

长盛货币市场基金

2010 年年度报告

2010 年 12 月 31 日

基金管理人：长盛基金管理有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

送出日期：2011 年 3 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2011 年 3 月 30 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，投资者在作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 2010 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录.....	1
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录.....	2
§ 2 基金简介.....	4
2.1 基金基本情况.....	4
2.2 基金产品说明.....	4
2.3 基金管理人和基金托管人.....	4
2.4 信息披露方式.....	5
2.5 其他相关资料.....	5
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况.....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	6
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	8
§ 4 管理人报告.....	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
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.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
§ 5 托管人报告.....	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	15
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... ..	15
§ 6 审计报告.....	16

6.1	审计报告基本信息.....	16
6.2	审计报告的基本内容.....	16
§ 7	年度财务报表.....	17
7.1	资产负债表.....	17
7.2	利润表.....	18
7.3	所有者权益(基金净值)变动表.....	19
7.4	报表附注.....	20
§ 8	投资组合报告.....	37
8.1	期末基金资产组合情况.....	37
8.2	债券回购融资情况.....	37
8.3	基金投资组合平均剩余期限.....	37
8.4	期末按债券品种分类的债券投资组合.....	38
8.5	期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细... 38	
8.6	“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离.....	39
8.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细	39
8.8	投资组合报告附注.....	39
§ 9	基金份额持有人信息.....	41
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	41
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况.....	41
§ 10	开放式基金份额变动.....	41
§ 11	重大事件揭示.....	42
11.1	基金份额持有人大会决议.....	42
11.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	42
11.3	涉及基金管理人、基金资产、基金托管业务的诉讼.....	42
11.4	基金投资策略的改变.....	42
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	42
11.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	42
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	43

11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况.....	44
11.9 其他重大事件.....	44
§ 12 备查文件目录.....	46
12.1 备查文件目录.....	46
12.2 存放地点.....	46
12.3 查阅方式.....	46

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	长盛货币市场基金
基金简称	长盛货币
基金主代码	080011
交易代码	080011
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2005 年 12 月 12 日
基金管理人	长盛基金管理有限公司
基金托管人	兴业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	739,734,559.90 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在力争本金安全、保证资产高流动性的基础上，追求高于业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金在投资组合管理中采用主动投资策略，在投资中将充分发挥现代金融工程与数量化分析技术方法的决策辅助作用，以提高投资决策的科学性与及时性，在控制风险的前提下，追求收益最大化。
业绩比较基准	银行一年定期存款利率（税后）
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中高流动性、低风险的品种，其预期风险和预期收益率都低于股票、债券和混合型基金。

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	兴业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	叶金松	张志永
	联系电话	010-82255818	021-62677777-212004
	电子邮箱	yejs@csfunds.com.cn	zhangzhy@cib.com.cn
客户服务电话		400-888-2666 010-62350088	95561

传真	010-82255988	021-62159217
注册地址	深圳市福田区福中三路1006号 诺德中心八楼GH单元	福州市湖东路154号
办公地址	北京市海淀区北太平庄路18号 城建大厦A座20-22层	上海江宁路168号兴业大厦 20楼(资产托管部办公地址)
邮政编码	100088	200041
法定代表人	凤良志	高建平

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所有限公司	上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
注册登记机构	长盛基金管理有限公司	北京市海淀区北太平庄路18号城建大厦A座20-22层

§ 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	2010 年	2009 年	2008 年
本期已实现收益	24,290,519.26	44,630,203.33	30,498,428.74
本期利润	24,290,519.26	44,630,203.33	30,498,428.74
本期净值收益率	2.0201%	1.6506%	3.4322%
3.1.2 期末数据和指标	2010 年末	2009 年末	2008 年末
期末基金资产净值	739,734,559.90	3,776,511,783.67	8,025,534,489.46
期末基金份额净值	1.00	1.00	1.00
3.1.3 累计期末指标	2010 年末	2009 年末	2008 年末
累计净值收益率	13.3093%	11.0657%	9.2622%

注：1、本基金收益分配是按日结转份额。

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，由于货币市场基金采用摊余成本法核算，因此公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值 收益率①	份额净值收益 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	0.5181%	0.0048%	0.6212%	0.0003%	-0.1031%	0.0045%
过去六个月	1.0855%	0.0062%	1.1884%	0.0004%	-0.1029%	0.0058%
过去一年	2.0201%	0.0062%	2.3041%	0.0003%	-0.2840%	0.0059%
过去三年	7.2633%	0.0067%	8.3163%	0.0020%	-1.0530%	0.0047%
过去五年	13.1896%	0.0062%	12.9812%	0.0020%	0.2084%	0.0042%
自基金合同生效起至今	13.3093%	0.0061%	13.0798%	0.0020%	0.2295%	0.0041%

