

长信长金通货币市场基金 2021 年第 4 季度报告

2021 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

报告送出日期：2022 年 1 月 24 日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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 2022 年 1 月 20 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 10 月 1 日起至 2021 年 12 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

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	
报告期末基金份额总额	11,871,761,732.84 份	
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。	
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	
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	2,266,154,263.02 份	9,605,607,469.82 份

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2021年10月1日—2021年12月31日）	
	长信长金货币 A	长信长金货币 B
1. 本期已实现收益	11,656,992.22	54,484,849.99
2. 本期利润	11,656,992.22	54,484,849.99
3. 期末基金资产净值	2,266,154,263.02	9,605,607,469.82

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

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

3.2 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	净值收益率①	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	0.5799%	0.0026%	0.3456%	0.0000%	0.2343%	0.0026%
过去六个月	1.1579%	0.0029%	0.6924%	0.0000%	0.4655%	0.0029%
过去一年	2.3372%	0.0027%	1.3781%	0.0000%	0.9591%	0.0027%
过去三年	7.3552%	0.0023%	4.1955%	0.0000%	3.1597%	0.0023%
自基金合同生效起至今	12.8656%	0.0031%	6.0880%	0.0000%	6.7776%	0.0031%

长信长金货币 B

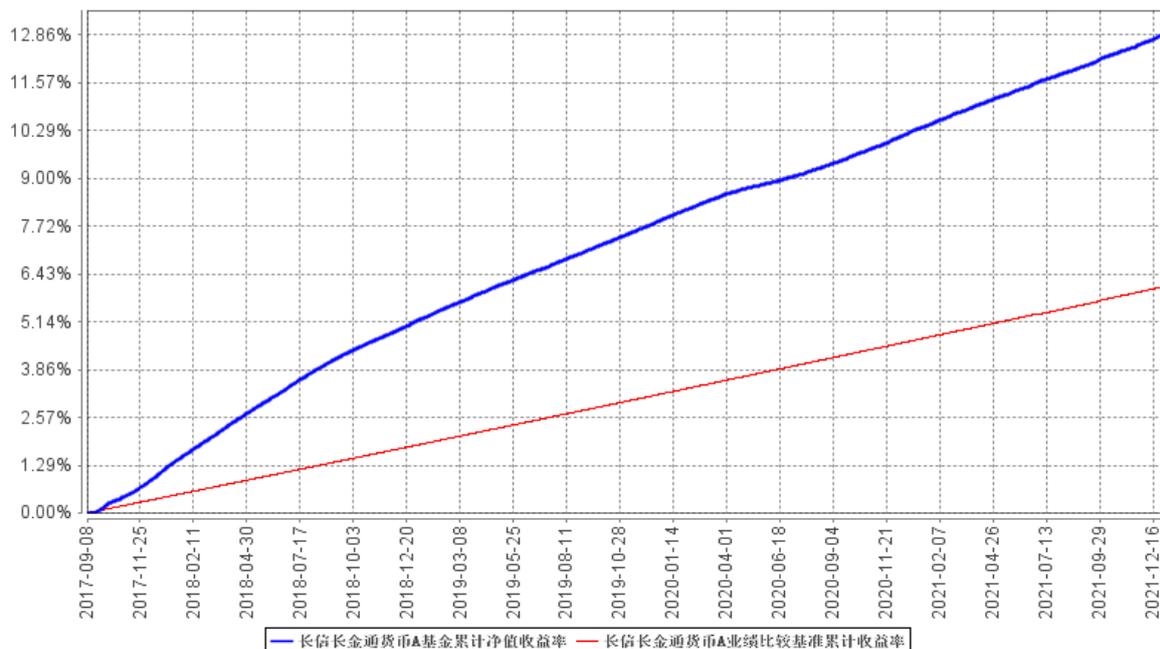
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	0.6152%	0.0026%	0.3456%	0.0000%	0.2696%	0.0026%
过去六个月	1.2292%	0.0029%	0.6924%	0.0000%	0.5368%	0.0029%
过去一年	2.4806%	0.0028%	1.3781%	0.0000%	1.1025%	0.0028%
过去三年	7.8074%	0.0023%	4.1955%	0.0000%	3.6119%	0.0023%

