

# 兴全保本混合型证券投资基金更新招募说明书摘要

基金管理人：兴业全球基金管理有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

二〇一六年九月

## 【重要提示】

本基金于 2011 年 4 月 11 日经中国证监会证监许可[2011]522 号文核准募集。本基金基金合同于 2011 年 8 月 3 日起正式生效，自该日起兴业全球基金管理有限公司（以下简称“本基金管理人”）正式开始管理本基金。

本招募说明书摘要是根据《兴全保本混合型证券投资基金基金合同》和《兴全保本混合型证券投资基金更新招募说明书》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。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务；基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅本基金的基金合同。

本基金作为保本混合型基金，将会有部分基金资产投资于股票市场，基金份额净值会随股票市场的变化而上下波动。投资者投资于本基金并不等于将资金作为存款存放在银行或存款类金融机构，本基金在极端情况下仍然存在本金损失的风险。在一个保本周期内，对于投资人认购并持有到期的基金份额，存在着仅能收回认购金额（包括净认购金额和认购费用）的可能性；对于投资人在日常申购的基金份额，存在着仅能部分收回本金的可能性。对于基金份额持有人未持有到期的基金份额，在赎回时不能获得保本保证，将承担市场波动的风险。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资人在投资本基金前，需充分了解本基金的产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，并承担基金投资中出现的各类风险，包括市场风险，管理风险、流动性风险、合规性风险、操作和技术风险以及本基金特有的风险（详见本招募说明书中“风险揭示”章节）等。本基金可投资于中小企业私募债券，由于中小企业私募债券不能公开交易，一般情况下，交易不活跃，潜在较大流动性风险。当发债主体信用质量恶化时，受市场流动性所限，本基金可能无法卖出所持有的

中小企业私募债券，由此可能给基金净值带来更大的负面影响和损失。巨额赎回风险是开放式基金所特有的一种风险，本基金为定期开放基金，即当单个开放日基金的净赎回申请超过前一工作日基金总份额的百分之二十时，投资人将可能无法及时获得所有的赎回款项。

投资有风险，投资者认购（或申购）基金时应认真阅读本基金的基金合同、招募说明书，全面认识本基金产品的风险收益特征，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要承担相应风险，包括市场风险、管理风险、流动性风险、本基金特定风险、操作或技术风险、合规风险等。在投资者作出投资决策后，基金投资运作与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责。

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

本更新招募说明书所载内容截止日 2016 年 8 月 2 日（特别事项注明除外），有关财务数据和净值表现摘自本基金 2016 年第 2 季度报告，数据截止日为 2016 年 6 月 30 日（财务数据未经审计）。本基金托管人兴业银行股份有限公司已复核了本次更新的招募说明书。

## 目 录

第一部分 基金管理人	4
第二部分 基金托管人	13
第三部分 相关服务机构	16
第四部分 基金的名称	32
第五部分 基金的类型	33
第六部分 保本	33
第七部分 保本的保证	35
第八部分 基金的投资目标	40
第九部分 基金的投资方向	40
第十部分 基金的投资策略及投资组合管理	40
第十一部分 基金的业绩比较基准	47
第十二部分 基金的风险收益特征	48
第十三部分 转型后“兴全精选股票型证券投资基金”的投资目标、范围、理念、策略	48
第十四部分 基金的投资组合报告	52
第十五部分 基金的业绩	55
第十六部分 基金费用与税收	56
第十七部分 对招募说明书更新部分的说明	58

## 第一部分 基金管理人

### 一、基金管理人概况

机构名称：兴业全球基金管理有限公司

成立日期：2003年9月30日

住所：上海市黄浦区金陵东路368号

办公地址：上海市张杨路500号时代广场20楼

法定代表人：庄园芳

联系人：冯晓莲

联系电话：021-20398888

组织形式：有限责任公司

注册资本：人民币1.5亿元

兴业全球基金管理有限公司（以下简称“公司”或“本公司”）经证监基金字[2003]100号文批准于2003年9月30日成立。2008年1月2日，中国证监会批准（证监许可[2008]6号）了公司股权变更申请，全球人寿保险国际公司（AEGON International B.V）受让本公司股权并成为公司股东。股权转让完成后，兴业证券股份有限公司的出资占注册资本的51%，全球人寿保险国际公司的出资占注册资本的49%。同时公司名称由“兴业基金管理有限公司”更名为“兴业全球人寿基金管理有限公司”，公司注册资本由9800万元变更为12000万元人民币。2008年7月7日，经中国证监会批准（证监许可[2008]888号文），公司名称由“兴业全球人寿基金管理有限公司”变更为“兴业全球基金管理有限公司”，同时，公司注册资本由人民币1.2亿元变更为人民币1.5亿元，其中两股东出资比

例不变。

截至 2016 年 8 月 2 日，公司旗下管理着兴全可转债混合型证券投资基金、兴全趋势投资混合型证券投资基金（LOF）、兴全货币市场证券投资基金、兴全全球视野股票型证券投资基金、兴全社会责任混合型证券投资基金、兴全有机增长灵活配置混合型证券投资基金、兴全磐稳增利债券型证券投资基金、兴全合润分级混合型证券投资基金、兴全沪深 300 指数增强型基金（LOF）、兴全绿色投资混合型证券投资基金（LOF）、兴全保本混合型证券投资基金、兴全轻资产投资混合型证券投资基金（LOF）、兴全商业模式优选混合型证券投资基金（LOF）、兴全添利宝货币市场基金、兴全新视野灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金、兴全稳益债券型证券投资基金、兴全天添益货币市场基金共 17 只基金。

兴业全球基金管理有限公司总部位于上海，在北京、深圳设有分公司，并成立了全资子公司——上海兴全睿众资产管理有限公司。公司总部下设投资决策委员会、风险管理委员会、综合管理部、财务室、监察稽核部、运作保障部、基金管理部、固定收益部、研究部、专户投资部、新三板投资部、金融工程与专题研究部、交易室、市场部、渠道部、机构业务部、电子商务部、客户服务中心，随着公司业务发展的需要，将对业务部门进行适当的调整。

## 二、主要人员情况

### 1、董事、监事概况

庄园芳女士，董事长，1970 年生，高级工商管理硕士、经济师。1992 年 9 月加入兴业证券，历任交易业务部干部、交易业务部总经理助理、交易业务部负责人、证券投资部副总经理、证券投资部总经理、投资总监、副总裁。现任兴业全球基金公司董事长，同时兼任兴业证券股份有限公司副总裁、兴业创新资本管理有限公司董事、兴证（香港）金融控股有限公司董事、兴证投资管理有限公司执行董事。

郑城美先生，董事，1974 年生，中共党员，EMBA。曾任兴业证券股份有限公司南平滨江路营业部副总经理（主持工作）、兴业证券股份有限公司计划财务部副总经理、总经理，及兴业证券股份有限公司财务总监（财务负责人）兼计划财务部总经理等职务。现任兴业证券股份有限公司副总裁。

万维德先生（Marc van Weede），董事，1965 年出生，荷兰国籍，经济学硕士。历任 Forsythe International B.V. 财务经理，麦肯锡公司全球副董事，海康人寿保险有限公司总经理。现任全球人寿保险集团执行副总裁。

巴斯蒂安·范布伦先生（Bastiaan Van Buuren），董事，1971 年生，荷兰国籍，经济学硕士。曾任荷兰国际集团（ING）投资管理公司亚洲区客户发展部门负责人

人、亚太区机构业务负责人、新加坡公司首席执行官、亚洲固定收益投资经理等职务。现任 AEGON 资产管理公司亚洲区负责人。

桑德·马特曼先生 (Sander Maatman)，董事，1969 年生，荷兰国籍，硕士。曾任荷兰 Robeco 鹿特丹投资公司固定收益经理，Aegon 投资管理公司固定收益经理及产品发展部总监、Aegon 银行财务总监、Aegon 荷兰风险与资本管理负责人等职务。现任 Aegon 资产管理公司首席财务官。

杨东先生，董事兼总经理，1970 年生，高级工商管理硕士。历任福建兴业证券公司上海业务部总经理助理，证券投资部副总经理兼上海业务部副总经理，兴业证券股份有限公司证券投资部总经理，兴业证券股份有限公司总裁助理、投资总监。现任兴业全球基金管理有限公司董事兼总经理。

欧阳辉先生，独立董事，1962 年生，美国国籍，获美国加州大学伯克利分校金融学博士和美国杜兰大学化学物理学博士学位。曾任雷曼兄弟公司、野村证券及瑞士银行的董事总经理。曾被美国北卡大学授予终生教职和任美国杜克大学副教授。现任长江商学院金融学杰出院长讲席教授。

吴明先生，独立董事，1977 年生，法学双学士，具有中国律师资格、英格兰及威尔士高等法院律师资格。曾任上海汇盛律师事务所律师，上亚太长城律师事务所律师，北京中咨律师事务所上海分所合伙人。现任北京大成（上海）律师事务所合伙人。

周鹤松先生，独立董事，1968 年生，工商管理硕士。曾任日本学术振兴会研究员，三菱信托银行职员，通用电器资本公司风险管理领导力项目成员。现任 DAC 财务管理（中国）有限公司合伙人及董事经理。

杜建新先生，监事，1959 年生，高级工商管理硕士，经济师。历任江西财经大学情报资料中心主任，中国银行三明分行办公室副主任，兴业证券股份有限公司三明营业部副总经理、上海管理总部总经理、人力资源部总经理，兴业全球基金管理有限公司督察长，兴业证券股份有限公司董事会秘书兼人力资源部总经理。

陈育能女士，监事，1974 年生，工商管理硕士。历任民航快递财务会计助理经理，KPMG 助理经理，新加坡 Prudential 担保公司财务经理，SunLife Everbright 人寿保险财务计划报告助理副总裁。现任同方全球人寿保险有限公司副总裁、首席财务官。

秦杰先生，职工监事，1981 年生，经济学硕士。历任毕马威企业咨询有限公司内部审计、风险管理与合规咨询服务部门高级经理、负责人，德勤华永会计师事务所高级咨询顾问等职务。现任兴业全球基金管理有限公司监察稽核部总监兼综合管理部总监。

李小天女士，职工监事，1982年生，工商管理硕士。历任《南方日报》、《南方都市报》记者，兴业全球基金管理有限公司市场部总监助理。现任兴业全球基金管理有限公司市场部副总监。

## 2、高级管理人员概况

杨东先生，董事兼总经理，1970年生，高级工商管理硕士。历任福建兴业证券公司上海业务部总经理助理，证券投资部副总经理兼上海业务部副总经理，兴业证券股份有限公司证券投资部总经理，兴业证券股份有限公司总裁助理、投资总监。现任兴业全球基金管理有限公司董事兼总经理。

冯晓莲女士，督察长，1964年生，中共党员，高级工商管理硕士、高级经济师。先后就职于新疆兵团组织部、新疆兵团驻海南办事处、海南国际信托公司，历任兴业银行党办副科长，兴业证券股份有限公司人力资源部副总经理、人力资源部总经理、合规与风险管理部总经理，兴业全球基金管理有限公司总经理助理。现任兴业全球基金管理有限公司督察长。

杨卫东先生，副总经理，1968年生，中共党员，法学学士。历任陕西团省委组织部科员，海南省省委台办接待处科员，海通证券股份有限公司海口营业部负责人、大连分公司总经理，兴业证券股份有限公司资产管理部副总经理，上海凯业集团公司总裁，兴业全球基金管理有限公司总经理助理兼市场部总监、副总经理兼市场部总监。现任兴业全球基金管理有限公司副总经理。

