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:2015年3月28日

§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 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2015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

23名自 里人远鲷。 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

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2014年01月01日起至12月31日止。 **82 基金简介**

	82 奉至町八
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	9,171,115,350.08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了 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 脱后)		
风险收益特征		本基金属于证券投资基金中。 都低于股票、债券和混合型基	高流动性、低风险的品种,其預期风险和预期收益3金。		
2.3 基金管理人和基金托管人					
项目		基金管理人	基金杆管人		

§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

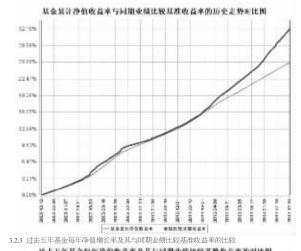
3.1.1 期间数据和指标	2014年	2013年	2012年
本期已实现收益	88,824,778.07	34,280,195.62	37,462,841.67
本期利润	88,824,778.07	34,280,195.62	37,462,841.67
本期净值收益率	5.0830%	3.6150%	3.9768%
3.1.2 期末数据和指标	2014年末	2013年末	2012年末
期末可供分配基金份額利润	-	-	_
期末基金资产净值	9,171,115,350.08	6,981,165,736.14	4,143,135,481.21
期末基金份額争值	1.0000	1.0000	1.0000

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)和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

3.2.1 基金份额争值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较						
阶段	份額净值收益率 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	0-3	2-4
过去三个月	1.1806%	0.0066%	0.7288%	0.0003%	0.4518%	0.0063%
过去六个月	2.2917%	0.0075%	1.4849%	0.0003%	0.8068%	0.0072%
过去一年	5.0830%	0.0094%	2.9726%	0.0002%	2.1104%	0.0092%
过去三年	13.2118%	0.0071%	9.2178%	0.0005%	3.9940%	0.0066%
过去五年	18.9743%	0.0070%	14.8021%	0.0011%	4.1722%	0.0059%
自基金合同生效 起至今	32.1396%	0.0067%	25.5880%	0.0017%	6.5516%	0.0050%

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。 **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



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	江:人民币ラ
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
2014	88,824,778.07	-	-	88,824,778.07	
2013	34,280,195.62	=	-	34,280,195.62	
2012	37,462,841.67	-	-	37,462,841.67	
合计	160,567,815.36	=	-	160,567,815.36	

§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 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,郑州,杭州,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(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3%。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代基金。合格境内机构投资者和特定客户资产管理业务资格。截至2014年12月31日,基金管理人共管理三十七只开放式基金,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。

排名	职务	任本基金的基金经理 (助理)期限		证券从业年限	TAKENED
SEA:	87(7)	任职日期	离任日期	HESPANSE 4-PR	说明
段鵬	本基金基金经理、长盛添 升30天理財債券型证券 投资基金基金经理、长 盛添利60天理財債券型 发金托工。并收益年基本 定期开放债券型证券投 资基金基金经理。	全经理,长盛添 材值券型证券 基金经理,长 天理財債券型 稅投资基金基 长。每年年收益 清券型证券投		7年	男。1982年12月出生、中国国籍、中央财 大学经济学品上、综合中信贷行股份有 公司从财人民币货币市场交易、债券投 放流对恰管理等工作。2013年12月加入 选基金管理有限公司,现任长盛货币市 基金 体基金 战金经里、长盛分和5 对66天理财债券型发起式进步投资基 基金经理、长废年率收益定期开放债券 证券投资基金基金经理、长废
贾志敏	本基企经歷 长盛河 國籍周用海利倫泰型運 與資基企經歷 天盛 與資基企經歷 天盛 與資基企經歷 遊科技術 遊科技術 遊科技術 遊科技術 是 與 是 是 是 是 是 是 是 是 是 是 是 是 是	2013年2月7日	2014年10月24日	8年	第,1982年3月出生,中国国籍、北京大公民等等的、中亚中国特许股份目标。 经济学等社、单生中销销行股份证的。 从事人民而佛旁资产地社会的目常管理及易享作。2012年11月批价人长盛全管里有限公司、曾任防卫收益部组改金基金经理,长级申信全债指按财强规划会发现的基金基金经理,长级争争的。 专业是一个企业,任务等的,是一个企业,任务等等的。 专业是一个企业,任务等的。 是一个企业,任务等的。 是一个企业,任务等的。 是一个企业,任务等的。 是一个企业,任务等的。 是一个企业,任务等的。 是一个企业,任务等的。 是一个企业,任务等的。 是一个企业,任务等的。 是一个企业,任务等的。 是一个企业,任务等的。 是一个企业,任务等的。 是一个企业,任务等的。 是一个企业,任务等。 是一个企业,任务等。 是一个企业,任务等。 是一个企业,任务等。 是一个企业,任务等。 是一个企业,任务等。 是一个企业,任务等。 是一个企业,任务等。 是一个企业,任务等。

