

长盛货币市场基金

【2015】第一季度报告

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、准确性和完整性承担个别及连带法律责任。

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。

本报告自2015年4月1日起至6月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金名称	长盛货币
基金代码	080011
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2005年12月11日
报告期末基金份额总额	1,676,812,116.08份
投资目标	在力争本金安全、保持资产流动性的基础上,追求高于业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金将跟踪宏观经济、微观经济运行状况、货币市场状况和财政政策变化,以及货币市场和证券市场利率变化等因素,在严格控制投资组合风险的前提下,通过动态调整投资组合,追求当期收益最大化。本基金主要投资于货币市场工具,如短期国债、央行票据、交易所成本、市场流动性等特征,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	本基金属于证券投资基金中低风险品种,低风险品种,其预期风险和预期收益都低于股票、债券和混合型基金。
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

3.1 主要财务指标

主要财务指标	报告期(2015年4月1日 - 2015年6月30日)	单位:人民币元
1、本期已实现收益	23,583,787.37	
2、本期利润	23,583,787.37	
3、期末未分配利润	1,676,812,116.08	

注:1、所列数据截至2015年6月30日。

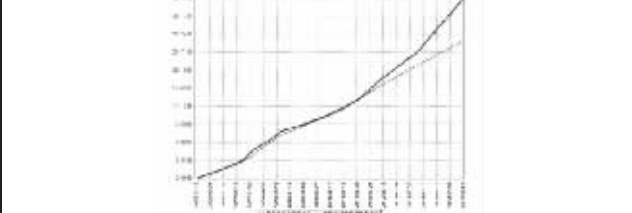
2、管理人应对报告期内本基金运作遵守诚信原则,投资收益,其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益;由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此公允价值变动收益为零。本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3.2 基金净值表现

阶段	净值增长率	业绩比较基准收益率	净值比较基准收益率	①-②	②-③
过去三个月	1.1538%	0.0126%	0.5863%	0.0004%	0.5676%
过去一年	1.1538%	0.0126%	0.5863%	0.0004%	0.5676%

注:1、本基金净值表现和业绩比较基准收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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



§ 4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金基金经理期限	证券从业年限	说明
周明	基金经理	2014年4月10日	8年	男,1982年12月出生,中国国籍,毕业于武汉大学,2005年加入长盛基金管理有限公司从事基金管理工作,2013年12月加入长盛货币市场基金基金经理,负责长盛货币市场基金(本基金)基金的投资管理工作。具有基金从业资格,持有证券投资基金从业资格和基金从业资格。具有证券从业资格,持有证券投资基金从业资格和基金从业资格。

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、“证券从业资格”指“证券投资基金从业资格”及“基金从业资格”的简称。本基金基金合同和其他有关法律、法规、基金管理人内部规定,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。

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内,公司严格执行《上市公司公平交易制度》各项规定,在研究、投资授权与决策、交易执行等各个环节,公平对待旗下所有投资组合,包括公募基金、社保组合、特定资产管理组合等。具体如下:

4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内,公司严格执行《上市公司公平交易制度》各项规定,在研究、投资授权与决策、交易执行等各个环节,公平对待旗下所有投资组合,包括公募基金、社保组合、特定资产管理组合等。具体如下:

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内,本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中,未发现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

报告期内,本基金管理人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但未产生利息损失的相关组合整体收益。

4.4.2 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

报告期内,本基金管理人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但未产生利息损失的相关组合整体收益。

4.4.3 异常交易行为的专项说明

报告期内,本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中,未发现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的交易。

4.4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

报告期内,本基金管理人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但未产生利息损失的相关组合整体收益。

4.4.5 异常交易行为的专项说明

报告期内,本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中,未发现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的交易。

4.4.6 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

报告期内,本基金管理人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但未产生利息损失的相关组合整体收益。

4.4.7 异常交易行为的专项说明

报告期内,本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中,未发现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的交易。

4.4.8 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

报告期内,本基金管理人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但未产生利息损失的相关组合整体收益。

4.4.9 异常交易行为的专项说明

报告期内,本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中,未发现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的交易。

4.4.10 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

报告期内,本基金管理人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但未产生利息损失的相关组合整体收益。

4.4.11 异常交易行为的专项说明

报告期内,本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中,未发现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的交易。

4.4.12 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

报告期内,本基金管理人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但未产生利息损失的相关组合整体收益。

4.4.13 异常交易行为的专项说明

报告期内,本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中,未发现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的交易。

4.4.14 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

报告期内,本基金管理人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但未产生利息损失的相关组合整体收益。

4.4.15 异常交易行为的专项说明

报告期内,本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中,未发现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的交易。

4.4.16 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

报告期内,本基金管理人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但未产生利息损失的相关组合整体收益。

4.4.17 异常交易行为的专项说明

报告期内,本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中,未发现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的交易。

4.4.18 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

报告期内,本基金管理人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但未产生利息损失的相关组合整体收益。

4.4.19 异常交易行为的专项说明

报告期内,本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中,未发现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的交易。

4.4.20 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

报告期内,本基金管理人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但未产生利息损失的相关组合整体收益。

4.4.21 异常交易行为的专项说明

报告期内,本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中,未发现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的交易。

4.4.22 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

报告期内,本基金管理人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但未产生利息损失的相关组合整体收益。

4.4.23 异常交易行为的专项说明

报告期内,本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中,未发现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的交易。

4.4.24 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

报告期内,本基金管理人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但未产生利息损失的相关组合整体收益。

