（上接 B65 版）

79、上海陆金所资产管理有限公司
注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元
法定代表人：郭坚
办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼?
联系人：宁博宇
网站：www.lufunds.com
客户服务电话：4008219031
80、浙江同花顺基金销售有限公司
注册地址：杭州市西湖区文二西路 1 号元茂大厦 903 室
办公地址：浙江省杭州市西湖区翠柏路 7 号电子商务产业园 2 号楼
法人代表：凌顺平
联系人：林海明
电话：0571-88911818-8580
传真：0571-88911818-8002
客户服务电话：4008-773-772
网站地址：www.5ifund.com
81、深圳市新兰德证券投资咨询有限公司
注册地址：深圳市福田区华强北路赛格科技园 4 栋 10 层 1006 号
法定代表人：杨懿
办公地址：深圳市福田区华强北路赛格科技园 4 栋 10 层 1006 号
联系人：张燕
联系电话：010-58325388*1588
网站：www.new-rand.cn
客户服务电话：400-166-1188
82、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
法定代表人：陈继武
客服电话：4000178000
联系人：葛佳蕊
电话：021-63333319
传真：021-63332523
网址：www.lingxianfund.com
83、武汉市伯嘉基金销售有限公司
注册地址：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 7 栋 23 层 1 号、4 号
法定代表人：陶捷
联系人：杨帆
电话：027-87006003、87006009
网站：www.buyfunds.cn
公司传真：027-87006010
客户服务电话：400-027-9899
84、北京蛋卷基金销售有限公司
注册地址：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
客服电话：4000618518
联系人：袁永娇
电话：010-61840688
传真：010-61840699
网址：https://danjuanapp.com
85、深圳市金斧子投资咨询有限公司
注册地址：深圳市南山区智慧广场第 A 栋 11 层 1101-1102
办公地址：深圳市南山区科苑路 18 号东方科技大厦 18 楼
法定代表人：陈姚坚
联系人：张烨
电话：0755-84034499
传真：0755-84034477
客服电话：400-950-0888
网址：http://www.jfzinv.com
86、泰诚财富基金销售（大连）有限公司
注册地址：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：张晓辉
电话：0411-88891212
传真：0411-84396536
客服电话：400-6411-999
网址：www.taichengcaifu.com
87、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
法定代表人：蒋煜
联系人：孙悦
电话：010-58170823
传真：010-58170800
客服电话：400-818-8866
网址：http://fund.shengshiview.com
88、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
法定代表人：林义相
客服电话：010-66045678
联系人：尹伶
传真：010-66045527
网址：www.txsec.com
89、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
办公地址：上海市浦东新区浦东大道 555 号裕景国际 B 座 16 层
法定代表人：张跃伟
客服电话：400-820-2899
网址：www.erichfund.com
（二）注册登记机构
名称：大成基金管理有限公司
住所：深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 32 层
办公地址：深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 33 层
法定代表人：刘卓
电话：0755-83183388
传真：0755-83195239
联系人：范瑛
（三）律师事务所和经办律师
名称：北京市金杜律师事务所
注册地址：北京市朝阳区东三环中路 7 号财富中心写字楼 A 座 40 层
办公地址：北京市朝阳区东三环中路 7 号财富中心写字楼 A 座 40 层
负责人：王玲
电话：0755-22163333
传真：0755-22163390
经办律师：靳庆军、冯艾
联系人：冯艾
（四）会计师事务所和经办注册会计师
名称：普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
住所：上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼
办公地址：上海市黄浦区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼
执行事务合伙人：李丹
经办注册会计师：薛竞、俞伟敏
电话：021-23238888
传真：021-23238800
联系人：俞伟敏

四、基金的名称

大成可转债增强债券型证券投资基金

五、基金的类型

债券型

六、基金的运作方式

开放式

七、基金的投资目标

在严格控制投资风险、保持资产流动性的前提下，采取自上而下的资产配置策略和自下而上的个券选择策略，通过主动投资组合管理，充分把握可转债兼具股性和债性的风险收益特征，追求投资资金的长期保值增值。

八、基金的投资范围

本基金的投资对象为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行或上市交易的股票（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）。

本基金为债券基金，重点投资于固定收益类资产，包括国债、央行票据、中期票据、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、可转债（含可分离交易可转债）、债券回购、银行存款，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。本基金投资于固定收益类资产的比例不低于基金资产的 80%，其中对可转债（含可分离交易可转债）的投资比例不低于基金固定收益类资产的 80%；股票（含一级市场新股申购和二级市场股票投资）、权证等权益类资产投资比例不高于基金资产的 20%；持有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%。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，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

1、大类资产配置策略

本基金主要投资于可转债等固定收益类资产，在确保基金资产收益安全与稳定的同时，以有限的风险载荷博取股票市场的上涨收益。本基金将在基金合同约定的投资范围内结合定性以及定量分析，自上而下地实施整体资产配置策略，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状况、信用风险变化情况和有关政策法律法规等因素的综合分析，预测各大类资产未来收益率变化情况，在不同的大类资产之间进行动态调整和优化，以规避市场风险，把握市场收益变化，进而提高基金收益率。

