

长信利息收益开放式证券投资基金 2017 年半年度报告

2017 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：2017 年 8 月 24 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（以下简称“中国农业银行”，下同）根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 22 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 2017 年 1 月 1 日起至 2017 年 6 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	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
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	8
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.....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	15
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
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.....	16
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.....	16
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	17
6.1 资产负债表.....	17
6.2 利润表.....	18
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	19

6.4 报表附注.....	20
§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.....	43
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.....	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	44
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.....	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.....	45
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.....	46
7.9 投资组合报告附注.....	46
§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 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	47
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.....	47
§9 开放式基金份额变动.....	48
§10 重大事件揭示.....	49
10.1 基金份额持有人大会决议.....	49
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.....	49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	49
10.4 基金投资策略的改变.....	49
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	49
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.....	49
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	49
10.8 偏离度绝对值超过 0.5% 的情况.....	50
10.9 其他重大事件.....	50
§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.....	53
§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	15,811,463,429.07 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
下属分级基金的场内简称:	利息 A	利息 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	501,546,220.80 份	15,309,917,208.27 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>

	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，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	zhouyig@xfund.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		成善栋	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 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(2017 年 1 月 1 日 - 2017 年 6 月 30 日)	报告期(2017 年 1 月 1 日 - 2017 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	9,657,945.98	188,275,397.41
本期利润	9,657,945.98	188,275,397.41
本期净值收益率	1.8641%	1.9853%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017 年 6 月 30 日)	
期末基金资产净值	501,546,220.80	15,309,917,208.27
期末基金份额净值	-	-
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017 年 6 月 30 日)	
累计净值收益率	49.9336%	28.7209%

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

长信利息收益货币 A

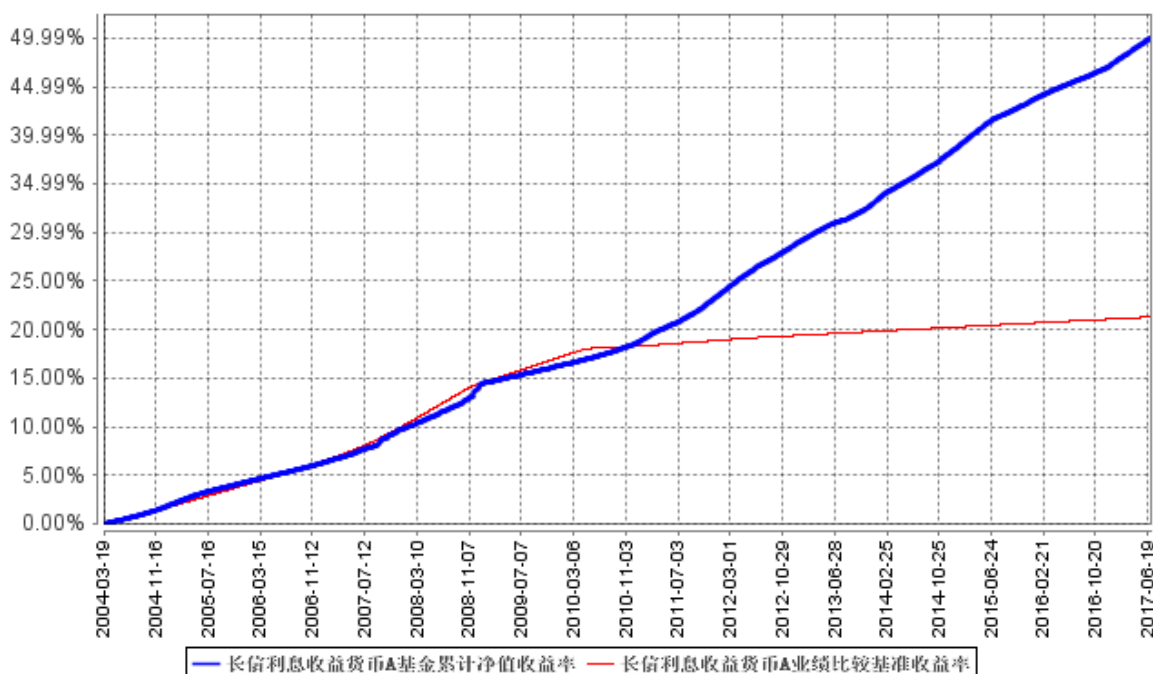
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.3204%	0.0012%	0.0292%	0.0000%	0.2912%	0.0012%

