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

（2014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：二〇一四年五月

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2014年3月25日，有关财务数据截止日为2013年3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：田德军

电话：（0755）26948070

联系人：敖敬东

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 Asset Management Co.,Ltd.）40%。

（二）主要人员情况

1、现任董事情况

董事长田德军先生，经济学博士，现任融通基金管理有限公司董事长。历任中信证券股份有限公司投资银行业务主管；上海远东证券有限公司董事长兼总经理；新时代证券有限责任公司总经理。2010年3月至今，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、执业律师。现任南开大学金融学教授（博士生导师），金融发展研究院副院长（主持工作）。曾经就读伦敦大学伦敦商学院，执教于密歇根大学WDI研究所、北京大学光华管理学院、长江商学院。2011年1月至今，任公司独立董事。

独立董事施天涛先生，教授。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。

董事奚星华先生，经济学硕士。现任融通基金管理有限公司总经理。历任黑龙江省证券公司宏观行业研究员，北京时代博讯高科技有限公司投资业务副总经理，长财证券经纪有限责任公司总裁，恒泰长财证券有限责任公司执行董事、法定代表人。2012年1月至今，任公司董事。

董事Frederick Reidenbach（弗莱德）先生，毕业于美国宾夕法尼亚州斯克兰顿大学，注册会计师。现任日兴资产管理有限公司执行副总裁兼首席财务官和首席营运官。历任日本富达投资首席行政官；富达投资（Fidelity Investment）旗下子公司KVH电信的首席执行长和首席营运官；日本Aon Risk Service的首席财务官和首席营运官。2010年3月至今，任公司董事。

董事Blair Pickerell（裴布雷）先生，工商管理硕士。现任日兴资产管理香港有限公司亚洲区总裁及全球首席营销总监。历任摩根士丹利亚洲有限公司董事总经理。2012年1月至今，任公司董事。

董事涂卫东先生，法学硕士。现任融通基金管理有限公司督察长。历任国务院法制办公室(原国务院法制局)财金司一处主任科员；中国证监会基金监管部监管一处处级干部；中国证监会公职律师。2009年4月至今，任中共融通基金管理有限公司支部委员会副书记。2010年3月至今，任公司董事。

2、现任监事情况

监事李东先生，经济学硕士，现任公司监察稽核部总监。曾任北京大学经济管理系讲师，1993年起历任广东省南方金融服务总公司基金部副总经理、广东华侨信托投资公司规划发展部总经理、广州鼎源投资理财顾问有限公司总经理兼广东南方资信评估公司董事长、天一证券有限责任公司广州营业部总经理及华南业务总部总经理。2011 年至今任公司监事。

3、公司高级管理人员情况

总经理奚星华先生，经济学硕士。历任黑龙江省证券公司宏观行业研究员，北京时代博讯高科技有限公司投资业务副总经理，长财证券经纪有限责任公司总裁，恒泰长财证券有限责任公司执行董事、法定代表人。2011 年至今任公司总经理。

常务副总经理颜锡廉（Allen Yan）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。

副总经理秦玮先生，工学硕士。历任中国工商银行深圳分行格兰信息咨询公司总经理助理，鹏华基金管理有限公司行政部总监，融通基金管理有限公司登记清算部总监、总经理助理等职务。2009 年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)财金司一处主任科员；中国证监会基金监管部监管一处处级干部；中国证监会公职律师。2011 年至今任公司督察长。

4、本基金基金经理

王超，金融工程硕士，经济学、数学双学士，7年证券从业经验，具有证券从业资格。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、融通七天理财债券和融通标普可转债指数基金经理。

5、投资决策委员会成员

公司投资决策委员会由总经理奚星华先生、常务副总经理颜锡廉（Allen Yan）先生、总经理助理陈帧嗣明（曾用名陈晓生）先生、基金管理部总监吴巍先生、研究策划部总监邹畿先生、基金交易部总监王冰心先生、基金经理郭恒先生组成。

