

# 长信利息收益开放式证券投资基金 2022 年第 3 季度报告

2022 年 9 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

报告送出日期：2022 年 10 月 26 日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金基金合同的规定，于 2022 年 10 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 7 月 1 日起至 2022 年 9 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

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
报告期末基金份额总额	42,877,710,940.97 份
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</p> <p>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</p> <p>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</p> <p>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</p> <p>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</p>

	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。	
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	
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	39,790,934,303.89 份	3,086,776,637.08 份

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2022 年 7 月 1 日-2022 年 9 月 30 日）	
	长信利息收益货币 A	长信利息收益货币 B
1. 本期已实现收益	159,661,633.52	11,206,488.61
2. 本期利润	159,661,633.52	11,206,488.61
3. 期末基金资产净值	39,790,934,303.89	3,086,776,637.08

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益，由于货币市场基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

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。

#### 3.2 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	净值收益率 ①	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
过去三个月	0.4093%	0.0009%	0.0895%	0.0000%	0.3198%	0.0009%
过去六个月	0.8539%	0.0007%	0.1790%	0.0000%	0.6749%	0.0007%
过去一年	1.9014%	0.0009%	0.3555%	0.0000%	1.5459%	0.0009%
过去三年	6.3354%	0.0013%	1.0712%	0.0000%	5.2642%	0.0013%
过去五年	12.8287%	0.0021%	1.7911%	0.0000%	11.0376%	0.0021%

自基金合同生效起至今	70.8083%	0.0076%	20.9388%	0.0032%	49.8695%	0.0044%
------------	----------	---------	----------	---------	----------	---------

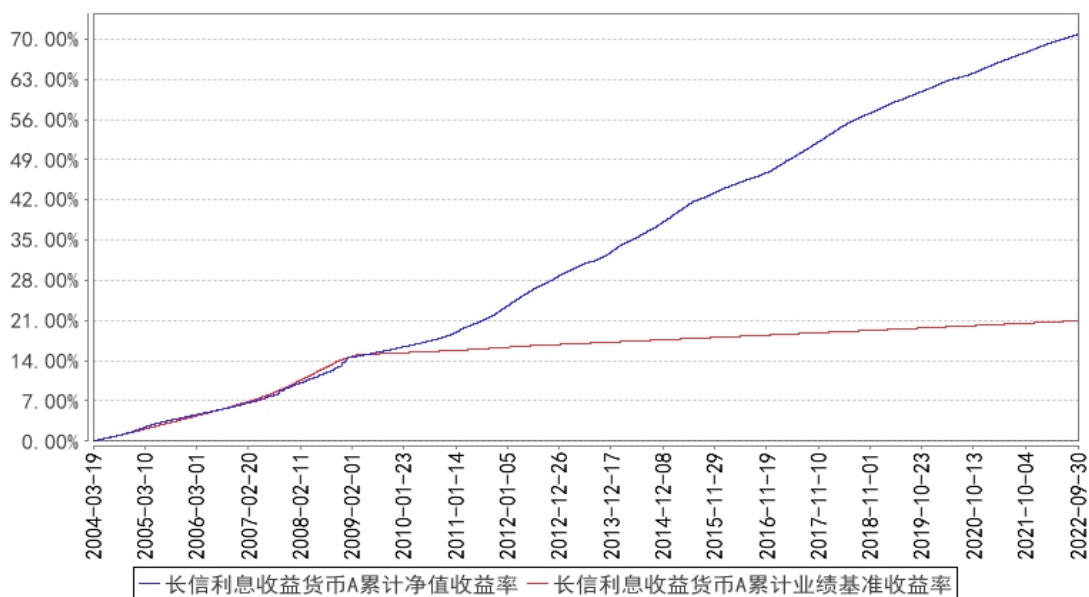
## 长信利息收益货币 B

阶段	净值收益率 ①	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
过去三个月	0.4700%	0.0009%	0.0895%	0.0000%	0.3805%	0.0009%
过去六个月	0.9753%	0.0007%	0.1790%	0.0000%	0.7963%	0.0007%
过去一年	2.1462%	0.0009%	0.3555%	0.0000%	1.7907%	0.0009%
过去三年	7.1030%	0.0013%	1.0712%	0.0000%	6.0318%	0.0013%
过去五年	14.1231%	0.0021%	1.7911%	0.0000%	12.3320%	0.0021%
自份额增加 日起至今	48.4073%	0.0037%	4.4982%	0.0001%	43.9091%	0.0036%

