

长盛货币市场基金 2017 年年度报告 摘要

2017 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：2018 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 2018 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（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告。

本报告期自 2017 年 01 月 01 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	
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	10,328,973,992.27 份	
下属分级基金的基金简称:	长盛货币 A	长盛货币 B
下属分级基金的交易代码:	080011	005230
报告期末下属分级基金的份额总额	4,009,098,063.63 份	6,319,875,928.64 份

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。本基金的核心投资策略由四部分组成：短期市场利率预期策略、期限机构的滚动配置策略、投资组合优化策略、无风险套利操作策略。
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	曾麓燕
	联系电话	010-82019988	021-52629999-212040
	电子邮箱	yejs@csfunds.com.cn	015292@cib.com.cn
客户服务电话		400-888-2666、010-62350088	95561
传真		010-82255988	021-62535823

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	2017 年		2016 年	2015 年
	长盛货币 A	长盛货币 B	长盛货币 A	长盛货币 A
本期已实现收益	65,773,336.16	42,730,657.48	68,808,111.33	107,449,749.35
本期利润	65,773,336.16	42,730,657.48	68,808,111.33	107,449,749.35
本期净值收益率	3.7401%	1.0233%	2.6832%	4.1892%
3.1.2 期末数据和指标	2017 年末		2016 年末	2015 年末
	长盛货币 A	长盛货币 B	长盛货币 A	长盛货币 A
期末基金资产净值	4,009,098,063.63	6,319,875,928.64	6,176,323,704.21	5,160,292,765.28
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000

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、本基金于 2017 年 10 月 10 日起新增 B 份额，原有基金份额全部转为 A 类基金份额。

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

长盛货币 A

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	1.0604%	0.0006%	0.3781%	0.0000%	0.6823%	0.0006%
过去六个月	2.0439%	0.0020%	0.7562%	0.0000%	1.2877%	0.0020%
过去一年	3.7401%	0.0035%	1.5000%	0.0000%	2.2401%	0.0035%
过去三年	10.9862%	0.0091%	5.1205%	0.0011%	5.8657%	0.0080%
过去五年	20.8438%	0.0086%	11.0932%	0.0019%	9.7506%	0.0067%
自基金合同生效起至今	46.6567%	0.0074%	30.7086%	0.0021%	15.9481%	0.0053%

长盛货币 B

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	1.0233%	0.0004%	0.3411%	0.0000%	0.6822%	0.0004%
自基金合同 生效起至今	1.0233%	0.0004%	0.3411%	0.0000%	0.6822%	0.0004%

注：1、本基金业绩比较基准的构建及再平衡过程：

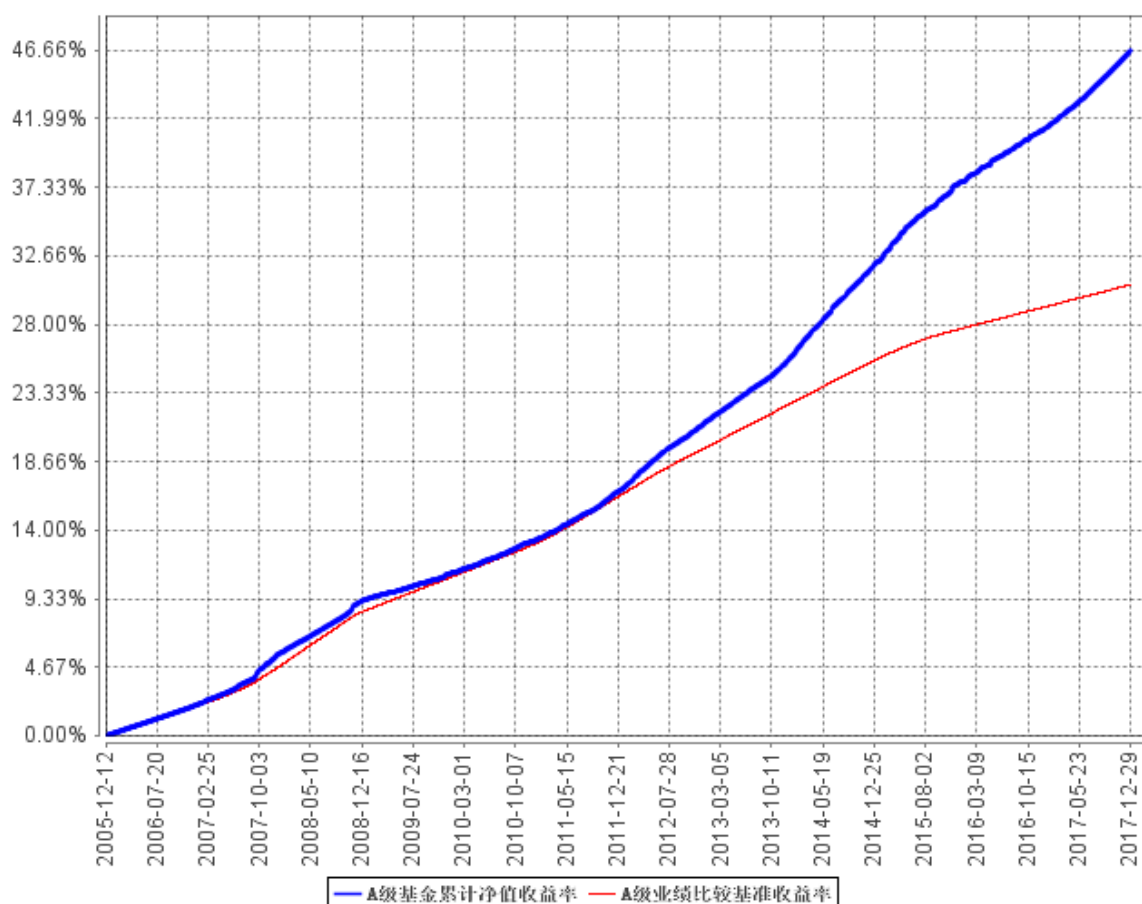
本基金业绩比较基准为银行一年期定期存款利率(税后)。本基金为储蓄存款的良好投资替代工具，所以投资业绩基准确定为：一年期定期存款利率（税后）。本比较基准与货币市场工具的收益率有一定的相关性，能够反映货币市场的收益率水平。

