

## 申万菱信可转换债券债券型证券投资基金招募说明书（第十三次更新）摘要

基金管理人：申万菱信基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

### 【重要提示】

- 本基金基金合同已于 2011 年 12 月 9 日生效。
- 投资有风险，投资人申购基金时应认真阅读招募说明书。
- 基金的过往业绩并不预示其未来的表现。
- 本摘要根据本基金之基金合同和基金招募说明书编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。
- 本招募说明书（更新）所载内容截止日为 2018 年 6 月 9 日，有关基金的财务数据和净值表现截止日为 2018 年 3 月 31 日（财务数据未经审计）。

### 目录

一、基金管理人	3
二、基金托管人	6
三、相关服务机构	7
四、基金的名称	33
五、基金的类型	33
六、基金的投资范围	33
七、基金的投资策略	34
八、业绩比较基准	39
九、风险收益特征	39
十、基金投资组合报告	40
十一、基金的业绩	45
十二、基金的费用与税收	46
十三、对招募说明书本次更新部分的说明	49

?

### 一、基金管理人

#### （一）基金管理人概况

名称：申万菱信基金管理有限公司

住所：上海市中山南路 100 号 11 层

法定代表人：刘郎

设立日期：2004 年 1 月 15 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证券监督管理委员会，证监基金字【2003】144 号文。

组织形式：有限责任公司

注册资本：壹亿伍仟万元人民币

联系电话：+86-21-23261188

联系人：赵鹏

股本结构：申万宏源证券有限公司持有 67% 的股权，三菱 UFJ 信托银行株式会社持有 33% 的股权

## （二）主要人员情况

### 1、董事会成员

刘郎先生，董事长，硕士研究生，副教授。曾任湖南邵阳学院助教，东南大学系副主任、副教授。

1994年起从事金融相关工作，历任泰阳证券有限责任公司党委副书记、总裁、董事，万联证券有限责任公司总裁、董事，广州城市职业学院商学部主任，大通证券股份有限公司党委委员、副总经理，申银万国证券股份有限公司副总经理，申万宏源证券有限公司副总经理。现任申万菱信基金管理有限公司董事长，兼任申万菱信（上海）资产管理有限公司董事长。

朱敏杰先生，董事，硕士研究生，经济师。1988年起从事证券相关工作，先后任职于万国证券公司，申银万国证券股份有限公司，现任申万宏源证券有限公司副总经理。

张克均先生，董事，硕士研究生。1990年起从事金融相关工作，曾任职于兴业银行厦门分行、申银万国证券股份有限公司，现任申万宏源证券有限公司总经理助理。

铃木晃先生，董事，日本籍，大学学历。1982年4月至今在三菱UFJ信托银行株式会社（原三菱信托银行）任职，历任投资商品开发部副部长、部长、执行官，管理受托财产部门常务执行官、副部长，现任受托财产副部长、资产管理事业部副事业长。

川上丰先生，董事，日本籍，大学学历。1990年4月至今在三菱UFJ信托银行株式会社（原三菱信托银行）任职，曾任投资企划部科长、海外资产管理事业部科长、次长、副部长等。现任三菱UFJ信托银行株式会社海外资产管理部部长。

来肖贤先生，董事，硕士研究生。曾任申银万国证券股份有限公司国际业务总部投资分析师、部门副经理等。2004年加入申万菱信基金管理有限公司，曾任监察稽核部副总监、公司督察长、公司副总经理，现任公司总经理，兼任申万菱信（上海）资产管理有限公司董事。

白虹女士，独立董事，硕士研究生。曾任职于中国工商银行总行、韩国釜山分行、万事达卡国际组织、FEXCO国际商务等，2012年起任跨界创新平台（COIN）创始人兼CEO。

阎小平先生，独立董事，硕士研究生，高级经济师。1969年开始工作，1984年进入金融行业，曾先后任职于中国工商银行总行、工商银行北京市分行等。2009年1月起退休。

张军建先生，独立董事，博士研究生，教授。曾在四川外国语大学、日本长崎县立大学、日本千叶大学、早稻田大学任教；此后曾任职于日本菱南开发株式会社。2001年至今在中南大学任法学院教授，中日经济法研究所所长，中南大学信托与信托法研究中心主任；中国银行法学研究会常务理事；中美法律交流基金会信托法委员会副主席。

### 2、监事会成员

徐志斌先生，监事会主席，硕士研究生。曾任高盛集团环球控制部高级分析师、项目经理、团队经理，高盛集团运营风险管理部欧洲区负责人、总监、执行董事，高盛集团市场风险管理部执行董事，中国建银投资有限责任公司风险管理部业务总监、高级业务总监、负责人，宏源证券股份有限公司副总经理，申万宏源证券有限公司副总经理、首席风险官，现任申万宏源证券有限公司党委委员、副总经理，兼任投资交易事业部总经理，申银万国投资有限公司董事长、申银万国创新投资有限公司董事长。

糠信英树先生，监事，日本籍，大学学历。1988年4月至今任职于三菱UFJ信托银行株式会社（原三菱信托银行），曾任职于人事部、资产运用部、权益运用部、投资企划部，现任受托财产企划部副部长兼资产管理事业部室长。

牛锐女士，职工监事，博士研究生，曾任职于申银万国证券股份有限公司、中国证监会上海监管局、中金公司、国泰基金等公司。2013年加入申万菱信基金管理有限公司，曾任监察稽核部总监，现任综合办公室主任。

葛菲斐女士，职工监事，大学本科学历，2006年加入申万菱信基金管理有限公司，曾任职于行政管理总部，主要从事行政管理、人力资源相关工作，曾任人力资源总部总监助理，现任人力资源部负责人，兼任

申万菱信（上海）资产管理有限公司监事。

### 3、高级管理人员

刘郎先生，相关介绍见董事会成员部分。

来肖贤先生，相关介绍见董事会成员部分。

王伟先生，博士研究生。曾任职于申银万国证券股份有限公司。2003年加入申万巴黎基金管理有限公司筹备组，后正式加入申万菱信基金管理有限公司，历任市场部副总监、总监，首席市场官，现任公司副总经理。

张少华先生，硕士研究生。曾任职于申银万国证券股份有限公司。2003年1月加入申万巴黎基金筹备组，后正式加入申万菱信基金管理有限公司，历任风险管理总部高级风险分析师、总监，基金投资管理总部基金经理、副总监，投资管理总部总监、基金经理，现任公司副总经理。

张丽红女士，硕士研究生。曾任职于中国工商银行股份有限公司，申银证券股份有限公司，申银万国证券股份有限公司。2004年加入申万菱信基金管理有限公司，历任财务管理总部总监、首席财务官兼财务管理总部总监，现任公司副总经理。

