

# 长信利息收益开放式证券投资基金 2024 年中期报告

2024 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：2024 年 8 月 30 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根据本基金基金合同的规定，于 2024 年 8 月 28 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 2024 年 1 月 1 日起至 2024 年 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	14
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>14</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	14
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>14</b>
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	16
6.3 净资产变动表.....	17
6.4 报表附注.....	19
<b>§7 投资组合报告</b> .....	<b>40</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	40
7.2 债券回购融资情况.....	40
7.3 基金投资组合平均剩余期限.....	40
7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明.....	41
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	41
7.6 期末按实际利率计算账面价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细.....	41

7.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值确定的基金资产净值的偏离 .....	42
7.8 期末按实际利率计算的账面价值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.....	42
7.9 投资组合报告附注.....	42
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>45</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	45
8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况.....	45
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	46
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	46
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>46</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>47</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	47
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.....	47
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	47
10.4 基金投资策略的改变.....	47
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	47
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.....	47
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	47
10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况.....	48
10.9 其他重大事件.....	48
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>50</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 .....	50
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	50
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>50</b>
12.1 备查文件目录.....	50
12.2 存放地点.....	51
12.3 查阅方式.....	51

## § 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	66,434,183,664.19 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	66,136,810,085.98 份	297,373,578.21 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。</p>
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
	联系电话	021-61009999
	电子邮箱	zhouyg@cxfund.com.cn
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 37 层	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、37 楼、38 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	刘元瑞	谷澍

### 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 38 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、37 楼、38 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

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2024 年 1 月 1 日-2024 年 6 月 30 日)	
	长信利息收益货币 A	长信利息收益货币 B
本期已实现收益	537,670,879.46	3,120,751.83
本期利润	537,670,879.46	3,120,751.83
本期净值收益率	0.9066%	1.0269%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)	
期末基金资产净值	66,136,810,085.98	297,373,578.21
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(2024年6月30日)	
累计净值收益率	76.1582%	53.6988%

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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、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。

4、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。

5、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	0.1190%	0.0002%	0.0292%	0.0000%	0.0898%	0.0002%
过去三个月	0.4131%	0.0012%	0.0885%	0.0000%	0.3246%	0.0012%
过去六个月	0.9066%	0.0016%	0.1771%	0.0000%	0.7295%	0.0016%
过去一年	1.7998%	0.0015%	0.3565%	0.0000%	1.4433%	0.0015%
过去三年	5.6222%	0.0011%	1.0712%	0.0000%	4.5510%	0.0011%
自基金合同生效起至今	76.1582%	0.0073%	21.6925%	0.0031%	54.4657%	0.0042%

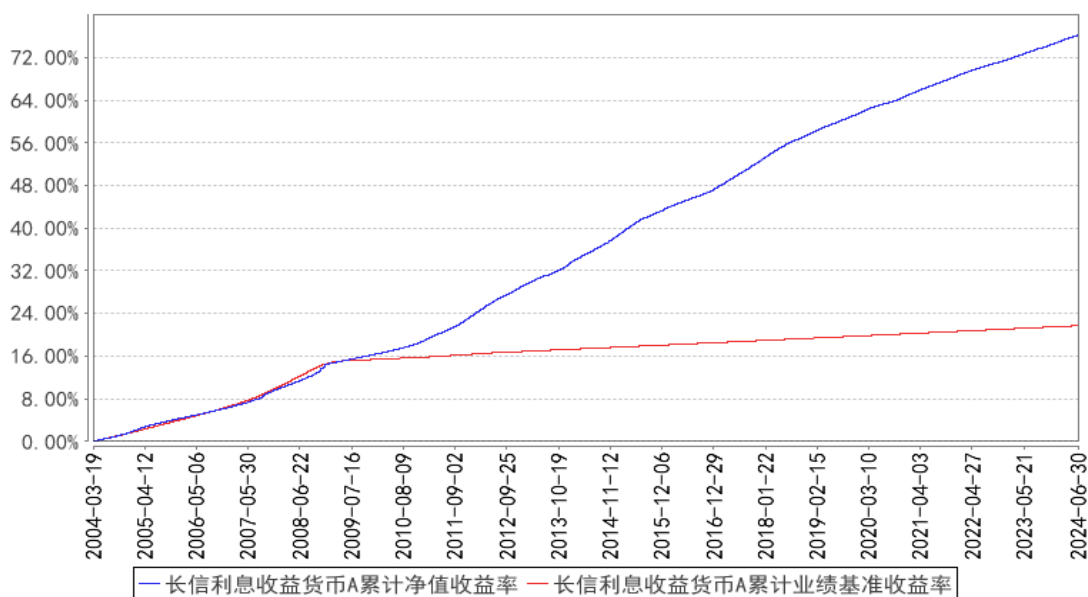
长信利息收益货币 B

阶段	份额净值	份额净值收	业绩比较	业绩比较基	①—③	②—④
----	------	-------	------	-------	-----	-----

	收益率①	益率标准差 ②	基准收益 率③	准收益率标 准差④		
过去一个月	0.1387%	0.0002%	0.0292%	0.0000%	0.1095%	0.0002%
过去三个月	0.4730%	0.0012%	0.0885%	0.0000%	0.3845%	0.0012%
过去六个月	1.0269%	0.0016%	0.1771%	0.0000%	0.8498%	0.0016%
过去一年	2.0446%	0.0015%	0.3565%	0.0000%	1.6881%	0.0015%
过去三年	6.3853%	0.0011%	1.0712%	0.0000%	5.3141%	0.0011%
自份额增加日 起至今	53.6988%	0.0037%	5.1494%	0.0001%	48.5494%	0.0036%

