

# 兴全合润分级股票型证券投资基金 更新招募说明书

基金管理人：兴业全球基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

二零一一年十二月

## 【重要提示】

本基金于 2010 年 2 月 21 日经中国证监会证监许可[2010] 229 号文核准募集。本基金基金合同于 2010 年 4 月 22 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“本公司”）正式开始管理本基金。

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。

投资有风险，投资者认购（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，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，但不保证投资于本基金一定盈利，也不保证最低收益。

本更新招募说明书所载内容截止日 2011 年 10 月 21 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 2011 年第 3 季度报告，数据截止日为 2011 年 9 月 30 日（财务数据未经审计）。本基金托管人招商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	绪言	3
第二部分	释义	4
第三部分	基金管理人	9
第四部分	基金托管人	18
第五部分	相关服务机构	24
第六部分	基金份额分级	35
第七部分	基金的募集	38
第八部分	基金合同的生效	38
第九部分	合润 A 份额与合润 B 份额的上市与交易	39
第十部分	合润基金份额的场外申购、赎回与转换	41
第十一部分	合润基金份额的场内申购与赎回	49
第十二部分	运作期内的场内份额配对转换	53
第十三部分	基金份额的登记、系统内转托管和跨系统转托管	54
第十四部分	基金的投资	56
第十五部分	基金的业绩	65
第十六部分	基金的财产	66
第十七部分	基金资产的估值	67
第十八部分	基金的收益分配	74
第十九部分	运作期到期日基金份额的折算及场内份额的分拆	75
第二十部分	运作期的提前到期	76
第二十一部分	合润 A 份额与合润 B 份额的终止运作	77
第二十二部分	基金费用与税收	78
第二十三部分	基金的会计与审计	80
第二十四部分	基金的信息披露	81
第二十五部分	风险揭示	86
第二十六部分	基金合同的变更、终止与基金财产的清算	89
第二十七部分	基金合同的内容摘要	93
第二十八部分	基金托管协议的内容摘要	110
第二十九部分	对基金份额持有人的服务	124
第三十部分	其他应披露事项	126
第三十一部分	招募说明书存放及查阅方式	126
第三十二部分	备查文件	127

## 第一部分 绪言

《兴全合润分级股票型证券投资基金招募说明书》(以下简称“招募说明书”或“本招募说明书”)依照《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《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》”)以及《兴全合润分级股票型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)编写。

基金管理人承诺本招募说明书不存在任何虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。

兴全合润分级股票型证券投资基金(以下简称“基金”或“本基金”)是根据本招募说明书所载明的资料申请募集的。本基金管理人没有委托或授权任何其他人提供未在本招募说明书中载明的信息,或对本招募说明书作任何解释或者说明。

本招募说明书根据本基金的基金合同编写,并经中国证券监督管理委员会(以下简称“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。基金投资者自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和基金合同的当事人,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》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资者欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

## 第二部分 释义

在本招募说明书中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

- 1、基金或本基金：指兴全合润分级股票型证券投资基金
- 2、基金管理人：指兴业全球基金管理有限公司
- 3、基金托管人：指招商银行股份有限公司
- 4、基金合同：指《兴全合润分级股票型证券投资基金基金合同》及对基金合同的任何有效修订和补充
- 5、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《兴全合润分级股票型证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充
- 6、招募说明书或本招募说明书：指《兴全合润分级股票型证券投资基金招募说明书》及其定期的更新
- 7、基金份额发售公告：指《兴全合润分级股票型证券投资基金份额发售公告》
- 8、法律法规：指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、规范性文件、司法解释、行政规章以及其他对基金合同当事人有约束力的决定、决议、通知等
- 9、《基金法》：指2003年10月28日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，自2004年6月1日起实施的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 10、《销售办法》：指中国证监会2004年6月25日颁布、同年7月1日实施的《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 11、《信息披露办法》：指中国证监会2004年6月8日颁布、同年7月1日实施的《证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 12、《运作办法》：指中国证监会2004年6月29日颁布、同年7月1日实施的《证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 13、中国证监会：指中国证券监督管理委员会
- 14、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银行业监督管理委员会
- 15、基金合同当事人：指受基金合同约束，根据基金合同享有权利并承担义务的法律主体，包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人
- 16、个人投资者：指依据有关法律法规规定或经中国证监会核准可投资于证券

投资基金的自然人

17、机构投资者：指依法可以投资开放式证券投资基金的、在中华人民共和国境内合法注册登记并存续或经有关政府部门批准设立并存续的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织

18、合格境外机构投资者：指符合现时有效的相关法律法规规定可以投资于中国境内证券市场的中国境外的机构投资者

19、投资人：指个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人的合称

20、基金份额持有人：指依基金合同和招募说明书合法取得基金份额的投资人

21、基金销售业务：指基金管理人或代销机构宣传推介基金，发售基金份额，办理基金份额的申购、赎回、转换、非交易过户、转托管及定期定额投资等业务

22、销售机构：指直销机构和代销机构

23、直销机构：指兴业全球基金管理有限公司

24、代销机构：指符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金代销业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务代理协议，代为办理基金销售业务的机构

25、销售网点：指直销机构的直销中心及代销机构的代销网点

26、注册登记业务：指基金登记、存管、过户、清算和结算业务，具体内容包括投资人基金账户的建立和管理、基金份额注册登记、基金销售业务的确认、清算和结算、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等

27、注册登记机构：兴业全球基金管理有限公司或其委托的其他符合条件的办理基金注册登记业务的机构，本基金的注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司

28、注册登记系统：中国证券登记结算有限责任公司开放式基金登记结算系统

29、证券登记结算系统：中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司证券登记结算系统

30、基金账户：指注册登记机构为投资人开立的、记录其持有的、基金管理人所管理的基金份额余额及其变动情况的账户

31、交易账户：指销售机构为投资人开立的、记录投资人通过该销售机构买卖本基金的基金份额变动及结余情况的账户

32、基金合同生效日：指基金募集达到法律法规规定及基金合同规定的条件，基金管理人向中国证监会办理基金备案手续完毕，并获得中国证监会书面确认的日期

33、基金合同终止日：指基金合同规定的基金合同终止事由出现后，基金财产清算完毕，清算结果报中国证监会备案并予以公告的日期

34、基金募集期：指自基金份额发售之日起至发售结束之日止的期间，最长不得超过3个月

35、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限

36、运作期：基金合同生效日起每三年为一个运作期。每一运作期届满后则进入下一个为期三年的运作期。每一运作期到期日如为非工作日，则运作期到期日顺延到下一个工作日

37、运作期到期日：指基金合同生效日起每一个届满三年的工作日；运作期提前到期日，指基金合同生效日起每个运作期符合基金合同约定的提前结束日

38、基金份额结构：本基金份额包括兴全合润分级股票型证券投资基金之基础份额（简称“合润基金份额”）、兴全合润A基金份额（简称“合润A份额”）和兴全合润B基金份额（简称“合润B份额”）。其中，合润A份额与合润B份额保持4:6的比例

39、份额期初净值：指在每个运作期初始日，合润基金份额、合润A份额与合润B份额的份额净值，即1.0000元

40、合润基金份额：兴全合润分级股票型证券投资基金之基础份额

41、合润A份额：在每个运作期到期日，当合润基金份额净值低于或等于临界点（1.2100元）时，获得其份额期初净值（1.0000元/份）；当合润基金份额净值高于临界点之后，与合润B份额、合润基金份额享有同等的份额净值增长率的一类基金份额

42、合润B份额：根据合润A份额与合润B份额的关系约定及分拆比例，获得基金剩余收益或承担其余风险的一类基金份额

43、场内份额的分拆：指场内持有人所持有的合润基金份额按照4:6的比例分拆成预期收益与风险不同的两类基金份额，即合润A份额与合润B份额的行为

44、场内份额的合并：指场内持有人所持有的合润A份额与合润B份额按照4:6的比例合并成合润基金份额的行为

45、运作期到期日基金份额的折算：指每个运作期到期日（或提前到期日），合润 A 份额、合润 B 份额按届时各自份额净值与合润基金份额净值之比折算为合润基金份额，折算后将所有合润基金份额净值调整为 1.0000 元的行为

46、运作期到期日场内基金份额的分拆：指每个运作期到期日（或提前到期日），在基金份额折算后，将场内的合润基金份额按照 4：6 的比例分拆成合润 A 份额与合润 B 份额的行为

47、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

48、T 日：指销售机构在规定时间受理投资人申购、赎回或其他业务申请的工作日

49、T+n 日：指自 T 日起第 n 个工作日（不包含 T 日）

50、开放日：指为投资人办理基金申购、赎回或其他业务的工作日

51、交易时间：指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段

52、发售：在本基金募集期内，销售机构向投资者销售本基金份额的行为

53、认购：指在基金募集期内，投资人申请购买基金份额的行为

54、申购：指基金合同生效后，投资人根据基金合同和招募说明书的规定申请购买合润基金份额的行为

55、赎回：指基金合同生效后，基金份额持有人按基金合同规定的条件要求将合润基金份额兑换为现金的行为

56、上市交易：指基金存续期间投资者通过场内会员单位以集中竞价的方式买卖合润 A 份额与合润 B 份额的行为

57、场外：通过深圳证券交易所外的销售机构办理基金份额认购、合润基金份额申购和赎回的场所。通过该等场所办理基金份额的认购、合润基金份额申购和赎回也称为场外认购、场外申购、场外赎回

58、场内：指通过深圳证券交易所交易系统内的会员单位进行基金份额认购、合润基金份额申购和赎回，合润 A 份额与合润 B 份额上市交易的深圳证券交易所会员单位 and 场所

59、基金转换：指基金份额持有人按照基金合同和基金管理人届时有效公告规定的条件，申请将其持有基金管理人管理的全部或部分合润基金份额转换为基金管理人管理的、且由同一注册登记机构办理注册登记的其他基金基金份额的行为



60、转托管：指基金份额持有人将其基金账户内的合润基金份额从一个交易账户托管转移到另一交易账户的行为

61、系统内转托管：投资者将其持有的合润基金份额在注册登记系统内不同销售机构（网点）之间或证券登记结算系统内不同会员单位（席位）之间进行转托管的行为

62、跨系统转托管：投资者将其持有的合润基金份额在注册登记系统和证券登记结算系统间进行转托管的行为

63、定期定额投资计划：指投资人通过有关销售机构提出申请，约定每期扣款日、扣款金额及扣款方式，由销售机构于每期约定扣款日在投资人指定银行账户内自动完成扣款及合润基金份额申购申请的一种投资方式

64、巨额赎回：指本基金单个开放日，合润基金净赎回申请（赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过上一开放日基金总份额（包括合润基金份额、合润 A 份额与合润 B 份额）的 10%

65、元：指人民币元

66、基金收益：指基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券价差、银行存款利息、已实现的其他合法收入及因运用基金财产带来的成本和费用的节约

67、基金资产总值：指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收申购款及其他资产的价值总和

68、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

69、基金资产估值：指计算评估基金资产和负债的价值，以确定基金资产净值

70、指定媒体：指中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊、互联网网站及其他媒体

71、不可抗力：指基金合同当事人不能预见、不能避免并不能克服且在基金合同由基金管理人、基金托管人签署之日后发生的，使基金合同当事人无法全部或部分履行基金合同的任何事件，包括但不限于洪水、地震及其他自然灾害、战争、骚乱、火灾、政府征用、没收、恐怖袭击、传染病传播、法律法规变化、突发停电或其他突发事件、证券交易所非正常暂停或停止交易、公众通讯设备或互联网络故障

## 第三部分 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：兰荣

联系人：郭贤珺

联系电话：021-58368998

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”。

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。

截止2011年10月21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、兴全社会责任股票型证券投资基金、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、兴全合润分级股票型证券投资基金、兴全沪深300指数增强型证券投资基金（LOF）、兴全绿色投资股票型证券投资基金（LOF）、兴全保本混合型证券投资基金共11只基金。

兴业全球基金管理有限公司总部位于上海，在北京设有分公司，公司总部下设投资决策委员会、风险管理委员会、基金管理部、研究部、金融工程与专题研究部、

交易室、监察稽核部、市场部、渠道部、客户服务中心、专户投资部、运作保障部、综合管理部、深圳办事处，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、经理及其他高级管理人员概况

兰荣先生，董事长，1960年生，工商管理硕士、高级经济师。历任福建省建设银行投资处干部，福建省福兴财务公司科长，兴业银行总行计划资金部副总经理，兴业银行证券业务部副总经理，福建兴业证券公司总裁，兴业证券股份有限公司董事长、总裁、党委书记。现任兴业证券股份有限公司董事长兼兴业全球基金管理有限公司董事长。

郑苏芬女士，董事，1962年生，工商管理硕士，审计师。历任福建省财政厅干部，福建省审计厅副处长，福建省广宇集团股份公司财务部经理，兴业证券股份有限公司副总裁，兴业全球基金管理有限公司董事长。现任兴业证券股份有限公司副总裁兼首席合规官。

郑城美先生，董事，1974年生，经济学硕士，中共党员。历任兴业证券股份有限公司客户经理、市场分析师、办公室文秘部经理、营业部副总经理（主持工作）、计划财务部副总经理、计划财务部总经理、董事会秘书处总经理等职务。现任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。

万维德（Mar van Weede）先生，董事，1965年出生，荷兰国籍。历任 Forsythe International N.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。

Andrew Fleming 先生，董事，1959年生，毕业于纽约大学。历任英国 Gartmore 基金公司管理培训生、日本公司负责人、美国合资公司首席执行官与首席投资官，荷兰银行资产管理公司首席投资官、组合资产管理全球负责人，AEGON 资产管理部资产配置委员会主席。现任 AEGON 资产管理公司董事会成员、第三方资产管理部负责人、英国地区负责人。

霍以礼先生（Elio Fattorini），董事，1970年生，荷兰国籍，美国达特茅斯学院塔克商学院 MBA。历任巴林银行分析师，贝恩管理咨询公司高级助理，博思艾伦咨询公司顾问，荷兰银行资产管理战略和并购部高级副总裁、亚太区公司业务发展部负责人。现任 AEGON 资产管理公司亚洲区负责人（香港）。

陈百助先生，独立董事，1963年生，哲学博士。历任加拿大萨斯喀彻温大学助

理教授，克雷蒙研究所助理教授，美国南加大马歇尔商学院助理教授、副教授。现任美国南加大马歇尔商学院教授。

吴雅伦先生，独立董事，1948年生，中共党员，工商管理硕士，高级经济师。历任黑龙江兵团一师四团副班长、团宣传队副队长、政治处宣传干事，中国人民银行上海市分行秘书科副科长，上海申银证券公司法定代表人，上海证券交易所交易部经理、总经理助理、副总经理，交易所非会员理事兼会员管理委员会主任和复核委员会主任等职，还曾任上海证券通信有限公司董事长、中国证券登记结算有限责任公司董事，主导了上海证券交易所信息网络有限公司和中证指数有限责任公司的筹建和初期运行等。2008年10月，因年龄原因在上海证券交易所理事位上退休。

张志超先生，独立董事，1952年生，经济学博士。1978年至1997年先后在华东师范大学攻取了经济学学士、经济学硕士、世界经济学博士，英国牛津大学经济学博士学位。现任英国杜伦大学商学院，任国际金融学讲师，此外，兼任复旦大学顾问教授、华东师大紫江学者、中国社会科学院世界经济研究所客座研究员、西南财经大学客座教授等职，同时担任中国世界经济学会副会长、上海国际金融研究中心理事、英国中国经济学会主席等社会团体职务。

郭辉先生，监事，1959年生，博士，高级经济师。历任中国农业银行信贷部，中国农业银行信托公司，中国农业银行信托公司财务处处长，中国农业银行办公室秘书处副处长、处长，中国农业银行信托公司副总经理、党委书记，中国农业银行托管部总经理，中国农业银行审计特派员。现任兴业证券股份有限公司董事长助理。

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。现任海康保险副总裁、首席财务官。

辛墨先生，监事，1975年生，经济学博士。历任山东省社会科学院研究员，天同证券研究所研究员、部门副经理、部门经理。现任兴业全球基金管理有限公司金融工程与专题研究部总监。

## 2、高级管理人员概况

杨东先生，总经理，1970年生，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总经理。

杨卫东先生，副总经理兼市场部总监，1968年生，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。现任兴业全球基金管理有限公司副总经理兼市场部总监。

杜昌勇先生，副总经理，1970年生，理学硕士。历任兴业证券公司福建天鹭营业部电脑房负责人、上海管理总部电脑部经理，兴业证券股份有限公司证券投资部总经理助理，兴业全球基金管理有限公司兴全可转债混合型证券投资基金基金经理、基金管理部总监、投资总监。现任兴业全球基金管理有限公司副总经理。

徐天舒先生，副总经理、代任督察长，1973年生，经济学硕士，英国特许注册会计师(ACCA)。历任中信证券股份有限公司基金管理部项目经理，澳大利亚怀特控股有限公司基金经理，海康人寿保险有限公司首席执行官特别助理、发展中心负责人、助理副总经理及投资总监。现任兴业全球基金管理有限公司副总经理、代任督察长。

### 3、本基金基金经理

张惠萍女士，1976年生，经济学硕士。2002年6月加入兴业基金管理有限公司（筹），历任兴业基金管理有限公司研究策划部行业研究员、兴全趋势投资混合型证券投资基金（LOF）基金经理助理、兴全趋势投资混合型证券投资基金（LOF）基金经理。现任本基金基金经理。

王海涛先生，1972年生，沃顿商学院MBA。历任DEC中国有限公司工程师，中国惠普沈阳分公司部门经理，北京百特赛威计算机网络有限公司总经理，美国Business Excellence Inc.投资经理，摩根士丹利亚洲有限公司全球财富管理部副总裁。现任兴业全球基金管理有限公司基金管理部总监助理兼本基金基金经理。

### 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总经理
杜昌勇	兴业全球基金管理有限公司副总经理
王晓明	兴业全球基金管理有限公司投资总监，兴全趋势投资混合型证券投资基金（LOF）基金经理
傅鹏博	兴业全球基金管理有限公司基金管理部副总监，兴全社会责任股票型证券投资基金、兴全绿色投资股票型证券投资基金（LOF）基金经理

董承非 兴全全球视野股票型证券投资基金基金经理

### 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、编制中期和年度基金报告；
- 7、计算并公告基金资产、合润基金份额净值、合润 A 份额净值与合润 B 份额净值，确定合润基金份额申购、赎回价格；
- 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、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，但是国务院另有规定的除外；
  - (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) 依照法律、行政法规有关规定, 由中国证监会规定禁止的其他活动。

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, 及时向合规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、制度执行及遵规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，并提交风险管理委员会；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，财务行政部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。

## 第四部分 基金托管人

### 一、基金托管人概况

#### 1、基本情况

名称：招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”）

成立日期：1987年4月8日

注册地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦

办公地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦

注册资本：215.77亿元

法定代表人：傅育宁

行长：马蔚华

资产托管业务批准文号：中国证监会证监基字【2002】83号

电话：0755—83199084

传真：0755—83195201

资产托管部信息披露负责人：张燕

#### 2、发展概况

招商银行成立于1987年4月8日，是我国第一家完全由企业法人持股的股份制商业银行，总行设在深圳。自成立以来，招商银行先后进行了三次增资扩股，并于2002年3月成功地发行了15亿A股，4月9日在上交所挂牌（股票代码：600036），是国内第一家采用国际会计标准上市的公司。2006年9月又成功发行了22亿H股，9月22日在香港联交所挂牌交易（股票代码：3968），10月5日行使H股超额配售，共发行了24.2亿H股。截止2011年6月30日，招商银行总资产2.643万亿元人民币，核心资本充足率7.81%。

2002年8月，招商银行成立基金托管部；2005年8月，经报中国证监会同意，更名为资产托管部，下设业务支持室、产品管理室、运营室、监察稽核室4个职能处室，现有员工52人。2002年11月，经中国人民银行和中国证监会批准获得证券投资基金托管业务资格，成为国内第一家获得该项业务资格上市银行；2003年4月，正式办理基金托管业务。招商银行作为托管业务资质最全的商业银行，拥有证券投资基金托管、受托投资管理托管、合格境外机构投资者托管（QFII）、全国社会保障基金托管、保险资金托管、企业年金基金托管等业务资格。

招商银行确立“因势而变、先您所想”的托管理念和“财富所托、信守承诺”

的托管核心价值，独创“6S 托管银行”品牌体系，以“保护您的业务、保护您的财富”为历史使命，不断创新托管系统、服务和产品：在业内率先推出“网上托管银系统”、托管业务综合系统和“6 心”托管服务标准，首家发布私募基金绩效分析报告，开办国内首个托管银行网站，成功托管国内第一只券商集合资产管理计划、第一只 FOF、第一只信托资金计划、第一只股权私募基金、第一家实现货币市场基金赎回资金 T+1 到账、第一只境外银行 QDII 基金、第一只红利 ETF 基金、第一只“1+N”基金专户理财、第一家大小非解禁资产、第一单 TOT 保管，实现从单一托管服务商向全面投资者服务机构的转变，得到了同业认可，被境内外权威媒体评为“中国最佳托管专业银行”“中国资产托管市场创新客户满意首选品牌”6S 资产托管综合业务平台荣获“深圳市金融创新奖二等奖第一名”。

经过八年发展，招商银行资产托管规模快速壮大。2010 年，招商银行实现托管利润 8.11 亿元，托管费收入 3.21 亿元，托管资产突破 3200 亿元，托管日均存款突破 300 亿元，托管产品数量、托管资产规模和托管费收入稳居中小托管银行第一，基金托管新增规模居行业首位，内部控制连续四年通过 SAS70 国际认证。

## 二、主要人员情况

傅育宁先生，招商银行董事长和非执行董事，英国布鲁诺尔大学博士学位。1999 年 3 月开始担任本公司董事。2010 年 8 月起任招商局集团有限公司董事长。兼任招商局国际有限公司（香港联合交易所上市公司）主席，利和经销集团有限公司（香港联合交易所上市公司）及信和置业有限公司（香港联合交易所上市公司）独立非执行董事，香港港口发展局董事，香港证券及期货事务监察委员会成员等；中国南山开发（集团）股份有限公司董事长，招商局能源运输股份有限公司（上海证券交易所上市公司）董事长，及中国国际海运集装箱（集团）股份有限公司（深圳证券交易所上市公司）董事长，及新加坡上市公司嘉德置地有限公司独立非执行董事。

