长盛添利30天理财债券型证券投资基金

2014 年度报告摘要

基金管理人:长盛基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
送出日期:2015年3月28日

§1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年3月27日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

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

本报告期自2014年01月01日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

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

2.2 基金产品说明

投资目标	在追求本金稳妥的基础上,力争为基金份额持有人获取高于业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金在投资组合管理中将采用主动投资策略,在投资中将充分发挥现代金融工程与数量化分析技术方法的决策辅助作用,以提高投资决策的科学性与及时性,在控制风险的前提下,追求收益最大化。
业绩比较基准	七天通知存款税后利率。
风险收益特征	本基金属于债券型证券投资基金,长期风险收益水平低于股票型基金、混合型基金、高于货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		长盛基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	叶金松	王永民
	联系电话	010-82019988	010-66594896
	电子邮箱	yejs@csfunds.com.cn	fcsd@bankofchina.com
客户服务电话		400-888-2666,010-62350088	95566
传真		010-82255988	010-66594942

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.csfunds.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人的办公地址及基金托管人住所

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

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

注:1、本基金收益分配是按日结转份额。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益,由于本基金采用摊余成本法核算,因此公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

长盛添利30天理财债券A

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.7827%	0.0028%	0.3403%	0.0000%	0.4424%	0.0028%
过去六个月	1.5609%	0.0092%	0.6805%	0.0000%	0.8804%	0.0092%
过去一年	3.4273%	0.0071%	1.3500%	0.0000%	2.0773%	0.0071%
自基金合同生效起至今	7.5678%	0.0052%	2.9478%	0.0000%	4.6200%	0.0052%

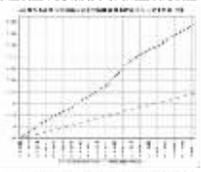
长盛添利30天理财债券B

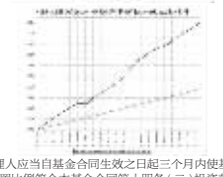
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.8422%	0.0028%	0.3403%	0.0000%	0.5019%	0.0028%
过去六个月	1.6713%	0.0093%	0.6805%	0.0000%	0.9908%	0.0093%
过去一年	3.6346%	0.0072%	1.3500%	0.0000%	2.2846%	0.0072%
自基金合同生效起至今	7.7937%	0.0053%	2.9478%	0.0000%	4.8459%	0.0053%

注:1、本基金收益分配是按日结转份额。

2、本基金业绩比较基准的构建及再平衡过程:本基金业绩比较基准为七天通知存款税后利率。通知存款是一种不约定存期,支取时需提前通知银行,约定支取日期和金额方能支取的存款,具有存期灵活、存取方便的特征,同时可获得高于活期存款利息的收益。本基金为短期理财型基金产品,风险收益水平低,是储蓄存款的良好投资替代工具,所以以七天通知存款税后利率作为业绩比较基准。本基金的业绩比较基准将根据央行调息而调整。

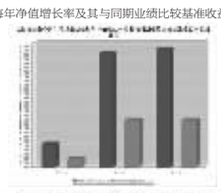
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

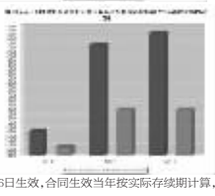




注:按照本基金合同规定,基金管理人应当自基金合同生效之日起三个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。截止报告日,本基金的各项资产配置比例符合本基金合同第十四条(二)投资范围、(七)投资禁止行为与限制的有关约定。

