

长信长金通货币市场基金 2018 年半年度报告

2018 年 6 月 30 日

基金管理人：长信基金管理有限责任公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

送出日期：2018 年 8 月 29 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。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金基金合同规定，于 2018 年 8 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2018 年 1 月 1 日起至 2018 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	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.....	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	16
§5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	17
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	17
5.3 托管人对本半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 半年度财务会计报告（未经审计）	18
6.1 资产负债表.....	18
6.2 利润表.....	19
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	20

6.4 报表附注.....	21
§7 投资组合报告.....	40
7.1 期末基金资产组合情况.....	40
7.2 债券回购融资情况.....	40
7.3 基金投资组合平均剩余期限.....	40
7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明.....	41
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	41
7.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细.....	42
7.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离.....	42
7.8 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.....	42
7.9 投资组合报告附注.....	43
§8 基金份额持有人信息.....	44
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	44
8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况.....	44
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	44
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	45
§9 开放式基金份额变动.....	46
§10 重大事件揭示.....	47
10.1 基金份额持有人大会决议.....	47
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	47
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	47
10.4 基金投资策略的改变.....	47
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	47
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	47
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	47
10.8 偏离度绝对值超过 0.5% 的情况.....	49
10.9 其他重大事件.....	49
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	52
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况.....	52
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	52

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

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	长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	6,219,758,729.86 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	5,387,430,518.42 份	832,328,211.44 份

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		长信基金管理有限责任公司	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	周永刚	陆志俊
	联系电话	021-61009999	95559
	电子邮箱	zhouyg@xfund.com.cn	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		4007005566	95559
传真		021-61009800	021-62701216
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区银城中路 68 号 9 楼	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	彭纯
-------	-----	----

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报、上海证券报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.cxfund.com.cn
基金半年度报告备置地点	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
注册登记机构	长信基金管理有限责任公司	上海市浦东新区银城中路 68 号 9 楼

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

基金级别	长信长金货币 A	长信长金货币 B
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2018 年 1 月 1 日 - 2018 年 6 月 30 日)	报告期(2018 年 1 月 1 日 - 2018 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	174, 712, 152. 62	12, 614, 800. 68
本期利润	174, 712, 152. 62	12, 614, 800. 68
本期净值收益率	2. 1648%	2. 0918%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018 年 6 月 30 日)	
期末基金资产净值	5, 387, 430, 518. 42	832, 328, 211. 44
期末基金份额净值	1. 0000	1. 0000
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2018 年 6 月 30 日)	
累计净值收益率	3. 3770%	2. 0918%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益，由于货币市场基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润相等。

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
过去一个月	0. 3344%	0. 0006%	0. 1126%	0. 0000%	0. 2218%	0. 0006%
过去三个月	1. 0417%	0. 0010%	0. 3418%	0. 0000%	0. 6999%	0. 0010%
过去六个月	2. 1648%	0. 0011%	0. 6810%	0. 0000%	1. 4838%	0. 0011%

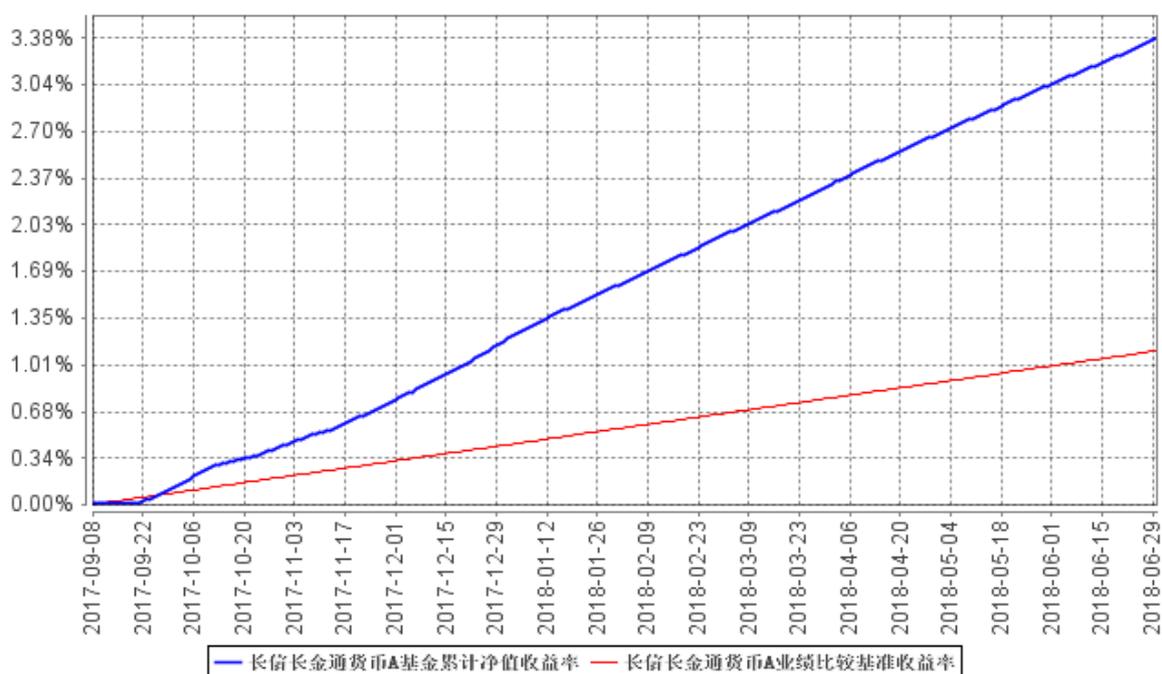
自基金合同生效起至今	3.3770%	0.0031%	1.1162%	0.0000%	2.2608%	0.0031%
------------	---------	---------	---------	---------	---------	---------

