

长信可转债债券型证券投资基金

2015 半年度报告摘要

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,不可进行收益分配；

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得低于面值；

4、分红权益登记日申请赎回的基金份额不享受次分红,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作为计算基准自动转为相应的同一类别的基金份额,红利再投资所得的份额按再投资的费用计算。

6、法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

4.8 报告期内基金份额持有人数或基金资产净值预警说明

§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 本托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值增长、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,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 本托管人对本基金报告期内净值增长、净值波动、利润分配及分红情况的说明

本报告期内,由长信基金管理有限责任公司编制本长信基金复核的财务报表、净值表、财务会计报告(注:财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分不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	本报告 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
货币资金	173,334,052.28	201,862,124.89
结算备付金	46,898,179.81	30,300,538.11
应收利息	3,689,434.12	40,697,564.80
买入返售金融资产	908,934,437.22	887,776,676.03
中期票据	176,064,472.62	62,737,779.02
其他资产	—	—
资产总计	730,880,680.03	866,038,262.86
负债和所有者权益		
负债：		
应付利息	—	—
应付赎回款	—	—
其他负债	—	—
负债合计	—	—
所有者权益：		
实收基金	136,112,053.87	139,010,448.52
未分配利润	8,880,680.26	2,399,725.30
所有者权益合计	145,000,000.00	141,409,173.82
所有者权益总计	145,000,000.00	141,409,173.82
所有者权益总计	145,000,000.00	141,409,173.82

注:本报告截止日2015年6月30日,基金份额净值1.6977元,份额总额571,371,675.66份。其中长信可转债A基金份额净值1.6774元,份额总额291,694,088.07份,长信可转债债券C基金份额净值1.6851元,份额总额222,687,586.88份。

6.2 利润表

会计主体:长信可转债债券型证券投资基金

报告截止日:2015年1月1日至2015年6月30日

单位:人民币元

项目	本报告 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	189,030,724.89	11,242,546.01
1.利息收入	7,399,779.63	1,486,334.87
其中:应收利息收入	3,689,434.12	389,688.00
债券利息收入	2,636,194.77	1,456,344.18
资产支持证券利息收入	—	—
买入返售金融资产收入	811,477.53	—
其他利息收入	—	1,989,696.69
2.投资收益	262,641,195.11	1,989,696.69
其中:公允价值变动收益	2,682,163.23	—
其他投资收益	1,980,779.88	1,989,696.69
3.公允价值变动收益	156,756,441.76	2,724,740.66
其中:公允价值变动收益	—	—
其他公允价值变动收益	156,756,441.76	2,724,740.66
4.其他收入	536,444.36	209,867.26
其中:公允价值变动收益	—	—
其他收入	536,444.36	209,867.26
二、费用	21,794,420.26	3,461,677.72
1.管理人报酬	1,561,269.87	625,470.09
2.托管费	1,480,779.63	549,462.17
3.销售服务费	429,282.23	46,453.40
4.交易费用	5,965,133.17	762,580.00
5.利息支出	8,626,944.16	1,772,360.01
其中:卖出回购金融资产支出	8,626,944.16	1,772,360.01
6.其他费用	179,124.41	188,243.90
其中:公允价值变动收益	—	—
其他费用	179,124.41	188,243.90
三、利润总额(亏损总额)“+”号填列	167,246,304.63	7,780,868.29
四、净利润(净亏损)“-”号填列	167,246,304.63	7,780,868.29

