

# 长盛添利宝货币市场基金 2024 年年度报告

2024 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：2025 年 3 月 29 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 2025 年 03 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。

本年度报告财务资料已经审计，立信会计师事务所（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 2024 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.....10

§4 管理人报告 .....10

4.1 基金管理人及基金经理情况.....10

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....12

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....12

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.....13

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....14

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....14

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....15

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....15

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.....15

§5 托管人报告 .....16

5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....16

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....16

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.....16

§6 审计报告.....16

6.1 审计报告基本信息.....16

6.2 审计报告的基本内容.....16

§7 年度财务报表 .....18

7.1 资产负债表.....18

7.2 利润表.....19

7.3 净资产变动表.....21

7.4 报表附注.....22

§8 投资组合报告 .....44

|                                                       |           |
|-------------------------------------------------------|-----------|
| 8.1 期末基金资产组合情况.....                                   | 44        |
| 8.2 债券回购融资情况.....                                     | 44        |
| 8.3 基金投资组合平均剩余期限.....                                 | 44        |
| 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 .....                 | 45        |
| 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....                            | 45        |
| 8.6 期末按实际利率计算账面价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细 .....        | 46        |
| 8.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值确定的基金资产净值的偏离 .....              | 46        |
| 8.8 期末按实际利率计算账面价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明<br>细..... | 46        |
| 8.9 投资组合报告附注.....                                     | 46        |
| <b>§9 基金份额持有人信息.....</b>                              | <b>47</b> |
| 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....                           | 47        |
| 9.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况 .....                          | 48        |
| 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....                        | 48        |
| 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情况 .....                | 48        |
| <b>§10 开放式基金份额变动.....</b>                             | <b>49</b> |
| <b>§11 重大事件揭示.....</b>                                | <b>49</b> |
| 11.1 基金份额持有人大会决议.....                                 | 49        |
| 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 .....                | 49        |
| 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....                     | 50        |
| 11.4 基金投资策略的改变.....                                   | 50        |
| 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....                           | 50        |
| 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 .....                   | 50        |
| 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....                          | 50        |
| 11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况 .....                           | 53        |
| 11.9 其他重大事件.....                                      | 53        |
| <b>§12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>                       | <b>54</b> |
| 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 .....              | 54        |
| 12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....                              | 54        |
| <b>§13 备查文件目录.....</b>                                | <b>55</b> |
| 13.1 备查文件目录.....                                      | 55        |
| 13.2 存放地点.....                                        | 55        |
| 13.3 查阅方式.....                                        | 55        |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

|                     |                     |                 |
|---------------------|---------------------|-----------------|
| 基金名称                | 长盛添利宝货币市场基金         |                 |
| 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<br>额总额      | 26,479,778,537.32 份 |                 |
| 基金合同存续期             | 不定期                 |                 |
| 下属分级基金的基<br>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<br>易代码     | 000424              | 000425          |
| 报告期末下属分级<br>基金的份额总额 | 26,383,911,396.98 份 | 95,867,140.34 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   | 本基金在短期市场利率预期策略的基础上，综合运用期限结构的滚动配置策略、投资组合优化策略和无风险套利操作策略，通过比较各类短期固定收益工具如央行票据、债券、短期融资券、银行存款、债券回购等投资品种在流动性、收益率水平和风险参数等指标的差异，确定这些投资品种的合理配置比例，以保证投资组合在低风险的前提下尽可能提高组合收益率。 |
| 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<br>负责人 | 姓名   | 张利宁                       | 许俊                        |
|             | 联系电话 | 010-86497608              | 010-66596688              |
|             | 电子邮箱 | zhangln@csfunds.com.cn    | fxjd_hq@bank-of-china.com |
| 客户服务电话      |      | 400-888-2666、010-86497888 | 95566                     |
| 传真          |      | 010-86497999              | 010-66594942              |
| 注册地址        |      | 深圳市福田区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        |      | 北京市朝阳区安定路 5 号院 3 号        | 北京市西城区复兴门内大街 1 号          |

|       |                 |        |
|-------|-----------------|--------|
|       | 楼中建财富国际中心 3-5 层 |        |
| 邮政编码  | 100029          | 100818 |
| 法定代表人 | 胡甲              | 葛海蛟    |

2.4 信息披露方式

|                     |                           |
|---------------------|---------------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称      | 《证券时报》                    |
| 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和基金托管人的住所       |

2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称               | 办公地址                              |
|--------|------------------|-----------------------------------|
| 会计师事务所 | 立信会计师事务所（特殊普通合伙） | 上海市黄浦区汉口路 99 号久事商务大厦 11 楼         |
| 注册登记机构 | 长盛基金管理有限公司       | 北京市朝阳区安定路 5 号院 3 号楼中建财富国际中心 3-5 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 | 2024 年            |               | 2023 年            |                | 2022 年            |                |
|---------------|-------------------|---------------|-------------------|----------------|-------------------|----------------|
|               | 长盛添利宝<br>货币 A     | 长盛添利宝<br>货币 B | 长盛添利宝<br>货币 A     | 长盛添利宝<br>货币 B  | 长盛添利宝<br>货币 A     | 长盛添利宝<br>货币 B  |
| 本期已实现收益       | 375,513,719.65    | 5,409,318.11  | 338,228,785.62    | 11,277,646.54  | 265,152,523.54    | 23,069,537.80  |
| 本期利润          | 375,513,719.65    | 5,409,318.11  | 338,228,785.62    | 11,277,646.54  | 265,152,523.54    | 23,069,537.80  |
| 本期净值收益率       | 1.5466%           | 1.7898%       | 1.7693%           | 2.0135%        | 1.7031%           | 1.9473%        |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2024 年末           |               | 2023 年末           |                | 2022 年末           |                |
|               | 长盛添利宝<br>货币 A     | 长盛添利宝<br>货币 B | 长盛添利宝<br>货币 A     | 长盛添利宝<br>货币 B  | 长盛添利宝<br>货币 A     | 长盛添利宝<br>货币 B  |
| 期末基金资产净值      | 26,383,911.396.98 | 95,867,140.34 | 21,414,572.303.91 | 341,604,711.74 | 16,804,026.908.71 | 498,220,860.22 |
| 期末基金份额净值      | 1.0000            | 1.0000        | 1.0000            | 1.0000         | 1.0000            | 1.0000         |
| 3.1.3 累计期末指标  | 2024 年末           |               | 2023 年末           |                | 2022 年末           |                |
|               | 长盛添利宝<br>货币 A     | 长盛添利宝<br>货币 B | 长盛添利宝<br>货币 A     | 长盛添利宝<br>货币 B  | 长盛添利宝<br>货币 A     | 长盛添利宝<br>货币 B  |
| 累计净值收益率       | 33.3764%          | 36.9642%      | 31.3451%          | 34.5559%       | 29.0616%          | 31.9000%       |

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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

第 6 页 共55页

额相等。

3、表中的“期末”均指本报告期最后一日，即 12 月 31 日。

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<br>值收益<br>率① | 份额净值<br>收益率标<br>准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基准<br>收益率标准差<br>④ | ①－③          | ②－④         |
|----------------|------------------|---------------------|----------------|-----------------------|--------------|-------------|
| 过去三个月          | 0.3229%          | 0.0002%             | 0.3403%        | 0.0000%               | -0.017<br>4% | 0.0002<br>% |
| 过去六个月          | 0.7026%          | 0.0010%             | 0.6805%        | 0.0000%               | 0.0221<br>%  | 0.0010<br>% |
| 过去一年           | 1.5466%          | 0.0012%             | 1.3537%        | 0.0000%               | 0.1929<br>%  | 0.0012<br>% |
| 过去三年           | 5.1033%          | 0.0011%             | 4.0537%        | 0.0000%               | 1.0496<br>%  | 0.0011<br>% |
| 过去五年           | 9.3141%          | 0.0012%             | 6.7574%        | 0.0000%               | 2.5567<br>%  | 0.0012<br>% |
| 自基金合同生效起<br>至今 | 33.3764<br>%     | 0.0048%             | 14.9462%       | 0.0000%               | 18.430<br>2% | 0.0048<br>% |

长盛添利宝货币 B

| 阶段    | 份额净<br>值收益<br>率① | 份额净值<br>收益率标<br>准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基准<br>收益率标准差<br>④ | ①－③         | ②－④         |
|-------|------------------|---------------------|----------------|-----------------------|-------------|-------------|
| 过去三个月 | 0.3830%          | 0.0002%             | 0.3403%        | 0.0000%               | 0.0427<br>% | 0.0002<br>% |
| 过去六个月 | 0.8235%          | 0.0010%             | 0.6805%        | 0.0000%               | 0.1430<br>% | 0.0010<br>% |
| 过去一年  | 1.7898%          | 0.0012%             | 1.3537%        | 0.0000%               | 0.4361<br>% | 0.0012<br>% |

|            |          |         |          |         |          |         |
|------------|----------|---------|----------|---------|----------|---------|
| 过去三年       | 5.8614%  | 0.0011% | 4.0537%  | 0.0000% | 1.8077%  | 0.0011% |
| 过去五年       | 10.6314% | 0.0012% | 6.7574%  | 0.0000% | 3.8740%  | 0.0012% |
| 自基金合同生效起至今 | 36.9642% | 0.0048% | 14.9462% | 0.0000% | 22.0180% | 0.0048% |

