

长信利息收益开放式证券投资基金 2020 年第 4 季度报告

2020 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

报告送出日期：2021 年 1 月 22 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 2021 年 1 月 20 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 2020 年 10 月 1 日起至 2020 年 12 月 31 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	24,403,331,983.12 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</p>

	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。	
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	23,506,130,837.33 份	897,201,145.79 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（2020年10月1日—2020年12月31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	132,878,400.45	4,983,825.24
2. 本期利润	132,878,400.45	4,983,825.24
3. 期末基金资产净值	23,506,130,837.33	897,201,145.79

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 ①	净值收益率 率标准差 ②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④

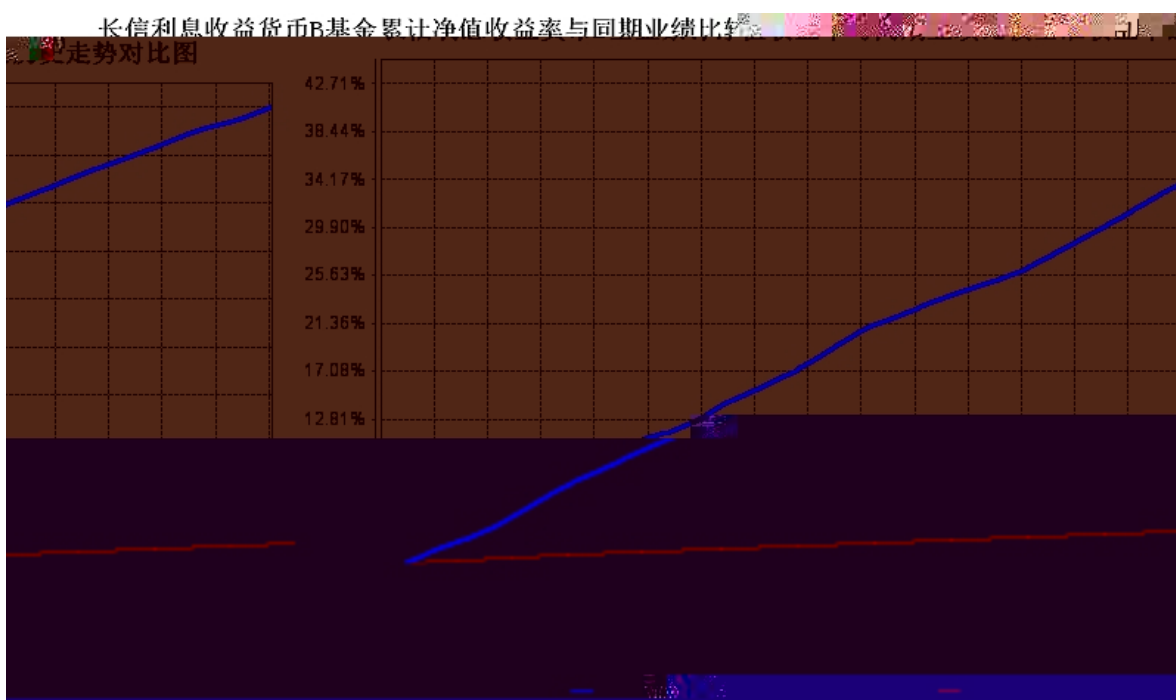
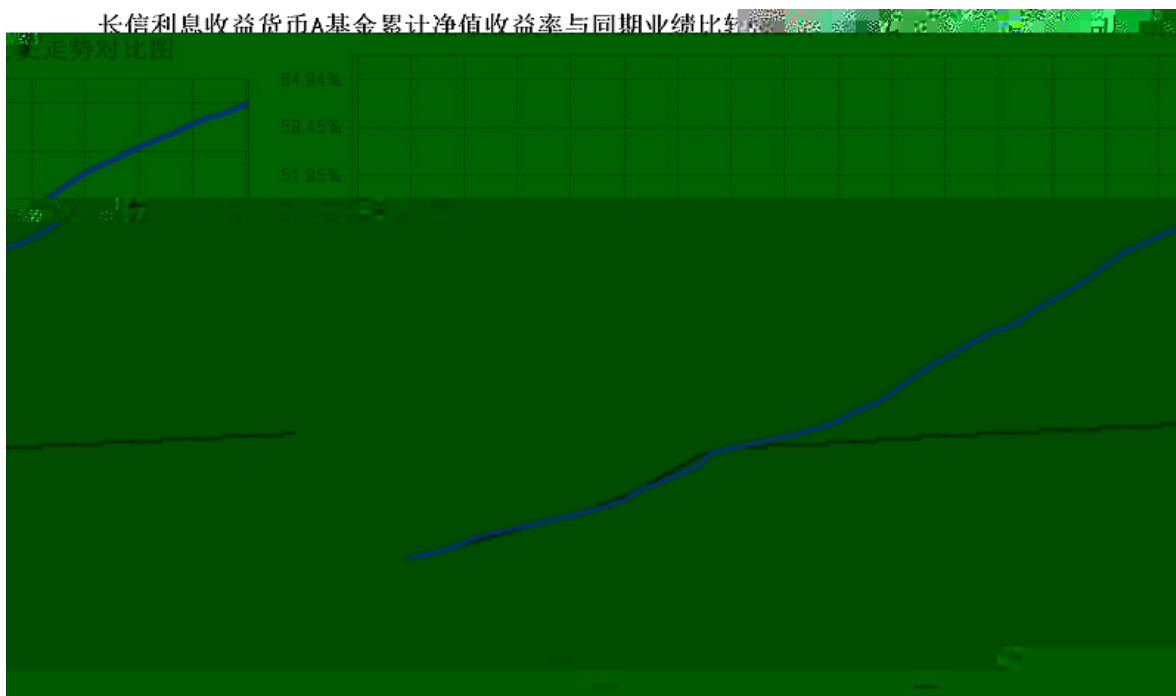
过去三个月	0.5949%	0.0008%	0.0895%	0.0000%	0.5054%	0.0008%
过去六个月	1.0228%	0.0012%	0.1790%	0.0000%	0.8438%	0.0012%
过去一年	2.0729%	0.0014%	0.3565%	0.0000%	1.7164%	0.0014%
过去三年	7.8742%	0.0021%	1.0712%	0.0000%	6.8030%	0.0021%
过去五年	14.8537%	0.0024%	1.7921%	0.0000%	13.0616%	0.0024%
自基金合同生效起至今	65.1457%	0.0062%	20.1910%	0.0033%	44.9547%	0.0029%

