长盛货币市场基金

招募说明书(更新)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

重要提示

投资有风险,投资人申购基金时应认真阅读招募说明书。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写,并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称《基金法》)、《证券投资基金运作管理办法》(以下简称《运作办法》)、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

本招募说明书(更新)所载内容截止日为2008年12月12日,有关财务数据和净值表现截止日为2008年9月30日(财务数据未经审计)。

一、基金合同生效的日期

2005年12月12日

二、基金管理人

(一)基金管理人概况

名称:长盛基金管理有限公司
住所:深圳市福田区福中三路1006号诺德中心八楼GH单元
办公地址:北京市海淀区北太平庄路18号城建大厦A座21层
法定代表人:陈平
电话:(010)82255818
传真:(010)82255988
联系人:叶金松

本基金管理人经中国证监会证监基字[1999]6号文件批准,于1999年3月成立,注册资本为人民币15000万元。截至目前,本公司股东及其出资比例为:国元证券股份有限公司(原国元证券有限责任公司)占注册资本的41%;新加坡星展资产管理有限公司占注册资本的33%;安徽省信用担保集团有限公司(原安徽省创新投资有限公司)占注册资本的13%;安徽省投资集团有限责任公司占注册资本的13%。截至2008年12月12日,基金管理人共管理两只封闭式基金、九只开放式基金和六只社保基金委托资产,公募基金管理资产规模约228.75亿元。

(二)主要人员情况

1、基金管理人董事会成员:

陈平先生,董事长,硕士。曾任教于合肥工业大学管理系,历任安徽省国际信托投资公司证券发行部副经理、证券投资部经理、国元证券有限责任公司副总裁,2004年10月始任长盛基金管理有限公司董事。

凤良志先生,董事,博士,高级经济师。历任安徽省政府办公厅第二办公室副主任、安徽省国际信托投资公司副总经理、安徽省证券管理办公室主任、安徽省政府驻香港窗口公司(黄山有限公司)董事长、安徽省国际信托投资公司副总经理(主持工作)、安徽国元控股(集团)有限责任公司暨国元信托有限责任公司董事长,现为国元证券股份有限公司(原国元证券有限责任公司)董事长。

杜长棣先生,董事,学士。历任安徽省第一轻工业厅研究室副主任、安徽省轻工业厅生产技术处、企业管理处处长、副厅长、安徽省巢湖市市委常委、常务副市长、安徽省发改委副主任,现任安徽省投资集团有限责任公司党委书记、总经理。

钱正先生,董事,学士,高级经济师。曾任安徽省人大常委办公厅副处长、处长,安徽省信托投资公司副总经理、党委副书记,安徽省国有资产管理局分党组书记,现为安徽省信用担保集团有限公司(原安徽省创新投资有限公司)董事长,安徽省信用担保集团总经理。

蔡咏先生,董事,学士,高级经济师。曾在安徽财贸学院财政金融系任会计教研室主任、安徽省国际经济技术合作公司美国(塞班)分公司任财务经理,历任安徽省国际信托投资公司国际金融部经理、深圳证券营业部总经理、安徽省政府驻香港窗口公司(黄山有限公司)总经理助理、安徽省国际信托投资公司证券总部副总经理,现为国元证券股份有限公司(原国元证券有限责任公司)董事、总裁。

叶约德女士,董事,工商管理硕士。曾任香港金融管理局助理总裁,并在花旗银行和罗富齐投资管理公司及摩根信托银行担任多项要职,于2006年10月获委任为星展银行(香港)有限公司行政总裁,同时担任星展集团控股管理委员会及星展银行资金管理有限公司主席。

何玉珠女士,董事,学士。历任JP摩根证券(亚洲)有限公司副总裁、瑞银集团董事总经理,现为星展资金管理有限公司首席执行官、新加坡财富管理学院资深顾问。

张仁良先生,独立董事,经济及金融学教授。曾任香港消费者委员会有关银行界调查的项目协调人,太平洋经济合作理事会(PECC)属下公司管制研究小组主席,上海交通大学管理学院兼职教授及上海复旦大学顾问教授。现为香港城市大学讲座教授、民政事务总署下的《伙伴倡自强》社区协作计划主席,为香港证监会的公众股东权益小组服务。于2007年被委任为太平绅士。

荣兆梓先生,独立董事,经济学学士,教授;兼任黄山金马股份有限公司独立董事。曾任安徽省社会科学院副主编,现为安徽大学经济学院院长,校学术委员会委员,产业经济学和工商管理硕士点学科带头人;武汉大学商学院博士生导师,安徽省政府特邀咨询员;全国马经史学会常务理事,全国资本论研究会常务理事,安徽省经济学会常务理事。

陈华平先生,独立董事,博士毕业,教授,博士生导师。曾任中国科技大学商学院信息管理与决策研究室主任、中国科技大学商学院商务智能实验室主任,现为中国科技大学商学院副院长,中国科技大学"管理科学与工程"一级学科博士点的学科带头人。

李伟强先生,独立董事,美国加州大学洛杉矶分校工商管理硕士,美国宾州州立大学政府管理硕士和法国文学硕士。曾任摩根士丹利纽约、新加坡、香港等地投资顾问、副总裁、花旗环球金融亚洲有限公司高级副总裁,现任香港国际资本管理有限公司董事长。

2、基金管理人监事会成员:

叶斌先生,监事,学士,高级经济师。曾任安徽大学管理系讲师、教研室副主任,历任安徽省信托投资公司部门经理、副总经理,现为安徽省中小企业信用担保中心副主任,安徽省信用担保集团有限公司(原安徽省创新投资有限公司)总经理,安徽省信用担保集团副总经理。