本基金的业绩比较基准将根据央行调息而调整。

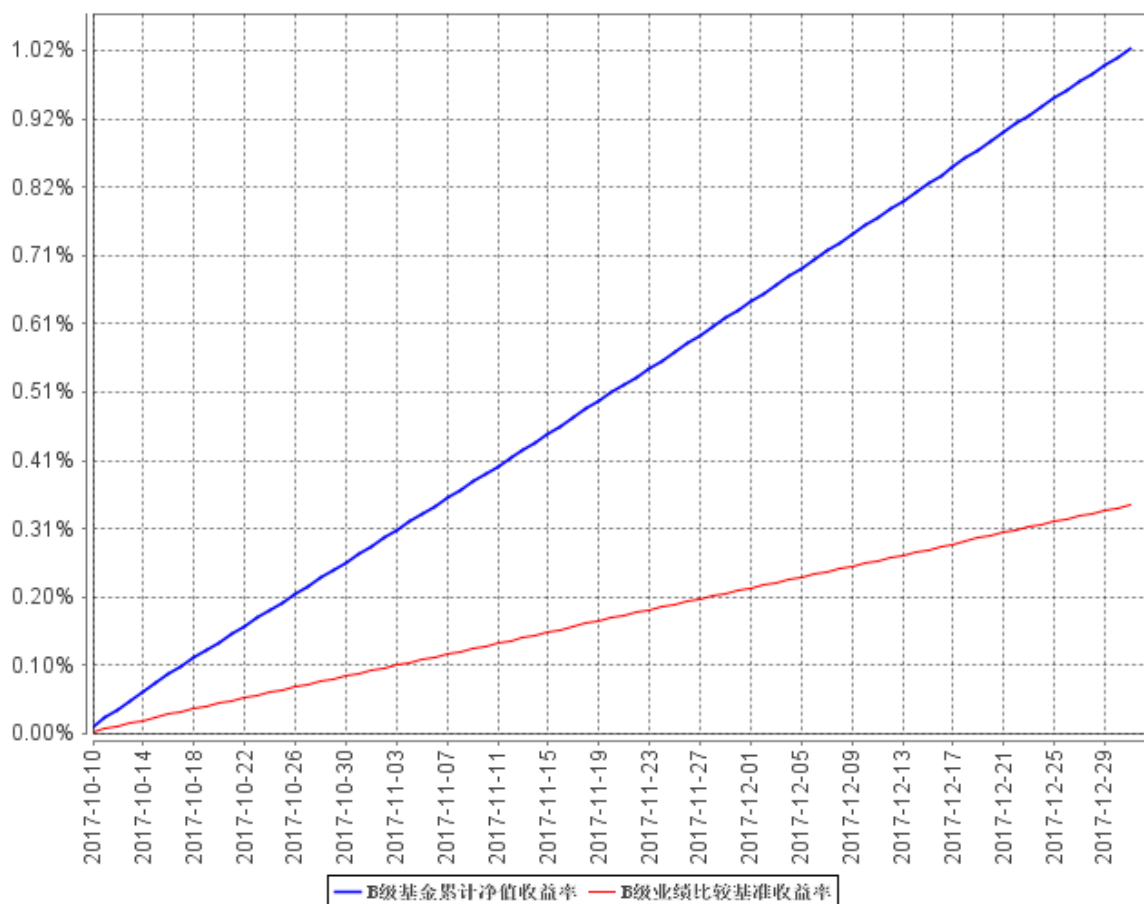
2、长盛货币 B 级为 2017 年 10 月 10 日新增份额，过去三个月的数据仅为 2017 年 10 月 10 日至 2017 年 12 月 31 日的数据。