董承非先生，副总经理，1977年生，理学硕士。历任兴业全球基金管理有限公司研究部行业研究员、兴全趋势投资混合型证券投资基金（LOF）基金经理助理、兴全商业模式优选混合型基金（LOF）基金经理、兴全全球视野股票型证券投资基金基金经理、上海兴全睿众资产管理有限公司执行董事。现任兴业全球基金管理有限公司副总经理、基金管理部投资总监兼兴全趋势投资混合型证券投资基金（LOF）基金经理、兴全新视野灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金基金经理。

傅鹏博先生，副总经理，1963年生，经济学硕士。历任上海财经大学经济管理系讲师，申银万国证券股份有限公司企业融资部经理，东方证券股份有限公司资产管理部负责人、研究所首席策略师，汇添富基金管理有限公司首席策略师，兴业全球基金管理有限公司兴全绿色投资混合型证券投资基金（LOF）基金经理、总经理助理、基金管理部副总监、金融工程与专题研究部总监。现任兴业全球基金管理有限公司副总经理兼研究部总监、兴全社会责任混合型证券投资基金基金经理。

郑文惠女士，副总经理，1969年生，EMBA。历任兴业证券泉州营业部财务部经理、

副总经理、总经理，运营管理部总经理兼上海分公司副总经理，运营管理部总经理兼上海分公司总经理，私人财富管理总部总经理兼上海分公司总经理。现任兴业全球基金管理有限公司副总经理兼上海兴全睿众资产管理有限公司执行董事。

### 3、本基金基金经理

张亚辉女士，工商管理硕士，曾任职于芜湖市商业银行，2005年6月加入兴业全球基金管理有限公司，历任渠道经理、财务会计、固定收益交易员、专户投资部投资经理。现任兴全可转债混合型证券投资基金（2015年7月13日起至今）、兴全保本混合型证券投资基金基金经理（2015年11月2日起至今）。

本基金历任基金经理：

肖娟女士，于2011年8月3日至2012年3月2日期间担任本基金基金经理。

张睿女士，于2013年7月11日至2014年7月23日期间担任本基金基金经理。

杨云先生，于2011年8月3日至2015年7月10日期间担任本基金基金经理。

毛水荣先生，于2014年7月23日至2015年12月14日期间担任本基金基金经理。

### 4、投资决策委员会成员

本基金采用投资决策委员会领导下的基金经理负责制。投资决策委员会成员由5人组成：

杨东 兴业全球基金管理有限公司董事兼总经理

傅鹏博 兴业全球基金管理有限公司副总经理助理兼研究部总监、兴全社会责任混合型证券投资基金基金经理

董承非 兴业全球基金管理有限公司副总经理兼基金管理部投资总监，兴全趋势投资混合型证券投资基金（LOF）基金经理、兴全新视野灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金基金经理

吴圣涛 兴业全球基金管理有限公司基金管理部副总监兼兴全商业模式优选混合型证券投资基金（LOF）基金经理、兴全全球视野股票型证券投资基金基金经理

谢治宇 兴业全球基金管理有限公司基金管理部副总监兼兴全轻资产投资混合型证券投资基金（LOF）基金经理、兴全合润分级混合型证券投资基金基金经理

上述人员之间不存在近亲属关系。

### 三、基金管理人的职责

1、依法募集基金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；

2、办理基金备案手续；

3、对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账，进行证券投资；



- 4、按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配基金收益；
- 5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
- 6、编制季度、半年度和年度基金报告；
- 7、按照有关规定计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回的价格；
- 8、办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；
- 9、召集基金份额持有人大会；
- 10、保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
- 11、以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
- 12、法律法规及中国证监会规定的其他职责。

#### 四、基金管理人承诺

- 1、基金管理人承诺基金管理人将根据基金合同的规定，按照招募说明书列明的投资目标、策略及限制进行基金资产的投资；
- 2、基金管理人承诺不从事违反《证券法》的行为，并承诺建立健全的内部控制制度，采取有效措施，防止违反《证券法》行为的发生；
- 3、基金管理人承诺不从事违反《基金法》的行为，并承诺建立健全的内部控制制度，采取有效措施，防止下列行为的发生：
  - (1) 承销证券；
  - (2) 向他人贷款或者提供担保；
  - (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) 向本基金管理人、基金托管人出资或者买卖本基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；
  - (6) 买卖与本基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与本基金管理人、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、操纵证券交易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。
- 4、基金管理人承诺加强人员管理，强化职业操守，督促和约束员工遵守国家法律法规及行业规范，诚实信用、勤勉尽责，不从事以下活动：
  - (1) 越权或违规经营；
  - (2) 违反基金合同或托管协议；

- (3) 故意损害基金份额持有人或其他基金相关机构的合法权益；
- (4) 在包括向中国证监会报送的资料中进行虚假信息披露；
- (5) 拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管；
- (6) 玩忽职守、滥用职权；
- (7) 泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；
- (8) 除按本公司制度进行基金运作投资外，直接或间接进行其他股票投资；
- (9) 协助、接受委托或以其他任何形式为其他组织或个人进行证券交易；
- (10) 违反证券交易场所业务规则，利用对敲、倒仓等手段操纵市场价格，扰乱市场秩序；
- (11) 贬损同行，以提高自己；
- (12) 在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分；
- (13) 以不正当手段谋求业务发展；
- (14) 有悖社会公德，损害证券投资基金人员形象；
- (15) 其他法律、行政法规禁止的行为。

## 5、基金经理承诺

- (1) 依照法律法规和基金合同的规定，本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益；
- (2) 不利用职务之便为自己、受雇人或任何第三者谋取利益；
- (3) 不泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密，尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；
- (4) 不以任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

## 五、基金管理人的风险管理与内部控制制度

### 1、风险管理的理念

- (1) 风险管理是业务发展的保障；
- (2) 最高管理层承担最终责任；
- (3) 分工明确、相互牵制的组织结构是前提；
- (4) 制度建设是基础；
- (5) 制度执行监督是保障。

### 2、风险管理的原则

- (1) 全面性原则：公司风险管理必须覆盖公司的所有部门和岗位，渗透各项业务过程和业务环节；
- (2) 独立性原则：公司设立独立的监察稽核部，监察稽核部保持高度的独立性

和权威性，负责对公司各部门风险控制工作进行稽核和检查；

（3）相互制约原则：公司及各部门在内部组织结构的设计上要形成一种相互制约的机制，建立不同岗位之间的制衡体系；

（4）定性和定量相结合原则：建立完备的风险管理指标体系，使风险管理更具客观性和操作性；

（5）重要性原则：公司的发展必须建立在风险控制完善和稳固的基础上，内部风险控制与公司业务发展同等重要。

### 3、风险管理和内部风险控制体系结构

公司的风险管理体系结构是一个分工明确、相互牵制的组织结构，由最高管理层对风险管理负最终责任，各个业务部门负责本部门的风险评估和监控，监察稽核部负责监察公司的风险管理措施的执行。具体而言，包括如下组成部分：

（1）董事会：负责制定公司的风险管理政策，对风险管理负完全的和最终的责任。董事会下设执行委员会和风险控制委员会；

（2）督察长：独立行使督察权利，直接对董事会负责，及时向风险控制委员会提交有关公司规范运作和风险控制方面的工作报告；

（3）投资决策委员会：负责指导基金财产的运作、制定本基金的资产配置方案和基本的投资策略；

（4）风险管理委员会：负责对基金投资运作的风险进行测量和监控；

（5）监察稽核部：负责对公司风险管理政策和措施的执行情况进行监察，并为每一个部门的风险管理系统的发展提供协助，使公司在一种风险管理和控制的环境中实现业务目标；

（6）业务部门：风险管理是每一个业务部门最首要的责任。部门经理对本部门的风险负全部责任，负责履行公司的风险管理程序，负责本部门的风险管理系统的开发、执行和维护，用于识别、监控和降低风险。

### 4、内部控制制度综述

#### （1）风险控制制度

公司风险控制的目标为严格遵守国家法律法规、行业自律规定和公司各项规章制度，自觉形成守法经营、规范运作的经营思想和经营风格；不断提高经营管理水平，在风险最小化的前提下，确保基金份额持有人利益最大化；建立行之有效的风险控制机制和制度，确保各项经营管理活动的健康运行与公司财产的安全完整；维护公司信誉，保持公司的良好形象。

针对公司面临的各种风险，包括政策和市场风险，管理风险和职业道德风险，分别制定严格防范措施，并制定岗位分离制度、空间分离制度、作业流程制度、

集中交易制度、信息披露制度、资料保全制度、保密制度和独立的监察稽核制度等相关制度。

### （2）监察稽核制度

监察稽核工作是公司内部风险控制的重要环节。公司设督察长和监察稽核部。督察长全面负责公司的监察稽核工作，可在授权范围内列席公司任何会议，调阅公司任何档案材料，对基金资产运作、内部管理、制度执行及遵纪守法情况进行内部监察、稽核；出具监察稽核报告，报公司董事会和中国证监会，如发现公司有重大违规行为，应立即向公司董事会和中国证监会报告。

监察稽核部具体执行监察稽核工作，并协助督察长工作。监察稽核部具有独立的检查权、独立的报告权、知晓权和建议权。具体负责对公司内部风险控制制度提出修改意见；检查公司各部门执行内部管理制度的情况；监督公司资产运作、财务收支的合法性、合规性、合理性；监督基金财产运作的合法性、合规性、合理性；调查公司内部的违规事件；协助监管机关调查处理相关事项；负责员工的离任审计；协调外部审计事宜等。

### （3）内部财务控制制度

财务管理的目的在于规范公司会计行为，保证会计资料真实、完整；加强财务管理，合理使用公司财务资源，提高公司资金的运用效率，控制公司财务风险，保护公司股东的利益，保证公司财产安全、完整和增值。

公司内部财务控制制度主要内容有：公司财务核算实行权责发生制的原则，会计使用国家许可的电算化软件。公司实行财务预算管理制度，财务室在综合各部门财务预算的基础上负责编制并报告公司总经理，经董事会批准后组织实施。各部门应认真做好财务预算的编制和实施工作。

## 5、风险管理和内部风险控制的措施

（1）建立、健全内控体系，完善内控制度：公司建立、健全了内控结构，高管人员关于内控有明确的分工，确保各项业务活动有恰当的组织授权，确保监察稽核工作是独立的，并得到高管人员的支持，同时置备操作手册，并定期更新；

（2）建立相互分离、相互制衡的内控机制：建立、健全了各项制度，做到基金经理分开，投资决策分开，基金交易集中，形成不同部门，不同岗位之间的制衡机制，从制度上减少和防范风险；

（3）建立、健全岗位责任制：建立、健全了岗位责任制，使每个员工都明确自己的任务、职责，并及时将各自工作领域中的风险隐患上报，以防范和减少风险；

（4）建立风险分类、识别、评估、报告、提示程序：建立了风险管理委员会，

使用适合的程序，确认和评估与公司运作有关的风险；公司建立了自下而上的风险报告程序，对风险隐患进行层层汇报，使各个层次的人员及时掌握风险状况，从而以最快速度作出决策；

（5）建立内部监控系统：建立了有效的内部监控系统，如电脑预警系统、投资监控系统，能对可能出现的各种风险进行全面和实时的监控；

（6）使用数量化的风险管理手段：采取数量化、技术化的风险控制手段，建立数量化的风险管理模型，用以提示指数趋势、行业及个股的风险，以便公司及时采取有效的措施，对风险进行分散、控制和规避，尽可能地减少损失；

（7）提供足够的培训：制定了完整的培训计划，为所有员工提供足够和适当的培训，使员工明确其职责所在，控制风险。

#### 6、基金管理人关于内部合规控制声明书

本公司确知建立、维护、维持和完善内部控制制度是本公司董事会及管理层的责任。本公司特别声明以上关于内部控制的披露真实、准确，并承诺将根据市场变化和公司业务发展不断完善内部控制制度。

