中国证券报
■ 2020年1月15日 星期三

大成基金管理有限公司关于以通讯方式召开大成景兴信用债债券型证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告

大成基金管理有限公司（以下简称“本基金管理人”）已于2020年1月14日在《中国证券报》和大成基金管理有限公司网站（www.dcfund.com.cn）发布了《大成基金管理有限公司关于以通讯方式召开大成景兴信用债债券型证券投资基金基金份额持有人大会的公告》。为了使本次基金份额持有人大会顺利召开，现发布《大成基金管理有限公司关于以通讯方式召开大成景兴信用债债券型证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告》。

一、会议基本情况

根据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》的有关规定和《大成景兴信用债债券型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的约定，大成景兴信用债债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）的基金管理人大成基金管理有限公司（以下简称“大成基金管理人”）经与本基金的基金托管人中国银行股份有限公司协商一致，决定以通讯方式召开本基金的基金份额持有人大会，会议具体安排如下：

1、会议召开方式：通讯方式

2、会议投票表决起止时间：2020年1月21日起，至2020年2月20日17:00止（以本公告列明的公证机关指定的表决票收件人收到纸质表决票的时间为准或以基金管理人系统记录时间为准）

3、纸质表决票的寄达地点

收件人：大成基金管理有限公司北京分公司

地址：北京市西城区平安里西大街28号中南国际中心1601室

邮政编码：100035

联系人：吕婧

联系电话：400-888-5558，010-88009300

传真：010-85252282

请在信封背面注明：“大成景兴信用债债券型证券投资基金基金份额持有人大会表决专用”。

4、电话投票形式表决票的提交（仅适用于个人持有人）

电话投票形式的表决票按本公告规定的方式回复至基金管理人指定的客服热线。

5、短信投票形式表决票的提交（仅适用于个人持有人）

短信投票形式的表决票按本公告规定的方式回复至基金管理人指定的短信平台。

二、会议审议事项

本次持有人会议审议事项为《关于大成景兴信用债债券型证券投资基金修改基金合同等相关事项的议案》（见附件一）。

三、权益登记日

本次大会的权益登记日为2020年1月20日，即该日在登记机构登记在册的本基金全体基金份额持有人享有本次会议的表决权。

四、投票方式

（一）纸质投票

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

2、基金份额持有人应当按照表决票的要求填写相关内容，其中：

（1）个人投资者自行投票的，需在表决票上签字，并提供本人身份证件（包括使用的身份证或其他能够表明其身份的有效证件或证明）正反面复印件；

（2）机构投资者自行投票的，需在表决票上加盖本单位公章或经授权的业务公章（以下合称“公章”），并提供加盖公章的营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他组织可使用加盖公章的事业单位法人登记证书、有权部门的批文或登记证书复印件等）；合格境外机构投资者自行投票的，需在表决票上加盖本单位公章（如有）或由授权代表在表决票上签字（如云公章），并提供该授权代表的身份证件、护照或其他能够证明其身份的有效证件或证明）的复印件，该合格境外机构投资者托管人的授权代表有权代表该合格境外机构投资者签署表决票的其他证明文件，以及该合格境外机构投资者的营业执照、商业登记证或者其他有效注册登记证明复印件，以及取得合格境外机构投资者资格的证明文件的复印件；

（3）基金份额持有人以授权委托书委托他人代为投票的，需在授权委托书上签字或盖章，并提供授权委托书的复印件；

（4）如果同一基金份额持有人先后提交了多次表决票，则以最后一次有效表决票为准。

五、投票

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

（一）委托人

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

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

（二）受托人

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

（三）授权方式

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

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

基金份额持有人通过非纸面方式授权的，授权形式及程序应符合本公告的规定。基金份额持有人通过非纸面方式授权应授权给基金管理人或

1、纸面方式授权

（1）基金份额持有人进行纸面授权所需提供的文件

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

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

（2）受托人投票

1、基金份额持有人委托受托人投票的，受托人应提供由委托人亲手签署的授权委托书原件（授权委托书的格式可参考附件三的样本）。

2、基金份额持有人委托受托人投票的，受托人应提供基金份额持有人的个人身份证明文件复印件。

（3）骑乘策略

基金管理人将通过分析收益率曲线各期限段的期限利差情况，买入收益率曲线最陡峭处所对应的期限债券，随着持有债券时间的延长，该债券的剩余期限将缩短，到期收益率将下降，届时卖出该债券可获得资本利得收入。该策略的关键是收益率曲线的陡峭程度、利收益率曲线较为陡峭，则随着债券剩余期限的缩短，债券的收益率水平将会有较大下滑，进而获得较高的资本利得。

