中海可转换债券债券型证券投资基金更新招募说明书摘要

（2018年第1号）

本基金基金合同于2013年3月20日生效。

重要提示

投资有风险，投资人申购基金时应认真阅读招募说明书。

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》、《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。

本招募说明书所载内容截止日为2018年9月20日，有关财务数据和净值表现截止日为2018年6月30日(财务数据未经审计)。

一、基金管理人

（一）基金管理人概况

名称：中海基金管理有限公司
住所：中国（上海）自由贸易试验区银城中路68号2905-2908室及30层
办公地址：上海市浦东新区银城中路68号2905-2908室及30层
邮政编码：200120
成立日期：2004年3月18日
法定代表人：杨皓鹏
总经理：杨皓鹏

经营范围：基金募集、基金销售、资产管理、中国证监会许可的其他业务。【依法须经批准的项目，经相关部门批准后方可开展经营活动】

批准设立机关：中国证券监督管理委员会
批准设立文号：证监基金字[2004]24号
组织形式：有限责任公司（中外合资）
注册资本：壹亿肆仟陆佰陆拾陆万陆仟柒佰元人民币
存续期间：持续经营
联系人：葛玮唐
联系电话：021-38429808
股东名称及其出资比例：

中海信托股份有限公司	41.591％
国联证券股份有限公司	33.409％
法国爱德蒙得洛希尔银行股份有限公司	25.000％

（二）主要人员情况

1、董事会成员

黄晓峰先生，董事长。中国人民大学硕士，高级经济师。现任中海信托股份有限公司总裁、党委书记。历任湖北省计划管理干部学院助教，国家海洋局管理司主任科员，中国海洋石油总公司计划项目处、经济评价处干部、保险处保险主管，中海石油有限公司税收保险岗、代理融资岗位经理、资金部副总监、代理总监、总监，中海石油财务有限责任公司总经理。

庞建先生，董事。中国人民大学本科学历，高级会计师。现任中海石油财务有限责任公司总经理。历任渤海石油公司对外合作部计划财务部外事会计，渤海13/03合作区联管会财务专业代表，10/15、11/19、06/17合作区联管会财务专业代表，中国海洋石油总公司审计部干部，中海会计审计公司第三业务处干部、审计业务三部经理（副处级），中国海洋石油总公司（有限公司）审计部审计三处处长、项目审计经理、审计监察部投资项目审计调查经理、内审岗经理，中国海洋石油有限公司审计监察部总经理，中国海洋石油总公司（有限公司）审计监察部副总经理兼审计中心主任，中国海洋石油国际有限公司副总经理，中国海洋石油总公司资金部总经理。

杨皓鹏先生，董事。复旦大学硕士。现任中海基金管理有限公司总经理兼中海恒信资产管理（上海）有限公司董事长。历任中海信托股份有限公司综合管理部总裁秘书、托管部项目经理、自有资金及信息管理部综合业务经理、办公室主任、党委秘书、人力资源部经理、资产经营部经理，中海基金管理有限公司总经理助理、代理督察长。

彭焰宝先生，董事。清华大学学士。现任国联证券股份有限公司总裁、董事，兼华英证券有限责任公司董事。历任无锡市证券公司（国联证券前身）交易员，国联证券有限责任公司投资经理，无锡市国联投资管理咨询有限公司投资经理，锡洲国际有限公司投资部经理，中海基金管理有限公司投资管理部总经理兼投资总监（期间曾兼任中海优质成长证券投资基金基金经理）、风险管理部总经理兼风控总监，国联证券股份有限公司证券投资部总经理、副总裁。

江志强先生，董事。东南大学硕士。现任国联证券股份有限公司监事会主席。历任国联证券股份有限公司证券投资部经理、证券营业部总经理、财富管理中心总经理、总裁助理、资产管理部总经理、副总裁兼资产管理部总经理。

MOLING CHEN（陈末翎）女士，董事。澳大利亚国籍。澳洲莫纳什大学工商管理硕士。现任爱德蒙罗斯柴尔德中国私募股权基金I期和II期主管合伙人。历任澳大利亚墨尔本药物技术研究所化学分析师，澳大利亚墨尔本凯龙生物区域经理，百奥维达中国基金高级投资总监。

陈道富先生，独立董事。中国人民银行金融研究所博士。现任国务院发展研究中心金融研究所副所长。曾任中关村证券公司总裁助理、国务院发展研究中心金融研究所综合研究室主任。

WANG WEIDONG（王卫东）先生，独立董事。美国国籍。芝加哥大学博士。现任北京市中伦律师事务所合伙人。历任Sidley Austin(盛德律师事务所)芝加哥总部律师，北京大学国家发展研究院国际MBA项目访问教授，北京德恒律师事务所合伙人，美国德杰律师事务所合伙人。

张军先生，独立董事。复旦大学博士。现任复旦大学经济学院院长、中国经济研究中心主任、复旦大学“当代中国经济”长江学者特聘教授、复旦发展研究院副院长、博士生导师、教育部重点研究基地中国社会主义市场经济研究中心主任。历任复旦大学经济学院助教、讲师，复旦大学经济学院副教授。

2、监事会成员

张悦女士，监事长。硕士，高级会计师。现任中海信托股份有限公司总稽核、党办主任、信托事务管理总部总经理。历任北京石油交易所交易部副经理，中国海洋石油东海公司计财部会计、企管部企业管理岗，中海石油总公司平湖生产项目计财部经理，中海石油财务有限责任公司上海分公司计财部岗位经理，中海信托股份有限公司计划财务部会计、计划财务部经理、稽核审计部经理、纪委副书记、合规总监。

Pascal CHARLOT（夏乐博）先生，监事。法国国籍。法国埃夫里大学金融系硕士、法国国立电信管理学院金融系硕士。现任爱德蒙得洛希尔资产管理(香港)有限公司董事会成员、执行总监、营运总监、第1类和第9类受规管活动的负责人员，爱德蒙得洛希尔集团亚太区财务长以及爱德蒙得洛希尔（瑞士）商务拓展部高级副总裁。历任法国巴黎银行全球IT部门客户经理、法国巴黎银行新加坡分行项目经理、爱德蒙得洛希尔资产管理香港有限公司营运总监、爱德蒙得洛希尔资产管理香港公司营运总监、第1类和第9类受规管活动的负责人员。

康铁祥先生，职工监事。博士。现任中海基金管理有限公司风险管理部总经理。历任山东省招远市绣品厂财务科科员，上海浦发银行外汇业务部科员，中海基金管理有限公司风险管理部助理风控经理、风控经理、风险管理部总经理助理、风险管理部副总经理兼风控总监、风控稽核部总经理。

张奇先生，职工监事。学士。现任中海基金管理有限公司信息技术部总经理。历任沈阳联正科技有限公司技术部经理，北京致达赛都科技有限公司网络部经理，上海致达信息产业股份有限公司技术支持部经理，中海基金管理有限公司信息技术部工程师、信息技术部总经理助理、信息技术部副总经理。

3、高级管理人员

杨皓鹏先生，总经理。复旦大学世界经济专业硕士。历任中海信托股份有限公司综合管理部总裁秘书、托管部项目经理、自有资金及信息管理部综合业务经理、办公室主任、党委秘书、人力资源部经理、资产经营部经理。2017年7月进入本公司工作，曾任总经理助理，2017年8月至今任本公司副总经理(期间2017年11月至2018年3月兼任本公司代理督察长)，2017年9月至今任本公司董事，2017年11月至今任中海恒信资产管理（上海）有限公司董事长。

宋宇先生，常务副总经理。复旦大学数理统计专业学士，经济师。历任无锡市统计局秘书，国联证券股份有限公司营业部副经理、发行调研部副经理、办公室主任、研究发展部总经理。2004年3月进入本公司工作，历任本公司督察长、副总经理（期间2011年1月至2011年10月兼任本公司代理总经理，2014年5月至2014年10月兼任本公司代理督察长），2015年4月至今任本公司常务副总经理。

黄乐军先生，督察长。厦门大学法律硕士。历任北京近铁运通运输有限公司厦门分公司职员、上海市公安局副主任科员、上海证监局主任科员、海富通基金管理有限公司监察稽核总监。2018年2月进入本公司工作，2018年3月至今任本公司督察长。

4、基金经理

彭海平先生，中国科学技术大学概率论与数理统计专业硕士。2009年7月进入本公司工作，历任金融工程助理分析师、金融工程分析师、金融工程分析师兼基金经理助理。2013年1月至今任中海上证50指数增强型证券投资基金基金经理，2015年7月至今任中海中证高铁产业指数分级证券投资基金基金经理，2016年4月至今任中海优势精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2016年12月至今任中海量化策略混合型证券投资基金基金经理，2017年4月至今任中海添顺定期开放混合型证券投资基金基金经理，2018年1月至今任中海添瑞定期开放混合型证券投资基金基金经理，2018年4月至今任中海中鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2018年9月至今任中海可转换债券债券型证券投资基金基金经理。

5、历任基金经理

本基金基金合同于2013年3月20日生效，历任基金经理如下表：

基金经理姓名	管理本基金时间
周其源	2013年3月20日-2014年3月20日
周其源、江小震	2014年3月21日-2014年4月30日
江小震	2014年5月1日-2018年9月11日
彭海平	2018年9月12日-至今

6、投资决策委员会成员

杨皓鹏先生，主任委员。现任中海基金管理有限公司董事、总经理。
许定晴女士，委员。现任中海基金管理有限公司代理投资总监、投资副总监、基金经理。
夏春晖先生，委员。现任中海基金管理有限公司投资副总监、首席策略分析师、基金经理。
江小震先生，委员。现任中海基金管理有限公司投资副总监、基金经理。

