长信可转债债券型证券投资基金 2018年半年度报告摘要

2018年6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

送出日期：2018年8月29日

§1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人平安银行股份有限公司，根据本基金合同规定，于2018年8月27日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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。

基金管理人承诺以诚实信用、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。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年1月1日起至2018年6月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	长信可转债债券	
场内简称	CX转债	
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	862,931,189.80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
下属分级基金的场内简称：	CX转债 A	CX转债 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	214,970,818.64份	647,960,371.16份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在投资于可转债债券（含可分离交易可转债），主要运用可转债品种兼具债券和股票的特性，通过积极主动的可转债投资管理，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定增值。
投资策略	本基金主要投资于可转债品种，一方面利用可转债的债券特性，强调投资组合的安全性和稳定性，另一方面利用可转债的股票特性，分享股市上涨产生的股东权益。
业绩比较基准	中信标普可转债指数收益率×70%+中证综合债指数收益率×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，属于较低风险的证券投资基金品种，其预期收益和预期风险高于货币市场基金，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
信息披露负责人	姓名	周永刚	方晓
	联系电话	021-61009999	0755-22160168
	电子邮箱	zhouyg@cxfund.com.cn	FANGQI275@ringan.com.cn
客户服务电话		4007005566	95511-3
传真		021-61009800	0755-82080387

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.cxfund.com.cn
基金半年度报告备置地点	上海市浦东新区银城中路68号9楼、广东省深圳市罗湖区深南东路5047号

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

基金报别	长信可转债债券A	长信可转债债券C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2018年1月1日 - 2018年6月30日)	报告期(2018年1月1日 - 2018年6月30日)
本期已实现收益	3,964,372.89	3,262,643.19
本期利润	-1,144,786.42	-38,314,323.69
加权平均基金份额本期利润	-0.0053	-0.0969
本期基金份额净值增长率	-0.72%	-0.94%
3.1.2 期末数据和指标	报告期(2018年6月30日)	
期末可供分配基金份额利润	-0.1646	-0.1850
期末基金资产净值	259,248,211.44	765,227,133.24
期末基金份额净值	1.2060	1.1810

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、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公允价值变动收益。

2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，封闭式基金交易佣金、开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

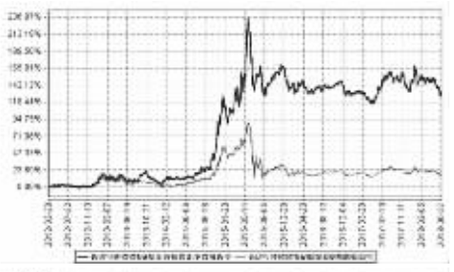
长信可转债债券A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-2.54%	0.94%	-2.85%	0.66%	0.31%	0.28%
过去三个月	-5.99%	0.83%	-4.76%	0.55%	-1.23%	0.28%
过去六个月	-0.72%	1.04%	-2.18%	0.62%	1.46%	0.42%
过去一年	-1.45%	0.91%	-3.34%	0.53%	1.89%	0.38%
过去三年	-8.14%	0.89%	-19.18%	1.12%	11.04%	-0.23%
自基金合同生效起至今	133.39%	1.29%	16.18%	1.10%	117.21%	0.19%

长信可转债债券C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-2.57%	0.94%	-2.85%	0.66%	0.28%	0.28%
过去三个月	-6.08%	0.83%	-4.76%	0.55%	-1.32%	0.28%
过去六个月	-0.94%	1.04%	-2.18%	0.62%	1.24%	0.42%
过去一年	-1.89%	0.91%	-3.34%	0.53%	1.45%	0.38%
过去三年	-9.85%	0.89%	-19.18%	1.12%	9.33%	-0.23%
自基金合同生效起至今	121.46%	1.29%	16.18%	1.10%	105.28%	0.19%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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



注：1、图示日期为2012-03-30至2018-06-30。

2、按基金合同规定，本基金管理人自基金合同生效之日起6个月内为建仓期。建仓期结束时，本基金的各项投资比例已符合基金合同约定。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

长信基金管理有限责任公司是经中国证监会证监基金字【2003】63号文批准，由长江证券股份有限公司、上海海欣集团股份有限公司、武汉钢铁股份有限公司共同发起设立。注册资本1.65亿元人民币。目前股权结构为：长江证券股份有限公司占44.55%、上海海欣集团股份有限公司占31.21%、武汉钢铁股份有限公司占15.15%、上海彤胜投资管理中心（有限合伙）占4.55%、上海彤骏投资管理中心（有限合伙）占4.54%。