王菲萍女士，硕士研究生。曾在申银万国证券股份有限公司总裁办任法律顾问等职务。2004年加入申万菱信基金管理有限公司，曾任监察稽核总部总监，现任公司督察长。

### 4、基金经理

叶瑜珍女士，硕士研究生。2005年加入申万菱信基金管理有限公司，历任风险分析师、信用分析师，基金经理助理等职务，现任申万菱信添益宝债券型证券投资基金、申万菱信可转换债券债券型证券投资基金，申万菱信收益宝货币市场基金、申万菱信安鑫优选混合型证券投资基金、申万菱信安鑫精选混合型证券投资基金基金经理。

周鸣女士，2011年12月至2013年7月任本基金基金经理。

### 5、投资决策委员会委员名单

本委员会由以下人员组成：总经理、公司分管投资的副总经理、权益研究部负责人、权益投资部负责人、量化投资部负责人、固定收益投资部负责人、指数与创新投资部负责人等。

公司总经理为本委员会主席，分管投资的副总经理为本委员会召集人，权益研究部负责人为本委员会秘书，负责协调统筹本委员会的各项事宜。

本公司董事长、督察长、监察稽核部负责人、风险管理部负责人作为非执行委员，有权列席本委员会的任何会议。非执行委员不参与投票表决。

### 6、上述人员之间不存在近亲属关系。

## 二、基金托管人

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：易会满

注册资本：人民币35,640,625.71万元

联系电话：010-66105799

联系人：郭明

## 三、相关服务机构

### （一）基金份额发售机构

#### 1、直销机构

申万菱信基金管理有限公司直销中心

住所：上海市中山南路 100 号 11 层  
法定代表人：刘郎  
电话：+86 21 23261188  
传真：+86 21 23261199  
联系人：陈继红  
客户服务电话：400 880 8588（免长途话费）或 +86 21 962299  
网址：www.swsmu.com  
电子邮件：service@swsmu.com

## 2、代销机构

(1)名称：中国工商银行股份有限公司  
住所：北京市西城区复兴门内大街 55 号  
办公地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号  
法定代表人：易会满  
客户服务电话：95588  
传真：010—66107738  
网址：www.icbc.com.cn

(2)名称：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：周慕冰  
客户服务电话：95599  
网址：www.abchina.com

(3)名称：中国建设银行股份有限公司  
法定代表人：王洪章  
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 号院 1 号楼  
联系人：王琳  
客户服务电话：95533  
传真：010-66275654  
网址：www.ccb.com

(4)名称：交通银行股份有限公司  
住所：上海市浦东新区银城中路 188 号  
办公地址：上海市银城中路 188 号  
法定代表人：牛锡明  
联系人：曹榕  
电话：021-58781234  
客户服务电话：95559  
网址：www.bankcomm.com

(5)名称：中信银行股份有限公司  
注册地址：北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座

办公地址：北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座

客服电话：95558

联系人：廉赵峰

传真：010-65550827

网址：bank.ecitic.com

(6)名称：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

传真：021-63604199

联系人：倪苏云、于慧

客户服务热线：95528

公司网站：www.spdb.com.cn

(7)名称：中国民生银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号

法定代表人：洪崎

客服电话：95568

联系人：王志刚

传真：010-58560666

网址：www.cmbc.com.cn

(8)名称：华夏银行股份有限公司

法定代表人：李民吉

办公地址：北京市东城区建国门内大街 22 号

联系人：王者凡

客户服务电话：95577

传真：010-85238680

网址：www.hxb.com.cn

(9)名称：平安银行股份有限公司

住所：深圳市深南东路 5047 号

注册办公所：广东省深圳市罗湖区深南东路 5047 号

法定代表人：孙建一

联系人：张莉

传真：021-50979507

客户服务电话：95511-3

网址：bank.pingan.com

(10)名称：上海农村商业银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路 8 号中融碧玉蓝天 15—20、22—27 层

法定代表人：冀光恒

客服电话：021-96 2999/4006 962 999

联系人：李晨

传真：021-50105124

网址：www.srcb.com

(11)名称：南京银行股份有限公司

注册地址：南京市白下区淮海路 50 号

办公地址：南京市白下区淮海路 50 号

法定代表人：林复

传真：025-84544129

联系人：翁俊

客户服务电话：4008896400

网址：www.njcb.com.cn

(12)名称：国泰君安证券股份有限公司

注册地址：中国(上海)自由贸易试验区商城路 618 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 168 号上海银行大厦 29 楼

法定代表人：杨德红

电话：021-38676666

传真：021-38670666

客户服务热线：95521

公司网站：www.gtja.com

(13)名称：中信建投证券股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址：北京市朝阳区门内大街 188 号

法定代表人：王常青

联系人：权唐

开放式基金咨询电话：400-8888-108

开放式基金业务传真：010-65182261

公司网站：www.csc108.com

(14)名称：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 号国信证券大厦十六层至二十六层

办公地址：深圳市罗湖区红岭中路 1010 号国际信托大厦 21 楼

法定代表人：何如

联系人：周杨

传真：0755-82133952

客户服务电话：95536

网址：www.guosen.com.cn

(15)名称：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

传真：0755-82943636

联系人：林生迎

客户服务热线：4008888111、95565

公司网站：www.newone.com.cn

(16)名称：广发证券股份有限公司

注册地址：广州天河区天河北路183-187号大都会广场43楼(4301-4316房)

办公地址：广东省广州天河北路大都会广场5、18、19、36、38、39、41、42、43、44楼

法定代表人：孙树明

联系人：黄岚

统一客户服务热线：95575 或致电各地营业网点

公司网站：广发证券网 www.gf.com.cn

(17)名称：中信证券股份有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座

办公地址：北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦

法定代表人：王东明

电话：010-60838888

传真：010-60833739

联系人：顾凌

网址：www.cs.ecitic.com

(18) 名称：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

客户服务热线：4008888888

传真：010-66568292

联系人：邓颜

公司网址：www.chinastock.com.cn

(19)名称：海通证券股份有限公司

注册地址：上海市淮海中路98号

办公地址：上海市广东路689号

法定代表人：王开国

联系人：金芸、李笑鸣

客户服务电话：400-8888-001(全国)，021-95553，或拨打各城市营业网点咨询电话

公司网站：www.htsec.com

(20) 名称：申万宏源证券有限公司

注册地址：上海市徐汇区长乐路989号45层

办公地址：上海市徐汇区长乐路989号45层

法定代表人：李梅

联系人：黄莹

电话：021-33389888

传真：021-33388224  
客服电话：95523 或 4008895523  
电话委托：021-962505  
公司网址：www.swhysc.com

