



# 信息披露

2013年3月26日 星期二  
zqsb@stcn.com (0755)83501750

# B161

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  
成立日期:2013年3月26日

## 重要提示

基金管理人及基金托管人承诺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。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对本报告所载资料进行了复核,对其中与基金托管人有关的内容进行了复核,但基金管理人对其真实性、准确性和完整性不承担责任。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对本报告所载资料进行了复核,对其中与基金托管人有关的内容进行了复核,但基金管理人对其真实性、准确性和完整性不承担责任。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。

## 基金简介

基金名称	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
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	4,143,135,481.21份
基金合同存续期	不定期

## 2.1 基金基本情况

基金名称	长盛货币	基金管理人	长盛基金管理有限公司
基金代码	080011	基金托管人	兴业银行股份有限公司
交易代码	080011	基金托管人	兴业银行股份有限公司

## 2.2 基金产品说明

投资目标	在力争本金安全、保证资产流动性的基础上,追求高于业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金在投资管理中将采用主动投资策略,在控制仓位的前提下,分散投资于流动性较好的资产,发挥资产配置对基金收益的辅助作用,以谋求提高投资中的安全性和流动性。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投资风险较低、低风险品种,其预期风险和预期收益都低于股票、债券和混合型基金。

## 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
注册地址	甘肃兰州	福建省福州市
办公地址	北京西城区阜成门内大街2号	福建省福州市城头街
联系电话	010-82281998	0591-87870000
传真	010-82281988	0591-87870000

## 3.1 主要会计数据和财务指标

3.1.1 主要会计数据指标	2012年末	2011年末	2010年末
本期已实现收益	37,462,841.67	20,785,096.86	24,290,519.26
本期利润	37,462,841.67	20,785,096.86	24,290,519.26
本期净收益率	3.9768%	3.0911%	2.0201%
3.1.2 期末资产负债表	2012年末	2011年末	2010年末
期末总资产	4,143,135,481.21	4,574,491,119.06	739,734,559.90
期末基金份额净值	1.00	1.00	1.00

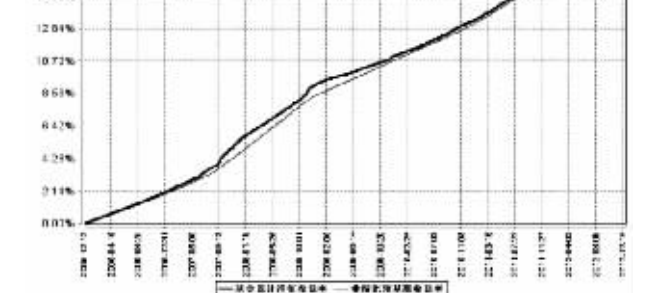
## 3.2 基金业绩表现

阶段	业绩比较基准	长盛货币基金净值增长率	业绩比较基准收益率	①-②	②-③	
过去三个月	0.0288%	0.0076%	0.0288%	-0.0000%	0.0720%	0.0076%
过去六个月	1.3750%	0.0082%	1.5188%	0.0001%	0.2528%	0.0518%
过去一年	3.9768%	0.0082%	3.2452%	0.0001%	0.7316%	0.0555%
过去三年	9.2262%	0.0083%	8.8295%	0.0014%	0.4977%	0.0497%
过去五年	14.8850%	0.0083%	14.8519%	0.0001%	0.0313%	0.0488%
自基金合同生效以来至今	21.3660%	0.0082%	19.6154%	0.0020%	1.7428%	0.0428%

## 3.3 基金业绩表现

阶段	业绩比较基准	长盛货币基金净值增长率	业绩比较基准收益率	①-②	②-③	
过去三个月	0.0288%	0.0076%	0.0288%	-0.0000%	0.0720%	0.0076%
过去六个月	1.3750%	0.0082%	1.5188%	0.0001%	0.2528%	0.0518%
过去一年	3.9768%	0.0082%	3.2452%	0.0001%	0.7316%	0.0555%
过去三年	9.2262%	0.0083%	8.8295%	0.0014%	0.4977%	0.0497%
过去五年	14.8850%	0.0083%	14.8519%	0.0001%	0.0313%	0.0488%
自基金合同生效以来至今	21.3660%	0.0082%	19.6154%	0.0020%	1.7428%	0.0428%