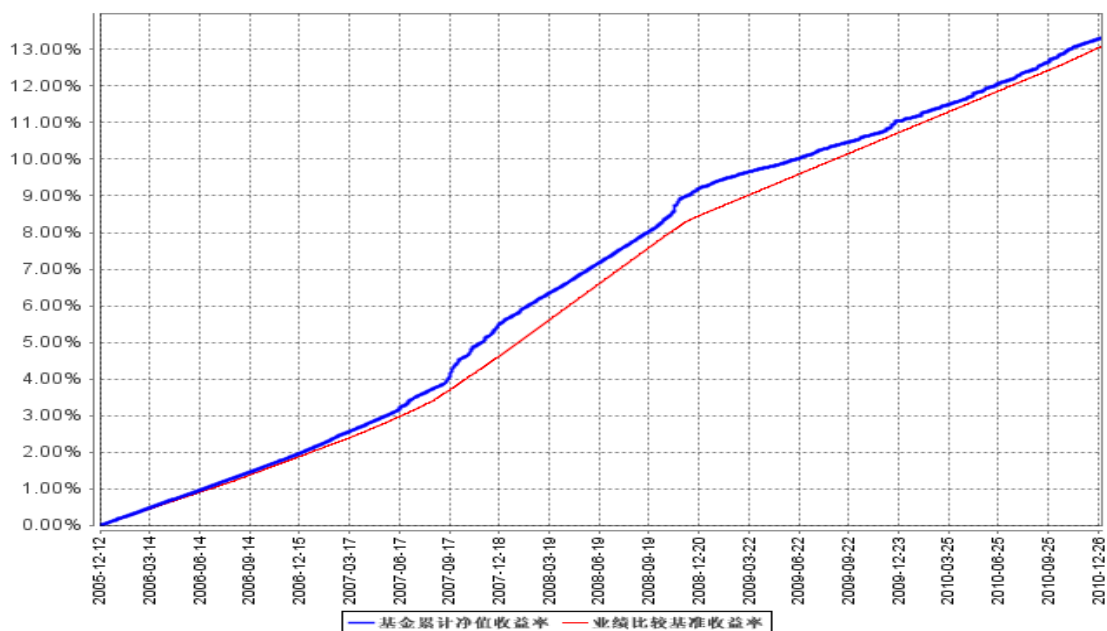
注：本基金业绩比较基准的构建及再平衡过程：

本基金业绩比较基准为银行一年期定期存款利率(税后)。本基金为储蓄存款的良好投资替代工具，所以投资业绩基准确定为：一年期定期存款利率（税后）。本比较基准与货币市场工具的收益率有一定的相关性，能够反映货币市场的收益率水平。

本基金的业绩比较基准将根据央行调息而调整。

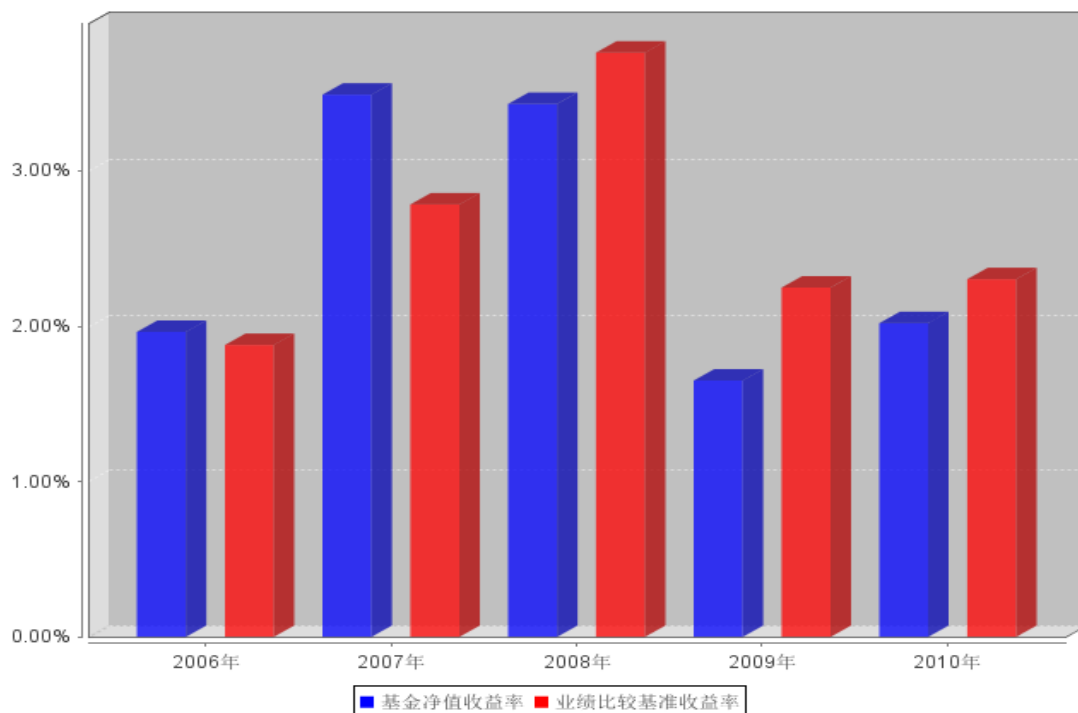
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



3.2.3 过去五年基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

过去五年基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	年度利润分配合计	备注
2010年	24,290,519.26	-	-	24,290,519.26	本基金收益每日分配，按月结转份额
2009年	44,630,203.33	-	-	44,630,203.33	本基金收益每日分配，按月结转份额
2008年	30,498,428.74	-	-	30,498,428.74	本基金收益每日分配，按月结转份额
合计	99,419,151.33	-	-	99,419,151.33	-

§ 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%；新加坡星展资产管理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%；安徽省投资集团有限责任公司占注册资本的13%。截止2010年12月31日，基金管理人共管理两支封闭式基金、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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘静	本基金基金经理，长盛中信全债指数增强型债券投资基金基金经理，长盛积极配置债券型证券投资基金基金经理。	2006年11月25日	-	10年	女，1977年1月出生，中国国籍。中央财经大学经济学硕士。2000年7月至2003年6月就职于北京证券有限责任公司；2003年7月加入长盛基金管理有限公司，先后担任交易部交易员、首席债券交易员。现任长盛中信全债指数增强型债券投资基金基金经理，长盛货币市场基金（本基金）基金经理，长盛积极配置债券型证券投资基金基金经理。
梁珂	本基金基金经理助理，债券研究员。	2010年12月10日	-	2年	男，1983年6月出生，中国国籍。北京大学硕士。2008年7月加入长盛基金管理有限公司，现任债券研究员，长盛中信全债指数增强型债券投资基金基金经理助理，长盛货币市场基金（本基金）基金经理助理。

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。

3、报经中国证券业协会同意，目前刘静女士已不再担任长盛货币市场基金基金经理，由梁婷女士担任本基金基金经理。该事项公司已于2011年2月16日进行公告。

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，本基金于2010年6月18日持有10柳化工CP01超过该债券发行量的百分之十，基金管理人已于2010年6月21日将此比例调整到规定的范围内。除此之外，基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其各项实施准则、《长盛货币市场基金基金合同》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 公平交易制度的执行情况

本报告期内，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，从投资授权、研究分析、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在各个环节严格控制交易公平执行，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。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本基金管理人管理的投资组合中没有与本基金投资风格相似的投资组合，暂无法对本基金的投资业绩进行比较。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未发生异常交易情况。

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

2010年货币市场利率相对09年趋势性上升。从统计数据看，银行间1天回购利率全年均值为1.72%，相比09年均值1.03%提高0.69%；银行间7天回购利率均值为2.14%，相比09年均值1.24%提高0.9%。