## 第二部分 基金托管人

### 一、基金托管人情况

#### （一）基本情况

名称：兴业银行股份有限公司

住所：福州市湖东路 154 号

办公地址：福州市湖东路 154 号

法定代表人：高建平

注册日期：1988 年 7 月 20 日

注册资本：人民币 190.52 亿元

托管部门联系人：刘峰

电话：021-62677777-212017

传真：021-62159217

#### （二）发展概况及财务状况

兴业银行成立于 1988 年 8 月，是经国务院、中国人民银行批准成立的首批股份制商业银行之一，总行设在福建省福州市，2007 年 2 月 5 日正式在上海证券交易所挂牌上市（股票代码：601166），注册资本 190.52 亿元。

开业 20 多年来，兴业银行始终坚持“真诚服务，相伴成长”的经营理念，致力

于为客户提供全面、优质、高效的金融服务。截至 2015 年 12 月 31 日，兴业银行资产总额达 5.30 万亿元，实现营业收入 1543.48 亿元，全年实现归属于母公司股东的净利润 502.07 亿元。2015 年兴业银行市场地位和品牌形象稳步提升，稳居全球银行 50 强、全球上市企业 100 强、世界企业 500 强。

### （三）托管业务部的部门设置及员工情况

兴业银行股份有限公司总行设资产托管部，下设综合管理处、市场处、委托资产管理处、科技支持处、稽核监察处、运营管理处、期货业务管理处、期货存管结算处和养老金管理中心等处室，共有员工 100 余人，业务岗位人员均具有基金从业资格。

### （四）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 2016 年 6 月 30 日，兴业银行已托管开放式基金 95 只，托管基金财产规模 3451.64 亿元。

## 二、基金托管人的内部风险控制制度说明

### （一）内部控制目标

严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和行内有关管理规定，守法经营、规范运作、严格监察，确保业务的稳健运行，保证基金资产的安全完整，确保有关信息的真实、准确、完整、及时，保护基金份额持有人的合法权益。

### （二）内部控制组织结构

兴业银行基金托管业务内部风险控制组织结构由兴业银行审计部、资产托管部内设稽核监察处及资产托管部各业务处室共同组成。总行审计部对托管业务风险控制工作进行指导和监督；资产托管部内设独立、专职的稽核监察处，配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作，具有独立行使监督稽核工作职权和能力。各业务处室在各自职责范围内实施具体的风险控制措施。

### （三）内部风险控制原则

- 1、全面性原则：风险控制必须覆盖基金托管部的所有处室和岗位，渗透各项业务过程和业务环节；风险控制责任应落实到每一业务部门和业务岗位，每位员工对自己岗位职责范围内的风险负责。
- 2、独立性原则：资产托管部设立独立的稽核监察处，该处室保持高度的独立性和权威性，负责对托管业务风险控制工作进行指导和监督。
- 3、相互制约原则：各处室在内部组织结构的设计上要形成一种相互制约的机制，建立不同岗位之间的制衡体系。
- 4、定性和定量相结合原则：建立完备的风险管理指标体系，使风险管理更具客

观性和操作性。

5、防火墙原则：托管部自身财务与基金财务严格分开；托管业务日常操作部门与行政、研发和营销等部门严格分离。

6、有效性原则。内部控制体系同所处的环境相适应，以合理的成本实现内控目标，内部制度的制订应当具有前瞻性，并应当根据国家政策、法律及经营管理的需要，适时进行相应修改和完善；内部控制应当具有高度的权威性，任何人不得拥有不受内部控制约束的权力，内部控制存在的问题应当能够得到及时反馈和纠正；

7、审慎性原则。内控与风险管理必须以防范风险，审慎经营，保证托管资产的安全与完整为出发点；托管业务经营管理必须按照“内控优先”的原则，在新设机构或新增业务时，做到先期完成相关制度建设；

8、责任追究原则。各业务环节都应有明确的责任人，并按规定对违反制度的直接责任人以及对负有领导责任的主管领导进行问责。

#### （四）内部控制制度及措施

1、制度建设：建立了明确的岗位职责、科学的业务流程、详细的操作手册、严格的人员行为规范等一系列规章制度。

2、建立健全的组织管理结构：前后台分离，不同部门、岗位相互牵制。

3、风险识别与评估：稽核监察处指导业务处室进行风险识别、评估，制定并实施风险控制措施。

4、相对独立的业务操作空间：业务操作区相对独立，实施门禁管理和音像监控。

5、人员管理：进行定期的业务与职业道德培训，使员工树立风险防范与控制理念，并签订承诺书。

6、应急预案：制定完备的《应急预案》，并组织员工定期演练；建立异地灾备中心，保证业务不中断。

#### 三、基金托管人对基金管理人进行监督的方法和程序

基金托管人负有对基金管理人的投资运作行使监督权的职责。根据《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定，托管人对基金的投资对象和范围、投资组合比例、投资限制、费用的计提和支付方式、基金会计核算、基金资产估值和基金净值的计算、收益分配、申购赎回以及其他有关基金投资和运作的事项，对基金管理人进行业务监督、核查。

基金托管人发现基金管理人违反《基金法》、《运作办法》、基金合同和有关法律法规规定的行为，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人

收到通知后应及时核对并以书面形式对基金托管人发出回函。在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人有关基金的重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时，通知基金管理人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人的指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当拒绝执行，立即通知基金管理人，并及时向中国证监会报告。

基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当立即通知基金管理人，并及时向中国证监会报告。

### 第三部分 相关服务机构

#### 一、基金份额发售机构

##### 1、直销机构

兴业全球基金管理有限公司直销柜台

地址：上海市张杨路 500 号时代广场 20 楼

联系人：何佳怡、秦洋洋

客户服务电话：400-678-0099、(021) 38824536

直销联系电话：(021) 20398927、20398706

传真：(021) 58368869

兴业全球基金管理有限公司网上直销平台（目前已开通工商银行直连、农业银行直连、建设银行直连、招商银行直连、银联通（工商银行、农业银行、建设银行、交通银行、民生银行、平安银行、邮储银行、兴业银行、光大银行、中信银行、浦发银行、南京银行、金华银行、浙商银行、温州银行、上海农商银行）、通联支付（工商银行、农业银行、中国银行、交通银行、建设银行、中信银行、光大银行、华夏银行、民生银行、招商银行、兴业银行、上海银行、平安银行））

（排名不分先后）

公司网站：<http://www.xyfunds.com.cn>

客服电话：400-678-0099；(021) 38824536

##### 2、代销机构

代销银行



(1) 兴业银行股份有限公司

住所：福州市湖东路 154 号

法定代表人：高建平

电话：（021）52629999

客户服务热线：95561

公司网站：<http://www.cib.com.cn>

(2) 中国工商银行股份有限公司

住所：中国北京复兴门内大街 55 号

办公地址：中国北京复兴门内大街 55 号

法定代表人：易会满

客户服务电话：95588

传真：（010）66107914

公司网站：<http://www.icbc.com.cn>

(3) 中国银行股份有限公司

住所（办公地址）：北京市西城区复兴门内大街 1 号

法定代表人：田国立

客户服务电话：95566

传真：（010）66107914

公司网站：<http://www.boc.cn>

(4) 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

法定代表人：周慕冰

客服电话：95599

传真：（010）85109219

公司网站：<http://www.abchina.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：李建红

客户服务电话：95555

传真：（0755）83195049

公司网站：<http://www.cmbchina.com>

(6) 中国邮政储蓄银行股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街 3 号

办公地址：北京市西城区金融大街 3 号

法定代表人：李国华

客户服务电话：95580

传真：（010）68858117

公司网站：<http://www.psbc.com>

（7）交通银行股份有限公司

住所：上海市银城中路 188 号

办公地址：上海市银城中路 188 号

法定代表人：牛锡明

电话：（021）58781234

传真：（021）58408483

客户服务电话：95559

公司网站：<http://www.bankcomm.com>

（8）中信银行股份有限公司

住所：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：常振明

电话：（010）65557013

传真：（010）65550827

客户服务电话：95558

公司网站：<http://bank.ecitic.com>

（9）民生银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街 2 号

法定代表人：洪崎

电话：（010）57092615

传真：（010）57092611

客户服务电话：95568

公司网站：<http://www.cmbc.com.cn>

（10）中国光大银行股份有限公司

住所（办公地址）：北京市西城区太平桥大街 25 号中国光大中心

法定代表人：唐双宁

客户服务电话：95595

传真：（010）63639709

公司网站：<http://www.cebbank.com>

(11) 宁波银行股份有限公司

住所(办公地址): 宁波市鄞州区宁南南路 700 号

法定代表人: 陆华裕

客户服务电话: 96528, (北京、上海地区 962528)

传真: (0574) 87050024

公司网站: <http://www.nbcb.com.cn>

(12) 上海浦东发展银行股份有限公司

住所: 上海市中山东一路 12 号

法定代表人: 吉晓辉

客户服务电话: 95528

传真: (021) 63604199

公司网站: <http://www.spdb.com.cn>

(13) 平安银行股份有限公司

住所(办公地址): 深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行大厦

法定代表人: 孙建一

客户服务电话: 95511-3

公司网站: <http://www.bank.pingan.com>

(14) 上海银行股份有限公司

住所: 上海市银城中路 168 号

法定代表人: 范一飞

客户服务电话: (021) 962888

公司网站: <http://www.bankofshanghai.com>

(15) 重庆银行股份有限公司

住所: 重庆市渝中区邹容路 153 号

法定代表人: 马千真

客户服务电话: 96899 (重庆地区)、400-709-6899 (其他地区)

公司网站: <http://www.cqcbank.com>

(16) 华夏银行股份有限公司

住所(办公地址): 北京市东城区建国门内大街 22 号华夏银行大厦

法定代表人: 吴建

客服电话: 95577

公司网站: <http://www.hxb.com.cn>

(17) 中国建设银行股份有限公司

住所：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：王洪章  
客户服务电话：95533  
公司网站：<http://www.ccb.com>

(18) 东莞农村商业银行股份有限公司  
住所：东莞市南城路 2 号  
办公地址：东莞市南城路 2 号  
法定代表人：何沛良  
客户服务电话：961122  
公司网站：<http://www.drcbank.com>

(19) 江苏江南农村商业银行股份有限公司  
住所：江苏省常州市延陵中路 668 号  
法定代表人：陆向阳  
客户服务电话：96005  
公司网站：<http://www.jnbank.cc>

代销券商

(1) 兴业证券股份有限公司  
住所：福州市湖东路 268 号  
法定代表人：兰荣  
客户服务热线：4008888123  
传真：(021) 38565785  
公司网站：<http://www.xyzq.com.cn>

(2) 国泰君安证券股份有限公司  
住所：上海市浦东新区商城路 618 号  
法定代表人：杨德红  
传真：(021) 38670161  
客户服务热线：4008888666  
公司网站：<http://www.gtja.com.cn>

(3) 中信建投证券股份有限公司  
住所：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼  
法定代表人：王常青  
开放式基金咨询电话：400888108

