

# 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

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

二〇一九年十二月

## 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 2019 年 5 月 30 日，有关财务数据和基金净值表现截止日为 2019 年 3 月 31 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 50%）、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%）三家公司。

法定代表人：吴庆斌

电话：0755-83183388

传真：0755-83199588

联系人：肖剑

#### （二）主要人员情况

##### 1. 董事会成员

吴庆斌先生，董事长，清华大学法学及工学双学士。先后任职于西南证券飞虎网、北京国际信托有限责任公司、广联（南宁）投资股份有限公司等机构。2012年7月至今，任广联（南宁）投资股份有限公司董事长；2012年任职于中泰信托有限责任公司，2013年6月至今，任中泰信托有限责任公司董事长。2019年11月3日起任大成基金管理有限公司董事长。

翟斌先生，副董事长，北京大学经济学硕士。曾在深圳市建材集团、君安证券、新华信托、招商证券股份有限公司等多家机构任职，2017年8月加入光大证券股份有限公司，历任机构业务总部董事总经理、机构业务总部总经理兼私募业务部总经理，现任光大证券股份有限公司机构业务总部总经理。2019年11月3日起任大成基金管理有限公司副董事长。

谭晓冈先生，董事、总经理，哈佛大学公共管理硕士。曾在财政部、世界银行、全国社保基金理事会任职。2016年7月加入大成基金管理有限公司，2016年12月至2019年8月任大成国际资产管理有限公司总经理，2017年2月至2019年6月任大成基金管理有限公司副总经理，2019年7月起任大成基金管理有限公司总经理，2019年8月起任大成国际资产管理有限公司董事长。

李超女士，董事，华中科技大学管理学学士。2007年6月至2008年5月，任职于深圳晨星咨询有限责任公司；2008年7月至2011年8月，任德勤华永会计师事务所高级审计员；2011年8月至2018年5月，任平安信托有限责任公司稽核监察部模型团队团队经理；2018年5月至今，任中泰信托有限责任公司稽核审计部总经理。

郭向东先生，董事，中国人民大学金融学在职研究生。1996年至1998年在中国新技术创业投资公司负责法律事务；1998年至2000年在中国华融信托投资公司负责法律事务；2000年至2006年任职于中国银河证券有限责任公司法律部；2007年1月加入中国银河投资管理有限公司，任职于负债处置部；2007年7月至2013年2月，历任人力资源部负责人、风险控制部总经理、监事会办公室主任、审计部负责人，曾兼任北京银河吉星创业投资有限责任公司监事；2013年2月起任资产管理部总经理兼行政负责人。

杨晓帆先生，独立董事，香港浸会大学工商管理学士。2006年至2011年，任惠理集团有限公司高级投资分析师兼投资组合经理；2012年至2016年，任FALCON EDGE CAPITAL LP 合伙人和大中华区负责人；2016年至今，任晨曦投资管理公司(ANATOLE INVESTMENT MANAGEMENT) 主要创始人。

胡维翊先生，独立董事，波士顿大学国际银行与金融法硕士。1991年7月至1994年4月，任全国人大常委会办公厅研究室政治组主任科员；1994年5月至1998年8月，任北京

乾坤律师事务所合伙人；2000年2月至2001年4月任北京市中凯律师事务所律师；2001年5月至今，历任北京市天铎律师事务所副主任、主任，现任北京市天铎律师事务所合伙人。

金李先生，独立董事，美国麻省理工学院金融学博士。现任北京大学光华管理学院副院长，九三学社中央常委，全国政协委员，经济委员会委员。曾在美国哈佛大学商学院任教十多年，并兼任哈佛大学费正清东亚研究中心执行理事。

黄隽女士，独立董事，中国人民大学经济学博士。现任中国人民大学应用经济学院教授、副院长。研究方向为货币政策、商议银行理论与政策、艺术品金融，出版多本专著，在经济、金融类学术核心期刊上发表多篇学术论文，具有丰富的教学和科研经验。

## 2. 监事会成员

许国平先生，监事会主席，中国人民大学国民经济学博士。1987年至2004年先后任中国人民银行国际司处长，东京代表处代表，研究局调研员，金融稳定局体改处处长；2005年6月至2008年1月任中央汇金投资有限责任公司建行股权管理部主任；2005年8月至2016年11月任中国银河金融控股有限责任公司董事、副总经理、党委委员；2007年2月至2016年11月任中国银河投资管理有限公司董事长、总裁、党委书记；2010年6月至2014年3月兼任北京银河吉星创业投资有限责任公司董事长；2007年1月至2015年6月任中国银河证券股份有限公司董事；2014年1月至2017年6月任银河基金管理有限公司党委书记；2014年3月至2018年1月任银河基金管理有限公司董事长（至2017年11月）及法定代表人；2018年3月加入大成基金管理有限公司，任监事会主席。

邓金煌先生，职工监事，上海财经大学管理学硕士。2001年9月至2003年9月任职于株洲电力局；2003年9月至2006年1月攻读硕士学位；2006年4月至2010年5月任华为三康技术有限公司人力资源专员；2010年5月至2011年9月任招商证券人力资源部高级经理；2011年9月至2016年8月任融通基金管理有限公司综合管理部总监助理；2016年8月加入大成基金管理有限公司，任人力资源部副总监；现任大成基金管理有限公司人力资源部总监。

