

(上海B0905)

深圳市前海商务秘书有限公司
 办公地址：深圳市南山区科技中一路腾讯大厦
 法人代表：刘明军
 联系人：刘鸣
 客服电话：96017
 公司网站：www.tengxianxinc.com
 (87) 国鑫基金销售有限公司
 办公地址：上海市黄浦区北京东路666号H区（东座）6楼A31室
 法人代表：高志谦
 联系人：杨一
 客服电话：021-50206003
 公司网站：www.msstec.com
 (88) 北京百度百盈基金销售有限公司
 办公地址：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号科利大厦
 法人代表：张旭阳
 联系人：陈博
 客服电话：90655-4
 公司网站：www.baiyingfund.com
 (89) 诺亚正行基金销售有限公司
 办公地址：上海市浦东新区银城中路66号205室
 办公地址：上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心2楼
 法人代表：汪静波
 联系人：李晨
 客服电话：400-921-5399
 公司网站：www.noah-fund.com
 (90) 深圳众禄基金销售股份有限公司
 办公地址：深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼J、J单元
 法人代表：薛峰
 联系人：潘春燕
 客服电话：4008-788-887
 公司网站：www.zlfund.com
 (91) 上海天天基金销售有限公司
 办公地址：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2楼
 法人代表：其实
 联系人：潘世华
 客服电话：400-1818-188
 公司网站：www.1234567.com
 (92) 上海好买基金销售有限公司
 办公地址：上海市虹口区欧阳路196号26号楼2楼41号
 办公地址：上海市浦东新区浦东南路1118号鄂尔多斯大厦903-906室
 法人代表：杨文斌
 联系人：张茹
 客服电话：4007-009-695
 公司网站：www.howbuy.com
 (93) 蚂蚁(杭州)基金销售有限公司
 办公地址：杭州市余杭区仓前街文一西路1218号1幢202室
 办公地址：杭州市滨江区江南大道3588号恒生大厦12楼
 法人代表：陈柏青
 联系人：张裕
 客服电话：4000-766-123
 公司网站：www.fund123.cn
 (94) 上海长耀基金销售有限公司
 办公地址：上海市浦东新区高翔路526号2幢220室
 办公地址：上海市浦东新区浦东大道556号裕景国际B座16层
 法人代表：张庆伟
 联系人：吴斌
 客服电话：400-886-661
 公司网站：www.mylfund.com
 (97) 上海利得基金销售有限公司
 办公地址：上海市宝山区蕴川路475号1033室
 办公地址：上海浦东新区耀川路91弄61号10号楼12楼
 法人代表：沈捷伟
 联系人：曹晨磊
 客服电话：400-067-6266
 公司网站：http://aleadfund.com.cn
 (98) 中期资产管理有限公司
 办公地址：北京市朝阳区建国门外光华路16号中国中期大厦A座11层
 法人代表：路颖
 联系人：侯英建
 客服电话：96162, 4008888160
 公司网站：www.cifcofund.com
 (99) 嘉实财富管理有限公司
 办公地址：上海市浦东新区世纪大道8号B座46楼06-10单元
 办公地址：上海市浦东新区世纪大道8号B座46楼06-10单元
 法人代表：赵学军
 联系人：张倩
 客服电话：400-021-8850
 公司网站：www.harvestwm.cn
 (100) 北京创金启富基金销售有限公司
 办公地址：北京市西城区民丰胡同31号5号楼215A
 法人代表：梁娟
 联系人：张旭
 客服电话：400-6262-818
 公司网站：www.sirich.com
 (101) 宜信普泽(北京)基金销售有限公司
 办公地址：北京市朝阳区建国路89号院15层1809
 办公地址：北京市朝阳区建国路88号SOHO现代城C座1809
 法人代表：沈伟栋
 联系人：程静
 客服电话：400-609-9200
 公司网站：www.yixinfund.com
 (102) 南京苏宁基金销售有限公司
 办公地址：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
 法人代表：钱鑫飞
 联系人：王静
 客服电话：95177
 公司网站：www.snjfund.com
 (103) 北京格上富信基金销售有限公司
 办公地址：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
 法人代表：李悦章
 联系人：张林
 客服电话：400-066-8586
 公司网站：https://www.gesafe.com/
 (104) 北京恒天明泽基金销售有限公司
 办公地址：北京市经济技术开发区宏达北路10号5层1122室
 法人代表：周斌
 联系人：马静瑶
 客服电话：400-706-9968
 公司网站：www.chtwm.com
 (105) 北京汇成基金销售有限公司
 办公地址：北京市海淀中关村大街11号1118号1108号
 办公地址：北京市海淀区中关村大街11号1118号1108号
 法人代表：王伟刚
 联系人：尹向博
 客服电话：400-619-9069
 公司网站：www.hcjin.com
 (106) 深圳前海微众银行股份有限公司
 办公地址：深圳市福田区莲花街道商报东路英龙商务大厦B座A-1(811-812)
 办公地址：辽宁省大连市中山区海军广场所道人民东路52号民生金融中心22楼盈信基金
 法人代表：孙洪升
 联系人：葛静怡
 客服电话：4007-3003-688
 公司网站：www.fundajing.com
 (107) 上海大智慧基金销售有限公司
 办公地址：上海自由贸易试验区杨高南路428号1号楼
 办公地址：上海自由贸易试验区杨高南路428号1号楼1102, 1108
 法人代表：申健
 联系人：印梦然
 客服电话：021-20293201
 公司网站：http://www.wisdom.com.cn/
 (108) 北京新浪仓石基金销售有限公司
 办公地址：北京市海淀区北四环西路65号理想国际大厦906室
 办公地址：北京市海淀区北四环西路68号理想国际大厦906室、海淀北二街10号瀚海大厦12层
 法人代表：姜奕
 联系人：李璇
 客服电话：400-567-8855
 公司网站：www.xincaifu.com
 (110) 诺安财富(北京)投资管理有限公司
 办公地址：北京市朝阳区东三环中路7号4号楼40层4601室
 办公地址：北京市朝阳区东三环中路7号北京财富中心A座46层
 法人代表：杨健
 联系人：李海森
 客服电话：400-673-7010
 公司网站：www.noanifund.com
 (111) 北京中民财富管理(上海)有限公司
 办公地址：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楼
 法人代表：燕斌
 联系人：凌秋艳
 客服电话：400-821-0203
 公司网站：www.szmidfund.com
 (112) 上海聚泰基金销售有限公司
 办公地址：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楼
 法人代表：燕斌
 联系人：凌秋艳
 客服电话：400-046-6788

