

大成可转债增强债券型证券投资基金 更新招募说明书摘要 (2014年第2期)

基金管理人：大成基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

二〇一五年一月

重要提示

大成可转债增强债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证监会 2011 年 9 月 15 日证监许可（2011）1473 号文核准募集，基金合同于 2011 年 11 月 30 日正式生效。

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明中国证监会对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

本基金为债券型基金产品，以固定收益类资产投资为主，属证券投资基金中的低风险收益品种，其预期风险与预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

基金管理人承诺依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金资产，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现，基金管理人管理的其他基金的业绩也不构成对本基金业绩表现的保证。

投资有风险，投资人申购本基金时，请仔细阅读本基金的招募说明书及基金合同。

本更新的招募说明书所载内容截止日为 2014 年 11 月 30 日，有关财务数据和基金净值表现截止日为 2014 年 9 月 30 日，本报告中所列财务数据未经审计。

一、基金管理人

（一）基金管理人概况

名称：大成基金管理有限公司

住所：深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层

办公地址：深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层

成立日期：1999 年 4 月 12 日

注册资本：贰亿元人民币

股权结构：公司股东为中泰信托有限责任公司（持股比例 48%）、中国银河投资管理有限公司（持股比例 25%）、光大证券股份有限公司（持股比例 25%）、广东证券股份有限公司（持股比例 2%）四家公司。

法定代表人：刘卓

电话：0755-83183388

传真：0755-83199588

联系人：肖冰

大成基金管理有限公司设有股东会、董事会、监事会，下设二十个部门，分别是股票投资部、数量投资部、社保基金及机构投资部、固定收益部、委托投资部、研究部、交易管理部、营销策划及产品开发部、信息技术部、客户服务部、市场部、总经理办公室、董事会办公室、人力资源部、计划财务部、行政部、基金运营部、监察稽核部、风险管理部和国际业务部。公司在北京、上海、西安、成都、武汉、福州、沈阳、广州和南京等地设立了九家分公司，拥有两家子公司，分别为大成国际资产管理有限公司及大成创新资本管理有限公司。此外，公司还设立了投资决策委员会、投资风险控制委员会和战略规划委员会等专业委员会。

公司以“责任、回报、专业、进取”为经营理念，坚持“诚实信用、勤勉尽责”的企业精神，致力于开拓基金及证券市场业务，以稳健灵活的投资策略和注重绩优、高成长的投资组合，力求为投资者获得更大投资回报。

二、证券投资基金管理情况

截至 2014 年 11 月 30 日，本基金管理人共管理 1 只封闭式证券投资基金：景福证券投资基金（2014 年 12 月 26 日已转型为大成产业升级股票型证券投资基金（LOF）），4 只 ETF 及 1 只 ETF 联接基金：大成中证 100 交易型开放式指数证券投资基金、深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金及大成深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、中证 500 深市交易型开放式指数证券投资基金、中证 500 沪市交易型开放式指数证券投资基金，2 只 QDII 基金：大成标普 500 等权重指数证券投资基金、大成纳斯达克 100 指数证券投资基金及 39 只开放式证券投资基金（2014 年 12 月 9 日大成景利混合型证券投资基金成立）：大成景丰债券型证券投资基金（LOF）、大成价值增长证券投资基金、大成债券投资基金、大成蓝筹稳健证券投资基金、大成精选增值混合型证券投资基金、大成货币市场证券投资基金、大成沪深 300 指数证券投资基金、大成财富管理 2020 生命周期证券投资基金、大成积极成长股票型证券投资基金、大成创新成长混合型证券投资基金(LOF)、大成景阳领先股票型证券投资基金、大成强化收益债券型证券投资基金、大成策略回报股票型证券投资基金、大成行业轮动股票型证券投资基金、大成中证红利指数证券投资基金、大成核心双动力股票型证券投资基金、大成竞争优势股票型证券投资基金、大成景恒保本混合型证券投资基金、大成内需增长股票型证券投资基金、大成可转债增强债券型证券投资基金、大成消费主题股票型证券投资基金、大成新锐产业股票型证券投资基金、大成优选股票型证券投资基金（LOF）、大成月添利理财债券型证券投资基金、大成现金增利货币市场证券投资基金、大

成月月盈短期理财债券型证券投资基金、大成现金宝场内实时申赎货币市场基金、大成景安短融债券型证券投资基金、大成景兴信用债债券型证券投资基金、大成景旭纯债债券型证券投资基金、大成景祥分级债券型证券投资基金、大成信用增利一年定期开放债券型证券投资基金、大成健康产业股票型证券投资基金、大成中小盘股票型证券投资基金（LOF）、大成灵活配置混合型证券投资基金、大成丰财宝货币市场基金、大成景益平稳收益混合型证券投资基金和大成添利宝货币市场基金。

（三）主要人员情况

1. 公司高级管理人员

董事会：

刘卓先生，董事，工学学士。曾任职于共青团哈尔滨市委、哈尔滨银行股份有限公司、中泰信托有限责任公司；2007年6月，任哈尔滨银行股份有限公司执行董事；2008年8月，任哈尔滨银行股份有限公司董事会秘书；2012年4月，任哈尔滨银行股份有限公司副董事长；2012年11月至今，任中泰信托有限责任公司监事会主席。（注：2014年12月15日起任大成基金管理有限公司董事长）

罗登攀，董事、总经理，耶鲁大学经济学博士。具注册金融分析师(CFA)、金融风险经理师(FRM)资格。曾任毕马威(KPMG)法律诉讼部资深咨询师、金融部资深咨询师，以及SLCG证券诉讼和咨询公司合伙人；2009年至2012年，任中国证券监督管理委员会规划委专家顾问委员，机构部创新处负责人，兼任国家“千人计划”专家；2013年2月至2014年10月，任中信并购基金管理有限公司董事总经理，执委会委员。2014年11月26日起任大成基金管理有限公司总经理。

周雄先生，董事，金融学博士，北京大学光华管理学院高级管理人员工商管理硕士(EMBA)。1987年8月至1993年4月，任厦门大学财经系教师；1993年4月至1996年8月，任华夏证券有限公司厦门分公司经理；1996年8月至1999年2月，任人民日报社事业发展局企业管理处副处长；1999年2月至今任职于中泰信托有限责任公司，历任副总裁、总裁，现任中泰信托有限责任公司董事、总裁。

靳天鹏先生，董事，国际法学硕士。1991年7月至1993年2月，任职于共青团河南省委；1993年3月至12月，任职于深圳市国际经济与法律咨询公司；1994年1月至6月，任职于深圳市蛇口律师事务所；1994年7月至1997年4月，任职于蛇口招商港务股份有限公司；1997年5月至今，任光大证券股份有限公司零售交易业务总部副总经理。

孙学林先生，董事，博士研究生在读，中国注册会计师，注册资产评估师。1997年5月—2000年4月，任职于中国长城信托投资公司；2000年4月—2007年2月，任职于中国银河证券有限公司审计与合规管理部；现任中国银河投资管理有限公司资产管理部总经理。

刘大为先生，独立董事，国家开发银行顾问，高级经济师，享受政府特殊津贴专家。中国人民银行研究生部硕士生指导老师，首都经济贸易大学兼职教授，清华大学中国经济研究中心高级研究员。先后在北京市人民政府研究室（副处长、处长），北京市第一商业局（副局长），中国建设银行信托投资公司（总经理），中国投资银行（行长），国家开发银行（总会计师）工作。

