

长信长金通货币市场基金 2021 年中期报告

2021 年 6 月 30 日

基金管理人：长信基金管理有限责任公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

送出日期：2021 年 8 月 31 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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金基金合同规定，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 1 月 1 日起至 2021 年 6 月 30 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	6
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
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
§4 管理人报告	11
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.....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	14
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.....	14
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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
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.....	16
§5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	17
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.....	17
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.....	17
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	18
6.1 资产负债表.....	18
6.2 利润表.....	19
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	20

6.4 报表附注.....	21
§7 投资组合报告.....	41
7.1 期末基金资产组合情况.....	41
7.2 债券回购融资情况.....	41
7.3 基金投资组合平均剩余期限.....	41
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.....	42
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	42
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.....	43
7.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离.....	43
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.....	43
7.9 投资组合报告附注.....	44
§8 基金份额持有人信息.....	47
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	47
8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况.....	47
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	47
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.....	48
§9 开放式基金份额变动.....	49
§10 重大事件揭示.....	50
10.1 基金份额持有人大会决议.....	50
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.....	50
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	50
10.4 基金投资策略的改变.....	50
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	50
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.....	50
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	50
10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况.....	53
10.9 其他重大事件.....	53
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	55
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.....	55
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	55

§12 备查文件目录	56
12.1 备查文件目录.....	56
12.2 存放地点.....	56
12.3 查阅方式.....	56

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	长信长金货币市场基金	
基金简称	长信长金货币	
基金主代码	005134	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017 年 9 月 8 日	
基金管理人	长信基金管理有限责任公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	10,004,075,194.93 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	长信长金货币 A	长信长金货币 B
下属分级基金的交易代码:	005134	005135
报告期末下属分级基金的份额总额	1,537,454,254.18 份	8,466,620,940.75 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金将遵循安全性和流动性优先原则，通过对宏观经济、政策环境、市场状况和资金供求的深入分析，在严格控制风险的前提下，主动构建及调整投资组合，追求适度收益。
投资策略	本基金将采用积极管理型的投资策略，在控制利率风险、尽量降低基金净值波动风险并满足流动性的前提下，提高基金收益。
业绩比较基准	同期七天通知存款利率（税后）。
风险收益特征	本基金为货币市场基金，属于证券投资基金中较高流动性、低风险的品种，其预期风险和预期收益率都低于股票型基金、混合型基金和债券型基金

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		长信基金管理有限责任公司	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	周永刚	陆志俊
	联系电话	021-61009999	95559
	电子邮箱	zhouyg@cxfund.com.cn	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		4007005566	95559
传真		021-61009800	021-62701216
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区银城中路 68 号 9 楼	中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 号
办公地址		上海市浦东新区银城中路 68 号 9 楼	中国（上海）长宁区仙霞路 18 号
邮政编码		200120	200336
法定代表人		刘元瑞	任德奇

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.cxfund.com.cn
基金中期报告备置地点	上海市浦东新区银城中路 68 号 9 楼， 上海市仙霞路 18 号

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	长信基金管理有限责任公司	上海市浦东新区银城中路 68 号 9 楼

§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	长信长金通货币 A	长信长金通货币 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	20,836,947.02	171,865,711.23
本期利润	20,836,947.02	171,865,711.23
本期净值收益率	1.1658%	1.2362%
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	1,537,454,254.18	8,466,620,940.75
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	11.5737%	10.6511%

注：1、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，由于货币市场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。

2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，封闭式基金交易佣金、开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、本基金收益分配为每日分配，按日支付。

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

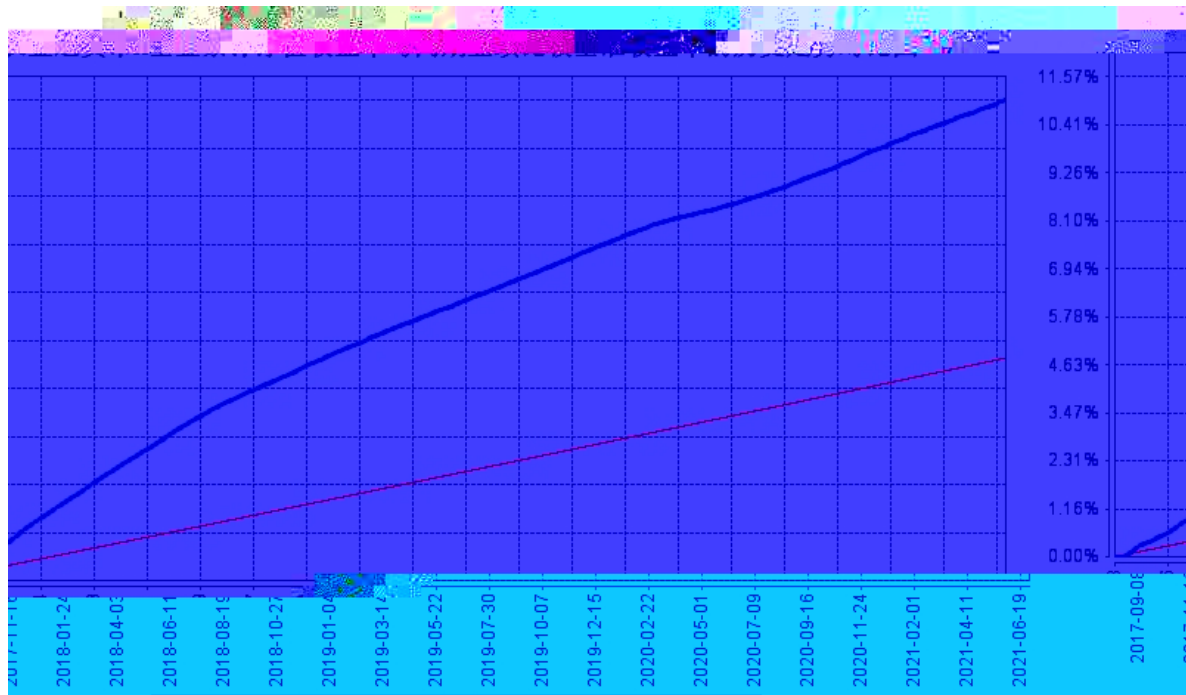
长信长金通货币 A

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	0.1877%	0.0024%	0.1126%	0.0000%	0.0751%	0.0024%
过去三个月	0.5639%	0.0026%	0.3418%	0.0000%	0.2221%	0.0026%
过去六个月	1.1658%	0.0025%	0.6810%	0.0000%	0.4848%	0.0025%
过去一年	2.3497%	0.0023%	1.3781%	0.0000%	0.9716%	0.0023%
过去三年	7.9289%	0.0023%	4.1955%	0.0000%	3.7334%	0.0023%
自基金合同生效起至今	11.5737%	0.0030%	5.3585%	0.0000%	6.2152%	0.0030%

