

# 长信利息收益开放式证券投资基金 2020 年中期报告

2020 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：2020 年 8 月 29 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。本中期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 2020 年 8 月 26 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 2020 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>6</b>
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
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>11</b>
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.....	15
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
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>16</b>
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 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	16
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>17</b>
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
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>42</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	42
7.2 债券回购融资情况.....	42
7.3 基金投资组合平均剩余期限.....	42
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.....	43
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	43
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.....	44
7.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离.....	44
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.....	44
7.9 投资组合报告附注.....	45
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>47</b>
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.....	47
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	47
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的情况.....	48
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>49</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>50</b>
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.....	50
10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况.....	51
10.9 其他重大事件.....	51
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>54</b>
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.....	54
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	54

<b>§12 备查文件目录</b> .....	<b>55</b>
12.1 备查文件目录.....	55
12.2 存放地点.....	55
12.3 查阅方式.....	55

## §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	19,212,062,931.76 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	18,621,740,680.28 份	590,322,251.48 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	在尽可能保证基金财产安全和高流动性的基础上，追求超过银行存款的收益水平。
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，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</p>

	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	贺倩
	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		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
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.cxfund.com.cn
基金中期报告备置地点	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	非直销渠道：中国证券登记结算有限责任公司、直销渠道：长信基金管理有限责任公司	非直销渠道：北京市西城区太平桥大街 17 号、直销渠道：上海市浦东新区银城中路 68 号 9 楼

### §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(2020年1月1日 - 2020年6月30日)	报告期(2020年1月1日 - 2020年6月30日)
本期已实现收益	196,750,834.82	10,534,525.36
本期利润	196,750,834.82	10,534,525.36
本期净值收益率	1.0395%	1.1600%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020年6月30日)	
期末基金资产净值	18,621,740,680.28	590,322,251.48
期末基金份额净值	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020年6月30日)	
累计净值收益率	63.2070%	41.0465%

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 A 级基金按分级前后延续计算，即本基金分级前的数据全部纳入 A 级基金核算，B 级基金自 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	0.1202%	0.0002%	0.0292%	0.0000%	0.0910%	0.0002%
过去三个月	0.4299%	0.0006%	0.0885%	0.0000%	0.3414%	0.0006%
过去六个月	1.0395%	0.0015%	0.1771%	0.0000%	0.8624%	0.0015%
过去一年	2.2342%	0.0016%	0.3565%	0.0000%	1.8777%	0.0016%



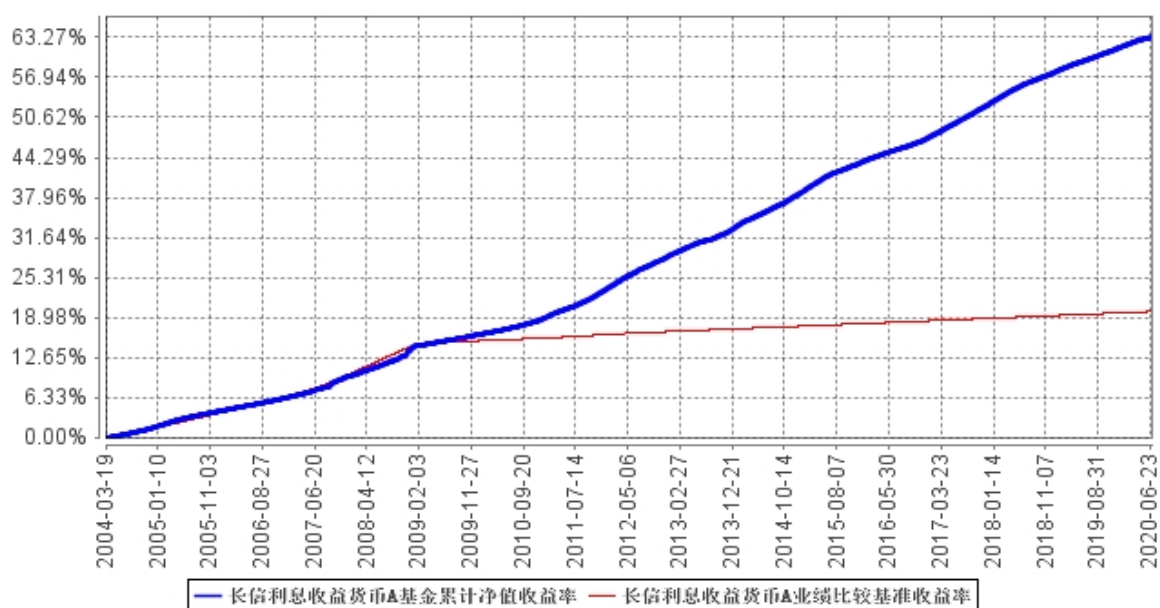
过去三年	8.8529%	0.0024%	1.0712%	0.0000%	7.7817%	0.0024%
自基金合同生效起至今	63.2070%	0.0063%	19.9762%	0.0033%	43.2308%	0.0030%

