

信息披露 Disclosure

长信可转换债券型证券投资基金

【2014】半年度报告摘要

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	600718	东软集团	28,074,849.26	25.48
2	600332	白云山	13,463,256.29	12.22
3	300037	新宙斯	10,221,268.17	9.29
4	600597	光明乳业	10,169,212.06	9.23
5	600600	青岛海尔	10,622,320.90	9.13
6	600540	华资实业	8,396,475.13	7.46
7	002146	盛通光电	6,449,314.29	5.85
8	600887	伊利股份	5,796,757.83	5.26
9	600109	国金证券	5,651,257.64	5.13
10	600066	宇通客车	5,459,048.68	4.95
11	601377	兴业证券	5,003,828.38	4.54
12	000573	松发股份	4,924,957.86	4.47
13	600376	普开股份	4,681,603.00	4.25
14	002594	比亚迪	4,574,930.06	4.15
15	002475	立讯精密	4,549,640.44	4.13
16	600739	辽宁成大	4,347,183.72	3.95
17	600469	福建股份	4,229,044.76	3.84
18	002368	天微电子	4,090,861.30	3.71
19	002603	以岭药业	3,918,407.26	3.56
20	600468	保利地产	3,905,128.38	3.54
21	000858	五粮液	3,893,504.66	3.53
22	600271	航天信息	3,807,749.05	3.46
23	300155	安居宝	3,610,268.60	3.28
24	600111	包钢稀土	3,591,071.00	3.26
25	600521	华海药业	3,568,742.60	3.24
26	600536	中信重工	3,396,304.85	3.08
27	001231	拓邦电子	3,292,577.20	2.98
28	002405	西陇药业	3,160,037.91	2.87
29	600073	上海梅林	2,824,005.79	2.56
30	600348	阳泉煤业	2,634,207.50	2.39
31	600809	山西汾酒	2,578,427.52	2.34
32	000402	金 鼎	2,576,711.41	2.33
33	000960	锡业股份	2,540,674.44	2.31
34	600702	冠脉股份	2,536,682.64	2.30
35	300133	华星光电	2,480,458.48	2.25
36	600496	国海证券	2,457,289.04	2.23
37	300246	宝莱特	2,420,469.51	2.20
38	600108	华鲁能源	2,395,649.32	2.17
39	002273	永晶光电	2,367,657.53	2.15
40	000029	中国宝安	2,265,131.37	2.06

序号	买入股票的成本(成交)总额	卖出股票的收入(成交)总额
1	278,172,989.28	244,506,191.48

注:本期“买入股票的成本(成交)总额”和“卖出股票的收入(成交)总额”均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑其他交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

序号	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国债逆回购	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
其中:政策性金融债	-	-	-
4	企业债券	10,004,000.00	5.81
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	188,410,990.44	109.45
8	合计	198,414,990.44	115.30

注:本基金A类基金份额不收取销售服务费,C类基金份额的销售服务费年费率为0.35%。销售服务费按照A类基金份额每日应计提的销售服务费计算,计算方法如下:H = E × 年销售服务费率 ÷ 当年天数

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	110025	民生转债	471,440	43,749,632.00	25.41
2	110001	中行转债	418,300	42,578,757.00	24.73
3	110049	中信转债	325,100	30,442,964.00	17.48
4	110020	南钢转债	258,220	24,543,179.20	14.26
5	110003	重工转债	90,000	10,220,400.00	5.94

7.7 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	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	110025	民生转债	471,440	43,749,632.00	25.41
2	110001	中行转债	418,300	42,578,757.00	24.73
3	110049	中信转债	325,100	30,442,964.00	17.48
4	110020	南钢转债	258,220	24,543,179.20	14.26
5	110003	重工转债	90,000	10,220,400.00	5.94

7.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货合约。

7.9 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

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

7.11 投资组合报告附注

7.12 投资组合报告附注

7.13 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 报告期内本基金投资的前十名股票中,不存在超出基金合同规定备选股票库的情形。

7.12.3 期末其他各项资产构成

序号	名称	金额
1	存出保证金	972,996.60
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	987,661.91
5	应收申购款	20,689.09
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,961,348.20

