

融通标普中国可转债指数增强型证券投资基金更新招募说明书

摘要（2016年第1号）

基金管理人：融通基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

日期：二〇一六年五月

重要提示

融通标普中国可转债指数增强型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证监会2012年12月5日

证监许可[2012]1632号文核准募集。本基金的基金合同于2013年3月26日正式生效。

投资有风险，投资者认购（或申购）基金时应认真阅读本招募说明书。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本摘要根据基金合同和基金更新招募说明书编写，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

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《基金法》、《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。

本招募说明书所载内容截止日为2016年3月26日，有关财务数

据截止日为 2015 年 12 月 31 日，本招募说明书中的财务数据未经审计。

一、基金合同生效日

2013 年 3 月 26 日

二、基金管理人

（一）基金管理人概况

名称：融通基金管理有限公司

注册地址：深圳市南山区华侨城汉唐大厦 13、14+层

办公地址：深圳市南山区华侨城汉唐大厦 13、14+层

成立日期：2001 年 5 月 22 日

法定代表人：高峰

电话：（0755）26948070

联系人：刘宏

注册资本：12500 万元人民币

目前公司股东及出资比例为：新时代证券有限责任公司 60%、日兴资产管理有限公司（Nikko+Asset9 Management9Co.,Ltd.）40%。

（二）主要人员情况

1、现任董事情况

董事长高峰先生，金融学博士，现任融通基金管理有限公司董事长。历任大鹏证券投行部高级经理、

业务董事，平安证券投行部副总经理，北京远略投资咨询有限公

司总经理，深圳新华富时资产管理有限公司

司总经理。2015年7月起至今，任公司董事长。

独立董事杜婕女士，民进会员，注册会计师，现任吉林大学经济学院教授。 历任电力部第一工程局一

处主管会计，吉林大学教师、讲师、教授。2011年1月至今，任公司独立董事。

独立董事田利辉先生，金融学博士后、执业律师，现任南开大学金融发展研究院教授。 历任密歇根大

学戴维德森研究所博士后研究员、北京大学光华管理学院副教授、南开大学金融发展研究院教授。2011年

1月至今，任公司独立董事。

独立董事施天涛先生，法学博士，现任清华大学法学院教授、法学院副院长、博士研究生导师、中国证

券法学研究会和中国保险法学研究会副会长。2012年1月至今，任公司独立董事。

董事马金声先生，高级经济师，现任新时代证券有限责任公司名誉董事长。历任中国人民银行办公厅

副主任、主任，金银管理司司长，中国农业发展银行副行长，国泰君安证券股份有限公司党委书记兼副董

事长，华林证券有限责任公司党委书记。2007年至今，任公司董事。

董事黄庆华先生，工科学士，现任上海宜利实业有限公司总裁助

理兼投资管理部总经理。历任上海宜利实业有限公司投资管理部经理助理、新时代证券有限责任公司经纪事业部综合管理处主管。2015年2月至今，任公司董事。

董事 David Semaya（薛迈雅）先生，教育学硕士，现任日兴资产管理有限公司执行董事长，三井住友信托银行有限公司顾问。历任日本美林副总，纽约美林总监，美林投资管理有限公司首席运营官、代表董事和副总、代表董事和主席，巴克莱全球投资者日本信托银行有限公司总裁及首席执行官，巴克莱全球投资者(英国)首席执行官，巴克莱集团、财富管理(英国)董事及总经理。2015年6月至今，任公司董事。

董事 Allen Yan（颜锡廉）先生，工商管理硕士，现任融通基金管理有限公司常务副总经理兼融通国际资产管理有限公司总经理。历任富达投资公司（美国波士顿）分析员、富达投资公司(日本东京)经理、日兴资产管理有限公司部长。2015年6月至今，任公司董事。

董事孟朝霞女士，经济学硕士，现任融通基金管理有限公司总经理。历任新华人寿保险股份有限公司企业年金管理中心总经理、泰康养老保险股份有限公司副总经理、富国基金管理有限公司副总经理。2015年2月至今，任公司董事。

2、现任监事情况

监事刘宇先生，金融学硕士、计算机科学硕士，现任公司监察稽核部总经理。 历任国信证券股份有限公司投资银行部项目助理、安永会计师事务所高级审计员、景顺长城基金管理有限公司法律监察稽核部副总监。2015年8月起至今任公司监事。

3、公司高级管理人员情况

董事长高峰先生，简历同上。

总经理孟朝霞女士，经济学硕士。历任新华人寿保险股份有限公司企业年金管理中心总经理，泰康养老保险股份有限公司副总经理，富国基金管理有限公司副总经理。2014年9月至今任公司总经理。

常务副总经理颜锡廉（AllenOYan）先生，工商管理硕士。 历任美国富达投资公司财务分析员、日本富达投资公司财务经理，日兴资产管理有限公司财务企划与分析部部长。2011年至今任公司常务副总经理。

