

# 长信长金通货币市场基金

## 2022年第3季度报告

2022年9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  
报告送出日期：2022年10月26日

[和基金净值表现](#)

[式基金份额变动](#)  
[本基金交易明细](#)  
[的其他重要信息](#)

## § 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10月24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2022年7月1日起至2022年9月30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	7,511,833,676.22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	2,178,186,460.40份	5,333,647,215.82份

分级基金的份 额总额		
---------------	--	--

### § 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（2022年7月1日-2022年9月30日）	
	长信长金货币A	长信长金货币B
1. 本期已实现收益	8,909,100.20	29,873,260.96
2. 本期利润	8,909,100.20	29,873,260.96
3. 期末基金资产净值	2,178,186,460.40	5,333,647,215.82

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	0.4222%	0.0033%	0.3456%	0.0000%	0.0766%	0.0033%
过去六个月	0.8848%	0.0029%	0.6886%	0.0000%	0.1962%	0.0029%
过去一年	2.0197%	0.0029%	1.3781%	0.0000%	0.6416%	0.0029%
过去三年	6.7847%	0.0025%	4.1955%	0.0000%	2.5892%	0.0025%
过去五年	14.3437%	0.0031%	7.0872%	0.0000%	7.2565%	0.0031%
自基金合同生效起至今	14.4813%	0.0032%	7.1796%	0.0000%	7.3017%	0.0032%

长信长金货币B

阶段	净值收益	净值收益率标	业绩比较基准收	业绩比较基准收益率	①-②	②-
----	------	--------	---------	-----------	-----	----

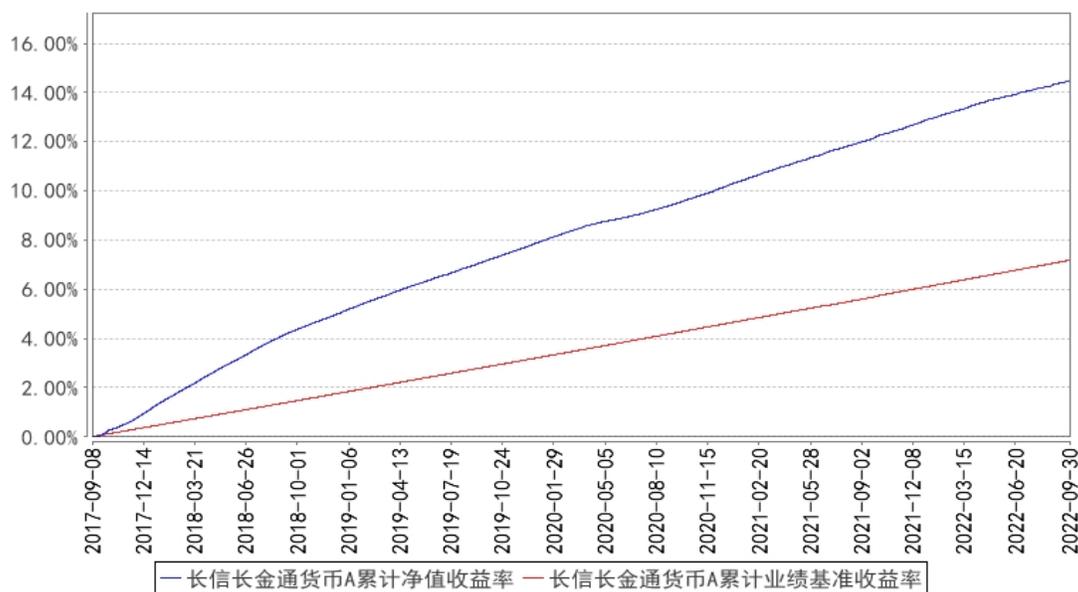
	率①	准差②	益率③	标准差④	③	④
过去三个月	0.4576%	0.0033%	0.3456%	0.0000%	0.1120%	0.0033%
过去六个月	0.9557%	0.0029%	0.6886%	0.0000%	0.2671%	0.0029%
过去一年	2.1625%	0.0029%	1.3781%	0.0000%	0.7844%	0.0029%
过去三年	7.2344%	0.0025%	4.1955%	0.0000%	3.0389%	0.0025%
过去五年	13.7338%	0.0033%	7.0872%	0.0000%	6.6466%	0.0033%
自基金合同生效起至今	13.7338%	0.0034%	7.1796%	0.0000%	6.5542%	0.0034%

