汇添富可转换债券债券型证券投资基金更新招募说明书摘要

（2012年第1号）

基金管理人:汇添富基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司

重要提示

本基金经2011年4月6日中国证券监督管理委员会证监许可〔2011〕495号文核准募集。本基金基金合同于2011年6月17日正式生效。

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核准,但中国证监会对本基金募集的核准,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。

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,但不保证本基金一定盈利,也不保证最低收益。

投资有风险,投资者拟认购（或申购）基金时应认真阅读本招募说明书,全面认识本基金产品的风险收益特征,并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。本基金是债券型基金,属于证券投资基金中的低风险品种,其预期风险与收益高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。投资者应充分考虑自身的风险承受能力,并对于认购（或申购）基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。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。

基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本摘要根据本基金的基金合同和本基金的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。本基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为本基金份额持有人和本基金合同当事人,其持有本基金份额的行为本身即表明其对本基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解本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2011年12月17日,有关财务数据和净值表现截止日为2011年9月30日。本招募说明书所载的财务数据未经审计。

一、基金管理人

（一）基金管理人简况
名称:汇添富基金管理有限公司
住所:上海市黄浦区大沽路288号6幢538室
办公地址:上海市富城路99号震旦国际大楼21楼
法定代表人:桂水发
成立时间:2005年2月3日
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〔2005〕5号
注册资本:人民币1亿元
联系人:李文
联系电话:（021）28932888
股东名称及其出资比例:

东方证券股份有限公司	47%
文汇新民联合报业集团	26.5%
东航金戎控股有限责任公司	26.5%

（二）主要人员情况

1、董事会成员

桂水发先生,董事长。国籍:中国,1965年出生,香港大学工商管理硕士,上海财经大学经济学学士。现任东方证券股份有限公司副总经理、财务总监、董事会秘书。曾在上海财经大学审计监察处任职,历任上海证券交易所上市部高级经理、北京办事处总经理、市场部总监等。

肖顺喜先生,董事。国籍:中国,1963年出生,复旦大学EMBA。现任东航金戎控股有限责任公司总经理、东航集团财务有限责任公司董事长、东航国际控股（香港）有限公司董事长。历任东航期货公司总经理助理、副总经理、总经理,东航集团财务有限责任公司常务副总经理等。

陈保平先生,董事。国籍:中国,1953年出生,高级编审,南洋交大EMBA。现任新民晚报社总编辑、党委副书记。历任文汇新民联合报业集团副社长、文汇新民联合报业集团投资公司总经理,上海青年报社编辑、记者、部主任、副总编,上海三联书店总编辑、沪港三联副董事长,上海文艺出版总社党委书记、副社长、总社总编辑等。

林利军先生,董事,总经理。国籍:中国,1973年出生,美国哈佛大学商学院工商管理硕士,复旦大学世界经济系硕士,历任上海证券交易所办公室主任助理、上市部总监助理,曾任职于中国证监会创业板筹备工作组,哈佛大学毕业后就职于美国道富金融集团（State Street Global Advisor）从事投资和风险管理工作。

韦杰夫（Jeffrey R. Williams）先生,独立董事。国籍:美国,1953年出生,哈佛大学商学院工商管理硕士,哈佛大学肯尼迪政府学院资深访问学者。现任哈佛上海中心董事总经理。历任美国花旗银行香港分行副总裁、深圳分行行长,美国运通银行台湾分行副总裁,台湾美国运通国际股份有限公司副总裁,渣打银行台湾分行总裁,深圳发展银行行长。

华民先生,独立董事。国籍:中国,1950年出生,复旦大学经济学博士,教授,博士生导师。现任复旦大学经济学院学术委员会主任,复旦大学世界经济研究所所长,兼任世界经济系主任。上海市人民政府决策咨询专家,中国世界经济学会副会长,"国家中长期科技发展规划战略研究"咨询专家,上海市国际友人协会副会长等。

周瑞金先生,独立董事。国籍:中国,1939年出生,复旦大学新闻系毕业。现任中国生产力学会副会长,上海生产力学会会长,中国社会科学院研究生院博士生导师,复旦大学新闻学院、北京广播学院兼职教授。1992年获国务院表彰为有突出贡献的专家学者,终身享受政府特殊津贴。历任《解放日报》记者、编辑、评论部主任、副总编辑、党委书记兼副总编辑,《人民日报》社副总编辑兼华东分社社长。

2、监事会成员

任瑞良先生,监事长。国籍:中国,1963年出生,大学学历,中国注册会计师。现任文汇新民联合报业集团投资公司副总经理。历任文汇新民联合报业集团财务中心财务主管,文汇新民联合报业集团投资公司财务主管、总经理助理等。

涂殷康先生,监事。国籍:中国,1970年1月出生,上海财经大学硕士研究生。现任东航金戎控股有限责任公司研发中心总经理,历任东航期货经纪有限责任公司部门经理、副总经理等。

李进安先生,监事。国籍:中国,1968年出生,金融学博士,中国注册会计师,律师资格。现任东方证券股份有限公司合规总监,兼任上海东方证券资产管理有限公司合规总监。历任君安证券南京业务部总经理,国泰君安证券股份有限公司江苏区总协调人,南京太平南路营业部总经理,总裁办公室、BPR办公室常务副主任,东吴证券有限责任公司总规划师、副总裁等职。

王静女士,职工监事,国籍:中国,1977年出生,中加商学院工商管理硕士。现任汇添富基金管理有限公司行政支持部总经理。曾任职于中国东方航空集团公司宣传部,东航金戎控股有限责任公司研究发展部。

