

建信转债增强债券型证券投资基金(A类份额)

基金产品资料概要更新

编制日期：2021年7月23日

送出日期：2021年7月30日

本概要提供本基金的重要信息，是招募说明书的一部分。

作出投资决定前，请阅读完整的招募说明书等销售文件。

一、产品概况

基金简称	建信转债增强债券	基金代码	530020
下属基金简称	建信转债增强债券A	下属基金代码	530020
基金管理人	建信基金管理有限责任公司	基金托管人	中国民生银行股份有限公司
基金合同生效日	2012年5月29日	上市交易所及上市日期	-
基金类型	债券型	交易币种	人民币
运作方式	普通开放式	开放频率	每个开放日
基金经理	李峰	开始担任本基金基金经理的日期	2019年8月6日
		证券从业日期	2007年5月21日
基金经理	牛兴华	开始担任本基金基金经理的日期	2021年01月25日
		证券从业日期	2010年09月13日
其他	当本基金连续60个工作日基金份额持有人数量达不到200人，或基金资产净值低于3,000万元，或本基金前十大基金份额持有人所持份额数在本基金全部份额数中所占比例达到90%以上，在依法履行有关程序后，本基金将与本基金管理人管理的其他债券型基金进行合并		

二、基金投资与净值表现

(一) 投资目标与投资策略

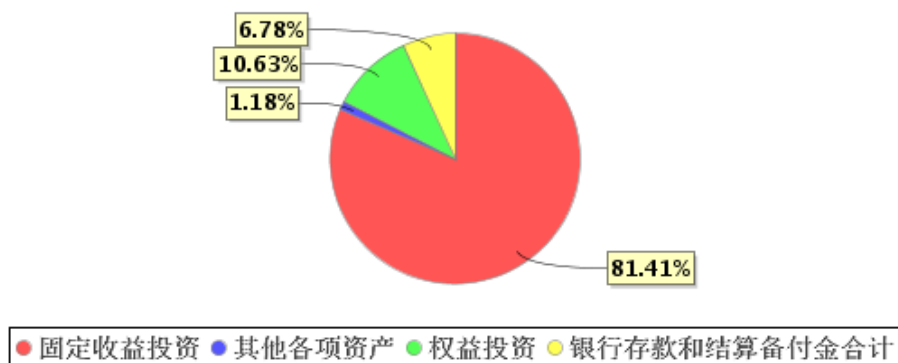
请投资者阅读《招募说明书》第九部分了解详细情况

投资目标	通过自上而下的分析对固定收益类资产和权益类资产进行配置，并充分利用可转债兼具权益类证券与固定收益类证券的特性，实施对大类资产的配置，在控制风险并保持良好流动性的基础上，追求超越业绩比较基准的超额收益。
投资范围	本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包含中小板、创业板、存托凭证及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规和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）。如法律法规和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。 本基金重点投资于固定收益类证券，包括可转债（含分离交易可转债，下同）、国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、短期融资券、中期票据、资产支持证券、次级债、

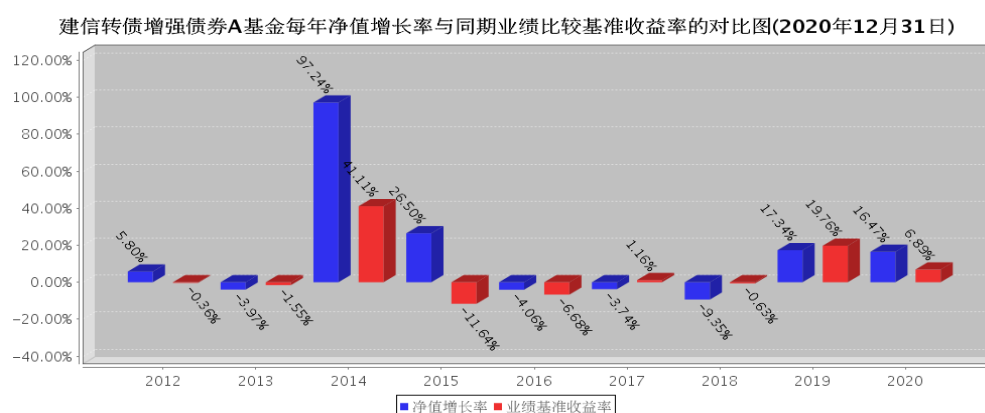
	地方政府债、政府机构债、债券回购、银行存款等，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他固定收益类金融工具。本基金可参与一级市场新股申购或增发新股，也可在二级市场上投资股票、权证等权益类证券。 本基金投资于固定收益类证券的比例不低于基金资产的 80%，其中投资于可转债的比例不低于基金固定收益类证券资产的 80%；投资于现金或到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；投资于股票和权证等权益类证券的比例不高于基金资产的 20%。 如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。
主要投资策略	本基金在合同约定的范围内实施稳健的整体资产配置，根据各项重要的经济指标分析宏观经济发展变动趋势，判断当前所处的经济周期，进而对未来做出科学预测。在此基础上，结合对流动性及资金流向的分析，综合股市估值水平和债市收益率情况及风险分析，进行灵活的大类资产配置进而在固定收益类资产、权益类资产以及货币类资产之间进行动态配置，确定资产的最优配置比例和相应的风险水平。 固定收益类资产投资策略针对各类资产的不同特性，本基金将市场细分为普通债券（含国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、短期融资券等）、可转债、资产支持证券三个子市场，因此本基金的固定收益类资产投资策略将分为普通债券投资策略、可转债投资策略、资产支持证券投资策略三个方面进行阐述。 1、普通债券投资策略本基金采取自上而下的方法确定投资组合久期，结合自下而上的个券选择方法构建普通债券投资组合，投资所采用的主要投资策略包括久期管理策略、期限配置策略、类属资产配置策略、套利策略等。 2、可转债投资策略 可转债是指由公司发行的，投资者在一定时期内可选择一定条件转换成公司股票的公司债券。可转债同时具备了普通股所不具备的债性和普通债券不具备的股性。当标的股票下跌时，可转债的价格可以受到债券价值的支撑；当标的股票上涨时，可转债内含的期权使其可以分享股价上涨带来的收益。 本基金投资可转债的主要策略有行业配置策略、个券精选策略、分阶段投资策略、买入并持有策略、条款博弈策略、低风险套利策略、分离交易可转债的投资策略。 3、资产支持证券投资策略 资产证券化是将缺乏流动性但能够产生稳定现金流的资产，通过一定的结构化安排，对资产中的风险与收益进行分离组合，进而转换成可以出售、流通，并带有固定收入的证券的过程。资产支持证券的定价受市场利率、发行条款、标的资产的构成及质量、提前偿还率等多种因素影响。 本基金将在基本面分析和债券市场宏观分析的基础上，对资产支持证券的交易结构风险、信用风险、提前偿还风险和利率风险等进行分析，采取包括收益率曲线策略、信用利差曲线策略、预期利率波动率策略等积极主动的投资策略，投资于资产支持证券。
业绩比较基准	中证可转换债券指数收益率*60%+中国债券总指数收益率*30%+沪深 300 指数收益率*10%
风险收益特征	本基金为债券型基金，债券型基金的风险高于货币市场基金，低于混合型和股票型基金，属于中低风险收益的品种。本基金主要投资于可转债，在债券型基金中属于风险水平相对较高的投资产品。