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

A 级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

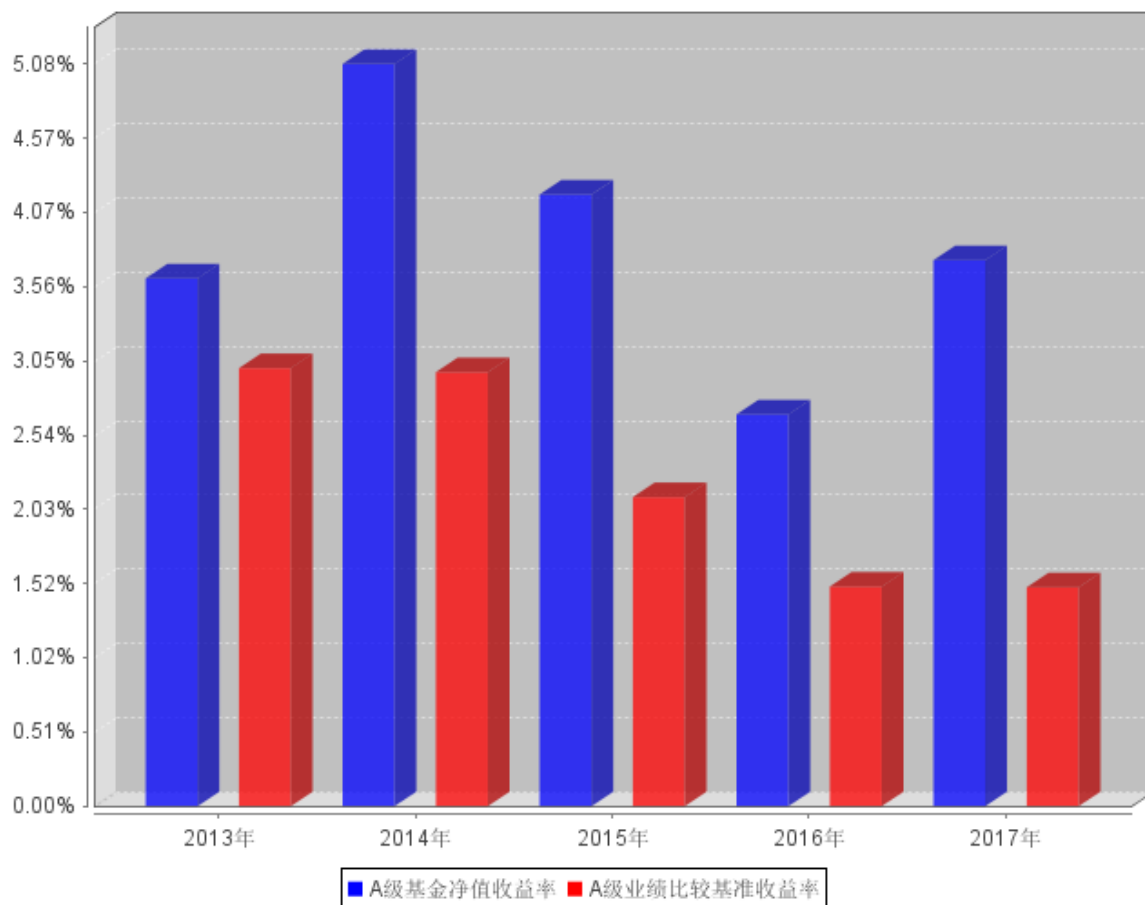


B级基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

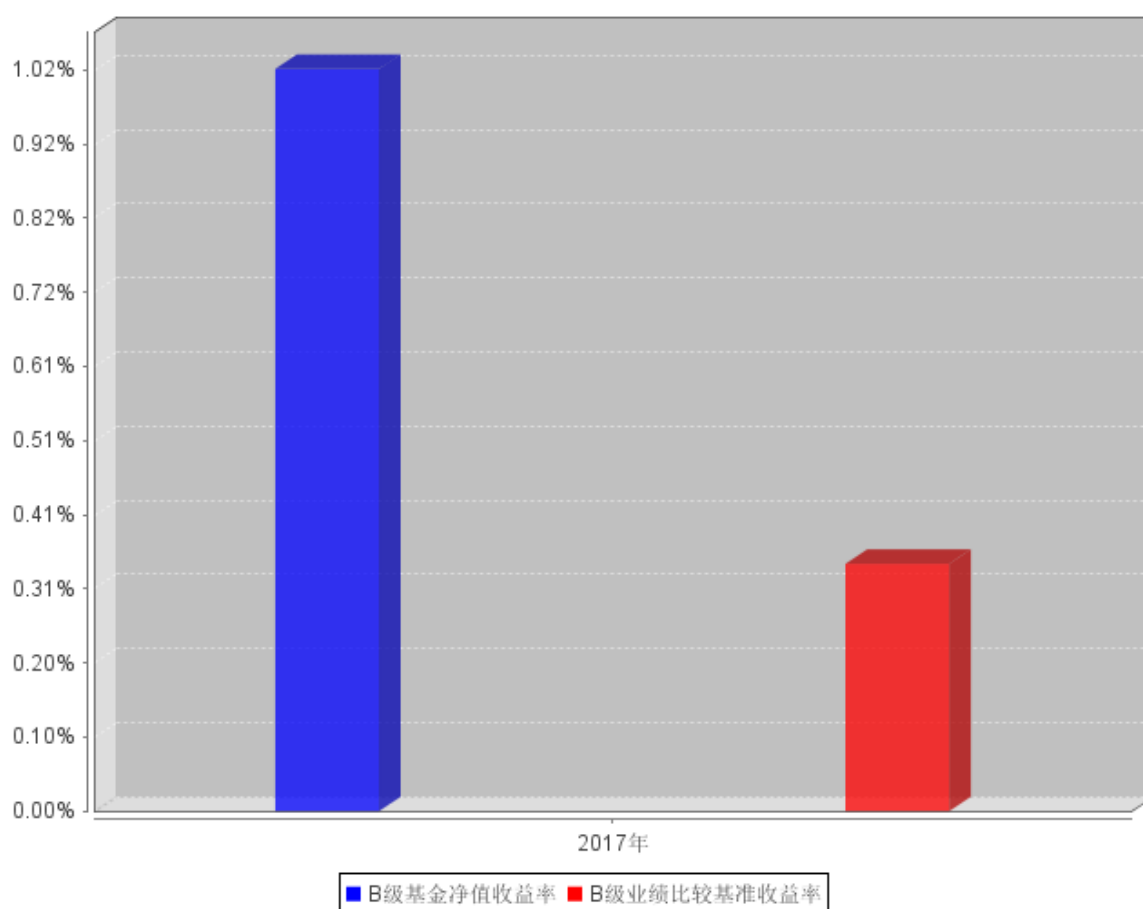


3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

A级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



B级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

长盛货币 A					
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
2017	65,773,336.16	-	-	65,773,336.16	
2016	68,808,111.33	-	-	68,808,111.33	
2015	107,449,749.35	-	-	107,449,749.35	
合计	242,031,196.84	-	-	242,031,196.84	

单位：人民币元

长盛货币 B					
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
2017	42,730,657.48	-	-	42,730,657.48	
合计	42,730,657.48	-	-	42,730,657.48	

§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

本基金管理人为长盛基金管理有限公司（以下简称公司），成立于 1999 年 3 月 26 日，是国内最早成立的十家基金管理公司之一。公司注册资本为人民币 18900 万元。公司注册地在深圳，总部设在北京，并在北京、上海、成都设有分公司，在香港、北京分别设有子公司。目前，公司股东及其出资比例为：国元证券股份有限公司占注册资本的 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%。公司获得首批全国社保基金、合格境内机构投资者和特定客户资产管理业务资格。截至 2017 年 12 月 31 日，基金管理人共管理七十四只开放式基金，并管理多个全国社保基金组合和专户产品。公司同时兼任境外 QFII 基金和专户理财产品的投资顾问。

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		
