

长信利息收益开放式证券投资基金 2016 年年度报告

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。

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

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
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
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	10
§4 管理人报告	12
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	14
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.....	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	16
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	16
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	17
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	18
4.9 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.....	18
§5 托管人报告	19
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	19
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.....	19
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.....	19
§6 审计报告	20
6.1 审计报告基本信息.....	20
6.2 审计报告的基本内容.....	20
§7 年度财务报表	22
7.1 资产负债表.....	22
7.2 利润表.....	23
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	24
7.4 报表附注.....	25
§8 投资组合报告	51
8.1 期末基金资产组合情况.....	51
8.2 债券回购融资情况.....	51
8.3 基金投资组合平均剩余期限.....	51
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.....	52
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	52
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.....	53
8.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离.....	53

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	53
8.9 投资组合报告附注	53
§9 基金份额持有人信息.....	55
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	55
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	55
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	55
§10 开放式基金份额变动.....	56
§11 重大事件揭示.....	57
11.1 基金份额持有人大会决议	57
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	57
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	57
11.4 基金投资策略的改变	57
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	57
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	58
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	58
11.8 偏离度绝对值超过 0.5% 的情况	59
11.9 其他重大事件	59
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	64
§13 备查文件目录.....	65
13.1 备查文件目录	65
13.2 存放地点	65
13.3 查阅方式	65

§ 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	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</p>

	配置对现金流进行预算管理，以满足基金运作的要求。同时在一部分资金管理上，将采用滚动投资策略，以提高基金资产的流动性。
业绩比较基准	银行活期存款利率（税后）
风险收益特征	本基金为货币市场基金，其预期收益和预期风险水平低于债券型、混合型和股票型基金，属于预期收益和预期风险偏低的基金品种。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		长信基金管理有限责任公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	周永刚	林葛
	联系电话	021-61009999	010-66060069
	电子邮箱	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、证券日报
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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）	北京东长安街 1 号东方广场东 2 座 8 层
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标、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
3.1.3 累计 期末 指标	2016 年末		2015 年末		2014 年末	
	累计 净值 收益 率	47.19%	26.22%	43.55%	22.80%	38.40%

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

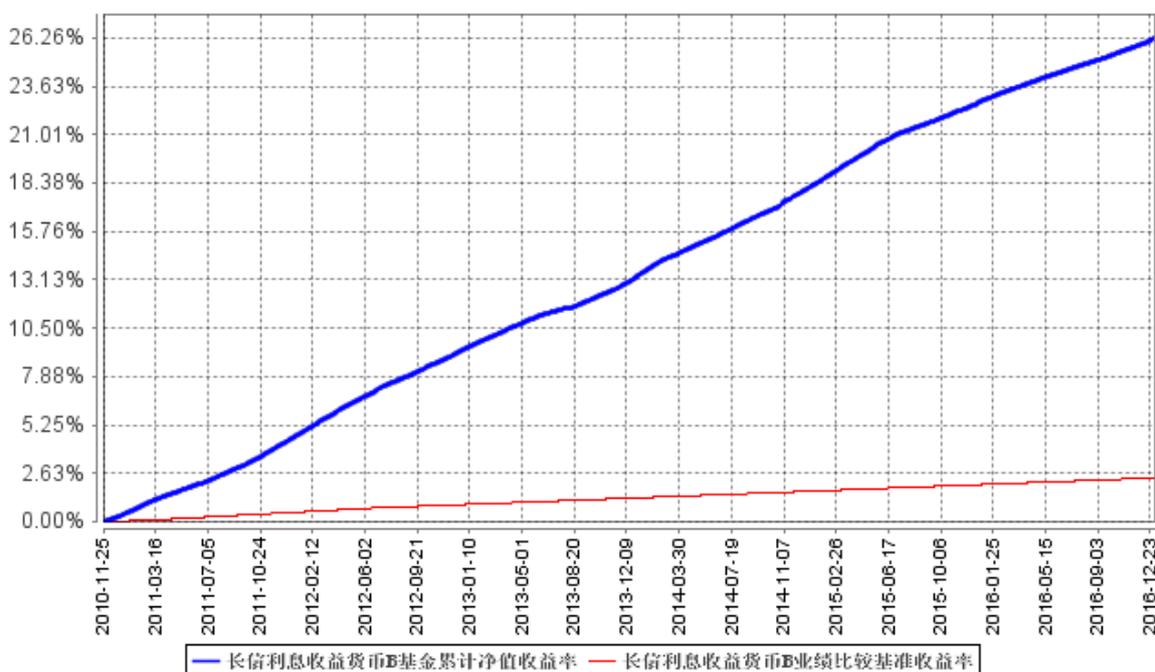
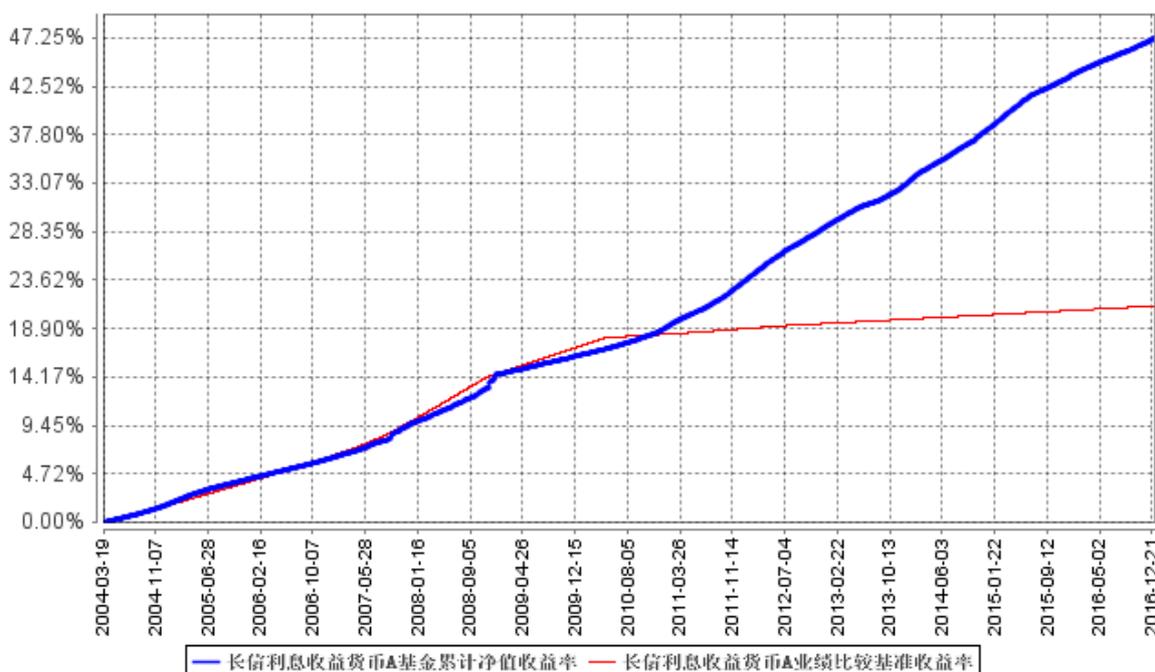
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	0.7073%	0.0022%	0.0895%	0.0000%	0.6178%	0.0022%
过去六个月	1.2759%	0.0019%	0.1790%	0.0000%	1.0969%	0.0019%
过去一年	2.5333%	0.0016%	0.3565%	0.0000%	2.1768%	0.0016%
过去三年	10.6117%	0.0045%	1.0711%	0.0000%	9.5406%	0.0045%
过去五年	19.3316%	0.0044%	1.8633%	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	26.2151%	0.0042%	2.3873%	0.0002%	23.8278%	0.0040%

