

7.2 债券回购融资情况

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基金资产净值的20%的说明

序号	发生日期	融资余额占基金资产净值比例(%)	原因	调整期
	2012年1月4日	21.15	巨额赎回	两个交易日

2012年1月5日	21.75	巨源赎回	-
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	

期末投资组合平均剩余期限	104
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	162
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	83
<p>报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明</p> <p>未发生未投资组合平均剩余期限超过180天的情况</p>	

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	36.15	14.23

	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	4.99	-
2	30天(含)—60天	20.71	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-

3	利率债 60天(含)—90天	20.13	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	14.48	-
4	90天(含)—180天	6.35	-

4	36天(含)—180天(含)	0.25	-
	其中: 剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)—397天(含)	29.65	-
	其中: 剩余存续期超过397天的浮动	-	-

利率债		
合计	112.99	14.23

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	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	632,474,610.04	22.21

3	金融债券	532,474,640.94	33.31
	其中:政策性金融债	532,474,640.94	33.31
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	605,691,048.67	37.89
6	中期票据		

7	其他	-	-
8	合计	1,138,165,689.61	71.20
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	311,275,546.28	19.47

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(%)
	090205	09国开05	1,400,000	141,211,568.87	8.83

070419	07农发19	1,300,000	130,811,140.45	8.18
070219	07国开19	900,000	90,387,954.21	5.65
100236	10国开36	900,000	90,253,937.24	5.65
110221	11国开21	800,000	79,810,040.17	4.99

041253009	12恒逸CP001	700,000	71,049,320.25	4.44
041258002	12产汇汽车CP001	400,000	40,716,193.56	2.55

041262008	12物类 CP001	400,000	40,337,635.31	2.52
041254021	12利港 CP001	400,000	40,147,659.94	2.51
041254022	12东阳光	400,000	40,146,337.15	2.51

041253026	CP001	400,000	40,136,317.10	2.51
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			47	

报告期内偏离度的最高值	0.4344%
报告期内偏离度的最低值	0.1398%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.2477%

**7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细**

7.8 投资组合报告附注

7.8.1 本基金估值采用摊余成本法,即估值对象以买入成本列示,按实际利率并考虑其买入时的溢价折价,在其剩余存续期内摊销,每日计提损益。本基金不采用市场利率和上市交易的债券和票据的市价确定其公允价值。本基金通过每日计算其应计利息的净值始终维持在 1.0000 元。

本基金资产净值20%的情况。

		(%)		
1	2012年3月30日	20.35	巨额赎回	四个交易日
2	2012年3月31日	20.34	持续赎回	-
3	2012年4月1日	20.34	持续赎回	-

	2012年4月5日	20.39	持续赎回	-
7.8.3本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年受到过公开谴责、处罚,不存在需说明的证券投资决策程序。				
7.8.4期末其他各项资产构成				

单位:人民币元		
序号	名称	金额
1	存出保证金	250,000.00
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	16,344,521.72

4	应收申购款	6,419,691.71
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-

8	合计	23,014,213.43
---	----	---------------

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				份额单位:份
份额	持有人户	户均持有的基金	持有人结构	
			机构投资者	个人投资者

类别	数(户)	份额	持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
长城证券A	21,765	53,308.02	19,002,157.88	1.64%	1,141,246,830.55	98.36%
长城						

资产B	33	13,283,367.66	190,373,013.16	43.43%	247,978,119.72	56.57%
合计	21,798	73,337.01	209,375,171.04	13.10%	1,389,224,950.27	86.90%

注：分级基金机构个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分子采用各级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数 即期末基金份额总额。

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本基金	长城货币A	1,322,736.73	0.1140%
	长城货币B	-	-

注:①本公司高级管理人员持有该只基金份额总量的数量区间为100万以上。  
②本公司基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间为0。  
③本基金基金经理持有本基金份额总量的数量区间为0。

§ 9 开放式基金份额变动		单位:份
	长城货币A	长城货币B
基金合同生效日(2005年5月30日)基金份额总	2,934,887,104.33	

报告期初基金份额总额	707,546,345.88	-
报告期基金总申购份额	6,479,879,162.78	3,297,409,925.27
2. 本报告期基金总赎回份额	6,027,176,520.23	2,859,058,792.39
本报告期基金拆分变动份额	-	-

报告期末基金份额总额	1,160,248,988.43	438,351,132.88
------------	------------------	----------------

注：本基金自2012年4月6日起实行分级，4月9日确认分级。本基金分级后，销售服务费实行分级收费方式，分设两级基金份额：A级基金份额和B级基金份额。详情请参阅相关公告。

**§ 10 重大事件揭示**

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

2、2012年5月23日,托管人华夏银行股份有限公司在托管人网站披露了《华夏银行股份有限公司关于资产托管部总经理变更的公告》,经中国证券监督管理委员会审核批准(证监许可[2012]503号),聘任彭波先生和桑煜先生为公司副总经理。

10.4 基金投资策略的改变

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

基金管理人、基金托管人涉及托管业务机构及其高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	

银河证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-

注：本基金管理人负责选择代理本基金证券买卖的证券经营机构，使用其席位作为基金的专用交易席位，选择的标准是：

1) 实力雄厚, 信誉良好, 注册资本不少于3亿元人民币;  
2) 财务状况良好, 各项财务指标显示公司经营情况稳定;  
3) 经营行为规范, 最近两年未发生重大违规行为而受到中国证监会处罚;  
4) 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;  
5) 具备各关运作所需的高素质的通晓各种语言且熟悉基金运作管理人才, 具备进行证券交易的需要, 并

6. 研究实力较强,有固定的研究机构和专门的研究人员,能及时为本基金提供高质量的咨询服务,涵盖宏观经济研究、行业研究、市场走向分析、个股分析报告及其他专门报告。

管理人应根据有关规定，在基金的中期报告和年度报告中将所选证券经营机构的有关情况、基金通过证券经营机构买卖证券的成交量、支付的佣金等予以披露。

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例

银河证券	-	-	15,000,000.00	100.00%	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-

10.8 偏离度绝对值超过0.5%的情况

注：本基金本报告期没有偏离度绝对值超过0.5%的情况。

银河证券	-	-	15,000,000.00	100.00%	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-

10.8 偏离度绝对值超过0.5%的情况

注：本基金本报告期没有偏离度绝对值超过0.5%的情况。