

# 长安货币市场证券投资基金

## 2020 年中期报告

2020 年 06 月 30 日

基金管理人:长安基金管理有限公司

基金托管人:广发银行股份有限公司

送出日期:2020 年 08 月 31 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。

基金托管人广发银行股份有限公司（以下简称：广发银行）根据本基金合同规定，于2020年8月28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，投资者在做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会计师事务所审计。

本报告期自2020年01月01日起至2020年06月30日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
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	7
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	8
§4 管理人报告	11
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合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
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	14
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	15
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	15
§6 中期财务会计报告(未经审计)	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	17
6.3 所有者权益(基金净值)变动表	18
6.4 报表附注	20
§7 投资组合报告	46
7.1 期末基金资产组合情况	47
7.2 债券回购融资情况	47
7.3 基金投资组合平均剩余期限	47
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	48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	48
7.6 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	49
7.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离	50
7.8 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	50
7.9 投资组合报告附注	50
§8 基金份额持有人信息	51
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	51
8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况	51
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	52
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	52
§9 开放式基金份额变动	52

§10 重大事件揭示.....	53
10.1 基金份额持有人大会决议.....	53
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.....	53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	53
10.4 基金投资策略的改变.....	53
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	53
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.....	53
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	53
10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况.....	55
10.9 其他重大事件.....	55
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	56
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.....	56
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	57
§12 备查文件目录.....	57
12.1 备查文件目录.....	57
12.2 存放地点.....	57
12.3 查阅方式.....	57

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	长安货币市场证券投资基金	
基金简称	长安货币	
基金主代码	740601	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013年01月25日	
基金管理人	长安基金管理有限公司	
基金托管人	广发银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,074,322,993.39份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	长安货币A	长安货币B
下属分级基金的交易代码	740601	740602
报告期末下属分级基金的份额总额	33,864,409.13份	1,040,458,584.26份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在保持基金资产的安全性和流动性的前提下，通过主动式管理，力求获得超过基金业绩比较基准的稳定回报。
投资策略	<p>1、整体配置策略</p> <p>通过全面研究经济运行状况，预测货币政策、财政政策等政府宏观经济政策取向，分析资本市场资金供给状况的变动趋势，形成对市场利率水平变动趋势的判断。在此基础上，根据各类别资产的流动性、收益性和信用水平，决定各类资产的配置比例和期限匹配量。</p> <p>2、久期策略</p> <p>组合久期是反映利率风险的重要指标，在对市场利率水平变化趋势预测的前提下，制定组合的目标久期。预测利率将进入下降通道时，基金管理人将通过提高组合的久期，以最大程度获取债券价格上升带来的资本利得；预测市场利率将进入上升通道时，本基</p>

	<p>金将缩短组合久期,降低债券收益率上升带来的风险,并增加再投资收益。</p> <p>3、个券选择策略</p> <p>本基金将优先考虑安全性因素,选择高信用等级的债券品种进行投资。在个券选择上,本基金将在整体配置策略和久期策略的基础上,对影响个别债券定价的主要因素,包括信用等级、流动性、市场供求、票息及付息频率、税赋等因素进行分析,选择具有良好投资价值的债券品种进行投资。</p> <p>4、套利策略</p> <p>套利策略主要包括两方面:(1)跨市场套利。由于其中的投资群体、交易方式等市场要素不同,使得交易所市场和银行间市场的资金面、短期利率期限结构、流动性都存在着一定的差别。本基金将在充分论证套利机会可行性的基础上,寻找合理的介入时机,进行跨市场套利操作。(2)跨品种套利。由于投资群体存在一定的差异性,对期限相近的交易品种同样可能因为存在流动性、税收等市场因素的影响出现内在价值明显偏离的情况。本基金将在保证高流动性的基础上进行跨品种套利操作,以增加超额收益。</p> <p>5、息差策略</p> <p>息差策略是指利用市场回购利率低于债券收益率的情形,通过正回购将所获得资金投资于债券的策略。市场回购利率往往低于相对较长期限债券的收益率,为息差交易提供了机会。本基金充分考虑市场回购资金利率与债券收益率之间的关系,选择适当的杠杆比率,谨慎实施息差策略,以提高投资组合收益水平。</p> <p>6、现金流管理策略</p> <p>本基金将根据对市场资金面分析以及对申购赎回变化的动态预测,通过回购的滚动操作和银行存款、债券品种的期限结构搭配,动态调整基金的现金流,在保持充分流动性的基础上争取较高收益。</p>
业绩比较基准	7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的低风险品种,其预期收益和风险均低于债券型基金、

	混合型基金及股票型基金。
--	--------------

## 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		长安基金管理有限公司	广发银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李永波	李今
	联系电话	021-20329700	010-65169498
	电子邮箱	service@changanfunds.com	lijin@cgbchina.com.cn
客户服务电话		400-820-9688	4008308003
传真		021-50598018	010-65169555
注册地址		上海市虹口区丰镇路806号3幢371室	广东省广州市越秀区东风东路713号
办公地址		上海市浦东芳甸路1088号紫竹大厦16楼	北京市西城区菜市口大街1号院2号楼信托大厦
邮政编码		201204	100053
法定代表人		万跃楠	尹兆君

## 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	<a href="http://www.changanfunds.com">http://www.changanfunds.com</a>
基金中期报告备置地点	上海市浦东芳甸路1088号紫竹大厦16楼

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	长安基金管理有限公司	上海市浦东新区芳甸路1088号紫竹国际大厦16层

## § 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(2020年01月01日-2020年06月30日)	
	长安货币A	长安货币B
本期已实现收益	306,240.31	11,257,252.31
本期利润	306,240.31	11,257,252.31
本期净值收益率	0.8884%	1.0089%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020年06月30日)	
期末基金资产净值	33,864,409.13	1,040,458,584.26
期末基金份额净值	1.000	1.000
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020年06月30日)	
累计净值收益率	28.0784%	30.3924%

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、基金收益分配按月结转份额。

## 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

长安货币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	0.1126%	0.0004%	0.1125%	0.0000%	0.0001%	0.0004%
过去三个月	0.3544%	0.0050%	0.3413%	0.0000%	0.0131%	0.0050%
过去六个月	0.8884%	0.0037%	0.6825%	0.0000%	0.2059%	0.0037%
过去一年	1.9770%	0.0027%	1.3725%	0.0000%	0.6045%	0.0027%



过去三年	8.7460%	0.0031%	4.1100%	0.0000%	4.636 0%	0.003 1%
过去五年	15.0896%	0.0035%	6.8513%	0.0000%	8.238 3%	0.003 5%
自基金合同 生效起至今	28.0784%	0.0050%	10.1775%	0.0000%	17.900 9%	0.005 0%

