

# 兴业可转债混合型证券投资基金

## 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：中国工商银行股份有限公司

发出日期：2010年12月

## 【重要提示】

兴业可转债混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会 2004 年 3 月 9 日出具的《关于同意兴业可转债混合型证券投资基金设立的批复》（证监基金字[2004]27 号文）核准公开发行。本基金的基金合同于 2004 年 5 月 11 日正式生效。

本招募说明书是对原《兴业可转债混合型证券投资基金招募说明书》的定期更新，原招募说明书与本招募说明书不一致的，以本招募说明书为准。兴业全球基金管理有限公司（以下简称“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，投资人认购（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，充分考虑投资人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人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。在投资人作出投资决策后，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。

基金管理人承诺依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，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为 2010 年 11 月 10 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 2010 年第 3 季度报告，数据截止日为 2010 年 9 月 30 日（财务数据未经审计）。本基金托管人中国工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

|                             |    |
|-----------------------------|----|
| 一、绪 言                       | 3  |
| 二、释 义                       | 4  |
| 三、基金管理人                     | 6  |
| 四、基金托管人                     | 14 |
| 五、相关服务机构                    | 18 |
| 六、基金的募集与基金合同的生效             | 28 |
| 七、基金份额的申购、赎回                | 28 |
| 八、基金的非交易过户、转托管、基金转换、冻结与质押   | 35 |
| 九、基金的投资                     | 36 |
| 十、基金的业绩                     | 45 |
| 十一、基金的财产                    | 45 |
| 十二、基金资产的估值                  | 46 |
| 十三、基金的收益分配                  | 50 |
| 十四、基金费用与税收                  | 52 |
| 十五、基金的会计与审计                 | 54 |
| 十六、基金的信息披露                  | 55 |
| 十七、风险揭示                     | 58 |
| 十八、基金合同的终止和基金财产的清算          | 60 |
| 十九、《兴业可转债混合型证券投资基金基金合同》的摘要  | 62 |
| 二十、《兴业可转债混合型证券投资基金基金托管协议》摘要 | 72 |
| 二十一、对基金份额持有人的服务             | 77 |
| 二十二、其他应披露事项                 | 79 |
| 二十三、招募说明书的存放与查阅             | 80 |
| 二十四、备查文件                    | 81 |

## 一、 绪 言

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《兴业可转债混合型证券投资基金基金合同》以及其它有关法律法规的规定编写。

本招募说明书阐述了兴业可转债混合型证券投资基金的投资目标、策略、风险、费率等与投资人投资决策有关的全部必要事项，投资者在作出投资决策前应仔细阅读招募说明书。

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

本招募说明书根据本基金的基金合同编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

## 二、释 义

本招募说明书中，除非文义另有所指，下列词语或简称代表以下含义：

|               |                                                                                           |
|---------------|-------------------------------------------------------------------------------------------|
| 基金或本基金：       | 指兴业可转债混合型证券投资基金                                                                           |
| 招募说明书或本招募说明书： | 指《兴业可转债混合型证券投资基金招募说明书》                                                                    |
| 基金合同：         | 指《兴业可转债混合型证券投资基金基金合同》及对基金合同的任何修订和补充                                                       |
| 发售公告：         | 指《兴业可转债混合型证券投资基金发售公告》                                                                     |
| 托管协议：         | 指《兴业可转债混合型证券投资基金托管协议》及对该协议的任何修订和补充                                                        |
| 《证券法》：        | 指 1998 年 12 月 29 日经第九届全国人民代表大会常务委员会第六次会议通过并颁布实施的《中华人民共和国证券法》及颁布机关对其不时作出的修订                |
| 《基金法》：        | 指 2003 年 10 月 28 日经中华人民共和国第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过并公布，自 2004 年 6 月 1 日起施行的《中华人民共和国证券投资基金法》 |
| 《运作办法》        | 指 2004 年 6 月 29 日中国证监会发布并于 2004 年 7 月 1 日起施行的《证券投资基金运作管理办法》                               |
| 《销售办法》        | 指 2004 年 6 月 29 日中国证监会发布并于 2004 年 7 月 1 日起施行的《证券投资基金销售管理办法》                               |
| 《信息披露管理办法》    | 指 2004 年 6 月 11 日中国证监会发布并于 2004 年 7 月 1 日起施行的《证券投资基金信息披露管理办法》                             |
| 中国证监会：        | 指中国证券监督管理委员会                                                                              |
| 中国银监会：        | 指中国银行业监督管理委员会                                                                             |
| 基金合同当事人：      | 指受基金合同约束，根据基金合同享受权利并承担义务的基金管理人、基金托管人和基金份额持有人                                              |
| 基金管理人：        | 指兴业全球基金管理有限公司                                                                             |
| 基金托管人：        | 指中国工商银行股份有限公司                                                                             |
| 注册登记业务：       | 指本基金登记、存管、清算和交收业务                                                                         |
| 注册登记人：        | 指兴业全球基金管理有限公司，或接受兴业全球基金管理有限公司委托代为办理基金注册登记的机构                                              |
| 销售机构：         | 指兴业全球基金管理有限公司及其他本基金的销售代理机构                                                                |

|           |                                                                                               |
|-----------|-----------------------------------------------------------------------------------------------|
| 销售代理人:    | 指依据有关销售代理协议办理本基金销售的代理机构                                                                       |
| 基金投资者:    | 指个人投资者和机构投资者                                                                                  |
| 个人投资者:    | 指合法持有现时有效的中华人民共和国居民身份证、军人证、武警证、护照等证件的中国居民                                                     |
| 机构投资者:    | 指在中华人民共和国境内合法注册登记或经有关政府部门批准设立的企业法人、事业法人、社会团体法人或其他组织,以及经中国证监会批准的,可以投资开放式证券投资基金的其他机构投资者(如 QFII) |
| 基金成立日:    | 指基金达到成立条件后,基金管理人宣布基金成立的日期,本基金的成立日为 2004 年 5 月 11 日                                            |
| 基金募集期:    | 指自招募说明书公告之日起到本基金成立日的时间段,最长不超过 3 个月                                                            |
| 存续期:      | 指基金生效至终止之间的不定期期限                                                                              |
| 开放日:      | 指销售机构为投资者办理基金申购、赎回等业务的工作日                                                                     |
| 工作日:      | 指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日                                                                        |
| T 日:      | 指销售机构在规定时间受理投资者认购、申购、赎回或其他业务申请的申请日                                                            |
| T + n 日:  | 指自 T 日起第 n 个工作日(不包含 T 日)                                                                      |
| 申购:       | 指在本基金存续期间,投资者向基金管理人提出申请购买本基金份额的行为                                                             |
| 赎回:       | 指在本基金存续期间,基金份额持有人按本《基金合同》规定的条件,要求基金管理人购回其持有的全部或部分本基金份额的行为                                     |
| 基金收益:     | 包括基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券价差,银行存款利息以及其它收益                                                        |
| 基金资产总值:   | 包括基金购买的各类证券价值、银行存款本息、基金应收的申购款以及其他投资所形成的价值总和                                                   |
| 基金资产净值:   | 指基金资产总值减去基金负债后的净资产值                                                                           |
| 基金资产估值:   | 指计算评估本基金资产和负债的价值,以确定基金资产净值和基金份额净值的过程                                                          |
| 基金账户:     | 指基金管理人为投资者开立的用于记录投资者持有的由该注册登记人办理注册登记的基金份额及其变动情况的帐户                                            |
| 指定信息披露媒体: | 指中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊、互联网站及其他媒体,包括但不限于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、上海证券交易所网站及深圳证券交易                  |

不可抗力：指任何无法预见、无法克服并无法避免的事件或因素，包括但不限于：相关法律、法规或规章的变更；国际、国内金融市场风险事故的发生；自然或人为破坏造成的交易系统或交易场所无法正常工作；战争或动乱等

### 三、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：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”）是经证监基金字[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 N.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，其中两股东出资比例不变。

截止2010年11月10日，公司旗下管理着兴业可转债混合型证券投资基金、兴业趋势投资混合型证券投资基金（LOF）、兴业货币市场证券投资基金、兴业全球视野股

票型证券投资基金、兴业社会责任股票型证券投资基金、兴业有机增长灵活配置混合型证券投资基金、兴业磐稳增利债券型证券投资基金、兴业合润分级股票型证券投资基金、兴业沪深300指数增强型证券投资基金（LOF）共九只开放式基金。

兴业全球基金管理有限公司下设投资决策委员会、风险管理委员会、基金管理部、研究部、专户投资部、监察稽核部、市场部、客户服务中心、运作保障部、综合管理部、金融工程与专题研究部、交易室、渠道部、北京办事处，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。

张训苏先生，董事，1963年生，博士后，副教授、高级经济师。历任安徽财贸学院讲师，港澳证券上海总部副总经理、研发总经理，兴业证券股份有限公司研究发展中心总经理、总裁助理兼客户资产管理部总经理、风险管理总监。现任兴业证券股份有限公司副总裁。

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。

万维德（Mar van Weede）先生，董事，1965年生，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。

Eric Rutten 先生，董事，1962年生，荷兰国籍。历任 Willems vd Wildenberg BV 合伙人和联合创立人，OOM 保险公司市场营销部负责人，Axent-AEGON 公司运营和 IT 部门负责人，阿尔伯特·海恩金融公司筹建管理团队主席，全球人寿派驻世界银行市场工作负责人，全球人寿（荷兰）人寿保险业务首席执行官。现任全球人寿（荷兰）资产管理部首席执行官。

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。

黄明先生，独立董事，1964年生，金融学博士。历任芝加哥大学商学院金融学助理教授，斯坦福大学商学院金融学助理教授、副教授，长江商学院副院长、金融学访问教授、上海财经大学金融学院院长。现任美国康奈尔大学金融学教授（终身）、长江商学院教授、中国教育部长江学者讲座教授、《美国经济评论》编委。

