

大成基金管理有限公司关于召开大成强化收益债券型证券投资基金基金份额持有人大会（通讯方式）的第一次提示性公告

大成基金管理有限公司已于2015年6月12日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及本公司网站（www.dcfund.com.cn）发布了“大成基金管理有限公司关于召开大成强化收益债券型证券投资基金基金份额持有人大会（通讯方式）的公告”。为了使本次基金份额持有人大会顺利召开，根据基金合同的相关规定，现发布本次基金份额持有人大会的第一次提示性公告。

一、会议基本情况

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《大成强化收益债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，大成强化收益债券型证券投资基金（以下简称“本基金”或“大成强化收益债券基金”）的管理人大成基金管理有限公司（以下简称“本基金管理人”）经与本基金的基金托管人中国建设银行股份有限公司协商一致，决定以通讯方式召开本基金的基金份额持有人大会，审议本基金转型方案等相关事宜，将本基金转型成为“大成强化收益定期开放债券型证券投资基金”。会议具体安排如下：

1、会议召开方式：通讯方式

2、会议投票表决起止时间：2015年6月20日起，至2015年7月13日17:00止（以本通知列明的公证机关指定的表决票收件人收到表决票的时间为准）

3、会议通讯表决票的寄达地点

收件人：大成基金管理有限公司北京分公司

地址：北京市西城区平安里西大街28号中海国际中心1601室

邮政编码：100035

联系人：吕婧

联系电话：400-888-5558，010-88009300

传真：010-85252282

请在信封背面注明：“大成强化收益债券型证券投资基金基金份额持有人大会表决专用”其他形式的会议通讯表决票按本公告规定的方式提交或发送至基金管理人或其指定的

系统，并在公证机关的监督下进行统计。

二、会议审议事项

本次持有人会议审议事项为《关于大成强化收益债券型证券投资基金转型相关事项的议案》（见附件一）

三、权益登记日

本次大会的权益登记日为 2015 年 6 月 19 日，即该日在大成基金管理有限公司登记在册的本基金全体基金份额持有人或其委托代理人享有本次会议的表决权。

四、投票方式

（一）纸质表决票的填写和寄交方式

1、本次会议表决票见附件二。基金份额持有人可通过剪报、复印或登陆基金管理人网站下载（www.dcfund.com.cn）等方式下载并打印表决票。

2、基金份额持有人应当按照表决票的要求填写相关内容，其中：

（1）个人投资者自行投票的，需在表决票上签字，并提供本人身份证件正反面复印件；

（2）机构投资者自行投票的，需在表决票上加盖本单位公章或经授权的业务公章（以下合称“公章”），并提供加盖公章的企业法人营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的事业单位法人登记证书、有权部门的批文或登记证书复印件等）；合格境外机构投资者自行投票的，需在表决票上加盖本单位公章（如有）或由授权代表在表决票上签字（如无公章），并提供该授权代表的身份证件、护照或其他身份证明文件的复印件，该合格境外机构投资者所签署的授权委托书或者证明该授权代表有权代表该合格境外机构投资者签署表决票的其他证明文件，以及该合格境外机构投资者的营业执照、商业登记证或者其他有效注册登记证明复印件，以及取得合格境外机构投资者资格的证明文件的复印件；

（3）基金份额持有人可根据本公告第五章规定的授权其他个人或机构代其在本次基金份额持有人大会上投票。受托人接受基金份额持有人纸面方式授权代理投票的，应由受托人在表决票上签字或盖章，并提供授权委托书原件以及本公告“第五章第（三）条授权方式 1、纸面方式授权”中所规定的基金份额持有人以及受托人的身份证明文件或机构主体资格证明文件，但下述“第（4）项”另有规定的除外；

（4）基金份额持有人通过本公告规定的电话授权方式或短信授权方式授权基金管理人

投票的，接受有效委托的基金管理人应在表决票上加盖本单位公章，并提供加盖公章的企业法人营业执照复印件。

3、基金份额持有人或其代理人需将填妥的表决票和所需的相关文件自 2015 年 6 月 20 日起，至 2015 年 7 月 13 日 17:00 以前（以本次大会公证机关指定的表决票收件人收到表决票时间为准）通过专人送交、邮寄送达至以下地址或按以下传真号码以传真的方式送达至下述收件人：