宣伟华女士，独立董事，日本国立神户大学法学院法学修士，中国国际经济贸易仲裁委员会仲裁员、上海仲裁委员会仲裁员，曾任上海市律师协会证券与期货法律研究委员会副主任。1986年—1993年，华东政法大学任教；1993年—1994年，日本神户学院大学法学部访问教授；1994年—1998年，日本国立神户大学学习；1999年—2000年，锦天城律师事务所兼职律师、北京市中伦金通律师事务所上海分所负责人；2001年始任国浩律师（上海）事务所合伙人。擅长于公司法、证券法、基金法、外商投资企业法、知识产权法等相关的法律事务。曾代理过中国证券市场第一例上市公司虚假陈述民事索赔共同诉讼案件，被CCTV·证券频道评为“五年风云人物”，并获得过“上海市优秀女律师”称号。

叶永刚先生，独立董事，经济学博士，武汉大学经济与管理学院教授、副院长、博士生导师，中国金融学会理事，中国金融学会金融工程研究会常务理事，中国金融学年会常务理事，湖北省政府咨询委员。1983—1988年，任武汉大学管理学院助教；1989—1994年，任武汉大学管理学院讲师；1994—1997年，任武汉大学管理学院副教授；1997年至今，任武汉大学教授，先后担任副系主任、系主任、副院长等行政职务。

王江先生，独立董事，金融学博士。2005年至今任职美国麻省理工学院斯隆管理学院瑞穗金融集团教授。2007年—2010年，兼任美国金融学会理事；2010年至今兼任美国西部金融学会理事；1997年至今兼任美国国家经济研究局研究员；2007年至今兼任纳斯达克公司经济顾问理事会理事；2009年至今兼任上海交通大学上海高级金融学院院长；2003年至今兼任清华大学中国金融研究中心主任。

监事会：

黄建农先生，监事长，大学本科。曾任中国银河证券有限责任公司上海江苏北路营业部

总经理，中国银河证券有限责任公司资产管理总部副总经理，总经理，中国银河投资管理公司投资管理部总经理。现任中国银河投资管理公司上海投资部董事总经理。

谢红兵先生，监事，双学士学位。1968年入伍，历任营教导员、军直属政治处主任；1992年转业，历任交通银行上海分行杨浦支行副行长（主持工作），营业处处长兼房地产信贷部经理，静安支行行长，杨浦支行行长；1998年调总行负责筹建基金托管部，任交通银行基金托管部副总经理（主持工作）、总经理；2005年负责筹建银行试点基金公司，任交银施罗德基金公司董事长；2008年任中国交银保险公司（香港）副董事长。2010年退休。

吴朝雷女士，监事，硕士学位。1988年9月—1990年12月任浙江省永嘉县峙口乡人民政府妇联主任、团委书记；1991年10月—1998年2月任浙江省温州市鹿城区人民政府民政科长；1998年3月—2001年6月，任浙江省温州市人民检察院起诉处助理检察员；2001年6月—2007年8月，就职于北京市宣武区人民检察院，任三级检察官；2007年8月起任民生人寿北京公司人事部经理。2007年11月—2009年12月，任中国人民人寿保险股份有限公司人力资源部副总经理；2010年1月加入大成基金管理有限公司，任纪委副书记、大成慈善基金会常务副秘书长。

其他高级管理人员：

杜鹏女士，督察长，研究生学历。1992年—1994年，历任原中国银行陕西省信托咨询公司证券部驻上交所上市代表、上海业务部负责人；1994年—1998年，历任广东省南方金融服务总公司投资基金管理部证券投资部副经理、广东华侨信托投资公司证券总部资产管理部经理；1998年9月参与大成基金管理有限公司的筹建；1999年3月起，任大成基金管理有限公司督察长。2009年3月19日起兼任大成国际资产管理有限公司董事。

杨春明先生，副总经理，硕士研究生。曾先后任职于长春税务学院、吉林省国际信托投资公司、招商证券股份有限公司。2005年6月加入大成基金管理有限公司，历任基金运营部总监、市场部总经理、公司助理总经理。2009年7月13日起任大成国际资产管理有限公司董事。2010年11月起任大成基金管理有限公司副总经理。2013年10月25日起任大成创新资本管理有限公司总经理。

肖冰先生，副总经理，工商管理硕士。曾任联合证券有限责任公司国际业务部总经理助理、鹏华基金管理有限公司市场部总监、泰达宏利基金管理有限公司市场部总监、景顺长城基金管理有限公司营销主管。2004年3月加入大成基金管理有限公司，历任市场部总监、综合管理部总监、公司董事会秘书。2009年7月13日起任大成国际资产管理有限公司董事。2010年11月起任大成基金管理有限公司副总经理兼董事会秘书。

刘明先生，副总经理，经济学硕士。1992年至1996年曾任厦门证券公司鹭江营业部总经理。1996年至2000年曾任厦门产权交易中心副总经理。2001年至2004年曾任香港时富金融服务集团投资经理，2004年3月加盟大成基金管理有限公司，曾任景宏证券投资基金基金经理、大成优选股票型证券投资基金基金经理及大成优选股票型证券投资基金（LOF）基金经理，公司助理总经理。现任股票投资决策委员会主席。2013年10月起任大成基金管理有限公司副总经理，并兼任股票投资部总监。

2、基金经理

王磊先生，经济学硕士，10年证券从业经历。2003年5月至2012年10月曾任证券时报社公司新闻部记者、世纪证券投资银行部业务董事、国信证券经济研究所分析师及资产管理总部专户投资经理、中银基金管理有限公司专户理财部投资经理级总监（主持工作）。2012年11月加入大成基金管理有限公司。2013年6月7日起担任大成强化收益债券型证券投资基金基金经理。2013年7月17日起兼任大成景恒保本混合型证券投资基金基金经理。2013年11月9日起任大成可转债增强债券型证券投资基金基金经理。2014年6月26日起任大成景益平稳收益混合型证券投资基金基金经理。2014年9月3日起任大成景丰债券型证券投资基金（LOF）基金经理。2014年12月9日起任大成景利混合型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。国籍：中国。

（2）历任基金经理

历任基金经理姓名	管理本基金时间
朱文辉	2011年11月30日—2013年11月8日

3、公司固定收益投资决策委员会

公司固定收益投资决策委员会由4名成员组成，设固定收益投资决策委员会主席1名，其他委员3名。名单如下：

钟鸣远，助理总经理，兼任固定收益部总监，固定收益投资决策委员会主席；王立，大成债券投资基金基金经理，大成货币市场证券投资基金基金经理（2014年12月24日起由黄海峰先生担任大成货币市场证券投资基金基金经理），大成月添利理财债券型证券投资基金基金经理，大成景旭纯债债券型证券投资基金基金经理，大成景兴信用债债券型证券投资基金基金经理，大成景丰债券型证券投资基金（LOF）基金经理，固定收益投资决策委员会委员；王磊，大成强化收益债券型证券投资基金基金经理，大成景恒保本混合型证券投资基金基金经理，大成可转债增强债券型证券投资基金基金经理，大成景益平稳收益混合型证券投资基金基金经理，大成景丰债券型证券投资基金（LOF）基金经理，2014年12月9日起任

大成景利混合型证券投资基金基金经理，固定收益投资决策委员会委员；谢民，交易管理部副总监，固定收益投资决策委员会委员。

上述人员之间不存在亲属关系。

二、基金托管人

一、基本情况

名称：中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街55号

成立时间：1984年1月1日

法定代表人：姜建清

注册资本：人民币349,018,545,827元

联系电话：010-66105799

联系人：赵会军

二、主要人员情况

截至2014年6月末，中国工商银行资产托管部共有员工170人，平均年龄30岁，95%以上员工拥有大学本科以上学历，高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

三、基金托管业务经营情况

作为中国大陆托管服务的先行者，中国工商银行自1998年在国内首家提供托管服务以来，秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨，依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队，严格履行资产托管人职责，为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务，展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、安心账户资金、企业年金基金、QFII资产、QDII资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII专户资产、ESCROW等门类齐全的托管产品体系，同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至2014年6月，中国工商银行共托管证券投资基金380只。自2003年以来，本行连续十年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的44项最佳托管银行大奖；是

