

# 长信利息收益开放式证券投资基金 2016 年半年度报告

2016 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：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2016 年 8 月 26 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。本半年度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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司，根据本基金合同规定，于 2016 年 8 月 24 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 2016 年 1 月 1 日起至 2016 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.....	6
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>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	7
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	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.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
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
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>14</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
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.....	14
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	14
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>15</b>
6.1 资产负债表.....	15
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.....	18
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>39</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	39
7.2 债券回购融资情况.....	39
7.3 基金投资组合平均剩余期限.....	40
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.....	40
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	40
7.6 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.....	41
7.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离.....	41
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	42
7.9 投资组合报告附注.....	42
<b>§8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>43</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	43
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	43

8.3 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的情况 .....	43
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>45</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 .....	46
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	46
10.4 基金投资策略的改变.....	46
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	46
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 .....	46
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.....	48
10.9 其他重大事件 .....	48
<b>§11 备查文件目录.....</b>	<b>50</b>
11.1 备查文件目录.....	50
11.2 存放地点.....	50
11.3 查阅方式.....	50

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	长信利息收益开放式证券投资基金	
基金简称	长信利息收益货币	
场内简称	长信利息	
基金主代码	519999	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2004 年 3 月 19 日	
基金管理人	长信基金管理有限责任公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	9,649,645,593.15 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	长信利息收益货币 A	长信利息收益货币 B
下属分级基金的交易代码	519999	519998
报告期末下属分级基金的份额总额	375,035,082.06 份	9,274,610,511.09 份

注：1、本基金于 2010 年 11 月 25 日起实行销售服务费分级收费方式，根据投资者持有本基金的份额划分 A、B 等级，并适用不同的销售服务费率。详见 2010 年 11 月 20 日《长信基金管理有限责任公司关于修改长信利息收益基金〈基金合同〉和〈招募说明书（更新）〉有关内容的公告》。

2、自 2011 年 12 月 19 日起，本基金可通过上海证券交易所场内系统办理申购、赎回业务，本基金 A、B 等级基金份额在上海证券交易所场内系统申购赎回的基金代码分别为 519599、519598，其对应的申购赎回的基金简称为“利息 A”、“利息 B”。

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在尽可能保证基金资产安全和高流动性的基础上，追求超过银行存款利率的收益水平。
投资策略	<p>1、利率预期策略 通过对宏观经济、货币政策、短期资金供给等因素的分析，形成对利率走势的判断，并确定投资组合的平均剩余期限。</p> <p>2、资产配置策略 根据对市场利率走势的判断，结合各品种之间流动性、收益性及风险情况，确定组合的资产配置，在保证组合高流动性、低风险的前提下尽量提升组合的收益。</p> <p>3、无风险套利策略 由于市场分割，使银行间市场与交易所市场的资金面和市场短期利率在一定时间可能存在定价偏离。同时在一定时间内市场中也可能出现跨品种、跨期限套利机会。本基金将在充分论证套利的可行性基础上谨慎参与。</p> <p>4、现金流预算管理策略 通过对未来现金流的预测，在投资组合的构建中，</p>

	采取合理的期限和权重配置对现金流进行预算管理，以满足基金运作的要求。同时在一部分资金管理上，将采用滚动投资策略，以提高基金资产的流动性。
业绩比较基准	银行活期存款利率（税后）
风险收益特征	本基金为货币市场基金，其预期收益和预期风险水平低于债券型、混合型和股票型基金，属于预期收益和预期风险偏低的基金品种。

### 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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	周永刚	林葛
	联系电话	021-61009999	010-66060069
	电子邮箱	zhouyg@cxfund.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		4007005566	95599
传真		021-61009800	010-68121816
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区银城中路 68 号 9 楼	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址		上海市浦东新区银城中路 68 号 9 楼	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 9 层
邮政编码		200120	100031
法定代表人		叶焯	周慕冰

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报、证券日报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.cxfund.com.cn
基金半年度报告备置地点	上海银城中路 68 号时代金融中心 9 楼、北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京西城区太平桥大街 17 号

### § 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

基金级别	长信利息收益货币 A	长信利息收益货币 B
3.1.1 期间数据和指标	报告期( 2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日 )	报告期( 2016 年 1 月 1 日 - 2016 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	4,109,492.08	157,781,359.15
本期利润	4,109,492.08	157,781,359.15
本期净值收益率	1.2415%	1.3624%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末( 2016 年 6 月 30 日 )	
期末基金资产净值	375,035,082.06	9,274,610,511.09
期末基金份额净值	-	-
3.1.3 累计期末指标	报告期末( 2016 年 6 月 30 日 )	
累计净值收益率	45.3348%	24.4748%

注：1、自 2016 年 1 月 1 日起，本基金收益分配调整为每日分配、按日支付。

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、本基金于 2010 年 11 月 25 日起实行销售服务费分级收费方式，根据投资者持有本基金的份额划分 A、B 等级，并适用不同的销售服务费率，分级后的 B 级基金份额从 2010 年 11 月 25 日起享受 B 级基金收益。

4、主要会计数据和财务指标中长信利息收益货币 A 级按分级前后延续计算，即本基金分级前的数据全部纳入长信利息收益货币 A 级基金核算，长信利息收益货币 B 级自 2010 年 11 月 25 日起开始计算。

#### 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

##### 3.2.1.1 长信利息收益货币A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

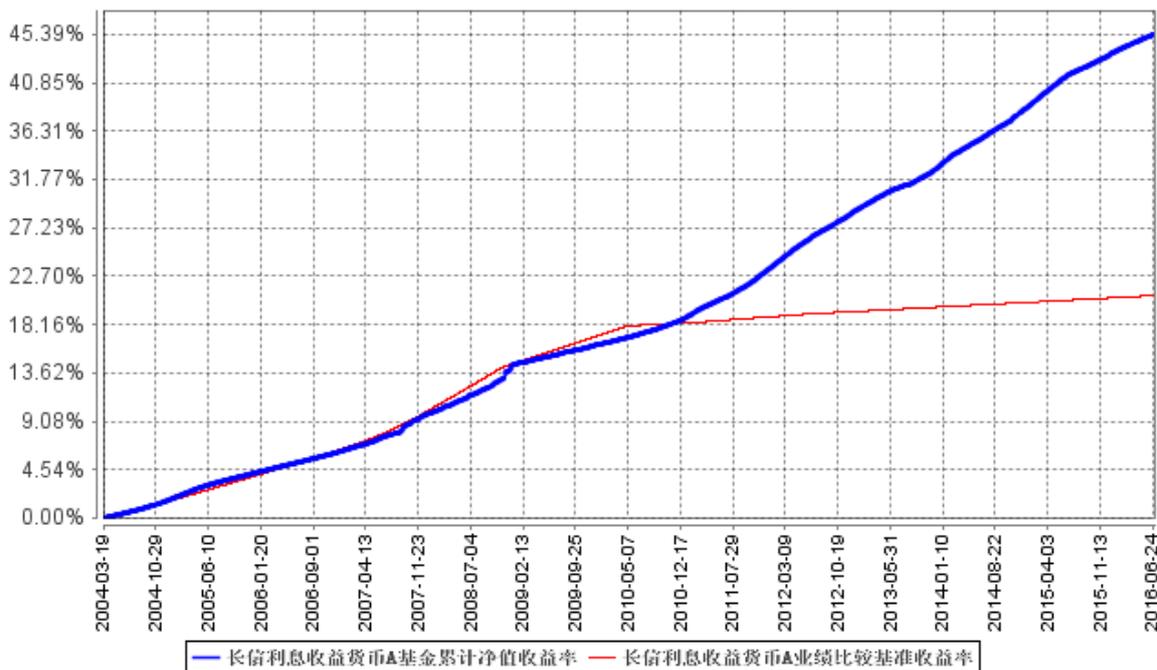
阶段	份额净值收 益率①	份额净值收 益率标准差 ②	业绩比较基准收 益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.1815%	0.0012%	0.0292%	0.0000%	0.1523%	0.0012%
过去三个月	0.5870%	0.0013%	0.0885%	0.0000%	0.4985%	0.0013%
过去六个月	1.2415%	0.0013%	0.1769%	0.0000%	1.0646%	0.0013%
过去一年	2.6812%	0.0023%	0.3558%	0.0000%	2.3254%	0.0023%
过去三年	10.9826%	0.0046%	1.0656%	0.0000%	9.9170%	0.0046%
自基金合同 生效起至今	45.3348%	0.0071%	14.9570%	0.0032%	30.3778%	0.0039%

