

# 长信长金通货币市场基金 2025 年中期报告

2025 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：2025 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。本中期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合同规定，于 2025 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 2025 年 1 月 1 日起至 2025 年 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
<b>§4 管理人报告</b>	<b>11</b>
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遵规守信情况的说明	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	14
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	15
<b>§5 托管人报告</b>	<b>15</b>
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	15
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	16
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	16
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>16</b>
6.1 资产负债表	16
6.2 利润表	17
6.3 净资产变动表	19
6.4 报表附注	21
<b>§7 投资组合报告</b>	<b>41</b>
7.1 期末基金资产组合情况	41
7.2 债券回购融资情况	41
7.3 基金投资组合平均剩余期限	41
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	42
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	42
7.6 期末按实际利率计算账面价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细	43

7.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值确定的基金资产净值的偏离 .....	43
7.8 期末按实际利率计算的账面价值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.....	43
7.9 投资组合报告附注.....	43
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>44</b>
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.....	45
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	45
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情况 .....	45
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>46</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>46</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	46
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
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>51</b>
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 .....	51
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	51
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>51</b>
12.1 备查文件目录.....	51
12.2 存放地点.....	51
12.3 查阅方式.....	51

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	长信长金通货币市场基金			
基金简称	长信长金通货币			
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	27,377,100,402.82 份			
基金合同存续期	不定期			
下属分级基金的基金简称	长信长金通货币 A	长信长金通货币 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	367,457,361.85 份	27,008,887,818.54 份	743,704.79 份	11,517.64 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	方圆
	联系电话	021-61009999	95559
	电子邮箱	zhouyg@cxfund.com.cn	fangy_20@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 37 层	中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 号
办公地址		上海市浦东新区银城中路 68 号 9 楼、37 楼、38 楼	中国（上海）长宁区仙霞路 18 号
邮政编码		200120	200336
法定代表人		刘元瑞	任德奇

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.cxfund.com.cn
基金中期报告备置地点	上海市浦东新区银城中路 68 号 38 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、37 楼、38 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

3.1.1 期 间 数据 和 指 标	报告期(2025 年 1 月 1 日-2025 年 6 月 30 日)			
	长信长金通货币 A	长信长金通货币 B	长信长金通货币 C	长信长金通货币 D
本期已实现收益	2,879,106.88	209,615,246.07	5,982.71	81.57
本期利润	2,879,106.88	209,615,246.07	5,982.71	81.57
本期净值收益率	0.7658%	0.8359%	0.7160%	0.7133%
3.1.2 期 末 数据 和 指 标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)			
期末基金资产净值	367,457,361.85	27,008,887,818.54	743,704.79	11,517.64
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指 标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)			

累计净值收益率	20.4514%	20.1278%	3.7397%	3.7392%
---------	----------	----------	---------	---------

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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、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

长信长金通货币 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	0.1204%	0.0006%	0.1126%	0.0000%	0.0078%	0.0006%
过去三个月	0.3738%	0.0006%	0.3418%	0.0000%	0.0320%	0.0006%
过去六个月	0.7658%	0.0006%	0.6810%	0.0000%	0.0848%	0.0006%
过去一年	1.6090%	0.0007%	1.3781%	0.0000%	0.2309%	0.0007%
过去三年	5.6591%	0.0020%	4.1955%	0.0000%	1.4636%	0.0020%
自基金合同生效起至今	20.4514%	0.0030%	11.2918%	0.0000%	9.1596%	0.0030%

长信长金通货币 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	0.1319%	0.0006%	0.1126%	0.0000%	0.0193%	0.0006%

过去三个月	0.4089%	0.0006%	0.3418%	0.0000%	0.0671%	0.0006%
过去六个月	0.8359%	0.0006%	0.6810%	0.0000%	0.1549%	0.0006%
过去一年	1.7514%	0.0007%	1.3781%	0.0000%	0.3733%	0.0007%
过去三年	6.1051%	0.0020%	4.1955%	0.0000%	1.9096%	0.0020%
自基金合同生效起至今	20.1278%	0.0030%	11.2918%	0.0000%	8.8360%	0.0030%

## 长信长金通货币 C

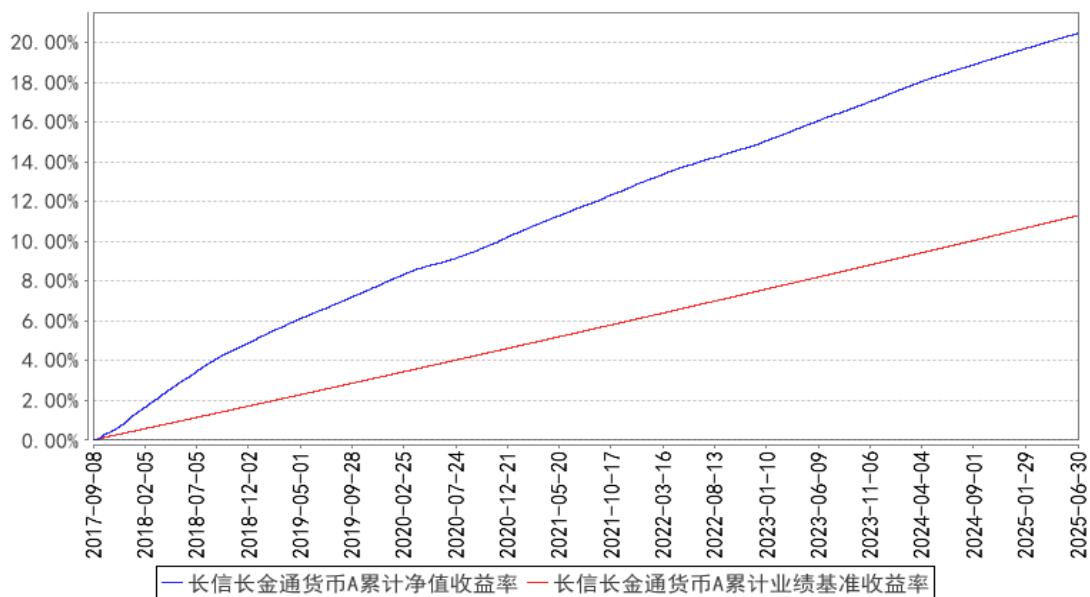
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.1122%	0.0006%	0.1126%	0.0000%	-0.0004%	0.0006%
过去三个月	0.3488%	0.0006%	0.3418%	0.0000%	0.0070%	0.0006%
过去六个月	0.7160%	0.0005%	0.6810%	0.0000%	0.0350%	0.0005%
过去一年	1.5066%	0.0007%	1.3781%	0.0000%	0.1285%	0.0007%
自份额增加日起至今	3.7397%	0.0018%	2.9759%	0.0000%	0.7638%	0.0018%