长信利息收益货币 B

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	0.6554%	0.0008%	0.0895%	0.0000%	0.5659%	0.0008%
过去六个月	1.1446%	0.0012%	0.1790%	0.0000%	0.9656%	0.0012%
过去一年	2.3179%	0.0014%	0.3565%	0.0000%	1.9614%	0.0014%
过去三年	8.5897%	0.0021%	1.0712%	0.0000%	7.5185%	0.0021%
过去五年	16.1717%	0.0024%	1.7921%	0.0000%	14.3796%	0.0024%
自基金合同生效起至今	42.6610%	0.0038%	3.8520%	0.0001%	38.8090%	0.0037%

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



注：1、长信利息收益货币 A 图示日期为 2004 年 3 月 19 日至 2020 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 2020 年 12 月 31 日。

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

§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、长信长金货币市场基金、长信稳鑫三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长信富瑞两年定期开放债券型证券投资基金、长信中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金和长信浦瑞 87 个月定期开放债券型证券投资基金的基金经理、现金理财部总监	2016 年 12 月 30 日	-	10 年	管理学学士，毕业于上海交通大学，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、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和长信稳通三个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理。现任现金理财部总监、长信利息收益开放式证券投资基金、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、长信长金货币市场基金、长信稳鑫三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长信富瑞两年定期开放债券型证券投资基金、长信中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金和长信浦瑞 87 个月定期开放债券型证券投资基金的基金经理。
段博卿	长信利息收益开放式证券投资基金、长信利率债债券型证券投资基金和长信稳鑫三个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理	2019 年 11 月 29 日	-	4 年	杜克大学经济学硕士，具有基金从业资格。曾任职于渣打银行（中国）有限公司、泰康资产管理有限责任公司和平安银行股份有限公司，2018 年 10 月加入长信基金管理有限责任公司，历任基金经理助理，现任长信利息收益开放式证券投资基金、长信利率债债券型证券投资基金和长信稳鑫

