长城货币市场证券投资基金

2010 年度报告摘要

基金管理人：长城基金管理有限公司
基金托管人：华夏银行股份有限公司
报告送出日期：２０１１年３月３１日

§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。

基金托管人华夏银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2011年03月22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，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自2010年01月01日起至12月31日止

§２ 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	长城货币
基金主代码	200003
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2005年5月30日
基金管理人	长城基金管理有限公司
基金托管人	华夏银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	234，553，854.27份
基金合同存续期	-

2.2 基金产品说明

投资目标	在本金安全和足够流动性的前提下，寻求货币资产稳定的收益。
投资策略	在严格控制风险的前提下，保证资金的安全性和高流动性，通过积极主动的三级资产配置和投资组合管理实现收益率的最大化。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为税后一年期银行定期存款利率。
风险收益特征	本基金在证券投资基金中属于高流动性、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		长城基金管理有限公司	华夏银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	彭洪波	郑鹏
	联系电话	0755-23982338	010-85238667
	电子邮箱	penghb@ccfund.com.cn	zhjjtgb@hxb.com.cn
客户服务电话		400-8868-666	95577
传真		0755-23982328	010-85238680

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.ccfund.com.cn
基金年度报告报告备置地点	深圳市福田区益田路6009号新世界商务中心41层

§３ 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2010 年	2009 年	2008 年
本期已实现收益	7,592,821.35	6,963,450.89	26,323,166.97
本期利润	7,592,821.35	6,963,450.89	26,323,166.97
本期净值收益率	2.0594%	0.8435%	3.5389%
3.1.2 期末数据和指标	2010 年末	2009 年末	2008 年末
期末基金资产净值	234,553,854.27	216,760,624.71	2,202,913,869.06
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000

注：①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。

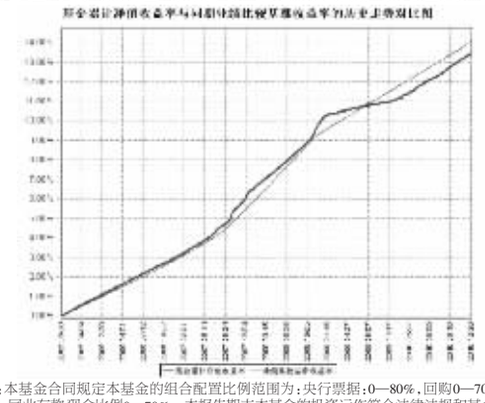
②本基金收益分配按日结转份额。

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

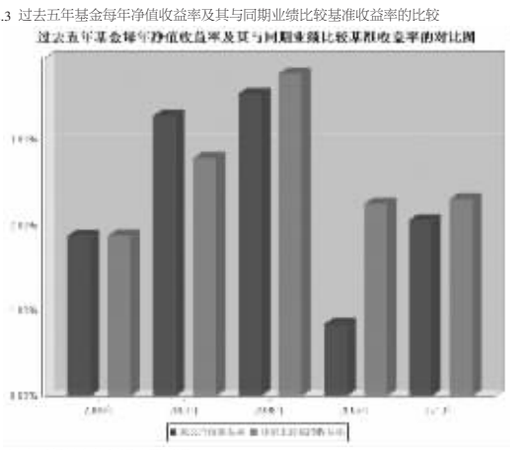
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.5097%	0.0017%	0.6212%	0.0003%	-0.1115%	0.0014%
过去六个月	1.0950%	0.0044%	1.1884%	0.0004%	-0.0934%	0.0040%
过去一年	2.0594%	0.0061%	2.3041%	0.0003%	-0.2447%	0.0058%
过去三年	6.5625%	0.0080%	8.3266%	0.0020%	-1.7641%	0.0060%
过去五年	12.1237%	0.0072%	12.9915%	0.0021%	-0.8678%	0.0051%
自基金合同生效起至今	13.4232%	0.0069%	14.0567%	0.0021%	-0.6335%	0.0048%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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



注：本基金合同规定本基金的组合配置比例范围为：央行票据：0—80%，回购0—70%，短期债券0—80%，同业存款/现金比例0—70%。本报告期末本基金的投资运作符合法律法规和基金合同的相关规定。

