长盛货币市场基金 2006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

重要提示

本基金管理人长盛基金管理有限公司（以下简称“本公司”）的董事会及董事保证长盛货币市场基金（以下简称“本基金”）2006年半年度报告（以下简称“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2006年8月25日复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告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，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告期为2006年1月1日至2006年6月30日，本报告期的财务资料未经审计。

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。

第一章 基金简介

一、基金基本资料

（一）基金简称：长盛货币市场基金

（二）基金交易代码：080011

（三）基金运作方式：契约型开放式

（四）基金合同生效日：2005年12月12日

（五）报告期末基金份额总额：732,292,100.06份

（六）基金合同存续期：不定期

（七）基金份额上市的证券交易所：无

（八）上市日期：无

二、基金产品说明

（一）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。

（二）投资策略

1、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。

2、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，以及据此做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

中央交易室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，中央交易室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。

3、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、期限结构的滚动配置策略、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做出研究与分析，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。

4、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。

（三）业绩比较基准

本基金业绩比较基准为银行一年定期存款利率（税后）。

（四）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。

三、基金管理人

（一）名称：长盛基金管理有限公司

（二）信息披露负责人：叶金松

（三）联系电话：010-82255818

（四）传真：010-82255988

（五）电子邮箱：yejs@csfunds.com.cn

四、基金托管人

（一）名称：兴业银行股份有限公司

（二）信息披露负责人：赵建明

（三）联系电话：021－62159219

（四）传真：021－62159217

（五）电子邮箱：zhaojianming@cib.com.cn

五、信息披露

（一）登载半年度报告正文的管理人互联网网址：http://www.csfunds.com.cn

（二）基金半年度报告置备地点：本报告分别置备于基金管理人和基金托管人的办公地址，供公众查阅、复制。

第二章 主要财务指标和基金净值表现

所述基金业绩指标不包括基金份额持有人交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

一、主要财务指标

序号	主要财务指标	2006年6月30日
1	本期净收益（元）	25,576,157.18
2	期末基金资产净值（元）	732,292,100.06
3	期末基金份额净值（元/份）	1.00
4	本期净值收益率	0.9484%
5	累计净值收益率	1.0552%

二、基金净值表现

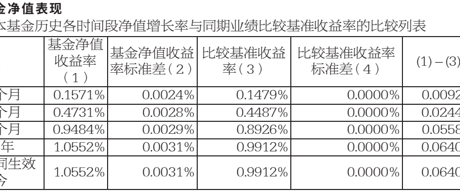
（一）本基金历史各时间段净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较列表

阶段	基金净值收益率（1）	基金净值收益率标准差（2）	比较基准收益率（3）	比较基准收益率标准差（4）	(1)－(3)	(2)－(4)
过去一个月	0.1571%	0.0024%	0.1479%	0.0000%	0.0092%	0.0024%
过去三个月	0.4731%	0.0028%	0.4487%	0.0000%	0.0244%	0.0028%
过去六个月	0.9484%	0.0029%	0.8926%	0.0000%	0.0558%	0.0029%
过去一年	1.0552%	0.0031%	0.9912%	0.0000%	0.0640%	0.0031%
自基金合同生效起至今	1.0552%	0.0031%	0.9912%	0.0000%	0.0640%	0.0031%

（二）自基金合同生效以来基金份额净值的变动情况，并与同期业绩比较基准的变动的比较

长盛货币市场基金累计份额净值增长率

与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



（2005年12月12日至2006年6月30日）

注：

1、本基金合同于2005年12月12日生效，截止报告日本基金合同生效未满一年。

2、按基金合同规定，本基金自基金合同生效起三个月内为建仓期，本基金在基金合同生效后三个月内完成建仓，从建仓结束至本报告期末遵守法律、法规和基金合同的比例限制进行证券投资。

3、基金合同中关于基金投资比例的约定：

（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）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。

（8）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。

第三章 管理人报告

一、基金管理人及基金经理情况

（一）基金管理人及其管理基金的经验

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10000万元。目前，本公司股东及其出资比例为：国元证券有限责任公司49%、安徽省创新投资有限公司26%、安徽省投资集团有限责任公司25%。截止2006年6月30日，基金管理人共管理四支封闭式基金、四支开放式基金，并于2002年12月，首批取得了全国社保基金管理资格。

（二）基金经理简介

王茜女士，武汉大学工商管理硕士，10年金融、证券从业经验。作为全国银行间市场的首批成员组建人，具有丰富的全国银行间市场投资经验和跨市场操作经验。1997年起历任武汉市商业银行信贷管理部交易员、副经理、总经理助理，2002年任职于中信证券固定收益部。2002年9月至今，就职于长盛基金管理公司投资管理部，先后负责封闭式基金债券组合管理，开放式基金债券组合管理，历任全国社保基金债券资产委托基金经理助理，长盛中信全债指数增强型债券基金经理。现任长盛中信全债指数增强型债券投资基金经理、长盛货币市场基金经理。