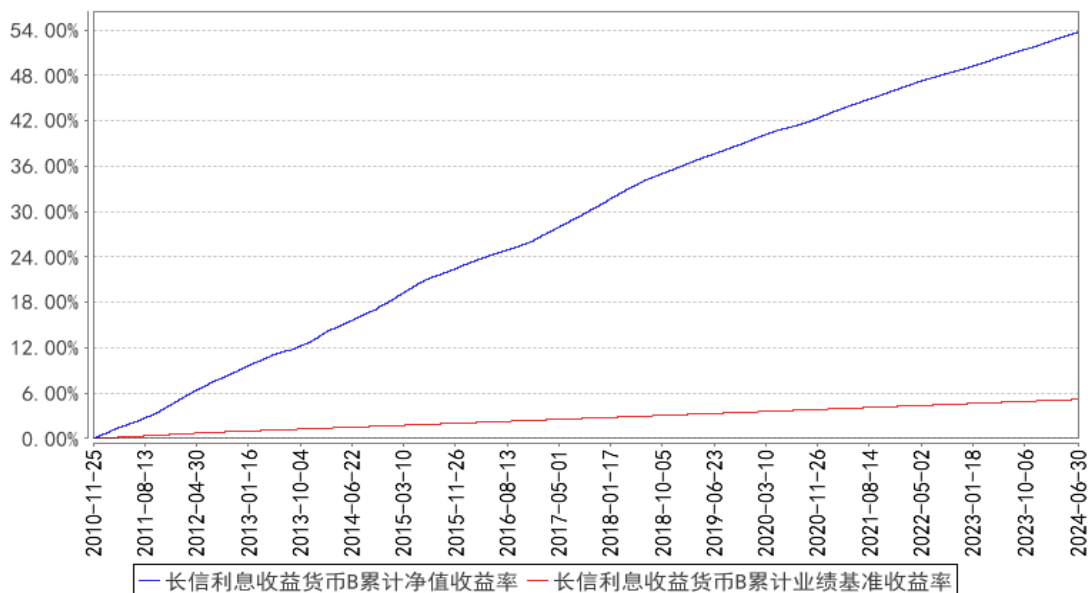
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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 2024 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 2024 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 2024 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 88 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、长信长金货币基金、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、长信先锐混合型证券投资基金、长信稳健精选混合型证券投资基金、长信浦瑞 87 个月定期开放债券型证券投资基金、长信消费升级混合型证券投资基金、长信企业优选一年持有期灵活配置混合型证券投资基金、长信稳健均衡 6 个月持有期混合型证券投资基金、长信优质企业混合型证券投资基金、长信内需均衡混合型证券投资基金、长信 30 天滚动持有短债债券型证券投资基金、长信稳惠债券型证券投资基金、长信稳丰债券型证券投资基金、长信先进装备三个月持有期混合型证券投资基金、长信颐和平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）、长信颐年平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）、长信稳健增长一年持有期混合型证券投资基金、长信稳健成长混合型证券投资基金、长信企业成长三年持有期混合型证券投资基金、长信稳兴三个月定期开放债券型证券投资基金、长信稳航 30 天持有期中短债债券型证券投资基金、长信稳恒债券型证券投资基金、长信中证科创创业 50 指数增强型证券投资基金、长信均衡策略一年持有期混合型证券投资基金、长信中证 1000 指数增强型证券投资基金、长信均衡优选混合型证券投资基金、长信 90 天滚动持有债券型证券投

资基金、长信稳固 60 天滚动持有债券型证券投资基金、长信汇智量化选股混合型证券投资基金、长信 120 天滚动持有债券型证券投资基金、长信中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、长信优势行业混合型证券投资基金、长信 180 天持有期债券型证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
俞玮晨	长信长金货币市场基金、长信利息收益开放式证券投资基金的基金经理	2024 年 6 月 21 日	-	9 年	法国雷恩商学院国际金融研究生毕业，具有基金从业资格，中国国籍。曾任浦银安盛基金管理有限公司债券交易员、债券基金经理助理，2023 年 12 月加入长信基金管理有限责任公司，现任长信长金货币市场基金和长信利息收益开放式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、长信稳惠债券型证券投资基金和长信中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金的基金经理、现金理财部副总监	2016 年 12 月 30 日	-	14 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、现金理财部总监、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。现任现金理财部副总监、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、长信稳惠债券型证券投资基金和长信中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期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合规守信情况的说明

本基金管理人在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同的规定，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

本基金将继续以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，在规范基金运作和严格控制投资风险的前提下，努力为基金份额持有人谋求最大利益。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾 2024 年上半年，债券市场整体走势较强，债券收益率呈下行趋势，国债期货屡创新高。年初以来各期限债券收益率均有明显下行，调整主要出现在 3 月中旬和 4 月下旬，调整幅度分别为 10bp 和 15bp 左右，调整之后债券收益率继续下行，各品种债券收益率较年初下行 30-80bp 不等，期限利差和信用利差均有收窄，其中一年期 AAA 存单收益率下行 50bp 左右，半年末处于年内低点和历史较低水平。一季度央行降准 0.5% 并定向降息，商业银行陆续调降存款利率，5 年期 LPR 超预期下调 25BP，政策利好债券市场。3 月公布的出口数据和 CPI 数据回暖，市场风险偏好提升，债市止盈情绪较强，季末资金、汇率波动及房地产政策调整等信息也对债市造成扰动。4 月央行表态“长期国债收益率将运行在与长期经济增长预期相匹配的合理区间内”，债市又出现一波明显调整，但央行公开市场操作对资金面较为呵护，同时经济数据出炉使得市场风险偏好回落，债券配置需求仍强，而政府债券供给减少且发行进度偏慢，调整之后债券收益率重新走低。在组合操作方面，本产品在上半年维持中性偏高久期，保持较高杠杆水平，提升组合静态收益，积极配置

同业存款、同业存单和信用债等资产。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2024 年 6 月 30 日，本报告期内长信利息收益货币 A 净值收益率为 0.9066%，长信利息收益货币 B 净值收益率为 1.0269%，同期业绩比较基准收益率为 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

