

# 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：

本基金于2005年10月25日经中国证监会证监基金字[2005]176号文批准募集。

本基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

投资有风险，投资人申购基金时应认真阅读本招募说明书。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

本基金的基金合同已根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《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》、《货币市场基金管理暂行规定》及其它有关规定进行修订。

本招募说明书（更新）所载内容截止日为2013年6月12日，有关财务数据和净值表现截止日为2013年3月31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：深圳市福田区福中三路 1006 号诺德中心 8 层 GH 单元

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）82019988

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金字[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。截至目前，本公司股东及其出资比例为：国元证券股份有限公司占注册资本的 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%；安徽省投资集团控股有限公司占注册资本的 13%。截至 2013 年 6 月 12 日，基金管理人共管理两只封闭式基金、二十六只开放式基金和五只社保基金委托资产，同时管理专户理财产品。

### （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，管理学博士，经济学硕士，高级经济师。曾任安徽省政府办公厅二办副主任，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，香港黄山有限公司董事长、总经理，安徽国元控股（集团）有限责任公司董事长、党委书记，安徽国元信托投资有限责任公司董事长，国元证券股份有限公司董事长。现任国元证券股份有限公司董事、党委书记，兼任安徽国元控股（集团）有限责任公司党委书记。

蔡咏先生，董事，学士，高级经济师。曾任安徽财经大学财政金融系讲师、会计教研室主任，安徽省国际经济技术合作公司美国分公司财务经理，安徽省国

际信托投资公司国际金融部经理、深圳证券部经理、证券总部副总经理，香港黄山有限公司总经理助理，国元证券股份有限公司总裁。现任国元证券股份有限公司董事长、党委副书记，兼任安徽国元控股（集团）有限责任公司党委委员、国元证券（香港）有限公司董事长。

钱正先生，董事，学士，高级经济师。曾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。现任安徽省信用担保集团有限公司总经理。

杜长棣先生，董事，学士。曾任安徽省第一轻工业厅研究室副主任，安徽省轻工业厅生产技术处、企业管理处处长、副厅长，安徽省巢湖市市委常委、常务副市长，安徽省发改委副主任。现任安徽省投资集团控股有限公司董事长、党委书记。

陈淑珊女士，董事，硕士。曾任职多个金融机构，包括 ING 霸菱证券公司、花旗银行、摩根士丹利。现任星展银行有限公司私人银行业务部董事总经理兼主管。

葛甘牛先生，董事，硕士。曾任职多个金融机构，包括所罗门兄弟公司、瑞士信贷第一波士顿银行（香港）有限公司、美林集团、德意志银行、荷兰银行、中银国际控股有限公司、瑞士信贷银行股份有限公司、瑞信方正证券有限责任公司。现任星展银行（中国）有限公司董事、行长/行政总裁。

周兵先生，董事、总经理，经济学硕士。曾任中国银行总行综合计划部副主任科员、香港南洋商业银行内地融资部副经理、香港中银国际亚洲有限公司企业财务部经理、广发证券股份有限公司北京业务总部副总经理（期间兼任海南华银国际信托投资公司北京证券营业部托管组负责人）、北京朝阳门大街证券营业部总经理。2004 年 10 月加入长盛基金管理有限公司，曾任公司副总经理。现任长盛基金管理有限公司总经理。

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。

张仁良先生，独立董事，金融学讲座教授。曾任香港消费者委员会有关银行

界调查的项目协调人、太平洋经济合作理事会（PECC）属下公司管制研究小组主席、上海交通大学管理学院兼职教授、上海复旦大学顾问教授、香港城市大学讲座教授。现任香港浸会大学工商管理学院院长、民政事务总署辖下的《伙伴倡自强》小区协作计划主席、香港金融管理局 ABF 香港创富债券指数基金监督委员会主席以及香港特区政府策略发展委员会委员。2007 年被委任为太平绅士。2009 年获香港特区政府颁发铜紫荆星章。

荣兆梓先生，独立董事，教授。曾任安徽大学经济学院副院长、院长。现任安徽大学教授、校学术委员会委员、政治经济学博士点学科带头人、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，中国科技大学兼职教授，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，安徽省经济学会副会长。

陈华平先生，独立董事，博士，教授，博士生导师。曾任中国科技大学信息管理与决策研究室主任、管理学院副院长。现任中国科学技术大学计算机学院执行院长、管理学院商务智能实验室主任。