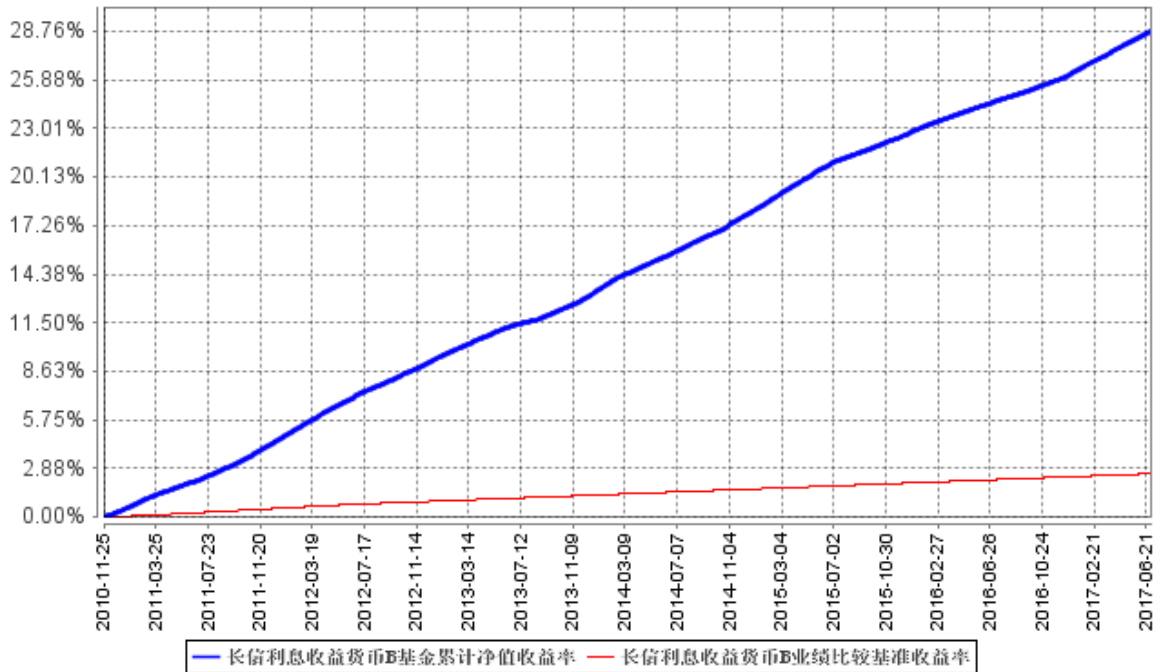
过去三个月	0.9366%	0.0013%	0.0885%	0.0000%	0.8481%	0.0013%
过去六个月	1.8641%	0.0014%	0.1761%	0.0000%	1.6880%	0.0014%
过去一年	3.1638%	0.0023%	0.3555%	0.0000%	2.8083%	0.0023%
过去三年	10.5200%	0.0044%	1.0712%	0.0000%	9.4488%	0.0044%
自基金合同生效起至今	49.9336%	0.0069%	21.3036%	0.0035%	28.6300%	0.0034%

长信利息收益货币 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	0.3402%	0.0012%	0.0292%	0.0000%	0.3110%	0.0012%
过去三个月	0.9970%	0.0013%	0.0885%	0.0000%	0.9085%	0.0013%
过去六个月	1.9853%	0.0014%	0.1761%	0.0000%	1.8092%	0.0014%
过去一年	3.4111%	0.0023%	0.3555%	0.0000%	3.0556%	0.0023%
过去三年	11.3169%	0.0044%	1.0712%	0.0000%	10.2457%	0.0044%
自基金合同生效起至今	28.7209%	0.0041%	2.5677%	0.0002%	26.1532%	0.0039%

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





注：1、长信利息收益货币 A 图示日期为 2004 年 3 月 19 日至 2017 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 2017 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1.65亿元人民币，目前股权结构为：长江证券股份有限公司占44.55%、上海海欣集团股份有限公司占31.21%、武汉钢铁股份有限公司占15.15%、上海彤胜投资管理中心（有限合伙）为4.55%、上海彤骏投资管理中心（有限合伙）为4.54%。

截至2017年6月30日，本基金管理人共管理49只开放式基金，即长信利息收益开放式证券投资基金、长信银利精选混合型证券投资基金、长信金利趋势混合型证券投资基金、长信增利动态策略混合型证券投资基金、长信双利优选灵活配置混合型证券投资基金、长信利丰债券型证券投资基金、长信恒利优势混合型证券投资基金、长信量化先锋混合型证券投资基金、长信美国标准普尔100等权重指数增强型证券投资基金、长信利鑫债券型证券投资基金(LOF)、长信内需成长混合型证券投资基金、长信可转债债券型证券投资基金、长信利众债券型证券投资基金(LOF)、长信纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信纯债壹号债券型证券投资基金、长信改革红利灵活配置混合型证券投资基金、长信量化中小盘股票型证券投资基金、长信新利灵活配置混合型证券投资基金、长信利富债券型证券投资基金、长信利盈灵活配置混合型证券投资基金、长信利广灵活配置混合型证券投资基金、长信多利灵活配置混合型证券投资基金、长信睿进灵活配置混合型证券投资基金、长信量化多策略股票型证券投资基金、长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金(LOF)、长信中证一带一路主题指数分级证券投资基金、长信富民纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信富海纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信利保债券型证券投资基金、长信富安纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信中证能源互联网主题指数型证券投资基金(LOF)、长信金葵纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信富全纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信利泰灵活配置混合型证券投资基金、长信海外收益一年定期开放债券型证券投资基金、长信先锐债券型证券投资基金、长信利发债券型证券投资基金、长信富泰纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信电子信息行业量化灵活配置混合型证券投资基金、长信富平纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信先利半年定期开放混合型证券投资基金、长信创新驱动股票型证券投资基金、长信稳益纯债债券型证券投资基金、长信利信灵活配置混合型证券