钱进先生,监事,硕士研究生。曾任安徽省节能中心副主任、安徽省经贸投资集团董事、安徽省医药集团股份公司总经理,现为安徽省投资集团有限责任公司总经理助理、资本运营部经理。

沈和付先生,监事,法学学士。曾任安徽省国际经济技术合作公司经理助理,安徽省信托投资公司法律部副主任,现为国元证券股份有限公司(原国元证券有限责任公司)合规管理部经理。

肖强先生,监事,学士。曾任中信证券有限责任公司北太平庄营业部交易部经理、营业部总经理助理,中信证券股份有限公司研究咨询部副总经理、高级分析师,中信证券股份有限公司交易部高级交易员。2002年6月加入长盛基金管理有限公司,历任基金同盛基金经理助理、基金同益基金经理、长盛动态精选基金基金经理、投资管理部副总监,现任长盛同智优势成长混合型证券投资基金(原基金同智)基金经理,并自2008年6月4日起兼任长盛创新先锋灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

林良友先生,监事,学士。曾在花旗银行、瑞信出任要职,现为星展银行(香港)有限公司私人银行部业务主管。

3、基金管理人高级管理人员

陈平先生,董事长,硕士。同上。

陈礼华先生,硕士,高级经济师。历任国务院财务税收物价大检查办公室、财政部国债司和国债金融司主任科员,华泰财产保险股份有限公司投资部研发处负责人、经理,南方基金管理有限公司总经理助理兼投资总监、投资交易总监,长盛基金管理有限公司副总经理等职。现任长盛基金管理有限公司总经理。

周兵先生,硕士,经济师。历任中国银行总行综合计划部副主任科员、香港南洋商业银行内地融资部副经理、香港中银国际亚洲有限公司企业财务部经理、广发证券股份有限公司北京业务总部副总经理(期间兼任海南华银国际信托投资公司北京证券营业部托管组负责人)、北京朝阳门大街证券营业部总经理等职。现任长盛基金管理有限公司副总经理。

叶金松先生,大学,会计师。历任美菱股份有限公司财会部经理,安徽省信托投资公司财会部副经理,国元证券有限责任公司清算中心主任、风险监管部副经理、经理等职,现任长盛基金管理有限公司督察长。

杨思乐先生,英国籍,拥有北京大学法学学士学位与英国伦敦政治经济学院硕士学位。从1992年9月开始曾先后任职于太古集团、摩根银行、野村项目融资有限公司、汇丰投资银行亚洲、美亚能源有限公司、康联马洪资产管理公司、星展银行有限公司(新加坡)。现任长盛基金管理有限公司副总经理。

4、本基金基金经理

刘静女士,1977年1月出生。毕业于中央财经大学投资管理系,获经济学学士。2000年7月至2003年6月就职于北京证券有限责任公司;2003年7月加入长盛基金管理有限公司,先后担任交易部交易员、首席债券交易员。自2006年11月29日起任长盛货币市场基金(本基金)基金经理,自2008年8月13日起兼任长盛中信全债指数增强型债券投资基金基金经理。自2008年10月8日起兼任长盛积极配置债券型证券投资基金基金经理。

本基金历任基金经理:

王茜女士:自2005年12月12日至2008年11月8日任本基金基金经理。

5、投资决策委员会成员

陈礼华先生,硕士,总经理,同上。

詹凌蔚先生,经济学硕士学位,曾历任融通基金管理有限公司研究部研究员,研究部副总监,基金经理助理,基金经理,投资总监,总经理助理;博时基金管理有限公司基金经理职务;现任长盛基金管理有限公司投资管理部总监、研究发展部总监,长盛同德主题增长股票型证券投资基金基金经理。

朱剑彪先生,金融学博士。历任广东商学院投资金融系教师、党支部书记;广州证券有限公司宏观与策略研究员、投资银行部项目经理、基金部经理;金鹰基金管理有限公司筹备组成员、董事会秘书、研究总监、投研副总监兼研究总监和督察长。2007年4月起加入长盛基金管理有限公司,现任机构理财部总监。

侯继雄先生,博士。曾任国泰君安证券股份有限公司企业融资业务经理、研究所行业研究员和策略经理等职务;于2007年2月加入长盛基金管理有限公司,现任研究发展部副总监,长盛同德主题增长股票型证券投资基金基金经理和基金同盛证券投资基金基金经理。

潘九岩先生,硕士。曾任博时基金管理公司交易部任中央交易员,2002年起至今在长盛基金管理有限公司任职,先后担任交易主管、同智基金经理助理、交易部副总监,现在担任交易部总监。

白仲光先生,金融工程专业工学博士,2003年加入长盛基金管理有限公司,历任研究员、高级金融工程师,中证100指数基金基金经理。现任金融工程部总监。

吴达先生,伦敦政治经济学院金融经济学硕士,美国特许金融分析师CFA。曾就职于新加坡星展资产管理有限公司,历任星展珊顿全球收益基金经理助理、星展增裕基金经理;新加坡毕盛高荣资产管理公司亚太专户投资组合经理、资产配置委员会成员;华夏基金管理有限公司国际策略分析师、固定收益投资经理;2007年8月起加入长盛基金管理有限公司,现任国际业务部总监。

上述人员之间均不存在近亲属关系。

三、基金托管人

(一)基金托管人情况

1、基本情况

名称:兴业银行股份有限公司
住所:福州市湖东路154号
办公地址:福州市湖东路154号
法定代表人:高建平
注册日期:1988年7月20日
注册资本:50亿元人民币
托管部门联系人:张志永
电话:(021)62677777*212004
传真:(021)62159217

