

# 长信利息收益开放式证券投资基金2011年年度报告

2011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：2012年3月28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），根据本基金合同规定，于2012年3月27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2011年1月1日起至2011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.....	7
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况.....	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	11
§ 4 管理人报告.....	13
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	13
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.....	15
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.....	17
§ 5 托管人报告.....	18
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	18
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.....	18
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	18
§ 6 审计报告.....	19
6.1 审计报告基本信息.....	19
6.2 审计报告的基本内容.....	19
§ 7 年度财务报表.....	21
7.1 资产负债表.....	21
7.2 利润表.....	22
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	23
7.4 报表附注.....	24
§ 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 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	52
8.5 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细.....	52
8.6 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离.....	53
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细.....	53
8.8 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开放式基金的情况.....	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监管部门稽查或处罚的情况.....	57
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.....	58
11.9 其他重大事件.....	58
§ 12 备查文件目录.....	63
12.1 备查文件目录.....	63
12.2 存放地点.....	63
12.3 查阅方式.....	63

## § 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	
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	5,721,456,770.86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
下属分级基金的交易代码	519999	519998
报告期末下属分级基金的份额总额	1,536,901,643.90份	4,184,555,126.96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	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。 2、资产配置策略

	<p>根据对市场利率走势的判断, 结合各品种之间流动性、收益性及风险情况, 确定组合的资产配置, 在保证组合高流动性、低风险的前提下尽量提升组合的收益。</p> <p>3、无风险套利策略</p> <p>由于市场分割, 使银行间市场与交易所市场的资金面和市场短期利率在一定时间可能存在定价偏离。同时在一定时间内市场中也可能出现跨品种、跨期限套利机会。本基金将在充分论证套利的可行性基础上谨慎参与。</p> <p>4、现金流预算管理策略</p> <p>通过对未来现金流的预测, 在投资组合的构建中, 采取合理的期限和权重配置对现金流进行预算管理, 以满足基金运作的要求。同时在一部分资金管理上, 将采用滚动投资策略, 以提高基金资产的流动性。</p>
业绩比较基准	银行活期存款利率(税后)
风险收益特征	本基金为货币市场基金, 其预期收益和预期风险水平低于债券型、混合型和股票型基金, 属于预期收益和预期风险偏低的基金品种。

## 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		长信基金管理有限责任公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	周永刚	李芳菲
	联系电话	021-61009999	010-63201510
	电子邮箱	zhouyg@cxfund.com.cn	lifangfei@abchina.com
客户服务电话		4007005566	95599
传真		021-61009999	010-63201816
注册地址		上海市浦东新区银城中路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号时代金融中心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
邮政编码		200120	100031
法定代表人		田丹	蒋超良

## 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	www.cxfund.com.cn

互联网网址	
基金年度报告备置地点	上海银城中路68号时代金融中心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	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	北京西城区太平洋桥大街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	2011年		2010年		2009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	40,233,363.03	165,265,704.41	73,008,035.88	9,881,893.49	86,815,679.11	—
本期利润	40,233,363.03	165,265,704.41	73,008,035.88	9,881,893.49	86,815,679.11	—
本期净值收益率	3.94%	4.19%	2.05%	0.33%	1.62%	—
3.1.2 期末数据和指标	2011年末		2010年末		2009年末	
期末基金资产净值	1,536,901,643.90	4,184,555,126.96	772,120,475.58	3,754,754,193.08	9,902,746,179.49	—
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	—
3.1.3 累计期末指标	2011年末		2010年末		2009年末	
累计净值收益率	23.37%	4.53%	18.70%	0.33%	16.31%	—

注：1、自2007年4月1日起，本基金收益分配按月结转份额。

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



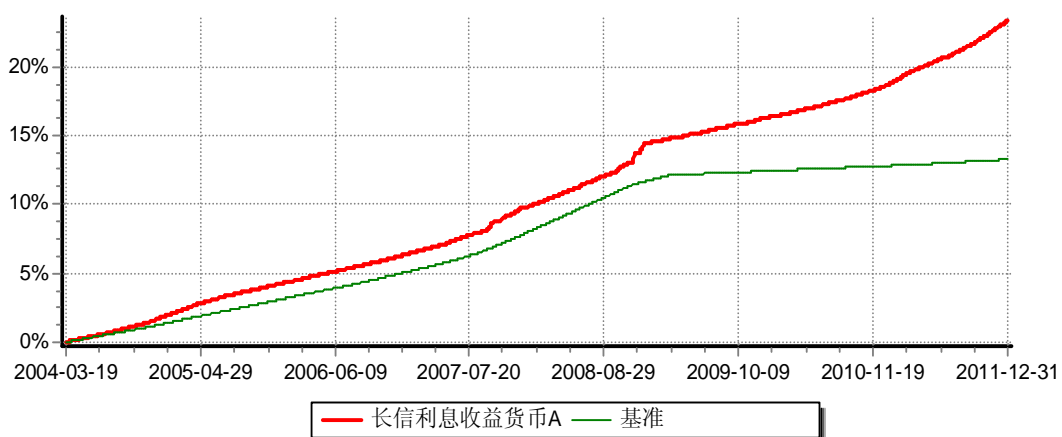
阶段 (长信利息收益货币A)	份额净值 收益率①	份额净 值收益 率标准 差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	1.2325%	0.0032%	0.1278%	0.0000%	1.1047%	0.0032%
过去六个月	2.2139%	0.0034%	0.2556%	0.0000%	1.9583%	0.0034%
过去一年	3.9417%	0.0032%	0.4762%	0.0001%	3.4655%	0.0031%
过去三年	7.7889%	0.0041%	1.6000%	0.0013%	6.1889%	0.0028%
过去五年	16.0436%	0.0098%	8.2485%	0.0041%	7.7951%	0.0057%
自基金合同生效日起 至今(2004年03月19 日-2011年12月31日)	23.3750%	0.0081%	13.2851%	0.0033%	10.0899%	0.0048%

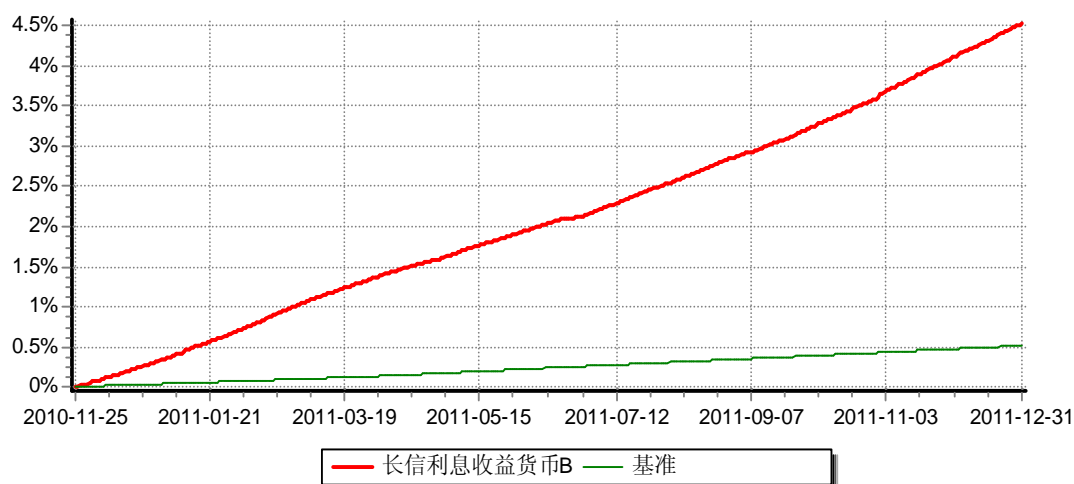
阶段 (长信利息收益货币B)	份额净值 收益率①	份额净 值收益 率标准 差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	1.2928%	0.0032%	0.1278%	0.0000%	1.1650%	0.0032%
过去六个月	2.3368%	0.0034%	0.2556%	0.0000%	2.0812%	0.0034%
过去一年	4.1903%	0.0032%	0.4762%	0.0001%	3.7141%	0.0031%
自销售服务费分级日 起至今(2010年11月25 日-2011年12月31日)	4.5347%	0.0033%	0.5132%	0.0002%	4.0215%	0.0031%