获得奖项最多的国内托管银行，优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

四、基金托管人的内部控制制度

中国工商银行资产托管部自成立以来，各项业务飞速发展，始终保持在资产托管行业的优势地位。这些成绩的取得，是与资产托管部“一手抓业务拓展，一手抓内控建设”的做法是分不开的。资产托管部非常重视改进和加强内部风险管理工作，在积极拓展各项托管业务的同时，把加强风险防范和控制的力度，精心培育内控文化，完善风险控制机制，强化业务项目全过程风险管理作为重要工作来做。继2005、2007、2009、2010、2011、2012年六次顺利通过评估组织内部控制和安全措施是否充分的最权威的SAS70（审计标准第70号）审阅后，2013年中国工商银行资产托管部第七次通过ISAE3402（原SAS70）审阅获得无保留意见的控制及有效性报告，表明独立第三方对我行托管服务在风险管理、内部控制方面的健全性和有效性的全面认可。也证明中国工商银行托管服务的风险控制能力已经与国际大型托管银行接轨，达到国际先进水平。目前，ISAE3402审阅已经成为年度化、常规化的内控工作手段。

1、内部风险控制目标

保证业务运作严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，强化和建立守法经营、规范运作的经营思想和经营风格，形成一个运作规范化、管理科学化、监控制度化的内控体系；防范和化解经营风险，保证托管资产的安全完整；维护持有人的权益；保障资产托管业务安全、有效、稳健运行。

2、内部风险控制组织结构

中国工商银行资产托管业务内部风险控制组织结构由中国工商银行稽核监察部门（内控合规部、内部审计局）、资产托管部内设风险控制处及资产托管部各业务处室共同组成。总行稽核监察部门负责制定全行风险管理政策，对各业务部门风险控制工作进行指导、监督。资产托管部内部设置专门负责稽核监察工作的内部风险控制处，配备专职稽核监察人员，在总经理的直接领导下，依照有关法律规章，对业务的运行独立行使稽核监察职权。各业务处室在各自职责范围内实施具体的风险控制措施。

3、内部风险控制原则

（1）合法性原则。内控制度应当符合国家法律法规及监管机构的监管要求，并贯穿于托管业务经营管理活动的始终。

（2）完整性原则。托管业务的各项经营管理活动都必须有相应的规范程序和监督制约；监督制约应渗透到托管业务的全过程和各个操作环节，覆盖所有的部门、岗位和人员。

(3) 及时性原则。托管业务经营活动必须在发生时能准确及时地记录；按照“内控优先”的原则，新设机构或新增业务品种时，必须做到已建立相关的规章制度。

(4) 审慎性原则。各项业务经营活动必须防范风险，审慎经营，保证基金资产和其他委托资产的安全与完整。

(5) 有效性原则。内控制度应根据国家政策、法律及经营管理的需要适时修改完善，并保证得到全面落实执行，不得有任何空间、时限及人员的例外。

(6) 独立性原则。设立专门履行托管人职责的管理部门；直接操作人员和控制人员必须相对独立，适当分离；内控制度的检查、评价部门必须独立于内控制度的制定和执行部门。

4、内部风险控制措施实施

(1) 严格的隔离制度。资产托管业务与传统业务实行严格分离，建立了明确的岗位职责、科学的业务流程、详细的操作手册、严格的人员行为规范等一系列规章制度，并采取了良好的防火墙隔离制度，能够确保资产独立、环境独立、人员独立、业务制度和管理独立、网络独立。

(2) 高层检查。主管行领导与部门高级管理层作为工行托管业务政策和策略的制定者和管理者，要求下级部门及时报告经营管理情况和特别情况，以检查资产托管部在实现内部控制目标方面的进展，并根据检查情况提出内部控制措施，督促职能管理部门改进。

(3) 人事控制。资产托管部严格落实岗位责任制，建立“自控防线”、“互控防线”、“监控防线”三道控制防线，健全绩效考核和激励机制，树立“以人为本”的内控文化，增强员工的责任心和荣誉感，培育团队精神和核心竞争力。并通过进行定期、定向的业务与职业道德培训、签订承诺书，使员工树立风险防范与控制理念。

(4) 经营控制。资产托管部通过制定计划、编制预算等方法开展各种业务营销活动、处理各项事务，从而有效地控制和配置组织资源，达到资源利用和效益最大化目的。

(5) 内部风险管理。资产托管部通过稽核监察、风险评估等方式加强内部风险管理，定期或不定期地对业务运作状况进行检查、监控，指导业务部门进行风险识别、评估，制定并实施风险控制措施，排查风险隐患。

(6) 数据安全控制。我们通过业务操作区相对独立、数据和传真加密、数据传输线路的冗余备份、监控设施的运用和保障等措施来保障数据安全。

(7) 应急准备与响应。资产托管业务建立专门的灾难恢复中心，制定了基于数据、应用、操作、环境四个层面的完备的灾难恢复方案，并组织员工定期演练。为使演练更加接近实战，资产托管部不断提高演练标准，从最初的按照预订时间演练发展到现在的“随机演练”。从演

练结果看，资产托管部完全有能力在发生灾难的情况下两个小时内恢复业务。

5、资产托管部内部风险控制情况

(1) 资产托管部内部设置专职稽核监察部门，配备专职稽核监察人员，在总经理的直接领导下，依照有关法律规章，全面贯彻落实全程监控思想，确保资产托管业务健康、稳定地发展。

(2) 完善组织结构，实施全员风险管理。完善的风险管理体系需要从上至下每个员工的共同参与，只有这样，风险控制制度和措施才会全面、有效。资产托管部实施全员风险管理，将风险控制责任落实到具体业务部门和业务岗位，每位员工对自己岗位职责范围内的风险负责，通过建立纵向双人制、横向多部门制的内部组织结构，形成不同部门、不同岗位相互制约、相互监督的组织结构。

(3) 建立健全规章制度。资产托管部十分重视内控制度的建设，一贯坚持把风险防范和控制的理念和方法融入岗位职责、制度建设和工作流程中。经过多年努力，资产托管部已经建立了一整套内部风险控制制度，包括：岗位职责、业务操作流程、稽核监察制度、信息披露制度等，覆盖所有部门和岗位，渗透各项业务过程，形成各个业务环节之间的相互制约机制。

(4) 内部风险控制始终是托管部工作重点之一，保持与业务发展同等地位。资产托管业务是商业银行新兴的中间业务，资产托管部从成立之日起就特别强调规范运作，一直将建立一个系统、高效的风险防范和控制体系作为工作重点。随着市场环境的变化和托管业务的快速发展，新问题、新情况不断出现，资产托管部始终将风险管理放在与业务发展同等重要的位置，视风险防范和控制为托管业务生存和发展的生命线。

五、基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

根据《基金法》、《运作办法》、基金合同和有关基金法律法规的规定，对基金的投资对象、基金资产的投资组合比例、基金资产的核算、基金资产净值的计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付、基金申购资金的到账和赎回资金的划付、基金收益分配等行为的合法性、合规性进行监督和核查。

基金托管人发现基金管理人的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当拒绝执行，立即通知基金管理人，并及时向中国证监会报告。

基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当立即通知基金管理人，并及时向中国证监会报告。

基金托管人发现基金管理人其他违反《基金法》、《运作办法》、基金合同和有关基金法律法规规定的行为，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应及

时核对确认并以书面形式对基金托管人发出回函。在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人有关重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正。