展望下半年，三中全会强调“坚定不移实现全年经济社会发展目标”，下半年稳增长政策有望加码，财政政策或保持稳健，政府债供给将提速。7 月央行已下调公开市场操作利率 10bp，1 年期和 5 年期 LPR 随之下调 10bp，未来配合政府债券发行不排除会有降准可能，整体资金面预计维持宽松，但同时央行通过临时正逆回购利率构建一个 70bp 范围内的利率走廊，短端利率的波动幅度可能变小。长期逻辑来看利率仍处于下行通道，在当前通胀水平和信贷提质增效背景下，债券供给带来的债市调整或有一定投资机会。未来我们将在保证货币基金安全性、流动性充足的基础上，通过把握阶段性资金面变化带来的投资机会，合理配置各类资产，匹配组合久期，努力提升组合收益。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人严格按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金持有的投资品种进行估值。基金托管人根据法律法规要求对基金管理公司采用的估值政策和程序进行核查，并对估值结果及净值计算进行复核。

根据相关法律法规，本基金管理人制订了健全、有效的估值政策和估值程序，设立了估值委员会，估值委员会是公司基金估值的主要决策机构，其主要职责是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，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及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。对于基金的估值政策和估值原则，公司已与基金托管人充分沟通，并达成一致意见。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 540,791,631.29 元，已分配利润 540,791,631.29 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《中华人民共和国证券投资基金法》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 2024 年 1 月 1 日至 2024 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《中华人民共和国证券投资基金法》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：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
----	-----	------------------------	--------------------------

<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	49,973,593,155.89	34,214,954,624.06
结算备付金		4,143,933.31	2,476,942.26
存出保证金		551,688.08	439,388.58
交易性金融资产	6.4.7.2	22,927,529,581.26	20,815,192,138.16
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		22,927,529,581.26	20,815,192,138.16
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	188,063,210.75	2,423,170,755.06
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		291,400.00	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		73,094,172,969.29	57,456,233,848.12
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024年6月30日</b>	<b>上年度末 2023年12月31日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		6,611,855,588.83	1,223,206,178.89
应付清算款		-	1,647,319,037.16
应付赎回款		3,067,338.21	8,349.08
应付管理人报酬		18,657,614.82	15,348,228.84
应付托管费		4,523,058.14	3,720,782.72
应付销售服务费		14,076,255.10	11,555,730.63
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	18,123.91
应付利润		7,211,074.43	9,350,328.29
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	598,375.57	780,395.44
负债合计		6,659,989,305.10	2,911,307,154.96

<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	66,434,183,664.19	54,544,926,693.16
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-	-
净资产合计		66,434,183,664.19	54,544,926,693.16
负债和净资产总计		73,094,172,969.29	57,456,233,848.12

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，长信利息收益货币 A 份额净值 1.0000 元，长信利息收益货币 B 份额净值 1.0000 元，基金份额总额为 66,434,183,664.19 份，其中长信利息收益货币 A 份额 66,136,810,085.98 份。长信利息收益货币 B 份额 297,373,578.21 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：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		778,352,040.94	645,068,400.82
1. 利息收入		483,838,446.69	438,855,013.89
其中：存款利息收入	6.4.7.13	475,029,527.74	396,697,302.67
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		8,808,918.95	42,157,711.22
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		294,513,594.25	206,213,386.93
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	294,513,594.25	206,213,386.93
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	-	-
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	-	-



4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6. 4. 7. 21	-	-
<b>减：二、营业总支出</b>		237,560,409.65	191,361,768.22
1. 管理人报酬	6. 4. 10. 2. 1	99,213,216.94	81,194,944.97
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	24,051,688.82	19,683,622.95
3. 销售服务费	6. 4. 10. 2. 3	74,797,162.77	60,890,464.88
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		39,299,427.79	29,370,769.07
其中：卖出回购金融资产支出		39,299,427.79	29,370,769.07
6. 信用减值损失	6. 4. 7. 22	-	-
7. 税金及附加		12,743.10	36,679.82
8. 其他费用	6. 4. 7. 23	186,170.23	185,286.53
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		540,791,631.29	453,706,632.60
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		540,791,631.29	453,706,632.60
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		540,791,631.29	453,706,632.60

### 6.3 净资产变动表

会计主体：长信利息收益开放式证券投资基金

本报告期：2024年1月1日至2024年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	54,544,926,693.16	-	-	54,544,926,693.16
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	54,544,926,693.16	-	-	54,544,926,693.16
三、本期增减变	11,889,256,971.03	-	-	11,889,256,971.03

动额(减少以“-”号填列)				
(一)、综合收益总额	-	-	540,791,631.29	540,791,631.29
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	11,889,256,971.03	-	-	11,889,256,971.03
其中:1.基金申购款	275,854,327,517.92	-	-	275,854,327,517.92
2.基金赎回款	-263,965,070,546.89	-	-	-263,965,070,546.89
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-540,791,631.29	-540,791,631.29
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	66,434,183,664.19	-	-	66,434,183,664.19
项目	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	42,096,427,528.80	-	-	42,096,427,528.80
加:会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	42,096,427,528.80	-	-	42,096,427,528.80
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	8,097,777,274.06	-	-	8,097,777,274.06
(一)、综合收益总额	-	-	453,706,632.60	453,706,632.60

(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数 (净资产减少以“-”号填列)	8,097,777,274.06	-	-	8,097,777,274.06
其中：1. 基金申购款	245,920,536,247.69	-	-	245,920,536,247.69
2. 基金赎回款	-237,822,758,973.63	-	-	-237,822,758,973.63
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-453,706,632.60	-453,706,632.60
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	50,194,204,802.86	-	-	50,194,204,802.86

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：

刘元瑞

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《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《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 3 号《半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〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

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 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本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。

#### 6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

## 6.4.6 税项

### 6.4.6.1 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，证券投资基金的基金管理人运营证券投资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。对证券投资基金在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，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。增值税应税行为的销售额根据财政部、国家税务总局财税[2017]90号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定确定。

### 6.4.6.2 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法》、《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。