林旋女士,职工监事,国籍:中国,1977年出生,华东政法学院法学硕士。现任汇添富基金管理有限公司稽核监察部高级稽核监察经理。曾任职于东方证券股份有限公司办公室。

3、高管人员

桂水发先生,董事长。（简历请参见上述董事会成员介绍）

林利军先生,总经理。（简历请参见上述董事会成员介绍）

李文先生,督察长。国籍:中国,1967年出生,厦门大学管理学博士,高级经济师,中国注册会计师。历任中国人民银行厦门市分行稽核监督处科员,中国人民银行杏林支行副行长,中国人民银行厦门中心支行银行管理处处长助理、金融机构监管二处副处长,东方证券股份有限公司稽核总部总经理、资金财务管理总部总经理等。

张晖先生,副总经理。国籍:中国,1971年出生,经济学硕士,历任申银万国研究所高级分析师、富国基金管理有限公司高级分析师、研究主管和基金经理。2005年4月加盟汇添富基金管理有限公司,现任公司副总经理、投资决策委员会副主席。

陈灿辉先生,副总经理。国籍:中国,1967年出生,大学本科,历任中国银行软件开发工程师,招银电脑有限公司证券基金事业部负责人,华夏基金管理有限公司资深高级经理,招商基金管理有限公司信息技术部总监、总经理助理。2008年7月加盟汇添富基金管理有限公司,现任公司副总经理、首席营运官。

4、基金经理

王珏池先生,国籍:中国,1974年出生,澳门科技大学管理学硕士,18年证券从业经验。曾任申银万国证券股份有限公司固定收益总部投资部经理。2005年4月加入汇添富基金管理有限公司任交易主管,2006年3月23日至今任汇添富货币市场基金的基金经理,2008年3月6日至2011年6月21日任汇添富增强收益债券型证券投资基金的基金经理,2011年6月17日至今任汇添富可转换债券债券型证券投资基金的基金经理。

5、投资决策委员会
主席:林利军先生（总经理）
副主席:张晖先生（副总经理）
成员:韩贤旺先生（研究总监）

6、上述人员之间不存在近亲属关系。

二、基金托管人

（一）基金托管人基本情况
名称:中国工商银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区复兴门内大街55 号
成立时间:1984 年1 月1 日
法定代表人:姜建清
注册资本:人民币349,018,545,827 元
联系电话:010-66105799
联系人:赵会军

（二）主要人员情况

截至2011年12月末,中国工商银行资产托管部共有员工145人,平均年龄30岁,95%以上员工拥有大学本科以上学历,高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

（三）基金托管业务经营情况

作为中国大陆托管服务的先行者,中国工商银行自1998年在国内首家提供托管服务以来,秉承"诚实信用、勤勉尽责"的宗旨,依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队,严格履行资产托管人职责,为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务,展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、安心账户资金、企业年金基金、QFII资产、QDII资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII专户资产、ESCROW等门类齐全的托管产品体系,同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务,可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至2011年12月,中国工商银行共托管证券投资基金231只,其中封闭式7只,开放式224只。自2003 年以来,本行连续八年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的28项最佳托管银行大奖;是获得奖项最多的国内托管银行,优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

