# 长信可转债债券型证券投资基金2014年半年度报告摘要

2014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：平安银行股份有限公司

送出日期：2014年8月28日

# §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。本半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。

基金托管人平安银行股份有限公司，根据本基金合同规定，于2014年8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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年1月1日起至2014年6月30日止。

# §2 基金简介

## 2.1 基金基本情况

| | | |
|---|---|---|
| 基金简称 | 长信可转债债券 | |
| 场内简称 | CX转债 | |
| 基金主代码 | 519977 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2012年3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 | 平安银行股份有限公司 | |
| 报告期末基金份额总额 | 175,779,881.63份 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 长信可转债债券A | 长信可转债债券C |
| 下属分级基金的交易代码 | 519977 | 519976 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 148,086,959.98份 | 27,692,921.65份 |

## 2.2 基金产品说明

| | |
|---|---|
| 投资目标 | 本基金重点投资于可转换债券（含可分离交易可转债），主要运用可转债品种兼具债券和股票的特性，通过积极主动的可转债投资管理，力争在锁定投资组合下方风险的基础上实现基金资产的长期稳定增值。 |
| 投资策略 | 本基金主要投资于可转债品种，一方面利用可转债的债券特性，强调投资组合的安全性和稳定性，另一方面利用可转债的股票特性，分享股市上涨产生的较高收益。 |
| 业绩比较基准 | 中信标普可转债指数收益率×70%+中信标普全债指数收益率×20%+沪深300指数收益率*10% |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金，属于较低风险的证券投资基金品种，其预期收益和预期风险高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。本基金主要投资于可转换债券，在债券型基金中属于风险水平相对较高的投资产品。 |

## 2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目 | 基金管理人 | 基金托管人 |
|---|---|---|

| 名称 | | 长信基金管理有限责任公司 | 平安银行股份有限公司 |
|---|---|---|---|
| 信息披露负责人 | 姓名 | 周永刚 | 陈萱 |
| | 联系电话 | 021-61009999 | 0755-22168863 |
| | 电子邮箱 | zhouyg@cxfund.com.cn | CHENXUAN964@pingan.com.cn |
| 客户服务电话 | | 4007005566 | 95501 |
| 传真 | | 021-61009800 | 0755-82080406 |

## 2.4 信息披露方式

| | |
|---|---|
| 登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址 | www.cxfund.com.cn |
| 基金半年度报告备置地点 | 上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心9楼、广东省深圳市深南东路5047号 |

# §3 主要财务指标和基金净值表现

## 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 | 报告期（2014年1月1日—2014年6月30日） | |
|---|---|---|
| | 长信可转债债券A | 长信可转债债券C |
| 本期已实现收益 | -685,551.98 | 51,983.03 |
| 本期利润 | 6,183,510.97 | 1,597,337.32 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0471 | 0.0574 |
| 本期基金份额净值增长率 | 6.70% | 6.50% |
| **3.1.2 期末数据和指标** | 报告期末（2014年6月30日） | |
| 期末可供分配基金份额利润 | -0.0513 | -0.0635 |
| 期末基金资产净值 | 145,315,168.93 | 26,831,765.53 |
| 期末基金份额净值 | 0.9813 | 0.9689 |

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。

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。

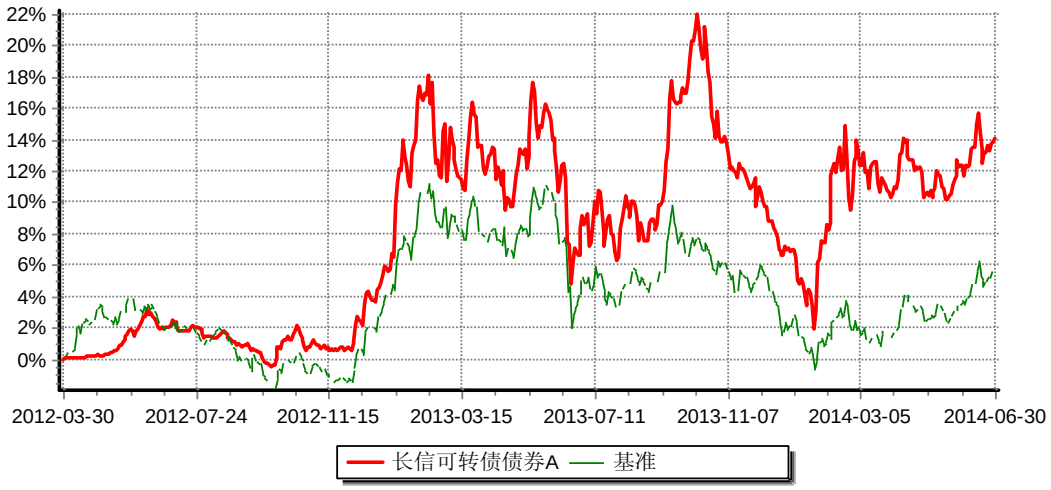
## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段（长信可转债债券A） | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差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 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去一个月 | 1.60% | 0.62% | 2.32% | 0.38% | -0.72% | 0.24% |
| 过去三个月 | 3.50% | 0.55% | 4.41% | 0.34% | -0.91% | 0.21% |
| 过去六个月 | 6.70% | 0.81% | 3.16% | 0.39% | 3.54% | 0.42% |
| 过去一年 | 7.02% | 0.79% | 1.88% | 0.43% | 5.14% | 0.36% |

| | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 自基金合同生效日起至今（2012年3月30日至2014年6月30日） | 14.12% | 0.74% | 6.32% | 0.45% | 7.80% | 0.29% |
| 阶段（长信可转债债券C） | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差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 |
| 过去一个月 | 1.57% | 0.62% | 2.32% | 0.38% | -0.75% | 0.24% |
| 过去三个月 | 3.40% | 0.55% | 4.41% | 0.34% | -1.01% | 0.21% |
| 过去六个月 | 6.50% | 0.81% | 3.16% | 0.39% | 3.34% | 0.42% |
| 过去一年 | 5.50% | 0.79% | 1.88% | 0.43% | 3.62% | 0.36% |
| 自基金合同生效日起至今（2012年3月30日至2014年6月30日） | 11.71% | 0.74% | 6.32% | 0.45% | 5.39% | 0.29% |

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



注：1、本基金基金合同生效日为2012年3月30日，图示日期为2012年3月30日至2014年6月30日。

2、按基金合同规定，本基金自合同生效日起6个月内为建仓期，建仓期结束时，本基金各项投资比例已符合基金合同中的约定。

# §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2014年6月30日，本基金管理人共管理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(自2014年7月1日起更名为长信纯债壹号债券)、长信量化先锋股票、长信美国标准普尔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、长信利息收益开放式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3月30日 | — | 7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、长信利息收益开放式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。 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 李小羽 | 本基金、长信利丰债券型证券投资基金和长信纯债一年定期开放债券型证券投资基金的基金经理、固定收益部总监、总经理助理 | 2012年3月30日 | — | 16年 | 上海交通大学工学学士，华南理工大学工学硕士，具有基金从业资格，加拿大特许投资经理资格（CIM）。曾任职长城证券公司、加拿大Investors Group Financial Services Co.，Ltd。2002年10月加入本公司（筹备），先后任基金经理助理、交易管理部总监、长信中短债证券投资基金基金经理。现任总经理助理、固定收益部总监、本基金、长信利丰债券型证券投资基金和长信纯债一年定期开放债券型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；新增或变更以刊登新增/变更基金经理的公告披露日为准。

2、本基金基金经理的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，未发现异常交易行为。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2014年上半年，欧美等发达经济体经济保持了较好的复苏势头，美国耐用品销售，房地产市场等关键经济指标向好，美联储进一步加大了QE缩减力度。欧元区6月份迎来新一轮降息及定向长期再融资计划（TLTRO），以负利率及定向宽松来刺激经济增长。日本则继续推行安倍经济刺激计划，经济状况相对稳定。中国经济复苏力度较弱，中长期增长动力仍然在于结构调整。宏观调控方面由于经济减速明显，微刺激升温。央行实施扩大人民币汇率日间波动后，人民币汇率出现大幅贬值。CPI维持低位，大宗商品价格低位筑底反弹。2014年一季度债券市场开始超跌反弹，随着货币政策取向在二季度更为明朗，央行定向降准加再贷款等定向宽松政策陆续出台，2014年上半年货币市场利率保持在偏低位置，6月末资金虽然略紧，但相比往年中枢有所下降，债券市场在资金面推动下，持续慢牛行情。随着国企改革力度的加大，低估值大盘转债表现相对稳健，中小盘转债跟随正股表现呈现出较大差异。

本基金2014年上半年适度控制久期，精选转债个券，规避信用风险，加大了灵活操作的力度，以提高组合的安全性。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2014年6月30日，长信可转债债券A份额净值为0.9813元，份额累计净值为1.1443元，本报告期内长信可转债债券A净值增长率为6.70%；长信可转债债券C份额净值为0.9689元，份额累计净值为1.1219元，本报告期内长信可转债债券C净值增长率为6.50%。同期业绩比较基准收益率为3.16%。

## 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的巩固对国内经济的正面拉动作用会逐步增强。国内经济处于结构转型期，政策重点立足于改革，全面推行经济刺激计划的可能性减弱，货币政策及财政政策的针对性逐渐增强，短期内继续通过扶持发展小微、支持三农建设、加快棚户区改造及基础设施建设等来维持经济增速底线的意图明显。通胀维持低位，未来全面升息和降息的概率都较小，定向放松政策仍可期待。汇率在大幅波动后预计短期将进入一个相对平衡的阶段。货币政策的总基调还是中性偏松，调整节奏和方式将视经济的回落和外汇占款情况而定，资金面总体而言将会保持宽松。下一阶段基本面仍有利于债市，但中低等级信用风险逐渐加大，个券资质需要审慎甄别。

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审慎判断。适度控制组合久期，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本基金基金合同规定的基金收益分配原则以及基金实际运作情况，本基金本报告期没有进行利润分配。

