长盛添利30天理财债券型证券投资基金
2014年年度报告

2014年12月31日

基金管理人：长盛基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2015年3月28日

§1 重要提示及目录

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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2015 年 3 月 27 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。

本年度报告财务资料已经审计，普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告。

本报告期自 2014 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录.....2
1.1 重要提示.....2
1.2 目录.....3
§2 基金简介.....5
2.1 基金基本情况.....5
2.2 基金产品说明.....5
2.3 基金管理人和基金托管人.....5
2.4 信息披露方式.....6
2.5 其他相关资料.....6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况.....6
3.1 主要会计数据和财务指标.....6
3.2 基金净值表现.....7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....11
§4 管理人报告.....12
4.1 基金管理人及基金经理情况.....12
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....14
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.....15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....16
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....17
4.9 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.....17
§5 托管人报告.....18
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....18
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.....18
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....18
§6 审计报告.....18
6.1 审计报告基本信息.....18
6.2 审计报告的基本内容.....18
§7 年度财务报表.....19
7.1 资产负债表.....19
7.2 利润表.....21
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....22
7.4 报表附注.....23
§8 投资组合报告.....41
8.1 期末基金资产组合情况.....41
8.2 债券回购融资情况.....41
8.3 基金投资组合平均剩余期限.....41
8.4 期末按债券品种分类的债券投资组合.....42
8.5 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.....42
8.6 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离.....42
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....42

8.8 投资组合报告附注.....43
§9 基金份额持有人信息.....43
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....43
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....44
9.3 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.....44
§10 开放式基金份额变动.....44
§11 重大事件揭示.....45
11.1 基金份额持有人大会决议.....45
11.2 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.....45
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....45
11.4 基金投资策略的改变.....45
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....45
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....46
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....46
11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况.....48
11.9 其他重大事件.....48
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....50
§13 备查文件目录.....50
13.1 备查文件目录.....50
13.2 存放地点.....50
13.3 查阅方式.....50

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	长盛添利 30 天理财债券型证券投资基金	
基金简称	长盛添利 30 天理财债券	
基金主代码	080016	
交易代码	080016	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2012 年 10 月 26 日	
基金管理人	长盛基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	52,032,117.70 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称：	长盛添利 30 天理财债券 A	长盛添利 30 天理财债券 B
下属分级基金的交易代码：	080016	080017
报告期末下属分级基金的份额总额	11,843,938.71 份	40,188,178.99 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在追求本金稳妥的基础上，力争为基金份额持有人获取高于业绩比较基准的投资收益。
投资策略	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。
业绩比较基准	七天通知存款税后利率。
风险收益特征	本基金属于债券型证券投资基金，长期风险收益水平低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。

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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	叶金松	王永民
	联系电话	010-82019988	010-66594896
	电子邮箱	yejs@csfunds.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-888-2666、010-62350088	95566
传真		010-82255988	010-66594942
注册地址		深圳市福田中心区福中三路诺德金融中心主楼 10D	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址		北京市海淀区北太平庄路 18 号城建大厦 A 座 20-22 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码		100088	100818
法定代表人		高新	田国立

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.csfunds.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人的办公地址及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼
注册登记机构	长盛基金管理有限公司	北京市海淀区北太平庄路 18 号城建大厦 A 座 20-22 层

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2014 年		2013 年		2012 年 10 月 26 日(基金合同生效日)-2012 年 12 月 31 日	
	长盛添利 30 天理财债券 A	长盛添利 30 天理财债券 B	长盛添利 30 天理财债券 A	长盛添利 30 天理财债券 B	长盛添利 30 天理财债券 A	长盛添利 30 天理财债券 B
本期已实现收益	835,032.80	1,371,193.40	6,069,200.34	2,792,831.81	15,764,321.89	6,570,734.80
本期利润	835,032.80	1,371,193.40	6,069,200.34	2,792,831.81	15,764,321.89	6,570,734.80
本期净值收益率	3.4273%	3.6346%	3.3031%	3.2613%	0.6777%	0.7282%
3.1.2 期末数据和指标	2014 年末		2013 年末		2012 年末	
期末基金资产净值	11,843,938.71	40,188,178.99	29,842,546.48	60,534,384.86	839,030,058.12	294,015,604.04
期末基金份额净值	1.00	1.00	1.00	1.00	1.00	1.00
3.1.3 累计期末指标	2014 年末		2013 年末		2012 年末	
累计净值收益率	7.5678%	7.7937%	4.0033%	4.0132%	0.6777%	0.7282%

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，由于本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

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

长盛添利 30 天理财债券 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
过去三个月	0.7827%	0.0028%	0.3403%	0.0000%	0.4424%	0.0028%
过去六个月	1.5609%	0.0092%	0.6805%	0.0000%	0.8804%	0.0092%
过去一年	3.4273%	0.0071%	1.3500%	0.0000%	2.0773%	0.0071%
自基金合同生效起至今	7.5678%	0.0052%	2.9478%	0.0000%	4.6200%	0.0052%

长盛添利 30 天理财债券 B

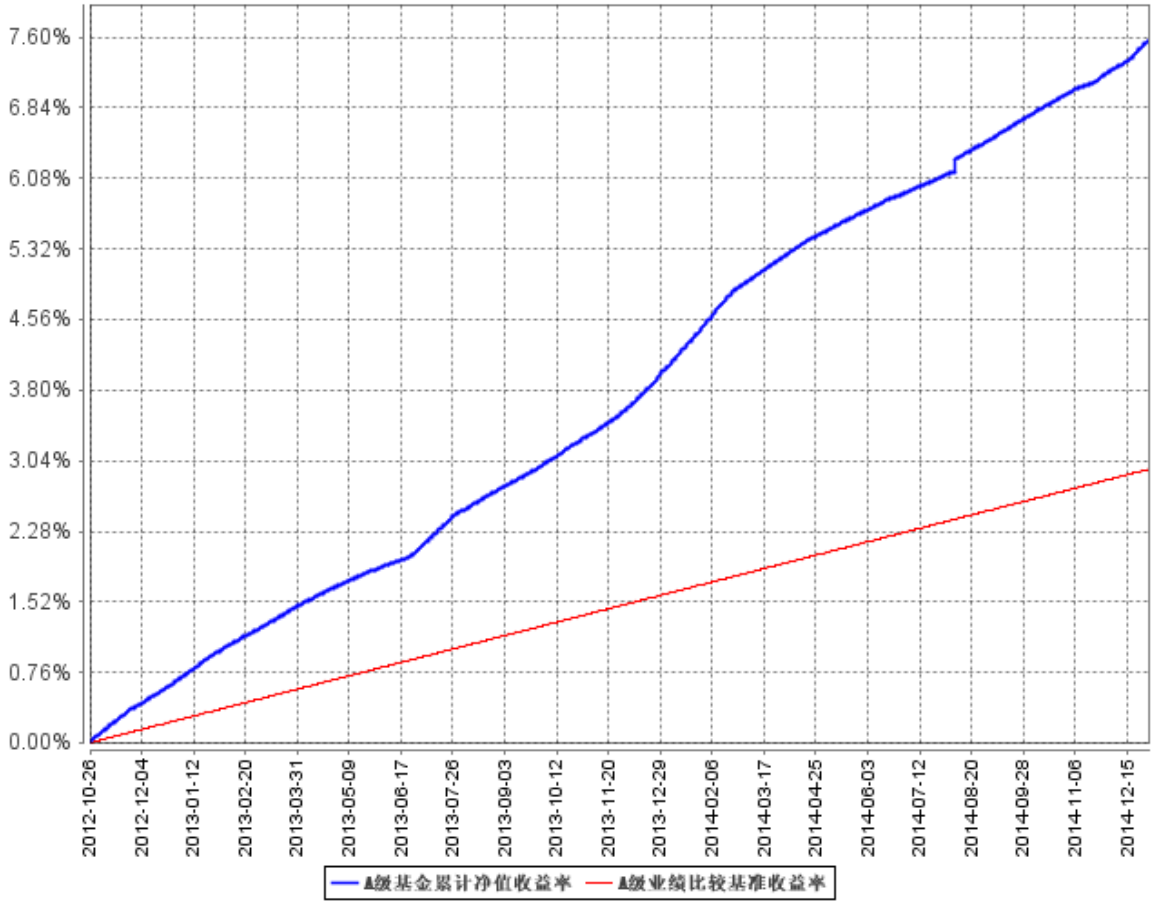
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	0.8422%	0.0028%	0.3403%	0.0000%	0.5019%	0.0028%
过去六个月	1.6713%	0.0093%	0.6805%	0.0000%	0.9908%	0.0093%
过去一年	3.6346%	0.0072%	1.3500%	0.0000%	2.2846%	0.0072%
自基金合同生效起至今	7.7937%	0.0053%	2.9478%	0.0000%	4.8459%	0.0053%