2、固定收益类资产投资策略

（1）可转债投资策略

可转债是一种含权债券，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，可转债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，可转债可分享正股股票上涨的收益。合理地利用可转债的股性和债性双重特征，可在有效控制组合风险的基础上获取一定的超额收益。在经济处于复苏和繁荣的阶段，若股市表现较好，则可通过超配转股期权价值高的可转债来增强债券组合的收益；在经济处于衰退的阶段，若市场基准利率下行，则可通过超配普通债券以及纯债价值较高的可转债来获得较好的收益。

在进行可转债筛选时，本基金将在对可转换债券条款以及发行人基本面要素进行深入研究的基础上，选择合适时机投资于低估的可转债品种，通过积极主动管理，获得超额收益。基本面要素包括股性特征、债性特征、流动性等。本基金将充分借鉴基金管理人股票研究团队的研究成果，对可转债对应的正股的基本面进行分析，形成对正股的价值评估。从行业选择和个券选择两方面进行全方位的评估，对盈利能力或成长性较好的行业和上市公司的可转债进行重点关注，将可转债自身的信用评估和其正股的价值分析结合起来，最终确定投资的可转债品种。

本基金将采取稳健性投资和进取型投资相结合的策略，即投资于基本面较好、具有成长性、转股价格修正条件优惠的可转债，从而在风险相对较低的前提下力求获得超越基准的投资回报。

1）可转债套利策略

转股权使得可转债价格与正股价格之间存在一定的关联关系，但两者价格受到各种市场因素影响后会出现失衡状况。基金管理人通过深入、细致的研究和实时跟踪，可侦测到这种定价失衡关系并加以利用：当处于转股期内的可转债市价低于转股价值，即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取反向套利价差。在日常交易运作过程中，本基金将密切关注可转债与标的股票价格的关系，择机实施套利策略，以加强本基金收益水平。

2）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债股性和债性的相对价值，把握可转债的价值走向，选择相应券种，从而获取较高投资收益。本基金利用可转债的底价溢价率和可转债的到期收益率来衡量可转债的债性特征，利用可转债的平价溢价率和可转债的 Delta 系数来衡量可转债的股性特征，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，结合股票市场与债券市场的预期相对风险收益，选择时机相应投资于期权价值低估或纯债价值低估的可转债品种，通过积极主动管理，获得超额收益。

3）可转债条款价值发现策略

国内可转债一般设有一些特殊条款，包括修正转股价条款、回售条款、赎回条款等，这些条款在特定环境下对转债价值有着较大的影响。修正转股价是指发行人向下修正转股价，从而可提升可转债的期权价值。回售条款给予投资者将可转债按照约定价格回售给发行人的权利，为可转债投资提供了一种安全边际。赎回条款给予发行人按照约定价格从投资者处赎回可转债的权利，一般是为了促进可转债持有人的转股；赎回条款会对可转债价格构成一定的抑制，若发行人放弃赎回权则会提高可转债的期权价值。本基金将深入分析发行人的经营趋势、财务状况和融资需求等基本面因素，结合公司调研和信息跟踪，及时地了解发行人实施特殊条款的意愿，并对条款实施方案进行情景分析，发掘条款给可转债带来的投资机会或规避不利条款可能带来的投资风险。

4）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，即在上市后分离为债券和权证分别独自进行交易。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，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。本基金也可将可分离交易可转债纯债与正股按适当的配比构成组合，实施复制期权策略，进行类可转债投资。

（2）普通债券投资策略

1）利率预期策略

利率风险是债券投资最主要的风险来源和收益来源之一，衡量债券利率风险的核心指标是久期。本基金将通过对宏观经济以及货币政策等因素的深入研究，判断利率变化的趋势，利用情景分析模拟利率变化的各种情形，根据组合的风险承受能力确定组合的目标久期区间。通过对利率变化方向和时间、目标久期区间的分析，借助市场收益率曲线结构分析和市场信用利差结构分析，确定资产配置的组合久期，有效控制风险，获取投资收益。

2）类属配置策略

类属配置的结果决定了债券组合在不同风险类属资产之间的分配比例和债券的期限配置，是影响债券投资业绩的重要因素。本基金将在确定目标久期后，通过对宏观经济、市场利率、债券供求等的分析，预测各类属资产预期风险及收益情况，综合考虑债券品种期限和不同债券市场流动性及收益性现状，制定普通债券品种期限配置策略，确立不同债券市场投资比例，确定普通债券组合资产在政府债券、企业主体债券、货币资产之间的分配比例。

