# 长盛货币市场基金

## 2014 年度报告摘要

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
送出日期:2015年3月28日

### §1 重要提示

1.1 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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年3月27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。

本年度报告财务资料已经审计,普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了无保留意见的审计报告。

本报告期自2014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 | 长盛货币 |
| 基金主代码 | 080011 |
| 交易代码 | 080011 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2005年12月12日 |
| 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 |
| 报告期末基金份额总额 | 9,171,115,350.08份 |

2.2 基金产品说明

| | |
|---|---|
| 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。 |
| 投资策略 | 本基金在投资组合管理中将采用主动投资策略,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。 |
| 业绩比较基准 | 银行一年定期存款利率(税后) |
| 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。 |

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 | | 长盛基金管理有限公司 | 兴业银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 叶金松 | 张志永 |
| | 联系电话 | 010-82019988 | 021-62677777-212004 |
| | 电子邮箱 | yejs@csfunds.com.cn | zhangzhy@cib.com.cn |
| 客户服务电话 | | 400-888-2666,010-62350088 | 95561 |
| 传真 | | 010-82255988 | 021-62159217 |

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 | http://www.csfunds.com.cn |
| 基金年度报告备置地点 | 基金管理人和基金托管人的办公地址 |

### §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 | 2014年 | 2013年 | 2012年 |
|---|---|---|---|
| 本期已实现收益 | 88,824,778.07 | 34,280,195.62 | 37,462,841.67 |
| 本期利润 | 88,824,778.07 | 34,280,195.62 | 37,462,841.67 |
| 本期净值收益率 | 5.0830% | 3.6150% | 3.9768% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2014年末 | 2013年末 | 2012年末 |
| 期末可供分配基金份额利润 | – | – | – |
| 期末基金资产净值 | 9,171,115,350.08 | 6,981,165,736.14 | 4,143,135,481.21 |
| 期末基金份额净值 | 1.0000 | 1.0000 | 1.0000 |

注:1、本基金收益分配是按日结转份额。

2、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。

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

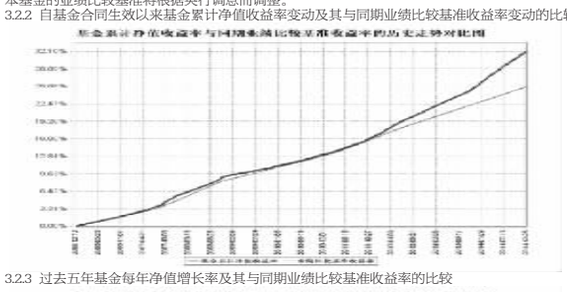
| 阶段 | 份额净值收益率① | 份额净值收益率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | 1.1806% | 0.0066% | 0.7288% | 0.0003% | 0.4518% | 0.0063% |
| 过去六个月 | 2.2917% | 0.0075% | 1.4849% | 0.0003% | 0.8068% | 0.0072% |
| 过去一年 | 5.0830% | 0.0094% | 2.9726% | 0.0002% | 2.1104% | 0.0092% |
| 过去三年 | 13.2118% | 0.0071% | 9.2178% | 0.0005% | 3.9940% | 0.0066% |
| 过去五年 | 18.9743% | 0.0070% | 14.8021% | 0.0011% | 4.1722% | 0.0059% |
| 自基金合同生效起至今 | 32.1396% | 0.0067% | 25.5880% | 0.0017% | 6.5516% | 0.0050% |

注:本基金业绩比较基准的构建及再平衡过程:

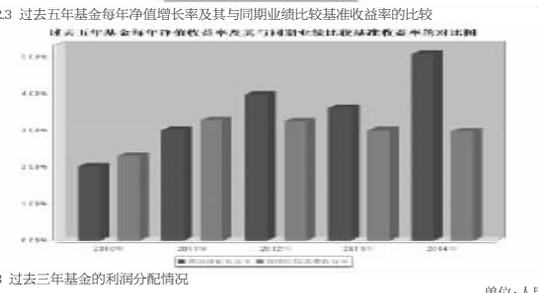
本基金业绩比较基准为银行一年期定期存款利率(税后)。本基金为储蓄存款的良好投资替代工具,所以投资业绩基准确定为:一年期定期存款利率(税后)。本比较基准与货币市场工具的收益率有一定的相关性,能够反映货币市场的收益率水平。

