

# 长盛货币市场基金 招募说明书（更新）摘要

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

## 重要提示：

投资有风险，投资人申购基金时应认真阅读招募说明书。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《基金法》）、《证券投资基金运作管理办法》（以下简称《运作办法》）、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

本招募说明书（更新）所载内容截止日为2006年12月12日，有关财务数据和净值表现截止日为2006年9月30日（财务数据未经审计）。

一、基金合同生效的日期：2005年12月12日

## 二、基金管理人

### （一）基金管理人概况

名称：长盛基金管理有限公司

住所：深圳市福田区华富路航都大厦13C

办公地址：北京市海淀区北太平庄路18号城建大厦A座20-22层

法定代表人：凤良志

电话：（010）82255818

传真：（010）82255988

联系人：叶金松

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10000万元。目前，本公司股东及其出资比例为：国元证券有限责任公司49%、安徽省创新投资有限公司26%、安徽省投资集团有限责任公司25%。截至2006年9月30日，基金管理人共管理四支封闭式基金、四支开放式基金和四个社保基金委托资产组合，公募基金管理资产规模约112亿元。

### （二）主要人员情况

#### 1、基金管理人董事会成员

凤良志先生，董事长，博士，高级经济师。曾历任安徽省政府办公厅第二办公室副主任、安徽省国际信托投资公司副总经理、安徽省证券管理办公室主任、安徽省政府驻香港窗口公司（黄山有限公司）董事长、安徽省国际信托投资公司副总经理（主持工作）、安徽国元控股（集团）有限责任公司暨国元信托有限责任公司董事长，现为国元证券有限责任公司董事长。

钱进先生（342301194601110231），董事，学士，高级工程师。曾历任安徽省全椒柴油机厂厂长、党委书记，全椒县政府副县长，全椒县委副书记、书记，滁州市常务副市长、市长，安徽省经贸委副主任，现为安徽省投资集团有限责任公司总经理、党委书记。

蔡咏先生，董事，学士，高级经济师。曾在安徽财贸学院财政金融系任会计教研室主任、安徽省国际经济技术合作公司美国（塞班）分公司任财务经理，历

任安徽省国际信托投资公司国际金融部经理、深圳证券营业部总经理、安徽省政府驻香港窗口公司（黄山有限公司）总经理助理、安徽省国际信托投资公司证券总部副总经理，现为国元证券有限责任公司董事、总裁。

叶斌先生，董事，学士，高级经济师。曾任安徽大学管理系讲师、教研室副主任，历任安徽省信托投资公司部门经理、副总经理，现为安徽省中小企业信用担保中心副主任、安徽省创新投资有限公司总经理。

陈平先生，董事，硕士研究生。曾在合肥工业大学管理系任教，历任安徽省国际信托投资公司证券发行部副经理、证券投资部经理，现为国元证券有限责任公司副总裁。

钱进先生（340104650425209），董事，硕士研究生。曾历任安徽省节能中心副主任、安徽省经贸投资集团董事、安徽省医药集团股份公司总经理，现为安徽省投资集团有限责任公司资本运营部经理。

徐经长先生，独立董事，博士，教授；中国人民大学商学院MPAcc中心主任，会计系副主任。财政部教材编审委员会委员；香港中文大学和清华大学FMBA项目特聘教授；香港理工大学MPAcc项目特聘教授。已主持国家社科基金、国家自然科学基金、财政部重点会计科研课题四项；主要研究领域为国际比较会计、证券市场会计监管。已公开出版专著两部，主编教材五本；在《经济理论与经济管理》、《财贸研究》、《会计研究》等核心期刊中发表论文100余篇。

荣兆梓先生，独立董事，经济学学士，教授；兼任黄山金马股份有限公司独立董事。曾任安徽省社会科学院副主编，现为安徽大学经济学院院长，校学术委员会委员，产业经济学和工商管理硕士点学科带头人；武汉大学商学院博士生导师，安徽省政府特邀咨询员；全国马经史学会常务理事，全国资本论研究会常务理事，安徽省经济学会常务理事。

陈华平先生，独立董事，博士毕业，教授，博士生导师。曾历任中国科技大学商学院信息管理与决策研究室主任、中国科技大学商学院商务智能实验室主任，现为中国科技大学商学院副院长，中国科技大学“管理科学与工程”一级学科博士点的学科带头人。