长信长金货币 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	0.1992%	0.0024%	0.1126%	0.0000%	0.0866%	0.0024%
过去三个月	0.5990%	0.0026%	0.3418%	0.0000%	0.2572%	0.0026%
过去六个月	1.2362%	0.0025%	0.6810%	0.0000%	0.5552%	0.0025%
过去一年	2.4930%	0.0023%	1.3781%	0.0000%	1.1149%	0.0023%
过去三年	8.3839%	0.0023%	4.1955%	0.0000%	4.1884%	0.0023%
自基金合同 生效起至今	10.6511%	0.0030%	5.3585%	0.0000%	5.2926%	0.0030%

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





注：1、图示日期为 2017 年 9 月 8 日至 2021 年 6 月 30 日。

2、按基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起 6 个月内为建仓期。建仓期结束时，本基金的各项投资比例已符合基金合同约定。

§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

长信基金管理有限责任公司是经中国证监会证监基金字【2003】63 号文批准，由长江证券股份有限公司、上海海欣集团股份有限公司、武汉钢铁股份有限公司共同发起设立。注册资本 1.65 亿元人民币。目前股权结构为：长江证券股份有限公司占 44.55%、上海海欣集团股份有限公司占 31.21%、武汉钢铁有限公司占 15.15%、上海彤胜投资管理中心（有限合伙）占 4.55%、上海彤骏投资管理中心（有限合伙）占 4.54%。

截至 2021 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 76 只开放式基金，即长信利息收益开放式证券投资基金、长信银利精选混合型证券投资基金、长信金利趋势混合型证券投资基金、长信增利动态策略混合型证券投资基金、长信利丰债券型证券投资基金、长信恒利优势混合型证券投资基金、长信量化先锋混合型证券投资基金、长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金、长信利鑫债券型证券投资基金(LOF)、长信内需成长混合型证券投资基金、长信可转债债券型证券投资基金、长信利众债券型证券投资基金(LOF)、长信纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信纯债壹号债券型证券投资基金、长信改革红利灵活配置混合型证券投资基金、长信量化中小盘股票型证券投资基金、长信新利灵活配置混合型证券投资基金、长信利富债券型证券投资基金、长信利盈灵活配置混合型证券投资基金、长信利广灵活配置混合型证券投资基金、长信多利灵活配置混合型证券投资基金、长信睿进灵活配置混合型证券投资基金、长信量化多策略股票型证券投资基金、长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、长信富民纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信富海纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信利保债券型证券投资基金、长信金葵纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信富全纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信利泰灵活配置混合型证券投资基金、长信利发债券型证券投资基金、长信电子信息行业量化灵活配置混合型证券投资基金、长信富平纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信先利半年定期开放混合型证券投资基金、长信创新驱动股票型证券投资基金、长信稳益纯债债券型证券投资基金、长信利信灵活配置混合型证券投资基金、长信稳健纯债债券型证券投资基金、长信国防军工量化灵活配置混合型证券投资基金、长信先优债券型证券投资基金、长信稳势纯债债券型证券投资基金、长信中证 500 指数增强型证券投资基金、长信长金通货币市场基金、长信稳通三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长信低碳环保行业量化股票型证券投资基金、长信利尚一年定期开放混合型证券投资基金、长信乐信灵活配置混合型证券投资基金、长信全球

债券证券投资基金、长信稳鑫三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长信先机两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、长信消费精选行业量化股票型证券投资基金、长信企业精选两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、长信量化价值驱动混合型证券投资基金、长信价值蓝筹两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、长信稳裕三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长信稳进资产配置混合型基金中基金（FOF）、长信价值优选混合型证券投资基金、长信利率债债券型证券投资基金、长信沪深 300 指数增强型证券投资基金、长信富安纯债半年定期开放债券型证券投资基金、长信合利混合型证券投资基金、长信双利优选混合型证券投资基金、长信富瑞两年定期开放债券型证券投资基金、长信颐天平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）、长信易进混合型证券投资基金、长信中证可转债及可交换债券 50 指数证券投资基金、长信先锐混合型证券投资基金、长信中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金、长信稳健精选混合型证券投资基金、长信浦瑞 87 个月定期开放债券型证券投资基金、长信稳利资产配置一年持有期混合型基金中基金（FOF）、长信添利安心收益混合型证券投资基金、长信消费升级混合型证券投资基金、长信企业优选一年持有期灵活配置混合型证券投资基金、长信稳健均衡 6 个月持有期混合型证券投资基金、长信优质企业混合型证券投资基金。

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		
陆莹	长信利息收益开放式证券投资基金、长信易进混合型证券投资基金、长信稳健纯债债券型证券投资基金、长信长金通货币市场基金、长信稳鑫三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长信富瑞两年定期开放债券型证券投资基金、长信中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金和长信浦瑞	2017 年 9 月 8 日	-	11 年	管理学学士，毕业于上海交通大学，2010 年 7 月加入长信基金管理有限责任公司，曾任基金事务部基金会计，交易管理部债券交易员、交易主管，债券交易部副总监、总监、长信稳裕三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长信纯债半年债券型证券投资基金和长信稳通三个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理。现任现金理财部总监、长信利息收益开放式证券投资基金、长信易进混合型证券投资基金、长信稳健

	87 个月定期开放债券型证券投资基金的基金经理、现金理财部总监				纯债债券型证券投资基金、长信长金货币市场基金、长信稳鑫三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长信富瑞两年定期开放债券型证券投资基金、长信中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金和长信浦瑞 87 个月定期开放债券型证券投资基金的基金经理。
杜国昊	长信长金货币市场基金、长信富瑞两年定期开放债券型证券投资基金、长信稳通三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长信易进混合型证券投资基金和长信稳势纯债债券型证券投资基金的基金经理	2019 年 11 月 29 日	-	7 年	上海财经大学经济学硕士，具有基金从业资格。曾任职于德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙），2014 年 6 月加入长信基金管理有限责任公司，历任基金会计、债券交易员和基金经理助理，现任长信长金货币市场基金、长信富瑞两年定期开放债券型证券投资基金、长信稳通三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长信易进混合型证券投资基金和长信稳势纯债债券型证券投资基金的基金经理。

注：1、首任基金经理任职日期以本基金成立之日为准；新增或变更基金经理的日期根据对外披露的公告日期填写；

2、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。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本基金管理人在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同的规定，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

本基金将继续以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，在规范基金运作和严格控制投资风险的前提下，努力为基金份额持有人谋求最大利益。

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

本报告期内，公司已实行公平交易制度，并建立公平交易制度体系，已建立投资决策体系，加强交易执行环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时，公司已通过对投资交易行为的监控、分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，除完全按照有关指数的构成比例进行投资的组合外，其余各投资组合未发生参与交易所公开竞价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% 的情形，未发现异常交易行为。

