长信可转债债券型证券投资基金2014年年度报告摘要

2014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：平安银行股份有限公司

送出日期：2015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。

基金托管人平安银行股份有限公司，根据本基金合同规定，于2015年3月25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2014年1月1日起至2014年12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	长信可转债债券	
场内简称	长信可转债	
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	558,575,712.44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	504,128,548.56份	54,447,163.88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	张波
	联系电话	021-61009969	0755-22168073
	电子邮箱	zhouyg@cxfund.com.cn	Zhangbo743@pingan.com.cn
客户服务电话		4007005566	95511
传真		021-61009800	0755-82080406

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、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	长信可转债债券A		
	2014年	2013年	2012年3月30日（基金合同生效日）-2012年12月31日
本期已实现收益	163,069,253.74	381,495.39	1,550,837.58
本期利润	228,427,480.63	-2,341,525.12	2,513,897.39
加权平均基金份额本期利润	1.3896	-0.0323	0.0462
本期基金份额净值增长率	95.11%	1.56%	5.32%
3.1.2 期末数据和指标	2014年末	2013年末	2012年末
期末可供分配基金份额利润	0.3985	-0.0803	0.0298
期末基金资产净值	904,626,255.32	84,136,938.66	44,856,128.27
期末基金份额净值	1.7944	0.9197	1.0532
3.1.1 期间数据和指标	长信可转债债券C		
	2014年	2013年	2012年3月30日（基金合同生效日）-2012年12月31日
本期已实现收益	36,748,588.81	3,480,664.12	2,420,402.68
本期利润	59,365,744.89	431,475.27	4,172,924.52
加权平均基金份额本期利润	1.4001	0.0099	0.0371
本期基金份额净值增长率	94.13%	-0.07%	4.96%
3.1.2 期末数据和指标	2014年末	2013年末	2012年末
期末可供分配基金份额利润	0.3757	-0.0902	0.0263
期末基金资产净值	96,164,870.17	26,045,615.04	47,123,689.17
期末基金份额净值	1.7662	0.9098	1.0496

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

3.2.1.1长信可转债债券A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

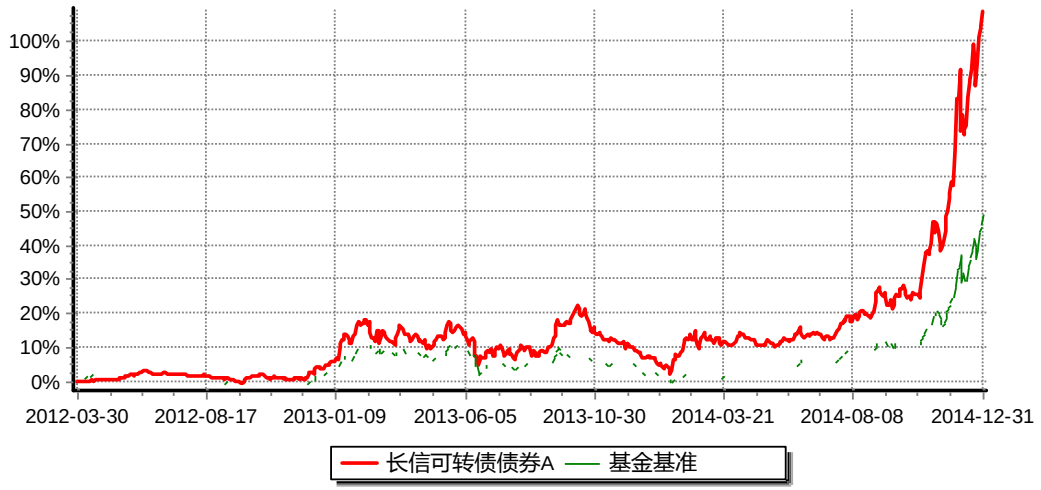
阶段 (长信可转债债券A)	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	64.46%	2.64%	34.10%	1.51%	30.36%	1.13%
过去六个月	82.86%	1.96%	41.33%	1.12%	41.53%	0.84%
过去一年	95.11%	1.53%	45.74%	0.85%	49.37%	0.68%
自基金合同生效日起至今（2012年03月30日-2014年12月31日）	108.69%	1.09%	49.70%	0.64%	58.99%	0.45%

3.2.1.2长信可转债债券C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
过去三个月	64.11%	2.64%	34.10%	1.51%	30.01%	1.13%
过去六个月	82.29%	1.96%	41.33%	1.12%	40.96%	0.84%
过去一年	94.13%	1.53%	45.74%	0.85%	48.39%	0.68%
自基金合同生效日起至今（2012年03月30日-2014年12月31日）	103.63%	1.09%	49.70%	0.64%	53.93%	0.45%

