

长信利息收益开放式证券投资基金 2016 年年度报告摘要

2016 年 12 月 31 日

基金管理人：长信基金管理有限责任公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2017 年 3 月 27 日

§ 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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行股份有限公司（以下简称“中国农业银行”，下同）根据本基金基金合同的规定，于 2017 年 3 月 23 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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 2016 年 12 月 31 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

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	
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	5, 101, 520, 990. 02 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	417, 897, 639. 63 份	4, 683, 623, 350. 39 份

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

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

2.2 基金产品说明

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

	管理上，将采用滚动投资策略，以提高基金资产的流动性。
业绩比较基准	银行活期存款利率（税后）
风险收益特征	本基金为货币市场基金，其预期收益和预期风险水平低于债券型、混合型和股票型基金，属于预期收益和预期风险偏低的基金品种。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		长信基金管理有限责任公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	周永刚	林葛
	联系电话	021-61009999	010-66060069
	电子邮箱	zhouyg@xfund.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		4007005566	95599
传真		021-61009800	010-68121816

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.cxfund.com.cn
基金年度报告备置地点	上海市浦东新区银城中路 68 号 9 楼、 北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨 世贸中心东座 F9

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2016 年		2015 年		2014 年	
	长信利息收益 货币 A	长信利息收益货币 B	长信利息收益货 币 A	长信利息收益货币 B	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	8,623,792.25	277,778,918.04	13,047,416.14	138,769,137.56	14,226,156.94	52,970,567.84
本期 利润	8,623,792.25	277,778,918.04	13,047,416.14	138,769,137.56	14,226,156.94	52,970,567.84
本期 净值 收益 率	2.53%	2.78%	3.73%	3.97%	3.99%	4.24%
3.1.2 期末 数据 和指 标	2016 年末		2015 年末		2014 年末	
	期末 基金 资产 净值	417,897,639.63	4,683,623,350.39	353,311,527.14	6,180,432,492.32	410,227,677.26
期末 基金 份额 净值	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000

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

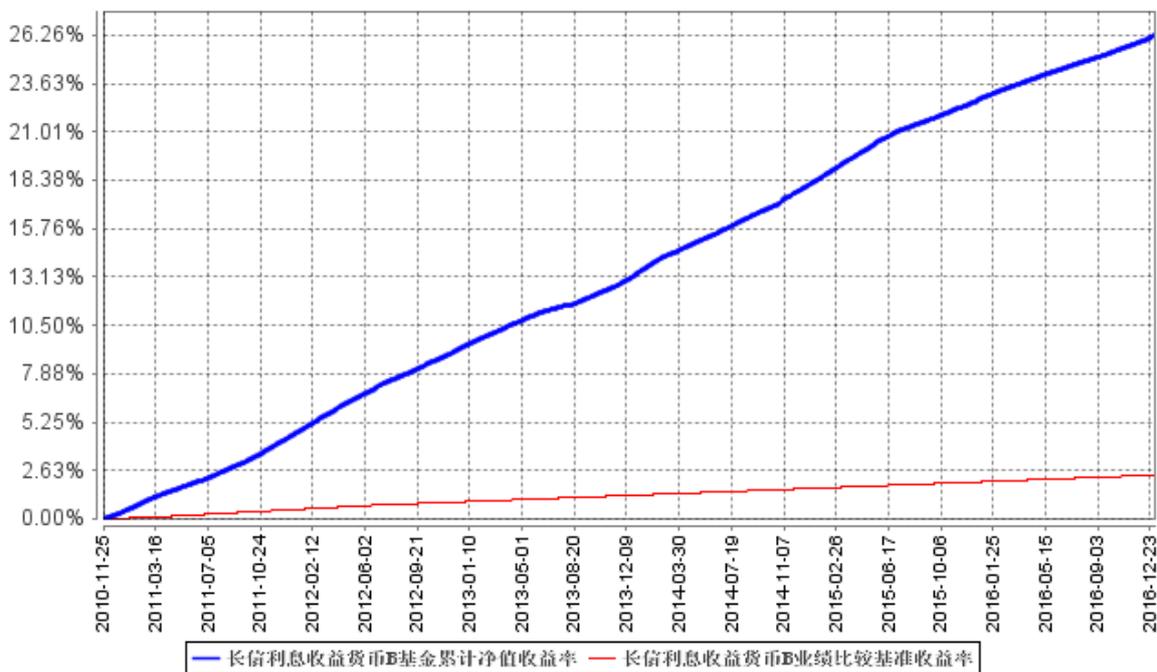
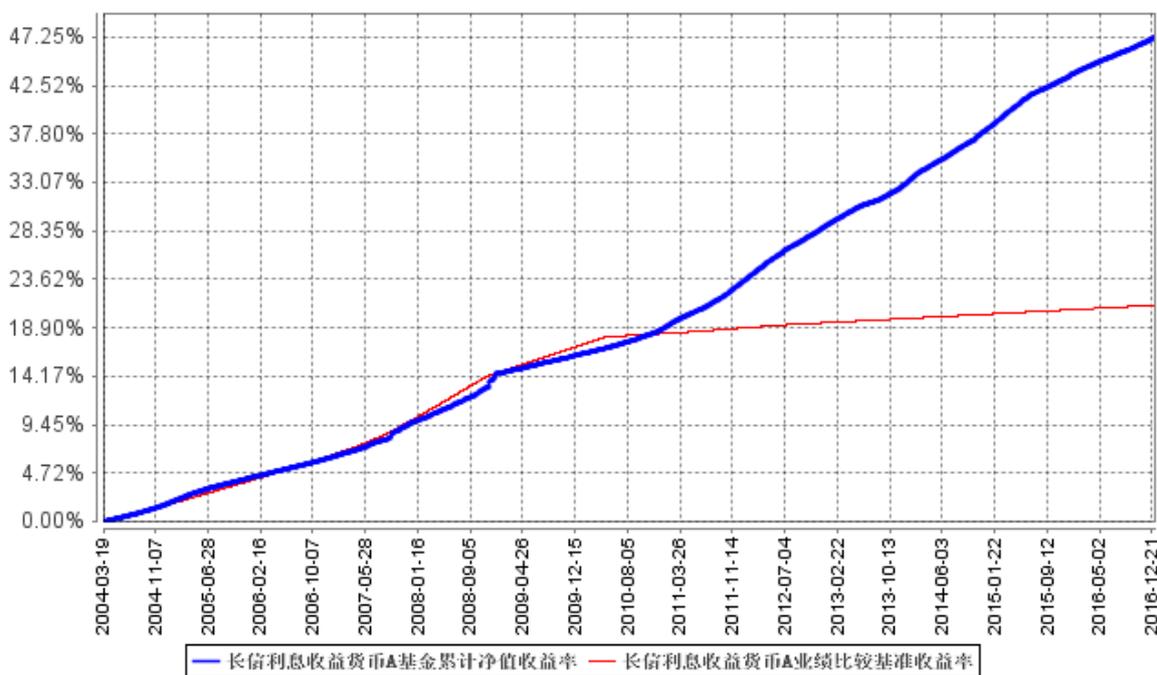
长信利息收益货币 A

