

长信利息收益开放式证券投资基金 2021 年年度报告

2021 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：2022 年 3 月 31 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“农业银行”，下同）根据本基金基金合同的规定，于 2022 年 3 月 29 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 2021 年 1 月 1 日起至 2021 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	7
2.1 基金基本情况.....	7
2.2 基金产品说明.....	7
2.3 基金管理人和基金托管人.....	8
2.4 信息披露方式.....	8
2.5 其他相关资料.....	8
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	9
3.1 主要会计数据和财务指标.....	9
3.2 基金净值表现.....	11
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	13
§4 管理人报告	15
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	15
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	17
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	18
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.....	19
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	19
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	19
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	20
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	21
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.....	21
§5 托管人报告	22
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	22
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.....	22
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.....	22
§6 审计报告	23
6.1 审计报告基本信息.....	23
6.2 审计报告的基本内容.....	23
§7 年度财务报表	25
7.1 资产负债表.....	25
7.2 利润表.....	26
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	27
7.4 报表附注.....	28
§8 投资组合报告	55
8.1 期末基金资产组合情况.....	55
8.2 债券回购融资情况.....	55
8.3 基金投资组合平均 期限.....	55
8.4 报告期内投资组合平均 存 期 过 240 情况说明.....	56
8.5 期末 债券品 分 的 债券投资组合.....	56
8.6 期末 本 基金资产净值 大 序 的前 债券投资明细.....	57

8.7 “定”“本法”确定的基金资产净值的	57
8.8 期末本基金资产净值大序的所有资产持证券投资明细	57
8.9 投资组合报告附注	57
§9 基金份额持有人信息	62
9.1 期末基金份额持有人数及持有人	62
9.2 期末货币市场基金前份持有人情况	62
9.3 期末基金管理人的业人持有本基金的情况	63
9.4 期末基金管理人的业人持有本开放式基金份额的情况	63
§10 开放式基金份额变动	64
§11 重大事示	65
11.1 基金份额持有人大会决	65
11.2 基金管理人、基金托管人的专基金托管部的重大人事变动	65
11.3 及基金管理人、基金财产、基金托管业务的	65
11.4 基金投资策略的变	65
11.5 基金行审计的会计事务所情况	65
11.6 管理人、托管人及其管理人稽或等情况	65
11.7 基金用证券公司交易的有关情况	65
11.8 度对值过 0.5%的情况	66
11.9 其他重大事	67
§12 投资者决策的其他重要信息	71
12.1 报告期内一投资者持有基金份额或过 20%的情况	71
12.2 投资者决策的其他重要信息	71
§13 目录	72
13.1 目录	72
13.2 存放	72
13.3 阅方式	72

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金 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	19999	
基金运作方式	开放式	
基金合同 日	200 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	3 1 9 9 2 1 份	
基金合同存 期	不定期	
下 分 基金的基金简称:	长信利息收益货币 A	长信利息收益货币
下 分 基金的场内简称:	利息 A	利息
下 分 基金的交易代 :	19999	1999
报告期末下 分 基金的份	3 0 33 份	1 9 3 份

注：1、本基金于 2010 年 11 月 2 日起实行 务 分 收 方式，根据投资者持有本基金的份 分 A、等 ，并 用不同的 务 。 见 2010 年 11 月 20 日 长信基金管理有限责任公司关于 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 过上 证券交易所场内 理 购、 回业务，本基金 A、等 基金份 在上 证券交易所场内 购 回的基金代 分别 19 99、19 9 ，其对应的 购 回的基金简称 “利息 A”、“利息 ”。

2.2 基金产品说明

投资目标	在尽 保证基金资产 和 动性的基 上， 过银行存 利的收益 平。
投资策略	<p>1、利 预期策略 过对宏观经济、货币 策、 期资金 等的分 ，形 对利 走势的 ，并确定投资组合的平均 期限。</p> <p>2、资产配 策略 根据对市场利 走势的 ， 合 品 之 动性、收益性及风险情况，确定组合的资产配 ，在保证组合 动性、 风险的前提下尽 提 组合的收益。</p> <p>3、 风险 利策略 由于市场分 ， 银行 市场 交易所市场的资金 和市场 期利 在一定 存在定 。同 在一定 内市场中 出现 品 、 期限 利 会。本基金 在 分 证 利的 行性基 上 。</p> <p>、现金 预算管理策略 过对未来现金 的预 ，在投资组合的 中，合理的期限和权重配 对现金 行预算管理，以 基金运作的要 。同 在一部分资金管理上， 用 动投资策略，以提 基金资产的动性。</p>

业绩 基准	银行 期存 利 ()
风险收益	本基金 货币市场基金，其预期收益和预期风险 平 于债券 、 合和股 基金， 于预期收益和预期风险 的基金品 。

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
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		—
	021 1009999	010 0 00 9
务	00 00	9 99
真	021 1009 00	010 121 1
注	中国 (上) 自由 易 银 中 9	市 国 内大 9
公	上 市 新 银 中 9	市 复 内大 2 中 9
	200120	100031
法定代表人		

2.4 信息披露方式

本基金 定的信息披露报 称	上 证券报
载基金年度报告 的管理人	
基金年度报告	上 市 新 银 中 9 、 市 复 内大 2 中 9

2.5 其他相关资料

项目	称	公
会计 事务所	明会计 事务所 (合)	上 市 新 大 100 0
注 记	: 中国证 券 记 算有 限责任公司、 : 长信基金 管理有限责任公司	: 市 平 大 1 、 : 上 市 新 银 中 9

§ 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 币

3.1 .1 期 数 据 和 指 标	2021 年		2020 年		2019 年	
	长信利息收益 货币 A	长信利息收 益货币	长信利息收益 货币 A	长信利息收 益货币	长信利息收益 货币 A	长信利息收 益货币
本 期 已 实 现 收 益	1 231 1	3 3	0 32 3 00	1 112 9 20	2 9 9 3	9 2 90 2
本 期 利 润	1 231 1	3 3	0 32 3 00	1 112 9 20	2 9 9 3	9 2 90 2
本 期 净 值 收 益	2 1 1	2 093	2 0 29	2 31 9	2 2	2 9
3.1 .2 期 末 数 据 和 指 标	2021 年末		2020 年末		2019 年末	
期 末	3 0 33	1 9 3	23 0 130 3 33	9 201 1 9	1 9 221 2 9	9 1 2

基金资产净值						
期末基金份额净值	1 0000	1 0000	1 0000	1 0000	1 0000	1 0000
3.1.3 计期末指标	2021 年末		2020 年末		2019 年末	
计净值收益	112	1 9	1	2 10	1 2 0	39 291

注：1、自 201 年 1 月 1 日起，本基金收益分配 整 日分配、 日 。

2、本期已实现收益指基金本期利息收 、投资收益、其他收 （不 公 值变动收益）相关 用 的 ，本期利润 本期已实现收益 上本期公 值变动收益，由于货币市场基金 用 本法核算， ，公 值变动收益 ，本期已实现收益和本期利润的金 相等。

3、所述基金业绩指标不 持有人 购或交易基金的 项 用（ ， 式基金交易 金、开放式基金的 购 回 、 利 投资 、基金 等），计 用 实 收益 平要 于所 数字。

、本基金于 2010 年 11 月 2 日起实行 务 分 收 方式，根据投资者持有本基金的份 分 A、 等 ，并 用不同的 务 ，分 的 基金份 2010 年 11 月 2 日起 基金收益。

、主要会计数据和财务指标中 A 基金 分 前 计算， 本基金分 前的数据 部

A 基金核算， 基金自 2010 年 11 月 2 日起开 计算。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额 净值收益 及其 同期业绩 基准收益 的

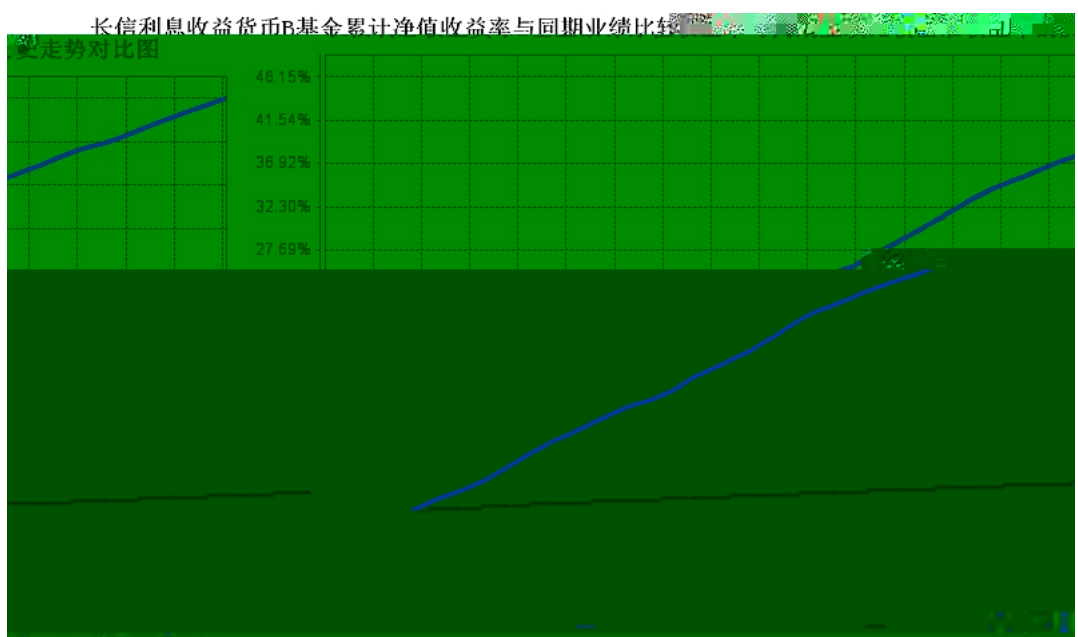
长信利息收益货币 A

	份 净值 收益	份 净值收 益 标准	业绩 基准收益	业绩 基 准收益 标准		
过去三个月	0 310	0 000	0 0 9	0 0000	0 1	0 000
过去 个月	1 03 1	0 000	0 1 90	0 0000	0 1	0 000
过去一年	2 1 1	0 0009	0 3	0 0000	1 0	0 0009
过去三年	11	0 001	1 0 12	0 0000	02	0 001
过去 年	1 02	0 002	1 911	0 0000	12 91	0 002
自基金合同 起至	112	0 00 1	20 1 2	0 0032	930	0 0029

长信利息收益货币

	份 净值 收益	份 净值收 益 标准	业绩 基准收益	业绩 基 准收益 标准		
过去三个月	0 91	0 000	0 0 9	0 0000	0 023	0 000
过去 个月	1 1 9	0 000	0 1 90	0 0000	0 9 0	0 000
过去一年	2 093	0 0009	0 3	0 0000	2 0 3	0 0009
过去三年		0 001	1 0 12	0 0000		0 001
过去 年	1 32	0 002	1 911	0 0000	13 9 21	0 002
自基金合同 起至	1 9	0 003	2212	0 0001	1 92	0 003

3.2.2 自基金合同 以来基金份 计净值收益 变动及其 同期业绩 基准收 益 变动的

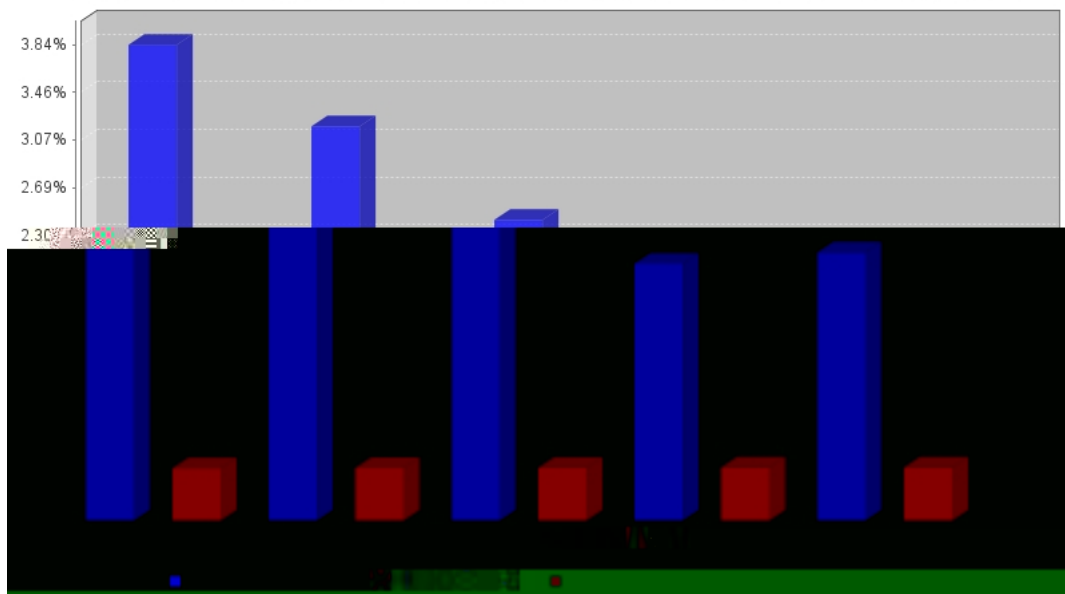


注：1、长信利息收益货币 A 示日期 200 年 3 月 19 日至 2021 年 12 月 31 日，长信利息收益货币 示日期 2010 年 11 月 2 日（本基金分 日）至 2021 年 12 月 31 日。

