

长信可转债债券型证券投资基金

[2012] 第三季度报告

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

报告送出日期:2012年10月25日

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、完整性和及时性承担个别及连带责任。

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2012年10月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告的内容,复核结果不存在虚假记载、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。投资人投资于基金时应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告期自2012年7月1日起至2012年9月30日止。

§ 2 基金产品概况

长信可转债债券

519977

契约型开放式

2012年3月30日

报告期末基金份额总额

108,504,152.79份

本基金重点关注于投资于可转换债券(含可分离交易可转换债券),主要运用转债品种兼具债券和股票的特性,通过锁定主动的可转债投资组合,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。

本基金主要投资于可转换债券,一方面利用可转换债券特性,强调投资组合的安全性和稳定性;另一方面利用可转换债券的股性,分享股市上涨带来的较高收益。

业绩比较基准 中信标普可转债指数收益率*70%+中信标普债指数收益率*30%

本基金为债券型基金,属于较低风险的证券投资基金品种,其预期风险和预期收益水平在货币市场基金、低于混合型基金和股票型基金中居中,风险水平相对较低的投资品种。

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

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 49,380,372.71份 59,123,780.08份

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2012年7月1日-2012年9月30日)

长信可转债债券A

长信可转债债券C

1.本期已实现收益 25,313.58 -291,007.72

2.本期利润 -710,792.06 -1,095,636.37

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0131 -0.0139

4.期末基金资产净值 49,761,645.77 59,440,547.42

5.期末基金份额净值 1.0077 1.0054

6.期末可供分配基金份额利润 0.0000 0.0000

7.期末基金资产净值 49,761,645.77 59,440,547.42

8.期末可供分配基金份额利润 0.0000 0.0000

9.期末基金份额净值 1.0077 1.0054

10.本期基金份额变动 49,380,372.71份 59,123,780.08份

11.期末基金资产净值 49,380,372.71 59,123,780.08

12.期末可供分配基金份额利润 0.0000 0.0000

13.期末基金份额净值 1.0077 1.0054

14.报告期利润 -2,333.00 0.17%

15.报告期基金份额净值增长率 -2.75% 0.27%

16.报告期基金份额净值增长率 -1.52% -0.10%

17.报告期基金份额净值增长率 -0.10%

18.报告期基金份额净值增长率 -0.10%

19.报告期基金份额净值增长率 -0.10%

20.报告期基金份额净值增长率 -0.10%

21.报告期基金份额净值增长率 -0.10%

22.报告期基金份额净值增长率 -0.10%

23.报告期基金份额净值增长率 -0.10%

24.报告期基金份额净值增长率 -0.10%

25.报告期基金份额净值增长率 -0.10%

26.报告期基金份额净值增长率 -0.10%

27.报告期基金份额净值增长率 -0.10%

28.报告期基金份额净值增长率 -0.10%

29.报告期基金份额净值增长率 -0.10%

30.报告期基金份额净值增长率 -0.10%

31.报告期基金份额净值增长率 -0.10%

32.报告期基金份额净值增长率 -0.10%

33.报告期基金份额净值增长率 -0.10%

34.报告期基金份额净值增长率 -0.10%

35.报告期基金份额净值增长率 -0.10%

36.报告期基金份额净值增长率 -0.10%

37.报告期基金份额净值增长率 -0.10%

38.报告期基金份额净值增长率 -0.10%