三、相关服务机构

（一）基金份额发售机构
1、汇添富基金管理有限公司
（1）汇添富基金管理有限公司直销中心
住所:上海市黄浦区大沽路288号6幢538室
办公地址:上海市富城路99号震旦国际大楼21楼
法定代表人:桂水发
电话:（021）28932823
传真:（021）28932803
联系人:丛菲
客户服务电话:400-888-9918（免长途话费）
网址:www.99fund.com
（2）汇添富基金管理有限公司网上直销系统（trade.99fund.com）
2、代销机构
1）中国工商银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区复兴门内大街55号
法定代表人:姜建清
电话:010-66106912
传真:010-66107914
联系人:刘业伟
客户服务电话:95588
网址:www.icbc.com.cn
2）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:北京市东城区建国门内大街69号
法定代表人:项俊波
客户服务电话:95599
网址:www.abchina.com
3）中国建设银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区金融大街25号
办公地址:北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
法定代表人:郭树清
电话:010-66275654
传真:010-66275654
联系人:王琳
客服电话:95533
网址:www.ccb.com
4）交通银行股份有限公司
住所:上海市浦东新区银城中路188号
法定代表人:胡怀邦
电话:（021）58781234
传真:（021）58408483
联系人:曹榕
客户服务电话:95559
网址:www.bankcomm.com
5）招商银行股份有限公司
办公地址: 深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦
法定代表人:傅育宁
开放式基金咨询电话:95555
开放式基金业务传真:0755-83195049
联系人:邓炯鹏
网址:www.cmbchina.com
6）中信银行股份有限公司
注册地址:北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座
法定代表人: 孔丹
客服电话:95558
联系人:丰靖
电话:010-65557083
传真:010-65550827
网址:http://bank.ecitic.com
7）上海浦东发展银行股份有限公司
注册地址:上海市浦东新区浦东南路500号
办公地址:上海市中山东一路12号
法定代表人:吉晓辉
电话:（021）61618888
传真:（021）63604199
联系人:倪苏云、虞谷云
客户服务热线:95528
公司网站:www.spdb.com.cn
8）深圳发展银行股份有限公司
住所:广东省深圳市深南东路5047号深圳发展银行大厦
办公地址:广东省深圳市深南东路5047号深圳发展银行大厦
法定代表人:肖遂宁
电话:（0755）82088888
联系人:张青
客服电话:95501
公司网站:www.sdb.com.cn
9）中国民生银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区复兴门大街2号
办公地址:北京市西城区复兴门大街2号
法定代表人:董文标
电话:010-57092615
传真:010-57092611
联系人:董云巍
客户服务电话:95568
网址:www.cmbc.com.cn
10）北京银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区金融大街甲17号首层
办公地址:北京市西城区金融大街丙17号
法定代表人:闫冰竹
联系人:王曦
电话:010-66223584
传真:010-66226045
客户服务电话:95526
公司网站:www.bankofbeijing.com.cn
11）上海银行股份有限公司
注册地址:上海市浦东新区银城中路168号
办公地址:上海市浦东新区银城中路168号
法定代表人:宁黎明
开放式基金咨询电话:021-962888
开放式基金业务传真:021-68476111
联系人:张萍
联系电话:021-68475888
网址:www.bankofshanghai.com
12）宁波银行股份有限公司
注册地址: 宁波市鄞州区宁南南路700号
办公地址:宁波市鄞州区宁南南路700号
法定代表人: 陆华裕
开放式基金咨询电话:96528（上海、北京地区962528）
联系人: 胡技勋
联系电话:0574-89068340
传真:0574-87050024
网址:www.nbcb.com.cn
13）上海农村商业银行股份有限公司
注册地址:上海市浦东新区浦东大道981号
办公地址:上海市银城中路8号中融碧玉蓝天大厦15层
法定代表人:胡平西
联系人:吴海平
电话:021-38576666
传真:021-50105124
客服电话:021-962999
上海农商银行网站:www.srcb.com
14）杭州银行股份有限公司
注册地址:杭州市庆春路46号杭州银行大厦
办公地址:杭州市庆春路46号杭州银行大厦
法定代表人:吴太普
电话:0571-85108309
传真:0571-85151339
联系人:严峻
客户服务电话:0571-96523 400-8888-508
网址:www.hzbank.com.cn
15）渤海银行股份有限公司
注册地址:天津市河西区马场道201-205号
办公地址:天津市河西区马场道201-205号
法定代表人:刘宝凤
开放式基金咨询电话:400-888-8811
联系人:王宏
联系电话:022-58316666
传真:022-58316569
网址:www.cbhb.com.cn
16）天津银行股份有限公司
注册地址:天津市河西区友谊路15号
办公地址:天津市河西区友谊路15号
法定代表人:王金龙
联系人:杨森
电话:022-28405330
传真:022-28405631
客服电话:4006-960296
天津银行网站:www.bank-of-tianjin.com
17）爱建证券有限责任公司
注册地址:上海市南京西路758号23楼
办公地址:上海市南京西路758号20-25楼
法定代表人:郭林
电话:021-32229888
传真:021-62878783
联系人:陈敏
客户服务电话:021-63340678
网址:www.ajzq.com
18）安信证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元
办公地址:深圳市福田区深南大道2008号中国凤凰大厦1栋9层
法定代表人:牛冠兴
开放式基金咨询电话:0755-82558305
开放式基金业务传真:0755-82558355
联系人:陈剑虹
统一客服电话:4008001001
公司网站地址:www.essence.com.cn
19）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
电话:022-28451861
传真:022-28451892
联系人:王兆权
网址:www.bhzq.com
客户服务电话:400-6515-988
20）财富证券有限责任公司
住所:长沙市芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26楼
办公地址:长沙市芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26、27、28楼
法定代表人:周晖
咨询电话:0731-84403319
传真:0731-84403439
联系人:郭磊
网址:www.cfzq.com
21）长城证券有限责任公司
注册地址: 深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层
办公地址: 深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层
法定代表人: 黄耀华
电 话:0755-83516089
传 真:0755-83515567
22）长江证券股份有限公司
注册地址:武汉市新华路特8号长江证券大厦
法定代表人:胡运钊
客户服务热线:4008-888-999
联系人:李良
电话:027-65799999
传真:027-85481900
长江证券客户服务网站:www.95579.com
23）德邦证券股份有限公司
注册地址:上海市普陀区曹杨路510号南半幢9楼
办公地址:上海市浦东新区福山路500号城建国际中心26楼
法定代表人: 姚文平
开放式基金咨询电话:4008888128
开放式基金业务传真:021-68767032
联系人:叶蕾
联系电话:021-68761616-8522
网址:www.tebon.com.cn
24）第一创业证券股份有限公司
