

长盛货币市场基金
2011 年半年度报告摘要
2011 年 6 月 30 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 8 月 27 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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2011 年 8 月 26 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，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2011 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 | 466,705,421.12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将采用主动投资策略，在投资中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 | 010-82019988 | 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

| | |
|----------------------|---|
| 登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址 | http://www.csfunds.com.cn |
| 基金半年度报告备置地点 | 基金管理人和基金托管人的办公地址 |

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

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 | 报告期（2011年1月1日至2011年6月30日） |
|---------------|---------------------------|
| 本期已实现收益 | 6,459,516.80 |
| 本期利润 | 6,459,516.80 |
| 本期净值收益率 | 1.3227% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末（2011年6月30日） |
| 期末基金资产净值 | 466,705,421.12 |
| 期末基金份额净值 | 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、表中的“期末”均指本报告期最后一日，即6月30日。

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 |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|----------|---------|
| 过去一个月 | 0.2214% | 0.0017% | 0.2671% | 0.0000% | -0.0457% | 0.0017% |
| 过去三个月 | 0.7248% | 0.0079% | 0.8068% | 0.0002% | -0.0820% | 0.0077% |
| 过去六个月 | 1.3227% | 0.0069% | 1.5199% | 0.0005% | -0.1972% | 0.0064% |
| 过去一年 | 2.4225% | 0.0066% | 2.7082% | 0.0011% | -0.2857% | 0.0055% |
| 过去三年 | 7.0231% | 0.0072% | 7.8804% | 0.0016% | -0.8573% | 0.0056% |
| 自基金合同生效起至今 | 14.8080% | 0.0062% | 14.5997% | 0.0020% | 0.2083% | 0.0042% |

注：本基金业绩比较基准的构建及再平衡过程：

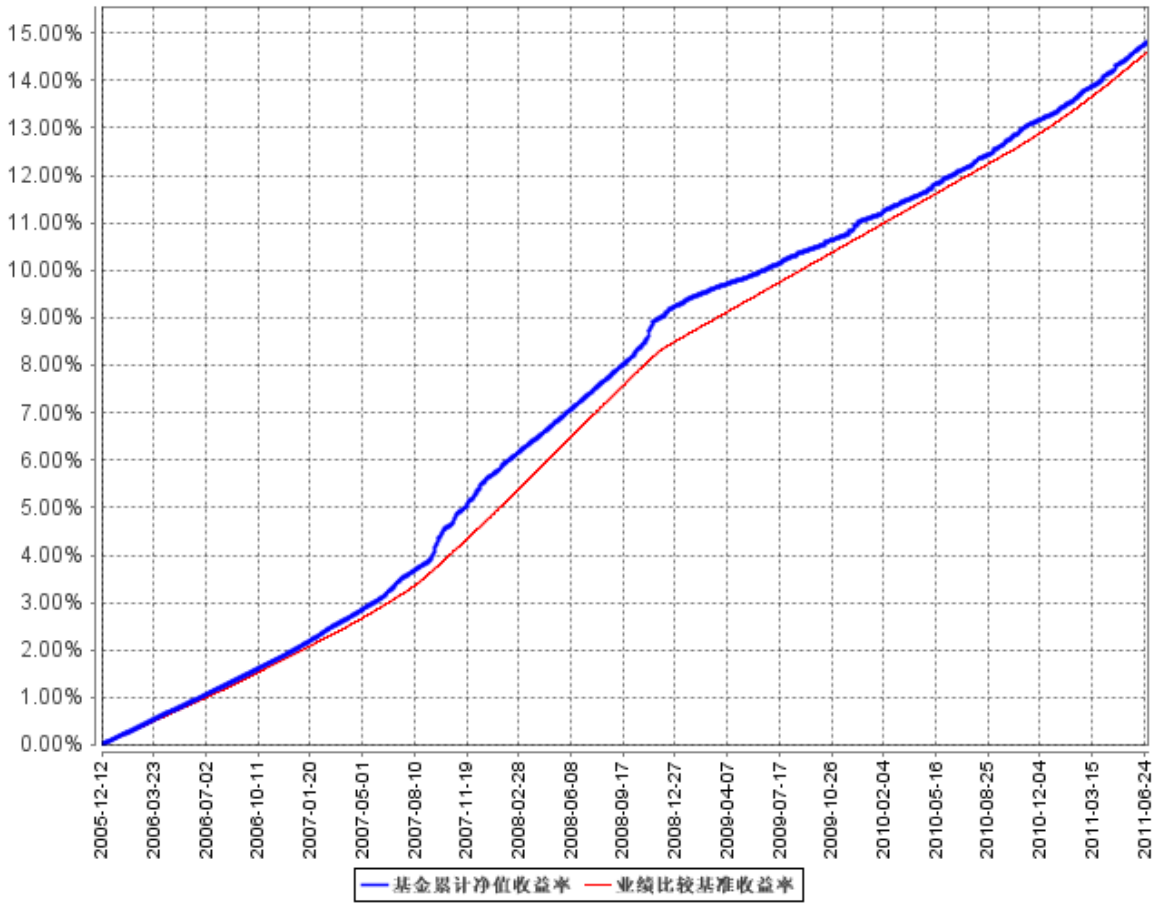
本基金业绩比较基准为银行一年期定期存款利率（税后）。本基金为储蓄存款的良好投资替代工具，所以投资业绩基准确定为：一年期定期存款利率（税后）。本比较基准与货币市场工具的收益率有一定的相关性，能够反映货币市场的收益率水平。

