

长信可转债债券型证券投资基金2013年半年度报告  
2013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：2013年8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2013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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2013年1月1日起至2013年6月30日止。

## 1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
§ 5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	15
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	15
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	15
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表	16
6.2 利润表	17
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	18
6.4 报表附注	20
§ 7 投资组合报告	40
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 期末按行业分类的股票投资组合	40
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	41
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	43
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细	44
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细	44
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细	44
7.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	44
7.10 投资组合报告附注	44
§ 8 基金份额持有人信息	47
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	47
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	47
§ 9 开放式基金份额变动	48
§ 10 重大事件揭示	49
10.1 基金份额持有人大会决议	49

---

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 .....	49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	49
10.4 基金投资策略的改变 .....	49
10.5 基金改聘会计师事务所情况 .....	49
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况 .....	49
10.7 本期基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	49
10.8 其他重大事件 .....	50
§ 11 备查文件目录 .....	52
11.1 备查文件目录 .....	52
11.2 存放地点 .....	52
11.3 查阅方式 .....	52

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	长信可转债债券型证券投资基金	
基金简称	长信可转债债券	
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	61,750,883.77份	
基金合同存续期	不定期	
下属两级基金的基金简称	长信可转债债券A	长信可转债债券C
下属两级基金的交易代码	519977	519976
报告期末下属两级基金的份额总额	19,589,731.66份	42,161,152.11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	孙蕾
	联系电话	021-61009969	0755-22168863

	电子邮箱	zhouyig@cfund.com.cn	Sunlei01@sdb.com.cn
客户服务电话		4007005566	95501
传真		021-61009800	0755-82080406
注册地址		上海市浦东新区银城中路68号 9楼	广东省深圳市深南东路 5047号
办公地址		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
邮政编码		200120	518001
法定代表人		田丹	孙建一

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载基金半年度报告正文的 管理人互联网网址	www.cfund.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

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17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

单位：人民币元

	报告期（2013年1月1日至2013年6月30日）	
<b>3.1.1 期间数据和指标</b>	长信可转债债券A	长信可转债债券C
本期已实现收益	2,155,023.56	2,599,533.71
本期利润	1,826,621.29	-554,042.79
加权平均基金份额本期利润	0.0550	-0.0103
本期基金加权平均净值利润率	4.88%	-0.92%
本期基金份额净值增长率	1.25%	0.88%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	报告期末（2013年6月30日）	
期末可供分配利润	1,300,669.71	2,477,402.56
期末可供分配基金份额利润	0.0664	0.0588
期末基金资产净值	20,890,401.37	44,638,554.67
期末基金份额净值	1.0664	1.0588
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	报告期末（2013年6月30日）	
基金份额累计净值增长率	6.64%	5.88%

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、期末可供分配利润为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

#### 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	①-③	②-④

				④		
过去一个月	-7.77%	1.21%	-5.79%	0.95%	-1.98%	0.26%
过去三个月	-6.15%	0.98%	-3.49%	0.69%	-2.66%	0.29%
过去六个月	1.25%	1.08%	0.56%	0.66%	0.69%	0.42%
过去一年	4.53%	0.77%	1.99%	0.51%	2.54%	0.26%
自基金合同生效日起 至今（2012年3月30日 至2013年6月30日）	6.64%	0.69%	4.19%	0.47%	2.45%	0.22%
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	-7.82%	1.21%	-5.79%	0.95%	-2.03%	0.26%
过去三个月	-6.38%	0.98%	-3.49%	0.69%	-2.89%	0.29%
过去六个月	0.88%	1.08%	0.56%	0.66%	0.32%	0.42%
过去一年	3.91%	0.77%	1.99%	0.51%	1.92%	0.26%
自基金合同生效日起 至今（2012年3月30日 至2013年6月30日）	5.88%	0.69%	4.19%	0.47%	1.69%	0.22%

### 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2013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关于投资范围、资产配置比例和投资限制的有关规定：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%。

## § 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6月30日，本基金管理人共管理15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）、长信利鑫分级债券，长信内需成长股票、长信可转债债券和长信利众分级债。

#### 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 (助理) 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	—	5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	2012年3月30日	—	15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

	的基金经 理、固定收 益部总监、 总经理助 理			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 金和长信利丰债券型证券 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说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

美国经济继续保持复苏状态，欧债危机小幅回潮，欧元区经济总体好转；日本实施超级宽松货币政策，日元快速贬值，安倍经济政策初见效果；国际政治经济出现新的动荡，对中国经济特别是对外贸易产生较大影响。中国经济复苏力度较弱，中长期增长动力减弱，增长的均衡水平下移确定。宏观调控更加注重改革和市场化方向，依靠强刺激政策的可能性很小。CPI受短期因素影响回落，大宗商品价格继续下跌。信贷放松步伐停滞，数量放松的空间缩小，结构调整优先，突显稳健货币政策防大风险的意图。但社会融资依然活跃，债券市场发行量扩容较大。货币政策重点在于稳住经济，同时盯住外汇占款和人民币汇率变化进行短期调整，但货币政策正由中性趋向于偏严。货币市场利率在6月出现巨大上涨，受短期因素影响，债券市场出现振荡，超出市场普遍预期。转债在股票市场影响下，总体出现下降趋势，同时资金利率的大幅度上涨也削弱了其债性的提高。

