

# 长盛添利宝货币市场基金 2021 年中期报告

2021 年 6 月 30 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：2021 年 8 月 28 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期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 2021 年 8 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>6</b>
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>11</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
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.....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
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.....	14
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>15</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
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.....	15
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	15
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>16</b>
6.1 资产负债表.....	16
6.2 利润表.....	17
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18

6.4 报表附注.....	19
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>39</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	39
7.2 债券回购融资情况.....	39
7.3 基金投资组合平均剩余期限.....	39
7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明.....	40
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	40
7.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细.....	41
7.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离.....	41
7.8 期末按摊余成本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.....	41
7.9 投资组合报告附注.....	41
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>44</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	44
8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况.....	44
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	45
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	45
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>46</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>47</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	47
10.2 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.....	47
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	47
10.4 基金投资策略的改变.....	47
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	47
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	47
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	47
10.8 偏离度绝对值超过 0.5% 的情况.....	50
10.9 其他重大事件.....	50
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>52</b>
11.1 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.....	52
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	52

<b>§12 备查文件目录</b> .....	<b>53</b>
12.1 备查文件目录.....	53
12.2 存放地点.....	53
12.3 查阅方式.....	53

## § 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	
交易代码	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	14,950,265,184.87 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	14,812,390,077.30 份	137,875,107.57 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
	联系电话	010-86497608
	电子邮箱	zhangln@csfunds.com.cn
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 号楼中建财富国际中心 3-5 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号

邮政编码	100029	100818
法定代表人	周兵	刘连舸

注：长盛基金管理有限公司法定代表人已于 2021 年 7 月 21 日变更为高民和。

## 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》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.csfunds.com.cn">http://www.csfunds.com.cn</a>
基金中期报告备置地点	基金管理人的办公地址及基金托管人住所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
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(2021年1月1日 - 2021年6月30日)	报告期(2021年1月1日 - 2021年6月30日)
本期已实现收益	122,784,130.52	3,118,281.02
本期利润	122,784,130.52	3,118,281.02
本期净值收益率	1.0487%	1.1686%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年6月30日)	
期末基金资产净值	14,812,390,077.30	137,875,107.57
期末基金份额净值	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年6月30日)	
累计净值收益率	25.6357%	27.9366%

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	0.1633%	0.0003%	0.1110%	0.0000%	0.0523%	0.0003%
过去三个月	0.5035%	0.0012%	0.3366%	0.0000%	0.1669%	0.0012%
过去六个月	1.0487%	0.0011%	0.6695%	0.0000%	0.3792%	0.0011%
过去一年	2.0267%	0.0013%	1.3500%	0.0000%	0.6767%	0.0013%
过去三年	6.7296%	0.0023%	4.0537%	0.0000%	2.6759%	0.0023%
自基金合同生效起至今	25.6357%	0.0054%	10.2119%	0.0000%	15.4238%	0.0054%

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	0.1830%	0.0003%	0.1110%	0.0000%	0.0720%	0.0003%

过去三个月	0.5634%	0.0012%	0.3366%	0.0000%	0.2268%	0.0012%
过去六个月	1.1686%	0.0011%	0.6695%	0.0000%	0.4991%	0.0011%
过去一年	2.2711%	0.0013%	1.3500%	0.0000%	0.9211%	0.0013%
过去三年	7.4977%	0.0023%	4.0537%	0.0000%	3.4440%	0.0023%
自基金合同生效起至今	27.9366%	0.0054%	10.2119%	0.0000%	17.7247%	0.0054%

