

长信长金通货币市场基金 2023 年第 2 季度报告

2023 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

报告送出日期：2023 年 7 月 21 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 7 月 19 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 4 月 1 日起至 2023 年 6 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	12,924,967,845.21 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	长信长金通 货币 C	长信长金通 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	819,529,477.61 份	12,105,058,301.04 份	368,932.07 份	11,134.49 份

注：基金管理人决定自 2023 年 5 月 11 日起对长信长金货币市场基金进行份额分类，原有基金

份额为 A 类份额、B 类份额，增设 C 类份额、D 类份额，具体事宜可详见基金管理人于 2023 年 5 月 9 日发布的《长信基金管理有限责任公司关于长信长金货币市场基金增设 C、D 类基金份额相关事项的公告》。

§ 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 4 月 1 日-2023 年 6 月 30 日）		报告期（2023 年 5 月 11 日-2023 年 6 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	4,129,214.97	57,421,222.34	821.63	30.43
2. 本期利润	4,129,214.97	57,421,222.34	821.63	30.43
3. 期末基金资产净值	819,529,477.61	12,105,058,301.04	368,932.07	11,134.49

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	0.5373%	0.0024%	0.3418%	0.0000%	0.1955%	0.0024%
过去六个月	1.0712%	0.0021%	0.6810%	0.0000%	0.3902%	0.0021%
过去一年	1.9394%	0.0025%	1.3781%	0.0000%	0.5613%	0.0025%
过去三年	6.6036%	0.0026%	4.1916%	0.0000%	2.4120%	0.0026%
过去五年	12.4148%	0.0026%	7.0872%	0.0000%	5.3276%	0.0026%
自基金合同生效起至今	16.2110%	0.0031%	8.2825%	0.0000%	7.9285%	0.0031%

长信长金货币 B

阶段	净值收益率①	净值收益率	业绩比较基	业绩比较基	①—③	②—④
----	--------	-------	-------	-------	-----	-----

		标准差②	准收益率③	准收益率标准差④		
过去三个月	0.5724%	0.0024%	0.3418%	0.0000%	0.2306%	0.0024%
过去六个月	1.1413%	0.0021%	0.6810%	0.0000%	0.4603%	0.0021%
过去一年	2.0831%	0.0025%	1.3781%	0.0000%	0.7050%	0.0025%
过去三年	7.0531%	0.0026%	4.1916%	0.0000%	2.8615%	0.0026%
过去五年	13.2061%	0.0026%	7.0872%	0.0000%	6.1189%	0.0026%
自基金合同生效起至今	15.5742%	0.0033%	8.2825%	0.0000%	7.2917%	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
自份额增加日起至今	0.2894%	0.0033%	0.1914%	0.0000%	0.0980%	0.0033%

长信长金货币 D

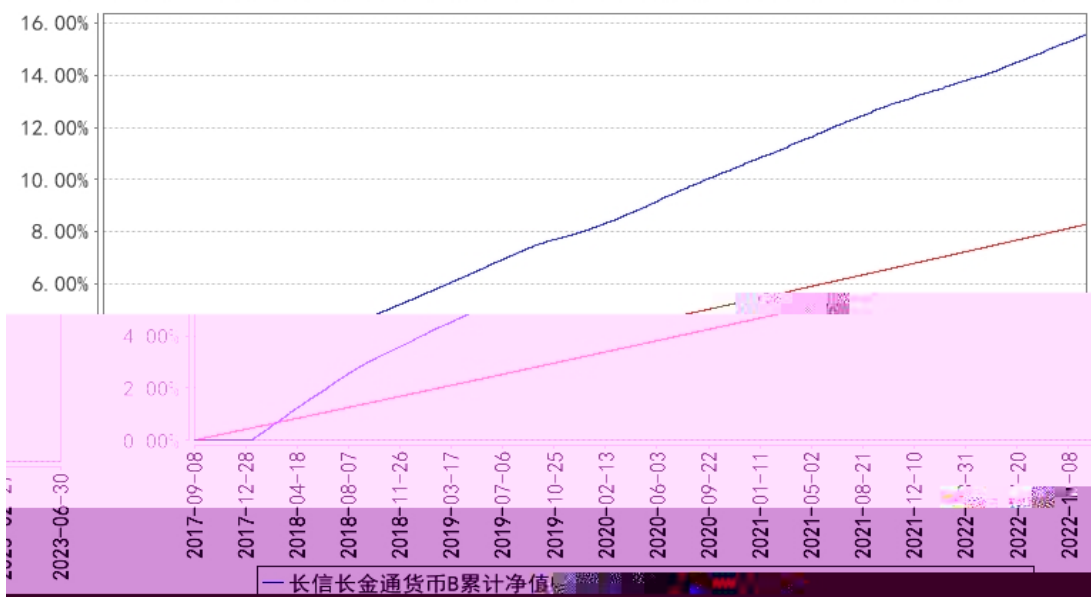
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
自份额增加日起至今	0.2929%	0.0033%	0.1914%	0.0000%	0.1015%	0.0033%