### 3.2.1.2 长信利息收益货币B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

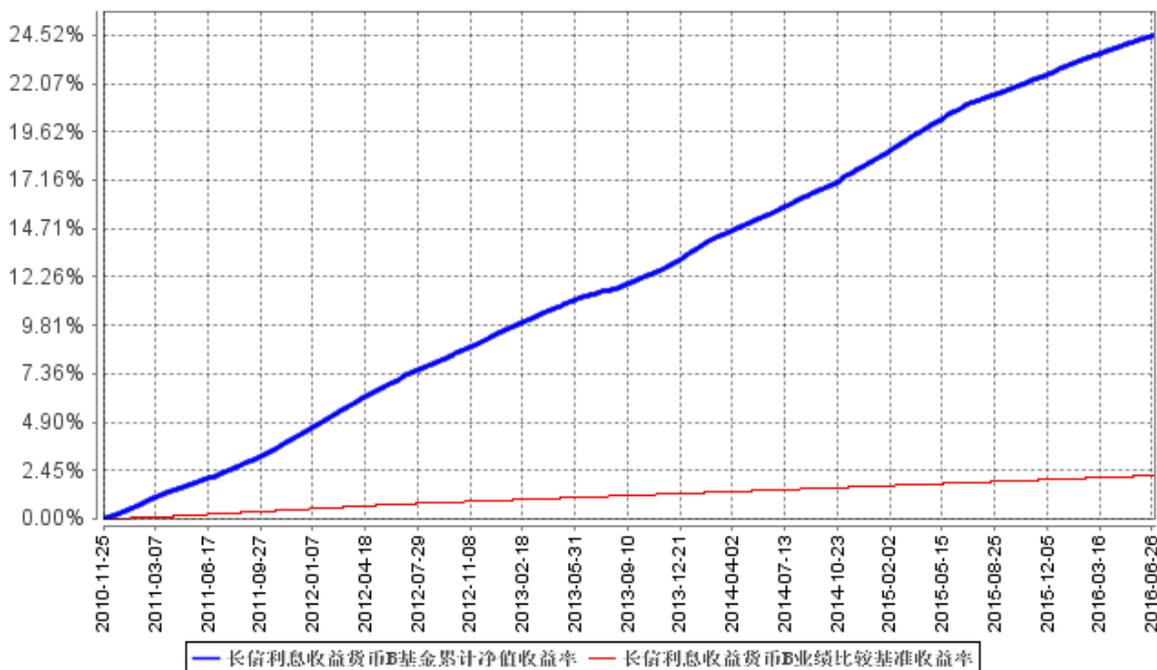
阶段	份额净值 收益率①	份额净值收 益率标准差②	业绩比较基准 收益率③	业绩比较基 准收益率标准 差④	①—③	②—④
过去一个月	0.2011%	0.0012%	0.0292%	0.0000%	0.1719%	0.0012%
过去三个月	0.6469%	0.0013%	0.0885%	0.0000%	0.5584%	0.0013%
过去六个月	1.3624%	0.0013%	0.1769%	0.0000%	1.1855%	0.0013%
过去一年	2.9280%	0.0023%	0.3558%	0.0000%	2.5722%	0.0023%
过去三年	11.7838%	0.0046%	1.0656%	0.0000%	10.7182%	0.0046%
自基金合同 生效起至今	24.4748%	0.0043%	2.1817%	0.0002%	22.2931%	0.0041%

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

#### 3.2.2.1 长信利息收益货币A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



### 3.2.2.2 长信利息收益货币B自基金分级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



注：1、长信利息收益货币 A 图示日期为 2004 年 3 月 19 日至 2016 年 6 月 30 日，长信利息收益货币 B 图示日期为 2010 年 11 月 25 日（本基金分级日）至 2016 年 6 月 30 日。

2、按基金合同规定，本基金自合同生效日起 3 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 1.5 亿元人民币。目前股权结构为：长江证券股份有限公司占 49%、上海海欣集团股份有限公司占 34.33%、武汉钢铁股份有限公司占 16.67%。

截至 2016 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 37 只开放式基金，即长信利息收益货币、长信银利精选混合、长信金利趋势混合、长信增利动态策略混合、长信双利优选混合、长信利丰债券、长信恒利优势混合、长信量化先锋混合、长信标普 100 等权重指数 (QDII)、长信利鑫债券 (LOF)、长信内需成长混合、长信可转债债券、长信利众债券 (LOF)、长信纯债一年定开债券、长信纯债壹号债券、长信改革红利混合、长信量化中小盘股票、长信新利混合、长信利富债券、长信利盈混合、长信利广混合、长信多利混合、长信睿进混合、长信量化多策略股票、长信医疗保健混合 (LOF)、长信中证一带一路指数、长信富民纯债一年定开债券、长信富海纯债一年定开债券、长信利保债券、长信富安纯债一年定开债券、长信中证能源互联网指数 (LOF)、长信金葵纯债一年定开债券、长信富全纯债一年定开债券、长信利泰混合、长信海外收益一年定开债券 (QDII)、长信先锐债券、长信利发债券。

#### 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		
张文琍	本基金、长信利鑫债券基金 (LOF) 和长信纯债壹号债券基金的基金经理、公司固定收益部总监	2013 年 8 月 8 日	-	22 年	高级工商管理硕士，上海财经大学 EMBA 毕业，具有基金从业资格。曾任湖北证券公司交易一部交易员、长江证券有限责任公司资产管理事业部主管、债券事业总部投资部经理、固定收益总部交易部经理。2004 年 9 月加入长信基金管理有限责任公司，历任长信利息收

					益货币基金的基金交易员、基金经理助理、本基金的基金经理。现任长信基金管理有限责任公司固定收益部总监，本基金、长信利鑫债券基金（LOF）和长信纯债壹号债券基金的基金经理。
--	--	--	--	--	--