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

#### 3.2.2.1 长信利息收益货币A自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



### 3.2.2.2 长信利息收益货币B自基金分级以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、长信利息收益货币A图示日期为2004年3月19日至2011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2011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第十五条（（八）投资限制）的规定：

（1）投资于同一公司发行的短期企业债券的比例，不得超过基金资产净值的10%；

（2）存放在具有基金托管资格的同一商业银行的存款，不得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，不得超过基金资产净值的5%；

（3）在全国银行间债券市场债券正回购的资金余额不得超过基金资产净值的20%；

（4）投资于短期金融工具的比重不低于基金资产总值的80%；

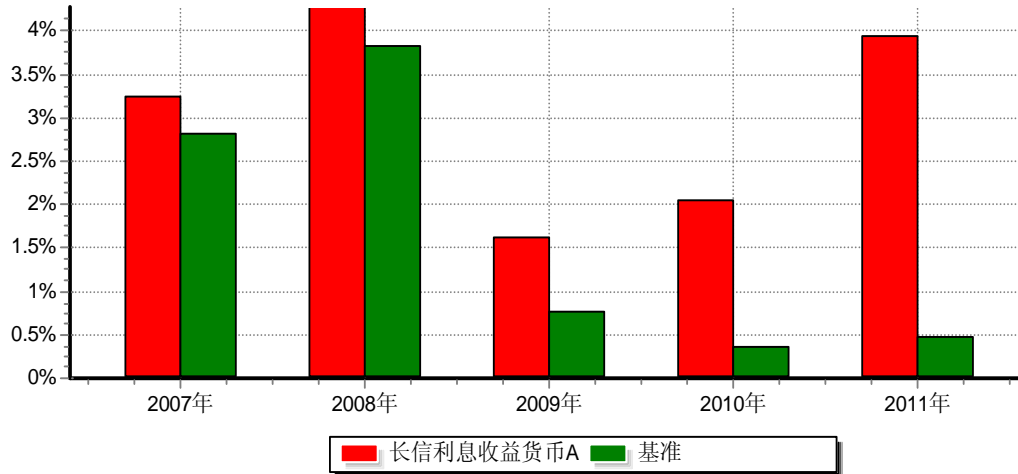
（5）中国证监会、中国人民银行规定的其他比例限制。

本基金投资组合的平均剩余期限，不超过180天。

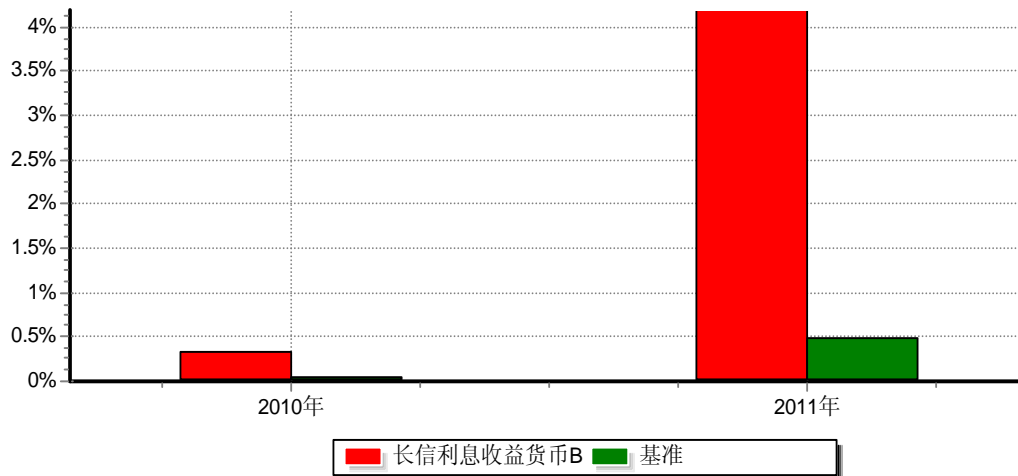
由于证券市场波动或投资组合处于调整过程中，造成基金在某一时间无法达到上述比例限制，本基金管理人将在10个交易日内积极调整基金投资组合，以达到上述比例限制。

### 3.2.3 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比较

#### 3.2.3.1 长信利息收益货币A过去五年以来每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



#### 3.2.3.2 长信利息收益货币B自基金分级以来每年净值收益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

#### 3.3.1 长信利息收益货币A过去三年的利润分配情况

单位：人民币元

年度 (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	年度利润 分配合计	备注
2011年	31,594,248.78	7,787,794.75	851,319.50	40,233,363.03	

2010年	64,640,951.38	9,690,484.17	-1,323,399.67	73,008,035.88	
2009年	84,067,812.96	33,535,039.13	-30,787,172.98	86,815,679.11	
合计	180,303,013.12	51,013,318.05	-31,259,253.15	200,057,078.02	

### 3.3.2 长信利息收益货币B过去三年的利润分配情况

单位：人民币元

年度 (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	年度利润 分配合计	备注
2011年	128,041,016.23	35,656,066.60	1,568,621.58	165,265,704.41	
2010年	5,441,446.20	1,337,417.98	3,103,029.31	9,881,893.49	
合计	133,482,462.43	36,993,484.58	4,671,650.89	175,147,597.90	

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2007年4月1日前按日结转份额，2007年4月1日后按月结转份额。

## § 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。目前股权结构为：长江证券股份有限公司占49%、上海海欣集团股份有限公司占34.33%、武汉钢铁股份有限公司占16.67%。

截至2011年12月31日，本基金管理人管理13只开放式基金，即长信利息收益货币、长信银利精选股票、长信金利趋势股票、长信增利动态策略股票、长信双利优选混合、长信利丰债券、长信恒利优势股票、长信中证中央企业100指数（LOF）、长信中短债债券、长信量化先锋股票、长信标普100等权重指数（QDII）、长信利鑫分级债和长信内需成长股票。

#### 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期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
万莉	本基金的基金经理	2011年06月04日	—	6年	经济学硕士，华南理工大学国民经济专业研究生毕业，具有基金从业资格。曾在广州银行任职债券交易员，2008年6月加入长信基金管理有限责任公司，先后担任交易管理部债券交易员、固定收益部基金经理助理，负责债券交易及投资研究工作，现任本基金的基金经理。
张文琍	固定收益部副总监，长信中短债证券投资基	2005年11月26日	2011年06月04日	18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

	金和长信利鑫分级债券型证券投资基金的基金经理			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交易员、基金经理助理、基金经理职务。现任固定收益部副总监，长信中短债证券投资基金和长信利鑫分级债券型证券投资基金的基金经理。
--	------------------------	--	--	--

注：1、本基金基金经理的任职日期以刊登变更基金经理的公告披露日为准；

2、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 公平交易制度的执行情况

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

##### 4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本报告期内，公司所管理的各基金之间不存在投资风格相类似的投资组合；公司没有管理的投资风格相似的不同投资组合之间的业绩表现差异超过5%之情形。

### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现可能异常交易行为。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2011年宏观经济政策在抑制通胀预期的前提下，延续了上一年的紧缩态势，一季度债券市场在充裕的流动性推动下走出一波上涨行情，随后在央行数次上调存款准备金率及加息的累积效应下行情发生转向，二季度市场出现流动性拐点，货币市场利率和债券市场利率纷纷创出历史新高，在持续的流动性压力和强烈的通胀预期双重作用下债市承压遭遇深幅调整，收益率在8月的短暂回调之后进入高位盘整。四季度在经济增速回落，通胀预期逐步减弱、流动性缓解的情况下，债市全面回暖。

本组合在年初市场资金的积极参与下规模急速增长，随之采取谨慎的防御策略提高组合的流动性配置，并在二季度的流动性紧缩期间积极减持债券拉低久期，较好的规避了市场随后的深幅调整。并在三季度货币市场利率高企的阶段增配了同业存款及回购等高流动性资产，提高了组合的安全性和收益性。在四季度经济增速及通胀预期双双回落的前提下，增加了债券资产的配置，适度拉长久期，为组合的收益奠定基础。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2011年12月末，本基金规模为57.21亿，比年初规模增加了26.39%；本年度长信利息货币A净值增长率为3.94%，高于同期业绩比较基收益346.55bp，长信利息货币B净值增长率为4.19%，高于同期业绩比较基收益371.41bp。

## 4.5 管理人对对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2012年经济增速将延续去年四季度的态势持续回落，经济景气程度下滑，经济增长方式的转变和外围经济的冲击将给国内经济增加变数，货币政策的放松将逐步显现，其针对性将有所加强，放松的节奏和方式是否如市场预期仍有待观察。资金面总体而言将比2011年有所改观。信贷放松将适度缓解地方财政及企业的现金流紧张状况，但对经济下滑所带来的信用风险仍需持谨慎态度。总的来说，上

半年市场具有对债市的正面驱动因素，收益率有望下行，下半年的通胀及政策变化的不确定性有所加大。

下阶段的投资工作我们将继续秉承谨慎原则，加强组合的流动性管理，在做好利率风险控制的同时，增加对新经济环境下信用风险的考量。合理控制组合久期，密切关注经济走势和政策动向，紧跟组合规模变动进行资产配置，争取在流动安全的前提下，为投资人获取更好的收益。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2011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基本实现，各项业务安全稳健运行，各项制度基本执行到位，有效保证业务风险的内控可靠性，未有不正当损害投资者利益与股东权益，未造成重大社会负面影响。公司治理、投资研究、营销与销售、后台运营、信息技术、行政与人力资源、投资管理人员行为规范与三条底线管理、反洗钱等重点业务领域的内部控制与风险管理取得良好成效。

2、公司已完成相关内部控制基础建设工作，内控管理继续深入开展，进一步推进事前的风险识别与防范措施改进完善，事中的监察控制及事后的问题督办。

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、公司内部控制制度体系不断完善，符合合法合规性、全面性、审慎性、适时性、自觉性原则的要求，符合基金销售费用及销售资金结算、基金行业人员离任审计及审查、特定客户资产管理业务、公平交易及三条底线管理等方面的最新监管要求。



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。

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》的规定，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，小组成员由投资管理部总监、固定收益部总监、研究发展部总监、交易管理部总监、金融工程部总监、基金事务部总监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、按月结转，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 205,499,067.44 元，已分配利润 205,499,067.44元。

## § 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

在托管长信利息收益开放式证券投资基金的过程中,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《长信利息收益开放式证券投资基金基金合同》、《长信利息收益开放式证券投资基金托管协议》的约定,对长信利息收益开放式证券投资基金管理人—长信基金管理有限责任公司2011年1月1日至2011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

在托管长信利息收益开放式证券投资基金的过程中,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《长信利息收益开放式证券投资基金基金合同》、《长信利息收益开放式证券投资基金托管协议》的约定,对长信利息收益开放式证券投资基金管理人—长信基金管理有限责任公司2011年1月1日至2011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。

### 5.3 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长信利息收益开放式证券投资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	KPMG-B(2012)AR No. 0125

### 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2011年12月31日的资产负债表、2011年度的利润表和所有者权益（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、《证券投资基金会计核算业务指引》、《长信利息收益开放式证券投资基金基金合同》及中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）允许的如财务报表附注所列示的基金行业实务操作的有关规定编制财务报表，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	<p>我们的责任是在实施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职业道德规范，计划和实施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。</p> <p>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，我们考虑与财务报表编制相关的内部控制，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基金管理人选用会计政策的恰当性</p>

	<p>和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>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。</p>
<p>审计意见段</p>	<p>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、《证券投资基金会计核算业务指引》、《长信利息收益开放式证券投资基金基金合同》及中国证监会允许的如财务报表附注所列示的基金行业实务操作的有关规定编制，公允反映了长信利息收益货币基金2011年12月31日的财务状况以及2011年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>
<p>注册会计师的姓名</p>	<p>王国蓓、黄小熠</p>
<p>会计师事务所的名称</p>	<p>毕马威华振会计师事务所</p>
<p>会计师事务所的地址</p>	<p>北京东长安街1号东方广场东2座8层</p>
<p>审计报告日期</p>	<p>2012-03-21</p>

## § 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：2011年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2011年12月31日	上年度末 2010年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	3,041,011,870.70	1,222,467,749.87
结算备付金		300,000.00	3,766,363.64
存出保证金		300,000.00	300,000.00
交易性金融资产	7.4.7.2	1,859,185,768.39	1,871,681,221.29
其中：股票投资		—	—
基金投资		—	—
债券投资		1,859,185,768.39	1,871,681,221.29
资产支持证券投资		—	—
衍生金融资产		—	—
买入返售金融资产	7.4.7.3	788,232,582.36	1,736,695,405.04
应收证券清算款		—	—
应收利息	7.4.7.4	60,311,538.54	34,128,038.89
应收股利		—	—
应收申购款		100.00	—
递延所得税资产		—	—
其他资产		—	—
资产总计		5,749,341,859.99	4,869,038,778.73
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2011年12月31日</b>	<b>上年度末 2010年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		—	—
交易性金融负债		—	—
衍生金融负债		—	—
卖出回购金融资产款		—	324,999,267.50
应付证券清算款		—	—

应付赎回款		18,407,141.61	10,722,725.67
应付管理人报酬		1,457,360.26	1,009,408.38
应付托管费		441,624.29	305,881.34
应付销售服务费		218,078.07	157,816.40
应付交易费用	7.4.7.5	65,233.58	70,771.16
应交税费		253,600.00	253,600.00
应付利息		—	57,769.86
应付利润		6,537,310.84	4,117,369.76
递延所得税负债		—	—
其他负债	7.4.7.6	504,740.48	469,500.00
负债合计		27,885,089.13	342,164,110.07
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.7	5,721,456,770.86	4,526,874,668.66
未分配利润	7.4.7.8	—	—
所有者权益合计		5,721,456,770.86	4,526,874,668.66
负债和所有者权益总计		5,749,341,859.99	4,869,038,778.73

注：报告截止日2011年12月31日，基金份额净值1.0000元，基金份额总额5,721,456,770.86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：2011年1月1日至2011年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2011年1月1日至2011 年12月31日	上年度可比期间 2010年01月01日至 2010年12月31日
<b>一、收入</b>		249,120,266.30	120,609,270.13
1. 利息收入		254,036,715.73	111,871,927.57
其中：存款利息收入	7.4.7.9	88,811,846.15	25,220,885.11
债券利息收入		96,019,766.62	50,834,546.76
资产支持证券利息收入		—	—
买入返售金融资产收入		69,205,102.96	35,816,495.70
其他利息收入		—	—
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-4,916,449.43	8,737,342.56
其中：股票投资收益		—	—

