

长信可转债债券型证券投资基金

[2016] 第一季度报告

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4月22日

重要提示

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，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同的规定，于2016年4月20日复核了报告中财务指标、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。

基金经理承诺以诚信守信、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书、基金合同及基金产品概要。

本报告书中的财务资料未经审计。

本报告期自2016年1月1日起至2016年3月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	长信可转债债券
基金主代码	320008
基金托管人	平安银行股份有限公司
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年12月31日
报告期末基金份额总额	126,409,106.06份
报告期末基金资产净值	人民币126,409,106.06元
报告期末基金份额净值	人民币1.000元
报告期损益	-0.0001元
报告期利息收入	1,000,000.00元
报告期投资收益	60,000,156.00元
报告期公允价值变动损益	-116,000.00元
报告期净利得/损失	74,143,299.00元
报告期其他收入	73,263,006.19元
报告期合计	1,066,200,252.07元
报告期末基金资产净值	100.00元

§ 3 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2016年1月1日-2016年3月31日)

1.本期已实现收益 -22,320,317.63

-8,476,693.28

2.本期利润 -42,774,070.12

-10,000,000.00

3.加权平均基金份额利润率 -0.1248%

-0.1119%

4.期末基金资产净值 400,788,847.09

142,000,346.00

5.期末基金份额净值 1.000

1.000

注:1.本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益;扣除相关费用后的申购赎回费、红利再投及转换费用等,计算方法同上。2.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金所产生的费用(例如,封闭式基金交易佣金、开放式基金的申购赎回费、红利再投费、基金转换费等),计算方法同上。3.报告期后实际收益以年度报告为准。