二、对报告期内基金运作的遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格按照《基金法》及其各项实施准则、《长盛货币市场基金基金合同》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，在认真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。

三、报告期内基金投资策略和业绩表现的说明与解释

（一）报告期内行情回顾和本基金投资策略分析

今年上半年，受宏观调控和商业银行信贷加速扩张的双重影响，以新股、再融资启动为导火索，货币市场利率出现大幅上升。就宏观环境而言，上半年过快的信贷扩张和固定资产投资增长，导致整体经济呈现过热苗头。在本轮宏观调控中，充当主要角色的货币当局展现了相当坚定的调控决心，相继通过提高贷款利率和存款准备金率，回收市场流动性和抬高贷款的机会成本；并在公开市场业务操作上通过央行票据的发行、掉期交易和发行定向票据等等措施来回收过剩流动性，抑制商业银行放贷的潜在动力。央行货币政策取向的变化，引发并引导货币市场利率的稳步回升。而5月中下旬新股与再融资的重新启动，打破了市场资金的原有供求格局，加剧了投资人对资金供应紧张的预期，货币市场利率出现了超出市场预期的加速上升。自年初至6月末，货币市场利率平均上升幅度超过70个基点。

货币市场利率短期内的大幅上升和恢复新股申购后低风险盈利模式的出现，使货币市场基金整体出现了大规模赎回，普遍面临流动性和收益性的双重压力。长盛货币市场基金比较准确的预测了利率上行态势和基金规模的变化趋势，自二季度初开始组合调整，重点调整策略为降低组合平均剩余期限，加大流动性好的央票、金融债券的持仓比重，在维持组合收益稳定的前提下，确保基金资产的流动性。基于良好的组合流动性管理，长盛货币市场基金在面临较大的赎回压力和利率风险时，仍能够保证本基金收益的稳定性、持续性和基金运作的合规性。

（二）本基金业绩表现

2006年上半年，长盛货币市场基金净值收益率为0.9484%，高于比较基准0.0558%。

四、对宏观经济、证券市场及行业走势等的简要展望

（一）对宏观经济和货币市场展望

展望未来货币市场利率趋势，我们认为虽然进一步出台宏观调控措施的压力仍在，而且随着下半年物价指数的温和走高，市场通胀预期可能有所加强，进而带动利率水平继续上升，但是外汇占款持续增加所带来的流动性供给以及中美利差的逐步缩小将限制货币市场利率的上行空间。也就是说，我们认为下半年货币市场利率在趋势上仍将保持上升态势，但上升幅度有限，并可能随着投资人预期和资金供求形势的短期变化在20-30个基点内上下波动。

（二）本基金下阶段投资策略

基于上述判断，本基金管理人在下半年的管理中将密切关注国内经济环境及全球经济趋势的变化，坚持一贯的稳健管理风格，在确保组合流动性的前提下，保持组合的适当平均剩余期限，通过对高流动性短期债券与较高信用程度的短期融资券的平衡配置实现组合流动性与长期稳定增值的良好匹配。

第四章 托管人报告

本托管人依据《长盛货币市场基金基金合同》与《长盛货币市场基金托管协议》，自2005年12月12日起托管长盛货币市场基金（以下称本基金）的全部资产。

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。

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。

本基金成立后，在建仓期内有基金投资组合平均剩余期限大于180天的情况；本报告期内，由于基金大额赎回及基金净值波动等原因，出现正回购资金余额占基金资产净值的比例超过20%、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大于基金资产净值的20%等情况。本托管人及时对基金管理人进行了书面或电话的风险提示，基金管理人及时作了反馈，并在规定期限内对投资组合进行了调整。