## 2、监事会成员

沈和付先生，监事，法学学士。曾任安徽省国际经济技术合作公司经理助理、安徽省信托投资公司法律部副主任。现任国元证券股份有限公司合规总监。

张利宁女士，监事，学士。曾任华北计算技术研究所会计，太极计算机公司子公司北京润物信息技术有限公司主管会计，历任长盛基金管理有限公司业务运营部总监、财务会计部总监。现任长盛基金管理有限公司监察稽核部总监。

邓永明先生，监事，学士。曾任大成基金管理有限公司研究员、交易员和基金经理助理。2005 年 7 月底加入长盛基金管理有限公司，曾任基金同益基金经理助理，同德证券投资基金基金经理，长盛同德主题增长股票型证券投资基金基金经理，长盛创新先锋灵活配置混合型证券投资基金基金经理。现任长盛基金管理有限公司权益投资部副总监，长盛动态精选证券投资基金基金经理，长盛同德主题增长股票型证券投资基金基金经理。

## 3、管理层成员

凤良志先生，董事长，管理学博士，经济学硕士，高级经济师。同上。

周兵先生，董事、总经理，经济学硕士。同上。

杨思乐先生，英国籍，拥有北京大学法学学士学位与英国伦敦政治经济学院硕士学位。从1992年9月开始曾先后任职于太古集团、摩根银行、野村项目融资有限公司、汇丰投资银行亚洲、美亚能源有限公司、康联马洪资产管理公司、星展银行有限公司（新加坡）。2007年8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。曾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。2004年10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督察长。

#### 4、本基金基金经理

贾志敏先生，1982年3月出生。北京大学经济学硕士。曾在中信银行股份有限公司从事人民币债券资产池组合的日常管理和交易等工作。2012年11月底加入长盛基金管理有限公司，现任固定收益部副总监，自2013年2月7日起任长盛货币市场基金（本基金）基金经理，自2013年2月7日起兼任长盛同禧信用增利债券型证券投资基金基金经理，自2013年3月21日起兼任长盛中信全债指数增强型债券投资基金基金经理，自2013年3月21日起兼任长盛积极配置债券型证券投资基金基金经理。

本基金历任基金经理：

王茜女士：自2005年12月12日至2008年11月6日任本基金基金经理；  
刘静女士：自2006年11月25日至2011年2月15日任本基金基金经理；  
梁婷女士：自2011年2月15日至2013年3月21日任本基金基金经理。

（本招募说明书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。）

#### 5. 投资决策委员会成员

周兵先生，董事、总经理，经济学硕士。同上。

王宁先生，EMBA。历任华夏基金管理有限公司基金经理助理，兴业基金经理等职务。2005年8月加盟长盛基金管理有限公司，曾任基金经理助理、长盛动态精选证券投资基金基金经理、长盛同庆可分离交易股票型证券投资基金基金经

理、长盛成长价值证券投资基金基金经理、长盛同庆中证 800 指数分级证券投资基金基金经理等职务。现任公司总经理助理，权益投资部总监，长盛同智优势成长混合型证券投资基金（LOF）基金经理。

侯继雄先生，清华大学博士。历任国泰君安证券研究所任研究员、策略部经理。2007 年 2 月加入长盛基金管理有限公司，现任公司总经理助理，研究部总监，同盛证券投资基金基金经理。

吴达先生，伦敦政治经济学院金融经济学硕士，美国特许金融分析师 CFA。曾就职于新加坡星展资产管理有限公司，历任星展珊瑚全球收益基金经理助理、星展增裕基金经理；新加坡毕盛高荣资产管理公司亚太专户投资组合经理、资产配置委员会成员；华夏基金管理有限公司国际策略分析师、固定收益投资经理；2007 年 8 月起加入长盛基金管理有限公司，曾任长盛积极配置债券型证券投资基金基金经理。现任国际业务部总监，长盛环球景气行业大盘精选股票型证券投资基金基金经理。

蔡宾先生，中央财经大学硕士，美国特许金融分析师 CFA。历任宝盈基金管理有限公司研究员、基金经理助理。2006 年 2 月加入长盛基金管理有限公司，曾任研究员、社保组合助理、投资经理，长盛积极配置债券基金基金经理、长盛同禧信用增利债券型证券投资基金基金经理等职务。现任固定收益部总监，社保组合组合经理，长盛同鑫保本混合型证券投资基金基金经理，长盛同鑫二号保本混合型证券投资基金基金经理。