## 基金业绩表现与同期业绩比较基准收益率的对比图



## 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



## 过去三年基金的利润分配情况

年度	已按约定形式分配的现金	直接支付给基金持有人的现金	应付利润与基金份额净值变动	年度利润分配率	备注
2012年	37,462,841.67	-	-	37,462,841.67	本基金按每日分配、按月结转份额
2011年	20,785,096.86	-	-	20,785,096.86	本基金按每日分配、按月结转份额
2010年	24,290,519.26	-	-	24,290,519.26	本基金按每日分配、按月结转份额
合计	82,538,457.79	-	-	82,538,457.79	

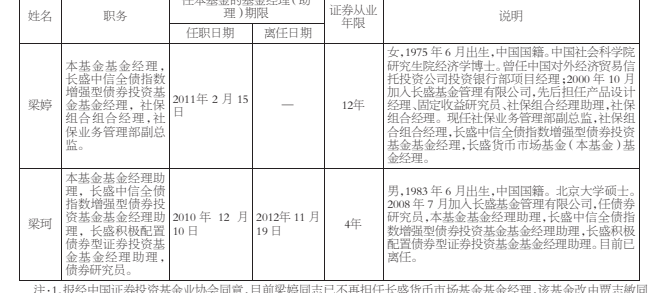
## 4.1 基金管理人及基金托管人

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

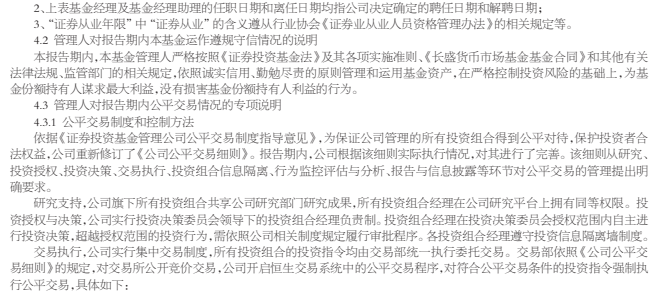
## 4.2 基金业绩表现

阶段	业绩比较基准	长盛货币基金净值增长率	业绩比较基准收益率	①-②	②-③	
过去三个月	0.0288%	0.0076%	0.0288%	-0.0000%	0.0720%	0.0076%
过去六个月	1.3750%	0.0082%	1.5188%	0.0001%	0.2528%	0.0518%
过去一年	3.9768%	0.0082%	3.2452%	0.0001%	0.7316%	0.0555%
过去三年	9.2262%	0.0083%	8.8295%	0.0014%	0.4977%	0.0497%
过去五年	14.8850%	0.0083%	14.8519%	0.0001%	0.0313%	0.0488%
自基金合同生效以来至今	21.3660%	0.0082%	19.6154%	0.0020%	1.7428%	0.0428%

## 基金业绩表现与同期业绩比较基准收益率的对比图



## 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



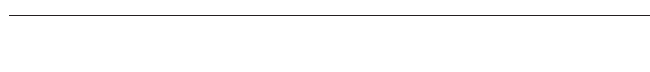
## 4.3 基金管理人及基金托管人

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

## 4.4 基金业绩表现

阶段	业绩比较基准	长盛货币基金净值增长率	业绩比较基准收益率	①-②	②-③	
过去三个月	0.0288%	0.0076%	0.0288%	-0.0000%	0.0720%	0.0076%
过去六个月	1.3750%	0.0082%	1.5188%	0.0001%	0.2528%	0.0518%
过去一年	3.9768%	0.0082%	3.2452%	0.0001%	0.7316%	0.0555%
过去三年	9.2262%	0.0083%	8.8295%	0.0014%	0.4977%	0.0497%
过去五年	14.8850%	0.0083%	14.8519%	0.0001%	0.0313%	0.0488%
自基金合同生效以来至今	21.3660%	0.0082%	19.6154%	0.0020%	1.7428%	0.0428%