李伟强先生，独立董事，美国加州大学洛杉矶分校工商管理硕士，美国宾州州立大学政府管理硕士和法国文学硕士。曾历任摩根士丹利纽约、新加坡、香港

等地投资顾问、副总裁、花旗环球金融亚洲有限公司高级副总裁，现任香港国际资本管理有限公司董事长。

## 2、基金管理人监事会成员

钱正先生，监事，学士，高级经济师。曾历任安徽省人大常委办公厅副处长、处长，安徽省信托投资公司副总经理、党委副书记，安徽省国有资产管理局分党组书记，现为安徽省创新投资有限公司董事长。

陶炜先生，监事，学士，经济师。曾历任海南联合租赁公司总经理助理、中山集团财务公司证券营业部经理、南京民生租赁有限公司董事长，现为江南模塑科技股份有限公司董事长、国元证券有限责任公司副董事长。

肖强先生，监事，学士。曾历任中信证券有限责任公司北太平庄营业部交易部经理、营业部总经理助理，中信证券股份有限公司研究咨询部副总经理、高级分析师，中信证券股份有限公司交易部高级交易员。2002年6月加入长盛基金管理有限公司，2002年11月2日—2004年10月15日任基金同益基金经理、2004年5月22日—2005年4月22日任长盛动态精选基金基金经理，2006年4月29日至今任基金同智基金经理，曾任投资管理部副总监。

## 3、本基金基金经理

王茜女士：武汉大学工商管理硕士，9年金融从业经验。作为全国银行间市场的首批成员组建人，具有丰富的全国银行间市场投资经验和跨市场操作经验。1997年起历任武汉市商业银行信贷管理部交易员、副经理、总经理助理，2002年任职于中信证券固定收益部。2002年9月至今，就职于长盛基金管理公司投资管理部，曾协助封闭式基金债券组合管理，开放式基金债券组合管理，曾任全国社保基金债券资产委托基金经理助理，自2005年12月12日起至今任本基金基金经理，自2003年10月25日起至今兼任长盛中信全债指数增强型债券投资基金基金经理。

刘静女士：经济学学士。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，负责公司旗下基金和组合的债券资产的交易管理，自2006年11月29日起至今任本基金基金经理。

## 4、投资决策委员会成员

陈礼华先生：硕士，高级经济师。历任国务院财务税收物价大检查办公室、财政部国债司和国债金融司主任科员，华泰财产保险股份有限公司投资部研发处负责人、经理，南方基金管理有限公司总经理助理兼投资总监、投资交易总监，长盛基金管理有限公司副总经理等职。现任长盛基金管理有限公司总经理。

宋炳山先生：清华大学工学硕士。历任国家科技部基础研究高技术司主任科员；博时基金管理有限公司研究部研究员，裕隆基金经理助理，基金裕阳基金经理，基金裕华基金经理，交易部总经理；富国基金管理有限公司投资副总监兼基金汉兴基金经理；东方基金管理有限责任公司分管投资副总经理兼东方龙基金经理；2006年3月起，加入长盛基金管理有限公司。现任长盛基金管理有限公司副总经理。

叶金松先生：大学，会计师。历任美菱股份有限公司财会部经理，安徽省信托投资公司财会部副经理，国元证券有限责任公司清算中心主任、风险监管部副经理、经理等职。现任长盛基金管理有限公司督察长。

李骥先生：博士，历任中体改研究会研究秘书、嘉实基金管理公司分析师、副总监。现任长盛基金管理公司研究发展部副总监。

5、上述人员之间均不存在近亲属关系。

### 三、基金托管人

名称：兴业银行股份有限公司

住所：福州市湖东路154号

办公地址：福州市湖东路154号

法定代表人：高建平

注册日期：1988年7月20日

注册资本：39.99亿元人民币

托管部门联系人：赵建明

电话：（021）62159219

传真：（021）62159217

发展概况及财务状况：兴业银行股份有限公司成立于1988年，是国务院和中国人民银行批准成立的我国首批股份制商业银行之一，总部设于福建省福州

市，注册资本 39.99 亿元，截止 2005 年末资本净额达到 200.77 亿元，资产总额达到 4739.88 亿元，各项存款余额 3552.18 亿元，各项贷款余额 2425.72 亿元，按五级分类法年末不良贷款比率 2.33%，全年实现净利润 24.55 亿元。根据英国《银行家》杂志 2006 年 7 月期公布的全球银行 1000 强的最新排名情况，该行国际排名再次大幅提升，其中按总资产排名列第 164 位，较上年提升 46 位，首次跻身全球 200 强行列；按一级资本排名列第 297 位，较上年提升 28 位。