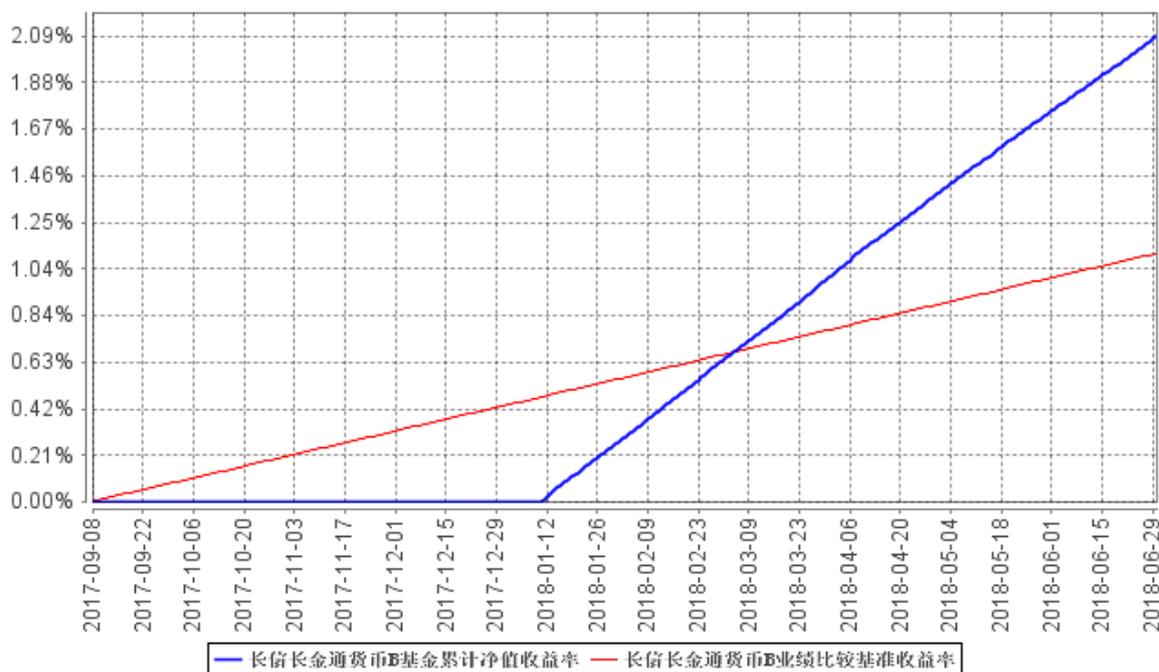
长信长金货币 B

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.3461%	0.0006%	0.1126%	0.0000%	0.2335%	0.0006%
过去三个月	1.0771%	0.0010%	0.3418%	0.0000%	0.7353%	0.0010%
过去六个月	2.0918%	0.0029%	0.6810%	0.0000%	1.4108%	0.0029%
自基金合同生效起至今	2.0918%	0.0060%	1.1162%	0.0000%	0.9756%	0.0060%

注：本基金收益分配按日结转份额。

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 2017-09-08，基金合同生效日至本报告期末，本基金运作时间未及一年。图示日期为 2017-09-08 至 2018-06-30。

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，报告期末已完成建仓但报告期末距建仓结束未及一年；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。

§ 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 2018 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 61 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、长信稳鑫三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长信先机两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、长信消费精选行业量化股票型证券投资基金、长信量化价值精选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、长信纯债半年债券型证券投资基金、长信稳健纯债债券型证券投资基金、长信长金货币市场基金、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、现金理财部总监	2017年9月8日	-	8年	管理学学士，毕业于上海交通大学，2010年7月加入长信基金管理有限责任公司，曾任基金事务部基金会计，交易管理部债券交易员、交易主管，债券交易部副总监、总监。现任现金理财部总监、长信利息收益开放式证券投资基金、长信纯债半年债券型证券投资基金、长信稳健纯债债券型证券投资基金、长信长金货币市场基金、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。
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	2017年11月4日	-	24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

	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、固定收益部总监			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。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，公司已实行公平交易制度，并建立公平交易制度体系，已建立投资决策体系，