注册地址: 深圳市罗湖区笋岗路12号中民时代广场B座25层
办公地址: 深圳市罗湖区笋岗路12号中民时代广场B座25层
法定代表人:刘学民
开放式基金咨询电话:4008881888
开放式基金业务传真:0755-82485081
联系人:崔国良
联系电话:075525832852
网址:www.fcsc.cn
25）东北证券股份有限公司
注册地址:长春市自由大路1138号
办公地址:长春市自由大路1138号
法定代表人:矫正中
联系人: 潘锴
电话:0431-85096709
客户服务电话:4006000686 0431-85096733
网址:www.nesc.cn
26）东方证券股份有限公司
注册地址:上海市中山南路318号2号楼22层-29层
法定代表人:潘鑫军
联系人:吴宇
电话:021-63325888
传真:021-63326173
客户服务热线:95503
东方证券网站:www.dfzq.com.cn
27）东吴证券股份有限公司
注册地址:苏州工业园区翠园路181号商旅大厦18-21层
法定代表人:吴永敏
联系人:方晓丹
电话:0512-65581136
传真:0512-65588021
客服电话:0512-33396288
网址:www.dwzq.com.cn
28）方正证券股份有限公司
注册地址:湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦22-24层
公司地址:湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦22-24层
法定代表人:雷杰
全国统一客服热线:95571
方正证券网站:www.foundersc.com
29）光大证券股份有限公司
注册地址: 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: 徐浩明
联系人: 刘晨、李芳芳
电话: 021-22169999
传真: 021-22169134
客户服务电话: 4008888788、10108998
公司网址: www.ebscn.com
30）广发证券股份有限公司
法定代表人:林治海
注册地址:广州天河区天河北路183-187号大都会广场43楼（4301-4316房）
办公地址:广东省广州天河北路大都会广场5、18、19、36、38、41和42楼
联系人:黄岚
统一客户服务热线:95575或致电各地营业网点
开放式基金业务传真:（020）87555305
公司网站:广发证券网 http://www.gf.com.cn
31）广州证券有限责任公司
注册地址:广州市先烈中路69号东山广场主楼十七楼
办公地址:广州市先烈中路69号东山广场主楼十七楼
法定代表人:刘东
开放式基金咨询电话:020-961303
开放式基金业务传真:020-87325036
联系人:林洁茹
联系电话:020-87322668
32）国都证券有限责任公司
注册地址: 北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层
办公地址: 北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层
法定代表人:常喆
开放式基金咨询电话:400-818-8118
网址:www.guodu.com
33）国金证券股份有限公司
注册地址:成都市东城根上街95号
办公地址:成都市东城根上街95号
法定代表人:冉云
联系人:金喆
客户服务电话:400-660-0109
网址:www.gjzq.com.cn
34）国联证券股份有限公司
注册地址:江苏省无锡市县前东街168号
办公地址:江苏省无锡市县前东街168号国联大厦6-8楼
法定代表人:雷建辉
基金业务对外联系人:徐 欣
联系电话:0510-82831662
联系传真:0510-82830162
公司网址:www.glsc.com.cn
客服电话:4008885288
35）国泰君安证券股份有限公司
注册地址:上海市浦东新区商城路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:万建华
客户服务热线:4008888666
网址:www.gtja.com
36）国信证券股份有限公司
注册地址:深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层
法人代表人:何如
基金业务联系人:齐晓燕
电话:0755-82130833
传真:0755-82133952
全国统一客户服务电话:95536
公司网址:www.guosen.com.cn
37）海通证券股份有限公司
注册地址: 上海市淮海中路98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
客服电话:95553
公司网址:www.htsec.com
38）恒泰证券股份有限公司
注册地址:内蒙古呼和浩特市新城区新华东街111号
办公地址:内蒙古呼和浩特市新城区新华东街111号
法定代表人:庞介民
联系人:王旭华
联系电话:0471-4972343
网址:www.cnht.com.cn
39）宏源证券股份有限公司
注册地址:新疆乌鲁木齐市文艺路233号
办公地址: 北京市西城区太平桥大街19号
法定代表人:冯戎
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
40）红塔证券股份有限公司
注册地址:云南省昆明市北京路155号附1号红塔大厦9楼
办公地址:云南省昆明市北京路155号附1号红塔大厦9楼
邮政编码:650011
法定代表人:况雨林
电 话:0871-3577398
传 真:0871-3578827
41）华安证券股份有限公司
注册地址:安徽省合肥市长江中路357号
办公地址:安徽省合肥市阜南路166号润安大厦A座
法定代表人:李工
电话:0551-5161666
传真:0551-5161600
联系人:甘霖
客户服务电话:96518、400-80-96518
网址:www.hazq.com
42）华宝证券有限责任公司
注册地址:上海市陆家嘴环路166号未来资产大厦27层
办公地址:上海市陆家嘴环路166号未来资产大厦27层
法定代表人:陈林
联系人:毛雪梅
电话:021-50122222
传真:021-50122218
客户服务电话:400-820-9898
网址:www.cnhbstock.com
43）华福证券有限责任公司
注册地址:福州市五四路157号新天地大厦7、8层
办公地址:福州市五四路157号新天地大厦7至10层
法定代表人:黄金琳
邮政编码:350003
联系人:张腾
联系电话:0591-87383623
业务传真:0591-87383610
统一客户服务电话:96326（福建省外请先拨0591）。
公司网址:www.hfzq.com.cn
44）华龙证券有限责任公司
注册地址:甘肃省兰州市静宁路308号
办公地址:甘肃省兰州市静宁路308号
法定代表人:李晓安
联系人:李昕田
客服电话:0931-96668、400-689-8888
公司网址:www.hlzqgs.com
45）华泰联合证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区中心区中心广场香港中旅大厦第五层（01A、02、03、04）、17A、18A、24A、25A、26A
办公地址:深圳市福田中心区中心广场香港中旅大厦第5层、17层、18层、24层、25层、26层
法定代表人:马昭明
基金业务对外联系人:盛宗凌、庞晓芸
联系电话:0755-82492000
联系传真:0755-82492962
公司网址:www.lhzq.com
客服电话:95513
46）华泰证券股份有限公司
注册地址:江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦
办公地址:江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦
法定代表人:吴万善
联系人:程高峰、万鸣
客服电话: 95597
网址:www.htsc.com.cn
47）江海证券有限公司
住所:黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号
注册地址:黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号
办公地址:黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号
法定代表人:孙名扬
联系人:张宇宏
电话:0451-82336863
传真:0451-82287211
客户服务热线:400-666-2288
网址:www.jhzq.com.cn
48）金元证券股份有限公司
注册地址:海口市南宝路36号证券大厦4楼
办公地址: 深圳市深南大道4001号时代金融中心17层
法定代表人:陆涛
联系电话:0755-83025666
