

## 长盛量化红利策略混合型证券投资基金

[2017] 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:2017年4月22日  
§ 1 重要提示  
基金管理人的董事会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。  
基金托管人中国工商银行股份有限公司承诺本报告不存在虚假记载、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。  
基金业协会对本基金的定期报告文本及摘要、定期报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等信息,不承担复核义务,该信息由基金管理人自行审核后披露,并承担相应的法律责任。  
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。  
本报告中财务数据未经审计。

本报告期自2017年1月1日起至3月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	长盛量化红利混合
基金主代码	000005
交易代码	000005
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年11月26日
报告期截至日	2017-03-31
报告期基金份额总额	219,406,461.05份
投资目标	本基金通过量化投资方法,在长盛量化红利股票型基金的基础上,通过量化模型对股票进行筛选,在基金资产中配置一定比例的债券,在严格控制风险的前提下,力争获得超越业绩基准的收益。
投资策略	本基金通过量化投资方法,在长盛量化红利股票型基金的基础上,通过量化模型对股票进行筛选,在基金资产中配置一定比例的债券,在严格控制风险的前提下,力争获得超越业绩基准的收益。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为:沪深300指数*80%+中债综合指数*20%。
风险收益特征	本基金为混合型基金,具有较高风险、较高收益的特征,其风险和预期收益均高于股票型基金,低于债券型基金。
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(2017年1月1日 - 2017年3月31日)
1.本期实现收益	-4,983,912.11
2.期初基金份额总额	10,949,356.97
3.本期可供基金份额本期利润	0.0392
4.期末基金份额总额	247,928,269.95
5.期末可供基金份额总额	247,928,269.95