截至2018年6月30日，本基金管理人共管理61只开放式基金，即长信利息收益开放式证券投资基金、长信银利精选混合型证券投资基金、长信金利趋势混合型证券投资基金、长信增利动态策略混合型证券投资基金、长信双利优选灵活配置混合型证券投资基金、长信利丰债券型证券投资基金、长信利利优势混合型证券投资基金、长信量化先锋混合型证券投资基金、长信美国标准普尔100等权重指数增强型证券投资基金、长信利鑫债券型证券投资基金(LOF)、长信内需成长混合型证券投资基金、长信可转债债券型证券投资基金、长信利众债券型证券投资基金(LOF)、长信纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信纯债壹号债券型证券投资基金、长信改革红利灵活配置混合型证券投资基金、长信量化中小盘股票型证券投资基金、长信新利灵活配置混合型证券投资基金、长信利富债券型证券投资基金、长信利盈灵活配置混合型证券投资基金、长信利广灵活配置混合型证券投资基金、长信多利灵活配置混合型证券投资基金、长信睿进灵活配置混合型证券投资基金、长信量化多策略股票型证券投资基金、长信医疗保健行业灵活配置混合型证券投资基金(LOF)、长信富民纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信富海纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信利保债券型证券投资基金、长信富安纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信中证能源互联网主题指数型证券投资基金(LOF)、长信金葵纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信富全纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信利泰灵活配置混合型证券投资基金、长信海外收益一年定期开放债券型证券投资基金、长信先锐债券型证券投资基金、长信利发债券型证券投资基金、长信富泰纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信电子信息行业量化灵活配置混合型证券投资基金、长信富平纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信先利半年定期开放混合型证券投资基金、长信创新驱动股票型证券投资基金、长信稳益纯债债券型证券投资基金、长信利信灵活配置混合型证券投资基金、长信稳健纯债债券型证券投资基金、长信上证港股通指数型发起式证券投资基金、长信纯债半年债券型证券投资基金、长信国防军工量化灵活配置混合型证券投资基金、长信先优债券型证券投资基金、长信稳势纯债债券型证券投资基金、长信中证500指数增强型证券投资基金、长信长金通货币市场基金、长信量化优选混合型证券投资基金(LOF)、长信稳通三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长信低碳环保行业量化股票型证券投资基金、长信利尚一年定期开放混合型证券投资基金、长信乐信灵活配置混合型证券投资基金、长信全球债券证券投资基金、长信稳鑫三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长信先机两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、长信消费精选行业量化股票型证券投资基金、长信量化价值精选混合型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李小羽	长信利丰债券型证券投资基金、长信利鑫债券型证券投资基金、长信可转债债券型证券投资基金、长信利广灵活配置混合型证券投资基金、长信利保债券型证券投资基金、长信金葵纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信利盈灵活配置混合型证券投资基金、长信利丰债券型证券投资基金、长信利利优势混合型证券投资基金、长信量化先锋混合型证券投资基金、长信美国标准普尔100等权重指数增强型证券投资基金、长信利众债券型证券投资基金、长信利泰灵活配置混合型证券投资基金、长信富全纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信富泰纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信富平纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信富安纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信富海纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信富民纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信利信灵活配置混合型证券投资基金、长信利尚一年定期开放混合型证券投资基金、长信乐信灵活配置混合型证券投资基金、长信稳鑫三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、长信先机两年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、长信消费精选行业量化股票型证券投资基金、长信量化价值精选混合型证券投资基金。	2012年3月30日	-	20年	上海交通大学工学学士，华南理工大学工学硕士，具有基金从业资格，加拿大特许投资经理资格（CIM），曾任职长城证券公司、加拿大Investors Group Financial Services Co., Ltd.、2002年加入本公司，筹备期，先后任基金经理助理、交易管理部总监、固定收益部总监、长信中短债证券投资基金、长信纯债一年定期开放债券型证券投资基金和长信利安债券型证券投资基金的基金经理，现任长信基金管理有限责任公司副总经理，投资决策委员会执行委员，长信利丰债券型证券投资基金、长信利鑫债券型证券投资基金、长信可转债债券型证券投资基金、长信利广灵活配置混合型证券投资基金、长信利保债券型证券投资基金、长信金葵纯债一年定期开放债券型证券投资基金和长信利尚一年定期开放混合型证券投资基金的基金经理，公司副总经理，投资决策委员会执行委员。
胡早子	曾任本基金的基金经理助理	2016年12月12日	2018年5月22日	6年	曾任本基金的基金经理助理
吴晖	长信利广灵活配置混合型证券投资基金、长信利盈灵活配置混合型证券投资基金、长信利丰债券型证券投资基金、长信利利优势混合型证券投资基金、长信可转债债券型证券投资基金、长信金葵纯债一年定期开放债券型证券投资基金和长信利尚一年定期开放混合型证券投资基金的基金经理，公司副总经理，投资决策委员会执行委员。	2017年7月28日	-	3年	清华大学工程学硕士毕业，具有基金从业资格，曾任职于上海通东发黄银行、东方证券股份有限公司，2017年5月加入长信基金管理有限责任公司，现任职于固定收益部，担任长信利广灵活配置混合型证券投资基金、长信利盈灵活配置混合型证券投资基金、长信利丰债券型证券投资基金、长信利利优势混合型证券投资基金、长信可转债债券型证券投资基金、长信金葵纯债一年定期开放债券型证券投资基金、长信利尚一年定期开放混合型证券投资基金的基金经理助理。