### 6.4.6.3 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。

#### 6.4.6.4 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。

### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	18,330,418,987.20
等于：本金	18,321,398,483.95
加：应计利息	9,020,503.25
减：坏账准备	-
定期存款	31,643,174,168.69
等于：本金	31,500,000,000.00
加：应计利息	143,174,168.69
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	31,643,174,168.69
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	49,973,593,155.89

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2024 年 6 月 30 日			
		按实际利率计算的账面价值	影子定价	偏离金额	偏离度 (%)
债券	交易所市场	1,695,763,197.97	1,693,439,302.49	-2,323,895.48	-0.0035
	银行间市场	21,231,766,383.29	21,252,886,872.06	21,120,488.77	0.0318
	合计	22,927,529,581.26	22,946,326,174.55	18,796,593.29	0.0283

资产支持证券	-	-	-	-
合计	22,927,529,581.26	22,946,326,174.55	18,796,593.29	0.0283

注：1. 偏离金额=影子定价-摊余成本；

2. 偏离度=偏离金额/摊余成本法确定的基金资产净值。

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2024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	188,063,210.75	-
合计	188,063,210.75	-

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 债权投资

##### 6.4.7.5.1 债权投资情况

本基金本报告期末无债权投资。

#### 6.4.7.6 其他债权投资

##### 6.4.7.6.1 其他债权投资情况

本基金本报告期末无其他债权投资。

#### 6.4.7.7 其他权益工具投资

##### 6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

本基金本报告期末无其他权益投资工具。

#### 6.4.7.8 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
应付券商交易单元保证金	-

应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	254,593.91
其中：交易所市场	-
银行间市场	254,593.91
应付利息	-
预提账户维护费	9,300.00
预提审计费	34,809.32
预提信息披露费	299,672.34
合计	598,375.57

#### 6.4.7.10 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 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	54,229,437,736.35	54,229,437,736.35
本期申购	275,816,187,532.38	275,816,187,532.38
本期赎回（以“-”号填列）	-263,908,815,182.75	-263,908,815,182.75
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	66,136,810,085.98	66,136,810,085.98

##### 长信利息收益货币 B

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	315,488,956.81	315,488,956.81
本期申购	38,139,985.54	38,139,985.54
本期赎回（以“-”号填列）	-56,255,364.14	-56,255,364.14
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	297,373,578.21	297,373,578.21

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.11 其他综合收益

本基金本报告期无其他综合收益。

#### 6.4.7.12 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	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	537,670,879.46	-	537,670,879.46
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	-537,670,879.46	-	-537,670,879.46
本期末	-	-	-

## 长信利息收益货币 B

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	3,120,751.83	-	3,120,751.83
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	-3,120,751.83	-	-3,120,751.83
本期末	-	-	-

## 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
活期存款利息收入	125,308,022.49
定期存款利息收入	349,606,449.45
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	111,251.39
其他	3,804.41
合计	475,029,527.74

注：其他为保证金利息收入。

## 6.4.7.14 股票投资收益

本基金本报告期无股票投资收益。

## 6.4.7.15 债券投资收益

## 6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月 30日
债券投资收益——利息收入	253,931,349.84
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	40,582,244.41
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	294,513,594.25

## 6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	34,755,285,508.97
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	34,462,091,945.79
减：应计利息总额	252,611,318.77
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	40,582,244.41

## 6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无债券投资赎回差价收入。

## 6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无债券投资申购差价收入。

## 6.4.7.16 资产支持证券投资收益

## 6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

## 6.4.7.17 贵金属投资收益

## 6.4.7.17.1 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。

## 6.4.7.18 衍生工具收益

## 6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期无衍生工具收益。

## 6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

**6.4.7.19 股利收益**

本基金本报告期无股利收益。

**6.4.7.20 公允价值变动收益**

本基金本报告期无公允价值变动收益。

**6.4.7.21 其他收入**

本基金本报告期无其他收入。

**6.4.7.22 信用减值损失**

本基金本报告期无信用减值损失。

**6.4.7.23 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024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	-
账户维护费	18,600.00
其他费用	73,088.57
合计	186,170.23

注：其他费用为银行汇划手续费等其他费用。

**6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明****6.4.8.1 或有事项**

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

**6.4.8.2 资产负债表日后事项**

截至本财务报告批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

**6.4.9 关联方关系****6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况**

本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。

**6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方**

关联方名称	与本基金的关系
长信基金管理有限责任公司（“长信基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
长江证券股份有限公司（“长江证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司（“农业银行”）	基金托管人、基金销售机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间均没有通过关联方交易单元进行的股票交易。

#### 6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023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	2,463,154,620.00	60.58	2,294,117,600.00	75.66

#### 6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)
长江证券	2,975,689,000.00	55.63	33,349,523,000.00	98.11

#### 6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

### 6.4.10.2 关联方报酬

#### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	99,213,216.94	81,194,944.97
其中：应支付销售机构的客户维护费	49,391,840.26	40,198,716.30
应支付基金管理人的净管理费	49,821,376.68	40,996,228.67

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

## 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	24,051,688.82	19,683,622.95

注：支付基金托管人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。

计算方法如下：

$$H = E \times \text{基金托管费年费率} / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

## 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2024 年 1 月 1 日至 2024 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	30,004.28	2,445.47	32,449.75
农业银行	80,032.29	517.77	80,550.06
长江证券	2,262.85	12,174.92	14,437.77
合计	112,299.42	15,138.16	127,437.58
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2023 年 1 月 1 日至 2023 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	41,173.96	13,431.12	54,605.08
农业银行	83,588.33	505.81	84,094.14
长江证券	629.63	11,895.07	12,524.70
合计	125,391.92	25,832.00	151,223.92

注：本基金 A 级的基金销售服务费按前一日 A 级基金资产净值的 0.25% 的年费率计提，本基金 B 级的基金销售服务费按前一日 B 级基金资产净值的 0.01% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{该级基金份额的销售服务费年费率} / \text{当年天数}$$