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。 42 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 有关法律法规、监管部门的相关规定。依照读实信用、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,确保公平对持不同投资组合,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警报见。

问等权限。 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

按於反於与決策,公司条行投資於東參與查例等下的投資組管經理以前,各投資組管經理化投資於 接委員会的授权范围內、独立完成投资組合的管理工作。各投资组合经理遵守投资信息隔离诸軸度。 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 照公司公平交易规则)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,保证容易执行的公平性。 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

43.3 异常交易行为的专项说明 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.报告期内行前回则 回顾2014年,经济增速有所下滑,通胀水平总体星下降走势,定向放松的货币政策及相对宽松的资金面驱动市场利率中枢持续下行,债券市场走出一波较强的趋势性牛市行情。利率债方面,收益率曲线整体下

长盛货币市场基金

2014 年度 报告摘要

行,10年期国债收益率下行93BP至3.62%,10年期国开行债收益率大幅下行173BP至4.09%;信用债方面,低评 级债券收益率下行幅度小于中高评级债券,主要是受信用风险事件频发及交易所债券质押回购规则变动等

同时受央行公开市场延续空窗操作及新一轮IPO等因素影响,货币市场各中短期资金利率呈现阶段性上升

2.报告期内本基金投资策略分析 在报告期内,本基金根据市场资金面变化和利率走势,把握好配置节奏,根据对市场判断,在利率相对 高点配置长期协议存款和信用债券,期间享受票息和资本利得收益,同时在配置过程中优化持仓结构,密切 关注高收益债券的信用风险暴露,严格控制其特仓比例,防控信用风险。

高点配直长期防以存款利自用债券,拥申享受票息和资本利润收益。同时往配直过程中优化符讫结构、密切关注高购达债券的信用风险量露,严格控制其持仓比例、防控信用风险。
4.4.2 报告期内基金的业绩表现
2014年,长盛货币市场基金净值收益率为5.0830%。同期业绩比较基准收益率2.9726%。
4.5 管理人对支观整济、证券市场及行业走势的简要展望
在深化改革和调整经济结构的背景下,政府对经济增长容忍度有所提高,国内经济的潜在增长率不断下降。2015年预计中国经济将维持相对疲弱的态势。12月中国PMI连续下滑至50.1%的中内低值、制造业价1年和产出针数双双定费,反映制造业等气度;转级形化、经济下行压力依然存在。通胀方面、12月已同比上涨1.5%,通胀延续弱势。房地产投资增速继续下降,未来房地产销售仍面临较大不确定性。在经济仍面临较大下行压力的背景下,货币政策有望进一步宽松。
在后期投资策略上、您们发注经济基本值、货币政策和资金面的各种变化,在仓位和久期上根据市场形势变化灵活应对。对信用债。深入研究行业及个券信用利整变化、积极发掘信用风险可控、持有期收益较高的个券,并且密书服宪济仓债券的信用风险状况,严助信用利险;对协议存款、把握好计人银行一般性存款的政策和使、利用好新限中购等利率被动机会。在利率高点拉长组合人期。
总之、无论后市如何变化、我们将季承递镇原则,在组合流动性得到保证的前提下,通过灵活的资产配置和深入的个券甄别分析,做好组合配置,力求确保基金资产实现持续的稳定增值。
4.6管要人对报告期内基金估值更是为了新确保基金资产实现持续的稳定增值。
4.6管要人对报告期内基金估值的方定,对基金所得投资品种进行估值。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二方机构估值数据,确保基金估值