7、上述人员之间均不存在近亲属关系。

二、基金托管人

（一）基金托管人情况

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：周慕冰
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：贺倩

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。自2010年起中国农业银行连续通过托管业务国际内控标准（ISAE3402）认证，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”。2012年荣获第十届中国财经风云榜“最佳资产托管银行”称号；2013年至2017年连续荣获上海清算所授予的“托管银行优秀奖”和中央国债登记结算有限责任公司授予的“优秀托管机构奖”称号；2015年、2016年荣获中国银行业协会授予的“养老金业务最佳发展奖”称号；2018年荣获中国基金报授予的公募基金20年“最佳基金托管银行”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，2014年更名为托管业务部/养老金管理中心，内设综合管理部、业务管理部、客户一部、客户二部、客户三部、客户四部、风险合规部、产品研发与信息技术部、营运一部、营运二部、市场营销部、内控监督部、账户管理部，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近240名，其中具有高级职称的专家30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2018年06月30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425只。

三、相关服务机构

（一）基金份额发售机构

1、直销机构

（1）中海基金管理有限公司
住所：中国（上海）自由贸易试验区银城中路68号2905-2908室及30层
办公地址：上海市浦东新区银城中路68号2905-2908室及30层
法定代表人：杨皓鹏
电话：021-68419518
传真：021-68419328
联系人：周颖
客户服务电话：400-888-9788（免长途话费）或021-38789788
网址：www.zhfund.com

（2）中海基金管理有限公司北京分公司
住所：北京市西城区复兴门内大街158号1号楼F218
办公地址：北京市西城区复兴门内大街158号1号楼F218
负责人：刘承来
电话：010-66493583
传真：010-66425292
联系人：郑健
客户服务电话：400-888-9788（免长途话费）
网站：www.zhfund.com

2、代销机构：

(1)中国农业银行股份有限公司
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：周慕冰
联系电话：010-66060069
传真：010-68121816
联系人：林葛
客户服务电话：95599
公司网址：www.abchina.com

(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：易会满
联系人：郭明
客户服务电话：95588
公司网址：www.icbc.com.cn

(3)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
电话：0755-83199084
传真：0755-83195049
资产托管部信息披露负责人：张燕
客户服务电话：95555
公司网址：www.cmbchina.com

(4)平安银行股份有限公司
住所：广东省深圳市罗湖区深南东路5047号
办公地址：广东省深圳市罗湖区深南东路5047号
法定代表人：谢永林
联系电话：(0755) 2219 7701
传真电话：021-50979507
联系人：高希泉
客户服务电话：95511-3
公司网址： www.bank.pingan.com

(5)上海浦东发展银行股份有限公司
住所：上海市中山东一路12号
办公地址：上海市中山东一路12号
法定代表人：高国富
电话：021－61616193
传真：021-63604196
联系人：朱萍
客户服务电话：95528
公司网址：www.spdb.com.cn

(6)上海农村商业银行股份有限公司
住所：上海市银城中路8号15-20楼、22-27楼
办公地址：上海市银城中路8号15-20楼、22-27楼
法定代表人：胡平西
联系人：施传荣
电话：（021）38576666
传真：（021）50105124
客户服务电话：（021）962999
公司网站：www.srcb.com

(7)宁波银行股份有限公司
注册地址：中国浙江宁波市鄞州区宁南南路700号
办公地址：中国浙江宁波市鄞州区宁南南路700号
法定代表人：陆华裕
联系人：王海燕
电话：0574-89103171
传真：0574-89103213
客户服务电话：95574
网址：http://www.nbcb.com.cn/

(8)国联证券股份有限公司
住所：无锡市太湖新城金融一街8号7-9层
办公地址：无锡市太湖新城金融一街8号7-9层
法定代表人：姚志勇
电话：0510-82831662
传真：0510-82830162
联系人：沈刚
客户服务电话：95570
公司网址：www.glsc.com.cn

(9)长江证券股份有限公司
住所：武汉市新华路特8 号长江证券大厦
办公地址：武汉市新华路特8 号长江证券大厦
法定代表人：胡运钊
电话：027-65799999
传真：027-85481900
联系人：李良
客户服务电话：95579或4008-888-999
公司网址：www.95579.com

(10)海通证券股份有限公司
住所：上海市广东路689号
办公地址：上海市广东路689号
法定代表人：王开国
电话：021-23219000
传真：021-23219100
联系人：金芸、李笑鸣
客户服务电话：95553
公司网址：www.htsec.com

(11)中信建投证券股份有限公司
住所：北京市朝阳区安立路66号4号楼
办公地址：北京市东城区朝阳门内大街188号
法定代表人：王常青
联系人：权唐、许梦园
电话：400-8888-108
开放式基金咨询电话： 400-8888-108
开放式基金业务传真：010-65182261
公司网址：www.csc108.com

(12)申万宏源证券有限公司
住所：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：李梅
电话：021-33389888
传真：021-33388224
联系人：黄莹
客户服务电话：95523或4008895523
公司网址：www.swhysc.com

(13)兴业证券股份有限公司
住所：福建省福州市湖东路268号
办公地址：上海浦东新区民生路1199弄证大五道口广场1号楼21楼
法定代表人：兰荣
电话：021-38565785
传真：021-38565955
联系人：谢高得
客户服务电话： 95562
公司网址：www.xyzq.com.cn

(14)国泰君安证券股份有限公司
注册地址：中国（上海）自由贸易试验区商城路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
电话：021-38676161
传真：021-38670161
联系人：芮敏祺
客户服务电话：400-888-8666/95521
公司网址：www.gtja.com

(15)招商证券股份有限公司
住所：深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层
办公地址：深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层
法定代表人：霍达
电话：0755-82943666
传真：0755-82943636
联系人：秦湘
客户服务电话：95565
公司网址：www.newone.com.cn

(16)东海证券股份有限公司
住所：江苏省常州市延陵西路23号投资广场18层
办公地址：上海市浦东新区东方路1928号东海证券大厦
法定代表人：赵俊
电话：021-20333333
传真：021-50498825
联系人：王一彦
客户服务电话：95531或400-888-8588
公司网址：www.longone.com.cn

(17)中银国际证券有限责任公司
住所：上海市浦东新区银城中路200号中银大厦39层
办公地址：上海市浦东新区银城中路200号中银大厦40层
法定代表人：许刚
电话：021-68604866
传真：021-50372474
联系人：李丹
客户服务电话：400-620-8888
公司网址：www.bocichina.com

(18)平安证券股份有限公司
住所：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场裙楼8楼
办公地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场裙楼8楼
法定代表人：杨宇翔
电话：4008866338
传真：0755-82400862
联系人：郑舒丽
客户服务电话：95511-8
公司网址：stock.pingan.com

(19)光大证券股份有限公司
住所：上海市静安区新闸路1508号
办公地址：上海市静安区新闸路1508号
法定代表人：薛峰
电话：021-22169999
传真：021-22169134
联系人：刘晨
客户服务电话：95525
公司网址：www.ebscn.com

(20)中泰证券股份有限公司
住所：山东省济南市经七路86号23层经纪业务总部
法定代表人：李玮
电话：0531-68889115
传真：0531-68889752
联系人：吴阳
客户服务电话：95538
公司网址：www.qlzq.com.cn

(21)第一创业证券股份有限公司
住所：广东省深圳市福田区福华一路115号投行大厦20楼
办公地址：广东省深圳市福田区福华一路115号投行大厦18楼
法定代表人：刘学民
联系人：吴军
电话：0755-23838751
传真：0755-82485081
客户服务电话：400-888-1888
公司网址：www.firstcapital.com.cn

(22)万联证券股份有限公司
住所：广州市中山二路18号广东电信广场36、37层
办公地址：广州市天河区珠江东路11号高德置地广场F座18、19楼
法定代表人：张建军
电话：020－37865070
联系人：王鑫
开放式基金咨询电话：400-8888-133
开放式基金接收传真：020-22373718-1013
公司网址：www.wlzq.com.cn

(23)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
办公地址：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（邮编：830002）
法定代表人：许建平
电话：010-88085858
传真：010-88085195
联系人：李巍
客户服务电话：400-800-0562
网址：www.hysec.com

(24)渤海证券股份有限公司
住所：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：天津市南开区宾水西道8号
法定代表人：杜庆平
联系人：王兆权
电话：022-28451861
传真：022-28451892
客户服务电话：400-651-5988
公司网址： www.bhzq.com

(25)国金证券股份有限公司
住所：成都市东城根上街95号
办公地址：成都市东城根上街95号6、16、17楼
法定代表人：冉云
联系人：刘婧漪、贾鹏
联系电话：028-86690057、028-86690058
传真：028-86690126
客户服务电话：95310
公司网址：www.gjzq.com.cn

(26)信达证券股份有限公司
住所：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
联系电话：010-63081000
传真：010-63080978
客户服务电话：95321
公司网址：www.cindasc.com

(27)中信证券股份有限公司
住所：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：王东明
联系电话：010-60838888
传真：010-60833739
联系人：顾凌
客户服务电话： 400-889-5548
公司网址：www.cs.ecitic.com

(28)中信证券股份有限公司
住所：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：王东明
联系电话：010-60838888
传真：010-60833739
联系人：顾凌
客户服务电话： 400-889-5548
公司网址：www.cs.ecitic.com