本组合继续重点配置价值突出的蓝筹转债，以及信用风险较小的信用债，加大了灵活操作的力度，以提高组合的收益水平。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2013年6月30日，长信可转债债券A份额净值为1.0664元，份额累计净值为1.0664元，本报告期内长信可转债债券A净值增长率为1.25%；长信可转债债券C份额净值为1.0588元，份额累计净值为1.0588元，本报告期内长信可转债债券C净值增长率为0.88%。同期业绩比较基准收益率为0.56%。

#### 4.5 管理人对对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

未来经济的政策重点在于通过改革释放增长红利，更多的依靠市场调节。M2

和M1回落至目前位置，继续大幅度上涨可能性很小，稳健的货币政策的重点在于防范系统风险。通胀在回落后，未来小幅反弹的可能性增加，但总体温和，未来降息应会相对谨慎。货币政策的总基调由中性至偏紧过度，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松中有紧。下一阶段债券投资的基本面趋势向好，资金状况为决定因素，信用风险在逐步加大。

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可转债的防御管理，对信用风险保持更审慎判断，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，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：2013年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2013年6月30日	上年度末 2012年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.6.1	7,742,987.48	5,863,832.62
结算备付金		5,878,270.08	1,414,143.70
存出保证金		700,104.16	250,000.00
交易性金融资产	6.4.6.2	95,458,543.25	160,395,358.30
其中：股票投资		9,206,738.28	—
基金投资		—	—
债券投资		86,251,804.97	160,395,358.30
资产支持证券投资		—	—
衍生金融资产	6.4.6.3	—	—
买入返售金融资产	6.4.6.4	—	—
应收证券清算款		3,103,613.57	—
应收利息	6.4.6.5	281,106.46	1,527,127.16
应收股利		—	—
应收申购款		9,424.60	80,426.27
递延所得税资产		—	—
其他资产		—	—
资产总计		113,174,049.60	169,530,888.05
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2013年6月30日</b>	<b>上年度末 2012年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
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		47,000,000.00	73,999,986.50
应付证券清算款		11,042.48	2,462,961.41
应付赎回款		131,435.37	438,428.28

应付管理人报酬		40,838.28	56,754.04
应付托管费		11,668.08	16,215.44
应付销售服务费		13,801.58	14,457.41
应付交易费用	6.4.6.6	147,451.58	556.38
应交税费		15,509.07	2,253.20
应付利息		13,902.20	—
应付利润		—	—
递延所得税负债		—	—
其他负债	6.4.6.7	259,444.92	559,457.95
负债合计		47,645,093.56	77,551,070.61
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.6.8	61,750,883.77	87,488,144.71
未分配利润	6.4.6.9	3,778,072.27	4,491,672.73
所有者权益合计		65,528,956.04	91,979,817.44
负债和所有者权益总计		113,174,049.60	169,530,888.05

注：报告截止日2013年6月30日，基金份额净值1.0612元，基金份额总额61,750,883.77份。其中长信可转债债券A基金份额净值1.0664元，份额总额19,589,731.66份，长信可转债债券C基金份额净值1.0588元，份额总额42,161,152.11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：2013年1月1日至2013年6月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2013年1月1日至2013 年6月30日	上年度可比期间 2012年3月30日至2012 年6月30日
<b>一、收入</b>		3,786,693.68	5,531,697.81
1. 利息收入		1,003,929.11	2,794,516.34
其中：存款利息收入	6.4.6.10	142,111.26	949,603.19
债券利息收入		825,299.36	1,474,502.99
资产支持证券利息 收入		—	—
买入返售金融资产		36,518.49	370,410.16

收入			
其他利息收入		—	—
2. 投资收益		6,203,395.93	1,456,247.01
其中：股票投资收益	6.4.6.11	3,052,402.16	1,300.00
基金投资收益		—	—
债券投资收益	6.4.6.12	3,088,802.69	1,454,947.01
资产支持证券投资 收益		—	—
衍生工具收益	6.4.6.13	—	—
股利收益	6.4.6.14	62,191.08	—
3. 公允价值变动收益	6.4.6.15	-3,481,978.77	1,256,223.25
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		—	—
5. 其他收入（损失以“-” 号填列）	6.4.6.16	61,347.41	24,711.21
<b>减：二、费用</b>		2,514,115.18	1,232,216.19
1. 管理人报酬		340,429.90	491,986.82
2. 托管费		97,265.73	140,567.69
3. 销售服务费		104,936.06	191,246.59
4. 交易费用	6.4.6.17	529,208.69	3,859.12
5. 利息支出		1,252,793.30	293,933.25
其中：卖出回购金融资产支 出		1,252,793.30	293,933.25
6. 其他费用	6.4.6.18	189,481.50	110,622.72
<b>三、利润总额（亏损总额以 “-”号填列）</b>		1,272,578.50	4,299,481.62
减：所得税费用		—	—
<b>四、净利润（净亏损以“-”     号填列）</b>		1,272,578.50	4,299,481.62

