长信利息收益开放式证券投资基金

【2013】年度报告摘要

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:2014年3月29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2014年3月26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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告期自2013年1月1日起至2013年12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

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	2,842,223,694.28	
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	737,215,808.43	2,105,007,885.85

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 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。 3、无风险套利策略 由于市场分割,使银行间市场与交易所市场的资金面和市场短期利率在一定时间可能存在定价偏离。同时在一定时间内市场中也可能出现跨品种、跨期限套利机会。本基金将在充分论证套利的可行性基础上谨慎参与。 4、现金流预算管理策略 通过对未来现金流的预测,在投资组合的构建中,采取合理的期限和权重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	010-66060069
	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

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.cxfund.com.cn
基金年度报告备置地点	上海银城中路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

§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	2013年		2012年		2011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	47,618,046.98	203,687,433.35	78,641,050.04	368,224,693.58	40,233,363.03	165,265,704.41
本期利润	47,618,046.98	203,687,433.35	78,641,050.04	368,224,693.58	40,233,363.03	165,265,704.41
本期净值收益率	3.33%	3.58%	4.39%	4.64%	3.94%	4.19%
3.1.2 期末数据和指标	2013年末		2012年末		2011年末	
期末基金资产净值	737,215,808.43	2,105,007,885.85	3,306,540,177.73	6,754,031,602.24	1,536,901,643.90	4,184,555,126.96
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000

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

3.2.1.1 长信利息收益货币A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

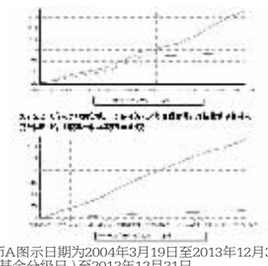
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.0083%	0.0025%	0.0894%	0.0000%	0.9189%	0.0025%
过去六个月	1.6275%	0.0038%	0.1789%	0.0000%	1.4486%	0.0038%
过去一年	3.3316%	0.0035%	0.3549%	0.0000%	2.9767%	0.0035%
过去三年	12.1219%	0.0039%	1.2571%	0.0002%	10.8648%	0.0037%
过去五年	16.2718%	0.0045%	2.3808%	0.0010%	13.8910%	0.0035%
自基金合同生效日起至今(2004年3月19日至2013年12月31日)	33.0846%	0.0076%	14.0660%	0.0033%	19.0186%	0.0043%

3.2.1.2 长信利息收益货币B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	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	1.0691%	0.0025%	0.0894%	0.0000%	0.9797%	0.0025%
过去六个月	1.7506%	0.0038%	0.1789%	0.0000%	1.5717%	0.0038%
过去一年	3.5803%	0.0035%	0.3549%	0.0000%	3.2254%	0.0035%
过去三年	12.9297%	0.0039%	1.2571%	0.0002%	11.6726%	0.0037%
自销售服务费分级日起至今(2010年11月25日至2013年12月31日)	13.3030%	0.0039%	1.2941%	0.0002%	12.0089%	0.0037%

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

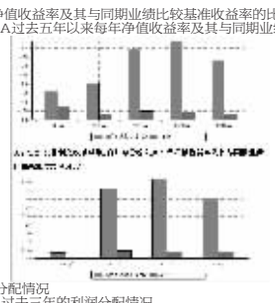


注:1、长信利息收益货币A图示日期为2004年3月19日至2013年12月31日,长信利息收益货币B图示日期为2010年11月25日(本基金分级日)至2013年12月31日。

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中的约定。

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



3.3 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	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
2013年	41,484,373.75	9,035,666.26	-2,901,993.03	47,618,046.98	
2012年	62,814,453.72	13,553,624.04	2,272,972.28	78,641,050.04	
2011年	31,594,248.78	7,787,794.75	851,319.50	40,233,363.03	
合计	135,893,076.25	30,377,085.05	222,298.75	166,492,460.05	

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	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
2013年	157,392,227.86	51,828,980.37	-5,533,774.88	203,687,433.35	
2012年	307,857,605.89	56,822,246.98	3,544,840.71	368,224,693.58	
2011年	128,041,016.23	35,656,066.60	1,568,621.58	165,265,704.41	
合计	593,290,849.98	144,307,293.95	-420,312.59	737,177,831.34	

