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

长盛量化红利策略股票型证券投资基金

2012年度报告摘要

2012年12月31日

§1 重要提示

1.1 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，并由董事长签发。

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2013年3月25日复核了本报告中的财务指标、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，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

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12月31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	290,968,666.33份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

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、政策导向和市场环境（市场估值水平、资金供求）等因素，股票投资中将以红利股票投资为主导，以价值型企业及分红能力作为选择投资对象的核心标准。
业绩比较基准	中证红利指数×75%+中证综合债指数×25%
风险收益特征	本基金为股票型基金产品，风险高于混合性基金，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

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
信息披露负责人	姓名	叶金松	赵会军
	联系电话	010-82019988	010-66105799
	电子邮箱	yejs@csfunds.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-888-2666 95588	95588
传真		010-82255988	010—66105798

2.4 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.csfunds.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的办公地址

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

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
期末可供分配基金份额利润	-0.1535	-0.1725	0.0477
期末基金资产净值	220,687,886.81	240,768,904.61	408,497,887.88
期末基金份额净值	0.847	0.827	1.048

注：1、所述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要低于所列数字。

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，本期利润为本期已实现收益加上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未分配利润中已实现部分的孰低数（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12月31日。

3.2 基金净值表现

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①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	3.17%	0.82%	9.86%	0.94%	-6.69%	-0.12%
过去六个月	-1.85%	0.82%	4.91%	0.90%	-6.76%	-0.08%
过去一年	2.42%	0.94%	6.57%	0.91%	-4.15%	0.03%
过去三年	-12.32%	1.11%	-19.58%	1.00%	7.26%	0.11%
自基金合同生效起至今	-11.80%	1.09%	-18.19%	1.03%	6.39%	0.06%

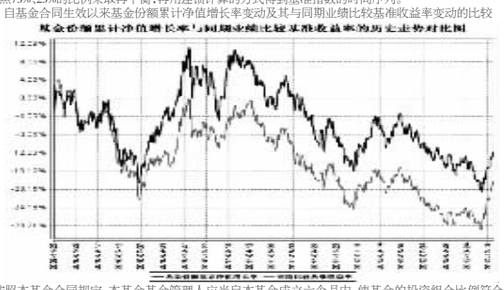
注：本基金业绩比较基准：中证红利指数×75%+中证综合债指数×25%

其中，中证红利指数挑选在上海证券交易所和深圳证券交易所上市的现金股息率高、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股市场高红利股票的整体状况和走势。比较起来，该指数具有较好的权威性、市场代表性，作为衡量本基金业绩的基准，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、短期融资券及一年期以下的国债、金融债和企业债，以更加全面地反映中国债券市场整体价格变动趋势。

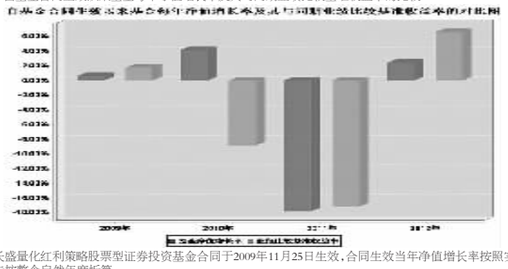
由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合基金合同要求，基准指数每日按照75%、25%的比例采取再平衡，再用连锁计算的方式得到基准指数的时间序列。

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



注：按照本基金合同规定，本基金基金管理人应当自本基金成立六个月内，使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。建仓期结束时，本基金的各项资产配置比例符合本基金合同第十一部分投资范围、投资限制的有关约定。本报告期内，本基金的各项资产配置比例符合基金合同约定。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：长盛量化红利策略股票型证券投资基金合同于2009年11月25日生效，合同生效当年净值增长率按照实际存续期计算，未按整个自然年度折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2012年	-	-	-	-	2012年度末分配收益
2011年	0.400	10,416,098.35	4,877,419.18	15,293,517.53	除息日：2011年1月17日
2010年	-	-	-	-	2010年度末分配收益
合计	0.400	10,416,098.35	4,877,419.18	15,293,517.53	