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。

兴业银行股份有限公司
2006年8月25日

第五章 财务会计报告

一、基金会计报表（未经审计）

（一）资产负债表

长盛货币市场基金
资产负债表

单位：人民币元

项 目	2006年6月30日	2005年12月31日
资 产		
银行存款	32,410,116.60	12,891,439.37
清算备付金	507,777.78	0.00
交易保证金	0.00	0.00
应收证券清算款	0.00	0.00
应收股利	0.00	0.00
应收利息	5,355,367.98	4,611,379.40
应收申购款	31,203,680.39	63,843,010.00
其他应收款	0.00	0.00
股票投资市值	0.00	0.00
其中：股票投资成本	0.00	0.00
债券投资市值	525,416,617.52	1,673,272,360.60
其中：债券投资成本	525,416,617.52	1,673,272,360.60
权证投资	0.00	0.00
其中：权证投资成本	0.00	0.00
买入返售证券	277,600,000.00	286,800,000.00
待摊费用	2,199.16	5,595.34
其他资产	0.00	0.00
资产总计	872,495,759.43	2,041,423,784.71
负债及持有人权益		
负债		
应付证券清算款	0.00	0.00
应付赎回款	0.00	0.00
应付赎回费	0.00	0.00
应付管理人报酬	430,664.28	474,406.92
应付托管费	130,504.34	143,759.65
应付销售服务费	326,260.80	359399.17
应付佣金	-20,301.00	-2,868.00
应付利息	26,407.67	52,594.52
应付收益	0.00	0.00
应交税金	0.00	0.00
其他应付款	127,387.49	6,400.00
卖出回购证券款	139,000,000.00	333,000,000.00
短期借款	0.00	0.00
预提费用	182,735.79	0.00
其他负债	0.00	0.00
负债合计	140,203,659.37	334,033,692.26
持有人权益		
实收基金	732,292,100.06	1,707,390,092.45
未实现利得	0.00	0.00
未分配收益	0.00	0.00
持有人权益合计	732,292,100.06	1,707,390,092.45
负债及持有人权益总计	872,495,759.43	2,041,423,784.71

基金份额净值为1.00元。

（二）经营业绩表及收益分配表

长盛货币市场基金
经营业绩表及收益分配表

单位：人民币元

项 目	2006年上半年度
收 入	
股票差价收入	0.00
债券差价收入	6,025,788.53
权证差价收入	0.00
债券利息收入	25,159,519.51
存款利息收入	2,043,840.04
股利收入	0.00
买入返售证券收入	5,518,398.88
其他收入	0.00
收入合计	38,747,546.96
费 用	
基金管理人报酬	4,424,733.19
基金托管费	1,340,828.25
基金销售服务费	3,352,070.57
卖出回购证券支出	3,642,771.28
利息支出	0.00
其他费用	410,986.49
其中：上市年费	0.00
信息披露费	148,767.52
审计费用	33,968.27
费用合计	13,171,389.78
基金净收益	25,576,157.18
加：未实现利得	
基金经营业绩	25,576,157.18
本期基金净收益	25,576,157.18
加：期初基金净收益	0.00
加：本期损益平准金	0.00
可供分配基金净收益	25,576,157.18
减：本期已分配基金净收益	25,576,157.18
期末基金净收益	0.00

本基金合同于2005年12月12日生效，本基金经营业绩表及收益分配表无上年度可比期间数据进行比较。

所述基金业绩指标不包括基金份额持有人交易基金的各项费用（例如开放式基金申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

（三）基金净值变动表

长盛货币市场基金
基金净值变动表

单位：人民币元

项目	2006年上半年度
期初基金净值	1,707,390,092.45
本期经营活动	
基金净收益	25,576,157.18
未实现利得	0.00
经营活动产生的基金净值变动数	25,576,157.18
本期基金份额交易	
基金申购款	8,157,715,926.34
其中：分红再投资	25,576,157.18
基金赎回款	9,132,813,918.73
基金份额交易产生的基金净值变动数	-975,097,992.39
本期向基金份额持有人分配收益	
向基金份额持有人分配收益产生的基金净值变动数	-25,576,157.18
年末基金净值	732,292,100.06

本基金合同于2005年12月12日生效，本基金基金净值变动表无上年度可比期间数据进行比较。

二、会计报表附注（未经审计）

（一）本基金的基本情况

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设立的批复》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》及其配套法规和《长盛货币市场基金基金合同》向社会公开募集，本基金募集期间为2005年11月16日至2005年12月6日，本基金合同于2005年12月12日正式生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。经普华永道中天会计师事务所有限公司验资，本基金首次设立募集资金及其产生的利息共计3,601,835,236.63元，其中，认购手续费0.00元，募集资金的银行存款利息458,092.23元。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》、《长盛货币市场基金基金合同》和最近公布的《长盛货币市场基金更新招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围为现金；一年以内的银行定期存款、大额存单；剩余期限在397天以内的债券；期限在一年以内的债券回购；期限在一年以内的中央银行票据以及中国证监会、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。

（二）会计报表编制基础

本基金的会计报表按照国家颁布的《企业会计准则》、《金融企业会计制度》、《证券投资基金会计核算办法》及中国证监会允许的如会计报表附注所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

（三）主要会计政策和会计估计

1、会计年度

本基金会计年度为公历1月1日至12月31日。

2、记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。记账单位为元。

3、记账基础和计价原则

本基金的记账基础为权责发生制。债券投资采用摊余成本法计价，同时按公允价值进行估值监控。除此之外，所有报表项目均以历史成本计价。

4、基金资产的估值原则

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利息，并考虑其买入时的溢价与折价在其剩余期限内平均摊销，每日计提收益。本基金不采用市场利率或上市交易的债券和票据的市价计算基金资产净值。在有关法律法规允许交易所短期债券可以采用摊余成本法前，本基金暂不投资于交易所短期债券。