段鹏	本基金基金经理，长盛年年收益定期开放债券型证券投资基金基金经理，长盛盛和纯债债券型证券投资基金基金经理，长盛盛景纯债债券型证券投资基金基金经理，长盛盛裕纯债债券型证券投资基金基金经理，长盛盛通纯债债券型证券投资基金基金经理。	2014 年 4 月 10 日	-	10 年	段鹏先生，1982 年 12 月出生。中央财经大学经济学硕士。曾在中信银行股份有限公司从事人民币货币市场交易、债券投资及流动性管理等工作。2013 年 12 月加入长盛基金管理有限公司。

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。

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、本基金的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 公平交易制度和控制方法

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，包括公募基金、社保组合、特定客户资产管理组合等，切实防范利益输送，保护投资者的合法权益。具体如下：

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，各投资组合经理在投资决策委员会的授权范围内，独立完成投资组合的管理工作。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，场内交易，强制开启恒生交易系统公平交易程序；场外交易，严格遵守相关工作流程，保证交易执行的公平性。

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。

4.3.2 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。

4.3.3 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，未发现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。

本报告期内，本基金未发生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

1、报告期内行情回顾

2017 年，在出口拉动、地产、基建投资等推动下，国内经济实际同比增速达到 6.9%，超出市场整体预期，实现近年来经济增速的首次反弹，体现出了较强的韧性。

债券市场全年持续调整，在经济基本面、资金面和金融监管政策等因素综合影响下，债券收益率整体上行明显，其中，国债收益率上行幅度相对较小，其他类型债券各期限品种上行幅度较大，存单和短融等短端品种收益率较 2016 年低点上行达 200bp，收益率曲线形态呈现扁平化。