## 长信长金通货币 D

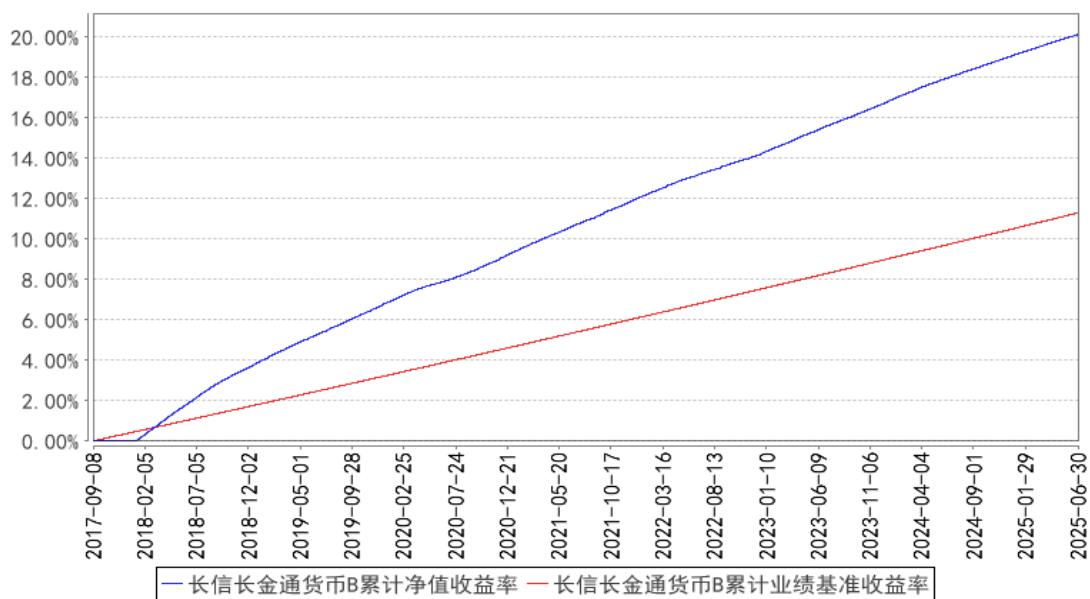
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.1116%	0.0006%	0.1126%	0.0000%	-0.0010%	0.0006%
过去三个月	0.3473%	0.0006%	0.3418%	0.0000%	0.0055%	0.0006%
过去六个月	0.7133%	0.0006%	0.6810%	0.0000%	0.0323%	0.0006%
过去一年	1.5017%	0.0007%	1.3781%	0.0000%	0.1236%	0.0007%
自份额增加日起至今	3.7392%	0.0018%	2.9759%	0.0000%	0.7633%	0.0018%

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

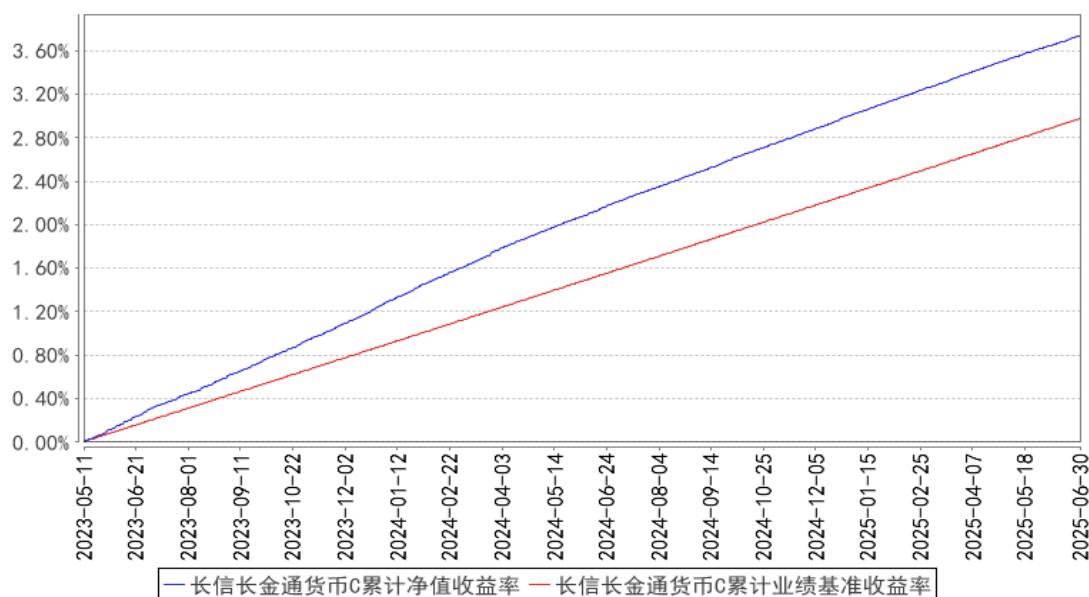
长信长金通货币A累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



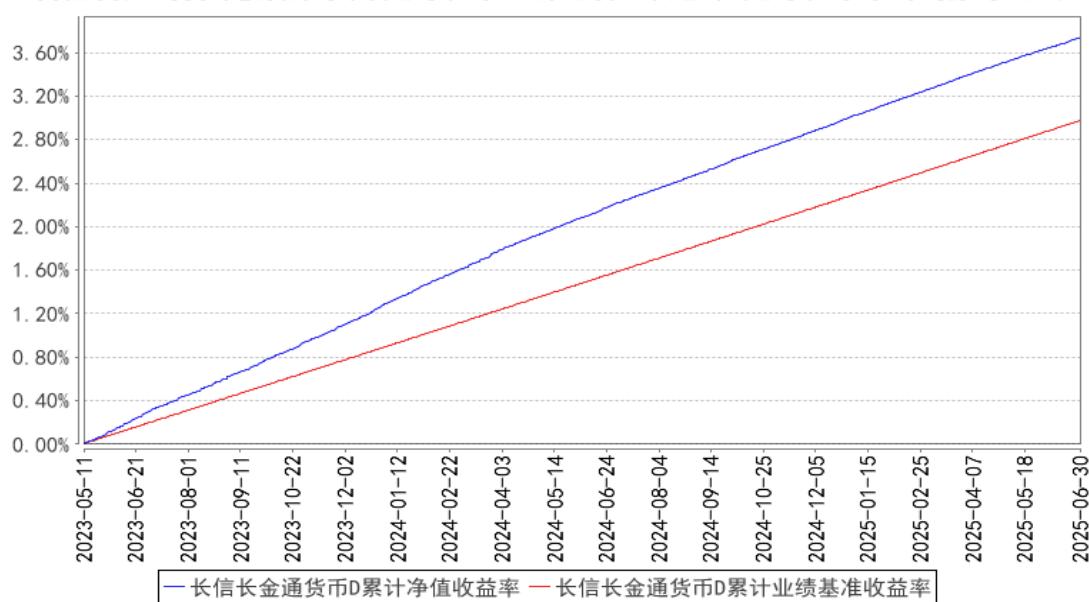
长信长金通货币B累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



