万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书摘要

（2019年第2号）

基金管理人：万家基金管理有限公司
基金托管人：兴业银行股份有限公司

二零一九年九月

重要提示

万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金经中国证监会证监许可［2008］316号文核准募集，于2008年6月27日生效。2015年5月25日万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会以通讯方式召开，大会审议并通过《关于修改万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案》，内容包括万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金修改基金投资比例、收益分配方式、及基金合同其他内容修订等事项。自持有人大会决议生效之日起，旧版《万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金基金合同》失效且新版《万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金基金合同》同时生效。

2018年3月24日，基金管理人按照中国证监会《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（［2017］12号）的要求对基金合同的部分内容进行了修订，修订后的法律文件自2018年3月31日起正式生效。

本基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会备案，但中国证监会对本基金募集的备案，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

本基金管理人承诺依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，基金管理人不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

本基金投资于证券市场，基金净值会因证券市场波动等因素产生波动。投资者拟申购基金时应认真阅读本招募说明书，全面认识基金产品的风险收益特征，充分考虑投资者自身风险承受能力，并对于申购基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。投资者在获得投资收益的同时亦承担基金投资中出现的各类风险，包括：因整体政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，由于基金投资者连续大量赎回基金产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，本基金的特定风险等等。本基金为灵活配置混合型基金，本基金股票资产占基金资产净值的0%—95%，通过定量分析与定性分析相结合，灵活配置股票、债券资产比例。在实际操作过程中，本基金资产配置中股票投资比例可能与股票市场表现存在差异，在牛市中股票投资比例较低或者在熊市中股票投资比例较高，从而可能使本基金收益率落后基金业绩比较基准。

基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责。

本基金管理人及其所管理基金的过往业绩并不预示本基金未来表现。本招募说明书（更新）所载内容截止日为2019年9月9日，有关财务数据和净值表现截止日为2019年3月31日（财务数据未经审计）。

第一部分 基金管理人

一、基金管理人概况

名称：万家基金管理有限公司
住所：中国（上海）自由贸易试验区浦电路360号8层（名义楼层9层）
办公地址：中国（上海）自由贸易试验区浦电路360号8层（名义楼层9层）
法定代表人：方一天
总经理：经晓云
成立日期：2002年8月23日
批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基金字［2002］44号
经营范围：基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其他业务
组织形式：有限责任公司
注册资本：1亿元人民币
存续期间：持续经营
联系人：兰剑
电话：021-38909626　　传真：021-38909627

二、主要人员情况

1、基金管理人董事会成员

董事长方一天先生，中共党员，大学本科，学士学位，先后在上海财政证券公司、中国证监会系统、上证所信息网络有限公司任职，2014年10月加入万家基金管理有限公司，2014年12月起任公司董事，2015年2月至2016年7月任公司总经理，2015年7月起任公司董事长。

董事马永春先生，政治经济学硕士学位，曾任新疆自治区党委政策研究室科长，新疆通宝投资有限公司总经理，新疆对外经贸集团总经理，新疆天山股份有限公司董事，新疆国际实业股份有限公司副董事长兼总经理。现为新疆国际实业股份有限公司高级顾问。

董事袁西存先生，中共党员，研究生，工商管理学硕士，曾任莱钢集团财务部科长，副部长，中泰证券股份有限责任公司计划财务部总经理，现任中泰证券股份有限公司财务总监。

董事经晓云女士，中国民主建国会会员，研究生，工商管理学硕士，曾任上海财政证券公司市场管理部经理，上海证券有限责任公司经纪管理总部副总经理、总经理，上投摩根基金管理有限公司副总经理。2016年7月加入万家基金管理有限公司，2016年7月起任公司董事、公司总经理。

独立董事黄磊先生，中国民主建国会成员，经济学博士，教授，曾任贵州财经学院财政金融系教师、山东财经大学金融学院院长、山东省政协常委，现任山东财经大学资本市场研究中心主任、山东金融产业优化与区域管理协同创新中心副主任、山东省人大常委、山东省人大财经委员会委员、教育部高校金融类专业教学指导委员会委员。

独立董事张伏波先生，经济学博士，曾任上海申佳船厂科员、浙江省经济建设投资公司副经理、国泰君安证券股份有限公司总裁助理、兴安证券有限责任公司副总经理、上海证券有限责任公司副总经理、海证期货有限公司董事长、亚太资源有限公司董事，现任玖源化工（集团）有限公司董事局副主席。

独立董事朱小能先生，中共党员，哲学博士，教授。曾任华东理工大学商学院讲师、中央财经大学中国金融发展研究院硕士生导师、副教授、博士生导师，上海财经大学金融学院副教授、博士生导师，现任上海财经大学金融学院教授、博士生导师。

独立董事武辉女士，农工党员，会计学博士，曾任潍坊市第二职业中专讲师，现任山东财经大学教授。

2、基金管理人监事会成员

监事会主席丁治平先生，工商管理硕士，EMBA，高级工程师，曾任职于新疆维吾尔自治区统计局、中国银行新疆分行，新疆对外经济贸易（集团）有限责任公司董事长。现任新疆国际实业股份有限公司董事长、总经理。

监事苏海静女士，大学本科，学士学位，先后任职于荣成飞利浦电子有限公司、山东永锋贸易有限公司、山东莱钢永锋钢铁有限公司。2007年7月起加入永锋集团有限公司，现任永锋集团有限公司资金中心副主任。

监事尹丽曼女士，中共党员，硕士，先后任职于申银万国期货有限公司、东海期货有限责任公司、万家共赢资产管理有限公司。2017年4月起加入本公司，现任公司机构业务部副总监。

监事卢涛先生，博士，先后任职于上海证券交易所、易方达基金管理有限公司。2015年6月起加入万家基金管理有限公司，现任公司产品开发部总监、组合投资部副总监。

监事路晓静女士，中共党员，硕士，先后任职于旺旺集团、长江期货有限公司。2015年5月起加入万家基金管理有限公司，现任公司合规稽核部总监助理。

3、基金管理人高级管理人员

董事长：方一天先生（简介请参见基金管理人董事会成员）

总经理：经晓云女士（简介请参见基金管理人董事会成员）

副总经理：李杰先生，硕士研究生。1994年至2003年任职于国泰君安证券，从事行政管理、机构客户开发等工作；2003年至2007年任职于兴安证券，从事营销管理工作；2007年至2011年任职于齐鲁证券，任营业部高级经理、总经理等职。2011年加入万家基金管理有限公司，曾任综合管理部总监、总经理助理，2013年4月起任公司副总经理。

