

长信长金通货币市场基金 2017年年度报告

2017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：2018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2018年3月28日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自2017年9月8日（本基金基金合同生效日）起至2017年12月31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	5
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.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	9
§4 管理人报告	10
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合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	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.....	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.....	15
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.....	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 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	17
§6 审计报告	18
6.1 审计报告基本信息.....	18
6.2 审计报告的基本内容.....	18
§7 年度财务报表	20
7.1 资产负债表.....	20
7.2 利润表.....	21
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	22
7.4 报表附注.....	23
§8 投资组合报告	44
8.1 期末基金资产组合情况.....	44
8.2 债券回购融资情况.....	44
8.3 基金投资组合平均剩余期限.....	44
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.....	45
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	45
8.6 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.....	46
8.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离.....	46
8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	46

8.9 投资组合报告附注.....	47
§9 基金份额持有人信息.....	48
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	48
9.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况.....	48
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	48
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的情况.....	49
§10 开放式基金份额变动.....	50
§11 重大事件揭示.....	51
11.1 基金份额持有人大会决议.....	51
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.....	51
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	51
11.4 基金投资策略的改变.....	51
11.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件.....	51
11.6 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	51
11.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	51
11.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	51
11.9 偏离度绝对值超过0.5%的情况.....	54
11.10 其他重大事件.....	54
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	58
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.....	58
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	58
§13 备查文件目录.....	59
13.1 备查文件目录.....	59
13.2 存放地点.....	59
13.3 查阅方式.....	59

§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	4,027,040,881.27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	4,027,040,881.27份	0.00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	上海市浦东新区银城中路188号
办公地址	上海市浦东新区银城中路68号9楼	上海市浦东新区银城中路188号
邮政编码	200120	200120
法定代表人	成善栋	牛锡明

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报、证券时报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	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	2017年9月8日(基金合同生效日)-2017年12月31日	
	长信长金货币A	长信长金货币B
本期已实现收益	6,528,517.64	-
本期利润	6,528,517.64	-
本期净值收益率	1.1865%	0.0000%
3.1.2 期末数据和指标	2017年末	
期末基金资产净值	4,027,040,881.27	-
期末基金份额净值	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	2017年末	
累计净值收益率	1.1865%	0.0000%

注：1、本基金基金合同生效日未2017年9月8日，截至本报告期末，本基金运作时间未满一年；

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益，由于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。

3、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。

4、本基金收益分配为每日分配，按日支付。

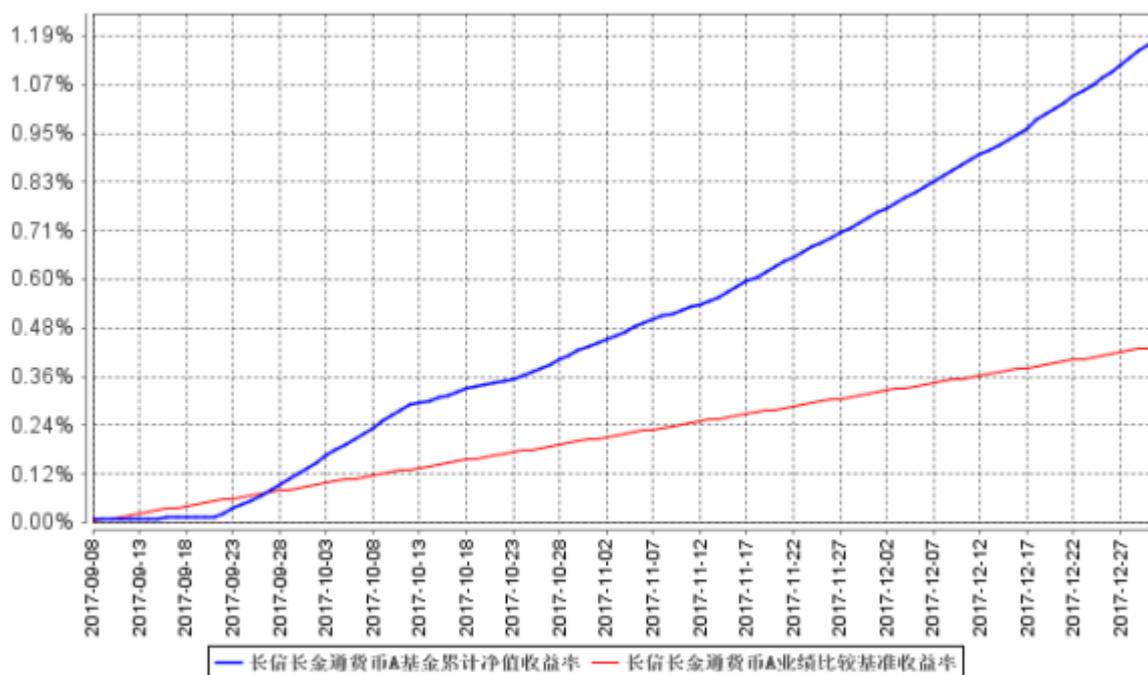
3.2 基金净值表现

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	1.0649%	0.0034%	0.3459%	0.0000%	0.7190%	0.0034%
自基金合同生效起至今	1.1865%	0.0046%	0.4322%	0.0000%	0.7543%	0.0046%