投资基金、长信稳健纯债债券型证券投资基金、长信上证港股通指数型发起式证券投资基金、长信纯债半年债券型证券投资基金、长信国防军工量化灵活配置混合型证券投资基金、长信中证上海改革发展主题指数型证券投资基金（LOF）。

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	长信利鑫债券型证券投资基金（LOF）、长信纯债壹号债券型证券投资基金、长信利息收益开放式证券投资基金、长信富平纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信稳益纯债债券型证券投资基金、长信富民纯债一年定期开放债券型证券投资基金和长信富海纯债一年定期开放债券型证券投资基金的基金经理、固定收益部总监	2013年8月8日	-	23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，历任长信利息收益开放式证券投资基金的基金交易员、基金经理助理、长信利息收益开放式证券投资基金的基金经理、固定收益部副总监。现任长信基金管理有限责任公司固定收益部总监，长信利鑫债券型证券投资基金（LOF）、长信纯债壹号债券型证券投资基金、长信利息收益开放式证券投资基金、长信富平纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信稳益纯债债券型证券投资基金、长信富民纯债一年定期开放债券型证券投资基金和长信富海纯债一年定期开放债券型证券投资基金的基金经理。
陆莹	长信利息收益开放式证券投资基金、长信稳健纯债债券型证券投资基金和长信纯债	2016年12月30日	-	7年	管理学学士，上海交通大学管理学学士，2010 年 7 月加入长信基金管理有限责任公司，曾任基金事务部基金会计，交易管理部债券交

	半年债券型证券投资基金的基金经理			易员、交易主管，债券交易部副总监、总监，现任长信利息收益开放式证券投资基金、长信稳健纯债债券型证券投资基金和长信纯债半年债券型证券投资基金的基金经理。
--	------------------	--	--	---

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

2、本基金基金经理的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；

3、自 2017 年 7 月 28 日起，赵鹏霄先生开始担任长信利息收益开放式证券投资基金、长信稳健纯债债券型证券投资基金和长信纯债半年定期开放债券型证券投资基金的基金经理助理。

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

2017 年上半年债市继续调整，主要是由于三月份经济增长数据显著超预期、货币政策存在紧缩预期以及金融强监管等因素共同导致。一至三月份 MLF 利率和公开市场利率两次上调，并伴随持续上调预期，资金成本明显上升，短融及同业存单利率一直维持在较高水平。进入四月份以后，资金面略显宽松，尤其在 6 月央行提前开展 MLF 操作向市场投放 4980 亿元，显示了其对六月份流动性的呵护，并且在美联储宣布加息 25bp 后，央行未跟随调整，均使得跨季资金利率大幅下行。流动性改善，叠加金融去杠杆取得一定成果，使得市场情绪缓和，同业存单利率在六月中旬达到最高点之后快速回落，从量跌价升回到量升价跌。上半年，我们保持了较短的组合久期，增加了利率债和同业存单的配置比例，同时把握了春节、季末等时点的资金波段操作，在坚持保证流动性前提下，维持了较高的组合整体收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2017 年 6 月末，本报告期长信利息收益货币 A 净值收益率为 1.8641%，长信利息收益货币 B 净值收益率为 1.9853%，同期业绩比较基准收益为 0.1761%。

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，预计市场资金面将维持不紧不松的状态，一方面经济基本面不支持紧缩的货币政策，另一方面资金过度宽松不利于金融去杠杆的目标，尽管金融监管政策 6 月呈现边际缓和，但预计下半年去杠杆仍将持续。且三季度同业理财和委外到期量较高，或许会面临一定流动性压力，存量债券抛售的现象或将对市场造成负面影响。此外美联储缩表渐行渐近，债券市场中后期仍面临调整压力。但总体来说，债券配置需求仍在，预计存在一定的交易性机会。下半年我们将维持目前的组合久期，提高利率债、同业存单及存款的配置轮动，在严控信用风险的情况下，把握市场调整带来的波段机会。

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》，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，小组成员由基金事务部、投资、研究、交易等相关业务部门负责人以及基金事务部至少一名业务骨干共同组成。相关参与人员都具有丰富的证券

行业工作经验，熟悉相关法规和估值方法。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，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 197,933,343.39 元，已分配利润 197,933,343.39 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 2017 年 1 月 1 日至 2017 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，未发现有关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：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.6.1	1,002,240,619.95	8,327,987.21
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	5,009,360,764.85	1,235,953,443.38
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		5,009,360,764.85	1,235,953,443.38
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	9,744,614,767.59	4,193,347,673.03
应收证券清算款		361,223.74	-
应收利息	6.4.6.5	35,437,449.98	20,484,562.66
应收股利		-	-
应收申购款		35,891,062.20	16,905.87
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.6.6	-	-
资产总计		15,828,505,888.31	5,458,730,572.15
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
负债：			
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		-	349,999,155.00
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		9,692,604.71	2,067,818.85
应付管理人报酬		3,247,305.00	1,984,633.75
应付托管费		984,031.83	601,404.15
应付销售服务费		198,550.36	139,103.64
应付交易费用	6.4.6.7	236,894.15	210,372.89

