

长盛货币市场基金

2014第三季度报告

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

报告送出日期:2014年10月27日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会对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责任。

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2014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。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年7月1日起至9月30日止。

§ 2 基金产品概况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	640,506,620.46	44.46
		640,506,620.46	44.46
	货币市场基金	-	-
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	784,472,506.66	54.45
4	其他资产	15,711,979.38	1.09
5	合计	1,440,691,106.50	100.00

注:本报告期内,根据流动性管理的需要,本基金提前支付了部分到期前支付且没有利息损失的存款。

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金净资产的比例(%)
1	报告期末债券回购融资本金额	5.75
	其中:买断式回购融资本金额	-
2	报告期末债券回购融资本金额	10.56
	其中:买断式回购的融资本金额	-
3	报告期末债券回购融资本金额	167,276,935.69

注:报告期内债券回购融资余额占基金净资产的比例为报告期内每个交易日融资余额占基金净资产比例的平均数。

债券正向回购的融资余额不超过基金净资产的20%的说明

5.3 基金投资组合平均剩余期限基本情况

序号	项目	天数
1	报告期末债券组合平均剩余期限	116
2	报告期末债券组合平均剩余期限	138
3	报告期末债券组合平均剩余期限	89

注:报告期内债券组合平均剩余期限超过180天的天数说明

5.3.2 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	各期限资产占基金净资产的比例(%)	各期限负债占基金净资产的比例(%)
1	30天以内	36.47	10.36
	其中:剩余期限不超过97天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	19.99	-
	其中:剩余期限超过97天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	4.62	-
	其中:剩余期限超过97天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-180天	15.38	-
	其中:剩余期限超过97天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)-397天(含)	33.09	-
	其中:剩余期限超过97天的浮动利率债	-	-
	合计	109.55	10.36

注:1.所列数据截止到2014年9月30日。

2.本期已实现收益指本期收入、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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本基金报告期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	净值增长率①	净值收益率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	1.098%	0.0983%	0.75%	0.0000%	0.3419%	0.0983%

注:本基金收益分配是按日结转份额。

3.2.2 本基金合同生效以来基金累计净值收益率变动与其同期业绩比较基准收益率变动的比较



§ 4 管理人报告

姓名	职务	任本基金的基金经理期限	证券从业年限	说明
贾志敏	基金经理	2013年2月7日	-	8年
殷鹤	基金经理	2014年4月10日	-	7年

注:1.上表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;

2.“证券从业人员”中“证券从业者”的含义遵从行业协会《证券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,基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及各项实施细则,本基金合同和其它有关法律法规、监察部门的规章制度,勤勉尽责地管理和运用基金资产,在严格控制投资风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易执行的情况

报告期内,公司严格执行《公司公平交易细则》各项规定,在研究、投资授权与决策、交易执行等各个环节,公司对买卖对象实行分类管理,包括私募基金、社保组合、特定客户等资产组合管理。具体如下:

研究报告支持,公司旗下所有投资组合共享公司研究报告,所有投资组合经理在公司研究平台上定期进行公平交易的申报。

投资授权与决策,公司实行投资决策委员会领导下的投资组合经理负责制,各投资组合在投资决策委员会的指导下,独立地进行投资操作。

投资监督与风控,公司设立专门的投资风险管理部,对投资组合的买卖时机和价格进行监控,并定期评估投资组合的公平交易情况。

公平交易制度,公司实行集中交易制度,所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中,同日反向交易成交较少的单边交易量超过该单边交易量的5%的交易共有3次,为指数基金被动跟踪标的指数和其他组合发生的正常交易。

公平交易制度,公司对过4个季度的同向交易行为进行分析,计算择时收益、收益率,占比优等比例,使用双边平均差价率、夏普比率、信息比率等指标,评估其买卖时机和价格选择的合理性。

公平交易制度,公司对过4个季度的同向交易行为进行分析,计算择时收益、收益率,占比优等比例,使用双边平均差价率、夏普比率、