兴业银行股份有限公司总行设资产托管部，下设综合处、核算管理处、稽核监察处、市场处等处室，共有员工 28，平均年龄 30 岁，100%员工拥有大学本科以上学历，业务岗位人员均具有基金从业资格。

兴业银行股份有限公司于 2005 年 4 月 26 日取得基金托管资格，截至 2006 年 9 月 30 日，兴业银行已托管开放式基金五只——兴业趋势投资混合型证券投资基金（LOF）、长盛货币市场基金、光大保德信红利股票型证券投资基金、兴业货币市场证券投资基金、兴业全球视野股票型证券投资基金，托管基金财产规模 50.68 亿元。

#### 四、相关服务机构

##### （一）基金份额发售机构

##### 1、直销机构

##### （1）长盛基金管理有限公司北京分公司

地址：北京市海淀区北太平庄路 18 号城建大厦 A 座 20 层

电话：（010）82255818 转 263、288

传真：（010）82255981、82255982

联系人：关威

客户服务电话：（010）62350088

##### （2）长盛基金管理有限公司上海分公司

地址：上海市浦东新区浦东南路 379 号金穗大厦 15 楼 F 座

电话：（021）68869285、（021）68869286

传真：（021）68869287

联系人：冯岩

## 2、代销机构

### （1）兴业银行股份有限公司

住所：福州市湖东路 154 号

办公地址：福州市湖东路 154 号

法定代表人：高建平

电话：（021）62677777-218937

联系人：陈晓瑾

客户服务电话：95561

### （2）中国农业银行

住所：北京海淀区复兴路甲 23 号

办公地址：北京海淀区复兴路甲 23 号

法定代表人：杨明生

电话：（010）68298560、68297268

传真：（010）68297268

联系人：蒋浩

### （3）国元证券证券有限责任公司

住所：合肥市寿春路 179 号

办公地址：合肥寿春路 179 号

法定代表人：凤良志

开放式基金咨询电话：安徽地区：96888；全国：400-8888-777

开放式基金业务传真：（0551）2634400-3612

联系人：李蔡

### （4）中信证券股份有限公司

住所：深圳市湖贝路 1030 号海龙王大厦

办公地址：北京市朝阳区新源南路 6 号京城大厦

法定代表人：王东明

电话：（010）84864818 转 63266

传真：（010）84865560

联系人：陈忠

(5) 广发证券股份有限公司

住所：广东省珠海市吉大海滨路光大国际贸易中心 26 楼 2611 室

办公地址：广东广州天河北路大都会广场 36、38、41 和 42 楼

法定代表人：王志伟

电话：(020) 87555888

传真：(020) 87557985

联系人：肖中梅

(6) 中国银河证券有限责任公司

住所：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

办公地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

法定代表人：朱利

电话：(010) 66568587

传真：(010) 66568536

联系人：郭京华

(7) 国泰君安证券股份有限公司

住所：上海市浦东新区商城路 618 号

办公地址：上海市延平路 135 号

法定代表人：祝幼一

电话：(021) 62580818-213

传真：(021) 62569400

联系人：芮敏祺

(8) 广发华福证券有限责任公司

住所：福州市新天地大厦 8 层

办公地址：福州市新天地大厦 8 层

法定代表人：王比

电话：(0591) 87383623

传真：(0591) 87383610

联系人：张腾

(9) 招商证券股份有限公司

住所：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 39—45 层

办公地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 39—45 层

法定代表人：宫少林

电话：（0755）82943666

传真：（0755）82943237

联系人：黄健

（10）兴业证券股份有限公司

住所：福州市湖东路 99 号标力大厦

办公地址：上海市陆家嘴东路 166 号中保大厦 18 层

法定代表人：兰荣

电话：（021）68419974

传真：（021）68419867

联系人：杨盛芳

（11）恒泰证券有限责任公司

住所：内蒙古呼和浩特市新城区东风路 111 号

办公地址：上海松林路 357 号通贸大厦 20 楼

法定代表人：李庆阳

电话：（021）68405392

客户服务电话：（021）68405392

传真：（021）68405181

联系人：吴夕芳

（12）德邦证券有限责任公司

住所：沈阳市沈河区小西路 49 号

办公地址：上海市浦东南路 588 号浦发大厦 26 层

法定代表人：王军

电话：（021）68590808-8119

传真：（021）68596077

联系人：罗芳

（13）海通证券股份有限公司

住所：上海市淮海中路 98 号