于宁先生，独立董事，1954年生，律师。历任江苏省镇江市卫生局干部，中央纪律检查委员会副处长、处长。现任中华全国律师协会会长、北京大学法学院兼职教授。

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。

杜建新先生，督察长，1959年生，经济学学士，经济师。历任江西财经大学情报资料中心主任，中国银行三明分行办公室副主任，兴业证券股份有限公司三明营业部副总经理、上海管理总部总经理、人力资源部总经理，兴业全球基金管理有限公司督察长兼监察稽核部总监。现任兴业全球基金管理有限公司督察长。

杨卫东先生，副总经理兼市场部总监，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。

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业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，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。

### 3、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共由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

王小明 兴业全球基金管理有限公司投资总监、兴业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、兴业社会责任股票型证券投资基金基金经理

董承非 兴业全球视野股票型证券投资基金基金经理

投资决策委员会主任委员由总经理杨东担任，投资决策委员会执行委员由副总经理杜昌勇担任。

### 4、本基金基金经理

杨云先生，1974年生，理学硕士，历任申银万国证券研究所金融工程部研究员、兴业全球基金管理有限公司兴业可转债混合型证券投资基金基金经理助理；现任本基金基金经理（2007年2月6日至今）。

本基金历任基金经理：

杜昌勇先生，于2004年5月11日至2007年2月6日期间担任本基金基金经理。

王晓明先生，于2004年9月29日至2005年12月7日期间担任本基金基金经理。

上述人员之间不存在近亲属关系。

### （三）基金管理人的职责

- 1、依法募集基金，或者委托经国务院证券监督管理机构认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；
- 2、办理基金备案手续；
- 3、对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账，进行证券投资；
- 4、按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；
- 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净值，确定基金份额申购、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、行政法规有关规定，由国务院证券监督管理机构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有关法律、法规、规章及行业规范，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、对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) 依照有关法律、法规、规章和基金合同的规定，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风险控制制度

#### 1、风险管理的理念

- (1) 风险管理是业务发展的保障；
- (2) 最高管理层负最终责任；

- (3) 分工明确、相互牵制的组织结构是前提;
- (4) 制度建设是基础;
- (5) 制度执行监督是保障。

## 2、风险管理的原则

(1) 全面性原则: 公司风险管理必须覆盖公司的所有部门和岗位, 渗透各项业务过程和业务环节;

(2) 独立性原则: 公司设立独立的监察稽核部, 监察稽核部保持高度的独立性和权威性, 负责对公司各部门风险控制工作进行稽核和检查;

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

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

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

## 3、风险管理和内部风险控制体系结构

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

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

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

(3) 投资决策委员会: 负责指导基金资产的运作、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有关法律、法规、行业规章和公司各项规章制度，自觉形成守法经营、规范运作的经营思想和经营风格；不断提高经营管理水平，在风险最小化的前提下，确保基金份额持有人利益最大化；建立行之有效的风险控制机制和制度，确保各项经营管理活动的健康运行与公司财产的安全完整；维护公司信誉，保持公司的良好形象。

针对公司面临的各种风险，包括政策和市场风险，管理风险和职业道德风险，分别制定严格防范措施，并制定岗位分离制度、空间分离制度、作业流程制度、集中交易制度、信息披露制度、资料保全制度、保密制度和独立的监察稽核制度等相关制度。

### （2）监察稽核制度

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

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，并提交风险控制委员会；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；监督基金资产运作的合法性、合规性、合理性；调查公司内部违规事件；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的措施

（1）建立、健全内控体系，完善内控制度：公司建立、健全了内控结构，高管人员关于内控有明确的分工，确保各项业务活动有恰当的组织和授权，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。

## 四、基金托管人

### (一) 基金托管人基本情况

名称：中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街55号

成立时间：1984年1月1日

法定代表人：姜建清

注册资本：人民币334,018,850,026元

联系电话：010-66105799

联系人：蒋松云

## （二）主要人员情况

截至2010年9月末，中国工商银行资产托管部共有员工121人，平均年龄30岁，95%以上员工拥有大学本科以上学历，高管人员均拥有硕士以上学位或高级职称。

## （三）基金托管业务经营情况

作为中国大陆托管服务的先行者，中国工商银行自1998年开展托管服务以来，秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨，严格履行资产托管人的责任和义务，依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的业务管理模式、先进的业务营运系统和专业的托管服务团队，为广大投资者、众多资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务，取得了优异业绩。建立了包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、收支账户资金、企业年金基金、QFII资产、QDII资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、银行理财产品等门类齐全的托管产品体系。截至2010年9月，中国工商银行共托管证券投资基金177只，其中封闭式8只，开放式169只。2010年，中国工商银行凭借在2009年国内外托管领域的杰出表现和品牌影响力，先后被英国《全球托管人》、香港《财资》和美国《环球金融》评选为“2009年度中国最佳托管银行”，本届《财资》评选首次设立了在亚太地区证券和基金服务领域有突出贡献的年度行业领导者奖项，中国工商银行资产托管部周月秋总经理荣获“年度最佳托管银行家”称号，是仅有的两位获奖人之一。自2004年以来，中国工商银行资产托管服务已经获得23项国内外大奖。”

## （四）基金托管人的内部控制制度

中国工商银行资产托管部自成立以来，各项业务飞速发展，始终保持在资产托管行业的优势地位。这些成绩的取得，是与资产托管部“一手抓业务拓展，一手抓内控建设”的做法是分不开的。资产托管部非常重视改进和加强内部风险管理工作，在积极拓展各项托管业务的同时，把加强风险防范和控制的力度，精心培育内控文化，完善风险控制机制，强化业务项目全过程风险管理作为重要工作来做。继2005、2007年两次顺利通过评估组织内部控制和安全措施是否充分的最权威的SAS70（审计标准第70号）审阅后，2009年中国工商银行资产托管部第三次通过SAS70审阅获得无保留意见的控制及有效性报告，表明独立第三方对我行托管服务在风险管理、内部控制方面的健全性和有效性的全面认可。也证明中国工商银行托管服务的风险控制能力已经与国际大型托管银行接轨，达到国际先进水平。目前，SAS70审阅已经成为年度化、常规化的内控工作手段。

### （1）内部风险控制目标

保证业务运作严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，强化和建立守法经营、规范运作的经营思想和经营风格，形成一个运作规范化、管理科学化、监控制度化的内控体系；防范和化解经营风险，保证托管资产的安全完整；维护持有人的权益；保障资产托管业务安全、有效、稳健运行。

## （2）内部风险控制组织结构

中国工商银行资产托管业务内部风险控制组织结构由中国工商银行股份有限公司稽核监察部门（内控合规部、内部审计局）、资产托管部内设风险控制处及资产托管部各业务处室共同组成。总行稽核监察部门负责制定全行风险管理政策，对各业务部门风险控制工作进行指导、监督。资产托管部内部设置专门负责稽核监察工作的内部风险控制处，配备专职稽核监察人员，在总经理的直接领导下，依照有关法律规章，对业务的运行独立行使稽核监察职权。各业务处室在各自职责范围内实施具体的风险控制措施。

## （3）内部风险控制原则

1）合法性原则。内控制度应当符合国家法律法规及监管机构的监管要求，并贯穿于托管业务经营管理活动的始终。

2）完整性原则。托管业务的各项经营管理活动都必须有相应的规范程序和监督制约；监督制约应渗透到托管业务的全过程和各个操作环节，覆盖所有的部门、岗位和人员。

3）及时性原则。托管业务经营活动必须在发生时能准确及时地记录；按照“内控优先”的原则，新设机构或新增业务品种时，必须做到已建立相关的规章制度。

4）审慎性原则。各项业务经营活动必须防范风险，审慎经营，保证基金资产和其他委托资产的安全与完整。

5）有效性原则。内控制度应根据国家政策、法律及经营管理的需要适时修改完善，并保证得到全面落实执行，不得有任何空间、时限及人员的例外。

6）独立性原则。资产托管部托管的基金资产、托管人的自有资产、托管人托管的其他资产应当分离；直接操作人员和控制人员应相对独立，适当分离；内控制度的检查、评价部门必须独立于内控制度的制定和执行部门。

## （4）内部风险控制措施实施

1）严格的隔离制度。资产托管业务与传统业务实行严格分离，建立了明确的岗位职责、科学的业务流程、详细的操作手册、严格的人员行为规范等一系列规章制度，并采取了良好的防火墙隔离制度，能够确保资产独立、环境独立、人员独立、业务制度和管理独立、网络独立。

2) 高层检查。主管行领导与部门高级管理层作为工行托管业务政策和策略的制定者和管理者，要求下级部门及时报告经营管理情况和特别情况，以检查资产托管部在实现内部控制目标方面的进展，并根据检查情况提出内部控制措施，督促职能部门改进。

3) 人事控制。资产托管部严格落实岗位责任制，建立“自控防线”、“互控防线”、“监控防线”三道控制防线，健全绩效考核和激励机制，树立“以人为本”的内控文化，增强员工的责任心和荣誉感，培育团队精神和核心竞争力。并通过进行定期、定向的业务与职业道德培训、签订承诺书，使员工树立风险防范与控制理念。

4) 经营控制。资产托管部通过制定计划、编制预算等方法开展各种业务营销活动、处理各项事务，从而有效地控制和配置组织资源，达到资源利用和效益最大化目的。

5) 内部风险管理。资产托管部通过稽核监察、风险评估等方式加强内部风险管理，定期或不定期地对业务运作状况进行检查、监控，指导业务部门进行风险识别、评估，制定并实施风险控制措施，排查风险隐患。