一、古生。 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

本基金管理人制订的证券投资基金恰值收乘与信值程序研定 1 估值目的、估值以后值对家、估值程序、估值方法以及估值卷转处里 暂停估值有种软持部处理等事项。本基金管理人设立了由公司经理任任估值小组组长)、农益投资部、风险管理部、研究部、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、风险管理或法律令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论论、但不参与估值原则和方法的选择失策和口常估值的规行。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

郊的以外田門的口間線及時。 4.7 管理人为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 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,2014年

度分配利润88,824,778.07元。

度分配利润88.824.778.07元。
4.8报告期内产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院的说明本基金在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公息再明报告,我是不是一个人工程,不托管人一个格遵守《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、尽贵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。本托管人报园国家有关法律法规、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》等有关法律基规,在各重要方面的公库。

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, "格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要万面的运作"格按服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、不存在底假记载、误导性除达或者重大遗漏。 86 审计报告 普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)注册会计师汪棣、沈兆杰2014年3月23日对本基金2014年的资产负债表。2014年度和阅表,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 (2015)第20180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。 87 年度财务报表 §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:2014年12月31日		
资产	本期末 2014年12月31日	上章 2013年
资产:		
银行存款	7,427,073,913.33	
结算备付金	=	
存出保证金	-	
交易性金融资产	1,455,460,595.84	
其中:股票投资	-	
基金投资	=	
债券投资	1,455,460,595.84	
资产支持证券投资	-	
贵金属投资	-	
CC et & CC March		

存出保证金	-	-
交易性金融资产	1,455,460,595.84	349,221,995.70
其中:股票投资	-	-
基金投资	-	=
债券投资	1,455,460,595.84	349,221,995.70
资产支持证券投资	=	=
贵金属投资	-	=
衍生金融资产	-	=
买人返售金融资产	413,971,940.96	1,903,553,060.33
应收证券清算款	=	=
应收利息	50,411,914.83	15,742,506.29
应败股利	=	=
应收申购款	-	1,106,080,805.01
递延所得税资产	-	-
其他资产	27,356.75	27,356.75
资产总计	9,346,945,721.71	7,563,940,317.23
负债和所有者权益	本期末 2014年12月31日	上年度末 2013年12月31日
负债:		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	=
衍生金融负债	-	=
实出回购金融资产款	171,269,543.09	-
应付证券清算款	=	579,976,416.67
应付赎回款	306,876.00	81,830.93
应付管理人报酬	1,308,960.66	578,555.06
应付托管费	396,654.74	175,319.71
应付销售服务费	991,636.86	438,299.26
应付交易费用	74,721.52	18,746.89
应交税费	1,175,800.00	1,175,800.00
应付利息	23,553.03	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	=	-
其他负债	282,625.73	329,612.57
负债合计	175,830,371.63	582,774,581.09
所有者权益:		
实收基金	9,171,115,350.08	6,981,165,736.14
未分配利润	=	-
所有者权益合计	9,171,115,350.08	6,981,165,736.14
负债和所有者权益总计	9,346,945,721.71	7,563,940,317.23