办公地址：上海市淮海中路 98 号

法定代表人：王开国

电话：（021）53594566—4125

传真：（021）53858549

联系人：金芸

（14）中信建投证券有限责任公司

住所：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址：北京市朝内大街 188 号

法定代表人：黎晓宏

开放式基金咨询电话：400-8888-108

开放式基金业务传真：（010）65182261

联系人：权唐

（15）光大证券股份有限公司

住所：上海市浦东新区浦东南路 528 号上海证券大厦南塔 15-16 楼

办公地址：上海市浦东新区浦东南路 528 号上海证券大厦南塔 14 楼

法定代表人：王明权

电话：（021）68816000

客户服务咨询电话：（021）68823685

传真：（021）68815009

联系人：刘晨

（16）长江证券有限责任公司

住所：武汉市新华下路特 8 号

办公地址：武汉市新华下路特 8 号

法定代表人：明云成

电话：（027）65799560

传真：（027）85481532

联系人：毕艇

（17）申银万国证券股份有限公司

住所：上海市常熟路 171 号

办公地址：上海市常熟路 171 号

法定代表人：谢平

电话：（021）54033888

传真：（021）54035333

联系人：王序微

（18）联合证券有限责任公司

住所：深圳市深南东路 5047 号发展银行大厦 10、14、24、25 楼

办公地址：深圳市深南东路 5047 号发展银行大厦 10、14、24、25 楼

法定代表人：王政

电话：（0755）82492000

传真：（0755）82492062

联系人：范雪玲

客户服务电话：400-8888-555，（0755）25125666

（19）招商银行股份有限公司

住所：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

办公地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

法定代表人：秦晓

电话：（0755）83195834，82090060

传真：（0755）83195049，82090817

联系人：朱虹、刘薇

客服电话：95555

公司网址：[www.cmbchina.com](http://www.cmbchina.com)

（二）注册登记机构

名称：长盛基金管理有限公司

住所：深圳市福田区华富路航都大厦 13C

办公地址：北京市海淀区北太平庄路 18 号城建大厦 A 座 21 层

法定代表人：凤良志

电话：（010）82255818

传真：（010）82255988

联系人：戴君棉

（三）出具法律意见书的律师事务所和经办律师

名称：北京市广盛律师事务所

住所：北京市建国路99号中服大厦25层

办公地址：北京市建国路99号中服大厦25层

法定代表人：夏善胜

电话：（010）65813529

传真：（010）65816534

经办律师：吴军

（四）审计基金财产的会计师事务所

名称：普华永道中天会计师事务所有限公司

住所：上海市浦东新区沈家弄325号

办公地址：上海市湖滨路202号普华永道中心11楼

法定代表人：Kent Watson

电话：（021）61238888

传真：（021）61238800

经办注册会计师：汪棣、薛竞

## 五、基金的名称

本基金名称：长盛货币市场基金

## 六、基金的类型

基金类型：契约型开放式

## 七、基金的投资目标

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。

## 八、基金的投资方向

本基金将投资于以下金融工具：

- （一）现金；
- （二）一年以内（含一年）的银行定期存款、大额存单；
- （三）剩余期限在三百九十七天以内（含三百九十七天）的债券；
- （四）期限在一年以内（含一年）的债券回购；
- （五）期限在一年以内（含一年）的中央银行票据；
- （六）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；
- （七）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。

## 九、基金的投资策略与程序

### （一）投资决策依据

- 1、国家有关法律、法规和本基金合同的有关规定。
- 2、宏观经济、微观经济运行状况，货币政策和财政政策执行状况，货币市场和证券市场运行状况；
- 3、策略分析师、固定收益分析师、定量分析师各自独立完成相应的研究报告，为投资策略提供依据。

### （二）投资决策程序

#### 1、投资组合计划的拟定

基金管理小组每月月末拟定下月资产配置计划，报投资决策委员会审批。投资组合计划制定的依据未来宏观经济形势、财政与货币政策、短期市场资金供求等因素变化的研究与分析，以及据此作出的对未来短期内不同市场、不同品种的市场利率的积极判断，在此基础上基金管理小组制定未来一段时间基金组合的期限结构和品种配置计划，并报投资决策委员会审批。投资组合计划是未来一段时间投资的基础与纲领。