注：1、首任基金经理任职日期以本基金成立之日为准；新增或变更以刊登新增/变更基金经理的公告披露日为准；

2、本基金基金经理的证券从业年限以基金经理进入证券业务相关机构的工作经历为时间计算标准。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本基金管理人在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同的规定，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

本基金将继续以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，在规范基金运作和严格控制投资风险的前提下，努力为基金份额持有人谋求最大利益。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，公司已实行公平交易制度，并建立公平交易制度体系，已建立投资决策体系，加强交易执行环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时，公司已通过对投资交易行为的监控、分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，除完全按照有关指数的构成比例进行投资的组合外，其余各投资组合未发生参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情形，未发现异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2018年以来，国内外的宏观环境不确定性加剧，无论是权益还是固定收益市场，走势均呈现震荡分化。权益市场经历了年初的大幅波动后，先后出现了创业板、消费、医药和石化等板块的轮动上涨，各行业优质个股获得超额收益。债券市场，在流动性和货币逐步宽松的推动下，以利率债为代表的无风险收益大幅下行，并逐步扩散至部分高等级信用品种。

上半年以科技创新为代表的成长板块，在一系列政策利好催化下，连续快速上涨，我们踏准了上涨节奏，深入研究个股，选取细分行业龙头，通过价差交易，获得超额收益。随后，在判断整体震荡行情的前提下，对收益及时兑现，并且在避险板块进行等待。债券类资产，在国债利率出现见顶迹象之后，迅速介入利率债的交易行情，获得波段操作收益。并且判断趋势确立后，适当拉长久期和配置仓位。信用债方面，继续控制信用风险，优选高等级流动性好的品种，保证组合的稳健盈利。此外，本基金适当配置了部分低估值转债品种，以期在正股上涨和流动性拐点到来时，获得业绩和估值提升的双重收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，长信可转债债券A份额净值为1.2060元，份额累计净值为2.1660元，本报告期内长信可转债债券A净值增长率为-0.72%；长信可转债债券C份额净值为1.1810元，份额累计净值为2.0880元，本报告期内长信可转债债券C净值增长率为-0.94%。同期业绩比较基准收益率为-2.18%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

虽然今年宏观环境较为复杂，但是我们仍然看到国内经济的韧性和潜力。在近期一系列政策发布的信号作用下，表明对整体经济走势做好了提前的应对，无论是传统基建还是新兴的科技领域，都会继续拉动经济的平稳向好发展。目前，市场估值已经接近历史底部，监管政策也较此前有所缓和，市场有望企稳回升。经过上半年市场的震荡整理，前期一些高估值的个股已经回到合理估值，今年将获取真正业绩所带来的价值回报。关注半年报发布窗口，挖掘业绩超预期，在下跌中被错杀的品种，继续看好科技、医药、金融等板块的中长期机会。