注：本基金基金合同于2012年3月30日起正式生效。上年度可比期间为2012年3月30日至2012年6月30日。

### 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：2013年1月1日至2013年6月30日

项 目	本期 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
项 目	上年度可比期间 2012年3月30日至2012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)	373,884,064.36	—	373,884,064.36
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	4,299,481.62	4,299,481.62
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)	-216,268,077.57	-1,240,184.74	-217,508,262.31
其中：1. 基金申购款	22,817,858.71	532,854.85	23,350,713.56
2. 基金赎回款	-239,085,936.28	-1,773,039.59	-240,858,975.87
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)	157,615,986.79	3,059,296.88	160,675,283.67

注：本基金基金合同于2012年3月30日起正式生效。上年度可比期间为2012年3月30日至2012年6月30日。

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2013年6月30日的财务状况、2013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

本基金在本报告期末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	上年度末
----	-----	------

	2013年6月30日	2012年12月31日
应缴债券利息收入所得税	15,509.07	2,253.20

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 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.6.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2013年6月30日
活期存款	7,742,987.48
定期存款	—
其中：存款期限1-3个月	—
其他存款	—
合计	7,742,987.48

##### 6.4.6.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2013年6月30日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	9,903,182.16	9,206,738.28	-696,443.88	
债券	交易所市场	76,414,280.53	76,075,804.97	-338,475.56
	银行间市场	9,907,477.68	10,176,000.00	268,522.32
	合计	86,321,758.21	86,251,804.97	-69,953.24
资产支持证券	—	—	—	
基金	—	—	—	
其他	—	—	—	
合计	96,224,940.37	95,458,543.25	-766,397.12	

##### 6.4.6.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

##### 6.4.6.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

##### 6.4.6.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2013年6月30日
应收活期存款利息	3,554.79
应收其他存款利息	—
应收结算备付金利息	2,645.20
应收债券利息	274,426.49
应收买入返售证券利息	—
应收申购款利息	164.88
其他	315.10
合计	281,106.46

注：其他为应收保证金利息。

#### 6.4.6.6 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2013年6月30日
交易所市场应付交易费用	146,951.58
银行间市场应付交易费用	500.00
合计	147,451.58

#### 6.4.6.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2013年6月30日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	398.82
预提信息披露费-上证报	49,588.57
预提信息披露费-中证报	39,671.58
预提信息披露费-证券时报	129,588.57
预提账户维护费	9,000.00
其它应付款	1,444.60
预提审计费	29,752.78
合计	259,444.92

#### 6.4.6.8 实收基金

金额单位：人民币元

项目 (长信可转债债券A)	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额

上年度末	42,590,787.84	42,590,787.84
本期申购	20,313,895.86	20,313,895.86
本期赎回（以“-”号填列）	-43,314,952.04	-43,314,952.04
期末数	19,589,731.66	19,589,731.66
项目 (长信可转债债券C)	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	44,897,356.87	44,897,356.87
本期申购	97,592,498.46	97,592,498.46
本期赎回（以“-”号填列）	-100,328,703.22	-100,328,703.22
期末数	42,161,152.11	42,161,152.11

#### 6.4.6.9 未分配利润

单位：人民币元

项目 (长信可转债债券A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,270,330.27	995,010.16	2,265,340.43
本期利润	2,155,023.56	-328,402.27	1,826,621.29
本期基金份额交易产生的变动数	-1,843,970.86	-947,321.15	-2,791,292.01
其中：基金申购款	1,422,679.59	1,548,358.37	2,971,037.96
基金赎回款	-3,266,650.45	-2,495,679.52	-5,762,329.97
本期已分配利润	—	—	—
本期末	1,581,382.97	-280,713.26	1,300,669.71
项目 (长信可转债债券C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,180,638.28	1,045,694.02	2,226,332.30
本期利润	2,599,533.71	-3,153,576.50	-554,042.79
本期基金份额交易产生的变动数	-711,000.35	1,516,113.40	805,113.05
其中：基金申购款	6,161,827.58	7,565,701.34	13,727,528.92
基金赎回款	-6,872,827.93	-6,049,587.94	-12,922,415.87
本期已分配利润	—	—	—
本期末	3,069,171.64	-591,769.08	2,477,402.56

#### 6.4.6.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2013年1月1日至2013年6月30日
活期存款利息收入	96,612.20
定期存款利息收入	—
其他存款利息收入	—
结算备付金利息收入	41,348.04
其他	4,151.02
合计	142,111.26

注：其他为直销申购款利息收入、保证金利息收入。

#### 6.4.6.11 股票投资收益

##### 6.4.6.11.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
卖出股票成交总额	171,639,210.89
减：卖出股票成本总额	168,586,808.73
买卖股票差价收入	3,052,402.16

