

# 长信长金通货币市场基金 2022 年年度报告

2022 年 12 月 31 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：2023 年 3 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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金基金合同规定，于 2023 年 3 月 29 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。

本报告期自 2022 年 1 月 1 日起至 2022 年 12 月 31 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>5</b>
2.1 基金基本情况 .....	5
2.2 基金产品说明 .....	5
2.3 基金管理人和基金托管人 .....	5
2.4 信息披露方式 .....	5
2.5 其他相关资料 .....	6
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标 .....	6
3.2 基金净值表现 .....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况 .....	10
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 .....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	13
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 .....	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 .....	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	16
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 .....	17
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>17</b>
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 .....	17
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 .....	17
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 .....	17
<b>§6 审计报告</b> .....	<b>17</b>
6.1 审计报告基本信息 .....	17
6.2 审计报告的基本内容 .....	17
<b>§7 年度财务报表</b> .....	<b>19</b>
7.1 资产负债表 .....	19
7.2 利润表 .....	21
7.3 净资产（基金净值）变动表 .....	22
7.4 报表附注 .....	25
<b>§8 投资组合报告</b> .....	<b>48</b>

8.1 期末基金资产组合情况.....	48
8.2 债券回购融资情况 .....	49
8.3 基金投资组合平均剩余期限.....	49
8.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明 .....	50
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	50
8.6 期末按实际利率计算账面价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细.....	50
8.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值确定的基金资产净值的偏离 .....	51
8.8 期末按实际利率计算账面价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明 细 .....	51
8.9 投资组合报告附注 .....	51
<b>§9 基金份额持有人信息.....</b>	<b>56</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	56
9.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况 .....	56
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	56
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	57
<b>§10 开放式基金份额变动.....</b>	<b>57</b>
<b>§11 重大事件揭示 .....</b>	<b>57</b>
11.1 基金份额持有人大会决议.....	57
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	57
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	58
11.4 基金投资策略的改变 .....	58
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	58
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	58
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	58
11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况.....	61
11.9 其他重大事件 .....	61
<b>§12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>65</b>
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	65
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	65
<b>§13 备查文件目录 .....</b>	<b>65</b>
13.1 备查文件目录 .....	65
13.2 存放地点 .....	66
13.3 查阅方式 .....	66

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	长信长金通货币市场基金	
基金简称	长信长金通货币	
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	6,104,236,205.13 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	长信长金通货币 A	长信长金通货币 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	749,572,903.36 份	5,354,663,301.77 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
	联系电话	021-61009999
	电子邮箱	zhouyg@cxfund.com.cn
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
----------------	-------

登载基金年度报告正文的基金管理人互联网网址	www.cxfund.com.cn
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市黄浦区延安东路 222 号 30 楼
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、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2022 年		2021 年		2020 年	
	长信长金通货币 A	长信长金通货币 B	长信长金通货币 A	长信长金通货币 B	长信长金通货币 A	长信长金通货币 B
本期已实现收益	38,057,822.24	148,988,054.99	43,434,515.34	295,061,088.47	43,181,149.96	238,400,421.97
本期利润	38,057,822.24	148,988,054.99	43,434,515.34	295,061,088.47	43,181,149.96	238,400,421.97
本期净值收益率	1.8728%	2.0165%	2.3372%	2.4806%	2.2032%	2.3465%
3.1.2 期末数据和指标	2022 年末		2021 年末		2020 年末	
	期末基金资产净值	749,572,903.36	5,354,663,301.77	2,266,154,263.02	9,605,607,469.82	1,941,600,026.07
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期	2022 年末		2021 年末		2020 年末	

末指标						
累计净值收益率	14.9794%	14.2700%	12.8656%	12.0113%	10.2879%	9.3000%

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益，由于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

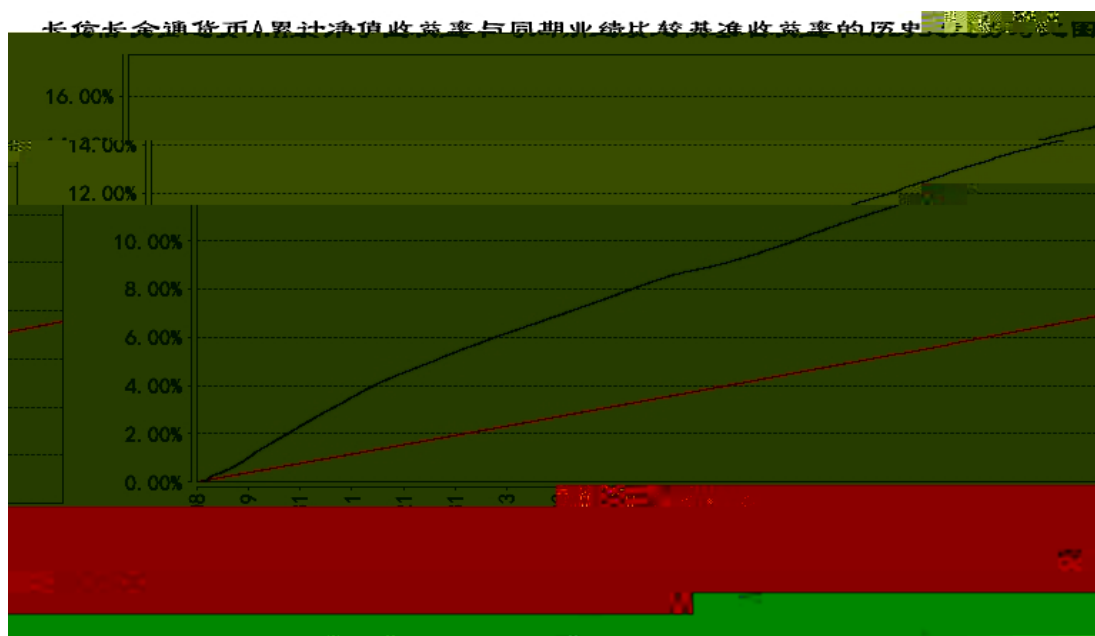
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	0.4351%	0.0019%	0.3456%	0.0000%	0.0895%	0.0019%
过去六个月	0.8591%	0.0027%	0.6924%	0.0000%	0.1667%	0.0027%
过去一年	1.8728%	0.0027%	1.3781%	0.0000%	0.4947%	0.0027%
过去三年	6.5508%	0.0026%	4.1955%	0.0000%	2.3553%	0.0026%
过去五年	13.6311%	0.0030%	7.0872%	0.0000%	6.5439%	0.0030%
自基金合同生效起至今	14.9794%	0.0032%	7.5501%	0.0000%	7.4293%	0.0032%

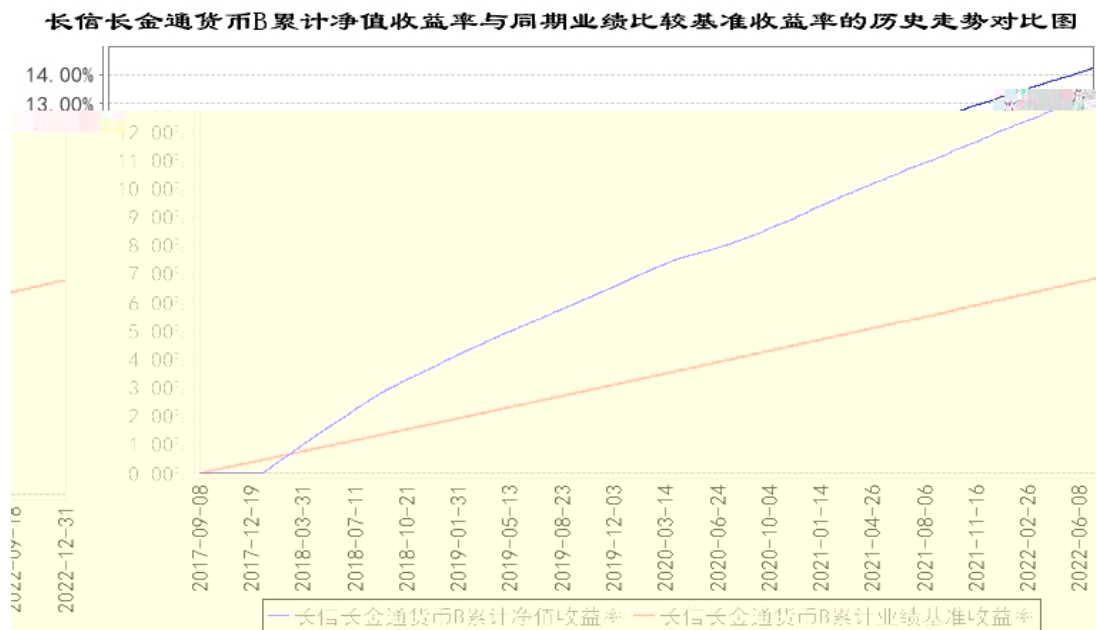
长信长金货币 B

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
----	----------	-------------	------------	---------------	-----	-----

				④		
过去三个月	0.4714%	0.0019%	0.3456%	0.0000%	0.1258%	0.0019%
过去六个月	0.9311%	0.0027%	0.6924%	0.0000%	0.2387%	0.0027%
过去一年	2.0165%	0.0027%	1.3781%	0.0000%	0.6384%	0.0027%
过去三年	7.0003%	0.0026%	4.1955%	0.0000%	2.8048%	0.0026%
过去五年	14.2700%	0.0030%	7.0872%	0.0000%	7.1828%	0.0030%
自基金合同生效起至今	14.2700%	0.0034%	7.5501%	0.0000%	6.7199%	0.0034%

