

长盛添利宝货币市场基金 2018 年年度报告 摘要

2018 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：2019 年 3 月 29 日

§ 1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本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 2019 年 3 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本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 2018 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | | |
|-----------------|--------------------|--------------------|
| 基金简称 | 长盛添利宝货币 | |
| 基金主代码 | 000424 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2013 年 12 月 9 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 | 1,562,942,708.83 份 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |
| 下属分级基金的基金简称: | 长盛添利宝货币 A | 长盛添利宝货币 B |
| 下属分级基金的交易代码: | 000424 | 000425 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 177,363,078.56 份 | 1,385,579,630.27 份 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|--|
| 投资目标 | 以有效控制投资风险和保持较高流动性为优先目标，力求获得高于业绩比较基准的稳定回报。 |
| 投资策略 | 本基金在投资组合管理中采用主动投资策略，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。本基金将综合运用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、类属资产配置策略、银行存款投资策略以及债券或债券回购投资策略。 |
| 业绩比较基准 | 七天通知存款税后利率 |
| 风险收益特征 | 本基金为货币市场基金，是证券投资基金中的低风险品种。本基金的预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。 |

2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目 | | 基金管理人 | 基金托管人 |
|---------|------|---------------------------|----------------------|
| 名称 | | 长盛基金管理有限公司 | 中国银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 张利宁 | 王永民 |
| | 联系电话 | 010-86497608 | 010-66594896 |
| | 电子邮箱 | zhangln@csmfunds.com.cn | fcid@bankofchina.com |
| 客户服务电话 | | 400-888-2666、010-86497888 | 95566 |
| 传真 | | 010-86497999 | 010-66594942 |

2.4 信息披露方式

| | |
|---------------------|---|
| 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 |

§ 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 | 2018 年 | | 2017 年 | | 2016 年 | |
|-----------------------|----------------|------------------|----------------|-------------------|------------------|-------------------|
| | 长盛添利宝货币 A | 长盛添利宝货币 B | 长盛添利宝货币 A | 长盛添利宝货币 B | 长盛添利宝货币 A | 长盛添利宝货币 B |
| 本期已实现收益 | 3,656,905.67 | 160,924,459.03 | 6,861,549.43 | 416,874,630.79 | 5,280,305.37 | 273,563,500.08 |
| 本期利润 | 3,656,905.67 | 160,924,459.03 | 6,861,549.43 | 416,874,630.79 | 5,280,305.37 | 273,563,500.08 |
| 本期净值 收益率 | 3.2717% | 3.5196% | 3.5279% | 3.7800% | 2.3581% | 2.6040% |
| 3.1.2 期末 数据和指 标 | 2018 年末 | | 2017 年末 | | 2016 年末 | |
| | 长盛添利宝货币 A | 长盛添利宝货币 B | 长盛添利宝货币 A | 长盛添利宝货币 B | 长盛添利宝货币 A | 长盛添利宝货币 B |
| 期末基金 资产净值 | 177,363,078.56 | 1,385,579,630.27 | 121,121,895.83 | 10,025,952,403.90 | 1,245,549,926.84 | 24,307,701,881.17 |
| 期末基金 份额净值 | 1.0000 | 1.0000 | 1.00 | 1.00 | 1.00 | 1.00 |

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

长盛添利宝货币 A

| 阶段 | 份额净值 收益率① | 份额净值 收益率标 准差② | 业绩比较 基准收益 率③ | 业绩比较基 准收益率标 准差④ | ①—③ | ②—④ |
|----------------|--------------|---------------------|--------------------|-----------------------|----------|---------|
| 过去三个月 | 0.6304% | 0.0034% | 0.3403% | 0.0000% | 0.2901% | 0.0034% |
| 过去六个月 | 1.3556% | 0.0032% | 0.6805% | 0.0000% | 0.6751% | 0.0032% |
| 过去一年 | 3.2717% | 0.0033% | 1.3500% | 0.0000% | 1.9217% | 0.0033% |
| 过去三年 | 9.4363% | 0.0028% | 4.0537% | 0.0000% | 5.3826% | 0.0028% |
| 过去五年 | 18.8632% | 0.0061% | 6.7537% | 0.0000% | 12.1095% | 0.0061% |
| 自基金合同 生效起至今 | 19.3097% | 0.0061% | 6.8388% | 0.0000% | 12.4709% | 0.0061% |

长盛添利宝货币 B

| 阶段 | 份额净值 收益率① | 份额净值 收益率标 准差② | 业绩比较 基准收益 率③ | 业绩比较基 准收益率标 准差④ | ①-③ | ②-④ |
|----------------|--------------|---------------------|--------------------|-----------------------|----------|---------|
| 过去三个月 | 0.6910% | 0.0034% | 0.3403% | 0.0000% | 0.3507% | 0.0034% |
| 过去六个月 | 1.4779% | 0.0032% | 0.6805% | 0.0000% | 0.7974% | 0.0032% |
| 过去一年 | 3.5196% | 0.0033% | 1.3500% | 0.0000% | 2.1696% | 0.0033% |
| 过去三年 | 10.2302% | 0.0028% | 4.0537% | 0.0000% | 6.1765% | 0.0028% |
| 过去五年 | 20.3029% | 0.0061% | 6.7537% | 0.0000% | 13.5492% | 0.0061% |
| 自基金合同 生效起至今 | 20.7722% | 0.0061% | 6.8388% | 0.0000% | 13.9334% | 0.0061% |