本基金的业绩比较基准将根据央行调息而调整。

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




3.2.3 过去五年基金每年净值增长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 |
|---|---|---|---|---|---|
| 2014 | 88,824,778.07 | – | – | 88,824,778.07 | |
| 2013 | 34,280,195.62 | – | – | 34,280,195.62 | |
| 2012 | 37,462,841.67 | – | – | 37,462,841.67 | |
| 合计 | 160,567,815.36 | – | – | 160,567,815.36 | |

### §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

本基金管理人为长盛基金管理有限公司(以下简称"公司"),成立于1999年3月26日,是国内最早成立的十家基金管理公司之一。公司注册资本为人民币18900万元。公司注册地在深圳,总部设在北京,并在北京、上海、郑州、杭州、成都设有分公司,在香港、北京分别设有子公司。目前,公司股东及其出资比例为:国元证券股份有限公司(以下简称"国元证券")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%。公司获得首批全国社保基金、合格境内机构投资者和特定客户资产管理业务资格。截至2014年12月31日,基金管理人共管理三十七只开放式基金,并管理多个全国社保基金组合和专户产品。公司同时兼任境外QFII基金和专户理财产品的投资顾问。

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 |
|---|---|---|---|---|---|
| 段鹏 | 本基金基金经理、长盛添利30天理财债券型证券投资基金基金经理、长盛添利60天理财债券型发起式证券投资基金基金经理、长盛年年收益定期开放债券型证券投资基金基金经理。 | 2014年4月10日 | – | 7年 | 男,1982年12月出生,中国国籍。中央财经大学经济学硕士。曾在中信银行股份有限公司从事人民币货币市场交易、债券投资及流动性管理等工作。2013年12月加入长盛基金管理有限公司,现任长盛货币市场基金(本基金)基金经理、长盛添利30天理财债券型证券投资基金基金经理、长盛添利60天理财债券型发起式证券投资基金基金经理、长盛年年收益定期开放债券型证券投资基金基金经理。 |
| 贾志敏 | 本基金基金经理、长盛同禧信用增利债券型证券投资基金基金经理、长盛中信金债指数增强型债券投资基金基金经理、长盛积极配置债券型证券投资基金基金经理、长盛季季红1年期定期开放债券型证券投资基金基金经理、长盛年年收益定期开放债券型证券投资基金基金经理、长盛双月红1年期定期开放债券型证券投资基金基金经理、固定收益部副总监。 | 2013年2月7日 | 2014年10月24日 | 8年 | 男,1982年3月出生,中国国籍。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,曾任固定收益部副总监,长盛同禧信用增利债券型证券投资基金基金经理、长盛中信金债指数增强型债券投资基金基金经理、长盛季季红1年期定期开放债券型证券投资基金基金经理、长盛年年收益定期开放债券型证券投资基金基金经理、长盛双月红1年期定期开放债券型证券投资基金基金经理等职务。自2014年10月24日起不再担任长盛货币市场基金基金经理。 |

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、"证券从业年限"中"证券从业"的含义遵从行业协会《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,本基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其各项实施准则、本基金的基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定,依照诚实信用、勤勉尽责的原则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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

本报告期内,本基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司相关制度等规定,从投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等环节严格把关,通过系统和人工等方式在各个环节严格控制交易公平执行,确保公平对待不同投资组合,包括公募基金、社保组合、特定客户资产管理组合等,切实防范利益输送,保护投资者的合法权益。具体如下:

研究支持,公司旗下所有投资组合共享公司研究部门研究成果,所有投资组合经理在公司研究平台上拥有同等权限。

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,各投资组合经理在投资决策委员会的授权范围内,独立完成投资组合的管理工作。各投资组合经理遵守投资信息隔离墙制度。

交易执行,公司实行集中交易制度,所有投资组合的投资指令均由交易部统一执行委托交易。交易部依照《公司公平交易细则》的规定,场内交易,强制开启恒生交易系统公平交易程序;场外交易,严格遵守相关工作流程,保证交易执行的公平性。

投资管理行为的监控与分析评估,公司风险管理部、监察稽核部,依照《公司公平交易细则》的规定,持续、动态监督公司投资管理全过程,并进行分析评估,及时向公司管理层报告发现问题,保障公司旗下所有投资组合均被公平对待。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

公司对该基金过去4个季度的同向交易行为进行数量分析,计算溢价率、贡献率、占优比等指标,使用双边90%置信水平对1日、3日、5日的交易片段进行T检验,未发现违反公平交易及利益输送的行为。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内,本基金未发生可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