为了避免采用摊余成本法计算的基金资产净值与按市场利率或交易市价计算的基金资产净值发生重大偏离，从而对基金份额持有人的利益产生稀释或不公平的结果，基金管理人于每一计价日采用市场利率和交易价格对基金持有的计价对象进行重新评估，即“影子定价”。当基金资产净值与影子定价的偏离达到或超过基金资产净值的0.5%时，或基金管理人认为发生了其他的重大偏离时，基金管理人可以与基金托管人商定后进行调整，使基金资产净值更能公允地反映基金资产价值，确保以摊余成本法计算的基金资产净值不会对基金份额持有人造成实质性的损害。

如有确凿证据表明按上述方法进行计价不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法计价。

5、证券投资基金成本计价方法

买入银行间同业市场交易的债券于实际支付价款时确认为债券投资。债券投资按成交日应支付的全部价款入账，其中所包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息作为应收利息单独核算，不构成债券投资成本。买入贴息债券无需单独核算应收利息。

卖出证券交易所交易的债券于成交日确认债券差价收入；卖出银行间同业市场交易的债券于实际收到全部价款时确认债券差价收入。出售债券的成本按移动加权平均法结转。

6、待摊费用的摊销方法和摊销期限

待摊费用按直线法在受益期内平均摊销。

7、收入的确认和计量

银行间同业市场交易的债券差价收入于实际收到全部价款时确认。债券差价收入按应收取全部价款与其成本、应收利息和相关费用的差额确认。

债券利息收入按债券票面价值与票面利率计算的金额，并根据买入债券时溢价或折价的摊销数及应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税进行调整后的金额确认，在债券实际持有期内逐日计提。短期融资券的利息收入按买入时溢价或折价的摊销数扣除个人所得税后的净额认列，银行次级债的利息收入按全额票面利息并调整买入时溢价或折价的摊销数后的金额认列。

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提，其中定期存款利息收入采用到期协议利率逐日计提。

买入返售证券收入按融出资金额及约定利率，在证券持有期内采用直线法逐日计提。

8、费用的确认和计量

本基金的基金管理人报酬按前一日基金资产净值0.33%的年费率逐日计提。

本基金的基金托管费按前一日基金资产净值0.10%的年费率逐日计提。

本基金的基金销售服务费按前一日基金资产净值0.25%的年费率逐日计提。

卖出回购证券支出按融入资金额及约定利率，在回购期限内采用直线法逐日计提。

9、实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额。每份基金份额面值为1.00元。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

10、基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。当日申购的基金份额自下一个工作日起享有基金的分配权益；当日赎回的基金份额自下一个工作日起不享有基金的分配权益。每一基金份额享有同等分配权。本基金以份额面值1.00元固定份额净值交易方式，自基金成立日起以红利再投资形式每日全额分配收益，每日分配的收益于分配次日按份额面值1.00元转入基金份额持有人权益。本基金每月第一个工作日集中将上月收益结转到基金份额持有人基金账户（如遇节假日顺延），基金成立不满一个月不结转。基金投资当期亏损时，采用等比例调减基金份额持有人持有份额的方式，将基金份额净值维持在份额面值1.00元。投资者可通过赎回基金份额获取现金收益。

（四）主要税项

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[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，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。

2、基金买卖债券的差价收入，自2004年1月1日起继续免征营业税和企业所得税。

3、对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴20%的个人所得税，暂不征收企业所得税。

（五）为处理对基金财务状况及基金运作有重大影响的事项而采取的其他会计政策和会计估计

本基金本报告期内并无为处理对基金财务状况及基金运作有重大影响的事项而采取其他会计政策和会计估计。

（六）会计政策、会计估计变更的内容、理由、影响数或影响数不能合理确定的理由

本基金本报告期内并无会计政策、会计估计变更。

（七）重大会计差错的内容和更正金额本基金本报告期内并无重大会计差错。

（八）关联方关系及关联方交易

1、关联方关系发生变化的情况：本报告期内，本基金无关联方关系的变化情况。

关联方名称	与本基金的关系
长盛基金管理有限公司	基金管理人、登记注册机构、基金销售机构
兴业银行股份有限公司（以下简称“兴业银行”）	基金托管人、基金代销机构
国元证券有限责任公司（以下简称“国元证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构
安徽省创新投资有限公司	基金管理人的股东
安徽省投资集团有限责任公司	基金管理人的股东

2、通过主要关联方席位进行的交易本基金本期未发生通过主要关联方席位进行的交易。

3、与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

项目	2006年上半年度
兴业银行：	
买入债券结算金额	414,840,894.98
卖出债券结算金额	485,844,101.15
卖出回购证券协议金额	300,700,000.00
卖出回购证券利息支出	247,974.52