注：本基金收益分配按日结转份额。

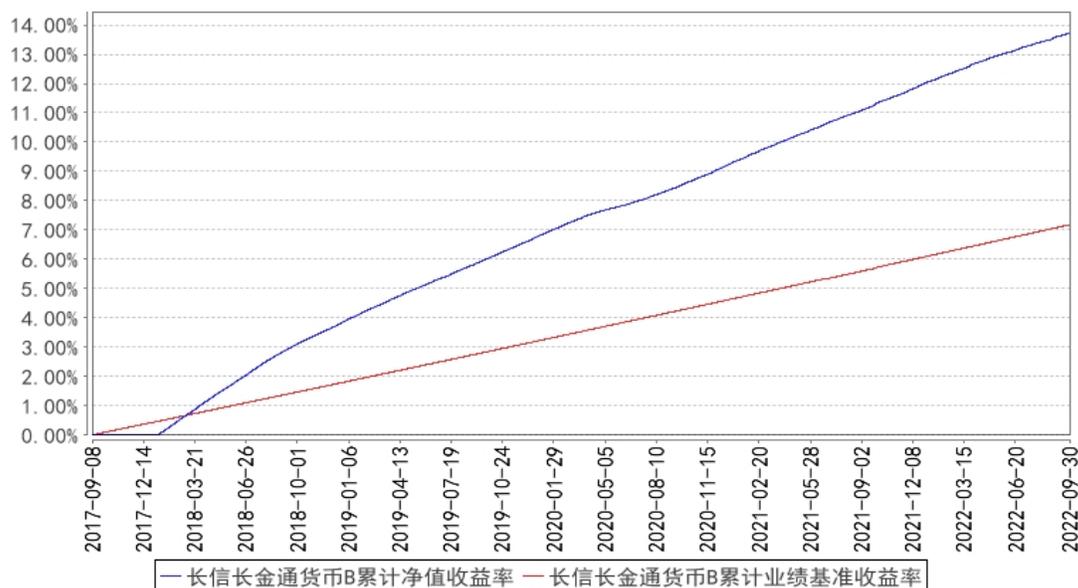
### 3.2.2

#### 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2022年9月30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	说明
		任职日期	
陈伟	长信利息收益开放式证券投资基金、长信长金货币市场基金、长信稳鑫三个月定	2011-10-21	1. 管理学学士，毕业于上海交通大学，具有基金从业资格，中国国籍。2010年7月加入长信基金管理有限责任公司，曾任基金事务部基金会计，交易管理部债券交易员、交易

期开放债券型发起式证券投资基金、长信浦瑞87个月定期开放债券型证券投资基金和长信稳惠债券型证券投资基金的基金经理、现金理财部总监	7 年 9 月 8 日	主管，债券交易部副总监、总监、长信稳裕三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长信纯债半年债券型证券投资基金、长信稳通三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长信易进混合型证券投资基金、长信稳健纯债债券型证券投资基金、长信富瑞两年定期开放债券型证券投资基金和长信中债1-3年政策性金融债指数证券投资基金的基金经理。现任现金理财部总监、长信利息收益开放式证券投资基金、长信长金货币市场基金、长信稳鑫三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长信浦瑞87个月定期开放债券型证券投资基金和长信稳惠债券型证券投资基金的基金经理。
长信长金货币市场基金、长信富瑞两年定期开放债券型证券投资基金、长信稳通三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长信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	2 0 1 9 年 1 1 月 2 9 日	上海财经大学经济学硕士，具有基金从业资格，中国国籍。曾任职于德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙），2014年6月加入长信基金管理有限责任公司，历任基金会计、债券交易员、基金经理助理和长信易进混合型证券投资基金的基金经理，现任长信长金货币市场基金、长信富瑞两年定期开放债券型证券投资基金、长信稳通三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长信稳势纯债债券型证券投资基金、长信30天滚动持有短债债券型证券投资基金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 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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 报告期内基金的投资策略和运作分析

回顾2022年，8月中旬MLF利率超预期下调10BP，政策稳增长意图明显，带动十年国债利率三季度触底2.6%附近。但随着9月中下旬开始，金融经济数据超预期、季末资金收敛、地产政策进一步放松等，长短端利率皆有所上行。整体来看，三季度十年国债累计下行6BP左右，1Y期同业存单收益率累计下行29BP左右。