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	本报告 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、投入	189,030,724.89	11,242,546.01
1.投入基金	7,399,779.63	1,486,334.87
其中:公允价值变动收益	2,682,163.23	—
其他投入	2,636,194.77	1,456,344.18
2.资产支持证券利息收入	—	—
3.买入返售金融资产收入	811,477.53	—
4.其他投入	—	1,989,696.69
二、分配	262,641,195.11	1,989,696.69
1.公允价值变动收益	2,682,163.23	—
2.其他分配	1,980,779.88	1,989,696.69
三、其他	—	—
四、所有者权益(基金净值)总计	145,000,000.00	141,409,173.82
五、所有者权益(基金净值)变动表	145,000,000.00	141,409,173.82
六、所有者权益(基金净值)变动表	145,000,000.00	141,409,173.82
七、所有者权益(基金净值)变动表	145,000,000.00	141,409,173.82
八、所有者权益(基金净值)变动表	145,000,000.00	141,409,173.82
九、所有者权益(基金净值)变动表	145,000,000.00	141,409,173.82
十、所有者权益(基金净值)变动表	145,000,000.00	141,409,173.82
十一、所有者权益(基金净值)变动表	145,000,000.00	141,409,173.82
十二、所有者权益(基金净值)变动表	145,000,000.00	141,409,173.82
十三、所有者权益(基金净值)变动表	145,000,000.00	141,409,173.82
十四、所有者权益(基金净值)变动表	145,000,000.00	141,409,173.82
十五、所有者权益(基金净值)变动表	145,000,000.00	141,409,173.82
十六、所有者权益(基金净值)变动表	145,000,000.00	141,409,173.82
十七、所有者权益(基金净值)变动表	145,000,000.00	141,409,173.82
十八、所有者权益(基金净值)变动表	145,000,000.00	141,409,173.82
十九、所有者权益(基金净值)变动表	145,000,000.00	141,409,173.82
二十、所有者权益(基金净值)变动表	145,000,000.00	141,409,173.82
二十一、所有者权益(基金净值)变动表	145,000,000.00	141,409,173.82
二十二、所有者权益(基金净值)变动表	145,000,000.00	141,409,173.82
二十三、所有者权益(基金净值)变动表	145,000,000.00	141,409,173.82
二十四、所有者权益(基金净值)变动表	145,000,000.00	141,409,173.82
二十五、所有者权益(基金净值)变动表	145,000,000.00	141,409,173.82
二十六、所有者权益(基金净值)变动表	145,000,000.00	141,409,173.82
二十七、所有者权益(基金净值)变动表	145,000,000.00	141,409,173.82
二十八、所有者权益(基金净值)变动表	145,000,000.00	141,409,173.82
二十九、所有者权益(基金净值)变动表	145,000,000.00	141,409,173.82
三十、所有者权益(基金净值)变动表	145,000,000.00	141,409,173.82
三十一、所有者权益(基金净值)变动表	145,000,000.00	141,409,173.82
三十二、所有者权益(基金净值)变动表	145,000,000.00	141,409,173.82
三十三、所有者权益(基金净值)变动表	145,000,000.00	141,409,173.82
三十四、所有者权益(基金净值)变动表	145,000,000.00	141,409,173.82
三十五、所有者权益(基金净值)变动表	145,000,000.00	141,409,173.82
三十六、所有者权益(基金净值)变动表	145,000,000.00	141,409,173.82
三十七、所有者权益(基金净值)变动表	145,000,000.00	141,409,173.82
三十八、所有者权益(基金净值)变动表	145,000,000.00	141,409,173.82
三十九、所有者权益(基金净值)变动表	145,000,000.00	141,409,173.82
四十、所有者权益(基金净值)变动表	145,000,000.00	141,409,173.82
四十一、所有者权益(基金净值)变动表	145,000,000.00	141,409,173.82
四十二、所有者权益(基金净值)变动表	145,000,000.00	141,409,173.82
四十三、所有者权益(基金净值)变动表	145,000,000.00	141,409,173.82
四十四、所有者权益(基金净值)变动表	145,000,000.00	141,409,173.82
四十五、所有者权益(基金净值)变动表	145,000,000.00	141,409,173.82
四十六、所有者权益(基金净值)变动表	145,000,000.00	141,409,173.82
四十七、所有者权益(基金净值)变动表	145,000,000.00	141,409,173.82
四十八、所有者权益(基金净值)变动表	145,000,000.00	141,409,173.82
四十九、所有者权益(基金净值)变动表	145,000,000.00	141,409,173.82
五十、所有者权益(基金净值)变动表	145,000,000.00	141,409,173.82
五十一、所有者权益(基金净值)变动表	145,000,000.00	141,409,173.82
五十二、所有者权益(基金净值)变动表	145,000,000.00	141,409,173.82
五十三、所有者权益(基金净值)变动表	145,000,000.00	141,409,173.82
五十四、所有者权益(基金净值)变动表	145,000,000.00	141,409,173.82
五十五、所有者权益(基金净值)变动表	145,000,000.00	141,409,173.82
五十六、所有者权益(基金净值)变动表	145,000,000.00	141,409,173.82
五十七、所有者权益(基金净值)变动表	145,000,000.00	141,409,173.82
五十八、所有者权益(基金净值)变动表	145,000,000.00	141,409,173.82
五十九、所有者权益(基金净值)变动表	145,000,000.00	141,409,173.82
六十、所有者权益(基金净值)变动表	145,000,000.00	141,409,173.82
六十一、所有者权益(基金净值)变动表	145,000,000.00	141,409,173.82
六十二、所有者权益(基金净值)变动表	145,000,000.00	141,409,173.82
六十三、所有者权益(基金净值)变动表	145,000,000.00	141,409,173.82
六十四、所有者权益(基金净值)变动表	145,000,000.00	141,409,173.82
六十五、所有者权益(基金净值)变动表	145,000,000.00	141,409,173.82
六十六、所有者权益(基金净值)变动表	145,000,000.00	141,409,173.82
六十七、所有者权益(基金净值)变动表	145,000,000.00	141,409,173.82
六十八、所有者权益(基金净值)变动表	145,000,000.00	141,409,173.82
六十九、所有者权益(基金净值)变动表	145,000,000.00	141,409,173.82
七十、所有者权益(基金净值)变动表	145,000,000.00	141,409,173.82
七十一、所有者权益(基金净值)变动表	145,000,000.00	141,409,173.82
七十二、所有者权益(基金净值)变动表	145,000,000.00	141,409,173.82
七十三、所有者权益(基金净值)变动表	145,000,000.00	141,409,173.82
七十四、所有者权益(基金净值)变动表	145,000,000.00	141,409,173.82
七十五、所有者权益(基金净值)变动表	145,000,000.00	141,409,173.82
七十六、所有者权益(基金净值)变动表	145,000,000.00	141,409,173.82
七十七、所有者权益(基金净值)变动表	145,000,000.00	141,409,173.82
七十八、所有者权益(基金净值)变动表	145,000,000.00	141,409,173.82
七十九、所有者权益(基金净值)变动表	145,000,000.00	141,409,173.82
八十、所有者权益(基金净值)变动表	145,000,000.00	141,409,173.82
八十一、所有者权益(基金净值)变动表	145,000,000.00	141,409,173.82
八十二、所有者权益(基金净值)变动表	145,000,000.00	141,409,173.82
八十三、所有者权益(基金净值)变动表	145,000,000.00	141,409,173.82
八十四、所有者权益(基金净值)变动表	145,000,000.00	141,409,173.82
八十五、所有者权益(基金净值)变动表	145,000,000.00	141,409,173.82
八十六、所有者权益(基金净值)变动表	145,000,000.00	141,409,173.82
八十七、所有者权益(基金净值)变动表	145,000,000.00	141,409,173.82
八十八、所有者权益(基金净值)变动表	145,000,000.00	141,409,173.82
八十九、所有者权益(基金净值)变动表	145,000,000.00	141,409,173.82
九十、所有者权益(基金净值)变动表	145,000,000.00	141,409,173.82
九十一、所有者权益(基金净值)变动表	145,000,000.00	141,409,173.82
九十二、所有者权益(基金净值)变动表	145,000,000.00	141,409,173.82
九十三、所有者权益(基金净值)变动表	145,000,000.00	141,409,173.82
九十四、所有者权益(基金净值)变动表	145,000,000.00	141,409,173.82
九十五、所有者权益(基金净值)变动表	145,000,000.00	141,409,173.82
九十六、所有者权益(基金净值)变动表	145,000,000.00	141,409,173.82
九十七、所有者权益(基金净值)变动表	145,000,000.00	141,409,173.82
九十八、所有者权益(基金净值)变动表	145,000,000.00	141,409,173.82
九十九、所有者权益(基金净值)变动表	145,000,000.00	141,409,173.82
一百、所有者权益(基金净值)变动表	145,000,000.00	141,409,173.82