4、关联方报酬

（1）基金管理人报酬

支付基金管理人长盛基金管理有限公司的基金管理人报酬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：

日基金管理人报酬＝前一日基金资产净值×0.33%/当年天数

本基金在本报告期需支付基金管理人报酬为人民币4,424,733.19元。

（2）基金托管费

支付基金托管人中国农业银行的基金托管费按前一日基金资产净值0.10%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：

日基金托管费＝前一日基金资产净值×0.10%/当年天数

本基金在本报告期需支付基金托管费为人民币1,340,828.25元

（3）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：

日基金销售服务费＝前一日基金资产净值×0.25%/当年天数

本基金在本报告期需支付基金销售服务费为人民币3,352,070.57元，其中，需要支付给国元证券的基金销售服务费为人民币114,621.47元，需支付给兴业银行的基金销售服务费为人民币355,337.74元，需支付给长盛基金管理有限公司销售服务费为人民币2,296,452.47元。

5、关联方持有的基金份额

关联方名称	2006年6月30日
国元证券：	100,000,000.00

6、由关联方保管的银行存款余额及由此产生的利息收入

本基金的银行存款由基金托管人兴业银行股份有限公司保管，并按银行同业存款利率计息。基金托管人于2006年6月30日保管的银行存款余额为人民币32,410,116.60元。本报告期内由基金托管人保管的银行存款产生的利息收入为人民币2,012,379.88元。

（九）报告期末流通转让受到限制的基金资产

截止2006年6月30日，本基金从事银行间同业市场非买断式债券回购交易形成的卖出回购证券139,000,000.00元，抵押债券如下：

单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末摊余成本单价	数量（张）	期末摊余成本总额	估值方法	转让受限原因
040212	04国开12	2006-7-5	100.06	500,000	50,027,640.36	摊余成本法	回购抵押
601006	06央行票据06	2006-7-5	98.40	400,000	39,358,939.05	摊余成本法	回购抵押
681102	06中铁工CP01	2006-7-5	96.81	100,000	9,680,983.13	摊余成本法	回购抵押
601006	06央行票据06	2006-7-4	98.40	500,000	49,198,673.81	摊余成本法	回购抵押

（十）其他重要事项

本基金无需要说明的其他重要事项。

第六章 投资组合报告

一、报告期末基金资产组合情况

资产组合	金额（人民币元）	占基金总资产的比例
债券投资	525,416,617.52	60.22%
买入返售证券	277,600,000.00	31.82%
其中：买断式回购的买入返售证券	0.00	0.00%
银行存款和清算备付金	32,917,894.38	3.77%
其中：定期存款	0.00	0.00%
其他资产	36,561,247.53	4.19%
合计	872,495,759.43	100.00%

二、报告期债券回购融资情况

序号	项目	金额（人民币元）	占基金资产净值的比例
1	报告期内债券回购融资余额	79,275,800,000.00	16.79%
	其中：买断式回购融资	0.00	0.00%
2	报告期末债券回购融资余额	139,000,000.00	18.98%
	其中：买断式回购融资	0.00	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、本报告期内货币市场基金正回购的资金余额超过资产净值的20%的情况