2、发展概况及财务状况

兴业银行股份有限公司成立于1988年,是国务院和中国人民银行批准成立的我国首批股份制商业银行之一,总部设于福建省福州市,注册资本50亿元。

自开业以来,兴业银行始终坚持与客户"同发展、共成长"和"服务源自真诚"的经营理念,致力于为客户提供全面、优质、高效的金融服务。截至2006年末,兴业银行资产总额为6177.04亿元,股东权益为162亿元,2006年实现净利润37.98亿元。根据英国《银行家》杂志2007年7月公布的最新的全球银行1000强排名,兴业银行排名再次大幅提升,其中按一级资本排名列260位,比上年提升37位;按资产总额排名列145位,比上年提升19位。

3、托管业务部的部门设置及员工情况

兴业银行股份有限公司总行设资产托管部,下设综合处、核算管理处、稽核监察处、市场处等处室,共有员工28人,平均年龄30岁,100%员工拥有大学本科以上学历,业务岗位人员均具有基金从业资格。

4、基金托管业务经营情况

兴业银行股份有限公司于2005年4月26日取得基金托管资格,基金托管业务批准文号:证监基金字[2005]74号。截至2008年9月30日,兴业银行已托管开放式基金9只——兴业趋势投资混合型证券投资基金(LOF)、长盛货币市场基金、光大保德信红利股票型证券投资基金、兴业货币市场证券投资基金、兴业全球视野股票型证券投资基金、万家和谐增长混合型证券投资基金、中欧新趋势股票型证券投资基金(LOF)、天弘永利债券型证券投资基金、万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金,托管基金财产规模348.16亿元。

四、相关服务机构

(一)基金份额发售机构

1、直销机构

(1)长盛基金管理有限公司北京分公司
地址:北京市海淀区北太平庄路18号城建大厦A座9层
电话:(010)82255818转263、288
传真:(010)82255981、82255982
联系人:银晓莉
客户服务电话:(010)62350088、4008882666

(2)长盛基金管理有限公司上海分公司
地址:上海市浦东新区浦东南路256号华夏银行大厦1601室
电话:(021)6888 9056、(021)6888 9206
传真:(021)6888 9156
联系人:冯岩

(3)长盛基金管理有限公司华南营销中心
地址:深圳市福田区福中三路1006号诺德中心8层GH单元
电话:(0755)88267980
传真:(0755)82022118
联系人:梁琪

2、代销机构

(1)兴业银行股份有限公司
住所:福州市湖东路154号中山大厦
办公地址:福州市湖东路154号中山大厦
法定代表人:高建平
电话:(021)52629999
联系人:苏健
客户服务电话:95561
网址:www.cib.com.cn

(2)中国农业银行
住所:北京市东城区建国门内大街69号
办公地址:北京市东城区建国门内大街69号
法定代表人:项俊波
传真:(010)85109219
联系人:滕 涛
客户服务电话:95599
网址: www.abchina.com

(3)招商银行股份有限公司
注册地址:深圳市福田区深南大道7088号
办公地址:深圳市福田区深南大道7088号
法定代表人:秦晓
电话:0755–83198888
传真:0755–83195109
联系人:兰奇
客户服务电话:95555
公司网址:www.cmbchina.com

(4)中国银行股份有限公司
住所:北京市西城区复兴门内大街1号
法定代表人:肖钢
联系人:靳晓杰
传真:(010)66594946
客户服务电话:95566
银行网站:www.boc.cn

(5)中国建设银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区金融大街25号
法定代表人:郭树清
电话:010–67597114
客户服务电话:95533
网址:www.ccb.com

(6)中国民生银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区复兴门内大街2号
法定代表人:董文标
客户服务电话:95568
网址:www.cmbc.com.cn

(7)上海浦东发展银行股份有限公司
办公地址:上海市中山东一路12号
法定代表人:吉晓辉
电话:(021)61618888
传真:(021)63604199
联系人:汤嘉惠、虞谷云
客户服务热线:95528
网站:www.spdb.com.cn

(8)交通银行股份有限公司
注册地址:上海市仙霞路18号
办公地址:上海市银城中路188号
法定代表人:胡怀邦
电话:021–58781234
传真:021–58408842
联系人:曹榕
客户服务电话:95559
网址:www.bankcomm.com

(9)中信银行股份有限公司
注册地址:北京市东城区朝阳门北大街富华大厦C座
法定代表人:孔丹
电话:010–65557018
联系人:黎珊
客户服务电话:95558
网址:bank.ecitic.com

(10)国元证券股份有限公司
住所:合肥市寿春路179号
法定代表人:凤良志
开放式基金咨询电话:安徽地区:96888;全国:400–8888–777
开放式基金业务传真:(0551)2634400–3612
联系人:祝丽萍

(11)中信证券股份有限公司
住所:深圳市湖贝路1030号海龙王大厦
办公地址:北京市朝阳区新源南路6号京城大厦
法定代表人:王东明
电话:(010)84864818转63266
传真:(010)84865560
联系人:陈忠

(12)广发证券股份有限公司
住所:广东省珠海市吉大海滨路光大国际贸易中心26楼2611室
办公地址:广东广州天河北路大都会广场36、38、41和42楼
法定代表人:王志伟
电话:(020)87555888
传真:(020)87557985
联系人:肖中梅
公司网站:www.gf.com.cn