H 为该级基金份额每日应计提的销售服务费；

E 为该级基金份额前一日的基金资产净值。

基金销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	-	-	-	-	12,306,495,000.00	930,822.85
上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 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	204,028,186.30	-	-	-	23,426,163,000.00	1,494,129.43

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

##### 6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间无与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况。

##### 6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间无与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	-	263,908,825.65
报告期间申购/买入总份额	-	2,727,101.55
报告期间因拆分变动份额	-	0.00

减：报告期间赎回/卖出总份额	-	0.00
报告期末持有的基金份额	-	266,635,927.20
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	0.40%
项目	上年度可比期间 2023年1月1日至2023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	-	258,617,606.13
报告期间申购/买入总份额	-	2,696,190.32
报告期间因拆分变动份额	-	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	0.00
报告期末持有的基金份额	-	261,313,796.45
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	0.52%

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 204,686,597.87 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。

#### 6.4.10.5.2 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

除基金管理人之外的其他关联方在本报告期末及上年度末均未投资本基金。

#### 6.4.10.6 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 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023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
农业银行	18,330,418,987.20	125,308,022.49	9,722,707,400.35	51,129,683.75

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2024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（2023年6月30日：同）。

#### 6.4.10.7 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过由关联方承销的证券。

#### 6.4.10.8 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。

#### 6.4.11 利润分配情况

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
539,781,875.71	6,093.57	-2,117,089.82	537,670,879.46	-
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
3,139,985.54	2,930.33	-22,164.04	3,120,751.83	-

#### 6.4.12 期末（2024 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

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。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2024 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 6,611,855,588.83 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
112315345	23 民生银行 CD345	2024 年 7 月 1 日	99.70	4,022,000	400,978,467.39
112318227	23 华夏银行 CD227	2024 年 7 月 1 日	99.52	1,139,000	113,358,707.31
112372806	23 长沙银行 CD232	2024 年 7 月 1 日	98.92	2,059,000	203,674,212.25
112385142	23 西安银行 CD052	2024 年 7 月 1 日	99.69	2,044,000	203,760,723.42
112402055	24 工商银行 CD055	2024 年 7 月 1 日	98.66	2,106,000	207,772,348.02
112406208	24 交通银行 CD208	2024 年 7 月 1 日	98.07	2,484,000	243,595,664.03
112408070	24 中信银行 CD070	2024 年 7 月 1 日	99.13	1,000,000	99,129,690.56
112411020	24 平安银行 CD020	2024 年 7 月 1 日	99.27	160,000	15,883,780.75
112413079	24 浙商银行 CD079	2024 年 7 月 1 日	99.19	3,245,000	321,887,649.00
112415230	24 民生银行 CD230	2024 年 7 月 1 日	98.08	2,151,000	210,976,645.30
112417093	24 光大银行 CD093	2024 年 7 月 1 日	98.67	3,000,000	296,015,034.45
112495060	24 徽商银行 CD035	2024 年 7 月 1 日	99.50	1,323,000	131,644,767.55
112495439	24 广州银行 CD011	2024 年 7 月 1 日	98.35	1,783,000	175,359,046.25
2120116	21 南京银行 01	2024 年 7 月 1 日	101.90	2,106,000	214,600,407.99



2128024	21 中国银行 02	2024 年 7 月 1 日	102.39	5,300,000	542,659,891.42
2128035	21 华夏银行 02	2024 年 7 月 1 日	102.18	6,175,000	630,932,858.55
2128046	21 浦发银行 02	2024 年 7 月 1 日	101.95	5,200,000	530,137,318.18
112304045	23 中国银行 CD045	2024 年 7 月 2 日	99.47	3,000,000	298,405,453.20
112310240	23 兴业银行 CD240	2024 年 7 月 2 日	99.73	1,000,000	99,729,262.09
112317207	23 光大银行 CD207	2024 年 7 月 2 日	99.43	1,000,000	99,425,827.70
112318227	23 华夏银行 CD227	2024 年 7 月 2 日	99.52	761,000	75,738,346.14
112402019	24 工商银行 CD019	2024 年 7 月 2 日	98.66	718,000	70,836,277.11
112408122	24 中信银行 CD122	2024 年 7 月 2 日	98.36	2,000,000	196,720,770.34
112408187	24 中信银行 CD187	2024 年 7 月 2 日	98.06	3,000,000	294,186,145.28
112409066	24 浦发银行 CD066	2024 年 7 月 2 日	99.13	2,000,000	198,258,444.49
112417113	24 光大银行 CD113	2024 年 7 月 2 日	98.60	3,000,000	295,786,893.32
112420040	24 广发银行 CD040	2024 年 7 月 2 日	99.33	807,000	80,159,769.39
112420049	24 广发银行 CD049	2024 年 7 月 2 日	99.75	5,000,000	498,767,879.57
112420057	24 广发银行 CD057	2024 年 7 月 2 日	99.13	2,000,000	198,259,089.41
112415125	24 民生银行 CD125	2024 年 7 月 5 日	98.36	1,725,000	169,679,616.92
合计				71,308,000	7,118,320,987.38

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无因交易所市场债券正回购交易而抵押的债券。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的融出证券。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金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。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合同责任，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。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
A-1	203,093,995.20	40,882,861.83
A-1 以下	50,967,663.92	-
未评级	60,578,165.80	1,302,908,028.35
合计	314,639,824.92	1,343,790,890.18

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。

##### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

##### 6.4.13.2.3 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 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	18,406,905,615.92	15,392,732,457.33
合计	18,406,905,615.92	15,392,732,457.33

注：本基金持有同业存单的主体评级均为 AA+ 及以上评级。

#### 6.4.13.2.4 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 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
AAA	4,205,984,140.42	3,822,184,595.95
AAA 以下	-	-
未评级	-	256,484,194.70
合计	4,205,984,140.42	4,078,668,790.65

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。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 6.4.13.2.6 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。

#### 6.4.13.3 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。

##### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》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，并严格遵守基金管理人流动性相关交易限制。