2010年货币市场利率相对09年，波动幅度加大，波动频率提高，特别在年底回购和拆借利率长时间处于高位。我们注意到这样一种特征，虽然与往年相比2010年末的回购利率波动并不是最频繁，也不是最激烈的，但是回购利率在高位持续时间却是最长的。我们认为其中大盘股发行等临时性因素并不具备决定性，银行体系的内部

因素则更为值得关注，连续三次上调法定存款准备金率的累积效应之下，银行流动性指标的定期考核等，以及持续负利率环境下的银行脱媒化成为了导致货币市场利率长时间维持高位的决定性因素。这样一种因素很可能贯穿 2011 年始终，为这一年的货币市场投资带来机遇的同时，也制造了很大的困难。

随着资金面的剧烈波动以及供需天平的不断摇摆，短期券种的走势也经历了剧烈的震荡上扬过程，整体来看，央票收益率趋势性上行，短融收益率在趋势上追随央票的同时不乏交易性机会。全年来看，1 年央票交易利率累计上行约 145bp 至年末的 3.48% 左右，其间仅在 6 月末到 7 月中旬出现过一波交易性机会；短融收益率则大致上行了约 120bp，1 年 AAA 短融年末收益率已经攀升到 4% 以上，期间一、三季度虽然各出现过一次约 30bp 的波段性机会，但把握难度较大，难以抵销流动性风险。

虽然经历了货币市场行情急剧转变的洗礼，但在操作上，本基金始终把组合的流动性放在首位，力争寻求收益最大化和风险最小化的最佳平衡，并且在此期间也获得了较好的投资收益。在对基金规模成长性、持有人结构及投资行为进行分析以及对短期货币市场利率走势、央行政策导向的深入研究后，本基金对组合结构进行了一定的调整，在短期利率面临上升压力的环境下，尽量降低了组合的投资剩余期限，同时在监管要求允许范围内将收益较高的信用产品的配置比例放到了上限。通过对组合的优化管理，始终保证了收益一贯的稳定性、持续性和基金运作的合规性。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2010 年，长盛货币市场基金净值收益率为 2.0201%，同期业绩比较基准收益率 2.3041%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

4.5.1 对下年度宏观经济和货币市场展望

我们判断在高基数作用下，经济增长同比在一季度仍将进一步小幅回落，但全年来看，这一同比数据将呈现前低后高、逐步攀升的态势，趋势上的表现要好于 2010 年前高后低的走势，从总体水平上看，我们估计 2011 年的 GDP 同比增长有望达到接近 9.5% 的水平，整体的经济增长仍将表现得较为强劲。

物价方面，我们则继续持相对谨慎的态度。虽然政府临时性的价格管制措施有望在短期内稳定物价，一季度内还难以看到物价同比达到 11 月的高点，进入下半年，翘尾因素的逐渐消退也会使恶性通胀爆发的可能明显减少。但我们依旧强调局部农产

品供给短缺、恶劣气候条件和自然灾害以及输入性通胀等预期外因素爆发推高通胀的可能。此外，在经济和人口结构面临转型的背景下，中低端劳动要素价格的刚性提升将系统性地提高通胀的波动中枢水平，这样一种历史趋势是短期的行政性措施难以改变的。

在宏观经济环境向好，通胀压力持续存在的环境下，我们判断货币市场及短券收益率波动水平将较去年呈现系统性的抬升，虽然基准利率以及存款准备金率政策的进一步调整可能还会造成债券市场风险的进一步释放，但在收益率曲线极度平坦的状态下，短端收益率已经在很大程度上反映了对这样一种政策冲击的预期，而且，随着年末考核的结束以及财政存款的滞后投放，银行体系流动性极度紧缩的局面将呈现趋势性好转。在这样一种背景下，我们预计无论是回购利率还是二级市场的央票及短融收益率水平继续提高的空间在减小，对货币基金来说已经具备了一定的投资价值。

4.5.2 本基金下年度投资策略

基于上述判断，2011年本基金仍继续坚持把保证组合流动性放在第一位，在保证组合良好流动性的前提下，密切关注国内及国外经济环境的变化，加强对市场走势的深入研究，坚持滚动操作策略，根据市场变化适时调整组合中类属资产的配置比例及组合的平均剩余期限，进一步着力于组合资产流动性与收益性的良好匹配；另一方面，积极关注市场不断推出的新投资品种，挖掘更多的投资机会。在货币市场和短券收益率已具备一定吸引力的情况下，我们将在流动性允许、监管指标合规的前提下积极选择收益性较高，流动性良好的投资品种进行配置，同时，进一步加强对短期融资券等信用产品的深入研究，以在风险可控的前提下获取更好的投资收益；另外，在新股 IPO 保持着较快节奏的情况下，短期资金面随时可能出现阶段性的变化，这为货币基金获取超额收益提供了良好的渠道，届时我们将最大限度的参与其中，以期为持有人争取更好的投资回报。另外，我们也将积极关注宏观经济和政策面变化带来的货币市场可能出现的交易机会。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人在内部监察工作中一切从合规运作，保障基金持有人利益出发，由独立于各业务部门的监察稽核部对公司经营、基金运作及员工行为的合规性进行定期和不定期检查，发现问题及时敦促有关部门整改，并定期制作监察报告报公司管理层。工作内容具体如下：

1、结合新法规、新监管要求，以及公司新业务的发展，及时推动公司各部门补充、修订、完善、优化各项业务制度与流程，以保证公司内控制度的合法合规、全面、适时、有效。

2、加大合规培训与考试力度，通过内部自学、外聘专家培训等多种形式对员工进行合规培训，并组织多次合规考试，强化、深化员工合规意识。

3、紧密跟踪与投资运作相关的法律、法规、基金合同及公司制度规定，全面掌控基金投资运作风险点，以前述风险点为依据，时时检查、监督各基金投资运作。

4、采用定期与不定期相结合的稽核、检查方式，推进公司内部控制制度的落实。报告期内，公司监察稽核部按照年初工作计划，开展专项稽核工作，内容涵盖基金投资、研究、交易、销售、基金估值、登记注册、公司财务、产品开发等等；此外，公司监察稽核部根据业务发展需要，以及日常监督、检查中发现问题，随时增加了多项的检查、稽核项目。针对发现问题，监察稽核部要求相关业务部门限期改进，并就改进情况进行检查验收。