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
过去三个月	0.7073%	0.0022%	0.0895%	0.0000%	0.6178%	0.0022%
过去六个月	1.2759%	0.0019%	0.1790%	0.0000%	1.0969%	0.0019%
过去一年	2.5333%	0.0016%	0.3565%	0.0000%	2.1768%	0.0016%
过去三年	10.6117%	0.0045%	1.0711%	0.0000%	9.5406%	0.0045%
过去五年	19.3316%	0.0044%	1.8633%	0.0001%	17.4683%	0.0043%
自基金合同生效起至今	47.1899%	0.0070%	21.0903%	0.0035%	26.0996%	0.0035%

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
过去三个月	0.7679%	0.0022%	0.0895%	0.0000%	0.6784%	0.0022%
过去六个月	1.3981%	0.0019%	0.1790%	0.0000%	1.2191%	0.0019%
过去一年	2.7795%	0.0016%	0.3565%	0.0000%	2.4230%	0.0016%
过去三年	11.4113%	0.0045%	1.0711%	0.0000%	10.3402%	0.0045%
过去五年	20.7732%	0.0044%	1.8633%	0.0001%	18.9099%	0.0043%
自基金合同生效起至今	26.2151%	0.0042%	2.3873%	0.0002%	23.8278%	0.0040%

