



中银转债增强债券型证券投资基金 更新招募说明书摘要

(2020年第1号)

基金管理人： 中银基金管理有限公司

基金托管人： 招商银行股份有限公司

二〇二〇年一月

重要提示

本基金的募集申请经中国证监会2011年4月27日证监许可【2011】608号文核准，基金合同于2011年6月29日正式生效。

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。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资人在投资本基金前，应全面了解本基金的产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险、个别证券特有的非系统性风险、由于基金投资人连续大量赎回基金产生的流动性风险、基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险、本基金的特定风险等等。

投资有风险，投资人认购（或申购）本基金时应认真阅读本基金的招募说明书、基金合同、基金产品资料概要。基金管理人建议投资人根据自身的风险收益偏好，选择适合自己的基金产品，并且中长期持有。

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招募说明书编写。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》、《运作办法》、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。

基金管理人保证本基金招募说明书的内容真实、准确、完整。本基金招募说明书经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其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。

本更新招募说明书所载内容截止日2019年12月18日（本招募说明书中关于基金合同内容变更事项的内容截止日为2019年10月24日），有关财务数据和净值表现截止日为2019年9月30日（财务数据未经审计）。本基金托管人招商银行股份有限公司已复核了本招募说明书中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容。

一、基金合同生效日期

2011年6月29日

二、基金管理人

(一) 基金管理人概况

名称：中银基金管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路200号中银大厦45楼

办公地址：上海市浦东新区银城中路200号中银大厦26楼、27楼、45楼

法定代表人：章砚

成立日期：2004年8月12日

电话：(021) 38834999

联系人：高爽秋

注册资本：1亿元人民币

股权结构：

股东	出资额	占注册资本的比例
中国银行股份有限公司	人民币 8350 万元	83.5%
贝莱德投资管理（英国）有限公司	相当于人民币 1650 万元的美元	16.5%

(二) 主要人员情况

1、董事会成员

章砚（ZHANG Yan）女士，董事长。国籍：中国。英国伦敦大学伦敦政治经济学院公共金融政策专业硕士。现任中银基金管理有限公司董事长。历任中国银行总行全球金融市场部主管、助理总经理、总监，总行金融市场总部、投资银行与资产管理部总经理。

李道滨（LI Daobin）先生，董事。国籍：中国。清华大学法学博士。中银基金管理有限公司执行总裁。2000年10月至2012年4月任职于嘉实基金管理有限公司，历任市场部副总监、总监、总经理助理和公司副总经理。

韩温（HAN Wen）先生，董事。国籍：中国。首都经济贸易大学经济学学士。现任中国银行总行人力资源部副总经理。历任中国银行北京市分行公司业务部高级经理，通州支行副行长，海淀支行副行长，上地支行副行长（主持工作）、行长，丰台支行行长等职。

杨柳（YANG Liu）先生，董事。国籍：中国。2019年9月起担任中银基金管理有限公司董事。武汉大学经管学院企业管理硕士研究生。现任中国银行财富与私人银行部副总经

理。曾任中国东方信托投资公司（原中国银行信托公司）副处长、处长，中国银行托管部处长、副总经理。

曾仲诚（Paul Tsang）先生，董事。国籍：中国。为贝莱德亚太区首席风险管理总监、董事总经理，负责领导亚太区的风险管理工作，同时担任贝莱德亚太区执行委员会成员。曾先生于 2015 年 6 月加入贝莱德。此前，他曾担任摩根士丹利亚洲首席风险管理总监，以及其亚太区执行委员会成员，带领独立的风险管理团队，专责管理摩根士丹利在亚洲各经营范围的市场、信贷及营运风险，包括机构销售及交易（股票及固定收益）、资本市场、投资银行、投资管理及财富管理业务。曾先生过去亦曾于美林的市场风险管理团队效力九年，并曾于瑞银的利率衍生工具交易\结构部工作两年。曾先生现为中国清华大学及北京大学的风险管理客座讲师。他拥有美国威斯康辛大学麦迪逊分校工商管理学士学位，以及宾夕法尼亚大学沃顿商学院工商管理硕士学位。

赵欣舸（ZHAO Xinge）先生，独立董事。国籍：中国。美国西北大学经济学博士。曾在美国威廉与玛丽学院商学院任教，并曾为美国投资公司协会（美国共同基金业行业协会）等公司和机构提供咨询。现任中欧国际工商学院金融学与会计学教授、副教授长和金融 MBA 主任，并在华宝信托担任独立董事。

杜惠芬（DU Huifen）女士，独立董事。国籍：中国。山西财经大学经济学学士，美国俄克拉荷马州梅达斯经济学院工商管理硕士，澳大利亚国立大学高级访问学者，中央财经大学经济学博士。现任中央财经大学金融学院教授，兼任新时代信托股份有限公司独立董事。曾任山西财经大学计统系讲师、山西财经大学金融学院副教授、中央财经大学独立学院（筹）教授、副院长、中央财经大学金融学院副院长等职。

付磊（Fu Lei）先生，独立董事。国籍：中国。首都经济贸易大学管理学博士。现任首都经济贸易大学会计学院教授、博士生导师。兼任中国商业会计学会常务理事、中国内部审计协会理事、中国会计学会会计史专业委员会主任、北京会计学会常务理事、北京总会计师协会学术委员，江河创建集团股份有限公司独立董事、北京九强生物技术股份有限公司独立董事、航天长征化学工程股份有限公司独立董事、国投泰康信托有限公司独立董事等职。

孙祁祥（SUN Qixiang）女士，独立董事。国籍：中国。北京大学经济学博士。现任北京大学经济学院教授，博士生导师。兼任北京大学政府和社会资本合作（PPP）研究中

心主任、北京大学中国保险与社会保障研究中心主任。曾任北京大学经济学院院长、亚太风险与保险学会主席、美国哈佛大学访问教授。

2、监事

卢井泉（LU Jingquan）先生，监事，国籍：中国。南京政治学院法学硕士。历任空军指挥学院教员、中国银行总行机关党委组织部副部长、武汉中北支行副行长、企业年金理事会高级经理、投资银行与资产管理部高级交易员。