注：因本报告期长信长金货币B无份额，故不计算其相关数据。

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

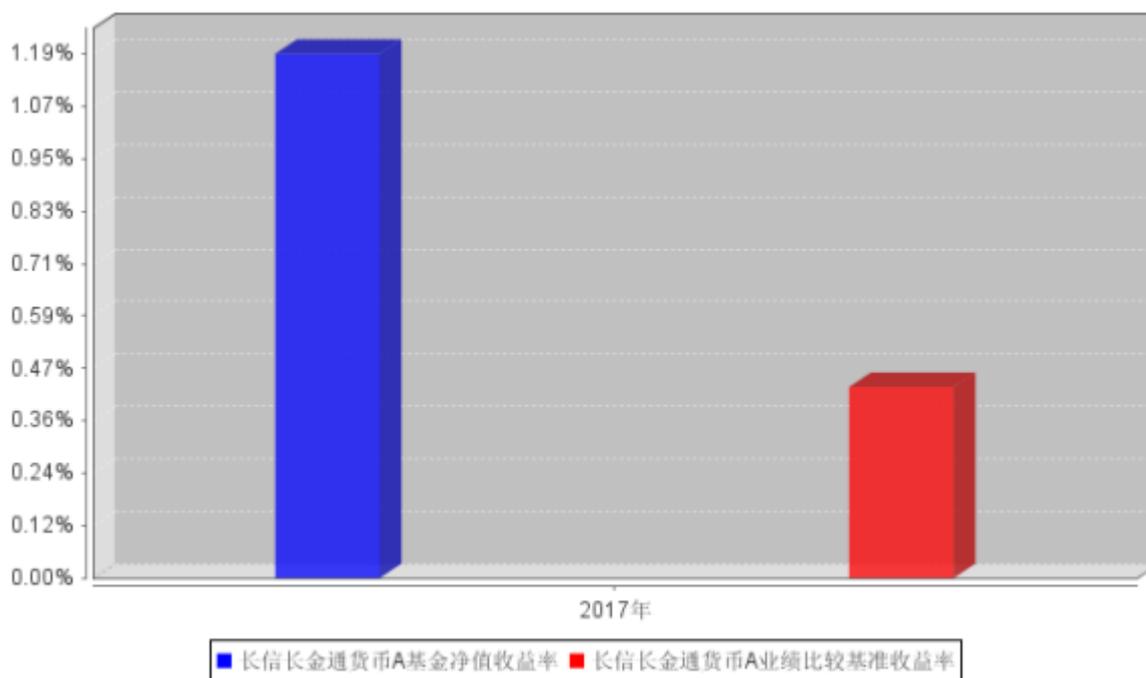


注：1、本基金基金合同生效日为2017年9月8日，基金合同生效日至本报告期末，本基金运作时间未满一年。图示日期为2017年9月8日至2017年12月31日。

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，本基金的各项资产配置比例应符合本基金合同第十二部分第二条投资范围、第四条投资限制的相关约定。

截至本报告期末，本基金尚未完成建仓。

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



注：1、本基金基金合同生效日为2017年9月8日，2017年净值增长率按当年实际存续期计算。

2、因本报告期长信长金货币B无份额，故不计算其相关数据。

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
2017年	4,312,053.36	214,070.40	2,002,393.88	6,528,517.64	
合计	4,312,053.36	214,070.40	2,002,393.88	6,528,517.64	

注：因本报告期长信长金货币B无份额，故不计算其相关数据。

§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%、武汉钢铁股份有限公司占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2017年12月31日，本基金管理人共管理58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、长信双利优选灵活配置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)、长信中证一带一路主题指数分级证券投资基金、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、长信富安纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信中证能源互联网主题指数型证券投资基金(LOF)、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、长信海外收益一年定期开放债券型证券投资基金、长信先锐债券型证券投资基金、长信利发债券型证券投资基金、长信富泰纯债一年定期开放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、长信上证港股通指数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、长信长金货币市场基金、长信量化优选混合型证券投资基金（LOF）、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。

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、长信稳健纯债债券型证券投资基金、长信纯债半年债券型证券投资基金、长信长金货币市场和长信稳通三个月定期开放债券型证券投资基金的基金经理	2017年9月8日	-	7年	管理学学士，上海交通大学管理学学士，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，现任长信利息收益开放式证券投资基金、长信稳健纯债债券型证券投资基金、长信纯债半年债券型证券投资基金、长信长金货币市场和长信稳通三个月定期开放债券型证券投资基金的基金经理。
张文琍	长信纯债壹号债券型证券投资基金、长信利鑫债券型证券投资基金（LOF）、长信利息收益开放式证券投资基金、长信富平纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信稳益纯债债券型证券投资基金、长信富民纯债一年定期开放债券型证券	2017年11月4日	-	23年	高级工商管理硕士，上海财经大学EMBA毕业，具有基金从业资格。曾任湖北证券公司交易一部交易员、长江证券有限责任公司资产管理事业部主管、债券事业总部投资部经理、固定收益总部交易部经理。2004年9月加入长信基金管理有限责任公司，历任长信利息收益开放式证券投资基金交易员、基金经理助理、长信利息收益开放式证券投资基金基金经理职务。现任固定收益部总监、长信纯债壹号债券型证券投资基金、长信

	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、长信稳势纯债债券型证券投资基金和长信长金货币市场基金的基金经理、固定收益部总监			利鑫债券型证券投资基金(LOF)、长信利息收益开放式证券投资基金、长信富平纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信稳益纯债债券型证券投资基金、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、长信稳势纯债债券型证券投资基金和长信长金货币市场基金的基金经理。
--	--	--	--	---

注：1、首任基金经理任职日期以本基金成立之日为准；新增或变更以刊登新增/变更基金经理的公告披露日为准；

2、本基金基金经理的证券从业年限以基金经理进入证券业务相关机构的工作经历为时间计算标准；

3、自2018年2月22日起，陆莹女士开始担任长信稳鑫三个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理；

4、自2018年2月22日起，陆莹女士开始担任现金理财部总监。

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，系统能够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，可豁免启动公平交易开关。

