

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:2013年3月26日
§ 1 重要提示

基金管理人的董事、监事、高级管理人员和基金经理等人员存在虚假记载、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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签章。

长盛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2013年3月25日复核了本报告中的财务指标、净值表现、资产配置情况、财务会计报告、投资组合报告等內容,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摘要。

本年度报告摘要根据年度报告,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告全文。

本年度报告财务资料已经审计,普华永道中天会计师事务所有限公司为本基金出具了无保留意见的审计报告。

本报告期自2012年1月1日起至2012年12月31日止。

§ 2 基金简介

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	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	299,968,666.33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

基金主代码:080005

交易代码:080005

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:299,968,666.33份

基金合同存续期:不定期

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,并追求风险调整后的收益最大化,满足投资人长期稳定的投资收益需求。

本基金将通过合理的数量化选股方法形成红利风格股票池,在此基础上构建核心股票组合和风格股票组合,从而形成核心+卫星股投资策略的股票投资组合。

本基金采用量化选股策略进行股票投资,通过价值型策略在层面深度挖掘,把握投资风格的长期稳定性。

4.6 管理人报告期内基金估值政策和程序的说明

根据中国证监会相关规定及基金合同约定,本基金管理人严格按照《企业会计准则》、中国证监会相关规定及基金合同约定,对基金投资品种进行估值。本基金管理人制订了证券投资基金估值政策和估值程序,设立基金估值小组,参考行业协会意见和独立第三方机构估值数据,确保基金估值的公平、合理。

本基金管理人制订的证券投资基金估值政策和估值程序规定了估值的原则、估值日、估值对象、估值程序、估值方法及估值差额处理、暂停估值及特殊情形处理等事项。本基金管理人设立了公司总经理负责、估值小组长、公司副总经理和督察长担任小组成员,负责投资、研究、指导并执行基金估值业务。小组成员均具有多年基金从业经验,具备基金估值运作、行业研究、风险管理或合规等领域的专业胜任能力。

基金经理参与估值原则和方法的讨论,但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

参与估值流程的各方还应包括本基金托管人和基金经理。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算结果进行复核,并有权要求基金管理公司作出合理解释,通过积极磋商达成一致。会计师事务所对基金管理人采用的估值方法进行复核,并提出书面报告。基金管理人对基金估值政策和估值程序予以公告。

4.7 基金管理人对本年度基金评价的说明

本基金评价在2012年1月1日至2012年12月31日,期间可供分配利润为-40,004,516.17元,其中:未分配利润已实现部分为-12,935,543.95元,未分配利润未实现部分为-27,068,972.22元。

5.1 报告期内本基金托管人遵守基金估值情况声明

2012年,本基金托管人在对长盛量化红利策略股票型证券投资基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关约定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人的义务。

5.2 托管人报告期间本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2012年,长盛量化红利策略股票型证券投资基金的托管运作,基金资产净值、基金份额净值和赎回价格、基金费用、基金收益等信息披露符合基金合同的规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人报告本年度基金评价的说明

本托管人依法对长盛基金管理有限公司编制的长盛量化红利策略股票型证券投资基金2012年度报告中财务报告、净值表现、利润分配情况等内容进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

5.4 审计报告

普华永道中天会计师事务所有限公司注册会计师江伟、张晓艺于2013年3月20日对本基金2012年12月31日的资产负债表、2012年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注出具了普华永道中天字[2013]第2129号无保留意见的审计报告,投资者欲了解审计报告全文,应阅读本年度报告正文。

5.5 本报告期基金评价

3.1 主要数据报告和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标:2012年 2011年 2010年

本期已实现收益 -30,079,758.79 12,308,335.02 -362,415.89

本期利润 5,803,066.67 -49,983,565.30 26,558,228.91

加权平均基金份额本期利润 0.0211 -0.1578 0.0305

本期基金份额净值增长率 2.42% -17.82% 4.17%

3.1.2 期末数据和指标:2012年末 2011年末 2010年末

5.5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵守基金估值情况声明

2012年,本基金托管人在对长盛量化红利策略股票型证券投资基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关约定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人的义务。