加强交易执行环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时，公司已通过对投资交易行为的监控、分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，除完全按照有关指数的构成比例进行投资的组合外，其余各投资组合未发生参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情形，未发现异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2018 年上半年宏观经济运行总体平稳，上半年 GDP 同比增长 6.8%，增速与上年全年持平，但较上年同期下滑 0.1%，虽然经济数据显示经济增长有较强韧性，但其它各项宏观数据显示经济增长仍存在压力，内外需疲软，固定投资弱于预期，叠加中美贸易战，进出口数据将受到影响，市场对经济增长预期普遍悲观。上半年 CPI 累计同比上涨 2%，涨幅较上年同期和上年全年分别提高 0.6% 和 0.4%，PPI 累计同比上涨 3.9%，涨幅较上年同期和上年全年分别大幅下降 2.7% 和 2.4%。信贷方面，上半年社会融资规模增量为 9.1 万亿元，同比少增 2.03 万亿元，截至 6 月末，社会融资规模存量同比仅增长 9.8%，为历史新低。货币政策方面，进入一季度，在 CRA、定向降准等安排下，货币市场整体转为宽松，随后，在央行公开市场操作、财政存款释放、央行定向降准、超额释放 MLF 等作用下，上半年货币市场流动性较为宽裕。监管方面，随着资管新规细则进一步落地，细则对于公募基金投资非标、资管计划的约束等有所放松，显示边际宽松的信号。上半年中，利率债市场整体收益率下行，同业存单市场收益率整体上也呈现下行趋势，资金面整体宽松，各期限资金利率均有不同幅度的下行。在一季度中，本基金在保持流动性的基础上，适当拉长了久期，抓住了合适的时点配置同业存单和利率债，在二季度中，本基金维持中长久期，在合适的时点进行资产配置，维持了较高的组合整体收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2018 年 6 月 30 日，本报告期内长信长金货币 A 收益率为 2.1648%，长信长金货币 B 收益率为 2.0918%，同期业绩比较基准收益率为 0.6810%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，下半年国内外经济环境均将趋紧，宏观经济增速下行压力也将有所加大。货币政策在保持稳健中性的基调上将边际宽松，央行通过定向降准等措施定向支持实体经济融资，更加积极的财政政策将进一步发挥作用，流动性整体上将维持宽松格局。金融监管方面，“去杠杆，防风险”更多的变为“稳杠杆，防风险”，在结构性去杠杆的时候，会加强对国内外经济形势预判、综合运用多种货币政策工具，把握好结构性去杠杆的力度和节奏，促进经济平稳健康发展。债券市场在未来一段时间将呈现震荡格局，存单市场目前收益率已处于较低位置，未来在关键节点收益率可能有所上行。本基金将在保证货币基金安全性、流动性充足的基础上，时时关注货币政策和紧跟市场，通过积极把握阶段性资金面变化带来的投资机会，合理配置各类资产，保持投资业绩稳定提高。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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及适用性的情况及时修订估值程序；估值委员会成员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。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。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。审计本基金的会计师事务所认可公司基金估值政策和程序的适当性。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规和基金合同要求，本基金根据每日收益情况将当日收益全部分配，即当日收益分配比例为 100%。基金收益分配采用红利再投资分红方式，每日分配、按日支付，投资者可通过赎回基金份额方式获取现金红利收益。本报告期，本基金应分配利润 187,326,953.30 元，已分配利润 187,326,953.30 元。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

2018 年上半年度，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

2018 年上半年度，长信基金管理有限责任公司在长信长金货币市场基金投资运作、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：174,712,152.62 元，向 B 级份额持有人分配利润：12,614,800.68 元。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

2018 年上半年度，由长信基金管理有限责任公司编制并经托管人复核审查的有关长信长金货币市场基金的半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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：长信长金货币市场基金

报告截止日：2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.6.1	1,705,381,416.02	204,589,749.56
结算备付金		-	2,727.27
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.6.2	5,095,101,818.52	2,544,058,016.06
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		4,995,101,818.52	2,544,058,016.06
资产支持证券投资		100,000,000.00	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.6.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.6.4	411,691,897.54	1,467,560,825.35
应收证券清算款		-	200,660.49
应收利息	6.4.6.5	20,981,160.90	6,848,747.01
应收股利		-	-
应收申购款		646,500.00	69,000.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.6.6	-	10,999.16
资产总计		7,233,802,792.98	4,223,340,724.90
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.6.3	-	-
卖出回购金融资产款		1,009,857,065.04	193,757,338.12
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		987,137.64	153,014.20
应付托管费		329,045.85	51,004.74
应付销售服务费		878,379.11	127,121.21
应付交易费用	6.4.6.7	153,476.83	24,624.94

应交税费		5,984.50	-
应付利息		192,411.54	89,346.54
应付利润		1,507,588.47	2,002,393.88
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.6.8	132,974.14	95,000.00
负债合计		1,014,044,063.12	196,299,843.63
所有者权益：			
实收基金	6.4.6.9	6,219,758,729.86	4,027,040,881.27
未分配利润	6.4.6.10	-	-
所有者权益合计		6,219,758,729.86	4,027,040,881.27
负债和所有者权益总计		7,233,802,792.98	4,223,340,724.90

