

长盛量化红利策略股票型证券投资基金

[2012] 第一季度报告

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4月21日

§ 1 重要提示

基金管理人长盛基金管理有限公司的董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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2012年4月20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，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告所含的财务数据未经审计。

本报告期自2012年1月1日起至2012年3月31日止。

§ 2 基金产品概况

5.1 报告期末基金资产组合情况

基金简称	长盛量化红利股票	占基金总资产的比例(%)
基金主代码	089005	
交易代码	089005	
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	
报告期末基金份额总额	284,191,259.42份	

本基金主要获得中国股票市场红利回报及长期增值为投资目标，并通过资产配置调整后的收益最大化，满足投资人长期稳定的收益需求。

本基金通过严格的风险控制机制，将红利投资作为以价值型企业和分红能

力为主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%×中证综合债指数

风险收益特征 本基金为股票型基金，风险高于混合型基金、债券基金、货币市场基金，属较高风险、较高回报的基金产品。

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

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2012年1月1日-2012年3月31日)

1.本期已实现收益 -4,956,816.46

2.本期利润 9,371,267.79

3.加权平均基金份额本期利润 0.0343

4.期末基金份额净值 244,174,290.27

5.期末基金份额净值 0.861

注:1.上表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.所列数据截至到2012年3月31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 净值增长率 净值增长率 净值增长率

① 净值增长率 ② 净值增长率 ③ 净值增长率 ④ 净值增长率

过去三个月 4.11% 1.20% 3.47% 1.05% 0.64% 0.15%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

单位:人民币元

基金净值增长率=报告期(2012年1月1日-2012年3月31日)

1.本期已实现收益 -4,956,816.46

2.本期利润 9,371,267.79

3.加权平均基金份额本期利润 0.0343

4.期末基金份额净值 244,174,290.27

5.期末基金份额净值 0.861

注:按照本基金合同规定,本基金基金管理人应当自基金成立六个月后,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法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 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

刘斌 本基金基金经理,金融工具与量化投资部副总监。男,1979年6月出生,中国国籍。清华大学工学硕士,中国科学院大学博士。2006年5月加入长盛基金管理有限公司,在公司期间历任固定收益研究员、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、长盛沪深300指数增强型证券投资基金、长盛量化红利策略股票型证券投资基金(本基金)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.证券从业人员中“证券从业”的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定等。

4.2 报告期内本基金运作遵循诚信情况说明

本基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其各项实施细则、《长盛量化红利策略股票型证券投资基金合同》和他有关法律法规、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 平等交易原则说明

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升佣拥有同等权限。

投资授权与决策:公司实行集中交易制度,所有投资组合均通过交易系统进行交易,强制开启公平交易程序;场外交易,严格遵守相关工作流程,保证交易执行的公平性。

投资授权与决策:公司实行集中交易制度,公司风险管理部、监察核对部,依照《公司公平交易细则》的规定,持续、动态监督各投资组合的公平交易制度执行情况,及时向公司风控部门反馈。

交易执行:公司实行集中交易制度,以确保交易公平、公开、透明,强制开启公平交易系统自动公平交易平台;场外交易,严格遵守相关工作流程,保证交易执行的公平性。

投资授权与决策:公司实行集中交易制度,公司风险管理部、监察核对部,依照《公司公平交易细则》的规定,持续、动态监督各投资组合的公平交易制度执行情况,及时向公司风控部门反馈。

4.3.2 公平交易行为的专项说明

4.3.3 平等交易原则的执行情况

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升佣拥有同等权限。

投资授权与决策:公司实行集中交易制度,所有投资组合均通过交易系统进行交易,强制开启公平交易程序;场外交易,严格遵守相关工作流程,保证交易执行的公平性。

投资授权与决策:公司实行集中交易制度,公司风险管理部、监察核对部,依照《公司公平交易细则》的规定,持续、动态监督各投资组合的公平交易制度执行情况,及时向公司风控部门反馈。

交易执行:公司实行集中交易制度,以确保交易公平、公开、透明,强制开启公平交易系统自动公平交易平台;场外交易,严格遵守相关工作流程,保证交易执行的公平性。

投资授权与决策:公司实行集中交易制度,公司风险管理部、监察核对部,依照《公司公平交易细则》的规定,持续、动态监督各投资组合的公平交易制度执行情况,及时向公司风控部门反馈。

4.3.4 报告期内本基金运作遵循审慎经营情况说明

本基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其各项实施细则、《长盛量化红利策略股票型证券投资基金合同》和他有关法律法规、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。

4.4 报告期内的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 行情回顾及运作分析

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

4.4.2 报告期内的投资策略和业绩表现说明

本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。

本报告所含的财务数据未经审计。

本报告期自2012年1月1日起至2012年3月31日止。

§ 2 基金产品概况

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	资产项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	189,126,412.09	76.86
其中:股票		189,126,412.09	76.86
2 固定收益投资	-	-	-
其中:债券	-	-	-
3 资产支持证券	-	-	-
4 金融衍生品投资	-	-	-
5 其他资产	-	-	-
6 其他负债	-	-	-
7 合计	246,068,420.54	100.00	

本基金通过严格的风险控制机制,将红利投资作为以价值型企业和分红能

力为主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%×中证综合债指数

风险收益特征 本基金为股票型基金,风险高于混合型基金、债券基金、货币市场基金,属较高风险、较高回报的基金产品。

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

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2012年1月1日-2012年3月31日)

1.本期已实现收益 -263,793,910.81

2.本期利润 332,668,458.89

3.加权平均基金份额本期利润 0.0227

4.期末基金份额净值 12,193,448,519.31

5.期末基金份额净值 0.830

注:1.上表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.所列数据截至到2012年3月31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 净值增长率 净值增长率

① 净值增长率 ② 净值增长率 ③ 净值增长率 ④ 净值增长率

过去三个月 2.72% 1.19% 3.58% 1.06% -0.86% 0.13%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

单位:人民币元

基金净值增长率=报告期(2012年1月1日-2012年3月31日)

1.本期已实现收益 -263,793,910.81

2.本期利润 332,668,458.89

3.加权平均基金份额本期利润 0.0227

4.期末基金份额净值 12,193,448,519.31

5.期末基金份额净值 0.830

注:按照本基金合同规定,本基金基金管理人应当自基金成立六个月后,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法基金合同投资组合中规定的各项比例。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理或基金经理助理简介

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

刘斌 本基金基金经理,金融工具与量化投资部副总监。男,1979年6月出生,中国国籍。清华大学工学硕士,中国科学院大学博士。2006年5月加入长盛基金管理有限公司,在公司期间历任固定收益研究员、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、长盛沪深300指数增强型证券投资基金、长盛量化红利策略股票型证券投资基金(本基金)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