基金投资收益		—	—
债券投资收益	7.4.7.10	-4,916,449.43	8,737,342.56
资产支持证券投资收益		—	—
衍生工具收益		—	—
股利收益		—	—
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		—	—
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		—	—
5. 其他收入（损失以“-”号填列）		—	—
<b>减：二、费用</b>		43,621,198.86	37,719,340.76
1. 管理人报酬		17,383,863.51	13,932,359.30
2. 托管费		5,267,837.45	4,221,927.05
3. 销售服务费		3,156,736.66	9,831,573.21
4. 交易费用		—	—
5. 利息支出		17,182,433.58	9,095,193.27
其中：卖出回购金融资产支出		17,182,433.58	9,095,193.27
6. 其他费用	7.4.7.11	630,327.66	638,287.93
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		205,499,067.44	82,889,929.37
减：所得税费用		—	—
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		205,499,067.44	82,889,929.37

### 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：2011年1月1日至2011年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011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）	4,526,874,668.66	—	4,526,874,668.66
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）		205,499,067.44	205,499,067.44

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）	1,194,582,102.20	—	1,194,582,102.20
其中：1. 基金申购款	47,375,292,529.91	—	47,375,292,529.91
2. 基金赎回款	-46,180,710,427.71	—	-46,180,710,427.71
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）	—	-205,499,067.44	-205,499,067.44
五、期末所有者权益（基金净值）	5,721,456,770.86	—	5,721,456,770.86
项 目	上年度可比期间 2010年01月01日至2010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）	9,902,746,179.49	—	9,902,746,179.49
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	82,889,929.37	82,889,929.37
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）	-5,375,871,510.83	—	-5,375,871,510.83
其中：1. 基金申购款	24,280,332,839.24	—	24,280,332,839.24
2. 基金赎回款	-29,656,204,350.07	—	-29,656,204,350.07
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）	—	-82,889,929.37	-82,889,929.37
五、期末所有者权益（基金净值）	4,526,874,668.66	—	4,526,874,668.66

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：

田丹

蒋学杰

孙红辉

基金管理人  
基金资产管理公司负责人

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《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)》并报中国证监会备案,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。

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”。

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。

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

本基金按照中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)于2006年2月15日颁布的《企业会计准则-基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证券业协会于2007年颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《长信利息收益开放式证券投资基金基金合同》和中国证监会允许的如财务报表附注7.4.4所列示的基金行业实务操作的规定编制年度财务报表。

#### 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2011年12月31日的财务状况、2011年度的经营成果和基金净值变动情况。

此外本财务报表同时符合如财务报表附注7.4.2所列示的其他有关规定的要求。

#### 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。本基金编制财务报表采用的货币为人民币。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融资产在初始确认时按基金对金融资产的持有意图和持有能力分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。本基金目前持有的债券投资划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产;其他金融资产划分为应收款项,暂无金融资产划分为可供出售金融资产或持有至到期投资。

金融负债在初始确认时按承担负债的目的分类为:以公允价值计量且其变动

计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债在资产负债表中以交易性金融负债列示。

#### 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

##### (a) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产——债券投资

买入交易所或银行间的债券均于交易日确认为债券投资。债券投资成本按交易日债券的公允价值确认，取得时发生的相关交易费用直接计入初始确认金额，上述公允价值不包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息(作为应收利息单独核算)。

卖出债券于交易日确认债券投资收益/(损失)。出售债券的成本按移动加权平均法结转。

##### (b) 应收款项

应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

应收款项以公允价值作为初始确认金额，采用实际利率法以摊余成本进行后续计量，直线法与实际利率法确定的金额差异较小的可采用直线法，其中买入返售金融资产以融出资金应付或实际支付的总额作为初始确认金额，相关交易费用计入初始成本。终止确认或摊销时收入计入当期损益。

##### (c) 其他金融负债

其他金融负债是指除以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债以外的金融负债。

其他金融负债按公允价值和相关交易费用作为初始确认金额，采用实际利率法以摊余成本进行后续计量，直线法与实际利率法确定的金额差异较小的可采用直线法，其中卖出回购金融资产款以融入资金应收或实际收到的总额作为初始确认金额，相关交易费用计入初始成本。终止确认或摊销时的支出计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

##### (a) 债券投资

本基金债券投资的估值采用摊余成本法，即估值对象以买入成本列示，按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内摊销，每日计提收益或损

失。本基金不采用市场利率和上市交易的债券和票据的市价对债券投资进行估值。

(b) 应收款项及其他金融负债

本基金的应收款项及其他金融负债在初始确认后,采用实际利率法按摊余成本进行估值,直线法与实际利率法确定的余额差异较小的可采用直线法。

如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的,基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后,按最能反映公允价值的价格估值。

相关法律法规以及监管部门有强制规定的,从其规定。如有新增事项,按国家最新规定估值。

本基金的金融资产和金融负债以上述原则确定的公允价值进行估值,另外对金融资产的特殊情况处理如下:

(c) 影子定价

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,采用其他可参考公允价值指标,对基金持有的估值对象进行重新评估,即“影子定价”。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偏离度的绝对值达到或超过0.25%时,基金管理人应根据风险控制的需要调整组合,使基金资产净值更能公允地反映基金资产净值。

计算影子价格时按如下原则确定债券投资的公允价值:

(i)对存在活跃市场的金融工具,如估值日有市价的,应采用市价确定公允价值;估值日无市价,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,应采用最近交易市价确定公允价值。

(ii)对存在活跃市场的金融工具,如估值日无市价,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,使潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在0.25%以上的,应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,确定公允价值。

(iii)当金融工具不再存在活跃市场,且其潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在0.25%以上的,应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，确定投资品种的公允价值。

公允价值是指在公平交易中熟悉情况的交易双方自愿进行资产交换或者债务清偿的金额。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。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。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：

- 本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的；
- 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 收入/(损失)的确认和计量

债券投资收益/(损失)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(适用于企业债和可转债等)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。如票面利率与实际利率出现重大差异，按实际利率计算利息收入。

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

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。

#### 7.4.4.9 费用的确认和计量

根据《长信利息收益开放式证券投资基金基金合同》的规定，本基金的基金管理人报酬按前一日基金资产净值0.33%的年费率逐日确认。

根据《长信利息收益开放式证券投资基金基金合同》的规定，本基金的基金托管费按前一日基金资产净值0.1%的年费率逐日确认。

根据《长信利息收益开放式证券投资基金基金合同》的规定，2010年11月25日前，本基金的基金销售服务费按前一日基金资产净值0.25%的年费率逐日计提。自2010年11月25日起，本基金实行销售服务费A、B分级收费方式。本基金的A级基金销售服务费按前一日基金资产净值0.25%的年费率逐日计提，本基金的B级基金销售服务费按前一日基金资产净值0.01%的年费率逐日计提。

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。

#### 7.4.4.10 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。本基金每日进行基金收益公告，以每万份基金份额收益为基准，为投资者每日计算并结转至应付利润科目，每月以红利再投资方式集中支付累计收益。

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。投资者当日收益的精度为0.01元，收益分派计算结果如为正，实行小数点第三位后截除，剩余部分划归基金财产；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。法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

#### **7.4.4.11 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并披露分部信息。

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

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。

#### **7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计**

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

### **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过重大会计差错。

### **7.4.6 税项**

#### **(1) 本基金适用的主要税项**

根据财税字[1998]55号文、财税字[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[2005]102号文《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107号文《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、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》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) 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) 对基金取得的债券的利息收入，由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。
- (d) 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。

(2) 应交税费

单位：人民币元

应交债券利息收入所得税	2011年	2010年
	253,600.00	253,600.00

该项系基金收到的债券发行人在支付债券利息时代扣代缴的利息税部分。

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 2011年12月31日	上年度末 2010年12月31日
活期存款	11,011,870.70	2,467,749.87
定期存款	3,030,000,000.00	1,220,000,000.00
其中：存款期限1个月以内	300,000,000.00	1,220,000,000.00
存款期限1-3个月	880,000,000.00	-
存款期限3个月到1年	1,850,000,000.00	-
合计	3,041,011,870.70	1,222,467,749.87