赵蓓青（ZHAO Beiqing）女士，职工监事，国籍：中国，研究生学历。历任辽宁省证券公司上海总部交易员、天治基金管理有限公司交易员、中银基金管理有限公司交易员、交易主管。现任中银基金管理有限公司交易部总经理。

3、管理层成员

李道滨（LI Daobin）先生，董事、执行总裁。简历见董事会成员介绍。

欧阳向军（Jason X.OUYANG）先生，督察长。国籍：加拿大。中国证券业协会-沃顿商学院高级管理培训班(Wharton-SAC Executive Program)毕业证书，加拿大西部大学毅伟商学院(Ivey School of Business, Western University)工商管理硕士（MBA）和经济学硕士。曾在加拿大太平洋集团公司、加拿大帝国商业银行和加拿大伦敦人寿保险公司等海外机构从事金融工作多年，也曾任蔚深证券有限责任公司（现英大证券）研究发展中心总经理、融通基金管理公司市场拓展总监、监察稽核总监和上海复旦大学国际金融系国际金融教研室主任、讲师。

张家文（ZHANG Jiawen）先生，副执行总裁。国籍：中国。西安交通大学工商管理硕士。历任中国银行苏州分行太仓支行副行长、苏州分行风险管理处处长、苏州分行工业园区支行行长、苏州分行副行长、党委委员。

陈军（CHEN Jun）先生，副执行总裁。国籍：中国。上海交通大学工商管理硕士、美国伊利诺伊大学金融学硕士。2004年加入中银基金管理有限公司，历任基金经理、权益投资部总经理、助理执行总裁。

王圣明（WANG Shengming）先生，副执行总裁。国籍：中国。北京师范大学教育管理学院的硕士。现任中银基金管理有限公司副执行总裁。历任中国银行托管业务部副总经理。

闫黎平（YAN Liping）女士，副执行总裁。国籍：中国。中国人民大学法学院法学硕士。2019年加入中银基金管理有限公司，现任中银基金管理有限公司副执行总裁。曾任南方基金管理股份有限公司总裁助理兼保险机构业务部总经理。

4、基金经理

李建（LI Jian）先生，中银基金管理有限公司权益投资部总经理，执行董事(ED)，经济学硕士。曾任联合证券有限责任公司固定收益研究员，恒泰证券有限责任公司固定收益研究员，上海远东证券有限公司投资经理。2005年加入中银基金管理有限公司，2007年8月至2011年3月任中银货币基金基金经理，2008年11月至2014年3月任中银增利基金基金经理，2010年11月至2012年6月任中银双利基金基金经理，2011年6月至今任中银转债基金基金经理，2012年9月至今任中银稳健策略基金（原中银保本）基金经理，2013年9月至今任中银新回报基金基金经理，2014年3月至今任中银多策略混合基金基金经理，2014年6月至2015年6月任中银聚利分级债券基金基金经理，2015年1月至今任中银恒利基金基金经理，2018年9月至今任中银双息回报基金基金经理。具有21年证券从业年限。具备基金、证券、期货和银行间债券交易员从业资格。

（三）投资决策委员会成员的姓名及职务

主席：李道滨（执行总裁）

成员：陈军（副执行总裁）、奚鹏洲（固定收益投资部总经理）、李建（权益投资部总经理）、张发余（研究部总经理）、方明（专户理财部副总经理）、李丽洋（财富管理部副总经理）

列席成员：欧阳向军（督察长）

（四）上述人员之间均不存在近亲属关系。

三、基金托管人

（一）基金托管人概况

1、基本情况

名称：招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”）

设立日期：1987年4月8日

注册地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦

办公地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦

注册资本：252.20亿元

法定代表人：李建红

行长：田惠宇

资产托管业务批准文号：证监基金字[2002]83号

电话：0755—83199084

传真：0755—83195201

资产托管部信息披露负责人：张燕

2、发展概况

招商银行成立于1987年4月8日，是我国第一家完全由企业法人持股的股份制商业银行，总行设在深圳。自成立以来，招商银行先后进行了三次增资扩股，并于2002年3月成功地发行了15亿A股，4月9日在上交所挂牌（股票代码：600036），是国内第一家采用国际会计标准上市的公司。2006年9月又成功发行了22亿H股，9月22日在香港联交所挂牌交易（股票代码：3968），10月5日行使H股超额配售，共发行了24.2亿H股。截至2019年9月30日，本集团总资产73,059.25亿元人民币，高级法下资本充足率15.44%，权重法下资本充足率12.86%。

2002年8月，招商银行成立基金托管部；2005年8月，经报中国证监会同意，更名为资产托管部，现下设业务管理团队、产品管理团队、项目管理团队、稽核监察团队、基金外包业务团队、养老金团队、系统与数据团队7个职能团队，现有员工87人。2002年11月，经中国人民银行和中国证监会批准获得证券投资基金托管业务资格，成为国内第一家获得该项业务资格上市银行；2003年4月，正式办理基金托管业务。招商银行作为托管业务资质最全的商业银行，拥有证券投资基金托管、受托投资管理托管、合格境外机构投资者托管（QFII）、合格境内机构投资者托管（QDII）、全国社会保障基金托管、保险资金托管、企业年金基金托管、存托凭证试点存托人等业务资格。

招商银行确立“因势而变、先您所想”的托管理念和“财富所托、信守承诺”的托管核心价值，独创“6S托管银行”品牌体系，以“保护您的业务、保护您的财富”为历史使命，不断创新托管系统、服务和产品：在业内率先推出“网上托管银行系统”、托管业务综合系统和“6心”托管服务标准，首家发布私募基金绩效分析报告，开办国内首个托管银行网站，推出国内首个托管大数据平台，成功托管国内第一只券商集合资产管理计划、第一只FOF、第一只信托资金计划、第一只股权私募基金、第一家实现货币市场基金赎回资金T+1到账、第一只境外银行QDII基金、第一只红利ETF基金、第一只“1+N”基金专户理财、第一家大小非解禁资产、第一单TOT保管，实现从单一托管服务商向全面投资者服务机构的转变，得到了同业认可。