刘斌先生，清华大学工学学士、中国科学院工学博士。2006 年 5 月加入长盛基金管理有限公司，在公司期间历任金融工程研究员、高级金融工程研究员、基金经理助理、长盛沪深 300 指数证券投资基金基金经理等职务。现任金融工程与量化投资部总监，长盛量化红利策略股票型证券投资基金基金经理，长盛成长价值证券投资基金基金经理，长盛同辉深证 100 等权重指数分级证券投资基金基金经理。

邓永明先生，监事，学士。同上。

李庆林先生，硕士。曾先后在长城证券有限公司、国元证券有限公司和建信基金管理有限公司担任研究员等职务。2009 年 2 月加入长盛基金管理有限公司，曾任研究发展部副总监，长盛创新先锋灵活配置混合型证券投资基金基金经理，

长盛同祥泛资源主题股票型证券投资基金基金经理等职务。现任社保组合组合经理。

上述人员之间均不存在近亲属关系。

### 三、基金托管人

#### 1、基本情况

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：上海江宁路 168 号兴业大厦 20 楼（资产托管部办公地址）

法定代表人：高建平

注册日期：1988 年 7 月 20 日

注册资本：127.02 亿元人民币

托管部门联系人：张志永

电话：(021) 62677777\*212004

传真：(021) 62159217

#### 2、发展概况及财务状况

兴业银行成立于 1988 年 8 月，是经国务院、中国人民银行批准成立的首批股份制商业银行之一，总行设在福建省福州市，2007 年 2 月 5 日正式在上海证券交易所挂牌上市（股票代码：601166），注册资本 127.02 亿元。

自开业以来，兴业银行始终坚持与客户“同发展、共成长”和“服务源自真诚”的经营理念，致力于为客户提供全面、优质、高效的金融服务。截至 2012 年 12 月 31 日，兴业银行资产总额达到 32,509.75 亿元，归属于母公司股东权益 1695.77 亿元，不良贷款比率为 0.43%，全年实现归属于母公司股东的净利润 347.18 亿元。根据英国《银行家》杂志最新排名，公司按一级资本排名 69 位，按总资产排名 61 位，均较上年提升 14 位。根据美国《财富》中文版中国 500 强企业最新排名，公司排名第 78 位，较上年提升 6 位。

#### 3、托管业务部的部门设置及员工情况

兴业银行股份有限公司总行设资产托管部，下设综合管理处、市场处、委托资产管理处、科技支持处、稽核监察处、运营管理处、期货业务管理处、期货存

管结算处、养老金管理中心等处室，共有员工 97 人，业务岗位人员均具有基金从业资格。

#### 4、基金托管业务经营情况

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，基金托管业务批准文号：证监基金字[2005]74 号。截止 2013 年 6 月 30 日，兴业银行已托管开放式基金 18 只——兴全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、兴全货币市场证券投资基金、兴全全球视野股票型证券投资基金、万家和谐增长混合型证券投资基金、中欧新趋势股票型证券投资基金（LOF）、天弘永利债券型证券投资基金、万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金、天弘永定价值成长股票型证券投资基金、兴全有机增长灵活配置混合型证券投资基金、中欧沪深 300 指数增强型证券投资基金、民生加银内需增长股票型证券投资基金、兴全保本混合型证券投资基金、中邮战略新兴产业证券投资基金、银河领先债券型证券投资基金、工银瑞信 60 天理财债券型证券投资基金、银河沪深 300 成长增强指数分级证券投资基金，托管基金财产规模 317.10 亿元。

## 四、相关服务机构

### （一）基金份额发售机构

#### 1、直销机构

长盛基金管理有限公司直销中心

地址：北京市海淀区北太平庄路 18 号城建大厦 A 座 20 层

邮政编码：100088

电话：（010）82019799、82019795

传真：（010）82255981、82255982

联系人：张莹、张晓丽

#### 2、代销机构

##### （1）兴业银行股份有限公司

注册地址：福州市湖东路 154 号中山大厦

办公地址：上海市江宁路 168 号兴业大厦 9 楼

法定代表人：高建平

联系人：刘玲

电话：021—52629999

传真：021—62569070

客户服务电话：95561

公司网站：[www.cib.com.cn](http://www.cib.com.cn)