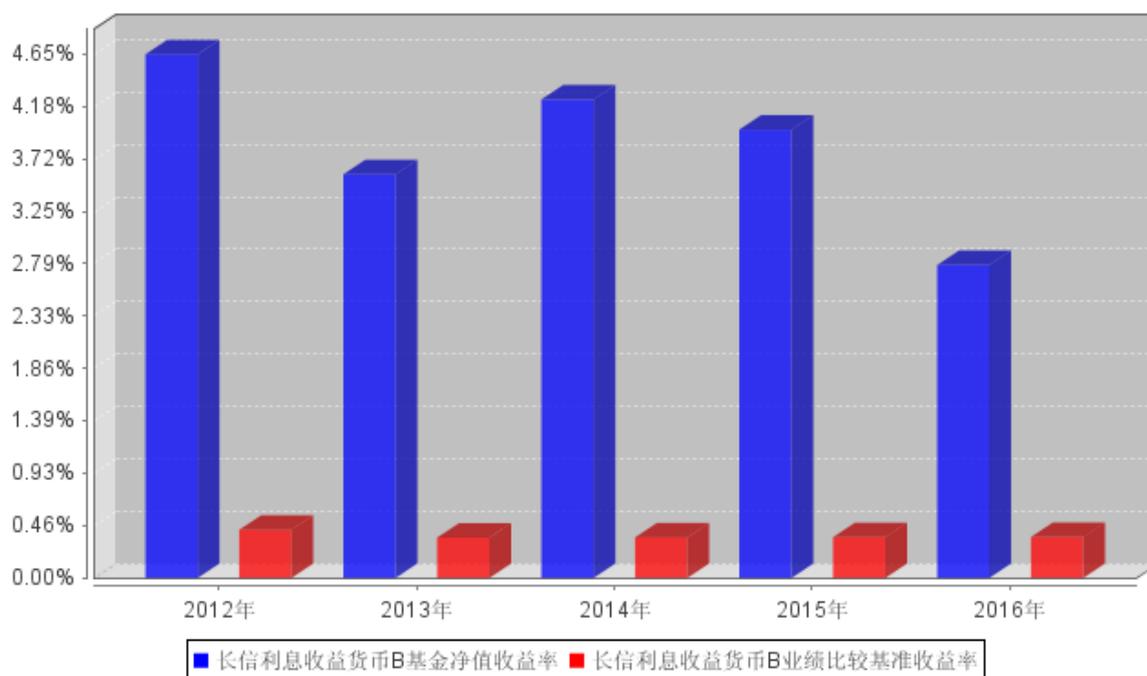
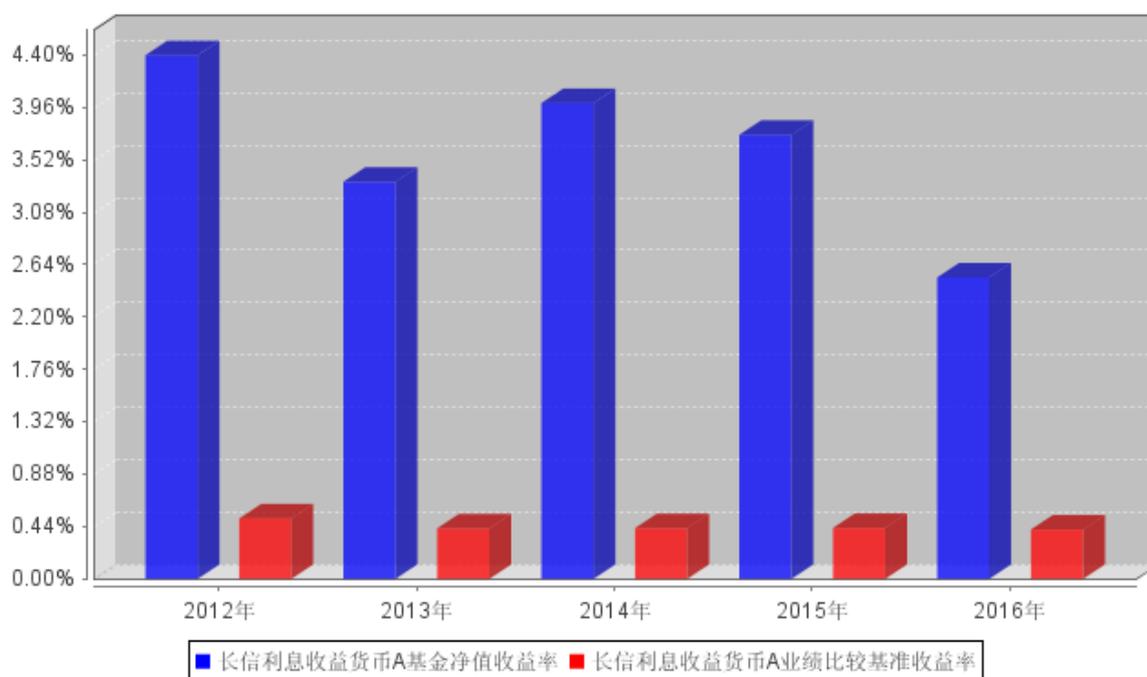
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、长信利息收益货币 A 图示日期为 2004 年 3 月 19 日至 2016 年 12 月 31 日，长信利息收益货币 B 图示日期为 2010 年 11 月 25 日(本基金分级日) 至 2016 年 12 月 31 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。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

长信利息收益货币 A					
年度	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	年度利润 分配合计	备注
2016年	8,718,595.62	167,495.24	-262,298.61	8,623,792.25	
2015年	11,239,219.94	1,856,635.69	-48,439.49	13,047,416.14	
2014年	13,087,103.20	1,789,313.30	-650,259.56	14,226,156.94	

合计	33,044,918.76	3,813,444.23	-960,997.66	35,897,365.33	
----	---------------	--------------	-------------	---------------	--

单位：人民币元

长信利息收益货币 B					
年度	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	年度利润 分配合计	备注
2016年	276,631,256.91	5,531,147.64	-4,383,486.51	277,778,918.04	
2015年	101,253,261.80	32,291,248.96	5,224,626.80	138,769,137.56	
2014年	43,700,577.16	11,720,788.91	-2,450,798.23	52,970,567.84	
合计	421,585,095.87	49,543,185.51	-1,609,657.94	469,518,623.44	

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，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。

2、本基金收益分配 2016 年 1 月 1 日前按月结转份额，2016 年 1 月 1 日后按日结转份额。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

长信基金管理有限责任公司是经中国证监会证监基金字【2003】63 号文批准，由长江证券股份有限公司、上海海欣集团股份有限公司、武汉钢铁股份有限公司共同发起设立，注册资本 1.5 亿元人民币。实收资本 1.65 亿元人民币，目前股权结构为：长江证券股份有限公司占 44.55%、上海海欣集团股份有限公司占 31.21%、武汉钢铁股份有限公司占 15.15%、上海彤胜投资管理中心（有限合伙）为 4.55%、上海彤骏投资管理中心（有限合伙）为 4.54%。