(21)名称：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：崔少华  
联系人：奚博宇  
传真：027-85481900  
客户服务电话：95579 或 4008-888-999  
网址：www.95579.com

(22)名称：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  
办公地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元  
深圳市福田区深南大道 2008 号中国凤凰大厦 1 栋 9 层  
法定代表人：王连志  
传真：0755-82558355  
联系人：陈剑虹  
统一客服电话：4008001001  
公司网站地址：www.essence.com.cn

(23)名称：国元证券股份有限公司  
注册地址：安徽省合肥市寿春路 179 号  
法定代表人：凤良志  
传真：0551-2207965  
联系人：李蔡  
客户服务电话：400-8888-777，95578  
网址：www.gyzq.com.cn

(24)名称：华泰证券股份有限公司  
注册地址：南京市江东中路 228 号  
办公地址：南京市建邺区江东中路 228 号华泰证券广场、深圳市福田区深南大道 4011 号港中旅大厦 18 楼  
法定代表人：周易  
联系人：庞晓芸  
电话：0755-82492193  
传真：0755-82492962  
客服电话：95597  
网址：www.htsc.com.cn

(25)名称：中信证券(山东)有限责任公司  
注册地址：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼 20 层  
办公地址：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼 20 层

法定代表人：杨宝林  
客户服务电话：95548  
网址：www.zxwt.com.cn

(26)名称：东吴证券股份有限公司  
住所：苏州工业园区星阳街5号东吴证券大厦  
法定代表人：范力  
联系人：方晓丹  
电话：0512-65581136  
传真：0512-65588021  
客服电话：95330  
公司网址：www.dwzq.com.cn

(27)名称：信达证券股份有限公司  
注册地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼  
办公地址：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  
联系人：唐静  
客服电话：95321  
公司网址：www.cindasc.com

(28)名称：光大证券股份有限公司  
注册地址：上海市静安区新闻路1508号  
办公地址：上海市静安区新闻路1508号  
法定代表人：薛峰  
联系人：刘晨、李芳芳  
电话：021-22169999  
传真：021-22169134  
客户服务电话：95525  
公司网址：www.ebscn.com

(29)名称：广州证券股份有限公司  
注册地址：广州市天河区珠江西路5号广州国际金融中心主塔19层、20层  
办公地址：广州市天河区珠江西路5号广州国际金融中心主塔19层、20层  
法定代表人：邱三发  
联系人：梁微  
联系电话：020-88836999  
传真：020-88836654  
客户服务电话：95396  
网址：www.gzs.com.cn

(30)名称：上海证券有限责任公司  
住所：上海市黄浦区四川中路213号7楼  
法定代表人：李俊杰

联系电话：021-53686888  
客户服务电话：021-962518  
传真：021-53686100-7008，021-53686200-7008  
网址：www.962518.com

(31) 名称：国联证券股份有限公司  
注册地址：江苏省无锡市金融一街 8 号 7-9 层  
法定代表人：姚志勇  
联系人：沈刚  
传真：0510-82830162  
客户服务电话：95570  
网址：www.glsc.com.cn

(32) 名称：平安证券股份有限公司  
住所：深圳市福田区中心区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层  
办公地址：深圳市福田区中心区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层  
法定代表人：詹露阳  
客户服务电话：95511-8  
传真：0755-82435367  
网址：<http://stock.pingan.com>

(33) 名称：浙商证券股份有限公司  
注册地址：浙江省杭州市西湖区杭大路 1 号黄龙世纪广场 A 座  
办公地址：浙江省杭州市西湖区杭大路 1 号黄龙世纪广场 A 座 6、7 楼  
邮政编码：310007  
法定代表人：吴承根  
传真：021-80106010  
客服电话：95345  
网址：www.stocke.com.cn

(34) 名称：华西证券股份有限公司  
注册地址：四川省成都市高新区天府二街 198 号华西证券大厦  
办公地址：四川省成都市高新区天府二街 198 号华西证券大厦  
法定代表人：杨炯洋  
联系人：周志茹  
客户服务电话：95584 或 400 888 8818  
传真：028-86150040  
网址：<http://www.hx168.com.cn>

(35) 名称：申万宏源西部证券有限公司  
住所：新疆乌鲁木齐市高新区(新市区)北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼 2005 室  
办公地址：新疆乌鲁木齐市高新区(新市区)北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼 2005 室  
法定代表人：韩志谦  
联系人：王怀春

客户服务电话：4008-000-562

传真：010-88085195

网址：www.hysec.com

(36)名称：中泰证券股份有限公司

注册地址：山东省济南市市中区经七路 86 号

办公地址：山东省济南市市中区经七路 86 号

法定代表人：李玮

联系人：吴阳

电话：0531-68889155

传真：0531-68889185

客服电话：95538

网址：www.zts.com.cn

(37)名称：第一创业证券股份有限公司

住所：深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 15-20 楼

办公地址：深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 15-20 楼

法定代表人：刘学民

客户服务电话：95358

传真：0755-23838999

网址：www.fcsc.com.cn

(38)名称：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

法定代表人：王宜四

联系人：史江蕊

客服电话：400-8866-567

网址：www.avicsec.com

(39)名称：西部证券股份有限公司

注册地址：西安市东大街 232 号陕西信托大厦 16-17 层

法定代表人：刘建武

联系人：梁承华

传真：029-87406710

客户服务电话：95582

网站：www.westsecu.com

(40)名称：中国国际金融股份有限公司

住所：北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层

办公地址：北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层

法定代表人：丁学东

客户服务电话：4009101166

传真：010-85679203

网址：www.cicc.com.cn

(41)名称：上海华信证券有限责任公司

住所：上海市黄浦区南京西路 399 号明天广场 22 楼

办公地址：上海市黄浦区南京西路 399 号明天广场 22 楼

法定代表人：郭林

客户服务电话：4008205999

传真：021-68776977-8951

网址：[www.shhxzq.com](http://www.shhxzq.com)

(42)名称：中山证券有限责任公司

注册地址：深圳市南山区科技中一路西华强高新发展大楼 7 层、8 层

办公地址：深圳市南山区科技中一路西华强高新发展大楼 7 层、8 层

法定代表人：黄扬录

联系人：刘军

电话：0755-83734659

传真：0755-82960582

客户服务电话：4001-022-011

网址：[www.zszq.com](http://www.zszq.com)

(43)名称：联讯证券股份有限公司

住所：广东省惠州市惠城区江北东江三路惠州广播电视新闻中心三、四楼

办公地址：广东省惠州市惠城区江北东江三路惠州广播电视新闻中心三、四楼

法定代表人：徐刚

客户服务电话：95564

传真：010-2119660

网址：[www.lxsec.com](http://www.lxsec.com)