5、继续加强对投资管理人员个人行为合规性的检查监督，将投资管理人员行为合规性检查常态化，增加、扩大了检查的频次与范围。

本基金管理人承诺：在今后的工作中，我们将继续以保障基金份额持有人的利益为宗旨，不断提高内部监察工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，保障公司、基金合规运作。

4.7 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副总经理（担任估值小组组长）、督察长（担任估值小组组长）及投资管理部、金融工程及量化投资部、研究发展部、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。

4.8 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十七条中对基金利润分配原则的约定，本基金按日分配收益，自基金合同生效日起每日将基金份额实现的基金净收益分配给份额持有人，并按月结转至投资人基金账户，使基金账面份额净值始终保持 1.00 元。按照上述通知及基金合同的规定，2010 年度分配利润 24,290,519.26 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

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

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

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，在对基金管理人在本基金的投资运作的监督中发现 2010 年 6 月 18 日，本基金持有一家公司发行的证券(10 柳化工 CP01)超过该证券的 10%，及时书面提示了基金管理人。基金管理人于次交易日将此比例调整合规，并表示今后一定会加强监测和计算，以防止任何疏漏出现。本托管人对基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认真复核了本年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2011)第 20555 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告	
审计报告收件人	长盛货币市场基金全体基金份额持有人	
引言段	我们审计了后附的长盛货币市场基金的财务报表，包括 2010 年 12 月 31 日的资产负债表、2010 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。	
管理层对财务报表的责任段	<p>按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表是长盛货币市场基金的基金管理人长盛基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括：</p> <ol style="list-style-type: none"> 1、设计、实施和维护与财务报表编制相关的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报； 2、选择和运用恰当的会计政策； 3、作出合理的会计估计。 	
注册会计师的责任段	<p>我们的责任是在实施审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守职业道德规范，计划和实施审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，我们考虑与财务报表编制相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>	
审计意见段	我们认为，上述财务报表已经按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，在所有重大方面公允反映了长盛货币市场基金 2010 年 12 月 31 日的财务状况以及 2010 年度的经营成果和基金净值变动情况。	
注册会计师的姓名	薛竞	张鸿
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所有限公司	
会计师事务所的地址	中国·上海市	
审计报告日期	2011 年 3 月 29 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：长盛货币市场基金

报告截止日：2010年12月31日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2010年12月31日	上年度末 2009年12月31日
资 产：			
银行存款	7.4.7.1	143,097,192.64	831,622,255.39
结算备付金		409,090.91	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	415,366,342.28	2,636,297,977.15
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		415,366,342.28	2,636,297,977.15
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	100,000,270.00	296,600,764.90
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	5,429,576.81	13,473,530.70
应收股利		-	-
应收申购款		76,848,267.00	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	27,356.75	27,356.75
资产总计		741,178,096.39	3,778,021,884.89
负债和所有者权益			
	附注号	本期末 2010年12月31日	上年度末 2009年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		492.50	-
应付管理人报酬		203,772.31	577,370.04
应付托管费		61,749.19	174,960.65
应付销售服务费		154,372.97	437,401.56

应付交易费用	7.4.7.7	10,042.02	14,368.97
应交税费		943,100.00	206,000.00
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	70,007.50	100,000.00
负债合计		1,443,536.49	1,510,101.22
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	739,734,559.90	3,776,511,783.67
未分配利润	7.4.7.10	-	-
所有者权益合计		739,734,559.90	3,776,511,783.67
负债和所有者权益总计		741,178,096.39	3,778,021,884.89

注：报告截止日2010年12月31日，基金份额净值：1.00元，基金份额总额739,734,559.90份。

7.2 利润表

会计主体：长盛货币市场基金

本报告期：2010年1月1日至2010年12月31日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
		2010年1月1日至 2010年12月31日	2009年1月1日至 2009年12月31日
一、收入		34,326,043.00	67,183,609.44
1. 利息收入		27,592,117.21	59,288,233.05
其中：存款利息收入	7.4.7.11	2,077,694.17	2,527,864.25
债券利息收入		24,973,294.83	56,731,838.84
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		541,128.21	28,529.96
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		6,733,925.79	7,895,376.39
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	6,733,925.79	7,895,376.39
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”填列）	7.4.7.16	-	-
4. 汇兑收益（损失以“-”填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”填列）	7.4.7.17	-	-

减：二、费用		10,035,523.74	22,553,406.11
1. 管理人报酬		4,248,757.34	9,606,776.95
2. 托管费		1,287,502.26	2,911,144.61
3. 销售服务费		3,218,755.57	7,277,861.30
4. 交易费用	7.4.7.18	-	-
5. 利息支出		915,043.98	2,320,723.40
其中：卖出回购金融资产支出		915,043.98	2,320,723.40
6. 其他费用	7.4.7.19	365,464.59	436,899.85
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		24,290,519.26	44,630,203.33
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		24,290,519.26	44,630,203.33

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：长盛货币市场基金

本报告期：2010年1月1日至2010年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2010年1月1日至2010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）	3,776,511,783.67	-	3,776,511,783.67
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	24,290,519.26	24,290,519.26
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）	-3,036,777,223.77	-	-3,036,777,223.77
其中：1. 基金申购款	11,490,894,830.05	-	11,490,894,830.05
2. 基金赎回款	-14,527,672,053.82	-	-14,527,672,053.82
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）	-	-24,290,519.26	-24,290,519.26
五、期末所有者权益（基金净值）	739,734,559.90	-	739,734,559.90
项 目	上年度可比期间 2009年1月1日至2009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）	8,025,534,489.46	-	8,025,534,489.46
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	44,630,203.33	44,630,203.33
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）	-4,249,022,705.79	-	-4,249,022,705.79
其中：1. 基金申购款	14,879,095,012.31	-	14,879,095,012.31
2. 基金赎回款	-19,128,117,718.10	-	-19,128,117,718.10
四、本期向基金份额持有人分配利润	-	-44,630,203.33	-44,630,203.33