公司网站：http://www.66zichan.com
 (113) 上海煜煜基金销售有限公司
 办公地址：上海市崇明县长兴镇浦沿公路1800号2号楼6153室
 上海东和经济发区一
 办公地址：上海市杨浦区昆明路518号A1002室
 法人代表：王翔
 联系人：蓝杰
 客服电话：400-820-5369
 公司网站：www.yuyufund.com
 (114) 上海凯石财富基金销售有限公司
 办公地址：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
 法人代表：陈盛武
 联系人：李晓明
 客服电话：4000-178-000
 公司网站：www.lingxianfund.com
 (115) 上海融金所基金销售有限公司
 办公地址：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
 法人代表：魏东华
 联系人：宁博宇
 客服电话：4008-219-031
 公司网站：www.lufunds.com
 (116) 珠海盈米基金销售有限公司
 办公地址：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
 法人代表：肖雯
 联系人：黄敏娥
 客服电话：020-89629066
 公司网站：www.yingmi.com.cn
 (117) 奕丰基金销售有限公司
 办公地址：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)
 办公地址：深圳市南山区海德三路海岸大厦东座 1115, 1116, 1301, 1302室
 法人代表：谭伟 WEE HOWE
 联系人：叶昊星
 客服电话：400-684-0500
 公司网站：http://www.ifastps.com.cn
 (118) 中证金牛(北京)投资咨询有限公司
 办公地址：北京市丰台区东管头1号2号楼2-45室
 办公地址：北京市宣武门外大街甲1号环球财讯中心A座9层
 法人代表：彭宇珍
 联系人：陈静
 客服电话：400-890-998
 公司网站：www.jiayin.com
 (119) 北京肯瑞瑞基金销售有限公司
 办公地址：北京市海淀区海淀东三街2号4层401-15
 办公地址：北京市亦庄经济开发区科创十一街18号院A座17层
 法人代表：江卉
 联系人：徐宇宁
 客服电话：95118
 公司网站：http://fund.ks.com/
 (120) 大通国际基金销售有限公司
 办公地址：辽宁省大连市沙河口区体坛路22号诺德大厦E座202室
 办公地址：辽宁省大连市沙河口区体坛路22号诺德大厦E座202室
 法人代表：樊怀东
 联系人：贾伟刚
 客服电话：400-899-1000
 公司网站：www.yibajin.com
 (121) 深圳市金斧子基金销售有限公司
 办公地址：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1106
 办公地址：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1108
 法人代表：魏君仁
 联系人：刘昕薇
 客服电话：400-930-0660
 公司网站：www.jfzinv.com
 (122) 北京蛋卷基金销售有限公司
 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
 办公地址：北京市朝阳区望京SOHO T2 B2B2507
 法人代表：戚晓强
 联系人：王亚菲
 客服电话：400-159-9288
 公司网站：danjuanapp.com
 (123) 上海华理财富投资管理有限公司
 办公地址：上海市虹口区东大名路687号1幢2楼268室
 办公地址：上海市西城区金融大街33号1002大厦B座8层
 法人代表：李一梅
 联系人：邱秋
 客服电话：400-817-5666
 公司网站：www.amcfund.com
 (124) 中银国际基金销售有限公司
 办公地址：上海市东方路800号7、8、10楼
 办公地址：上海市东方路800号7、8、10楼
 联系人：史艺雯
 客服电话：400-888-7868
 公司网站：www.siywqh.com
 (125) 玄元保险代理有限公司
 办公地址：中国(上海)自由贸易试验区张杨路707号1105室
 办公地址：中国(上海)自由贸易试验区张杨路707号1105室
 法人代表：马永涛
 联系人：卢亚博
 客服电话：400-080-8208
 公司网站：www.lieaimofang.com
 (126) 中国人寿保险股份有限公司
 办公地址：中国北京市西城区金融大街16号
 办公地址：中国北京市西城区金融大街16号
 法人代表：陈旻
 联系人：杨生
 客服电话：010-63635114
 公司网站：www.wa-chinalife.com