副总经理刘晓玲女士，金融学学士。历任博时基金管理有限公司零售业务部渠道总监，富国基金管理有限公司零售业务部负责人，泰康资产管理有限责任公司公募事业部市场总监。2015年9月起至今任公司副总经理。

督察长涂卫东先生，法学硕士。历任国务院法制办公室(原国务院法制局)财金司公务员，曾在中国证监会法律部和基金监管部工作，曾是中国证监会公职律师。20119年至今任公司督察长。

4、基金经理

(1) 现任基金经理情况

王超，金融工程硕士，经济学、数学双学士，7年证券从业经验，具有基金从业资格。2007年7月至2012年8月在深圳发展银行（现更名为平安银行）工作，主要从事债券自营交易盘投资与理财投资管理。2012年8月加入融通基金管理公司任投资经理。现同时担任融通债券、融通通瑞债券、融通标普中国可转债指数增强、融通通源短融债券、融通四季添利债券(LOF)和融通岁岁添利定期开放债券基金经理。

(2) 历任基金经理情况

自2013年3月26日起至2013年12月26日，由张李陵先生担任本基金的基金经理。

自2013年12月27日起至2014年1月6日，由张李陵先生和王超先生共同担任本基金的基金经理。

自2014年1月7日起至今，由王超先生担任本基金的基金经理。

5、投资决策委员会成员

公司固定收益投资决策委员会成员：固定收益投资总监孙海忠先

生，固定收益部总经理、基金经理张一格先生，固定收益部总监助理、基金经理王超先生，基金交易部副总经理谭奕舟先生，风险管理部副总经理马洪元先生。

6、上述人员之间不存在近亲属关系。

三、基金托管人

1、基本情况

名称：中国农业银行股份有限公司（简称中国农业银行）

住所：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

法定代表人：刘士余

成立日期：2009 年 1 月 15 日

批准设立机关和批准设立文号：中国银监会银监复[2009]13 号

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[1998]23 号

注册资本：32,479,411.7 万元人民币

存续期间：持续经营

联系电话：010-66060069

传真：010-68121816

联系人：林葛

中国农业银行股份有限公司是中国金融体系的重要组成部分，总行设在北京。经国务院批准，中国农

业银行整体改制为中国农业银行股份有限公司并于 2009 年 1 月

15 日依法成立。中国农业银行股份有限公司承继原中国农业银行全部资产、负债、业务、机构网点和员工。中国农业银行网点遍布中国城乡，成为国内网点最多、业务辐射范围最广，服务领域最广，服务对象最多，业务功能齐全的大型国有商业银行之一。

在海外，中国农业银行同样通过自己的努力赢得了良好的信誉，每年位居《财富》世界 500 强企业之列。作为一家城乡并举、联通国际、功能齐备的大型国有商业银行，中国农业银行一贯秉承以客户为中心的经营理念，坚持审慎稳健经营、可持续发展，立足县域和城市两大市场，实施差异化竞争策略，着力打造“伴你成长”服务品牌，依托覆盖全国的分支机构、庞大的电子化网络和多元化的金融产品，致力为广大客户提供优质的金融服务，与广大客户共创价值、共同成长。

中国农业银行是中国第一批开展托管业务的国内商业银行，经验丰富，服务优质，业绩突出，2004 年被英国《全球托管人》评为中国“最佳托管银行”。2007 年中国农业银行通过了美国 SAS70 内部控制审计，并获得无保留意见的 SAS70 审计报告，表明了独立公正第三方对中国农业银行托管服务运作流程的风险管理、内部控制的健全有效性的全面认可。中国农业银行着力加强能力建设，品牌声誉进一步提升，

在 2010 年首届“‘金牌理财’ TOP10 颁奖盛典”中成绩突出，获“最佳托管银行”奖。2010 年再次荣获《首席财务官》杂志颁发的“最佳资产托管奖”。

中国农业银行证券投资基金托管部于 1998 年 5 月经中国证监会和中国人民银行批准成立，2004 年 9 月更名为托管业务部，内设养老金管理中心、技术保障处、营运中心、委托资产托管处、保险资产托管处、证券投资基金托管处、境外资产托管处、综合管理处、风险管理处，拥有先进的安全防范设施和基金托管业务系统。

2、主要人员情况

中国农业银行托管业务部现有员工 140 余名，其中高级会计师、高级经济师、高级工程师、律师等专家 10 余名，服务团队成员专业水平高、业务素质好、服务能力强，高级管理层均有 20 年以上金融从业经验和高级技术职称，精通国内外证券市场的运作。

3、基金托管业务经营情况

截止到 2015 年 12 月 31 日，中国农业银行托管的封闭式证券投资基金和开放式证券投资基金共 321 只。

4、基金托管人的内部控制制度

1、内部控制目标

严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和行内有关管理规定,守法经营、规范运作、严格监察,确保业务的稳健运行,保证基金财产的安全完整,确保有关信息的真实、准确、完整、及时,保护基金份额持有人的合法权益。