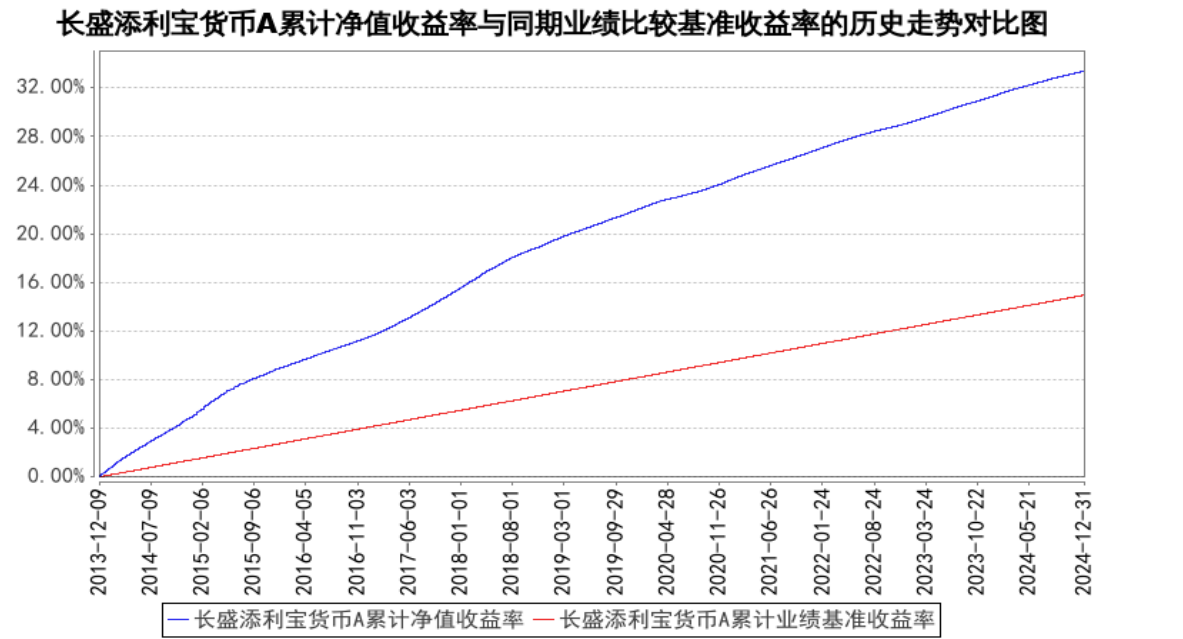
注：1、本基金收益分配是按日结转份额。

2、本基金业绩比较基准的构建及再平衡过程：

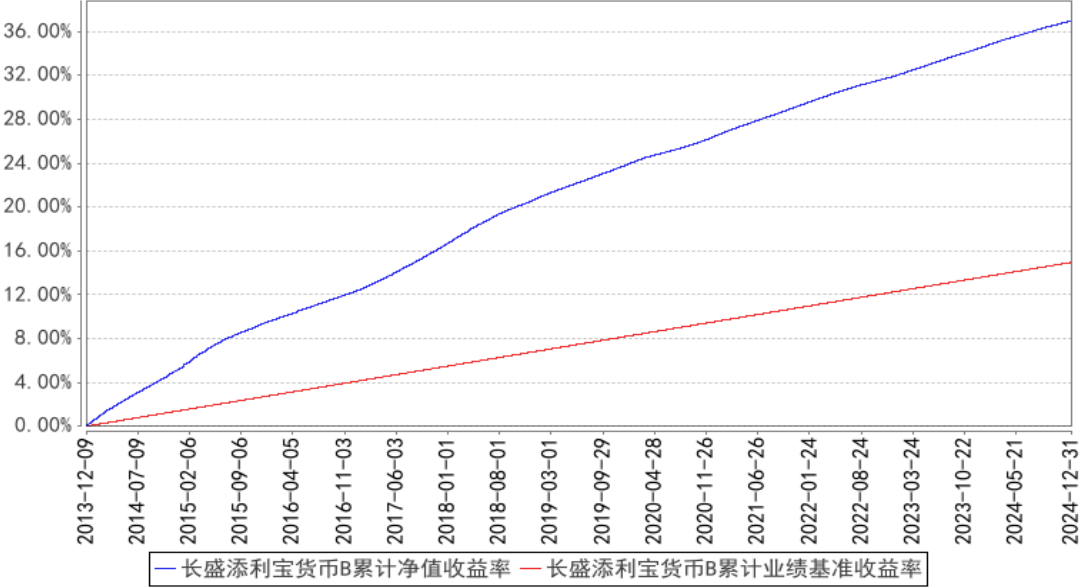
本基金业绩比较基准为七天通知存款税后利率。本基金为储蓄存款的良好投资替代工具，所以投资业绩基准确定为七天通知存款税后利率。本比较基准与货币市场工具的收益率有一定的相关性，能够反映货币市场的收益率水平。

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份额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



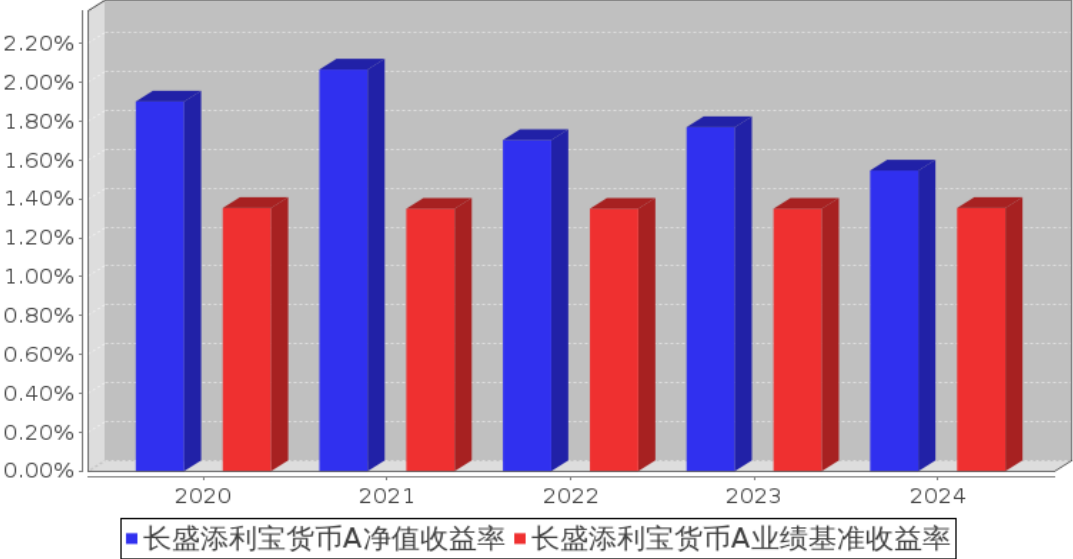
长盛添利宝货币B累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

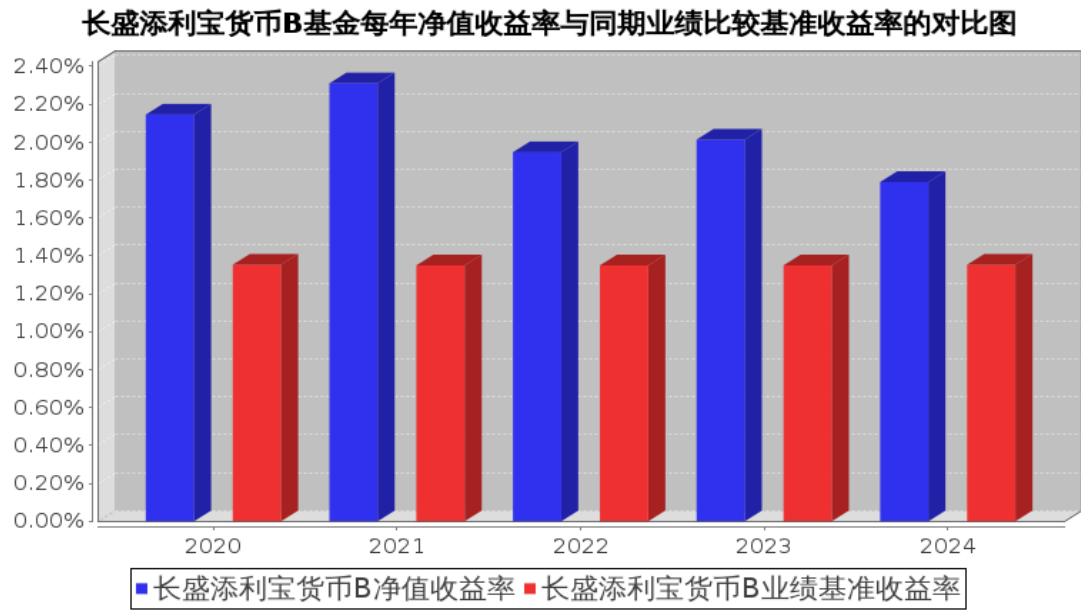


注：按照本基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起三个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。截至报告日，本基金的各项资产配置比例符合本基金合同的有关约定。

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基金每年净值收益率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<br>转实收基金  | 直接通过应付<br>赎回款转出金额 | 应付利润<br>本年变动 | 年度利润<br>分配合计      | 备注 |
| 2024 年    | 375, 513, 719. 65 | -                 | -            | 375, 513, 719. 65 | -  |
| 2023 年    | 338, 228, 785. 62 | -                 | -            | 338, 228, 785. 62 | -  |
| 2022 年    | 265, 152, 523. 54 | -                 | -            | 265, 152, 523. 54 | -  |
| 合计        | 978, 895, 028. 81 | -                 | -            | 978, 895, 028. 81 | -  |

| 长盛添利宝货币 B |                  |                   |              |                  |    |
|-----------|------------------|-------------------|--------------|------------------|----|
| 年度        | 已按再投资形式<br>转实收基金 | 直接通过应付<br>赎回款转出金额 | 应付利润<br>本年变动 | 年度利润<br>分配合计     | 备注 |
| 2024 年    | 5, 409, 318. 11  | -                 | -            | 5, 409, 318. 11  | -  |
| 2023 年    | 11, 277, 646. 54 | -                 | -            | 11, 277, 646. 54 | -  |
| 2022 年    | 23, 069, 537. 80 | -                 | -            | 23, 069, 537. 80 | -  |
| 合计        | 39, 756, 502. 45 | -                 | -            | 39, 756, 502. 45 | -  |

§ 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，是国内首批成立的十家基金管理公司之一，公司注册资本为人民币 2.06 亿元。长盛基金注册地为深圳，总部办公地位于北京，在北京、上海、成都等地设有分支机构，拥有全资子公司长盛基金（香港）

有限公司和长盛创富资产管理有限公司。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（DBS Bank Ltd.）占注册资本的 33%，安徽省信用融资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，同时可担任私募资产管理计划和境外 QFII 基金的投资顾问。截至 2024 年 12 月 31 日，基金管理人共管理七十四只开放式基金，并管理多个全国社保基金组合和私募资产管理计划。

