长盛货币市场基金 2018年半年度报告摘要

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:2018年8月29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。本半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2018年8月28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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计 。

本报告期自2018年01月01日起至06月30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	
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	6,412,808,617.56份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	长盛货币A	长盛货币B
下属分级基金的交易代码:	080011	005230
报告期末下属分级基金的份额总额	941,708,509.57份	5,471,100,107.99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	本基金将根据宏观经济、微观经济运行状况,货币政策和财政政策执行情况,以及货币市场、证券市场运行状况制定投资策略。采用积极的投资策略,通过动态调整优化投资组合,追求当期收益最大化。在动态调整过程中,基金管理小组将全面考虑收益目标、交易成本、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	张利宁	曾麓燕
	联系电话	010-82019988	021-52629999-212040
	电子邮箱	zhangln@csfunds.com.cn	015292@cib.com.cn
客户服务电话		400-888-2666 010-62350088	95561
传真		010-82255988	021-62535823

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.csfunds.com.cn
基金半年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的办公地址

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

基金级别	长盛货币A	长盛货币B
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2018年1月1日 - 2018年6月30日)	报告期(2018年1月1日 - 2018年6月30日)
本期已实现收益	30,514,092.75	114,558,906.41
本期利润	30,514,092.75	114,558,906.41
本期净值收益率	2.0265%	2.1490%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)	
期末基金资产净值	941,708,509.57	5,471,100,107.99
期末基金份额净值	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、本基金于2017年10月10日起新增B份额,原有基金份额全部转为A类基金份额。

4、表中的"期末"均指本报告期最后一日,即6月30日。

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

长盛货币A

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
过去一个月	0.3126%	0.0007%	0.1233%	0.0000%	0.1893%	0.0007%
过去三个月	0.9687%	0.0011%	0.3740%	0.0000%	0.5947%	0.0011%
过去六个月	2.0265%	0.0014%	0.7438%	0.0000%	1.2827%	0.0014%
过去一年	4.1118%	0.0018%	1.5000%	0.0000%	2.6118%	0.0018%
过去三年	10.6232%	0.0069%	4.6212%	0.0003%	6.0020%	0.0066%
自基金合同生效起至今	49.6287%	0.0073%	31.4524%	0.0021%	18.1763%	0.0052%

长盛货币B

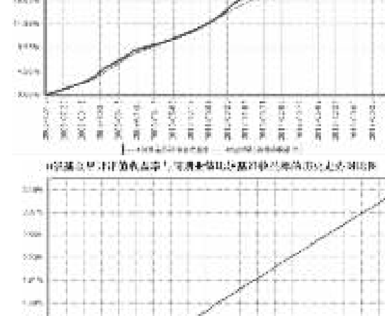
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.3324%	0.0007%	0.1233%	0.0000%	0.2091%	0.0007%
过去三个月	1.0293%	0.0011%	0.3740%	0.0000%	0.6553%	0.0011%
过去六个月	2.1490%	0.0014%	0.7438%	0.0000%	1.4052%	0.0014%
自基金合同生效起至今	3.1944%	0.0012%	1.0849%	0.0000%	2.1095%	0.0012%

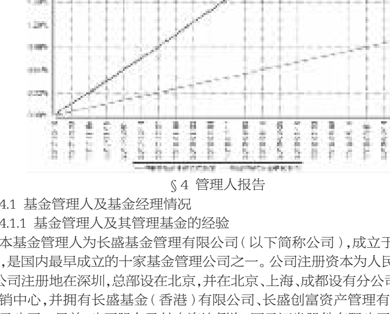
注:本基金业绩比较基准的构建及再平衡过程:

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





§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、成都设有分公司,在深圳设有营销中心,并拥有长盛基金(香港)有限公司、长盛创富资产管理有限公司两家全资子公司。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、特定客户资产管理业务资格和保险资产管理人资格。截至2018年6月30日,基金管理人共管理六十八只开放式基金,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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
段鹏	本基金基金经理,长盛年年收益定期开放债券型证券投资基金基金经理,长盛盛和纯债债券型证券投资基金基金经理,长盛盛景纯债债券型证券投资基金基金经理,长盛盛裕纯债债券型证券投资基金基金经理,长盛添利宝货币市场基金基金经理,长盛积极配置债券型证券投资基金基金经理。	2014年4月10日	-	11年	段鹏先生,1982年12月出生。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。

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 公平交易制度的执行情况

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,公平对待旗下所有投资组合,包括公募基金、社保组合、特定客户资产管理组合等。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。

公司对过去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。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中,未发生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的5%的交易。

本报告期内,未发现本基金有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

(一)报告期内行情回顾

回顾上半年,去杠杆累积效应逐步体现,叠加中美贸易摩擦导致外需有所放缓,经济基本面逐步下行;尽管油价持续攀升,但国内总需求减弱,传导效应不明显,通胀总体处于低位运行区间。在国内外形势发生变化的背景下,政策层面出现微调,监管政策节奏有所调整,货币政策基调出现放松,开始定向降准,并且二季度货币政策例会上,央行提出了"保持流动性合理充裕",资金面总体逐步宽松。

上半年,尽管有所反复,但市场收益率整体下行,债券市场经历了一波上涨,十年期国开债收益率下行约60BP,中等久期高等级信用债收益率也明显下行,一年及以内短端资产下行幅度略大于长端。

(二)报告期内本基金投资策略分析

在报告期内,本基金掌握资产配置节奏,增加长期资产配置比例,优化持仓结构,保持组合流动性,努力提高组合整体收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期长盛货币A的基金份额净值收益率为2.0265%,本报告期长盛货币B的基金份额净值收益率为2.1490%,同期业绩比较基准收益率为0.7438%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年,中美贸易摩擦或将持续扰动,下半年净出口改善存在不确定性,经济基本面大概率缓慢下行;央行提出了"保持流动性合理充裕",相较去年的"基本稳定",宽松信号释放明显,下半年或将持续进行定向降准等相关操作来放松货币。

总体来看,国内经济基本面趋于下行,且央行已释放松货币信号,同时权益市场难有大幅起色,下半年整体环境对债券市场仍然偏有利,预计货币市场收益率将继续下行。

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(担任估值工作小组组长)、公司督察长(担任估值工作小组副组长)、公司相关投资、研究部门分管领导、公司运营部分管领导、相关研究部门、相关投资部门、监察稽核部、风险管理部、信息技术部及业务运营部总监或指定人员组成的估值工作小组,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。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已分别与中央国债登记结算有限责任公司和中证指数有限公司签署服务协议,由其分别按约定提供在银行间同业市场交易的债券品种和在交易所市场交易或挂牌的部分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

根据本基金基金合同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,2018上半年度分配利润 145,072,999.16元。其中:A类别份额分配利润30,514,092.75元,B类别份额分配利润114,558,906.41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 托管人对本半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半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 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:长盛货币市场基金

报告截止日:2018年6月30日

单位:人民币元

资产	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
资产:		
银行存款	3,558,672,858.25	2,899,605,018.70
结算备付金	-	-
存出保证金	-	-
交易性金融资产	1,515,641,243.11	7,269,799,564.79
其中:股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	1,515,641,243.11	7,269,799,564.79
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	1,546,137,479.21	339,519,349.28
应收证券清算款	-	-
应收利息	34,340,135.33	39,899,508.74
应收股利	-	-
应收申购款	322,066,345.80	87,380,254.56
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	6,976,858,061.70	10,636,203,696.07
负债和所有者权益	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017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	558,498,816.74	300,575,649.71
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	15,424.44	11,932.14
应付管理人报酬	887,151.09	1,268,018.03
应付托管费	295,717.05	422,672.67
应付销售服务费	261,121.26	777,302.56
应付交易费用	96,266.50	149,100.89
应交税费	1,208,152.28	1,175,800.00
应付利息	102,089.64	85,988.64
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	2,684,705.14	2,763,239.16
负债合计	564,049,444.14	307,229,703.80
所有者权益:		
实收基金	6,412,808,617.56	10,328,973,992.27
未分配利润	-	-
所有者权益合计	6,412,808,617.56	10,328,973,992.27
负债和所有者权益总计	6,976,858,061.70	10,636,203,696.07