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人经中国证监会证监基字[1999]6号文件批准，于1999年3月成立，注册资本为人民币15000万元。目前，本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%；安徽省信用担保集团有限公司占注册资本的13%；安徽省投资集团控股有限公司占注册资本的13%。截止2012年12月31日，基金管理人共管理两支封闭式基金、二十三支开放式基金，并于2002年12月，首批取得了全国社保基金管理资格。基金管理人于2007年9月，取得合格境内机构投资者资格，并于2008年2月，取得从事特定客户资产管理业务资格。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
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，长盛同辉深证100等权重指数分级证券投资基金基金经理，金融工程与量化投资部执行总监。	2009年11月25日	-	6年	男，1979年6月出生，中国国籍。清华大学工学学士、中国科学院工学博士。2006年5月加入长盛基金管理有限公司，在公司期间历任金融工程研究员、高级金融工程研究员、基金经理助理、长盛沪深300指数证券投资基金基金经理等职务。现任金融工程与量化投资部执行总监、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（本基金）基金经理、长盛同辉深证100等权重指数分级证券投资基金基金经理。

注：1、上表基金经理及基金经理助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》的相关规定等。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其各项实施准则、《长盛量化红利策略股票型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规、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，在认真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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1公平交易制度和控制方法

依据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，为保证公司管理的所有投资组合得到公平对待，保护投资者合法权益，公司重新修订了《公司公平交易细则》。报告期内，公司根据该细则实际执行情况，对其进行了完善。该细则从研究、投资授权、投资决策、交易执行、投资组合信息隔离、行为监控评估与分析、报告与信息披露等环节对公平交易的管理提出明确要求。

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限。投资授权与决策，公司实行投资决策委员会领导下的投资组合经理负责制。投资组合经理在投资决策委员会授权范围内自主进行投资决策，超越授权范围的投资行为，需依照公司相关制度规定履行审批程序。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。交易部依照《公司公平交易细则》的规定，对交易所公开竞价交易，公司开启恒生交易系统中的公平交易程序，对符合公平交易条件的投资指令强制执行公平交易，具体如下：

一、限价指令的执行原则：对于不同限价的同向指令，按照“价格优先、时间优先、同时均分”的原则执行；对于相同限价的同向交易指令，强制执行恒生交易系统中的公平交易程序，按照各投资组合委托数量设置委托比例，按比例具体执行。

二、市价指令的执行原则：对于市价同向交易指令，按照“时间优先”的原则执行交易指令，后到达指令后按照先到指令剩余数量和新到指令数量采用公平委托系统执行；对于同时同向交易指令，强制执行恒生交易系统中的公平交易程序，按照各投资组合委托数量设置委托比例，按比例具体执行。

三、部分限价指令与部分市价指令的执行原则：对于不同投资经理下达的不同类型的同向交易指令，按照“价格优先”的原则执行交易指令，在未满足限价执行条件时，先执行市价指令，后执行限价指令。

对债券一级市场申购、非公开发行股票等以公司名义进行的交易，公司依照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配。

对于银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价的交易，则按照“时间优先、价格优先、同时申报时要求价格差异趋于零且申购量等比分配”的原则进行。

投资管理行为的监控与分析评估，公司风险管理部、监察稽核部，依照《公司公平交易细则》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问题，保障公司旗下所有投资组合均被公平对待。风险管理部每日通过系统监控不同组合的反向交易等，监控分析发现异常情况时，要求相关人员作出合理性解释备查，每月度出具上月度公平交易监控分析报告，每季度和每年度分别出具公平交易专项分析报告；公司通过系统记录场内异常交易情况，监察稽核部定期对其进行分析评估，每月度出具异常交易总结报告；针对场外交易，监察稽核部每月度对公司旗下所有投资组合场外交易进行专项检查，检查范围包括但不限于：银行间市场、交易所大宗交易等，每月度出具检查报告；监察稽核部对非公开发行股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购的申购方案、分配过程进行监督，确保分配结果符合公平交易原则。