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





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

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

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

单位:人民币元

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

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为长盛基金管理有限公司(以下简称"公司"),成立于1999年3月26日,是国内最早成立的十家基金管理公司之一。公司注册资本为人民币18900万元。公司注册地在深圳,总部设在北京,并在北京、上海、郑州、杭州、成都设有分公司,在香港、北京分别设有子公司。目前,公司股东及其出资比例为:国元证券股份有限公司(以下简称"国元证券")占注册资本的41%,新加坡星展银行有限公司占注册资本的33%,安徽省信用担保集团有限公司占注册资本的13%,安徽省投资集团控股有限公司占注册资本的13%。公司获得首批全国社保基金、合格境内机构投资者和特定客户资产管理业务资格。截至2014年12月31日,基金管理人共管理三十七只开放式基金,并管理多个全国社保基金组合和专户产品。公司同时兼任境外QFII基金和专户理财产品的投资顾问。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
段鹏	本基金基金经理,长盛货币市场基金基金经理,长盛添利60天理财债券型发起式证券投资基金基金经理,长盛年年收益定期开放债券型证券投资基金基金经理。	2014年4月10日	-	7年	男,1982年12月出生,中国国籍,中央财经大学经济学硕士。曾在中信银行股份有限公司从事人民币货币市场交易,债券投资及流动性管理等工作。2013年12月加入长盛基金管理有限公司,现任长盛货币市场基金基金经理,长盛添利30天理财债券型证券投资基金(本基金)基金经理,长盛添利60天理财债券型发起式证券投资基金基金经理,长盛年年收益定期开放债券型证券投资基金基金经理。
杨衡	本基金基金经理,长盛添利60天理财债券型发起式证券投资基金基金经理,长盛同丰分级债券型证券投资基金基金经理,长盛纯债债券型证券投资基金基金经理,社保组合组合经理。	2012年10月26日	2014年4月10日	7年	男,1975年10月出生,中国国籍,中国科学院数学与系统科学研究院博士,博士后。2007年7月进入长盛基金管理公司,先后任固定收益研究员、社保组合组合经理助理等职务,现任社保组合组合经理。自2014年4月10日起不再担任长盛添利30天理财债券型证券投资基金(本基金)基金经理,长盛添利60天理财债券型发起式证券投资基金基金经理,长盛同丰分级债券型证券投资基金基金经理,长盛纯债债券型证券投资基金基金经理。

注:1、上表基金经理的任职日期和离任日期均指公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2、"证券从业年限"中"证券从业"的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格按照《证券投资基金法》及其各项实施准则、本基金的基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定,依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制投资风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

研究支持,公司旗下所有投资组合共享公司研究部门研究成果,所有投资组合经理在公司研究平台上拥有同等权限。

投资授权与决策,公司实行投资决策委员会领导下的投资组合经理负责制,各投资组合经理在投资决策委员会的授权范围内,独立完成投资组合的管理工作。各投资组合经理遵守投资信息隔离墙制度。

交易执行,公司实行集中交易制度,所有投资组合的投资指令均由交易部统一执行委托交易。交易部依照《公司公平交易细则》的规定,场内交易,强制开启恒生交易系统公平交易程序;场外交易,严格遵守相关工作流程,保证交易执行的公平性。

投资管理行为的监控与分析评估,公司风险管理部、监察稽核部,依照《公司公平交易细则》的规定,持续、动态监督公司投资管理全过程,并进行分析评估,及时向公司管理层报告发现问题,保障公司旗下所有投资组合均被公平对待。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

公司对该基金过去4个季度的同向交易行为进行数量分析,计算溢价率、贡献率、占优比等指标,使用双边90%置信水平对1日、3日、5日的交易片段进行T检验,未发现违反公平交易及利益输送的行为。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内,本基金未发生可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

1、报告期内行情回顾

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

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

2、报告期内本基金投资策略分析

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

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

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

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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

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

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

本基金管理人制订的证券投资基金估值政策与估值程序确定了估值目的、估值日、估值对象、估值程序、估值方法以及估值差错处理、暂停估值和特殊情形处理等事项。本基金管理人设立了由公司总经理(担任估值小组组长)、公司副总经理和督察长(担任估值小组副组长)、权益投资部、风险管理部、研究部、监察稽核部、业务运营部等部门负责人组成的基金估值小组,负责研究、指导并执行基金估值业务。小组成员均具有多年证券、基金从业经验,具备基金估值运作、行业研究、风险管理或法律合规等领域的专业胜任能力。

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

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内,中国银行股份有限公司(以下称"本托管人")在对长盛添利30天理财债券型证券投资基金(以下称"本基金")的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§6 审计报告

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)注册会计师汪棣、沈兆杰于2015年3月23日对本基金2014年12月31日的资产负债表、2014年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注出具了普华永道中天审字(2015)第20193号无保留意见的审计报告。投资者欲查看审计报告全文,应阅读本年度报告正文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:长盛添利30天理财债券型证券投资基金