督察长：兰剑先生，中国民盟盟员，法学硕士，律师、注册会计师，曾在江苏淮安知源律师事务所、上海和华利盛律师事务所从事律师工作，2005年10月进入万家基金管理有限公司工作，2015年4月起任公司督察长。

副总经理：黄海先生，硕士研究生。先后在上海德锦投资有限责任公司、上海申银万国证券研究所有限公司、华宝信托有限责任公司、中银国际证券有限责任公司工作，历任项目经理、研究员、投资经理、投资总监等职务。2015年4月进入万家基金管理有限公司任投资总监职务，负责公司投资管理工作，2017年4月任公司副总经理。

副总经理：沈芳女士，经济学博士。历任东亚银行上海经济研究中心主任，富国基金管理有限公司资产管理部高级经理，长江养老保险股份有限公司大客户部副总经理（主持工作），汇添富基金管理有限公司战略发展部总监，华融基金管理有限公司筹备组副组长、拟任公司副总经理，中保保险资产登记交易系统有限公司运营管理委员会副主任等职。2018年7月加入万家基金管理有限公司工作，2018年10月起任公司副总经理。

副总经理：满黎先生，硕士学位，曾任金鹰基金管理有限公司副总经理、国联安基金管理有限公司副总经理、华安基金管理有限公司高级董事总经理等职务。2019年6月加入万家基金管理有限公司工作，2019年7月起任公司副总经理。

首席信息官：陈广益先生，中共党员，硕士学位，曾任职兴全基金管理有限公司运作保障部，2005年3月加入本公司，曾任运作保障部副总监，现任公司公司首席信息官，分管信息技术、基金运营、交易等业务。

4、本基金基金经理简历

叶勇，中国政法大学法学本科。2015年3月加入万家基金管理有限公司，先后担任股权投资部副总监、权益投资二部总监、投资经理等职。现任万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

历任基金经理：

欧庆铃，自本基金成立时至2009年8月任本基金基金经理。
鞠英利，自2009年3月至2010年7月任本基金基金经理。
吴印，自2010年7月至2013年8月任本基金基金经理。
朱颖，自2012年2月至2015年2月任本基金基金经理。
华光磊，自2013年8月至2015年5月任本基金基金经理。
高翰昆，自2015年5月至2018年8月任本基金基金经理。
陈佳昀，自2018年8月至2019年9月任本基金基金经理。

5、投资决策委员会成员

主　任：方一天
副主任：黄海
委　员：莫海波、乔亮、李弢、苏谋东、徐朝贞、陈旭、李文宾、高源、黄兴亮
方一天先生，董事长。
黄海先生，副总经理、投资总监。
莫海波先生，总经理助理、投资研究部总监、基金经理。
乔亮先生，总经理助理。
李弢先生，总经理助理、专户业务部总监。
苏谋东先生，固定收益部总监，基金经理。
徐朝贞先生，国际业务部总监，组合投资部总监，基金经理。
陈旭先生，量化投资部副总监，基金经理。
李文宾先生，基金经理。
高源女士，基金经理。
黄兴亮先生，基金经理。

（2）固定收益投资决策委员会

主　任：方一天
委　员：陈广益、莫海波、李弢、苏谋东、尹诚庸、侯慧娣
方一天先生，董事长。
陈广益先生，首席信息官。
莫海波先生，总经理助理、投资研究部总监、基金经理。
李弢先生，总经理助理、专户业务部总监。
苏谋东先生，固定收益部总监，基金经理。
尹诚庸先生，固定收益部总监助理，基金经理。
侯慧娣女士，现金管理部副总监，基金经理。

6、上述人员之间不存在近亲属关系

第二部分 基金托管人

一、基金托管人概况

（一）基本情况

名称：兴业银行股份有限公司（简称：兴业银行）
住所：福建省福州市湖东路154号
办公地址：上海市银城路167号
法定代表人：高建平
成立时间：1988年8月22日
组织形式：股份有限公司
注册资本：207.74亿元人民币
存续期间：持续经营
基金托管业务批准文号：中国证监会证监基金字［2005］74号
联系人：刘峰
电话：021-62159217

（二）主要人员情况

兴业银行股份有限公司总行设资产托管部，下设综合处、运行管理处、稽核监察处、产品管理处、市场处、委托资产管理处、企业年金中心等处室，共有员工100余人，业务岗位人员均具有基金从业资格。

（三）基金托管业务经营情况

兴业银行股份有限公司于2005年4月26日取得基金托管资格。基金托管业务批准文号：证监基金字［2005］74号。截至2018年12月31日，兴业银行共托管证券投资基金248只，托管基金的基金资产净值合计8964.38亿元，基金份额合计8923.86亿份

第三部分 相关服务机构

一、本基金销售机构

（一）直销机构

本基金直销机构为万家基金管理有限公司以及本公司的网上交易平台。

住所：中国（上海）自由贸易试验区浦电路360号8层（名义楼层9层）
办公地址：中国（上海）自由贸易试验区浦电路360号8层（名义楼层9层）
法定代表人：方一天
联系人：亓翡
电话：（021）38909777
传真：（021）38909798
客户服务热线：400-888-0800；95538转6
网址：http://www.wjasset.com/