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

3.2.2.1长信可转债债券A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



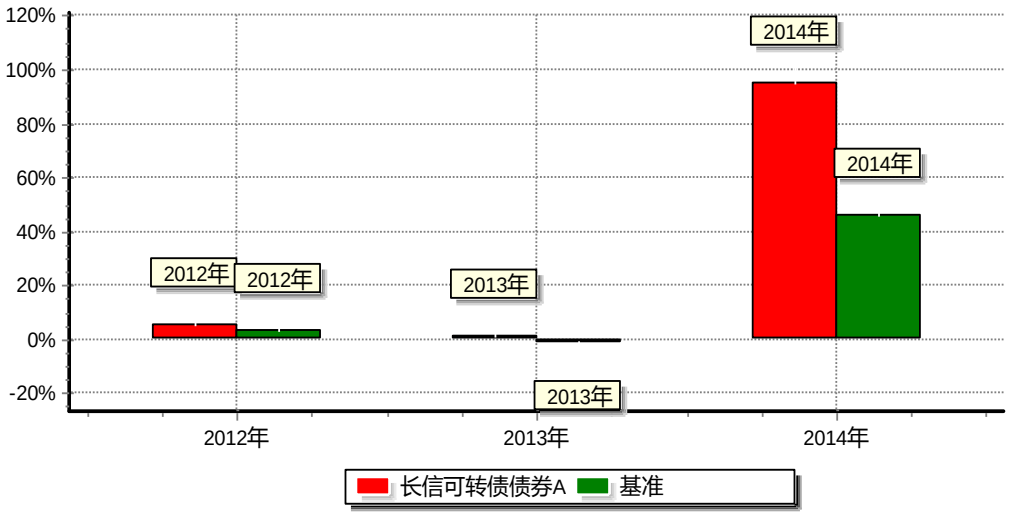
3.2.2.2 长信可转债债券C自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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12月31日。

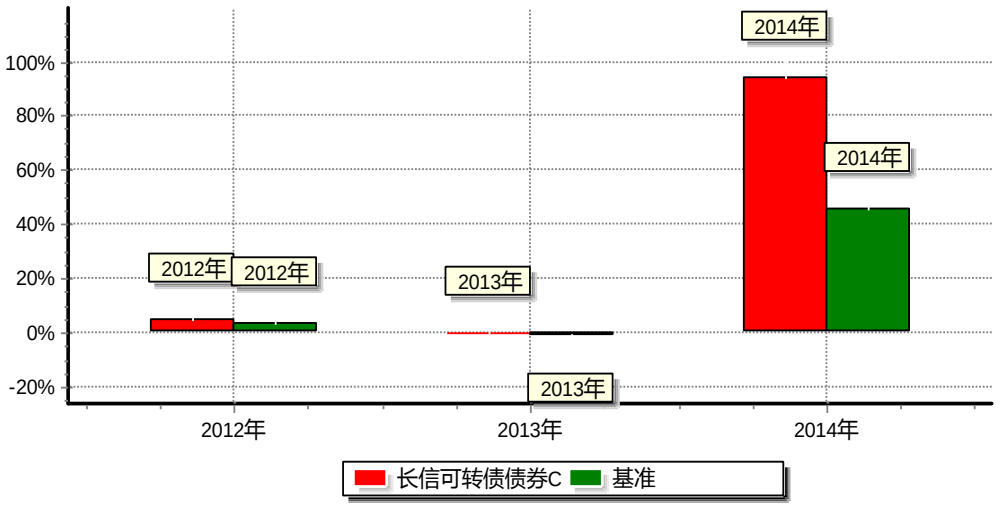
2、按基金合同规定，本基金自合同生效日起6个月内为建仓期，建仓期结束时，本基金各项投资比例已符合基金合同中的约定。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.3.1 长信可转债债券A自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



3.2.3.2 长信可转债债券C自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：本基金基金合同生效日为2012年3月30日，2012年净值增长率按本基金实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

3.3.1 长信可转债债券A过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2014年	-	-	-	-	

2013年	1.630	342,054,613.12	323,953.27	342,378,566.39	
2012年	-	-	-	-	
合计	1.630	342,054,613.12	323,953.27	342,378,566.39	

3.3.2 长信可转债债券C过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2014年	-	-	-	-	
2013年	1.530	4,544,574.16	849,693.31	5,394,267.47	
2012年	-	-	-	-	
合计	1.530	4,544,574.16	849,693.31	5,394,267.47	

