

长盛量化红利策略股票型证券投资基金

长盛上证市值百强交易型开放式指数证券投资基金联接基金

2013 第四季度报告

2013 第四季度报告

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：2014年1月22日

**1 重要提示**

基金管理人的董事会及董事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责任。

基金管理人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2014年1月21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预示其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告期财务报表未审计。

本报告自2013年10月1日起至12月31日止。

基金简称	长盛量化红利股票
基金代码	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
报告期末基金份额总额	220,439,908.87份
投资目标	本基金以获取中国股票市场长期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。
投资策略	本基金通过严格的数量化股票选择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、政策走向和市场环境、市场估值水平、资金供求等因素，股票资产将以红利股票资产为主导，以价值型基金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，属于较高风险、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

3.1 主要财务指标	单位：人民币元
主要财务指标	报告期（2013年10月1日－2013年12月31日）
1.本期已实现收益	7,975,528.93
2.本期利润	273,601.34
3.加权平均基金份额本期利润	0.0012
4.期末基金资产净值	200,678,745.52
5.期末基金份额净值	0.910

注：1.上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，计入费用后实现的净值水平。

2.所列数据截至2013年12月31日。

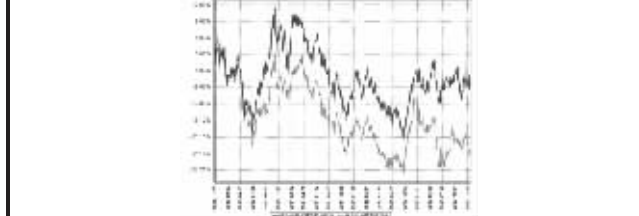
3.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.11%	1.26%	-2.70%	0.82%	2.81%	0.44%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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



注：按照本基金合同约定，本基金基金管理人应当自本基金成立6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。

4.1 基金经理（或基金经理小组）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
翟彦彦	本基金基金经理、长盛成长价值证券投资基金基金经理	2013年8月30日	-	4年	男，1982年3月出生，中国国籍。中国人民大学银行学硕士研究生。2007年加入长盛基金管理有限公司，曾任行业研究员、基金助理、助理研究员、现任长盛成长价值证券投资基金基金经理、长盛量化红利策略股票型证券投资基金基金经理。
刘斌	本基金基金经理、长盛成长价值证券投资基金基金经理	2009年11月25日	2013年11月4日	7年	男，1979年6月出生，中国国籍。清华大学工学学士，中国科学院金融学硕士。2007年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、基金助理、长盛沪深300指数证券投资基金基金经理、金融工程与量化投资部副经理、长盛成长价值证券投资基金基金经理、长盛同辉深证100等权重指数证券投资基金基金经理等职务。曾任本基金基金经理，目前离任。

注：1.上表基金经理的任职日期和离任日期均指公司公告聘任或解聘日期。

2.“证券从业年限”中“证券从业”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。

4.2 管理人及报告期内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》及其各项实施细则、《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、基金合同的有关规定，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的利益。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司相关制度等规定，对投资授权、研究支持、投资决策、交易执行、业绩评估等环节严格把关，通过系统和人工等方式各个环节严格把控交易公平问题，确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送，保护投资者的合法权益。报告期内，公司严格执行《公平交易制度》各项规定，在研究、投资决策与执行、交易执行各个环节，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拥有同等权利。

投资决策与执行：公司实行投资决策委员会领导下的投资组合经理负责制，所有投资组合经理在投资决策委员会的授权范围内，独立完成投资组合的管理工作。各投资组合经理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，所有投资组合的投资指令均由交易部统一执行委托交易。交易系统按照《公司公平交易制度》的规定，场内交易，强制分开恒生交易系统公平交易程序；场外交易，严格遵循相关工作流程，保证交易执行的公平性。

投资管理行为的监控与分析评估：公司风险管理部，依照《公司公平交易制度》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情况，保障公司旗下所有投资组合均能公平对待。