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，必须开启系统的公平交易开关。

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2017年，从外部经济环境来看，全球经济继续呈现复苏态势，美联储年内三次加息并推出缩表计划，对国际金融市场形成了一定的冲击。从国内的金融形势看，经济稳中向好，结构持续改善，总供求更加平衡，制造业出清、行业集中度提升以及企业利润改善较为明显，2017年4季度GDP同比6.8%，与3季度持平，全年GDP同比6.9%，较2016年明显修复，总体来看，2017年经济表现持续韧劲。同时，2017年是监管大年，监管大方向是要消除监管套利，推动金融体系去杠杆、去通道、去链条，强调优化资源配置，增强服务实体的能力，打击通道业务，倒逼泛资管行业瘦身。在海外市场美联储加息步伐加快、国内推进金融监管和去杠杆的背景下，货币市场利率和债券市场利率不断上行。

2017年在去杠杆、强监管和防风险的背景下，货币政策维持稳健中性，流动性溢价处于高位，回购市场的流动性经历了“总量紧，结构紧张加剧”的状态到“总量不紧，但结构性差异明显”的过程。在面对结构性问题时，央行拉长公开市场操作中回购期限，控制短期资金投放规模，这体现了央行既维护市场资金面稳定，又防止金融机构过度加杠杆的决心。

全年中，我们保持短久期，时时关注流动性和监管政策，适当配置同业存单，提高资金波段操作效率，抓住了年末资金利率高企的机会，在坚持保证流动性前提下，提高了组合整体收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2017年12月31日，本报告期内长信长金通货币A净值收益率为1.1865%，同期业绩比较基准收益率0.4322%。

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2018年，2018年预计政策层面“严监管+货币稳健中性”的组合仍将继续，这意味着流动性的格局可能仍然会延续“总量稳+结构紧缺”的状态。货币政策方面，在2017年四季度货币政策执行报告中明确指出“保持货币信贷和社会融资规模合理增长，把握好稳增长、去杠杆、防风险之间的平衡。一方面要掌握流动性尺度，助力去杠杆和防范化解金融风险；另一方面，综合考虑金融监管政策的宏观效应及对金融业态和市场运行格局的影响，加强监管协调”，在去杠杆和严监管的背景下，货币政策料将不会明显转向宽松，但会阶段性灵活调整。2018年1月以来，央行提前释放MLF、合理安排CRA使得今年春节资金面相对前几年格外宽松等都能体现今年货币政策可能不会进一步收紧，短端利率再创新高的概率不大。监管方面，随着金融去杠杆的延续，资

管新规等监管政策的落地以及后续监管政策的出台，对市场的影响仍需观察。基本面方面，在全球经济复苏、通胀预期升温的背景下，我国经济持续韧劲、货币政策稳健中性，当前整体环境对债市暂无支撑。预计在三季度左右，随着监管政策的落地，市场对于监管新规的适应后可能会出现投资机会。

我们今年整体仍将维持短久期的组合配置，时刻关注监管政策，做好流动性管理，在资金利率波动加剧的情况下，努力抓住资金波段操作机会。同时如果短融和同业存单在资金面冲击的背景下收益大幅上升，会适当加大配置力度，增加久期，把握市场超调带来的机会。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2017年度，随着市场调整及政府职能以及监管方式的转换，强监管、重落实的监管要求进一步明确，对公司的合规及风险管理工作提出了更高的要求。在此情况下，本年度监察稽核工作主要围绕以下几个部分展开：

本年度，监察稽核部严把合规底线不动摇，及时、有效将各项监管要求传导到位并紧抓落实。对于新下发的法律法规的后续通报、分析、培训、制度修订、新业务风险评估与合规支持等工作，监察稽核部均能做到及时通报全员，融会贯通，并及时对公司的内部控制方式及制度进行调整。

本年度，监察稽核部在督察长的指导下，继续加强公司内部控制的体系建设，落实内控与风控防线的全面前置。在督察长的领导下开展了全面风险梳理与自查工作，并依据自查工作成果汇总整理更新了公司的风险地图，使公司各部门更加深刻地认识到内控制度对促进公司规范经营，有效防范和化解风险，保障基金持有人利益等方面的重要性。为公司后续业务发展奠定了良好的合规基础。

本年度，监察稽核部着力于加强部门内部人员管理及风险管控，做好前、中、后台的协调和服务工作。监察稽核部密切关注监管部门法律法规及指导意见更新情况，对于新发法律法规的后续通报、分析、培训、制度修订、新业务风险评估与合规支持等工作，监察稽核部均能做到及时通报全员，融会贯通，并及时与业务部门进行沟通，对公司的内部控制方式及制度进行调整。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据相关法律法规，长信基金管理有限责任公司（以下简称“公司”）制订了健全、有效的估值政策和估值程序，成立了估值委员会，估值委员会是公司基金估值的主要决策机构，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，健全公司估值决策体系，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。基金经理不直接参与估值决策，估值决策由与会估值工作小组成员1/2以上多数票通过。对于估值政策和估值原则，公司与基金托管人充分沟通，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6,528,517.64元，已分配利润6,528,517.64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

自2017年9月22日至2017年10月25日，本基金资产净值已连续二十个工作日低于五千万元。自2017年12月7日起至报告期末，本基金资产净值高于五千万元。

§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

2017年度，基金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

2017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、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、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：6,528,517.64元，向B级份额持有人分配利润：0元。

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

2017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（18）第P00419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	<p>我们审计了长信长金货币市场基金的财务报表，包括2017年12月31日的资产负债表，2017年9月8日（基金合同生效日）至2017年12月31日止期间的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。</p> <p>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2017年12月31日的财务状况、2017年9月8日（基金合同生效日）至2017年12月31日止期间的经营成果和基金净值变动情况。</p>
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货币市场基金2017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。</p> <p>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，</p>

	<p>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，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，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、结构和内容(包括披露)，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	曾浩 吴凌志
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	2018年3月26日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：长信长金货币市场基金