三、相关服务机构

(一) 销售机构及联系人

1. 直销机构

大成基金管理有限公司

住所：深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层

办公地址：深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层

法定代表人：刘卓

电话：0755-83183388

传真：0755-83199588

联系人：王为开

公司网址：www.dcfund.com.cn

大成基金客户服务热线：400-888-5558（免长途固话费）

大成基金管理有限公司现分别在深圳、上海设有投资理财中心：

(1) 大成基金深圳投资理财中心

地址：深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦32层

联系人：王欢欢、白小雪

电话：0755-83195236/22223555/22223556

传真：83195239/83195235/83195242/83195232

(2) 大成基金上海投资理财中心

地址：上海市浦东新区陆家嘴东路161号101室

联系人：徐聆

电话：021-62185377/62185277/63513925/62173331

传真：021-63513928/62185233

2. 代销机构

(1) 中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

法定代表人：姜建清

客服电话：95588

电话：010-66107900

传真：010-66107914

网址：www.icbc.com.cn

(2) 中国建设银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号长安兴融中心 1 号楼

法定代表人：王洪章

联系人：王琳

电话：010-67596084

传真：010-66275654

客服电话：95533

网址：www.ccb.com

(3) 中国银行股份有限公司

注册地址：北京西城区复兴门内大街 1 号

法定代表人：田国立

客服电话：95566

联系人：王娟

电话：010-66594909

传真：010-66594942

网址：www.boc.cn

(4) 中国农业银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街 69 号

法定代表人：蒋超良

客服电话：95599

电话：010-85109219

传真：010-85109219

网址：www.abchina.com

(5) 交通银行股份有限公司

办公地址：上海市浦东新区银城中路 188 号

法定代表人：胡怀邦

客服电话：95559

联系人：曹榕

电话：021-58781234

传真：021-58408483

网址：www.bankcomm.com

(6) 招商银行股份有限公司

注册地址：深圳市福田区深南大道 7088 号

法定代表人：傅育宁

客服电话：95555

联系人：邓炯鹏

电话：0755-83077278

传真：0755-83195049

网址：www.cmbchina.com

(7) 上海农村商业银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区浦东大道 981 号

法定代表人：胡平西

客服电话：021-962999

电话：021-38576985

传真：021-50105124

联系人：周睿

网址：www.shrcb.com

(8) 北京农村商业银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区阜成门内大街 410 号

法定代表人：乔瑞

联系人：刘雨喻

联系电话：010-63229482

传真：010-66506163

客服电话：96198

网址：www.bjrcb.com

(9) 杭州银行股份有限公司

地址：杭州市凤起路 432 号

法定代表人：马时雍

联系人：严峻

电话：0571-85108195

传真：0571-85106576

客服电话：浙江省内 0571-96523、全国客户服务热线 4008888508

网址：www.hzbank.com.cn

(10) 大连银行股份有限公司

注册地址：大连市中山区中山路 88 号天安国际大厦 49 楼

法定代表人：陈占维

客服电话：4006640099

联系人：李鹏

电话：0411-82308602

传真：0411-82311420

网址：www.bankofdl.com

(11) 上海浦东发展银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区浦东南路 500 号

办公地址：上海市中山东一路 12 号

法定代表人：吉晓辉

联系人：倪苏云

客服热线：95528

电话：021-61618888

传真：021-63604199

网址：www.spdb.com.cn

(12) 浙商银行股份有限公司

注册地址：杭州市庆春路 288 号（办公地址同注册地址）

法定代表人：张达洋

联系人：吴强

客户服务热线：95105665

电话：0571-87659167

传真：0571-87659188

网址：www.czbank.com

（13）渤海银行股份有限公司

注册地址：天津市河西区马场道 201-205 号

法定代表人：刘宝凤

客服电话：400-888-8811

联系人：王宏

电话：022-58316666

传真：022-58316259

网址：www.cbhb.com.cn

（14）北京银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街甲 17 号首层

办公地址：北京市西城区金融大街丙 17 号

法定代表人：闫冰竹

联系人：王曦

电话：010-66223584

传真：010-66226045

客户服务电话：95526

公司网站：www.bankofbeijing.com.cn

（15）洛阳银行股份有限公司

注册地址：洛阳市洛龙区开元大道 256 号

办公地址：洛阳市洛龙区开元大道 256 号

客服电话：0379-96699

法定代表人：王建甫

联系人：胡艳丽

电话：0379-65921977

传真：0379-65921851

网址：www.bankofluoyang.com.cn

（16）哈尔滨银行股份有限公司

住所：哈尔滨市道里区尚志大街 160 号

办公地址：哈尔滨市道里区尚志大街 160 号

法人：郭志文

联系人：王超

联系电话：0451-86779007

传真：0451-86779007

客服电话：95537

公司网址：www.hrbb.com.cn

（17）国信证券股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦六层

法定代表人：何如

客服电话：95536

联系人：齐晓燕

电话：0755-82130833

传真：0755-82133952

网址：www.guosen.com.cn

（18）招商证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38-45 层

法定代表人：宫少林

客服电话：95565

联系人：林生迎

电话：0755-82960223

传真：0755-82943636

网址：www.newone.com.cn

（19）东北证券股份有限公司

注册地址：长春市自由大路 1138 号

办公地址：长春市自由大路 1138 号

法定代表人：矫正中

客户服务电话：4006000686

联系人：潘锴

电话：0431-85096709

网址：www.nesc.cn

(20) 中国银河证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

法定代表人：陈有安

客服电话：4008-888-888

联系人：田薇

联系电话：010-66568430

传真：010-66568990

网址：www.chinastock.com.cn

(21) 申银万国证券股份有限公司

通讯地址：上海市常熟路 171 号

法定代表人：丁国荣

客服电话：021-962505

联系人：黄维琳、曹晔

电话：021-54033888

传真：021-54038844

网址：www.sywg.com

(22) 东方证券股份有限公司

地址：上海市中山南路 318 号新源广场 2 号楼 22-29 楼

法定代表人：潘鑫军

客户电话：95503

联系人：吴宇

电话：021-63325888-3108

传真：021-63326173

网址：www.dfzq.com.cn

(23) 海通证券股份有限公司

注册地址：上海市淮海中路 98 号

法定代表人：王开国

客服电话：95553、400-888-8001

联系人：金芸、李笑鸣

电话：021-23219000

传真：021-63602722

网址：www.htsec.com

(24) 中信证券股份有限公司

注册地址：深圳市深南路 7088 号招商银行大厦

法定代表人：王东明

客服电话：010-84588888

联系人：陈忠

电话：010-84588888

传真：010-84865560

网址：www.cs.ecitic.com

(25) 安信证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元

法定代表人：牛冠兴

客服电话：4008 001 001

联系人：陈剑虹

电话：0755-82825551

传真：0755-82558355

网址：www.essence.com.cn

(26) 光大证券股份有限公司

办公地址：上海市静安区新闻路 1508 号

法定代表人：徐浩明

客服电话：400-888-8788、95525

联系人：刘晨、李芳芳

电话：021-22169081

传真：021-22169134

网址：www.ebscn.com

(27) 中信万通证券有限责任公司

注册地址：青岛市崂山区苗岭路 29 号澳柯玛大厦 15 层（1507-1510 室）

办公地址：青岛市东海西路 28 号

法定代表人：张智河

客服电话：0532-96577

联系人：吴忠超

电话：0532-85022326

传真：0532-85022605

网址：www.zxwt.com.cn

(28) 东海证券股份有限公司

注册地址：江苏省常州市延陵西路 2 3 号投资广场 1 8 — 1 9 楼

办公地址：上海市东方路 1928 号东海证券大厦