(13)中国银河证券股份有限公司
住所:北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座
办公地址:北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座
法定代表人:肖时庆
电话:(010)66568047
传真:(010)66568536
联系人:李洋
公司网站:www.chinastock.com.cn

(14)国泰君安证券股份有限公司
住所:上海市浦东新区商城路618号
办公地址:上海市延平路135号
法定代表人:祝幼一
电话:(021)62580818–213
传真:(021)62569400
联系人:芮敏祺

(15)广发华福证券有限责任公司
住所:福州市新天地大厦8层
办公地址:福州市新天地大厦8层
法定代表人:黄金琳
电话:(0591)87383623
传真:(0591)87383610
联系人:张腾
公司网址:www.gfhfzq.com.cn

(16)招商证券股份有限公司
住所:深圳市福田区益田路江苏大厦A座40—45层
办公地址:深圳市福田区益田路江苏大厦A座40—45层
法定代表人:宫少林
电话:0755–82943666
传真:0755–82943237
联系人:黄健
客户服务热线:4008888111、(0755)26951111

(17)兴业证券股份有限公司
住所:福州市湖东路99号标力大厦
办公地址:上海市陆家嘴东路166号中保大厦18层
法定代表人:兰荣
电话:(021)68419974
传真:(021)68419867
联系人:杨盛芳

(18)恒泰证券有限责任公司
住所:内蒙古自治区呼和浩特市新城区东风路111号
办公地址:上海浦东松林路357号通贸大厦20楼
法定代表人:刘汝军
联系人:张同量
联系电话:(021)68405273
客户咨询电话:(021)68405392
公司网址:http://www.cnht.com.cn

(19)德邦证券有限责任公司
住所:沈阳市沈河区小西路49号
办公地址:上海市浦东南路588号浦发大厦26层
法定代表人:王军
联系电话:021–68590808–8119
传真:021–68596077
联系人:罗芳
公司网址:www.tebon.com.cn

(20)海通证券股份有限公司
住所:上海市广东路689号海通证券大厦
办公地址:上海市广东路689号海通证券大厦
法定代表人:王开国
联系电话:021–53594566–4125
传真:021–53858549
联系人:金芸
客服电话:400–8888–001、(021)962503

(21)中信建投证券有限责任公司
住所:北京市朝阳区安立路66号4号楼
办公地址:北京市朝内大街188号
法定代表人:张佑军
开放式基金咨询电话:400–8888–108
开放式基金业务传真:(010)65182261
联系人:权唐

(22)光大证券股份有限公司
住所:上海市静安区新闸路1508号
办公地址:上海市浦东新区浦东南路528号上海证券大厦南塔14楼
法定代表人:徐浩明
联系人:刘晨
联系电话:021–50818887–281
客户咨询电话:021–68823685
公司网址:www.ebscn.com

(23)长江证券股份有限公司
住所:武汉市新华路特8号长江证券大厦
法定代表人:胡运钊
客户服务热线:4008–888–999或027–85808318
联系人:李良
电话:021–63219781
传真:021–51062920
长江证券长网网址:www.95579.com

(24)申银万国证券股份有限公司
住所:上海市常熟路171号
办公地址:上海市常熟路171号
法定代表人:丁国荣
电话:(021)54033888
传真:(021)54035333
联系人:李清怡
公司网址:www.sw2000.com.cn

(25)联合证券有限责任公司
住所:深圳市深南东路5047号发展银行大厦10、14、24、25楼
办公地址:深圳市深南东路5047号发展银行大厦10、14、24、25楼
法定代表人:马昭明
电话:(0755)82492000
传真:(0755)82492062
联系人:盛宗凌
客户服务电话:400–8888–555,(0755)25125666

(26) 中信金通证券有限责任公司
住所:浙江省杭州市中河南路11号万凯庭院商务楼A座
办公地址:浙江省杭州市中河南路11号万凯庭院商务楼A座
法定代表人:刘军
联系人:王勤
联系电话:0571–85783750
客户咨询电话:0571–96598
公司网址:www.bigsun.com.cn

(27) 渤海证券有限责任公司
注册地址:天津市开发区第一大街29号
办公地址:天津市河西区宾水道3号
法定代表人: 张志军
电话: (022)28451861
传真: (022)28451892
联系人:王兆权
客服电话:28455588
网址:www.bhzq.com

(28) 国联证券有限责任公司
住所:无锡市县前东街8号
办公地址:无锡市县前东街8号6楼、7楼
法定代表人:范炎
开放式基金咨询电话:(0510)82831662,(0510)82588168
开放式基金业务传真:(0510)82831589
联系人:袁丽萍

(29) 中信万通证券有限责任公司
注册地址:青岛市崂山区香港东路316号
办公地址:青岛市东海西路28号
法定代表人:史洁民
联系电话:0532–85022026
传真:0532–85022026
联系人:丁韶燕
公司网址:http://www.zxwt.com.cn

(30)齐鲁证券有限公司
地址:山东省济南市经十路128号
法定代表人:李玮
电话:0531–81283728
传真:0531–81283735
联系人:傅咏梅

(31)华泰证券股份有限公司
地址:江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦
法定代表人:吴万善
电话:025–84457777–893
传真:025–84579763
联系人:程高峰

(32)安信证券股份有限公司
地址:深圳市福田区金田路2222号安联大厦34层
法定代表人:牛冠兴
电话:0755–82558323
传真:0755–82558355
联系人:余江

(33)长城证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层
法定代表人:黄耀华
联系人:匡婷
电话:0755–83516289
传真:0755–83516199
客户服务热线: 0755–33680000 400 6666 888
长城证券网站:www.cc168.com.cn