3.2.3 过去五年基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	年度利润分配合计	备注
2010年	7,592,821.35	-	-	7,592,821.35	
2009年	6,963,450.89	-	-	6,963,450.89	
2008年	26,323,166.97	-	-	26,323,166.97	
合计	40,879,439.21	-	-	40,879,439.21	

§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

长城基金管理有限公司是经中国证监会批准设立的第15家基金管理公司，由长城证券有限责任公司（40%）、东方证券股份有限公司（15%）、西北证券有限责任公司（15%）、北方国际信托投资股份有限公司（15%）、中原信托投资有限公司（15%）于2001年12月27日共同出资设立，当时注册资本为壹亿元人民币。2007年5月21日，经中国证监会批准，公司完成股权结构调整，现有股东为长城证券有限责任公司（47.059%）、东方证券股份有限公司（17.647%）、北方国际信托股份有限公司（17.647%）和中原信托有限公司（17.647%）。2007年10月12日，经中国证监会批准，将注册资本增加至壹亿伍仟万元人民币。公司经营范围是基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其他业务。截止本报告期末，公司管理的基金有封闭式基金：久嘉证券投资基金；开放式基金：长城久富核心成长股票型证券投资基金（LOF）、长城久恒平衡型证券投资基金、长城久泰中信标普300指数证券投资基金、长城货币市场证券投资基金、长城消费增值股票型证券投资基金、长城安心回报混合型证券投资基金、长城品牌优选股票型证券投资基金、长城稳健增利债券型证券投资基金、长城双动力股票型证券投资基金和长城景气行业龙头灵活配置混合型证券投资基金。

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(助理)期限 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
钟光正	本基金的基金经理、长城稳健增利债券型证券投资基金的基金经理	2010年2月24日	-	1年	男，中国籍，经济学硕士。具有7年债券投资管理经历。曾就职于安徽安凯汽车股份有限公司、广发银行总行资金部、招商银行总行资金交易部。2009年11月进入长城基金管理有限公司，曾任债券研究员。
王定元	本基金基金经理、长城稳健增利债券型证券投资基金基金经理、研究部总经理	2009年9月22日	2010年10月21日	18年	男，中国籍。东北工学院数学系理学学士、中南财经大学计划统计系经济学硕士、中南财经政法大学投资系经济学博士。具有18年证券从业经验。曾就职于武汉钢铁学院、东莞市城区政府审计师事务所、广东宏远工业区股份有限公司、东莞证券有限责任公司、联合证券有限责任公司。2005年进入长城基金管理有限公司，曾任长城货币基金基金经理、固定收益部副经理、基金管理部副总经理。

注：①上述任职日期、离任日期根据公司做出决定的任免日期填写。

②证券从业年限的计算方式遵从证券业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

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，本基金管理人严格遵守了《证券投资基金法》、《长城货币市场证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制和防范风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大的利益，未出现投资违反法律法规、基金合同约定和相关规定的情况，无因公司未勤勉尽责或操作不当而导致基金财产损失的情况，不存在损害基金份额持有人利益的行为。本报告期运作过程中曾出现投资组合指标被动偏离标准的情况，托管人根据有关规定及时向基金管理人进行了提示，基金管理人按照规定进行了调整。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

托管人认为，由基金管理人编制并经托管人复核的本基金2010年年度报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