同生效起 至今					
------------	--	--	--	--	--

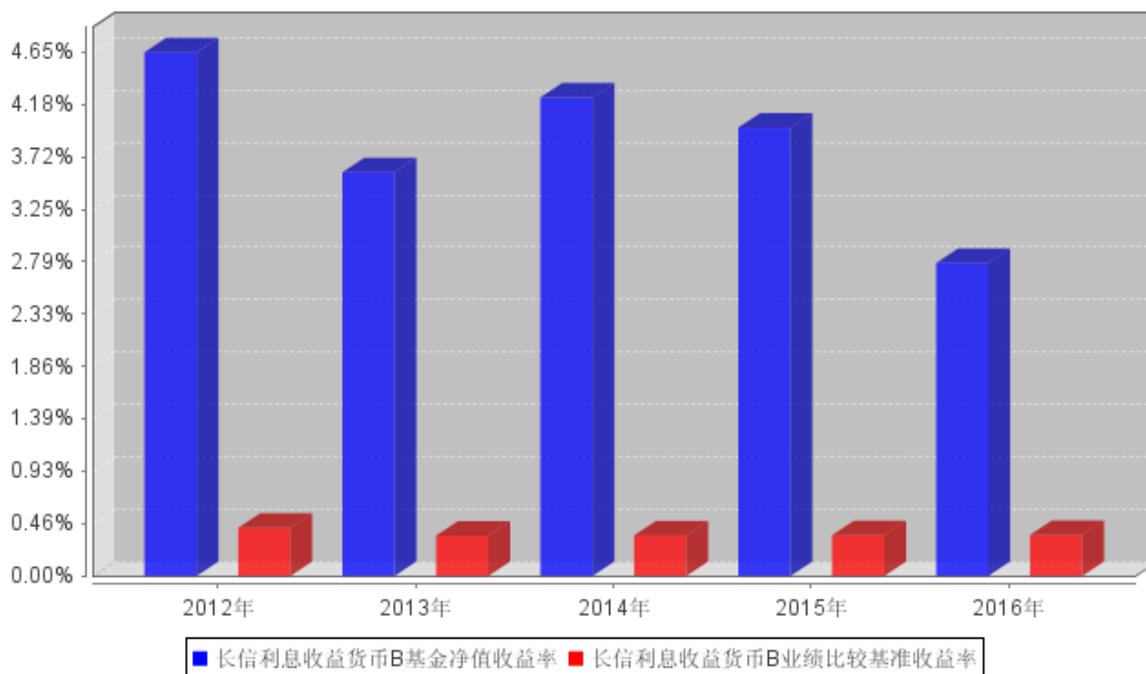
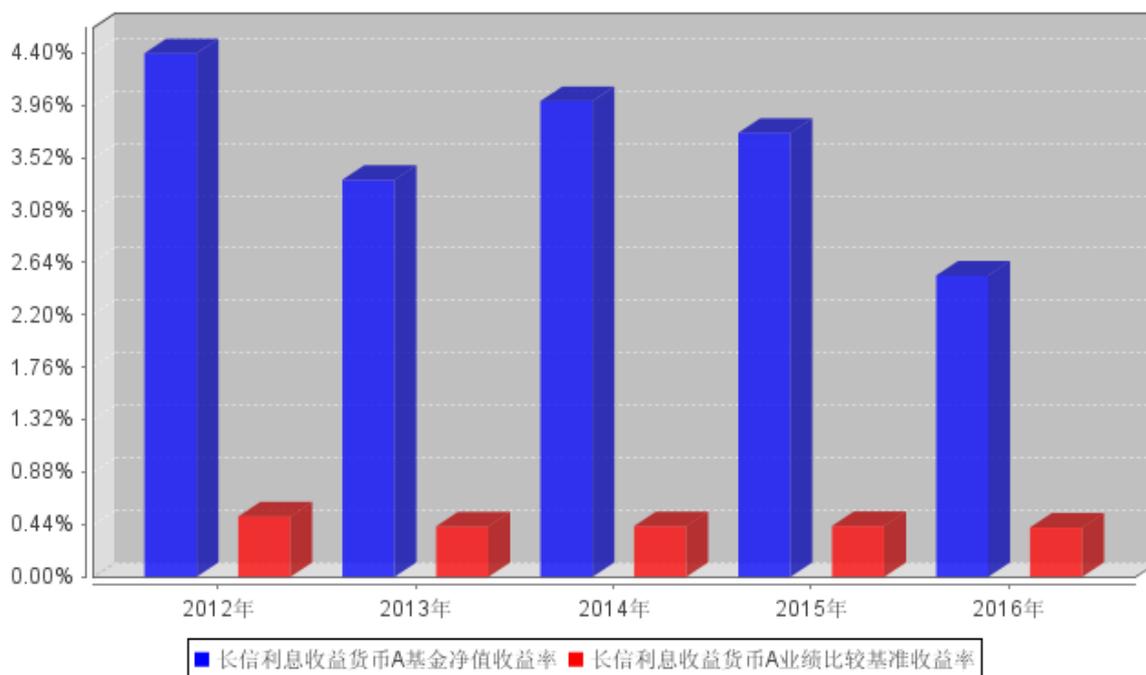
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2016 年度，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及配套法律法规，时刻以合规运作、防范风险为核心，以维护基金持有人利益为宗旨，保证基金合同得到严格履行。公司监察稽核部独立地开展工作，对基金运作进行事前、事中与事后的监督检查，发现问题及时提出改进建议并督促业务部门进行整改，同时定期向公司董事会和公司管理层出具监察稽核报告。

