内的公平交易和利益输送情况

本基金在报告期未发现有明显异常交易行为。

4.4.34 报告期内的公平交易和利益输送情况

本基金在报告期未发现有明显异常交易行为。

4.4.35 报告期内的公平交易和利益输送情况

本基金在报告期未发现有明显异常交易行为。

4.4.36 报告期内的公平交易和利益输送情况

本基金在报告期未发现有明显异常交易行为。

4.4.37 报告期内的公平交易和利益输送情况

本基金在报告期未发现有明显异常交易行为。

4.4.38 报告期内的公平交易和利益输送情况

本基金在报告期未发现有明显异常交易行为。

4.4.39 报告期内的公平交易和利益输送情况

本基金在报告期未发现有明显异常交易行为。

4.4.40 报告期内的公平交易和利益输送情况

本基金在报告期未发现有明显异常交易行为。

4.4.41 报告期内的公平交易和利益输送情况

本基金在报告期未发现有明显异常交易行为。

4.4.42 报告期内的公平交易和利益输送情况

本基金在报告期未发现有明显异常交易行为。

4.4.43 报告期内的公平交易和利益输送情况

本基金在报告期未发现有明显异常交易行为。