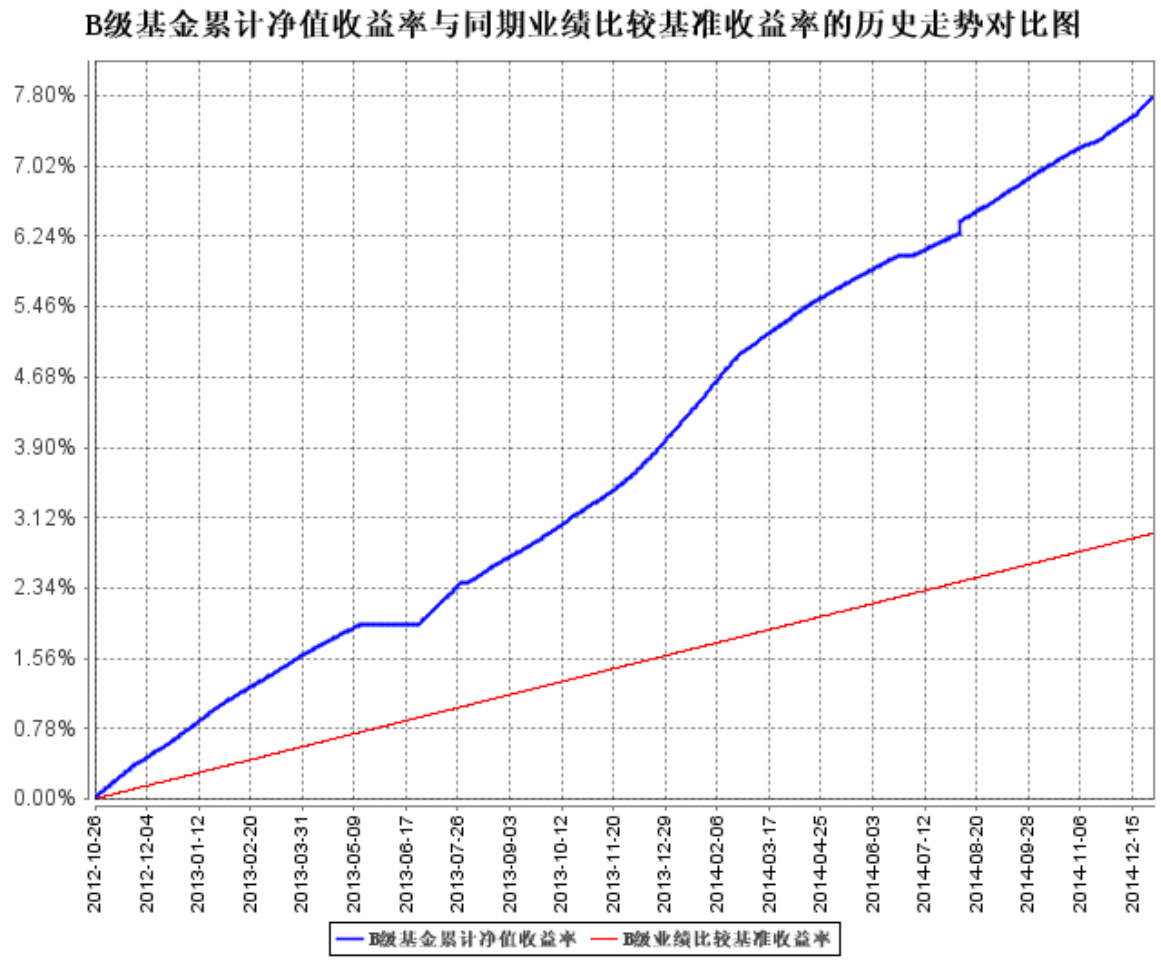
注：1、本基金收益分配是按日结转份额。

2、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七天通知存款税后利率。通知存款是一种不约定存期，支取时需提前通知银行，约定支取日期和金额方能支取的存款，具有存期灵活、存取方便的特征，同时可获得高于活期存款利息的收益。本基金为短期理财型基金产品，风险收益水平低，是储蓄存款的良好投资替代工具，所以以七天通知存款税后利率作为业绩比较基准。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