2、报告期内本基金投资策略分析

在报告期内，本基金注意把握资产配置节奏，保持组合流动性，确保关键时点流动性安全，同时优化组合结构，合理调整协存、存单和债券配置比例，努力提高组合整体收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2017 年，长盛货币 A 的基金份额净值收益率为 3.7401%，同期业绩比较基准收益率为 1.5000%；本报告期长盛货币 B 的基金份额净值收益率为 1.0233%，同期业绩比较基准收益率为 0.3411%。（长盛货币 B 的本报告期自 2017 年 10 月 10 日至 2017 年 12 月 31 日）

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2018 年，预计国内宏观经济韧性较强，消费对 GDP 增长贡献率逐步提升，棚户区改造、住房租赁带动地产投资继续平稳，基建投资仍将发挥托底作用，海外复苏带动出口，预计经济增速整体平稳，下行风险不大。通胀方面，猪肉价格回升，原油价格走高，其它非食品项继续上行，通胀压力有所增加。在基本面支持下，金融去杠杆和防风险仍将是全年的政策主基调，货币政策难于放松。

债券市场方面，在基本面和政策等多重因素影响下，预计收益率将维持高位震荡，市场收益率趋势下行受到制约，将合理控制组合久期，把握有利配置时机，继续以高等级存单、短融和存款为配置重点。

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（担任估值工作小组组长）、公司督察长（担任估值工作小组副组长）、公司相关投资、研究部门分管领导、公司运营部分管领导、相关研究部门、相关投资部门、监察稽核部、风险管理部、信息技术部及业务运营部总监或指定人员组成的估值工作小组，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。

本基金管理人已分别与中央国债登记结算有限责任公司和中证指数有限公司签署服务协议，由其分别按约定提供在银行间同业市场交易的债券品种和在交易所市场交易或挂牌的部分债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金基金合同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，2017 年度分配利润 108,503,993.64 元。其中：A 类别份额分配利润 65,773,336.16 元，B 类别份额分配利润 42,730,657.48 元。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内无基金持有人数或基金资产净值预警说明。

§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基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，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(特殊普通合伙)注册会计师薛竞、顾卓毅 2018 年 3 月 27 日对本基金 2017 年 12 月 31 日的资产负债表、2017 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(2018)第 22110 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：2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资 产：		
银行存款	2,899,605,018.70	1,852,092,563.46
结算备付金	-	-
存出保证金	-	-
交易性金融资产	7,269,799,564.79	1,893,566,495.09
其中：股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	7,269,799,564.79	1,893,566,495.09
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	339,519,349.28	2,212,786,119.17
应收证券清算款	-	-
应收利息	39,899,508.74	25,559,504.90
应收股利	-	-
应收申购款	87,380,254.56	198,026,532.27
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	27,356.75
资产总计	10,636,203,696.07	6,182,058,571.64
负债和所有者权益	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 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	300,575,649.71	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	11,932.14	37,404.95
应付管理人报酬	1,268,018.03	865,161.70
应付托管费	422,672.67	262,170.22
应付销售服务费	777,302.56	655,425.54

应付交易费用	149,100.89	65,665.97
应交税费	1,175,800.00	1,175,800.00
应付利息	85,988.64	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	2,763,239.16	2,673,239.05
负债合计	307,229,703.80	5,734,867.43
所有者权益：		
实收基金	10,328,973,992.27	6,176,323,704.21
未分配利润	-	-
所有者权益合计	10,328,973,992.27	6,176,323,704.21
负债和所有者权益总计	10,636,203,696.07	6,182,058,571.64

注：报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额总额 10,328,973,992.27 份，其中 A 类基金份额总额 4,009,098,063.63 份，基金份额净值 1.00 元；B 类基金份额总额 6,319,875,928.64 份，基金份额净值 1.00 元。

7.2 利润表

会计主体：长盛货币市场基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期	上年度可比期间
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
一、收入	132,130,121.59	95,159,950.82
1.利息收入	131,574,808.09	89,730,155.83
其中：存款利息收入	43,169,266.55	24,657,195.41
债券利息收入	79,496,983.93	59,316,756.93
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	8,908,557.61	5,756,203.49
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	555,313.50	4,824,033.99
其中：股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	555,313.50	4,824,033.99
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-

5.其他收入（损失以“-”号填列）	-	605,761.00
减：二、费用	23,626,127.95	26,351,839.49
1. 管理人报酬	6,551,407.47	8,878,385.53
2. 托管费	2,048,120.57	2,690,419.83
3. 销售服务费	4,603,064.81	6,726,049.67
4. 交易费用	-	-
5. 利息支出	9,898,679.92	7,576,264.49
其中：卖出回购金融资产支出	9,898,679.92	7,576,264.49
6. 其他费用	524,855.18	480,719.97
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	108,503,993.64	68,808,111.33
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	108,503,993.64	68,808,111.33