注：本基金基金合同生效日为2012年3月30日。本基金本报告期未进行利润分配。

§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12月31日，本基金管理人共管理17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)、长信纯债壹号债券、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、长信纯债一年定开债券和长信改革红利混合。

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		
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、公司总经理助理、固定收益	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的基金经理。现任长信基金管理有限责任公司总经理助理、固定收益部总监，本基金、长信利

	部总监				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。
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、长信利众分级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。

3、刘波先生自2015年2月11日开始担任长信新利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。

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

2014年，美国经济持续向好，失业率趋势性回落，QE退出计划有条不紊的实施，货币政策选择逐渐进入加息议题；欧元区经济企稳复苏，西班牙、意大利等国国债收益率逐渐回落到危机前水平，但失业率仍处于高位；日本在安倍刺激计划下经济状况相对稳定，通缩局面有所缓和。新兴经济体经济增速普遍下行，长期国债利率高位震荡，汇率贬值迹象明显，经济情况变得复杂。国内方面，2014年通胀维持低位，经济下行压力加大，政策上通过加大基建投资、放松房地产相关政策、实施中国版“马歇尔计划”等方式来对冲经济下行风险。央行公开市场持续以SLO、SLF、逆回购等操作来营造宽松的货币市场环境，并在年底通过降息引导实体经济资金成本下行，政策维稳意图明显。2014年外汇占款增幅缩窄，热钱呈现流出迹象，人民币汇率区间震荡。市场方面，2014年资金面整体宽松，下半年随着IPO重启资金价格呈现一定波动；债券市场呈现牛市行情，利率债收益率普遍下行，受地方融资平台债务清理及中证登质押新规影响，年底信用债收益率呈现一定波动；2014年国企改革主线贯穿于转债市场全年，随着四季度股市大幅上扬，部分转债陆续触发赎回条款，转债稀缺性明显增强，期间转债资产获得了良好的投资回报。

报告期内，本基金保持了较高的转债杠杆比例，以国企改革为投资主线，集中持有了估值较低的大盘转债以及部分优质的中小盘转债品种，获得了较好的投资收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2014年12月31日，长信可转债债券A份额净值为1.7944元，份额累计净值为1.9574元，本报告期内长信可转债债券A净值增长率为95.11%；长信可转债

债券C份额净值为1.7662元，份额累计净值为1.9192元，本报告期内长信可转债债券C净值增长率为94.13%。同期业绩比较基准收益率为45.74%。

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的势头不改，美国在2015年可能加息，国际资本流动可能进一步加大新兴经济体经济及汇率波动风险。国内经济进入改革阵痛期，经济面临下行压力，未来可能继续通过放松性货币政策及财政政策来缓冲经济下行风险，降息、降准均有一定空间，但大水漫灌式全面刺激的可能性较小。随着国际资本流通速度加快，未来外汇占款波动将继续加大，人民币汇率波动幅度会增强。就市场而言，当前下行的经济状况和宽松性货币政策对债市形成一定支撑，未来利率中枢仍有下行空间，投资级信用债及利率债均具有一定吸引力，经济下行周期中信用风险需要重点关注；可转债作为普通债券的替代品种，将继续享受权益溢价及稀缺性溢价，存在较好的配置价值，未来国企改革主线仍是转债投资重点，我们将关注其中优质品种。下一阶段我们将继续保持审慎严谨的态度，进一步优化投资组合，争取为投资人提供安全、稳健的投资收益。

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

本基金报告期内未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§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、基金费用开支以及利润分配情况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。

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 审计报告

本报告期本基金2014年度财务报告经毕马威华振会计师事务所审计，注册会计师出具了无保留意见的审计报告（毕马威华振字第1500289号），投资者可以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：长信可转债债券型证券投资基金

报告截止日：2014年12月31日

单位：人民币元

资 产	本期末 2014年12月31日	上年度末 2013年12月31日
资 产：		
银行存款	201,692,121.60	4,366,333.28
结算备付金	30,200,535.11	3,268,569.47
存出保证金	920,265.69	405,418.58
交易性金融资产	887,776,618.78	109,377,842.10
其中：股票投资	82,737,778.82	-
基金投资	-	-
债券投资	805,038,839.96	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	139,010,448.52	-
应收证券清算款	-	2,995,951.67
应收利息	2,199,725.30	1,002,938.39
应收股利	-	-
应收申购款	36,762,607.37	4,563.49
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,298,562,322.37	121,421,616.98
负债和所有者权益	本期末 2014年12月31日	上年度末 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	200,000,000.00	10,000,000.00