## 长信利息收益货币 B

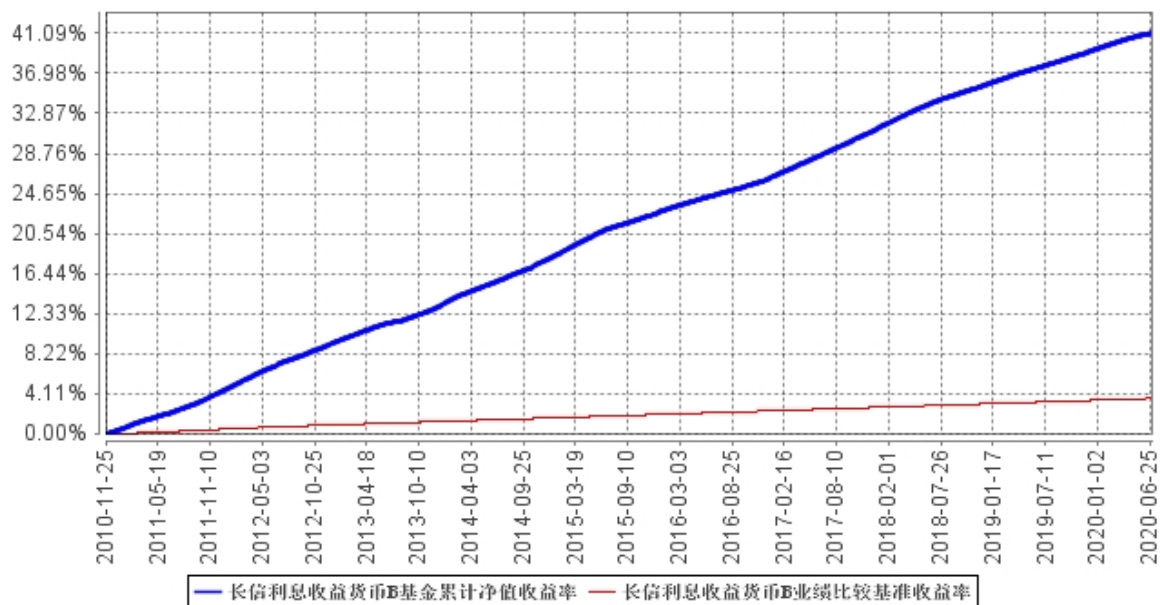
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.1399%	0.0002%	0.0292%	0.0000%	0.1107%	0.0002%
过去三个月	0.4899%	0.0006%	0.0885%	0.0000%	0.4014%	0.0006%
过去六个月	1.1600%	0.0015%	0.1771%	0.0000%	0.9829%	0.0015%
过去一年	2.4800%	0.0016%	0.3565%	0.0000%	2.1235%	0.0016%
过去三年	9.5755%	0.0024%	1.0712%	0.0000%	8.5043%	0.0024%
自基金合同生效起至今	41.0465%	0.0038%	3.6664%	0.0001%	37.3801%	0.0037%

### 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

长信利息收益货币A基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



### 长信利息收益货币B基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、长信利息收益货币 A 图示日期为 2004 年 3 月 19 日至 2020 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 2020 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%、武汉钢铁有限公司占 15.15%、上海彤胜投资管理中心（有限合伙）占 4.55%、上海彤骏投资管理中心（有限合伙）占 4.54%。

截至 2020 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 68 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、长信利发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、长信国防军工量化灵活配置混合型证券投资基金、长信先优债券型证券投资基金、长信稳势纯债债券型证券投资基金、长信中证 500 指数增强型证券投资基金、长信长金通货币市场基金、长信稳通三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长信低碳环保行业量化股票型证券投资基金、长信利尚一年定期开放混合型证券投资基金、长信乐信灵活配置混合型证券投资基金、长信全球

债券证券投资基金、长信稳鑫三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长信先机两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、长信消费精选行业量化股票型证券投资基金、长信企业精选两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、长信量化价值驱动混合型证券投资基金、长信价值蓝筹两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、长信稳裕三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长信稳进资产配置混合型基金中基金（FOF）、长信价值优选混合型证券投资基金、长信利率债债券型证券投资基金、长信沪深 300 指数增强型证券投资基金、长信富安纯债半年定期开放债券型证券投资基金、长信合利混合型证券投资基金、长信双利优选混合型证券投资基金、长信富瑞两年定期开放债券型证券投资基金、长信颐天平平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）、长信易进混合型证券投资基金、长信中证可转债及可交换债券 50 指数证券投资基金、长信先锐混合型证券投资基金、长信中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金。

#### 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		
陆莹	长信利息收益开放式证券投资基金、长信易进混合型证券投资基金、长信稳健纯债债券型证券投资基金、长信长金货币市场基金、长信稳通三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长信稳鑫三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长信富瑞两年定期开放债券型证券投资基金和长信中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金的基金经理、现金理财部总监	2016 年 12 月 30 日	-	10 年	管理学学士，毕业于上海交通大学，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，交易管理部债券交易员、交易主管，债券交易部副总监、总监、长信稳裕三个月定期开放债券型发起式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。现任现金理财部总监、长信利息收益开放式证券投资基金、长信易进混合型证券投资基金、长信稳健纯债债券型证券投资基金、长信长金货币市场基金、长信稳通三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长信稳鑫三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长信富瑞两年定期开放债券型证券投资基金和长信中债 1-3 年政策性金融

					债指数证券投资基金的基金经理。
段博卿	长信利息收益开放式证券投资基金、长信利率债债券型证券投资基金和长信稳鑫三个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理	2019 年 11 月 29 日	-	4 年	杜克大学经济学硕士，具有基金从业资格。曾任职于渣打银行（中国）有限公司、泰康资产管理有限责任公司和平安银行股份有限公司，2018 年 10 月加入长信基金管理有限责任公司，历任基金经理助理，现任长信利息收益开放式证券投资基金、长信利率债债券型证券投资基金和长信稳鑫三个月定期开放债券型发起式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；新增或变更基金经理的日期根据对外披露的公告日期填写；