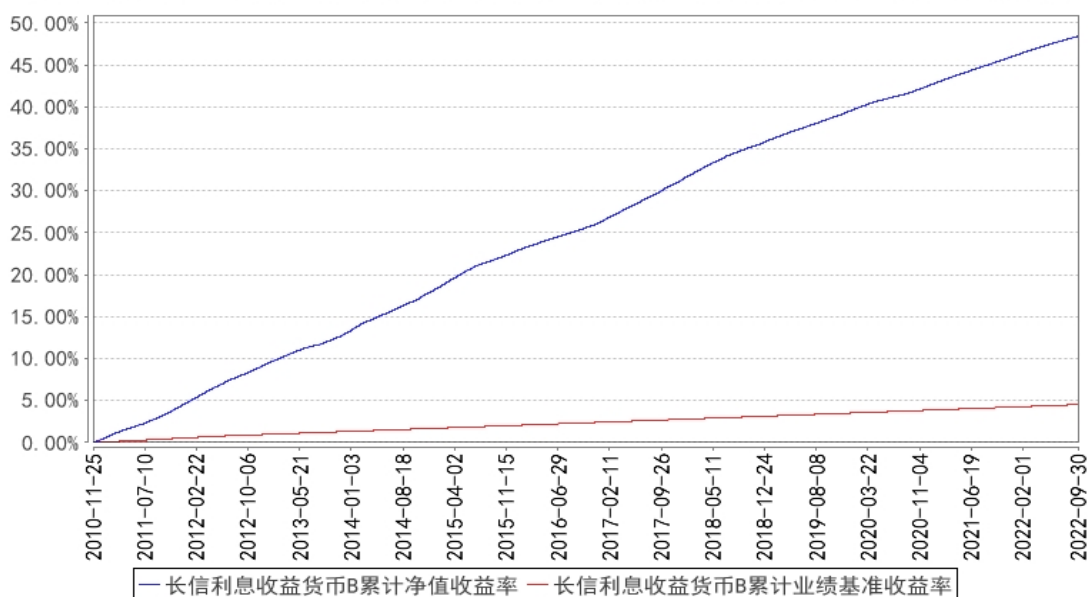
注：本基金收益分配按日结转份额。

### 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 2022 年 9 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 2022 年 9 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 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		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、长信长金货币市场基金、长信稳鑫三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长信浦瑞 87 个月定期开放债券型证券投资基金和长信稳惠债券型证券投资基金的基金经理、现金理	2016 年 12 月 30 日	-	12 年	管理学学士，毕业于上海交通大学，具有基金从业资格，中国国籍。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、长信纯债半年债券型证券投资基金、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、长信长金货币市场基金、长信稳鑫三个月定期开放债券型发起式

	财部总监				证券投资基金、长信浦瑞 87 个月定期开放债券型证券投资基金和长信稳惠债券型证券投资基金的基金经理。
钱进	长信利息收益开放式证券投资基金和长信利率债债券型证券投资基金的基金经理	2021 年 10 月 28 日	-	7 年	北京大学金融学硕士毕业，具有基金从业资格，中国国籍。曾任职于广发银行股份有限公司金融市场部，从事债券相关投资和交易工作，2021 年 7 月加入长信基金管理有限责任公司，现担任长信利息收益开放式证券投资基金和长信利率债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 报告期内本基金运作合规守信情况说明

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 公平交易专项说明

##### 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 报告期内基金的投资策略和运作分析

回顾三季度，国内经济增速面临压力，政策及时于 8 月中降息进行逆周期调节，随后数据显示经济逐步回升。货币政策维持合理充裕偏宽松的总基调为经济修复保驾护航，短端利率水平维持低位，带动短期资产震荡下行，以 1 年期存单为例，从二季度末 2.3% 下行至三季度末 2.0% 水平。