应付证券清算款	48,097,543.40	-
应付赎回款	47,707,509.35	493,303.36
应付管理人报酬	438,637.32	67,670.55
应付托管费	125,324.96	19,334.45
应付销售服务费	103,583.17	7,980.14
应付交易费用	585,938.42	202,974.34
应交税费	13,390.14	15,509.07
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	699,270.12	432,291.37
负债合计	297,771,196.88	11,239,063.28
所有者权益：		
实收基金	558,575,712.44	120,108,287.39
未分配利润	442,215,413.05	-9,925,733.69
所有者权益合计	1,000,791,125.49	110,182,553.70
负债和所有者权益总计	1,298,562,322.37	121,421,616.98

注：报告截止日2014年12月31日，基金份额净值1.7917元，基金份额总额558,575,712.44份。其中长信可转债债券A基金份额净值1.7944元，份额总额504,128,548.56份，长信可转债债券C基金份额净值1.7662元，份额总额54,447,163.88份。

7.2 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12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日
一、收入	300,097,256.83	3,329,703.57
1.利息收入	4,135,291.55	2,925,867.07
其中：存款利息收入	646,184.77	1,046,511.75
债券利息收入	3,364,365.62	1,709,096.34
资产支持证券利息收入	-	-

买入返售金融资产收入	124,741.16	170,258.98
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	207,323,053.76	3,557,774.88
其中：股票投资收益	14,379,066.88	1,358,863.96
基金投资收益	-	-
债券投资收益	192,682,662.94	2,131,219.92
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	261,323.94	67,691.00
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	87,975,382.97	-5,772,209.36
4.汇兑收益（损失以“－”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	663,528.55	2,618,270.98
减：二、费用	12,304,031.31	5,239,753.42
1．管理人报酬	1,623,645.04	990,554.32
2．托管费	463,898.67	283,015.61
3．销售服务费	165,479.91	167,970.46
4．交易费用	2,692,304.78	1,108,174.11
5．利息支出	6,981,047.91	2,311,038.92
其中：卖出回购金融资产支出	6,981,047.91	2,311,038.92
6．其他费用	377,655.00	379,000.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	287,793,225.52	-1,910,049.85
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	287,793,225.52	-1,910,049.85

7.3 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12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2014年1月1日至2014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）	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）	-	287,793,225.52	287,793,225.52
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）	438,467,425.05	164,347,921.22	602,815,346.27
其中：1.基金申购款	1,013,400,203.66	387,074,191.57	1,400,474,395.23
2.基金赎回款	-574,932,778.61	-222,726,270.35	-797,659,048.96
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）	558,575,712.44	442,215,413.05	1,000,791,125.49
项 目	上年度可比期间 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）	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）	-	-1,910,049.85	-1,910,049.85
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）	32,620,142.68	335,265,477.29	367,885,619.97
其中：1.基金申购款	2,229,603,378.36	357,279,306.86	2,586,882,685.22
2.基金赎回款	-2,196,983,235.68	-22,013,829.57	-2,218,997,065.25
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）	-	-347,772,833.86	-347,772,833.86
五、期末所有者权益（基金净值）	120,108,287.39	-9,925,733.69	110,182,553.70

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	覃波	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

7.4 报表附注

7.4.1 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，基金托管人为中国平安银行股份有限公司（原深圳发展银行股份有限公司)(以下简称“中国平安银行”)。

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%。如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

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。

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”)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。

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2014年12月31日的财务状况、自2014年1月1日至2014年12月31日止期间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发生变更，对本基金本报告期无重大影响，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

本基金于2014年7月1日起执行下述财政部新颁布/修订的企业会计准则：

(i)《企业会计准则第2号——长期股权投资》(以下简称“准则2号(2014)”)；

(ii)《企业会计准则第9号——职工薪酬》(以下简称“准则9号(2014)”)；

(iii)《企业会计准则第30号——财务报表列报》(以下简称“准则30号(2014)”)；

(iv)《企业会计准则第33号——合并财务报表》(以下简称“准则33号(2014)”)；

(v)《企业会计准则第39号——公允价值计量》(以下简称“准则39号”)；

(vi)《企业会计准则第40号——合营安排》(以下简称“准则40号”)；

(vii)《企业会计准则第41号——在其他主体中权益的披露》(以下简称“准则41号”)。

同时，本基金于2014年3月17日开始执行财政部颁布的《金融负债与权益工具的区分及相关会计处理规定》(“财会[2014]13号文”)以及在2014年度财务报告中开始执行财政部修订的《企业会计准则第37号——金融工具列报》(以下简称“准则37号(2014)”)。

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重大会计差错。

7.4.6 税项

7.4.6.1 主要税项说明

根据财税字[1998]55号文《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收问题的通知》、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[2012]85号文《财政部、国家税务总局、证监会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》、财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、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》及深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、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)证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的投资收益暂免征收营业税和企业所得税。