注:报告截止日2018年6月30日,基金份额总额6,412,808,617.56份,其中A类基金份额总额941,708,509.57份,基金份额净值1.00元;B类基金份额总额5,471,100,107.99份,基金份额净值1.00元。

6.2 利润表

会计主体:长盛货币市场基金

本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

单位:人民币元

项 目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
一、收入	156,758,084.61	34,751,650.69
1.利息收入	154,985,007.35	34,753,253.61
其中:存款利息收入	63,705,492.35	11,585,323.43
债券利息收入	74,749,972.82	19,698,241.73
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	16,529,542.18	3,469,688.45
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	1,773,077.26	-1,602.92
其中:股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	1,773,077.26	-1,602.92
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	11,685,085.45	8,674,156.95
1. 管理人报酬	5,123,717.48	2,716,557.12
2. 托管费	1,707,905.87	823,199.16
3. 销售服务费	2,138,710.10	2,057,997.79
4. 交易费用	-	-
5. 利息支出	2,424,261.51	2,828,183.24
其中:卖出回购金融资产支出	2,424,261.51	2,828,183.24
6. 税金及附加	26,193.58	-
7. 其他费用	264,296.91	248,219.64
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	145,072,999.16	26,077,493.74
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	145,072,999.16	26,077,493.74

6.3 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:2018年1月1日 至 2018年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30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)	10,328,973,992.27	-	10,328,973,992.27
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	145,072,999.16	145,072,999.16
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)	-3,916,165,374.71	-	-3,916,165,374.71
其中:1.基金申购款	13,501,010,388.41	-	13,501,010,388.41
2.基金赎回款	-17,417,175,763.12	-	-17,417,175,763.12
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)	-	-145,072,999.16	-145,072,999.16
五、期末所有者权益(基金净值)	6,412,808,617.56	-	6,412,808,617.56
项目	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30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)	6,176,323,704.21	-	6,176,323,704.21
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	26,077,493.74	26,077,493.74
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)	-3,994,675,150.86	-	-3,994,675,150.86
其中:1.基金申购款	2,766,592,568.30	-	2,766,592,568.30
2.基金赎回款	-6,761,267,719.16	-	-6,761,267,719.16
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)	-	-26,077,493.74	-26,077,493.74
五、期末所有者权益(基金净值)	2,181,648,553.35	-	2,181,648,553.35

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署:

______林培富______ ______刁俊东______ ____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

6.4 报表附注

6.4.1 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。

根据长盛基金管理有限公司2017年10月10日发布的《长盛货币市场基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》,本基金增设B类基金份额,原有基金份额全部转为A类基金份额。

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;期限在1年以内(含1年)的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单;剩余期限在397天以内(含397天)的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券;以及中国证监会、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银行一年期定期存款利率(税后)。

6.4.2 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(以下简称"中国基金业协会")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》和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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2018年6月30日的财务状况以及2018年1月1日至6月30日期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 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。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 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。

6.4.5.3 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。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1)资管产品运营过程中发生的增值税应税行为,以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为,暂适用简易计税方法,按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为,未缴纳增值税的,不再缴纳;已缴纳增值税的,已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税,对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务,以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2)对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,股票的股息、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。

(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。对基金从上市公司取得的股息红利所得,持股期限在1个月以内(含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股,解禁后取得的股息、红利收入,按照上述规定计算纳税,持股时间自解禁日起计算;解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4)基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。

