长盛货币市场基金
2018 年第 2 季度报告

2018 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

报告送出日期：2018 年 7 月 20 日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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 7 月 19 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2018 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§2 基金产品概况

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	
报告期末基金份额总额	6,412,808,617.56 份	
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	本基金将根据宏观经济、微观经济运行状况，货币政策和财政政策执行情况，以及货币市场、证券市场运行状况制定投资策略。采用积极的投资策略，通过动态调整优化投资组合，追求当期收益最大化。在动态调整过程中，基金管理小组将全面考虑收益目标、交易成本、市场流动性等特征，实现收益与风险的平衡。	
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。	
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	
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	941,708,509.57 份	5,471,100,107.99 份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（ 2018 年 4 月 1 日 － 2018 年 6 月 30 日 ）	
	长盛货币 A	长盛货币 B
1. 本期已实现收益	10,534,725.22	49,414,920.60
2. 本期利润	10,534,725.22	49,414,920.60
3. 期末基金资产净值	941,708,509.57	5,471,100,107.99

注：1、所列数据截止到 2018 年 6 月 30 日。

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 本报告期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

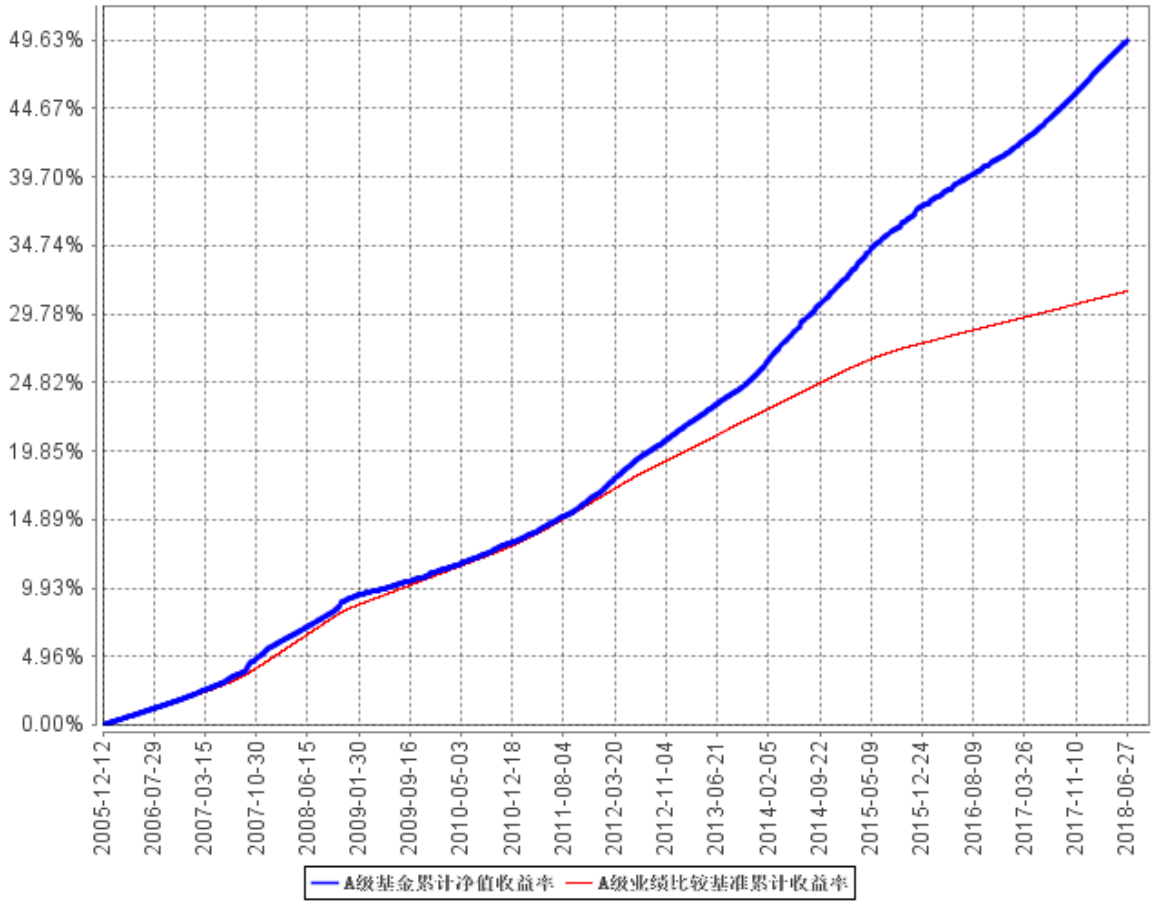
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	0.9687%	0.0011%	0.3740%	0.0000%	0.5947%	0.0011%