(44)名称：国金证券股份有限公司

办公地址：四川省成都市东城根上街 95 号

客服电话：95310

公司网址：[www.gjzq.com.cn](http://www.gjzq.com.cn)

联系人：刘婧漪、贾鹏

联系电话：028-86690057、028-86690058

传真号码：028-86690126

(45)名称：华宝证券有限责任公司

注册地址：中国(上海)自由贸易试验区世纪大道 100 号 57 层

办公地址：中国(上海)自由贸易试验区世纪大道 100 号 57 层

代表法人：陈林

联系人：刘闻川

传真：021-20515593

客服电话：400-820-9898

公司网址：[www.cnhbstock.com](http://www.cnhbstock.com)

(46)名称：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

办公地址：北京市朝阳区朝阳门北大街 18 号中国人保寿险大厦 12 层

法定代表人：祝献忠

联系人：李慧灵

联系电话：010-85556100

传真：010-58568062

客户服务电话：400-898-9999

网址：www.hrsec.com.cn

(47)名称：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 4 楼

办公地址：湖北省武汉市武昌区中南路 99 号保利广场 A 座 37 楼

法定代表人：余磊

联系人：杨晨

电话：027-87107535

传真：027-87618863

客服热线：4008005000

(48)名称：太平洋证券股份有限公司

住所：云南省昆明市青年路 389 号志远大厦 18 层

办公地址：北京市西城区北展北街 9 号华远企业号 D 座 3 单元

法定代表人：李长伟

客户服务电话：400-665-0999

传真：010-88321819

网址：www.tpyzq.com

(49)名称：开源证券股份有限公司

住所：西安市高新区锦业路 1 号都市之门 B 座 5 层

办公地址：西安市高新区锦业路 1 号都市之门 B 座 5 层

法定代表人：李刚

客户服务电话：400-860-8866

传真：029-81887060

网址：www.kysec.cn

(50)名称：申银万国期货有限公司

住所：上海市浦东新区东方路 800 号宝安大厦 7、8、10 楼

办公地址：上海市浦东新区东方路 800 号宝安大厦 7、8、10 楼

法定代表人：李建中

客户服务电话：400-888-7868

传真：021-50586045

网址：www.sywgqh.com

(51)名称：深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

注册地址：深圳市福田区华强北路赛格科技园 4 栋 10 层 1006#  
办公地址：北京市西城区宣武门外大街 28 号富卓大厦 16 层  
法定代表人：杨懿  
联系人：张燕  
客服电话：400-166-1188  
网址：8.jrj.com.cn

(52)名称：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  
传真：021-20835879  
客服电话：400-920-0022/ 021-20835588  
网址：licaikexun.com

(53)名称：诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司  
注册地址：上海市金山区廊下镇漕廊公路 7650 号 205 室  
法定代表人：汪静波  
联系人：方成  
传真：021-38509777  
客户服务电话：400-821-5399  
网址：www.noah-fund.com

(54)名称：深圳众禄基金销售股份有限公司  
注册地址：深圳市罗湖区深南东路 5047 号发展银行大厦 25 楼 I、J 单元  
办公地址：深圳市罗湖区梨园路 8 号 HALO 广场 4 楼  
法定代表人：薛峰  
联系人：童彩平  
电话：0755-33227950  
传真：0755-82080798  
客户服务电话：4006-788-887  
网址：众禄基金网 www.zlfund.cn，基金买卖网 www.jjmmw.com

(55)名称：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 190 号 2 号楼 2 层  
办公地址：上海市徐汇区宛平南路 88 号金座  
法定代表人：其实  
联系人：潘世友  
电话：021-54660526  
传真：021-54660501  
客户服务电话：400-1818-188  
网址：www.1234567.com.cn

(56)名称：上海好买基金销售有限公司  
注册地址：上海市虹口区欧阳路 196 号 26 号楼 2 楼 41 号

办公地址：上海市浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 903-906 室

法定代表人：杨文斌

联系人：张茹

客服电话：400-700-9665

公司网址：www.ehowbuy.com

(57) 蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

住所：杭州市余杭区仓前街道文一西路 1218 号 1 栋 202 室

办公地址：浙江省杭州市西湖区万塘路 18 号黄龙时代广场 B 座 6F

法定代表人：陈柏青

联系人：韩爱彬

客服电话：4000-766-123

公司网址：www.fund123.cn

(58)名称：上海长量基金销售投资顾问有限公司

注册地址：上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室

办公地址：上海市浦东新区浦东大道 555 号裕景国际 B 座 16 层

法定代表人：单丙焯

传真：021-20691861

客服电话：400-089-1289

公司网站：www.erichfund.com

(59)名称：浙江同花顺基金销售有限公司

注册办公地址：杭州市西湖区文二西路 1 号元茂大厦 903 室

法定代表人：凌顺平

联系人：杨翼

传真：0571-88910240

客户服务电话：4008-773-772，0571-88920897

网站：www.5ifund.com

(60)名称：北京展恒基金销售股份有限公司

注册地址：北京市顺义区后沙峪镇安富街 6 号

办公地址：北京市朝阳区安苑路 15-1 号邮电新闻大厦 2 层

法定代表人：闫振杰

联系人：马林

电话：010-59601366-7024

传真：010-62020355

客服电话：4008188000

网址：www.myfund.com

(61)名称：上海利得基金销售有限公司

注册地址：上海市宝山区蕴川路 5475 号 1033 室

办公地址：上海浦东新区峨山路 91 弄 61 号 10 号楼 12 楼

法定代表人：李兴春

联系人：赵沛然  
电话：86-021-50583533  
传真：86-021-50583633  
客户服务电话：400-921-7755

(62)名称：宜信普泽投资顾问（北京）有限公司  
注册地址：北京市朝阳区建国路 88 号 9 号楼 15 层 1809  
办公地址：北京市朝阳区建国路 88 号 SOHO 现代城 C 座 1809  
法定代表人：沈伟桦  
联系人：程刚  
客户服务电话：400-6099-200  
网址：[www.yixinfund.com](http://www.yixinfund.com)

(63)名称：众升财富（北京）基金销售有限公司  
注册地址：北京市朝阳区望京东园四区 13 号楼 A 座 9 层 908 室  
法定代表人：李招娣  
联系人：李艳  
联系电话：010-59497361  
传真：010-64788016  
客服电话：400-876-9988  
网址：[www.zscffund.com](http://www.zscffund.com)