在本报告期，基金管理人的内部监察稽核主要工作如下：

1、公司内部控制总体目标得以实现。一是公司各项业务运作严格遵守有关法律法规、监管机构的规定和行业监管规则，继续践行守法经营、规范管理的经营理念。二是公司未发生重大经营风险，确保经营业务稳健运行和受托资产安全完整。三是公司对外披露、备案、报送的基金信息、专户投资组合信息、公司财务信息及其他信息真实、准确、完整、及时。公司始终以“合规运营，控制风险”为首要目标，梳理风险，积极应对外部变化，将合规理念传递到业务第一线，加强业务风控防线各岗位的自控与互控，从而有效防范并积极应对风险。

2、公司继续贯彻“工作精细化”理念，落实“风险导向型”内控，有重点、有序推进相关内部控制工作。优化监察方式，在完成公司多维度、多方位的风险全面梳理工作后，对前期梳理的风险及各项业务流程进行“回头看”。一是通过各部门的自查及合规部门的监督检查，核实对于前期梳理出的多项风险点的内部控制落实情况，检查是否存在未整改或执行不到位的情况；二是随

着外部市场环境及监管要求的不断变化，需要定期对新业务、新环境下所面临的业务风险进行识别及剖析，针对新风险、高风险领域进行充分讨论，真正使风控走在业务的前面，建立有效的内部控制措施，减少风险事件的发生。

3、公司内部控制组织架构在公司章程与《内部控制大纲》规定的框架内顺利运作，董事会风险控制委员会、管理层内部控制委员会工作正常开展，相关内部控制职责得以充分发挥。

4、公司较好把握内控制度建设的整体节奏，并完成内部控制制度建设流程的梳理工作，内部控制制度体系不断完善。内部控制制度建设继续遵循合法合规、全面、审慎、科学、适时、自觉的原则，内部控制的制度性环境不断健全。一是对监管机关新修订的法律法规或新出台的监管要求，监察稽核部及时发起制定或修订公司相关内部制度；二是各业务部门不定期评估实际运作需要，适时发起制度的修订。

5、监察稽核工作改进、内部控制与合规培训、内控逐级责任制等内控保障性措施严格执行，内部控制与风险管理基础进一步夯实。公司着力于搭建多层级的沟通及信息传导平台。首先，内部控制委员会作为内部通报平台，定期召开会议，及时、适时将各项监管要求、公司内部控制及风险管控的总体情况进行通报；其次，部门间定期召开部门负责人和关键岗位员工专项沟通会议，作为内控的主要沟通平台，对业务操作过程中的实际情况进行评估，高效解决跨部门及部门内部存在的风险隐患；最后，由合规部门牵头，不定期针对各个部门及各个岗位员工开展合规与内部控制培训，建立合规要求传达平台，将各项内控要求传递到各个岗位员工。

本基金管理人承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则，秉持内控优先、内控从严的理念，不断提高内部监察稽核工作的科学性和实效性、并完善内部控制体系，做好各项内控工作，努力防范和控制各种风险，确保基金资产的规范运作，充分保障基金持有人的合法权益。

4.7 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。

4.8 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。

4.9 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

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	毕马威华振审字第 1700178 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	长信利息收益开放式证券投资基金全体基金份额持有人
引言段	我们审计了后附的长信利息收益开放式证券投资基金(以下简称“长信利息收益货币”)财务报表,包括 2016 年 12 月 31 日的资产负债表,2016 年度的利润表、所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是长信利息收益货币基金管理人长信基金管理有限责任公司管理层的责任,这种责任包括:(1)按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制财务报表,并使其实现公允反映;(2)设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。
注册会计师的责任段	我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则,计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。审计工作涉及实施审计程序,以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断,包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时,注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价长信基金管理有限责任公司管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性,以及评价财务报表的总体列报。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。
审计意见段	我们认为,长信利息收益货币基金财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制,公允反映了长信利息收益货币基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年

	期间的经营成果和基金净值变动情况。	
注册会计师的姓名	王国蓓	薛晨俊
会计师事务所的名称	毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）	
会计师事务所的地址	北京东长安街 1 号东方广场东 2 座 8 层	
审计报告日期	2017-03-23	

§ 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	附注号	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	7.4.7.1	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	7.4.7.2	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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	4,193,347,673.03	2,822,289,333.42
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	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	7.4.7.6	-	-
资产总计		5,458,730,572.15	7,655,981,737.71
负债和所有者权益	附注号	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	7.4.7.3	-	-
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	7.4.7.7	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	7.4.7.8	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	7.4.7.9	5,101,520,990.02	6,533,744,019.46
未分配利润	7.4.7.10	-	-
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	附注号	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
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	7.4.7.11	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	7.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	4,296,044.04	17,906,191.51
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	46,891.64	-
减：二、费用		77,833,319.86	33,475,976.27