(34)第一创业证券有限责任公司
住所:深圳市罗湖区笋岗路12号中民时代广场B座25层
办公地址:深圳市罗湖区笋岗路12号中民时代广场B座25层
法定代表人:刘学民
开放式基金咨询电话:(0755)25832686
开放式基金业务传真:(0755)25831718
联系人:杨柳

(35)红塔证券股份有限公司
注册地址:昆明市北京路155号附1号红塔大厦9楼
办公地址:昆明市北京路155号附1号红塔大厦9楼
法定代表人:况雨林
联系人: 王敏
电话:0871–3577011
客户服务电话:0871–3577930
网址:www.hongtazq.com

(二)注册登记机构

名称:长盛基金管理有限公司
住所:深圳市福田区福中三路1006号诺德中心八楼GH单元
办公地址:北京市海淀区北太平庄路18号城建大厦A座21层
法定代表人:陈平
电话:(010)82255818
传真:(010)82255988
联系人:戴君棉

(三)出具法律意见书的律师事务所和经办律师

名称:北京市广盛律师事务所
住所:北京市朝阳区建国路99号中服大厦25层
办公地址:北京市朝阳区建国路99号中服大厦25层
法定代表人:夏善胜
电话:(010)65813529
传真:(010)65816534
经办律师: 吴军

(四)审计基金财产的会计师事务所

名称:普华永道中天会计师事务所有限公司
住所:上海市浦东新区沈家弄325号
办公地址:上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
法定代表人: Kent Watson
电话:(021)23238888
传真:(021)23238800
经办注册会计师:薛竞、陈宇

五、基金的名称

本基金名称:长盛货币市场基金

六、基金的类型

基金类型:契约型开放式

七、基金的投资目标

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。

八、基金的投资方向

本基金将投资于以下金融工具:
(一)现金;
(二)一年以内(含一年)的银行定期存款、大额存单;
(三)剩余期限在三百九十七天以内(含三百九十七天)的债券;
(四)期限在一年以内(含一年)的债券回购;
(五)期限在一年以内(含一年)的中央银行票据;
(六)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;
(七)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。

九、基金的投资策略与程序

(一)投资决策依据
1、国家有关法律、法规和本基金合同的有关规定。
2、宏观经济、微观经济运行状况,货币政策和财政政策执行状况,货币市场和证券市场运行状况;
3、策略分析师、固定收益分析师、定量分析师各自独立完成相应的研究报告,为投资策略提供依据。

(二)投资决策程序

1、投资组合计划的拟定

基金管理小组每月月末拟定下月资产配置计划,报投资决策委员会审批。投资组合计划制定的依据未来宏观经济形势、财政与货币政策、短期市场资金供求等因素变化的研究与分析,以及据此作出的对未来短期内不同市场、不同品种的市场利率的积极判断,在此基础上基金管理小组制定未来一段时间基金组合的期限结构和品种配置计划,并报投资决策委员会审批。投资组合计划是未来一段时间投资的基础与纲领。

如果基金管理小组认为影响各期限、品种收益率的因素产生了重大变化,还可以临时提出新的投资计划,并由投资决策委员会审批。

2、投资计划的实施

基金管理小组在投资委员会通过的投资组合计划规定限制下,根据市场的实际情况,按照投资策略实施步骤,采用积极投资策略,通过动态调整优化投资组合,追求当期收益最大化。在动态调整的过程中,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。

在组合调整过程中,基金管理小组将根据未来可预测资金流动状况,合理管理组合现金头寸,保证组合流动性。

3、交易执行

交易部负责执行基金管理小组下达的交易指令,同时履行一线监控的职能。在交易指令执行前,交易部对交易指令进行复核,确保交易指令执行后基金各项投资比例符合法律法规以及基金合同、招募说明书的各项规定。

4、组合监控与调整

基金经理与公司的风险管理人员将密切关注宏观经济和市场变化,结合基金申购和赎回导致的现金流量情况,每日对组合的风险和流动性进行监控,确保基金的各项风险控制指标维持在合理水平,确保组合的流动性能够满足投资者的赎回要求。当组合中货币市场工具价格波动引起组合投资比例不能符合控制标准时,或当组合中货币市场工具信用评级调整导致信用等级不符合要求时,基金管理小组应采取有效的措施,在合理的时间内调整组合。

(三)投资管理的方法

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。本基金的核心投资策略由四部分组成:短期市场利率预期策略、期限机构的滚动配置策略、投资组合优化策略、无风险套利操作策略。

1、短期市场利率预期策略

短期利率预期策略是指基金管理人根据对短期货币市场有影响的宏观经济形势、财政与货币政策、短期市场资金供求等因素变化作出研究与分析,对未来短期内不同市场、不同品种的市场利率进行积极的判断,并以此为依据制定未来一段时间基金组合的期限结构和品种配置计划,期限结构与品种配置计划是未来一段投资的基础。

2、期限结构的滚动配置策略

为了保证组合资产高流动性,组合资产在到期期限配置上采用滚动配置的策略,即在一个相对固定的投资周期中,将各期限品种的投资均衡分布在不同时间上,从而保证在投资周期内的任何时刻都有稳定的到期现金流,最大限度地提高到期期限约束条件下的流动性。

3、投资组合优化策略

投资组合优化管理策略是指在期限结构与品种比例约束下,在滚动配置策略的基础上采用优化技术获得最大化收益的策略体系。其优化目标是组合资产收益最大化,约束条件为期限结构比例约束、品种类属比例约束、信用风险约束等。