### 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

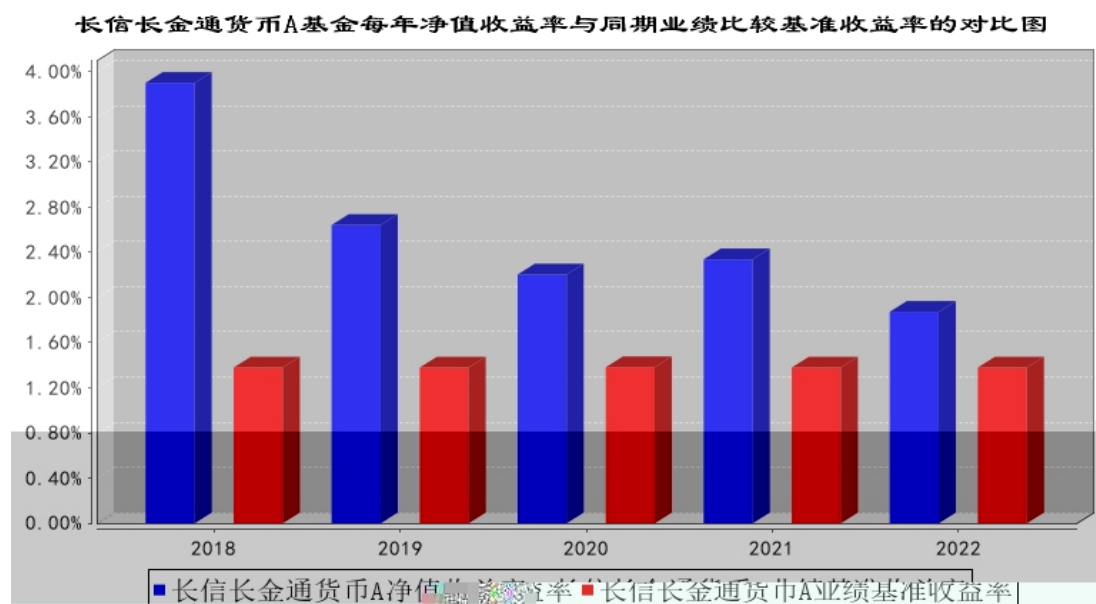




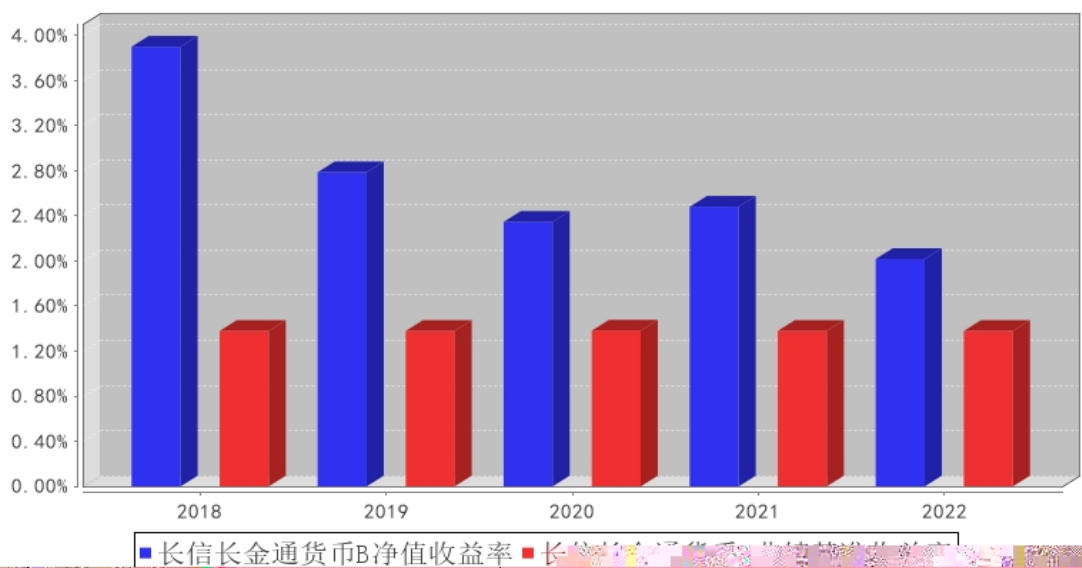
注：1、图示日期为 2017 年 9 月 8 日至 2022 年 12 月 31 日。

2、按基金合同规定，本基金自基金合同生效日起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的约定。

### 3.2.3 过去五年基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



长信长金货币B基金每年净值收益率与同期业绩比较基准收益率的对比图



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

#### 长信长金货币 A

年度	已按再投资形式 转实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	年度利润 分配合计	备注
2022 年	37,645,017.30	464,163.57	-51,358.63	38,057,822.24	-
2021 年	42,610,701.25	789,640.44	34,173.65	43,434,515.34	-
2020 年	42,765,760.40	448,412.74	-33,023.18	43,181,149.96	-
合计	123,021,478.95	1,702,216.75	-50,208.16	124,673,487.54	-

#### 长信长金货币 B

年度	已按再投资形式 转实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	年度利润 分配合计	备注
2022 年	147,116,260.98	1,730,683.05	141,110.96	148,988,054.99	-
2021 年	292,099,239.99	3,200,034.72	-238,186.24	295,061,088.47	-
2020 年	236,385,351.79	1,678,176.53	336,893.65	238,400,421.97	-
合计	675,600,852.76	6,608,894.30	239,818.37	682,449,565.43	-

注：本基金本报告期内进行的利润分配情况，详见 4.8。

## § 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 2022 年 12 月 31 日，本基金管理人共管理 85 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、长信先锐混合型证券

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、长信内需均衡混合型证券投资基金、长信 30 天滚动持有短债债券型证券投资基金、长信稳惠债券型证券投资基金、长信稳丰债券型证券投资基金、长信先进装备三个月持有期混合型证券投资基金、长信颐和平平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）、长信颐年平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）长信稳健增长一年持有期混合型证券投资基金、长信稳健成长混合型证券投资基金、长信企业成长三年持有期混合型证券投资基金、长信稳兴三个月定期开放债券型证券投资基金、长信稳航 30 天持有期中短债债券型证券投资基金、长信稳恒债券型证券投资基金、长信中证科创创业 50 指数增强型证券投资基金、长信均衡策略一年持有期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、长信浦瑞 87 个月定期开放债券型证券投资基金和长信稳惠债券型证券投资基金的基金经理、现金理财部总监	2017 年 9 月 8 日	-	12 年	管理学学士，毕业于上海交通大学，具有基金从业资格，中国国籍。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、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、长信稳健纯债债券型证券投资基金、长信富瑞两年定期开放债券型证券投资基金和长信中债 1-3 年政策性金融债指数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、长信浦瑞 87 个月定期开放债券型证券投资基金和长信稳惠债券型证券投资基金的基金经理。
杜国昊	长信长金通货币市场基	2019 年 11 月 29	-	8 年	上海财经大学经济学硕士，具有基金从业资格，中国国籍。曾任职于德勤

	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、长信稳势纯债债券型证券投资基金、长信30天滚动持有短债债券型证券投资基金、长信稳丰债券型证券投资基金和长信稳航30天持有期中短债债券型证券投资基金的基金经理	日			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、基金经理助理和长信易进混合型证券投资基金的基金经理，现任长信长金通货币市场基金、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、长信稳势纯债债券型证券投资基金、长信30天滚动持有短债债券型证券投资基金、长信稳丰债券型证券投资基金和长信稳航30天持有期中短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遵规守信情况的说明

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 公平交易制度和控制方法

1、所有投资对象的投资指令必须经由交易部门总监或其授权人审核分配至交易人员执行。进行投资指令分配的人员必须保证投资指令得到公平对待。

2、公司使用的交易执行软件系统必须具备如下功能：

(1) 严格按照时间顺序发送委托指令；

(2) 对于多个投资组合在同一时点就同一证券下达的相同方向的投资指令，并且市价在限价范围内的，系统自动将交易员针对该证券下达的每笔委托自动按照指令数量比例分拆为各投资组合的委托指令。对于不同投资组合且不同投资经理针对交易所同一证券的同一方向竞价交易指令，指令数量比例达到 5:1 或以上的，根据市场情况审核后通过人工分发给不同交易员豁免公平交易。

3、交易人员对于接收到的交易指令依照价格优先、时间优先的顺序执行。在执行多个投资组合在同一时点就同一证券下达的相同方向的交易所投资指令时，除制度规定的例外指令外，系统已强制开启公平交易开关。

4、对于不同投资组合均进行债券一级市场申购、非公开发行股票申购等非集中竞价交易的投资对象，交易部门必须严格独立接收各投资组合的投资指令，在申购结果产生前，不得以任何形式向任何人泄露各投资指令的内容，包括指令价格及数量等要素。

5、对于各投资组合以独立账户名义进行申购的投资对象，除需经过公平性审核的例外指令外，申购获配的证券数量由投资管理系统接收各类证券登记结算机构发送的数据进行分配。交易部门根据证券发行人在指定公开披露媒体上披露的申购结果对系统内分配数量进行核准，数量不符的，应当第一时间告知各投资管理部门的总监及监察稽核部总监。对于以公司名义进行申购的投资对象，公司在获配额度确定后，严格按照价格优先的原则在各投资组合间进行分配。申购价格相同的投资组合则根据投资指令的数量按比例进行分配。确因特殊原因不能按照上述原则进行分配的，应启动异常交易识别流程，审核通过的，可以进行相应分配。

#### 4.3.2 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。

#### 4.3.3 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。同时，对本年度同向交易价差进行专项分析，未发现异常情况。

## 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 2022 年，上半年债券市场走势以区间震荡为主，政策利率下调且市场资金利率一直维持低位，短端收益率下行较多，下半年债市波动加剧，债券收益率先下后上，年底随着防疫政策优化和稳经济政策加码，资金利率逐步往上向政策利率靠拢，年末 1Y 同业存单收益率较年初仍有 18bp 下行。全年货币政策维持宽松，1 月下调 MLF 和公开市场操作利率 10bp，4 月降准 25bp，8 月 MLF 和公开市场操作利率又超预期下调 10bp，12 月再次降准 25bp，资金利率中枢有所下移。二三季度 1Y 存单利率累计下行近 60bp，四季度防疫相关政策优化和稳经济政策加码，地产行业政策推进，经济基本面边际修复，市场风险偏好回升，同时临近年末资金面边际趋紧，存单利率调整至 12 月中旬，之后央行投放大量跨年流动性，保持金融体系流动性充裕，且债市调整出一定配置价值，机构提前布局开年，存单利率企稳回落，四季度 1Y 存单利率累计上行超 40bp。本年度报告中，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，维持了较好的组合整体收益。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2022 年 12 月 31 日，本报告期内长信长金通货币 A 净值增长率为 1.8728%，长信长金通货币 B 净值增长率为 2.0165%，同期业绩比较基准收益率为 1.3781%。