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            |        |                                                                                     |
| 王赛飞 | 本基金基金经理，长盛盛琪一年期定期开放债券型证券投资基金基金经理，长盛盛华一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理，长盛中债 0-3 年政策性金融债指数证券投资基金基金经理。 | 2018 年 6 月 22 日 | -               | 12 年   | 王赛飞女士，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。 |
| 王文豪 | 本基金基金经理，长盛安鑫中短债债券型证券投资基金基金经理，长盛悦鑫 60 天持有期纯债债券型证券投资基金基金经理。                                 | 2024 年 9 月 20 日 | -               | 8 年    | 王文豪先生，硕士。曾任中债资信评估有限责任公司评级分析岗位。2018 年 12 月加入长盛基金管理有限公司，历任信用研究员、基金经理助理。               |
| 段鹏  | 本基金基金经理。                                                                                  | 2018 年 6 月 22 日 | 2024 年 9 月 24 日 | 17 年   | 段鹏先生，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。 |
|--|--|--|--|--|----------------|

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《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本基金本报告期内无基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.1.4 基金经理薪酬机制

本基金基金经理薪酬激励不存在与私募资产管理计划浮动管理费或产品业绩表现挂钩的情况。

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

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规制定了《公司公平交易细则》，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、私募资产管理计划等，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，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。

公司对管理的不同投资组合过去 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原则及利益输送的行为。

#### 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

报告期内，央行进行了两次降准，并综合运用公开市场操作、中期借贷便利、再贷款再贴现等工具，开展国债买卖操作，保持了流动性的合理充裕。此外，央行还两次下调了 OMO 利率，并继续推动存款利率市场化。随着政策利率的下调，以 DR007 为代表的银行间市场质押式回购利率的中枢在报告期内也有一定幅度的下行，报告期内资金面整体较为宽松。同业存单方面，受资金面宽松影响，收益率整体下行幅度较大。

##### 2、报告期内本基金投资策略分析

在报告期内，本基金规模有一定幅度波动。基金根据合同要求，结合市场收益波动情况灵活调整存单、存款、债券及逆回购等资产的配置比例，持续构建适配负债端特点的组合结构，确保组合流动性安全。报告期内，基金根据市场情况阶段性增加对逆回购资产的配置，并灵活调整久期、择机利用杠杆工具，努力提升持有人的收益体验。

#### 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 1.5466%，同期业绩比较基准收益率为 1.3537%；本报告期长盛添利宝货币 B 的基金份额净值收益率为 1.7898%，同期业绩比较基准收益率为 1.3537%。

#### 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 2025 年，中国经济面临的外部环境不确定性仍然较多，同时内部面临有效需求不足等挑战。经济仍将处于新旧动能转换期，基本面的表现预计仍将延续较为温和的态势，债券市场面临的基本面方面的压力整体可控。但当前收益率处于较低位置，同时市场对于货币政策进一步宽松保持较高预期，需密切关注制约货币政策的内外部因素变化情况并警惕预期差带来的市场冲击。此外，政府债券的发行大概率扩容加速，需关注供给冲击、基建实物工作量的回升等方面带来的影响。

#### 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，本基金管理人遵循合规运作、保护基金投资者利益的原则，结合监管要求、市场形势及自身业务发展需要，由独立于业务部门的监察稽核部对公司经营、受托资产的运作及员工行为的合规性进行监督、检查，发现问题及时督促相关部门改进，并定期制作检查报告报送公司管理层。具体工作情况如下：

1、加强合规宣导与培训，持续推动公司合规文化建设。报告期内，监察稽核部通过外请专业机构、内部自学、岗前培训、基金经理合规谈话、合规考试等多种形式，有重点、有针对性地开展合规培训工作，及时组织学习法律法规与监管文件，深化员工合规理念，提升员工合规工作技能。

2、持续完善公司制度规章体系建设。根据新法规、新监管要求，以及公司业务发展实际，及时督促、提示业务部门进行相关制度、流程的新订、修订与完善，保证公司制度规章的合法合规、全面、适时、有效。报告期内，公司除完成有关制度的新订、修订工作外，还要求业务部门就制度、流程变化内容与其他相关执行部门进行沟通，确保各相关部门对新订、修订内容的理解保持一致，保证制度、流程被严格执行。

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》的规定，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，防范非公平交易和利益输送。

4、加强专项稽核与检查力度，完善发现问题与改进情况的跟踪、落实机制，保障公司运营及受托资产投资运作合规。报告期内，公司监察稽核部开展定期、临时专项稽核，内容涵盖受托资产投资、研究、交易、销售、员工行为、信息技术等。此外，根据业务发展需要、监管机构通报的业内问题，以及公司在日常监督中发现的问题，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，合理保障公司及受托资产合规、稳健运作。

5、参与新产品设计、新业务、新流程的合规论证工作，提供合规意见或建议，确保依法合规开展相关业务。

本基金管理人承诺：在今后的工作中，我们将继续以保护基金投资者的利益为宗旨，不断提高内部监察稽核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

本基金管理人按照《企业会计准则》、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引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。

本基金管理人设有估值工作小组，负责制定、评估、复核和修订基金估值程序和技术，适时更新估值相关制度，指导并监督各类投资品种的估值程序，评估会计政策变更的影响，对证券投资基金估值方法进行最终决策等。估值工作小组由总经理担任组长，督察长担任副组长，小组成员均具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备投资、研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理可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。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，由中债金融估值中心有限公司按约定提供银行间同业市场的估值数据和流通受限股票的折扣率数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所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

本报告期内，本基金每日计算收益并分配，符合法律法规和基金合同的相关约定。具体参见本报告“7.4.11 利润分配情况”。

#### 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

本基金本报告期内不存在连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 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”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”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     | 信会师报字[2025]第 ZA30437 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   | 长盛添利宝货币市场基金全体基金份额持有人                                                                                                                                                                                                                                                      |
| 审计意见      | 我们审计了长盛添利宝货币市场基金(以下简称“长盛添利宝货币基金”)的财务报表，包括 2024 年 12 月 31 日的资产负债表，2024 年度的利润表和净资产变动表以及财务报表附注。我们认为，后附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券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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，公允反映了长盛添利宝货币基金 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年度的经营成果和净资产变动情况。 |
| 形成审计意见的基础 | 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。                                                                                                                                                                                                                                                |

|                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
|-----------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|                 | <p>审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。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。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于长盛添利宝货币基金，并履行了职业道德方面的其他责任。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                       |
| 其他信息            | <p>长盛添利宝货币基金的基金管理人长盛基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已经执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>                                                                                                                                       |
| 管理层和治理层对财务报表的责任 | <p>长盛添利宝货币基金的基金管理人长盛基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表，使其实现公允反映，并设计、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。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估长盛添利宝货币基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算长盛添利宝货币基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督长盛添利宝货币基金的财务报告过程。</p>                                                                                                                        |
| 注册会计师对财务报表审计的责任 | <p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，</p> |

|           |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |    |
|-----------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----|
|           | <p>但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三)评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四)对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对长盛添利宝货币基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致长盛添利宝货币基金不能持续经营。</p> <p>(五)评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p> |    |
| 会计师事务所的名称 | 立信会计师事务所（特殊普通合伙）                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |    |
| 注册会计师的姓名  | 吴凌志                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         | 杨婧 |
| 会计师事务所的地址 | 中国 上海                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |    |
| 审计报告日期    | 2025 年 3 月 26 日                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |    |

§ 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：2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资 产      | 附注号     | 本期末<br>2024 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2023 年 12 月 31 日 |
|----------|---------|-------------------------|--------------------------|
| 资 产：     |         |                         |                          |
| 货币资金     | 7.4.7.1 | 7,938,235,298.32        | 9,113,746,306.71         |
| 结算备付金    |         | -                       | -                        |
| 存出保证金    |         | 2,424.87                | -                        |
| 交易性金融资产  | 7.4.7.2 | 15,485,240,029.64       | 10,236,575,005.50        |
| 其中：股票投资  |         | -                       | -                        |
| 基金投资     |         | -                       | -                        |
| 债券投资     |         | 15,485,240,029.64       | 10,236,575,005.50        |
| 资产支持证券投资 |         | -                       | -                        |
| 贵金属投资    |         | -                       | -                        |
| 其他投资     |         | -                       | -                        |
| 衍生金融资产   | 7.4.7.3 | -                       | -                        |
| 买入返售金融资产 | 7.4.7.4 | 3,722,275,974.18        | 2,931,074,661.47         |

|           |          |                         |                          |
|-----------|----------|-------------------------|--------------------------|
| 债权投资      | 7.4.7.5  | -                       | -                        |
| 其中：债券投资   |          | -                       | -                        |
| 资产支持证券投资  |          | -                       | -                        |
| 其他投资      |          | -                       | -                        |
| 其他债权投资    | 7.4.7.6  | -                       | -                        |
| 其他权益工具投资  | 7.4.7.7  | -                       | -                        |
| 应收清算款     |          | -                       | -                        |
| 应收股利      |          | -                       | -                        |
| 应收申购款     |          | 6,783.39                | 1.02                     |
| 递延所得税资产   |          | -                       | -                        |
| 其他资产      | 7.4.7.8  | -                       | -                        |
| 资产总计      |          | 27,145,760,510.40       | 22,281,395,974.70        |
| 负债和净资产    | 附注号      | 本期末<br>2024 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2023 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 |          | 650,068,888.40          | 512,237,736.59           |
| 应付清算款     |          | -                       | -                        |
| 应付赎回款     |          | -                       | 99.21                    |
| 应付管理人报酬   |          | 7,532,485.32            | 6,113,103.39             |
| 应付托管费     |          | 2,282,571.31            | 1,852,455.56             |
| 应付销售服务费   |          | 5,686,137.58            | 4,537,285.66             |
| 应付投资顾问费   |          | -                       | -                        |
| 应交税费      |          | 33,605.14               | 81,892.52                |
| 应付利润      |          | -                       | -                        |
| 递延所得税负债   |          | -                       | -                        |
| 其他负债      | 7.4.7.9  | 378,285.33              | 396,386.12               |
| 负债合计      |          | 665,981,973.08          | 525,218,959.05           |
| 净资产：      |          |                         |                          |
| 实收基金      | 7.4.7.10 | 26,479,778,537.32       | 21,756,177,015.65        |
| 其他综合收益    | 7.4.7.11 | -                       | -                        |
| 未分配利润     | 7.4.7.12 | -                       | -                        |
| 净资产合计     |          | 26,479,778,537.32       | 21,756,177,015.65        |
| 负债和净资产总计  |          | 27,145,760,510.40       | 22,281,395,974.70        |