注：1、报告截止日 2018 年 6 月 30 日，长信长金货币 A 基金份额净值 1.0000 元，长信长金货币 B 基金份额净值 1.0000 元。基金份额总额 6,219,758,729.86 份，其中长信长金货币 A 份额 5,387,430,518.42 份，长信长金货币 B 份额 832,328,211.44 份。

2、本基金基金合同于 2017 年 9 月 8 日起正式生效，本报告期的财务报表和报表附注均无同期对比数据。

6.2 利润表

会计主体：长信长金货币市场基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期
		2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
一、收入		207,861,960.19
1.利息收入		203,764,047.16
其中：存款利息收入	6.4.6.11	55,790,856.11
债券利息收入		106,472,637.93
资产支持证券利息收入		178,108.75
买入返售金融资产收入		41,322,444.37
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		4,097,913.03
其中：股票投资收益	6.4.6.12	-
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.6.13	4,097,913.03
资产支持证券投资收	6.4.6.13.5	-
益		-
贵金属投资收益	6.4.6.14	-

衍生工具收益	6.4.6.15	-
股利收益	6.4.6.16	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.6.17	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.6.18	-
减：二、费用		20,535,006.89
1. 管理人报酬	6.4.9.2.1	6,504,911.66
2. 托管费	6.4.9.2.2	2,168,303.93
3. 销售服务费	6.4.9.2.3	6,102,273.63
4. 交易费用	6.4.6.19	327.04
5. 利息支出		5,592,384.81
其中：卖出回购金融资产支出		5,592,384.81
6. 税金及附加		641.20
7. 其他费用	6.4.6.20	166,164.62
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		187,326,953.30
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		187,326,953.30

注：本基金基金合同于 2017 年 9 月 8 日起正式生效，本报告期的财务报表和报表附注均无同期对比数据。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长信长金货币市场基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	4,027,040,881.27	-	4,027,040,881.27
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	187,326,953.30	187,326,953.30

三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	2,192,717,848.59	-	2,192,717,848.59
其中：1. 基金申购款	38,525,965,404.43	-	38,525,965,404.43
2. 基金赎回款	-36,333,247,555.84	-	-36,333,247,555.84
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）	-	-187,326,953.30	-187,326,953.30
五、期末所有者权益（基金净值）	6,219,758,729.86	-	6,219,758,729.86

注：本基金基金合同于 2017 年 9 月 8 日起正式生效，本报告期的财务报表和报表附注均无同期对比数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<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

6.4 报表附注

6.4.1 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《长信长金通

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

6.4.2 会计报表的编制基础

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

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2018 年 6 月 30 日的财务状况以及 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.4.2 差错更正的说明

本基金本报告期内无需说明的重大会计差错更正。

6.4.5 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

1) 证券投资基金(封闭式证券投资基金, 开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、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。

6.4.6 重要财务报表项目的说明

6.4.6.1 银行存款

单位: 人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
活期存款	5,381,416.02
定期存款	1,700,000,000.00
其中: 存款期限 1 个月以内	500,000,000.00
存款期限 1-3 个月	1,200,000,000.00
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计:	1,705,381,416.02

6.4.6.2 交易性金融资产

单位: 人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日				
	摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度	
债券	交易所市场	-	-	-	
	银行间市场	4,995,101,818.52	5,002,119,000.00	7,017,181.48	0.1128%
	合计	4,995,101,818.52	5,002,119,000.00	7,017,181.48	0.1128%
资产支持券	100,000,000.00	100,130,000.00	130,000.00	0.0021%	
合计	5,095,101,818.52	5,102,249,000.00	7,147,181.48	0.1149%	

6.4.6.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.6.4 买入返售金融资产**6.4.6.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券-交易所	-	-
买入返售证券-银行间	411,691,897.54	-
合计	411,691,897.54	-

6.4.6.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.6.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日
应收活期存款利息	10,018.39
应收定期存款利息	12,360,555.19
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	7,817,923.29
应收资产支持证券利息	183,452.05
应收买入返售证券利息	609,211.98
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	-
合计	20,981,160.90

6.4.6.6 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.6.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日
交易所市场应付交易费用	-

银行间市场应付交易费用	153,476.83
合计	153,476.83

6.4.6.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	132,974.14
预提审计费	-
预提信息披露费	-
合计	132,974.14

6.4.6.9 实收基金

金额单位：人民币元

长信长金货币 A		
项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	4,027,040,881.27	4,027,040,881.27
本期申购	37,027,807,613.71	37,027,807,613.71
本期赎回(以“-”号填列)	-35,667,417,976.56	-35,667,417,976.56
- 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	5,387,430,518.42	5,387,430,518.42