## 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 2023 年，经济弱复苏趋势可能不变，财政、货币政策将持续发力，地方债等供给节奏适度提前，资金保持合理充裕，关注后续工业生产、消费和地产投资等实际增长情况，考虑到今年全球经济增速下行压力增大，预计债市调整幅度有限。全年 GDP 高点可能出现在二季度，CPI、PPI 低位企稳，社零预计有明显修复，进出口数据可能偏弱。地产方面，融资端的利好政策在四季度出台，“三箭齐发”支持房企信贷、债券和股权融资，需求端刺激政策持续推出，央行和银保监会也提出建立首套住房贷款利率政策动态调整机制，因城施策更好支持刚性住房需求，未来根据政策实际效果可能继续加大放松力度。中期来看债券收益率可能震荡向上，但从短期层面可以把握资金面宽松、经济修复不及预期、降准降息概率等因素带来的交易机会。未来我们将在保证货币基金安全性、流动性充足的基础上，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，匹配组合久期，为持有人获取较好的投资回报。

## 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本年度内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及配套法律法规，时刻以合规运作、防范风险为核心，以维护基金持有人利益为宗旨，保证基金合同得到严格履行。公司监察稽核部

独立地开展工作，对基金运作进行事前、事中与事后的监督检查，发现问题及时提出改进建议并督促业务部门进行整改，同时定期向公司董事会和公司管理层出具监察稽核报告。

本年度内，为确保监管要求的有效实施，公司监察稽核部根据各项法律法规监管政策性要求以及公司内部控制执行情况，积极开展公司业务流程及风险梳理的工作，适时组织召开内部控制委员会会议，对各项监管要求进行解读，并对各业务部门业务流程及制度规范的调整进行深入探讨，加强对关键业务岗位合规传导及培训工作。

本年度内，监察稽核部以组合压力测试为主要方式，定期对投资组合的风险状况进行检测，对投资组合整体流动性情况进行分析，并适时召集各业务部门的沟通会议就各项可能面临的风险进行沟通、讨论，防范组合风险事件发生。

本基金管理人承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则，秉持风控优先、内控从严的理念，不断提高内部监察稽核工作的科学性和实效性、并完善内部控制体系，做好各项内控工作，努力防范和控制各种风险，确保基金资产的规范运作，充分保障基金持有人的合法权益。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人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、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。

#### 4.8 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 187,045,877.23 元，已分配利润 187,045,877.23 元。

#### 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

本报告期内，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

本报告期内，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、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支、基金收益分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，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年度报告中财务指标、净值表现、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 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	德师报(审)字(23)第 P00818 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	长信长金货币市场基金全体持有人
审计意见	我们审计了长信长金货币市场基金的财务报表，包括 2022 年 12 月 31 日的资产负债表，2022 年度的利润表、净资产(基金净值)变动表以及财务报表附注。 我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，公允反映了长信长金货币市场基金 2022 年 12 月 31 日的财务状况、2022 年度的经营成果和基金净值变动情况。

形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于长信长金通货币市场基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	<p>长信基金管理有限责任公司(以下简称“基金管理人”)管理层对其他信息负责。其他信息包括长信长金通货币市场基金 2022 年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>基金管理人管理层负责按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估长信长金通货币市场基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算长信长金通货币市场基金、终止经营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督长信长金通货币市场基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，</p>

	<p>未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和做出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对长信长金通货币市场基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致长信长金通货币市场基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	汪芳   冯适
会计师事务所的地址	上海市黄浦区延安东路 222 号 30 楼
审计报告日期	2023 年 3 月 28 日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：长信长金通货币市场基金

报告截止日：2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	603,726,019.92	5,204,172,234.90
结算备付金		-	27,034,545.45
存出保证金		1,941.72	23,647.72
交易性金融资产	7.4.7.2	4,441,843,807.50	5,069,099,753.52
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		4,441,843,807.50	5,069,099,753.52
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-

其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	2,098,514,663.90	3,546,129,009.20
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		-	200,328,802.27
应收股利		-	-
应收申购款		3,002,465.00	2,850.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	40,132,507.86
资产总计		7,147,088,898.04	14,086,923,350.92
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022年12月31日</b>	<b>上年度末 2021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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		1,040,335,299.03	1,611,439,659.23
应付清算款		-	600,000,000.00
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		748,642.89	1,460,961.21
应付托管费		249,547.62	486,987.03
应付销售服务费		130,237.94	374,642.88
应付投资顾问费		-	-
应交税费		31,150.56	12,006.18
应付利润		1,033,944.38	944,192.05
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	323,870.49	443,169.50
负债合计		1,042,852,692.91	2,215,161,618.08
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.10	6,104,236,205.13	11,871,761,732.84
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	-	-
净资产合计		6,104,236,205.13	11,871,761,732.84
负债和净资产总计		7,147,088,898.04	14,086,923,350.92

注：1、报告截止日 2022 年 12 月 31 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 6,104,236,205.13 份，其中长信长金通货币 A 份额 749,572,903.36 份，长信长金通货币 B 份额 5,354,663,301.77 份。

2、以下比较数据已根据本年《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〉》中的资产负债表格式的要求进行列示：2021 年年度报告资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目的“本期末”余额合并列示在 2022 年年度报告资产负债表中“其他资产”项目的“上年度末”余额，2021 年年度报告资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在 2022 年年度报告资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额。

## 7.2 利润表

会计主体：长信长金通货币市场基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		221,715,007.39	381,216,195.34
1. 利息收入		107,538,869.96	376,538,584.65
其中：存款利息收入	7.4.7.13	55,057,612.52	98,985,153.84
债券利息收入		-	195,298,808.92
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		52,481,257.44	82,254,621.89
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		114,176,137.43	4,677,610.69
其中：股票投资收益	7.4.7.14	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	114,176,137.43	4,677,610.69
资产支持证券投资	7.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-	-
股利收益	7.4.7.19	-	-
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.20	-	-
4. 汇 收益（损失以“-”		-	-

号填列)			
5. 其他收入 (损失以“-”号填列)	7.4.7.21	-	-
<b>减: 二、营业总支出</b>		34,669,130.16	42,720,591.53
1 管理人报酬	7.4.10.2.1	14,299,478.79	21,141,151.54
2 托管费	7.4.10.2.2	4,766,492.88	7,047,050.43
3 销售服务费	7.4.10.2.3	3,838,859.90	4,061,024.10
4 投资顾问费		-	-
5 利息支出		11,416,501.24	10,129,632.62
其中: 卖出回购金融资产支出		11,416,501.24	10,129,632.62
6 信用减值损失	7.4.7.22	-	-
7 税金及附加		86,472.35	81,210.82
8 其他费用	7.4.7.23	261,325.00	260,522.02
<b>三、利润总额 ( 损总额以“-”号填列)</b>		187,045,877.23	338,495,603.81
减: 所得税费用		-	-
<b>四、净利润 (净 损以“-”号填列)</b>		187,045,877.23	338,495,603.81
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		187,045,877.23	338,495,603.81

注: 以下比较数据已根据本年《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>》中的利润表格式的要求进行列示: 2021 年年度报告利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在 2022 年年度报告利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

### 7.3 净资产 (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: 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产 (基金净值)	11,871,761,732.84	-	-	11,871,761,732.84
加: 会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-

其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	11,871,761,732.84	-	-	11,871,761,732.84
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-5,767,525,527.71	-	-	-5,767,525,527.71
（一）、综合收益总额	-	-	187,045,877.23	187,045,877.23
（二）、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）	-5,767,525,527.71	-	-	-5,767,525,527.71
其中：1. 基金申购款	33,418,993,587.04	-	-	33,418,993,587.04
2. 基金赎回款	-39,186,519,114.75	-	-	-39,186,519,114.75
（三）、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）	-	-	-187,045,877.23	-187,045,877.23
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	6,104,236,205.13	-	-	6,104,236,205.13
项目	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	15,320,555,430.45	-	-	15,320,555,430.45
加：会计政策变更	-	-	-	-

前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	15,320,555,430.45	-	-	15,320,555,430.45
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-3,448,793,697.61	-	-	-3,448,793,697.61
（一）、综合收益总额	-	-	338,495,603.81	338,495,603.81
（二）、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）	-3,448,793,697.61	-	-	-3,448,793,697.61
其中：1. 基金申购款	55,725,751,882.79	-	-	55,725,751,882.79
2. 基金赎回款	-59,174,545,580.40	-	-	-59,174,545,580.40
（三）、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）	-	-	-338,495,603.81	-338,495,603.81
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	11,871,761,732.84	-	-	11,871,761,732.84

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

刘元瑞

波

红

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

长信长金通货币市场基金(以下简称“本基金”)系由基金管理人长信基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《长信长金通货币市场基金基金合同》(以下简称“基金合同”)及其他有关法律法规的规定,本基金由长信利息满场内实时申赎货币市场基金(以下简称“原基金”变更注册而来,原基金于2013年11月7日经中国证券监督管理委员会证监可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,经毕华会计师事务所有限公司验证,并出具了编号为毕华验字第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)。

### 7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部布的《企业会计准则 基本准则》以及其后布及修订的具体会计准则、应用指、解以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定(统称“企业会计准则”)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《基金行业实务操作》。

本财务报表以持续经营为基础编制。

### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和基金净值变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

###### (1) 金融资产的分类

根据本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征，本基金将所持有的金融资产在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和以摊余成本计量的金融资产，无金融资产划分为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

金融资产的合同条款规定在特定日期产生的现金流量为对本金和以未付本金金额为基础的利息的支付，且本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标，则本基金将该金融资产分类为以摊余成本计量的金融资产。此类金融资产主要包括货币资金、各类应收款项、买入返售金融资产等。

不符合分类为以摊余成本计量的金融资产以及公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产的金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产计入“衍生金融资产”外，其他以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产计入“交易性金融资产”。

###### (2) 金融负债的分类

本基金将持有的金融负债在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金无分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

##### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。对于以常规方式购买或出售金融资产的，在交易日确认将收到的资产和为此将承担的负债，或者在交易日终止确认已出售的资产。金融资产和金融负债在初始确认时以公允价值计量。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；以摊余成本计量的金融资产和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或

债券或资产支持证券已到付息期但尚未 取的利息，单独确认为应收项目。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量，公允价值变动形成的利得或损失以及与该金融资产相关的股利和利息收入计入当期损益。以摊余成本计量的金融资产和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量，发生减值或终止确认产生的利得或损失，计入当期损益。

本基金对分类为以摊余成本计量的金融资产以预期信用损失为基础确认损失准备。除购买或生的已发生信用减值的金融资产外，本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初确认后的变动情况。该金融工具的信用风险自初确认后已显 增加，本基金按照相当于该金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备；该金融工具的信用风险自初确认后并未显 增加，本基金按照相当于该金融工具未来 12 个月内预期信用损失的金额计量其损失准备。信用损失准备的增加或转回金额，作为减值损失或利得计入当期损益。

本基金在前一会计期间已经按照相当于金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量了损失准备，但在当期资产负债表日，该金融工具已不再属于自初确认后信用风险显 增加的情形，本基金在当期资产负债表日按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量该金融工具的损失准备，由此形成的损失准备的转回金额作为减值利得计入当期损益。

本基金利用可获得的合理且有依据的前 性信息，通过比较金融工具在资产负债表日发生约的风险与在初 确认日发生 约的风险，以确定金融工具的信用风险自初 确认后是否已显 增加。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止、该金融资产已转移且其所有权上 乎所有的风险和报酬已转移或 然既 有转移也 有保留金融资产所有权上 乎所有的风险和报酬，但是未保留对该金融资产的控制，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。本基金既 有转移也 有保留金融资产所有权上 乎所有风险和报酬，且保留了对该金融资产控制的，则按照其继续涉入 转移金融资产的程度继续确认该 转移金融资产，并相应确认相关负债。金融负债的现时义务全部或部分已经解除的， 能终止确认该金融负债或其一部分。金融负债全部或部分终止确认的，将终止确认部分的账面价值与支付的对价(包括转出的非现金资产或承担的新金融负债)之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债基于公允价值的入值的可观察程度以及该等 入值对公允价值计量整体的重要 性，将其公允价值划分为三个层

次。第一层次 入值是在计量日能 取得的相同资产或负债在活 市场上未经调整的报价；第二层次 入值是除第一层次 入值外相关资产或负债直接或间接可观察的 入值；第三层次 入值是相关资产或负债的不可观察 入值。

本基金采用影子定价和偏离度控制确定金融资产的公允价值。在本基金存续期间，基金管理人定期计算本基金投资组合摊余成本与其他可参考公允价值指标之间的偏离程度，并定期测试其他可参考公允价值指标确定方法的有效性。投资组合的摊余成本与其他可参考公允价值指标产生重大偏离的，按其他公允价值指标对组合的账面价值进行调整。

如有确 证据表明按上述方法不能客观反映交易性金融工具的公允价值，基金管理人将根据具体情况与基金托管人 定后采用估值技术确定最能反映公允价值的价格。估值技术包括参考熟悉情况并自 交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的 销

当本基金具有 销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且目前可执行该种法定权利，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清 该金融负债时，金融资产和金融负债以相互 销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不 相互 销。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所对应的金额。每份基金份额面值为人民币 1.00 元。申购、赎回、转换及分红再投资等 起的实收基金的变动分别于上述各交易确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所 起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 收入（损失）的确认和计量

##### (1) 利息收入

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提。

##### (2) 投资收益

债券投资收益包括债券利息收入以及买卖债券价差收入。基金持有的附息债券、 现券按摊余成本和实际利率计算确定利息收入。买卖债券价差收入为卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本、应收利息（ 有）与相关交易费用后的差额确认。

资产支持证券投资收益包括资产支持证券利息收入以及买卖资产支持证券价差收入。基金持

有的资产支持证券按摊余成本和实际利率计算确定利息收入。资产支持证券投资收益为卖出资产支持证券交易日的成交总额扣除应结转的资产支持证券投资成本、应收利息（有）与相关交易费用后的差额确认。

### (3) 信用减值损失

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认信用损失准备。本基金所计提的信用减值损失计入当期损益。

#### 7.4.4.9 费用的确认和计量

本基金的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 0.15% 的年费率逐日计提。

本基金的基金托管费按前一日基金资产净值 0.05% 的年费率逐日计提。

本基金 A 类基金份额的销售服务费按前一日基金资产净值 0.15% 的年费率逐日计提；B 类基金份额的销售服务费按前一日基金资产净值 0.01% 的年费率逐日计提。

卖出回购金融资产款支出按卖出回购金融资产款的摊余成本在回购期内以实际利率逐日计提。

#### 7.4.4.10 基金的收益分配政策

(1) 本基金同一类别内的每份基金份额 有同等分配权；

(2) 本基金收益分配方式为红利再投资，免收再投资的费用；

(3) “每日分配、按日支付”。本基金根据每日基金收益情况，以每 份基金已实现收益为基准，为投资人每日计算当日收益并分配，且每日进行支付。投资人当日收益分配的计算保留到小数点后 2 位，小数点后第 3 位按去 原则处理（因去 形成的余额进行再次分配，直到分完为止）；

(4) 本基金根据每日收益情况，将当日收益全部分配， 当日已实现收益大于零时，为投资人记正收益； 当日已实现收益小于零时，为投资人记负收益； 当日已实现收益等于零时，当日投资人不记收益；

(5) 本基金每日进行收益计算并分配时，收益支付方式只采用红利再投资（即红利转基金份额）方式，投资人可通过赎回基金份额获得现金收益；投资人在当日累计收益支付时， 当日净收益大于零，则增加基金份额持有人基金份额； 当日净收益等于零时，则保持基金份额持有人基金份额不变；基金管理人将采取必要 施尽量 免基金净收益小于零， 当日基金净收益小于零时， 减基金份额持有人基金份额；

(6) 当日申购的基金份额自下一个工作日起， 有基金的收益分配权益；当日赎回的基金份额自下一个工作日起，不 有基金的收益分配权益；

(7) 法律法规或监管机构有规定的，从其规定。

在不违反法律法规、基金合同的约定以及对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，基金管理人可调整基金收益的分配原则和支付方式，不需召开基金份额持有人大会。

#### 7.4.4.11 分部报告

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

- (1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；
- (2) 能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；
- (3) 能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### 7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金计算影子价格过程中确定债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

根据《关于发布〈中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准〉的通知》（中基协发〔2014〕24 号），在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上市交易或转的固定收益品种（估值处理标准有规定的除外），采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

根据财政部发布的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认与计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》和《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（以下合称“新金融工具准则”）相关规定，以及财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布的《关于进一步落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。本基金在编制 2022 年度财务报表时已采用该准则，并采用准则允许的实务简化方法，调整期初基金净值，2021 年的比较数据将不作重述。

于首次执行日，本基金因执行新金融工具准则调减期初基金净值人民币 0.00 元，本基金执行新金融工具准则的影响如下：

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融工具包括银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、应收利息、卖出回购金融资产款和应付利息，金额分别为人民币 5,204,172,234.90 元、人民币 27,034,545.45 元、人民币 23,647.72 元、人民币 3,546,129,009.20

元、人民币 40,132,507.86、人民币 1,611,439,659.23 元和人民币 107,870.69 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融工具包括银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、其他资产-应收利息、卖出回购金融资产款和其他负债-应付利息。本基金将基于实际利率法计提的金融工具的利息包含在相应金融工具的账面余额中，并反映在银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产和卖出回购金融资产款等项目中，不单独列示应收利息项目或应付利息项目。新金融工具准则下，银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、其他资产-应收利息、卖出回购金融资产款和其他负债-应付利息的金额分别为人民币 5,220,968,500.69 元、人民币 27,047,927.50 元、人民币 23,659.38 元、人民币 3,548,828,553.91 元、人民币 0.00 元、人民币 1,611,547,529.92 元和人民币 0.00 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融工具为交易性金融资产，金额为人民币 5,069,099,753.52 元，属于交易性金融资产的应收利息金额为人民币 20,623,303.65 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融工具为交易性金融资产，金额为人民币 5,089,723,057.17 元。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内无需说明的重大会计估计变更。

#### 7.4.5.3 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。

#### 7.4.6 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 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 充通知》、财税 2016 140 号《关于明确金融房地产开发 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 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 定资产进项税额 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；2018 年 1 月 1 日起，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 税人，适用简易计税方法，按照 3%的征收率 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，不 企业所得税。

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

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
活期存款	3,411,769.95	1,504,172,234.90
等于：本金	3,410,587.70	1,504,172,234.90
加：应计利息	1,182.25	-
减： 账准备	-	-
定期存款	600,314,249.97	3,700,000,000.00
等于：本金	600,000,000.00	3,700,000,000.00
加：应计利息	314,249.97	-
减： 账准备	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	300,000,000.00
存款期限 3 个月以上	600,314,249.97	3,400,000,000.00
其他存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减： 账准备	-	-
合计	603,726,019.92	5,204,172,234.90

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2022 年 12 月 31 日			
		按实际利率计算的账面价值	影子定价	偏离金额	偏离度 (%)
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	4,441,843,807.50	4,444,494,243.30	2,650,435.80	0.0434
	合计	4,441,843,807.50	4,444,494,243.30	2,650,435.80	0.0434
资产支持证券		-	-	-	-
合计		4,441,843,807.50	4,444,494,243.30	2,650,435.80	0.0434
项目		上年度末 2021 年 12 月 31 日			
		按实际利率计算的账面价值	影子定价	偏离金额	偏离度 (%)
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	5,069,099,753.52	5,070,559,000.00	1,459,246.48	0.0123
	合计	5,069,099,753.52	5,070,559,000.00	1,459,246.48	0.0123