收件人：大成基金管理有限公司北京分公司

地址：北京市西城区平安里西大街 28 号中海国际中心 1601 室

邮政编码：100035

联系人：吕婧

联系电话：400-888-5558，010-88009300

传真：010-85252282

（二）电话投票

为方便基金份额持有人参与大会投票，自 2015 年 6 月 20 日起，至 2015 年 7 月 13 日 17:00 以前（以基金管理人系统记录时间为准），基金份额持有人可拨打基金管理人客服电话并按提示转人工坐席进行投票。

基金管理人也将主动与预留联系方式的基金份额持有人取得联系，在通话过程中以回答提问方式核实持有人身份后，由人工坐席根据客户意愿进行投票记录从而完成投票。为保护基金份额持有人利益，整个通话过程将被录音。

基金份额持有人通过电话投票的方式仅适用于个人持有人，对机构持有人暂不开通。

（三）短信投票

为方便基金份额持有人参与大会投票，自 2015 年 6 月 20 日起，至 2015 年 7 月 13 日 17:00 以前（以基金管理人系统记录时间为准），基金管理人提供以下短信通道供投资者进行投票。

基金管理人通过短信平台向预留手机号码的个人持有人发送征集投票短信，持有人回复短信表明表决意见。

基金份额持有人通过短信投票的方式仅适用于个人持有人，对机构持有人暂不开通。

基金份额持有人原预留手机号码已变更或已不再实际使用的，可选择其他方式进行投票。因电信运营商原因导致持有人无法获取短信进行投票，请投资者采用纸质或电话方式进行投票。

五、授权

为便于基金份额持有人有尽可能多的机会参与本次大会，使基金份额持有人在本次大会上充分表达其意志，基金份额持有人除可以直接投票外，还可以授权他人代其在基金份额持有人大会上投票。根据法律法规的规定及《基金合同》的约定，基金份额持有人授权他人在基金份额持有人大会上表决需符合以下规则：

（一）委托人

本基金的基金份额持有人自本公告发布之日起可委托他人代理行使本次基金份额持有人大会的表决权。

基金份额持有人在权益登记日是否持有基金份额以及所持有的基金份额的数额以注册登记机构的登记为准。

（二）受托人

基金份额持有人可以委托本基金的基金管理人以及其他符合法律规定的机构和个人，代为行使本次基金份额持有人大会上的表决权。

（三）授权方式

本基金的基金份额持有人可通过纸面、电话和短信等其他法律法规和中国证监会认可的授权方式授权受托人代为行使表决权。

基金份额持有人通过纸面方式授权的，授权委托书的样本请见本公告附件三。基金份额持有人可通过剪报、复印或登录基金管理人网站下载（www.dcfund.com.cn）等方式获取授权委托书样本。

基金份额持有人通过非纸面方式授权的，授权形式及程序应符合本通知的规定。基金份额持有人通过非纸面方式授权仅限授权给基金管理人。

1、纸面方式授权

（1）基金份额持有人进行纸面授权所需提供的文件

1) 个人基金份额持有人委托他人投票的，受托人应提供由委托人填妥并签署授权委托书原件（授权委托书的格式可参考附件三的样本），并提供基金份额持有人的个人身份证明文件复印件。如受托人为个人，还需提供受托人的身份证明文件复印件；如受托人为机构，还需提供该受托人加盖公章的企业法人营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的事业单位法人登记证书、有权部门的批文或登记证书复印件等）。

2) 机构基金份额持有人委托他人投票的, 受托人应提供由委托人填妥的授权委托书原件(授权委托书的格式可参考附件三的样本)并在授权委托书上加盖该机构公章, 并提供该机构持有人加盖公章的企业法人营业执照复印件(事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的事业单位法人登记证书、有权部门的批文或登记证书复印件等)。如受托人为个人, 还需提供受托人的身份证明文件复印件; 如受托人为机构, 还需提供该受托人加盖公章的企业法人营业执照复印件(事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的事业单位法人登记证书、有权部门的批文或登记证书复印件等)。