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末2011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	1,859,185,768.39	1,864,798,000.00	5,612,231.61	0.0981



市场					
合计		1,859,185,768.39	1,864,798,000.00	5,612,231.61	0.0981
项目		上年度末2010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	1,871,681,221.29	1,866,679,000.00	-5,002,221.29	-0.1105
	合计	1,871,681,221.29	1,866,679,000.00	-5,002,221.29	-0.1105

注：截至2011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。

#### 7.4.7.3 买入返售金融资产

##### 7.4.7.3.1 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2011年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
7天逆回购	48,500,192.75	—
12天逆回购	199,190,538.79	—
14天逆回购	200,790,501.19	—
16天逆回购	79,200,238.80	—
19天逆回购	50,000,275.00	—
21天逆回购	50,350,195.53	—
52天逆回购	98,000,347.00	—
55天逆回购	62,200,293.30	—
合计	788,232,582.36	
项目	上年度末2010年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
13天逆回购	199,000,618.50	
14天逆回购	155,800,473.70	
16天逆回购	50,000,195.00	
17天逆回购	20,000,150.00	
21天逆回购	80,000,240.00	
28天逆回购	78,500,317.75	

29天逆回购	348,501,082.75	
30天逆回购	248,000,692.00	
31天逆回购	456,891,365.34	
40天逆回购	100,000,270.00	—
合计	1,736,695,405.04	

#### 7.4.7.3.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

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。

#### 7.4.7.4 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末2011年12月31日	上年度末2010年12月31日
应收活期存款利息	1,288.77	3,733.59
应收定期存款利息	25,241,000.15	984,544.61
应收其他存款利息	—	—
应收结算备付金利息	297.00	22,565.52
应收债券利息	33,497,928.23	29,563,411.80
应收买入返售证券利息	1,571,024.39	3,553,783.37
应收申购款利息	—	—
合计	60,311,538.54	34,128,038.89

#### 7.4.7.5 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末2011年12月31日	上年度末2010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	65,233.58	70,771.16
合计	65,233.58	70,771.16

#### 7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末2011年12月31日	上年度末2010年12月31日
应付券商交易单元保证金	—	—
应付赎回费	240.48	—
信息披露费-上证报	340,000.00	240,000.00
审计费用	80,000.00	80,000.00

预提帐户维护费	4,500.00	4,500.00
信息披露费-证券日报	80,000.00	—
券商席位佣金	—	145,000.00
合计	504,740.48	469,500.00

#### 7.4.7.7 实收基金

##### 7.4.7.7.1 长信利息收益货币A

金额单位：人民币元

项目(长信利息收益货币A)	本期2011年1月1日至2011年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	772,120,475.58	772,120,475.58
本期申购	11,349,093,615.59	11,349,093,615.59
本期赎回(以“-”号填列)	-10,584,312,447.27	-10,584,312,447.27
本期末	1,536,901,643.90	1,536,901,643.90

##### 7.4.7.7.2 长信利息收益货币B

金额单位：人民币元

项目(长信利息收益货币B)	本期2011年1月1日至2011年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	3,754,754,193.08	3,754,754,193.08
本期申购	36,026,198,914.32	36,026,198,914.32
本期赎回(以“-”号填列)	-35,596,397,980.44	-35,596,397,980.44
本期末	4,184,555,126.96	4,184,555,126.96

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。

#### 7.4.7.8 未分配利润

##### 7.4.7.8.1 长信利息收益货币A

单位：人民币元

项目 (长信利息收益货币A)	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	40,233,363.03	—	40,233,363.03
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（以“-”号填列）	—	—	—
本期已分配利润	-40,233,363.03	—	-40,233,363.03
本期末	—	—	—

#### 7.4.7.8.2 长信利息收益货币B

单位：人民币元

项目 (长信利息收益货币B)	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	165,265,704.41	—	165,265,704.41
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（以“-”号填列）	—	—	—
本期已分配利润	-165,265,704.41	—	-165,265,704.41
本期末	—	—	—

#### 7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2011年1月1日至2011年12月31日	2010年01月01日至2010年12月31日
活期存款利息收入	34,591.54	2,046,547.31
定期存款利息收入	88,754,794.47	21,604,405.18
其他存款利息收入	—	—
结算备付金利息收入	17,739.61	1,566,100.12
其他	4,720.53	3,832.50
合计	88,811,846.15	25,220,885.11

注：此处其他列示的是TA保证金的利息收入。

#### 7.4.7.10 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年12月 31日	上年度可比期间 2010年01月01日至2010年 12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	10,810,353,977.46	5,208,846,453.93
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	10,717,470,033.36	5,136,094,685.34
减：应收利息总额	97,800,393.53	64,014,426.03
债券投资收益	-4,916,449.43	8,737,342.56

#### 7.4.7.11 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年12月 31日	上年度可比期间 2010年01月01日至2010年 12月31日
审计费用	80,000.00	80,000.00
信息披露费	180,000.00	180,000.00
帐户维护费	18,000.00	18,000.00
券商交易单元佣金	145,000.00	145,000.00
其他费用	207,327.66	215,287.93
合计	630,327.66	638,287.93

#### 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

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

本基金于资产负债表日后的收益分配事项如下：

2012年度	公告日	分配收益所属期间
第1号收益支付公告	2012年1月31日	自2011年12月21日起至2012年1月20日
第2号收益支付公告	2012年2月22日	自2012年1月30日起至2012年2月20日
第3号收益支付公告	2012年3月22日	自2012年2月21日起至2012年3月20日

#### 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
长江证券承销保荐有限责任公司	基金管理人控股股东的控股子公司
长江证券控股(香港)有限公司	基金管理人控股股东的控股子公司
长江期货有限公司	基金管理人控股股东的控股子公司
长江成长资本投资有限公司	基金管理人控股股东的控股子公司
上海海欣生物技术有限责任公司	基金管理人控股股东的控股子公司

#### 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 2011年1月1日至2011年12月31日		上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日	
	成交金额	占当期同类成交总额的比例	成交金额	占当期同类成交总额的比例
长江证券	350,000,000.00	100%	6,095,000,000.00	100%

##### 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 2011年1月1日至2011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%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2010年1月1日至2010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%	145,000.00	100%

注：本基金承担的席位使用费，以弥补券商相关的席位费用为原则，而不依据交易量。根据《证券交易席位及证券综合服务协议》，本基金管理人长信基金管理有限责任公司在租用长江证券交易专用席位进行债券交易的同时，从长江证券获

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	上年度可比期间
	2011年1月1日至2011年12月31日	2010年01月01日至2010年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	17,383,863.51	13,932,359.30
其中：支付销售机构的客户维护费	1,881,298.09	1,414,602.49

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：

$$\text{日基金管理费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.33\% / \text{当年天数}$$

##### 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
	2011年1月1日至2011年12月31日	2010年01月01日至2010年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	5,267,837.45	4,221,927.05

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：

$$\text{日基金托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.1\% / \text{当年天数}$$

##### 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		
	2011年1月1日至2011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	1,835,378.32	36,024.24	1,871,402.56
长信基金	160,113.84	348,241.16	508,355.00
长江证券	28,697.33	8,262.20	36,959.53

合计	2,024,189.49	392,527.60	2,416,717.09
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2010年01月01日至2010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	2,198,660.52	3,052.77	2,201,713.29
长信基金	6,030,311.81	21,959.01	6,052,270.82
长江证券	223,777.18	949.20	224,726.38
合计	8,452,749.51	25,960.98	8,478,710.49