应交税费		-	-
应付利息		-	63,710.18
应付利润		2,168,144.22	1,348,700.32
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.6.8	514,928.97	794,683.35
负债合计		17,042,459.24	357,209,582.13
所有者权益：			
实收基金	6.4.6.9	15,811,463,429.07	5,101,520,990.02
未分配利润	6.4.6.10	-	-
所有者权益合计		15,811,463,429.07	5,101,520,990.02
负债和所有者权益总计		15,828,505,888.31	5,458,730,572.15

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 15,811,463,429.07 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：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017年1月1日至2017 年6月30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016 年6月30日
一、收入		225,729,462.79	205,753,685.57
1.利息收入		225,851,541.86	200,909,447.75
其中：存款利息收入	6.4.6.11	8,533,209.15	46,839,552.93
债券利息收入		89,964,298.92	67,977,746.75
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		127,354,033.79	86,092,148.07
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-122,079.08	4,844,237.82
其中：股票投资收益	6.4.6.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.6.13	-122,079.08	4,844,237.82
资产支持证券投资收益	6.4.6.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.6.14	-	-
衍生工具收益	6.4.6.15	-	-
股利收益	6.4.6.16	-	-
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）	6.4.6.17	0.01	-
减：二、费用		27,796,119.40	43,862,834.34
1. 管理人报酬	6.4.9.2.1	16,787,275.79	20,128,584.24
2. 托管费	6.4.9.2.2	5,087,053.26	6,099,570.91
3. 销售服务费	6.4.9.2.3	1,134,623.42	1,007,260.01
4. 交易费用	6.4.6.18	71,904.06	72,102.94
5. 利息支出		4,517,806.21	16,360,841.45
其中：卖出回购金融资产支出		4,517,806.21	16,360,841.45
6. 其他费用	6.4.6.19	197,456.66	194,474.79
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		197,933,343.39	161,890,851.23
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		197,933,343.39	161,890,851.23

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：2017年1月1日至2017年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017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）	5,101,520,990.02	-	5,101,520,990.02
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	197,933,343.39	197,933,343.39
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）	10,709,942,439.05	-	10,709,942,439.05
其中：1. 基金申购款	51,191,463,971.90	-	51,191,463,971.90
2. 基金赎回款	-40,481,521,532.85	-	-40,481,521,532.85
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）	-	-197,933,343.39	-197,933,343.39
五、期末所有者权益（基	15,811,463,429.07	-	15,811,463,429.07

项目	上年度可比期间 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
	金净值)		
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

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：

 成善栋 覃波 孙红辉
 基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

长信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。

司(以下简称“中国农业银行”)。

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。

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。同时,《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)》的相关内容也进行了修改。本基金于 2010 年 11 月 25 日的规模为 3,684,021,305.50 份基金份额,分级后 A 级基金规模为 571,492,324.41 份基金份额, B 级基金规模为 3,112,528,981.09 份基金份额。

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颁布的《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 2017 年 6 月 30 日的财务状况、2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日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[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[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《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[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》、上证交字[2008]16 号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、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]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《税务总局关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2015] 125 号文《关于内地与香港基金互认有关税收政策的通知》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) 证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入暂免征收营业税和企业所得税。
- (c) 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。证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券收入免征增值税。对香港市场投资者（包括单位和个人）通过基金互认买卖内地基金份额免征增值税。自 2018 年 1 月 1 日起，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（以下称资管产品运营业务），暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率

缴纳增值税。

(d) 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、现金对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(e) 对基金取得的股票的股息、红利收入，债券的利息收入，由上市公司、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。自 2013 年 1 月 1 日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：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；持股期限超过 1 年的，股权登记日为自 2013 年 1 月 1 日起至 2015 年 9 月 7 日期间的，暂减按 25% 计入应纳税所得额，股权登记日在 2015 年 9 月 8 日及以后的，暂免征收个人所得税。

(f) 关于香港市场投资者通过基金互认买卖内地基金份额的所得税问题：对香港市场投资者（包括企业和个人）通过基金互认买卖内地基金份额取得的转让差价所得，暂免征收所得税。对香港市场投资者（包括企业和个人）通过基金互认从内地基金分配取得的收益，由内地上市公司向该内地基金分配股息红利时，对香港市场投资者按照 10% 的税率代扣所得税；或发行债券的企业向该内地基金分配利息时，对香港市场投资者按照 7% 的税率代扣所得税，并由内地上市公司或发行债券的企业向其主管税务机关办理扣缴申报。该内地基金向投资者分配收益时，不再扣缴所得税。内地基金管理人应当向相关证券登记结算机构提供内地基金的香港市场投资者的相关信息。

(g) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(h) 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 2017 年 6 月 30 日
活期存款	2, 240, 619. 95
定期存款	1, 000, 000, 000. 00
其中：存款期限 1-3 个月	1, 000, 000, 000. 00
1 个月以内	-
其他存款	-
合计：	1, 002, 240, 619. 95

6.4.6.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2017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	5,009,360,764.85	5,010,805,000.00	1,444,235.15	0.0091%
	合计	5,009,360,764.85	5,010,805,000.00	1,444,235.15	0.0091%