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

回顾 2021 年上半年，国内外疫苗稳步推进，经济活动较去年逐步恢复，外需回升带动国内出口维持高景气度。工业增长平稳运行，制造业投资维持高增长，地产投资保持韧性，基建投资表现则相对乏力。4 月政治局会议强调用好稳增长压力较小的窗口期，或为财政后置留下了一定空间。通胀方面，CPI 温和上行，PPI 则受海外通胀输入以及低基数影响在二季度迎来快速上行，预计二季度为年内高点。社融增速呈现逐月下行趋势，广义流动性有所收敛，但信贷绝对量上并不低，实体经济中长期贷款的需求较为强劲。债市在 1 月末资金面异常紧张时收益率大幅上行，随后进入小牛市迎来一波下行，上半年整体来看，十年国债从年初 3.1% 附近最高上行至 3.3% 后重新回落至 3.1% 附近，1 年期国股存单从年初 2.9% 附近最高上行至 3.2% 后重新回落至 2.85% 附近。

上半年中，我们在收益率高点及时配置了同业存款、同业存单和信用债等资产，维持了较高的组合整体收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2021 年 6 月 30 日，本报告期内长信长金货币 A 收益率为 1.1658%，长信长金货币 B 收益率为 1.2362%，同期业绩比较基准收益率为 0.6810%。

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 2021 年下半年，外部环境更趋复杂严峻，国内经济恢复不稳固不均衡，稳增长压力较小的窗口期或已关闭，连续回落的制造业 PMI 显示经济增长动能未来有边际放缓的迹象，7 月政治

局会议强调做好宏观政策跨周期调节，积极的财政政策要提升效能，稳健的货币政策保持流动性合理充裕。7月初的全面降准显示了央行提前对货币政策预调微调来应对未来潜在经济放缓的精准操作。下半年财政适度发力，地方债发行提速在即，资金面面临一定的扰动，同时美联储或于三季度讨论QE退出，以上因素制约国内债券收益率进一步下行，在没有新增利好的大背景下大概率维持震荡。中期来看，社融增速下行，经济复苏边际放缓，通胀压力缓解，四季度利空因素减少，相对债市来说更加友好。

本基金将在保证货币基金安全性、流动性充足的基础上，时时关注货币政策和紧跟市场，通过积极把握阶段性资金面变化带来的投资机会，合理配置各类资产，保持投资业绩稳定提高。

4.6 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，对基金持有的投资品种进行估值。基金托管人根据法律法规要求对基金管理公司采用的估值政策和程序进行核查，并对估值结果及净值计算进行复核。

根据相关法律法规，本基金管理人制订了健全、有效的估值政策和估值程序，设立了估值委员会，估值委员会是公司基金估值的主要决策机构，其主要职责是负责拟定公司的估值政策、估值方法及采用的估值程序和技术，对公司现有程序和技术进行复核和审阅，当发生了影响估值程序和技术的有效性及适用性的情况及时修订估值程序；估值委员会成员由基金事务部、投资、研究、交易等相关业务部门负责人以及基金事务部至少一名业务骨干共同组成，相关参与人员都具有丰富的证券行业工作经验，熟悉相关法规和估值方法，均具备估值业务所需的专业胜任能力。对于基金的估值政策和估值原则，公司已与基金托管人充分沟通，并达成一致意见。审计本基金的会计师事务所认可公司基金估值政策和程序的适当性。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定分别提供银行间同业市场及交易所交易的债券品种的估值数据以及流通受限股票的折扣率。参与估值流程各方不存在任何重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规和基金合同要求，本基金根据每日收益情况将当日收益全部分配，即当日收益分配比例为100%。基金收益分配采用红利再投资分红方式，每日分配、按日支付，投资者可通过赎回基金份额方式获取现金红利收益。本报告期，本基金应分配利润192,702,658.25元，已分配利润192,702,658.25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

无。

§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

2021 年上半年度，托管人在长信长金货币市场基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

2021 年上半年度，长信基金管理有限责任公司在长信长金货币市场基金投资运作、资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本基金本报告期内向 A 级份额持有人分配利润：20,836,947.02 元，向 B 级份额持有人分配利润：171,865,711.23 元。

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

2021 年上半年度，由长信基金管理有限责任公司编制并经托管人复核审查的有关长信长金货币市场基金的中期报告中财务指标、收益表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、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：长信长金货币市场基金

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
资产：			
银行存款	6.4.6.1	3,605,216,116.08	4,203,763,222.91
结算备付金		28,888,888.89	7,580,268.83
存出保证金		28,727.22	13,715.81
交易性金融资产	6.4.6.2	5,015,379,123.55	8,296,230,695.29
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		5,015,379,123.55	8,296,230,695.29
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.6.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.6.4	1,201,082,091.63	3,128,727,058.09
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.6.5	62,984,757.69	61,326,020.10
应收股利		-	-
应收申购款		502,183,429.14	700.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.6.6	-	-
资产总计		10,415,763,134.20	15,697,641,681.03
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.6.3	-	-
卖出回购金融资产款		407,959,476.02	372,997,870.49
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	99.94
应付管理人报酬		1,695,779.00	1,615,714.25
应付托管费		565,259.65	538,571.41
应付销售服务费		319,788.49	323,450.94
应付交易费用	6.4.6.7	143,187.94	148,037.69
应交税费		179,801.35	58,347.72

应付利息		42,319.16	56,953.44
应付利润		679,108.11	1,148,204.64
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.6.8	103,219.55	199,000.06
负债合计		411,687,939.27	377,086,250.58
所有者权益：			
实收基金	6.4.6.9	10,004,075,194.93	15,320,555,430.45
未分配利润	6.4.6.10	-	-
所有者权益合计		10,004,075,194.93	15,320,555,430.45
负债和所有者权益总计		10,415,763,134.20	15,697,641,681.03

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，长信长金通货币 A 份额净值 1.0000 元，长信长金通货币 B 份额净值 1.0000 元，基金份额总额为 10,004,075,194.93 份，其中长信长金通货币 A 份额 1,537,454,254.18 份；长信长金通货币 B 份额 8,466,620,940.75 份。

6.2 利润表

会计主体：长信长金通货币市场基金

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
一、收入		215,653,536.48	171,938,032.07
1.利息收入		214,325,408.28	172,824,008.43
其中：存款利息收入	6.4.6.11	58,643,955.77	39,188,432.67
债券利息收入		112,621,044.36	100,200,379.31
资产支持证券利息收入		-	1,292,415.16
买入返售金融资产收入		43,060,408.15	32,142,781.29
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,328,128.20	-885,976.36
其中：股票投资收益	6.4.6.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.6.13	1,328,128.20	-885,976.36
资产支持证券投资收益	6.4.6.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.6.14	-	-
衍生工具收益	6.4.6.15	-	-
股利收益	6.4.6.16	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.6.17	-	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填		-	-