(3)基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(4)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。自2013年1月1日起，对所取得的股息红利收入按根据持有期限计提个人所得税：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，上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(5)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。

(6)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

项目	2014年12月31日	2013年12月31日
债券利息收入所得税	13,390.14	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。

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	基金管理人
中国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（“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

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 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年12月31日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31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	1,189,551,084.11	66.60%	317,470,721.55	43.78%

7.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均没有通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.8.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年12月31日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31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	4,901,096,171.47	96.59%	2,121,446,939.36	96.55%

7.4.8.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年12月31日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日	
	成交金额	占当期债券	成交金额	占当期债券

		回购成交总额的比例		回购成交总额的比例
长江证券	29,820,500,000.00	99.28%	9,416,200,000.00	99.64%

7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014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	1,082,963.56	66.60%	376,230.93	64.45%
关联方名称	上年度可比期间 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	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
长江证券	289,025.13	43.95%	108,475.52	53.57%

注：股票交易佣金计提标准如下：

深圳证券交易所交易佣金=买(卖)成交金额×1‰-清算库中买(卖)经手费-证券结算风险基金(按股票成交金额的十万分之三收取)

上海证券交易所交易佣金=买(卖)成交金额×1‰-买(卖)经手费-买(卖)证管费-证券结算风险基金(按股票成交金额的十万分之三收取)

上述佣金比率均在合理商业条款范围内收取，并符合行业标准。

根据《证券交易席位及证券综合服务协议》，本基金的基金管理人在租用长江证券股份有限公司证券交易专用交易单元进行股票和债券交易的同时，还从长江证券股份有限公司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 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,623,645.04	990,554.32
其中：支付销售机构的客户维护费	351,869.28	224,238.82

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）。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	463,898.67	283,015.61

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）。

7.4.8.2.3 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 2014年1月1日至2014年12月31日		
	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	-	14,740.54	14,740.54
平安银行股份有限公司	-	35,077.12	35,077.12
长江证券	-	72.00	72.00
合计	-	49,889.66	49,889.66
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12月31日		
	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	-	3,024.21	3,024.21
平安银行股份有限公司	-	70,241.47	70,241.47
长江证券	-	42.05	42.05
合计	-	73,307.73	73,307.73

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

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.4.8.4.2 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

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

7.4.8.5 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12月31日		上年度可比期间 2013年1月1日至2013年12月31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	201,692,121.60	63,911.95	4,366,333.28	862,886.29

注：本基金通过“中国平安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2014年12月31日的相关余额为人民币30,200,535.11元。(2013年12月31日：为人民币3,268,569.47元)

7.4.8.6 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。

7.4.8.7 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。

7.4.9 期末（2014年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

根据《证券发行与承销管理办法》，证券投资基金参与网下配售，可与发行人、承销商自主约定网下配售股票的持有期限。持有期自公开发行的股票上市之

日起计算。在持有期内的股票为流动受限制而不能自由转让的资产。基金通过网上申购获配的新股或认购的新发或增发债券，从新股获配日或债券成功认购日至该证券上市日期间，为流通受限制而不能自由转让的资产。此外，基金还可作为特定投资者，认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起12个月内不得转让。

于2014年12月31日，本基金未有因认购新发或增发证券而持有上述流通受限证券。

7.4.9.2 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。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2014年12月31日止，本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为0。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2014年12月31日止，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人民币20,000,000.00元，于2015年1月1日到期。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。

§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	权益投资	82,737,778.82	6.37
	其中：股票	82,737,778.82	6.37
2	固定收益投资	805,038,839.96	61.99
	其中：债券	805,038,839.96	61.99
	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	139,010,448.52	10.70
	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	231,892,656.71	17.86
7	其他各项资产	39,882,598.36	3.07
8	合计	1,298,562,322.37	100.00

8.2 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	2,322,000.00	0.23
C	制造业	35,800,597.77	3.58
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	3,366,333.60	0.34
F	批发和零售业	5,421,000.00	0.54
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	21,889,791.11	2.19
J	金融业	8,660,056.34	0.87

K	房地产业	5,278,000.00	0.53
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	82,737,778.82	8.27

8.3 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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	002405	四维图新	380,000	7,421,400.00	0.74
2	002108	沧州明珠	549,944	7,314,255.20	0.73
3	002407	多氟多	389,901	6,624,417.99	0.66
4	000848	承德露露	299,942	6,595,724.58	0.66
5	300253	卫宁软件	93,585	6,548,142.45	0.65
6	600718	东软集团	400,000	6,324,000.00	0.63
7	300246	宝莱特	285,000	6,127,500.00	0.61
8	600998	九州通	300,000	5,421,000.00	0.54
9	000024	招商地产	200,000	5,278,000.00	0.53
10	002081	金 螳 螂	200,377	3,366,333.60	0.34

