

# 长信可转债债券型证券投资基金

## 2019年第一季度报告

增长的逆周期调控政策效应显现，经济增速有望逐步企稳，预计全年增速在6.2-6.3%左右。

一季度市场的估值修复完成，二季度将逐步向基本面靠拢。继续寻找确定性高、行业景气度好、基本面能够持续超预期投资机会。转债重点关注上个季中的优良品种，把握转债条款博弈等套利机会；股票从指数行情为结构性行情，侧重自下而上挖掘行业龙头，包括消费、周期和科技等领域。

下一阶段我们将继续保持审慎的态度，密切关注经济走势和政策走向，适度调整组合的行业分布和个股集中度，加强流动性管理，严格防范信用风险，进一步优化投资组合，力争为投资者获取更好的收益。

4.5 报告期内基金的投资业绩和净值增长率  
截至本报告期末长信可转债债券型证券投资基金份额净值为1.3678元，份额累计净值为2.2276元。本报告期内长信可转债债券型证券投资基金净值增长率为16.67%，截至本报告期末长信可转债债券型C基金份额净值为1.3347元，份额累计净值为2.2417元。本报告期内长信可转债债券型C净值增长率为16.05%，同期业绩比较基准收益率为14.02%。

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	代码	名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	300064	鼎捷股份	6,038,219	60,302,190.00	2.36
2	001039	德联集团	7,000,261	16,272,046.61	2.63
3	603918	光大银行	7,500,133	30,793,548.30	2.43
4	601588	中国银河	1,000,000	20,072,000.00	1.23
5	005703	三七互娱	1,200,000	35,263,560.00	2.83
6	000887	伊府股份	620,048	18,048,200.00	0.82
7	000196	复星医药	600,000	17,888,000.00	0.82
8	601888	中国铝业	250,000	17,500,000.00	0.80
9	300112	华测检测	1,500,000	13,728,000.00	0.62
10	000333	润兴股份	280,000	13,681,232.67	1.02

5.2 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林、牧、渔业	-	-
B	制造业	106,408,100.00	7.08
C	金融业	156,104,500.00	7.68
D	房地产业	-	-
E	信息技术	-	-
F	公用事业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	批发和零售业	-	-
I	住宿和餐饮业	-	-
J	健康护理业	-	-
K	房地产业	-	-
L	综合类	-	-
M	其他	-	-
N	合计	166,512,600.00	10.00

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	代码	名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	300064	鼎捷股份	6,038,219	60,302,190.00	2.36
2	113010	中信特钢	3,200,000	327,532,300.00	14.06
3	113011	华信新材	2,530,000	288,232,900.00	13.17
4	310033	润兴股份	2,178,000	207,008,000.00	11.79
4	150009	中钢国际	2,038,000	207,672,300.00	9.49
6	190031	润兴股份	1,300,000	130,000,000.00	5.84

5.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	代码	名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	122016	19中钢国际	3,200,000	327,532,300.00	14.06
2	113011	华信新材	2,530,000	288,232,900.00	13.17
3	113013	润兴股份	2,178,000	207,008,000.00	11.79
4	150009	中钢国际	2,038,000	207,672,300.00	9.49
6	190031	润兴股份	1,300,000	130,000,000.00	5.84

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

序号	代码	名称	数量(克)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	122016	19中钢国际	3,200,000	327,532,300.00	14.06
2	113011	华信新材	2,530,000	288,232,900.00	13.17
3	113013	润兴股份	2,178,000	207,008,000.00	11.79
4	150009	中钢国际	2,038,000	207,672,300.00	9.49
6	190031	润兴股份	1,300,000	130,000,000.00	5.84

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

序号	代码	名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	122016	19中钢国际	3,200,000	327,532,300.00	14.06
2	113011	华信新材	2,530,000	288,232,900.00	13.17
3	113013	润兴股份	2,178,000	207,008,000.00	11.79
4	150009	中钢国际	2,038,000	207,672,300.00	9.49
6	190031	润兴股份	1,300,000	130,000,000.00	5.84

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货投资明细

序号	代码	名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	IF1901	沪深300股指期货	-	-	-
2	IF1902	沪深300股指期货	-	-	-
3	IF1903	沪深300股指期货	-	-	-
4	IF1904	沪深300股指期货	-	-	-
5	IF1905	沪深300股指期货	-	-	-

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名国债期货投资明细

序号	代码	名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	TF1901	国债期货	-	-	-
2	TF1902	国债期货	-	-	-
3	TF1903	国债期货	-	-	-
4	TF1904	国债期货	-	-	-
5	TF1905	国债期货	-	-	-

5.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

序号	代码	名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	010006	国开1907	1,300,000	11,001,100.00	7.66
2	113010	中信特钢	2,100,000	21,000,000.00	7.86
3	113011	华信新材	2,530,000	28,823,290.00	10.69
4	113013	润兴股份	2,178,000	20,700,800.00	7.62
5	150009	中钢国际	2,038,000	20,767,230.00	7.65

5.10 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	620,589.66
2	应收股利	900,000.00
3	应收利息	-
4	应收申购款	6,307,530.00
5	其他应收款	16,912,462.08
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	23,440,581.74