§６ 审计报告

安永华明会计师事务所为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§７ 年度财务报表

7.1资产负债表

会计主体：长城货币市场证券投资基金

报告截止日：2010年12月31日

单位：人民币元

资 产	本期末 2010年12月31日	上年度末 2009年12月31日
资 产：		
银行存款	34,430,972.85	34,376,519.96
结算备付金	68,181.82	22,978,000.41
存出保证金	250,000.00	250,000.00
交易性金融资产	240,188,925.77	80,017,377.85
其中：股票投资	-	-
债券投资	240,188,925.77	80,017,377.85
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	40,015,477.76
应收利息	1,851,421.85	574,938.42
应收股利	-	-
应收申购款	29,022,690.61	50,158,681.84
其他资产	-	-
资产总计	305,812,192.90	228,370,996.24
负债和所有者权益	本期期末 2010年12月31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	69,599,695.60	-
应付证券清算款	-	10,001,126.11
应付赎回款	95,693.16	262,664.33
应付管理人报酬	97,223.01	38,466.92
应付托管费	29,461.50	11,656.65
应付销售服务费	73,653.76	29,141.58
应付交易费用	9,585.75	4,384.00
应交税费	1,017,919.25	957,600.00
应付利息	40,446.60	-
应付利润	-	-
其他负债	294,660.00	305,331.94
负债合计	71,258,338.63	11,610,371.53
所有者权益：		
实收基金	234,553,854.27	216,760,624.71
未分配利润	-	-
所有者权益合计	234,553,854.27	216,760,624.71
负债和所有者权益总计	305,812,192.90	228,370,996.24

注：报告截止日2010年12月31日，基金份额净值1.0000元，基金份额总额234,553,854.27份。

7.2 利润表

会计主体：长城货币市场证券投资基金

本报告期：2010年1月1日至2010年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日
一、收入	10,721,857.94	12,870,581.00
1.利息收入	8,809,941.40	11,261,757.27
其中：存款利息收入	286,226.82	3,034,998.84
债券利息收入	7,786,578.18	6,544,786.65
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	737,136.40	1,681,971.78
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	1,911,916.54	1,608,823.73
其中：股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	1,911,916.54	1,608,823.73
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“-”号填列)	-	-
4.其他收入(损失以“-”号填列)	-	-
减：二、费用	3,129,036.59	5,907,130.11
1.管理人报酬	1,286,604.32	2,456,706.02
2.托管费	389,880.09	744,456.39
3.销售服务费	974,700.17	1,861,140.89
4.交易费用	-	50.00
5.利息支出	210,137.01	555,701.28
其中：卖出回购金融资产支出	210,137.01	555,701.28
6.其他费用	267,715.00	289,075.53
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	7,592,821.35	6,963,450.89
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	7,592,821.35	6,963,450.89

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长城货币市场证券投资基金

本报告期：2010年1月1日至2010年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31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)	216,760,624.71	-	216,760,624.71
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	7,592,821.35	7,592,821.35
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）	17,793,229.56	-	17,793,229.56
其中：1.基金申购款	4,393,713,089.02	-	4,393,713,089.02
2.基金赎回款	-4,375,919,859.46	-	-4,375,919,859.46
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-7,592,821.35	-7,592,821.35
五、期末所有者权益(基金净值)	234,553,854.27	-	234,553,854.27
项目	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31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)	2,202,913,869.06	-	2,202,913,869.06
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	6,963,450.89	6,963,450.89
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）	-1,986,153,244.35	-	-1,986,153,244.35
其中：1.基金申购款	2,301,877,228.90	-	2,301,877,228.90
2.基金赎回款	-4,288,030,473.25	-	-4,288,030,473.25
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-6,963,450.89	-6,963,450.89
五、期末所有者权益(基金净值)	216,760,624.71	-	216,760,624.71

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

_____杨光裕_____ _____关林文_____ ____桑煜____

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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

长城货币市场证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（“中国证监会”）证监基金字［2005］52号文《关于同意长城货币市场证券投资基金募集的批复》的核准，由长城基金管理有限公司作为发起人向社会公开发行募集，首次设立募集规模为2，934，887，104.33份基金份额，本基金基金合同于2005年5月30日生效。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定。本基金的基金管理人为长城基金管理有限公司，注册登记机构为长城基金管理有限公司，基金托管人为华夏银行股份有限公司（“华夏银行”）。

本基金投资于国内依法发行、高信用等级、具有一定剩余到期期限的债券、央行票据、回购，以及法律法规允许投资的其他金融工具。包括：现金；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）的债券回购；期限在一年以内（含一年）的中央银行票据；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。本基金的业绩比较基准为：税后一年期银行定期存款利率。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部2006年2月颁布的《企业会计准则—基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定（统称“企业会计准则”）、中国证券业协会制定的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露编报规则》第5号《货币市场基金信息披露特别规定》和《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》及其他中国证监会颁布的相关规定编制。