马蔚华先生，招商银行执行董事、行长兼首席执行官，1999 年 1 月加入本公司。经济学博士学位，高级经济师。第十一届全国政协委员。1999 年 1 月起任招商银行股份有限公司行长兼首席执行官。分别自 1999 年 9 月、2003 年 9 月、2007 年 11 月及 2008 年 10 月起兼任招银国际金融有限公司董事长、招商信诺人寿保险有限公司董事长及招商基金管理有限公司董事长及永隆银行有限公司董事长，并自 2002 年 7 月起担任招商局集团公司董事。同时担任中国国际商会副主席、中国企业家协会执行副会长、中国金融学会常务理事、中国红十字会第八届理事会常务理事、深圳市综研软科学发展基金会理事长和北京大学、清华大学等多所高校兼职教

授等职。

唐志宏先生，招商银行副行长，吉林大学本科毕业，高级经济师。1995年5月加入本公司，历任沈阳分行副行长，深圳管理部副主任，兰州分行行长，上海分行行长，深圳管理部主任，总行行长助理，2006年4月起担任本公司副行长。同时担任招商信诺人寿保险公司及中国银联股份有限公司董事。

吴晓辉先生，招商银行资产托管部总经理，大学本科，高级经济师。1993年10月进入招商银行工作；历任招商银行总行计划资金部副总经理，总行资金交易部总经理，招银国际金融有限公司总裁；招商银行济南分行党委书记、行长，2011年7月起担任招商银行总行资产托管部总经理。

胡家伟先生，大学本科学历，现任招商银行资产托管部副总经理。30多年银行业务及管理工作经验，已获得基金从业资格。历任招商银行总行国际业务部副总经理、招商银行蛇口支行副行长、招商银行总行单证中心主任。曾任中国银行湖北省分行国际结算处副科长、副处长、中国银行十堰分行副行长、香港南洋商业银行押汇部高级经理、香港中银集团港澳管理处业务部高级经理等职务。

### 三、基金托管业务经营情况

截至2011年9月30日，招商银行股份有限公司托管了招商安泰系列证券投资基金（含招商安泰股票型投资基金、招商安泰平衡型证券投资基金和招商安泰债券投资基金），招商现金增值证券投资基金、华夏经典配置混合型证券投资基金、长城久泰中信标普300指数证券投资基金、中信现金优势货币市场基金、光大保德信货币市场证券投资基金、华泰柏瑞金字塔稳本增利债券型证券投资基金、海富通强化回报混合型证券投资基金、光大保德信新增长股票型证券投资基金、富国天合稳健优选股票型证券投资基金、上证红利交易型开放式指数证券投资基金、德盛优势股票型证券投资基金、华富成长趋势股票型证券投资基金、光大保德信优势配置股票型证券投资基金、益民多利债券型证券投资基金、德盛红利股票证券投资基金、上证央企50交易型开放式指数基金、上投摩根行业轮动股票型证券投资基金、中银蓝筹精选灵活配置混合型证券投资基金、南方策略优化股票型证券投资基金、兴全合润分级股票型证券投资基金、中邮核心主题股票型证券投资基金、长盛沪深300指数证券投资基金（LOF）、中银价值精选灵活配置混合型基金、中银稳健双利债券型证券投资基金、银河创新成长股票型证券投资基金、嘉实多利分级债券型证券投资基金、国泰保本混合型证券投资基金、华宝兴业可转债债券型证券投资基金、建信双利策略主题分级基金、诺安保本混合证券投资基金、鹏华新兴产业股票型证券投

资基金、博时裕祥分级债券基金、中银上证国有企业 100 交易型开放式指数证券投资基金、华安可转换债券债券型证券投资基金、中银转债增强债券型证券投资基金、富国低碳环保股票型证券投资基金、诺安油气能源股票证券投资基金（QDII-LOF）共 40 只开放式基金及其它托管资产，托管资产为 4429.49 亿元人民币。

#### 四、托管人的内部控制制度

##### 1、内部控制目标

确保托管业务严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，自觉形成守法经营、规范运作的经营思想和经营理念；形成科学合理的决策机制、执行机制和监督机制，防范和化解经营风险，确保托管业务的稳健运行和托管资产的安全完整；建立有利于查错防弊、堵塞漏洞、消除隐患，保证业务稳健运行的风险控制制度，确保托管业务信息真实、准确、完整、及时；确保内控机制、体制的不断改进和各项业务制度、流程的不断完善。

##### 2、内部控制组织结构

招商银行资产托管业务建立三级内控风险防范体系：

一级风险防范是在总行行长层面对风险进行预防和控制。招商银行实行董事会领导下的行长负责制，重大事项的决策经行长办公会讨论决定，行长室下设风险控制委员会、内部控制状况评审委员会、稽核监督管理委员会、信息规划委员会等机构。

二级风险防范是总行资产托管部在业务室、专业岗位设置时，必须遵循内控制衡原则，监督制衡的形式和方式视业务的风险程度决定。

总行资产托管部内设立稽核监察室，负责部门内部风险预防和控制。稽核监察室在总经理室直接领导下，独立于部门内其他业务室和托管分部，对各岗位、各业务室、各分部、各项业务中的风险控制情况实施监督。

三级风险防范是各业务室对自身业务风险进行自我防范和控制。业务室根据法律法规、监管规定、业务规则及本部门具体情况制定工作流程及风险控制措施。

##### 3、内部控制原则

（1）全面性原则。内部控制应覆盖各项业务过程和操作环节、覆盖所有室和岗位，并由全部人员参与。

（2）审慎性原则。内部控制的核心是有效防范各种风险，托管组织体系的构成、内部管理制度的建立都要以防范风险、审慎经营为出发点，应当体现“内控优先”的要求。

(3) 独立性原则。各室、各岗位职责应当保持相对独立，不同托管资产之间、托管资产和自有资产之间应当分离。内部控制的检查、评价部门应当独立于内部控制的建立和执行部门，稽核监察室应保持高度的独立性和权威性，负责对部门内部控制工作进行评价和检查。

(4) 有效性原则。内部控制应当符合国家法律法规和监管机关的规章，具有高度的权威性，成为所有员工严格遵守的行动指南；执行内部控制制度不能存在任何例外，部门任何员工不得拥有超越制度或违反规章的权力。

(5) 适时性原则。内部控制应随着托管业务经营战略、经营方针、经营理念等内部环境的变化和国家法律、法规、政策制度等外部环境的改变及时进行相应的修订和完善。

(6) 防火墙原则。核算、清算、稽核监察等相关部门，应当在制度上和人员上适当分离，办公网和业务网分离，部门业务网和全行业务网分离，以达到风险防范的目的。

#### 4、内部控制措施

(1) 完善的制度建设。招商银行资产托管部制定了《招商银行证券投资基金托管业务管理办法》、《招商银行托管业务内控管理办法》和《招商银行证券投资基金托管业务操作规程》等一系列规章制度，从资产托管业务操作流程、会计核算、岗位管理、档案管理、保密管理和信息管理等方面，保证资产托管业务科学化、制度化、规范化运作。为保障托管资产安全和托管业务正常运作，切实维护托管业务各当事人的利益，避免托管业务危机事件发生或确保危机事件发生后能够及时、准确、有效地处理，招商银行还制定了《招商银行托管业务危机事件应急处理办法》，并建立了灾难备份中心，各种业务数据能及时在灾难备份中心进行备份，确保灾难发生时，托管业务能迅速恢复和不间断运行。

(2) 经营风险控制。招商银行资产托管部托管项目审批、资金清算与会计核算双人双岗、大额资金专人跟踪、凭证管理、差错处理等一系列完整的操作规程，有效地控制业务运作过程中的风险

(3) 业务信息风险控制。招商银行资产托管部通过数据加密传输、业务信息启动异地自动备份功能、业务信息磁带备份并由专人签收保存等措施保证业务信息及数据传递的安全性。业务信息不得泄漏，有关人员如需调用，须经总经理室审批，并做好调用登记。

(4) 客户资料风险控制。招商银行资产托管部对业务运作过程中形成的客户资

料，视同会计资料保管。客户资料不得泄露，有关人员如需调用，须经总经理室成员审批，并做好调用登记。

(5) 信息技术系统风险控制。招商银行资产托管部对信息技术系统管理实行双人双岗双责、机房空间隔离并设置门禁管理、电脑密码设置及权限管理、业务网和办公网、与全行业务网双分离制度，与外部业务机构实行防火墙保护等，保证信息技术系统的安全。

(6) 人力资源控制。招商银行资产托管部通过建立良好的企业文化和员工培训、激励机制、加强人力资源管理及建立人才梯队队伍及人才储备机制，有效的进行人力资源控制。

### 五、基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

根据《基金法》、《运作办法》等有关证券法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资范围、投资对象、基金投融资比例、基金投资禁止行为、基金管理人参与银行间债券市场、基金管理人选择存款银行、基金资产净值计算、基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等的合法性、合规性进行监督和核查。

基金托管人对上述事项的监督与核查中发现基金管理人的实际投资运作违反《基金法》、《运作办法》、基金合同、托管协议、上述监督内容的约定和其他有关法律法规的规定，应及时以书面形式通知基金管理人进行整改，整改的时限应符合法规允许的投资比例调整期限。基金管理人收到通知后应及时核对确认并以书面形式向基金托管人发出回函并改正。在规定时间内，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。基金管理人对于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的投资指令违反《基金法》、《运作办法》、基金合同和有关法律法规规定，应当拒绝执行，立即通知基金管理人限期改正，如基金管理人未能在通知期限内纠正的，基金托管人应向中国证监会报告。

基金管理人负有义务配合和协助基金托管人依照法律法规、基金合同和本托管协议对基金业务执行核查。对基金托管人发出的书面提示，基金管理人应在规定时间内答复并改正，或就基金托管人的疑义进行解释或举证；对基金托管人按照法律法规、基金合同和本托管协议的要求需向中国证监会报送基金监督报告的事项，基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

基金托管人发现基金管理人存在重大违规行为，应及时报告中国证监会，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。基金管理人无正当理由，拒绝、阻挠对方根据本托管协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督，情节严重或经基金托管人提出警告仍不改正的，基金托管人应报告中国证监会。

## 第五部分 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中心

地址：上海市张杨路 500 号时代广场 20 楼

联系人：何佳怡、黄琳蔚

客户服务电话：400-678-0099、(021) 38824536

直销联系电话：(021) 58368886、58368919

传真：(021) 58368915、58368869

- 兴业全球基金管理有限公司电子直销（目前仅开通建设银行、兴业银行、工商银行、招商银行借记卡，农业银行借记卡、准贷记卡）

交易网站：<https://trade.xyfunds.com.cn>

客服电话：400-678-0099；(021) 38824536

#### 2、代销机构

- 代销银行

##### (1) 招商银行股份有限公司

住所：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

法定代表人：傅育宁

电话：(0755) 83198888

传真：(0755) 83195049

客服电话：95555

公司网站：<http://www.cmbchina.com>

(2) 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>

(3) 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：姜建清

客户服务电话：95588

传真：(010) 66107914

公司网站：<http://www.icbc.com.cn>

(4) 中国邮政储蓄银行有限责任公司

住所：北京市西城区宣武门西大街 131 号

办公地址：北京市西城区金融大街 3 号

法定代表人：刘安东

客户服务电话：95580

传真：(010) 68858117

公司网站：<http://www.psbc.com>

(5) 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：胡怀邦

电话：(021) 58781234

传真：(021) 58408483

客户服务电话：95559

公司网站：<http://www.bankcomm.com>

(6) 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：田国立

电话：(010) 65557013

传真：(010) 65550827

客户服务电话：95558

公司网站：<http://bank.ecitic.com>

(7) 中国民生银行股份有限公司

住所（办公地址）：北京市西城区复兴门内大街2号

法定代表人：董文标

客户服务电话：95568

传真：(010) 57092611

公司网站：<http://www.cmbc.com.cn>

(8) 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：肖钢

客户服务电话：95566

公司网站：<http://www.boc.cn>

(9) 中国农业银行股份有限公司

住所（办公地址）：北京市东城区建国门内大街69号

法定代表人：项俊波

客户服务电话：95599

公司网站：<http://www.abchina.com>

(10) 中国光大银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门外大街6号光大大厦

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) 中国宁波银行股份有限公司

住所：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.nbc.com.cn>

（12）上海浦发银行股份有限公司

住所：上海市浦东新区浦东南路 500 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）深圳发展银行股份有限公司

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：肖遂宁

客户服务电话：95501

公司网站：<http://www.sdb.com.cn>

（14）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

客户服务电话：95577

公司网站：<http://www.hxb.com.cn>

（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>

● 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：万建华

客户服务咨询电话：4008888666

电话：(021) 38676666

传真：(021) 38670161

客户服务热线：4008888666

公司网站：<http://www.gtja.com.cn>

(3) 中信建投证券有限责任公司

住所：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

法定代表人：张佑君

开放式基金咨询电话：4008888108

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：吴万善

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：胡运钊

电话：(027) 63219781

传真：(027) 51062920

客户服务热线：4008-888-999 或 95579

公司网站：<http://www.95579.com>

(6) 海通证券股份有限公司

住所：上海市淮海中路 98 号

法定代表人：王开国

客服电话：400-8888-001、(021) 962503 或拨打各城市营业网点咨询电话

传真: (021)53858549

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) 82960223

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 号国际企业大厦 C 座

法定代表人: 肖时庆

联系电话: (010) 66568047

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 号大都会广场 43 楼

法定代表人: 王志伟

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

客服电话: 4006661618

联系电话: (0351) 8686703

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: 王益民

电话: (021) 63325888

传真: (021) 63326173

客服热线: (021) 962506 或 40088-88506

公司网站: <http://www.dfzq.com.cn>

(12) 德邦证券有限责任公司

办公地址: 上海市浦东新区浦东南路 588 号浦发大厦 26 楼

法定代表人: 方加春

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: 唐新宇

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) 国海证券有限责任公司

住所: 中国广西南宁市滨湖路 46 号

法定代表人: 张雅峰

联系电话: (0771) 5539262

传 真: (0771) 5539033

客服热线: 4008888100 (全国)、96100 (广西)

公司网站: <http://www.ghzq.com.cn>

(15) 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: 徐浩明

联系电话: (021) 22169081

传 真: (021) 22169134

客服热线: 4008888788

公司网站: <http://www.ebscn.com>

(16) 国元证券股份有限公司

法定代表人： 凤良志

住所： 合肥市寿春路 179 号

联系电话： 安徽地区： 96888； 全国： 400-8888-777

传真电话： (0551) 2207114

公司网站： <http://www.gyzq.com.cn>

(17) 湘财证券有限责任公司

地址： 长沙市黄兴中路 63 号中山国际大厦 12 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>

(18) 申银万国证券股份有限公司

住所（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) 54035333

客服电话： (021) 962505

公司网站： <http://www.sw2000.com.cn>

(19) 华泰联合证券有限责任公司

住所： 深圳市罗湖区深南东路 5047 号深圳发展银行大厦 10、25 层

法定代表人： 马昭明

联系电话： (0755) 82492000

传真电话： (0755) 82492962

客服电话： 400-8888-555, (0755) 25125666

公司网站： <http://www.lhzq.com>

(20) 中航证券有限公司

住所： 南昌市抚河北路 291 号

法定代表人： 杜航

联系电话： (0791) 6768763



传真：(0791) 6789414

客服电话：400-8866-567

公司网站：<http://www.scstock.com>

(21) 渤海证券有限公司

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.bhzq.com>

(22) 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：刘弘

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>

(23) 华福证券有限责任公司

住所：福州市五四路157号新天地大厦7、8层

法定代表人：黄金琳

联系电话：(0591) 87383623

传真：(0591) 87383610

公司网站：<http://www.gfhfzq.com.cn>

(24) 齐鲁证券有限公司

住所：济南市经十路20518号

法定代表人：李玮

联系电话：(0531) 68889155

传真：(0531) 68889752

公司网站：<http://www.qlzq.com.cn>

(25) 爱建证券有限责任公司

住所：上海市南京西路758号24楼

法定代表人：张建华  
联系电话：(021) 32229888  
客服电话：(021) 63340678  
公司网站：<http://www.ajzq.com>

(26) 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：牛冠兴  
联系电话：(0755) 82825551  
传真：(0755) 82558355  
客服电话：4008001001  
公司网站：<http://www.essence.com.cn>

(27) 华融证券股份有限公司

住所：北京市西城区月坛北街 26 号  
法定代表人：丁之锁  
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>

(28) 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) 82133302  
客服电话：95536  
公司网站：<http://www.guosen.com.cn>

(29) 东莞证券有限责任公司

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：游锦辉  
联系电话：(0769) 22119341  
传真：(0769) 22116999  
公司网站：<http://www.dgzq.com.cn>

(30) 东海证券有限责任公司

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：(0519) 88166222、(021) 52574550、(0379) 64902266

公司网站：<http://www.longone.com.cn>

(31) 中信证券股份有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦第 A 层

法定代表人：王东明

统一客服电话：95558

公司网站地址：<http://www.ecitic.com>

● 其他代销机构

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) 66045522

传真：(010) 66045500

客服电话：(010) 66045678

公司网站：<http://www.txsec.com>

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：北京西城区金融大街 27 号投资广场 23 层

法定代表人：金颖

办公地址：北京西城区金融大街 27 号投资广场 23 层

联系电话：010-58598853

传真：010-58598907

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：安永华明会计师事务所

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

法定代表人：葛明

电话：010-58153000

传真：010-85188298

经办注册会计师：徐艳、蒋燕华

联系人：蒋燕华

## 第六部分 基金份额分级

本基金为开放式基金，基金合同成立后，场内合润基金份额可按照 4: 6 的比例分成预期收益与风险不同的两类基金份额，即兴全合润 A 基金份额（简称“合润 A 份额”）与兴全合润 B 基金份额（简称“合润 B 份额”）。合润 A 份额与合润 B 份额分别在深圳证券交易所上市交易，交易代码不同。

本基金的每个运作期为三年，在运作期到期时按合润 A 份额与合润 B 份额关系约定进行基金份额的折算及场内份额的分拆，同时进入下一个运作期，并将顺延上一个运作期内合润 A 份额与合润 B 份额的关系约定。

## 一、基金份额结构

本基金的基金份额包括兴全合润分级股票型证券投资基金之基础份额(简称“合润基金份额”)、合润 A 份额和合润 B 份额。

合润 A 份额,指在每个运作期到期日,当合润基金份额净值低于或等于 1.2100 元时,获得其份额期初净值(1.0000 元/份);当合润基金份额净值高于 1.2100 元之后,与合润 B 份额、合润基金份额享有同等的份额净值增长率的一类基金份额。

合润 B 份额,指根据合润 A 份额与合润 B 份额的关系约定及分拆比例,获得基金剩余收益或承担其余风险的一类基金份额。

## 二、基金运作概要

1、本基金通过场内、场外两种方式公开发售。基金发售结束后,场外认购的全部份额将确认为合润基金份额;场内认购的份额将按照 4:6 的比例确认为合润 A 份额与合润 B 份额。

2、本基金《基金合同》生效后,基金管理人对合润基金份额开放申购、赎回,但不对合润 A 份额与合润 B 份额单独开放申购、赎回业务。

场内、场外申购赎回的具体事宜见本基金的基金合同和招募说明书。

3、本基金《基金合同》生效后场内份额配对转换

场内份额的分拆,指场内持有人将其所持有的合润基金份额按照 4:6 的比例分拆成预期收益与风险不同的两类基金份额,即“合润 A 份额”与“合润 B 份额”的行为;场内份额的合并,指场内持有人将其所持有的合润 A 份额与合润 B 份额按照 4:6 的比例合并成合润基金份额的行为。

场内份额配对转换程序遵循深圳证券交易所、基金登记结算机构的最新业务规则,具体见相关业务公告。

场外的基金份额不进行份额配对转换。在场外基金份额通过跨系统转托管至场内后,可按照上述场内份额配对转换规则进行操作。

4、合润 A 份额、合润 B 份额的上市交易

在运作期内,合润 A 份额、合润 B 份额分别在深圳证券交易所上市交易,交易代码不同。

## 三、合润 A 份额与合润 B 份额概要

1、运作期

本基金的每个运作期为三年(符合运作期提前到期触发机制的情况除外),自基金合同生效起按运作期滚动存续。在每个运作期内,合润 A 份额与合润 B 份额将遵

守运作期内的关系约定。

## 2、合润 A 份额、合润 B 份额的关系约定

基金合同生效后，合润 A 份额、合润 B 份额与合润基金份额的资产合并投资运作。

本基金设定在合润基金份额净值等于 1.2100 元时为临界点。每个运作期到期日，合润基金份额净值在高于或低于该临界点时，合润 A 份额与合润 B 份额具有不同的关系约定。

运作期到期日，当合润基金份额净值低于或等于 1.2100 元时，合润 A 份额获得其份额期初净值（1.0000 元/份），而合润 B 份额获得剩余收益或承担其余损失。当合润基金份额净值高于 1.2100 元之后，合润 A 份额、合润 B 份额与合润基金份额享有同等的份额净值增长率。

## 3、运作期到期日的操作

在每个运作期到期日，基金管理人将持有人持有的合润 A 份额、合润 B 份额按照第十八部分所述，将合润 A 份额与合润 B 份额按届时各自份额净值与合润基金份额净值之比折算为合润基金份额，折算后将所有合润基金份额净值调整为 1.0000 元。最后，场内的合润基金份额将再次以 4: 6 的比例分为合润 A 份额和合润 B 份额，并进入下一运作期。

下一运作期的合润 A 份额、合润 B 份额将顺延上一个运作期内合润 A 份额与合润 B 份额的关系约定。

## 四、运作期提前到期日的触发机制

当 T 日的合润基金份额净值不高于 0.5000 元，则触发运作期提前到期机制。在 T 日起的三个工作日内，基金管理人将就运作期提前到期日的确定及相关事项予以公告。运作期提前到期日的操作具体见第十九部分或届时基金管理人公告。

## 五、基金运作相关公告

1、在运作期内，如合润基金份额净值临近运作期提前到期的触发机制，即合润基金份额净值不高于 0.6000 元时，基金管理人将就提前到期日的有关事项进行提示性公告。

2、在运作期到期的前三十个工作日，基金管理人将就暂停合润基金份额的申购赎回、合润 A 份额与合润 B 份额上市交易等相关业务；运作期到期日合润 A 份额、合润 B 份额的折算及场内份额的分拆方案；下一运作期合润 A 份额与合润 B 份额的关系约定、上市交易等有关事项进行提示性公告。