1、报告期内行情回顾

回顾2014年,经济增速有所下滑,通胀水平总体呈下降走势,定向放松的货币政策及相对宽松的资金面驱动市场利率中枢持续下行,债券市场走出一波较强的趋势性牛市行情。利率债方面,收益率曲线整体下行,10年期国债收益率下行93BP至3.62%,10年期国开行债收益率大幅下行173BP至4.09%;信用债方面,低评级债券收益率下行幅度小于中高评级债券,主要是受信用风险事件频发及交易所债券质押回购规则变动等因素影响所致。

货币市场方面,2014年资金面总体呈现相对宽松格局。一季度受春节因素影响,资金利率呈现先升后降走势;4月份开始,央行通过定向降准降息、MLF、PSL等多种工具向市场投放资金,资金面相对宽松,各中短期限Shibor利率及银行间质押式回购利率总体处于相对低位;其中,7月和11月银行间资金利率小幅上行,但央行后续均投放资金平抑资金利率波动;十二月中旬以来,随着年末资金需求高峰来临,银行收紧流动性,同时受央行公开市场延续空窗操作及新一轮IPO等因素影响,货币市场各中短期资金利率呈现阶段性上升局面。

2、报告期内本基金投资策略分析

在报告期内,本基金根据市场资金面变化和利率走势,把握好配置节奏,根据对市场判断,在利率相对高点配置长期协议存款和信用债券,期间享受票息和资本利得收益,同时在配置过程中优化持仓结构,密切关注高收益债券的信用风险暴露,严格控制其持仓比例,防控信用风险。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2014年,长盛货币市场基金净值收益率为5.0830%,同期业绩比较基准收益率2.9726%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在深化改革和调整经济结构的背景下,政府对经济增长容忍度有所提高,国内经济的潜在增长率不断下降,2015年预计中国经济将维持相对疲弱的态势。12月中国PMI连续下滑至50.1%的年内低值,制造业新订单和产出指数双双走弱,反映制造业景气度持续弱化,经济下行压力依然存在。通胀方面,12月CPI同比上涨1.5%,通胀延续弱势。房地产投资增速继续下降,未来房地产销售仍面临较大不确定性。在经济仍面临较大下行压力的背景下,货币政策有望进一步宽松。

在后期投资策略上,密切关注经济基本面、货币政策和资金面的各种变化,在仓位和久期上根据市场形势变化灵活应对;对信用债,深入研究行业及个券信用利差变化,积极发掘信用风险可控、持有期收益较高的个券,并且密切跟踪持仓债券的信用风险状况,严防信用风险;对协议存款,把握好计入银行一般性存款的政策利好,利用好新股申购等利率波动机会,在利率高点拉长组合久期。

总之,无论后市如何变化,我们将秉承谨慎原则,在组合流动性得到保证的前提下,通过灵活的资产配置和深入的个券甄别分析,做好组合配置,力求确保基金资产实现持续的稳定增值。

4.6管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及本基金合同约定,本基金管理人严格按照《企业会计准则》、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定,对基金所持投资品种进行估值。本基金管理人制订了证券投资基金估值政策与估值程序,设立基金估值小组,参考行业协会估值意见和独立第三方机构估值数据,确保基金估值的公平、合理。

本基金管理人制订的证券投资基金估值政策与估值程序确定了估值目的、估值日、估值对象、估值程序、估值方法以及估值差错处理、暂停估值和特殊情形处理等事项。本基金管理人设立了由公司总经理(担任估值小组组长)、公司副总经理和督察长(担任估值小组副组长)、权益投资部、风险管理部、研究部、监察稽核部、业务运营部等部门负责人组成的基金估值小组,负责研究、指导并执行基金估值业务。小组成员均具有多年证券、基金从业经验,具备基金估值运作、行业研究、风险管理或法律合规等领域的专业胜任能力。

基金经理参与估值原则和方法的讨论,但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

参与估值流程的各方还包括本基金托管人和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任,当存有异议时,托管人有责任要求基金管理公司作出合理解释,通过积极商讨达成一致意见。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司签署服务协议,由其按约定提供在银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《证券投资基金运作管理办法》的规定以及本基金基金合同第十七条中对基金利润分配原则的约定,本基金按日分配收益,自基金合同生效日起每日将基金份额实现的基金净收益分配给份额持有人,并按月结转到投资人基金账户,使基金账面份额净值始终保持1.00元。按照上述通知及基金合同的规定,2014年度分配利润88,824,778.07元。