本基金主要投资于基金合同约定的具有良好流动性的金融工具，基金管理人流动性指标进行持续的监测和分析，定期开展压力测试，评估在不同的压力情境下资产变现情况的变化。

基金管理人持续监测本基金开放期内的赎回情况，当市场环境或投资者结构发生变化时，及时调整投资组合资产结构及比例，保持基金资产可变现规模和期限与负债赎回规模和期限的匹配。

同时，针对兑付赎回资金的流动性风险，基金管理人在基金合同中约定了巨额赎回条款，制定了发生巨额赎回时资金的处理模式，控制因开放模式而产生的流动性风险。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动

而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

#### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量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。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024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						
货币资金	45,763,458,239.92	4,210,134,915.97	-	-	-	49,973,593,155.89
结算备付金	4,143,933.31	-	-	-	-	4,143,933.31
存出保证金	551,688.08	-	-	-	-	551,688.08
交易性金融资产	16,694,303,998.94	6,233,225,582.32	-	-	-	22,927,529,581.26
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	188,063,210.75	-	-	-	-	188,063,210.75
债权投资	-	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	291,400.00	291,400.00
应收清算款	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-
资产总计	62,650,521,071.00	10,443,360,498.29	-	-	291,400.00	73,094,172,969.29
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	3,067,338.21	3,067,338.21
应付管理人报酬	-	-	-	-	18,657,614.82	18,657,614.82
应付托管费	-	-	-	-	4,523,058.14	4,523,058.14
应付清算款	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	6,611,855,588.83	-	-	-	-	6,611,855,588.83
应付销售	-	-	-	-	14,076,255.10	14,076,255.10

服务费						
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	7,211,074.43	7,211,074.43
应交税费	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	598,375.57	598,375.57
负债总计	6,611,855,588.83	-	-	-	48,133,716.27	6,659,989,305.10
利率敏感度缺口	56,038,665,482.17	10,443,360,498.29	-	-	-47,842,316.27	66,434,183,664.19
上年度末 2023 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						
货币资金	30,209,551,846.16	4,005,402,777.90	-	-	-	34,214,954,624.06
结算备付金	2,476,942.26	-	-	-	-	2,476,942.26
存出保证金	439,388.58	-	-	-	-	439,388.58
交易性金融资产	17,965,312,453.58	2,849,879,684.58	-	-	-	20,815,192,138.16
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	2,423,170,755.06	-	-	-	-	2,423,170,755.06
债权投资	-	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-
资产总计	50,600,951,385.64	6,855,282,462.48	-	-	-	57,456,233,848.12
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	8,349.08	8,349.08
应付管理人报酬	-	-	-	-	15,348,228.84	15,348,228.84
应付托管费	-	-	-	-	3,720,782.72	3,720,782.72
应付清算款	-	-	-	-	1,647,319,037.16	1,647,319,037.16
卖出回购金融资产	1,223,206,178.89	-	-	-	-	1,223,206,178.89

款						
应付销售服务费	-	-	-	-	11,555,730.63	11,555,730.63
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	9,350,328.29	9,350,328.29
应交税费	-	-	-	-	18,123.91	18,123.91
其他负债	-	-	-	-	780,395.44	780,395.44
负债总计	1,223,206,178.89	-	-	-	1,688,100,976.07	2,911,307,154.96
利率敏感度缺口	49,377,745,206.75	6,855,282,462.48	-	-	-1,688,100,976.07	54,544,926,693.16

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，按合约规定的重新定价日及剩余到期日中的孰早者进行分类。

#### 6.4.13.4.1.2 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（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月31日）
	市场利率上升27个基点	-25,310,759.52	-19,229,522.06
	市场利率下降27个基点	25,310,759.52	19,229,522.06

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于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。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险的敏感性分析

本基金主要投资债券等固定收益品种，无重大其他价格风险，因此未进行其他价格风险的敏感性分析。

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的

最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

#### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

##### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
第一层次	-	-
第二层次	22,927,529,581.26	20,815,192,138.16
第三层次	-	-
合计	22,927,529,581.26	20,815,192,138.16

##### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。本基金本报告期及上年度可比期间持有的持续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。

##### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

##### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 6.4.15.1 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。

##### 6.4.15.2 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	22,927,529,581.26	31.37
	其中：债券	22,927,529,581.26	31.37
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	188,063,210.75	0.26
	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	49,977,737,089.20	68.37
4	其他各项资产	843,088.08	0.00
5	合计	73,094,172,969.29	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	6.38	
	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	6,611,855,588.83	9.95
	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

本报告期内本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	104
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	106
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	80

#### 报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

本报告期内本基金投资组合平均剩余期限不存在超过 120 天的情况。

#### 7.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例 (%)	各期限负债占基金资产净值的比例 (%)
1	30 天以内	29.16	9.95



	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	10.02	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	8.58	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	10.11	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	51.81	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
	合计	109.68	9.95

#### 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

本报告期内本基金投资组合平均剩余存续期不存在超过 240 天的情况。

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	按实际利率计算的账面价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	2,794,712,795.86	4.21
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	1,695,763,197.97	2.55
5	企业短期融资券	30,147,971.51	0.05
6	中期票据	-	-
7	同业存单	18,406,905,615.92	27.71
8	其他	-	-
9	合计	22,927,529,581.26	34.51
10	剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债券	-	-

#### 7.6 期末按实际利率计算账面价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资 明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量（张）	按实际利率计算的 账面价值（元）	占基金资产净值 比例（%）
1	2128035	21 华夏银行 02	6,200,000	633,487,242.59	0.95
2	2128024	21 中国银行 02	5,300,000	542,659,891.42	0.82
3	2128046	21 浦发银行 02	5,200,000	530,137,318.18	0.80
4	112420049	24 广发银行 CD049	5,000,000	498,767,879.57	0.75