2、证券从业的含义遵从《证券业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遵规守信情况的说明

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

回顾 2020 年 1 季度，货币市场资产收益率呈现先上后下趋势，与资金利率走势基本相似。跨年结束后，年末扰动因素消退，各期限存单收益率断崖式下跌，后由于春节取现因素导致的资金面扰动略有走高。节后受疫情影响，央行加码宽松，以及市场对货币政策进一步加大宽松力度的预期迅速升温，各期限利率单边下行，叠加以货币基金为主力的刚需配置盘逐渐入场被动买入，各期限收益率屡创新低。2 季度存单收益率呈现先下后上趋势，与资金利率走势基本相似。一季度跨季结束后，央行超预期下调超额准备金利率，市场打开想象空间，对货币政策进一步加大宽松力度的预期迅速升温，各期限存单利率单边下行，各期限存单收益率屡创新低。后在 5 月货币政策退出疫情时事件冲击的超常宽松后，滞后利率大幅上行调整。

本基金在 2020 年一季度中，在保持流动性及防风险的基础上，根据高波动的市场环境进行了提前判断，灵活调整组合久期和杠杆，较好的抓住了配置时点，维持了较高的组合整体收益。二季度利率低点以防御为主，稳健操作，控制风险，为投资者创造较好回报。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2020 年 6 月末，本报告期长信利息收益货币 A 净值收益率为 1.0395%，长信利息收益货币 B 净值收益率为 1.1600%，同期业绩比较基准收益为 0.1771%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

二季度 GDP 同比 3.2%，相比于一季度增速，回升了 10 个百分点。需要注意到，工业增加值、固定资产投资和出口三者的增速，基本都回到疫情前的水平，但消费仍然恢复较慢。三大需求中，出口的韧性持续好于预期，稳增长压力下固定资产投资也较快修复，相对而言消费尤其是服务消费恢复较慢，是最主要的拖累。但同时也要注意，经济恢复斜率最高的阶段基本已经过去（二阶导变慢）。目前各期限债券利率已经回到 1 月 23 日附近，同时对货币政策有较为正确的预期。因此短期该位置基本是符合基本面和政策的合理水平。后续可以博弈经济复苏不及预期，货币政

策超预期宽松的机会。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据相关法律法规，长信基金管理有限责任公司（以下简称“公司”）制订了健全、有效的估值政策和估值程序，成立了估值委员会，估值委员会是公司基金估值的主要决策机构，负责拟定公司的估值政策、估值方法及采用的估值程序和技术，健全公司估值决策体系，对公司现有程序和技术进行复核和审阅，当发生了影响估值程序和技术的有效性、适用性的情况及时修订估值程序；估值委员会成员由基金事务部、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，均具备估值业务所需的专业胜任能力。基金经理不直接参与估值决策，估值决策由与会估值工作小组成员 1/2 以上多数票通过。对于估值政策和估值原则，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。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定分别提供银行间同业市场及交易所交易的债券品种的估值数据以及流通受限股票的折扣率。参与估值流程各方不存在任何重大利益冲突。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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、按日支付，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 207,285,360.18 元，已分配利润 207,285,360.18 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 2020 年 1 月 1 日至 2020 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 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，长信基金管理有限责任公司的信息披露事务符合《公开募集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中期报告中的财务指标、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：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.6.1	8,903,430,684.62	6,410,819,070.79
结算备付金		300,000.00	300,000.00
存出保证金		305,901.98	319,225.45
交易性金融资产	6.4.6.2	8,943,819,101.78	11,893,157,821.13
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		8,603,819,101.78	11,403,157,821.13
资产支持证券投资		340,000,000.00	490,000,000.00
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	1,818,686,808.05	1,098,836,728.25
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.6.5	80,166,926.73	79,007,751.26
应收股利		-	-
应收申购款		194,088.40	729,984.79
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.6.6	-	-
资产总计		19,746,903,511.56	19,483,170,581.67
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2020 年 6 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	6.4.6.3	-	-
卖出回购金融资产款		522,324,138.83	1,752,828,730.74
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		556,486.75	969,520.58
应付管理人报酬		5,393,326.37	4,748,623.19
应付托管费		1,307,473.09	1,151,181.36
应付销售服务费		3,915,870.41	3,404,461.26
应付交易费用	6.4.6.7	113,788.81	114,768.89
应交税费		27,847.68	66,243.22

应付利息		32,508.22	377,400.69
应付利润		781,509.58	1,087,591.93
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.6.8	387,630.06	483,215.74
负债合计		534,840,579.80	1,765,231,737.60
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.6.9	19,212,062,931.76	17,717,938,844.07
未分配利润	6.4.6.10	-	-
所有者权益合计		19,212,062,931.76	17,717,938,844.07
负债和所有者权益总计		19,746,903,511.56	19,483,170,581.67

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，长信利息收益货币 A 基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 18,621,740,680.28 份；长信利息收益货币 B 基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 590,322,251.48 份。长信利息收益货币份额总额合计为 19,212,062,931.76 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：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		281,396,673.26	202,089,099.12
1.利息收入		279,147,176.64	196,724,284.87
其中：存款利息收入	6.4.6.11	103,791,434.77	35,714,563.46
债券利息收入		156,160,127.15	136,954,914.97
资产支持证券利息收入		5,911,386.43	-
买入返售金融资产收入		13,284,228.29	24,054,806.44
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		2,249,496.62	5,364,814.25
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	2,249,496.62	5,364,814.25
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）	6.4.6.17	-	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填		-	-