传真:0755-83025625
联系人:马贤清
联系电话:0755-83025022
传真:0755-83025625
客服电话:400-8888-228
公司网站:www.jyzq.cn
49）中国民族证券有限责任公司
注册地址:北京市西城区金融街5号新盛大厦A座6-9层
办公地址:北京市西城区金融街5号新盛大厦A座6-9层
法定代表人: 赵大建
开放式基金咨询电话: 400-889-5618
联系人:李微
联系电话:010-59355941
传真:010-66553791
网址:www.e5618.com
50）平安证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区金田路大中华国际交易广场8楼
办公地址:深圳市福田区金田路大中华国际交易广场8楼（518048）
法定代表人:杨宇翔
全国免费业务咨询电话:95511-8
开放式基金业务传真:0755-82400862
联系人:郑舒丽 （zhengshuli001@pingan.com.cn,0755-22626391）
网址:http://www.pingan.com
51）齐鲁证券有限公司
注册地址:山东省济南市市中区经七路86号
办公地址:山东省济南市市中区经七路86号
法定代表人:李玮
联系人:吴阳
电话:0531-68889155
传真:0531-68889752
客服电话:95538
网址:www.qlzq.com.cn
52）日信证券有限责任公司
注册地址: 呼和浩特市新城区锡林南路18号
联络地址: 呼和浩特市新城区锡林南路18号
法定代表人:孔佑杰
联系人:陈韦杉
联系电话:010-88086830-730
网址:www.rxzq.com.cn
53）上海证券有限责任公司
注册地址:上海西藏中路336号
法定代表人:郁忠民
联系人:张瑾
客户服务电话:（021）962518、4008918918（全国热线）
公司网站:www.962518.com
54）申银万国证券股份有限公司
注册地址:上海市常熟路171号
办公地址:上海市常熟路171号
法定代表人:丁国荣
电话:021-54033888
传真:021-54038844
客服电话:95523或4008895523
电话委托:021-962505
网址:www.sywg.com
55）万联证券有限责任公司
注册地址:广州市中山二路18号电信广场36、37层
办公地址:广州市中山二路18号电信广场36、37层
法定代表人:张建军
开放式基金咨询电话:400-8888-133
开放式基金接收传真:020-22373718-1013
联系人:罗创斌
联系电话:020-37865070
邮箱:luocb@wlzq.com.cn
网址:www.wlzq.com.cn
56）西南证券股份有限公司
住所:重庆市江北区桥北苑8号
办公地址:重庆市江北区桥北苑8号西南证券大厦
法定代表人:王珠林
客户服务电话:4008-096-096
网址:www.swsc.com.cn
57）厦门证券有限公司
地址:厦门市莲前西路2号
客户服务电话:0592-5163588
公司网址:www.xmzq.cn
58）湘财证券有限责任公司
注册地址:长沙市黄兴中路63号中山国际大厦12楼
办公地点:湖南省长沙市天心区湘府中路198号标志商务中心A栋11层
法定代表人:林俊波
电话:021-68634518
传真:021-68865680
联系人:钟康莺 021-68634518-8503
客服电话:400-888-1551
公司网址:www.xcsc.com
59）信达证券股份有限公司
注册（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:高冠江
联系人:唐静
联系电话:010-63081000
传真:010-63080978
客服电话:400-800-8899
公司网址:www.cindasc.com
60）兴业证券股份有限公司
注册地址:福州市湖东路268号
邮政编码:350003
法定代表人:兰荣
注册资金:22亿元人民币
办公地址:浦东新区民生路1199弄证大五道口广场1号楼21层
邮政编码:200135
客服电话:4008888123
业务联系电话:021-38565785
业务联系人:谢高得
兴业证券公司网站（www.xyzq.com.cn）
61）银河证券有限责任公司
注册地址:北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座
办公地址:北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座
法定代表人:顾伟国
开放式基金咨询电话:4008-888-888
开放式基金业务传真:010-83574078
联系人: 田薇
联系电话:010-66568430
网址:www.chinastock.com.cn
62）招商证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区益田路江苏大厦A座38—45层
法定代表人:宫少林
电话:0755-82943666
传真:0755-82943636
联系人:林生迎
客户服务电话:95565、4008888111
公司网址:www.newone.com.cn
63）浙商证券有限责任公司
住所:浙江省杭州市杭大路1号黄龙世纪广场A区6-7层
办公地址:浙江省杭州市杭大路1号黄龙世纪广场A区6-7层
电话: 0571-87901908、0571-87901053
传真:0571-87901913
联系人:刘虹、谢项辉
客户服务电话:0571-967777
公司网址:www.stocke.com.cn
64）中航证券有限责任公司
注册地址:江西省南昌市抚河北路291号
办公地址:江西省南昌市抚河北路291号
法定代表人:杜航
电话:0791-6768681
联系人:戴蕾
客户服务电话:400-8866-567
网址:www.avicsec.com
65）中国中投证券有限责任公司
注册地址: 深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋第18层-21层及第04层01、02、03、05、11、12、13、15、16、18、19、20、21、22、23单元
办公地址:深圳市福田区益田路6003号荣超商务中心A栋第04、18层至21层
法定代表人:龙增来
联系人:刘毅
电话:0755-82023442
传真:0755-82026539
网址:www.cjis.cn
客服电话:400-600-8008
66）中信建投证券股份有限公司
注册地址:北京市朝阳区安立路66号4号楼
办公地址:北京市朝阳门内大街188号
法定代表人:王常青
基金业务对外联系人:权唐
联系电话:400-8888-108
联系传真:010-65182261
公司网址:www.csc.com.cn
客服电话:400-8888-108
67）中信证券（浙江）有限责任公司
注册地址:浙江省杭州市滨江区江南大道588号恒鑫大厦主楼19、20层
办公地址:浙江省杭州市滨江区江南大道588号恒鑫大厦主楼19、20层
法人代表:沈强
联系人:丁思聪
联系电话:0571-96598
公司网站:www.bigsun.com.cn
68）中信万通证券有限责任公司
注册地址: 青岛市崂山区苗岭路29号澳柯玛大厦15层（1507至1510室）
法定代表人: 史洁民
电话:0532-85022026
传真:0532-85022026
联系人: 丁韶燕
客户服务电话:0532-96577
公司网址:www.zxwt.com.cn
69）中信证券股份有限公司
住址:深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦A层
法定代表人:王东明
电话:010-84588888
传真:010-84865560
联系人:陈忠
公司网址:www.ecitic.com
70）中原证券股份有限公司
注册地址:郑州市郑东新区商务外环路10号
办公地址:郑州市郑东新区商务外环路10号
法定代表人:石保上
联系人:程月艳、耿铭
联系电话:0371—65585670
联系传真:0371--65585665
客服电话:967218（郑州市外客户需要加拨区号）、400-813-9666
网址:www.ccnew.com
71）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 邮编:100132
办公地址: 北京市西城区金融街5号新盛大厦B座4层 邮编:100133
法定代表人:林义相
联系电话: 010-66045608
客服电话: 010-66045678
传真: 010-66045500
联系人:林爽
天相基金网网址:http://jijin.txsec.com
72）五矿证券有限公司
注册地址:深圳市福田区金田路4028号荣超经贸中心办公室47层01单元
办公地址:深圳市福田区金田路4028号荣超经贸中心办公室47层01单元
法定代表人:高竹
电 话:0755-82545555