报告截止日:2014年12月31日

单位:人民币元

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

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

7.2 利润表

会计主体:长盛添利30天理财债券型证券投资基金

本报告期:2014年1月1日至2014年12月31日

单位:人民币元

项 目	本期 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日
一、收入	2,835,850.83	11,284,540.10
1.利息收入	2,835,092.22	11,297,542.57
其中:存款利息收入	2,211,197.01	8,079,714.93
债券利息收入	145,450.98	2,560,396.24
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	478,444.23	657,431.40
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	758.61	-357,002.47
其中:股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	758.61	-357,002.47
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	-	-
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-	-
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	-	344,000.00
减:二、费用	629,624.63	2,422,507.95
1.管理人报酬	156,298.36	733,705.49
2.托管费	46,310.60	217,394.28
3.销售服务费	66,380.08	547,211.54
4.交易费用	-	-
5.利息支出	1,420.06	548,579.90
其中:卖出回购金融资产支出	1,420.06	548,579.90
6.其他费用	359,215.53	375,616.74
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	2,206,226.20	8,862,032.15
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	2,206,226.20	8,862,032.15

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:长盛添利30天理财债券型证券投资基金

本报告期:2014年1月1日至2014年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	90,376,931.34	-	90,376,931.34
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	2,206,226.20	2,206,226.20
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	-38,344,813.64	-	-38,344,813.64
其中:1.基金申购款	280,698,741.54	-	280,698,741.54
2.基金赎回款	-319,043,555.18	-	-319,043,555.18
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-2,206,226.20	-2,206,226.20
五、期末所有者权益(基金净值)	52,032,117.70	-	52,032,117.70
项目	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	1,133,045,662.16	-	1,133,045,662.16
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	8,862,032.15	8,862,032.15
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	-1,042,668,730.82	-	-1,042,668,730.82
其中:1.基金申购款	250,146,691.56	-	250,146,691.56
2.基金赎回款	-1,292,815,422.38	-	-1,292,815,422.38
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-8,862,032.15	-8,862,032.15
五、期末所有者权益(基金净值)	90,376,931.34	-	90,376,931.34

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署:

周兵 林培富 龚珉

基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

长盛添利30天理财债券型证券投资基金(以下简称"本基金")经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监许可[2012]1343号《关于核准长盛添利30天理财债券型证券投资基金募集的批复》核准,由长盛基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《长盛添利30天理财债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型定期开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集4,138,323,703.82元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2012)第415号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《长盛添利30天理财债券型证券投资基金基金合同》于2012年10月26日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为4,138,676,687.06份基金份额,其中认购资金利息折合352,983.24份基金份额。本基金的基金管理人为长盛基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司。

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《长盛添利30天理财债券型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为现金、通知存款、一年以内(含一年)的银行定期存款和大额存单、剩余期限(或回售期限)在397天以内(含397天)的债券、资产支持证券、中期票据、期限在一年以内(含一年)的债券回购、期限在一年以内(含一年)的中央银行票据、短期融资券及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他固定收益类金融工具。本基金的业绩比较基准为:七天通知存款税后利率。

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

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则-基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称"企业会计准则")、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《长盛添利30天理财债券型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2014年度财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金2014年12月31日的财务状况以及2014年度经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

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

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1)以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围,不征收营业税。基金买卖债券的差价收入不予征收营业税。

(2)对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖债券的差价收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入,应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。

7.4.7 关联方关系

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

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

注:本基金本期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行交易。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

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

注:支付基金管理人 长盛基金公司的管理人报酬按前一日基金资产净值0.27%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.27%/当年天数。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

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

注:支付基金托管人 中国银行 的托管费按前一日基金资产净值0.08%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日托管费=前一日基金资产净值×0.08%/当年天数。

7.4.8.2.3 销售服务费

单位:人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	长盛添利30天理财债券A	长盛添利30天理财债券B	合计
中国银行	57,970.32	538.23	58,508.55
长盛基金公司	252.20	2,949.74	3,201.94
国元证券	25.76	-	25.76
合计	58,248.28	3,487.97	61,736.25
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	长盛添利30天理财债券A	长盛添利30天理财债券B	合计
中国银行	529,254.38	1,224.87	530,479.25
长盛基金公司	781.13	6,478.35	7,259.48
国元证券	44.20	-	44.20
合计	530,079.71	7,703.22	537,782.93

注:支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值的约定年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付给 长盛基金公司,再由 长盛基金公司 计算并支付给各基金销售机构。A类基金份额和B类基金份额约定的销售服务费年费率分别为0.28%和0.01%。销售服务费的计算公式为:对应级别日销售服务费=前一日对应级别基金资产净值×约定年费率/当年天数。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位:人民币元

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

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注:本基金基金管理人本期及上年度可比期间未运用固有资金投资本基金。

7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注:除基金管理人之外的其他关联方本期末及上年度末未投资本基金。

7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年12月31日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当