(29)东兴证券股份有限公司
住所：北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12-15层
法定代表人：魏庆华
联系人：汤漫川
电话：010-66555316
传真：010-66555246
客户服务电话：400-888-8993
公司网址：www.dxzq.net.cn

(30)天相投资顾问有限公司
住所：北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701
办公地址：北京市西城区新街口外大街28号C座5层
法定代表人：林义相
电话：010-66045529
传真：010-66045518
联系人：尹伶
客户服务电话：010-66045678
公司网址：www.txsec.com
天相基金网网址：www.jjm.com.cn

(31)中信证券（山东）有限责任公司
住所：青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼20层
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20层
法定代表人：杨宝林
联系人：吴忠超
联系电话：0532-85022326
客服电话：95548
公司网址：www.citicssd.com

(32)华林证券有限责任公司
住所：深圳市福田区民田路178号华融大厦5-6楼
法定代表人：薛荣年
联系人：王叶平
联系电话：0755-82707705
客服电话：400-188-3888
公司网址：http://www.chinalions.com

(33)华鑫证券有限责任公司
注册地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦28层A01、B01（b）单元
办公地址：上海市肇嘉浜路750号
法定代表人：俞洋
联系人：陈敏
业务联系电话：021-64339000-807
客服热线：021-32109999；029-68918888；4001099918
公司网址：www.cfsc.com.cn

(34)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
办公地址：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
联系人：洪诚
电话：0755-23953913
传真：0755-83217421
客户服务电话：400-990-8826
网址：www.citicsf.com

(35)华西证券股份有限公司
住所：四川省成都市高新区天府二街198号华西证券大厦
办公地址：四川省成都市高新区天府二街198号华西证券大厦
法定代表人：杨炯洋
联系人：周志茹
电话：028-86135991
传真：028-86150040
客户服务电话：95584和4008-888-818
公司网址：http://www.hx168.com.cn

(36)中国国际金融股份有限公司
住所：北京市朝阳区建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层
办公地址：北京市朝阳区建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层
法定代表人：丁学东
联系人：杨涵宇
联系电话：01065051166
客服电话：4009101166
公司网址：www.cicc.com.cn

(37)联讯证券股份有限公司
注册地址：广东省惠州市惠城区江北东江三路惠州广播电视新闻中心三、四楼
办公地址：广东省惠州市惠城区江北东江三路惠州广播电视新闻中心三、四楼
法定代表人：徐刚
联系人：彭莲
电话：0752-2119700
传真：0752-2119660
客户服务电话：95564
网址：www.lxsec.com

(38)深圳前海凯恩斯基金销售有限公司
注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）
办公地址：深圳市福田区深南大道6019号金润大厦23A
法定代表人：高锋
联系人：廖苑兰
电话：0755-83655588
传真：0755-83655518
客户服务电话：4008048688
网址：www.keynesasset.com

(39)上海证券有限责任公司
住所：上海市黄浦区四川中路213号7楼
办公地址：上海市黄浦区四川中路213号7楼
法定代表人：李俊杰
联系人：邵珍珍
客户服务电话：021-962518
公司网址：www.962518.com

(40)深圳前海财厚资产管理有限公司
住所：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室
办公地址：深圳市南山区南山大道1088号南园枫叶大厦15层15K室
法定代表人：孙方厚
联系人：李军
客户服务电话：400-699-0071
公司网址：www.caiho.cn

(41) 东莞证券股份有限公司
住所：广东省东莞市莞城区可园南路一号
办公地址：广东省东莞市莞城区可园南路一号金源中心22楼
联系人：李荣
电话：0769-22115712
传真：0769-22115712
客户服务电话：95328
公司网址：http://www.dgzq.com.cn/

（42）蚂蚁（杭州）基金销售有限公司
住所：杭州市余杭区仓前街道文一西路1218号1幢202室
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：韩爱彬
客服电话：4000-766-123
公司网址：www.fund123.cn

（43）深圳众禄基金销售股份有限公司
住所：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦8楼
办公地址：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦8楼
法定代表人：薛峰
联系人：童彩平
联系电话：0755-33227950
客服电话：4006-788-887
公司网址：www.zlfund.cn及www.jjmmw.com

（44）上海长量基金销售投资顾问有限公司
住所：上海市浦东新区高翔路526号2幢220室
办公地址：上海市浦东新区东方路1267号11层
法定代表人：张跃伟
业务联系人：郑茵华
联系电话：021-20691831
客服电话：400-089-1289
公司网址：www.erichfund.com

（45）诺亚正行基金销售有限公司
住所：上海市虹口区飞虹路360弄9号3724室
办公地址：上海市杨浦区秦皇岛路32号c栋
法定代表人：汪静波
联系人：余翼飞
联系电话：021-80358749
客服电话：400－821－5399
公司网址：www.noah-fund.com

（46）和讯信息科技有限公司
住所：北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层
办公地址：北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层
法定代表人：王莉
联系人：刘洋
联系电话：021-20835787
客服电话：400-920-0022/ 021-20835588
公司网址：licaike.hexun.com

（47）上海天天基金销售有限公司
住所：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号金座
法定代表人：其实
联系人：朱玉
联系电话：021-54509977
客服电话：400-1818-188
公司网址：www.1234567.com.cn

（48）众升财富（北京）基金销售有限公司
住所：北京市朝阳区望京东园四区13号楼A座9层908室
办公地址：北京市朝阳区望京浦项中心A座9层04-08
法定代表人：李招娣
联系人：李艳
联系电话：010-59497361
客服电话：400-876-9988
公司网址：www.wy-fund.com

（49）上海好买基金销售有限公司
住所：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：王诗玙
联系电话：021-20613999
客服电话：400-700-9665
公司网址：www.ehowbuy.com

（50）上海利得基金销售有限公司
住所：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18层
法定代表人：李兴春
联系人：陈孜明
联系电话：021-50583533
传真：021-61101630
客服电话：400-921-7755
公司网址：www.leadfund.com.cn

（51）北京增财基金销售有限公司
住所：北京市西城区南礼士路66号建威大厦1208号
办公地址：北京市西城区南礼士路66号建威大厦1208-1209号
法定代表人：罗细安
联系人：史丽丽
联系电话：010-67000988
客服电话：400-001-8811
公司网址：www.zcvc.com.cn

（52）北京恒天明泽基金销售有限公司
住所：北京市经济技术开发区宏达北路10号五层5122室
办公地址：北京市朝阳区东三环中路20号乐成中心A座23层
法定代表人：梁越
联系人：周斌
联系电话：010-57756019
客服电话：400-786-8868-5
公司网址：www.chtfund.com

（53）深圳市新兰德证券投资咨询有限公司
住所：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10号庄胜广场中央办公楼东翼7层727室
法定代表人：杨懿
联系人：刘宝文
联系电话：010-63130889-8369
客服电话：400-166-1188
公司网址：8.jrj.com.cn

（54）浙江同花顺基金销售有限公司
住所：浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦903室
办公地址：浙江省杭州市翠柏路7号杭州电子商务产业园2号楼2楼
法定代表人：凌顺平
联系人：胡璇
联系电话：0571-88911818
客服电话：4008-773-772
公司网址：www.5ifund.com

（55）中期资产管理有限公司
住所：北京市朝阳区建国门外光华路14号1幢11层1103号
办公地址：北京市朝阳区建国门外光华路14号中期大厦8层
法定代表人：姜新
联系人：方艳美
联系电话：010-65807865
传真：010-65807865
客服电话：010-65807865
公司网址：www.cifcofund.com

（56）浙江金观诚财富管理有限公司
住所：杭州市拱墅区登云路45号（锦昌大厦）1幢10楼1001室
办公地址：杭州市拱墅区登云路45号锦昌大厦一楼金观诚财富
法定代表人：徐黎云
联系人：孙成岩
联系电话：0571-88337717
客服电话：400-068-0058
公司网址：www.jincheng-fund.com

（57）上海汇付基金销售有限公司
住所：上海市中山南路100号金外滩国际广场19楼
办公地址：上海市宜山路700号普天信息产业园2期C5栋汇付天下总部大楼2楼
法定代表人：金佶
联系人：臧静
联系电话：13818223736
客服电话：400-820-2819
公司网址：https://www.hotjijin.com

（58）泰诚财富基金销售（大连）有限公司
住所：辽宁省大连市沙河口区星海中龙园3号
办公地址：辽宁省大连市沙河口区星海中龙园3号
法定代表人：林卓
联系人：徐江
联系电话：0411-88891212-119
传真：0411-84396536
客服电话：400-0411-001
公司网址：www.taichengcaifu.com

（59）上海陆金所基金销售有限公司
住所：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：胡学勤
联系人：宁博宇
联系电话：021-20665952
传真：021-22066653
客服电话：4008219031
公司网址：www.lufunds.com

（60）北京虹点基金销售有限公司
住所：北京市朝阳区工人体育馆北路甲2号盈科中心B座裙楼二层
办公地址：北京市朝阳区工人体育馆北路甲2号盈科中心B座裙楼二层
法定代表人：董浩
联系人：陈铭洲
联系电话：010-65951887
传真：010-65951887
客服电话：4000681176
公司网址：www.hongdianfund.com

（61）大泰金石基金销售有限公司
住所：南京市建邺区江东中路222号南京奥体中心现代五项馆2105室
办公地址：上海市浦东新区峨山路505号东方纯一大厦15楼
法定代表人：袁顾明
联系人：孟召社
联系电话：021-20324176
传真：021-20324199
客服电话：400-928-2266
公司网址：www.dtfunds.com