本基金收益分配应遵循下列原则：

1、由于本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金金额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可分配收益将有所不同，本基金同一基金份额类别内每一基金份额享有同等分配权；

2、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为6次，每份基金份额每次分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的20%；若基金合同生效不满3个月，可不进行收益分配；

3、基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4、分红权益登记日申请申购的基金份额不享受当次分红，分红权益登记日申请赎回的基金份额享受当次分红；

5、本基金收益分配方式分为两种：现金分红与红利再投资，基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若基金份额持有人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金份额持有人可对A类和C类基金份额分别选择不同的分红方式。选择采取红利再投资形式的，同一类别基金份额的现金红利将按除息日除权后的基金份额净值为计算基准自动转为相应的同一类别的基金份额，红利再投资的份额免收再投资的费用。

6、法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

# §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

本报告期内，平安银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对长信可转债债券型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

## 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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金本报告期内未进行利润分配。

## 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由长信基金管理有限责任公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

# §6 半年度财务会计报告（未经审计）

## 6.1 资产负债表

会计主体：长信可转债债券型证券投资基金

报告截止日：2014年6月30日

单位：人民币元

| 资 产 | 本期末<br>2014年6月30日 | 上年度末<br>2013年12月31日 |
|---|---|---|
| **资 产：** | | |
| 银行存款 | 17,604,848.00 | 4,366,333.28 |
| 结算备付金 | 6,074,372.77 | 3,268,569.47 |
| 存出保证金 | 972,996.60 | 405,418.58 |
| 交易性金融资产 | 230,599,989.90 | 109,377,842.10 |
| 其中：股票投资 | 32,185,039.46 | - |
| 基金投资 | - | - |
| 债券投资 | 198,414,950.44 | 109,377,842.10 |
| 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 | - | - |
| 应收证券清算款 | - | 2,995,951.67 |
| 应收利息 | 987,661.91 | 1,002,938.39 |
| 应收股利 | - | - |
| 应收申购款 | 20,689.69 | 4,563.49 |
| 递延所得税资产 | - | - |
| 其他资产 | - | - |
| 资产总计 | 256,260,558.87 | 121,421,616.98 |
| **负债和所有者权益** | 本期末<br>2014年6月30日 | 上年度末<br>2013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 | 83,000,000.00 | 10,000,000.00 |
| 应付证券清算款 | - | - |
| 应付赎回款 | 55,032.67 | 493,303.36 |

| | | |
|---|---|---|
| 应付管理人报酬 | 98,478.95 | 67,670.55 |
| 应付托管费 | 28,136.86 | 19,334.45 |
| 应付销售服务费 | 23,217.82 | 7,980.14 |
| 应付交易费用 | 475,464.88 | 202,974.34 |
| 应交税费 | 15,643.34 | 15,509.07 |
| 应付利息 | 58,496.40 | - |
| 应付利润 | - | - |
| 递延所得税负债 | - | - |
| 其他负债 | 359,153.49 | 432,291.37 |
| 负债合计 | 84,113,624.41 | 11,239,063.28 |
| **所有者权益：** | | |
| 实收基金 | 175,779,881.63 | 120,108,287.39 |
| 未分配利润 | -3,632,947.17 | -9,925,733.69 |
| 所有者权益合计 | 172,146,934.46 | 110,182,553.70 |
| 负债和所有者权益总计 | 256,260,558.87 | 121,421,616.98 |

注：报告截止日2014年6月30日，基金份额净值0.9793元，基金份额总额175,779,881.63份。其中长信可转债债券A基金份额净值0.9813元，份额总额148,086,959.98份，长信可转债债券C基金份额净值0.9689元，份额总额27,692,921.65份。

## 6.2 利润表

会计主体：长信可转债债券型证券投资基金

本报告期：2014年1月1日至2014年6月30日

单位：人民币元

| 项 目 | 本期<br>2014年1月1日至2014年6月30日 | 上年度可比期间<br>2013年1月1日至2013年6月30日 |
|---|---|---|
| **一、收入** | 11,242,546.01 | 3,786,693.68 |
| 1.利息收入 | 1,645,534.07 | 1,003,929.11 |
| 其中：存款利息收入 | 189,689.89 | 142,111.26 |
| 债券利息收入 | 1,455,844.18 | 825,299.36 |
| 资产支持证券利息收入 | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | - | 36,518.49 |
| 其他利息收入 | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”号填列） | 1,169,990.55 | 6,203,395.93 |
| 其中：股票投资收益 | -1,758,618.00 | 3,052,402.16 |

| | | |
|---|---|---|
| 基金投资收益 | - | - |
| 债券投资收益 | 2,724,740.66 | 3,088,802.69 |
| 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 | 203,867.89 | 62,191.08 |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 8,414,417.24 | -3,481,978.77 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列） | - | - |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | 12,604.15 | 61,347.41 |
| **减：二、费用** | 3,461,697.72 | 2,514,115.18 |
| 1．管理人报酬 | 523,470.79 | 340,429.90 |
| 2．托管费 | 149,563.14 | 97,265.73 |
| 3．销售服务费 | 45,451.40 | 104,936.06 |
| 4．交易费用 | 782,590.88 | 529,208.69 |
| 5．利息支出 | 1,772,380.01 | 1,252,793.30 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | 1,772,380.01 | 1,252,793.30 |
| 6．其他费用 | 188,241.50 | 189,481.50 |
| **三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）** | 7,780,848.29 | 1,272,578.50 |
| 减：所得税费用 | - | - |
| **四、净利润（净亏损以“-”号填列）** | 7,780,848.29 | 1,272,578.50 |