本基金的业绩比较基准为：同期七天通知存款利率（税后）。

长安货币B

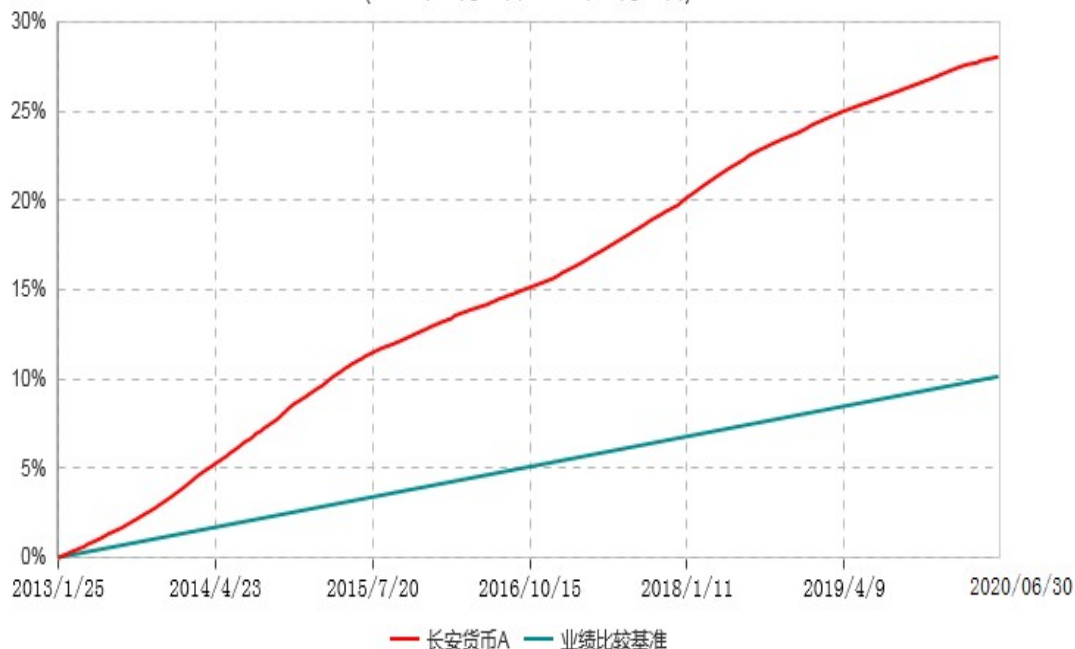
阶段	份额净值 收益率①	份额净值 收益率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去一个月	0.1324%	0.0004%	0.1125%	0.0000%	0.019 9%	0.000 4%
过去三个月	0.4143%	0.0050%	0.3413%	0.0000%	0.073 0%	0.005 0%
过去六个月	1.0089%	0.0037%	0.6825%	0.0000%	0.326 4%	0.003 7%
过去一年	2.2224%	0.0027%	1.3725%	0.0000%	0.849 9%	0.002 7%
过去三年	9.5320%	0.0031%	4.1100%	0.0000%	5.422 0%	0.003 1%
过去五年	16.4896%	0.0035%	6.8513%	0.0000%	9.638 3%	0.003 5%
自基金合同 生效起至今	30.3924%	0.0050%	10.1775%	0.0000%	20.214 9%	0.005 0%

本基金的业绩比较基准为：同期七天通知存款利率（税后）。

### 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

长安货币A累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

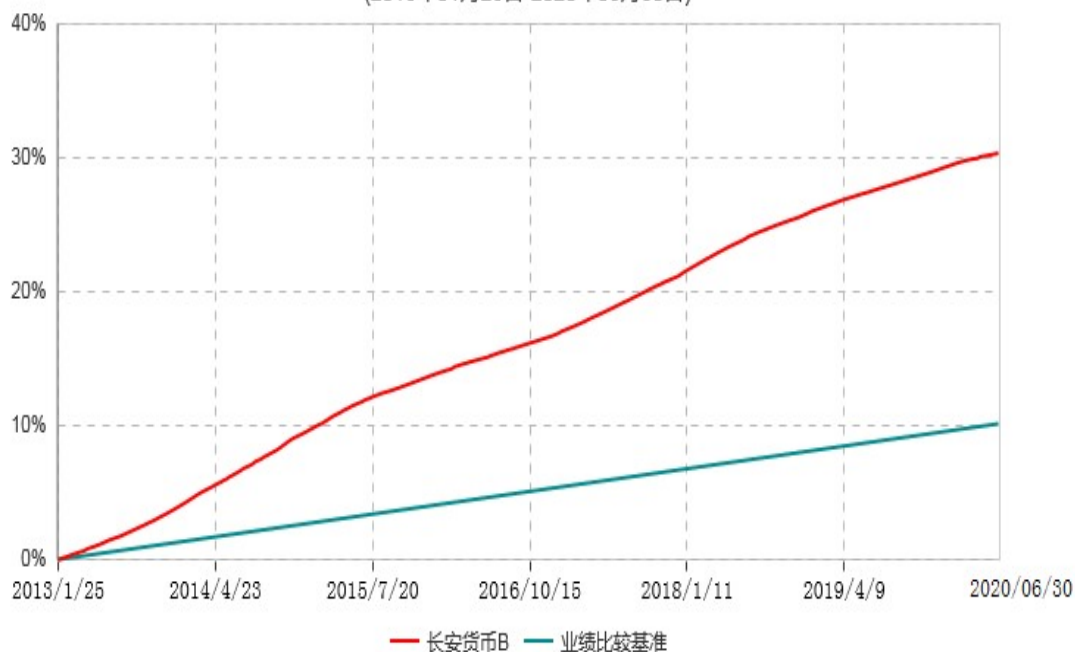
(2013年01月25日-2020年06月30日)



本基金的收益分配是按月结转份额。按基金合同规定，本基金自基金合同生效起 6 个月为建仓期，截止到建仓期结束时，本基金的各项投资组合比例已符合基金合同的相关规定。图示日期为 2013 年 1 月 25 日至 2020 年 06 月 30 日。

长安货币B累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2013年01月25日-2020年06月30日)



本基金的收益分配是按月结转份额。按基金合同规定，本基金自基金合同生效起 6 个月为建仓期，截止到建仓期结束时，本基金的各项投资组合比例已符合基金合同的相关规定。图示日期为 2013 年 1 月 25 日至 2020 年 06 月 30 日。

## § 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

长安基金管理有限公司成立于2011年9月5日，公司的股东分别为：长安国际信托股份有限公司、杭州景林投资管理合伙企业（有限合伙）、上海恒嘉美联发展有限公司、五星控股集团有限公司、兵器装备集团财务有限责任公司。截至2020年6月30日，本基金管理人共管理长安宏观策略混合型证券投资基金、长安沪深300非周期行业指数证券投资基金、长安货币市场证券投资基金、长安产业精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、长安鑫利优选灵活配置混合型证券投资基金、长安鑫益增强混合型证券投资基金、长安泓泽纯债债券型证券投资基金、长安鑫富领先灵活配置混合型证券投资基金、长安泓源纯债债券型证券投资基金、长安泓沅中短债债券型证券投资基金、长安鑫旺价值灵活配置混合型证券投资基金、长安鑫兴灵活配置混合型证券投资基金、长安裕盛灵活配置混合型证券投资基金、长安裕泰灵活配置混合型证券投资基金、长安鑫禧灵活配置混合型证券投资基金、长安裕腾灵活配置混合型证券投资基金、长安泓润纯债债券型证券投资基金、长安裕隆灵活配置混合型证券投资基金、长安鑫盈灵活配置混合型证券投资基金等19只证券投资基金。

#### 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		
孟楠	本基金的基金经理	2019-09-19	-	7年	曾任东证融汇证券资产管理有限公司（原东北证券股份有限公司上海分公司）投研助理、投资经理助理及投资主办等职。现任长安基金管理有限公司

					基金投资部基金经理。
--	--	--	--	--	------------

- 1、任职日期和离任日期均指公司做出决定后正式对外公告之日；
- 2、证券从业的含义遵从行业协会关于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

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金运作管理办法》、基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在认真控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