报告截止日：2017年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017年12月31日
资产：		
银行存款	7.4.7.1	204,589,749.56
结算备付金		2,727.27
存出保证金		-
交易性金融资产	7.4.7.2	2,544,058,016.06
其中：股票投资		-
基金投资		-
债券投资		2,544,058,016.06
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	1,467,560,825.35
应收证券清算款		200,660.49
应收利息	7.4.7.5	6,848,747.01
应收股利		-
应收申购款		69,000.00

递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	10,999.16
资产总计		4,223,340,724.90
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017年12月31日
负 债:		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		193,757,338.12
应付证券清算款		-
应付赎回款		-
应付管理人报酬		153,014.20
应付托管费		51,004.74
应付销售服务费		127,121.21
应付交易费用	7.4.7.7	24,624.94
应交税费		-
应付利息		89,346.54
应付利润		2,002,393.88
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	95,000.00

负债合计		196,299,843.63
所有者权益:		
实收基金	7.4.7.9	4,027,040,881.27
未分配利润	7.4.7.10	-
所有者权益合计		4,027,040,881.27
负债和所有者权益总计		4,223,340,724.90

注：1、报告截止日2017年12月31日，长信长金货币A基金份额净值人民币1.0000元，基金份额总额4,027,040,881.27份；长信长金货币B基金份额净值人民币1.0000元，基金份额总额0.00份；份额总计为4,027,040,881.27份。

2、本基金本报告期为2017年9月8日至2017年12月31日，本基金合同于2017年9月8日起正式生效，为报告期内合同生效的基金，本报告期的财务报表和报表附注均无同期对比数据。

7.2 利润表

会计主体：长信长金货币市场基金

本报告期：2017年9月8日(基金合同生效日)至2017年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017年9月8日(基金合同生效日)至2017年12 月31日
一、收入		6,991,673.62
1.利息收入		6,909,648.82
其中：存款利息收入	7.4.7.11	165,093.47
债券利息收入		3,125,077.17
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		3,619,478.18
其他利息收入		-

2.投资收益（损失以“-”填列）		82,024.80
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13	82,024.80
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-
股利收益	7.4.7.16	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	-
减：二、费用		463,155.98
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	163,128.23
2. 托管费	7.4.10.2.2	55,557.06
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	140,778.46
4. 交易费用	7.4.7.19	-
5. 利息支出		90,401.53
其中：卖出回购金融资产支出		90,401.53
6. 其他费用	7.4.7.20	13,290.70
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		6,528,517.64
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		6,528,517.64

注：本基金本报告期为2017年9月8日至2017年12月31日，本基金合同于2017年9月8日起正式生效，为报告期内合同生效的基金，本报告期的财务报表和报表附注均无同期对比数据。

7.3 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：2017年9月8日(基金合同生效日)至2017年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2017年9月8日(基金合同生效日)至2017年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	251,016,200.45	-	251,016,200.45
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	6,528,517.64	6,528,517.64
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）	3,776,024,680.82	-	3,776,024,680.82
其中：1. 基金申购款	5,278,803,364.21	-	5,278,803,364.21
2. 基金赎回款	-1,502,778,683.39	-	-1,502,778,683.39
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-6,528,517.64	-6,528,517.64
五、期末所有者权益（基金净值）	4,027,040,881.27	-	4,027,040,881.27

注：本基金本报告期为2017年9月8日至2017年12月31日，本基金合同于2017年9月8日起正式生效，为报告期内合同生效的基金，本报告期的财务报表和报表附注均无同期对比数据。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>成善栋</u>	<u>覃波</u>	<u>孙红辉</u>
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溢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许可[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(以下简称“交通银行”)。

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)。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部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。

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2017年12月31日的财务状况以及2017年9月8日(基金合同生效日)至2017年12月31日止期间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。本期财务报表的实际编制期间为2017年9月8日(基金合同生效日)至2017年12月31日止期间。

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

根据本基金的业务特点和风险管理要求，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贷款及应收款项，暂无金融资产划分为可供出售金融资产或持有至到期投资。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示，包括债券投资、资产支持证券投资等。

本基金持有的各类应收款项、买入返售金融资产等在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产分类为贷款及应收款项。

2) 金融负债的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求，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。本基金暂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

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。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；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。贷款及应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及金融负债按照公允价值进行后续计量，贷款及应收款项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。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，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。金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，才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根据对计量整体具有重大意义的最低层次的输入值确定公允价值计量层次。第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。

本基金的债券投资等金融资产，均以实际利率法计算的摊余成本估算公允价值。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，调整差额确认为“公允价值变动损益”，并按其他公允价值指标进行后续计量。如基金份额净值恢复至1元，恢复使用摊余成本估算公允价值。

如有确凿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商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愿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抵销

当本基金具有抵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偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵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，不予相互抵销。

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引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引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，以及因类别调整而引起的长信长金货币A、长信长金货币B基金份额之间的转换所产生的实收基金变动。

7.4.4.8 收入/(损失)的确认和计量

-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。

基金持有的附息债券、贴现券按摊余成本和实际利率计算确定利息收入。

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。

-投资收益

债券投资收益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与应收利息(若有)后的差额确认。

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享有同等分配权；

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，以每万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位按去尾原则处理(因去尾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，若当日已实现收益大于零时，为投资人记正收益；若当日已实现收益小于零时，为投资人记负收益；若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，若当日净收益大于零，则增加基金份额持有人基金份额；若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措施尽量避免基金净收益小于零，若当日基金净收益小于零时，缩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，享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，不享有基金的收益分配权益；

7) 法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

7.4.4.11 分部报告

根据本基金的内部组织机构、管理要求及内部报告制度，本基金整体为一个报告分部，且向管理层报告时采用的会计政策及计量基础与编制财务报表时的会计政策与计量基础一致。

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挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），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