2、内部控制组织结构

风险管理委员会总体负责中国农业银行的风险管理与内部控制工作,对托管业务风险管理和内部控制工作进行监督和评价。托管业务部专门设置了风险管理处,配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作,独立行使监督稽核职权。

3、内部控制制度及措施

具备系统、完善的制度控制体系,建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程,可以保证托管业务的规范操作和顺利进行;业务人员具备从业资格;业务管理实行严格的复核、审核、检查制度,授权工作实行集中控制,业务印章按规程保管、存放、使用,账户资料严格保管,制约机制严格有效;业务操作区专门设置,封闭管理,实施音像监控;业务信息由专职信息披露人负责,防止泄密;业务实现自动化操作,防止人为事故的发生,技术系统完整、独立。

5、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

基金托管人通过参数设置将《基金法》、《运作办法》、基金合同、托管协议规定的投资比例和禁止投资品种输入监控系统,每日登录监控系统监督基金管理人的投资运作,并通过基金资金账户、基金管理人的投资指令等监督基金管理人的其他行为。

当基金出现异常交易行为时,基金托管人应当针对不同情况进行以下方式的处理:

1、电话提示。对媒体和舆论反映集中的问题,电话提示基金管理人;

2、书面警示。对本基金投资比例接近超标、资金头寸不足等问题,以书面方式对基金管理人进行提示;

3、书面报告。对投资比例超标、清算资金透支以及其他涉嫌违规交易等行为,书面提示有关基金管理人并报中国证监会。

四、相关服务机构

(一) 基金份额发售机构

1、直销机构

(1) 融通基金管理有限公司机构理财部机构销售及深圳小组

办公地址: 深圳市南山区华侨城汉唐大厦 13、149 层

邮政编码: 518053

联系人：陈思辰

电话：（0755）26948034

客户服务中心电话：400-883-8088（免长途通话费用）、（0755）
26948088

（2）融通基金管理有限公司机构理财部机构销售及服务北京小组

办公地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座
1241-1243 单元

邮政编码：100140

联系人：魏艳薇

电话：（010）66190989

（3）融通基金管理有限公司机构理财部机构销售及服务上海小组

办公地址：上海市世纪大道 8 号国金中心汇丰银行大楼 6 楼 601
—602

邮政编码：200120

联系人：杨雁

联系电话：（021）38424950

（4）融通基金管理有限公司网上直销

办公地址：深圳市南山区华侨城汉唐大厦 13、14 层

邮政编码：518053

联系人：殷洁

联系电话：（0755）26947856

2、代销机构

（1）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：北京市东城区建国门内大街 69 号

法定代表人：赵欢

电话：（010）85109619

传真：（010）85108557

客服电话：95599

（2）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 559 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 559 号

法定代表人：姜建清

联系电话：8610-6610-8608

传真：8610-6610-7571

（3）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：牛锡明

客服电话：95559

传真：（8621）5879-8398

（4）上海银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路 168 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 168 号