注：1、本基金收益分配是按日结转份额。

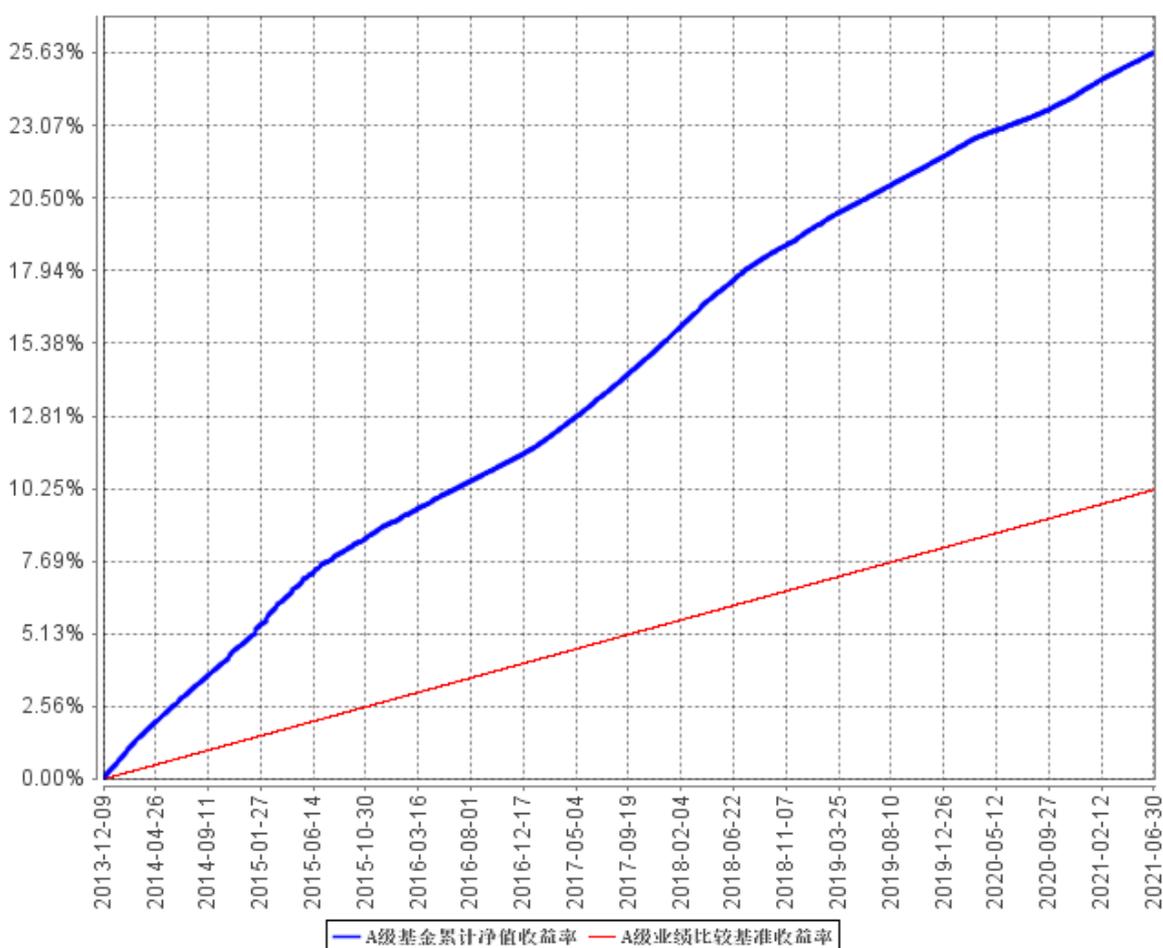
2、本基金业绩比较基准的构建及再平衡过程：

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。

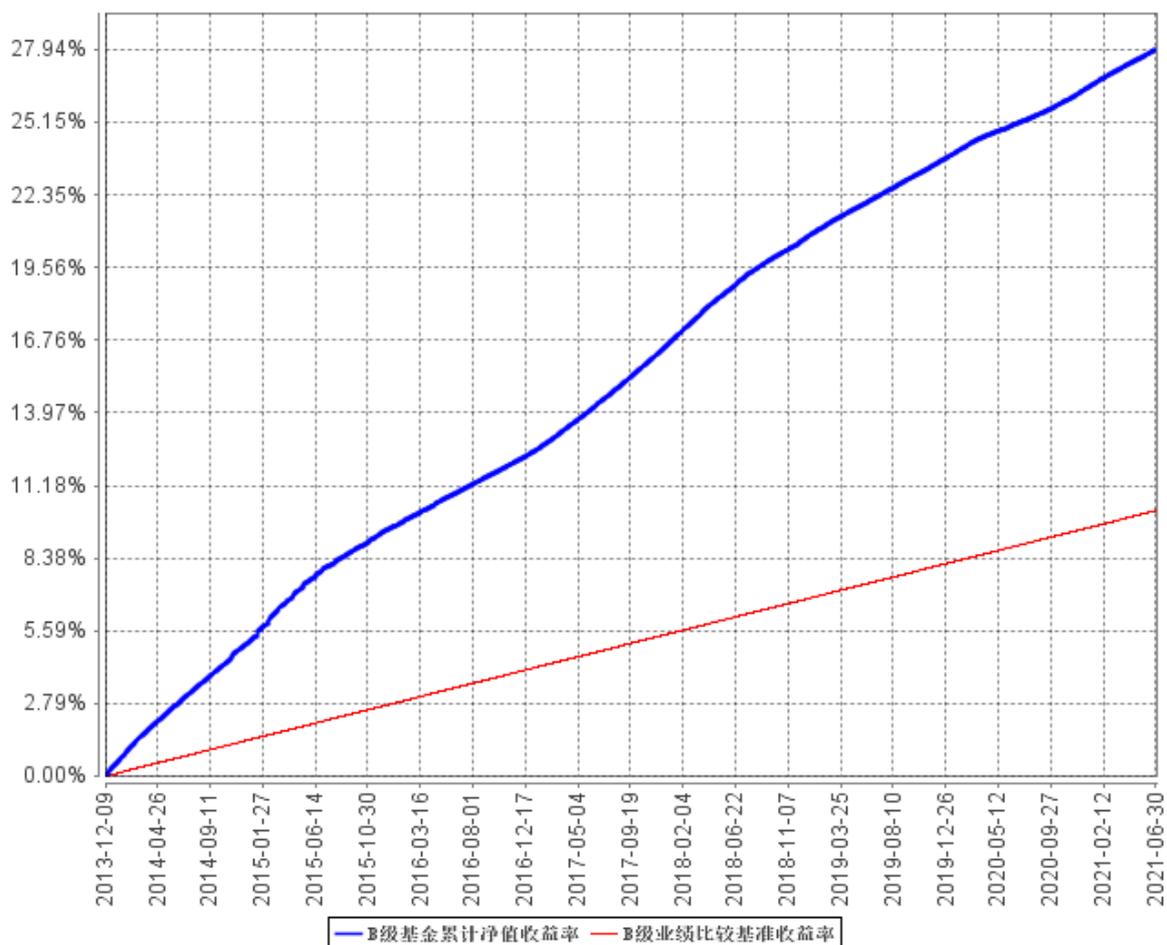
本基金的业绩比较基准将根据央行调息而调整。

### 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

A级基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



B级基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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