本基金本报告期内无需说明的重大会计政策变更。

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[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、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股票、债券免征营业税和增值税；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其他增值税应税行为，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。

3) 对基金取得的债券利息收入，由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税，暂不缴纳企业所得税。

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 2017年12月31日
活期存款	4,589,749.56
定期存款	200,000,000.00
其中：存款期限1个月以内	200,000,000.00
存款期限1-3个月	-
其他存款	-
合计：	204,589,749.56

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017年12月31日				
	摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度	
债券	交易所市场	-	-	-	
	银行间市场	2,544,058,016.06	2,544,289,000.00	230,983.94	0.0057%
	合计	2,544,058,016.06	2,544,289,000.00	230,983.94	0.0057%

7.4.7.3 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 2017年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券-银行间	1,163,560,825.35	-
买入返售证券-交易所	304,000,000.00	-
合计	1,467,560,825.35	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017年12月31日
应收活期存款利息	1,069.50
应收定期存款利息	96,666.66
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	2,612.45
应收债券利息	4,348,178.08
应收买入返售证券利息	2,400,220.32
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	-
合计	6,848,747.01

7.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017年12月31日
其他应收款	10,999.16
待摊费用	-
合计	10,999.16

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017年12月31日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	24,624.94
合计	24,624.94

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年12月31日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提审计费	15,000.00
预提信息披露费	80,000.00
合计	95,000.00

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

长信长金货币A		
项目	本期 2017年9月8日(基金合同生效日)至2017年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	251,016,200.45	251,016,200.45

本期申购	5,278,803,362.21	5,278,803,362.21
本期赎回(以“-”号填列)	-1,502,778,681.39	-1,502,778,681.39
- 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	4,027,040,881.27	4,027,040,881.27

金额单位：人民币元

长信长金货币B		
项目	本期 2017年9月8日(基金合同生效日)至2017年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	-	-
本期申购	2.00	2.00
本期赎回(以“-”号填列)	-2.00	-2.00
- 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	-	-

注：1、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。

2、本基金自2017年8月30日至2017年9月1日止期间公开发售，共募集有效净认购资金251,016,200.00元。根据本基金法律文件的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入0.45元在本基金成立后，折算成0.45份基金份额，划入基金份额持有人账户。

7.4.7.10 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
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	6,528,517.64	-	6,528,517.64
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	-6,528,517.64	-	-6,528,517.64
本期末	-	-	-

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年9月8日(基金合同生效日)至2017年12月31日	
	活期存款利息收入	64,480.30

定期存款利息收入	96,666.66
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	3,946.51
其他	-
合计	165,093.47

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

注：本基金本报告期末持有股票。

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2017年9月8日(基金合同生效日)至2017年12月31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	82,024.80
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	82,024.80

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年9月8日(基金合同生效日)至2017年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	77,604,267.26
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	77,100,108.21
减：应收利息总额	422,134.25
买卖债券差价收入	82,024.80

7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期无债券投资赎回差价收入。

7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期无债券投资申购差价收入。

7.4.7.13.5 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。

7.4.7.14 贵金属投资收益**7.4.7.14.1 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。

7.4.7.15 衍生工具收益**7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注：本基金本报告期无衍生工具收益。

7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期无衍生工具收益。

7.4.7.16 股利收益

注：本基金本报告期无股利收益。

7.4.7.17 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。

7.4.7.18 其他收入

注：本基金本报告期无其他收入。

7.4.7.19 交易费用

注：本基金本报告期无交易费用。

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年9月8日(基金合同生效日)至2017年12月31日
审计费用	3,043.50
信息披露费	6,956.60
其他费用	3,290.60
合计	13,290.70

注：其他费用为银行汇划手续费等其他费用。

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**

注：截至资产负债表日，本基金未发生需要披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

注：根据财政部和国家税务总局于2016年12月21日和2017年6月30日联合颁布的《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[2016]140号）和《关于资管产品增值税有关问题的通知》（财税[2017]56号）的有关规定，自2018年1月1日起，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本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。

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、基金销售机构、基金注册登记机构
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
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
上海海欣集团股份有限公司	基金管理人的股东
武汉钢铁股份有限公司	基金管理人的股东
上海长江财富资产管理有限公司	基金管理人的子公司

注：经长信基金管理有限责任公司股东会审议通过，新增上海彤胜投资管理中心(有限合伙)和上海彤骏投资管理中心(有限合伙)为基金管理人的股东，基金管理人已履行相关程序办理完成股东变更事项的工商变更登记并向监管机构备案，并已于2017年2月8日就上述股东变更事项进行公告。

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

注：本基金本报告期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

注：本基金本报告期无通过关联方交易单元进行的债券交易。

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 2017年9月8日(基金合同生效日)至2017年12月31日	
	回购成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例

长江证券	936,600,000.00	100.00%
------	----------------	---------

7.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期内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

注：本基金本报告期内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 2017年9月8日(基金合同生效日)至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	163,128.23
其中：支付销售机构的客户维护费	739.35

注：1、本基金基金合同于2017年9月8日正式生效，无上年度可比期间数据。

2、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 $\times 0.15\%$ 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 $\times 0.15\% \div$ 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017年9月8日(基金合同生效日)至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	55,557.06

注：1、本基金基金合同于2017年9月8日正式生效，无上年度可比期间数据。

2、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 $\times 0.05\%$ 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 $\times 0.05\% \div$ 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 2017年9月8日(基金合同生效日)至2017年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	长信长金通货币A	长信长金通货币B	合计
长信基金	139,218.09	-	139,218.092
交通银行	-	-	-

长江证券	171.28	-	171.28
合计	139,389.37	-	139,389.37

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

注：本基金本报告期内无与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2017年9月8日(基金合同生效日)至2017年12月31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	-	-
期初持有的基金份额	-	-
期间申购/买入总份额	57,561,759.09	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	57,561,759.09	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.43%	-