6.4 现金流量表

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

一、本期经营活动产生的现金流量净额(净增加/净减少以“-”号填列)	-	167,243,306.43	367,243,306.43
二、本期基金投资交易产生的现金流量净额(净增加/净减少以“-”号填列)	-43,204,006.79	2,022,471,163.36	1,979,267,126.58
三、本期基金份额持有人分配股利产生的现金流量净额(净增加/净减少以“-”号填列)	6,989,859,968.00	5,822,816,348.04	12,401,686,348.24
2.基金赎回款	-6,902,044,036.40	-3,430,346,186.18	-10,432,389,221.66
四、本期因基金申购和/或有分配股利产生的现金流量净额(净增加/净减少以“-”号填列)	-	-2,722,343,073.17	-2,722,343,073.17
五、期末所有者权益(基金净值)	515,371,675.06	389,565,805.67	874,067,484.23

项目	2014年1月1日至2014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	2013年12月31日
一、期初所有者权益(基金净值)	120,158,267.30	-9,925,723.69	110,152,563.70
二、本期经营活动产生的现金流量净额(净增加/净减少以“-”号填列)	-	7,780,848.29	7,780,848.29
三、本期基金投资交易产生的现金流量净额(净增加/净减少以“-”号填列)	56,671,554.24	-1,486,007.16	54,181,532.47
四、基金份额申购款	72,101,257.41	-2,367,094.51	69,734,383.10
五、基金赎回款	-16,489,482.41	679,332.54	-15,609,880.63
六、期末所有者权益(基金净值)	-	-	-