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：2017年1月1日至2017年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017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）	6,176,323,704.21	-	6,176,323,704.21
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	108,503,993.64	108,503,993.64
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）	4,152,650,288.06	-	4,152,650,288.06
其中：1. 基金申购款	25,264,089,998.65	-	25,264,089,998.65
2. 基金赎回款	-21,111,439,710.59	-	-21,111,439,710.59
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）	-	-108,503,993.64	-108,503,993.64
五、期末所有者权益（基金净值）	10,328,973,992.27	-	10,328,973,992.27
项目	上年度可比期间 2016年1月1日至2016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)	5,160,292,765.28	-	5,160,292,765.28
二、本期经营活动产生的 基金净值变动数(本 期利润)	-	68,808,111.33	68,808,111.33
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)	1,016,030,938.93	-	1,016,030,938.93
其中:1.基金申购款	16,313,852,253.94	-	16,313,852,253.94
2.基金赎回款	-15,297,821,315.01	-	-15,297,821,315.01
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)	-	-68,808,111.33	-68,808,111.33
五、期末所有者权益 (基金净值)	6,176,323,704.21	-	6,176,323,704.21

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:

林培富	刁俊东	龚珉
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。

根据长盛基金管理有限公司2017年10月10日发布的《长盛货币市场基金基金份额持有人

大会表决结果暨决议生效的公告》，本基金增设 B 类基金份额，原有基金份额全部转为 A 类基金份额。

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；期限在 1 年以内(含 1 年)的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单；剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券；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银行一年期定期存款利率(税后)。

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 2018 年 3 月 27 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 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(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(以下简称“中国基金业协会”)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、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2017 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 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号《财政部、国家税务总局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》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前，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。对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入，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，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。

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（“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、基金销售机构
国元证券股份有限公司（“国元证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
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	基金管理人的股东
长盛基金(香港)有限公司	基金管理人的全资子公司
长盛创富资产管理有限公司（“长盛创富”）	基金管理人的全资子公司

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

注：无。

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 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	6,551,407.47	8,878,385.53
其中：支付销售机构的客户维护费	1,755,131.16	1,767,002.75

注：自 2005 年 12 月 12 日至 2017 年 10 月 9 日，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。

根据基金份额持有人大会表决通过的《关于修改长盛货币市场基金基金合同有关事项的议案》，自 2017 年 10 月 10 日起，支付基金管理人长盛基金的管理人报酬按前一日基金资产净值

0.15% 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：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.15% / 当年天数。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	2,048,120.57	2,690,419.83

注：自 2005 年 12 月 12 日至 2017 年 10 月 9 日，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：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.1% / 当年天数。

根据基金份额持有人大会表决通过的《关于修改长盛货币市场基金基金合同有关事项的议案》，自 2017 年 10 月 10 日起，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 0.05% 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 × 0.05% / 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 2017年1月1日至2017年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	长盛货币 A	长盛货币 B	合计
长盛基金	1,443,510.46	62,556.84	1,506,067.30
兴业银行	34,561.70	-	34,561.70
国元证券	3,765.91	48.25	3,814.16
合计	1,481,838.07	62,605.09	1,544,443.16
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	长盛货币 A	长盛货币 B	合计
长盛基金	2,099,928.92	-	2,099,928.92
兴业银行	49,574.94	-	49,574.94
国元证券	437,659.47	-	437,659.47
合计	2,587,163.33	-	2,587,163.33

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的约定年费率计提，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。A类基金份额和B类基金份额约定的销售服务费年费率分别为0.25%和0.01%。销售服务费的计算公式为：

对应级别日销售服务费 = 前一日对应级别基金资产净值 × 约定年费率 / 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

银行间市场交易的各关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年12月31日					
	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	-	29,917,049.51	-	-	307,200,000.00	25,602.92
银行间市场交易的各关联方名称	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日					
	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	259,082,731.70	52,195,859.84	-	-	-	-

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 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	
	长盛货币 A	长盛货币 B
基金合同生效日（ 2005 年 12 月 12 日）持有的 基金份额	-	-
期初持有的基金份额	-	-
期间申购/买入总份额	-	161,734,483.88
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	-	161,734,483.88
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	-	2.5591%

项目	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	
	长盛货币 A	长盛货币 B
基金合同生效日（ 2005 年 12 月 12 日）持有的 基金份额	-	-
期初持有的基金份额	171,407,974.87	-
期间申购/买入总份额	54,914,168.02	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	226,322,142.89	-
期末持有的基金份额	-	-
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	-	-

注：基金管理人持有本基金基金份额的交易费用按市场公开的交易费率计算并支付。

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

长盛货币 B

份额单位：份

关联方名称	本期末 2017 年 12 月 31 日		上年度末 2016 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
长盛创富	7,060,757.09	0.0684%	-	-

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 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
兴业银行	31,605,018.70	4,655,881.49	476,092,563.46	6,337,392.95