招商银行资产托管业务持续稳健发展，社会影响力不断提升，四度蝉联获《财资》“中

国最佳托管专业银行”。2016年6月招商银行荣膺《财资》“中国最佳托管银行奖”，成为国内唯一获得该奖项的托管银行；“托管通”获得国内《银行家》2016中国金融创新“十佳金融产品创新奖”；7月荣膺2016年中国资产管理“金贝奖”“最佳资产托管银行”。2017年6月招商银行再度荣膺《财资》“中国最佳托管银行奖”；“全能网上托管银行2.0”荣获《银行家》2017中国金融创新“十佳金融产品创新奖”；8月荣膺国际财经权威媒体《亚洲银行家》“中国年度托管银行奖”。2018年1月招商银行荣膺中央国债登记结算有限责任公司“2017年度优秀资产托管机构”奖项；同月，招商银行托管大数据平台风险管理系统荣获2016-2017年度银监会系统“金点子”方案一等奖，以及中央金融团工委、全国金融青联第五届“双提升”金点子方案二等奖；3月荣膺公募基金20年“最佳基金托管银行”奖；5月荣膺国际财经权威媒体《亚洲银行家》“中国年度托管银行奖”；12月荣膺2018东方财富风云榜“2018年度最佳托管银行”、“20年最值得信赖托管银行”奖。2019年3月招商银行荣获《中国基金报》“2018年度最佳基金托管银行”奖；6月荣获《财资》“中国最佳托管机构”“中国最佳养老金托管机构”“中国最佳零售基金行政外包”三项大奖。

（二）主要人员情况

李建红先生，本行董事长、非执行董事，2014年7月起担任本行董事、董事长。英国东伦敦大学工商管理硕士、吉林大学经济管理专业硕士，高级经济师。招商局集团有限公司董事长，兼任招商局国际有限公司董事会主席、招商局能源运输股份有限公司董事长、中国国际海运集装箱（集团）股份有限公司董事长、招商局华建公路投资有限公司董事长和招商局资本投资有限责任公司董事长。曾任中国远洋运输（集团）总公司总裁助理、总经济师、副总裁，招商局集团有限公司董事、总裁。

田惠宇先生，本行行长、执行董事，2013年5月起担任本行行长、本行执行董事。美国哥伦比亚大学公共管理硕士学位，高级经济师。曾于2003年7月至2013年5月历任上海银行副行长、中国建设银行上海市分行副行长、深圳市分行行长、中国建设银行零售业务总监兼北京市分行行长。

汪建中先生，本行副行长。1991年加入本行；2002年10月至2013年12月历任本行长沙分行行长，总公司银行部副总经理，佛山分行筹备组组长，佛山分行行长，武汉分行行长；2013年12月至2016年10月任本行业务总监兼公司金融总部总裁，期间先后兼任公司金融综合管理部总经理、战略客户部总经理；2016年10月至2017年4月任本行业

务总监兼北京分行行长；2017年4月起任本行党委委员兼北京分行行长。2019年4月起任本行副行长。

姜然女士，招商银行资产托管部总经理，大学本科毕业，具有基金托管人高级管理人员任职资格。先后供职于中国农业银行黑龙江省分行，华商银行，中国农业银行深圳市分行，从事信贷管理、托管工作。2002年9月加盟招商银行至今，历任招商银行总行资产托管部经理、高级经理、总经理助理等职。是国内首家推出的网上托管银行的主要设计、开发者之一，具有20余年银行信贷及托管专业从业经验。在托管产品创新、服务流程优化、市场营销及客户关系管理等领域具有深入的研究和丰富的实务经验。

（三）基金托管业务经营情况

截至2019年9月30日，招商银行股份有限公司累计托管510只证券投资基金。

四、相关服务机构

（一）基金份额发售机构

1、直销机构

中银基金管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路200号中银大厦45楼

办公地址：上海市浦东新区银城中路200号中银大厦26楼、27楼、45楼

法定代表人：章砚

电话：(021) 38834999

传真：(021) 50960970

1) 中银基金管理有限公司直销柜台

地址：上海市浦东新区银城中路200号中银大厦45楼

客户服务电话：021-38834788，400-888-5566

电子信箱：clientservice@bocim.com

联系人：曹卿

2) 中银基金管理有限公司电子直销平台

本公司电子直销平台包括：

中银基金官方网站（www.bocim.com）

官方微信服务号（在微信中搜索公众号“中银基金”并选择关注）

中银基金官方APP客户端（在各大手机应用商城搜索“中银基金”下载安装）

客户服务电话：021-38834788，400-888-5566

电子信箱：clientservice@bocim.com

联系人：张磊

2、销售机构

1) 中国银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街1号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号

法定代表人：刘连舸

客户服务电话：95566

联系人：陈思思

网址：<http://www.boc.cn>

2) 招商银行股份有限公司

注册地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦

办公地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦

法定代表人：李建红

客户服务电话：95555

联系人：邓炯鹏

网址：<http://www.cmbchina.com>

3) 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：易会满

客户服务电话：95588

联系人：王隽

网址：<http://www.icbc.com.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号院1号楼