金额单位：人民币元

长信长金货币 B		
项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	-	-
本期申购	1,498,157,790.72	1,498,157,790.72
本期赎回(以“-”号填列)	-665,829,579.28	-665,829,579.28
- 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	832,328,211.44	832,328,211.44

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

6.4.6.10 未分配利润

单位：人民币元

长信长金货币 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	174,712,152.62	-	174,712,152.62
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	-174,712,152.62	-	-174,712,152.62
本期末	-	-	-

单位：人民币元

长信长金货币 B			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	12,614,800.68	-	12,614,800.68
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	-12,614,800.68	-	-12,614,800.68
本期末	-	-	-

6.4.6.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	95,533.13
定期存款利息收入	55,684,471.88
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	10,851.10
其他	-
合计	55,790,856.11

6.4.6.12 股票投资收益

注：本基金本报告期无股票投资收益。

6.4.6.13 债券投资收益**6.4.6.13.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	4,097,913.03
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	4,097,913.03

6.4.6.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	10,531,893,821.86
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	10,499,709,644.44
减：应收利息总额	28,086,264.39
买卖债券差价收入	4,097,913.03

6.4.6.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期无债券赎回差价收入。

6.4.6.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期无债券申购差价收入。

6.4.6.13.5 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

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

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

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

注：本基金本报告期无买卖权证差价收入。

6.4.6.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期无其他衍生工具投资收益。

6.4.6.16 股利收益

注：本基金本报告期无股利收益。

6.4.6.17 公允价值变动收益

注：本基金本报告期无公允价值变动收益。

6.4.6.18 其他收入

注：本基金本报告期无其他收入。

6.4.6.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
交易所市场交易费用	-
银行间市场交易费用	327.04
合计	327.04

6.4.6.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
审计费用	44,137.82
信息披露费	78,466.44
帐户维护费	25,500.00
其他费用	18,060.36
合计	166,164.62

注：其他费用为银行汇划手续费等其他费用。

6.4.7 或有事项、资产负债表日后事项的说明**6.4.7.1 或有事项**

注：截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.7.2 资产负债表日后事项

注：截至本财务报告批准报出日，本基金未发生需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.8 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方无变化。

6.4.8.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
长信基金管理有限责任公司（以下简称“长信基金”）	基金管理人、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
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

6.4.9 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.9.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.9.1.1 股票交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.9.1.2 债券交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.9.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	
	回购成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例
长江证券	1,047,700,000.00	100.00%

6.4.9.1.4 权证交易

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.9.1.5 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期无应付关联方交易单元的佣金。

6.4.9.2 关联方报酬

6.4.9.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	6,504,911.66
其中：支付销售机构的客户维护费	2,591,987.89

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×0.15%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×0.15%÷当年天数。

6.4.9.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	2,168,303.93

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×0.05%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.05%÷当年天数。

6.4.9.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	长信长金货币 A	长信长金货币 B	合计
长信基金	387,466.97	28,759.89	416,226.86
长江证券	18,895.73	-	18,895.73
合计	406,362.70	28,759.89	435,122.59

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。

6.4.9.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金在本报告期末与关联方通过银行间同业市场进行债券(含回购)交易。

6.4.9.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.9.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	
	长信长金货币 A	长信长金货币 B
基金合同生效日（2017年9月8日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	57,561,759.09	-
期间申购/买入总份额	1,261,017.89	-
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	58,822,776.98	-
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	0.95%	-

注：1、本基金基金合同于2017年9月8日起正式生效，无上年度可比期间数据。

2、期间申购总份额包括当期收益转份额部分。

3、基金管理人运用固有资金投资本基金费率按本基金招募说明书公布的费率执行。

6.4.9.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未持有本基金。

6.4.9.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方 名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
交通银行	5,381,416.02	6,230,949.80

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2018年6月30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（2017 年 12 月 31 日：同）。

6.4.9.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金在本报告期末未在承销期内购入由关联方承销的证券。

6.4.9.7 其他关联交易事项的说明

注：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。

6.4.10 利润分配情况

金额单位：人民币元

长信长金货币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
169,721,300.46	5,693,113.43	-702,261.27	174,712,152.62	-

长信长金货币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
12,334,880.60	72,464.22	207,455.86	12,614,800.68	-

6.4.11 期末（2018 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.11.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金本报告期末未因认购新发/增发证券而持有流通受限证券。

6.4.11.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.11.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.11.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2018 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 1,009,857,065.04 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
170211	17 国开 11	2018 年 7 月 2 日	100.13	400,000	40,052,000.00