注：本基金收益分配按日结转份额。

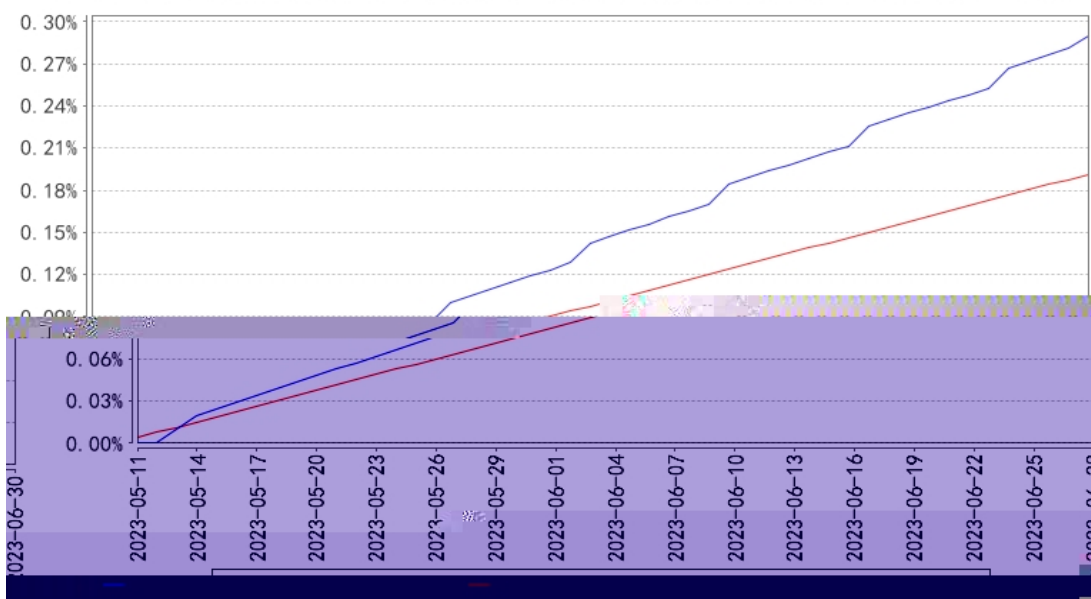
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



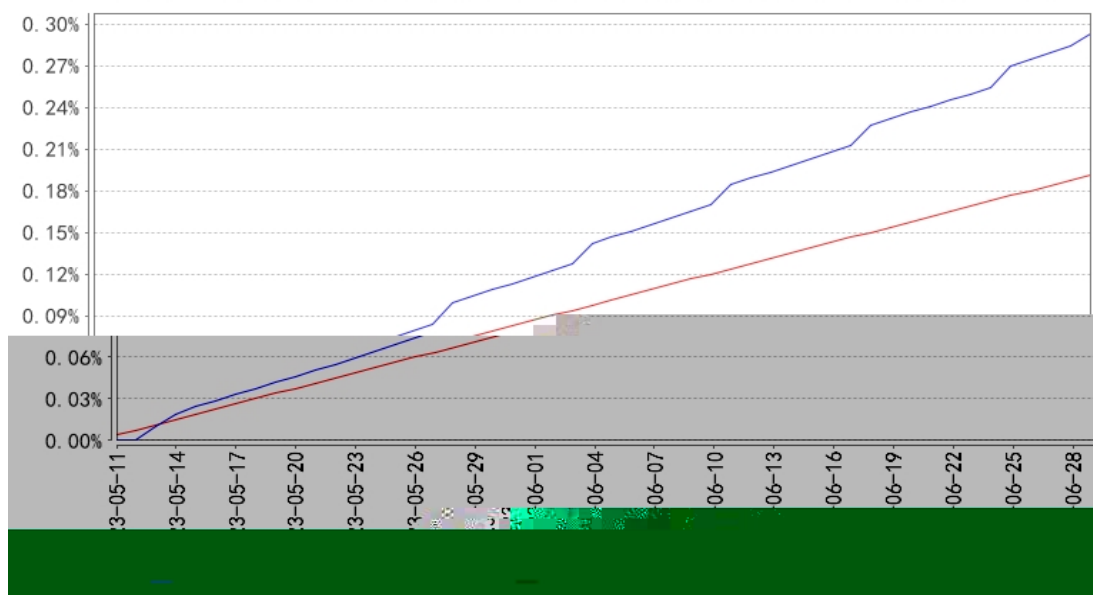
长信长金货币B累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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 6 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 6 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	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

	投资基金和长信稳惠债券型证券投资基金的基金经理、现金理财部副总监				资基金的基金经理。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和长信稳航 30 天持有期中短债债券型证券投资基金的基金经理	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航 30 天持有期中短债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