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基金,并及时公告。

（二）注册登记机构
名称:汇添富基金管理有限公司
住所:上海市黄浦区大沽路288号6幢538室
办公地址:上海市富城路99号震旦国际大楼21楼
法定代表人:桂水发
电话:（021）28932888
传真:（021）28932998
联系人:王小练

（三）律师事务所和经办律师
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
负责人:韩炯
电话:（021）31358666
传真:（021）31358600
经办律师:吕红、李永波
联系人:吕红

（四）会计师事务所和经办注册会计师
名称:安永华明会计师事务所
法定代表人:葛明
住所:北京市东城区东长安街1号东方广场东方经贸城安永大楼16层
办公地址:北京市东城区东长安街1号东方广场东方经贸城安永大楼16层
邮政编码:100738
公司电话:（010）58153000
公司传真:（010）85188298
签章会计师:徐艳、汤骏
业务联系人:汤骏

四、基金的名称

本基金名称:汇添富可转换债券债券型证券投资基金。

五、基金的类型

本基金为契约型开放式债券型基金

六、基金的投资目标

本基金重点投资于可转换债券（含可分离交易可转债）,努力在控制投资组合下方风险的基础上实现基金资产的长期稳健增值。

七、基金的投资方向

本基金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（包括中小板、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）。

本基金主要投资于固定收益类金融工具,包括国内依法发行、上市的国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、可转换债券（含可分离交易可转债）、债券回购、短期融资券、次级债、资产支持证券以及经法律法规或中国证监会允许投资的其他固定收益类金融工具。本基金可投资于一级市场新股申购、持有可转换债券、可交换债券转股所得的股票以及权证等中国证监会允许基金投资的其它金融工具,也可直接从二级市场上买入股票和权证。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。

基金的投资组合比例为: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%,其中对可转换债券（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%;非固定收益类资产的比例合计不超过基金资产的20%。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%。

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、基金的投资策略

（一）投资策略

1、资产配置和类属资产配置策略

本基金80%以上的基金资产投资于固定收益类金融工具,并在严格控制风险的基础上,通过对全球经济形势、中国经济发展（包括宏观经济运行周期、财政及货币政策、资金供需情况）、证券市场估值水平等的研判,适度参与权益类资产配置,适度把握市场时机力争为基金资产获取稳健回报。

类属资产配置由本基金管理人根据宏观经济分析、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。

2、可转换债券投资策略

基于行业分析、企业基本面分析和可转换债券估值模型分析,并结合市场环境情况等,本基金在一、二级市场投资可转换债券,以达到在严格控制风险的基础上,实现基金资产稳健增值的目的。

（1）行业配置策略

可转换债券有别于一般债券,其自身含有的期权价值与公司股票价格走势、波动率水平等密切相关。本基金将采用"自上而下"的分析方法,综合考虑各种宏观因素,以实现最优的行业配置。