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的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	60,339,120.08	54.76
2	601377	兴业证券	33,878,323.75	30.75

3	601688	华泰证券	30,965,386.64	28.10
4	600597	光明乳业	29,485,674.01	26.76
5	002405	四维图新	27,503,911.91	24.96
6	600588	用友网络	27,160,600.13	24.65
7	601336	新华保险	25,863,113.95	23.47
8	600332	白云山	24,768,693.18	22.48
9	600633	浙报传媒	24,370,782.68	22.12
10	603000	人民网	23,937,809.51	21.73
11	002407	多氟多	23,335,545.13	21.18
12	002081	金 螳 螂	21,329,550.19	19.36
13	600536	中国软件	20,700,138.56	18.79
14	601788	光大证券	19,686,438.69	17.87
15	600259	广晟有色	16,856,516.31	15.30
16	600340	华夏幸福	16,149,098.73	14.66
17	600271	航天信息	14,440,244.09	13.11
18	300253	卫宁软件	14,132,466.45	12.83
19	601901	方正证券	13,899,805.98	12.62
20	000024	招商地产	13,604,026.26	12.35
21	300037	新宙邦	13,442,317.40	12.20
22	300246	宝莱特	12,150,130.94	11.03
23	600690	青岛海尔	12,026,846.00	10.92
24	000848	承德露露	12,026,303.86	10.91
25	600998	九州通	11,819,335.56	10.73
26	000768	中航飞机	11,092,385.72	10.07
27	002108	沧州明珠	10,744,098.49	9.75
28	002146	荣盛发展	10,652,866.74	9.67
29	002410	广联达	9,934,873.47	9.02
30	600497	驰宏锌锗	9,858,269.17	8.95
31	600410	华胜天成	9,427,524.47	8.56
32	600111	北方稀土	8,818,490.42	8.00
33	600196	复星医药	8,507,519.88	7.72
34	601555	东吴证券	7,794,153.83	7.07
35	600109	国金证券	7,426,501.90	6.74
36	002368	太极股份	7,394,083.09	6.71
37	002603	以岭药业	7,344,643.13	6.67
38	000596	古井贡酒	6,826,175.69	6.20
39	600557	康缘药业	6,691,615.69	6.07

40	600999	招商证券	6,337,573.07	5.75
41	000977	浪潮信息	6,034,360.90	5.48
42	000960	锡业股份	6,001,111.72	5.45
43	600887	伊利股份	5,902,244.11	5.36
44	600066	宇通客车	5,816,191.13	5.28
45	002024	苏宁云商	5,725,000.00	5.20
46	300168	万达信息	5,702,187.67	5.18
47	002073	软控股份	5,647,775.05	5.13
48	002475	立讯精密	5,274,170.18	4.79
49	000878	云南铜业	5,173,985.31	4.70
50	600366	宁波韵升	5,086,108.76	4.62
51	600376	首开股份	4,880,774.01	4.43
52	600809	山西汾酒	4,670,816.30	4.24
53	600739	辽宁成大	4,599,034.64	4.17
54	600073	上海梅林	4,548,478.83	4.13
55	002594	比亚迪	4,293,046.14	3.90
56	600649	城投控股	4,275,858.39	3.88
57	300182	捷成股份	4,175,805.37	3.79
58	600199	金种子酒	4,084,336.00	3.71
59	600348	阳泉煤业	3,924,592.82	3.56
60	601231	环旭电子	3,881,953.97	3.52
61	000538	云南白药	3,860,730.24	3.50
62	000858	五 粮 液	3,860,259.58	3.50
63	600521	华海药业	3,856,179.27	3.50
64	300133	华策影视	3,848,545.41	3.49
65	000060	中金岭南	3,758,659.78	3.41
66	600048	保利地产	3,665,999.72	3.33
67	300155	安居宝	3,640,444.67	3.30
68	600176	中国玻纤	3,625,959.67	3.29
69	600158	中体产业	3,557,707.36	3.23
70	300369	绿盟科技	3,491,823.78	3.17
71	600298	安琪酵母	3,448,171.00	3.13
72	600702	沱牌舍得	3,392,200.07	3.08
73	002230	科大讯飞	3,387,274.20	3.07
74	600108	亚盛集团	3,232,728.01	2.93
75	600031	三一重工	3,144,105.50	2.85
76	300020	银江股份	3,126,874.79	2.84