1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	35,524,364.80	14,741,647.66
2. 托管费	7.4.10.2.2	10,764,958.91	4,467,166.00
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	1,899,082.94	1,299,242.10
4. 交易费用	7.4.7.19	-	-
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	7.4.7.20	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 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币，编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

本基金在初始确认时按取得资产或承担负债的目的，把金融资产和金融负债分为不同类别：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债、应收款项、持有至到期投资、可供出售金融资产和其他金融负债。本基金现无金融资产分类为持有至到期投资和可供出售金融资产。本基金现无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

本基金目前持有的债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

取得债券投资支付的价款中包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，应当单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。债券投资采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量，即债券投资按票面利率或商定利率每日计提应收利息，按实际利率法在其剩余期限内摊销其买入时的溢价或折价；同时于每一估值日计算影子价格，以避免债券投资的摊余成本与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离。应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产的现金流量的合同权利终止或将所有权上几乎所有的风险和报酬转移时，本基金终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，本基金终止确认该金融负债或其一部分。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

为了避免采用摊余成本法计算的基金资产净值与按其他可参考公允价值指标计算的基金资产净值发生重大偏离，从而对基金份额持有人的利益产生稀释和不公平的结果，基金管理人于每一估值日，采用金融工具的公允价值确定影子价格。

当影子定价确定的基金资产净值与摊余成本法计算的基金资产净值的负偏离度绝对值达到 0.25%时，基金管理人应当在 5 个交易日内将负偏离度绝对值调整到 0.25%以内。当正偏离度绝对值达到 0.5%时，基金管理人应当暂停接受申购并在 5 个交易日内将正偏离度绝对值调整到 0.5%以内。当负偏离度绝对值达到 0.5%时，基金管理人应当使用风险准备金或者自有资金弥补潜在资产损失，将负偏离度绝对值控制在 0.5%以内。当负偏离度绝对值连续两个交易日超过 0.5%时，基金管理人应当采用公允价值估值方法对持有投资组合的账面价值进行调整，或者采取暂停接受所有赎回申请并终止基金合同进行财产清算等措施。

计算影子价格时按如下原则确定金融工具的公允价值：

存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

一本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；

一本基金计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额。每份基金份额面值为 1.00 元。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少，以及因类别调整而引起的 A、B 级基金份额之间的转换所产生的实收基金变动。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日进行确认和计量，并于会计期末全额转入“未分配利润/(累计亏损)”。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

债券投资收益按相关金融资产于处置日成交金额与其成本的差额确认。

债券投资收益于卖出交易日按卖出债券成交金额与其成本和应收利息的差额确认。

债券利息收入按债券投资的摊余成本与实际利率计算的金额扣除应由发行债券的企业代扣代缴的个人所得税(如适用)后的净额确认,在债券实际持有期内逐日计提。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债,根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后,逐日计提利息收入。

利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额,在回购期内按实际利率法逐日确认,直线法与实际利率法确定的收入差异较小的可采用直线法。

公允价值变动收益/(损失)核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产、衍生金融资产、以公允价值计量且变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

本基金的交易费用于进行股票、债券、权证等交易发生时按照确定的金额确认。

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

卖出回购金融资产利息支出按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额,在回购期内以实际利率法逐日确认,直线法与实际利率法确定的支出差异较小的可采用直线法。

本基金的其他费用如不影响估值日基金份额净值小数点后第四位,发生时直接计入基金损益;如果影响基金份额净值小数点后第四位的,应采用待摊或预提的方法,待摊或预提计入基金损益。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

由于本基金 A、B 级基金份额收取销售服务费的费率不同,各基金份额类别对应的可分配收益有所不同,本基金同一类别内的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益分配采用红利再投资分红方式,投资者可通过赎回基金份额方式获取现金红利收益。本基金根据每日基金收益情况,以基金净收益为基准,为投资人每日计算当日收益并分配,且每日进行支付。投资人当日收益分配的计算保留到小数点后 2 位,小数点后第 3 位按去尾原则处理(因去尾形成的余额进行再次分配,直到分完为止)。

若投资者赎回基金份额时,该赎回份额对应的待支付收益将与赎回款项一起结算并支付,若

收益为负值，则将从投资者赎回基金款中扣除。当日申购的基金份额自下一个工作日起享有基金的分配权益；当日赎回的基金份额自下一工作日起，不享有基金的分配权益。在符合法律法规的前提下，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%。如当日收益为正，则相应增加基金份额；如当日收益为负，则不进行收益分配并相应减少基金份额，保持基金份额净值为 1 元；收益分派计算结果如为负，实行小数点第三位非零即入，剩余部分划归基金财产。在不影响投资者利益情况下，基金管理人可酌情调整基金收益分配方式。法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》，在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

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 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
活期存款	8,327,987.21	2,710,314.10
定期存款	-	850,000,000.00
其中：存款期限 1 个月以内	-	350,000,000.00
存款期限 1-3 个月	-	500,000,000.00
其他存款	-	-
合计：	8,327,987.21	852,710,314.10

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2016 年 12 月 31 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	1,235,953,443.38	1,235,242,000.00	-711,443.38	-0.0139
	合计	1,235,953,443.38	1,235,242,000.00	-711,443.38	-0.0139
项目		上年度末 2015 年 12 月 31 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	3,913,312,436.89	3,923,737,990.00	10,425,553.11	0.1596
	合计	3,913,312,436.89	3,923,737,990.00	10,425,553.11	0.1596

注：截至 2016 年 12 月 31 日，本基金的交易性金融资产均为采用摊余成本法摊余的债券投资成本。

本基金管理人认为本基金债券投资的公允价值与摊余成本间的差异在合理范围内。

1. 偏离金额=影子定价-摊余成本；
2. 偏离度=偏离金额/摊余成本法确定的基金资产净值。

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 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 2016年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
银行间市场	1,805,347,673.03	-
交易所市场	2,388,000,000.00	-
合计	4,193,347,673.03	-
项目	上年度末 2015年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
银行间市场	2,622,289,333.42	-
交易所市场	200,000,000.00	-
合计	2,822,289,333.42	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本报告期及上年度末本基金无买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
应收活期存款利息	2,640.33	17,526.76
应收定期存款利息	-	178,750.02
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	148.50	148.50
应收债券利息	11,414,218.07	63,100,685.64
应收买入返售证券利息	9,067,407.26	3,771,693.90
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	148.50	148.50
合计	20,484,562.66	67,068,953.32