39.报告期基金份额净值增长率 -0.10%

40.报告期基金份额净值增长率 -0.10%

41.报告期基金份额净值增长率 -0.10%

42.报告期基金份额净值增长率 -0.10%

43.报告期基金份额净值增长率 -0.10%

44.报告期基金份额净值增长率 -0.10%

45.报告期基金份额净值增长率 -0.10%

46.报告期基金份额净值增长率 -0.10%

47.报告期基金份额净值增长率 -0.10%

48.报告期基金份额净值增长率 -0.10%

49.报告期基金份额净值增长率 -0.10%

50.报告期基金份额净值增长率 -0.10%

51.报告期基金份额净值增长率 -0.10%

52.报告期基金份额净值增长率 -0.10%

53.报告期基金份额净值增长率 -0.10%

54.报告期基金份额净值增长率 -0.10%

55.报告期基金份额净值增长率 -0.10%

56.报告期基金份额净值增长率 -0.10%

57.报告期基金份额净值增长率 -0.10%

58.报告期基金份额净值增长率 -0.10%

59.报告期基金份额净值增长率 -0.10%

60.报告期基金份额净值增长率 -0.10%

61.报告期基金份额净值增长率 -0.10%

62.报告期基金份额净值增长率 -0.10%

63.报告期基金份额净值增长率 -0.10%

64.报告期基金份额净值增长率 -0.10%

65.报告期基金份额净值增长率 -0.10%

66.报告期基金份额净值增长率 -0.10%

67.报告期基金份额净值增长率 -0.10%

68.报告期基金份额净值增长率 -0.10%

69.报告期基金份额净值增长率 -0.10%

70.报告期基金份额净值增长率 -0.10%

71.报告期基金份额净值增长率 -0.10%

72.报告期基金份额净值增长率 -0.10%

73.报告期基金份额净值增长率 -0.10%

74.报告期基金份额净值增长率 -0.10%

75.报告期基金份额净值增长率 -0.10%

76.报告期基金份额净值增长率 -0.10%

77.报告期基金份额净值增长率 -0.10%

78.报告期基金份额净值增长率 -0.10%

79.报告期基金份额净值增长率 -0.10%

80.报告期基金份额净值增长率 -0.10%

81.报告期基金份额净值增长率 -0.10%

82.报告期基金份额净值增长率 -0.10%

83.报告期基金份额净值增长率 -0.10%

84.报告期基金份额净值增长率 -0.10%

85.报告期基金份额净值增长率 -0.10%

86.报告期基金份额净值增长率 -0.10%

87.报告期基金份额净值增长率 -0.10%

88.报告期基金份额净值增长率 -0.10%

89.报告期基金份额净值增长率 -0.10%

90.报告期基金份额净值增长率 -0.10%

91.报告期基金份额净值增长率 -0.10%

92.报告期基金份额净值增长率 -0.10%

93.报告期基金份额净值增长率 -0.10%

94.报告期基金份额净值增长率 -0.10%

95.报告期基金份额净值增长率 -0.10%

96.报告期基金份额净值增长率 -0.10%

97.报告期基金份额净值增长率 -0.10%

98.报告期基金份额净值增长率 -0.10%

99.报告期基金份额净值增长率 -0.10%

100.报告期基金份额净值增长率 -0.10%

101.报告期基金份额净值增长率 -0.10%

102.报告期基金份额净值增长率 -0.10%

103.报告期基金份额净值增长率 -0.10%

104.报告期基金份额净值增长率 -0.10%

105.报告期基金份额净值增长率 -0.10%

106.报告期基金份额净值增长率 -0.10%

107.报告期基金份额净值增长率 -0.10%

108.报告期基金份额净值增长率 -0.10%

109.报告期基金份额净值增长率 -0.10%

110.报告期基金份额净值增长率 -0.10%

111.报告期基金份额净值增长率 -0.10%

112.报告期基金份额净值增长率 -0.10%

113.报告期基金份额净值增长率 -0.10%

114.报告期基金份额净值增长率 -0.10%

115.报告期基金份额净值增长率 -0.10%

116.报告期基金份额净值增长率 -0.10%

117.报告期基金份额净值增长率 -0.10%

118.报告期基金份额净值增长率 -0.10%

119.报告期基金份额净值增长率 -0.10%

120.报告期基金份额净值增长率 -0.10%

121.报告期基金份额净值增长率 -0.10%

122.报告期基金份额净值增长率 -0.10%

123.报告期基金份额净值增长率 -0.10%

124.报告期基金份额净值增长率 -0.10%

125.报告期基金份额净值增长率 -0.10%

126.报告期基金份额净值增长率 -0.10%

127.报告期基金份额净值增长率 -0.10%