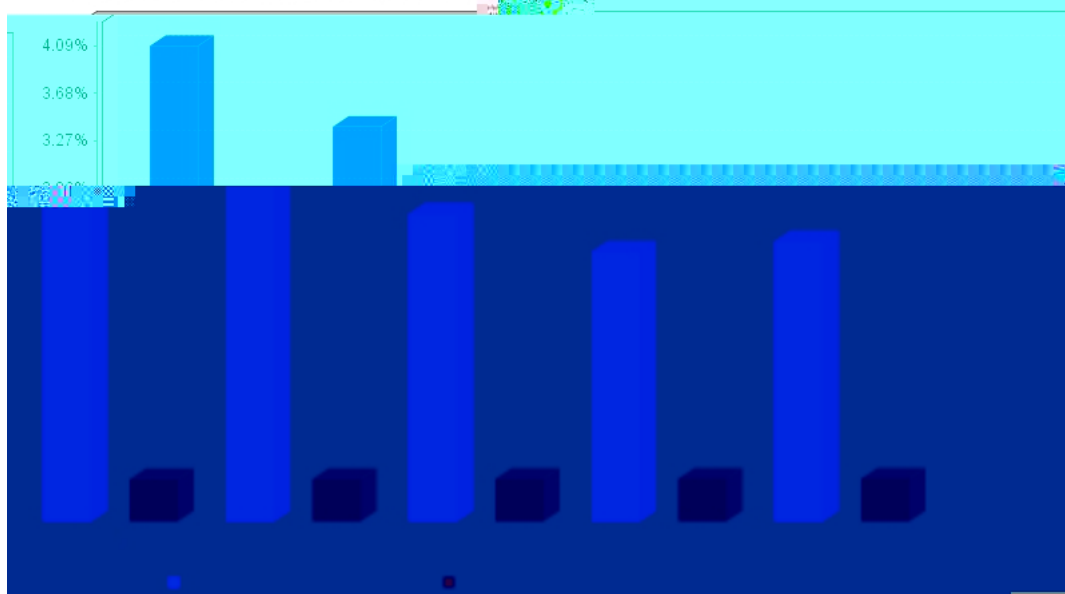
2、基金合同规定，本基金自合同 日起 3 个月内 期。 期 ，本基金的项投资 已 合基金合同的 定。

3.2.3 过去 年基金 年净值收益 及其 同期业绩 基准收益 的

长信利息收益货币A过去五年基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



长信利息收益货币B过去五年基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

：人 币

长信利息收益货币 A					
年度	已 投资形式 实收基金	过应 回 出金	应 利润 本年变动	年度利润 分配合计	注
2021	1 12 9 2 0	21 3 2	9 921 32	1 231 1	
2020	0 29 1	1 9 22	23 09 93	0 32 3 00	
2019	2 3 12 12 0	2 12 9	931 9 0	2 9 9 3	

合计	1 3 2 20 1 00	1 2	1 9 1	1 3 33 92 0	
----	---------------	-----	-------	-------------	--

：人 币

长信利息收益货币					
年度	已 投资形式 实收基金	过应 回 出金	应 利润 本年变动	年度利润 分配合计	注
2021	3 00 9	0 9	2 12 2	3 3	
2020	1 0 9 30	293	1 3	1 112 9 20	
2019	90 102 0 2	1 2 309 03	1 30 11	9 2 90 2	
合计	1 3 1	1 3 0 3 3	1 03 2	1 3 1 2 12	

注：本基金本报告期内 行的利润分配情况， 见 。

§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

长信基金管理有限责任公司 经中国证监会证监基金字〔2003〕3 号 准，由长 证券股份
 份有限公司、上 证券股份有限公司、 证券股份有限公司共同发起 立。注 资本 1
 人 币。目前股权 ；长 证券股份有限公司 、上 证券股份有限公司
 31.21%、 有限公司 11.11%、上 投资管理中 （有限合 ） 、上
 投资管理中 （有限合 ） 。

至 2021 年 12 月 31 日，本基金管理人共管理 2 开放式基金， 长信利息收益开放式证
 券投资基金、长信银利 合 证券投资基金、长信金利 势 合 证券投资基金、长信 利
 动 策略 合 证券投资基金、长信利 债券 证券投资基金、长信 利 势 合 证券投资基
 金、长信 合 证券投资基金、长信 国标准 100 等权重指数 证券投资基金、
 长信利 债券 证券投资基金 、长信内 长 合 证券投资基金、长信 债债券 证
 券投资基金、长信利 债券 证券投资基金 、长信 债一年定期开放债券 证券投资基
 金、长信 债 债券 证券投资基金、长信 利 配 合 证券投资基金、长信 中
 股 证券投资基金、长信新利 配 合 证券投资基金、长信利 债券 证券投资基金、
 长信利盈 配 合 证券投资基金、长信利 配 合 证券投资基金、长信 利
 配 合 证券投资基金、长信 配 合 证券投资基金、长信 策略股 证
 券投资基金、长信 保 行业 配 合 证券投资基金（ ）、长信 债一年定期开放
 债券 证券投资基金、长信 债一年定期开放债券 证券投资基金、长信利保债券 证
 券投资基金、长信金 债一年定期开放债券 证券投资基金、长信 债一年定期开放债券 证
 券投资基金、长信利 配 合 证券投资基金、长信利发债券 证券投资基金、长信
 信息行业 配 合 证券投资基金、长信 平 债一年定期开放债券 证券投资基金、
 长信 利 年定期开放 合 证券投资基金、长信 新 动股 证券投资基金、长信 益 债
 债券 证券投资基金、长信利信 配 合 证券投资基金、长信 债债券 证
 券投资基金、长信国 工 配 合 证券投资基金、长信 债券 证券投资基金、长信 势
 债债券 证券投资基金、长信中证 00 指数 证券投资基金、长信长金 货币市场基金、
 长信 三个月定期开放债券 发起式证券投资基金、长信 保行业 股 证
 券投资基金、长信利 一年定期开放 合 证券投资基金、长信 信 配 合 证
 券投资基金、长信 债券证券投资基金、长信 三个月定期开放债券 发起式证
 券投资基金、长信 年定

期开放 配 合 证券投资基金、长信 行业 股 证券投资基金、长信 业
 年定期开放 配 合 证券投资基金、长信 值 动 合 证券投资基金、长信
 值 年定期开放 配 合 证券投资基金、长信 三个月定期开放债券 发起式证券
 投资基金、长信 资产配 合 基金中基金（ ）、长信 值 合 证券投资基金、长
 信利 债债券 证券投资基金、长信 300 指数 证券投资基金、长信 债 年定期
 开放债券 证券投资基金、长信合利 合 证券投资基金、长信 利 合 证券投资基金、
 长信 年定期开放债券 证券投资基金、长信 平 目标三年持有期 合 基金中基
 金（ ）、长信易 合 证券投资基金、长信中证 债及 交 债券 0 指数证券投资基金、
 长信 合 证券投资基金、长信中债 1 3 年 策性金融债指数证券投资基金、长信
 合 证券投资基金、长信 个月定期开放债券 证券投资基金、长信 利资产配 一年持
 有期 合 基金中基金（ ）、长信 利 收益 合 证券投资基金、长信 合 证
 券投资基金、长信 业 一年持有期 配 合 证券投资基金、长信 均 个月持有
 期 合 证券投资基金、长信 业 合 证券投资基金、长信内 均 合 证券投资基金、
 长信 30 动持有 债债券 证券投资基金、长信 债券 证券投资基金、长信 债券 证
 券投资基金、长信 三个月持有期 合 证券投资基金、长信 和平 目标三年持有
 期 合 基金中基金（ ）。

4.1.2 基金经理（或基金经理 组）及基金经理 理简介

	务	任本基金的基金经理 (理) 期限		证券 业年 限	说明
		任 日期	任日期		
	长信利息收益 开放式证券投 资基金、长信易 合 证券 投资基金、长信 债债券 证券投资基金 、长信长金 货币市场基金、 长信 三个 月定期开放债 券 发起式证 券投资基金、长 信 年定 期开放债券	201 年 12 月 30 日		11 年	管理 ， 业于上 交 大 ， 2010 年 月 长信基金管理有限责任 公司， 任基金事务部基 金会计， 交易管理部债券 交易 、 交易主管， 债券 交易部 监、 监、长信 三个月定期开放债 券 发起式证券投资基金、 长信 债 年债券 证券 投资基金和长信 三个 月定期开放债券 发起式 证券投资基金的基金经理。 现任现金理财部 监、长 信利息收益开放式证券投

	证券投资基金、长信中债 1 3 年 策性金融债指数证券投资基金、长信 个月定期开放债券 证券投资基金和长信 债券 证券投资基金的基金经理、现金理财部 监				资基金、长信易 合 证券投资基金、长信 债债券 证券投资基金、长信长金 货币市场基金、长信 三个月定期开放债券 发起式证券投资基金、长信 年定期开放债券 证券投资基金、长信中债 1 3 年 策性金融债指数证券投资基金、长信 个月定期开放债券 证券投资基金和长信 债券 证券投资基金的基金经理。
	任本基金的 基金经理	2019 年 11 月 29 日	2021 年 月 1 日	年	任本基金的基金经理
	长信利息收益 开放式证券投资基金的基金经理	2021 年 10 月 2 日		年	大 金融 业， 有基金 业资 。 任 于 发银行股份有限公司金融市场部， 事债券 相关投资和交易工作， 2021 年 月 长信基金 管理有限责任公司，现 担任长信利息收益开放式 证券投资基金的基金经理。

注：1、 任基金经理任 日期以本基金 立之日 准 新 或变更基金经理的日期根据对 披露 的公告日期

2、证券 业的 遵 证券业 业人 资 管理法 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， 遵守了 中 人 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 基金份 持有人 利益，不存在 基金份 持有人利 益的行 。

本基金 以 信于市场、 信于 会投资公 ，承诺 一 往 本 诚实信用、 勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，在规 基金运作和 投资风险的前提下， 基 金份 持有人 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 度和 方法

1、所有投资对 的投资指 经由交易部 监或其 权人审核分配至交易人 行。
行投资指 分配的人 保证投资指 公平对 。

2、公司 用的交易 行 下 ；

(1) 序发送 托指

(2)对于 个投资组合在同一 同一证券下 的相同方 的投资指 ，并 市 在限
内的， 自动 交易 对 证券下 的 托自动 指 数 分 投资组
合的 托指 。对于不同投资组合 不同投资经理 对交易所同一证券的同一方 交易指 ，
指 数 : 1 或以上的,根据市场情况审核 过人工分发 不同交易 公平交易。

3、交易人 对于 收 的交易指 、 的 序 行。在 行 个投资组
合在同一 同一证券下 的相同方 的交易所投资指 ， 度规定的 指 ，
已 开 公平交易开关。

、对于不同投资组合均 行债券一 市场 购、 公开发股 购等 中 交易的投
资对 ，交易部 独立 收 投资组合的投资指 ，在 购 产 前，不 以任 形
式 任 人 露 投资指 的内容， 指 及数 等要 。

、对于 投资组合以独立 行 购的投资对 ， 经过公平性审核的 指 ，
购 配的证券数 由投资管理 收 证券 记 算 发送的数据 行分配。交易部
根据证券发行人在指定公开披露 上披露的 购 对 内分配数 行核准,数 不 的,
应 第一 告 投资管理部 的 监及监察稽核部 监。对于以公司 行 购的投资对
，公司在 配 度确定 ， 的原则在 投资组合 行分配。 购 相同
的投资组合则根据投资指 的数 行分配。确 原 不 上述原则 行分配的，
应 动 交易 别 程,审核 过的， 以 行相应分配。

4.3.2 公平交易 度的 行情况

本报告期内，公司已实行公平交易 度，并 立公平交易 度 ， 已 立投资决策 ，
交易 行 的内部 ，并 过工作 度、 程和 保证公平交易原则的实现。同
，公司已 过对投资交易行 的监 、分 估和信息披露来 对公平交易过程和 的监
。

4.3.3 交易行 的专项说明

本报告期内， 完 有关指数的 行投资的组合 ，其 投资组合未发

交易所公开 同日 交易 交 的 交易 过 证券 日 交 的 的情形，未发现 交易行 。同 ，对本年度同 交易 行专项分 ，未发现 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

回 2021 年，开年利 下行至 ，一月中资金收 ，利 开 一个月的上行， 资金回 平 ，上 年市场 ，但在 的 配 下利 下行 30 月 预期 准，利 在一个月 下行 20 9 月 ，但长 整有限，整 平 10 月利 上行 10 11 12 月上 资 品 ，资金 ，中 经济工作会 对经济定 ，提出“三重 ”， 准 ， 一 带动利 下行。

报告期内，本基金在保持 动性和 风险的基 上， 资金 变 、 行宏观形势 ， 整组合 期和 ， 年基本保持 的策略， 配 ， 持 了 的整 组合收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

至 2021 年 12 月 31 日，本报告期内长信利息收益货币 A 净值收益 2 1 1 ，长信利息收益货币 净值收益 2 093 ，同期业绩 基准收益 0 3 。

