

基金管理人:长安基金管理有限公司  
基金托管人:广发银行股份有限公司  
送出日期:2013年8月29日  
§ 1 重要提示

基金管理人的董事、监事及高级管理人员保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述及重大遗漏，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。基金经理人声明该基金的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

本基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资者在做出投资决策前请仔细阅读本基金的招募说明书。

本基金于2013年8月25日完成募集，2013年8月26日起至6月30日止。

## § 2 基金简介

基金管理人:长安基金管理有限公司  
基金托管人:广发银行股份有限公司

基金名称:长安货币市场证券投资基金  
基金简称:长安货币  
基金主代码:740601  
基金运作方式:契约型开放式

基金合同生效日:2013年1月25日  
基金销售代理人:长安基金管理有限公司  
广发银行股份有限公司

报告期基金份额总额:218,595,523.92份  
基金合同延续期:不定期

下属两只基金的基金简称:长安货币A  
长安货币B  
下属两只基金的交易代码:740601  
740602  
报告期末下属两级基金的份额总额:37,999,802.00份  
180,595,721.92份

§ 2.2 基金产品说明

投资目标 在保持基金资产的安全性和流动性的前提下,通过主动式管理,力求获得超过基金业绩比较基准的稳定回报。

整体配置策略:通过全面研究宏观经济状况,预测货币政策对金融市场的影响,分析不同资金供给对收益率的影响,根据资金供给的变动趋势,适时调整资产配置比例,力求在风险与收益之间取得平衡。