## 第七部分 基金的募集

本基金由管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关规定，并经中国证监会 2010 年 2 月 21 日证监许可[2010] 229 号文核准募集。

### 一、基金类别

股票型

### 二、基金运作方式

契约型开放式

### 三、基金存续期限与运作期

基金存续期限为不定期。

本基金基金合同生效后，基金的每一个运作期为三年（含三年），每一运作期届满后则进入下一个为期三年的运作期。每一运作期到期日如为非工作日，则运作期到期日顺延到下一个工作日。

### 四、募集情况

本基金经中国证监会证监许可[2010]229 号文批准，由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关规定，自 2010 年 3 月 22 日起至 2010 年 4 月 16 日向全社会公开募集。经安永华明会计师事务所验资，募集期募集的基金份额及利息转份额共计 3,328,967,444.30 份，其中利息结转基金份额共计 1,126,495.76 份，募集户数为 37,556 户。

## 第八部分 基金合同的生效

### 一、基金合同生效时间

本基金的基金合同于 2010 年 4 月 22 日正式生效。

### 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 5,000

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，基金管理人应当向中国证监会说明原因并报送解决方案。法律法规或监管部门另有规定的，从其规定。

## 第九部分 合润A份额与合润B份额的上市与交易

### 一、合润 A 份额与合润 B 份额的上市与交易

基金合同生效后，在本基金符合法律法规和深圳证券交易所规定的上市条件的情况下，在基金运作期内，合润 A 份额与合润 B 份额分别在深圳证券交易所上市与交易，交易代码不同。

### 二、上市交易的地点

深圳证券交易所

合润A份额与合润B份额上市后，登记在中国证券登记结算有限公司深圳分公司场内证券登记结算系统中的合润A份额与合润B份额可直接在深圳证券交易所上市交易；登记在中国证券登记结算有限公司注册登记（TA）系统中的合润基金份额通过办理跨系统转托管业务将合润基金份额转至场内证券登记结算系统并分拆成合润A份额与合润B份额后，方可上市交易。

### 三、上市交易的时间

2010年5月31日。

### 四、上市交易的规则

- 1、上市首日合润A份额与合润B份额的开盘参考价为前一交易日合润A份额、合润B份额的份额净值；
- 2、每个运作期起始日，合润A份额与合润B份额的开盘参考价为前一运作期到期日经折算及场内份额分拆后的份额净值，即1.0000元；
- 3、合润A份额与合润B份额上市交易遵循《深圳证券交易所交易规则》及相关规定。



## 五、上市交易的费用

合润A份额与合润B份额上市交易的费用比照上市开放式基金的有关规定办理。

## 六、上市交易的行情揭示

合润A份额与合润B份额在深圳证券交易所挂牌交易，交易行情通过行情发布系统揭示。行情发布系统同时揭示合润A份额与合润B份额前一交易日的份额净值。

## 七、上市交易的停复牌、暂停上市、恢复上市

在每个运作期到期日（包括运作期提前到期日），合润A份额与合润B份额将暂停交易，在下一个运作期开始后，恢复合润A份额与合润B份额的上市交易。

合润A份额与合润B份额的停复牌、暂停上市、恢复上市按照深圳证券交易所的相关规定执行。

## 八、终止上市的情形和处理方式

发生下列情况之一时，合润A份额与合润B份额应同时终止上市交易：

- （1）自暂停上市之日起半年内未能消除暂停上市原因的；
- （2）基金合同终止；
- （3）基金份额持有人大会决定终止上市；
- （4）深圳证券交易所认为须终止上市的其他情况。

发生上述终止上市情形时，基金管理人报经中国证监会备案后终止本基金的上市，并在至少一种指定报刊和网站上刊登终止上市公告。

九、相关法律法规、中国证监会及深圳证券交易所对基金上市交易的规则等相关规定内容进行调整的，本基金基金合同相应予以修改，且此项修改无须召开基金份额持有人大会，并在本基金更新的招募说明书中列示。

## 第十部分 合润基金份额的场外申购、赎回与转换

本章内容仅适用于本基金合润基金份额的场外申购、赎回和转换业务。

### 一、场外申购、赎回业务办理的场所

本基金的销售机构包括基金管理人和基金管理人委托的代销机构。

具体销售网点由基金管理人在本招募说明书或基金份额发售公告等公告中列明。基金管理人可根据情况变更增减基金销售机构或办理本基金申购、赎回的场所，并予以公告。

### 二、场外申购、赎回的开放日及时间

#### 1、开放日及开放时间

合润基金份额的申购、赎回的开放日为证券交易所交易日（基金管理人公告暂停申购或赎回时除外），投资者应当在开放日办理申购和赎回申请。办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间，但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。开放日的具体业务办理时间见发售公告。

基金管理人不在开放日之外的日期或者时间办理合润基金份额的申购、赎回，投资人在基金合同约定之外的日期和时间（每个开放日 15:00 以后）提出申购或者赎回申请的，其合润基金份额申购、赎回价格为下次办理合润基金份额申购、赎回时间所在开放日的价格。

基金合同生效后，若出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更或其他特殊情况，基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整，但应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

#### 2、申购、赎回的开始时间

本基金自 2010 年 5 月 24 日起办理场内、场外日常申购、赎回业务。

3、基金管理人如果对申购、赎回时间进行调整，应报中国证监会备案，在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在中国证监会指定媒体上公告。

### 三、场外申购、赎回的原则

1、“未知价”原则，即申购、赎回价格以申请当日收市后计算的合润基金份额净值为基准进行计算。

2、“金额申购，份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请。

3、当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销。

4、基金管理人在不损害基金份额持有人权益的情况下可更改上述原则。在变更上述原则时，基金管理人必须最迟在新规则实施日前3个工作日内在至少一种中国证监会指定的报刊和网站上刊登公告。

#### 四、场外申购、赎回的程序

##### 1、申购和赎回的申请方式

投资人必须根据销售机构规定的程序，在开放日的具体业务办理时间内提出申购或赎回的申请。

投资者在提交申购合润基金份额的申请时，须按销售机构规定的方式备足申购资金；投资者在提交赎回申请时，账户中必须有足够的合润基金份额余额，否则所提交的申购、赎回申请无效而不予成交。

##### 2、申购和赎回申请的确认

T日提交的有效申请，投资者应在T+2日起到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。

##### 3、申购和赎回的款项支付

申购采用全额缴款方式，若申购资金在规定时间内未全额到账则申购不成功。若申购不成功或无效，基金管理人或基金管理人指定的代销机构将投资人已缴付的申购款项本金退还给投资人。

合润基金份额持有人赎回申请确认后，赎回款项在T+7日内支付。在发生延期支付的情形时，款项的支付办法参照基金合同的有关条款处理。

#### 五、场外申购、赎回的限制

1、投资者通过代销机构、兴业全球基金网上直销首次申购基金单笔最低金额为人民币1,000元（含申购费），追加申购单笔最低金额为500元（含申购费），中国工商银行股份有限公司销售网点的追加申购最低金额为1,000元（含申购费）；投资者通过直销中心申购基金单笔最低金额为人民币1万元（含申购费），追加申购单笔最低金额为1万元（含申购费）。已在销售网点有认购记录的投资者不受单笔申购最低金额的限制。

2、基金份额持有人可将其全部或部分合润基金份额赎回。若某笔份额减少类业

务导致单个交易账户的合润基金份额余额少于500份的,基金管理人有权对该基金持有人持有的合润基金份额做全部赎回处理。(份额减少类业务指赎回、转换转出、非交易过户、转托管等业务,具体种类以中登公司相关业务规则为准。)

3、基金管理人可根据市场情况,在法律法规允许的情况下,调整上述规定的申购的金额和赎回的份额数量限制,基金管理人必须在调整前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告并报中国证监会备案。

## 六、场外申购费率与赎回费率

### 1、申购费率:

(1)投资者在申购本基金时需交纳申购费用。申购费用按申购金额采用比例费率。投资者在一天之内如果有多笔申购,适用费率按单笔分别计算。具体费率如下:

申购金额 M (元)	申购费率
M < 50 万	1.2%
50 万 ≤ M < 200 万	0.8%
200 万 ≤ M < 500 万	0.5%
M ≥ 500 万	每笔 1000 元

(2)本基金的申购费用由申购人承担,可用于市场推广、销售、注册登记等各项费用,不列入基金财产。

### 2、赎回费:

投资者在赎回合润基金份额时,应交纳赎回费。赎回费总额的 25% 计入基金财产,扣除计入基金财产部分,赎回费的其他部分用于支付注册登记费和必要的手续费。赎回费率随赎回合润基金份额持有年份的增加而递减,具体费率如下:

持有年限 (Y)	场外赎回费率
Y < 1 年	0.5%
1 年 ≤ Y < 2 年	0.25%
Y ≥ 2 年	0

3、基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式,并最迟应于新的费率或收费方式实施 2 日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告并报中国证监会备案。

## 七、场外申购份额、赎回金额的计算公式

### 1、基金申购份额的计算

基金的申购金额包括申购费用和净申购金额。其中：

净申购金额 = 申购金额 / (1 + 申购费率)

申购费用 = 申购金额 - 净申购金额

申购份额 = 净申购金额 / 申购当日合润基金份额净值

例如，某投资者投资 5,000 元申购合润基金份额，对应费率为 1.2%，假设申购当日合润基金份额净值为 1.1280 元，则其可得到的申购份额为：

净申购金额 =  $5,000 / (1 + 1.2\%) = 4,940.71$  元

申购费用 =  $5,000 - 4,940.71 = 59.29$  元

申购份数 =  $4,940.71 / 1.1280 = 4,380.06$  份

即：某投资者投资 5,000 元申购合润基金份额，假设申购当日合润基金份额净值为 1.1280 元，则可得到 4,380.06 份合润基金份额。

## 2、基金赎回金额的计算

本基金的净赎回金额为赎回总金额扣减赎回费用。其中，

赎回总金额 = 赎回份额 × 赎回当日合润基金份额净值

赎回费用 = 赎回总金额 × 赎回费率

净赎回金额 = 赎回总金额 - 赎回费用

例如：某基金份额持有人持有本基金 10,000 份合润基金份额一年后(未满 2 年)决定赎回，对应的赎回费率为 0.25%，假设赎回当日合润基金份额净值是 1.1480 元，则可得到的净赎回金额为：

赎回总金额 =  $10,000 \times 1.1480 = 11,480$  元

赎回费用 =  $11,480 \times 0.25\% = 28.70$  元

净赎回金额 =  $11,480 - 28.70 = 11,451.30$  元

即：某基金份额持有人持有 10,000 份合润基金份额一年后(未满 2 年)赎回，假设赎回当日合润基金份额净值是 1.1480 元，则可得到的净赎回金额为 11,451.30 元。

3、T 日的合润基金份额净值在当天收市后计算，并在 T+1 日内公告。遇特殊情况，可以适当延迟计算或公告，并报中国证监会备案。合润基金份额净值的计算，保留到小数点后 4 位，小数点后第 5 位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

## 4、申购份额、余额的处理方式：

申购的有效份额为按实际确认的申购金额在扣除相应的费用后，以当日合润基

金份额净值为基准计算，申购份额计算结果保留到小数点后 2 位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

赎回金额为按实际确认的有效赎回份额以当日合润基金份额净值为基准并扣除相应的费用，赎回金额计算结果保留到小数点后 2 位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

#### 八、场外申购、赎回的注册登记

投资人申购合润基金份额成功后，注册登记机构在 T+1 日自动为投资者登记权益并办理注册登记手续，投资者自 T+2 日（含该日）后有权赎回该部分合润基金份额。

投资人赎回合润基金份额成功后，注册登记机构在 T+1 日自动为投资者办理扣除权益的注册登记手续。

基金管理人可在法律法规允许的范围内，对上述注册登记办理时间进行调整，但不得实质影响投资人的合法权益，并最迟于开始实施前 3 个工作日在至少一家指定媒体及基金管理人网站公告。

#### 九、拒绝或暂停接受申购申请的情形及处理方式

发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购合润基金份额或合润基金份额转入申请：

- 1、因不可抗力导致基金无法正常运转。
- 2、证券交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。
- 3、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况。
- 4、基金管理人认为接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时。
- 5、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，从而损害现有基金份额持有人利益的情形。
- 6、在每个运作期到期日（包括运作期提前到期日），本基金将暂停合润基金份额的场内申购与赎回。
- 7、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述暂停申购情形且基金管理人决定暂停或拒绝申购时，基金管理人应当

根据有关规定在指定媒体上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。

#### 十、暂停赎回或者延缓支付赎回款项的情形及处理方式

发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项：

- 1、因不可抗力导致基金无法正常运作。
- 2、证券交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。
- 3、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。
- 4、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况。
- 5、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形且基金管理人决定拒绝接受或暂停基金份额持有人的合润基金份额赎回申请或者延缓支付赎回款项时，基金管理人应在当日报中国证监会备案，已接受的赎回申请，基金管理人应足额支付；如暂时不能足额支付，应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分可延期支付，并以后续开放日的合润基金份额净值为依据计算赎回金额。若连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回，延期支付最长不得超过 20 个工作日，并在指定媒体上公告。投资人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并予以公告。

#### 十一、巨额赎回的情形及处理方式

##### 1、巨额赎回的认定

若本基金单个开放日内的合润基金份额净赎回申请（赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过前一开放日的基金总份额（包括合润基金份额、合润 A 份额与合润 B 份额）的 10%，即认为是发生了巨额赎回。

##### 2、巨额赎回的处理方式

当出现巨额赎回时，基金管理人可以根据本基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分顺延赎回。

1) 全额赎回：当基金管理人认为有能力支付投资者的全部赎回申请时，按正常赎回程序执行。

2) 部分顺延赎回：当基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，基金管理人应当在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额的 10% 的前提下，可对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定单个基金份额持有人当日受理的赎回份额；对于未能赎回部分，投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的合润基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。部分顺延赎回不受单笔赎回最低份额的限制。

3) 暂停赎回：连续 2 日以上（含本数）发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受合润基金份额的赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过 20 个工作日，并应当在指定媒体上进行公告。

### 3、巨额赎回的公告

当发生上述延期赎回并延期办理时，基金管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在 3 个工作日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，同时在指定媒体上刊登公告。

## 十二、暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

1、发生上述暂停申购或赎回情况的，基金管理人当日应立即向中国证监会备案，并在规定期限内指定媒体上刊登暂停公告。

2、如发生暂停的时间为 1 日，基金管理人应于重新开放日，在指定媒体上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公布最近 1 个开放日的合润基金份额净值。

3、如发生暂停的时间超过 1 日但少于 2 周，暂停结束，合润基金份额重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前 2 日在指定媒体上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公告最近 1 个开放日的合润基金份额净值。

4、如发生暂停的时间超过 2 周，暂停期间，基金管理人应每 2 周至少刊登暂停



公告1次；当连续暂停时间超过2个月时，刊登暂停公告的频率由基金管理人视情况调整。暂停结束，合润基金份额重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前2日在指定媒体上连续刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公告最近1个开放日的合润基金份额净值。

5、在运作期到期日（包括运作期提前到期日），合润基金份额暂停申购与赎回业务后，在下一运作期起始日合润基金份额重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前2日在指定媒体上连续刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公告最近1个开放日的合润基金份额净值。

### 十三、基金的转换

基金管理人可以根据相关法律法规以及基金合同的规定决定开办本基金合润基金份额与基金管理人管理的、且由同一注册登记机构办理注册登记的其他基金之间的转换业务，基金转换可以收取一定的转换费，相关规则由基金管理人届时根据相关法律法规及基金合同的规定制定并公告，并提前告知基金托管人与相关机构。

### 十四、定期定额投资计划

基金管理人可以为投资人办理合润基金份额定期定额投资计划，具体规则由基金管理人在届时发布公告或更新的招募说明书中确定。投资人在办理定期定额投资计划时可自行约定每期扣款日、扣款金额，每期扣款金额必须不低于基金管理人在相关公告或更新的招募说明书中所规定的定期定额投资计划最低合润基金份额申购金额。

### 十五、基金的非交易过户

基金的非交易过户是指基金注册登记机构受理继承、捐赠和司法强制执行而产生的非交易过户以及注册登记机构认可、符合法律法规的其它非交易过户。无论在上述何种情况下，接受划转的主体必须是依法可以持有本基金基金份额的投资人。

继承是指基金份额持有人死亡，其持有的基金份额由其合法的继承人继承；捐赠指基金份额持有人将其合法持有的基金份额捐赠给福利性质的基金会或社会团体；司法强制执行是指司法机构依据生效司法文书将基金份额持有人持有的基金份额强制划转给其他自然人、法人或其他组织。办理非交易过户必须提供基金注册登记机构要求提供的相关资料，对于符合条件的非交易过户申请按基金注册登记机构的规定办理，并按基金注册登记机构规定的标准收费。

## 十六、基金的冻结与解冻

基金注册登记机构只受理国家有权机关依法要求的合润基金份额的冻结与解冻，以及注册登记机构认可、符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻。合润基金份额的冻结手续、冻结方式按照基金注册登记机构的相关规定办理。

## 第十一部分 合润基金份额的场内申购与赎回

本章内容仅适用于本基金通过深圳证券交易所会员单位办理的场内合润基金份额的申购和赎回业务。在运作期内，基金管理人不对合润A份额与合润B份额单独开放申购、赎回业务。

### 一、场内申购和赎回的办理场所

具有基金代销业务资格且符合深圳证券交易所风险控制要求的深圳证券交易所会员单位。获得基金代销资格的深圳证券交易所会员单位具体名单可在深圳证券交易所网站查询，本基金管理人就不就此事项进行公告。

### 二、申购与赎回的账户

投资者通过场内申购、赎回应使用中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司开立的人民币普通股票账户或证券投资基金账户（账户开立的具体事项参见本基金份额发售公告认购开户相关内容）。

### 三、场内申购和赎回的开放日及开放时间

#### 1、开放日及开放时间

深圳证券交易所的工作日为本基金的场内合润基金份额的申购赎回开放日。业务办理时间为深圳证券交易所交易时间。在基金合同约定时间外提交的申请按下一交易日申请处理。

#### 2、申购与赎回的开始时间

本基金自2010年5月24日起办理场内、场外日常申购、赎回业务。

### 四、场内申购和赎回的原则

1、“未知价”原则，申购、赎回价格以申请当日收市后计算的合润基金份额净值为基准进行计算。

2、“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请。申购和赎回申报单位以深圳证券交易所的规定为准。

3、当日的申购与赎回申请可以在当日交易结束时间前撤销，在当日的交易时间结束后不得撤销。

4、基金管理人可根据基金运作的实际情况并在不影响基金份额持有人实质利益的前提下调整上述原则。基金管理人必须在新规则开始实施前按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体及基金管理人网站公告并报中国证监会备案。

## 五、场内申购和赎回的程序

### 1、申购和赎回的申请方式

基金投资者需遵循深圳证券交易所场内申购赎回相关业务规则，在开放日的业务办理时间内提出申购或赎回申请。投资者在申购合润基金份额时须按业务办理单位规定的方式备足申购资金。投资者在提交赎回申请时，应确保账户内有足够的合润基金份额余额，否则赎回申请无效。基金份额持有人持有的合润基金份额数量若不能满足其提交的赎回申请数量，赎回申请亦将被确认无效。

### 2、申购和赎回申请的确认

T日规定时间受理的申请，正常情况下，基金注册登记机构在T+1日内为投资者对该交易的有效性进行确认，在T+2日后（包括该日）投资者应向销售机构或以销售机构规定的其他方式查询申购与赎回的成交情况，否则，由此产生的投资者任何损失由投资者自行承担。

业务办理单位对申购申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表业务办理单位确实接收到申购申请。申购的确认以基金注册登记机构或基金管理人的确认结果为准。

### 3、申购和赎回的款项支付

申购采用全额缴款方式，若资金在规定时间内未全额到账则申购不成功。若申购不成功或无效，申购款项本金将退回投资者账户。

投资者赎回申请成功后，基金托管人按有关规定将在T+7日（包括该日）内支付赎回款项。在发生巨额赎回时，款项的支付办法按基金合同有关规定处理。

## 六、场内申购和赎回的数额限制

- 1、投资者通过业务办理单位场内申购本基金，单笔最低申购金额为 1,000 元。
- 2、基金管理人、深圳证券交易所或中国证券登记结算有限责任公司可根据市场情况，在不违反相关法律法规规定的前提下，调整上述限制。基金管理人必须在调整前 2 日内至少在一种中国证监会指定的媒体上刊登公告并报中国证监会备案。

## 七、场内申购和赎回的费用

- 1、本基金场内申购费率如下：

申购金额 M (元)	申购费率
$M < 50$ 万	1.2%
$50$ 万 $\leq M < 200$ 万	0.8%
$200$ 万 $\leq M < 500$ 万	0.5%
$M \geq 500$ 万	每笔 1000 元

投资者在一天之内如果有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。

本基金的申购费用应在投资人申购合润基金份额时收取。合润基金份额的申购费用不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

- 2、赎回费：场内赎回的赎回费率统一为 0.5%。

本基金的赎回费用在投资者赎回本基金份额时收取。本基金的赎回费用由赎回申请人承担，赎回费总额的 25% 归基金财产，75% 用于支付市场推广、注册登记费和其他手续费。

- 3、基金管理人和基金托管人协商后，可以根据《基金合同》的相关约定调整费率或收费方式，基金管理人最迟应于新的费率或收费方式实施日前 2 个工作日在至少一家指定媒体及基金管理人网站公告。

- 4、基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，针对以特定交易方式（如网上交易、电话交易等）等进行基金交易的投资者定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行必要手续后，基金管理人可以适当调低基金申购费率和基金赎回费率。

## 八、场内申购份额和赎回金额的计算

- 1、基金申购份额的计算

净申购金额 = 申购金额 / (1 + 申购费率)

申购费用 = 申购金额 - 净申购金额

申购份额 = 净申购金额 / 申购当日合润基金份额净值

申购份额计算结果保留到整数位，整数位后小数部分的份额对应的资金返还至投资者资金账户。

例如：某投资者通过场内投资 10,000 元申购合润基金份额，对应的申购费率为 1.2%，假设申购当日合润基金份额净值为 1.0250 元，则其申购手续费、可得到的申购份额及返还的资金余额为：

