长盛货币市场基金 2010年半年度报告摘要

2010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
送出日期:2010年8月24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2010年8月23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。

本报告期自2010年1月1日起至6月30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	973,880,763.98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	010-82255818	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

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.csfunds.com.cn
基金半年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的办公地址

§3 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期(2010年1月1日—2010年6月30日)
本期已实现收益	14,431,095.58
本期利润	14,431,095.58
本期净值收益率	0.9246%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2010年6月30日)
期末基金资产净值	973,880,763.98
期末基金份额净值	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、表中的"期末"均指本报告期最后一日,即6月30日。

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
过去一个月	0.1762%	0.0069%	0.1849%	0.0000%	-0.0087%	0.0069%
过去三个月	0.5025%	0.0076%	0.5610%	0.0000%	-0.0585%	0.0076%
过去六个月	0.9246%	0.0063%	1.1158%	0.0000%	-0.1912%	0.0063%
过去一年	1.8382%	0.0068%	2.2500%	0.0000%	-0.4118%	0.0068%
过去三年	8.4902%	0.0073%	8.8256%	0.0021%	-0.3354%	0.0052%
自基金合同生效起至今	12.0926%	0.0061%	11.8914%	0.0021%	0.2012%	0.0040%

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

§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%;新加坡星展资产管理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2010年6月30日,基金管理人共管理两支封闭式基金、十二支开放式基金(包括一支QDII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期限 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
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	—	10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。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,长盛积极配置债券型证券投资基金基金经理。

注:1、上表基金经理的任职日期和离任日期均指公司作出决定之日;

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,本基金于6月18日持有10柳化工CP01超过该债券发行量的百分之十,基金管理人已于2010年6月21日将此比例调整到规定的范围内。除此之外,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 报告期内行情回顾和本基金投资策略分析

4.4.1.1 报告期内行情回顾

随着国民经济扩张态势的逐步确立,管理层上半年的政策重心明显侧重于对通胀预期和资产泡沫的有效管理。央行连续三次上调存款准备金率,并持续在公开市场进行大幅净回笼操作,在持续紧缩操作的累积效应以及外汇占款大幅下降的作用下,6月后半段银行间资金面出现了极度紧缩的局面,货币市场利率出现了急剧大幅上扬的情况。在这种情况下,央行的公开市场操作行为随之转向连续净投放,连续6周累计投放货币量达到7830亿元,银行体系资金面极度紧缩的局面得到明显缓解,央票利率结束了连续上扬的局面,回购利率高位回落。

整体来看,货币市场行情以6月中旬为界分为两个阶段,前一阶段回购、Shibor及央票利率大体平稳,短融遭遇市场热烈追捧,一二级市场溢价突出6月中下旬之后,回购利率大举冲高后虽有回落,但整体波动区间提升大约70bp,Shibor及央票利率随之大幅上扬,短融虽然一度遇冷,但较高的收益依旧保持了对机构的吸引力,收益率在经历了大幅上扬后保持了大约20bp的一二级市场利差。

4.4.1.2 报告期内本基金投资策略分析

上半年,货币市场行情风云突变,在这种极端情况下,本基金始终把组合的流动性放在首位,力争寻求收益最大化和风险最小化的最佳平衡,并且在此期间也获得了较好的投资收益。在对基金规模成长性、持有人结构及投资行为进行分析以及对短期货币市场利率走势、央行政策导向的深入研究后,本基金对组合结构进行了一定的调整,在短期利率面临上升压力的环境下,尽量降低了组合的投资剩余期限,同时适度增持相对收益较高的信用产品。通过对组合的优化管理,始终保证了收益一贯的稳定性、持续性和基金运作的合规性。