A级基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

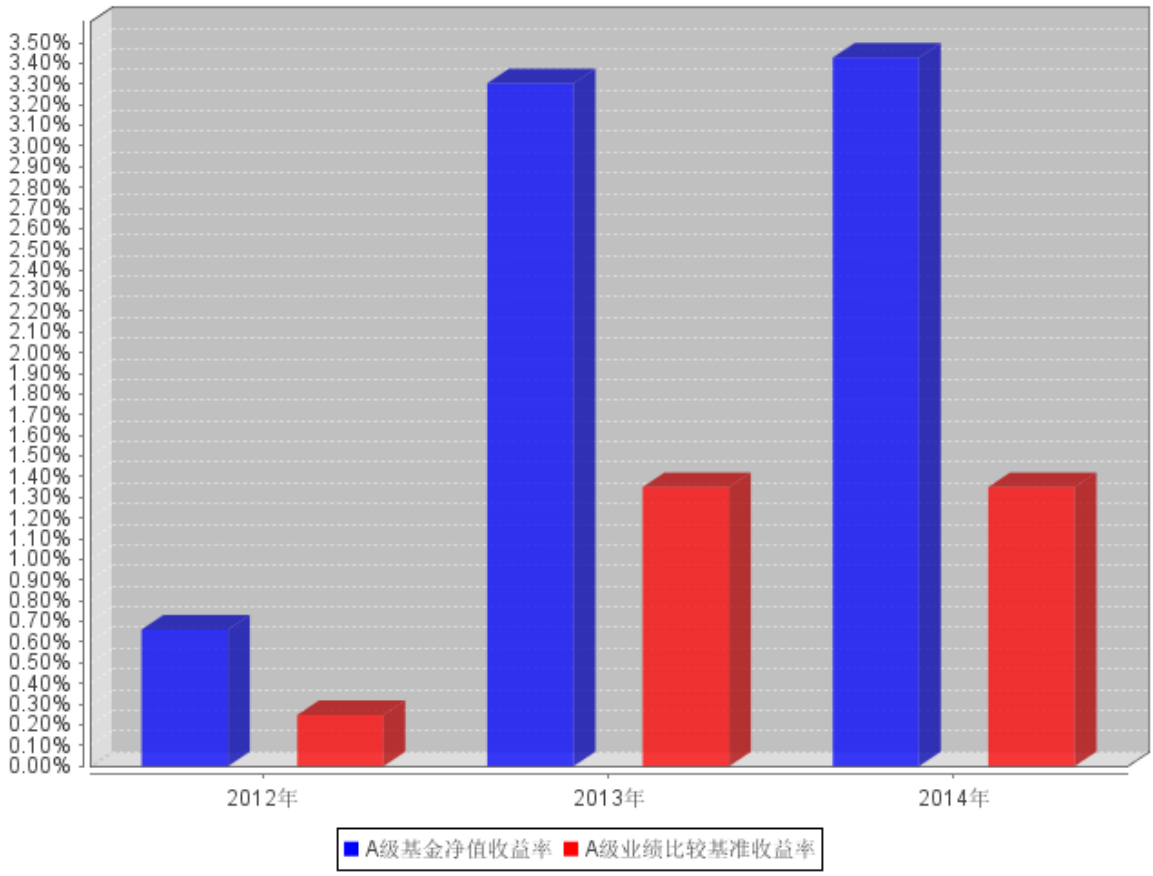




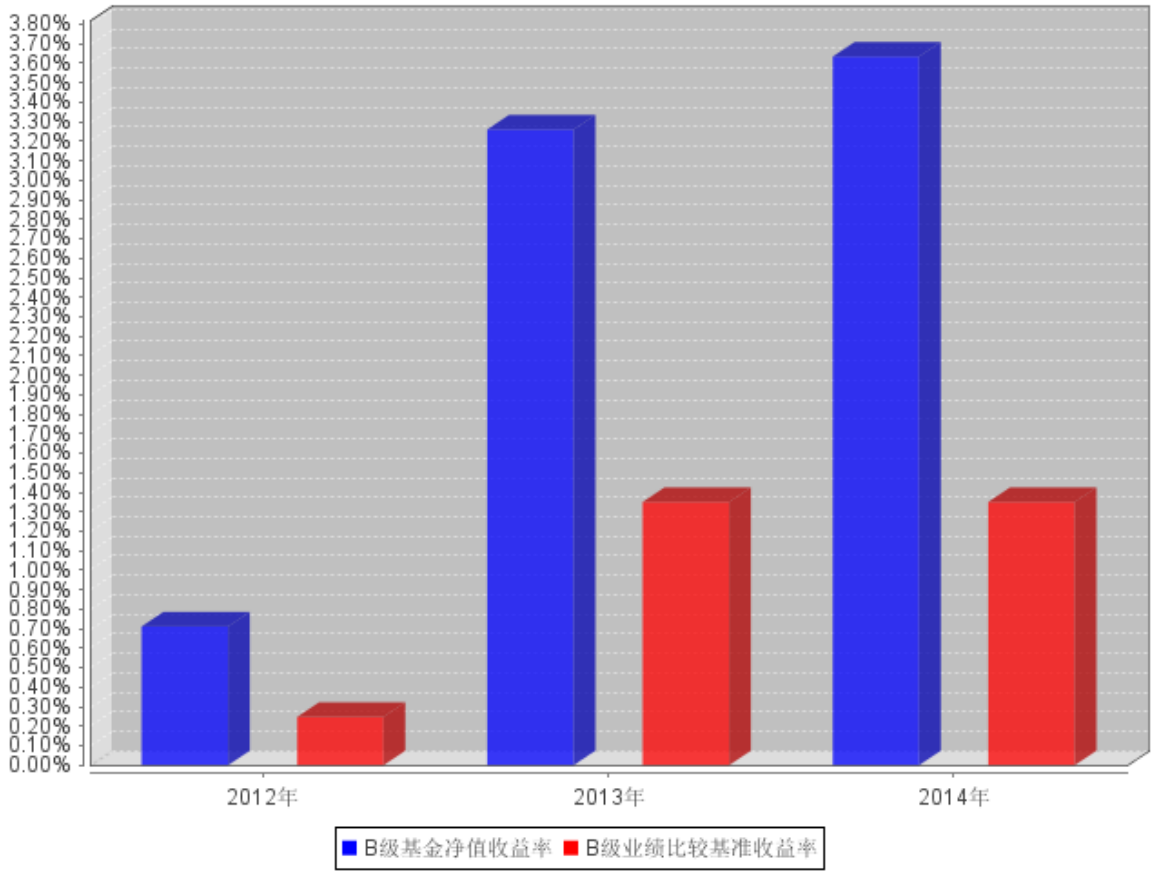
注：按照本基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起三个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。截止报告日，本基金的各项资产配置比例符合本基金合同第十四条（二）投资范围、（七）投资禁止行为与限制的有关约定。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

A级自基金合同生效以来基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



B级自基金合同生效以来基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金基金合同于 2012 年 10 月 26 日生效，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

长盛添利 30 天理财债券 A					
年度	已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	年度利润分配合计	备注
2014年	835,032.80	-	-	835,032.80	注：本基金每日进行收益计算并分配，并在运作期末集中支付。
2013年	6,069,200.34	-	-	6,069,200.34	注：本基金每日进行收益计算并分配，并在运作期末集中支付。
2012年	15,764,321.89	-	-	15,764,321.89	注：本基金每日进行收益计算并分配，并在运作期末集中支付。
合计	22,668,555.03	-	-	22,668,555.03	

单位：人民币元

长盛添利 30 天理财债券 B					
年度	已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	年度利润分配合计	备注
2014年	1,371,193.40	-	-	1,371,193.40	注：本基金每日进行收益计算并分配，并在运作期末集中支付。
2013年	2,792,831.81	-	-	2,792,831.81	注：本基金每日进行收益计算并分配，并在运作期末集中支付。
2012年	6,570,734.80	-	-	6,570,734.80	注：本基金每日进行收益计算并分配，并在运作期末集中支付。
合计	10,734,760.01	-	-	10,734,760.01	