2、电话授权方式

为方便基金份额持有人参与大会, 基金份额持有人可拨打基金管理人客服电话并按提示转人工坐席进行授权。

基金管理人也将主动与预留联系方式的基金份额持有人取得联系, 在通话过程中以回答提问方式核实持有人身份后, 由人工坐席根据客户意愿进行授权记录从而完成授权。为保护基金份额持有人利益, 整个通话过程将被录音。

基金份额持有人通过电话授权的方式仅适用于个人持有人, 对机构持有人暂不开通。电话授权仅支持授权给基金管理人模式。

3、短信授权

为方便基金份额持有人参与大会, 基金管理人提供以下短信通道供投资者进行授权。

基金管理人将通过短信平台向预留手机号码的个人持有人发送征集授权短信, 持有人可回复短信表明授权意见。

基金份额持有人通过短信授权的方式仅适用于个人持有人, 对机构持有人暂不开通。短信授权仅支持授权给基金管理人模式。

基金份额持有人原预留手机号码已变更或已不再实际使用的, 可选择其他方式进行授权。因电信运营商原因导致持有人无法获取短信进行授权, 请投资者采用纸质或电话方式进行授权。

4、授权效力确定规则

(1) 如果同一基金份额存在包括有效纸面方式授权和其他非纸面方式有效授权的, 以有效的纸面授权为准。多次以有效纸面方式授权的, 以时间在最后的一次纸面授权为准。同时多次以有效纸面方式授权的, 若授权表示一致, 以一致的授权表示为准; 若授权表示不一致, 视为无效授权;

(2) 如果同一基金份额在只存在有效纸面方式授权时，委托人签署的授权委托书没有表示具体表决意见的，视为委托人授权受托人按照受托人意志行使表决权；

(3) 如果同一基金份额无有效纸面方式授权，但存在任意一种有效的其他非纸面方式授权的，以该种有效的其他非纸面方式的授权为准；

(4) 如果同一基金份额以非纸面方式进行多次授权的，以时间在最后的授权为准。同时多次以非纸面方式进行授权的，若授权表示一致，以一致的授权表示为准；若授权表示不一致，视为无效授权；

(5) 如委托人未在授权委托表示中明确其表决意见的，视为委托人授权受托人按照受托人的意志行使表决权；如委托人在授权委托表示中表达多种表决意见的，视为无效授权。

(6) 如委托人既进行委托授权，自身又送达了有效表决票，则以自身有效表决票为准。

六、会议召开的条件和表决票数要求

本次会议召开的条件为：本人或委托他人代表出具有效表决意见的基金份额持有人持有的基金份额不少于权益登记日本基金基金总份额的 50%（含 50%）。

本会议表决的票数要求为：基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权，不足一份的基金份额不具有表决权。本次议案按特别决议处理，须经出席会议的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方为有效。

本次基金份额持有人大会决定的事项自表决通过之日起生效。基金管理人应当自通过之日起五日内报中国证监会备案。

七、计票

1、本次通讯会议的计票方式为：由本基金管理人授权的两名监督员在基金托管人（中国建设银行股份有限公司）授权代表的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。

2、基金份额持有人所持每份基金份额享有一票表决权。

3、表决票效力的认定如下：

(1) 纸面表决票通过专人送交、邮寄或传真送达本公告规定的收件人的，表决时间以收到时间为准；通过其他非纸面方式表决的，表决时间以系统记录时间为准。2015 年 7 月 13 日 17: 00 以后送达基金管理人的，为无效表决。

(2) 如果同一基金份额存在包括有效纸面方式表决和其他非纸面方式有效表决的，以有效的纸面表决为准。

(3) 纸面表决票的效力认定

纸面表决票填写完整清晰，所提供文件符合本会议通知规定，且在截止时间之前送达本公告规定的收件人的，为有效表决票；有效表决票按表决意见计入相应的表决结果，其所代表的基金份额计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

如纸面表决票上的表决意见未选、多选或无法辨认，但其他各项符合会议通知规定的，视为弃权表决，计入有效表决票；并按“弃权”计入对应的表决结果，其所代表的基金份额计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