投资人可以通过本公司网上交易系统办理本基金的开户、认购、申购及赎回等业务，具体交易细则请参阅本公司网站公告。

网上交易网址：https://trade.wjasset.com/

（二）场外代销机构

1）中国国际金融有限公司
客户服务电话：010-65051166
网址：www.cicc.com.cn
2）中国建设银行股份有限公司
客户服务电话：95533
网址：www.ccb.com
3）交通银行股份有限公司
客户服务电话：95559
网址：www.bankcom.com
4）中国农业银行股份有限公司
客户服务电话：95599（或拨打各城市营业网点咨询电话）
网址：www.abchina.com
5）招商银行股份有限公司
客户服务电话：95555
网址：www.cmbchina.com
6）中信银行股份有限公司
客户服务电话：95558
网址：bank.ecitic.com
7）兴业银行股份有限公司
客户服务电话：95561
网址：www.cib.com.cn
8）平安银行股份有限公司
客户服务电话：95511-3
网址：bank.pingan.com
9）中国邮政储蓄银行股份有限公司
客户服务电话：95580
网址：www.psbc.com
10）华夏银行股份有限公司
客户服务电话：95577
网址：www.hxb.com.cn
11）中国银行股份有限公司
客户服务电话：95566
网址：www.boc.cn
12）中国工商银行股份有限公司
客户服务电话：95588
网址：www.icbc.com.cn
13）中国民生银行股份有限公司
客户服务电话：95568
网址：www.cmbc.com.cn
14）上海浦东发展银行股份有限公司
客户服务电话：95528
网址：www.spdb.com.cn
15）东方证券股份有限公司
客户服务电话：95503
网址：www.dfzq.com.cn
16）广发证券股份有限公司
客户服务电话：95575
网址：www.gf.com.cn
17）民生证券有限责任公司
客户服务电话：400-619-8888
网址：www.mszq.com
18）西南证券股份有限公司
客户服务电话：400-809-6096
网址：www.swsc.com.cn
19）华泰证券股份有限公司
客户服务电话：95597
网址：www.htsc.com.cn
20）华宝证券有限责任公司
客户服务电话：4008209898、021-38929908
公司网站：www.cnhbstock.com
21）国融证券股份有限公司
客户服务电话：95385
网址：www.grzq.com
22）光大证券股份有限公司
客户服务电话：400-888-8788，10108998，95525
网址：www.ebscn.com
23）申万宏源西部证券有限公司
客户服务电话：400-800-0562
网址：www.hysec.com
24）中泰证券股份有限公司
客户服务电话：95538
网址：www.zts.com.cn
25）上海证券有限责任公司
客户服务电话：400-891-8918，021-962518
网址：www.962518.com
26）国泰君安证券股份有限公司
客户服务电话：400-888-8666
网址：www.gtja.com
27）东吴证券股份有限公司
客户服务电话：4008601555
网址：www.dwzq.com.cn
28）信达证券股份有限公司
客户服务电话：400-800-8899
网址：www.cindasc.com
29）天相投资顾问有限公司
客户服务电话：010-66045566
公司网站：www.txsec.com
30）五矿证券有限公司
客户服务电话：400-184-0028
网址：wkzq.com.cn
31）山西证券股份有限公司
客户服务电话：400-666-1618
网址：www.sxzq.com
32）申万宏源证券有限公司
客户服务电话：95523或4008895523
网址：www.swhysc.com
33）海通证券股份有限公司
客户服务电话：95553或拨打各城市营业网点咨询电话
公司网址：www.htsec.com
34）中银国际证券有限责任公司
客户服务电话：4006208888
网址：www.bocichina.com
35）中国银河证券股份有限公司
客户服务电话：400-888-8888
网址：www.chinastock.com.cn
36）江海证券有限公司
客户服务热线：400-666-2288
网址：www.jhzq.com.cn
37）中信证券股份有限公司
客户服务电话：95558
网址：www.cs.ecitic.com
38）中信证券（山东）有限责任公司
客服电话：96577
网址：www.zxwt.com.cn
39）中国光大银行股份有限公司
客户服务电话：95595
网址：www.cebbank.com
40）爱建证券有限责任公司
客户服务电话：4008-888-228
公司网站：www.jyzq.cn
41）华福证券有限责任公司
联系电话：0591-87383600
网址：www.gfhfzq.com.cn
42）财富证券有限公司
联系电话：0731-84403319
网址：www.cfzq.com
43）东北证券股份有限公司
客户服务电话：95360
网址：www.nesc.cn
44）华鑫证券有限责任公司
客户服务电话：400-109-9918
网址：www.cfsc.com.cn
45）东海证券股份有限公司
电话：021-20333395
网址：www.longone.com.cn
46）华龙证券有限责任公司
客户服务电话：96668
公司网址：www.hlzqgs.com
47）泉州银行股份有限公司
客户服务电话：400-889-6312
公司网站：www.qzccbank.com
48）招商证券股份有限公司
客户服务电话：95565
网址：www.newone.com.cn
49）上海汇付金融服务有限公司
客户服务电话：400-820-2819
网址：https://tty.chinapnr.com/
50）北京钱景基金销售有限公司
客户服务电话：400-893-6885
网址：fund.qianjing.com
51）深圳市新兰德证券投资咨询有限公司
客户服务电话：400-166-1188
网址：www.xinlande.com.cn
52）珠海盈米基金销售有限公司
客户服务电话：020-89629066
网址：www.yingmi.cn
53）国金证券股份有限公司
客户服务电话：400-660-0109
网址：www.gjzq.com.cn
54）北京虹点基金销售有限公司
客户服务电话：400-068-1176
网址：www.hongdianfund.com
55）大泰金石基金销售有限公司
客户服务电话：400-928-2266
网址：www.dtfunds.com
56）中信期货有限公司
客户服务电话：400-990-8826
网址：www.citicsf.com
57）浙江同花顺基金销售有限公司
客服电话：4008-773-772
网址：http://fund.10jqka.com.cn
58）上海天天基金销售有限公司
客服电话：400-1818-188
网址：www.1234567.com.cn
59）上海好买基金销售有限公司
客服电话：400-700-9665
网址：www. ehowbuy.com
60）中证金牛（北京）投资咨询有限公司
客服电话：400-8909-998
网址：www.jnlc.com
61）奕丰基金销售有限公司
客服电话：400-684-0500
网址：www.ifastps.com.cn
62）浙江金观诚基金销售有限公司
客服电话：400-068-0058
网址：www.jincheng-fund.com
63）深圳富济基金销售有限公司
客服电话：0755-83999907
网址：http://www.fujiwealth.cn
64）上海陆金所基金销售有限公司
客户服务电话：4008-219-031
网址：www.lufunds.com
65）浙商银行股份有限公司
客服电话：95527
网址：http://www.czbank.com/
66）武汉市伯嘉基金销售有限公司
客服电话：400-027-9899
网址：www.buyfunds.cn
67）海银基金销售有限公司
客服电话：400-808-1016
网址：www.fundhaiyin.com
68）北京广源达信基金销售有限公司
客服电话：400-623-6060
网址：www:niuniufund.com
69）平安证券有限责任公司
客户服务电话：95511-8
网址：stock.pingan.com
70）北京恒天明泽基金销售有限公司
客服电话：4008980618
网址：www.chtfund.com
71）南京证券股份有限公司
客服电话：95386
网址：http://www.njzq.com.cn/
72）上海基煜基金销售有限公司
客户服务电话：021-65370077
网址：www.jiyufund.com.cn
73）北京懒猫金融信息服务有限公司
客户服务电话：4001-500-882
网址：http:// www.lanmao.com
74）北京肯特瑞基金销售有限公司
个人业务：95118
企业业务：4000888816
网址：fund.jd.com
75）北京新浪仓石基金销售有限公司
客服电话：010-62675369
网址：www.xincai.com
76）北京汇成基金销售有限公司
客服电话：4006199059
网址：www.hcjijin.com
77）北京蛋卷基金销售有限公司
客服电话：400-061-8518
网址：https://danjuanapp.com
78）万家财富基金销售（天津）有限公司
客服电话：010-59013895
网址：www.wanjiawealth.com
79）上海凯石财富基金销售有限公司
客服电话：4006-433-389
网址：www.vstonewealth.com
80）济安财富（北京）基金销售有限公司
客服电话：400-673-7010
网址：www.jianfortune.com
81）民商基金销售（上海）有限公司
客服电话：021-50206003
网址：www.msftec.com
82）北京百度百盈基金销售有限公司
客服电话：95055-9
网址：https://www.baiyingfund.com/
83）西藏东方财富证券股份有限公司
客服电话：95357
网址：http://www.18.cn
84）联储证券有限责任公司
客服电话：4006206868
网址：www.lczq.com