（62）上海凯石财富基金销售有限公司
注册地址：上海市黄浦区西藏南路765号602-115室
办公地址：上海市黄浦区延安东路1号凯石大厦4楼
法定代表人：陈继武
联系人：高皓辉
联系电话：021-63333389
传真：021-63333390
客服电话：4006-433-389
公司网址：www.vstonewealth.com

（63）珠海盈米财富管理有限公司
住所：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
联系人：黄敏娥
联系电话：020-89629099
传真：020-89629011
客服电话：020-89629066
公司网址：www.yingmi.cn

（64）奕丰金融服务（深圳）有限公司
住所：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室（入住深圳市前海商务秘书有限公司）
办公地址：深圳市南山区海德三道航天科技广场A座17楼1704室
法定代表人：TEO WEE HOWE
联系人：叶健
联系电话：0755-89460500
传真：0755-21674453
客服电话：400-684-0500
公司网址：www.ifastps.com.cn

（65）安粮期货股份有限公司
住所：安徽省合肥市包河区芜湖路168号同济大厦10-11层
办公地址：安徽省合肥市包河区芜湖路168号同济大厦10-11层（总部）
法定代表人：朱中文
联系人：梁蕾
联系电话：0551-62870125
传真：0551-62870131
客服电话：400 626 9988
公司网址：http://www.alqh.com/

（66）上海联泰资产管理有限公司
住所：中国（上海）自由贸易试验区富特北路277号3层310室
办公地址：上海市长宁区福泉北路518号8座3层
法定代表人：燕斌
联系人：陈东
联系电话：021-52822063
传真：021-52975270
客服电话：4000-466-788
公司网址：www.66zichan.com

（67）北京钱景基金销售有限公司
住所：北京市海淀区丹棱街丹棱soho10层
办公地址：北京市海淀区丹棱街丹棱soho10层
法定代表人：赵荣春
联系人：陈剑炜
联系电话：010-57418813
客服电话：400-893-6885
公司网址：www.qianjing.com

（68）北京展恒基金销售股份有限公司
住所：北京市顺义区后沙峪镇安富街6号
办公地址：北京市朝阳区安苑路15-1号邮电新闻大厦2层
法定代表人：闫振杰
电话：010-59601366
传真：010-62020355
联系人：翟文
客户服务电话：4008188000
公司网址：www.myfund.com

（69）深圳市金斧子基金销售有限公司
住所：深圳市南山区粤海街道科技园中区科苑路15号科兴科学园B栋3单元11层
办公地址：深圳市南山区粤海街道科苑路科兴科学园B3单元7楼
法定代表人：赖任军
电话：0755-29330513
传真：0755-26920530
联系人：刘昕霞
客户服务电话：400-930-0660
公司网址：www.jfzinv.com

（70）北京广源达信基金销售有限公司
住所：北京市西城区新街口外大街28号C座六层605室
办公地址：北京市朝阳区望京东园四区13号楼浦项中心B座19层
法定代表人：齐剑辉
电话：4006236060
传真：010-82055860
联系人：王英俊
客户服务电话：400-623-6060
公司网址：www.niuniufund.com

（71）上海中正达广基金销售有限公司
住所：上海市徐汇区龙腾大道2815号302室
办公地址：上海市徐汇区龙腾大道2815号302室
法定代表人：黄欣
电话：021-33768132
传真：021-33768132-802
联系人：戴珉微
客户服务电话：4006767523
公司网址：www.zhongzhengfund.com

（72）乾道盈泰基金销售（北京）有限公司
办公地址：北京市西城区德外大街合生财富广场1302室
住所：北京市西城区德外大街合生财富广场1302室
法定代表人：王兴吉
联系人：高雪超
联系电话：18601207732
传真：010-82057741
客服电话：4000888080
公司网址：www.qiandaojr.com

（73）上海基煜基金销售有限公司
注册地址：上海市崇明县长兴镇路潘园公路1800号2号楼6153室（上海泰和经济发展区）
办公地址：上海市杨浦区昆明路518号A1002室
法定代表人：王翔
联系人：蓝杰
电话：021-65370077-220
传真：021-55085991
客户服务电话：021-65370077
网址：www.jiyufund.com.cn

（74）北京懒猫金融信息服务有限公司
住所：北京市石景山区石景山路31号院盛景国际广场3号楼1119
办公地址：北京市朝阳区四惠东通惠河畔产业园区1111号
法定代表人：许现良
电话：010-57649619
传真：010-57649620
联系人：朱翔宇
客户服务电话：010-57649619
公司网址：www.lanmao.com

（75）一路财富（北京）信息科技有限公司
住所：北京市西城区阜成门大街2号万通新世界广场A座2208
办公地址：北京市西城区阜成门大街2号万通新世界广场A座2208
法定代表人：吴雪秀
电话：+86(10)88312877
传真：+86(10)88312877
联系人：徐越
客户服务电话：400-001-1566
公司网址：http://www.yilucaifu.com/

（76）南京苏宁基金销售有限公司
住所：南京市玄武区苏宁大道1-5号
办公地址：南京市玄武区苏宁大道1-5号
法定代表人：王锋
电话：025-66996699-887226
传真：025-66008800-887226
联系人：张慧
客户服务电话：95177
公司网址：www.snjijin.com

（77）北京蛋卷基金销售有限公司
住所：北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507
办公地址：北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507
法定代表人：钟斐斐
电话：010-61840688
传真：010-61840699
联系人：吴季林
客户服务电话：4000618518
公司网址：https://danjuanapp.com

（78）上海景谷基金销售有限公司
住所：上海市浦东新区陆家嘴环路958号华能联合大厦402k
办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路958号华能联合大厦402k
法定代表人：袁飞
电话：61621602
传真：61621602*819
联系人：袁振荣
客户服务电话：61621602
公司网址：www.g-fund.com.cn

（79）北京汇成基金销售有限公司
住所：北京市海淀区中关村大街11号A座1108室
办公地址：北京市海淀区中关村大街11号A座1108室
法定代表人：王伟刚
电话：010-56251471
传真：010-62680827
联系人：熊小满
客户服务电话：400-619-9059
公司网址：www.hcjijin.com

（80）厦门市鑫鼎盛控股有限公司
住所：厦门市思明区鹭江道2号第一广场15楼
办公地址：厦门市思明区鹭江道2号第一广场15楼
法定代表人：陈洪生
电话：0592-3122672
传真：0592-3122701
联系人：梁云波
客户服务电话：400-9180808
公司网址：www.xds.com.cn

（81）北京新浪仓石基金销售有限公司
住所：北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2地块新浪总部科研楼5层518室
办公地址：北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2地块新浪总部科研楼5层518室
法定代表人：李昭琛
电话：010-62676405
传真：8610-62675979
联系人：付文红
客户服务电话：010-62675369
公司网址：www.xincai.com

（82）天津国美基金销售有限公司
住所：天津经济技术开发区南港工业区综合服务区办公楼D座二层202-1室
办公地址：北京市朝阳区霄云路26号鹏润大厦B座19层
法定代表人：丁东华
电话：010-59287984
传真：010-59287825
联系人：郭宝亮
客服电话：400-111-0889
公司网址：www.gomefund.com

（83）上海华信证券有限责任公司
住所：上海市浦东新区世纪大道100号环球金融中心9楼
办公地址：上海市黄浦区南京西路399号明天广场20楼
法定代表人：郭林
电话：021-63898427
传真：021-68776977-8427
联系人：徐璐
客户服务电话：400-820-5999
公司网址：www.shhxzq.com

（84）凤凰金信（银川）基金销售有限公司
住所：宁夏回族自治区银川市金凤区阅海湾中央商务区万寿路142号14层1402
办公地址：北京市朝阳区紫月路18号院 朝来高科技产业园18号楼
法定代表人：程刚
电话：010-58160168
传真：010-58160173
联系人：张旭
客户服务电话：400-810-5919
公司网址：www.fengfd.com

（85）上海云湾基金销售有限公司
注册地址：中国（上海）自由贸易试验区新金桥路27号13号楼2层
办公地址：上海市浦东新区锦康路308号6号楼6楼
法定代表人：戴新装
电话：021-20538888
传真：021-20538999
联系人：江辉
客户服务电话：400-820-1515
公司网址：www.zhengtongfunds.com

（86）南京途牛基金销售有限公司
注册地址：南京市玄武区玄武大道699-1号
办公地址：南京市玄武区玄武大道699-1号
法定代表人：宋时琳
联系人：张士帅
联系电话：025-86853969
客服电话：4007-999-999
公司网址：http://jr.tuniu.com

（87）上海万得基金销售有限公司
住所：中国（上海）自由贸易试验区福山路33号11楼B座
办公地址：上海市浦东新区浦明路1500号万得大厦11楼
法定代表人：王廷富
联系人：徐亚丹
联系电话：021-51327185
传真：021-50710161
客服电话：400-821-0203
公司网址：www.520fund.com.cn

（88）杭州科地瑞富基金销售有限公司
住所：杭州市下城区武林时代商务中心1604室
办公地址：杭州市下城区上塘路15号武林时代20楼
法定代表人：陈刚
联系人：张丽琼
联系电话：0571-85262700
传真：0571-85269200
客服电话：0571-86915761
公司网址：www.cd121.com

（89）北京植信基金销售有限公司
住所：北京市密云县兴盛南路8号院2号楼106室-67
办公地址： 北京市朝阳区惠河南路盛世龙源10号
法定代表人：杨纪锋
联系人：吴鹏
电话：010-56075718
传真：010-67767615
客服电话：400-680-2123
网址：www.zhixin-inv.com