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	110025	民生转债	43,749,632.00	25.41
2	110001	中行转债	42,578,757.00	24.73
3	110017	中信转债	30,442,964.00	17.48
4	110020	南钢转债	24,543,179.20	14.26
5	110003	重工转债	10,220,400.00	5.94
6	110005	平安转债	7,375,921.00	4.28
7	110015	石化转债	7,307,409.60	4.24
8	110022	同仁转债	5,719,000.00	3.32
9	110011	通惠转债	3,311,070.80	1.92
10	110018	海泰转债	743,043.20	0.43
11	127001	南昌转债	647,875.00	0.38
12	127002	津滨转债	188,489.78	0.11
13	128003	晋元转债	122,023.85	0.07
14	113002	广博转债	21,080.00	0.01

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,部分之和与合计项可能存在尾差。

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	机构投资者持有份额	个人投资者持有份额
			持有份额	持有份额
			占总份额比例	占总份额比例
长信可转换债券A	880	168,206.64	122,249,983.48	25,836,976.50
长信可转换债券C	646	42,868.30	337,019.06	27,355,902.59
合计	1,526	115,189.96	122,587,002.54	53,192,879.09

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人有关从业人员持有本基金	长信可转换债券A	26,209.38	0.02%
	长信可转换债券C	66,543.27	0.03%
	合计	73,752.65	0.04%

注:上表中长信可转换债券A、长信可转换债券C占基金总份额比例以长信可转换债券A、长信可转换债券C的各自份额为分母计算得出;合计项中以基金总份额比例以长信可转换债券的总额度为分母计算得出。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金总份额区间情况

项目	份额级别	持有基金份额数量区间(万份)
基金管理公司高级管理人员及基金经理持有本基金	长信可转换债券A	0
	长信可转换债券C	0
	合计	0
基金基金经理持有本基金	长信可转换债券A	0
	长信可转换债券C	0
	合计	0

注:上表中长信可转换债券A、长信可转换债券C占基金总份额比例以长信可转换债券A、长信可转换债券C的各自份额为分母计算得出;合计项中以基金总份额比例以长信可转换债券的总额度为分母计算得出。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金总份额区间情况

项目	份额级别	持有基金份额数量区间(万份)
基金管理公司高级管理人员及基金经理持有本基金	长信可转换债券A	0
	长信可转换债券C	0
	合计	0
基金基金经理持有本基金	长信可转换债券A	0
	长信可转换债券C	0
	合计	0

注:上表中长信可转换债券A、长信可转换债券C占基金总份额比例以长信可转换债券A、长信可转换债券C的各自份额为分母计算得出;合计项中以基金总份额比例以长信可转换债券的总额度为分母计算得出。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金总份额区间情况

项目	份额级别	持有基金份额数量区间(万份)
基金管理公司高级管理人员及基金经理持有本基金	长信可转换债券A	0
	长信可转换债券C	0
	合计	0
基金基金经理持有本基金	长信可转换债券A	0
	长信可转换债券C	0
	合计	0

注:上表中长信可转换债券A、长信可转换债券C占基金总份额比例以长信可转换债券A、长信可转换债券C的各自份额为分母计算得出;合计项中以基金总份额比例以长信可转换债券的总额度为分母计算得出。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金总份额区间情况

项目	份额级别	持有基金份额数量区间(万份)
基金管理公司高级管理人员及基金经理持有本基金	长信可转换债券A	0
	长信可转换债券C	0
	合计	0
基金基金经理持有本基金	长信可转换债券A	0
	长信可转换债券C	0
	合计	0

注:上表中长信可转换债券A、长信可转换债券C占基金总份额比例以长信可转换债券A、长信可转换债券C的各自份额为分母计算得出;合计项中以基金总份额比例以长信可转换债券的总额度为分母计算得出。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金总份额区间情况

项目	份额级别	持有基金份额数量区间(万份)
基金管理公司高级管理人员及基金经理持有本基金	长信可转换债券A	0
	长信可转换债券C	0
	合计	0
基金基金经理持有本基金	长信可转换债券A	0
	长信可转换债券C	0
	合计	0

注:上表中长信可转换债券A、长信可转换债券C占基金总份额比例以长信可转换债券A、长信可转换债券C的各自份额为分母计算得出;合计项中以基金总份额比例以长信可转换债券的总额度为分母计算得出。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金总份额区间情况

项目	份额级别	持有基金份额数量区间(万份)
基金管理公司高级管理人员及基金经理持有本基金	长信可转换债券A	0
	长信可转换债券C	0
	合计	0
基金基金经理持有本基金	长信可转换债券A	0
	长信可转换债券C	0
	合计	0