截至 2016 年 12 月 31 日，本基金管理人共管理 47 只开放式基金，即长信利息收益开放式证券投资基金、长信银利精选混合型证券投资基金、长信金利趋势混合型证券投资基金、长信增利动态策略混合型证券投资基金、长信双利优选灵活配置混合型证券投资基金、长信利丰债券型证券投资基金、长信恒利优势混合型证券投资基金、长信量化先锋混合型证券投资基金、长信美国标准普尔 100 等权重指数增强型证券投资基金、长信利鑫债券型证券投资基金 (LOF)、长信内需成长混合型证券投资基金、长信可转债债券型证券投资基金、长信利众债券型证券投资基金 (LOF)、长信纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信纯债壹号债券型证券投资基金、长信改革红利灵活配置混合型证券投资基金、长信量化中小盘股票型证券投资基金、长信新利灵活配置混合型证券投资基金、长信利富债券型证券投资基金、长信利盈灵活配置混合型证券投资基金、长信利广灵活配置混合型证券投资基金、长信多利灵活配置混合型证券投资基金、长信睿进灵活配置混合型证券投资基金、长信量化多策略股票型证券投资基金、长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)、长信中证一带一路主题指数分级证券投资基金、长信富民纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信富海纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信利保债券型证券投资基金、长信富安纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信中证能源互联网主题指数型证券投资基金 (LOF)、长信金葵纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信富全纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信利泰灵活配置混合型证券投资基金、长信海外收益一年定期开放债券型证券投资基金、长信先锐债券型证券投资基金、长信利发债券型证券投资基金、长信富泰纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信电子信息行业量化灵活配置混合型证券投资基金、长信富平纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信先利半年定期开放混合型证券投资基金、长信创新驱动股票型证券投资基金、长信稳益纯债债券型证券投资基金、长信利信灵活配置混合型证券投资基金、长信稳健纯债债券型证券投资基金、长信上证港股通指数型发起式证券投资基金、

长信纯债半年债券型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张文琍	长信利鑫债券型证券投资基金（LOF）、长信纯债壹号债券型证券投资基金、长信利息收益开放式证券投资基金、长信富平纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信稳益纯债债券型证券投资基金、长信富民纯债一年定期开放债券型证券投资基金和长信富海纯债一年定期开放债券型证券投资基金的基金经理、固定收益部总监	2013年8月8日	-	22年	高级工商管理硕士，上海财经大学 EMBA 毕业，具有基金从业资格。曾任湖北证券公司交易一部交易员、长江证券有限责任公司资产管理事业部主管、债券事业总部投资部经理、固定收益总部交易部经理。2004年9月加入长信基金管理有限责任公司，历任长信利息收益开放式证券投资基金的基金交易员、基金经理助理、长信利息收益开放式证券投资基金的基金经理、固定收益部副总监。现任长信基金管理有限责任公司固定收益部总监，长信利鑫债券型证券投资基金（LOF）、长信纯债壹号债券型证券投资基金、长信利息收益开放式证券投资基金、长信富平纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信稳益纯债债券型证券投资基金、长信富民纯债一年定期开放债券型证券投资基金和长信富海纯债一年定期开放债券型证券投资基金的基金经理。
陆莹	长信利息收益开放式证券投资基金的基金经理	2016年12月30日	-	6年	管理学学士，上海交通大学管理学学士，2010年7月加入长信基金管理有限责任公司，曾任基金事务部基金会计，交易管理部债券交易员、交易主管，债券交易部副总监、

					总监，现任长信利息收益开放式证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--	----------------------------

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

2、本基金基金经理的证券从业年限以基金经理进入证券业务相关机构的工作经历为时间计算标准。

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 公平交易制度和控制方法

1、所有投资对象的投资指令必须经由交易部门总监或其授权人审核分配至交易人员执行。进行投资指令分配的人员必须保证投资指令得到公平对待。

2、公司使用的交易执行软件系统必须具备如下功能：

(1) 严格按照时间顺序发送委托指令；

(2) 对于多个投资组合在同一时点就同一证券下达的相同方向的投资指令，并且市价在限价范围内的，系统能够将交易员针对该证券下达的每笔委托自动按照指令数量比例分拆为各投资组合的委托指令。对于不同投资组合针对交易所同一证券的同一方向竞价交易指令，指令数量比例达到 5: 1 或以上的，可豁免启动公平交易开关。

3、交易人员对于接收到的交易指令依照价格优先、时间优先的顺序执行。在执行多个投资组合在同一时点就同一证券下达的相同方向的交易所投资指令时，除制度规定的例外指令外，必须开启系统的公平交易开关。

4、对于不同投资组合均进行债券一级市场申购、非公开发行股票申购等非集中竞价交易的投资对象，交易部门必须严格独立接收各投资组合的投资指令，在申购结果产生前，不得以任何形式向任何人泄露各投资指令的内容，包括指令价格及数量等要素。

5、对于各投资组合以独立账户名义进行申购的投资对象，除需经过公平性审核的例外指令外，申购获配的证券数量由投资管理系统接收各类证券登记结算机构发送的数据进行分配。交易部门根据证券发行人在指定公开披露媒体上披露的申购结果对系统内分配数量进行核准，数量不符的，应当第一时间告知各投资管理部门的总监及监察稽核部总监。对于以公司名义进行申购的投资对象，公司在获配额度确定后，严格按照价格优先的原则在各投资组合间进行分配。申购价格相同的投资组合则根据投资指令的数量按比例进行分配。确因特殊原因不能按照上述原则进行分配的，应启动异常交易识别流程，审核通过的，可以进行相应分配。

4.3.2 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。

4.3.3 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。同时，对本年度同向交易价差进行专项分析，未发现异常情况。