§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、郑州、杭州、成都设有分公司，在香港、北京分别设有子公司。目前，公司股东及其出资比例为：国元证券股份有限公司（以下简称“国元证券”）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和特定客户资产管理业务资格。截至 2014 年 12 月 31 日，基金管理人共管理三十七只开放式基金，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，长盛货币市场基	2014 年 4 月 10 日	-	7 年	男，1982 年 12 月出生，中国国籍。中央财经大学经

	金基金经理，长盛添利60 天理财债券型发起式证券投资基金基金经理，长盛年年收益定期开放债券型证券投资基金基金经理。				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，现任长盛货币市场基金基金经理，长盛添利 30 天理财债券型证券投资基金（本基金）基金经理，长盛添利 60 天理财债券型发起式证券投资基金基金经理，长盛年年收益定期开放债券型证券投资基金基金经理。
杨衡	本基金基金经理，长盛添利 60 天理财债券型发起式证券投资基金基金经理，长盛同丰分级债券型证券投资基金基金经理，长盛纯债债券型证券投资基金基金经理，社保组合组合经理。	2012 年 10 月 26 日	2014 年 4 月 10 日	7 年	男，1975 年 10 月出生，中国国籍。中国科学院数学与系统科学研究院博士、博士后。2007 年 7 月进入长盛基金管理公司，先后任固定收益研究员、社保组合组合经理助理等职务，现任社保组合组合经理。自 2014 年 4 月 10 日起不再担任长盛添利30 天理财债券型证券投资基金（本基金）基金经理，长盛添利60 天理财债券型发起式证券投资基金基金经理，长盛同丰分级债

					券型证券投资基金基金经理，长盛纯债债券型证券投资基金基金经理。

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 公平交易制度和控制方法

本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司相关制度等规定，从投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等环节严格把关，通过系统和人工等方式在各个环节严格控制交易公平执行，确保公平对待不同投资组合，包括公募基金、社保组合、特定客户资产管理组合等，切实防范利益输送，保护投资者的合法权益。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。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

公司对该基金过去 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。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未发生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

1、报告期内行情回顾

回顾 2014 年，经济增速有所下滑，通胀水平总体呈下降走势，定向放松的货币政策及相对宽松的资金面驱动市场利率中枢持续下行，债券市场走出一波较强的趋势性牛市行情。利率债方面，收益率曲线整体下行，10 年期国债收益率下行 93BP 至 3.62%，10 年期国开行债收益率大幅下行 173BP 至 4.09%；信用债方面，低评级债券收益率下行幅度小于中高评级债券，主要是受信用风险事件频发及交易所债券质押回购规则变动等因素影响所致。

货币市场方面，2014 年资金面总体呈现相对宽松格局。一季度受春节因素影响，资金利率呈现先升后降走势；4 月份开始，央行通过定向降准降息、MLF、PSL 等多种工具向市场投放资金，资金面相对宽松，各中短期限 Shibor 利率及银行间质押式回购利率总体处于相对低位；其中，7 月和 11 月银行间资金利率小幅上行，但央行后续均投放资金平抑资金利率波动；十二月中旬以来，随着年末资金需求高峰来临，银行收紧流动性，同时受央行公开市场延续空窗操作及新一轮 IPO 等因素影响，货币市场各中短期资金利率呈现阶段性上升局面。

2、报告期内本基金投资策略分析

在报告期内，依据本基金自身规模较小的特点，坚持到期匹配策略，以协议存款配置为主，同时辅助交易所回购，争取在保证组合流动性需要的同时抓住市场波动的机会，尽可能提高组合静态收益，最大程度克服由于固定成本占比较高对组合的影响。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2014 年本基金 A 级净值收益率为 3.4273%，B 级净值收益率为 3.6346%，同期业绩比较基准收益率 1.3500%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在深化改革和调整经济结构的背景下，政府对经济增长容忍度有所提高，国内经济的潜在

增长率不断下降，2015年预计中国经济将维持相对疲弱的态势。12月中国PMI连续下滑至50.1%的年内低值，制造业新订单和产出指数双双走弱，反映制造业景气度持续弱化，经济下行压力依然存在。通胀方面，12月CPI同比上涨1.5%，通胀延续弱势。房地产投资增速继续下降，未来房地产销售仍面临较大不确定性。在经济仍面临较大下行压力的背景下，货币政策有望进一步宽松。

在后期投资策略上，继续坚持到期匹配策略，在保证组合流动性安全的前提下，尽可能提高组合收益。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人在内部监察工作中一切从合规运作，保障资产委托人利益出发，由独立于各业务部门的监察稽核部对公司经营、受托资产运作及员工行为的合规性进行监督、检查，发现问题及时敦促有关部门改进、完善，并定期制作监察报告报公司管理层。工作内容具体如下：

1、强调合规培训，夯实公司合规文化环境基础。报告期内，监察稽核部通过外请律师、内部自学、岗前培训等多种方式，有重点、有针对性地展开合规培训工作，强化员工合规理念，深化员工合规意识，努力夯实公司合规内控环境基础。

2、强调制度/流程建设，扎实公司内控制度建设。根据新法规、新监管要求，以及公司业务发展实际，及时推动公司各部门补充、修订、完善、优化各项业务制度与流程，保证公司制度/流程的合法合规、全面、适时、有效。

3、加强合规监督，确保受托资产投资运作合法合规。紧密跟踪与投资运作相关的法律、法规、受托资产合同及公司制度等的规定，全面把控受托资产投资运作风险点，并以前述风险点为依据，检查、监督各受托资产投资运作合规情况。根据《公司公平交易细则》规定，通过量化分析、日常合规监督及事后专项检查评估等，确保公司旗下各受托资产被公平对待。

4、加强专项稽核与检查，确保制度/流程严肃性与执行力。报告期内，监察稽核部按照年初工作计划，开展专项稽核工作，内容涵盖受托资产投资、研究、交易、销售、清算、登记注册、产品开发等等；并根据业务发展需要，以及日常监督中发现问题，临时增加多个检查项目。稽核、检查工作中，监察稽核部重视对发现问题改进完成情况的跟踪，强调问题改进效率与效果，以保障公司制度/流程的严肃性与执行力。

5、加强员工行为合规的检查监督。报告期内，监察稽核部借助信息技术系统，通过完善员工投资报备系统、建设员工合规档案系统等，提高员工行为合规管理水平，督促员工自觉合规。

