

# 长信利息收益开放式证券投资基金

## 2024 年第 2 季度报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：长信基金管理有限责任公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：2024 年 7 月 19 日

## §1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金基金合同的规定，于 2024 年 7 月 17 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 4 月 1 日起至 2024 年 6 月 30 日止。

## §2 基金产品概况

|            |  |
|------------|--|
| 基金简称       | 长信利息收益货币   |
| 场内简称       | 长信利息   |
| 基金主代码      | 519999   |
| 基金运作方式     | 契约型开放式   |
| 基金合同生效日    | 2004 年 3 月 19 日  |
| 报告期末基金份额总额 | 66,434,183,664.19 份  |
| 投资目标       | 在尽可能保证基金财产安全和高流动性的基础上，追求超过银行存款的收益水平。   |
| 投资策略       | <p>1、利率预期策略</p> <p>通过对宏观经济、货币政策、短期资金供给等因素的分析，形成对利率走势的判断，并确定投资组合的平均剩余期限。</p> <p>2、资产配置策略</p> <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</p> |

|                 |  |                  |
|-----------------|--|------------------|
|                 | 满足基金运作的要求。同时在一部分资金管理上，将采用滚动投资策略，以提高基金资产的流动性。               |                  |
| 业绩比较基准          | 银行活期存款利率（税后）   |                  |
| 风险收益特征          | 本基金为货币市场基金，其预期收益和预期风险水平低于债券型、混合型和股票型基金，属于预期收益和预期风险偏低的基金品种。 |                  |
| 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   |                  |
| 下属分级基金的基金简称     | 长信利息收益货币 A   | 长信利息收益货币 B       |
| 下属分级基金的场内简称     | 利息 A   | 利息 B             |
| 下属分级基金的交易代码     | 519999   | 519998           |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 66,136,810,085.98 份  | 297,373,578.21 份 |

### §3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标      | 报告期（2024 年 4 月 1 日-2024 年 6 月 30 日） |                |
|-------------|-------------------------------------|----------------|
|             | 长信利息收益货币 A                          | 长信利息收益货币 B     |
| 1. 本期已实现收益  | 268,375,623.75                      | 1,403,856.80   |
| 2. 本期利润     | 268,375,623.75                      | 1,403,856.80   |
| 3. 期末基金资产净值 | 66,136,810,085.98                   | 297,373,578.21 |

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益，由于货币市场基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，封闭式基金交易佣金、开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

长信利息收益货币 A

| 阶段    | 净值收益率<br>① | 净值收益率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①—③     | ②—④     |
|-------|------------|---------------|----------------|-----------------------|---------|---------|
| 过去三个月 | 0.4131%    | 0.0012%       | 0.0885%        | 0.0000%               | 0.3246% | 0.0012% |
| 过去六个月 | 0.9066%    | 0.0016%       | 0.1771%        | 0.0000%               | 0.7295% | 0.0016% |
| 过去一年  | 1.7998%    | 0.0015%       | 0.3565%        | 0.0000%               | 1.4433% | 0.0015% |
| 过去三年  | 5.6222%    | 0.0011%       | 1.0712%        | 0.0000%               | 4.5510% | 0.0011% |
| 过去五年  | 10.3032%   | 0.0013%       | 1.7921%        | 0.0000%               | 8.5111% | 0.0013% |

|            |          |         |          |         |          |         |
|------------|----------|---------|----------|---------|----------|---------|
| 自基金合同生效起至今 | 76.1582% | 0.0073% | 21.6925% | 0.0031% | 54.4657% | 0.0042% |
|------------|----------|---------|----------|---------|----------|---------|