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（日）
1	2006-1-24	21.58%	建仓期内	到2月8日调整完毕
2	2006-1-25	24.66%	建仓期内	到2月8日调整完毕
3	2006-1-26	24.66%	建仓期内	到2月8日调整完毕
4	2006-1-27	24.66%	建仓期内	到2月8日调整完毕
5	2006-1-28	24.66%	建仓期内	到2月8日调整完毕
6	2006-1-29	24.66%	建仓期内	到2月8日调整完毕
7	2006-1-30	24.66%	建仓期内	到2月8日调整完毕
8	2006-1-31	24.66%	建仓期内	到2月8日调整完毕
9	2006-2-1	24.66%	建仓期内	到2月8日调整完毕
10	2006-2-2	24.66%	建仓期内	到2月8日调整完毕
11	2006-2-3	24.65%	建仓期内	到2月8日调整完毕
12	2006-2-4	24.65%	建仓期内	到2月8日调整完毕
13	2006-2-5	24.65%	建仓期内	到2月8日调整完毕
14	2006-2-6	24.67%	建仓期内	到2月8日调整完毕
15	2006-2-7	21.56%	建仓期内	到2月8日调整完毕
16	2006-4-12	20.65%	大额赎回导致被动超标	到4月13日调整完毕
17	2006-4-26	20.94%	大额赎回导致被动超标	到5月9日调整完毕
18	2006-4-27	23.17%	大额赎回导致被动超标	到5月9日调整完毕
19	2006-4-28	26.05%	大额赎回导致被动超标	到5月9日调整完毕
20	2006-4-29	26.05%	大额赎回导致被动超标	到5月9日调整完毕
21	2006-4-30	26.05%	大额赎回导致被动超标	到5月9日调整完毕
22	2006-5-1	26.05%	大额赎回导致被动超标	到5月9日调整完毕
23	2006-5-2	26.05%	大额赎回导致被动超标	到5月9日调整完毕
24	2006-5-3	26.04%	大额赎回导致被动超标	到5月9日调整完毕
25	2006-5-4	26.04%	大额赎回导致被动超标	到5月9日调整完毕
26	2006-5-5	26.04%	大额赎回导致被动超标	到5月9日调整完毕
27	2006-5-6	26.04%	大额赎回导致被动超标	到5月9日调整完毕
28	2006-5-7	26.04%	大额赎回导致被动超标	到5月9日调整完毕
29	2006-5-8	26.00%	大额赎回导致被动超标	到5月9日调整完毕
30	2006-6-1	20.41%	大额赎回导致被动超标	到6月6日调整完毕
31	2006-6-2	21.88%	大额赎回导致被动超标	到6月6日调整完毕
32	2006-6-3	21.88%	大额赎回导致被动超标	到6月6日调整完毕
33	2006-6-4	21.88%	大额赎回导致被动超标	到6月6日调整完毕
34	2006-6-5	21.87%	大额赎回导致被动超标	到6月6日调整完毕
35	2006-6-9	20.21%	大额赎回导致被动超标	到6月15日调整完毕
36	2006-6-10	20.21%	大额赎回导致被动超标	到6月15日调整完毕
37	2006-6-11	20.21%	大额赎回导致被动超标	到6月15日调整完毕
38	2006-6-12	20.20%	大额赎回导致被动超标	到6月15日调整完毕
39	2006-6-13	24.41%	大额赎回导致被动超标	到6月15日调整完毕
40	2006-6-14	26.28%	大额赎回导致被动超标	到6月15日调整完毕
41	2006-6-22	20.40%	大额赎回导致被动超标	到6月28日调整完毕
42	2006-6-23	20.58%	大额赎回导致被动超标	到6月28日调整完毕
43	2006-6-24	20.58%	大额赎回导致被动超标	到6月28日调整完毕
44	2006-6-25	20.57%	大额赎回导致被动超标	到6月28日调整完毕
45	2006-6-26	20.55%	大额赎回导致被动超标	到6月28日调整完毕
46	2006-6-27	21.62%	大额赎回导致被动超标	到6月28日调整完毕

三、基金投资组合平均剩余期限

（一）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	114
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	224
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	76

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

序号	发生日期	平均剩余期限（天）	原因	调整期（日）
1	2006-1-1	224	建仓期内	到1月16日调整完毕
2	2006-1-2	223	建仓期内	到1月16日调整完毕
3	2006-1-3	222	建仓期内	到1月16日调整完毕
4	2006-1-4	215	建仓期内	到1月16日调整完毕
5	2006-1-5	191	建仓期内	到1月16日调整完毕
6	2006-1-6	224	建仓期内	到1月16日调整完毕
7	2006-1-7	223	建仓期内	到1月16日调整完毕
8	2006-1-8	222	建仓期内	到1月16日调整完毕
9	2006-1-9	213	建仓期内	到1月16日调整完毕
10	2006-1-10	203	建仓期内	到1月16日调整完毕
11	2006-1-11	216	建仓期内	到1月16日调整完毕
12	2006-1-12	206	建仓期内	到1月16日调整完毕
13	2006-1-13	188	建仓期内	到1月16日调整完毕
14	2006-1-14	188	建仓期内	到1月16日调整完毕
15	2006-1-15	187	建仓期内	到1月16日调整完毕

（二）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	40.13%	18.98%
2	30天（含）－60天	20.10%	0.00%
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	9.55%	0.00%
3	60天（含）－90天	1.30%	0.00%
4	90天（含）－180天	16.30%	0.00%
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	9.55%	0.00%
5	180天（含）－397天（含）	36.32%	0.00%
	合计	114.15%	18.98%

四、报告期末债券投资组合

（一）按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	成本（人民币元）	占基金资产净值的比例
1	国家债券	0.00	0.00%
2	金融债券	149,958,570.39	20.48%
	其中：政策性金融债	149,958,570.39	20.48%
3	央行票据	167,249,783.72	22.84%
4	企业债券	208,208,263.41	28.43%
5	其他	0.00	0.00%
	合计	525,416,617.52	71.75%
剩余存续期超过397天的浮动利率债券		139,821,536.46	19.09%