长信长金通货币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



长信长金通货币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 日起对长信长金通货币进行份额分类，原有基金份额为 A 类、B 类份额，增设 C 类、D 类份额。

2、长信长金通货币 A 类、B 类份额图示日期为 2017 年 9 月 8 日至 2025 年 6 月 30 日，长信长金通货币 C 类、D 类份额图示日期为 2023 年 5 月 11 日（份额增加日）至 2025 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2025年6月30日，本基金管理人共管理85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、长信利丰债券型证券投资基金、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、长信利富债券型证券投资基金、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)、长信利保债券型证券投资基金、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、长信利发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、长信国防军工量化灵活配置混合型证券投资基金、长信优先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、长信长金通货币市场基金、长信稳通三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长信低碳环保行业量化股票型证券投资基金、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、长信消费精选行业量化股票型证券投资基金、长信企业精选两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、长信量化价值驱动混合型证券投资基金、长信稳裕三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长信稳进资产配置混合型基金中基金(FOF)、长信利率债债券型证券投资基金、长信沪深300指数增强型证券投资基金、长信双利优选混合型证券投资基金、长信富瑞两年定期开放债券型证券投资基金、长信颐天平衡养老目

标三年持有期混合型基金中基金（FOF）、长信易进混合型证券投资基金、长信先锐混合型证券投资基金、长信稳健精选混合型证券投资基金、长信浦瑞 87 个月定期开放债券型证券投资基金、长信消费升级混合型证券投资基金、长信企业优选一年持有期灵活配置混合型证券投资基金、长信稳健均衡 6 个月持有期混合型证券投资基金、长信优质企业混合型证券投资基金、长信内需均衡混合型证券投资基金、长信 30 天滚动持有短债债券型证券投资基金、长信稳惠债券型证券投资基金、长信稳丰债券型证券投资基金、长信先进装备三个月持有期混合型证券投资基金、长信颐和平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）、长信颐年平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）、长信稳健增长一年持有期混合型证券投资基金、长信稳健成长混合型证券投资基金、长信企业成长三年持有期混合型证券投资基金、长信稳兴三个月定期开放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、长信稳恒债券型证券投资基金、长信中证科创创业 50 指数增强型证券投资基金、长信均衡策略一年持有期混合型证券投资基金、长信中证 1000 指数增强型证券投资基金、长信均衡优选混合型证券投资基金、长信 90 天滚动持有债券型证券投资基金、长信稳固 60 天滚动持有债券型证券投资基金、长信汇智量化选股混合型证券投资基金、长信 120 天滚动持有债券型证券投资基金、长信中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、长信优势行业混合型证券投资基金、长信 180 天持有期债券型证券投资基金、长信富安纯债 180 天持有期债券型证券投资基金、长信中证 A500 指数增强型证券投资基金、长信稳瑞纯债债券型证券投资基金。

#### 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		
俞玮晨	长信长金通货币市场基金、长信利息收益开放式证券投资基金和长信中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金的基金经理	2024 年 2 月 5 日	-	10 年	法国雷恩商学院国际金融硕士，具有基金从业资格，中国国籍。曾任浦银安盛基金管理有限公司债券交易员、债券基金经理助理，2023 年 12 月加入长信基金管理有限责任公司现金理财部，现任长信长金通货币市场基金、长信利息收益开放式证券投资基金和长信中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金的基金经理。
陆莹	长信利息收益开放式证	2017 年 9 月 8 日	-	15 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

	券投资基金、长信长金通货币市场基金、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、长信稳健债券型证券投资基金和长信中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金的基金经理、现金理财部副总监			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、长信长金通货币市场基金、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、长信稳健债券型证券投资基金和长信中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期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遵规守信情况的说明

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

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 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

回顾 2025 年上半年，宏观经济层面，财政政策积极发力，新增的政府债券发行为中国经济注入了强劲的动力。消费方面，超长期特别国债支持“两新”政策，法定节假日天数增加，有效拉动了消费增速。出口方面，尽管今年面临较大挑战，我国储备政策和对出口结构调整的提前布局，显出了一定的韧性。人民银行积极呵护债券收益率，加大买断式逆回购、中期借贷便利以及关键点位的公开市场投放，并于 5 月降准降息，更是为我国经济注入了强心剂。

上半年债券市场收益率冲高回落，2024 年 12 月份抢跑行情于今年 1、2 月份得到一定的修复，二季度国内外形势复杂多变，但资金面平稳宽松，市场平稳有序进入利率下行周期。具体来看 10 年期国债收益率在 1.62%-1.73% 区间震荡。整体上半年，1 年期国债收益率较 2024 年年底上行 26BP 至 1.34%，10 年期国债收益率下行 3BP 至 1.65%，曲线平坦化，10 年期与 1 年期国债利差收窄 29BP。同业存单方面，受存款端影响，3 个月、6 个月、9 个月和 1 年期 AAA 级商业银行同业存单到期收益率分别大幅上行 28 个、27 个、26 个和 22 个基点，分别至 2.035%、2.017%、1.991% 和 1.955%，随后同业存单收益率有所下降。

基于对经济基本面、货币政策及资金面的预判，本基金在 2025 年上半年灵活调整配置策略，并充分运用杠杆和久期策略，在类属配置方面以利率债、同业存单、高等级信用债为主，分析适当时机，配置收益率较高的短期资产，在保证组合良好流动性的基础上，提高组合整体收益。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2025 年 6 月 30 日，本报告期内长信长金通货币 A 净值收益率为 0.7658%，长信长金通货币 B 净值收益率为 0.8359%，长信长金通货币 C 净值收益率为 0.7160%，长信长金通货币 D 净值收益率为 0.7133%，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 2025 年 3 季度，二季度的货币执行报告措辞的变更，降低了市场对短期之内进一步降准降息的预期，由于债券市场处于期限利差和信用利差压缩的情况，基金会考虑配属高信用资质、

高流动性品种，同时灵活调整组合久期。后续观察在投资端、需求端、上下游价格的变化，以及对未来的 PPI、CPI 指标的观察，及时调整组合结构。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人严格按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金持有的投资品种进行估值。基金托管人根据法律法规要求对基金管理公司采用的估值政策和程序进行核查，并对估值结果及净值计算进行复核。

根据相关法律法规，本基金管理人制订了健全、有效的估值政策和估值程序，设立了估值委员会，估值委员会是公司基金估值的主要决策机构，其主要职责是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，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时修订估值程序；估值委员会成员由基金事务部、投资、研究、交易等相关业务部门负责人以及基金事务部至少一名业务骨干共同组成，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。对于基金的估值政策和估值原则，公司已与基金托管人充分沟通，并达成一致意见。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 212,500,417.23 元，已分配利润 212,500,417.23 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