本基金将根据宏观经济走势、经济周期,以及阶段性市场投资主题的变化,综合考虑宏观调控目标、产业结构调整等因素,精选成长前景明确或受益政策扶持的行业内公司发行的可转换债券进行投资布局。另外,由于宏观经济所处的时期和市场发展的阶段不同,不同行业的可转换债券也将表现出不同的风险收益特征。在经济复苏的初期,持有资源类行业的可转换债券将获得良好的投资收益;而在经济衰退时期,持有防御类非周期行业的可转换债券,将获得更加稳定的收益。

（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,达到分享正股上涨收益的目的。

理论价值分析策略是指本基金将结合可转换债券的条款,根据其标的股票股价的波动率水平、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走势、债券市场供求关系、市场资金面情况、物价水平预期紧密相关;期权价值主要与发债主体的行业发展前景、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、分红率越高、剩余期限越长,可转换债券的期权价值就越高。

此外,可转换债券一般设置提前赎回、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,可转换债券的价值可表达为:

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

在实际操作中,本基金管理人将运用BS模型以及蒙特卡洛模型等方法,计算可转换债券的理论价值。本基金将首先利用无风险利率和违约风险溢酬贴现的方法计算定价时点的纯债价值;再结合可转换债券设置的提前赎回、向下修正转股价、提前回售等条款,用BS公式计算出其隐含的期权价值;两者相加即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。

可转换债券理论价值计算流程

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。本基金将持续跟踪可转换债券市场的供求变化、流动性以及估值溢价水平,判断转股溢价率和纯债溢价率,从而挑选出具有投资价值的可转换债券。

（3）转股策略

在转股期内,当本基金所持有可转换债券市场交易价格显著低于转股平价时,即转股溢价率明显为负时,本基金将通过转股并卖出股票以实现收益;当可转换债券流动性不能满足组合需求时,本基金将通过转股来保障基金财产的流动性;当正股价格上涨且满足提前赎回触发条件时,本基金将首先通过转股来锁定已有收益,并进一步分析正股未来的价格走势,做出继续持有正股或立即卖出的决定。

（4）条款博弈策略

国内可转换债券一般设置提前赎回、向下修正转股价、提前回售等条款,其中赎回条款赋予发行人提前赎回可转换债券的权力,修正条款赋予发行人向下修正转股价格的权力,回售条款赋予投资者将可转换债券回售给发行人的权利,这些条款将对可转换债的价值产生影响。例如,当正股价格持续低于转股价达到一定程度,如发行人向下修正转股价,则可转换债券的转股价值得到大幅提高,同时降低了未来由于正股价格下降带来的可能损失。

本基金将深入分析公司基本面,包括经营状况和财务状况,预测其未来发展战略和融资需求,结合流动性、到期收益率、纯债溢价率等因素,充分发掘这些条款给可转换债券带来的投资机会。

（5）套利策略

本基金将密切关注以下两种套利机会:1）在可转换债券的转股期内,当转换溢价率为负时,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;2）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。

本基金将在严格控制风险的基础上,争取获得更大的套利收益。

3、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。可分离交易可转债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征,甚至也可以构造出类可转换债券品种。

可分离交易可转债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适时进行动态调整。

4、普通债券投资策略

本基金将采取利率策略、信用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。其中利率策略是指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;信用策略是指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;个券选择策略是指通过自上而下和自下而上相结合的研究方法,形成具体的投资策略。

5、股票投资策略

（1）新股申购

在国内股票市场上,股票供求关系不平衡经常使得新股上市后的二级市场价格高于其发行价,从而使得新股（IPO和增发等）申购成为一种风险较低的投资方式。本基金将研究首次发行股票及增发新股的上市公司基本面因素,根据股票市场整体定价水平,估计新股上市交易的合理价格,同时参考一级市场资金供求关系,最终制定相应的新股申购策略。本基金通过参与新股认购所获得的股票,将根据其上市后的二级市场价格相对于其合理内在价值的高低,确定继续持有或者卖出。

（2）个股精选

在股票投资中,采用"自下而上"的策略,精选出具有持续竞争优势且估值有吸引力的股票,精心科学构建股票投资组合,并辅以严格的投资组合风险控制,以获得当期的较高投资收益。

本基金精选组合成份股的过程具体分为二个层次进行:第一层次,企业竞争优势评估。通过深入的案头分析和实地调研,发现在经营中具有一个或多个方面的持续竞争优势（如公司治理优势、管理层优势、生产优势、市场优势、技术优势、政策性优势等）、管理出色且财务透明稳健的企业;第二层次,估值精选。基于定性定量分析、动态静态指标相结合的原则,采用内在价值、相对价值、收购价值相结合的估值方法,选择股价没有充分反映价值的股票进行投资及组合管理。只要一个企业保持和提升它的竞争优势,本基金就作长期投资。如果一个企业丧失了它的竞争优势或它的股价已经超过其价值,本基金就将其出售。

6、资产证券化产品投资策略

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分析,评估其相对投资价值并作出相应的投资决策,以在控制风险的前提下尽可能的提高本基金的收益。

7、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。

未来,随着证券市场的发展、金融工具的丰富和交易方式的创新等,基金还将积极寻求其他投资机会,履行适当程序后更新和丰富组合投资策略。

8、其他衍生工具投资策略

本基金将密切跟踪国内各种衍生产品的动向,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,同时结合对衍生工具的研究,在充分考虑衍生产品风险和收益特征的前提下,谨慎进行投资。本基金将按照相关法律法规通过利用其他衍生金融工具进行套利、避险交易,控制基金组合风险,并通过灵活运用趋势投资策略获取超额收益。