6、上述人员之间不存在近亲属关系。

三、基金托管人

1、基金托管人基本情况

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

法定代表人：蒋超良

成立日期：2009年1月15日

注册资本：32,479,411.7万元人民币

存续期间：持续经营

组织形式：股份有限公司

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基金字[1998]23号

联系电话：010-63201510

传真：010-63201816

联系人：李芳菲

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2013年9月25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176只，包括富国天源平衡混合型证券投资基金、华夏平稳增长混合型证券投资基金、大成积极成长股票型证券投资基金、大成景阳领先股票型证券投资基金、大成创新成长混合型证券投资基金、长盛同德主题增长股票型证券投资基金、博时内需增长灵活配置混合型证券投资基金、汉盛证券投资基金、裕隆证券投资基金、景福证券投资基金、鸿阳证券投资基金、丰和价值证券投资基金、久嘉证券投资基金、长盛成长价值证券投资基金、宝盈鸿利收益证券投资基金、大成价值增长证券投资基金、大成债券投资基金、银河稳健证券投资基金、银河收益证券投资基金、长盛中信全债指数增强型债券投资基金、长信利息收益开放式证券投资基金、长盛动态精选证券投资基金、景顺长城内需增长开放式证券投资基金、万家增强收益债券型证券投资基金、大成精选增值混合型证券投资基金、长信银利精选开放式证券投资基金、富国天瑞强势地区精选混合型证券投资基金、鹏华货币市场证券投资基金、中海分红增利混合型证券投资基金、国泰货币市场证券投资基金、新华优选分红混合型证券投资基金、交银施罗德精选股票证券投资基金、泰达宏利货币市场基金、交银施罗德货币市场证券投资基金、景顺长城资源垄断股票型证券投资基金、大成沪深300指数证券投资基金、信诚四季红混合型证券投资基金、富国天时货币市场基金、富兰克林国海弹性市值股票型证券投资基金、益民货币市场基金、长城安心回报混合型证券投资基金、中邮核心优选股票型证券投资基金、景顺长城内需增长贰号股票型证券投资基金、交银施罗德成长股票证券投资基金、长盛中证100指数证券投资基金、泰达宏利首选企业股票型证券投资基金、东吴价值成长双动力股票型证券投资基金、鹏华动力增长混合型证券投资基金、宝盈策略增长股票型证券投资基金、国泰金牛创新成长股票型证券投资基金、益民创新优势混合型证券投资基金、中邮核心成长股票型证券投资基金、华夏复兴股票型证券投资基金、富国天成红利灵活配置混合型证券投资基金、长信双利优选灵活配置混合型证券投资基金、富兰克林国海深化价值股票型证券投资基金、中万巴黎竞争优势股票型证券投资基金、新华优选成长股票型证券投资基金、金元惠理成长动力灵活配置混合型证券投资基金、天治稳健双盈债券型证券投资基金、中海蓝筹灵活配置混合型证券投资基金、长信利丰债券型证券投资基金、金元惠理丰利债券型证券投资基金、交银施罗德先锋股票证券投资基金、东吴进取策略灵活配置混合型开放式证券投资基金、建信收益增强债券型证券投资基金、银华内需精选股票型证券投资基金(LOF)、大成行业轮动股票型证券投资基金、交银施罗德上证180公司治理交易型开放式指数证券投资基金联接基金、上证180公司治理交易型开放式指数证券投资基金、富兰克林国海沪深300指数增强型证券投资基金、南方中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)、景顺长城能源基建股票型证券投资基金、中邮核心优势灵活配置混合型证券投资基金、工银瑞信中小盘成长股票型证券投资基金、东吴货币市场证券投资基金、博时创业成长股票型证券投资基金、招商信用添利债券型证券投资基金、易方达消费行业股票型证券投资基金、富国汇利分级债券型证券投资基金、大成景丰分级债券型证券投资基金、兴全沪深300指数增强型证券投资基金(LOF)、工银瑞信深证红利交易型开放式指数证券投资基金、工银瑞信深证红利交易型开放式指数证券投资基金联接基金、富国可转换债券证券投资基金、大成深证成长40交易型开放式指数证券投资基金、大成深证成长40交易型开