4、无风险套利操作策略

由于市场环境差异以及市场参与成员的不同,市场中常常存在无风险套利机会。本基金管理人认为随着市场有效性的提高,无风险套利的机会与收益会不断减少,但是相信在较长一段时间中市场中仍然会存在的无风险套利机会,基金管理人将贯彻谨慎的原则,充分把握市场无风险套利机会,为投资人带来更大收益。

同时,随着市场的发展、新的货币投资工具的推出,会产生新的无风险套利机会,本基金将加强对市场前沿的研究,及时发现市场中新的无风险套利机会,扩大基金投资收益。

为了保证上述投资策略的顺利实施,基金管理人根据货币市场基金的特点,开发了货币资产组合优化管理系统,以提高投资决策的科学化与实时化。

(四)投资品种的选择标准

在上述组合管理的基础上,基金管理小组也将充分重视根据市场形势灵活把握投资品种的主动选择,具有下列一项或多项特征的投资品种是本基金重点投资的对象:
1、在相似到期期限和信用等级下,收益率较高的债券、票据或债券回购;
2、相似条件下,流动性较高的债券、票据;
3、相似条件下,交易对手信用等级较高的债券、票据或债券回购。

(五)投资限制

基金管理人应依据有关法律法规及《基金合同》规定,运作管理本基金。为了实现投资目标,贯彻投资理念,本基金投资组合遵循下列规定:

1、本基金不得投资于以下金融工具:
(1)股票
(2)可转换债券
(3)剩余期限超过三百九十七天的债券
(4)信用等级在AAA级以下的企业债券
(5)以定期存款为基准利率的浮动利率债券
(6)中国证监会、中国人民银行禁止投资的其他金融工具。

2、投资组合遵循如下投资限制

(1)投资于同一公司发行的短期企业债券的比例,不得超过基金资产净值的百分之十;

(2)存放在具有基金托管资格的同一商业银行的存款,不得超过基金资产净值的百分之三十;存放在不具有基金托管资格的同一商业银行的存款,不得超过基金资产净值的百分之五;

(3)除发生巨额赎回情形外,债券正回购的资金余额在每个交易日均不得超过基金资产净值的20%。因发生巨额赎回导致债券正回购的资金余额超过基金资产净值20%的,基金管理人应在5个交易日内进行调整。

(4)投资组合的平均剩余期限在每个交易日都不得超过180天。

(5)持有的剩余期限不超过397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券的摊余成本总计不得超过当日基金资产净值的20%。

(6)通过买断式回购融入的基础债券的剩余期限不得超过397天。

(7)本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例,不得超过该资产支持证券规模的10%。

(8)本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例,不得超过该基金资产净值的10%。

(9)本公司管理的全部证券投资基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券合计规模的10%。

(10)本基金持有的全部资产支持证券,其市值不得超过该基金资产净值的20%。

(11)因基金规模或市场变化等原因导致投资组合超出上述规定不在限制之内,但基金管理人应在10个交易日内进行调整,以达到上述标准。

(12)法律法规或监管部门对上述比例、限制另有规定的,从其规定。

3、投资组合平均剩余期限计算方法

平均剩余期限的计算公式为:

$$\frac{\sum \text{投资于金融工具产生的资产}\times\text{剩余期限}-\sum \text{投资于金融工具产生的负债}\times\text{剩余期限}+\text{债券正回购}\times\text{剩余期限}}{\text{投资于金融工具产生的资产}-\text{投资于金融工具产生的负债}+\text{债券正回购}}$$

其中:投资于金融工具产生的资产包括现金类资产(含银行存款、清算备付金、交易保证金、证券清算款、买断式回购履约金)、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)的逆回购、期限在一年以内(含一年)的中央银行票据、买断式回购产生的待回购债券、剩余期限在397天以内(含397天)的资产支持证券、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。

投资于金融工具产生的负债包括期限在一年以内(含一年)的正回购、买断式回购产生的待返售债券等。

采用"摊余成本法"计算的附息债券成本包括债券的面值和折溢价;贴现式债券成本包括债券投资成本和内在应收利息。

(六)禁止行为

本基金禁止以下投资行为:
1、以基金的名义使用不属于基金名下的资金买卖证券或进行证券回购;
2、从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动;
3、买卖其他基金份额,但是国务院另有规定的除外;
4、将基金资产用于担保、资金拆借或者贷款;
5、从事证券信用交易;
6、从事可能使基金承担无限责任的投资;
7、投资于与基金托管人或基金管理人有利害关系的公司发行的证券;
8、与管理人的股东进行交易,通过交易上的安排人为降低投资组合的平均剩余期限的真实天数;
9、法律法规及监管机关规定禁止从事的其他行为。

十、基金的业绩比较标准

本基金业绩比较基准为银行一年期定期存款利率(税后)。

十一、基金的风险收益特征

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。

十二、基金的投资组合报告

本投资组合报告所载数据取自长盛货币市场基金2008年第3季度报告,相关财务资料未经审计。

1、报告期末基金资产组合情况

序号	资产组合	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	999,501,845.92	97.70
	其中:债券	999,501,845.92	97.70
	资产支持证券	–	0.00
2	买入返售金融资产	–	0.00
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	–	0.00
3	银行存款和结算备付金合计	16,734,007.94	1.64
4	其他资产	6,757,084.64	0.66
5	合计	1,022,992,938.50	100.00