#### 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

本基金管理人树立价值投资理念，设置合理的组织架构和科学的投资决策体系，确保投资、研究、交易各个环节的独立性。同时，建立健全公司适用的投资对象备选库和交易对手备选库，共享研究成果，在确保投资组合间的信息隔离与保密的情况下，保证建立信息公开、资源共享的公平投资管理环境。

公司建立了专门的公平交易制度，并在交易系统中采用公平交易模块，保证公平交易的严格执行。对异常交易的监控包括事前、事中和事后三个环节，并经过严格的报告和审批程序，防范和控制异常交易。报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《长安基金管理有限公司公平交易制度》的规定。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

#### 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

2020年上半年，对债券市场来说是波澜壮阔的半年。1月20日，公共卫生事件的突发超出预期，债券利率开启下行趋势。受到全球性公共卫生事件爆发的影响，海外央行普遍采取超常规的宽松措施，国内央行货币政策也明显宽松，多次降准、降息、调降超额存款准备金利率。资金的泛滥式宽松使得利率债收益率从1月20日到4月中下旬走出了一波单边下行的牛市行情，各期限收益率均推向历史新低，利率曲线陡峭化下移。1月1日到4月30日，1年期国债收益率下行124bp，5年期国债收益率下行117bp，10年期国债收益率下行72.5bp。进入5月，国内疫情防控态势明显好转，市场的关注重心逐渐由公共卫生事件的发展情况转移到基本面的恢复情况和央行宽松政策的持续情况。经济数据

和金融数据在5月均出现明显好转，市场对经济反弹信心有所恢复，同时利率债供给压力明显加大，专项债放量带动当月地方债供给规模大幅增加，汇率一度逼近7.2%的重要关口。种种因素作用下，央行出于防控金融风险 and 资金空转的考虑，货币政策开始实质性收紧，从“饱和式宽松”回购“常态化操作”，利率中枢上移向OMO利率2.2%靠拢。这基本逆转了市场前期对央行加码货币政策的预期，经济基本面与货币政策对债市均不利，利率债市场快速调整。从4月30日到6月30日，1年期国债收益率上行107bp，5年期国债收益率上行79bp，10年期国债收益率上行33bp，收益率曲线平坦化上移，回吐了前期涨幅。

信用债市场方面，整体走势基本与利率债保持一致，只是波动幅度相对较小，信用利差呈现先阔后窄行情。3月开始，受到中短期利率债继续下行的影响，信用债出现一定程度滞涨，信用利差被动走阔。而5月开始中短期利率债收益率出现大幅下跌，信用债由于票息因素表现出一定程度的抗跌属性，信用利差开始被动收窄。报告期内，前4个月由于资金面的极度宽松以及央行不断下调公开市场利率，整体债券市场利率中枢快速下移，货币基金投资收益受到明显冲击。后随着货币政策回归常态化操作，基金收益有所上行。在策略上以配置高评级同业存单、中短期存款、回购几大类主要配置资产为主。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末长安货币A基金份额净值为1.000元，本报告期内，该类基金份额净值收益率为0.8884%，同期业绩比较基准收益率为0.6825%；截至报告期末长安货币B基金份额净值为1.000元，本报告期内，该类基金份额净值收益率为1.0089%，同期业绩比较基准收益率为0.6825%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

海外市场方面，欧美经济陆续复工，可能也是避免经济崩溃的无奈选择，但部分经济体复工后新增病例又创新高，也会拉长整体抗疫的时间，而新兴市场国家疫情仍在蔓延，经济复苏道阻且艰，依然需要时间。海外市场对中国进口需求的恢复也会相对缓慢，中间甚至可能会反复，外需存在不确定性。

国内市场方面，经济逐步恢复至正轨可能是下半年经济的主线逻辑。3月以来随着生产端的复工复产带来了经济动能初步复苏，而随着防疫措施逐步降级或取消，此前由于防疫措施而受到抑制的需求适当释放，带动了经济恢复。6月整体经济数据向好明显，超出市场预期。

财政政策方面，今年受疫情影响，我国财政收支状况一度承压。预计下半年财政政策将更加积极有为。财政部已提前下达2020年部分新增地方政府专项债券，同时陆续发行抗疫特别国债1万亿元。随着国内复工复产持续推进，预计财政收入将有所提升，但

在目前海外疫情发展仍不明朗和减税政策的双重影响下，将维持负增长局面。财政支出方面，《政府工作报告》中指出，2020年财政赤字规模比去年增加1万亿元，预计下半年财政支出将大幅增加，保证脱贫攻坚和基本民生领域的建设。仍需关注后续债券供给情况。

货币政策方面，目前来看进入了观察期，央行定力十足，但在实体经济和就业没有完全复原之前，货币政策大概率不会进入方向性转变，而是维持目前的宽松态势不变。

利率债方面，后市大概率以震荡为主。虽然经济基本面确定性复苏，但斜率可能难超预期，就业也未见明显改善，大概率会围着市场消息和资金面变化上下波动；中期随着基本面和货币政策逐渐明朗再有所调整。

信用债方面，市场信用分层现象依旧，高等级信用债各期限收益率位于低位，配置价值不足，一旦市场反转安全边际有限，短久期的中低评级信用债票息收益目前看更为稳妥。

综合考虑现有的宏观经济状况、政策方向，基于DR007利率中枢已经回归政策利率，投资价值提升，这一环境有利于货币基金市场。后续在策略上我们将继续重点关注高评级同业存单、高评级高流动性现券、中短期存款、回购几大类主要配置资产，紧跟市场趋势，适时调整杠杆和久期。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人制订了健全、有效的估值政策和程序，清算登记部按照管理层批准后的估值政策进行估值。对于在交易所上市的证券(除固定收益品种外)，采用交易所发布的行情信息来估值。对本基金所持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所和银行间上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外)采用第三方估值机构提供的价格进行估值。除了投资总监外，其他基金经理不参与估值政策的决策。但是对于非活跃投资品种，基金经理可以提供估值建议。上述参与估值流程各方之间无任何重大利益冲突。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金在本报告期进行了6次基金收益集中支付并结转为基金份额，分别为2020年2月3日，2020年2月25日，2020年3月25日，2020年4月27日，2020年5月25日，2020年6月29日。累计分配收益10,949,577.22元，利润分配金额、方式等符合相关法规和本基金基金合同的规定。

#### 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

本基金无连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元情形。

## § 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，广发银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对长安货币市场证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

### 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，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作方面进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

### 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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

## § 6 中期财务会计报告(未经审计)

### 6.1 资产负债表

会计主体：长安货币市场证券投资基金

报告截止日：2020年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020年06月30日	上年度末 2019年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	15,675,167.75	390,940,043.18
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	782,896,017.74	657,551,176.89
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-

债券投资		782,896,017.74	657,551,176.89
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	210,821,276.24	170,000,575.00
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	1,916,144.42	6,685,795.59
应收股利		-	-
应收申购款		86,031,903.00	129,714.28
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,097,340,509.15	1,225,307,304.94
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2020年06月30日</b>	<b>上年度末 2019年12月31日</b>
<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		16,909,871.54	99,909,730.13
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		150,000.00	-
应付管理人报酬		278,148.92	275,741.98
应付托管费		46,358.16	45,957.01
应付销售服务费		17,009.52	16,824.31
应付交易费用	6.4.7.7	24,911.60	13,237.95
应交税费		5,399,344.68	5,399,637.86
应付利息		2,491.23	8,072.99
应付利润		95,844.75	525,929.10
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	93,535.36	179,000.00