注:注:报告截止日2014年12月31日,基金份额净值:1.0000元,基金份额总额9,171,115,350.08份。

本报告期: 2014年1月1日至2014年12月31日

项目	本期 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日
一、收入	106,181,782.06	41,834,864.9
1.利息收入	98,411,824.67	39,797,201.45
其中:存款利息收入	65,289,401.64	23,558,737.17
债券利息收入	30,975,476.05	13,510,319.79
资产支持证券利息收入	-	-
买人返售金融资产收入	2,146,946.98	2,728,144.49
其他利息收入	-	
2.投资收益 损失以""填列)	7,769,957.39	2,037,663.4
其中:股票投资收益	-	
基金投资收益	-	
债券投资收益	7,769,957.39	2,037,663.4
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 假失以""号填列)	-	
4. 汇兑收益 颁失以""号填列)	-	
5.其他收入 假失以 ""号填列)	-	
减:二、费用	17,357,003.99	7,554,669.2
1.管理人报酬	6,118,429.51	3,067,712.1
2.托管费	1,854,069.55	929,609.7
3.销售服务费	4,635,173.91	2,324,024.3
4.交易费用	=	
5.利息支出	4,263,146.64	798,965.1
其中:卖出回购金融资产支出	4,263,146.64	798,965.1
6.其他费用	486,184.38	434,357.9
三、利润总额(亏损总额以""号填列)	88,824,778.07	34,280,195.6
域:所得税费用	-	
四、净利润(净亏损以""号填列)	88,824,778.07	34,280,195.6

项目	201	本期 4年1月1日至2014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)	6,981,165,736.14	-	6,981,165,736.14
二、本期经营活动产生的基金净值 变动数 (本期净利润)	-	88,824,778.07	88,824,778.07
三、本期基金份額交易产生的基金 争值变动数 (争值减少以""号填列)	2,189,949,613.94	-	2,189,949,613.94
其中:1.基金申购款	18,298,944,281.09	-	18,298,944,281.09
2.基金赎回款	-16,108,994,667.15	-	-16,108,994,667.15
四、本期向基金份额持有人分配利 同产生的基金净值变动 (净值减少 以""号填列)	-	-88,824,778.07	-88,824,778.07
五、期末所有者权益(基金净值)	9,171,115,350.08	-	9,171,115,350.08
项目	201	上年度可比期间 3年1月1日至2013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(ҍ金净值)	4,143,135,481.21	-	4,143,135,481.21
二、本期经营活动产生的基金净值 变动数 (本期净利润)	-	34,280,195.62	34,280,195.62
三、本期基金份額交易产生的基金 争值变动数 (争值减少以 ="号填列)	2,838,030,254.93	-	2,838,030,254.93
其中:1.基金申购款	11,913,477,662.60	-	11,913,477,662.60
基金赎回款	-9,075,447,407.67	-	-9,075,447,407.67
9、本期向基金份额持有人分配利 到产生的基金净值变动 (净值减少 火 = "号填列)	=	-34,280,195.62	-34,280,195.62
五、期末所有者权益 (基金净值)	6.981.165.736.14	_	6.981.165.736.14

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署:

基金管理人负责人 主管会计工作负责人

会计机构负责人

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 [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、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 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

根据《货币市场基金管理暂行规定》和《长威货币市场基金基金会同》的有关规定 木基金的投资范围 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;剩余期限在三百九十七天以内(含三百九十七天)的资产支持证券、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2015年3月23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2014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2014年12月31日的财

务状况以及2014年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计 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 财政部于2014年颁布《企业会计准则第39号——公允价值计量》、《企业会计准则第40号——合营安

排》、《企业会计准则第41号 在其他主体中权益的披露》和修订后的《企业会计准则第2号 长期股权投资》、《企业会计准则第9号 职工薪酬》、《企业会计准则第30号 财务报表列报》、《企业会计准则第37号 企融工具列报》、要求除《企业会计准则第37号 企融工具列报》、要求除《企业会计准则第37号 号——金融工具列报》自2014年度财务报表起施行外,其他准则自2014年7月1日起施行。上述准则对本基金 本报告期无重大影响。