净申购金额 =  $10,000 / (1 + 1.2\%) = 9,881.42$  元

申购手续费 =  $10,000 - 9,881.42 = 118.58$  元

申购份额 =  $9,881.42 / 1.0250 = 9,640.41$  份

因场内申购份额保留至整数份，故投资者申购所得份额为 9,640 份，整数位后小数部分的申购份额对应的资金返还给投资者。具体计算公式为：

实际净申购金额 =  $9,640 \times 1.0250 = 9,881.00$  元

退款金额 =  $10,000 - 9,881.00 - 118.58 = 0.42$  元

即：投资者投资 10,000 元从场内申购合润基金份额，假设申购当日合润基金份额净值为 1.0250 元，则其可得到合润基金份额 9,640 份，退款 0.42 元。

## 2、基金赎回金额的计算

赎回总金额 = 赎回份额 × 赎回当日合润基金份额净值

赎回费用 = 赎回总金额 × 赎回费率

净赎回金额 = 赎回总金额 - 赎回费用

赎回金额计算结果保留到小数点后 2 位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

例如：某投资者从场内赎回本基金 10,000 份合润基金份额，赎回费率为 0.5%，假设赎回当日合润基金份额净值为 1.1480 元，则其可得净赎回金额为：

赎回总金额 =  $10,000 \times 1.1480 = 11,480$  元

赎回费用 =  $11,480 \times 0.5\% = 57.40$  元

净赎回金额 =  $11,480 - 57.40 = 11,422.60$  元

即：投资者从深圳证券交易所场内赎回 10,000 份合润基金份额，假设赎回当日

合润基金份额净值为 1.1480 元，则可得到的净赎回金额为 11,422.60 元。

### 九、场内申购与赎回的注册登记

基金申购、赎回的注册登记按照中国证券登记结算有限责任公司的有关规定办理。

十、办理合润基金份额场内申购、赎回业务应遵守深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的有关业务规则。若相关法律法规、中国证监会、深圳证券交易所或中国证券登记结算有限责任公司对场内申购、赎回业务规则有新的规定，按新规定执行。

十一、有关拒绝或暂停申购、暂停赎回及处理方式、重新开放申购或赎回的公告、非交易过户、冻结与解冻、定期定额投资计划等，请参见基金合同中关于“场外申购和赎回”部分的相关规定以及深圳证券交易所的有关规定，并据此执行。

## 第十二部分 运作期内的场内份额配对转换

本基金《基金合同》生效后的每个运作期内，本基金份额持有人可办理场内份额配对转换业务。

### 一、运作期内的场内份额配对转换

1、场内份额的分拆，指场内持有人将其所持有的合润基金份额按照4: 6的比例分拆成预期收益与风险不同的两类基金份额，即“合润A份额”与“合润B份额”的行为；

2、场内份额的合并，指场内持有人将其所持有的合润A份额与合润B份额按照4: 6的比例合并成合润基金份额的行为。

3、场外的合润基金份额不进行份额配对转换。在场外合润基金份额通过跨系统转托管至场内后，可按照场内份额配对转换规则进行操作。

### 二、业务办理机构

本基金运作期内场内份额配对转换业务的办理机构见基金管理人届时发布的相

关公告。深圳证券交易所、基金登记结算机构或基金管理人可根据情况变更或增减该业务的办理机构，并予以公告。

### 三、业务办理时间

本基金自2010年5月31日起开始办理配对转换业务。

### 四、业务办理程序

运作期内场内份额配对转换程序遵循深圳证券交易所、基金登记结算机构的最新业务规则，具体见相关业务公告。

### 五、暂停场内份额配对转换的情形

1、深圳证券交易所、基金登记结算机构、业务办理机构因异常情况无法办理该业务的情形。

2、法律法规、深圳证券交易所规定或经中国证监会认定的其他情形。

发生前述情况的，基金管理人应在至少一家指定媒体及基金管理人网站就暂停场内份额配对转换业务予以公告。

当恢复场内份额配对转换业务时，基金管理人也将至少在一家指定媒体及基金管理人网站予以公告。

### 六、业务办理费用

具体见相关业务公告。本基金运作期内场内份额配对转换业务的办理机构可对该业务的办理酌情收取不高于0.3%的标准收取佣金，其中包含证券交易所、登记结算机构等收取的相关费用，具体见相关业务公告。

## 第十三部分 基金份额的登记、系统内转托管和跨系统转托管

### 一、基金份额的登记

本基金的份额采用分系统登记的原则。场外认购或申购的合润基金份额登记在注册登记系统持有人开放式基金账户下；场内认购、申购、上市交易买入的基金份额登记在证券登记结算系统持有人证券账户下。登记在证券登记结算系统中的合润

A 份额与合润 B 份额只能在深圳证券交易所上市交易，不能直接申请场内赎回。登记在证券登记结算系统中的合润基金份额可以直接申请场内赎回，登记在注册登记系统中的合润基金份额可申请场外赎回。

本基金合润基金份额的转托管包括系统内转托管和跨系统转托管。

## 二、系统内转托管

1、系统内转托管是指持有人将持有的合润基金份额在注册登记系统内不同销售机构（网点）之间或证券登记结算系统内不同会员单位（席位）之间进行转托管的行为。

2、合润基金份额登记在注册登记系统的基金份额持有人在变更办理基金赎回业务的销售机构（网点）时，可办理已持有合润基金份额的系统内转托管。

3、登记在证券登记结算系统的基金份额持有人在变更办理合润 A 份额与合润 B 份额上市交易或合润基金份额赎回的会员单位（席位）时，可办理已持有合润基金份额的系统内转托管。

## 三、跨系统转托管

1、跨系统转托管是指持有人将持有的合润基金份额在注册登记系统和证券登记结算系统之间进行转托管的行为。

2、本基金跨系统转托管的具体业务按照中国证券登记结算有限责任公司的相关规定办理。

3、投资者采用基金管理人直销中心网上交易方式认购或申购的基金份额将不能办理跨系统转托管业务。若网上交易有关规定及业务规则发生变更，基金管理人可为投资者采用直销中心网上交易方式认购或申购的基金份额办理跨系统转托管时，届时基金管理人将做出调整并及时公告。



## 第十四部分 基金的投资

### 一、投资目标

本基金通过定量与定性相结合精选股票,以追求当期收益与实现长期资本增值。

### 二、投资范围和投资比例

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、国债、金融债、企业债、公司债、回购、央行票据、可转换债券、权证、资产支持证券以及经中国证监会批准允许基金投资的其它金融工具。

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%;权证投资比例为基金资产净值的 0%-3%;资产支持证券比例为基金资产净值的 0%-20%;本基金保留不低于基金资产净值的 5%的现金和到期日在一年以内的政府债券。

### 三、投资策略

#### 1、大类资产配置策略

本基金以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。本基金通过动态跟踪海内外主要经济体的 GDP、CPI、利率等宏观经济指标,以及估值水平、盈利预期、流动性、投资者心态等市场指标,确定未来市场变动趋势。本基金通过全面评估上述各种关键指标的变动趋势,对股票、债券等大类资产的风险和收益特征进行预测。

投资决策委员会将定期或根据需要召开会议,审议有关资产配置策略的分析结论,确定未来一段时间内的资产配置策略,即基金投资组合中股票与债券等资产类别的构成比例。基金经理执行审定后的资产配置计划。

#### 2、股票选择策略

本基金认为股票的瞬时市场价格受公司经营情况、证券市场供求变化等诸多因素影响,但在一定的时期内,每一只股票都有其合理的价格区间,同时,这一价格区间还将表现出时变性。

##### (1) 量化筛选

本基金运用量化筛选的方法，用静态与动态预期数据相结合的方式考察股票的价值、成长风格特征，选择那些价值被低估并具有稳定持续增长潜力的股票。

本基金采用市盈率（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。

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

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。因为市盈率相同的公司成长性差异可能很大，仅单独比较低估值或成长性无法帮助投资者筛选出价格合理、兼具成长性的股票。因此，本基金还采用GARP筛选法精选股票，以避免过分依赖价值与成长风格筛选的一些缺陷，比如由价值持续低估现象（DASP, Decline At a Reasonable Price）和成长泡沫破灭（GASP, Growth At a Stupid Price）带来的投资失败。

PEG（市盈增长比率，市盈率相对增长率之比）是本基金筛选GARP风格特征股票的重要指标。PEG为不同成长性公司的市盈率提供了可比性，暗含了获得每一个百分点增长率所需的投资成本。本基金还考察了PEGY（市盈增长及股息比率），具体而言，即市盈率相对预期盈利增长和现金股息之和的比率。相对市盈增长比率而言，PEGY更为可测和稳定。同样逻辑，PBG（市净增长比率）、PSG（市销增长比率）等则是比PEG更稳定的指标。

## （2）定性筛选

本基金认为不能完全依靠财务数据确定股票的合理价格区间，还需要综合考察诸如财务数据质量、公司治理水平、管理层能力与技术创新能力等方面，从而给以相应的折溢价水平，并最终股票合理价格区间。本基金重点考察以下定性指标：

- 公司的盈利能力和增长是否是有机，并具有持续性；
- 公司的股东、债权人、管理层之间的制衡机制、管理团队激励机制是否有效，投资者关系是否良好；
- 公司所处行业竞争程度、进入壁垒，公司自有技术、专利水平，是否具有持续的创新能力；
- 公司的行业地位、发展战略，是否具有并购价值等等。

综上所述，本基金根据上述定量指标确定相应的估值水平，鉴于相对估值法可能存在的某些局限性，本基金还综合运用了其它估值模型，比如 DCF、DDM 与 EVA 模型，进行估值再检验。并根据上述定性指标给出相应的折溢价水平，最终确定股票合理价格区间，并动态根据上述指标的演变进行价格区间的调整。

除此之外，本基金更注重通过研究团队的上市公司实地调研获得最新、最为准确的信息，及时跟踪和调整各级股票库，并最终确定具体的投资品种。

### 3、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。

### 4、债券投资策略

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。

## 四、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

研究策划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、研究策划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

研究策划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集中交易室。

#### （6）指令执行及反馈

集中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

风险控制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

金融工程小组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。

## 五、业绩比较基准

本基金的业绩基准为： $80\% \times \text{沪深300指数} + 20\% \times \text{中证国债指数}$

如果指数编制单位停止计算编制该指数或更改指数名称、或有更权威的、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。

## 六、风险收益特征

本基金为股票型基金产品，基金资产整体的预期收益和预期风险均较高，属于较高风险、较高收益的基金品种。

## 七、投资组合限制与禁止行为

除另有说明外，以下投资限制及禁止行为适用于本基金存续的全部期间。

### 1、组合限制

本基金在投资策略上兼顾投资原则以及本基金的固有特点，通过分散投资降低基金财产的非系统性风险，保持基金组合良好的流动性。基金的投资组合将遵循以下限制：

- (1) 本基金持有一家上市公司的股票，其市值不超过基金资产净值的10%；
- (2) 本基金与本基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的10%；
- (3) 基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不得超过本基金的总资产，本基金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；
- (4) 本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的0.5%；
- (5) 本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的3%；
- (6) 本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的10%；
- (7) 本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基金资产净值的10%；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

基金管理人管理的全部基金持有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%；

(9) 本基金股票投资占基金资产的比例为60%-95%，债券投资占基金资产的比例为5%-40%；资产支持证券比例为基金资产净值的0%-20%；权证投资比例为基金资产净值的0%-3%；本基金保留不低于基金资产净值的5%的现金和到期日在一年以内的政府债券。

(10) 本基金不得违反基金合同中有关投资范围、投资比例的规定；

(11) 有关法律法规以及监管部门规定的其它投资限制。

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

因证券市场变化、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合上述规定的比例或者基金合同约定的投资比例的，基金管理人应当在10个交易日内调整完毕。

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。除投资资产配置比例外，基金托管人对基金的投资比例的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

## 2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

- (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，但是法律法规或中国证监会另有规定的除外；
- (5) 向其基金管理人、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者债券；
- (6) 买卖与其基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与其基金管理人、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) 依照法律法规、中国证监会及基金合同规定禁止的其他活动；

(9) 法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

#### 八、基金管理人代表基金行使股东权利的处理原则及方法

1、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东权利，保护基金份额持有人的利益；

2、不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司的经营管理；

3、有利于基金财产的安全与增值；

4、不通过关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利害关系的第三人牟取任何不当利益。

#### 九、基金的融资、融券

如法律法规或监管机构以后允许基金进行融资、融券，本基金管理人在履行适当程序后，可以按照国家的有关法律法规进行融资、融券。

#### 十、基金投资组合报告

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人招商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合润分级股票型证券投资基金 2011 年第 3 季度报告，所载数据截至 2011 年 9 月 30 日，本报告中所列财务数据未经审计。

##### 1、报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	1,180,945,700.67	81.63
	其中：股票	1,180,945,700.67	81.63
2	固定收益投资	111,587,800.00	7.71
	其中：债券	111,587,800.00	7.71
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	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	150,774,239.84	10.42
6	其他各项资产	3,387,920.62	0.23

7	合计	1,446,695,661.13	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	13,800,000.00	0.96
B	采掘业	32,584,777.35	2.27
C	制造业	743,417,863.63	51.70
C0	食品、饮料	134,597,427.55	9.36
C1	纺织、服装、皮毛	5,937,000.00	0.41
C2	木材、家具	13,932,000.00	0.97
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	144,486,646.00	10.05
C5	电子	96,748,486.38	6.73
C6	金属、非金属	49,222,208.16	3.42
C7	机械、设备、仪表	126,204,730.51	8.78
C8	医药、生物制品	172,289,365.03	11.98
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	38,395,000.00	2.67
E	建筑业	657,000.00	0.05
F	交通运输、仓储业	77,067,622.00	5.36
G	信息技术业	64,886,194.41	4.51
H	批发和零售贸易	13,380,641.04	0.93
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	175,309,556.18	12.19
K	社会服务业	4,405,000.00	0.31
L	传播与文化产业	15,618,869.85	1.09
M	综合类	1,423,176.21	0.10
	合计	1,180,945,700.67	82.12

## 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	000895	双汇发展	1,708,355	111,043,075.00	7.72
2	600143	金发科技	7,149,000	107,949,900.00	7.51
3	600208	新湖中宝	28,099,980	105,936,924.60	7.37
4	002020	京新药业	4,854,843	96,417,181.98	6.70
5	600029	南方航空	12,000,000	77,040,000.00	5.36
6	300136	信维通信	2,834,781	62,308,486.38	4.33
7	000661	长春高新	1,566,667	61,256,679.70	4.26
8	300101	国腾电子	1,935,000	58,301,550.00	4.05



9	000800	一汽轿车	3,799,871	43,470,524.24	3.02
10	600529	山东药玻	3,353,410	42,152,363.70	2.93

#### 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	86,904,000.00	6.04
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	14,194,600.00	0.99
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	10,489,200.00	0.73
8	其他	-	-
9	合计	111,587,800.00	7.76

#### 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	1101028	11央票28	900,000	86,904,000.00	6.04
2	122009	08新湖债	140,000	14,194,600.00	0.99
3	110015	石化转债	120,000	10,489,200.00	0.73

#### 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、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末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) 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,470,405.30

2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,485,915.68
5	应收申购款	431,599.64
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,387,920.62

(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	110015	石化转债	10,489,200.00	0.73

(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600029	南方航空	77,040,000.00	5.36	非公开发行

## 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 2010 年 4 月 22 日，基金业绩截止日 2011 年 9 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
2011 年第 3 季度	-10.22%	1.18%	-12.14%	1.05%	1.92%	0.13%
2011 年上半年度	-6.99%	1.21%	-1.71%	0.99%	-5.28%	0.22%
2010 年度	8.44%	1.28%	-2.42%	1.33%	10.86%	-0.05%
自基金合同成立起至	-9.45%	1.24%	-15.73%	1.17%	6.28%	0.07%

2011年9月30日						
------------	--	--	--	--	--	--

注：2010年度数据统计期间为2010年4月22日（基金合同成立之日）至2010年12月31日，不满一年。

## 第十六部分 基金的财产

### 一、基金资产总值

基金资产总值是指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收申购款以及其他资产的价值总和。

### 二、基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

### 三、基金财产的账户

本基金财产以基金名义开立银行存款账户，以基金托管人的名义开立证券交易清算资金的结算备付金账户，以基金托管人和本基金联名的方式开立基金证券账户，以本基金的名义开立银行间债券托管账户。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金销售机构和注册登记机构自有的财产账户以及其他基金财产账户相独立。

### 四、基金财产的处分

基金财产独立于基金管理人、基金托管人和代销机构的固有财产，并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人因基金财产的管理、运用或者其他情形而取得的财产和收益归入基金财产。基金管理人、基金托管人可以按基金合同的约定收取管理费、托管费以及其他基金合同约定的费用。基金财产的债权，不得与基金管理人、基金托管人固有财产的债务相抵销，不同基金财产的债权债务，不得相互抵销。基金管理人、基金托管人以其自有资产承担法律责任，其债权人不得对基金财产行使请求冻结、扣押和其他权利。基金管理人、基金托管人不得将基金财产归入其固有财产。

基金管理人、基金托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，基金财产不属于其清算财产。

除依据《基金法》、基金合同及其他有关法律法规处分外，基金财产不得被处分。非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。

## 第十七部分 基金资产的估值

### 一、估值日

本基金的估值日为本基金相关的证券交易场所的正常营业日以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非营业日。

### 二、估值方法

本基金按以下方式进行估值：

#### 1、证券交易所上市的有价证券的估值

(1) 交易所上市的有价证券（包括股票、权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

(2) 交易所上市实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

(3) 交易所上市未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息（自债券计息起始日或上一起息日至估值当日的利息）得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如

最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

(4) 交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。交易所上市的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

(1) 送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市价（收盘价）估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值；

(2) 首次公开发行未上市的股票、债券和权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

(3) 首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的市价（收盘价）估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

3、交易所停止交易等非流通品种的估值。因持有股票而享有的配股权，以及停止交易、但未行权的权证，采用估值技术确定公允价值。

4、全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值。

5、同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

6、如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

7、相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

如基金管理人或基金托管人发现基金估值违反基金合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时，应立即通知对方，共同查明原因，双方协商解决。

根据有关法律法规，基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人对于基金资产净值的计算结果对外予以公布。

### 三、估值对象

基金所拥有的股票、权证、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。

### 四、估值程序

1、合润基金份额净值是按照每个开放日闭市后，基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算，精确到 0.0001 元，小数点后第 5 位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。合润 A 份额与合润 B 份额的份额净值精确到 0.0001 元，小数点后第 5 位四舍五入。

每个工作日计算基金资产净值及合润基金份额、合润 A 份额净值与合润 B 份额净值，并按规定公告。

2、基金管理人应每个工作日对基金资产估值。基金管理人每个开放日对基金资产估值后，将合润基金份额、合润 A 份额净值与合润 B 份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

### 五、基金份额净值的计算

#### 1、合润基金份额的基金份额净值计算

本基金 T 日合润基金份额净值 = T 日闭市后的基金资产净值 / T 日基金份额数量。

其中，T 日基金份额数量为合润基金份额、合润 A 份额与合润 B 份额数量之和。

合润基金份额净值的计算，保留到小数点后 4 位，小数点后第 5 位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

T 日的合润基金份额净值在当天收市后计算，并在下一日内公告。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

#### 2、合润 A 份额与合润 B 份额运作期的份额净值计算

(1) 合润 A 份额、合润 B 份额的份额净值计算以三年为一个计算周期。

(2) 本基金合润基金份额可按照 4: 6 的比例分成合润 A 份额与合润 B 份额，因此 4 份合润 A 份额与 6 份合润 B 份额净值之和将等于 10 份合润基金份额的净值。任一个运作期内，合润 A 份额与合润 B 份额的份额净值计算方法如下：

1) 若 T 日合润基金份额净值低于或等于 1.2100 元时，合润 A 份额获得其份额期初净值 (1.0000 元/份)；而合润 B 份额将根据合润 A 份额与合润 B 份额净值与合

润基金份额净值的比例关系求得。

2) 若 T 日合润基金份额净值高于 1.2100 元之后, 合润 A 份额、合润 B 份额与合润基金份额享有同等的份额净值增长率, 合润 A 份额净值等于其份额期初净值 (1.0000 元/份) 与根据合润基金份额净值增长率所求得的合润 A 份额净值增长之和; 而合润 B 份额将根据合润 A 份额与合润 B 份额净值与合润基金份额净值的比例关系求得。

(3) 合润 A 份额与合润 B 份额的份额净值计算公式

在第  $i$  个运作期内 T 日时, 合润 A 份额与合润 B 份额净值计算公式如下:

$$Nav_A = 1 + \frac{MAX(Nav - 1.21, 0)}{1.21} \times 1.00 = 1 + \frac{100}{121} \times MAX(Nav - 1.21, 0);$$

$$Nav_B = (Nav - 0.4 \times Nav_A) / 0.6。$$

其中,  $Nav$ 、 $Nav_A$  与  $Nav_B$  分别为第  $i$  个运作期内 T 日的合润基金份额净值、合润 A 份额净值与合润 B 份额净值。合润 A 份额净值与合润 B 份额净值的计算, 保留到小数点后 4 位, 小数点后第 5 位四舍五入。

### 3、运作期内基金份额净值计算举例

例1:

假设 T 日基金份额数量为 100 亿份, T 日闭市后的基金资产净值为 112 亿元。则:

$$Nav = 112 / 100 = 1.1200 \text{ 元};$$

根据合润 A 份额净值与合润 B 份额净值计算公式可得:

$$Nav_A = 1 + \frac{100}{121} \times MAX(Nav - 1.21, 0) = 1.0000 \text{ 元};$$

$$Nav_B = (Nav - 0.4 \times Nav_A) / 0.6 = 1.2000 \text{ 元}。$$

例2:

假设 T 日基金份额数量为 100 亿份, T 日闭市后的基金资产净值为 181.5 亿元。则:

$$Nav = 181.5 / 100 = 1.8150 \text{ 元};$$

根据合润 A 份额净值与合润 B 份额净值计算公式可得:

$$Nav_A = 1 + \frac{100}{121} \times MAX(Nav - 1.21, 0) = 1.5000 \text{ 元};$$

$$Nav_B = (Nav - 0.4 \times Nav_A) / 0.6 = 2.0250 \text{元。}$$

## 六、估值错误的处理

基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当合润基金份额净值小数点后4位以内（含第4位）时，视为合润基金份额净值错误。