（2）中国农业银行股份有限公司

住所：北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址：北京市东城区建国门内大街 69 号

法定代表人：蒋超良

联系人：高阳

电话：010—85108206

传真：010—85109219

客户服务电话：95599

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

（3）招商银行股份有限公司

注册地址：深圳市福田区深南大道 7088 号

办公地址：深圳市福田区深南大道 7088 号

法定代表人：傅育宁

联系人：邓炯鹏

电话：0755—83077278

传真：0755—83195050

客户服务电话：95555

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

（4）中国银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号

行长：李礼辉

联系人：宋府

电话：010—66594904

传真：010—66594946

客户服务电话：95566

公司网址：[www.boc.cn](http://www.boc.cn)

（5）中国建设银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街25号

办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼

法定代表人：王洪章

联系人：王嘉朔

电话：010—67596220

传真：010—66275654

客户服务电话：95533

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

（6）中国民生银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街2号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街2号

法定代表人：董文标

联系人：董云巍

电话：010—57092851

传真：010—57092611

客户服务电话：95568

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

（7）上海浦东发展银行股份有限公司

注册地址：上海市中山东一路12号

办公地址：上海市中山东一路12号

法定代表人：吉晓辉

联系人：虞谷云

电话：021—61616206

传真：021—63604199

客户服务电话：95528

公司网站：[www.spdb.com.cn](http://www.spdb.com.cn)

（8）交通银行股份有限公司

注册地址：上海市仙霞路 18 号

办公地址：上海市银城中路 188 号

法定代表人：胡怀邦

联系人：张作伟

电话：021-58781234

传真：021-58408842

客户服务电话：95559

网址：[www.bankcomm.com](http://www.bankcomm.com)