注：1、基金经理任职日期以本基金成立之日为准。新增或变更以刊登新增/变更基金经理的公告披露日为准。

2、证券从业年限以基金经理进入证券业务相关机构的工作经历为时间计算标准。

#### 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

本报告期内，公司已实行公平交易制度，并建立公平交易制度体系，已建立投资决策体系，加强交易执行环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时，公司已通过对投资交易行为的监控、分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，除完全按照有关指数的构成比例进行投资的组合外，其余各投资组合未发生参与交易所公开竞价同日反向交易且成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情形，未发现异常交易行为。

## 4.4 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

从 2016 年一季度市场的走势看，上涨的节奏出现了一定的放缓。但是同时，对经济较为悲观的预期和股市的大幅调整，导致投资者风险偏好降低，大量资金涌入债市的趋势未发生明显变化。

其中，4 月开始，美国经济复苏势头有所放缓，通胀略微上升。欧元区经济增长复苏势头较为温和，通缩势头持续。国内宏观经济略显企稳迹象，CPI 同比涨幅与上月相同，环比降幅收窄，PPI 环比升幅扩大。出口贸易额同比大幅上升，但贸易顺差降幅继续收窄。从债券市场来看，因信用违约集中爆发，信用债市场分化严重，机构提高入池门槛，中高信用等级信用债群贤毕至，低等级无人问津，市场情绪波动加大，各券种债券收益率曲线区间波动加剧。6 月英国脱欧公投后，全球开启避险模式，风险资产大跌，债券黄金又再次受到追捧。

上半年，我们保持较短久期，继续减持信用债，增持存单和资金波段操作效率，在坚持保证流动性前提下，提高组合回报。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2016 年 6 月末，本报告期长信利息收益货币 A 净值收益率为 1.2415%，长信利息收益货币 B 净值收益率为 1.3624%，同期业绩比较基准收益为 0.1769%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，全球市场不确定因素增加，债券市场多空因素交织，供给侧改革与需求端刺激的政策相互博弈，债券市场维持震荡概率较大。目前政策正处于“上、下限”的管理模式，同时，通胀影响因素尚存，全球金融环境动荡，人民币汇率贬值预期加大，央行货币政策仍将以中性为主。从政策和国内外宏观经济环境的角度出发，债券收益率下行动力由于供给以及货币政策中性尤其是量松价控的拖累下显得不足，美国加息预期也将左右市场情绪，市场存在局部的波段操作机会。在信用风险事件频发的大背景下，需要我们更多地介入信用风险把控，并将努力把握市场超调带来的波段机会。

## 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 2008 年 9 月 12 日发布的[2008]38 号文《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》的规定，长信基金管理有限责任公司（以下简称“公司”）制订了健全、有效的估值政策和程序，成立了估值工作小组，小组成员由投资管理部总监、固定收益

部总监、研究发展部总监、股票交易部总监、量化投资部总监、基金事务部总监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。基金经理不直接参与估值决策，如果基金经理认为某证券有更好的证券估值方法，可以申请公司估值工作小组对某证券进行专项评估。估值决策由与会估值工作小组成员 1/2 以上多数票通过。对于估值政策，公司与基金托管人充分沟通，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。

参与估值流程各方不存在任何重大利益冲突。报告期内，未签订与估值相关的定价服务。

#### **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、按月结转，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 161,890,851.23 元，已分配利润 161,890,851.23 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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—长信基金管理有限责任公司 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

### 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

本托管人认为，长信基金管理有限责任公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，长信基金管理有限责任公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

## § 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：长信利息收益开放式证券投资基金

报告截止日：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.6.1	3,556,059,495.66	852,710,314.10
结算备付金		300,000.00	300,000.00
存出保证金		300,000.00	300,000.00
交易性金融资产	6.4.6.2	3,056,881,608.71	3,913,312,436.89
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		3,056,881,608.71	3,913,312,436.89
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.6.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.6.4	3,872,771,632.70	2,822,289,333.42
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.6.5	47,031,596.69	67,068,953.32
应收股利		-	-
应收申购款		134,231,784.23	699.98
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.6.6	9,633.48	-
资产总计		10,667,585,751.47	7,655,981,737.71
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2015 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	6.4.6.3	-	-
卖出回购金融资产款		1,009,399,095.30	1,111,478,854.26
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		1,063,483.33	1,817,681.13
应付管理人报酬		4,297,991.71	1,508,060.07
应付托管费		1,302,421.78	456,987.89
应付销售服务费		195,706.97	109,127.49
应付交易费用	6.4.6.7	301,235.04	149,223.31

应交税费		-	-
应付利息		59,822.83	78,707.64
应付利润		729,966.72	5,994,485.44
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.6.8	590,434.64	644,591.02
负债合计		1,017,940,158.32	1,122,237,718.25
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.6.9	9,649,645,593.15	6,533,744,019.46
未分配利润	6.4.6.10	-	-
所有者权益合计		9,649,645,593.15	6,533,744,019.46
负债和所有者权益总计		10,667,585,751.47	7,655,981,737.71

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 9,649,645,593.15 份。

## 6.2 利润表

会计主体：长信利息收益开放式证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016年1月1日至2016 年6月30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015 年6月30日
<b>一、收入</b>		205,753,685.57	62,313,448.84
1.利息收入		200,909,447.75	51,933,815.78
其中：存款利息收入	6.4.6.11	46,839,552.93	3,734,519.22
债券利息收入		67,977,746.75	14,878,536.28
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		86,092,148.07	33,320,760.28
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		4,844,237.82	10,379,633.06
其中：股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.6.12	4,844,237.82	10,379,633.06
资产支持证券投资收益	6.4.6.12.3	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.6.13	-	-
股利收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）		-	-

<b>减：二、费用</b>		43,862,834.34	8,347,847.80
1. 管理人报酬	6.4.9.2.1	20,128,584.24	3,867,127.67
2. 托管费	6.4.9.2.2	6,099,570.91	1,171,856.90
3. 销售服务费	6.4.9.2.3	1,007,260.01	551,387.86
4. 交易费用	6.4.6.14	72,102.94	71,904.06
5. 利息支出		16,360,841.45	2,484,004.62
其中：卖出回购金融资产支出		16,360,841.45	2,484,004.62
6. 其他费用	6.4.6.15	194,474.79	201,566.69
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		161,890,851.23	53,965,601.04
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		161,890,851.23	53,965,601.04

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长信利息收益开放式证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 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）	6,533,744,019.46	-	6,533,744,019.46
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	161,890,851.23	161,890,851.23
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）	3,115,901,573.69	-	3,115,901,573.69
其中：1. 基金申购款	37,055,693,267.25	-	37,055,693,267.25
2. 基金赎回款	-33,939,791,693.56	-	-33,939,791,693.56
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）	-	-161,890,851.23	-161,890,851.23
五、期末所有者权益（基金净值）	9,649,645,593.15	-	9,649,645,593.15
项目	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 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)	849,989,256.75	-	849,989,256.75
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	53,965,601.04	53,965,601.04
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)	1,863,059,978.18	-	1,863,059,978.18
其中：1. 基金申购款	14,348,927,603.50	-	14,348,927,603.50
2. 基金赎回款	-12,485,867,625.32	-	-12,485,867,625.32
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)	-	-53,965,601.04	-53,965,601.04
五、期末所有者权益(基金净值)	2,713,049,234.93	-	2,713,049,234.93