170413	17 农发 13	2018 年 7 月 2 日	100.23	300,000	30,069,000.00
180201	18 国开 01	2018 年 7 月 2 日	100.30	1,300,000	130,390,000.00
189918	18 贴现国债 18	2018 年 7 月 2 日	99.81	200,000	19,962,000.00
111711523	17 平安银行 CD523	2018 年 7 月 2 日	99.31	2,105,000	209,047,550.00
111814037	18 江苏银行 CD037	2018 年 7 月 2 日	98.34	1,000,000	98,340,000.00
111814046	18 江苏银行 CD046	2018 年 7 月 2 日	98.18	53,000	5,203,540.00
111809147	18 浦发银行 CD147	2018 年 7 月 2 日	99.50	1,021,000	101,589,500.00
111782955	17 广州农村商业银行 CD147	2018 年 7 月 2 日	99.55	1,000,000	99,550,000.00
111786285	17 广州农村商业银行 CD179	2018 年 7 月 2 日	98.91	1,000,000	98,910,000.00
111891672	18 哈尔滨银行 CD003	2018 年 7 月 2 日	99.61	2,000,000	199,220,000.00
111891924	18 宁波银行 CD029	2018 年 7 月 2 日	98.56	286,000	28,188,160.00
合计				10,665,000	1,060,521,750.00

6.4.11.3.2 交易所市场债券正回购

注：本基金本报告期末未持有因交易所市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

6.4.12 金融工具风险及管理

6.4.12.1 风险管理政策和组织架构

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。

6.4.12.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的银行存款存放在本基金的托管行交通银行，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，本基金投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估并采用券款对付交割方式以控制相应的信用风险。

6.4.12.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
A-1	49,998,885.13	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	320,257,522.03	243,919,331.24
合计	370,256,407.16	243,919,331.24

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

6.4.12.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-

未评级	100,000,000.00	-
合计	100,000,000.00	-

6.4.12.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	4,574,840,931.97	2,297,138,178.80
合计	4,574,840,931.97	2,297,138,178.80

注：本基金持有同业存单的主体评级均为 AA+及以上评级。

6.4.12.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	50,004,479.39	3,000,506.02
合计	50,004,479.39	3,000,506.02

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

6.4.12.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金于本报告期末及上年末均未持有长期信用评级资产支持证券。

6.4.12.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金于本报告期末及上年末均未持有长期信用评级同业存单。

6.4.12.3 流动性风险

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

6.4.12.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《货币市场基金监督管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风

险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。

本基金坚持组合管理、分散投资的原则开展投资活动，所持证券均在证券交易所或银行间同业市场交易，本期末本基金未持有有重大流动性风险的投资品种。在严格遵守基金管理人流动性相关交易限制前提下，本基金基金管理人根据相关法规对本基金份额持有人集中度实施严格监控和管理，针对投资人集中度情况对本基金的投资组合实施动态调整。针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金管理人在基金合同中约定了巨额赎回条款，设计了非常情况下赎回资金的处理模式，控制因开放模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。同时，本基金在需要时刻通过卖出回购金融资产方式融入短期资金，以缓解流动性风险。

本基金本报告期末及上年度末均无重大流动性风险。

6.4.12.4 市场风险

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

6.4.12.4.1 利率风险

利率风险是指金融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。

6.4.12.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2018年6月30日	6个月以内	6个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产						
银行存款	1,705,381,416.02	-	-	-	-	1,705,381,416.02
交易性金融资产	4,964,906,190.93	130,195,627.59	-	-	-	5,095,101,818.52
买入返售金融资产	411,691,897.54	-	-	-	-	411,691,897.54
应收利息	-	-	-	-	20,981,160.90	20,981,160.90
应收申购款	-	-	-	-	646,500.00	646,500.00
其他资产	-	-	-	-	-	-
资产总计	7,081,979,504.49	130,195,627.59	-	-	-21,627,660.90	7,233,802,792.98

负债						
卖出回购金融资产款	1,009,857,065.04	-	-	-	-	1,009,857,065.04
应付管理人报酬	-	-	-	-	987,137.64	987,137.64
应付托管费	-	-	-	-	329,045.85	329,045.85
应付销售服务费	-	-	-	-	878,379.11	878,379.11
应付交易费用	-	-	-	-	153,476.83	153,476.83
应付利息	-	-	-	-	192,411.54	192,411.54
应交税费	-	-	-	-	5,984.50	5,984.50
应付利润	-	-	-	-	1,507,588.47	1,507,588.47
其他负债	-	-	-	-	132,974.14	132,974.14
负债总计	1,009,857,065.04	-	-	-	4,186,998.08	1,014,044,063.12
利率敏感度缺口	6,072,122,439.45	130,195,627.59	-	-	-17,440,662.82	6,219,758,729.86
上年度末 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。

6.4.12.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）

		本期末(2018 年 6 月 30 日)	上年度末 (2017 年 12 月 31 日)
	市场利率下降 27 个基点	3,120,645.24	844,343.60
	市场利率上升 27 个基点	-3,120,645.24	-844,343.60

6.4.12.4.2 外汇风险

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

6.4.12.4.3 其他价格风险

其他市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无重大其他市场价格风险。

6.4.12.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日		上年度末 2017 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	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	5,102,249,000.00	82.03	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	5,102,249,000.00	82.03	2,544,289,000.00	63.18

6.4.12.4.3.2 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，无重大其他价格风险，因此未进行其他价格风险的敏感性分析。