## § 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 2.06 亿元。长盛基金总部办公地位于北京，在北京、上海、成都、深圳等地设有分支机构，并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占注册资本的 33%，安徽省信用担保集团有限公司占注册资本的 13%，安徽省投资集团控股有限公司占注册资本的 13%。公司拥有公募基金、全国社保基金、特定客户资产管理、合格境内机构投资者（QDII）、合格境外机构投资者（QFII）、保险资产管理人等业务资格。截至 2021 年 6 月 30 日，基金管理人共管理六十七只开放式基金，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，长盛稳益 6 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理。	2018 年 6 月 22 日	-	14 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。
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基金经理，长盛中债 1-3 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	-	9 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。

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《证券业从业人员资格管理办法》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

注：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。

## 4.2 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、私募资产管理计划等。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 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。

### 4.3.2 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，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，国内经济延续修复，由于上年同期的低基数效应，投资、消费、出口等经济数据同比提升。物价方面，大宗商品涨价叠加基数效应推动 PPI 回升，CPI 相对平稳。政策方面，货币政策保持稳健，除部分特殊时点有较大波动外，资金面整体较为宽松。

市场方面，具体来看，1月中下旬，资金利率大幅上行，带动同业存单等资产收益率上行。2月以来，随着资金面的边际宽松，同业存单利率逐步下行。进入6月，资金利率略有波动，带动存单利率小幅上行。随着央行公开市场操作的放量，市场确认资金平稳预期，存单利率见顶回落。

#### 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 1.0487%，本报告期长盛添利宝货币 B 的基金份额净值收益率为 1.1686%，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，在稳货币、紧信用的政策下，经济复苏较为温和；物价方面，通胀压力预计见顶回落。从央行近期释放的信号看，MLF 到期、地方债等发行计划或不会造成资金面的大幅收紧；但在美联储紧缩预期下，资金面也不具备大幅宽松的基础。整体来看，基本面对债券相对较为友好。

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

#### **4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

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

按照上述办法及基金合同的规定，2021 上半年度分配利润 125,902,411.54 元，其中：A 类别份额分配利润 122,784,130.52 元，B 类别份额分配利润 3,118,281.02 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 托管人对本中期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 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：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	8,085,779,799.23	4,822,459,298.24
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	2,995,467,692.45	3,617,437,519.18
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		2,995,467,692.45	3,342,437,519.18
资产支持证券投资		-	275,000,000.00
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	4,302,624,975.87	778,398,887.60
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	75,043,639.96	49,218,158.43
应收股利		-	-
应收申购款		361,257.00	7,316,155.82
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	102.60	102.60
资产总计		15,459,277,467.11	9,274,830,121.87
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2020 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		499,998,930.00	933,935,076.03
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		986.93	-
应付管理人报酬		4,129,788.66	2,229,171.71
应付托管费		1,251,451.10	675,506.59
应付销售服务费		3,064,389.80	1,668,965.89
应付交易费用	6.4.7.7	195,296.64	101,432.70
应交税费		42,399.11	49,951.05

应付利息		199,821.30	49,922.12
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	129,218.70	251,400.00
负债合计		509,012,282.24	938,961,426.09
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	14,950,265,184.87	8,335,868,695.78
未分配利润	6.4.7.10	-	-
所有者权益合计		14,950,265,184.87	8,335,868,695.78
负债和所有者权益总计		15,459,277,467.11	9,274,830,121.87

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，长盛添利宝货币 A 基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 14,812,390,077.30 份；长盛添利宝货币 B 基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 137,875,107.57 份。长盛添利宝货币份额总额合计为 14,950,265,184.87 份。

## 6.2 利润表

会计主体：长盛添利宝货币市场基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021年1月1日至2021 年6月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020 年6月30日
<b>一、收入</b>		168,551,230.76	79,731,219.60
1.利息收入		165,055,447.03	76,824,159.57
其中：存款利息收入	6.4.7.11	97,171,773.04	41,930,823.39
债券利息收入		38,906,340.88	20,023,516.12
资产支持证券利息收入		673,565.28	117,430.42
买入返售金融资产收入		28,303,767.83	14,752,389.64
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		3,495,783.73	2,907,060.03
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	2,822,829.54	2,907,060.03
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	672,954.19	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-

5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-	-
<b>减：二、费用</b>		42,648,819.22	23,164,972.12
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	19,966,736.77	10,150,261.49
2. 托管费	6.4.10.2.2	6,050,526.21	3,075,836.79
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	14,803,990.78	7,485,494.99
4. 交易费用	6.4.7.19	-	-
5. 利息支出		1,614,659.10	2,281,242.95
其中：卖出回购金融资产支出		1,614,659.10	2,281,242.95
6. 税金及附加		27,675.04	6,474.80
7. 其他费用	6.4.7.20	185,231.32	165,661.10
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		125,902,411.54	56,566,247.48
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		125,902,411.54	56,566,247.48