列)			
5.其他收入(损失以“-”号填列)	6.4.6.18	-	-
<b>减: 二、费用</b>		74,111,313.08	42,730,512.24
1. 管理人报酬	6.4.9.2.1	32,879,182.04	21,519,164.05
2. 托管费	6.4.9.2.2	7,970,710.83	6,520,958.89
3. 销售服务费	6.4.9.2.3	23,819,217.22	9,768,339.82
4. 交易费用	6.4.6.19	-	44,095.86
5. 利息支出		9,261,501.80	4,712,631.35
其中: 卖出回购金融资产支出		9,261,501.80	4,712,631.35
6. 税金及附加		22,843.38	13,094.79
7. 其他费用	6.4.6.20	157,857.81	152,227.48
<b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b>		207,285,360.18	159,358,586.88
减: 所得税费用		-	-
<b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>		207,285,360.18	159,358,586.88

### 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: 2020年1月1日至2020年6月30日

单位: 人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020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)	17,717,938,844.07	-	17,717,938,844.07
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	207,285,360.18	207,285,360.18
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)	1,494,124,087.69	-	1,494,124,087.69
其中: 1. 基金申购款	166,800,186,920.40	-	166,800,186,920.40
2. 基金赎回款	-165,306,062,832.71	-	-165,306,062,832.71
四、本期向基金份额持	-	-207,285,360.18	-207,285,360.18

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）	19,212,062,931.76	-	19,212,062,931.76
项目	上年度可比期间 2019年1月1日至2019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）	6,658,227,716.22	-	6,658,227,716.22
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	159,358,586.88	159,358,586.88
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）	8,934,392,711.27	-	8,934,392,711.27
其中：1. 基金申购款	61,159,535,029.60	-	61,159,535,029.60
2. 基金赎回款	-52,225,142,318.33	-	-52,225,142,318.33
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）	-	-159,358,586.88	-159,358,586.88
五、期末所有者权益（基金净值）	15,592,620,427.49	-	15,592,620,427.49

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”），系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[2003]149号文《关于同意设立长信利息收益开放式证券投资基金的批复》的核准，由基金管理人长信基金管理有限责任公司向社会公开发行募集，基金合

同于 2004 年 3 月 19 日正式生效，首次设立募集规模为 7,042,630,886.94 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为长信基金管理有限责任公司，直销渠道的注册登记机构为长信基金管理有限责任公司，非直销渠道的注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

本基金自 2010 年 11 月 25 日起实行销售服务费分级收费方式，单个基金账户保留的本基金份额低于 500 万份的享受 A 级基金份额的收益，单个基金账户保留的本基金份额达到或超过 500 万份的享受 B 级基金份额的收益。两级基金份额单独设置基金代码，并单独公布每万份基金净收益和七日年化收益率。根据《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取消基金份额升降级业务的公告》，自 2019 年 2 月 25 日起取消长信利息收益开放式证券投资基金基金份额的升降级业务。单个交易账户保留的基金份额累计达到或超过 500 万份时，本基金的注册登记机构将不再把 A 类基金份额自动升级为 B 类基金份额；单个交易账户保留的基金份额低于 500 万份时，本基金的注册登记机构将不再把 B 类基金份额自动降级为 A 类基金份额。

本基金投资对象主要包括：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。

本基金业绩比较基准为：银行活期存款利率（税后）。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 5 号《货币市场基金信息披露特别规定》、《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〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2020 年 6 月 30 日的财务状况、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。

### 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

本基金本报告期内无需说明的重大会计差错更正。

### 6.4.5 税项

#### 6.4.5.1 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，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试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（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、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，本基金的基金管理人运营本基金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。对本基金在 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，已纳税额从本基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

#### 6.4.5.2 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011 年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

#### 6.4.5.3 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（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、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

#### 6.4.5.4 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

### 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 2020 年 6 月 30 日
活期存款	3,430,684.62
定期存款	8,900,000,000.00
其中：存款期限 1 个月以内	3,000,000,000.00
存款期限 1-3 个月	4,900,000,000.00
存款期限 3 个月以上	1,000,000,000.00
其他存款	-
合计：	8,903,430,684.62

**6.4.6.2 交易性金融资产**

单位：人民币元

项目		本期末 2020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	8,603,819,101.78	8,606,000,000.00	2,180,898.22	0.0114%
	合计	8,603,819,101.78	8,606,000,000.00	2,180,898.22	0.0114%
	资产支持证券	340,000,000.00	341,143,000.00	1,143,000.00	0.0059%
	合计	8,943,819,101.78	8,947,143,000.00	3,323,898.22	0.0173%

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。

**6.4.6.3 衍生金融资产/负债**

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/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 2020年6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	1,818,686,808.05	-
合计	1,818,686,808.05	-

**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 2020年6月30日
应收活期存款利息	783.86
应收定期存款利息	53,064,441.88



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	18,163,882.51
应收资产支持证券利息	7,721,600.01
应收买入返售证券利息	1,215,945.77
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	137.70
合计	80,166,926.73

注：其他为应收结算保证金利息。

#### 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 2020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	113,788.81
合计	113,788.81

#### 6.4.6.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	52.54
应付证券出借违约金	-
预提账户维护费	9,000.00
预提审计费	34,809.32
预提信息披露费	299,672.34
券商席位佣金	44,095.86
合计	387,630.06