展望四季度，前期出台的政策已陆续看到效果；政策方面，后续仍可期待更多稳增长工具，货币政策兼顾内外平衡，短端资产仍将锚定资金价格进行定价。本基金将密切关注货币政策和资金面的边际变化，对组合进行灵活调整，积极把握配置机会，同时加强对信用主体的风险筛查，努力提升组合收益，同时做好风险防控。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2022 年 9 月 30 日，本报告期内长信利息收益货币 A 净值收益率为 0.4093%，长信利息收益货币 B 净值收益率为 0.4700%，同期业绩比较基准收益率为 0.0895%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

### § 5 投资组合报告

#### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	固定收益投资	17,112,706,284.34	38.09
	其中：债券	17,112,706,284.34	38.09
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	3,597,629,165.70	8.01
	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	24,212,867,518.42	53.90
4	其他资产	312,664.96	0.00
5	合计	44,923,515,633.42	100.00

#### 5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	金额（元）	占基金资产净值的比例（%）
1	报告期内债券回购融资余额	-	8.60
	其中：买断式回购融资	-	-
2	报告期末债券回购融资余额	20,045,687.34	0.05
	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比例为报告期内每个交易日融资余额占基金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%。

### 5.3 基金投资组合平均剩余期限

#### 5.3.1 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	116
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	116
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	76

#### 报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

报告期内投资组合平均剩余期限不存在超过 120 天的情况。

#### 5.3.2 报告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	39.92	4.71
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	5.17	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	8.26	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	2.46	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	48.58	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	104.39	4.71

#### 5.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

报告期内投资组合平均剩余存续期不存在超过 240 天的情况。

#### 5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本（元）	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	199,271,058.59	0.46
2	央行票据	-	-
3	金融债券	2,712,855,359.36	6.33
	其中：政策性金融债	2,007,562,101.98	4.68
4	企业债券	176,030,665.06	0.41
5	企业短期融资券	131,555,515.61	0.31
6	中期票据	104,049,286.16	0.24
7	同业存单	13,329,342,547.11	31.09
8	其他	459,601,852.45	1.07



9	合计	17,112,706,284.34	39.91
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

### 5.6 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量 (张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	112108173	21 中信银行 CD173	6,000,000	596,559,552.66	1.39
2	200402	20 农发 02	5,800,000	587,027,356.10	1.37
3	112114168	21 江苏银行 CD168	5,000,000	497,608,276.70	1.16
4	112209012	22 浦发银行 CD012	5,000,000	496,066,743.77	1.16
5	112285454	22 昆仑银行 CD032	5,000,000	493,902,523.27	1.15
6	112285906	22 江苏江南农村商业银行 CD087	5,000,000	493,775,250.98	1.15
7	112204001	22 中国银行 CD001	4,000,000	397,138,237.96	0.93
8	112285376	22 郑州银行 CD188	4,000,000	395,070,186.48	0.92
9	210216	21 国开 16	3,300,000	336,815,646.72	0.79
10	112113246	21 浙商银行 CD246	3,000,000	298,979,031.68	0.70

### 5.7 “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	0
报告期内偏离度的最高值	0.1092%
报告期内偏离度的最低值	0.0387%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0751%

#### 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。

### 5.8 报告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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 5.9 投资组合报告附注

#### 5.9.1 基金计价方法说明

本基金采用摊余成本法计价。

#### 5.9.2 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否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

报告期内本基金投资的前十名证券中，发行主体中信银行股份有限公司于 2022 年 3 月 21 日收到中国银行保险监督管理委员会行政处罚信息公开表（银保监罚决字（2022）17 号），根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条和相关审慎经营规则，经查，中信银

行监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在以下违法违规行为：一、漏报抵押物价值 EAST 数据；二、未报送权益类投资业务 EAST 数据；三、漏报跟单信用证业务 EAST 数据；四、漏报其他担保类业务 EAST 数据；五、EAST 系统理财产品底层持仓余额数据存在偏差；六、EAST 系统《关联关系》表漏报；七、面向非机构客户发行的理财产品投资不良资产；八、2018 年行政处罚问题依然存在。综上，中国银行保险监督管理委员会决定对中信银行股份有限公司罚款人民币 290 万元。