开放式基金业务传真：（010）85130577

公司网站：<http://www.csc108.com>

（4）华泰证券股份有限公司

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：周易

电话：（025）83290979

客户咨询电话：95597

公司网站：<http://www.htsc.com.cn>

（5）长江证券股份有限公司

住所：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

法定代表人：尤习贵

电话：（027）65799999

传真：（027）85481900

客户服务热线：4008-888-999 或 95579

公司网站：<http://www.cjsc.com.cn>

（6）海通证券股份有限公司

住所：上海市广东路 689 号

法定代表人：王开国

办公电话：（021）23219000

客服电话：95553 或拨打各城市营业网点咨询电话

公司网站：<http://www.htsec.com>

（7）招商证券股份有限公司

住所：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

客户服务热线：95565、4008888111

公司网站：<http://www.newone.com.cn>

（8）中国银河证券股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街 35 号 2-6 层

法定代表人：陈有安

传真：（010）66568430

客服电话：4008-888-888

公司网站：<http://www.chinastock.com.cn>

(9) 广发证券股份有限公司

住所：广州市天河北路 183-187 号大都会广场 43 楼

法定代表人：孙树明

开放式基金咨询电话：95575 转各营业网点

开放式基金业务传真：(020) 87555305

公司网站：<http://www.gf.com.cn>

(10) 山西证券股份有限公司

办公（注册）地址：山西省太原市府西街 69 号山西国贸中心东塔楼

法定代表人：侯巍

联系电话：0351-8686619

客服电话：4006661618

传真：(0351) 8686619

公司网站：<http://www.i618.com.cn>

(11) 东方证券股份有限公司

住所：上海市中山南路 318 号 2 号楼 22 层-29 层

法定代表人：潘鑫军

电话：(021) 63325888

传真：(021) 63326173

客服热线：95503

公司网站：<http://www.dfzq.com.cn>

(12) 德邦证券股份有限公司

住所：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

联系电话：(021) 68761616

传真电话：(021) 68767981

客服电话：4008888128

公司网站：<http://www.tebon.com.cn>

(13) 中银国际证券有限责任公司

住所：上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 39 层

法定代表人：许刚

开放式基金咨询电话：4006208888 或各地营业网点咨询电话

开放式基金业务传真：(021) 50372474

公司网站: <http://www.bocichina.com.cn>

(14) 光大证券股份有限公司

住所: 上海市静安区新闻路 1508 号

法定代表人: 薛峰

联系电话: (021) 22169081

传真: (021) 22169134

客服热线: 4008888788

公司网站: <http://www.ebscn.com>

(15) 国元证券股份有限公司

住所: 合肥市梅山路 18 号

法定代表人: 蔡咏

客户服务电话: 95578

传真电话: (0551) 2207965

公司网站: <http://www.gyzq.com.cn>

(16) 湘财证券股份有限公司

地址: 长沙市天心区湘府中路 198 号新南城商务中心 A 栋 11 楼

法定代表人: 林俊波

电话: (021) 68634518

传真: (021) 68865680

客服电话: 400-888-1551

公司网站: <http://www.xcsc.com>

(17) 申万宏源证券有限公司

住所(办公地址): 上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

法定代表人: 李梅

电话: (021) 33389888

传真: (021) 33388224

客服电话: 95523 或 4008895523

公司网站: <http://www.swhysc.com>

(18) 中航证券有限公司

住所: 南昌市红谷中大道 1619 号南昌国际金融大厦 A 栋 41 层

法定代表人: 王宜四

联系电话: (0791) 6768763

传真电话: (0755) 6789414

客服电话：400-8866-567

公司网站：<http://www.avicsec.com>

(19) 渤海证券股份有限公司

住所：天津经济技术开发区第二大街 42 号写字楼 101 室

法定代表人：王春峰

联系电话：(022) 28451861

传真：(022) 28451892

客服电话：4006515988

公司网站：<http://www.ewww.com.cn>

(20) 瑞银证券有限责任公司

住所：北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心 12 层、15 层

法定代表人：程宜荪

联系电话：(010) 5832 8752

传真：(010) 5922 8748

客服电话：400-887-8827

公司网站：<http://www.ubssecurities.com>

(21) 华福证券有限责任公司

住所：福州市鼓楼区温泉街道五四路 157 号 7-8 层

法定代表人：黄金琳

联系电话：(0591) 87383623

传真：(0591) 87383610

客户服务电话：96326（福建省外请加拨 0591）

公司网站：<http://www.hfzq.com.cn>

(22) 中泰证券股份有限公司

住所：山东省济南市经七路 86 号

法定代表人：李玮

联系电话：(0531) 68889155

传真：(0531) 68889752

客户服务电话：95538

公司网站：<http://www.zts.com.cn>

(23) 爱建证券有限责任公司

住所：上海市世纪大道 1600 号 32 楼

法定代表人：钱华



联系电话：（021）32229888

客服电话：（021）63340678

公司网站：<http://www.ajzq.com>

（24）安信证券股份有限公司

住所：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元

法定代表人：王连志

联系电话：（0755）82825551

传真：（0755）82558355

客服电话：4008001001

公司网站：<http://www.essence.com.cn>

（25）华融证券股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街 8 号

法定代表人：祝献忠

联系电话：（010）58568007

传真：（010）58568062

客服电话：（010）58568118

公司网站：<http://www.hrsec.com.cn>

（26）国信证券股份有限公司

住所：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

法定代表人：何如

联系电话：（0755）82130833

传真：（0755）82133952

客服电话：95536

公司网站：<http://www.guosen.com.cn>

（27）东莞证券股份有限公司

住所：东莞市莞城区可园南路 1 号金源中心 30 楼

法定代表人：张运勇

联系电话：（0769）22119341

传真：（0769）22116999

客服电话：（0769）961130

公司网站：<http://www.dgzq.com.cn>

（28）东海证券股份有限公司

住所：江苏省常州市延陵西路 23 号投资广场 18-19 楼

法定代表人：朱科敏

联系电话：（0519）88157761

传真：（0519）88157761

客服电话：4008888588、95531

公司网站：<http://www.longone.com.cn>

（29）九州证券股份有限公司

住所：青海省西宁市南川工业园区创业路108号

法定代表人：魏先锋

传真：（0755）33329815

客户服务热线：4006543218

公司网站：<http://www.jzsec.com>

（30）中信证券股份有限公司

住所：广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座

法定代表人：王东明

联系电话：（010）84683893

传真：（010）84685560

客服电话：95558

公司网站：<http://www.cs.ecitic.com>

（31）国海证券股份有限公司

住所：广西桂林市辅星路13号

法定代表人：何春梅

联系电话：（0771）5539262

传真：（0771）5539033

客服电话：400-888-8100（全国）、96100（广西）

公司网站：<http://www.ghzq.com.cn>

（32）长城证券股份有限公司

住所：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：丁益

联系电话：（0755）83516094

传真：（0755）83516289

客服电话：4006666888

公司网站：<http://www.cgws.com>

（33）中信证券（山东）有限责任公司

住所：山东省青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼 20 层

法定代表人：杨宝林

客户服务电话：95548

公司网站：[http:// www.zxwt.com.cn](http://www.zxwt.com.cn)

(34) 信达证券股份有限公司

住所：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

法定代表人：张志刚

客户服务电话：400-800-8899

基金业务传真：010-63080978

公司网站：<http://www.cindasc.com>

(35) 华鑫证券有限责任公司

住所：上海市肇嘉浜路 750 号

法定代表人：俞洋

客户服务电话：400-109-9918

基金业务传真：021-64333051

公司网站：[http:// www.cfsc.com.cn](http://www.cfsc.com.cn)

(36) 国都证券股份有限公司

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：王少华

客户服务电话：4008188118

基金业务传真：010-84183311

公司网站：<http://www.guodu.com>

(37) 联讯证券股份有限公司

住所：广东省惠州市惠城区江北东江三路 55 号

法定代表人：徐刚

客户服务电话：95564

基金业务传真：010-64408834

公司网站：<http://www.lxzq.com.cn/>

(38) 广州证券股份有限公司

住所：广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19 楼、20 楼

法定代表人：邱三发

客户服务电话：020-961303

基金业务传真：020-88836654

公司网站: <http://www.gzs.com.cn>

(39) 平安证券有限责任公司

住所: 深圳市福田区中心区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层

法定代表人: 谢永林

网站: <http://stock.pingan.com>

客户服务电话: 4006-788-887

其他代销机构

(1) 天相投资顾问有限公司

住所: 北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座

法定代表人: 林义相

联系电话: (010) 66045608

传真: (010) 66045527

客服电话: (010) 66045678

公司网站: <http://www.txsec.com>

(2) 上海天天基金销售有限公司

住所: 上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼 2 层

法定代表人: 其实

客户服务电话: ?400-1818-188

基金业务传真: (021) 64385308

公司网站: <http://www.1234567.com.cn>

(3) 和讯信息科技有限公司

住所: 北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦 10 层

法定代表人: 王莉

客户服务电话: ?4009200022

基金业务传真: 021- 20835879

公司网站: <http://licaike.hexun.com>

(4) 上海好买基金销售有限公司

注册地址: 上海市虹口区场中路 685 弄 37 号 4 号楼 449 室

办公地址: 上海市浦东南路 1118 号鄂尔多斯大厦 903~906 室

法定代表人: 杨文斌

联系人: 汪莹

电话: (021) 58870011

传真：（021）68596916

客户服务电话：4007009665

公司网站：[http:// www.ehowbuy.com](http://www.ehowbuy.com)

（5）杭州数米基金销售有限公司

住所：浙江省杭州市滨江区江南大道 3588 号恒生大厦 12 楼

法定代表人：陈柏青

联系人：周熤旻

电话：（0571）28829790

传真：（0571）26698533

客户服务电话：4000-766-123 ??

?公司网站：<http://www.fund123.cn>

（6）浙江同花顺基金销售有限公司

住所：浙江省杭州市文二西路 1 号元茂大厦 903

法定代表人：凌顺平

客户服务热线：4008-773-772

传真：0571-86800423

公司网站：<http://www.5ifund.com>

（7）珠海盈米财富管理有限公司??

住所：广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 12 楼 1201-1203 室

法定代表人：肖雯

客户服务热线：020-89629066

传真：020-89629011

公司网站：<http://www.yingmi.cn>

（8）上海陆金所资产管理有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 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

法定代表人：郭坚

联系人：宁博宇

电??话：021-20665952

传??真：021-22066653

客户服务电话：?4008219031

网址：<http://www.lufunds.com>

（9）诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司

住所：上海市虹口区飞虹路 360 弄 9 号 3724 室

法定代表人：汪静波

客户服务电话：400—821—5399

传真：021-38509777

网站：<http://www.noah-fund.com>

（10）深圳众禄金融控股股份有限公司

住所：深圳市罗湖区笋岗街道梨园路物资控股置地大厦 8 楼 801

法定代表人：薛峰

网站：<http://www.zlfund.cn>

客户服务电话：4006-788-887

（11）上海大智慧财富管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 428 号 1 号楼 1102、1103 单元

法定代表人：申健

网站：<https://8.gw.com.cn/>

客户服务电话：021-20219931

（12）中信期货有限公司

住所：北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦 18 层

法定代表人：张磊

网站：<http://www.citicsf.com/>

客户服务电话：400-9908-826

（13）厦门市鑫鼎盛控股有限公司

办公地址：厦门市思明区鹭江道 2 号厦门第一广场西座 1501-1504 室

法定代表人：陈洪生

网站：<http://www.xds.com.cn/>

客户服务电话：400-918-0808

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

法定代表人：周明

办公地址：北京市西城区太平桥大街 17 号

客服电话：4008-058-058

传真：0755-25987538

联系人：任瑞新

三、出具法律意见书的律师事务所和经办律师

名称：通力律师事务所

住所（办公地址）：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

负责人：韩炯

经办律师：吕红、安冬

电话：021-31358666

传真：021-31358600

联系人：安冬

四、审计基金资产的会计师事务所和经办注册会计师

名称：德勤华永会计师事务所有限公司

办公地址：上海市延安东路 222 号 30 楼

执行事务合伙人：卢伯卿

电话：（021）61418888

传真：（021）63350377

经办注册会计师：陶坚、吴凌志

联系人：吴凌志

第四部分 基金的名称

兴全保本混合型证券投资基金

第五部分 基金的类型

契约型开放式

第六部分 保本

## 一、保本

本基金为基金份额持有人持有到期的基金份额提供保本额分为以下几种情况：

- 1、本基金第一个保本周期为基金份额持有人提供的保本额为基金份额持有人认购并持有到期的基金份额的净认购金额、认购费用及募集期间的利息收入之和。
- 2、本基金第一个保本周期后的各保本周期为基金份额持有人提供的保本额分为上一保本周期选择或默认选择转入当期保本周期并持有到当期保本周期到期日的基金份额的保本额，以及过渡期申购并持有到当期保本周期到期日的基金份额的保本额。分别按以下方式进行计算：