6) 数据安全控制。我们通过业务操作区相对独立、数据和传真加密、数据传输线路的冗余备份、监控设施的运用和保障等措施来保障数据安全。

7) 应急准备与响应。资产托管业务建立专门的灾难恢复中心，制定了基于数据、应用、操作、环境四个层面的完备的灾难恢复方案，并组织员工定期演练。为使演练更加接近实战，资产托管部不断提高演练标准，从最初的按照预订时间演练发展到现在的“随机演练”。从演练结果看，资产托管部完全有能力在发生灾难的情况下两个小时内恢复业务。

#### (5) 资产托管部内部风险控制情况

1) 资产托管部内部设置专职稽核监察部门，配备专职稽核监察人员，在总经理的直接领导下，依照有关法律规章，全面贯彻落实全程监控思想，确保资产托管业务健康、稳定地发展。

2) 完善组织结构，实施全员风险管理。完善的风险管理体系需要从上至下每个员工的共同参与，只有这样，风险控制制度和措施才会全面、有效。资产托管部实施全员风险管理，将风险控制责任落实到具体业务部门和业务岗位，每位员工对自己岗位职责范围内的风险负责，通过建立纵向双人制、横向多部门制的内部组织结构，形成不同部门、不同岗位相互制衡的组织结构。

3) 建立健全规章制度。资产托管部十分重视内控制度的建设，一贯坚持把风险防范和控制的理念和方法融入岗位职责、制度建设和工作流程中。经过多年努力，资产托管部已经建立了一整套内部风险控制制度，包括：岗位职责、业务操作流程、稽核

监察制度、信息披露制度等，覆盖所有部门和岗位，渗透各项业务过程，形成各个业务环节之间的相互制约机制。

4) 内部风险控制始终是托管部工作重点之一，保持与业务发展同等地位。资产托管业务是商业银行新兴的中间业务，资产托管部从成立之日起就特别强调规范运作，一直将建立一个系统、高效的风险防范和控制体系作为工作重点。随着市场环境的变化和托管业务的快速发展，新问题、新情况不断出现，资产托管部始终将风险管理放在与业务发展同等重要的位置，视风险防范和控制为托管业务生存和发展的生命线。

## 五、相关服务机构

### (一) 基金发售机构

#### 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

客户服务电话：400-678-0099（免长话费）、（021）38824536

电话：（021）58368886、58368919

传真：（021）58368869、58368915

联系人：汤凡、何佳怡

公司网站：www.xyfunds.com.cn

- 兴业全球基金网上直销（目前仅对持有兴业银行、建设银行、招商银行、工商银行借记卡，农业银行借记卡、准贷记卡的个人投资者开通网上直销业务）

交易网站：<https://trade.xyfunds.com.cn>

客户服务电话：400-678-0099，021-38824536

#### 2. 代销机构

- 代销银行

##### 1) 中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街55号

法定代表人：姜建清

电话：（010）66107900  
传真：（010）66107914  
客户服务电话：95588  
公司网站：www.icbc.com.cn

**2）兴业银行股份有限公司**

办公地址：福建省福州市湖东路154号  
法定代表人：高建平  
电话：（021）52629999  
客户服务电话：95561  
公司网站：www.cib.com.cn

**3）招商银行股份有限公司**

注册地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦  
法定代表人：秦晓  
电话：（0755）83198888  
客户服务电话：95555  
公司网站：www.cmbchina.com

**4）中国建设银行股份有限公司**

注册地址：北京市西城区金融大街25号  
法定代表人：郭树清  
客户服务电话：95533（全国）  
公司网站：www.ccb.com

**5）上海浦东发展银行股份有限公司**

注册地址：上海市浦东新区浦东南路500号  
办公地址：上海市中山东一路12号  
法定代表人：吉晓辉  
传真：（021）63602431  
客户服务热线：95528  
公司网站：www.spdb.com.cn

**6）交通银行股份有限公司**

住所：上海市仙霞路18号  
办公地址：上海市银城中路188号  
法定代表人：蒋超良  
电话：021-58781234  
传真：021-58408843

客户服务电话：95559

公司网站：www.bankcomm.com

**7) 中国民生银行股份有限公司**

住所：北京市西城区复兴门内大街2号

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）83914283

公司网站：www.cmbc.com.cn

**8) 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

电话：（010）68098000

传真：（010）68560311

客服电话：95595（全国）

公司网站：www.cebbank.com

**9) 中国农业银行股份有限公司**

住所：北京市东城区建国门内大街69号

法定代表人：项俊波

客服电话：95599

传真：（010）85109219

公司网站：www.abchina.com

**10) 中国银行股份有限公司**

住所：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：www.boc.cn

**11) 中国宁波银行股份有限公司**

住所：宁波市江东区中山东路294号

法定代表人：陆华裕

客户服务统一咨询电话：96528，上海地区962528

传真：（021）63586215

公司网站：www.nbcb.com.cn

**12) 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：孔丹

电话：（010）65541405

传真：（010）65541281

客户服务电话：95558

公司网站：bank.ecitic.com

### 13) 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>

### 14) 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>

### 15) 渤海银行股份有限公司

住所（办公地址）：天津市河西区马场道201-205号

法定代表人：刘宝凤

客服电话：400-888-8811

公司网址：<http://www.cbhb.com.cn>

## ● 代销券商

#### 1) 兴业证券股份有限公司

办公地址：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：[www.xyzq.com.cn](http://www.xyzq.com.cn)

#### 2) 海通证券股份有限公司

办公地址：上海市淮海中路98号

法定代表人：王开国

电话：（021）23219000

传真：（021）53858549

客户服务咨询电话：4008888001、021-962503或拨打各城市营业网点咨询电话

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

**3) 国泰君安证券股份有限公司**

注册地址： 上海市浦东新区商城路618号

办公地址： 上海市延平路135号

法定代表人： 祝幼一

传真： (021) 38670161

客户服务咨询电话： 400-8888-666

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

**4) 中信建投证券有限责任公司**

办公地址： 北京市朝阳区门内大街188号

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： [www.csc108.com](http://www.csc108.com)

**5) 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

法定代表人： 吴万善

电话： (025) 84457777-950、248

客户咨询电话： (025) 84579897

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

**6) 长江证券股份有限公司**

办公地址： 武汉市新华路特8号

法定代表人： 胡运钊

客户服务热线： 4008-888-999或027-85808318

电话： (027) 65799999

传真： (027) 85481900

公司网站： [www.95579.com](http://www.95579.com)

**7) 中国银河证券股份有限公司**

办公地址： 北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座

法定代表人： 顾伟国

客服电话： 4008-888-888

传真： 010-66568116

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

**8) 广发证券股份有限公司**

办公地址: 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: [www.gf.com.cn](http://www.gf.com.cn)

**9) 山西证券有限责任公司**

办公地址: 山西省太原市府西街69号山西国贸中心

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: [www.i618.com.cn](http://www.i618.com.cn)

**10) 招商证券股份有限公司**

办公地址: 深圳市福田区益田路江苏大厦A座39—45层

法定代表人: 宫少林

电话: (0755) 82960223

传真: (0755) 82943636

客服电话: 4008888111, 95565

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

**11) 德邦证券有限责任公司**

办公地址: 上海市浦东南路588号浦发大厦26层

法定代表人: 方加春

开放式基金咨询电话: 4008888128

开放式基金业务传真: 021-68767981

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

**12) 国海证券有限责任公司**

注册地址: 中国广西南宁市滨湖路46号

法定代表人: 张雅峰

客服热线: 4008888100 (全国)、96100 (广西)

开放式基金业务传真: (0771) 5539033

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

**13) 东方证券股份有限公司**

注册地址：上海市中山南路318号2号楼22层-29层

法定代表人：王益民

客服热线：（021）962506或40088-88506

传真：（021）63326173

公司网站：www.dfzq.com.cn

**14) 光大证券股份有限公司**

注册地址：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

开放式基金咨询电话：4008888788

公司网站：www.ebscn.com

**15) 中银国际证券有限责任公司**

注册地址：上海市银城中路200号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：www.bocichina.com

**16) 湘财证券有限责任公司**

注册地址：湖南省长沙市黄兴中路63号中山国际大厦12楼

办公地址：上海市浦东银城东路139号华能联合大厦18楼

法定代表人：陈学荣

联系电话：（021）68634818

传真：（021）68865680

客服电话：400-888-1551

公司网站：www.xcsc.com

**17) 华泰联合证券有限责任公司**

注册地址：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

电话：（0755）82492000

传真：（0755）82492962

客户服务电话：400-8888-555，（0755）25125666

公司网站：www.lhzq.com

**18) 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  
电话：（0791）6768763  
传真：（0791）6789414  
客户服务电话：400-8866-567  
公司网站：www.scstock.com

**19) 申银万国证券股份有限公司**

注册地址：上海市常熟路171号  
法定代表人：丁国荣  
电话：021-54033888  
传真：021-54035333  
客服热线：021-962505  
公司网站：www.sw2000.com.cn

**20) 国元证券股份有限公司**

注册地址：合肥市寿春路179号  
法定代表人：凤良志  
开放式基金咨询电话：安徽地区：96888；全国：400-8888-777  
开放式基金业务传真：0551-2207114  
公司网站：www.gyzq.com.cn

**21) 渤海证券股份有限公司**

住所：天津市经济技术开发区第二大街42号写字楼101室  
法定代表人：王春峰  
电话：（022）28451861  
传真：（022）28451892  
客户服务电话：4006515988  
公司网站：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  
客户服务电话：400-887-8827  
公司网站：www.ubssecurities.com