3）信用债券投资策略

信用类债券是本基金重要投资标的，信用风险管理对于提高债券组合收益率至关重要。本基金将根据宏观经济运行状况、发行主体所属行业发展周期、公司业务状况、公司治理结构、财务状况等因素综合评估信用风险，确定信用类债券的信用风险利差，有效管理组合的整体信用风险。

债券市场上各种级别的信用产品（主要是政府信用债券与企业主体债券、各类企业主体债券之间）会形成一个不同收益率水平的利差结构体系。在正常条件下，由信用风险形成的收益率利差是稳定的，但在特定条件下，比如某个行业在经济周期的某一时期面临信用风险改变或者市场供求发生变化时，这种稳定关系将被打破。提前预测并进行交易，就可能获得套利收益或者减少损失。本基金将主要利用定性与定量相结合的方式，综合考虑监管环境、市场供求关系、行业分析，并运用财务数据统计模型和现金流分析模型等对整个市场的信用利差结构进行全面分析，在有效控制整个组合信用风险的基础上，采取积极的投资策略，发现价值被低估的信用类债券产品，挖掘投资机会，获取超额收益。

4）套利交易策略

套利交易策略主要包括跨市场债券套利策略、回购套利策略和利差交易策略。本基金将在法律法规和监管机构许可的条件下，积极运用套利交易策略，提高组合收益。

A. 跨市场债券套利策略。通过在交易所市场和银行间市场买卖同时在两市托管的债券，或者在两市之间买卖到期期限相同但收益率不同的债券，可以获取二者之间可能存在的价差。

B. 回购套利策略。利用回购进行无风险或低风险套利的主要策略包括回购跨市场套利、回购与现券的套利以及不同回购期限之间的套利等；利用回购进行高风险套利的主要策略包括正回购杠杆操作、逆回购卖空操作等。。

C.利差交易策略。利差交易是指同时买进涨多（跌少）/ 卖出涨少（跌多）的债券，达到不受市场涨跌的直接影响、规避市场风险的效果。同时，也可以将利差交易作为一种债券用于组合投资，是增加组合投资回报率的重要手段。最常见的利差交易为增斜交易与扁平交易。当预期收益率曲线将变陡峭时，进行增斜交易，即买入短期债，卖空长期债，同时保持久期中性，获取收益率曲线增斜带来的利差收益，规避了收益率曲线平移带来的风险（反之则进行扁平交易）。

3、权益类资产投资策略

（1）新股申购投资策略

本基金可以参与一级市场新股申购或增发新股。在进行新股申购时，本基金将充分考虑新股在资本市场不同阶段的风险特征，根据内外部研究成果评估股票的内在价值，对于拟发行上市的新股（或增发新股）的投资价值进行深入发掘，结合市场资金利率水平和预期中签率，得出新股申购预期收益率，作为参与新股申购的决策依据。

（2）股票二级市场投资策略

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。本基金将从经济周期、产业政策、行业竞争趋势、公司发展战略、综合业务状况、公司治理等多方面因素对上市公司进行综合评估，重点关注基金管理人研究团队长期跟踪并有良好业绩的公司，在此基础上从股票初选库中筛选出符合要求的股票构成股票备选库。

本基金将结合市场资金面，估值水平，投资主题，基金资产整体风险承受水平，以及内外部的研究成果，择机投资于股票备选库中的具有良好成长性特征或较高安全边际的优质股票，追求稳健回报，适当提高基金组合的收益率。

4、资产支持证券投资策略

本基金将在宏观经济和基本面分析的基础上，对资产支持证券标的资产的质量和构成、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。

5、权证投资策略

本基金将在控制投资风险和保障基金财产安全的前提下，对权证进行投资。权证投资策略主要包括以下几个方面：1）采用市场公认的多种期权定价模型对权证进行定价，作为权证投资的价值基准；2）根据权证标的股票基本面的研究估值，结合权证理论价值进行权证趋势投资；3）利用权证衍生工具的特性，通过权证与证券的组合投资，达到改善组合风险收益特征的目的，包括但不限于杠杆交易策略、看跌保护组合策略等。

十、基金的业绩比较基准

中信标普可转债指数 × 60%+中债综合指数 × 40%。

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债，市场覆盖面广、代表性高。中债综合指数由中央国债登记结算有限责任公司编制，其样本范围涵盖银行间市场和交易所市场，成份债券包括国家债券、企业债券、央行票据等所有主要债券种类，具有广泛的市场代表性，能够反应中国债券市场的总体走势。本基金认为，该业绩比较基准能较好地反映本基金的风险收益特征。

在本基金的运作过程中，如果由于外部投资环境或法律法规的变化而使得调整业绩比较基准更符合基金份额持有人的利益，则经基金管理人与基金托管人协商一致，可以对业绩比较基准进行适当调整，并在报中国证监会核准后，公告并予以实施。

十一、基金的风险收益特征

本基金为债券型基金产品，属证券投资基金中的低风险收益品种，其预期风险与预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

十二、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。

基金托管人中国工商银行根据基金合同规定，于 2016 年 12 月 22 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 2016 年 9 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