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 2022 年， ，发 国 息 ，对 产 一定 ，国内经济工作 “ 字 、 中 ”， 长 工作重 。货币 策 会 度、保持 动性合理 ，但经过 准、一 息 观察期， 策 前的 货币 信用， 更 对实 的 持 度 性、产业性 策，目前已在 平的宏观 信用 出行 。 基本 的观察重 在基 、 业、 出 和 产。2022 年基本 的复 情况 利 走势的关 。

上所述，本基金 保持中性 和 期 平， 关注经济基本 和资金 的变 ，对组 合 行 整。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本年度内，本基金管理人 遵守 证券投资基金法 及配 法律法规， 以合规运作、

风险核，以基金持有人利益，保证基金合同行。公司监察稽核部独立开展工作，对基金运作行事前、事中事的监，发现及提出并业务部行整，同定期公司董事会和公司管理出监察稽核报告。

本年度内，确保监管要的有实，公司监察稽核部根据项法律法规监管策性要以及公司内部行情况，开展公司业务程及风险理的工作，组开内部会会，对项监管要行读，并对业务部业务程及度规的整行，对关业务合规导及工作。

本年度内，监察稽核部以组合主要方式，定期对投资组合的风险况行，对投资组合整动性情况行分，并业务部的会项的风险行、，组合风险事发。

本基金管理人承诺一向本诚实信用、勤勉尽责的原则，持风、内的理，不提内部监察稽核工作的性和实性、并完内部，项内工作，和 risk 风险，确保基金资产的规运作，分保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

本基金管理人业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的一，对基金持有的投资品行估值。基金托管人根据法律法规要对基金管理公司用的估值策和程序行核，并对估值及净值计算行复核。

根据相关法律法规，本基金管理人了、有的估值策和估值程序，立了估值会，估值会公司基金估值的主要决策，其主要责负责定公司的估值策、估值方法及用的估值程序和，对公司现有程序和行复核和审阅，发了估值程序和的有性及用性的情况及估值程序估值会由基金事务部、投资、交易等相关业务部负责人以及基金事务部至一业务共同组，相关人有证券行业工作经，相关法规和估值方法，均估值业务所的专业任。对于基金的估值策和估值原则，公司已基金托管人分，并一意见。审计本基金的会计事务所公司基金估值策和程序的性。

本基金管理人已中国债记算有限责任公司及中证指数有限公司签务，由其定分别提银行同业市场及交易所交易的债券品的估值数据以及限股的估值程方不存在任重大利益。

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，本基金根据 日收益情况 日收益 部分配， 日收益分配 100。基金收益分配 用 利 投资分 方式， 日分配、 日 ，投资者 过 回基金份 方式 现金 利收益。本报告期，本基金应分配利润 22 9 92 20 ，已分配利润 22 9 92 20 。

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

。

§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 遵守 中 人 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 的 定，对本基金基金管理人长信基金管理有限责任公司2021年1月1日至2021年12月31日基金的投资运作， 行了 真、独立的会计核算和 要的投资监 ， 真 行了托管人的 务， 有 事任 基金份 持有人利益的行 。

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 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 购 回 的计算、基金 用开 及利润分配等 上，不存在 基金份 持有人利益的行 在报告期内， 遵守了 中 人 共和国证券投资基金法 等有关法律法规，在重要方 的运作 基金合同的规定 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 ，长信基金管理有限责任公司的信息披露事务 合 公开募 证券投资基金信息披露管理 法 及其他相关法律法规的规定，基金管理人所 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 基金持有人利益的行 。

§6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表	经过审计	
审计意见		标准 保 意见
审计报告		明（2022）审字第 1399 3 01

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标	审计报告
审计报告收 人	长信利息收益开放式证券投资基金 基金份 持有人
审计意见	<p>审计了长信利息收益开放式证券投资基金的财务报表，2021 年 12 月 31 日的资产负债表，2021 年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>， 附的长信利息收益开放式证券投资基金的财务报表在所有重大方 业会计准则的规定 ，公 了长信利息收益开放式证券投资基金 2021 年 12 月 31 日的财务 况以及 2021 年度的经 和净值变动情况。</p>
形 审计意见的基	<p>中国注 会计 审计准则的规定 行了审计工作。审计报告的“注 会计 对财务报表审计的责任”部分 一 述了在 准则下的责任。 中国注 会计 业 守则， 独 立于长信利息收益开放式证券投资基金，并 行了 业 方的其他责任。 相信， 的审计证据 分、 的， 发表审计意见提 了基 。</p>
事项	
其他事项	
其他信息	<p>长信利息收益开放式证券投资基金管理 对其他信息负责。其他信息 年度报告中 的信息，但不 财务报表和 的审计报告。</p> <p>对财务报表发表的审计意见不 其他信息， 不对其他信息发表任 形式的 证 。</p> <p>合 对财务报表的审计， 的责任 阅读其他信息，在 过程中， 其他信息 财务报表或 在审计过程中了 的情况存在重大不一 或者 存在重大 报。</p> <p>基于 已 行的工作， 确定其他信息存在重大 报， 应 报告 事实。在 方 ， 任 事项 要报告。</p>
管理 和 理 对财务报表的 责任	<p>管理 负责 业会计准则的规定 财务报表， 其实现公 ，并 计、 行和 要的内部 ，以 财务报表不存在由于 或 误导 的重大 报。</p> <p>在 财务报表 ，管理 负责 估长信利息收益开放式证券投资基金的持 经 ，披露 持 经 相关的事项（ 用），并运用持 经 假 ， 计 行 算、 止运 或别 其他现实</p>

	<p>的。</p> <p>理 负责监 长信利息收益开放式证券投资基金的财务报告过程。</p>
注 会计 对财务报表审计的责任	<p>的目标 对财务报表整 不存在由于 或 误导 的重大 报 合理保证,并出 审计意见的审计报告。合理保证 平的保证,但并不 保证 审计准则 行的审计在一 重大 报存在 发现。 报 由于 或 误导 , 合理预期 报 独或 起来 财务报表 用者 据财务报表作出的经济决策,则 报 重大的。</p> <p>在 审计准则 行审计工作的过程中, 运用 业 , 并保持 业 。同 , 行以下工作:</p> <p>1 别和 估由于 或 误导 的财务报表重大 报风险, 计和实 审计程序以应对 风险,并 分、 的审计证据, 作 发表审计意见的基 。由于 及 、 、 意遗漏、虚假陈述或 于内部 之上,未 发现由于 导 的重大 报的风险 于未 发现由于 误导 的重大 报的风险。</p> <p>2 了 审计相关的内部 , 以 计 的审计程序, 但目的 并对内部 的有 性发表意见。</p> <p>3 管理 用会计 策的 性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>对管理 用持 经 假 的 性出 。同 , 根据 的审计证据, 导 对长信利息收益开放式证券投资基金持 经 产 重大 的事项或情况 存在重大不确定性 出 。 出 存在重大不确定性, 审计准则要 在审计报告中提 报表 用者注意财务报表中的相关披露 披露不 分, 应 发表 保 意见。 的 基于 至 审计报告日 的信息。 , 未来的事项或情况 导 长信 利息收益开放式证券投资基金不 持 经 。</p> <p>财务报表的 报(披露)、 和内容, 并 财 务报表 公 相关交易和事项。</p> <p>理 计 的审计 、 和重大审计发现等事项 行 , 在审计中 别出的值 关注的内部 。</p>
会计 事务所的 称	明会计 事务所(合)
注 会计 的	
会计 事务所的	市 长 1 方 场 大 1
审计报告日期	2022 年 3 月 2 日

§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 止日：2021 年 12 月 31 日

：人 币

资 产	附注	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存	7.4.7.1	22 02 112 31	1 1 3 3 9 3
算 金		1 21	300 000 00
存出保证金		32 1 1	300 000 00
交易性金融资产	7.4.7.2	1 310 2 2 9	11 9 9 100 2 9 99
其中：股 投资			
基金投资			
债券投资		1 310 2 2 9	11 9 9 100 2 9 99
资产 持证券投资			
金 投资			
金融资产	7.4.7.3		
金融资产	7.4.7.4	3 2 992 3 9 9	000 130 0
应收证券 算			
应收利息	7.4.7.5	1 9 99 91 3	1 0 0 09 11
应收股利			
应 收 购			
所 资产			
其他资产	7.4.7.6		
资产 计		2 0 9 33	2 2 0 12 0 13
负债和所有者权益	附注	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
负 债：			
期			
交易性金融负债			
金融负债	7.4.7.3		
出回购金融资产		09 21	1 0 39 39 0
应 证券 算			
应 回		1 0 9	3 1 2
应 管理人报		10 103 3	99 01
应 托管		2 3 11 9	1 9 92
应 务		1 3	10 91 11
应 交易 用	7.4.7.7	2 9	10 3 2
应交		1 332 11	
应 利息		0 2	3 0 99

应 利润		2 13 93	1 11 03 29
所 负债			
其他负债	7.4.7.8	39 000 00	3 09 3
负债合计		3 9 39 92	1 93 22 01
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	3 1 9 9 2 1	2 03 331 9 3 12
未分配利润	7.4.7.10		
所有者权益合计		3 1 9 9 2 1	2 03 331 9 3 12
负债和所有者权益 计		2 0 9 33	2 2 0 12 0 13

注：报告 止日 2021 年 12 月 31 日，长信利息收益货币 A 份 净值 1 0000 ，长信利息收益货币 份 净值 1 0000 ，基金份 3 1 9 9 2 1 份，其中长信利息收益货币 A 份 3 0 33 份 长信利息收益货币 份 1 9 3 份。

7.2 利润表

会计主 ：长信利息收益开放式证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

：人 币

项 目	附注	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度 期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
一、收		1 00 9 13	0 29 32
1.利息收		1 001 3 99 9	9 33 9 9
其中：存 利息收	7.4.7.11	2 00 3	2 932 00 21
债券利息收		09 1 9 199 1	2 03 0 2
资产 持证券利息收			11 0 1 0
金融资产收		1 2 33	2 1 02
证券出 利息收			
其他利息收			
2.投资收益（ 以“-” ）		2 3	1 1 9 3
其中：股 投资收益	7.4.7.12		
基金投资收益			
债券投资收益	7.4.7.13	2 3	1 1 9 3
资产 持证券投资收益	7.4.7.13.5		
金 投资收益	7.4.7.14		
工 收益	7.4.7.15		
股利收益	7.4.7.16		
3.公 值变动收益（ 以“-” ）	7.4.7.17		
4. 收益（ 以“-” ）			

5.其他收 (以“-”)	7.4.7.18		
：二、用		2 9 1 1	1 1 3 2 12
1 管理人报	7.4.10.2.1	11 0 1	1 3 23
2 托管	7.4.10.2.2	2 1 1 20 10	1 2 90
3 务	7.4.10.2.3	3 21 2	9 020 2 92
4 交易用	7.4.7.19		
5 利息出		2 30 3 29	1 0 19 3
其中：出回购金融资产出		2 30 3 29	1 0 19 3
6 金及附		1 20	2 9
7 其他用	7.4.7.20	2 2 1 3 0	313 91
三、利润 (以“ ”)		1 00 9 2	22 9 92 20
：所 用			
、净利润(净以“ ”)		1 00 9 2	22 9 92 20

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主：长信利息收益开放式证券投资基金

本报告期：2021年1月1日至2021年12月31日

：人 币

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期 所有者权益(基金净值)	2 03 331 9 3 12		2 03 331 9 3 12
二、本期经 动产 的基金净值变动数(本期利润)		1 00 9 2	1 00 9 2
三、本期基金份 交易 产的基金净值变动数 (净值以“ ”)	13 9 29		13 9 29
其中：1 基金 购	19 2 92 90		19 2 92 90
2 基金 回	0 0 900 13 1		0 0 900 13 1
、本期 基金份 持 有人分配利润产的基 金净值变动(净值 以“ ”)		1 00 9 2	1 00 9 2
、期末所有者权益(基 金净值)	3 1 9 9 2 1		3 1 9 9 2 1

项目	上年度 期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期 所有者权益（基金净值）	1 1 93 0		1 1 93 0
二、本期经 动产 的基金净值变动数（本期利润）		22 9 92 20	22 9 92 20
三、本期基金份 交易 产的基金净值变动数 （净值 以“ ” ）	393 139 0		393 139 0
其中：1 基金 购	3 1 3 0 0 31 3		3 1 3 0 0 31 3
2 基金 回	3 3 92		3 3 92
、本期 基金份 持 有人分配利润产 的基 金净值变动（净值 以“ ” ）		22 9 92 20	22 9 92 20
、期末所有者权益（基金净值）	2 03 331 9 3 12		2 03 331 9 3 12

报表附注 财务报表的组 部分。

本报告 1 至 财务报表由下 负责人签 ：

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计 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 管理 会（以下简称“中国证监会”）证监 2003 1 9 关于同意 立长信利息收益开放式证券投资基金的 复 的核准，由基金管理人长信基金管理有限责任公司 会公开发行募 ，基金合同于 200 年 3 月 19 日 式 ， 立募 规 0 2 30 9 份基金份额 。本基金 开放式，存 期限不定。本基金的基金管理人 长信基金管理有限责任公司， 的 注 记 长信基金管理有限责任公司， 的注 记 中国证券 记 算有 限责任公司，基金托管人 中国农业银行股份有限公司。

