

信息披露 Disclosure

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：2011年3月31日

§ 1 重要提示

1.1 重要提示
基金管理人和基金托管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法律责任。本基金的基金合同由基金管理人和基金托管人根据法律法规及基金合同的原则，经充分协商，在严格的基础上订立，其任何条款如与基金合同的原则有冲突，以基金合同的原则为准。

基金管理人中行国际商业银行有限公司（以下简称“中行国际银行”）根据本基金合同规定，于2011年3月20日复核了报告中的相关指标、净值表现、利差情况、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。

基金管理人和基金托管人表示，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摘要。

本年度报告摘要自2010年1月1日起至2012年3月31日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称 长盛量化红利股票
基金代码 0080005
交易代码 0080005
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 389,891,447.10份
基金合同存续期间 不定期

2.2 基金产品说明

本基金通过量化的方法在风格轮动的基础上精选核心行业，卫星投资策略的股票资产组合，其中，大类资产配置理念贯穿宏观经济、政策导向和市场环境(市场估值水平、资金供求关系)等能力为选择投资对象的核心标准。

业绩比较基准 中证红利指数×75%+中证综合债指×25%

本基金为股票型基金，风险等级为混合型基金，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 基金管理人和基金托管人

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

姓名 叶金松 董会军

联系人 电子邮箱 010-82255818 010-66105799
jeip@csfunds.com.cn custody@icbc.com.cn

客户服务电话 400-888-2666
yef@csfunds.com.cn
传真 010-82255988 010-66105798

2.4 信息披露方式

基金管理人互联网站 http://www.csfunds.com.cn

基金管理人报告备置地点 基金管理人和基金托管人的办公地址

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 利润数据和指标 2010年初 [2009年11月25日(基金合同生效日)-2010年12月31日] 2009年初 [2009年11月25日(基金合同生效日)-2010年12月31日]

本期已实现收益 -362,415.89 2,170,376.41

本期利润 26,558,228.91 7,585,788.27

加权平均基金份额本期利润 0.0305 0.0061

本期基金份额净值增长率 4.17% 0.60%

3.1.2 年度数据和指标 2010年末 [2009年末] 2009年末

期初可供分配基金份额利润 0.0477 0.0017

期末基金份额净值 408,497,887.88 1,229,896,661.13

期末基金份额总额 1,048 1,006

注：上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的申购费用，计入费用后实际收益水平将低于或高于上述列示。

2.本期实现收益为本基金本期利息收入、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。

4.期末可供分配利润，即期末可供分配股利，按每份基金份额0.0477元折算。

5.本基金在2010年11月25日生效，合同生效当期不享受完整报告期。

6.2.3 基金净值表现

6.2.3.1 基金净值增长值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 额份额净值增长 约比绩效基准业 绩比较基准收 益率差③ 益基准差额④

长期(1) 单位标准差(2)