法定代表人：范一飞

开放式基金咨询电话：（021）962888

开放式基金业务传真：（021）68476497

联系人：汤征程

联系电话：（021）68475521

（5）渤海银行股份有限公司

办公地址：天津市河西区马场道 201-205 号

法定代表人：刘宝凤

联系人：王宏

电话：（022）58316666

传真：（022）58316569

客服电话：4008888811

（6）恒丰银行股份有限公司

办公地址：烟台市南大街 248 号

法定代表人：蔡国华

电话：4008138888

（7）中国邮政储蓄银行有限责任公司（仅代销前端）

注册地址：北京市西城区宣武门西大街 131 号

法定代表人：李国华

客服热线：95580

公司网站：www.psbc.com

(8) 天相投资顾问有限公司

办公地址：北京市西城区金融街 5 号新盛大厦 B 座 4 层

法定代表人：林义相

电话：（010）66045577

联系人：林爽

(9) 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

法定代表人：张跃伟

联系人：吕慧

电话：（021）58788678

传真：（021）8788678-8101

(10) 深圳众禄金融控股股份有限公司

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

法定代表人：薛峰

联系人：童彩平

客服电话：4006-788-887

网址：www.jjmmw.com

(11) 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 室

法定代表人：杨文斌

联系人：张茹

电话：（021）58870011

（12）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道海曙路东 2 号

办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道 3588 号恒生大厦 12 楼

法定代表人：陈柏青

联系人：周熾旻

电话：（0571）28829790，（021）60897869

传真：（0571）26698533

客服电话：4000-766-123

（13）上海天天基金销售有限公司

注册地址：上海市浦东新区峨山路 613 号 6 幢 551 室

办公地址：上海市徐汇区龙田路 195 号 3C 座 9 楼

法定代表人：其实

联系人：练兰兰

电话：（021）54509988

传真：（021）64383798

（14）北京展恒基金销售有限公司

注册地址：北京市顺义区后沙峪镇安富街 6 号

法定代表人：闫振杰

联系人：王婉秋

电话：010-62020088

传真：010-62020355

客服电话：400-888-6661

（15）中期资产管理有限公司

注册地址：北京市朝阳区建国门外光华路 169 号 19 幢 119 层

办公地址：北京市朝阳区建国门外光华路 14 号 1 幢 11 层 1103 号

法定代表人：朱剑林

客服电话：400-8888-160

传真：010-59539866

客服电话：95162、4008888160

（16）北京增财基金销售有限公司

注册地址：北京市西城区南礼士路 66 号 1 号楼 12 层 1208 号

法定代表人：罗细安

客服电话：400-001-8811

（17）北京钱景财富投资管理有限公司

注册地址：北京市海淀区丹棱街 6 号 1 幢 9 层 1008-1012

法定代表人：赵荣春

客服电话：400-893-6885

（18）嘉实财富管理有限公司（仅代销前端）

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 46 层 4609-10 单元

法定代表人：赵学军

客服电话：400-021-8850

(19) 深圳腾元基金销售有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路 2028 号皇岗商务中心主楼 4F(07)

单元

办公地址：深圳市福田区金田路 2028 号皇岗商务中心主楼 4F(07)

单元

法定代表人：卓紘晶

联系人：王媿萍

电话：0755-33376853

传真：0755-33065516

客服电话：4006-877-899

(20) 一路财富（北京）信息科技有限公司

注册地址：北京市西城区车公庄大街 9 号院 5 号楼 702(德胜园

区)

法定代表人：吴雪秀

客服电话：400-001-1566

(21) 中国国际期货有限公司

注册地址：北京市朝阳区建国门外光华路 14 号 1 幢 1 层、2 层、

9 层、11 层、12 层

法定代表人：王兵

客服电话：95162

(22) 浙江同花顺基金销售有限公司

注册地址：浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦 903

法定代表人：凌顺平

电话：0571-88911818

传真：0571-88911818-8001

客服电话：95525

(23) 上海利得基金销售有限公司

公司地址：上海市浦东新区东方路 989 号中达大厦 2 楼

联系电话：021-50583533

传真：86-021-50583633

客服热线：4000676266

公司网站：www.leadfund.com.cn

(24) 厦门市鑫鼎盛控股有限公司

办公地址：厦门市思明区鹭江道 2 号第一广场 1501-1504

法定代表人：陈洪生

联系人：李智磊

联系电话：0592-3122679

传真：0592-3122701

客服热线：0592-3122716

公司网站：www.xds.com.cn

(25) 上海汇付金融服务有限公司

注册地址：上海市黄浦区中山南路 100 号 19 层

办公地址：上海市黄浦区中山南路 100 号金外滩国际广场 19 层

法定代表人：冯修敏

电话：021-33323999

传真：021-33323830

联系人：陈云卉

客服热线：400-820-2819

公司网站：www.fund.bundtrade.com

(26) 宁波银行股份有限公司

办公地址：宁波市鄞州区宁南南路 700 号 24 层

法定代表人：陆华裕

客户服务电话：95574

联系人：邱艇

电话：0574-87050397

(27) 上海陆金所资产管理有限公司（仅代销前端）

办公地址：00 上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼

法定代表人：0 郭坚

联系人：0 宁博宇

电话：0021-20665952

客户服务电话：4008219031

(28) 珠海盈米财富管理有限公司（仅代销前端）

注册地址：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

传真：020-89629011

联系人：黄敏嫦

电话：020-89629099

客服热线：020-89629066

(29) 深圳富济财富管理有限公司

办公地址：深圳市南山区高新南七道 12 号惠恒集团二期 418 室

法定代表人：齐小贺

电话：0755-83999907

联系人：马力佳

(30) 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：文雯

电话：010-83363101

(31) 长城证券股份有限公司

注册地址：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：黄耀华

联系人：刘阳

电话：（0755）83516289

客服电话：4006666888

（32）申万宏源证券有限公司

注册地址：上海市徐汇区长乐路 989 号世纪商贸广场 45 层

法定代表人：李梅

联系人：曹晔

电话：（021）33389888

客服电话：95523 或 4008895523

（33）海通证券股份有限公司

注册地址：上海广东路 689 号

法定代表人：王开国

联系人：李笑鸣

电话：（021）23219275

客服电话：4008888001

（34）国盛证券有限责任公司

注册地址：江西省南昌市北京西路 889 号江信国际金融大厦

法定代表人：马跃进

联系人：俞驰

电话：（0791）86283080

客服电话：4008222111

（35）新时代证券股份有限公司

注册地址:北京市海淀区北三环西路999号院19号楼159层1501

法定代表人:田德军

联络人:田芳芳

电话:(010)83561146

客服电话:400698989

(36)恒泰证券有限责任公司

注册地址:内蒙古呼和浩特市赛罕区敕勒川大街东方君座D座光

大银行办公楼14-18楼

法定代表人:庞介民

联系人:王旭华

电话:(0471)4972343

客服电话:(0471)4961259

(37)中信证券股份有限公司

注册地址:深圳市福田区中心三路89号卓越时代广场(二期)