本基金自 2010 年 11 月 2 日起实行 务 分 收 方式， 个基金 保 的本基金份

于 00 份的 A 基金份额的收益，个基金保的本基金份额或过 00 份的基金份额的收益。基金份额独基金代，并独公基金份额基金净收益和日年收益。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基金份额业务的公告，自 2019 年 2 月 2 日起长信利息收益开放式证券投资基金基金份额的业务。个交易保的基金份额计或过 00 份，本基金的注记不 A 基金份额自动基金份额个交易保的基金份额于 00 份，本基金的注记不基金份额自动 A 基金份额。

本基金投资对主要：现金期限在 1 年以内（1 年）的银行存、债券回购、中银行据、同业存期限在 39 以内（39）的债券、金融业债务融资工、资产持证券中国证监会、中国人银行的其他有动性的货币市场工。

本基金业绩基准：银行期存利（）。

7.4.2 会计报表的基

本财务报表财部的业会计准则基本准则以及其及的会计会计准则、应用指、以及其他相关规定（以下合称“业会计准则”），同，对于在会计核算和信息披露方，了中国证券投资基金业会并发发的证券投资基金会计核算业务指、中国证监会定的中国证券监管理会关于证券投资基金估值业务的指导意见、公开募证券投资基金信息披露管理法、证券投资基金信息披露内容式准则第 2 年度报告的内容式、证券投资基金信息披露报规则第 3 会计报表附注的及披露、证券投资基金信息披露报规则第货币市场基金信息披露别规定、证券投资基金信息披露第 3 年度报告和中期报告及其他中国证监会及中国证券投资基金业会的相关规定。

本财务报表以本基金持经基报。

7.4.3 遵业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表合业会计准则的要，真实、完整了本基金于 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经和净值变动情况。

7.4.4 重要会计 策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度 用公 年度， 年自 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记 本 币

本基金记 本 币和 本财务报表所 用的货币均 人 币。 有 别说明 ，均以人 币 表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分

金融工 指形 本基金的金融资产（或负债），并形 其他 的金融负债（或资产）或权益工 的合同。

本基金的金融资产于 确 分 交易性金融资产及 和应收 项。本基金持有的交易性金融资产主要 债券投资等。

本基金的金融负债于 确 分 其他金融负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的 确 、 计 和 止确

本基金于 金融工 合同的一方 确 一项金融资产或金融负债。

本基金的金融资产在 确 以公 值计 。本基金对所持有的债券投资以 本法 行 计 。本会计期 内，本基金持有的债券投资的 本 其公 值。

本基金的金融负债于 确 以公 值计 ，并以 本 行 计 。

收 金融资产现金 的合同权利 止，或 收 金融资产现金 的权利已 ， 合金融资产 的 止确 的，金融资产 止确 。

金融负债的现 务 部或部分已经 的， 金融负债或其一部分 止确

本基金已 金融资产所有权上 所有的风险和报 方的， 止确 金融资产 保 了金融资产所有权上 所有的风险和报 的，不 止确 金融资产。本基金 有

有保 金融资产所有权上 所有的风险和报 的，分别下 情况 理：放 了对 金融资 产的， 止确 金融资产并确 产的资产和负债 未放 对 金融资 产的， 其

所 金融资产的程 度确 有关金融资产，并相应确 有关负债。

本基金主要金融工 的 本计 方法 下：

1 债券投资

银行 同业市场交易的债券于 交日确 债券投资。债券投资 实 的 部 ，其中所 债券起息日或上 息日至购 日止的利息，作 应收利息 独核算，不

债券投资 本，对于 息债券， 等利息应作 债券投资 本 出银行 同业市场交易的债券 于 交日确 债券投资收益。出 债券的 本 动 权平均法 。

2 回购

本基金持有的回购 （ 式回购）以 本 示， 实 利 （ 实 利 合同利 ， 以 用合同利 ）在实 持有期 内 日计提利息。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公 值 指市场 者在计 日发 的有序交易中，出 一项资产所 收 或者 一项 负债所 的 。以公 值计 或披露的资产和负债，根据对公 值计 整 有 重要意 的 值，确定所 的公 值 ：第一 值，在计 日 的 相同资产或负债在 市场上未经 整的报 第二 值， 第一 值 相关资产 或负债 或 观察的 值 第三 值，相关资产或负债的不 观察 值。

本基金估值 用 本法，其相 于公 值。估值对 以 本 示， 实 利 并 其 的 ，在其 期限内 ， 日计提收益或 。

本基金不 用市场利 和上市交易的债券和 据的市 计算基金资产净值

本基金持有的金融工 的估值方法 下：

1 银行存

本基金持有的银行存 以本金 示， 银行实 利 日计提利息

2 债券投资

本基金持有的附息债券、 现券购 用实 （ 交易 用）确定 本， 日 本和实 利 计算确定利息收

3 回购

1 本基金持有的回购 （ 式回购），以 本 示， 实 利 在实 持有期 内 日计 提利息

2 本基金持有的 式回购以 本 示，所产 的利息在实 持有期 内 日计提。回 购期 对 及的金融资产根据其资产的性 行相应的估值。回购期 ， 方 ， 则 行交 。 融资业务 期 法 ， 则 持有现金资产 融券业务 期 法 ， 则 持有债券资产，实 持有的相关资产 其性 行估值

其他

1 有确 证据表明 上述方法 行估值不 观 其公 值的，基金管理人 根据 情况 基金托管人 定 ， 公 值的方法估值

2 了 用 本法计算的基金资产净值 其他 公 值指标计算的基金资产净值发 重大 ， 对基金份额 持有人的利益产 和不公平的 ， 基金管理人于一估值日， 用其他 公 值指标，对基金持有的估值对 行重新 估， “ 定 ”。 基金资产净值 产 重大 ， 基金管理人应根据相关法律法规 相应 ， 基金资产净值更 公 基金资产 值

3 有新 事项， 国 新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的

本基金 有 已确 金融资产和金融负债的法定权利， 法定权利现在 行的， 同 本基金计 以净 算或同 变现 金融资产和 金融负债 ， 金融资产和金融负债以相 的金 在资产负债表内 示。 以 ， 金融资产和金融负债在资产负债表内分别 示，不 相 。

7.4.4.7 实收基金

实收基金 对 发行的基金份额 所对应的金 。由于 购和 回 起的实收基金变动分别于基金 购确 日及基金 回确 日确 。上述 购和 回分别 基金 所 起的 基金的实收基金 和 出基金的实收基金 。

7.4.4.8 收 /()的确 和计

1 存 利息收 存 的本金 用的实 利 日计提的金 。提前 定期存 ， 规定的利 及持有期重新计算存 利息收 ， 并根据提前 所实 收 的利息收 已确 的利息收 的 确 利息 ， 利息收 项，存 利息收 以净 示。 ， 根据中国证监会 第 120 货币市场基金监 管理法 的规定， 出现 提前 导 的利息 的情形，基金管理人应 用风险准 金 以 ， 风险准 金不 的，应 用 有资金 以

2 债券利息收 实 持有期内 日计提。附息债券、 现券购 用实 (交易 用)确定 本， 日 本和实 利 计算确定利息收

3 金融资产收 ， 金融资产的 本及实 利 (实 利 合同 利 ， 以用合同利)，在回购期内 日计提

债券投资收益 于 出债券 交日确 ， 并 出债券 交金 其 本、应收利息 及相关 用的

其他收 在本基金 行了基金合同中的 务， 在 务 权 确 收 。

7.4.4.9 用的确 和计

本基金的管理人报 和托管 等在 用 期 基金合同或相关公告 定的 和计算方 法 日确 。

其他金融负债在持有期 确 的利息 出 实 利 法计算，实 利 法 法 的则 法计算。

7.4.4.10 基金的收益分配 策

1 本基金的 份基金份 有同等分配权

2 基金收益分配 用 利 投资分 方式，投资者 过 回基金份 方式 现金 利收 益

3 “ 日分配、 日 ”。本基金 201 年 1 月 1 日起，收益分配由以前的“ 日分配、 月 ” 整 “ 日分配、 日 ”。 201 年 1 月 1 日至 1 月 3 日 法定 假日， 假日收益并 前一交易日 201 年 12 月 31 日 以分配。本基金根据 日基金收益情况，以基金净 收益 基准， 投资人 日计算 日收益并分配， 日 行 。投资人 日收益分配的计算 保 数 2 ， 数 第 3 去 原则 理（ 去 形 的 行 分配， 分完 止）

日 购的基金份 自下一个工作日起， 有基金的分配权益 日 回的基金份 自下 一工作日起，不 有基金的分配权益

在 合法律法规的前提下，本基金根据 日收益情况 日收益 部分配， 日收益分 配 100 。 日收益 ， 则相应 基金份 日收益 负， 则不 行收益分配并 相应 基金份 ， 保持基金份 净值 1

在不 投资者利益情况下，基金管理人 情 整基金收益分配方式， 项 整不 要 基金份 持有人大会决 过。

法律、法规或监管 有规定的 其规定。

7.4.4.11 分部报告

经 分部 指本基金内同 下 的组 部分：

1 组 部分 在日 动中产 收 、发 用

2 定期 组 部分的经 ， 以决定 其配 资 、 其业绩

3 组 部分的财务 况、经 和现金 等有关会计信息。

个或 个经 分部 有相 的经济 ， 并 一定 的， 则合并 一个经 分

部。

本基金目前以一个经 分部运作，不 要 行分部报告的披露。

7.4.4.12 其他重要的会计 策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会 的基金行业估值实务 作，本基金确定以下 别债券投资的公 值 用的估值方法及其关 假 下：

根据 关于发 中国证券投资基金业 会估值核算工作 组关于 201 年 1 度 定收益品的估值 理标准 的 中基 发 201 2 ，在上 证券交易所、 证券交易所及银行 同业市场上市交易或 的 定收益品 估值 理标准 有规定的 ， 用第三方估值 提 的 数据 行估值。

7.4.5 会计 策和会计估计变更以及 更 的说明

7.4.5.1 会计 策变更的说明

本基金本报告期 会计 策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期 会计估计变更。

7.4.5.3 更 的说明

本基金本报告期 重大会计 的内容和更 金 。

7.4.6 项

1 值

根据财 部、国 务 财 201 3 关于 开 业 值 的 的规定，经国 务 准，自 201 年 月 1 日起在 国 内 开 业 值 ，金融 业 ，由 业 值 。对证券投资基金（ 式证券投资基金，开 放式证券投资基金）管理人运用基金 股 、债券的 收 值 国债、 方 债 利息收 以及金融同业往来利息收 值 存 利息收 不 收 值

根据财 部、国 务 财 201 关于 一 明确 开 金融 业 有关 策的 的规定，金融 开展的 式 金融 品业务及持有 策性金融债券 的利息收 于金融同业往来利息收

根据财 部、国 务 财 201 0 关于金融 同业往来等 值 策的
的规定，金融 开展的 式 金融 品业务、同业存 、同业存 以及持有金
融债券 的利息收 于金融同业往来利息收

根据财 部、国 务 财 201 1 0 关于明确金融、 产开发、
务等 值 策的 的规定，本基金运 过程中发 的 值 应 行 ，以本基金的基金管
理人 值 人

根据财 部、国 务 财 201 关于资管产品 值 有关 的 的规
定，自 201 年 1 月 1 日起，本基金的基金管理人运 本基金过程中发 的 值 应 行 ，
用简易计 方法， 3 的 收 值 。对本基金在 201 年 1 月 1 日前运 过程中发
的 值 应 行 ，未 值的，不 已 值的，已 本基金的基金管
理人以 月份的 值 应 中 。

2 市 、 附 、 方 附

根据 中 人 共和国 市 行 (2011 年)、 收 附 的 行
规定(2011 年) 及相关 方 附 的 收规定， 、 值 、 业 的
和个人， 应 规定 市 、 附 (相关规定 农 事业
附 的) 及 方 附 。

3 业所

根据财 部、国 务 财 200 关于证券投资基金 收 策的 的规定，
自 200 年 1 月 1 日起，对证券投资基金 (式证券投资基金，开放式证券投资基金) 管理人运
用基金 股 、债券的 收 ， 业所

根据财 部、国 务 财 200 1 关于 业所 策的 的规
定，对证券投资基金 证券市场中 的收 ， 股 、债券的 收 ，股权的股息、
利收 ，债券的利息收 及其他收 ， 不 收 业所 。

个人所

根据财 部、国 务 财 200 132 财 部、国 务 关于 存 利息
所 有关个人所 策的 的规定，自 200 年 10 月 9 日起，对 存 利息所
收个人所 。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存

：人 币

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
期存	2 112 31	3 3 9 3
定期存	22 00 000 000 00	1 1 0 000 000 00
其中：存 期限 1 个月以内		
存 期限 1 3 个月		
存 期限 3 个月以上	22 00 000 000 00	1 1 0 000 000 00
其他存		
合计：	22 02 112 31	1 1 3 3 9 3

7.4.7.2 交易性金融资产

：人 币

项目		本期末 2021 年 12 月 31 日			
		本	定	金	度
债券	交易所市场				
	银行 市场	1 310 2 2 9	1 32 2 000 00	1 99 3 03	0 0
	合计	1 310 2 2 9	1 32 2 000 00	1 99 3 03	0 0
资产 持证券					0 0000
合计		1 310 2 2 9	1 32 2 000 00	1 99 3 03	0 0
项目		上年度末 2020 年 12 月 31 日			
		本	定	金	度
债券	交易所市场				
	银行 市场	11 9 9 100 2 9 99	11 9 9 0 000 00	1 9 20 01	0 0
	合计	11 9 9 100 2 9 99	11 9 9 0 000 00	1 9 20 01	0 0
资产 持证券					0 0000
合计		11 9 9 100 2 9 99	11 9 9 0 000 00	1 9 20 01	0 0