陈焱女士，职工监事，吉林大学法学硕士。2005年8月至2008年3月任金杜律师事务所深圳分所公司证券部律师；2008年3月加入大成基金管理有限公司，历任监察稽核部律师、总监助理；现任大成基金管理有限公司监察稽核部副总监。

## 3. 高级管理人员情况

吴庆斌先生，董事长。简历同上。

谭晓冈先生，总经理。简历同上。

肖剑先生，副总经理，哈佛大学公共管理硕士。曾任深圳市南山区委（政府）办公室副主任，深圳市广聚能源股份有限公司副总经理兼广聚投资控股公司执行董事、总经理，深圳市人民政府国有资产监督管理委员会副处长、处长。2014年11月加入大成基金管理有限公司，2015年1月起任公司副总经理，2019年8月起任大成国际资产管理有限公司总经理。

温智敏先生，副总经理，哈佛大学法学博士。曾任职于美国 Hunton & Williams 国际律师事务所纽约州执业律师。中银国际投行业务副总裁，香港三山投资公司董事总经理，标准银行亚洲有限公司董事总经理兼中国投行业务主管。2015年4月加入大成基金管理有限公司，任首席战略官，2015年8月起任公司副总经理。

周立新先生，副总经理兼首席信息官，中央党校经济管理本科。曾任新疆精河县党委办公室机要员、新疆精河县团委副书记、新疆精河县人民政府体改委副主任、新疆精河县八家户农场党委书记、新疆博尔塔拉蒙古自治州团委副书记及少工委主任、江苏省铁路发展股份有限公司办公室主任、江苏省铁路发展股份有限公司控股企业及江苏省铁路实业集团有限公司控股企业负责人、中国华闻投资控股有限公司燃气战略管理部项目经理。2005年1月加入大成基金管理有限公司，历任客户服务中心总监助理、市场部副总经理、上海分公司副总经理、客户服务部总监兼上海分公司总经理、公司助理总经理，2015年8月起任公司副总经理，2019年5月起兼任首席信息官。

姚余栋先生，副总经理，英国剑桥大学经济学博士。曾任职于原国家经贸委企业司、美国花旗银行伦敦分行。曾任世界银行咨询顾问，国际货币基金组织国际资本市场部和非洲部经济学家，原黑龙江省招商局副局长，黑龙江省商务厅副厅长，中国人民银行货币政策二司副巡视员，中国人民银行货币政策司副司长，中国人民银行金融研究所所长。2016年9月加入大成基金管理有限公司，任首席经济学家，2017年2月起任公司副总经理。

赵冰女士，督察长，清华大学工商管理硕士。曾供职于中国证券业协会资格管理部、专业联络部、基金公司会员部，曾任中国证券业协会分析师委员会委员、基金销售专业委员会委员。曾参与基金业协会筹备组的筹备工作。曾先后任中国证券投资基金业协会投教与媒体公关部负责人、理财及服务机构部负责人。2017年7月加入大成基金管理有限公司，2017年8月起任公司督察长。

### （三） 基金经理

#### （1） 现任基金经理

李富强：经济学硕士，证券从业年限5年。2009年7月至2013年12月任中国银行间

市场交易商协会市场创新部高级助理。2014年1月至2017年7月任北信瑞丰基金管理有限公司固定收益部基金经理。2017年7月加入大成基金管理有限公司，任职于固定收益总部。2018年7月16日起任大成强化收益定期开放债券型证券投资基金、大成景丰债券型证券投资基金（LOF）、大成景益平稳收益混合型证券投资基金、大成可转债增强债券型证券投资基金、大成景利混合型证券投资基金、大成景盛一年定期开放债券型证券投资基金、大成月月盈短期理财债券型证券投资基金基金经理。2018年11月16日起任大成景禄灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2019年6月12日起任大成景润灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2019年9月26日起任大成中债1-3年国开行债券指数证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。2019年11月25日起任大成通嘉三年定期开放债券型证券投资基金基金经理。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
王磊	2013年11月9日—2016年3月25日
赵世宏	2017年6月6日—2018年7月20日

#### （四）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7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6名。名单如下：

谭晓冈，公司总经理，固定收益投资决策委员会主席；姚余栋，公司副总经理，固定收益投资决策委员会委员；王立，基金经理，固定收益总部总监，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；陈会荣，基金经理，固定收益投资决策委员会委员；方孝成，基金经理，固定收益投资决策委员会委员；杨艳林，研究员，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）基金托管人基本情况

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：陈四清

注册资本：人民币 34,932,123.46 万元

联系电话：010-66105799

联系人：郭明

#### （二）主要人员情况

截至 2018 年 12 月，中国工商银行资产托管部共有员工 202 人，平均年龄 33 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、基本养老保险、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 2018 年 12 月，中国工商银行共托管证券投资基金 923 只。自 2003 年以来，本行连续十五年获得香港《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 64 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。2005、2007、2009、2010、2011、2012、2013、2014、2015、2016、2017、2018 共十二次顺利通过评估组织内部控制和安全措施最权威的 ISAE3402 审阅，获得无保留意见的控制及有效性报告。充分表明独立第三方对中国工商银行托管服务