本基金管理人承诺：在今后的工作中，我们将继续以保障资产委托人的利益为宗旨，不断

提高内部监察工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，保障公司、受托资产合规运作。

4.7 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（担任估值小组组长）、公司副总经理和督察长（担任估值小组副组长）、权益投资部、风险管理部、研究部、监察稽核部、业务运营部等部门负责人组成的基金估值小组，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并出具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司签署服务协议，由其按约定提供在银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《证券投资基金运作管理办法》的规定以及本基金基金合同第十九条中对基金利润分配原则的约定，本基金每日进行收益计算并分配，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，并在运作期期末集中支付，使基金账面份额净值始终保持1.00元。同时本基金各类基金份额对应的可供分配收益将有所不同，同一类别的每份基金份额享有同等分配权。

按照上述办法及基金合同的规定，2014年度分配利润2,206,226.20元，其中：A类别份额分配利润835,032.80元，B类别份额分配利润1,371,193.40元。

4.9 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

本基金自 2014 年 9 月 29 日至 2014 年 11 月 18 日期间出现连续 20 个工作日基金资产净值低于 5000 万元的情形。

§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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对长盛添利 30 天理财债券型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《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有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《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，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2015)第 20193 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	长盛添利 30 天理财债券型证券投资基金 全体基金份额持有人：
引言段	我们审计了后附的 长盛添利 30 天理财债券型证券投资基金

	的财务报表，包括 2014 年 12 月 31 日的资产负债表、2014 年度 的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是 长盛添利 30 天理财债券型证券投资基金的基金管理人 长盛基金管理有限公司 管理层的责任。这种责任包括： (1)按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)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，并使其实现公允反映； (2)设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。
注册会计师的责任段	我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。 审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。 我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
审计意见段	我们认为，上述 长盛添利 30 天理财债券型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了 长盛添利 30 天理财债券型证券投资基金 2014 年 12 月 31 日的财务状况以及 2014 年度经营成果和基金净值变动情况。
注册会计师的姓名	汪棣　　沈兆杰
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
会计师事务所的地址	中国 上海市
审计报告日期	2015 年 3 月 23 日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：长盛添利 30 天理财债券型证券投资基金

报告截止日： 2014 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2014年12月31日	上年度末 2013年12月31日
资 产：			
银行存款	7.4.7.1	47,272,848.86	57,817,306.94
结算备付金		232,500.00	413,809.52
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	-	20,000,417.28
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		-	20,000,417.28
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	4,500,000.00	12,200,134.25
应收证券清算款		100,151.48	-
应收利息	7.4.7.5	124,821.94	773,977.20
应收股利		-	-
应收申购款		101,000.00	32,000.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		52,331,322.28	91,237,645.19
负债和所有者权益	**附注号**	**本期末 2014年12月31日**	**上年度末 2013年12月31日**
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	499,297.67
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		12,531.72	16,859.73
应付托管费		3,713.07	4,995.50
应付销售服务费		3,502.29	8,069.79
应付交易费用	7.4.7.7	457.50	2,491.16
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	279,000.00	329,000.00
负债合计		299,204.58	860,713.85
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	52,032,117.70	90,376,931.34
未分配利润	7.4.7.10	-	-
所有者权益合计		52,032,117.70	90,376,931.34

负债和所有者权益总计		52,331,322.28	91,237,645.19

注：报告截止日2014年12月31日，基金份额总额52,032,117.70份，其中A类基金份额总额11,843,938.71份，基金份额净值1.00元；B类基金份额总额40,188,178.99份，基金份额净值1.00元。

7.2 利润表

会计主体：长盛添利30天理财债券型证券投资基金

本报告期：2014年1月1日至2014年12月31日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2014年1月1日至 2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至 2013年12月31日
一、收入		2,835,850.83	11,284,540.10
1.利息收入		2,835,092.22	11,297,542.57
其中：存款利息收入	7.4.7.11	2,211,197.01	8,079,714.93
债券利息收入		145,450.98	2,560,396.24
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		478,444.23	657,431.40
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		758.61	-357,002.47
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	758.61	-357,002.47
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-	-
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-	344,000.00
减：二、费用		629,624.63	2,422,507.95
1．管理人报酬	7.4.10.2.1	156,298.36	733,705.49
2．托管费	7.4.10.2.2	46,310.60	217,394.28
3．销售服务费	7.4.10.2.3	66,380.08	547,211.54
4．交易费用	7.4.7.18	-	-
5．利息支出		1,420.06	548,579.90
其中：卖出回购金融资产支出		1,420.06	548,579.90

6．其他费用	7.4.7.19	359,215.53	375,616.74
三、利润总额 （亏损总额以“-”号填列）		2,206,226.20	8,862,032.15
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		2,206,226.20	8,862,032.15

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长盛添利 30 天理财债券型证券投资基金

本报告期：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 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）	90,376,931.34	-	90,376,931.34
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	2,206,226.20	2,206,226.20
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）	-38,344,813.64	-	-38,344,813.64
其中：1.基金申购款	280,698,741.54	-	280,698,741.54
2.基金赎回款	-319,043,555.18	-	-319,043,555.18
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）	-	-2,206,226.20	-2,206,226.20
五、期末所有者权益（基金净值）	52,032,117.70	-	52,032,117.70
项目	**上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 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）	1,133,045,662.16	-	1,133,045,662.16
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	8,862,032.15	8,862,032.15
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）	-1,042,668,730.82	-	-1,042,668,730.82

其中：1.基金申购款	250,146,691.56	-	250,146,691.56
2.基金赎回款	-1,292,815,422.38	-	-1,292,815,422.38
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）	-	-8,862,032.15	-8,862,032.15
五、期末所有者权益（基金净值）	90,376,931.34	-	90,376,931.34

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

周兵	林培富	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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

长盛添利30天理财债券型证券投资基金(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”)证监许可[2012]1343号《关于核准长盛添利30天理财债券型证券投资基金募集的批复》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《长盛添利30天理财债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型定期开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集4,138,323,703.82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(2012)第415号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《长盛添利30天理财债券型证券投资基金基金合同》于2012年10月26日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为4,138,676,687.06份基金份额，其中认购资金利息折合352,983.24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，基金托管人为中国银行股份有限公司。

本基金根据投资者持有本基金的份额数量不同，对投资者持有的基金份额按照不同的费率计提销售服务费用，因此形成A类和B类两类基金份额，两类基金份额分别设置基金代码，并单独公布每万份基金净收益和7日年化收益率。本基金每份基金份额自基金合同生效日或申购确认日起每一个月为一个运作期，运作期到期日前不得赎回。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《长盛添利30天理财债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为现金、通知存款、一年以内(含一年)的银行定期存款和大额存单、剩余期限(或回售期限)在397天以内(含397天)的债券、资产支持证券、中期票据、期限在一年以内(含一年)的债券回购、期限在一年以内(含一年)的中央银行票据、短期融资券及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他固定收益类金融工具。本基金的业绩比较基准为：七

天通知存款税后利率。

本财务报表由本基金的基金管理人长盛基金管理有限公司于 2015 年 3 月 23 日批准报出。

7.4.2 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颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《长盛添利 30 天理财债券型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2014 年度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 2014 年 12 月 31 日的财务状况以及 2014 年度经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1)金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2)金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。对于取得债券投资支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