注:上表中长信可转换债券A、长信可转换债券C占基金总份额比例以长信可转换债券A、长信可转换债券C的各自份额为分母计算得出;合计项中以基金总份额比例以长信可转换债券的总额度为分母计算得出。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金总份额区间情况

项目	份额级别	持有基金份额数量区间(万份)
基金管理公司高级管理人员及基金经理持有本基金	长信可转换债券A	0
	长信可转换债券C	0
	合计	0
基金基金经理持有本基金	长信可转换债券A	0
	长信可转换债券C	0
	合计	0

注:上表中长信可转换债券A、长信可转换债券C占基金总份额比例以长信可转换债券A、长信可转换债券C的各自份额为分母计算得出;合计项中以基金总份额比例以长信可转换债券的总额度为分母计算得出。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金总份额区间情况

项目	份额级别	持有基金份额数量区间(万份)
基金管理公司高级管理人员及基金经理持有本基金	长信可转换债券A	0
	长信可转换债券C	0
	合计	0
基金基金经理持有本基金	长信可转换债券A	0
	长信可转换债券C	0
	合计	0

注:上表中长信可转换债券A、长信可转换债券C占基金总份额比例以长信可转换债券A、长信可转换债券C的各自份额为分母计算得出;合计项中以基金总份额比例以长信可转换债券的总额度为分母计算得出。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金总份额区间情况

项目	份额级别	持有基金份额数量区间(万份)
基金管理公司高级管理人员及基金经理持有本基金	长信可转换债券A	0
	长信可转换债券C	0
	合计	0
基金基金经理持有本基金	长信可转换债券A	0
	长信可转换债券C	0
	合计	0

注:上表中长信可转换债券A、长信可转换债券C占基金总份额比例以长信可转换债券A、长信可转换债券C的各自份额为分母计算得出;合计项中以基金总份额比例以长信可转换债券的总额度为分母计算得出。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金总份额区间情况

项目	份额级别	持有基金份额数量区间(万份)
基金管理公司高级管理人员及基金经理持有本基金	长信可转换债券A	0
	长信可转换债券C	0
	合计	0
基金基金经理持有本基金	长信可转换债券A	0
	长信可转换债券C	0
	合计	0

注:上表中长信可转换债券A、长信可转换债券C占基金总份额比例以长信可转换债券A、长信可转换债券C的各自份额为分母计算得出;合计项中以基金总份额比例以长信可转换债券的总额度为分母计算得出。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金总份额区间情况

项目	份额级别	持有基金份额数量区间(万份)
基金管理公司高级管理人员及基金经理持有本基金	长信可转换债券A	0
	长信可转换债券C	0
	合计	0
基金基金经理持有本基金	长信可转换债券A	0
	长信可转换债券C	0
	合计	0

注:上表中长信可转换债券A、长信可转换债券C占基金总份额比例以长信可转换债券A、长信可转换债券C的各自份额为分母计算得出;合计项中以基金总份额比例以长信可转换债券的总额度为分母计算得出。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金总份额区间情况

项目	份额级别	持有基金份额数量区间(万份)
基金管理公司高级管理人员及基金经理持有本基金	长信可转换债券A	0
	长信可转换债券C	0
	合计	0
基金基金经理持有本基金	长信可转换债券A	0
	长信可转换债券C	0
	合计	0

注:上表中长信可转换债券A、长信可转换债券C占基金总份额比例以长信可转换债券A、长信可转换债券C的各自份额为分母计算得出;合计项中以基金总份额比例以长信可转换债券的总额度为分母计算得出。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金总份额区间情况

项目	份额级别	持有基金份额数量区间(万份)
基金管理公司高级管理人员及基金经理持有本基金	长信可转换债券A	0
	长信可转换债券C	0
	合计	0
基金基金经理持有本基金	长信可转换债券A	0
	长信可转换债券C	0
	合计	0

注:上表中长信可转换债券A、长信可转换债券C占基金总份额比例以长信可转换债券A、长信可转换债券C的各自份额为分母计算得出;合计项中以基金总份额比例以长信可转换债券的总额度为分母计算得出。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金总份额区间情况

项目	份额级别	持有基金份额数量区间(万份)
基金管理公司高级管理人员及基金经理持有本基金	长信可转换债券A	0
	长信可转换债券C	0
	合计	0