报告期内本基金投资的前十名证券中，发行主体中国农业发展银行于 2022 年 3 月 21 日收到中国银行保险监督管理委员会行政处罚决定书（银保监罚决字（2022）10 号），根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条和相关审慎经营规则，经查，中国农业发展银行监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在以下违法违规行为：一、漏报不良贷款余额 EAST 数据；二、逾期 90 天以上贷款余额 EAST 数据存在偏差；三、漏报贷款核销业务 EAST 数据；四、漏报抵押物价值 EAST 数据；五、错报信贷资产转让业务 EAST 数据；六、未报送债券投资业务 EAST 数据；七、未报送权益类投资业务 EAST 数据；八、银行承兑汇票业务 EAST 数据存在偏差；九、漏报跟单信用证业务 EAST 数据；十、未报送贷款承诺业务 EAST 数据；十一、未报送委托贷款业务 EAST 数据；十二、EAST 系统分户账与总账比对不一致；十三、漏报对公活期存款账户明细 EAST 数据；十四、未在开户当月向 EAST 系统报送账户信息；十五、EAST 系统《表外授信业务》表错报；十六、EAST 系统《对公信贷业务借据》表错报；十七、EAST 系统《对公信贷分户账》表漏报。综上，中国银行保险监督管理委员会决定对中国农业发展银行罚款 480 万元。

报告期内本基金投资的前十名证券中，发行主体上海浦东发展银行股份有限公司于 2022 年 3 月 21 日收到中国银行保险监督管理委员会行政处罚决定书（银保监罚决字（2022）25 号），根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条和相关审慎经营规则，经查，浦发银行监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在以下违法违规行为：一、漏报逾期 90 天以上贷款余额 EAST 数据；二、漏报贸易融资业务 EAST 数据；三、漏报信贷资产转让业务 EAST 数据；四、漏报债券投资业务 EAST 数据；五、未报送权益类投资业务 EAST 数据；六、漏报公募基金投资业务 EAST 数据；七、漏报投资资产管理产品业务 EAST 数据；八、错报跟单信用证业务 EAST 数据；九、错报保函业务 EAST 数据；十、错报贷款承诺业务 EAST 数据；十一、EAST 系统理财产品底层持仓余额数据存在偏差；十二、EAST 系统理财产品非标投向行业余额数据存在偏差；十三、漏报对公活期存款账户明细 EAST 数据；十四、EAST 系统《表外授信业务》表错报；十五、EAST 系统《对公信贷业务借据》表错报；十六、EAST 系统《对公信贷分户账》表漏报。综上，中国银行保险监督管理委员会决定对上海浦东发展银行股份有限公司罚款 420 万元。

报告期内本基金投资的前十名证券中, 发行主体中国银行股份有限公司于 2022 年 3 月 21 日收到中国银行保险监督管理委员会行政处罚决定书(银保监罚决字(2022)13 号), 根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条和相关审慎经营规则, 经查, 中国银行监管标准化数据(EAST)系统数据质量及数据报送存在以下违法违规行为: 一、不良贷款余额 EAST 数据存在偏差; 二、逾期 90 天以上贷款余额 EAST 数据存在偏差; 三、漏报贷款核销业务 EAST 数据; 四、漏报抵押物价值 EAST 数据; 五、漏报债券投资业务 EAST 数据; 六、未报送权益类投资业务 EAST 数据; 七、漏报公募基金投资业务 EAST 数据; 八、未报送投资资产管理产品业务 EAST 数据; 九、漏报其他担保类业务 EAST 数据; 十、EAST 系统理财产品底层持仓余额数据存在偏差; 十一、EAST 系统理财产品非标投向行业余额数据存在偏差; 十二、EAST 系统《表外授信业务》表错报; 十三、EAST 系统《个人信贷业务借据》表错报; 十四、EAST 系统《对公信贷业务借据》表错报; 十五、EAST 系统《关联关系》表错报; 十六、EAST 系统《对公信贷分户账》表错报; 十七、理财产品登记不规范; 十八、2018 年行政处罚问题依然存在。综上, 中国银行保险监督管理委员会决定对中国银行罚款 480 万元。