注：1、本基金收益分配是按日结转份额。

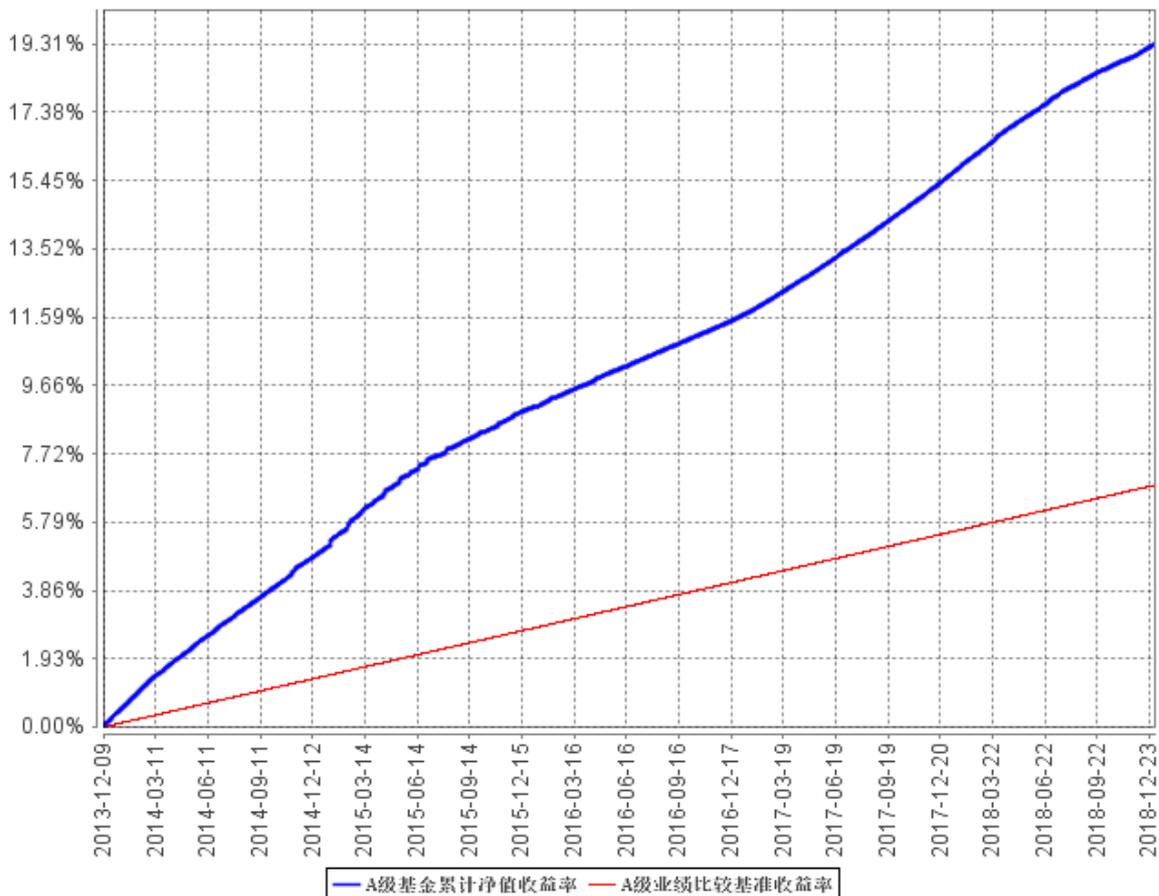
2、本基金业绩比较基准的构建及再平衡过程：

本基金业绩比较基准为七天通知存款税后利率。本基金为储蓄存款的良好投资替代工具，所以投资业绩基准确定为七天通知存款税后利率。本比较基准与货币市场工具的收益率有一定的相关性，能够反映货币市场的收益率水平。

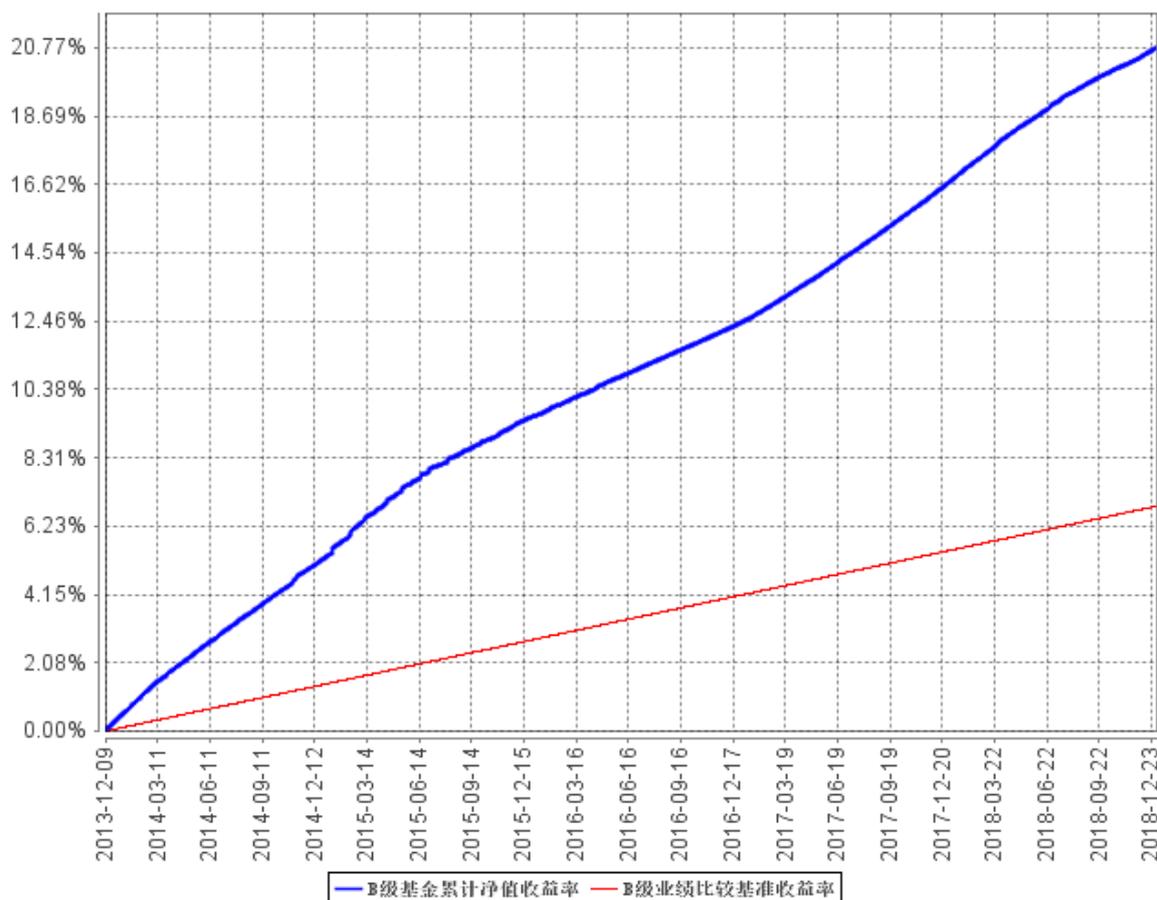
本基金的业绩比较基准将根据央行调息而调整。

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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