本基金财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2010年12月31日的财务状况以及2010年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4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。

7.4.5差错更正的说明

本基金于本报告期未发生会计差错更正。

7.4.6 税项

1 .营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字［2004］78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》，自2004年1月1日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税和企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税［2008］1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

2.个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字［2002］128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》，对基金取得的债券的利息等收入，由上市公司、债券发行企业等在向基金派发时代扣代缴20%的个人所得税。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
长城基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
华夏银行	基金托管人、基金代销机构
长城证券有限责任公司("长城证券")	基金管理人股东、基金代销机构
东方证券股份有限公司("东方证券")	基金管理人股东、基金代销机构
中原信托有限责任公司("中原信托")	基金管理人股东
北方国际信托股份有限公司	基金管理人股东

注：于本年度，并无与对本基金存在控制关系或其他重大影响关系的关联方发生变化的情况。以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

注：本基金于本期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行交易。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,286,604.32	2,456,706.02
其中，支付销售机构的客户维护费	222,901.83	147,704.13

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的0.33%的年费率计提。计算方法如下：

H=E×0.33%/当年天数

H为每日应支付的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	389,880.09	744,456.39

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的0.10%的年费率计提。计算方法如下：

H=E×0.10%/当年天数

H为每日应支付的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付；由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支取。

7.4.8.2.3 销售服务费

金额单位：人民币元

获得销售服务费各关联方名称	本期 2010年1月1日至2010年12月31日 当期发生的基金应支付的销售服务费
华夏银行	71,273.66
长城基金管理有限公司	84,897.76
长城证券	11,249.66
东方证券	313.27
合计	167,734.35
获得销售服务费各关联方名称	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日 当期发生的基金应支付的销售服务费
华夏银行	95,812.53
长城基金管理有限公司	867,011.32
长城证券	8,934.27
东方证券	1,291.81
合计	973,049.93

注：基金销售服务费用于支付销售机构佣金、基金的营销费用以及基金份额持有人服务费等。本基金的基金销售服务费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下：

H=E×0.25%/当年天数

H为每日应支付的基金销售服务费

E为前一日的基金资产净值

基金销售服务费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付；由基金托管人复核后于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支取，并由注册登记机构代付给销售机构。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

注：本基金于本年度及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金的基金管理人本期及上年度可比期间未运用固有资金投资于本基金。基金管理人于本期末及上年度末均未持有本基金份额。

7.4.8.4.2 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

注：除基金管理人外的其他关联方于本期末及上年度末均未持有本基金份额。

7.4.8.5 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12月31日		上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
华夏银行	34,430,972.85	64,445.40	34,376,519.96	525,912.16

注：本基金的银行存款由基金托管人华夏银行保管，并按银行间同业利率计息。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金于本年度及上年度，均未在承销期内直接购入关联方承销证券。

7.4.9 期末（2010年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金于本年末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金于本年末未持有暂时停牌的股票。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2010年12月31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69，599，695.60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
060202	06国开02	2011年1月4日	100.08	500,000	50,039,553.95
100221	10国开21	2011年1月4日	99.84	200,000	19,968,640.46
合计				700,000	70,008,194.41

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金于本期末未持有从事交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

§８ 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	240,188,925.77	78.54
	其中：债券	240,188,925.77	78.54
	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	34,499,154.67	11.28
4	其他各项资产	31,124,112.46	10.18
5	合计	305,812,192.90	100.00

8.2 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	3.42	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	69,599,695.60	29.67
	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
1	2010年12月28日	37.98	巨额赎回	4个交易日
2	2010年12月29日	36.93	巨额赎回	-
3	2010年12月30日	37.29	巨额赎回	-
4	2010年12月31日	29.67	巨额赎回	-

8.3 基金投资组合平均剩余期限

8.3.1 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	74
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	178
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	48

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

注：本基金本报告期内投资组合平均剩余期限未发生违规超过180天的情况。

8.3.2 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	70.33	29.67
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	4.34	-
2	30天(含)—60天	-	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	12.80	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	4.30	-
4	90天(含)—180天	12.79	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)—397天(含)	21.29	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		117.21	29.67