2、报告期债券回购融资情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	2,709,899,101.14	3.55
	其中:买断式回购融资	–	0.00
2	报告期末债券回购融资余额	146,999,579.50	16.80
	其中:买断式回购融资	–	0.00

注:(1)上表中报告期内债券回购融资余额为报告期内每日的融资余额的合计数,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日融资余额占基金资产净值比例的简单平均值。

(2)债券正回购的资金余额超过资产净值的20%的说明

序号	发生日期	融资余额占基金资产净值的比例(%)	原因	调整期
1	2008–9–24	25.13	大额赎回导致被动超标	到2008年9月25日调整完毕

3、基金投资组合平均剩余期限

(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	144
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	178
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	113

报告期内无投资组合平均剩余期限超过180天情况。

(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天内	25.93	16.80
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	12.60	0.00
2	30天(含)–60天	18.25	0.00
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	5.69	0.00
3	60天(含)–90天	10.23	0.00
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	5.69	0.00
4	90天(含)–180天	21.50	0.00
5	180天(含)–397天(含)	40.23	0.00
	合计	116.13	16.80

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	国家债券	–	0.00
2	央行票据	539,748,463.22	61.68
3	金融债券	319,750,572.94	36.54
	其中:政策性金融债	319,750,572.94	36.54
4	企业债券	–	0.00
5	企业短期融资券	140,002,809.76	16.00
6	其他	–	0.00
7	合计	999,501,845.92	114.22
8	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	209,914,476.38	23.99

注:上表中,债券的成本包括债券面值和折溢价。

5、报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	070417	07农发17	1,100,000	110,279,683.67	12.60
2	080302	08进出02	1,100,000	109,836,096.56	12.55
3	0801082	08央行票据82	1,000,000	99,861,017.03	11.41
4	0801034	08央行票据34	1,000,000	97,988,635.53	11.20
5	0801092	08央行票据92	1,000,000	96,535,282.58	11.03
6	0801104	08央行票据104	1,000,000	96,307,847.51	11.01
7	0801088	08央行票据88	800,000	79,785,924.78	9.12
8	0881065	08天生桥CP01	400,000	40,288,535.93	4.60
9	0701139	07央行票据139	400,000	39,666,732.79	4.53
10	0781239	07沪电气CP01	300,000	30,133,613.29	3.44

6、"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	1
报告期内偏离度的最高值	0.2501%
报告期内偏离度的最低值	0.0560%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1813%

7、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8、投资组合报告附注

(1)基金计价方法说明: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。

(2)本报告期内,本基金持有的剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值20%的情况:

序号	发生日期	该类浮动债占基金资产净值的比例(%)	原因	调整期
1	2008–9–2	21.68	基金规模波动导致超标	到2008年9月4日调整完毕
2	2008–9–3	21.43	基金规模波动导致超标	到2008年9月4日调整完毕
3	2008–9–24	23.40	基金规模波动导致超标	到2008年10月9日调整完毕
4	2008–9–25	23.89	基金规模波动导致超标	到2008年10月9日调整完毕
5	2008–9–26	24.00	基金规模波动导致超标	到2008年10月9日调整完毕
6	2008–9–27	23.99	基金规模波动导致超标	到2008年10月9日调整完毕
7	2008–9–28	23.99	基金规模波动导致超标	到2008年10月9日调整完毕
8	2008–9–29	23.99	基金规模波动导致超标	到2008年10月9日调整完毕
9	2008–9–30	23.99	基金规模波动导致超标	到2008年10月9日调整完毕

(3)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。本报告期内无需说明的证券投资决策程序。

(4)报告期末其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	–
2	应收证券清算款	–
3	应收利息	6,757,084.64
4	应收申购款	–
5	其他资产	–
6	合计	6,757,084.64

十三、基金的业绩

本基金成立以来的业绩如下:

	2005.12.12–2005.12.31	2006.1.1–2006.12.31	2007.1.1–2007.12.31	2008.1.1至2008.9.30	自成立至2008.9.30
基金净值收益率	0.1058%	1.9641%	3.4923%	2.3604%	8.1300%
同期业绩比较基准收益率	0.0986%	1.8799%	2.7850%	2.9444%	7.7079%
超额收益率	0.0072%	0.0842%	0.7073%	–0.5840%	0.4221%

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

十四、基金费用与税收

(一)与基金运作有关的费用

1、费用的种类
(1)基金管理人的管理费;
(2)基金托管人的托管费;
(3)证券交易费用;
(4)基金信息披露费用;
(5)基金份额持有人大会费用;
(6)与基金相关的会计师费和律师费;
(7)按照国家有关规定可以列入的其它费用。

2、费用计提方法、计提标准和支付方式

(1)基金管理人的管理费

基金管理费按前一日基金资产净值的0.33%年费率计算。计算方法如下:

H=E×0.33%÷当年天数
H为每日应计提的基金管理费
E为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提,逐日累计至每个月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令,基金托管人复核后于次月首日起两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

(2)基金托管人的托管费

基金托管费按前一日的基金资产净值的0.10%的年费率计算。计算方法如下:

H=E×0.10%÷当年天数
H为每日应计提的基金托管费
E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提,逐日累计至每个月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令,基金托管人复核后于次月首日起两个工作日内从基金资产中一次性支取。

(3)上述(一)项1中(3)至(7)项费用由基金托管人根据有关法规及相应协议的规定,按费用实际支出金额支付,列入当期基金费用。基金合同生效前所发生的律师费和会计师费等费用自基金发行费用中列支,不另从基金资产中支付,与基金有关的法定信息披露费按有关法规列支。

(4)基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失,以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不得列入基金费用。