法定代表人：朱科敏

客服电话：95531

免费服务热线：95531

联系人：汪汇

电话：021-20333333

传真：021-50498825

网址：www.longone.com.cn

(29) 中信证券（浙江）有限责任公司

注册地址：浙江省杭州市滨江区江南大道 588 号恒鑫大厦主楼 19、20 层

法定代表人：沈强

客服电话：95548

联系人：王霏霏

电话：0571-87112507

传真：0571-85783771

网址：www.bigsun.com.cn

(30) 广州证券有限责任公司

注册地址：广州市先烈中路 69 号东山广场主楼十七楼

法定代表人：刘东

客服电话：961303

联系人：林洁茹

联系电话：020-87322668

传真：020-87325036

网址：www.gzs.com.cn

（31）平安证券有限责任公司

办公地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场 8 楼

法定代表人：杨宇翔

客服电话：95511 转 8

联系人：郑舒丽

电话：0755-22626391

传真：0755-82400862

网址：www.pingan.com

（32）湘财证券有限责任公司

注册地址：长沙市黄兴中路 63 号中山国际大厦 12 楼

法定代表人：林俊波

客服电话：400-888-1551

联系人：钟康莺

电话：021-68634518-8503

传真：021-68865938

网址：www.xcsc.com

（33）上海证券有限责任公司

注册地址：上海市西藏中路 336 号

法定代表人：龚德雄

客服电话：021-962518，4008918918

联系人：张瑾

电话：021-53519888

传真：021-63608830

网址：www.962518.com

(34) 兴业证券股份有限公司

注册地址：福州市湖东路 268 号

法定代表人：兰荣

客户服务电话：95562

联系人：黄英

电话：0591-38162212

传真：0591-38507538

网址：www.xyzq.com.cn

(35) 渤海证券股份有限公司

注册地址：天津市经济技术开发区第二大街 42 号写字楼 101 室

法定代表人：杜庆平

联系人：王兆权

电话：022-28451861

传真：022-28451892

客服电话：4006515988

网址：www.bhzq.com

(36) 方正证券股份有限公司

注册地址：湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦 22-24 层

法定代表人：雷杰

客服电话：95571

联系人：邵艳霞

电话：010-57398063

传真：010-57398058

网址：www.foundersc.com

(37) 东莞证券有限责任公司

注册地址：东莞市莞城区可园南路 1 号金源中心 30 楼

法定代表人：张运勇

客服电话：0769-961130

联系人：梁健伟

电话：0769-22119341

传真：0769-22116999

网址：www.dgzq.com.cn

(38) 瑞银证券有限责任公司

注册地址：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心12层、15层

法定代表人：程宜荪

电话：010-58328337

传真：010-58328748

联系人：慕丽娜

客户服务电话：400-887-8827

网址：www.ubssecurities.com

(39) 宏源证券股份有限公司

注册地址：新疆乌鲁木齐市文艺路233号

办公地址：北京市西城区太平桥大街19号

法定代表人：冯戎

客户服务电话：4008000562

联系人：李巍

电话：010-88085858

传真：010-88085195

网址：www.hysec.com

(40) 长城证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层

法定代表人：黄耀华

客户服务热线：0755-33680000、400-6666-888

联系人：高峰

电话：0755-83516094

传真：0755-83516199

网址：www.cgws.com

(41) 国都证券有限责任公司

注册地址：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层

法定代表人：常喆

客户服务电话：400-818-8118

联系人：黄静

电话：010-84183333

传真：010-84183311-3389

网址：www.guodu.com

(42) 江海证券有限公司

办公地址：哈尔滨市香坊区赣水路 56 号

法人代表：孙名扬

电话：0451-82336863

客服热线：4006662288

联系人：徐世旺

网址：www.jhzq.com.cn

(43) 长江证券股份有限公司

注册地址：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

法定代表人：胡运钊

客户服务热线：95579、4008-888-999

联系人：李良

电话：027-65799999

传真：027-85481900

网址：www.95579.com

(44) 国金证券股份有限公司

注册地址：成都市东城根上街 95 号

法定代表人：冉云

客户服务电话：4006600109

联系人：刘一宏

电话：028-86690070

传真：028-86690126

网址：www.gjzq.com.cn

(45) 中航证券有限公司

注册地址：南昌市红谷滩新区红谷中大道 1619 号国际金融大厦 A 座 41 楼

办公地址：南昌市红谷滩新区红谷中大道 1619 号国际金融大厦 A 座 41 楼

法人代表：杜航

客户服务热线：4008866567

联系人：戴蕾

电话：0791-86768681

传真：0791-86770178

网址：www.avicsec.com

(46) 爱建证券有限责任公司

地址：上海市南京西路 758 号 23 楼

法定代表人：郭林

客服电话：021-63340678

联系人：陈敏

电话：021-32229888

传真：021-62878783

网址：www.ajzq.com

(47) 天相投资顾问有限公司

注册地址：北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座 701

法定代表人：林义相

客服电话：010-66045678

联系人：林爽

传真：010-66045527

网址：www.txsec.com

(48) 信达证券股份有限公司

地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

法定代表人：张志刚

客户服务电话：4008008899

联系人：唐静

联系电话：010-63081000

传真：010-63080978

公司网址：www.cindasc.com

(49) 华宝证券有限责任公司

地址：上海市浦东新区环球金融中心 57 楼

法定代表人：陈林

客户服务电话：400-820-9898

联系人：汪明丽

电话：021-68778075

传真：021-68868117

网址：www.cnhbstock.com

(50) 中国中投证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心 A 栋第 18 层-21 层及第 04 层 01.02.03.05.11.12.13.15.16.18.19.20.21.22.23 单元

办公地址：深圳市福田区益田路 6003 号荣超商务中心 A 栋第 04、18 层至 21 层

法定代表人：龙增来

联系人：刘毅

客户电话：400 600 8008

电话：0755-82023442

传真：0755-82026539

网址：www.china-invs.cn

(51) 齐鲁证券有限公司

办公地址：山东省济南市经十路 20518 号

法定代表人：李玮

客户服务电话：95538

联系人：吴阳

电话：0531-81283938

传真：0531-81283900

网址：www.qlzq.com.cn

(52) 财富证券有限责任公司

办公地址：湖南长沙芙蓉中路二段 80 号顺天国际财富中心 26 层

法人代表：周晖

客户服务热线：0731-84403319

联系人：胡智

电话：0731-84779521

传真：0731-84403439

网址：www.cfzq.com

（53）中原证券股份有限公司

地址：郑州市郑东新区商务外环路 10 号

法定代表人：菅明军

客服电话：0371-967218、4008139666

联系人：卢琳

联系电话: 0371-68599287 联系传真:0371-65585665

网址：www.ccnew.com

（54）民生证券股份有限公司

地址：北京市东城区建国门内大街 28 号民生金融中心 A 座

法定代表人：余政

客服电话：4006198888

联系人：赵明

联系电话：010-85127622

联系传真：010-85127917

公司网址：www.msyzq.com

（55）天源证券经纪有限公司

注册地址：青海省西宁市长江路 53 号汇通大厦六楼

办公地址：深圳市福田区民田路新华保险大厦 18 楼

法定代表人：林小明

电话：0755-33331188

传真：0755-33329815

统一客服电话：4006543218

公司网站地址：www.tyzq.com.cn

（56）天风证券股份有限公司

注册地址:湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路 2 号高科大厦四楼

法定代表人：余磊

联系人：翟璟

联系电话：(027) 87618882/(028) 86711410

传真：(027) 87618863

公司网站：www.tfzq.com

(57) 国盛证券有限责任公司

注册地址：江西省南昌市北京西路 88 号江信国际金融大厦

办公地址：江西省南昌市北京西路 88 号江信国际金融大厦 4 楼

法定代表人：曾小普

联系人：徐美云

电话：0791-6285337

传真：0791-6282293

网址：www.gsstock.com

(58) 华鑫证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 28 层 A01、B01 (b) 单元