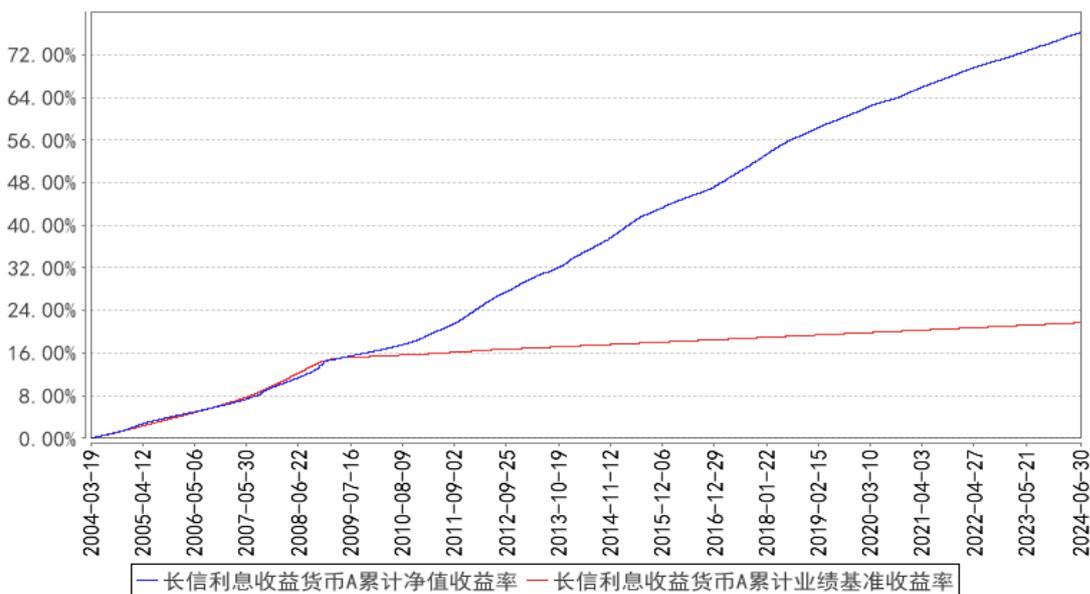
长信利息收益货币 B

| 阶段            | 净值收益率<br>① | 净值收益率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①-③      | ②-④     |
|---------------|------------|---------------|----------------|-----------------------|----------|---------|
| 过去三个月         | 0.4730%    | 0.0012%       | 0.0885%        | 0.0000%               | 0.3845%  | 0.0012% |
| 过去六个月         | 1.0269%    | 0.0016%       | 0.1771%        | 0.0000%               | 0.8498%  | 0.0016% |
| 过去一年          | 2.0446%    | 0.0015%       | 0.3565%        | 0.0000%               | 1.6881%  | 0.0015% |
| 过去三年          | 6.3853%    | 0.0011%       | 1.0712%        | 0.0000%               | 5.3141%  | 0.0011% |
| 过去五年          | 11.6339%   | 0.0013%       | 1.7921%        | 0.0000%               | 9.8418%  | 0.0013% |
| 自份额增加<br>日起至今 | 53.6988%   | 0.0037%       | 5.1494%        | 0.0001%               | 48.5494% | 0.0036% |