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：

覃波

基金管理人负责人

覃波

主管会计工作负责人

孙红辉

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

长信利息收益开放式证券投资基金(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”)《关于同意长信利息收益开放式证券投资基金募集的批复》(证监基金字[2003]149号)批准,由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》及其配套规则和《长信利息收益开放式证券投资基金基金合同》发售,基金合同于2004年3月19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7,042,630,886.94份基金份额。本基金的基金管理人为长信基金管理有限责任公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司(以下简称“中国农业银行”)。

根据《长信利息收益开放式证券投资基金基金合同》和《长信利息收益开放式证券投资基金招募说明书(更新)》并报中国证监会备案,本基金于2010年11月25日起实行销售服务费A、B

分级收费方式，按单个基金账户内保留的基金份额是否达到或超过 500 万份将其分设为 A 级或 B 级基金份额，并分别适用不同的销售服务费费率。本基金分级后，除 A、B 两级基金份额收益率不同外，各级基金份额持有人的其他权益平等。

自 2011 年 12 月 19 日起，本基金可通过上海证券交易所场内系统办理申购、赎回业务，本基金 A、B 等级基金份额在上海证券交易所场内系统申购赎回的基金代码分别为 519599、519598，其对应的申购赎回的基金简称为“利息 A”、“利息 B”。

自 2013 年 6 月 21 日起，本基金在基金管理人“长金通”网上直销平台开通“T+0 快速赎回”业务。基金管理人已于 2013 年 6 月 19 日公开披露了《长信基金管理有限责任公司关于开通网上直销“T+0 快速赎回”业务的公告》及于 2013 年 6 月 21 日公开披露了《长信基金管理有限责任公司关于开通货币基金网上直销“T+0 快速赎回”业务调整的公告》。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《货币市场基金管理暂行规定》和《长信利息收益开放式证券投资基金基金合同》和《长信利息收益开放式证券投资基金招募说明书(更新)》的有关规定，本基金的投资范围为银行存款、大额存单、短期债券、中央银行票据、债券回购及中国证监会或中国人民银行认可的其他具有良好流动性的金融工具。在正常的市场情况下，本基金投资组合的范围为：现金、一年以内(含一年)的银行定期存款、大额存单、剩余期限在三百九十七天以内(含三百九十七天)的债券、期限在一年以内(含一年)的债券回购、期限在一年以内(含一年)的中央银行票据以及中国证监会、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。本基金的业绩比较基准为：银行活期存款税后利息率。

根据《证券投资基金信息披露管理办法》，本基金定期报告在公开披露的第二个工作日，报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。

#### 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公告[2010]5 号《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》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

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2016 年 6 月 30 日的财务状况、2016 年上半年的经营成果和基金净值变动情况。

#### 6.4.4 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.4.1 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。

##### 6.4.4.2 差错更正的说明

本基金在本报告期末未发生过重大会计差错。

#### 6.4.5 税项

根据财税字[1998]55 号文《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收问题的通知》、财税字[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[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》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) 以发行基金方式募集资金，不属于营业税征收范围，不征收营业税。
- (b) 基金管理人运用基金买卖债券的投资收益暂免征收营业税和企业所得税。
- (c) 对基金取得债券的利息收入，由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税。
- (d) 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。

#### 6.4.6 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.6.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
活期存款	6,059,495.66
定期存款	3,550,000,000.00
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	3,556,059,495.66

##### 6.4.6.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 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	3,056,881,608.71	3,057,377,000.00	495,391.29	0.0051%
	合计	3,056,881,608.71	3,057,377,000.00	495,391.29	0.0051%

注：截至 2016 年 6 月 30 日，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。

#### 6.4.6.3 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。

#### 6.4.6.4 买入返售金融资产

##### 6.4.6.4.1 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 2016 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券_银行间	3,872,771,632.70	-
合计	3,872,771,632.70	-

##### 6.4.6.4.2 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。

#### 6.4.6.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	18,414.77
应收定期存款利息	4,972,694.49
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	135.00
应收债券利息	33,965,055.20
应收买入返售证券利息	8,075,162.23
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	135.00
合计	47,031,596.69

#### 6.4.6.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产

## 6.4.6.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6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	301,235.04
合计	301,235.04

## 6.4.6.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	14.78
信息披露费-上证报	289,726.04
审计费用	34,809.32
预提帐户维护费	4,500.00
信息披露费-证券日报	39,781.56
预提帐户维护费-上清所	4,500.00
券商席位佣金	217,102.94
合计	590,434.64

## 6.4.6.9 实收基金

金额单位：人民币元

长信利息收益货币 A		
项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	353,311,527.14	353,311,527.14
本期申购	887,493,403.83	887,493,403.83
本期赎回(以“-”号填列)	-865,769,848.91	-865,769,848.91
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	375,035,082.06	375,035,082.06
长信利息收益货币 B		
项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	6,180,432,492.32	6,180,432,492.32
本期申购	36,168,199,863.42	36,168,199,863.42

本期赎回(以“-”号填列)	-33,074,021,844.65	-33,074,021,844.65
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	9,274,610,511.09	9,274,610,511.09

注：表内各级基金的申购和赎回均包括红利再投资、分级调整以及基金转入和转出数。

#### 6.4.6.10 未分配利润

单位：人民币元

长信利息收益货币 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	4,109,492.08	-	4,109,492.08
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	-4,109,492.08	-	-4,109,492.08
本期末	-	-	-
长信利息收益货币 B			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	157,781,359.15	-	157,781,359.15
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	-157,781,359.15	-	-157,781,359.15
本期末	-	-	-

#### 6.4.6.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月1日至2016年6月30日
活期存款利息收入	264,810.92
定期存款利息收入	46,551,332.26
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	20,952.75
其他	2,457.00
合计	46,839,552.93

**6.4.6.12 债券投资收益****6.4.6.12.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6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	4,844,237.82
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	4,844,237.82

**6.4.6.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	20,275,721,276.93
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	20,092,648,574.46
减：应收利息总额	178,228,464.65
买卖债券差价收入	4,844,237.82