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

2016 年上半年债券市场经历一波调整，一方面是前期债券收益下行过快导致的回调，另一方面是国内宏观经济略显企稳迹象，CPI 同比涨幅持平，环比降幅收窄，PPI 环比升幅扩大，出口贸易额同比大幅上升，但贸易顺差降幅继续收窄。此外，信用违约集中爆发，信用债市场分化严重，机构提高入池门槛，中高等级信用债群贤毕至，低等级无人问津，市场情绪波动加大，各券种债券收益率曲线区间波动加剧。6 月英国脱欧公投后，全球开启避险模式，风险资产大跌，债券黄金又再次受到追捧。债券市场三季度整体延续震荡态势，但在四季度经历一波大幅调整，主要原因是央行通过拉长流动性工具久期的方式，抬高了市场的资金成本以引导“债市去杠杆”。因此十月底开始资金面逐渐紧张，跨年资金利率高企，债券收益率逐步抬升。

上半年，我们保持较短久期，继续减持信用债，增持同业存单。下半年，我们进一步缩短久期，适当配置同业存单，提高资金波段操作效率，抓住了年末资金利率高企的机会，在坚持保证流动性前提下，提高了组合整体收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2016 年 12 月 31 日，本年度长信利息货币 A 净值增长率为 2.5333%，高于同期业绩比较基准收益 218bp，长信利息货币 B 净值增长率为 2.7795%，高于同期业绩比较基准收益 242bp。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

进入 2017 年，全球政治经济格局仍充满不确定性，人均工资水平、住房租金、石油价格的上涨导致美国仍然面临通胀压力，预计会有 2 次左右加息，人民币汇率贬值压力对国内流动性带来负面作用。国内经济增长短期保持稳定，工业生产和投资都有可能扩大，基本上不利于债券。且央行在四季度货币政策委员会例会中，删除了关于“降低企业融资成本”的描述，金融监管“去杠杆，防风险”的基调下，预计未来我国央行货币政策仍维持紧平衡。但长期来看，整个货币政策持续收紧之后，预计 2-3 季度经济增长会重新走弱，可能有建仓机会。

我们今年整体将维持较短久期的组合配置，在资金利率波动加剧的情况下，努力抓住资金波段操作机会。同时如果短融和同业存单在资金面冲击的背景下收益大幅上升，会适当加大配置力度，把握市场超调带来的机会。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证券监督管理委员会 2008 年 9 月 12 日发布的[2008]38 号文《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，长信基金管理有限责任公司（以下简称“公司”）制订了健全、有效的估值政策和程序，成立了估值工作小组，小组成员由基金事务部、投资、研究、交易等相关业务部门负责人以及基金事务部至少一名业务骨干共同组成。相关参与人员都具有丰富的证券行业工作经验，熟悉相关法规和估值方法。基金经理不直接参与估值决策，如果基金经理认为某证券有更好的证券估值方法，可以申请公司估值工作小组对某证券进行专项评估。估值决策由与会估值工作小组成员 1/2 以上多数票通过。对于估值政策，公司与基金托管人充分沟通，达成一致意见。审计本基金的会计师事务所认可公司基金估值政策和程序的适当性。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规和基金合同要求，本基金根据每日收益情况将当日收益全部分配，即当日收益分配比例为 100%。基金收益分配采用红利再投资分红方式，每日分配、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 286,402,710.29 元，已分配利润 286,402,710.29 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《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—长信基金管理有限责任公司 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 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 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 审计报告

本报告期末基金2016年度财务报告经毕马威华振会计师事务所审计，注册会计师出具了无保留意见的审计报告（毕马威华振字第1700178号），投资者可以通过年度报告正文查看审计报告全文。

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：长信利息收益开放式证券投资基金

报告截止日：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	8,327,987.21	852,710,314.10
结算备付金	300,000.00	300,000.00
存出保证金	300,000.00	300,000.00
交易性金融资产	1,235,953,443.38	3,913,312,436.89
其中：股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	1,235,953,443.38	3,913,312,436.89
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	4,193,347,673.03	2,822,289,333.42
应收证券清算款	-	-
应收利息	20,484,562.66	67,068,953.32
应收股利	-	-
应收申购款	16,905.87	699.98
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	5,458,730,572.15	7,655,981,737.71
负债和所有者权益	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
负债：		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	349,999,155.00	1,111,478,854.26
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	2,067,818.85	1,817,681.13
应付管理人报酬	1,984,633.75	1,508,060.07
应付托管费	601,404.15	456,987.89
应付销售服务费	139,103.64	109,127.49
应付交易费用	210,372.89	149,223.31
应交税费	-	-
应付利息	63,710.18	78,707.64

应付利润	1,348,700.32	5,994,485.44
递延所得税负债	-	-
其他负债	794,683.35	644,591.02
负债合计	357,209,582.13	1,122,237,718.25
所有者权益：		
实收基金	5,101,520,990.02	6,533,744,019.46
未分配利润	-	-
所有者权益合计	5,101,520,990.02	6,533,744,019.46
负债和所有者权益总计	5,458,730,572.15	7,655,981,737.71

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 5,101,520,990.02 份。

7.2 利润表

会计主体：长信利息收益开放式证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
一、收入	364,236,030.15	185,292,529.97
1.利息收入	359,893,094.47	167,386,338.46
其中：存款利息收入	63,892,776.26	10,578,114.10
债券利息收入	114,105,602.06	76,090,564.50
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	181,894,716.15	80,717,659.86
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	4,296,044.04	17,906,191.51
其中：股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	4,296,044.04	17,906,191.51
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	46,891.64	-
减：二、费用	77,833,319.86	33,475,976.27

