长盛货币市场基金 2006年年度报告摘要

重要提示

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

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 2007 年 3 月 28 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, 投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告财务资料已经审计,普华永道中天会计师事务所有限公司为本基金出具了无保留意见的审计报告。

本报告会计期间:2006 年 1 月 1 日至 2006 年 12 月 31 日。

第一章 基金简介

一、基金基本资料

(一)基金名称:长盛货币市场基金

(二)基金简称:长盛货币市场基金

(三)基金交易代码:080011

(四)基金运作方式:契约型开放式

(五)基金合同生效日:2005 年 12 月 12 日

(六)报告期末基金份额总额:428,430,431.51 份

(七)基金合同存续期:不定期

(八)基金份额上市的证券交易所:无

(九)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决策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。

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。

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)登载本报告正文的管理人互联网网址:http://www.csfunds.com.cn

(二) 基金年度报告置备地点: 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、基金净值表现和收益分配情况

所述基金业绩指标不包括基金份额持有人认购或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	项目	2006年	2005年
1	本期净收益	31,827,669.64	2,779,476.15
2	期末基金资产净值	428,430,431.51	1,707,390,092.45
3	期末基金份额净值	1.00	1.00
4	本期净值收益率	1.9641%	0.1058%
5	累计净值收益率	2.0719%	0.1058%

注:1、本基金收益分配是按日结转份额。

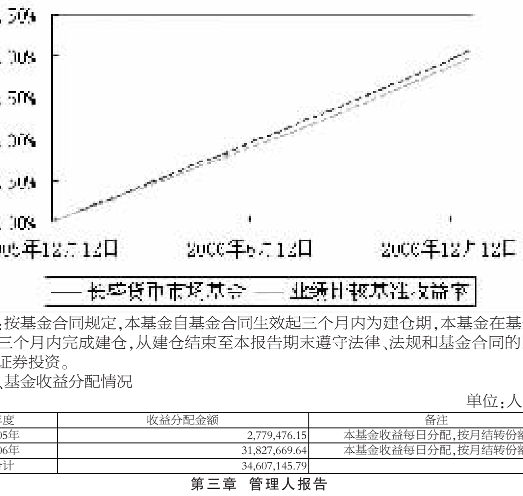
2、本基金合同生效日为 2005 年 12 月 12 日,2005 年度主要财务指标的计算期间为 2005 年 12 月 12 日至 2005 年 12 月 31 日。

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)
过去三个月	0.5150%	0.0006%	0.5081%	0.0000%	0.0069%	0.0006%
过去六个月	1.0061%	0.0013%	0.9873%	0.0003%	0.0188%	0.0010%
过去一年	1.9641%	0.0022%	1.8799%	0.0003%	0.0842%	0.0019%
自基金合同生效起至今	2.0719%	0.0024%	1.9785%	0.0003%	0.0934%	0.0021%

(二)本基金合同生效以来基金累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比(2005 年 12 月 12 日至 2006 年 12 月 31 日)



注: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。

三、基金收益分配情况

单位:人民币元

年度	收益分配金额	备注
2005年	2,779,476.15	本基金收益每日分配,按月结转份额
2006年	31,827,669.64	本基金收益每日分配,按月结转份额
合计	34,607,145.79	

第三章 管理人报告

第一节 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%。截至 2006 年 12 月 31 日,基金管理人共管理四支封闭式基金、五支开放式基金,并于 2002 年 12 月,首批取得了社保基金管理资格。

二、基金经理小组简介

基金经理: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基金基金经理、长盛货币市场基金基金经理。

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,全面负责公司旗下所有基金和组合的债券资产的交易管理。现任长盛货币市场基金基金经理。

第二节 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。

第三节 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

过去一年里,货币政策经历了严峻的考验,并且也取得了一系列的成果;2006 年国内生产总值(GDP)出现了加速上行的苗头,GDP 增长率创出了 1998 年以来的新高,这一现象引发了管理层对于经济过热的担忧,并进而连续出台了一系列紧缩性货币政策;总体上 06 年央行采取了以数量控制回收流动性为主,行政调控、价格型工具并用的调控方式,其间两次提高贷款利率,三次提高存款准备金率,四次发行定向央票。

2006 年的货币市场利率也因此变得跌宕起伏:

(一)2006 年货币市场回购利率整体呈现缓慢上升的态势,银行间 7 天回购年化利率从年初的 1.5%上升了 50-100bp,最高曾到达过 4%的天价(其中加息因素仅使银行资金成本上升约 14bp),年末又回落到 2%附近的水平,其上升的主要原因在于银行的信贷增速持续加快,加之新股开闸、股市走强等原因使得市场资金分流,结果导致资金分布不均,回购利率大幅波动。

(二) 央票利率也呈现一路走高的态势, 一年期央票利率从年初的 1.85%一路走高到 2.79%,其中曾一度突破到 2.82%,但是在央行的坚决引导下,这个具有风向标意义的央票利率又重新回到 2.79%的水平,且这种状况一直持续到现在。

二、2006 年,长盛货币市场基金净值收益率为 1.9641%,高于比较基准 0.0842%。

三、报告期内本基金投资策略分析

2006 年,面对货币市场的风云变幻,本基金始终坚持把组合的流动性放在首位;通过对货币政策的深入研究及货币市场短期利率走势的准确预测, 并结合对基金规模成长性、持有人结构及投资行为的分析,本基金成功的完成了组合的建仓及调整,通过动态调整组合平均剩余期限及个券构成,实现了组合的较高收益;在下半年货币基金惨遭大额赎回的风潮面前,本基金凭借组合合理科学的资产配置、良好的组合流动性管理,从容的渡过了这个难关,保证了本基金收益一贯的稳定性、持续性和基金运作的合规性。

第四节 对宏观经济、证券市场及行业走势等的简要展望

一、对 2007 年宏观经济和货币市场展望

我们认为 2007 年“宽货币”的局面仍将有一定程度的延续,因此货币政策的主要目的依然是回笼流动性,所以数量型的货币调控工具依然是 2007 年的主流,而价格型货币政策工具依然难以占据市场主流,特别是在可预期的美联储从下半年进入降息通道后,中国利率调整的空间将变得更为狭小; 预计 2007 年中国人民银行回笼流动性的主要工具依然集中于公开市场操作和法定存款准备金率的调整,而存在较大不确定性的当属法定存款准备金率的调整节奏。

预计 2007 年货币市场回购利率将面临小幅上升的压力,其原因主要包括:2007 年可能存在的加息因素,将导致银行资金成本的上升;另外股市对回购利率的冲击仍将在相当长一段时间里存在,这将大大拉高市场回购利率、并且加剧回购利率的波动性。

二、本基金 2007 年投资策略

基于上述判断,2007 年本基金仍继续坚持把组合流动性放在第一位, 在保证组合良好流动性的前提下,密切关注国内及国外经济环境的变化,加强对市场的敏感度,根据市场变化适时调整组合中类属资产的配置比例及组合的平均剩余期限,进一步着力于组合资产流动性与收益性的良好匹配;同时还要加强对企业信用风险的评估,准确的把握好信用评级较高,收益较好的企业短期融资券的投资,积极关注信用评估差异及金融创新可能带来的投资机会;另外基于对回购利率将面临上升的预测,我们认为以 7 天回购利率为基准的中短期浮息债的投资价值将更加突出,因此本组合将可能在适当时机增加部分此类品种的配置比例。最后继续关注由于股票一级市场发行所带来的交易所和银行间市场出现的套利机会,以便获取更多的无风险收益。

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;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。

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%、投资于同一公司的短期企业债超过基金资产净值的 10%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资产托管部

2007 年 3 月 28 日

第五章 审计报告

普华永道中天会计师事务所有限公司注册会计师汪棣、陈宇 2007 年 3 月 26 日对本基金 2006 年 12 月 31 日的财务状况以及 2005 年 12 月 12 日(基金合同生效日)至 2005 年 12 月 31 日止期间和 2006 年度的经营成果和基金净值变动出具了普华永道中天审字(2007)第 20270 号无保留意见的审计报告。