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、不同岗位相互制衡的组织结构。

(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》、基金合同、托管协议和有关基金法规的规定，基金托管人对基金的投资范围和投资对象、基金投融资比例、基金投资禁止行为、基金参与银行间债券市场、基金资产净值的计算、基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等进行监督和核查，其中对基金的投资比例的监督和核查自基金合同生效之后六个月开始。

基金托管人发现基金管理人违反《基金法》、基金合同、基金托管协议或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，并以书面形式对基金托管人发出回函确认。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。基金管理人对于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存在重大违规行为，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：吴庆斌

电话：0755-83183388

传真：0755-83199588

联系人：教姣

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：吴海灵、关志玲、白小雪

电话：0755-2223556/2223177/2223555

传真：0755-83195235/83195242/83195232

邮编：518040

## 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

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

法定代表人：陈四清

客服电话：95588

联系人：洪渊

联系电话：010-66105799

传真：010-66107914

网址：www.icbc.com.cn

### 2、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

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9

法定代表人：周慕冰

联系人：贺倩

联系电话：010-66060069

传真：010-68121816

客服电话：95599

网址：[www.abchina.com](http://www.abchina.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

办公地址：北京西城区复兴门内大街1号

法定代表人：刘连舸

客服电话：95566

联系人：王永民

电话：010-66594896

传真：010-66594942

网址：[www.boc.cn](http://www.boc.cn)

4、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：田国立

联系人：王嘉朔

电话：010-66275654

传真：010-66275654

客服电话：95533

网址：[www.ccb.com](http://www.ccb.com)

5、交通银行股份有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区银城中路188号

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区银城中路188号

法定代表人：彭纯

客服电话：95559

联系人：曹榕

电话：021-58781234

传真：021-58408483

网址：[www.bankcomm.com](http://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

办公地址：深圳市福田区深南大道 7088 号

法定代表人：李建红

客服电话：95555

联系人：邓炯鹏

电话：0755-83077278

传真：0755-83195049

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

7、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：高天、虞谷云

客服热线：95528

电话：021-61618888

传真：021-63604199

网址：[www.spdb.com.cn](http://www.spdb.com.cn)

8、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：张东宁

联系人：周黎

电话：010-66224815

传真：010-66226045

客服电话：95526

网址：[www.bankofbeijing.com.cn](http://www.bankofbeijing.com.cn)

9、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

办公地址：上海市黄浦区中山东二路 70 号

法定代表人：冀光恒

客服电话：021-962999、400-696-2999

电话：021-61899999

传真：021-50105124

联系人：施传荣

网址：www.shrcb.com

10、北京农村商业银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区月坛南街1号院2号楼

办公地址：北京市西城区月坛南街1号院2号楼

法定代表人：王金山

联系人：董汇

联系电话：010-85605588

传真：010-66506163

客服电话：96198

网址：www.bjrcb.com

11、浙商银行股份有限公司

注册地址：杭州市庆春路288号

法定代表人：沈仁康

联系人：唐燕

客户服务热线：95105665

电话：0571-87659056

传真：0571-87659188

网址：www.czbank.com

12、杭州银行股份有限公司

办公地址：杭州庆春路46号

法定代表人：吴太普

联系人：严峻

联系电话：0571-85108309

客服电话：95398

网址：www.hzbank.com.cn

13、渤海银行股份有限公司

注册地址：天津市河东区海河东路218号

法人代表 李伏安

客服电话：95541

联系人：王宏

电话：022-58316666

传真：022-58316259

网址：<http://www.cbhb.com.cn>

14、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](http://www.bankofluoyang.com.cn)

15、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：李格格

电话：0411-82356627

传真：0411-82311420

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

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：遇玺

联系电话：0451-86779018

传真：0451-86779007

客服电话：95537

公司网址：www.hrbb.com.cn

17、郑州银行股份有限公司

注册地址：郑州市郑东新区商务外环路 22 号

法定代表人：王天宇

客服电话：967585(河南地区)，4000-967585（全国）

网址：www.zzbank.cn

18、四川天府银行股份有限公司

注册地址：四川省南充市涪江路 1 号

法定代表人：邢敏

办公地址：四川省南充市涪江路 1 号

客服热线：40016-96869

公司网址：www.tf.cn

19、晋城银行股份有限公司

注册地址：山西省晋城市文昌西街 1669 号

办公地址：山西省太原市高新区高新街联合大厦

法定代表人：贾沁林

联系人：朱丹

联系电话：18734835708

客服电话：95105757

网址：www.jccb.com.cn

20、中信期货有限公司

注册地址：深圳市福田区中信三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 13 层 1301-1305 室、  
14 层

办公地址：深圳市福田区中信三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 13 层 1301-1305 室、  
14 层

法定代表人：张皓

联系人：刘宏莹

联系电话：010-60833754

传真：0755-83217421



客服电话：400-990-8826

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

21、徽商期货有限责任公司

注册地址：合肥市芜湖路 258 号

法人代表人：吴国华

联系人：蔡芳

传真：0551-62862801

客服电话：4008878707

网址：<http://www.hsqh.net>

22、东海期货有限责任公司

注册地址：江苏省常州市延陵西路 23、25、27、29 号

办公地址：上海市浦东新区东方路 1928 号东海证券大厦 8 楼

法定代表人：陈太康

联系人：李天雨

联系电话：021-68757102

客服电话：95531/4008888588

网址：[www.qh168.com.cn](http://www.qh168.com.cn)