5.2 托管人报告期间本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2012年,长盛量化红利策略股票型证券投资基金的托管运作,基金资产净值、基金份额净值和赎回价格、基金费用、基金收益等信息披露符合基金合同的规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 期末资产报告

5.4 本报告期基金评价

3.2 基金管理人和基金托管人

3.2.1 基金管理人

姓名:叶金松

职务:长盛基金管理有限公司

名称:长盛基金管理有限公司

信息披露义务人:010-82019988

电子邮箱:yejs@scfunds.com.cn

客户服务电话:400-888-2666

传真:010-82255988

3.2.2 基金托管人

姓名:赵会军

职务:中国工商银行股份有限公司

名称:中国工商银行股份有限公司

信息披露义务人:010-66105799

电子邮箱:custody@icbc.com.cn

客户服务电话:95588

3.3 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址: http://www.scfunds.com.cn

基金年度报告备置地点:叶金松、赵会军的办公地址

3.3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

金额单位:人民币元

3.3.1 期间数据和指标:2012年 2011年 2010年

本期已实现收益 -30,079,758.79 12,308,335.02 -362,415.89

本期利润 5,803,066.67 -49,983,565.30 26,558,228.91

加权平均基金份额本期利润 0.0211 -0.1578 0.0305

本期基金份额净值增长率 2.42% -17.82% 4.17%

3.3.2 期末数据和指标:2012年末 2011年末 2010年末

5.5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵守基金估值情况声明

2012年,本基金托管人在对长盛量化红利策略股票型证券投资基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关约定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人的义务。

5.2 托管人报告期间本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2012年,长盛量化红利策略股票型证券投资基金的托管运作,基金资产净值、基金份额净值和赎回价格、基金费用、基金收益等信息披露符合基金合同的规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 期末资产报告

5.4 本报告期基金评价

3.4 基金管理人和基金托管人

3.4.1 基金管理人

姓名:叶金松

职务:长盛基金管理有限公司

名称:长盛基金管理有限公司

信息披露义务人:010-82019988

电子邮箱:yejs@scfunds.com.cn

客户服务电话:400-888-2666

传真:010-82255988

3.4.2 基金托管人

姓名:赵会军

职务:中国工商银行股份有限公司

名称:中国工商银行股份有限公司

信息披露义务人:010-66105799

电子邮箱:custody@icbc.com.cn

客户服务电话:95588

3.5 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址: http://www.scfunds.com.cn

基金年度报告备置地点:叶金松、赵会军的办公地址

3.5 主要财务指标

金额单位:人民币元

3.5.1 期间数据和指标:2012年 2011年 2010年

本期已实现收益 -30,079,758.79 12,308,335.02 -362,415.89

本期利润 5,803,066.67 -49,983,565.30 26,558,228.91

加权平均基金份额本期利润 0.0211 -0.1578 0.0305

本期基金份额净值增长率 2.42% -17.82% 4.17%

3.5.2 期末数据和指标:2012年末 2011年末 2010年末

5.5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵守基金估值情况声明

2012年,本基金托管人在对长盛量化红利策略股票型证券投资基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关约定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人的义务。

5.2 托管人报告期间本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2012年,长盛量化红利策略股票型证券投资基金的托管运作,基金资产净值、基金份额净值和赎回价格、基金费用、基金收益等信息披露符合基金合同的规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 期末资产报告

5.4 本报告期基金评价

3.6 基金管理人和基金托管人

3.6.1 基金管理人

姓名:叶金松

职务:长盛基金管理有限公司

名称:长盛基金管理有限公司

信息披露义务人:010-82019988

电子邮箱:yejs@scfunds.com.cn

客户服务电话:400-888-2666

传真:010-82255988

3.6.2 基金托管人