第六章 财务会计报告

第一节 基金会计报表(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12月31日	2005年12月31日
资产		
银行存款	10,558,743.56	12,891,439.37
清算备付金	290,909.09	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	919,964.26	4,611,379.40
应收申购款	0.00	63,843,010.00
其他应收款	21,619.50	2,868.00
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	496,115,185.83	1,673,272,360.60
其中:债券投资成本	496,115,185.83	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	20,000,000.00	286,800,000.00
待摊费用	164.96	5,595.34
其他资产	0.00	0.00
资产总计	527,906,587.20	2,041,426,652.71
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	19,702.20	0.00
应付赎回费	300.00	0.00
应付管理人报酬	150,047.49	474,406.92
应付托管费	45,468.94	143,759.65
应付销售服务费	113,672.32	359,399.17
应付佣金	0.00	0.00
应付利息	40,684.92	52,594.52
应付收益	0.00	0.00
应交税金	0.00	0.00
其他应付款	22,679.82	6,400.00
卖出回购证券款	99,000,000.00	333,000,000.00
短期借款	0.00	0.00
预提费用	83,600.00	0.00
其他负债	0.00	0.00
负债合计	99,476,155.69	334,036,560.26
持有人权益		
实收基金及持有人权益	428,430,431.51	1,707,390,092.45
负债及持有人权益总计	527,906,587.20	2,041,426,652.71

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年度	2005年12月12日(基金合同生效日)至2005年12月31日止期间
收入		
股票差价收入	0.00	0.00
债券差价收入	6,361,524.92	437,129.51
权证差价收入	0.00	0.00
债券利息收入	33,721,261.27	1,376,616.34
存款利息收入	2,257,848.50	1,867,775.08
股利收入	0.00	0.00
买入返售证券收入	6,181,885.98	142,038.65
其他收入	0.00	0.00
收入合计	48,522,520.67	3,823,559.58
费用		
基金管理人报酬	5,469,374.49	474,406.92
基金托管费	1,657,386.23	143,759.65
基金销售服务费	4,143,465.48	359,399.17
卖出回购证券支出	4,729,175.22	52,594.52
利息支出		
其他费用	695,449.61	13,923.17
其中:上市年费	0.00	0.00
信息披露费	270,000.00	0.00
审计费用	83,600.00	0.00
费用合计	16,694,851.03	1,044,083.43
基金净收益	31,827,669.64	2,779,476.15
加:未实现利得	0.00	0.00
基金经营业绩	31,827,669.64	2,779,476.15
基金净收益	31,827,669.64	2,779,476.15
加:期初基金净收益	0.00	0.00
加:本期损益平准金	0.00	0.00
可供分配基金净收益	31,827,669.64	2,779,476.15
减:本期已分配基金净收益	31,827,669.64	2,779,476.15
未分配基金净收益	0.00	0.00

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年度	2005年12月12日(基金合同生效日)至2005年12月31日止期间
年/期初基金净值	1,707,390,092.45	3,601,835,236.63
本年/期经营活动		
基金净收益	0.00	0.00
未实现利得	0.00	0.00
经营活动产生的基金净值变动数	0.00	0.00
本年/期基金份额交易		
基金申购款	11,020,846,970.02	117,229,272.89
其中:分红再投资	31,827,669.64	2,779,476.15
基金赎回款	-12,299,806,630.96	-2,011,674,417.07
基金份额交易产生的基金净值变动数	1,278,959,660.94	1,894,445,144.18
本年/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	-31,827,669.64	-2,779,476.15
期末基金净值	428,430,431.51	1,707,390,092.45

第二节 年度会计报表附注(经审计)

一、本报告期对投资分离交易可转债以及获取的权证所采用的会计政策、会计估计的相关列示见本报告正文。

二、本报告期无重大会计差错和内容的更正金额。

三、关联方关系及关联方交易

(一)关联方关系: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(以下简称“长盛基金”)	基金管理人、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

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

(二)基金管理人报酬

支付基金管理人长盛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。

本基金在本年度需支付基金管理人报酬 5,469,374.49 元(2005 年:474,406.92 元)。

(三)基金托管费

支付基金托管人兴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。

本基金在本年度需支付基金托管费 1,657,386.23 元(2005 年:143,759.65 元)。

(四)基金销售服务费

支付基金销售机构的基金销售服务费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付给长盛基金管理有限公司,再由长盛基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为: 日基金销售服务费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

本基金在本年度需向关联方支付的基金销售服务费如下:

单位:人民币元

	2006年度	2005年12月12日(基金合同生效日)至2005年12月31日止期间
长盛基金(管理人)	2,613,246.22	160,289.80
兴业银行(托管人)	576,686.81	47,120.29
国元证券(管理人股东)	164,667.27	44,472.46
合计	3,354,600.30	251,882.55

(五)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保管,按银行同业利率计息。基金托管人于 2006 年 12 月 31 日保管的银行存款余额为 10,558,743.56 元(2005 年:12,891,439.37 元)。本年度由基金托管人保管的银行存款产生的利息收入为 2,225,190.90 元(2005 年:1,750,325.08 元)。