注：上表中，附息债券的成本包括债券面值和折溢价，贴现式债券的成本包括债券投资成本和内在应收利息。

（二）基金投资前十名债券明细

序号	债券名称	债券数量		成本（人民币元）	占基金资产净值的比例
		自有投资	买断式回购		
1	06央票06	1,400,000	0.00	137,756,286.68	18.81%
2	04国开12	800,000	0.00	80,044,224.57	10.93%
3	06国开08	700,000	0.00	69,914,345.82	9.55%
4	05中信债1	700,000	0.00	69,907,190.64	9.55%
5	06金融街CP01	500,000	0.00	50,000,000.00	6.83%
6	06中石化CP01	400,000	0.00	39,576,510.30	5.40%
7	06央票08	300,000	0.00	29,493,497.04	4.03%
8	06铁二局CP02	300,000	0.00	29,362,596.21	4.01%
9	06中铁工CP01	200,000	0.00	19,361,966.26	2.64%
10	–	–	–	–	–

注：上表中，“债券数量”中的“自有投资”和“买断式回购”指自有的债券投资和通过债券买断式回购业务买入的债券卖出后的余额。

五、“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	64
报告期内偏离度的最高值	0.4625%
报告期内偏离度的最低值	0.0235%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.2500%

六、投资组合报告附注

（一）基金计价方法说明：本基金估值采用摊余成本法，即估值对象以买入成本列示，按照票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价和折价，在剩余存续期内平均摊销，每日计提损益。

（二）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存在超过日基金资产净值20%的情况，具体如下表：

序号	日期	比例	原因	调整期
1	2006-4-10	22.09%	基金规模波动导致超标	到4月19日调整完毕
2	2006-4-11	22.04%	基金规模波动导致超标	到4月19日调整完毕
3	2006-4-12	23.14%	基金规模波动导致超标	到4月19日调整完毕
4	2006-4-13	23.12%	基金规模波动导致超标	到4月19日调整完毕
5	2006-4-14	23.34%	基金规模波动导致超标	到4月19日调整完毕
6	2006-4-15	23.34%	基金规模波动导致超标	到4月19日调整完毕
7	2006-4-16	23.34%	基金规模波动导致超标	到4月19日调整完毕
8	2006-4-17	23.41%	基金规模波动导致超标	到4月19日调整完毕
9	2006-4-18	22.73%	基金规模波动导致超标	到4月19日调整完毕
10	2006-5-31	23.53%	基金规模波动导致超标	到6月5日调整完毕
11	2006-6-1	24.55%	基金规模波动导致超标	到6月5日调整完毕
12	2006-6-2	21.14%	基金规模波动导致超标	到6月5日调整完毕
13	2006-6-3	21.14%	基金规模波动导致超标	到6月5日调整完毕
14	2006-6-4	21.14%	基金规模波动导致超标	到6月5日调整完毕
15	2006-6-13	21.97%	基金规模波动导致超标	到6月14日调整完毕
16	2006-6-19	20.51%	基金规模波动导致超标	到6月21日调整完毕
17	2006-6-20	21.37%	基金规模波动导致超标	到6月21日调整完毕
18	2006-6-27	21.54%	基金规模波动导致超标	到6月28日调整完毕
19	2006-6-29	23.10%	基金规模波动导致超标	到6月30日调整完毕

（三）本报告期内无需说明的证券投资决策程序。

（四）报告期末基金其他资产的构成

序号	其他资产	金额（人民币元）
1	应收利息	5,355,367.98
2	应收申购款	31,203,680.39
3	待摊费用	2,199.16
	合计	36,561,247.53

（五）报告期末基金持有的资产支持证券明细：

本基金期末未持有资产支持证券。

（六）基金管理人未以自有资产投资本基金。

第七章 基金份额持有人情况

一、报告期末基金份额持有人户数

报告期末基金份额持有人户数（户）	7,753
报告期末平均每户持有的基金份额（份）	94,452.74

二、报告期末基金份额持有人结构

单位：份

项目	数量	占总份额的比例
基金份额总额：	732,292,100.06	100.00%
其中：机构投资者持有的基金份额	353,025,327.39	48.21%
个人投资者持有的基金份额	379,266,772.67	51.79%

第八章 开放式基金份额变动情况

本基金份额变动情况如下：

单位：份

基金合同生效日的基金份额总额	3,601,835,236.63
本报告期期初基金份额总额	1,707,390,092.45
本报告期期间总申购份额	8,157,715,926.34
本报告期期间总赎回份额	9,132,813,918.73
本报告期期末基金份额总额	732,292,100.06

第九章 重大事件揭示

一、本基金在2006年上半年未召开基金份额持有人大会。

二、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。

三、基金招募说明书更新情况

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《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》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第5号<招募说明书的内容与格式>》、《货币市场基金管理暂行规定》等有关法规以及《长盛货币市场基金基金合同》的要求，本基金管理人经与托管人协商，于2006年5月17日对本基金的招募说明书进行了更新，本基金更新的招募说明书摘要于2006年6月9日刊登于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》，并登载在公司的网站上。