(64)名称：北京恒天明泽基金销售有限公司  
注册地址：北京市经济技术开发区宏达北路 10 号五层 5122 室  
办公地址：北京市朝阳区亮马桥路 39 号第一上海中心 C 座 6 层  
法定代表人：梁越  
联系人：马鹏程  
电话：86-010-58845304  
传真：86-021-58845306  
客户服务电话：4008-980-618  
网址：[www.chtfund.com](http://www.chtfund.com)

(65) 名称：一路财富（北京）信息科技股份有限公司  
注册地址：北京市西城区阜成门外大街 2 号 1 幢 A2208 室  
办公地址：北京市西城区阜成门外大街 2 号 1 幢 A2208 室  
法定代表人：吴雪秀  
联系人：段京璐  
电话：010-88312877  
传真：010-88312099  
客户服务电话：400-001-1566  
网址：<http://www.yilucaifu.com/>

(66)名称：北京钱景基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区丹棱街 6 号 1 幢 9 层 1008-1012

办公地址：北京市海淀区丹棱街 6 号 1 幢 9 层 1008-1012

法定代表人：赵荣春

联系人：高静

电话：010-59158281

传真：010-57569671

客户服务电话：400-893-6885

网址：[www.qianjing.com](http://www.qianjing.com)

(67)名称：上海联泰资产管理有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区富特北路 277 号 3 层 310 室

办公地址：上海市长宁区福泉北路 518 号 8 号楼 3 层

法定代表人：燕斌

联系人：陈东

电话：021-52822063

传真：021-52975270

客服电话：4000-466-788

网址：<http://www.66zichan.com>

(68)名称：上海汇付基金销售有限公司

注册地址：上海市黄浦区中山南路 100 号 19 层

办公地址：上海市宜山路 700 号普天信息产业园 2 期 C5 栋汇付天下总部大楼 2 楼

法定代表人：金佶

联系人：陈云卉

电话：021-33323999

传真：8621-33323837

客户服务电话：400 820 2819

手机客户端：天天盈基金

网址：[www.chinapnr.com](http://www.chinapnr.com)

(69) 名称：深圳富济财富管理有限公司

注册地址：深圳市福田区福田街道金田路中洲大厦 35 层 01B、02、03、04 单位

办公地址：深圳市福田区福田街道金田路中洲大厦 35 层 01B、02、03、04 单位

法定代表人：刘鹏宇

联系人：刘勇

电话：0755-83999907-8814

传真：0755-83999926

客户服务电话：0755-83999907

网址：[www.jinqianwo.cn](http://www.jinqianwo.cn)

(70)名称：上海陆金所基金销售有限公司

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元

法定代表人：郭坚

客户服务电话：400-821-9031

传真：021-22066653

网址：www.lufunds.com

(71)名称：大泰金石基金销售有限公司

住所：南京市建邺区江东中路 222 号南京奥体中心现代五项馆 2105 室

办公地址：上海市浦东新区峨山路 505 号东方纯一大厦 15 楼

法定代表人：袁顾明

客户服务电话：4009282266

传真：021-20324199

网址：www.dtfunds.com

(72)名称：珠海盈米财富管理有限公司

住所：珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室-3491

办公地址：广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 12 楼 B1201-1203

法定代表人：肖雯

客户服务电话：020-89629066

传真：020-89629011

网址：www.yingmi.cn

(73)北京肯特瑞财富投资管理有限公司

注册地址：北京市海淀区中关村东路 66 号 1 号楼 22 层 2603-06

办公地址：北京市亦庄经济开发区科创十一街 18 号院京东集团总部 A 座 17 层

法定代表人：陈超

联系人：赵德赛

电话：18600280556

传真：010-89188000

客户服务电话：4000988511

网址：<http://fund.jd.com/>

(74)名称：中民财富基金销售（上海）有限公司

注册地址：上海市黄浦区中山南路 100 号 07 层

办公地址：上海市黄浦区中山南路 100 号 17 层

法定代表人：弭洪军

客户服务电话：400-876-5716

传真：021-63353736

网址：www.cmiwm.com

(75)北京汇成基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108

办公地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108

法定代表人：王伟刚

联系人：李瑞真

电话：010-56282140

传真：010-62680827

客户服务电话：400-619-9059

网址：www.hcjijin.com

（76）北京蛋卷基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507

办公地址：北京市朝阳区阜通东大街望京SOHO T3 A座19层

法定代表人：钟斐斐

联系人：袁永姣

电话：010-61840688

传真：010-61840699

客户服务电话：4000-618-518

网址：www.danjuanapp.com

（77）上海大智慧基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路428号1号楼1102单元

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路428号1号楼1102、1103单元

法定代表人：申健

联系人：印强明

电话：021-20219988

传真：021-20219923

客户服务电话：021-20292031

网址：www.wg.com.cn

（78）南京苏宁基金销售有限公司

注册地址：南京市玄武区苏宁大道1号

办公地址：南京市玄武区苏宁大道1号

法定代表人：刘汉青

联系人：王锋

电话：025-66996699-887226

传真：

客户服务电话：95177

网址：www.snjijin.com

（79）上海基煜基金销售有限公司

注册地址：上海市崇明县长兴镇路潘园公路1800号2号楼6153室（上海泰和经济发展区）

办公地址：上海市浦东新区银城中路488号太平金融大厦1503室

法定代表人：王翔

联系人：吴鸿飞

电话：021-65370077

传真：021-55085991

客户服务电话：4008-205-369

网址：www.jiyufund.com.cn

(80) 上海挖财基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 799 号 5 层 01、02、03 室

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 799 号 5 层 01、02、03 室

法定代表人：冷飞

联系人：李娟

电话：021-50810687

传真：021-58300279

客户服务电话：021-50810673

网址：www.wacaijijin.com

App：挖财宝

(二) 基金注册登记机构

申万菱信基金管理有限公司

注册地址：上海市中山南路 100 号 11 层

法定代表人：刘郎

电话：+86 21 23261188

传真：+86 21 63353879

联系人：李濮君

(三) 律师事务所和经办律师

律师事务所：通力律师事务所

注册地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

负责人：韩炯

电话：+86-21-31358666

传真：+86-21-31358600

联系人姓名：安冬

经办律师：吕红、安冬

(四) 会计师事务所和经办注册会计师

会计师事务所：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

注册地址：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：上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

法定代表人姓名：杨绍信

电话：+86 -21-23238888

传真：+86-21-23238800

联系人姓名：赵钰

经办注册会计师姓名：薛竞、赵钰

四、基金的名称

本基金名称：申万菱信可转换债券债券型证券投资基金

五、基金的类型

本基金的类型：契约型开放式

## 六、基金的投资范围

本基金投资于流动性良好的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、权证、资产支持证券以及中国证监会允许基金投资的其它金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。