4.3.2公平交易制度的执行情况

报告期内，公司执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《公司公平交易细则》各项规定，保证公平对待旗下的每一个投资组合。各投资组合按投资管理制度和流程独立决策，并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；交易环节中，严格执行集中交易制度，确保各投资组合享有公平的交易执行机会；事后监控分析环节中，公司定期对投资组合公平交易情况和异常交易情况进行分析，并出具公平交易执行情况分析报告；同时，公司对公平交易制度的遵守和相关业务流程的执行情况进行定期和不定期的检查，并对发现的问题进行及时报告。

报告期内，公司按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《公司公平交易细则》中的规定对公司所有投资组合同向交易价差进行分析，取最近4个季度交易记录，分别以1、3、5日为时间片段分析不同基金间以及公募基金、社保组合、专户组合等大类资产的同向交易情况。对于同向交易次数足够进行T检验的情况，以95%置信水平对其进行假设检验排查；对于同向交易次数较少的情况考察交易价差对基金净值带来的累计贡献。分析结果显示本投资组合与公司其它组合同同向交易价差未见异常。

本报告期内，公司严格执行了公平交易制度的相关规定。

4.3.3 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，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%的交易共有37次，其中24次为指数基金被动跟踪标的指数和其他组合发生的反向交易；13次为长盛同庆封闭式基金转型为指数型基金前的反向交易。

本报告期一季度内，长盛同庆报经公司投资决策委员会批准，打开交易所公开竞价同日反向交易控制，因此而产生13笔交易所公开竞价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5%的交易。具体原因如下：

长盛同庆于2012年5月11日结束三年封闭期，转型为开放式证券投资基金（以下简称“开放式基金”）。为确保转型后的开放式基金保持充裕流动性，以保障基金份额持有人利益，该基金一季度制定了数量化组合投资交易策略，并申请打开与公司旗下其他投资组合交易所市场的反向交易控制。上述申请已报经公司投资决策委员会批准。打开反向交易控制期间，长盛同庆严格执行既定数量化组合投资交易策略，批量下达投资指令。公司交易部对上述指令进行严格审核，在指令分发后，通过恒生交易系统自动委托交易程序执行指令，以确保公司旗下投资组合在可能发生的反向交易中保持公平，杜绝交易执行中可能发生的利益输送行为。

本报告期内，未发现本组合有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2012年中国经济呈现触底回升态势，其中第四季度GDP升7.9%，扭转了GDP增速连续6个季度逐季回落的局面。在改革和城镇化等乐观政策预期下，市场在年末出现大幅反弹。行业表现持续呈高度分化，房地产、金融服务、家用电器、有色金属、建筑建材等早周期行业涨幅较大，信息服务、商业贸易、机械设备、纺织服装、信息设备等行业表现较弱。从风格角度看，价值、低换手风格表现相对较好。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为0.847元，本报告期份额净值增长率为2.42%，同期业绩比较基准增长率为6.57%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

中观数据显示未来一个季度经济回稳延续，有助于投资者风险偏好的提升。随着政策预期的逐步消化以及情绪的迅速修复，一季度市场大概率将呈现明显的结构分化行情，市场后续的表现取决于经济复苏的力度。我们将密切关注经济数据和市场情绪，及时调整资产、风格和行业配置。

本基金采用数量化策略进行股票投资，按照红利价值型策略在价值层面深度挖掘，保持投资风格的长期稳定。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及本基金合同约定，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和基金合同关于估值的约定，对基金所持投资品种进行估值。本基金管理人制订了证券投资基金估值政策与估值程序，设立基金估值小组，参考行业协会估值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与估值程序确定了估值目的、估值日、估值对象、估值程序、估值方法以及估值差错处理、暂停估值和特殊情形处理等事项。本基金管理人设立了由公司总经理（担任估值小组组长）、公司副总经理和督察长（担任估值小组副组长）、权益投资部、金融工程与量化投资部、研究部、监察稽核部、业务运营部等部门负责人组成的基金估值小组，负责研究、指导并执行基金估值业务。小组成员均具有多年证券、基金从业经验，具备基金估值运作、行业研究、风险管理或法律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包括本基金托管人和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任，当存有异议时，托管人有责任要求基金管理公司作出合理解释，通过积极商讨达成一致意见。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金未签约与任何估值相关的定价服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《证券投资基金运作管理办法》的规定以及本基金基金合同第十五条中对基金利润分配原则的约定，2012年度未实施利润分配。