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



§ 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2011年6月30日，基金管理人共管理两支封闭式基金、十四支开放式基金(包括一支QDII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 | | |
| 梁婷 | 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。 | 2011年2月15日 | - | 11年 | 女，1975年6月出生，中国国籍。中国社会科学院研究生院经济学博士。曾任中国对外经济贸易信托投资公司投资银行部项目经理；2000年10月加入长盛基金管理有限公司，先后担任产品设计经理、固定收益研究员、社保组合经理助理，社保组合经理。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。 |
| 梁珂 | 本基金经理助理，长盛中信全债指数增强型债券投资基金基金经理助理，债券研究员。 | 2010年12月10日 | - | 3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。 |

| | | | | | |
|----|--|-------------|------------|-----|---|
| 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 | 2011年2月15日 | 11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。曾任本基金基金经理，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。目前已离职。 |
|----|--|-------------|------------|-----|---|

注：1、上表基金经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合规守信情况的说明

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

2011年上半年，通胀预期和货币政策紧缩力度都不断强化，伴随着政策调控力度的增加，各项宏观经济数据也在二季度起逐渐回落。

一季度，货币政策紧缩刚开始，扣除春节因素，资金面依然处于相对宽裕的格局，货币市场利率依然维持低位。二季度货币政策紧缩力度加大，存款准备金率维持了一月一调的频率，三年央票一度重启，货币市场利率波动加剧，重心上移。

5月中旬之前，尽管货币市场利率已有所抬高，但资金面相对较为宽松，因此，短融作为风险收益率较好的品种受到追捧，一二级利差持续存在，特别是4月份加息后，短融发行利率有所提高，而市场预期短期内不会再次加息，因而市场对短融有明显的配置和交易需求。进入5月中下旬，紧缩政策的边际效应逐渐体现，银行间资金面开始进入较为紧张的局面，这种局面在月末只经历了短暂的缓和，就进入了6月份的资金紧张状态，银行间7天回购利率达到历史高位，短债市场出现快速大幅下跌，短期信用品种遭遇了流动性困难。

在组合操作上，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。特别是时至半年末，市场流动性风险和基金赎回压力并存，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，尽量保持了一定的现金比例，降低了组合的投资剩余期限。通过对组合的优化管理，保证了收益一贯的稳定性、持续性。但是5月末起，一方面资金紧张程度还是超出我们的预期，另一方面银行理财产品的高回报增加了货币基金的赎回压力，对于货币基金的收益也造成了一定的影响。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2011年上半年，长盛货币市场基金净值收益率为1.3227%，同期业绩比较基准收益率1.5199%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势等的简要展望

当前宏观经济增速如期回落，紧缩性货币政策以及经济结构调整效应逐步显现。我们认为，三季度起，货币政策紧缩的压力大大减小，宏观经济将呈现软着陆态势，并且四季度将逐渐企稳后或有望步入短周期的回升。因此四季度的宏观经济尚需观