23、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

客服电话：95521

联系人：芮敏祺、朱雅崑

联系电话：021-38676666

传真：021-38670161

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

24、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

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

25、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

法定代表人：何如

客服电话：95536

联系人：周杨

电话：0755-82130833

传真：0755-82133952

网址：www.guosen.com.cn

26、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：黄婵君

电话：0755-82960167

传真：0755-82943636

网址：www.newone.com.cn

27、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

法定代表人：张佑君

客服电话：010-84588888

联系人：顾凌

电话：010-60838696

传真：010-84865560

网址：www.cs.ecitic.com

28、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 2-6 层

法定代表人：陈共炎

客服电话：4008-888-888

联系人：辛国政

联系电话：010-83574507

传真：010-83574807

网址：[www.chinastock.com.cn](http://www.chinastock.com.cn)

29、海通证券股份有限公司

注册地址：上海市广东路 689 号

法定代表人：周杰

客服电话：95553、400-888-8001

联系人：李笑鸣

电话：021-23219000

传真：021-63602722

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

30、申万宏源证券有限公司

通讯地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 40 层

法定代表人：李梅

客服电话：95523 或 4008895523

联系人：曹晔

电话：021-54033888

传真：021-54038844

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

31、兴业证券股份有限公司

住所：福州市湖东路 268 号

办公地址：上海市浦东新区长柳路 36 号

法定代表人：杨华辉

电话：021-38565547

联系人：乔琳雪

网址：[www.xyzq.com.cn](http://www.xyzq.com.cn)

客户服务电话：95562

32、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：杨泽柱

客户服务热线：95579、4008-888-999

联系人：奚博宇

电话：027-65799999

传真：027-85481900

网址：www.95579.com

33、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：王连志

客服电话：95517

联系人：陈剑虹

电话：0755-82825551

传真：0755-82558355

网址：www.essence.com.cn

34、湘财证券股份有限公司

注册地址：湖南省长沙市天心区湘府中路 198 号新南城商务中心 A 栋 11 楼

办公地点：湖南省长沙市天心区湘府中路 198 号新南城商务中心 A 栋 11 楼

法定代表人：孙永祥

电话：021-38784580-8918

传真：021-68865680

联系人：李欣

邮编：410004

客服电话：95351

公司网址：www.xcsc.com

35、万联证券有限责任公司

注册地址：北京市海淀区北三环西路 99 号院 1 号楼 15 层 1501

法定代表人：张建军

联系人：王鑫

联系电话：020-38286651

客服电话：400-8888-133

网址：[www.wlzq.com.cn](http://www.wlzq.com.cn)

### 36、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.msza.com](http://www.msza.com)

### 37、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：王春峰

联系人：蔡霆

电话：022-28451991

传真：022-28451892

客服电话：4006515988

网址：[WWW.EWWW.COM.CN](http://WWW.EWWW.COM.CN)

### 38、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 1 号楼 2001

办公地址：青岛市市南区东海西路 28 号龙翔广场东座 5 层

法定代表人：姜晓林

客服电话：95548

联系人：焦刚

电话：0531-89606166

传真：0532-85022605

网址：<http://sd.citics.com/>

### 39、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

客服电话：4008008899

联系人：唐静

联系电话：010-63081000

传真：010-63080978

公司网址：www.cindasc.com

40、东方证券股份有限公司

注册地址：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

客服电话：95503

联系人：胡月茹

电话：021-63325888

传真：021-63326173

网址：www.dfzq.com.cn

41、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：徐锦福

电话：010-57398062

传真：010-57398058

网址：www.foundersc.com

42、长城证券股份有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 16-17 层

法定代表人：曹宏

联系人：金夏

电话：0755-83516289

传真：-83515567

客户服务热线：400-666-6888

网址：www.cgws.com

43、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：周健男

客服电话：95525

联系人：龚俊涛

电话：021-22169999

传真：021-22169134

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

44、广州证券股份有限公司

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：邱三发

客服电话：95396

联系人：林洁茹

联系电话：020-87322668

传真：020-87325036

网址：[www.gzs.com.cn](http://www.gzs.com.cn)

45、东北证券股份有限公司

注册地址：长春市生态大街 6666 号

办公地址：长春市生态大街 6666 号

法定代表人：李福春

客服电话：95360

联系人：安岩岩

电话：0431-85096517

传真：0431-85096795

网址：[www.nesc.cn](http://www.nesc.cn)

46、南京证券股份有限公司

办公地址：南京市玄武区大钟亭 8 号

法定代表人：步国旬

客服电话：95386

联系人：石健

电话：025-83367888

传真：025-83364032

网址：[www.njzq.com.cn](http://www.njzq.com.cn)

47、上海证券有限责任公司

注册地址：上海市黄浦区四川中路 213 号久事商务大厦 7 楼

法定代表人：李俊杰

客服电话：021-962518，4008918918

联系人：许曼华

电话：021-53519888

传真：021-63608830

网址：[www.962518.com](http://www.962518.com)