如果基金管理小组认为影响各期限、品种收益率的因素产生了重大变化，还可以临时提出新的投资计划，并由投资决策委员会审批。

#### 2、投资计划的实施

基金管理小组在投资委员会通过的投资组合计划规定限制下，根据市场的实际情况，按照投资策略实施步骤，采用积极投资策略，通过动态调整优化投资组合，追求当期收益最大化。在动态调整的过程中，基金管理小组将全面考虑收益目标、交易成本、市场流动性等特征，实现收益与风险的平衡。

在组合调整过程中，基金管理小组将根据未来可预测资金流动状况，合理管理组合现金头寸，保证组合流动性。

### 3、交易执行

中央交易室负责执行基金管理小组下达的交易指令，同时履行一线监控的职能。在交易指令执行前，中央交易室对交易指令进行复核，确保交易指令执行后基金各项投资比例符合法律法规以及基金合同、招募说明书的各项规定。

### 4、组合监控与调整

基金经理与公司的风险管理人员将密切关注宏观经济和市场变化，结合基金申购和赎回导致的现金流量情况，每日对组合的风险和流动性进行监控，确保基金的各项风险控制指标维持在合理水平，确保组合的流动性能够满足投资者的赎回要求。当组合中货币市场工具价格波动引起组合投资比例不能符合控制标准时，或当组合中货币市场工具信用评级调整导致信用等级不符合要求时，基金管理小组应采取有效的措施，在合理的时间内调整组合。

## （三）投资管理的方法

本基金在投资组合管理中采用主动投资策略，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。本基金的核心投资策略由四部分组成：短期市场利率预期策略、期限机构的滚动配置策略、投资组合优化策略、无风险套利操作策略。

### 1、短期市场利率预期策略

短期利率预期策略是指基金管理人根据对短期货币市场有影响的宏观经济形势、财政与货币政策、短期市场资金供求等因素变化作出研究与分析，对未来短期内不同市场、不同品种的市场利率进行积极的判断，并以此为依据制定未来一段时间基金组合的期限结构和品种配置计划，期限结构与品种配置计划是未来一段投资的基础。

## 2、期限结构的滚动配置策略

为了保证组合资产高流动性，组合资产在到期期限配置上采用滚动配置的策略，即在一个相对固定的投资周期中，将各期限品种的投资均衡分布在不同时间上，从而保证在投资周期内的任何时刻都有稳定的到期现金流，最大限度地提高到期期限约束条件下的流动性。

## 3、投资组合优化策略

投资组合优化管理策略是指在期限结构与品种比例约束下，在滚动配置策略的基础上采用优化技术获得最大化收益的策略体系。其优化目标是组合资产收益最大化，约束条件为期限结构比例约束、品种类属比例约束、信用风险约束等。

## 4、无风险套利操作策略

由于市场环境差异以及市场参与成员的不同，市场中常常存在无风险套利机会。本基金管理人认为随着市场有效性的提高，无风险套利的机会与收益会不断减少，但是相信在较长一段时间中市场中仍然会存在的无风险套利机会，基金管理人将贯彻谨慎的原则，充分把握市场无风险套利机会，为投资人带来更大收益。

同时，随着市场的发展、新的货币投资工具的推出，会产生新的无风险套利机会，本基金将加强对市场前沿的研究，及时发现市场中新的无风险套利机会，扩大基金投资收益。

为了保证上述投资策略的顺利实施，基金管理人根据货币市场基金的特点，开发了货币资产组合优化管理系统，以提高投资决策的科学化与实时化。

### （四）投资品种的选择标准

在上述组合管理的基础上，基金管理小组也将充分重视根据市场形势灵活把握投资品种的主动选择，具有下列一项或多项特征的投资品种是本基金重点投资的对象：

- 1、在相似到期期限和信用等级下，收益率较高的债券、票据或债券回购；
- 2、相似条件下，流动性较高的债券、票据；
- 3、相似条件下，交易对手信用等级较高的债券、票据或债券回购。

### （五）投资限制

基金管理人应依据有关法律法规及《基金合同》规定，运作管理本基金。为了实现投资目标，贯彻投资理念，本基金投资组合遵循下列规定：

1、本基金不得投资于以下金融工具：

- (1) 股票
- (2) 可转换债券
- (3) 剩余期限超过三百九十七天的债券
- (4) 信用等级在AAA级以下的企业债券
- (5) 以定期存款为基准利率的浮动利率债券
- (6) 中国证监会、中国人民银行禁止投资的其他金融工具。