察，不排除经济和通胀上行导致政策继续紧缩的可能。

通货膨胀方面，食品价格反季节增长推动物价持续上涨，三季度起物价同比将随翘尾因素的逐渐减弱而有所回落，但年内低点大概率下仍将维持在4%左右的较高水平上。虽然短期经济出现了一定程度放缓，但这种放缓更多反映的决策层主动调控的效果，在保障房建设及中西部城镇化推动下固定资产投资增速保持在较高水平，经济增长底部支撑依旧坚实，同时，中国人口红利的逐渐衰退以及劳动观念的逐渐转变，中期看，通胀波动的中枢水平会较以往有所抬高。

展望下半年货币市场，随着紧缩政策逐渐接近尾声，短期内政策紧缩的利空因素已经得到很大程度的释放，资金面也将有所缓解。当前由于当前银行超储率处于相对低位，三季度到期资金量相对较少，资金面仍然相对不会太宽松，四季度的经济仍有待观察，因此下半年货币市场利率总体仍会维持相对较高的水平。同时，短融的供给将会加快，在经济下行过程中违约风险增加，流动性或受到制约，因此本基金将适度降低短融的投资比例，保持充分的流动性，同时获取货币市场相对较高的利率水平。

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，并按月结转到投资人基金账户，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，2011 年上半年度分配利润 6,459,516.80 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，对基金管理人在本基金的投资运作、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 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人认真复核了本半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 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：长盛货币市场基金

报告截止日：2011年6月30日

单位：人民币元

| 资 产 | 本期末 2011年6月30日 | 上年度末 2010年12月31日 |
|-----------------|-----------------------|-----------------------|
| 资 产： | | |
| 银行存款 | 55,116,970.40 | 143,097,192.64 |
| 结算备付金 | 666,666.67 | 409,090.91 |
| 存出保证金 | - | - |
| 交易性金融资产 | 231,175,037.26 | 415,366,342.28 |
| 其中：股票投资 | - | - |
| 基金投资 | - | - |
| 债券投资 | 231,175,037.26 | 415,366,342.28 |
| 资产支持证券投资 | - | - |
| 衍生金融资产 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 26,700,160.05 | 100,000,270.00 |
| 应收证券清算款 | - | - |
| 应收利息 | 1,624,183.96 | 5,429,576.81 |
| 应收股利 | - | - |
| 应收申购款 | 152,778,250.00 | 76,848,267.00 |
| 递延所得税资产 | - | - |
| 其他资产 | 27,356.75 | 27,356.75 |
| 资产总计 | 468,088,625.09 | 741,178,096.39 |
| | 本期末 | 上年度末 |
| 负债和所有者权益 | 2011年6月30日 | 2010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 | - | - |
| 应付赎回款 | - | 492.50 |
| 应付管理人报酬 | 107,349.77 | 203,772.31 |
| 应付托管费 | 32,530.24 | 61,749.19 |
| 应付销售服务费 | 81,325.59 | 154,372.97 |

| | | |
|-------------------|-----------------------|-----------------------|
| 应付交易费用 | 22,154.46 | 10,042.02 |
| 应交税费 | 976,200.00 | 943,100.00 |
| 应付利息 | - | - |
| 应付利润 | - | - |
| 递延所得税负债 | - | - |
| 其他负债 | 163,643.91 | 70,007.50 |
| 负债合计 | 1,383,203.97 | 1,443,536.49 |
| 所有者权益： | | |
| 实收基金 | 466,705,421.12 | 739,734,559.90 |
| 未分配利润 | - | - |
| 所有者权益合计 | 466,705,421.12 | 739,734,559.90 |
| 负债和所有者权益总计 | 468,088,625.09 | 741,178,096.39 |