基金合同的当事人应按照以下约定处理：

### 1、差错类型

本基金运作过程中，如果由于基金管理人或基金托管人、或注册登记机构、或代销机构、或投资人自身的过错造成差错，导致其他当事人遭受损失的，过错的责任人应当对由于该差错遭受损失的当事人（“受损方”）的直接损失按下述“差错处理原则”给予赔偿，承担赔偿责任。

上述差错的主要类型包括但不限于：资料申报差错、数据传输差错、数据计算差错、系统故障差错、下达指令差错等；对于因技术原因引起的差错，若系同行业现有技术水平不能预见、不能避免、不能克服，则属不可抗力，按照下述规定执行。

由于不可抗力原因造成投资人的交易资料灭失或被错误处理或造成其他差错，因不可抗力原因出现差错的当事人不对其他当事人承担赔偿责任，但因该差错取得不当得利的当事人仍应负有返还不当得利的义务。

### 2、差错处理原则

（1）差错已发生，但尚未给当事人造成损失时，差错责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正差错发生的费用由差错责任方承担；由于差错责任方未及时更正已产生的差错，给当事人造成损失的，由差错对直接损失责任方承担赔偿责任；若差错责任方已经积极协调，并且有协助义务的当事人有足够的时间进行更正而未更正，则其应当承担相应赔偿责任。差错责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认，确保差错已得到更正。

（2）差错的责任方对有关当事人的直接损失负责，不对间接损失负责，并且仅对差错的有关直接当事人负责，不对第三方负责。

（3）因差错而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但差错责任方仍应对差错负责。如果由于获得不当得利的当事人不返还或不全部返还不当得



利造成其他当事人的利益损失（“受损方”），则差错责任方应赔偿受损方的损失，并在其支付的赔偿金额的范围内对获得不当得利的当事人享有要求交付不当得利的权利；如果获得不当得利的当事人已经将此部分不当得利返还给受损方，则受损方应当将其已经获得的赔偿额加上已经获得的不当得利返还的总和超过其实际损失的差额部分支付给差错责任方。

（4）差错调整采用尽量恢复至假设未发生差错的正确情形的方式。

（5）差错责任方拒绝进行赔偿时，如果因基金管理人过错造成基金财产损失时，基金托管人应为基金的利益向基金管理人追偿，如果因基金托管人过错造成基金财产损失时，基金管理人应为基金的利益向基金托管人追偿。基金管理人和基金托管人之外的第三方造成基金财产的损失，并拒绝进行赔偿时，由基金管理人负责向差错方追偿；追偿过程中产生的有关费用，应列入基金费用，从基金资产中支付。

（6）如果出现差错的当事人未按规定对受损方进行赔偿，并且依据法律法规、基金合同或其他规定，基金管理人自行或依据法院判决、仲裁裁决对受损方承担了赔偿责任，则基金管理人有权向出现差错的当事人进行追索，并有权要求其赔偿或补偿由此发生的费用和遭受的直接损失。

（7）如果出现差错的当事人未按规定对受损方进行赔偿，并且依据法律法规、基金合同或其他规定，基金托管人自行或依据法院判决、仲裁裁决对受损方承担了赔偿责任，则基金托管人有权向出现差错的当事人进行追索，并有权要求其赔偿或补偿由此发生的费用和遭受的损失。

（8）按法律法规规定的其他原则处理差错。

### 3、差错处理程序

差错被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

（1）查明差错发生的原因，列明所有的当事人，并根据差错发生的原因确定差错的责任方；

（2）根据差错处理原则或当事人协商的方法对因差错造成的损失进行评估；

（3）根据差错处理原则或当事人协商的方法由差错的责任方进行更正和赔偿损失；

（4）根据差错处理的方法，需要修改基金注册登记机构交易数据的，由基金注

册登记机构进行更正，并就差错的更正向有关当事人进行确认。

4、基金份额净值差错处理的原则和方法如下：

(1) 基金份额净值计算出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，通报基金托管人，并采取合理的措施防止损失进一步扩大。

(2) 基金份额净值的错误偏差达到基金份额净值的 0.25% 时，基金管理人应当通报基金托管人并报中国证监会备案；错误偏差达到基金份额净值的 0.5% 时，基金管理人应当公告并报中国证监会备案。

(3) 因基金份额净值计算错误，给基金或基金份额持有人造成损失的，应由基金管理人先行赔付，基金管理人按差错情形，有权向其他当事人追偿。

(4) 基金管理人和基金托管人由于各自技术系统设置而产生的净值计算尾差，以基金管理人计算结果为准。

(5) 前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。

## 七、暂停估值的情形

- 1、基金投资所涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；
- 2、因不可抗力或其它情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；
- 3、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

## 八、基金净值的确认

用于基金信息披露的基金资产净值、合润基金份额净值、合润 A 份额与合润 B 份额由基金管理人负责计算，基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个开放日交易结束后计算当日或国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非工作日的基金资产净值并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人，由基金管理人对基金净值予以公布。

## 九、特殊情况的处理

- 1、基金管理人按估值方法的第 6 项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理；
- 2、由于不可抗力原因，或由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误，或国家会计政策变更、市场规则变更等，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、

适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

## 第十八部分 基金的收益分配

### 一、收益的构成

基金合同项下基金收益指基金利润，包括：

- 1、利息收入。
- 2、公允价值变动收入。
- 3、投资收益。
- 4、其他收入。

基金已实现收益为基金利润减去公允价值变动后的余额。因运用基金财产带来的成本或费用的节约应计入收益。

基金期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

### 二、收益分配原则

1、本基金不进行收益分配，运作期内也不单独对合润A份额与合润B份额进行收益分配。

2、经基金份额持有人大会决议通过，并经中国证监会核准后，如果终止合润A份额与合润B份额的运作，本基金将根据基金份额持有人大会决议调整基金的收益分配。具体见基金管理人届时发布的相关公告。

## 第十九部分 运作期到期日基金份额的折算及场内份额的分拆

在本基金每个运作期的到期日，即运作期的最后一个工作日，本基金将按照以下规则进行基金份额的折算及场内份额的分拆。

### 一、基金份额的折算及场内份额的分拆的基准日

每个运作期到期日，即每个运作期的最后一个工作日。

### 二、基金份额的折算与场内基金份额的分拆

1、运作期到期日基金份额的折算，指运作期到期日合润 A 份额与合润 B 份额按届时各自份额净值与合润基金份额净值之比折算为合润基金份额，并且折算后将所有合润基金份额净值调整为 1.0000 元。

2、运作期到期日场内基金份额的分拆，指运作期到期日，在基金份额折算后，将场内的合润基金份额按照 4: 6 的比例分拆成合润 A 份额与合润 B 份额的行为。届时，分拆后的合润 A 份额、合润 B 份额与合润基金份额净值均为 1.0000 元。下一运作期内，分拆后的合润 A 份额、合润 B 份额将顺延上一运作期内合润 A 份额与合润 B 份额的关系约定。

### 三、基金份额的折算方法

合润 A 份额与合润 B 份额折算公式如下：

合润 A 份额折算成份额净值为 1.0000 元的合润基金份额数=折算前合润 A 份额数  $\times \frac{Nav_A}{Nav} \times \frac{Nav}{1.0000}$  = 折算前合润 A 份额数  $\times Nav_A$ ；

合润 B 份额折算成份额净值为 1.0000 元的合润基金份额数=折算前合润 B 份额数  $\times \frac{Nav_B}{Nav} \times \frac{Nav}{1.0000}$  = 折算前合润 B 份额数  $\times Nav_B$ 。

运作期到期日，合润 A 份额、合润 B 份额折算成的合润基金份额数，场外份额数保留至小数点后 2 位，小数点 2 位以后的部分四舍五入，由此产生的误差归入基金资产；场内份额数保留至整数（最小单位为 1 份），余额计入基金资产。

### 四、运作期到期日的基金业务办理

为保证运作期到期日本基金的平稳运作，基金管理人可根据深圳证券交易所、

中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定暂停合润 A 份额与合润 B 份额的上市交易和合润基金份额的申购或赎回等业务，具体见届时基金管理人公告。

### 五、基金份额折算及场内份额分拆的公告

1、在运作期到期的前三十个工作日，基金管理人将就暂停合润基金份额的申购赎回、合润 A 份额与合润 B 份额上市交易等相关业务；运作期到期日合润 A 份额、合润 B 份额的折算及场内份额的分拆方案；下一运作期合润 A 份额与合润 B 份额的关系约定、上市交易等有关事项进行提示性公告。

2、基金份额的折算及场内份额的分拆方案最迟于实施日前 2 日在至少一家指定媒体和基金管理人网站公告，并报中国证监会备案。

3、基金份额的折算及场内份额的分拆结束后，基金管理人应在 2 日在至少一家指定媒体和基金管理人网站公告，并报中国证监会备案。

## 第二十部分 运作期的提前到期

### 一、运作期提前到期日的触发机制

本基金设定当某一运作期内，合润基金份额净值不高于 0.5000 元时，则触发该运作期提前到期机制。

### 二、运作期提前到期机制的触发日及运作期提前到期日

#### 1、运作期提前到期机制的触发日

某一运作期内，合润基金份额净值不高于 0.5000 元时的工作日，即为该运作期提前到期机制的触发日（T 日）。

#### 2、运作期提前到期日

触发日后的五个工作日内，运作期将提前结束。运作期提前结束的工作日即为运作期提前到期日。

### 三、运作期提前触发机制的实施

1、触发日后的三个工作日内，基金管理人将就运作期提前到期日的确定及相关

事项予以公告。

2、运作期提前到期日的操作与第二十章所述的操作一致，并进入下一运作期。具体操作见届时基金管理人公告。

#### 四、运作期提前到期机制的提示公告

在运作期内，如合润基金份额净值临近运作期提前到期的触发机制，即合润基金份额净值不高于 0.6000 元时，基金管理人将就提前到期日的有关事项进行提示性公告。

## 第二十一部分 合润A份额与合润B份额的终止运作

一、经基金份额持有人大会决议通过，合润 A 份额与合润 B 份额可申请终止运作。该基金份额持有人大会决议须经本基金所有份额以特别决议的形式表决通过，即须经参加基金份额持有人大会的合润基金份额、合润 A 份额与合润 B 份额各自的基金份额持有人或其代理人所持表决权的 2/3 以上（含 2/3）通过方为有效。

#### 二、合润 A 份额与合润 B 份额终止运作后的份额折算

合润 A 份额与合润 B 份额终止运作后，除非基金份额持有人大会决议另有规定的，合润 A 份额、合润 B 份额将全部折算成场内合润基金份额。

##### 1、份额折算基准日

合润 A 份额与合润 B 份额终止运作日（如该日为非工作日，则顺延至下一个工作日）。

##### 2、份额折算方式

运作期到期日合润 A 份额与合润 B 份额按届时各自份额净值与合润基金份额净值之比折算为合润基金份额。

##### 3、份额折算计算公式：

$$\text{合润 A 份额折算成合润基金份额数} = \text{折算前合润 A 份额数} \times \frac{Nav_A}{Nav}$$

$$\text{合润 B 份额折算成合润基金份额数} = \text{折算前合润 B 份额数} \times \frac{Nav_B}{Nav}$$

合润 A 份额、合润 B 份额折算成的合润基金份额数,场内份额数保留至整数(最小单位为 1 份),余额计入基金资产。

#### 4、份额折算后的基金运作

合润 A 份额与合润 B 份额全部折算为场内合润基金份额后,本基金接受场外与场内申购和赎回。

#### 5、份额折算的公告

合润 A 份额与合润 B 份额进行份额折算结束后,基金管理人应在 2 日内在至少一家指定媒体和基金管理人网站公告,并报中国证监会备案。

## 第二十二部分 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、基金财产划拨支付的银行费用;
- 4、基金合同生效后的基金信息披露费用;
- 5、基金份额持有人大会费用;
- 6、基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费;
- 7、基金的证券交易费用;
- 8、依法可以在基金财产中列支的其他费用。

二、上述基金费用由基金管理人在法律法规规定的范围内参照公允的市场价格确定,法律法规另有规定时从其规定。

### 三、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

在通常情况下,基金管理费按前一日基金资产净值的 1.5% 年费率计提。计算方法如下:

$$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费，E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 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、休息日，支付日期顺延。

## 2、基金托管人的托管费

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费，E 为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

3、除管理费和托管费之外的基金费用，由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定，按费用支出金额支付，列入或摊入当期基金费用。

## 四、不列入基金费用的项目

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，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金合同生效前所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付。

五、基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率和基金托管费率。降低基金管理费率和基金托管费率，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 2 日前在指定媒体上刊登公告。

## 六、基金税收

本基金运作过程中的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律法规履行。



## 第二十三部分 基金的会计与审计

### 一、基金的会计政策

- 1、基金管理人为本基金的会计责任方；
- 2、本基金的会计年度为公历每年的1月1日至12月31日；
- 3、本基金的会计核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位；
- 4、会计制度执行国家有关的会计制度；
- 5、本基金独立建账、独立核算；
- 6、基金管理人保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关规定编制基金会计报表；
- 7、基金托管人定期与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并书面确认。

### 二、基金的审计

- 1、基金管理人聘请具有从事证券相关业务资格的会计师事务所及其注册会计师对本基金年度财务报表及其他规定事项进行审计。会计师事务所及其注册会计师与基金管理人、基金托管人相互独立。
- 2、会计师事务所更换经办注册会计师时，应事先征得基金管理人和基金托管人同意。
- 3、基金管理人（或基金托管人）认为有充足理由更换会计师事务所，经基金托管人（或基金管理人）同意，并报中国证监会备案后可以更换。就更换会计师事务所，基金管理人应当依照《信息披露办法》的有关规定在2日内指定媒体上公告。

## 第二十四部分 基金的信息披露

基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、基金合同、及其他有关规定。基金管理人、基金托管人和其他基金信息披露义务人应当依法披露基金信息，并保证所披露信息的真实性、准确性和完整性。

本基金信息披露义务人包括基金管理人、基金托管人、召集基金份额持有人大会的基金份额持有人等法律法规和中国证监会规定的自然人、法人和其他组织。基金管理人、基金托管人和其他基金信息披露义务人应按规定将应予披露的基金信息披露事项在规定时间内通过中国证监会指定的全国性报刊（以下简称“指定报刊”）和基金管理人、基金托管人的互联网网站（以下简称“网站”）等媒介披露。

本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息，不得有下列行为：

- 1、虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏；
- 2、对证券投资业绩进行预测；
- 3、违规承诺收益或者承担损失；
- 4、诋毁其他基金管理人、基金托管人或者基金份额发售机构；
- 5、登载任何自然人、法人或者其他组织的祝贺性、恭维性或推荐性的文字；
- 6、中国证监会禁止的其他行为。

本基金公开披露的信息应采用中文文本。如同时采用外文文本的，基金信息披露义务人应保证两种文本的内容一致。两种文本发生歧义的，以中文文本为准。

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。公开披露的基金信息包括：

### 一、招募说明书

招募说明书是基金向社会公开发售时对基金情况进行说明的法律文件。

基金管理人按照《基金法》、《信息披露办法》、基金合同编制并在基金份额发售的3日前，将基金招募说明书登载在指定报刊和网站上。基金合同生效后，基金管理人应当在每6个月结束之日起45日内，更新招募说明书并登载在网站上，将更新的招募说明书摘要登载在指定报刊上。基金管理人将在公告的15日前向主要办公场所所在地的中国证监会派出机构报送更新的招募说明书，并就有关更新内容提供书面说明。更新后的招募说明书公告内容的截止日为每6个月的最后1日。

## 二、基金合同、托管协议

基金管理人应在基金份额发售的3日前，将基金合同摘要登载在指定报刊和网站上；基金管理人、基金托管人应将基金合同、托管协议登载在各自网站上。

## 三、基金份额发售公告

基金管理人将按照《基金法》、《信息披露办法》的有关规定，就基金份额发售的具体事宜编制基金份额发售公告，并在披露招募说明书的当日登载于指定报刊和网站上。

## 四、基金合同生效公告

基金管理人将在基金合同生效的次日在指定报刊和网站上登载基金合同生效公告。基金合同生效公告中将说明基金募集情况。

## 五、合润A份额与合润B份额上市交易公告书

本基金合润A份额与合润B份额获准在证券交易所上市交易后，基金管理人将在上市交易3个工作日前，将合润A份额与合润B份额上市交易公告书登载在指定报刊和网站上。

## 六、基金资产净值公告、基金份额净值公告、基金份额累计净值公告

1、本基金的基金合同生效后，在开始办理合润基金份额申购或者赎回前，基金管理人将至少每周公告一次基金资产净值、合润基金份额净值、合润A份额净值与合润B份额净值；

2、在开始办理合润基金份额申购或者赎回后，基金管理人将在每个开放日的次日，通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介，披露开放日的合润基金份额净值、合润A份额净值、合润B份额净值与合润基金份额累计净值；

3、基金管理人将公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值、合润基金份额净值、合润A份额净值与合润B份额净值。基金管理人应当在上述市场交易日的次日，将基金资产净值、合润基金份额净值、合润A份额净值、合润B份额净值与合润基金份额累计净值登载在指定报刊和网站上。

## 七、合润基金份额申购、赎回价格公告

基金管理人应当在本基金的基金合同、招募说明书等信息披露文件上载明合润基金份额申购、赎回价格的计算方式及有关申购、赎回费率，并保证投资人能够在

基金份额发售网点查阅或者复制前述信息资料。

#### 八、基金年度报告、基金半年度报告、基金季度报告

1、基金管理人应当在每年结束之日起 90 日内，编制完成基金年度报告，并将年度报告正文登载于网站上，将年度报告摘要登载在指定报刊上。基金年度报告的财务会计报告需经具有从事证券相关业务资格的会计师事务所审计后，方可披露；

2、基金管理人应当在上半年结束之日起 60 日内，编制完成基金半年度报告，并将半年度报告正文登载在网站上，将半年度报告摘要登载在指定报刊上；

3、基金管理人应当在每个季度结束之日起 15 个工作日内，编制完成基金季度报告，并将季度报告登载在指定报刊和网站上；

4、基金合同生效不足 2 个月的，本基金管理人可以不编制当期季度报告、半年度报告或者年度报告；

5、基金定期报告应当按有关规定分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。

#### 九、基金运作相关公告

1、在运作期内，如合润基金份额净值临近运作期提前到期的触发机制，即合润基金份额净值不高于 0.6000 元时，基金管理人将就提前到期日的有关事项进行提示性公告。

2、在运作期到期的前三十个工作日，基金管理人将就暂停合润基金份额的申购赎回、合润 A 份额与合润 B 份额的上市交易等相关业务；运作期到期日合润 A 份额、合润 B 份额的折算及场内份额的分拆方案；下一运作期合润 A 份额与合润 B 份额的关系约定、上市交易等有关事项进行提示性公告。

在运作期到期日的操作中，本基金所有基金份额的份额净值都将折算为 1.0000 元。本基金运作期到期日前三十个工作日起，基金管理人将就相关折算业务不断予以公告。

#### 十、临时报告与公告

在基金运作过程中发生如下可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的事件时，有关信息披露义务人应当在 2 日内编制临时报告书，予以公告，并在公开披露日分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案：

- 1、基金份额持有人大会的召开及决议；
- 2、提前终止基金合同；
- 3、转换基金运作方式；

- 4、更换基金管理人、基金托管人;
- 5、基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更;
- 6、基金管理人股东及其出资比例发生变更;
- 7、基金募集期延长;
- 8、基金管理人的董事长、总经理及其他高级管理人员、基金经理和基金托管人基金托管部门负责人发生变动;
- 9、基金管理人的董事在一年内变更超过 50%;
- 10、基金管理人、基金托管人基金托管部门的主要业务人员在一年内变动超过 30%;
- 11、涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼;
- 12、基金管理人、基金托管人受到监管部门的调查;
- 13、基金管理人及其董事、总经理及其他高级管理人员、基金经理受到严重行政处罚,基金托管人及其基金托管部门负责人受到严重行政处罚;
- 14、涉及基金的重大关联交易事项;
- 15、基金收益分配事项;
- 16、管理费、托管费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更;
- 17、基金份额净值计价错误达基金份额净值 0.5%;
- 18、基金改聘会计师事务所;
- 19、基金变更、增加或减少代销机构;
- 20、基金更换注册登记机构;
- 21、本基金开始办理合润基金份额的申购、赎回;
- 22、本基金合润基金份额的申购、赎回费率及其收费方式发生变更;
- 23、本基金发生巨额赎回并延期支付;
- 24、本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请;
- 25、本基金暂停接受合润基金份额申购、赎回申请后重新接受申购、赎回;
- 26、本基金接受或暂停接受场内份额配对转换;
- 27、本基金运作期的提前到期;
- 28、本基金暂停接受场内份额配对转换后恢复办理场内份额配对转换;
- 29、本基金实施运作期到期日基金份额的折算及场内份额的分拆;
- 30、合润 A 份额与合润 B 份额终止运作;
- 31、合润 A 份额与合润 B 份额终止运作后合润 A 份额、合润 B 份额的份额折算;

- 32、合润 A 份额、合润 B 份额上市交易；
- 33、中国证监会或基金合同规定的其他事项。

#### 十一、澄清公告

在基金合同存续期限内，任何公共媒体中出现的或者在市场上流传的消息可能对合润基金份额价格产生误导性影响或者引起较大波动的，相关信息披露义务人知悉后应当立即对该消息进行公开澄清，并将有关情况立即报告中国证监会。

#### 十二、基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决议应自生效之日起 2 日内在指定媒体公告。如果采用通讯方式进行表决，在公告基金份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。

#### 十三、中国证监会规定的其他信息

#### 十四、信息披露事务管理

基金管理人、基金托管人应当建立健全信息披露管理制度，指定专人负责管理信息披露事务。

基金信息披露义务人公开披露基金信息，应当符合中国证监会相关基金信息披露内容与格式准则的规定。

基金托管人应当按照相关法律、行政法规、中国证监会的规定和基金合同的约定，对基金管理人编制的基金资产净值、合润基金份额净值、合润 A 份额净值、合润 B 份额净值、合润基金份额申购赎回价格、基金定期报告和定期更新的招募说明书等公开披露的相关基金信息进行复核、审查，并向基金管理人出具书面文件或者盖章确认。