法定代表人：田国立

客户服务电话：95533

联系人：张静

网址：<http://www.ccb.com>

5) 交通银行股份有限公司

注册地址：上海银城中路 188 号

办公地址：上海市银城中路 188 号

法定代表人：彭纯

客户服务电话：95559

联系人：曹榕

网址：<http://www.bankcomm.com>

6) 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 9 号

办公地址：北京市东城区朝阳门北大街 9 号

法定代表人：李庆萍

客户服务电话：95558

联系人：赵树林

网址：<http://www.citicbank.com/>

7) 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

客户服务电话：95568

联系人：姚建英

公司网站：<http://www.cmbc.com.cn>

8) 华夏银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街 22 号

注册地址：北京市东城区建国门内大街 22 号

法定代表人：李民吉

客户服务电话：95577

联系人：刘军祥

公司网站：<http://www.hxb.com.cn>

9) 南洋商业银行（中国）有限公司

注册地址：上海市浦东新区世纪大道 800 号三层、六层至九层

办公地址：上海市浦东新区世纪大道 800 号三层、六层至九层

法定代表人：陈孝周

客服电话：800-830-2066；400-830-2066

联系人：王晓明

网址：<http://www.ncbchina.cn>

10) 兴业银行股份有限公司

注册地址：福州市湖东路 154 号中山大厦

办公地址：福州市湖东路 154 号中山大厦

法定代表人：高建平

联系人：李博

联系电话：95561

公司网址：<http://www.cib.com.cn/>

11) 上海浦东发展银行股份有限公司

注册地址：上海市中山东一路 12 号

法定代表人：高国富

联系人：唐苑

联系电话：95528

公司网站：www.spdb.com.cn

12) 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

办公地址：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼第 20 层

法定代表人：姜晓林

联系人：孙秋月

客服电话：(0532) 96577

公司网站：<http://www.zxwt.com.cn>

13) 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：周健男

联系人：姚巍

客服电话：95525

公司网站：www.ebscn.com

14) 广发证券股份有限公司

注册地址：广东省广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街 2 号

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：吴韵琪

客服电话：95575 或致电各地营业网点

公司网站：www.gf.com.cn

15) 华福证券有限责任公司

注册地址：福州市五四路 157 号新天地大厦 7、8 层

办公地址：福州市五四路 157 号新天地大厦 7 至 10 层

法定代表人：黄金琳

联系人：林晓东、王虹

客服电话：96326（福建省外加拨 0591）

公司网站：www.hfzq.com.cn

16) 国泰君安证券股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区商城路 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

联系人：李明霞

客服电话：95521

公司网站：www.gtja.com

17) 平安证券股份有限公司

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

办公地址：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

联系人：周一涵、吴琼

客服电话：95511-8

公司网站：<http://stock.pingan.com>

18) 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：杨玉成

联系人：黄莹

客服电话：95523

公司网站：www.swhysc.com

19) 天风证券股份有限公司

注册地址：湖北武汉东湖新技术开发区关东园路 2 号高科大厦四楼

办公地址：湖北武汉江汉区唐家墩路 32 号国资大厦 B 座

法定代表人：余磊

联系人：翟璟

客服电话：028-86712334

公司网站：www.tfzq.com

20) 中国银河证券股份有限公司

办公地址：北京市西城区金融大街 35 号 2-6 层

法定代表人：陈共炎

联系人：徐小琴、肖克

客服电话：4008-888-888

公司网站：www.chinastock.com.cn

21) 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：张佑君

联系人：汤迅、侯艳红

联系电话：95558

公司网站：www.cs.ecitic.com

22) 中信建投证券股份有限公司

注册地址：北京安立路 66 号 4 号楼

法定代表人：王常青

联系人：刘芸

客服电话：4008-888-108

公司网站：<http://www.csc108.com/>

23) 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 楼、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 楼、28 层 A02 单元

法定代表人：王连志

客服电话：95517

联系人：郑效义、杨天枝

公司网址：www.essence.com.cn

24) 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

办公地址：天津市南开区滨水西道 8 号

法定代表人：王春峰

联系人：张彤

客服电话：4006515988

公司网站：<http://www.bhzq.com>

25) 国都证券有限责任公司

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

办公地址：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

联系人：李航

客服电话：4008188118

公司网站：www.guodu.com

26) 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：周杰

联系人：刘佳

客服电话：95553 或拨打各城市营业网点咨询电话

公司网站：www.htsec.com

27) 华安证券股份有限公司

注册地址:安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号

法定代表人:章宏韬

联系人:甘霖

客户电话:95318

公司网站:<http://www.hazq.com>

28) 中泰证券股份有限公司

地址：山东省济南市经七路 86 号

法定代表人：李玮

客服电话：95538

联系人：王霖

公司网站：www.qlzq.com.cn

29) 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

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

联系人：蒋刻真

客服电话：010-66045678

公司网站：<http://www.txsec.com> 或 www.jjm.com.cn

30) 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：400-800-8899

公司网站：<http://www.cindasc.com>

31) 中国国际金融有限公司

注册地址：北京建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层

法定代表人：丁学东

联系人：罗春蓉、肖婷

联系电话：010-65051166 或直接联系各营业部

公司网站：<http://www.cicc.com.cn>

32) 中银国际证券股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路200号中银大厦39F

法定代表人：宁敏

联系人：李澎

联系电话：61195566

公司网站：www.bocichina.com

33) 上海陆金所基金销售有限公司

注册地址：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

法定代表人：王之光

客户服务电话：4008219031

联系人：宁博宇

网址：www.lufunds.com

34) 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号东方财富大厦

法定代表人：其实

客户服务电话：95021/4001818188

联系人：苑格格

网址：<http://fund.eastmoney.com/>

35) 蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

注册地址：浙江省杭州市余杭区五常街道文一西路 969 号 3 幢 5 层 599 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：祖国明

客户服务电话：4000-766-123

联系人：韩爱彬

网址：www.fund123.cn

36) 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

客户服务电话：4007009665

联系人：王诗珺

网址：www.ehowbuy.com

37) 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

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 1201-1203 室

法定代表人：肖雯

客户服务电话：020-89629066

联系人：邱湘湘

网址：www.yingmi.cn

38) 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：上海市虹口区东大名路 1098 号浦江国际金融广场

法定代表人：李兴春

客户服务电话：95733

联系人：陈孜明

网址：www.leadfund.com.cn

39) 浙江同花顺基金销售有限公司

注册地址：杭州市文二西路1号903室

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

客户服务电话：4008773772

联系人：董一锋

网址：www.5ifund.com

40) 北京肯特瑞基金销售有限公司

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：江卉

客户服务电话：95118

网址：fund.jd.com

41) 南京苏宁基金销售有限公司

注册地址：江苏省南京市玄武区苏宁大道1-5号

办公地址：江苏省南京市玄武区苏宁大道1-5号

法定代表人：王锋

客户服务电话：95177

网址：www.snjjjn.com

42) 北京蛋卷基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区创远路34号院6号楼15层1501室