(1) 从上一保本周期选择或默认选择转入当期保本周期并持有到当期保本周期到期日的基金份额持有人的保本额为：

保本额=基金份额持有人选择或默认选择转入当期保本周期并持有到当期保本周期到期日的基金份额在基金份额折算日所代表的资产净值。

(2) 过渡期申购并持有到当期保本周期到期日的基金份额持有人的保本额为：

保本额=基金份额持有人过渡期申购并持有到当期保本周期到期日的基金份额在基金份额折算日所代表的资产净值+过渡期申购费用。

在保本周期到期日，如按基金份额持有人持有到期的基金份额与到期日基金份额净值的乘积加上相应基金份额累计分红款项之和计算的总金额高于或等于保本额，基金管理人将按到期日基金份额净值计算的赎回金额支付给基金份额持有人；如基金份额持有人持有到期的基金份额与到期日基金份额净值的乘积加上相应基金份额累计分红款项之和计算的总金额低于保本额，则基金管理人应补足该差额，并在保本周期到期日后二十个工作日内（含第二个工作日）将该差额支付给基金份额持有人。但基金份额持有人未持有到期而赎回或转换转出的基金份额或者发生《基金合同》约定的其他不适用保本条款情形的，相应基金份额不适用保本条款。

## 二、适用保本条款的情形

- 1、对第一个保本周期而言，基金份额持有人认购并持有到期的基金份额。
- 2、对于第一个保本周期后的各保本周期而言，基金份额持有人在本基金过渡期内申购并持有到当期保本周期到期日的基金份额，以及基金份额持有人从本基金上一保本周期选择或默认选择转入当期保本期并持有到当期保本期到期日的基金份额（进行基金份额折算的，指折算后对应的基金份额）。
- 3、对于持有到期的基金份额，基金份额持有人于保本周期到期后无论选择赎回、转换到基金管理人管理的其他基金、本基金转入下一保本周期或是转型为“兴全精选股票型证券投资基金”，都同样适用保本条款。



### 三、不适用保本条款的情形

- 1、在保本周期到期日，按持有人在当期保本周期持有到期的基金份额与到期日基金份额净值的乘积加上其在当期保本周期持有到期的基金份额累计分红款项之和计算的总金额不低于本基金为持有人提供的保本额；
- 2、投资人在基金保本周期到期日前（不包括该日）赎回或转换转出本基金的基金份额；
- 3、投资人在保本周期内申购或转换转入的基金份额；
- 4、在保本周期内发生《基金合同》约定的《基金合同》终止的情形；
- 5、在保本周期内发生本基金与其他基金合并或更换基金管理人的情形，且担保人不同意继续承担保证责任；
- 6、在保本周期到期日之后（不包括该日），基金份额发生的任何形式的净值减少；
- 7、因不可抗力的原因导致基金投资亏损；或因不可抗力事件直接导致基金管理人无法按约定履行全部或部分义务或延迟履行义务的，或《基金合同》约定的其他情形基金管理人免于履行保本义务的；
- 8、未经担保人书面同意修改《基金合同》条款，可能加重担保人保证责任的，但根据法律法规要求进行修改的除外。

### 四、保本基金到期的处理方案

具体保本周期到期处理方案见《招募说明书》（更新）第十九部分“保本周期到期”。

## 第七部分 保本的保证

### 一、保证人基本情况

名称：深圳市高新投集团有限公司

成立日期：1994年12月29日

住所：深圳市福田区深南大道7028号时代科技大厦23楼2308房

营业范围：从事担保业务；投资开发，信息咨询；贷款担保；自有物业租赁。

法定代表人：陶军

联系电话：0755-82852588

组织形式：有限责任公司

注册资本：22亿元人民币

## 二、保证人对外提供担保情况

截至 2014 年 5 月 31 日，深圳市高新投集团有限公司对外担保规模为 280.89 亿元人民币，暂未对保本基金提供过担保。

## 三、保证合同的主要内容

保证合同全文见本基金合同或招募说明书附件。

### 1、保证的范围和最高限额

(1) 本基金为持有人提供的保本额为：第二个保本周期持有到期的基金份额的保本额。

(2) 担保人承担保证责任的金额即保证范围为：在保本周期到期日，持有人在第二个保本周期持有到期的基金份额与保本周期到期日基金份额净值的乘积（即“可赎回金额”）加上其第二个保本周期持有到期的基金份额累计分红金额之和计算的总金额低于保本额的差额部分（该差额部分即为第二个保本周期的保本赔付差额）。

(3) 投资人在第二个保本周期内申购或转换转入的基金份额，以及在第二个保本周期到期日前（不包括该日）赎回或转换出的部分不在保证范围之内，且担保人承担保证责任的最高限额不超过第二个保本周期持有到期的基金份额的保本额。

(4) 保本周期到期日是指本基金第一个保本周期到期日指本基金基金合同生效之日起至三年后的对应日，本基金第一个保本周期后的各保本周期自本基金公告的当期保本周期起始日起至三年后对应日。如该对应日为非工作日，保本周期到期日顺延至下一个工作日。

### 2、保证期间

保证期间为基金保本周期到期日起六个月。

### 3、保证的方式

在保证期间，本担保人在保证范围内承担不可撤销的连带保证责任。

### 4、除外责任

下列任一情形发生时，担保人不承担保证责任：

(1) 在保本周期到期日，按持有人在当期保本周期持有到期的基金份额与到期日基金份额净值的乘积加上其在当期保本周期持有到期的基金份额累计分红款项之和计算的总金额不低于本基金为持有人提供的保本额；

(2) 投资人在基金保本周期到期日前（不包括该日）赎回或转换转出本基金的基金份额；

(3) 投资人在保本周期内申购或转换转入的基金份额；

- (4) 在保本周期内发生《基金合同》约定的《基金合同》终止的情形；
- (5) 在保本周期内发生本基金与其他基金合并或更换基金管理人的情形，且担保人不同意继续承担保证责任；
- (6) 在保本周期到期日之后（不包括该日），基金份额发生的任何形式的净值减少；
- (7) 因不可抗力的原因导致基金投资亏损；或因不可抗力事件直接导致基金管理人无法按约定履行全部或部分义务或延迟履行义务的，或《基金合同》约定的其他情形基金管理人免于履行保本义务的；
- (8) 未经担保人书面同意修改《基金合同》条款，可能加重担保人保证责任的，但根据法律法规要求进行修改的除外。

#### 5、责任分担及清偿程序

(1) 持有人于此同意授权基金管理人作为其代理人代为行使向担保人索偿的权利并办理相关的手续(包括但不限于向担保人发送《履行保证责任通知书》及代收相关款项等)。如果保本周期到期日持有人在第二个保本周期持有到期的基金份额与保本周期到期日基金份额净值的乘积（即“可赎回金额”）加上其第二个保本周期持有到期的基金份额累计分红金额之和计算的总金额低于保本额，基金管理人未能按照《基金合同》的约定全额履行保本义务的，基金管理人应在保本周期到期日后5个工作日内，向担保人发出书面《履行保证责任通知书》（应当载明基金管理人应向持有人支付的本基金保本赔付差额、基金管理人已自行偿付的金额、需担保人支付的代偿款项以及基金管理人指定的本基金在基金托管人处开立的账户信息）。

(2) 担保人应在收到基金管理人发出的《履行保证责任通知书》后的5个工作日内，将《履行保证责任通知书》载明的代偿款项划入基金管理人指定的本基金在基金托管人处开立的账户中，由基金管理人将该代偿款项支付给持有人。担保人将上述代偿金额全额划入基金管理人指定的本基金在基金托管人处开立的账户中后即全部履行了保证责任，担保人无须对持有人逐一进行代偿。代偿款项的分配与支付由基金管理人负责，担保人对此不承担责任。

(3) 基金管理人最迟应在保本周期到期日后20个工作日（含第20个工作日）内将保本赔付差额支付给持有人。

(4) 如果保本周期到期日持有人在第二个保本周期持有到期的基金份额与保本周期到期日基金份额净值的乘积（即“可赎回金额”）加上其第二个保本周期持有到期的基金份额累计分红金额之和计算的总金额低于保本额，基金管理人及担保人未履行《基金合同》及本合同上述条款中约定的保本义务及保证责任的，自

保本周期到期后第 21 个工作日起，持有人可以根据《基金合同》的约定，直接向基金管理人或担保人请求解决保本赔付差额支付事宜，但持有人直接向担保人追偿的，仅得在保证期间内提出。

#### 6、追偿权、追偿程序和还款方式

(1) 担保人履行了保证责任后，即有权要求基金管理人归还担保人为履行保证责任支付的全部款项。

(2) 基金管理人应自担保人履行保证责任之日起一个月内，向担保人提交担保人认可的还款计划。

#### 四、担保费用的费率和支付方式

1、基金管理人应按本条规定向担保人支付担保费。

2、担保费支付方式：担保费从基金管理人收取的本基金管理费中列支，按本条第 3 款公式每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。基金管理人应于每月收到基金管理费之后的五个工作日内向担保人支付担保费。担保人于收到款项后的五个工作日内向基金管理人出具合法发票。

3、每日担保费计算公式=担保费计算日前一日基金资产净值×0.18%×1/当年天数。

担保费计算期间自基金管理人公告的第二个保本周期开始之日起，至担保人解除保证责任之日或第二个保本周期到期日较早者止，起始日及终止日均应计入期间。

#### 五、保本基金到期的处理方案

具体保本周期到期处理方案见第十九部分“保本周期到期”。

#### 六、保证人免除保证责任的情形

除“更换保证人的,原保证人承担的所有与本基金保证责任相关的权利义务由继任的保证人承担”以及《保证合同》中所列明的免责情形外，保证人不得免除保证责任。基金管理人有权代表基金份额持有人要求保证人按照本基金合同及保证合同的约定履行保证责任。当发生以下情形时,保证人不承担支付义务：

1、在保本周期到期日，按持有人在当期保本周期持有到期的基金份额与到期日基金份额净值的乘积加上其在当期保本周期持有到期的基金份额累计分红款项之和计算的总金额不低于本基金为持有人提供的保本额；

2、投资人在基金保本周期到期日前（不包括该日）赎回或转换转出本基金的基金份额；

3、投资人在保本周期内申购或转换转入的基金份额；

4、在保本周期内发生《基金合同》约定的《基金合同》终止的情形；

5、在保本周期内发生本基金与其他基金合并或更换基金管理人的情形，且担保人不同意继续承担保证责任；

6、在保本周期到期日之后（不包括该日），基金份额发生的任何形式的净值减少；

7、因不可抗力的原因导致基金投资亏损；或因不可抗力事件直接导致基金管理人无法按约定履行全部或部分义务或延迟履行义务的，或《基金合同》约定的其他情形基金管理人免于履行保本义务的；

