

# 长江乐享货币市场基金

## 2020 年中期报告

2020 年 06 月 30 日

基金管理人:长江证券(上海)资产管理有限公司

基金托管人:交通银行股份有限公司

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。本中期报告由董事长签发。

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2020年8月20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2020年1月1日起至6月30日止。

## 1.2 目录

§ 1 重要提示及目录.....	1
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录.....	2
§ 2 基金简介.....	4
2.1 基金基本情况.....	4
2.2 基金产品说明.....	4
2.3 基金管理人和基金托管人.....	4
2.4 信息披露方式.....	5
2.5 其他相关资料.....	5
§ 3 主要财务指标和基金净值表现.....	5
3.1 主要会计数据和财务指标.....	5
3.2 基金净值表现.....	6
§ 4 管理人报告.....	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
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.....	13
§ 5 托管人报告.....	13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	13
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.....	14
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.....	14
§ 6 半年度财务会计报告(未经审计).....	14
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	16
6.3 所有者权益(基金净值)变动表.....	17
6.4 报表附注.....	19
§ 7 投资组合报告.....	43
7.1 期末基金资产组合情况.....	43
7.2 债券回购融资情况.....	43
7.3 基金投资组合平均剩余期限.....	44
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.....	45
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	45
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.....	45
7.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离.....	46
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.....	46
7.9 投资组合报告附注.....	47
§ 8 基金份额持有人信息.....	47
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	47
8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况.....	48
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	49
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.....	49
§ 9 开放式基金份额变动.....	49
§ 10 重大事件揭示.....	50

10.1 基金份额持有人大会决议.....	50
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.....	50
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	50
10.4 基金投资策略的改变.....	50
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	50
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.....	50
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	51
10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况.....	52
10.9 其他重大事件.....	52
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....	53
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.....	53
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	54
§ 12 备查文件目录.....	54
12.1 备查文件目录.....	54
12.2 存放地点.....	54
12.3 查阅方式.....	54

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	长江乐享货币市场基金		
基金简称	长江乐享货币		
基金主代码	003363		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2016年10月26日		
基金管理人	长江证券（上海）资产管理有限公司		
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	8,734,887,868.20份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称	长江乐享货币A类份额	长江乐享货币B类份额	长江乐享货币C类份额
下属分级基金的交易代码	003363	003364	003365
报告期末下属分级基金的份额总额	3,724,685.33份	2,720,178,843.62份	6,010,984,339.25份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金将结合国内外环境，综合宏观分析和微观分析制定投资策略，力求在满足安全性、流动性需要的基础上实现超越业绩比较基准的收益率。
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、尽量降低基金资产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	中国人民银行最新公布的七天通知存款利率(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的低风险品种，其预期收益和长期平均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	长江证券（上海）资产管理有限公司	交通银行股份有限公司

信息披露 负责人	姓名	高杨	陆志俊
	联系电话	4001-166-866	95559
	电子邮箱	zgxxpl@cjsc.com.cn	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		4001-166-866	95559
传真		021-80301393	021-62701216
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区世纪大道1198号世纪汇一座27层	中国（上海）自由贸易试验区银城中路188号
办公地址		上海市浦东新区世纪大道1198号世纪汇一座27层	中国（上海）长宁区仙霞路18号
邮政编码		200122	200336
法定代表人		周纯	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	证券时报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.cjzcg1.com
基金中期报告备置地点	上海市浦东新区世纪大道1198号世纪汇一座27层

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	长江证券（上海）资产管理有限公司	上海市浦东新区世纪大道1198号世纪汇一座27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)		
	长江乐享货币 A类份额	长江乐享货币 B类份额	长江乐享货币 C类份额
本期已实现收益	33,153.21	14,731,116.54	57,901,172.88

本期利润	33,153.21	14,731,116.54	57,901,172.88
本期净值收益率	0.9375%	1.0590%	0.8131%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	报告期末(2020年06月30日)		
期末基金资产净值	3,724,685.33	2,720,178,843.62	6,010,984,339.25
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	报告期末(2020年06月30日)		
累计净值收益率	11.0657%	12.0556%	10.0557%

注：(1) 本基金收益分配方式为每日分配、按月支付；(2) 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。由于按摊余成本法核算的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。

## 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

#### 长江乐享货币A类份额

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	0.1292%	0.0010%	0.1110%	0.0000%	0.0182%	0.0010%
过去三个月	0.4074%	0.0015%	0.3371%	0.0000%	0.0703%	0.0015%
过去六个月	0.9375%	0.0014%	0.6754%	0.0000%	0.2621%	0.0014%
过去一年	2.0680%	0.0012%	1.3629%	0.0000%	0.7051%	0.0012%
过去三年	8.7273%	0.0022%	4.1369%	0.0000%	4.5904%	0.0022%
自基金合同 生效起至今	11.0657%	0.0021%	5.0965%	0.0000%	5.9692%	0.0021%

#### 长江乐享货币B类份额

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	0.1492%	0.0010%	0.1110%	0.0000%	0.0382%	0.0010%
过去三个月	0.4672%	0.0015%	0.3371%	0.0000%	0.1301%	0.0015%
过去六个月	1.0590%	0.0014%	0.6754%	0.0000%	0.3836%	0.0014%
过去一年	2.3141%	0.0012%	1.3629%	0.0000%	0.9512%	0.0012%
过去三年	9.5152%	0.0022%	4.1369%	0.0000%	5.3783%	0.0022%
自基金合同生效起至今	12.0556%	0.0021%	5.0965%	0.0000%	6.9591%	0.0021%

## 长江乐享货币C类份额

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	0.1088%	0.0010%	0.1110%	0.0000%	-0.0022%	0.0010%
过去三个月	0.3447%	0.0015%	0.3371%	0.0000%	0.0076%	0.0015%
过去六个月	0.8131%	0.0014%	0.6754%	0.0000%	0.1377%	0.0014%
过去一年	1.8129%	0.0012%	1.3629%	0.0000%	0.4500%	0.0012%
过去三年	7.9161%	0.0022%	4.1369%	0.0000%	3.7792%	0.0022%
自基金合同生效起至今	10.0557%	0.0021%	5.0965%	0.0000%	4.9592%	0.0021%

注：（1）本基金基金合同生效日为 2016 年 10 月 26 日，业绩比较基准为中国人民银行最新公布的七天通知存款利率（税后）；（2）本基金收益分配方式为每日分配、按月支付。