办公地址：上海市肇嘉浜路 750 号

法定代表人：洪家新

联系人：陈敏

网站：www.cfsc.com.cn

客户服务电话：021-32109999；029-68918888；4001099918

(59) 深圳众禄基金销售有限公司

办公地址：深圳市罗湖区深南东路 5047 号发展银行大厦 25 楼 I、J 单元

法定代表人：薛峰

客服电话：4006-788-887

联系人：童彩平

电话：0755-33227950

传真：0755-82080798

网址：www.zlfund.cn

(60) 中山证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区益田路 6009 号新世界中心 29 层

法定代表人：吴永良

客服电话：400-1022-011

网址：www.zszq.com.cn

(61) 国泰君安证券股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区商城路 618 号

法定代表人：万建华

客服电话：95521

联系人：芮敏祺

电话：021-38676666

传真：021-38670161

网址：www.gtja.com

(62) 中信建投股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

法定代表人：王常青

客服电话：4008888108

联系人：权唐

电话：010-85130577

传真：010-65182261

网址：www.csc108.com

(63) 上海好买基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区场中路 685 弄 37 号 4 号楼 449 室

办公地址：上海市浦东新区浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 903~906

法定代表人：杨文斌

客服电话：400-700-9665

联系人：张茹

联系电话：021-58870011

传真：021-68596916

网址：www.ehowbuy.com

(64) 华融证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 8 号

法定代表人：祝献忠

联系人：黄恒

联系电话：010-58568062

传真：010-58568062

客户服务电话：010-58568118

网址：www.hrsec.com.cn

(65) 和讯信息科技有限公司

注册地址：北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦 10 层

法定代表人：王莉

联系人：常春艳

联系电话：0755-82721122

传真：0755-82029055

客户服务电话：4009200022

网址：<http://licaike.hexun.com>

(66) 上海天天基金销售有限公司

注册地址：上海市徐汇区龙田路 195 号 3C 座 9 楼

法人代表：其实

联系人：高莉莉

电话：021-54509988

传真：021-64383798

客户服务电话：400-1818-188

网址：www.1234567.com.cn

(67) 杭州数米基金销售有限公司

注册地址：杭州市余杭区仓前街文一西路 1218 号 1 栋 202 室

法人代表：陈柏青

联系人：张裕

电话：0571-2882935

传真：0571-26698533

客户服务电话：4000-766-123

网址：www.fund123.cn

(68) 中国民族证券有限责任公司

注册地址：北京市朝阳区北四环中路 27 号院 5 号楼 40 层-43 层

法人代表：赵大建

联系人：李微

客户服务电话：400-889-5618

网址：www.e5618.com

（二）注册登记机构

名称：大成基金管理有限公司

住所：深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层

办公地址：深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 33 层

法定代表人：刘卓

电话：0755-83183388

传真：0755-83195239

联系人：范瑛

（三）律师事务所和经办律师

名称：北京市金杜律师事务所

注册地址：北京市朝阳区东三环中路7号财富中心写字楼A座40层

办公地址：北京市朝阳区东三环中路7号财富中心写字楼A座40层

负责人：王玲

电话：0755-22163333

传真：0755-22163390

经办律师：靳庆军、冯艾

联系人：冯艾

（四）会计师事务所和经办注册会计师

名称：普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼

办公地址：上海市黄浦区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼

法定代表人：杨绍信

电话：(021) 23238888

传真：(021) 23238800

联系人：刘莉

经办注册会计师：薛竞、叶尔甸

四、基金的名称

大成可转债增强债券型证券投资基金

五、基金的类型

债券型

六、基金的运作方式

开放式

七、基金的投资目标

在严格控制投资风险、保持资产流动性的前提下，采取自上而下的资产配置策略和自下而上的个券选择策略，通过主动投资组合管理，充分把握可转债兼具股性和债性的风险收益特征，追求投资资金的长期保值增值。

八、基金的投资范围

本基金的投资对象为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行或上市交易的股票（包含中小板，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）。

本基金为债券基金，重点投资于固定收益类资产，包括国债、央行票据、中期票据、公司债、企业债、资产支持证券、短期融资券、政府机构债、金融债、次级债、可转债（含可分离交易可转债）、债券回购、银行存款，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他固定收益类金融工具。本基金投资于固定收益类资产的比例不低于基金资产的 80%，其中对可转债（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%；股票（含一级市场新股申购和二级市场股票投资）、权证等权益类资产投资比例不高于基金资产的 20%；

持有现金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%。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

九、基金的投资策略

1、大类资产配置策略

本基金主要投资于可转债等固定收益类资产，在确保基金资产收益安全与稳定的同时，以有限的风险载荷博取股票市场的上涨收益。本基金将在基金合同约定的投资范围内结合定性以及定量分析，自上而下地实施整体资产配置策略，通过对国内外宏观经济状况、证券市场走势、市场利率走势以及市场资金供求状况、信用风险变化情况和有关政策法规等因素的综合分析，预测各大类资产未来收益率变化情况，在不同的大类资产之间进行动态调整和优化，以规避市场风险，把握市场收益变化，进而提高基金收益率。

2、固定收益类资产投资策略

(1) 可转债投资策略

可转债是一种含权债券，它同时具备了普通股票所不具备的债性和普通债券所不具备的股性。在股票市场下跌时，可转债由于受到纯债价值的支撑，一般不会跌破其债券价值部分；在股票市场上涨时，又由于内生的期权属性，可转债可分享正股股票上涨的收益。合理地利用可转债的股性和债性双重特征，可在有效控制组合风险的基础上获取一定的超额收益。在经济处于复苏和繁荣的阶段，若股市表现较好，则可通过超配转股期权价值高的可转债来增强债券组合的收益；在经济处于衰退的阶段，若市场基准利率下行，则可通过超配普通债券以及纯债价值较高的可转债来获得较好的收益。

在进行可转债筛选时，本基金将在对可转换债券条款以及发行人基本面要素进行深入研究的基础上，选择合适时机投资于低估的可转债品种，通过积极主动管理，获得超额收益。基本面要素包括股性特征、债性特征、流动性等。本基金将充分借鉴基金管理人股票研究团队的研究成果，对可转债对应的正股的基本面进行分析，形成对正股的价值评估。从行业选择和个券选择两方面进行全方位的评估，对盈利能力或成长性较好的行业和上市公司的可转债进行重点关注，将可转债自身的信用评估和其正股的价值分析结合起来，最终确定投资的可转债品种。

本基金将采取稳健性投资和进取型投资相结合的策略，即投资于基本面较好、具有成长

性、转股价格修正条件优惠的可转债，从而在风险相对较低的前提下力求获得超越基准的投资回报。

1) 可转债套利策略

转股权使得可转债价格与正股价格之间存在一定的关联关系，但两者价格受到各种市场因素影响后会出现失衡状况。基金管理人通过深入、细致的研究和实时跟踪，可侦测到这种定价失衡关系并加以利用：当处于转股期内的可转债市价低于转股价值，即可转债的转换溢价率为负时，买入可转债的同时卖出标的股票可以获得套利价差；反之，买入标的股票的同时卖出可转债也可以获取反向套利价差。在日常交易运作过程中，本基金将密切关注可转债与标的股票价格的关系，择机实施套利策略，以加强本基金收益水平。

2) 相对价值分析策略

本基金采用相对价值分析策略，即通过分析不同市场环境下可转债股性和债性的相对价值，把握可转债的价值走向，选择相应券种，从而获取较高投资收益。本基金利用可转债的底价溢价率和可转债的到期收益率来衡量可转债的债性特征，利用可转债的平价溢价率和可转债的 Delta 系数来衡量可转债的股性特征，并在对可转换债券条款、发行人基本面要素、正股估值水平与盈利成长性进行深入研究的基础上，结合股票市场与债券市场的预期相对风险收益，选择时机相应投资于期权价值低估或纯债价值低估的可转债品种，通过积极主动管理，获得超额收益。