（9）中信银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座

办公地址：北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座

法定代表人：田国立

联系人：赵树林

电话：010-65556960

传真：010-65550981

客户服务电话：95558

公司网址：<http://bank.ecitic.com>

（10）中国工商银行股份有限公司

注册地址：中国北京复兴门内大街 55 号

办公地址：中国北京复兴门内大街 55 号

法定代表人：姜建清

联系人：王隽

电话：010-66107900

传真：010-66107914

客户服务电话：95588

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

（11）华夏银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街 22 号

办公地址：北京市东城区建国门内大街 22 号

法定代表人：吴建

联系人：李慧

电话：010-85238000

传真：010-85238680

客户服务电话：95577

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

（12）广发银行股份有限公司

注册地址：广州市越秀区东风东路713号

办公地址：广州市越秀区东风东路713号

法定代表人：董建岳

联系人：李静筠

电话：020-38321739

传真：020-87311780

客户服务电话：400-830-8003

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

（13）国元证券股份有限公司

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

联系人：祝丽萍

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) 2272100

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

（14）中信证券股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区新源南路6号京城大厦

法定代表人：王东明

联系人：张于爱

电话：010-84864818

传真：010-84865560

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

（15）广发证券股份有限公司

注册地址：广州天河区天河北路 183-187 号大都会广场 43 楼

办公地址：广州天河北路大都会广场 5、18、19、36、38、41 和 42 楼

法定代表人：林治海

联系人：黄岚

统一客户服务热线：95575 或致电各地营业网点

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

（16）中国银河证券股份有限公司

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：陈有安

联系人：田薇

电话：（010）66568430

传真：（010）66568536

客服电话：400-888-8888

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

（17）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：万建华

联系人：芮敏祺

电话：（021）62580818-213

传真：（021）62569400

客服电话：95521

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

（18）华福证券有限责任公司

住所：福州市五四路157号新天地大厦7、8层

办公地址：福州市五四路157号新天地大厦7至10层

法定代表人：黄金琳

联系人：张腾

电话：（0591）87383623

传真：（0591）87383610

统一客户服务电话：96326

公司网址：www.hfzq.com.cn

（19）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40—45层

办公地址：深圳市福田区益田路江苏大厦A座40—45层

法定代表人：宫少林

联系人：林生迎

电话：0755-82943666

传真：0755-82943237

客户服务热线：95565、4008888111、（0755）26951111

公司网址：www.newone.com.cn

（20）兴业证券股份有限公司

注册地址：福州市湖东路268号

办公地址：浦东新区民生路1199弄证大五道口广场1号楼21层

法定代表人：兰荣

联系人：谢高得

电话：021-38565785

传真：021-38565955

客服服务热线：95562

公司网址：www.xyzq.com.cn

（21）恒泰证券有限责任公司

住所：内蒙古自治区呼和浩特市新城区东风路111号

办公地址：上海浦东松林路357号通贸大厦20楼

法定代表人：刘汝军

联系人：张同亮

电话：021-68405273

传真：021-68405181

客户服务电话：0471-4961259

公司网址：www.cnht.com.cn

（22）德邦证券有限责任公司

住所：上海市普陀区曹杨路 510 号南半幢 9 楼

办公地址：上海市福山路 500 号城建大厦 26 楼

法定代表人：方加春

联系人：罗芳

电话：021-68761616

传真：021-68767981

客户服务电话：400-888-8128

公司网址：www.tebon.com.cn

（23）海通证券股份有限公司

住所：上海市广东路689 号海通证券大厦

办公地址：上海市广东路689 号海通证券大厦

法定代表人：王开国

联系人：李笑鸣

联系电话：021-53594566-4125

传真：021-53858549

客服电话：400-8888-001、（021）962503

公司网址：www.htsec.com

（24）中信建投证券股份有限公司

住所：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址：北京市朝阳区门内大街 188 号

法定代表人：王常青

联系人：权唐

开放式基金咨询电话：400-8888-108

开放式基金业务传真：（010）65182261

客服电话：400-8888-108

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

（25）光大证券股份有限公司

住所：上海市静安区新闻路1508号

办公地址：上海市静安区新闻路1508号

法定代表人：徐浩明

联系人：刘晨、李芳芳

联系电话：021-22169999

客户服务热线：4008888788、10108998

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

（26）长江证券股份有限公司

注册地址：武汉市新华路特8号长江证券大厦

法定代表人：胡运钊

联系人：李良

联系电话：027-65799999

传真：027-85481900

客服电话：95579 或 4008-888-999

公司网址：[www.95579.com](http://www.95579.com)