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)	3,776,511,783.67	-	3,776,511,783.67

注：报表附注为本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：

陈礼华

杨思乐

戴君棉

基金管理人负责人：

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

长盛货币市场基金(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”)证监基金字[2005]第176号《关于同意长盛货币市场基金募集的批复》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《长盛货币市场基金基金合同》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人民币3,601,377,144.40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(2005)第182号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《长盛货币市场基金基金合同》于2005年12月12日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为3,601,835,236.63份基金份额,其中认购资金利息折合458,092.23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,基金托管人为兴业银行股份有限公司。

根据《货币市场基金管理暂行规定》和《长盛货币市场基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为现金;一年以内(含一年)的银行定期存款、大额存单;剩余期限在397天以内(含397天)的债券;期限在一年以内(含一年)的债券回购;期限在一年以内(含一年)的中央银行票据以及中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。本基金的业绩比较基准为当期银行一年期定期储蓄存款的税后利率。

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2011年3月29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”)、中国证监会公告[2010]5号《证券投资基金信息披露XBRL模版第3号〈年度报告和半年度报告〉》、中国证券业协会于2007年5月15日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《长盛货币市场基金基金合同》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2010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2010年12月31日的财务状况以及2010年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

1、金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金目前暂无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金持有的债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款、买入返售金融资产和各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

2、金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当

期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。取得债券投资支付的的价款中包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，应当单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

债券投资采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量，即债券投资按票面利率或商定利率每日计提应收利息，按实际利率法在其剩余期限内摊销其买入时的溢价或折价；同时于每一计价日计算影子价格，以避免债券投资的摊余成本与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离。应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

为了避免债券投资的摊余成本与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离，从而对基金持有人的利益产生稀释或不公平的结果，基金管理人于每一计价日采用债券投资的公允价值计算影子价格。当基金资产净值与影子价格的偏离达到或超过基金资产净值的 0.25%时，基金管理人应根据风险控制的需要调整组合，使基金资产净值更能公允地反映基金资产价值。

计算影子价格时按如下原则确定债券投资的公允价值：

1、存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

2、存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

3、当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交

易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额。每份基金份额面值为 1.00 元。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 收入/(损失)的确认和计量

债券投资在持有期间按实际利率计算确定的金额扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

债券投资处置时其公允价值与摊余成本之间的差额确认为投资收益。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的也可按直线法计算。

7.4.4.9 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的也可按直线法计算。

7.4.4.10 基金的收益分配政策

每一基金份额等级的基金份额享有同等分配权。申购的基金份额享有确认当日的分红权益，而赎回的基金份额不享有确认当日的分红权益。本基金以份额面值 1.00 元固定份额净值交易方式，每日计算当日收益并以红利再投资形式每日全部按份额面值 1.00 元分配结转至实收基金科目。每月集中宣告收益分配并将当月收益结转至基

基金份额持有人基金账户，基金成立不满一个月不结转。基金投资当期亏损时，采用等比例调减基金份额持有人持有份额的方式，将基金份额净值维持在份额面值 1.00 元。

7.4.4.11 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

重要会计估计及其关键假设

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金计算影子价格过程中确定债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

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：本年度不存在会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明：本年度不存在会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明：本年度不存在差错更正。

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[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、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、基金买卖债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2010年12月31日	上年度末 2009年12月31日
活期存款	143,097,192.64	831,622,255.39
定期存款	-	-
其他存款	-	-
合计	143,097,192.64	831,622,255.39

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2010年12月31日			
		摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	415,366,342.28	415,612,500.00	246,157.72	0.0333%
	合计	415,366,342.28	415,612,500.00	246,157.72	0.0333%
项目		上年度末 2009年12月31日			
		摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	2,636,297,977.15	2,640,617,000.00	4,319,022.85	0.1144%
	合计	2,636,297,977.15	2,640,617,000.00	4,319,022.85	0.1144%

注：1、偏离金额=影子定价-摊余成本；

2、偏离度=偏离金额/摊余成本法确定的基金资产净值。

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2010年12月31日
----	--------------------

	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所买入返售证券	-	-
银行间买入返售证券	100,000,270.00	-
合计	100,000,270.00	-
项目	上年度末 2009年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所买入返售证券	-	-
银行间买入返售证券	296,600,764.90	-
合计	296,600,764.90	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本期末及上年度末未持有因买断式逆回购而取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2010年12月31日	上年度末 2009年12月31日
应收活期存款利息	53,363.28	659,214.31
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	157.52	-
应收债券利息	5,341,202.26	12,785,763.74
应收买入返售证券利息	34,302.96	28,529.96
应收申购款利息	550.79	22.69
其他	-	-
合计	5,429,576.81	13,473,530.70

7.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2010年12月31日	上年度末 2009年12月31日
其他应收款	27,356.75	27,356.75
合计	27,356.75	27,356.75

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2010年12月31日	上年度末 2009年12月31日
交易所市场应付交易费用	-	-
银行间市场应付交易费用	10,042.02	14,368.97
合计	10,042.02	14,368.97

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2010年12月31日	上年度末 2009年12月31日
预提费用	70,000.00	100,000.00
应付赎回费	7.50	-
应付券商交易单元保证金	-	-
合计	70,007.50	100,000.00

7.4.7.9. 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	3,776,511,783.67	3,776,511,783.67
本期申购	11,490,894,830.05	11,490,894,830.05
本期赎回(以“-”号填列)	-14,527,672,053.82	-14,527,672,053.82
本期末	739,734,559.90	739,734,559.90

注：申购含红利再投及转换入份额；赎回含转换出份额。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	24,290,519.26	-	24,290,519.26
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-24,290,519.26	-	-24,290,519.26
本期末	-	-	-

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至 2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至 2009年12月31日
活期存款利息收入	2,034,830.61	2,435,715.13
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	429.57	983.51

其他	42,433.99	91,165.61
合计	2,077,694.17	2,527,864.25

7.4.7.12 股票投资收益

本基金本期及上年度可比期间未取得股票投资收益。

7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至 2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至 2009年12月31日
卖出债券及债券到期兑付成交总额	4,180,579,672.61	6,983,390,751.12
减：卖出债券及债券到期兑付成本总额	4,136,924,412.45	6,926,232,956.33
减：应收利息总额	36,921,334.37	49,262,418.40
债券投资收益	6,733,925.79	7,895,376.39