### 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：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 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）	8,335,868,695.78	-	8,335,868,695.78
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	125,902,411.54	125,902,411.54
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）	6,614,396,489.09	-	6,614,396,489.09
其中：1. 基金申购款	133,478,631,633.73	-	133,478,631,633.73
2. 基金赎回款	-126,864,235,144.64	-	-126,864,235,144.64
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）	-	-125,902,411.54	-125,902,411.54
五、期末所有者权益（基金净值）	14,950,265,184.87	-	14,950,265,184.87
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 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）	5,152,881,503.24	-	5,152,881,503.24
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	56,566,247.48	56,566,247.48
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）	2,940,518,868.90	-	2,940,518,868.90
其中：1. 基金申购款	87,450,966,607.30	-	87,450,966,607.30
2. 基金赎回款	-84,510,447,738.40	-	-84,510,447,738.40
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）	-	-56,566,247.48	-56,566,247.48
五、期末所有者权益（基金净值）	8,093,400,372.14	-	8,093,400,372.14

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：

周兵	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、银行协议存款和大量存单；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。

#### 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。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日止期间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 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年 1 月 1 日至 6 月 30 日止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

本基金在本报告期间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。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
活期存款	6,779,799.23
定期存款	8,079,000,000.00
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	600,000,000.00
存款期限 3 个月以上	7,479,000,000.00
其他存款	-
合计：	8,085,779,799.23

注：定期存款的存款期限指定期存款的票面存期。

**6.4.7.2 交易性金融资产**

单位：人民币元

项目		本期末 2021年6月30日			
		摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	2,995,467,692.45	2,995,764,000.00	296,307.55	0.0020%
	合计	2,995,467,692.45	2,995,764,000.00	296,307.55	0.0020%
	资产支持证券	-	-	-	-
	合计	2,995,467,692.45	2,995,764,000.00	296,307.55	0.0020%

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。

**6.4.7.3 衍生金融资产/负债**

注：无余额。

**6.4.7.4 买入返售金融资产****6.4.7.4.1 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 2021年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	4,302,624,975.87	-
合计	4,302,624,975.87	-

**6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券**

注：无。

**6.4.7.5 应收利息**

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应收活期存款利息	1,192.72
应收定期存款利息	62,277,755.22

应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	11,106,545.87
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	1,658,146.15
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	-
合计	75,043,639.96

#### 6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
其他应收款	102.60
待摊费用	-
合计	102.60

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	195,296.64
合计	195,296.64

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	14.79
应付证券出借违约金	-
预提费用	129,203.91
合计	129,218.70

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

长盛添利宝货币 A	
项目	本期

	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	8,233,344,940.59	8,233,344,940.59
本期申购	132,666,204,183.37	132,666,204,183.37
本期赎回(以“-”号填列)	-126,087,159,046.66	-126,087,159,046.66
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	14,812,390,077.30	14,812,390,077.30

金额单位：人民币元

长盛添利宝货币 B		
项目	本期	
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	102,523,755.19	102,523,755.19
本期申购	812,427,450.36	812,427,450.36
本期赎回(以“-”号填列)	-777,076,097.98	-777,076,097.98
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	137,875,107.57	137,875,107.57

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。

#### 6.4.7.10 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	-	-	-
本期利润	122,784,130.52	-	122,784,130.52
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	-122,784,130.52	-	-122,784,130.52
本期末	-	-	-

单位：人民币元

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	-	-	-
本期利润	3,118,281.02	-	3,118,281.02
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	-3,118,281.02	-	-3,118,281.02
本期末	-	-	-

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
活期存款利息收入	31,593.68
定期存款利息收入	97,139,549.36
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	630.00
其他	-
合计	97,171,773.04

#### 6.4.7.12 股票投资收益

注：无。

#### 6.4.7.13 债券投资收益

##### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	2,822,829.54
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	2,822,829.54

##### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	7,595,978,833.53

减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	7,565,710,327.29
减：应收利息总额	27,445,676.70
买卖债券差价收入	2,822,829.54

#### 6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

#### 6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

#### 6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出资产支持证券成交总额	278,478,189.75
减：卖出资产支持证券成本总额	275,000,000.00
减：应收利息总额	2,805,235.56
资产支持证券投资收益	672,954.19

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

注：无。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

注：无。

#### 6.4.7.16 股利收益

注：无。

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

注：无。

#### 6.4.7.18 其他收入

注：无。

#### 6.4.7.19 交易费用

注：无。

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
审计费用	60,696.54
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费	46,547.41
其他	600.00
银行间账户维护费	17,880.00
合计	185,231.32

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

无。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 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。

##### 6.4.9.2 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（“长盛基金公司”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人、基金销售机构
国元证券股份有限公司（“国元证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
新加坡星展银行有限公司（“星展银行”）	基金管理人的股东、基金销售机构
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

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。

##### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

无。

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

注：无。

## 6.4.10.2 关联方报酬

### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	19,966,736.77	10,150,261.49
其中：支付销售机构的客户维护费	81,564.53	69,271.20

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。

### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	6,050,526.21	3,075,836.79

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。

### 6.4.10.2.3 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		
	2021 年 1 月 1 日至 2021 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	8,226.08	8.22	8,234.30
星展银行	42,256.58	0.00	42,256.58
长盛基金公司	12,686.05	6,142.72	18,828.77
国元证券	134.77	3,065.66	3,200.43
合计	63,303.48	9,216.60	72,520.08
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2020 年 1 月 1 日至 2020 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	14,123.43	0.00	14,123.43
星展银行	41,941.68	51.84	41,993.52
长盛基金公司	5,644.65	5,288.21	10,932.86
国元证券	83.27	1,836.70	1,919.97
合计	61,793.03	7,176.75	68,969.78

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。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 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	-	-	-	-	234,600,000.00	12,022.23
上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 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	-	50,478,922.13	-	-	2,676,150,000.00	160,296.81