注：其他为应收保证金利息。

7.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	-	-
银行间市场应付交易费用	210,372.89	149,223.31
合计	210,372.89	149,223.31

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	5,683.35	591.02
信息披露费-上证报	340,000.00	340,000.00
审计费用	70,000.00	70,000.00
预提账户维护费	9,000.00	9,000.00
信息披露费-证券日报	80,000.00	80,000.00
券商席位佣金	290,000.00	145,000.00
合计	794,683.35	644,591.02

7.4.7.9 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 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	353,311,527.14	353,311,527.14
本期申购	2,091,521,373.48	2,091,521,373.48
本期赎回(以“-”号填列)	-2,026,935,260.99	-2,026,935,260.99
- 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	417,897,639.63	417,897,639.63

金额单位：人民币元

长信利息收益货币 B		
项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额

上年度末	6,180,432,492.32	6,180,432,492.32
本期申购	53,119,510,958.35	53,119,510,958.35
本期赎回(以“-”号填列)	-54,616,320,100.28	-54,616,320,100.28
- 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	4,683,623,350.39	4,683,623,350.39

注：表内各级基金的申购和赎回均包括红利再投资、分级调整以及基金转入和转出数。

7.4.7.10 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	8,623,792.25	-	8,623,792.25
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	-8,623,792.25	-	-8,623,792.25
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	277,778,918.04	-	277,778,918.04
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	-277,778,918.04	-	-277,778,918.04
本期末	-	-	-

7.4.7.11 存款利息收入

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
活期存款利息收入	424,566.32	433,254.97
定期存款利息收入	63,431,471.11	10,099,180.50
其他存款利息收入	-	-

结算备付金利息收入	36,738.83	45,678.63
其他	-	-
合计	63,892,776.26	10,578,114.10

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

7.4.7.13 注：本基金本报告期及上年度可比期间均未持有股票。债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

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
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	4,296,044.04	17,906,191.51
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	4,296,044.04	17,906,191.51

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 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
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	38,232,062,304.02	7,794,503,505.79
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	38,002,065,341.87	7,655,905,123.54
减：应收利息总额	225,700,918.11	120,692,190.74
买卖债券差价收入	4,296,044.04	17,906,191.51

7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间内无债券投资赎回差价收入。

7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间内无债券投资申购差价收入。

7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未持有资产支持证券。

7.4.7.14 贵金属投资收益**7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成**

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

7.4.7.15 衍生工具收益**7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未持有衍生工具。

7.4.7.15.2 衍生工具收益 ——其他投资收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未持有衍生工具。

7.4.7.16 股利收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未持有股票，无股利收益。

7.4.7.17 公允价值变动收益

注：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。

7.4.7.18 其他收入

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
基金赎回费收入	-	-
其他收入	46,891.64	-
合计	46,891.64	-

注：其他收入为交易账户产生的利息等其他收入。

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

7.4.7.20 本基金本报告期内及上年度可比期间均无交易费用。其他费用

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
审计费用	80,000.00	60,000.00
信息披露费	180,000.00	180,000.00
帐户维护费	36,210.00	36,000.00
其他费用	93,232.97	102,236.24
券商席位佣金	145,000.00	145,000.00

合计	534,442.97	523,236.24
----	------------	------------

注：其他费用为银行汇划手续费等其他费用。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

注：截至本财务报告批准报出日，本基金未发生需要披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

注：截至本财务报告批准报出日，本基金未发生需要披露的日后事项。

7.4.9 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

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易**7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易****7.4.10.1.1 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%

7.4.10.1.2 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。

7.4.10.2 关联方报酬**7.4.10.2.1 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

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	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

7.4.10.2.3 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		
	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

7.4.10.3 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 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

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 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。

7.4.10.4.2 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。

7.4.10.5 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)。

7.4.10.6 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。

7.4.10.7 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。

7.4.11 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
8,718,595.62	167,495.24	-262,298.61	8,623,792.25	-

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
276,631,256.91	5,531,147.64	-4,383,486.51	277,778,918.04	-

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。

7.4.12 期末（2016 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券**7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

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。

7.4.12.2 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。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**7.4.12.3.1 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。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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
- 市场风险

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

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

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

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

7.4.13.2 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约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国农业银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，本基金投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评

估并采用券款对付交割方式以控制相应的信用风险。

7.4.13.2.1 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 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
A-1	0.00	1,149,441,776.20
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	1,235,953,443.38	2,763,870,660.69
合计	1,235,953,443.38	3,913,312,436.89

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

根据中国人民银行 2006 年 3 月 29 日发布的“银发[2006]95 号”文《中国人民银行信用评级管理指导意见》，以及 2006 年 11 月 21 日发布的《信贷市场和银行间债券市场信用评级规范》等文件的有关规定，短期债券信用评级等级划分为四等六级，符号表示为：A-1、A-2、A-3、B、C、D。其中，每一个信用等级可用“+”、“-”符号进行微调，表示略高或略低于本等级。

级别设置含义

A-1 还本付息能力最强，安全性最高。

A-2 还本付息能力较强，安全性较高。

A-3 还本付息能力一般，安全性易受不良环境变化的影响。

B 还本付息能力较低，有一定的违约风险。

C 还本付息能力很低，违约风险较高。

D 不能按期还本付息。

7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

注：本基金于本报告期末及上年末均未持有长期信用评级债券。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度与可能遭受的损失。本基金的流动性风险一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现，另一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人主要通过限制、跟踪和控制基金投资交易的不活跃品种(企业债或短期融资券)来实现。本基金存放在具有基金托管资格的同一商业银行的存款，不超过基金资产净值的 30%；存放在不具有基金托管资格的同一商业银行的存款，不超过基金资产净值的 5%；本基金投资于短期金融工具的比重不低于基金资产总值的 80%，投资组

