

长信长金通货币市场基金更新的招募说明书摘要

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
长信长金通货币市场基金(以下简称“本基金”)由长信利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...

Table with columns: 姓名, 职务, 任期时间, 简历. Lists key personnel including the General Manager and Board Members.

5.投资决策委员会成员

Table with columns: 姓名, 职务, 简历. Lists members of the Investment Decision Committee.

二、基金托管人

基金托管人:交通银行股份有限公司
基金托管人职责:安全保管基金财产,按照规定开设基金财产的资金账户和证券账户...

三、基金管理人

基金管理人:长信基金管理有限责任公司
基金管理人职责:依法募集基金,办理基金备案手续;对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账...

四、基金的投资

本基金的投资范围:货币市场基金,属于证券投资基金中较高流动性、低风险品种,其预期风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金和债券型基金...

五、基金业绩

截至2018年9月30日,交通银行资产总额为人民币93915.57亿元。2018年1-9月,交通银行实现净利润归属于公司股东人民币573.04亿元。

六、基金的风险控制

交通银行始终将风险管理作为核心业务,建立了全面、系统、主动的风险管理体系,形成了覆盖全行、全流程、全员的风险管理文化...

七、基金的费用

基金费用的种类:基金管理费,基金托管费,基金销售服务费,基金信息披露费,基金持有人服务费,基金账户维护费,基金开户费,基金赎回费,基金申购费,基金认购费,基金赎回费,基金申购费,基金认购费...

八、基金的信息披露

基金信息披露:基金管理人应当按照法律法规和中国证监会的有关规定,及时、准确、完整地披露基金信息,保证基金投资者能够及时、准确地获取基金信息...

九、基金合同的变更、终止与基金财产的清算

基金合同的变更:基金管理人有权根据法律法规和基金合同的约定,对基金合同进行变更,但变更后的基金合同不得与基金合同的基本原则相抵触...

十、基金资产净值的计算

基金资产净值的计算:基金资产净值是指基金资产减去负债后的余额。基金资产净值除以基金份额总数,即为基金份额净值...

十一、基金合同的生效

基金合同的生效:基金合同经中国证监会注册,自基金募集期限届满之日起生效。基金管理人应当在基金合同生效后,按照基金合同的约定,及时披露基金资产净值和基金份额净值...

十二、基金合同的终止

基金合同的终止:基金合同出现下列情形之一的,应当终止:基金合同约定的存续期限届满;基金份额持有人大会决定终止;基金管理人、基金托管人协商一致终止;基金合同约定的其他情形...

十三、基金合同的附件

基金合同的附件:基金合同附件包括基金招募说明书、基金托管协议、基金销售服务协议、基金持有人服务协议、基金账户服务协议、基金申购赎回服务协议、基金信息披露服务协议、基金估值服务协议、基金清算服务协议、基金其他服务协议...

十四、基金合同的解释权

基金合同的解释权:基金合同解释权归基金管理人所有。基金管理人有权根据法律法规和基金合同的约定,对基金合同进行解释和说明...

十五、基金合同的生效日期

基金合同的生效日期:基金合同自中国证监会注册之日起生效。基金管理人应当在基金合同生效后,按照基金合同的约定,及时披露基金资产净值和基金份额净值...

十六、基金合同的终止日期

基金合同的终止日期:基金合同出现下列情形之一的,应当终止:基金合同约定的存续期限届满;基金份额持有人大会决定终止;基金管理人、基金托管人协商一致终止;基金合同约定的其他情形...

十七、基金合同的变更

基金合同的变更:基金管理人有权根据法律法规和基金合同的约定,对基金合同进行变更,但变更后的基金合同不得与基金合同的基本原则相抵触...

十八、基金合同的解释

基金合同的解释:基金合同解释权归基金管理人所有。基金管理人有权根据法律法规和基金合同的约定,对基金合同进行解释和说明...

十九、基金合同的生效

基金合同的生效:基金合同经中国证监会注册,自基金募集期限届满之日起生效。基金管理人应当在基金合同生效后,按照基金合同的约定,及时披露基金资产净值和基金份额净值...

二十、基金合同的终止

基金合同的终止:基金合同出现下列情形之一的,应当终止:基金合同约定的存续期限届满;基金份额持有人大会决定终止;基金管理人、基金托管人协商一致终止;基金合同约定的其他情形...