在三季度中，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年四季度，海外持续加息压制了主要经济体的需求，叠加高基数，未来出口仍将承压放缓。未来资金面或缓慢收敛但不收紧，利率面临大幅调整的压力不大。关注稳增长政策加码以及经济基本面修复的节奏。

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

截至本报告期末，本季度长信长金货币A净值收益率为0.4222%，长信长金货币B净值收益率为0.4576%，同期业绩比较基准收益率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	4,737,692,075.72	60.45

	其中：债券	4,737,692,075.72	60.45
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	1,568,840,631.66	20.02
	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	1,531,017,393.20	19.53
4	其他资产	5,769.71	0.00
5	合计	7,837,555,870.29	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	-	7.71
	其中：买断式回购融资	-	-
2	报告期末债券回购融资余额	323,022,615.63	4.30
	其中：买断式回购融资	-	-

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

### 债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

## 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	46
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	59
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	34

### 报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

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	50.74	4.30
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天（含）—60天	12.11	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率	-	-

	债		
3	60天（含）—90天	34.34	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天（含）—120天	6.92	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天（含）—397天（含）	-	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		104.12	4.30

#### 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

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	182,029,476.91	2.42
2	央行票据	-	-
3	金融债券	222,453,299.24	2.96
	其中：政策性金融债	222,453,299.24	2.96
4	企业债券	1,033,082.99	0.01
5	企业短期融资券	674,386,536.32	8.98
6	中期票据	61,585,290.66	0.82
7	同业存单	3,596,204,389.60	47.87
8	其他	-	-
9	合计	4,737,692,075.72	63.07
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名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	112221161	22渤海银行CD161	5,000,000	499,143,949.57	6.64
2	112117207	21光大银行CD207	3,500,000	349,114,309.64	4.65
3	112219126	22恒丰银行CD126	3,000,000	299,662,697.07	3.99
4	112284001	22宁波银行CD2	3,000,000	299,622,794.07	3.99

		04			
5	112117210	21光大银行CD210	3,000,000	299,229,009.67	3.98
6	112108187	21中信银行CD187	3,000,000	298,761,860.91	3.98
7	112120300	21广发银行CD300	2,500,000	249,060,749.97	3.32
8	012281929	22国新控股SCP005	2,000,000	201,155,994.11	2.68
9	112283460	22华融湘江银行CD153	2,000,000	199,816,091.84	2.66
10	112109298	21浦发银行CD298	2,000,000	199,443,435.68	2.66

## 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	0.0874%
报告期内偏离度的最低值	0.0074%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0608%

### 报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

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

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名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 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是否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

报告期内本基金投资的前十名证券中，发行主体渤海银行股份有限公司于2022年3月21日收到中国银行保险监督管理委员会行政处罚决定书（银保监罚决字（2022）28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，渤海银行监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在以下违法违规行为：一、漏报贸易融

资业务EAST数据；二、漏报贷款核销业务EAST数据；三、漏报抵押物价值EAST数据；四、未报送信贷资产转让业务EAST数据；五、漏报债券投资业务EAST数据；六、公募基金投资业务EAST数据存在偏差；七、EAST系统理财产品底层持仓余额数据存在偏差；八、EAST系统理财产品非标投向行业余额数据存在偏差；九、EAST系统分户账与总账比对不一致；十、漏报总账或分户账EAST数据；十一、漏报对公活期存款账户明细EAST数据；十二、EAST系统《表外授信业务》表错报；十三、EAST系统《对公信贷业务借据》表错报；十四、EAST系统《个人信贷业务借据》表错报；十五、未报送本行理财产品间相互交易记录。综上，中国银行保险监督管理委员会决定对渤海银行股份有限公司罚款360万元。