合的平均剩余期限在每个交易日均不超过 180 天。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式融入短期资金应对流动性需求，除发生巨额赎回的情形外，在全国银行间债券市场债券正回购的资金余额不超过基金资产净值 20%。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金管理人量化投资部，每日通过平均剩余期限、久期、信用债、浮息债、银行存款及清算备付金占资产总值的比例等指标，监测基金所持有证券的流动性，衡量申购、赎回资金的比例，从而设定资金需求，避免发生流动性风险。

本基金所持有的全部金融负债无固定到期日或合同约定到期日均为一个月以内且不计息（除卖出回购金融资产款余额中有 349,999,155.00 元将在一个月以内到期且计息外），可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融市场利率波动导致证券市场及及利息收益的价格和收益率发生变动，从而直接影响基金的融资成本和经营业绩水平的风险。

本基金的投资范围为银行存款、大额存单、短期债券、央行票据、债券回购等银行间市场固定收益品种。基金估值采用摊余成本法，按实际利率在其剩余期限内摊销，每日计提收益或损失，并通过“影子定价”（附注 7.4.4.5）对基金持有的估值对象进行重新评估，因此利率风险在一定程度上存在。

本基金管理人量化投资部，通过定期对所持债券修正久期等参数的监控进行利率风险敏感性测试。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016年12月31 日	6个月以内	6个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
------------------------	-------	--------	------	------	-----	----

资产						
银行存款	8,327,987.21	-	-	-	-	8,327,987.21
结算备付金	300,000.00	-	-	-	-	300,000.00
存出保证金	300,000.00	-	-	-	-	300,000.00
交易性金融资产	1,215,829,653.26	20,123,790.12	-	-	-	1,235,953,443.38
买入返售金融资产	4,193,347,673.03	-	-	-	-	4,193,347,673.03
应收利息	-	-	-	-	20,484,562.66	20,484,562.66
应收申购款	-	-	-	-	16,905.87	16,905.87
其他资产	-	-	-	-	-	-
资产总计	5,418,105,313.50	20,123,790.12	-	-	20,501,468.53	5,458,730,572.15
负债						
卖出回购金融资产款	349,999,155.00	-	-	-	-	349,999,155.00
应付赎回款	-	-	-	-	2,067,818.85	2,067,818.85
应付管理人报酬	-	-	-	-	1,984,633.75	1,984,633.75
应付托管费	-	-	-	-	601,404.15	601,404.15
应付销售服务费	-	-	-	-	139,103.64	139,103.64
应付交易费用	-	-	-	-	210,372.89	210,372.89
应付利息	-	-	-	-	63,710.18	63,710.18
应付利润	-	-	-	-	1,348,700.32	1,348,700.32
其他负债	-	-	-	-	794,683.35	794,683.35
负债总计	349,999,155.00	-	-	-	7,210,427.13	357,209,582.13
利率敏感度缺口	5,068,106,158.50	20,123,790.12	-	-	13,291,041.40	5,101,520,990.02
上年度末 2015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	852,710,314.10	-	-	-	-	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	2,503,409,784.05	1,409,902,652.84	-	-	-	3,913,312,436.89
买入返售金融资产	2,822,289,333.42	-	-	-	-	2,822,289,333.42
应收利息	-	-	-	-	67,068,953.32	67,068,953.32
应收申购款	-	-	-	-	699.98	699.98
其他资产	-	-	-	-	-	-
资产总计	6,179,009,431.57	1,409,902,652.84	-	-	67,069,653.30	7,655,981,737.71

负债						
卖出回购金融资产款	1,111,478,854.26	-	-	-	-	1,111,478,854.26
应付赎回款	-	-	-	-	1,817,681.13	1,817,681.13
应付管理人报酬	-	-	-	-	1,508,060.07	1,508,060.07
应付托管费	-	-	-	-	456,987.89	456,987.89
应付销售服务费	-	-	-	-	109,127.49	109,127.49
应付交易费用	-	-	-	-	149,223.31	149,223.31
应付利息	-	-	-	-	78,707.64	78,707.64
应付利润	-	-	-	-	5,994,485.44	5,994,485.44
其他负债	-	-	-	-	644,591.02	644,591.02
负债总计	1,111,478,854.26	-	-	-	10,758,863.99	1,122,237,718.25
利率敏感度缺口	5,067,530,577.31	1,409,902,652.84	-	-	-56,310,789.31	6,533,744,019.46

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。

7.4.13.4.1.2 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（2016年12月31日）	上年度末（2015年12月31日）
	市场利率下降27个基点	712,355.09	4,607,898.59
市场利率上升27个基点	-712,355.09	-4,607,898.59	

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无重大其他市场价格风险。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值计量

(a) 公允价值计量的层次

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

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

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

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

单位：人民币元

	本期末 2016年12月31日			
	第一层级	第二层级	第三层级	合计
2016年				
股票投资	-	-	-	-
债券投资	-	1,235,242,000.00	-	1,235,242,000.00
2015年				
股票投资	-	-	-	-
债券投资	-	3,923,737,990.00	-	3,923,737,990.00

2016年，本基金上述持续以公允价值计量的资产和负债金融工具的第一层次与第二层次之间没有发生重大转换。本基金是在发生转换当年的报告期末确认各层次之间的转换。

(b) 第二层次的公允价值计量

对于本基金投资的证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于限售期间等情况时，本基金将相应进行估值方法的变更。根据估值方法的变更，本基金综合考虑估值调整中采用的可观察与不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关证券公允价值的层次。

2016年，本基金上述持续和非持续第二层次公允价值计量所使用的估值技术并未发生该变更。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2016年12月31日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具（2015年12月31日：无）。