长盛货币 B

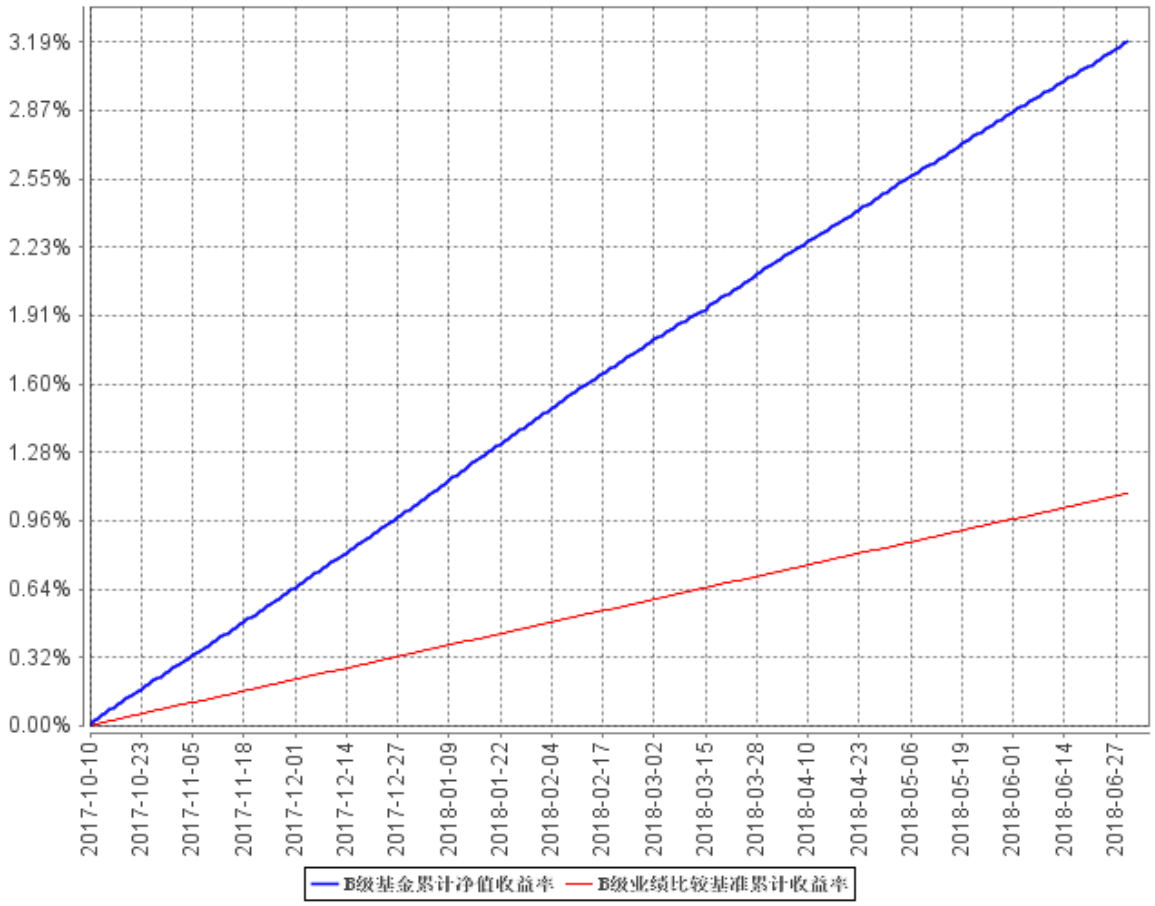
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	1.0293%	0.0011%	0.3740%	0.0000%	0.6553%	0.0011%

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



§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		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，长盛添利宝货币市场基金基金经理，长盛积极配置债券型证券投资基金基金经理。	2014 年 4 月 10 日	-	11 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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司严格执行《公司公平交易细则》各项规定，在研究、投资授权与决策、交易执行等各个环节，公平对待旗下所有投资组合，包括公募基金、社保组合、特定客户资产管理组合等。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。

公司对过去 4 个季度的同向交易行为进行数量分析，计算溢价率、贡献率、占优比等指标，使用双边 90%置信水平对 1 日、3 日、5 日的交易片段进行 T 检验，未发现违反公平交易及利益输送的行为。