4.4.2 本基金业绩表现

2010年上半年,长盛货币市场基金净值收益率为0.9246%,同期业绩比较基准收益率1.1158%。

4.5 对宏观经济、证券市场及行业走势等的简要展望

4.5.1 对下半年宏观经济和货币市场展望

在欧洲债务危机持续深化的外部经济条件下,国内经济又面临着宏观调控刺激措施逐步退出,地方融资平台受到严控,房地产调控政策接连出台的不利影响,在这一状况下,市场对短中长期的国民经济走势均出现了相对悲观的看法。但是,从我们的视角看,市场参与者对经济的预期存在从过度悲观中逐步修正的需要,下半年的经济增长将通过"软着陆"的形态呈现,而非市场担心的二次探底。我们做出这一判断的依据在于,下半年持续不断出台的各项结构调整政策会更加注重与保增长的平衡,这将有效地遏制经济增速急剧下滑的风险,这些政策包括保障性住房建设、中西部崛起以及对民营经济支持力度的进一步加大。

物价方面,我们预计随着经济增速的放缓未来通胀急剧恶化的风险将显著降低,CPI指数在三季度仍将保持在3%以上,但在四季度有望出现显著下降。同时,我们还将密切关注今年多变的气候条件、农牧产品生产中存在的结构性问题以及其他未可知因素推升物价走势的可能。

随着经济增速的放缓和通胀恶化可能性的降低,我们相应地调低了对下半年加息可能的预期,预计下半年央行逐步改变在公开市场持续净投放的行为。同时,考虑到上半年较长的回笼期限以及年末过低的到期资金,预计央行将减少甚至停止3年央票的使用,而6个月央票重启的必要在上升。

综合来看,下半年在相对较高平台上运行的物价水平,以及公开市场净投放的结束将对货币市场利率形成有力支撑,而年初预防性信贷额度控制下下半年相对较大的新增信贷规模将继续分流债市以及资金市场的资金供给,预计下半年货币市场利率在当前平台运行的基础上将择机再次向上突破。当然,具体的时机还需视外部资金的流动状况、货币政策的实际走向以及新股发行的节奏而定。

4.5.2 本基金下半年投资策略

基于上述判断,下半年本基金仍继续坚持把保证组合流动性放在第一位,在保证组合良好流动性的前提下,密切关注国内及国外经济环境的变化,加强对市场走势的深入研究,坚持滚动操作策略,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,进一步着力于组合资产流动性与收益性的良好匹配;另一方面,积极关注市场不断推出的新投资品种,挖掘更多的投资机会,包括各种信用产品和浮息品种,在市场利率面临整体调整风险的情况下,选择更易规避利率风险,并且流动性良好的投资品种,进一步加强对短期融资券等信用产品的深入研究,尽量提高抗风险能力;积极关注宏观经济和政策面变化带来的货币市场可能出现的交易机会;最后密切跟踪持有人结构的变化。

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,2010年上半年度分配利润14,431,095.58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。

本报告期内,本基金持有一家公司发行的证券(10柳化工CP01)出现超过该证券的10%的情况,托管人及时进行了提示,管理人次日将比例调整到位,并表示今后将加强监测和计算,严格核查投资过程中基金法规规定与合同约定的所有风控点,以防止任何疏漏出现。

5.3 托管人对本半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半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 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:长盛货币市场基金

报告截止日:2010年6月30日

单位:人民币元

资 产	本期末 2010年6月30日	上年度末 2009年12月31日
资 产:		
银行存款	109,944,965.90	831,622,255.39
结算备付金	-	-
存出保证金	-	-
交易性金融资产	1,035,475,606.45	2,636,297,977.15
其中:股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	1,035,475,606.45	2,636,297,977.15
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	296,600,764.90
应收证券清算款	10,083,695.48	-
应收利息	9,597,357.76	13,473,530.70
应收股利	-	-
应收申购款	12,029,050.53	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	27,356.75	27,356.75
资产总计	1,177,158,032.87	3,778,021,884.89
负债和所有者权益	本期末 2010年6月30日	上年度末 2009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	201,599,497.60	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	368,208.23	577,370.04
应付托管费	111,578.24	174,960.65
应付销售服务费	278,945.62	437,401.56
应付交易费用	17,997.15	14,368.97
应交税费	680,000.00	206,000.00
应付利息	31,841.70	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	189,200.35	100,000.00
负债合计	203,277,268.89	1,510,101.22
所有者权益:		
实收基金	973,880,763.98	3,776,511,783.67
未分配利润	-	-
所有者权益合计	973,880,763.98	3,776,511,783.67
负债和所有者权益总计	1,177,158,032.87	3,778,021,884.89