2、投资组合遵循如下投资限制

(1) 投资于同一公司发行的短期企业债券的比例，不得超过基金资产净值的百分之十；

(2) 存放在具有基金托管资格的同一商业银行的存款，不得超过基金资产净值的百分之三十；存放在不具有基金托管资格的同一商业银行的存款，不得超过基金资产净值的百分之五；

(3) 除发生巨额赎回情形外，债券正回购的资金余额在每个交易日均不得超过基金资产净值的 20%。因发生巨额赎回导致债券正回购的资金余额超过基金资产净值 20%的，基金管理人应在 5 个工作日内进行调整。

(4) 投资组合的平均剩余期限在每个交易日都不得超过 180 天。

(5) 持有的剩余期限不超过 397 天但剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券的摊余成本总计不得超过当日基金资产净值的 20%。

(6) 通过买断式回购融入的基础债券的剩余期限不得超过 397 天。

(7) 本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%。

(8) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过该基金资产净值的 10%。

(9) 本公司管理的全部证券投资基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%。

(10) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过该基金资产净值的 20%。

(11) 因基金规模或市场变化等原因导致投资组合超出上述规定不在限制之

内，但基金管理人应在 10 个交易日内进行调整，以达到上述标准。

(12) 法律法规或监管部门对上述比例、限制另有规定的，从其规定。

### 3、投资组合平均剩余期限计算方法

平均剩余期限的计算公式为：

$$\frac{\sum \text{投资于金融工具产生的资产} \times \text{剩余期限} - \sum \text{投资于金融工具产生的负债} \times \text{期限} + \text{债券正回购} \times \text{期限}}{\text{投资于金融工具产生的资产} - \text{投资于金融工具产生的负债} + \text{债券正回购}}$$

### (六) 禁止行为

本基金禁止以下投资行为：

- 1、以基金的名义使用不属于基金名下的资金买卖证券或进行证券回购；
- 2、从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- 3、买卖其他基金份额，但是国务院另有规定的除外；
- 4、将基金资产用于担保、资金拆借或者贷款；
- 5、从事证券信用交易；
- 6、从事可能使基金承担无限责任的投资；
- 7、投资于与基金托管人或基金管理人有关利益关系的公司发行的证券；
- 8、与管理人的股东进行交易，通过交易上的安排人为降低投资组合的平均剩余期限的真实天数；
- 9、法律法规及监管机关规定禁止从事的其他行为。

### 十、基金的业绩比较标准

本基金业绩比较基准为银行一年期定期存款利率（税后）。

### 十一、基金的风险收益特征

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。

### 十二、基金的投资组合报告

本基金管理人的董事会及董事保证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 2006 年 10 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告所载数据内容截止日为 2006 年 9 月 30 日,相关财务资料未经审计。

### 1、报告期末基金资产组合情况

资产组合	金额（人民币元）	占基金总资产的比例
债券投资	684,136,263.52	97.53%
买入返售证券	9,900,000.000	1.41%
其中：买断式回购的买入返售证券	0.00	0.00%
银行存款和清算备付金	4,830,418.95	0.69%
其中：定期存款	0.00	0.00%
其他资产	2,597,175.42	0.37%
合计	701,463,857.89	100.00%

### 2、报告期债券回购融资情况

序号	项目	金额（人民币元）	占基金资产净值比例
1	报告期内债券回购融资余额	7,702,020,000.00	12.86%
	其中：买断式回购融资	0.00	0.00%
2	报告期末债券回购融资余额	45,000,000.00	6.86%
	其中：买断式回购融资	0.00	0.00%

注：（1）上表中报告期内债券回购融资余额为报告期内每日的融资余额的合计数,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日融资余额占基金资产净值比例的简单平均值。

（2）本报告期内货币市场基金正回购的资金余额超过资产净值的 20%的情况

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（日）
1	2006-7-18	27.01%	大额赎回导致被动超标	到 7 月 19 日调整完毕
2	2006-7-24	20.56%	大额赎回导致被动超标	到 7 月 26 日调整完毕
3	2006-7-25	20.38%	大额赎回导致被动超标	到 7 月 26 日调整完毕

### 3、基金投资组合平均剩余期限

#### （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	131
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	154
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	71

报告期内无投资组合平均剩余期限超过 180 天情况。

(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 天内	0.74%	6.86%
2	30 天（含）—60 天	10.63%	0.00%
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	9.12%	0.00%
3	60 天（含）—90 天	24.38%	0.00%
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	7.63%	0.00%
4	90 天（含）—180 天	61.90%	0.00%
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	3.05%	0.00%
5	180 天（含）—397 天（含）	8.92%	0.00%
	合计	106.57%	6.86%

