

长盛货币市场基金  
2010 年年度报告摘要  
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

### 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 2010 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	

### 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	<a href="http://www.csfunds.com.cn">http://www.csfunds.com.cn</a>
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	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

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%

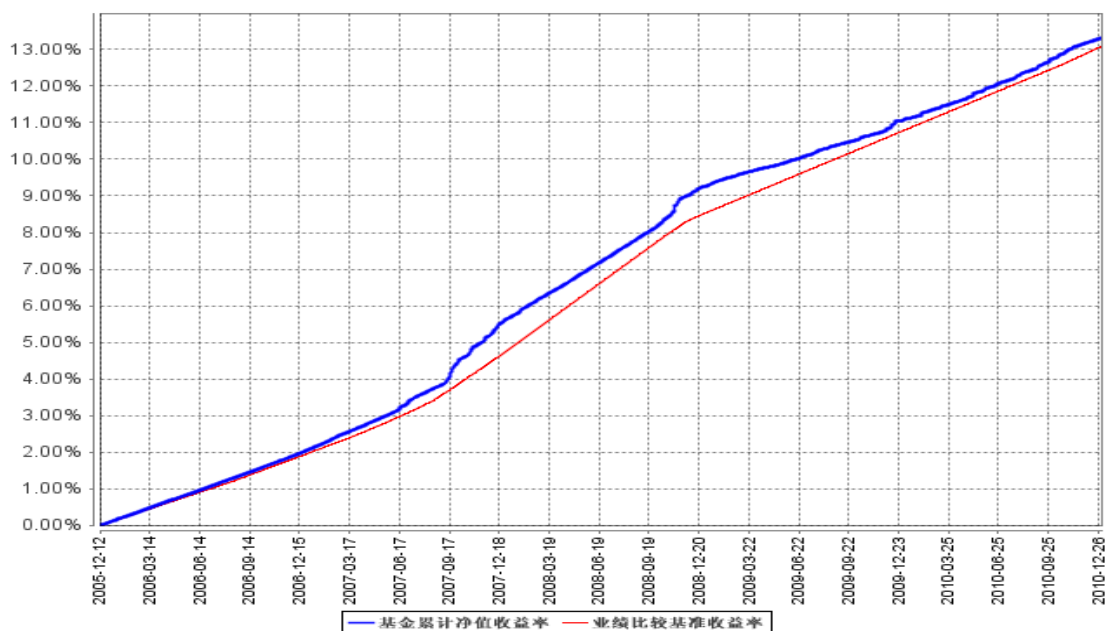
注：本基金业绩比较基准的构建及再平衡过程：

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。

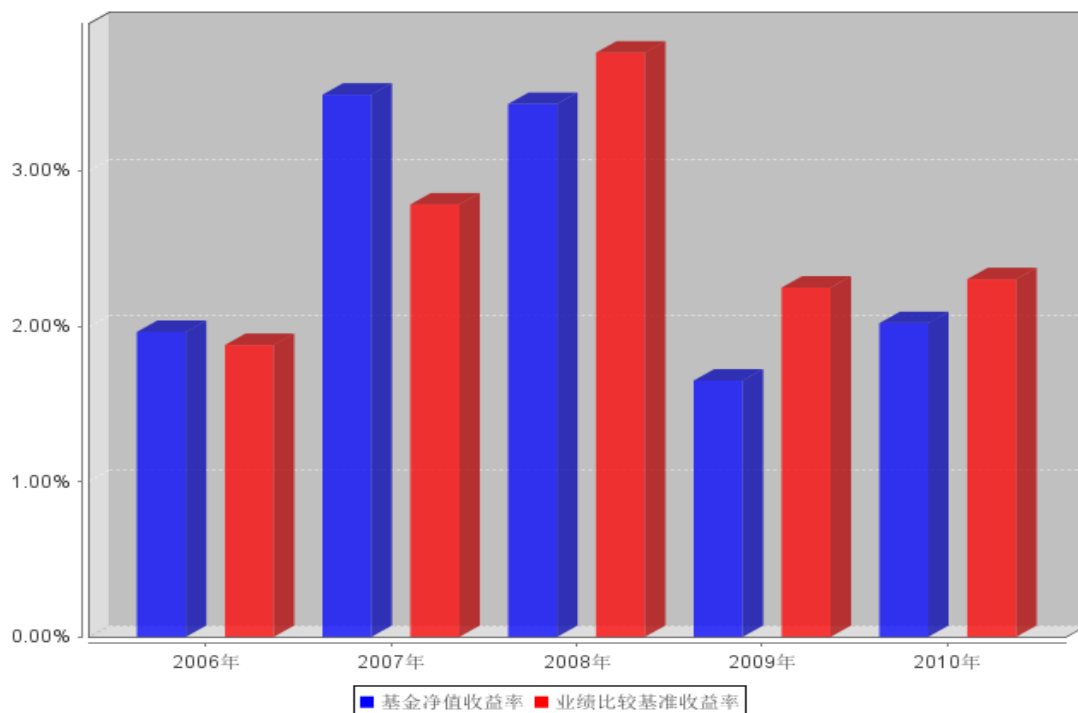
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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合规守信情况的说明**

