长信可转债债券型证券投资基金

2015 半年度 报告摘要

2015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:2015年8月27日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任.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2015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2015年1月1日起至2015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	515,371,675.66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
下属分级基金场内简称	CX转债A	CX转债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	291,684,088.78份	223,687,586.88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。

注:2015年8月7日起本基金业绩比较基准变更为：中信标普可转债指数收益率×70%+中证综合债指数收益率×20%+沪深300指数收益率×10%,关于业绩比较基准变更的事宜,我公司已于该日发布《长信基金管理有限责任公司关于旗下部分基金更名及调整业绩比较基准的公告》。

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	Zhangbo7438@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（2015年1月1日—2015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	197,566,596.70	82,023,460.10
本期利润	189,625,720.73	-22,383,415.30
加权平均基金份额本期利润	0.2476	-0.1557
本期基金份额净值增长率	21.75%	20.64%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2015年6月30日）	
期末可供分配基金份额利润	0.4770	0.4579
期末基金资产净值	498,026,408.19	376,931,076.14
期末基金份额净值	1.7074	1.6851

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。

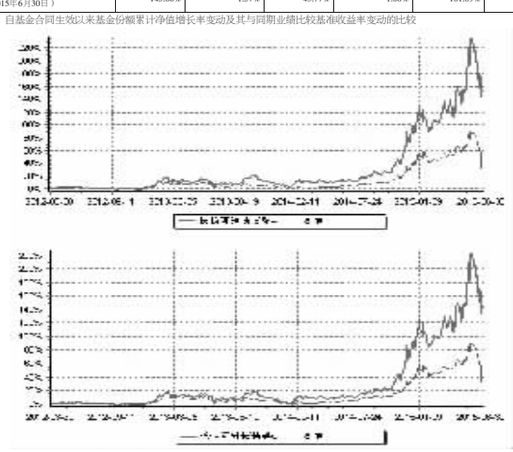
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如,封闭式基金交易佣金、开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等）,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	-15.92%	3.74%	-19.62%	4.20%	3.70%	-0.46%
过去三个月	14.59%	3.75%	-5.36%	2.89%	19.95%	0.86%
过去六个月	21.75%	3.13%	-3.96%	2.34%	25.71%	0.79%
过去一年	122.62%	2.59%	35.73%	1.82%	86.89%	0.77%
过去三年	149.04%	1.64%	40.74%	1.12%	108.30%	0.52%
自基金合同生效日起至今（2012年3月30日-2015年6月30日）	154.07%	1.57%	43.77%	1.08%	110.30%	0.49%
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	-16.00%	3.74%	-19.62%	4.20%	3.62%	-0.46%
过去三个月	14.24%	3.75%	-5.36%	2.89%	19.60%	0.86%
过去六个月	20.64%	3.13%	-3.96%	2.34%	24.60%	0.79%
过去一年	119.92%	2.59%	35.73%	1.82%	84.19%	0.77%
过去三年	141.08%	1.64%	40.74%	1.12%	100.34%	0.52%
自基金合同生效日起至今（2012年3月30日-2015年6月30日）	145.66%	1.57%	43.77%	1.08%	101.89%	0.49%

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2015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2015年6月30日,本基金管理人共管理25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）（2015年7月20日起变更为长信医疗保健混合（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、长信改革红利混合、长信量化中小盘股票、长信新利混合、长信利富债券、长信利盈混合及长信利广混合。

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利富债券型证券投资基金的基金经理,公司副总经理、固定收益部总监	2012年3月30日	—	17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年加入长信基金管理有限责任公司,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、总经理助理,现任长信基金管理有限责任公司副总经理、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利富债券型证券投资基金的基金经理。
刘波	本基金、长信利众分级债券型证券投资基金、长信新利灵活配置混合型证券投资基金、长信利盈灵活配置混合型证券投资基金和长信利广灵活配置混合型证券投资基金的基金经理	2012年3月30日	—	8年	经济学硕士,上海财经大学国防经济专业研究生毕业,具有基金从业资格,曾任大平养老投资有限公司投资管理部投资经理,2011年3月加入长信基金管理有限责任公司,曾任长信利息收益开放式证券投资基金的基金经理,现任本基金、长信利众分级债券型证券投资基金、长信新利灵活配置混合型证券投资基金、长信利盈灵活配置混合型证券投资基金、长信利广灵活配置混合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发现参与交易所证券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