(六)与关联方通过银行间同业市场进行的债券交易

本基金在本年度与基金托管人兴业银行通过银行间同业市场进行的债券交易如下:

单位:人民币元

	2006年度	2005年12月12日(基金合同生效日)至2005年12月31日止期间
买入债券结算金额	414,840,894.98	0.00
卖出债券结算金额	485,844,101.15	0.00
卖出回购证券协议金额	974,740,000.00	0.00
卖出回购证券利息支出	534,280.90	0.00

四、报告期末流通受限制不能自由转让的基金资产

本基金截至 2006 年 12 月 31 日止从事银行间同业市场的债券回购交易形成的卖出回购证券款余额 99,000,000.00 元(2005 年:333,000,000.00 元),系以如下债券作为抵押:

债券代码	债券名称	回购到期日	年末摊余成本单价	数量	年末摊余成本总额
0601006	06央行票据 06	2007-1-9	99.69	1,000,000	99,685,023.86

第七章 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	496,115,185.83	93.98%
买入返售证券	20,000,000.00	3.79%
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	10,849,652.65	2.06%
其中:定期存款	0.00	0.00%
其他资产	941,748.72	0.17%
合计	527,906,587.20	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	95,245,070,000.00	15.39%
	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	99,000,000.00	23.11%
	其中:买断式回购融资	0.00	0.00%

注:(一)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。

(二)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 2006 年 2 月 8 日调整完毕
2	2006-1-25	24.66%	建仓期内	到 2006 年 2 月 8 日调整完毕
3	2006-1-26	24.66%	建仓期内	到 2006 年 2 月 8 日调整完毕
4	2006-1-27	24.66%	建仓期内	到 2006 年 2 月 8 日调整完毕
5	2006-1-28	24.66%	建仓期内	到 2006 年 2 月 8 日调整完毕
6	2006-1-29	24.66%	建仓期内	到 2006 年 2 月 8 日调整完毕
7	2006-1-30	24.66%	建仓期内	到 2006 年 2 月 8 日调整完毕
8	2006-1-31	24.66%	建仓期内	到 2006 年 2 月 8 日调整完毕
9	2006-2-1	24.66%	建仓期内	到 2006 年 2 月 8 日调整完毕
10	2006-2-2	24.66%	建仓期内	到 2006 年 2 月 8 日调整完毕
11	2006-2-3	24.65%	建仓期内	到 2006 年 2 月 8 日调整完毕
12	2006-2-4	24.65%	建仓期内	到 2006 年 2 月 8 日调整完毕
13	2006-2-5	24.65%	建仓期内	到 2006 年 2 月 8 日调整完毕
14	2006-2-6	24.67%	建仓期内	到 2006 年 2 月 8 日调整完毕
15	2006-2-7	21.56%	建仓期内	到 2006 年 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 2006 年 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 2006 年 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 2006 年 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 2006 年 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 2006 年 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 2006 年 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 2006 年 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 2006 年 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 2006 年 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 2006 年 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 2006 年 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 2006 年 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 2006 年 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 2006 年 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 2006 年 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 2006 年 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 2006 年 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 2006 年 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 2006 年 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 2006 年 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 2006 年 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 2006 年 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 2006 年 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 2006 年 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 2006 年 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 2006 年 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 2006 年 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 2006 年 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 2006 年 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 2006 年 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 2006 年 6 月 28 日调整完毕
47	2006-7-18	27.01%	大额赎回导致被动超标	到 2006 年 7 月 19 日调整完毕
48	2006-7-24	20.56%	大额赎回导致被动超标	到 2006 年 7 月 26 日调整完毕
49	2006-7-25	20.38%	大额赎回导致被动超标	到 2006 年 7 月 26 日调整完毕
50	2006-12-1	20.46%	大额赎回导致被动超标	到 2006 年 12 月 5 日调整完毕
51	2006-12-2	20.46%	大额赎回导致被动超标	到 2006 年 12 月 5 日调整完毕
52	2006-12-3	20.45%	大额赎回导致被动超标	到 2006 年 12 月 5 日调整完毕
53	2006-12-4	20.63%	大额赎回导致被动超标	到 2006 年 12 月 5 日调整完毕
54	2006-12-29	23.11%	大额赎回导致被动超标	到 2007 年 1 月 9 日调整完毕
55	2006-12-30	23.11%	大额赎回导致被动超标	到 2007 年 1 月 9 日调整完毕
56	2006-12-31	23.11%	大额赎回导致被动超标	到 2007 年 1 月 9 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	109
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	71