4.8报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内无基金持有人数或基金资产净值预警说明。

### §5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

报告期内,本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,诚信、尽责地履行了基金托管人义务,不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

报告期内,本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查,未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为;基金管理人在报告期内,严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认真复核了本年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,认为其真实、准确和完整,不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

### §6 审计报告

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)注册会计师汪棣、沈兆杰2014年3月23日对本基金2014年的资产负债表、2014年度利润表、所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注出具了普华永道中天审字(2015)第20180号无保留意见的审计报告。投资者欲查看审计报告全文,应阅读本年度报告正文。

### §7 年度财务报表

7.1资产负债表

会计主体:长盛货币市场基金

报告截止日:2014年12月31日

单位:人民币元

| 资 产 | 本期末 2014年12月31日 | 上年度末 2013年12月31日 |
|---|---|---|
| 资 产: | | |
| 银行存款 | 7,427,073,913.33 | 4,189,314,593.15 |
| 结算备付金 | – | – |
| 存出保证金 | – | – |
| 交易性金融资产 | 1,455,460,595.84 | 349,221,995.70 |
| 其中:股票投资 | – | – |
| 基金投资 | – | – |
| 债券投资 | 1,455,460,595.84 | 349,221,995.70 |
| 资产支持证券投资 | – | – |
| 贵金属投资 | – | – |
| 衍生金融资产 | – | – |
| 买入返售金融资产 | 413,971,940.96 | 1,903,553,060.33 |
| 应收证券清算款 | – | – |
| 应收利息 | 50,411,914.83 | 15,742,506.29 |
| 应收股利 | – | – |
| 应收申购款 | – | 1,106,080,805.01 |
| 递延所得税资产 | – | – |
| 其他资产 | 27,356.75 | 27,356.75 |
| 资产总计 | 9,346,945,721.71 | 7,563,940,317.23 |
| 负债和所有者权益 | 本期末 2014年12月31日 | 上年度末 2013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 | 171,269,543.09 | – |
| 应付证券清算款 | – | 579,976,416.67 |
| 应付赎回款 | 306,876.00 | 81,830.93 |
| 应付管理人报酬 | 1,308,960.66 | 578,555.06 |
| 应付托管费 | 396,654.74 | 175,319.71 |
| 应付销售服务费 | 991,636.86 | 438,299.26 |
| 应付交易费用 | 74,721.52 | 18,746.89 |
| 应交税费 | 1,175,800.00 | 1,175,800.00 |
| 应付利息 | 23,553.03 | – |
| 应付利润 | – | – |
| 递延所得税负债 | – | – |
| 其他负债 | 282,625.73 | 329,612.57 |
| 负债合计 | 175,830,371.63 | 582,774,581.09 |
| 所有者权益: | | |
| 实收基金 | 9,171,115,350.08 | 6,981,165,736.14 |
| 未分配利润 | – | – |
| 所有者权益合计 | 9,171,115,350.08 | 6,981,165,736.14 |
| 负债和所有者权益总计 | 9,346,945,721.71 | 7,563,940,317.23 |

