

长信长金通货币市场基金 2023 年第 3 季度报告

2023 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：2023 年 10 月 25 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 2023 年 10 月 23 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 2023 年 7 月 1 日起至 2023 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	10,644,654,558.91 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	长信长金货币 C	长信长金 货币 D
下属分级基金的交易代码	005134	005135	018346	018349
报告期末下属分级基金的份额总额	712,660,559.16 份	9,930,930,093.87 份	1,052,720.01 份	11,185.87 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（2023 年 7 月 1 日-2023 年 9 月 30 日）			
	长信长金货币 A	长信长金货币 B	长信长金货币 C	长信长金货币 D
1. 本期已实现收益	3,580,451.67	55,216,624.18	3,409.00	52.87
2. 本期利润	3,580,451.67	55,216,624.18	3,409.00	52.87
3. 期末基金资产净值	712,660,559.16	9,930,930,093.87	1,052,720.01	11,185.87

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	0.4933%	0.0033%	0.3456%	0.0000%	0.1477%	0.0033%
过去六个月	1.0333%	0.0029%	0.6886%	0.0000%	0.3447%	0.0029%
过去一年	2.0117%	0.0024%	1.3781%	0.0000%	0.6336%	0.0024%
过去三年	6.5697%	0.0027%	4.1916%	0.0000%	2.3781%	0.0027%
过去五年	11.9083%	0.0025%	7.0872%	0.0000%	4.8211%	0.0025%
自基金合同 生效起至今	16.7843%	0.0031%	8.6567%	0.0000%	8.1276%	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	0.5288%	0.0033%	0.3456%	0.0000%	0.1832%	0.0033%
过去六个月	1.1043%	0.0029%	0.6886%	0.0000%	0.4157%	0.0029%
过去一年	2.1555%	0.0024%	1.3781%	0.0000%	0.7774%	0.0024%
过去三年	7.0191%	0.0027%	4.1916%	0.0000%	2.8275%	0.0027%
过去五年	12.6960%	0.0025%	7.0872%	0.0000%	5.6088%	0.0025%
自基金合同 生效起至今	16.1854%	0.0033%	8.6567%	0.0000%	7.5287%	0.0033%

长信长金货币 C

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	0.4679%	0.0032%	0.3456%	0.0000%	0.1223%	0.0032%
自份额增加 日起至今	0.7587%	0.0033%	0.5377%	0.0000%	0.2210%	0.0033%