7.4.7.14 衍生工具收益

本基金本期及上年度可比期间未取得衍生工具收益。

7.4.7.15 股利收益

本基金本期及上年度可比期间未取得股利收益。

7.4.7.16 公允价值变动收益

本基金本期及上年度可比期间未取得公允价值变动收益。

7.4.7.17 其他收入

本基金本期及上年度可比期间未取得其他收入。

7.4.7.18 交易费用

本基金本期及上年度可比期间未产生交易费用。

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至 2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至 2009年12月31日
信息披露费	270,000.00	270,000.00
审计费用	40,000.00	100,000.00
银行划款手续费	37,464.59	48,899.85
债券托管账户维护费	18,000.00	18,000.00
合计	365,464.59	436,899.85

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金于资产负债表日后的收益分配事项如下：

	宣告日	分配收益所属期间
2011 年度		
—第 1 号收益支付公告	2011/01/04	2010/12/01-2011/01/03
—第 2 号收益支付公告	2011/02/01	2011/01/04-2011/01/31
—第 3 号收益支付公告	2011/03/01	2011/02/01-2011/02/28

7.4.9 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
兴业银行股份有限公司（“兴业银行”）	基金托管人、基金代销机构
国元证券	基金管理人的股东、基金代销机构
新加坡星展资产管理有限公司	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
安徽省投资集团有限责任公司	基金管理人的股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金 2010 和 2009 年度未通过关联方交易单元发生股票交易、权证交易、债券交易、债券回购交易，也没有发生应支付关联方的佣金业务。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	4,248,757.34	9,606,776.95
其中：支付销售机构的客户维护费	857,511.73	1,248,750.06

注：支付基金管理人长盛基金管理有限公司的基金管理费按前一日基金资产净值 0.33%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 × 0.33% / 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2010年1月1日至 2010年12月31日	2009年1月1日至 2009年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,287,502.26	2,911,144.61

注：支付基金托管人兴业银行的托管费按前一日基金资产净值 0.1%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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.1\% / \text{当年天数}。$$

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期
	2010年1月1日至2010年12月31日 当期发生的基金应支付的销售服务费
长盛基金管理有限公司	1,307,588.45
兴业银行	161,877.93
国元证券	4,034.52
合计	1,473,500.90
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间
	2009年1月1日至2009年12月31日 当期发生的基金应支付的销售服务费
长盛基金管理有限公司	4,145,635.35
兴业银行	151,893.30
国元证券	50,246.46
合计	4,347,775.11

注：支付基金销售机构的销售服务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，按月支付给长盛基金管理有限公司，再由长盛基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.25\% / \text{当年天数}。$$

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

单位：人民币元

本期						
2010年1月1日至2010年12月31日						
银行间市场交易的 各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
-	-	-	-	-	-	-
上年度可比期间						
2009年1月1日至2009年12月31日						
银行间市场交易的	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	

各关联方名称	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
兴业银行	-	10,017,061.51	-	-	-	-

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

基金管理人本期及上年度可比期间未运用固有资金投资本基金。

7.4.10.4.2 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

除基金管理人之外的其他关联方本期及上年度可比期间未投资本基金。

7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2010年1月1日至2010年12月31日		上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日	
	期末金额	当期利息收入	期末金额	当期利息收入
兴业银行	143,097,192.64	2,034,830.61	831,622,255.39	2,435,715.13

注：本基金的银行存款由基金托管人兴业银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本期及上年度可比期间无其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

已按再投资形式转 实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	本期利润分配合计	备注
24,290,519.26	-	-	24,290,519.26	

注：本基金在本年度累计分配收益 24,290,519.26 元，其中以红利再投资方式结转入实收基金 24,290,519.26 元。

7.4.12 期末（2010年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本期末无银行间市场债券正回购中作为抵押的债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本期末无交易所市场债券正回购中作为抵押的债券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只货币型证券投资基金，属于低风险合理稳定收益品种，本基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“低风险、高流动性和持续稳定收益”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，在董事会下设立风险控制管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部与金融工程部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。

本基金的基金管理人建立了以风险控制管理委员会为核心的、由风险控制管理委员会、风险控制委员会、监察稽核部与金融工程部、相关业务部门构成的四级风险管理架构体系。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行兴业银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，不投资于短期信用评级在 A-1 级以下或长期信用评级在 AAA 级以下的债券，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2010年12月31日	上年度末 2009年12月31日
A-1	205,071,459.94	1,000,153,801.99
A-1 以下	-	-
未评级	170,239,777.71	1,446,635,383.90
合计	375,311,237.65	2,446,789,185.89

7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2010年12月31日	上年度末 2009年12月31日
AAA	-	19,810,815.45
AAA 以下	-	-
未评级	40,055,104.63	169,697,975.81
合计	40,055,104.63	189,508,791.26

注：未评级债券为国债、央行票据及政策性金融债。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人主要通过限制、跟踪和控制基金投资交易的不活跃品种(企业债或短期融资券)来实现。本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 180 天，且能够通过出售所持有的银行间同业市场交易债券应对流动性需求。此外本基金还可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金

应对流动性需求，正回购上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值以及基金资产净值的 20%。本基金投资于同一公司发行的短期企业债券不超过本基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的 10%。

本基金所持有的全部金融负债无固定到期日或合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金主要投资于银行间及交易所市场交易的固定收益品种，此外还持有银行存款、结算备付金、买入返售金融资产等利率敏感性资产，因此存在相应的利率风险。本基金的基金管理人每日通过“影子定价”对本基金面临的市场风险进行监控，定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2010年12月31日	6个月以内	6个月至1年	1至5年	不计息	合计
资产					
银行存款	143,097,192.64	-	-	-	143,097,192.64
结算备付金	409,090.91	-	-	-	409,090.91
交易性金融资产	365,349,860.01	50,016,482.27	-	-	415,366,342.28
买入返售金融资产	100,000,270.00	-	-	-	100,000,270.00
应收利息	-	-	-	5,429,576.81	5,429,576.81
应收申购款	10,031,007.00	-	-	66,817,260.00	76,848,267.00
其他资产	-	-	-	27,356.75	27,356.75