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2013年12月31日,本基金管理人管理16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、长信内需成长股票、长信可转债债券、长信利众分级债和长信纯债一年定开债券。

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		
刘波	本基金的基金经理,长信可转债债券型证券投资基金和长信利众分级债券型证券投资基金的基金经理	2012年9月1日	-	6年	经济学硕士,上海财经大学经济学研究生毕业。曾任太平养老保险股份有限公司固定收益投资经理。2011年2月加入长信基金管理有限责任公司,担任固定收益基金经理助理,从事投资研究工作。现任本基金、长信可转债债券型证券投资基金和长信利众分级债券型证券投资基金的基金经理。
张文琍	本基金的基金经理,长信利鑫分级债券型证券投资基金和长信中短债证券投资基金的基金经理、公司固定收益部副总监	2013年8月8日	-	19年	高级工商管理硕士,上海财经大学EMBA毕业,具有基金从业资格。曾任湖北证券公司交易一部交易员、长江证券有限责任公司资产管理事业部主管、债券事业总部投资部经理、固定收益总部交易部经理。2004年9月加入长信基金管理有限责任公司,历任长信利息收益基金交易员、基金经理助理。现任长信基金管理有限责任公司固定收益部副总监。本基金、长信利鑫分级债券型证券投资基金和长信中短债证券投资基金的基金经理。
万莉	本基金的基金经理	2011年6月4日	2013年7月20日	7年	曾任本基金的基金经理。

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遵规守信情况的说明

本基金管理人在报告期内,严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同的规定,勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

本基金将继续以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨,承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产,在规范基金运作和严格控制投资风险的前提下,努力为基金份额持有人谋求最大利益。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

1、所有投资对象的投资指令必须经由交易部门总监或其授权人审核分配至交易人员执行。进行投资指令分配的人员必须保证投资指令得到公平对待。

2、公司使用的交易执行软件系统必须具备如下功能:

(1)严格按照时间顺序发送委托指令;

(2)对于多个投资组合在同一时点就同一证券下达的相同方向的投资指令,并且市价在限价范围内的,系统能够将交易员针对该证券下达的每笔委托自动按照指令数量比例分拆为各投资组合的委托指令。

3、交易人员对于接收到的交易指令依照价格优先、时间优先的顺序执行。在执行多个投资组合在同一时点就同一证券下达的相同方向的交易所投资指令时,除制度规定的例外指令外,必须开启系统的公平交易开关。

4、对于不同投资组合均进行债券一级市场申购、非公开发行股票申购等非集中竞价交易的投资对象,交易部门必须严格独立接收各投资组合的投资指令,在申购结果产生前,不得以任何形式向任何人泄露各投资指令的内容,包括指令价格及数量等要素。

5、对于各投资组合以独立账户名义进行申购的投资对象,除需经过公平性审核的例外指令外,申购获配的证券数量由投资管理系统接收各类证券登记结算机构发送的数据进行分配。交易部门根据证券发行人在指定公开披露媒体上披露的申购结果对系统内分配数量进行核准,数量不符的,应当第一时间告知各投资管理部门的总监及监察稽核部总监。对于以公司名义进行申购的投资对象,公司在获配额度确定后,严格按照价格优先的原则在各投资组合间进行分配。申购价格相同的投资组合则根据投资指令的数量按比例进行分配。确因特殊原因不能按照上述原则进行分配的,应启动异常交易识别流程,审核通过的,可以进行相应分配。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内,除完全按照有关指数的构成比例进行投资的组合外,其余各投资组合均未参与交易所公开竞价同日反向交易,不涉及成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情形,对本年度同向交易价差进行专项分析,未发现异常情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2013年发达经济体经济运行良好,美国经济持续复苏,带动QE规模缩减力度加大;欧元区逐渐走出主权债务危机困境,国债收益率明显下行;日本通过推行量化宽松货币政策缓解通缩压力,经济状况有所改善。相对而言,新兴经济体经济波动幅度较大,货币政策差异化明显,同时,还面临因美国QE政策缩减而导致的汇率波动幅度加大问题,使得经济复苏的环境变得复杂。国内经济处于结构转型阶段,管理层对经济刺激的力度减弱,对风险的测试力度加强,经济增速有所回落。全年货币政策依然稳健,但对流动性的控制力度明显加强。就市场而言,2013年1月至5月份资金面相对宽裕,市场呈现出较高的做多热情,债券收益率震荡下行;进入6月份,随着监管力度的加大,资金状况明显趋紧,"钱荒"效应导致机构降杠杆力度加大,推动债券收益率显著上行,债券市场出现长达半年的深度调整。