					三个月定期开放债券型发起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 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 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 报告期内基金投资策略和运作分析

2020 年 4 季度存单收益率先上后下，主要以 11 月 30 日央行超预期投放 MLF 为分界点。

央行投放 MLF 前，承接 3 季度逻辑，一级政府债券净融资仍然较大，而银行负债端压力也在加大：理财产品老产品有压降压力；结构性存款刚性压降任务导致负债流失；央行超储率整体维持低位。CD 各期限收益率继续冲高，达到年内高点。而 11 月 30 日央行超预期投放 MLF 后，信号意义较强，且后续资金面持续超预期呵护宽松，叠加 CD 主要需求方货币基金到达大量配置时点，

CD 收益率转为下行，基本回到年初水平。

本基金在整个 4 季度货币市场利率顶部区域大量配置，稳健操作，控制风险，为投资者创造较好回报。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2020 年 12 月 31 日，本报告期内长信利息收益货币 A 净值收益率为 0.5949%，长信利息收益货币 B 净值收益率为 0.6554%，同期业绩比较基准收益率为 0.0895%。

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	11,949,100,279.99	45.50
	其中：债券	11,949,100,279.99	45.50
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	7,000,130.50	0.03
	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	14,153,679,685.53	53.90
4	其他资产	150,345,409.11	0.57
5	合计	26,260,125,505.13	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	-	3.61
	其中：买断式回购融资	-	-
2	报告期末债券回购融资余额	1,840,396,439.40	7.54
	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

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

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	84
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	101
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	84

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

注：报告期内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	9.88	7.54
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)-60 天	28.65	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)-90 天	30.84	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)-120 天	8.54	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)-397 天(含)	29.08	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	106.99	7.54

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

注：报告期内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	496,503,669.11	2.03
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,869,996,779.91	7.66
	其中：政策性金融债	1,869,996,779.91	7.66
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	100,005,018.61	0.41
6	中期票据	-	-
7	同业存单	9,482,594,812.36	38.86
8	其他	-	-
9	合计	11,949,100,279.99	48.97
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序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	112011061	20 平安银行 CD061	5,000,000	497,722,649.46	2.04
2	112021375	20 渤海银行 CD375	5,000,000	496,899,616.71	2.04
3	160206	16 国开 06	4,400,000	440,064,723.61	1.80
4	112092017	20 广州银行 CD016	4,000,000	398,543,764.62	1.63
5	112004109	20 中国银行 CD109	4,000,000	394,558,381.69	1.62
6	180409	18 农发 09	3,200,000	321,600,959.54	1.32
7	112070419	20 广州农村商业银行 CD118	3,000,000	299,368,219.26	1.23
8	112014017	20 江苏银行 CD017	3,000,000	298,915,480.96	1.22
9	112011222	20 平安银行 CD222	3,000,000	298,340,204.67	1.22
10	112009214	20 浦发银行 CD214	3,000,000	298,216,502.97	1.22

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	0.0774%
报告期内偏离度的最低值	-0.0282%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0186%

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

注：报告期内不存在负偏离度的绝对值达到 0.25%的情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

注：报告期内不存在正偏离度的绝对值达到 0.5%的情况。

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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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受到调查以及处罚的情况的说明