(二)与基金销售有关的费用

1、基金销售服务费

基金销售服务费按前一日的基金资产净值的0.25%的年费率计算。计算方法如下:

H=E×0.25%÷当年天数
H为每日应计提的销售服务费
E为前一日的基金资产净值

基金管理人可以调整销售服务费率,但销售服务费年费率最高不超过0.25%。基金管理人必须在开始调整之日的3个工作日之前至少在一种中国证监会指定的媒体上刊登公告并报中国证监会备案。

基金销售服务费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划付指令,基金托管人复核后于次月首日起两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人,由基金管理人支付给各代销机构。

2、基金认购费用

本基金不收取认购费用。

3、申购费

本基金不收取申购费用。

4、赎回费

本基金不收取赎回费用。

5、转换费

本基金可以与基金管理人所管理的长盛成长价值基金之间进行转换。转换费率如下:

(1)由本基金转换为长盛成长价值基金,转换费如下表所示:

长盛货币基金转长盛成长价值基金转换金额(M)	费 率
M<100万元	1.5%
100≤M<500万元	1.2%
500≤M<1000万元	0.6%
M≥1000万元	0.2%

(2)由长盛成长价值基金转换为本基金,转换费率为0.5%,其中的25%归入长盛成长价值基金资产。

基金转换的具体业务规则详见基金管理人相关业务公告。

(三)税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体,依照国家法律法规的规定履行纳税义务。

十五、对招募说明书更新部分的说明

本基金管理人依据《基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他有关法律法规的要求,对本基金招募说明书进行了更新,主要更新内容如下:

1、在"重要提示"中,明确了更新的招募说明书内容的截止日期及有关财务数据的截止日期。
2、在"三、基金管理人"中,更新了基金管理人的相关基本情况。
3、在"四、基金托管人"中,更新了基金托管人的相关基本情况。
4、在"五、相关服务机构"中,增加和更新了直销机构和代销机构的有关信息。
5、在"十、基金的投资"中,更新了(十)基金投资组合报告,数据截至到2008年3季度。
6、在"十一、基金的业绩"中,更新了基金从成立到2008年9月30日的业绩情况。
7、在"二十一、基金托管协议的内容摘要"中,更新基金基金托管当事人的基本信息。
8、在"二十二、对基金份额持有人的服务"中,更新了相关条款。
9、在"二十三、其他应披露的事项"中,披露了如下事项:
(一)本基金管理人、托管人目前无重大诉讼事项。
(二)最近3年基金管理人、基金托管人及其高级管理人员没有受到任何处罚。
(三)2008年7月1日本基金管理人发布关于增加中国银行为代销机构的公告。
(四)2008年7月2日本基金管理人发布关于增加中国民生银行股份有限公司为旗下基金代销机构的公告。
(五)2008年7月4日本基金管理人发布关于变更公司高管的公告。
(六)2008年7月15日本基金管理人发布本基金招募说明书(更新)全文及其摘要。
(七)2008年7月15日本基金管理人发布关于旗下基金通过民生银行开展定期定额投资业务的公告。
(八)2008年7月19日本基金管理人发布本基金2008年第2季度报告。
(九)2008年8月1日本基金管理人发布本基金收益支付公告20080801。
(十)2008年8月5日发布关于参与中国银行网上银行及定期定额申购费率优惠活动公告。
(十一)2008年8月6日本基金管理人发布关于增加定期定额投资业务代销机构的公告。
(十二)2008年8月28日本基金管理人发布关于调整网上直销申购费率的公告。
(十三)2008年8月29日本基金管理人发布本基金2008年半年度报告及其摘要。
(十四)2008年9月1日本基金管理人发布本基金收益支付公告(2008年第9号)。
(十五)2008年9月3日本基金管理人发布关于开通长盛网上直销基金定期定额申购业务的公告。
(十六)2008年9月16日本基金管理人发布关于调整本司旗下证券投资基金所持停牌股票估值方法的公告。
(十七)2008年9月17日本基金管理人发布关于本司旗下证券投资基金所持停牌股票估值调整的公告。
(十八)2008年9月23日本基金管理人发布关于赎回旗下长盛动态精选基金的公告。
(十九)2008年9月23日本基金管理人发布关于本基金"十一"假前三个工作日暂停申购和转入业务公告。
(二十)2008年9月25日本基金管理人发布关于增加浦发银行为旗下基金代销机构的公告。
(二十一)2008年10月6日本基金管理人发布本基金收益支付公告。
(二十二)2008年10月10日本基金管理人发布关于增加长城证券有限责任公司为旗下基金代销机构的公告。
(二十三)2008年10月24日本基金管理人发布本基金2008年第3季度报告。
(二十四)2008年10月29日本基金管理人发布关于增加交通银行为代销机构并开通定期定额投资业务及同时参加定期定额申购费率优惠活动的公告。
(二十五)2008年11月5日本基金管理人发布关于增加注册资本、变更注册地址和股东名称的公告。
(二十六)2008年11月8日本基金管理人发布关于调整基金经理的公告。
(二十七)2008年11月17日本基金管理人发布关于增加第一创业证券有限责任公司和红塔证券股份有限公司为旗下基金代销机构的公告。
(二十八)2008年12月1日本基金管理人发布本基金收益支付公告(2008年第12号)。
(二十九)2008年12月1日本基金管理人发布关于增加中信银行股份有限公司为本基金代销机构的公告。

十六、签署日期

本招募说明书(更新)于2008年12月31日签署。

长盛基金管理有限公司
二零零九年一月二十日