(二) 其他机构投资者
 基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择其他符合要求的机构代理销售本基金，并在基金管理人网站公示。
 二、基金登记机构
 名称：富国基金管理有限公司
 住所：中国(上海)自由贸易试验区世纪大道1196号世纪汇办公楼2座27-30层
 办公地址：中国(上海)自由贸易试验区世纪大道1196号世纪汇办公楼2座27-30层
 法定代表人：裴长江
 成立日期：1999年9月13日
 电话：(021) 20361818
 传真：(021) 20361616
 联系人：徐慧
 三、出具法律意见书的律师事务所
 名称：上海市源泰律师事务所
 住所：上海市浦东新区浦东南路256号华夏银行大厦1405室
 办公地址：上海市浦东新区浦东南路256号华夏银行大厦1405室
 负责人：廖海
 电话：(021) 51150298
 传真：(021) 51150398
 联系人：廖海
 经办律师：廖丽金、刘佳
 四、审计基金资产的会计师事务所
 名称：安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)
 注册地址：北京市东城区东长安街1号东方广场E座东塔16层
 办公地址：上海市浦东新区世纪大道100号环球金融中心50楼
 执行事务合伙人：毛鞍宁
 联系电话：021-22228888
 传真：021-22290000
 联系人：蒋燕华
 经办注册会计师：蒋燕华、费泽旭

第四部分 基金名称
 富国可转债债券证券投资基金
第五部分 基金类型
 债券型
第六部分 投资目标
 本基金主要利用可转债品种兼具债券和股票的特性，通过“自上而下”宏观分析”与“自下而上”个股选择有效结合，力争在锁定投资组合下方风险的基础上实现基金资产的长期稳定增值。
第七部分 基金投资方向
 本基金将投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行的股票、债券、权证以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金所投资的固定收益类资产包括国债、央行票据、金融债、企业债、可转债、短期融资券、次级债、资产证券化产品、可转换(含分离交易可转债)和回购等;本基金可参与一级市场新股申购或增发新股,也可在二级市场投资股票、权证等权益类证券,但二级市场的股票投资限于传统可转债对应的标的股票以及分离交易可转债发行人发行的股票。
 如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种,基金管理人可在履行适当程序后,将其纳入投资范围。