报告期内本基金投资的前十名证券中，发行主体江苏银行股份有限公司于 2020 年 12 月 31 日收到江苏银保监局行政处罚信息公开表（苏银保监罚决字〔2020〕88 号），根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条第（五）项，经查，江苏银行股份有限公司存在：1、个人贷款资金用途管控不严；2、发放流动资金贷款偿还银行承兑汇票垫款；3、理财投资和同业投资非标准化债权资产未严格比照自营贷款管理；4、个人理财资金对接项目资本金；5、理财业务未与自营业务相分离；6、理财资金投资非标准化债权资产的余额超监管比例要求。综上，江苏银保监局决定对江苏银行股份有限公司罚款 240 万元。

报告期内本基金投资的前十名证券中，发行主体平安银行股份有限公司于 2020 年 1 月 20 日收到中国银保监会深圳监管局行政处罚决定书文（深银保监罚决字〔2020〕7 号），根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条，经查，平安银行股份有限公司违规事项如下：汽车金融事业部将贷款调查的核心事项委托第三方完成；代理保险销售的人员为非商业银行人员；汽车消费贷款风险分类结果不能反映真实风险水平；个人消费贷款风险分类结果不能反映真实风险水平；个人经营性贷款分类结果不能反映真实风险水平；汽车消费贷款和汽车抵押贷款贷前调查存在缺失；汽车消费及经营贷款审查不到位；个人汽车贷款和汽车抵押贷款业务存在同一抵押物重复抵押；个别汽车消费贷款和汽车抵押贷款用途管控不力，贷款资金被挪用；个人消费贷款及个人经营性贷款用途管控不力，贷款资金被挪用；部分个人消费贷款未按要求进行受托支付；信用卡现金分期用途管控不力；代销产品风险评级结果与合作机构评级结果不一致，未采用较高风险评级的评级结果；代销产品底层资产涉及本行非标资产，没有实现代销业务与其他业务的风险隔离；“双录”管理审慎性不足，理财销售人员销售话术不当。综上，中国银保监会深圳监管局决定对平安银行股份有限公司罚款 720 万元。

报告期内本基金投资的前十名证券中，发行主体平安银行股份有限公司于 2020 年 10 月 16 日收到宁波银保监局行政处罚信息公开表（甬银保监罚决字〔2020〕66 号），根据《中华人民共和国

国银行业监督管理法》第四十六条，经查，平安银行股份有限公司贷款资金用途管控不到位、借贷搭售、对房地产开发贷及预售资金监管不力等。综上，宁波银保监局决定对平安银行股份有限公司合计罚款人民币 100 万元。

报告期内本基金投资的前十名证券中，发行主体上海浦东发展银行股份有限公司于 2020 年 8 月 10 日收到上海银保监局行政处罚信息公开表（沪银保监银罚决字（2020）12 号），根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条第（五）项等，经查，上海浦东发展银行股份有限公司 2013 年至 2018 年存在下列违法违规事实：未按专营部门制规定开展同业业务；同业投资资金违规投向“四证”不全的房地产项目；延迟支付同业投资资金吸收存款；为银行理财资金投向非标准化债权资产违规提供担保；未按规定进行贷款资金支付管理与控制；个人消费贷款贷后管理未尽职；通过票据转贴现业务调节信贷规模；银行承兑汇票业务保证金来源审核未尽职；办理无真实贸易背景的贴现业务；委托贷款资金来源审查未尽职；未按权限和程序办理委托贷款业务；未按权限和程序办理非融资性保函业务。综上，中国银行保险监督管理委员会上海监管局决定对上海浦东发展银行股份有限公司采取责令改正措施，并处罚款共计 2100 万元。

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 2020 年 12 月 1 日收到中国银行保险监督管理委员会行政处罚信息公开表（银保监罚决字（2020）60 号），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，经查，中国银行“原油宝”产品风险事件相关违法违规行为主要包括：产品管理不规范，包括保证金相关合同条款不清晰、产品后评价工作不独立、未对产品开展压力测试相关工作等；风险管理不审慎，包括市场风险限额设置存在缺陷、市场风险限额调整和超限操作不规范、交易系统功能存在缺陷未按要求及时整改等；内控管理不健全，包括绩效考核和激励机制不合理、消费者权益保护履职不足、全行内控合规检查未涵盖全球市场部对私产品销售管理等；销售管理不合规，包括个别客户年龄不满足准入要求、部分宣传销售文本内容存在夸大或者片面宣传、采取赠送实物等方式销售产品等。综上，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罚款 5050 万元。