1. 管理人报酬	35,524,364.80	14,741,647.66
2. 托管费	10,764,958.91	4,467,166.00
3. 销售服务费	1,899,082.94	1,299,242.10
4. 交易费用	-	-
5. 利息支出	29,110,470.24	12,444,684.27
其中：卖出回购金融资产支出	29,110,470.24	12,444,684.27
6. 其他费用	534,442.97	523,236.24
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	286,402,710.29	151,816,553.70
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	286,402,710.29	151,816,553.70

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长信利息收益开放式证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	6,533,744,019.46	-	6,533,744,019.46
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	286,402,710.29	286,402,710.29
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）	-1,432,223,029.44	-	-1,432,223,029.44
其中：1. 基金申购款	55,211,032,331.83	-	55,211,032,331.83
2. 基金赎回款	-56,643,255,361.27	-	-56,643,255,361.27
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）	-	-286,402,710.29	-286,402,710.29
五、期末所有者权益（基金净值）	5,101,520,990.02	-	5,101,520,990.02
项目	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计

一、期初所有者权益（基金净值）	849,989,256.75	-	849,989,256.75
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	151,816,553.70	151,816,553.70
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）	5,683,754,762.71	-	5,683,754,762.71
其中：1. 基金申购款	38,720,136,016.78	-	38,720,136,016.78
2. 基金赎回款	-33,036,381,254.07	-	-33,036,381,254.07
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）	-	-151,816,553.70	-151,816,553.70
五、期末所有者权益（基金净值）	6,533,744,019.46	-	6,533,744,019.46

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

长信利息收益开放式证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)《关于同意长信利息收益开放式证券投资基金募集的批复》(证监基金字[2003]149号)批准,由长信基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《长信利息收益开放式证券投资基金基金合同》发售,基金合同于2004年3月19日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集规模为7,042,630,886.94份基金份额。本基金的基金管理人为长信基金管理有限责任公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司(“中国农业银行”)。

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

百九十七天以内(含三百九十七天)的债券、期限在一年以内(含一年)的债券回购、期限在一年以内(含一年)的中央银行票据以及中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。本基金的业绩比较基准为：银行活期存款税后利息率。

本基金于 2010 年 11 月 25 日起实行销售服务费 A、B 分级收费方式，按单个基金账户内保留的基金份额是否达到或超过 500 万份将其分设为 A 级或 B 级基金份额，并分别适用不同的销售服务费费率。本基金分级后，除 A、B 两级基金份额收益率不同外，各级基金份额持有人的其他权益平等。同时，《长信利息收益开放式证券投资基金基金合同》和《长信利息收益开放式证券投资基金招募说明书(更新)》的相关内容也进行了修改。本基金于 2010 年 11 月 25 日的规模为 3,684,021,305.50 份基金份额，分级后 A 级基金规模为 571,492,324.41 份基金份额，B 级基金规模为 3,112,528,981.09 份基金份额。

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

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础。本财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则的要求，同时亦按照中国证监会公告[2010]5号《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》以及中国证券投资基金业协会于2012年11月16日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况、2016 年度的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 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、会计估计与上年度会计报表一致。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本年度未发生重大会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本年度未发生重大会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本年度未发生重大会计差错更正。

7.4.6 税项

(1) 主要税项说明

根据财税字[1998]55 号文《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收问题的通知》、财税[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税 [2008]1 号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2015] 125 号文《关于内地与香港基金互认有关税收政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

(a) 以发行基金方式募集资金，不属于营业税征收范围，不征收营业税。

(b) 证券投资基金管理人运用基金买卖债券的差价收入暂免征收营业税和企业所得税。

(c) 自 2016 年 5 月 1 日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税（以下称营改增）试点，建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人，纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。

证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券收入免征增值税。

对香港市场投资者（包括单位和个人）通过基金互认买卖内地基金份额免征增值税。

2017 年 7 月 1 日（含）以后，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在 2017 年 7 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，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。因此，截至 2016 年 12 月 31 日，本基金没有计提有关增值税费用。

(d) 对基金取得的债券的利息收入，发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税。

(e)关于香港市场投资者通过基金互认买卖内地基金份额的所得税问题:

对香港市场投资者(包括企业和个人)通过基金互认买卖内地基金份额取得的转让差价所得,暂免征收所得税。

对香港市场投资者(包括企业和个人)通过基金互认从内地基金分配取得的收益,由发行债券的企业向该内地基金分配利息时,对香港市场投资者按照7%的税率代扣所得税,并由内地发行债券的企业向其主管税务机关办理扣缴申报。该内地基金向投资者分配收益时,不再扣缴所得税。