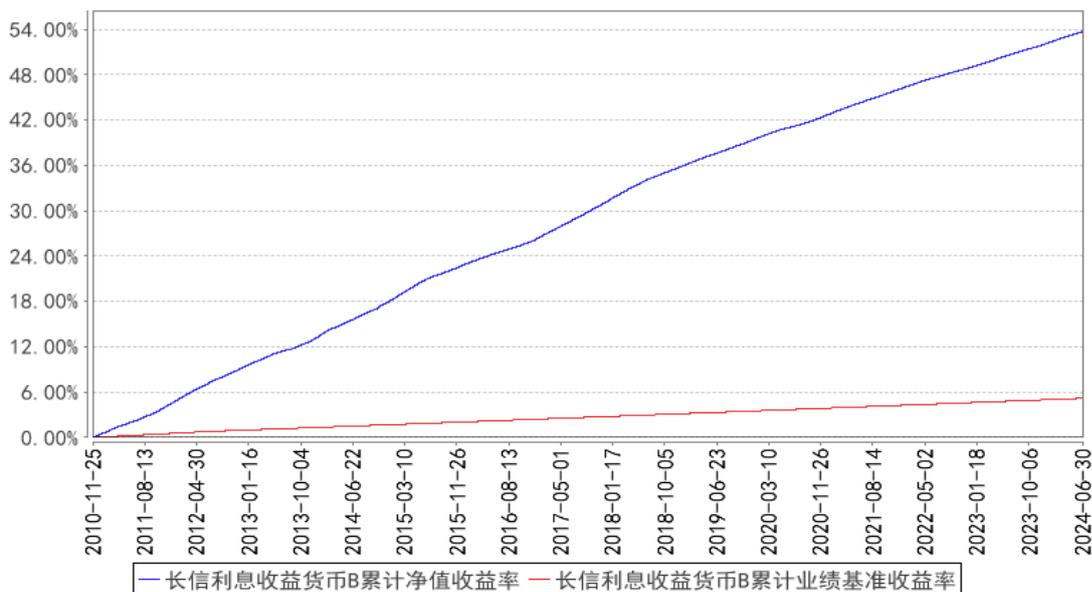
注：本基金收益分配按日结转份额。

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

长信利息收益货币A累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



长信利息收益货币B累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、长信利息收益货币 A 图示日期为 2004 年 3 月 19 日至 2024 年 6 月 30 日，长信利息收益货币 B 图示日期为 2010 年 11 月 25 日(本基金分级日)至 2024 年 6 月 30 日。

2、按基金合同规定，本基金自合同生效日起 3 个月内为建仓期；建仓期结束时，本基金的各项投资比例已符合基金合同的约定。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）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 |        |  |
| 陆莹 | 长信利息收益开放式证券投资基金、长信长金通货币市场基金、长信稳鑫三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长信浦瑞 87 个月定期开放债券型证券投资基金、长信稳惠债券型证券投资 | 2016 年 12 月 30 日 | -    | 14 年   | 管理学学士，毕业于上海交通大学，具有基金从业资格，中国国籍。2010 年 7 月加入长信基金管理有限责任公司，曾任基金事务部基金会计，交易管理部债券交易员、交易主管，债券交易部副总监、总监、现金理财部总监、长信稳裕三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长信纯债半年债券型证券投资基金、长信稳通三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长信易进混合型证券投资基金、长信稳健纯债债券型证券投资基金、长信富瑞两年定期开放债券型证券投资基金和长信中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金的基金经理。现任现金理财部副总监、长信利息收益开放式证券投资基金、长信长金通货币市场基金、长信稳鑫三个月定 |

|     |   |                 |   |     |   |
|-----|---|-----------------|---|-----|---|
|     | 基金和长信中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金的基金经理、现金理财部副总监 |                 |   |     | 期开放债券型发起式证券投资基金、长信浦瑞 87 个月定期开放债券型证券投资基金、长信稳惠债券型证券投资基金和长信中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金的基金经理。                                  |
| 俞玮晨 | 长信长金通货币市场基金、长信利息收益开放式证券投资基金的基金经理              | 2024 年 6 月 21 日 | - | 9 年 | 法国雷恩商学院国际金融研究生毕业，具有基金从业资格，中国国籍。曾任浦银安盛基金管理有限公司债券交易员、债券基金经理助理，2023 年 12 月加入长信基金管理有限责任公司，现任长信长金通货币市场基金和长信利息收益开放式证券投资基金的基金经理。 |

注：1、首任基金经理任职日期以本基金成立之日为准；新增或变更基金经理的日期根据对外披露的公告日期填写；

2、证券从业的含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

## 4.2 报告期内本基金运作合规守信情况说明

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 公平交易专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

#### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

回顾二季度，债券收益率呈倒 N 字型走势，季初各期限债券收益率延续之前的下行趋势，短端下行幅度大于长端，4 月底至 5 月上旬债市出现一波调整，债券收益率上行幅度在 15bp 左右，5 月中旬之后债券收益率继续下行，季末各期限品种较季初均有不同幅度的下行，其中一年期 AAA 存单收益率下行近 30bp。二季度货币政策维持稳定，市场流动性较为宽松，资金利率中枢小幅下行。4 月央行表态“长期国债收益率将运行在与长期经济增长预期相匹配的合理区间内”，债市出现一波调整，但整体上央行公开市场操作对资金面较为呵护，同时市场风险偏好仍低的情况下对债券配置需求较强，而政府债券供给减少且发行进度偏慢，调整之后债券收益率重新走低。在组合操作方面，本产品在二季度维持中性偏高久期，保持较高杠杆水平，提升组合静态收益，季末积极配置同业存款、同业存单和信用债等资产。

展望未来，积极政策对于经济数据的改善将逐渐体现，关注各项政策的推进落实和起效。6 月 7 日国常会强调“着力推动已出台政策措施落地见效，继续研究储备新的去库存、稳市场政策措施”，关注地产政策放开的效果和政府收储的进展。此外，下半年国债和地方政府专项债大概率将加速发行，积极财政政策也将支撑基建投资逐步回升。三季度资金面预计仍维持宽松，央行配合政府债券发行不排除会有降准可能，长期逻辑来看利率仍处于下行通道，在当前通胀水平和信贷提质增效背景下，债券供给影响带来的债市调整或有一定投资机会。未来我们将在保证货币基金安全性、流动性充足的基础上，通过把握阶段性资金面变化带来的投资机会，合理配置各类资产，匹配组合久期，努力提升组合收益。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2024 年 6 月 30 日，本报告期内长信利息收益货币 A 净值收益率为 0.4131%，长信利息收益货币 B 净值收益率为 0.4730%，同期业绩比较基准收益率为 0.0885%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

## §5 投资组合报告

#### 5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目                | 金额（元）             | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------------------|-------------------|--------------|
| 1  | 固定收益投资            | 22,927,529,581.26 | 31.37        |
|    | 其中：债券             | 22,927,529,581.26 | 31.37        |
|    | 资产支持证券            | -                 | -            |
| 2  | 买入返售金融资产          | 188,063,210.75    | 0.26         |
|    | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -                 | -            |
| 3  | 银行存款和结算备付金合计      | 49,977,737,089.20 | 68.37        |

|   |      |                   |        |
|---|------|-------------------|--------|
| 4 | 其他资产 | 843,088.08        | 0.00   |
| 5 | 合计   | 73,094,172,969.29 | 100.00 |

## 5.2 报告期债券回购融资情况

| 序号 | 项目           | 占基金资产净值的比例 (%)   |                |
|----|--------------|------------------|----------------|
| 1  | 报告期内债券回购融资余额 | 6.80             |                |
|    | 其中：买断式回购融资   | -                |                |
| 序号 | 项目           | 金额 (元)           | 占基金资产净值的比例 (%) |
| 2  | 报告期末债券回购融资余额 | 6,611,855,588.83 | 9.95           |
|    | 其中：买断式回购融资   | -                | -              |

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

## 债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的说明

本报告期内本基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的 20%。

## 5.3 基金投资组合平均剩余期限

### 5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

| 项目                | 天数  |
|-------------------|-----|
| 报告期末投资组合平均剩余期限    | 104 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 106 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 | 80  |

### 报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

本报告期内本基金投资组合平均剩余期限不存在超过 120 天的情况。

### 5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

| 序号 | 平均剩余期限                 | 各期限资产占基金资产净值的比例 (%) | 各期限负债占基金资产净值的比例 (%) |
|----|------------------------|---------------------|---------------------|
| 1  | 30 天以内                 | 29.16               | 9.95                |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                   | -                   |
| 2  | 30 天 (含) — 60 天        | 10.02               | -                   |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                   | -                   |
| 3  | 60 天 (含) — 90 天        | 8.58                | -                   |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                   | -                   |
| 4  | 90 天 (含) — 120 天       | 10.11               | -                   |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                   | -                   |
| 5  | 120 天 (含) — 397 天 (含)  | 51.81               | -                   |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动    | -                   | -                   |

|     |        |      |
|-----|--------|------|
| 利率债 |        |      |
| 合计  | 109.68 | 9.95 |