3) 可转债条款价值发现策略

国内可转债一般设有一些特殊条款，包括修正转股价条款、回售条款、赎回条款等，这些条款在特定环境下对转债价值有着较大的影响。修正转股价是指发行人向下修正转股价，从而可提升可转债的期权价值。回售条款给予投资者将可转债按照约定价格回售给发行人的权利，为可转债投资提供了一种安全边际。赎回条款给予发行人按照约定价格从投资者处赎回可转债的权利，一般是为了促进可转债持有人的转股；赎回条款会对可转债价格构成一定的抑制，若发行人放弃赎回权则会提高可转债的期权价值。本基金将深入分析发行人的经营趋势、财务状况和融资需求等基本面因素，结合公司调研和信息跟踪，及时地了解发行人实施特殊条款的意愿，并对条款实施方案进行情景分析，发掘条款给可转债带来的投资机会或规避不利条款可能带来的投资风险。

4) 可分离交易可转债投资策略

可分离交易可转债是指认股权证和债券分离交易的可转债品种，即在上市后分离为债券和权证分别独自进行交易。在可分离交易可转债投资方面，本基金一般不主动从二级市场上

买入权证部分，如果通过申购可分离交易可转债而获得部分权证，本基金采取上市后尽快卖出的策略以降低权证高波动风险。在可分离交易可转债纯债方面，本基金将综合分析纯债部分的信用状况、流动性以及与利率产品的利差等情况，在此基础上合理评估可分离转债纯债部分的投资价值并作出相应的投资决策，力求在保持流动性的基础上为组合增强收益。本基金也可将可分离交易可转债纯债与正股按适当的配比构成组合，实施复制期权策略，进行类可转债投资。

（2）普通债券投资策略

1) 利率预期策略

利率风险是债券投资最主要的风险来源和收益来源之一，衡量债券利率风险的核心指标是久期。本基金将通过对宏观经济以及货币政策等因素的深入研究，判断利率变化的趋势，利用情景分析模拟利率变化的各种情形，根据组合的风险承受能力确定组合的目标久期区间。通过对利率变化方向和时间、目标久期区间的分析，借助市场收益率曲线结构分析和市场信用利差结构分析，确定资产配置的组合久期，有效控制风险，获取投资收益。

2) 类属配置策略

类属配置的结果决定了债券组合在不同风险类属资产之间的分配比例和债券的期限配置，是影响债券投资业绩的重要因素。本基金将在确定目标久期后，通过对宏观经济、市场利率、债券供求等的分析，预测各类属资产预期风险及收益情况，综合考虑债券品种期限和不同债券市场流动性及收益性现状，制定普通债券品种期限配置策略，确立不同债券市场投资比例，确定普通债券组合资产在政府债券、企业主体债券、货币资产之间的分配比例。

3) 信用债券投资策略

信用类债券是本基金重要投资标的，信用风险管理对于提高债券组合收益率至关重要。本基金将根据宏观经济运行状况、发行主体所属行业发展周期、公司业务状况、公司治理结构、财务状况等因素综合评估信用风险，确定信用类债券的信用风险利差，有效管理组合的整体信用风险。

债券市场上各种级别的信用产品（主要是政府信用债券与企业主体债券、各类企业主体债券之间）会形成一个不同收益率水平的利差结构体系。在正常条件下，由信用风险形成的收益率利差是稳定的，但在特定条件下，比如某个行业在经济周期的某一时期面临信用风险改变或者市场供求发生变化时，这种稳定关系将被打破。提前预测并进行交易，就可能获得套利收益或者减少损失。本基金将主要利用定性与定量相结合的方式，综合考虑监管环境、市场供求关系、行业分析，并运用财务数据统计模型和现金流分析模型等对整个市场的信用

利差结构进行全面分析，在有效控制整个组合信用风险的基础上，采取积极的投资策略，发现价值被低估的信用类债券产品，挖掘投资机会，获取超额收益。

4) 套利交易策略

套利交易策略主要包括跨市场债券套利策略、回购套利策略和利差交易策略。本基金将在法律法规和监管机构许可的条件下，积极运用套利交易策略，提高组合收益。

A. 跨市场债券套利策略。通过在交易所市场和银行间市场买卖同时在两市托管的债券，或者在两市之间买卖到期期限相同但收益率不同的债券，可以获取二者之间可能存在的价差。

B. 回购套利策略。利用回购进行无风险或低风险套利的主要策略包括回购跨市场套利、回购与现券的套利以及不同回购期限之间的套利等；利用回购进行高风险套利的主要策略包括正回购杠杆操作、逆回购卖空操作等。

C. 利差交易策略。利差交易是指同时买进涨多（跌少）/卖出涨少（跌多）的债券，达到不受市场涨跌的直接影响、规避市场风险的效果。同时，也可以将利差交易作为一种债券用于组合投资，是增加组合投资回报率的重要手段。最常见的利差交易为增斜交易与扁平交易。当预期收益率曲线将变陡峭时，进行增斜交易，即买入短期债，卖空长期债，同时保持久期中性，获取收益率曲线增斜带来的利差收益，规避了收益率曲线平移带来的风险（反之则进行扁平交易）。

3、权益类资产投资策略

（1）新股申购投资策略

本基金可以参与一级市场新股申购或增发新股。在进行新股申购时，本基金将充分考虑新股在资本市场不同阶段的风险特征，根据内外部研究成果评估股票的内在价值，对于拟发行上市的新股（或增发新股）的投资价值进行深入发掘，结合市场资金利率水平和预期中签率，得出新股申购预期收益率，作为参与新股申购的决策依据。

（2）股票二级市场投资策略

本基金可以进行适当的股票二级市场投资以强化组合获利能力，提高预期收益水平。本基金将从经济周期、产业政策、行业竞争趋势、公司发展战略、综合业务状况、公司治理等多方面因素对上市公司进行综合评估，重点关注基金管理人研究团队长期跟踪并有良好业绩的公司，在此基础上从股票初选库中筛选出符合要求的股票构成股票备选库。

本基金将结合市场资金面，估值水平，投资主题，基金资产整体风险承受水平，以及内外部的研究成果，择机投资于股票备选库中的具有良好成长性特征或较高安全边际的优质股

票，追求稳健回报，适当提高基金组合的收益率。

4、资产支持证券投资策略

本基金将在宏观经济和基本面分析的基础上，对资产支持证券标的资产的质量和构成、利率风险、信用风险、流动性风险和提前偿付风险等进行定性和定量的全方面分析，评估其相对投资价值并作出相应的投资决策，力求在控制投资风险的前提下尽可能的提高本基金的收益。

5、权证投资策略

本基金将在控制投资风险和保障基金财产安全的前提下，对权证进行投资。权证投资策略主要包括以下几个方面：1) 采用市场公认的多种期权定价模型对权证进行定价，作为权证投资的价值基准；2) 根据权证标的股票基本面的研究估值，结合权证理论价值进行权证趋势投资；3) 利用权证衍生工具的特性，通过权证与证券的组合投资，达到改善组合风险收益特征的目的，包括但不限于杠杆交易策略、看跌保护组合策略等。

十、基金的业绩比较基准

中信标普可转债指数×60%+中债综合指数×40%。

中信标普可转债指数由中信标普指数公司推出，最大限度地涵盖了在上海证券交易所和深圳证券交易所上市的可转债，市场覆盖面广、代表性高。中债综合指数由中央国债登记结算有限责任公司编制，其样本范围涵盖银行间市场和交易所市场，成份债券包括国家债券、企业债券、央行票据等所有主要债券种类，具有广泛的市场代表性，能够反应中国债券市场的总体走势。本基金认为，该业绩比较基准能较好地反映本基金的风险收益特征。