6.4.13 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 不以公允价值计量的金融工具

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

(b) 以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2018 年 6 月 30 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 5,095,101,818.52 元，无属于第一层次和第三层次的余额。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

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

(iii) 第三层次公允价值计量的金融工具

无。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	固定收益投资	5,095,101,818.52	70.43
	其中: 债券	4,995,101,818.52	69.05
	资产支持证券	100,000,000.00	1.38
2	买入返售金融资产	411,691,897.54	5.69
	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	1,705,381,416.02	23.58
4	其他各项资产	21,627,660.90	0.30
5	合计	7,233,802,792.98	100.00

7.2 债券回购融资情况

金额单位:人民币元

序号	项目	占基金资产净值的比例 (%)	
1	报告期内债券回购融资余额	4.12	
	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	1,009,857,065.04	16.24
	其中: 买断式回购融资	-	-

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

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的说明

注: 在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的 20%。

7.3 基金投资组合平均剩余期限

7.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	71
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	84

报告期内投资组合平均剩余期限最低值	30
-------------------	----

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。

7.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例 (%)	各期限负债占基金资产净值的比例 (%)
1	30 天以内	21.33	16.24
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	0.00	-
2	30 天(含)—60 天	28.68	0.00
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	0.00	-
3	60 天(含)—90 天	36.73	0.00
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	0.00	-
4	90 天(含)—120 天	11.90	0.00
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	0.00	-
5	120 天(含)—397 天(含)	17.31	0.00
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	0.00	-
合计		115.96	16.24

7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

注：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。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	摊余成本	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	109,909,203.44	1.77
2	央行票据	-	-
3	金融债券	260,352,797.98	4.19
	其中：政策性金融债	260,352,797.98	4.19
4	企业债券	-	-

5	企业短期融资券	49,998,885.13	0.80
6	中期票据	-	-
7	同业存单	4,574,840,931.97	73.55
8	其他	-	-
9	合计	4,995,101,818.52	80.31
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

7.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	111821083	18 渤海银行 CD083	4,500,000	445,761,101.88	7.17
2	111711523	17 平安银行 CD523	3,000,000	297,558,859.55	4.78
3	111821130	18 渤海银行 CD130	2,000,000	199,768,477.94	3.21
4	111803091	18 农业银行 CD091	2,000,000	198,995,194.70	3.20
5	111891672	18 哈尔滨银行 CD003	2,000,000	198,984,369.72	3.20
6	111809147	18 浦发银行 CD147	2,000,000	198,780,883.47	3.20
7	111894133	18 厦门国际银行 CD052	2,000,000	198,067,828.51	3.18
8	111815161	18 民生银行 CD161	2,000,000	197,370,122.07	3.17
9	111892636	18 南京银行 CD032	1,500,000	147,263,883.40	2.37
10	180201	18 国开 01	1,300,000	130,195,627.59	2.09

7.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在 0.25(含)-0.5%间的次数	-
报告期内偏离度的最高值	0.1257%
报告期内偏离度的最低值	-0.0063%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0327%

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不存在负偏离度的绝对值达到 0.25%的情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

注：本报告期内本货币市场基金不存在正偏离度的绝对值达到 0.5%的情况。

7.8 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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值	占基金资产净值
----	------	------	-------	------	---------

					比例(%)
1	1889112	18 上和 1A1(总价)	1,000,000.00	100,000,000.00	1.61

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未出现被监管部门立案调查或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.9.2 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	20,981,160.90
4	应收申购款	646,500.00
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	21,627,660.90

7.9.3 投资组合报告附注的其他文字描述部分

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
长信长金货币 A	54,163	99,466.99	412,193,199.71	7.65%	4,975,237,318.71	92.35%
长信长金货币 B	4	208,082,052.86	832,328,211.44	100.00%	0.00	0.00%
合计	54,167	114,825.61	1,244,521,411.15	20.01%	4,975,237,318.71	79.99%

8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

序号	持有人类别	持有份额(份)	占总份额比例
1	其他机构	275,064,171.35	4.42%
2	保险类机构	254,929,218.75	4.10%
3	券商类机构	151,220,681.92	2.43%
4	信托类机构	151,114,139.42	2.43%
5	保险类机构	101,962,508.21	1.64%
6	基金类机构	70,793,736.11	1.14%
7	保险类机构	50,975,886.08	0.82%
8	保险类机构	50,248,412.81	0.81%
9	个人	30,134,780.61	0.48%
10	券商类机构	30,000,000.00	0.48%

注：期末前十名份额持有人不包括基金管理人运用自有资金投资的情况。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员	长信长金货币 A	5,713,635.13	0.11%

持有本基金	长信长金货币 B	0.00	0.00%
	合计	5,713,635.13	0.09%

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	长信长金货币 A	>100
	长信长金货币 B	0
	合计	>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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