注：1 金 定 本

2 度 金 本法确定的基金资产净值。

7.4.7.3 金融资产/负债

注：本基金本报告期末及上年度末未持有 金融资产 负债。

7.4.7.4 金融资产

7.4.7.4.1 项 金融资产期末

：人 币

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	
		其中 式 回购
交易所市场		
银行 市场	3 2 992 3 9 9	
合计	3 2 992 3 9 9	
项目	上年度末 2020 年 12 月 31 日	
		其中 式 回购
交易所市场		
银行 市场	000 130 0	
合计	000 130 0	

7.4.7.4.2 期末 式 回购交易中 的债券

注：本报告期及上年度末本基金 式 回购交易中 的债券。

7.4.7.5 应收利息

：人 币

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
应收 期存 利息	2 0 3	902 1
应收定期存 利息	130 0 3	110 913 2 0
应收其他存 利息		
应收 算 金利息	313	1 0
应收债券利息	1 91 3	39 130 1 2
应收资产 持证券利息		
应收 证券利息	0 230	0 3
应收 购 利息		
应收 金合 息		
应收出 证券利息		
其他	1 1	1 0
合计	1 9 99 91 3	1 0 0 09 11

注：其他 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 交易 用

：人 币

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
交易所市场应 交易 用		
银行 市场应 交易 用	2 9	10 3 2
合计	2 9	10 3 2

7.4.7.8 其他负债

：人 币

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
应 券 交易 保证金		
应 回		0 0
应 证券出 金		
预提	9 000 00	9 000 00
预提审计	0 000 0	0 000 00
预提信息披露	3 0 000 0	3 0 000 00
券 金		09
合计	39 000 0	3 09 3

7.4.7.9 实收基金

金 ；人 币

长信利息收益货币 A		
项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	
	基金份 (份)	金
上年度末	23 0 130 3 33	23 0 130 3 33
本期 购	1 3 0	1 3 0
本期 回(以"-")	0 3 3 9 01	0 3 3 9 01
基金 分份 算前		
基金 分份 算变动份		
本期 购		
本期 回(以"-")		
本期末	3 0 33	3 0 33

金 ；人 币

长信利息收益货币

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	
	基金份 (份)	金
上年度末	9 201 1 9	9 201 1 9
本期 购	1 2 00 9	1 2 00 9
本期 回(以"-")	13 3 3 0	13 3 3 0
基金 分 份 算前		
基金 分 份 算变动份		
本期 购		
本期 回(以"-")		
本期末	1 9 3	1 9 3

注： 购 利 投、 份 ， 回 出份 。

7.4.7.10 未分配利润

： 人 币

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	1 231 1		1 231 1
本期基金份 交易 产的变动数			
其中：基金 购			
基金 回			
本期已分配利润	1 231 1		1 231 1
本期末			

： 人 币

长信利息收益货币			
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	3 3		3 3
本期基金份 交易 产的变动数			
其中：基金 购			
基金 回			
本期已分配利润	3 3		3 3
本期末			

7.4.7.11 存 利息收

： 人 币

项目	本期	上年度 期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
期存 利息收	3 313 92	0 3 39
定期存 利息收	21 3 3 93	2 0 1 9 31
其他存 利息收		
算 金利息收	3 2 03	10 939 33
其他	2 9 02	13 1
合计	2 00 3	2 932 00 21

注：其他 保证金利息收 。

7.4.7.12 股 投资收益

7.4.7.12.1 股 投资收益 股 收

注：本基金本报告期及上年度 期 均未持有股 。

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目

：人 币

项目	本期	上年度 期
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
债券投资收益 债券（、债 股及债券 期） 收	2 3	1 1 9 3
债券投资收益 回 收		
债券投资收益 购 收		
合计	2 3	1 1 9 3

7.4.7.13.2 债券投资收益 债券 收

：人 币

项目	本期	上年度 期
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
出债券（、债 股及债券 期） 交	1 1 9	30 1 1 9 30
： 出债券（、债 股及债券 期） 本	1 3 23 3 20	30 0 0 0 1 29
： 应收利息	23 9 0 20	100 12 0 1
债券 收	2 3	1 1 9 3

7.4.7.13.3 债券投资收益 回 收

注：本基金本报告期及上年度 期 内均 债券投资 回 收 。

7.4.7.13.4 债券投资收益 购 收

注：本基金本报告期及上年度 期 内均 债券投资 购 收 。

7.4.7.13.5 资产 持证券投资收益

：人 币

项目	本期 2021年1月1日至2021年 12月31日	上年度 期 2020年1月1日至2020年12月 31日
出资产 持证券 交		02 12 322 23
： 出资产 持证券 本		90 000 000 00
： 应收利息		12 12 322 23
资产 持证券投资收益		

7.4.7.14 金 投资收益

注：本基金本报告期及上年度 期 均 金 投资收益。

7.4.7.15 工 收益**7.4.7.15.1 工 收益 权证 收**

注：本基金本报告期及上年度 期 均未持有 工 。

7.4.7.15.2 工 收益 其他投资收益

注：本基金本报告期及上年度 期 均 工 收益。

7.4.7.16 股利收益

注：本基金本报告期及上年度 期 均未持有股 ， 股利收益。

7.4.7.17 公 值变动收益

注：本基金本报告期及上年度 期 均 公 值变动收益。

7.4.7.18 其他收

注：本基金本报告期及上年度 期 均 其他收 。

7.4.7.19 交易 用

注：本基金本报告期内及上年度 期 均 交易 用。

7.4.7.20 其他 用

：人 币

项目	本期 2021年1月1日至2021年 12月31日	上年度 期 2020年1月1日至2020年12 月31日
审计 用	0 000 00	0 000 00
信息披露	120 000 00	120 000 00
证券出 金		
	3 0 00	1 3
其他 用	2 3 0	2 0 9
券 金		
合计	2 2 1 3 0	313 91

注：其他 用 银行 等其他 用。

7.4.8 或有事项、资产负债表日 事项的说明

7.4.8.1 或有事项

至资产负债表日，本基金 要说明的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日 事项

至本财务报告 准报出日，本基金 要披露的资产负债表日 事项。

7.4.9 关 方关

关 方 称	本基金的关
长信基金管理有限责任公司（以下简称“长信基金”）	基金管理人、注 记 、基金
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、基金
长 证券股份有限公司（以下简称“长 证券”）	基金管理人的股 、基金
上 股份有限公司（以下简称“ ”	基金管理人的股
有限公司（以下简称“ 有限”	基金管理人的股
上 投资管理中 （有限合 ）（以下简称“ 投资”）	基金管理人的股
上 投资管理中 （有限合 ）（以下简称“ 投资”	基金管理人的股
上 长 财 资产管理有限公司（以下简称“长 财 ”）	基金管理人的 公司
长 期货股份有限公司（以下简称“长 期货”）	基金管理人的股 的 公司

注：以下关 交易均在 业务 内 一 业 立。

7.4.10 本报告期及上年度 期 的关 方交易**7.4.10.1 过关 方交易 行的交易****7.4.10.1.1 股 交易**

注：本基金本报告期及上年度 期 均未 过关 方交易 行的股 交易。

7.4.10.1.2 债券交易

金：人 币

关 方 称	本期 2021年1月1日至2021年12月31日		上年度 期 2020年1月1日至2020年12月31日	
	交金	期债券 交 的	交金	期债券 交 的
长 证券	3 0 3	32	1 31 1	100 00

7.4.10.1.3 债券回购交易

金：人 币

关 方 称	本期 2021年1月1日至2021年12月31日		上年度 期 2020年1月1日至2020年12月31日	
	回购 交金	期债券回 购 交 的	回购 交金	期债券回 购 交 的
长 证券	11 100 000 00	100 00	13 000 000 00	100 00

7.4.10.1.4 应 关 方的 金

金：人 币

关 方 称	本期 2021年1月1日至2021年12月31日			
	期 金	期 的 金	期末应 金	期末应 的 金
长 证券				
关 方 称	上年度 期 2020年1月1日至2020年12月31日			
	期 金	期 的 金	期末应 金	期末应 的 金
长 证券			09	100 00

注：上述 金 市场 经本基金的基金管理人 对方 确定，以 由中国证券 记 算 有限责任公司收 的证管 和经 的净 示。 金 的 务 金收 方 本基金提 的证券投资 和市场信息 务。

7.4.10.2 关 方报

7.4.10.2.1 基金管理

：人 币

项目	本期	上年度 期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
期发 的基金应 的管理	11 0 1	1 3 23
其中： 的	02 220 31	1 1 2 10

注： 基金管理人长信基金管理有限责任公司的基金管理人报 前一日基金资产净值 0 33 的年 计提， 日 计至 月月 ， 月 。

计算公式：日基金管理 前一日基金资产净值 0 33 年 数

7.4.10.2.2 基金托管

：人 币

项目	本期	上年度 期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
期发 的基金应 的托管	2 1 1 20 10	1 2 90

注： 基金托管人农业银行的基金托管 前一日基金资产净值 0 0 的年 计提。

计算方法 下：

基金托管 年 年 数

日应计提的基金托管

前一日的基金资产净值

基金托管 日计提， 日 计至 月月末， 月 。

7.4.10.2.3 务

：人 币

务 的 关 方 称	本期		
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		
	期发 的基金应 的 务		
	长信利息收益货 币 A	长信利息收益货币	合计
长信基金	1 90 1	12 0	2 2 1 1
农业银行	1 2 919 2	9 3 33	1 3 902
长 证券	212	23 12	2 33 02
合计	33 22 32	1 1	10

务 的 关 方 称	上 年 度 期 2020 年 1 月 1 日 至 2020 年 12 月 31 日		
	期 发 的 基 金 应 的 务		
	长 信 利 息 收 益 货 币 A	长 信 利 息 收 益 货 币	合 计
长信基金	9 01	3 1	132 3 2
农业银行	201 0	9 0 9	202 2
长 证 券	110 3	22 9	29 9 30
合 计	2 93 9	392 1	3 9

注：本基金 A 的基金 务 前一日 A 基金资产净值的 0.2% 的年 计提，本基金
的基金 务 前一日 基金资产净值的 0.01% 的年 计提。计算方法 下：

基金份 的 务 年 年 数

基金份 日应计提的 务

基金份 前一日的基金资产净值。

基金 务 日计提， 日 计至 月月末， 月 。

7.4.10.3 关 方 行 银 行 同 业 市 场 的 债 券 (回 购) 交 易

： 人 币

本 期 2021 年 1 月 1 日 至 2021 年 12 月 31 日						
银 行 市 场 交 易 的 关 方 称	债 券 交 易 金		基 金 回 购		基 金 回 购	
	基 金	基 金 出	交 易 金	利 息 收	交 易 金	利 息 出
农业银行	1 0 9 00				1 11 000 00	1 1 9 9 02
上 年 度 期 2020 年 1 月 1 日 至 2020 年 12 月 31 日						
银 行 市 场 交 易 的 关 方 称	债 券 交 易 金		基 金 回 购		基 金 回 购	
	基 金	基 金 出	交 易 金	利 息 收	交 易 金	利 息 出
农业银行	102 03 323 0				1 1 01 000 00	1 10 3 9 2

7.4.10.4 关 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 有 资 金 投 资 本 基 金 的 情 况

份 份

项 目	本 期 2021 年 1 月 1 日 至 2021 年 12 月 31 日	
	长 信 利 息 收 益 货 币 A	长 信 利 息 收 益 货 币

基金合同 日 (200 年 3 月 19 日) 持有的基金份		
报告期 持有的基金份		2 01
报告期 购 份		9 9 0
报告期 分变动份		
: 报告期 回 出 份		
报告期末持有的基金份		2 3 33 1
报告期末持有的基金份 基金 份		0

项目	上年度 期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	
	长信利息收益货币 A	长信利息收益货币
基金合同 日 (200 年 3 月 19 日) 持有的基金份		
报告期 持有的基金份		291 3 2 9
报告期 购 份		1 1 02 12
报告期 分变动份		
: 报告期 回 出 份		0 000 000 00
报告期末持有的基金份		2 01
报告期末持有的基金份 基金 份		1 01

注：1、期 购 份 期收益 份 部分

2、报告期末持有基金份 中的 19 1 3 份 本基金管理人风险准 金投资

3、基金管理人运用 有资金投资本基金 本基金招募说明书公 的 行。

7.4.10.4.2 报告期末 基金管理人之 的其他关 方投资本基金的情况

注： 基金管理人之 的其他关 方在本年末及上年度末均未持有本基金。

7.4.10.5 由关 方保管的银行存 及 期产 的利息收

: 人 币

关 方 称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		上年度 期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	
	期末	期利息收	期末	期利息收
中国农业银行 股份有限公司	2 112 31	3 313 92	3 3 9 3	0 3 39

注：本基金用于证券交易 算的资金 过本基金托管人的基金托管 算资金专用存 存于
中国证券 记 算有限责任公司， 银行同业利 计息。于 2021 年 12 月 31 日的相关 在资产
负债表中的“ 算 金” 目中 独 示（2020 年 12 月 31 日：同）。