**6.4.6.12.3 资产支持证券投资收益**

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

**6.4.6.13 衍生工具收益**

本基金本报告期无衍生工具收益。

**6.4.6.14 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
交易所市场交易费用	72,102.94
银行间市场交易费用	-
合计	72,102.94

**6.4.6.15 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
审计费用	35,175.84

信息披露费	89,507.60
帐户维护费	9,030.00
帐户维护费-上清所	9,000.00
其他费用	51,761.35
合计	194,474.79

注：其他费用为银行手续费。

## 6.4.7 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 6.4.7.1 或有事项

截至本财务报告批准报出日，本基金未发生需要披露的或有事项。

### 6.4.7.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金未发生需要披露的资产负债表日后事项。

## 6.4.8 关联方关系

### 6.4.8.1 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。

### 6.4.8.2 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
中国农业银行股份有限公司(以下简称“农业银行”)	基金托管人
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
上海海欣生物技术有限责任公司	基金管理人的股东的控股子公司
长信-策略6号资产管理计划	基金管理人管理的特定客户资产管理计划
长信基金-涌信2号资产管理计划	基金管理人管理的特定客户资产管理计划
长信基金-涌信3号资产管理计划	基金管理人管理的特定客户资产管理计划
长信-牡丹债券增强1号资产管理计划	基金管理人管理的特定客户资产管理计划
长信-融耀债券型1号资产管理计划	基金管理人管理的特定客户资产管理计划
长信-优享1号资产管理计划	基金管理人管理的特定客户资产管理计划
长信-广东农信普惠债券型1号	基金管理人管理的特定客户资产管理计划
长信-浦发-粤信2号资产管理计划	基金管理人管理的特定客户资产管理计划
长信-聚享1号资产管理计划	基金管理人管理的特定客户资产管理计划

## 6.4.9 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.9.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.9.1.1 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日	
	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
长江证券	600,000,000.00	100.00%	2,832,400,000.00	100.00%

#### 6.4.9.1.2 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
长江证券	72,102.94	100.00%	72,102.94	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
长江证券	71,904.06	100.00%	71,904.06	100.00%

注：本基金承担的席位使用费，以弥补券商相关的席位费用为原则，而不依据交易量。根据《证券交易席位及证券综合服务协议》，本基金管理人长信基金管理有限责任公司在租用长江证券交易专用席位进行债券交易的同时，从长江证券获得证券研究综合服务。

### 6.4.9.2 关联方报酬

#### 6.4.9.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日
	当期发生的基金应支付的管理费	20,128,584.24
其中：支付销售机构的客户维护费	254,248.12	289,278.36

注：支付基金管理人长信基金管理有限责任公司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。

计算公式为：日基金管理费=前一日基金资产净值×0.33%/当年天数

#### 6.4.9.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年6月30日	2015年1月1日至2015年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	6,099,570.91	1,171,856.90

注：支付基金托管人中国农业银行的基金托管费按前一日基金资产净值0.1%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.1%/当年天数

#### 6.4.9.2.3 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		
	2016年1月1日至2016年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	长信利息收益货币 A	长信利息收益货币 B	合计
农业银行	201,994.75	909.53	202,904.28
长信基金	106,326.25	549,863.91	656,190.16
长江证券	8,391.00	11,883.87	20,274.87
合计	316,712.00	562,657.31	879,369.31
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2015年1月1日至2015年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	长信利息收益货币 A	长信利息收益货币 B	合计
农业银行	270,145.80	2,145.58	272,291.38
长信基金	71,667.48	77,396.59	149,064.07
长江证券	5,411.33	13,243.57	18,654.90
合计	347,224.61	92,785.74	440,010.35

注：本基金于2010年11月25日起实行销售服务费分级收费方式，根据投资者持有本基金的份额划分A、B等级，并适用不同的销售服务费率，其中长信利息收益货币A的销售服务费用按前一日的基金资产净值的0.25%年费率计提，长信利息收益货币B的销售服务费用按前一日的基金资产净值的0.01%年费率计提。基金销售服务费逐日计提，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×R%/当年天数

R为该级基金的年销售服务费率

## 6.4.9.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本期 2016年1月1日至2016年6月30日						
银行间市场交易的各关联方名称	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
农业银行	1,904,900,448.08	-	-	-	800,000,000.00	42,821.92
上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日						
银行间市场交易的各关联方名称	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
农业银行	-	-	-	-	-	-

## 6.4.9.4 各关联方投资本基金的情况

## 6.4.9.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	
	长信利息收益货币 A	长信利息收益货币 B
基金合同生效日(2004年3月19日)持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	-	240,560,796.08
期间申购/买入总份额	-	83,604,131.26
期间因拆分变动份额	-	-
减:期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	-	324,164,927.34
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	3.36%
项目	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年6月30日	
	长信利息收益货币 A	长信利息收益货币 B
基金合同生效日(2004年3月19日)持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	-	304,905,628.97
期间申购/买入总份额	-	6,178,606.21
期间因拆分变动份额	-	-
减:期间赎回/卖出总份额	-	54,000,000.00
期末持有的基金份额	-	257,084,235.18
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	9.48%

注：1、期间申购总份额包括当期收益转份额部分。

2、报告期末持有基金份额中的 165,833,784.16 份为本基金管理人风险准备金投资。

#### 6.4.9.4.2 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

##### 6.4.9.4.2.1 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资长信利息收益货币 A 的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2016年6月30日		上年度末 2015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
上海海欣生物技术 有限公司	915.15	0.00%	902.59	0.00%
长信-策略6号资产 管理计划	12,957.93	0.00%	-	-
长信-聚享1号资产 管理计划	-	-	70,907.96	0.00%
长信基金-涌信2号 资产管理计划	1,046,243.19	0.01%	1,032,269.94	0.02%
长信基金-涌信3号 资产管理计划	1,046,243.19	0.01%	1,032,269.94	0.02%
长信-牡丹债券增 强1号资产管理计 划	1,309,130.50	0.01%	-	-
长信-融耀债券型1 号资产管理计划	13,107.86	0.00%	-	-
长信-优享1号资产 管理计划	8,879.63	0.00%	-	-

##### 6.4.9.4.2.1 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资长信利息收益货币 B 的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2016年6月30日		上年度末 2015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
长信-广东农 信普惠债券型 1号	165,087,570.05	1.71%	-	-
长信-浦发-粤	483,569,104.09	5.01%	-	-

信 2 号资产管理计划				
-------------	--	--	--	--

注：1、本基金无申购赎回费。

2、长信-策略 6 号资产管理计划、长信-广东农信普惠债券型 1 号资产管理计划、长信-聚享 1 号资产管理计划、长信基金-涌信 2 号资产管理计划、长信基金-涌信 3 号资产管理计划、长信-牡丹债券增强 1 号资产管理计划、长信-浦发-粤信 2 号资产管理计划、长信-融耀债券型 1 号资产管理计划、长信-优享 1 号资产管理计划均为本公司管理的专户产品。

#### 6.4.9.5 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		上年度可比期间	
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行股份有限公司	6,059,495.66	264,810.92	3,279,641.25	94,648.73

注：本基金通过“中国农业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备付金，于 2016 年 6 月 30 日的相关余额为人民币 300,000.00 元(2015 年 12 月 31 日：人民币 300,000.00 元)。

#### 6.4.9.6 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由关联方承销的证券。

#### 6.4.9.7 其他关联交易事项的说明

上述关联交易均根据正常的商业交易条件进行，并以一般交易价格为定价基础。

#### 6.4.10 利润分配情况

金额单位：人民币元

##### 长信利息收益货币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
3,931,436.86	69,402.57	108,652.65	4,109,492.08	-

##### 长信利息收益货币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
152,180,636.97	3,517,832.72	2,082,889.46	157,781,359.15	-

注：本基金于 2010 年 11 月 25 日起实行销售服务费分级收费方式，根据投资者持有本基金的份额划分 A、B 等级，并适用不同的销售服务费率，分级后的 B 级基金份额从 2010 年 11 月 25 日起享受 B 级基金收益。