报告期内投资组合平均剩余期限超过 180 天情况

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 2006 年 1 月 16 日调整完毕
2	2006-1-2	223	建仓期内	到 2006 年 1 月 16 日调整完毕
3	2006-1-3	222	建仓期内	到 2006 年 1 月 16 日调整完毕
4	2006-1-4	215	建仓期内	到 2006 年 1 月 16 日调整完毕
5	2006-1-5	191	建仓期内	到 2006 年 1 月 16 日调整完毕
6	2006-1-6	224	建仓期内	到 2006 年 1 月 16 日调整完毕
7	2006-1-7	223	建仓期内	到 2006 年 1 月 16 日调整完毕
8	2006-1-8	222	建仓期内	到 2006 年 1 月 16 日调整完毕
9	2006-1-9	213	建仓期内	到 2006 年 1 月 16 日调整完毕
10	2006-1-10	203	建仓期内	到 2006 年 1 月 16 日调整完毕
11	2006-1-11	216	建仓期内	到 2006 年 1 月 16 日调整完毕
12	2006-1-12	206	建仓期内	到 2006 年 1 月 16 日调整完毕
13	2006-1-13	188	建仓期内	到 2006 年 1 月 16 日调整完毕
14	2006-1-14	188	建仓期内	到 2006 年 1 月 16 日调整完毕
15	2006-1-15	187	建仓期内	到 2006 年 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	7.20%	23.11%
2	30天(含)-60 天	58.16%	0.00%
	其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	9.32%	0.00%
3	60天(含)-90 天	20.91%	0.00%
	其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	9.29%	0.00%
4	90天(含)-180 天	2.30%	0.00%
5	180天(含)-397 天(含)	34.43%	0.00%
	合计	123.00%	23.11%

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	79,733,813.37	18.61%
	其中:政策性金融债	39,924,249.10	9.32%
3	央行票据	318,162,490.77	74.26%
4	企业债券	98,218,881.69	22.93%
5	其他	0.00	0.00%
合计		496,115,185.83	115.80%
剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券		79,733,813.37	18.61%

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央行票据 06	1,100,000	0.00	109,653,526.25	25.59%
2	06央行票据 08	1,000,000	0.00	99,591,183.62	23.25%
3	06央行票据 12	500,000	0.00	49,759,219.00	11.61%
4	06美丰 CP01	400,000	0.00	40,000,745.49	9.34%
5	06国开 08	400,000	0.00	39,924,249.10	9.32%
6	05工行 03	400,000	0.00	39,809,564.27	9.29%
7	06天士力 CP01	400,000	0.00	38,844,103.42	9.07%
8	06央行票据 46	300,000	0.00	29,593,454.18	6.91%
9	06央行票据 53	200,000	0.00	19,697,391.87	4.60%
10	06振华 CP01	200,000	0.00	19,374,032.78	4.52%

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	92
报告期内偏离度的最高值	0.6834%
报告期内偏离度的最低值	-0.0523%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.2215%

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超过日基金资产净值 20%的情况:

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
20	2006-7-3	22.86%	基金规模波动导致超标	到 7 月 4 日调整完毕
21	2006-7-20	20.44%	基金规模波动导致超标	到 7 月 24 日调整完毕
22	2006-7-21	20.55%	基金规模波动导致超标	到 7 月 24 日调整完毕
23	2006-7-22	20.55%	基金规模波动导致超标	到 7 月 24 日调整完毕
24	2006-7-23	20.55%	基金规模波动导致超标	到 7 月 24 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)报告期末其他资产构成

序号	其他资产	金额(人民币元)
1	应收利息	919,964.26
2	应收券商费用	21,619.50
3	待摊费用	164.96
合计		941,748.72

(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。

第八章 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)	5868
报告期末平均每户持有的基金份额(份)	73,011.32

二、报告期末基金份额持有人结构:

项目	数量	占总份额的比例
基金份额总额:	428,430,431.51	100.00%
其中:机构投资者持有的基金份额	209,373,951.88	48.87%
个人投资者持有的基金份额	219,056,479.63	51.13%