（4）息差放大策略

该策略是利用债券回购收益率低于债券收益率的机会通过循环回购以放大债券投资收益的投资策略。该策略的基本模式是将利用买入债券进行正回购，再利用回购融入资金购买收益率较高债券品种。在执行息差放大策略过程中，基金管理人将密切关注债券收益率与回购收益率的相互关系，并始终保持回购利率低于债券收益率。

5）可转换债券投资策略

可转换债券是一种兼具债券和股票特性的复合性衍生证券。本基金对可转换债券的投资主要从公司基本面分析、理论定价分析、投资与回购交变化等方面综合考虑。本基金在不同的市场环境中，对可转换债券投资的投资导向也有所不同。一般而言，在熊市环境中，更多地关注可转换债券的债性价值、上市公司的信用风险以及条款博弈的价值；在牛市环境中，则更多地关注可转换债券的股性价值。

6）可交换债券投资策略

可交换债券与可转换债券的区别在于换股资源时用于交换的股票并非自身新发的股票，而是发行人持有的其他上市公司的股票。可交换债券同样具有股性和债性，其中债性与可转换债券相同，因选择持有可交换债券至到期以获取票面价值和票面利息；而对于股性的分析则需关注目标公司的股票价值。本基金将通过对目标公司股票的投资价值分析和可交换债券的吸债部分价值分析综合开展投资决策。

（7）资产支持证券投资策略

本基金将通过对宏观经济、提前偿还率、资产池结构以及资产池资产所在行业景气变化等因素的研究，预测资产池未来现金流变化，并通过研究标的证券发行条款，预测提前偿还率变化对标的证券的久期与收益率的影响，在严格控制风险的情况下，结合信用评级和流动性管理，选择风险调整后收益高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。

4、固债期货投资策略

为有效控制债券投资的系统性风险，本基金根据风险管理的原则，以套期保值为目的，适度运用国债期货，提高投资组合的运作效率。

在国债期货投资时，本基金将首先分析国债期货各合约的价格与最便宜可交割券的关系，选择定价合理的国债期货合约，其次，考虑国债期货各合约的流动性情况，最终确定与现货组合的合适匹配，以达到风险管理的目标。

5、信用衍生品投资策略

为了更好地管理债券投资的信用风险，本基金根据风险管理的原则，以风险对冲为目的，将适当参与信用衍生品的投资。本基金将在详细评估信用债风险状况的前提下，对比权衡个券风险收益与信用衍生品价格，构建信用风险对冲组合。持有期内，本基金会紧密跟踪信用利差与信用衍生品价格的动态变化，灵活调整对冲比例，追求经信用风险对冲后的收益回报最大化。

（7）投资限制

1.组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

（1）本基金对债券的投资比例不低于基金资产的80%，对信用债券的投资比例不低于非现金基金资产的80%；

（2）每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有的现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）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%；

（3）本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的10%；

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

（5）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，不超过该上市公司可流通股票的30%；

（6）本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%；因市场波动、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。

（7）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%；

（8）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%；

（9）本基金持有的一笔信用衍生品，其市值不得超过基金资产净值的10%；

（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%；

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

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

（13）本基金总资产不得超过基金净资产的140%；

（14）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，可接受质押品的范围、比例要求等应当与本基金保持一致；

（15）本基金参与国债期货投资时，应遵循下列限制：

1）本基金在任何交易日日终，持有的买入国债期货合约价值不得超过基金资产净值的15%，持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的30%；

2）本基金持有的债券（不含到期日在一年以内的政府债券）市值和买入、卖出国债期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合本基金投资范围中关于债券资产的投资比例，国不低于基金资产净值的80%；

3）本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的国债期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的30%；

（16）本基金不持有具有信用保护实力属性的信用衍生品，不持有合约类信用衍生品；本基金持有的信用衍生品名义本金合计不得超过本基金净资产的10%；本基金投资于同一信用保护实力的各类信用衍生品名义本金合计不得超过基金资产净值的10%。因证券/期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资组合不符合上述规定比例限制的，基金管理人应当在三个月内进行调整；

（17）法律法规及中国证监会规定的其他投资限制。

除上述第（2）、（6）、（11）、（14）项外，因证券市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在10个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。

基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在上述期间内，本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门取消或调整上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或按照调整后的规定执行。