北座

法定代表人:王东明

联系人:侯艳红

电话:(010)60838995

客服电话:4008895548

(38)中信证券(山东)有限责任公司

注册地址:山东省青岛市崂山区深圳路222号1号楼2001

法定代表人:杨宝林

联系人：赵艳青

电话：（0532）85023924

客服电话：95548

（39）信达证券股份有限公司

办公地址：北京市西城区闹市口大街 99 号院 19 号楼

法定代表人：张志刚

联系人：鹿馨方

电话：（010）63080994

客服电话：4008008899

（40）光大证券股份有限公司

注册地址：上海市静安区新闻路 15089 号

法定代表人：薛峰

联系人：刘晨

电话：（021）22169081

客服电话：95525

（41）华安证券有限责任公司

注册地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 1989 号

法定代表人：李工

联系人：范超

电话：（0551）65161821

客服电话：95318，4008096518

（42）第一创业证券股份有限公司

联系地址：深圳市罗湖区笋岗路中民时代广场 B9 座 25、26 层

法定代表人：刘学民

联系人：毛诗莉

电话：（0755）25831754

客服电话：95358，4008881888

（43）长江证券股份有限公司

联系地址：武汉市江汉区新华路特 89 号长江证券大厦

法定代表人：杨泽柱

联系人：奚博宇

电话：（027）68751860

客服热线：400-8888-999、95579

（44）平安证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区金田路荣超大厦 4036 号 16-20 层

法定代表人：谢永林

联系人：吴琼

电话：（0755）22621866

9999 客服电话：955119 转 8

（45）太平洋证券股份有限公司

注册地址：云南省昆明市青年路 389 号志远大厦 18 层

法定代表人：李长伟

联系人：谢兰

电话：010-988321613

客服电话：4006-650-999

(46) 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

法定代表人：李季

联系人：李巍

电话：010-88085858

客户服务电话：400-800-0562

网址：www.hysec.com

(47) 中国国际金融股份有限公司

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

法定代表人：丁学东

电话：010-85679888-6035?

联系人：秦朗

客服电话：4009101166

(48) 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

电话：028-86690057

联系人：刘婧漪

客服电话：4006-600109

(49) 中信期货有限公司

注册地址：深圳市福田区中心三路 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

电话：0755-82791065

联系人：吴川

客服热线：4009908826

(50) 招商证券股份有限公司

注册地址：广东省深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A201 室
(入驻深圳市前海商务秘书有限公司)

法定代表人：熊剑涛

联系人：黄婵君

电话：(0755) 82960167

客服电话：4008888111、95565

(51) 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 669 号 49 号楼

法定代表人：王常青

联系人：许梦园

电话：(010) 85130236

客服电话：95587、400-8888-108

(52) 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：陈有安

联系人：邓颜

电话：（010）66568292

客服电话：4008-888-8888

（53）西南证券股份有限公司

注册地址：重庆市江北区桥北苑 8 号

法定代表人：余维佳

电话：023-63786141

联系人：张煜

客服电话：4008096096

（54）中泰证券股份有限公司

注册地址：山东省济南市经七路 86 号

办公地址：山东省济南市经七路 86 号

法定代表人：李玮

电话：021-20315255

联系人：马晓男

客户服务电话：95538

（55）国信证券股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区红岭中路国信证券大厦十六层至二十六层

法定代表人：何如

联系人：周杨

电话：（0755）82130833

客服电话：995536

（二）基金注册登记机构

融通基金管理有限公司

办公地址：深圳市南山区华侨城汉唐大厦 13、14 层

成立日期：2001 年 5 月 22 日

法定代表人：高峰

电话：（0755）26948075

联系人：杜嘉

（三）律师事务所

名称：广东嘉得信律师事务所

注册地址：深圳市罗湖区笋岗东路中民时代广场 A 座 201

办公地址：深圳市罗湖区笋岗东路中民时代广场 A 座 201

法定代表人：闵齐双

联系人：尹小胜

经办律师：闵齐双刘少华尹小胜崔卫群

电话：075533382888（总机） 075533033020（直线）15302728596

传真：075533033086

（四）会计师事务所

名称：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 12339 号汇亚大厦

1604-16089 室

办公地址：上海市湖滨路 2029 号普华永道中心 119 楼（邮编：200021）

法人代表：杨绍信

电话：（021）23238888

传真：（021）23238800

联系人：俞伟敏@

经办注册会计师：陈玲、俞伟敏

五、基金的名称

融通标普中国可转债指数增强型证券投资基金

六、基金的类型

债券型证券投资基金

七、基金的投资目标

本基金为增强型指数基金，对指数投资部分，采用最优复制法的投资策略，按照成份券在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份券及其权重的变化进行相应调整。 本基金对主动投资部分，采取积极配置策略，利用可转债兼具债券和股票的特性，力争实现在控制基金资产下跌风险和保证投资组合流动性的基础上，为投资者获得超越业绩比较基准的稳健收益。