77	002273	水晶光电	3,083,199.77	2.80
78	600372	中航电子	2,974,299.44	2.70
79	000559	万向钱潮	2,970,615.70	2.70
80	600305	恒顺醋业	2,931,244.92	2.66
81	000970	中科三环	2,894,906.00	2.63
82	600079	人福医药	2,851,844.90	2.59
83	002340	格林美	2,791,938.20	2.53
84	600261	阳光照明	2,771,468.98	2.52
85	002640	百圆裤业	2,719,941.50	2.47
86	600406	国电南瑞	2,669,243.38	2.42
87	000402	金 融 街	2,637,348.60	2.39
88	600276	恒瑞医药	2,511,987.34	2.28
89	600795	国电电力	2,400,000.00	2.18
90	000009	中国宝安	2,367,000.00	2.15
91	000562	宏源证券	2,338,405.13	2.12
92	002428	云南锗业	2,212,842.33	2.01

8.4.2 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	52,546,193.68	47.69
2	601688	华泰证券	34,840,033.12	31.62
3	601377	兴业证券	34,283,502.54	31.12
4	600588	用友网络	31,891,106.30	28.94
5	600597	光明乳业	28,722,973.57	26.07
6	601336	新华保险	25,483,762.27	23.13
7	600332	白云山	24,546,109.78	22.28
8	600633	浙报传媒	24,435,214.06	22.18
9	603000	人民网	23,742,361.19	21.55
10	600536	中国软件	21,247,616.81	19.28
11	002405	四维图新	20,493,536.43	18.60
12	002081	金 螳 螂	18,220,591.15	16.54
13	600259	广晟有色	17,376,553.98	15.77
14	601788	光大证券	16,247,424.74	14.75
15	600340	华夏幸福	16,150,977.06	14.66
16	002407	多氟多	15,758,663.39	14.30
17	601901	方正证券	14,675,043.96	13.32

18	600271	航天信息	13,853,100.05	12.57
19	300037	新宙邦	12,176,385.04	11.05
20	000768	中航飞机	12,099,690.34	10.98
21	600690	青岛海尔	11,345,315.58	10.30
22	002146	荣盛发展	10,513,290.46	9.54
23	600410	华胜天成	10,408,854.36	9.45
24	002410	广联达	10,391,488.36	9.43
25	300253	卫宁软件	9,328,558.78	8.47
26	000024	招商地产	9,034,486.59	8.20
27	600111	北方稀土	8,874,722.82	8.05
28	600196	复星医药	8,603,971.82	7.81
29	600109	国金证券	7,931,528.64	7.20
30	002368	太极股份	7,859,346.90	7.13
31	600497	驰宏锌锗	7,431,995.58	6.75
32	002603	以岭药业	7,282,814.08	6.61
33	000596	古井贡酒	6,946,160.49	6.30
34	600999	招商证券	6,917,668.90	6.28
35	601555	东吴证券	6,658,129.11	6.04
36	600557	康缘药业	6,494,079.80	5.89
37	600998	九州通	6,476,263.07	5.88
38	300168	万达信息	6,463,077.86	5.87
39	000960	锡业股份	6,038,299.90	5.48
40	000977	浪潮信息	5,918,417.46	5.37
41	600887	伊利股份	5,796,757.63	5.26
42	002024	苏宁云商	5,467,000.00	4.96
43	600066	宇通客车	5,459,048.68	4.95
44	002475	立讯精密	5,147,661.78	4.67
45	600366	宁波韵升	5,069,225.87	4.60
46	000848	承德露露	4,992,997.84	4.53
47	300246	宝莱特	4,977,252.73	4.52
48	002073	软控股份	4,924,957.86	4.47
49	000878	云南铜业	4,792,348.58	4.35
50	600376	首开股份	4,681,693.00	4.25
51	002594	比亚迪	4,574,930.06	4.15
52	600809	山西汾酒	4,397,552.73	3.99
53	600073	上海梅林	4,360,990.79	3.96
54	600739	辽宁成大	4,347,153.72	3.95