在本基金的运作过程中，如果由于外部投资环境或法律法规的变化而使得调整业绩比较基准更符合基金份额持有人的利益，则经基金管理人与基金托管人协商一致，可以对业绩比较基准进行适当调整，并在报中国证监会核准后，公告并予以实施。

十一、基金的风险收益特征

本基金为债券型基金产品，属证券投资基金中的低风险收益品种，其预期风险与预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。本基金主要投资于可转换债券（含可分离交易可转债），在债券型基金中属于风险水平相对较高的投资产品。

十二、基金投资组合报告

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。

基金托管人中国工商银行根据基金合同规定，于2014年12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。

本投资组合报告所载数据截至2014年9月30日，本报告中所列财务数据未经审计。

1. 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	3,606,500.00	3.58
	其中：股票	3,606,500.00	3.58
2	固定收益投资	89,696,354.76	89.13
	其中：债券	89,696,354.76	89.13
	资产支持证券	-	0.00
3	贵金属投资	-	0.00
4	金融衍生品投资	-	0.00
5	买入返售金融资产	-	0.00
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	0.00
6	银行存款和结算备付金合计	6,790,009.22	6.75
7	其他资产	543,317.14	0.54
8	合计	100,636,181.12	100.00

2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	0.00
B	采矿业	-	0.00
C	制造业	3,606,500.00	5.61
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	0.00
E	建筑业	-	0.00
F	批发和零售业	-	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	0.00
H	住宿和餐饮业	-	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	0.00
J	金融业	-	0.00
K	房地产业	-	0.00

L	租赁和商务服务业	-	0.00
M	科学研究和技术服务业	-	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	-	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	0.00
P	教育	-	0.00
Q	卫生和社会工作	-	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	0.00
S	综合	-	0.00
	合计	3,606,500.00	5.61

3. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300110	华仁药业	90,000	738,900.00	1.15
2	600309	万华化学	40,000	692,400.00	1.08
3	000407	胜利股份	100,000	679,000.00	1.06
4	000651	格力电器	20,000	554,600.00	0.86
5	300131	英唐智控	40,000	536,000.00	0.83
6	600525	长园集团	30,000	405,600.00	0.63

4. 报告期末按券种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	3,510,150.00	5.46
2	央行票据	-	0.00
3	金融债券	-	0.00
	其中：政策性金融债	-	0.00
4	企业债券	-	0.00
5	企业短期融资券	-	0.00
6	中期票据	-	0.00
7	可转债	86,186,204.76	134.03
8	其他	-	0.00
9	合计	89,696,354.76	139.49

5. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	110023	民生转债	180,100	16,850,156.00	26.20
2	110015	石化转债	120,000	13,083,600.00	20.35
3	110027	东方转债	80,000	9,615,200.00	14.95
4	110028	冠城转债	70,000	8,260,000.00	12.85

5	110020	南山转债	60,000	6,750,600.00	10.50
---	--------	------	--------	--------------	-------

6. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

8. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

9. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(1) 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

(2) 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

(3) 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

10. 投资组合报告附注

(1) 本基金投资的前十名证券的发行主体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。

根据石化转债债券发行主体中国石油化工股份有限公司于 2014 年 1 月 12 日发布的公告，国务院对山东省青岛市“11.22”中石化东黄输油管道泄漏爆炸特别重大事故调查报告作出批复，同意国务院事故调查组的调查处理结果，认定是一起特别重大责任事故；同意对事故有关责任单位和责任人的处理建议，对中国石化及当地政府的 48 名责任人分别给予纪律处分，对涉嫌犯罪的 15 名责任人移送司法机关依法追究法律责任。本次事故造成直接经济损失人民币 75,172 万元，中国石油化工股份有限公司将承担其相应赔偿责任。相关资金主要来自中国石化在以前年度积累的安全生产保险基金（指经国家有关部门批准由中国石油化工集团公司面向公司所属企事业单位设立的企业安全生产保险基金）和公司向商业保险公司投保的商业巨灾保险的保险理赔资金。

在上述公告公布后，本基金管理人对该上市公司进行了进一步了解和他分析，认为上述处罚不会对石化转债的投资价值构成实质性负面影响，因此本基金管理人对其投资判断未发生改变。

(2) 基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

(3) 基金的其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	10,617.90
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	530,115.84
5	应收申购款	2,583.40
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	543,317.14

(4) 报告期末基金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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110023	民生转债	16,850,156.00	26.20
2	110015	石化转债	13,083,600.00	20.35
3	110020	南山转债	6,750,600.00	10.50
4	113005	平安转债	6,567,000.00	10.21
5	110017	中海转债	3,154,482.00	4.91
6	113001	中行转债	3,106,800.00	4.83
7	110022	同仁转债	2,754,620.00	4.28
8	110024	隧道转债	2,627,200.00	4.09
9	113006	深燃转债	1,659,525.90	2.58
10	110011	歌华转债	1,195,800.00	1.86
11	127002	徐工转债	1,139,620.00	1.77
12	128004	久立转债	642,508.06	1.00

(5) 报告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。

(6) 由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

十三、基金业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投

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。

一、自基金合同生效以来（2011年11月30日）至2013年9月30日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：

阶段	净值增长率 ①	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
2011.11.30—2011.12.31	0.20%	0.03%	-0.16%	0.29%	0.36%	-0.26%
2012.01.01—2012.12.31	2.99%	0.20%	4.21%	0.21%	-1.22%	-0.01%
2013.01.01—2013.12.31	-4.15%	0.54%	-0.60%	0.39%	-3.55%	0.15%
2014.01.01—2014.09.30	13.78%	0.58%	9.05%	0.29%	4.73%	0.29%
2011.11.30—2014.09.30	12.55%	0.46%	12.79%	0.31%	-0.24%	0.15%

二、自基金合同生效以来基金份额净值的变动情况，并与同期业绩比较基准的变动的比较：

大成可转债增强债券型证券投资基金累计份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

（2011年11月30日至2014年9月30日）



注：按基金合同规定，大成可转债增强债券型证券投资基金自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。截至报告期末，本基金的各项投资比例已符合基金合同中规定的各项投资比例。

十四、基金的费用与税收

一、基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金的证券交易费用；
- 7、基金的银行汇划费用；
- 8、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

本基金终止清算时所发生费用，按实际支出额从基金财产总值中扣除。

二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.00% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.00\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.20% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起 2 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

上述“基金费用的种类”中第3—8项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

三、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；

2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；

3、《基金合同》生效前的相关费用，包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费用等费用；

4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

四、费用调整

基金管理人和基金托管人协商一致后，可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率、基金销售费率等相关费率。

调高基金管理费率、基金托管费率或基金销售费率等费率，须召开基金份额持有人大会审议；调低基金管理费率、基金托管费率或基金销售费率等费率，无须召开基金份额持有人大会。

基金管理人必须最迟于新的费率实施日前2日在至少一种指定媒体上公告。

五、基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

十五、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他有关法律法规的要求，对2014年7月15日公布的《大成可转债增强债券型证券投资基金更新招募说明书（2014年1期）》进行了更新，并根据本基金管理人对本基金实施的投资经营活动进行了内容补充和更新，主要更新的内容如下：

1. 根据最新资料，更新了“第三部分、基金管理人”部分。
2. 根据最新资料，更新了“第四部分、基金托管人”部分。
3. 根据最新资料，更新了“第五部分、相关服务机构”部分。

4. 根据最新数据，更新了“第八部分、基金的投资”部分。
5. 根据最新数据，更新了“第九部分、基金业绩”部分。
6. 根据最新公告，更新了“第二十一部分、其他应披露的事项”。
7. 根据最新情况，更新了“第二十二部分、对招募说明书更新部分的说明”。

大成基金管理有限公司

二〇一五年一月十四日