列)			
5.其他收入(损失以“-”号填列)	6.4.6.18	-	-
减: 二、费用		22,950,878.23	23,599,511.94
1. 管理人报酬	6.4.9.2.1	11,862,579.76	10,502,350.06
2. 托管费	6.4.9.2.2	3,954,193.21	3,500,783.41
3. 销售服务费	6.4.9.2.3	2,047,964.97	2,191,647.47
4. 交易费用	6.4.6.19	103.28	184.51
5. 利息支出		4,900,618.98	7,226,811.87
其中: 卖出回购金融资产支出		4,900,618.98	7,226,811.87
6. 税金及附加		56,149.00	46,410.01
7. 其他费用	6.4.6.20	129,269.03	131,324.61
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		192,702,658.25	148,338,520.13
减: 所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		192,702,658.25	148,338,520.13

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体: 长信长金通货币市场基金

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)	15,320,555,430.45	-	15,320,555,430.45
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	192,702,658.25	192,702,658.25
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)	-5,316,480,235.52	-	-5,316,480,235.52
其中: 1. 基金申购款	26,285,486,549.03	-	26,285,486,549.03
2. 基金赎回款	-31,601,966,784.55	-	-31,601,966,784.55
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基	-	-192,702,658.25	-192,702,658.25

[2013]1411 号文注册,根据 2017 年 8 月 17 日经中国证券监督管理委员会证监许可[2017]1517 号文,准予原基金变更注册为本基金并募集)。本基金为契约型开放式基金,存续期限为不定期。本基金根据销售服务费用收取方式的不同,将基金份额分为 A 类基金份额和 B 类基金份额。本基金首次设立募集基金份额为 251,016,200.45 份,经毕马威华振会计师事务所有限公司验证,并出具了编号为毕马威华振验字第 1700025 号验资报告。《长信长金通货币市场基金基金合同》于 2017 年 9 月 8 日正式生效。本基金的基金管理人为长信基金管理有限责任公司,基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、截至报告期末最新公告的基金合同及《长信长金通货币市场基金招募说明书》的有关规定,本基金的投资范围为:1、现金;2、期限在 1 年以内(含 1 年)的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单;3、剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券;4、中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围,并可依据届时有效的法律法规适时合理地调整投资范围。本基金的业绩比较基准为:同期七天通知存款利率(税后)。

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颁布的企业会计准则及相关规定(以下简称“企业会计准则”)以及中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制,同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求,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 2021 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.4.1 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。

6.4.4.2 差错更正的说明

本基金本报告期内无需说明的重大会计差错更正。

6.4.5 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号《财政部、国家税务总局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]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]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》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

1) 证券投资基金(封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖债券免征增值税；公开募集证券投资基金运营过程中发生的资管产品运营业务，以基金管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

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，暂不缴纳企业所得税。

6.4.6 重要财务报表项目的说明

6.4.6.1 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	5,216,116.08
定期存款	3,600,000,000.00
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	200,000,000.00
存款期限3个月以上	3,400,000,000.00
其他存款	-
合计：	3,605,216,116.08

6.4.6.2 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	360,316,722.47	360,141,000.00	-175,722.47	-0.0018%
	银行间市场	4,655,062,401.08	4,660,429,000.00	5,366,598.92	0.0536%
	合计	5,015,379,123.55	5,020,570,000.00	5,190,876.45	0.0519%
资产支持证券		-	-	-	0.0000%
合计		5,015,379,123.55	5,020,570,000.00	5,190,876.45	0.0519%

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。

6.4.6.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.6.4 买入返售金融资产

6.4.6.4.1 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	500,000,000.00	-
银行间市场	701,082,091.63	-
合计	1,201,082,091.63	-

6.4.6.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.6.5 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	592.45
应收定期存款利息	25,963,470.53
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	13,000.00
应收债券利息	36,498,941.38
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	508,740.43
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	12.90
合计	62,984,757.69

注：其他为应收结算保证金利息。

6.4.6.6 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.6.7 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	143,187.94
合计	143,187.94

6.4.6.8 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	-
应付证券出借违约金	-
预提账户维护费	9,000.00
预提审计费	34,712.18
预提信息披露费	59,507.37
合计	103,219.55

6.4.6.9 实收基金

金额单位：人民币元

长信长金通货币 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	1,941,600,026.07	1,941,600,026.07
本期申购	5,284,211,398.84	5,284,211,398.84
本期赎回(以“-”号填列)	-5,688,357,170.73	-5,688,357,170.73
- 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	1,537,454,254.18	1,537,454,254.18

金额单位：人民币元

长信长金货币 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	13,378,955,404.38	13,378,955,404.38
本期申购	21,001,275,150.19	21,001,275,150.19
本期赎回(以“-”号填列)	-25,913,609,613.82	-25,913,609,613.82
- 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	8,466,620,940.75	8,466,620,940.75

注：表内各级基金的申购和赎回均包括红利再投资、分级调整以及基金转入和转出数。

6.4.6.10 未分配利润

单位：人民币元

长信长金货币 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	20,836,947.02	-	20,836,947.02
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	-20,836,947.02	-	-20,836,947.02
本期末	-	-	-

单位：人民币元

长信长金货币 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	171,865,711.23	-	171,865,711.23
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	-171,865,711.23	-	-171,865,711.23
本期末	-	-	-

6.4.6.11 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	28,108.11
定期存款利息收入	58,357,081.67
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	258,558.03
其他	207.96
合计	58,643,955.77

注：其他为结算保证金利息收入。

6.4.6.12 股票投资收益

注：本基金本报告期无股票投资收益。

6.4.6.13 债券投资收益**6.4.6.13.1 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	1,328,128.20
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	1,328,128.20

6.4.6.13.2 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	22,391,899,200.64
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	22,218,548,583.47
减：应收利息总额	172,022,488.97
买卖债券差价收入	1,328,128.20

6.4.6.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期无债券赎回差价收入。

6.4.6.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期无债券申购差价收入。

6.4.6.13.5 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.6.14 贵金属投资收益**6.4.6.14.1 贵金属投资收益项目构成**

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.6.15 衍生工具收益**6.4.6.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注：本基金本报告期无买卖权证差价收入。

6.4.6.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期无其他衍生工具投资收益。

6.4.6.16 股利收益

注：本基金本报告期无股利收益。

6.4.6.17 公允价值变动收益

注：本基金本报告期无公允价值变动收益。

6.4.6.18 其他收入

注：本基金本报告期无其他收入。

6.4.6.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
交易所市场交易费用	-
银行间市场交易费用	103.28
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	103.28