债券投资按票面利率或商定利率每日计提应收利息，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；同时于每一计价日计算影子价格，以避免债券投资的账面价值与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离。对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

为了避免债券投资的账面价值与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离，从而对基金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债券投资的公允价值计算影子价格。当基金资产净值与影子价格的偏离达到或超过基金资产净值的 0.25%时，基金管理人应根据风险控制的需要调整组合，使基金资产净值更能公允地反映基金资产价值。

计算影子价格时按如下原则确定债券投资的公允价值：

(1)存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2)存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3)当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2)交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额。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。上述申购和赎回包括因类别调整而引起的 A、B 类基金份额之间的转换所产生的实收基金变动。

7.4.4.8 收入/(损失)的确认和计量

债券投资在持有期间按实际利率计算确定的金额扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

债券投资处置时其处置价格扣除相关交易费用后的净额与账面价值之间的差额确认为投资收益。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.9 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。申购的基金份额享有确认当日的分红权益，而赎回的基金份额不享有确认当日的分红权益。本基金以份额面值 1.00 元固定份额净值交易方式，每日计算当

日收益并以红利再投资形式每日全部按份额面值 1.00 元分配结转至实收基金科目。每个运作期到期日集中将该运作期收益结转到投资人基金账户。

7.4.4.11 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金计算影子价格过程中确定债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21 号《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

财政部于 2014 年颁布《企业会计准则第 39 号——公允价值计量》、《企业会计准则第 40 号——合营安排》、《企业会计准则第 41 号——在其他主体中权益的披露》和修订后的《企业会计准则第 2 号——长期股权投资》、《企业会计准则第 9 号——职工薪酬》、《企业会计准则第 30 号——财务报表列报》、《企业会计准则第 33 号——合并财务报表》以及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》，要求除《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》自 2014 年度财务报表起施行外，其他准则自 2014 年 7 月 1 日起施行。上述准则对本基金本报告期无重大影响。

7.4.5.2 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。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期无须说明的会计差错更正。

7.4.6 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[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)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。基金买卖债券的差价收入不予征收营业税。

(2)对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入，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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 12 月 31 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
活期存款	2,772,848.86	917,306.94
定期存款	44,500,000.00	56,900,000.00
其中：存款期限 1-3 个月	37,500,000.00	20,400,000.00
其中：存款期限 1 个月以内	7,000,000.00	36,500,000.00
其他存款	-	-
合计：	47,272,848.86	57,817,306.94

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2014 年 12 月 31 日			
		摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
项目		上年度末 2013 年 12 月 31 日			
		摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度

债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	20,000,417.28	19,998,000.00	-2,417.28	-0.0027%
	合计	20,000,417.28	19,998,000.00	-2,417.28	-0.0027%

注：1、偏离金额＝影子定价－摊余成本；

2、偏离度＝偏离金额/摊余成本法确定的基金资产净值。

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券_交易所	4,500,000.00	-
买入返售证券_银行间	-	-
合计	4,500,000.00	-
项目	上年度末 2013 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券_交易所	2,700,000.00	-
买入返售证券_银行间	9,500,134.25	-
合计	12,200,134.25	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本期末及上年度末未持有因买断式逆回购而取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 12 月 31 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	809.46	166.68
应收定期存款利息	117,912.26	102,415.99
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	115.06	204.82
应收债券利息	-	647,627.40
应收买入返售证券利息	5,985.16	23,561.67
应收申购款利息	-	0.64
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	-	-

合计	124,821.94	773,977.20

7.4.7.6 其他资产

注：本基金本期末及上年度末未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 12 月 31 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	-	-
银行间市场应付交易费用	457.50	2,491.16
合计	457.50	2,491.16

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 12 月 31 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
应付赎回费	-	-
预提费用	279,000.00	329,000.00
合计	279,000.00	329,000.00

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

长盛添利 30 天理财债券 A		
项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	29,842,546.48	29,842,546.48
本期申购	39,327,548.14	39,327,548.14
本期赎回(以"-"号填列)	-57,326,155.91	-57,326,155.91
本期末	11,843,938.71	11,843,938.71

金额单位：人民币元

长盛添利 30 天理财债券 B		
项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	60,534,384.86	60,534,384.86
本期申购	241,371,193.40	241,371,193.40
本期赎回(以"-"号填列)	-261,717,399.27	-261,717,399.27
本期末	40,188,178.99	40,188,178.99

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。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

长盛添利 30 天理财债券 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	835,032.80	-	835,032.80
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-835,032.80	-	-835,032.80
本期末	-	-	-

单位：人民币元

长盛添利 30 天理财债券 B			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	1,371,193.40	-	1,371,193.40
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-1,371,193.40	-	-1,371,193.40
本期末	-	-	-

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	12,860.22	26,849.07
定期存款利息收入	2,194,246.44	8,044,855.57
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	3,468.35	5,787.06
其他	622.00	2,223.23
合计	2,211,197.01	8,079,714.93

7.4.7.12 股票投资收益

注：本基金本期及上年度可比期间未取得股票投资收益。

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至 2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年 12月31日
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	758.61	-357,002.47
合计	758.61	-357,002.47

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至 2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年 12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	35,170,186.61	243,451,842.12
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	34,007,620.89	239,939,477.47
减：应收利息总额	1,161,807.11	3,869,367.12
买卖债券差价收入	758.61	-357,002.47

7.4.7.14 衍生工具收益

注：本基金本期及上年度可比期间未取得衍生工具收益。

7.4.7.15 股利收益

注：本基金本期及上年度可比期间未取得股利收益。

7.4.7.16 公允价值变动收益

注：本基金本期及上年度可比期间未取得公允价值变动收益。

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日
其他	-	344,000.00
合计	-	344,000.00

7.4.7.18 交易费用

注：本基金本期及上年度可比期间未产生交易费用。

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日
审计费用	46,000.00	50,000.00
信息披露费	270,000.00	270,000.00
其他	400.00	400.00
银行汇划费	17,315.53	35,716.74
银行间账户维护费（上清所）	7,500.00	-
银行间账户维护费（中债）	18,000.00	19,500.00
合计	359,215.53	375,616.74

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

根据本基金的基金管理人长盛基金管理有限公司于 2015 年 3 月 6 日发布的《关于以通讯开会方式召开长盛添利 30 天理财债券型证券投资基金基金份额持有人大会的公告》，决定以通讯开会方式召开本基金的基金份额持有人大会。自 2015 年 3 月 12 日起至 2015 年 4 月 10 日 17:00 止，针对《关于终止长盛添利 30 天理财债券型证券投资基金基金合同有关事项的议案》进行投票表决。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
长盛基金管理有限公司(“长盛基金公司”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	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
新加坡星展银行有限公司	基金管理人的股东
安徽省信用担保集团有限公司	基金管理人的股东
安徽省投资集团控股有限公司	基金管理人的股东
长盛基金(香港)有限公司	基金管理人的全资子公司
长盛创富资产管理有限公司	基金管理人的全资子公司