报告期内本基金投资的前十名证券中，发行主体国家开发银行于 2020 年 12 月 25 日收到中国银行保险监督管理委员会处罚决定书（银保监罚决字（2020）67 号），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，经查，国家开发银行：一、为违规的政府购买服务项目提供融资；二、项目资本金管理不到位，棚改贷款项目存在资本金违规抽回情况；三、违规变相发放土地储备贷款；四、设置不合理存款考核要求，以贷转存，虚增存款；五、贷款风险分类不准确；六、向资产管理公司以外的主体批量转让不良信贷资产；七、违规进行信贷资产拆分转让，隐匿信贷资产质量；八、向棚改业务代理结算行强制搭售低收益理财产品；

九、扶贫贷款存贷挂钩；十、易地扶贫搬迁贷款“三查”不尽职，部分贷款资金未真正用于扶贫搬迁；十一、未落实同业业务交易对手名单制监管要求；十二、以贷款方式向金融租赁公司提供同业融资，未纳入同业借款业务管理；十三、以协定存款方式吸收同业存款，未纳入同业存款业务管理；十四、风险隔离不到位，违规开展资金池理财业务；十五、未按规定向投资者充分披露理财产品投资非标准化债权资产情况；十六、逾期未整改，屡查屡犯，违规新增业务；十七、利用集团内部交易进行子公司间不良资产非洁净出表；十八、违规收取小微企业贷款承诺费；十九、收取财务顾问费质价不符；二十、利用银团贷款承诺费浮利分费；二十一、向检查组提供虚假整改说明材料；二十二、未如实提供信贷资产转让台账；二十三、案件信息迟报、瞒报；二十四、对以往监管检查中发现的国别风险管理问题整改不到位。综上，中国银行保险监督管理委员会决定对国家开发银行罚款 4880 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五名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	300,000.00
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	150,045,409.11
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	其他	-
7	合计	150,345,409.11

5.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

§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	17,638,592,988.08	525,524,142.25

报告期期间基金总申购份额	116,924,988,323.25	514,949,176.96
报告期期间基金总赎回份额	111,057,450,474.00	143,272,173.42
报告期期末基金份额总额	23,506,130,837.33	897,201,145.79

§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	2020年10月9日	145,962.86	145,962.86	0.00%
2	红利再投	2020年10月12日	48,107.38	48,107.38	0.00%
3	红利再投	2020年10月13日	16,506.85	16,506.85	0.00%
4	红利再投	2020年10月14日	16,462.45	16,462.45	0.00%
5	红利再投	2020年10月15日	16,177.68	16,177.68	0.00%
6	红利再投	2020年10月16日	33,919.99	33,919.99	0.00%
7	红利再投	2020年10月19日	49,247.33	49,247.33	0.00%
8	红利再投	2020年10月20日	16,502.51	16,502.51	0.00%
9	红利再投	2020年10月21日	16,685.60	16,685.60	0.00%
10	红利再投	2020年10月22日	16,451.21	16,451.21	0.00%
11	红利再投	2020年10月23日	16,472.28	16,472.28	0.00%
12	红利再投	2020年10月26日	49,499.84	49,499.84	0.00%
13	红利再投	2020年10月27日	16,520.72	16,520.72	0.00%
14	红利再投	2020年10月28日	16,518.67	16,518.67	0.00%
15	红利再投	2020年10月29日	23,618.63	23,618.63	0.00%
16	红利再投	2020年10月30日	16,925.43	16,925.43	0.00%
17	红利再投	2020年11月2日	50,370.35	50,370.35	0.00%
18	红利再投	2020年11月3日	20,214.92	20,214.92	0.00%
19	红利再投	2020年11月4日	16,997.45	16,997.45	0.00%
20	红利再投	2020年11月5日	16,909.44	16,909.44	0.00%
21	红利再投	2020年11月6日	17,064.12	17,064.12	0.00%
22	红利再投	2020年11月9日	51,160.44	51,160.44	0.00%
23	红利再投	2020年11月10日	16,914.40	16,914.40	0.00%
24	红利再投	2020年11月11日	17,016.15	17,016.15	0.00%
25	红利再投	2020年11月12日	17,003.14	17,003.14	0.00%
26	红利再投	2020年11月13日	16,969.05	16,969.05	0.00%
27	红利再投	2020年11月16日	50,820.59	50,820.59	0.00%
28	红利再投	2020年11月17日	17,081.18	17,081.18	0.00%
29	红利再投	2020年11月18日	17,040.21	17,040.21	0.00%
30	红利再投	2020年11月19日	17,031.39	17,031.39	0.00%
31	红利再投	2020年11月20日	17,046.05	17,046.05	0.00%
32	红利再投	2020年11月23日	50,928.18	50,928.18	0.00%
33	红利再投	2020年11月24日	16,980.18	16,980.18	0.00%