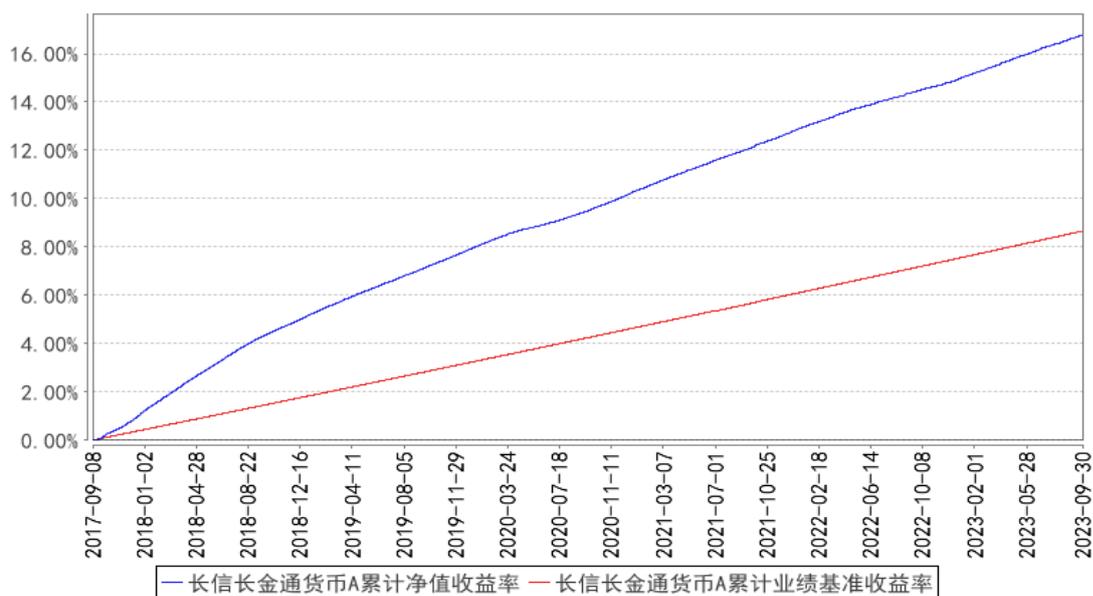
长信长金货币 D

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	0.4748%	0.0032%	0.3456%	0.0000%	0.1292%	0.0032%
自份额增加 日起至今	0.7691%	0.0033%	0.5377%	0.0000%	0.2314%	0.0033%