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

注：本基金本期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行交易。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	156,298.36	733,705.49
其中：支付销售机构的客户维护费	33,364.89	247,175.42

注：支付基金管理人　长盛基金公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.27%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×0.27% / 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	46,310.60	217,394.28

注：支付基金托管人　中国银行　的托管费按前一日基金资产净值 0.08%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×0.08% / 当年天数。

7.4.10.2.3 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 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	长盛添利 30 天理财债券 A	长盛添利 30 天理财债券 B	合计
中国银行	57,970.32	538.23	58,508.55
长盛基金公司	252.20	2,949.74	3,201.94
国元证券	25.76	-	25.76
合计	58,248.28	3,487.97	61,736.25
获得销售服务费的	上年度可比期间		

各关联方名称	2013年1月1日至2013年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	长盛添利30天理财债券A	长盛添利30天理财债券B	合计
中国银行	529,254.38	1,224.87	530,479.25
长盛基金公司	781.13	6,478.35	7,259.48
国元证券	44.20	-	44.20
合计	530,079.71	7,703.22	537,782.93

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 长盛基金公司，再由 长盛基金公司 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0.28%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×约定年费率/当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期 2014年1月1日至2014年12月31日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国银行	-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国银行	-	30,430,188.49	-	-	48,975,000.00	9,836.31

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金基金管理人本期及上年度可比期间未运用固有资金投资本基金。

7.4.10.4.2 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

注：除基金管理人之外的其他关联方本期末及上年度末未投资本基金。

7.4.10.5 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 2014年1月1日至2014年12月31日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	2,772,848.86	56,655.78	917,306.94	123,965.69

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率/约定利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本期及上年度可比期间无其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

7.4.11.1 利润分配情况——货币市场基金

金额单位：人民币元

长盛添利30天理财债券A

已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	本期利润分配合计	备注
835,032.80	-	-	835,032.80	-

长盛添利30天理财债券B

已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	本期利润分配合计	备注
1,371,193.40	-	-	1,371,193.40	-

7.4.12 期末（ 2014 年 12 月 31 日 ）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金本期末无因认购新发/增发证券而持有的流通受限证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本期末无暂时停牌等流通受限的股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本期末无银行间市场债券正回购中作为抵押的债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本期末无交易所市场债券正回购中作为抵押的债券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金属于债券型证券投资基金，长期风险收益水平低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范

围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“低风险、高流动性和持续稳定收益”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，在董事会下设立风险控制管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部与风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。

本基金的基金管理人建立了以风险控制管理委员会为核心的、由风险控制管理委员会、风险控制委员会、监察稽核部与风险管理部、相关业务部门构成的四级风险管理架构体系。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本公司在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款和部分定期存款存放在本基金的托管行中国银行，其他定期存款存放在具有基金托管资格的上海银行股份有限公司、兴业银行股份有限公司、中国民生银行股份有限公司以及中信银行股份有限公司，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，不投资于短期信用评级在 A-1 级以下或长期信用评级在 AAA 级以下的债券。本基金在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险；在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险。信用等级评估以内部信用评级为主，外部信用评级为辅。内部债券信用评级主要考察发行人的经营风险、财务风险和流动性风险，以及信用产品的条款和担保人的情况等。此外，本基金的基金管理人根据信用产品的内部评级，通过单只信用产品投资占基金资产净值的比例及占发行量的比例进行控制，通过分散化投资以分散信用风险。于 2014 年 12 月 31 日，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券(2013 年 12 月 31 日：同)。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人要求于运作期到期日赎回其持有的基金份额，另一方面来自于

投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人主要通过限制、跟踪和控制基金投资交易的不活跃品种(企业债或短期融资券)来实现。本基金投资于投资于同一公司发行的短期企业债券及短期融资券的比例，合计不得超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金能够通过出售所持有的银行间同业市场交易债券应对流动性需求。此外本基金还可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，除发生巨额赎回情形外，银行间同业市场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 40%。

于 2014 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。本基金的基金管理人每日通过“影子定价”对本基金面临的市场风险进行监控，定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2014 年 12 月 31 日	6 个月以内	6 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

资产						
银行存款	47,272,848.86	-	-	-	-	47,272,848.86
结算备付金	232,500.00	-	-	-	-	232,500.00
买入返售金融资产	4,500,000.00	-	-	-	-	4,500,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	100,151.48	100,151.48
应收利息	-	-	-	-	124,821.94	124,821.94
应收申购款	-	-	-	-	101,000.00	101,000.00
其他资产	-	-	-	-	-	-
资产总计	52,005,348.86	-	-	-	325,973.42	52,331,322.28
负债						
应付管理人报酬	-	-	-	-	12,531.72	12,531.72
应付托管费	-	-	-	-	3,713.07	3,713.07
应付销售服务费	-	-	-	-	3,502.29	3,502.29
应付交易费用	-	-	-	-	457.50	457.50
其他负债	-	-	-	-	279,000.00	279,000.00
负债总计	-	-	-	-	299,204.58	299,204.58
利率敏感度缺口	52,005,348.86	-	-	-	26,768.84	52,032,117.70
上年度末 2013 年 12 月 31 日	6 个月以内	6 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产						
银行存款	57,817,306.94	-	-	-	-	57,817,306.94
结算备付金	413,809.52	-	-	-	-	413,809.52
交易性金融资产	20,000,417.28	-	-	-	-	20,000,417.28
买入返售金融资产	12,200,134.25	-	-	-	-	12,200,134.25
应收利息	-	-	-	-	773,977.20	773,977.20
应收申购款	32,000.00	-	-	-	-	32,000.00
资产总计	90,463,667.99	-	-	-	773,977.20	91,237,645.19
负债						
应付证券清算款	-	-	-	-	499,297.67	499,297.67
应付管理人报酬	-	-	-	-	16,859.73	16,859.73
应付托管费	-	-	-	-	4,995.50	4,995.50
应付销售服务费	-	-	-	-	8,069.79	8,069.79
应付交易费用	-	-	-	-	2,491.16	2,491.16
其他负债	-	-	-	-	329,000.00	329,000.00
负债总计	-	-	-	-	860,713.85	860,713.85
利率敏感度缺口	90,463,667.99	-	-	-	-86,736.65	90,376,931.34

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（ 2014 年 12 月 31 日 ）	上年度末（ 2013 年 12 月 31 日 ）
	市场利率下降 25 个基点	-	30,137.64
	市场利率上升 25 个基点	-	-30,137.64

注：债券资产余额小于资产净值 20%，市场价格因素影响不重大。

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

7.4.14 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 2014 年 12 月 31 日，本基金未持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产(2013 年 12 月 31 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 20,000,417.28 元，无属于第一层次或第三层次的余额)。

(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2014年12月31日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2013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。

§8 投资组合报告

8.1 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	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	4,500,000.00	8.60
	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	47,505,348.86	90.78
4	其他各项资产	325,973.42	0.62
5	合计	52,331,322.28	100.00