4、报告期末债券投资组合

(1) 债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	成本（人民币元）	占基金资产净值的比例
1	国家债券	0.00	0.00%
2	金融债券	189,660,974.94	28.92%
	其中：政策性金融债	169,652,765.86	25.87%
3	央行票据	385,942,643.97	58.85%
4	企业债券	108,532,644.61	16.55%
5	其他	00.00	0.00%
	合计	684,136,263.52	104.32%
	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	129,832,735.55	19.80%

注：上表中，付息债券的成本包括债券面值和折溢价，贴现式债券的成本包括债券投资成本和内在应收利息。

(2) 基金投资前十名债券明细

序号	债券名称	债券数量		成本（人民币元）	占基金资产净值的比例
		自有投资	买断式回购		
1	06 央行票据 06	1,400,000	0.00	138,625,380.45	21.14%
2	05 农发 17	1,100,000	0.00	109,845,323.16	16.75%
3	06 央行票据 08	1,000,000	0.00	98,909,412.10	15.08%
4	06 国开 08	600,000	0.00	59,807,442.70	9.12%
5	05 中信债 1	500,000	0.00	50,017,083.77	7.63%
6	06 央行票据 03	500,000	0.00	49,600,637.78	7.56%
7	06 央行票据 12	500,000	0.00	49,419,811.12	7.54%
8	06 央行票据 14	500,000	0.00	49,387,402.52	7.53%
9	06 天士力 CP01	400,000	0.00	38,515,701.14	5.87%
10	05 工行 03	200,000	0.00	20,008,209.08	3.05%

注：上表中，“债券数量”中的“自有投资”和“买断式回购”指自有的债券投资和通过债券买断式回购业务买入的债券卖出后的余额。

#### 5、“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	23
报告期内偏离度的最高值	0.6834%
报告期内偏离度的最低值	-0.0456%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.2644%

#### 6、投资组合报告附注

（1）基金计价方法说明：本基金估值采用摊余成本法，即估值对象以买入成本列示，按照票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价和折价，在剩余存续期内平均摊销，每日计提损益。

（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存在超过日基金资产净值 20%的情况，具体如下表：

序号	日期	比例	原因	调整期
1	2006-07-03	22.86%	基金规模波动导致超标	到 7 月 4 日调整完毕
2	2006-07-20	20.44%	基金规模波动导致超标	到 7 月 24 日调整完毕
3	2006-07-21	20.55%	基金规模波动导致超标	到 7 月 24 日调整完毕
4	2006-07-22	20.55%	基金规模波动导致超标	到 7 月 24 日调整完毕
5	2006-07-23	20.55%	基金规模波动导致超标	到 7 月 24 日调整完毕

（3）本报告期内无需说明的证券投资决策程序。

（4）报告期末其他资产构成

序号	其他资产	金额（人民币元）
1	应收利息	2,597,073.45
2	待摊费用	101.97
合 计		2,597,175.42

### 十三、基金的业绩

	2005.12.12- 2005.12.31	2006.1.1- 2006.9.30	自成立至 2006.9.30
基金份额净值增长率	0.1058%	1.4416%	1.5489%
同期业绩比较基准收益率	0.0986%	1.3718%	1.4704%
超额收益率	0.0072%	0.0698%	0.0785%

### 十四、基金费用与税收

（一）与基金运作有关的费用

## 1、费用的种类

- (1) 基金管理人的管理费；
- (2) 基金托管人的托管费；
- (3) 证券交易费用；
- (4) 基金信息披露费用；
- (5) 基金份额持有人大会费用；
- (6) 与基金相关的会计师费和律师费；
- (7) 按照国家有关规定可以列入的其它费用。

## 2、费用计提方法、计提标准和支付方式

### (1) 基金管理人的管理费

基金管理费按前一日基金资产净值的0.33%年费率计算。计算方法如下：

$$H=E \times 0.33\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

### (2) 基金托管人的托管费

基金托管费按前一日的基金资产净值的0.10%的年费率计算。计算方法如下：

$$H=E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起两个工作日内从基金资产中一次性支取。

(3) 上述（一）项1中（3）至（7）项费用由基金托管人根据有关法规及相应协议的规定，按费用实际支出金额支付，列入当期基金费用。基金合同生效前所发生的律师费和会计师费等费用自基金发行费用中列支，不另从基金资产中支付，与基金有关的法定信息披露费按有关法规列支。