## 基金业绩表现与同期业绩比较基准收益率的对比图



## 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



2013年3月26日 星期二  
zqsb@stcn.com (0755)83501750

# 长盛货币市场基金

# 2012 年度 报告摘要

2012年12月31日

发行路演申购,以公司名义进行的债券一级市场申购的交易,分期进行估值,确保分配结果符合公平交易原则。

## 4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内,公司执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《公司公平交易细则》各项规定,保证公平对待旗下各投资组合,各投资组合按照投资管理流程和制度决策,并在取得投资信息、投资决策和实施投资决策等层面享有公平的机会;交易环节,严格执行集中交易制度,确保各投资组合在授权范围内公平交易;事后监控环节,公司定期对投资组合公平交易情况和异常交易情况进行分析,并出具公平交易执行情况分析报告,同时,公司对公平交易制度的遵守和关联交易流程的执行情况进行定期和不定期检查,并对发现的异常情况进行及时报告。

## 4.3.3 异常交易行为的专项说明

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 管理人及基金托管人报告期内遵守法律法规的情况  
4.4.1 报告期内基金管理人和基金托管人遵守法律法规的情况  
4.4.2 报告期内基金管理人遵守法律法规的情况  
4.4.3 报告期内基金托管人遵守法律法规的情况  
4.4.4 报告期内基金管理人和基金托管人遵守法律法规的情况

单位:人民币元

项目	2012年1月1日至2012年12月31日		所有者权益合计
	实收基金	未分配利润	
本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	4,574,491,119.06	-	4,574,491,119.06
一、期初所有者权益(基金净值)	-	37,462,841.67	37,462,841.67
二、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)	-431,355,637.85	-	-431,355,637.85
其中:1.基金申购款	10,806,133,120.55	-	10,806,133,120.55
2.基金赎回款	-11,237,488,758.40	-	-11,237,488,758.40
三、期末所有者权益(基金净值)	4,143,135,481.21	-	4,143,135,481.21

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

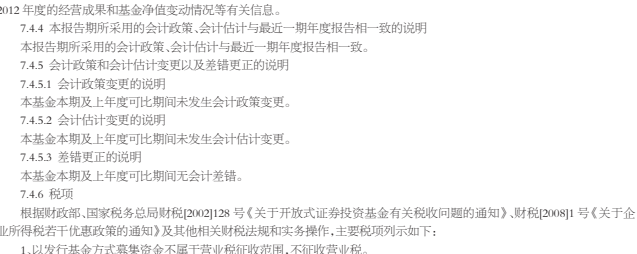
项目	2011年1月1日至2011年12月31日		所有者权益合计
	实收基金	未分配利润	
本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	739,734,559.90	-	739,734,559.90
一、期初所有者权益(基金净值)	-	20,785,096.86	20,785,096.86
二、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	3,834,756,559.16	-	3,834,756,559.16
其中:1.基金申购款	10,854,742,295.06	-	10,854,742,295.06
2.基金赎回款	-7,019,987,735.90	-	-7,019,987,735.90
三、期末所有者权益(基金净值)	4,574,491,119.06	-	4,574,491,119.06

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

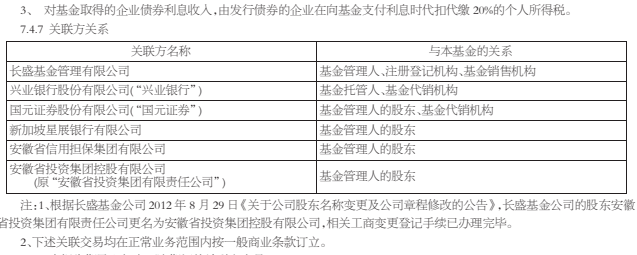
## 基金业绩表现

本基金在投资管理中将采用主动投资策略,在控制仓位的前提下,分散投资于流动性较好的资产,发挥资产配置对基金收益的辅助作用,以谋求提高投资中的安全性和流动性。在控制风险的前提下,追求收益最大化。