开通本基金网银（包括手机银行等）或网上交易申购优惠业务的销售机构包括本公司直销中心及相关代销机构。有关网银或网上交易优惠的具体规定，请投资者查阅本公司网站以及各代销机构的有关公告。

基金管理人可以根据情况增加或者减少代销机构，并另行公告。敬请投资者留意。

（三）场内代销机构

除上述销售机构外，投资者亦可通过“上证基金通”办理本基金的上海证券交易所场内申购与赎回（基金简称：万家引擎；基金代码：519183），通过具有基金代销业务资格并开通“上证基金通”业务的上交所会员均可办理本基金的场内申购与赎回。

基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择其它符合要求的机构代理销售本基金，并及时公告。

二、注册登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司
住所：北京市西城区太平桥大街17号
电话：010-58598888
传真：010-58598824

三、审计基金财产的会计师事务所

名称：立信会计师事务所（特殊普通合伙）
住所：中国上海市南京东路61号新黄浦金融大厦四楼
办公地址：中国上海市南京东路61号新黄浦金融大厦四楼
联系电话：021-63391166
传真：021-63392558
联系人：徐冬
经办注册会计师：王斌、徐冬、詹阳

四、律师事务所

名称：北京大成（上海）律师事务所
住所：上海市银城中路501号上海中心15层、16层
电话：（021）3872 2416
执行主任：陈峰
经办律师：华涛
电话：（021）3872 2416

第四部分 基金的历史沿革和存续

一、基金的历史沿革

万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金经中国证监会证监许可［2008］316号文核准募集，基金管理人为万家基金管理有限公司，基金托管人为兴业银行股份有限公司。

万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金自2008年5月7日至2008年6月20日公开募集，募集结束后基金管理人向中国证监会办理备案手续。经中国证监会书面确认，《万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2008年6月27日生效。

2015年5月25日万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会以通讯方式召开，大会审议并通过《关于修改万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案》，内容包括万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金修改基金投资范围、投资比例、收益分配方式、及基金合同其他内容修订等事项。自持有人大会决议生效之日起，旧版《万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金基金合同》失效且新版《万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金基金合同》同时生效。

二、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

《基金合同》生效后，基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元的，基金管理人应当及时报告中国证监会；连续20个工作日出现前述情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续60个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。法律法规另有规定时，从其规定。

第五部分 基金的名称

本基金名称：万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金

第六部分 基金的类型

本基金为契约型开放式基金

第七部分 基金的投资目标

本基金通过股票、债券的有效配置，把握价值、成长风格特征，精选个股，构造风格类资产组合。在有效控制风险的前提下，谋求基金资产的持续稳健增值。

第八部分 基金的投资方向

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、债券（含中小企业私募债、证券公司短期公司债券）、现金、债券回购、银行存款、资产支持证券、权证及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

本基金投资组合资产配置比例为：股票资产占基金资产净值的0-95%；其中，现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%，其中，现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等、权证占基金资产净值的0%—3%、资产支持证券占基金资产净值的0%-20%。

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。

第九部分 基金的投资策略

（一）资产配置策略

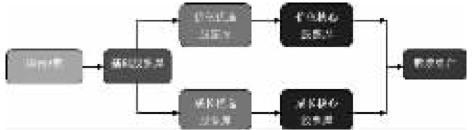
本基金根据对宏观经济环境、经济增长前景及证券市场发展状况的综合分析，结合对股票市场整体估值水平、上市公司利润增长情况，债券市场整体收益率曲线变化等综合指标的分析，形成对各大类资产收益风险水平的前瞻性预测，以此确定股票、固定收益证券和现金等大类资产及中国证监会允许基金投资的其他金融工具在给定区间内的动态配置。

本基金对宏观经济环境、经济增长前景分析中的定量指标，主要考察GDP及其增幅、居民消费价格指数、固定资产投资完成情况及其增幅、货币供应量M0、M1、M2等指标的变化；定性分析因素主要考察宏观经济趋势变化、宏观经济增长模式以及宏观经济政策的变化及含义。

本基金对证券市场发展状况的分析，主要考察制度性建设和变革、证券市场政策变化、参与主体变化、上市公司数量、质量和市场估值变化。

（二）股票投资策略

本基金股票投资组合采取自下而上的策略，以量化指标分析为基础，结合定性分析，精选具有明显价值、成长风格特征且具备估值优势的股票，构建投资组合，在有效控制风险的前提下，谋求基金资产的持续稳健增值。下图是本基金股票组合构建流程图：



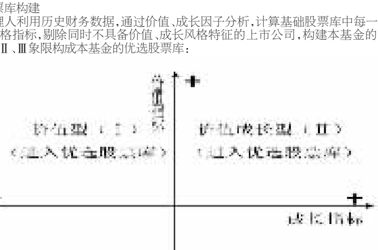
1、基础股票库构建

本基金对A股市场中的所有股票进行初选，以过滤掉明显不具备投资价值的股票，建立本基金的基础股票库。初选过滤掉的股票主要包括以下几类：

（1）法律法规和公司制度明确禁止投资的股票；
（2）流动性差的股票（由公司投研团队根据股票的交易量、换手率的研究进行确定）；
（3）当前涉及重大诉讼、仲裁等重大事件公司的股票。