注：报告截止日2011年6月30日，基金份额净值：1.00元，基金份额总额466,705,421.12份。

6.2 利润表

会计主体：长盛货币市场基金

本报告期：2011年1月1日至2011年6月30日

单位：人民币元

| 项 目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|-----------------------|----------------------|----------------------|
| | 2011年1月1日至2011年6月30日 | 2010年1月1日至2010年6月30日 |
| 一、收入 | 8,565,926.05 | 20,612,477.01 |
| 1. 利息收入 | 7,446,297.39 | 16,466,414.01 |
| 其中：存款利息收入 | 830,432.84 | 1,341,085.56 |
| 债券利息收入 | 5,951,518.14 | 14,662,233.86 |
| 资产支持证券利息收入 | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | 664,346.41 | 463,094.59 |
| 其他利息收入 | - | - |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） | 1,119,628.66 | 4,146,063.00 |
| 其中：股票投资收益 | - | - |
| 基金投资收益 | - | - |
| 债券投资收益 | 1,119,628.66 | 4,146,063.00 |
| 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） | - | - |
| 减：二、费用 | 2,106,409.25 | 6,181,381.43 |

| | | |
|----------------------------|---------------------|----------------------|
| 1. 管理人报酬 | 834,098.49 | 2,696,746.07 |
| 2. 托管费 | 252,757.10 | 817,195.78 |
| 3. 销售服务费 | 631,892.77 | 2,042,989.43 |
| 4. 交易费用 | - | - |
| 5. 利息支出 | 191,315.42 | 431,885.40 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | 191,315.42 | 431,885.40 |
| 6. 其他费用 | 196,345.47 | 192,564.75 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | 6,459,516.80 | 14,431,095.58 |
| 减：所得税费用 | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | 6,459,516.80 | 14,431,095.58 |

6.3 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：2011年1月1日至2011年6月30日

单位：人民币元

| 项 目 | 本期 2011年1月1日至2011年6月30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） | 739,734,559.90 | - | 739,734,559.90 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 6,459,516.80 | 6,459,516.80 |
| 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） | -273,029,138.78 | - | -273,029,138.78 |
| 其中：1. 基金申购款 | 2,845,161,794.70 | - | 2,845,161,794.70 |
| 2. 基金赎回款(以“-”号填列) | -3,118,190,933.48 | - | -3,118,190,933.48 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列） | - | -6,459,516.80 | -6,459,516.80 |
| 五、期末所有者权益（基金净值） | 466,705,421.12 | - | 466,705,421.12 |
| 项 目 | 上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30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） | - | 14,431,095.58 | 14,431,095.58 |
| 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） | -2,802,631,019.69 | - | -2,802,631,019.69 |
| 其中：1. 基金申购款 | 5,988,859,310.12 | - | 5,988,859,310.12 |
| 2. 基金赎回款(以“-”号填列) | -8,791,490,329.81 | - | -8,791,490,329.81 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动数（净值减少以 | - | -14,431,095.58 | -14,431,095.58 |

| | | | |
|-----------------|----------------|---|----------------|
| “-”号填列) | | | |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 973,880,763.98 | - | 973,880,763.98 |

注：后附财务报表附注为本财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

周兵

杨思乐

戴君棉

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 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。

6.4.2 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.2.1 会计政策变更的说明：本报告期不存在会计政策变更。

6.4.2.2 会计估计变更的说明：本报告期不存在会计估计变更。

6.4.2.3 差错更正的说明：本报告期不存在差错更正。

6.4.3 关联方关系

6.4.3.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内，未存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.3.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|--------------------|---------------------|
| 长盛基金管理有限公司(“长盛基金”) | 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 |

6.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金无关联方交易单元，未发生通过关联方交易单元进行的交易。

6.4.4.2 关联方报酬

6.4.4.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2011年1月1日至2011年 6月30日 | 上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6 月30日 |
|----------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 834,098.49 | 2,696,746.07 |

| | | |
|------------------|------------|------------|
| 其中：支付给销售机构的客户维护费 | 233,649.57 | 495,176.98 |
|------------------|------------|------------|

注：支付基金管理人长盛基金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。

6.4.4.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|----------------|----------------------|----------------------|
| | 2011年1月1日至2011年6月30日 | 2010年1月1日至2010年6月30日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 252,757.10 | 817,195.78 |

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 0.10% 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 × 0.10% / 当年天数。

6.4.4.2.3 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 |
|----------------|----------------------|
| | 2011年1月1日至2011年6月30日 |
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 |
| 长盛基金 | 114,521.25 |
| 兴业银行 | 52,773.68 |
| 国元证券 | 2,593.24 |
| 合计 | 169,888.17 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间 |
| | 2010年1月1日至2010年6月30日 |
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 |
| 长盛基金 | 968,810.92 |
| 兴业银行 | 52,901.81 |
| 国元证券 | 2,262.02 |
| 合计 | 1,023,974.75 |