本基金截至2012年12月31日，期末可供分配利润为-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 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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规定，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应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内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管理人——长盛基金管理有限公司在长盛量化红利策略股票型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，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 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对长盛基金管理有限公司编制和披露的长盛量化红利策略股票型证券投资基金2012年年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§6 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汪棣、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审字（2013）第21292号无保留意见的审计报告。投资者欲查看审计报告全文，应阅读本年度报告正文。

§7 年度财务会计报表

7.1 资产负债表

会计主体：长盛量化红利策略股票型证券投资基金

报告截止日：2012年12月31日

单位：人民币元

资 产	本期末 2012年12月31日	上年度末 2011年12月31日
资 产：		
银行存款	64,377,430.98	82,703,708.45
结算备付金	92,918.45	193,565.21
存出保证金	500,000.00	500,000.00
交易性金融资产	178,434,744.23	172,934,304.82
其中：股票投资	178,434,744.23	172,934,304.82
基金投资	-	-
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	-
应收利息	15,336.97	16,616.98
应收股利	-	-
应收申购款	12,346.17	3,159.13
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	243,432,776.80	256,351,354.59
负债和所有者权益	本期末 2012年12月31日	上年度末 2011年12月31日
负 债：		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	21,418,744.73	14,220,177.86
应付赎回款	51,526.56	24,747.16
应付管理人报酬	266,334.47	312,587.18
应付托管费	44,389.08	52,097.88
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	143,829.77	132,746.69
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	820,065.38	840,093.21
负债合计	22,744,889.99	15,582,449.98
所有者权益:		
实收基金	260,692,402.98	290,968,666.33
未分配利润	-40,004,516.17	-50,199,761.72
所有者权益合计	220,687,886.81	240,768,904.61
负债和所有者权益总计	243,432,776.80	256,351,354.59

注：报告截止日2012年12月31日，基金份额净值：0.847元，基金份额总额：260,692,402.98份。

7.2 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：2012年1月1日至2012年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日
一、收入	11,316,904.20	-42,474,671.88
1.利息收入	478,672.83	566,469.66
其中：存款利息收入	478,409.65	560,717.12
债券利息收入	263.18	5,752.54
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	-25,056,397.86	19,151,639.96
其中：股票投资收益	-28,389,477.30	16,570,842.42
基金投资收益	-	-
债券投资收益	96,117.02	473,606.11
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	3,236,962.42	2,107,191.43
3.公允价值变动收益（损失以“-”填列）	35,882,825.46	-62,291,900.32
4.汇兑收益（损失以“-”填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”填列）	11,803.77	99,118.82
减：二、费用	5,513,837.53	7,508,893.42
1.管理人报酬	3,527,063.26	4,577,905.93
2.托管费	587,843.92	762,984.29
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	1,077,412.21	1,808,361.46
5.利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	321,518.14	359,641.74
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	5,803,066.67	-49,983,565.30
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	5,803,066.67	-49,983,565.30

7.3 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：2012年1月1日至2012年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	290,968,666.33	-50,199,761.72	240,768,904.61
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	5,803,066.67	5,803,066.67
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-30,276,263.35	4,392,178.88	-25,884,084.47
其中：1.基金申购款	11,556,941.67	-1,468,954.04	10,087,987.63
2.基金赎回款	-41,833,205.02	5,861,132.92	-35,972,072.10
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	260,692,402.98	-40,004,516.17	220,687,886.81
项目	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	389,891,447.10	18,606,440.78	408,497,887.88
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-49,983,565.30	-49,983,565.30
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-98,922,780.77	-3,529,119.67	-102,451,900.44
其中：1. 基金申购款	36,144,196.58	-1,359,920.30	34,784,276.28
2. 基金赎回款	-135,066,977.35	-2,169,199.37	-137,236,176.72
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-15,293,517.53	-15,293,517.53
五、期末所有者权益(基金净值)	290,968,666.33	-50,199,761.72	240,768,904.61