## 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长信可转债债券型证券投资基金

本报告期：2014年1月1日至2014年6月30日

单位：人民币元

| 项 目 | 本期<br>2014年1月1日至2014年6月30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) | 120,108,287.39 | -9,925,733.69 | 110,182,553.70 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 7,780,848.29 | 7,780,848.29 |
| 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） | 55,671,594.24 | -1,488,061.77 | 54,183,532.47 |
| 其中：1.基金申购款 | 72,161,257.41 | -2,367,864.31 | 69,793,393.10 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 2.基金赎回款 | -16,489,663.17 | 879,802.54 | -15,609,860.63 |
| 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） | - | - | - |
| 五、期末所有者权益（基金净值） | 175,779,881.63 | -3,632,947.17 | 172,146,934.46 |
| **项 目** | 上年度可比期间<br>2013年1月1日至2013年6月30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) | 87,488,144.71 | 4,491,672.73 | 91,979,817.44 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 1,272,578.50 | 1,272,578.50 |
| 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） | -25,737,260.94 | -1,986,178.96 | -27,723,439.90 |
| 其中：1.基金申购款 | 117,906,394.32 | 16,698,566.88 | 134,604,961.20 |
| 2.基金赎回款 | -143,643,655.26 | -18,684,745.84 | -162,328,401.10 |
| 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） | - | - | - |
| 五、期末所有者权益（基金净值） | 61,750,883.77 | 3,778,072.27 | 65,528,956.04 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署：

| 田 丹 | 蒋学杰 | 孙红辉 |
|---|---|---|
| 基金管理人负责人 | 主管会计工作负责人 | 会计机构负责人 |

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

长信可转债债券型证券投资基金(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”)《关于核准长信可转债债券型证券投资基金募

集的批复》(证监许可[2012]6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《长信可转债债券型证券投资基金基金合同》发售，基金合同于2012年3月30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373,884,064.36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，基金托管人为平安银行股份有限公司。

本基金于2012年2月27日至2012年3月27日募集，募集资金总额人民币373,764,793.90元，利息转份额人民币119,270.46元，募集规模为373,884,064.36份。上述募集资金已由上海众华沪银会计师事务所有限公司验证，并出具了沪众会字(2012)第6077号验资报告。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《长信可转债债券型证券投资基金基金合同》和《长信可转债债券型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金主要投资于固定收益类金融工具，包括国内依法发行上市的国债、央行票据、金融债、公司债、企业债、可转换债券（含可分离交易可转债）、债券回购、次级债、短期融资券、资产支持证券、中期票据、银行存款等固定收益类金融工具。本基金可参与一级市场新股申购或增发新股，也可在二级市场上投资股票、权证等权益类证券，并可持有由可转债转股获得的股票、因所持股票派发以及因投资可分离债券而产生的权证。如出现法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金的投资组合比例为：投资于固定收益类资产的比例不低于基金资产的80%，其中对可转债（含可分离交易可转债）的投资比例不低于基金固定收益类资产的80%；对权益类资产的投资比例不高于基金资产的20%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

本基金的业绩比较基准为中信标普可转债指数收益率×70%+中信标普全债指数收益率×20%+沪深300指数收益率*10%。

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。

### 6.4.2 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。

### 6.4.3 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2014年6月30日的财务状况、2014年上半年度的经营成果和基金净值变动情况。

### 6.4.4 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 6.4.4.1 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、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.4.2 差错更正的说明

本基金在本报告期未发生过重大会计差错。

### 6.4.5 税项

#### 6.4.5.1 主要税项说明

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》、上证交字[2008]16号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》、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：

1、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。

2、基金买卖股票、债券的投资收益暂免征收营业税和企业所得税。

3、对基金取得的股票的股息、红利收入，债券的利息收入，由上市公司、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，暂不征收企业所得税。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自2013年1月1日起，个人从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂减按25%计入应纳税所得额。

4、基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

5、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。

**6.4.5.2 应交税费**

单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2014年6月30日 | 上年度末<br>2013年12月31日 |
|---|---|---|
| 应交债券利息收入所得税 | 15,643.34 | 15,509.07 |

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。

**6.4.6关联方关系**

**6.4.6.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况**

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方无变化。

**6.4.6.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方**

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|---|---|
| 长信基金管理有限责任公司 | 基金管理人 |
| 平安银行股份有限公司 | 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 |