注：1、本基金基金合同于2017年9月8日正式生效，无上年度可比期间数据。

2、基金管理人运用自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。

7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年9月8日(基金合同生效日)至2017年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
交通银行	4,589,749.56	64,480.30

注：1、本基金基金合同于2017年9月8日正式生效，无上年度可比期间数据。

2、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2017年12月31日相关余额为人民币2,727.27元。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金在本报告期末在承销期内购入过由关联方承销的证券。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

注：上述关联交易均根据正常的商业交易条件进行，并以一般交易价格为定价基础。本基金非基金中基金，不存在当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用。

7.4.11 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
4,312,053.36	214,070.40	2,002,393.88	6,528,517.64	-

7.4.12 期末（2017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**

注：本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而持有的流通受限证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末无因暂时停牌而流通受限的股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**7.4.12.1.1 银行间市场债券正回购**

截至本报告期末2017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为193,757,338.12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
170401	17农发01	2018年1月2日	99.98	314,000	31,393,720.00
111709483	17浦发银CD483	2018年1月2日	99.08	330,000	32,696,400.00
170204	17国开04	2018年1月2日	99.80	300,000	29,940,000.00
170203	17国开03	2018年1月2日	99.93	300,000	29,979,000.00
170311	17进出11	2018年1月2日	99.28	700,000	69,496,000.00
111709483	17浦发银CD483	2018年1月4日	99.08	51,000	5,053,080.00
合计				1,995,000	198,558,200.00

7.4.12.1.2 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。

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，量化投资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。

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

	2017年12月31日
A-1	0.00
A-1以下	0.00
未评级	2,541,057,510.04
合计	2,541,057,510.04

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

7.4.13.2.2 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 2017年12月31日
AAA	0.00
AAA以下	0.00
未评级	3,000,506.02
合计	3,000,506.02

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

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。

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》、《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。

本基金本报告期末无重大流动性风险。

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

利率风险是指金融市场利率波动导致证券市场及及利息收益的价格和收益率发生变动，从而直接影响基金的融资成本和经营业绩水平的风险。本基金的投资范围为银行存款、大额存单、短期债券、央行票据、债券回购等银行间市场固定收益品种。基金估值采用摊余成本法，按实际利率在其剩余期限内摊销，每日计提收益或损失，并通过“影子定价”对基金持有的估值对象进行重新评估，因此利率风险在一定程度上存在。本基金管理人量化投资部，通过定期对所持债券修正久期等参数的监控进行利率风险敏感性测试。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017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	204,589,749.56	-	-	-	-	204,589,749.56
结算备付金	2,727.27	-	-	-	-	2,727.27
交易性金融资产	2,474,603,299.35	69,454,716.71	-	-	-	2,544,058,016.06
买入返售金融资产	1,467,560,825.35	-	-	-	-	1,467,560,825.35
应收证券清算款	-	-	-	-	200,660.49	200,660.49
应收利息	-	-	-	-	6,848,747.01	6,848,747.01
应收申购款	-	-	-	-	69,000.00	69,000.00
其他资产	-	-	-	-	10,999.16	10,999.16
资产总计	4,146,756,601.53	69,454,716.71	-	-	7,129,406.66	4,223,340,724.90
负债						
卖出回购金融资产款	193,757,338.12	-	-	-	-	193,757,338.12
应付管理人报酬	-	-	-	-	153,014.20	153,014.20
应付托管费	-	-	-	-	51,004.74	51,004.74
应付销售服务费	-	-	-	-	127,121.21	127,121.21
应付交易费用	-	-	-	-	24,624.94	24,624.94
应付利息	-	-	-	-	89,346.54	89,346.54

应付利润	-	-	-	-	2,002,393.88	2,002,393.88
其他负债	-	-	-	-	95,000.00	95,000.00
负债总计	193,757,338.12	-	-	-	2,542,505.51	196,299,843.63
利率敏感度缺口	3,952,999,263.41	69,454,716.71	-	-	4,586,901.15	4,027,040,881.27

注：表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

7.4.13.1.1.2 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（2017年12月31日）
	市场利率下降27个基点	844,343.60
	市场利率上升27个基点	-844,343.60

7.4.13.1.2 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。

7.4.13.1.3 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。

7.4.13.1.1.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产-股票投资	-	-
交易性金融资产-基金投资	-	-
交易性金融资产-债券投资	2,544,289,000.00	63.18
交易性金融资产-贵金属投资	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-
其他	-	-
合计	2,544,289,000.00	63.18

7.4.13.1.1.2 其他价格风险的敏感性分析

注：本基金主要投资债券等固定收益品种，因此未进行其他价格风险的敏感性分析。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 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2017年12月31日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第二层次的余额为人民币 2,544,058,016.06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。

§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	固定收益投资	2,544,058,016.06	60.24
	其中:债券	2,544,058,016.06	60.24
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	1,467,560,825.35	34.75
	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	204,592,476.83	4.84
4	其他各项资产	7,129,406.66	0.17
5	合计	4,223,340,724.90	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	0.08	
	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	193,757,338.12	4.81
	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

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%。

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	32
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	47
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	0

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

注：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	71.96	4.81
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	8.88	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	22.14	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—120天	-	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)—397天(含)	1.72	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	104.70	4.81

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

注：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	摊余成本	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	49,549,890.03	1.23
2	央行票据	-	-
3	金融债券	197,369,947.23	4.90
	其中：政策性金融债	197,369,947.23	4.90
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单	2,297,138,178.80	57.04
8	其他	-	-
9	合计	2,544,058,016.06	63.17
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