资产总计	618,887,420.56	50,016,482.27	-	72,274,193.56	741,178,096.39
负债					
应付赎回款	-	-	-	492.50	492.50
应付管理人报酬	-	-	-	203,772.31	203,772.31
应付托管费	-	-	-	61,749.19	61,749.19
应付销售服务费	-	-	-	154,372.97	154,372.97
应付交易费用	-	-	-	10,042.02	10,042.02
应交税费	-	-	-	943,100.00	943,100.00
其他负债	-	-	-	70,007.50	70,007.50
负债总计	-	-	-	1,443,536.49	1,443,536.49
利率敏感度缺口	618,887,420.56	50,016,482.27	-	70,830,657.07	739,734,559.90
上年度末 2009年12月31日	6个月以内	6个月至1年	1至5年	不计息	合计
资产					
银行存款	831,622,255.39	-	-	-	831,622,255.39
交易性金融资产	2,286,241,781.72	350,056,195.43	-	-	2,636,297,977.15
买入返售金融资产	296,600,764.90	-	-	-	296,600,764.90
应收利息	-	-	-	13,473,530.70	13,473,530.70
其他资产	-	-	-	27,356.75	27,356.75
资产总计	3,414,464,802.01	350,056,195.43	-	13,500,887.45	3,778,021,884.89
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	577,370.04	577,370.04
应付托管费	-	-	-	174,960.65	174,960.65
应付销售服务费	-	-	-	437,401.56	437,401.56
应付交易费用	-	-	-	14,368.97	14,368.97
应交税费	-	-	-	206,000.00	206,000.00
其他负债	-	-	-	100,000.00	100,000.00
负债总计	-	-	-	1,510,101.22	1,510,101.22
利率敏感度缺口	3,414,464,802.01	350,056,195.43	-	11,990,786.23	3,776,511,783.67

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位：人民币万元)	
		本期末 2010年12月31日	上年度末 2009年12月31日
	市场利率下降25个基点	增加约53	增加约263
	市场利率上升25个基点	下降约53	下降约263

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(b) 以公允价值计量的金融工具

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值，公允价值层级可分为：

第一层级：相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。

第二层级：直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级：以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

于2010年12月31日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第二层级的余额为415,366,342.28元，无属于第一层级和第三层级的余额(2009年12月31日：第二层级2,636,297,977.15元，无第一层级和第三层级)。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	固定收益投资	415,366,342.28	56.04
	其中：债券	415,366,342.28	56.04
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	100,000,270.00	13.49
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	143,506,283.55	19.36
4	其他各项资产	82,305,200.56	11.10
5	合计	741,178,096.39	100.00

8.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目	占基金资产净值的比例 (%)	
1	报告期内债券回购融资余额	3.47	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例 (%)
2	报告期末债券回购融资余额	-	-
	其中：买断式回购融资	-	-

注：上表中报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过资产净值的 20% 的说明：

序号	发生日期	融资余额占基金资产净值比例 (%)	原因	调整期 (日)
1	2010-6-30	20.70	大额赎回导致被动超标	到 2010 年 7 月 1 日调整完毕

8.3 基金投资组合平均剩余期限

8.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	61
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	183
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	61

报告期内投资组合平均剩余期限超过 180 天情况说明

序号	发生日期	平均剩余期限(天数)	原因	调整期
1	2010-3-17	183	大额赎回导致被动超标	到2010年3月18日调整完毕

8.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	42.37	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	11.48	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	14.88	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	2.71	-
4	90天(含)-180天	13.58	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)-397天(含)	6.76	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	89.07	-

8.4 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	摊余成本	占基金资产净值的比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	170,239,777.71	23.01
3	金融债券	40,055,104.63	5.41
	其中：政策性金融债	40,055,104.63	5.41
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	205,071,459.94	27.72
6	其他	-	-
7	合计	415,366,342.28	56.15
8	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	20,063,026.11	2.71

注：上表中，债券的成本包括债券面值和折溢价。

8.5 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	1001093	10 央行票据 93	500,000	49,882,913.94	6.74
2	0801062	08 央行票据 62	400,000	40,398,266.69	5.46
3	1001011	10 央行票据 11	400,000	39,908,586.11	5.39
4	1081065	10 鲁晨鸣 CP01	300,000	30,024,440.54	4.06

5	1081234	10 中广核 CP02	300,000	30,016,482.27	4.06
6	0801047	08 央行票据 47	200,000	20,154,419.37	2.72
7	090205	09 国开 05	200,000	20,063,026.11	2.71
8	1081069	10 武水务 CP01	200,000	20,015,410.56	2.71
9	1081066	10 方正 CP01	200,000	20,010,459.16	2.71
10	1081189	10 紫江 CP01	200,000	20,000,609.78	2.70

8.6 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在 0.25(含)-0.5%间的次数	174
报告期内偏离度的最高值	0.4840%
报告期内偏离度的最低值	-0.0342%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.2796%

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 投资组合报告附注

8.8.1 基金计价方法说明

本基金的债券投资采用摊余成本法计价，即计价对象以买入成本列示，按票面利率或商定利率每日计提应收利息，并按实际利率法在其剩余期限内摊销其买入时的溢价或折价。

8.8.2 声明本报告期内，本基金持有的剩余期限小于 397 天但剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值 20%的情况：

序号	发生日期	该类浮动债占基金资产净值的比例(%)	原因	调整期
1	2010-10-28	20.15	基金规模波动导致超标	到 2010 年 10 月 29 日调整完毕

8.8.3 声明本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体有无被监管部门立案调查记录，或无在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

本报告期内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。

8.8.4 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	5,429,576.81
4	应收申购款	76,848,267.00
5	其他应收款	27,356.75
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	82,305,200.56

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人 户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额 比例
12,970	57,034.28	321,846,624.01	43.51%	417,887,935.89	56.49%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	78,507.36	0.01%

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2005年12月12日）基金份额总额	3,601,835,236.63
本报告期期初基金份额总额	3,776,511,783.67
本报告期基金总申购份额	11,490,894,830.05
减：本报告期基金总赎回份额	14,527,672,053.82
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	739,734,559.90