注：截至 2017 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。

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。

6.4.6.3 衍生金融资产/负债

注：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 2017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	7,791,724,767.59	-
买入返售证券	1,500,000,000.00	-
买入返售证券_固定平台	452,890,000.00	-
合计	9,744,614,767.59	-

6.4.6.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：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 2017年6月30日

应收活期存款利息	28,976.45
应收定期存款利息	3,518,888.70
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	19,159,270.66
应收买入返售证券利息	12,730,044.17
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	135.00
合计	35,437,449.98

注：其他为保证金利息收入。

6.4.6.6 其他资产

注：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 2017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	236,894.15
合计	236,894.15

6.4.6.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	52.58
信息披露费-上证报	289,588.57
审计费用	104,712.18
预提账户维护费	9,000.00
信息披露费-证券日报	39,671.58
券商席位佣金	71,904.06
合计	514,928.97

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 2017年1月1日至2017年6月30日

	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	417,897,639.63	417,897,639.63
本期申购	1,227,930,093.55	1,227,930,093.55
本期赎回(以“-”号填列)	-1,144,281,512.38	-1,144,281,512.38
- 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	501,546,220.80	501,546,220.80

金额单位：人民币元

长信利息收益货币 B		
项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	4,683,623,350.39	4,683,623,350.39
本期申购	49,963,533,878.35	49,963,533,878.35
本期赎回(以“-”号填列)	-39,337,240,020.47	-39,337,240,020.47
- 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	15,309,917,208.27	15,309,917,208.27

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	9,657,945.98	-	9,657,945.98
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	-9,657,945.98	-	-9,657,945.98
本期末	-	-	-

单位：人民币元

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	188,275,397.41	-	188,275,397.41

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	-188,275,397.41	-	-188,275,397.41
本期末	-	-	-

6.4.6.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
活期存款利息收入	69,155.67
定期存款利息收入	8,459,166.48
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	4,887.00
其他	-
合计	8,533,209.15

6.4.6.12 股票投资收益

6.4.6.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

注：本基金本报告期末持有股票。

6.4.6.13 债券投资收益

6.4.6.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017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	-122,079.08
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	-122,079.08

6.4.6.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	19,966,974,223.73
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	19,947,222,002.81

减：应收利息总额	19,874,300.00
买卖债券差价收入	-122,079.08

6.4.6.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期无债券投资赎回差价收入。

6.4.6.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期无债券投资申购差价收入。

6.4.6.13.5 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.6.14 贵金属投资收益

6.4.6.14.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.6.15 衍生工具收益

6.4.6.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.6.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.6.16 股利收益

注：本基金本报告期及未持有股票，无股利收益。

6.4.6.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2017年1月1日至2017年6月30日
基金赎回费收入	-
其他收入	0.01
合计	0.01

注：其他收入为交易账户产生的利息等其他收入。

6.4.6.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	71,904.06
银行间市场交易费用	-
合计	71,904.06

6.4.6.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
审计费用	34,712.18
信息披露费	89,260.15
帐户维护费	18,030.00
其他费用	55,454.33
券商席位佣金	-
合计	197,456.66

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

注：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

注：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

经长信基金管理有限责任公司股东会审议通过，新增上海彤胜投资管理中心（有限合伙）和上海彤骏投资管理中心（有限合伙）为基金管理人的股东，基金管理人已履行相关程序办理完成股东变更事项的工商变更登记并向监管机构备案，并已于 2017 年 2 月 8 日就上述股东变更事项进行公告。

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公司	基金管理人的股东的控股子公司
长信-齐鲁-量化 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-浦益 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-浦益 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-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-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
长信基金-浦发银行-聚富 4 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-得益纯债 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

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 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 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	1,900,000,000.00	100.00%	600,000,000.00	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 2017 年 1 月 1 日至 2017 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%
关联方名称	上年度可比期间 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%

注：上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

根据《证券交易单元租用协议》，本基金管理人在租用长江证券股份有限公司证券交易专用交易单元进行股票、债券、权证及回购交易的同时，还从长江证券股份有限公司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	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年6月30日	2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	16,787,275.79	20,128,584.24
其中：支付销售机构的客户维护费	283,421.67	254,248.12

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
	2017年1月1日至2017年6月30日	2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	5,087,053.26	6,099,570.91

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 2017年1月1日至2017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	218,141.52	1,451.58	219,593.10
长信基金	177,091.08	439,251.42	616,342.50
长江证券	6,257.63	11,513.28	17,770.91
合计	401,490.23	452,216.28	853,706.51
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 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

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

单位：人民币元

银行间市场 交易的 各关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6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
农业银行	299,819,366.67	-	-	-	99,200,000.00	52,997.26
银行间市场	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日					
	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	

交易的各关联方名称	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
农业银行	1,904,900,448.08	-	-	-	800,000,000.00	42,821.92

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 2017年1月1日至2017年6月30日	
	长信利息收益货币 A	长信利息收益货币 B
期初持有的基金份额	-	264,191,373.63
期间申购/买入总份额	-	105,404,672.43
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	-	369,596,046.06
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	-	2.34%
项目	上年度可比期间 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%

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 171,479,950.52 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