2.禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

（1）承销证券；

（2）违反规定向他人贷款或者提供担保；

（3）从事证券买卖责任的投资；

（4）买卖其他上市公司股票；

（5）向其基金管理人、基金托管人出资；

（6）从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；

（7）法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

基金管理人运用基金财产进行证券投资，除投资于证券市场外，还可以在法律法规允许的前提下从事证券借贷、证券回购等证券交易活动。

基金管理人运用基金财产进行证券投资，应当在合理分析市场对证券投资的影响、合理估计证券投资的流动性、合理安排证券投资的资金来源、合理测算证券投资的成本、充分揭示证券投资的风险的基础上，结合证券市场的发展趋势、流动性状况、证券发行人的财务状况、证券投资的品种、数量、期限、成本、风险状况等情况，进行科学的分析、判断和决策。

基金管理人运用基金财产进行证券投资，应当建立健全内部风险控制和监察稽核制度，采取有效措施，防范因内部管理不当、内部控制失效造成的风险。

基金管理人应当建立投资决策委员会、投资管理部门、监察稽核部门等证券投资内部决策、执行、监察稽核的专门机构，明确各机构的职责权限，建立健全内部风险控制和监察稽核的具体工作程序。

基金管理人应当建立证券投资的决策、执行、监察稽核的内部控制制度，报中国证监会备案。

基金管理人应当建立证券投资的风险评估、风险控制、风险监测、风险报告的证券投资风险管理系统，并保证该系统的有效运行。

基金管理人应当建立证券投资的业绩评估体系，对证券投资的业绩进行评估。

基金管理人应当建立证券投资的信息系统，保证证券投资的信息来源及时、准确、完整、合法。

基金管理人应当建立证券投资的档案管理系统，保证证券投资的决策、执行、监察稽核等各项工作的可追溯性。

基金管理人应当建立证券投资的应急处理机制，保证证券投资的正常开展。

基金管理人应当建立证券投资的信息隔离墙制度，保证证券投资的信息不被泄露、不被利用。

基金管理人应当建立证券投资的内部稽核制度，保证证券投资的合规性、合理性、有效性。

基金管理人应当建立证券投资的内部报告制度，保证证券投资的内部报告的及时、准确、完整。

基金管理人应当建立证券投资的内部责任追究制度，对证券投资的违规、违反内部管理制度、给基金财产造成损失的，应当追究有关当事人的责任。

基金管理人应当建立证券投资的内部应急处理机制，对证券投资的内部应急处理的原则、内部应急处理的组织机构、内部应急处理的程序、内部应急处理的方法、内部应急处理的报告、内部应急处理的责任追究等内容作出明确规定。

基金管理人应当建立证券投资的内部控制制度的评估、检查、修订制度，对证券投资的内部控制制度的适时性、有效性、合法性、合理性进行评估、检查、修订。

基金管理人应当建立证券投资的内部稽核监察制度，对证券投资的内部控制制度的执行情况进行稽核监察。

基金管理人应当建立证券投资的内部控制制度的实施细则，对证券投资的内部控制制度的具体内容、内部控制制度的实施方式、内部控制制度的实施程序、内部控制制度的实施责任、内部控制制度的实施时间、内部控制制度的实施效果等内容作出明确规定。

基金管理人应当建立证券投资的内部控制制度的实施细则的评估、检查、修订制度，对证券投资的内部控制制度的实施细则的适时性、有效性、合法性、合理性进行评估、检查、修订。

基金管理人应当建立证券投资的内部控制制度的实施细则的报告制度，对证券投资的内部控制制度的实施细则的评估、检查、修订的情况、证券投资的内部控制制度的实施细则的执行情况、证券投资的内部控制制度的实施细则的内部稽核监察情况、证券投资的内部控制制度的实施细则的内部应急处理情况、证券投资的内部控制制度的实施细则的内部责任追究情况、证券投资的内部控制制度的实施细则的内部控制制度的实施时间、证券投资的内部控制制度的实施效果等内容作出定期报告。

基金管理人应当建立证券投资的内部控制制度的实施细则的报告制度的内部报告的及时、准确、完整、合法。

基金管理人应当建立证券投资的内部控制制度的实施细则的报告制度的内部报告的责任追究制度，对证券投资的内部控制制度的实施细则的内部报告的虚假、隐瞒、遗漏、滞后、不合法、不合理、不合规的情况，进行责任追究。

基金管理人应当建立证券投资的内部控制制度的实施细则的报告制度的内部报告的责任追究制度的实施细则的内部报告的责任追究制度的实施细则的内部报告的责任追究制度的实施细则