注：1. 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/约定利率计息。

2. 于 2017 年 12 月 31 日，本基金持有基金托管人兴业银行同业存单 200,000,000.00 元(2016 年 12 月 31 日：无)。

7.4.8.6 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 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 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：份）	总金额
兴业银行	111710648	17 兴业银行 CD648	簿记建档集中配售	1,000,000	98,782,100.00
兴业银行	111710464	17 兴业银行 CD464	簿记建档集中配售	500,000	49,430,650.00
上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 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：份）	总金额
兴业银行	111610375	16 兴业 CD375	簿记建档集中配售	1,500,000	148,930,200.00
兴业银行	111610175	16 兴业 CD175	簿记建档集中配售	1,000,000	99,759,500.00
兴业银行	111610022	16 兴业 CD022	簿记建档集中配售	500,000	49,654,300.00

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.9 期末（2017 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**

注：无。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无。

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**

截至本报告期末 2017 年 12 月 31 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 300,575,649.71 元，是以如下债券作为抵押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
179950	17 贴现国 债 50	2018 年 1 月 2 日	99.73	300,000	29,919,941.50
179955	17 贴现国 债 55	2018 年 1 月 2 日	99.40	500,000	49,701,046.73
110211	11 国开 11	2018 年 1 月 2 日	100.03	800,000	80,027,430.28
170203	17 国开 03	2018 年 1 月 2 日	99.94	731,000	73,055,791.33
170204	17 国开 04	2018 年 1 月 2 日	99.84	800,000	79,869,167.01
合计				3,131,000	312,573,376.85

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

无。

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) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2017 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第二层次的余额为 7,269,799,564.79 元，无属于第一或第三层次的余额(2016 年 12 月 31 日：第二层次的余额为 1,893,566,495.09 元，无属于第一或第三层次的余额)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2017 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2016 年 12 月 31 日：同)。

(d) 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。

(2) 增值税

根据财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布的财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。

根据财政部、国家税务总局于 2017 年 6 月 30 日颁布的财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

此外，财政部、国家税务总局于 2017 年 12 月 25 日颁布的财税[2017]90 号《关于租入固定资产进行税额抵扣等增值税政策的通知》对资管产品管理人自 2018 年 1 月 1 日起运营资管产品

提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务的销售额确定做出规定。

上述税收政策对本基金截至 2017 年 12 月 31 日止的财务状况和经营成果无影响。

(3)除公允价值和增值税外，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	7,269,799,564.79	68.35
	其中: 债券	7,269,799,564.79	68.35
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	339,519,349.28	3.19
	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	2,899,605,018.70	27.26
4	其他各项资产	127,279,763.30	1.20
5	合计	10,636,203,696.07	100.00

注: 本报告期内, 根据流动性管理的需要, 本基金提前支取了部分可提前支取且没有利息损失的存款。

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	13.47	
	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	300,575,649.71	2.91
	其中: 买断式回购融资	-	-

注: 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基金资产净值的 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
1	2017 年 2 月 9 日	20.70	基金规模变动	1
2	2017 年 3 月 9 日	22.53	基金规模变动	7

3	2017 年 3 月 10 日	22.86	基金规模变动	6
4	2017 年 3 月 13 日	23.48	基金规模变动	5
5	2017 年 3 月 14 日	23.14	基金规模变动	4
6	2017 年 3 月 15 日	28.87	基金规模变动	3
7	2017 年 3 月 16 日	23.78	基金规模变动	2
8	2017 年 3 月 17 日	25.32	基金规模变动	1
9	2017 年 9 月 5 日	24.90	基金规模变动	2
10	2017 年 9 月 6 日	30.86	基金规模变动	1
11	2017 年 10 月 11 日	22.81	基金规模变动	4
12	2017 年 10 月 12 日	27.62	基金规模变动	3
13	2017 年 10 月 13 日	31.88	基金规模变动	2
14	2017 年 10 月 16 日	27.00	基金规模变动	1

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	52
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	85
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	31

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

注：报告期内无投资组合平均剩余存续期超过 120 天情况。

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	34.43	2.91
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	29.71	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	28.18	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—120 天	0.96	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-

5	120 天(含)—397 天(含)	8.46	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		101.74	2.91

8.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

注：报告期内无投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况。

8.5 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	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	209,223,254.57	2.03
2	央行票据	-	-
3	金融债券	729,743,584.61	7.07
	其中：政策性金融债	729,743,584.61	7.07
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	200,124,083.42	1.94
6	中期票据	-	-
7	同业存单	6,130,708,642.19	59.35
8	其他	-	-
9	合计	7,269,799,564.79	70.38
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

注：上表中，债券的成本包括债券面值和折溢价。

8.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序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	111713085	17 浙商银行 CD085	2,500,000	249,148,779.93	2.41
2	170203	17 国开 03	2,400,000	239,854,855.26	2.32
3	111709483	17 浦发银行 CD483	2,400,000	237,927,214.14	2.30
4	111713076	17 浙商银行 CD076	2,000,000	199,545,998.35	1.93
5	111717251	17 光大银行 CD251	2,000,000	199,397,420.59	1.93
6	111718287	17 华夏银行 CD287	2,000,000	199,191,121.79	1.93