四、基金收益支付情况

（一）本基金管理人长盛基金管理有限公司定于2006年2月6日对本基金自2005年12月12日至2006年2月5日的累计收益进行集中支付并结转为基金份额。公告刊登于2006年2月6日《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及本公司网站。

（二）本基金管理人长盛基金管理有限公司定于2006年3月1日对本基金自2006年2月6日至2006年2月28日的累计收益进行集中支付并结转为基金份额。公告刊登于2006年3月2日《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及本公司网站。

（三）本基金管理人长盛基金管理有限公司定于2006年4月3日对本基金自2006年3月1日至2006年4月2日的累计收益进行集中支付并结转为基金份额。公告刊登于2006年4月3日《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及本公司网站。

（四）本基金管理人长盛基金管理有限公司定于2006年5月8日对本基金自2006年4月3日至2006年5月7日的累计收益进行集中支付并结转为基金份额。公告刊登于2006年5月8日《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及本公司网站。

（五）本基金管理人长盛基金管理有限公司定于2006年6月1日对本基金自2006年5月8日至2006年5月31日的累计收益进行集中支付并结转为基金份额。公告刊登于2006年6月1日《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及本公司网站。

（六）本基金管理人长盛基金管理有限公司定于2006年7月3日对本基金自2006年6月1日至2006年7月2日的累计收益进行集中支付并结转为基金份额。公告刊登于2006年6月1日《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及本公司网站。

五、本基金增加代销机构

自2006年3月2日起，联合证券将代理长盛货币市场基金（基金代码为：080011）的销售业务。公告刊登于2006年2月27日《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及本公司网站。

六、基金转换业务

为更好地满足投资者的需求，长盛基金管理有限公司决定于2006年3月2日起开放长盛货币市场基金与长盛成长价值证券投资基金之间的转换业务。公告刊登于2006年2月27日《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及本公司网站。

七、基金管理人高级管理人员的变更

根据长盛基金管理有限公司第三届董事会第九次会议决议，本公司同意蒋月勤先生辞去公司总经理职务，聘任陈礼华先生担任公司总经理职务。陈礼华先生的总经理任职资格已获中国证监会核准（证监基金字[2006]52号文）。关于变更高级管理人员的公告刊登于2006年4月10日《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及本公司网站。

八、为保护基金份额持有人的利益，根据法律法规和基金合同的相关规定，我公司决定，春节放假前长盛货币市场基金申购业务安排如下：兴业银行在1月24日、1月25日暂停本基金的申购，其他销售机构（包括长盛基金直销中心）均在1月23日、1月24日、1月25日暂停本基金的申购。赎回业务等其他业务以及本公司管理的其他开放式基金的各项交易业务仍照常办理。2月6日本基金将恢复办理正常的申购业务。公告刊登于2006年1月18日《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及本公司网站。

九、本报告期内本基金的投资策略未曾改变。

十、报告期内披露的其他重大事项

（一）2006年4月26日基金管理人发布关于中国农业银行金穗卡用户网上交易费率优惠的公告，投资者可通过“中国农业银行－长盛基金管理公司网上直销系统”申购本基金。

（二）2006年4月26日基金管理人发布关于兴业卡与银联卡用户网上交易费率优惠的公告，投资者可通过“银联通开放式基金网上交易系统”申购本基金。

（三）2006年6月28日基金管理人发布了关于开通全国统一客户服务免费电话号码400-888-2666的公告。

十一、基金管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情形

无。

十二、聘请会计师事务所情况

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有限公司。普华永道中天会计师事务所有限公司已连续为本基金提供审计服务7个月。

十三、本基金交易席位使用情况

（一）根据中国证监会《关于加强证券投资基金监管有关问题的通知》、《关于基金证券交易量分配限制有关规定的解释》的有关要求，我司按照选择证券经营机构的标准，经认真研究后，截止本报告期末本基金选择的交易席位如下

序号	证券公司名称	租用上海席位数量	租用深圳席位数量	合计
1	中信建投证券有限责任公司	1	0	1

（二）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。

（三）本公司租用基金专用席位的程序

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》、《券商席位租用协议》，并办理基金专用席位租用手续。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，并撤销租用的席位；

6、席位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。

（四）2006年1-6月券商回购交易量情况如下

公司名称	回购年交易量（人民币元）	占交易量比例
中信建投证券有限责任公司	1,940,900,000.00	100.00%

（五）报告期内租用证券公司席位的变更情况：报告期内未有席位变更。

长盛基金管理有限公司
二〇〇六年八月二十八日