#### 6.4.6.12 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
卖出债券(债转股及债券到期兑付)成交金额	653,205,757.35
减：卖出债券(债转股及债券到期兑付)成本总额	646,542,809.79
减：应收利息总额	3,574,144.87
债券投资收益	3,088,802.69

#### 6.4.6.13 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

#### 6.4.6.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
股票投资产生的股利收益	62,191.08
基金投资产生的股利收益	—

合计	62,191.08
----	-----------

#### 6.4.6.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
1. 交易性金融资产	-3,481,978.77
——股票投资	-696,443.88
——债券投资	-2,785,534.89
——资产支持证券投资	—
——基金投资	—
2. 衍生工具	—
——权证投资	—
3. 其他	—
合计	-3,481,978.77

#### 6.4.6.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
基金赎回费收入	61,018.04
转换费收入	329.37
合计	61,347.41

#### 6.4.6.17 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
交易所市场交易费用	528,858.69
银行间市场交易费用	350.00
合计	529,208.69

#### 6.4.6.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
审计费用	29,752.78
信息披露费	138,848.72
账户维护费	18,000.00
其他费用	2,880.00

合计	189,481.50
----	------------

#### 6.4.7 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.7.1 或有事项

截至本财务报告批准报出日,本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

##### 6.4.7.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日,本基金没有需要在财务报表附注中说明的资产负债表日后事项。

#### 6.4.8 关联方关系

##### 6.4.8.1 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。

##### 6.4.8.2 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(简称“长江证券”)	基金管理人的股东

#### 6.4.9 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.9.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.9.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年6月30日		上年度可比期间 2012年3月30日(基金合同生效日) 至2012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	141,148,994.15	40.31%	8,070.00	44.93%

##### 6.4.9.1.2 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。

### 6.4.9.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年6月30日		上年度可比期间 2012年3月30日（基金合同生效日） 至2012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	1,177,994,962.48	97.48%	217,189,056.20	85.39%

### 6.4.9.1.4 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6月30日		上年度可比期间 2012年3月30日（基金合同生效日） 至2012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	5,260,400,000.00	99.36%	1,892,900,000.00	94.82%

### 6.4.9.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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 总量的比例
长江证券	128,502.13	40.64%	50,329.88	34.25%
关联方名称	上年度可比期间 2012年3月30日（基金合同生效日）至2012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 总量的比例
长江证券	6.86	45.01%	6.86	45.01%

### 6.4.9.2 关联方报酬

#### 6.4.9.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日		上年度可比期间 2012年3月30日（基金合同生效日） 至2012年6月30日	
----	----------------------------	--	---	--

当期发生的基金应支付的管理费	340,429.90	491,986.82
其中：支付销售机构的客户维护费	136,868.41	138,463.87

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 $H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$ （H 为每日应计提的基金管理费，E 为前一日基金资产净值）。

#### 6.4.9.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2013年1月1日至2013年6月30日	2012年3月30日（基金合同生效日）至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	97,265.73	140,567.69

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 $H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$ （H 为每日应计提的基金托管费，E 为前一日基金资产净值）。

#### 6.4.9.2.3 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		
	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
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2012年3月30日（基金合同生效日）至2012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	—	73,352.66	73,352.66
平安银行股份有限公司	—	77,932.69	77,932.69

长江证券			
合计	—	151,285.35	151,285.35

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：

$$H = E \times \text{年销售服务费率} \div \text{当年天数}$$

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

#### 6.4.9.3 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。

#### 6.4.9.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.9.4.1 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。

##### 6.4.9.4.2 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均未投资本基金。

#### 6.4.9.5 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 2013年1月1日至2013年6月30日		上年度可比期间 2012年3月30日（基金合同生效日） 至2012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	7,742,987.48	96,612.20	6,763,728.60	251,498.81

#### 6.4.9.6 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。

#### 6.4.9.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间均未无其他需要说明的关联交易事项。

#### 6.4.10 利润分配情况

本报告期本基金未进行利润分配。

#### 6.4.11 期末（2013年6月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.11.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未因认购新发/增发证券而持有流通受限证券。

##### 6.4.11.2 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临时停牌等流通受限股票。

##### 6.4.11.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.11.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2013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。

###### 6.4.11.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2013年6月30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47,000,000.00元，于2013年7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。

#### 6.4.12 金融工具风险及管理

##### 6.4.12.1 风险管理政策和组织架构

本基金金融工具的风险主要包括：

信用风险

流动性风险

市场风险

本基金在下文主要论述上述风险敞口及其形成原因；风险管理目标、政策和过程以及计量风险的方法等。

本基金管理人从事风险管理的目标是使本基金在风险和收益之间取得适当

的平衡，以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。基于该风险管理目标，本基金管理人已制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及设计相应内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金的基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由风险控制委员会、金融工程部和相关职能部门构成的多级风险管理架构体系。

#### 6.4.12.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的银行存款存放在本基金的托管行平安银行股份有限公司，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