2015年上半年,美国失业率下降至2008年以来的新低,经济复苏势头延续,加息预期升温,国债收益率大幅上行;欧元区经济缓慢复苏,失业率高位徘徊,3月份启动了为期18个月的QE计划以稳定经济增长,2015年二季度希腊债务问题再次呈现,欧债问题反复;日本经济表现平稳,2015年二季度经济扩张势头略有减速,新兴经济体经济增长普遍减速,汇率波动较大,国内方面,上半年通胀维持低位,管理层通过降息、降准、定向宽松等货币工具来刺激经济增长,同时,地方债务置换顺利进行,财政项目投入力度加大,带动基建投资增速及房地产市场的上扬。2015年上半年存款保险制度正式意见稿下发,存款利率上浮区间扩大,大额存单制度推出,利率市场化准备工作逐渐完善。市场方面,2015年上半年资金面整体宽松,IPO周期对资金价格有一定扰动影响;债市延续了2014年以来的牛市行情,信用债表现优于利率债品种,尤其是地方政府债务置换使城投债受到市场青睐;2015年上半年权益市场波动剧烈,公司债跟随权益市场呈现一定波动;可转债上半年整体获得较好表现,但受制于转债集中赎回,市场存量规模明显下降,溢价率压缩使转债表现不及正股,2015年6月中下旬跟随股市呈现剧烈调整。

报告期内,本基金在1-5月份保持了较高的可转债配置比例,集中持有了估值较低的大盘蓝筹转债以及部分优质的中小盘转债品种,6月后随着转债的集中到期以及市场的调整,本基金逐渐降低了转债配置比例,以期降低组合收益率波动,期间获得了一定投资收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2015年6月30日,长信可转债债券A份额净值为1.7074元,份额累计净值为2.2674元,本报告期内长信可转债债券A净值增长率为21.75%;长信可转债债券C份额净值为1.6851元,份额累计净值为2.2121元,本报告期内长信可转债债券C净值增长率为20.64%,同期业绩比较基准收益率为-3.96%。

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,美国经济趋势性复苏的势头不改,2015年下半年加息概率加大,国际资本回流可能加大新兴经济体汇率波动,国内经济复苏基础仍不稳固,降息、降准均有一定空间,同时,2015年下半年财政刺激及定向宽松的力度可能仍会加大,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,利率风险可控,信用债中城投债券仍是相对较好的投资品种,产业债可寻找基本面较好的个券进行配置,但信用风险需要重点关注;可转债进入严重稀缺阶段,二级市场博弈力度加大,新券上市溢价率较高,可重点关注一级市场申购机会。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

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。

本基金本报告期已公告实施一次分红,符合基金合同中关于利润分配条款的约定,详细情况如下:

单位:人民币元

份额级别	权益登记日	除息日	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	利润分配合计
可转债A	2015-01-23	2015-01-23	3.97	2,152,326,573.79	102,238,210.09	2,254,564,783.88
可转债C	2015-01-23	2015-01-23	3.74	11,310,494.37	6,467,794.92	17,778,289.29

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日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。

4.8 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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。

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:2015年6月30日

单位:人民币元

资 产	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
资 产:		
银行存款	173,334,032.38	201,692,121.60
结算备付金	45,898,176.81	30,200,535.11
存出保证金	3,689,434.12	920,265.69
交易性金融资产	908,934,437.62	887,776,618.78
其中:股票投资	178,064,747.72	82,737,778.82
基金投资	-	-
债券投资	730,869,689.90	805,038,839.96
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	125,112,053.87	-
应收利息	8,080,696.95	2,199,725.30
应收股利	-	-
应收申购款	4,191,672.96	36,762,607.37
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,269,240,504.71	1,298,562,322.37
负债和所有者权益	本期末 2015年06月30日	上年度末 2014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	300,000,000.00	200,000,000.00
应付证券清算款	-	48,097,543.40
应付赎回款	90,913,065.32	47,707,509.35
应付管理人报酬	764,717.75	438,637.32
应付托管费	218,490.79	125,324.96
应付销售服务费	353,382.01	103,583.17
应付交易费用	1,574,710.51	585,938.42
应交税费	13,390.14	13,390.14
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	445,263.86	699,270.12
负债合计	394,283,020.38	297,771,196.88
所有者权益:		
实收基金	515,371,675.66	558,575,712.44
未分配利润	359,585,808.67	442,215,413.05
所有者权益合计	874,957,484.33	1,000,791,125.49
负债和所有者权益总计	1,269,240,504.71	1,298,562,322.37