资产支持证券	-	-	-	0.0000
合计	5,069,099,753.52	5,070,559,000.00	1,459,246.48	0.0123

注：1. 偏离金额 影子定价-摊余成本；

2. 偏离度 偏离金额 摊余成本法确定的基金资产净值。

#### 7.4.7.3 衍生金融资产 负债

##### 7.4.7.3.1 衍生金融资产 负债期末余额

本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融工具。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日	
	账面余额	其中：买断式 回购
交易所市场	-	-
银行间市场	2,098,514,663.90	-
合计	2,098,514,663.90	-
项目	上年度末 2021年12月31日	
	账面余额	其中：买断式 回购
交易所市场	1,300,000,000.00	-
银行间市场	2,246,129,009.20	-
合计	3,546,129,009.20	-

##### 7.4.7.4.2 期末买断式 回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末未持有因买断式 回购交易而取得的债券。

#### 7.4.7.5 债权投资

##### 7.4.7.5.1 债权投资情况

本基金本报告期末及上年度末均无债权投资。

#### 7.4.7.6 其他债权投资

##### 7.4.7.6.1 其他债权投资情况

本基金本报告期末及上年度末均无其他债权投资。

#### 7.4.7.7 其他权益工具投资

##### 7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

本基金本报告期末及上年度末均无其他权益工具投资。

## 7.4.7.8 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
应收利息	-	40,132,507.86
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
合计	-	40,132,507.86

## 7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
应付券 交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借 约金	-	-
应付交易费用	124,570.49	136,298.81
其中：交易所市场	-	-
银行间市场	124,570.49	136,298.81
应付利息	-	107,870.69
预提账户维护费	9,300.00	9,000.00
预提审计费	70,000.00	70,000.00
预提信息披露费	120,000.00	120,000.00
合计	323,870.49	443,169.50

## 7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

## 长信长金通货币 A

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,266,154,263.02	2,266,154,263.02
本期申购	9,490,357,412.02	9,490,357,412.02
本期赎回（以“-”号填列）	-11,006,938,771.68	-11,006,938,771.68
基金拆分 份额折算前	-	-
基金拆分 份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	749,572,903.36	749,572,903.36

## 长信长金通货币 B

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	9,605,607,469.82	9,605,607,469.82

本期申购	23,928,636,175.02	23,928,636,175.02
本期赎回（以“-”号填列）	-28,179,580,343.07	-28,179,580,343.07
基金拆分 份额折算前	-	-
基金拆分 份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	5,354,663,301.77	5,354,663,301.77

注：本期申购含红利再投、转换入份(金)额，本期赎回含转换出份(金)额。

#### 7.4.7.11 其他综合收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无其他综合收益。

#### 7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

##### 长信长金通货币 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	38,057,822.24	-	38,057,822.24
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	-38,057,822.24	-	-38,057,822.24
本期末	-	-	-

##### 长信长金通货币 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	148,988,054.99	-	148,988,054.99
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	-148,988,054.99	-	-148,988,054.99
本期末	-	-	-

#### 7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
活期存款利息收入	717,715.69	832,485.05
定期存款利息收入	54,186,721.37	97,658,778.64
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	153,039.47	493,483.84

其他	135.99	406.31
合计	55,057,612.52	98,985,153.84

注：其他为保证金利息收入。

#### 7.4.7.14 股票投资收益

##### 7.4.7.14.1 股票投资收益 买卖股票差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无股票投资收益。

#### 7.4.7.15 债券投资收益

##### 7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年 12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12 月31日
债券投资收益 利息收入	112,921,350.47	-
债券投资收益 买卖债券（债转股及 债券到期 付）差价收入	1,254,786.96	4,677,610.69
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	114,176,137.43	4,677,610.69

##### 7.4.7.15.2 债券投资收益 买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31 日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31 日
卖出债券（债转股及债券 到期 付）成交总额	24,042,032,812.27	40,079,080,780.75
减：卖出债券（债转股及 债券到期 付）成本总额	23,886,216,502.79	39,773,208,692.17
减：应计利息总额	154,561,222.52	301,194,477.89
减：交易费用	300.00	-
买卖债券差价收入	1,254,786.96	4,677,610.69

##### 7.4.7.15.3 债券投资收益 赎回差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均无债券投资赎回差价收入。

##### 7.4.7.15.4 债券投资收益 申购差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均无债券投资申购差价收入。

**7.4.7.16 资产支持证券投资收益****7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成**

本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

**7.4.7.17 贵金属投资收益****7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成**

本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

**7.4.7.18 衍生工具收益****7.4.7.18.1 衍生工具收益 买卖权证差价收入**

本基金本报告期及上年度可比期间无衍生工具收益。

**7.4.7.18.2 衍生工具收益 其他投资收益**

本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益。

**7.4.7.19 股利收益**

本基金本报告期及上年度可比期间无股利收益。

**7.4.7.20 公允价值变动收益**

本基金本报告期及上年度可比期间无公允价值变动收益。

**7.4.7.21 其他收入**

本基金本报告期及上年度可比期间无其他收入。

**7.4.7.22 信用减值损失**

本基金本报告期及上年度可比期间均无信用减值损失。

**7.4.7.23 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022年1月1日至2022年12月31日	2021年1月1日至2021年12月31日
审计费用	70,000.00	70,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借 佣金	-	-
账户维护费	36,580.00	35,080.00
其他费用	34,745.00	35,338.74
交易费用	-	103.28
合计	261,325.00	260,522.02

注：其他费用为银行汇划手续费和上清所查 费。

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

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。

#### 7.4.9 关联方关系

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、基金销售机构
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
上海海欣集团股份有限公司（以下简称“海欣集团”）	基金管理人的股东
武汉钢铁有限公司（以下简称“武钢有限”）	基金管理人的股东
上海彤胜投资管理中心（有限合伙）（以下简称“彤胜投资”）	基金管理人的股东
上海彤骏投资管理中心（有限合伙）（以下简称“彤骏投资”）	基金管理人的股东
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
长江期货股份有限公司（以下简称“长江期货”）	基金管理人的股东的子公司

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一业款订立。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的股票交易。

###### 7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年12月31日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31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	101,125,600.00	100.00	764,070,233.98	88.32

###### 7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 (%)
长江证券	18,900,000,000.00	100.00	69,561,800,000.00	98.58

#### 7.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

#### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	14,299,478.79	21,141,151.54
其中：支付销售机构的客户维护费	1,110,452.83	1,677,814.10

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。

##### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	4,766,492.88	7,047,050.43

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。

##### 7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方 名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
	当期发生的基金应支付的销售服务费

	长信长金货币 A	长信长金货币 B	合计
长信基金	1,389,505.10	632,967.11	2,022,472.21
交通银行	41,629.70	1,288.85	42,918.55
长江证券	11,070.83	-	11,070.83
合计	1,442,205.63	634,255.96	2,076,461.59
获得销售服务费的各关联方 名称	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	长信长金货币 A	长信长金货币 B	合计
长信基金	967,314.64	992,908.82	1,960,223.46
长江证券	13,011.03	-	13,011.03
合计	980,325.67	992,908.82	1,973,234.49

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：长信长金货币 A 的年费率为 0.15%，长信长金货币 B 的年费率为 0.01%。其计算公式为：长信长金货币 A 日销售服务费 = 前一日长信长金货币 A 资产净值 × 0.15% ÷ 当年天数；长信长金货币 B 日销售服务费 = 前一日长信长金货币 B 资产净值 × 0.01% ÷ 当年天数。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日						
银行间市场交易的 各关联方名称	债券交易金额		基金 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	99,544,747.40	50,959,652.74	-	-	-	-
上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日						
银行间市场交易的 各关联方名称	债券交易金额		基金 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	498,226,278.08	-	-	-	-	-

#### 7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

##### 7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用 定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间无与关联方通过约定申报方式进行的适用 定期限费率的证券出借业务的情况。

#### 7.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间无与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

基金管理人在本报告期及上年度可比期间均未运用 自有资金投资本基金。

##### 7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

长信长金通货币 A

关联方名称	本期末 2022 年 12 月 31 日		上年度末 2021 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 (%)
长江财富	14,761,145.62	0.24	98,622.15	0.00

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。

#### 7.4.10.6 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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行	3,411,769.95	717,715.69	1,504,172,234.90	832,485.05

注：本基金用于证券交易结算的资金通过本基金托管人的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，按银行同业利率计息。于 2022 年 12 月 31 日的相关余额在资产负债表中的“结算备付金”科目中单独列示（2021 年 12 月 31 日：同）。

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期及上年度可比期间均未在承销期内购入过由关联方承销的证券。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

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。

#### 7.4.11 利润分配情况

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

37,645,017.30	464,163.57	-51,358.63	38,057,822.24	-
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
147,116,260.98	1,730,683.05	141,110.96	148,988,054.99	-

#### 7.4.12 期末（2022 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

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

本基金本报告期末无因认购新发 增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 7.4.12.2 期末持有的 时 等流通受限股票

本基金本报告期末无 时 等流通受限股票。

##### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为 的债券

###### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2022 年 12 月 31 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 1,040,335,299.03 元，是以如下债券作为质：

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（ ）	期末估值总额
112202010	22 工 银行 CD010	2023 年 1 月 3 日	99.45	2,000,000	198,897,519.71
112203040	22 业银行 CD040	2023 年 1 月 3 日	99.10	729,000	72,246,352.32
112204023	22 中国银行 CD023	2023 年 1 月 3 日	98.96	265,000	26,225,102.20
112205102	22 建设银行 CD102	2023 年 1 月 3 日	99.45	666,000	66,234,367.04
112208068	22 中信银行 CD068	2023 年 1 月 3 日	99.40	1,000,000	99,404,085.36
112217223	22 大银行 CD223	2023 年 1 月 3 日	99.43	1,000,000	99,426,271.09
130209	13 国开 09	2023 年 1 月 3 日	101.40	900,000	91,256,217.42
200402	20 发 02	2023 年 1 月 3 日	101.63	1,300,000	132,120,308.59
210212	21 国开 12	2023 年 1 月 3 日	102.83	385,000	39,589,720.56
220304	22 进出 04	2023 年 1 月 3 日	101.26	1,300,000	131,634,870.04
2204103	22 发 现 03	2023 年 1 月 3 日	99.55	500,000	49,773,996.62
2204108	22 发 现 08	2023 年 1 月 3 日	99.19	1,000,000	99,185,297.71
229958	22 现国债 58	2023 年 1 月 3 日	99.93	300,000	29,979,991.43
合计				11,345,000	1,135,974,100.09

###### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无因交易所市场债券正回购交易而 的债券。

##### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无因参与转融通证券出借业务而出借的证券。

## 7.4.13 金融工具风险及管理

### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金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 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 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 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 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 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， 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。

### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现 约、 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在本基金的托管人交通银行，与该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 好信用等级的证券，且通过分 化投资以分 信用风险。本基金投资于一 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 公司发行的证券，不得超过该证券的10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此 约风险发生的可能性 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 方式以控制相应的信用风险。

#### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日

A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	310,574,155.80	609,522,973.95
合计	310,574,155.80	609,522,973.95

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。

#### 7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

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。

#### 7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	3,856,477,904.18	3,894,740,695.02
合计	3,856,477,904.18	3,894,740,695.02

注：本基金持有同业存单的主体评级均为 AA 及以上评级。

#### 7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
AAA	-	564,836,084.55
AAA 以下	-	-
未评级	274,791,747.52	-
合计	274,791,747.52	564,836,084.55

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。

#### 7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

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。

#### 7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

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。

### 7.4.13.3 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自于开放式基金每日支付赎回资金的流动性风险，以及因部分投资品种交易不活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。

#### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》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，并严格遵守基金管理人流动性相关交易限制。

本基金主要投资于基金合同约定的具有良好流动性的金融工具，基金管理人流动性指标进行持续的监测和分析，定期开展压力测试，评估在不同的压力情境下资产变现情况的变化。

基金管理人持续监测本基金开放期内的赎回情况，当市场环境或投资者结构发生变化时，及时调整投资组合资产结构及比例，保持基金资产可变现规模和期限与负债赎回规模和期限的匹配。

同时，针对应付赎回资金的流动性风险，基金管理人在基金合同中约定了巨额赎回条款，制定了发生巨额赎回时资金的处理模式，控制因开放模式而产生的流动性风险。

#### 7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或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。

###### 7.4.13.4.1.1 利率风险 口

单位：人民币元

本期末 2022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	603,726,019.92	-	-	-	-	603,726,019.92
结算备付金	-	-	-	-	-	-
存出保证金	1,941.72	-	-	-	-	1,941.72
交易性金融资产	4,392,551,312.32	49,292,495.18	-	-	-	4,441,843,807.50
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	2,098,514,663.90	-	-	-	-	2,098,514,663.90
债权投资	-	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	3,002,465.00	3,002,465.00
应收清算款	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-

资产总计	7,094,793,937.86	49,292,495.18	-	-	3,002,465.00	7,147,088,898.04
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	748,642.89	748,642.89
应付托管费	-	-	-	-	249,547.62	249,547.62
应付清算款	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	1,040,335,299.03	-	-	-	-	1,040,335,299.03
应付销售服务费	-	-	-	-	130,237.94	130,237.94
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	1,033,944.38	1,033,944.38
应交税费	-	-	-	-	31,150.56	31,150.56
其他负债	-	-	-	-	323,870.49	323,870.49
负债总计	1,040,335,299.03	-	-	-	2,517,393.88	1,042,852,692.91
利率  度 缺口	6,054,458,638.83	49,292,495.18	-	-	485,071.12	6,104,236,205.13
上年度末 2021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	4,504,172,234.90	700,000,000.00	-	-	-	5,204,172,234.90
结算备付金	27,034,545.45	-	-	-	-	27,034,545.45
存出保证金	23,647.72	-	-	-	-	23,647.72
交易性金融资产	5,019,921,579.66	49,178,173.86	-	-	-	5,069,099,753.52
买入返售金融资产	3,546,129,009.20	-	-	-	-	3,546,129,009.20
应收证券清算款	-	-	-	-	200,328,802.27	200,328,802.27
应收申购款	-	-	-	-	2,850.00	2,850.00
其他资产	-	-	-	-	40,132,507.86	40,132,507.86
资产总计	13,097,281,016.93	749,178,173.86	-	-	240,464,160.13	14,086,923,350.92
负债						
卖出回购金融资产款	1,611,439,659.23	-	-	-	-	1,611,439,659.23
应付证券清算款	-	-	-	-	600,000,000.00	600,000,000.00
应付管理人报酬	-	-	-	-	1,460,961.21	1,460,961.21
应付托管费	-	-	-	-	486,987.03	486,987.03
应付销售服	-	-	-	-	374,642.88	374,642.88

务费						
应交税费	-	-	-	-	12,006.18	12,006.18
应付利润	-	-	-	-	944,192.05	944,192.05
其他负债	-	-	-	-	443,169.50	443,169.50
负债总计	1,611,439,659.23	-	-	-	603,721,958.85	2,215,161,618.08
利率 度 缺口	11,485,841,357.70	749,178,173.86	-	-	-363,257,798.72	11,871,761,732.84

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，按合同规定的重新定价日及剩余到期日中的 者进行分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的 性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
	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（2022年12月31日）	上年度末（2021年12月 31日）
分析	市场利率上升 27 个基点	-2,894,078.61	-2,237,118.22
	市场利率下降 27 个基点	2,894,078.61	2,237,118.22

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他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 定收益品种，因此无重大其他市场价格风险。

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险的 性分析

本基金主要投资债券等 定收益品种，无重大其他价格风险，因此未进行其他价格风险的 性分析。

#### 7.4.14 公允价值

##### 7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活 市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次 入值外相关资产或负债直接或间接可观察的 入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察 入值。

#### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

##### 7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	-	-
第二层次	4,441,843,807.50	5,069,099,753.52
第三层次	-	-
合计	4,441,843,807.50	5,069,099,753.52

##### 7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，出现重大事项、交易不活（包括时的交易不活）、或属于非公开发行等情况，本基金分别于 日至交易 复活 日期间、交易不活 期间及限售期间根据估值调整中采用的不可观察 入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次或第三层次。

##### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

##### 7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

#### 7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	定收益投资	4,441,843,807.50	62.15
	其中：债券	4,441,843,807.50	62.15
	资产支持证券	-	-

2	买入返售金融资产	2,098,514,663.90	29.36
	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	603,726,019.92	8.45
4	其他各项资产	3,004,406.72	0.04
5	合计	7,147,088,898.04	100.00

## 8.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目	占基金资产净值的比例 (%)	
1	报告期内债券回购融资余额	7.00	
	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	1,040,335,299.03	17.04
	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

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%。

## 8.3 基金投资组合平均剩余期限

### 8.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	64
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	67
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	23

### 报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余期限不存在超过 120 天的情况。

### 8.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例 (%)	各期限负债占基金资产净值的比例 (%)
1	30 天以内	41.28	17.04
	其中：剩余存续期超过 397 天的 动利率债	-	-
2	30 天（含） 60 天	13.88	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的 动利率债	-	-
3	60 天（含） 90 天	33.42	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的 动利率债	-	-

4	90 天（含） 120 天	10.78	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的 动利率债	-	-
5	120 天（含） 397 天（含）	17.53	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的 动利率债	-	-
合计		116.89	17.04

#### 8.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余存续期不存在超过 240 天的情况。

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	按实际利率计算的账面价值	占基金资产净值比例（%）
1	国 债券	29,979,991.43	0.49
2	央行票据	-	-
3	金融债券	555,385,911.89	9.10
	其中：政策性 金融债	555,385,911.89	9.10
4	企业债券	-	-
5	企业短期融 资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单	3,856,477,904.18	63.18
8	其他	-	-
9	合计	4,441,843,807.50	72.77
10	剩余存续期 超过 397 天 的 动利率 债券	-	-

#### 8.6 期末按实际利率计算账面价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明 细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量（ ）	按实际利率计算的 的账面价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	112215502	22 民生银行 CD502	3,000,000	298,944,223.93	4.90
2	112213153	22 银行 CD153	3,000,000	298,326,491.57	4.89
3	112290967	22 银行 CD003	2,500,000	249,647,218.17	4.09
4	112270725	22 江网 银行 CD035	2,000,000	199,497,052.67	3.27

5	112292431	22 宁波银行 CD044	2,000,000	199,377,583.96	3.27
6	112203110	22 业银行 CD110	2,000,000	198,911,005.75	3.26
7	112211138	22 平安银行 CD138	2,000,000	198,910,383.95	3.26
8	112202010	22 工 银行 CD010	2,000,000	198,897,519.71	3.26
9	112203115	22 业银行 CD115	2,000,000	198,852,398.89	3.26
10	112219334	22 恒丰银行 CD334	2,000,000	198,460,371.16	3.25

### 8.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在 0.25（含）-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.0874%
报告期内偏离度的最低值	-0.0139%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0399%

#### 报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

本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

本报告期内不存在正偏离度的绝对值达到 0.5%的情况。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 8.9 投资组合报告附注

#### 8.9.1 基金计价方法说明

本基金采用摊余成本法计价。

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

报告期内本基金投资的前十名证券中，发行主体民生银行股份有限公司于 2022 年 3 月 21 日收到中国银行保险监督管理委员会行政处罚决定书（银保监罚决字 2022 20 号），根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一 、第四十六 和相关审 经营规则，经查，民生银行监管标准化数据（ A ）系统数据质量及数据报送存在以下 法 规行为：一、未报送贸易融资业务 A 数据；二、漏报贷款核销业务 A 数据；三、漏报信贷资产转 业务 A 数据；四、

债券投资业务 A 数据存在偏差；五、未报送权益类投资业务 A 数据；六、未报送公募基金投资业务 A 数据；七、未报送其他担保类业务 A 数据；八、未报送不可无件 销的贷款承诺业务 A 数据；九、漏报委托贷款业务 A 数据；十、A 系统理财产品销售端与产品端数据核对不一致；十一、A 系统理财产品底层持仓余额数据存在偏差；十二、A 系统理财产品非标投向行业余额数据存在偏差；十三、A 系统《表外授信业务》表错报；十四、A 系统《对公信贷业务借据》表错报；十五、报送不实数据；十六、面向非机构客户发行的理财产品投资不 资产。综上，中国银行保险监督管理委员会给 公司罚款 490 元。