##### 6.4.12.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2013年6月30日	上年度末 2012年12月31日
A-1	—	—
A-1以下	—	—
未评级	—	9,987,000.00
合计	—	9,987,000.00

注：未评级债券为国债、政策金融债及央行票据等免评级债券。

根据中国人民银行2006年3月29日发布的“银发[2006]95号”文《中国人民银行信用评级管理指导意见》，以及2006年11月21日发布的《信贷市场和银行间债券市场信用评级规范》等文件的有关规定，短期债券信用评级等级划分为四等六级，符号表示为：A-1、A-2、A-3、B、C、D。其中，每一个信用等级可用“+”、

“-”符号进行微调，表示略高或略低于本等级。

级别设置	含义
A-1	还本付息能力最强，安全性最高。
A-2	还本付息能力较强，安全性较高。
A-3	还本付息能力一般，安全性易受不良环境变化的影响。
B	还本付息能力较低，有一定的违约风险。
C	还本付息能力很低，违约风险较高。
D	不能按期还本付息。

#### 6.4.12.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2013年6月30日	上年度末 2012年12月31日
AAA	57,278,020.60	129,732,349.30
AAA以下	28,973,784.37	20,676,009.00
未评级	—	—
合计	86,251,804.97	150,408,358.30

注：根据中国人民银行2006年3月29日发布的“银发[2006]95号”文《中国人民银行信用评级管理指导意见》，以及2006年11月21日发布的《信贷市场和银行间债券市场信用评级规范》等文件的有关规定，中长期债券信用等级划分成三等九级，分别用AAA、AA、A、BBB、BB、B、CCC、CC和C表示，其中，除AAA级、CCC级(含)以下等级外，每一个信用等级可用“+”、“-”符号进行微调，表示略高或略低于本等级。

级别设置	含义
AAA	偿还债务的能力极强，基本不受不利经济环境的影响，违约风险极低。
AA	偿还债务的能力很强，受不利经济环境的影响较小，违约风险很低。
A	偿还债务的能力较强，较易受不利经济环境的影响，违约风险较低。
BBB	偿还债务的能力一般，受不利经济环境影响较大，违约风险一般。
BB	偿还债务的能力较弱，受不利经济环境影响很大，有较高违约风险。
B	偿还债务的能力较大地依赖于良好的经济环境，违约风险很高。
CCC	偿还债务的能力极度依赖于良好的经济环境，违约风险极高。
CC	在破产重组时可获得保护较小，基本不能保证偿还债务。
C	不能偿还债务。

#### 6.4.12.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而

无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现,另一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额。

针对投资品种变现的流动性风险,本基金的基金管理人主要通过限制、跟踪和控制基金投资交易的不活跃品种来实现。本基金所持大部分证券在证券交易所上市,其余亦可在银行间同业市场交易,除附注6.4.11中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外,其余均能及时变现。此外,本基金可通过卖出回购金融资产方式融入短期资金应对流动性需求,其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

针对兑付赎回资金的流动性风险,本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求,保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款,约定在非常情况下赎回申请的处理方式,控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险,有效保障基金持有人利益。

本基金的基金管理人每日预测本基金的流动性需求,并同时通过专设的金融工程部设定流动性比例要求,对流动性指标进行持续的监测和分析。

#### 6.4.12.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险,包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.12.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息,因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。本基金管理人金融工程部对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

下表统计了本基金面临的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值,并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

##### 6.4.12.4.1.1 利率风险敞口

单位:人民币元

本期末	6个月以内	6个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
-----	-------	--------	------	------	-----	----

2013年6月30日						
资产						
银行存款	7,742,987.48	—	—	—	—	7,742,987.48
结算备付金	5,878,270.08	—	—	—	—	5,878,270.08
存出保证金	700,104.16	—	—	—	—	700,104.16
交易性金融资产	—	1,370,957.00	59,531,168.75	25,349,679.22	9,206,738.28	95,458,543.25
应收证券清算款	—	—	—	—	3,103,613.57	3,103,613.57
应收利息	—	—	—	—	281,106.46	281,106.46
应收申购款	—	—	—	—	9,424.60	9,424.60
资产总计	14,321,361.72	1,370,957.00	59,531,168.75	25,349,679.22	12,600,882.91	113,174,049.60
负债						
卖出回购金融资产款	47,000,000.00	—	—	—	—	47,000,000.00
应付证券清算款	—	—	—	—	11,042.48	11,042.48
应付赎回款	—	—	—	—	131,435.37	131,435.37
应付管理人报酬	—	—	—	—	40,838.28	40,838.28
应付托管费	—	—	—	—	11,668.08	11,668.08
应付销售服务费	—	—	—	—	13,801.58	13,801.58
应付交易费用	—	—	—	—	147,451.58	147,451.58
应交税费	—	—	—	—	15,509.07	15,509.07
应付利息	—	—	—	—	13,902.20	13,902.20
其他负债	—	—	—	—	259,444.92	259,444.92
负债总计	47,000,000.00	—	—	—	645,093.56	47,645,093.56
利率敏感度缺口	-32,678,638.28	1,370,957.00	59,531,168.75	25,349,679.22	11,955,789.35	65,528,956.04
上年度末 2012年12月31日	6个月以内	6个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产						
银行存款	5,863,832.62	—	—	—	—	5,863,832.62
结算备付金	1,414,143.70	—	—	—	—	1,414,143.70
存出保证金	—	—	—	—	250,000.00	250,000.00
交易性金融资产	—	9,987,000.00	135,649,349.30	14,759,009.00	—	160,395,358.30
应收利息	—	—	—	—	1,527,127.16	1,527,127.16
应收申购款	—	—	—	—	80,426.27	80,426.27
资产总计	7,277,976.32	9,987,000.00	135,649,349.30	14,759,009.00	1,857,553.43	169,530,888.05
负债						