负债合计		23,017,515.76	106,374,131.33
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	1,074,322,993.39	1,118,933,173.61
未分配利润	6.4.7.10	-	-
所有者权益合计		1,074,322,993.39	1,118,933,173.61
负债和所有者权益总计		1,097,340,509.15	1,225,307,304.94

报告截止日2020年6月30日，基金份额总额1,074,322,993.39份。其中A类基金份额为33,864,409.13份，B类基金份额为1,040,458,584.26份。

## 6.2 利润表

会计主体：长安货币市场证券投资基金

本报告期：2020年01月01日至2020年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期2020年01月01日至2020年06月30日	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年06月30日
<b>一、收入</b>		13,911,912.08	85,797,842.76
1. 利息收入		13,908,125.87	85,468,528.31
其中：存款利息收入	6.4.7.11	3,232,909.12	16,968,257.07
债券利息收入		7,358,213.49	49,462,916.94
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		3,317,003.26	19,037,354.30
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		3,786.21	329,314.45
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-	-
基金投资收益	6.4.7.13	-	-
债券投资收益	6.4.7.14	3,786.21	329,314.45

资产支持证券投资收益	6.4.7.14.3	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-	-
股利收益	6.4.7.17	-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-	-
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	-	-
<b>减：二、费用</b>		2,348,419.46	15,516,990.66
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,720,603.22	8,959,426.68
2. 托管费	6.4.10.2.2	286,767.16	2,714,977.73
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	99,584.42	349,310.32
4. 交易费用	6.4.7.20	-	250.00
5. 利息支出		135,437.78	3,384,443.16
其中：卖出回购金融资产支出		135,437.78	3,384,443.16
6. 税金及附加		2,891.52	9,663.79
7. 其他费用	6.4.7.21	103,135.36	98,918.98
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		11,563,492.62	70,280,852.10
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		11,563,492.62	70,280,852.10

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长安货币市场证券投资基金

本报告期：2020年01月01日至2020年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2020年01月01日至2020年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	1,118,933,173.61	-	1,118,933,173.61
二、本期经营活动产 生的基金净值变动 数(本期利润)	-	11,563,492.62	11,563,492.62
三、本期基金份额交 易产生的基金净值 变动数(净值减少以 “-”号填列)	-44,610,180.22	-	-44,610,180.22
其中：1. 基金申购款	1,898,604,507.54	-	1,898,604,507.54
2. 基金赎回款	-1,943,214,687.76	-	-1,943,214,687.76
四、本期向基金份额 持有人分配利润产 生的基金净值变动 (净值减少以“-” 号填列)	-	-11,563,492.62	-11,563,492.62
五、期末所有者权益 (基金净值)	1,074,322,993.39	-	1,074,322,993.39
项 目	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	6,542,720,626.79	-	6,542,720,626.79
二、本期经营活动产 生的基金净值变动 数(本期利润)	-	70,280,852.10	70,280,852.10
三、本期基金份额交 易产生的基金净值	-4,120,179,450.88	-	-4,120,179,450.88

变动数(净值减少以“-”号填列)			
其中: 1. 基金申购款	9,144,354,473.49	-	9,144,354,473.49
2. 基金赎回款	-13,264,533,924.37	-	-13,264,533,924.37
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-70,280,852.10	-70,280,852.10
五、期末所有者权益(基金净值)	2,422,541,175.91	-	2,422,541,175.91

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:

袁丹旭

吴纓

欧鹏

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

长安货币市场证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)《关于核准长安货币市场证券投资基金募集的批复》(证监许可[2012]1589号文)的批准,由长安基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《长安货币市场证券投资基金基金合同》发售,基金合同于2013年1月25日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集规模为573,358,755.50份基金份额。本基金的基金管理人为长安基金管理有限公司,基金托管人为广发银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《长安货币市场证券投资基金基金合同》和《长安货币市场证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金的投资范围为:现金,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,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、资产支持证券和中国证监会、中国人民银行认可的其它具有良好流动性的货币市场工具。本基金业绩比较基准为:同期七天通知存款利率(税后)。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础。本财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则的要求,同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》以及中国证券投资基金业协会于2012年11月16日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求,真实、完整地反映了本基金2020年06月30日的财务状况、自2020年01月01日至2020年06月30日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 6.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为自2020年01月01日至2020年06月30日止。

##### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币,编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

##### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

本基金在初始确认时按取得资产或承担负债的目的,把金融资产和金融负债分为不同类别:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债、应收款项、持有至到期投资、可供出售金融资产和其他金融负债。本基金现无金融资产分类为持有至到期投资和可供出售金融资产。本基金现无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

本基金目前持有的债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

##### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时,于资产负债表内确认。

取得债券投资支付的价款中包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，应当单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。债券投资采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量，即债券投资按票面利率或商定利率每日计提应收利息，按实际利率法在其剩余期限内摊销其买入时的溢价或折价；同时于每一估值日计算影子价格，以避免债券投资的摊余成本与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离。应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

- 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；
- 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；
- 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，本基金终止确认该金融负债或其一部分。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

为了避免采用摊余成本法计算的基金资产净值与按其他可参考公允价值指标计算的基金资产净值发生重大偏离，从而对基金份额持有人的利益产生稀释和不公平的结果，基金管理人于每一估值日，采用金融工具的公允价值确定影子价格。

当影子定价确定的基金资产净值与摊余成本法计算的基金资产净值的负偏离度绝对值达到0.25%时，基金管理人应当在5个交易日内将负偏离度绝对值调整到0.25%以内。当正偏离度绝对值达到0.5%时，基金管理人应当暂停接受申购并在5个交易日内将正偏离度绝对值调整到0.5%以内。当负偏离度绝对值达到0.5%时，基金管理人应当使用风险准备金或者固有资金弥补潜在资产损失，将负偏离度绝对值控制在0.5%以内。当负偏离度绝对值连续两个交易日超过0.5%时，基金管理人应当采用公允价值估值方法对持有投资组合的账面价值进行调整，或者采取暂停接受所有赎回申请并终止基金合同进行财产清算等措施。

计算影子价格时按如下原则确定金融工具的公允价值：

存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除会计准则规定的情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。与上述金融工具相同，但具有不同特征的，以相

同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

对不存在活跃市场的金融工具，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整并确定公允价值。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

- 本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；
- 本基金计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额。每份基金份额面值为1.000元。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少，以及因类别调整而引起的A、B级基金份额之间的转换所产生的实收基金变动。

#### 6.4.4.8 收入/（损失）的确认和计量

债券投资收益于卖出交易日按卖出债券成交金额与其成本和应收利息的差额确认。

债券利息收入按债券投资的摊余成本与实际利率计算的金额扣除应由发行债券的企业代扣代缴的个人所得税（如适用）后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，逐日计提利息收入。

存款利息收入按存款本金与适用利率逐日计提。

买入返售金融资产收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额，在回购期内按实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的收入差异较小的可采用直线法。

#### 6.4.4.9 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

卖出回购金融资产利息支出按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额，在回购期内以实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的支出差异较小的可采用直线法。

本基金的其他费用如不影响估值日基金份额净值小数点后第四位，发生时直接计入基金损益；如果影响基金份额净值小数点后第四位的，应采用待摊或预提的方法，待摊或预提计入基金损益。