（90）北京肯特瑞基金销售有限公司
住所：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
法定代表人：江卉
联系人：赵德赛
电话：4000988511/ 4000888816
传真：010-89188000
客服电话：95118
网址：http://fund.jd.com/

（91）上海朝阳永续基金销售有限公司
住所：浦东新区上丰路977号1幢B座812室
办公地址：上海市浦东新区碧波路690号4号楼2楼
法定代表人：廖冰
联系人：郑秋月
联系电话：021-802348888-6694
传真：021-80234898
客服电话：4006991888
公司网址：www.998fund.com

（92）中证金牛（北京）投资咨询有限公司
住所：北京市丰台区东管头1号2号楼2-45室
办公地址：北京市西城区宣武门外大街甲1号环球财讯中心A座5层
法定代表人：钱昊旻
联系人：徐英
电话：010-59336539
传真：010-59336500
客服电话：4008-909-998
公司网址：www.jnlc.com

（93）上海华夏财富投资管理有限公司
住所：上海市虹口区东大名路687号1幢2楼268室
办公地址：北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座8层
法定代表人：毛淮平
联系人：仲秋玥
电话：010-88066632
传真：010-63136184
客服电话：400-817-5666
网址：www.amcfortune.com

（94）武汉市伯嘉基金销售有限公司
住所：湖北省武汉市江汉区武汉中央商务区泛海国际SOHO城（一期）第七幢23层1号4号
办公地址：湖北省武汉市江汉区武汉中央商务区泛海国际SOHO城（一期）第七幢23层1号4号
法定代表人：陶捷
联系人：陆锋
客户服务电话：4000279899
公司网址：www.buyfunds.cn

（95）和耕传承基金销售有限公司
住所：郑州市郑东新区东风南路康宁街互联网金融大厦六层
办公地址：郑州市郑东新区东风南路康宁街互联网金融大厦六层
法定代表人：李淑慧
联系人：罗聪
客户服务电话：0371-85518396
公司网址：www.hgccpb.com

（96）徽商期货有限责任公司
住所：安徽省合肥市芜湖路258号3号楼4、6、7层，6号楼1、2层
办公地址：安徽省合肥市芜湖路258号3号楼4、6、7层，6号楼1、2层
法定代表人：吴国华
联系人：申倩倩
客户服务电话：4008878707
公司网址：www.hsqh.net

（97）北京微动利基金销售有限公司
住所：北京市石景山区古城西路113号景山财富中心341
办公地址：北京市石景山区古城西路113号景山财富中心341
法定代表人：梁洪军
联系人：季长军
客户服务电话：400-819-6665
公司网址：www.buyforyou.com.cn

（98）成都华羿恒信基金销售有限公司
住所：中国（四川）自由贸易试验区成都高新区蜀锦路88号1号楼32楼2号
办公地址：中国（四川）自由贸易试验区成都高新区蜀锦路88号1号楼32楼2号
法定代表人：赵壁
联系人：徐莉
客户服务电话：400-8010-009
公司网址：http://www.huayihengxin.com

（99）上海挖财基金销售有限公司
住所：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路799号5层01、02、03室
办公地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路799号5层01、02、03室
法定代表人：冷飞
联系人：李娟
联系电话：021-50810687
客服电话：021-50810673
公司网址： www.wacaijijin.com

（100）上海大智慧基金销售有限公司
住所：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路428号1号楼1102单元
办公地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路428号1号楼1102单元
法定代表人：申健
联系人：宋楠
联系电话：021-20219988
客服电话：021-20292031
网址：https://www.wg.com.cn/

（101）北京加和基金销售有限公司
注册地址：北京市西城区车公庄大街 4 号 5 号楼一层
办公地址：北京市西城区北礼士路甲 129 号文化创新工场四层 404
法定代表人：徐福星
联系人：李美
电话：010-68292940
传真：010-68292964
客户服务电话：400-600-0030
网址：www.bzfunds.com

（102）北京晟视天下投资管理有限公司
注册地址：北京市怀柔区九渡河镇黄坎村 735 号 03 室
办公地址：北京市朝阳区朝外大街甲六号万通中心 D 座 21 层&28 层
法定代表人：蒋煜
联系人：刘聪慧/徐晓荣
电话：010-58170905/010-58170876
传真：010-58100800
客户服务电话：400-818-8866
网址：www.shengshiview.com.cn

（103）北京格上富信基金销售有限公司
住所：北京市朝阳区东三环北路 19 号楼 701 内 09 室
办公地址：北京市朝阳区东三环北路 19 号楼 701 内 09 室
法定代表人：李悦章
联系人：曹庆展
客户服务电话：400-066-8586
公司网址：www.igesafe.com

（104）北京电盈基金销售有限公司
住所：北京市朝阳区呼家楼（京广中心）1 号楼 36 层 3603 室
办公地址：北京市朝阳区呼家楼（京广中心）1 号楼 36 层 3603 室
法定代表人：程刚
联系人：赵立芳
客户服务电话：400-100-3391
公司网址：http://www.dianyingfund.com/

（105）天津万家财富资产管理有限公司
住所：天津自贸区（中心商务区）迎宾大道 1988 号滨海浙商大厦公寓 2-2413室
办公地址：北京市西城区丰盛胡同 28 号太平洋保险大厦 5 层
法定代表人：李修辞
联系人：邵玉磊
客户服务电话：010-59013825
公司网址：http://www.wanjiawealth.com/

基金管理人可根据有关法律法规要求，根据实情，选择其他符合要求的机构代理销售本基金或变更上述代销机构，并及时公告。

（二）注册登记机构

名称：中海基金管理有限公司
住所：中国（上海）自由贸易试验区银城中路68号2905-2908室及30层
办公地址：上海市浦东新区银城中路68号2905-2908室及30层
法定代表人：杨皓鹏
成立日期：2004年3月18日
电话：021-38429808
传真：021-68419328
联系人：周琳

（三）出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市通力律师事务所
住所：上海市银城中路68号时代金融中心19楼
办公地址：上海市银城中路68号时代金融中心19楼
法定代表人：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

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01-12室
办公地址：北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室
执行事务合伙人：毛鞍宁
联系电话：010-58153000
传真：010-58153000
联系人：徐艳
经办会计师：徐艳、朱昀

四、基金的名称

中海可转换债券债券型证券投资基金

五、基金的类型

债券型证券投资基金

六、基金的投资目标

本基金以可转换债券为主要投资目标，在严格控制投资组合风险的基础上，充分把握可转换债券兼具股性和债性的风险收益特征，实现基金资产的长期稳健增值。

七、基金的投资范围

本基金主要投资于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）。本基金投资的固定收益类资产包括国债、央行票据、中期票据、金融债、公司债、企业债、政府机构债、可转换债券（含可分离交易可转换债券）、中小企业私募债、债券回购、短期融资券、次级债、银行存款、资产支持证券等。

本基金可直接从二级市场上买入股票和权证，也可参与一级市场新股申购或增发新股。本基金的二级市场股票将优先选择盈利增长稳定、过去两年连续分红且股息收益率排名居前的红利股票，传统可转换债券对应的标的股票以及可分离交易可转换债券发行人发行的股票。

如法律法规或中国证监会允许基金投资其他品种的，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入本基金的投资范围。

本基金投资于固定收益类资产的比例不低于基金资产的80%，对可转换债券（含可分离交易可转换债券）的投资比例不低于基金固定收益类资产的80%，对中小企业私募债的投资比例不高于基金固定收益类资产的20%；非固定收益类资产的比例合计不超过基金资产的20%。其中现金或到期日在1年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。权证的投资比例不得超过基金资产净值的3%。

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。

八、基金的投资理念

本基金通过“自上而下”的宏观分析来实现在不同市场周期内对固定收益类资产和权益类资产的整体配置；在严格控制风险的基础上，通过“自下而上”的个券分析充分挖掘可转换债券的投资价值，并辅以精选其他高质量的固定收益类和权益类投资品种，以谋取基金获得长期稳健的投资收益。

九、基金的投资策略

1、整体资产配置策略

本基金在严格风险控制基础上，通过对国内外宏观经济形势、证券市场估值水平、财政及货币政策、资金供需情况以及信用风险情况等因素的综合研判，预测各大类资产在不同市场周期的风险收益特征，进而在各大类资产之间进行整体动态配置，力争为基金资产获取稳健回报。

2、类属资产配置策略

本基金根据宏观经济分析、债券基准收益率研究、不同类属债券利差水平研究，判断不同类属债券的相对投资价值，并确定不同债券类属在组合资产中的配置比例。针对固定收益类资产，本基金将市场细分为可转换债券（含传统可转换债券、可分离交易可转换债券）、普通债券（含国债、央行票据、中期票据、金融债、公司债、企业债、政府机构债、债券回购、短期融资券、次级债、银行存款等）、中小企业私募债、资产证券化产品四个子市场，其中可转换债券根据其市场转换溢价率及其标的股票的相对价值又分为偏股型、平衡型和偏债型进行优化配置。

3、可转换债券投资策略

本基金将积极参与发行条款较好、申购收益较高、公司基本面优秀的可转换债券的一级市场申购，上市后根据个券的具体情况做出持有或卖出的决策；同时，本基金将综合运用多种可转换债券投资策略进行二级市场投资操作，在承担较小风险的前提下获取较高的投资回报。