长信利息收益货币 A

份额单位：份

关联方名称	本期末 2017年6月30日	上年度末 2016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	945.00	0.00%	927.22	0.00%
长信基金- 涌信 3 号资 产管理计划	1,079,278.83	0.01%	1,059,399.74	0.02%
长信-牡丹 债券增强 1 号资产管理 计划	18,034.54	0.00%	1,325,592.74	0.03%
长信-融耀 债券型 1 号 资产管理计 划	-	-	13,273.19	0.00%
长信-广东 农信普惠债 券型 1 号资 产管理计划	141,527.49	0.00%	138,920.41	0.00%
长信-得益 纯债 1 号资 产管理计划	255,651.64	0.00%	250,942.53	0.00%
长信基金- 浦发银行- 聚富 4 号资 产管理计划	58,139.57	0.00%	-	-

长信利息收益货币 B

份额单位：份

关联方名称	本期末 2017 年 6 月 30 日		上年度末 2016 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-浦发- 粤信 2 号资 产管理计划	410,810,880.39	2.60%	445,062,383.73	8.72%
长信-齐鲁- 量化 1 号资 产管理计划	50,694,405.84	0.32%	-	-
长信-浦益 2 号资产管理	15,000,000.00	0.09%	-	-

计划				
长信-浦益 1 号资产管理计划	17,000,000.00	0.11%	-	-

注：1、本基金无申购赎回费。

2、长信-广东农信普惠债券型 1 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-得益纯债 1 号资产管理计划、长信基金-浦发银行-聚富 4 号资产管理计划、长信-齐鲁-量化 1 号资产管理计划、长信-浦益 2 号资产管理计划、长信-浦益 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 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 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	2,240,619.95	69,155.67	6,059,495.66	264,810.92

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 2017 年 6 月 30 日的相关余额为人民币 300,000.00 元(2016 年 12 月 31 日的相关余额为人民币 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

注：本基金在本报告期及上年度可比期间均未在承销期内购入过由关联方承销的证券。

6.4.9.7 其他关联交易事项的说明

注：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
9,569,571.83	128,213.47	-39,839.32	9,657,945.98	-

长信利息收益货币B

已按再投资形式转实收基	直接通过应付	应付利润	本期利润分配合	备注
-------------	--------	------	---------	----

金	赎回款转出金额	本年变动	计	
181,921,363.89	5,494,750.30	859,283.22	188,275,397.41	-

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（2017 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.11.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金本报告期末未因认购新发/增发证券而持有流通受限的证券。

6.4.11.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有股票。

6.4.11.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.11.3.1 银行间市场债券正回购

注：本基金本报告期末未持有因银行间市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

6.4.11.3.2 交易所市场债券正回购

注：本基金本报告期末未持有因交易所市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

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

本基金在下文主要论述上述风险敞口及其形成原因；风险管理目标、政策和过程以及计量风险的方法等。

本基金的基金管理人从事风险管理的目标是使本基金在风险和收益之间取得适当的平衡，以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。基于该风险管理目标，本基金的基金管理人已制定了政策和程序来辨别和分析这些风险，设定适当的风险限额并设计相应的内部控制程序，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，在董事会下设立风险控制委员会，负责对公司经营管理和基金业务运作的合法性、合规性进行全面的检查和评估等；在管理层层面设立内部控制委员会，主要职责是讨论审议公司内部控制制度及针对公司在经营管理和投资组合运作中的风险进行识别、评估并研究制订有效的防范措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部负责协调并与各部门合作完成运作风险管理工作，量化投资部负责进行投资风险分析与绩效评估。监察稽核部向督察长负责，并向总经理汇报日常行政事务。

本基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

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。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国农业银行，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发行的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估并采用券款对付交割方式以控制相应的信用风险。

6.4.12.2.1 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 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	5,009,360,764.85	1,235,953,443.38
合计	5,009,360,764.85	1,235,953,443.38

注：未评级债券为国债、央行票据、政策性金融债、同业存单及超短期融资券等无信用评级债券。

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 按长期信用评级列示的债券投资

注：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。

6.4.12.4 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。

6.4.12.4.1.1 利率风险敞口

单位:人民币元

本期末 2017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	1,002,240,619.95	-	-	-	-	1,002,240,619.95
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	4,610,988,841.05	398,371,923.80	-	-	-	5,009,360,764.85
买入返售金融资产	9,744,614,767.59	-	-	-	-	9,744,614,767.59
应收证券清算款	-	-	-	-	361,223.74	361,223.74
应收利息	-	-	-	-	35,437,449.98	35,437,449.98
应收申购款	-	-	-	-	35,891,062.20	35,891,062.20
其他资产	-	-	-	-	-	-
资产总计	15,358,444,228.59	398,371,923.80	-	-	71,689,735.92	15,828,505,888.31
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	9,692,604.71	9,692,604.71
应付管理人报酬	-	-	-	-	3,247,305.00	3,247,305.00
应付托管费	-	-	-	-	984,031.83	984,031.83
应付销售服务费	-	-	-	-	198,550.36	198,550.36