基金托管人在基金年度报告、半年度报告等信息披露文件中出具基金托管人报告。托管人报告应说明基金托管人和基金管理人履行基金合同的情况。

基金管理人应当在指定报刊中选择披露信息的报刊。

基金管理人、基金托管人除依法在指定报刊和网站上披露信息外，还可以根据需要其他公共媒体披露信息，但是其他公共媒体不得早于指定媒体披露信息，并且在不同媒介上披露同一信息的内容应当一致。

#### 十五、信息披露文件的存放与查阅

基金合同、托管协议、招募说明书或更新后的招募说明书、年度报告、半年度报告、季度报告和合润基金份额净值、合润 A 份额净值与合润 B 份额净值公告等文本文件在编制完成后，将存放于基金管理人所在地、基金托管人所在地，供公众查

阅。投资人在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复制件或复印件。

投资人也可在基金管理人指定的网站上进行查阅。本基金的信息披露事项将在指定媒体上公告。

本基金的信息披露将严格按照法律法规和基金合同的规定进行。

## 第二十五部分 风险揭示

### 一、投资于本基金的主要风险

#### 1. 市场风险

本基金主要投资于证券市场，而各种证券的市场价格受到经济因素、政治因素、投资者心理和交易制度等各种因素的影响，导致基金收益水平的不确定性。市场风险主要包括：政策风险、利率风险、上市公司经营风险、购买力风险，主要包括：

##### (1) 政策风险：

因国家宏观政策（如货币政策、财政政策、行业政策、地区发展政策等）发生变化，导致市场价格波动而产生风险。

##### (2) 经济周期风险：

随经济运行的周期性变化，证券市场的收益水平也呈周期性变化。基金投资于国债与上市公司的股票，收益水平也会随之变化，从而产生风险。

##### (3) 利率风险：

金融市场利率的波动会导致证券市场价格和收益率的变动。利率直接影响着国债的价格和收益率，影响着企业的融资成本和利润。基金投资于国债和股票，其收益水平会受到利率变化的影响。

##### (4) 上市公司经营风险：

上市公司的经营好坏受多种因素影响，如管理能力、财务状况、市场前景、行业竞争、人员素质等，这些都会导致企业的盈利发生变化。如果基金所投资的上市公司经营不善，其股票价格可能下跌，或者能够用于分配的利润减少，使基金投资收益下降。虽然基金可以通过投资多样化来分散这种非系统风险，但不能完全规避。

##### (5) 购买力风险：

基金的利润将主要通过现金形式来分配，而现金可能因为通货膨胀的影响而导致购买力下降，从而使基金的实际收益下降。

## 2. 信用风险

基金在交易过程中可能发生交收违约或者所投资债券的发行人违约、拒绝支付到期本息的情况，从而导致基金财产损失。

## 3. 管理风险

在基金管理运作过程中基金管理人的知识、经验、判断、决策、技能等，会影响其对信息的占有和对经济形势、证券价格走势的判断，从而影响基金收益水平。因此，本基金的收益水平与本基金管理人的管理水平、管理手段和管理技术等相关性较大。因此本基金可能因为基金管理人的因素而影响基金收益水平。

## 4. 流动性风险

本基金属于开放式基金，基金管理人都有义务接受投资者的申购、赎回和基金间转换。由于应对基金赎回和基金间转换的经验不足，加之中国股票市场波动性较大，在市场下跌时经常出现交易量急剧减少的情况，如果在这时出现较大数额的基金赎回和基金间转换申请，则使基金资产变现困难，基金面临流动性风险。

## 5. 其他风险

- (1) 因技术因素而产生的风险，如电脑系统不可靠产生的风险；
- (2) 因基金业务快速发展而在制度建设、人员配备、内控制度建立等方面不完善而产生的风险；
- (3) 因人为因素而产生的风险，如内幕交易、欺诈行为等产生的风险；
- (4) 对主要业务人员如基金经理的依赖而可能产生的风险；
- (5) 因业务竞争压力可能产生的风险；
- (6) 战争、自然灾害等不可抗力可能导致基金资产的损失，影响基金收益水平，从而带来风险；
- (7) 其他意外导致的风险。

## 6. 本基金的特定风险

### 1) 股票投资风险

本基金为股票型基金，投资于证券市场，在具体投资管理中，本基金可能面临特定类型股票所具有的特有风险，也可能由于股票投资比例较高而带来较高的系统性风险。

从资产整体运作来看，本基金为股票型基金产品，基金资产整体的预期收益和



预期风险均较高，属于较高风险、较高收益的股票型基金品种。

## 2) 基金运作的特有风险

### (1) 杠杆性风险

合润B份额在合润基金份额净值1.2100元以下区间时，合润B份额具有一定的杠杆性，因此，表现出比一般股票型份额更高的风险特征。

为减小合润B份额净值归零的风险，本基金设定在合润基金份额净值不高于0.5000元时触发运作期提前到期机制。但极端情况下，在运作期提前到期日之前，合润B份额仍有归零的风险。

### (2) 不进行收益分配的风险

在基金存续期内，本基金不进行收益分配，运作期内也不单独对合润A份额与合润B份额进行收益分配。

在每个运作期到期日，基金管理人将根据《基金合同》中的约定对本基金所有份额进行折算及场内份额的分拆。运作期到期日的操作后，投资者可通过卖出合润A份额、合润B份额或按比例合并合润A份额、合润B份额后赎回来获取投资回报。但是，投资者通过上述方式获取投资回报不等同于基金收益分配，投资者不仅须承担相应的交易成本，还可能面临基金份额卖出或赎回的价格波动风险。

### (3) 场内份额配对转换的风险

本基金《基金合同》生效后的每个运作期内，本基金份额持有人可办理场内份额配对转换业务。一方面，可能改变合润A份额与合润B份额的市场供求关系，从而可能影响基金份额的交易价格；另一方面，可能出现暂停办理该业务的情形，投资者的份额配对转换申请也可能存在不能及时确认的风险。

### (4) 流动性风险

在合润A份额与合润B份额上市交易后，合润A份额与合润B份额的规模可能较小或交易量不足，导致投资者不能迅速、低成本地变现或买入的风险。

### (5) 基金份额折算的风险

由于本基金各级份额的风险收益特征不同，在运作期到期日（或运作期提前到期日）合润A份额与合润B份额折算成合润基金份额及合润基金份额的场内份额分拆成合润A份额与合润B份额后；或者当合润A份额与合润B份额运作终止，合润A份额与合润B折算成合润基金份额后，基金份额持有人所持有的基金份额将面临风险收益特征变化的风险。

基金募集期间，投资者在场内认购基金份额后，将按照4: 6的比例确认为合润A

份额与合润B份额。运作期到期日，投资者持有的所有基金份额的份额净值都将折算为1.0000元。在下一运作期起始时，其持有基金份额数会发生变化，但基金资产不变。本基金运作期到期日前三十个工作日起，基金管理人将就相关折算业务不断予以公告。

(6) 本基金在场内、场外合润基金份额转托管、场内基金份额配对转换等业务过程中，一些券商可能由于其自身原因限制，存在无法进行场内交易的风险。

(7) 基金份额的折/溢价交易风险

合润A份额与合润B份额上市交易后，基金份额的交易价格与其基金份额净值之间可能发生偏离并出现折/溢价交易的风险。

受场内份额配对转换业务与本基金开放式机制的影响，四份合润A份额与六份合润B份额的市价总和将与十份合润基金份额的净值趋同，但是，合润A份额或合润B份额仍有可能处于折/溢价交易状态。此外，由于场内份额配对转换业务与本基金开放式机制会形成一定的套利机会，合润A份额与合润B份额的交易价格可能会相互影响。

## 二、声明

1、投资者投资于本基金，须自行承担投资风险；

2、除基金管理人直接办理本基金的销售外，本基金还通过招商银行股份有限公司等基金代销机构代理销售，基金管理人与基金代销机构都不能保证其收益或本金安全。

## 第二十六部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算

### 一、基金合同的变更

1、以下基金合同变更内容对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的，应召开基金份额持有人大会，基金合同变更的内容应经基金份额持有人大会决议同意。

(1) 提前终止基金合同；

(2) 转换基金运作方式；

- (3) 变更基金类别;
- (4) 变更基金投资目标、投资范围或投资策略(法律法规或中国证监会另有规定的除外);
- (5) 变更基金份额持有人大会程序;
- (6) 更换基金管理人、基金托管人;
- (7) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准。但根据适用的相关规定提高该等报酬标准的除外;
- (8) 本基金与其他基金的合并;
- (9) 终止合润 A 份额与合润 B 份额的运作;
- (10) 对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的其他事项;
- (11) 法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

但出现下列情况之一时,可不经基金份额持有人大会决议,由基金管理人和基金托管人同意变更后公布,并报中国证监会备案:

- (1) 调低基金管理费、基金托管费和其他应由基金承担的费用,法律法规要求增加基金费用收取;
- (2) 在法律法规和基金合同规定的范围内变更收费方式、合润基金份额的申购费率、调低赎回费率;
- (3) 因相应的法律法规及交易所的有关规则发生变动必须对基金合同进行修改;
- (4) 经中国证监会允许,基金推出新业务或服务;
- (5) 经中国证监会允许,基金管理人、基金注册登记机构、代销机构在法律法规规定的范围内调整有关基金认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务的规则;
- (6) 对基金合同的修改不涉及基金合同当事人权利义务关系发生变化;
- (7) 基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响;
- (8) 按照法律法规或基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

2、关于变更基金合同的基金份额持有人大会决议应报中国证监会核准或备案,并于中国证监会核准或出具无异议意见后生效执行,并自生效之日起 2 日内在至少一种指定媒体公告。

## 二、基金合同的终止

有下列情形之一的，基金合同经中国证监会核准后将终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止的；
- 2、基金管理人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金管理人的职务，而在6个月内无其他适当的基金管理公司承接其原有权利义务；
- 3、基金托管人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金托管人的职务，而在6个月内无其他适当的托管机构承接其原有权利义务；
- 4、中国证监会、基金合同规定的其他情况。

### 三、基金财产的清算

#### 1、基金财产清算组

(1) 基金合同终止时，成立基金财产清算组，基金财产清算组在中国证监会的监督下进行基金清算。

(2) 自基金合同终止之日起30个工作日内由基金管理人组织成立基金财产清算组，基金财产清算组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算组可以聘用必要的工作人员。

(3) 基金财产清算组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算组可以依法进行必要的民事活动。

#### 2、基金财产清算程序

基金合同终止，应当按法律法规和基金合同的有关规定对基金财产进行清算。基金财产清算程序主要包括：

- (1) 基金合同终止后，发布基金财产清算公告；
- (2) 由基金财产清算组统一接管基金财产；
- (3) 对基金财产进行清理和确认；
- (4) 对基金财产进行估价和变现；
- (5) 基金财产清算组制作清算报告；
- (6) 聘请会计师事务所对清算报告进行审计；
- (7) 聘请律师事务所出具法律意见书；
- (8) 将基金财产清算结果报告中国证监会；
- (9) 公布基金财产清算结果；

(10) 对基金剩余财产进行分配;

(11) 基金财产清算的期限为 6 个月。

### 3、清算费用

清算费用是指基金财产清算组在进行基金财产清算过程中发生的所有合理费用, 清算费用由基金财产清算组优先从基金财产中支付。

### 4、基金财产清算后剩余资产的分配

基金财产按下列顺序清偿:

(1) 支付清算费用;

(2) 交纳所欠税款;

(3) 清偿基金债务;

(4) 按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

基金财产未按前款(1) - (3)项规定清偿前, 不分配给基金份额持有人。

依据基金财产清算的分配方案, 将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后, 分别计算合润基金份额、合润 A 份额与合润 B 份额各自的应计分配比例, 并据此由合润基金份额、合润 A 份额与合润 B 份额各自的基金份额持有人根据其持有的基金份额比例进行分配。

经基金份额持有人大会决议通过, 并经中国证监会核准, 在本基金的合润 A 份额与合润 B 份额终止运作后, 如果本基金进行基金财产清算, 则依据基金财产清算的分配方案, 将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后, 按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

### 5、基金财产清算的公告

基金财产清算公告于基金合同终止并报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算组公告; 清算过程中的有关重大事项须及时公告; 基金财产清算结果经会计师事务所审计, 律师事务所出具法律意见书后, 由基金财产清算组报中国证监会备案并公告。

### 6、基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

## 第二十七部分 基金合同的内容摘要

### 一、基金合同当事人及权利义务

#### 1、基金管理人

名称：兴业全球基金管理有限公司

住所：上海市黄浦区金陵东路 368 号

办公地址：上海市浦东张杨路 500 号时代广场 20 楼

邮政编码：200122

法定代表人：兰荣

成立时间：2003 年 9 月 30 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基字[2003]100 号

组织形式：有限责任公司

注册资本：1.5 亿元人民币

存续期间：持续经营

经营范围：发起设立基金，基金管理业务，中国证监会允许的其它业务

#### 2、基金托管人

名称：招商银行股份有限公司(简称：招商银行)

住所：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

办公地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

邮政编码：518040

法定代表人：傅育宁

成立时间：1987 年 4 月 8 日

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[2002]83 号

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；办理结算；办理票据贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券；同业拆借；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保管箱服务。外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外币兑换；国际结算；结汇、售汇；同业外汇拆借；外汇票据的承兑和贴现；外汇借款；外汇担保；发行和代理发行股票以外的外币有价证券；买卖和代理买卖股票以外的外币有价证券；自营和代客外汇买卖；资信调查、咨询、见证业务；离岸金融业务。经中国人民银行批准的其他业务。

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币 215.77 亿元

存续期间：持续经营

### 3、基金份额持有人

投资人自依基金合同、招募说明书取得基金份额即成为基金份额持有人和基金合同当事人，直至其不再持有本基金的基金份额，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的完全承认和接受。基金份额持有人作为基金合同当事人并不以在基金合同上书面签章或签字为必要条件。

本基金除合润 A 份额与合润 B 份额净值计算、基金份额折算、《基金合同》终止时的基金清算财产分配、合润 A 份额与合润 B 份额终止运作后的份额折算外，本基金每份基金份额具有同等的合法权益。如果合润 A 份额与合润 B 份额的运作出现终止，则在终止合润 A 份额与合润 B 份额的运作后，本基金每份基金份额具有同等的合法权益。

### 4、基金管理人的权利

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金管理人的权利为：

(1) 自基金合同生效之日起，依照有关法律法规和基金合同的规定独立运用并管理基金财产；

(2) 依照基金合同获得基金管理费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入；

(3) 发售基金份额；

(4) 依照有关规定行使因基金财产投资于证券所产生的权利；

(5) 在符合有关法律法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务的规则，在法律法规和基金合同规定的范围内决定和调整基金的相关费率结构和收费方式；

(6) 根据基金合同及有关规定监督基金托管人，对于基金托管人违反了基金合同或有关法律法规规定的行为，对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应及时呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金及相关当事人的利益；

(7) 在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理合润基金份额申购和赎回申请；

(8) 在法律法规允许的前提下，为基金份额持有人的利益依法为基金进行融资、融券；

(9) 自行担任或选择、更换注册登记机构，获取基金份额持有人名册，并对注

册登记机构的代理行为进行必要的监督和检查；

(10) 选择、更换代销机构，并依据销售代理协议和有关法律法规，对其行为进行必要的监督和检查；

(11) 选择、更换律师、审计师、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；

(12) 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；

(13) 依法召集基金份额持有人大会；

(14) 法律法规、中国证监会、基金合同以及依据基金合同制订的其他法律文件所规定的其他权利。

#### 5、基金管理人的义务

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金管理人的义务为：

(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) 自基金合同生效之日起，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产；

(4) 配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；

(5) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；

(6) 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；

(7) 依法接受基金托管人的监督；

(8) 计算并公告基金资产及合润基金份额、合润 A 份额与合润 B 份额的份额净值，确定合润基金份额申购、赎回价格；

(9) 采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合基金合同等法律文件的规定；

(10) 按规定受理合润基金份额申购和赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

(11) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

(12) 编制季度、半年度和年度基金报告；



(13) 严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；

(14) 保守基金商业秘密，不得泄露基金投资计划、投资意向等，除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不得向他人泄露；

(15) 依据《基金法》、基金合同及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

(16) 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收益；

(17) 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；

(18) 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；

(19) 组织并参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

(20) 因违反基金合同导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

(21) 基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；

(22) 按规定向基金托管人提供基金份额持有人名册资料；

(23) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产或由接管人接管其资产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；

(24) 执行生效的基金份额持有人大会决议；

(25) 不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；

(26) 依照法律法规为基金份额持有人的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利，不谋求对上市公司的控股和直接管理；

(27) 法律法规、中国证监会和基金合同规定的其他义务。

## 6、基金托管人的权利

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金托管人的权利为：

(1) 依基金合同约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入；

- (2) 监督基金管理人对本基金的投资运作;
- (3) 自基金合同生效之日起, 依法保管基金资产;
- (4) 在基金管理人更换时, 提名新任基金管理人;
- (5) 根据基金合同及有关规定监督基金管理人, 对于基金管理人违反基金合同或有关法律法规规定的行为, 对基金资产、其他当事人的利益造成重大损失的情形, 应及时呈报中国证监会, 并采取必要措施保护基金及相关当事人的利益;
- (6) 依法召集基金份额持有人大会;
- (7) 按规定取得基金份额持有人名册资料;
- (8) 法律法规和基金合同规定的其他权利。

#### 7、基金托管人的义务

根据《基金法》及其他有关法律法规, 基金托管人的义务为:

- (1) 安全保管基金财产;
- (2) 设立专门的基金托管部, 具有符合要求的营业场所, 配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员, 负责基金财产托管事宜;
- (3) 对所托管的不同基金财产分别设置账户, 确保基金财产的完整与独立;
- (4) 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外, 不得为自己及任何第三人谋取利益, 不得委托第三人托管基金财产;
- (5) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证;
- (6) 按规定开设基金财产的资金账户和证券账户;
- (7) 保守基金商业秘密, 除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外, 在基金信息公开披露前应予保密, 不得向他人泄露;
- (8) 对基金财务会计报告、季度、半年度和年度基金报告出具意见, 说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照基金合同的规定进行; 如果基金管理人未执行基金合同规定的行为, 还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施;
- (9) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料;
- (10) 按照基金合同的约定, 根据基金管理人的投资指令, 及时办理清算、交割事宜;
- (11) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项;
- (12) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、合润基金份额、合润 A 份额与合润 B 份额的份额净值和合润基金份额申购、赎回价格;
- (13) 按照规定监督基金管理人的投资运作;

- (14) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对;
- (15) 依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项;
- (16) 按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会;
- (17) 因违反基金合同导致基金财产损失, 应承担赔偿责任, 其赔偿责任不因其退任而免除;
- (18) 基金管理人因违反基金合同造成基金财产损失时, 应为基金向基金管理人追偿;
- (19) 参加基金财产清算小组, 参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配;
- (20) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时, 及时报告中国证监会和银行业监督管理机构, 并通知基金管理人;
- (21) 执行生效的基金份额持有人大会决议;
- (22) 不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动;
- (23) 建立并保存基金份额持有人名册;
- (24) 法律法规、中国证监会和基金合同规定的其他义务。

#### 8、基金份额持有人的权利

除合润 A 份额与合润 B 份额的份额净值计算、运作期到期日 (或提前到期日) 基金份额折算、《基金合同》终止时的基金清算财产分配、合润 A 份额与合润 B 份额终止运作后的份额折算外, 本基金每份基金份额具有同等的合法权益。如果合润 A 份额与合润 B 份额的运作终止, 则在终止合润 A 份额与合润 B 份额的运作后, 本基金每份基金份额具有同等的合法权益。

根据《基金法》及其他有关法律法规, 基金份额持有人的权利为:

- (1) 分享基金财产收益;
- (2) 参与分配清算后的剩余基金财产;
- (3) 依法转让其持有的合润 A 份额与合润 B 份额, 依法申请赎回其持有的合润基金份额;
- (4) 按照规定要求召开或自行召集基金份额持有人大会;
- (5) 出席或者委派代表出席基金份额持有人大会, 对基金份额持有人大会审议事项行使表决权;

- (6) 查阅或者复制公开披露的基金信息资料;
- (7) 监督基金管理人的投资运作;
- (8) 对基金管理人、基金托管人、基金份额发售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼;
- (9) 法律法规和基金合同规定的其他权利。

#### 9、基金份额持有人的义务

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金份额持有人的义务为：

- (1) 遵守法律法规、基金合同及其他有关规定;
- (2) 交纳基金认购、申购、赎回款项及法律法规和基金合同所规定的费用;
- (3) 在持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者基金合同终止的有限责任;
- (4) 不从事任何有损基金及其他基金份额持有人合法权益的活动;
- (5) 执行生效的基金份额持有人大会决议;
- (6) 返还在基金交易过程中因任何原因，自基金管理人及基金管理人的代理人、基金托管人、代销机构、其他基金份额持有人处获得的不当得利;
- (7) 法律法规和基金合同规定的其他义务。

10、基金合同当事各方的权利义务以基金合同为依据，不因基金财产账户名称而有所改变。

## 二、基金份额持有人大会

1、基金份额持有人大会由基金份额持有人或基金份额持有人的合法授权代表共同组成。基金份额持有人大会的审议事项应分别由合润基金份额、合润 A 份额与合润 B 份额的基金份额持有人独立进行表决。基金份额持有人持有的每一基金份额在其对应的份额级别内拥有平等的投票权。

### 2、召开事由

- 1) 当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会：
  - (1) 提前终止基金合同;
  - (2) 转换基金运作方式;
  - (3) 变更基金类别;
  - (4) 变更基金投资目标、投资范围或投资策略（法律法规或中国证监会另有规定的除外）;
  - (5) 变更基金份额持有人大会程序;
  - (6) 更换基金管理人、基金托管人;

(7) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，但法律法规要求提高该等报酬标准的除外；

(8) 本基金与其他基金的合并；

(9) 终止合润 A 份额与合润 B 份额的运作；

(10) 单独或合计持有合润基金份额、合润 A 份额与合润 B 份额各自基金份额 10% 以上（含 10%）的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）提议时，就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会；