### 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





## § 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

长江证券（上海）资产管理有限公司于2014年9月16日正式成立，是长江证券股份有限公司旗下专门从事证券资产管理、公开募集证券投资基金管理业务的全资子公司。注册地上海，注册资本23亿元人民币。

公司秉承“专业至臻，追求卓越”的理念，致力于为广大投资者创造稳定而丰厚的回报。公司以“客户导向、研究驱动、技术领先、内控先行”为业务发展策略，全方位参与客户资产配置和资产增值全过程，通过深度挖掘客户的投融资需求，紧跟市场创新步伐，以满足客户差异化需求。在严格控制风险的前提下，挑选优质投资品种，丰富产品架构，为客户提供多元化资产管理服务。

截至本报告期末，本基金管理人管理的基金有长江收益增强债券型证券投资基金、长江乐享货币市场基金、长江优享货币市场基金、长江乐丰纯债定期开放债券型发起式证券投资基金、长江乐盈定期开放债券型发起式证券投资基金、长江乐越定期开放债券型发起式证券投资基金、长江汇聚量化多因子灵活配置混合型发起式证券投资基金、长江乐鑫纯债定期开放债券型发起式证券投资基金、长江可转债债券型证券投资基金、长江量化匠心甄选股票型证券投资基金和长江安盈中短债六个月定期开放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		
漆志伟	基金经理	2016-10-26	-	11年	国籍：中国。硕士研究生，具备基金从业资格。曾任东兴证券股份有限公司客服经理、华农财产保险股份有限公司投资经理。现任长江证券（上海）资产管理有限公司基金管理总部副总经理、基金经理。自2016年10月17日至今任长江收益增强债券基金经理，自2016年10月26日至今任长江乐享货币基金经理，自2017年8月11日至2020年3月16日起任长江优享货币基金经理，自2017年8月22日至今任长江乐丰纯债基金经理，自2017年11月24日至今任长江乐盈定开债基金经理，自2018年4月12日至2020年3月16日任长江乐越定开债基金经理，自2018年8月16日至今任长江乐鑫定开债基金经理，自2018年12月25日至今任长江可转债债券基金经理，自2019年9月25日至今任长江安盈中短债六个月定开基金经理。
陆威	基金经理	2019-04-15	-	7年	国籍：中国。本科，具备基金从业资格。曾任国联证券股份有限公司投资助理、东

					兴证券股份有限公司投资经理、长江证券（上海）资产管理有限公司基金经理助理。现任长江证券（上海）资产管理有限公司基金经理。自2019年4月15日至今任长江乐享货币、长江优享货币基金经理，自2020年3月17日至今任长江乐越定开债基金经理。
--	--	--	--	--	--

注：（1）此处的任职日期、离职日期均指公司做出决定之日，若该基金经理自基金合同生效日起即任职，则任职日期为基金合同生效日；

（2）证券从业的含义遵从行业协会《证券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《证券法》、《证券投资基金法》、《基金管理公司公平交易制度指导意见》等有关法律法规的规定，严格遵守基金合同和招募说明书约定，本着诚实信用、勤勉尽责、最大限度保护投资人合法权益等原则管理和运用基金资产，在控制风险的基础上为持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作合法合规，未发生损害基金份额持有人利益的行为，未发生内幕交易、操纵市场和不当关联交易及其他违规行为，信息披露及时、准确、完整，本基金与本基金管理人所管理的其他基金资产、投资组合与公司资产之间严格分开、公平对待，基金管理保持独立运作，并通过科学决策、规范运作、精心管理和健全内控体系，有效保障投资人的合法权益。

#### 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

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的相关规定，通过严格的内部风险控制制度和流程，对各环节的投资风险和管理风险进行有效控制，确保公平对待所管理的所有基金和投资组合，切实防范利益输送行为。

##### （一）本基金管理人所管理的基金或组合间同向交易价差分析

根据证监会公平交易指导意见，我们计算了公司旗下基金、组合同日同向交易纪录配对。通过对这些配对的交易价差分析，我们发现有效配对溢价率均值大部分在1%数量级及以下，且大部分溢价率均值通过95%置信度下等于0的t检验。

##### （二）扩展时间窗口下的价差分析

本基金管理人选取T=3和T=5作为扩展时间窗口，将基金或组合交易情况分别在这两个时间窗口内作平均，并以此为依据，进行基金或组合间在扩展时间窗口中的同向交易价差分析。对于有足够多观测样本的基金配对（样本数=30），溢价率均值大部分在1%数量级及以下。

### （三）基金或组合间模拟溢价金额分析

对于不能通过溢价率均值为零的t检验的基金组合配对、对于在时间窗口中溢价率均值过大的基金组合配对，已要求基金经理对价差作出了解释，根据基金经理解释公司旗下基金或组合间没有可能导致不公平交易和利益输送的行为。

本报告期内，未出现违反公平交易制度的情况，公司旗下各基金不存在因非公平交易等导致的利益输送行为，公平交易制度的整体执行情况良好。

## 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金与本基金管理人所管理的其他投资组合未发生大额同日反向交易。本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

## 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

纵观2020年上半年，货币市场利率呈现出先下后上的“V”走势。年初新冠疫情席卷全球，世界各大经济体分别通过降息、量化宽松等手段应对疫情带来的冲击。中国央行也打开新的宽松周期，无风险利率下行明显。从货币市场来看，各条利率曲线下行明显，3M股份制同业存单发行价格在整个一季度呈现出单边下行的态势，从2.60%下行至1.55%，下行幅度超过100BP。进入二季度，央行通过定向降准、下调MLF利率等手段进一步引导货币市场利率曲线进一步下移。银行间市场资金量供应充足，整体回购利率中枢明显下移。市场步入五月，伴随着MLF的延期缩量续作、市场降息预期的落空、央行连续暂停20个交易日的公开市场操作，货币市场的利率中枢得到了明显的提升，各短端资产收益率呈现出单边上行的趋势。叠加半年末效应，一年期国开债到期收益率从4月低点1.20%上行至6月底的2.40%，上行幅度达到120BP。3M及1Y股份制同业存单一级发行价格上行幅度分别为100BP及85BP。

报告期内，本基金采取较为稳健的投资策略，适度缩短了组合剩余期限，保持较高现金类资产比例。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金A类份额净值收益率为0.9375%，B类份额净值收益率为1.0590%，C类份额净值收益率为0.8131%，同期业绩比较基准收益率为0.6754%。