4.4.25 异常交易行为的专项说明

报告期内,本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中,未发现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的交易。

4.4.26 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

报告期内,本基金管理人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但未产生利息损失的相关组合整体收益。

4.4.27 异常交易行为的专项说明

报告期内,本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中,未发现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的交易。

4.4.28 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

报告期内,本基金管理人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但未产生利息损失的相关组合整体收益。

4.4.29 异常交易行为的专项说明

报告期内,本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中,未发现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的交易。

4.4.30 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

报告期内,本基金管理人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但未产生利息损失的相关组合整体收益。

4.4.31 异常交易行为的专项说明

报告期内,本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中,未发现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的交易。

4.4.32 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

报告期内,本基金管理人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但未产生利息损失的相关组合整体收益。

4.4.33 异常交易行为的专项说明

报告期内,本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中,未发现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的交易。

4.4.34 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

报告期内,本基金管理人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但未产生利息损失的相关组合整体收益。

4.4.35 异常交易行为的专项说明

报告期内,本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中,未发现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的交易。

4.4.36 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

报告期内,本基金管理人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但未产生利息损失的相关组合整体收益。

4.4.37 异常交易行为的专项说明

报告期内,本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中,未发现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的交易。

4.4.38 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

报告期内,本基金管理人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但未产生利息损失的相关组合整体收益。

4.4.39 异常交易行为的专项说明

报告期内,本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中,未发现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的交易。

4.4.40 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

报告期内,本基金管理人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但未产生利息损失的相关组合整体收益。

4.4.41 异常交易行为的专项说明

报告期内,本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中,未发现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的交易。

4.4.42 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

报告期内,本基金管理人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但未产生利息损失的相关组合整体收益。

4.4.43 异常交易行为的专项说明

报告期内,本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中,未发现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的交易。

4.4.44 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

报告期内,本基金管理人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但未产生利息损失的相关组合整体收益。

4.4.45 异常交易行为的专项说明

报告期内,本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中,未发现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的交易。

4.4.46 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

报告期内,本基金管理人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但未产生利息损失的相关组合整体收益。

4.4.47 异常交易行为的专项说明

报告期内,本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中,未发现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的交易。

4.4.48 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

报告期内,本基金管理人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但未产生利息损失的相关组合整体收益。

4.4.49 异常交易行为的专项说明

报告期内,本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中,未发现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的交易。

4.4.50 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

报告期内,本基金管理人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但未产生利息损失的相关组合整体收益。

4.4.51 异常交易行为的专项说明

报告期内,本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中,未发现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的交易。

4.4.52 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

报告期内,本基金管理人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但未产生利息损失的相关组合整体收益。

4.4.53 异常交易行为的专项说明

报告期内,本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中,未发现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的交易。

4.4.54 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

报告期内,本基金管理人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但未产生利息损失的相关组合整体收益。

4.4.55 异常交易行为的专项说明

报告期内,本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中,未发现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的交易。

4.4.56 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

报告期内,本基金管理人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但未产生利息损失的相关组合整体收益。

4.4.57 异常交易行为的专项说明

报告期内,本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中,未发现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的交易。

4.4.58 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

报告期内,本基金管理人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但未产生利息损失的相关组合整体收益。

4.4.59 异常交易行为的专项说明

报告期内,本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中,未发现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的交易。

4.4.60 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

报告期内,本基金管理人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但未产生利息损失的相关组合整体收益。

4.4.61 异常交易行为的专项说明

报告期内,本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中,未发现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的交易。

4.4.62 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

报告期内,本基金管理人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但未产生利息损失的相关组合整体收益。

4.4.63 异常交易行为的专项说明

报告期内,本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中,未发现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的交易。

4.4.64 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

报告期内,本基金管理人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但未产生利息损失的相关组合整体收益。

4.4.65 异常交易行为的专项说明

报告期内,本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中,未发现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的交易。

4.4.66 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

报告期内,本基金管理人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但未产生利息损失的相关组合整体收益。

4.4.67 异常交易行为的专项说明

报告期内,本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中,未发现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的交易。

4.4.68 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

报告期内,本基金管理人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但未产生利息损失的相关组合整体收益。

4.4.69 异常交易行为的专项说明

报告期内,本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中,未发现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的交易。

4.4.70 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

报告期内,本基金管理人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但未产生利息损失的相关组合整体收益。

4.4.71 异常交易行为的专项说明

报告期内,本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中,未发现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的交易。

4.4.72 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

报告期内,本基金管理人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但未产生利息损失的相关组合整体收益。

4.4.73 异常交易行为的专项说明

报告期内,本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中,未发现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的交易。

4.4.74 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

报告期内,本基金管理人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但未产生利息损失的相关组合整体收益。

4.4.75 异常交易行为的专项说明

报告期内,本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中,未发现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的交易。

4.4.76 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

报告期内,本基金管理人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但未产生利息损失的相关组合整体收益。

4.4.77 异常交易行为的专项说明

报告期内,本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中,未发现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的交易。

4.4.78 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

报告期内,本基金管理人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但未产生利息损失的相关组合整体收益。

4.4.79 异常交易行为的专项说明

报告期内,本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中,未发现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的交易。

4.4.80 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

报告期内,本基金管理人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但未产生利息损失的相关组合整体收益。

4.4.81 异常交易行为的专项说明

报告期内,本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中,未发现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的交易。

4.4.82 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

报告期内,本基金管理人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但未产生利息损失的相关组合整体收益。

4.4.83 异常交易行为的专项说明

报告期内,本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中,未发现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的交易。

4.4.