1）传统可转换债券投资策略

传统可转换债券即指可转换公司债券，其投资者可以在约定的期限内按照事先确定的价格将该债券转换为公司普通股。可转换公司债券是一种含权债券，它同时具备了普通股票所不具备的债性和普通债券所不具备的股性。在股票市场下跌时，可转换债券由于受到纯债价值的支撑，一般不会跌破其债券价值部分；在股票市场上涨时，又由于内生的期权属性，可转换债券可以分享股票价格上涨的收益。合理地利用可转换债券的债性和股性双重特征，可在有效控制组合风险的基础上获取一定的超额收益。

2）个券选择策略

本基金将运用企业基本面分析和理论价值分析策略，在严格控制风险的前提上，精选个券，力争实现较高的投资收益。

企业基本面分析策略是指本基金将采取定性分析（经济周期、行业地位、竞争优势、治理结构等）与定量分析（P/B,P/E,PEG等）相结合的方式，对可转换债券对应的标的股票进行深入研究，精选具有良好成长性且估值相对合理的标的股票，达到分享股票上涨收益的目的。

理论价值分析策略是指本基金将结合可转换债券的条款，根据其标的股票的波动率水平、分红率、市场的基准利率、可转换债券的剩余期限、当前股价水平等因素，运用BS模型以及蒙特卡洛模型等，计算期权价值，从而确定可转换债券的理论价值。

可转换债券的理论价值分为纯债价值和期权价值。其中纯债价值由当期贴现利率水平、债券的信用评级、剩余期限等因素决定，其中关键因素是当期贴现利率水平。当期贴现利率水平与宏观经济运行态势、市场供求关系、市场资金面情况、物价水平等诸多因素相关。期权价值主要与发债主体的股价历史波动率、公司基本面、公司股价历史波动率、分红率、市场基准利率和可转换债券的剩余期限相关。一般而言，股价波动率越高，分红率越低，剩余期限越长，可转换债券的期权价值就越高。

纯债价值加期权价值即可得到可转换债券的理论价值。本基金将针对标的股票从定价时点至可转换债券到期日的不同价格路径，重复上述步骤，取均值后得到最终的理论价值。

此外，可转换债券一般设置有赎回、向下修正转股价、提前回售等条款，因此还内含了其他期权，包括转股权，赎回权，回售权以及转股价向下修正权。其中转股权和回售权属于投资者的多头期权，而转股价向下修正权和赎回权则属于发债主体的多头期权。因此，可转换债券的理论价值可表达为：

可转换债券理论价值=纯债价值+期权价值+回售权价值-赎回权价值-转股价向下修正权价值

本基金将理论价值作为可转换债券投资价值的参考，并与市场真实价格进行比较。如果理论价值显著高于当前价格，说明该可转换债券可能被低估，如果理论价值显著低于当前价格，显示该可转换债券可能被高估。

3）相对价值分析策略

本基金采用相对价值分析策略，即通过分析不同市场环境下可转换债券股性和债性的相对价值，把握可转换债券的价值走向，选择相应券种，从而获取较高投资收益。本基金将根据可转换债券的底价溢价率和到期收益率来判断其债性，根据可转换债券的平价溢价率和Delta系数（转债价格对标的股票价格的敏感性）大小来判断其股性强弱。并在对可转换债券条款、发行人基本面要素、正股估值水平与盈利成长性进行深入研究的基础上，结合股票市场的走势和债券市场的预期利率风险，选择出相对价值在可接受的投资期内价值低估或债性价值低估的可转换债券品种，通过积极主动的投资管理，获得超额收益。

4）低风险套利策略

在严格控制风险的基础上，本基金将密切关注以下两类套利机会：一方面，在可转换债券的转股期内，当转股溢价率为负时，可以买入可转换债券并及时转股，然后在二级市场卖出股票，以获取套利收益；另一方面，在可转换债券发行期内，当可转换债券的优先配售条款具有吸引力时，可以买入股票并配售可转换债券，待其上市后再卖出，以获取收益。

5）条款博弈策略

通常情况下，国内可转换债券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，有利于提升可转换债券的期权价值，对投资者是一种保护条款，有时甚至能直接推动可转换债券价格的上涨；回售条款给予投资者将可转换债券回售给发行人的权利，对投资者有保护作用，回售价格是判断可转换债券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换债券的权利，如发行人放弃赎回权则会提高可转换债券的期权价值。本基金会将充分发掘条款博弈带来的投资机会。

6）可分离交易可转换债券投资策略

可分离交易可转换债券是指认股权证和债券分离交易的可转换公司债券，即是一种附认股权证的公司债，上市后可分离为纯债和认股权证两部分。可分离交易可转换债券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性，甚至也可以构造出类可转换债券品种。

可分离交易可转换债券的投资策略与传统可转换债券的投资策略类似。本基金将综合分析纯债部分的收益性、流动性，以及发债公司基本面等情况，以此为基础判断纯债部分的投资价值。此外，本基金将通过调整纯债和认股权证或标的股票之间的比例，来组合成不同风险收益特征的类可转换债券产品，并根据不同的市场环境进行动态调整。

4、普通债券投资策略

本基金将采取利率策略、期限结构策略、信用策略、息差策略和个券选择策略，判断不同债券在经济周期的不同阶段的相对投资价值，并确定不同债券在组合资产中的配置比例，实现组合的稳健增值。

1）利率策略

本基金通过全面研究和分析宏观经济运行情况和金融市场资金供求状况变化趋势及结构，结合对财政政策、货币政策等宏观经济政策取向的研判，从而预测出金融市场利率水平变动趋势。

2）期限结构策略

本基金在确定组合久期后，通过研究收益率曲线形态，采用收益率曲线分析模型对各期限段的风险收益情况进行评估，对收益率曲线各个期限的骑乘收益进行分析。通过选择预期收益率最高的期限段进行配比组合，从而在子弹组合、杠铃组合和梯形组合中选择风险收益比最佳的配置方案。

3）信用策略

本基金依靠内部信用评级系统跟踪研究发债主体的经营状况、财务指标等情况，对其信用风险进行评估，以此作为个券选择的基本依据。

4）息差策略

本基金可通过正回购，融资买入收益率高于回购成本的债券，获得杠杆放大收益。

5）个券选择策略

本基金采取自下而上的方法精选个券。在个券选择方面，本基金将债券的估值水平、剩余期限以及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；

5、中小企业私募债投资策略

本基金对中小企业私募债的投资主要以信用品种投资策略为基础，在此基础上重点分析私募债的信用风险及流动性风险。首先，确定经济周期所处阶段，研究中小企业私募债发行人所处行业在经济周期和政策变动中所受的影响，以确定行业总体信用风险的变动情况，并投资具有积极因素的行业，规避具有潜在风险的行业；其次，对中小企业私募债发行人的经营管理、发展前景、公司治理、财务状况及偿债能力综合分析；最后，结合中小企业私募债的票面利率、剩余期限、担保情况及发行规模等因素，综合评价中小企业私募债的信用风险和流动性风险，选择风险与收益相匹配的品种进行配置。

6、股票投资策略

1）新股申购投资策略

本基金作为固定收益类产品，将充分依靠公司研究平台和股票估值体系，深入研究首次发行(IPO)股票及增发新股的上市公司基本面，在有效控制风险的前提下制定相应的新股认购策略。对通过新股申购获得的股票，将根据其实际的投资价值确定持有或卖出。

2）股票二级市场投资策略

本基金投资于非固定收益类资产的比例合计不超过基金资产的20%。因此，在投资比例约束范围内，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。

本基金将采用定量分析与定性分析相结合的方法，精选具有突出价值优势的优质上市公司进行投资。

定性分析指标包括：具备良好的公司治理结构、具有诚信、优秀且稳定的管理团队、资产质量及财务状况良好，资金流充足、在行业中具有良好的品牌影响力、具备自主知识产权或自主创新能力、具备在市场定价能力以及产品质量控制能力强，且具有良好的成本控制能力。

定量分析方面，基于对公司估值、资产质量及财务状况的考量，本基金还要将各优质上市公司的估值、成长及财务指标进行比较，优先选择具有相对比较优势的公司作为最终股票投资对象。

本基金考察的估值指标包括：市盈率(P/E)、市净率(P/B)、市盈率/增长率(PEG)、企业价值/销售收入(EV/SALES)、企业价值/息税折旧摊销前利润（EV/EBITDA）、自由现金流贴现（DCF）等。

本基金考察的成长指标包括：总资产增长率、主营业务收入增长率、主营业务利润增长率、销售毛利率变化率、净利润增长率、存货周转率。

本基金考察的财务指标包括：净资产收益率、销售毛利率、总资产周转率、利息保障比率、经营活动净收益/利润总额、经营活动产生的现金流量/营业收入。

通过归一化等量化处理，对入选的上市公司按照其在每项指标的高低顺序进行打分，最终得到一个标准化的指标分数。再将分指标分数加权相加，得到一个总分数。最后，按照总分的高低进行排序，选取排名靠前的股票组成本基金的二级市场最终股票投资标的。

在以上最终股票投资标的基础上，本基金将会优先选择公司盈利增长稳定、过去两年连续分红且股息收益率排名居前的红利股票，传统可转换债券对应的标的股票以及可分离交易可转换债券发行人发行的股票。

本基金对红利股票的选取标准为：公司过去三年扣除经常性损益后的净利润持续增长，过去两年连续分红，且过去两年年均股息率排名和对投资者回报高的A股上市公司。本基金认为那些盈利能力较强的、以持续稳定的现金分红方式回报投资人的上市公司将成为本基金股票投资的首选。