### 6.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 6.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.7.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2014年1月1日至2014年6月30日 | | 上年度可比期间<br>2013年1月1日至2013年6月30日 | |
|---|---|---|---|---|
| | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 |
| 长江证券 | 345,249,241.35 | 66.12% | 141,148,994.15 | 40.31% |

##### 6.4.7.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2014年1月1日至2014年6月30日 | | 上年度可比期间<br>2013年1月1日至2013年6月30日 | |
|---|---|---|---|---|
| | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 |
| 长江证券 | 915,270,234.74 | 92.59% | 1,177,994,962.48 | 97.48% |

##### 6.4.7.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2014年1月1日至2014年6月30日 | | 上年度可比期间<br>2013年1月1日至2013年6月30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 | 8,188,000,000.00 | 98.98% | 5,260,400,000.00 | 99.36% |

##### 6.4.7.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间没有通过关联方交易单元进行的权证交易。

##### 6.4.7.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2014年1月1日至2014年6月30日 | | | |
|---|---|---|---|---|
| | 当期佣金 | 占当期佣金总量的比例 | 期末应付佣金余额 | 占应付佣金总额的比例 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 长江证券 | 314,313.77 | 66.12% | 314,313.77 | 66.12% |
| 关联方名称 | 上年度可比期间<br>2013年1月1日至2013年6月30日 | | | |
| | 当期佣金 | 占当期佣金总量的比例 | 期末应付佣金余额 | 占应付佣金总额的比例 |
| 长江证券 | 128,502.13 | 40.64% | 50,329.88 | 34.25% |

### 6.4.7.2 关联方报酬

#### 6.4.7.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2014年1月1日至2014年6月30日 | 上年度可比期间<br>2013年1月1日至2013年6月30日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 523,470.79 | 340,429.90 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 72,322.39 | 136,868.41 |

注：基金管理费按前一日基金资产净值0.70%的年费率逐日计提，按月支付。

计算方法H＝E×年管理费率÷当年天数（H 为每日应计提的基金管理费，E为前一日基金资产净值）。

#### 6.4.7.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2014年1月1日至2014年6月30日 | 上年度可比期间<br>2013年1月1日至2013年6月30日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 149,563.14 | 97,265.73 |

注：基金托管费按前一日基金资产净值0.20%的年费率逐日计提，按月支付。

计算方法H＝E×年托管费率÷当年天数（H 为每日应计提的基金托管费，E为前一日基金资产净值）。

#### 6.4.7.2.3 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<br>2014年1月1日至2014年6月30日 | | |
|---|---|---|---|
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 长信可转债债券A | 长信可转债债券C | 合计 |
| 长信基金管理有限责任公司 | - | 754.93 | 754.93 |
| 平安银行股份有限公司 | - | 17,515.67 | 17,515.67 |
| 长江证券 | - | 5.43 | 5.43 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 合计 | — | 18,276.03 | 18,276.03 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日 | | |
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 长信可转债债券A | 长信可转债债券C | 合计 |
| 长信基金管理有限责任公司 | — | 2,055.39 | 2,055.39 |
| 平安银行股份有限公司 | — | 47,123.52 | 47,123.52 |
| 长江证券 | — | 35.58 | 35.58 |
| 合计 | — | 49,214.49 | 49,214.49 |

注：本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额的销售服务费年费率为0.35%。销售服务费按照C类基金资产净值的0.35%年费率计提。计算方法如下：

H＝E×年销售服务费率÷当年天数

H为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E为C类基金份额前一日基金资产净值

**6.4.7.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易**

本基金本报告期及上年度可比期间内均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

**6.4.7.4 各关联方投资本基金的情况**

**6.4.7.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

本报告期及上年度可比期间内基金管理人均未运用固有资金投资本基金。

**6.4.7.4.2 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**

除基金管理人之外的其他关联方在本报告期间与上年度可比期间均未投资过本基金。

**6.4.7.5 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 2014年1月1日至2014年6月30日 | | 上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日 | |
|---|---|---|---|---|
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 平安银行股份有限公司 | 17,604,848.00 | 121,364.52 | 7,742,987.48 | 96,612.20 |

**6.4.7.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内购入过由关联方承销的证券。

### 6.4.7.7 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。

## 6.4.8 期末（2014年6月30日）本基金持有的流通受限证券

### 6.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

| 6.4.11.1.1 受限证券类别：股票 | | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 证券代码 | 证券名称 | 成功认购日 | 可流通日 | 流通受限类型 | 认购价格 | 期末估值单价 | 数量(单位：股) | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
| 300387 | 富邦股份 | 2014-6-26 | 2014-7-16 | 新股认购 | 20.48 | 20.48 | 500 | 10,240.00 | 10,240.00 | |

### 6.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

### 6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.8.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2014年6月30日止，基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额人民币0元。

#### 6.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2014年6月30日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额83,000,000.00元，于2014年7月10日前到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