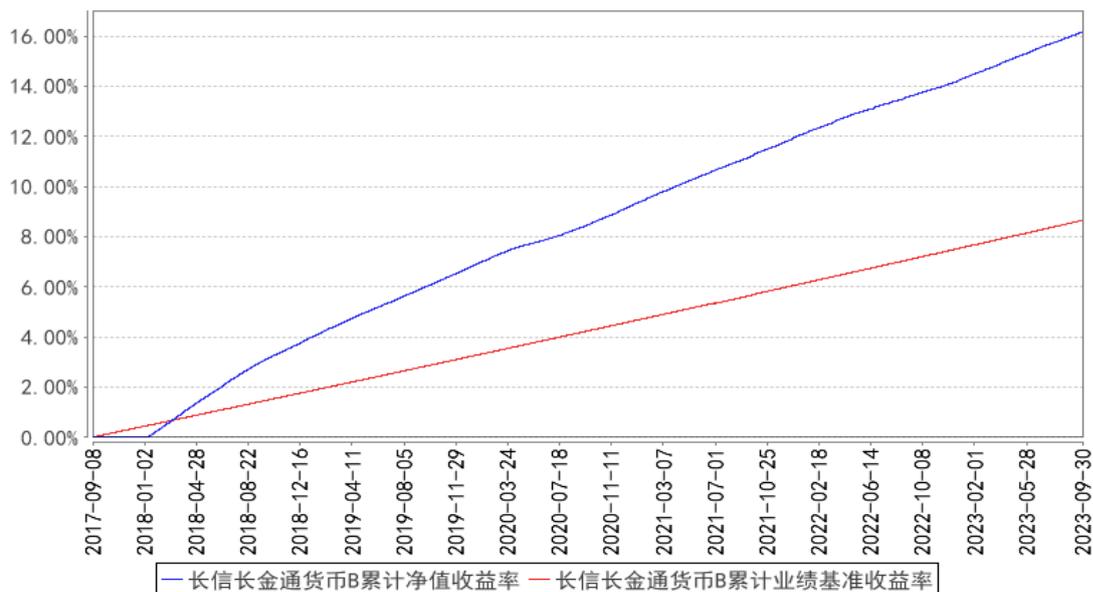
注：本基金收益分配按日结转份额。

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

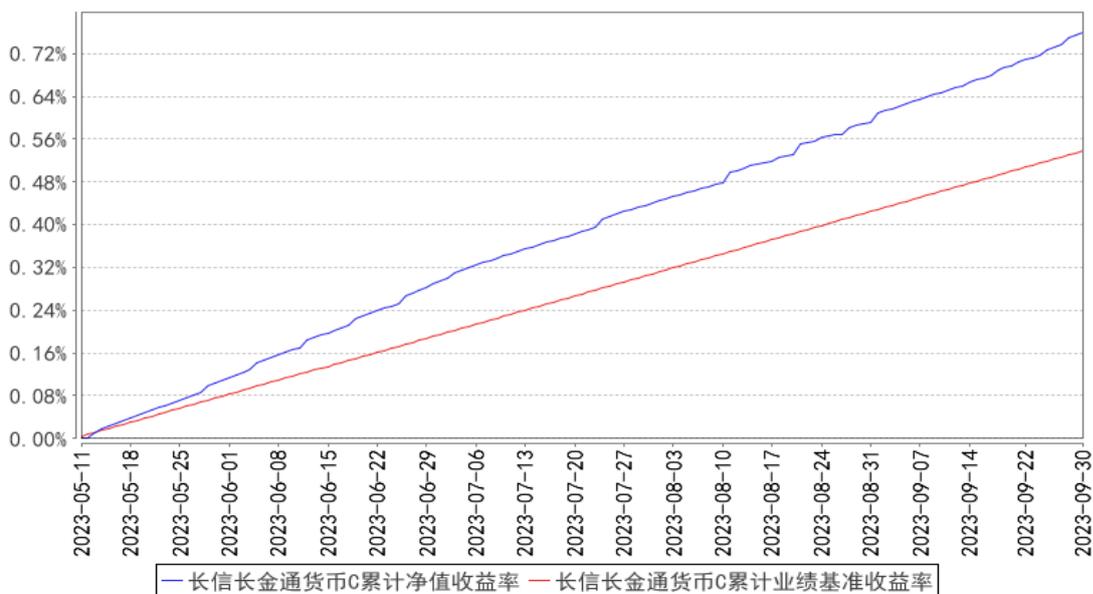
长信长金货币A累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



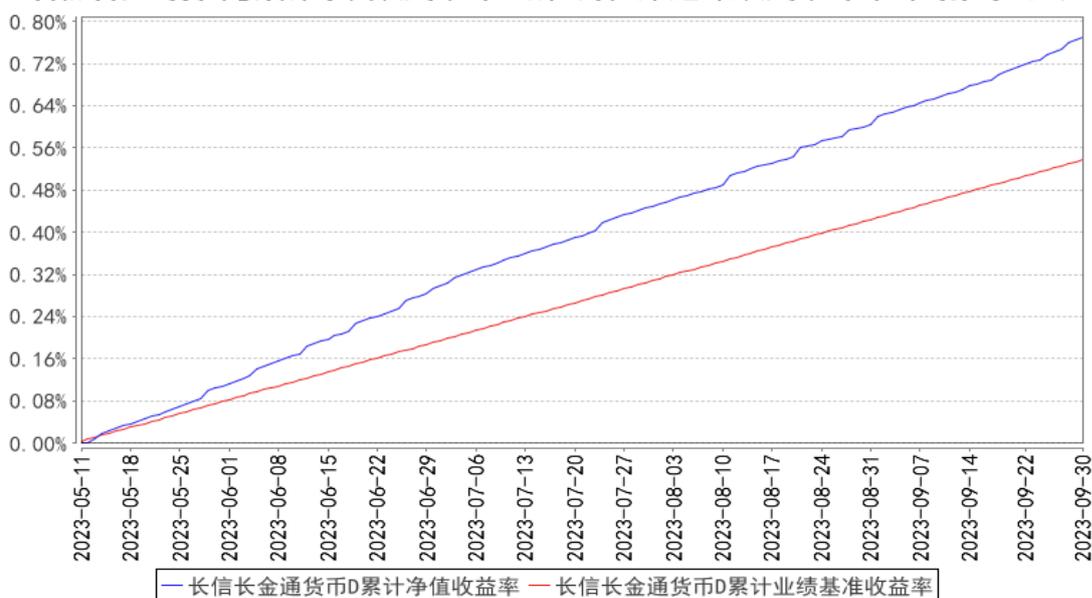
长信长金货币B累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