（二）投资决策依据和投资程序

1、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;
（2）国内外宏观经济形势及对中国债券市场的影响;
（3）国家货币政策及债券市场政策;
（4）商业银行的信贷扩张;
（5）可转换债券市场的基本情况。

2、投资决策机制

本基金实行投资决策团队制,强调团队合作,充分发挥集体智慧。本基金管理人将投资和研究职能整合,设立了投资研究部,策略分析师、固定收益分析师、金融工程小组和基金经理,充分发挥主观能动性,渗透到投资研究的关键环节,群策群力,为基金份额持有人谋取中长期稳定的较高投资回报。

3、投资决策程序

本基金具体的投资决策机制与流程为:
（1）宏观分析师根据宏观经济形势、物价形势、货币政策等判断市场利率的走向,提交策略报告。
（2）债券策略分析师提交关于债券市场基本面、债券市场供求、收益率曲线预测的分析报告。
（3）信用分析师负责信用风险的评估、信用利差的分析及信用评级的调整。
（4）数量分析师对衍生产品和创新产品进行分析。
（5）在分析研究报告的基础上,基金经理提出月度投资计划并提交投资决策委员会审议。
（6）投资决策委员会审议基金经理提交的投资计划。
（7）如审议通过,基金经理在考虑资产配置的情况下,挑选合适的债券品种,灵活采取各种策略,构建投资组合。
（8）集中交易室执行交易指令。

（三）投资限制

1、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益,本基金禁止从事下列行为:
（1）承销证券;
（2）向他人贷款或提供担保;
（3）从事承担无限责任的投资;
（4）买卖其他基金份额,但法律法规或中国证监会另有规定的除外;
（5）向基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或债券;
（6）买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券;
（7）从事内幕交易、操纵证券价格及其他不正当的证券交易活动;
（8）当时有效的法律法规、中国证监会及《基金合同》规定禁止从事的其他行为。

如法律法规或监管部门取消上述禁止性规定,本基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制。

2、投资组合限制

本基金的投资组合将遵循以下限制:
（1）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%,其中可转换债券（含分离交易可转债）的比例不低于固定收益资产的80%;非固定收益类资产的比例合计不超过基金资产的20%。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%;
（2）持有一家上市公司的股票,其市值不得超过基金资产净值的10%;
（3）本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券,不得超过该证券的10%;
（4）本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%;在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为1年,债券回购到期后不展期;
（5）本基金在任何交易日买入权证的总金额,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%,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%。法律法规或中国证监会另有规定的,遵从其规定;
（6）现金或到期日不超过1年的政府债券不低于基金资产净值的5%;
（7）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%;本基金应投资于信用级别评级为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;
（8）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%;
（9）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%;
（10）本基金财产参与股票发行申购,所申报的金额不得超过本基金的总资产,所申报的股票数量不得超过拟发行股票公司本次发行股票的总量;
（11）一只基金持有一家公司发行的流通受限证券,其市值不得超过基金资产净值的百分之三;一只基金持有的所有流通受限证券,其市值不得超过该基金资产净值的百分之十五;经基金管理人和托管人协商,可对以上比例进行调整;
（12）本基金不得违反《基金合同》关于投资范围、投资策略和投资比例的约定;
（13）相关法律法规以及监管部门规定的其它投资限制。

《基金法》及其他有关法律法规或监管部门取消上述限制的,履行适当程序后,基金不受上述限制。

基金管理人应当自基金合同生效日起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。基金托管人对基金的投资的监督和检查自《基金合同》生效日起开始。

由于证券市场波动、上市公司合并或基金规模变动等基金管理人之外的原因导致的投资组合不符合上述约定的比例不在限制之内,但基金管理人应在10个交易日内进行调整,以达到标准。法律法规另有规定的从其规定。

九、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为:天相转债指数收益率×70%+中债综合指数收益率×20%+沪深300指数收益率×10%

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未转股规模帕氏加权计算,反映两市可转债的总体走势。天相转债指数的基期为1999年12月30日,是国内较早编制的可转债指数。

中债综合指数是中国全市场债券指数,以2001年12月31日为基期,基点为100点,并于2002年12月31日起发布。中债综合指数的样本具有广泛的市场代表性,其样本范围涵盖银行间市场和交易所市场,成分债券包括国债、企业债券、央行票据等所有主要债券种类。

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地反映本基金的风险收益特征。如果今后法律法规发生变化,或者有更权威的、更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基准的指数时,本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。

十、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较低预期风险、较低预期收益的品种,其预期风险收益水平高于货币市场基金,低于混合型基金及股票型基金。

十一、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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2011年10月24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。本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2011年7月1日起至9月30日止。

投资组合报告

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	22,923,533.35	3.17
	其中:股票	22,923,533.35	3.17
2	固定收益投资	387,157,084.72	53.55
	其中:债券	387,157,084.72	53.55
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	246,700,690.05	34.13
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	64,125,572.34	8.87
6	其他资产	2,023,467.21	0.28
7	合计	722,930,347.67	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	采掘业	11,240,000.00	1.62
C	制造业	7,133,533.35	1.03
C0	食品、饮料	188,493.51	0.03
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	1,680,589.84	0.24
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	1,322,900.00	0.19
C8	医药、生物制品	3,941,550.00	0.57
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	3,780,000.00	0.55
H	批发和零售贸易	770,000.00	0.11
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	22,923,533.35	3.31

（下转B22版）