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

11.2.1 本基金管理人的高级管理人员重大人事变动情况

本基金管理人于 2010 年 6 月 18 日发布公告，经长盛基金管理有限公司第五届董事会第一次会议审议通过，并报中国证监会审核批准(证监许可[2010]762 号)，聘任公司董事凤良志先生担任公司董事长，陈平先生不再担任公司董事长一职。

本基金管理人于 2010 年 6 月 23 日发布公告，经长盛基金管理有限公司第五届董事会第二次会议审议通过，决定聘任朱剑彪先生担任公司副总经理职务。

11.2.2 基金经理变动情况

本报告期基金经理未发生变动。

11.2.3 本基金托管人的基金托管部门重大人事变动情况

本报告期本基金托管人的基金托管部门未发生重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金资产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略没有改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所有限公司，本报告期内本基金未更换会计师事务所，本报告期支付给该会计师事务所的报酬 70,000.00 元，已连续提供审计服务 6 年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

2010 年 9 月 6 日，本基金管理人因旗下长盛创新先锋基金所持债券投资比例连续 12 个交易日不符合基金合同的约定，以及长盛货币市场基金所持“10 柳化工 CP01”债券的数量超过该债券发行数量的 10% 的原因，受到北京证监局的行政监管措施。本基金管理人根据行政监管措施决定书的要求及时、认真地对公司投资管理制度流程、风险管理、监察稽核及执行等各方面进行了整改、梳理和完善。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

券商名称	交易单元数量	债券回购交易	
		成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
中信建投证券	1	130,000,000.00	100.00%

注：1、本公司选择证券经营机构的标准

(1) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时为本公司提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析、个股分析报告等，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告。

(2) 资力雄厚，信誉良好。

(3) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定。

(4) 经营行为规范，最近两年未因重大违规行为而受到中国证监会和中国人民银行处罚。

(5) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求。

(6) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本公司基金进行证券交易的需要，并能为本公司基金提供全面的信息服务。

2、本公司租用券商交易单元的程序

(1) 研究机构提出服务意向，并提供相关研究报告；

(2) 研究机构的研究报告需要有一定的试用期。试用期视服务情况和研究服务评价结果而定；

(3) 研究发展部、投资管理等部门试用研究机构的研究报告后，按照研究服务评价规定，对研究机构进行综合评价；

(4) 试用期满后，评价结果符合条件，双方认为有必要继续合作，经公司领导审批后，我司与研究机构签定《研究服务协议》、《券商交易单元租用协议》，并办理基金专用交易单元租用手续。评价结果如不符合条件则终止试用；

(5) 本公司每两个月对签约机构的服务进行一次综合评价。经过评价，若本公司认为签约机构的服务不能满足要求，或签约机构违规受到国家有关部门的处罚，本公司有权终止签署的协议，并撤销租用的交易单元；

(6) 交易单元租用协议期限为一年，到期后若双方没有异议可自动延期一年。

3、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况

本报告期内未有交易单元变更。

11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

本报告期本基金无偏离度绝对值超过 0.5%的情况。

11.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	披露日期
1	长盛基金管理有限公司关于代为履行基金经理职责的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》以及本公司网站	2010-12-25
2	关于增加信达证券为旗下部分基金代销机构、推出定期定申购业务及费率优惠活动的公告	同上	2010-12-15
3	长盛货币市场基金收益支付公告（2010 年第 12 号）	同上	2010-12-01
4	关于增加平安证券有限责任公司为旗下部分基金代销机构的公告	同上	2010-11-16
5	长盛货币市场基金收益支付公告（2010 年第 11 号）	同上	2010-11-01
6	长盛货币市场基金收益支付公告（2010 年第 10 号）	同上	2010-10-08
7	长盛基金管理有限公司关于长盛货币市场基金限制大额申购业务的公告	同上	2010-10-08
8	长盛基金管理有限公司关于开通网上交易智能投资业务的公告	同上	2010-09-17
9	关于《关于长盛货币市场基金暂停申购和转换转入业务的公告》的补充公告	同上	2010-09-11
10	关于长盛货币市场基金暂停申购和转换转入业务的公告	同上	2010-09-10
11	长盛基金管理有限公司关于增加代销机构的更正公告	同上	2010-09-08
12	长盛货币市场基金收益支付公告（2010 年第 9 号）	同上	2010-09-01
13	关于增加平安证券和东北证券为旗下部分基金代销机构的公告	同上	2010-08-31
14	长盛货币市场基金收益支付公告（2010 年第 8 号）	同上	2010-08-02
15	长盛货币市场基金收益支付公告（2010 年第 7 号）	同上	2010-07-01
16	长盛货币市场基金招募说明书（更新）	同上	2010-06-24
17	长盛基金管理有限公司关于聘任公司副总经理的公告	同上	2010-06-23
18	长盛基金管理有限公司关于更换董事长的公告	同上	2010-06-18
19	长盛货币市场基金收益支付公告（2010 年第 6 号）	同上	2010-06-02
20	长盛基金管理有限公司关于设立郑州分公司的公告	同上	2010-05-27
21	长盛货币市场基金收益支付公告（2010 年第 5 号）	同上	2010-05-04

22	长盛货币市场基金收益支付公告（2010年第4号）	同上	2010-04-01
23	长盛货币市场基金收益支付公告（2010年第3号）	同上	2010-03-01
24	长盛基金管理有限公司关于开通直销电话交易的公告	同上	2010-02-24
25	关于长盛货币市场基金“春节”假期前三个工作日暂停申购和转换转入业务的公告	同上	2010-02-10
26	长盛货币市场基金收益支付公告（2010年第2号）	同上	2010-02-01
27	长盛货币市场基金招募说明书（更新）	同上	2010-01-13
28	长盛货币市场基金收益支付公告（2010年第1号）	同上	2010-01-04

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准基金募集的文件；
- 2、《长盛货币市场基金基金合同》；
- 3、《长盛货币市场基金托管协议》；
- 4、《长盛货币市场基金招募说明书》；
- 5、法律意见书；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、基金托管人业务资格批件、营业执照。

12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

12.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的办公场所和/或管理人网站免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人长盛基金管理有限公司。

客户服务中心电话：400-888-2666、010-62350088。

网址：<http://www.csfunds.com.cn>。