注:报告截止日2010年6月30日,基金份额净值:1.00元,基金份额总额973,880,763.98份。后附财务报表附注为本财务报表的组成部分。

6.2 利润表

会计主体:长盛货币市场基金

本报告期:2010年1月1日至2010年6月30日

单位:人民币元

项 目	本期 2010年1月1日至2010年6月30日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年6月30日
一、收入	20,612,477.01	46,501,064.63
1.利息收入	16,466,414.01	42,721,714.97
其中:存款利息收入	1,341,085.56	1,122,920.40
债券利息收入	14,662,233.86	41,598,794.57
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	463,094.59	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	4,146,063.00	3,779,349.66
其中:股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	4,146,063.00	3,779,349.66
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)	-	-
减:二、费用	6,181,381.43	15,845,953.62
1.管理人报酬	2,696,746.07	6,893,733.81
2.托管费	817,195.78	2,089,010.23
3.销售服务费	2,042,989.43	5,222,525.56
4.交易费用	-	-
5.利息支出	431,885.40	1,421,115.95
其中:卖出回购金融资产支出	431,885.40	1,421,115.95
6.其他费用	192,564.75	219,568.07
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	14,431,095.58	30,655,111.01
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	14,431,095.58	30,655,111.01

注:后附财务报表附注为本财务报表的组成部分。

6.3 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:2010年1月1日至2010年6月30日

单位:人民币元

项 目	本期 2010年1月1日至2010年6月30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)	-	14,431,095.58	14,431,095.58
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)	-2,802,631,019.69	-	-2,802,631,019.69
其中:1.基金申购款	5,988,859,310.12	-	5,988,859,310.12
2.基金赎回款(以"-"号填列)	-8,791,490,329.81	-	-8,791,490,329.81
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	-	-14,431,095.58	-14,431,095.58
五、期末所有者权益(基金净值)	973,880,763.98	-	973,880,763.98
项 目	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年6月30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)	8,025,534,489.46	-	8,025,534,489.46
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	30,655,111.01	30,655,111.01
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)	-5,549,801,793.00	-	-5,549,801,793.00
其中:1.基金申购款	7,955,005,482.79	-	7,955,005,482.79
2.基金赎回款(以"-"号填列)	-13,504,807,275.80	-	-13,504,807,275.80
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	-	-30,655,111.01	-30,655,111.01
五、期末所有者权益(基金净值)	2,475,732,696.45	-	2,475,732,696.45

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:

陈礼华 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

6.4 报表附注

6.4.1 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。

6.4.2 关联方关系

6.4.2.1 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。

6.4.2.2 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
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

6.4.3 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。

6.4.3.1 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。

6.4.3.2 关联方报酬

6.4.3.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年6月30日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,696,746.07	6,893,733.81
其中:支付给销售机构的客户维护费	495,176.98	913,155.89

注:支付基金管理人长盛基金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。

6.4.3.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年6月30日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年6月30日
当期应支付的托管费	817,195.78	2,089,010.23

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0.10%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×0.10%/当年天数。

6.4.3.2.3 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 2010年1月1日至2010年6月30日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
长盛基金	968,810.92
兴业银行	52,901.81
国元证券	2,262.02
合计	1,023,974.75
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年6月30日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
长盛基金	2,832,018.82
兴业银行	107,918.49
国元证券	44,442.22
合计	2,984,379.53

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,再由长盛基金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。

6.4.3.3 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 2010年1月1日至2010年6月30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	-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2009年1月1日至2009年6月30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	-	10,017,061.51	-	-	-	-

6.4.3.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.3.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金管理人于本报告期(2010年1月1日至2010年6月30日)及上年度可比期间内均未投资本基金份额。

6.4.3.4.2 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(2010年6月30日)及上年度末均未投资本基金份额。