在市场趋势弱化，波动加大情况下，需要我们加强研判，甄别个股，加强做好仓位和回撤控制。我们将继续秉承谨慎原则，加强组合的流动性管理，在做好风险控制的同时，增加对新经济环境下信用风险的审慎判断，积极寻找权益资产的增强机会。密切关注经济走势和政策动向，紧跟组合规模变动进行资产配置，争取在流动安全的前提下，为投资者获取更好的收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据相关法律法规，长信基金管理有限责任公司（以下简称“公司”）制订了健全、有效的估值政策和估值程序，成立了估值委员会，估值委员会是公司基金估值的主要决策机构，负责拟定公司的估值政策、估值方法及采用的估值程序和技术，健全公司估值决策体系，对公司现有程序和技术进行复核和审阅，当发生了影响估值程序和技术的有效性及适用性的情况及时修订估值程序；估值委员会成员相关参与人员都具有丰富的证券行业工作经验，熟悉相关法规和估值方法，均具备估值业务所需的专业胜任能力，基金经理不直接参与估值决策。对于估值政策和估值原则，公司与基金托管人充分沟通，达成一致意见。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。审计本基金的会计师事务所认可公司基金估值政策和程序的适当性。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定分别提供银行间同业市场及交易所交易的债券品种的估值数据以及流通受限股票的折扣率。参与估值流程各方不存在任何重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规和本基金基金合同规定的基金收益分配原则以及基金实际运作情况，本基金本报告期没有进行利润分配。

本基金收益分配原则如下：

1、由于本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金金额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可分配收益将有所不同，本基金同一基金份额类别内每一基金份额享有同等分配权；

2、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为6次，每份基金份额每次分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的20%；若基金合同生效不满3个月，可不进行收益分配；

3、基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4、分红权益登记日申请申购的基金份额不享受当次分红，分红权益登记日申请赎回的基金份额享受当次分红；

5、本基金收益分配方式分为两种：现金分红与红利再投资，基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若基金份额持有人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金份额持有人可对A类和C类基金份额分别选择不同的分红方式。选择采取红利再投资形式的，同一类别基金份额的现金红利将按除息日除权后的基金份额净值为计算基准自动转为相应的同一类别的基金份额，红利再投资的份额免收再投资的费用。

6、法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，平安银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在长信可转债债券型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支以及利润分配情况等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金本报告期内未进行利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由长信基金管理有限责任公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：长信可转债债券型证券投资基金

报告截止日：2018年6月30日

单位：人民币元

资产	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
资产：		
银行存款	33,820,057.02	13,776,634.20
结算备付金	18,697,047.93	5,914,050.08
存出保证金	510,253.22	410,141.09
交易性金融资产	1,144,877,429.77	580,242,534.06
其中：股票投资	205,391,862.69	64,400,106.16
基金投资	-	-
债券投资	939,485,567.08	515,842,427.90
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	11,889,429.11	-
应收利息	3,520,985.10	1,838,013.59
应收股利	-	-
应收申购款	791,737.51	490,903.91
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,214,106,939.66	602,672,276.94
负债和所有者权益	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
负债：		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	152,000,000.00	155,000,000.00
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	35,432,163.75	1,170,766.05
应付管理人报酬	597,956.38	286,793.48
应付托管费	170,844.68	81,940.99
应付销售服务费	220,001.27	65,138.25
应付交易费用	871,959.10	423,875.32
应交税费	20,054.84	13,390.14
应付利息	- 37,307.82	225,274.35
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	355,922.78	492,001.47
负债合计	189,631,594.98	157,759,180.05
所有者权益：		
实收基金	862,931,189.80	369,143,799.80
未分配利润	161,544,154.88	75,769,297.09
所有者权益合计	1,024,475,344.68	444,913,096.89
负债和所有者权益总计	1,214,106,939.66	602,672,276.94

注：报告截止日2018年6月30日，长信可转债债券A基金份额净值1.2060元，长信可转债债券C基金份额净值1.1810元。基金份额总额862,931,189.80份，其中长信可转债债券A份额214,970,818.64份，长信可转债债券C份额647,960,371.16份。