报告期内本基金投资的前十名证券中，发行主体 银行股份有限公司于 2022 年 3 月 21 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 2022 27 号），根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一 、第四十六 和相关审 经营规则，经查，银行监管标准化数据（A）系统数据质量及数据报送存在以下 法 规行为：一、漏报 期 90 天以上贷款余额 A 数据；二、漏报贸易融资业务 A 数据；三、漏报 价值 A 数据；四、漏报信贷资产转 业务 A 数据；五、债券投资业务 A 数据存在偏差；六、未报送权益类投资业务 A 数据；七、未报送 募基金投资业务 A 数据；八、漏报投资资产管理产品业务 A 数据；九、漏报贷款承诺业务 A 数据；十、A 系统理财产品销售端与产品端数据核对不一致；十一、A 系统理财产品底层持仓余额数据存在偏差；十二、A 系统理财产品非标投向行业余额数据存在偏差；十三、A 系统《对公信贷业务借据》表错报；十四、A 系统《个人活期存款分户账明细记录》表错报；十五、A 系统《表外授信业务》表错报。综上，中国银行保险监督管理委员会决定对 银行股份有限公司罚款人民币 380 元。

报告期内本基金投资的前十名证券中，发行主体 江网 银行股份有限公司于 2022 年 3 月 24 日收到中国银保监会 江监管局行政处罚信息公开表（银保监罚决字 2022 4 号），根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六 第（五）项，经查， 江网 银行股份有限公司存在授信审 性不足的情况。综上，中国银保监会 江监管局决定对 江网 银行罚款人民币 30 元。

报告期内本基金投资的前十名证券中，发行主体宁波银行股份有限公司于 2022 年 4 月 11 日收到宁波银保监局行政处罚决定书（银保监罚决字 2022 28 号），根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六 ，经查，宁波银行股份有限公司存在信贷资金 规流入房地产 、 规向 地 备项目提供融资、非标投资业务资金支用审核不到位、房地产贷款授信管理不到位情况。综上，宁波银保监局给 公司罚款人民币 220 元。

报告期内本基金投资的前十名证券中，发行主体宁波银行股份有限公司于 2022 年 4 月 11 日

收到宁波银保监局行政处罚决定书（银保监罚决字 2022 30 号），根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六 第（五）项，经查，宁波银行股份有限公司存在代理保险销售不规范情况。综上，宁波银保监局给 公司罚款人民币 30 元。

报告期内本基金投资的前十名证券中，发行主体宁波银行股份有限公司于 2022 年 4 月 21 日收到宁波银保监局行政处罚决定书（银保监罚决字 2022 35 号），根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六 ， 经查，宁波银行股份有限公司存在 酬管理不到位、关联交易管理不规范、 信贷政策执行不到位、授信管理不审 、资金用 管控不严、贷款风险分类不准确、票据业务管控不严、非现场统计数据差错情况。综上，宁波银保监局给 公司罚款人民币 270 元。

报告期内本基金投资的前十名证券中，发行主体宁波银行股份有限公司于 2022 年 5 月 27 日收到宁波银保监局行政处罚决定书（银保监罚决字 2022 44 号），根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六 ， 经查，宁波银行股份有限公司存在非标投资业务管理不审 、理财业务管理不规范、主承销债券管控不到位、 规办理衍生产品交易业务、信用证议付资金用于购买本行理财、 规办理委托贷款业务、非银融资业务开展不规范、内控管理不到位、数据治理存在 缺情况。综上，宁波银保监局给 公司罚款人民币 290 元。

报告期内本基金投资的前十名证券中，发行主体宁波银行股份有限公司于 2022 年 9 月 8 日收到宁波银保监局行政处罚决定书（银保监罚决字 2022 60 号），根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六 ， 经查，宁波银行股份有限公司 面业务内控管理不到位。综上，宁波银保监局给 公司罚款人民币 25 元。

报告期内本基金投资的前十名证券中，发行主体平安银行股份有限公司于 2022 年 3 月 21 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 2022 24 号），根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一 、第四十六 和相关审 经营规则，经查，平安银行监管标准化数据（A）系统数据质量及数据报送存在以下 法 规行为：一、不 贷款余额 A 数据存在偏差；二、 期 90 天以上贷款余额 A 数据存在偏差；三、漏报贸易融资业务 A 数据；四、漏报 价值 A 数据；五、未报送权益类投资业务 A 数据；六、漏报投资资产管理产品业务 A 数据；七、漏报委托贷款业务 A 数据； 、 A 系统理财产品销售端与产品端数据核对不一致； 、 A 系统理财产品底层持仓余额数据存在偏差；十、 A 系统理财产品非标投向行业余额数据存在偏差；十一、漏报分户账 A 数据；十二、 A 系统《表外授信业务》表错报；十三、 A 系统《个人信贷业务借据》表错报；十四、 A 系统《关联关系》表漏报；十五、 A 系统《对公信贷分户账》表漏报。综上，中国银行保险监督管理委员会决

定对平安银行股份有限公司罚款人民币 400 元。

报告期内本基金投资的前十名证券中,发行主体中国 业银行股份有限公司于 2022 年 3 月 21 日收到中国银行保险监督管理委员会行政处罚决定书(银保监罚决字 2022 12 号),根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一 、第四十六 和相关审 经营规则,经查,中国 业银行监管标准化数据(A )系统数据质量及数据报送存在以下 法 规行为:一、漏报贷款核销业务 A 数据;二、未报送权益类投资业务 A 数据;三、未报送公募基金投资业务 A 数据;四、未报送投资资产管理产品业务 A 数据;五、其他担保类业务 A 数据存在偏差;六、A 系统理财产品销售端与产品端数据核对不一致;七、A 系统理财产品底层持仓余额数据存在偏差; 、A 系统理财产品非标投向行业余额数据存在偏差; 、漏报分户账 A 数据;十、未在开户当月向 A 系统报送账户信息;十一、A 系统《个人活期存款分户账明细记录》表错报;十二、A 系统《表外授信业务》表错报;十三、A 系统《个人信贷业务借据》表错报;十四、A 系统《对公信贷业务借据》表错报;十五、A 系统《关联关系》表漏报;十六、理财产品登记不规范;十七、2018 年行政处罚问题依然存在。综上,中国银行保险监督管理委员会决定对 业银行罚款 480 元。

报告期内本基金投资的前十名证券中,发行主体中国 业银行股份有限公司于 2022 年 9 月 30 日收到中国银行保险监督管理委员会行政处罚决定书(银保监罚决字 2022 52 号),根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一 、第四十六 和相关审 经营规则,经查, 业银行理财业务存在以下 法 规行为:一、作为托管机构,存在未及时发现理财产品投资集中度超标情况;二、理财托管业务 反资产独立性原则要求,操作管理不到位。综上,中国银行保险监督管理委员会决定对 业银行罚款 150 元。

报告期内本基金投资的前十名证券中,发行主体中国工 银行股份有限公司于 2022 年 3 月 21 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 2022 11 号),根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一 、第四十六 和相关审 经营规则,经查,中国工 银行监管标准化数据(A )系统数据质量及数据报送存在以下 法 规行为:一、价值 A 数据存在偏差;二、漏报信贷资产转 业务 A 数据;三、未报送公募基金投资业务 A 数据;四、漏报 单信用证业务 A 数据;五、漏报保 业务 A 数据;六、A 系统理财产品销售端与产品端数据核对不一致;七、A 系统理财产品底层持仓余额数据存在偏差; 、A 系统《表外授信业务》表错报; 、A 系统《对公信贷业务借据》表错报;十、A 系统《对公信贷分户账》表漏报;十一、理财产品登记不规范;十二、2018 年行政处罚问题依然存在。综上,中国银行保险监督管理委员会决定对中国工 银行股份有限公司罚款人民币 360

元。

报告期内本基金投资的前十名证券中,发行主体恒丰银行股份有限公司于 2022 年 3 月 21 日收到中国银行保险监督管理委员会行政处罚决定书(银保监罚决字 2022 26 号),根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一、第四十六 和相关审 经营规则,经查,恒丰银行监管标准化数据(A)系统数据质量及数据报送存在以下 法 规行为:一、漏报 期 90 天以上贷款余额 A 数据;二、漏报贸易融资业务 A 数据;三、漏报贷款核销业务 A 数据;四、错报债券投资业务 A 数据;五、未报送权益类投资业务 A 数据;六、未报送 募基金投资业务 A 数据;七、未报送投资资产管理产品业务 A 数据; 、漏报单信用证业务 A 数据 、A 系统理财产品销售端与产品端数据核对不一致;十、A 系统理财产品底层持仓余额数据存在偏差;十一、A 系统理财产品非标投向行业余额数据存在偏差;十二、A 系统分户账与总账比对不一致;十三、漏报对公活期存款账户明细 A 数据;十四、未在开户当月向 A 系统报送账户信息;十五、A 系统《表外授信业务》错报;十六、A 系统《对公信贷业务借据》表错报;十七、A 系统《个人活期存款分户账明细记录》表错报;十 、A 系统《个人信贷业务借据》表错报。综上,中国银行保险监督管理委员会决定对恒丰银行股份有限公司罚款 480 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 。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的发行主体未出现 监管部门立 调查或在报告编制日前一年内受到公开 责、处罚的情形。

### 8.9.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,941.72
2	应收清算款	-
3	应收利息	-
4	应收申购款	3,002,465.00
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	3,004,406.72

#### 8.9.4 投资组合报告附注的其他文字 述部分

由于四 五入的原因，分项之和与合计项可能存在 差。

### § 9 基金份额持有人信息

#### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例(%)	持有份额	占总份额比例(%)
长信长金通货币 A	85,450	8,772.06	197,367,028.21	26.33	552,205,875.15	73.67
长信长金通货币 B	42	127,491,983.38	5,354,663,301.77	100.00	0.00	0.00
合计	85,492	71,401.26	5,552,030,329.98	90.95	552,205,875.15	9.05

注：对下属分级基金，比例的分 采用各自级别的份额，对合计数，比例的分 采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

