

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

长盛货币市场基金

2011 半年度 报告摘要

2011年6月30日

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。
本报告自2011年1月1日起至6月30日止。

2.1 基金基本情况
基金简称:长盛货币
基金代码:080011
交易代码:080011
基金运作方式:契约型开放式

2.3 基金管理人及基金托管人
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
法定代表人 张忠斌 张世忠

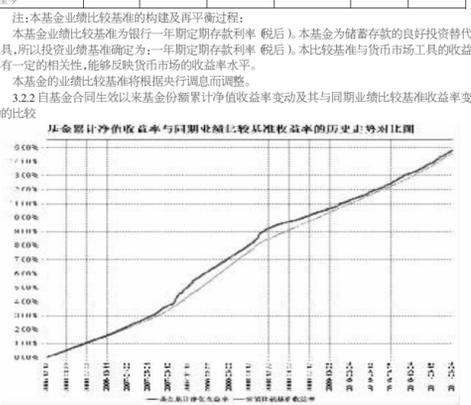
2.4 信息披露方式
基金半年度报告正文的管理人互联网网址: http://www.csfund.com.cn
基金半年度报告备置地点:基金管理人及基金托管人的办公地址

3.1 主要会计数据和财务指标
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)

3.1.2 期末数据和指标 报告期末(2011年6月30日)
3.1.3 本基金业绩比较基准
注:1、本基金收益分配是按日结转份额。

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
阶段 份额净值收益率 业绩比较基准收益率

3.2.2 基金合同生效以来基金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
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。



4.1 基金管理人及基金基金经理情况
4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验
4.1.2 基金基金经理简历及基金经理助理简介

Table with columns: Name, Position, Tenure, and Description. Lists fund managers and their backgrounds.

注:1、上表基金经理的任职日期和离任日期指公司决定确定的聘任日期和解聘日期;
2、职务从年报中“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》及其他各项实施准则、《长盛货币市场基金合同》及其他有关法律法规、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的利益的行为。

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,从授权授信、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对比。

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
2011年上半年,通胀预期和货币政策紧缩力度都不断加强,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逐渐回落。

一季度,货币政策紧缩预期开始,扣除春节因素,资金面依然处于相对宽松的格局,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,三年央票一度重估,货币市场利率波动加剧,重心上移。

5月中下旬之前,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,二、三级利差持续存在,特别是4月份加息后,短融发行利率有所抬高,而市场预期的短期不会再次加息,因而市场对未来有明确的配置和交易需求。进入5月中下旬,紧缩政策的边际效应逐渐显现,银行间市场开始进入较为紧张的局面,这种局面在月末已经历了短债的赎回,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,短融信用品种也遭遇了流动性困难。

在组合操作上,本基金始终将组合的流动性放在首位,力争寻求收益最大化及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,在对基金规模或流动性、持有人结构状况等进行了一定的分析,以及对短期利率走势、央行政策导向的深入研究了后,本基金对组合进行了进一步的调整,在短期利率面临上升压力的环境下,尽量锁定了一定的仓位比例,降低了组合的投资利率风险。通过对组合的优化管理,保证了收益一定的稳定性、持续性。但是5月末起,一方面资金紧张程度还超出我们的预期,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 报告期内基金的投资表现
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为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

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
6.1 报表附注
6.1.1 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保持一致的说明

6.1.2 会计政策变更的说明;本报告期不存在会计政策变更。
6.1.2.1 会计政策变更的说明;本报告期不存在会计政策变更。
6.1.2.2 会计估计变更的说明;本报告期不存在会计估计变更。

6.1.3 关联方关系
6.1.3.1 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。

6.1.3.2 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

6.1.4 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。
6.1.4.1 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。

6.1.4.2 关联方报酬
单位:人民币元
项目 本期 2011年1月1日至2011年6月30日 上期可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日

6.1.4.3 销售服务费
单位:人民币元
项目 本期 2011年1月1日至2011年6月30日 上期可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日

6.1.4.4 各关联方投资本基金的情况
6.1.4.4.1 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。

6.1.4.4.2 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。

6.1.4.5 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 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

6.1.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况
单位:人民币元
关联方名称 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

6.1.4.7 其他关联交易事项的说明;无。
6.1.5 期末2011年6月30日本基金持有的流通受限证券
6.1.5.1 因认购新增发证券而于期末持有的流通受限证券

6.1.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限证券
6.1.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券
6.1.5.3.1 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。

6.1.5.3.2 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。
6.1.6 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项
0公允价值
6)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。

6)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(比如报价)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。

7.1 期末基金资产组合情况
单位:人民币元
序号 投资组合 金额 占基金总资产的比例(%)

7.2 债券回购融资情况
单位:人民币元
序号 项目 占基金资产净值比例(%)

7.3 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
单位:天

7.4 期末投资组合品种分类的债券投资组合
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(%)

7.5 影子定价与摊余成本法确定的基金资产净值的偏离
单位:人民币元
项目 偏离情况

7.6 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。

7.7 投资组合报告附注
7.7.1 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、处罚的情况
7.7.2 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否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。本报告期内无需说明的证券投资决策程序。

7.8 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。

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构
单位:人民币元
序号 名称 金额

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
单位:人民币元
项目 持有份额占基金份额总额的比例

8.3 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

8.4 重大事件提示
10.1 基金份额持有人大会决议
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 本基金管理人高级管理人员、基金经理等基金管理人第五屆董事会第十五次会议审议通过,并经中国证监会审核批准,聘任公司副总经理阮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 本基金托管人的基金托管部门发生重大人事变动情况
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、基金托管人、基金托管业务的诉讼
本报告期内无涉及本基金管理人、基金托管人、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未做变更。
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况
本基金聘请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 基金租用证券交易单元的情况
单位:人民币元
序号 券商名称 交易单元数量 成交金额 占当期债券回购成交总额的比例

注:1、本公司选择证券经营机构的标准
0 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,提供有针对性研究报告;
0 履约能力强,信誉良好;
0 服务状况良好,各项财务指标显示公司经营状况稳定。

10.8 本报告期末租用交易单元为一年,到期后双方没有异议可自动续租一年。
10.9 报告期内租用证券交易单元变更的情况:报告期内未有交易单元变更。
10.10 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。