注:1.本基金的业指标不包括基金份额持有人认购或交易基金的各项费用,计价费用后实际收益水平将低于所列数字。  
2.所有数据截至2017年3月31日。

3.本期已实现收益指基金本期利息收入、应收股息收入、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。

4.期末可供基金份额净值=基金本期可供基金份额总额/期末基金份额总额。

5.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变动的比较

3.2.2 本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

3.2.3 本基金合同生效以来基金资产净值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

3.2.4 本报告期期末按行业分类的股票投资组合

3.2.5 本报告期期末按行业分类的债券投资组合

3.2.6 本报告期期末按行业分类的贵金属投资组合

3.2.7 本报告期期末按品种类别持有的股票投资组合

3.2.8 本报告期期末按品种类别持有的股票投资组合

3.2.9 本报告期期末按品种类别持有的股票投资组合

3.2.10 本报告期期末按品种类别持有的股票投资组合

3.2.11 本报告期期末按品种类别持有的股票投资组合

3.2.12 本报告期期末按品种类别持有的股票投资组合

3.2.13 本报告期期末按品种类别持有的股票投资组合

3.2.14 本报告期期末按品种类别持有的股票投资组合

3.2.15 本报告期期末按品种类别持有的股票投资组合

3.2.16 本报告期期末按品种类别持有的股票投资组合

3.2.17 本报告期期末按品种类别持有的股票投资组合

3.2.18 本报告期期末按品种类别持有的股票投资组合

3.2.19 本报告期期末按品种类别持有的股票投资组合

3.2.20 本报告期期末按品种类别持有的股票投资组合

3.2.21 本报告期期末按品种类别持有的股票投资组合

3.2.22 本报告期期末按品种类别持有的股票投资组合

3.2.23 本报告期期末按品种类别持有的股票投资组合

3.2.24 本报告期期末按品种类别持有的股票投资组合

3.2.25 本报告期期末按品种类别持有的股票投资组合

3.2.26 本报告期期末按品种类别持有的股票投资组合

3.2.27 本报告期期末按品种类别持有的股票投资组合

3.2.28 本报告期期末按品种类别持有的股票投资组合

3.2.29 本报告期期末按品种类别持有的股票投资组合

3.2.30 本报告期期末按品种类别持有的股票投资组合

3.2.31 本报告期期末按品种类别持有的股票投资组合

3.2.32 本报告期期末按品种类别持有的股票投资组合

3.2.33 本报告期期末按品种类别持有的股票投资组合

3.2.34 本报告期期末按品种类别持有的股票投资组合

3.2.35 本报告期期末按品种类别持有的股票投资组合

3.2.36 本报告期期末按品种类别持有的股票投资组合

3.2.37 本报告期期末按品种类别持有的股票投资组合

3.2.38 本报告期期末按品种类别持有的股票投资组合

3.2.39 本报告期期末按品种类别持有的股票投资组合

3.2.40 本报告期期末按品种类别持有的股票投资组合

3.2.41 本报告期期末按品种类别持有的股票投资组合

3.2.42 本报告期期末按品种类别持有的股票投资组合

3.2.43 本报告期期末按品种类别持有的股票投资组合

3.2.44 本报告期期末按品种类别持有的股票投资组合

3.2.45 本报告期期末按品种类别持有的股票投资组合

3.2.46 本报告期期末按品种类别持有的股票投资组合

3.2.47 本报告期期末按品种类别持有的股票投资组合

3.2.48 本报告期期末按品种类别持有的股票投资组合

3.2.49 本报告期期末按品种类别持有的股票投资组合

3.2.50 本报告期期末按品种类别持有的股票投资组合

3.2.51 本报告期期末按品种类别持有的股票投资组合

3.2.52 本报告期期末按品种类别持有的股票投资组合

3.2.53 本报告期期末按品种类别持有的股票投资组合

3.2.54 本报告期期末按品种类别持有的股票投资组合

3.2.55 本报告期期末按品种类别持有的股票投资组合

3.2.56 本报告期期末按品种类别持有的股票投资组合

3.2.57 本报告期期末按品种类别持有的股票投资组合

3.2.58 本报告期期末按品种类别持有的股票投资组合

3.2.59 本报告期期末按品种类别持有的股票投资组合

3.2.60 本报告期期末按品种类别持有的股票投资组合

3.2.61 本报告期期末按品种类别持有的股票投资组合

3.2.62 本报告期期末按品种类别持有的股票投资组合

3.2.63 本报告期期末按品种类别持有的股票投资组合

3.2.64 本报告期期末按品种类别持有的股票投资组合

3.2.65 本报告期期末按品种类别持有的股票投资组合

3.2.66 本报告期期末按品种类别持有的股票投资组合

3.2.67 本报告期期末按品种类别持有的股票投资组合

3.2.68 本报告期期末按品种类别持有的股票投资组合

3.2.69 本报告期期末按品种类别持有的股票投资组合

3.2.70 本报告期期末按品种类别持有的股票投资组合

3.2.71 本报告期期末按品种类别持有的股票投资组合

3.2.72 本报告期期末按品种类别持有的股票投资组合

3.2.73 本报告期期末按品种类别持有的股票投资组合

3.2.74 本报告期期末按品种类别持有的股票投资组合

3.2.75 本报告期期末按品种类别持有的股票投资组合

3.2.76 本报告期期末按品种类别持有的股票投资组合

3.2.77 本报告期期末按品种类别持有的股票投资组合

3.2.78 本报告期期末按品种类别持有的股票投资组合

3.2.79 本报告期期末按品种类别持有的股票投资组合

3.2.80 本报告期期末按品种类别持有的股票投资组合

3.2.81 本报告期期末按品种类别持有的股票投资组合

3.2.82 本报告期期末按品种类别持有的股票投资组合

3.2.83 本报告期期末按品种类别持有的股票投资组合

3.2.84 本报告期期末按品种类别持有的股票投资组合

3.2.85 本报告期期末按品种类别持有的股票投资组合

3.2.86 本报告期期末按品种类别持有的股票投资组合

3.2.87 本报告期期末按品种类别持有的股票投资组合

3.2.88 本报告期期末按品种类别持有的股票投资组合

3.2.89 本报告期期末按品种类别持有的股票投资组合

3.2.90 本报告期期末按品种类别持有的股票投资组合

3.2.91 本报告期期末按品种类别持有的股票投资组合

3.2.92 本报告期期末按品种类别持有的股票投资组合

3.2.93 本报告期期末按品种类别持有的股票投资组合

3.2.94 本报告期期末按品种类别持有的股票投资组合

3.2.95 本报告期期末按品种类别持有的股票投资组合

3.2.96 本报告期期末按品种类别持有的股票投资组合

3.2.97 本报告期期末按品种类别持有的股票投资组合

3.2.98 本报告期期末按品种类别持有的股票投资组合

3.2.99 本报告期期末按品种类别持有的股票投资组合

3.2.100 本报告期期末按品种类别持有的股票投资组合

3.2.101 本报告期期末按品种类别持有的股票投资组合

3.2.102 本报告期期末按品种类别持有的股票投资组合

3.2.103 本报告期期末按品种类别持有的股票投资组合

3.2.104 本报告期期末按品种类别持有的股票投资组合

3.2.105 本报告期期末按品种类别持有的股票投资组合

3.2.106 本报告期期末按品种类别持有的股票投资组合

3.2.107 本报告期期末按品种类别持有的股票投资组合

3.2.108 本报告期期末按品种类别持有的股票投资组合

3.2.109 本报告期期末按品种类别持有的股票投资组合

3.2.110 本报告期期末按品种类别持有的股票投资组合

3.2.111 本报告期期末按品种类别持有的股票投资组合

3.2.112 本报告期期末按品种类别持有的股票投资组合

3.2.113 本报告期期末按品种类别持有的股票投资组合

3.2.114 本报告期期末按品种类别持有的股票投资组合

3.2.115 本报告期期末按品种类别持有的股票投资组合

3.2.116 本报告期期末按品种类别持有的股票投资组合

3.2.117 本报告期期末按品种类别持有的股票投资组合

3.2.118 本报告期期末按品种类别持有的股票投资组合

3.2.119 本报告期期末按品种类别持有的股票投资组合

3.2.120 本报告期期末按品种类别持有的股票投资组合

3.2.121 本报告期期末按品种类别持有的股票投资组合

3.2.122 本报告期期末按品种类别持有的股票投资组合

3.2.123 本报告期期末按品种类别持有的股票投资组合

3.2.124 本报告期期末按品种类别持有的股票投资组合