2、优选股票库构建

本基金管理人利用历史财务数据，通过价值、成长因子分析，计算基础股票库中每一上市公司的价值、成长风格指标，剔除同时不具备价值、成长风格特征的上市公司，构建本基金的优选股票库。下图第Ⅰ、Ⅱ、Ⅲ象限构成本基金的优选股票库：



具体构建方法如下：

（1）确定价值、成长因子。本基金价值、成长因子包括：

1）价值因子：
i）市净率P/B；
ii）股息收益率；
iii）年现金流量/市值；
iv）销售收入/市值。

2）成长因子：
i）过去3年每股收益复合增长率；
ii）过去3年主营业务收入增长率；
iii）ROE ＊（1-红利支付率）。

（2）对基础股票库中每一上市公司确定其价值、成长特征

1）计算每一上市公司的价值、成长因子；
2）利用数据标准化程序，确定该上市公司的价值、成长指标；
3）确定每一公司的风格特征；
4）风格特征的调整。

i）常规调整

每年上市公司年报、半年报披露后，本基金管理人将根据更新数据按上述1）、2）方式计算该上市公司的风格特征。

ii）突发事件调整

上市公司由于基本面状况出现较大的转变，预期企业业绩会出现突发性增长，如：行业复苏、产业政策扶植、并购、重组、资产注入等情况。基金管理人根据对该公司未来业绩增长的预期数值，按上述1）、2）方式计算该股票的风格特征。

3、核心股票库构建

在优选股票库的基础上，本基金通过对企业发展的内外部因素分析、估值分析，结合实地调研，构建成核心股票库。

（1）企业发展的内部因素：

1）制度因素：完善的公司治理结构及规范的管理制度；
2）管理团队因素：管理团队团结高效、经验丰富、富有协作、进取精神；
3）财务因素：财务清晰透明，财务政策合理，良好的企业财务状况、合理的资本结构，突出的成本控制能力；
4）生产因素：企业在资源配置、产能扩张等方面具有优势；
5）技术因素：具有技术竞争优势，且具有持续性的技术研发能力和学习能力，可以使企业所掌握的技术不断地转化为新产品或新服务，从而为企业成长提供源源不断的动力；
6）市场因素：良好的市场品牌、市场扩张和保护能力。

（2）企业发展的外部因素：

1）法律环境：包括权益保护、商业规范以及市场制度等；
2）政策环境：严格的市场准入政策、扶持性的地区和产业政策、优惠的税费政策以及宽松的信用政策等；
3）市场环境：合理的行业集中度、有利的竞争态势以及不断增长的市场需求等；

（3）估值分析

根据企业和行业的不同特点，选择较适合的指标进行估值，这些指标包括但不限于市盈率（P/E）、PEG、企业价值/息税前利润（EV/EBIT）、企业价值/息税、折旧、摊销前利润（EV/EBITDA）、自由现金流贴现（DCF）等。

4、股票组合的构建

基金经理通过对市场估值水平的分析，结合公司投研团队对行业景气度、行业发展趋势的研究，合理配置价值、成长股票的权重。充分权衡行业集中度、资产流动性等多种因素对投资组合风险收益水平的影响，审慎精选，构建本基金的股票组合。。

5、持续跟踪和风险评估

对所投资的企业进行密切跟踪，关注发展变化，动态评估企业的价值、成长风格及估值水平，同时由风险控制小组通过VAR分析等技术对投资组合进行动态风险评估。

（三）债券投资策略

配置型基金中债券投资管理的目标是分散股票投资的市场风险，保持投资组合稳定收益和充分流动性，追求基金资产的长期增值。

1、利率预期策略

利率变化是影响债券价格的最重要的因素，利率预期策略是本基金的基本投资策略。通过对宏观经济形势、财政与货币政策、金融监管政策、市场结构变化和资金供给等因素的分析，定性分析与定量分析相结合，形成对未来利率走势的判断，并依此调整组合的期限和品种配置。

2、久期控制策略

在利率变化方向判断的基础上，确定恰当的久期控制目标。在预期利率整体上升时，缩短组合的平均久期；在预期利率整体下降时，延长组合的平均久期。

3、期限结构配置策略

基准利率的变化对短中长期债券收益率的影响多数情况下并不是同等幅度的。根据对债券市场期限结构变动特征的历史分析和现阶段期限结构特征的分析，结合市场运行、持有人结构、债券供求等因素，形成期限结构配置策略，对不同期限结构的债券应用不同的买卖策略。

4、类属配置策略

不同类型的债券在收益率、流动性和信用风险上形成差异，有必要采用类属配置策略，使债券组合资产配置于不同的债券品种（国债、企业债、金融债、可转债、央行票据、资产支持证券等），以及在不同的市场上进行配置（交易所和银行间）。

本基金将结合信用分析、流动性分析、税收分析、市场成员结构等综合因素来决定投资组合的类属配置策略，在保证流动性和基金资产安全的前提下，谋求收益的最大化。

5、杠杆放大策略和换券策略

在具体操作中，本基金还将利用换券操作、放大操作等多种策略，提高组合的超额收益。

6、套利策略

套利策略包括跨市场回购套利、跨市场债券套利、结合远期的债券跨期限套利、可转债套利等。本基金充分利用市场出现的机会，为持有人带来无风险或低风险的超额利润。

7、可转债投资策略

可转债（含可分离转债）是债券和复杂权证的混合体，兼具股性和债性，是可攻可守的投资品种。投资可转债需要更多的技巧。在牛市中，本基金更多地投资股性强的可转债；熊市中，本基金更多地考虑债性强的可转债。同时结合可转债的条款，时刻关注赎回风险、回售机会、转股价可能下调带来的额外机会和溢价率为负时的套利机会。

8、中小企业私募债券债券投资策略

本基金将综合运用类别资产配置、久期管理、收益率曲线、个券选择和利差定价管理等策略，在严格遵守法律法规和基金合同基础上，进行中小企业私募债券的投资。

本基金将特别注重中小企业私募债券的信用风险和流动性管理，本着风险调整后收益最大化的原则，确定中小企业私募债券类资产的合理配置比例，保证本金相对安全和资产流动性，以期获得长期稳定收益。在投资决策过程中，将评估中小企业私募债券的流动性对基金资产流动性的影响，分散投资，确保所投资的中小企业私募债券具有适当的流动性；同时密切关注影响中小企业私募债券价值的因素，并进行相应的投资操作。