（27）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：储晓明

电话：021-33389888 或 021-54033888

传真：021-54038844

客户服务电话：95523 或 4008895523

电话委托：021-962505

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

(28) 中信证券（浙江）有限责任公司

住所：浙江省杭州市中河南路 11 号万凯庭院商务楼 A 座

办公地址：浙江省杭州市中河南路 11 号万凯庭院商务楼 A 座

法定代表人：刘军

联系人：王勤

联系电话：0571-85783750

客户咨询电话：0571-96598

公司网址：www.bigsun.com.cn

(29) 渤海证券股份有限公司

住所：天津市经济技术开发区第二大街 42 号写字楼 101 室

法定代表人：杜庆平

联系人：王兆权

电话：022-28451861

传真：022-28451892

客户服务电话：400-651-5988

公司网址：www.bhzq.com

(30) 国联证券股份有限公司

住所：江苏省无锡市县前东街 168 号国联大厦 6 层

办公地址：江苏省无锡市太湖新城金融一街 8 号国联金融大厦 702

法定代表人：雷建辉

联系人：沈刚

开放式基金咨询电话：(0510) 82831662

开放式基金业务传真：(0510) 82830162

客户服务热线：4008885288 或 95570

公司网址：www.glsc.com.cn

(31) 中信万通证券有限责任公司

住所：青岛市崂山区苗岭路 29 号澳柯玛大厦 15 层（1507-1510 室）

办公地址：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼第 20 层

法定代表人：张智河

联系人：吴忠超

电话：0532-85022326

传真：0532-85022605

客户咨询电话：0532-96577

公司网址：www.zxwt.com.cn

（32）齐鲁证券有限公司

注册地址：济南市经七路 86 号

办公地址：济南市经七路 86 号 23 层

法定代表人：李玮

联系人：吴阳

电话：0531-68889155

传真：0531-68889752

客户服务电话：95538

公司网址：www.qlzq.com.cn

（33）华泰证券股份有限公司

地址：江苏省南京市中山东路 90 号华泰证券大厦

法定代表人：吴万善

联系人：程高峰

电话：025-84457777-893

传真：025-84579763

客户咨询电话：95597

公司网址：www.htsc.com.cn

（34）安信证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元

办公地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元

深圳市福田区深南大道2008号中国凤凰大厦1栋9层

法定代表人：牛冠兴

联系人：陈剑虹

电话：0755-82825551

传真：0755-82558355

统一客服电话：4008001001

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

（35）长城证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 14、16、17 层

办公地址：深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 14、16、17 层

法定代表人：黄耀华

联系人：李春芳

电话：0755-83516089

传真：0755-83515567

客户服务热线：0755-33680000 400-6666-888

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

（36）第一创业证券股份有限公司

住所：深圳市罗湖区笋岗路 12 号中民时代广场 B 座 25、26 层

办公地址：深圳市罗湖区笋岗路 12 号中民时代广场 B 座 25、26 层

法定代表人：刘学民

联系人：崔国良

电话：（0755）25832852

传真：（0755）25831718

客户服务电话：4008881888

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

（37）红塔证券股份有限公司

注册地址：昆明市北京路 155 号附 1 号红塔大厦 9 楼

办公地址：昆明市北京路 155 号附 1 号红塔大厦 9 楼

法定代表人：况雨林

联系人：王敏

电话：0871-3577011

客户服务电话：0871-3577930

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

（38）瑞银证券有限责任公司

注册地址：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心12层、15层

法定代表人：刘弘

联系人：牟冲

电话：010-5832-8112

客户服务热线：400-887-8827

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

（39）中国中投证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋第18层-21层及第04层01.02.03.05.11.12.13.15.16.18.19.20.21.22.23单元

办公地址：深圳市福田区益田路6003号荣超商务中心A栋第04、18层至21层

法定代表人：龙增来

联系人：刘毅

电话：0755-82023442

传真：0755-82026539

客服电话 400 600 8008

公司网址：[www.china-invs.cn](http://www.china-invs.cn)

（40）华宝证券有限责任公司

注册地址：上海市陆家嘴环路166号未来资产大厦27层

法定代理人：陈林

联系人：楼斯佳

联系电话：021-50122107

客户咨询电话：400-820-9898

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

（41）中航证券有限公司

注册地址：江西省南昌市抚河北路291号

办公地址：南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号国际金融大厦A座41楼

法定代表人：杜航

联系人：戴蕾

电话：0791-86768681

客户服务热线：400-8866-567

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

（42）平安证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场 8 楼

办公地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场 8 楼（518048）

法定代表人：杨宇翔

电话：0755-22626391

联系人：郑舒丽

客服电话：95511—8

开放式基金业务传真：0755-82400862

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

（43）信达证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

法定代表人：高冠江

联系人：唐静

电话：010-63081000

传真：010-63080978

客服电话：400-800-8899

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

（44）民生证券股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街 28 号民生金融中心 A 座 16-20 层

办公地址：北京市东城区建国门内大街 28 号民生金融中心 A 座 16-20 层

法定代表人：岳献春

客服热线：4006 19 8888

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

（45）五矿证券有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路 4028 号荣超经贸中心办公室 47 层 01 单元

办公地址：深圳市福田区金田路 4028 号经贸中心 47-49 楼

法定代表人：张永衡

联系人：赖君伟

电话：0755-23902400

传真：0755-82545500

客服电话：40018-40028

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

（46）东北证券股份有限公司

住所：长春市自由大路 1138 号

办公地址：长春市自由大路 1138 号

法定代表人：矫正中

联系人：安岩岩

开放式基金咨询电话：4006000686

开放式基金业务传真：（0431）85096795

公司网址：[www.nesc.cn](http://www.nesc.cn)