本基金投资的固定收益类证券主要包括国债、央行票据、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、可转换债券（包含可分离交易可转债）、回购等；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等。

本基金投资于固定收益类证券的比例不低于基金资产的 80%，其中对可转换债券（包含可分离交易可转债）的投资比例不低于基金固定收益类证券资产的 80%；投资于股票和权证等非固定收益类证券的比例不高于基金资产的 20%；投资于现金或到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。

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。

## 七、基金的投资策略

本基金的投资策略分三个层次：第一个层次是大类资产配置，主要是确定基金资产在债券、股票、现金等资产间的配置比例；第二个层次是债券类属资产投资策略，主要是确定基金投资与可转债和普通债的券种和比例；第三个层次是指权益类资产投资策略。

### 1、大类资产配置

在大类资产的配置上，本基金管理人一方面采用自上而下宏观分析方法研究宏观经济基本面状况和关注各时期政策面的变化；另一方面采用自下而上的市场分析方法研究证券市场资产结构、投资者结构和市场风险溢价水平，以此来动态调整基金资产在债券、股票、现金等大类资产间的配置比例。

本基金自上而下的宏观分析将通过宏观经济运行状况、国家财政和货币政策研究把握这些宏观因子对企业盈利、风险预测、通胀预测和利率汇率等重要金融变量的影响，以此来判定各类资产的风险收益水平；自下而上的市场分析则主要通过对证券市场资产结构、投资者结构及风险溢价水平分析，从市场自身规律角度判断各类资产未来走势。

在对宏观经济与市场运行趋势进行综合判断后，确定债券、股票及现金的资金配置比例，考虑到宏观因子和市场面因子的不断变化，本基金将每季度定期对各大类资产的配置策略进行调整，当遇到重大市场变动和政策变动时，本基金将及时评估该事件对本基金资产配置的影响以便相应对资产配置策略做出调整，优化各大类资产的配置比例。

### 2、债券类资产配置策略

本基金将债券类资产细分为可转债（包含传统可转债和可分离交易可转债）、普通债券（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债及短期融资券等）。

可转债券种选择上，将可转债的纯债价值、到期收益率、纯债收益率、转换价值、转股溢价率和其正股基本面状况作为其是否纳入本基金投资组合的主要考察内容。

普通债券券种的选择上，本基金主要采用目标久期策略、收益率分析策略、基于市场信用利差曲线策略、基于信用债本身的信用分析策略等方法对债券市场、债券收益率水平、各债券价格变化及信用债的信用利差进行预测，合理配置，与此同时通过把握跨市场回购交易、息差套利及回购掉期等无风险套利机会增加盈利。

#### （1）可转债投资策略

本基金重点投资品种为可转债，故可转债的投资策略是本基金的核心策略。

可转债是在一定条件下，投资人具有转股和回售权利的债券，是一种兼具债性和股性的混合证券，具有抵御市场下跌风险，同时可分享股市上涨收益的特点。影响可转债价值的因素主要包括：债性指标（纯债价

值、到期收益率、纯债溢价率)和股性指标(转换价值、转股溢价率和正股基本面)。本基金在进行可转债投资时将根据不同市场环境下可转债自身的股性特征、债性特征、流动性等基本要素,判断其股性和债性的相对价值,把握其价值走向,精选个券,从而获取较高的收益,具体的可转债投资策略包括传统可转债的投资策略和可分离交易可转债的投资策略。

#### 1) 传统可转债投资策略

##### 可转债正股基本面分析策略

本基金管理人将充分利用自身的股票研究平台,采用定性分析和定量分析相结合的分析方法对可转债正股的未来成长潜力、公司竞争优势、公司治理结构、估值水平等基本因子进行深入分析,精选出未来具有良好成长潜力且估值合理的正股,然后通过计算可转债的转换价值和转股溢价率等股性指标判断其估值是否合理,如果可转债估值合理,则重点配置该券种,以获得其正股上涨带来的收益。当股票市场处于牛市或震荡向上的行情时,可转债的股性突出,因此对可转债的正股基本面、转换价值及转股溢价率的分析将是该阶段的重要策略。

##### 可转债债性分析策略

当股票市场处于熊市或震荡向下的行情时,可转债的正股价格会持续下跌,悲观的市场情绪会导致可转债所含看涨期权价值严重低估,此时可转债的债性会很明显的体现出来,即可转债的纯债溢价率很低,纯债价值和到期收益率会很高,投资可转债的安全度很高。本基金通过买入纯债溢价率低,纯债价值和到期收益率高的可转债,并长期持有,以获得稳定的投资回报。

##### 可转债条款投资策略

一般情况下,可转债本身会附加的提前赎回条款、回售条款及向下修正股价条款,在一定环境下这些条款对可转债的投资价值有很大影响。

提前赎回条款是指在可转债存续期内,当可转债正股价格连续一段时间高于其转股价格一定幅度时,可转债发行公司有权按照高于债券面值一定幅度的赎回价格赎回全部或部分未转股的可转债,该条款是赋予可转债发行方的一个权利。提前赎回的条件往往可以视为可转债的价值最大限度,本基金将会在接近提前赎回条件触发的时候,理性分析可转债正股的基本面状况及未来走势,以选择抛出或转股出售或转股持有。

提前回售条款是指在可转债存续期内,如果可转债正股价格连续一段时间内低于转股价格一定幅度或者可转债发行方改变募集资金投资用途时,可转债持有人有权将其持有的可转债全部或部分按照高于可转债面值一定幅度的价格回售给可转债的发行公司,该条款是赋予可转债持有人的一个权利。本基金将通过可转债及其正股投资价值的合理分析,以选择是否行使该项权利。

转股价格向下修正条款是指在可转债存续期间内,当一段时间内正股价格持续低于转股价达到一定程度,则可转债发行方董事会可发起向下修正转股价的提议,通过向下修正转股价而大幅提高可转债的转股价值,从而提升可转债价值,也为该转债未来可能出现较好表现提供支撑,这也有效地降低了正股可能较大幅下跌给转债带来的损失,因此提前对此进行合理的判断将提升组合投资价值。除此之外,当可转债发行方发生送红股、转增股本、增发新股、配股以及派发股利等情况时,可转债发行方会对可转债的转股价格作出相应调整,本公司可以通过对相关事件及正股基本面的分析,把握可能存在的投资机会。

##### 可转债低风险套利策略

由于可转债可以按照约定的价格转换为股票,故当可转债的转股溢价率为负时,买入可转债的同时卖出标的股票既可以获得无风险套利收益,反之,当可转债转股溢价率为正时,亦可买入股票的同时卖出可转债以获得无风险套利机会。本基金将在日常的交易过程中,密切关注可转债和正股之间可能的套利机会,在对预期转股收益率有明确判断的情况下,把握套利时机,以增强组合收益。

