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:2012年3月28日

长盛货币市场基金

2011 年度 报告摘要

2011年12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2012年3月27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2011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	4,574,491,119.06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	010-82019988	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	2011年	2010年	2009年
本期已实现收益	20,785,096.86	24,290,519.26	44,630,203.33
本期利润	20,785,096.86	24,290,519.26	44,630,203.33
本期净值收益率	3.0091%	2.0201%	1.6506%
3.1.2期末数据和指标	2011年末	2010年末	2009年末
期末基金资产净值	4,574,491,119.06	739,734,559.90	3,776,511,783.67
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

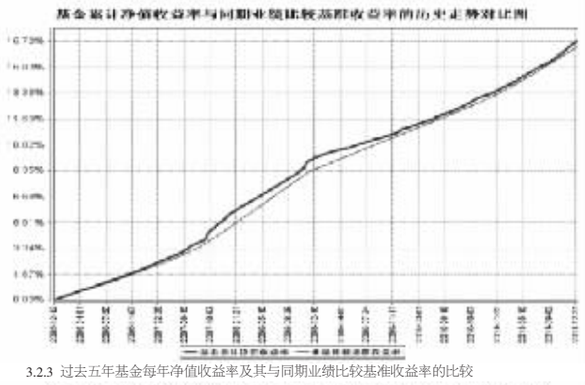
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.9603%	0.0023%	0.8822%	0.0000%	0.0781%	0.0023%
过去六个月	1.6645%	0.0031%	1.7603%	0.0001%	-0.0958%	0.0030%
过去一年	3.0091%	0.0054%	3.2801%	0.0007%	-0.2710%	0.0047%
过去三年	6.8246%	0.0059%	7.8342%	0.0014%	-1.0096%	0.0045%
过去五年	14.3497%	0.0065%	14.3917%	0.0019%	-0.0420%	0.0046%
自基金合同生效起至今	16.7189%	0.0061%	16.3702%	0.0020%	0.3487%	0.0041%

注:本基金业绩比较基准的构建及再平衡过程:

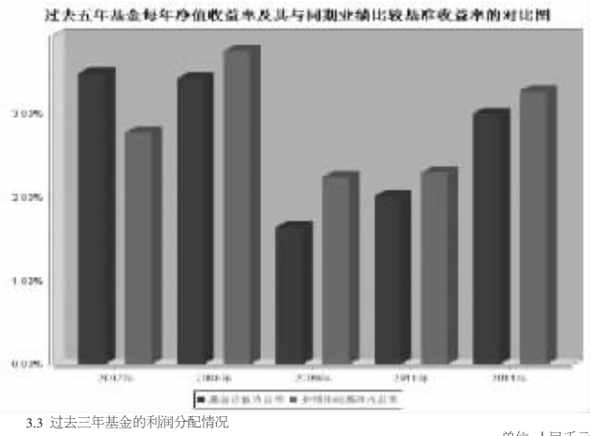
本基金业绩比较基准为银行一年期定期存款利率 (税后)。本基金为储蓄存款的良好投资替代工具,所以投资业绩基准确定为:一年期定期存款利率 (税后)。本比较基准与货币市场工具的收益率有一定的相关性,能够反映货币市场的收益率水平。

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



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



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
2011年	20,785,096.86	-	-	20,785,096.86	本基金收益每日分配,按月结转份额
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
合计	89,705,819.45	-	-	89,705,819.45	

§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%;安徽省投资集团有限责任公司占注册资本的13%。截止2011年12月31日,基金管理人共管理两支封闭式基金、十七支开放式基金,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		
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。