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	9,927,380.50	14.82
	其中：股票	9,927,380.50	14.82
2	基金投资	–	0.00
3	固定收益投资	55,840,451.30	83.37
	其中：债券	55,840,451.30	83.37
	资产支持证券	–	0.00
4	贵金属投资	–	0.00
5	金融衍生品投资	–	0.00
6	买入返售金融资产	–	0.00
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	–	0.00
7	银行存款和结算备付金合计	944,972.18	1.41
8	其他资产	264,111.60	0.39
9	合计	66,976,915.58	100.00

2. 报告期末按行业分类的股票投资组合（1）报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	–	0.00
B	采矿业	772,502.00	1.34
C	制造业	7,477,934.50	12.99
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	–	0.00
E	建筑业	–	0.00
F	批发和零售业	–	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	–	0.00
H	住宿和餐饮业	–	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	–	0.00
J	金融业	1,162,596.00	2.02
K	房地产业	514,348.00	0.89
L	租赁和商务服务业	–	0.00
M	科学研究和技术服务业	–	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	–	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	–	0.00
P	教育	–	0.00
Q	卫生和社会工作	–	0.00
R	文化、体育和娱乐业	–	0.00
S	综合	–	0.00
	合计	9,927,380.50	17.24

（2）报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

无。

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	000750	国海证券	166,800	1,162,596.00	2.02
2	600110	诺德股份	107,300	1,081,584.00	1.88
3	000910	大亚科技	49,800	940,224.00	1.63
4	600535	天士力	21,100	889,998.00	1.55
5	002510	天汽模	121,800	873,306.00	1.52
6	600497	驰宏锌锗	140,200	772,502.00	1.34
7	000752	西藏发展	32,900	612,927.00	1.06
8	600688	上海石化	96,700	569,563.00	0.99
9	600767	运盛医疗	29,800	514,348.00	0.89
10	002433	太安堂	41,700	471,627.00	0.82

4. 报告期末按券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	6,501,306.20	11.29
2	央行票据	–	0.00
3	金融债券	–	0.00
	其中：政策性金融债	–	0.00
4	企业债券	–	0.00
5	企业短期融资券	–	0.00
6	中期票据	–	0.00
7	可转债（可交换债）	49,339,145.10	85.68
8	同业存单	–	0.00
9	其他	–	0.00
10	合计	55,840,451.30	96.97

5. 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	132004	15国盛 EB	104,720	10,444,772.80	18.14
2	128009	歌尔转债	50,390	6,650,472.20	11.55
3	132002	15天集 EB	52,970	5,780,616.10	10.04
4	128010	顺昌转债	41,821	5,625,342.71	9.77
5	120001	16以岭 EB	36,360	4,277,390.40	7.43

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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

8. 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。

9. 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

本基金本报告期末未持有国债期货。

（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。

（3）本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

10. 投资组合报告附注

（1）本基金投资的前十名证券的发行主体未出现本期被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

（2）基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

（3）基金的其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	26,986.49
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	235,704.99
5	应收申购款	1,420.12
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	264,111.60

（4）报告期末基金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	110033	国贸转债	1,922,068.80	3.34
2	110034	九州转债	2,461,683.90	4.27
3	110035	白云转债	1,169,784.00	2.03
4	113010	江南转债	3,361,774.20	5.84
5	128009	歌尔转债	6,650,472.20	11.55
6	128010	顺昌转债	5,625,342.71	9.77
7	128011	汽模转债	2,773,309.98	4.82
8	132002	15天集 EB	5,780,616.10	10.04

（5）报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	002510	天汽模	873,306.00	1.52	临时停牌

（6）由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

十三、基金业绩

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。

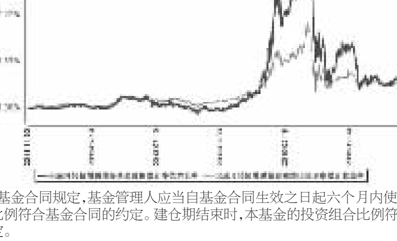
一、自基金合同生效以来（2011 年 11 月 30 日）至 2016 年 9 月 30 日基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较：

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
2011.11.30—2011.12.31	0.20%	0.03%	-0.16%	0.29%	0.36%	-0.26%
2012.01.01—2012.12.31	2.99%	0.20%	4.21%	0.21%	-1.22%	-0.01%
2013.01.01—2013.12.31	-4.15%	0.54%	-0.60%	0.39%	-3.55%	0.15%
2014.01.01—2014.12.31	79.80%	1.38%	36.64%	0.64%	43.16%	0.74%
2015.01.01—2015. 12.31	-16.86%	2.87%	-10.54%	1.89%	-6.32%	0.98%
2016.01.01—2016. 09.30	-16.25%	1.01%	-2.88%	0.45%	-13.37%	0.56%
2011.11.30—2016.09.30	23.85%	1.53%	22.78%	0.95%	1.07%	0.58%

