长盛添利宝货币市场基金 2018年半年度报告摘要

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:2018年8月29日

§1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半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2018年8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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年01月01日起至06月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	长盛添利宝货币	
基金主代码	000424	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013年12月9日	
基金管理人	长盛基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	2,523,394,829.77份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	长盛添利宝货币A	长盛添利宝货币B
下属分级基金的交易代码:	000424	000425
报告期末下属分级基金的份额总额	99,901,605.87份	2,423,493,223.90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
信息披露负责人	姓名	张利宁	王永民
	联系电话	010-82019988	010-66594896
	电子邮箱	zhangln@csfunds.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-888-2666,010-62350088	95566
传真		010-82265988	010-66594942

2.4 信息披露方式

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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

基金级别	长盛添利宝货币A	长盛添利宝货币B
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2018年1月1日-2018年6月30日)	报告期(2018年1月1日-2018年6月30日)
本期已实现收益	2,101,549.91	119,538,393.56
本期利润	2,101,549.91	119,538,393.56
本期净值收益率	1.8905%	2.0120%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)	
期末基金资产净值	99,901,605.87	2,423,493,223.90
期末基金份额净值	1.0000	1.0000

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、表中的"期末"均指本报告期最后一日,即6月30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
过去一个月	0.2979%	0.0033%	0.1110%	0.0000%	0.1869%	0.0033%
过去三个月	0.8681%	0.0024%	0.3366%	0.0000%	0.5315%	0.0024%
过去六个月	1.8905%	0.0026%	0.6695%	0.0000%	1.2210%	0.0026%
过去一年	3.7965%	0.0020%	1.3500%	0.0000%	2.4465%	0.0020%
过去三年	9.5393%	0.0042%	4.0537%	0.0000%	5.4856%	0.0042%
自基金合同生效起至今	17.7140%	0.0063%	6.1582%	0.0000%	11.5558%	0.0063%

长盛添利宝货币B

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.3177%	0.0033%	0.1110%	0.0000%	0.2067%	0.0033%
过去三个月	0.9285%	0.0024%	0.3366%	0.0000%	0.5919%	0.0024%
过去六个月	2.0120%	0.0026%	0.6695%	0.0000%	1.3425%	0.0026%
过去一年	4.0483%	0.0020%	1.3500%	0.0000%	2.6983%	0.0020%
过去三年	10.3336%	0.0042%	4.0537%	0.0000%	6.2799%	0.0042%
自基金合同生效起至今	19.0133%	0.0063%	6.1582%	0.0000%	12.8551%	0.0063%

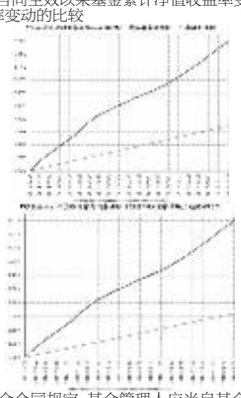
注:1、本基金收益分配是按日结转份额。

2、本基金业绩比较基准的构建及再平衡过程:

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

本基金的业绩比较基准将根据央行调息而调整。

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



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。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为长盛基金管理有限公司(以下简称公司),成立于1999年3月26日,是国内最早成立的十家基金管理公司之一。公司注册资本为人民币18900万元。公司注册地在深圳,总部设在北京,并在北京、上海、成都设有分公司,在深圳设有营销中心,并拥有长盛基金(香港)有限公司、长盛创富资产管理有限公司两家全资子公司。目前,公司股东及其出资比例为:国元证券股份有限公司占注册资本的41%,新加坡星展银行有限公司占注册资本的33%,安徽省信用担保集团有限公司占注册资本的13%,安徽省投资集团控股有限公司占注册资本的13%。公司获得首批全国社保基金、合格境内机构投资者、特定客户资产管理业务资格和保险资产管理人资格。截至2018年6月30日,基金管理人共管理六十八只开放式基金,并管理多个全国社保基金组合和专户产品。公司同时兼任境外QFII基金和专户理财产品的投资顾问。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张帆	本基金基金经理。长盛纯债债券型证券投资基金基金经理。长盛同禧债券型证券投资基金基金经理。长盛盛杰一年期定期开放混合型证券投资基金基金经理,FOF业务部总监。	2013年12月9日	-	11年	张帆先生,1983年1月出生。华中科技大学硕士,曾在长江证券股份有限公司从事债券研究、债券投资工作。2012年4月加入长盛基金管理有限公司,曾任非信用研究员、长盛同丰分级债券型证券投资基金基金经理等职务。
段鹏	本基金基金经理,长盛货币市场基金基金经理。长盛年年收益定期开放债券型证券投资基金基金经理。长盛盛和纯债债券型证券投资基金基金经理。长盛盛誉纯债债券型证券投资基金基金经理。长盛盛裕纯债债券型证券投资基金基金经理。长盛盛裕极配置债券型证券投资基金基金经理。	2018年6月22日	-	11年	段鹏先生,1982年12月出生。中央财经大学经济学硕士,曾任中信银行股份有限公司从事人民币货币市场交易、债券投资及离岸地区管理等工作。2013年12月加入长盛基金管理有限公司。
王赛飞	本基金基金经理。长盛积极配置债券型证券投资基金。	2018年6月22日	-	6年	王赛飞女士,1987年10月出生。中国人民大学金融学硕士,曾任大公国际资信评估有限公司分析师、信用评审委员会委员。2015年7月加入长盛基金管理有限公司固定收益部,曾任信用研究员、长盛盛丰灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理等职务。