(2) 其他金融工具的公允价值（年末非以公允价值计量的项目）

其他金融工具主要包括买入返售金融资产、应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

§ 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。

11.9 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变更旗下基金所持停牌股票估值方法的提示性公告	上证报、中证报、 证券时报	2016 年 1 月 5 日
2	长信基金管理有限责任公司关于变更旗下基金所持停牌股票估值方法的提示性公告	上证报、中证报、 证券时报	2016 年 1 月 8 日
3	长信基金管理有限责任公司关于变更旗下基金所持停牌股票估值方法的提示性公告	上证报、中证报、 证券时报	2016 年 1 月 11 日
4	长信基金管理有限责任公司关于增加平安证券有限责任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、中证报、 证券时报、证券 日报	2016 年 1 月 15 日
5	长信利息收益开放式证券投资基金 2015 年第 4 季度报告	上证报、证券日 报、公司网站	2016 年 1 月 20 日
6	长信基金管理有限责任公司关于变更旗下基金所持停牌股票估值方法的提示性公告	上证报、中证报、 证券时报	2016 年 1 月 28 日
7	长信基金管理有限责任公司关于变更旗下基金所持停牌股票估值方法的提示性公告	上证报、中证报、 证券时报	2016 年 1 月 29 日
8	长信基金管理有限责任公司关于长信利息收益开放式证券投资基金暂停申购和转换转入业务的公告	上证报、证券日 报	2016 年 2 月 2 日
9	长信基金管理有限责任公司关于旗下基金所持金亚科技估值调整的公告	上证报、中证报、 证券时报	2016 年 2 月 26 日
10	长信基金管理有限责任公司关于变更旗下基金所持停牌股票估值方法的提示性公告	上证报、中证报、 证券时报	2016 年 2 月 26 日
11	长信基金管理有限责任公司关于增加海银基金销售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、中证报、 证券时报、证券 日报	2016 年 3 月 1 日
12	长信基金管理有限责任公司关于变更旗下基金所持停牌股票估值方法的提示性公告	上证报、中证报、 证券时报	2016 年 3 月 19 日
13	长信基金管理有限责任公司关于变更旗下基金所持停牌股票估值方法的提示性公告	上证报、中证报、 证券时报	2016 年 3 月 24 日
14	长信利息收益开放式证券投资基金 2015 年年度报告及摘要	上证报、证券日 报	2016 年 3 月 26 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	上证报、证券日 报	2016 年 3 月 29 日

	业务的公告		
16	长信基金管理有限责任公司关于调整网上直销平台招商银行借记卡费率优惠方案的公告	上证报、中证报、 证券时报	2016 年 4 月 7 日
17	长信基金管理有限责任公司关于变更旗下基金所持停牌股票估值方法的提示性公告	上证报、中证报、 证券时报	2016 年 4 月 13 日
18	长信基金管理有限责任公司关于变更旗下基金所持停牌股票估值方法的提示性公告	上证报、中证报、 证券时报	2016 年 4 月 15 日
19	长信利息收益开放式证券投资基金 2016 年第 1 季度报告	上证报、证券日 报	2016 年 4 月 21 日
20	长信基金管理有限责任公司关于长信利息收益开放式证券投资基金暂停申购和转换转入业务的公告	上证报、证券日 报	2016 年 4 月 26 日
21	长信利息收益开放式证券投资基金更新的招募说明书（2016 年第【1】号）及摘要	上证报、证券日 报	2016 年 4 月 29 日
22	长信基金管理有限责任公司关于网上直销支付宝渠道关闭基金支付服务的公告	上证报、中证报、 证券时报	2016 年 5 月 5 日
23	长信基金管理有限责任公司关于调整长信利息收益开放式证券投资基金机构客户最低持有份额数额限制的公告	上证报、证券日 报	2016 年 5 月 10 日
24	长信基金管理有限责任公司关于增加上海凯石财富基金销售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、中证报、 证券时报、证券 日报	2016 年 5 月 11 日
25	长信基金管理有限责任公司关于变更旗下基金所持停牌股票估值方法的提示性公告	上证报、中证报、 证券时报	2016 年 5 月 14 日
26	长信基金管理有限责任公司关于变更旗下基金所持停牌股票估值方法的提示性公告	上证报、中证报、 证券时报	2016 年 5 月 31 日
27	长信基金管理有限责任公司关于基金行业高级管理人员变更公告	上证报、中证报、 证券时报	2016 年 6 月 3 日
28	长信基金管理有限责任公司关于长信利息收益开放式证券投资基金暂停申购和转换转入业务的公告	上证报、证券日 报	2016 年 6 月 3 日
29	长信基金管理有限责任公司关于变更旗下基金所持停牌股票估值方法的提示性公告	上证报、中证报、 证券时报	2016 年 6 月 3 日
30	长信基金管理有限责任公司关于变更旗下基金所持停牌股票估值方法的提示性公告	上证报、中证报、 证券时报	2016 年 6 月 14 日
31	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金在上海陆金所资产管理有限公司开通定期定额投资业务并参加定投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	2016 年 6 月 16 日
32	长信基金管理有限责任公司关于变更旗下基金所持停牌股票估值方法的提示性公告	上证报、中证报、 证券时报	2016 年 6 月 16 日
33	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分开	上证报、中证报、	2016 年 6 月 28 日