4.本期每十份可供分配利润 0.0000元

0.0000

5.2.1 报告期未按行业分类的境内股票投资组合

5.2.2 报告期未按行业分类的港股通投资股票投资组合

5.2.3 报告期未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

5.3 报告期未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组合

5.4 报告期未按债券品种分类的债券投资组合

5.5 报告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

5.6 报告期未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

5.7 报告期未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

5.8 报告期未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

5.9 报告期未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

5.10 报告期未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

5.11 投资组合报告期内的前十名普通股的可转换债券明细

5.12 投资组合报告期内的前十名权证投资明细

5.13 投资组合报告期内的前十名股指期货投资明细

5.14 投资组合报告期内的前十名国债期货投资明细

5.15 投资组合报告期内的前十名股票投资情况说明

5.16 投资组合报告期内的前十名债券投资情况说明

5.17 投资组合报告期内的前十名权证投资情况说明

5.18 投资组合报告期内的前十名股指期货投资情况说明

5.19 投资组合报告期内的前十名国债期货投资情况说明

5.20 投资组合报告期内的前十名股票投资情况说明

5.21 投资组合报告期内的前十名债券投资情况说明

5.22 投资组合报告期内的前十名权证投资情况说明

5.23 投资组合报告期内的前十名股指期货投资情况说明

5.24 投资组合报告期内的前十名国债期货投资情况说明

5.25 投资组合报告期内的前十名股票投资情况说明

5.26 投资组合报告期内的前十名债券投资情况说明

5.27 投资组合报告期内的前十名权证投资情况说明

5.28 投资组合报告期内的前十名股指期货投资情况说明

5.29 投资组合报告期内的前十名国债期货投资情况说明

5.30 投资组合报告期内的前十名股票投资情况说明

5.31 投资组合报告期内的前十名债券投资情况说明

5.32 投资组合报告期内的前十名权证投资情况说明

5.33 投资组合报告期内的前十名股指期货投资情况说明

5.34 投资组合报告期内的前十名国债期货投资情况说明

5.35 投资组合报告期内的前十名股票投资情况说明

5.36 投资组合报告期内的前十名债券投资情况说明

5.37 投资组合报告期内的前十名权证投资情况说明

5.38 投资组合报告期内的前十名股指期货投资情况说明

5.39 投资组合报告期内的前十名国债期货投资情况说明

5.40 投资组合报告期内的前十名股票投资情况说明

5.41 投资组合报告期内的前十名债券投资情况说明

5.42 投资组合报告期内的前十名权证投资情况说明

5.43 投资组合报告期内的前十名股指期货投资情况说明

5.44 投资组合报告期内的前十名国债期货投资情况说明

5.45 投资组合报告期内的前十名股票投资情况说明

5.46 投资组合报告期内的前十名债券投资情况说明

5.47 投资组合报告期内的前十名权证投资情况说明

5.48 投资组合报告期内的前十名股指期货投资情况说明

5.49 投资组合报告期内的前十名国债期货投资情况说明

5.50 投资组合报告期内的前十名股票投资情况说明

5.51 投资组合报告期内的前十名债券投资情况说明

5.52 投资组合报告期内的前十名权证投资情况说明

5.53 投资组合报告期内的前十名股指期货投资情况说明

5.54 投资组合报告期内的前十名国债期货投资情况说明

5.55 投资组合报告期内的前十名股票投资情况说明

5.56 投资组合报告期内的前十名债券投资情况说明

5.57 投资组合报告期内的前十名权证投资情况说明

5.58 投资组合报告期内的前十名股指期货投资情况说明

5.59 投资组合报告期内的前十名国债期货投资情况说明

5.60 投资组合报告期内的前十名股票投资情况说明

5.61 投资组合报告期内的前十名债券投资情况说明

5.62 投资组合报告期内的前十名权证投资情况说明

5.63 投资组合报告期内的前十名股指期货投资情况说明

5.64 投资组合报告期内的前十名国债期货投资情况说明

5.65 投资组合报告期内的前十名股票投资情况说明

5.66 投资组合报告期内的前十名债券投资情况说明

5.67 投资组合报告期内的前十名权证投资情况说明

5.68 投资组合报告期内的前十名股指期货投资情况说明

5.69 投资组合报告期内的前十名国债期货投资情况说明

5.70 投资组合报告期内的前十名股票投资情况说明

5.71 投资组合报告期内的前十名债券投资情况说明

5.72 投资组合报告期内的前十名权证投资情况说明

5.73 投资组合报告期内的前十名股指期货投资情况说明

5.74 投资组合报告期内的前十名国债期货投资情况说明

5.75 投资组合报告期内的前十名股票投资情况说明

5.76 投资组合报告期内的前十名债券投资情况说明

5.77 投资组合报告期内的前十名权证投资情况说明

5.78 投资组合报告期内的前十名股指期货投资情况说明

5.79 投资组合报告期内的前十名国债期货投资情况说明

5.80 投资组合报告期内的前十名股票投资情况说明

5.81 投资组合报告期内的前十名债券投资情况说明

5.82 投资组合报告期内的前十名权证投资情况说明

5.83 投资组合报告期内的前十名股指期货投资情况说明

5.84 投资组合报告期内的前十名国债期货投资情况说明

5.85 投资组合报告期内的前十名股票投资情况说明

5.86 投资组合报告期内的前十名债券投资情况说明

5.87 投资组合报告期内的前十名权证投资情况说明

5.88 投资组合报告期内的前十名股指期货投资情况说明

5.89 投资组合报告期内的前十名国债期货投资情况说明

5.90 投资组合报告期内的前十名股票投资情况说明

5.91 投资组合报告期内的前十名债券投资情况说明

5.92 投资组合报告期内的前十名权证投资情况说明

5.93 投资组合报告期内的前十名股指期货投资情况说明

5.94 投资组合报告期内的前十名国债期货投资情况说明

5.95 投资组合报告期内的前十名股票投资情况说明

5.96 投资组合报告期内的前十名债券投资情况说明

5.97 投资组合报告期内的前十名权证投资情况说明

5.98 投资组合报告期内的前十名股指期货投资情况说明

5.99 投资组合报告期内的前十名国债期货投资情况说明

5.100 投资组合报告期内的前十名股票投资情况说明

5.101 投资组合报告期内的前十名债券投资情况说明

5.102 投资组合报告期内的前十名权证投资情况说明

5.103 投资组合报告期内的前十名股指期货投资情况说明

5.104 投资组合报告期内的前十名国债期货投资情况说明

5.105 投资组合报告期内的前十名股票投资情况说明

5.106 投资组合报告期内的前十名债券投资情况说明

5.107 投资组合报告期内的前十名权证投资情况说明

5.108 投资组合报告期内的前十名股指期货投资情况说明

5.109 投资组合报告期内的前十名国债期货投资情况说明

5.110 投资组合报告期内的前十名股票投资情况说明

5.111 投资组合报告期内的前十名债券投资情况说明

5.112 投资组合报告期内的前十名权证投资情况说明

5.113 投资组合报告期内的前十名股指期货投资情况说明

5.114 投资组合报告期内的前十名国债期货投资情况说明

5.115 投资组合报告期内的前十名股票投资情况说明

5.116 投资组合报告期内的前十名债券投资情况说明

5.117 投资组合报告期内的前十名权证投资情况说明

5.118 投资组合报告期内的前十名股指期货投资情况说明

5.119 投资组合报告期内的前十名国债期货投资情况说明

5.120 投资组合报告期内的前十名股票投资情况说明

5.121 投资组合报告期内的前十名债券投资情况说明

5.122 投资组合报告期内的前十名权证投资情况说明