#### 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 2020年1月1日至2020年6月30日

	基金份额（份）	账面金额
上年度末	16,769,221,257.79	16,769,221,257.79
本期申购	166,689,642,164.85	166,689,642,164.85
本期赎回(以“-”号填列)	-164,837,122,742.36	-164,837,122,742.36
- 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	18,621,740,680.28	18,621,740,680.28

金额单位：人民币元

长信利息收益货币 B		
项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	948,717,586.28	948,717,586.28
本期申购	110,544,755.55	110,544,755.55
本期赎回(以“-”号填列)	-468,940,090.35	-468,940,090.35
- 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	590,322,251.48	590,322,251.48

注：表内各级基金的申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 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	196,750,834.82	-	196,750,834.82
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	-196,750,834.82	-	-196,750,834.82
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	10,534,525.36	-	10,534,525.36

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	-10,534,525.36	-	-10,534,525.36
本期末	-	-	-

#### 6.4.6.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
活期存款利息收入	19,758.31
定期存款利息收入	103,766,357.12
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	5,188.12
其他	131.22
合计	103,791,434.77

#### 6.4.6.12 股票投资收益

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 2020年1月1日至2020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	2,249,496.62
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	2,249,496.62

##### 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 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	18,452,987,834.17
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	18,388,510,847.85
减：应收利息总额	62,227,489.70

买卖债券差价收入	2,249,496.62
----------	--------------

#### 6.4.6.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无债券赎回差价收入。

#### 6.4.6.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无债券申购差价收入。

#### 6.4.6.13.5 资产支持证券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出资产支持证券成交总额	151,675,950.00
减：卖出资产支持证券成本总额	150,000,000.00
减：应收利息总额	1,675,950.00
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

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

本基金本报告期无买卖权证差价收入。

##### 6.4.6.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期无衍生工具其他投资收益。

#### 6.4.6.16 股利收益

本基金本报告期及未持有股票，无股利收益。

#### 6.4.6.17 公允价值变动收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无公允价值变动收益。

#### 6.4.6.18 其他收入

本基金本报告期无其他收入。

#### 6.4.6.19 交易费用

本基金本报告期无交易费用。

#### 6.4.6.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
审计费用	34,809.32
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
帐户维护费	23,537.86
其他费用	39,838.29
其他	-
券商席位佣金	-
合计	157,857.81

注：其他费用为银行手续费等。

#### 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

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 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、注册登记机构、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司	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”）	基金管理人的股东、基金销售机构

## 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 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日	
	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 成交总额的比例
长江证券	40,396,783.56	100.00%	-	-

#### 6.4.9.1.2 债券回购交易

本基金本期间及上年度可比期间均未发生通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

#### 6.4.9.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020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	-	-	44,095.86	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2019年1月1日至2019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	44,095.86	100.00%	44,095.86	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 2020年1月1日至2020年6月 30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月 30日

当期发生的基金应支付的管理费	32,879,182.04	21,519,164.05
其中：支付销售机构的客户维护费	21,890,426.02	8,908,398.97

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
	2020年1月1日至2020年6月30日	2019年1月1日至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	7,970,710.83	6,520,958.89

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 0.08% 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×0.08%/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		
	2020年1月1日至2020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
长信基金	38,327.87	33,453.81	71,781.68
农业银行	104,241.92	475.10	104,717.02
长江证券	4,607.93	11,172.77	15,780.70
合计	147,177.72	45,101.68	192,279.40
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2019年1月1日至2019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
长信基金	62,495.98	228,724.01	291,219.99
农业银行	96,891.50	461.87	97,353.37
长江证券	4,054.90	11,327.91	15,382.81
合计	163,442.38	240,513.79	403,956.17

注：A 级基金日基金销售服务费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数

B 级基金日基金销售服务费=前一日基金资产净值×0.01%/当年天数

根据基金管理人 2018 年 10 月 11 日发布的《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费率优惠活动的公告》，从 2018 年 10 月 11 日起（具体截止日期另行公告），对于长信利息收益开放式证券投资基金 A 级份额开展销售服务费优惠活动，优惠后销售服务费率 0.10%。

根据基金管理人 2019 年 2 月 23 日发布的《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费率优惠活动结束的公告》，自 2019 年 2 月 25 日起，结束对长信利息收益开放式证券投资基金 A 级份额开展的销售服务费费率优惠活动，销售服务费率恢复为 0.25%。

#### 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

本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 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	102,603,323.50	-	-	-	18,716,014,000.00	1,410,389.52
上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 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	-	98,275,453.42	-	-	4,563,947,000.00	333,678.47

#### 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 2020 年 1 月 1 日至 2020 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		
报告期初持有的基金份额	-	291,435,526.89
报告期间申购/买入总份额	-	3,355,253.85
报告期间因拆分变动份额	-	-
减: 报告期间赎回/卖出总份额	-	50,000,000.00
报告期末持有的基金份额	-	244,790,780.74
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	1.31%

项目	上年度可比期间 2019年1月1日至2019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	-	-
报告期初持有的基金份额	-	343,642,865.30
报告期间申购/买入总份额	-	4,002,520.09
报告期间因拆分变动份额	-	-
减: 报告期间赎回/卖出总份额	-	60,000,000.00
报告期末持有的基金份额	-	287,645,385.39
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	1.84%

注：1、报告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 187,916,882.09 份为本基金管理人风险准备金投资；