##### 可转债不同阶段投资策略

可转债与股票类似,包含一级市场的发行阶段和二级市场的存续阶段。本基金将会积极参与发行条款较好、公司基本面优秀的可转债的一级市场申购,上市后根据个券的具体情况做出持有或买出的决定;同时本基金也会综合运用上述多种可转债投资策略在不同的存续阶段进行不同二级市场投资操作,在承担预期较小风险的前提下,获取预期较高的投资回报。

## 2) 可分离交易可转债投资策略

可分离交易可转债是指一类在上市后债券部分跟权证部分实行分离交易的可转债品种。

在可分离交易可转债权证方面，本基金如果通过申购可分离交易可转债而获得部分权证，本基金将根据对其投资价值的判断采取相应的投资策略。

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，以及分析可分离转债纯债跟股市之间的相关性，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。

## (2) 普通债券投资策略

### 1) 国债、央票、金融债投资策略

#### 目标久期策略

本基金管理人通过对经济增长、通货膨胀、财政政策指标、货币政策指标等金融变量的分析，结合市场资金供求结构的研究，预测未来不同期限债券的利率变化的方向、幅度和时间。

根据预期利率水平的变化，确定基金投资组合的目标久期。预期利率水平上升时，则降低组合目标久期，以规避债券价格下降的风险；预期利率水平下降时，则增加组合目标久期，以更多的分享债券价格上升带来的收益。

#### 收益率分析策略

在确定组合目标久期的基础上，本基金管理人通过分析预期收益率曲线可能发生的变化，在期限结构配置上适当采用子弹型策略、哑铃型策略及阶梯型策略，以优化组合在长期、中期和短期债券间的配置，使本基金未来获得较好的收益。

### 2) 信用债投资策略

#### 基于市场信用利差曲线的策略

市场信用利差曲线的变动主要取决于两个方面：其一是宏观经济环境的变化，当宏观经济环境良好时，企业盈利能力提升，现金流充裕，市场信用利差曲线便会收窄，反之则不然；其二是信用债市场容量、信用债结构、流动性等市场因子的变化趋势，当这些因素导致信用债市场供需关系发生变化时，便会影响到市场信用利差曲线的变动。本基金将综合考虑上述因子，预测信用债的市场信用利差水平，以动态调整信用债的投资比例。

#### 基于信用债本身的信用分析策略

本基金基于信用债本身的信用分析策略主要是通过建立信用评级体系分析信用债的信用风险。研究员将根据债券发行人自身状况的变化，包括公司产权状况、法人治理结构、管理水平、经营状况、财务质量、抗风险能力等变化对信用级别产生的影响综合评价债券发行人信用风险，评价债券的信用级别。同时，本基金管理人通过分析任意时间段不同债券的历史利差情况，并且能够统计出历史利差的均值和波动度，挖掘相对价值被低估的信用债券。

### 3) 套利策略

#### 跨市场回购交易的套利操作

适当把握交易所和银行间回购市场之间的套利机会，在银行间通过正回购低价融入资金，然后择机在交易所高价放出，从而在不占用自身资金的情况下，来获取相对低风险的套利收益。

#### 息差套利策略

利用回购利率低于债券收益率的情形，通过正回购将所获得的资金投资于债券的策略。实际上就是杠杆放大策略。在进行放大策略操作时，必须考虑回购资金成本与债券收益率之间的关系。只有当债券收益率高于回购资金成本（即回购利率）时，该策略才能取得正的收益。

#### 回购掉期的套利操作

即利用不同期限回购利率的差异，在连续借入短期资金的同时，放出长期限资金，以获取无风险的利差收益。

### 3、权益类资产投资策略

#### (1) 一级市场新股申购策略

为保证新股发行成功，一般一级市场新股价格较二级市场价格存在一定折价，在中国证券市场发展进程中，新股申购是一种预期风险较低的投资方式。本基金将利用公司股票研究平台研究新股公司的基本面，估计其合理价格，判断是否参与其的一级市场申购。在新股申购时，本基金将充分利用新股询价制度，通过深入的研究及与股票发行人和承销商的充分交流和沟通，确定合理的股票价格区间，参与申购，以获得良好的投资收益。

#### (2) 二级市场股票投资策略

本基金对二级市场的股票投资旨在为投资者提供适度参与股票市场，并获取一定收益的机会。

本基金对二级市场股票的投资主要按照如下三步进行：

1) 充分利用本基金管理人投研团队平台，以其重点关注、长期跟踪并质地优良的公司作为本基金的基本股票池；

2) 通过对基本股票池中股票价值和成长性的分析，筛选价值被低估且未来成长潜力大的公司，作为本基金股票投资组合；

3) 对本基金股票投资组合的动态监测，即使调整股票组合，以保证所投资股票的质量。

#### (3) 二级市场权证投资策略

本基金将通过对权证标的证券基本面的研究，并结合权证定价模型计算权证价值。本基金权证操作将根据权证的高杠杆性、有限损失性、灵活性等特性结合本基金的需要进行该产品的投资。主要考虑运用的策略包括：限量投资、趋势投资、优化组合策略、价差策略、双向权证策略等。

### 八、业绩比较基准

天相转债指数收益率×70%+沪深300指数收益率×10%+中债总指数（全价）收益率×20%。

### 九、风险收益特征

本基金为债券型基金，属于证券投资基金中风险较低的品种，其预期平均风险和预期收益率均低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。但由于本基金重点投资于可转换债券，故属于债券基金中风险较高的品种。

### 十、基金投资组合报告

本投资组合报告所载数据截止日为2018年3月31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 2,684,100.00 4.35

其中：股票 2,684,100.00 4.35

2 固定收益投资 56,235,409.36 91.23

其中：债券 56,235,409.36 91.23

资产支持证券 --

3 贵金属投资 --

4 金融衍生品投资 --

5 买入返售金融资产 --

其中：买断式回购的买入返售金融资产 --

6 银行存款和结算备付金合计 2,198,074.88 3.57

7 其他各项资产 524,889.56 0.85

8 合计 61,642,473.80 100.00

注：本基金未开通港股通交易机制投资于港股。

## 2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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 --

B 采矿业 --

C 制造业 1,789,800.00 2.98

D 电力、热力、燃气及水生产和供应业 --

E 建筑业 --

F 批发和零售业 --

G 交通运输、仓储和邮政业 --

H 住宿和餐饮业 --

I 信息传输、软件和信息技术服务业 --

J 金融业 490,200.00 0.82

K 房地产业 404,100.00 0.67

L 租赁和商务服务业 --

M 科学研究和技术服务业 --

N 水利、环境和公共设施管理业 --

O 居民服务、修理和其他服务业 --

P 教育 --

Q 卫生和社会工作 --

R 文化、体育和娱乐业 --

S 综合 --

合计 2,684,100.00 4.47

### 2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金未开通港股通交易机制投资于港股。

## 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投资明细

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 601009 南京银行 60,000.00 490,200.00 0.82