48、平安证券股份有限公司

办注册地址：深圳市福田区益田路 5033 号平安金融中心 61 层-64 层

法定代表人：何之江

客户服务热线：95511-8

联系人：王阳

电话：021-38632136

传真：021-58991896

网址：<http://stock.pingan.com>

49、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：蔡一兵

客户服务热线：0731-84403333 400-88-35316

联系人：郭磊

传真：0731-84403439

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

50、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

51、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：95377

联系人：程月艳 李盼盼 党静

联系电话:0371--69099882

联系传真: 0371--65585899

网址：www.ccnew.com

52、国都证券股份有限公司

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：王少华

客服电话：400-818-8118

联系人：黄静

电话：010-84183333

传真：010-84183311-3389

网址：www.guodu.com

53、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

联系人：梁旭

电话：021-20333333

传真：021-50498825

网址：www.longone.com.cn

54、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：徐丽峰

联系人：周欣玲

电话：0791-86281305、13803512671

传真：0791-86281305

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

55、申万宏源西部证券有限公司

注册地址：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

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

电话：010-88085858

传真：010-88085195

联系人：李巍

客服电话：400-800-0562

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

56、中泰证券股份有限公司

办公地址：山东省济南市经十路 20518 号

法定代表人：李玮

客服电话：95538

联系人：吴阳

电话：0531-81283938

传真：0531-81283900

网址：[www.qlzq.com.cn](http://www.qlzq.com.cn)

57、第一创业证券股份有限公司

地址：深圳市罗湖区笋岗路 12 号中民时代广场 B 座 25F

法人代表：刘学民

电话：95358

网址：[www.firstcapital.com.cn](http://www.firstcapital.com.cn)

58、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：王宜四

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](http://www.avicsec.com)

59、中国国际金融有限公司

注册地址：北京市建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层

办公地址：北京市建国门外大街甲 6 号 SK 大厦

法定代表人：丁学东

联系人：杨涵宇

电话：010-65051166

网址：[www.ciccs.com.cn](http://www.ciccs.com.cn)

60、上海华信证券有限责任公司

注册地址：上海浦东新区世纪大道 100 号环球金融中心 9 楼

法定代表人：郭林

客服电话：4008205999

联系人：李颖

电话：021-38784814

传真：021-68774818

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

61、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：俞洋

联系人：陈敏

网站：[www.cfsc.com.cn](http://www.cfsc.com.cn)

客服电话：021-32109999、029-68918888、4001099918

62、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：010-58328373

传真：010-58328748

联系人：冯爽

客服电话：400-887-8827

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

63、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：高涛

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](http://www.china-invs.cn)

64、中山证券有限责任公司

公司名称：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大厦7层、8层

办公地址：深圳市南山区科技中一路西华强高新大厦7层、8层

法定代表人：林炳城

电话：0755-82943755

传真：0755-82960582

客户服务电话：95329

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

65、联讯证券股份有限公司

注册地址：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

法人代表：徐刚

联系人：郭晴

联系电话：0752-2119391

客服电话：95564

网址：[www.lxzq.com.cn](http://www.lxzq.com.cn)

66、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：0451-85863726

客服热线：400662288

联系人：周俊

网址：[www.jhzq.com.cn](http://www.jhzq.com.cn)

67、九州证券股份有限公司

注册地址：青海省西宁市南川工业园区创业路 108 号

办公地址：北京市朝阳区安立路 30 号仰山公园东一门 2 号楼

法人代表人：魏先锋

电话：010-57672000

传真：010-57672296

统一客服电话：95305

68、国金证券股份有限公司

注册地址：成都市东城根上街 95 号

客服电话：4006600109

联系人：刘婧漪

电话：028-86690057

传真：028-86690126

客服电话：95310

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

69、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

客服电话：400-820-9898

联系人：刘闻川

电话：021-68778075

传真：021-68868117

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

70、爱建证券有限责任公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道1600号1幢32楼

法定代表人：钱华

客服电话：4001-962-502

联系人：陈敏

电话：021-32229888

传真：021-62878783

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

71、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：李慧灵

联系电话：010-58315221

传真：010-58568062

客服电话：010-58568118、400-898-9999

网址：[www.hrsec.com.cn](http://www.hrsec.com.cn)

72、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

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

73、宏信证券有限责任公司

办公地址：四川省成都市人民南路二段 18 号川信大厦 10 楼

法人代表人：吴玉明

客服电话：4008366366

联系人：刘文涛

电话：02886199765

传真：02886199533

网址：<http://www.hx818.com>

74、联储证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区福田街道岗厦社区深南大道南侧金地中心大厦 9 楼

办公地址：北京市朝阳区安定路 5 号院 3 号楼中建财富国际中心 27 层联储证券

法定代表人：吕春卫

联系人：丁倩云

联系电话：010-86499427 13051859661

传真：0755-23947482

客服电话：400-620-6868

网址：<http://www.lczq.com/>

75、阳光人寿保险股份有限公司

注册地址：海南省三亚市迎宾路 360-1 号三亚阳光金融广场 16 层

办公地址：北京市朝阳区朝阳门外大街乙 12 号院 1 号昆泰国际大厦 12 层

法定代表人：李科

电话：010-85632771

传真：010-85632773

联系人：王超

客服热线：95510

公司网站：<http://fund.sinosig.com/>

76、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：尹伶

传真：010-66045527

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

77、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号

法定代表人：杨懿

办公地址：深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006号

联系人：张燕

联系电话：010-58325388\*1588

网站：[www.new-rand.cn](http://www.new-rand.cn)