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：无。

##### 6.4.10.4.2 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

长盛添利宝货币 A

份额单位：份

关联方名称	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日

	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例
长盛创富	4,643,379.13	0.0313%	4,595,484.22	0.0558%

注：对于分级基金，比例的分母采用各自级别的份额。

#### 6.4.10.5 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 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30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	6,779,799.23	31,593.68	1,623,652.50	16,206.27

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

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：无。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

金额单位：人民币元

##### 长盛添利宝货币A

已按再投资形式转实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	本期利润分配合 计	备注
122,784,130.52	-	-	122,784,130.52	-

##### 长盛添利宝货币B

已按再投资形式转实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	本期利润分配合 计	备注
3,118,281.02	-	-	3,118,281.02	-

#### 6.4.12 期末（2021年6月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：无。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无。

### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 6 月 30 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 499,998,930.00 元，是以如下债券作为抵押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
200406	20 农发 06	2021 年 7 月 2 日	100.00	1,021,000	102,100,468.87
200010	20 付息国债 10	2021 年 7 月 2 日	100.01	500,000	50,002,643.83
219917	21 贴现国债 17	2021 年 7 月 2 日	99.94	500,000	49,969,377.00
200309	20 进出 09	2021 年 7 月 2 日	100.04	500,000	50,021,854.80
217707	21 贴现国债 07	2021 年 7 月 2 日	99.87	110,000	10,985,374.67
219918	21 贴现国债 18	2021 年 7 月 2 日	99.91	500,000	49,955,046.99
217705	21 贴现国债 05	2021 年 7 月 2 日	99.94	1,000,000	99,938,140.20
219922	21 贴现国债 22	2021 年 7 月 2 日	99.77	400,000	39,908,692.79
190009	19 付息国债 09	2021 年 7 月 2 日	100.02	600,000	60,013,945.84
合计				5,131,000	512,895,544.99

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只货币型证券投资基金，属于低风险合理稳定收益品种，本基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“低风险、高流动性和持续稳定收益”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，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金融工程部负责，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。

#### 6.4.13.2 信用风险

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

本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。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行中国银行；定期存款存放在具有基金托管资格的民生银行股份有限公司、上海银行股份有限公司、中信银行股份有限公司、中国光大银行股份有限公司、交通银行股份有限公司、兴业银行股份有限公司、广发银行股份有限公司、江苏银行股份有限公司及中原银行股份有限公司，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，不投资于短期信用评级在 A-1 级以下或长期信用评级在 AAA 级以下的债券，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。本基金投资于主体信用评级低于 AAA 的机构发行的金融工具占基金资产净值的比例合计不得超过 10%，其中单一机构发行的金融工具占基金资产净值的比例合计不得超过 2%。且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他货币市场基金投资同一商业银行的银行存款及其发行的同业存单与债券不得超过该商业银行最近一个季度末的净值的 10%。

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。

##### 6.4.13.2.1 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 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日

A-1	410,000,360.11	239,264,076.02
A-1 以下	-	-
未评级	1,510,887,763.72	749,211,212.24
合计	1,920,888,123.83	988,475,288.26

注：未评级部分为国债、政策性金融债与超短期融资券。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	-	275,000,000.00
合计	-	275,000,000.00

#### 6.4.13.2.3 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 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	974,552,714.68	2,223,222,222.87
合计	974,552,714.68	2,223,222,222.87

#### 6.4.13.2.4 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 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
未评级	100,026,853.94	130,740,008.05
合计	100,026,853.94	130,740,008.05

注：未评级部分为国债、政策性金融债。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

### 6.4.13.3 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。此外，本基金还可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，除发生巨额赎回、连续 3 个交易日累计赎回 20%以上或者连续 5 个交易日累计赎回 30%以上的情形外，债券正回购的资金余额在每个交易日均不得超过基金资产净值的 20%。

于 2021 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额中有 499,998,930.00 元将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.3.1 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%。于 2021 年 6 月 30 日，本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计占基金总份额的比例为 1.39%，本基金投资组合的平均剩余期限为 99 天，平均剩余存续期为 99 天。本基金持有的现金、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为 27.70%。

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的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他货币市场基金投资同一商业银行的银行存款及其发行的同业存单与债券不得超过该商业银行最近一个季度末净资产的 10%。

本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 10%。于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有流动性受限的资产的估值占基金资产净值的比例符合上述要求。