34	红利再投	2020 年 11 月 25 日	17,047.86	17,047.86	0.00%
36	红利再投	2020 年 11 月 26 日	17,219.72	17,219.72	0.00%
37	红利再投	2020 年 11 月 27 日	17,277.91	17,277.91	0.00%
38	红利再投	2020 年 11 月 30 日	52,516.91	52,516.91	0.00%
39	红利再投	2020 年 12 月 1 日	17,583.33	17,583.33	0.00%
40	红利再投	2020 年 12 月 2 日	17,942.07	17,942.07	0.00%
41	红利再投	2020 年 12 月 3 日	18,212.48	18,212.48	0.00%
42	红利再投	2020 年 12 月 4 日	18,068.50	18,068.50	0.00%
43	红利再投	2020 年 12 月 7 日	53,632.20	53,632.20	0.00%
44	红利再投	2020 年 12 月 8 日	17,848.33	17,848.33	0.00%
45	红利再投	2020 年 12 月 9 日	18,034.33	18,034.33	0.00%
46	红利再投	2020 年 12 月 10 日	18,309.50	18,309.50	0.00%
47	红利再投	2020 年 12 月 11 日	18,613.29	18,613.29	0.00%
48	红利再投	2020 年 12 月 14 日	55,539.78	55,539.78	0.00%
49	红利再投	2020 年 12 月 15 日	18,347.87	18,347.87	0.00%
50	红利再投	2020 年 12 月 16 日	18,455.59	18,455.59	0.00%
51	红利再投	2020 年 12 月 17 日	18,681.20	18,681.20	0.00%
52	红利再投	2020 年 12 月 18 日	18,452.55	18,452.55	0.00%
53	红利再投	2020 年 12 月 21 日	54,818.84	54,818.84	0.00%
54	红利再投	2020 年 12 月 22 日	18,397.89	18,397.89	0.00%
55	红利再投	2020 年 12 月 23 日	18,555.43	18,555.43	0.00%
56	红利再投	2020 年 12 月 24 日	18,668.69	18,668.69	0.00%
57	红利再投	2020 年 12 月 25 日	18,646.71	18,646.71	0.00%
58	红利再投	2020 年 12 月 28 日	56,002.85	56,002.85	0.00%
59	红利再投	2020 年 12 月 29 日	18,788.43	18,788.43	0.00%
60	红利再投	2020 年 12 月 30 日	18,494.02	18,494.02	0.00%
61	红利再投	2020 年 12 月 31 日	17,902.15	17,902.15	0.00%
合计			1,615,185.10	1,615,185.10	

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

注：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

注：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招募说明书》；
- 4、《长信利息收益开放式证券投资基金托管协议》；
- 5、报告期内在指定报刊上披露的各种公告的原稿；
- 6、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：<http://www.cxfund.com.cn>。

长信基金管理有限责任公司

2021 年 1 月 22 日