#### 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2020年下半年，预计海外疫情肆虐情形有望好转并转为常规化，各国的复工复产将稳步推进外需逐步恢复。国内经济预计将在基建托底、消费复苏、出口改善的情况下，持续迎来复苏，但整体复苏的力度较二季度或将降低。货币政策宽松力度目前有所减弱，但综合考量下，下半年整体流动性水平预计依然会比较充裕。债市市场在二季度调整后，进入下半年大概率将是一个震荡整理的走势。而权益市场的结构化行情预计仍可能持续，成长股相对价值股估值压倒性占优的态势可能有所收敛，低估值价值股板块或有望迎来增量资金的重视。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证券监督管理委员会《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》和中国证券业协会基金估值工作小组《关于停牌股票估值的参考方法》等法律法规的有关规定，本基金管理人设立估值委员会并制定估值委员会制度。

估值委员会由公司领导、运营部、财务部、权益研究部、固定收益研究部、法律合规部、风险管理部等相关部门工作人员组成。估值委员会成员均具有会计核算经验、行业分析经验、金融工具应用等丰富的证券投资基金行业从业经验和专业能力，且之间不存在任何重大利益冲突。基金经理如果认为某证券有更能准确反应其公允价值的估值方法，可以向估值委员会申请对其进行专项评估。新的证券价格需经估值委员会和托管行同意后才能采纳，否则不改变用来进行证券估值的初始价格。

估值委员会职责：根据相关估值原则研究相关估值政策和估值模型，拟定公司的估值政策、估值方法和估值程序，确保公司各基金产品净值计算的公允性，以维护广大投资者的利益。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金合同的约定，本基金根据每日基金收益情况，每日进行收益分配，每月集中支付，每月累计收益支付方式采用红利再投资（即红利转基金份额）方式。

本基金本报告期内累计分配收益72,665,442.63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

本报告期内，本基金不存在连续二十个工作日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的情形。

### § 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

托管人在长江乐享货币市场基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

长江证券（上海）资产管理有限公司在长江乐享货币市场基金投资运作、资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本基金本报告期内向A类份额持有人分配利润44,328.85元，向B类份额持有人分配利润14,719,940.90元，向C类份额持有人分配利润57,901,172.88元。

## 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

由长江证券（上海）资产管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关长江乐享货币市场基金的2020年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：长江乐享货币市场基金

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	1,439,634,809.94	1,242,824,032.82
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	4,200,890,533.28	3,375,198,322.54
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		4,147,206,533.28	3,345,198,322.54
资产支持证券投资		53,684,000.00	30,000,000.00

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	2,944,714,657.07	3,036,314,234.46
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	22,895,778.75	19,368,079.83
应收股利		-	-
应收申购款		133,993,490.00	931,301,000.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		8,742,129,269.04	8,605,005,669.65
<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		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		2,550,409.09	1,743,121.93
应付托管费		618,280.97	422,575.06
应付销售服务费		21,071.14	11,052.94
应付交易费用	6.4.7.7	129,795.94	61,305.54
应交税费		23,148.66	37,864.01
应付利息		-	-
应付利润		847,934.97	2,743,961.04
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	3,050,760.07	2,474,078.98
负债合计		7,241,400.84	7,493,959.50
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6.4.7.9	8,734,887,868.20	8,597,511,710.15

未分配利润	6.4.7.10	-	-
所有者权益合计		8,734,887,868.20	8,597,511,710.15
负债和所有者权益总计		8,742,129,269.04	8,605,005,669.65

注:报告截止日2020年6月30日,基金份额净值1.0000元,基金份额总额8,734,887,868.20份(其中A类基金份额的份额总额为3,724,685.33份,B类基金份额的份额总额为2,720,178,843.62份,C类基金份额的份额总额为6,010,984,339.25份)

## 6.2 利润表

会计主体:长江乐享货币市场基金

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>		108,521,671.64	106,663,223.45
1. 利息收入		107,316,233.32	106,433,384.48
其中:存款利息收入	6.4.7.11	20,416,814.71	21,697,546.80
债券利息收入		57,036,369.76	52,558,844.93
资产支持证券利息收入		919,489.16	2,620,661.44
买入返售金融资产收入		28,943,559.69	29,556,331.31
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益(损失以“-”填列)		1,205,438.32	229,838.97
其中:股票投资收益	6.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	1,205,438.32	231,491.18
资产支持证券投资 收益	6.4.7.13.5	-	-1,652.21

贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-	-
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-	-
<b>减：二、费用</b>		35,856,229.01	30,134,652.91
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	13,569,728.57	11,333,005.66
2. 托管费	6.4.10.2.2	3,435,085.73	2,747,395.25
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	76,175.51	39,145.90
4. 交易费用	6.4.7.18	-	-
5. 利息支出		773,456.96	457,795.68
其中：卖出回购金融资产支出		773,456.96	457,795.68
6. 税金及附加		11,898.37	37,736.59
7. 其他费用	6.4.7.19	17,989,883.87	15,519,573.83
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		72,665,442.63	76,528,570.54
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		72,665,442.63	76,528,570.54

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长江乐享货币市场基金

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)	8,597,511,710.15	-	8,597,511,710.15
二、本期经营活动产生 的基金净值变动 数(本期利润)	-	72,665,442.63	72,665,442.63
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)	137,376,158.05	-	137,376,158.05
其中: 1. 基金申购款	87,731,890,465.47	13,692.26	87,731,904,157.73
2. 基金赎回款	-87,594,514,307.42	-13,692.26	-87,594,527,999.68
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)	-	-72,665,442.63	-72,665,442.63
五、期末所有者权益 (基金净值)	8,734,887,868.20	-	8,734,887,868.20
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)	4,345,060,474.67	-	4,345,060,474.67
二、本期经营活动产生 的基金净值变动 数(本期利润)	-	76,528,570.54	76,528,570.54
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)	2,854,380,261.33	-	2,854,380,261.33
其中: 1. 基金申购款	78,187,874,352.56	3,403.85	78,187,877,756.41
2. 基金赎回款	-75,333,494,091.23	-3,403.85	-75,333,497,495.08
四、本期向基金份额	-	-76,528,570.54	-76,528,570.54