长信长金货币C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D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、基金管理人自 2023 年 5 月 11 日起对长信长金货币进行份额分类，原有基金份额为 A 类、B 类份额，增设 C 类、D 类份额。

2、长信长金货币 A 类、B 类份额图示日期为 2017 年 9 月 8 日至 2023 年 9 月 30 日，长信长金货币 C 类、D 类份额图示日期为 2023 年 5 月 11 日（份额增加日）至 2023 年 9 月 30 日。

3、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	2017 年 9 月 8 日	-	13 年	管理学学士，毕业于上海交通大学，具有基金从业资格，中国国籍。2010 年 7 月加入长信基金管理有限责任公司，曾任基金事务部基金会计，交易管理部债券交易员、交易主管，债券交易部副总监、总监、现金理财部总监、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

	理、现金理财部 副总监				金的基金经理。现任现金理财部副总监、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。
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、长信稳通三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长信稳势纯债债券型证券投资基金、长信 30 天滚动持有短债债券型证券投资基金、长信稳航 30 天持有期中短债债券型证券投资基金、长信 90 天滚动持有债券型证券投资基金和长信稳固 60 天滚动持有债券型证券投资基金的基金经理、现金理财部副总监	2019 年 11 月 29 日	-	9 年	上海财经大学经济学硕士，具有基金从业资格，中国国籍。曾任职于德勤华永会计师事务所（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、长信易进混合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，现任现金理财部副总监、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、长信稳航 30 天持有期中短债债券型证券投资基金、长信 90 天滚动持有债券型证券投资基金和长信稳固 60 天滚动持有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合规守信情况说明

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

回顾三季度，债券收益率先下后上呈 V 型走势，各期限季末较季初均有一定幅度的上行，但 10Y 国开债收益率下行 3bp，表现突出。整体来看，长期限债券表现优于短期限债券，利率和信用的利差以及信用债等级利差基本持平。同业存单方面，3M-1Y 均有 15bp 左右的上行，短期限存单上行幅度更大。7-8 月资金面较为宽松，债券收益率震荡下行。8 月央行意外降息，下调 MLF 利率 15bp 同时下调公开市场操作利率 10bp，为支持实体经济央行再度放松货币政策。与二季度类似，降息后市场呈现利好出尽的走势，随着地产优化政策密集出台，市场预期和信心有所改变，叠加地方债加大发行力度，资金面边际收紧，债市出现 30bp 左右的明显调整。9 月央行全面降准 0.25%，且市场对于地产政策放松等影响逐渐消化，债券收益率小幅回落。在三季度中，我们积极把握收益率高点拉长组合剩余期限，配置同业存款、同业存单和信用债等资产，维持了组合整体收益。

展望四季度，随着地方特殊再融资债启动发行，财政政策的支持力度加大，预计消费保持复苏态势，基建投资延续增长，房地产投资逐步企稳，债市可能承压。需要关注基本面、政策面的边际变化以及机构行为的共振情况，包括利率债供给对资金面的扰动，相对来说短端的确定性和性价比更高，信用债也有一定利差优势。另一方面，短期经济仍面临需求不足等挑战，资金不具备持续收紧的基础，机构提前布局明年带来的配置力量也对债市形成支撑，债券收益率可能震荡向上但幅度有限。未来我们将在保证货币基金安全性、流动性充足的基础上，通过把握阶段性资金面变化带来的投资机会，合理配置各类资产，匹配组合久期，为持有人获取较高的投资回报。

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 0.4933%，长信长金货币 B 净

值收益率为 0.5288%，长信长金货币 C 净值收益率为 0.4679%，长信长金货币 D 净值收益率为 0.4748%，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	6,992,509,482.50	62.72
	其中：债券	6,992,509,482.50	62.72
	资产支持证 券	-	-
2	买入返售金融资产	1,685,987,099.72	15.12
	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	2,470,997,759.20	22.16
4	其他资产	128,851.66	0.00
5	合计	11,149,623,193.08	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	-	4.60
	其中：买断式回购融资	-	-
2	报告期末债券回购融资余额	500,186,011.43	4.70
	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