(5)本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内未存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
长盛基金管理有限公司("长盛基金")	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("国元证券")	基金管理人的股东、基金销售机构
长盛创富资产管理有限公司("长盛创富")	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。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

注:无。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	5,123,717.48	2,716,557.12
其中:支付销售机构的客户维护费	1,104,308.17	720,678.20

注:自2005年12月12日至2017年10月9日,支付基金管理人长盛基金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 X 0.33% / 当年天数。

根据基金份额持有人大会表决通过的《关于修改长盛货币市场基金基金合同有关事项的议案》,自2017年10月10日起,支付基金管理人长盛基金的管理人报酬按前一日基金资产净值0.15%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:

日管理人报酬=前一日基金资产净值 X 0.15% / 当年天数。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,707,905.87	823,199.16

注:自2005年12月12日至2017年10月9日,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 X 0.1% / 当年天数。

根据基金份额持有人大会表决通过的《关于修改长盛货币市场基金基金合同有关事项的议案》,自2017年10月10日起,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0.05%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 X 0.05% / 当年天数。

6.4.8.2.3 销售服务费

单位:人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日 当期发生的基金应支付的销售服务费		
	长盛货币A	长盛货币B	合计
长盛基金	53,762.97	237,841.31	291,604.28
兴业银行	13,811.27	-	13,811.27
国元证券	15,025.32	32.89	15,058.21
合计	82,599.56	237,874.20	320,473.76
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日 当期发生的基金应支付的销售服务费		
	长盛货币A	长盛货币B	合计
长盛基金	747,266.16	-	747,266.16
兴业银行	18,456.02	-	18,456.02
国元证券	952.50	-	952.50
合计	766,674.68	-	766,674.68

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的约定年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付给长盛基金,再由长盛基金计算并支付给各基金销售机构。A类基金份额和B类基金份额约定的销售服务费年费率分别为0.25%和0.01%。销售服务费的计算公式为:

对应级别日销售服务费=前一日对应级别基金资产净值 X约定年费率 / 当年天数。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注:无。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位:份

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	
	长盛货币A	长盛货币B
基金合同生效日(2005年12月12日)持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	-	161,734,483.88
期间申购/买入总份额	-	2,817,248.86
期间因拆分变动份额	-	-
减:期间赎回/卖出总份额	-	80,000,000.00
期末持有的基金份额	-	84,551,732.74
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	1.5454%
项目	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日	
	长盛货币A	长盛货币B
基金合同生效日(2005年12月12日)持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	-	-
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减:期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	-	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-

注:1、基金管理人持有本基金基金份额的交易费用按市场公开的交易费率计算并支付。

2、对于分级基金,比例的分母采用各自级别的份额。

6.4.8.4.2 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

长盛货币B

份额单位:份

关联方名称	本期末 2018年6月30日		上年度末 2017年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
长盛创富	7,216,540.94	0.1319%	7,060,757.09	0.1117%

注:对于分级基金,比例的分母采用各自级别的份额。6.4.8.5 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 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30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	619,672,858.25	12,368,416.62	83,299,876.76	3,364,148.12

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。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注:无。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.9 期末(2018年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注:无。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注:无。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2018年6月30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558,498,816.74 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
011800492	18大唐集SCP004	2018年7月2日	100.27	1,200,000	120,328,336.31
011801170	18中化股SCP010	2018年7月2日	100.00	470,000	47,001,132.13
111783543	17贵阳银行CD106	2018年7月2日	99.33	500,000	49,666,202.18
111809182	18浦发银行CD182	2018年7月2日	99.17	500,000	49,584,923.43
011801043	18中电投SCP013	2018年7月2日	100.00	65,000	6,500,018.80
170410	17农发10	2018年7月6日	100.04	1,300,000	130,047,750.07
170207	17国开07	2018年7月6日	100.01	1,000,000	100,007,070.83
110311	11进出11	2018年7月6日	100.06	900,000	90,053,227.09
合计				5,935,000	593,188,660.84