持有人分配利润产生的基金净值变动 (净值减少以“-”号填列)			
五、期末所有者权益 (基金净值)	7,199,440,736.00	-	7,199,440,736.00

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：

周纯

唐吟波

何永生

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

长江乐享货币市场基金(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”)证监许可[2016]1729号文《关于准予长江乐享货币市场基金注册的批复》准予注册,由长江证券(上海)资产管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《长江乐享货币市场基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金,基金存续期限不定期,首次设立募集资金为2,808,017,284.70元,认购资金在募集期间产生的利息301,421.15元,合计为2,808,318,705.85元,按照每份基金份额面值人民币1.00元计算,折合基金份额为2,808,318,705.85份,业经中审众环会计师事务所(特殊普通合伙)众环验字(2016)010128号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《长江乐享货币市场基金基金合同》于2016年10月26日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为2,808,318,705.85份。基金份额总额中A类基金份额365,630,163.87份,B类基金份额1,786,429,883.80份,C类基金份额656,258,658.18份。本基金的基金管理人为长江证券(上海)资产管理有限公司,基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《长江乐享货币市场基金招募说明书》的有关规定,本基金根据销售渠道、基金份额持有人在单个基金账户保留的基金份额数量以及开立证券资金账户等的不同,对基金份额按照不同的费率计提销售服务费用和增值服务费,因此形成不同的基金份额类别。本基金设A类、B类和C类三类基金份额,其中:A类基金份额按照0.25%年费率计提销售服务费,不计提增值服务费;B类基金份额按照0.01%年费率计提销售服务费,不计提增值服务费;C类基金份额不计提销售服务费,按照0.50%年费率计提增值服务费。三类基金份额分别设置基金代码,并分别公布每万份基金已实现收益和7日年化收益率。当A类基金份额持有人在单个基金账户保留的基金份额达到或超过300万份时,本基金的

登记机构自动将其在该基金账户持有的A类基金份额升级为B类基金份额。若B类基金份额持有人在单个基金账户保留的基金份额低于300万份时，本基金的登记机构自动将其在该基金账户持有的B类基金份额降级为A类基金份额。C类基金份额无自动升降级。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《货币市场基金管理暂行规定》和《长江乐享货币市场基金基金合同》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；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。

本基金的业绩比较基准为中国人民银行最新公布的七天通知存款利率(税后)。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金根据实际发生的交易和事项，按照《长江乐享货币市场基金基金合同》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会发布的《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>》和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金实务操作编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2020年中期报告的财务报表符合报表附注所列编制基础的要求，真实、完整地反映了本基金2020年6月30日的财务状况以及2020年1月1日至2020年6月30日的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 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

本基金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一致。

#### 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 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号文《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[2005]11号文《关于调整证券（股票）交易印花税税率的通知》、财税[2005]102号文《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税字[2005]107号文《关于利息红利个人所得税政策的补

充通知》、财税[2007]84号文《关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知》、财税[2012]85号文《财政部 国家税务总局 证监会关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号文《财政部 国家税务总局 证监会关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、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》、财政部及国家税务总局“证券(股票)交易印花税税率2008年4月24日起由3%调整为1%”、财政部“证券交易印花税2008年9月19日起单边征收”及其他相关税务法规和实务操作,主要税项列示如下:

#### (1) 所得税:

①对基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入,暂免征收企业所得税。

②对基金取得的股票的股息、红利收入,债券的利息收入、储蓄存款利息收入,由上市公司、发行债券的企业和银行在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税。

③按照财税[2015]101号文规定,基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,持股期限超过1年的,股息红利所得暂免征收个人所得税;持股期限在1个月以内(含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

④基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价,暂免予缴纳企业所得税和个人所得税。

⑤对投资者(包括个人和机构投资者)从基金分配中取得的收入,暂不征收个人所得税和企业所得税。

#### (2) 增值税

①资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为,暂适用简易计税方法,按照3%的征收率缴纳增值税。

②对资管产品在2018年1月1日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,已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

#### (3) 印花税

自2008年9月19日起,对基金卖出证券(股票)按0.1%的税率征收印花税,对基金买入证券(股票)不再征收印花税。

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体、纳税义务按上述税收法律法规执行。

### 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	4,634,809.94
定期存款	1,435,000,000.00
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	580,000,000.00
存款期限3个月以上	855,000,000.00
其他存款	-
合计	1,439,634,809.94

## 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 (%)
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	4,147,206,533.28	4,148,339,000.00	1,132,466.72	0.0130
	合计	4,147,206,533.28	4,148,339,000.00	1,132,466.72	0.0130
资产支持证券		53,684,000.00	53,723,000.00	39,000.00	0.0004
合计		4,200,890,533.28	4,202,062,000.00	1,171,466.72	0.0134

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

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

## 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	2,944,714,657.07	-
合计	2,944,714,657.07	-

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有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	614,046.77
应收定期存款利息	8,050,097.56
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	12,531,171.91
应收资产支持证券利息	407,345.53
应收买入返售证券利息	1,293,116.98
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	-
合计	22,895,778.75

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产余额。

#### 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	129,795.94
合计	129,795.94

#### 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	208,753.90
应付增值服务费	2,842,006.17
合计	3,050,760.07

#### 6.4.7.9 实收基金

##### 6.4.7.9.1 长江乐享货币A类份额

金额单位：人民币元

项目 (长江乐享货币A类份额)	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	7,656,281.55	7,656,281.55
本期申购	5,489,380.61	5,489,380.61
本期赎回(以“-”号填列)	-9,420,976.83	-9,420,976.83
本期末	3,724,685.33	3,724,685.33

##### 6.4.7.9.2 长江乐享货币B类份额

金额单位：人民币元

项目 (长江乐享货币B类份额)	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	3,521,376,597.21	3,521,376,597.21
本期申购	5,543,731,439.06	5,543,731,439.06
本期赎回(以“-”号填列)	-6,344,929,192.65	-6,344,929,192.65

本期末	2,720,178,843.62	2,720,178,843.62
-----	------------------	------------------

#### 6.4.7.9.3 长江乐享货币C类份额

金额单位：人民币元

项目 (长江乐享货币C类份额)	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	5,068,478,831.39	5,068,478,831.39
本期申购	82,182,669,645.80	82,182,669,645.80
本期赎回(以“-”号填列)	-81,240,164,137.94	-81,240,164,137.94
本期末	6,010,984,339.25	6,010,984,339.25