#### 5.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

本报告期内本基金投资组合平均剩余存续期不存在超过 240 天的情况。

#### 5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

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

#### 5.6 报告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

| 序号 | 债券代码      | 债券名称          | 债券数量（张）   | 摊余成本（元）        | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|---------------|-----------|----------------|--------------|
| 1  | 2128035   | 21 华夏银行 02    | 6,200,000 | 633,487,242.59 | 0.95         |
| 2  | 2128024   | 21 中国银行 02    | 5,300,000 | 542,659,891.42 | 0.82         |
| 3  | 2128046   | 21 浦发银行 02    | 5,200,000 | 530,137,318.18 | 0.80         |
| 4  | 112420049 | 24 广发银行 CD049 | 5,000,000 | 498,767,879.57 | 0.75         |
| 5  | 112421151 | 24 渤海银行 CD151 | 5,000,000 | 496,205,587.75 | 0.75         |
| 6  | 112413021 | 24 浙商银行 CD021 | 5,000,000 | 495,975,042.27 | 0.75         |
| 7  | 112413079 | 24 浙商银行 CD079 | 5,000,000 | 495,974,805.86 | 0.75         |
| 8  | 112315345 | 23 民生银行 CD345 | 4,100,000 | 408,754,777.80 | 0.62         |
| 9  | 112499313 | 24 广州银行 CD040 | 4,000,000 | 396,763,618.18 | 0.60         |
| 10 | 112490931 | 24 青岛银行 CD005 | 3,500,000 | 347,631,415.81 | 0.52         |

#### 5.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

| 项目                            | 偏离情况    |
|-------------------------------|---------|
| 报告期内偏离度的绝对值在 0.25（含）-0.5%间的次数 | 0       |
| 报告期内偏离度的最高值                   | 0.0501% |
| 报告期内偏离度的最低值                   | 0.0169% |
| 报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值        | 0.0302% |

#### 报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

本报告期内本基金不存在负偏离度的绝对值达到 0.25%的情况。

#### 报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

本报告期内本基金不存在正偏离度的绝对值达到 0.5% 的情况。

## 5.8 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 5.9 投资组合报告附注

### 5.9.1 基金计价方法说明

本基金采用摊余成本法计价。

### 5.9.2 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

报告期内本基金投资的前十名证券中，发行主体中国银行股份有限公司于 2023 年 12 月 28 日收到国家金融监督管理总局行政处罚信息公开表（金罚决字〔2023〕68 号），经查，中国银行股份有限公司存在以下情况：一、部分重要信息系统识别不全面，灾备建设和灾难恢复能力不符合监管要求；二、重要信息系统投产及变更未向监管部门报告，且投产及变更长期不规范引发重要信息系统较大及以上突发事件；三、信息系统运行风险识别不到位、处置不及时，引发重要信息系统重大突发事件；四、监管意见整改落实不到位，引发重要信息系统重大突发事件；五、信息科技外包管理不审慎；六、网络安全域未开展安全评估，网络架构重大变更未开展风险评估且未向监管部门报告；七、信息系统突发事件定级不准确，导致未按监管要求上报；八、迟报重要信息系统重大突发事件；九、错报漏报监管标准化（EAST）数据。综上，根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条和相关审慎经营规则，国家金融监督管理总局决定对中国银行处以罚款 430 万元。

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

报告期内本基金投资的前十名证券中，发行主体浙商银行股份有限公司于 2024 年 2 月 2 日收

到国家金融监督管理总局浙江监管局行政处罚信息公开表（浙金罚决字〔2024〕4号），经查，浙商银行股份有限公司存在以下情况：向小微企业客户转嫁成本，违规要求客户承担抵押评估费；向小微企业客户转嫁成本，违规要求客户承担抵押登记费。综上，根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条及相关审慎经营规则，国家金融监督管理总局浙江监管局决定对浙商银行处以罚款 55 万元。