#### 9.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

序号	持有人类别	持有份额（份）	占总份额比例（%）
1	银行类机构	522,934,897.70	8.57
2	银行类机构	505,934,652.08	8.29
3	保险类机构	303,261,181.27	4.97
4	银行类机构	302,576,126.00	4.96
5	银行类机构	300,087,525.49	4.92
6	银行类机构	212,100,022.08	3.47
7	券 类机构	209,186,140.35	3.43
8	保险类机构	208,752,203.21	3.42
9	银行类机构	207,603,471.39	3.40
10	银行类机构	200,124,744.15	3.28

#### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	长信长金通货币 A	240,107.06	0.03
	长信长金通货币 B	0.00	0.00
	合计	240,107.06	0.00

注：对下属分级基金，比例的分 采用各自级别的份额，对合计数，比例的分 采用下属分级基

金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

#### 9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（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

### § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	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	2,266,154,263.02	9,605,607,469.82
本报告期基金总申购份额	9,490,357,412.02	23,928,636,175.02
减：本报告期基金总赎回份额	11,006,938,771.68	28,179,580,343.07
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	749,572,903.36	5,354,663,301.77

### § 11 重大事件揭示

#### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期未召开本基金的基金份额持有人大会。

#### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

##### 11.2.1 基金管理人的重大人事变动

自 2022 年 2 月 21 日起，安 先生不再担任公司副总经理。

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。

##### 11.2.2 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， 铁任交通银行资产托管部总经理

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略未改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金未更换会计师事务所；报告期应支付给德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）审计的报酬为人民币 70,000.00 元，该审计机构为本基金提供的审计服务的连续年限为 6 年。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

施 1	内容
受到稽查或处罚等 施的主体	管理人及督察长
受到稽查或处罚等 施的时间	2022 年 1 月 18 日
采取稽查或处罚等 施的机构	上海证监局
受到的具体 施类型	责令改正及警示
受到稽查或处罚等 施的原因	内部控制制度未能得到有效执行
管理人采取整改 施的情况（如提出整改意见）	已完成整改并验收通过
其他	无

#### 11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券 名称	交易单元 数量	股票交易		应支付该券 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 (%)	
安信证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
东 证券	1	-	-	-	-	-

东方证券	1	-	-	-	-	-
东 证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
大证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国泰 安	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
金元证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
申银 国	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
东方 国际证券	1	-	-	-	-	-
证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中银国际 证券	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东 证券交易单元 1 个、 证券交易单元 1 个、民生证券交易单元 1 个。

## 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 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：

- a、券 基本面评价（财务状况、经营状况）；
- b、券 研究机构评价（报告质量、及时性和数量）；
- c、券 每日信息评价（及时性和有效性）；
- d、券 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 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。

## 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券名称	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(%)
安信证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	101,125,600.00	100.00	18,900,000,000.00	100.00	-	-
东证	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东证	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
大证	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
金元证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
兴业证	-	-	-	-	-	-

券						
东方国际 证券	-	-	-	-	-	-
证 券	-	-	-	-	-	-
中泰证 券	-	-	-	-	-	-
中银国 际证券	-	-	-	-	-	-

### 11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

本报告期本基金不存在偏离度绝对值超过 0.5%的情况。

### 11.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	长信基金管理有限责任公司关于增加济安财富（ ）基金销售有限公司为 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、中国证监会电子披露网 、公司网	2022 年 1 月 13 日
2	长信长金货币市场基金 2021 年第 4 季度报告	中国证监会电子披露网 、公司网	2022 年 1 月 24 日
3	长信基金管理有限责任公司 下全部基金 2021 年第四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 、公司网	2022 年 1 月 24 日
4	长信基金管理有限责任公司关于长信长金货币市场基金 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 、公司网	2022 年 1 月 25 日
5	长信基金管理有限责任公司关于增加四天银行股份有限公司为 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、中国证监会电子披露网 、公司网	2022 年 1 月 26 日
6	长信基金管理有限责任公司关于增加第一创业证券股份有限公司为 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、中国证监会电子披露网 、公司网	2022 年 2 月 8 日
7	长信基金管理有限责任公司关于增加 下部分开放式基金参加“长金通”网上直销平台及直销 台基金转换业务的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、中国证监会电子披露网 、公司网	2022 年 2 月 16 日

8	长信基金管理有限责任公司关于在“长金通”网上直销平台开展基金“转换 差费率”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、公司网	2022 年 2 月 16 日
9	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、公司网	2022 年 2 月 23 日
10	长信基金管理有限责任公司关于在直销 台开展个人投资者基金申购及货币市场基金转换“转换 差费率”优惠活动的公告	上证报、中国证监会电子披露网、公司网	2022 年 2 月 23 日
11	长信基金管理有限责任公司关于增加财通证券股份有限公司为 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、中国证监会电子披露网、公司网	2022 年 3 月 3 日
12	长信基金管理有限责任公司关于增加 中 基金销售有限公司为 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、中国证监会电子披露网、公司网	2022 年 3 月 17 日
13	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 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、公司网	2022 年 3 月 29 日
14	长信长金通货币市场基金 2021 年年度报告	中国证监会电子披露网、公司网	2022 年 3 月 31 日
15	长信基金管理有限责任公司 下全部基金 2021 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、公司网	2022 年 3 月 31 日
16	长信长金通货币市场基金 2022 年第 1 季度报告	中国证监会电子披露网、公司网	2022 年 4 月 22 日
17	长信基金管理有限责任公司 下全部基金 2022 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、公司网	2022 年 4 月 22 日
18	长信基金管理有限责任公司关于增加 财证券股份有限公司为 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、中国证监会电子披露网、公司网	2022 年 4 月 25 日
19	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 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、公司网	2022 年 4 月 26 日
20	长信基金管理有限责任公司关于终止	上证报、中国证监会电	2022 年 5 月 7 日

	华基金销售有限公司、 信基金销售有限公司办理下基 金相关销售业务的公告	子披露网、公司网	
21	长信基金管理有限责任公司关于下 基金持有的长期股票调整估值方 法的公告	上证报、中国证监会电 子披露网、公司网	2022年5月11日
22	长信基金管理有限责任公司关于增加 苏宁基金销售有限公司为下部 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、中国证监会电 子披露网、公司网	2022年5月25日
23	长信基金管理有限责任公司关于增加 深新华信通基金销售有限公司为 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、中国证监会电 子披露网、公司网	2022年5月26日
24	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、公司网	2022年5月30日
25	长信基金管理有限责任公司关于增加 创金启富基金销售有限公司为 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、中国证监会电 子披露网、公司网	2022年6月8日
26	长信基金管理有限责任公司关于增加 上海中财富基金销售有限公司为 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、中国证监会电 子披露网、公司网	2022年6月13日
27	长信基金管理有限责任公司关于增加 上海基金销售有限公司为下部 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、中国证监会电 子披露网、公司网	2022年6月15日
28	长信基金管理有限责任公司关于增加 泰信财富基金销售有限公司为下部 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、中国证监会电 子披露网、公司网	2022年6月15日
29	长信基金管理有限责任公司关于增加 证券股份有限公司为下部分开 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、中国证监会电 子披露网、公司网	2022年6月30日

30	长信长金通货币市场基金更新的招募说明书（2022 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、公司网	2022 年 6 月 30 日
31	长信长金通货币市场基金 2022 年第 2 季度报告	中国证监会电子披露网、公司网	2022 年 7 月 21 日
32	长信基金管理有限责任公司 下全部基金 2022 年第二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、公司网	2022 年 7 月 21 日
33	长信基金管理有限责任公司关于 财富基金销售有限公司办理 下基金相关销售业务的公告	上证报、中国证监会电子披露网、公司网	2022 年 8 月 4 日
34	长信基金管理有限责任公司关于增加 国 证券有限责任公司为 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、中国证监会电子披露网、公司网	2022 年 8 月 17 日
35	长信基金管理有限责任公司关于增加 证券股份有限公司为 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、中国证监会电子披露网、公司网	2022 年 8 月 17 日
36	长信基金管理有限责任公司关于增加 东兴证券股份有限公司为 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、中国证监会电子披露网、公司网	2022 年 8 月 24 日
37	长信长金通货币市场基金 2022 年中期报告	中国证监会电子披露网、公司网	2022 年 8 月 31 日
38	长信基金管理有限责任公司 下全部基金 2022 年中期报告提示性公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、中国证监会电子披露网、公司网	2022 年 8 月 31 日
39	长信基金管理有限责任公司关于增加 兴业证券股份有限公司为 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、中国证监会电子披露网、公司网	2022 年 9 月 2 日
40	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 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、公司网	2022 年 9 月 6 日
41	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 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、公司网	2022 年 9 月 27 日

42	长信基金管理有限责任公司关于长信基金 APP 终止运营及维护服务的公告	上证报、中国证监会电子披露网、公司网	2022 年 9 月 28 日
43	长信长金货币市场基金 2022 年第三季度报告	中国证监会电子披露网、公司网	2022 年 10 月 26 日
44	长信基金管理有限责任公司 下全部基金 2022 年第三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、公司网	2022 年 10 月 26 日
45	长信基金管理有限责任公司关于调整长信长金货币市场基金 B 类基金份额首次申购最低金额、基金账户最低基金份额余额的公告	中证报、中国证监会电子披露网、公司网	2022 年 11 月 7 日
46	长信长金货币市场基金更新的招募说明书及基金产品资料概要（更新）	中国证监会电子披露网、公司网	2022 年 11 月 7 日
47	长信基金管理有限责任公司关于长信长金货币市场基金招募说明书提示性公告	中证报、中国证监会电子披露网、公司网	2022 年 11 月 7 日
48	长信基金管理有限责任公司关于增加方正证券股份有限公司为 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、中国证监会电子披露网、公司网	2022 年 11 月 8 日
49	长信基金管理有限责任公司关于增加兴证券有限公司为 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、中国证监会电子披露网、公司网	2022 年 12 月 16 日
50	长信基金管理有限责任公司关于长信长金货币市场基金 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、公司网	2022 年 12 月 27 日

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金本报告期内未有单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期未发生影响投资者决策的其他重要信息。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

1、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 上披露的各种公告的原 ；
- 6、长信基金管理有限责任公司营业执照、公司 程及相关资格批复文件。

### 13.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

### 13.3 查阅方式

长信基金管理有限责任公司网 ； h p      www.cxfund.com.cn。

长信基金管理有限责任公司

2023 年 3 月 31 日