(11) 对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的其他事项；

(12) 法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

2) 出现以下情形之一的，可由基金管理人和基金托管人协商后修改基金合同，不需召开基金份额持有人大会：

(1) 调低基金管理费、基金托管费和其他应由基金承担的费用，法律法规要求增加基金费用收取；

(2) 在法律法规和基金合同规定的范围内变更收费方式、合润基金份额的申购费率、调低赎回费率；

(3) 因相应的法律法规发生变动必须对基金合同进行修改；

(4) 对基金合同的修改不涉及基金合同当事人权利义务关系发生变化；

(5) 基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响；

(6) 按照法律法规或基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

### 3、召集人和召集方式

1) 除法律法规或基金合同另有约定外，基金份额持有人大会由基金管理人召集。基金管理人未按规定召集或者不能召集时，由基金托管人召集。

2) 基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人就同一事项仍认为有必要召开的，应当自行召集。

3) 单独或合计代表合润基金份额、合润 A 份额与合润 B 份额各自基金份额 10% 以上（含 10%）的基金份额持有人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定

召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，单独或合计代表合润基金份额、合润 A 份额与合润 B 份额各自基金份额 10% 以上（含 10%）的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开。

4) 单独或合计代表合润基金份额、合润 A 份额与合润 B 份额各自基金份额 10% 以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，单独或合计代表合润基金份额、合润 A 份额与合润 B 份额各自基金份额 10% 以上（含 10%）的基金份额持有人有权自行召集基金份额持有人大会，但应当至少提前 30 日向中国证监会备案。

5) 基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的，基金管理人、基金托管人应当配合，不得阻碍、干扰。

#### 4、召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

1) 基金份额持有人大会的召集人（以下简称“召集人”）负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。召开基金份额持有人大会，召集人必须于会议召开日前 30 天在指定媒体公告。基金份额持有人大会通知须至少载明以下内容：

- (1) 会议召开的时间、地点；
- (2) 会议拟审议的主要事项；
- (3) 会议形式；
- (4) 议事程序；
- (5) 有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人权益登记日；
- (6) 代理投票的授权委托书的内容要求（包括但不限于代理人身份、代理权限和代理有效期限等）、送达时间和地点；
- (7) 表决方式；
- (8) 会务常设联系人姓名、电话；
- (9) 出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；
- (10) 召集人需要通知的其他事项。

2) 采用通讯方式开会并进行表决的情况下，由召集人决定通讯方式和书面表决方式，并在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表决意见寄交的截止时间和收取方式。

3) 如召集人为基金管理人, 还应另行书面通知基金托管人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督; 如召集人为基金托管人, 则应另行书面通知基金管理人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督; 如召集人为基金份额持有人, 则应另行书面通知基金管理人和基金托管人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。基金管理人或基金托管人拒不派代表对书面表决意见的计票进行监督的, 不影响计票和表决结果。

#### 5、基金份额持有人出席会议的方式

##### 1) 会议方式

(1) 基金份额持有人大会的召开方式包括现场开会和通讯方式开会, 但基金管理人或基金托管人的更换必须以现场开会方式召开基金份额持有人大会。

(2) 现场开会由基金份额持有人本人出席或通过授权委托书委派其代理人出席, 现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当出席, 如基金管理人或基金托管人拒不派代表出席的, 不影响表决效力。

(3) 通讯方式开会指按照基金合同的相关规定以通讯的书面方式进行表决。

(4) 会议的召开方式由召集人确定。

##### 2) 召开基金份额持有人大会的条件

###### (1) 现场开会方式

在同时符合以下条件时, 现场会议方可举行:

a) 对到会者在权益登记日持有基金份额的统计显示, 全部有效凭证所对应的合润基金份额、合润 A 份额与合润 B 份额应占权益登记日各自基金份额的 50% 以上(含 50%);

b) 到会的基金份额持有人身份证明及持有基金份额的凭证、代理人身份证明、委托人持有基金份额的凭证及授权委托书代理手续完备, 到会者出具的相关文件符合有关法律法规和基金合同及会议通知的规定, 并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的注册登记资料相符。

###### (2) 通讯开会方式

在同时符合以下条件时, 通讯会议方可举行:

a) 召集人按基金合同规定公布会议通知后, 在 2 个工作日内连续公布相关提示性公告;

b) 召集人按基金合同规定通知基金托管人或/和基金管理人(分别或共同称为“监督人”)到指定地点对书面表决意见的计票进行监督;

c)召集人在监督人和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取和统计基金份额持有人的书面表决意见,如基金管理人或基金托管人经通知拒不到场监督的,不影响表决效力;

d)本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所代表的合润基金份额、合润 A 份额与合润 B 份额占权益登记日各自基金份额的 50% 以上(含 50%);

e)直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的代理人提交的持有基金份额的凭证、授权委托书等文件符合法律法规、基金合同和会议通知的规定,并与注册登记机构记录相符。

## 6、议事内容与程序

### 1) 议事内容及提案权

(1) 议事内容为基金合同规定的召开基金份额持有人大会事由所涉及的内容。

(2) 基金管理人、基金托管人、单独或合并持有权益登记日合润基金份额、合润 A 份额与合润 B 份额各自基金总份额 10% 以上(含 10%)的基金份额持有人可以在大会召集人发出会议通知前就召开事由向大会召集人提交需由基金份额持有人大会审议表决的提案;也可以在会议通知发出后向大会召集人提交临时提案,临时提案应当在大会召开日至少 35 天前提交召集人并由召集人公告。

(3) 对于基金份额持有人提交的提案,大会召集人应当按照以下原则对提案进行审核:

关联性。大会召集人对于基金份额持有人提案涉及事项与基金有直接关系,并且不超出法律法规和基金合同规定的基金份额持有人大会职权范围的,应提交大会审议;对于不符合上述要求的,不提交基金份额持有人大会审议。如果召集人决定不将基金份额持有人提案提交大会表决,应当在该次基金份额持有人大会上进行解释和说明。

程序性。大会召集人可以对基金份额持有人的提案涉及的程序性问题做出决定。如将其提案进行分类表决,需征得原提案人同意;原提案人不同意变更的,大会主持人可以就程序性问题提请基金份额持有人大会做出决定,并按照基金份额持有人大会决定的程序进行审议。

(4) 单独或合并持有权益登记日合润基金份额、合润 A 份额与合润 B 份额各自基金份额 10% 以上(含 10%)的基金份额持有人提交基金份额持有人大会审议表决的提案,基金管理人或基金托管人提交基金份额持有人大会审议表决的提案,未



获基金份额持有人大会审议通过，就同一提案再次提请基金份额持有人大会审议，其时间间隔不少于 6 个月。法律法规另有规定的除外。

(5) 基金份额持有人大会的召集人发出召开会议的通知后，如果需要对原有提案进行修改，应当在基金份额持有人大会召开前 30 日及时公告。否则，会议的召开日期应当顺延并保证至少与公告日期有 30 日的间隔期。

## 2) 议事程序

### (1) 现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照规定程序宣布会议议事程序及注意事项，确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，经合法执业的律师见证后形成大会决议。

大会由召集人授权代表主持。基金管理人为召集人的，其授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权代表主持；如果基金管理人和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的合润基金份额、合润 A 份额与合润 B 份额各自基金份额持有人所持表决权的 50% 以上（含 50%）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。

召集人应当制作出席会议人员的签名册。签名册载明参加会议人员姓名（或单位名称）、身份证号码、持有或代表有表决权的基金份额数量、委托人姓名（或单位名称）等事项。

### (2) 通讯方式开会

在通讯表决开会的方式下，首先由召集人提前 30 日公布提案，在所通知的表决截止日期后第 2 个工作日在公证机关及监督人的监督下由召集人统计全部有效表决并形成决议。如监督人经通知但拒绝到场监督，则在公证机关监督下形成的决议有效。

3) 基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

## 7、决议形成的条件、表决方式、程序

1) 合润基金份额、合润 A 份额与合润 B 份额的基金份额持有人所持每份基金份额在其对应份额级别内享有平等的表决权。

2) 基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

### (1) 一般决议

一般决议须经出席会议的合润基金份额、合润 A 份额与合润 B 份额持有人（或其代理人）各自所持表决权的 50% 以上（含 50%）通过方为有效，除下列（2）所

规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过；法律法规另有规定时，从其规定。

## (2) 特别决议

特别决议须经出席会议的合润基金份额、合润 A 份额与合润 B 份额持有人（或其代理人）各自所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方为有效；涉及更换基金管理人、更换基金托管人、转换基金运作方式、终止合润 A 份额与合润 B 份额的运作、终止基金合同必须以特别决议通过方为有效。

3) 基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会核准或者备案，并予以公告。

4) 采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则表面符合法律法规和会议通知规定的书面表决意见即视为有效的表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

5) 基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

6) 基金份额持有人大会的各项提案或同一项提案内并列的各项议题应当分开审议、逐项表决。

## 8、计票

### 1) 现场开会

(1) 如基金份额持有人大会由基金管理人或基金托管人召集，则基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中推举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中推举两名基金份额持有人代表与基金管理人、基金托管人共同授权的一名监督员共同担任监票人；但如果基金管理人和基金托管人的授权代表未出席，则大会主持人可自行选举三名基金份额持有人代表担任监票人。

(2) 监票人应当在基金份额持有人表决后立即进行清点，由大会主持人当场公布计票结果。

(3) 如大会主持人对于提交的表决结果有异议，可以对投票数进行重新清点；如大会主持人未进行重新清点，而出席大会的基金份额持有人或代理人对大会主持人宣布的表决结果有异议，其有权在宣布表决结果后立即要求重新清点，大会主持

人应当立即重新清点并公布重新清点结果。重新清点仅限一次。

## 2) 通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监票人在监督人派出的授权代表的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证；如监督人经通知但拒绝到场监督，则大会召集人可自行授权三名监票人进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。

## 9、基金份额持有人大会决议报中国证监会核准或备案后的公告时间、方式

1) 基金份额持有人大会通过的一般决议和特别决议，召集人应当自通过之日起5日内报中国证监会核准或者备案。基金份额持有人大会决定的事项自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效。

2) 生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人、基金托管人均有约束力。基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会决议。

3) 基金份额持有人大会决议应自生效之日起2日内在指定媒体公告。如果采用通讯方式进行表决，在公告基金份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。

10、法律法规或中国证监会对基金份额持有人大会另有规定的，从其规定。

## 三、《基金合同》的变更、终止与基金财产的清算

### 1、基金合同的变更

1) 以下基金合同变更内容对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的，应召开基金份额持有人大会，基金合同变更的内容应经基金份额持有人大会决议同意。

(1) 提前终止基金合同；

(2) 转换基金运作方式；

(3) 变更基金类别；

(4) 变更基金投资目标、投资范围或投资策略（法律法规或中国证监会另有规定的除外）；

(5) 变更基金份额持有人大会程序；

(6) 更换基金管理人、基金托管人；

(7) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准。但根据适用的相关规定提高该等报酬标准的除外；

(8) 本基金与其他基金的合并；

- (9) 终止合润 A 份额与合润 B 份额的运作;
- (10) 对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的其他事项;
- (11) 法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

但出现下列情况之一时,可不经基金份额持有人大会决议,由基金管理人和基金托管人同意变更后公布,并报中国证监会备案:

(1) 调低基金管理费、基金托管费和其他应由基金承担的费用,法律法规要求增加基金费用收取;

(2) 在法律法规和基金合同规定的范围内变更收费方式、合润基金份额的申购费率、调低赎回费率;

(3) 因相应的法律法规及交易所的有关规则发生变动必须对基金合同进行修改;

(4) 经中国证监会允许,基金推出新业务或服务;

(5) 经中国证监会允许,基金管理人、基金注册登记机构、代销机构在法律法规规定的范围内调整有关基金认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务的规则;

(6) 对基金合同的修改不涉及基金合同当事人权利义务关系发生变化;

(7) 基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响;

(8) 按照法律法规或基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

2) 关于变更基金合同的基金份额持有人大会决议应报中国证监会核准或备案,并于中国证监会核准或出具无异议意见后生效执行,并自生效之日起 2 日内在至少一种指定媒体公告。

## 2、基金合同的终止

有下列情形之一的,基金合同经中国证监会核准后将终止:

1) 基金份额持有人大会决定终止的;

2) 基金管理人因解散、破产、撤销等事由,不能继续担任基金管理人的职务,而在 6 个月内无其他适当的基金管理公司承接其原有权利义务;

3) 基金托管人因解散、破产、撤销等事由,不能继续担任基金托管人的职务,而在 6 个月内无其他适当的托管机构承接其原有权利义务;

4) 中国证监会、基金合同规定的其他情况。

## 3、基金财产的清算

1) 基金财产清算组

(1) 基金合同终止时，成立基金财产清算组，基金财产清算组在中国证监会的监督下进行基金清算。

(2) 自基金合同终止之日起 30 个工作日内由基金管理人组织成立基金财产清算组，基金财产清算组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算组可以聘用必要的工作人员。

(3) 基金财产清算组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算组可以依法进行必要的民事活动。

## 2) 基金财产清算程序

基金合同终止，应当按法律法规和基金合同的有关规定对基金财产进行清算。基金财产清算程序主要包括：

- (1) 基金合同终止后，发布基金财产清算公告；
- (2) 由基金财产清算组统一接管基金财产；
- (3) 对基金财产进行清理和确认；
- (4) 对基金财产进行估价和变现；
- (5) 基金财产清算组制作清算报告；
- (6) 聘请会计师事务所对清算报告进行审计；
- (7) 聘请律师事务所出具法律意见书；
- (8) 将基金财产清算结果报告中国证监会；
- (9) 公布基金财产清算结果；
- (10) 对基金剩余财产进行分配；
- (11) 基金财产清算的期限为 6 个月。

## 3) 清算费用

清算费用是指基金财产清算组在进行基金财产清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算组优先从基金财产中支付。

## 4) 基金财产清算后剩余资产的分配

基金财产按下列顺序清偿：

- (1) 支付清算费用；
- (2) 交纳所欠税款；
- (3) 清偿基金债务；
- (4) 按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

基金财产未按前款（1）-（3）项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，分别计算合润基金份额、合润 A 份额与合润 B 份额各自的应计分配比例，并据此向合润基金份额、合润 A 份额与合润 B 份额各自的基金份额持有人根据其持有的基金份额比例进行分配。

经基金份额持有人大会决议通过，并经中国证监会核准，在本基金的合润 A 份额与合润 B 份额终止运作后，如果本基金进行基金财产清算，则依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

#### 5) 基金财产清算的公告

基金财产清算公告于基金合同终止并报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算组公告；清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算结果经会计师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，由基金财产清算组报中国证监会备案并公告。

#### 6) 基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

### 四、争议的处理

对于因基金合同的订立、内容、履行和解释或与基金合同有关的争议，基金合同当事人应尽量通过协商、调解途径解决。不愿或者不能通过协商、调解解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会上海分会，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为上海市。仲裁裁决是终局的，对各方当事人均有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

争议处理期间，基金合同当事人应恪守各自的职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

本基金合同受中华人民共和国法律管辖。

### 五、基金合同存放地点和查询办法

基金合同可印制成册，供投资人在基金管理人、基金托管人、代销机构和注册登记机构办公场所查阅，但其效力应以基金合同正本为准。

## 第二十八部分 基金托管协议的内容摘要

### 一、基金托管协议当事人

#### (一) 基金管理人（或简称“管理人”）

名称：兴业全球基金管理有限公司

住所：上海市黄浦区金陵东路 368 号

法定代表人：兰荣

成立时间：2003 年 9 月 30 日

批准设立机关和设立文号：中国证监会证监基字【2003】100 号

组织形式：有限责任公司

注册资本：1.5 亿元人民币

存续期间：持续经营

经营范围：发起设立基金，基金管理业务，中国证监会允许的其它业务

#### (二) 基金托管人

名称：招商银行股份有限公司(简称：招商银行)

住所：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

办公地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

邮政编码：518040

法定代表人：傅育宁

成立时间：1987 年 4 月 8 日

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[2002]83 号

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；办理结算；办理票据贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券；同业拆借；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保管箱服务。外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外币兑换；国际结算；结汇、售汇；同业外汇拆借；外汇票据的承兑和贴现；外汇借款；外汇担保；发行和代理发行股票以外的外币有价证券；买卖和代理买卖股票以外的外币有价证券；自营和代客外汇买卖；资信调查、咨询、见证业务；离岸金融业务。经中国人民银行批准的其他业务。

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币 215.77 亿元

存续期间：持续经营

## 二、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

(一) 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资范围、投资对象进行监督。

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、国债、金融债、企业债、公司债、回购、央行票据、可转换债券、权证、资产支持证券以及经中国证监会批准允许基金投资的其它金融工具。

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%；权证投资比例为基金资产净值 0%-3%；本基金保留不低于基金资产净值的 5% 的现金和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。

基金合同明确约定基金投资风格或证券选择标准的，基金管理人应事先向基金托管人提供投资品种池和交易对手库，以便基金托管人对基金实际投资是否符合基金合同关于证券选择标准的约定进行监督。

对基金管理人发送的不符合基金合同规定的投资行为，基金托管人可以拒绝执行，并书面通知基金管理人；对于已经执行的投资，基金托管人发现该投资行为不符合基金合同的规定的，基金托管人应书面通知基金管理人进行整改，并将该情况报告中国证监会。

(二) 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资、融资比例进行监督。

本基金在投资策略上兼顾投资原则以及本基金的固有特点，通过分散投资降低基金财产的非系统性风险，保持基金组合良好的流动性。基金的投资组合将遵循以下限制：

- (1) 本基金持有一家上市公司的股票，其市值不超过基金资产净值的 10%；
- (2) 本基金与本基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%；
- (3) 基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不得超过本基金的总资产



产，本基金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；

(4) 本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%；

(5) 本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；

(6) 本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；

(7) 本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基金资产净值的 10%；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%；本基金管理人管理的全部基金持有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%；

(9) 本基金股票投资占基金资产的比例为 60%-95%，债券投资占基金资产的比例为 5%-40%；权证投资比例为基金资产净值的 0%-3%；资产支持证券比例为基金资产净值的 0%-20%；本基金保留不低于基金资产净值的 5% 的现金和到期日在一年以内的政府债券。

(10) 本基金不得违反基金合同中有关投资范围、投资比例的规定；

(11) 有关法律法规以及监管部门规定的其它投资限制。

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

因证券市场变化、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合上述规定的比例或者基金合同约定的投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内调整完毕。

基金托管人应对基金的投资和融资比例是否符合基金合同的规定进行监督。基金托管人应监督基金合同约定的基金投资资产配置比例（自基金合同生效之日起满 6 个月开始）、单一投资类别比例限制、融资限制、股票申购限制、基金投资比例是否符合法规和基金合同的规定，不符合规定的，基金托管人应书面通知基金管理人及时进行整改，整改的时限应符合法规和基金合同允许的投资比例调整期限。

(三) 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对本托管协议第十五条第九款基金投资禁止行为进行监督。基金托管人通过事后监督方式对基金管理人基金投资禁止行为和关联交易进行监督。根据法律法规有关基金禁止从事关联交易的规定，基金管理人和基金托管人应事先相互提供与本机构有控股关系的股

东、与本机构有其他重大利害关系的公司名单及有关关联方发行的证券名单。基金管理人和基金托管人有责任确保各自关联交易名单的真实性、准确性、完整性，并负责及时将更新后的名单发送给对方。

若基金托管人发现基金管理人与关联交易名单中列示的关联方进行法律法规禁止基金从事的关联交易时，如基金托管人提醒基金管理人后仍无法阻止关联交易发生时，基金托管人有权向中国证监会报告。

(四) 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金管理人参与银行间债券市场进行监督。基金管理人应在基金投资运作之前向基金托管人提供符合法律法规及行业标准的、经慎重选择的、本基金适用的银行间债券市场交易对手名单，并约定各交易对手所适用的交易结算方式。基金管理人有责任确保及时将更新后的交易对手名单发送给基金托管人，否则由此造成的损失应由基金管理人承担。基金管理人应严格按照交易对手名单的范围在银行间债券市场选择交易对手。基金托管人监督基金管理人是否按事前提供的银行间债券市场交易对手名单进行交易。在基金存续期间基金管理人可以调整交易对手名单，但应将调整结果至少提前一个工作日书面通知基金托管人。新名单确定前已与本次剔除的交易对手所进行但尚未结算的交易，仍应按照协议进行结算。

基金管理人负责对交易对手的资信控制，按银行间债券市场的交易规则进行交易，并负责解决因交易对手不履行合同而造成的纠纷及损失。若未履约的交易对手在基金管理人确定的时间内仍未承担违约责任及其他相关法律责任的，基金管理人可以对相应损失先行予以承担，然后再向相关交易对手追偿。基金托管人则根据银行间债券市场成交单对合同履行情况进行监督。如基金托管人事后发现基金管理人没有按照事先约定的交易对手或交易方式进行交易时，基金托管人应及时提醒基金管理人，基金托管人不承担由此造成的任何损失和责任。

(五) 本基金投资流通受限证券，基金管理人应事先根据中国证监会相关规定，与基金托管人就相关事项协商一致后签订补充协议，明确基金投资流通受限证券的比例。基金管理人应制订严格的投资决策流程和风险控制制度，防范流动性风险、法律风险和操作风险等各种风险。基金托管人对基金管理人是否遵守相关制度、流动性风险处置预案以及相关投资额度和比例等的情况进行监督。

(六) 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金管理人选择存款银行进行监督。

基金投资银行定期存款的，基金管理人应根据法律法规的规定及基金合同的约

定，确定符合条件的所有存款银行的名单，并及时提供给基金托管人，基金托管人应据以对基金投资银行存款的交易对手是否符合有关规定进行监督。

本基金投资银行存款应符合如下规定：

1. 基金管理人、基金托管人应当与存款银行建立定期对账机制，确保基金银行存款业务账目及核算的真实、准确。

2. 基金管理人与基金托管人应根据相关规定，就本基金银行存款业务另行签订书面协议，明确双方在相关协议签署、账户开设与管理、投资指令传达与执行、资金划拨、账目核对、到期兑付、文件保管以及存款证实书的开立、传递、保管等流程中的权利、义务和职责，以确保基金资产的安全，保护基金份额持有人的合法权益。

3. 基金托管人应加强对基金银行存款业务的监督与核查，严格审查、复核相关协议、账户资料、投资指令、存款证实书等有关文件，切实履行托管职责。

4. 基金管理人与基金托管人在开展基金存款业务时，应严格遵守《基金法》、《运作办法》等有关法律法规，以及国家有关账户管理、利率管理、支付结算等的各项规定。

基金托管人发现基金管理人在选择存款银行时有违反有关法律法规的规定及基金合同的约定的行为，应及时以书面形式通知基金管理人在 10 个工作日内纠正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在 10 个工作日内纠正的，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在 10 个工作日内纠正或拒绝结算。