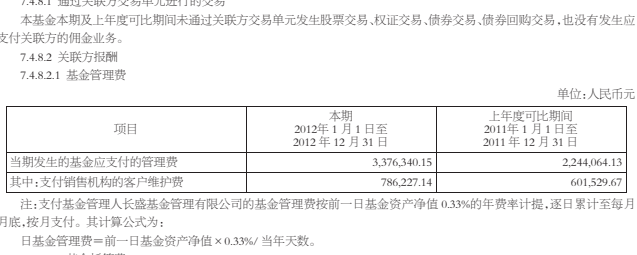
## 基金业绩表现与同期业绩比较基准收益率的对比图



## 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



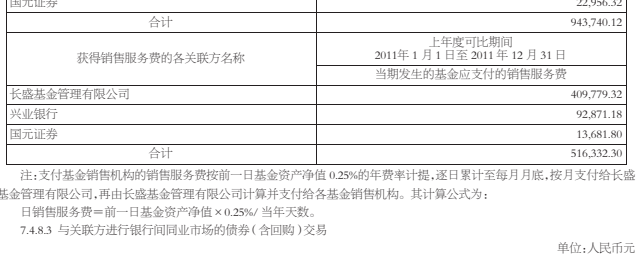
## 基金业绩表现与同期业绩比较基准收益率的对比图



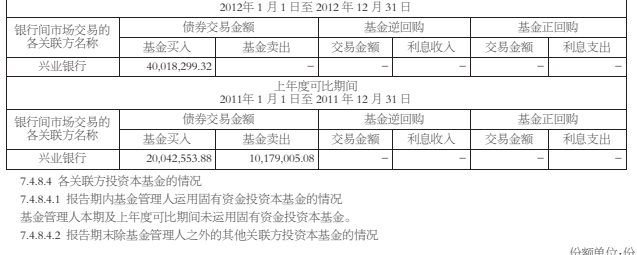
## 基金业绩表现与同期业绩比较基准收益率的对比图



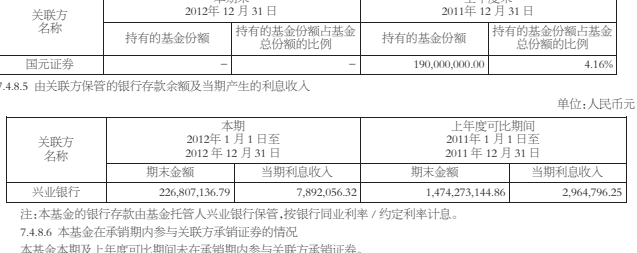
## 基金业绩表现与同期业绩比较基准收益率的对比图



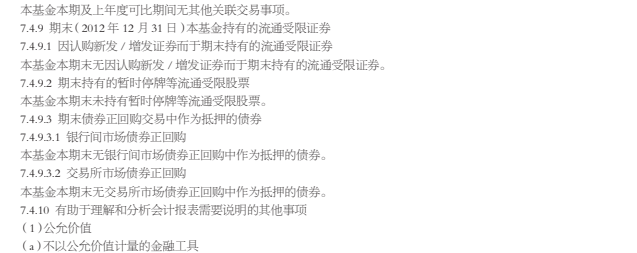
## 基金业绩表现与同期业绩比较基准收益率的对比图



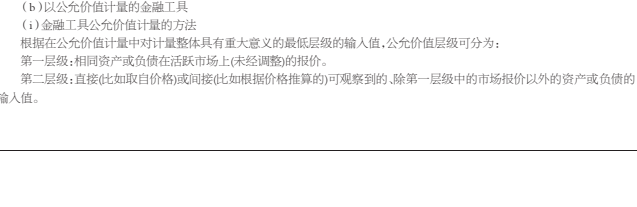
## 基金业绩表现与同期业绩比较基准收益率的对比图



## 基金业绩表现与同期业绩比较基准收益率的对比图



## 基金业绩表现与同期业绩比较基准收益率的对比图



第三层级,以可观察到的市场报价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)。

- (a) 各层级金融工具公允价值
- (b) 公允价值所属层级的重大变动
- (c) 公允价值所属层级在当期无重大变动
- (d) 第三层级公允价值余额和期初余额