客服电话：400-166-1188

78、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：刘洋

联系电话：021-20835785

传真：021-20835879

客服电话：400-920-0022

网址：<http://licaike.hexun.com>

79、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楼01、02、03室

法定代表人：冷飞

客服电话：021-50810673

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

80、北京百度百盈基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区上地十街10号1幢1层101

办公地址：北京市海淀区信息路甲9号奎科大厦

法人代表：张旭阳

公告联系人：杨琳

公告电话：010-61952702

公告传真：010-61951007



客服电话：95055-9

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

81、诺亚正行基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区飞虹路360弄9号3724室

法定代表人：汪静波

办公地址：上海市杨浦区昆明路508号北美广场B座12楼

联系人：徐诚

联系电话：021-38509639

网站：[www.noah-fund.com](http://www.noah-fund.com)

客服电话：400-821-5399

82、深圳众禄基金销售股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区笋岗街道梨园路物资控股置地大厦8楼801

法定代表人：薛峰

联系人：童彩平

电话：0755-33227950

传真：0755-82080798

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

客服电话：4006-788-887

83、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：潘世友

电话：021-54509998

传真：021-64383798

客服电话：400-1818-188

网址：[www.1234567.com.cn](http://www.1234567.com.cn)

84、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](http://www.ehowbuy.com)

85、蚂蚁(杭州)基金销售有限公司

注册地址：浙江省杭州市西湖区万塘路18号黄龙时代广场B座6F

法人代表：陈柏青

联系人：韩爱彬

电话：021-60897840

传真：0571-26697013

客服电话：4000-766-123

网址：[www.fund123.cn](http://www.fund123.cn)

86、上海长量基金销售有限公司

办公地址：上海市浦东新区东方路1267号11层

法定代表人：张跃伟

客服电话：4008202899

联系人：邱燕芳

电话：021-20691931

传真：021-20691861

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

87、浙江同花顺基金销售有限公司

注册地址：杭州市西湖区文二西路1号元茂大厦903室

办公地址：浙江省杭州市西湖区翠柏路7号电子商务产业园2号楼

法人代表：凌顺平

联系人：林海明

电话：0571-88911818-8580

传真：0571-88911818-8002

客服电话：4008-773-772

网站地址：[www.5ifund.com](http://www.5ifund.com)

## 88、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：上海市浦东新区峨山路 91 弄 61 号 1 幢 14 层

法定代表人：李兴春

传真：021-50583633

电话：021-50583533

客服电话：400-921-7755

网址：[www.leadfund.com.cn](http://www.leadfund.com.cn)

## 89、嘉实财富管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心办公楼二期 53 层 5312-15 单元

法定代表人：赵学军

电话：010-65215588

传真：010-85712195

联系人：李雯

联系人邮箱：[liwen@harvestwm.cn](mailto:liwen@harvestwm.cn)

客服电话：400-021-8850

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

## 90、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 1-5 号

办公地址：南京市玄武区苏宁大道 1-5 号

法定代表人：王锋

客服电话：95177

网址：<https://www.snjjin.com/>

## 91、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：北京市朝阳区东三环北路甲 19 号 SOHO 嘉盛中心 30 层 3001 室

法定代表人：周斌

客服电话：4008980618

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

## 92、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

法定代表人：王伟刚

联系人：丁向坤

电话：010-56282140

传真：010-62680827

客服电话：400-619-9059

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

93、北京晟视天下投资管理有限公司

注册地址：北京市怀柔区九渡河镇黄坎村 735 号 03 室

法定代表人：蒋煜

联系人：孙悦

电话：010-58170823

传真：010-58170800

客服电话：400-818-8866

网址：<http://fund.shengshiview.com>

94、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 号中关村金融大厦（丹棱 soho）1008

法定代表人：赵荣春

联系人：魏争

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

客服电话：400-893-6885

95、上海万得基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区福山路 33 号 11 楼 B 座

办公地址：上海市浦东新区浦明路 1500 号万得大厦 11 楼

法定代表人：黄祎

联系人：徐亚丹

联系电话：021-50712782

传真：021-50710161

客服电话：400-799-1888

网址：[www.520fund.com.cn](http://www.520fund.com.cn)

96、上海联泰基金销售有限公司

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 座 3 层

邮编：200335

法定代表人：燕斌

联系人：兰敏

电话：021-52822063

传真：021-52975270

客服电话：400-166-6788

公司网址：[www.66zichan.com](http://www.66zichan.com)

97、泰诚财富基金销售（大连）有限公司

注册地址：辽宁省大连市沙河口区星海中路 3 号

法定代表人：林卓

联系人：张晓辉

电话：0411-88891212

传真：0411-84396536

客服电话：400-6411-999

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

98、上海基煜基金销售有限公司

住所：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：上海市杨浦区昆明路 518 号 a1002 室

法定代表人：王翔

联系人：安彬

客服电话：400-820-5369

网址：[www.jiyufund.com.cn](http://www.jiyufund.com.cn)