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。

#### 6.4.13.4 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。

##### 6.4.13.4.1 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。

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

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 年 6 月 30 日	6 个月以内	6 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产						
银行存款	6,065,779,799.23	2,020,000,000.00	-	-	-	8,085,779,799.23
交易性金融资产	2,515,786,834.65	479,680,857.80	-	-	-	2,995,467,692.45
买入返售金融资产	4,302,624,975.87	-	-	-	-	4,302,624,975.87
应收利息	-	-	-	-	75,043,639.96	75,043,639.96
应收申购款	-	-	-	-	361,257.00	361,257.00
其他资产	-	-	-	-	102.60	102.60
资产总计	12,884,191,609.75	2,499,680,857.80	-	-	75,404,999.56	15,459,277,467.11
负债						
卖出回购金融资产 款	499,998,930.00	-	-	-	-	499,998,930.00
应付赎回款	-	-	-	-	986.93	986.93
应付管理人报酬	-	-	-	-	4,129,788.66	4,129,788.66
应付托管费	-	-	-	-	1,251,451.10	1,251,451.10
应付销售服务费	-	-	-	-	3,064,389.80	3,064,389.80
应付交易费用	-	-	-	-	195,296.64	195,296.64
应付利息	-	-	-	-	199,821.30	199,821.30
应交税费	-	-	-	-	42,399.11	42,399.11
其他负债	-	-	-	-	129,218.70	129,218.70
负债总计	499,998,930.00	-	-	-	9,013,352.24	509,012,282.24
利率敏感度缺口	12,384,192,679.75	2,499,680,857.80	-	-	66,391,647.32	14,950,265,184.87
上年度末 2020 年 12 月 31 日	6 个月以内	6 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产						
银行存款	4,622,459,298.24	200,000,000.00	-	-	-	4,822,459,298.24
交易性金融资产	3,527,432,517.42	90,005,001.76	-	-	-	3,617,437,519.18
买入返售金融资产	778,398,887.60	-	-	-	-	778,398,887.60
应收利息	-	-	-	-	49,218,158.43	49,218,158.43
应收申购款	-	-	-	-	7,316,155.82	7,316,155.82
其他资产	-	-	-	-	102.60	102.60
资产总计	8,928,290,703.26	290,005,001.76	-	-	56,534,416.85	9,274,830,121.87
负债						
卖出回购金融资产 款	933,935,076.03	-	-	-	-	933,935,076.03
应付管理人报酬	-	-	-	-	2,229,171.71	2,229,171.71
应付托管费	-	-	-	-	675,506.59	675,506.59
应付销售服务费	-	-	-	-	1,668,965.89	1,668,965.89
应付交易费用	-	-	-	-	101,432.70	101,432.70
应付利息	-	-	-	-	49,922.12	49,922.12

应交税费	-	-	-	-	49,951.05	49,951.05
其他负债	-	-	-	-	251,400.00	251,400.00
负债总计	933,935,076.03	-	-	-	5,026,350.06	938,961,426.09
利率敏感度缺口	7,994,355,627.23	290,005,001.76	-	-	51,508,066.79	8,335,868,695.78

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。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2021年6月30日）	上年度末（2020年12月31日）
	1. 市场利率下降 25 个基点	1,976,022.42	2,298,029.41
	2. 市场利率上升 25 个基点	-1,976,022.42	-2,298,029.41

#### 6.4.13.4.2 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。

#### 6.4.13.4.3 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。本基金主要投资于定期存款和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。

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第二层次的余额为 2,995,467,692.45 元，无属于第一或第三层次的余额(2020 年 12 月 31 日：属于第二层次的余额为 3,617,437,519.18 元，无属于第一或第三层次的余额)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2021 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2020 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 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	2,995,467,692.45	19.38
	其中:债券	2,995,467,692.45	19.38
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	4,302,624,975.87	27.83
	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	8,085,779,799.23	52.30
4	其他各项资产	75,404,999.56	0.49
5	合计	15,459,277,467.11	100.00

### 7.2 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	1.75	
	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	499,998,930.00	3.34
	其中:买断式回购融资	-	-

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占基金资产净值比例的简单平均值。

### 债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的说明

注:本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%。

### 7.3 基金投资组合平均剩余期限

#### 7.3.1 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	99
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	109
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	77

### 报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

注：本基金本报告期内投资组合平均剩余期限无超过 120 天情况。

#### 7.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例 (%)	各期限负债占基金资产净值的比例 (%)
1	30 天以内	40.67	3.34
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	5.58	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	8.09	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—120 天	11.50	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)—397 天(含)	37.05	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		102.90	3.34

#### 7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

注：报告期内无投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况。

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	摊余成本	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	269,811,236.12	1.80
2	央行票据	-	-
3	金融债券	959,925,316.65	6.42
	其中：政策性金融债	549,924,956.54	3.68
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	791,178,425.00	5.29
6	中期票据	-	-
7	同业存单	974,552,714.68	6.52
8	其他	-	-
9	合计	2,995,467,692.45	20.04
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

注：上表中，债券的成本包括债券面值和折溢价。

## 7.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	012102380	21 中交疏浚 SCP001	2,000,000	200,000,146.67	1.34
2	072100104	21 广发证券 CP002BC	2,000,000	200,000,137.65	1.34
3	112183791	21 中原银行 CD229	2,000,000	197,343,299.34	1.32
4	200406	20 农发 06	1,700,000	170,000,780.68	1.14
5	2103671	21 进出 671	1,600,000	159,991,160.02	1.07
6	112199323	21 广州银行 CD033	1,500,000	148,558,945.92	0.99
7	012102181	21 华能水电 SCP008	1,000,000	100,001,535.26	0.67
8	012102186	21 招商蛇口 SCP004	1,000,000	100,000,125.05	0.67
9	072100056	21 招商证券 CP003BC	1,000,000	100,000,013.71	0.67
10	012102145	21 江铜 SCP003	1,000,000	99,943,662.08	0.67

## 7.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在 0.25(含)-0.5%间的次数	-
报告期内偏离度的最高值	0.0353%
报告期内偏离度的最低值	-0.0432%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0112%

## 报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

注：报告期内无负偏离度的绝对值达到 0.25%情况。

## 报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

注：报告期内无正偏离度的绝对值达到 0.5%情况。

## 7.8 期末按摊余成本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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 7.9 投资组合报告附注