3、基金管理人运用固有资金投资本基金费率按本基金招募说明书公布的费率执行。

#### 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 2020年6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
上海海欣生物技术有 限公司	0.00	0.00%	1,019.24	0.00%

注：除基金管理人之外的其他关联方在本报告期末未持有本基金。

**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 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019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	3,430,684.62	19,758.31	10,177,030.92	44,760.00

注：本基金用于证券交易结算的资金通过本基金托管人的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，按银行同业利率计息。于2020年6月30日的相关余额在资产负债表中的“结算备付金”科目中单独列示（2019年12月31日：同）

**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**

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

**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
197,011,985.19	8,547.94	-269,698.31	196,750,834.82	-

## 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
10,544,755.55	26,153.85	-36,384.04	10,534,525.36	-

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（2020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**

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证券。

### 6.4.11.2 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

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 522,324,138.83 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
190012	19 附息国债 12	2020 年 7 月 1 日	100.11	2,000,000	200,223,124.34
130422	13 农发 22	2020 年 7 月 1 日	100.67	53,000	5,335,721.67
150420	15 农发 20	2020 年 7 月 1 日	100.28	1,412,000	141,597,455.73
209922	20 贴现国债 22	2020 年 7 月 1 日	99.86	1,000,000	99,858,697.57
150220	15 国开 20	2020 年 7 月 1 日	100.37	1,000,000	100,369,262.04
合计				5,465,000	547,384,261.35

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。

#### 6.4.11.3.2 交易所市场债券正回购

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、流动性风险和市场风险。

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理念，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。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，战略与产品研发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。

#### 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人中国农业银行股份有限公司，与该银行存款相关的信用风险不重大。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，本基金投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的 10%。

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

##### 6.4.12.2.1 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 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
A-1	0.00	1,231,096,659.32
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	559,501,207.55	600,224,816.23
合计	559,501,207.55	1,831,321,475.55

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

##### 6.4.12.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
--------	------------------------	--------------------------

A-1	0.00	150,000,000.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	150,000,000.00

注：短期信用评级 A-1 所填列的资产支持证券投资均为 AAA 级的短期资产支持证券。

#### 6.4.12.2.3 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 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	7,612,671,834.08	8,799,620,407.13
合计	7,612,671,834.08	8,799,620,407.13

注：本基金持有同业存单的主体评级均为 AA+ 及以上评级。

#### 6.4.12.2.4 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 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
AAA	0.00	141,074,610.33
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	431,646,060.15	631,141,328.12
合计	431,646,060.15	772,215,938.45

注：未评级债券为国债、央行票据及政策性金融债等无信用评级债券。

#### 6.4.12.2.5 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 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
AAA	300,000,000.00	300,000,000.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	40,000,000.00	40,000,000.00
合计	340,000,000.00	340,000,000.00

注：未评级资产支持证券为根据万得最新评级数据显示为未评级的资产支持证券。

#### 6.4.12.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

#### 6.4.12.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。

本基金流动性风险来源于开放式基金每日兑付赎回资金的流动性风险，以及因部分投资品种交易不活跃而出现的变现风险和因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理价格变现投资的风险。

#### 6.4.12.3.1 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》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。

本基金坚持组合管理、分散投资的原则开展投资活动，所持证券均在证券交易所或银行间同业市场交易，本期末本基金未持有有重大流动性风险的投资品种。在严格遵守基金管理人流动性相关交易限制前提下，本基金基金管理人根据相关法规对本基金份额持有人集中度实施严格监控和管理，针对投资人集中度情况对本基金的投资组合实施动态调整。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金管理人在基金合同中约定了巨额赎回条款，设计了非常情况下赎回资金的处理模式，控制因开放模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。同时，本基金在需要时刻通过卖出回购金融资产方式融入短期资金，以缓解流动性风险。

本基金本报告期末及上年度末均无重大流动性风险。

#### 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

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。

##### 6.4.12.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020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	8,903,430,684.62	-	-	-	-	8,903,430,684.62
结算备付金	300,000.00	-	-	-	-	300,000.00

存出保证金	305,901.98	-	-	-	-	305,901.98
交易性金融资产	7,469,897,151.51	1,473,921,950.27	-	-	-	8,943,819,101.78
买入返售金融资产	1,818,686,808.05	-	-	-	-	1,818,686,808.05
应收利息	-	-	-	-	80,166,926.73	80,166,926.73
应收申购款	-	-	-	-	194,088.40	194,088.40
其他资产	-	-	-	-	-	-
资产总计	18,192,620,546.16	1,473,921,950.27	-	-	80,361,015.13	19,746,903,511.56
负债	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	522,324,138.83	-	-	-	-	522,324,138.83
应付赎回款	-	-	-	-	556,486.75	556,486.75
应付管理人报酬	-	-	-	-	5,393,326.37	5,393,326.37
应付托管费	-	-	-	-	1,307,473.09	1,307,473.09
应付销售服务费	-	-	-	-	3,915,870.41	3,915,870.41
应付交易费用	-	-	-	-	113,788.81	113,788.81
应付利息	-	-	-	-	32,508.22	32,508.22
应交税费	-	-	-	-	27,847.68	27,847.68
应付利润	-	-	-	-	781,509.58	781,509.58
其他负债	-	-	-	-	387,630.06	387,630.06
负债总计	522,324,138.83	-	-	-	12,516,440.97	534,840,579.80
利率敏感度缺口	17,670,296,407.33	1,473,921,950.27	-	-	67,844,574.16	19,212,062,931.76
上年度末 2019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	5,610,819,070.79	800,000,000.00	-	-	-	6,410,819,070.79
结算备付金	300,000.00	-	-	-	-	300,000.00
存出保证金	319,225.45	-	-	-	-	319,225.45
交易性金融资产	11,406,012,671.25	487,145,149.88	-	-	-	11,893,157,821.13
买入返售金融资产	1,098,836,728.25	-	-	-	-	1,098,836,728.25
应收利息	-	-	-	-	79,007,751.26	79,007,751.26
应收申购款	-	-	-	-	729,984.79	729,984.79
其他资产	-	-	-	-	-	-
资产总计	18,116,287,695.74	1,287,145,149.88	-	-	79,737,736.05	19,483,170,581.67
负债	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	1,752,828,730.74	-	-	-	-	1,752,828,730.74
应付赎回款	-	-	-	-	969,520.58	969,520.58
应付管理人报酬	-	-	-	-	4,748,623.19	4,748,623.19
应付托管费	-	-	-	-	1,151,181.36	1,151,181.36