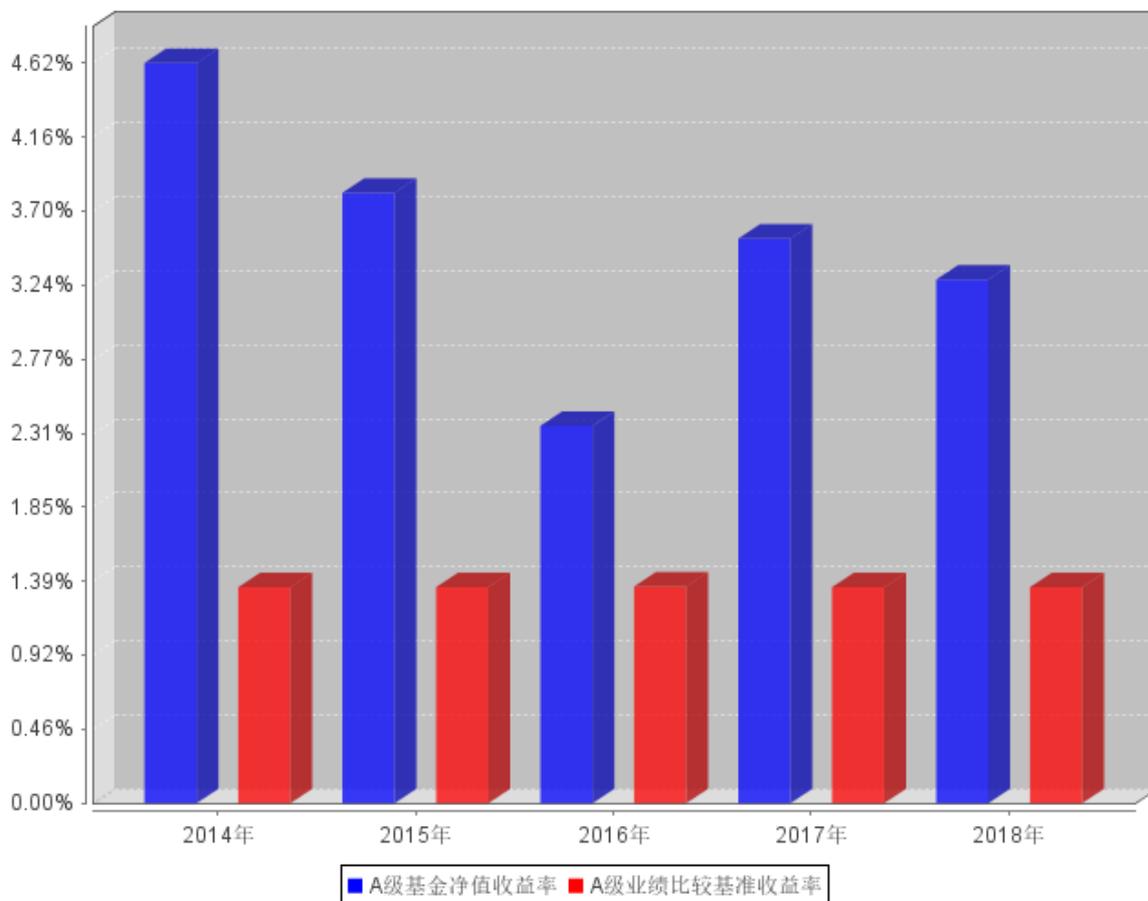
B级基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



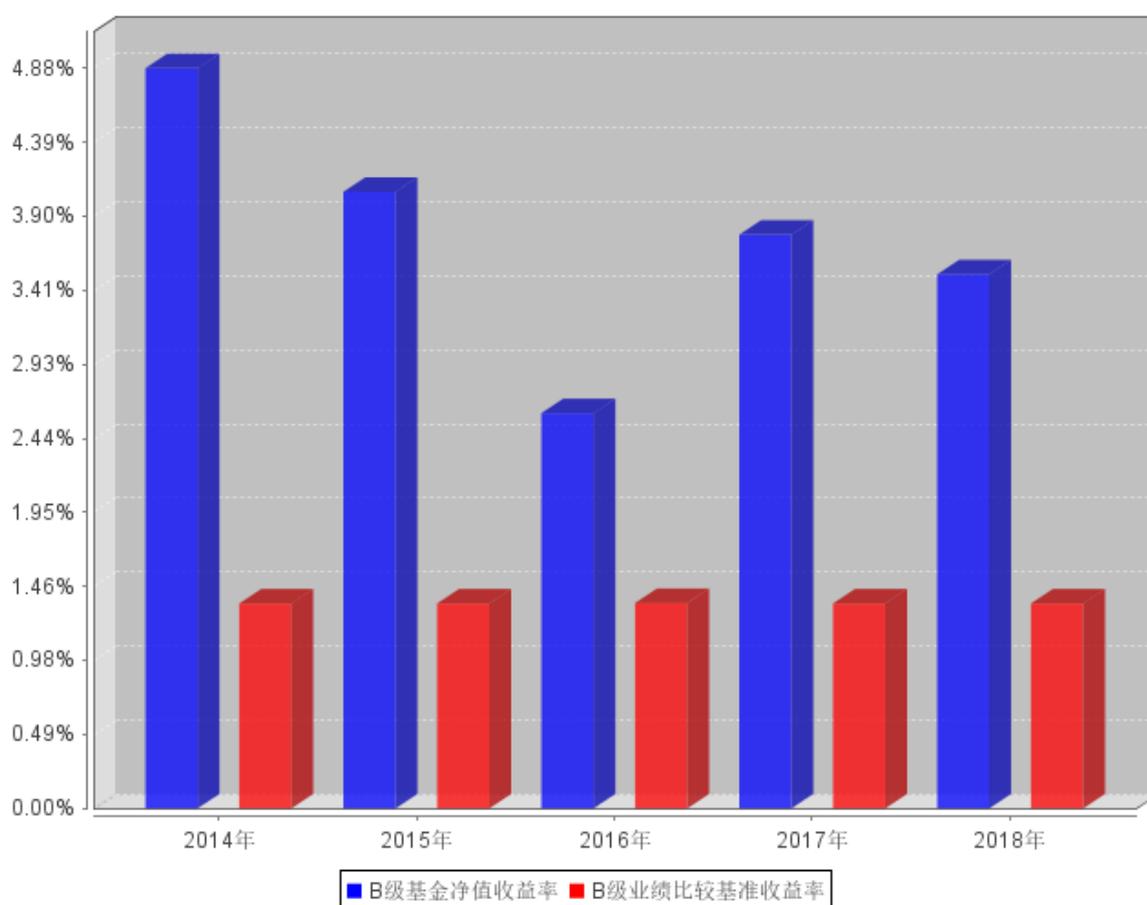
注：按照本基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起三个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。截至报告日，本基金的各项资产配置比例符合本基金合同的有关约定。

3.2.3 过去五年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级过去五年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级过去五年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



3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

| 长盛添利宝货币 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 |
| 2018 | 3,656,905.67 | - | - | 3,656,905.67 | |
| 2017 | 6,861,549.43 | - | - | 6,861,549.43 | |
| 2016 | 5,280,305.37 | - | - | 5,280,305.37 | |
| 合计 | 15,798,760.47 | - | - | 15,798,760.47 | |

单位：人民币元

| 长盛添利宝货币 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 |
| 2018 | 160,924,459.03 | - | - | 160,924,459.03 | |
| 2017 | 416,874,630.79 | - | - | 416,874,630.79 | |
| 2016 | 273,563,500.08 | - | - | 273,563,500.08 | |
| 合计 | 851,362,589.90 | - | - | 851,362,589.90 | |