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，其中长信利息收益货币A的销售服务费用按前一日的基金资产净值的0.25%年费率计提，长信利息收益货币B的销售服务费用按前一日的基金资产净值的0.01%年费率计提。基金销售服务费逐日计提，按月支付。计算公式为：

$$\text{日基金销售服务费} = \text{前一日基金资产净值} \times R\% / \text{当年天数}$$

R为该级基金的年销售服务费率

#### 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 2011年1月1日至2011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	50,148,583.33	321,093,439.70	-	-	2,805,340,000.00	739,634.29
上年度可比期间 2010年01月01日至2010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	563,139,545.22	79,501,858.08	-	-	1,464,070,000.00	105,363.54

#### 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 2011年1月1日至2011年12月31日		上年度可比期间 2010年01月01日至2010年12月31日	
	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
期初持有的基金份额	—	50,902,157.42	—	—
期间申购/买入总份额	—	22,745,463.91	50,781,849.63	120,307.79
期间因拆分变动的份 额	—	—	-50,781,849.63	50,781,849.63
减：期间赎回/卖出总 份额	—	—	—	—
期末持有的基金份额	—	73,647,621.33	—	50,902,157.42
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	—	1.76%	—	1.12%

注：期间申购总份额包括当期收益转份额部分。

**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**

份额单位：份

关联方名称	本期末 2011年12月31日			上年度末 2010年12月31日		
	持有的长信利 息收益货币A 份额	持有的 长信利 息收益 货币B份 额	持有的基 金份额占 基金总份 额的比例	持有的长信利 息收益货币A 份额	持有的 长信利 息收益 货币B份 额	持有的基 金份额占 基金总份 额的比例
长江证券 承销保荐 有限公司	1,736,143.30	—	0.11%	1,671,142.96	—	0.22%
上海海欣 生物技术 有限公司	775.43	—	0.00%	748.74	—	0.00%

注：本基金无申购赎回费。

**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 2011年1月1日至2011年12月31日		上年度可比期间 2010年01月01日至2010年12月31日	
	期末	当期	期末	当期

	存款余额	存款利息收入	存款余额	存款利息收入
中国农业银行股份有限公司	11,011,870.70	34,591.54	2,467,749.87	91,213.71

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2011年12月31日的相关余额为人民币300,000.00元（2010年：人民币3,766,363.64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

本基金在本年度与上一会计年度，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

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

单位：人民币元

已按再投资形式 转实收基金 (长信利息收益货币A)	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
31,594,248.78	7,787,794.75	851,319.50	40,233,363.03	-
已按再投资形式 转实收基金 (长信利息收益货币B)	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
128,041,016.23	35,656,066.60	1,568,621.58	165,265,704.41	-

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（2011年12月31日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.1.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2011年12月31日止,本基金没有从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款。

#### 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

本基金金融工具的风险主要包括:

信用风险

流动风险

利率风险

外汇风险

其他市场价格风险

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。

本基金基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由风险控制委员会、金融工程部和相关职能部门构成的多级风险管理架构体系。

##### 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。

本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行中国农业银行,其他定期存款存放在具有托管行资格的上海银行股份有限公司、中信银行股份有限公司、深圳发展银行股份有限公司和中国民生银行股份有限公司,与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金均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,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2011年12月31日	上年度末2010年12月31日
A-1	1,549,158,033.52	1,351,765,373.20
A-1以下		—
合计	1,549,158,033.52	1,351,765,373.20

注:上述表格中不含本基金于2011年12月31日持有的政策金融债、央行票据等免评级非信用债券合计人民币310,027,734.87元(2010年12月31日:人民币519,915,848.09元)。

**7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资**

本基金于本年末及上年末均未持有长期信用评级债券投资。

**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。

本基金管理人金融工程部,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,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。

#### 7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

单位:人民币元

本期末 2011年12 月31日	1个月以内	1-3 个月	3个月 -1年	1- 5 年	5 年 以上	无期限	合计
资产							
银行存款	311,011,870.70	880,000,000.00	1,850,000,000.00	—	—	—	3,041,011,870.70
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	—	289,939,007.03	1,569,246,761.36	—	—	—	1,859,185,768.39
买入返售证券	788,232,582.36	—	—	—	—	—	788,232,582.36
应收利息	1,727,274.38	20,290,080.68	38,294,183.48	—	—	—	60,311,538.54
应收申购款	100	—	—	—	—	—	100
资产总计	1,100,971,827.44	1,190,229,087.71	3,457,540,944.84	—	—	600,000.00	5,749,341,859.99
负债							
应付赎回款	18,407,141.61	—	—	—	—	—	18,407,141.61
应付管理人报酬	1,457,360.26	—	—	—	—	—	1,457,360.26
应付托管费	441,624.29	—	—	—	—	—	441,624.29
应付销售服务费	218,078.07	—	—	—	—	—	218,078.07

应付交易费用	65,233.58	—	—	—	—	—	65,233.58
应交税费	253,600.00	—	—	—	—	—	253,600.00
应付利润	6,537,310.84	—	—	—	—	—	6,537,310.84
其他负债	504,740.48	—	—	—	—	—	504,740.48
负债总计	27,885,089.13	—	—	—	—	—	27,885,089.13
流动性净额	1,073,086,738.31	1,190,229,087.71	3,457,540,944.84	—	—	600,000.00	5,721,456,770.86

单位：人民币元

上年度末 2010年12 月31日	1个月以内	1-3 个月	3个月 -1年	1- 5 年	5 年 以上	无期限	合计
资产							
银行存款	1,222,467,749.87	—	—	—	—	—	1,222,467,749.87
结算备付金	—	—	—	—	—	3,766,363.64	3,766,363.64
存出保证金	—	—	—	—	—	300,000.00	300,000.00
交易性金融资产	119,897,399.04	620,096,586.79	1,131,687,235.46	—	—	—	1,871,681,221.29
买入返售证券	1,636,695,135.04	100,000,270.00	—	—	—	—	1,736,695,405.04
应收利息	6,534,528.37	17,256,704.76	10,336,805.76	—	—	—	34,128,038.89
资产总计	2,985,594,812.32	737,353,561.55	1,142,024,041.22	—	—	4,066,363.64	4,869,038,778.73
负债							
卖出回购金融资产款	324,999,267.50	—	—	—	—	—	324,999,267.50
应付赎回款	10,722,725.67	—	—	—	—	—	10,722,725.67
应付管理人报酬	1,009,408.38	—	—	—	—	—	1,009,408.38
应付托管费	305,881.34	—	—	—	—	—	305,881.34
应付销售服务费	157,816.40	—	—	—	—	—	157,816.40
应付交易费用	70,771.16	—	—	—	—	—	70,771.16
应交税费	253,600.00	—	—	—	—	—	253,600.00
应付利息	57,769.86	—	—	—	—	—	57,769.86
应付利润	4,117,369.76	—	—	—	—	—	4,117,369.76
其他负债	469,500.00	—	—	—	—	—	469,500.00
负债总计	342,164,110.07	—	—	—	—	—	342,164,110.07

流动性净额	2,643,430,702.25	737,353,561.55	1,142,024,041.22	-	-	4,066,363.64	4,526,874,668.66
-------	------------------	----------------	------------------	---	---	--------------	------------------

#### 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。

本基金管理人金融工程部,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 2011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	2,941,011,870.70	100,000,000.00	-	-	-	3,041,011,870.70
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	708,875,832.20	1,150,309,936.19	-	-	-	1,859,185,768.39
买入返售金融资产	788,232,582.36	-	-	-	-	788,232,582.36
应收利息	-	-	-	-	60,311,538.54	60,311,538.54
应收申购款	-	-	-	-	100.00	100.00
资产总计	4,438,720,285.26	1,250,309,936.19	-	-	60,311,638.54	5,749,341,859.99
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	18,407,141.61	18,407,141.61