报告期内本基金投资的前十名证券中，发行主体中国民生银行股份有限公司于 2023 年 8 月 2 日收到国家金融监督管理总局行政处罚信息公开表（金罚决字〔2023〕7号），经查，中国民生银行股份有限公司存在以下行为：一、规避委托贷款监管，违规利用委托债权投资业务向企业融资；二、违规贷款未整改收回情况下继续违规发放贷款；三、对政府平台公司融资行为监控不力，导致政府债务增加；四、股权质押管理问题未整改五、审计人员配备不足问题未整改；六、对相关案件未按照有关规定处置；七、未按监管要求将福费廷业务纳入表内核算；八、代销池业务模式整改不到位；九、违规开展综合财富管理代销业务整改不到位；十、个别贷款风险分类结果仍存在偏离，整改不到位；十一、发放违反国家宏观调控政策贷款仍未整改收回；十二、部分正常资产转让问题整改不到位；十三、部分不良资产转让问题整改不到位或未整改；十四、对部分违规问题未进行责任追究或追究不到位。综上，根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条和相关审慎经营规则，国家金融监督管理总局决定对民生银行处以罚款合计 4780 万元。其中，总行 4430 万元，分支机构 350 万元。

报告期内本基金投资的前十名证券中，发行主体广州银行股份有限公司于 2023 年 11 月 17 日收到国家金融监督管理总局广东监管局行政处罚信息公开表（2023 年 26 号），经查，广州银行股份有限公司存在以下情况：未全面认定关联自然人；未全面认定关联非自然人；关联交易未按规定备案；未按规定向监管部门报送关联交易情况；未经任职资格许可实际履行高管职责；违规出具询证函回函；询证函业务管理不到位；未向监管部门真实反映房地产贷款报表数据；未按规定进行资产风险分类；贷款风险分类工作管理不到位；向不符合规定的政府购买服务项目提供融资；违规向棚户区改造项目提供融资；向固定资产项目违规发放贷款；制度违反监管规定；贴现资金被用于定期存单质押担保开立银承；投资业务严重违反审慎经营规则。综上，根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十条，第二十一条第三款，第四十六条第一项、第三项、第五项，第四十八条第二项；《中华人民共和国商业银行法》第四十七条、第七十四条第三项、第八十九条第二款及相关审慎经营规则，国家金融监督管理总局广东监管局决定对广州银行没收违法所得并处罚款合计 1168.4 万元。

报告期内本基金投资的前十名证券中，发行主体青岛银行股份有限公司于 2023 年 7 月 4 日收

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

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

报告期内本基金投资的前十名证券中，发行主体青岛银行股份有限公司于 2024 年 1 月 2 日收到国家金融监督管理总局青岛监管局行政处罚信息公开表（青国金罚决字〔2024〕3号），经查，青岛银行股份有限公司存在监管标准化（EAST）数据错报漏报的情况，根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条和相关审慎经营规则，国家金融监督管理总局青岛监管局决定对青岛银行股份有限公司处以罚款人民币 30 万元。

对如上证券投资决策程序的说明：公司研究部门按照内部研究工作规范对该证券进行分析后将其列入基金投资对象备选库。在此基础上本基金的基金经理根据具体市场情况独立作出投资决策。该事件发生后，本基金管理人对该证券的发行主体进行了进一步了解与分析，认为此事件未对该证券投资价值判断产生重大的实质性影响。本基金投资于该证券的投资决策过程符合制度规定的投资权限范围与投资决策程序。

报告期内本基金投资的前十名证券中其余的发行主体未出现被监管部门立案调查或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

### 5.9.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额（元）      |
|----|---------|------------|
| 1  | 存出保证金   | 551,688.08 |
| 2  | 应收证券清算款 | -          |
| 3  | 应收利息    | -          |
| 4  | 应收申购款   | 291,400.00 |
| 5  | 其他应收款   | -          |
| 6  | 其他      | -          |
| 7  | 合计      | 843,088.08 |