放式指数证券投资基金联接基金、泰达宏利领先中小盘股票型证券投资基金、交银施罗德信用添利债券证券投资基金、东吴中证新兴产业指数证券投资基金、工银瑞信四季收益债券型证券投资基金、招商安瑞进取债券型证券投资基金、汇添富社会责任股票型证券投资基金、工银瑞信消费服务行业股票型证券投资基金、易方达黄金主题证券投资基金（LOF）、中邮中小盘灵活配置混合型证券投资基金、浙商聚潮产业成长股票型证券投资基金、嘉实领先成长股票型证券投资基金、广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金、广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金联接基金、南方保本混合型证券投资基金、交银施罗德先进制造股票证券投资基金、上投摩根新兴动力股票型证券投资基金、富兰克林国海策略回报灵活配置混合型证券投资基金、金元惠理保本混合型证券投资基金、招商安达保本混合型证券投资基金、交银施罗德深证300价值交易型开放式指数证券投资基金、南方中国中小盘股票指数证券投资基金（LOF）、交银施罗德深证300价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金、富国中证500指数增强型证券投资基金（LOF）、长信内需成长股票型证券投资基金、大成中证内地消费主题指数证券投资基金、中海消费主题精选股票型证券投资基金、长盛同瑞中证200指数分级证券投资基金、景顺长城核心竞争力股票型证券投资基金、汇添富信用债债券型证券投资基金、光大保德信行业轮动股票型证券投资基金、富兰克林国海亚洲（除日本）机会股票型证券投资基金、汇添富逆向投资股票型证券投资基金、大成新锐产业股票型证券投资基金、申万菱信中小板指数分级证券投资基金、广发消费品精选股票型证券投资基金、鹏华金刚保本混合型证券投资基金、汇添富理财14天债券型证券投资基金、嘉实全球房地产证券投资基金、金元惠理新经济主题股票型证券投资基金、东吴保本混合型证券投资基金、建新社会责任股票型证券投资基金、嘉实理财宝7天债券型证券投资基金、富兰克林国海恒久信用债券型证券投资基金、大成月添利理财债券型证券投资基金、安信目标收益债券型证券投资基金、富国7天理财宝债券型证券投资基金、交银施罗德理财21天债券型证券投资基金、易方达中债新综合指数发起式证券投资基金（LOF）、工银瑞信信用纯债债券型证券投资基金、大成现金增利货币市场基金、景顺长城支柱产业股票型证券投资基金、易方达月月利理财债券型证券投资基金、摩根士丹利华鑫量化配置股票型证券投资基金、东方央视财经50指数增强型证券投资基金、交银施罗德纯债债券型发起式证券投资基金、鹏华理财21天债券型证券投资基金、国泰民安增利债券型发起式证券投资基金、万家14天理财债券型证券投资基金、华安纯债债券型发起式证券投资基金、金元惠理惠利保本混合型证券投资基金、南方中证500交易型开放式指数证券投资基金、招商双债增强分级债券型证券投资基金、景顺长城品质投资股票型证券投资基金、中海可转换债券债券型证券投资基金、融通标普中国可转债指数增强型证券投资基金、大成现金宝场内实时申赎货币市场基金、交银施罗德荣祥保本混合型证券投资基金、国泰中国企业境外高收益债券型证券投资基金、富兰克林国海焦点联动灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城沪深300等权重交易型开放式指数证券投资基金、广发聚源定期开放债券型证券投资基金、大成景安短融债券型证券投资基金、嘉实研究阿尔法股票型证券投资基金、新华行业轮换灵活配置混合型证券投资基金、富国目标收益一年期纯债债券型证券投资基金、汇添富高息债债券型证券投资基金、东方利群混合型发起式证券投资基金、南方稳利一年定期开放债券型证券投资基金、景顺长城四季金利纯债债券型证券投资基金、华夏永福养老理财混合型证券投资基金、嘉实丰益信用定期开放债券型证券投资基金、国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金、交银施罗德定期支付双息平衡混合型证券投资基金、光大保德信现金宝货币市场基金、易方达投资级信用债债券型证券投资基金、广发趋势优选灵活配置混合型证券投资基金、华润元大保本混合型证券投资基金、长盛双月红一年期定期开放债券型证券投资基金、富国国有企业债债券型证券投资基金。