**23) 广发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  
办公地址：福州市五四路157号新天地大厦7、8、10层  
法定代表人：黄金琳

联系电话：（0591）87841160

传真：（0591）87841150

客户服务电话：96326（福建省外请加拨0591）

公司网站：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）81283906

传真：（0531）81283900

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>

● 其他代销机构

**天相投资顾问有限公司**

办公地址: 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: [www.txsec.com](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。销售机构可以根据情况变化增加或者减少销售城市(网点), 并另行公告。

**(二) 注册登记机构**

名称: 兴业全球基金管理有限公司

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

电话: (021) 58368998

传真: (021) 58368858

**(三) 出具法律意见书的律师事务所和经办律师**

名称: 上海源泰律师事务所

办公地址: 上海市浦东南路256号华夏银行大厦14楼

负责人: 廖海

电话: (021) 51150298

传真: (021) 51150398

经办律师: 廖海、吕红

联系人: 廖海

**(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、方侃

联系人：徐艳

## 六、基金的募集与基金合同的生效

### （一）基金的募集

本基金经中国证券监督管理委员会证监基金字[2004] 27号核准，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募集，募集期从2004年4月2日起到2004年4月30日止，共募集3,282,404,810.93份基金份额，募集户数为70,846户。

### （二）基金合同的生效

本基金的基金合同已于2004年5月11日正式生效。

### （三）基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模限制

本基金合同生效后，基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元的，基金管理人应当及时报告中国证监会；连续20个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会说明原因和报送解决方案。

## 七、基金份额的申购、赎回

### （一）申购、赎回场所

- 1、本基金管理人直销网点及网站；
- 2、受本基金管理人委托、具有销售本系列基金资格的商业银行或其它机构的营业网点；
- 3、有网上交易功能的销售机构的网站。

上述直销和代销机构的名称、住所等参见本招募说明书“五、相关服务机构（一）基金份额发售机构”。

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。销售机构可以根据情况变化增加或者减少销售城市（网点），并另行公告。

## （二）申购和赎回的开放日及开放时间

1、本基金开放日为投资者办理基金申购、赎回等业务的工作日，即上海证券交易所、深圳证券交易所的交易日。开放日的具体业务办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所交易日的交易时间。目前，上海证券交易所、深圳证券交易所的交易时间为交易日上午：9:30-11:30，下午1:00-3:00。

投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回申请的，其基金份额申购、赎回价格为下次办理基金份额申购、赎回时间所在开放日的价格。

本基金设立以后，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进行相应的调整并公告，并报中国证监会备案，并在实施日3个工作日前在至少一种证监会指定的媒体上刊登公告。

2、本基金日常申购自2004年7月5日开始办理，日常赎回自2004年7月12日开始办理。

## （三）申购、赎回的原则

1、“未知价”原则，即申购、赎回价格以受理申请当日收市后计算的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，赎回以持有的基金份额申请；

3、当日的申购、赎回申请可以在基金管理人规定的时间以前撤销，在当日的交易时间结束后不得撤销；

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个工作日在至少一种中国证监会指定的媒体上刊登公告。

## （四）申购、赎回的程序

1、申请方式：书面申请、电话申请或销售人公布的其他方式。

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

### 3、申购、赎回的确认与通知

申购、赎回的确认与通知：T日提交的有效申请，本基金注册登记人在T+1日内为投资者对该交易的有效性进行确认，投资者可在T+2日起到销售网点柜台或以销售人规定的其他方式查询申购与赎回的确认情况。

### 4、申购、赎回款项的支付

基金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，申购款项将退回投资者账户。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，款项和份额的支付办法参照本基金合同的有关条款处理。

5、T日的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。

## （五）申购、赎回的数额限制

1、工商银行的代销网点每个基金账户首次单笔最低申购金额为5,000元（含申购费），已认购或首次申购后追加申购最低金额为1,000元（含申购费），其他代销机构网点首次单笔最低申购金额为1,000元（含申购费），已认购或首次申购后追加申购最低金额为500元（含申购费）。

2、直销中心每个账户首次申购的最低金额为100,000元（含申购费），追加申购的最低金额为10,000元人民币；已在直销中心有认购本基金记录的投资者不受首次申购最低金额的限制。代销网点的投资者欲转入直销网点进行交易要受直销网点最低金额的限制。基金管理人可根据市场情况，调整本基金首次申购的最低金额。

3、赎回的最低份额为1,000份基金份额，基金份额持有人可将其全部或部分基金份额赎回，但某笔赎回导致单个交易账户的基金份额余额少于1,000份时，余额部分基金份额必须一同赎回。

4、基金管理人可根据市场情况，调整申购的金额和赎回的份额的数量限制，基金管理人必须在调整前3个工作日至少在一种中国证监会指定的信息披露媒体上刊登公告并报中国证监会备案。

5、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，以当日基金份额净值为基准计算，保留到小数点后两位，剩余部分舍去，舍去部分所代表的资产归基金所有。

6、赎回金额的处理方式：赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值为基准并扣除相应的费用，保留到小数点后两位，两位以后的部分舍去，舍去部分所代表的资产归基金所有。

## （六）申购、赎回的费用

## 1、申购费

(1) 本基金的申购遵循金额申购的原则，即申购金额中包含申购费用；费用计算原则为单笔单次收费。

| 金额 (M, 含申购费) | 申购费率      |
|--------------|-----------|
| M < 1000 万   | 1.0%      |
| M ≥ 1000 万   | 每笔 1000 元 |

投资者选择红利自动再投资所转成的份额不收取申购费用。

(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，不列入基金资产。

## 2、赎回费

本基金的赎回遵循份额赎回的原则，基金赎回费用由投资者承担，在扣除必要的手续费后，赎回费总额的25%归入基金资产。

本基金赎回费率随投资人持有本基金时间的增加而递减，具体费率如下：

| 连续持有期限 (T)    | 赎回费率  |
|---------------|-------|
| T ≤ 1 年       | 0.50% |
| 1 年 < T ≤ 2 年 | 0.25% |
| T > 2 年       | 0     |

本基金管理人已于2006年10月10日刊登公告，决定自2006年10月13日起对兴业可转债混合型证券投资基金的申购、赎回费率进行适当调整。

3、本基金实际执行费率在上述范围内由基金管理人决定，并在招募说明书或公开说明书中进行公告。基金管理人认为需要调整费率时，如果没有超过上述费率限额，基金管理人可自行调整；若提高本基金上述费率的上限应召开基金份额持有人大会审议。费率上限变更的，最迟将于新的费率开始实施前3个工作日至少在一种中国证监会指定的媒体上予以公告。

## (七) 申购份额、赎回金额的计算方式

### 1、基金申购份额的计算

申购份额为申购金额减去申购费用后除以当日的基金份额净值为基准计算的申购价格，有效份额单位为份，基金份额份数保留到小数点后两位，两位以后的部分舍去，舍去部分所代表的资产归基金所有。

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 / 申购当日基金份额净值

例：某投资者投资50,000元申购本基金，对应费率为1%，假设申购当日基金份额净值为1.0160元，则其可得到的申购份额为：

净申购金额 =  $50000 / (1 + 1\%) = 49504.95$ 元

基金申购费用 =  $50000 - 49504.95 = 495.05$ 元

申购份额 =  $49504.95 / 1.0160 = 48725.34$ 份

即：投资者投资50,000元申购本基金，假设申购当日基金份额净值为1.0160元，则可以得到48,725.34份基金份额。

本基金管理人已于2007年5月15日刊登了《兴业基金管理有限公司关于修改兴业可转债混合型基金和兴业全球视野股票型基金基金合同部分条款的公告》，自2007年5月18日起本基金采用“外扣法”计算申购份额和申购费用。

## 2、基金赎回金额的计算

赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值为基准计算的赎回价格减去赎回费用，赎回金额单位为元，赎回金额保留到小数点后两位，两位以后的部分舍去，舍去部分所代表的资产归基金所有。

赎回费用 = (赎回份额 × 基金份额净值) × 赎回费率

赎回金额 = (赎回份额 × 基金份额净值) - 赎回费用

例：某投资者赎回本基金10,000份基金份额，持有时间为8个月，对应的赎回费率为0.5%，假设赎回当日基金份额净值是1.0160元，则其可得到的赎回金额为：

赎回费用 =  $(10000 \times 1.0160) \times 0.5\% = 50.80$ 元

赎回金额 =  $(10000 \times 1.0160) - 50.80 = 10109.20$ 元

即：投资者赎回本基金10,000份基金份额，假设赎回当日基金份额净值是1.0160元，则其可得到的赎回金额为10,109.20元。

3、本基金T日的基金份额净值在当天收市后计算，并在T+1日公告。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。

## (八) 申购、赎回的注册登记

基金投资者提出的申购、赎回申请，在当日交易时间结束前可以撤销，交易时间结束后不得撤销。

1、投资者申购基金成功后，基金注册登记人在T+1工作日为投资者办理注册与过户登记手续，投资者自T+2工作日（含该日）后有权赎回该部分基金份额；

2、投资者赎回基金成功后，基金注册登记人在T+1工作日为投资者办理扣除权益的注册与过户登记手续；

3、基金管理人可在法律法规允许的范围内及技术条件允许的情况下，对上述注册登记办理时间进行调整，但不得实质影响投资者的合法权益，并最迟于开始实施前3个工作日在至少一种中国证监会指定的媒体上予以公告。

## (九) 拒绝或暂停申购、赎回的情形与处理

### 1、拒绝或暂停申购的情形和处理

出现以下情况之一时，基金管理人可拒绝或暂停接受基金投资者的申购申请：

(1) 不可抗力的原因导致基金无法正常工作；

(2) 证券交易所交易时间非正常停市或其他情形，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；

(3) 发生基金合同或招募说明书中未予载明的事项，但基金管理人认为有正当理由认为需要暂停基金申购，应当报中国证监会批准；经批准后，基金管理人应当立即在中国证监会指定的信息披露媒体上刊登暂停申购公告；