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。

#### **4.7 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合规守信情况声明

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合规守信、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

普华永道中天会计师事务所有限公司注册会计师薛竞、张鸿于 2011 年 3 月 29 日对本基金 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出具了普华永道中天审字(2011)第 20555 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	本期末 2010年12月31日	上年度末 2009年12月31日
<b>资 产：</b>		
银行存款	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	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	-	-
买入返售金融资产	100,000,270.00	296,600,764.90
应收证券清算款	-	-
应收利息	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	27,356.75	27,356.75
<b>资产总计</b>	<b>741,178,096.39</b>	<b>3,778,021,884.89</b>

负债和所有者权益	本期末 2010年12月31日	上年度末 2009年12月31日
<b>负 债：</b>		
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	-	-
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	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	70,007.50	100,000.00
<b>负债合计</b>	<b>1,443,536.49</b>	<b>1,510,101.22</b>
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	739,734,559.90	3,776,511,783.67
未分配利润	-	-
<b>所有者权益合计</b>	<b>739,734,559.90</b>	<b>3,776,511,783.67</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>	<b>741,178,096.39</b>	<b>3,778,021,884.89</b>

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	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
<b>一、收入</b>	<b>34,326,043.00</b>	<b>67,183,609.44</b>
1. 利息收入	27,592,117.21	59,288,233.05
其中：存款利息收入	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	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	6,733,925.79	7,895,376.39
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”填列）	-	-
4. 汇兑收益（损失以“-”填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”填列）	-	-
<b>减：二、费用</b>	<b>10,035,523.74</b>	<b>22,553,406.11</b>
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	-	-
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	365,464.59	436,899.85
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>24,290,519.26</b>	<b>44,630,203.33</b>
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>24,290,519.26</b>	<b>44,630,203.33</b>

### 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	-	-24,290,519.26	-24,290,519.26

产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)			
<b>五、期末所有者权益(基金净值)</b>	<b>739,734,559.90</b>	<b>-</b>	<b>739,734,559.90</b>
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产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-44,630,203.33	-44,630,203.33
<b>五、期末所有者权益(基金净值)</b>	<b>3,776,511,783.67</b>	<b>-</b>	<b>3,776,511,783.67</b>

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》和中国证监会允许的如财务报表附注 7.4.4 所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

#### **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 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 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。

#### 7.4.8 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

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。

##### 7.4.8.2 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 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。

#### 7.4.8.2.2 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：

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

#### 7.4.8.2.3 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：

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

#### 7.4.8.3 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 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
兴业银行	-	10,017,061.51	-	-	-	-

#### 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

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。

##### 7.4.8.4.2 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

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。

##### 7.4.8.5 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。

##### 7.4.8.6 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。

##### 7.4.8.7 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。

#### 7.4.9 期末（2010年12月31日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.9.1 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。

##### 7.4.9.2 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。

##### 7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.9.3.1 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。

###### 7.4.9.3.2 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。

#### 7.4.10 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前十名资产支持证券投资 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。