8、未经担保人书面同意修改《基金合同》条款，可能加重担保人保证责任的，但根据法律法规要求进行修改的除外。

七、保本周期内，保证人出现足以影响其担保能力情形的，应在该情形发生之日起3个工作日内通知基金管理人以及基金托管人。基金管理人在接到通知之日起3个工作日内应将上述情况报告中国证监会并提出处理办法，包括但不限于加强对保证人担保能力的持续监督、在确信保证人丧失担保能力的情形下及时召开基金份额持有人大会等；在确信保证人丧失担保能力的情形下，基金管理人应在接到通知之日起60日内召开基金份额持有人大会，就更换保证人、终止基金合同、基金转型等事项进行审议。基金管理人应在接到保证人通知之日起5个工作日内在指定媒体上公告上述情形。

八、保本周期内更换保证人的程序

除本合同另有约定外，基金管理人更换保证人应首先按照基金合同约定的程序召集基金份额持有人大会予以审议。并且保证人的更换必须符合基金份额持有人的利益。

保本周期内更换保证人的程序：

1、提名

新任保证人由基金管理人提名。

基金管理人提名的新任保证人必须符合如下条件：（1）具有法律法规和中国证监会规定的担任基金保证人的资质和条件；（2）符合基金份额持有人的利益。

2、决议

基金份额持有人大会对被提名的新任保证人形成决议，该决议需经参加大会的基金份额持有人所持表决权的1/2以上（含1/2）表决通过。

3、核准

基金份额持有人大会选任新任保证人的决议须经中国证监会核准生效后方可执行。

4、签订《保证合同》

更换保证人经中国证监会核准后，基金管理人与新任保证人签订《保证合同》。

#### 5、公告

基金管理人在中国证监会核准后 2 日内在至少一家指定媒体及基金管理人网站公告更换保证人的有关事项以及基金管理人与新任保证人签订的《保证合同》。

#### 6、交接

原保证人职责终止的，原保证人应妥善保管保本周期内保证业务资料，及时向基金管理人和新任保证人办理保证业务资料的交接手续，基金管理人和新任保证人应及时接收。

更换保证人的，原保证人承担的所有与本基金保证责任相关的权利义务由继任的保证人承担。在新的保证人接任之前，原保证人应继续承担保证责任。增加保证人的，原保证人继续承担保证责任，新增加保证人和原保证人共同承担连带保证责任。

#### 九、保本周期内增加担保人

增加担保人的，原担保人应继续承担保证责任。新增担保人，且原担保人并未免除保证责任的，新增担保人和原担保人共同承担连带保证责任。

增加担保人的程序与更换担保人程序相同。

十、 保本周期届满时，担保人或基金管理人认可的其他符合条件的担保人或保本义务人为本基金下一保本周期提供保本保障，并与基金管理人就本基金下一保本周期签订保证合同或风险买断合同，同时本基金满足法律法规和《基金合同》规定的基金存续要求的，本基金将转入下一保本周期。否则，本基金转型为非保本的股票型基金，基金名称相应变更为“兴全精选股票型证券投资基金”。

### 第八部分 基金的投资目标

本基金通过特定组合保险策略，在确保保本周期到期时的保本底线的基础上，寻求组合资产的稳定增长。

### 第九部分 基金的投资方向

本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括投资于股票（包括中小板、

创业板以及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、金融债、企业债、公司债、回购、央行票据、可转换债券、中小企业私募债券、资产支持证券等）、货币市场工具、权证及中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但需符合中国证监会的相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许本基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：股票、权证等权益类资产占基金资产的 0%-30%；债券、货币市场工具等固定收益类资产占基金资产的 70%-100%，其中基金保留的现金以及投资于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%。

在基金实际管理过程中，基金管理人将根据中国宏观经济情况和证券市场的阶段性变化，在上述投资组合比例范围内，适时调整基金资产在股票、债券及货币市场工具等投资品种间的配置比例。

## 第十部分 基金的投资策略及投资组合管理

### 一、基于可转债投资的 OBPI 策略

本基金通过可转债来实现基于期权的投资组合保险策略（Option Based Portfolio Insurance），以下简称 OBPI 策略。因此，本基金采用的是基于可转债投资的 OBPI 策略，即本基金以可转债所隐含的看涨期权代替投资组合保险策略所要求的看涨期权，利用可转债自身特性来避免因为频繁调整低风险资产与风险资产配比带来的交易成本。

本基金在个券选择层面，积极参与发行条款优惠、期权价值较高、公司基本面优良的可转债的一级市场申购；选择对应发债公司具有良好发展潜力或基础股票有着较高上涨预期的可转债进行投资，在有效规避市场风险的同时，充分攫取内在的期权价值。

本基金采用转股溢价率（可转债价格相对于转换成股票后的当前价值的溢价程度）、纯债到期收益率等指标来衡量可转债相对股票和债券的相对估值情况，本基金采用这些指标确定可转债资产的风险收益属性，并根据本基金的保本机制动态调整可转债资产的配置比例。

简单来说，一般意义上的 OBPI 策略主要是指通过持有一部分债券同时买入持有一部分看涨期权，其中债券部分到期价值满足保本资产的规模要求，期权价格上涨则为本基金带来额外收益。但由于国内尚未推出股票期权，因此本基金通过可转债内含看涨期权的特质，通过持有一部分债券加上一部分可转债的方式以实现

OBPI 策略。可转债具有债券和期权的双重属性，持有人可以选择持有可转债到期，获取本息；也可以选择约定的时间内转换成股票，享受资本增值。

## 二、可转债与股票替代的 TIPP 策略

本基金资产分为风险资产和低风险资产两类。其中，本基金对可转债将根据纯债到期收益率、转股溢价率等指标来确定是否属于风险资产或低风险资产；除可转债外的债券、货币市场工具等固定收益类资产属于低风险资产；股票、权证等权益类资产属于风险资产。

本基金采用时间不变性投资组合保险策略（Time Invariant Portfolio Protection）实现保本目标，以下简称 TIPP 策略，该策略指基金设置的价值底线（低风险资产的最低配置）随着投资组合收益的变动而调整的投资策略。同时，本基金将选择转换溢价率较小的可转债进行投资，但当可转债市场无投资合适品种时，本基金将用股票资产部分或全部代替可转债的 TIPP 策略实现组合保险目的。

本基金的 TIPP 策略具体是指：首先，确定低风险资产的最低配置比例。根据保本周期末投资组合最低目标价值和合理的贴现率，设定期初应持有的低风险资产的最低配置比例，即设定基金期初价值底线；其次，确定风险资产的最高配置比例。根据组合中风险资产的风险特性，决定安全垫（即基金净资产超过基金价值底线的数额）的放大倍数，然后根据安全垫和放大倍数乘数计算期初可持有的风险资产的最高配置比例。最后，当基金净值上涨超过一定幅度后，本基金将择机提高价值底线，以及时锁定已实现的收益。本基金的 TIPP 策略相对 CPPI 策略而言，由于在净值上升过程中提高了价值底线，从而锁定了已实现收益，因此整体风险要小于 CPPI 策略。

用更简单的方式说，TIPP 策略就是用低风险资产的投资收益作为可以损失的风险资本，去股票等风险资产市场搏取更高的收益，当在风险资产获取一定收益后不断提高低风险资产的投资以锁定已有收益。

比如一个基金的初始资产为 100 万，如果用 95 万投资债券等低风险资产，可以获得 5 万元的到期收益，那么就可以用剩余 5 万元投资股票等风险资产，即使完全亏损，基金整体也不会亏损。实际应用中，以股票为主的风险资产不可能亏损 100%，因此，可以对低风险资产的收益进行放大后，投资于风险资产市场。

当一定时间后，如果风险资产获得收益，比如由最初的 5 万元增长到 10 万元，则基金管理人将对两类资产进行重新调整。此时的基金总资产增长至 105 万元，如果用 99 万投资债券等低风险资产，可以获得 6 万元的到期收益，那么则可以用剩余 6 万元投资股票等风险资产，即使完全亏损，基金到期时也会保证 105 万



元的资产不亏损。这样，基金管理人就可以通过提高债券等低风险资产来锁定基金资产的收益。

本基金还将根据各类资产的预期风险与收益情况动态调整低风险资产和风险资产比例以及相应的放大倍数。

本基金中可转债占风险资产的比例，以及放大倍数的调整将参照可转债的转换溢价率以及股票替代部分的估值情况来确定。

当可转债转换溢价率较小时，本基金的全部风险资产可用该类可转债配置；转换溢价率过高时，本基金将降低放大倍数。若同时采取股票替代策略，则还将结合股票市场估值情况，调整放大倍数：在估值过高时，降低放大倍数；而在估值过低时，提高放大倍数。

### 三、股票投资策略

本基金是一只保本基金，因此，本基金将主要挑选较为稳健的股票投资品种，避免投资于成长性较差、风险相对较高的 ST 股票和\*ST 股票（重组成功但尚未摘帽的除外），以达到稳健投资的目标。

本基金运用静态与动态预期数据相结合的方式考察股票的估值水平、财务指标、成长风格、盈利水平。

在考察个股的估值水平时，本基金考察企业贴现现金流以及内在价值贴现，结合市盈率（市值/净利润）、市净率（市值/净资产）、市销率（市值/营业收入）等指标考察股票的价值是否被低估。本基金认为高成长性的股票通常具有高市盈率，但高市盈率又往往意味着对该股票的高估值。因而本基金在个股选择中会强调对成长性和估值水平的甄别。

财务情况方面，本基金重点关注流动资产与流动负债、资产负债率、自由现金流负债比、自由现金流占销售收入的比重、主营业务带来的现金增长比例、无形资产比重等指标。

本基金采用年复合营业收入增长率、盈利增长率、息税前利润增长率、净资产收益率、以及现金流量增长率等指标综合考察上市公司的成长性。

在盈利水平方面，本基金对盈利速度和盈利质量并重，而不单纯追求上市公司盈利的速度。本基金重点考察主营业务收入、经营现金流、盈利波动程度三个关键指标，以衡量具有高质量持续增长的公司。具体而言，营业收入增长率/应收账款增长率（GAR/GSales）、核心营业利润与净资产比例（CE/Equity）、经营性现金流与核心营业利润比例（CFFO/CE）等核心指标都将被运用到盈利水平的度量上。

在强调基本面选股的同时，本基金致力于挖掘优秀公司或有潜力成为优秀公司的

股票标的进行投资，本基金认为上述公司应至少具备以下多个特征：

（1）具有竞争优势

上市公司所处的行业地位通常决定其利润水平，在衡量其竞争优势时，本产品考察该公司是否具有稳定的市场占有率，进入与退出的壁垒高低，商誉和品牌是否具有影响力，同时该公司是否具备一定的网络渠道和网络效应。

（2）具有较为独特的商业模式

本基金认为一个好的商业模式是决定一个企业能否持续经营的根本。本基金将重点比较公司产品与市场产品的情况。现有产品面向的是一个新兴市场还是一个已有市场，公司的新产品面向的是新兴市场还是已有的成熟市场。同时，该上市公司有无价格优势，有无能力提价并留住顾客，有没有细分目标市场，都是本产品重点关注的方面。

（3）良好的公司治理机制

本基金认为优秀公司应具备良好的内外部公司治理机制，有合理的股权结构、良好的股东管理层沟通机制、并对员工、社会等相关利益者保持密切关怀等等。在实际的实施过程中，本基金除依据各种公开披露信息外，更注重通过对上市公司实地调研获得最新、最为准确的经营动态，并实时跟踪和更新。

#### 四、债券投资策略

本基金在严格的风险控制和确保基金资产流动性的前提下，在系统性分析研究的基础上，适时合理地利用现有的央票、国债、企业债券类证券、资产支持证券等投资工具，配合套利策略的积极运用，追求低风险下的稳健收益。

本基金结合保本周期运作要求，采用目标久期匹配原则，即根据对宏观环境中的市场、气氛和未来利率变动趋势的判断，深入分析收益率曲线与资金供求状况，通过适时选用子弹、杠铃、梯形等策略确定并控制投资组合平均剩余期限，在中长期目标久期管理的前提下，也将根据利率预期变化情况适当调整当前久期：如果预测利率将上升，可以适当降低组合的目标久期；如果预测利率将下降，则可以适当增加组合的目标久期。