第八部分 基金投资策略
1. 投资策略
 本基金主要投资于可转债品种,一方面通过利用可转债的债券特性,强调配置的安全性及稳定性,另一方面利用可转债的股票特性(内含转股期权),分散股市上涨跌产生的较高风险。
(1) 自上而下的整体资产配置策略
 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供求情况、信用风险状况、风险和收益有关因素的综合分析,预测各类资产在中、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调整,确定资产的最优配置比例和相应的风险水平。
(2) 自上而下的类属资产配置策略
 本基金在整体资产配置策略的框架下,根据类属资产的收益水平、风险来源、市场流动性、利率走势等因素,采取积极的投资策略,定期对投资组合类属资产进行优化配置,以求收益、风险、流动性之间的最佳平衡点。针对固定收益类资产,本基金将主要投资于可转债(含传统可转债、分离交易可转债等)、普通债券(含国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、短期融资券等)、资产证券化产品等;二级市场,本基金将根据其市场转换溢价率及其价格相对标的股票价格的变动情况,可选择进一步划分为偏股型、平衡型和偏债型进行优化配置。
(3) 自下而上的明股暗债配置策略
 本基金采取自上而下的方法挑选个股和个股。在个股选择方面,本基金将遵循估值水平、剩余期限、正股基本面、信用风险等因素作为个股是否值得纳入投资组合的主要考量指标;同时参照本基金的收益要求,进一步考虑正股基本面与可转债估值水平的配比、普通债券的收益率与剩余期限的配比等因素;并且根据个股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进行精选,并重点关注基本面良好、估值具有优势的优秀品种。
① 固定收益类资产配置策略
1) 可转债投资策略
 本基金将积极投资于发行条款较好、申购收益率高、公司基本面优秀的可转债的一级市场申购,上市后将根据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债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。
(2) 传统可转债投资策略
 传统可转债即转股公司债券,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。可转换公司债券同时具有“普通债券”具备的债权和“普通债券”不具备的期权。当股票下跌时,可转换公司债券的价格可以受到债券价值的支撑;当标的股票上涨时,可转换公司债券内含的期权使其可以分享股价上涨带来的收益。

转换公司债券的理论价值应该等于作为普通公司债券的基础价值加上内含的转股期权价值。

1. 个券精选策略。本基金将对于有可转债对应的标的股票进行深入研究,采用定性分析(行业地位、竞争优势、治理结构、市场开拓、创新能力等)与定量分析(P/B、P/E、PEG、DCF、DDM、NAV等)相结合的方式精选成长性良好且估值合理的个股,同时考虑证券市场的环境,并在对方式可转债估值合理的前提下集中投资,以分享正股上涨带来的收益。
 2. 买入并持有策略。与股票市场类似,可转债市场存在着周期性的起伏波动,当股票市场处于下跌时,投资者容易过度悲观,可转债的期权价值可能因此被低估,表现为可转债的溢价率很低。本基金将在信用风险可控的前提下,买入溢价率较低的转债,并坚持长期持有,以获取低风险稳定回报。
 3. 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力,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提高了可转债的期权价值。本基金将充分把握各项条款带给可转债带来的投资机会。
 4. 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对应的正股的套利机会。当可转债的转换溢价率为负时,买入可转债的同时卖出对应的股票可以获得价差;反之,买入人转债的同时卖出可转债也可以获得套利机会。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,本基金将密切关注可转债与对应的股票之间的对比关系,恰当的选择时机进行套利,以增强基金资产组合的收益。
 5. 分阶段投资策略。在可转债发行和存续的各个阶段,由于品种本身的特征和属性,可转债的走势和市场环境会呈现出与股票市场正相关或弱相关的特征,它在大部分时间里是有价值的,仅在少数情况下受可转债的个性影响而不适用。本基金将充分利用可转债各个阶段的特征,并结合个股的具体情况,适时运用分阶段投资策略。
(3) 分离交易可转债投资策略
 分离交易可转债即认股权和债券分离交易的可转换公司债券,它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。分离交易可转债是债券和股票的混合融资品种,它与传统可转债的本质区别在于上市后债券与期权将各自单独交易。尽管如此,分离交易后的纯债和认股权证结合在一起仍然具有传统可转债的部分特征,因为分离后的纯债和认股权证组合在一起也可以构成类似可转债品种,基于该逻辑,不是认股权证还是标的股票,与传统可转债内含的期权之间也具有高度的相关性。
 分离交易可转债可以采取与可转债类似的投资策略。此外,也可以通过调整纯债和认股权证对应的股票之间的比例来组合成不同风险收益特征的资产组合,从而应对不同的市场环境。本基金将对纯债和认股权证的标的股票之间的最佳比例进行量化研究,并适时进行动态调整。