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、《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,在认真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,国内宏观经济经历了典型的滞涨—调控—衰退的后半周期的过程,通胀预期和货币政策紧缩力度在上半年不断强化,央行连续提高利率和准备金率,宏观经济从2季度起逐渐回落。从5月份起,紧缩政策的对流动性的影响逐渐显现,银行间资金面开始进入较为紧张的局面,银行间7天回购利率不断攀升,直至年中达到8%以上的历史高位。在政策紧缩和流动性紧张的情况下,债券市场也开始了全面快速调整的过程,短期信用品种、浮息债均遭遇了流动性困难。7月份后,流动性才开始逐渐好转,直至9月份国内外各种不利的经济形势引起决策层的关注,使市场对政策转向产生预期,同时,央行向市场投放流动性,债券市场开始企稳,长端带动短端开始了一波慢牛的行情,货币市场流动性状况也有了明显改善。

2011年,本基金本着流动性放在首位的原则进行组合管理,主要投资于逆回购投放、同业存款、央行票据、短期融资券等品种,但对于流动性的紧张程度以及银行理财产品对货币基金的冲击仍然预期不足,加之债券市场下跌过程中变现困难,在一定程度上影响了基金整体收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2011年,长盛货币市场基金净值收益率为3.0091%,同期业绩比较基准收益率3.2801%。

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

展望2012年,国内外经济形势复杂多变,不确定性非常大。国际上,欧元区债务危机将难以明显缓解,风险可能向银行体系扩散,美国、日本等发达经济体也存在严重的债务问题,全球去杠杆化远未结束。新兴和发展中经济体则面临资本流出的风险和潜在的通胀压力,经济增速将持续回落。全球贸易保护主义程度加深,世界经济复苏动力明显减弱。国内方面,房地产价格下降过程远未完成,经济总体去杠杆的形势依然严峻,地方政府债务问题存在隐患,经济下行已成定局。尽管政府已明确采取积极的财政政策和稳健的货币政策,但政府的政策手段相对不足。流动性方面,由于宏观调控的需要,以及下调准备金率的政策空间存在,流动性总体上会好于2011年,但鉴于政策转型和迫切性和政府对经济下行的容忍度提高,政策大幅放松的空间并不大。

4.5.2 本基金下年度投资策略

基于上述判断,我们认为,保持充足的流动性仍然是第一位的。在配置方向上,利率产品依然可以持有,随着政策的放松,短期债券的收益率水平仍有一定的下降空间。信用产品方面,由于供给明显增加,在获取票息收益的同时信用风险的防范尤为重要。此外,滚动配置银行存款到期期限。同时,基金将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, 努力做到组合资产流动性与收益性的良好匹配。

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年度分配利润20,785,096.86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;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有限公司注册会计师汪棣、张鸿于2012年3月20日对本基金2011年12月31日的资产负债表、2011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(2012)第20299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:2011年12月31日

单位:人民币元

资 产	本期末 2011年12月31日	上年度末 2010年12月31日
资 产:		
银行存款	2,897,273,144.86	143,097,192.64
结算备付金	-	409,090.91
存出保证金	-	-
交易性金融资产	278,303,909.03	415,366,342.28
其中:股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	278,303,909.03	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	1,392,443,128.66	100,000,270.00
应收证券清算款	-	-
应收利息	8,879,039.39	5,429,576.81
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
资产总计	4,576,926,578.69	741,178,096.39
负债和所有者权益	本期末 2011年12月31日	上年度末 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	536,921.91	203,772.31
应付托管费	162,703.63	61,749.19
应付销售服务费	406,759.05	154,372.97
应付交易费用	22,875.04	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	330,000.00	70,007.50
负债合计	2,435,459.63	1,443,536.49
所有者权益:		
实收基金	4,574,491,119.06	739,734,559.90
未分配利润	-	-
所有者权益合计	4,574,491,119.06	739,734,559.90
负债和所有者权益总计	4,576,926,578.69	741,178,096.39