55	300182	捷成股份	4,279,440.31	3.88
56	600649	城投控股	4,229,044.96	3.84
57	600199	金种子酒	4,095,911.31	3.72
58	601231	环旭电子	4,053,632.40	3.68
59	600048	保利地产	3,905,128.38	3.54
60	600348	阳泉煤业	3,899,379.59	3.54
61	000858	五 粮 液	3,893,504.66	3.53
62	000538	云南白药	3,880,906.82	3.52
63	300133	华策影视	3,770,060.26	3.42
64	000060	中金岭南	3,636,806.94	3.30
65	300155	安居宝	3,610,268.60	3.28
66	600176	中国玻纤	3,585,915.79	3.25
67	600521	华海药业	3,568,742.60	3.24
68	600158	中体产业	3,564,000.00	3.23
69	002230	科大讯飞	3,319,964.75	3.01
70	600702	沱牌舍得	3,293,904.64	2.99
71	002273	水晶光电	3,261,081.53	2.96
72	600108	亚盛集团	3,181,770.54	2.89
73	300020	银江股份	3,079,215.60	2.79
74	600031	三一重工	2,955,179.00	2.68
75	600372	中航电子	2,906,130.54	2.64
76	600305	恒顺醋业	2,904,229.44	2.64
77	000970	中科三环	2,868,535.00	2.60
78	600079	人福医药	2,830,568.24	2.57
79	002108	沧州明珠	2,722,424.95	2.47
80	002640	百圆裤业	2,589,973.00	2.35
81	000402	金 融 街	2,576,347.11	2.34
82	600261	阳光照明	2,550,448.00	2.31
83	002340	格林美	2,542,932.00	2.31
84	600276	恒瑞医药	2,467,783.70	2.24
85	600406	国电南瑞	2,457,298.04	2.23
86	002268	卫 士 通	2,438,731.69	2.21
87	000562	宏源证券	2,395,242.36	2.17
88	600795	国电电力	2,304,000.00	2.09
89	000009	中国宝安	2,265,131.17	2.06

8.4.3 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	930,055,415.56
卖出股票收入（成交）总额	856,744,754.23

8.5 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	10,017,000.00	1.00
	其中：政策性金融债	10,017,000.00	1.00
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	795,021,839.96	79.44
8	其他	-	-
9	合计	805,038,839.96	80.44

8.6 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	110029	浙能转债	1,741,110	243,685,755.60	24.35
2	110023	民生转债	1,232,040	170,354,170.80	17.02
3	110015	石化转债	949,070	128,048,524.40	12.79
4	113501	洛钼转债	834,720	105,925,968.00	10.58
5	110027	东方转债	317,180	54,304,387.80	5.43

8.7 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。

8.8 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

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 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。

8.10 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。

8.11 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，在报告编制日前一年内也没有受到公开谴责、处罚。

8.12.2 本基金投资的前十名股票中，不存在投资于超出基金合同规定备选股票库的情形。

8.12.3 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	920,265.69
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,199,725.30
5	应收申购款	36,762,607.37
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	39,882,598.36

8.12.4 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	170,354,170.80	17.02

2	110015	石化转债	128,048,524.40	12.79
3	110020	南山转债	25,431,357.60	2.54
4	110011	歌华转债	9,869,321.30	0.99
5	113002	工行转债	2,421,353.70	0.24
6	110022	同仁转债	2,228,873.00	0.22
7	128005	齐翔转债	2,010,185.76	0.20
8	110017	中海转债	769,896.00	0.08

8.12.5 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。

8.12.6 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。

§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
长信可转债债券A	23,738	21,237.20	81,974,448.08	16.26%	422,154,100.48	83.74%
长信可转债债券C	2,454	22,187.11	8,876,340.15	16.30%	45,570,823.73	83.70%
合计	26,192	21,326.20	90,850,788.23	16.26%	467,724,924.21	83.74%

9.2 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	27,700.73	0.01%
	长信可转债债券C	896.99	0.00%
	合计	28,597.72	0.01%

9.3 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）
本公司高级管理人员、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
	合计	0

§10 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	779,850,415.09	233,549,788.57
减：本报告期基金总赎回份额	367,202,218.89	207,730,559.72
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	504,128,548.56	54,447,163.88

§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

11.2.1 报告期内本基金管理人的重大人事变动

本报告期内，原总经理蒋学杰先生离职，覃波先生担任本基金管理人的总经理，本基金管理人于2014年12月20日在指定信息披露媒体发布相应的《关于基金行业高级管理人员变更公告》。

11.2.2 报告期内基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、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未改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金未改聘为基金审计的会计师事务所。报告期应支付给毕马威华振会计师事务所审计的报酬为人民币60,000.00元，该审计机构为本基金提供审计服务的连续年限为3年。

11.6 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。

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	股票交易		债券交易		债券回购交易		应支付该券商的佣金	
		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	1,189,551,084.11	66.60%	4,901,096,171.47	96.59%	29,820,500,000.00	99.28%	1,082,963.56	66.60%
中信证券	1	596,682,150.08	33.40%	4,901,096,171.47	96.59%	29,820,500,000.00	99.28%	543,219.76	33.40%

注：1、本报告期租用证券公司交易单元的变更情况

本报告期内席位无变化。

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

二〇一五年三月二十八日