注： 报告截止日 2024 年 12 月 31 日，长盛添利宝货币 A 的基金份额净值为 1.0000 元，份额总额为 26,383,911,396.98 份；长盛添利宝货币 B 的基金份额净值为 1.0000 元，份额总额为 95,867,140.34 份。基金份额总额 26,479,778,537.32 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：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项 目                    | 附注号        | 本期<br>2024 年 1 月 1 日至 2024<br>年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2023 年 1 月 1 日至 2023<br>年 12 月 31 日 |
|------------------------|------------|-------------------------------------------|------------------------------------------------|
| 一、营业总收入                |            | 555,646,656.94                            | 489,355,842.73                                 |
| 1. 利息收入                |            | 279,735,109.64                            | 259,990,021.76                                 |
| 其中：存款利息收入              | 7.4.7.13   | 192,747,088.07                            | 198,894,615.48                                 |
| 债券利息收入                 |            | -                                         | -                                              |
| 资产支持证券利息收入             |            | -                                         | -                                              |
| 买入返售金融资产收入             |            | 86,988,021.57                             | 61,095,406.28                                  |
| 其他利息收入                 |            | -                                         | -                                              |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）      |            | 275,911,547.30                            | 229,365,820.97                                 |
| 其中：股票投资收益              | 7.4.7.14   | -                                         | -                                              |
| 基金投资收益                 |            | -                                         | -                                              |
| 债券投资收益                 | 7.4.7.15   | 275,911,547.30                            | 229,365,820.97                                 |
| 资产支持证券投资               | 7.4.7.16   | -                                         | -                                              |
| 收益                     |            |                                           |                                                |
| 贵金属投资收益                | 7.4.7.17   | -                                         | -                                              |
| 衍生工具收益                 | 7.4.7.18   | -                                         | -                                              |
| 股利收益                   | 7.4.7.19   | -                                         | -                                              |
| 其他投资收益                 |            | -                                         | -                                              |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 7.4.7.20   | -                                         | -                                              |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）     |            | -                                         | -                                              |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列）     | 7.4.7.21   | -                                         | -                                              |
| 减：二、营业总支出              |            | 174,723,619.18                            | 139,849,410.57                                 |
| 1. 管理人报酬               | 7.4.10.2.1 | 82,823,225.05                             | 65,646,900.44                                  |
| 2. 托管费                 | 7.4.10.2.2 | 25,097,946.93                             | 19,893,000.08                                  |
| 3. 销售服务费               | 7.4.10.2.3 | 62,039,903.76                             | 48,381,776.50                                  |
| 4. 投资顾问费               |            | -                                         | -                                              |
| 5. 利息支出                |            | 4,385,764.95                              | 5,444,207.22                                   |
| 其中：卖出回购金融资产支出          |            | 4,385,764.95                              | 5,444,207.22                                   |
| 6. 信用减值损失              | 7.4.7.22   | -                                         | -                                              |
| 7. 税金及附加               |            | 74,149.20                                 | 78,320.63                                      |
| 8. 其他费用                | 7.4.7.23   | 302,629.29                                | 405,205.70                                     |
| 三、利润总额（亏损总额            |            | 380,923,037.76                            | 349,506,432.16                                 |

|                   |  |                |                |
|-------------------|--|----------------|----------------|
| 以“-”号填列)          |  |                |                |
| 减：所得税费用           |  | -              | -              |
| 四、净利润(净亏损以“-”号填列) |  | 380,923,037.76 | 349,506,432.16 |
| 五、其他综合收益的税后净额     |  | -              | -              |
| 六、综合收益总额          |  | 380,923,037.76 | 349,506,432.16 |

7.3 净资产变动表

会计主体：长盛添利宝货币市场基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目                                       | 本期<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日      |                 |                     |
|------------------------------------------|---------------------------------------------|-----------------|---------------------|
|                                          | 实收基金                                        | 未分配利润           | 净资产合计               |
| 一、上期期末净资产                                | 21,756,177,015.65                           | -               | 21,756,177,015.65   |
| 二、本期期初净资产                                | 21,756,177,015.65                           | -               | 21,756,177,015.65   |
| 三、本期增减变动额<br>(减少以“-”号填列)                 | 4,723,601,521.67                            | -               | 4,723,601,521.67    |
| (一)、综合收益总额                               | -                                           | 380,923,037.76  | 380,923,037.76      |
| (二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数<br>(净资产减少以“-”号填列)  | 4,723,601,521.67                            | -               | 4,723,601,521.67    |
| 其中：1. 基金申购款                              | 293,912,375,577.78                          | -               | 293,912,375,577.78  |
| 2. 基金赎回款                                 | -289,188,774,056.11                         | -               | -289,188,774,056.11 |
| (三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列) | -                                           | -380,923,037.76 | -380,923,037.76     |
| 四、本期期末净资产                                | 26,479,778,537.32                           | -               | 26,479,778,537.32   |
| 项目                                       | 上年度可比期间<br>2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日 |                 |                     |
|                                          | 实收基金                                        | 未分配利润           | 净资产合计               |

|                                          |                     |                 |                     |
|------------------------------------------|---------------------|-----------------|---------------------|
| 一、上期期末净资产                                | 17,302,247,768.93   | -               | 17,302,247,768.93   |
| 二、本期期初净资产                                | 17,302,247,768.93   | -               | 17,302,247,768.93   |
| 三、本期增减变动额<br>(减少以“-”号填列)                 | 4,453,929,246.72    | -               | 4,453,929,246.72    |
| (一)、综合收益总额                               | -                   | 349,506,432.16  | 349,506,432.16      |
| (二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数<br>(净资产减少以“-”号填列)  | 4,453,929,246.72    | -               | 4,453,929,246.72    |
| 其中: 1. 基金申购款                             | 245,397,068,329.67  | -               | 245,397,068,329.67  |
| 2. 基金赎回款                                 | -240,943,139,082.95 | -               | -240,943,139,082.95 |
| (三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列) | -                   | -349,506,432.16 | -349,506,432.16     |
| 四、本期期末净资产                                | 21,756,177,015.65   | -               | 21,756,177,015.65   |

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：

胡甲

基金管理人负责人

张壬午

主管会计工作负责人

龚珉

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 2025 年 3 月 26 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、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(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<年度报告和中期报告>》、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本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和净资产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

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产、金融负债或权益工具。

##### (1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

##### 债务工具

本基金持有的金融资产主要为债务工具，是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

##### 以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

##### 以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。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主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

##### (2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融负债和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。本基金持有的以摊余成本计量的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在初始确认时，以公允价值计量。对于取得债券投资或资产支持证券投资支付的价款中包含的债券或资产支持证券投资起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在债券投资或资产支持证券投资的账面价值中。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。

债券投资和资产支持证券投资按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率每日计提应计利息,同时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,以避免债券投资和资产支持证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。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产,以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息,以发生违约的风险为权重,计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额,确认预期信用损失。

于每个资产负债表日,本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的,处于第一阶段,本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备;金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的,处于第二阶段,本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备;金融工具自初始确认后已经发生信用减值的,处于第三阶段,本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具,本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加,认定为处于第一阶段的金融工具,按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具,按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具,按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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

为了避免投资组合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投资组合的公允价值计

算影子价格。当影子价格确定的基金资产净值与摊余成本法计算的基金资产净值的偏离度绝对值达到或超过 0.25%时，基金管理人应根据相关法律法规采取相应措施，使基金资产净值更能公允地反映基金投资组合价值。

计算影子价格时按如下原则确定债券投资和资产支持证券投资的公允价值：

(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；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 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确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少，以及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。

本基金发行的份额作为可回售工具具备以下特征：(1) 赋予基金份额持有人在基金清算时按比例份额获得该基金净资产的权利，这里所指基金净资产是扣除所有优先于该基金份额对基金资产要求权之后的剩余资产；这里所指按比例份额是清算时将基金的净资产分拆为金额相等的单位，并且将单位金额乘以基金份额持有人所持有的单位数量；(2) 该工具所属的类别次于其他所有工具类别，即本基金份额在归属于该类别前无须转换为另一种工具，且在清算时对基金资产没有优先

于其他工具的要求权；(3) 该工具所属的类别中(该类别次于其他所有工具类别)，所有工具具有相同的特征(例如它们必须都具有可回售特征，并且用于计算回购或赎回价格的公式或其他方法都相同)；(4) 除了发行方应当以现金或其他金融资产回购或赎回该基金份额的合同义务外，该工具不满足金融负债定义中的任何其他特征；(5) 该工具在存续期内的预计现金流量总额，应当实质上基于该基金存续期内基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括本基金的任何影响)。

可回售工具，是指根据合同约定，持有方有权将该工具回售给发行方以获取现金或其他金融资产的权利，或者在未来某一不确定事项发生或者持有方死亡或退休时，自动回售给发行方的金融工具。

本基金没有同时具备下列特征的其他金融工具或合同：(1) 现金流量总额实质上基于基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括该基金或合同的任何影响)；(2) 实质上限制或固定了上述工具持有方所获得的剩余回报。

本基金将实收基金分类为权益工具，列报于净资产。

#### 7.4.4.8 损益平准金

无。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

债券投资和资产支持证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及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

债券投资和资产支持证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。

#### 7.4.4.10 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。

以摊余成本计量的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。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的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全部分配结转至应付收益科目，于下一工作日以红利再投资方式集中支付累计收益。

#### 7.4.4.12 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。

#### 7.4.4.13 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：

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566号《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