	放式基金参加交通银行股份有限公司网上银行、手机银行基金申购费率优惠活动的公告	证券时报	
34	长信基金管理有限责任公司关于增加上海利得基金销售有限公司为旗下部分开放式基金代销机构及参加认购、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	2016 年 7 月 5 日
35	长信基金管理有限责任公司关于变更旗下基金所持停牌股票估值方法的提示性公告	上证报、中证报、 证券时报	2016 年 7 月 5 日
36	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式证券投资基金参加诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司认购、申购（含定期定额投资申购）费率优惠活动的公告	上证报、中证报、 证券时报	2016 年 7 月 12 日
37	长信基金管理有限责任公司关于变更旗下基金所持停牌股票估值方法的提示性公告	上证报、中证报、 证券时报	2016 年 7 月 13 日
38	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式证券投资基金参加和讯信息科技有限公司申购费率优惠活动的公告	上证报、中证报、 证券时报	2016 年 7 月 18 日
39	长信利息收益开放式证券投资基金 2016 年第 2 季度报告	上证报、证券日 报	2016 年 7 月 20 日
40	长信基金管理有限责任公司关于变更旗下基金所持停牌股票估值方法的提示性公告	上证报、中证报、 证券时报	2016 年 7 月 27 日
41	长信基金管理有限责任公司关于变更旗下基金所持停牌股票估值方法的提示性公告	上证报、中证报、 证券时报	2016 年 7 月 28 日
42	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式证券投资基金参加广发证券股份有限公司申购（含定期定额投资申购）费率优惠活动的公告	上证报、中证报、 证券时报	2016 年 7 月 28 日
43	长信基金管理有限责任公司关于基金行业高级管理人员变更公告	上证报、中证报、 证券时报	2016 年 7 月 30 日
44	长信基金管理有限责任公司关于增加珠海盈米财富管理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、中证报、 证券时报、证券 日报	2016 年 8 月 18 日
45	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杭州银行股份有限公司网上银行、手机银行等渠道基金申购（含定期定额投资申购）费率优惠活动的公告	上证报、中证报 证券时报、证券 日报	2016 年 8 月 24 日
46	长信利息收益开放式证券投资基金 2016 年半年度报告及摘要	上证报、证券日 报、公司网站	2016 年 8 月 26 日
47	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式证券投资基金参加长江证券股份有限公司申购（含定期定额投资申购）费率优惠的公告	上证报、中证报、 证券时报、证券 日报	2016 年 9 月 1 日

48	长信基金管理有限责任公司关于长信利息收益开放式证券投资基金暂停申购和转换转入业务的公告	上证报、证券日报	2016年9月9日
49	长信基金管理有限责任公司关于增加北京汇成基金销售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认购、申购（含定投申购）费率优惠活动的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2016年9月12日
50	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金参加交通银行股份有限公司手机银行基金申购（含定期定额投资申购）费率优惠活动的公告	上证报、中证报、证券时报	2016年9月20日
51	长信基金管理有限责任公司关于长信利息收益开放式证券投资基金暂停申购和转换转入业务的公告	上证报、证券日报	2016年9月27日
52	长信基金管理有限责任公司关于变更旗下基金所持停牌股票估值方法的提示性公告	上证报、中证报、证券时报	2016年10月14日
53	长信基金管理有限责任公司关于变更旗下基金所持停牌股票估值方法的提示性公告	上证报、中证报、证券时报	2016年10月19日
54	长信利息收益开放式证券投资基金 2016 年第 3 季度报告	上证报、证券日报	2016年10月24日
55	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招商证券股份有限公司基金申购（含定期定额投资申购）费率优惠活动的公告	上证报、中证报、证券时报	2016年10月27日
56	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浙江同花顺基金销售有限公司基金认购、申购（含定期定额投资申购）费率优惠活动的公告	上证报、中证报、证券时报	2016年10月27日
57	长信利息收益开放式证券投资基金更新的招募说明书（2016年第【2】号）及摘要	上证报、证券日报	2016年11月2日
58	长信基金管理有限责任公司关于变更旗下基金所持停牌股票估值方法的提示性公告	上证报、中证报、证券时报	2016年11月15日
59	长信基金管理有限责任公司关于 2016 年公司董事变更的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2016年11月23日
60	长信基金管理有限责任公司关于变更旗下基金所持停牌股票估值方法的提示性公告	上证报、中证报、证券时报	2016年11月23日
61	长信基金管理有限责任公司关于基金行业高级管理人员变更公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2016年11月24日
62	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	上证报、中证报、证券时报	2016年11月29日

	惠活动的公告		
63	长信基金管理有限公司关于调整旗下开放式基金在蚂蚁金融服务集团销售平台申购金额下限的公告	上证报、中证报、 证券时报	2016 年 12 月 1 日
64	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金参加中国银河证券股份有限公司基金申购（含定期定额投资申购）费率优惠活动的公告	上证报、中证报、 证券时报	2016 年 12 月 6 日
65	长信基金管理有限责任公司关于变更旗下基金所持停牌股票估值方法的提示性公告	上证报、中证报、 证券时报	2016 年 12 月 6 日
66	长信基金管理有限责任公司关于变更旗下基金所持停牌股票估值方法的提示性公告	上证报、中证报、 证券时报	2016 年 12 月 17 日
67	长信基金管理有限责任公司关于旗下基金所持证券调整估值价的公告	上证报、中证报、 证券时报	2016 年 12 月 20 日
68	长信基金管理有限责任公司关于董事变更的公告	上证报、中证报、 证券时报	2016 年 12 月 21 日
69	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金参加交通银行股份有限公司手机银行基金申购（含定期定额投资申购）费率优惠活动的公告	上证报、中证报、 证券时报	2016 年 12 月 22 日
70	长信基金管理有限责任公司关于基金行业高级管理人员变更公告	上证报、中证报、 证券时报	2016 年 12 月 27 日
71	长信基金管理有限责任公司关于长信利息收益开放式证券投资基金暂停申购和转换转入业务的公告	上证报、证券日 报	2016 年 12 月 27 日
72	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分基金参加中国工商银行股份有限公司定期定额投资申购费率优惠活动的公告	上证报、中证报、 证券时报	2016 年 12 月 29 日
73	长信基金管理有限责任公司关于旗下基金参加中国农业银行股份有限公司基金及基金组合申购（含定期定额投资申购）费率优惠活动的公告	上证报、中证报、 证券时报	2016 年 12 月 29 日
74	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、证券日 报	2016 年 12 月 30 日
75	长信基金管理有限责任公司关于旗下基金所持证券调整估值价的公告	上证报、中证报、 证券时报	2016 年 12 月 30 日

§ 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。

§ 13 备查文件目录

13.1 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。

13.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

13.3 查阅方式

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

长信基金管理有限责任公司

2017年3月27日