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，再由长盛基金计算并支付给各基金销售机构。

其计算公式为：日销售服务费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

6.4.4.3 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 2011年1月1日至2011年6月30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 | 20,042,553.88 | - | - | - | - | - |
| 上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30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 |
| - | - | - | - | - | - | - |

6.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金基金管理人于本报告期（2011年1月1日至2011年6月30日）及上年度可比期间内均未投资本基金份额。

6.4.4.4.2 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

本基金其他关联方及其控制的机构于本报告期末（2011年6月30日）及上年度末均未投资本基金份额。

6.4.4.5 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 | | 上年度可比期间 | |
|-------|----------------------|------------|----------------------|--------------|
| | 2011年1月1日至2011年6月30日 | | 2010年1月1日至2010年6月30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 | 5,116,970.40 | 208,579.74 | 109,944,965.90 | 1,315,439.33 |

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。

6.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

| 本期 2011年1月1日至2011年6月30日 | | | | | |
|---------------------------------|---------|-------------|------|------------|---------------|
| 关联方名称 | 证券代码 | 证券名称 | 发行方式 | 基金在承销期内买入 | |
| | | | | 数量(单位:股/张) | 总金额 |
| 兴业银行 | 1181175 | 11 闽交运 CP01 | 分销 | 100,000 | 10,000,000.00 |
| 上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日 | | | | | |
| 关联方名称 | 证券代码 | 证券名称 | 发行方式 | 基金在承销期内买入 | |
| | | | | 数量(单位:股/张) | 总金额 |
| - | - | - | - | - | - |

6.4.4.7 其他关联交易事项的说明：无。

6.4.5 期末（2011年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金报告期末未持有因认购新发/增发的流通受限证券。

6.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限证券

本基金报告期末未持有暂时停牌等流通受限证券。

6.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.5.3.1 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。

6.4.5.3.2 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。

6.4.6 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2011年6月30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231,175,037.26元，无属于第一层级和第三层级的余额。(2010年12月31日：第二层级415,366,342.28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。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 资产组合 | 金额 | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|----------------|---------------|
| 1 | 固定收益投资 | 231,175,037.26 | 49.39 |
| | 其中：债券 | 231,175,037.26 | 49.39 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 2 | 买入返售金融资产 | 26,700,160.05 | 5.70 |
| | 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 | 55,783,637.07 | 11.92 |
| 4 | 其他各项资产 | 154,429,790.71 | 32.99 |
| 5 | 合计 | 468,088,625.09 | 100.00 |

7.2 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 | 2.75 | |
| | 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

本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的 20%。

7.3 基金投资组合平均剩余期限

7.3.1 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 | 136 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 155 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 | 52 |

报告期内投资组合平均剩余期限超过 180 天情况说明：

报告期内无投资组合平均剩余期限超过 180 天情况。

7.3.2 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 | 13.40 | - |

| | | | |
|-----------|------------------------|--------------|----------|
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | 2.16 | - |
| 2 | 30 天(含)-60 天 | 10.71 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 3 | 60 天(含)-90 天 | 10.94 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | 10.94 | - |
| 4 | 90 天(含)-180 天 | 6.43 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 5 | 180 天(含)-397 天(含) | 25.72 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 合计 | | 67.21 | - |

7.4 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 | 19,972,670.39 | 4.28 |
| 3 | 金融债券 | 61,155,558.87 | 13.10 |
| | 其中：政策性金融债 | 61,155,558.87 | 13.10 |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | 150,046,808.00 | 32.15 |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 其他 | - | - |
| 8 | 合计 | 231,175,037.26 | 49.53 |
| 9 | 剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券 | 61,155,558.87 | 13.10 |