八、基金的投资方向

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。

本基金主要投资于固定收益类金融工具，包括可转债（含分离交易可转债）、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。

本基金的投资组合比例为：投资于固定收益类证券的比例不低于基金资产的 80%，其中投资于标普中国可转债指数的成份券及其备选成份券的比例不低于基金固定收益类证券资产的 90%；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%；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%，其它金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，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

（一）投资策略

本基金为增强型指数基金，对指数投资部分，采用最优复制法的投资策略，主要以标的指数的成份券及其备选成份券构成为基础，综合考虑跟踪效果、操作风险等因素构建组合，并根据本基金资产规模、日常申购赎回情况、市场流动性以及交易所可转债交易特性等情况，对投资组合进行优化调整，以保证对标的指数的有效跟踪。对主动投资部分，采取积极配置策略，力争在有效跟踪标的指数的基础上，获取超越基准的业绩表现。如果未来可转债市场出现流动性不足、券种数量下降或其它不可预见的异常情况，导致本基金无法有效对指数进行跟踪和合理配置，本基金可选择在主动投资部分适当增加对其它金融工具的投资比例，以作为对可转债投资的临时性替代。在正常市场情况下，力争将本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均偏离度的绝对值控制在0.5%以内，如因指数编制规则或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。

1、指数投资策略

对指数投资部分，采用最优复制法，主要以标的指数的成份券构成为基础，综合考虑跟踪效果、操作风险等因素构建组合，并根据本基金资产规模、日常申购赎回情况、市场流动性以及交易所可转债交易特性等情况，对投资组合进行优化调整，以保证对标的指数的有效跟踪。

（1）可转债投资组合的定期调整

本基金所构建的指数化投资组合将定期根据所跟踪的标的指数对其成份券及成分券权重的调整而进行相应调整。

（2）可转债投资组合的不定期调整

当以下情况发生时，本基金可以根据市场情况，结合经验判断，对个券权重和券种进行适当调整，以期在规定的风险承受限度之内，尽量缩小跟踪误差。

- 1) 本基金预期标的指数的成份券即将调整或权重发生变化；
- 2) 成份券流动性不足、价格严重偏离合理估值、单只成份券交易量不符合市场交易惯例；
- 3) 由于市场因素影响、法律法规限制等原因，本基金无法根据指数构建组合；
- 4) 基金发生申购赎回、市场流动性变化等其他可能影响跟踪效果的情形。

（3）可转债投资组合的优化

为更好地跟踪指数走势，本基金将根据本基金的资产规模、日常申购赎回情况、市场流动性以及交易所可转债交易特性等情况，对投资组合进行优化调整，以保证对标的指数的有效跟踪。

2、指数增强策略

（1）行业配置策略

可转债因内含期权价值使其与公司股票价格走势和波动率水平密切相关。本基金将综合考虑各种宏观因素，实现最优行业配置。本基金以宏观经济走势、经济周期特征和阶段性市场投资主题的研究为基础，综合考量宏观调控目标、产业结构调整因素等，精选具有良好成长潜力和受益于政策扶持具有优良成长环境的公司发行的可转债进行投资布局。同时，结合经济和市场阶段性特征，动态调整不同行业的可转债进行投资。

（2）个券精选策略

可转换债券兼具权益类证券与固定收益类证券的特性，具有债底保护抵御下行风险、一定股性特征分享股票价格上涨收益的特点。本基金在对可转换公司债券条款和发行债券公司基本面进行深入分析研究的基础上，利用可转换公司债券定价模型进行估值分析。本基金还会充分借鉴基金管理人股票分析团

队及外部研究机构的研究成果，对可转债的基础股票的基本面进行分析，形成对基础股票的价值评估，最终选择合适的投资品种。

（3）时机选择策略

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卖出的决定；同时本基金也会综合运用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。

（4）转股策略

在转股期内，当本基金所持可转债市场价格显著低于转换价值时，即转股溢价率为负时，本基金将实现转股并卖出股票实现收益；当可转债流动性不足以满足投资组合的需要时，本基金将通过转股保障基金财产安全；当正股价格上涨且满足提前赎回触发条件时，本基金将通过转股锁定已有收益，并通过进一步分析和预测正股未来走势，作出进一步投资决策。

（5）条款博弈策略

通常情况下，可转债均设有一些特殊条款，如修正条款、回售条款、赎回条款等。修正条款给予发行人

向下修正转股价格的权利，有利于提升可转债的期权价值，对投资者是一种保护条款，有时甚至能直接推动可转债价格的上涨；回售条款给予投资者将可转债回售给发行人的权利，对于投资者有保护作用，回售价格是判断可转债安全边际的重要因素之一；赎回条款给予发行人从投资者处赎回可转债的权利，如发行人放弃赎回权则会提高可转债的期权价值。 本基金将充分发掘各项条款博弈给可转债带来的投资机会。

