

长盛货币市场基金

[2015] 第二季度报告

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:2015年7月21日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及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、完整性、及时性和合法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2015年7月20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。

基金的过往业绩并不代表未来表现。投资人对基金的投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本基金的管理费率为零。

本报告期自2015年4月1日起至6月30日止。

§ 2 基金产品概况

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 短期开放式

基金合同生效日 2006年12月12日

报告期末基金份额总额 1,678,812,115.00份

投资目标 在货币基金的基础上，保证资产的高流动性基础上，追求货币比

较收益，同时兼顾风险与收益的平衡，通过主动负债化操作机制，

运用杠杆的资产负债，通过动态调整负债比例，追求货币投

资目标，实现货币市场的绝对等价，实现收益与风险的平衡。

业绩比较基准 银行一年定期存款利率(税后)

风险收益特征 本基金属于货币基金，风险较低，预期收益高于货币型基金。

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2015年4月1日 - 2015年6月30日)

1. 本期已实现收益 23,563,787.37

2. 本期利润 23,563,787.37

3. 期末基金资产净值 1,678,812,115.00

注:1. 所示数据截止至2015年6月30日。

2. 本公司现收取基金管理费，投资人已实现本期和上一期的平均价值变动收益，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。

3.2.1 本基金报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

净收益/净利润 净资产收益率 业绩比较基准收益率

阶段 ①-③ ②-④

过去三个月 1.103% -0.012% 0.0004% 0.0575% 0.0123%

注:本基金收益分配是按日结转份额。

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:本基金合同生效日为2006年12月12日。

3.3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2015年4月1日 - 2015年6月30日)

1. 本期已实现收益 23,563,787.37

2. 本期利润 23,563,787.37

3. 期末基金资产净值 1,678,812,115.00

注:1. 所示数据截止至2015年6月30日。

2. 本公司现收取基金管理费，投资人已实现本期和上一期的平均价值变动收益，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。

3.2.1 本基金报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

净收益/净利润 净资产收益率 业绩比较基准收益率

阶段 ①-③ ②-④

过去三个月 1.103% -0.012% 0.0004% 0.0575% 0.0123%

注:本基金收益分配是按日结转份额。

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:本基金合同生效日为2006年12月12日。

3.3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2015年4月1日 - 2015年6月30日)

1. 本期已实现收益 23,563,787.37

2. 本期利润 23,563,787.37

3. 期末基金资产净值 1,678,812,115.00

注:1. 所示数据截止至2015年6月30日。

2. 本公司现收取基金管理费，投资人已实现本期和上一期的平均价值变动收益，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。

3.2.1 本基金报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

净收益/净利润 净资产收益率 业绩比较基准收益率

阶段 ①-③ ②-④

过去三个月 1.103% -0.012% 0.0004% 0.0575% 0.0123%

注:本基金收益分配是按日结转份额。

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:本基金合同生效日为2006年12月12日。

3.3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2015年4月1日 - 2015年6月30日)

1. 本期已实现收益 33,075,624.33

2. 本期利润 289,231,352.91

3. 期末基金资产净值 979,854,967.94

4. 期末可供分配基金份额 2,361

5. 合计 1,991,522,566.30

注:本基金期内,根据流动性管理的需要,本基金提前支取了部分可提前支取且无利息损失的存款。

6. 期末可供分配基金份额 2,361

7. 期末可供分配基金份额 2,361

8. 期末可供分配基金份额 2,361

9. 期末可供分配基金份额 2,361

10. 期末可供分配基金份额 2,361

11. 期末可供分配基金份额 2,361

12. 期末可供分配基金份额 2,361

13. 期末可供分配基金份额 2,361

14. 期末可供分配基金份额 2,361

15. 期末可供分配基金份额 2,361

16. 期末可供分配基金份额 2,361

17. 期末可供分配基金份额 2,361

18. 期末可供分配基金份额 2,361

19. 期末可供分配基金份额 2,361

20. 期末可供分配基金份额 2,361

21. 期末可供分配基金份额 2,361

22. 期末可供分配基金份额 2,361

23. 期末可供分配基金份额 2,361

24. 期末可供分配基金份额 2,361

25. 期末可供分配基金份额 2,361

26. 期末可供分配基金份额 2,361

27. 期末可供分配基金份额 2,361

28. 期末可供分配基金份额 2,361

29. 期末可供分配基金份额 2,361

30. 期末可供分配基金份额 2,361

31. 期末可供分配基金份额 2,361

32. 期末可供分配基金份额 2,361

33. 期末可供分配基金份额 2,361

34. 期末可供分配基金份额 2,361

35. 期末可供分配基金份额 2,361

36. 期末可供分配基金份额 2,361

37. 期末可供分配基金份额 2,361

38. 期末可供分配基金份额 2,361

39. 期末可供分配基金份额 2,361

40. 期末可供分配基金份额 2,361

41. 期末可供分配基金份额 2,361

42. 期末可供分配基金份额 2,361

43. 期末可供分配基金份额 2,361

44. 期末可供分配基金份额 2,361

45. 期末可供分配基金份额 2,361

46. 期末可供分配基金份额 2,361

47. 期末可供分配基金份额 2,361

48. 期末可供分配基金份额 2,361

49. 期末可供分配基金份额 2,361

50. 期末可供分配基金份额 2,361

51. 期末可供分配基金份额 2,361

52. 期末可供分配基金份额 2,361

53. 期末可供分配基金份额 2,361

54. 期末可供分配基金份额 2,361

55. 期末可供分配基金份额 2,361

56. 期末可供分配基金份额 2,361

57. 期末可供分配基金份额 2,361

58. 期末可供分配基金份额 2,361

59. 期末可供分配基金份额 2,361

60. 期末可供分配基金份额 2,361

61. 期末可供分配基金份额 2,361

62. 期末可供分配基金份额 2,361

63. 期末可供分配基金份额 2,361

64. 期末可供分配基金份额 2,361

65. 期末可供分配基金份额 2,361

66. 期末可供分配基金份额 2,361

67. 期末可供分配基金份额 2,361

68. 期末可供分配基金份额 2,361

69. 期末可供分配基金份额 2,361

70. 期末可供分配基金份额 2,361

71. 期末可供分配基金份额 2,361

72. 期末可供分配基金份额 2,361

73. 期末可供分配基金份额 2,361

74. 期末可供分配基金份额 2,361

75. 期末可供分配基金份额 2,361

76. 期末