自基金合同生效起至今	12.0113%	0.0034%	6.0880%	0.0000%	5.9233%	0.0034%
------------	----------	---------	---------	---------	---------	---------

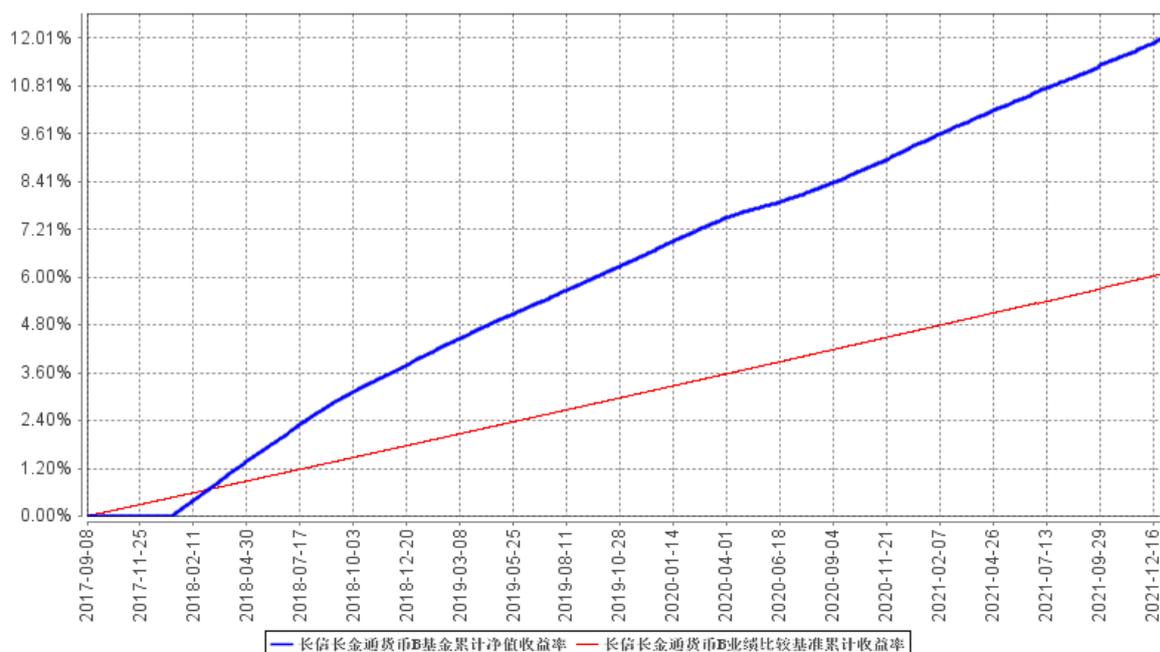
注：本基金收益分配按日结转份额。

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

长信长金货币A基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



长信长金货币B基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、图示日期为 2017 年 9 月 8 日至 2021 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。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陆莹	长信利息收益开放式证券投资基金、长信易进混合型证券投资基金、长信稳健纯债债券型证券投资基金、长信长金货币市场基金、长信稳鑫三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长信富瑞两年定期开放债券型证券投资基金、长信中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金、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	-	11 年	管理学学士，毕业于上海交通大学，2010 年 7 月加入长信基金管理有限责任公司，曾任基金事务部基金会计，交易管理部债券交易员、交易主管，债券交易部副总监、总监、长信稳裕三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长信纯债半年债券型证券投资基金和长信稳通三个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理。现任现金理财部总监、长信利息收益开放式证券投资基金、长信易进混合型证券投资基金、长信稳健纯债债券型证券投资基金、长信长金货币市场基金、长信稳鑫三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长信富瑞两年定期开放债券型证券投资基金、长信中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金、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	2019 年 11 月 29 日	-	7 年	上海财经大学经济学硕士，具有基金从业资格。曾任职于德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙），2014 年 6 月加入长信基金管理有限责任公司，历

	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和长信稳丰债券型证券投资基金的基金经理				任基金会计、债券交易员和基金经理助理，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、长信易进混合型证券投资基金、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和长信稳丰债券型证券投资基金的基金经理。
--	---	--	--	--	---