5	112421151	24 渤海银行 CD151	5,000,000	496,205,587.75	0.75
6	112413021	24 浙商银行 CD021	5,000,000	495,975,042.27	0.75
7	112413079	24 浙商银行 CD079	5,000,000	495,974,805.86	0.75
8	112315345	23 民生银行 CD345	4,100,000	408,754,777.80	0.62
9	112499313	24 广州银行 CD040	4,000,000	396,763,618.18	0.60
10	112490931	24 青岛银行 CD005	3,500,000	347,631,415.81	0.52

### 7.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值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	0.0576%
报告期内偏离度的最低值	0.0146%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0321%

#### 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 期末按实际利率计算的账面价值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。

### 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 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，发行主体中国银行股份有限公司于 2023 年 12 月 28 日收到国家金融监督管理总局行政处罚信息公开表（金罚决字（2023）68 号），经查，中国银行股份有限公司存在以下情况：一、部分重要信息系统识别不全面，灾备建设和灾难恢复能力不符合监管要求；二、重要信息系统投产及变更未向监管部门报告，且投产及变更长期不规范引发重要信息系统较大及以上突发事件；三、信息系统运行风险识别不到位、处置不及时，引发重要信息系统重大突发事件；四、监管意见整改落实不到位，引发重要信息系统重大突发事件；五、信息科技外包管理不审慎；六、网络安全域未开展安全评估，网络架构重大变更未开展风险评估且未向监管部门报告；七、信息系统突发事件定级不准确，导致未按监管要求上报；八、迟报重要信息系统重大突发事件；九、错报漏报监管标准化（EAST）数据。综上，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，国家金融监督管理总局决定

对中国银行处以罚款 430 万元。

报告期内本基金投资的前十名证券中，发行主体广发银行股份有限公司于 2023 年 8 月 3 日收到国家金融监督管理总局行政处罚信息公开表（金罚决字〔2023〕5 号），经查，广发银行股份有限公司存在以下问题：一、小微企业划型不准确；二、违规发放房地产贷款；三、违规发放流动资金贷款；四、违规发放土地储备贷款；五、违规向企业发放贷款用于土地储备项目；六、未经任职资格核准履行高级管理人员职责；七、未对集团客户统一授信；八、信贷资产质量反映不真实；九、信贷资金违规流入证券账户；十、贷款资金违规回流借款人；十一、未严格落实受托支付；十二、虚增存贷款规模；十三、信用卡透支资金流入房地产开发企业；十四、并购贷款管理不规范。综上，根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十条、第二十一条、第四十六条和相关审慎经营规则，国家金融监督管理总局决定对广发银行罚款合计 2340 万元。其中，总行 550 万元，分支机构 1790 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 2024 年 2 月 2 日收到国家金融监督管理总局浙江监管局行政处罚信息公开表（浙金罚决字〔2024〕4 号），经查，浙商银行股份有限公司存在以下情况：向小微企业客户转嫁成本，违规要求客户承担抵押评估费；向小微企业客户转嫁成本，违规要求客户承担抵押登记费。综上，根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条及相关审慎经营规则，国家金融监督管理总局浙江监管局决定对浙商银行处以罚款 55 万元。

报告期内本基金投资的前十名证券中，发行主体中国民生银行股份有限公司于 2023 年 8 月 2 日收到国家金融监督管理总局行政处罚信息公开表（金罚决字〔2023〕7 号），经查，中国民生银行股份有限公司存在以下行为：一、规避委托贷款监管，违规利用委托债权投资业务向企业融资；二、违规贷款未整改收回情况下继续违规发放贷款；三、对政府平台公司融资行为监控不力，导致政府债务增加；四、股权质押管理问题未整改五、审计人员配备不足问题未整改；六、对相关案件未按照有关规定处置；七、未按监管要求将福费廷业务纳入表内核算；八、代销池业务模式整改不到位；九、违规开展综合财富管理代销业务整改不到位；十、个别贷款风险分类结果仍存在偏离，整改不到位；十一、发放违反国家宏观调控政策贷款仍未整改收回；十二、部分正常资产转让问题整改不到位；十三、部分不良资产转让问题整改不到位或未整改；十四、对部分违规问题未进行责任追究或追究不到位。综上，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，国家金融监督管理总局决定对民生银行处以罚款合计 4780 万元。其中，总行 4430 万元，分支机构 350 万元。

报告期内本基金投资的前十名证券中，发行主体广州银行股份有限公司于 2023 年 11 月 17

日收到国家金融监督管理总局广东监管局行政处罚信息公开表（2023 年 26 号），经查，广州银行股份有限公司存在以下情况：未全面认定关联自然人；未全面认定关联非自然人；关联交易未按规定备案；未按规定向监管部门报送关联交易情况；未经任职资格许可实际履行高管职责；违规出具询证函回函；询证函业务管理不到位；未向监管部门真实反映房地产贷款报表数据；未按规定进行资产风险分类；贷款风险分类工作管理不到位；向不符合规定的政府购买服务项目提供融资；违规向棚户区改造项目提供融资；向固定资产项目违规发放贷款；制度违反监管规定；贴现资金被用于定期存单质押担保开立银承；投资业务严重违反审慎经营规则。综上，根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十条，第二十一条第三款，第四十六条第一项、第三项、第五项，第四十八条第二项；《中华人民共和国商业银行法》第四十七条、第七十四条第三项、第八十九条第二款及相关审慎经营规则，国家金融监督管理总局广东监管局决定对广州银行没收违法所得并处罚款合计 1168.4 万元。

报告期内本基金投资的前十名证券中，发行主体青岛银行股份有限公司于 2023 年 7 月 4 日收到青岛银保监局行政处罚信息公开表（青银保监罚决字（2023）54 号），经查，青岛银行股份有限公司存在向小微企业收取银行承兑汇票敞口承诺费、互联网贷款信息披露不规范、夸大营销的情况，根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条规定，中国银行保险监督管理委员会青岛监管局决定对青岛银行股份有限公司处以罚款人民币 52 万元。