二、自基金合同生效以来基金份额净值的变动情况，并与同期业绩比较基准的变动的比较：

大成可转债增强债券型证券投资基金累计份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

（2011 年 11 月 30 日至 2016 年 9 月 30 日）



注：本基金合同规定，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。建仓期结束时，本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

十四、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、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
5、基金份额持有人大会费用；
6、基金的证券交易费用；
7、基金的银行汇划费用；
8、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

本基金终止清算时所发生费用，按实际支出额从基金财产总值中扣除。

二、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

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.00%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H＝E × 1.00% ÷ 当年天数
H 为每日应计提的基金管理费
E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，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基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起 2 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、公休假等，支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.20%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

H＝E × 0.20% ÷ 当年天数
H 为每日应计提的基金托管费
E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，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基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起 2 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

上述“基金费用的种类”中第 3—8 项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

三、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

1、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；

2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；

3、《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、信息披露费用等费用；

4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

四、费用调整

基金管理人和基金托管人协商一致后，可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率、基金销售费率等相关费率。

调高基金管理费率、基金托管费率或基金销售费率等费率，须召开基金份额持有人大会审议；调低基金管理费率、基金托管费率或基金销售费率等费率，无须召开基金份额持有人大会。

基金管理人必须最迟于新的费率实施日前 2 日在至少一种指定媒体上公告。

五、基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

十五、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《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》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他有关法律法规的要求，对 2016 年 7 月 16 日公布的《大成可转债增强债券型证券投资基金更新招募说明书（2016 年 1 期）》进行了更新，并根据本基金管理人对本基金实施的投资经营活动进行了内容补充和更新，主要更新的内容如下：

1. 根据最新资料，更新了“第三部分、基金管理人”部分。
2. 根据最新资料，更新了“第四部分、基金托管人”部分。
3. 根据最新资料，更新了“第五部分、相关服务机构”部分。
4. 根据最新数据，更新了“第八部分、基金的投资”部分。
5. 根据最新数据，更新了“第九部分、基金业绩”部分。
6. 根据最新公告，更新了“第二十一部分、其他应披露的事项”。
7. 根据最新情况，更新了“第二十二部分、对招募说明书更新部分的说明”。

大成基金管理有限公司
二〇一七年一月十三日

证券代码：002771　　证券简称：真视通　　公告编码：2017-009

北京真视通科技股份有限公司关于使用闲置募集资金进行投资理财的进展公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露的内容真实、准确、完整，没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

北京真视通科技股份有限公司（以下简称“公司”）第二届董事会第二十次会议于 2016 年 10 月 26 日审议通过了《关于使用闲置募集资金进行投资理财的议案》。为了提高公司闲置募集资金的使用效率，在确保不影响企业的正常运营前提下，公司拟使用不超过人民币 6,800 万元，投资短期（不超过十二个月）保本型银行理财产品，不包括《深圳证券交易所中小企业板上市公司规范运作指引》中涉及的风险投资品种，且在上述额度内，资金可以滚动使用。授权董事长在上述额度和范围内决定投资具体事项，授权期限自董事会审议通过之日起 1 年。

现将公司近期使用闲置募集资金进行投资理财的事项公告如下：

一、理财产品基本情况

序号	受托方	产品名称	产品类型	资金来源	金额	起息日	到期日	年化收益率	关联关系
1	杭州银行股份有限公司北京中关村支行	“添利宝”结构性存款	保本浮动收益型	募集资金	3000万元	2017 年 1 月 10 日	2017 年 2 月 10 日	2.5%	无
2	北京银行阜裕支行	稳健系列人民币 40 天期限银行间保证收益理财产品	保本保证收益型	募集资金	2500万元	2017 年 1 月 12 日	2017 年 2 月 21 日	2.5%	无

二、风险控制措施

1、公司董事会授权董事长在额度范围内决定投资具体事项，公司财务与资产管理中心负责组织实施；

2、公司财务与资产管理中心将及时分析和跟踪理财产品投向，在上述理财产品理财期间，公司将与相关机构保持密切联系，及时跟踪理财资金的运作情况，加强风险控制和监督，严格控制资金的安全；

3、公司内部审计部负责对资金的使用与保管情况进行审计与监督；

4、独立董事、监事会有权对资金使用情况进行监督与检查，必要时可以聘请专业机构进行审计；

5、公司将依据深圳证券交易所等相关规定，及时做好信息披露工作。

三、对公司经营的影响

公司购买的理财产品为商业银行发行的安全性高、流动性好、低风险的短期（一年之内）理财产品，在确保公司日常运营正常运转、募集资金投资项目照常建设的情况下，进行上述投资理财，可以提高资金使用效率，获得一定的投资效益，同时提升公司整体业绩水平，为公司股东谋取更多的投资回报。