（6）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，即是一种附认股权证的公司债，在上市后分离为债券和权证分别独自进行交易。可分离交易可转债是债券和股票的混合融资品种，它与传统可转换债券的本质区别在于上市后债券与期权可分离交易。但是，不论是认股权证还是标的股票，与传统可转换债券内含的期权之间都具有很强的相关性。因此，分离交易后的纯债和认股权证组合在一起仍然具有传统可转换债券的部分特征，甚至也可以构造出类可转换债券品种。

在可分离交易可转债投资方面，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。

（7）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，因此在日常交易过程中会出现可转债与标的股票之间的套利机会。当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得套利价差。当对可转债未来的转换溢价率有比较明确的趋势判断时，该种套利策略同样适用。

在日常交易过程中，本基金将利用可转换债券定价模型密切关注可转债与标的股票之间的对比关

系，寻找被市场严重错误定价的可转换债券，选择恰当的时机进行套利，以增强基金资产组合的收益。本

基金将进行动态监视的因素包括：可转债是否具备良好的流动性、低转换溢价、高凸性和低隐含波动性，

以及标的股票是否具备高预期的价格波动性、融券的便利性、以及支付很少的股息或者不支付股息等因

素。

（8）债券投资策略

本基金的债券投资将以优化流动性管理、分散投资风险为主要目标，同时根据需要进行积极操作。在有效控制风险的基础上，积极把握宏观经济发展趋势、利率走势、债券市场相对收益率、券种的流动性以及信用水平，优化固定收益类金融工具的资产比例配置和进行个券选择，适时调整组合久期，以获得基金资产的稳定增值，提高基金总体收益率。

（9）资产支持证券的投资策略

资产支持类证券的定价受市场利率、流动性、发行条款、标的资产的构成及质量、提前偿还率及其它附加条款等多种因素的影响。本基金将在利率基本面分析、市场流动性分析和信用评级支持的基础上，辅以与国债、企业债等债券品种的相对价值比较，审慎投资资产支持证券类资产。

（二）、投资决策依据

（1）国家有关法律、法规的相关规定和基金合同的相关约定。

（2）宏观经济发展趋势、微观经济运行趋势和证券市场走势。

（三）、投资决策程序

（1）投资决策委员会定期召开会议，对资产配置制定整体投资战略；如遇重大事项，投资决策委员会

将及时召开临时会议做出决策；

(2) 金融工程小组运用风险监测模型以及各种风险监控指标，对投资风险和流动性风险进行测算，并提供数量化风险分析报告，供基金经理决策参考；

(3) 基金经理根据量化风险分析报告和申购赎回分析报告，在风险控制范围内，进行投资交易；

(4) 基金经理根据投资组合实施方案制定具体的操作计划，并以投资指令的形式下达至基金交易部；

(5) 基金交易部依据投资指令具体执行买卖操作，并将指令的执行情况反馈给基金经理；

(6) 监察稽核部对投资的决策和执行过程进行日常监督，风险管理小组负责向基金经理及投资决策委员会提交绩效评估报告及风险评估报告。

十、业绩比较基准

本基金业绩比较基准为：标普中国可转债价格指数 (S&P9China9Convertible9Bond9Index) 9×95%+银行活期存款利率(税后)×5%

十一、风险收益特征

本基金是债券型指数基金，长期平均风险和预期收益率低于股票基金、混合基金，高于货币市场基金，属于较低风险、较低收益的品种。

十二、基金投资组合报告

本基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2016年4月19日复核了本报告中的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2016年3月31日。

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	211,600.00	1.03
---	------	------------	------

其中：股票	211,600.00	1.03
-------	------------	------

2	固定收益投资	19,339,907.00	94.58
---	--------	---------------	-------

其中：债券	19,339,907.00	94.58
-------	---------------	-------

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	854,662.47	4.18
--------------	------------	------

7	其他资产	41,182.99	0.20
---	------	-----------	------

8	合计	20,447,352.46	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	--B	采矿业	--C	制造业	--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 --K 房地产业 --L
租赁和商务服务业 211,600.00 1.41

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 211,600.00
1.41

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	300058	蓝色光标	20,000	211,600.00	1.41
---	--------	------	--------	------------	------

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	500,250.00	3.34
---	------	------------	------

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
		18,839,657.00		125.96			

8	同业存单	--9 其他	--10 合计	19,339,907.00	129.30
---	------	--------	---------	---------------	--------

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	110031	航信转债	38,000	4,933,920.00	32.99
2	113008	电气转债	24,000	2,851,680.00	19.07
3	110032	三一转债	19,800	2,222,352.00	14.86
4	113009	蓝标转债	16,700	2,000,159.00	13.37
5	110035	白云转债	15,000	1,849,350.00	12.36

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国债期货交易情况说明

9.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

截止本报告期末，本基金未投资国债期货。

9.3 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

10.1 本基金投资的前十名证券的发行主体报告期内没有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。