7.4.10.6 本基金在承 期内 关 方承 证券的情况

注：本基金在本报告期及上年度 期 均未在承 期内购 过由关 方承 的证券。

7.4.10.7 其他关 交易事项的说明

注：本基金本报告期内及上年度 期 其他关 交易事项。

7.4.11 利润分配情况

金 : 人 币

长信利息收益货币A

已 投资形式 实收基 金	过应 回 出金	应 利润 本年变动	本期利润分配合 计	注
1 12 9 2 0	21 3 2	9 921 32	1 231 1	

长信利息收益货币

已 投资形式 实收基 金	过应 回 出金	应 利润 本年变动	本期利润分配 合计	注
3 00 9	0 9	2 12 2	3 3	

7.4.12 期末（ 2021 年 12 月 31 日 ）本基金持有的 限证券

12 1 购新发/ 发证券 于期末持有的 限证券

注：本基金本报告期末未 购新发 发证券 持有 限的证券。

7.4.12.2 期末持有的 等 限股

注：本基金本报告期末未持有股 。

7.4.12.3 期末债券 回购交易中作 的债券

7.4.12.3.1 银行 市场债券 回购

至本报告期末 2021 年 12 月 31 日止，本基金 事银行 市场债券 回购交易形 的 出回

购证券 09 21 , 以 下债券作 :

金 : 人 币

债券代	债券 称	回购 期日	期末估值	数 ()	期末估值
11210913	21 发银 行 13	2022 年 1 月 日	99 3	2 1 3 000	21 91 99 2
210301	21 出 01	2022 年 1 月 日	100 01	1 100 000	110 00 1 1
1 020	1 国开 0	2022 年 1 月 日	100 13	1 000 000	100 130 0 33
112113212	21 银 行 212	2022 年 1 月 日	99 1	3 000 000	29 1 192
19030	19 出 0	2022 年 1 月 日	100 32	1 00 000	1 0 1 90
210211	21 国开 11	2022 年 1 月 日	99 1	2 900 000	2 9 0 9 0
1 0 09	1 农发 09	2022 年 1 月 日	100 3	3 3 000	3 02 1 2
2199 3	21 现国 债 3	2022 年 1 月 日	9	3 000 000	29 9 1
11210 00	21 中国 银 00	2022 年 1 月 日	99 0	21 000	2 091 0 13
190 03	19 农发 03	2022 年 1 月 日	100 20	2 000 000	200 391 1 1
11210 02	21 中国 银 02	2022 年 1 月 日	99 09	3 1 000	3 1 1 3
1121 90	21 银 行 2	2022 年 1 月 日	99 03	1 1 000	11 3 0 3
210 01	21 农发 01	2022 年 1 月 日	100 03	3 000	32 03 0
1121 01	21 银 行 221	2022 年 1 月 日	99	090 000	0 13 9 1
11210 0 9	21 中国 银 0 9	2022 年 1 月 日	9	2 3 000	23 00 3 30
120232	12 国开 32	2022 年 1 月 日	100 9	2 00 000	2 1 9 2 03
11211 0	21 银 行 0	2022 年 1 月 日	99 2	2 000 000	19 0 109 1
12020	12 国开 0	2022 年 1 月 日	99 99	1 3 9 000	13 2 0 33
11210 23	21 银 行 23	2022 年 1 月 日	9 0	3 000 000	292 93 3 91
1121 9	21 银 行 331	2022 年 1 月 日	99 1	2 000 000	19 11 99
11211111	21 平 银	2022 年 1 月	99 1	1 0 000	10 3 0

	行 11	日			
190303	19 出 03	2022 年 1 月 日	100 0	1 000 000	100 0 1 2 1
11211 1	21 银 行 1	2022 年 1 月 日	9 0	2 000 000	19 0 2 9
1121 1	21 银 行 1	2022 年 1 月 日	9	1 3 000	1 1 31 1 9 11
11219 3	21 重 农 行 090	2022 年 1 月 日	99 1	2 1 000	21 929 3
1 0 12	1 农发 12	2022 年 1 月 日	100 0	3 100 000	311 0 3 3
1121 09	21 银 行 1	2022 年 1 月 日	9 9	1 100 000	10 2 9 9
11211 0	21 银 行 0	2022 年 1 月 日	9 99	1 000 000	9 993 31
合计				9 90 000	9 22 31 0

7.4.12.3.2 交易所市场债券 回购

注：本基金本报告期末 交易所市场债券 回购交易 的债券。

13 金融工 风险及管理

7.4.13.1 风险管理 策和组

本基金在日 动中 金融工 的风险，主要 ：信用风险、 动性风险和市场风险。

本基金在下 主要 述上述风险 及其形 原 、风险管理目标、 策和过程以及计 风险的方法等。

本基金的基金管理人 事风险管理的目标 本基金在风险和收益之 的平 ，以实现“风险和收益相 配”的风险收益目标。基于 风险管理目标，本基金的基金管理人已 定了 策和程序来 别和分 风险， 定 的风险限 并 计相应的内部 程序， 过的管理及信息 持 监 上述 风险。

本基金管理人 行 风险管理 理 ， 立了以风险 会 核 的、由 察长、监察稽核部和相关业务部 的风险管理 。在董事会下 立风险 会，负责对公司经 管理和基金业务运作的合法性、合规性 行 的 和 估等 在管理 立内部 会，主要 责 审 公司内部 度及 对公司在经 管理和投资组合运作中的风险 行 别、 估并 有的 在业务 作 风险管理 责主要由监察稽

核部负责 并 部 合作完 运作风险管理工作， 略 产品 发部负责 行投资风险分
绩 估。监察稽核部 察长负责，并 经理 报日 行 事务。

7.4.13.2 信用风险

信用风险 指基金在交易过程中 交易对 未 行合 责任，或者基金所投资证券之发行人
出现 、 期本息，导 基金资产 和收益变 的风险。本基金的银行存 存放在
本基金的托管人中国农业银行股份有限公司， 银行存 相关的信用风险不重大。

本基金的基金管理人 立了信用风险管理 程，本基金投资于 有 信用等 的证券，
过分 投资以分 信用风险。本基金投资于一 公司发行的证券市值不 过基金资产净值的
10 ， 本基金 由本基金管理人管理的其他基金共同持有一 公司发行的证券，不 过 证券
的 10 。

本基金在交易所 行的交易均 中国证券 记 算有限责任公司完 证券交收和 项 算，
风险发 的 性 本基金在 行银行 同业市场交易前均对交易对 行信用
估并 用券 对 交 方式以 相应的信用风险。

7.4.13.2.1 期信用 示的债券投资

：人 币

期信用	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
A 1	0 00	100 00 01 1
A 1 以下	0 00	0 00
未	0 3 9 2	1 023 939 19 0
合计	0 3 9 2	1 123 9 21 31

注：未 债券 国债、 行 据、 策性金融债及 期融资券等 信用 债券。

7.4.13.2.2 期信用 示的资产 持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末 期信用 示的资产 持证券投资。

7.4.13.2.3 期信用 示的同业存 投资

：人 币

期信用	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
A-1	0 00	0 00
A-1 以下	0 00	0 00
未	13 0 30 3	9 2 9 12 3
合计	13 0 30 3	9 2 9 12 3

注：本基金持有同业存 的主 均 AA 及以上 。

7.4.13.2.4 长期信用 示的债券投资

：人 币

长期信用	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
AAA	33 1 1 1 93	0 00
AAA 以下	0 00	0 00
未	1 1 199 1 9 1	1 3 2 1 2 3 32
合计	2 0 3 0 31 11	1 3 2 1 2 3 32

注：未 债券 国债、 行 据及 策性金融债等 信用 债券。

7.4.13.2.5 长期信用 示的资产 持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末 长期信用 示的资产 持证券投资。

7.4.13.2.6 长期信用 示的同业存 投资

注：本基金本报告期末及上年度末 长期信用 示的同业存 投资。

7.4.13.3 动性风险

动性风险 指基金管理人未 以合理 及 变现基金资产以 投资者 回 项的风险。本基金 动性风险来 于开放式基金 日 回资金的 动性风险，以及 部分投资品 交易不 出现的变现风险和 投资 中 法在市场出现 动的情况下以合理 变现投资的风险。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的 动性风险分

本基金的基金管理人 公开募 证券投资基金运作管理 法 及 公开募 开放式证券投资基金 动性风险管理规定 等有关法规的要 立 开放式基金 动性风险管理的内部 ，审 估 资产的 动性， 对性 定 动性风险管理 ，对本基金组合资产的 动性风险 行管理。本基金 持组合管理、分 投资的原则开展投资 动，所持证券均在证 券交易所或银行 同业市场交易，并 遵守基金管理人 动性相关交易限 。

本基金主要投资于基金合同 定的 有 动性的金融工 ，基金管理人 对 动性指标 行持 的监 和分 ，定期开展 ， 估在不同的 情 下资产变现情况的变 。

基金管理人持 监 本基金开放期内的 回情况， 市场 或投资者 发 变 ，及 整投资组合资产 及 ，保持基金资产 变现规 和期限 负债 回规 和期限的 配。

同 ， 对 回资金的 动性风险，基金管理人在基金合同中 定了 回 ， 定了发 回 资金的 理 式， 开 放 式 产 的 动性风险。

7.4.13.4 市场风险

市场风险 指基金所持金融工 的公 值或未来现金 所 市场 的变动 发 动的风险， 利 风险、 风险和其他 风险。

7.4.13.4.1 利 风险

利 风险 指金融工 的公 值或现金 市场利 变动 发 动的风险。本基金的 息资产主要 银行存 、 算 金、存出保证金及债券投资等。

7.4.13.4.1.1 利 风险

：人 币

本期末 2021 年 12 月 31 日	个月以内	个月 1 年	1 年	年 以上	不计息	合计
资产						
银行存	19 02 112 31	2 00 000 000 00				22 02 112 31
算 金	1 21					1 21
存出保证金	32 1 1					32 1 1
交易性金融资 产	13 00 29 9 9	3 30 32 3				1 310 2 2 9
金融 资产	3 2 992 3 9 9					3 2 992 3 9 9
应收利息					1 9 99 91 3	1 9 99 91 3
资产 计	3 1 30	10 32 3			1 9 99 91 3	2 0 9 33
负债						
出回购金融 资产	09 21					09 21
应 回					1 0 9	1 0 9
应 管理人报					10 103 3	10 103 3
应 托管					2 3 11 9	2 3 11 9
应 务					1 3	1 3
应 交易 用					2 9	2 9
应 利息					0 2	0 2
应交					1 332 11	1 332 11
应 利润					2 13 93	2 13 93
其他负债					39 000 00	39 000 00
负债 计	09 21				2 39 1 1	3 9 39 92
利 度	31 9 2	10 32 3			1 0 2	3 1 9 9 2 1
上年度末	个月以内	个月 1 年	1	年	不计息	合计

2020 年 12 月 31 日			年	以上		
资产						
银行存款	13 3 3 9 3	00 000 000 00				1 1 3 3 9 3
算 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	11 2 31 1 1 30	19 3 9 12 9				11 9 9 100 2 9 99
金融 资产	000 130 0					000 130 0
应收利息					1 0 0 09 11	1 0 0 09 11
其他资产						
资产 计	2 313 10 9 33	9 3 9 12 9			1 0 0 09 11	2 2 0 12 0 13
负债						
出回购金融 资产	1 0 39 39 0					1 0 39 39 0
应 回					3 1 2	3 1 2
应 管理人报					99 01	99 01
应 托管					1 9 92	1 9 92
应 务					10 91 11	10 91 11
应 交易 用					10 3 2	10 3 2
应 利息					3 0 99	3 0 99
应 利润					1 11 03 29	1 11 03 29
其他负债					3 09 3	3 09 3
负债 计	1 0 39 39 0				1 39 0 2 1	1 93 22 01
利 度	23 3 31 2 93	9 3 9 12 9			133 32 0	2 03 331 9 3 12

注：本基金根据所持有资产和负债的 本法确定的公 值， 合 规定的重新定 日及 期日中的 者 行分 。

7.4.13.4.1.2 利 风险的 性分

假	市场利 以 的其他市场变 保持不变	
分	相关风险变 的变动	对资产负债表日基金资产净值的 金 (: 人 币)
		本期末(2021 年 12 月 31 日) 上年度末(2020 年 12 月 31 日)
	市场利 下 2 个 基	1 992 23 3 9 2 2 292
	市场利 上 2 个 基	1 992 23 3 9 2 2 292

注：本基金于本报告期末及上年度末均未持有债券， 重大利 风险， 未 行 性分 。

银行存及算金之动利根据中国人银行的基准利和相关的相关策动。

7.4.13.4.2 风险

风险指金融工的公 值或未来现金 变动 发 动的风险。本基金的所有资产及负债以人 币计 ， 重大 风险。

7.4.13.4.3 其他 风险

其他 风险指基金所持金融工的公 值或未来现金 市场利 和 以 的市场 变动 发 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 同 业市场交易的 定收益品 ， 重大其他市场 风险。