如纸面表决票上的签字或盖章部分填写不完整、不清晰的，或未能提供有效证明基金份额持有人身份或代理人经有效授权的证明文件的，或未能在截止时间之前送达本公告规定的收件人的，均为无效表决票；无效表决票不计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

基金份额持有人重复提交纸面表决票的，如各表决票表决意见相同，则视为同一表决票；如各表决票表决意见不相同，则按如下原则处理：

1) 送达时间不是同一天的，以最后送达的填写有效的表决票为准，先送达的表决票视为被撤回；

2) 送达时间为同一天的，视为在同一表决票上做出了不同表决意见，计入弃权表决票；

3) 送达时间按如下原则确定：专人送达的以实际递交时间为准，邮寄的以本公告规定的收件人收到的时间为准，传真的以本公告规定的收件人传真接收到的时间为准。

(4) 如果同一基金份额以非纸面方式进行多次表决的，以时间在最后的表决为准。

八、本次大会相关机构

1、召集人：大成基金管理有限公司

联系地址：广东省深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层

联系人：肖剑

联系电话：0755-83183388

传真：0755-83199588

客户服务电话：400-888-5558

网址：www.dcfund.com.cn

2、监督人：中国建设银行股份有限公司

联系地址：北京市西城区金融大街 25 号

联系人：田青

联系电话：010-67595096

客户服务电话：95533

网址：www.ccb.com

3、公证机构：北京市长安公证处

地址：北京市东城区朝阳门北大街 6 号首创大厦 7 层

联系人：陆晓冬

电话：010-65543888-8066

邮政编码：100027

4、见证律师：北京市金杜律师事务所

注册及办公地址：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

联系电话：0755-22163333

传真：0755-22163390

联系人：冯艾

经办律师：靳庆军、冯艾

九、重要提示

1、请基金份额持有人在提交表决票时，充分考虑邮寄在途时间，提前寄出表决票。

2、本次基金份额持有人大会有关公告可通过本基金管理人网站查阅，投资者如有任何疑问，可致电本基金管理人客户服务电话 400-888-5558 咨询。

3、本基金份额持有人大会召开期间，本基金日常申购赎回业务照常进行，投资者可以按照本基金招募说明书的相关规定办理申购赎回。本次基金份额持有人大会决议生效后，本基金将按照新基金合同的规定进行运作，届时本基金的开放日将变更为每年 5 月、11 月第七个工作日和第八个工作日，投资人可以在开放日办理申购赎回业务。本基金在封闭运作期内不办理申购与赎回业务。请本基金份额持有人根据自身资金使用计划提前做好相应安排。

4、本通知的有关内容由大成基金管理有限公司负责解释。

大成基金管理有限公司

二零一五年七月六日

附件一：《关于大成强化收益债券型证券投资基金转型相关事项的议案》

附件二：《大成强化收益债券型证券投资基金基金份额持有人大会通讯表决票》

附件三：《授权委托书》

附件四：《大成强化收益债券型证券投资基金转型方案说明书》

附件一：关于大成强化收益债券型证券投资基金转型相关事项的议案

大成强化收益债券型证券投资基金份额持有人：

为了优化基金的投资运作管理，提高产品的市场竞争力，根据《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》和《大成强化收益债券型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的有关规定，基金管理人经与本基金的基金托管人中国建设银行股份有限公司协商一致，提议对大成强化收益债券型证券投资基金实施转型。转型方案见附件四：《大成强化收益债券型证券投资基金转型方案说明书》。

为实施大成强化收益债券型证券投资基金转型，提议授权基金管理人办理本次大成强化收益债券型证券投资基金转型的有关具体事宜，包括但不限于根据市场情况确定基金转型各项工作的具体时间，在不涉及基金合同当事人权利义务关系变化或对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下根据《大成强化收益债券型证券投资基金转型方案说明书》、现时有效的法律法规的相关要求、证监会公布实施的《证券投资基金基金合同填报指引》和转型后基金的特征，对《大成强化收益债券型证券投资基金基金合同》等法律文件进行必要的修改和补充。