(4) 基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不得列入基金费用。

## (二) 与基金销售有关的费用

### 1、基金销售服务费

基金销售服务费按前一日的基金资产净值的0.25%的年费率计算。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的销售服务费

E为前一日的基金资产净值

基金管理人可以调整销售服务费率，但销售服务费年费率最高不超过0.25%。基金管理人必须在开始调整之日的3个工作日之前至少在一种中国证监会指定的媒体上刊登公告并报中国证监会备案。

基金销售服务费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人，由基金管理人支付给各代销机构。

### 2、基金认购费用

本基金不收取认购费用。

### 3、申购费

本基金不收取申购费用。

### 4、赎回费

本基金不收取赎回费用。

### 5、转换费

本基金可以与基金管理人所管理的长盛成长价值基金之间进行转换。转换费率如下：

(1) 由本基金转换为长盛成长价值基金，转换费如下表所示：

长盛货币基金转长盛成长价值基金转换金额 (M)	费 率
M < 100 万元	1.5%
100 ≤ M < 500 万元	1.2%

500≤M<1000 万元	0.6%
M≥1000 万元	0.2%

(2) 由长盛成长价值基金转换为本基金，转换费率为 0.5%，其中的 25% 归入长盛成长价值基金资产。

基金转换的具体业务规则详见基金管理人相关业务公告。

### (三) 税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，依照国家法律法规的规定履行纳税义务。

## 十五、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他有关法律法规的要求，对本基金 2005 年 6 月招募说明书进行了更新，主要更新内容如下：

1、在“重要提示”中，明确了更新的招募说明书内容的截止日期及有关财务数据的截止日期。

2、在“三、基金管理人”中，更新了基金管理人的相关基本情况。

3、在“四、基金托管人”中，更新了基金托管人的相关基本情况。

4、在“五、相关服务机构”中，更新了相关服务机构的内容，并增加招商银行股份有限公司作为本基金代销机构。

5、在“十、基金的投资”中做如下更新：

(1) 更新投资范围内容，增加资产支持证券投资内容。

(2) 更新业绩比较基准内容。

(3) 更新投资限制内容，增加资产支持证券投资限制的内容。

(4) 更新投资组合平均剩余期限计算方法内容，增加资产支持证券投资限制的内容。

(5) 更新投资组合报告内容，数据内容截止时间为 2006 年 9 月 30 日。

6、在“二十二、对基金份额持有人的服务”中，更新了对基金份额持有人服务内容。

7、在“二十三、其它应披露的事项”中，披露了如下事项：

- （1）2006年4月19日本基金管理人发布本基金2006年第1季度报告。
- （2）2006年5月8日本基金管理人发布本基金收益支付公告。
- （3）2006年6月1日本基金管理人发布本基金收益支付公告。
- （4）2006年6月28日本基金管理人发布关于开通全国统一客户服务号码400-888-2666公告。
- （5）2006年7月3日本基金管理人发布本基金收益支付公告。
- （6）2006年7月15日本基金管理人发布本基金临时公告。
- （7）2006年7月20日本基金管理人发布本基金临时公告。
- （8）2006年7月21日本基金管理人发布本基金2006年第2季度报告。
- （9）2006年7月22日本基金管理人发布本基金临时公告。
- （10）2006年8月1日本基金管理人发布本基金收益支付公告。
- （11）2006年8月2日本基金管理人发布本基金临时公告。
- （12）2006年8月10日本基金管理人发布本基金临时公告。
- （13）2006年8月16日本基金管理人发布本基金关于资产支持证券投资方案的公告。
- （14）2006年8月25日本基金管理人发布本基金半年度报告。
- （15）2006年9月1日本基金管理人发布本基金收益支付公告。
- （16）2006年9月26日本基金管理人发布关于本基金“十一”放假前暂停申购和转让的公告。
- （17）2006年10月9日本基金管理人发布本基金收益支付公告。
- （18）2006年10月25日本基金管理人发布本基金第3季度报告。
- （19）2006年11月1日本基金管理人发布本基金收益支付公告。
- （20）2006年11月23日本基金管理人发布关于聘任公司副总经理的公告。
- （21）2006年11月29日本基金管理人发布关于变更基金经理的公告。
- （22）2006年12月1日本基金管理人发布本基金收益支付公告。

## 十六、 签署日期

本招募说明书（更新）于 2006 年 12 月 22 日签署。

长盛基金管理有限公司  
二〇〇七年二月一日