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

2、证券从业的含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

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

4.3 公平交易专项说明

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且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 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾 2021 年四季度，长端利率债十年国债收益率从 10 月初开始快速上行，至最高 3.04% 附近后逐步回落至年末的 2.8% 附近。10 月份债市收益率上行主要受全球通胀预期升温，国内市场降准预期落空等影响，但随着国内政策保供稳价、供给约束得到缓解，同时央行 OMO 公开市场操作常态化呵护资金面，债市做多情绪有所好转。而 10 月地产投资超季节性回落，经济下行压力加大，三季度货政报告传递稳货币信号，叠加南非新冠变异毒株助推，市场预期宽货币先于宽信用兑现，12 月全面降准落地，债市收益率震荡下行。整体来看，四季度十年国债累计下行 6BP 左右，1Y 期同业存单收益率持平于 9 月末水平。

在四季度中，我们在收益率高点及时配置了同业存款、同业存单和信用债等资产，维持了较高的组合整体收益。

展望 2022 年一季度，经济基本面对债市仍有支撑，通胀及海外加息对我国债市影响不大，宽信用的前提仍需稳货币，债市预计以震荡为主。

本基金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，保持投资业绩稳定提高，为持有人获取较高的投资回报。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2021 年 12 月 31 日，本报告期内长信长金通货币 A 净值收益率为 0.5799%，长信长金通货币 B 净值收益率为 0.6152%，同期业绩比较基准收益率为 0.3456%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	固定收益投资	5,069,099,753.52	35.98
	其中：债券	5,069,099,753.52	35.98
	资产支持证券	-	-

2	买入返售金融资产	3,546,129,009.20	25.17
	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	5,231,206,780.35	37.14
4	其他资产	240,487,807.85	1.71
5	合计	14,086,923,350.92	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	金额（元）	占基金资产净值的比例（%）
1	报告期内债券回购融资余额	-	5.48
	其中：买断式回购融资	-	-
2	报告期末债券回购融资余额	1,611,439,659.23	13.57
	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%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 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	59
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	68
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	45

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

注：报告期内投资组合平均剩余期限不存在超过 120 天的情况。

5.3.2 报告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	55.14	18.63
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)-60 天	11.34	-
	其中：剩余存续期超过 397	-	-

	天的浮动利率债		
3	60 天(含)-90 天	22.79	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)-120 天	14.32	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)-397 天(含)	14.73	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	118.32	18.63

5.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

注：报告期内投资组合平均剩余存续期不存在超过 240 天的情况。

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	249,523,802.85	2.10
2	央行票据	-	-
3	金融债券	611,782,840.96	5.15
	其中：政策性金融债	359,999,171.10	3.03
4	企业债券	161,624,234.62	1.36
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	151,428,180.07	1.28
7	同业存单	3,894,740,695.02	32.81
8	其他	-	-
9	合计	5,069,099,753.52	42.70
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

5.6 报告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

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	112103019	21 农业银行 CD019	5,000,000	497,854,126.86	4.19
2	112108064	21 中信银行 CD064	4,000,000	397,697,699.09	3.35
3	112111003	21 平安银行 CD003	3,000,000	299,988,039.17	2.53
4	112115326	21 民生银行 CD326	3,000,000	299,170,443.86	2.52
5	112115396	21 民生银行 CD396	3,000,000	298,118,063.80	2.51
6	1928005	19 浦发银行小微债 01	2,500,000	251,783,669.86	2.12
7	112110041	21 兴业银行 CD041	2,500,000	249,542,883.85	2.10
8	112115323	21 民生银行 CD323	2,500,000	249,326,436.55	2.10
9	112118275	21 华夏银行 CD275	2,000,000	199,425,552.52	1.68

10	112173315	21 宁波银行 CD319	2,000,000	199,421,051.00	1.68
----	-----------	---------------	-----------	----------------	------

5.7 “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	0
报告期内偏离度的最高值	0.0528%
报告期内偏离度的最低值	-0.0058%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0249%

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

注：报告期内不存在负偏离度的绝对值达到 0.25%的情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

注：报告期内不存在正偏离度的绝对值达到 0.5%的情况。

5.8 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 基金计价方法说明

本基金采用摊余成本法计价。

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

报告期内本基金投资的前十名证券中，发行主体宁波银行股份有限公司于 2021 年 6 月 10 日收到宁波银保监局行政处罚决定书（甬银保监罚决字〔2021〕36 号），根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条第（五）项、第四十八条第（一）项，经查，宁波银行股份有限公司存在代理销售保险不规范。综上，宁波银保监局给予公司罚款人民币 25 万元，并责令该行对相关直接责任人员给予纪律处分。