7、资产证券化产品投资策略

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。资产证券化产品的定价受市场利率、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，对资产证券化产品的质量和构成、利率风险、信用风险、流动性风险和提前偿付风险等进行定性和定量的全方面分析，评估其相对投资价值并作出相应的投资决策，力求在控制投资风险的前提下尽可能的提高本基金的收益。

8、权证投资策略

在严格控制风险的前提下，本基金可适度进行权证投资。投资权证的目的为控制下跌风险和实现基金资产增值。本基金管理人将以价值分析为基础，采用权证定价模型分析其合理定价，充分考虑可能持有的权证品种的收益率、流动性及风险收益特征，通过资产配置、品种与类属选择，力求取得稳健收益。

十、基金的投资决策依据和决策程序

(一) 投资决策依据

1、国家有关法律、法规和基金合同的有关规定。依法决策是本基金进行投资的前提；

2、中国宏观经济发展态势、区域经济发展情况、微观经济运行环境，以及证券市场走势等因素是本基金投资决策的基础；

3、投资对象收益和风险的配比关系。在充分权衡投资对象的收益和风险的前提下作出投资决策，是本基金维护投资者利益的重要保障；

4、团队投资方式。本基金在投资决策委员会领导下，通过基金管理人投资团队的共同努力与分工协作，由基金经理具体执行投资计划，争取良好投资业绩。

(二) 投资决策流程

本基金投资流程包括：一级资产配置、久期配置/期限结构配置、债券类别配置/个券选择、可转换债券选择、股票投资组合构建，组合调整，风险管理与绩效评估等七个部分。

1、一级资产配置

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，权益类资产收益都超过固定收益类资产。当经济从滞涨到衰退期时，债券市场开始逐步向好并进入债券市场的牛市。通过对经济周期不同阶段的判断，调整权益类资产和固定收益类资产投资比例，完成对一级资产配置的要求。

2、久期配置/期限结构配置

1）久期配置

首先，利用宏观经济模型，确定宏观经济的周期变化，主要是中长期的变化趋势，由此确定利率变动的方向和趋势；其次，根据不同大类资产在宏观经济周期的属性，即货币市场顺周期、债券市场逆周期的特点，确定债券资产配置的基本方向和特征，从而达到获得收益和规避风险的目的。具体而言，就是在宏观经济处于上升期，市场利率也处于上升时期，资产主要配置在货币市场、短期债券等方向上，组合保持较低久期，以回避市场利率上升带来的风险。在宏观经济处于下降期，市场利率也处于下降时期，资产主要配置在中、长期债券等方向上，组合保持较高久期，以获得市场利率下降带来的收益。具体情况见下表。

表1：债券资产配置对应宏观周期表

宏观经济周期	资产配置	备注
上升	货币市场、短期债券、少量中期债券	根据当时市场情况选择投资策略
高涨	货币市场、短期债券	
衰退	中、长期债券	
复苏	货币市场、短期、中期债券	

在定量分析的基础上，本基金还对可能影响市场走势的相关因素进行定性分析，主要包括国家宏观经济和证券市场政策、国家政治环境、资本项目外汇管理政策、市场参与主体的诚信程度等，灵活调整投资策略，以获得市场阶段性波动带来的收益。

2）期限结构配置

在确定组合久期后，组合具体期限结构的配比存在多种选择。通过研究收益率曲线形态，采用收益率曲线分析模型对各期限段的风险收益情况进行评估，对收益率曲线各个期限的骑乘收益进行分析。通过AAM模型选择预期收益率最高的期限段进行配比组合，从而在子弹组合、杠铃组合和梯形组合中选择风险收益比最佳的配置方案。

3、债券类别配置/个券选择

1）债券类别配置：依据信用利差分析，自上而下的资产配置。

根据国外研究证明，在宏观经济处于上升期，企业盈利情况好转，违约率下降，信用利差收窄；在宏观经济处于下降期，违约率上升，信用利差增大。

本基金以宏观经济周期性变化为依据，综合不同固定收益证券品种历史价格关系的数量分析，同时兼顾特定类别收益品种的基本面分析，评价各个品种的信用利差变化。在信用利差水平较高时持有金融债、企业债、短期融资券、可分离交易可转换债券、资产支持证券等信用债券，在信用利差水平较低时持有国债，从而确定整个债券组合中各类别债券投资比例。

2）个券选择：基于各个投资品种具体情况，自下而上的资产配置。

个券选择应遵循如下原则：

相对价值原则：同等风险中收益率较高的品种，同等收益率风险较低的品种。

流动性原则：其它条件类似，选择流动性较好的品种。

4、可转换债券选择

可转换债券兼具债券和股票的相关特性，其投资风险和收益介于股票和债券之间。在进行可转换债券筛选时，本基金将首先对可转换债券自身的内在债券价值（如票面利息、利息补偿及无条件回售价格）、保护条款的适用范围、流动性等方面进行研究；然后对可转换债券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；最后将可转换债券自身的基本面评分和其基础股票的基本面评分结合在一起以确定投资的可转换债券品种。

5、股票投资组合构建

本基金将首先以“红利股票、传统可转换债券对应的标的股票以及可分离交易可转换债券发行人发行的股票”为标准对A股上市公司进行筛选后得到初选股票库。随后采用定量分析方法，选取成长、财务及估值等指标，从初选股票库中选取优质上市公司得到优选股票库。随后，本基金将通过定性分析以及实地调研相结合的方法，对优选股票库进行筛选，最终选择其中具有突出价值优势的优质上市公司进行投资。

6、组合调整

组合调整分为主动调整和被动调整。主动调整包括组合管理本身所进行的调整以及根据风险控制与绩效评估报告所进行的调整。被动调整是基金应对申购、赎回进行的调整。

在组合投资管理和申购赎回过程中，都受到风险管理体系的约束和控制，并根据风险管理体系的反馈不断调整投资组合，因此组合调整是一个循环的、不间断的过程。以下从两方面进行说明。

1）主动调整：

（1）日常组合管理本身进行的主动调整。

本基金将根据绩效评估的反馈主动调整组合和策略，通过绩效评估全面评估基金的业绩，并对业绩进行归因分析，以全面评价和检讨投资决策的效果，从而改进投资管理工作。基金管理人根据研究发展部的研究报告，并结合市场形势变化对投资仓位及投资组合品种进行主动调整。

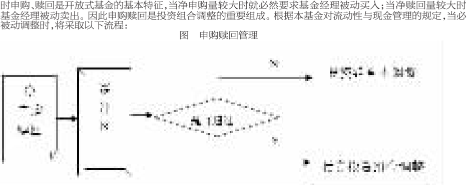
（2）根据风险控制与绩效评估报告进行调整。

基金的投资受到风险控制的约束，风险控制系统如果对基金投资组合的波动性风险、流动性风险等做出提示和警告，基金经理必须立即做出相应调整，将风险控制在一定水平之下。风险管理是实时和动态的过程，相应的主动调整具备实时性和动态性。

2）被动调整：申购赎回

随时申购、赎回是开放式基金的基本特征，当净申购量较大时就必然要求基金经理被动买入；当净赎回量较大时则要求基金经理被动卖出。因此申购赎回是投资组合调整的重要组成。根据本基金对流动性与现金管理的规定，当必须进行被动调整时，将采取以下流程：

图 申购赎回管理



如图所示，如果净申购赎回额加原有现金储备仍在预设的现金缓冲区间内，则债券投资组合不作调整，否则需要债券投资组合进行调整。

7、风险管理与绩效评估

风险管理通过建立一系列完整的风险预警、风险识别以及风险控制体系，运用数量化和系统化的方法来识别、测度、监督和控制风险。

绩效评估通过业绩表现分析、归因分析、绩效检讨报告，对基金投资进行总结，协助基金经理提高投资业绩。

十一、基金的投资限制

本基金的投资组合将遵循以下限制：

1、债券等固定收益类资产比例不低于基金资产的80%，其中可转换债券（含可分离交易可转换债券）的投资比例不低于固定收益类资产的80%；本基金所指固定收益类资产包括国债、央行票据、中期票据、金融债、公司债、企业债、政府机构债、可转换债券（含可分离交易可转换债券）、中小企业私募债、债券回购、短期融资券、次级债、银行存款、资产支持证券等金融工具，以及法律法规或监管部门允许的其他固定收益类资产；

2、股票等非固定收益类资产的投资比例不超过基金资产的20%；

3、本基金持有一家上市公司的股票，其市值不超过基金资产净值的10%；

4、本基金与由本基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的10%；本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的15%；本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的30%；

5、进入全国银行间同业市场的债券回购融入的资金余额不得超过基金资产净值的40%。债券回购最长期限为1年，债券回购到期后不得展期；

6、本基金参与股票发行申购，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；

7、保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

8、本基金投资权证，在任何交易日买入的总金额，不超过上一交易日基金资产净值的0.5%，基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%，本基金管理人管理的全部基金持有同一权证的比例不超过该权证的10%。投资于其他权证的投资比例，遵从法律法规或监管部门的相关规定；

9、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%；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%；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%；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%；

10、本基金投资的资产支持证券信用级别评级为BBB级以上(含BBB)或相当于BBB级，在本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；

11、本基金持有的全部中小企业私募债券，其市值不得超过固定收益类基金资产的20％；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%；

12、本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过本基金资产净值的15%。因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