2 002078 太阳纸业 40,000.00 440,000.00 0.73

3 002271 东方雨虹 10,000.00 410,600.00 0.68

4 600048 保利地产 30,000.00 404,100.00 0.67

5 600183 生益科技 20,000.00 354,800.00 0.59

6 002008 大族激光 6,000.00 328,200.00 0.55

7 002236 大华股份 10,000.00 256,200.00 0.43

## 4 报告期末按债券品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 3,150,630.00 5.25

2 央行票据 --

3 金融债券 --

其中：政策性金融债 --

4 企业债券 --

5 企业短期融资券 --

6 中期票据 --

7 可转债（可交换债） 53,084,779.36 88.39

8 同业存单 --

9 其他 --

10 合计 56,235,409.36 93.64

5 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债券投资明细

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 113011 光大转债 45,000.00 4,881,600.00 8.13

2 110032 三一转债 38,000.00 4,376,840.00 7.29

3 128024 宁行转债 30,000.00 3,447,600.00 5.74

4 113013 国君转债 30,000.00 3,246,000.00 5.41

5 019563 17 国债 09 31,500.00 3,150,630.00 5.25

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序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。

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股指期货交易情况说明

9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

根据本基金基金合同，本基金不得参与股指期货交易。

9.2 本基金投资股指期货的投资政策

根据本基金基金合同，本基金不得参与股指期货交易。

10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

10.1 本基金投资国债期货的投资政策

根据本基金基金合同，本基金不得参与国债期货交易

10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

根据本基金基金合同，本基金不得参与国债期货交易

10.3 本基金投资国债期货的投资评价

根据本基金基金合同，本基金不得参与国债期货交易

11 投资组合报告附注

11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有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。

11.2 基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

11.3 其他各项资产构成

序号 名称 金额(元)

1 存出保证金 6,208.01

2 应收证券清算款 347,999.65

3 应收股利 -

4 应收利息 170,383.81

5 应收申购款 298.09

6 其他应收款 -

7 待摊费用 -

8 其他 -

9 合计 524,889.56

#### 11.4 报告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(元) 占基金资产净值比例(%)

1	113011	光大转债	4,881,600.00	8.13
2	110032	三一转债	4,376,840.00	7.29
3	113013	国君转债	3,246,000.00	5.41
4	110033	国贸转债	3,137,292.90	5.22
5	132005 15	国资 EB	2,597,859.70	4.33
6	110030	格力转债	2,513,160.00	4.18
7	128015	久其转债	2,512,980.00	4.18
8	128016	雨虹转债	2,456,370.00	4.09
9	113010	江南转债	2,284,260.00	3.80
10	132004 15	国盛 EB	1,848,200.00	3.08
11	113009	广汽转债	1,086,800.00	1.81
12	113008	电气转债	1,006,100.00	1.68
13	132006 16	皖新 EB	991,500.00	1.65
14	128010	顺昌转债	569,250.00	0.95
15	113012	骆驼转债	83,352.90	0.14

#### 11.5 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。

#### 十一、基金的业绩

本基金的过往业绩不代表未来表现。

##### 1. 净值增长率与业绩比较基准收益率比较：

阶段 基金份额净值增长率① 基金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

2011年12月09日至2011年12月31日 0.20% 0.03% -0.77% 0.39% 0.97% -0.36%

2012年 4.19% 0.33% 3.23% 0.35% 0.96% -0.02%

2013年 3.43% 0.92% -2.08% 0.57% 5.51% 0.35%

2014年 78.75% 1.29% 44.88% 0.83% 33.87% 0.46%

2015年 -4.10% 2.77% -15.87% 2.34% 11.77% 0.43%

2016年 -18.66% 0.74% -8.38% 0.60% -10.28% 0.14%

2017年 -1.07% 0.42% 0.55% 0.33% -1.62% 0.09%

2018年1月1日至2018年03月31日 -1.39% 0.74% 2.31% 0.62% -3.70% 0.12%

自基金合同生效起至2018年03月31日 46.88% 1.33% 15.23% 1.07% 31.65% 0.26%

注：上述基金业绩指标已扣除了基金的管理费、托管费和各项交易费用，但不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如：申购费、赎回费等），计入认购或交易基金的各项费用后，实际收益水平要低于所列数字。

##### 2. 自基金合同生效以来基金累计份额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

申万菱信可转换债券债券型证券投资基金

累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

（2011年12月9日至2018年03月31日）

#### 十二、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和律师费和诉讼费；
  - 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 0.70% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.70\% \div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计提，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前 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、公休日等，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前 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“一、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、基金销售服务费率等相关费率。

调高基金管理费率、基金托管费率或基金销售服务费率等费率，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服务费率等费率，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和基金管理人网站上公告。

## （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。

## 十三、对招募说明书本次更新部分的说明

本招募说明书（更新）依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集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》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及其它有关法律法规的要求，并根据基金管理人在《基金合同》生效后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、更新了重要提示中部分信息以及本招募说明书内容的截止日期；
- 2、更新了绪言中部分信息；
- 3、新增了释义中“流动性管理规定”、“流动性受限资产”、“摆动定价机制”的释义；
- 4、更新了基金管理人的部分信息；
- 5、更新了基金托管人的部分信息；
- 6、更新了相关服务机构的部分信息；
- 7、更新了基金份额的申购与赎回的部分信息；
- 8、更新了投资范围的部分信息；
- 9、更新了投资限制的部分信息；
- 10、更新了投资组合报告，数据截止日期为 2018 年 3 月 31 日；
- 11、更新了基金的业绩部分，数据截止日期为 2018 年 3 月 31 日；
- 12、更新了基金资产估值的部分信息；
- 13、更新了基金的信息披露的部分信息；
- 14、更新了风险揭示的部分信息；
- 15、更新了基金合同的内容摘要的部分信息；
- 16、更新了基金托管协议的内容摘要的部分信息；
- 17、在“其他应披露事项”一章，列举了本基金自 2017 年 12 月 10 日至 2018 年 6 月 9 日发布的有关公告。

以上内容仅为摘要，须与本《招募说明书》（更新）（正文）所载之详细资料一并阅读。