#### 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

本基金本报告期末未发生会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末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[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》、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 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

| 项目             | 本期末<br>2024 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2023 年 12 月 31 日 |
|----------------|-------------------------|--------------------------|
| 活期存款           | 238,873,219.53          | 786,076.03               |
| 等于：本金          | 238,862,869.81          | 784,115.84               |
| 加：应计利息         | 10,349.72               | 1,960.19                 |
| 减：坏账准备         | -                       | -                        |
| 定期存款           | 7,699,362,078.79        | 9,112,960,230.68         |
| 等于：本金          | 7,659,000,000.00        | 9,058,000,000.00         |
| 加：应计利息         | 40,362,078.79           | 54,960,230.68            |
| 减：坏账准备         | -                       | -                        |
| 其中：存款期限 1 个月以内 | -                       | -                        |
| 存款期限 1-3 个月    | -                       | 510,547,486.10           |

|             |                  |                  |
|-------------|------------------|------------------|
| 存款期限 3 个月以上 | 7,699,362,078.79 | 8,602,412,744.58 |
| 其他存款        | -                | -                |
| 等于：本金       | -                | -                |
| 加：应计利息      | -                | -                |
| 减：坏账准备      | -                | -                |
| 合计          | 7,938,235,298.32 | 9,113,746,306.71 |

注：定期存款的存款期限指定期存款的票面存期。

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目     |       | 本期末<br>2024 年 12 月 31 日  |                   |               |            |
|--------|-------|--------------------------|-------------------|---------------|------------|
|        |       | 按实际利率计算的账<br>面价值         | 影子定价              | 偏离金额          | 偏离度<br>(%) |
| 债券     | 交易所市场 | -                        | -                 | -             | -          |
|        | 银行间市场 | 15,485,240,029.64        | 15,500,808,951.63 | 15,568,921.99 | 0.0588     |
|        | 合计    | 15,485,240,029.64        | 15,500,808,951.63 | 15,568,921.99 | 0.0588     |
| 资产支持证券 |       | -                        | -                 | -             | -          |
| 合计     |       | 15,485,240,029.64        | 15,500,808,951.63 | 15,568,921.99 | 0.0588     |
| 项目     |       | 上年度末<br>2023 年 12 月 31 日 |                   |               |            |
|        |       | 按实际利率计算的账<br>面价值         | 影子定价              | 偏离金额          | 偏离度<br>(%) |
| 债券     | 交易所市场 | 50,110,356.17            | 50,170,356.17     | 60,000.00     | 0.0003     |
|        | 银行间市场 | 10,186,464,649.33        | 10,195,776,860.66 | 9,312,211.33  | 0.0428     |
|        | 合计    | 10,236,575,005.50        | 10,245,947,216.83 | 9,372,211.33  | 0.0431     |
| 资产支持证券 |       | -                        | -                 | -             | -          |
| 合计     |       | 10,236,575,005.50        | 10,245,947,216.83 | 9,372,211.33  | 0.0431     |

- 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

无。

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<br>2024 年 12 月 31 日 |           |
|-------|-------------------------|-----------|
|       | 账面余额                    | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | -                       | -         |
| 银行间市场 | 3,722,275,974.18        | -         |
| 合计    | 3,722,275,974.18        | -         |

| 项目    | 上年度末<br>2023 年 12 月 31 日 |           |
|-------|--------------------------|-----------|
|       | 账面余额                     | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | -                        | -         |
| 银行间市场 | 2,931,074,661.47         | -         |
| 合计    | 2,931,074,661.47         | -         |

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

7.4.7.5 债权投资

无。

7.4.7.6 其他债权投资

无。

7.4.7.7 其他权益工具投资

无。

7.4.7.8 其他资产

无。

7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2024 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2023 年 12 月 31 日 |
|-------------|-------------------------|--------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                       | -                        |
| 应付赎回费       | -                       | 0.79                     |
| 应付证券出借违约金   | -                       | -                        |
| 应付交易费用      | 204,285.33              | 114,385.33               |
| 其中：交易所市场    | -                       | -                        |
| 银行间市场       | 204,285.33              | 114,385.33               |
| 应付利息        | -                       | -                        |
| 预提费用        | 174,000.00              | 282,000.00               |
| 合计          | 378,285.33              | 396,386.12               |

7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

长盛添利宝货币 A

| 项目            | 本期<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日 |                     |
|---------------|----------------------------------------|---------------------|
|               | 基金份额（份）                                | 账面金额                |
| 上年度末          | 21,414,572,303.91                      | 21,414,572,303.91   |
| 本期申购          | 292,442,898,974.59                     | 292,442,898,974.59  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -287,473,559,881.52                    | -287,473,559,881.52 |

|     |                   |                   |
|-----|-------------------|-------------------|
| 本期末 | 26,383,911,396.98 | 26,383,911,396.98 |
|-----|-------------------|-------------------|

长盛添利宝货币 B

| 项目            | 本期                               |                   |
|---------------|----------------------------------|-------------------|
|               | 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日 |                   |
|               | 基金份额（份）                          | 账面金额              |
| 上年度末          | 341,604,711.74                   | 341,604,711.74    |
| 本期申购          | 1,469,476,603.19                 | 1,469,476,603.19  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -1,715,214,174.59                | -1,715,214,174.59 |
| 本期末           | 95,867,140.34                    | 95,867,140.34     |

注：申购份额含红利再投、转换入份额和因份额升降级导致的强制调增份额，赎回份额含转换出份额和因份额升降级导致的强制调减份额。

7.4.7.11 其他综合收益

无。

7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

长盛添利宝货币 A

| 项目             | 已实现部分           | 未实现部分 | 未分配利润合计         |
|----------------|-----------------|-------|-----------------|
| 上年度末           | -               | -     | -               |
| 本期期初           | -               | -     | -               |
| 本期利润           | 375,513,719.65  | -     | 375,513,719.65  |
| 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        | -375,513,719.65 | -     | -375,513,719.65 |
| 本期末            | -               | -     | -               |

长盛添利宝货币 B

| 项目             | 已实现部分         | 未实现部分 | 未分配利润合计       |
|----------------|---------------|-------|---------------|
| 上年度末           | -             | -     | -             |
| 本期期初           | -             | -     | -             |
| 本期利润           | 5,409,318.11  | -     | 5,409,318.11  |
| 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        | -5,409,318.11 | -     | -5,409,318.11 |
| 本期末            | -             | -     | -             |

7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期                             | 上年度可比期间                |
|----|--------------------------------|------------------------|
|    | 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 | 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 |

|           | 日              | 12 月 31 日      |
|-----------|----------------|----------------|
| 活期存款利息收入  | 175,155.80     | 56,485.42      |
| 定期存款利息收入  | 192,571,838.12 | 198,837,536.88 |
| 其他存款利息收入  | -              | -              |
| 结算备付金利息收入 | 72.04          | 593.18         |
| 其他        | 22.11          | -              |
| 合计        | 192,747,088.07 | 198,894,615.48 |

7.4.7.14 股票投资收益

无。

7.4.7.15 债券投资收益

7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目                           | 本期<br>2024年1月1日至2024<br>年12月31日 | 上年度可比期间<br>2023年1月1日至2023年12<br>月31日 |
|------------------------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 债券投资收益——利息收入                 | 252,708,693.92                  | 215,594,147.74                       |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | 23,202,853.38                   | 13,771,673.23                        |
| 债券投资收益——赎回差价收入               | -                               | -                                    |
| 债券投资收益——申购差价收入               | -                               | -                                    |
| 合计                           | 275,911,547.30                  | 229,365,820.97                       |

7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目                     | 本期<br>2024年1月1日至2024<br>年12月31日 | 上年度可比期间<br>2023年1月1日至2023年12<br>月31日 |
|------------------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额   | 27,292,350,514.07               | 21,263,963,327.78                    |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 27,098,322,663.69               | 21,149,371,957.10                    |
| 减：应计利息总额               | 170,824,997.00                  | 100,819,697.45                       |
| 减：交易费用                 | -                               | -                                    |
| 买卖债券差价收入               | 23,202,853.38                   | 13,771,673.23                        |

7.4.7.16 资产支持证券投资收益

无。

7.4.7.17 贵金属投资收益

无。

7.4.7.18 衍生工具收益

无。

7.4.7.19 股利收益

无。

7.4.7.20 公允价值变动收益

无。

7.4.7.21 其他收入

无。

7.4.7.22 信用减值损失

无。

7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日 |
|---------|----------------------------------------|---------------------------------------------|
| 审计费用    | 45,000.00                              | 153,000.00                                  |
| 信息披露费   | 120,000.00                             | 120,000.00                                  |
| 证券出借违约金 | -                                      | -                                           |
| 银行费用    | 100,429.29                             | 95,365.70                                   |
| 账户维护费   | 36,000.00                              | 35,640.00                                   |
| 其他      | 1,200.00                               | 1,200.00                                    |
| 合计      | 302,629.29                             | 405,205.70                                  |

7.4.7.24 分部报告

无。

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

无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

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（“星展银行”）  | 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      |
| 安徽省信用融资担保集团有限公司          | 基金管理人的股东      |
| 长盛创富资产管理有限公司（“长盛创富”）     | 基金管理人的全资子公司   |
| 长盛基金（香港）有限公司             | 基金管理人的全资子公司   |
| 国元股权投资有限公司               | 基金管理人股东的控股子公司 |
| 星展银行（中国）有限公司（“星展银行（中国）”） | 基金管理人股东的控股子公司 |

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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

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<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年<br>12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2023 年 1 月 1 日至 2023 年<br>12 月 31 日 |
|------------------|-------------------------------------------|------------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费   | 82,823,225.05                             | 65,646,900.44                                  |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 41,057,855.05                             | 31,283,719.59                                  |
| 应支付基金管理人的净管理费    | 41,765,370.00                             | 34,363,180.85                                  |

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.33%的年管理费率计提。计算方法如下：

$$H=E\times\text{年管理费率}/\text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12<br>月 31 日 | 上年度可比期间<br>2023 年 1 月 1 日至 2023 年<br>12 月 31 日 |
|----------------|-------------------------------------------|------------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 25,097,946.93                             | 19,893,000.08                                  |