过去三个月 7.60% 1.58% 1.27% 0.34% 0.31%

过去六个月 26.88% 1.33% 17.14% 9.74% 0.21%

过去一年 4.17% 1.30% -9.10% 1.14% 13.27% 0.16%

自基金合同生 4.80% 1.24% -7.55% 1.20% 12.35% 0.04%

起至今 1.048 1.24% -7.55% 1.20% 12.35% 0.04%

注：本基金业绩比较基准：中证红利指数×75%+中证综合债指×25%。

7.4.1.1 本基金在2010年11月25日生效，合同生效当期不享受完整报告期。

7.4.1.2 本基金在2010年11月25日生效，合同生效当期不享受完整报告期。

7.4.1.3 本基金在2010年11月25日生效，合同生效当期不享受完整报告期。

7.4.1.4 本基金在2010年11月25日生效，合同生效当期不享受完整报告期。

7.4.1.5 本基金在2010年11月25日生效，合同生效当期不享受完整报告期。

7.4.1.6 本基金在2010年11月25日生效，合同生效当期不享受完整报告期。

7.4.1.7 本基金在2010年11月25日生效，合同生效当期不享受完整报告期。

7.4.1.8 本基金在2010年11月25日生效，合同生效当期不享受完整报告期。

7.4.1.9 本基金在2010年11月25日生效，合同生效当期不享受完整报告期。

7.4.1.10 本基金在2010年11月25日生效，合同生效当期不享受完整报告期。

7.4.1.11 本基金在2010年11月25日生效，合同生效当期不享受完整报告期。

7.4.1.12 本基金在2010年11月25日生效，合同生效当期不享受完整报告期。

7.4.1.13 本基金在2010年11月25日生效，合同生效当期不享受完整报告期。

7.4.1.14 本基金在2010年11月25日生效，合同生效当期不享受完整报告期。

7.4.1.15 本基金在2010年11月25日生效，合同生效当期不享受完整报告期。

7.4.1.16 本基金在2010年11月25日生效，合同生效当期不享受完整报告期。

7.4.1.17 本基金在2010年11月25日生效，合同生效当期不享受完整报告期。

7.4.1.18 本基金在2010年11月25日生效，合同生效当期不享受完整报告期。

7.4.1.19 本基金在2010年11月25日生效，合同生效当期不享受完整报告期。

7.4.1.20 本基金在2010年11月25日生效，合同生效当期不享受完整报告期。

7.4.1.21 本基金在2010年11月25日生效，合同生效当期不享受完整报告期。

7.4.1.22 本基金在2010年11月25日生效，合同生效当期不享受完整报告期。

7.4.1.23 本基金在2010年11月25日生效，合同生效当期不享受完整报告期。

7.4.1.24 本基金在2010年11月25日生效，合同生效当期不享受完整报告期。

7.4.1.25 本基金在2010年11月25日生效，合同生效当期不享受完整报告期。

7.4.1.26 本基金在2010年11月25日生效，合同生效当期不享受完整报告期。

7.4.1.27 本基金在2010年11月25日生效，合同生效当期不享受完整报告期。

7.4.1.28 本基金在2010年11月25日生效，合同生效当期不享受完整报告期。

7.4.1.29 本基金在2010年11月25日生效，合同生效当期不享受完整报告期。

7.4.1.30 本基金在2010年11月25日生效，合同生效当期不享受完整报告期。

7.4.1.31 本基金在2010年11月25日生效，合同生效当期不享受完整报告期。

7.4.1.32 本基金在2010年11月25日生效，合同生效当期不享受完整报告期。

7.4.1.33 本基金在2010年11月25日生效，合同生效当期不享受完整报告期。

7.4.1.34 本基金在2010年11月25日生效，合同生效当期不享受完整报告期。

7.4.1.35 本基金在2010年11月25日生效，合同生效当期不享受完整报告期。

7.4.1.36 本基金在2010年11月25日生效，合同生效当期不享受完整报告期。

7.4.1.37 本基金在2010年11月25日生效，合同生效当期不享受完整报告期。

7.4.1.38 本基金在2010年11月25日生效，合同生效当期不享受完整报告期。

7.4.1.39 本基金在2010年11月25日生效，合同生效当期不享受完整报告期。

7.4.1.40 本基金在2010年11月25日生效，合同生效当期不享受完整报告期。

7.4.1.41 本基金在2010年11月25日生效，合同生效当期不享受完整报告期。

7.4.1.42 本基金在2010年11月25日生效，合同生效当期不享受完整报告期。

7.4.1.43 本基金在2010年11月25日生效，合同生效当期不享受完整报告期。

7.4.1.44 本基金在2010年11月25日生效，合同生效当期不享受完整报告期。

7.4.1.45 本基金在2010年11月25日生效，合同生效当期不享受完整报告期。

7.4.1.46 本基金在2010年11月25日生效，合同生效当期不享受完整报告期。

7.4.1.47 本基金在2010年11月25日生效，合同生效当期不享受完整报告期。

7.4.1.48 本基金在2010年11月25日生效，合同生效当期不享受完整报告期。

7.4.1.49 本基金在2010年11月25日生效，合同生效当期不享受完整报告期。

7.4.1.50 本基金在2010年11月25日生效，合同生效当期不享受完整报告期。

7.4.1.51 本基金在2010年11月25日生效，合同生效当期不享受完整报告期。

7.4.1.52 本基金在2010年11月25日生效，合同生效当期不享受完整报告期。

7.4.1.53 本基金在2010年11月25日生效，合同生效当期不享受完整报告期。

7.4.1.54 本基金在2010年11月25日生效，合同生效当期不享受完整报告期。

7.4.1.55 本基金在2010年11月25日生效，合同生效当期不享受完整报告期。

7.4.1.56 本基金在2010年11月25日生效，合同生效当期不享受完整报告期。

7.4.1.57 本基金在2010年11月25日生效，合同生效当期不享受完整报告期。

7.4.1.58 本基金在2010年11月25日生效，合同生效当期不享受完整报告期。

7.4.1.59 本基金在2010年11月25日生效，合同生效当期不享受完整报告期。

7.4.1.60 本基金在2010年11月25日生效，合同生效当期不享受完整报告期。

7.4.1.61 本基金在2010年11月25日生效，合同生效当期不享受完整报告期。

7.4.1.62 本基金在2010年11月25日生效，合同生效当期不享受完整报告期。

7.4.1.63 本基金在2010年11月25日生效，合同生效当期不享受完整报告期。

7.4.1.64 本基金在2010年11月25日生效，合同生效当期不享受完整报告期。

7.4.1.65 本基金在2010年11月25日生效，合同生效当期不享受完整报告期。

7.4.1.66 本基金在2010年11月25日生效，合同生效当期不享受完整报告期。

7.4.1.67 本基金在2010年11月25日生效，合同生效当期不享受完整报告期。

7.4.1.68 本基金在2010年11月25日生效，合同生效当期不享受完整报告期。