以上议案，请予审议。

基金管理人：大成基金管理有限公司

二〇一五年六月十二日

附件二：大成强化收益债券型证券投资基金基金份额持有人大会通讯表决票

基金份额持有人名称：

证件号码(身份证件号/营业执照号)：

基金帐号：

表决事项：关于大成强化收益债券型证券投资基金转型相关事项的议案

表决结果：

同意

反对

弃权

机构基金份额持有人签章栏

个人基金份额持有人签字栏

单位公章：

签字：

日期：

日期：

说明：

1、请就表决内容表示“同意”、“反对”或“弃权”，并在相应栏内画“√”，同一议案只能表示一项意见，否则表决票无效；

2、未填、错填、字迹无法辨认或意愿无法判断的表决票均视为投票人放弃表决权利，其所持全部基金份额的表决结果均计为“弃权”。

3、本表决票可从相关网站下载、从报纸上剪裁、复印或按此格式打印。

附件三：授权委托书

兹全权委托 先生 / 女士或 单位代表本人（或本机构）参加
投票截止日为2015年7月13日17:00的以通讯方式召开的大成强化收益债券型证券投资基金基金份额持有人大会，并代为行使表决权。表决意见以受托人的表决意见为准。

委托人签名/盖章：

委托人身份证明名称及编号：

基金帐号（如有多个，请逐一填写）：

受托人签章（受托人为自然人则签字/受托人为机构则盖公章）：

受托人身份证号码或营业执照注册号：

委托日期：××年××月××日

（本授权委托书可剪报、复印或按以上格式自制，在填写完整并签字盖章后均为有效）

附件四：大成强化收益债券型证券投资基金转型方案说明书

大成强化收益债券型证券投资基金（以下简称“本基金”或“大成强化收益债券基金”）于 2008 年 8 月 6 日成立，大成基金管理有限公司（以下简称“本基金管理人”）为本基金的管理人，中国建设银行股份有限公司（以下简称“本基金托管人”）为本基金的托管人。

鉴于目前基金市场需求的变化，为提高产品的市场竞争力，根据《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》和《大成强化收益债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，基金管理人经与基金托管人中国建设银行股份有限公司（以下简称“中国建设银行”）协商一致，提议对本基金实施转型。

本次大成强化收益债券基金转型方案应当经参加大会的基金份额持有人（或其代理人）所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方为有效，故本转型方案存在无法获得基金份额持有人大会表决通过的可能。

本次基金份额持有人大会决定的事项自表决通过之日起生效。基金管理人应当自通过之日起五日内报中国证监会备案。中国证监会对本次大成强化收益债券基金转型方案所作的任何决定或意见，均不表明其对本次转型方案或基金的价值或者投资者的收益做出实质性判断或保证。

一、大成强化收益债券基金转型的方案要点

（一）变更基金名称

基金名称由“大成强化收益债券型证券投资基金”变更为“大成强化收益定期开放债券型证券投资基金”。

（二）变更基金运作方式

基金运作方式由以每日开放方式运作的契约型开放式变更为以定期开放方式运作的契约型开放式。本基金以定期开放方式运作，基金每年 5 月、11 月第七个工作日和第八个工作日为开放期，在开放期投资人可以办理申购赎回业务。每个开放期结束之日次日起进入下一个封闭运作期，以此类推。因不可抗力或其他因素影响导致基金不能正常开放申购赎回业务，则基金开放期为不可抗力或其他因素消除之日起下两个工作日，届时以基金管理人公告为准。例如，假设本基金基金合同于 2015 年 3 月 5 日生效，则本基金的第一个开放期为 2015 年 5 月 12 日（周二）、13 日（周三）；第二个开放期为 2015 年 11 月 10 日（周二）、11 日（周三）。

本基金在封闭运作期内不办理申购与赎回业务。

（三）变更基金投资目标、投资范围、投资策略等条款

变更后的内容如下：

“1、投资目标

通过积极主动的投资管理，追求基金资产的长期稳定增值，力争获取超过业绩比较基准的投资业绩。

2、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，包括国内依法发行和上市的国债、央行票据、政策性金融债、企业债、公司债、可转债（含可分离交易可转债）、可交换债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、中小企业私募债、债券回购、资产支持证券、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、现金等固定收益品种以及股票、权证等权益类金融工具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相关规定。