卖出回购金融资产款	73,999,986.50	—	—	—	—	73,999,986.50
应付证券清算款	—	—	—	—	2,462,961.41	2,462,961.41
应付赎回款	—	—	—	—	438,428.28	438,428.28
应付管理人报酬	—	—	—	—	56,754.04	56,754.04
应付托管费	—	—	—	—	16,215.44	16,215.44
应付销售服务费	—	—	—	—	14,457.41	14,457.41
应付交易费用	—	—	—	—	556.38	556.38
应交税费	—	—	—	—	2,253.20	2,253.20
其他负债	—	—	—	—	559,457.95	559,457.95
负债总计	73,999,986.50	—	—	—	3,551,084.11	77,551,070.61
利率敏感度缺口	-66,722,010.18	9,987,000.00	135,649,349.30	14,759,009.00	-1,693,530.68	91,979,817.44

注：表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

#### 6.4.12.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率之外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2013年6月30日	上年度末 2012年12月31日
	市场利率下降27个基点	901,499.542	1,585,100.51
	市场利率上升27个基点	-901,499.542	-1,585,100.51

#### 6.4.12.4.2 外汇风险

本基金所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.12.4.3 其他价格风险

其他市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票和债券以及银行间同业市场交易的债券，所面临的最大其他市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他市场价格风险，并且定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

**6.4.12.4.3.1 其他价格风险敞口**

金额单位：人民币元

项目	本期末 2013年6月30日		上年度末 2012年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)
交易性金融资产 -股票投资	9,206,738.28	14.05	—	—
交易性金融资产 -债券投资	86,251,804.97	131.62	160,395,358.30	174.38
衍生金融资产— 权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	95,458,543.25	145.67	160,395,358.30	174.38

**6.4.12.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析**

假设	在95%的置信区间内，于2013年6月30日，基金资产组合的市场价格风险VaR值为1.24% (2012:0.63%)		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末	上年度末
		-814,731.25	-579,472.85

注：上述风险价值VaR的分析是基于资产负债表日所持证券过去一年市场价格波动情况而有可能发生的最大损失，且此变动适用于本基金所有的衍生工具及非衍生金融工具。取95%的置信度是基于本基金所持有的金融工具风险度量的要求。

**6.4.13 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**

以公允价值计量的金融工具

下表按公允价值三个层级列示了以公允价值计量的金融资产工具于2013年6月30日的账面价值。公允价值计量中的层级取决于对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值。三个层级的定义如下：

第一层级：相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价；

第二层级：直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除市场报价以外的有关资产或负债的输入值；

第三层级：以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的

输入值(不可观察输入值)。

单位：人民币元

项目	第一层级	第二层级	第三层级	合计
交易性金融资产				
股票投资	9,206,738.28			9,206,738.28
债券投资	65,071,653.77	21,180,151.20		86,251,804.97
合计	74,278,392.05	21,180,151.20		95,458,543.25

本报告期，本基金金融工具的第一层级与第二层级之间没有发生重大转换。

本报告期，本基金金融工具的公允价值估值技术并未发生改变。

## § 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	9,206,738.28	8.14
	其中：股票	9,206,738.28	8.14
2	固定收益投资	86,251,804.97	76.21
	其中：债券	86,251,804.97	76.21
	资产支持证券	—	—
3	金融衍生品投资	—	—
4	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
5	银行存款和结算备付金合计	13,621,257.56	12.04
6	其他各项资产	4,094,248.79	3.62
7	合计	113,174,049.60	100.00

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	—	—
C	制造业	5,973,148.28	9.12
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	775,800.00	1.18
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	282,590.00	0.43
J	金融业	—	—
K	房地产业	—	—
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	2,175,200.00	3.32
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	9,206,738.28	14.05

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	600763	通策医疗	80,000	2,175,200.00	3.32
2	000559	万向钱潮	409,997	2,152,484.25	3.28
3	000012	南玻A	150,000	1,390,500.00	2.12
4	000413	宝石A	102,190	1,266,134.10	1.93
5	002091	江苏国泰	60,000	775,800.00	1.18
6	600332	广州药业	20,000	685,200.00	1.05
7	000848	承德露露	20,383	462,897.93	0.71
8	300245	天玑科技	20,000	255,600.00	0.39
9	300168	万达信息	1,000	26,990.00	0.04
10	002603	以岭药业	700	15,932.00	0.02

