

长信可转债债券型证券投资基金

[2015] 第四季度报告

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

报告送出日期:2016年1月20日

报告期起至报告期末:2015年1月1日至2015年12月31日

基金合同的董事会及监事会在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责任。

基金财产由长信基金管理有限公司根据基本管理制度,于2016年1月15日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等数据,保证复核结果不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺就本报告的内容承担法律责任,勤勉尽责地履行职责,但不对本基金的招募说明书承担责任。

本基金的财务资料未经审计。

本报告期自2015年10月1日起至2015年12月31日止。

§ 1.2 基金产品概况

本基金是长信基金管理有限公司管理的可转换债券型基金(含分离交易可转换债券),主要运用可转换债券投资和股票投资两种投资品种,通过长期主动的转换投资管理,力争在锁定投资组合方面取得超越市场的收益。

本基金的主要投资于可转换债券,强调投资组合的安全性和稳定性,另一方面利用可转换的投资特性,分享股息产生的投资收益。

本基金的业绩比较基准为:中证转债指数收益率*70%+中证综合债指数收益率*30%+沪深300指数收益率*10%。

本基金的业绩评价标准:基金净值增长率,其期间收益和同期风险指数收益率和股票型基金。本基金主要投资于可转换债券,在债券基金中属于风险水平相对较高的投资产品。

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

报告送出日期:2016年1月20日

报告期起至报告期末:2015年1月1日至2015年12月31日

基金合同的董事会及监事会在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责任。

基金财产由长信基金管理有限公司根据基本管理制度,于2016年1月15日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等数据,保证复核结果不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺就本报告的内容承担法律责任,勤勉尽责地履行职责,但不对本基金的招募说明书承担责任。

本基金的财务资料未经审计。

本报告期自2015年10月1日起至2015年12月31日止。

§ 1.3 基金产品概况

本基金是长信基金管理有限公司管理的可转换债券型基金(含分离交易可转换债券),主要运用可转换债券投资和股票投资两种投资品种,通过长期主动的转换投资管理,力争在锁定投资组合方面取得超越市场的收益。

本基金的主要投资于可转换债券,强调投资组合的安全性和稳定性,另一方面利用可转换的投资特性,分享股息产生的投资收益。

本基金的业绩评价标准:基金净值增长率,其期间收益和同期风险指数收益率和股票型基金。本基金主要投资于可转换债券,在债券基金中属于风险水平相对较高的投资产品。

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

报告送出日期:2016年1月20日

报告期起至报告期末:2015年1月1日至2015年12月31日

基金合同的董事会及监事会在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责任。

基金财产由长信基金管理有限公司根据基本管理制度,于2016年1月15日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等数据,保证复核结果不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺就本报告的内容承担法律责任,勤勉尽责地履行职责,但不对本基金的招募说明书承担责任。

本基金的财务资料未经审计。

本报告期自2015年10月1日起至2015年12月31日止。

§ 1.4 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2015年10月1日-2015年12月31日)

长信可转债债券C 长信可转债债券C

1.本期已实现收益 28,131,783.51 9,342,029.26

2.本期利润 48,321,436.04 16,663,774.46

3.期末可供基金份额总额 301,599,575.67 137,866,020.90

4.期末基金资产净值 563,889,153.36 185,929,339.05

5.期末基金份额净值 1.3626 1.3407

注:1.本公司已实现收益基金当期收入,投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期利润减去本期利润的所得税影响数,并按100%的分配比例计提现金分红,其中基金的销售费用不包括持有人认购或申购基金的各项费用(例如,封闭式基金交易佣金、开放式基金的申购赎回费、基金认购费等),即持有人认购或申购基金所支付的费用不列入本期利润;2.基金的利润将全部分配给基金份额持有人。

3.2.1.1 长信可转债债券A的净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率① 净值增长率标准差② 业绩比较基准③ 业绩比较基准收益率④ 业绩基准差值⑤

过去一个月 0.21% 0.03% 6.88% 0.07% 3.33% -0.07%

3.2.1.2 长信可转债债券C的净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率① 净值增长率标准差② 业绩比较基准③ 业绩比较基准收益率④ 业绩基准差值⑤

过去一个月 0.07% 0.03% 6.88% 0.07% 3.19% -0.07%

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

3.2.2.12 长信可转债债券C的净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

阶段 净值增长率① 净值增长率标准差② 业绩比较基准③ 业绩比较基准收益率④ 业绩基准差值⑤

过去三个月 0.07% 0.03% 6.88% 0.07% 3.19% -0.07%

3.2.2.13 长信可转债债券C的净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

阶段 净值增长率① 净值增长率标准差② 业绩比较基准③ 业绩比较基准收益率④ 业绩基准差值⑤

过去三个月 0.07% 0.03% 6.88% 0.07% 3.19% -0.07%

3.2.2.14 长信可转债债券C的净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.2.15 长信可转债债券C的净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.2.16 长信可转债债券C的净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.2.17 长信可转债债券C的净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.2.18 长信可转债债券C的净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.2.19 长信可转债债券C的净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.2.20 长信可转债债券C的净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.2.21 长信可转债债券C的净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.2.22 长信可转债债券C的净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.2.23 长信可转债债券C的净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.2.24 长信可转债债券C的净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.2.25 长信可转债债券C的净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.2.26 长信可转债债券C的净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.2.27 长信可转债债券C的净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.2.28 长信可转债债券C的净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.2.29 长信可转债债券C的净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.2.30 长信可转债债券C的净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.2.31 长信可转债债券C的净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.2.32 长信可转债债券C的净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.2.33 长信可转债债券C的净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.2.34 长信可转债债券C的净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.2.35 长信可转债债券C的净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.2.36 长信可转债债券C的净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.2.37 长信可转债债券C的净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.2.38 长信可转债债券C的净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.2.39 长信可转债债券C的净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.2.40 长信可转债债券C的净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.2.41 长信可转债债券C的净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.2.42 长信可转债债券C的净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.2.43 长信可转债债券C的净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.2.44 长信可转债债券C的净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.2.45 长信可转债债券C的净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.2.46 长信可转债债券C的净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.2.47 长信可转债债券C的净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.2.48 长信可转债债券C的净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.2.49 长信可转债债券C的净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.2.50 长信可转债债券C的净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.2.51 长信可转债债券C的净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.2.52 长信可转债债券C的净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.2.53 长信可转债债券C的净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.2.54 长信可转债债券C的净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.2.55 长信可转债债券C的净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.2.56 长信可转债债券C的净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.2.57 长信可转债债券C的净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.2.58 长信可转债债券C的净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.2.59 长信可转债债券C的净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.2.60 长信可转债债券C的净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.2.61 长信可转债债券C的净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.2.62 长信可转债债券C的净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.2.63 长信可转债债券C的净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.2.64 长信可转债债券C的净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.2.65 长信可转债债券C的净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.2.66 长信可转债债券C的净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.2.67 长信可转债债券C的净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.2.68 长信可转债债券C的净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.2.69 长信可转债债券C的净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.2.70 长信可转债债券C的净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.2.71 长信可转债债券C的净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.2.2.72 长信可转债债券C的净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较