

上接B081版

| |
|------------------------------|
| (61)上海汇付金融服务有限公司 |
| 注册地址:上海市浦东中山南路100号金外滩国际广场19楼 |
| 办公地址:上海市浦东中山南路100号金外滩国际广场19楼 |
| 法定代表人:冯敏敏 |
| 联系人:陈云卉 |
| 电话:021-33323999-5611 |
| 传真:021-33322830 |
| 客户服务电话:4008220819 |
| 网址:www.chinapn.com |

| |
|--------------------------------|
| (62)上海陆金所资产管理有限公司 |
| 注册地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14号楼09单元 |
| 办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14号楼 |
| 法定代表人:郭坚 |
| 联系人:宁博宇 |
| 电话:021-20666962 |
| 传真:021-22066653 |
| 客户服务电话:4008219031 |
| 网址:www.lufunds.com |

| |
|------------------------------------|
| (63)大泰金石投资管理有限公司 |
| 注册地址:南京市建邺区江东中路269号国睿大厦一号楼B4层A506室 |
| 办公地址:上海市长宁区虹桥路1386号文广大楼15楼 |
| 法定代表人:袁晓明 |
| 联系人:朱真卿 |
| 电话:021-22267943 |
| 传真:021-22268089 |
| 客户服务电话:400-928-2266 |
| 网址:www.dtfuture.com |

| |
|----------------------------------|
| (64)上海联泰资产评估有限公司 |
| 注册地址:中国(上海)自由贸易试验区富特西路277号3层310室 |
| 办公地址:上海市长宁区福泉北路158号9座3楼 |
| 法定代表人:燕斌 |
| 联系人:凌秋艳 |
| 电话:021-52822063 |
| 传真:021-52935270 |
| 客户服务电话:400-046-6788 |
| 网址:www.ltzhichan.com |

| |
|----------------------------|
| (65)海银基金销售有限公司 |
| 注册地址:上海市浦东新区东方路1217号16楼B单元 |
| 办公地址:上海市浦东新区东方路1217号6楼 |
| 法定代表人:刘振 |
| 联系人:毛林 |
| 电话:021-80136397 |
| 传真:021-80133413 |
| 客户服务电话:4008081016 |
| 网址:www.fundhaiyin.com |

| |
|---|
| 3.场内销售机构 |
| 场内代销机构是指持有代销业务资格的上海证券交易所会员,名单详见上海证券交易所网站: http://www.sse.com.cn |
| 基金管理人可根据有关法律法规的要求,选择其他符合要求的机构代理销售本基金,并及时公告。 |

(二)其他相关机构

| | | | |
|-------|---------------------|----------------|--------------|
| 信息类型 | 注册登记机构 | 律师事务所 | 会计师事务所 |
| 名称 | 中证登上海分公司 | 上海泰和律师事务所 | 毕马威华振会计师事务所 |
| 注册地址 | 北京市西城区太平桥大街 | 北京市东城区建国门内大街9号 | |
| 办公地址 | 上海市浦东陆家嘴26号中国人寿金融中心 | 北京东直门安华里1号东厂区 | |
| 法定代表人 | 金颖 | 廖静 | 毕马威华振 |
| 联系人 | 010-65378956 | 021-51160298 | 021-22228888 |
| 电话 | 010-65378907 | 021-51160398 | 021-62818189 |
| 邮箱 | | | |
| 联系人 | 赵娟 | 王丽娟(理财经理) | 刘佳(理财经理) |

四、基金的名称

长信可转债债券型证券投资基金

五、基金的类型

契约开放式

六、基金的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。

七、基金的投资范围

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今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: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(含公司分离交易可转债)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总资产的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。

八、基金的投资策略

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。

(一)资产配置和类属资产配置策略

1.整体资产配置策略

本基金在合同约定的范围内实施稳健的整体资产配置,通过对国内外宏观经济状况、证券市场走势、市场价格走势以及市场资金供求情况、信用风险情况、风险预算和有关法律法规等因素的综合分析,预测各类资产在长、中、短期内的风险收益特征,进而对固定收益类资产和权益类资产之间进行动态配置,确定资产的最优配置比例和相应的风险水平。