基金管理人报酬的计提和支付

基金管理人报酬的计提和支付:基金管理人报酬的计提和支付,基金的申购资金的到账与赎回资金的划付、基金收益分配等行为的合法性、合规性进行监督和核查...

交通银行作为基金托管人,发现基金管理人违反《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等相关法律法规和《基金合同》的行为,应及时通知基金管理人予以纠正...

本基金将密切跟踪履行承兑汇票、商业承兑汇票等商业票据以及各衍生产品的动向

本基金将密切跟踪履行承兑汇票、商业承兑汇票等商业票据以及各衍生产品的动向,一旦监管机构允许基金参与此类金融工具的投资,本基金将在届时相应法律法规的框架内,根据对该类金融工具的研究,制定符合本基金投资目标的投资策略,在充分考虑该投资品种风险和收益特征的前提下,谨慎投资...

九、基金的业绩比较基准

基金的业绩比较基准:本基金的业绩比较基准为同期七天通知存款利率(税后)。根据基金的投资标的、投资目标及流动性特征,本基金选取同期七天通知存款利率作为本基金的业绩比较基准...

如果今后法律法规发生变化,或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出,或者是市场上出现更加适合用于本基金业绩基准的业绩比较基准,本基金管理人可以根据本基金的投资范围和投资策略,依据维护基金份额持有人合法权益的原则,经与基金托管人协商一致并按照规定程序要求履行适当程序后,调整或变更本基金的业绩比较基准并及时在指定媒介上公告,无需召开基金份额持有人大会。

十、基金的风险收益特征

本基金为货币市场基金,属于证券投资基金中较高流动性、低风险品种,其预期风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金和债券型基金...

十一、基金投资组合报告

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。

基金管理人交通银行股份有限公司根据本基金合同约定,于2019年3月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。

本投资组合报告所载数据截至2018年12月31日(摘自本基金2018年四季报),本报告中所列财务数据未经审计。

(一) 报告期末基金资产组合情况

Table with columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)

(二) 报告期末债券回购融资情况

Table with columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例(%)

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值比例

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值比例,报告期内每个交易日债券回购融资余额占基金资产净值比例均不超过20%。

(三) 基金投资组合平均剩余期限

1. 投资组合平均剩余期限基本情况

Table with columns: 项目, 天数

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明:报告期内投资组合平均剩余期限不存在超过120天的情况。

2. 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

Table with columns: 序号, 平均剩余期限, 报告期投资组合资产净值占基金资产净值的比例(%)

(四) 报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

注:报告期内投资组合平均剩余存续期不存在超过240天的情况。

(五) 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with columns: 序号, 债券品种, 摊余成本(元), 占基金资产净值比例(%)

(六) 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

Table with columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 债券余额(元), 摊余成本(元), 占基金资产净值比例(%)

(七) “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值偏离度

Table with columns: 项目, 偏离度(%)

报告期内偏离度的绝对值超过0.25%的情况说明

报告期内偏离度的绝对值超过0.25%的情况说明:报告期内偏离度的绝对值超过0.25%的情况,报告期内偏离度的绝对值超过0.5%的情况说明。

报告期内偏离度的绝对值超过0.5%的情况说明

报告期内偏离度的绝对值超过0.5%的情况说明:报告期内偏离度的绝对值超过0.5%的情况,报告期内偏离度的绝对值超过1.0%的情况说明。

资产支持证券投资说明

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

(九) 投资组合报告附注

1. 本基金采用摊余成本法计价。

2. 报告期内本基金投资的前十名证券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。

3. 其他资产构成

Table with columns: 序号, 名称, 金额(元)

4. 投资组合报告附注的其他文字描述部分

注:由于四舍五入的原因,分项之和与合计项可能存在尾差。

十二、基金的投资策略

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。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。