注:注:报告截止日2014年12月31日,基金份额净值:1.0000元,基金份额总额9,171,115,350.08份。

7.2 利润表

会计主体:长盛货币市场基金

本报告期:2014年1月1日至2014年12月31日

单位:人民币元

| 资 产 | 本期 2014年1月1日至2014年12月31日 | 上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日 |
|---|---|---|
| 一、收入 | 106,181,782.06 | 41,834,864.91 |
| 1.利息收入 | 98,411,824.67 | 39,797,201.45 |
| 其中:存款利息收入 | 65,289,401.64 | 23,558,737.17 |
| 债券利息收入 | 30,975,476.05 | 13,510,319.79 |
| 资产支持证券利息收入 | – | – |
| 买入返售金融资产收入 | 2,146,946.98 | 2,728,144.49 |
| 其他利息收入 | – | – |
| 2.投资收益(损失以"-"填列) | 7,769,957.39 | 2,037,663.46 |
| 其中:股票投资收益 | – | – |
| 基金投资收益 | – | – |
| 债券投资收益 | 7,769,957.39 | 2,037,663.46 |
| 资产支持证券投资收益 | – | – |
| 贵金属投资收益 | – | – |
| 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.汇兑收益(损失以"-"号填列) | – | – |
| 5.其他收入(损失以"-"号填列) | – | – |
| 减:二、费用 | 17,357,003.99 | 7,554,669.29 |
| 1.管理人报酬 | 6,118,429.51 | 3,067,712.17 |
| 2.托管费 | 1,854,069.55 | 929,609.70 |
| 3.销售服务费 | 4,635,173.91 | 2,324,024.32 |
| 4.交易费用 | – | – |
| 5.利息支出 | 4,263,146.64 | 798,965.15 |
| 其中:卖出回购金融资产支出 | 4,263,146.64 | 798,965.15 |
| 6.其他费用 | 486,184.38 | 434,357.95 |
| 三、利润总额(亏损总额以"-"号填列) | 88,824,778.07 | 34,280,195.62 |
| 减:所得税费用 | – | – |
| 四、净利润(净亏损以"-"号填列) | 88,824,778.07 | 34,280,195.62 |

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:长盛货币市场基金

本报告期:2014年1月1日至2014年12月31日

单位:人民币元

| 项目 | 本期 2014年1月1日至2014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) | 6,981,165,736.14 | – | 6,981,165,736.14 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润) | – | 88,824,778.07 | 88,824,778.07 |
| 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) | 2,189,949,613.94 | – | 2,189,949,613.94 |
| 其中:1.基金申购款 | 18,298,944,281.09 | – | 18,298,944,281.09 |
| 2.基金赎回款 | -16,108,994,667.15 | – | -16,108,994,667.15 |
| 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) | – | -88,824,778.07 | -88,824,778.07 |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 9,171,115,350.08 | – | 9,171,115,350.08 |
| 项目 | 上年度可比期间 2013年1月1日至2013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) | 4,143,135,481.21 | – | 4,143,135,481.21 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润) | – | 34,280,195.62 | 34,280,195.62 |
| 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) | 2,838,030,254.93 | – | 2,838,030,254.93 |
| 其中:1.基金申购款 | 11,913,477,662.60 | – | 11,913,477,662.60 |
| 2.基金赎回款 | -9,075,447,407.67 | – | -9,075,447,407.67 |
| 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) | – | -34,280,195.62 | -34,280,195.62 |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 6,981,165,736.14 | – | 6,981,165,736.14 |

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:

周兵 林培富 龚珉

基金管理人负责人 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

长盛货币市场基金(以下简称"本基金")经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监基金字[2005]第176号《关于同意长盛货币市场基金募集的批复》核准,由长盛基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《长盛货币市场基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币3,601,377,144.40元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2005)第182号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《长盛货币市场基金基金合同》于2005年12月12日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为3,601,835,236.63份基金份额,其中认购资金利息折合458,092.23份基金份额。本基金的基金管理人为长盛基金管理有限公司,基金托管人为兴业银行股份有限公司。

根据《货币市场基金管理暂行规定》和《长盛货币市场基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为现金;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)的中央银行票据以及中国证监会;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、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当期银行一年期定期储蓄存款的税后利率。

本财务报表由本基金的基金管理人长盛基金管理有限公司于2015年3月23日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则-基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称"企业会计准则")、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《长盛货币市场基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2014年度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2014年12月31日的财务状况以及2014年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

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 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

财政部于2014年颁布《企业会计准则第39号——公允价值计量》、《企业会计准则第40号——合营安排》、《企业会计准则第41号——在其他主体中权益的披露》和修订后的《企业会计准则第2号——长期股权投资》、《企业会计准则第9号——职工薪酬》、《企业会计准则第30号——财务报表列报》、《企业会计准则第33号——合并财务报表》以及《企业会计准则第37号——金融工具列报》,要求除《企业会计准则第37号——金融工具列报》自2014年度财务报表起施行外,其他准则自2014年7月1日起施行。上述准则对本基金本报告期无重大影响。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1)以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围,不征收营业税。基金买卖债券的差价收入不予征收营业税。

(2)对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖债券的差价收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入,应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。