#### 6.4.4.10 基金的收益分配政策

本基金同一类别内的每份基金份额享有同等分配权。本基金收益分配方式为红利再投资，免收再投资的费用。“每日分配、按月支付”。本基金根据每日基金收益情况，以每万份基金已实现收益为基准，为投资人每日计算当日收益并分配，每月集中支付。投资人当日收益分配的计算保留到小数点后2位，小数点后第3位按去尾原则处理，因去尾形成的余额进行再次分配，直到分完为止。本基金根据每日收益情况，将当日收益全部分配，若当日已实现收益大于零时，为投资人记正收益；若当日已实现收益小于零时，为投资人记负收益；若当日已实现收益等于零时，当日投资人不记收益。本基金每日进行收益计算并分配时，每月累计收益支付方式只采用红利再投资(即红利转基金份额)方式，投资人可通过赎回基金份额获得现金收益；若投资人在每月累计收益支付时，其累计收益为正值，则为投资人增加相应的基金份额，其累计收益为负值，则缩减投资人基金份额。若投资人赎回基金份额时，其对应收益将立即结清；若收益为负值，则从投资人赎回基金款中扣除。当日申购的基金份额自下一个工作日起，享有基金的收益分配权益；当日赎回的基金份额自下一个工作日起，不享有基金的收益分配权益。法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

#### 6.4.4.11 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### 6.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：



在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本年度未发生重大会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本年度未发生重大会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本年度未发生重大会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

##### (1) 主要税项说明

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号文《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号文《财政部、国家税务总局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号文《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号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

(a) 证券投资基金管理人运用基金买卖债券的差价收入暂不征收企业所得税。

(b) 自2016年5月1日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税（以下称营改增）试点，建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人，纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。

2018年1月1日（含）以后，资管产品管理人（以下称管理人）运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，以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。对资管产品在2018年1月1日以前运营过程中发生的增值税应税行为，

未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

证券投资基金管理人运用基金买卖债券取得的金融商品转让收入免征增值税；对自国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。

(c) 对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

(d) 对基金在2018年1月1日（含）以后运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

(2) 应交税费 债券利息收入所得税

2019年12月31日 5,399,637.86元

2018年12月31日 5,418,064.01元

2017年12月31日 5,397,850.82元

该项系基金收到的债券发行人在支付债券利息时未代扣代缴的利息税部分。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020年06月30日
活期存款	675,167.75
定期存款	15,000,000.00
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	15,000,000.00
存款期限3个月以上	-
其他存款	-
合计	15,675,167.75

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末2020年06月30日			
		摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度(%)
债	交易所市	-	-	-	-

券	场				
	银行间市 场	782,896,017.74	782,831,500.00	-64,517.74	-0.0060
	合计	782,896,017.74	782,831,500.00	-64,517.74	-0.0060
资产支持证券		-	-	-	-
合计		782,896,017.74	782,831,500.00	-64,517.74	-0.0060

本基金的交易性金融资产均为采用摊余成本法摊余的债券投资成本。本基金管理人认为本基金债券投资的公允价值与摊余成本间的差异在合理范围内。

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

本基金于本年度与上年度可比期间均未持有任何衍生金融资产/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2020年06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	210,821,276.24	-
合计	210,821,276.24	-

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本年度及上年度可比期间均无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年06月30日
应收活期存款利息	241.15
应收定期存款利息	42,187.50
应收其他存款利息	-

应收结算备付金利息	-
应收债券利息	1,502,089.44
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	233,257.82
应收申购款利息	138,368.51
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	-
合计	1,916,144.42

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本年度及上年度可比期间均未持有其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020年06月30日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	24,911.60
合计	24,911.60

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年06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	-
预提费用-审计费	24,863.02
预提费用-信息披露费	59,672.34
预提费用-账户维护费	9,000.00
合计	93,535.36

### 6.4.7.9 实收基金

#### 6.4.7.9.1 长安货币A

金额单位：人民币元

项目 (长安货币A)	本期2020年01月01日至2020年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	37,756,607.49	37,756,607.49
本期申购	78,551,434.31	78,551,434.31
本期赎回(以“-”号填列)	-82,443,632.67	-82,443,632.67
本期末	33,864,409.13	33,864,409.13

#### 6.4.7.9.2 长安货币B

金额单位：人民币元

项目 (长安货币B)	本期2020年01月01日至2020年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	1,081,176,566.12	1,081,176,566.12
本期申购	1,820,053,073.23	1,820,053,073.23
本期赎回(以“-”号填列)	-1,860,771,055.09	-1,860,771,055.09
本期末	1,040,458,584.26	1,040,458,584.26

1、申购含红利再投资、转换入份额；赎回含转换出份额。

2、本基金于2013年1月4日至2013年1月23日募集，募集期间净认购资金人民币573,332,659.12元，认购资金在募集期间产生的利息人民币26,096.38元，募集的有效认购份额及利息结转的基金份额合计573,358,755.50份。

### 6.4.7.10 未分配利润

#### 6.4.7.10.1 长安货币A

单位：人民币元

项目 (长安货币A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	306,240.31	-	306,240.31
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	-306,240.31	-	-306,240.31
本期末	-	-	-

## 6.4.7.10.2 长安货币B

单位：人民币元

项目 (长安货币B)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	11,257,252.31	-	11,257,252.31
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	-11,257,252.31	-	-11,257,252.31
本期末	-	-	-

## 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2020年01月01日至2020年06月30日
活期存款利息收入	10,167.54
定期存款利息收入	3,222,698.63
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	42.95
其他	-
合计	3,232,909.12

## 6.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

本基金在本年度及上年度可比期间均无股票投资收益。

**6.4.7.13 基金投资收益**

本基金在本报告期及上年度可比期间均无基金投资收益。

**6.4.7.14 债券投资收益****6.4.7.14.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年06月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	3,786.21
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	3,786.21

**6.4.7.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年06月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	1,158,537,761.61
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	1,148,792,723.89
减：应收利息总额	9,741,251.51
买卖债券差价收入	3,786.21

**6.4.7.14.3 资产支持证券投资收益**

本基金在本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

**6.4.7.15 贵金属投资收益****6.4.7.15.1 贵金属投资收益——申购差价收入**

本基金在本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

**6.4.7.16 衍生工具收益**

本基金在本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益。

**6.4.7.17 股利收益**

本基金在本报告期及上年度可比期间均无股利收益。

**6.4.7.18 公允价值变动收益**

本基金在本报告期及上年度可比期间均无公允价值变动收益。

**6.4.7.19 其他收入**

本基金本报告期内及上年度可比期间均无其他收入。

**6.4.7.20 交易费用**

本基金在本报告期无交易费用。

**6.4.7.21 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年06月30日
审计费用	24,863.02
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
汇划手续费	0.00
帐户维护费	18,000.00
上清所账户查询费	600.00
合计	103,135.36

**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，本基金无需要在财务报表附注中说明的或有事项。

**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

本基金本报告期内不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。

##### 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
长安基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
广发银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
长安国际信托股份有限公司	基金管理人的股东
杭州景林投资管理合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
上海恒嘉美联发展有限公司	基金管理人的股东
五星控股集团有限公司	基金管理人的股东
兵器装备集团财务有限责任公司	基金管理人的股东
长安财富资产管理有限公司	基金管理人的子公司

上述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。并以一般交易价格为定价基础。

#### 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内均未通过关联方交易单元进行股票交易。

###### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内均未通过关联方交易单元进行权证交易。

###### 6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内均未通过关联方交易单元进行债券交易。

###### 6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

#### 6.4.10.1.5 基金交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内均未通过关联方交易单元进行基金交易。

#### 6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间内均无应支付给关联方的佣金。

### 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 2020年01月01日至2020年06月30日	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,720,603.22	8,959,426.68
其中：支付销售机构的客户维护费	13,754.69	112,248.11