99、上海凯石财富基金销售有限公司

注册地址：上海市黄浦区西藏南路 765 号 602-115 室

法定代表人：陈继武

客服电话：400-643-3389

联系人：葛佳蕊

电话：021-63333319

传真：021-63332523

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

100、上海中正达广基金销售有限公司

注册地址：上海市徐汇区龙腾大道 2815 号 302 室

办公地址：上海市徐汇区龙腾大道 2815 号 3 楼

法定代表人：黄欣

公司电话：021-3376 8132

客服电话：400-6767-523

网址：<http://www.zhongzhengfund.com>

101、武汉市伯嘉基金销售有限公司

注册地址：湖北省武汉市江汉区武汉中央商务区泛海国际 SOHO 城（一期）第 7 栋 23 层 1 号、4 号

法定代表人：陶捷

联系人：杨帆

电话：027-87006003、87006009

网站：[www.buyfunds.cn](http://www.buyfunds.cn)

公司传真：027-87006010

客服电话：400-027-9899

102、上海陆金所基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元

法定代表人：王之光

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元

联系人：宁博宇

客服电话：4008219031

网站：[www.lufunds.com](http://www.lufunds.com)

103、珠海盈米基金销售有限公司

注册地址：珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室-3491

法定代表人：肖雯

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

联系人：黄敏嫦

网站：www.yingmi.cn

客服电话：020-89629066

104、和耕传承基金销售有限公司

注册地址：河南自贸试验区郑州片区（郑东）东风南路东康宁街北6号楼5楼503房间

办公地址：北京市朝阳区酒仙桥路6号院国际电子城b座

法定代表人：王旋

客服电话：4000-555-671

网址：<http://www.hgccpb.com/>

105、奕丰基金销售有限公司

注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室（入住深圳市前海商务秘书有限公司）

办公地址：深圳市南山区海德三路航天科技广场A座17楼1704室

法定代表人：TEO WEE HOWE

联系人：叶健

电话：0755-89460507

传真：0755-21674453

客服电话：400-684-0500

网址：[www.ifastps.com.cn](http://www.ifastps.com.cn)

106、深圳市金斧子基金销售有限公司

注册地址：深圳市南山区粤海街道科技园中区科苑路15号科兴科学园B栋3单元11层

办公地址：深圳市南山区粤海街道科苑路科兴科学园B3单元7楼

法定代表人：赖任军

联系人：刘昕霞

电话：0755-29330513

传真：0755-26920530

客服电话：400-9302-888

网址：<https://www.jfz.com/>

107、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

法定代表人：钟斐斐

客服电话：4000618518

联系人：袁永娇

电话：010-61840688

传真：010-61840699

网址：<https://danjuanapp.com>

108、上海华夏财富投资管理有限公司

注册地址：上海市虹口区东大名路 687 号 1 幢 2 楼 268 室

法定代表人：毛淮平

办公地址：北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B8 层

客服热线：400-817-5666

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

基金管理人可根据有关法律、法规的要求，选择其他符合要求的机构代理销售本基金，并及时公告。

## （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：吴庆斌

电话：0755-83183388

传真：0755-83195239

联系人：黄慕平

## （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：沈娜、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：中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路 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

执行事务合伙人：李丹

电话：021-23238888

传真：021-23238800

联系人：陈薇瑶

经办注册会计师：张振波、陈薇瑶

#### **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**

契约型开放式

#### **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（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。

## 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2019年6月24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2019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	2,468,553.50	7.80
	其中：股票	2,468,553.50	7.80
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	28,195,741.16	89.07
	其中：债券	28,195,741.16	89.07
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	768,279.87	2.43
8	其他资产	223,210.24	0.71
9	合计	31,655,784.77	100.00

### 2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### (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	461,320.00	1.74
C	制造业	467,740.00	1.77
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	108,900.00	0.41
E	建筑业	974,871.00	3.68

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	455,722.50	1.72
K	房地产业	-	-
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	2,468,553.50	9.33

(2) 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合  
无。

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	601186	中国铁建	43,200	497,232.00	1.88
2	601390	中国中铁	65,700	477,639.00	1.80
3	601766	中国中车	51,400	467,740.00	1.77
4	601857	中国石油	60,700	461,320.00	1.74
5	601128	常熟银行	60,763	455,722.50	1.72
6	601985	中国核电	18,000	108,900.00	0.41

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	5,108,826.50	19.30
	其中：政策性金融债	5,108,826.50	19.30
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）	23,086,914.66	87.23
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	28,195,741.16	106.53



## 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	113011	光大转债	30,420	3,494,345.40	13.20
2	132009	17 中油 EB	30,060	3,063,114.00	11.57
3	018009	国开 1803	20,000	2,150,000.00	8.12
4	018005	国开 1701	19,250	1,925,192.50	7.27
5	127010	平银转债	16,240	1,921,679.20	7.26

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  
无。

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  
无。

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  
无。

## 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

无。

## (2) 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

## (3) 本期国债期货投资评价

无。

## 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出现本期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。

1、本基金投资的前十名证券之一光大转债（113011.SH）的发行主体中国光大银行股份有限公司于 2018 年 11 月 9 日因以误导方式违规销售理财产品等，受到中国银行保险监督管理委员会处罚（银保监银罚决字〔2018〕10 号）。本基金认为，对光大银行的处罚不会对其投资价值构成实质性负面影响。

2、本基金投资的前十名证券之一平银转债（127010.SZ）的发行主体平安银行股份有限公司于 2018 年 7 月 26 日因未按照规定履行客户身份识别义务等，受到中国人民银行处罚（银反洗罚决字〔2018〕2 号）。本基金认为，对平安银行的处罚不会对其投资价值构成实质性负面影响。