本基金将对中小企业私募债券进行深入研究，由债券研究员根据公司内部《信用债券库管理办法》对中小企业私募债券的信用风险和投资价值进行分析并给予内部信用评分和投资评级。本基金可投资于内部评级界定为可配置类的中小企业私募债券；对于内部评级界定为风险规避类的中小企业私募债券，禁止进行投资。

9、资产支持证券投资策略

本基金投资资产支持证券将综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择和把握市场交易机会等积极策略，在严格遵守法律法规和基金合同基础上，通过信用研究和流动性管理，选择经风险调整后相对价值较高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。

10、证券公司短期公司债券投资策略

本基金在对证券公司短期公司债券特点和发行债券公司基本面进行深入分析研究的基础上，通过考察利率水平、票息率、付息频率、信用风险及流动性等因素判断其债券价值；采用多种定价模型以及研究人员对证券公司基本面等不同变量的研究确定其投资价值。投资综合实力较强的证券公司发行的短期公司债券，获取稳健的投资回报。本基金持有单只短期公司债券，其市值不得超过本基金资产净值的10%；

（四）权证投资策略

本基金将权证的投资作为控制投资风险和在有效控制风险前期下提高基金投资组合收益的辅助手段。本基金的权证投资策略包括：

1、根据权证对应公司基本面研究成果确定权证的合理估值，发现市场对股票权证的非理性定价；

2、在产品定价时，主要采用市场公认的多种期权定价模型以及研究人员对包括对应公司基本面等不同变量的预测对权证确定合理定价；

3、利用权证衍生工具的特性，本基金通过权证与证券的组合投资，来达到改善组合风险收益特征的目的；

4、本基金投资权证策略包括但不限于杠杆交易策略、看跌保护组合策略、获利保护策略、买入跨式投资策略等等。

（五）其他金融衍生产品投资策略

本基金将密切跟踪国内各种金融衍生产品的动向，一旦有新的产品推出市场，将在届时相应法律法规的框架内，制订符合本基金投资目标的投资策略，同时结合对金融衍生产品的研究，在充分考虑金融衍生产品风险和收益特征的前提下，谨慎进行投资。

第十部分 基金的业绩比较基准

本基金业绩比较基准为：60%×沪深300指数收益率+40%×上证国债指数收益率

第十一部分 基金的风险收益特征

本基金是混合型基金，风险高于货币市场基金和债券型基金，属于中高风险、中高预期收益的证券投资基金。

第十二部分 基金的投资组合报告

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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年4月17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2019年3月31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	11,092,094.00	45.46
	其中：股票	11,092,094.00	45.46
2	基金投资	–	–
3	固定收益投资	1,375,137.50	5.64
	其中：债券	1,375,137.50	5.64
	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	5,500,000.00	22.54
	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	6,132,362.46	25.14
8	其他资产	297,682.72	1.22
9	合计	24,397,276.68	100.00

2.报告期末按行业分类的股票投资组合

2.1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	1,479,165.00	8.03
B	采矿业	–	–
C	制造业	5,693,236.00	30.92
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	1,335,410.00	7.25
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	1,995,383.00	10.84
J	金融业	–	–
K	房地产业	588,900.00	3.20
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	11,092,094.00	60.24

2.2报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期无沪港通投资股票投资组合。

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	603108	润达医疗	69,000	837,660.00	4.55
2	300498	温氏股份	18,500	751,100.00	4.08
3	002714	牧原股份	11,500	728,065.00	3.95
4	600748	上实发展	65,000	588,900.00	3.20
5	002439	启明星辰	18,600	548,328.00	2.98
6	002309	中利集团	51,600	547,992.00	2.98
7	000876	新 希 望	40,200	534,660.00	2.90
8	002373	千方科技	27,000	511,110.00	2.78
9	002367	康力电梯	62,500	508,125.00	2.76
10	002589	瑞康医药	55,000	497,750.00	2.70

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	1,375,137.50	7.47
	其中：政策性金融债	1,375,137.50	7.47
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）	–	–
8	同业存单	–	–
9	其他	–	–
10	合计	1,375,137.50	7.47

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	018005	国开1701	13,750	1,375,137.50	7.47

6.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序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。

8.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股指期货交易情况说明

9.1报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

9.2本基金投资股指期货的投资政策

本报告期内，本基金未投资股指期货。

10.报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

10.1本期国债期货投资政策

本报告期内，本基金未投资国债期货。

10.2报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本报告期内，本基金未投资国债期货。

11.投资组合报告附注

11.1本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体不存在被监管部门立案调查的，在报告编制日前一年内也不存在受到公开谴责、处罚的情况。

11.2基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

基金投资的前十名股票中，不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

11.3其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	42,801.89
2	应收证券清算款	198,201.25
3	应收股利	–
4	应收利息	52,125.11
5	应收申购款	4,554.47
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	297,682.72

11.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

11.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

第十三部分 基金的业绩

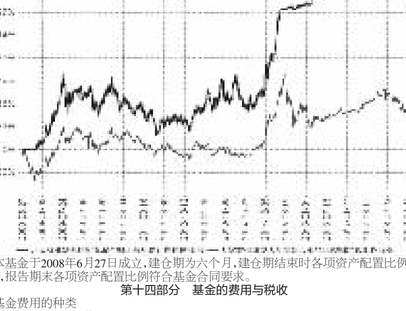
基金业绩截止日为2019年3月31日。

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）本报告期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）
2019年一季度	17.13%	1.18%	17.09%	0.93%	0.04%	0.25%
2018年	-14.77%	0.75%	-13.74%	0.80%	-1.03%	-0.05%
2017年	5.99%	0.21%	12.98%	0.38%	-6.99%	-0.17%
2016年	7.28%	0.17%	-5.13%	0.84%	12.41%	-0.67%
2015年	30.53%	0.61%	7.74%	1.49%	22.79%	-0.88%
2014年	21.73%	1.28%	31.20%	0.73%	-9.47%	0.55%
2013年	13.36%	1.37%	-3.08%	0.84%	16.44%	0.53%
2012年	2.90%	1.05%	6.36%	0.77%	-3.46%	0.28%
2011年	-16.71%	0.97%	-14.09%	0.78%	-2.62%	0.19%
2010年	-2.98%	1.23%	-5.83%	0.95%	2.85%	0.28%
2009年	49.35%	1.44%	52.55%	1.23%	-3.20%	0.21%
基金成立日至2008年12月31日	4.19%	0.53%	-22.57%	1.79%	26.76%	-1.26%
基金成立日至2019年3月31日	164.57%	1.00%	50.74%	0.99%	113.83%	0.01%