(4) 法律、法规、规章规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述第(1)到第(4)项暂停申购情形时，基金管理人应当立即向中国证监会备案，并应在至少一种中国证监会指定的媒体上刊登暂停公告。

### 2、拒绝或暂停赎回的情形和处理

发生下列情形之一时，基金管理人可拒绝或暂停接受基金投资者的赎回申请：

(1) 不可抗力的原因导致基金无法正常工作；

(2) 证券交易场所交易时间非正常停市或其他情形，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；

(3) 因市场剧烈波动或其它原因而出现连续两个开放日巨额赎回，导致本基金的现金支付出现困难；

(4) 法律、法规、规章规定或中国证监会认定的其它情形。

发生上述情形之一的，基金管理人应在当日立即向中国证监会备案。已接受的赎回申请，基金管理人将足额支付；如暂时不能足额支付时，将按每个赎回申请人已被接受的赎回申请量占已接受赎回申请总量的比例分配给赎回申请人，其余部分根据基金管理人制定的原则在后续开放日予以兑付，但不得超过正常支付时间20个工作日，并以后续开放日的基金份额净值为依据计算赎回金额。投资者也可在申请赎回时选择当日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。

### 3、其他暂停申购、赎回情形及处理方式

发生基金合同或招募说明书中未予载明的事项，但基金管理人认为有正当理由认为需要暂停接受基金申购、赎回的，应当报经中国证监会批准。经批准后，基金管理人应立即在至少一种中国证监会指定的媒体上刊登暂停公告。暂停期间，应每两周至少刊登提示性公告一次，暂停期间结束，基金重新开放时，基金管理人应当公告最新的基金份额净值。

## (十) 巨额赎回的情形及处理

### 1、巨额赎回的认定

在基金单个开放日，本基金净赎回申请（赎回申请总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过上一日该基金总份额的10%时，即认为发生了巨额赎回。

## 2、巨额赎回的处理

（1）全额赎回：当基金管理人认为有能力兑付投资者的赎回申请时，按正常赎回程序执行。

（2）顺延赎回：巨额赎回申请发生时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于该基金总份额的10%的前提下，可以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，确定当日受理的赎回份额；投资者未能赎回部分，除投资者在提交赎回申请时明确作出不参加顺延下一个开放日赎回的表示外，自动转为下一个开放日赎回处理。但投资者可在申请赎回时选择将当日未获受理部分予以撤消。转入下一开放日的赎回申请不享有赎回优先权，并将以该下一个开放日的该基金份额净值为基准计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。

（3）巨额赎回的公告：当发生巨额赎回和基金间转换并延期支付时，基金管理人将通过邮寄、传真或者《基金合同》、《招募说明书》规定的其他方式、在规定的时间内通知基金投资人，说明有关处理方法。同时在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体上公告，通知投资者，并说明有关处理方法。通知和公告的时间最长不得超过三个证券交易所交易日。

（4）基金连续两个开放日以上发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受赎回申请；已经确认的赎回可以延期支付赎回款项，但不得超过正常支付时间后的20个工作日，并应当在中国证监会指定的信息披露媒体上公告。

## （十一）暂停申购、赎回的公告及重新开放申购、赎回的公告

1、发生暂停申购或赎回情况的，基金管理人应在当日立即向中国证监会备案并应在规定期限内指定媒体上刊登暂停公告。

2、如果发生暂停的时间为一天，第二个工作日基金管理人应在至少一种中国证监会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个开放日的基金份额净值。

3、如果发生暂停的时间超过一天但少于两周，暂停结束基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前1个工作日在至少一种中国证监会指定媒体上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并在重新开放申购或赎回日公告最近1个工作日的基金份额净值。

4、如果发生暂停的时间超过两周，暂停期间，基金管理人应每两周至少重复刊登暂停公告一次；当连续暂停时间超过两个月时，可将重复刊登暂停公告的频率调整为每月一次。暂停结束基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前3个工作日在至

少一种中国证监会指定媒体上连续刊登基金重新开放申购或赎回公告并在重新开放申购或赎回公告最近一个开放日的基金份额净值。

## （十二）定期定额投资计划

定期定额投资计划指投资者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者指定银行账户内自动完成扣款及基金申购申请的一种投资方式。基金管理人已于2006年8月4日开始推出旗下部分基金定期定额投资计划，具体规则详见基金管理人于2006年8月4日在指定媒体刊登的《兴业基金管理有限公司关于旗下基金开办定期定额投资业务的公告》。

## 八、基金的非交易过户、转托管、基金转换、冻结与质押

### （一）非交易过户

非交易过户是指不采用申购、赎回等基金交易方式，依法将一定数量的基金份额按照一定规则从某一基金投资者基金账户转移到另一基金投资者基金账户的行为。

基金注册登记人只受理继承、捐赠、司法强制执行等情况下的非交易过户。其中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；捐赠是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关依据生效的司法文书将基金份额持有人持有的基金份额强制判决划转给其他自然人、法人、社会团体或其他组织。

办理非交易过户时必须提供注册登记机构要求提供的相关资料。符合条件的非交易过户按《兴业基金管理有限公司开放式基金业务管理规则》的有关规定办理。申请自申请受理日起二个月内办理，并按基金注册登记人规定的标准支付过户费用。

### （二）转托管

基金份额持有人在变更办理基金申购、赎回的销售人（网点）时，销售人之间（网点）不能通存通兑的，可办理已持有基金份额的转托管，即投资者将所持有的基金份额从一个交易账户转到另一交易账户进行交易。

基金份额持有人可以以同一基金账户在多个销售机构申购（认购）基金份额，但必须在原申购（认购）的销售机构赎回该部分基金份额。投资者申购（认购）基金份

额后可以向原申购（认购）基金的销售机构发出转托管指令，缴纳转托管手续费，转托管完成后投资者才可以在转入的销售机构赎回其基金份额。

投资者在转出方办理转托管手续之前，应先到转入方办理基金账户登记手续。

### （三）基金转换

本基金开放赎回后，基金管理人可以按规定申请将其持有的本基金份额与基金管理人管理的、由同一注册登记机构注册登记的其他开放式基金的基金份额相互转换。本基金管理人已于2006年8月9日开始推出旗下部分开放式基金转换业务，具体规定详见基金管理人分别于2006年8月4日和2006年11月23日在指定媒体刊登的《兴业基金管理有限公司关于开通旗下部分开放式基金转换业务的公告》和《兴业基金关于开通兴业全球与兴业转基、以及兴业全球与兴业货币之间基金转换业务的公告》等相关公告。

### （四）冻结与质押

基金注册登记人只受理司法机构依法要求的基金份额的冻结与解冻。基金份额的冻结手续、冻结方式按照基金注册登记人的相关规定办理。

在相关法律法规有明确规定的条件下，基金管理人将可以办理基金份额的质押业务或其他业务，并会同注册登记人制定、公布、实施相应的业务规则。

## 九、基金的投资

### （一）投资目标

在锁定投资组合下方风险的基础上，以有限的期权成本获取基金资产的长期稳定增值。

### （二）投资方向

本基金投资范围是具有良好的流动性的金融工具，包括国内依法公开发行上市的可转换公司债券、股票、国债，以及法律法规允许基金投资的其他金融工具。资产配置比例为：可转债30%~95%（其中可转债在除国债之外已投资资产中比例不低于

50%)，股票不高于30%，现金和到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

本基金管理人已于2006年8月2日刊登公告，即日起对兴业可转债混合型证券投资基金的资产配置比例进行调整。

### (三) 投资策略

#### 1、投资决策依据

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

#### 2、投资决策程序

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。

基金的资产配置采用自上而下的程序，个券和个股选择采用自下而上的程序，并严格控制投资风险。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、可转债市场和利率期限结构的判断确定可转债组合的加权平均内含收益率、久期水平和国债组合的加权平均久期水平。在此基础上根据各种定量和定性标准，以及研究策划部的个券和个股研究报告构建基金组合，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

研究策划部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。

### 3、投资组合管理

基金的资产配置采用自上而下的程序，个券（可转债，下同）和个股选择采用自下而上的程序，并严格控制投资风险。在个券选择层面，积极参与发行条款优惠、期权价值较高、公司基本面优良的可转债的一级市场申购；选择对应的发债公司具有良好发展潜力或基础股票有着较高上涨预期的可转债进行投资，以有效规避市场风险，并充分分享股市上涨的收益；运用“兴业可转债评价体系”，选择定价失衡的个券进行投资，实现低风险的套利。在个股选择层面，以“相对投资价值”判断为核心，选择所处行业发展前景良好、价值被相对低估的股票进行投资。

“兴业可转债评价体系”是指兴业基金管理有限公司投资团队在长期投资研究实践中形成的一套可转债评价系统，该系统的理论基础是期权的二叉树定价模型，核心功能是实现可转债的定价，此外，该系统还可实现转债和正股之间套利机会的发现，和风险指标的揭示。