1、支付基金管理人的基金管理人报酬按前一日基金资产净值0.33%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×0.33% / 当年天数。2019年7月1日起支付基金管理人的基金管理人报酬按前一日基金资产净值0.30%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×0.30% / 当年天数

2、客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年06月30日	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	286,767.16	2,714,977.73

支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值0.10%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×0.10% / 当年天数。2019年7月1日起支付基金托管人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 2020年01月01日至2020年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	长安货币A	长安货币B	合计
长安基金	19,850.97	55,311.58	75,162.55
广发银行	1,197.99	0.00	1,197.99
合计	21,048.96	55,311.58	76,360.54
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	长安货币A	长安货币B	合计
长安基金	49,066.84	256,786.19	305,853.03
广发银行	1,650.42	0.00	1,650.42
合计	50,717.26	256,786.19	307,503.45

长安货币A类支付销售机构的基金销售服务费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金销售服务费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数；

长安货币B类支付销售机构的基金销售服务费按前一日基金资产净值0.01%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金销售服务费=前一日基金资产净值×0.01%/当年天数；

## 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

单位：人民币元

银行间市场交易的各关	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年06月30日					
	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出

联方名称						
广发银行股份有限公司	-	49,817,048.35	-	-	-	-
广发银行股份有限公司	49,763,326.19	-	-	-	-	-
广发银行股份有限公司	-	-	-	-	452,000,000.00	26,253.15
广发银行股份有限公司	-	-	-	-	126,500,000.00	7,278.08
广发银行股份有限公司	-	-	-	-	150,000,000.00	30,821.92
广发银行股份有限公司	-	-	-	-	213,400,000.00	12,453.21
广发银行	-	-	-	-	106,000,000.00	6,969.86

股份 有限 公司						
广发 银行 股份 有限 公司	-	-	-	-	118,800,000. 00	7,974.25
广发 银行 股份 有限 公司	-	-	-	-	228,000,000. 00	16,366.0 3
广发 银行 股份 有限 公司	-	-	-	-	148,000,000. 00	11,353.4 2

本基金本报告期内未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均未与关联方进行转融通证券出借业务。

#### 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

长安货币A

份额单位：份

项目	本期 2020年01月01日至2020年06 月30日	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年06 月30日
报告期初持有的基金份额	0.00	0.00

报告期间申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%	0.00%

长安货币B

份额单位：份

项目	本期 2020年01月01日至2020年06 月30日	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年06 月30日
报告期初持有的基金份额	287,535,504.20	208,859,272.19
报告期间申购/买入总份额	107,786,775.21	42,635,436.25
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	128,200,000.00	55,200,000.00
报告期末持有的基金份额	267,122,279.41	196,294,708.44
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	24.86%	8.10%

基金管理人于本报告期内通过直销柜台申购本基金，根据基金合同规定，申购费为0元。以上申购份额包含红利再投资金额。

#### 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

长安货币B

关联方名称	本期末 2020年06月30日		上年度末 2019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
长安财富资产管理有限公司	186,629,887.05	17.37%	216,994,771.91	19.39%
长安国际信托股份有限公司	0.00	0.0000%	100,422,545.93	8.97%

以上关联方于本报告期内通过长安基金直销柜台申购本基金，申购手续费按照基金合同约定为0元。

#### 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 2020年01月01日至2020年06月30日		上年度可比期间 2019年01月01日至2019年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
广发银行股份有限公司	675,167.75	10,167.54	502,405.03	1,795,488.36

本基金通过“广发银行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的结算保证金，于2020年06月30日的相关余额为人民币元0.00元。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间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——按摊余成本法核算的货币市场基金

长安货币A

单位：人民币元

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
296,486.67	34,830.31	-25,076.67	306,240.31	-

长安货币B

单位：人民币元

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
10,653,090.55	1,009,169.44	-405,007.68	11,257,252.31	-

#### 6.4.12 期末（2020年06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

根据中国证监会相关规定，证券投资基金参与网下配售，可与发行人、承销商自主约定网下配售股票的持有期限并公开披露。持有期自公开发行的股票上市之日起计算。在持有期内的股票为流动受限制而不能自由转让的资产。证券投资基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期根据交易所相关规定执行。证券投资基金还可作为特定投资者，认购由中国证监会规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起在法规规定的限售期内不得转让。证券投资基金对上述非公开发行股票的减持还需根据交易所相关规定执行。

于2020年06月30日，本基金未持有因认购新发或增发证券而受上述规定约束的流通受限证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

于2020年06月30日，本基金未持有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2020年06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16,909,871.54元，是以以下债券作为质押。

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
112011073	20平安银行CDO	2020-07-01	98.32	178,000	17,500,960.00



	73				
合计				178,000	17,500,960.00

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2020年06月30日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券余额为0元，因此没有作为抵押的债券。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末没有参与转融通证券出借业务的证券。

### 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
- 市场风险

本基金管理人按照“健全、合理、制衡、独立”的原则，建立了合规与风险管理委员会（董事会层面）、督察长、监察稽核部和相关部门构成的全方位、多层级的合规风险管理架构。本基金管理人秉承全面风险管理的理念，将风险管理贯穿日常经营活动的整个过程，渗透到各个业务环节，覆盖所有部门和岗位，建立了集风险识别、风险测量、风险控制、风险评价、风险报告为一体的风险管理机制，全面、及时识别、分析和评估各类风险，有效防范日常经营和基金运作过程中可能面临的各种风险，最大限度地保护基金份额持有人的合法权益。

#### 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行广发银行，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%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，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 2020年06月30日	上年度末 2019年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	154,979,447.34	220,086,609.90
合计	154,979,447.34	220,086,609.90

未评级债券为国债、央行票据及政策性金融债等免评级债券及未有第三方机构评级的短期融资券。根据中国人民银行2006年3月29日发布的“银发[2006]95号”文《中国人民银行信用评级管理指导意见》，以及2006年11月21日发布的《信贷市场和银行间债券市场信用评级规范》等文件的有关规定，短期债券信用评级等级划分为四等六级，符号表示为：A-1、A-2、A-3、B、C、D。每一个信用等级均不进行微调。本基金本报告期末持有的按短期信用评级列示的债券如图列示。

#### 6.4.13.2.2 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 2020年06月30日	上年度末 2019年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	627,916,570.40	437,464,566.99
合计	627,916,570.40	437,464,566.99

#### 6.4.13.2.3 按长期信用评级列示的债券投资

未评级债券为国债、央行票据及政策性金融债等免评级债券。根据中国人民银行2006年3月29日发布的“银发[2006]95号”文《中国人民银行信用评级管理指导意见》，以及2006年11月21日发布的《信贷市场和银行间债券市场信用评级规范》等文件的有关规定，中长期债券信用等级划分成三等九级，分别用AAA、AA、A、BBB、BB、B、CCC、CC和C表示，其中，除AAA级、CCC级(含)以下等级外，每一个信用等级可用“+”、“-”符号进

行微调，表示略高或略低于本等级。本基金于本报告期末未持有按长期信用评级列示的债券。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险主要来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难和基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额。

本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种，因此均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求。本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日。

此外，针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的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。本基金的基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

##### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

报告期内，本基金主要投资于在银行间市场正常交易的债券、同业存单、逆回购以及银行存款等。基金组合资产中的主要投资标的属于《公开募集证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“流动性新规”）中定义的7个工作日可变现资产的范围，基金管理人每日对基金组合资产中的7个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估和测算，保证该基金每日净赎回申请不超过基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值。本基金主动投资于流动性新规中定义的流动性受限资产的市值不超过基金的资产净值的10%。报告期内本基金组合资产的流动性和变现能力较强，流动性风险较小。

#### 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

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金的基金管理人日常通过对持仓品种组合的久期分析等方法对上述利率风险进行管理。

下表统计了本基金面临的利率风险敞口。表中所示为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，并按合同约定的利率重新定价日或到期日孰早者进行分类：

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末2020年06月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
<b>资产</b>					
银行存款	15,675,167.75	-	-	-	15,675,167.75
交易性金融资产	782,896,017.74	-	-	-	782,896,017.74
买入返售金融资产	210,821,276.24	-	-	-	210,821,276.24
应收利息	-	-	-	1,916,144.42	1,916,144.42
应收申购款	-	-	-	86,031,903.00	86,031,903.00
资产总计	1,009,392,461.73	-	-	87,948,047.42	1,097,340,509.15
<b>负债</b>					
卖出回购金融资产款	16,909,871.54	-	-	-	16,909,871.54
应付赎回款	-	-	-	150,000.00	150,000.00
应付管理人报酬	-	-	-	278,148.92	278,148.92
应付托管费	-	-	-	46,358.16	46,358.16
应付销售服务费	-	-	-	17,009.52	17,009.52
应付交易费用	-	-	-	24,911.60	24,911.60
应交税费	-	-	-	5,399,344.68	5,399,344.68
应付利息	-	-	-	2,491.23	2,491.23
应付利润	-	-	-	95,844.75	95,844.75
其他负债	-	-	-	93,535.36	93,535.36
负债总计	16,909,871.54	-	-	6,107,644.22	23,017,515.76
利率敏感度缺口	992,482,590.19	-	-	81,840,403.20	1,074,322,993.39
上年度末2019年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
<b>资产</b>					
银行存款	390,940,043.18	-	-	-	390,940,043.18
交易性金融资产	657,551,176.89	-	-	-	657,551,176.89
买入返售金融资产	170,000,575.00	-	-	-	170,000,575.00
应收利息	-	-	-	6,685,795.59	6,685,795.59
应收申购款	-	-	-	129,714.28	129,714.28
资产总计	1,218,491,795.07	-	-	6,815,509.87	1,225,307,304.94
<b>负债</b>					
卖出回购金融资产款	99,909,730.13	-	-	-	99,909,730.13
应付管理人报酬	-	-	-	275,741.98	275,741.98
应付托管费	-	-	-	45,957.01	45,957.01
应付销售服务费	-	-	-	16,824.31	16,824.31
应付交易费用	-	-	-	13,237.95	13,237.95

应交税费	-	-	-	5,399,637.86	5,399,637.86
应付利息	-	-	-	8,072.99	8,072.99
应付利润	-	-	-	525,929.10	525,929.10
其他负债	-	-	-	179,000.00	179,000.00
负债总计	99,909,730.13	-	-	6,464,401.20	106,374,131.33
利率敏感度缺口	1,118,582,064.94	-	-	351,108.67	1,118,933,173.61

表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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 2020年06月30日	上年度末 2019年12月31日
		利率下降25个基点	292,571.98
利率上升25个基点	-292,118.29	-235,232.14	

假定所有期限的利率均以相同幅度变动25个基点，其他市场变量均不发生变化。

#### 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

其他价格风险主要是本基金所面临的市场价格风险。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，且以摊余成本进行后续计量，因此无重大其他价格风险。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020年06月30日		上年度末 2019年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)

交易性金融资产—股票投资	-	-	-	-
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	782,896,017.74	72.87	657,551,176.89	58.77
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	782,896,017.74	72.87	657,551,176.89	58.77

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (a) 以公允价值计量的金融工具

公允价值计量中的层级取决于对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值。三个层级的定义如下：

第一层级：相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价；

第二层级：直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除市场报价以外的有关资产或负债的输入值；

第三层级：以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

于2020年06月30日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第二层级的余额为782,896,017.74元，无属于第一，三层级的余额。

对于本基金投资的证券交易所上市的证券，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)、或属于限售期间等情况时，本基金将相应进行估值方法的变更。根据估值方法的变更，本基金综合考虑估值调整中采用的可观察与不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关证券公允价值的层级。

##### (b) 其他金融工具的公允价值(非以公允价值计量账面价值)

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之间无重大差异。

## § 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	782,896,017.74	71.34
	其中：债券	782,896,017.74	71.34
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	210,821,276.24	19.21
	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	15,675,167.75	1.43
4	其他各项资产	87,948,047.42	8.02
5	合计	1,097,340,509.15	100.00

## 7.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目	占基金资产净值比例 (%)	
1	报告期内债券回购融资余额	1.47	
	其中：买断式回购融资	0.00	
序号	项目	金额	占基金资产净值比例 (%)
2	报告期末债券回购融资余额	16,909,871.54	1.57
	其中：买断式回购融资	-	0.00

报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占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

在本报告期内未发生债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的情况。

## 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	45
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	66
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	39

### 报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

本报告期内未发生投资组合平均剩余期限超过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	36.90	1.57
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	-
2	30天(含)—60天	38.57	0.00
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	-
3	60天(含)—90天	11.12	0.00
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	-
4	90天(含)—120天	4.63	0.00
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	-
5	120天(含)—397天(含)	2.75	0.00
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	-
	合计	93.96	1.57

### 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

本报告期内未发生投资组合平均剩余存续期超过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	摊余成本	占基金资产净值比例
----	------	------	-----------



			(%)
1	国家债券	79,850,989.96	7.43
2	央行票据	-	-
3	金融债券	40,128,134.34	3.74
	其中：政策性金融债	40,128,134.34	3.74
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	35,000,323.04	3.26
6	中期票据	-	-
7	同业存单	627,916,570.40	58.45
8	其他	-	-
9	合计	782,896,017.74	72.87
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

#### 7.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	111906185	19交通银行CD185	900,000	89,964,057.49	8.37
2	112014049	20江苏银行CD049	500,000	49,951,362.50	4.65
3	111984004	19宁波银行CD157	500,000	49,928,567.83	4.65
4	111904062	19中国银行CD062	500,000	49,910,209.53	4.65
5	209922	20贴现国债22	500,000	49,880,353.36	4.64
6	111904073	19中国银行CD073	500,000	49,875,066.46	4.64

7	111912077	19北京银行CD077	500,000	49,838,555.63	4.64
8	111907159	19招商银行CD159	500,000	49,803,568.65	4.64
9	112006094	20交通银行CD094	500,000	49,774,598.91	4.63
10	112016105	20上海银行CD105	500,000	49,774,269.15	4.63

### 7.7 “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	0.1487%
报告期内偏离度的最低值	-0.0329%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0575%

上表中“偏离情况”根据报告期内各工作日数据计算。

#### 报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

本报告期内未发生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

本报告期内未发生正偏离度的绝对值达到0.5%的情况。

### 7.8 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。

### 7.9 投资组合报告附注

#### 7.9.1 基金计价方法说明

本基金计价采用摊余成本法，即计价对象以买入成本列示，按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内按照实际利率法每日计提收益。

本基金通过每日计算基金收益并分配的方式，使基金份额资产净值保持在人民币1.00元。

7.9.2 本基金本报告期内不存在投资的前十名证券的发行主体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	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	1,916,144.42
4	应收申购款	86,031,903.00
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	87,948,047.42