## 7.9.1 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。

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

### （一）21 广发证券 CP002BC

2020 年 7 月 10 日，广发证券股份有限公司（以下简称“公司”）及相关人员分别收到中国证券监督管理委员会广东监管局（以下简称“广东证监局”）《行政监管措施事先告知书》。公司在康美药业股份有限公司 2014 年非公开发行优先股项目、2015 年公司债券项目、2016 年非公开发行股票项目、2018 年公司债券项目、康美实业投资控股有限公司 2017 年可交换公司债券项目中未勤勉尽责，尽职调查环节基本程序缺失，缺乏应有的执业审慎，内部控制流于形式，未按规定履行持续督导与受托管理义务。广东证监局决定对公司采取以下监管措施：一、责令改正。公司应对投行业务进行深入整改，建立健全和严格执行投行业务内控制度、工作流程和操作规范，诚实守信、勤勉尽责，切实提升投资银行业务质量。公司应严格按照内部问责制度对责任人员进行内部问责，并向我局提交书面问责报告。二、2020 年 7 月 20 日至 2021 年 1 月 19 日期间，暂停公司保荐机构资格；在 2020 年 7 月 20 日至 2021 年 7 月 19 日期间，暂不受理公司债券承销业务有关文件。三、责令限制高级管理人员权利，限制时任分管相关投行业务的副总经理欧阳西领取 2014 年度、2015 年度、2016 年度基本工资以外薪酬的权利，限制时任分管相关投行业务的副总经理秦力领取 2017 年度、2018 年度基本工资以外薪酬的权利，已领取部分应全部退回公司。

本基金认为：该处罚对于公司整体经营业绩不构成重大影响。

### （二）21 中原银行 CD229

2021 年 1 月 15 日，交易商协会发布的自律处分信息显示，中原银行作为债务融资工具主承销商，在为永煤控股提供中介服务过程中，存在以下违反银行间债券市场相关自律管理规则的行为：一是未对永煤控股独立性开展进一步核查并在尽职调查报告中体现，未能充分保证尽职调查质量；二是未就永煤控股涉及的中原银行股权划转事项及时履行信息披露督促义务；三是永煤控股 DFI 项目尽职调查工作底稿不规范。根据银行间债券市场相关自律规定，经 2020 年第 18 次自律处分会议审议，对中原银行予以诫勉谈话；责令其针对本次事件中暴露出的问题进行全面深入的整改。对以上事件，本基金判断，中原银行经营稳健，上述处罚对公司影响可控。后续关注其制度建设与执行等公司基础性建设问题的合规性以及企业的经营状况。

### （三）21 广州银行 CD033

2021 年 2 月 24 日，广东银保监局行政处罚信息公开表（2021 年 2 号）显示，广州银行未经批准开展衍生产品交易、以个人理财资金承接不良资产、向未取得有关批准文件的固定资产项目提供融资，对广州银行罚款 180 万元。对以上事件，本基金判断，广州银行经营稳健，上述处罚

对公司影响可控。后续关注其制度建设与执行等公司基础性建设问题的合规性以及企业的经营状况。

除上述事项外，本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体无被监管部门立案调查记录，无在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

### 7.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	75,043,639.96
4	应收申购款	361,257.00
5	其他应收款	102.60
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	75,404,999.56

### 7.9.4 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。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基 金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
长盛添利宝货币 A	3,243,745	4,566.45	6,560,995.82	0.04%	14,805,829,081.48	99.96%
长盛添利宝货币 B	3	45,958,369.19	137,875,107.57	100.00%	0.00	0.00%
合计	3,243,748	4,608.95	144,436,103.39	0.97%	14,805,829,081.48	99.03%

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。

### 8.2 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	券商类机构	83,477,596.92	0.56%
2	基金类机构	44,319,073.88	0.30%
3	个人	20,226,117.11	0.14%
4	个人	16,099,023.02	0.11%
5	保险类机构	10,068,670.20	0.07%
6	个人	7,926,892.32	0.05%
7	个人	6,618,558.84	0.04%

8	个人	6,520,860.11	0.04%
9	个人	5,904,898.50	0.04%
10	个人	5,520,541.26	0.04%

### 8.3 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	586,062.25	0.0040%
	长盛添利宝货币 B	0.00	0.0000%
	合计	586,062.25	0.0039%

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。

### 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

	长盛添利宝货币 A	长盛添利宝货币 B
基金合同生效日（2013 年 12 月 9 日）基金份额总额	1,343,455,033.04	2,531,846,369.15
本报告期期初基金份额总额	8,233,344,940.59	102,523,755.19
本报告期基金总申购份额	132,666,204,183.37	812,427,450.36
减：本报告期基金总赎回份额	126,087,159,046.66	777,076,097.98
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期末基金份额总额	14,812,390,077.30	137,875,107.57

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。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 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。

### 10.2 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

#### 10.2.1 本基金管理人的高级管理人员重大人事变动情况

我公司第七届董事会任期已满，根据《公司法》和《公司章程》的有关规定，2021年6月6日，我公司召开了2021年第一次临时股东会会议。会议选举俞仕新、高民和、毕功兵、杜愚为新任董事，蔡咏、陈翔、李伟强、朱慈蕴不再担任董事。公司已按规定向相关监管机构报备。