## 6.4.11 期末（2016 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

### 6.4.11.1 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.11.1.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2016 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 1,009,399,095.30 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
150416	15 农发 16	2016 年 7 月 1 日	100.01	4,100,000	410,045,439.42
130228	13 国开 28	2016 年 7 月 1 日	100.07	2,000,000	200,139,712.80
111609239	16 浦发 CD239	2016 年 7 月 1 日	99.27	1,000,000	99,266,723.29
111610016	16 兴业 CD016	2016 年 7 月 1 日	99.92	2,000,000	199,842,025.42
111610171	16 兴业 CD171	2016 年 7 月 1 日	99.96	1,000,000	99,960,524.18
111610176	16 兴业 CD176	2016 年 7 月 1 日	99.95	1,000,000	99,953,823.96
111608010	16 中信 CD010	2016 年 7 月 1 日	99.91	500,000	49,955,092.29
合计				11,600,000.00	1,159,163,341.36

注：由于估值单价保留位数的问题，估值单价乘以质押数量与实际期末估值总额可能存在尾差。

## 6.4.12 金融工具风险及管理

### 6.4.12.1 风险管理政策和组织架构

本基金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。

本基金的基金管理人建立了以内部控制委员会为核心的、由内部控制委员会、量化投资部和相关职能部门构成的多级风险管理架构体系。

### 6.4.12.2 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。

本基金的活期银行存款存放在本基金的托管人中国农业银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金均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，以控制相应的信用风险。

#### 6.4.12.2.1 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 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
A-1	80,536,000.00	1,149,441,776.20
A-1 以下	-	-
未评级	2,976,841,000.00	2,763,870,660.69
合计	3,057,377,000.00	3,913,312,436.89

注：未评级债券为国债、政策金融债及央行票据等免评级债券。

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，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。其中，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。

级别设置	含义
A-1	还本付息能力最强，安全性最高。
A-2	还本付息能力较强，安全性较高。
A-3	还本付息能力一般，安全性易受不良环境变化的影响。
B	还本付息能力较低，有一定的违约风险。
C	还本付息能力很低，违约风险较高。
D	不能按期还本付息。

#### 6.4.12.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

本基金于本报告期末及上年末均未持有长期信用评级债券。

### 6.4.12.3 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与可能遭受的损失。本基金的流动性风险

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，另一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人主要通过限制、跟踪和控制基金投资交易的不活跃品种(企业债或短期融资券)来实现。本基金存放在具有基金托管资格的同一商业银行的存款，不超过基金资产净值的 30%；存放在不具有基金托管资格的同一商业银行的存款，不超过基金资产净值的 5%；本基金投资于短期金融工具的比重不低于基金资产总值的 80%，投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不超过 180 天。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式融入短期资金应对流动性需求，除发生巨额赎回的情形外，在全国银行间债券市场债券正回购的资金余额不超过基金资产净值 20%。

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。

本基金管理人量化投资部，每日通过平均剩余期限、久期、信用债、浮息债、银行存款及清算备付金占资产总值的比例等指标，监测基金所持有证券的流动性，衡量申购、赎回资金的比例，从而设定资金需求，避免发生流动性风险。

本基金所持有的全部金融负债无固定到期日或合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.12.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

本期末 2016年6月30日	1个月以内	1-3个月	6个月以 内	3个月-1年	6个月-1 年	1年以内	1-5年	5年以上	合计
资产									
银行存款	2,256,059,495.66	1,300,000,000.00	-	-	-	-	-	-	3,556,059,495.66
结算备付金	300,000.00	-	-	-	-	-	-	-	300,000.00
存出保证金	300,000.00	-	-	-	-	-	-	-	300,000.00
交易性金融资产	2,038,625,524.49	788,226,596.28	-	230,029,487.94	-	-	-	-	3,056,881,608.71
买入返售证券	3,872,771,632.70	-	-	-	-	-	-	-	3,872,771,632.70
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	47,031,596.69	-	-	-	-	47,031,596.69
应收申购款	134,231,784.23	-	-	-	-	-	-	-	134,231,784.23
待摊费用	-	-	-	9,633.48	-	-	-	-	9,633.48
资产总计	8,302,288,437.08	2,088,226,596.28	-	277,070,718.11	-	-	-	-	10,667,585,771.47

负债										
卖出回购金融资产款	1,009,399,095.30	-	-	-	-	-	-	-	-	1,009,399,095.30
应付赎回款	1,063,483.33	-	-	-	-	-	-	-	-	1,063,483.33
应付管理人报酬	4,297,991.71	-	-	-	-	-	-	-	-	4,297,991.71
应付托管费	1,302,421.78	-	-	-	-	-	-	-	-	1,302,421.78
应付销售服务费	195,706.97	-	-	-	-	-	-	-	-	195,706.97
应付交易费用	301,235.04	-	-	-	-	-	-	-	-	301,235.04
应付利息	59,822.83	-	-	-	-	-	-	-	-	59,822.83
应付利润	729,966.72	-	-	-	-	-	-	-	-	729,966.72
应交税费	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	590,434.64	-	-	-	-	-	-	-	-	590,434.64
负债总计	1,017,940,158.32	-	-	-	-	-	-	-	-	1,017,940,158.32
流动性净额	7,284,348,278.76	2,088,226,596.28	-	277,070,718.11	-	-	-	-	-	9,649,645,593.15
上年度末 15年12月31日		1个月以内	1-3个月	6个月以内	3个月-1年	6个月-1年	1年以内	1-5年	5年以上	合计
资产	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
银行存款	352,710,314.10	500,000,000.00	-	-	-	-	-	-	-	852,710,314.10
结算备付金	300,000.00	-	-	-	-	-	-	-	-	300,000.00
存出保证金	300,000.00	-	-	-	-	-	-	-	-	300,000.00
交易性金融资产	-	171,960,453.90	-	3,741,351,982.99	-	-	-	-	-	3,913,312,436.89
买入返售证券	2,822,289,333.42	-	-	-	-	-	-	-	-	2,822,289,333.42
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	3,838,360.57	2,255,704.13	-	60,974,888.62	-	-	-	-	-	67,068,953.32
应收申购款	699.98	-	-	-	-	-	-	-	-	699.98
资产总计	3,179,438,708.07	674,216,158.03	-	3,802,326,871.61	-	-	-	-	-	7,655,981,737.71
负债										
卖出回购金融资产款	1,111,478,854.26	-	-	-	-	-	-	-	-	1,111,478,854.26
应付赎回款	1,817,681.13	-	-	-	-	-	-	-	-	1,817,681.13
应付管理人报酬	1,508,060.07	-	-	-	-	-	-	-	-	1,508,060.07
应付托管费	456,987.89	-	-	-	-	-	-	-	-	456,987.89
应付销售服务费	109,127.49	-	-	-	-	-	-	-	-	109,127.49
应付交易费用	149,223.31	-	-	-	-	-	-	-	-	149,223.31
应付利息	78,707.64	-	-	-	-	-	-	-	-	78,707.64
应付利润	5,994,485.44	-	-	-	-	-	-	-	-	5,994,485.44
应交税费	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	565,591.02	-	-	79,000.00	-	-	-	-	-	644,591.02
负债总计	1,122,158,718.25	-	-	79,000.00	-	-	-	-	-	1,122,237,718.25
流动性净额	2,057,279,989.82	674,216,158.03	-	3,802,247,871.61	-	-	-	-	-	6,533,744,027.46