6.2 利润表

会计主体：长信可转债债券型证券投资基金

本报告期：2018年1月1日至2018年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
一、收入	- 30,408,529.46	11,368,171.17
1.利息收入	3,403,788.13	1,512,645.33
其中：存款利息收入	449,195.13	213,391.34
债券利息收入	2,954,593.00	1,299,253.99
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	12,711,423.81	- 31,278,303.91
其中：股票投资收益	2,968,033.38	- 20,451,096.40
基金投资收益	-	-
债券投资收益	9,128,934.72	- 11,160,905.82
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	614,455.71	333,698.31
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	- 46,686,126.19	41,035,249.17
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	162,384.79	98,580.58
减：二、费用	9,050,580.65	4,237,977.99
1、管理人报酬	2,638,161.30	1,516,888.84
2、托管费	753,760.35	433,396.80
3、销售服务费	838,752.75	252,664.28
4、交易费用	1,394,082.81	744,909.88
5、利息支出	3,289,070.35	1,117,151.27
其中：卖出回购金融资产支出	3,289,070.35	1,117,151.27
6、税金及附加	4,097.75	-
7、其他费用	132,655.34	172,966.92
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	- 39,459,110.11	7,130,193.18
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	- 39,459,110.11	7,130,193.18

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：长信可转债债券型证券投资基金

本报告期：2018年1月1日至2018年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	369,143,799.80	75,769,297.09	444,913,096.89
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	- 39,459,110.11	- 39,459,110.11
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	493,787,390.00	125,233,967.90	619,021,357.90
其中：1.基金申购款	1,136,598,828.11	294,764,542.51	1,431,363,370.62
2.基金赎回款	- 642,811,438.11	- 169,530,574.61	- 812,342,012.72
四、本期向投资者分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	862,931,189.80	161,544,154.88	1,024,475,344.68
项目	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	406,324,150.10	78,911,668.56	485,235,818.66
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	7,130,193.18	7,130,193.18
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	- 69,910,178.64	- 13,187,725.29	- 83,097,903.93
其中：1.基金申购款	92,404,952.66	14,939,656.11	107,344,608.77
2.基金赎回款	- 162,315,131.30	- 28,127,381.40	- 190,442,512.70
四、本期向投资者分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	336,413,971.46	72,854,136.45	409,268,107.91

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署：

_____成善栋_____ _____覃波_____ _____孙红辉_____

基金管理人负责人　　主管会计工作负责人　　会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

长信可转债债券型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2012]6号文《关于核准长信可转债债券型证券投资基金募集的批复》的核准，由基金管理人长信基金管理有限公司向社会公开发行募集，基金合同于2012年3月30日正式生效，首次设立募集规模为373,884,064.36份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为长信基金管理有限责任公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为平安银行股份有限公司。

本基金将基金份额分为A类基金份额和C类基金份额。本基金的A类基金份额在申购时收取申购费，赎回时根据持有期限收取赎回费；C类基金份额不收取申购费，赎回时根据持有期限收取赎回费，但从该类别基金资产中计提销售服务费。

本基金的投资范围为：具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金主要投资于固定收益类金融工具，包括国内依法发行上市的国债、央行票据、金融债、公司债、企业债、可转换债券（含可分离交易可转债）、债券回购、次级债、短期融资券、资产支持证券、中期票据、银行存款等固定收益类金融工具。本基金可参与一级市场新股申购或增发新股也可在二级市场上投资股票、权证等权益类证券，并可持有由可转债转股获得的股票、因所持股票派发以及因投资可分离债券而产生的权证。如出现法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金投资组合的比例范围为：投资于固定收益类资产的比例不低于基金资产的80%，其中对转债（含可分离交易可转债）的投资比例不低于基金固定收益类资产的80%；对权益类资产的投资比例不高于基金资产的20%，现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

本基金业绩比较基准为：中信标普可转债指数收益率×70%+中证综合债指数收益率×20%+沪深300指数收益率*10%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号〈年度报告和半年度报告〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金2018年6月30日的财务状况以及2018年1月1日至2018年6月30日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.4.2 差错更正的说明

本基金本报告期内无需说明的重大会计差错更正。

6.4.5 税项

6.4.5.1 印花税

经国务院批准、财政部、国家税务总局研究决定，自2008年4月24日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的3‰调整为1‰；

经国务院批准、财政部、国家税务总局研究决定，自2008年9月19日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

6.4.5.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自2016年5月1日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自2018年1月1日起，本基金的基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对本基金在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从本基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

6.4.5.3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。本基金的具体缴纳标准如下：

城市维护建设税 － 按实际缴纳的流转税的7%计缴。

教育费附加 － 按实际缴纳的流转税的3%计缴。

地方教育附加 － 按实际缴纳的流转税的2%计缴

6.4.5.4 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自2004年1月1日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

6.4.5.5 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税