#### （1）资产配置策略

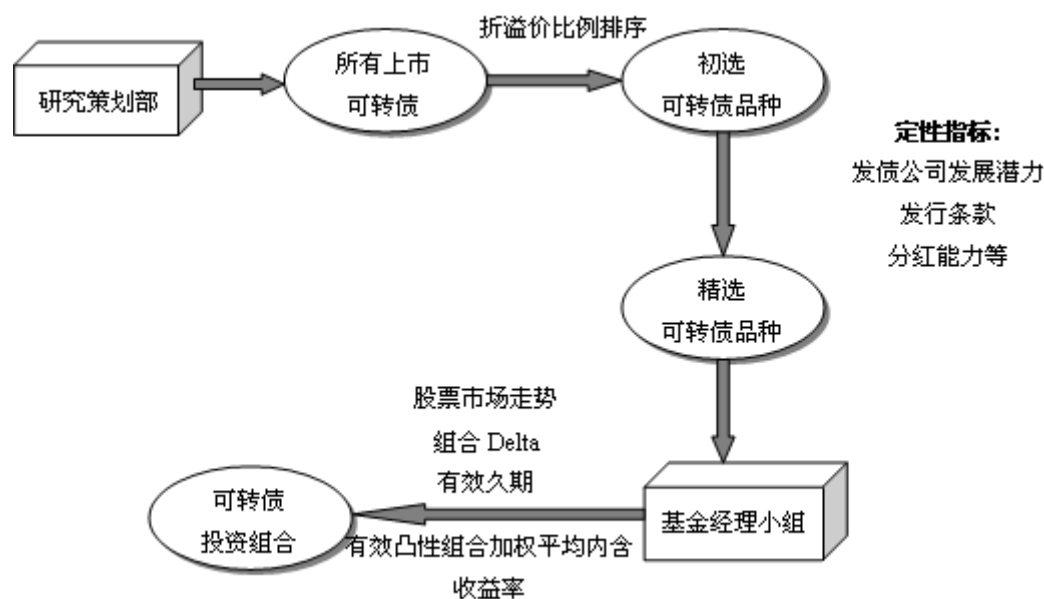
投资决策委员会定期或不定期召开投资决策委员会会议，在分析宏观经济、政策变化以及证券市场总体趋势的基础上，结合有关法律法规，确定今后一段时间内基金资产的具体配置策略，即基金投资组合中可转债、股票、国债和现金的具体构成比例，以及可转债组合中股性与债性的配置。

#### （2）可转债投资策略

本基金将着重对可转债对应的基础股票的分析与研究，对那些有着较好盈利能力或成长前景的上市公司的转债进行重点投资。同时依据科学、完善的“兴业可转债评价体系”选择具有较高投资价值的个券进行投资，并根据内含收益率、折溢价比率、久期、凸性等因素构建可转债投资组合。

可转债不同于一般的企业债券，其投资人具有在一定条件下转股、回售的权利，因此其理论价值应当等于作为普通债券的基础价值加上可转债内含期权价值。可转债的基础价值是实现下方风险锁定的基础，计算可转债的基础价值，只需按照同期企业债券的收益率水平对可转债到期日内的最大可回收利息、本金（包括持有到期的利息补偿）进行贴现即可。对可转债内含期权价值的定价是“兴业可转债评价体系”中的核心，其主要与基础股票的价格预期、发行条款、发债上市公司基本面等要素有关。可转债内含期权定价分析主要分为二叉树定价模型分析和定性分析两个部分，其中：二叉树定价模型属量化分析过程，也是期权定价的基础；定性分析是基于无法量化的发行条款、发债公司基本面，基础股票特点等要素对期权价值进行再分析，是对二叉树定价模型的再完善，以提高可转债定价的合理性。

可转债投资组合的构建流程如下：



### （3）可转债转换为基础股票的策略

当发生以下情况时，本基金将把相关的可转债转换为基础股票：在转股期内，当发生本基金所持有可转债的实际转股价格明显低于基础股票市场交易价格时，即存在明显的市场套利机会时，本基金将通过转股实现获益；当存在可转债在变现过程中可能出现较大的变现损失时，本基金将通过转股来保障基金资产的流动性；当由于基础股票价格上涨且满足赎回触发条件时，本基金将通过转股来保障已有收益；其他通过转股能够有效保障或提升基金份额持有人利益的情况。

本基金原则上不长期持有由可转债转换而得的基础股票。

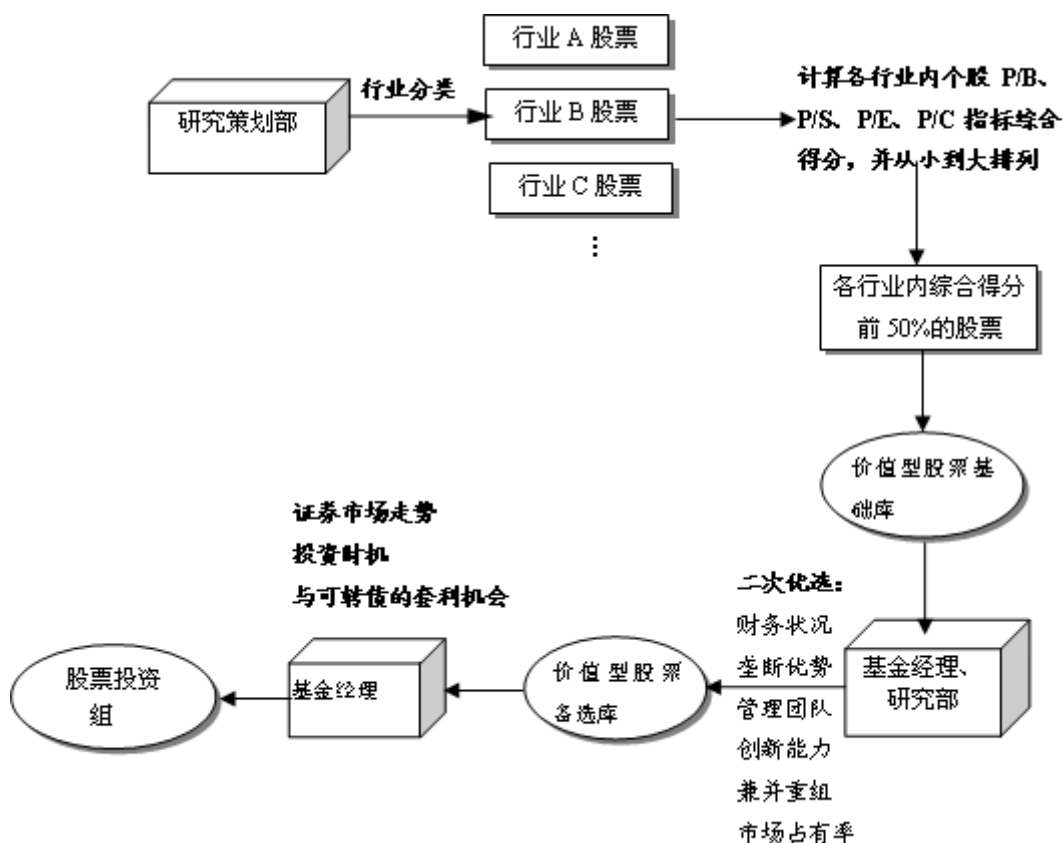
#### (4) 债券投资策略

本基金管理人所要投资的债券包括国债、企业债、金融债等。在债券投资中主要基于对国家财政政策、货币政策的深入分析以及对宏观经济的动态跟踪，运用利率预期、收益率曲线预测等策略，通过科学的数量分析构造有效的债券投资组合，以久期和凸性为主要的投资管理工具，进行长期投资，并适当进行波段操作。

#### (5) 股票投资策略

在股票投资中，本基金将坚持选择不同行业中价值型股票特征较为明显的个股，并确立以“相对投资价值”判断为核心，强调将定量的股票筛选和定性的公司研究进行有机结合的选股思路。研究策划部对股票备选库中的个股采用实地调研等方式进行广泛和深入的研究，形成研究报告，并进行投资论证。基金经理根据研究策划部的投资建议并结合证券市场的股票走势和投资时机，最终确定所要投资的个股。

股票投资组合的构建流程如下：



#### (四) 业绩比较基准

本基金业绩比较基准为：“80%×天相可转债指数+15%×中信标普300指数+5%×同业存款利率”

经与托管银行中国工商银行股份有限公司协商一致，并报中国证监会批准，已自2005年6月21日起将本基金的业绩比较基准调整为“80%×天相可转债指数+15%×中信标普300指数+5%×同业存款利率”。

在制定业绩比较基准过程中，考虑到指数的代表性和实用性，选取天相可转债指数和中信标普300指数分别作为可转债业绩和股票业绩的比较基准。“天相可转债指数”是国内较早编制的可转债指数，编制原则具有严肃性，能够较好的反映可转债市场变化。中信标普300指数代表效果较好。

### （五）投资限制

1、本基金投资组合在遵守法律、法规、中国证监会及《基金合同》规定的投资限制的同时，还将遵守基金管理人内设监察稽核部所制定的投资对象限制。

2、本基金投资组合符合以下规定：

（1）本基金投资于一家上市公司股票的比例不超过该基金资产净值的10%；

（2）本基金与由本基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券总和不超过该证券的10%；

（3）遵守法律、法规、中国证监会及本基金合同所规定的其他比例限制。

3、本基金禁止从事下列行为：

（1）投资于其他基金；

（2）将基金资产用于抵押、担保、资金拆借或者贷款；

（3）以本基金的名义使用不属于本基金名下的资金买卖证券；

（4）从事证券信用交易；

（5）以基金资产进行房地产投资；

（6）从事可能使基金资产承担无限责任的投资；

（7）将基金资产投资于与基金托管人或者基金管理人有关联关系的公司发行的证券；

（8）违反证券交易所业务规则，进行内幕交易，利用对敲、倒仓等行为来操纵和扰乱市场价格，通过关联交易损害基金份额持有人的利益；

（9）法律法规、中国证监会及《基金合同》规定禁止从事的其他行为；

（10）法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定时从其规定。

### （六）基金投资组合报告

本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。

本基金的托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据取自兴业可转债混合型证券投资基金2010年第3季度报告，数据截至2010年9月30日，本报告财务资料未经审计师审计。