办公地址：北京市朝阳区创远路34号院6号楼15层1501室

法定代表人：钟斐斐

客户服务电话：400-159-9288

网址：danjuanapp.com

43) 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：北京市海淀区上地信息路甲9号奎科科技大厦1层

法定代表人：张旭阳

客户服务电话：95055-4

网址：www.baiyingfund.com

基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择其它符合要求的机构销售本基金，并在基金管理人网站公示。

（二）注册登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

注册地址：北京市西城区太平桥大街17号

办公地址：北京市西城区太平桥大街17号

法定代表人：周明

电话：(010) 59378835

传真：(010) 59378907

联系人：任瑞新

（三）出具法律意见书的律师事务所和经办律师

名称：上海通力律师事务所

住所：上海市银城中路68号时代金融中心19楼

负责人：韩炯

电话：(021) 31358666

传真：(021) 31358600

联系人：黎明

经办律师：吕红、黎明

（四）审计基金财产的会计师事务所和经办注册会计师

名称：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层

执行事务合伙人：毛鞍宁

电话：010-58153000

传真：010-85188298

联系人：徐艳

经办会计师：徐艳、许培菁

五、基金的名称

中银转债增强债券型证券投资基金

六、基金的类型

债券型证券投资基金

七、基金的投资目标

本基金主要利用可转换公司债券品种兼具债券和股票的特性，通过“自上而下”宏观分析和“自下而上”个券选择的有效结合来实施大类资产配置和精选可转换公司债券，在控制风险和保持资产流动性的前提下，追求超越业绩比较基准的超额收益。

八、基金的投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行的股票（包含中小板、创业板及其它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它金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其它品种，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、次级债、可转换公司债券（包含可分离交易可转债）、回购等。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%，其中对可转换公司债券（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%；现金或到期日在一年以内的政府债券投资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（含一级市场新股申购和二级市场股票投资）和权证等权益类证券的比例不高于基金资产的 20%。

九、基金的投资策略

1. “自上而下”资产配置策略

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%，其中对可转换公司债券

（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%；现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%；投资于股票（含一级市场新股申购和二级市场股票投资）和权证等权益类证券的比例不高于基金资产的 20%。

(1)整体资产配置策略

本基金在合同约定的范围内实施稳健的整体资产配置，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情况、信用风险情况、风险预算和有关法律法规等因素的综合分析，预测各类资产在长、中、短期内的风险收益特征，进而在债券类资产、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。

通常，在经济从复苏到繁荣时，股票市场将进入牛市，在这两个阶段，权益资产的收益率都超过固定收益类资产。当经济从滞涨到衰退时，债券市场开始逐步向好进而进入债券市场的牛市。通过对权益类资产和固定收益类资产投资比例的调整可以提高产品的收益水平。

(2)类属资产配置策略

本基金的类属资产配置策略主要通过“自上而下”的宏观分析，结合量化的经济指标综合判断经济周期的运行方向，决定类属资产的投资比例。分析的内容包括：影响经济中长期运行的变量，如经济增长模式、中长期经济增长动力；影响宏观经济的周期性变量，如宏观政策、货币供应、CPI、PPI、M1、M2 等；市场自身的指标，如可转换公司债的转股溢价率和隐含波动率等、公司债的信用状况和偿债能力等、债券市场其它品种的信用利差、期限利差、远期利率和股票的估值指标等。

2.“自下而上”个券精选策略

本基金采取“自下而上”的方法挑选个券和个股。

在个券选择方面，本基金将债券的估值水平、剩余期限、正股基本面、信用风险程度等作为个券是否能够纳入投资组合的主要考量指标；同时对照本基金的收益要求，进一步考虑正股基本面与可转换公司债估值水平的配比、公司债的信用状况和偿债能力、其它普通债券的收益率与剩余期限的配比等因素；并且根据个券的流动性指标决定投资总量。

在个股选择方面，本基金将采用定性分析与定量分析相结合的方式精选具有成长前景向好、估值具有优势的优质品种。

(1)固定收益类品种投资策略

本基金资产主要配置在可转换公司债来获取超额收益，可转换公司债部分的投资策略是本基金的核心策略。

1)可转换公司债投资策略

可转换公司债（以下简称“可转债”）兼有股性和债性两方面的属性。本基金管理人将认真考量可转债的股权价值、债券价值以及其转换期权价值，将选择具有较高投资价值的可转债。

针对可转债的发行主体，本基金管理人将考量包括所处行业景气程度、公司成长性、市场竞争力等因素，参考同类公司估值水平评价其股权投资价值；通过考量利率水平、票息率、付息频率、信用风险及流动性等综合因素判断其债券投资价值；采用经典期权定价模型，量化其转换期权价值，并予以评估。本基金将重点关注公司基本面良好、具备良好的成长空间与潜力、转股溢价率和投资溢价率合理并有一定下行保护的可转债。

具体策略如下：

A. 可转债投资的行业选择

可转债投资的收益主要来自两大块：转股价值和估值水平的提升，前者与正股价格紧密相连，后者与转股溢价率和隐含波动率等有着密切的关系。可转债收益与其正股收益有较强的相关性，同时可转债还有其自身特点，特定情况下其走势还可能背离正股的走势，因此，本基金在股票分析框架的基础上建立一套特定的可转债分析方法和投资策略。

在可转债投资的行业类别选择上，可转债投资收益的来源是分析的根本出发点，根据收益来源的特征进行行业选择，以有效地完成可转债的配置。首先，可转债与股票形成联接，正股的变动从本质上影响着可转债的表现，因此需要根据股票市场周期和经济周期的相关性，确定可转债市场所处的投资环境和预期表现。具体来说，先从宏观环境大势确定未来经济运行态势，进而分析和预测股票市场的整体走势，并确定当前经济发展阶段所对应股票市场各行业的表现，以确定行业层面上的选择排序。比如在经济复苏阶段，选择资源类行业，该类公司的股票表现相对更好，对应的可转债转股价值上升，带动转债价格上涨，从而分享正股上涨带来的收益，而在衰退阶段，选择一些非周期性防御性行业，如公共事业、食品等。其次，从经济层面确定好行业选择的排序后，需进一步根据可转债市场估值特点来最终确定该配置哪些最有效的行业。从估值方面看，转股溢价率和正股隐含波动率的提高是可转债价格上升的最主要因素，而不同行业不同类型的公司对旗下可转债转股溢价率的支撑程度是不一样的，正股的波动性也不相同，比如当前成长性较快的行业其