内地基金管理人应当向相关证券登记结算机构提供内地基金的香港市场投资者的相关信息。

(f)对投资者(包括个人和机构投资者)从基金分配中取得的收入,暂不征收个人所得税和企业所得税。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
长信基金管理有限责任公司(以下简称“长信基金”)	基金管理人
中国农业银行股份有限公司(以下简称“农业银行”)	基金托管人
长江证券股份有限公司(以下简称“长江证券”)	基金管理人的股东
上海海欣集团股份有限公司	基金管理人的股东
武汉钢铁股份有限公司	基金管理人的股东
上海长江财富资产管理有限公司	基金管理人的子公司
上海海欣生物技术有限公司	基金管理人的股东的控股子公司
长信基金-聚享1号资产管理计划	基金管理人管理的特定客户资产管理计划
长信基金-涌信2号资产管理计划	基金管理人管理的特定客户资产管理计划
长信基金-涌信3号资产管理计划	基金管理人管理的特定客户资产管理计划
长信-得益纯债1号资产管理计划	基金管理人管理的特定客户资产管理计划
长信-广东农信普惠债券型1号资产管理计划	基金管理人管理的特定客户资产管理计划
长信-牡丹债券增强1号资产管理计划	基金管理人管理的特定客户资产管理计划
长信-融耀债券型1号资产管理计划	基金管理人管理的特定客户资产管理计划
长信-浦发-粤信2号资产管理计划	基金管理人管理的特定客户资产管理计划

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易**7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易****7.4.8.1.1 债券回购交易**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日	
	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例
长江证券	600,000,000.00	100.00%	4,896,600,000.00	100.00%

7.4.8.1.2 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31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	145,000.00	100.00%	290,000.00	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31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	145,000.00	100.00%	145,000.00	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。

7.4.8.2 关联方报酬**7.4.8.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月 31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月 31日
	当期发生的基金应支付	35,524,364.80

的管理费		
其中：支付销售机构的客户维护费	504,217.17	456,479.86

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

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	10,764,958.91	4,467,166.00

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

计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.1%/当年天数

7.4.8.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2016年1月1日至2016年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	长信利息收益货币 A	长信利息收益货币 B	合计
农业银行	386,733.84	2,015.99	388,749.83
长信基金	251,675.34	951,336.60	1,203,011.94
长江证券	14,335.23	25,950.79	40,286.02
合计	652,744.41	979,303.38	1,632,047.79
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2015年1月1日至2015年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	长信利息收益货币 A	长信利息收益货币 B	合计
农业银行	504,076.46	5,898.67	509,975.13
长信基金	162,789.09	335,460.59	498,249.68
长江证券	10,944.31	24,435.92	35,380.23
合计	677,809.86	365,795.18	1,043,605.04

注：2010年11月25日起本基金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。A 级基金支付销售机构的销售服务费用按前一日基金资

产净值 0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。B 级基金支付销售机构的基金销售服务费按前一日基金资产净值 0.01%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

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

7.4.8.3 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 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日						
银行间 市场交 易的 各关联 方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易 金 额	利息 收 入	交易金额	利息支出
农业银行	1,904,900,448.08	-	-	-	2,099,550,000.00	124,710.76
上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 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	131,094,867.11	232,571,810.11	-	-	710,000,000.00	34,624.66

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	
	长信利息收益货币 A	长信利息收益货币 B
期初持有的基金份额	-	240,560,796.08
期间申购/买入总份额	-	152,630,577.55
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	129,000,000.00
期末持有的基金份额	-	264,191,373.63
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	-	5.18%

项目	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	
	长信利息收益货币 A	长信利息收益货币 B
期初持有的基金份额	-	304,905,628.97
期间申购/买入总份额	-	30,205,167.11
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	94,550,000.00
期末持有的基金份额	-	240,560,796.08
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	-	3.68%

注：1、期间申购总份额包括当期收益转份额部分；

2、报告期末持有基金份额中的 168,120,436.24 份为本基金管理人风险准备金投资。

7.4.8.4.2 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 2016 年 12 月 31 日		上年度末 2015 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例
上海海欣生物技术 有限公司	927.22	0.00%	902.59	0.00%
长信-聚享 1 号资 产管理计划	-	-	70,907.96	0.00%
长信基金-涌信 2 号资产管理计划	-	-	1,032,269.94	0.02%
长信基金-涌信 3 号资产管理计划	1,059,399.74	0.02%	1,032,269.94	0.02%
长信-得益纯债 1 号资产管理计划	250,942.53	0.00%	-	-
长信-广东农信普 惠债券型 1 号资 产管理计划	138,920.41	0.00%	-	-
长信-牡丹债券增 强 1 号资产管理 计划	1,325,592.74	0.03%	-	-
长信-融耀债券型 1 号资产管理计划	13,273.19	0.00%	-	-

长信利息收益货币 B

份额单位：份

关联方名称	本期末 2016 年 12 月 31 日		上年度末 2015 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例
长信-浦发-粤信 2 号资产管理计 划	445,062,383.73	8.72%	-	-

注：1、本基金无申购、赎回费。

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

7.4.8.5 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 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 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	8,327,987.21	424,566.32	2,710,314.10	433,254.97

注：本基金通过“中国农业银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金，于 2016 年 12 月 31 日的相关余额为人民币 300,000.00 元(2015 年：人民币 300,000.00 元)。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

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

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

注：上述关联交易均根据正常的商业交易条件进行，并以一般交易价格为定价基础。

7.4.9 期末（2016 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金本报告期末未因认购新发/增发证券而持有流通受限的证券。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有股票。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购**

截至本报告期末 2016 年 12 月 31 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 349,999,155.00 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
111682085	16 龙江银行 CD003	2017 年 1 月 3 日	99.83	60,000	5,989,800.00
111690782	16 华融湘江银行 CD012	2017 年 1 月 3 日	99.35	440,000	43,714,000.00
111696831	16 九江银行 CD056	2017 年 1 月 3 日	99.28	1,000,000	99,280,000.00
160414	16 农发 14	2017 年 1 月 3 日	99.85	2,000,000	199,700,000.00
合计				3,500,000	348,683,800.00