### 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              | 1,325,248,714.26 | 26.24        |
|    | 其中：股票             | 1,325,248,714.26 | 26.24        |
| 2  | 固定收益投资            | 3,029,671,387.73 | 59.99        |
|    | 其中：债券             | 3,029,671,387.73 | 59.99        |
|    | 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      | 576,295,436.06   | 11.41        |
| 6  | 其他资产              | 119,496,326.57   | 2.37         |
| 7  | 合计                | 5,050,711,864.62 | 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       | 68,042,814.21  | 1.35         |
| B   | 采掘业            | 55,866,144.97  | 1.11         |
| C   | 制造业            | 700,312,376.82 | 13.91        |
| C0  | 食品、饮料          | 184,464,063.76 | 3.66         |
| C1  | 纺织、服装、皮毛       | 1,239,953.30   | 0.02         |
| C2  | 木材、家具          | -              | -            |
| C3  | 造纸、印刷          | -              | -            |
| C4  | 石油、化学、塑胶、塑料    | 125,388,085.86 | 2.49         |
| C5  | 电子             | 144,720,181.14 | 2.88         |
| C6  | 金属、非金属         | 10,068,606.12  | 0.20         |
| C7  | 机械、设备、仪表       | 134,066,473.83 | 2.66         |
| C8  | 医药、生物制品        | 73,735,984.50  | 1.46         |
| C99 | 其他制造业          | 26,629,028.31  | 0.53         |
| D   | 电力、煤气及水的生产和供应业 | 27,504,614.70  | 0.55         |
| E   | 建筑业            | 10,044,806.21  | 0.20         |
| F   | 交通运输、仓储业       | -              | -            |
| G   | 信息技术业          | 75,989,529.43  | 1.51         |
| H   | 批发和零售贸易        | 37,839,343.82  | 0.75         |

|   |         |                  |       |
|---|---------|------------------|-------|
| I | 金融、保险业  | 165,976,410.63   | 3.30  |
| J | 房地产业    | -                | -     |
| K | 社会服务业   | 48,114,834.97    | 0.96  |
| L | 传播与文化产业 | -                | -     |
| M | 综合类     | 135,557,838.50   | 2.69  |
|   | 合计      | 1,325,248,714.26 | 26.33 |

### 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  | 601718 | 际华集团 | 27,664,865 | 135,557,838.50 | 2.69         |
| 2  | 000869 | 张裕A  | 1,031,624  | 123,784,563.76 | 2.46         |
| 3  | 002139 | 拓邦股份 | 3,674,708  | 88,156,244.92  | 1.75         |
| 4  | 600000 | 浦发银行 | 6,500,000  | 84,240,000.00  | 1.67         |
| 5  | 600066 | 宇通客车 | 3,099,557  | 64,811,736.87  | 1.29         |
| 6  | 000592 | 中福实业 | 7,313,121  | 64,062,939.96  | 1.27         |
| 7  | 601318 | 中国平安 | 1,178,549  | 62,333,456.61  | 1.24         |
| 8  | 002408 | 齐翔腾达 | 1,616,100  | 56,434,212.00  | 1.12         |
| 9  | 600547 | 山东黄金 | 999,931    | 55,866,144.97  | 1.11         |
| 10 | 600143 | 金发科技 | 3,877,869  | 52,700,239.71  | 1.05         |

### 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      | 1,176,320,000.00 | 23.37        |
| 3  | 金融债券      | -                | -            |
|    | 其中：政策性金融债 | -                | -            |
| 4  | 企业债券      | -                | -            |
| 5  | 企业短期融资券   | -                | -            |
| 6  | 可转债       | 1,853,351,387.73 | 36.82        |
| 7  | 其他        | -                | -            |
| 8  | 合计        | 3,029,671,387.73 | 60.19        |

### 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  | 113001  | 中行转债       | 6,426,470 | 676,450,232.20 | 13.44        |
| 2  | 1001019 | 10 央行票据 19 | 6,000,000 | 588,300,000.00 | 11.69        |
| 3  | 1001021 | 10 央行票据 21 | 4,000,000 | 392,160,000.00 | 7.79         |
| 4  | 125709  | 唐钢转债       | 2,751,987 | 306,323,672.97 | 6.09         |
| 5  | 110003  | 新钢转债       | 2,500,000 | 294,075,000.00 | 5.84         |

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

(2) 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

(3) 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额（人民币元）       |
|----|---------|----------------|
| 1  | 存出保证金   | 1,952,051.97   |
| 2  | 应收证券清算款 | 72,542,827.52  |
| 3  | 应收股利    | -              |
| 4  | 应收利息    | 15,644,859.22  |
| 5  | 应收申购款   | 29,356,587.86  |
| 6  | 其他应收款   | -              |
| 7  | 待摊费用    | -              |
| 8  | 其他      | -              |
| 9  | 合计      | 119,496,326.57 |

(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  | 125709 | 唐钢转债 | 306,323,672.97 | 6.09         |
| 2  | 110003 | 新钢转债 | 294,075,000.00 | 5.84         |
| 3  | 110007 | 博汇转债 | 100,167,210.00 | 1.99         |
| 4  | 110008 | 王府转债 | 80,992,554.50  | 1.61         |
| 5  | 125960 | 锡业转债 | 69,159,946.80  | 1.37         |
| 6  | 110078 | 澄星转债 | 44,117,500.00  | 0.88         |

(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  | 601718 | 际华集团 | 135,557,838.50 | 2.69         | 认购新发证券   |

## 十、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 2004 年 5 月 11 日，基金业绩截止日 2010 年 9 月 30 日。

本基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表

| 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  |
|-----------------------------|---------|-----------|------------|---------------|---------|--------|
| 2010 年第 3 季度                | 10.12%  | 0.52%     | 6.44%      | 0.42%         | 3.68%   | 0.10%  |
| 2010 年上半年度                  | -6.21%  | 0.54%     | -19.03%    | 0.81%         | 12.82%  | -0.27% |
| 2009 年度                     | 35.21%  | 0.80%     | 37.37%     | 1.46%         | -2.16%  | -0.66% |
| 2008 年度                     | -19.65% | 0.87%     | -42.04%    | 1.27%         | 22.39%  | -0.40% |
| 2007 年度                     | 113.44% | 1.22%     | 99.30%     | 1.74%         | 14.14%  | -0.52% |
| 2006 年度                     | 71.70%  | 0.72%     | 52.91%     | 0.69%         | 18.79%  | 0.03%  |
| 2005 年度                     | 7.53%   | 0.49%     | 4.83%      | 0.39%         | 2.70%   | 0.10%  |
| 2004.5.11-2004.12.31        | -3.00%  | 0.27%     | -4.37%     | 0.37%         | 1.37%   | -0.10% |
| 2004.5.11（基金成立之日）-2010.9.30 | 328.90% | 0.79%     | 109.50%    | 1.12%         | 219.40% | -0.33% |

## 十一、基金的财产

### （一）基金财产的构成

基金财产包括所拥有的各类证券价值、银行存款本息和基金应收的申购基金款以及其他投资所形成的价值总和。

### （二）基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后净资产值。

### （三）基金财产的账户

本基金资产使用以基金托管人名义开立的基金托管专户和证券交易资金账户，并以基金托管人和“兴业可转债混合型证券投资基金”联名的方式开立基金证券账户，由基金托管人在中央国债登记结算有限责任公司开设债券托管乙类账户并报中国证监会备案。

本基金的专用账户与基金管理人、基金托管人、基金销售代理人 and 基金注册登记人自有的资产账户以及其他基金资产账户严格分开、相互独立。本条将根据中国证券登记结算有限公司账户改革的要求实时修订。

#### （四）基金财产的保管及处分

1、本基金财产独立于基金管理人和基金托管人的固有财产，并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人不得将基金财产归入其固有财产。

2、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。

3、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；基金管理人、基金托管人以其自有的资产承担法律责任，其债权人不得对基金资产行使请求冻结、扣押或其它权利。

4、非因本基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。

5、除依据《证券投资基金法》、基金合同及其它有关规定处分外，基金财产不得被处分。

## 十二、基金资产的估值

### （一）估值目的

基金资产估值的目的是客观、准确地反映每只基金资产价值。依据经基金资产估值后确定的基金资产净值而计算出的基金份额净值，是计算基金申购、赎回的基础。

### （二）估值日

本基金的估值日为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。

### （三）估值对象

本基金所拥有的股票、债券、银行存款本息等资产。

#### （四）估值程序

基金日常估值由基金管理人进行。基金管理人完成估值后，将估值结果加盖业务公章以书面形式加密传真至基金托管人，基金托管人按法律法规、《基金合同》规定的估值方法、时间、程序进行复核，复核无误后在基金管理人传真的书面估值结果上加盖业务公章返回给基金管理人；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）估值方法

本基金的估值按照以下方法进行：

##### 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、因持有股票而享有的配股权，从配股除权日起到配股确认日止，如果收盘价高于配股价，按收盘价高于配股价的差额估值。收盘价等于或低于配股价，则估值为零。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。

根据《基金法》，基金管理人计算并公告基金资产净值，基金托管人复核、审查基金管理人计算的基金资产净值。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。

#### (六) 基金份额净值的确认及错误的处理方式

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。当估值或份额净值计价错误实际发生时，基金管理人应当立即纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大。当错误达到或超过基金资产净值的0.25%时，基金管理人应报中国证监会备案；当估值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。

因基金估值错误给投资者造成损失的，应先由基金管理人承担，基金管理人对其不应由其承担的责任，有权向过错人追偿。关于差错处理，本合同的当事人按照以下约定处理：

##### 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、或代理销售机构、或投资者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无法预见、无法避免、无法抗拒，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者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；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资产损失时，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资产损失时，基金管理人应为基金的利益向基金托管人追偿。除基金管理人和托管人之外的第三方造成基金资产的损失，并拒绝进行赔偿时，由基金管理人负责向差错方追偿。