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署：

周 兵 杨思乐 戴君棉

基金管理公司负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

长盛量化红利策略股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2009]927号《关于核准长盛量化红利策略股票型证券投资基金募集的批复》核准，由长盛基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《长盛量化红利策略股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集1,251,673,981.96元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2009)第248号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《长盛量化红利策略股票型证券投资基金基金合同》于2009年11月25日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为1,251,832,665.50份基金份额，其中认购资金利息折合158,683.54份基金份额。本基金的基金管理人为长盛基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《长盛量化红利策略股票型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，主要包括国内依法发行、上市的股票、债券、短期金融工具、权证以及经中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。股票投资占基金资产净值的比例为60%-95%，其中投资于红利股票的比例不低于股票类资产的80%。债券投资占基金资产净值的比例为0%-40%，权证投资占基金资产净值的比例为0%-3%，现金或到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于5%。本基金的业绩比较基准为：中证红利指数×75%+中证综合债指数×25%。

本财务报表由本基金的基金管理人长盛基金管理有限公司于2013年3月20日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日颁布的《企业会计准则－基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《长盛量化红利策略股票型证券投资基金基金合同》 和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2012年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2012年12月31日的财务状况以及2012年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本期及上年度可比期间未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本期及上年度可比期间未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本期及上年度可比期间无会计差错。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2005]102号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴20%的个人所得税，暂不征收企业所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按50%计入个人应纳税所得额，依照现行税法规定即20%代扣代缴个人所得税，暂不征收企业所得税。

(4)基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
长盛基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	基金托管人、基金代销机构
国元证券股份有限公司(“国元证券”)	基金管理人的股东、基金代销机构
新加坡星展银行有限公司	基金管理人的股东
安徽省信用担保集团有限公司	基金管理人的股东
安徽省投资集团控股有限公司(原“安徽省投资集团有限责任公司”)	基金管理人的股东

注：1.根据长盛基金公司2012年8月29日《关于公司股东名称变更及公司章程修改的公告》，长盛基金公司的股东安徽省投资集团有限责任公司更名为安徽省投资集团控股有限公司，相关工商变更登记手续已办理完毕。

2.下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年12月31日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
国元证券	181,610,399.75	25.77%	451,361,277.57	39.62%

7.4.8.1.2 权证交易

本基金本期及上年度可比期间未通过关联方交易单元发生权证交易。

7.4.8.1.3 债券交易

本基金本期及上年度可比期间未通过关联方交易单元发生债券交易。

7.4.8.1.4 应支付关联方佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国元证券	151,407.05	24.93%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国元证券	366,733.96	38.55%	46,147.75	34.76%

注：1、上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费后的净额列示。债券及权证交易不计佣金。

2、该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至 2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至 2011年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	3,527,063.26	4,577,905.93
其中：支付销售机构的客户维护费	778,230.05	1,048,824.19

注：支付基金管理人长盛基金公司的基金管理费按前一日基金资产净值1.5%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日基金管理费＝前一日基金资产净值×1.5%/当年天数。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	587,843.92	762,984.29

注：支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费＝前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

本基金本期及上年度可比期间无与关联方进行的银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2012年1月1日至 2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至 2011年12月31日
基金合同生效日(2009年11月25日)持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	30,000,050.00	30,000,050.00
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	30,000,050.00	30,000,050.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	11.51%	10.31%

7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2012年12月31日		上年度末 2011年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
安徽省投资集团控股有限公司	27,999,980.00	10.74%	27,999,980.00	9.62%
国元证券	9,000,000.00	3.45%	10,000,000.00	3.44%

7.4.8.5 由关联方