6.4.6.20 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	34,712.18
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
账户维护费	17,080.00
其他费用	17,969.48
合计	129,269.03

注：其他费用为银行汇划手续费等其他费用。

6.4.7 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.7.1 或有事项

注：截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.7.2 资产负债表日后事项

注：截至本财务报告批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.8 关联方关系

6.4.8.1 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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方无变化。

6.4.8.2 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
长信基金管理有限责任公司（以下简称“长信基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
交通银行股份有限公司（以下简称“交通银行”）	基金托管人
长江证券股份有限公司（以下简称“长江证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
上海长江财富资产管理有限公司（以下简称“长江财富”）	基金管理人的子公司

6.4.9 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.9.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.9.1.1 股票交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.9.1.2 债券交易

金额单位：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	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
长江证券	361,933,801.10	78.17%	222,171,894.53	100.00%

6.4.9.1.3 债券回购交易

金额单位：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	
	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
长江证券	38,433,800,000.00	99.48%	13,460,000,000.00	99.26%

6.4.9.1.4 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.9.1.5 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无应付关联方交易单元的佣金。

6.4.9.2 关联方报酬**6.4.9.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	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
当期发生的基金应支付的管理费	11,862,579.76	10,502,350.06
其中：支付销售机构的客户维护费	679,025.22	376,018.96

注：支付基金管理人长信基金的基金管理人报酬按前一日基金资产净值×0.15%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：日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×0.15%÷当年天数。

6.4.9.2.2 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	3,954,193.21	3,500,783.41

注：支付基金托管人交通银行的基金托管费按前一日基金资产净值×0.05%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：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.05%÷当年天数。

6.4.9.2.3 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		
	长信长金通货币 A	长信长金通货币 B	合计
长信基金	489,766.01	572,669.73	1,062,435.74
长江证券	4,257.37	-	4,257.37
合计	494,023.38	572,669.73	1,066,693.11
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		
	长信长金通货币 A	长信长金通货币 B	合计
长信基金	931,408.43	468,217.20	1,399,625.63
长江证券	1,288.79	-	1,288.79
合计	932,697.22	468,217.20	1,400,914.42

注：根据基金合同的规定，本基金实行销售服务费分级收费方式，逐日累计至每月月底，按月支付。其中：长信长金通货币 A 的年费率为 0.15%，长信长金通货币 B 的年费率为 0.01%。其计算公式为：长信长金通货币 A 日销售服务费=前一日长信长金通货币 A 资产净值×0.15%÷当年天数；长信长金通货币 B 日销售服务费=前一日长信长金通货币 B 资产净值×0.01%÷当年天数。

6.4.9.3 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	本期		
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	债券交易金额	基金逆回购	基金正回购

的各关联方名称	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
交通银行	-	-	-	-	-	-
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
交通银行	51,021,086.89	-	-	-	-	-

6.4.9.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.9.4.1 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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	长信长金货币 A	长信长金货币 B
基金合同生效日（2017 年 9 月 8 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-

项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	长信长金货币 A	长信长金货币 B
基金合同生效日（2017 年 9 月 8 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	61,412,499.96	-
报告期间申购/买入总份额	321,316.31	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	61,733,816.27	-
报告期末持有的基金份额	0.00	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%	-

注：1、报告期间申购总份额包括当期收益转份额部分；

2、基金管理人运用固有资金投资本基金费率按本基金招募说明书公布的费率执行。

6.4.9.4.2 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

长信长金货币 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
上海长江财富资产管理有限公司	5,227,356.42	0.05%	15,611,147.52	0.10%

长信长金货币 B

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
长江证券股份有限公司	200,273,252.62	2.00%	-	-

注：除基金管理人之外的其他关联方投资本基金费率按本基金招募说明书公布的费率执行。

6.4.9.5 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
交通银行	5,216,116.08	28,108.11	1,614,958.29	23,475.41

注：本基金通过“交通银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司等结算账户，于 2021 年 6 月 30 日相关余额为人民币 28,888,888.89 元(2020 年 6 月 30 日：21,888,888.89 元)。

6.4.9.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金在本报告期及上一年度可比期间均未在承销期内购入由关联方承销的证券。

6.4.9.7 其他关联交易事项的说明

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

6.4.10 利润分配情况

金额单位：人民币元

长信长金通货币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
20,493,445.48	383,356.31	-39,854.77	20,836,947.02	-

长信长金通货币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
170,637,294.91	1,657,658.08	-429,241.76	171,865,711.23	-

6.4.11 期末（2021年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.11.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金本报告期末未因认购新发/增发证券而持有流通受限证券。

6.4.11.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.11.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.11.3.1 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 407,959,476.02 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	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
160309	16 进出 09	2021 年 7 月 1 日	100.07	2,184,000	218,554,814.00
200010	20 付息国债 10	2021 年 7 月 1 日	100.01	1,000,000	100,011,046.40
200406	20 农发 06	2021 年 7 月 1 日	100.00	1,000,000	100,002,900.72
合计				4,184,000	418,568,761.12

6.4.11.3.2 交易所市场债券正回购

注：本基金本报告期末无因交易所市场债券正回购交易而抵押的债券。

6.4.12 金融工具风险及管理

6.4.12.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常活动中面临各种金融工具的风险，主要包括：信用风险、流动性风险和市场风险。本基金在下文主要论述上述风险敞口及其形成原因、风险管理目标、政策和过程以及计量风险的方法等。

本基金的基金管理人从事风险管理的目标是使本基金在风险和收益之间取得适当的平衡，以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。基于该风险管理目标，本基金的基金管理人已制定了政策和程序来辨别和分析这些风险，设定适当的风险限额并设计相应的内部控制程序，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人奉行全面风险管理体系理念，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。在董事会下设立风险控制委员会，负责对公司经营管理和基金业务运作的合法性、合规性进行全面的检查和评估等；在管理层层面设立内部控制委员会，主要职责是讨论审议公司内部控制制度及针对公司在经营管理和投资组合运作中的风险进行识别、评估并研究制订有效的防范措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部负责协调并与各部门合作完成运作风险管理工作，战略与产品研发部负责进行投资风险分析与绩效评估。监察稽核部向督察长负责，并向总经理汇报日常行政事务。

6.4.12.2 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，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的银行存款存放于本基金的基金托管人交通银行，与银行存款相关的信用风险不重大。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，本基金投资于具有良好信用等级的证券，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；本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

估并采用券款对付交割方式以控制相应的信用风险。

6.4.12.2.1 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	479,985,124.94	420,337,268.96
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	520,075,142.77	499,238,388.87
合计	1,000,060,267.71	919,575,657.83