注：基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.10%的年托管费率计提。计算方法如下：

$$H=E\times\text{年托管费率}/\text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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                               |           |           |
|----------------|----------------------------------|-----------|-----------|
|                | 2024 年 1 月 1 日至 2024 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        |
| 长盛基金公司         | 6,969.93                         | 12,577.86 | 19,547.79 |
| 中国银行           | 11,721.06                        | -         | 11,721.06 |
| 国元证券           | 5,058.79                         | -         | 5,058.79  |
| 星展银行（中国）       | 38,204.93                        | -         | 38,204.93 |
| 合计             | 61,954.71                        | 12,577.86 | 74,532.57 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间                          |           |           |
|                | 2023 年 1 月 1 日至 2023 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        |
| 长盛基金公司         | 7,426.88                         | 18,859.27 | 26,286.15 |
| 中国银行           | 13,861.32                        | -         | 13,861.32 |
| 国元证券           | 1,815.36                         | 1,960.11  | 3,775.47  |
| 星展银行（中国）       | 50,025.15                        | 111.11    | 50,136.26 |
| 合计             | 73,128.71                        | 20,930.49 | 94,059.20 |

注：基金销售服务费每日计提，按月支付。本基金 A 类基金份额和 B 类基金份额的年销售服务费率分别为 0.25%和 0.01%。计算方法如下：

$H=E\times \text{对应级别年销售服务费率}/\text{当年天数}$

H 为对应级别每日应计提的销售服务费

E 为对应级别前一日的基金资产净值

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

| 银行间市场交易的各关联方名称 | 本期                               |      |       |      |       |      |
|----------------|----------------------------------|------|-------|------|-------|------|
|                | 2024 年 1 月 1 日至 2024 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 |
| -              | -                                | -    | -     | -    | -     | -    |
| 银行间市场交易的各关联方名称 | 上年度可比期间                          |      |       |      |       |      |
|                | 2023 年 1 月 1 日至 2023 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           | 100,018,528.15                   | -    | -     | -    | -     | -    |

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

无。

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

份额单位：份

长盛添利宝货币 A

| 关联方名称          | 本期末<br>2024 年 12 月 31 日 |                         | 上年度末<br>2023年12月31日 |                         |
|----------------|-------------------------|-------------------------|---------------------|-------------------------|
|                | 持有的<br>基金份额             | 持有的基金份额<br>占基金总份额的比例（%） | 持有的<br>基金份额         | 持有的基金份额<br>占基金总份额的比例（%） |
| 国元股权投资<br>有限公司 | -                       | -                       | 1,401,999.14        | 0.0065                  |

注：对于分级基金，比例的分母采用各自级别的份额。

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<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31<br>日 |            | 上年度可比期间<br>2023年1月1日至2023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  | 238,873,219.53                            | 175,155.80 | 786,076.03                       | 56,485.42 |
| 合计    | 238,873,219.53                            | 175,155.80 | 786,076.03                       | 56,485.42 |

注：本基金的活期银行存款和部分定期存款（如有）由基金托管人中国银行保管，按银行约定利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

| 长盛添利宝货币 A        |                   |              |                |    |
|------------------|-------------------|--------------|----------------|----|
| 已按再投资形式转<br>实收基金 | 直接通过应付<br>赎回款转出金额 | 应付利润<br>本年变动 | 本期利润分配合<br>计   | 备注 |
| 375,513,719.65   | -                 | -            | 375,513,719.65 | -  |
| 长盛添利宝货币 B        |                   |              |                |    |
| 已按再投资形式转<br>实收基金 | 直接通过应付<br>赎回款转出金额 | 应付利润<br>本年变动 | 本期利润分配合<br>计   | 备注 |
| 5,409,318.11     | -                 | -            | 5,409,318.11   | -  |

7.4.12 期末（2024 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

无。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

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

截至本报告期末 2024 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 650,068,888.40 元，是以如下债券作为质押：

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<br>单价 | 数量（张）     | 期末估值总额         |
|--------|----------|----------------|------------|-----------|----------------|
| 220202 | 22 国开 02 | 2025 年 1 月 2 日 | 102.25     | 1,500,000 | 153,380,200.67 |
| 220214 | 22 国开 14 | 2025 年 1 月 2 日 | 100.21     | 212,000   | 21,243,714.52  |
| 230302 | 23 进出 02 | 2025 年 1 月 2 日 | 101.77     | 800,000   | 81,412,299.42  |
| 240304 | 24 进出 04 | 2025 年 1 月 2 日 | 101.12     | 500,000   | 50,557,636.17  |
| 240309 | 24 进出 09 | 2025 年 1 月 2 日 | 100.38     | 1,053,000 | 105,697,518.12 |
| 240401 | 24 农发 01 | 2025 年 1 月 2 日 | 101.50     | 3,100,000 | 314,652,630.48 |
| 合计     |          |                |            | 7,165,000 | 726,943,999.38 |

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

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

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，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。本基金的基金管理人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对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，

及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

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同责任，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，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估，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，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本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%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末<br>2024 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2023 年 12 月 31 日 |
|--------|-------------------------|--------------------------|
| A-1    | -                       | 50,110,356.17            |
| A-1 以下 | -                       | -                        |
| 未评级    | 1,169,622,910.18        | 2,299,322,682.10         |
| 合计     | 1,169,622,910.18        | 2,349,433,038.27         |

注：上述评级均取自第三方评级机构。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末<br>2024 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2023 年 12 月 31 日 |
|--------|-------------------------|--------------------------|
| A-1    | -                       | -                        |
| A-1 以下 | -                       | -                        |
| 未评级    | 13,371,772,159.60       | 6,888,112,227.32         |
| 合计     | 13,371,772,159.60       | 6,888,112,227.32         |

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末 | 上年度末 |
|--------|-----|------|
|--------|-----|------|

|        | 2024 年 12 月 31 日 | 2023 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------|------------------|
| AAA    | 215,887,968.70   | 71,889,965.85    |
| AAA 以下 | 10,422,619.82    | -                |
| 未评级    | 717,534,371.34   | 927,139,774.06   |
| 合计     | 943,844,959.86   | 999,029,739.91   |

注：上述评级均取自第三方评级机构。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

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可随时要求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。

于本报告期末，除卖出回购金融资产款余额(计息但该利息金额不重大)以外，本基金承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一年以内且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《货币市场基金监督管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过监控基金平均剩余期限、平均剩余存续期限、高流动资产占比、持仓集中度、投资交易的不活跃品种(企业债或短期融资券)，并结合份额持有人集中度变化予以实现。

一般情况下，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 120 天，平均剩余存续期限在每个交易日均不得超过 240 天，且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；当本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的 20%时，本基金投资

组合的平均剩余期限在每个交易日不得超过 90 天，平均剩余存续期不得超过 180 天；投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于 20%；当本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的 50% 时，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 60 天，平均剩余存续期在每个交易日均不得超过 120 天；投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于 30%。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

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未来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。

本基金的基金管理人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<br>2024 年 12 月 31 日 | 6 个月以内            | 6 个月-1 年         | 1-5 年 | 不计息           | 合计                |
|-------------------------|-------------------|------------------|-------|---------------|-------------------|
| 资产                      |                   |                  |       |               |                   |
| 货币资金                    | 6,304,862,869.81  | 1,593,000,000.00 | -     | 40,372,428.51 | 7,938,235,298.32  |
| 存出保证金                   | 2,423.66          | -                | -     | 1.21          | 2,424.87          |
| 交易性金融资产                 | 13,644,641,364.72 | 1,809,336,713.29 | -     | 31,261,951.63 | 15,485,240,029.64 |
| 买入返售金融资产                | 3,721,087,221.62  | -                | -     | 1,188,752.56  | 3,722,275,974.18  |
| 应收申购款                   | -                 | -                | -     | 6,783.39      | 6,783.39          |
| 资产总计                    | 23,670,593,879.81 | 3,402,336,713.29 | -     | 72,829,917.30 | 27,145,760,510.40 |

|                          |                   |                  |       |                |                   |
|--------------------------|-------------------|------------------|-------|----------------|-------------------|
| 负债                       |                   |                  |       |                |                   |
| 应付管理人报酬                  | -                 | -                | -     | 7,532,485.32   | 7,532,485.32      |
| 应付托管费                    | -                 | -                | -     | 2,282,571.31   | 2,282,571.31      |
| 卖出回购金融资产款                | 649,998,805.00    | -                | -     | 70,083.40      | 650,068,888.40    |
| 应付销售服务费                  | -                 | -                | -     | 5,686,137.58   | 5,686,137.58      |
| 应交税费                     | -                 | -                | -     | 33,605.14      | 33,605.14         |
| 其他负债                     | -                 | -                | -     | 378,285.33     | 378,285.33        |
| 负债总计                     | 649,998,805.00    | -                | -     | 15,983,168.08  | 665,981,973.08    |
| 利率敏感度缺口                  | 23,020,595,074.81 | 3,402,336,713.29 | -     | 56,846,749.22  | 26,479,778,537.32 |
| 上年度末<br>2023 年 12 月 31 日 | 6 个月以内            | 6 个月-1 年         | 1-5 年 | 不计息            | 合计                |
| 资产                       |                   |                  |       |                |                   |
| 货币资金                     | 6,706,784,115.84  | 2,352,000,000.00 | -     | 54,962,190.87  | 9,113,746,306.71  |
| 交易性金融资产                  | 8,515,999,104.25  | 1,674,101,684.42 | -     | 46,474,216.83  | 10,236,575,005.50 |
| 买入返售金融资产                 | 2,927,819,631.72  | -                | -     | 3,255,029.75   | 2,931,074,661.47  |
| 应收申购款                    | -                 | -                | -     | 1.02           | 1.02              |
| 资产总计                     | 18,150,602,851.81 | 4,026,101,684.42 | -     | 104,691,438.47 | 22,281,395,974.70 |
| 负债                       |                   |                  |       |                |                   |
| 应付赎回款                    | -                 | -                | -     | 99.21          | 99.21             |
| 应付管理人报酬                  | -                 | -                | -     | 6,113,103.39   | 6,113,103.39      |
| 应付托管费                    | -                 | -                | -     | 1,852,455.56   | 1,852,455.56      |
| 卖出回购金融资产款                | 512,089,023.84    | -                | -     | 148,712.75     | 512,237,736.59    |
| 应付销售服务费                  | -                 | -                | -     | 4,537,285.66   | 4,537,285.66      |
| 应交税费                     | -                 | -                | -     | 81,892.52      | 81,892.52         |
| 其他负债                     | -                 | -                | -     | 396,386.12     | 396,386.12        |
| 负债总计                     | 512,089,023.84    | -                | -     | 13,129,935.21  | 525,218,959.05    |
| 利率敏感度缺口                  | 17,638,513,827.97 | 4,026,101,684.42 | -     | 91,561,503.26  | 21,756,177,015.65 |