报告期内本基金投资的前十名证券中, 发行主体国家开发银行于 2022 年 3 月 21 日收到中国银行保险监督管理委员会行政处罚决定书(银保监罚决字(2022)8 号), 根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条和相关审慎经营规则, 经查, 国家开发银行监管标准化数据(EAST)系统数据质量及数据报送存在以下违法违规行为: 一、未报送逾期 90 天以上贷款余额 EAST 数据; 二、漏报贸易融资业务 EAST 数据; 三、漏报贷款核销业务 EAST 数据; 四、信贷资产转让业务 EAST 数据存在偏差; 五、未报送债券投资业务 EAST 数据; 六、漏报权益类投资业务 EAST 数据; 七、漏报跟单信用证业务 EAST 数据; 八、漏报保函业务 EAST 数据; 九、EAST 系统理财产品底层持仓余额数据存在偏差; 十、EAST 系统理财产品非标投向行业余额数据存在偏差; 十一、漏报分户账 EAST 数据; 十二、漏报授信信息 EAST 数据; 十三、EAST 系统《表外授信业务》表错报; 十四、EAST 系统《对公信贷业务借据》表错报; 十五、EAST 系统《关联关系》表漏报; 十六、EAST 系统《对公信贷分户账》表漏报; 十七、理财产品登记不规范。综上, 中国银行保险监督管理委员会决定对国家开发银行罚款 440 万元。

报告期内本基金投资的前十名证券中, 发行主体浙商银行股份有限公司于 2022 年 3 月 21 日收到中国银行保险监督管理委员会行政处罚信息公开表(银保监罚决字(2022)27 号), 根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条和相关审慎经营规则, 经查, 浙商银行监管标准化数据(EAST)系统数据质量及数据报送存在以下违法违规行为: 一、漏报逾期 90 天以上贷款余额 EAST 数据; 二、漏报贸易融资业务 EAST 数据; 三、漏报抵押物价值 EAST 数据; 四、

漏报信贷资产转让业务 EAST 数据；五、债券投资业务 EAST 数据存在偏差；六、未报送权益类投资业务 EAST 数据；七、未报送私募基金投资业务 EAST 数据；八、漏报投资资产管理产品业务 EAST 数据；九、漏报贷款承诺业务 EAST 数据；十、EAST 系统理财产品销售端与产品端数据核对不一致；十一、EAST 系统理财产品底层持仓余额数据存在偏差；十二、EAST 系统理财产品非标投向行业余额数据存在偏差；十三、EAST 系统《对公信贷业务借据》表错报；十四、EAST 系统《个人活期存款分户账明细记录》表错报；十五、EAST 系统《表外授信业务》表错报。综上，中国银行保险监督管理委员会决定对浙商银行股份有限公司罚款人民币 380 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。

### 5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	312,464.96
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	-
4	应收申购款	200.00
5	其他应收款	-
6	其他	-
7	合计	312,664.96

### 5.9.4 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。

## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	长信利息收益货币 A	长信利息收益货币 B
报告期期初基金份额总额	35,525,523,845.55	1,956,296,968.99
报告期期间基金总申购份额	100,221,002,784.66	1,371,131,362.46
报告期期间基金总赎回份额	95,955,592,326.32	240,651,694.37
报告期期末基金份额总额	39,790,934,303.89	3,086,776,637.08

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率(%)
1	红利再投	2022-07-01	13,653.26	13,653.26	0.0000
2	红利再投	2022-07-04	41,428.97	41,428.97	0.0000
3	红利再投	2022-07-05	13,589.87	13,589.87	0.0000
4	红利再投	2022-07-06	13,495.21	13,495.21	0.0000
5	红利再投	2022-07-07	13,468.82	13,468.82	0.0000
6	红利再投	2022-07-08	13,286.71	13,286.71	0.0000
7	红利再投	2022-07-11	39,748.13	39,748.13	0.0000
8	红利再投	2022-07-12	13,065.01	13,065.01	0.0000
9	红利再投	2022-07-13	13,188.42	13,188.42	0.0000
10	红利再投	2022-07-14	13,228.97	13,228.97	0.0000
11	红利再投	2022-07-15	13,127.94	13,127.94	0.0000
12	红利再投	2022-07-18	39,005.05	39,005.05	0.0000
13	红利再投	2022-07-19	12,823.93	12,823.93	0.0000
14	红利再投	2022-07-20	12,934.77	12,934.77	0.0000
15	红利再投	2022-07-21	12,882.42	12,882.42	0.0000
16	红利再投	2022-07-22	12,956.42	12,956.42	0.0000
17	红利再投	2022-07-25	38,861.33	38,861.33	0.0000
18	红利再投	2022-07-26	29,108.42	29,108.42	0.0000
19	红利再投	2022-07-27	13,141.45	13,141.45	0.0000
20	红利再投	2022-07-28	13,125.96	13,125.96	0.0000
21	红利再投	2022-07-29	13,036.62	13,036.62	0.0000
22	红利再投	2022-08-01	38,229.96	38,229.96	0.0000
23	红利再投	2022-08-02	18,087.05	18,087.05	0.0000
24	红利再投	2022-08-03	12,804.13	12,804.13	0.0000
25	红利再投	2022-08-04	12,465.93	12,465.93	0.0000
26	红利再投	2022-08-05	12,504.09	12,504.09	0.0000