（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（2008年6月27日至2019年3月31日）



注：本基金于2008年6月27日成立，建仓期为六个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同要求，报告期末各项资产配置比例符合基金合同要求。

第十四部分 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、基金的开户费用、账户维护费用；
9、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。

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0.8%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H=E×0.8%÷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前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0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

H=E×0.25%÷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前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“一、基金费用的种类中第3-9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；
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、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。

第十五部分 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》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及其它有关法律法规的要求，对本基金2019年8月10日发布的更新招募说明书内容进行了更新，并根据本基金管理人在本基金成立后对本基金实施的投资经营活动进行了内容补充和更新，主要更新内容如下：

1、在重要提示部分，更新了招募说明书内容的截止日期。
2、在“三、基金管理人”部分，更新了基金管理人的有关内容。
3、新增了“二十三、其他应披露事项”部分，更新了本基金最近一次招募说明书更新以来的公告事项。

万家基金管理有限公司
二零一九年九月十二日

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。

证券代码：000887　证券简称：中鼎股份　公告编号：2019-073
转债代码：127011　转债简称：中鼎转2

安徽中鼎密封件股份有限公司
关于中鼎转2开始转股的提示性公告

特别提示：

证券代码：000887　证券简称：中鼎股份
转债代码：127011　转债简称：中鼎转2
转股价格：人民币11.79元/股
转股时间：2019年9月16日至2025年3月8日

一、关于可转换公司债券发行上市概况

（一）可转换公司债券发行情况

经中国证券监督管理委员会“证监许可［2018］1803号”文核准，安徽中鼎密封件股份有限公司（以下简称“中鼎股份”、“公司”或“发行人”）于2019年3月8日公开发行了1,200万张可转换公司债券，每张面值100元，发行总额12亿元。

（二）可转换公司债券上市情况

经深圳证券交易所（以下简称“深交所”）“深证上［2019］【165】号”文同意，公司12亿元可转换公司债券于2019年4月4日起在深交所挂牌交易，债券简称“中鼎转2”，债券代码“127011”。

（三）可转换公司债券转股情况

根据《深圳证券交易所股票上市规则》等有关规定和《安徽中鼎密封件股份有限公司公开发行可转换公司债券募集说明书》的约定，本次发行的可转换公司债券转股期限自发行结束之日起满六个月后的第一个交易日起至可转换公司债券到期日止，即2019年9月16日至2025年3月8日。

二、可转换公司债券转股的相关条款

（一）发行数量：1,200万张；
（二）发行规模：12亿元；
（三）票面金额：100元/张；
（四）债券利率：第一年0.5%，第二年0.7%，第三年1.0%，第四年1.5%，第五年2.0%，第六年2.5%。到期赎回价为110元（含最后一期利息）；
（五）债券期限：自发行之日起6年；
（六）转股期限：2019年9月16日至2025年3月8日；
（七）转股价格：人民币11.79元/股。

三、可转换公司债券转股申报的有关事项

（一）转股申报程序

1、转股申报应按照深交所的有关规定，通过深交所交易系统以报盘方式进行。

2、持有人可以将自己账户内的“中鼎转2”全部或部分申请转换为中鼎股份股票，具体转股操作建议持有人在申报前咨询开户证券公司。

3、可转换公司债券转股申报单位为“张”，每张面额为100元，转换成股份的最小单位为1股；同一交易日内多次申报转股的，将合并计算转股数量（转股数量=可转换公司债券持有人申请转股的可转换公司债券票面总金额/申请转股当日有效的转股价格，并以去尾法取一股的整数倍）。可转换公司债券持有人申请转换成的股份须为整数股。转股时不足转换为1股股票的可转换公司债券余额，公司将按照深交所等部门的有关规定，在可转换公司债券持有人转股当日后的五个交易日内以现金兑付该可转换公司债券余额及该余额所对应的当期应计利息，按照四舍五入原则精确到0.01元。

4、可转换公司债券买卖申报优先于转股申报，可转换公司债券持有人申请转股的可转换公司债券数额大于其实际拥有的可转换公司债券数额的，按其实际拥有的数额进行转股，申请剩余部分予以取消。

（二）转股申报时间

持有人可在转股期内（2019年9月16日至2025年3月8日）深交所交易日的正常交易时间申报转股，但下述时间除外：

1、“中鼎转2”停止交易前的停牌时间；
2、公司股票停牌期间；
3、按有关规定，公司申请停止转股的期间。

（三）可转换公司债券的冻结及注销

中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司对转股申请确认有效后，将记减（冻结并注销）可转换公司债券持有人的转债余额，同时，记增可转换公司债券持有人相应的股份数额，完成变更登记。

（四）可转换公司债券转股新增股份的上市交易和所享有的权益

当日买进的可转换公司债券当日可申请转股。可转换公司债券转股新增股份，可于转股申报后次一个交易日上市流通。可转换公司债券转股新增股份享有与原股份同等的权益。

（五）转股过程中的有关税费

可转换公司债券转股过程中如发生有关税费，由纳税义务人自行负担。

（六）转换年度利息的归属

“中鼎转2”采用每年付息一次的付息方式，计息起始日为可转换公司债券发行首日，即2019年3月8日。每年的付息债权登记日为每年付息日的前一交易日，公司将在每年付息日之后的5个交易日内支付当年利息。在付息债权登记日前（包括付息债权登记日）申请转换成公司股票的可转换公司债券，公司不再向其持有人支付本计息年度及以后计息年度的利息。

四、可转换公司债券转股价格的调整和修正情况

（一）初始转股价格和最新转股价格

公司本次可转换公司债券的初始转股价格为人民币11.99元/股，经调整后的最新转股价格为人民币11.79元/股。

（二）转股价格调整情况

根据公司2018年年度股东大会审议通过，公司实施2018年年度利润分配方案，以公司可参与分配的股本1,213,227,095股为基数，向全体股东每10股派发现金股利2元（含税），除权除息日为2019年5月31日。根据《安徽中鼎密封件股份有限公司公开发行可转换公司债券募集说明书》相关条款以及中国证监会关于可转换公司债券发行的有关规定，中鼎转2的转股价格由原来的11.99元/股调整为11.79元/股，调整后的转股价格于2019年5月31日生效。具体内容详见公司于2019年5月24日在巨潮资讯网（www.cninfo.com.cn）披露的《关于可转债转股价格调整的公告》（公告编号：2019-057）。