（47）华龙证券有限责任公司

注册地址：甘肃省兰州市东岗西路 638 号财富大厦

办公地址：甘肃省兰州市东岗西路 638 号财富大厦 21 楼

法定代表人：李晓安

联系人：李昕田

电话：0931-8888088

传真：0931-4890515

客户服务电话：4006898888、96668

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

（48）中国国际金融有限公司

住所：北京建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层

法定代表人：金立群

联系人：罗春蓉，武明明

联系电话：010-65051166 或直接联系各营业部

传真：010-65058065

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

（49）华鑫证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 28 层 A01、B01(b) 单元

办公地址：上海市肇嘉浜路 750 号

法定代表人：洪家新

联系人姓名：陈敏

联系人电话：021-64339000

联系人传真：021-64333051

客服电话：021-32109999、029-68918888

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

（50）江海证券有限公司

注册地址：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路 56 号

办公地址：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路 56 号

法定代表人：孙名扬

联系人：张宇宏

电话：0451-82336863

传真：0451-82287211

客户服务热线：400-666-2288

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

（51）国金证券股份有限公司

注册地址：成都市东城根上街 95 号

办公地址：成都市东城根上街 95 号

法定代表人：雷波

联系人姓名：王丹

联系人电话：028-86690125

联系人传真：028-86690126

客服电话：028-95105111

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

（52）华融证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 8 号 A 座三、五层

办公地址：北京市西城区金融大街 8 号 A 座三、五层

法定代表人：宋德清

联系人：陶颖

电话：010-58568040

传真：010-58568062

客户服务电话：010-58568118

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

(53) 山西证券股份有限公司

办公（注册）地址：山西省太原市府西街 69 号山西国际贸易中心东塔楼

法定代表人：侯巍

联系人：郭熠

联系电话：0351-8686659

传真：0351-8686619

客服电话：400-666-1618、95573

公司网址：[www.i618.com.cn](http://www.i618.com.cn)

(54) 财通证券有限责任公司

注册地址：杭州杭大路 15 号嘉华国际商务中心

办公地址：杭州杭大路 15 号嘉华国际商务中心

法定代表人：沈继宁

联系人：徐轶青

电话：0571-87822359

传真：0571-97918329

客户服务电话：96336（浙江），40086-96336（全国）

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

(55) 方正证券股份有限公司

注册地址：湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦 22-24 层

公司地址：湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦 22-24 层

法定代表人：雷杰

联系人：郭军瑞

电话：0731-85832503

传真：0731-85832214

客户服务电话：95571

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

(56) 东兴证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12-15层

办公地址：北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12-15层

法定代表人：魏庆华

联系人：汤漫川

电话：010-66555316

传真：010-6655

客服电话：4008888993

公司网址：[www.dxzq.net](http://www.dxzq.net)

(57) 国海证券股份有限公司

注册地址：广西桂林市辅星路13号

办公地址：广西南宁市滨湖路46号

法定代表人：张雅锋

联系人：牛孟宇

电话：0755-83709350

传真：0755-83704850

客户服务电话：95563

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

(58) 湘财证券有限责任公司

注册地址：湖南省长沙市天心区湘府中路198号新南城商务中心A栋11楼

办公地点：湖南省长沙市天心区湘府中路198号新南城商务中心A栋11楼

法定代表人：林俊波

电话：021-68634510-8620

传真：021-68865680

联系人：赵小明

客服电话：400-888-1551

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

（59）诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司

住所：上海市金山区廊下镇漕廊公路 7650 号 205 室

办公地址：上海市浦东新区银城中路 68 号时代金融中心 8 楼 801 室

法定代表人：汪静波

联系人：张姚杰

开放式基金咨询电话：400-821-5399

开放式基金业务传真：021-38509777

公司网址：<http://www.noah-fund.com/>

（60）深圳众禄基金销售有限公司

住所：深圳市罗湖区深南东路 5047 号发展银行大厦 25 楼 I、J 单元

办公地址：深圳市罗湖区深南东路 5047 号发展银行大厦 25 楼 I、J 单元

法定代表人：薛峰

联系人：童彩萍

开放式基金咨询电话：4006-788-887

开放式基金业务传真：0755-82080798

公司网址：[www.zlfund.cn](http://www.zlfund.cn) 及 [www.jjmmw.com](http://www.jjmmw.com)

（61）上海好买基金销售有限公司

住所：上海市虹口区场中路685弄37号4号楼449室

办公地址：上海浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦9楼

法定代表人：杨文斌

联系人：张茹

开放式基金咨询电话：400-700-9665

开放式基金业务传真：021-68596916

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

（二）注册登记机构

名称：长盛基金管理有限公司

注册地址：深圳市福田区福中三路 1006 号诺德中心 8 层 GH 单元

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）82019988

传真：（010）82255988

联系人：龚珉

（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：北京市朝阳区建国路 99 号中服大厦 25 层

办公地址：北京市朝阳区建国路 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

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼

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：杨绍信

电话：（021）23238888

传真：（021）23238800

经办注册会计师：汪棣、张晓艺

## 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

交易部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，交易部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 个交易日内进行调整。

（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：

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

其中：投资于金融工具产生的资产包括现金类资产(含银行存款、清算备付金、交易保证金、证券清算款、买断式回购履约金)、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)的逆回购、期限在一年以内(含一年)的中央银行票据、买断式回购产生的待回购债券、剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的资产支持证券、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。