注：未评级债券为国债、央行票据、政策性金融债及超短期融资券等无信用评级债券。

6.4.12.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.12.2.3 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	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	2,830,743,779.33	6,542,849,643.35
合计	2,830,743,779.33	6,542,849,643.35

注：本基金持有同业存单的主体评级均为 AA+ 及以上评级。

6.4.12.2.4 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	884,362,419.91	383,391,222.78
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	300,212,656.60	450,414,171.33
合计	1,184,575,076.51	833,805,394.11

注：未评级债券为国债、央行票据及政策性金融债等无信用评级债券。

6.4.12.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.12.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.12.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金流动性风险来源于开放式基金每日兑付赎回资金的流动性风险，以及因部分投资品种交易不活跃而出现的变现风险和因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理价格变现投资的风险。

6.4.12.3.1 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》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。

本基金坚持组合管理、分散投资的原则开展投资活动，所持证券均在证券交易所或银行间同业市场交易，本期末本基金未持有有重大流动性风险的投资品种。在严格遵守基金管理人流动性相关交易限制前提下，本基金基金管理人根据相关法规对本基金份额持有人集中度实施严格监控和管理，针对投资人集中度情况对本基金的投资组合实施动态调整。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金管理人在基金合同中约定了巨额赎回条款，设计了非常情况下赎回资金的处理模式，控制因开放模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。同时，本基金在需要时刻通过卖出回购金融资产方式融入短期资金，以缓解流动性风险。

本基金本报告期末及上年度末均无重大流动性风险。

6.4.12.4 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。

6.4.12.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。

6.4.12.4.1.1 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	3,605,216,116.08	-	-	-	-	3,605,216,116.08
结算备付金	28,888,888.89	-	-	-	-	28,888,888.89
存出保证金	28,727.22	-	-	-	-	28,727.22
交易性金融资产	5,015,379,123.55	-	-	-	-	5,015,379,123.55
买入返售金融资产	1,201,082,091.63	-	-	-	-	1,201,082,091.63
应收利息	-	-	-	-	62,984,757.69	62,984,757.69
应收申购款	-	-	-	-	502,183,429.14	502,183,429.14
资产总计	9,850,594,947.37	-	-	-	565,168,186.83	10,415,763,134.20
负债						
卖出回购金融资产款	407,959,476.02	-	-	-	-	407,959,476.02
应付管理人报酬	-	-	-	-	1,695,779.00	1,695,779.00
应付托管费	-	-	-	-	565,259.65	565,259.65
应付销售服务费	-	-	-	-	319,788.49	319,788.49
应付交易费用	-	-	-	-	143,187.94	143,187.94
应付利息	-	-	-	-	42,319.16	42,319.16
应交税费	-	-	-	-	179,801.35	179,801.35
应付利润	-	-	-	-	679,108.11	679,108.11
其他负债	-	-	-	-	103,219.55	103,219.55
负债总计	407,959,476.02	-	-	-	3,728,463.25	411,687,939.27
利率敏感度缺口	9,442,635,471.35	-	-	-	561,439,723.58	10,004,075,194.93
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	4,203,763,222.91	-	-	-	-	4,203,763,222.91
结算备付金	7,580,268.83	-	-	-	-	7,580,268.83
存出保证金	13,715.81	-	-	-	-	13,715.81
交易性金融资产	8,296,230,695.29	-	-	-	-	8,296,230,695.29
买入返售金融资产	3,128,727,058.09	-	-	-	-	3,128,727,058.09
应收利息	-	-	-	-	61,326,020.10	61,326,020.10
应收申购款	-	-	-	-	700.00	700.00
其他资产	-	-	-	-	-	-
资产总计	15,636,314,960.93	-	-	-	61,326,720.10	15,697,641,681.03
负债						
卖出回购金融资产款	372,997,870.49	-	-	-	-	372,997,870.49
应付赎回款	-	-	-	-	99.94	99.94
应付管理人报酬	-	-	-	-	1,615,714.25	1,615,714.25
应付托管费	-	-	-	-	538,571.41	538,571.41

应付销售服务费	-	-	-	323,450.94	323,450.94
应付交易费用	-	-	-	148,037.69	148,037.69
应付利息	-	-	-	56,953.44	56,953.44
应交税费	-	-	-	58,347.72	58,347.72
应付利润	-	-	-	1,148,204.64	1,148,204.64
其他负债	-	-	-	199,000.06	199,000.06
负债总计	372,997,870.49	-	-	4,088,380.09	377,086,250.58
利率敏感度缺口	15,263,317,090.44	-	-	57,238,340.01	15,320,555,430.45

注：本基金根据所持有资产和负债的按摊余成本法确定的公允价值，按合约规定的重新定价日及剩余到期日中的孰早者进行分类。

6.4.12.4.1.2 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）
	市场利率下降 27 个基点	2,557,902.41	4,978,631.43
	市场利率上升 27 个基点	-2,557,902.41	-4,978,631.43

6.4.12.4.2 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。

6.4.12.4.3 其他价格风险

其他市场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。本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无重大其他市场价格风险。

6.4.13 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) 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。

(b) 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人民币 5,015,379,123.55 元，无属于第一层次和第三层次的余额。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于本基金投资的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关证券公允价值应属第二层次或第三层次。

(iii) 第三层次公允价值计量的金融工具

无。

(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	5,015,379,123.55	48.15
	其中:债券	5,015,379,123.55	48.15
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	1,201,082,091.63	11.53
	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	3,634,105,004.97	34.89
4	其他各项资产	565,196,914.05	5.43
5	合计	10,415,763,134.20	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		3.06
	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	407,959,476.02	4.08
	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:在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	60
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	71
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	44

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

注：报告期内投资组合平均剩余期限不存在超过 120 天的情况。

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	39.74	4.08
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	15.69	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	17.14	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—120 天	10.96	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)—397 天(含)	14.94	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		98.47	4.08

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：报告期内投资组合平均剩余存续期不存在超过 240 天的情况。

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	100,011,046.40	1.00
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,073,951,589.59	10.74
	其中：政策性金融债	400,215,557.32	4.00
4	企业债券	360,316,722.47	3.60
5	企业短期融资券	550,046,320.59	5.50
6	中期票据	100,309,665.17	1.00
7	同业存单	2,830,743,779.33	28.30
8	其他	-	-

9	合计	5,015,379,123.55	50.13
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

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	1828005	18 浙商银行 01	3,400,000	342,503,547.85	3.42
2	160309	16 进出 09	3,000,000	300,212,656.60	3.00
3	112109212	21 浦发银行 CD212	3,000,000	298,284,932.60	2.98
4	112119088	21 恒丰银行 CD088	3,000,000	298,140,102.93	2.98
5	112104021	21 中国银行 CD021	3,000,000	298,077,416.96	2.98
6	112121123	21 渤海银行 CD123	3,000,000	298,018,808.80	2.98
7	112197824	21 南京银行 CD093	3,000,000	297,604,397.66	2.97
8	072100083	21 东财证券 CP003	2,000,000	199,982,424.80	2.00
9	112198572	21 天津农村商业银行 CD206	2,000,000	199,633,554.43	2.00
10	112181205	21 厦门银行 CD121	2,000,000	199,114,983.13	1.99