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注：本基金本报告期末未持有因交易所市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	1,235,953,443.38	22.64
	其中:债券	1,235,953,443.38	22.64
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	4,193,347,673.03	76.82
	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	8,627,987.21	0.16
4	其他各项资产	20,801,468.53	0.38
5	合计	5,458,730,572.15	100.00

8.2 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	11.71	
	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	349,999,155.00	6.86
	其中:买断式回购融资	-	-

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的说明

注:在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的 20%。

8.3 基金投资组合平均剩余期限

8.3.1 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	30
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	92
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	13

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

注:本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余期限未超过 120 天。

8.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值比例 (%)	各期限负债占基金资产净值比例 (%)
1	30 天以内	67.33	6.86
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	26.72	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	2.33	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—120 天	9.82	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)—397 天(含)	0.39	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	106.60	6.86

8.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

注：本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余期限未超过 240 天。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	摊余成本	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	521,089,766.37	10.21
	其中：政策性金融债	521,089,766.37	10.21
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单	714,863,677.01	14.01
8	其他	-	-
9	合计	1,235,953,443.38	24.23
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

8.6 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	160414	16 农发 14	4,000,000	400,225,663.17	7.85
2	111690841	16 湖北银行 CD005	2,000,000	198,648,776.29	3.89
3	111696930	16 昆山农村商行 CD016	1,200,000	119,119,386.15	2.33
4	140208	14 国开 08	1,000,000	100,740,313.08	1.97
5	111696831	16 九江银行 CD056	1,000,000	99,259,165.54	1.95
6	111690728	16 青岛银行 CD011	1,000,000	99,204,083.18	1.94
7	111690782	16 华融湘江银行 CD012	1,000,000	99,176,731.69	1.94
8	111696526	16 昆山农村商行 CD011	800,000	79,490,783.43	1.56
9	150417	15 农发 17	200,000	20,123,790.12	0.39
10	111682085	16 龙江银行 CD003	200,000	19,964,750.73	0.39

8.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在 0.25(含)-0.5%间的次数	-
报告期内偏离度的最高值	0.1517%
报告期内偏离度的最低值	-0.0538%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0296%

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

注：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

注：报告期内不存在正偏离度的绝对值达到 0.5%的情况。

8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.9 投资组合报告附注**8.9.1 基金计价方法说明**

注：本基金采用摊余成本法计价。

8.9.2 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，在报告编制日前一年内也没有受到公开谴责、处罚。

8.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	300,000.00
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	20,484,562.66
4	应收申购款	16,905.87
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	20,801,468.53

8.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 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	337,232	1,239.20	51,673,375.43	12.37%	366,224,264.20	87.63%
长信利息收益货币 B	50	93,672,467.01	4,649,085,523.98	99.26%	34,537,826.41	0.74%
合计	337,282	15,125.39	4,700,758,899.41	92.14%	400,762,090.61	7.86%

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。

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	长信利息收益货币 A	2,806,927.10	0.67%
	长信利息收益货币 B	-	-
	合计	2,806,927.10	0.06%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	长信利息收益货币 A	10~50
	长信利息收益货币 B	0
	合计	10~50
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

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

	长信利息收益货币 A	长信利息收益货币 B
基金合同生效日（2004 年 3 月 19 日）基金份额总额	7,042,630,886.94	-
本报告期期初基金份额总额	353,311,527.14	6,180,432,492.32
本报告期基金总申购份额	2,091,521,373.48	53,119,510,958.35
减:本报告期基金总赎回份额	2,026,935,260.99	54,616,320,100.28
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	417,897,639.63	4,683,623,350.39

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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

11.2.1 基金管理人的重大人事变动

本报告期内，原董事长叶焯先生离职，总经理覃波先生自 2016 年 6 月 3 日起代为履行董事长（法定代表人）职责。因新任董事长（法定代表人）成善栋先生自 2016 年 11 月 24 日起正式任职，覃波先生自该日起不再代为履行董事长（法定代表人）职责，本基金管理人已按相关规定进行备案，并及时办理法定代表人的工商变更登记等相关手续。

自 2016 年 7 月 30 日起，宋小龙先生不再担任本基金管理人副总经理。

自 2016 年 12 月 27 日起，本基金管理人增聘程燕春先生为副总经理。

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

11.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金托管人的专门基金托管部门本报告期内未发生重大人事变动。

11.3 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。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略未改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金未更换会计师事务所，本年度应支付给毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）审计的报酬为人民币 70,000.00 元，该审计机构为本基金提供的审计服务的连续年限为 13 年。

11.6 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况**11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况**

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
安信证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	145,000.00	100.00%	-

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
安信证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	600,000,000.00	100.00%	-	-

注：1、本报告期内租用的证券公司交易单元没有发生变更。

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：

- a、券商基本面评价（财务状况、经营状况）；
- b、券商研究机构评价（报告质量、及时性和数量）；
- c、券商每日信息评价（及时性和有效性）；
- d、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。

11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

注：本报告期本基金不存在偏离度绝对值超过 0.5%的情况。

§ 12 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。

长信基金管理有限责任公司

2017 年 3 月 27 日