注：上述“本期申购”、“本期赎回”包含A类份额、B类份额之间升降级的调增、调减份额及红利再投资份额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

##### 6.4.7.10.1 长江乐享货币A类份额

单位：人民币元

项目 (长江乐享货币A类份 额)	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	33,153.21	-	33,153.21
本期基金份额交易产 生的变动数	11,175.64	-	11,175.64
其中：基金申购款	12,433.95	-	12,433.95
基金赎回款	-1,258.31	-	-1,258.31
本期已分配利润	-44,328.85	-	-44,328.85
本期末	-	-	-

##### 6.4.7.10.2 长江乐享货币B类份额

单位：人民币元

项目 (长江乐享货币B类份 额)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
------------------------	-------	-------	---------

额)			
上年度末	-	-	-
本期利润	14,731,116.54	-	14,731,116.54
本期基金份额交易产生的变动数	-11,175.64	-	-11,175.64
其中：基金申购款	1,258.31	-	1,258.31
基金赎回款	-12,433.95	-	-12,433.95
本期已分配利润	-14,719,940.90	-	-14,719,940.90
本期末	-	-	-

## 6.4.7.10.3 长江乐享货币C类份额

单位：人民币元

项目 (长江乐享货币C类份额)	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	57,901,172.88	-	57,901,172.88
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	-57,901,172.88	-	-57,901,172.88
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	1,994,636.06
定期存款利息收入	18,408,736.50
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	13,442.15
其他	-

合计	20,416,814.71
----	---------------

#### 6.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

本基金本报告期无股票投资收益。

#### 6.4.7.13 债券投资收益

##### 6.4.7.13.1 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	1,205,438.32
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	1,205,438.32

##### 6.4.7.13.2 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	6,768,956,117.15
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	6,738,699,269.98
减：应收利息总额	29,051,408.85
买卖债券差价收入	1,205,438.32

##### 6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无债券投资收益——赎回价差收入。

##### 6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无债券投资收益—申购价差收入。

#### 6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年06月30日
卖出资产支持证券成交总额	26,874,600.00
减：卖出资产支持证券成本总额	26,316,000.00
减：应收利息总额	558,600.00
资产支持证券投资收益	-

#### 6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

#### 6.4.7.15 股利收益

本基金本报告期无股利收益。

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

本基金本报告期无公允价值变动收益。

#### 6.4.7.17 其他收入

本基金本报告期无其他收入。

#### 6.4.7.18 交易费用

本基金本报告期无交易费用。

#### 6.4.7.19 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	39,781.56
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-

账户维护费	18,900.00
增值服务费	17,871,529.97
合计	17,989,883.87

#### 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，本基金无须作披露的或有事项。

##### 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，本基金无须作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
长江证券（上海）资产管理有限公司	基金管理人、基金销售机构、注册登记机构
交通银行股份有限公司	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”）	基金管理人股东、基金销售机构
长江期货股份有限公司	基金管理人股东子公司、基金销售机构
长江证券创新投资（湖北）有限公司	基金管理人股东子公司
长江成长资本投资有限公司	基金管理人股东子公司
上海长江财富资产管理有限公司	基金管理人股东联营企业
长江资管锦绣20号定向资产管理计划	基金管理人管理的定向资产管理计划
长江证券-山西天然气供气合同债权资产支持专项计划	基金管理人管理的资产支持专项计划

注：下述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

本基金本报告期及上年度可比期间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

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 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 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	
	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	1,745,000,000.00	100.00%	390,000,000.00	100.00%

#### 6.4.10.1.4 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间未产生应支付关联方的佣金。

#### 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	13,569,728.57	11,333,005.66
其中：支付销售机构的客户维护费	332,641.58	28,806.65

注：（1）本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.33%年费率计提。

管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.33\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

（2）基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托

管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前五个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

#### 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	3,435,085.73	2,747,395.25

注：（1）本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.08%的年费率计提。

托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.08\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

（2）基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前五个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

#### 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			
	长江乐享货币 A类份额	长江乐享货币 B类份额	长江乐享货币 C类份额	合计
交通银行股份 有限公司	357.15	0.00	0.00	357.15
长江证券股份 有限公司	78.93	863.64	0.00	942.57
长江证券（上 海）资产管理 有限公司	2,979.30	50,508.16	0.00	53,487.46
长江期货股份	3.78	0.00	0.00	3.78

有限公司				
合计	3,419.16	51,371.80	0.00	54,790.96
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			
	长江乐享货币 A类份额	长江乐享货币 B类份额	长江乐享货币 C类份额	合计
交通银行股份 有限公司	611.08	0.00	0.00	611.08
长江证券股份 有限公司	0.00	21.25	0.00	21.25
长江证券（上 海）资产管理 有限公司	2,809.52	33,549.24	0.00	36,358.76
合计	3,420.60	33,570.49	0.00	36,991.09

注：（1）本基金A类基金份额的年销售服务费率为0.25%，对于由B类降级为A类的基金份额持有人，年销售服务费率应自其降级后的下一个工作日起适用A类基金份额的费率。本基金B类基金份额的年销售服务费率为0.01%，对于由A类升级为B类的基金份额持有人，年销售服务费率应自其升级后的下一个工作日起适用B类基金份额的费率。具体如下：

$H = E \times \text{年销售服务费率} \div \text{当年天数}$

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

（2）基金销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支付给登记机构，由登记机构代付给销售机构。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延至最近可支付日支付。

#### 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

单位：人民币元

本期 2020年01月01日至2020年06月30日			
银行间市场交	债券交易金额	基金逆回购	基金正回购

易的各关联方名称	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
交通银行股份有限公司	97,342,600.00	-	-	-	-	-

注：本基金上年度可比期间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 各关联方投资本基金的情况

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

本基金本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

##### 6.4.10.4.2 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

#### 长江乐享货币A类份额

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
长江资管 锦绣20号 定向资产 管理计划	300,034.50	8.06%	297,162.77	3.88%

#### 长江乐享货币B类份额

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
长江楚越- 宝湾物 流第1期 资产支持 专项计划	0.00	0.0000%	22,079,604.13	0.63%

长江证券-山西天然气供气合同债权资产支持专项计划	9,731,641.45	0.36%	50,022,291.54	1.42%
长江证券创新投资(湖北)有限公司	28,651,579.93	1.05%	28,342,546.58	0.8%
长江成长资本投资有限公司	50,545,175.66	1.86%	50,000,000.00	1.42%
长江期货股份有限公司	100,000,000.00	3.68%	0.00	0.0000%