投资于金融工具产生的负债包括期限在一年以内(含一年)的正回购、买断式回购产生的待返售债券等。

采用“摊余成本法”计算的附息债券成本包括债券的面值和折溢价；贴现式债券成本包括债券投资成本和内在应收利息。

#### (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联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

本投资组合报告所载数据取自长盛货币市场基金2013年第1季度报告，相关财务资料未经审计。

### 1、报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	固定收益投资	530,523,221.21	51.75
	其中：债券	530,523,221.21	51.75
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	154,200,431.30	15.04
	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	330,556,946.70	32.24
4	其他资产	9,961,644.63	0.97
5	合计	1,025,242,243.84	100.00

### 2、报告期债券回购融资情况

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	2.92	
	其中：买断式回购融资	-	
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	168,399,236.90	19.70
	其中：买断式回购融资	-	-

注：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基金资产净值的 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%。

### 3、期末基金组合剩余期限

#### (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	114
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	133
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	18

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。

#### (2) 报告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	49.10	19.70
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)-60 天	12.87	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	1.18	-
3	60 天(含)-90 天	9.39	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	5.89	-
4	90 天(含)-180 天	2.34	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	180 天(含)-397 天(含)	45.05	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	118.75	19.70

### 4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	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	160,298,042.94	18.75
	其中：政策性金融债	160,298,042.94	18.75
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	370,225,178.27	43.30
6	中期票据	-	-

7	其他	-	-
8	合计	530,523,221.21	62.05
9	剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债券	60,402,892.25	7.06

#### 5、报告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

序号	债券代码	债券名称	债券数量 (张)	摊余成本(元)	占基金资产 净值比例(%)
1	090407	09 农发 07	500,000	50,314,968.44	5.89
2	041253058	12 山钢集 CP001	500,000	50,170,086.54	5.87
3	041359012	13 沙钢 CP001	500,000	49,989,265.43	5.85
4	120320	12 进出 20	400,000	39,852,528.24	4.66
5	041364003	13 沁新能源 CP001	300,000	30,024,339.41	3.51
6	041359005	13 广汇能源 CP001	300,000	30,006,118.01	3.51
7	120245	12 国开 45	300,000	29,999,938.91	3.51
8	110206	11 国开 06	200,000	20,039,558.58	2.34
9	041262020	12 富通 CP001	200,000	20,008,599.69	2.34
10	041358008	13 山钢 CP001	200,000	20,002,951.28	2.34

#### 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	-
报告期内偏离度的最高值	0.2085%
报告期内偏离度的最低值	0.0170%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1132%

#### 7、报告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。

#### 8、投资组合报告附注

##### (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。

(2) 若本报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 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。

(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。

#### (4) 其他资产构成

序号	其他资产	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	8,933,460.34
4	应收申购款	1,000,827.54
5	其他应收款	27,356.75
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	9,961,644.63

#### (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。

### 十三、基金的业绩

本基金成立以来的业绩如下：

	基金净值收益率	同期业绩比较基准收益率	超额收益率
2005年12月12日（基金合同生效日）至2005年12月31日	0.1058%	0.0986%	0.0072%
2006年度	1.9641%	1.8799%	0.0842%
2007年度	3.4923%	2.7850%	0.7073%
2008年度	3.4322%	3.7621%	-0.3299%
2009年度	1.6506%	2.2500%	-0.5994%
2010年度	2.0201%	2.3041%	-0.2840%
2011年度	3.0091%	3.2801%	-0.2710%

2012 年度	3.9768%	3.2452%	0.7316%
2013 年 1 月 1 日至 2013 年 3 月 31 日	0.8163%	0.7397%	0.0766%
2005 年 12 月 12 日（基金合同生效日）至 2013 年 3 月 31 日	22.3512%	20.3552%	1.9960%

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。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。

#### 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。

### （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

本基金管理人依据《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，对本基金招募说明书进行了更新，主要更新内容如下：

（一）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。

（二）在“三、基金管理人”中，更新了基金管理人的相关基本情况。

（三）在“四、基金托管人”中，更新了基金托管人的相关基本情况。

（四）在“五、相关服务机构”中，更新了相关服务机构的有关信息。

（五）在“十、基金的投资”中，更新了“（十）投资组合报告”的相关内容。

（六）在“十一、基金的业绩”中，更新了基金成立至今的业绩情况。

（七）在“二十三、其他应披露事项”中，更新了本次招募说明书更新期间所涉及的相关信息披露。

## 十六、 签署日期

本招募说明书（更新）于2013年7月17日签署。

长盛基金管理有限公司  
二〇一三年七月二十五日