本报告期内，托管人在长信长金通货币市场基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金管理法》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

本报告期内，长信基金管理有限责任公司在长信长金通货币市场基金投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支、基金收益分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

## 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，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通货币市场基金的中期报告中财务指标、收益表现、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：长信长金通货币市场基金

报告截止日：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025年6月30日	上年度末 2024年12月31日
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	4,933,382,147.97	2,416,641,024.99
结算备付金		-	4,019,860.23
存出保证金		30,705.67	69,113.18
交易性金融资产	6.4.7.2	20,397,947,956.80	21,695,453,273.80
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		20,397,947,956.80	21,695,453,273.80
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	6,705,932,282.60	8,943,179,124.35
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		184,899.23	21,083,473.00

递延所得税资产		-	-
其他资产	6. 4. 7. 8	-	-
资产总计		32, 037, 477, 992. 27	33, 080, 445, 869. 55
负债和净资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
<b>负债:</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6. 4. 7. 3	-	-
卖出回购金融资产款		4, 613, 130, 407. 06	4, 536, 686, 626. 74
应付清算款		40, 493, 796. 71	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		3, 555, 268. 54	3, 216, 243. 10
应付托管费		1, 185, 089. 51	1, 072, 081. 01
应付销售服务费		276, 424. 06	262, 821. 01
应付投资顾问费		-	-
应交税费		102, 366. 36	164, 604. 00
应付利润		1, 145, 053. 24	1, 663, 290. 94
递延所得税负债		-	-
其他负债	6. 4. 7. 9	489, 183. 97	616, 213. 27
负债合计		4, 660, 377, 589. 45	4, 543, 681, 880. 07
<b>净资产:</b>			
实收基金	6. 4. 7. 10	27, 377, 100, 402. 82	28, 536, 763, 989. 48
其他综合收益	6. 4. 7. 11	-	-
未分配利润	6. 4. 7. 12	-	-
净资产合计		27, 377, 100, 402. 82	28, 536, 763, 989. 48
负债和净资产总计		32, 037, 477, 992. 27	33, 080, 445, 869. 55

注：报告截止日 2025 年 6 月 30 日，长信长金通货币 A 份额净值 1.0000 元。长信长金通货币 B 份额净值 1.0000 元。长信长金通货币 C 份额净值 1.0000 元。长信长金通货币 D 份额净值 1.0000 元。基金份额总额为 27, 377, 100, 402. 82 份，其中长信长金通货币 A 份额 367, 457, 361. 85 份。长信长金通货币 B 份额 27, 008, 887, 818. 54 份。长信长金通货币 C 份额 743, 704. 79 份。长信长金通货币 D 份额 11, 517. 64 份。

## 6. 2 利润表

会计主体：长信长金通货币市场基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
一、营业总收入		252, 500, 675. 82	221, 628, 442. 18

<b>1. 利息收入</b>		81,272,092.85	87,305,760.15
其中：存款利息收入	6.4.7.13	36,467,400.36	46,690,099.22
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		44,804,692.49	40,615,660.93
其他利息收入		-	-
<b>2. 投资收益（损失以“-”号填列）</b>		171,228,582.97	134,322,682.03
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	171,228,582.97	134,322,682.03
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	-	-
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
<b>3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）</b>	6.4.7.20	-	-
<b>4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）</b>		-	-
<b>5. 其他收入（损失以“-”号填列）</b>	6.4.7.21	-	-
<b>减：二、营业总支出</b>		40,000,258.59	28,301,720.40
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	19,075,024.31	14,101,288.34
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	6,358,341.45	4,700,429.35
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	1,535,221.51	1,402,902.49
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		12,834,239.71	7,850,753.50
其中：卖出回购金融资产支出		12,834,239.71	7,850,753.50
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		36,665.25	95,050.29
8. 其他费用	6.4.7.23	160,766.36	151,296.43
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		212,500,417.23	193,326,721.78
<b>减：所得税费用</b>		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”）</b>		212,500,417.23	193,326,721.78

号填列)			
五、其他综合收益的税后 净额		-	-
六、综合收益总额		212,500,417.23	193,326,721.78

### 6.3 净资产变动表

会计主体：长信长金通货币市场基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净 资产	28,536,763,989 .48	-	-	28,536,763,989. 48
加：会计政策变 更	-	-	-	-
前期差错更 正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净 资产	28,536,763,989 .48	-	-	28,536,763,989. 48
三、本期增减变 动额(减少以“-” 号填列)	-1,159,663,586 .66	-	-	-1,159,663,586. 66
(一)、综合收益 总额	-	-	212,500,417.23	212,500,417.23
(二)、本期基金 份额交易产生的 净资产变动数 (净资产减少以 “-”号填列)	-1,159,663,586 .66	-	-	-1,159,663,586. 66
其中：1. 基金申 购款	39,533,525,569 .85	-	-	39,533,525,569. 85
2. 基金赎 回款	-40,693,189,15 6.51	-	-	-40,693,189,156 .51
(三)、本期向基 金份额持有人分 配利润产生的净 资产变动(净资	-	-	-212,500,417.2 3	-212,500,417.23

产减少以“-”号填列)				
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	27,377,100,402 .82	-	-	27,377,100,402. 82
项目				
上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月30日				
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	10,673,783,306 .26	-	-	10,673,783,306. 26
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	10,673,783,306 .26	-	-	10,673,783,306. 26
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	15,139,157,159 .00	-	-	15,139,157,159. 00
(一)、综合收益总额	-	-	193,326,721.78	193,326,721.78
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数 (净资产减少以“-”号填列)	15,139,157,159 .00	-	-	15,139,157,159. 00
其中：1. 基金申购款	36,838,578,924 .82	-	-	36,838,578,924. 82
2. 基金赎回款	-21,699,421,76 5.82	-	-	-21,699,421,765 .82
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-193,326,721.7 8	-193,326,721.78

(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	25,812,940,465 .26	-	-	25,812,940,465. 26

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：

刘元瑞

覃波

孙红辉

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

长信长金通货币市场基金(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》、《长信长金通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。《长信长金通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。

根据本基金管理人发布的相关公告，本基金自 2023 年 5 月 11 日起本基金增设 C 类份额(以下简称“长信长金通货币 C”)、D 类份额(以下简称“长信长金通货币 D”)。长信长金通货币 C、长信长金通货币 D 的年销售服务费率为 0.25%。

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**

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定(统称“企业会计准则”)、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管理业协会发布的若干基金行业实务操作。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### **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 2025 年 6 月 30 日的财务状况以及 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

#### **6.4.4 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。

#### **6.4.5 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。

#### **6.4.6 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]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、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]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、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资管产品运营业务，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) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用