此外，本基金还将采用债券类属配置策略在不同债券投资品种之间的配置比例；采用个券选择策略在正确拟合收益率曲线的基础上，及时发现偏离市场收益率的债券，选择投资于定价低估的债券品种；并通过回购套利以及跨市场、跨品种套利策略提高收益。

在法律法规许可时，本基金可基于谨慎原则运用其他相关金融工具，对基金投资组合进行管理。

#### 五、权证投资策略

本基金将综合考虑权证定价模型、市场供求关系、交易制度设计等多种因素对权证进行投资，主要运用的投资策略为：正股价值发现驱动的杠杆投资策略、组合套利策略以及复制性组合投资策略等。

#### 六、中小企业私募债投资策略

由于中小企业私募债券采取非公开方式发行和交易，并限制投资人数量上限，整体流动性相对较差。同时，受到发债主体资产规模较小、经营波动性较高、信用基本面稳定性较差的影响，整体的信用风险相对较高。中小企业私募债券的这两个特点要求在具体的投资过程中，应采取更为谨慎的投资策略。本基金认为，投资该类债券的核心要点是分析和跟踪发债主体的信用基本面，并综合考虑信用基本面、债券收益率和流动性等要素，确定最终的投资决策。

#### 七、投资决策程序

为了保证整个投资组合计划的顺利贯彻与实施，本基金遵循以下投资决策依据以及具体的决策程序：

##### 1、投资决策依据

- (1) 国家有关法律、法规和本基金合同的有关规定；
- (2) 海外及国内宏观经济环境；
- (3) 海外及国内货币政策、利率走势；
- (4) 海外及国内证券市场政策；
- (5) 地区及行业发展状况；
- (6) 上市公司研究；
- (7) 证券市场的走势。

##### 2、决策机制与程序

本基金实行投资决策委员会领导下的基金经理负责制。

投资决策委员会是本基金的最高投资决策机构，主要职责是根据基金投资目标和对市场的判断决定本基金的总体投资策略，审核并批准基金经理提出的资产配置方案或重大投资决定。投资决策委员会定期召开会议，在紧急情况下可召开临时会议。

具体的基金投资决策程序如下：

##### (1) 研究策划

研究部通过自身研究及借助外部研究机构形成有关宏观分析、市场分析、行业分析、公司分析、个券分析以及数据模拟的各类报告，提出本基金股票备选库的构建和更新方案，经投资研究联席会议讨论并最终决定本基金股票备选库，为本基金的投资管理提供决策依据。

## （2）资产配置

投资决策委员会定期召开会议，并依据基金管理部、研究部的报告确定基金资产配置的比例；如遇重大事项，投资决策委员会及时召开临时会议作出决策。

## （3）构建投资组合

基金经理根据对股票市场及债券市场的判断构建基金组合，并报投资决策委员会备案。

## （4）组合的监控和调整

研究部协同基金经理对投资组合进行跟踪。研究员应保持对个券和个股的定期跟踪，并及时向基金经理反馈个券和个股的最新信息，以利于基金经理作出相应的调整。

## （5）投资指令下达

基金经理根据投资组合方案制订具体的操作计划，并以投资指令的形式下达至交易室。

## （6）指令执行及反馈

交易室依据投资指令进行操作，并将指令的执行情况反馈给基金经理。交易完成后，由交易员完成交易日志报基金经理，交易日志存档备查。

## （7）风险控制

风险管理委员会根据市场变化对投资组合计划提出风险防范措施，监察稽核部对投资组合计划的执行过程进行日常监督和实时风险控制，基金经理依据基金申购赎回的情况控制投资组合的流动性风险。

## （8）业绩评价

绩效评价人员将定期对基金的业绩进行归因分析，找出基金投资管理的长处和不足，为日后的管理提供客观的依据。

## 七、投资限制

### （一）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。

## （二）投资组合限制

本基金的投资组合将遵循以下限制：

- 1、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%；
- 2、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%；
- 3、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%；本基金在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；
- 4、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；
- 5、现金和到期日不超过 1 年的政府债券不低于基金资产净值的 5%；
- 6、本基金持有的全部资产支持证券信用级别评级为 BBB 以上（含 BBB），其市值不得超过基金资产净值的 20%。在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；
- 7、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%；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，不得超过本基金资产净值的 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%；
- 8、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；
- 9、本基金投资单只中小企业私募债占基金资产净值比例不得超过 5%；本基金投资于中小企业私募债的比例合计不得超过基金资产净值的 30%；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中小企业私募债，不得超过该券发行总量的 10%；

10、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；  
11、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。

如法律法规或监管部门取消上述限制性规定，履行适当程序后，本基金不受上述规定的限制。

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。

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。

#### 第十一部分 基金的业绩比较基准

本基金业绩比较基准：3 年期银行定期存款税后收益率。

本基金选择三年期银行定期存款税后收益率作为业绩比较基准的原因如下：

本基金是保本型基金，保本周期为三年，保本但不保证收益率。以三年期银行定期存款税后收益率作为本基金的业绩比较基准，能够使本基金保本受益人理性判断本基金的风险收益特征，合理地衡量比较本基金保本保证的有效性。

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，基金管理人经与基金托管人协商一致，履行相关程序并报中国证监会备案后，调整业绩比较基准并及时公告。

#### 第十二部分 基金的风险收益特征

本基金为保本混合型基金，属于证券投资基金中的低风险品种。

#### 第十三部分 转型后“兴全精选股票型证券投资基金”的投资目标、范围、理念、

## 策略

### （一）投资理念

本基金致力于挖掘优秀公司或有潜力成为优秀公司的股票标的精选投资，并分享其成长过程所带来资本增值。本基金认为上述公司应具有竞争优势、独特商业模式以及良好公司治理等等基本要素。

### （二）投资目标

本基金投资于优秀公司或有潜力成为优秀公司的股票，力争获取当期收益及实现长期资本增值。

### （三）投资比例

本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括依法公开发行上市的股票（包括中小板、创业板以及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、金融债、企业债、公司债、回购、央行票据、可转换债券、中小企业私募债券、资产支持证券等）、权证以及经中国证监会批准允许基金投资的其它金融工具（但需符合中国证监会的相关规定）。

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。

本基金为股票型基金，股票投资比例为基金资产的 60%-95%，债券投资比例为基金资产的 5%-40%，其中本基金保留不低于基金资产净值的 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。

如果法律法规对该比例要求有变更的，以变更后的比例为准，本基金的投资范围会做相应调整。

### （四）大类资产配置策略

在大类资产配置上，本基金采取定性与定量研究相结合，在股票与债券等资产类别之间进行资产配置。在宏观与微观层面对各类资产的价值增长能力展开综合评估，动态优化资产配置。

有关资产配置策略的分析结论主要从以下几个方面综合考察判断：本产品全面跟踪并分析宏观经济、行业基本面、市场与行业估值、市场资金、以及市场情绪四个层面，确定未来市场可能的变动趋势。调整当前大类资产的配置比例，主要对股票投资部分进行适度的择时调整。

投资决策委员会将定期或根据需要召开会议，审议基金经理对于资产配置策略的分析结论，确定今后一段时间内资产配置策略，即基金投资组合中股票和其他金融品种的构成比例。基金经理执行审定后的资产配置计划。

### （五）行业配置策略

本基金的行业配置主要通过行业基本面筛选与行业估值筛选两大筛选体系实现，重点投资具有成长优势、估值优势和竞争优势的行业及公司，追求超额收益。

### 1、行业基本面筛选

不同行业分享经济增长能力显现出一定的差异，本基金通过综合分析行业基本面指标选出具有高成长性的优势行业。行业基本面筛选主要包含行业生命周期分析和行业内竞争态势分析等方面；而对于行业政策因素，行业收入及税前利润增长等基本面情况也将实时跟踪。

本基金认为，任何行业的生命周期与竞争状况并非是一成不变的，由于政策扶持、突发事件等因素都会导致行业的生命周期发生相应的叠加或者蜕变，而改变原有的生命周期轨迹，从而行业内竞争状况也会发生变化。因而，本基金在实际的行业配备中还会重点关注那些引起生命周期、行业竞争状态变化的因素。

### 2、行业估值筛选

本基金的行业估值筛选主要分为静态和动态两个层面，根据各个行业的历史数据和成长性，重点关注行业平均动态市盈率、行业平均市净率等指标的分析，确定行业估值水平，并进行可行的国际比较，以找到那些具有国际估值优势的行业。本基金还会定期与不定期地跟踪影响行业相对估值的各种因素，如行业的盈利能力、成长性、股利支付率、资本成本等。当行业估值水平与其影响因素发生背离时，通过筛选相应的行业以获得超额收益。????

综上，本基金通过行业基本面和估值筛选出具有良好景气和快速发展潜力的高成长性行业。最终确定行业资产投资权重，并进行动态优化配置。

#### （六）股票精选策略

本基金运用静态与动态预期数据相结合的方式考察股票的估值水平、财务指标、成长风格、盈利水平。

在考察个股的估值水平时，本基金考察企业贴现现金流以及内在价值贴现，结合市盈率（市值/净利润）、市净率（市值/净资产）、市销率（市值/营业收入）等指标考察股票的价值是否被低估。本基金认为高成长性的股票通常具有高市盈率，但高市盈率又往往意味着对该股票的高估值。因而本基金在个股选择中会强调对成长性和估值水平的甄别。

财务情况方面，本基金重点关注流动资产与流动负债、资产负债率、自由现金流负债比、自由现金流占销售收入的比重、主营业务带来的现金增长比例、无形资产比重等指标。

本基金采用年复合营业收入增长率、盈利增长率、息税前利润增长率、净资产收益率、以及现金流量增长率等指标综合考察上市公司的成长性。



在盈利水平方面，本基金对盈利速度和盈利质量并重，而不单纯追求上市公司盈利的速度。本基金重点考察主营业务收入、经营现金流、盈利波动程度三个关键指标，以衡量具有高质量持续增长的公司。具体而言，营业收入增长率/应收账款增长率（GAR/GSales）、核心营业利润与净资产比例（CE/Equity）、经营性现金流与核心营业利润比例（CFF0/CE）等核心指标都将被运用到盈利水平的度量上。

在强调基本面选股的同时，本基金致力于挖掘优秀公司或有潜力成为优秀公司的股票标的进行投资，本基金认为上述公司应至少具备以下多个特征：

#### （1）具有竞争优势

上市公司所处的行业地位通常决定其利润水平，在衡量其竞争优势时，本产品考察该公司是否具有稳定的市场占有率，进入与退出的壁垒高低，商誉和品牌是否具有影响力，同时该公司是否具备一定的网络渠道和网络效应。

#### （2）具有较为独特的商业模式

本基金认为一个好的商业模式是决定一个企业能否持续经营的根本。本基金将重点比较公司产品与市场产品的情况。现有产品面向的是一个新兴市场还是一个已有市场，公司的新产品面向的是新兴市场还是已有的成熟市场。同时，该上市公司有无价格优势，有无能力提价并留住顾客，有没有细分目标市场，都是本产品重点关注的方面。

#### （3）良好的公司治理机制

本基金认为优秀公司应具备良好的内外部公司治理机制，有合理的股权结构、良好的股东管理层沟通机制、并对员工、社会等相关利益者保持密切关怀等等。

在实际的实施过程中，本基金除依据各种公开披露信息外，更注重通过对上市公司实地调研获得最新、最为准确的经营动态，并实时跟踪和更新。

#### （七）权证投资策略

本基金将综合考虑权证定价模型、市场供求关系、交易制度设计等多种因素对权证进行投资，主要运用的投资策略为：正股价值发现驱动的杠杆投资策略、组合套利策略以及复制性组合投资策略等。