（三）转股价格的调整方式及计算公式

在本次发行之后，当公司发生派送红股、转增股本、增发新股或配股以及派发现金股利等情况（不包括因本次发行的可转换公司债券转股增加的股本），则转股价格相应调整。具体的转股调整公式如下（保留小数点后两位，最后一位四舍五入）：

派送红股或转增股本：$P1=P0/(1+n)$；
增发新股或配股：$P1=(P0+A\times k)/(1+k)$；
上述两项同时进行：$P1=(P0+A\times k)/(1+n+k)$；
派发现金股利：$P1=P0-D$；
上述三项同时进行：$P1=(P0-D+A\times k)/(1+n+k)$。

其中：P0为调整前转股价，P1为调整后转股价，n为送股或转增股本率，k为增发新股或配股率，A为增发新股价或配股价，D为每股派发现金股利。

当公司出现上述股份和/或股东权益变化情况时，将依次进行转股价格调整，并在中国证监会指定的上市公司信息披露媒体上刊登转股价格调整的相关公告，并于公告中载明转股价格调整日、调整办法及暂停转股时期（如需）。当转股价格调整日为本次发行的可转换公司债券持有人转股申请日或之后，转换股份登记日之前，则该持有人的转股申请按公司调整后的转股价格执行。

当公司可能发生股份回购、合并、分立或任何其他情形使公司股份类别、数量和/或股东权益发生变化从而可能影响本次发行的可转换公司债券持有人的债权利益或转股衍生权益时，公司将视具体情况按照公平、公正、公允的原则以及充分保护本次发行的可转换公司债券持有人权益的原则调整转股价格。有关转股价格调整内容及操作办法将依据届时国家有关法律法规及证券监管部门的相关规定来制订。

（四）、转股价格的向下修正条款

1、修正条件及修正幅度

在本次发行的可转换公司债券存续期间，当公司股票在任意连续30个交易日中至少有15个交易日的收盘价格低于当期转股价格的85%时，公司董事会有权提出转股价格向下修正方案并提交公司股东大会审议。

上述方案须经出席会议的股东所持表决权的三分之二以上通过方可实施。股东大会进行表决时，持有本次发行的可转换公司债券的股东应当回避。修正后的转股价格应不低于本次股东大会召开日前20个交易日公司股票交易均价和前一交易日均价之间的较高者。

若在前述30个交易日内发生过转股价格调整的情形，则在转股价格调整日前的交易日按调整前的转股价格和收盘价格计算，在转股价格调整日及之后的交易日按调整后的转股价格和收盘价格计算。

2、修正程序

如公司决定向下修正转股价格时，公司将在中国证监会指定的上市公司信息披露媒体上刊登股东大会决议公告，公告修正幅度、股权登记日及暂停转股期间（如需）等。从股权登记日后的第一个交易日（即转股价格修正日）开始恢复转股申请并执行修正后的转股价格。

若转股价格修正日为转股申请日或之后，转换股份登记日之前，该类转股申请应按修正后的转股价格执行。

五、可转换公司债券赎回条款及回售条款

（1）、赎回条款

1、到期赎回条款

在本次发行的可转换公司债券期满后5个交易日内，公司将以本次可转债票面面值的110%（含最后一期利息）的价格向投资者赎回未转股的可转换公司债券。

2、有条件赎回条款

在本次发行的可转换公司债券转股期内，当下述两种情形的任意一种出现时，公司董事会有权决定按照债券面值加上当期应计利息的价格赎回全部或部分未转股的可转换公司债券：

①在本次发行的可转换公司债券转股期内，如果公司股票在任意连续30个交易日中至少有15个交易日的收盘价格不低于当期转股价格的130%（含130%）；

②当本次发行的可转换公司债券未转股余额不足3,000万元时。

当期应计利息的计算公式为：$IA=B\times i\times t/365$

IA：指当期应计利息；
B：指本次发行的可转换公司债券持有人持有将赎回的可转换公司债券票面总金额；
i：指可转换公司债券当年票面利率；
t：指计息天数，即从上一个付息日起至本计息年度赎回日止的实际日历天数（算头不算尾）。

若在前述30个交易日内发生过转股价格调整的情形，则在调整前的交易日按调整前的转股价格和收盘价格计算，调整后的交易日按调整后的转股价格和收盘价格计算。

（2）回售条款

1、有条件回售条款

在本次发行的可转换公司债券的最后两个计息年度，如果公司股票在任意连续30个交易日的收盘价格低于当期转股价格的70%时，可转换公司债券持有人有权将其持有的全部或部分可转换公司债券按面值加上当期应计利息的价格回售给公司。若在上述30个交易日内发生过转股价格调整的情形，则调整前的交易日按调整前的转股价格和收盘价格计算，调整后的交易日按调整后的转股价格和收盘价格计算。如果出现转股价格向下修正的情况，则上述连续30个交易日须从转股价格向下修正之后的第一个交易日起重新计算。

本次发行的可转换公司债券最后两个计息年度，可转换公司债券持有人在每年回售条件首次满足后可按上述约定条件行使回售权一次；若在首次满足回售条件而可转换公司债券持有人未在公司届时公告的回售申报期内申报并实施回售的，该计息年度不应再行使回售权。可转换公司债券持有人不能多次行使部分回售权。

2、附加回售条款

若公司本次发行的可转换公司债券募集资金投资项目的实施情况与公司在募集说明书中的承诺情况相比出现重大变化，根据中国证监会的相关规定被视作改变募集资金用途或被中国证监会认定为改变募集资金用途的，可转换公司债券持有人享有一次回售的权利。可转换公司债券持有人有权将其持有的可转换公司债券全部或部分按债券面值加当期应计利息的价格回售给公司。持有人在附加回售条件满足后，可以在公司公告后的附加回售申报期内进行回售，该次附加回售申报期内不实施回售的，不应再行使附加回售权。

六、转股年度有关股利的归属

因本次发行的可转换公司债券转股而增加的公司股票享有与原股票同等的权益，在股利发放的股权登记日下午收市后登记在册的所有股东（含因可转债转股形成的股东）均参与当期股利分配，享有同等权益。

七、其他

投资者如需了解中鼎转2的其他相关内容，请查阅2019年3月6日刊载于巨潮资讯网（www.cninfo.com.cn）的《安徽中鼎密封件股份有限公司公开发行可转换公司债券募集说明书》全文。

咨询部门：公司证券部
咨询电话：0563-4181887
传真：0563-4181880转6071
特此公告。

安徽中鼎密封件股份有限公司董事会
2019年9月12日