

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:2013年03月26日
封基提示

1.1 基金提示
基金管理人的董事会及高级管理人员承诺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。本基金年度报告分为二部分之一，即独立董事签字报告，由董事长签发。

1.2 基金合同
长信基金管理有限公司
基金托管人:平安银行股份有限公司

报告期:2012年3月30日至2012年12月31日

1.3 基金简介

基金名称:长信可转债债券型证券投资基金

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:87,488,144.71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

下属分级基金的交易代码:519977 519976

报告期末下属分级基金的份额总额:42,590,787.84份 44,897,356.87份

2.1 基金基本情况

基金简称:长信可转债债券

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:87,488,144.71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

下属分级基金的交易代码:519977 519976

报告期末下属分级基金的份额总额:42,590,787.84份 44,897,356.87份

2.2 基金产品说明

投资目标:本基金主要投资于可转换债券(含可分离交易可转债),主要运用可转债投资策略,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健增值。

投资策略:本基金主要投资于可转债的股票特性,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,属于较低风险的债券型投资基金品种,其预期收益和预期风险均高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。本基金主要投资于可转债债券,在债券型基金中属于风险水平相对较高的投资产品。

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

信息披露义务人 周永刚 董雁

联系人电话 021-61009697 0272-2116596

电子邮箱 zhongy@efund.com.cn dongyan@sdh.com.cn

客户服务电话 4007005566 95501

传真 021-61009800 0755-82080406

2.4 信息披露方式

报告公告的网址:www.efund.com.cn

基金年度报告备置地点: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、基金净值表现及利润分配情况

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 2012年3月30日-2012年12月31日

长信可转债债券A 长信可转债债券C

本期已实现收益 1,550,837.58 2,420,402.68

本期利润 2,513,897.39 4,172,924.52

加权平均基金份额本期利润 0.0462 0.0371

本期基金份额净值增长率 5.32% 4.96%

3.1.2 期末数据和指标 2012年末

期末可供分配基金份额利润 0.0298 0.0263

期末基金份额净值 44,856,128.77 47,123,689.17

期末基金份额净值 1.0532 1.0496

注:1.本基金管理人基金合同生效日为2012年3月30日,截至本报告期末,本基金运作未满一个会计年度。

2.本期已实现收益金额为基金本期收入减去各项费用后的余额,不含货币市场基金收益扣除相关费用后的余额,本期利润为基金本期收入减去各项费用后的余额,不含货币市场基金收益扣除相关费用后的余额。

3.所列数据不包括持有人认购或申购基金时所发生的费用,例如,封闭式基金的申购费、开放式基金的申购费、赎回费、基金转换费等。

3.2 基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.1 阶段 份额净值增长 份额净值增长标准差 业绩比较基准收益率标准差 ①-③ ②-④

A 长信可转债债券A 4.52% 0.33% 4.29% 0.34% 0.23% -0.01%

过去三个月 3.23% 0.26% 1.42% 0.31% 1.81% -0.05%

自基金合同生效日起至2012年3月31日 5.32% 0.23% 3.61% 0.31% 1.71% -0.08%

3.2.2 阶段 份额净值增长 份额净值增长标准差 业绩比较基准收益率标准差 ①-③ ②-④

C 长信可转债债券C 4.40% 0.32% 4.29% 0.34% 0.11% -0.02%

过去六个月 3.00% 0.26% 1.42% 0.31% 1.58% -0.05%

自基金合同生效日起至2012年3月31日 4.96% 0.23% 3.61% 0.31% 1.35% -0.08%

注:本基金合同生效日起至2012年3月31日止,基金运作未满一个会计年度。

3.2.2 基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.2.1 长信可转债债券A自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.2.2 长信可转债债券C自基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.3.1 长信可转债债券A自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.3.2 长信可转债债券C自基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.3.3 长信可转债债券C自基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.3.4 长信可转债债券C自基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.3.5 长信可转债债券A自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.3.6 长信可转债债券C自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.3.7 长信可转债债券C自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.3.8 长信可转债债券C自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.3.9 长信可转债债券C自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.3.10 长信可转债债券C自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.3.11 长信可转债债券C自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.3.12 长信可转债债券C自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.3.13 长信可转债债券C自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.3.14 长信可转债债券C自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.3.15 长信可转债债券C自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.3.16 长信可转债债券C自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.3.17 长信可转债债券C自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.3.18 长信可转债债券C自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.3.19 长信可转债债券C自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.3.20 长信可转债债券C自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.3.21 长信可转债债券C自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.3.22 长信可转债债券C自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.3.23 长信可转债债券C自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.3.24 长信可转债债券C自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.3.25 长信可转债债券C自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.3.26 长信可转债债券C自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.3.27 长信可转债债券C自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.3.28 长信可转债债券C自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.3.29 长信可转债债券C自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.3.30 长信可转债债券C自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.3.31 长信可转债债券C自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.3.32 长信可转债债券C自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.3.33 长信可转债债券C自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.3.34 长信可转债债券C自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.3.35 长信可转债债券C自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.3.36 长信可转债债券C自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.3.37 长信可转债债券C自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.3.38 长信可转债债券C自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.3.39 长信可转债债券C自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.3.40 长信可转债债券C自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.3.41 长信可转债债券C自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.3.42 长信可转债债券C自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.3.43 长信可转债债券C自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.3.44 长信可转债债券C自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.3.45 长信可转债债券C自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.3.46 长信可转债债券C自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.3.47 长信可转债债券C自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.3.48 长信可转债债券C自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.3.49 长信可转债债券C自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.3.50 长信可转债债券C自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.3.51 长信可转债债券C自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较