#### （八）债券投资策略

本基金在严格的风险控制和确保基金资产流动性的前提下，在系统性分析研究的基础上，通过对债券类属配置和目标久期的适时调整，适时合理地利用现有的企业债券等投资工具，配合套利策略的积极运用，追求低风险下的稳健收益。

本基金采取稳健的债券投资管理策略。制定具体投资策略时，自上而下考虑的因素是：基础利率、债券收益率曲线、市场波动、个券的相对价值和套利可能性。

本基金将采取久期偏离、收益率曲线配置和类属配置、无风险套利、杠杆策略和个券选择策略等投资策略，发现、确认并利用市场失衡实现组合增值。这些投资策略是在遵守投资纪律并有效管理风险的基础上作出的。

#### （九）基金业绩比较基准

本基金的业绩基准为：80%×沪深 300 指数+20%×中证国债指数

如果法律法规发生变化，在本基金转型为“兴全精选股票型证券投资基金”之时或未来有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，本基金管理人有权对此基准进行调整。业绩比较基准的变更须经基金管理人和基金托管人协商一致，并报中国证监会备案，基金管理人应在调整前 3 个工作日在至少一种中国证监会指定媒体上公告，并在更新的招募说明书中列示。

#### （十）风险收益特征

本基金为股票型基金产品，预期风险与预期收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金，属于较高风险、较高收益的基金品种。

### 第十四部分 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根据本基金合同规定，复核了本投资组合报告，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取自兴全保本混合型证券投资基金 2016 年第 2 季度报告，所载数据截至 2016 年 6 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 87,970,225.13 6.93

其中：股票 87,970,225.13 6.93

2 固定收益投资 1,109,572,141.81 87.41

其中：债券 1,109,572,141.81 87.41

资产支持证券 --

3 贵金属投资 --

4 金融衍生品投资 --

5 买入返售金融资产 --

其中：买断式回购的买入返售金融资产 --

6 银行存款和结算备付金合计 35,920,188.16 2.83

7 其他资产 35,902,054.14 2.83

8 合计 1,269,364,609.24 100.00

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 5,286,421.27 0.50

B 采矿业 6,818,668.00 0.64

C 制造业 44,439,135.01 4.18

D 电力、热力、燃气及水生产和供应业 8,702,708.00 0.82

E 建筑业 --

F 批发和零售业 8,574,995.00 0.81

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 11,068,744.10 1.04

J 金融业 2,962,872.00 0.28

K 房地产业 --

L 租赁和商务服务业 --

M 科学研究和技术服务业 116,681.75 0.01

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 87,970,225.13 8.28

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 002322 理工环科 706,468 13,380,503.92 1.26

2 002001 新和成 414,884 8,766,498.92 0.83

3 601199 江南水务 1,118,600 8,702,708.00 0.82

4 600297 广汇汽车 984,500 8,574,995.00 0.81

5 600309 万华化学 488,100 8,444,130.00 0.79

6 300290 荣科科技 454,860 8,355,778.20 0.79

7	000581	威孚高科	388,200	7,826,112.00	0.74
8	600882	华联矿业	677,800	6,818,668.00	0.64
9	002458	益生股份	120,667	5,286,421.27	0.50
10	300261	雅本化学	431,430	5,250,503.10	0.49

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 49,995,000.00 4.71

2 央行票据 --

3 金融债券 53,035,000.00 4.99

其中：政策性金融债 --

4 企业债券 543,847,267.61 51.18

5 企业短期融资券 29,970,000.00 2.82

6 中期票据 235,068,000.00 22.12

7 可转债 197,656,874.20 18.60

8 同业存单 --

9 其他 --

10 合计 1,109,572,141.81 104.42

5、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 1382080 13 三安 MTN2 800,000 82,880,000.00 7.80

2 112220 14 福星 01 670,391 74,755,300.41 7.04

3 122346 14 贵人鸟 700,000 72,030,000.00 6.78

4 1480508 14 宜都国通债 600,000 65,196,000.00 6.14

5 110032 三一转债 588,330 62,568,895.50 5.89

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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

9、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(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。

(2) 本基金投资股指期货的投资政策  
股指期货暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

#### 10、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  
国债期货暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

(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  
国债期货暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

#### 11、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本期未出现被监管部门立案调查，并且未在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

(2) 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

(3) 其他资产构成

序号 名称 金额(元)

1	存出保证金	514,862.68
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	35,344,090.76
5	应收申购款	43,100.70
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	35,902,054.14

(4) 报告期末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	117009	15 九洲债	30,825,000.00	2.90
2	137002	15 新钢 EB	19,488,000.00	1.83
3	123001	蓝标转债	5,364,644.70	0.50
4	137001	15 美克 EB	3,935,320.00	0.37
5	117014	15 大族 01	3,727,080.00	0.35

(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

(6) 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## 第十五部分 基金的业绩

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本基金合同生效日 2011 年 8 月 3 日，基金业绩截止日 2016 年 6 月 30 日。

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

2016 年第 2 季度 0.56% 0.16% 0.70% 0.01% -0.14% 0.15%

2016 年上半年 -0.52% 0.25% 1.40% 0.01% -1.92% 0.24%

2015 年度 16.94% 0.77% 3.47% 0.01% 13.47% 0.76%

2014 年度 13.42% 0.14% 4.37% 0.01% 9.05% 0.13%

2013 年度 6.57% 0.22% 4.40% 0.01% 2.17% 0.21%

2012 年度 3.87% 0.24% 4.79% 0.01% -0.92% 0.23%

2011 年度 -1.45% 0.37% 2.12% 0.02% -3.57% 0.35%

自基金合同成立起至 2016 年 6 月 30 日 43.94% 0.41% 22.35% 0.01% 21.59%

0.40%

注：2011 年度数据统计期间为 2011 年 8 月 3 日至 2011 年 12 月 31 日，不满一年。

## 第十六部分 基金费用与税收

### 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事务所费、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 1.3%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 1.3\% \div \text{当年天数}$$

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

保本周期内，本基金的担保费用从基金管理人的管理费收入中列支。

若保本周期到期，本基金转型为“兴全精选股票型证券投资基金”，则管理费按前一日基金资产净值的 1.5%年费率计提。

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 0.2%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

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

若保本周期到期，本基金转型为“兴全精选股票型证券投资基金”，则托管费按前一日基金资产净值的 0.25%年费率计提。

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。

在保本周期到期操作期间和过渡期间，基金管理人和基金托管人免收本基金的管理费和托管费。

上述“一、基金费用的种类”中第3—7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依照《信息披露办法》的有关规定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项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

## 第十七部分 对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书根据《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》（以下简称《运作办法》）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称《销售办法》）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称《信息披露办法》）及其他有关规定，并依据本基金管理人在本基金合同生效后对本基金实施的投资经营活动，对本基金管理人于2016年3月17日刊登《兴全保本混合型证券投资基金更新招募说明书》进行了更新，主要更



新内容如下：

一、“重要提示”部分

更新了本招募说明书所载内容截止日及有关财务数据和净值表现截止日。

二、“第三部分 基金管理人”部分

更新了公司法定代表人，更新了公司董事会成员、高级管理人员简介；更新了投资决策委员会成员简介。

三、“第四部分 基金托管人”部分

对基金托管人的基本情况、托管业务经营情况进行了更新。

四、“第五部分 相关服务机构”部分

更新了个别销售机构情况，新增销售机构——平安证券有限责任公司、诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司、深圳众禄金融控股股份有限公司、上海大智慧财富管理有限公司、中信期货有限公司、厦门市鑫鼎盛控股有限公司。

五、“第八部分 基金份额的申购、赎回与转换”部分

更新了申购金额限制的表述。

六、“第十一部分 基金的投资”部分

更新了“十一、基金投资组合报告”部分，数据内容取自本基金 2016 年第 2 季度报告，数据截止日为 2016 年 6 月 30 日，所列财务数据未经审计。

七、“第十二部分 基金的业绩”部分

更新了此部分内容，数据截止日为 2016 年 6 月 30 日。

八、“第二十二部分 基金合同的内容摘要”部分

添加脚注说明基金管理人的法定代表人已变更。

九、“第二十三部分 托管协议的内容摘要”部分

添加脚注说明基金管理人的法定代表人已变更。

十、“第二十五部分 其他应披露事项”部分

以下为自 2016 年 2 月 3 日至 2016 年 8 月 2 日，本基金刊登于《中国证券报》、《上海证券报》和公司网站的基金公告。

序号 事项名称 披露日期

- 1 关于调整陆金所资管基金申购金额下限的公告 2016-2-15
- 2 关于长期停牌股票（凯撒旅游）估值方法调整的公告 2016-3-2
- 3 关于调整旗下基金在江南农商银行定期定额申购起点金额的公告 2016-3-3
- 4 关于调整旗下基金中信银行定期定额申购起点金额的公告 2016-3-7
- 5 关于调整浙江同花顺基金销售有限公司基金申购起点金额的公告 2016-3-14
- 6 关于长期停牌股票（长安汽车）估值方法调整的公告 2016-3-22

- 7 关于长期停牌股票（鼎龙股份）估值方法调整的公告 2016-4-22
- 8 关于调整招商银行借记卡基金网上直销优惠费率的公告 2016-4-29
- 9 关于官方淘宝店和支付宝基金支付渠道关闭基金申购等业务的公告 2016-5-5
- 10 关于董事长及法定代表人变更的公告 2016-5-9
- 11 关于开通网上直销通联支付业务的公告 2016-5-11
- 12 关于长期停牌股票（利欧股份）估值方法调整的公告 2016-5-11
- 13 关于长期停牌股票（唐德影视）估值方法调整的公告 2016-5-17
- 14 关于调整旗下基金在珠海盈米财富管理有限公司基金定投起点的公告 2016-5-19
- 15 关于长期停牌股票（广电运通）估值方法调整的公告 2016-6-15
- 16 关于在上海陆金所资产管理有限公司开通旗下部分基金定期定额投资业务的公告 2016-6-17
- 17 关于调整开放式基金开户证件类型类型的公告 2016-6-21
- 18 关于增加诺亚正行为旗下部分基金销售机构的公告 2016-6-23
- 19 关于调整诺亚正行申购、定投金额下限的公告 2016-6-23
- 20 关于增加众禄金融为旗下部分基金销售机构的公告 2016-6-23
- 21 关于调整众禄金融申购、定投金额下限的公告 2016-6-23
- 22 关于旗下基金继续参加交通银行网上银行、手机银行申购优惠费率的公告 2016-6-28
- 23 旗下各基金 2016 年 6 月 30 日资产净值公告 2016-7-1
- 24 关于调整“通联支付”部分银行卡网上直销申购费率的公告 2016-7-5
- 25 关于增加平安证券有限责任公司为旗下部分基金销售机构的公告 2016-7-15
- 26 关于在工商银行开通基金转换业务的公告 2016-7-18
- 27 关于调整旗下部分基金在工商银行基金转换业务的公告 2016-7-19
- 28 关于增加上海大智慧财富管理有限公司为旗下部分基金销售机构的公告 2016-7-26
- 29 关于增加中信期货有限公司为旗下基金销售机构的公告 2016-7-26
- 30 关于增加厦门市鑫鼎盛控股有限公司为旗下部分基金销售机构的公告 2016-7-29
- 31 关于调整旗下部分基金在指定销售机构的申购、定投、最低赎回、转换转出及最低持有份额限制的公告 2016-7-29

上述内容仅为摘要，须与本《招募说明书》（正文）所载之详细资料一并阅读。

兴业全球基金管理有限公司

2016年9月14日