13、本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致；

14、本基金不得违反基金合同中有关投资范围、投资策略、投资比例的规定；

15、法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的，从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。在符合相关法律法规规定的前提下，除上述第7、10、12、13项外，因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等非本基金管理人的因素致使基金的投资组合不符合上述各项规定的投资比例的，基金管理人应当在10个交易日内进行调整。法律法规或监管部门另有规定的，从其规定。

若法律法规或监管部门取消上述限制，履行适当程序后，本基金投资可不受上述规定限制。

十二、基金的业绩比较基准

本基金业绩比较基准：

中信标普可转债指数收益率×70%＋中证综合债券指数收益率×20%＋上证红利指数×10%。

中信标普可转债指数由中信标普指数公司推出，最大限度地涵盖了在上海证券交易所和深圳证券交易所上市的可转换债券，市场覆盖面广、代表性高。

中证综合债券指数是中证指数公司编制的综合反映银行间债券市场和沪深交易所债券市场的跨市场债券指数。该指数是在中证全债指数样本的基础上，增加了央行票据、短期融资券及一年期以下的国债、金融债和企业债，于2008年11月12日正式发布，以更加全面地反映中国债券市场整体价格变动趋势。

上证红利指数是由上海证券交易所授权，由中证指数有限公司开发的中国A股市场指数。该指数挑选在上证所上市的现金股息率高、分红比较稳定、具有一定规模及流动性的50只股票作为样本，能够反映上海证券市场高红利股票的整体状况和走势。该指数于2004年12月28日正式发布。

由于本基金为债券型基金，在综合考虑了指数的权威性和代表性、指数的编制方法以及指数与本基金投资范围、投资理念的吻合度后，本基金认为，以上业绩比较基准目前能够忠实地反映本基金的风险收益特征。

如果今后市场出现更具代表性的业绩比较基准，或者指数编制单位停止编制该指数，或有更具权威、更科学的复合指数权重比例，在与基金托管人协商一致后，本基金管理人可以在报中国证监会备案后调整或变更业绩比较基准并及时公告，而无需召开基金份额持有人大会。

十三、基金的风险收益特征

本基金为债券型基金，属于证券投资基金中的中低风险、中低预期收益品种，其预期风险和预期收益水平低于股票型、混合型基金，高于货币市场基金。

本基金主要投资于可转换债券，在债券型基金中属于风险水平相对较高的投资产品。

十四、基金投资组合报告

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。

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，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2018年06月30日，本报告中所列财务数据未经审计。

1、报告期末基金资产组合情况

截至2018年06月30日，中海可转换债券债券型证券投资基金A类资产净值为27,533,041.81元，基金份额净值为0.671元，累计基金份额净值为0.881元；C类资产净值为17,195,370.72元，基金份额净值0.672元，累计基金份额净值为0.882元。其资产组合情况如下：

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（％）
1	权益投资	6,811,243.84	14.65
	其中：股票	6,811,243.84	14.65
2	基金投资	–	–
3	固定收益投资	38,693,923.66	83.21
	其中：债券	38,693,923.66	83.21
	资产支持证券	–	–
4	贵金属投资	–	–
5	金融衍生品投资	–	–
6	买入返售金融资产	–	–
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	–	–
7	银行存款和结算备付金合计	878,173.97	1.89
8	其他资产	117,268.55	0.25
9	合计	46,500,610.02	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	1,581,696.40	3.54
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	5,229,547.44	11.69
J	金融业	–	–
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	–	–
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	6,811,243.84	15.23

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	600588	用友网络	100,000	2,451,000.00	5.48
2	002624	完美世界	76,344	2,367,427.44	5.29
3	603986	兆易创新	11,200	1,215,424.00	2.72
4	300687	赛意信息	14,400	411,120.00	0.92
5	300316	晶盛机电	27,560	366,272.40	0.82

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	–	–
2	央行票据	–	–
3	金融债券	2,609,880.00	5.83
	其中：政策性金融债	2,609,880.00	5.83
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）	36,084,043.66	80.67
8	同业存单	–	–
9	其他	–	–
10	合计	38,693,923.66	86.51

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	123006	东财转债	57,000	6,855,390.00	15.33
2	110032	三一转债	51,310	6,297,789.40	14.08
3	128024	宁行转债	52,672	5,510,017.92	12.32
4	110038	济川转债	37,630	4,600,267.50	10.28
5	018005	国开1701	26,000	2,609,880.00	5.83

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名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

（1）本期国债期货投资政策

根据基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

（2）报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

（3）本期国债期货投资评价

根据基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

9、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）报告期内本基金投资的前十名股票中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

（3）截至2018年6月30日，本基金的其他资产项目构成如下：

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	12,940.48
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	79,302.18
5	应收申购款	25,025.89
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	117,268.55

（4）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	123006	东财转债	6,855,390.00	15.33
2	110032	三一转债	6,297,789.40	14.08
3	128024	宁行转债	5,510,017.92	12.32
4	110038	济川转债	4,600,267.50	10.28
5	113011	光大转债	2,537,000.00	5.67
6	128016	雨虹转债	2,076,503.82	4.64
7	128029	太阳转债	2,065,441.17	4.62
8	113015	隆基转债	1,287,520.00	2.88
9	110040	生益转债	1,194,720.00	2.67
10	128020	水晶转债	918,500.00	2.05
11	110039	宝信转债	864,180.00	1.93
12	128010	顺昌转债	294,233.85	0.66

（5）报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中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

本基金由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

十五、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。

基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较（截止日期2018年6月30日）：

中海可转换债券A类：

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
2013.4.1－2013.6.30	−4.60%	0.66%	−3.66%	0.69%	−0.94%	−0.03%
2013.7.1－2013.12.31	−2.10%	0.68%	−2.17%	0.47%	0.07%	0.21%
2014.1.1－2014.12.31	56.55%	1.17%	46.71%	0.92%	9.84%	0.25%
2015.1.1－2015.12.31	−12.32%	2.77%	−14.30%	2.41%	1.98%	0.36%
2016.1.1－2016.12.31	−23.08%	0.84%	−7.57%	0.59%	−15.51%	0.25%
2017.1.1－2017.12.31	−5.31%	0.46%	0.82%	0.36%	−6.13%	0.10%
2018.1.1－2018.6.30	−12.52%	1.03%	−2.04%	0.61%	−10.48%	0.42%
自基金合同生效起至今	−21.11%	1.43%	7.71%	1.18%	−28.82%	0.25%

中海可转换债券C类：

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
2013.4.1－2013.6.30	−4.60%	0.65%	−3.66%	0.69%	−0.94%	−0.04%
2013.7.1－2013.12.31	−2.41%	0.68%	−2.17%	0.47%	−0.24%	0.21%
2014.1.1－2014.12.31	57.07%	1.17%	46.71%	0.92%	10.36%	0.25%
2015.1.1－2015.12.31	−11.41%	2.77%	−14.30%	2.41%	2.89%	0.36%
2016.1.1－2016.12.31	−23.40%	0.84%	−7.57%	0.59%	−15.83%	0.25%
2017.1.1－2017.12.31	−5.64%	0.46%	0.82%	0.36%	−6.46%	0.10%
2018.1.1－2018.6.30	−12.61%	1.03%	−2.04%	0.61%	−10.57%	0.42%
自基金合同生效起至今	−20.99%	1.43%	7.71%	1.18%	−28.70%	0.25%

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

十六、基金的费用与税收

（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、基金销售服务费：本基金从C类基金份额的基金资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、基金财产拨划支付的银行费用；
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

基金管理费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

H＝E×年管理费率÷当年天数，本基金年管理费率为0.75%

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

基金托管费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

H＝E×年托管费率÷当年天数，本基金年托管费率为0.2%

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A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为0.4%，销售服务费按前一日C 类基金资产净值的0.4%年费率计提。计算方法如下：

H＝E×0.4%÷当年天数

H 为C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为C 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，逐日累计至每月月末，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前2 个工作日内从基金财产中一次性划付给基金管理人，由基金管理人支付给销售机构。若遇法定节假日、公休假等，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、基金托管费率和销售服务费率。降低基金管理费率、基金托管费率和销售服务费率，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。

十七、对招募说明书更新部分的说明

（一）在“重要提示”部分，对相关内容进行补充。
（二）在“绪言”部分，对相关法律法规的名称进行了补充。
（三）在“释义”部分，对相关释义进行了补充
（四）在“基金管理人”部分，对“主要人员情况”进行了更新。
（五）对“基金托管人”部分进行了更新。
（六）对“相关服务机构”部分进行了更新。
（七）在“基金份额的申购和赎回”部分，对“申购与赎回的数额限制”、“申购费用和赎回费用”、“拒绝或暂停申购的情形及处理方式”、“暂停赎回或者延缓支付赎回款项的情形及处理方式”和“巨额赎回的情形及处理方式”的相关内容进行了更新。
（八）在“基金的投资”部分，对“投资范围”和“投资限制”的相关内容进行了更新，并对“基金投资组合报告”部分按最新资料进行了更新。
（九）在“基金的业绩”部分按最新资料进行了更新。
（十）在“基金资产的估值”部分，对“估值方法”和“暂停估值的情形”的相关内容进行了更新。
（十一）在“基金的信息披露”部分，对“公开披露的基金信息”的相关内容进行了更新。
（十二）在“风险揭示”部分，对“投资于本基金的主要风险包括：”的相关内容进行了更新。
（十三）对“基金托管协议的内容摘要”部分按最新《中海可转换债券债券型证券投资基金托管协议》进行了更新。
（十四）在“其他应披露的事项”中，披露了本期间本基金的公告信息。

中海基金管理有限公司
二〇一八年十一月三日