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 2021 年 7 月 30 日收到宁波银保监局行政处罚决定书（甬银保监罚决字〔2021〕57 号），根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条第、第四十八条，经查，宁波银行股份有限公司存在贷款被挪用于缴纳土地款或土地收储；开发贷款支用审核不严；房地产贷款放款和支用环节审核不严；贷款资金违规流入房市；房地产贷款资金回流借款人；票据业务开展不审慎。综上，宁波银保监局给予公司罚款人民币 275 万元，并责令该行对相关直接责任人员给予纪律处分。

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 2021 年 12 月 29 日收到宁波银保监局行政处罚决定书（甬银保监罚决字〔2021〕81 号），根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条第（五）项、第四十八条第（一）项，经查，宁波银行股份有限公司存在信用卡业务管理不到位情况。综上，宁波银保监局给予公司罚款人民币 30 万元，并责令该行对相关直接责任人给予纪律处分。

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 2021 年 7 月 13 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〔2021〕26 号），根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条和相关审慎经营规则，经查，民生银行股份有限公司存在一、监管发现问题屡查屡犯；二、检查发现问题整改不到位三、对责任人员的责任认定和问责不到位；四、内部制度管理不足，个别制度与监管要求冲突；五、配合现场检查不力；六、信息系统管控有效性不足；七、未向监管部门真实反映业务数据；八、未严格执行理财投资合作机构名单制管理；九、理财业务整改转型不符合监管要求；十、违规调整理财产品收益；十一、理财产品收益兑付不合规；十二、违规调节理财业务利润；十三、使用内部账户截留理财产品浮动管理费收入和承接风险资产；十四、理财产品间相互交易资产调节收益；十五、理财产品未实现账实相符、单独托管；十六、理财产品投资清单未反映真实情况，合格投资者认定不审慎；十七、开放式公募理财产品投资杠杆水平超标；十八、公募理财产品持有单只证券市值比例超标；十九、开放式公募理财产品流动性资产持有比例不达标；二十、理财产品信息登记不规范；二十一、理财产品信息披露不规范；二十二、理财产品托管不尽职；二十三、违规开展委托资产管理业务；二十四、同业业务未实行专营部门制；二十五、同业业务交易对手管理不健全；二十六、同业业务统一授信管理不到位；二十七、违规将转贴现票据转为投资资产，未真实反映票据规模；二十八、会计核算不规范；二十九、发行虚假结构性存款产品；三十、未对信贷资产收益权转让业务对应资产计提资本；三十一、委托贷款委托人资质审查不审慎。综上，中国银行保险监督管理委员会给予公司罚款 11450 万元。

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 2021 年 5 月 28 日收到中国银保监会云南监管局行政处罚信息公开表（云银保监罚决字〔2021〕34 号），根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条第（五）项，经查，平安银行股份有限公司利用来源于本行授信的固定资产贷款和黄金租赁融资的资金发放委托贷款，用于承接处置本行其他贷款风险；固定资产授信严重不审慎，贷款用途审查监控不到位，贷款资金挪用于借款人母公司归还股票质押融资；流动资金贷款用途审查监控不到位，贷款资金部分回流借款人用作银行承兑汇票质押存单；固定资产贷款用途审查监控不到位，贷款资金部分回流借款人或借款人关联公司用作