## 长江乐享货币C类份额

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
上海长江财富资产管理有限公司	2,472.82	0.0000%	4,000,000.00	0.08%

注：（1）本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方持有的基金份额占基金总份额的比例计算中，比例的分母采用其所持有的各自类别的份额总额；（2）本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金适用的相关费率符合基金合同和招募说明书的有关规定。

## 6.4.10.5 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
交通银行股份有限公司	4,634,809.94	1,994,636.06	200,591,100.10	271,522.78

注：本基金由基金托管人交通银行股份有限公司保管的银行存款，按约定利率计息。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.11 利润分配情况--按摊余成本法核算的货币市场基金

##### 长江乐享货币A类份额

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
33,767.69	13,222.00	-2,660.84	44,328.85	-

##### 长江乐享货币B类份额

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
10,298,561.73	5,058,705.84	-637,326.67	14,719,940.90	-

##### 长江乐享货币C类份额

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
52,090,103.21	7,067,108.23	-1,256,038.56	57,901,172.88	-

#### 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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：资产支持证券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
168596	恒信27A1	2020-06-17	2020-07-22	未上市流通受限	100.00	100.00	200,000	20,000.00	20,000.00	

#### 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为0，无抵押债券。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2020年6月30日止，本基金从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为0，无抵押债券。

#### 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

本基金投资的金融工具主要为各类货币市场工具。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，以实现在保证本金安全和资产流动性最大化的前提下，追求超过业绩比较基准的收益的投资目标。

本基金的基金管理人奉行全员与全程结合、风控与发展并重的风险管理理念。董事会主要负责公司的风险管理战略和控制政策、协调突发重大风险等事项。在公司经营管理层下设风险控制委员会，制定公司日常经营过程中各类风险的防范和管理措施；在业务操作层面，一线业务部门负责对各自业务领域风险的管控，公司具体的风险管理职责由法律合规部、风险管理部负责，组织、协调并与各业务部门共同完成对法律风险、投资风险、操作风险、合规风险等风险类别的管理，并定期向公司专门的风险管理委员会报告公司风险状况。法律合规部和风险管理部分别由合规总监和首席风险官分管，配置

有合规、风控方面专业人员。本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 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、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，因此违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

##### 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	730,008,659.31	510,006,070.42
A-1以下	-	-
未评级	1,108,096,326.10	649,948,263.11
合计	1,838,104,985.41	1,159,954,333.53

注：（1）债券评级取自第三方评级机构的债项评级；（2）截止报告期末，本基金持有的未评级的债券包括债券期限在一年及一年以内的超短期融资券、政策性金融债。

##### 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	2,208,616,002.52	2,185,243,989.01
合计	2,208,616,002.52	2,185,243,989.01

注：同业存单评级取自第三方评级机构的债项评级。

#### 6.4.13.2.3 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 2020年06月30日	上年度末 2019年12月31日
AAA	-	-
AAA以下	-	-
未评级	100,485,545.35	-
合计	100,485,545.35	-

注：（1）债券评级取自第三方评级机构的债项评级；（2）截止报告期末，本基金持有的未评级的债券包括债券期限在一年以上的政策性金融债。

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2020年06月30日	上年度末 2019年12月31日
AAA	33,684,000.00	30,000,000.00
AAA以下	-	-
未评级	20,000,000.00	-
合计	53,684,000.00	30,000,000.00

注：资产支持证券评级取自第三方评级机构的债项评级。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指在履行以交付现金或其他金融资产的方式结算的义务时发生资金短缺的风险。对于本基金而言，体现在所持金融工具变现的难易程度。

本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可在基金运作周期内的每个开放日要求赎回其持有的基金份额，另一方面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或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

#### 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》、《货币市场基金监督管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用流动性受限资产比例、份额持有人集中度、调整平均剩余期限和平均剩余存续期、压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申赎模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金主要投资于公开发行的、信用级别较好的债券资产，高流动性资产比例较高。当在基金运作过程中遇到流动性风险时，可通过交易所回购、交易所协议回购和银行间回购、债券资产变现等多种操作缓解流动性风险。

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

#### 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因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。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，此外还持有银行存款、结算备付金等利率敏感性资产，因此存在相应的利率风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

##### 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个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5 年	5年 以上	不计息	合计
------------------------	-------	-------	--------	----------	----------	-----	----

资产							
银行存款	104,634,809.94	710,000,000.00	625,000,000.00	-	-	-	1,439,634,809.94
交易性金融资产	349,889,613.79	1,208,591,649.72	2,642,409,269.77	-	-	-	4,200,890,533.28
买入返售金融资产	2,944,714,657.07	-	-	-	-	-	2,944,714,657.07
应收利息	-	-	-	-	-	22,895,778.75	22,895,778.75
应收申购款	-	-	-	-	-	133,993,490.00	133,993,490.00
资产总计	3,399,239,080.80	1,918,591,649.72	3,267,409,269.77	-	-	156,889,268.75	8,742,129,269.04
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	2,550,409.09	2,550,409.09
应付托管费	-	-	-	-	-	618,280.97	618,280.97
应付销售服务费	-	-	-	-	-	21,071.14	21,071.14
应付交易费用	-	-	-	-	-	129,795.94	129,795.94
应交税费	-	-	-	-	-	23,148.66	23,148.66
应付利润	-	-	-	-	-	847,934.97	847,934.97
其他负债	-	-	-	-	-	3,050,760.07	3,050,760.07
负债总计	-	-	-	-	-	7,241,400.84	7,241,400.84
利率敏感度缺口	3,399,239,080.80	1,918,591,649.72	3,267,409,269.77	-	-	149,647,867.91	8,734,887,868.20
上年度末 2019年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	422,824,032.82	620,000,000.00	200,000,000.00	-	-	-	1,242,824,032.82
交易性金融资产	689,736,211.73	1,006,284,756.74	1,679,177,354.07	-	-	-	3,375,198,322.54
买入返售	3,036,314,2	-	-	-	-	-	3,036,314,234.