6.4.3.5 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 2010年1月1日至2010年6月30日		上年度可比期间 2009年1月1日至2009年6月30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	109,944,965.90	1,315,439.33	1,604,991.64	1,059,021.21

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。

6.4.3.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期间及比较期间内未参与关联方承销证券交易。

6.4.3.7 其他关联交易事项的说明:无。

6.4.4 期末(2010年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.4.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金报告期末未持有因认购新发/增发的流通受限证券。

6.4.4.2 期末持有的暂时停牌等流通受限证券

本基金报告期末未持有暂时停牌等流通受限证券。

6.4.4.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.4.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2010年6月30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201,599,497.60元,是以如下债券作为质押:

金额单位:人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量(张)	期末估值总额
050503	05工行03	2010-07-06	99.13	100,000	9,913,140.46
070219	07国开19	2010-07-06	100.06	300,000	30,019,382.75
090205	09国开05	2010-07-06	100.34	300,000	30,102,899.56
100209	10国开09	2010-07-06	99.85	1,000,000	99,854,399.50
080303	08进出03	2010-07-06	99.92	200,000	19,983,063.28
070420	07农发20	2010-07-06	100.14	200,000	20,027,952.35
合计				2,100,000	209,900,837.90

6.4.4.3.2 交易所市场债券正回购

本基金报告期末无交易所市场债券正回购。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	资产组合	金额	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	1,035,475,606.45	87.96
	其中:债券	1,035,475,606.45	87.96
	资产支持证券	-	-
2	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	银行存款和结算备付金合计	109,944,965.90	9.34
4	其他各项资产	31,737,460.52	2.70
5	合计	1,177,158,032.87	100.00

7.2 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	3.27	
	其中:买断式回购融资	0.00	
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	201,599,497.60	20.70
	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

序号	发生日期	融资余额占基金资产净值的比例(%)	原因	调整期
1	2010-06-30	20.70	大额赎回导致被动超标	到2010年7月1日调整完毕

7.3 基金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

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	123
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	183
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	70

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明:

序号	发生日期	平均剩余期限(天数)	原因	调整期
1	2010-3-17	183	大额赎回导致被动超标	到2010年3月18日调整完毕

7.3.2 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	32.83	20.70
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	10.25	-
2	30天(含)-60天	10.28	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	18.48	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	8.21	-
4	90天(含)-180天	19.51	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)-397天(含)	37.55	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		118.65	20.70

7.4 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

序号	债券品种	摊余成本	占基金资产净值的比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	319,638,961.52	32.82
	其中:政策性金融债	299,812,680.61	30.79
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	715,836,644.93	73.50
6	其他	-	-
7	合计	1,035,475,606.45	106.32
8	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	179,802,962.72	18.46

注:上表中,债券的成本包括债券面值和折溢价。

7.5 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	100209	10国开09	1,000,000	99,854,399.50	10.25
2	060202	06国开02	1,000,000	99,824,983.17	10.25
3	1081066	10方正CP01	900,000	90,173,484.48	9.26
4	1081067	10苏龙CP01	600,000	60,186,074.08	6.18
5	1081030	10恒逸CP01	500,000	50,100,605.36	5.14
6	0981227	09首钢CP01	500,000	50,045,130.20	5.14
7	0981214	09攀钢集CP02	500,000	49,992,095.50	5.13
8	1081086	10鄂化工CP01	400,000	40,143,854.11	4.12
9	0981248	09阳光CP01	400,000	40,000,000.00	4.11
10	090205	09国开05	300,000	30,102,899.56	3.09

7.6 "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	101
报告期内偏离度的最高值	0.4840%
报告期内偏离度的最低值	0.1082%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.3366%

7.7 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。

7.8 投资组合报告附注

7.8.1 基金计价方法说明

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。

7.8.2 本报告期内,本基金持有的剩余期限小于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资产净值20%的情况

本报告期内不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20%的情况。

7.8.3 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,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、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。

7.8.4 其他资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	10,083,695.48
3	应收利息	9,597,357.76
4	应收申购款	12,029,050.53
5	其他应收款	27,356.75
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	31,737,460.52

7.8.5 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 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额