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。

7.453 差结更正的说明

本基金在本报告期内无须说明的会计差错更正。

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 [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。基金买卖债券的差价收入不予征

(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

(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

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、基金销售机构	
国元证券股份有限公司	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	基金管理人的全资子公司	

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

本基金未开立关联方交易单元。 7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

		单位:人民币
项目	本期 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	6,118,429.51	3,067,712.17
其中:支付销售机构的客户维护费	1,620,072.33	636,976.79
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

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

2014年1月1日至2014年12月31日 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 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。

金额单位:人民市	
本期 2014年1月1日至2014年12月31日	获得销售服务费 各关联方名称
当期发生的基金应支付的销售服务费	台大联万石 协
1,118,571.9	长盛基金公司
90,247.0	兴业银行
12,737.7	国元证券
1,221,556.6	合计
上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日	获得销售服务费
当期发生的基金应支付的销售服务费	各关联方名称
918,338.0	长盛基金
161,464.8	兴业银行
13,566.8:	国元证券
1,093,369.7	合计
7一日基金资产净值0.25%的年费率计提,逐日累计至每月	注, 支付基金销售机构的销售服务费按定

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。

						单位:人民市	
		2014年1月	本期 1日至2014年12	931⊟			
银行间市场交易的	债券交易会	注 額	基金逆回购		基金正回购		
各关联方名称	基金买人	基金实出	交易金額	利息收入	交易金額	利息支出	
兴业银行	16,739,095.01	-	-	-	57,000,000.00	4,919.	
			年度可比期间 1日至2013年12	∃31⊟			
银行间市场交易的	债券交易会	注 額	基金i	基金逆回购		基金正回购	
各关联方名称	基金买人	基金实出	交易金額	利息收入	交易金額	利息支出	
兴业银行	-	-	-	-	-		

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 注: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

注:除基金管理人之外的其他关联方本期末及上年度末未投资本基金。

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

				里位:人民巾兀	
关联方 名称	本期 2014年1月1日至2014年12月31日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日		
	期末余額	当期利息收入	期末余額	当期利息收入	
兴业银行	1,604,073,913.33	10,828,207.54	1,076,314,593.15	7,282,448.35	
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/约定利率计息。					

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注:本基金本期及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

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须作说明的其他关联交易事项。 7.4.9 期末(2014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:本基金本期末无因认购新发/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

注:本基金报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2014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171,269,543.09元,是以如下债券作为质押:

					金额单位:人民市:
外代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量 (张)	期末估值总额
207	14国开07	2015年1月5日	100.20	330,000	33,066,820.17
213	14国开13	2015年1月5日	99.84	200,000	19,968,012.12
327	14进出27	2015年1月5日	100.22	200,000	20,044,009.33
204	14国开04	2015年1月5日	100.03	1,000,000	100,032,399.82
合计				1,730,000	173,111,241.44

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 (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

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2014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1,455,460,595.84元,无属于第一或第三层次的余额(2013年12月31日:第二层次349,221,995.70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

(iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具

于2014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(2013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

(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
号	项目	金額	占基金总资产的比例 66)
1	固定收益投资	1,455,460,595.84	15.57
	其中:债券	1,455,460,595.84	15.57
	资产支持证券	-	-
2	买人返售金融资产	413,971,940.96	4.43
	其中:买断式回购的买人返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	7,427,073,913.33	79.46
4	其他各项资产	50,439,271.58	0.54
5	合计	9.346.945.721.71	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 1	责券回购融资情况		
			金额单位:人民币
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		7.55
	其中;买断式回购融资		=
序号	項目	金額	占基金资产净值的比例 %)
2	报告期末债券回购融资余额	171,269,543.09	1.87
	其中:买断式回购融资	-	-
53. Lt	7 44 #0 4 74 C 194 2 1 Ve A der 4 44	A Marchanda Marchall Long of Artists House	- A