注：由于模板更新，原计入“无期限”的金额现统一计入“1个月以内”。

#### 6.4.12.4 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。

#### 6.4.12.4.1 利率风险

利率风险是指金融市场利率波动导致证券市场及利息收益的价格和收益率发生变动，从而直接影响基金的融资成本和经营业绩水平的风险。本基金的投资范围为银行存款、大额存单、短期债券、央行票据、债券回购等银行间市场固定收益品种。基金估值采用摊余成本法，按实际利率在其剩余期限内摊销，每日计提收益或损失，并通过“影子定价”对基金持有的估值对象进行重新评估，因此利率风险在一定程度上存在。

本基金管理人量化投资部，通过定期对所持债券修正久期等参数的监控进行利率风险敏感性测试。

下表统计了本基金面临的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

##### 6.4.12.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016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						
银行存款	3,556,059,495.66	-	-	-	-	3,556,059,495.66
结算备付金	300,000.00	-	-	-	-	300,000.00
存出保证金	300,000.00	-	-	-	-	300,000.00
交易性金融资产	3,056,881,608.71	-	-	-	-	3,056,881,608.71
买入返售金融资产	3,872,771,632.70	-	-	-	-	3,872,771,632.70
应收利息	-	-	-	-	47,031,596.69	47,031,596.69
应收申购款	-	-	-	-	134,231,784.23	134,231,784.23
其他资产	-	-	-	-	9,633.48	9,633.48
资产总计	10,486,312,737.07	-	-	-	181,273,014.40	10,667,585,751.47
负债						
卖出回购金融资产款	1,009,399,095.30	-	-	-	-	1,009,399,095.30
应付赎回款	-	-	-	-	1,063,483.33	1,063,483.33
应付管理人报酬	-	-	-	-	4,297,991.71	4,297,991.71
应付托管费	-	-	-	-	1,302,421.78	1,302,421.78
应付销售服务费	-	-	-	-	195,706.97	195,706.97

应付交易费用	-	-	-	-	301,235.04	301,235.04
应付利息	-	-	-	-	59,822.83	59,822.83
应付利润	-	-	-	-	729,966.72	729,966.72
其他负债	-	-	-	-	590,434.64	590,434.64
负债总计	1,009,399,095.30	-	-	-	8,541,063.02	1,017,940,158.32
利率敏感度缺口	9,476,913,641.77	-	-	-	172,731,951.38	9,649,645,593.15
上年度末 2015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						
银行存款	852,710,314.10	-	-	-	-	852,710,314.10
结算备付金	300,000.00	-	-	-	-	300,000.00
存出保证金	300,000.00	-	-	-	-	300,000.00
交易性金融资产	2,503,409,784.05	1,409,902,652.84	-	-	-	3,913,312,436.89
买入返售金融资产	2,822,289,333.42	-	-	-	-	2,822,289,333.42
应收利息	-	-	-	-	67,068,953.32	67,068,953.32
应收申购款	-	-	-	-	699.98	699.98
其他资产	-	-	-	-	-	-
资产总计	6,179,009,431.57	1,409,902,652.84	-	-	67,069,653.30	7,655,981,737.71
负债						
卖出回购金融资产款	1,111,478,854.26	-	-	-	-	1,111,478,854.26
应付赎回款	-	-	-	-	1,817,681.13	1,817,681.13
应付管理人报酬	-	-	-	-	1,508,060.07	1,508,060.07
应付托管费	-	-	-	-	456,987.89	456,987.89
应付销售服务费	-	-	-	-	109,127.49	109,127.49
应付交易费用	-	-	-	-	149,223.31	149,223.31
应付利息	-	-	-	-	78,707.64	78,707.64
应付利润	-	-	-	-	5,994,485.44	5,994,485.44
其他负债	-	-	-	-	644,591.02	644,591.02
负债总计	1,111,478,854.26	-	-	-	10,758,863.99	1,122,237,718.25
利率敏感度缺口	5,067,530,577.31	1,409,902,652.84	-	-	56,310,789.31	6,533,744,019.46

## 6.4.12.4.1.2 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 （2016年6月30日）	上年度末（2015年12月31日）
市场利率下降 27 个基点	783, 112. 06	4, 607, 898. 59
市场利率上升 27 个基点	-783, 112. 06	-4, 607, 898. 59

#### 6.4.12.4.2 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。

#### 6.4.12.4.3 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。

##### 6.4.12.4.3.1 其他价格风险敞口

于 2016 年 6 月 30 日，本基金投资组合中债券投资比例为基金资产净值的 31.68%。于 2016 年 6 月 30 日，本基金面临的其他价格风险列示如下：

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日		上年度末 2015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	3, 057, 377, 000. 00	31. 68	3, 923, 737, 990. 00	60. 05
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	3, 057, 377, 000. 00	31. 68	3, 923, 737, 990. 00	60. 05

#### 6.4.13 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 1、以公允价值计量的金融工具

下表按公允价值三个层级列示了以公允价值计量的金融资产工具于 2016 年 6 月 30 日的账面价值。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)。

单位：人民币元

资产	本期末 2016年6月30日			
	第一层级	第二层级	第三层级	合计
股票投资	-	-	-	-
债券投资	-	3,057,377,000.00	-	3,057,377,000.00
合计	-	3,057,377,000.00	-	3,057,377,000.00

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。

## 2、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	3,056,881,608.71	28.66
	其中: 债券	3,056,881,608.71	28.66
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	3,872,771,632.70	36.30
	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	3,556,359,495.66	33.34
4	其他各项资产	181,573,014.40	1.70
5	合计	10,667,585,751.47	100.00

### 7.2 债券回购融资情况

金额单位:人民币元

序号	项目	占基金资产净值的比例 (%)	
1	报告期内债券回购融资余额	12.34	
	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	1,009,399,095.30	10.46
	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。

### 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	23
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	94
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	15

#### 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投资组合平均剩余期限未超过 120 天。

#### 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	84.65	10.46
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	14.39	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	6.22	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—120 天	1.03	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)—397 天(含)	2.38	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	108.67	10.46

#### 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投资组合平均剩余存续期未超过 240 天。

#### 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	1,250,369,465.17	12.96
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	79,948,837.78	0.83
6	中期票据	-	-
7	同业存单	1,726,563,305.76	17.89
8	其他	-	-
9	合计	3,056,881,608.71	31.68
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序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	150419	15 农发 19	4,100,000	410,154,825.01	4.25
2	150416	15 农发 16	4,100,000	410,045,439.42	4.25
3	150222	15 国开 22	2,300,000	230,029,487.94	2.38
4	130228	13 国开 28	2,000,000	200,139,712.80	2.07
5	111610016	111610016	2,000,000	199,842,025.42	2.07
6	111611224	111611224	2,000,000	199,793,767.63	2.07
7	111619022	111619022	1,800,000	179,256,702.30	1.86
8	111692349	111692349	1,500,000	149,869,327.68	1.55
9	111610171	111610171	1,000,000	99,960,524.18	1.04
10	111591072	111591072	1,000,000	99,959,823.33	1.04