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为长盛基金管理有限公司（以下简称公司），成立于 1999 年 3 月 26 日，是国内最早成立的十家基金管理公司之一。公司注册资本为人民币 18900 万元。公司注册地在深圳，总部设在北京，并在北京、上海、成都设有分公司，在深圳设有营销中心，并拥有长盛基金（香港）有限公司、长盛创富资产管理有限公司两家全资子公司。目前，公司股东及其出资比例为：国元证券股份有限公司占注册资本的 41%，新加坡星展银行有限公司占注册资本的 33%，安徽省信用担保集团有限公司占注册资本的 13%，安徽省投资集团控股有限公司占注册资本的 13%。公司拥有公募基金、全国社保基金、特定客户资产管理、合格境内机构投资者（QDII）、合格境外机构投资者（QFII）、保险资产管理人等业务资格。截至 2018 年 12 月 31 日，基金管理人共管理五十八只开放式基金，并管理多个全国社保基金组合和专户产品。公司同时兼任境外 QFII 基金和专户理财产品的投资顾问。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理（助理）期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|-----|--|-----------------|------|--------|--|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 段鹏 | 本基金基金经理，长盛货币市场基金基金经理，长盛年年收益定期开放债券型证券投资基金基金经理，长盛盛和纯债债券型证券投资基金基金经理，长盛盛景纯债债券型证券投资基金基金经理，长盛盛裕纯债债券型证券投资基金基金经理，长盛积极配置债券型证券投资基金基金经理，固定收益部副总监。 | 2018年6月22日 | - | 11年 | 段鹏先生，1982年12月出生。中央财经大学经济学硕士。曾在中信银行股份有限公司从事人民币货币市场交易、债券投资及流动性管理工作。2013年12月加入长盛基金管理有限公司。 |
| 王赛飞 | 本基金基金经理，长盛积极配置债券型证券投资基金。 | 2018年6月22日 | - | 6年 | 王赛飞女士，1987年10月出生。中国人民大学金融学硕士。曾任大公国际资信评估有限公司分析师、信用评审委员会委员。2015年7月加入长盛基金管理有限公司固定收益部，曾任信用研究员、基金经理助理等职务。 |

| | | | | | |
|----|--------------------|--------------------------|-------------------------|---------|---|
| 张帆 | 本基金基金经理，FOF 业务部总监。 | 2013 年 12 月 9 日 | 2018 年 8 月 7 日 | 11 年 | 张帆先生，1983 年 1 月出生。华中科技大学硕士。曾在长江证券股份有限公司从事债券研究、债券投资工作。2012 年 4 月加入长盛基金管理有限公司，曾任非信用研究员，长盛同丰分级债券型证券投资基金基金经理等职务。目前已离任该职务。 |
|----|--------------------|--------------------------|-------------------------|---------|---|

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合规守信情况的说明

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

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，切实防范利益输送，保护投资者的合法权益。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，未发现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易。

本报告期内，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

2018 年，经济形势错综复杂，内部严监管下融资受阻、外部贸易摩擦反复，国内经济下行压力较大，货币政策、财政政策、金融监管转向边际宽松。全年，GDP 同比增速 6.6%，其中四季度 GDP 增速创近十年新低。

在此环境下，债券市场收益率全年整体震荡向下，其中存单、短融等短期品种的收益率上半年在边际宽松的资金面支撑下快速下行，下半年整体维持在较低水平。

2、报告期内本基金投资策略分析

在报告期内，本基金始终控制资产配置节奏，优化持仓结构，保持组合流动性，合理调整存单、存款及债券配置比例，努力提高组合整体收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期长盛添利宝货币 A 的基金份额净值收益率为 3.2717%，本报告期长盛添利宝货币 B 的基金份额净值收益率为 3.5196%，同期业绩比较基准收益率为 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

展望 2019 年，我们认为中国经济增速将进一步下行，地产销售下滑将向投资传导，全球需求放缓叠加中美贸易摩擦将对外需产生较大压力，基建投资增速或较 2018 年有所改善，但较难改变经济下行的趋势。通胀方面，CPI 预计保持温和，PPI 进一步回落。货币政策逐渐从数量型调控向价格型调控为主转变，基于保持流动性合理充裕以及促进金融服务实体经济、降低企业融

资成本等需要，降准仍有空间。财政政策方面，可期待更多有关减税、增加支出等方面的措施。

债券市场方面，在经济下行、通胀低位、社融增速下滑的环境下，货币政策仍将保持宽松，后续若继续降准或出现降息，市场利率仍有下行空间，基本面与市场环境仍有利于债券。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及本基金合同约定，本基金管理人严格按照《企业会计准则》、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持投资品种进行估值。本基金管理人制订了证券投资基金估值政策与估值程序，设立基金估值小组，参考行业协会估值意见和独立第三方机构估值数据，确保基金估值的公平、合理。

本基金管理人制订的证券投资基金估值政策与估值程序确定了估值目的、估值日、估值对象、估值程序、估值方法以及估值差错处理、暂停估值和特殊情形处理等事项。本基金管理人设立了由公司总经理（担任估值工作小组组长）、公司督察长（担任估值工作小组副组长）、公司相关投资、研究部门分管领导、公司运营部分管领导、相关研究部门、相关投资部门、监察稽核部、风险管理部、信息技术部及业务运营部总监或指定人员组成的估值工作小组，负责研究、指导并执行基金估值业务。小组成员均具有多年证券、基金从业经验，具备基金估值运作、行业研究、风险管理或法律合规等领域的专业胜任能力。

基金经理参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

参与估值流程的各方还包括本基金托管人和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任，当存有异议时，托管人有责任要求基金管理公司作出合理解释，通过积极商讨达成一致意见。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已分别与中债金融估值中心有限公司和中证指数有限公司签署服务协议，由其分别按约定提供在银行间同业市场交易的债券品种和在交易所市场交易或挂牌的部分债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金基金合同对基金收益分配原则的约定，本基金按日分配收益，自基金合同生效日起每日将基金份额实现的基金净收益分配给份额持有人，使基金账面份额净值始终保持 1.00 元。

按照上述办法及基金合同的规定，2018 年度分配利润 164,581,364.70 元，其中：A 类别份额分配利润 3,656,905.67 元，B 类别份额分配利润 160,924,459.03 元。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内无基金持有人数或基金资产净值预警说明。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在长盛添利宝货币市场基金（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、基金净值收益率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

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)注册会计师薛竞、叶尔甸于 2019 年 3 月 27 日对本基金 2018 年 12 月 31 日的资产负债表、2018 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出具了普华永道中天审字(2019)第 22269 号标准无保留意见的审计报告。投资者欲查看审计报告全文，应阅读本年度报告正文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：长盛添利宝货币市场基金