报告期内本基金投资的前十名证券中,发行主体中国光大银行股份有限公司于2022年3月21日收到中国银行保险监督管理委员会行政处罚决定书（银保监罚决字〔2022〕18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，光大银行监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在以下违法违规行为：一、逾期90天以上贷款余额EAST数据存在偏差；二、漏报贷款核销业务EAST数据；三、漏报抵押物价值EAST数据；四、漏报信贷资产转让业务EAST数据；五、漏报权益类投资业务EAST数据；六、未报送其他担保类业务EAST数据；七、漏报委托贷款业务EAST数据；八、EAST系统理财产品销售端与产品端数据核对不一致；九、EAST系统理财产品底层持仓余额数据存在偏差；十、EAST系统理财产品非标投向行业余额数据存在偏差；十一、漏报分户账EAST数据；十二、漏报对公活期存款账户明细EAST数据；十三、未在开户当月向EAST系统报送账户信息；十四、EAST系统《个人活期存款分户账明细记录》表错报；十五、EAST系统《表外授信业务》表错报；十六、EAST系统《对公信贷业务借据》表错报；十七、EAST系统《个人信贷业务借据》表错报；十八、2018年行政处罚问题依然存在。综上，中国银行保险监督管理委员会决定对光大银行罚款490万元。

报告期内本基金投资的前十名证券中,发行主体中国光大银行股份有限公司于2022年5月24日收到中国银行保险监督管理委员会行政处罚信息公开表（银保监罚决字〔2022〕31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，光大银行理财业务存在以下违法违规行为：一、老产品规模在部分时点出现反弹；二、托管机构未及时发现理财产品集中度超标；三、托管业务违反资产独立性要求，操作管理不到位。综上，中国银行保险监督管理委员会决定对光大银行罚款400万元。

报告期内本基金投资的前十名证券中,发行主体恒丰银行股份有限公司于2022年3月21日收到中国银行保险监督管理委员会行政处罚决定书（银保监罚决字〔2022〕26号），根据《中华人民

《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，恒丰银行监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在以下违法违规行为：一、漏报逾期90天以上贷款余额EAST数据；二、漏报贸易融资业务 EAST 数据；三、漏报贷款核销业务 EAST 数据；四、错报债券投资业务 EAST 数据；五、未报送权益类投资业务 EAST 数据；六、未报送私募基金投资业务 EAST 数据；七、未报送投资资产管理产品业务 EAST 数据；八、漏报跟单信用证业务 EAST 数据；九、EAST 系统理财产品销售端与产品端数据核对不一致；十、EAST 系统理财产品底层持仓余额数据存在偏差；十一、EAST 系统理财产品非标投向行业余额数据存在偏差；十二、EAST 系统分户账与总账比对不一致；十三、漏报对公活期存款账户明细 EAST 数据；十四、未在开户当月向 EAST 系统报送账户信息；十五、EAST 系统《表外授信业务》错报；十六、EAST 系统《对公信贷业务借据》表错报；十七、EAST 系统《个人活期存款分户账明细记录》表错报；十八、EAST 系统《个人信贷业务借据》表错报。综上，中国银行保险监督管理委员会决定对恒丰银行股份有限公司罚款480万元。

报告期内本基金投资的前十名证券中，发行主体宁波银行股份有限公司于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，发行主体宁波银行股份有限公司于2022年4月11日收到宁波银保监局行政处罚决定书（甬银保监罚决字〔2022〕28号），根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条，经查，宁波银行股份有限公司存在信贷资金违规流入房地产领域、违规向土地储备项目提供融资、非标投资业务资金支用审核不到位、房地产贷款授信管理不到位情况。综上，宁波银保监局给予公司罚款人民币220万元。

报告期内本基金投资的前十名证券中，发行主体宁波银行股份有限公司于2022年4月11日收到宁波银保监局行政处罚决定书（甬银保监罚决字〔2022〕30号），根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条第（五）项，经查，宁波银行股份有限公司存在代理保险销售不规范情况。综上，宁波银保监局给予公司罚款人民币30万元。

报告期内本基金投资的前十名证券中，发行主体宁波银行股份有限公司于2022年4月21日收到宁波银保监局行政处罚决定书（甬银保监罚决字（2022）35号），根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条，经查，宁波银行股份有限公司存在薪酬管理不到位、关联交易管理不规范、绿色信贷政策执行不到位、授信管理不审慎、资金用途管控不严、贷款风险分类不准确、票据业务管控不严、非现场统计数据差错情况。综上，宁波银保监局给予公司罚款人民币270万元。