应付管理人报酬	—	—	—	—	1,457,360.26	1,457,360.26
应付托管费	—	—	—	—	441,624.29	441,624.29
应付销售服务费	—	—	—	—	218,078.07	218,078.07
应付交易费用	—	—	—	—	65,233.58	65,233.58
应交税费	—	—	—	—	253,600.00	253,600.00
应付利润	—	—	—	—	6,537,310.84	6,537,310.84
其他负债	—	—	—	—	504,740.48	504,740.48
负债总计	—	—	—	—	27,885,089.13	27,885,089.13
利率敏感度缺口	4,438,720,285.26	1,250,309,936.19	—	—	32,426,549.41	5,721,456,770.86
上年度末2010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	1,222,467,749.87	—	—	—	—	1,222,467,749.87
结算备付金	3,766,363.64	—	—	—	—	3,766,363.64
存出保证金	300,000.00	—	—	—	—	300,000.00
交易性金融资产	739,993,985.83	1,131,687,235.46	—	—	—	1,871,681,221.29
买入返售金融资产	1,736,695,405.04	—	—	—	—	1,736,695,405.04
应收证券清算款	—	—	—	—	—	—
应收利息	—	—	—	—	34,128,038.89	34,128,038.89
应收申购款	—	—	—	—	—	—
资产总计	3,703,223,504.38	1,131,687,235.46	—	—	34,128,038.89	4,869,038,778.73
负债						
卖出回购金融资产款	324,999,267.50	—	—	—	—	324,999,267.50
应付赎回款	—	—	—	—	10,722,725.67	10,722,725.67
应付管理人报酬	—	—	—	—	1,009,408.38	1,009,408.38
应付托管费	—	—	—	—	305,881.34	305,881.34
应付销售	—	—	—	—	157,816.40	157,816.40



服务费						
应付交易费用	-	-	-	-	70,771.16	70,771.16
应付税费	-	-			253,600.00	253,600.00
应付利息	-	-	-	-	57,769.86	57,769.86
应付利润	-	-	-	-	4,117,369.76	4,117,369.76
其他负债	-	-	-	-	469,500.00	469,500.00
负债总计	324,999,267.50	-	-	-	17,164,842.57	342,164,110.07
利率敏感度缺口	3,378,224,236.88	1,131,687,235.46	-	-	16,963,196.32	4,526,874,668.66

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2011年12月31日	上年度末2010年12月31日
	市场利率下降27个基点	3,015,503.73	2,284,992.39
	市场利率上升27个基点	-3,015,503.73	-2,284,992.39

#### 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

##### (a) 以公允价值计量的金融工具

下表按公允价值三个层级列示了以公允价值计量的金融资产工具于12月31日的账面价值。公允价值计量中的层级取决于对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值。三个层级的定义如下：

第一层级：相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价；

第二层级：直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除市场报价以外的有关资产或负债的输入值；

第三层级：以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

单位：人民币元

2011年	第一层级	第二层级	第三层级	合计
交易性金融资产				
债券投资	-	1,859,185,768.39	-	1,859,185,768.39

单位：人民币元

2010年	第一层级	第二层级	第三层级	合计
交易性金融资产				
债券投资	-	1,871,681,221.29	-	1,871,681,221.29

2011年，本基金金融工具的第一层级与第二层级之间没有发生重大转换。

2011年，本基金金融工具的公允价值的估值技术并未发生改变。

对于在资产负债表日以公允价值计量的交易性金融资产的公允价值信息，本基金在估计公允价值时运用的主要方法和假设参见附注7.4.4.4和7.4.4.5。

(b) 其他金融工具的公允价值(非以公允价值计量账面价值)

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括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	1,859,185,768.39	32.34
	其中：债券	1,859,185,768.39	32.34
	资产支持证券	—	—
2	买入返售金融资产	788,232,582.36	13.71
	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	3,041,311,870.70	52.90
4	其他各项资产	60,611,638.54	1.05
5	合计	5,749,341,859.99	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	10.52	
	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	—	—
	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。

### 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	129
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	160
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	69

**报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明**

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180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的比例 (%)	各期限负债占基金资产净值的比例 (%)
1	30天以内	13.98	—
2	30天(含)—60天	13.28	—
3	60天(含)—90天	12.41	—
4	90天(含)—180天	35.29	—
5	180天(含)—397天(含)	24.47	—
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
	合计	99.43	—

**8.4 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	310,027,734.87	5.42
	其中：政策性金融债	310,027,734.87	5.42
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	1,549,158,033.52	27.08
6	中期票据	—	—
7	其他	—	—
8	合计	1,859,185,768.39	32.49
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	—	—

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

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	110414	11农发14	2,500,000	250,164,197.56	4.37
2	1181105	11荣盛CP01	800,000	79,887,940.17	1.40
3	1181215	11农垦CP01	700,000	69,836,328.78	1.22
4	041162007	11青投CP001	600,000	59,951,489.56	1.05
5	1181102	11闽建工CP01	500,000	50,009,355.10	0.87
6	1181099	11兵建工CP01	500,000	50,005,745.63	0.87
7	041154010	11石河子CP002	500,000	50,002,267.79	0.87
8	041154014	11铁二股CP001	500,000	50,002,033.73	0.87
9	041159004	11铁十九CP001	500,000	50,001,831.51	0.87
10	041160007	11方大CP001	500,000	50,001,830.02	0.87

### 8.6 “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	15
报告期内偏离度的最高值	0.1599
报告期内偏离度的最低值	-0.2989
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1026

### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 8.8 投资组合报告附注

#### 8.8.1 基金计价方法说明。

本基金采用摊余成本法计价。

8.8.2 本报告期内本基金不持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券,本报告期内不存在该类浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值的20%的情况。

8.8.3 本基金投资的前十名证券的发行主体本报告期内未出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

#### 8.8.4 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	60,311,538.54
4	应收申购款	100.00
5	其他应收款	—
6	待摊费用	—
7	其他	—
8	合计	60,611,638.54

#### 8.8.5 投资组合报告附注的其他文字描述部分。

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

## § 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	19,803	77,609.54	136,625,436.64	8.89%	1,400,276,207.26	91.11%
长信利息收益货币B	142	29,468,698.08	3,531,688,855.14	84.40%	652,866,271.82	15.60%
合计	19,945	286,861.71	3,668,314,291.78	64.12%	2,053,142,479.08	35.88%

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开放式基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	长信利息收益货币A	4,110,621.13	0.27%
	长信利息收益货币B	—	—
	合计	4,110,621.13	0.07%

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	长信利息收益货币A	长信利息收益货币B
基金合同生效日(2004年3月19日) 基金份额总额	7,042,630,886.94	3,112,528,981.09
本报告期期初基金份额总额	772,120,475.58	3,754,754,193.08
本报告期间基金总申购份额	11,349,093,615.59	36,026,198,914.32
减：本报告期间基金总赎回份额	10,584,312,447.27	35,596,397,980.44
本报告期间基金拆分变动份额	—	—
本报告期末基金份额总额	1,536,901,643.90	4,184,555,126.96



## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期未召开本基金的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

1、报告期内本基金管理人的重大人事变动：

本基金管理人于2011年10月21日召开股东会2011年第二次会议，会议审议通过《关于由胡柏枝先生接替余秉立先生担任长信基金管理有限责任公司第三届董事会独立董事的议案》，同意原独立董事余秉立先生辞去独立董事职务，并由胡柏枝先生接任。

2、本报告期内基金托管人的基金托管部门重大人事变动情况：

2011年1月21日，中国证监会核准中国农业银行股份有限公司张健基金行业高级管理人员任职资格（证监许可【2011】116号），张健任中国农业银行股份有限公司托管业务部总经理。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期没有涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略没有改变