### 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	0.1517%
报告期内偏离度的最低值	0.0043%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0520%

#### 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负偏离度的绝对值未达到 0.25%。

#### 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正偏离度的绝对值未达到 0.5%。

**7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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 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。**

**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	300,000.00
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	47,031,596.69
4	应收申购款	134,231,784.23
5	其他应收款	-
6	待摊费用	9,633.48
7	其他	-
8	合计	181,573,014.40

**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)	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
长信利息收益货币 A	286,285	1,310.01	48,646,697.79	12.97%	326,388,384.27	87.03%
长信利息收益货币 B	86	107,844,308.27	9,227,834,837.63	99.50%	46,775,673.46	0.50%
合计	286,371	33,696.31	9,276,481,535.42	96.13%	373,164,057.73	3.87%

注：本基金于 2010 年 11 月 25 日起实行销售服务费分级收费方式，根据投资者持有本基金的份额划分 A、B 等级，并适用不同的销售服务费率。

### 8.2 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	长信利息收益货币 A	7,337,523.80	1.96%
	长信利息收益货币 B	20,079,658.89	0.22%
	合计	27,417,182.69	0.28%

注：上表中长信利息收益货币 A/B 占基金总份额比例以长信利息收益货币 A/B 份额为分母计算得出；合计项中占基金总份额比例以长信利息收益货币的份额总额为分母计算得出。

### 8.3 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的情况

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	长信利息收益货币 A	>=100
	长信利息收益货币 B	>=100

有本开放式基金	合计	>=100
本基金基金经理持有本开放式基金	长信利息收益货币 A	0
	长信利息收益货币 B	0
	合计	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

	长信利息收益货币 A	长信利息收益货币 B
基金合同生效日（2004 年 3 月 19 日）基金份额总额	7,042,630,886.94	-
本报告期期初基金份额总额	353,311,527.14	6,180,432,492.32
本报告期基金总申购份额	887,493,403.83	36,168,199,863.42
减：本报告期基金总赎回份额	865,769,848.91	33,074,021,844.65
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期末基金份额总额	375,035,082.06	9,274,610,511.09

注：本基金于 2010 年 11 月 25 日起实行销售服务费分级收费方式，根据投资者持有本基金的份额划分 A、B 等级，并适用不同的销售服务费率，分级后的 B 级基金份额从 2010 年 11 月 25 日起享受 B 级基金收益；相关数据中长信利息收益货币 A 级按分级前后延续计算，即本基金分级前的数据全部纳入长信利息收益货币 A 级基金核算。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期未召开本基金的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 报告期内本基金管理人的重大人事变动

本报告期内，原董事长叶焯先生离职，总经理覃波先生自 2016 年 6 月 3 日起代为履行董事长（法定代表人）职责。

报告截止日至报告批准送出日期间，自 2016 年 7 月 30 日起，宋小龙先生不再担任本基金管理人副总经理。

上述重大人事变动情况，本基金管理人均已在指定信息披露媒体发布相应的《基金行业高级管理人员变更公告》。

#### 10.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

### 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发生改变。

### 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

本报告期，基金管理人、托管人及其高级管理人员没有受监管部门稽查或处罚的情形。

## 10.7 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	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	72,102.94	100.00%	-

### 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
安信证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	600,000,000.00	100.00%	-	-

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证券公司交易单元没有变更。

#### 2、专用交易单元的选择标准和程序

根据中国证监会《关于加强证券投资基金监管有关问题的通知》（证监基字【1998】29号）和《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字【2007】48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) 券商基本面评价（财务状况、经营状况）；
- 2) 券商研究机构评价（报告质量、及时性和数量）；
- 3) 券商每日信息评价（及时性和有效性）；
- 4) 券商协作表现评价。

##### （2）选择程序：

首先根据租用证券公司专用交易单元的选择标准形成《券商服务评价表》，然后根据评分高低进行选择基金专用交易单元。

## 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增加平安证券有限责任公司为旗下部分开放式基金代销机构并开通转换、定期定额投资业务及参加申购（含定投申购）费率优惠活动的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2016年1月15日
2	长信利息收益开放式证券投资基金 2015 年第 4 季度报告	上证报、证券日报	2016年1月20日
3	长信基金管理有限责任公司关于长信利息收益开放式证券投资基金暂停申购和转换转入业务的公告	上证报、证券日报	2016年2月2日
4	长信基金管理有限责任公司关于增加海银基金销售有限公司为旗下部分开放式基金代销机构并开通转换、定期定额投资业务及参加申购（含定投申购）费率优惠活动的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2016年3月1日
5	长信利息收益开放式证券投资基金 2015 年年度报告及摘要	上证报、证券日报	2016年3月26日
6	长信基金管理有限责任公司关于长信利息收益开放式证券投资基金暂停申购和转换转入业务的公告	上证报、证券日报	2016年3月29日
7	长信基金管理有限责任公司关于调整网上直销平台招商银行借记卡费率优惠方案的公告	上证报、中证报、证券时报	2016年4月7日
8	长信利息收益开放式证券投资基金 2016 年第 1 季度报告	上证报、证券日报	2016年4月21日
9	长信基金管理有限责任公司关于长信利息收益开放式证券投资基金暂停申购和转换转入业务的公告	上证报、证券日报	2016年4月26日
10	长信利息收益开放式证券投资基金更新的招募说明书（2016 年第【1】号）及摘要	上证报、证券日报	2016年4月29日
11	长信基金管理有限责任公司关于调整长信利息收益开放式证券投资基金机构客户最低持有份额数额限制的公告	上证报、证券日报	2016年5月10日
12	长信基金管理有限责任公司关于增加上海凯石财富基金销售有限公司为旗下部分开放式基金代销机构并开通转换、定期定额投资业务及参加申购（含定投申购）费率	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2016年5月11日

	优惠活动的公告		
13	长信基金管理有限责任公司关于长信利息收益开放式证券投资基金暂停申购和转换转入业务的公告	上证报、证券日报	2016 年 6 月 3 日
14	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金在上海陆金所资产管理有限公司开通定期定额投资业务并参加定投申购费率优惠活动的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2016 年 6 月 16 日
15	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金参加交通银行股份有限公司网上银行、手机银行基金申购费率优惠活动的公告	上证报、中证报、证券时报	2016 年 6 月 28 日

## § 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立基金的文件；
- 2、《长信利息收益开放式证券投资基金基金合同》；
- 3、《长信利息收益开放式证券投资基金托管协议》；
- 4、《长信利息收益开放式证券投资基金招募说明书》；
- 5、报告期内在指定报刊上披露的各种公告的原稿；
- 6、《中国农业银行证券交易资金结算协议》；
- 7、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。

### 11.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

### 11.3 查阅方式

长信基金管理有限责任公司网站：<http://www.cxfund.com.cn>。

长信基金管理有限责任公司  
2016年8月26日