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

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作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 公平交易制度的执行情况

报告期内,公司严格执行《公司公平交易细则》各项规定,在研究、投资授权与决策、交易执行等各个环节,公平对待旗下所有投资组合,包括公募基金、社保组合、特定客户资产管理组合等。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。

公司对过去4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。

4.3.2 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,未发生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,未发现本基金有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,国内经济稳中趋缓,基本面继续温和回落。表外及低等级债券融资被动收缩,M2和社融同比增速下行,增加了经济的不确定性。为缓解经济下行压力,宏观政策以宽货币进行对冲,例如年初以来央行3次定向降准、大额投放MLF等,整体银行间市场资金宽松。

报告期内,债券收益率震荡下行,二季度降准落地后,资金面短期反而收紧,市场情绪警惕,带动收益率小幅回调。但随后,在贸易战升温、经济基本面回落担忧、货币政策边际改善确认、股市下跌等因素带动下,利率大幅下行。

2、报告期内本基金投资策略分析

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

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期长盛添利宝货币A的基金份额净值收益率为1.8905%,本报告期长盛添利宝货币B的基金份额净值收益率为2.0120%,同期业绩比较基准收益率为0.6695%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年,降杠杆会持续,但力度和节奏会考虑实体经济的可承受度。国务院常务会议上释放出财政边际发力信号,同时强调不搞大水漫灌式强刺激,货币政策基调维持宽松,而信贷方面对小微企业和平台企业有适当放松,叠加央行窗口指导银行增配低评级信用债,市场对"宽信用"预期升温。

考虑到中美贸易战加剧以及宽信用政策在短期内尚难见效,短期内经济增长下行压力仍存。宽货币带来的流动性宽松格局仍将持续,有利于债券市场的表现,但波动将加大。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

参与估值流程的各方还包括本基金托管人和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任,当存有异议时,托管人有责任要求基金管理公司作出合理解释,通过积极商讨达成一致意见。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见。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央国债登记结算有限责任公司和中证指数有限公司签署服务协议,由其分别按约定提供在银行间同业市场交易的债券品种和在交易所市场交易或挂牌的部分债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

按照上述办法及基金合同的规定,2018上半年度分配利润121,639,943.47元,其中:A类别份额分配利润2,101,549.91元,B类别份额分配利润119,538,393.56元。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内无基金持有人数或基金资产净值预警说明。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

5.3 托管人对本半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 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:长盛添利宝货币市场基金

报告截止日:2018年6月30日

单位:人民币元

资 产	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
资 产:		
银行存款	354,728,009.46	3,064,062,564.90
结算备付金	-	22,727.27
存出保证金	-	-
交易性金融资产	2,252,923,758.27	6,299,835,359.10
其中:股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	2,252,923,758.27	6,299,835,359.10
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	296,491,004.74	1,269,752,084.64
应收证券清算款	-	-
应收利息	32,387,240.33	62,426,704.60
应收股利	-	-
应收申购款	57,606.90	55,233,834.40
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	2,936,587,619.70	10,751,333,274.91
负债和所有者权益	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
负 债:		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	411,279,233.56	599,458,380.77
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	-	0.99
应付管理人报酬	1,046,343.18	2,888,987.14
应付托管费	317,073.68	875,450.66
应付销售服务费	53,039.15	110,652.89
应付交易费用	73,957.21	129,862.88
应交税费	34,336.07	-
应付利息	83,166.62	356,639.84
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	305,640.46	439,000.01
负债合计	413,192,789.93	604,258,975.18
所有者权益:		
实收基金	2,523,394,829.77	10,147,074,299.73
未分配利润	-	-
所有者权益合计	2,523,394,829.77	10,147,074,299.73
负债和所有者权益总计	2,936,587,619.70	10,751,333,274.91

注:报告截止日2018年6月30日,基金份额总额2,523,394,829.77份,其中A类基金份额总额99,901,605.87份,基金份额净值1.00元;B类基金份额总额2,423,493,223.90份,基金份额净值1.00元。

6.2 利润表

会计主体:长盛添利宝货币市场基金

本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

单位:人民币元

项 目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
一、收入	140,188,022.34	194,133,234.54
1.利息收入	137,325,275.16	197,794,640.95
其中:存款利息收入	31,082,362.33	85,128,161.50
债券利息收入	94,966,885.75	82,026,506.21
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	11,276,027.08	30,639,973.24
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	2,862,747.18	-3,661,406.41
其中:股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	2,862,747.18	-3,661,406.41
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)	-	-
减:二、费用	18,548,078.87	24,603,037.58
1. 管理人报酬	9,998,660.93	16,345,610.36
2. 托管费	3,029,897.18	4,953,215.29
3. 销售服务费	438,079.25	763,756.59
4. 交易费用	-	-
5. 利息支出	4,778,581.09	2,234,490.67
其中:卖出回购金融资产支出	4,778,581.09	2,234,490.67
6. 税金及附加	36,196.77	-
7. 其他费用	266,663.65	305,965.67
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	121,639,943.47	169,530,196.96
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	121,639,943.47	169,530,196.96