4.3.2 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，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

1、报告期内行情回顾

二季度，国内经济基本面缓慢回落；通胀低位运行；受中美贸易摩擦影响，出口转弱初现端倪，经济下行压力有所加大，同时中央政治局会议要求尽快推进结构性去杠杆，在此背景下，货币政策虽然仍维持稳健中性基调，但出现连续降准，微调信号明显。

二季度债券收益率震荡下行，在降准预期引导下，4 月份前半月市场延续前期回暖走势，随着 4 月中旬降准落地，由于各种因素，资金面反而出现超预期紧张，叠加经济基本面不弱、美国利率创新高等，市场出现明显回调，6 月以来，在宽松预期的引导下，市场重新回暖，随着降准再次实施，市场收益率明显下行，短端表现十分明显，季末资金大体平稳，收益率迅速下行。

2、报告期内本基金投资策略分析

在报告期内，本基金始终控制资产配置节奏，保持组合流动性，在满足法规要求的前提下，在收益高企阶段尽可能提高组合久期，努力提高组合整体收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期长盛货币 A 的基金份额净值收益率为 0.9687%，本报告期长盛货币 B 的基金份额净值收益率为 1.0293%，同期业绩比较基准收益率为 0.3740%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	固定收益投资	1,515,641,243.11	21.72
	其中：债券	1,515,641,243.11	21.72
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	1,546,137,479.21	22.16
	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	3,558,672,858.25	51.01
4	其他资产	356,406,481.13	5.11
5	合计	6,976,858,061.70	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

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	1.99	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额（元）	占基金资产净值的比例（%）
2	报告期末债券回购融资余额	558,498,816.74	8.71
	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基金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

注：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%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 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	54
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	58
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	35

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。

5.3.2 报告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	37.99	8.71
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)-60 天	15.76	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)-90 天	40.02	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)-120 天	2.34	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)-397 天（含）	7.13	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		103.24	8.71

5.4 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。

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	40,016,521.44	0.62
2	央行票据	-	-
3	金融债券	370,118,999.73	5.77
	其中：政策性金融债	370,118,999.73	5.77
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	439,830,944.55	6.86
6	中期票据	-	-
7	同业存单	665,674,777.39	10.38
8	其他	-	-
9	合计	1,515,641,243.11	23.63
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

5.6 报告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

序号	债券代码	债券名称	债券数量（张）	摊余成本(元)	占基金资产净值比例（%）
1	170410	17 农发 10	1,300,000	130,047,750.07	2.03
2	011800492	18 大唐集 SCP004	1,200,000	120,328,336.31	1.88
3	170207	17 国开 07	1,000,000	100,007,070.83	1.56
4	111891144	18 天津银行 CD020	1,000,000	99,669,038.95	1.55
5	111818126	18 华夏银行 CD126	1,000,000	99,381,591.84	1.55
6	111810296	18 兴业银行 CD296	1,000,000	99,041,221.71	1.54
7	110311	11 进出 11	900,000	90,053,227.09	1.40
8	011801170	18 中化股 SCP010	800,000	80,001,927.03	1.25
9	011801114	18 澜沧江 SCP003	700,000	70,000,106.44	1.09
10	111783160	17 广州农村商业银行 CD150	600,000	59,661,057.25	0.93

5.7 “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	0
报告期内偏离度的最高值	0.1233%
报告期内偏离度的最低值	0.0307%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0708%

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。

5.8 报告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。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1

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。

5.9.2

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。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	34,340,135.33
4	应收申购款	322,066,345.80
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	356,406,481.13

5.9.4 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。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	长盛货币 A	长盛货币 B
报告期期初基金份额总额	1,168,736,924.64	3,361,769,495.61
报告期期间基金总申购份额	446,059,940.40	7,400,572,968.55
报告期期间基金总赎回份额	673,088,355.47	5,291,242,356.17
报告期期末基金份额总额	941,708,509.57	5,471,100,107.99

注：申购份额含红利再投、转换入份额和因份额升降级导致的强制调增份额，赎回份额含转换出份额和因份额升降级导致的强制调减份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额（份）	交易金额（元）	适用费率
1	赎回	2018 年 5 月 30 日	30,000,000.00	30,000,000.00	-
合计			30,000,000.00	30,000,000.00	

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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。

8.2 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。

§9 备查文件目录

9.1 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。

9.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的办公地址。

9.3 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及/或管理人互联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。

长盛基金管理有限公司

2018 年 7 月 20 日