基金的投资组合比例为：债券、货币市场工具等固定收益类资产的投资比例不低于基金资产的 80%，开放期以及开放期前十个工作日和后十个工作日不受此限制；现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，封闭运作期内除外；股票类资产投资比例不高于基金资产的 20%；权证投资比例不高于基金资产净值的 3%，其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

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。

3、投资策略

在封闭运作期内本基金将在严格控制组合风险的前提下，基于收益的要求，在资产配置、个券选择和交易策略层面上实施积极管理策略，以期在承担有限风险的前提下获得较高投资收益。在开放期内，本基金为保持较高的组合流动性，方便投资人安排投资，在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下，将主要投资于高流动性的投资品种。

（1）资产配置

本基金将在基金合同约定的投资范围内实施稳健的战略资产配置，确保投资组合整体的安全性和流动性，并在此基础上进行积极的战术资产配置，通过预测各类别资产（包括固定收益类资产、权益类资产和货币资产等）中短期回报率变化，不断优化各类别资产配置比例，规避市场短期波动风险，获取超额收益。

（2）固定收益类资产投资策略

本基金对固定收益类资产实施自上而下的、积极的投资策略。在确定目标久期、类属资产配置后，综合采用多种投资策略甄选个券，构建固定收益类资产组合。

1) 利率预期策略

利率风险是债券投资面临的主要风险，衡量债券利率风险最有效的指标是久期。本基金将以“目标久期”管理作为利率预期策略的核心内容，通过深入分析宏观经济运行状况、财政政策、货币政策，判断利率变化的方向和时间。利用情景分析，模拟利率变化幅度的各种情形，考察投资基准和投资组合在收益率曲线变化时的风险收益特征及久期情况，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，制定债券品种期限配置策略，确立不同债券市场投资比例，确定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) 信用利差策略

信用风险将是本基金投资管理所面临的另一主要风险。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、业务状况、公司治理结构、财务状况等因素综合评估发行主体信用风险，确定信用产品的信用风险利差，有效管理组合的整体信用风险。

随着债券市场的发展，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) 敏感度指标策略

可转换债券是介于股票和债券之间的投资品种，兼具股性和债性的双重特征，具有抵御

下行风险、分享股票价格上涨收益的特点。本基金在对可转换债券条款和发行主体基本面进行深入研究的基础上，以敏感度指标（Delta 等）作为市场风险控制的主要技术指标，利用可转换债券溢价率来判断转债的股性，积极管理，获取超额收益。

5) 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。

i) 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差价。

ii) 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。

iii) 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）。

6) 个券选择策略

本基金将在以上投资策略的基础上实施精细化的个券选择，充分评估每一只债券的到期收益率、信用风险、流动性风险、税收、含权等各种因素，选择定价合理或价值被低估的债券进行投资。具有以下一项或多项特征的债券，是本基金构建固定收益类资产组合的重点投资对象：

- i) 符合上述投资策略的品种；
- ii) 具有套利空间的品种；
- iii) 价值低估的品种；
- iv) 符合风险管理指标的品种。

(3) 权益类资产投资策略

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。本基金将通过对企业发展战略、企业所属行业周期、业务状况、公司治理结构、财务状况等多

种因素的综合评估，评价企业竞争优势和行业地位，从股票初选库中筛选出符合要求的股票构成股票备选库。在此基础上结合内外部研究、实地调研、价值评估等方法，根据本基金的风险收益要求进行股票投资。

（4）中小企业私募债投资策略

中小企业私募债票面利率较高、信用风险较大、二级市场流动性较差。

本基金将根据对宏观经济的研究，前瞻性判断经济周期，调整组合汇总中小企业私募债的配置比例。同时，根据债券市场的收益率水平，重点考虑个券的风险收益水平，综合考虑个券的信用等级（如有）、期限、流动性、息票率、提前偿还和赎回等因素，结合债券发行人所处行业发展前景、发行人业务发展状况、企业市场地位、财务状况、管理水平及其债务水平等，以确定债券的实际信用风险状况及其信用利差水平，重点选择信用风险相对较低、信用利差收益相对较大、或预期信用质量将改善的中小企业私募债。