10.2 其他资产构成

序号 名称 金额（元）

1 存出保证金 10,091.12

2 应收证券清算款 -3 应收股利 -4 应收利息 24,163.91

5 应收申购款 6,927.96

6 其他应收款 -7 待摊费用 -8 其他 -9 合计 41,182.99

10.3 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 110031 航信转债 4,933,920.00 32.99

2 113008 电气转债 2,851,680.00 19.07

3 128009 歌尔转债 1,267,200.00 8.47

4 128010 顺昌转债 251,240.00 1.68

5 110030 格力转债 171,920.00 1.15

10.4 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。

十三、基金的业绩

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。

自基金合同生效以来，本基金基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较如下：

融通标普中国可转债指数增强 A

阶段

份额净值增长率

①

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

标准差④

①—③ ②—④

2013年3月26日

至2013年12月31

日

-7.40% 0.47% -8.09% 0.58% 0.69% -0.11%

2014年度 63.61% 1.21% 53.35% 1.01% 10.26% 0.20%

2015 年度 -28.54% 3.12% -23.42% 2.99% -5.12% 0.13%

融通标普中国可转债指数增强 C

阶段

份额净值增长率

①

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

2013 年 3 月 26 日

至 2013 年 12 月 31

日

-7.70% 0.47% -8.09% 0.58% 0.39% -0.11%

2014 年度 63.16% 1.20% 53.35% 1.01% 9.81% 0.19%

2015 年度 -28.44% 3.12% -23.42% 2.99% -5.02% 0.13%

十四、基金费用概览

(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、从 C 类基金份额的基金财产中计提的销售服务费；
- 4、基金合同生效后的信息披露费用；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费；
- 7、基金的证券交易费用；
- 8、基金财产划拨支付的银行费用；
- 9、证券账户开户费用和银行账户维护费；
- 10、按照国家有关规定可以在基金财产中列支的其他费用。

(二) 上述基金费用由基金管理人在法律法规规定的范围内按照公允的市场价格确定，法律法规和基金合同另有规定时从其规定。

(三) 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

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的 0.50% 年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$ ，本基金年管理费率为 0.50%

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管

人复核后于次月首日起 3 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、休息日，

支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$ ，本基金年托管费率为 0.10%

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管

人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日，

支付日期顺延。

3、基金销售服务费

本基金 A0 类基金份额不收取销售服务费，C0 类基金份额的销售服务费年费率为 0.30%。本基金销售

服务费将专门用于本基金的销售与基金份额持有人服务，基金管理人将在基金年度报告中对该项费用的

列支情况作专项说明。销售服务费按前一日 C0 类基金资产净值的 0.30% 年费率计提。计算方法如下：

$H = E_0 \times 0.30\% \div \text{当年天数}$

H0 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E0 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 50 个工作日内从基金资产中划出，由注册登记机构代收，注册登记机构收到后按相关合同规定支付给基金销售机构等。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

4、上述(一)中 4 到 10 项费用由基金托管人根据其他有关法律法规及相应协议的规定，按费用支出金额支付，列入或摊入当期基金费用。

(四) 不列入基金费用的项目

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，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。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、信息披露费等费用不列入基金费用。基金收取认购费的，可以从认购费中列支。

(五) 基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率和基金托管费率。降低基金管理费率和基金托管费率，无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须依照有关规定最迟于新的费率实施日前在指定媒体和基金管理人网站上刊登公告。

(六) 基金税收

基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定,履行纳税义务。

十五、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《基金法》、《运作管理办法》、《销售管理办法》、《信息披露管理办法》及其他有

关法律法规的要求,对本基金管理人于 2015 年 11 月 8 日刊登的本基金招募说明书进行了更新。

本次更新招募说明书中重要变动部分如下:

一、在“三、基金管理人”部分,根据最新资料更新了公司董事及高管人员情况。

二、在“四、基金托管人”部分:更新了“(一)基金托管人概况”的“主要人员情况”与“基金托管业务经营情况”和“(二)基金托管人的内部控制制度”的相关信息。

三、在“五、相关服务机构”部分:“(一)基金份额发售机构”部分更新了部分直销机构和代销机构相关联系信息,新增代销机构为宁波银行股份有限公司、上海陆金所资产管理有限公司、珠海盈米财富管理有限公司、深圳富济财富管理有限公司、深圳市新兰德证券投资咨询有限公司、中国银河证券股份有限公司、西南证券股份有限公司、中泰证券股份有限公司和国信证券股份有限公司。

四、在“九、基金的投资”部分:更新了“(十一)基金投资组

合报告”的内容，数据为本基金 2015 年 4 季度报告中的投资组合数据。

五、在“十基金的业绩”部分：按规定要求对基金的投资业绩数据进行了列示，已经基金托管人复核。

六、在“第二十一节对基金份额持有人的服务”部分，对“定制服务”和“在线服务”进行了更新；

七、在“二十二、其他应披露的事项”部分：对本报告期内的基金公告进行了列表说明。

融通基金管理有限公司

2016 年 5 月 7