四、公司前十二个月内购买理财产品的情况

序号	受托方	产品名称	产品类型	资金来源	金额	起息日	到期日	年化收益率	关联关系	是否到期
1	北京银行股份有限公司阜裕支行	结构性存款产品	保本浮动收益型	募集资金	3000万元	2016 年 2 月 5 日	2016年 8 月 5 日	3.10%	无	是
2	兴业银行股份有限公司北京分行方庄支行	“兴业金雪球-优先 2 号”人民币理财计划	保本浮动收益型	自有资金	500万元	2016 年 3 月 15 日	2016 年 5 月 26 日	2.66%	无	是
3	兴业银行股份有限公司北京分行方庄支行	“兴业金雪球-优先 2 号”人民币理财计划	保本浮动收益型	自有资金	1000万元	2016 年 3 月 15 日	2016 年 5 月 20 日	2.67%	无	是
4	建设银行北京安华支行	“乾元”北京区域资产组合型保本理财产品	保本浮动收益型	自有资金	2000万元	2016 年 3 月 23 日	2016 年 6 月 24 日	3.40%	无	是
5	杭州银行股份有限公司北京分行	“添利宝”结构性存款产品	保本浮动收益型	募集资金	3500	2016年 3 月 29 日	2016年 6 月 29 日	2.70%	无	是
6	杭州银行股份有限公司北京分行	“添利宝”结构性存款产品	保本浮动收益型	募集资金	3500万元	2016 年 07 月 01 日	2016 年 10 月 1 日	2.70%	无	是
7	浦发银行北京安外支行	惠至 28 天	保证收益型	自有资金	1000万元	2016 年 07 月 19 日	2016 年 08 月 15 日	3.10%	无	是
8	兴业银行股份有限公司北京分行方庄支行	“兴业金雪球-优先 2 号”人民币理财计划	保本浮动收益型	自有资金	1000万元	2016 年 07 月 25 日	2016 年 07 月 28 日	2.7%	无	是
9	兴业银行股份有限公司北京分行方庄支行	“兴业金雪球-优先 2 号”人民币理财计划	保本浮动收益型	自有资金	1000万元	2016 年 07 月 25 日	2016 年 10 月 25 日	2.7%	无	是
10	北京银行阜裕支行	稳健系列人民币 40 天期限银行间保证收益理财产品	保本保证收益型	募集资金	2500万元	2016 年 08 月 11 日	2016 年 09 月 20 日	2.5%	无	是
11	北京银行阜裕支行	稳健系列人民币 40 天期限银行间保证收益理财产品	保本保证收益型	募集资金	3100万元	2016 年 11 月 10 日	2016 年 12 月 20 日	2.6%	无	是
12	杭州银行股份有限公司北京中关村支行	“添利宝”结构性存款产品	保本浮动收益型	募集资金	3500万元	2016 年 11 月 10 日	2016 年 12 月 12 日	2.5%	无	是

截至本公告日，公司前 12 个月内累计购买理财产品共计 5,500 万元（含本次 5,500 万元），不超过最近一期经审计净资产的 50%。本事项在公司董事会决策权限范围内。

特此公告。

五、备查文件

1、《杭州银行股份有限公司“添利宝”结构性存款协议》；

2、《稳健系列人民币 40 天期限银行间保证收益理财产品合约》。

北京真视通科技股份有限公司董事会
2017 年 1 月 12 日

方正富邦基金管理有限公司关于旗下部分基金参加上海天天基金销售有限公司申购及定期定额投资费率优惠活动及开通基金转换业务的公告

为满足广大投资者的理财需求，方正富邦基金管理有限公司（以下简称"本公司"）经与上海天天基金销售有限公司（以下简称"天天基金"）协商一致，决定自 2017 年 1 月 17 日起参加天天基金申购及定期定额投资费率优惠活动并开通基金转换业务，现将相关事项公告如下：

一、参加申购及定期定额投资费率优惠

1、新增适用基金

（1）方正富邦睿利纯债债券型证券投资基金（基金代码：A 类 003795 C 类 003796）；

（2）方正富邦惠利纯债债券型证券投资基金（基金代码：A 类 003787 C 类 003788）。

2、费率优惠

投资者通过天天基金申购（含已开通定期定额投资）上述基金，前端申购费率不设折扣限制，具体折扣费率请以天天基金页面公示为准。

二、通过天天基金开通基金转换业务

1、自 2017 年 1 月 17 日起在天天基金开通本公司旗下可转换基金之间的转换业务，新增适用基金如下：

（1）方正富邦睿利纯债债券型证券投资基金（基金代码：A 类 003795 C 类 003796）；

（2）方正富邦惠利纯债债券型证券投资基金（基金代码：A 类 003787 C 类 003788）。

投资者在办理基金的转换业务时，应留意本公司相关公告，确认转出基金处于可赎回状态，转入基金处于可申购状态。

2、基金转换业务的费用

基金转换费用由转出和转入基金的申购费补差和转出基金的赎回费两部分构成，具体收取情况视每次转换时两只基金的申购费率（具体折扣费率请以天天基金页面公示为准）差异情况和转出基金的赎回费率而定。基金转换费用由基金持有人承担。