报告截止日：2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资产 | 本期末 2018 年 12 月 31 日 | 上年度末 2017 年 12 月 31 日 |
|-----------------|---------------------------------------|--|
| 资产： | | |
| 银行存款 | 100,656,076.87 | 3,064,062,564.90 |
| 结算备付金 | - | 22,727.27 |
| 存出保证金 | - | - |
| 交易性金融资产 | 1,248,073,542.84 | 6,299,835,359.10 |
| 其中：股票投资 | - | - |
| 基金投资 | - | - |
| 债券投资 | 1,248,073,542.84 | 6,299,835,359.10 |
| 资产支持证券投资 | - | - |
| 贵金属投资 | - | - |
| 衍生金融资产 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 339,787,149.69 | 1,269,752,084.64 |
| 应收证券清算款 | - | - |
| 应收利息 | 13,471,020.54 | 62,426,704.60 |
| 应收股利 | - | - |
| 应收申购款 | 5,066,407.71 | 55,233,834.40 |
| 递延所得税资产 | - | - |
| 其他资产 | - | - |
| 资产总计 | 1,707,054,197.65 | 10,751,333,274.91 |
| 负债和所有者权益 | 本期末 2018 年 12 月 31 日 | 上年度末 2017 年 12 月 31 日 |
| 负债： | | |
| 短期借款 | - | - |
| 交易性金融负债 | - | - |
| 衍生金融负债 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | 142,819,345.76 | 599,458,380.77 |
| 应付证券清算款 | - | - |
| 应付赎回款 | - | 0.99 |
| 应付管理人报酬 | 451,081.95 | 2,888,987.14 |
| 应付托管费 | 136,691.51 | 875,450.66 |
| 应付销售服务费 | 39,624.76 | 110,652.89 |
| 应付交易费用 | 49,004.12 | 129,862.88 |
| 应交税费 | 49,045.82 | - |

| | | |
|---------------|------------------|-------------------|
| 应付利息 | 140,994.90 | 356,639.84 |
| 应付利润 | - | - |
| 递延所得税负债 | - | - |
| 其他负债 | 425,700.00 | 439,000.01 |
| 负债合计 | 144,111,488.82 | 604,258,975.18 |
| 所有者权益： | | |
| 实收基金 | 1,562,942,708.83 | 10,147,074,299.73 |
| 未分配利润 | - | - |
| 所有者权益合计 | 1,562,942,708.83 | 10,147,074,299.73 |
| 负债和所有者权益总计 | 1,707,054,197.65 | 10,751,333,274.91 |

注：报告截止日 2018 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额

1,562,942,708.83 份，其中长盛添利宝货币市场基金 A 类基金份额 177,363,078.56 份，长盛添利宝货币市场基金 B 类基金份额 1,385,579,630.27 份。

7.2 利润表

会计主体：长盛添利宝货币市场基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项 目 | 本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日 |
|-----------------------|---|--|
| 一、收入 | 192,492,362.19 | 483,111,484.52 |
| 1.利息收入 | 186,567,100.31 | 486,031,024.08 |
| 其中：存款利息收入 | 35,792,163.97 | 157,958,483.50 |
| 债券利息收入 | 131,651,260.85 | 260,673,592.52 |
| 资产支持证券利息收入 | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | 19,123,675.49 | 67,398,948.06 |
| 其他利息收入 | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | 5,925,261.88 | -2,919,612.97 |
| 其中：股票投资收益 | - | - |
| 基金投资收益 | - | - |
| 债券投资收益 | 5,925,261.88 | -2,919,612.97 |
| 资产支持证券投资收益 | - | - |
| 贵金属投资收益 | - | - |
| 衍生工具收益 | - | - |
| 股利收益 | - | - |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | - | - |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列） | - | - |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | - | 73.41 |

| | | |
|----------------------------|----------------|----------------|
| 减：二、费用 | 27,910,997.49 | 59,375,304.30 |
| 1. 管理人报酬 | 14,846,810.97 | 38,044,752.47 |
| 2. 托管费 | 4,499,033.55 | 11,528,712.84 |
| 3. 销售服务费 | 723,896.82 | 1,653,343.32 |
| 4. 交易费用 | - | - |
| 5. 利息支出 | 7,239,596.93 | 7,527,647.60 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | 7,239,596.93 | 7,527,647.60 |
| 6. 税金及附加 | 78,630.04 | - |
| 7. 其他费用 | 523,029.18 | 620,848.07 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | 164,581,364.70 | 423,736,180.22 |
| 减：所得税费用 | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | 164,581,364.70 | 423,736,180.22 |

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长盛添利宝货币市场基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 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） | 10,147,074,299.73 | - | 10,147,074,299.73 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 164,581,364.70 | 164,581,364.70 |
| 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） | -8,584,131,590.90 | - | -8,584,131,590.90 |
| 其中：1. 基金申购款 | 16,369,123,118.91 | - | 16,369,123,118.91 |
| 2. 基金赎回款 | -24,953,254,709.81 | - | -24,953,254,709.81 |
| 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） | - | -164,581,364.70 | -164,581,364.70 |
| 五、期末所有者权益（基金净值） | 1,562,942,708.83 | - | 1,562,942,708.83 |
| 项目 | 上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 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) | 25,553,251,808.01 | - | 25,553,251,808.01 |
| 二、本期经营活动产生的 基金净值变动数(本 期利润) | - | 423,736,180.22 | 423,736,180.22 |
| 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) | -15,406,177,508.28 | - | -15,406,177,508.28 |
| 其中: 1. 基金申购款 | 74,491,491,058.10 | - | 74,491,491,058.10 |
| 2. 基金赎回款 | -89,897,668,566.38 | - | -89,897,668,566.38 |
| 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) | - | -423,736,180.22 | -423,736,180.22 |
| 五、期末所有者权益 (基金净值) | 10,147,074,299.73 | - | 10,147,074,299.73 |

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:

| | | |
|----------|-----------|---------|
| 林培富 | 刁俊东 | 龚珉 |
| 基金管理人负责人 | 主管会计工作负责人 | 会计机构负责人 |

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

长盛添利宝货币市场基金(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”)证监许可[2013]第 1403 号《关于核准长盛添利宝货币市场基金募集的批复》核准,由长盛基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《长盛添利宝货币市场基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 3,874,930,536.49 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2013)第 819 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《长盛添利宝货币市场基金基金合同》于 2013 年 12 月 9 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 3,875,301,402.19 份基金份额,其中认购资金利息折合 370,865.70 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。

根据《长盛添利宝货币市场基金招募说明书》的有关规定,本基金根据适用的销售服务费

率的不同，将基金份额分为 A 类、B 类两类份额。在基金存续期内的任何一个开放日，如 A 类基金份额持有人持有的基金份额余额达到 5,000,000 份，即升级为 B 类份额持有人，如 B 类基金份额持有人持有的基金份额余额少于 5,000,000 份，即降级为 A 类份额持有人。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《长盛添利宝货币市场基金基金合同》的有关规定，本基金投资于法律法规允许的金融工具包括现金；通知存款；短期融资券；一年以内(含一年)的银行定期存款、银行协议存款和大额存单；剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的债券、资产支持证券和中期票据；期限在一年以内(含一年)的债券回购和中央银行票据；以及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其他货币市场工具。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 2019 年 3 月 27 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(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《长盛添利宝货币市场基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2018 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 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

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

本基金在本报告期间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[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入，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。

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

7.4.7 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(“星展银行”) | 基金管理人的股东、基金销售机构 |
| 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 |

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

注：无。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2018年1月1日至2018年 12月31日 | 上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月 31日 |
|-----------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 14,846,810.97 | 38,044,752.47 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 345,999.64 | 1,936,139.02 |

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 0.33% 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：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.33% / 当年天数。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2018年1月1日至2018年 12月31日 | 上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月 31日 |
|----------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 4,499,033.55 | 11,528,712.84 |