# §7 投资组合报告

## 7.1 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 | 权益投资 | 32,185,039.46 | 12.56 |
| | 其中：股票 | 32,185,039.46 | 12.56 |
| 2 | 固定收益投资 | 198,414,950.44 | 77.43 |
| | 其中：债券 | 198,414,950.44 | 77.43 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 3 | 贵金属投资 | - | - |
| 4 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 5 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 6 | 银行存款和结算备付金合计 | 23,679,220.77 | 9.24 |
| 7 | 其他各项资产 | 1,981,348.20 | 0.77 |
| 8 | 合计 | 256,260,558.87 | 100.00 |

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

| 代码 | 行业类别 | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | 3,859,500.00 | 2.24 |
| C | 制造业 | 18,163,278.41 | 10.55 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 8,901,772.62 | 5.17 |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | 1,260,488.43 | 0.73 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | - | - |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 32,185,039.46 | 18.70 |

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 600332 | 白云山 | 170,000 | 4,231,300.00 | 2.46 |
| 2 | 600597 | 光明乳业 | 200,241 | 3,211,865.64 | 1.87 |
| 3 | 002405 | 四维图新 | 150,000 | 2,493,000.00 | 1.45 |
| 4 | 600718 | 东软集团 | 180,000 | 2,428,200.00 | 1.41 |
| 5 | 600259 | 广晟有色 | 60,000 | 2,293,800.00 | 1.33 |
| 6 | 600261 | 阳光照明 | 190,000 | 1,877,200.00 | 1.09 |
| 7 | 002368 | 太极股份 | 54,467 | 1,824,099.83 | 1.06 |
| 8 | 600497 | 驰宏锌锗 | 170,000 | 1,565,700.00 | 0.91 |
| 9 | 600340 | 华夏幸福 | 50,079 | 1,260,488.43 | 0.73 |
| 10 | 300168 | 万达信息 | 65,681 | 1,205,246.35 | 0.70 |

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于长信基金管理有限责任公司网站（www.cxfund.com.cn）的半年度报告正文。

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计买入金额 | 占期初基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 600718 | 东软集团 | 30,266,707.17 | 27.47 |
| 2 | 600332 | 白云山 | 17,592,699.99 | 15.97 |
| 3 | 600597 | 光明乳业 | 13,928,055.41 | 12.64 |
| 4 | 600690 | 青岛海尔 | 11,558,846.00 | 10.49 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 5 | 300037 | 新宙邦 | 10,105,706.40 | 9.17 |
| 6 | 600340 | 华夏幸福 | 9,507,455.09 | 8.63 |
| 7 | 002146 | 荣盛发展 | 6,778,173.42 | 6.15 |
| 8 | 600887 | 伊利股份 | 5,902,244.11 | 5.36 |
| 9 | 600066 | 宇通客车 | 5,816,191.13 | 5.28 |
| 10 | 002368 | 太极股份 | 5,665,602.70 | 5.14 |
| 11 | 002073 | 软控股份 | 5,647,775.05 | 5.13 |
| 12 | 600109 | 国金证券 | 5,506,501.90 | 5.00 |
| 13 | 002475 | 立讯精密 | 5,274,170.18 | 4.79 |
| 14 | 002603 | 以岭药业 | 5,078,339.52 | 4.61 |
| 15 | 002405 | 四维图新 | 4,950,238.62 | 4.49 |
| 16 | 601377 | 兴业证券 | 4,894,341.00 | 4.44 |
| 17 | 600376 | 首开股份 | 4,880,774.01 | 4.43 |
| 18 | 600739 | 辽宁成大 | 4,599,034.64 | 4.17 |
| 19 | 002594 | 比亚迪 | 4,293,046.14 | 3.90 |
| 20 | 600649 | 城投控股 | 4,275,858.39 | 3.88 |
| 21 | 600111 | 包钢稀土 | 4,129,963.58 | 3.75 |
| 22 | 000858 | 五 粮 液 | 3,860,259.58 | 3.50 |
| 23 | 600521 | 华海药业 | 3,856,179.27 | 3.50 |
| 24 | 600271 | 航天信息 | 3,756,862.13 | 3.41 |
| 25 | 600048 | 保利地产 | 3,665,999.72 | 3.33 |
| 26 | 300155 | 安居宝 | 3,640,444.67 | 3.30 |
| 27 | 600497 | 驰宏锌锗 | 3,241,725.34 | 2.94 |
| 28 | 601231 | 环旭电子 | 3,213,534.09 | 2.92 |
| 29 | 600536 | 中国软件 | 3,197,794.28 | 2.90 |
| 30 | 600073 | 上海梅林 | 2,989,270.48 | 2.71 |
| 31 | 600809 | 山西汾酒 | 2,799,183.30 | 2.54 |
| 32 | 600348 | 阳泉煤业 | 2,718,638.82 | 2.47 |
| 33 | 600702 | 沱牌舍得 | 2,693,129.07 | 2.44 |
| 34 | 600406 | 国电南瑞 | 2,669,243.38 | 2.42 |
| 35 | 000402 | 金 融 街 | 2,637,348.60 | 2.39 |
| 36 | 000960 | 锡业股份 | 2,527,965.98 | 2.29 |
| 37 | 600276 | 恒瑞医药 | 2,511,987.34 | 2.28 |
| 38 | 600108 | 亚盛集团 | 2,484,813.01 | 2.26 |
| 39 | 300133 | 华策影视 | 2,393,393.88 | 2.17 |
| 40 | 000009 | 中国宝安 | 2,367,000.00 | 2.15 |
| 41 | 300246 | 宝莱特 | 2,343,017.86 | 2.13 |
| 42 | 300168 | 万达信息 | 2,302,270.96 | 2.09 |
| 43 | 600259 | 广晟有色 | 2,260,365.74 | 2.05 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 44 | 002428 | 云南锗业 | 2,212,842.33 | 2.01 |