II. 普通债券投资策略
 本基金主要基于对宏观经济政策、货币政策的深入分析及对宏观经济运行态势跟踪,在对普通债券的投资过程中,采用久期控制下的主动性投资策略。主要包括:久期控制、期限结构配置、信用风险控制、市场套利和相对价值判断等管理手段,对债券市场、债券收益率曲线以及各种券种的价格变化进行跟踪,相机而动,积极调整。
(1) 久期控制是根据对宏观经济形势、金融市场运行特点等因素的分析确定组合的整体久期,有效控制投资组合风险。
(2) 期限结构配置是在确定组合久期后,针对收益率曲线形态特征确定合理的组合期限结构,包括采用集中策略、两端策略和梯型策略等,在长期、中期和短期债券间进行动态调整,从长、中、短期债券的相对价格变化中获利。
(3) 信用风险控制是基金管理人充分利用现有行业与公司研究力量,根据投资主体的经营状况和现金流等情况对其信用风险进行评估,以此作为品种选择的基本依据。
(4) 跨市场套利是根据不同债券市场的运行规律和风险特征,构建和调整债券资产组合,提高投资收益,实现跨市场套利。
(5) 相对价值判断是根据对同类债券的相对价值判断,选择合适的交易时机,增持相对低估、价格将上涨的债券,减持相对高估、价格将下跌的债券。

此外,对于内含赎回或回售选择权的债券,本基金将利用债券市场收益率曲线,运用利率模型,计算赎回或回售选择权的价值,并纳入调整(OAS)作为此类品种投资决策的主要依据。
III. 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、标的资产的结构及质量、提前偿还率等多种因素影响。

本基金将在基本分析和债券市场宏观分析的基础上,对资产证券化产品的交易结构、信用风险、提前偿还风险和利率风险等进行分析,采取包括收益率曲线策略、信用利差曲线策略、预期利率波动率策略等多种积极主动投资策略,投资于资产证券化产品。
(二) 股票投资策略
1. 二级市场股票投资策略
 本基金可以直接参与二级市场投资的品种仅限于与可转债相关的股票,包括传统可转债对应的标的股票、分离交易可转债发行人发行的股票。
 自上市公司公告董事会通过可转债发行议案之日起,该股票可进入本基金股票池;自可转债挂牌日或上市公司公告可转债发行议案之日起,本基金必须在二级市场内卖出对应股票。
 本基金将与二级市场股票投资与可转债的研究和投资紧密相联,重点关注个股行业地位、成长前景向好、估值具有优势的标的股票,以及有利于可转债套利、纯债和标的股票均属于可转债组合等投资策略的执行的股票品种。

此外,本基金将充分利用标的股票在可转债发行及存续的各个阶段呈现出的不同特征,积极参与标的股票在各个阶段的投资机会。
 在个股选择过程中,本基金主要采取自下而上的投资策略,借鉴国外的投资管理经验,结合国内市场的特征,采用基本面研究与数量化分析相结合的方法,对以下三类上市公司进行重点投资:
(1) 现金流充沛、行业竞争优势明显、具有良好现金分红记录或现金分红潜力较强的上市公司;
(2) 业绩持续明显超越同行的上市公司;
(3) 未来盈利水平具有明显增长潜力且估值合理的上市公司。
II-二级市场股票投资策略
 本基金将深入研究和公开发行(IPO)股票及增发新股的上市公司基本面,挖掘公司的内在价值,根据当时股票市场整体投资环境及定价水平,发行折价水平及一、二级市场间资金供求关系,在有效控制风险的前提下制定相应的新股申购策略。通过对新股申购获得的股票,本基金将在其上市流通之日前3个交易日卖出。
(三) 权证投资策略
 在确保基金投资目标一致以及风险可控的前提下,本基金可适度进行谨慎的权证投资。针对权证投资的目标首先是与投资组合构成类可转换品种,其次是谋求基金资产的稳定增值。