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:长盛添利宝货币市场基金

本报告期:2018年1月1日 至 2018年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	10,147,074,299.73	-	10,147,074,299.73
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	121,639,943.47	121,639,943.47
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)	-7,623,679,469.96	-	-7,623,679,469.96
其中:1.基金申购款	10,229,233,586.22	-	10,229,233,586.22
2.基金赎回款	-17,852,913,056.18	-	-17,852,913,056.18
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)	-	-121,639,943.47	-121,639,943.47
五、期末所有者权益(基金净值)	2,523,394,829.77	-	2,523,394,829.77
项目	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	25,553,251,808.01	-	25,553,251,808.01
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	169,530,196.96	169,530,196.96
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)	-1,359,457,208.74	-	-1,359,457,208.74
其中:1.基金申购款	41,435,494,821.41	-	41,435,494,821.41
2.基金赎回款	-42,794,952,030.15	-	-42,794,952,030.15
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)	-	-169,530,196.96	-169,530,196.96
五、期末所有者权益(基金净值)	24,193,794,599.27	-	24,193,794,599.27

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署:

林培富 刁俊东 龚珉

基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 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2018年8月27日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则-基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称"企业会计准则")、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号(年度报告和半年度报告)》、中国证券投资基金业协会(以下简称"中国基金业协会")颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《长盛添利宝货币市场基金基金合同》和中国证监会、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。

财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 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2018年6月30日的财务状况以及2018年1月1日至6月30日期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 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

本报告期所采用的的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 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。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、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股票、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,包括买卖股票、债券的差价收入,股票的股息、红利收入,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。对基金从上市公司取得的股息红利所得,持股期限在1个月以内(含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股,解禁后取得的股息、红利收入,按照上述规定计算纳税,持股时间自解禁日起计算;解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4)基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。

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

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内,未存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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”)	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

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。

6.4.8 报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 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。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	9,998,660.93	16,345,610.36
其中:支付销售机构的客户维护费	208,224.92	1,711,098.30

注:支付基金管理人长盛基金公司的管理人报酬按前一日基金资产净值0.33%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.33%/当年天数。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	3,029,897.18	4,953,215.29

注:支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值0.10%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日托管费=前一日基金资产净值×0.10%/当年天数。

6.4.8.2.3 销售服务费

单位:人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	长盛添利宝货币A	长盛添利宝货币B	合计
中国银行	27,066.80	1,028.70	28,096.50
星展银行	34,325.03	524.55	34,849.58
长盛基金	24,273.58	285,111.70	309,385.28
国元证券	62.88	5,597.64	5,660.52
合计	85,728.29	292,262.59	377,990.88
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	长盛添利宝货币A	长盛添利宝货币B	合计
中国银行	46,460.91	1,761.20	48,222.11
星展银行	17,552.75	-	17,552.75
长盛基金	32,949.45	428,280.77	461,230.22
国元证券	68.09	18,679.71	18,747.80
合计	97,031.20	448,721.68	545,752.88

注:支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值的约定年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付给长盛基金公司,再由长盛基金公司计算并支付给各基金销售机构。A类基金份额和B类基金份额约定的销售服务费年费率分别为0.25%和0.01%。销售服务费的计算公式为:

对应级别日销售服务费=前一日对应级别基金资产净值×约定年费率/当年天数。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位:人民币元

银行间市场交易的各关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日					
	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国银行	235,378,855.34	10,191,100.14	-	-	10,747,290,000.00	1,229,789.52
银行间市场交易的各关联方名称	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30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	448,513,180.58	-	-	-	97,700,000.00	7,208.30

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位:份

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	
	长盛添利宝货币A	长盛添利宝货币B
基金合同生效日(2013年12月9日)持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	-	353,568,507.30
期间申购/买入总份额	-	6,719,673.42
期间因拆分变动份额	-	-
减:期间赎回/卖出总份额	-	50,000,000.00
期末持有的基金份额	-	310,288,180.72
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	12.8020%

项目	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日	
	长盛添利宝货币A	长盛添利宝货币B
基金合同生效日(2013年12月9日)持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	-	460,972,364.64
期间申购/买入总份额	-	6,453,167.80
期间因拆分变动份额	-	-
减:期间赎回/卖出总份额	-	140,000,000.00
期末持有的基金份额	-	327,425,532.44
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	14.4331%

注:1、期间申购总份额含红利再投份额。2、基金管理人持有本基金基金份额的交易费用按市场公开的交易费率计算并支付。3、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。

6.4.8.4.2 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