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.10 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2018年6月30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1,515,641,243.11元,无属于第一或第三层次的余额(2017年12月31日:属于第二层次的余额为7,269,799,564.79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2018年6月30日,本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2017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)除公允价值外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 投资组合报告

7.1 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	1,515,641,243.11	21.72
	其中:债券	1,515,641,243.11	21.72
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	1,546,137,479.21	22.16
	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	3,558,672,858.25	51.01
4	其他各项资产	356,406,481.13	5.11
5	合计	6,976,858,061.70	100.00

7.2 债券回购融资情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金资产净值的比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额		2.46
	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	558,498,816.74	8.71
	其中:买断式回购融资	-	-

注:上表中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

注:本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

7.3 基金投资组合平均剩余期限

7.3.1 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	54
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	60
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	33

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

注:报告期内无投资组合平均剩余期限超过120天情况。

7.3.2 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	37.99	8.71
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	15.76	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	40.02	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—120天	2.34	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)—397天(含)	7.13	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		103.24	8.71

7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

注:报告期内无投资组合平均剩余存续期超过240天情况。

7.5 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	40,016,521.44	0.62
2	央行票据	-	-
3	金融债券	370,118,999.73	5.77
	其中:政策性金融债	370,118,999.73	5.77
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	439,830,944.55	6.86
6	中期票据	-	-
7	同业存单	665,674,777.39	10.38
8	其他	-	-
9	合计	1,515,641,243.11	23.63
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

7.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序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	170410	17农发10	1,300,000	130,047,750.07	2.03
2	011800492	18大唐集SCP004	1,200,000	120,328,336.31	1.88
3	170207	17国开07	1,000,000	100,007,070.83	1.56
4	111891144	18天津银行CD020	1,000,000	99,669,038.95	1.55
5	111818126	18华夏银行CD126	1,000,000	99,381,591.84	1.55
6	111810296	18兴业银行CD296	1,000,000	99,041,221.71	1.54
7	110311	11进出11	900,000	90,053,227.09	1.40
8	011801170	18中化股SCP010	800,000	80,001,927.03	1.25
9	011801114	18澜沧江SCP003	700,000	70,000,106.44	1.09
10	111783160	17广州农村商业银行CD150	600,000	59,661,057.25	0.93

7.7 "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	0
报告期内偏离度的最高值	0.1262%
报告期内偏离度的最低值	0.0307%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0711%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

注:报告期内无负偏离度的绝对值达到0.25%情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

注:报告期内无正偏离度的绝对值达到0.5%情况。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1

本基金的债券投资采用摊余成本法计价,即计价对象以买入成本列示,按票面利率或商定利率每日计提应收利息,并按实际利率法在其剩余期限内摊销其买入时的溢价或折价。

7.9.2

本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体无被监管部门立案调查记录,无在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

7.9.3 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	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	34,340,135.33
4	应收申购款	322,066,345.80
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	356,406,481.13

7.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

份额级别	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
长盛货币A	39,386	23,909.73	27,604,693.17	2.93%	914,103,816.40	97.07%
长盛货币B	60	91,185,001.80	5,360,579,793.70	97.98%	110,520,314.29	2.02%
合计	39,446	162,571.84	5,388,184,486.87	84.02%	1,024,624,130.69	15.98%

注:对于分级基金,比例的分母采用各自级别的份额;对于合计数,比例的分母采用下属分级基金份额的合计数。

8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

序号	持有人类别	持有份额(份)	占总份额比例
1	银行类机构	700,172,140.03	10.92%
2	银行类机构	509,687,576.57	7.95%
3	银行类机构	406,965,624.90	6.35%
4	其他机构	401,543,065.89	6.26%
5	信托类机构	320,263,343.75	4.99%
6	保险类机构	300,200,140.05	4.68%
7	基金类机构	300,000,000.00	4.68%
8	基金类机构	202,101,075.05	3.15%
9	基金类机构	200,519,121.55	3.13%
10	银行类机构	200,519,121.55	3.13%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	长盛货币A	9,382,774.99	0.9964%
	长盛货币B	5,691,592.30	0.1040%
	合计	15,074,367.29	0.2351%