报告期内,本基金通过降低债券类资产、加强现金类资产管理的方式,在充分保持组合流动性的同时获得稳定收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2013年12月31日,本年度长信利息货币A净值增长率为3.33%,高于同期业绩比较基准收益297bp,长信利息货币B净值增长率为3.58%,高于同期业绩比较基准收益322bp。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来,发达经济体经济复苏势头仍将延续,美国QE收缩的力度可能进一步加大,从而对国际资本流动产生一定扰动。国内政策制定立足于改革,总量刺激的可能性减弱,未来经济增速会相对平稳,通胀相对温和,货币政策继续保持稳健来防范和化解金融风险,市场资金面可能处于紧平衡状态,外汇占款波动可能对资金面造成新的扰动。债券市场经历了近半年的持续调整,目前利率品种及中高评级信用品种已具备一定投资价值,中低评级信用品种利差保护较弱,信用风险需要重点关注。下一阶段我们将继续保持审慎严谨的态度,在充分考虑流动性安全的前提下,适时调整投资组合,争取为投资人提供安全、稳定的投资收益。

4.6 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。

4.7 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251,305,480.33元,已分配利润251,305,480.33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在2013年1月1日至2013年12月31日基金的投资运作,进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督,认真履行了托管人的义务,没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本托管人认为,长信基金管理有限责任公司在长信利息收益开放式证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上,不存在损害基金份额持有人利益的行为;在报告期内,严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为,长信基金管理有限责任公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定,基金管理人所编制和披露的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

本报告期本基金2013年度财务报告经毕马威华振事务所(特殊普通合伙)审计,注册会计师出具了无保留意见的审计报告(毕马威华振审字第1400164号),投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§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:2013年12月31日

单位:人民币元

资 产	本期末 2013年12月31日	上年度末 2012年12月31日
资 产:		
银行存款	410,049,251.84	6,171,608,302.01
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	381,752,444.15	2,620,550,836.20
其中:股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	381,752,444.15	2,620,550,836.20
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	2,026,703,683.53	1,448,897,728.34
应收证券清算款	25,163,314.85	793,801.54
应收利息	12,134,473.25	71,029,134.95
应收股利	-	-
应收申购款	30,126,258.57	1,000.00
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	2,886,529,426.19	10,313,480,803.04
负债和所有者权益	本期末 2013年12月31日	上年度末 2012年12月31日
负 债:		
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	-	219,999,470.00
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	38,314,686.23	13,942,102.28
应付管理人报酬	680,521.78	3,691,783.73
应付托管费	206,218.74	1,118,722.41
应付销售服务费	154,047.39	687,692.09
应付交易费用	123,288.25	106,862.44
应交税费	253,600.00	253,600.00
应付利息	-	99,634.36
应付利润	3,919,355.92	12,355,123.83
递延所得税负债	-	-
其他负债	654,013.60	654,031.93
负债合计	44,305,731.91	252,909,023.07
所有者权益:		
实收基金	2,842,223,694.28	10,060,571,779.97
未分配利润	-	-
所有者权益合计	2,842,223,694.28	10,060,571,779.97
负债和所有者权益总计	2,886,529,426.19	10,313,480,803.04

注:报告截止日2013年12月31日,基金份额净值1.0000元,基金份额总额2,842,223,694.28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:2013年1月1日至2013年12月31日