三、通过天天基金开通基金定期定额投资业务

1、新增适用基金

（1）方正富邦睿利纯债债券型证券投资基金（基金代码：A 类 003795 C 类 003796）；

（2）方正富邦惠利纯债债券型证券投资基金（基金代码：A 类 003787 C 类 003788）。

2、定期定额投资业务办理网点

投资者可以通过天天基金相关渠道办理定期定额投资业务。

3、办理时间

本业务的申请受理时间与上述基金在天天基金进行日常基金交易的受理时间相同。若遇非基金开放日则顺延到下一基金开放日，并以该日为基金申购申请日。

4、定期扣款金额及费率

投资者可与天天基金约定每月固定扣款金额，每期最低申购金额为人民币 100 元（含申购手续费），不受上述基金首次单笔申购最低为 1000 元人民币的限制，且不设定级差及累计申购限额；投资者通过天天基金定投以上指定开放式基金，其申购上述基金，申购费率不设折扣限制，具体优惠费率请以天天基金页面公示为准。

四、参加申购及定期定额投资费率优惠活动期限及重要提示

2017 年 1 月 17 日起开展开放式基金申购（含定期定额申购）费率优惠活动，优惠活动结束日期以天天基金官方网站页面展示或相关公告为准。

本优惠活动适用于处于正常申购期的基金的前端申购手续费，包括基金定投业务，不包括基金赎回、转换等业务的基金手续费。

本次优惠活动期间，业务办理的具体时间、流程以天天基金的页面公示为准。

本活动最终解释权归天天基金所有，有关活动的具体规定如有变化，敬请投资者留意天天基金的页面公示及有关公告。投资者欲了解本基金产品的详细情况，请仔细阅读基金的基金合同、最新招募说明书等相关法律文件。

五、投资者可以通过以下途径咨询有关详情：

1、天天基金销售有限公司
客户服务电话：400-991-8918
公司网址：www.1234567.com.cn
2、方正富邦基金管理有限公司
客服电话：400-8180-990（免长途话费）
公司网址：www.founderff.com

风险提示：基金管理人承诺以恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金管理人提醒投资者在做出投资决策前应全面了解基金的产品特性并充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，投资者自行承担基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险。投资有风险，选择须谨慎。敬请投资者于投资前认真阅读基金的基金合同、最新招募说明书及其他法律文件。

特此公告。

方正富邦基金管理有限公司
二〇一七年一月十三日

证券代码：000930　　证券简称：中粮生化　　公告编号：2017-002

中粮生物化学(安徽)股份有限公司
六届董事会 2017 年第一次临时会议
决议公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露的内容真实、准确、完整，没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

一、董事会会议召开情况

中粮生物化学（安徽）股份有限公司（以下简称"公司"）于 2017 年 1 月 8 日分别以传真和专人送达的方式向公司全体董事、监事和高级管理人员发出召开公司六届董事会 2017 年第一次临时会议的书面通知。2016 年 1 月 12 日公司召开了六届董事会 2017 年第一次临时会议，在保障所有董事充分表达意见的情况下，本次董事会临时会议采用通讯方式表决，会议由公司董事长佟毅先生主持，公司部分监事、高级管理人员列席会议。会议应参加表决董事 9 人，实际参加表决的董事共 9 人，参加表决的董事有：佟毅先生、李北先生、张德国先生、杨克非先生、乔映宾先生、刘德华先生、何鸣元先生、陈敦先生和卓敏女士，符合《公司法》和《公司章程》的相关规定。

二、董事会会议审议情况

1、以 9 票同意、0 票反对、0 票弃权的表决结果，审议通过了《中粮生化：关于公司副总经理辞职的议案》。

同意郭顺杰先生、王年忠先生辞去公司副总经理职务。

2、以 9 票同意、0 票反对、0 票弃权的表决结果，审议通过了《中粮生化：关于公司总经理辞职的议案》。

同意李北先生辞去公司总经理职务，辞职后仍继续担任公司六届董事会董事职务。

3、以 9 票同意、0 票反对、0 票弃权的表决结果，审议通过了《中粮生化：关于聘任公司总经理的议案》

经董事长佟毅先生提名，公司董事会同意聘任张德国先生为公司总经理，任期自公司董事会决议通过之日起 3 年。张德国先生简历详见附件。

公司独立董事发表了同意的独立意见，具体内容详见同日发布的《中粮生化：独立董事关于聘任公司总经理的独立意见》相关公告。

三、备查文件

1、六届董事会 2017 年第一次临时会议决议。

2、独立董事关于聘任公司总经理的独立意见。

特此公告。

中粮生物化学(安徽)股份有限公司
董 事 会
2017 年 1 月 12 日

附件：

张德国先生简历

张德国先生，1975 年出生，研究生学历。曾任黑龙江华润酒精有限公司财务部经理，中粮生化能源（肇东）有限公司财务总监，中粮集团生化能源事业部财务部副总经理、总经理，本公司财务总监、副总经理，中国粮油控股有限公司财务部总经理助理、生物能源事业部副总经理。现任本公司常务副总经理、六届董事会董事。