注：本项“买入金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑其他交易费用。

### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计卖出金额 | 占期初基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 600718 | 东软集团 | 28,074,849.26 | 25.48 |
| 2 | 600332 | 白云山 | 13,463,256.29 | 12.22 |
| 3 | 300037 | 新宙邦 | 10,231,268.17 | 9.29 |
| 4 | 600597 | 光明乳业 | 10,169,212.06 | 9.23 |
| 5 | 600690 | 青岛海尔 | 10,062,320.90 | 9.13 |
| 6 | 600340 | 华夏幸福 | 8,215,475.13 | 7.46 |
| 7 | 002146 | 荣盛发展 | 6,449,314.29 | 5.85 |
| 8 | 600887 | 伊利股份 | 5,796,757.63 | 5.26 |
| 9 | 600109 | 国金证券 | 5,651,257.64 | 5.13 |
| 10 | 600066 | 宇通客车 | 5,459,048.68 | 4.95 |
| 11 | 601377 | 兴业证券 | 5,003,820.38 | 4.54 |
| 12 | 002073 | 软控股份 | 4,924,957.86 | 4.47 |
| 13 | 600376 | 首开股份 | 4,681,693.00 | 4.25 |
| 14 | 002594 | 比亚迪 | 4,574,930.06 | 4.15 |
| 15 | 002475 | 立讯精密 | 4,549,640.44 | 4.13 |
| 16 | 600739 | 辽宁成大 | 4,347,153.72 | 3.95 |
| 17 | 600649 | 城投控股 | 4,229,044.96 | 3.84 |
| 18 | 002368 | 太极股份 | 4,090,861.30 | 3.71 |
| 19 | 002603 | 以岭药业 | 3,918,407.26 | 3.56 |
| 20 | 600048 | 保利地产 | 3,905,128.38 | 3.54 |
| 21 | 000858 | 五 粮 液 | 3,893,504.66 | 3.53 |
| 22 | 600271 | 航天信息 | 3,807,749.05 | 3.46 |
| 23 | 300155 | 安居宝 | 3,610,268.60 | 3.28 |
| 24 | 600111 | 包钢稀土 | 3,591,071.00 | 3.26 |
| 25 | 600521 | 华海药业 | 3,568,742.60 | 3.24 |
| 26 | 600536 | 中国软件 | 3,396,304.85 | 3.08 |
| 27 | 601231 | 环旭电子 | 3,392,757.40 | 3.08 |
| 28 | 002405 | 四维图新 | 3,160,037.91 | 2.87 |
| 29 | 600073 | 上海梅林 | 2,824,005.79 | 2.56 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 30 | 600348 | 阳泉煤业 | 2,634,207.50 | 2.39 |
| 31 | 600809 | 山西汾酒 | 2,578,442.52 | 2.34 |
| 32 | 000402 | 金 融 街 | 2,576,347.11 | 2.34 |
| 33 | 000960 | 锡业股份 | 2,540,674.44 | 2.31 |
| 34 | 600702 | 沱牌舍得 | 2,536,882.64 | 2.30 |
| 35 | 300133 | 华策影视 | 2,480,458.48 | 2.25 |
| 36 | 600406 | 国电南瑞 | 2,457,298.04 | 2.23 |
| 37 | 300246 | 宝莱特 | 2,420,469.51 | 2.20 |
| 38 | 600108 | 亚盛集团 | 2,395,649.32 | 2.17 |
| 39 | 002273 | 水晶光电 | 2,367,657.53 | 2.15 |
| 40 | 000009 | 中国宝安 | 2,265,131.17 | 2.06 |

注：本项“卖出金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑其他交易费用。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

| | |
|---|---|
| 买入股票成本（成交）总额 | 278,172,989.28 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 244,506,019.48 |

注：本项“买入股票的成本（成交）总额”和“卖出股票的收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

## 7.5 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 | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|
| 1 | 国家债券 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | - | - |
| | 其中：政策性金融债 | - | - |
| 4 | 企业债券 | 10,004,000.00 | 5.81 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债 | 188,410,950.44 | 109.45 |
| 7 | 其他 | - | - |
| 8 | 合计 | 198,414,950.44 | 115.26 |