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<br>影响金额（单位：人民币元） |                        |
|    |                    | 本期末（2024 年 12 月 31 日）           | 上年度末（2023 年 12 月 31 日） |
|    | 1. 市场利率下降 25 个基点   | 13,059,528.88                   | 8,053,647.22           |
|    | 2. 市场利率上升 25 个基点   | -13,059,528.88                  | -8,053,647.22          |

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。本基金主要投资于证券交易所上市或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 公允价值

7.4.14.1 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。                          |

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

| 公允价值计量结果所属的层次 | 本期末<br>2024 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2023 年 12 月 31 日 |
|---------------|-------------------------|--------------------------|
| 第一层次          | -                       | -                        |
| 第二层次          | 15,485,240,029.64       | 10,236,575,005.50        |
| 第三层次          | -                       | -                        |
| 合计            | 15,485,240,029.64       | 10,236,575,005.50        |

7.4.14.2.2 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。                |
| 本基金本期及上年度可比期间持有的持续以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次间未发生重大转换。 |

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

无。

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

|                                        |
|----------------------------------------|
| 于本报告期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(上年度末：同)。 |
|----------------------------------------|

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括以摊余成本计量的金融资产和金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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            | 15,485,240,029.64 | 57.04        |
|    | 其中：债券             | 15,485,240,029.64 | 57.04        |
|    | 资产支持证券            | -                 | -            |
| 2  | 买入返售金融资产          | 3,722,275,974.18  | 13.71        |
|    | 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      | 7,938,235,298.32  | 29.24        |
| 4  | 其他各项资产            | 9,208.26          | 0.00         |
| 5  | 合计                | 27,145,760,510.40 | 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 | 0.93           |               |
|    | 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 | 650,068,888.40 | 2.45          |
|    | 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

本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的 20%。

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    | 104 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 110 |

|                   |    |
|-------------------|----|
| 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 | 79 |
|-------------------|----|

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

本基金本报告期内无投资组合平均剩余期限超过 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<br>净值的比例（%） | 各期限负债占基金资产<br>净值的比例（%） |
|----|----------------------------|------------------------|------------------------|
| 1  | 30 天以内                     | 24.62                  | 2.45                   |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的<br>浮动利率债 | -                      | -                      |
| 2  | 30 天（含）—60 天               | 8.87                   | -                      |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的<br>浮动利率债 | -                      | -                      |
| 3  | 60 天（含）—90 天               | 16.79                  | -                      |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的<br>浮动利率债 | -                      | -                      |
| 4  | 90 天（含）—120 天              | 8.09                   | -                      |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的<br>浮动利率债 | -                      | -                      |
| 5  | 120 天（含）—397 天（含）          | 43.88                  | -                      |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的<br>浮动利率债 | -                      | -                      |
| 合计 |                            | 102.24                 | 2.45                   |

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

本基金本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                     | 按实际利率计算的账面价值      | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------------------------|-------------------|--------------|
| 1  | 国家债券                     | -                 | -            |
| 2  | 央行票据                     | -                 | -            |
| 3  | 金融债券                     | 1,160,353,029.77  | 4.38         |
|    | 其中：政策性金融债                | 1,140,343,342.10  | 4.31         |
| 4  | 企业债券                     | -                 | -            |
| 5  | 企业短期融资券                  | 603,723,437.71    | 2.28         |
| 6  | 中期票据                     | 349,391,402.56    | 1.32         |
| 7  | 同业存单                     | 13,371,772,159.60 | 50.50        |
| 8  | 其他                       | -                 | -            |
| 9  | 合计                       | 15,485,240,029.64 | 58.48        |
| 10 | 剩余存续期超过 397 天的浮<br>动利率债券 | -                 | -            |

8.6 期末按实际利率计算账面价值占基金资产净值比例大小排名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<br>(张) | 按实际利率计算的<br>账面价值 (元) | 占基金资产<br>净值比例 (%) |
|----|-----------|-----------------|-------------|----------------------|-------------------|
| 1  | 240401    | 24 农发 01        | 3,100,000   | 314,652,630.48       | 1.19              |
| 2  | 200203    | 20 国开 03        | 3,000,000   | 309,557,956.92       | 1.17              |
| 3  | 112470061 | 24 广州银行 CD096   | 3,000,000   | 297,820,406.53       | 1.12              |
| 4  | 112470408 | 24 厦门国际银行 CD178 | 3,000,000   | 297,742,857.47       | 1.12              |
| 5  | 112470719 | 24 厦门国际银行 CD180 | 3,000,000   | 297,708,378.24       | 1.12              |
| 6  | 112472663 | 24 长沙银行 CD288   | 3,000,000   | 297,547,488.05       | 1.12              |
| 7  | 112471478 | 24 徽商银行 CD231   | 3,000,000   | 296,325,285.10       | 1.12              |
| 8  | 112482491 | 24 中原银行 CD204   | 2,000,000   | 199,838,128.17       | 0.75              |
| 9  | 112483160 | 24 郑州银行 CD181   | 2,000,000   | 199,754,346.62       | 0.75              |
| 10 | 112483799 | 24 厦门国际银行 CD137 | 2,000,000   | 199,641,482.49       | 0.75              |

8.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值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 | 0        |
| 报告期内偏离度的最高值                   | 0.0843%  |
| 报告期内偏离度的最低值                   | -0.0094% |
| 报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值        | 0.0412%  |

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

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

报告期内无正偏离度的绝对值达到 0.5%情况。

8.8 期末按实际利率计算账面价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.9 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 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

（一）20 国开 03

2024 年 12 月 27 日，京金罚决字（2024）43 号显示，国家开发银行存在贷款支付管理不到位、

向未取得行政许可的项目发放贷款等违法违规事实，被处罚款 60 万元。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合法律法规、基金合同和公司投资制度的规定。

(二) 24 长沙银行 CD288

2024 年 10 月 11 日，湘银罚决字（2024）10 号显示，长沙银行股份有限公司存在违反账户管理规定的违法违规事实，被处罚款 200 万元。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合法律法规、基金合同和公司投资制度的规定。

(三) 24 徽商银行 CD231

2024 年 1 月 10 日，皖金罚决字（2023）16 号显示，徽商银行股份有限公司存在管理不到位，违规向虚假项目提供融资等 4 项违法违规事实，被处罚款 395 万元。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合法律法规、基金合同和公司投资制度的规定。

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，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 | 2,424.87 |
| 2  | 应收清算款 | —        |
| 3  | 应收利息  | —        |
| 4  | 应收申购款 | 6,783.39 |
| 5  | 其他应收款 | —        |
| 6  | 待摊费用  | —        |
| 7  | 其他    | —        |
| 8  | 合计    | 9,208.26 |

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<br>额比例<br>(%) | 持有份额              | 占总<br>份额<br>比例<br>(%) |
|---------------|-----------|--------------|----------------|-------------------|-------------------|-----------------------|
| 长盛添利<br>宝货币 A | 5,732,494 | 4,602.52     | 5,635,485.14   | 0.02              | 26,378,275,911.84 | 99.98                 |
| 长盛添利<br>宝货币 B | 16        | 5,991,696.27 | 95,867,140.34  | 100.00            | 0.00              | 0.00                  |
| 合计            | 5,732,510 | 4,619.23     | 101,502,625.48 | 0.38              | 26,378,275,911.84 | 99.62                 |

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（即期末基金份额总额），户均持有的基金份额的合计数=期末基金份额总额/期末持有人户数合计。

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  | 个人    | 62,198,894.56 | 0.23      |
| 2  | 银行类机构 | 20,850,687.05 | 0.08      |
| 3  | 个人    | 19,095,769.88 | 0.07      |
| 4  | 个人    | 16,400,171.60 | 0.06      |
| 5  | 个人    | 15,593,833.70 | 0.06      |
| 6  | 个人    | 12,594,881.46 | 0.05      |
| 7  | 个人    | 12,387,364.62 | 0.05      |
| 8  | 个人    | 10,774,692.77 | 0.04      |
| 9  | 个人    | 7,502,474.65  | 0.03      |
| 10 | 个人    | 7,394,737.53  | 0.03      |

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 | 55,334.15 | 0.0002      |
|                  | 长盛添利宝货币 B | 0.00      | 0.0000      |
|                  | 合计        | 55,334.15 | 0.0002      |

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<br>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

| 项目                             | 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                   | 21, 414, 572, 303. 91  | 341, 604, 711. 74    |
| 本报告期基金总申购份额                    | 292, 442, 898, 974. 59 | 1, 469, 476, 603. 19 |
| 减：本报告期基金总赎回份额                  | 287, 473, 559, 881. 52 | 1, 715, 214, 174. 59 |
| 本报告期基金拆分变动份额                   | —                      | —                    |
| 本报告期期末基金份额总额                   | 26, 383, 911, 396. 98  | 95, 867, 140. 34     |

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

本报告期内本基金管理人的高级管理人员未发生重大人事变动。

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 2024 年 9 月 20 日起，王文豪同志担任长盛添利宝货币市场基金基金经理。

报经中国证券投资基金业协会同意，自 2024 年 9 月 24 日起，段鹏同志不再担任长盛添利宝货币市场基金基金经理。

11.2.3 本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动情况

本报告期内，经中国银行股份有限公司研究决定，郭德秋先生不再担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。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

本报告期内，因业务需要，根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、基金合同及招募说明书等法律文件的规定，经履行内部适当程序，本基金自 2024 年 12 月 9 日起改聘立信会计师事务所（特殊普通合伙），详情请参考基金管理人发布的《长盛基金管理有限公司关于旗下基金改聘会计师事务所公告》。本报告期应支付给该会计师事务所的报酬为 45,000.00 元，已为本基金提供审计服务 1 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