8.6 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	111716274	17上海银行CD274	2,000,000	198,103,563.27	4.92
2	111716281	17上海银行CD281	1,500,000	149,791,190.90	3.72
3	111714016	17江苏银行CD016	1,500,000	149,655,247.47	3.72
4	111786473	17杭州银行CD203	1,500,000	149,653,044.78	3.72
5	111713079	17浙商银行CD079	1,200,000	119,693,490.58	2.97
6	111770366	17宁波银行CD233	1,200,000	118,854,596.30	2.95
7	111718267	17华夏银行CD267	1,000,000	99,646,761.10	2.47
8	111712280	17北京银行CD280	1,000,000	99,095,324.58	2.46
9	111720280	17广发银行CD280	1,000,000	99,060,310.35	2.46
10	111709483	17浦发银行CD483	1,000,000	99,045,557.70	2.46

8.7 “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	0.0055%
报告期内偏离度的最低值	-0.0120%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0026%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

注：本报告期内本货币市场基金负偏离度的绝对值未达到0.25%。

报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

注：本报告期内本货币市场基金正偏离度的绝对值未达到0.5%。

8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 本基金采用摊余成本法计价。

8.9.2 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，在报告编制日前一年内也没有受到公开谴责、处罚。

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	-
2	应收证券清算款	200,660.49
3	应收利息	6,848,747.01
4	应收申购款	69,000.00
5	其他应收款	10,999.16

6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	7,129,406.66

8.9.4 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。

§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
长信长金货币A	26,920	149,592.90	62,699,087.01	1.56%	3,964,341,794.26	98.44%
长信长金货币B	0	0.00	0.00	0.00%	0.00	0.00%
合计	26,920	149,592.90	62,699,087.01	1.56%	3,964,341,794.26	98.44%

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	个人	33,511,144.28	0.83%
2	个人	21,232,912.26	0.53%
3	个人	19,623,548.39	0.49%
4	个人	17,727,554.63	0.44%
5	个人	17,488,129.98	0.43%
6	个人	13,399,768.87	0.33%
7	个人	13,145,061.46	0.33%
8	个人	12,014,464.94	0.30%
9	个人	11,300,968.57	0.28%
10	个人	11,252,595.30	0.28%

注：期末前十名份额持有人不包括基金管理人运用固有资金投资的情况。

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	长信长金货币A	2,384,968.60	0.06%
	长信长金货币B	0.00	0.00%
	合计	2,384,968.60	0.06%

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	长信长金货币A	50~100

	长信长金货币B	0
	合计	50~100
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

	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	-	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	5,278,803,362.21	2.00
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	1,502,778,681.39	2.00
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	4,027,040,881.27	-

注：本基金基金合同于2017年9月8日正式生效，本报告期为2017年9月8日至2017年12月31日。

§11 重大事件揭示

11.1 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。

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

报告期内基金管理人未发生重大人事变动。

11.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

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 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

本基金非基金中基金，报告期内未持有基金。

11.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金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15,000.00元，该审计机构为本基金提供的审计服务的连续年限为1年。

11.7 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。

11.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.8.1 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	
		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	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
中银国际证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
爱建证券	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	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-

11.8.2 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	-	-	936,600,000.00	100%	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
中银国际证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
爱建证券	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-

注：1、本报告期内本基金租用爱建证券交易单元1个，安信证券交易单元1个，东方证券交易单元1个，平安证券交易单元1个，中银国际证券交易单元1个，中泰证券交易单元1个，天风证券交易单元1个，长江证券交易单元2个，光大交易单元1个，国金证券交易单元1个，兴业证券交易单元2个，华泰证券交易单元2个，广发证券交易单元1个，国泰君安证券交易单元1个，华创证券交易单元1个，申银万国证券交易单元1个，海通证券交易单元1个，东北证券交易单元1个，金元证券交易单元1个，方正证券交易单元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。

11.9 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。

11.10 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开放式证券投资基金参加蚂蚁（杭州）基金销售有限公司认购、申购（含定期定额投资申购）费率优惠的公告	上证报、中证报、证券时报、公司网站	2017年1月12日
2	长信基金管理有限责任公司关于变更旗下基金所持停牌股票估值方法的提示性公告	上证报、中证报、证券时报、公司网站	2017年1月13日
3	长信基金管理有限责任公司关于变更旗下基金所持停牌股票估值方法的提示性公告	上证报、中证报、证券时报、公司网站	2017年1月14日
4	长信基金管理有限责任公司关于变更旗下基金所持停牌股票估值方法的提示性公告	上证报、中证报、证券时报、公司网站	2017年1月17日
5	长信基金管理有限责任公司关于旗下基金所持证券调整估值价的公告	上证报、中证报、证券时报、公司网站	2017年1月17日
6	长信基金管理有限责任公司关于股东及股东出资比例变更的公告	上证报、中证报、证券时报、公司网站	2017年2月8日
7	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交通银行股份有限公司手机银行基金申购（含定期定额投资申购）费率优惠活动的公告	上证报、中证报、证券时报、公司网站	2017年2月23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宜信普泽投资顾问（北京）有限公司基金认购、申购（含定期定额投资申购）费率优惠活动的公告	上证报、中证报、证券时报、公司网站	2017年3月10日
9	长信基金管理有限责任公司关于增加上海华夏财富投资管理有限公司为旗下部分开放式基金代销机构的公告	上证报、中证报、证券时报、公司网站	2017年3月22日
10	长信基金管理有限责任公司关于变更旗下基金所持停牌股票估值方法的提示性公告	上证报、中证报、证券时报、公司网站	2017年3月22日
11	长信基金管理有限责任公司关于变更旗下基金所持停牌股票估值方法的提示性公告	上证报、中证报、证券时报、公司网站	2017年4月1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交通银行股份有限公司手机银行基金申购（含定期定额投资申购）费率优惠活动的公告	上证报、中证报、证券时报、公司网站	2017年4月22日
13	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式证券投资基金参加平安银行股份有限公司申购(含定期定额投资申购)费率优	上证报、中证报、公司网站	2017年5月4日

