

长盛量化红利策略股票型证券投资基金

[2014] 年度报告摘要

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:2014年8月28日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会、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、完整性、及时性承担个别及连带的法律责任。半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管银行根据本基金合同规定，于2014年8月27日复核了本报告中的财务数据、净值表现、利润分配情况、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。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。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及其摘要。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告全文。

本报告中财务数据未经审计。

本报告期自2014年1月1日起至6月30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
基金代码	160600
交易状态	正常
基金运作方式	契约型开放式
上市交易日	2009年1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
报告期基金份额总额	265,400,062.23份
报告期基金份额净值	1.061元

2.2 基金产品说明

基金目标 在追求资产长期稳定增值的同时，追求股息收入，为投资者提供稳定的收益回报。

投资策略 本基金通过量化选股模型选择基本面优秀的上市公司，从行业配置上精选具有核心竞争力的公司，结合对宏观经济、政策、市场等的综合分析，精选出具有较好成长性的股票，进行积极的投资管理。

业绩比较基准 75%×上证红利指数+25%×中证综合债指

风险收益特征 本基金为股票型基金，风险收益特征高于货币基金、债券基金，低于股票基金。

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	叶柏松	赵晓军
信息披露负责人	010-82099888	010-66105798
电子邮箱	ypls@czsfund.com.cn	czsfund@icbc.com.cn
客户服务电话	400-888-2666; 010-62350088	95538
传真	010-82255988	010-66105798

2.4 信息披露方式

登载在半年度报告正文中基金管理人的互联网网址:

基金管理人或基金托管人的住所:

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

金额单位:人民币元

报告期(2014年1月1日 - 2014年6月30日)		
本期	上年度	本报告期
1.本期初余额	15,448,310.27	29,472,186.00
2.本期利润	-0.605	-
3.本期盈余分布	16.99%	-
4.期末余额	15,448,310.27	29,472,186.00

注:1.所列基金业绩指标不包括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.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, 本期利润即为本期已实现收益减去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本期利润之和减去年内已实现部分的跌价数(为期末余额, 不是当期发生数)。表中的“期末”均指本报告期最后一日,即6月30日。

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

报告期(2014年1月1日 - 2014年6月30日)		
本期	上年度	本报告期
1.本期利润	15,448,310.27	29,472,186.00
2.本期利润	-0.605	-
3.期末可供分配利润	16.99%	-
4.期末净资产	15,448,310.27	29,472,186.00

注:本基金管理费按基本比例=7.5%×中证红利指数×2.5%×中证综合债指。

其中, 中证红利指数挑选在上证证券交易所和深圳证券交易所上市的股票股息率高、分红比较稳定, 具有一定规模及流动性的100只股票作为样本, 以反映A股市场高分红股票的整体状况和走势。比较起来, 该指数具有较好的敏感性、市场代表性, 作为衡量基金业绩的标准较为合适。

中证综合债指数是在中证全债指数样本的基础上, 增加了央行票据、短期融资券、企业债、国债等的国债和企业债, 以更加全面地反映国债和债券市场整体价格变动趋势。

由于基金管理费配比随市场价格变化的过程, 需要通过平滑来使资产的配置比例符合基金经理要求, 基准指数每日按7.5%×2.5%的比例采取再平衡, 再用连算的方法得到基准指数的时序排列。

3.2 基金合同生效以来基金份额累计净值增长率的变化

3.2.1 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	份额净值增长率为(%)	业绩比较基准收益率为(%)	差额(%)	①-③	②-④
过去一个月	3.99%	1.20%	1.0%	0.68%	4.95%
过去三个月	12.26%	1.20%	-0.08%	0.71%	12.32%
过去六个月	16.99%	1.40%	-0.61%	0.81%	17.20%
过去一年	24.87%	1.31%	-3.23%	0.92%	21.59%
过去三年	8.27%	1.11%	-16.99%	0.98%	25.26%
成立以来	10.49%	1.18%	-28.00%	1.03%	34.29%

注:本基金业绩比较基准=7.5%×中证红利指数×2.5%×中证综合债指。

3.2.2 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.3 基金份额净值增长率与同期同类型基金业绩比较基准收益率的比较

3.3 报告期内基金主要财务指标

金额单位:人民币元

报告期(2014年1月1日 - 2014年6月30日)		
本期	上年度	本报告期
1.收入	32,363,823.97	47,074,223.34
2.费用	29,472,186.00	25,088.29
3.利润	15,448,310.27	29,472,186.00

注:报告截止日2014年6月30日, 基金份额净值:1.061元, 基金份额总额:265,400,062.23份。

6.2 利润表

会计主体:长盛量化红利策略股票型证券投资基金

本报告期:2014年1月1日至2014年6月30日

单位:人民币元

报告期(2014年1月1日 - 2014年6月30日)		
本期	上年度	本报告期
1.收入	32,363,823.97	47,074,223.34
2.费用	29,472,186.00	25,088.29
3.利润	15,448,310.27	29,472,186.00

注:报告截止日2014年6月30日, 基金份额净值:1.061元, 基金份额总额:265,400,062.23份。

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:长盛量化红利策略股票型证券投资基金

本报告期:2014年1月1日至2014年6月30日

单位:人民币元

报告期(2014年1月1日 - 2014年6月30日)		
本期	上年度	本报告期
1.实收基金	220,439,907.87	19,761,163.35
2.本期利润	-19,761,163.35	200,678,45.52
3.期末基金余额	200,678,45.52	220,439,907.87

注:本基金截至2014年6月30日止以前以上以公布的的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票, 该股票将在本公告发布的事项影响消除后经交易所批准恢复交易。

6.4 管理人报告

6.4.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金基金管理人为长盛基金管理有限公司(以下简称“公司”), 成立于1999年3月26日, 是国内最早成立的一家基金基金管理公司之一, 公司注册资本为人民币15000万元人民币, 公司注册地在深圳, 总部设在北京, 并在上海、北京、杭州、成都设有分公司。目前, 公司股东及其出资比例为: 国元证券股份有限公司(以下简称“国元证券”)占注册资本的41%, 新加坡星展银行有限公司占注册资本的33%, 安徽省信函投资基金有限公司占注册资本的13%。公司得首肯全国社保基金理事会、三一集团两个基金和客户资产管理业务资格, 截至2014年6月30日, 基金管理人已获得全国社保基金理事会、三一集团两个基金和客户资产管理资格。

公司同时担任境外ETP基金管理人的职责。

6.4.2 基金经理(或基金经理)及其基金从业经验简介

6.4.3 期间内未发生诉讼情况的说明