金融资产	34.46						46
应收利息	-	-	-	-	-	19,368,079.83	19,368,079.83
应收申购款	-	-	-	-	-	931,301,000.00	931,301,000.00
资产总计	4,148,874,479.01	1,626,284,756.74	1,879,177,354.07	-	-	950,669,079.83	8,605,005,669.65
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,743,121.93	1,743,121.93
应付托管费	-	-	-	-	-	422,575.06	422,575.06
应付销售服务费	-	-	-	-	-	11,052.94	11,052.94
应付交易费用	-	-	-	-	-	61,305.54	61,305.54
应交税费	-	-	-	-	-	37,864.01	37,864.01
应付利润	-	-	-	-	-	2,743,961.04	2,743,961.04
其他负债	-	-	-	-	-	2,474,078.98	2,474,078.98
负债总计	-	-	-	-	-	7,493,959.50	7,493,959.50
利率敏感度缺口	4,148,874,479.01	1,626,284,756.74	1,879,177,354.07	-	-	943,175,120.33	8,597,511,710.15

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约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

假设	该利率敏感性分析基于本基金于资产负债表日的利率风险状况	
假设	该利率敏感性分析基于本基金于资产负债表日的利率风险状况 除利率之外的其他市场变量保持不变	
假设	该利率敏感性分析并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动	
假设	银行存款、结算备付金、存出保证金和部分应收申购款均以活期存款利率计息，假定利率变动仅影响该类资产的未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响；买入返售金融资产的利息收益和卖出回购金融资产款的利息支出在交易时已确定，不受利率变化影响	
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
市场利率上升25个基点	-1, 615, 178. 31	-2, 376, 753. 77
市场利率下降25个基点	1, 615, 178. 31	2, 376, 753. 77

#### 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。本基金主要投资于交易所及银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 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。

##### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

##### (i) 各层次金融工具公允价值

于2020年6月30日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第二层次的余额为 4, 200, 890, 533. 28 元，无属于第一和第三层次的余额。（于2019年12月31日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第二层次的余额为3, 375, 198, 322. 54元，无属于第一和第三层次的余额。）

##### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

##### (iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

##### (c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2020年6月30日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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。

(2) 除公允价值外，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	4,200,890,533.28	48.05
	其中：债券	4,147,206,533.28	47.44
	资产支持证券	53,684,000.00	0.61
2	买入返售金融资产	2,944,714,657.07	33.68
	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	1,439,634,809.94	16.47
4	其他各项资产	156,889,268.75	1.79
5	合计	8,742,129,269.04	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	1.17	
	其中：买断式回购融资	-	
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	-	-
	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；对于货币市场基金，只要其投资的市场（如银行间市场）可交易，即可视为交易日。

### 债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过基金资产净值的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	88
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	118
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	58

### 报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

本报告期内本货币市场基金未出现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	38.92	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	8.69	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	13.27	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—120天	6.32	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)—397天(含)	31.08	-

	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		98.29	-

#### 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

本报告期内本货币市场基金未出现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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	798,365,109.39	9.14
	其中：政策性金融债	798,365,109.39	9.14
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	1,140,225,421.37	13.05
6	中期票据	-	-
7	同业存单	2,208,616,002.52	25.28
8	其他	-	-
9	合计	4,147,206,533.28	47.48
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	200201	20国开01	2,000,000	200,382,405.20	2.29
2	200206	20国开06	2,000,000	198,464,921.33	2.27
3	111903216	19农业银行CD 216	2,000,000	197,605,453.39	2.26

4	200403	20农发03	1,500,000	148,860,662.84	1.70
5	012000549	20中石集SCP001	1,000,000	100,210,642.06	1.15
6	190211	19国开11	1,000,000	100,184,320.05	1.15
7	012001185	20中金集SCP001	1,000,000	100,003,568.72	1.14
8	072000138	20广发证券CP006BC	1,000,000	100,002,094.12	1.14
9	072000112	20东北证券CP004	1,000,000	100,001,323.64	1.14
10	111909237	19浦发银行CD237	1,000,000	99,889,223.14	1.14

#### 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	1
报告期内偏离度的最高值	0.2561%
报告期内偏离度的最低值	-0.0068%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1032%

#### 报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

本报告期内本货币市场基金未出现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

本报告期内本货币市场基金未出现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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	摊余成本	占基金资产净值比例（%）
1	165440	一局01优	300,000	30,000,000.00	0.34
2	168596	恒信27A1	200,000	20,000,000.00	0.23
3	165555	中电6优A	300,000	3,684,000.00	0.04

## 7.9 投资组合报告附注

### 7.9.1 基金计价方法说明

本基金估值采用“摊余成本法”，即计价对象以买入成本列示，按照票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价与折价，在剩余存续期内按实际利率法摊销，每日计提损益。本基金不采用市场利率和上市交易的债券和票据的市价计算基金资产净值。

7.9.2 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有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	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	22,895,778.75
4	应收申购款	133,993,490.00
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	156,889,268.75

### 7.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## §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)	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

长江乐享货币A类份额	426	8,743.39	1,909,394.94	51.26%	1,815,290.39	48.74%
长江乐享货币B类份额	42	64,766,162.94	2,720,178,843.62	100.00%	0.00	0.00%
长江乐享货币C类份额	131,004	45,883.98	528,116,392.84	8.79%	5,482,867,946.41	91.21%
合计	131,472	66,439.15	3,250,204,631.40	37.21%	5,484,683,236.80	62.79%

注：（1）分类基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分类基金，比例的分母采用各自类别的份额；对合计数，比例的分母采用下属分类基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

（2）户均持有的基金份额合计=期末基金份额总额/期末持有人户数合计。

## 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	券商类机构	400,125,247.60	4.58%
2	基金类机构	350,000,000.00	4.01%
3	基金类机构	238,166,360.62	2.73%
4	其他机构	227,787,302.21	2.61%
5	券商类机构	200,346,193.46	2.29%
6	券商类机构	160,050,099.04	1.83%
7	其他机构	120,177,071.25	1.38%
8	券商类机构	119,000,000.00	1.36%
9	其他机构	110,821,796.90	1.27%

10	银行类机构	100,663,155.18	1.15%
----	-------	----------------	-------

注：持有份额占总份额比例的计算中，比例的分母采用期末基金份额总额。

### 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	长江乐享货币A类份额	14,196.09	0.3811%
	长江乐享货币B类份额	-	0.00%
	长江乐享货币C类份额	369,732.99	0.0062%
	合计	383,929.08	0.0044%