本报告期内本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	77
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	87
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	69

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

本报告期内本基金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	35.58	4.70
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	25.73	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	5.44	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	11.24	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	26.28	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	104.27	4.70

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

本报告期内本基金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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	707,160,017.99	6.64
	其中：政策性金融债	573,082,876.15	5.38
4	企业债券	504,413,745.49	4.74
5	企业短期融资券	534,726,818.56	5.02
6	中期票据	20,556,049.76	0.19
7	同业存单	5,225,652,850.70	49.09
8	其他	-	-
9	合计	6,992,509,482.50	65.69
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	112382564	23 浙江网商银行 CD007	2,000,000	199,881,779.11	1.88
2	112396983	23 昆仑银行 CD007	2,000,000	199,804,829.75	1.88
3	112396892	23 湖南银行	2,000,000	199,791,140.02	1.88

		CD044			
4	112321162	23 渤海银行 CD162	2,000,000	199,675,680.14	1.88
5	112384526	23 浙江网商银 行 CD011	2,000,000	199,576,972.15	1.87
6	112321199	23 渤海银行 CD199	2,000,000	197,994,047.73	1.86
7	210402	21 农发 02	1,800,000	184,164,366.27	1.73
8	190305	19 进出 05	1,500,000	153,683,411.19	1.44
9	112273088	22 西安银行 CD037	1,500,000	149,290,798.93	1.40
10	112386661	23 广州农村商 业银行 CD103	1,500,000	148,345,794.49	1.39

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	-
报告期内偏离度的最高值	0.0446%
报告期内偏离度的最低值	-0.0428%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0226%

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

本报告期内本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

本报告期内本基金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，发行主体湖南银行股份有限公司于 2023 年 2 月 13 日收到湖南银保监局机关行政处罚信息公开表（湘银保监罚决字（2023）32 号），经查，湖南银行股份有限公司存在信用卡系统安全管理不到位，员工异常行为排查不到位的情况，根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条，中国银行保险监督管理委员会湖南监管局决定对长沙银行股份有限公司罚款 70 万元。

报告期内本基金投资的前十名证券中，发行主体昆仑银行股份有限公司于 2022 年 12 月 26

日收到中国银行保险监督管理委员会克拉玛依监管分局行政处罚信息公开表（克银保监罚决字（2022）16 号），经查，昆仑银行股份有限公司存在贷款资金未按约定用途使用、发放贷款偿还母公司存量信托融资掩盖风险、个人贷款风险分类不准确等问题。根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条，中国银行保险监督管理委员会克拉玛依监管分局决定对昆仑银行股份有限公司处以罚款人民币 80 万元。

报告期内本基金投资的前十名证券中，发行主体昆仑银行股份有限公司于 2022 年 12 月 26 日收到中国银行保险监督管理委员会克拉玛依监管分局行政处罚信息公开表（克银保监罚决字（2022）22 号），经查昆仑银行股份有限公司存在内部控制不到位导致发生操作风险事件、薪酬管理违反审慎经营规则、互联网贷款管理不到位、信贷资产质押权未落实到位、非现场统计数据差错、监管要求落实不力等问题。根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条，中国银行保险监督管理委员会克拉玛依监管分局决定对昆仑银行股份有限公司处以罚款人民币 265 万元，并责令对其他相关责任人予以纪律处分。