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服务深圳小组

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：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：宋雅萍

电话：（010）66190975

（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：居雯莉

联系电话：（021）38424888转4984

（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：刘晨

联系电话：（0755）26948105

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：蒋超良

传真：（010）85109219

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：姜建清

客户服务电话：95588

传真：(010)66107914

（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：胡怀邦

客服电话：95559

传真：（021）58408483

（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）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

（7）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

（8）深圳众禄基金销售有限公司

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：汤素婕

电话：（0755）33227950

传真：（0755）82080798

（9）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

（10）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：周嫣旻

电话：（0571）28829790，（021）60897869

传真：（0571）26698533

客服电话：4000-766-123

（11）长城证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区深南大道6008 号特区报业大厦14、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

（12）中银万国证券股份有限公司

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：储晓明

联系人：曹晔

电话：（021）54033888

客服电话：4008895523

（13）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

（14）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

法定代表人：曾小普

联系人：周欣玲

电话：（0791）86281305

客服电话：4008222111

（15）新时代证券有限责任公司

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：刘汝军

联络人：宋旸

电话：（010）83561149

客服电话：400698989

（16）恒泰证券有限责任公司

注册地址：内蒙古呼和浩特市新城区新华东街111 号

法定代表人：庞介民

联系人：王旭华

电话：（0471）4972343

客服电话：（0471）4961259

（17）中信证券股份有限公司

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

法定代表人：王东明

联系人：腾艳

电话：（010）60838832

客服电话：4008895548

（18）中信证券（浙江）有限责任公司

办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道588 号恒鑫大厦19、20 层

法定代表人：沈强

联系人：王霈霈

电话：（0571）87112507

客服电话：95548

（19）中信万通证券有限责任公司

注册地址：山东省青岛市崂山区苗岭路29 号澳柯玛大厦15 层

法定代表人：杨宝林

联系人：吴中超

电话：（0532）85022326

客服电话：95548

（20）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9 号院1 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

（21）光大证券股份有限公司

注册地址：上海市静安区新闸路1508 号

法定代表人：袁长清（代行）

联系人：刘晨

电话：（021）22169081

客服电话：95525

（22）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198 号

法定代表人：李工

联系人：钱欢

电话：（0551）5161771

客服电话：96518

（23）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笋中民时代广场B 座25、26层

法定代表人：刘学民

联系人：福丽娜

电话：（010）63197785

客服电话：4008881888

（24）长江证券股份有限公司

联系地址：武汉市江汉区新华路特8 号长江证券大厦

法定代表人：胡运钊

联系人：李良

电话：（027）65799999

客服热线：400-8888-999，95579

（25）平安证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场8 楼

法定代表人：杨宇翔

联系人：郑舒丽

电话：（0755）22626391

客服电话：95511 转8

（26）上海天天基金销售有限公司

注册地址：上海市浦东新区娥山路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

（27）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

（28）中期时代基金销售（北京）有限公司

注册地址：北京市朝阳区建国门外光华路16 号1 幢11 层

法定代表人：路瑶

联系人：朱剑秋

电话：400-8888-160

传真：010-59539866

客服电话：95162、4008888160

（29）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：卓紘矗

联系人：王娓萍

电话：0755-33076853

传真：0755-33065516

客服电话：4006-877-899

（30）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号建威大厦1208室

办公地址：北京市西城区南礼士路66号建威大厦1208－1209室

法定代表人：罗仙安

联系人：孙晋晓

电话：010-67000988

传真：010-67000988-6000

客户服务电话：400－001－8811

（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：田德军

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：深圳市红岭中路国信证券大厦12楼

办公地址：深圳市红岭中路国信证券大厦12楼

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有限公司

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1233号汇亚大厦1604－1608室

办公地址：上海市湖滨路202 号普华永道中心11 楼（邮编：200021）

法人代表：杨绍信

电话：（021）23238888

传真：（021）23238800

联系人：薛竞、刘莉

经办注册会计师：薛竞、王灵

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、基金的投资内容

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基础组合，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，具有彼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，是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。

（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，以增强本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&P China Convertible Bond Index) × 95%　+银行活期