比例计算缴纳。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025年6月30日
活期存款	1,001,460,897.43
等于：本金	1,001,043,182.36
加：应计利息	417,715.07
减：坏账准备	-
定期存款	3,931,921,250.54
等于：本金	3,925,000,000.00
加：应计利息	6,921,250.54
减：坏账准备	-
其中：存款期限1个月以内	775,262,112.52
存款期限1-3个月	500,092,777.76
存款期限3个月以上	2,656,566,360.26
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	4,933,382,147.97

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2025年6月30日			
	按实际利率计算的账面价值	影子定价	偏离金额	偏离度(%)
债券	交易所市场	70,861,752.75	70,813,701.38	-48,051.37
	银行间市场	20,327,086,204.05	20,331,992,465.14	4,906,261.09
	合计	20,397,947,956.80	20,402,806,166.52	4,858,209.72
资产支持证券	-	-	-	-
合计	20,397,947,956.80	20,402,806,166.52	4,858,209.72	0.0177

注：1. 偏离金额=影子定价-摊余成本；

2. 偏离度=偏离金额/摊余成本法确定的基金资产净值。

##### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

###### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 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 2025年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	6,705,932,282.60	-
合计	6,705,932,282.60	-

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 债权投资

##### 6.4.7.5.1 债权投资情况

本基金本报告期末无债权投资。

#### 6.4.7.6 其他债权投资

##### 6.4.7.6.1 其他债权投资情况

本基金本报告期末无其他债权投资。

#### 6.4.7.7 其他权益工具投资

##### 6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

本基金本报告期末无其他权益投资工具。

#### 6.4.7.8 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	385,664.42
其中：交易所市场	-
银行间市场	385,664.42
应付利息	-
预提账户维护费	9,300.00
预提审计费	34,712.18
预提信息披露费	59,507.37
合计	489,183.97

### 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

#### 长信长金通货币 A

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	519,355,308.52	519,355,308.52
本期申购	790,720,350.61	790,720,350.61
本期赎回(以“-”号填列)	-942,618,297.28	-942,618,297.28
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	367,457,361.85	367,457,361.85

#### 长信长金通货币 B

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	28,016,889,864.34	28,016,889,864.34
本期申购	38,741,587,136.08	38,741,587,136.08
本期赎回(以“-”号填列)	-39,749,589,181.88	-39,749,589,181.88
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	27,008,887,818.54	27,008,887,818.54

#### 长信长金通货币 C

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	507,380.73	507,380.73
本期申购	1,218,001.41	1,218,001.41
本期赎回(以“-”号填列)	-981,677.35	-981,677.35
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	743,704.79	743,704.79

#### 长信长金通货币 D

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	11,435.89	11,435.89

本期申购	81.75	81.75
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	11,517.64	11,517.64

注：本期申购含红利再投、转换入份(金)额，本期赎回含转换出份(金)额。

#### 6.4.7.11 其他综合收益

本基金本报告期无其他综合收益。

#### 6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

##### 长信长金通货币 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	2,879,106.88	-	2,879,106.88
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	-2,879,106.88	-	-2,879,106.88
本期末	-	-	-

##### 长信长金通货币 B

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	209,615,246.07	-	209,615,246.07
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	-209,615,246.07	-	-209,615,246.07
本期末	-	-	-

##### 长信长金通货币 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	5,982.71	-	5,982.71
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	-5,982.71	-	-5,982.71
本期末	-	-	-

## 长信长金通货币 D

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	81.57	-	81.57
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	-81.57	-	-81.57
本期末	-	-	-

## 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日	
活期存款利息收入		3,225,304.71
定期存款利息收入		33,029,247.10
其他存款利息收入		-
结算备付金利息收入		2,758.61
其他		210,089.94
合计		36,467,400.36

注：其他为保证金利息收入。

## 6.4.7.14 股票投资收益

本基金本报告期无股票投资收益。

### 6.4.7.15 债券投资收益

#### 6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2025年1月1日至2025年6月30日
债券投资收益——利息收入	163,693,140.58
债券投资收益——买卖债券(债转股及债券到期兑付)差价收入	7,535,442.39
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	171,228,582.97

#### 6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2025年1月1日至2025年6月30日
卖出债券(债转股及债券到期兑付)成交总额	68,854,754,474.50
减：卖出债券(债转股及债券到期兑付)成本总额	68,743,178,742.22
减：应计利息总额	104,040,289.89
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	7,535,442.39

#### 6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无债券投资赎回差价收入。

#### 6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无债券投资申购差价收入。

### 6.4.7.16 资产支持证券投资收益

#### 6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

### 6.4.7.17 贵金属投资收益

#### 6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期无贵金属投资收益。

### 6.4.7.18 衍生工具收益

#### 6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期无衍生工具收益。

#### 6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

#### 6.4.7.19 股利收益

本基金本报告期无股利收益。

#### 6.4.7.20 公允价值变动收益

本基金本报告期无公允价值变动收益。

#### 6.4.7.21 其他收入

本基金本报告期无其他收入。

#### 6.4.7.22 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

#### 6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2025年1月1日至2025年6月30日
审计费用	34,712.18
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
账户维护费	18,600.00
其他费用	47,946.81
合计	160,766.36

注：其他费用为银行汇划手续费等。

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 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。

##### 6.4.9.2 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、注册登记机构、基金销售机构
交通银行股份有限公司(以下简称“交通银行”)	基金托管人、基金销售机构
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
上海长江财富资产管理有限公司(以下简称“长江财富”)	基金管理人的子公司

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的股票交易。

###### 6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年1月1日至2025年6月 30日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月30日	
	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 成交总额的比例 (%)
长江证券	230,175,000.00	35.93	661,228,200.00	85.71

###### 6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年1月1日至2025年6月 30日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 (%)
长江证券	193,000,000.00	100.00	24,062,578,000.00	100.00

###### 6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

###### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均无应付关联方交易单元的佣金。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年 6月30日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	19,075,024.31	14,101,288.34
其中：应支付销售机构的客户维护费	2,698,839.52	1,473,663.01
应支付基金管理人的净管理费	16,376,184.79	12,627,625.33

注：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值×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。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6 月30日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年 6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	6,358,341.45	4,700,429.35

注：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。

#### 6.4.10.2.3 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 2025年1月1日至2025年6月30日				
	当期发生的基金应支付的销售服务费				
	长信长金通货币A	长信长金通货币B	长信长金通货币C	长信长金通货币D	合计
长信基金	34,319.84	673,126.78	6.92	14.48	707,468.02
长江证券	3,163.08	507.01	—	—	3,670.09
交通银行	—	11,297.43	—	—	11,297.43
合计	37,482.92	684,931.22	6.92	14.48	722,435.54
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月30日				
	当期发生的基金应支付的销售服务费				
	长信长金通货币A	长信长金通货币B	长信长金通货币C	长信长金通货币D	合计
长信基金	36,381.62	614,112.60	14.56	14.56	650,523.34
长江证券	2,249.46	—	64.49	—	2,313.95
交通银行	—	4,310.37	—	—	4,310.37
合计	—	—	—	—	657,147.66