注：持有份额总数占基金总份额比例的计算中，对下属分类基金，比例的分母采用各自类别的份额；对合计数，比例的分母采用下属分类基金份额的合计数（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、基金投资和相关部门负责人持有本开放式基金	长江乐享货币A类份额	0
	长江乐享货币B类份额	0
	长江乐享货币C类份额	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	长江乐享货币A类份额	0
	长江乐享货币B类份额	0
	长江乐享货币C类份额	0
	合计	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

	长江乐享货币 A类份额	长江乐享货币 B类份额	长江乐享货币 C类份额
基金合同生效日(2016年10月26日)基	365,630,163.87	1,786,429,883.80	656,258,658.18

金份额总额			
本报告期期初基金份额总额	7,656,281.55	3,521,376,597.21	5,068,478,831.39
本报告期基金总申购份额	5,489,380.61	5,543,731,439.06	82,182,669,645.80
减：本报告期基金总赎回份额	9,420,976.83	6,344,929,192.65	81,240,164,137.94
本报告期期末基金份额总额	3,724,685.33	2,720,178,843.62	6,010,984,339.25

注：本基金基金合同于2016年10月26日生效。上述“基金总申购份额”、“基金总赎回份额”包含A类份额、B类份额之间升降级的调增、调减份额及红利再投资份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内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

1、本报告期内，吴迪先生自2020年2月25日起任本基金管理人合规负责人；周纯先生自2020年2月25日起不再代任本基金管理人合规负责人。

2、本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及对公司运营管理和基金运作产生重大影响的，与本基金管理人、基金财产、基金托管业务相关的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期内未改变投资策略。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期内继续选聘中审众环会计师事务所（特殊普通合伙）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，本基金管理人、托管人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	
安信证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-

注：1、基金专用交易单元的选择标准如下：

- (1) 资历雄厚，信誉良好，注册资本不少于2亿元人民币；
- (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，最近两年未因重大违规行为而受到中国证监会和中国人民银行处罚；
- (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) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理基金进行证券交易的需要，并能为基金公司提供全面的信息服务；
- (6) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时为基金提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析报告、个股分析报告及其他专门报告，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告。

2、基金专用交易单元的选择程序如下：

我司根据上述标准，选定符合条件的证券公司作为租用交易单元的对象，并签订交易单元租用协议。公司的投资和研究部门定期对所选证券公司的服务进行综合评比，评比内容包括：提供宏观、行业、策略、专题、公司等研究报告的质量和数量；组织相关研讨会议的数量和质量；协助安排上市公司调研的质量和数量；主动进行上门路演和反路演的数量和质量；以及其他及时性及提供研究服务主动性和质量等情况。最终公司统一依据评比结果确定交易单元交易的具体情况。

3、本基金本报告期内租用的券商交易单元未发生变更。

### 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	
	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
安信证券	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-
长江证券	-	-	1,745,000,000.00	100.00%

### 10.8 偏离度绝对值超过0.5%的情况

本基金本报告期内未出现偏离度绝对值超过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	长江乐享货币市场基金2019年第四季度报告	指定网站	2020-01-17
2	长江证券（上海）资产管理有限公司旗下全部基金2019年第四季度报告提示性公告	指定报刊	2020-01-17
3	长江证券（上海）资产管理有限公司关于关于长江乐享货币市场基金A、B类份额于2020年“春节”假期前暂停及节后恢复大额申购、定期定额投资业务的公告	指定报刊、网站	2020-01-21
4	长江证券（上海）资产管理有限公司关于2020年春节假期延长期间申购赎回等交易业务及清算交收安排的提示性公告	指定报刊、网站	2020-01-30
5	长江证券（上海）资产管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	指定报刊、网站	2020-02-27
6	长江证券（上海）资产管理有限公司关于长江乐享货币市场基金B类、C类份额持有人单个基金账户持有限额的公告	指定报刊、网站	2020-03-24
7	长江证券（上海）资产管理有限公司关于旗下基金延期披露2019年年度报告的公告	指定报刊、网站	2020-03-25
8	长江乐享货币市场基金招募说明书（更新）摘要（2020年3月31日更新）	指定报刊、网站	2020-03-31
9	长江乐享货币市场基金招募说明书（更新）（2020年3月31日更新）	指定网站	2020-03-31

10	长江乐享货币市场基金2020年第一季度报告	指定网站	2020-04-22
11	长江证券（上海）资产管理有限公司旗下全部基金2020年第一季度报告提示性公告	指定报刊	2020-04-22
12	长江证券（上海）资产管理有限公司关于泰诚财富基金销售（大连）有限公司终止办理旗下基金相关销售业务的公告	指定报刊、网站	2020-04-27
13	长江乐享货币市场基金2019年年度报告	指定网站	2020-04-30
14	长江证券（上海）资产管理有限公司旗下全部基金2019年年度报告提示性公告	指定报刊	2020-04-30
15	长江证券（上海）资产管理有限公司关于开展网上服务系统应急演练的公告	指定报刊、网站	2020-05-14
16	长江证券（上海）资产管理有限公司关于网上交易系统暂停服务的公告	指定报刊、网站	2020-06-03
17	长江证券（上海）资产管理有限公司关于网上交易系统暂停服务的公告	指定报刊、网站	2020-06-23

## § 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	20200207-20200318	-	3,506,492,842.80	3,167,883,743.69	338,609,099.11	3.88%

#### 产品特有风险

报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过 20%的情况，由此可能导致的特有风险包括但不限于：当投资者持有份额占比较为集中时，个别投资者的大额赎回可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响；极端情况下基金管理人可能无法以合理价格及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请，可能带来流动性风险；如个别投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据基金合同约定决定部分延期赎回或暂停赎回，可能影响投资者赎回业务办理；持有基金份额占比较高的投资者在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。

## 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、中国证监会准予长江乐享货币市场基金募集申请的注册文件
- 2、长江乐享货币市场基金基金合同
- 3、长江乐享货币市场基金招募说明书
- 4、长江乐享货币市场基金托管协议
- 5、法律意见书
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 7、本报告期内按照规定披露的各项公告

### 12.2 存放地点

存放地点为基金管理人办公地址：上海市浦东新区世纪大道1198号世纪汇一座27层。

### 12.3 查阅方式

投资者可在营业时间至基金管理人办公地点免费查阅，亦可通过基金管理人网站查阅，网址为www.cjzcg1.com。

长江证券（上海）资产管理有限公司  
二〇二〇年八月三十一日