(七) 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金资产净值计算、合润基金份额净值、合润 A 份额净值与合润 B 份额净值的计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等进行监督和核查。

(八) 基金托管人发现基金管理人的上述事项及投资指令或实际投资运作违反法律法规、基金合同和本托管协议的规定，应及时以电话提醒或书面提示等方式通知基金管理人限期纠正。基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查。基金管理人收到通知后应及时核对并回复基金托管人，对于收到的书面通知基金管理人应以书面形式给基金托管人发出回函，就基金托管人的疑义进行解释或举证，说明违规原因及纠正期限。在上述规定期限内，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。

(九) 基金管理人 有义务配合和协助基金托管人依照法律法规、基金合同和本托管协议对基金业务执行核查。包括但不限于：对基金托管人发出的提示，基金管理人应在规定时间内答复并改正，或就基金托管人的疑义进行解释或举证；对基金托管人按照法律法规、基金合同和本托管协议的要求需向中国证监会报送基金监督报告的事项，基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

(十) 若基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当立即通知基金管理人及时纠正，由此造成的损失由基金管理人承担。

(十一) 基金托管人发现基金管理人 有重大违规行为，应及时报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正。

### 三、基金管理人 对基金托管人的业务核查

(一) 基金管理人 对基金托管人履行托管职责情况进行核查，核查事项包括基金托管人安全保管基金财产、开设基金财产的资金账户和证券账户、复核基金管理人计算的基金资产净值和合润基金份额净值、合润 A 份额净值、合润 B 份额净值、根据基金管理人指令办理清算交收、相关信息披露和监督基金投资运作等行为。

(二) 基金管理人 发现基金托管人擅自挪用基金财产、未对基金财产实行分账管理、未执行或无故延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄露基金投资信息等违反《基金法》、基金合同、本协议及其他有关规定时，应及时以书面形式通知基金托管人限期纠正。基金托管人收到书面通知后应及时核对并以书面形式给基金管理人发出回函，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内，基金管理人 有权随时对通知事项进行复查，督促基金托管人改正。

(三) 基金托管人 有义务配合和协助基金管理人依照法律法规、基金合同和本托管协议对基金业务执行核查，包括但不限于：对基金管理人发出的书面提示，基金托管人应在规定时间内答复并改正，或就基金管理人的疑义进行解释或举证；基金托管人应积极配合提供相关资料以供基金管理人核查托管财产的完整性和真实性。

(四) 基金管理人 发现基金托管人 有重大违规行为，应及时报告中国证监会，同时通知基金托管人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。

### 四、基金财产的保管

(一) 基金财产保管的原则

- 1、基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。
- 2、基金托管人应安全保管基金财产。
- 3、基金托管人按照规定开设基金财产的资金账户和证券账户。
- 4、基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整与独立。
- 5、基金托管人根据基金管理人的指令，按照基金合同和本协议的约定保管基金财产。未经基金管理人的正当指令，不得自行运用、处分、分配基金的任何资产。属于基金托管人实际有效控制下的实物证券在基金托管人保管期间的损坏、灭失，由此产生的责任应由基金托管人承担。
- 6、对于因为基金投资产生的应收资产，应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知基金托管人，到账日基金财产没有到达基金账户的，基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收。基金管理人未及时催收给基金财产造成损失的，基金管理人应负责向有关当事人追偿基金财产的损失。
- 7、基金托管人应安全、完整地保管基金资产；除依据法律法规和基金合同的规定外，基金托管人不得委托第三人托管基金财产。

#### （二）基金募集期间及募集资金的验资

- 1、基金募集期间募集的资金应开立“基金募集专户”。该账户由基金管理人开立并管理。
- 2、基金募集期满或基金停止募集时，募集的基金份额总额（包括合润基金份额、合润 A 份额与合润 B 份额）、基金募集金额、基金份额持有人人数符合《基金法》、《运作办法》等有关规定后，基金管理人应将属于基金财产的全部资金划入基金托管人开立的基金银行账户，同时在规定时间内，基金管理人应聘请具有从事证券相关业务资格的会计师事务所进行验资，出具验资报告。出具的验资报告由参加验资的 2 名或 2 名以上中国注册会计师签字方为有效。
- 3、若基金募集期限届满，未能达到基金合同生效的条件，由基金管理人按规定办理退款等事宜。

#### （三）基金银行账户的开立和管理

- 1、基金托管人以基金的名义在其营业机构开立基金的银行账户，保管基金的银行存款，并根据基金管理人的指令办理资金收付。本基金的银行预留印鉴由基金托管人保管和使用。
- 2、基金银行账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人

和基金管理人不得假借本基金的名义开立任何其他银行账户；亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。

3、基金银行账户的开立和管理应符合法律法规及银行业监督管理机构的有关规定。

#### （四）基金证券账户和证券交易结算备付金账户的开立和管理

1、基金托管人在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司、深圳分公司为基金开立基金托管人与基金联名的证券账户。

2、基金证券账户的开立和使用，仅限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得出借或未经对方同意擅自转让基金的任何证券账户，亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。

3、基金证券账户的开立和证券账户卡的保管由基金托管人负责，账户资产的管理和运用由基金管理人负责。

4、基金托管人以基金托管人的名义在中国证券登记结算有限责任公司开立证券交易结算备付金账户，并代表所托管的基金完成与中国证券登记结算有限责任公司的一级法人清算工作，基金管理人应予以积极协助。结算备付金、结算互保基金、交收价差资金等的收取按照中国证券登记结算有限责任公司的规定执行。

5、若中国证监会或其他监管机构在本托管协议订立日之后允许基金从事其他投资品种的投资业务，涉及相关账户的开立、使用的，若无相关规定，则基金托管人比照上述关于账户开立、使用的规定执行。

#### （五）债券托管专户的开设和管理

基金合同生效后，基金托管人根据中国人民银行、中央国债登记结算有限责任公司的有关规定，在中央国债登记结算有限责任公司开立债券托管账户，并代表基金进行银行间市场债券的结算。基金管理人和基金托管人共同代表基金签订全国银行间债券市场债券回购主协议。

#### （六）其他账户的开立和管理

1、因业务发展需要而开立的其他账户，可以根据法律法规和基金合同的规定，由基金托管人负责开立。新账户按有关规定使用并管理。

2、法律法规等有关规定对相关账户的开立和管理另有规定的，从其规定办理。

#### （七）基金财产投资的有关有价凭证等的保管

基金财产投资的有关实物证券等有价凭证按约定由基金托管人存放于基金托管人的保管库，或存入中央国债登记结算有限责任公司、中国证券登记结算有限责任

公司上海分公司/深圳分公司或票据营业中心的代保管库，实物保管凭证由基金托管人持有。实物证券等有价凭证的购买和转让，由基金托管人根据基金管理人的指令办理。基金托管人对由上述存放机构以及基金托管人以外机构实际有效控制的有价凭证不承担保管责任。

#### （八）与基金财产有关的重大合同的保管

由基金管理人代表基金签署的、与基金财产有关的重大合同的原件分别由基金管理人、基金托管人保管。除本协议另有规定外，基金管理人代表基金签署的与基金财产有关的重大合同应保证基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。基金管理人应在重大合同签署后及时将重大合同传真给基金托管人，并在三十个工作日内将正本送达基金托管人处。因基金管理人发送的合同传真件与事后送达的合同原件不一致所造成的后果，由基金管理人负责。重大合同的保管期限为基金合同终止后 15 年。因基金托管人将自己保管的本基金重大合同在未经基金管理人同意的情况下，用于抵押、质押、担保或债权转让或作其他权利处分而造成基金资产损失，由基金托管人负责。

### 五、基金资产净值计算和会计核算

#### （一）基金资产净值的计算、复核与完成的时间及程序

##### 1. 基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的金额。

合润基金份额净值是指基金资产净值除以基金份额总数，合润基金份额净值的计算，精确到 0.0001 元，小数点后第 5 位四舍五入，国家另有规定的，从其规定。

基金管理人每个工作日计算基金资产净值、合润基金份额净值、合润 A 份额净值与合润 B 份额净值，经基金托管人复核，按规定公告。

合润 A 份额净值与合润 B 份额净值应按照基金合同的规定进行计算并公告。

##### 2. 复核程序

基金管理人每工作日对基金资产进行估值后，将合润基金份额净值、合润 A 份额净值与合润 B 份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

3. 根据有关法律法规，基金资产净值和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致意见的，按照基金管理人对于基金资产净值的计算结果对外予以公布。

## （二）估值错误的处理方式

基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当合润基金份额净值小数点后4位以内（含第4位）发生错误时，视为合润基金份额净值错误。

基金合同的当事人应按照以下约定处理：

### 1、差错类型

本基金运作过程中，如果由于基金管理人或基金托管人、或注册登记机构、或代销机构、或投资人自身的过错造成差错，导致其他当事人遭受损失的，过错的责任人应当对由于该差错遭受损失的当事人（“受损方”）按下述“差错处理原则”给予赔偿，承担赔偿责任。

上述差错的主要类型包括但不限于：资料申报差错、数据传输差错、数据计算差错、系统故障差错、下达指令差错等；对于因技术原因引起的差错，若系同行业现有技术水平不能预见、不能避免、不能克服，则属不可抗力，按照下述规定执行。

由于不可抗力原因造成投资人的交易资料灭失或被错误处理或造成其他差错，因不可抗力原因出现差错的当事人不对其他当事人承担赔偿责任，但因该差错取得不当得利的当事人仍应负有返还不当得利的义务。

### 2、差错处理原则

（1）差错已发生，但尚未给当事人造成损失时，差错责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正差错发生的费用由差错责任方承担；由于差错责任方未及时更正已产生的差错，给当事人造成损失的，由差错责任方承担赔偿责任；若差错责任方已经积极协调，并且有协助义务的当事人有足够的时间进行更正而未更正，则其应当承担相应赔偿责任。差错责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认，确保差错已得到更正。

（2）差错的责任方对可能导致有关当事人的直接损失负责，不对间接损失负责，并且仅对差错的有关直接当事人负责，不对第三方负责。

（3）因差错而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但差错责任方仍应对差错负责。如果由于获得不当得利的当事人不返还或不全部返还不当得利造成其他当事人的利益损失（“受损方”），则差错责任方应赔偿受损方的损失，并在其支付的赔偿金额的范围内对获得不当得利的当事人享有要求交付不当得利的权利；如果获得不当得利的当事人已经将此部分不当得利返还给受损方，则受损方应当将其已经获得的赔偿额加上已经获得的不当得利返还的总和超过其实际损失的差



额部分支付给差错责任方。

(4) 差错调整采用尽量恢复至假设未发生差错的正确情形的方式。

(5) 差错责任方拒绝进行赔偿时,如果因基金管理人过错造成基金财产损失时,基金托管人应为基金的利益向基金管理人追偿,如果因基金托管人过错造成基金财产损失时,基金管理人应为基金的利益向基金托管人追偿。基金管理人和基金托管人之外的第三方造成基金财产的损失,并拒绝进行赔偿时,由基金管理人负责向差错方追偿;追偿过程中产生的有关费用,应列入基金费用,从基金资产中支付。

(6) 如果出现差错的当事人未按规定对受损方进行赔偿,并且依据法律法规、基金合同或其他规定,基金管理人自行或依据法院判决、仲裁裁决对受损方承担了赔偿责任,则基金管理人有权向出现差错的当事人进行追索,并有权要求其赔偿或补偿由此发生的费用和遭受的损失。

(7) 如果出现差错的当事人未按规定对受损方进行赔偿,并且依据法律法规、基金合同或其他规定,基金托管人自行或依据法院判决、仲裁裁决对受损方承担了赔偿责任,则基金托管人有权向出现差错的当事人进行追索,并有权要求其赔偿或补偿由此发生的费用和遭受的损失。

(8) 按法律法规规定的其他原则处理差错。

### 3、差错处理程序

差错被发现后,有关的当事人应当及时进行处理,处理的程序如下:

(1) 查明差错发生的原因,列明所有的当事人,并根据差错发生的原因确定差错的责任方;

(2) 根据差错处理原则或当事人协商的方法对因差错造成的损失进行评估;

(3) 根据差错处理原则或当事人协商的方法由差错的责任方进行更正和赔偿损失;

(4) 根据差错处理的方法,需要修改基金注册登记机构交易数据的,由基金注册登记机构进行更正,并就差错的更正向有关当事人进行确认。

### 4、基金份额净值差错处理的原则和方法如下:

(1) 基金份额净值计算出现错误时,基金管理人应当立即予以纠正,通报基金托管人,并采取合理的措施防止损失进一步扩大。

(2) 基金份额净值的错误偏差达到基金份额净值的 0.25% 时,基金管理人应当通报基金托管人并报中国证监会备案;错误偏差达到基金份额净值的 0.5% 时,基金管理人应当公告并报中国证监会备案。。

(3) 因基金份额净值计算错误, 给基金或基金份额持有人造成损失的, 应由基金管理人先行赔付, 基金管理人按差错情形, 有权向其他当事人追偿。

(4) 基金管理人和基金托管人由于各自技术系统设置而产生的净值计算尾差, 以基金管理人计算结果为准。

(5) 前述内容如法律法规或监管机关另有规定的, 从其规定处理。

(三) 暂停估值与公告基金份额净值的情形

(1) 基金投资所涉及的证券交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时;

(2) 因不可抗力或其他情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时;

(3) 中国证监会和基金合同认定的其他情形。

## 六、基金份额持有人名册的登记与保管

本基金注册登记机构负责登记、编制和保管基金份额持有人名册, 并对持有人名册的真实性、完整性和准确性负责, 并按国家法律法规及中国证监会的要求执行对基金份额持有人名册的保管。

基金份额持有人名册内容包括但不限于基金份额持有人的名称、持有的基金份额以及基金管理人、基金托管人为履行有关法律法规、基金合同规定的职责之目的所需内容。

基金管理人应当及时向基金托管人提供基金合同生效日的基金份额持有人名册、基金权益登记日的基金份额持有人名册、基金份额持有人大会登记日的基金份额持有人名册、每月最后一个交易日的基金份额持有人名册。基金管理人应当自上述日期之日起 10 个工作日内, 以书面 (包括但不限于电子传输数据文件、电子光盘文件、纸文件) 形式将上述日期的基金份额持有人名册送达基金托管人保存。基金管理人应保证向托管人提供基金份额持有人名册的真实性、准确性和完整性。为基金托管人履行有关法律法规、基金合同规定的职责之目的, 基金管理人应当提供必要的协助。

基金托管人应当根据有关法律法规的规定妥善保管基金份额持有人名册, 对基金份额持有人名册的相关信息负有保密义务, 基金托管人未依照法律及本合同约定保管基金份额持有人名册而对投资者或基金带来损失的, 应当承担相应的赔偿责任。

基金份额持有人名册保管期限不得低于 15 年。

## 七、托管协议的变更、终止与基金财产的清算

(一) 基金托管协议的变更

本协议双方当事人经协商一致，可以对协议进行变更。变更后的新协议，其内容不得与基金合同的规定有任何冲突。变更后的新协议，应当报中国证监会核准。

## （二）基金托管协议的终止

发生以下情况，本托管协议终止：

- 1、基金合同终止；
- 2、基金托管人依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产、被依法取消基金托管资格或因其他事由造成其他基金托管人接管基金财产；
- 3、基金管理人依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产、被依法取消基金管理资格或因其他事由造成其他基金管理人接管基金管理权；
- 4、发生《基金法》、其他法律法规或基金合同规定的其他终止事项。

## （三）基金财产的清算

### 1、基金财产清算组

（1）基金管理人应当自基金合同终止之日起 30 个工作日内组织成立基金财产清算组。基金财产清算组在中国证监会的监督下进行基金清算，在基金财产清算组接管基金财产之前，基金管理人和基金托管人应按照基金合同和托管协议的规定继续履行保护基金财产安全的职责。

（2）基金财产清算组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金清算组可以聘用必要的工作人员。

（3）基金财产清算组接管基金财产后，负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算组可以依法进行必要的民事活动。

### 2、基金财产的清算程序

- （1）基金合同终止后，发布基金财产清算公告；
- （2）由基金财产清算组统一接管基金财产；
- （3）基金财产清算组对基金财产和债权债务进行清理和确认；
- （4）基金财产清算组对基金财产进行估价和变现；
- （5）基金财产清算组制作清算报告；
- （6）会计师事务所对清算报告进行审计；
- （7）律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- （8）将基金财产清算结果报告中国证监会；
- （9）公布基金财产清算结果；

(10) 对基金剩余财产进行分配。

(11) 基金财产清算的期限为 6 个月。

### 3、清算费用

清算费用是指基金财产清算组在进行基金财产清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算组优先从基金财产中支付。

### 4、基金财产清算后剩余资产的分配

基金财产按下列顺序清偿：

(1) 支付清算费用；

(2) 缴纳所欠税款；

(3) 清偿基金债务；

(4) 按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

基金财产未按前款 (1)、(2)、(3) 项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，分别计算合润基金份额、合润 A 份额与合润 B 份额各自的应计分配比例，并据此向合润基金份额、合润 A 份额与合润 B 份额各自的基金份额持有人根据其持有的基金份额比例进行分配。

经基金份额持有人大会决议通过，并经中国证监会核准，在本基金的合润 A 份额与合润 B 份额终止运作后，如果本基金进行基金财产清算，则依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

### 5、基金财产清算的公告

基金财产清算公告于基金合同终止并报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算组公告；清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算结果经会计师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，由基金财产清算组报中国证监会备案并公告。

### 6、基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人按照国家有关规定保存 15 年以上。

## 八、争议解决方式

(一) 本协议适用中华人民共和国法律并从其解释。

(二) 双方当事人同意，因本协议而产生的或与本协议有关的一切争议，应先友好协商解决。如果协商开始后三十日内各方仍不能解决该争议，则任何一方均有

权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会上海分会，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁的地点在上海，仲裁裁决是终局的，对各方当事人均有约束力。

争议处理期间，双方当事人应恪守基金管理人和基金托管人职责，各自继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同和托管协议规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

## 第二十九部分 对基金份额持有人的服务

基金管理人承诺为基金份额持有人提供一系列的服务。以下是主要的服务内容，基金管理人将根据基金份额持有人的需要和市场的变化，增加或变更服务项目。主要服务内容如下：

### 一、通知服务

通知基金份额持有人的内容包括邮寄季度对账单等服务。季度对账单每季度提供，在每季度结束后的 20 个工作日内向投资者以书面形式寄出，投资者也可以选择定制电子对账单，不获取邮寄对账单服务。此外，基金管理人还向客户寄送《兴业全球基金投资纵览》。对于新开户认、申购的客户，将于下一月度向客户寄送新开户的账户信息。

选择不获取邮寄对账单服务的投资者也可以选择定制电子对账单，对于订制电子对账单的客户，基金管理人将每季度或每月通过 E-MAIL 向账单期内有交易或期末有余额的客户发送上季度基金交易对账单，以方便投资者快速获得交易信息。

### 二、在线服务

基金管理人利用自己的网站提供实时在线客服咨询服务以及与基金经理的定期在线交流服务。

### 三、网上交易服务

本基金管理人已开通个人投资者网上交易业务。个人投资者通过基金管理人网站 <https://trade.xyfunds.com.cn> 可以办理基金认购、申购、赎回、分红方式修改、账

户资料修改、交易密码修改、交易申请查询和账户资料查询等各类业务。

#### 四、资讯服务

投资者如果了解申购与赎回的交易情况、基金账户余额、基金产品与服务等信息，可拨打基金管理人客户服务中心电话或登录公司网站。

##### 1、客户服务电话

客服热线：400-678-0099、021-38824536

传真：021-58367239

##### 2、互联网站

公司网站：<http://www.xyfunds.com.cn>

电子信息：[service@xyfunds.com.cn](mailto:service@xyfunds.com.cn)

#### 五、信息定制服务

向基金份额持有人提供免费的手机短信和电子邮件信息定制服务。通过定制，基金份额持有人可以通过手机短信收到基金管理人发送的基金净值，并可通过电子邮件收到基金管理人的基金净值、相关公告、电子对账单等资讯。

#### 六、投诉受理

投资者可以拨打基金管理人客户服务中心电话，或通过本公司网站留言的投诉栏目、书信、电子邮件等渠道对本公司和销售网点所提供的服务进行投诉。

基金管理人根据基金份额持有人的需要和市场的变化，有权增加或变更服务项目。

### 第三十部分 其他应披露事项

#### 一、基金管理人发布的临时公告

以下为自 2011 年 4 月 22 日至 2011 年 10 月 21 日,本基金刊登于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站的基金公告。

序号	事项名称	披露日期
1	关于增加中信证券为办理旗下基金定期定额投资业务代销机构的公告	2011-5-25
2	关于在中信证券开通基金转换业务的公告	2011-5-25
3	关于旗下两只基金在工商银行开通定投业务及参加定投费率优惠活动的公告	2011-6-23
4	关于北京分公司成立的公告	2011-6-29
5	关于旗下部分基金继续参加交通银行网上银行、手机银行基金申购费率优惠活动的公告	2011-6-30
6	旗下各基金2011年半年度资产净值公告	2011-7-1
7	关于旗下基金停止通过东方证券办理定期定额投资业务的公告	2011-7-9
8	关于在网上交易平台开通兴业银行卡定期定额投资业务的公告	2011-7-28
9	关于部分董事、独立董事变更的公告	2011-9-23

#### 二、基金托管人发布的临时报告

招商银行股份有限公司于 2011 年 7 月 29 日在《证券时报》上发布《关于招商银行股份有限公司总行资产托管部夏博辉同志通知离任公告》

### 第三十一部分 招募说明书存放及查阅方式

本基金招募说明书存放在基金管理人、基金托管人的办公场所和营业场所,投资者可免费查阅。在支付工本费后,可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

## 第三十二部分 备查文件

- 一、中国证监会核准本基金募集的文件
- 二、关于申请募集兴全合润分级股票型证券投资基金之法律意见书
- 三、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- 四、基金托管人业务资格批件和营业执照
- 五、《兴全合润分级股票型证券投资基金基金合同》
- 六、《兴全合润分级股票型证券投资基金托管协议》
- 七、中国证监会规定的其他文件

以上第（四）项备查文件存放在基金托管人的办公场所，其他文件存放在基金管理人的办公场所、营业场所。基金投资者在营业时间内可免费查阅，在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

兴业全球基金管理有限公司

2011年12月6日