### 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	600332	广州药业	15,665,338.50	17.03
2	600887	伊利股份	12,306,756.98	13.38
3	600597	光明乳业	10,610,532.88	11.54
4	000848	承德露露	7,717,678.99	8.39
5	600557	康缘药业	7,301,015.71	7.94
6	000960	锡业股份	7,266,932.02	7.90
7	002273	水晶光电	6,641,917.30	7.22
8	300054	鼎龙股份	5,498,756.44	5.98
9	300155	安居宝	5,391,137.00	5.86
10	002013	中航精机	4,900,297.35	5.33
11	000413	宝石A	4,309,203.61	4.68

12	002007	华兰生物	4,033,289.55	4.38
13	000768	中航飞机	3,744,550.40	4.07
14	300168	万达信息	3,448,638.56	3.75
15	600497	驰宏锌锗	3,125,094.49	3.40
16	600763	通策医疗	2,964,419.97	3.22
17	300026	红日药业	2,954,265.26	3.21
18	600702	沱牌舍得	2,954,263.14	3.21
19	000559	万向钱潮	2,932,466.66	3.19
20	002603	以岭药业	2,921,564.25	3.18
21	002091	江苏国泰	2,779,050.32	3.02
22	300355	蒙草抗旱	2,594,126.69	2.82
23	000012	南玻A	2,588,026.50	2.81
24	000046	泛海建设	2,475,046.14	2.69
25	002570	贝因美	2,459,152.90	2.67
26	002155	辰州矿业	2,183,076.00	2.37
27	300229	拓尔思	2,154,105.29	2.34
28	000631	顺发恒业	2,140,190.87	2.33
29	300020	银江股份	2,134,130.04	2.32
30	002407	多氟多	2,130,831.90	2.32
31	600000	浦发银行	2,073,000.00	2.25
32	300101	国腾电子	2,018,075.60	2.19
33	600276	恒瑞医药	2,010,730.52	2.19
34	300245	天玑科技	2,005,307.62	2.18
35	600062	华润双鹤	1,882,145.00	2.05

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，不考虑其它交易费用。

#### 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	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600332	广州药业	16,282,403.80	17.70
2	600887	伊利股份	12,446,636.50	13.53
3	600597	光明乳业	11,214,924.92	12.19
4	000848	承德露露	8,512,235.44	9.25
5	600557	康缘药业	7,276,559.85	7.91
6	000960	锡业股份	6,902,457.50	7.50

7	002273	水晶光电	6,467,334.88	7.03
8	300054	鼎龙股份	5,725,752.14	6.23
9	300155	安居宝	5,430,718.61	5.90
10	002013	中航精机	4,720,241.41	5.13
11	002007	华兰生物	4,125,546.56	4.49
12	000768	中航飞机	3,863,275.91	4.20
13	300168	万达信息	3,664,765.37	3.98
14	600497	驰宏锌锗	3,028,152.21	3.29
15	300026	红日药业	3,025,317.66	3.29
16	002603	以岭药业	2,872,024.86	3.12
17	600702	沱牌舍得	2,825,024.66	3.07
18	000413	宝 石 A	2,818,328.41	3.06
19	002570	贝因美	2,692,610.46	2.93
20	300355	蒙草抗旱	2,549,196.50	2.77
21	000046	泛海建设	2,443,013.09	2.66
22	300229	拓尔思	2,248,862.28	2.44
23	002155	辰州矿业	2,182,796.00	2.37
24	300020	银江股份	2,133,894.60	2.32
25	600000	浦发银行	2,107,934.00	2.29
26	000631	顺发恒业	2,090,895.00	2.27
27	002407	多氟多	2,049,233.14	2.23
28	300101	国腾电子	2,025,044.00	2.20
29	600276	恒瑞医药	1,985,076.00	2.16

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，不考虑其它交易费用。

#### 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	178,489,990.89
卖出股票收入（成交）总额	171,639,210.89

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	15,797,885.15	24.11
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	—	—
7	可转债	70,453,919.82	107.52
7	其他	—	—
8	合计	86,251,804.97	131.62

### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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	110018	国电转债	168,740	18,136,175.20	27.68
2	113001	中行转债	150,000	15,016,500.00	22.92
3	113003	重工转债	100,660	11,004,151.20	16.79
4	110011	歌华转债	110,000	10,747,000.00	16.40
5	1280183	12鄂州城投债	100,000	10,176,000.00	15.53

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有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 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

### 7.9 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

### 7.10 投资组合报告附注

#### 7.10.1 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。

7.10.2 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。

### 7.10.3 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	700,104.16
2	应收证券清算款	3,103,613.57
3	应收股利	—
4	应收利息	281,106.46
5	应收申购款	9,424.60
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	4,094,248.79