(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	4,336.50
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	217,611.57
5	应收申购款	1,262.17
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	223,210.24

(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	113011	光大转债	3,494,345.40	13.20
2	132009	17 中油 EB	3,063,114.00	11.57
3	132013	17 宝武 EB	1,786,225.00	6.75
4	128027	崇达转债	1,387,386.00	5.24
5	113015	隆基转债	1,278,691.20	4.83
6	128016	雨虹转债	1,189,792.80	4.50
7	113018	常熟转债	1,182,727.00	4.47
8	128035	大族转债	1,021,435.50	3.86
9	123002	国祯转债	614,300.00	2.32
10	128024	宁行转债	614,150.00	2.32
11	110040	生益转债	517,760.10	1.96
12	110038	济川转债	472,925.30	1.79
13	110041	蒙电转债	466,889.00	1.76
14	128044	岭南转债	432,424.96	1.63

(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

(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2019年3月31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：

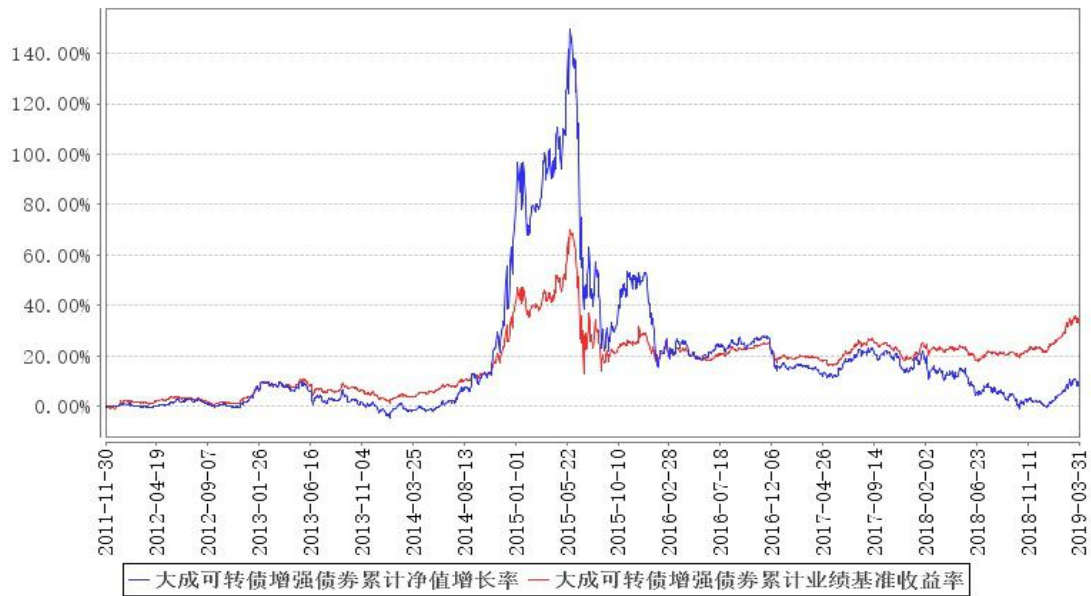
阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差 ②	业绩比较 基准收益 率 ③	业绩比 较基准 收益率 标准差 ④	①-③	②-④
2011.11.30—2011.12.31	0.20%	0.03%	-0.16%	0.29%	0.36%	-0.26%
2012.01.01—2012.12.31	2.99%	0.20%	4.21%	0.21%	-1.22%	-0.01%
2013.01.01—2013.12.31	-4.15%	0.54%	-0.60%	0.39%	-3.55%	0.15%
2014.01.01—2014.12.31	79.80%	1.38%	36.64%	0.64%	43.16%	0.74%
2015.01.01—2015.12.31	-16.86%	2.87%	-10.54%	1.89%	-6.32%	0.98%
2016.01.01—2016.12.31	-21.77%	0.94%	-5.59%	0.43%	-16.18%	0.51%
2017.01.01—2017.12.31	-0.44%	0.48%	-0.54%	0.29%	0.10%	0.19%
2018.01.01—2018.12.31	-13.06%	0.79%	2.57%	0.37%	-15.63%	0.42%
2019.01.01—2019.03.31	9.58%	0.66%	10.61%	0.57%	-1.03%	0.09%
2011.11.30—2019.03.31	9.72%	1.30%	34.67%	0.80%	-24.95%	0.50%

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2019年3月31日）

大成可转债增强债券累计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



注：本基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。建仓期结束时，本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

#### 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

本更新的招募说明书依据《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》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《流动性风险管理规定》及其他有关法律法规的要求，并根据本基金管理人对本基金实施的投资经营活动，对 2019 年 7 月 12 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(2019 年第 1 期)》进行了内容补充和更新,本更新的招募说明书主要更新的内容如下：

根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》，更新了“一、绪言”、“二、释义”、“三、基金管理人”、“七、基金份额的申购与赎回”、“十三、基金收益与分配”、“十四、基金的会计与审计”、“十五、基金的信息披露”、“十八、基金合同内容摘要”、十九、基金托管协议内容摘要”。

大成基金管理有限公司

2019 年 12 月 17 日