报告期内本基金投资的前十名证券中，发行主体青岛银行股份有限公司于 2023 年 12 月 28 日收到国家金融监督管理总局青岛监管局行政处罚信息公开表（青国金罚决字（2023）35 号），经查，青岛银行股份有限公司存在个人经营性贷款“三查”不严导致贷款资金被挪用、信用卡中心违规经营的情况，根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条规定，国家金融监督管理总局青岛监管局决定对青岛银行股份有限公司处以罚款人民币 30 万元。

报告期内本基金投资的前十名证券中，发行主体青岛银行股份有限公司于 2024 年 1 月 2 日收到国家金融监督管理总局青岛监管局行政处罚信息公开表（青国金罚决字（2024）3 号），经查，青岛银行股份有限公司存在监管标准化（EAST）数据错报漏报的情况，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，国家金融监督管理总局青岛监管局决定对青岛银行股份有限公司处以罚款人民币 30 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。

### 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	551,688.08
2	应收清算款	-
3	应收利息	-
4	应收申购款	291,400.00
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	843,088.08

### 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	6,843,037	9,664.83	18,182,789.56	0.03	66,118,627,296.42	99.97
长信利息收益货币 B	8	37,171,697.28	281,909,404.34	94.80	15,464,173.87	5.20
合计	6,843,045	9,708.28	300,092,193.90	0.45	66,134,091,470.29	99.55

注：对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 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	个人	58,280,117.77	0.09

2	个人	37,131,559.17	0.06
3	个人	25,373,598.38	0.04
4	个人	22,248,420.57	0.03
5	个人	21,784,852.03	0.03
6	个人	21,516,261.97	0.03
7	个人	20,739,468.62	0.03
8	个人	19,688,112.95	0.03
9	个人	17,188,649.51	0.03
10	个人	17,178,378.97	0.03

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持有本基金	长信利息收益货币 A	5,444,751.29	0.01
	长信利息收益货币 B	0.00	0.00
	合计	5,444,751.29	0.01

注：对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	长信利息收益货币 A	>100
	长信利息收益货币 B	0
	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

项目	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	54,229,437,736.35	315,488,956.81
本报告期基金总申购份额	275,816,187,532.38	38,139,985.54
减：本报告期基金总赎回份额	263,908,815,182.75	56,255,364.14
本报告期基金拆分变动份额	-	-

本报告期末基金份额总额	66,136,810,085.98	297,373,578.21
-------------	-------------------	----------------

## § 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

本报告期内，本基金管理人无重大人事变动。

#### 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

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内未发生基金管理人及高级管理人员受稽查或处罚等情形。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期本基金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 (%)	
长江证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	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(%)
长江证券	2,463,154,620.00	60.58	2,975,689,000.00	55.63	-	-
银河证券	1,602,816,210.00	39.42	2,373,386,000.00	44.37	-	-

## 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提醒投资者防范不法分子假冒本公司工作人员名义从事诈骗活动的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2024-1-19
2	长信利息收益开放式证券投资基金 2023 年第 4 季度报告	中国证监会电子披露网站、公司网站	2024-1-22
3	长信基金管理有限责任公司旗下全部基金 2023 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	2024-1-22



		证监会电子披露网站、 公司网站	
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	2024-2-5
5	长信基金管理有限责任公司关于旗下基金持有的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	2024-2-6
6	长信基金管理有限责任公司关于增加华西证券股份有限公司为旗下部分开放式基金代销机构并开通转换、定期定额投资业务及参加申购（含定投申购）费率优惠活动的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2024-3-6
7	长信利息收益开放式证券投资基金 2023 年年度报告	中国证监会电子披露网站、公司网站	2024-3-29
8	长信基金管理有限责任公司旗下全部基金 2023 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	2024-3-29
9	长信基金管理有限责任公司关于长信利息收益开放式证券投资基金暂停申购和转换转入业务的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2024-3-29
10	长信基金管理有限责任公司关于增加中航证券有限公司为旗下部分开放式基金代销机构并开通转换、定期定额投资业务及参加申购（含定投申购）费率优惠活动的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2024-4-1
11	长信利息收益开放式证券投资基金 2024 年第 1 季度报告	中国证监会电子披露网站、公司网站	2024-4-22
12	长信基金管理有限责任公司旗下全部基金 2024 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	2024-4-22
13	长信基金管理有限责任公司关于长信利息收益开放式证券投资基金暂停申购和转换转入业务的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2024-4-25
14	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	2024-6-4
15	长信基金管理有限责任公司关于住所变更的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2024-6-15
16	长信基金管理有限责任公司关于暂停海银基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2024-6-15
17	长信基金管理有限责任公司关于增加德邦证券有限公司为旗下部分开放式基金代销	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2024-6-20

	机构并开通转换、定期定额投资业务及参加申购（含定投申购）费率优惠活动的公告		
18	长信基金管理有限责任公司关于增聘长信利息收益开放式证券投资基金基金经理的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2024-6-22
19	长信基金管理有限责任公司关于增加麦高证券有限公司为旗下部分开放式基金代销机构并开通转换、定期定额投资业务及参加申购（含定投申购）费率优惠活动的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2024-6-24
20	长信基金管理有限责任公司关于增加信达证券股份有限公司为旗下部分开放式基金代销机构并开通转换、定期定额投资业务及参加申购（含定投申购）费率优惠活动的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2024-6-25
21	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汉口银行股份有限公司申购（含定投申购）费率优惠活动的公告	上证报、中国证监会电子披露网站、公司网站	2024-6-26
22	长信利息收益开放式证券投资基金更新的招募说明书及基金产品资料概要（更新）	中国证监会电子披露网站、公司网站	2024-6-26
23	长信利息收益开放式证券投资基金更新的招募说明书（2024 年第【1】号）及基金产品资料概要（更新）	中国证监会电子披露网站、公司网站	2024-6-28

## § 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：<https://www.cxfund.com.cn>。

长信基金管理有限责任公司

2024 年 8 月 30 日