注：本报告期内，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且没有利息损失的存款。

8.2 债券回购融资情况

金额单位:人民币元

序号	项目	占基金资产净值的比例（%）	
1	报告期内债券回购融资余额	0.05	
	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	-	-
	其中：买断式回购融资	-	-

注：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基金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：本基金合同约定：“本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%”。本报告期内，本基金未发生超标情况。

8.3 基金投资组合平均剩余期限

8.3.1 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	18
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	82
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	4

报告期内投资组合平均剩余期限超过 180 天情况说明

注：本基金合同约定：“本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 150 天”，本报告期内，本基金未发生超标情况。

8.3.2 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	100.14	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	-	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	-	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—180 天	-	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	180 天(含)—397 天（含）	-	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		100.14	-

8.4 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

8.5 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

注：本基金本报告期末未持有债券。

8.6 “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	-
报告期内偏离度的最高值	0.1161%
报告期内偏离度的最低值	-0.0197%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0113%

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金报告期末未持有资产支持证券。

8.8 投资组合报告附注

8.8.1 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。

8.8.2 本报告期内不存在剩余期限小于 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的 20%的情况。

8.8.3 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。

8.8.4 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	100,151.48
3	应收利息	124,821.94
4	应收申购款	101,000.00
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	325,973.42

8.8.5 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。

§9 基金份额持有人信息

9.1 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
长盛添利 30 天理财债券 A	440	26,918.04	34,490.70	0.29%	11,809,448.01	99.71%
长盛添利 30 天理财债券 B	1	40,188,178.99	40,188,178.99	100.00%	0.00	0.00%
合计	441	117,986.66	40,222,669.69	77.30%	11,809,448.01	22.70%

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。

9.2 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	长盛添利 30 天理财债券 A	1,076.05	0.0091%
	长盛添利 30 天理财债券 B	-	-
	合计	1,076.05	0.0021%

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。

9.3 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	长盛添利 30 天理财债券 A	0
	长盛添利 30 天理财债券 B	0
	合计	0
本基金基金经理持有本	长盛添利 30 天理财债券 A	0

开放式基金	长盛添利 30 天理财债券 B	0
	合计	0

§10 开放式基金份额变动

单位：份

	长盛添利 30 天理财债券 A	长盛添利 30 天理财债券 B
基金合同生效日（2012 年 10 月 26 日）基金份额总额	2,941,584,355.15	1,197,756,443.05
本报告期期初基金份额总额	29,842,546.48	60,534,384.86
本报告期基金总申购份额	39,327,548.14	241,371,193.40
减:本报告期基金总赎回份额	57,326,155.91	261,717,399.27
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	11,843,938.71	40,188,178.99

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。

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期未召开基金份额持有人大会。

11.2 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

11.2.1 本基金管理人的高级管理人员重大人事变动情况

本基金管理人于 2014 年 4 月 16 日发布公告，经公司第五届董事会第五十七次会议以及第六届董事会第一次会议审议通过， 并报中国证监会审核批准，由高新先生担任公司董事长，凤良志先生因年龄原因不再担任公司董事长职务。根据公司章程相关规定,“董事长为公司的法定代表人”。公司已于 2014 年 4 月 14 日完成相关工商登记变更手续。

11.2.2 基金经理的变动情况

报经中国证券投资基金业协会同意，自 2014 年 4 月 10 日起，段鹏同志兼任长盛添利 30 天理财债券型证券投资基金基金经理；自 2014 年 4 月 10 日起，杨衡同志不再兼任长盛添利 30 天理财债券型证券投资基金基金经理。

11.2.3 本基金托管人的基金托管部门重大人事变动情况

2014 年 2 月 14 日中国银行股份有限公司公告，自 2014 年 2 月 13 日起，陈四清先生担任本行行长。

报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略没有改变。

11.5 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，本报告期应支付给该会计师事务所的报酬 46,000.00 元，已连续提供审计服务 2 年。

11.6 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	
国泰君安	1	-	-	-	-	-
中金国际	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
五矿证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-

申银万国	2	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
东海证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
华福证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
国泰君安	-	-	472,600,000.00	100.00%	-	-
中金国际	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
五矿证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-

广发证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-

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、本基金租用证券公司交易单元均为共用交易单元。

4、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

（1）本基金报告期内新增租用交易单元情况：无。

（2）本基金报告期内停止租用交易单元情况：无。

11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

注：本基金本报告期内无偏离度绝对值超过 0.5%的情况。

11.9 其他重大事件

除上述事项之外，均已作为临时报告在指定媒体披露过的其他在本报告期内发生的重大事项如下：

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	长盛基金管理有限公司关于调整长盛添利 30 天理财债券型证券投资基金基金经理的公告	《中国证券报》《上海证券报》《证券时报》及本公司网站	2014 年 4 月 12 日
2	长盛基金管理有限公司关于公司法定代表人变更的公告	同上	2014 年 4 月 16 日
3	长盛基金管理有限公司关于董事长变更的公告	同上	2014 年 4 月 16 日
4	关于增加上海证券为旗下部分开放式基金代销机构并推出申购费率优惠活动的公告	同上	2014 年 6 月 16 日
5	关于增加万银财富为旗下部分开放式基金代销机构并推出定期定额投资业务及费率优惠活动的公告	同上	2014 年 7 月 9 日
6	关于增加联讯证券为旗下部分开放式基金代销机构的公告	同上	2014 年 10 月 13 日
7	关于增加广州证券为旗下部分开放式基金代销机构并推出申购费率优惠活动的公告	同上	2014 年 10 月 13 日
8	长盛基金管理有限公司关于公司从业人员在子公司兼职情况	同上	2014 年 10 月 14 日

	的公告		
9	关于增加长量基金为旗下部分开放式基金代销机构并推出定期定额投资业务及费率优惠活动的公告	同上	2014 年 10 月 16 日
10	长盛基金管理有限公司关于增加注册资本的公告	同上	2014 年 10 月 29 日
11	关于增加联泰资产为旗下部分开放式基金代销机构并推出定期定额投资业务及费率优惠活动的公告	同上	2014 年 12 月 22 日

§12 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，本基金托管人中国银行的专门基金托管部门的名称由托管及投资者服务部更名为托管业务部。

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

1、中国证监会核准基金募集的文件；

2、《长盛添利 30 天理财债券型证券投资基金基金合同》；

3、《长盛添利 30 天理财债券型证券投资基金托管协议》；

4、《长盛添利 30 天理财债券型证券投资基金招募说明书》；

5、法律意见书；

6、基金管理人业务资格批件、营业执照；

7、基金托管人业务资格批件、营业执照。

13.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公地址和/或基金托管人的住所。

13.3 查阅方式

投资者可到基金管理人的办公地址和/或基金托管人的住所和/或基金管理人互联网站免费查

阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人长盛基金管理有限公司。

客户服务中心电话：400-888-2666、010-62350088。

网址：http://www.csfunds.com.cn。

长盛基金管理有限公司
2015 年 3 月 28 日