注:对于分级基金,比例的分母采用各自级别的份额;对于合计数,比例的分母采用下属分级基金份额的合计数。

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	长盛货币A	>100
	长盛货币B	0
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	长盛货币A	0
	长盛货币B	0
	合计	0

§9 开放式基金份额变动

单位:份

	长盛货币A	长盛货币B
基金合同生效日(2005年12月12日)基金份额总额	3,601,835,236.63	-
本报告期期初基金份额总额	4,009,098,063.63	6,319,875,928.64
本报告期基金总申购份额	1,436,030,905.32	12,064,979,483.09
减:本报告期基金总赎回份额	4,503,420,459.38	12,913,755,303.74
本报告期基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-	-
本报告期期末基金份额总额	941,708,509.57	5,471,100,107.99

注:申购份额含红利再投和因份额升降级导致的强制调增份额,赎回份额含因份额升降级导致的强制调减份额。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 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

10.2.1本基金管理人的高级管理人员重大人事变动情况

原督察长叶金松先生因退休离任,由张利宁女士担任本公司督察长。

上述变更事项已经公司第七届董事会第七次会议审议通过,并按规定向相关监管机构备案。2018年4月27日,中国证券监督管理委员会北京监管局作出《关于对长盛基金管理有限公司拟任合规负责人任职资格的意见》(京证监发(2018)136号),对张利宁女士担任本公司督察长无异议。

10.2.2 基金经理变动情况

本报告期本基金基金经理未曾变动。

10.2.3本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动情况

本报告期内基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略不曾改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙),本报告期内本基金未更换会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

基金管理人、托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信建投	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-

注:1、本公司选择证券经营机构的标准

(1)研究实力较强,有固定的研究机构和专门研究人员,能及时为本公司提供高质量的咨询服务,包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析、个股分析报告等,并能根据基金投资的特定要求,提供专门研究报告。

(2)资力雄厚,信誉良好。

(3)财务状况良好,各项财务指标显示公司经营状况稳定。

(4)经营行为规范,最近两年未因重大违规行为而受到中国证监会和中国人民银行处罚。

(5)内部管理规范、严格,具备健全的内控制度,并能满足基金运作高度保密的要求。

(6)具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件,交易设施符合代理本公司基金进行证券交易的需要,并能为本公司基金提供全面的信息服务。

2、本公司租用券商交易单元的程序

(1)研究机构提出服务意向,并提供相关研究报告;

(2)研究机构的研究报告需要有一定的试用期。试用期视服务情况和研究服务评价结果而定;

(3)研究发展部、投资管理等部门试用研究机构的研究报告后,按照研究服务评价规定,对研究机构进行综合评价;

(4)试用期满后,评价结果符合条件,双方认为有必要继续合作,经公司领导审批后,我司与研究机构签定《研究服务协议》、《券商交易单元租用协议》,并办理基金专用交易单元租用手续。评价结果如不符合条件则终止试用;

(5)本公司每两个月对签约机构的服务进行一次综合评价。经过评价,若本公司认为签约机构的服务不能满足要求,或签约机构违规受到国家有关部门的处罚,本公司有权终止签署的协议,并撤销租用的交易单元;

(6)交易单元租用协议期限为一年,到期后若双方没有异议可自动延期一年。

3、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况:报告期内未有交易单元变更。

10.8 偏离度绝对值超过0.5%的情况

注:本基金报告期内无偏离度绝对值超过0.5%的情况。

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

注:本基金报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期内无影响投资者决策的其他重要信息。

长盛基金管理有限公司

2018年8月29日