第九章 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	11,020,846,970.02
本报告期期间总赎回份额	12,299,806,630.96
本报告期期末基金份额总额	428,430,431.51

第十章 重大事件揭示

一、本基金在 2006 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、基金管理人、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动

(一)基金管理人高级管理人员的变更

根据本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。

经本公司第三届董事会第九次会议审议通过,本公司聘任宋炳山先生担任公司副总经理,宋炳山先生任职资格已报中国证监会核准(证监基金字【2006】208 号)。关于公司聘任公司副总经理的公告刊登于 2006 年 11 月 23 日《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及本公司网站。

(二)基金经理的变更

2006 年 11 月 29 日,本公司发布聘任刘静女士为本基金基金经理,与本基金现任基金经理王茜女士共同担任该基金基金经理的公告。公告刊登于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及本公司网站。

四、聘请会计师事务所情况

本基金报告期内未改聘会计师事务所。

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,报告年度未支付审计费。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 2 年。

五、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。

六、基金投资策略的改变情况

本基金本报告期内投资策略不曾改变。

七、2006 年 2 月 27 日,公司发布关于开放基金间转换业务的公告,决定于 2006 年 3 月 2 日起开放长盛货币市场基金(以下简称“长盛货币基金”)与长盛成长价值证券投资基金(以下简称“长盛成长价值基金”)之间的转换业务。公告刊登于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及本公司网站。

八、2006 年 8 月 16 日,本公司发布本基金关于资产支持证券投资方案的公告。公告刊登于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及本公司网站。

九、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>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,分别于 2006 年 6 月 9 日、2007 年 2 月 1 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分别于 2006 年 6 月 9 日、2007 年 2 月 1 日刊登在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》,同时本基金更新的招募说明书正文及摘要登载于公司的网站上。

十、本基金增加代销机构

(一)自 2006 年 3 月 2 日起,联合证券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。

(二)自 2006 年 12 月 8 日起,招商银行代理长盛货币市场基金(基金代码为:080011)的开户、申购和赎回等业务。公告刊登于 2006 年 12 月 6 日《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及本公司网站。

十一、基金收益分配事项

本基金本年度累计分配收益 31,827,669.64 元。各次分配情况详见以下公告

(一)2005 年 12 月 19 日,本公司发布本基金收益公告。

(二)2006 年 2 月 6 日,本公司发布本基金收益支付公告。

(三)2006 年 5 月 8 日,本公司发布本基金收益支付公告。

(四)2006 年 6 月 1 日,本公司发布本基金收益支付公告。

(五)2006 年 7 月 3 日,本公司发布本基金收益支付公告。

(六)2006 年 8 月 1 日,本公司发布本基金收益支付公告。

(七)2006 年 9 月 1 日,本公司发布本基金收益支付公告。

(八)2006 年 10 月 9 日,本公司发布本基金收益支付公告。

(九)2006 年 11 月 1 日,本公司发布本基金收益支付公告。

(十)2006 年 12 月 1 日,本公司发布本基金收益支付公告。

(十一)2007 年 1 月 4 日,本公司发布本基金收益支付公告。

上述公告已刊登于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及本公司网站。

十二、其他公告事项

(一)2005 年 12 月 15 日,本公司发布本基金关于开放日常申购、赎回业务的公告。

(二)2005 年 12 月 27 日,本公司发布本基金关于开通定期定额申购业务的公告。

(三)2006 年 1 月 18 日,本公司发布关于本基金春节放假前暂停申购的公告。

(四)2006 年 6 月 28 日,本公司发布了开通全国统一客户服务号码 400-888-2666 的公告。公告刊登于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及本公司网站。

(五)2006 年 7 月 15 日,本公司发布本基金影子定价偏离的临时公告。

(六)2006 年 7 月 20 日,本公司发布本基金影子定价偏离的临时公告。

(七)2006 年 7 月 22 日,本公司发布本基金影子定价偏离的临时公告。

(八)2006 年 8 月 2 日,本公司发布本基金影子定价偏离的临时公告。

(九)2006 年 8 月 10 日,本公司发布本基金影子定价偏离的临时公告。

(十)2006 年 9 月 26 日,本公司发布关于本基金“十一”放假前暂停申购和转入的公告。

(十一)2006 年 12 月 26 日, 本公司发布关于本基金元旦放假前暂停申购和转入的公告。

上述公告已刊登于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及本公司网站。

十三、(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	2,017,900,000.00	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

二〇〇七年三月二十九日