回顾二季度，债券收益率全面下行，1-5Y 各债券品种下行幅度均达 30bp 左右，10Y 国开收益率下行超 20bp，而 30Y 国债收益率下行幅度也超过 20bp，成为季度表现最佳品种。整体来看，长期限债券表现优于短期限债券，利率债表现略优于信用债，信用债里高评级债券表现略优于低评级债券。3M-1Y 同业存单有 20-30bp 的下行，同样是长期限品种下行更多。今年政策定力较足，官方制造业指数连续三个月低于荣枯线，地产投资同比持续走低。6 月央行超预期下调公开市场操作利率 10bp，之后 MLF 和 LPR 也跟随下调 10bp，体现了央行为支持实体经济进一步放松货币政策，整个二季度资金中枢回落 20bp。降息后市场出现止盈盘，且临近半年末资金边际收紧，债市出现小幅调整。在二季度中，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，维持了较高的组合整体收益。

展望三季度，消费保持温和复苏，基建投资延续较快增长，对高新技术产业投资支撑制造业投资增长，房地产投资逐步企稳，财政政策和货币政策继续发力，债市或将呈现震荡格局。当前经济发展重点在加快社会经济结构转型，扩大高新技术产业发展，坚持房住不炒，在这样的宏观环境中利率的长期趋势仍是往下，但短期在市场预期和情绪面扰动下或有一定的调整。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 0.5373%，长信长金货币 B 净值收益率为 0.5724%，同期业绩比较基准收益率为 0.3418%；长信长金货币 C 净值收益率为 0.2894%，长信长金货币 D 净值收益率为 0.2929%，同期业绩比较基准收益率为 0.1914%。

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	7,692,861,544.59	56.24
	其中：债券	7,692,861,544.59	56.24
	资产支持证 券	-	-
2	买入返售金融资产	3,207,539,861.86	23.45
	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	2,778,104,885.30	20.31
4	其他资产	222,748.80	0.00
5	合计	13,678,729,040.55	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	-	4.69
	其中：买断式回购融资	-	-
2	报告期末债券回购融资余额	690,931,065.71	5.35
	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	86
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	86
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	64

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	各期限负债占基金资产净
----	--------	-------------	-------------

		值的比例 (%)	值的比例 (%)
1	30 天以内	34.74	5.80
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	18.85	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	4.47	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	13.49	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	33.96	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	105.52	5.80

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	906,651,390.48	7.01
	其中：政策性金融债	752,083,699.01	5.82
4	企业债券	398,923,830.87	3.09
5	企业短期融资券	292,157,636.67	2.26
6	中期票据	51,798,710.62	0.40
7	同业存单	6,043,329,975.95	46.76
8	其他	-	-
9	合计	7,692,861,544.59	59.52
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	112217195	22 光大银行 CD195	3,000,000	299,182,187.45	2.31
2	112308039	23 中信银行 CD039	3,000,000	299,053,610.31	2.31
3	112396847	23 郑州银行 CD116	2,000,000	199,782,231.81	1.55
4	112319153	23 恒丰银行	2,000,000	199,511,251.54	1.54

		CD153			
5	112307006	23 招商银行 CD006	2,000,000	199,488,323.55	1.54
6	112396983	23 昆仑银行 CD007	2,000,000	198,751,913.81	1.54
7	112396892	23 湖南银行 CD044	2,000,000	198,594,420.84	1.54
8	112321162	23 渤海银行 CD162	2,000,000	198,383,651.40	1.53
9	112317031	23 光大银行 CD031	2,000,000	198,250,660.65	1.53
10	112321199	23 渤海银行 CD199	2,000,000	196,789,705.66	1.52

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	0.0476%
报告期内偏离度的最低值	0.0065%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0243%

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，发行主体招商银行股份有限公司于 2022 年 9 月 9 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〕48 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，招商银行存在以下行为：一、个人经营贷款挪用至房地产市场；二、个人经营贷款“三查”不到位；三、总行对分支机构管控不力承担管理责任。综上，中国银行保险监督管理委员会决定对招商银行股份有限公司处以罚款人民币 460 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八十万元。

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二百六十五万元，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、大中小微型企业贷款、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、制度建设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。

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	47,471.83
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	-
4	应收申购款	175,276.97
5	其他应收款	-
6	其他	-

7	合计	222,748.80
---	----	------------

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
报告期期初 基金份额总 额	805,868,062.99	7,440,075,484.13	-	-
报告期期间 基金总申购 份额	551,593,725.80	12,714,902,273.83	1,630,034.21	11,134.49
报告期期间 基金总赎回 份额	537,932,311.18	8,049,919,456.92	1,261,102.14	-
报告期期末 基金份额总 额	819,529,477.61	12,105,058,301.04	368,932.07	11,134.49

注：长信长金货币市场基金 C 类、D 类份额增加日为 2023 年 5 月 11 日。

§ 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：

长信基金管理有限责任公司
2023 年 7 月 21 日