公司对于过去一个季度的同投资类别、同投资品种的基金，计算净值率、业绩率、占比优势等指标，使用双边90%置信水平对1、3、5日的交易片段进行T检验，未发现违反公平交易及利益输送的行为。

4.3.2 异常交易的专项说明

报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，未发现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%的情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

海外市场：美国经济复苏势头不减，美联储宣布缩减QE规模，4季度道琼斯指数涨幅4.44%，纳斯达克涨10.45%，欧洲逐步走出阴霾，尤其德国经济显示出复苏迹象，德国法兰克福DAX指数涨10.28%，伦敦富

100指数涨3.63%，全球大宗商品中基本金属价格在4季度震荡，贵金属呈下行态势。

国内市场：4季度的热点是改革预期，十八届三中全会和中央工作会议召开，国企改革和土地流转等改革预期成为市场热点，但由于工业企业利润增速回落，以及年底流动性压力重，A股先涨后跌，4季度上证指数下跌2.04%。由于IPO重围，高估值的创业板形成洼地，创业板涨幅1.46%。

在4季度的投资运作中，我们根据市场风格演变和个股基本面的情况，在维持红利价值风格的前提下，适度增加了个股集中度。

4.4.2 报告期内基金的投资表现

截止报告期末，本基金份额净值为0.910元，本报告期份额净值增长率为0.11%，业绩比较基准收益率为-2.70%。

公司对过去4个季度的同向交易行为进行数量分析,计算溢价率、贡献率、占优比等指标,使用双边90%置信水平对1日、3日、5日的交易片段进行t 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,未发现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。

本报告期内,未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林牧渔	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	104,331,254.27	51.99
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	37,090,028.08	18.48
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	2,165,046.50	1.08
N	水利、环境和公共设施管理业	2,427,600.00	1.21
O	国民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	2,036,241.60	1.01
S	综合	-	-
合计	合计	148,050,170.45	73.27

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002138	顺络电子	620,000	10,688,800.00	5.33
2	300303	聚飞光电	419,960	8,420,399.60	4.19
3	300115	长盈精密	215,100	8,120,025.00	4.05
4	600570	恒生电子	300,000	6,258,000.00	3.12
5	002063	远光软件	269,820	5,247,999.00	2.62
6	300155	安居宝	259,965	5,165,464.81	2.57
7	300045	华力创通	199,903	4,977,584.70	2.48
8	300219	华科光电	580,000	4,808,200.00	2.40
9	600584	长电科技	700,000	4,480,000.00	2.23
10	300075	数字政通	114,162	4,281,075.00	2.13

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.8.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金报告期内未进行股指期货投资，报告期末无股指期货持仓。

5.8.2 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金合同中未约定本基金投资股指期货的投资政策。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

注：本基金合同中未约定国债期货的投资政策。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金报告期内未进行国债期货投资，报告期末无国债期货持仓。

5.9.3 本期国债期货投资政策

注：本基金报告期内未进行国债期货投资。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体无被监管部门立案调查记录，无在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