注：上表中，债券的成本包括债券面值和折溢价。

7.5 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 | 090205 | 09 国开 05 | 500,000 | 51,067,621.44 | 10.94 |
| 2 | 1181220 | 11 中铝业 CP02 | 300,000 | 30,003,260.63 | 6.43 |
| 3 | 1181175 | 11 闽交运 CP01 | 300,000 | 30,000,389.40 | 6.43 |
| 4 | 1181174 | 11 苏京沪 CP01 | 200,000 | 20,051,955.20 | 4.30 |
| 5 | 1181135 | 11 恒逸 CP02 | 200,000 | 20,006,310.11 | 4.29 |
| 6 | 1181237 | 11 步步高 CP01 | 200,000 | 20,000,675.29 | 4.29 |
| 7 | 1181248 | 11 三峡 CP01 | 200,000 | 19,982,098.91 | 4.28 |
| 8 | 1101023 | 11 央行票据 23 | 200,000 | 19,972,670.39 | 4.28 |
| 9 | 100209 | 10 国开 09 | 100,000 | 10,087,937.43 | 2.16 |
| 10 | 1181023 | 11 龙盛 CP01 | 100,000 | 10,002,118.46 | 2.14 |

7.6 “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 | 11 |
| 报告期内偏离度的最高值 | 0.2144% |
| 报告期内偏离度的最低值 | -0.4036% |
| 报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值 | 0.1060% |

7.7 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。

7.8 投资组合报告附注

7.8.1 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。

7.8.2 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 | 2011 年 6 月 13 日 | 20.20 | 基金规模波动导致超标 | 到 2011 年 6 月 24 日调整完毕 |
| 2 | 2011 年 6 月 14 日 | 21.00 | 基金规模波动导致超标 | 到 2011 年 6 月 24 日调整完毕 |
| 3 | 2011 年 6 月 15 日 | 21.64 | 基金规模波动导致超标 | 到 2011 年 6 月 24 日调整完毕 |
| 4 | 2011 年 6 月 16 日 | 22.73 | 基金规模波动导致超标 | 到 2011 年 6 月 24 日调整完毕 |
| 5 | 2011 年 6 月 17 日 | 23.53 | 基金规模波动导致超标 | 到 2011 年 6 月 24 日调整完毕 |
| 6 | 2011 年 6 月 18 日 | 23.53 | 基金规模波动导致超标 | 到 2011 年 6 月 24 日调整完毕 |
| 7 | 2011 年 6 月 19 日 | 23.52 | 基金规模波动导致超标 | 到 2011 年 6 月 24 日调整完毕 |
| 8 | 2011 年 6 月 20 日 | 23.50 | 基金规模波动导致超标 | 到 2011 年 6 月 24 日调整完毕 |
| 9 | 2011 年 6 月 21 日 | 24.68 | 基金规模波动导致超标 | 到 2011 年 6 月 24 日调整完毕 |
| 10 | 2011 年 6 月 22 日 | 26.14 | 基金规模波动导致超标 | 到 2011 年 6 月 24 日调整完毕 |
| 11 | 2011 年 6 月 23 日 | 23.81 | 基金规模波动导致超标 | 到 2011 年 6 月 24 日调整完毕 |

7.8.3 声明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或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。本报告期内无需说明的证券投资决策程序。

7.8.4 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 | 1,624,183.96 |
| 4 | 应收申购款 | 152,778,250.00 |
| 5 | 其他应收款 | 27,356.75 |
| 6 | 待摊费用 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 154,429,790.71 |

7.8.5 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 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 |
| 13,015 | 35,859.04 | 277,671,047.17 | 59.50% | 189,034,373.95 | 40.50% |

8.2 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 | 114,277.25 | 0.02% |

§ 9 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 | 739,734,559.90 |
| 本报告期基金总申购份额 | 2,845,161,794.70 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 3,118,190,933.48 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 466,705,421.12 |

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期末未召开基金份额持有人大会。

10.2 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

10.2.1 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 2011 年 5 月 14 日发布公告，经长盛基金管理有限公司第五届董事会第十五次会议审议通过，并报中国证监会审核批准，聘任公司副总经理周兵先生担任公司总经理，陈礼华先生不再担任公司总经理。

10.2.2 基金经理变动情况

本基金管理人于 2011 年 2 月 16 日发布公告，经公司第五届董事会第十一次会议审议批准，同意梁婷担任本基金基金经理，刘静不再担任本基金基金经理。

10.2.3 本基金托管人的基金托管部门重大人事变动情况

本基金托管人的基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金资产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略不曾改变。

10.5 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。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

基金管理人、托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.7 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 | 485,000,000.00 | 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：报告期内未有交易单元变更。

10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

本基金报告期内无偏离度绝对值超过 0.5%的情况。