未来获利能力相对较强，市场对其关注度较高，投资者会有所偏爱，此类行业会被给予相对较高的估值，在其他因素相同的情形下，此类行业的可转债能支撑更高的转股溢价率等，可转债的估值水平会提升，从而提升可转债的价格，同时本基金会根据可转债当前价格来评估当前估值水平是否已经体现了其自身可支撑的未来估值水平，选择低估的行业和公司。

总体来看，对可转债行业选择的分析是结合经济周期、股票市场和可转债本身估值特点等因素综合考虑，结合数量分析，最终确定行业的排序，挖掘出特定时期下最优的行业并进行合适的配置。

B. 可转债个券的选择

可转债不同于一般的企业债券，该债券赋予投资者在一定条件下将可转债转换成股票的权利，投资者可能还具有回售等其他权利，因此从这方面看可转债的理论价值应等于普通债券的基础价值和可转债自身内含的期权价值之和。可转债的基础价值，即纯债价值，该部分价值的计算与普通债券价值的计算方法一样，即按照债券市场相应的收益率水平将未来的一系列现金流进行贴现即可。可转债价值中的另一部分即期权价值的定价是可转债定价的核心，该部分定价涉及到对应正股的价格及其预期、可转债发行条款、该发债上市公司基本面特征、股价波动率等关键要素。关于期权定价，常用的模型有二叉树模型、修正的 BS 模型等，本基金在分析期权价值的过程将结合定价模型、市场定性分析和定量比较分析，充分考虑市场各时期的特征，合理地给出可转债的估值。

C. 可转债条款投资策略

国内转债一般具有提前赎回、修正转股价、提前回售等条款，这些条款在特定环境下对转债价值有着较大的影响。例如，当一段时间内正股价格持续低于转股价达到一定程度，则发行该可转债的公司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转债的转股价值，从而提升转债价值，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。本基金从公司层面进行分析，包括当前经营状况和未来发展战略，以及公司的财务状况和融资需求，站在企业方面看问题，从而较好地把握企业在提前赎回、修正转股价等方面的态度。另外，因增发或派息等而引起转股价变动，不同的情形会对转债价值产生不同的影响，本基金可以通过有效分析相关信息而把握可能的投资机会。

D. 可转债转换成相应股票的投资策略

在转股期内，可转债具有按规定转换条件转换成相应股票的权力，因此需要有合理的可转债转换成股票的策略，本基金认为是否进行转股主要根据转股前后的价值对比进行判断，一般来说包括如下情况：

a) 当转股溢价率明显为负时，即一张可转债转换成股票后卖出的所得收益大于转债价格，本基金将抓住此套利机会，通过将可转债转股卖出而获得超额收益；

b) 当因正股价格大涨而触发提前赎回时，本基金将具体分析该正股未来的可能表现情况，据此首先做出将可转债进行转股来保障投资者的利益，然后进一步做出是继续持有正股还是立即卖出的决定；

c) 当转债流动性不能满足组合所要求时，本基金将合理地通过转股来保持高流通性；

d) 通过可转债转股能提升投资者收益的其他情况。

E. 可分离交易可转债投资策略

可分离交易可转债是一类特殊的可转债品种，与普通可转债不同的一点主要在于可分离交易可转债在上市后债券部分跟权证部分实行分离交易。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，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)其它固定收益类资产投资策略

除可转债外，本基金可投资的债券范围包括国债、金融债、央票、企业债、公司债、资产证券化产品和短期融资券等其他债券资产。在该部分投资管理上，本基金灵活应用各种期限结构策略、信用策略、互换策略、息差策略和资产支持证券策略等，在合理管理并控制组合风险的前提下，为组合增加最大的收益。

A. 期限结构策略

期限结构配置策略原则上是基于收益率曲线变化的情景分析，“自上而下”的进行资产配置，构建最优化债券组合。

在确定组合目标久期后，通过研究收益率曲线结构，采用情景分析方法对各期限段债券风险收益特征进行评估，将预期收益率与波动率匹配度最高的期限段进行配比，从而在

子弹组合、哑铃组合和梯形组合中选择风险收益特征最优的配置组合。

B. 信用策略

信用利差收益率主要受两个方面的影响，一是债券对应信用水平的市场信用利差曲线走势；二是债券本身的信用变化。本基金依靠内部评级系统分析债券的相对信用水平、违约风险及理论信用利差，分析信用利差曲线整体及分行业走势，确定各类债券投资比例。

C. 互换策略

不同券种在利息、违约风险、久期、流动性、税收和衍生条款等方面存在差别，投资管理人可以同时买入和卖出具有相近特性的两个或两个以上券种，赚取收益率差。

D. 息差策略

息差策略是指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资金投资于债券的策略。

息差策略实际上也就是杠杆放大策略，进行放大策略时，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，息差策略才能取得正的收益。

E. 资产支持证券策略

本基金管理人通过考量宏观经济形势、提前偿还率、违约率、资产池结构以及资产池资产所在行业景气情况等因素，预判资产池未来现金流变动；预测提前偿还率变化对标的证券平均久期及收益率曲线的影响，密切关注流动性变化，在严格控制信用风险暴露程度的前提下，选择风险调整后收益较高的品种进行投资。

(2) 权益类品种投资策略

1) 股票投资策略

本基金在大类资产配置下，通过对股票基本面的分析来精选个股。分析主要包括股票的价值和成长性指标。价值投资的核心思想是寻找市场上被低估的股票，具体指标包括：市盈率、市净率、市销率、股息收益率等。成长股的重要评估指标是考察公司的成长性，具体指标包括：预期净利润增长率、中长期净利润增长率、内部成长率及历史增长率等。