27	红利再投	2022-08-08	37,449.98	37,449.98	0.0000
28	红利再投	2022-08-09	17,321.41	17,321.41	0.0000
29	红利再投	2022-08-10	19,092.19	19,092.19	0.0000
30	红利再投	2022-08-11	12,171.38	12,171.38	0.0000
31	红利再投	2022-08-12	12,245.79	12,245.79	0.0000
32	红利再投	2022-08-15	43,992.95	43,992.95	0.0000
33	红利再投	2022-08-16	12,137.82	12,137.82	0.0000
34	红利再投	2022-08-17	12,155.76	12,155.76	0.0000
35	红利再投	2022-08-18	11,964.88	11,964.88	0.0000
36	红利再投	2022-08-19	11,868.55	11,868.55	0.0000
37	红利再投	2022-08-22	42,806.66	42,806.66	0.0000
38	红利再投	2022-08-23	11,946.24	11,946.24	0.0000
39	红利再投	2022-08-24	11,933.85	11,933.85	0.0000
40	红利再投	2022-08-25	11,981.12	11,981.12	0.0000
41	红利再投	2022-08-26	11,693.57	11,693.57	0.0000
42	红利再投	2022-08-29	40,240.26	40,240.26	0.0000
43	红利再投	2022-08-30	11,918.89	11,918.89	0.0000
44	红利再投	2022-08-31	12,052.41	12,052.41	0.0000
45	红利再投	2022-09-01	12,093.24	12,093.24	0.0000
46	红利再投	2022-09-02	11,900.66	11,900.66	0.0000
47	红利再投	2022-09-05	40,549.83	40,549.83	0.0000
48	红利再投	2022-09-06	12,112.32	12,112.32	0.0000
49	红利再投	2022-09-07	12,103.95	12,103.95	0.0000
50	红利再投	2022-09-08	12,077.28	12,077.28	0.0000
51	红利再投	2022-09-09	12,054.88	12,054.88	0.0000
52	红利再投	2022-09-13	48,245.12	48,245.12	0.0000
53	红利再投	2022-09-14	12,094.49	12,094.49	0.0000
54	红利再投	2022-09-15	12,074.70	12,074.70	0.0000

55	红利再投	2022-09-16	12,041.25	12,041.25	0.0000
56	红利再投	2022-09-19	35,995.97	35,995.97	0.0000
57	红利再投	2022-09-20	12,506.77	12,506.77	0.0000
58	红利再投	2022-09-21	11,950.51	11,950.51	0.0000
59	红利再投	2022-09-22	12,175.22	12,175.22	0.0000
60	红利再投	2022-09-23	11,915.46	11,915.46	0.0000
61	红利再投	2022-09-26	35,826.44	35,826.44	0.0000
62	红利再投	2022-09-27	13,039.71	13,039.71	0.0000
63	红利再投	2022-09-28	11,951.80	11,951.80	0.0000
64	红利再投	2022-09-29	12,078.32	12,078.32	0.0000
65	红利再投	2022-09-30	12,709.06	12,709.06	0.0000
合计			1,205,719.53	1,205,719.53	

注：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中公布的费率执行。

## § 8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 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。

### 8.2 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。

## § 9 备查文件目录

### 9.1 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招募说明书》；
- 4、《长信利息收益开放式证券投资基金托管协议》；
- 5、报告期内在指定报刊上披露的各种公告的原稿；
- 6、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。

### 9.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

### 9.3 查阅方式

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

长信基金管理有限责任公司

2022 年 10 月 26 日