(二) 投资组合资产配置图表/区域配置图表

投资组合资产配置图表(2021年6月30日)



(三) 自基金合同生效以来/最近十年(孰短)基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图



注:基金的过往业绩不代表未来表现。

基金合同生效当年不满完整自然年度的,按实际期限计算净值增长率。

三、投资本基金涉及的费用

(一) 基金销售相关费用

以下费用在认购/申购/赎回基金过程中收取:

费用类型	份额(S)或金额(M) /持有期限(N)	收费方式/费率
申购费 (前收费)	0 万元 $\leq$ M<100 万元	0.80%
	100 万元 $\leq$ M<500 万元	0.50%
	M $\geq$ 500 万元	1,000.00 元/笔
赎回费	0 天 $\leq$ N<7 天	1.50%
	7 天 $\leq$ N<1 年	0.10%
	1 年 $\leq$ N<2 年	0.05%
	N $\geq$ 2 年	0.00%

(二) 基金运作相关费用

以下费用将从基金资产中扣除:

费用类别	收费方式/年费率
管理费	0.75%

托管费	0.20%
其他费用	《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用,《基金合同》生效后与基金相关的会计师事务所费、律师费,基金份额持有人大会费用,基金的证券交易或结算费用,基金的资金汇划费用,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

注:本基金交易证券、基金等产生的费用和税负,按实际发生额从基金资产扣除。

四、风险揭示与重要提示

(一) 风险揭示

本基金不提供任何保证。投资者可能损失投资本金。

投资有风险,投资者购买基金时应认真阅读本基金的《招募说明书》等销售文件。

1、利率风险

金融市场利率的波动会直接导致债券市场的价格和收益率变动,同时也影响到证券市场资金供求状况,以及拟投资债券的融资成本和收益率水平。上述变化将直接影响证券价格和本基金的收益。

2、债券收益率曲线变动的风险

债券收益率曲线变动风险是指与收益率曲线非平行移动有关的风险。

3、非系统性风险

非系统性风险是指个别证券特有的风险。相对于本基金而言,主要为发债主体特别是公司债、企业债的发债主体的信用质量变化造成的信用风险,以及无法偿债造成的信用违约风险;以及可转债价格下跌的风险。基金可以通过多样化投资来分散这种非系统性风险。

4、本基金的特定风险

本基金主要投资于可转债品种,可转债的条款相对于普通债券和股票而言更为复杂,对这些条款研究不足导致的事件可能为本基金带来损失。例如,当可转债的价格明显高于其赎回价格时,若本基金未能在转债被赎回前转股或卖出,则可能产生不必要的损失。本基金的投资范围包括存托凭证,除与其他仅投资于沪深市场股票的基金所面临的共同风险外,本基金还将面临中国存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险,以及与中国存托凭证发行机制相关的风险。

(二) 重要提示

中国证监会对本基金募集的核准,并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

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。

基金投资者自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和基金合同的当事人。

基金产品资料概要信息发生重大变更的,基金管理人将在三个工作日内更新,其他信息发生变更的,基金管理人每年更新一次。因此,本文件内容相比基金的实际情况可能存在一定的滞后,如需及时、准确获取基金的相关信息,敬请同时关注基金管理人发布的相关临时公告等。

五、其他资料查询方式

以下资料详见基金管理人官方网站 [www.ccbfund.cn] [客服电话: 400-81-95533]

- 基金合同、托管协议、招募说明书
- 定期报告,包括基金季度报告、中期报告和年度报告
- 基金份额净值
- 基金销售机构及联系方式
- 其他重要资料