## 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 110023 | 民生转债 | 471,440 | 43,749,632.00 | 25.41 |
| 2 | 113001 | 中行转债 | 418,300 | 42,578,757.00 | 24.73 |
| 3 | 110017 | 中海转债 | 325,100 | 30,442,364.00 | 17.68 |
| 4 | 110020 | 南山转债 | 258,230 | 24,542,179.20 | 14.26 |
| 5 | 113003 | 重工转债 | 90,000 | 10,220,400.00 | 5.94 |

**7.7 期末按公允价值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**

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

**7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细**

本基金本期报告期末未持有贵金属。

**7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细**

本基金本报告期末未持有权证。

**7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**

本基金本报告期末未投资股指期货。

**7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

本基金本报告期末未投资国债期货。

**7.12 投资组合报告附注**

**7.12.1 报告期内本基金投资的前十名证券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。**

**7.12.2 报告期内本基金投资的前十名股票中，不存在超出基金合同规定备选股票库的情形。**

**7.12.3 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 | 972,996.60 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 987,661.91 |
| 5 | 应收申购款 | 20,689.69 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 1,981,348.20 |

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 110023 | 民生转债 | 43,749,632.00 | 25.41 |
| 2 | 113001 | 中行转债 | 42,578,757.00 | 24.73 |
| 3 | 110017 | 中海转债 | 30,442,364.00 | 17.68 |
| 4 | 110020 | 南山转债 | 24,542,179.20 | 14.26 |
| 5 | 113003 | 重工转债 | 10,220,400.00 | 5.94 |
| 6 | 113005 | 平安转债 | 7,375,921.00 | 4.28 |
| 7 | 110015 | 石化转债 | 7,307,409.60 | 4.24 |
| 8 | 110022 | 同仁转债 | 5,719,000.00 | 3.32 |
| 9 | 110011 | 歌华转债 | 3,311,070.80 | 1.92 |
| 10 | 110018 | 国电转债 | 743,043.20 | 0.43 |
| 11 | 127001 | 海直转债 | 647,875.00 | 0.38 |
| 12 | 127002 | 徐工转债 | 188,489.78 | 0.11 |
| 13 | 128003 | 华天转债 | 122,023.85 | 0.07 |
| 14 | 113002 | 工行转债 | 21,080.00 | 0.01 |

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### 7.12.6 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。

# §8 基金份额持有人信息

## 8.1 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 |
| 长信可转债债券A | 880 | 168,280.64 | 122,249,983.48 | 82.55% | 25,836,976.50 | 17.45% |
| 长信可转债债券C | 646 | 42,868.30 | 337,019.06 | 1.23% | 27,355,902.59 | 98.78% |
| 合计 | 1,526 | 115,189.96 | 122,587,002.54 | 69.74% | 53,192,879.09 | 30.26% |

## 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 份额级别 | 持有份额总数（份） | 占基金总份额比例 |
|---|---|---|---|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 长信可转债债券A | 25,289.24 | 0.02% |
| | 长信可转债债券C | 48,534.27 | 0.18% |
| | 合计 | 73,823.51 | 0.04% |

注：上表中长信可转债债券A、长信可转债债券C占基金总份额比例分别以长信可转债债券A、长信可转债债券C的各自份额为分母计算得出；合计项中占基金总份额比例以长信可转债的份额总额为分母计算得出。

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

| 项目 | 份额级别 | 持有基金份额总量的数量区间(万份) |
|---|---|---|
| 公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金 | 长信可转债债券 A | 0 |
| | 长信可转债债券 C | 0 |
| | 合计 | 0 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 长信可转债债券 A | 0 |
| | 长信可转债债券 C | 0—10 |
| | 合计 | 0—10 |

# §9 开放式基金份额变动

单位：份

| | 长信可转债债券A | 长信可转债债券C |
|---|---|---|
| 基金合同生效日(2012年3月30日)基金份额总额 | 65,799,961.38 | 308,084,102.98 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 91,480,352.36 | 28,627,935.03 |
| 本报告期基金总申购份额 | 67,539,178.15 | 4,622,079.26 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | -10,932,570.53 | -5,557,092.64 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 148,086,959.98 | 27,692,921.65 |

# §10 重大事件揭示

## 10.1 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。

## 10.2 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

本报告期基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门没有重大人事变动。

## 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

## 10.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略未改变。

## 10.5 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。

## 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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。

## 10.7 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 | 股票交易 | | 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 | 占当期股票成交总额的比例 | 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 | 345,249,241.35 | 66.12% | 915,270,234.74 | 92.59% | 8,188,000,000.00 | 98.98% | 314,313.77 | 66.12% | |

| | | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 中信证券 | 1 | 176,873,891.81 | 33.88% | 73,237,723.07 | 7.41% | 84,700,000.00 | 1.02% | 161,026.11 | 33.88% | |

注：1、本报告期租用证券公司交易单元的变更情况

本报告期内本基金租用证券公司交易单元无变化。

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》（证监基金字[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：

1）券商基本面评价（财务状况、经营状况）；

2）券商研究机构评价（报告质量、及时性和数量）；

3）券商每日信息评价（及时性和有效性）；

4）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。

**长信基金管理有限责任公司**

**二〇一四年八月二十八日**