值比例的简单平均值。

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

报告期末投资组合平均剩余期限	
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	1:
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	
报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况	说明
注:报告期内无投资组合平均剩余期限超过1807	天的情况。
832 期末投资组合平均剩余期限分布比例	

3	60天(含)—90天	3.93	-		
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.22	-		
4	90天(含)—180天	7.12		-	
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-		-	
5	180天(含)—397天 (含)	6.93		-	
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	=	-		
	合计	101.37	1.37		
8.4 其	明末按债券品种分类的债券投资组	合			
				金额单位:人民币	
序号	债券品种	摊余成本		占基金资产净值比例 66)	
1	国家债券			-	
2	央行票据		-	-	
3	心 正确的	510 214 006 51		5.56	

注:上表中,债券的成本包括债券面值和折溢价

8.5 班	木按摊余成/	P. 白基金分产伊	值比例大小排序的前。	十名愤寿投货明细	
					金额单位:人民币
序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	推余成本	占基金资产净值比例 %)
1	140204	14国开04	3,000,000	300,097,199.45	3.27
2	071441004	14恒泰证券CP004	700,000	69,983,647.27	0.76
3	140207	14国开07	600,000	60,121,491.22	0.66
4	140429	14次发29	500,000	50,064,019.08	0.55
5	041455046	14复星高科CP001	500,000	50,000,147.60	0.55
6	041458092	14皖山應CP001	500,000	49,952,274.50	0.54
7	041460120	14陕煤化CP003	400,000	40,001,449.62	0.44
8	041459075	14苏汇湾CP002	400,000	40,000,141.92	0.44
9	011499082	14山钢SCP001	400,000	40,000,141.78	0.44
10	071412006	14—@∫CP006	400,000	39,992,297.26	0.44

8.6 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值	的偏离
項目	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	46
报告期内偏离度的最高值	0.4122%
报告期内偏离度的最低值	-0.0298%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1814%
8.7 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。

8.8.1基金计价方法说明

本基金的(前分投资)。 本基金的债券投资采用摊余成本法计价,即计价对象以买人成本列示,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。

8.8.2本根告期内货币市场基金持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的 浮动利率债券,应声明本报告期内是否存在该类浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值的 本报告期内不存在剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券的摊余成本超过当日

基金净值的20%的情况。 8.8.3声明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

年内受到公开谴责、处罚的情形 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

8.8.4 期末其他各项资产构成 单位:人民币元

由于四舍五人的原因,分项之和与合计项;

89 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

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 §10 开放式基金份额变动

单位:份

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议 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 德理人的海線管理人员重大人事变动情况 理从于2014年3月16日发帝公告、是公ຫ五届董事全第五十七次会议以及第六届董事会第一次会议时议通过,并除中国证监会 简称生组任公司董事长、凤良忠生组母帝原因不再担任公司董事长职多。根据公司章程相关规定,董事长为公司的法定代表 2014年3月1日12年304年7月 1872年 187 11.22 基金经理的支加牌2。 提受中国证券的收益金៤协会同意,自2014年4月10日起,段響同志兼任长盛货币市场基金基金经理;自2014年10月24日起,贾志敏同; 日1.23 本基金任常人房基金任理部訂 重大人事变动情况 本程度资本基金任常人房基金任管部訂 重大人事变动情况

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 11.4 基金投资策略的改变 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金轉任的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所、转殊普通合伙).本报告期内本基金未更换会计师事务所,本报计师事务所创现例90,000,00元。已连续提供审计服务争年。 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 11 7基全和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

37:101-(2)17	文の平元以底	成交金額	占当期股票 成交总额的比例	佣金	占当期佣金 总量的比例	HILL.		
中信建投	1	-	-		-			
11.7.2 基金	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		
	(A	券交易	债券[回购交易	权证效	易		
券商名称	成交金額	占当期债券	成交金額	占当期债券回购	成交金額	占当期权证		

(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

(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

(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 (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

(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

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。

长盛基金管理有限公司