	惠活动的公告		
14	长信基金管理有限责任公司关于变更旗下基金所持停牌股票估值方法的提示性公告	上证报、中证报、证券时报、公司网站	2017年5月12日
15	长信基金管理有限责任公司关于变更旗下基金所持停牌股票估值方法的提示性公告	上证报、中证报、证券时报、公司网站	2017年5月24日
16	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交通银行股份有限公司手机银行基金申购（含定期定额投资申购）费率优惠活动的公告	上证报、中证报、证券时报、公司网站	2017年6月30日
17	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交通银行股份有限公司网上银行基金申购费率优惠活动的公告	上证报、中证报、证券时报、公司网站	2017年7月1日
18	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分基金参加蚂蚁（杭州）基金销售有限公司转换费率优惠活动的公告	上证报、中证报、证券时报、公司网站	2017年7月5日
19	长信基金管理有限责任公司关于设立武汉分公司的公告	上证报、中证报、证券时报、公司网站	2017年7月8日
20	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华泰证券股份有限公司基金申购（含定期定额投资申购）费率优惠活动的公告	上证报、中证报、证券时报、公司网站	2017年7月28日
21	长信基金管理有限责任公司关于变更旗下基金所持停牌股票估值方法的提示性公告	上证报、中证报、证券时报、公司网站	2017年8月18日
22	长信长金货币市场基金基金份额发售公告	上证报、证券时报、公司网站	2017年8月25日
23	长信长金货币市场基金基金合同及摘要（仅摘要见报）	上证报、证券时报、公司网站	2017年8月25日
24	长信长金货币市场基金托管协议	公司网站	2017年8月25日
25	长信长金货币市场基金招募说明书	上证报、证券时报、公司网站	2017年8月25日
26	长信基金管理有限责任公司关于变更旗下基金所持停牌股票估值方法的提示性公告	上证报、中证报、证券时报、公司网站	2017年9月8日
27	长信基金管理有限责任公司关于长信长金货币市场基金基金合同生效公告	上证报、证券时报、公司网站	2017年9月9日
28	长信基金管理有限责任公司关于长信长金货币市场基金开放日常申购、赎回、转换及定期定额投资等业务的公告	上证报、证券时报、公司网站	2017年9月9日
29	长信基金管理有限责任公司关于长信长金	上证报、证券时报、公司网站	2017年9月26日

	通货币市场基金暂停申购和转换转入业务的公告		
30	长信基金管理有限责任公司关于旗下长信长金货币市场基金增加长江证券股份有限公司为代销机构的公告	上证报、证券时报、 公司网站	2017年10月12日
31	长信基金管理有限责任公司关于增聘长信长金货币市场基金基金经理的公告	上证报、证券时报、 公司网站	2017年11月4日
32	长信基金管理有限责任公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	上证报、中证报、证 券时报、公司网站	2017年11月11日
33	长信基金管理有限责任公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	上证报、中证报、证 券时报、公司网站	2017年11月17日
34	长信基金管理有限责任公司关于长信长金货币市场基金费率优惠活动的公告	上证报、证券时报、 公司网站	2017年11月30日
35	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、赎回、转换转出及最低持有份额数额限制的公告	上证报、证券时报、 公司网站	2017年12月6日
36	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大额申购（含转换转入、定期定额投资）业务的公告	上证报、证券时报、 公司网站	2017年12月9日
37	长信基金管理有限责任公司关于旗下基金调整流通受限股票估值方法的公告	上证报、中证报、证 券时报、公司网站	2017年12月18日
38	长信基金管理有限责任公司关于改聘会计师事务所公告（德勤）	上证报、中证报、证 券时报、公司网站	2017年12月19日
39	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费率优惠活动的公告	上证报、证券时报、 公司网站	2017年12月19日
40	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	上证报、证券时报、 公司网站	2017年12月26日
41	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工商银行股份有限公司定期定额投资申购费率优惠活动的公告	上证报、中证报、证 券时报、公司网站	2017年12月28日
42	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农业银行股份有限公司基金及基金组合申购（含定期定额投资申购）费率优惠活动的公告	上证报、中证报、证 券时报、公司网站	2017年12月28日
43	长信基金管理有限责任公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	上证报、中证报、证 券时报、公司网站	2017年12月28日
44	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分	上证报、中证报、证 券时报、公司网站	2017年12月29日

	开放式基金参加交通银行股份有限公司手机银行基金申购（含定期定额投资申购）费率优惠活动的公告		
45	长信基金管理有限责任公司关于资管产品增值税事项的提示性公告	上证报、中证报、证券时报、公司网站	2017年12月30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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2017年10月25日至2017年12月6日	0.00	57,561,759.09	0.00	57,561,759.09	1.43%
	2	2017年9月13日至2017年12月6日	0.00	30,135,415.75	25,000,000.00	5,135,415.75	0.13%
	3	2017年9月13日至2017年9月17日	0.00	30,003,305.95	30,003,305.95	0.00	0.00%
	4	2017年9月13日至2017年9月21日	0.00	30,004,405.07	30,004,405.07	0.00	0.00%
个人	1	2017年12月7日	0.00	36,111,144.28	2,600,000.00	33,511,144.28	0.83%
产品特有风险							
<p>1、流动性风险 单一持有基金比例过高的投资者连续大量赎回，可能会影响基金投资的持续性和稳定性，增加变现成本，引发流动性风险。</p> <p>2、赎回申请延期办理的风险 单一持有基金比例过高的投资者大额赎回后可能触发本基金巨额赎回条件，导致同期中小投资者小额赎回面临部分延期办理的情况。</p>							

12.2 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。

§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。

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站：<http://www.cxfund.com.cn>。

长信基金管理有限责任公司

2018年3月31日