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，管理人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

11.6.2 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 (%) |    |
| 财通证券   | 2      | -    | -                | -         | -              | -  |
| 长城证券   | 1      | -    | -                | -         | -              | -  |
| 长江证券   | 2      | -    | -                | -         | -              | -  |
| 德邦证券   | 1      | -    | -                | -         | -              | -  |
| 东方财富证券 | 2      | -    | -                | -         | -              | -  |
| 东吴证券   | 1      | -    | -                | -         | -              | -  |
| 东兴证券   | 1      | -    | -                | -         | -              | -  |
| 方正证券   | 1      | -    | -                | -         | -              | -  |
| 光大证券   | 2      | -    | -                | -         | -              | -  |
| 广发证券   | 1      | -    | -                | -         | -              | -  |
| 国海证券   | 1      | -    | -                | -         | -              | -  |
| 国联证券   | 1      | -    | -                | -         | -              | -  |

|      |   |   |   |   |   |   |
|------|---|---|---|---|---|---|
| 国泰君安 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国投证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 国新证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国信证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国元证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华安证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华泰证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华源证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 上海证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 西南证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 星展证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 兴业证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 银河证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 招商证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 浙商证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中金公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中信建投 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中信证券 | 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 (%) |
| 财通证券   | -             | -                | -      | -                  | -    | -                |
| 长城证券   | -             | -                | -      | -                  | -    | -                |
| 长江证券   | -             | -                | -      | -                  | -    | -                |
| 德邦证券   | -             | -                | -      | -                  | -    | -                |
| 东方财富证券 | -             | -                | -      | -                  | -    | -                |
| 东吴证券   | -             | -                | -      | -                  | -    | -                |
| 东兴证券   | -             | -                | -      | -                  | -    | -                |
| 方正证券   | -             | -                | -      | -                  | -    | -                |
| 光大证券   | -             | -                | -      | -                  | -    | -                |
| 广发证券   | -             | -                | -      | -                  | -    | -                |
| 国海证券   | -             | -                | -      | -                  | -    | -                |
| 国联证券   | -             | -                | -      | -                  | -    | -                |
| 国泰君安   | 20,058,900.00 | 100.00           | -      | -                  | -    | -                |
| 国投证券   | -             | -                | -      | -                  | -    | -                |
| 国新证券   | -             | -                | -      | -                  | -    | -                |

|      |   |   |   |   |   |   |
|------|---|---|---|---|---|---|
| 国信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国元证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华安证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华泰证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华源证券 | - | - | - | - | - | - |
| 上海证券 | - | - | - | - | - | - |
| 西南证券 | - | - | - | - | - | - |
| 星展证券 | - | - | - | - | - | - |
| 兴业证券 | - | - | - | - | - | - |
| 银河证券 | - | - | - | - | - | - |
| 招商证券 | - | - | - | - | - | - |
| 浙商证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中金公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中信建投 | - | - | - | - | - | - |
| 中信证券 | - | - | - | - | - | - |

注：1、交易单元的选择标准

（1）具备监管机构规定的相关资质、财务状况良好、经营行为规范、合规风控能力较强。

（2）具有较强的研究服务能力、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。

（3）具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合证券交易的需要。

2、交易单元的选择程序：

（1）基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单元的证券经营机构。

（2）基金管理人和被选中的证券经营机构签订协议。

3、本报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

（1）报告期内，本基金新增租用：华源证券 1 个交易单元。

（2）报告期内，本基金停止租用：东北证券 2 个交易单元、申万宏源证券 2 个交易单元、申港证券 1 个交易单元、华安证券 1 个交易单元、中信建投证券 1 个交易单元。

4、本部分的数据统计时间区间与本报告的报告期一致，统计范围仅包括本基金；本公司网站披露的《长盛基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况公告（2024 年度）》的报告期为 2024 年 7 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日，报告的主要内容为报告期间本公司旗下存续过的所有公募基金通过租用证券公司交易单元和委托证券公司进行证券投资及佣金支付情况，包括报告期间成立、清算、转型（如有）的公募基金。敬请投资者关注上述报告的统计口径

差异。

11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

本报告期本基金无偏离度绝对值超过 0.5%的情况。

11.9 其他重大事件

| 序号 | 公告事项                                              | 法定披露方式      | 法定披露日期          |
|----|---------------------------------------------------|-------------|-----------------|
| 1  | 长盛添利宝货币市场基金 2023 年第 4 季度报告                        | 中国证监会指定披露媒介 | 2024 年 1 月 20 日 |
| 2  | 长盛基金管理有限公司旗下基金 2023 年第 4 季度报告提示性公告                | 中国证监会指定披露媒介 | 2024 年 1 月 20 日 |
| 3  | 长盛基金管理有限公司关于旗下基金增加江苏银行为代销机构的公告                    | 中国证监会指定披露媒介 | 2024 年 3 月 6 日  |
| 4  | 长盛添利宝货币市场基金 2023 年年度报告                            | 中国证监会指定披露媒介 | 2024 年 3 月 30 日 |
| 5  | 长盛基金管理有限公司旗下基金 2023 年年度报告提示性公告                    | 中国证监会指定披露媒介 | 2024 年 3 月 30 日 |
| 6  | 长盛基金管理有限公司旗下基金 2024 年 1 季度报告提示性公告                 | 中国证监会指定披露媒介 | 2024 年 4 月 20 日 |
| 7  | 长盛添利宝货币市场基金 2024 年第 1 季度报告                        | 中国证监会指定披露媒介 | 2024 年 4 月 20 日 |
| 8  | 长盛添利宝货币市场基金招募说明书（更新）                              | 中国证监会指定披露媒介 | 2024 年 5 月 7 日  |
| 9  | 长盛添利宝货币市场基金（长盛添利宝货币 B 份额）基金产品资料概要更新               | 中国证监会指定披露媒介 | 2024 年 5 月 7 日  |
| 10 | 长盛添利宝货币市场基金（长盛添利宝货币 A 份额）基金产品资料概要更新               | 中国证监会指定披露媒介 | 2024 年 5 月 7 日  |
| 11 | 长盛添利宝货币市场基金（长盛添利宝货币 B 份额）基金产品资料概要更新               | 中国证监会指定披露媒介 | 2024 年 6 月 25 日 |
| 12 | 长盛添利宝货币市场基金（长盛添利宝货币 A 份额）基金产品资料概要更新               | 中国证监会指定披露媒介 | 2024 年 6 月 25 日 |
| 13 | 长盛基金管理有限公司旗下基金 2024 年 2 季度报告提示性公告                 | 中国证监会指定披露媒介 | 2024 年 7 月 19 日 |
| 14 | 长盛添利宝货币市场基金 2024 年第 2 季度报告                        | 中国证监会指定披露媒介 | 2024 年 7 月 19 日 |
| 15 | 长盛基金管理有限公司关于增加西部证券为旗下部分开放式基金代销机构并开通基金定投业务及转换业务的公告 | 中国证监会指定披露媒介 | 2024 年 8 月 15 日 |
| 16 | 长盛添利宝货币市场基金 2024 年中                               | 中国证监会指定披露媒介 | 2024 年 8 月 30 日 |

|    |                                           |             |                  |
|----|-------------------------------------------|-------------|------------------|
|    | 期报告                                       | 介           |                  |
| 17 | 长盛基金管理有限公司旗下基金 2024 年中期报告提示性公告            | 中国证监会指定披露媒介 | 2024 年 8 月 30 日  |
| 18 | 长盛基金管理有限公司关于调整长盛添利宝货币市场基金基金经理的公告          | 中国证监会指定披露媒介 | 2024 年 9 月 21 日  |
| 19 | 长盛添利宝货币市场基金（长盛添利宝货币 A 份额）基金产品资料概要更新       | 中国证监会指定披露媒介 | 2024 年 9 月 25 日  |
| 20 | 长盛添利宝货币市场基金（长盛添利宝货币 B 份额）基金产品资料概要更新       | 中国证监会指定披露媒介 | 2024 年 9 月 25 日  |
| 21 | 长盛添利宝货币市场基金招募说明书（更新）                      | 中国证监会指定披露媒介 | 2024 年 9 月 25 日  |
| 22 | 长盛基金管理有限公司关于调整长盛添利宝货币市场基金基金经理的公告          | 中国证监会指定披露媒介 | 2024 年 9 月 26 日  |
| 23 | 长盛添利宝货币市场基金招募说明书（更新）                      | 中国证监会指定披露媒介 | 2024 年 9 月 27 日  |
| 24 | 长盛添利宝货币市场基金（长盛添利宝货币 B 份额）基金产品资料概要更新       | 中国证监会指定披露媒介 | 2024 年 9 月 27 日  |
| 25 | 长盛添利宝货币市场基金（长盛添利宝货币 A 份额）基金产品资料概要更新       | 中国证监会指定披露媒介 | 2024 年 9 月 27 日  |
| 26 | 长盛添利宝货币市场基金 2024 年第 3 季度报告                | 中国证监会指定披露媒介 | 2024 年 10 月 25 日 |
| 27 | 长盛基金管理有限公司旗下基金 2024 年第 3 季度报告提示性公告        | 中国证监会指定披露媒介 | 2024 年 10 月 25 日 |
| 28 | 长盛基金管理有限公司关于旗下基金改聘会计师事务所公告                | 中国证监会指定披露媒介 | 2024 年 12 月 9 日  |
| 29 | 长盛基金管理有限公司关于旗下基金增加上海中欧财富基金销售有限公司作为销售机构的公告 | 中国证监会指定披露媒介 | 2024 年 12 月 24 日 |

§ 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

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

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。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、长盛添利宝货币市场基金相关批准文件；
- 2、《长盛添利宝货币市场基金基金合同》；
- 3、《长盛添利宝货币市场基金托管协议》；
- 4、《长盛添利宝货币市场基金招募说明书》；
- 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、010-86497888。

网址：<http://www.csfunds.com.cn>。

长盛基金管理有限公司

2025 年 3 月 29 日