7	111715387	17 民生银行 CD387	2,000,000	199,020,674.41	1.93
8	111717270	17 光大银行 CD270	2,000,000	198,987,206.10	1.93
9	111709442	17 浦发银行 CD442	2,000,000	198,799,082.84	1.92
10	111711392	17 平安银行 CD392	2,000,000	198,229,874.40	1.92

8.7 “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	-
报告期内偏离度的最高值	0.2419%
报告期内偏离度的最低值	-0.0374%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1156%

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

注：报告期内无负偏离度的绝对值达到 0.25%情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

注：报告期内无正偏离度的绝对值达到 0.5%情况。

8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1

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。

8.9.2

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。

8.9.3 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	39,899,508.74
4	应收申购款	87,380,254.56
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	127,279,763.30

8.9.4 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。

§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

份额级别	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
长盛货币 A	45,774	87,584.61	68,896,991.14	1.72%	3,940,201,072.49	98.28%
长盛货币 B	283	22,331,717.06	3,968,698,926.19	62.80%	2,351,177,002.45	37.20%
合计	46,057	224,265.02	4,037,595,917.33	39.09%	6,291,378,074.94	60.91%

注：对于分级基金，比例的分母采用各自级别的份额；对于合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数。

9.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

序号	持有人类别	持有份额（份）	占总份额比例
1	银行类机构	500,000,000.00	4.84%
2	银行类机构	300,000,000.00	2.90%
3	保险类机构	251,315,633.65	2.43%
4	保险类机构	200,530,282.66	1.94%
5	券商类机构	200,000,000.00	1.94%
6	其他机构	200,000,000.00	1.94%
7	银行类机构	200,000,000.00	1.94%
8	其他机构	195,470,896.57	1.89%
9	基金类机构	161,147,409.85	1.56%
10	基金类机构	133,000,000.00	1.29%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	长盛货币 A	17,179,546.35	0.4299%
	长盛货币 B	5,183,047.42	0.0822%
	合计	22,362,593.77	0.2165%

注：对于分级基金，比例的分母采用各自级别的份额；对于合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数。

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	长盛货币 A	>100
	长盛货币 B	0
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	长盛货币 A	0
	长盛货币 B	0
	合计	0

§10 开放式基金份额变动

单位：份

	长盛货币 A	长盛货币 B
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	6,176,323,704.21	-
本报告期基金总申购份额	13,770,059,800.81	11,494,030,197.84
减:本报告期基金总赎回份额	15,937,285,441.39	5,174,154,269.20
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	4,009,098,063.63	6,319,875,928.64

注：申购份额含红利再投和因份额升降级导致的强制调增份额，赎回份额含因份额升降级导致的强制调减份额。

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

长盛货币市场基金以通讯方式召开基金份额持有人大会，大会表决投票时间为 2017 年 9 月 7 日至 2017 年 10 月 8 日，会议审议了《关于修改长盛货币市场基金基金合同有关事项的议案》（以下简称“本次会议议案”）。依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《长盛货币市场基金基金合同》、《长盛货币市场基金关于以通讯方式召开基金份额持有人大会的公告》等规定，本次基金份额持有人大会于 2017 年 10 月 9 日表决通过本次会议议案，同意长盛货币市场基金增设 B 类份额、调整基金费率，允许基金管理人按照相关法律法规及中国证监会的有关规定对基金合同进行修订，本次基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效。

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

由于任期届满，高新不再担任公司董事长，周放生不再担任公司独立董事。根据公司 2016 年度股东会议决议，选举林培富为公司董事，选举张良庆为公司独立董事；根据公司第七届董事会第一次会议决议，选举周兵担任公司董事长；根据公司第七届董事会第二次会议决议，聘任林培富担任公司总经理，周兵不再担任公司总经理，同时林培富不再担任公司副总经理。以上公司高级管理人员变更，已于 2017 年 3 月 30 日向中国证监会北京监管局报备。

根据公司 2017 年第一次临时股东大会决议，同意张良庆先生不再担任公司第七届董事会独立董事职务，选举朱慈蕴女士担任公司第七届董事会独立董事。以上独立董事人员变更，已于 2018 年 1 月 9 日向中国证监会北京监管局报备。

11.2.2 基金经理的变动情况

本报告期本基金基金经理未曾变动。

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无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、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

本报告期内本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（特殊普通合伙），本报告期内本基金未更换会计师事务所，本报告期应支付给该会计师事务所的报酬 90,000.00 元，已连续提供审计服务 12 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

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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信建投	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中信建投	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-

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) 财力雄厚，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

注：本报告期本基金无偏离度绝对值超过 0.5%的情况。

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注：本基金报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期内无影响投资者决策的其他重要信息。

长盛基金管理有限公司

2018 年 3 月 31 日