(一) 2018年度及历史同期债券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

Table with columns: 阶段, 净值收益率, 业绩比较基准收益率, 超额收益, 超额收益占净值比例

Table with columns: 阶段, 净值收益率, 业绩比较基准收益率, 超额收益, 超额收益占净值比例

注:本基金收益分配以结转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B

Table with columns: 阶段, 净值收益率, 业绩比较基准收益率, 超额收益, 超额收益占净值比例

Table with columns: 阶段, 净值收益率, 业绩比较基准收益率, 超额收益, 超额收益占净值比例

注:本基金收益分配以结转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C

Table with columns: 阶段, 净值收益率, 业绩比较基准收益率, 超额收益, 超额收益占净值比例

Table with columns: 阶段, 净值收益率, 业绩比较基准收益率, 超额收益, 超额收益占净值比例

注:本基金收益分配以结转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D

Table with columns: 阶段, 净值收益率, 业绩比较基准收益率, 超额收益, 超额收益占净值比例

Table with columns: 阶段, 净值收益率, 业绩比较基准收益率, 超额收益, 超额收益占净值比例

注:本基金收益分配以结转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E

Table with columns: 阶段, 净值收益率, 业绩比较基准收益率, 超额收益, 超额收益占净值比例

Table with columns: 阶段, 净值收益率, 业绩比较基准收益率, 超额收益, 超额收益占净值比例

注:本基金收益分配以结转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F

Table with columns: 阶段, 净值收益率, 业绩比较基准收益率, 超额收益, 超额收益占净值比例

Table with columns: 阶段, 净值收益率, 业绩比较基准收益率, 超额收益, 超额收益占净值比例

注:本基金收益分配以结转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G

Table with columns: 阶段, 净值收益率, 业绩比较基准收益率, 超额收益, 超额收益占净值比例

Table with columns: 阶段, 净值收益率, 业绩比较基准收益率, 超额收益, 超额收益占净值比例

注:本基金收益分配以结转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H

Table with columns: 阶段, 净值收益率, 业绩比较基准收益率, 超额收益, 超额收益占净值比例

Table with columns: 阶段, 净值收益率, 业绩比较基准收益率, 超额收益, 超额收益占净值比例

注:本基金收益分配以结转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I

Table with columns: 阶段, 净值收益率, 业绩比较基准收益率, 超额收益, 超额收益占净值比例

Table with columns: 阶段, 净值收益率, 业绩比较基准收益率, 超额收益, 超额收益占净值比例

注:本基金收益分配以结转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J

Table with columns: 阶段, 净值收益率, 业绩比较基准收益率, 超额收益, 超额收益占净值比例

Table with columns: 阶段, 净值收益率, 业绩比较基准收益率, 超额收益, 超额收益占净值比例

注:本基金收益分配以结转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K

Table with columns: 阶段, 净值收益率, 业绩比较基准收益率, 超额收益, 超额收益占净值比例

Table with columns: 阶段, 净值收益率, 业绩比较基准收益率, 超额收益, 超额收益占净值比例

注:本基金收益分配以结转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L

Table with columns: 阶段, 净值收益率, 业绩比较基准收益率, 超额收益, 超额收益占净值比例

Table with columns: 阶段, 净值收益率, 业绩比较基准收益率, 超额收益, 超额收益占净值比例

注:本基金收益分配以结转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M

Table with columns: 阶段, 净值收益率, 业绩比较基准收益率, 超额收益, 超额收益占净值比例

Table with columns: 阶段, 净值收益率, 业绩比较基准收益率, 超额收益, 超额收益占净值比例

注:本基金收益分配以结转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N

Table with columns: 阶段, 净值收益率, 业绩比较基准收益率, 超额收益, 超额收益占净值比例

Table with columns: 阶段, 净值收益率, 业绩比较基准收益率, 超额收益, 超额收益占净值比例

注:本基金收益分配以结转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O

Table with columns: 阶段, 净值收益率, 业绩比较基准收益率, 超额收益, 超额收益占净值比例

Table with columns: 阶段, 净值收益率, 业绩比较基准收益率, 超额收益, 超额收益占净值比例

注:本基金收益分配以结转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P

Table with columns: 阶段, 净值收益率, 业绩比较基准收益率, 超额收益, 超额收益占净值比例

Table with columns: 阶段, 净值收益率, 业绩比较基准收益率, 超额收益, 超额收益占净值比例

注:本基金收益分配以结转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Q

Table with columns: 阶段, 净值收益率, 业绩比较基准收益率, 超额收益, 超额收益占净值比例

Table with columns: 阶段, 净值收益率, 业绩比较基准收益率, 超额收益, 超额收益占净值比例

注:本基金收益分配以结转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