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	0.0718%
报告期内偏离度的最低值	-0.0199%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0429%

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

注：报告期内不存在负偏离度的绝对值达到 0.25%的情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

注：报告期内不存在正偏离度的绝对值达到 0.5%的情况。

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

本基金采用摊余成本法计价。

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

报告期内本基金投资的前十名证券中,发行主体上海浦东发展银行股份有限公司于 2020 年 8 月 10 日收到上海银保监局行政处罚信息公开表(沪银保监银罚决字(2020)12 号),根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条第(五)项等,经查,上海浦东发展银行股份有限公司 2013 年至 2018 年存在下列违法违规事实:未按专营部门制规定开展同业业务;同业投资资金违规投向“四证”不全的房地产项目;延迟支付同业投资资金吸收存款;为银行理财资金投向非标准化债权资产违规提供担保;未按规定进行贷款资金支付管理与控制;个人消费贷款贷后管理未尽职;通过票据转贴现业务调节信贷规模;银行承兑汇票业务保证金来源审核未尽职;办理无真实贸易背景的贴现业务;委托贷款资金来源审查未尽职;未按权限和程序办理委托贷款业务;未按权限和程序办理非融资性保函业务。综上,中国银行保险监督管理委员会上海监管局决定对上海浦东发展银行股份有限公司采取责令改正措施,并处罚款共计 2100 万元。

报告期内本基金投资的前十名证券中,发行主体上海浦东发展银行股份有限公司于 2021 年 4 月 23 日收到中国银行保险监督管理委员会上海监管局(沪银保监罚决字(2021)29 号),根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条第(五)项、《中国银监会关于规范商业银行代理销售业务的通知》(银监发(2016)24 号),经查,上海浦东发展银行股份有限公司 2016 年 5 月至 2019 年 1 月,公司未按规定开展代销业务。综上,中国银行保险监督管理委员会上海监管局决定对上海浦东发展银行股份有限公司采取责令改正措施,并处罚款共计 760 万元。

报告期内本基金投资的前十名证券中,发行主体中国银行股份有限公司于 2020 年 12 月 1 日收到中国银行保险监督管理委员会行政处罚信息公开表(银保监罚决字(2020)60 号),根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条和相关审慎经营规则,经查,中国银行“原油宝”产品风险事件相关违法违规行为主要包括:产品管理不规范,包括保证金相关合同条款不清晰、产品后评价工作不独立、未对产品开展压力测试相关工作等;风险管理不审慎,包括市场风险限额设置存在缺陷、市场风险限额调整和超限操作不规范、交易系统功能存在缺陷未按要求及时整改等;内控管理不健全,包括绩效考核和激励机制不合理、消费者权益保护履职不足、全行内控合规检查未涵盖全球市场部对私产品销售管理等;销售管理不合规,包括个别客户年龄不满足准入要求、部分宣传销售文本内容存在夸大或者片面宣传、采取赠送实物等方式销售产品等。综上,中国银行保险监督管理委员会决定对中国银行股份有限公司罚款 5050 万元。

报告期内本基金投资的前十名证券中，发行主体中国银行股份有限公司于 2021 年 5 月 17 日收到中国银行保险监督管理委员会行政处罚信息公开表（银保监罚决字（2021）11 号），根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条，《中华人民共和国商业银行法》第四十条、第七十四条和相关审慎经营规则，经查，中国银行在业务过程中存在一、向未纳入预算的政府购买服务项目发放贷款；二、违规向关系人发放信用贷款；三、向无资金缺口企业发放流动资金贷款；四、存款月末冲时点；五、为无真实贸易背景企业签发银行承兑汇票；六、贷款管理不严，信贷资金被挪用；七、票据贴现资金直接回流至出票人或其关联人账户；八、理财产品质押贸易融资业务风险控制有效性不足；九、超比例发放并购贷款；十、向未经备案的跨境并购业务提供并购贷款；十一、违规为私募股权基金收购境内企业发放并购贷款；十二、超授权期限办理汇出汇款融资业务；十三、与名单外交易对手开展同业业务；十四、违规为他行开立投融资性同业账户；十五、以同业返存方式不当吸收存款；十六、自营和代客理财业务未能实现风险隔离；十七、面向一般客户销售的理财产品投资二级市场股票；十八、未按规定向投资者充分披露理财产品投资非标准化债权风险状况；十九、违规向四证不全房地产项目提供融资；二十、理财资金违规用于支付土地款或置换股东购地借款；二十一、理财资金违规用于土地储备项目；二十二、理财非标融资入股商业银行；二十三、理财非标融资用于商业银行注册验资；二十四、超授信额度提供理财非标融资；二十五、买入返售业务标的资产不合规；二十六、个人住房贷款业务搭售保险产品；二十七、单家分支行代销 3 家以上保险公司保险产品；二十八、主承销债券包销余券未通过风险处置专户处置；二十九、通过平移贷款延缓风险暴露；三十、债券投资业务未分类，表内人民币债券未计提减值准备；三十一、与资产管理公司合作设立有限合伙基金，不洁净转让不良资产；三十二、迟报案件信息；三十三、案件问责不到位；三十四、提供质价不符的服务；三十五、违规收取福费廷风险承担费；三十六、违规向部分已签约代发工资客户；收取年费。综上，中国银行保险监督管理委员会决定对中国银行股份有限公司罚没 8761.355 万元。

对如上证券投资决策程序的说明：公司研究部门按照内部研究工作规范对该证券进行分析后将其列入基金投资对象备选库。在此基础上本基金的基金经理根据具体市场情况独立作出投资决策。该事件发生后，本基金管理人对该证券的发行主体进行了进一步了解与分析，认为此事件未对该证券投资价值判断产生重大的实质性影响。本基金投资于该证券的投资决策过程符合制度规定的投资权限范围与投资决策程序。

报告期内本基金投资的前十名证券中其余八名的发行主体未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。

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	28,727.22
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	62,984,757.69
4	应收申购款	502,183,429.14
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	565,196,914.05

7.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

§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
长信长金通货币 A	81,591	18,843.43	890,391,278.21	57.91%	647,062,975.97	42.09%
长信长金通货币 B	23	368,113,953.95	8,466,620,940.75	100.00%	0.00	0.00%
合计	81,614	122,577.93	9,357,012,218.96	93.53%	647,062,975.97	6.47%