应付销售服务费	-	-	-	3,404,461.26	3,404,461.26
应付交易费用	-	-	-	114,768.89	114,768.89
应付利息	-	-	-	377,400.69	377,400.69
应交税费	-	-	-	66,243.22	66,243.22
应付利润	-	-	-	1,087,591.93	1,087,591.93
其他负债	-	-	-	483,215.74	483,215.74
负债总计	1,752,828,730.74	-	-	12,403,006.86	1,765,231,737.60
利率敏感度缺口	16,363,458,965.00	1,287,145,149.88	-	67,334,729.19	17,717,938,844.07

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（2020年6月30日）	上年度末（2019年12月31日）
	市场利率下降27个基点	7,294,124.72	8,462,731.62
市场利率上升27个基点	-7,294,124.72	-8,462,731.62	

#### 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。本基金主要投资于证券交易所上市的债券和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

#### 6.4.13.1 公允价值

##### 6.4.13.1.1 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贷款和应收款项以及其他金融负债，其因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

##### 6.4.13.1.2 以公允价值计量的金融工具



#### 6.4.13.1.2.1 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一层次的余额为人民币 0.00 元，属于第二层次的余额为人民币 8,943,819,101.78 元，属于第三层次余额为人民币 0.00 元。

#### 6.4.13.2 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。

#### 第三层次公允价值余额和本期变动金额

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工具第三层次公允价值本期未发生变动。

#### 6.4.13.3 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

#### 6.4.13.4 其他事项

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	8,943,819,101.78	45.29
	其中: 债券	8,603,819,101.78	43.57
	资产支持证券	340,000,000.00	1.72
2	买入返售金融资产	1,818,686,808.05	9.21
	其中: 买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	8,903,730,684.62	45.09
4	其他各项资产	80,666,917.11	0.41
5	合计	19,746,903,511.56	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	5.91	
	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	522,324,138.83	2.72
	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	73
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	104
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	73

### 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	27.60	2.72
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	15.56	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	33.88	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—120 天	10.13	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)—397 天(含)	15.20	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		102.37	2.72

#### 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	409,834,895.99	2.13
2	央行票据	-	-
3	金融债券	581,312,371.71	3.03
	其中：政策性金融债	581,312,371.71	3.03
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单	7,612,671,834.08	39.62
8	其他	-	-
9	合计	8,603,819,101.78	44.78

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	112099780	20 重庆农村商行 CD094	5,000,000	498,853,407.53	2.60
2	111905119	19 建设银行 CD119	5,000,000	498,796,448.70	2.60
3	112094281	20 广州农村商业银行 CD027	5,000,000	497,781,080.45	2.59
4	112020100	20 广发银行 CD100	5,000,000	497,743,408.98	2.59
5	112014045	20 江苏银行 CD045	5,000,000	497,713,032.07	2.59
6	112021119	20 渤海银行 CD119	5,000,000	497,511,434.07	2.59
7	112092017	20 广州银行 CD016	4,000,000	393,010,473.04	2.05
8	112013007	20 浙商银行 CD007	3,000,000	299,237,942.33	1.56
9	111914167	19 江苏银行 CD167	3,000,000	298,650,651.34	1.55
10	112081326	20 徽商银行 CD046	3,000,000	296,840,256.43	1.55

## 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	0.2335%
报告期内偏离度的最低值	0.0041%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1074%

### 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

本报告期内本货币市场基金不存在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	159909	19 借 02A1	1,700,000.00	170,000,000.00	0.88

2	138029	深借呗 5A	800,000.00	80,000,000.00	0.42
3	159915	19 借 01A1	500,000.00	50,000,000.00	0.26
4	138042	信借 02A	400,000.00	40,000,000.00	0.21

## 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 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

报告期内本基金投资的前十名证券中，发行主体广州农村商业银行股份有限公司于 2019 年 10 月 25 日收到中国银保监会广东监管局行政处罚决定书文（粤银保监罚决字（2019）54 号），根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条第三款，《中国银监会关于整治银行业金融机构不规范经营的通知》第二条，经查，广州农村商业银行股份有限公司违规向客户收取服务费。综上，中国银保监会广东监管局决定对广州农村商业银行股份有限公司罚款 65 万元。

报告期内本基金投资的前十名证券中，发行主体中国建设银行股份有限公司于 2019 年 12 月 27 日收到中国银行保险监督管理委员会行政处罚决定书文（银保监罚决字（2019）22 号），根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条第（五）项的规定和相关内控管理和业务审慎经营规则，经查，中国建设银行股份有限公司用于风险缓释的保证金管理存在漏洞；国别风险管理不完善。综上，中国银行保险监督管理委员会决定对中国建设银行股份有限公司罚款合计 80 万元。