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 0.10% 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：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.10% / 当年天数。

7.4.8.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期 2018年1月1日至2018年12月31日 | | |
|----------------|----------------------------------|--------------|--------------|
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 长盛添利宝货币 A | 长盛添利宝货币 B | 合计 |
| 中国银行 | 61,176.69 | 1,479.52 | 62,656.21 |
| 星展银行 | 77,022.67 | 735.45 | 77,758.12 |
| 长盛基金公司 | 42,309.12 | 415,290.24 | 457,599.36 |
| 国元证券 | 148.36 | 11,513.85 | 11,662.21 |
| 合计 | 180,656.84 | 429,019.06 | 609,675.90 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日 | | |
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 长盛添利宝货币 A | 长盛添利宝货币 B | 合计 |
| 中国银行 | 85,095.31 | 3,470.46 | 88,565.77 |
| 星展银行 | 38,728.48 | 256.89 | 38,985.37 |
| 长盛基金公司 | 66,059.31 | 1,046,120.10 | 1,112,179.41 |
| 国元证券 | 121.70 | 26,823.99 | 26,945.69 |
| 合计 | 190,004.80 | 1,076,671.44 | 1,266,676.24 |

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0.25%和0.01%。销售服务费的计算公式为：
 对应级别日销售服务费 = 前一日对应级别基金资产净值 × 约定年费率 / 当年天数。

7.4.8.3 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

| 银行间市场交易的各关联方名称 | 本期 2018年1月1日至2018年12月31日 | | | | | |
|----------------------------------|-----------------------------|---------------|-------|------|-------------------|--------------|
| | 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 | 235,378,855.34 | 10,191,100.14 | - | - | 15,760,336,000.00 | 1,896,016.95 |
| 上年度可比期间 2017年1月1日至2017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 | 1,299,968,517.76 | 179,885,297.14 | - | - | 97,700,000.00 | 7,208.30 |

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

| 项目 | 本期 2018年1月1日至2018年12月31日 | |
|----------------------------|-----------------------------|----------------|
| | 长盛添利宝货币 A | 长盛添利宝货币 B |
| 基金合同生效日（2013年12月9日）持有的基金份额 | - | - |
| 期初持有的基金份额 | - | 353,568,507.30 |
| 期间申购/买入总份额 | - | 11,154,066.30 |
| 期间因拆分变动份额 | - | - |
| 减：期间赎回/卖出总份额 | - | 50,000,000.00 |
| 期末持有的基金份额 | - | 314,722,573.60 |
| 期末持有的基金份额占基金总份额比例 | - | 22.7142% |

| 项目 | 上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日 | |
|----------------------------|----------------------------------|----------------|
| | 长盛添利宝货币 A | 长盛添利宝货币 B |
| 基金合同生效日（2013年12月9日）持有的基金份额 | - | - |
| 期初持有的基金份额 | - | 460,972,364.64 |
| 期间申购/买入总份额 | - | 362,462,317.76 |
| 期间因拆分变动份额 | - | - |
| 减：期间赎回/卖出总份额 | - | 469,866,175.10 |

| | | |
|-----------------------|---|----------------|
| 期末持有的基金份额 | - | 353,568,507.30 |
| 期末持有的基金份额 占基金总份额比例 | - | 3.5300% |

注：1、期间申购总份额含红利再投份额。2、基金管理人持有本基金基金份额的交易费用按市场公开的交易费率计算并支付。3、本基金基金管理人本期及上年度可比期间未运用自有资金投资本基金 A 类基金份额。4、对于分级基金，比例的分母采用各自级别的份额。

7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

长盛添利宝货币 B

份额单位：份

| 关联方名称 | 本期末 2018 年 12 月 31 日 | | 上年度末 2017 年 12 月 31 日 | |
|-------|-------------------------|--------------------------|--------------------------|--------------------------|
| | 持有的 基金份额 | 持有的基金份额 占基金总份额的 比例 | 持有的 基金份额 | 持有的基金份额 占基金总份额的 比例 |
| 长盛创富 | 42,751,185.47 | 3.0854% | 41,189,236.07 | 0.4108% |

注：对于分级基金，比例的分母采用各自级别的份额。

7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方 名称 | 本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日 | | 上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 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 | 656,076.87 | 73,898.85 | 9,062,564.90 | 740,593.28 |

注：本基金的部分银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业/协议利率计息。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.9 期末（2018 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：无。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2018 年 12 月 31 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 142,819,345.76 元，是以如下债券作为抵押：

金额单位：人民币元

| 债券代码 | 债券名称 | 回购到期日 | 期末估值单价 | 数量（张） | 期末估值总额 |
|-----------|---------------|----------------|--------|-----------|----------------|
| 111814042 | 18 江苏银行 CD042 | 2019 年 1 月 2 日 | 99.39 | 435,000 | 43,233,220.79 |
| 180404 | 18 农发 04 | 2019 年 1 月 3 日 | 100.22 | 525,000 | 52,614,662.71 |
| 180404 | 18 农发 04 | 2019 年 1 月 2 日 | 100.22 | 30,000 | 3,006,552.15 |
| 180201 | 18 国开 01 | 2019 年 1 月 3 日 | 100.04 | 500,000 | 50,018,936.40 |
| 合计 | | | | 1,490,000 | 148,873,372.05 |

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2018 年 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 1,248,073,542.84 元，无属于第一或第三层次的余额(2017 年 12 月 31 日：属于第二层次的余额为 6,299,835,359.10 元，无属于第一或第三层次的余额)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2018 年 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(2017 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§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 | 1,248,073,542.84 | 73.11 |
| | 其中: 债券 | 1,248,073,542.84 | 73.11 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 2 | 买入返售金融资产 | 339,787,149.69 | 19.90 |
| | 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 | 100,656,076.87 | 5.90 |
| 4 | 其他各项资产 | 18,537,428.25 | 1.09 |
| 5 | 合计 | 1,707,054,197.65 | 100.00 |

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 | 7.00 | |
| | 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 | 142,819,345.76 | 9.14 |
| | 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

| 序号 | 发生日期 | 融资余额占基金资产净值比例 (%) | 原因 | 调整期 |
|----|-----------------|-------------------|--------|-----|
| 1 | 2018 年 3 月 27 日 | 20.11 | 基金规模变动 | 3 |
| 2 | 2018 年 3 月 28 日 | 20.07 | 基金规模变动 | 2 |
| 3 | 2018 年 3 月 29 日 | 20.13 | 基金规模变动 | 1 |
| 4 | 2018 年 4 月 16 日 | 23.87 | 基金规模变动 | 1 |
| 5 | 2018 年 6 月 27 日 | 28.77 | 基金规模变动 | 1 |

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 | 38 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 60 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 | 30 |

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

注：本基金本报告期内投资组合平均剩余期限无超过 120 天情况。

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 | 49.95 | 9.14 |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 2 | 30 天(含)—60 天 | 31.90 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 3 | 60 天(含)—90 天 | 24.92 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 4 | 90 天(含)—120 天 | 1.27 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 5 | 120 天(含)—397 天(含) | - | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| | 合计 | 108.03 | 9.14 |