银行承兑汇票保证金、购买理财产品。综上，中国银保监会云南监管局决定对平安银行股份有限公司罚款人民币 210 万元。

报告期内本基金投资的前十名证券中，发行主体华夏银行股份有限公司于 2021 年 5 月 17 日收到中国银行保险监督管理委员会行政处罚决定书（银保监罚决字（2021）19 号），根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条、第四十七条和相关审慎经营规则，经查，华夏银行股份有限公司存在一、违规使用自营资金、理财资金购买本行转让的信贷资产；二、贷前审查及贷后管理不严；三、同业投资投前审查、投后管理不严；四、通过同业投资向企业提供融资用于收购银行股权；五、违规向土地储备项目提供融资；六、违规开立同业账户；七、通过投资底层资产为本行信贷资产的信托计划，少计风险资产；八、同业资金协助他行增加一般性存款，且部分期限超过监管要求；九、会计核算不准确，将同业存款计入一般性存款；十、部分理财产品相互交易、风险隔离不到位；十一、违规销售无真实投资、无测算依据、无充分信息披露的理财产品；十二、策略保本型理财产品销售文件未充分揭示风险；十三、出具的理财投资清单与事实不符或未全面反映真实风险；十四、理财资金违规投资权益类资产；十五、理财资金违规投资信托次级类高风险资产；十六、理财资金投资非标准化债权资产超过监管要求；十七、非标资产非洁净转让；十八、自营业务与代客业务未有效分离；十九、部分理财产品信息披露不合规，对接本行信贷资产；二十、部分理财资金违规投向土地储备项目；二十一、部分理财资金投向不符合政府购买服务规定的项目；二十二、部分理财投资投前调查不尽职；二十三、委托贷款资金来源不合规；二十四、与未备案理财投资合作机构开展业务；二十五、漏报错报监管标准化数据且逾期未改正；二十六、提供与事实不符的材料；二十七、部分理财资金未托管。综上，中国银行保险监督管理委员会给予公司罚款 9830 万元。

报告期内本基金投资的前十名证券中，发行主体中国农业银行股份有限公司于 2021 年 1 月 19 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（2021）1 号），根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条第五项和相关审慎经营规则，经查，中国农业银行股份有限公司存在发生重要信息系统突发事件未报告；制卡数据违规明文留存；生产网络、分行无线互联网络保护不当；数据安全较粗放，存在数据泄露风险；网络信息系统存在较多漏洞；互联网门户网站泄露敏感信息的情况。综上，中国银行保险监督管理委员会决定对农业银行罚款 420 万元。

报告期内本基金投资的前十名证券中，发行主体中国农业银行股份有限公司于 2021 年 12 月 8 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（2021）38 号），根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条和相关审慎经营规则以及《中华人民

共和国商业银行法》第七十三条规定，经查，中国农业银行股份有限公司存在 1、农业银行制定文件要求企业对公账户必须开通属于该行收费项目的动账短信通知服务，侵害客户自主选择权；2、农业银行河南分行和新疆分行转发并执行总行强制企业对公账户开通动账短信通知服务要求，违法行为情节较为严重。综上，中国银行保险监督管理委员会决定对农业银行罚款 150 万元。

报告期内本基金投资的前十名证券中，发行主体中信银行股份有限公司于 2021 年 3 月 17 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（2021）5 号），根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条和相关审慎经营规则，以及《商业银行法》第七十三条，经查，中信银行股份有限公司存在客户信息保护体制机制不健全；柜面非密查询客户账户明细缺乏规范、统一的业务操作流程与必要的内部控制措施，乱象整治自查不力；客户信息收集环节管理不规范；客户数据访问控制管理不符合业务“必须知道”和“最小授权”原则；查询客户账户明细事由不真实；未经客户本人授权查询并向第三方提供其个人银行账户交易信息；对客户敏感信息管理不善，致其流出至互联网；违规存储客户敏感信息；系统权限管理存在漏洞，重要岗位及外包机构管理存在缺陷的情况。综上，中国银行保险监督管理委员会给予公司罚款 450 万元。

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

报告期内本基金投资的前十名证券中其余四名的发行主体未出现被监管部门立案调查或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	23,647.72
2	应收证券清算款	200,328,802.27
3	应收利息	40,132,507.86
4	应收申购款	2,850.00
5	其他应收款	-
6	其他	-
7	合计	240,487,807.85

5.9.4 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。

§ 6 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
报告期期初基金份额总额	1,524,967,734.73	5,984,898,601.25
报告期期间基金总申购份额	4,754,299,257.63	11,746,915,775.16
报告期期间基金总赎回份额	4,013,112,729.34	8,126,206,906.59
报告期期末基金份额总额	2,266,154,263.02	9,605,607,469.82

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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。

8.2 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。

§ 9 备查文件目录

9.1 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。

9.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

9.3 查阅方式

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

长信基金管理有限责任公司

2022 年 1 月 24 日