报告期内本基金投资的前十名证券中，发行主体昆仑银行股份有限公司于 2023 年 4 月 11 日收到中国证券监督管理委员会新疆监管局《关于对昆仑银行股份有限公司采取责令改正措施的决定》（（2023）7 号），经查，昆仑银行股份有限公司基金销售业务存在以下问题：一、基金销售业务内部制度建立和执行不到位；二、对分支机构基金销售业务管理有待加强，分支机构是否开展或暂停基金销售业务缺少内部审批；三、2022 年 8 月，手机银行系统“新客户联动风评”功能出现故障，导致手机银行基金销售系统发生错链问题，该事项发生后未在 3 个工作日内向新疆证监局报告。上述情形违反了《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》第三十条、《关于实施〈公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法〉的规定》第十七条、第十八条、第二十五条的规定，中国证券监督管理委员会新疆监管局决定对昆仑银行股份有限公司采取责令改正的行政监管措施。

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 2023 年 2 月 16 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（2023）8 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，渤海银行存在以下行为：一、小微企业贷款风险分类不准确；二、小微企业贷款资金被挪用于购买理财产品；三、将银行员工、公务员等个人商用房贷计入普惠型个体工商户或小微企业主贷款统计口径；四、将非小微企业划归统计口径；五、违规发放商用房贷。综上，中国银行保险监督管理委员会对渤海总行罚款 430 万元，对分支机构罚款 1230 万元，合计罚款 1660 万元。

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 2023 年 2 月 17 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〔2023〕21号），根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条、第四十七条和相关审慎经营规则，经查，渤海银行存在以下行为：一、风险加权资产计算不准确；二、流动性风险指标计算不准确；三、全部关联度计算不准确；四、未准确反映信用风险信息；五、未准确反映国别风险信息；六、股权质押业务错报；七、理财业务数据错报；八、主要股东数据错报；九、大中小微企业贷款、普惠型消费贷款数据错报；十、投资数据错报；十一、同业交易对手错报；十二、数据治理机制不健全；十三、制度和信息系统建设不到位。综上，中国银行保险监督管理委员会决定对渤海银行罚款 860 万元。

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 2023 年 4 月 24 日收到中国证券监督管理委员会天津监管局《关于对渤海银行股份有限公司采取责令改正措施的决定》，经查，渤海银行股份有限公司基金销售业务存在以下违规行为：一、基金销售业务部门负责人、部分分支行基金销售业务负责人未取得基金从业资格；二、合规风控人员未对基金新销售产品进行合规审查并出具合规审查意见；三、未将基金销售保有规模、投资人长期收益纳入分支机构和基金销售人员考核评价指标体系。上述行为违反了《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》第八条第四项、第二十六条第二款、第三十条第一款的规定，中国证券监督管理委员会天津监管局决定对渤海银行股份有限公司采取责令改正的行政监管措施。

报告期内本基金投资的前十名证券中，发行主体西安银行股份有限公司于 2023 年 5 月 30 日收到中国银保监会陕西监管局行政处罚信息公开表（陕银保监罚决字〔2023〕16号），经查，西安银行股份有限公司存在债券投资投前调查、审查审批不审慎，自营资金承接表外理财资产的情况，违反了《中国银保监会办公厅关于加强商业银行债券投资风险管理的通知》第四条，《中国银保监会关于银行业风险防控工作的指导意见》第三条，《中国银保监会关于规范商业银行使用外部信用评级的通知》第三条，《商业银行授信工作尽职指引》第十五条、第三十三条，《中国银保监会办公厅关于做好当前部分领域风险防控工作的通知》第三条以及《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条的规定，综上，中国银行保险监督管理委员会陕西监管局决定对西安银行股份有限公司罚款 65 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	128,851.66
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	-
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	其他	-
7	合计	128,851.66

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	长信长金货币 C	长信长金货币 D
报告期初基金份额总额	819,529,477.61	12,105,058,301.04	368,932.07	11,134.49
报告期内基金申购份额	373,212,171.91	5,836,864,843.44	2,069,487.69	51.38
报告期内基金赎回份额	480,081,090.36	8,010,993,050.61	1,385,699.75	-
报告期末基金份额总额	712,660,559.16	9,930,930,093.87	1,052,720.01	11,185.87

额				
---	--	--	--	--

§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

本基金本报告期末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

2023 年 10 月 25 日