5.11 报告期末按行业分类的港股投资股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林、牧、渔业	-	-
B	制造业	66,846,116.43	69.73
C	金融业	-	-
D	房地产业	-	-
E	信息技术	-	-
F	公用事业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	批发和零售业	-	-
I	住宿和餐饮业	-	-
J	健康护理业	-	-
K	房地产业	-	-
L	综合类	-	-
M	其他	-	-
N	合计	129,832,428.37	100.00

5.12 报告期末按行业分类的港股投资股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	
1	制造业	190,000,000.00	6.64	
2	000033	德联集团	190,000,000.00	6.64
3	001018	华信新材	200,000,000.00	4.85
4	300323	润兴股份	366,500,000.00	4.85
5	002211	中国银河	110,000,000.00	3.81
6	002271	东方财富	278,000,000.00	4.00
7	300012	华测检测	600,000,000.00	4.00
8	601233	润兴股份	373,500,000.00	3.73
9	001010	广联达	180,000,000.00	3.50
10	300190	东方财富	360,300,000.00	3.70

5.13 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	代码	名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	122016	19中钢国际	3,200,000	327,532,300.00	14.06
2	000033	德联集团	190,000,000.00	9,268,700.00	6.64
3	001018	华信新材	200,000,000.00	7,014,000.00	5.06
4	300323	润兴股份	366,500,000.00	6,200,000.00	4.54
5	002211	中国银河	110,000,000.00	5,871,000.00	4.00
6	002271	东方财富	278,000,000.00	5,720,000.00	4.00
7	300012	华测检测	600,000,000.00	5,603,000.00	3.73
8	001010	广联达	180,000,000.00	5,068,000.00	3.50
9	300190	东方财富	360,300,000.00	5,319,320.00	3.70

5.14 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

序号	代码	名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	122016	19中钢国际	3,200,000	327,532,300.00	14.06
2	113010	中信特钢	2,100,000	21,000,000.00	7.66
3	113011	华信新材	2,530,000	28,823,290.00	10.69
4	113013	润兴股份	2,178,000	20,700,800.00	7.62
5	150009	中钢国际	2,038,000	20,767,230.00	7.65

5.15 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名资产支持证券投资明细

序号	代码	名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	122016	19中钢国际	3,200,000	327,532,300.00	14.06
2	113011	华信新材	2,530,000	288,232,900.00	13.17
3	113013	润兴股份	2,178,000	207,008,000.00	11.79
4	150009	中钢国际	2,038,000	207,672,300.00	9.49
6	190031	润兴股份	1,300,000	130,000,000.00	5.84

5.16 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名国债期货投资明细

序号	代码	名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	TF1901	国债期货	-	-	-
2	TF1902	国债期货	-	-	-
3	TF1903	国债期货	-	-	-
4	TF1904	国债期货	-	-	-
5	TF1905	国债期货	-	-	-

5.17 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

序号	代码	名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	010006	国开1907	1,300,000	11,001,100.00	7.66
2	113010	中信特钢	2,100,000	21,000,000.00	7.86
3	113011	华信新材	2,530,000	28,823,290.00	10.69
4	113013	润兴股份	2,178,000	20,700,800.00	7.62
5	150009	中钢国际	2,038,000	20,767,230.00	7.65

5.18 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	28,179.67
2	应收股利	402,600.00
3	应收利息	-
4	应收申购款	402,600.00
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	813,379.67

5.19 报告期末按行业分类的港股投资股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林、牧、渔业	-	-
B	制造业	406,000.00	1.32
C	金融业	-	-
D	房地产业	-	-
E	信息技术	-	-
F	公用事业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	批发和零售业	-	-
I	住宿和餐饮业	-	-
J	健康护理业	-	-
K	房地产业	-	-
L	综合类	-	-
M	其他	-	-
N	合计	406,000.00	1.32

5.20 报告期末按行业分类的港股投资股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	制造业	406,000.00	1.32
2	金融业	31,660,210.00	98.29
3	信息技术	31,660,210.00	98.29
4	房地产业	-	-
5	公用事业	-	-
6	交通运输、仓储和邮政业	-	-
7	批发和零售业	-	-
8	住宿和餐饮业	-	-
9	健康护理业	-	-
10	房地产业	-	-
11	综合类	-	-
12	其他	-	-
13	合计	96,326,420.00	100.00

5.21 报告期末按行业分类的港股投资股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林、牧、渔业	-	-
B	制造业	406,000.00	1.32
C	金融业	-	-
D	房地产业	-	-
E	信息技术	-	-
F	公用事业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	批发和零售业	-	-
I	住宿和餐饮业	-	-
J	健康护理业	-	-
K	房地产业	-	-
L	综合类	-	-
M	其他	-	-
N	合计	406,000.00	1.32

5.22 报告期末按行业分类的港股投资股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	制造业	406,000.00	1.32
2	金融业	31,660,210.00	98.29
3	信息技术	31,660,210.00	98.29
4	房地产业	-	-
5	公用事业	-	-
6	交通运输、仓储和邮政业	-	-
7	批发和零售业	-	-
8	住宿和餐饮业	-	-
9	健康护理业	-	-
10	房地产业	-	-
11	综合类	-	-
12	其他	-	-
13	合计	96,326,420.00	100.00

5.23 报告期末按行业分类的港股投资股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林、牧、渔业	-	-
B	制造业	406,000.00	1.32
C	金融业	-	-
D	房地产业	-	-
E	信息技术	-	-
F	公用事业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	批发和零售业	-	-
I	住宿和餐饮业	-	-
J	健康护理业		