注：对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，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）。

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	保险类机构	877,386,360.66	8.77%
2	保险类机构	831,056,327.02	8.31%
3	银行类机构	757,471,464.88	7.57%
4	银行类机构	722,517,929.91	7.22%
5	银行类机构	511,811,044.45	5.12%
6	银行类机构	500,000,000.00	5.00%
7	银行类机构	407,064,467.25	4.07%
8	银行类机构	403,111,289.22	4.03%
9	券商类机构	402,639,985.04	4.02%
10	保险类机构	303,957,025.30	3.04%

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	长信长金通货币 A	345,394.62	0.02%

持有本基金	长信长金货币 B	0.00	0.00%
	合计	345,394.62	0.00%

注：对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，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）。

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	长信长金货币 A	0~10
	长信长金货币 B	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	长信长金货币 A	0
	长信长金货币 B	0
	合计	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	长信长金货币 A	长信长金货币 B
基金合同生效日（2017 年 9 月 8 日）基金份额总额	251,016,200.45	-
本报告期期初基金份额总额	1,941,600,026.07	13,378,955,404.38
本报告期基金总申购份额	5,284,211,398.84	21,001,275,150.19
减：本报告期基金总赎回份额	5,688,357,170.73	25,913,609,613.82
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	1,537,454,254.18	8,466,620,940.75

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

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 基金管理人的重大人事变动

自 2021 年 1 月 25 日起，成善栋先生不再担任公司董事长，由总经理覃波先生代任董事长。

自 2021 年 4 月 28 日起，刘元瑞先生担任公司董事长，总经理覃波先生不再代任董事长。

上述重大人事变动情况，本基金管理人均已在规定信息披露媒介发布相关公告。

10.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，交通银行托管部负责人由袁庆伟变更为徐铁。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金未改聘会计师事务所。

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

本报告期基金管理人、托管人及其高级管理人员没有受监管部门稽查或处罚的情形。

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	
长江证券	2	-	-	-	-	-
爱建证券（已退租）	1	-	-	-	-	-

东北证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
开源证券（已 退租）	1	-	-	-	-	-
野村东方国 际证券	1	-	-	-	-	-
中银国际证 券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
金元证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
申银万国	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
财信证券（已 退租）	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-

注：1、本期租用证券公司交易单元的变更情况

本报告期内本基金租用证券公司交易单元没有变更。

2、专用交易单元的选择标准和程序

根据中国证监会《关于加强证券投资基金监管有关问题的通知》（证监基字【1998】29号）和《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字【2007】48号）的有关规定，本公司制定了租用证券公司专用交易单元的选择标准和程序。

（1）选择标准：

- 1) 券商基本面评价（财务状况、经营状况）；
- 2) 券商研究机构评价（报告质量、及时性和数量）；
- 3) 券商每日信息评价（及时性和有效性）；
- 4) 券商协作表现评价。

(2) 选择程序：

首先根据租用证券公司专用交易单元的选择标准形成《券商服务评价表》，然后根据评分高低进行选择基金专用交易单元。

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的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
长江证券	361,933,801.10	78.17%	38,433,800,000.00	99.48%	-	-
爱建证券 (已退租)	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
开源证券 (已退租)	-	-	-	-	-	-
野村东方国际证券	-	-	-	-	-	-
中银国际证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
金元证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
财信证券 (已退租)	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	101,054,767.12	21.83%	200,000,000.00	0.52%	-	-

10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

注：本报告期本基金不存在偏离度绝对值超过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	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金在天风证券股份有限公司开通转换、定期定额投资业务及参加申购（含定投申购）费率优惠活动的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2021年1月14日
2	长信长金通货币市场基金 2020 年第 4 季度报告	中国证监会电子披露网站、公司网站	2021年1月22日
3	长信基金管理有限责任公司旗下全部基金 2020 年第 4 季度报告提示性公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2021年1月22日
4	长信基金管理有限责任公司关于基金行业高级管理人员变更公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2021年1月26日
5	长信长金通货币市场基金更新的招募说明书（2021 年第【1】号）及基金产品资料概要（更新）	中国证监会电子披露网站、公司网站	2021年1月28日
6	长信基金管理有限责任公司关于长信长金通货币市场基金暂停申购和转换转入业务的公告	中证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2021年2月5日
7	长信基金管理有限责任公司关于增加中信建投证券股份有限公司为旗下部分开放式基金代销机构并开通转换、定期定额投资业务及参加申购（含定投申购）费率优惠活动的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2021年3月16日
8	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金参加国金证券股份有限公司申购费率优惠活动的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2021年3月26日
9	长信长金通货币市场基金 2020 年年度报告	中国证监会电子披露网站、公司网站	2021年3月30日
10	长信基金管理有限责任公司旗下全部基金 2020 年年度报告提示性公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2021年3月30日

11	长信基金管理有限责任公司关于长信长金货币市场基金暂停申购和转换转入业务的公告	中证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2021 年 3 月 30 日
12	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金参加中国银行股份有限公司申购（含定投申购）费率优惠活动的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2021 年 3 月 31 日
13	长信长金货币市场基金 2021 年第 1 季度报告	中国证监会电子披露网站、公司网站	2021 年 4 月 21 日
14	长信基金管理有限责任公司旗下全部基金 2021 年第一季度报告提示性公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2021 年 4 月 21 日
15	长信基金管理有限责任公司关于长信长金货币市场基金暂停申购和转换转入业务的公告	中证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2021 年 4 月 27 日
16	长信基金管理有限责任公司关于董事长变更公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2021 年 4 月 30 日
17	长信基金管理有限责任公司关于增加恒泰证券股份有限公司为旗下部分开放式基金代销机构并开通转换、定期定额投资业务及参加申购（含定投申购）费率优惠活动的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2021 年 6 月 7 日
18	长信基金管理有限责任公司关于长信长金货币市场基金暂停申购和转换转入业务的公告	中证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2021 年 6 月 8 日
19	长信基金管理有限责任公司公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2021 年 6 月 22 日
20	长信长金货币市场基金更新的招募说明书（2021 年第【2】号）及基金产品资料概要（更新）	中国证监会电子披露网站、公司网站	2021 年 6 月 30 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：本基金本报告期内未有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

注：本基金本报告期未发生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、中国证监会批准设立基金的文件；
- 2、《长信长金货币市场基金基金合同》；
- 3、《长信长金货币市场基金招募说明书》；
- 4、《长信长金货币市场基金托管协议》；
- 5、报告期内在指定报刊上披露的各种公告的原稿；
- 6、长信基金管理有限责任公司营业执照、公司章程及相关资格批复文件。

12.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

12.3 查阅方式

长信基金管理有限责任公司网站：

。

长信基金管理有限责任公司

2021 年 8 月 31 日