根据公司第八届董事会第二次会议决议，聘任周兵同志担任公司总经理，林培富同志不再担任公司总经理。公司已按规定向相关监管机构报备。

原董事会秘书孙杰同志退休，根据公司第八届董事会第二次会议决议，聘任刁俊东同志担任财务负责人兼董事会秘书。

#### 10.2.2 基金经理变动情况

本报告期本基金基金经理未曾变动。

#### 10.2.3 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，无涉及本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

### 10.3 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。

### 10.4 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。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙），本报告期内本基金未更换会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国泰君安	1	-	-	-	-	-

中信建投	2	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
德邦证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
日信证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
申港证券	1	-	-	-	-	-
西藏东方财富证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-

### 10.7.2 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	成交金额	占当期权证成交总额的比例

				的比例		
国泰君安	272,774,306.67	100.00%	100,000,000.00	100.00%	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
日信证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-
东莞证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
申港证券	-	-	-	-	-	-
西藏东方财富证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-

注：1、本公司选择证券经营机构的标准

(1) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时为本公司提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析、个股分析报告等，并能根据基金投资的特定要求，

提供专门研究报告。

- (2) 资力雄厚，信誉良好。
- (3) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定。
- (4) 经营行为规范，最近两年未因重大违规行为而受到中国证监会和中国人民银行处罚。
- (5) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求。
- (6) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本公司基金进行证券交易的需 要，并能为本公司基金提供全面的信息服 务。

## 2、本公司租用券商交易单元的程序

- (1) 研究机构提出服务意向，并提供相关研究报告；
- (2) 研究机构的研究报告需要有一定的试用期。试用期视服务情况和研究服务评价结果而定；
- (3) 研究发展部、投资管理等部门试用研究机构的研究报告后，按照研究服务评价规定，对研究机构进行综合评价；
- (4) 试用期满后，评价结果符合条件，双方认为有必要继续合作，经公司领导审批后，我司与研究机构签定《研究服务协议》、《券商交易单元租用协议》，并办理基金专用交易单元租用手续。评价结果如不符合条件则终止试用；
- (5) 本公司每两个月对签约机构的服务进行一次综合评价。经过评价，若本公司认为签约机构的服务不能满足要求，或签约机构违规受到国家有关部门的处罚，本公司有权终止签署的协议，并撤销租用的交易单元；
- (6) 交易单元租用协议期限为一年，到期后若双方没有异议可自动延期一年。

## 3、本基金租用证券公司交易单元均为共用交易单元。

## 4、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

- (1) 本基金报告期内新增租用交易单元情况：无。
- (2) 本基金报告期内停止租用交易单元情况：无。

## 10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

注：本报告期本基金无偏离度绝对值超过0.5%的情况。

## 10.9 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	长盛基金管理有限公司关于增加华西证券为旗下部分开放式基金代销机构及开通基金定投和转换业务的公告	证券时报、本公司网站、中国证监会基金信息披露网站	2021年6月29日

2	长盛基金管理有限公司高级管理人员总经理变更的公告	证券时报、本公司网站、中国证监会基金信息披露网站	2021年6月18日
3	长盛基金管理有限公司关于旗下基金增加销售机构并开通定投和转换业务及参加费率优惠活动的公告	证券时报、本公司网站、中国证监会基金信息披露网站	2021年6月10日
4	长盛基金管理有限公司关于增加中金财富证券为旗下部分开放式基金代销机构及开通基金定投和转换业务的公告	证券时报、本公司网站、中国证监会基金信息披露网站	2021年5月31日
5	长盛基金管理有限公司旗下全部基金 2021 年 1 季度报告提示性公告	证券时报、本公司网站、中国证监会基金信息披露网站	2021年4月22日
6	长盛添利宝货币市场基金 2021 年第 1 季度报告	本公司网站、中国证监会基金信息披露网站	2021年4月22日
7	长盛基金管理有限公司关于网上直销暂停货币基金快速提现业务的公告	证券时报、本公司网站、中国证监会基金信息披露网站	2021年4月7日
8	长盛基金管理有限公司关于旗下基金增加销售机构并开通定投和转换业务及参加费率优惠活动的公告	证券时报、本公司网站、中国证监会基金信息披露网站	2021年4月6日
9	长盛基金管理有限公司旗下全部基金 2020 年年度报告提示性公告	证券时报、本公司网站、中国证监会基金信息披露网站	2021年3月31日
10	长盛添利宝货币市场基金 2020 年年度报告	本公司网站、中国证监会基金信息披露网站	2021年3月31日
11	长盛基金管理有限公司关于旗下基金增加销售机构并开通定投和转换业务及参加费率优惠活动的公告	证券时报、本公司网站、中国证监会基金信息披露网站	2021年3月18日
12	长盛基金管理有限公司关于旗下基金增加销售机构并开通定投和转换业务及参加费率优惠活动的公告	证券时报、本公司网站、中国证监会基金信息披露网站	2021年3月11日
13	关于长盛基金管理有限公司直销柜台开展旗下部分基金费率优惠活动的公告	证券时报、本公司网站、中国证监会基金信息披露网站	2021年2月22日
14	长盛基金管理有限公司关于基金经理暂停履行职务的公告	证券时报、本公司网站、中国证监会基金信息披露网站	2021年2月9日
15	长盛添利宝货币市场基金 2020 年第 4 季度报告	本公司网站、中国证监会基金信息披露网站	2021年1月22日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 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

注：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。

### 11.2 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。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 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。

### 12.2 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。

### 12.3 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

2021 年 8 月 28 日