2.类属资产配置策略

本基金在整体资产配置策略的框架下,根据类属资产的收益率水平、风险来源、市场流动性、利息税务处理等因素,采取积极的投资策略,定期对投资组合类属资产进行优化配置,以寻求收益、风险、流动性之间的最佳平衡点。针对固定收益类资产,本基金将市场细分分为可转债(含传统可转债、分离交易可转债等)、普通债券(含国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、短期融资券等),资产支持证券三个子市场对基金资产进行动态优化配置。

(二)可转债投资策略

可转债即可以转换为公司债券,其投资者可以在约定期限内按照事先约定的价格将该债券转换为公司普通股。可转债同时具备普通股不具备的属性和普通债权不具备的属性。当标的股票下跌时,可转债价格受到债券价值的有力支撑,当标的股票上涨时,可转债内含的期权使其可以分享上涨股价上涨带来的收益。

基于行业分析、企业基本面分析和可转债估值模型分析,本基金在二级市场投资可转债,以达到控制风险,实现基金资产稳健增值的目的。

十、基金的风险收益特征

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,在债券型基金的投资目标方面具有风险相对较高的投资产品。

十一、基金的投资组合报告

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,并对其中内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金经理平安银行股份有限公司根据基金合同规定,于2016年4月复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本基金组合报告所载数据截至2015年12月31日(摘自本公司2015年年度报告)。

(一)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 | 权证投资 | 132,676,789.00 | 14.38 |
| 2 | 固定收益投资 | 132,676,789.00 | 14.38 |
| 3 | 股票 | 692,116,514.10 | 74.91 |
| 4 | 其他(债券) | - | - |
| 5 | 贵金属投资 | - | - |
| 6 | 货币市场基金 | - | - |
| 7 | 其他资产 | 12,360,761.65 | 1.34 |
| 8 | 合计 | 1,023,877,800.65 | 100.00 |

注:本基金报告期末通过沪港通交易机制投资港股。

(二)期末按行业分类的股票投资组合

1.报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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 | - | - |
| C | 制造业 | 76,816,267.35 | 10.08 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应、修理和其他服务业 | - | - |
| E | 建筑业 | 3,326.04 | - |
| F | 批发和零售业 | 5,581,000.00 | 0.78 |
| 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 | 46,171,366.08 | 6.28 |
| J | 金融业 | 1,044,266.14 | 0.16 |
| K | 房地产业 | 32,729.64 | - |
| L | 科学研究、技术服务和地质勘查业 | - | - |
| M | 水利、环境和公共设施管理业 | - | - |
| N | 广播、电视、电影和音像业 | - | - |
| O | 仪器仪表、计算机、通信和其他电子设备制造业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 2,866,687.20 | 0.03 |
| S | 综合 | - | - |
| 合计 | | 132,876,789.00 | 100.00 |

注:本项“卖出金额”均按卖出成交金额(成交单价乘以成交量)填列,不考虑其他交易费用。

3.买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位:人民币元

| 股票代码 | 股票名称 | 买入金额(元) | 卖出金额(元) |
|--------|------|----------------|---------|
| 601788 | 光大证券 | 117,091,656.61 | 117 |
| 601698 | 华夏银行 | 84,069,943.77 | 8.4 |
| 600999 | 招商银行 | 63,716,219.39 | 8.37 |
| 600099 | 浦发银行 | 76,849,782.00 | 7.69 |
| 300253 | 卫宁健康 | 68,095,236.50 | 6.8 |
| 600410 | 华胜天成 | 64,840,341.79 | 6.48 |
| 601900 | 方正证券 | 65,928,084.79 | 5.59 |
| 601655 | 东吴证券 | 51,003,972.15 | 5.1 |
| 300146 | 汤臣倍健 | 50,469,359.79 | 5.04 |
| 2407 | 多氟多 | 49,820,489.22 | 4.99 |
| 2073 | 欧普康视 | 48,068,171.46 | 4.83 |
| 300369 | 绿盟科技 | 46,12 | |