注：本基金 A 类基金份额的年销售服务费率为 0.15%，本基金 B 类基金份额的年销售服务费率为 0.01%，C 类基金份额的年销售服务费率为 0.25%，D 类基金份额的年销售服务费率为 0.25%。各类基金份额的销售服务费计提的计算公式相同，具体如下：

$$H = E \times \text{该类基金份额年销售服务费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日该类基金份额应计提的基金销售服务费

E 为前一日该类基金份额的基金资产净值

基金销售服务费每日计提，按月支付。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

##### 6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间无与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况。

##### 6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间无与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

基金管理人在本报告期及上年度可比期间内均未运用固有资金投资本基金。

##### 6.4.10.5.2 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

份额单位：份

长信长金通货币 A

关联方名称	本期末 2025年6月30日		上年度末 2024年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例（%）	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例（%）
长江财富	365,771.02	0.00	0.00	0.00

份额单位：份

长信长金通货币 B

关联方名称	本期末 2025年6月30日		上年度末 2024年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例（%）	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例（%）
长江财富	0.00	0.00	17,810,373.60	0.06
交通银行	1,239,538,527.97	4.53	1,727,903,867.38	6.06

注：除基金管理人之外的其他关联方投资本基金费率按本基金招募说明书公布的费率执行。

#### 6.4.10.6 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		上年度可比期间	
	2025年1月1日至2025年6月30日	期末余额	当期利息收入	期末余额
交通银行	1,501,927,564.03	4,110,026.87	82,960,931.64	3,929,032.47

注：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 2025 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（2024 年 6 月 30 日：同）。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期及上年度可比期间均未在承销期内购入过由关联方承销的证券。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

长信长金通货币 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
2,868,795.38	24,709.26	-14,397.76	2,879,106.88	-
长信长金通货币 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
208,525,805.95	1,593,279.78	-503,839.66	209,615,246.07	-
长信长金通货币 C				
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
5,982.40	0.41	-0.10	5,982.71	-
长信长金通货币 D				
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
81.75	-	-0.18	81.57	-

#### 6.4.12 期末（2025 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：债券										
证券 代码	证券 名称	成 功 认	受 限 期	流 通 受	认 购 价 格	期 末 估	数 量 (单 位)	期 末 成 本 总 额	期 末 估 值 总 额	备 注

		购 日		限 类 型		值 单 价	张)				
07251011 4	25 中 金公 司 CP00 4	202 5年 6月 30 日	1-6 个 月 (含)	新 债 未 上 市	100. 0 0	100. 0 0	800, 00 0	80, 000, 000. 0 0	80, 002, 945. 7 5	-	

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末无暂时停牌等流通受限股票。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2025 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 4,613,130,407.06 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
092503007	25 进出清发 007	2025 年 7 月 1 日	99.74	900,000	89,766,215.04
09250409	25 农发清发 09	2025 年 7 月 1 日	100.22	7,899,000	791,620,019.12
112515121	25 民生银行 CD121	2025 年 7 月 1 日	99.74	6,000,000	598,467,750.58
160408	16 农发 08	2025 年 7 月 1 日	102.36	144,000	14,739,460.19
210203	21 国开 03	2025 年 7 月 1 日	102.27	300,000	30,681,602.93
230213	23 国开 13	2025 年 7 月 1 日	100.80	100,000	10,080,358.56
230405	23 农发 05	2025 年 7 月 1 日	101.26	1,600,000	162,022,384.69
230409	23 农发 09	2025 年 7 月 1 日	100.61	4,700,000	472,850,921.00
240213	24 国开 13	2025 年 7 月 1 日	101.00	1,500,000	151,493,870.15
240214	24 国开 14	2025 年 7 月 1 日	101.43	3,800,000	385,451,356.86
240309	24 进出 09	2025 年 7 月 1 日	101.21	500,000	50,607,383.52
250201	25 国开 01	2025 年 7 月 1 日	100.31	400,000	40,123,966.04
250206	25 国开 06	2025 年 7 月 1 日	100.43	1,100,000	110,473,617.37
250214	25 国开 14	2025 年 7 月 1 日	100.06	3,000,000	300,185,948.19
250411	25 农发 11	2025 年 7 月 1 日	100.54	1,000,000	100,535,579.96
112402077	24 工商银行 CD077	2025 年 7 月 3 日	99.89	2,000,000	199,774,290.79
112403193	24 农业银行 CD193	2025 年 7 月 3 日	99.86	1,000,000	99,857,170.34
112403250	24 农业银行 CD250	2025 年 7 月 3 日	99.88	1,000,000	99,876,567.94
112417139	24 光大银行 CD139	2025 年 7 月 3 日	99.89	3,000,000	299,676,903.01

112515133	25 民生银行 CD133	2025 年 7 月 3 日	99.26	3,000,000	297,768,353.46
112515102	25 民生银行 CD102	2025 年 7 月 4 日	99.86	6,000,000	599,163,362.44
合计				48,943,000	4,905,217,082.18

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无因交易所市场债券正回购交易而抵押的债券。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无因参与转融通证券出借业务而出借的证券。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本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，战略与产品研发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。

#### 6.4.13.2 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人交通银行，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%，且本基金与由基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，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。

#### 6.4.13.2.1 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 2025年6月30日	上年度末 2024年12月31日
A-1	20,013,742.47	50,084,471.24
A-1 以下	-	-
未评级	2,590,825,495.71	1,557,902,001.80
合计	2,610,839,238.18	1,607,986,473.04

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。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 6.4.13.2.3 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 2025年6月30日	上年度末 2024年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	15,131,477,600.97	16,766,346,838.27
合计	15,131,477,600.97	16,766,346,838.27

注：本基金持有同业存单的主体评级均为 AA+及以上评级。

#### 6.4.13.2.4 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 2025年6月30日	上年度末 2024年12月31日
AAA	111,722,583.02	377,912,304.66
AAA 以下	-	-
未评级	2,543,908,534.63	2,943,207,657.83
合计	2,655,631,117.65	3,321,119,962.49

注：未评级债券为国债、央行票据及政策性金融债等无信用评级债券。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

#### 6.4.13.3 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。

##### 6.4.13.3.1 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》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，并严格遵守基金管理人流动性相关交易限制。

本基金主要投资于基金合同约定的具有良好流动性的金融工具，基金管理人对流动性指标进行持续的监测和分析，定期开展压力测试，评估在不同的压力情境下资产变现情况的变化。

基金管理人持续监测本基金开放期内的赎回情况，当市场环境或投资者结构发生变化时，及时调整投资组合资产结构及比例，保持基金资产可变现规模和期限与负债赎回规模和期限的匹配。

同时，针对兑付赎回资金的流动性风险，基金管理人在基金合同中约定了巨额赎回条款，制定了发生巨额赎回时资金的处理模式，控制因开放模式而产生的流动性风险。

#### 6.4.13.4 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。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。

###### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025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						
货币资金	4,733,137,758.97	200,244,389.00	-	-		4,933,382,147.97

结算备付金	-	-	-	-	-	-
存出保证金	30,705.67	-	-	-	-	30,705.67
交易性金融资产	16,951,661,513.79	3,446,286,443.01	-	-	-	20,397,947,956.80
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	6,705,932,282.60	-	-	-	-	6,705,932,282.60
债权投资	-	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	184,899.23	184,899.23
应收清算款	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-
资产总计	28,390,762,261.03	3,646,530,832.01	-	-	184,899.23	32,037,477,992.27
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	3,555,268.54	3,555,268.54
应付托管费	-	-	-	-	1,185,089.51	1,185,089.51
应付清算款	-	-	-	-	40,493,796.71	40,493,796.71
卖出回购金融资产款	4,613,130,407.06	-	-	-	-	4,613,130,407.06
应付销售服务费	-	-	-	-	276,424.06	276,424.06
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	1,145,053.24	1,145,053.24
应交税费	-	-	-	-	102,366.36	102,366.36
其他负债	-	-	-	-	489,183.97	489,183.97
负债总计	4,613,130,407.06	-	-	-	47,247,182.39	4,660,377,589.45
利率敏感度缺口	23,777,631,853.97	3,646,530,832.01	-	-	47,062,283.16	27,377,100,402.82
上年度末 2024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						
货币资金	2,366,635,691.65	50,005,333.34	-	-	-	2,416,641,024.99
结算备付金	4,019,860.23	-	-	-	-	4,019,860.23
存出保证金	69,113.18	-	-	-	-	69,113.18
交易性金融资产	19,590,686,253.24	2,104,767,020.56	-	-	-	21,695,453,273.80
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-
买入返售金	8,943,179,124.35	-	-	-	-	8,943,179,124.35

融资资产						
债权投资	-	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	21,083,473.00	21,083,473.00
应收清算款	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-
资产总计	30,904,590,042.65	2,154,772,353.90	-	-	21,083,473.00	33,080,445,869.55
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	-	-
应付管理人 报酬	-	-	-	-	3,216,243.10	3,216,243.10
应付托管费	-	-	-	-	1,072,081.01	1,072,081.01
应付清算款	-	-	-	-	-	-
卖出回购金 融资产款	4,536,686,626.74	-	-	-	-	4,536,686,626.74
应付销售服 务费	-	-	-	-	262,821.01	262,821.01
应付投资顾 问费	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	1,663,290.94	1,663,290.94
应交税费	-	-	-	-	164,604.00	164,604.00
其他负债	-	-	-	-	616,213.27	616,213.27
负债总计	4,536,686,626.74	-	-	-	6,995,253.33	4,543,681,880.07
利率敏感度 缺口	26,367,903,415.91	2,154,772,353.90	-	-	14,088,219.67	28,536,763,989.48

注：本基金根据所持有资产和负债的按摊余成本法确定的公允价值，按合约规定的重新定价日及剩余到期日中的孰早者进行分类。

#### 6.4.13.4.1.2 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（2025年6月30日）	上年度末（2024年12月 31日）
	市场利率上升 27 个基点	-17,434,689.68	-17,026,752.18
	市场利率下降 27 个基点	17,434,689.68	17,026,752.18

#### 6.4.13.4.2 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。

### 6.4.13.4.3 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。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险的敏感性分析

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。

### 6.4.14 公允价值

#### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

#### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

##### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2025年6月30日	上年度末 2024年12月31日
第一层次	-	-
第二层次	20,397,947,956.80	21,695,453,273.80
第三层次	-	-
合计	20,397,947,956.80	21,695,453,273.80

##### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，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，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次或第三层次。

##### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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	20,397,947,956.80	63.67
	其中：债券	20,397,947,956.80	63.67
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	6,705,932,282.60	20.93
	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	4,933,382,147.97	15.40
4	其他各项资产	215,604.90	0.00
5	合计	32,037,477,992.27	100.00

#### 7.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目		
1	报告期内债券回购融资余额		5.28
	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	4,613,130,407.06	16.85
	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%。

#### 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	89
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	89
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	50

### 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。

#### 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	44.83	17.00
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	3.06	-
2	30 天（含）—60 天	17.98	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	2.89	-
3	60 天（含）—90 天	7.57	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	0.33	-
4	90 天（含）—120 天	6.70	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	39.94	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		117.02	17.00

### 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

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。

#### 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	按实际利率计算的账面价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	2,745,113,501.56	10.03
	其中：政策性金融债	2,745,113,501.56	10.03
4	企业债券	70,861,752.75	0.26
5	企业短期融资券	2,389,620,528.78	8.73
6	中期票据	60,874,572.74	0.22
7	同业存单	15,131,477,600.97	55.27
8	其他	-	-
9	合计	20,397,947,956.80	74.51
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	1,718,617,627.11	6.28

## 7.6 期末按实际利率计算账面价值占基金资产净值比例大小排名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)	按实际利率计算的账面价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	09250409	25农发清发09	7,900,000	791,720,236.87	2.89
2	112515102	25民生银行CD102	6,000,000	599,163,362.44	2.19
3	112515121	25民生银行CD121	6,000,000	598,467,750.58	2.19
4	112510095	25兴业银行CD095	5,000,000	499,102,137.31	1.82
5	230409	23农发09	4,700,000	472,850,921.00	1.73
6	240214	24国开14	3,800,000	385,451,356.86	1.41
7	112515156	25民生银行CD156	3,500,000	347,255,554.00	1.27
8	012580753	25招商局SCP004	3,000,000	301,261,712.52	1.10
9	112417139	24光大银行CD139	3,010,000	300,675,826.02	1.10
10	250214	25国开14	3,000,000	300,185,948.19	1.10

## 7.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值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	0.0741%
报告期内偏离度的最低值	-0.0401%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0225%

### 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。

## 7.8 期末按实际利率计算的账面价值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。

## 7.9 投资组合报告附注

### 7.9.1 基金计价方法说明

本基金采用摊余成本法计价。

### 7.9.2 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，发行主体兴业银行股份有限公司于 2024 年 7 月 17 日收到国家金融监督管理总局福建监管局行政处罚信息公开表（闽金罚决字〔2024〕12 号），经查，兴业银行股份有限公司存在以下情况：一、未严格按照公布的收费价目名录收费；二、向小微企业贷款客户转嫁抵押评估费；三、企业划型管理不到位。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、第四十八条及相关审慎经营规则，以及《中华人民共和国商业银行法》第七十三条，国家金融监督管理总局福建监管局决定对兴业银行股份有限公司合计处以 190 万元罚款并对相关人员进行警告。