### 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审计的报酬为人民币80,000.00元，该审计机构为本基金提供的审计服务的连续年限为8年。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况

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

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	债券交易		债券回购交易		应支付该券商的佣金		备注
		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	佣金	占当期佣金总量的比例	
长江证券	1	—	—	350,000,000.00	100.00%	145,000.00	100.00%	0

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

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	关于旗下基金2010年年度资产净值的公告	上证报、证券日报	2011-1-4
2	长信基金管理有限责任公司关于增加汉口银行股份有限公司为旗下基金代销机构的公告	上证报、证券日报	2011-1-15
3	长信基金管理有限责任公司关于增加国信证券股份有限公司为旗下基金代销机构的公告	上证报、证券日报	2011-1-15
4	长信基金管理有限责任公司关于通过国信证券股份有限公司开展基金定期定额投资业务的公告	上证报、证券日报	2011-1-15
5	长信基金管理有限责任公司关于通过汉口银行股份有限公司开展基金定期定额投资业务的公告	上证报、证券日报	2011-1-15
6	长信利息收益开放式证券投资基金收益支付公告（2011年1月）	上证报、证券日报	2011-1-22
7	长信利息收益开放式证券投资基金2010年第四季度报告	上证报、证券日报	2011-1-24
8	长信基金管理有限责任公司关于长信利息收益货币基金暂停申购和转换转入业务的公告	上证报、证券日报	2011-1-26
9	长信基金管理有限责任公司关于长信利息收益货币基金恢复申购和转换转入业务的公告	上证报、证券日报	2011-1-26
10	长信基金管理有限责任公司关于在申银万国证券开通旗下基金转换业务的公告	上证报、证券日报	2011-2-21
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收益支付公告（2011年2月）	上证报、证券日报	2011-2-23
12	长信基金管理有限责任公司关于运用本公司自有资金投资长信利息收益开放式证券投资基金（B级）的公告	上证报、证券日报	2011-3-8
13	长信基金管理有限责任公司关于调整旗下基金在交通银行基金定期定额投资业务起点金额的公告	上证报、证券日报	2011-3-9
14	长信基金管理有限责任公司关于开通汇付天下“天天盈”账户网上直销业务的公告	上证报、证券日报	2011-3-18
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收益支付公告（2011年3月）	上证报、证券日报	2011-3-23
16	长信基金管理有限责任公司关于长信利息收益货币基金暂停申购、转换转入业务的公告	上证报、证券日报	2011-3-29

17	长信基金管理有限责任公司关于长信利息收益货币基金恢复申购和转换转入业务的公告	上证报、证券日报	2011-3-29
18	长信利息收益开放式证券投资基金2010年年度报告（正文）及摘要	上证报、证券日报	2011-3-31
19	长信基金管理有限责任公司关于增加中信证券股份有限公司为旗下基金代销机构并开通部分基金定期定额投资业务的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2011-4-11
20	长信利息收益开放式证券投资基金2011年第一季度报告	上证报、证券日报	2011-4-21
21	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收益支付公告（2011年4月）	上证报、证券日报	2011-4-22
22	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、转换转入业务的公告	上证报、证券日报	2011-4-26
23	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恢复申购和转换转入业务的公告	上证报、证券日报	2011-4-26
24	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分证券投资基金开放日常转换业务的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2011-4-28
25	长信利息收益开放式证券投资基金更新的招募说明书及摘要2011年第【1】号	上证报、证券日报	2011-5-4
26	长信基金管理有限责任公司关于长信量化先锋股票型证券投资基金参加“长金通”网上直销基金转换及相关业务费率优惠的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2011-5-20
27	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收益支付公告（2011年5月）	上证报、证券日报	2011-5-24
28	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分基金在天相投资顾问有限公司开通定期定额投资业务的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2011-5-31
29	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、转换转入业务的公告	上证报、证券日报	2011-5-31
30	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恢复申购和转换转入业务的公告	上证报、证券日报	2011-5-31
31	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、中证报、证券时报、证券日报	2011-6-4
32	长信基金管理有限责任公司关于开通多交易账户业务的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2011-6-10

33	长信基金管理有限责任公司关于增加招商证券股份有限公司为旗下部分基金代销机构并开通定期定额投资业务的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2011-6-13
34	长信基金管理有限责任公司关于增加国盛证券有限责任公司为旗下部分基金代销机构并开通定期定额投资业务的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2011-6-18
35	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收益支付公告（2011年6月）	上证报、证券日报	2011-6-22
36	长信基金管理有限责任公司关于增加深圳发展银行股份有限公司为旗下部分基金代销机构的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2011-7-1
37	长信基金管理有限责任公司关于旗下基金2011年6月30日资产净值的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2011-7-1
38	长信基金管理有限责任公司关于增加杭州银行股份有限公司为旗下基金代销机构并开通定期定额投资业务的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2011-7-6
39	长信利息收益开放式证券投资基金2011年第二季度报告	上证报、证券日报	2011-7-19
40	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收益支付公告（2011年7月）	上证报、证券日报	2011-7-22
41	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收益支付公告（2011年8月）	上证报、证券日报	2011-8-24
42	长信利息收益开放式证券投资基金2011年半年度报告及摘要（仅摘要见报）	上证报、证券日报	2011-8-27
43	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	2011-9-6
44	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恢复申购和转换转入业务的公告	上证报、证券日报	2011-9-8
45	长信基金管理有限责任公司关于增加重庆银行股份有限公司为旗下基金代销机构的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2011-9-10
46	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收益支付公告（2011年9月）	上证报、证券日报	2011-9-22
47	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、转换转入业务的公告	上证报、证券日报	2011-9-27
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恢复申购、转换转入业务的公告	上证报、证券日报	2011-9-30
49	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收益支付公	上证报、证券日报	2011-10-22

	告（2011年10月）		
50	长信利息收益开放式证券投资基金 2011年第三季度报告	上证报、证券日报	2011-10-26
51	长信利息收益开放式证券投资基金更新的招募说明书（2011年第2号）及摘要	上证报、证券日报	2011-11-3
52	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收益支付公告（2011年11月）	上证报、证券日报	2011-11-23
53	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开通在上海证券交易所场内系统办理申购赎回业务的公告	上证报、证券日报	2011-12-16
54	长信基金管理有限责任公司关于增加广发证券股份有限公司为旗下部分基金代销机构并开通定期定额投资业务的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2011-12-17
55	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开通在上海证券交易所场内系统办理申购赎回业务的提示性公告	上证报、证券日报	2011-12-21
56	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收益支付公告（2011年12月）	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2011-12-22
57	长信基金管理有限责任公司关于增加中山证券有限责任公司为旗下基金代销机构并开通部分基金定期定额投资业务的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2011-12-22
58	长信基金管理有限责任公司关于增加东莞证券有限责任公司为旗下部分基金代销机构并开通定期定额投资业务的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2011-12-23
59	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	2011-12-27
60	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恢复申购和转换转入业务的公告	上证报、证券日报	2011-12-30

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立基金的文件；
- 2、《长信利息收益开放式证券投资基金基金合同》；
- 3、《长信利息收益开放式证券投资基金托管协议》；
- 4、《长信利息收益开放式证券投资基金招募说明书》；
- 5、报告期内在指定报刊上披露的各种公告的原稿；
- 6、《中国农业银行证券交易资金结算协议》；
- 7、长信基金管理有限责任公司营业执照、公司章程及相关资格批复文件。

### 12.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

### 12.3 查阅方式

投资者可在有效的工作时间内免费查阅，在支付工本费后，也可在有效的工作时间内取得上述文件的复制件或复印件。

长信基金管理有限责任公司

二〇一二年三月二十八日