8.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

注：报告期内无投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种 | 摊余成本 | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|-----------|----------------|---------------|
| 1 | 国家债券 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 230,193,660.53 | 14.73 |
| | 其中：政策性金融债 | 130,193,660.53 | 8.33 |
| 4 | 企业债券 | - | - |

| | | | |
|----|----------------------|------------------|-------|
| 5 | 企业短期融资券 | 410,779,676.78 | 26.28 |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 同业存单 | 607,100,205.53 | 38.84 |
| 8 | 其他 | - | - |
| 9 | 合计 | 1,248,073,542.84 | 79.85 |
| 10 | 剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券 | - | - |

注：上表中，债券的成本包括债券面值和折溢价。

8.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 债券数量(张) | 摊余成本 | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|-----------|---------------|-----------|----------------|---------------|
| 1 | 111811231 | 18 平安银行 CD231 | 2,000,000 | 199,118,757.90 | 12.74 |
| 2 | 071800054 | 18 中信 CP011 | 1,000,000 | 100,000,000.00 | 6.40 |
| 3 | 011802342 | 18 华能 SCP015 | 1,000,000 | 99,929,261.39 | 6.39 |
| 4 | 111818341 | 18 华夏银行 CD341 | 1,000,000 | 99,513,894.74 | 6.37 |
| 5 | 111809279 | 18 浦发银行 CD279 | 1,000,000 | 99,268,949.78 | 6.35 |
| 6 | 180404 | 18 农发 04 | 800,000 | 80,174,724.13 | 5.13 |
| 7 | 011800908 | 18 中石油 SCP001 | 700,000 | 70,260,998.06 | 4.50 |
| 8 | 011801033 | 18 豫投资 SCP002 | 600,000 | 60,389,087.11 | 3.86 |
| 9 | 011800662 | 18 鞍钢 SCP004 | 600,000 | 60,008,786.16 | 3.84 |
| 10 | 180201 | 18 国开 01 | 500,000 | 50,018,936.40 | 3.20 |

8.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

| 项目 | 偏离情况 |
|-------------------------------|---------|
| 报告期内偏离度的绝对值在 0.25(含)-0.5%间的次数 | - |
| 报告期内偏离度的最高值 | 0.1890% |
| 报告期内偏离度的最低值 | 0.0001% |
| 报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值 | 0.0855% |

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

注：报告期内无负偏离度的绝对值达到 0.25%情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

注：报告期内无正偏离度的绝对值达到 0.5%情况。

8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 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。

8.9.2 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

1、18 浦发银行 CD279

根据银保监会 2018 年 5 月 4 日公布的《中国银行保险监督管理委员会行政处罚信息公开表-银监罚决字〔2018〕4 号-上海浦东发展银行股份有限公司》的公告，浦发银行因内控管理严重违反审慎经营规则；通过资管计划投资分行协议存款，虚增一般存款；通过基础资产在理财产品之间的非公允交易进行收益调节；理财资金投资非标准化债权资产比例超监管要求；提供不实说明材料、不配合调查取证；以贷转存，虚增存贷款；票据承兑、贴现业务贸易背景审查不严；国内信用证业务贸易背景审查不严；贷款管理严重缺失，导致大额不良贷款；违规通过同业投资转存款方式，虚增存款；票据资管业务在总行审批驳回后仍继续办理；对代理收付资金的信托计划提供保本承诺；以存放同业业务名义开办委托定向投资业务，并少计风险资产；投资多款同业理财产品未尽职审查，涉及金额较大；修改总行理财合同标准文本，导致理财资金实际投向与合同约定不符；为非保本理财产品出具保本承诺函；向关系人发放信用贷款；向客户收取服务费，但未提供实质性服务，明显质价不符；收费超过服务价格目录，向客户转嫁成本共 19 项违规被罚款 5845 万元，没收违法所得 10.927 万元，罚没合计 5855.927 万元。根据 1 月 20 日浦发银行《关于成都分行处罚事项的公告》2018 年 1 月 18 日，银监会四川监管局对公司成都分行作出行政处罚决定，对成都分行内控管理严重失效，授信管理违规，违规办理信贷业务等严重违反审慎经营规则的违规行为依法查处，执行罚款 46,175 万元人民币。此外，对成都分行原行长、2 名副行长、1 名部门负责人和 1 名支行行长分别给予禁止终身从事银行业工作、取消其高级管理人员任职资格、警告及罚款。对以上事件，本基金做出如下说明：浦发银行是中国最优秀的银行之一，基本面良好，上述处罚对经营管理不构成实质性影响，同时公司高度重视相关事项，已进一步采取控制措施改进或正在落实整改。针对成都分行上述违规经营事项，浦发银行高度重视，在监管机构和地方政府的指导和帮助下，及时调整了成都分行经营班子，并对资产状况进行了全面评估，分类施策、强化管理，按照审慎原则计提风险拨备，稳妥有序化解风险。目前，成都分行已按监管要求完成了整改，总体风险可控，客户权益未受影响，经营管理迈入正轨。在此基础上，公司在全行范围内认真开展举一反三教育整改工作，深刻反思，统一思想，吸取教训；端正全行经营理念，更加关注安全性、流动性和效益性的平衡发展，强化统一法人管理；将防范和化解金融风险放在更加突出的位置，强化合规内控体制机制建设，着重提升内控执行力和有效性，确保全行依法合规、稳健发展。并且上述处罚金额已全额计入 2017 年度公司损益，对公司的业务开

展及持续经营无重大不利影响。基于相关研究，本基金判断，上述处罚对公司影响极小。今后，我们将继续加强与该公司的沟通，密切关注其制度建设与执行等公司基础性建设问题的合规性以及企业的经营状况。

2、18 平安银行 CD231

根据大连银监局行政处罚信息公开表（大银监罚决字[2018]5号），公司因贷款资金转存款质押开立银行承兑汇票并在他行贴现，贴现资金回流转存款质押重复开立银行承兑汇票，被大连银监局罚款人民币四十万元；根据银支付罚决字【2018】2号，公司因违反清算管理规定、人民币银行结算账户管理相关规定、非金融机构支付服务管理办法相关规定，被中国人民银行给予警告，没收违法所得 3,036,061.39 元，并处罚款 10,308,084.15 元，合计处罚金额 13,344,145.54 元；根据天津银监局 2018 年 6 月 28 日的行政处罚信息公开表，公司因贷前调查不到位，向环保未达标的企业提供融资，贷后管理失职，流动资金贷款被挪用，被天津银监局罚款人民币五十万元；根据银反洗罚决字【2018】2号，公司因未按照规定履行客户身份识别义务、未按照规定保存客户身份资料和交易记录、未按照规定报送大额交易报告或者可疑交易报告，被中国人民银行合计罚款人民币一百四十万元。对以上事件，本基金判断，平安银行作为一家全国性股份制商业银行，上述处罚对公司影响小。后续关注其制度建设与执行等公司基础性建设问题的合规性以及企业的经营状况。