8.4 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	140,295,794.17	59.81
	其中：政策性金融债	140,295,794.17	59.81
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	99,893,131.60	42.59
6	其他	-	-
7	合计	240,188,925.77	102.40
8	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	20,248,045.81	8.63

8.5 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	060202	06国开02	1,000,000	100,079,107.90	42.67
2	1081324	10凤凰CP01	200,000	19,999,359.65	8.53
3	100221	10国开21	200,000	19,968,640.46	8.51
4	1081289	10粤水电CP01	200,000	19,948,117.19	8.50
5	1081276	10北建工CP02	200,000	19,917,106.91	8.49
6	090213	09国开13	100,000	10,169,742.73	4.34
7	090205	09国开05	100,000	10,078,303.08	4.30
8	1081251	10吴融CP02	100,000	10,010,746.66	4.27
9	1081262	10超声CP01	100,000	10,007,039.64	4.27
10	1081199	10丰原CP02	100,000	10,005,524.65	4.27

8.6 “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	1
报告期内偏离度的最高值	0.2560%
报告期内偏离度的最低值	-0.1946%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1000%

8.7 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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 投资组合报告附注

8.8.1 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与折价，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计算基金资产净值。

8.8.2 本基金在本报告期内存在剩余期限小于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。

序号	发生日期	该类浮动债占基金资产净值的比例(%)	原因	调整期
1	2010年7月28日	20.23	持续赎回	2个交易日
2	2010年7月29日	20.12	持续赎回	-
3	2010年8月20日	21.49	持续赎回	7个交易日
4	2010年8月23日	20.29	持续赎回	-
5	2010年8月24日	23.63	巨额赎回	-
6	2010年8月25日	23.88	持续赎回	-
7	2010年8月26日	24.51	持续赎回	-
8	2010年8月27日	24.54	持续赎回	-
9	2010年8月30日	23.98	持续赎回	-
10	2010年9月21日	20.76	持续赎回	4个交易日
11	2010年9月25日	20.75	持续赎回	-
12	2010年9月26日	20.75	持续赎回	-
13	2010年9月27日	21.20	持续赎回	-
14	2010年10月19日	23.08	巨额赎回	5个交易日
15	2010年10月20日	22.52	巨额赎回	-
16	2010年10月21日	23.30	巨额赎回	-
17	2010年10月22日	22.38	巨额赎回	-
18	2010年10月25日	22.48	巨额赎回	-
19	2010年10月27日	20.45	巨额赎回	4个交易日
20	2010年10月28日	21.86	巨额赎回	-
21	2010年10月29日	21.87	巨额赎回	-
22	2010年11月1日	21.98	巨额赎回	-
23	2010年11月16日	22.88	巨额赎回	5个交易日
24	2010年11月17日	23.20	巨额赎回	-
25	2010年11月18日	23.35	巨额赎回	-
26	2010年11月19日	22.18	巨额赎回	-
27	2010年11月22日	22.33	巨额赎回	-
28	2010年12月15日	20.65	持续赎回	2个交易日
29	2010年12月16日	20.74	持续赎回	-

8.8.3 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内受到过公开谴责、处罚，不存在需说明的证券投资决策程序。

8.8.4 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	1,851,421.85
4	应收申购款	29,022,690.61
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	31,124,112.46

8.8.5投资组合报告附注的其他文字描述部分。

注：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。

§９ 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
9,012	26,026.84	93,284,314.53	39.77%	141,269,539.74	60.23%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	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开放式基金	497.89	0.00%

§１０ 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2005年5月30日)基金份额总额	2,934,887,104.33
本报告期期初基金份额总额	216,760,624.71
本报告期基金总申购份额	4,393,713,089.02
减：本报告期基金总赎回份额	4,375,919,859.46
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	234,553,854.27

§１１ 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 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

1、基金管理人重大人事变动

经长城基金管理有限公司第三届董事会第二十五次会议审议通过，同意汪钦同志辞去公司副总经理职务。

2、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的