7.4.7 关联方关系

| 项目 | 与本基金的关系 |
|---|---|
| 长盛基金管理有限公司("长盛基金公司") | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构 |
| 兴业银行股份有限公司("兴业银行") | 基金托管人、基金销售机构 |
| 国元证券股份有限公司 | 基金管理人的股东、基金销售机构 |
| 新加坡星展银行有限公司 | 基金管理人的股东 |
| 安徽省信用担保集团有限公司 | 基金管理人的股东 |
| 安徽省投资集团控股有限公司 | 基金管理人的股东 |
| 长盛基金(香港)有限公司 | 基金管理人的全资子公司 |
| 长盛创富资产管理有限公司 | 基金管理人的全资子公司 |

注:下述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

本基金未开立关联方交易单元。

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 2014年1月1日至2014年12月31日 | 上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 6,118,429.51 | 3,067,712.17 |
| 其中:支付销售机构的客户维护费 | 1,620,072.33 | 636,976.79 |

注:支付基金管理人长盛基金管理有限公司的基金管理费按前一日基金资产净值0.33%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。

其计算公式为:日基金管理费=前一日基金资产净值×0.33%/当年天数。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

| 项目 | 本期 2014年1月1日至2014年12月31日 | 上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 1,854,069.55 | 929,609.70 |

注:支付基金托管人兴业银行的托管费按前一日基金资产净值0.1%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。

其计算公式为:日托管费=前一日基金资产净值×0.1%/当年天数。

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 2014年1月1日至2014年12月31日 当期发生的基金应支付的销售服务费 |
|---|---|
| 长盛基金公司 | 1,118,571.92 |
| 兴业银行 | 90,247.04 |
| 国元证券 | 12,737.71 |
| 合计 | 1,221,556.67 |
| 获得销售服务费各关联方名称 | 上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日 当期发生的基金应支付的销售服务费 |
| 长盛基金 | 918,338.06 |
| 兴业银行 | 161,464.81 |
| 国元证券 | 13,566.85 |
| 合计 | 1,093,369.72 |

注:支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付给长盛基金管理有限公司,再由长盛基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。

其计算公式为:日销售服务费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

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

单位:人民币元

| 本期 2014年1月1日至2014年12月31日 | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 银行间市场交易的各关联方名称 | 债券交易金额 | | 基金逆回购 | | 基金正回购 | |
| | 基金买入 | 基金卖出 | 交易金额 | 利息收入 | 交易金额 | 利息支出 |
| 兴业银行 | 16,739,095.01 | – | – | – | 57,000,000.00 | 4,919.18 |
| 上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日 | | | | | | |
| 银行间市场交易的各关联方名称 | 债券交易金额 | | 基金逆回购 | | 基金正回购 | |
| | 基金买入 | 基金卖出 | 交易金额 | 利息收入 | 交易金额 | 利息支出 |
| 兴业银行 | – | – | – | – | – | – |

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:基金管理人本期及上年度可比期间未运用固有资金投资本基金。

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:除基金管理人之外的其他关联方本期末及上年度末未投资本基金。

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 2014年1月1日至2014年12月31日 | | 上年度可比期间 2013年1月1日至2013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 |
| 兴业银行 | 1,604,073,913.33 | 10,828,207.54 | 1,076,314,593.15 | 7,282,448.35 |

注:本基金的银行存款由基金托管人兴业银行保管,按银行同业利率/约定利率计息。

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:本基金本期及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.9 期末(2014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:本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注:本基金报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2014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171,269,543.09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 |
|---|---|---|---|---|---|
| 140207 | 14国开07 | 2015年1月5日 | 100.20 | 330,000 | 33,066,820.17 |
| 140213 | 14国开13 | 2015年1月5日 | 99.84 | 200,000 | 19,968,012.12 |
| 140327 | 14进出27 | 2015年1月5日 | 100.22 | 200,000 | 20,044,009.33 |
| 140204 | 14国开04 | 2015年1月5日 | 100.03 | 1,000,000 | 100,032,399.82 |
| 合计 | | | | 1,730,000 | 173,111,241.44 |

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本期末无交易所市场债券正回购中作为抵押的债券。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1)公允价值

(a)金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次,由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定:

第一层次:相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次:除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次:相关资产或负债的不可观察输入值。

(b)持续的以公允价值计量的金融工具

(i)各层次金融工具公允价值

于2014年12月31日,本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第二层次的余额为1,455,460,595.84元,无属于第一或第三层次的余额(2013年12月31日:第二层次349,221,995.70元,无属于第一或第三层次的余额)。

(ii)公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

(iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具

于2014年12月31日,本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2013年12月31日:同)。

(d)不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债,其账面价值与公允价值相差很小。

(2)除公