利率风险的中性目标:在对市场利率水平变化趋势预判的基础上,制定合理的久期策略,将利率期限错配控制在合理范围内。

久期策略:在久期策略上,坚持“长短结合”的原则,通过定期调整久期,降低债券投资基

础,并增加再投资收益。

3.个券选择策略:基金将优先考虑安全性高、选择高信

用级别的债券品种进行投资。在个券选择上,本基金将在整体配置策略和久期策略的基础上,根据信用利差、流动性、评级等因素,选择具有良好投资价值的债券品种进行投资。

4.套利策略:套利策略主要应用在:①跨市场套利,由

于其不同的投资群体、交易方式等市场差异,基金将充分考虑套利机会的成熟度,寻找

套利空间;②跨期限套利,通过定期调整久期,将长期

久期与短期久期的债券品种进行套利操作。

5.息差策略:息差策略是指利用回购利率与

拆借利率之间的差价,选择适当的杠杆比率,谨慎实

施策略,以提高投资组合收益。

6.现金流管理策略:本基金根据对货币市场金融

产品市场价格及收益率的分析,对申购赎回量的变化、预期现金流、流动性安排等进行动态

调整,从而提高流动性,降低流动性风险。

7.风险管理策略:本基金将充分考虑资金的流动性

情况,通过定期调整久期,降低债券投资基

础,并增加再投资收益。

8.其他策略:本基金将根据对宏观经济、政策、市

场、行业、公司等多方面的综合分析,选择具有较好

投资价值的债券品种进行投资。

9.资产配置策略:本基金将根据对宏观经济、政策、

市场、行业、公司等多方面的综合分析,选择具有较

好投资价值的债券品种进行投资。

10.套利策略:套利策略主要应用在:①跨市场套利,

由于其不同的投资群体、交易方式等市场差异,基金将充分考虑套利机会的成熟度,寻找

套利空间;②跨期限套利,通过定期调整久期,将长

期与短期久期的债券品种进行套利操作。

11.息差策略:息差策略是指利用回购利率与

拆借利率之间的差价,选择适当的杠杆比率,谨慎实

施策略,以提高投资组合收益。

12.现金流管理策略:本基金根据对货币市场金融

产品市场价格及收益率的分析,对申购赎回量的变化、预期现金流、流动性安排等进行动态

调整,从而提高流动性,降低流动性风险。

13.风险管理策略:本基金将充分考虑资金的流动性

情况,通过定期调整久期,降低债券投资基

础,并增加再投资收益。

14.其他策略:本基金将根据对宏观经济、政策、市

场、行业、公司等多方面的综合分析,选择具有较

好投资价值的债券品种进行投资。

15.资产配置策略:本基金将根据对宏观经济、政策、

市场、行业、公司等多方面的综合分析,选择具有较

好投资价值的债券品种进行投资。

16.套利策略:套利策略主要应用在:①跨市场套利,

由于其不同的投资群体、交易方式等市场差异,基金将充分考虑套利机会的成熟度,寻找

套利空间;②跨期限套利,通过定期调整久期,将长

期与短期久期的债券品种进行套利操作。

17.息差策略:息差策略是指利用回购利率与

拆借利率之间的差价,选择适当的杠杆比率,谨慎实

施策略,以提高投资组合收益。

18.现金流管理策略:本基金根据对货币市场金融

产品市场价格及收益率的分析,对申购赎回量的变化、预期现金流、流动性安排等进行动态

调整,从而提高流动性,降低流动性风险。

19.风险管理策略:本基金将充分考虑资金的流动性

情况,通过定期调整久期,降低债券投资基

础,并增加再投资收益。

20.其他策略:本基金将根据对宏观经济、政策、市

场、行业、公司等多方面的综合分析,选择具有较

好投资价值的债券品种进行投资。

21.资产配置策略:本基金将根据对宏观经济、政策、

市场、行业、公司等多方面的综合分析,选择具有较

好投资价值的债券品种进行投资。

22.套利策略:套利策略主要应用在:①跨市场套利,

由于其不同的投资群体、交易方式等市场差异,基金将充分考虑套利机会的成熟度,寻找

套利空间;②跨期限套利,通过定期调整久期,将长

期与短期久期的债券品种进行套利操作。

23.息差策略:息差策略是指利用回购利率与

拆借利率之间的差价,选择适当的杠杆比率,谨慎实

施策略,以提高投资组合收益。

24.现金流管理策略:本基金根据对货币市场金融

产品市场价格及收益率的分析,对申购赎回量的变化、预期现金流、流动性安排等进行动态

调整,从而提高流动性,降低流动性风险。

25.风险管理策略:本基金将充分考虑资金的流动性

情况,通过定期调整久期,降低债券投资基

础,并增加再投资收益。

26.其他策略:本基金将根据对宏观经济、政策、市

场、行业、公司等多方面的综合分析,选择具有较

好投资价值的债券品种进行投资。

27.资产配置策略:本基金将根据对宏观经济、政策、

市场、行业、公司等多方面的综合分析,选择具有较

好投资价值的债券品种进行投资。

28.套利策略:套利策略主要应用在:①跨市场套利,

由于其不同的投资群体、交易方式等市场差异,基金将充分考虑套利机会的成熟度,寻找

套利空间;②跨期限套利,通过定期调整久期,将长

期与短期久期的债券品种进行套利操作。

29.息差策略:息差策略是指利用回购利率与

拆借利率之间的差价,选择适当的杠杆比率,谨慎实

施策略,以提高投资组合收益。

30.现金流管理策略:本基金根据对货币市场金融

产品市场价格及收益率的分析,对申购赎回量的变化、预期现金流、流动性安排等进行动态

调整,从而提高流动性,降低流动性风险。

31.风险管理策略:本基金将充分考虑资金的流动性

情况,通过定期调整久期,降低债券投资基

础,并增加再投资收益。

32.其他策略:本基金将根据对宏观经济、政策、市

场、行业、公司等多方面的综合分析,选择具有较

好投资价值的债券品种进行投资。

33.资产配置策略:本基金将根据对宏观经济、政策、

市场、行业、公司等多方面的综合分析,选择具有较

好投资价值的债券品种进行投资。

34.套利策略:套利策略主要应用在:①跨市场套利,

由于其不同的投资群体、交易方式等市场差异,基金将充分考虑套利机会的成熟度,寻找

套利空间;②跨期限套利,通过定期调整久期,将长

期与短期久期的债券品种进行套利操作。

35.息差策略:息差策略是指利用回购利率与

拆借利率之间的差价,选择适当的杠杆比率,谨慎实

施策略,以提高投资组合收益。

36.现金流管理策略:本基金根据对货币市场金融

产品市场价格及收益率的分析,对申购赎回量的变化、预期现金流、流动性安排等进行动态

调整,从而提高流动性,降低流动性风险。

37.风险管理策略:本基金将充分考虑资金的流动性

情况,通过定期调整久期,降低债券投资基

础,并增加再投资收益。

38.其他策略:本基金将根据对宏观经济、政策、市

场、行业、公司等多方面的综合分析,选择具有较

好投资价值的债券品种进行投资。

39.资产配置策略:本基金将根据对宏观经济、政策、

市场、行业、公司等多方面的综合分析,选择具有较

好投资价值的债券品种进行投资。

40.套利策略:套利策略主要应用在:①跨市场套利,

由于其不同的投资群体、交易方式等市场差异,基金将充分考虑套利机会的成熟度,寻找

套利空间;②跨期限套利,通过定期调整久期,将长

期与短期久期的债券品种进行套利操作。

41.息差策略:息差策略是指利用回购利率与

拆借利率之间的差价,选择适当的杠杆比率,谨慎实

施策略,以提高投资组合收益。

42.现金流管理策略:本基金根据对宏观经济、政策、

市场、行业、公司等多方面的综合分析,选择具有较

好投资价值的债券品种进行投资。

43.风险管理策略:本基金根据对宏观经济、政策、

市场、行业、公司等多方面的综合分析,选择具有较

好投资价值的债券品种进行投资。

44.资产配置策略:本基金根据对宏观经济、政策、

市场、行业、公司等多方面的综合分析,选择具有较

好投资价值的债券品种进行投资。

45.风险管理策略:本基金根据对宏观经济、政策、

市场、行业、公司等多方面的综合分析,选择具有较

好投资价值的债券品种进行投资。

46.资产配置策略:本基金根据对宏观经济、政策、

市场、行业、公司等多方面的综合分析,选择具有较

好投资价值的债券品种进行投资。

47.风险管理策略:本基金根据对宏观经济、政策、

市场、行业、