应付交易费用	-	-	-	-	236,894.15	236,894.15
应付利润	-	-	-	-	2,168,144.22	2,168,144.22
其他负债	-	-	-	-	514,928.97	514,928.97
负债总计	-	-	-	-	17,042,459.24	17,042,459.24
利率敏感度缺口	15,358,444,228.59	398,371,923.80	-	-	54,647,276.68	15,811,463,429.07
上年度末 2016 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	8,327,987.21	-	-	-	-	8,327,987.21
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	1,215,829,653.26	20,123,790.12	-	-	-	1,235,953,443.38
买入返售金融资产	4,193,347,673.03	-	-	-	-	4,193,347,673.03
应收利息	-	-	-	-	20,484,562.66	20,484,562.66
应收申购款	-	-	-	-	16,905.87	16,905.87
其他资产	-	-	-	-	-	-
资产总计	5,418,105,313.50	20,123,790.12	-	-	20,501,468.53	5,458,730,572.15
负债						
卖出回购金融资产 款	349,999,155.00	-	-	-	-	349,999,155.00
应付赎回款	-	-	-	-	2,067,818.85	2,067,818.85
应付管理人报酬	-	-	-	-	1,984,633.75	1,984,633.75
应付托管费	-	-	-	-	601,404.15	601,404.15
应付销售服务费	-	-	-	-	139,103.64	139,103.64
应付交易费用	-	-	-	-	210,372.89	210,372.89
应付利息	-	-	-	-	63,710.18	63,710.18
应付利润	-	-	-	-	1,348,700.32	1,348,700.32
其他负债	-	-	-	-	794,683.35	794,683.35
负债总计	349,999,155.00	-	-	-	7,210,427.13	357,209,582.13
利率敏感度缺口	5,068,106,158.50	20,123,790.12	-	-	13,291,041.40	5,101,520,990.02

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

6.4.12.4.1.2 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（2017年6月30日）	上年度末（2016年12月31日）
	市场利率下降 27 个基点	1,859,760.85	712,355.09
	市场利率上升 27 个基点	-1,859,760.85	-712,355.09

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。

6.4.13 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值计量

(a) 公允价值计量的层次

下表列示了本基金在每个资产负债表日持续和非持续以公允价值计量的资产和负债于本报告期末的公允价值信息及其公允价值计量的层次。公允价值计量结果所属层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

第一层次输入值：在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

单位：人民币元

资产	本期末			
	2017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	-	5,010,805,000.00	-	5,010,805,000.00
合计	-	5,010,805,000.00	-	5,010,805,000.00

2017年上半年，本基金上述持续以公允价值计量的资产和负债金融工具的第一层次与第二层次之间没有发生重大转换。本基金是在发生转换当年的报告期末确认各层次之间的转换。

(b) 第二层次的公允价值计量

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次。

2017 年上半年，本基金上述持续和非持续第二层次公允价值计量所使用的估值技术并未发生该变更。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2017 年 6 月 30 日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具。

(2) 其他金融工具的公允价值（年末非以公允价值计量的项目）

其他金融工具主要包括买入返售金融资产、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	5,009,360,764.85	31.65
	其中: 债券	5,009,360,764.85	31.65
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	9,744,614,767.59	61.56
	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	1,002,540,619.95	6.33
4	其他各项资产	71,989,735.92	0.45
5	合计	15,828,505,888.31	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	3.48	
	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	-	-
	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

注: 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	25
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	31
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	13

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

注：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比例 (%)	各期限负债占基金资产净值比例 (%)
1	30 天以内	74.95	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	14.84	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	5.04	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—120 天	2.12	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)—397 天(含)	2.71	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		99.66	-

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	349,626,235.88	2.21
2	央行票据	-	-
3	金融债券	718,737,018.96	4.55

	其中：政策性金融债	718,737,018.96	4.55
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单	3,940,997,510.01	24.92
8	其他	-	-
9	合计	5,009,360,764.85	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	170401	17 农发 01	2,400,000	238,957,936.72	1.51
2	140220	14 国开 20	2,000,000	200,289,614.85	1.27
3	111716074	17 上海银行 CD074	2,000,000	199,917,282.32	1.26
4	111617149	16 光大 CD149	2,000,000	199,897,905.86	1.26
5	111796116	17 盛京银行 CD087	2,000,000	199,597,001.78	1.26
6	111780085	17 云南红塔银行 CD009	2,000,000	199,376,443.16	1.26
7	111718149	17 华夏银行 CD149	2,000,000	199,201,422.09	1.26
8	111719132	17 恒丰银行 CD132	2,000,000	199,183,573.88	1.26
9	111798037	17 锦州银行 CD131	2,000,000	198,868,374.88	1.26
10	111798335	17 厦门农商行 CD058	2,000,000	198,768,875.39	1.26

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	0.0142%
报告期内偏离度的最低值	-0.0197%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0050%

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

报告期内不存在负偏离度的绝对值达到 0.25%的情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

报告期内不存在正偏离度的绝对值达到 0.5%的情况。

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

注：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 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	361,223.74
3	应收利息	35,437,449.98
4	应收申购款	35,891,062.20
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	71,989,735.92