## 8.1 期末投资组合情况

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	国债逆回购	340,365,220.35	8.21
	其中:债券	340,365,220.35	8.21
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	1,593,203,919.84	38.43
	其中:买入返售金融资产的买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和拆借资金	863,307,136.79	20.83
4	其他货币资金	1,348,384,928.59	32.53
5	合计	4,143,261,206.57	100.00

## 8.2 报告期末投资组合

序号	项目	占基金资产净值的比例 (%)
1	报告期末债券回购余额	1.83
	其中:买断式回购融资	-
2	报告期末债券回购余额	-
	其中:买断式回购融资	-

注:上表中报告期末债券回购余额占基金资产净值的比例与报告期各期末每个交易日融资余额占基金资产净值比例的中位数不一致。

## 8.3 投资组合平均持有期限分析

报告期末投资组合平均持有期限最高

报告期末投资组合平均持有期限最低

报告期末投资组合平均持有期限超过180天情况

报告期末投资组合平均持有期限超过180天情况

## 8.4 期末投资组合持仓分析

序号	项目	金额	占基金资产净值的比例 (%)
1	30天以内	32.63	--
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债券	--	--
2	30天<=60天	1.69	--
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债券	0.73	--
3	60天<=90天	6.91	--
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债券	1.22	--
4	90天<=180天	3.86	--
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债券	2.41	--
5	180天<=397天(含)	2.41	--
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债券	6.51	--
	合计	67.51	--

## 8.4 期末投资组合持仓分析

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

序号	债券名称	持仓数量(张)	持仓成本	占基金资产净值的比例 (%)
1	国债逆回购	340,365,220.35	1.22	
2	央行票据	-	3.14	
3	金融债	130,100,078.20	3.14	
4	企业债	-	5.08	
5	企业短期融资券	210,265,142.15	5.08	
6	中期票据	-	6.85	
7	其他	-	6.85	
8	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	340,365,220.35	8.22	
	合计	80,540,567.23	1.94	

注:上表中,债券的成本包括债券溢价和折价。

## 8.5 期末投资组合持仓分析

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

序号	债券名称	持仓数量(张)	持仓成本	占基金资产净值的比例 (%)
1	094047	094047	30,385,572.16	1.22
2	120202	120202	400,000	0.05
3	04120408	120408 CP001	20,000,000	0.49
4	110206	110206 国债	200,000	0.48
5	04125219	120521 CP001	200,000	0.48
6	04125201	120521 CP001	200,000	0.48
7	04126280	120528 CP001	200,000	0.48
8	04126283	120528 CP002	200,000	0.48
9	04126269	120528 CP001	200,000	0.48
10	090206	090206 国债	160,000	0.24

注:“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

偏离情况	偏离情况
报告期内偏离度的最大值在0.25%(含)-0.5%的次数	40
报告期内偏离度的平均值	0.4227%
报告期内偏离度绝对值最大的基金组合	0.0019%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1613%

## 8.6 期末投资组合持仓分析

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

序号	债券名称	持仓数量(张)	持仓成本	占基金资产净值的比例 (%)
1	094047	094047	30,385,572.16	1.22
2	120202	120202	400,000	0.05
3	04120408	120408 CP001	20,000,000	0.49
4	110206	110206 国债	200,000	0.48
5	04125219	120521 CP001	200,000	0.48
6	04125201	120521 CP001	200,000	0.48
7	04126280	120528 CP001	200,000	0.48
8	04126283	120528 CP002	200,000	0.48
9</				