### 5.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

## §6 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     |
|--------------|--------------------|----------------|
| 报告期期初基金份额总额  | 62,117,454,887.85  | 296,009,851.01 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 145,605,020,083.64 | 16,413,267.94  |
| 报告期期间基金总赎回份额 | 141,585,664,885.51 | 15,049,540.74  |
| 报告期期末基金份额总额  | 66,136,810,085.98  | 297,373,578.21 |

## §7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

| 序号 | 交易方式 | 交易日期       | 交易份额(份)   | 交易金额(元)   | 适用费率(%) |
|----|------|------------|-----------|-----------|---------|
| 1  | 红利再投 | 2024-04-01 | 43,268.68 | 43,268.68 | 0.0000  |
| 2  | 红利再投 | 2024-04-02 | 14,488.63 | 14,488.63 | 0.0000  |
| 3  | 红利再投 | 2024-04-03 | 14,653.79 | 14,653.79 | 0.0000  |
| 4  | 红利再投 | 2024-04-08 | 71,419.14 | 71,419.14 | 0.0000  |
| 5  | 红利再投 | 2024-04-09 | 14,569.18 | 14,569.18 | 0.0000  |
| 6  | 红利再投 | 2024-04-10 | 15,506.93 | 15,506.93 | 0.0000  |
| 7  | 红利再投 | 2024-04-11 | 15,262.54 | 15,262.54 | 0.0000  |
| 8  | 红利再投 | 2024-04-12 | 14,095.43 | 14,095.43 | 0.0000  |
| 9  | 红利再投 | 2024-04-15 | 42,969.39 | 42,969.39 | 0.0000  |
| 10 | 红利再投 | 2024-04-16 | 15,803.25 | 15,803.25 | 0.0000  |
| 11 | 红利再投 | 2024-04-17 | 13,615.96 | 13,615.96 | 0.0000  |
| 12 | 红利再投 | 2024-04-18 | 16,313.90 | 16,313.90 | 0.0000  |
| 13 | 红利再投 | 2024-04-19 | 13,577.60 | 13,577.60 | 0.0000  |
| 14 | 红利再投 | 2024-04-22 | 42,117.78 | 42,117.78 | 0.0000  |
| 15 | 红利再投 | 2024-04-23 | 13,476.18 | 13,476.18 | 0.0000  |
| 16 | 红利再投 | 2024-04-24 | 14,828.01 | 14,828.01 | 0.0000  |
| 17 | 红利再投 | 2024-04-25 | 17,531.38 | 17,531.38 | 0.0000  |
| 18 | 红利再投 | 2024-04-26 | 14,070.25 | 14,070.25 | 0.0000  |
| 19 | 红利再投 | 2024-04-29 | 41,631.40 | 41,631.40 | 0.0000  |
| 20 | 红利再投 | 2024-04-30 | 13,718.10 | 13,718.10 | 0.0000  |