7.4.14 有 于理 和分 会计报表 要说明的其他事项

1 有 于理 和分 会计报表 要说明的其他事项

1 1 公 值

1 1 1 不以公 值计 的金融工

不以公 值计 的金融资产和负债主要 和应收 项以及其他金融负债，其 期限不长，公 值 值相 。

1 1 2 以公 值计 的金融工

1 1 2 1 金融工 公 值

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的以公 值计 其变动计 期 益的金融资产中 于第一 的 人 币 0 00 ， 于第二 的 人 币 1 310 2 2 9 ， 于 第三 的 人 币 0 00 （于 2020 年 12 月 31 日，本基金持有的以公 值计 其变 动计 期 益的金融资产中 于第一 的 人 币 0 00 ， 于第二 的 人 币 11 9 9 100 2 9 99 ， 于第三 的 人 币 0 00 ）。

1 1 2 2 公 值所 的重大变动

本基金本期持有的以公 值计 的金融工 的公 值所 未发 重大变动。

1 1 2 3 第三 公 值 和本期变动金

本基金持有的以公 值计 其变动计 期 益的金融工 第三 公 值本期未发 变动。

1 2 承诺事项

至资产负债表日，本基金 要说明的承诺事项。

1.3 其他事项

至资产负债表日，本基金 要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

		金 人 币	
序	项目	金	基金资产的 ()
1	定收益投资	1 310 2 2 9	3 12
	其中：债券	1 310 2 2 9	3 12
	资产 持证券		
2	金融资产	3 2 992 3 9 9	
	其中：式回购的 金融资 产		
3	银行存 和 算 金合计	22 10 2 0 9 33	2
4	其他 项资产	190 02 093	0
5	合计	2 0 9 33	100 00

8.2 债券回购融资情况

		金 人 币	
序	项目	基金资产净值的 ()	
1	报告期内债券回购融资	3	
	其中：式回购融资		
2	报告期末债券回购融资	09 21	12 0
	其中：式回购融资		

注：报告期内债券回购融资 基金资产净值 报告期内 个交易日融资 基金资产净值的简 平均值。

债券 回购的资金 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 回购的资金 未 过资产净值的 20 。

8.3 基金投资组合平均 期限

8.3.1 投资组合平均 期限基本情况

项目	数
报告期末投资组合平均 期限	109
报告期内投资组合平均 期限 值	11
报告期内投资组合平均 期限 值	

报告期内投资组合平均 期限 过 120 情况说明

注：本报告期内本货币市场基金投资组合平均 期限不存在 过 120 的情况。

8.3.2 期末投资组合平均 期限分

序	平均 期限	期限资产 基金资产 净值的 ()	期限负债 基金资 产净值的 ()
1	30 以内	1	12 0
	其中： 存 期 过 39 的 动利 债		
2	30 0	20 20	
	其中： 存 期 过 39 的 动利 债		
3	0 90	10 32	
	其中： 存 期 过 39 的 动利 债		
4	90 120	2 3	
	其中： 存 期 过 39 的 动利 债		
5	120 39 ()	3 32	
	其中： 存 期 过 39 的 动利 债		
	合计	111	12 0

8.4 报告期内投资组合平均 存 期 过 240 情况说明

注：本报告期内本货币市场基金投资组合平均 存 期不存在 过 2 0 的情况。

8.5 期末 债券品 分 的债券投资组合

序	债券品	本	基金资产净值 ()
1	国 债券	29 9 1	0
2	行 据		
3	金融债券	2 3 9 9 21	1
	其中： 策性金融债	1 91 90 3 2 3	02
	业债券	1 030 1 93	0 19
	业 期融资券	0 0 3 131 32	0 1
	中期 据	120 231 232 2	0 32
	同业存	13 0 30 3	3 1
	其他		
9	合计	1 310 2 2 9	2
10	存 期 过 39 的 动利 债 券		

8.6 期末 本 基金资产净值 大 序的前 债券投资明细

金 : 人 币

序	债券代	债券 称	债券数	本	基金资产净值 ()
1	11210 1 3	21 中信银行 1 3	000 000	3 3 00	1 3
2	11210 1	21 交 银行 1	00 000	0 0 2	1 3
3	1121 01	21 银行 221	000 000	9 1 3 339 1	1 31
	1121 133	21 银行 09	000 000	9 9 3 1	1 30
	1121101 1	21 业银行 1 1	000 000	9 3 2	1 30
	11219 3	21 重 农 行 090	000 000	9 3 10 02	1 30
	11211111	21 平 银行 11	000 000	9 9 10 3	1 30
	11210 01	21 中国银行 01	00 000	9 3 20	1 1
9	11210 02	21 中国银行 02	000 000	39 309 3 03	1 0
10	1 0 12	1 农发 12	3 100 000	311 0 3 3	0 2

8.7 “ 定 ” “ 本法” 确定的基金资产净值的

项目	情况
报告期内 度的 对值在 0 2 0 的 数	
报告期内 度的 值	0 0921
报告期内 度的 值	0 01
报告期内 个交易日 度的 对值的简 平均值	0 0320

报告期内负 度的 对值 0.25%情况说明

注：报告期内不存在负 度的 对值 0 2 的情况。

报告期内 度的 对值 0.5%情况说明

注：报告期内不存在 度的 对值 0 的情况。

8.8 期末 本 基金资产净值 大 序的所有资产 持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产 持证券。

8.9 投资组合报告附注**8.9.1 基金计 方法说明**

注：本基金 用 本法计 。

8.9.2 本基金投资的前 证券的发行主 本期 以及 的情况的说明

报告期内本基金投资的前 证券中，发行主 银行股份有限公司于 2021 年 月 10 日收 银保监 行 决定书（银保监 决字 2021 3 ），根据 中 人 共和国银行业监 管理法 第 第（ ）项、第 第（一）项，经 ， 银行股份有限公司存在代理 保险不规 。 上， 银保监 公司 人 币 2 ，并责 行对相关 责任人 律 分。

报告期内本基金投资的前 证券中，发行主 银行股份有限公司于 2021 年 月 30 日收 银保监 行 决定书（银保监 决字 2021 ），根据 中 人 共和国银行业监 管理法 第 第、第 ，经 ， 银行股份有限公司存在 用于 或 收 开发 用审核不 产 放 和 用 审核不 资 金 规 市 产 资金回 人 据业务开展不审 。 上， 银保监 公司 人 币 2 ，并责 行对相关 责任人 律 分。

报告期内本基金投资的前 证券中，发行主 银行股份有限公司于 2021 年 12 月 29 日收 银保监 行 决定书（银保监 决字 2021 1 ），根据 中 人 共和国银行业监 管理法 第 第（ ）项、第 第（一）项，经 ， 银行股份有限公司存在信用 业务管理不 情况。 上， 银保监 公司 人 币 30 ，并责 行对相关 责任人 律 分。

报告期内本基金投资的前 证券中，发行主 交 银行股份有限公司于 2021 年 月 13 日收 中国银行保险监 管理 会（银保监 决字 2021 2 ），根据 中 人 共和国银行业监 管理法 第二 一、第 和关审 经 规则，经 ，一、理财业务和同业业务 度不 二、理财业务数据 事实不 三、部分理财业务发展 监管导 不 、理财业务风险 不 ，利用本行表内自有资金 本行表 理财产品提 融资 、理财资金 规投 项目 、理财产品相 交易 收益 、 投资者发行的理财产品投资 不 资产 持证券 、公募理财产品投资 证券 限 、理财资金 规投 交易所上市 交易的股 、理财资金投资 标资产 管理不 一、 募理财产品 未 定 期 二、开放式公募理财产品资产配 未 动性管理监管 要 三、理财产品信息 记不及 、理财产品信息披露不合规 、同业业务交易对 整不及 、 同业存 一 性存 核算 、同业 管理不规 、 规 性债务， 同业投资 风险管理有 性不 、 性存 产品 品交易 真实交 易对 和交易行 二 、未 审 托 资金来 二 一、 规 托 人收

二、利用理财资金 他行 投不 资产收益权，实现不 资产虚假出表 二、三、
 监管 发现 。 上，中国银行保险监 管理 会决定对交 银行股份有限公司
 100 。

报告期内本基金投资的前 证券中，发行主 平 银行股份有限公司于 2021 年 月 2 日
 收 中国银保监会 监管 行 信息公开表（ 银保监 决字 2021 3 ），根据 中
 人 共和国银行业监 管理法 第 第（ ）项，经 ，平 银行股份有限公司利用来
 于本行 信的 定资产 和 金 融资的资金发放 托 ，用于承 本行其他
 风险 定资产 信 重不审 ， 用 审 监 不 ， 资金 用于 人 公司
 股 融资 动资金 用 审 监 不 ， 资金部分回 人用作银行承
 存 定资产 用 审 监 不 ， 资金部分回 人或 人关 公司用作
 银行承 保证金、购 理财产品。 上，中国银保监会 监管 决定对平 银行股份有限
 公司 人 币 210 。

报告期内本基金投资的前 证券中，发行主 中国银行股份有限公司于 2021 年 月 1 日
 收 中国银行保险监 管理 会行 信息公开表（银保监 决字 2021 11 ），根据 中
 人 共和国银行业监 管理法 第二 一 、第 ， 中 人 共和国 业银行法 第
 、第 和相关审 经 规则，经 ，中国银行在业务过程中存在一、 未 预算的
 购 务项目发放 二、 规 关 人发放信用 三、 资金 业发放 动
 资金 、存 月末 、 真实 易 业签发银行承 、 管理
 不 ，信 资金 用 、 据 现资金 回 至出 人或其关 人 、理财产品
 易融资业务风险 有 性不 、 发放并购 、 未经 的 并购业
 务提 并购 一、 规 募股权基金收购 内 业发放并购 二、 权期限
 理 出 融资业务 三、 交易对 开展同业业务 、 规 他行开立投融资性
 同业 、以同业 存方式不 收存 、自 和代 理财业务未 实现风险
 、 一 的理财产品投资二 市场股 、未 规定 投资者 分披露理财
 产品投资 标准 债权风险 况 、 规 证不 产项目提 融资 二 、理财资金
 规用于 或 股 购 二 一、理财资金 规用于 项目 二 二、
 理财 标融资 股 业银行 二 三、理财 标融资用于 业银行注 资 二 、 信
 度提 理财 标融资 二 、 业务标的资产不合规 二 、个人 业务
 保险产品 二 、 分行代 3 以上保险公司保险产品 二 、主承 债券 券
 未 过风险 专 二 、 过平 风险 露 三 、债券投资业务未分 ，

表内人民币债券未计提减值准备。三、一、资产管理公司合作设立有限合伙基金，不净
 不资产。三、二、报信息。三、三、责不。三、提不的务
 三、规收。风险承担。三、规部分已签代发工资。收年。
 上，中国银行保险监督管理委员会决定对中国银行股份有限公司 13。

报告期内本基金投资的前证券中，发行主中信银行股份有限公司于 2021 年 3 月 1 日
 收中国银行保险监督管理委员会行决定书（银保监决字 2021），根据中
 人共和国银行业监督管理法第二一、第和相关审经规则，以及业银行法
 第三，经，中信银行股份有限公司存在信息保不
 明细规、一的业务作程要的内部，整自不信息
 息收管理不规数据管理不合业务“”和“权”原则
 明细事由不真实未经本人权并第三方提其个人银行交易信息
 对信息管理不，其出至规存信息权限管理存在漏，
 重要及管理存在的情况。上，中国银行保险监督管理委员会公司 0
 。

对上证券投资决策程序的说明：公司部内部工作规对证券行分
 其基金投资对。在基上本基金的基金经理根据市场情况独立作出投资决
 策。事发，本基金管理人对证券的发行主行了了一了分，事未
 对证券投资值产重大的实性。本基金投资于证券的投资决策过程合度规
 定的投资权限投资决策程序。

报告期内本基金投资的前证券中其的发行主未出现监管部立或在报
 告日前一年内公开责、的情形。

8.9.3 期末其他项资产

：人民币

序	称	金
1	存出保证金	32 1 1
2	应收证券算	
3	应收利息	1 9 99 91 3
4	应收购	
5	其他应收	
6	用	
7	其他	
8	合计	190 02 093

8.9.4 投资组合报告附注的其他 字 述部分

注：由于 的原 ，分项之和 合计项 存在 。

§9 基金份额 持有人信息

9.1 期末基金份额 持有人 数及持有人

份 : 份

份 别	持有人 数	均持有的基金 份	持有人			
			投资者		个人投资者	
			持有份	份	持有份	份
长 信 利 息 收 益 货 币 A	0	1 1	3 3 0 93	0 13	3 32 9 1 1	99
长 信 利 息 收 益 货 币	13	113 0 1 90	1 9 9 2 2	99 32	9 9 0 3 9	0
合 计	93	99 11	1 0 9 9 0 1	3 9	3 2 901 11 0	9 0

注：对下 分 基金， 的分 用 自 别的份 ，对合计数， 的分 用下 分 基
金份 的合计数（ 期末基金份 ）。

9.2 期末货币市场基金前 份 持有人情况

序	持有人 别	持有份 （份）	份
1	银行	1 020 201 20	2
2	保险	9 093 9	0 1
3	银行	1 921 1	0 1
	其他	2 2 9	0 0
	个人	22 3 0 1 2 2	0 0

	基金	20 93 00	0 0
	个人	20 129 109 21	0 0
	个人	19 192 2 39	0 0
9	银行	1 3 1 0 1 0	0 0
10	个人	1 3 9	0 0