报告期内本基金投资的前十名证券中，发行主体国家开发银行于 2024 年 12 月 17 日收到国家金融监督管理总局北京监管局行政处罚信息公开表（京金罚决字〔2024〕43 号），经查，国家开发银行存在贷款支付管理不到位、向未取得行政许可的项目发放贷款的情况，因此，国家金融监督管理总局北京监管局决定对国家开发银行处以罚款 60 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。

### 7.9.3 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	30,705.67
2	应收清算款	-
3	应收利息	-
4	应收申购款	184,899.23
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	215,604.90

### 7.9.4 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。

## § 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	户均持有的基金份额	持有人结构	
			机构投资者	个人投资者

	(户)		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
长信长金通货币 A	71,283	5,154.91	123,548,821.96	33.62	243,908,539.89	66.38
长信长金通货币 B	96	281,342,581.44	27,008,887,818.54	100.00	0.00	0.00
长信长金通货币 C	112	6,640.22	0.00	0.00	743,704.79	100.00
长信长金通货币 D	2	5,758.82	0.00	0.00	11,517.64	100.00
合计	71,493	382,934.00	27,132,436,640.50	99.11	244,663,762.32	0.89

注：对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

## 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	银行类机构	1,335,427,089.69	4.88
2	银行类机构	1,306,563,604.96	4.77
3	银行类机构	1,239,538,527.97	4.53
4	银行类机构	1,222,751,238.96	4.47
5	银行类机构	1,115,752,830.34	4.08
6	银行类机构	1,113,372,881.03	4.07
7	银行类机构	1,017,217,304.05	3.72
8	银行类机构	917,655,369.02	3.35
9	银行类机构	807,119,976.34	2.95
10	银行类机构	801,863,479.34	2.93

## 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持有本基金	长信长金通货币 A	1,317,441.17	0.36
	长信长金通货币 B	0.00	0.00
	长信长金通货币 C	11,509.10	1.55
	长信长金通货币 D	11,517.64	100.00
	合计	1,340,467.91	0.00

注：对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

## 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	长信长金通货币 A	0~10

金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	长信长金通货币 B	0
	长信长金通货币 C	0
	长信长金通货币 D	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	长信长金通货币 A	0
	长信长金通货币 B	0
	长信长金通货币 C	0
	长信长金通货币 D	0
	合计	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	长信长金通货币 A	长信长金通货币 B	长信长金通货币 C	长信长金通货币 D
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	519,355,308.52	28,016,889,864.34	507,380.73	11,435.89
本报告期内基金总申购份额	790,720,350.61	38,741,587,136.08	1,218,001.41	81.75
减：本报告期内基金总赎回份额	942,618,297.28	39,749,589,181.88	981,677.35	-
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-	-
本报告期末基金份额总额	367,457,361.85	27,008,887,818.54	743,704.79	11,517.64

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金未召开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

### 10.2.1 基金管理人的重大人事变动

自 2025 年 1 月 24 日起，邓挺先生不再担任公司副总经理。

自 2025 年 4 月 18 日起，沈伟担任公司首席信息官。

上述重大人事变动情况，本基金管理人均已在规定信息披露媒介发布相关公告。

### 10.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

## 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

本报告期本基金未更换会计师事务所。

## 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

### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，基金管理人及其高级管理人员没有受监管部门稽查或处罚的情形。

### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

## 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	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-

国泰海通	2	-	-	-	-	-	-
国投证券	1	-	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-	-
开源证券	1	-	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-	-
麦高证券	1	-	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-	-
野村东方 国际证券	1	-	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-	-
中银国际 证券	1	-	-	-	-	-	-

注：1、本期租用证券公司交易单元的变更情况

本报告期内本基金租用麦高证券交易单元 1 个。

## 2、专用交易单元的选择标准和程序

根据中国证监会《公开募集证券投资基金管理费用管理规定》(中国证券监督管理委员会公告〔2024〕3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) 财务状况良好；
- 2) 经营行为规范；
- 3) 合规风控能力较强；
- 4) 交易能力较强；
- 5) 研究能力较强。

### (2) 选择程序：

依照证券公司专用交易单元的选择标准，拟定备选证券公司，并根据公司要求提交准入评估报告，经证券公司准入审核流程审批通过后，签订相关协议。公司定期对各证券公司提供的服务质量进行综合评价。依照评价结果选择基金证券交易专用交易单元。

3、当期周期为 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日，《公开募集证券投资基金管理费用管理规定》自 2024 年 7 月 1 日起施行以来，本公司严格遵循法规及公司内部制度要求，未发现存在不符合法规及制度要求的情况。

### 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	230,175,000.00	35.93	193,000,000.00	100.00	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国泰海通	410,390,530.00	64.07	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
麦高证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
野村东方 国际证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中银国际 证券	-	-	-	-	-	-

### 10.8 偏离度绝对值超过 0.5% 的情况

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	上证报、中国证监会电子	2025-1-4

	持有的停牌股票调整估值方法的公告	披露网站、公司网站	
2	长信基金管理有限责任公司关于增加旗下部分开放式基金转换业务的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2025-1-10
3	长信长金通货币市场基金 2024 年第 4 季度报告	中国证监会电子披露网站、公司网站	2025-1-22
4	长信基金管理有限责任公司旗下全部基金 2024 年第四季度报告提示性公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2025-1-22
5	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	中证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2025-1-22
6	长信基金管理有限责任公司关于基金行业高级管理人员变更公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2025-1-25
7	长信基金管理有限责任公司关于增加旗下部分开放式基金转换业务的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2025-3-21
8	长信长金通货币市场基金 2024 年年度报告	中国证监会电子披露网站、公司网站	2025-3-28
9	长信基金管理有限责任公司旗下全部基金 2024 年年度报告提示性公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2025-3-28
10	长信基金管理有限责任公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况(2024 年度)	中国证监会电子披露网站、公司网站	2025-3-31
11	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	中证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2025-3-31
12	长信基金管理有限责任公司关于基金行业高级管理人员变更公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2025-4-19
13	长信长金通货币市场基金 2025 年第 1 季度报告	中国证监会电子披露网站、公司网站	2025-4-22
14	长信基金管理有限责任公司旗下全部基金 2025 年第一季度报告提示性公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2025-4-22
15	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	中证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2025-4-25
16	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分	上证报、中国证监会电子	2025-4-26

	基金参加招商银行费率优惠活动的公告	披露网站、公司网站	
17	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	中证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2025-5-27
18	长信基金管理有限责任公司关于旗下基金持有的停牌股票调整估值方法的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2025-6-6
19	长信长金通货币市场基金更新的招募说明书（2025 年第【1】号）及基金产品资料概要（更新）	中国证监会电子披露网站、公司网站	2025-6-30

## § 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

本基金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

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、《长信长金通货币市场基金基金合同》；
- 3、《长信长金通货币市场基金招募说明书》；
- 4、《长信长金通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：<https://www.cxfund.com.cn>。

长信基金管理有限责任公司

2025 年 8 月 29 日