张德国先生与本公司、控股股东不存在关联关系，截止披露日通过竞价交易持有公司股票 7,275 股，未受过中国证监会及其他有关部门处罚及证券交易所惩戒。经在最高人民法院网站失信被执行人目录查询，张德国先生不是失信被执行人，符合《公司法》等相关法律、法规和规定要求的任职条件。

中粮生物化学（安徽）股份有限公司
独立董事关于聘任公司总经理的
独立意见

根据中国证监会《关于在上市公司建立独立董事制度的指导意见》、《深圳证券交易所股票上市规则》及《公司章程》等有关规定，作为中粮生物化学（安徽）股份有限公司（以下简称"公司"）的独立董事，基于独立判断的立场，现就公司六届董事会 2017 年第一次临时会议审议的关于聘任张德国先生为公司总经理发表独立意见如下：

经认真审查公司聘任总经理张德国先生的相关资料，不存在《公司法》、《公司章程》和《深圳证券交易所股票上市规则》有关限制担任公司高级管理人员的行为，具备担任公司高级管理人员的任职条件，其任职资格合法。本次聘任总经理的提名及聘任程序符合相关法律、法规及《公司章程》的有关规定，公司所聘任的总经理具有丰富的管理和实践经验，符合公司发展的需要。

鉴此，我们同意董事会聘任张德国先生为公司总经理，任期自本次董事会审议通过之日起 3 年。

独立董事签名：
何鸣元　　陈敦　　卓敏
2017 年 1 月 12 日

股票代码：600173　　股票简称：卧龙地产　　公告编号：临 2017-005
债券代码：122327　　债券简称：13 卧龙债

卧龙地产集团股份有限公司重大资产重组进展公告

本公司董事会及全体董事保证本公告内容不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，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。

卧龙地产集团股份有限公司（下称"公司"）于 2016 年 12 月 22 日发布了《重大事项停牌公告》（公告编号：临 2016-073）并开始停牌。公司于 2017 年 1 月 6 日发布了《重大资产重组停牌公告》（公告编号：临 2017-003）。经与有关各方论证和协商，上述重大事项对公司构成重大资产重组。经申请，公司股票自 2017 年 1 月 6 日起继续停牌，公司前期筹划重大事项停牌时间计入本次重大资产重组停牌时间，即从 2016 年 12 月 22 日起连续停牌不超过一个月。

截至本公告披露之日，各相关方正按照《上市公司重大资产重组管理办法》及其他有关规定，积极推进本次重大资产重组事项所涉及的审计、评估等各项工作。因相关重大资产重组事项尚存在不确定性，为避免公司股价异常波动，切实维护投资者利益，公司股票将继续停牌。停牌期间，公司将根据重大资产重组的进展情况，及时履行信息披露义务，每五个交易日发布一次重大资产重组进展公告。

公司指定信息披露媒体为《上海证券报》、《证券时报》和上海证券交易所网站（www.sse.com.cn），有关信息均以上述指定媒体发布的公告为准，敬请广大投资者关注公司后续公告，注意投资风险。

特此公告。

卧龙地产集团股份有限公司
董事会
2017 年 1 月 13 日

股票代码：600416　　股票简称：湘电股份　　编号：2017 临 -001

湘潭电机股份有限公司
关于控股股东股票质押式回购交易提前购回的公告

本公司董事会及全体董事保证本公告内容不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，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。

湘潭电机股份有限公司（以下简称"公司"）于 2017 年 1 月 12 日接到本公司控股股东湘电集团有限公司（以下简称"湘电集团"）有关股票质押式回购交易提前购回的通知，具体情况如下：

一、控股股东股份提前购回的基本情况

公司于 2016 年 10 月 28 日披露了控股股东湘电集团将其持有的公司 7,000,000 无限售流通股（占公司总股份数的 0.74%）质押给财富证券有限责任公司，进行股票权利质押融资业务，初始交易日为 2016 年 10 月 26 日，购回交易日为 2017 年 4 月 24 日。具体详细内容请见公司 2016 临 -060 号公告。

2017 年 1 月 12 日，湘电集团与财富证券有限责任公司办理了股票质押式回购交易的提前购回业务，提前购回了上述 7,000,000 股股票（占公司总股份数的 0.74%），并办理了相关解除质押手续。

二、控股股东股份累计质押情况

截止本公告日，湘电集团共持有本公司股份总计为 317,212,264 股，占本公司总股本的 33.54%。其中已累计质押了公司 145,910,000 股，占公司总股本的 15.43%。

特此公告。

湘潭电机股份有限公司
二〇一七年一月十三日