单位:人民币元

项 目	本期 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日
一、收入	303,930,227.52	506,646,105.42
1.利息收入	300,443,897.00	471,709,057.03
其中:存款利息收入	152,991,718.61	286,148,946.39
债券利息收入	79,318,851.15	125,498,532.75
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	68,133,327.24	60,061,577.89
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	3,474,205.05	34,937,048.39
其中:股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	3,474,205.05	34,937,048.39
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
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)	12,125.47	-
减:二、费用	52,624,747.19	59,780,361.80
1.管理人报酬	23,428,988.82	33,522,443.45
2.托管费	7,106,848.99	10,158,316.35
3.销售服务费	4,185,770.72	5,504,411.53
4.交易费用	-	-
5.利息支出	17,244,042.48	9,955,349.21
其中:卖出回购金融资产支出	17,244,042.48	9,955,349.21
6.其他费用	659,096.18	639,841.26
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	251,305,480.33	446,865,743.62
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	251,305,480.33	446,865,743.62

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:2013年1月1日至2013年12月31日

单位:人民币元

项 目	本期 2013年1月1日至2013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)	10,060,571,779.97	-	10,060,571,779.97
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)		251,305,480.33	251,305,480.33
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)	-7,218,348,085.69	-	-7,218,348,085.69
其中:1.基金申购款	46,614,811,297.54	-	46,614,811,297.54
2.基金赎回款	-53,833,159,383.23	-	-53,833,159,383.23
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)	-	-251,305,480.33	-251,305,480.33
五、期末所有者权益(基金净值)	2,842,223,694.28	-	2,842,223,694.28
项 目	上年度可比期间 2012年1月1日至2012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)	5,721,456,770.86	-	5,721,456,770.86
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	446,865,743.62	446,865,743.62
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)	4,339,115,009.11	-	4,339,115,009.11
其中:1.基金申购款	69,365,880,055.30	-	69,365,880,055.30
2.基金赎回款	-65,026,765,046.19	-	-65,026,765,046.19
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)	-	-446,865,743.62	-446,865,743.62
五、期末所有者权益(基金净值)	10,060,571,779.97	-	10,060,571,779.97

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:

项 目	蒋学杰	孙红辉
	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

本基金的财务报表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")的要求编制,同时亦按照中国证监会公告[2010]5号《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》以及中国证券投资基金业协会于2012年11月16日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制。

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2013年12月31日的财务状况、2013年度的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与上年度会计报表一致。

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

7.4.6.1 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。

7.4.6.2 应交税费

单位:人民币元

应交债券利息收入所得税	2013年	2012年
	253,600.00	253,600.00

注:该项系基金收到的债券发行人在支付债券利息时未代扣代缴的利息税部分。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
长信基金管理有限责任公司(以下简称"长信基金")	基金管理人
中国农业银行股份有限公司(以下简称"农业银行")	基金托管人
长江证券股份有限公司(以下简称"长江证券")	基金管理人的股东
上海海欣集团股份有限公司	基金管理人的股东
武汉钢铁股份有限公司	基金管理人的股东
上海长江财富资产管理有限公司	基金管理人的子公司
长江证券承销保荐有限公司	基金管理人的股东的控股子公司
长江证券控股(香港)有限公司	基金管理人的股东的控股子公司
长江期货有限公司	基金管理人的股东的控股子公司
长江成长资本投资有限公司	基金管理人的股东的控股子公司
上海海欣生物技术有限公司	基金管理人的股东的控股子公司
长信-首善1号分级资产管理计划	基金管理人管理的特定客户资产管理计划
长信灵活风格1号资产管理计划	基金管理人管理的特定客户资产管理计划
长信五矿信托3号投资组合	基金管理人管理的特定客户资产管理计划
长信五矿信托1号投资组合	基金管理人管理的特定客户资产管理计划
长信五矿信托2号投资组合	基金管理人管理的特定客户资产管理计划

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 债券回购交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年12月31日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
长江证券	1,055,000,000.00	100.00%	4,784,800,000.00	100.00%

7.4.8.1.2 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金金额	占期末应付佣金总额的比例
长江证券	145,000.00	100.00%	145,000.00	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金金额	占期末应付佣金总额的比例
长江证券	145,000.00	100.00%	145,000.00	100.00%

注: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。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日