5.10.2 基金的前十名股票，均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

5.10.3 其他资产构成

5.10.4 其他资产构成

5.10.5 其他资产构成

5.10.6 其他资产构成

5.10.7 其他资产构成

5.10.8 其他资产构成

5.10.9 其他资产构成

5.10.10 其他资产构成

5.10.11 其他资产构成

5.10.12 其他资产构成

5.10.13 其他资产构成

5.10.14 其他资产构成

5.10.15 其他资产构成

5.10.16 其他资产构成

5.10.17 其他资产构成

5.10.18 其他资产构成

5.10.19 其他资产构成

5.10.20 其他资产构成

5.10.21 其他资产构成

5.10.22 其他资产构成

5.10.23 其他资产构成

5.10.24 其他资产构成

5.10.25 其他资产构成

5.10.26 其他资产构成

5.10.27 其他资产构成

5.10.28 其他资产构成

5.10.29 其他资产构成

5.10.30 其他资产构成

5.10.31 其他资产构成

5.10.32 其他资产构成

5.10.33 其他资产构成

5.10.34 其他资产构成

5.10.35 其他资产构成

5.10.36 其他资产构成

5.10.37 其他资产构成

5.10.38 其他资产构成

5.10.39 其他资产构成

5.10.40 其他资产构成

5.10.41 其他资产构成

5.10.42 其他资产构成

5.10.43 其他资产构成

5.10.44 其他资产构成

5.10.45 其他资产构成

5.10.46 其他资产构成

5.10.47 其他资产构成

5.10.48 其他资产构成

5.10.49 其他资产构成

5.10.50 其他资产构成

5.10.51 其他资产构成

5.10.52 其他资产构成

5.10.53 其他资产构成

5.10.54 其他资产构成

5.10.55 其他资产构成

5.10.56 其他资产构成

5.10.57 其他资产构成

5.10.58 其他资产构成

5.10.59 其他资产构成

5.10.60 其他资产构成

5.10.61 其他资产构成

5.10.62 其他资产构成

5.10.63 其他资产构成

5.10.64 其他资产构成

5.10.65 其他资产构成

5.10.66 其他资产构成

5.10.67 其他资产构成

5.10.68 其他资产构成

5.10.69 其他资产构成

5.10.70 其他资产构成

5.10.71 其他资产构成

5.10.72 其他资产构成

5.10.73 其他资产构成

5.10.74 其他资产构成

5.10.75 其他资产构成

5.10.76 其他资产构成

5.10.77 其他资产构成

5.10.78 其他资产构成

5.10.79 其他资产构成

5.10.80 其他资产构成

5.10.81 其他资产构成

5.10.82 其他资产构成

5.10.83 其他资产构成

5.10.84 其他资产构成

5.10.85 其他资产构成

5.10.86 其他资产构成

5.10.87 其他资产构成

5.10.88 其他资产构成

5.10.89 其他资产构成

5.10.90 其他资产构成

5.10.91 其他资产构成

5.10.92 其他资产构成

5.10.93 其他资产构成

5.10.94 其他资产构成

5.10.95 其他资产构成

5.10.96 其他资产构成

5.10.97 其他资产构成

5.10.98 其他资产构成

5.10.99 其他资产构成

5.10.100 其他资产构成

5.10.101 其他资产构成

5.10.102 其他资产构成

5.10.103 其他资产构成

5.10.104 其他资产构成

5.10.105 其他资产构成

5.10.106 其他资产构成

5.10.107 其他资产构成

5.10.108 其他资产构成

5.10.109 其他资产构成

5.10.110 其他资产构成

5.10.111 其他资产构成

5.10.112 其他资产构成

5.10.113 其他资产构成

5.10.114 其他资产构成

5.10.115 其他资产构成

5.10.116 其他资产构成

5.10.117 其他资产构成

5.10.118 其他资产构成

5.10.119 其他资产构成

5.10.120 其他资产构成

5.10.121 其他资产构成

5.10.122 其他资产构成

5.10.123 其他资产构成

5.10.124 其他资产构成

5.10.125 其他资产构成

5.10.126 其他资产构成

5.10.127 其他资产构成

5.10.128 其他资产构成

5.10.129 其他资产构成

5.10.130 其他资产构成

5.10.131 其他资产构成

5.10.132 其他资产构成

5.10.133 其他资产构成

5.10.134 其他资产构成

5.10.135 其他资产构成

5.10.136 其他资产构成

5.10.137 其他资产构成

5.10.138 其他资产构成

5.10.139 其他资产构成

5.10.140 其他资产构成

5.10.141 其他资产构成

5.10.142 其他资产构成

5.10.143 其他资产构成

5.10.144 其他资产构成

5.10.145 其他资产构成

5.10.146 其他资产构成