注：期末前 份 持有人不 基金管理人运用 有资金投资的情况。

9.3 期末基金管理人的 业人 持有本基金的情况

项目	份 别	持有份 数 (份)	基金 份
基金管理人所有 业人 持有本基金	长信利息收益货币 A	9 930 0	0 00
	长信利息收益货币	0 00	0 00
	合计	9 930 0	0 00

注：对下 分 基金， 的分 用 自 别的份 ，对合计数， 的分 用下 分 基金份 的合计数（ 期末基金份 ）。

9.4 期末基金管理人的 业人 持有本开放式基金份 的情况

项目	份 别	持有基金份 的数 (份)
本公司 管理人 、基金 投资和 部 负责人持 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	0
	合计	0 10
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	0
	合计	0 10

§10 开放式基金份额 变动

: 份

	长信利息收益货币 A	长信利息收益货币
基金合同 日 (200 年 3 月 19 日) 基金份	0 2 30 9	
本报告期期 基金份	23 0 130 3 33	9 201 1 9
本报告期基金 购份	1 3 0	1 2 00 9
:本报告期基金 回份	0 3 3 9 01	13 3 3 0
本报告期基金 分变动份 (份 以"-"))		
本报告期期末基金份	3 0 33	1 9 3

§11 重大事 示

11.1 基金份 持有人大会决

本报告期末 开本基金的基金份 持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专 基金托管部 的重大人事变动

11.2.1 基金管理人的重大人事变动

自 2021 年 1 月 2 日起, 不 担任公司董事长, 由 经理 代任董事长。

自 2021 年 月 2 日起, 担任公司董事长, 经理 不 代任董事长。

自 2021 年 月 9 日起, 程 不 担任公司 经理。

自 2021 年 月 19 日起, 担任公司 经理。

上述重大人事变动情况, 本基金管理人均已在规定信息披露 介发 相关公告。

11.2.2 基金托管人的专 基金托管部 的重大人事变动

2021 年 月, 中国农业银行 行决定 任托管业务部 。

2021 年 月, 中国农业银行 行决定 任托管业务部 。

11.3 及基金管理人、基金财产、基金托管业务的

本报告期 及基金管理人、基金财产、基金托管业务的 。

11.4 基金投资策略的 变

本报告期本基金投资策略未 变。

11.5 基金 行审计的会计 事务所情况

本报告期本基金未更 会计 事务所 报告期应 明会计 事务所 (合) 审计的报 人 币 0 000 00 , 审计 本基金提 的审计 务的连 年限 年。

11.6 管理人、托管人及其 管理人 稽 或 等情况

本报告期, 基金管理人、托管人及其 管理人 有 监管部 稽 或 的情形。

11.7 基金 用证券公司交易 的有关情况

11.7.1 基金 用证券公司交易 行股 投资及 金 情况

金 : 人 币

券 称	交易数	股 交 易		应 券 的 金		注
		交 金	期 股 交 的	金	期 的 金	
银 证 券	1					
长 证 券	1					

注：1、本报告期 用证券公司交易 变 。

2、专用交易 的 标准和程序

根据中国证监会 关于 证券投资基金监管有关 的 （证监基字 199 29 ）和
关于完 证券投资基金交易 度有关 的 （证监基金字 200 ）的有关规定，
本公司 定了 用证券公司专用交易 的 标准和程序。

(1) 标准：

- 、券 基本 （财务 况、经 况）
- 、券 （报告 、及 性和数 ）
- 、券 日信息 （及 性和有 性）
- 、券 作表现 。

(2) 程序：

根据 用证券公司专用交易 的 标准形 券 务 表 ， 根据 分
行 基金专用交易 。

11.7.2 基金 用证券公司交易 行其他证券投资的情况

金 币

券 称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	交 金	期 债 券 交 的	交 金	期 债 券 回 购 交 的	交 金	期 权 证 交 的
银 证 券	2 1 903 1	31				
长 证 券	3 0 3	32	11 100 000 00	100 00		

11.8 度 对值 过 0.5%的情况

注：本报告期本基金不存在 度 对值 过 0 的情况。

11.9 其他重大事

序	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 下部分开放式基金在 风证券股份有限公司开 、定期定 投资业务及 购(定投 购) 动的公告	上证报、中国证监会披露 、公司	2021 年 1 月 1 日
2	长信利息收益开放式证券投资基金 2020 年 第 度报告	中国证监会 披 露 、公司	2021 年 1 月 22 日
3	长信基金管理有限责任公司 下 部基金 2020 年 第 度报告提示性公告	上证报、中证报、证 券 报、证券日报、 中国证监会 披 露 、公司	2021 年 1 月 22 日
	长信基金管理有限责任公司关于基金行业 管理人 变更公告	上证报、中国证监会 披 露 、公司	2021 年 1 月 2 日
	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 购和 业务的公告	上证报、中国证监会 披 露 、公司	2021 年 2 月 日
	长信基金管理有限责任公司关于 下部分开 放式基金 国金证券股份有限公司 购 动的公告	上证报、中国证监会 披 露 、公司	2021 年 3 月 2 日
	长信利息收益开放式证券投资基金 2020 年 年度报告	中国证监会 披 露 、公司	2021 年 3 月 30 日
	长信基金管理有限责任公司 下 部基金 2020 年年度报告提示性公告	上证报、中证报、证 券 报、证券日报、 中国证监会 披 露 、公司	2021 年 3 月 30 日
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 购和 业务的公告	上证报、中国证监会 披 露 、公司	2021 年 3 月 30 日
10	长信基金管理有限责任公司关于 下部分开 放式基金 中国银行股份有限公司 购 (定投 购) 动的公告	上证报、中国证监会 披 露 、公司	2021 年 3 月 31 日
11	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基金经理变更的公告	上证报、中国证监会 披 露 、公司	2021 年 月 1 日
12	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 要(更新)	中国证监会 披 露 、公司	2021 年 月 20 日
13	长信利息收益开放式证券投资基金 2021 年 第 1 度报告	中国证监会 披 露 、公司	2021 年 月 21 日
1	长信基金管理有限责任公司 下 部基金 2021 年第一 度报告提示性公告	上证报、中证报、证 券 报、证券日报、 中国证监会 披 露 、公司	2021 年 月 21 日

1	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 购和 业务的公告	上证报、中国证监会披露 、公司	2021 年 月 2 日
1	长信基金管理有限责任公司关于董事长变更公告	上证报、中国证监会披露 、公司	2021 年 月 30 日
1	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 购和 业务的公告	上证报、中国证监会披露 、公司	2021 年 月 日
1	长信基金管理有限责任公司公告	上证报、中国证监会披露 、公司	2021 年 月 22 日
19	长信基金管理有限责任公司关于 下部分开放式基金 招 银行股份有限公司 购 (定投 购) 动的公告	上证报、中国证监会披露 、公司	2021 年 月 日
20	长信基金管理有限责任公司关于 部证券股份有限公司 下部分开放式基金代 并开 、定期定 投资业务及 购 (定投 购) 动的公告	上证报、中国证监会披露 、公司	2021 年 月 1 日
21	长信利息收益开放式证券投资基金 2021 年第 2 度报告	中国证监会 披 露 、公司	2021 年 月 21 日
22	长信基金管理有限责任公司 下 部基金 2021 年第二 度报告提示性公告	上证报、中证报、证 券 报、证券日报、 中国证监会 披 露 、公司	2021 年 月 21 日
23	长信基金管理有限责任公司关于 基金 有限公司 下部分开放式基金代 并开 、定期定 投资业务及 购 (定投 购) 动的公告	上证报、中国证监会披露 、公司	2021 年 月 22 日
2	长信基金管理有限责任公司关于 招 证 券股份有限公司 下部分开放式基金代 并开 、定期定 投资业务及 购 (定投 购) 动的公告	上证报、中国证监会披露 、公司	2021 年 月 29 日
2	长信基金管理有限责任公司关于 方财 证券股份有限公司 下部分开放式基金代 并开 、定期定 投资业务及 购 (定投 购) 动的公告	上证报、中国证监会披露 、公司	2021 年 月 日
2	长信基金管理有限责任公司关于 国 证 券股份有限公司 下部分开放式基金代 并开 、定期定 投资业务及 购 (定投 购) 动的公告	上证报、中国证监会披露 、公司	2021 年 月 日
2	长信基金管理有限责任公司关于基金行业	上证报、中国证监会	2021 年 月 11 日

	管理人 变更公告	披露 、公司	
2	长信基金管理有限责任公司关于 证 券股份有限公司 下部分开放式基金代 并开 、定期定 投资业务及 购（ 定投 购） 动的公告	上证报、中国证监会 披露 、公司	2021 年 月 13 日
29	长信基金管理有限责任公司关于 立 分 公司的公告	上证报、中国证监会 披露 、公司	2021 年 月 1 日
30	长信基金管理有限责任公司关于 上 利 基金 有限公司 下部分开放式基金 代 并开 、定期定 投资业务及 购（ 定投 购） 动的公 告	上证报、中国证监会 披露 、公司	2021 年 月 1 日
31	长信基金管理有限责任公司关于基金行业 管理人 变更公告	上证报、中国证监会 披露 、公司	2021 年 月 20 日
32	长信基金管理有限责任公司关于 下部分开 放式基金 中国工 银行股份有限公司 购（ 定投 购） 动的公告	上证报、中国证监会 披露 、公司	2021 年 月 2 日
33	长信利息收益开放式证券投资基金 2021 年 中期报告	中国证监会 披 露 、公司	2021 年 月 31 日
3	长信基金管理有限责任公司 下 部基金 2021 年中期报告提示性公告	上证报、中证报、证 券 报、证券日报、 中国证监会 披 露 、公司	2021 年 月 31 日
3	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 购和 业务的公告	上证报、中国证监会 披露 、公司	2021 年 9 月 1 日
3	长信基金管理有限责任公司关于 银 行股份有限公司 下部分开放式基金代 并开 、定期定 投资业务及 购（ 定投 购） 动的公告	上证报、中国证监会 披露 、公司	2021 年 9 月 1 日
3	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 购和 业务的公告	上证报、中国证监会 披露 、公司	2021 年 9 月 2 日
3	长信基金管理有限责任公司关于 上 基 基金 有限公司 下部分开放式基金 代 并开 、定期定 投资业务及 购（ 定投 购）、 回 动 的公告	上证报、中国证监会 披露 、公司	2021 年 10 月 21 日
39	长信利息收益开放式证券投资基金 2021 年 第 3 度报告	中国证监会 披 露 、公司	2021 年 10 月 2 日
0	长信基金管理有限责任公司 下 部基金	上证报、中证报、证	2021 年 10 月 2

	2021 年第三 度报告提示性公告	券 报、证券日报、 中国证监会 披 露 、公司	日
1	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基金经理的公告	上证报、中国证监会 披露 、公司	2021 年 10 月 29 日
2	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 要（更新）	中国证监会 披 露 、公司	2021 年 11 月 2 日
3	长信基金管理有限责任公司关于 国 证券股份有限公司 下部分开放式基金 代 并开 、定期定 投资业务及 购（ 定投 购） 动的公 告	上证报、中国证监会 披露 、公司	2021 年 11 月 9 日
	长信基金管理有限责任公司关于 证 券股份有限公司 下部分开放式基金代 并开 、定期定 投资业务及 购（ 定投 购） 动的公告	上证报、中国证监会 披露 、公司	2021 年 11 月 1 日
	长信基金管理有限责任公司关于 金 过 中 购（ ） 下所有 基金 的公告	上证报、中国证监会 披露 、公司	2021 年 11 月 23 日
	长信利息收益开放式证券投资基金更新的招 募说明书（2021 年第 1 ）及基金产品 资料 要（更新）	中国证监会 披 露 、公司	2021 年 11 月 30 日
	长信基金管理有限责任公司关于 证 券股份有限公司 下部分开放式基金代 并开 、定期定 投资业务及 购（ 定投 购） 动的公告	上证报、中国证监会 披露 、公司	2021 年 12 月 2 日
	长信基金管理有限责任公司关于 上 基金 有限公司 下部分开放式基金 代 并开 、定期定 投资业务及 购（ 定投 购） 动的公 告	上证报、中国证监会 披露 、公司	2021 年 12 月 3 日
9	长信基金管理有限责任公司关于 证 券股份有限公司 下部分开放式基金代 并开 、定期定 投资业务及 购（ 定投 购） 动的公告	上证报、中国证监会 披露 、公司	2021 年 12 月 23 日
0	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 购和 业务的公告	上证报、中国证监会 披露 、公司	2021 年 12 月 2 日

§12 投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内 一投资者持有基金份 或 过 20%的情况

注：本基金本报告期内未有 一投资者持有基金份 或 过 20 的情况。

12.2 投资者决策的其他重要信息

注：本基金本报告期未发 投资者决策的其他重要信息。

§13 目录

13.1 目录

- 1、中国证监会 准 立基金的
- 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
 - 、长信利息收益开放式证券投资基金招募说明书
 - 、报告期内在指定报 上披露的 公告的原
 - 、中国农业银行证券交易资金 算
 - 、长信基金管理有限责任公司 业 、公司 程及相关资 复 。

13.2 存放

基金管理人的 公场所。

13.3 阅方式

长信基金管理有限责任公司 :

长信基金管理有限责任公司

2022 年 3 月 31 日