7.9.4 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。

§ 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	341,828	1,467.25	83,338,652.65	16.62%	418,207,568.15	83.38%
长信利息收益货币 B	157	97,515,396.23	15,146,492,191.93	98.93%	163,425,016.34	1.07%
合计	341,985	46,234.38	15,229,830,844.58	96.32%	581,632,584.49	3.68%

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	3,347,616.83	0.67%
	长信利息收益货币 B	13,033,130.95	0.09%
	合计	16,380,747.78	0.10%

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有本开放式基金	长信利息收益货币 A	0~10
	长信利息收益货币 B	>100
	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	0~10
	长信利息收益货币 B	0
	合计	0~10

§ 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	417,897,639.63	4,683,623,350.39
本报告期基金总申购份额	1,227,930,093.55	49,963,533,878.35
减：本报告期基金总赎回份额	1,144,281,512.38	39,337,240,020.47
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	501,546,220.80	15,309,917,208.27

§ 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 基金管理人的重大人事变动

本报告期基金管理人未发生重大人事变动。

10.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内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

本报告期本基金未改聘为基金审计的会计师事务所。

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	-	-	71,904.06	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	-	-	1,900,000,000.00	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

注：本报告期本基金不存在偏离度绝对值超过0.5%的情况。

10.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	长信基金管理有限责任公司关于旗下开放式证券投资基金参加蚂蚁（杭州）基金销售有限公司认购、申购（含定期定额投资申购）费率优惠的公告	上证报、中证报、证券时报、公司网站	2017年1月12日

2	长信基金管理有限责任公司关于变更旗下基金所持停牌股票估值方法的提示性公告	上证报、中证报、证券时报、公司网站	2017年1月13日
3	长信基金管理有限责任公司关于变更旗下基金所持停牌股票估值方法的提示性公告	上证报、中证报、证券时报、公司网站	2017年1月14日
4	长信基金管理有限责任公司关于变更旗下基金所持停牌股票估值方法的提示性公告	上证报、中证报、证券时报、公司网站	2017年1月17日
5	长信基金管理有限责任公司关于旗下基金所持证券调整估值价的公告	上证报、中证报、证券时报、公司网站	2017年1月17日
6	长信利息收益开放式证券投资基金 2016 年第 4 季度报告	上证报、证券日报、公司网站	2017年1月21日
7	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、公司网站	2017年1月23日
8	长信基金管理有限责任公司关于股东及股东出资比例变更的公告	上证报、中证报、证券时报、公司网站	2017年2月8日
9	长信基金管理有限责任公司关于增加旗下部分开放式基金参加“长金通”网上直销平台及直销柜台基金转换业务的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、公司网站	2017年2月18日
10	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手机银行基金申购（含定期定额投资申购）费率优惠活动的公告	上证报、中证报、证券时报、公司网站	2017年2月23日
11	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宜信普泽投资顾问（北京）有限公司基金认购、申购（含定期定额投资申购）费率优惠活动的公告	上证报、中证报、证券时报、公司网站	2017年3月10日
12	长信基金管理有限责任公司关于增加上海华夏财富投资管理有限公司为旗下部分开放式基金代销机构的公告	上证报、中证报、证券时报、公司网站	2017年3月22日
13	长信基金管理有限责任公司关于变更旗下基金所持停牌股票估值方法的提示性公告	上证报、中证报、证券时报、公司网站	2017年3月22日
14	长信利息收益开放式证券投资基金 2016 年年度报告及摘要（仅摘要见报）	上证报、证券日报、公司网站	2017年3月27日
15	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、公司网站	2017年3月28日
16	长信基金管理有限责任公司关于变更旗下基金所持停牌股票估值方法的提示性公告	上证报、中证报、证券时报、公司网站	2017年4月1日
17	长信利息收益开放式证券投资基金 2017 年第 1 季度报告	上证报、证券日报、公司网站	2017年4月22日
18	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手机银行基金申购（含定期定额投资申购）费率优惠活动的公告	上证报、中证报、证券时报、公司网站	2017年4月22日

19	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、 公司网站	2017年4月25日
20	长信利息收益开放式证券投资基金更新的招募说明书（2017年第【1】号）及摘要（仅摘要见报）	上证报、证券日报、 公司网站	2017年5月2日
21	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式证券投资基金参加平安银行股份有限公司申购(含定期定额投资申购)费率优惠活动的公告	上证报、中证报、公 司网站	2017年5月4日
22	长信基金管理有限责任公司关于变更旗下基金所持停牌股票估值方法的提示性公告	上证报、中证报、证 券时报、公司网站	2017年5月12日
23	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、 公司网站	2017年5月23日
24	长信基金管理有限责任公司关于变更旗下基金所持停牌股票估值方法的提示性公告	上证报、中证报、证 券时报、公司网站	2017年5月24日
25	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中泰证券股份有限公司申购（含定投申购）费率优惠活动的公告	上证报、中证报、证 券时报、公司网站	2017年5月26日
26	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手机银行基金申购（含定期定额投资申购）费率优惠活动的公告	上证报、中证报、证 券时报、公司网站	2017年6月30日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金本报告期内未有单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期未发生影响投资者决策的其他重要信息。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立基金的文件；
- 2、《长信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。

12.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

12.3 查阅方式

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

长信基金管理有限责任公司

2017年8月24日