第九部分 基金业绩比较基准
 本基金业绩比较基准=天相转债指数收益率×60%+沪深300指数收益率×20%+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转股规模加权计算,反映两市可转债的总体走势。
 沪深300指数是由上海证券交易所和深圳证券交易所授权,由中证指数有限公司开发的中国A股市场指数,它的样本选自沪深两个证券市场,覆盖了大部分流通市值,其成份股票为中国A股市场中代表性强、流动性高的股票,能够反映A股市场总体发展趋势。
 本基金认为,该业绩比较基准目前能够忠实反映本基金的业绩比较基准。如果今后法律法规发生变化,或者有更权威的、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合用于本基金的业绩比较的指数时,本基金可以在履行相关程序后变更业绩比较基准并及时公告。

第十部分 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风险较低品种,其预期风险与预期收益低于货币型基金,低于混合型基金和股票型基金。本基金投资于可转债品种,在债券型基金中属于风险水平相对较高的投资品种。
第十一部分 投资组合报告
一、报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	382,401,563.19	11.31
	其中:股票	382,401,563.19	11.31
2	固定收益投资	2,887,088,500.32	89.37
	其中:债券	2,887,088,500.32	89.37
3	银行存款和结算备付金合计	39,046,543.18	1.20
4	金融资产公允价值变动损益	-	-
5	其他资产	444,510.00	0.01
6	负债和净负债	-	-
7	未分配利润	1,546,611.00	0.05

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金总资产比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	制造业	-	-
C	采矿业	217,615,284.21	7.06
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	22,066,167.04	0.72
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息技术业	50,731,385.27	1.65
J	房地产业	42,736,060.00	1.39
K	金融业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	29,446,022.53	0.94
N	水利、环境和公共设施管理业	40,262,826.67	1.30
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		382,401,563.19	12.40

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金总资产比例(%)
1	002271	东方雨润	3,313,794.00	78,738,405.62	2.55
2	002174	游族网络	2,689,313.00	50,731,385.27	1.65
3	603585	国能环保	2,469,946.00	27,119,412.48	0.85
4	002228	新凤鸣	8,046,528.00	26,712,403.06	0.85
5	200909	华信国际	1,949,000.00	24,705,000.00	0.78
6	003810	国脉健康	1,989,590.00	23,719,088.38	0.76
7	002932	润兴股份	4,964,000.00	22,066,167.04	0.72
8	003023	润兴股份	1,000,000.00	19,960,000.00	0.63
9	300033	乐视网	522,967.00	19,106,404.34	0.62
10	600816	华泰集团	527,440.00	18,523,809.00	0.60

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金总资产比例(%)
1	000001	平安银行	-	-	-
2	000002	万科A	-	-	-
3	000003	招商银行	169,140,150.00	5.30	
	其中:境内上市的外资股	169,140,150.00	5.30		
4	000005	工商银行	-	-	-
5	000006	建设银行	-	-	-
6	000008	中信银行	-	-	-
7	000016	民生银行	-	-	-
8	000021	招商局A	-	-	-
9	000031	中信证券	-	-	-
10	000033	美的集团	-	-	-
11	000035	中国科达	-	-	-
12	000036	招商银行	-	-	-
13	000039	浦发银行	-	-	-
14	000041	深国商A	-	-	-
15	000043	中航地产	-	-	-
16	000045	深天马A	-	-	-
17	000046	深赛格	-	-	-
18	000048	招商局A	-	-	-
19	000051	万科A	-	-	-
20	000052	招商局A	-	-	-
21	000054	广生堂	-	-	-
22	000056	中航地产	-	-	-
23	000058	海螺水泥	-	-	-
24	000060	中金黄金	-	-	-
25	000061	华森药业	-	-	-
26	000062	万科A	-	-	-
27	000063	中兴通讯	-	-	-
28	000065	长江证券	-	-	-
29	000066	万科A	-	-	-
30	000068	华鲁恒升	-	-	-
31	00006				