	长信长金货币 A	长信长金货币 B
基金合同生效日（2017 年 9 月 8 日）基金份额总额	251,016,200.45	-
本报告期期初基金份额总额	4,027,040,881.27	-
本报告期基金总申购份额	37,027,807,613.71	1,498,157,790.72
减：本报告期基金总赎回份额	35,667,417,976.56	665,829,579.28
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期末基金份额总额	5,387,430,518.42	832,328,211.44

§ 10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期基金管理人、托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，基金管理人、托管人及其高级管理人员没有受监管部门稽查或处罚的情形。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
长江证券	2	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-
开源证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比 例	成交金额	占当期债 券回购 成交总额 的比例	成交金额	占当期权 证 成交总额 的比例
长江证券	-	-	1,047,700,000.00	100.00%	-	-
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	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-

注：1、本期租用证券公司交易单元的变更情况

本报告期内本基金新增租用开源证券交易单元 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。

10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

注：本报告期本基金不存在偏离度绝对值超过0.5%的情况。

10.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	长信基金管理有限责任公司关于旗下基金 2017 年 12 月 31 日资产净值的公告	公司网站	2018 年 1 月 1 日

2	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	2018 年 1 月 4 日
3	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	2018 年 1 月 5 日
4	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	2018 年 1 月 16 日
5	长信长金货币市场基金 2017 年第 4 季度报告	上证报、证券时报、公司网站	2018 年 1 月 20 日
6	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	2018 年 2 月 1 日
7	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	2018 年 2 月 6 日
8	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	2018 年 2 月 7 日
9	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	2018 年 2 月 9 日
10	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	2018 年 2 月 10 日
11	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蚂蚁（杭州）基金销售有限公司为代销机构的公告	上证报、证券时报、公司网站	2018 年 2 月 27 日
12	长信基金管理有限责任公司关于旗下 53 只基金修改基金合同、托管协议的公告	上证报、中证报、证券时报、公司网站	2018 年 3 月 24 日
13	长信长金货币市场基金基金合同（流动性新规修改）	公司网站	2018 年 3 月 24 日
14	长信长金货币市场基金托管协议（流动性新规修改）	公司网站	2018 年 3 月 24 日
15	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	2018 年 3 月 29 日
16	长信基金管理有限责任公司关于增加北京蛋卷基金销售有限公司为旗下部分开放式证券投资基金代销机构并开通转换、定期定额投资业务及参加申购（含定投申购）费率优惠活动的公告	上证报、中证报、证券时报、公司网站	2018 年 3 月 29 日
17	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	2018 年 3 月 30 日
18	长信长金货币市场基金 2017 年年度报告及摘要（仅摘要见报）	上证报、证券时报、公司网站	2018 年 3 月 31 日
19	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	2018 年 4 月 18 日
20	长信长金货币市场基金 2018 年第 1 季度报告	上证报、证券时报、公司网站	2018 年 4 月 20 日
21	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	2018 年 4 月 21 日
22	长信长金货币市场基金更新的招募说明书（2018 年第【1】号）及摘要（仅摘要见报）	上证报、证券时报、公司网站	2018 年 4 月 21 日

23	长信基金管理有限责任公司关于长信长金通货币市场基金暂停申购和转换转入业务的公告	上证报、证券时报、 公司网站	2018 年 4 月 24 日
24	长信基金管理有限责任公司关于增加嘉实财富管理有限公司为旗下部分开放式证券投资基金代销机构并开通转换业务及参加申购费率优惠活动的公告	上证报、中证报、证 券时报、证券日报、 公司网站	2018 年 5 月 7 日
25	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	2018 年 5 月 8 日
26	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金参加中国银河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	2018 年 5 月 17 日
27	长信基金管理有限责任公司关于增加上海基煜基金销售有限公司为旗下部分开放式证券投资基金代销机构并开通转换、定期定额投资业务及参加申购（含定投申购）费率优惠活动的公告	上证报、中证报、证 券时报、证券日报、 公司网站	2018 年 5 月 28 日
28	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	2018 年 5 月 31 日
29	长信基金管理有限责任公司关于旗下基金投资资产支持证券的公告	上证报、中证报、证 券时报、公司网站	2018 年 6 月 7 日
30	长信基金管理有限责任公司关于长信长金通货币市场基金暂停申购和转换转入业务的公告	上证报、证券时报、 公司网站	2018 年 6 月 12 日
31	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	2018 年 6 月 15 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	2018 年 6 月 20 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	2018 年 6 月 22 日
34	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	2018 年 6 月 28 日
35	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）费率优惠活动及网上银行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	2018 年 6 月 30 日
36	长信基金管理有限责任公司关于旗下基金 2018 年 6 月 30 日资产净值的公告	公司网站	2018 年 6 月 30 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注：本基金本报告期内未有单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

注：本基金本报告期未发生影响投资者决策的其他重要信息。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

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

12.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

12.3 查阅方式

长信基金管理有限责任公司网站：<http://www.cxfund.com.cn>。

长信基金管理有限责任公司

2018年8月29日