基金在控制信用风险的基础上，对中小企业私募债投资，主要采取分散投资，控制个债持有比例。当预期发债企业的基本面情况出现恶化时，采取“尽早出售”策略，控制投资风险。

（5）其他投资策略

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。

（四）变更基金投资组合限制

1. 变更后的基金投资组合将遵照以下限制：

“（1）债券、货币市场工具等固定收益类资产的投资比例不低于基金资产的 80%，开放期以及开放期前十个工作日和后十个工作日不受此限制；

（2）本基金股票类资产的投资比例不得高于基金资产的 20%；

（3）现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，封闭运作期内除外；

（4）本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%；

（5）本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；

（6）本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；

（7）本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；

(8) 本基金在任何交易日买入权证的总金额, 不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%;

(9) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例, 不得超过基金资产净值的 10%;

(10) 本基金持有的全部资产支持证券, 其市值不得超过基金资产净值的 20%;

(11) 本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例, 不得超过该资产支持证券规模的 10%;

(12) 本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券, 不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%;

(13) 本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上(含 BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间, 如果其信用等级下降、不再符合投资标准, 应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出;

(14) 基金财产参与股票发行申购, 本基金所申报的金额不超过本基金的总资产, 本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量;

(15) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%;

(16) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制;

(17) 封闭期内本基金基金资产总值不得超过基金净资产的 200%, 开放期内本基金资产总值不得超过基金净值的 140%;

(18) 本基金持有单只中小企业私募债券, 其市值不得超过基金资产净值的 10%; 本基金投资中小企业私募债券的剩余期限, 不得超过本基金的剩余封闭运作期。

因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的, 基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整, 但中国证监会规定的特殊情形除外。

基金管理人应当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有关约定。期间, 基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门取消上述限制, 如适用于本基金, 基金管理人在履行适当程序后, 则本基金投资不再受相关限制。

2. 禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

- (1) 承销证券；
- (2) 违反规定向他人贷款或者提供担保；
- (3) 从事承担无限责任的投资；
- (4) 向其基金管理人、基金托管人出资；
- (5) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- (6) 依照法律法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他活动；
- (7) 法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，在履行适当程序后，本基金投资不再受相关限制。”

(五) 调整费率水平

1、基金管理人的管理费。

本基金的管理费率由固定管理费率 0.7%调整浮动管理费率。修改后的基金管理人费率表述如下：

“基金管理人的管理费

本基金采用浮动管理费模式，以分档计提方式收取浮动管理费。每个封闭运作期结束后，基金管理人将以封闭运作期基金资产净值增长率（折年化）为基础分档收取管理费。

浮动管理费分档费率表如下：

封闭运作期基金净值年化增长率（M）	管理费率
$M \leq 4\%$	0.2%
$4\% < M \leq 6\%$	0.3%
$6\% < M \leq 8\%$	0.4%
$M > 8\%$	0.65%

其中，M 的计算公式为：

$$M = \left(\frac{NAV_1 + \sum D}{NAV_0} - 1 \right) \times \frac{\text{当年天数}}{T} \times 100\%$$

NAV₁ 为第 N 个封闭运作期结束后第一个开放日的未扣除管理费的基金份额净值；

NAV₀ 为第 N-1 个封闭运作期结束后第二个开放日的基金份额净值，若 N=1，则为基金合同生效日基金份额净值

$\sum D$ 为第 N 个封闭运作期内的任一日的除息日的份额红利的总和。

T 为第 N 个封闭运作期的天数，即第 N 个封闭运作期起始日（含）至第 N 个封闭运作期结束后第一个开放日（含）。

本基金在封闭运作期内不计提管理费，每个封闭运作期结束后的第一个开放日对管理费进行一次计提并支付，并于管理费计提日起 10 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

管理费的计算方法如下：

$$H = E \times \text{管理费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值”

2、托管费率

本基金的托管费率由 0.20% 调整为 0.18%。

3、赎回费率

取消本基金的赎回费。

（六）修改基金份额净值的保留位数

将本基金份额净值的计算保留到小数点后 4 位，小数点后第 5 位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。**修改为：**本基金份额净值的计算保留到小数点后 3 位，小数点后第 4 位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