在股票投资方面，本基金遵循如下投资步骤：

A. 对股票的风格特征进行评估，从股票池中选择成长与价值特性突出的股票。

根据一系列指标对市场上所有股票的风格特征进行评估，初步筛选出成长与价值股票池。

B.对股票的基本面素质进行筛选，应用基本面分析方法，确定优质成长股与优质价值股的评价标准，在第一步选择出的具有鲜明风格的股票名单中，进一步分析，选出基本面较好的股票。

成长股与价值股在股票资产中进行相对均衡的配置，适度调整，以控制因风格带来的投资风险，降低组合波动，提高整体收益率。

2)权证投资策略

权证为本基金辅助性投资工具，投资原则为有利于基金资产增值、控制下跌风险、实现保值和锁定收益。本基金将主要投资满足成长和价值优选条件的公司发行的权证。

十、业绩比较基准

天相转债指数收益率×80%+中债综合指数收益率×20%。

天相转债指数是以沪深两市所有可转债的交易价格，按发行公司公告的实际未转股规模帕氏加权计算，反映两市可转债的总体走势。天相转债指数的基期为1999年12月30日，是国内较早编制的可转债指数。

中债综合指数是由中央国债登记结算有限责任公司编制，样本债券涵盖的范围更加全面，具有广泛的市场代表性，涵盖主要交易市场（银行间市场、交易所市场等）、不同发行主体（政府、企业等）和期限（长期、中期、短期等），能够很好地反映中国债券市场总体价格水平和变动趋势。中债综合指数各项指标值的时间序列更加完整，有利于更加深入地研究和分析市场。

在综合考虑了指数的权威性和代表性、指数的编制方法和本基金的投资范围和投资理念，本基金选择市场认同度较高的天相转债指数和中债综合指数的组合：天相转债指数收益率×80%+中债综合指数收益率×20%，作为业绩比较基准。如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适用于本基金的业绩基准的指数时，本基金的基金管理人可以在与基金托管人协商一致，并履行适当程序后，变更业绩比较基准并及时公告。

十一、风险收益特征

本基金属于债券型基金，其预期风险收益低于股票型基金和混合型基金，高于货币市场基金。

十二、投资组合报告

本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。

本基金的托管人——招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2020年1月10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9月30日，本报告所列财务数据未经审计。

（一）报告期末基金资产组合情况

1、报告期末按行业分类的境内股票投资组合

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	28,935,233.00	16.80
	其中：股票	28,935,233.00	16.80
2	固定收益投资	134,604,951.23	78.14
	其中：债券	134,604,951.23	78.14
	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	6,814,994.01	3.96
7	其他各项资产	1,910,410.23	1.11
8	合计	172,265,588.47	100.00

2、报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

（二）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	17,931,206.00	11.40
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	3,230,683.00	2.05
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	3,897,072.00	2.48
J	金融业	3,130,472.00	1.99
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	745,800.00	0.47
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	28,935,233.00	18.39

(三) 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	600519	贵州茅台	4,100	4,715,000.00	3.00
2	000895	双汇发展	128,700	3,178,890.00	2.02
3	000001	平安银行	200,800	3,130,472.00	1.99
4	603566	普莱柯	102,200	1,885,590.00	1.20
5	300253	卫宁健康	113,400	1,800,792.00	1.14
6	603883	老百姓	22,100	1,673,633.00	1.06

7	002697	红旗连锁	209,000	1,557,050.00	0.99
8	603517	绝味食品	36,540	1,482,062.40	0.94
9	603806	福斯特	30,669	1,392,372.60	0.89
10	600183	生益科技	55,100	1,374,194.00	0.87

(四) 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	699,930.00	0.44
2	央行票据	-	-
3	金融债券	8,267,356.10	5.26
	其中：政策性金融债	8,267,356.10	5.26
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）	125,637,665.13	79.87
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	134,604,951.23	85.57

(五) 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	156,940	17,815,828.80	11.33
2	110053	苏银转债	113,030	12,256,973.20	7.79
3	113013	国君转债	88,850	10,435,432.50	6.63
4	128016	雨虹转债	66,165	7,610,298.30	4.84
5	113533	参林转债	48,200	7,238,194.00	4.60

(六) 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。

(七) 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。

(八) 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

(九) 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

1、本基金投资国债期货的投资政策

本基金投资范围未包括国债期货，无相关投资政策。

2、报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金报告期内未参与国债期货投资。

3、本基金投资国债期货的投资评价

本基金报告期内未参与国债期货投资，无相关投资评价。

(十) 投资组合报告附注

1、报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

2、本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。

3、其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	27,924.52
2	应收证券清算款	238,160.28
3	应收股利	-
4	应收利息	405,934.79
5	应收申购款	1,238,390.64
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,910,410.23

4、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	17,815,828.80	11.33
2	110053	苏银转债	12,256,973.20	7.79

3	113013	国君转债	10,435,432.50	6.63
4	128016	雨虹转债	7,610,298.30	4.84
5	128020	水晶转债	6,293,386.95	4.00
6	113021	中信转债	5,931,103.20	3.77
7	132005	15 国资 EB	5,830,110.00	3.71
8	127005	长证转债	4,196,936.64	2.67
9	128059	视源转债	3,908,614.32	2.48
10	127011	中鼎转 2	3,656,191.68	2.32
11	113529	绝味转债	3,231,849.90	2.05
12	110054	通威转债	3,000,260.40	1.91
13	113510	再升转债	2,550,465.00	1.62
14	128035	大族转债	2,364,010.23	1.50
15	110055	伊力转债	2,341,957.40	1.49
16	113522	旭升转债	2,237,333.50	1.42
17	128045	机电转债	1,528,308.00	0.97
18	128048	张行转债	1,134,433.60	0.72
19	128058	拓邦转债	1,111,801.92	0.71
20	113508	新凤转债	739,891.00	0.47

5、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不存在流通受限情况。

6、投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于计算中四舍五入的原因，本报告分项之和与合计项之间可能存在尾差。

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。

本基金合同生效日为 2011 年 6 月 29 日，基金合同生效以来基金投资业绩与同期业绩比较基准的比较如下表所示：

中银转债增强债券 A:

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 年 6 月 29 日(基金 合同生效日)至 2011 年 12 月 31 日	-0.20%	0.21%	-7.91%	0.59%	7.71%	-0.38%

2012年1月1日至2012年12月31日	9.42%	0.37%	2.91%	0.28%	6.51%	0.09%
2013年1月1日至2013年12月31日	3.02%	0.84%	-1.15%	0.51%	4.17%	0.33%
2014年1月1日至2014年12月31日	70.40%	1.24%	44.96%	0.84%	25.44%	0.40%
2015年1月1日至2015年12月31日	21.02%	3.52%	-19.01%	2.45%	40.03%	1.07%
2016年1月1日至2016年12月31日	-20.39%	0.88%	-8.35%	0.57%	-12.04%	0.31%
2017年1月1日至2017年12月31日	1.19%	0.45%	-1.35%	0.33%	2.54%	0.12%
2018年1月1日至2018年12月31日	-8.19%	0.69%	1.18%	0.42%	-9.37%	0.27%
2019年1月1日至2019年9月30日	20.28%	0.92%	11.14%	0.48%	9.14%	0.44%
自基金合同生效起至2019年9月30日	106.40%	1.43%	11.82%	0.98%	94.58%	0.45%

中银转债增强债券 B:

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年6月29日(基金合同生效日)至2011年12月31日	-0.40%	0.21%	-7.91%	0.59%	7.51%	-0.38%
2012年1月1日至2012年12月31日	9.04%	0.37%	2.91%	0.28%	6.13%	0.09%
2013年1月1日至2013年12月31日	2.67%	0.84%	-1.15%	0.51%	3.82%	0.33%

2014年1月1日至2014年12月31日	69.60%	1.24%	44.96%	0.84%	24.64%	0.40%
2015年1月1日至2015年12月31日	20.52%	3.52%	-19.01%	2.45%	39.53%	1.07%
2016年1月1日至2016年12月31日	-20.67%	0.88%	-8.35%	0.57%	-12.32%	0.31%
2017年1月1日至2017年12月31日	0.83%	0.45%	-1.35%	0.33%	2.18%	0.12%
2018年1月1日至2018年12月31日	-8.56%	0.69%	1.18%	0.42%	-9.74%	0.27%
2019年1月1日至2019年9月30日	19.98%	0.92%	11.14%	0.48%	8.84%	0.44%
自基金合同生效起至2019年9月30日	100.00%	1.43%	11.82%	0.98%	88.18%	0.45%

十四、基金费用概览

（一）与基金运作有关的费用

1、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) 本基金从B类基金份额的基金财产中计提销售服务费；
- 4) 基金财产拨划支付的银行费用；
- 5) 基金合同生效后的基金信息披露费用；
- 6) 基金份额持有人大会费用；
- 7) 基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费；
- 8) 基金的证券交易费用；
- 9) 依法可以在基金财产中列支的其他费用。

上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内参照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定。

2、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，基金管理费按基金资产净值的 0.75% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.75\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 5 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，基金托管费按基金资产净值的 0.20% 年费率计提。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 为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 5 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) 销售服务费

本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，B 类基金份额的销售服务费年费率为 0.35%。销售服务费计算方法如下，按 B 类基金份额基金资产净值计提：

$$H = E \times 0.35\% \div \text{当年天数}$$

H 为 B 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 B 类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，由基金管理人按相关合同规定支付给基金销售机构等。若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

4) 除管理费、托管费、销售服务费之外的基金费用，由基金托管人根据其他有关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。

3、不列入基金费用的项目

基金合同生效前的律师费、会计师费和信息披露费用不得从基金财产中列支。基金管

理人与基金托管人因未履行或未完全履行义务导致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。

4、基金管理费、基金托管费和销售服务费的调整

基金管理人和基金托管人可协商酌情降低基金管理费率、基金托管费、销售服务费率，此项调整不需要基金份额持有人大会决议通过。基金管理人必须最迟于新的费率实施日 2 日前在指定媒介上刊登公告。

5、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。

(二) 与基金销售有关的费用

1、认购费

本基金已经成立，不再收取认购费。

2、申购与赎回费

注 1：就赎回费率的计算而言，1 年指 365 日，2 年 730 日，以此类推。

	A 类基金份额		B 类基金份额	
	金额 (M)	前端申购费	申购费率	
申购费率	M < 100 万	0.80%	0%	
	100 万 ≤ M < 200 万	0.50%		
	200 万 ≤ M < 500 万	0.30%		
	M ≥ 500 万	每笔 1000 元		
赎回费率	持有期限	赎回费率	赎回费率	
	Y < 7 日	1.5%	Y < 7 日	1.5%
	7 日 ≤ Y < 1 年	0.10%	Y ≥ 7 日	0%
	1 年 ≤ Y < 2 年	0.05%		
	Y ≥ 2 年	0%		

注 2：上述持有期是指在注册登记系统内，投资人持有基金份额的连续期限。

(三) 其他费用

本基金其他费用根据相关法律法规执行。

十五、对招募说明书更新部分的说明

本基金管理人依据《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》及其它有关法律法规的要求，结合本基金运作的实际情况，对本基金的原招募说明书进行了更新。本次主要更新的内容为：

- （一） 在“重要提示”部分，对招募说明书所载内容的截止日与有关财务数据和净值表现截止日进行更新；
- （二） 在“基金管理人”部分，对管理人的相关信息进行了更新；
- （三） 在“基金托管人”部分，对基金托管人相关信息进行了更新；
- （四） 在“相关服务机构”部分，对基金份额发售机构的相关信息进行了更新；
- （五） 在“投资组合报告”部分，根据《信息披露内容与格式准则第5号》及《基金合同》，披露了本基金最近一期投资组合报告的内容；
- （六） 在“基金的业绩”部分，披露了基金自合同生效以来的投资业绩；
- （七） 在“其他应披露事项”部分，列明了前次更新招募说明书所载内容以来的其他应披露事项。

中银基金管理有限公司

2020年1月17日