报告期内本基金投资的前十名证券中，发行主体宁波银行股份有限公司于2022年5月27日收到宁波银保监局行政处罚决定书（甬银保监罚决字（2022）44号），根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条，经查，宁波银行股份有限公司存在非标投资业务管理不审慎、理财业务管理不规范、主承销债券管控不到位、违规办理衍生产品交易业务、信用证议付资金用于购买本行理财、违规办理委托贷款业务、非银融资业务开展不规范、内控管理不到位、数据治理存在欠缺情况。综上，宁波银保监局给予公司罚款人民币290万元。

报告期内本基金投资的前十名证券中，发行主体宁波银行股份有限公司于2022年9月8日收到宁波银保监局行政处罚决定书（甬银保监罚决字（2022）60号），根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条，经查，宁波银行股份有限公司柜面业务内控管理不到位。综上，宁波银保监局给予公司罚款人民币25万元。

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2022年3月21日收到中国银行保险监督管理委员会行政处罚信息公开表（银保监罚决字（2022）17号），根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条和相关审慎经营规则，经查，中信银行监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在以下违法违规行为：一、漏报抵押物价值EAST数据；二、未报送权益类投资业务EAST数据；三、漏报跟单信用证业务EAST数据；四、漏报其他担保类业务EAST数据；五、EAST系统理财产品底层持仓余额数据存在偏差；六、EAST系统《关联关系》表漏报；七、面向非机构客户发行的理财产品投资不良资产；八、2018年行政处罚问题依然存在。综上，中国银行保险监督管理委员会决定对中信银行股份有限公司罚款人民币290万元。

报告期内本基金投资的前十名证券中，发行主体广发银行股份有限公司于2022年3月21日收到中国银行保险监督管理委员会行政处罚信息公开表（银保监罚决字（2022）23号），根据《中

《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，广发银行监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在以下违法违规行为：一、逾期90天以上贷款余额EAST数据存在偏差；二、漏报贷款核销业务EAST数据；三、漏报信贷资产转让业务EAST数据；四、债券投资业务EAST数据存在偏差；五、漏报公募基金投资业务EAST数据；六、投资资产管理产品业务EAST数据存在偏差；七、EAST系统理财产品非标投向行业余额数据存在偏差；八、EAST系统分户账与总账比对不一致；九、漏报分户账EAST数据；十、漏报对公活期存款账户明细EAST数据；十一、未在开户当月向EAST系统报送账户信息；十二、EAST系统《表外授信业务》表错报；十三、EAST系统《对公信贷业务借据》表错报；十四、EAST系统《关联关系》表漏报；十五、EAST系统《对公信贷分户账》表漏报；十六、EAST系统《总账会计全科目表》漏报币种信息。综上，中国银行保险监督管理委员会决定对广发银行股份有限公司罚款人民币420万元。

报告期内本基金投资的前十名证券中，发行主体上海浦东发展银行股份有限公司于2022年3月21日收到中国银行保险监督管理委员会行政处罚决定书（银保监罚决字〔2022〕25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，浦发银行监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在以下违法违规行为：一、漏报逾期90天以上贷款余额EAST数据；二、漏报贸易融资业务EAST数据；三、漏报信贷资产转让业务EAST数据；四、漏报债券投资业务EAST数据；五、未报送权益类投资业务EAST数据；六、漏报公募基金投资业务EAST数据；七、漏报投资资产管理产品业务EAST数据；八、错报跟单信用证业务EAST数据；九、错报保函业务EAST数据；十、错报贷款承诺业务EAST数据；十一、EAST系统理财产品底层持仓余额数据存在偏差；十二、EAST系统理财产品非标投向行业余额数据存在偏差；十三、漏报对公活期存款账户明细EAST数据；十四、EAST系统《表外授信业务》表错报；十五、EAST系统《对公信贷业务借据》表错报；十六、EAST系统《对公信贷分户账》表漏报。综上，中国银行保险监督管理委员会决定对上海浦东发展银行股份有限公司罚款420万元。

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	2,609.71
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	-
4	应收申购款	3,160.00
5	其他应收款	-
6	其他	-
7	合计	5,769.71

### 5.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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	1,906,434,170.64	5,329,496,608.84
报告期期间基金总申购份额	2,740,049,832.04	4,740,534,347.84
报告期期间基金总赎回份额	2,468,297,542.28	4,736,383,740.86
报告期末基金份额总额	2,178,186,460.40	5,333,647,215.82

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

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

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

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10月26日