## § 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)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总 份额 比例	持有份额	占总份 额比例
长安 货币A	2,151	15,743.57	10,783,140.26	31.84%	23,081,268.87	68.16%
长安 货币B	13	80,035,275.71	1,040,458,584.26	100.00%	0.00	0.00%
合计	2,164	496,452.40	1,051,241,724.52	97.85%	23,081,268.87	2.15%

### 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	基金类机构	267,122,279.41	24.86%
2	基金类机构	186,629,887.05	17.37%
3	基金类机构	181,973,573.80	16.94%
4	证券类机构	103,361,497.63	9.62%
5	保险类机构	100,052,610.61	9.31%
6	证券类机构	86,000,000.00	8.01%
7	证券类机构	27,006,648.84	2.51%
8	证券类机构	20,085,629.90	1.87%
9	信托类机构	20,018,910.00	1.86%
10	信托类机构	20,011,378.73	1.86%

### 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	长安货币A	33,282.52	0.09%
	长安货币B	0.00	0.00%
	合计	33,282.52	0.00%

### 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、基金投资 和研究部门负责人持有本开放式 基金	长安货币A	0~10
	长安货币B	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基 金	长安货币A	0
	长安货币B	0
	合计	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

	长安货币A	长安货币B
--	-------	-------

基金合同生效日(2013年01月25日)基金份额总额	404,349,048.93	168,998,693.94
本报告期期初基金份额总额	37,756,607.49	1,081,176,566.12
本报告期基金总申购份额	78,551,434.31	1,820,053,073.23
减:本报告期基金总赎回份额	82,443,632.67	1,860,771,055.09
本报告期期末基金份额总额	33,864,409.13	1,040,458,584.26

总申购份额包含红利再投资、转换入份额,总赎回份额包含转换出份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内,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

2020年5月11日,徐小勇正式担任长安基金管理有限公司副总经理。

除此之外,本报告期内,基金管理人、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

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)(原“毕马威华振会计师事务所”)自本基金基金合同生效日起为本基金提供审计服务。

### 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

本报告期内,基金管理人、基金托管人其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

### 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	
东兴证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-

1、基金租用席位的选择标准是：

- (1) 资力雄厚，信誉良好；
- (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- (3) 经营行为规范，在最近一年内无重大违规经营行为；
- (4) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- (5) 公司具有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供具有相当质量的关于宏观经济面分析、行业发展趋势及证券市场走向、个股分析的研究报告以及丰富全面的信息服务；能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告。

选择程序是：根据对各券商提供的各项投资、研究服务情况的考评结果，符合席位券商标准的，由公司研究部提出席位券商的调整意见（调整名单及调整原因），并经公司批准。

2、在上述租用的券商交易单元中，本基金本期无新增和退租的券商交易单元。

#### 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		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	6,000,000.00	100.00%	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-

### 10.8 偏离度绝对值超过0.5%的情况

本报告期内未发生偏离度的绝对值达到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	关于旗下基金参加交通银行股份有限公司手机银行申购和定期定额投资手续费率优惠活动的公告	中国证券报	2020-01-02
2	740601_长安货币市场证券投资基金2019年第四季度报告	中国证券报	2020-01-18
3	740601_长安货币市场证券投资基金2019年年度报告	中国证券报	2020-03-31
4	关于旗下基金在上海挖财基金销售有限公司开通申购、赎回、基金转换业务以及定期定额投资业务并参与费率优惠活动的公告	中国证券报	2020-04-02
5	关于暂停泰诚财富基金销售（大连）有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证券报	2020-04-09
6	740601_长安货币市场证券投资基金2020年第一季度报告	中国证券报	2020-04-22
7	关于旗下基金在洪泰财富	中国证券报	2020-04-27

	（青岛）基金销售有限责任公司开通申购、赎回、基金转换业务以及定期定额投资业务并参与费率优惠活动的公告		
8	关于旗下基金在中信证券华南股份有限公司参与费率优惠活动的公告	中国证券报	2020-04-28
9	关于旗下基金在喜鹊财富基金销售有限公司开通申购、赎回、基金转换业务以及定期定额投资业务并参与费率优惠活动的公告	中国证券报	2020-05-08
10	长安基金管理有限公司副总经理徐小勇任职公告	中国证券报	2020-05-12
11	关于旗下基金在万联证券股份有限公司开通基金转换业务以及定期定额投资业务并参与费率优惠活动的公告	中国证券报	2020-05-18
12	关于旗下基金在和耕传承基金销售有限公司开通申购、赎回、基金转换业务以及定期定额投资业务并参与费率优惠活动的公告	中国证券报	2020-05-27
13	长安基金管理有限公司关于包商银行转让相关业务的提示性公告	中国证券报	2020-05-28
14	关于旗下基金2020年6月30日基金份额净值及基金份额累计净值的公告	中国证券报	2020-06-30

## § 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



投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2020/03/04-2020/06/30	287,535,504.20	107,786,775.21	128,200,000.00	267,122,279.41	24.86%
	2	2020/01/07-2020/03/03	216,994,771.91	7,135,115.14	37,500,000.00	186,629,887.05	17.37%
产品特有风险							
<p>本基金由于存在上述单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况，存在以下特有风险：</p> <p>(1) 当基金份额集中度较高时，少数基金份额持有人所持有的基金份额占比较高，其在召开持有人大会并对重大事项进行投票表决时可能拥有较大话语权；</p> <p>(2) 在极端情况下，当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致在其赎回后本基金资产规模长期低于 5000 万元，进而可能导致本基金终止或与其他基金合并或转型为另外的基金，其他基金份额持有人丧失继续投资本基金的机会；</p> <p>(3) 当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，更容易触发巨额赎回条款，基金份额持有人将无法及时赎回所持有的全部基金份额；</p> <p>(4) 当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，基金为支付赎回款项而卖出所持有的证券，可能造成证券价格波动，导致本基金的收益水平发生波动。同时，巨额赎回、份额净值小数保留位数是采用四舍五入、管理费及托管费等费用是按前一日资产计提，会导致基金份额净值出现大幅波动；</p> <p>(5) 当某一基金份额持有人所持有的基金份额达到或超过本基金规模的 50%时，本基金管理人将不再接受该持有人对本基金基金份额提出的申购及转换转入申请。在其他基金份额持有人赎回基金份额导致某一基金份额持有人所持有的基金份额达到或超过本基金规模 50%的情况下，该基金份额持有人将面临所提出的对本基金基金份额的申购及转换转入申请被拒绝的风险。如果投资人某笔申购或转换转入申请导致其持有本基金基金份额达到或超过本基金规模的50%，该笔申购或转换转入申请可能被确认失败。</p>							

## 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 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长安货币市场证券投资基金的文件。
- 2、长安货币市场证券投资基金合同。
- 3、长安货币市场证券投资基金托管协议。
- 4、中国证监会批准设立长安基金管理有限公司的文件。
- 5、报告期内在选定报刊上披露的各项公告。

### 12.2 存放地点

上海市浦东芳甸路1088号紫竹大厦16楼

### 12.3 查阅方式

投资者可到基金管理人、基金托管人的办公场所或基金管理人网站免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

投资者对本报告如有疑问，可咨询本管理人。

咨询电话：400-820-9688

公司网址：www.changanfunds.com。

长安基金管理有限公司  
二〇二〇年八月三十一日