发行主体中国建设银行股份有限公司于 2020 年 4 月 20 日收到中国银行保险监督管理委员会行政处罚决定书文号：银保监罚决字（2020）8 号，根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十七条和相关内控管理、审慎经营规定，经查，中国建设银行股份有限公司在监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在以下违法违规行为：资金交易信息漏报严重；信贷资产转让业务漏报；银行承兑汇票业务漏报；贸易融资业务漏报和错报；分户账明细记录应报未报；分户账账户数据应报未报；关键且应报字段漏报或填报错误。综上，中国银行保险监督管理委员会决定对中国建设银行股份有限公司罚款合计 230 万元。

对如上证券投资决策程序的说明：公司研究部门按照内部研究工作规范对该证券进行分析后将其列入基金投资对象备选库。在此基础上本基金的基金经理根据具体市场情况独立作出投资决策。该事件发生后，本基金管理人对该证券的发行主体进行了进一步了解与分析，认为此事件未对该证券投资价值判断产生重大的实质性影响。本基金投资于该证券的投资决策过程符合制度规定的投资权限范围与投资决策程序。

报告期内本基金投资的前十名证券中其余八名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	305,901.98
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	80,166,926.73
4	应收申购款	194,088.40
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	80,666,917.11

### 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	3,928,408	4,740.28	21,424,997.74	0.12%	18,600,315,682.54	99.88%
长信利息收益货币 B	25	23,612,890.06	580,715,630.10	98.37%	9,606,621.38	1.63%
合计	3,928,433	4,890.52	602,140,627.84	3.13%	18,609,922,303.92	96.87%

### 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	保险类机构	106,571,667.38	0.55%
2	其他机构	54,432,010.54	0.28%
3	保险类机构	30,038,170.41	0.16%
4	其他机构	25,177,304.89	0.13%
5	券商类机构	20,078,642.26	0.10%
6	个人	18,595,760.79	0.10%
7	银行类机构	16,751,333.97	0.09%
8	个人	16,584,936.61	0.09%
9	其他机构	10,610,348.06	0.06%
10	保险类机构	10,482,029.06	0.05%

注：期末前十名份额持有人不包括基金管理人运用固有资金投资的情况。

### 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	长信利息收益货币 A	1,176,475.03	0.01%

持有本基金	长信利息收益货币 B	-	-
	合计	1,176,475.03	0.01%

#### 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	50~100
	长信利息收益货币 B	0
	合计	50~100
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	16,769,221,257.79	948,717,586.28
本报告期基金总申购份额	166,689,642,164.85	110,544,755.55
减：本报告期基金总赎回份额	164,837,122,742.36	468,940,090.35
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	18,621,740,680.28	590,322,251.48

## §10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

#### 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

本报告期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	
银河证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-

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。

### 10.7.2 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
银河证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	40,396,783.56	100.00%	-	-	-	-

### 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旗下部分开放式基金在安信证券股份有限公司调整定期定额投资业务投资起点的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2020年1月15日
2	长信利息收益开放式证券投资基金 2019 年第 4 季度报告	中国证监会电子披露网站、公司网站	2020年1月17日
3	长信基金管理有限责任公司旗下全部基金 2019 年第四季度报告提示性公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2020年1月17日

4	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、中国证监会电子披露网站、公司网站	2020 年 1 月 20 日
5	长信基金管理有限责任公司关于 2020 年春节假期延长期间调整公司旗下基金申购赎回、清算交收等事宜的提示性公告	中国证监会电子披露网站、公司网站	2020 年 1 月 31 日
6	长信利息收益开放式证券投资基金更新的招募说明书（2020 年第【1】号）及摘要（仅摘要见报）	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2020 年 2 月 28 日
7	长信基金管理有限责任公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2020 年 3 月 13 日
8	长信基金管理有限责任公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2020 年 3 月 17 日
9	长信基金管理有限责任公司关于推迟披露旗下公募基金 2019 年年度报告的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2020 年 3 月 25 日
10	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、中国证监会电子披露网站、公司网站	2020 年 3 月 31 日
11	长信利息收益开放式证券投资基金 2020 年第 1 季度报告	中国证监会电子披露网站、公司网站	2020 年 4 月 22 日
12	长信基金管理有限责任公司旗下全部基金 2020 年第一季度报告提示性公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2020 年 4 月 22 日
13	长信利息收益开放式证券投资基金 2019 年年度报告	中国证监会电子披露网站、公司网站	2020 年 4 月 27 日
14	长信基金管理有限责任公司旗下全部基金 2019 年年度报告提示性公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2020 年 4 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、中国证监会电子披露网站、公司网站	2020 年 4 月 27 日
16	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申万宏源证券有限公司基金申购（含定期定额投资申购）费率优惠活动的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2020 年 6 月 3 日
17	长信基金管理有限责任公司关于增加民商基金销售（上海）有限公司为旗下部分开放式基金代销机构并开通转换业务及参加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、中国证监会电子披露网站、公司网站	2020 年 6 月 3 日
18	长信基金管理有限责任公司关于长信利	上证报、中国证监会电子	2020 年 6 月 19 日

	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	披露网站、公司网站	日
19	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、中国证监会电子披露网站、公司网站	2020 年 6 月 29 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

2020年8月29日