### 7.10.4 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	110018	国电转债	18,136,175.20	27.68
2	113001	中行转债	15,016,500.00	22.92
3	113003	重工转债	11,004,151.20	16.79
4	110011	歌华转债	10,747,000.00	16.40
5	110016	川投转债	3,624,000.00	5.53
6	110022	同仁转债	907,410.00	1.38
7	127001	海直转债	196,399.22	0.30
8	110015	石化转债	95,827.20	0.15

### 7.10.5 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。

#### 7.10.6 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	531	36,892.15	99,475.58	0.51%	19,490,256.08	99.49%
长信可转债债券C	945	44,614.98	1,196,976.41	2.84%	40,964,175.70	97.16%
合计	1,476	41,836.64	1,296,451.99	2.10%	60,454,431.78	97.90%

### 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	0.13%
	长信可转债债券C	48,534.27	0.12%
	合计	73,823.51	0.12%

注：1、期末本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有该只基金份额总量的数量区间为0。

2、期末该只基金的基金经理持有该只基金份额总量的数量区间为0份至10万份。

## § 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	42,590,787.84	44,897,356.87
本报告期基金总申购份额	20,313,895.86	97,592,498.46
减：本报告期基金总赎回份额	-43,314,952.04	-100,328,703.22
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	19,589,731.66	42,161,152.11

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期末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

1、2013年1月5日，基金管理人发布了《关于基金行业高级管理人员变更公告》，增聘宋小龙先生担任公司副总经理。

2、2013年6月14日，基金托管人发布公告，叶萍女士自2013年5月24日起不再担任公司资产托管部总经理职务。经平安银行股份有限公司审议通过，聘任陈正涛先生为平安银行资产托管部副总经理（主持工作）（待中国证券监督管理委员会核准）。

### 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

本报告期基金投资策略未改变。

### 10.5 基金改聘会计师事务所情况

本报告期本基金未改聘为基金审计的会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况

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 本期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	占股票成交总额比例	成交金额	占债券成交总额比例	成交金额	占债券回购成交总额比例	佣金	占当期佣金总量的比例
中信证券	1	208,980,207.63	59.69%	30,412,161.89	2.52%	34,000,000.00	0.64%	187,701.68	59.36%
长江证券	1	141,148,994.15	40.31%	1,177,994,962.48	97.48%	5,260,400,000.00	99.36%	128,502.13	40.64%

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。

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	信息披露方式	披露日期
1	长信可转债债券型证券投资基金2012年第四季度报告	上证报、中证报、证券时报	2013-1-19
2	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金在诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司开通定期定额投资业务及转换业务的公告	上证报、中证报、证券时报、证券日报	2013-1-23

3	长信基金管理有限责任公司关于增加杭州数米基金销售有限公司为长信可转债债券型证券投资基金代销机构并开通定期定额投资业务、及参加申购（含定投申购）费率优惠活动的公告	上证报、中证报、证券时报	2013-2-20
4	长信基金管理有限责任公司关于增加申银万国证券股份有限公司为长信增利动态策略股票型证券投资基金的代销机构并开通旗下部分开放式基金的转换业务的公告	上证报、中证报、证券时报、 证券日报	2013-3-05
5	长信基金管理有限责任公司关于长信可转债债券型证券投资基金在国信证券等28家基金销售机构开通定期定额投资业务及参加申购、定投申购费率优惠活动的公告	上证报、中证报、证券时报	2013-3-23
6	长信可转债债券型证券投资基金2012年年报及摘要（仅摘要见报）	上证报、中证报、证券时报	2013-3-26
7	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金参加中国工商银行股份有限公司个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	上证报、中证报、证券时报	2013-3-28
8	长信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金在上海好买基金销售有限公司基金电子交易平台开通定期定额投资业务、及参加定期定额投资申购费率优惠活动的公告	上证报、中证报、证券时报、 证券日报	2013-3-28
9	长信基金管理有限责任公司关于增加和讯信息科技有限公司为旗下部分开放式基金代销机构并开通定期定额投资业务、参加申购（含定投申购）费率优惠活动及开通转换业务的公告	上证报、中证报、证券时报、 证券日报	2013-4-17
10	长信可转债债券型证券投资基金2013年第1季度报告	上证报、中证报、证券时报、	2013-4-22
11	长信可转债债券型证券投资基金更新的招募说明书（2013年第【1】号）及摘要	上证报、中国证券报、证券 时报	2013-5-13
12	长信基金管理有限责任公司关于长信可转债债券型证券投资基金暂停申购、转换转入、定期定额投资业务的公告	上证报、中证报、证券时报	2013-5-31

## § 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立基金的文件；
- 2、《长信可转债债券型证券投资基金基金合同》；
- 3、《长信可转债债券型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《长信可转债债券型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。

### 11.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

### 11.3 查阅方式

投资者可在有效的工作时间内免费查阅，在支付工本费后，也可在有效的工作时间内取得上述文件的复制件或复印件。

长信基金管理有限责任公司

二〇一三年八月二十九日