四、授权基金管理人修改基金合同等法律文件

首先，基金管理人提请基金份额持有人大会授权基金管理人根据转型后基金运作的特点相应修订《大成强化收益债券型证券投资基金基金合同》等法律文件，并根据监管机构意见适时调整本转型方案说明书所载上述六点转型方案要点的文字表述，但该等调整不得实质性修改上述内容。

其次，自《大成强化收益债券型证券投资基金基金合同》生效以来，《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》等法律法规陆续修改和实施，基金管理人需要根据法律法规要求和证监会公布实施的《证券投资基金基金合同填报指引》修订《大成强化收益债券型证券投资基金基金合同》的相关内容。

拟请持有人大会授权基金管理人根据上述事项修订基金合同等法律文件。修订后的基金合同等法律文件已报中国证监会审核。

五、《大成强化收益定期开放债券型证券投资基金基金合同》的生效

本次基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效，表决通过之日起5个工作日内基金管理人向证监会进行备案。自表决通过之日起，大成强化收益债券型证券投资基金将变更为大成强化收益定期开放债券型证券投资基金。基金管理人将按照《大成强化收益定期开放债券型证券投资基金基金合同》的有关规定进行管理。

六、关于本次基金转型的合规情况说明

1、本基金托管人中国建设银行股份有限公司对本次基金转型方案及相关文件出具了无异议的函。

2、本基金管理人聘请的法律顾问北京金杜律师事务所为本次转型出具了法律意见书，认为本基金转型方案的内容符合《基金法》、《运作办法》等法律、行政法规和中国证监会的规定以及《基金合同》的约定；转型后本基金符合《基金法》、《运作办法》等法律、行政法规和中国证监会的规定；本基金的转型已完成中国证监会变更注册，尚需经基金份额持有人大会审议通过并报送中国证监会备案。

3、本基金转型后的基金名称表明了基金的类别。本基金名称不存在损害国家利益、社会公共利益，欺诈、误导投资人，或者其他侵犯他人合法权益的内容。

七、基金转型的主要风险及预备措施

（一）转型方案被持有人大会否决的风险

为防范转型方案被基金份额持有人大会否决的风险，基金管理人将提前向基金份额持有人征询意见。如有必要，基金管理人将根据持有人意见，对基金转型方案等进行适当的修订。基金管理人可在必要情况下，推迟基金份额持有人大会的召开时间，或更改其他会务安排，并予以公告。

（二）基金转型后基金运作方式将出现变化

基金转型后，基金的运作方式将由每日开放模式变更为定期开放模式。转型后的基金每年5月、11月第七个和第八个工作日开放申购赎回。在开放期投资人可以办理申购赎回业务。每个开放期结束之日次日起进入下一个封闭运作期，基金在封闭运作期内不办理申购与赎回业务，基金份额持有人面临不能赎回基金份额的风险。基金管理人在召开基金份额持有人大会期间，尽可能与基金份额持有人进行沟通，向基金份额持有人说明基金运作方式变化对基金份额持有人的影响，请基金份额持有人根据自身资金使用计划提前做好相应安排。

（三）基金转型后遭遇大规模赎回的风险

为应对转型前后遭遇大规模赎回,本基金在转型期间将保证投资组合的流动性,应付转型前后可能出现的较大赎回,降低净值波动率。

(四) 预防及控制在转型过程中的操作及市场风险

为维护基金份额持有人利益,防范大额赎回或市场风险对基金净值造成大幅波动,基金管理人将根据申购赎回情况及对可能存在的市场投资风险进行有效评估,保持相对合理的仓位水平,科学有效地控制基金的市场风险。

八、基金管理人的联系方式

持有人若对本方案的内容有任何意见和建议,请通过以下方式联系基金管理人:

联系机构:大成基金管理有限公司客户服务部

联系电话:400-888-5558

电子信箱:callcenter@dcfund.com.cn

网站:www.dcfund.com.cn

大成基金管理有限公司

二〇一五年六月十二日