注:报告截止日2015年6月30日,基金份额净值1.6977元,基金份额总额515,371,675.66份,其中长信可转债债券A基金份额净值1.7074元,份额总额291,684,088.78份,长信可转债债券C基金份额净值1.6851元,份额总额223,687,586.88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:2015年1月1日至2015年6月30日

单位:人民币元

项 目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
一、收入	189,036,734.69	11,242,546.01
1.利息收入	7,309,775.53	1,645,534.07
其中:存款利息收入	3,662,163.23	189,689.89
债券利息收入	2,836,194.77	1,455,844.18
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	811,417.53	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益	282,641,165.11	1,169,990.55
其中:股票投资收益	123,730,281.97	-1,758,618.00
基金投资收益	-	-
债券投资收益	158,376,441.78	2,724,740.66
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	534,441.36	203,867.89
3.公允价值变动收益	-112,347,751.37	8,414,417.24
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	11,433,545.42	12,604.15
减:二、费用	21,794,429.26	3,461,697.72
1.管理人报酬	5,130,265.87	523,470.79
2.托管费	1,465,790.33	149,563.14
3.销售服务费	429,285.23	45,451.40
4.交易费用	5,965,119.17	782,590.88
5.利息支出	8,625,844.15	1,772,380.01
其中:卖出回购金融资产支出	8,625,844.15	1,772,380.01
6.其他费用	178,124.51	188,241.50
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	167,242,305.43	7,780,848.29
减:所得税费用	-	-
四、净利润（亏损以“-”号填列）	167,242,305.43	7,780,848.29

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:2015年1月1日至2015年6月30日

单位:人民币元

项 目	本期 2015年1月1日至2015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)	558,575,712.44	442,215,413.05	1,000,791,125.49
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	167,242,305.43	167,242,305.43
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）	-43,204,036.78	2,022,471,163.36	1,979,267,126.58
其中:1.基金申购款	6,948,839,998.70	5,452,816,349.54	12,401,656,348.24
2.基金赎回款	-6,992,044,035.48	-3,430,345,186.18	-10,422,389,221.66
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）	-	-2,272,343,073.17	-2,272,343,073.17
五、期末所有者权益(基金净值)	515,371,675.66	359,585,808.67	874,957,484.33
项 目	上年度可比期间 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

根据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:

叶桦 曹波 孙红辉

基金管理公司负责人	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2015年6月30日的财务状况、2015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 会计政策变更的说明

本报告期本基金会计政策与最近一期年度报告相一致。

6.4.4.2 会计估计变更的说明

根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》,自2015年3月27日起,本基金管理人对旗下证券投资基金持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外）,采用第三方估值机构提供的价格进行估值。详情请见本基金管理人于2015年3月31日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站发布的《长信基金管理有限责任公司关于调整旗下基金交易所固定收益品种估值方法的公告》。

6.4.4.3 差错更正的说明

本报告期本基金无重大会计差错。

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 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
债券利息收入所得税	13,390.14	13,390.14

注:该项系基金收到的债权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 2015年1月1日至2015年6月30日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014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	1,918,810,980.43	49.14%	345,249,241.35	66.12%

6.4.7.1.2 债券交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014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	6,800,339,011.94	91.84%	915,270,234.74	92.59%

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 2015年1月1日至2015年6月30日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014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	64,295,200,000.00	91.71%	8,188,000,000.00	98.98%

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 2015年1月1日至2015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	1,746,885.56	49.14%	515,768.77	32.90%
关联方名称	上年度可比期间 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%

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

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	5,130,265.87	523,470.79
其中:支付销售机构的客户维护费	1,681,166.70	72,322.39

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

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,465,790.33	149,563.14

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 2015年1月1日至2015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	-	86,635.95	86,635.95
平安银行股份有限公司	-	19,328.04	19,328.04
长江证券	-	340.14	340.14
合计	-	106,304.13	106,304.13
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 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