注:报告截止日2011年12月31日,基金份额净值1.00元,基金份额总额4,574,491,119.06份。

7.2 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12月31日

单位:人民币元

项 目	本期 2011年1月1日至 2011年12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至 2010年12月31日
一、收入	26,121,568.64	34,326,043.00
1.利息收入	25,661,652.39	27,592,117.21
其中:存款利息收入	9,346,642.99	2,077,694.17
债券利息收入	10,969,234.57	24,973,294.83
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	5,345,774.83	541,128.21
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	454,916.25	6,733,925.79
其中:股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	454,916.25	6,733,925.79
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)	5,000.00	-
减:二、费用	5,336,471.78	10,035,523.74
1.管理人报酬	2,244,064.13	4,248,757.34
2.托管费	680,019.43	1,287,502.26
3.销售服务费	1,700,048.66	3,218,755.57
4.交易费用	-	-
5.利息支出	315,062.88	915,043.98
其中:卖出回购金融资产支出	315,062.88	915,043.98
6.其他费用	397,276.68	365,464.59
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	20,785,096.86	24,290,519.26
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	20,785,096.86	24,290,519.26

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:2011年1月1日至2011年12月31日

单位:人民币元

项 目	本期 2011年1月1日至2011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)	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)	-	20,785,096.86	20,785,096.86
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)	3,834,756,559.16	-	3,834,756,559.16
其中:1.基金申购款	10,854,742,295.06	-	10,854,742,295.06
2.基金赎回款	-7,019,985,735.90	-	-7,019,985,735.90
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)	-	-20,785,096.86	-20,785,096.86
五、期末所有者权益(基金净值)	4,574,491,119.06	-	4,574,491,119.06
项 目	上年度可比期间 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产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-24,290,519.26	-24,290,519.26
五、期末所有者权益(基金净值)	739,734,559.90	-	739,734,559.90

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:

周兵 杨思乐 戴君棉

基金管理公司负责人: 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2012年3月20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模板第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基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2011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2011年12月31日的财务状况以及2011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

本基金本期及上年度可比期间未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本期及上年度可比期间未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本期及上年度可比期间无会计差错。

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
新加坡星展银行有限公司	基金管理人的股东(2011年9月2日起)
新加坡星展资产管理有限公司	基金管理人的原股东(2011年9月2日前)
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:1、根据本基金的基金管理人2011年9月2日发布的公告,经中国证监会证监许可[2011]1315号文核准,本基金的基金管理人原股东新加坡星展资产管理有限公司将其持有的本基金的基金管理人33%股权全部转让给新加坡星展银行有限公司。此次变更后本基金的基金管理人的股东及持股比例为:国元证券股份有限公司41%,新加坡星展银行有限公司33%,安徽省信用担保集团有限公司13%,安徽省投资集团有限责任公司13%。

2、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2011和2010年度末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 2011年1月1日至 2011年12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至 2010年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	2,244,064.13	4,248,757.34
其中:支付销售机构的客户维护费	601,529.67	857,511.73

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 2011年1月1日至 2011年12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至 2010年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	680,019.43	1,287,502.26

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:

日托管费=前一日基金资产净值×0.1%/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 2011年1月1日至2011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	409,779.32
兴业银行	92,871.18
国元证券	13,681.80
合计	516,332.30
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

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:

日销售服务费=前一日基金资产净值×0.25%/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 2011年1月1日至2011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	20,042,553.88	10,179,005.08	-	-	-	-
上年度可比期间 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
-	-	-	-	-	-	-

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

份额单位:份

关联方名称	本期末 2011年12月31日		上年度末 2010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
国元证券	190,000,000.00	4.16%	-	-

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 2011年1月1日至 2011年12月31日		上年度可比期间 2010年1月1日至 2010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	154,273,144.86	415,120.09	143,097,192.64	2,034,830.61

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(2011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

本基金本期未无因认购新发/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

(i)金融工具公允价值计量的方法

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)。

(ii)各层次金融工具公允价值

于2011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278,303,909.03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)。

(iii)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级未发生重大变动。

(iv)第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(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	278,303,909.03	6.08
	其中:债券	278,303,909.03	6.08
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	1,392,443,128.66	30.42
	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	2,897,273,144.86	63.30
4	其他各项资产	8,906,396.14	0.19
5	合计	4,576,926,578.69	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	1.85	
	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%。

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	19
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	19

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。

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	91.59	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	2.19	-