|    |      |            |           |           |        |
|----|------|------------|-----------|-----------|--------|
| 21 | 红利再投 | 2024-05-06 | 79,474.29 | 79,474.29 | 0.0000 |
| 22 | 红利再投 | 2024-05-07 | 13,108.83 | 13,108.83 | 0.0000 |
| 23 | 红利再投 | 2024-05-08 | 12,980.23 | 12,980.23 | 0.0000 |
| 24 | 红利再投 | 2024-05-09 | 12,964.39 | 12,964.39 | 0.0000 |
| 25 | 红利再投 | 2024-05-10 | 12,925.30 | 12,925.30 | 0.0000 |
| 26 | 红利再投 | 2024-05-13 | 38,186.36 | 38,186.36 | 0.0000 |
| 27 | 红利再投 | 2024-05-14 | 26,577.03 | 26,577.03 | 0.0000 |
| 28 | 红利再投 | 2024-05-15 | 12,822.99 | 12,822.99 | 0.0000 |
| 29 | 红利再投 | 2024-05-16 | 33,269.83 | 33,269.83 | 0.0000 |
| 30 | 红利再投 | 2024-05-17 | 17,672.73 | 17,672.73 | 0.0000 |
| 31 | 红利再投 | 2024-05-20 | 41,008.05 | 41,008.05 | 0.0000 |
| 32 | 红利再投 | 2024-05-21 | 26,742.56 | 26,742.56 | 0.0000 |
| 33 | 红利再投 | 2024-05-22 | 13,610.50 | 13,610.50 | 0.0000 |
| 34 | 红利再投 | 2024-05-23 | 12,801.15 | 12,801.15 | 0.0000 |
| 35 | 红利再投 | 2024-05-24 | 12,640.95 | 12,640.95 | 0.0000 |
| 36 | 红利再投 | 2024-05-27 | 37,404.12 | 37,404.12 | 0.0000 |
| 37 | 红利再投 | 2024-05-28 | 12,398.42 | 12,398.42 | 0.0000 |
| 38 | 红利再投 | 2024-05-29 | 12,958.55 | 12,958.55 | 0.0000 |
| 39 | 红利再投 | 2024-05-30 | 12,308.02 | 12,308.02 | 0.0000 |
| 40 | 红利再投 | 2024-05-31 | 12,261.30 | 12,261.30 | 0.0000 |
| 41 | 红利再投 | 2024-06-03 | 36,857.79 | 36,857.79 | 0.0000 |
| 42 | 红利再投 | 2024-06-04 | 12,404.79 | 12,404.79 | 0.0000 |
| 43 | 红利再投 | 2024-06-05 | 12,327.57 | 12,327.57 | 0.0000 |
| 44 | 红利再投 | 2024-06-06 | 13,689.79 | 13,689.79 | 0.0000 |
| 45 | 红利再投 | 2024-06-07 | 12,487.37 | 12,487.37 | 0.0000 |
| 46 | 红利再投 | 2024-06-11 | 49,086.37 | 49,086.37 | 0.0000 |
| 47 | 红利再投 | 2024-06-12 | 13,413.01 | 13,413.01 | 0.0000 |
| 48 | 红利再投 | 2024-06-13 | 12,109.23 | 12,109.23 | 0.0000 |

|    |      |            |              |              |        |
|----|------|------------|--------------|--------------|--------|
| 49 | 红利再投 | 2024-06-14 | 12,270.67    | 12,270.67    | 0.0000 |
| 50 | 红利再投 | 2024-06-17 | 36,402.16    | 36,402.16    | 0.0000 |
| 51 | 红利再投 | 2024-06-18 | 12,127.00    | 12,127.00    | 0.0000 |
| 52 | 红利再投 | 2024-06-19 | 12,251.77    | 12,251.77    | 0.0000 |
| 53 | 红利再投 | 2024-06-20 | 12,113.52    | 12,113.52    | 0.0000 |
| 54 | 红利再投 | 2024-06-21 | 12,161.74    | 12,161.74    | 0.0000 |
| 55 | 红利再投 | 2024-06-24 | 36,727.61    | 36,727.61    | 0.0000 |
| 56 | 红利再投 | 2024-06-25 | 12,701.83    | 12,701.83    | 0.0000 |
| 57 | 红利再投 | 2024-06-26 | 12,191.80    | 12,191.80    | 0.0000 |
| 58 | 红利再投 | 2024-06-27 | 12,428.17    | 12,428.17    | 0.0000 |
| 59 | 红利再投 | 2024-06-28 | 13,689.79    | 13,689.79    | 0.0000 |
| 合计 |      |            | 1,264,645.30 | 1,264,645.30 |        |

注：基金管理人运用固有资金投资本基金费率按本基金招募说明书中公布的费率执行。

## §8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金本报告期内未有单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

### 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期未发生影响投资者决策的其他重要信息。

## §9 备查文件目录

### 9.1 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。

### 9.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

### 9.3 查阅方式

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

长信基金管理有限责任公司  
2024 年 7 月 19 日