除上述事项外，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。

8.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|----|---------|---------------|
| 1 | 存出保证金 | - |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收利息 | 13,471,020.54 |
| 4 | 应收申购款 | 5,066,407.71 |
| 5 | 其他应收款 | - |
| 6 | 待摊费用 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 18,537,428.25 |

8.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§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 |
| 长盛添利宝货币 A | 61,441 | 2,886.72 | 16,915,406.61 | 9.54% | 160,447,671.95 | 90.46% |
| 长盛添利宝货币 B | 29 | 47,778,607.94 | 1,282,197,156.36 | 92.54% | 103,382,473.91 | 7.46% |
| 合计 | 61,470 | 25,426.11 | 1,299,112,562.97 | 83.12% | 263,830,145.86 | 16.88% |

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 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

| 序号 | 持有人类别 | 持有份额（份） | 占总份额比例 |
|----|-------|----------------|--------|
| 1 | 基金类机构 | 314,722,573.60 | 20.14% |
| 2 | 券商类机构 | 250,150,425.32 | 16.01% |
| 3 | 信托类机构 | 168,439,411.96 | 10.78% |
| 4 | 券商类机构 | 119,475,603.11 | 7.64% |
| 5 | 保险类机构 | 95,011,641.80 | 6.08% |
| 6 | 基金类机构 | 53,053,631.76 | 3.39% |
| 7 | 其他机构 | 50,005,128.81 | 3.20% |
| 8 | 基金类机构 | 42,751,185.47 | 2.74% |
| 9 | 基金类机构 | 41,824,278.83 | 2.68% |
| 10 | 保险类机构 | 40,199,495.97 | 2.57% |

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 份额级别 | 持有份额总数（份） | 占基金总份额比例 |
|------------------|-----------|------------|----------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 长盛添利宝货币 A | 758,094.39 | 0.4317% |
| | 长盛添利宝货币 B | 0.00 | 0.0000% |
| | 合计 | 758,094.39 | 0.0485% |

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。

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

| 项目 | 份额级别 | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|--------------------------------|-----------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金 | 长盛添利宝货币 A | 0~10 |
| | 长盛添利宝货币 B | 0 |
| | 合计 | 0~10 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 长盛添利宝货币 A | 0 |
| | 长盛添利宝货币 B | 0 |
| | 合计 | 0 |

§10 开放式基金份额变动

单位：份

| | 长盛添利宝货币 A | 长盛添利宝货币 B |
|------------------------------------|------------------|-------------------|
| 基金合同生效日（2013 年 12 月 9 日）基金 份额总额 | 1,343,455,033.04 | 2,531,846,369.15 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 121,121,895.83 | 10,025,952,403.90 |
| 本报告期期间基金总申购份额 | 464,856,052.33 | 15,904,267,066.58 |
| 减:本报告期期间基金总赎回份额 | 408,614,869.60 | 24,544,639,840.21 |
| 本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少 以“-”填列） | - | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 177,363,078.56 | 1,385,579,630.27 |

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

本报告期内本基金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

原督察长叶金松先生因退休离任，由张利宁女士担任本公司督察长。

上述变更事项已经公司第七届董事会第七次会议审议通过，并按规定向相关监管机构备案。

2018 年 4 月 27 日，中国证券监督管理委员会北京监管局作出《关于对长盛基金管理有限公司拟任合规负责人任职资格的意见》（京证监发〔2018〕136 号），对张利宁女士担任本公司督察长无异议。

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 2018 年 6 月 22 日起，段鹏、王赛飞同志担任长盛添利宝货币市场基金基金经理。自 2018 年 8 月 7 日起，张帆同志不再担任长盛添利宝货币市场基金基金经理。

11.2.3 本基金托管人的基金托管部门重大人事变动情况

报告期内，2018 年 8 月，刘连舸先生担任中国银行股份有限公司行长职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

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

本报告期内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 146,700.00 元，已连续提

供审计服务 5 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

本报告期内本基金管理人、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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 | - | - | - | - | - |
| 中信建投 | 2 | - | - | - | - | - |
| 东兴证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 东海证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 西南证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 广发证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中信证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 招商证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国信证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 上海证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 德邦证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 安信证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 申银万国 | 2 | - | - | - | - | - |
| 日信证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中金公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华安证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国元证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 高华证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 长城证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国联证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华泰证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华融证券 | 1 | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|------|---|---|---|---|---|---|
| 东莞证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 长江证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 东北证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 方正证券 | 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 | - | - | - | - | - | - |
| 中信建投 | - | - | - | - | - | - |
| 东兴证券 | - | - | - | - | - | - |
| 东海证券 | - | - | - | - | - | - |
| 西南证券 | - | - | - | - | - | - |
| 广发证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 招商证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 上海证券 | - | - | - | - | - | - |
| 德邦证券 | - | - | - | - | - | - |
| 安信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 申银万国 | - | - | - | - | - | - |
| 日信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中金公司 | - | - | - | - | - | - |
| 华安证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国元证券 | - | - | - | - | - | - |
| 高华证券 | - | - | - | - | - | - |
| 长城证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国联证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华泰证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华融证券 | - | - | - | - | - | - |
| 东莞证券 | - | - | - | - | - | - |
| 长江证券 | - | - | - | - | - | - |
| 东北证券 | - | - | - | - | - | - |

| | | | | | |
|------|---|---|---|---|---|
| 方正证券 | - | - | - | - | - |
|------|---|---|---|---|---|

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：

| 序号 | 证券公司名称 | 交易单元所属市场 | 数量 |
|----|--------|----------|----|
| 1 | 方正证券 | 上海 | 1 |

(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：本报告期本基金无偏离度绝对值超过 0.5%的情况。

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 | | | | | 报告期末持有基金情况 | |
|-------|----------------|---|------------------|----------------|------------------|----------------|--------|
| | 序号 | 持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间 | 期初份额 | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额 | 份额占比 |
| 机构 | 1 | 20180629~20180701 | 0.00 | 504,812,422.02 | 504,812,422.02 | 0.00 | 0.00% |
| | 2 | 20181128~20181213、 20181227~20181231 | 352,423,607.74 | 12,298,965.86 | 50,000,000.00 | 314,722,573.60 | 20.17% |
| | 3 | 20180227~20180415 | 1,517,269,120.14 | 28,106,465.80 | 1,545,375,585.94 | 0.00 | 0.00% |

产品特有风险

本基金本报告期存在单一投资者持有基金份额比例超过 20%的情况，当该基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致的风险包括：巨额赎回风险、流动性风险、基金资产净值持续低于 5000 万元的风险、基金份额净值大幅波动风险以及基金收益水平波动风险。本基金管理人将对申购赎回进行审慎的应对，保护中小投资者利益。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期内无影响投资者决策的其他重要信息。

长盛基金管理有限公司

2019 年 3 月 29 日