(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、行政法规、《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过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) 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的交易数据的，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；

(5) 基金管理人及基金托管人基金份额净值计算错误偏差达到基金份额净值的 0.25% 时，基金管理人应当报告中国证监会；基金管理人及基金托管人基金份额净值计算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。

#### (七) 暂停估值的情形

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、托管人无法准确评估基金资产价值时；

3、中国证监会规定的其他情形。

#### (八) 特殊情形的处理

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份额净值错误处理。

2、由于证券交易所及其登记结算公司发送的数据错误，或由于其他不可抗力原因，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，但是未能发现该错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人、基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

## 十三、基金的收益分配

### (一) 基金收益的构成

基金收益包括基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券价差、银行存款利息以及其他收入。因运用基金资产带来的成本或费用的节约计入基金收益。

## （二）基金净收益

基金净收益为基金收益扣除按照国家有关规定可以在基金收益中扣除的费用后的余额。

## （三）基金收益分配原则

1、基金收益分配采用现金方式，投资者可选择获取现金红利或者将现金红利按红利权益登记日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资（下称“再投资方式”）；如果投资者没有明示选择，则视为选择现金分红方式；

2、在满足分配条件下，本基金收益每年至少分配一次。成立不满3个月，则不进行收益分配。期中分配由基金管理人另行公告，年度分配在基金会计年度结束后4个月内完成；

3、基金当年收益弥补上一年度亏损后，才可进行当年收益分配；

4、如果基金投资当期出现亏损，则可不进行收益分配；

5、基金收益分配比例不低于净收益的90%；

6、基金中每一基金份额享有同等分配权；

7、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；

8、上述规定若根据国家法律、法规以及中国证监会规定发生调整时，经中国证监会核准后公告，无须召开持有人大会；

9、法律、法规或监管机构另有规定的从其规定。

## （四）基金收益分配方案

本基金收益分配方案中应载明基金收益的范围、基金净收益、基金收益分配对象、分配原则、分配时间、分配数额及比例、分配方式、支付方式及有关手续费等内容。

## （五）基金收益分配方案的确定与公告

本基金的收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人核实后确定，在报中国证监会备案后5个工作日内在至少一种中国证监会指定的媒体上由基金管理人公告。

## （六）收益分配中发生的费用

红利分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者的现金红利小于1元，为降低投资者的转账成本，保障基金份额持有人利益，基金注册登记人可将投资者的现金红利按红利发放日的基金份额净值自动转为基金份额。自动再投资的计算方法，依照《兴业基金管理有限公司开放式基金业务规则》的有关规定执行。

本基金管理人已于 2007 年 5 月 25 日刊登《关于修改兴业可转债混合型证券投资基金招募说明书收益分配相关内容的公告》，自 2007 年 5 月 25 日将投资者现金分红自动转为基金份额的现金红利下限由 100 元变更为 1 元，详情请见具体公告。

## 十四、基金费用与税收

### （一）与基金运作有关的费用

#### 1、基金管理费

本基金的管理费提取。按前一日的基金资产净值乘以相应的管理费年费率来计算，计算方法如下：

$$H = E \times I \div \text{当年天数}$$

H：为每日应计提的基金管理费，E：为前一日基金资产净值，I：基金的管理费年费率

本基金的管理费年费率为 1.3%。

基金管理人的管理费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人于次月前 2 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

#### 2、基金托管费

本基金的托管费，按前一日的基金资产净值乘以托管费年费率来计算，计算方法如下：

$$H = E \times I \div \text{当年天数}$$

H：为每日应支付的基金托管费，E：为前一日的基金资产净值，I：基金的托管费年费率

兴业可转债混合型证券投资基金的托管费年费率为 0.25%。

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人于次月前 2 个工作日内从基金资产中一次性支取。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

#### 3、与基金运作有关的其他费用

主要包括：基金的证券交易费用、基金合同生效后的基金信息披露费用、基金合同生效后的与基金相关的会计师费和律师费、基金份额持有人大会费用、以及其它按

照国家有关规定可以在基金资产中列支的其它费用。该等费用由基金托管人根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额，列入当前基金费用。

4、经基金管理人与基金托管人协商一致，可以酌情调低基金管理人的报酬及基金托管费，并报中国证监会核准后公告，无须召开基金份额持有人大会通过。

## （二）与基金销售有关的费用

### 1、申购费

（1）本基金的申购遵循金额申购的原则，即申购金额中包含申购费用；费用计算原则为单笔单次收费。

本基金的申购费率：

| 金额（M，含申购费）      | 申购费率      |
|-----------------|-----------|
| $M < 1000$ 万    | 1.0%      |
| $M \geq 1000$ 万 | 每笔 1000 元 |

投资者选择红利自动再投资所转成的份额不收取申购费用。

（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，不列入基金资产。

### 2、赎回费

本基金的赎回遵循份额赎回的原则，基金赎回费用由投资者承担，在扣除必要的手续费后，赎回费总额的 25% 归入基金资产。

本基金赎回费率随投资人持有本基金时间的增加而递减，具体费率如下：

| 连续持有期限（T）                  | 赎回费率  |
|----------------------------|-------|
| $T \leq 1$ 年               | 0.50% |
| $1 \text{ 年} < T \leq 2$ 年 | 0.25% |
| $T > 2$ 年                  | 0     |

3、本基金实际执行费率在上述范围内由基金管理人决定，并在招募说明书或公开说明书中进行公告。基金管理人认为需要调整费率时，如果没有超过上述费率限额，基金管理人可自行调整；若提高本基金上述费率的上限应召开基金份额持有人大会审议。费率上限变更的，最迟将于新的费率开始实施前 3 个工作日至少在一种中国证监会指定的媒体上予以公告。

## （三）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本基金资产的损失，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。基金成立前的相关费用，包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费等不列入基金费用。

#### （四）费用调整

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

#### （五）基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规履行。

### 十五、基金的会计与审计

#### （一）基金会计政策

1、基金管理人为本基金的基金会计责任方，基金管理人也可以委托基金托管人或者具有证券从业资格的独立的会计师事务所担任基金会计，但该会计师事务所不能同时从事本基金的审计业务；

2、基金的会计年度为公历每年1月1日至12月31日；

3、基金核算以人民币为记账本位币，记账单位是人民币元；

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、基金管理人及基金托管人各自保留完整的基金会计账目、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、基金托管人每月与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以书面方式确认；

8、上述规定因国家法律、法规或政策变化而发生调整时，经中国证监会核准后公告，无须召开基金份额持有人大会。

#### （二）基金审计

1、本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具有证券从业资格的注册会计师对基金进行基金年度财务会计报告进行审计。会计师事务所及其注册会计师与基金发起人、基金管理人、基金托管人相互独立，并具有从事证券相关业务资格；

2、会计师事务所更换经办注册会计师时，须事先征得基金管理人和基金托管人同意，并报中国证监会备案；

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，报中国证监会备案后可以更换。更换会计师事务所需在5个工作日内在至少一种中国证监会指定的媒体上公告。

## 十六、基金的信息披露

本基金的信息披露严格按照《基金法》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露编报规则》、《证券投资基金信息披露内容格式准则》、基金合同及其它有关规定进行。应予披露的信息将通过至少一种中国证监会指定的全国性报刊（以下简称指定报刊）和基金管理人的互联网网站 <http://www.xyfunds.com.cn>。

公开披露的信息包括：

### （一）基金募集信息披露

1、招募说明书：基金募集申请经中国证监会核准后，基金管理人在基金份额发售的三日前在至少一种中国证监会指定的全国性报刊上公告并同时基金管理人的网站登载。

2、基金合同摘要：基金募集申请经中国证监会核准后，基金管理人在基金份额发售的三日前在至少一种中国证监会指定的全国性报刊上公告并同时基金管理人的网站登载基金合同全文。

3、基金托管协议：基金管理人在公告招募说明书和基金合同摘要的同时，应将基金托管协议登载在其网站上。

4、基金份额发售公告：基金管理人按照《基金法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及相关法律法规的规定编制基金份额发售公告并在披露招募说明书当日刊登在至少一种指定报刊和基金管理人网站。

5、基金合同生效公告：基金管理人于基金合同生效次日在至少一种指定报刊和基金管理人网站登载。

基金管理人应在开放式基金的基金合同、招募说明书等信息披露文件上载明基金份额申购、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。

### （二）基金运作信息披露

开放式基金的基金合同生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人至少每周公告一次基金资产净值和基金份额净值。

基金管理人应当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，披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。

基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值和基金份额净值。

### （三）定期报告

本基金定期报告由基金管理人和基金托管人按照《基金法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他一系列有关证券投资基金信息披露的法规编制，包括年度报告、半年度报告、季度报告及更新的招募说明书，并在至少一种中国证监会指定的全国性报刊和基金管理人网站登载。

基金管理人在定期报告公开披露的第二个工作日，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。

基金合同生效不足两个月的，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。

1、年度报告：基金管理人应当在每年结束之日起九十日内，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应当经过审计。

2、半年度报告：基金管理人应当在上半年结束之日起六十日内，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、季度报告：基金管理人应当在每个季度结束之日起十五个工作日内，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、更新的招募说明书：本基金的基金合同生效后，基金管理人应在每六个月结束之日起四十五日内更新招募说明书并公告。更新内容截止至每六个月的最后一日。基金管理人应按照规定提前将更新的招募说明书及托管人复核意见报中国证监会备案。

### （四）基金临时信息披露

本基金在运作过程中发生下列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项之一时，基金管理人应当在两日之内编制临时报告书，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；
- 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、基金经理发生变动；
- 9、基金管理人的董事在一年内变更超过百分之五十；
- 10、基金管理人的主要业务人员在一年内变动超过百分之三十；
- 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；
- 14、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百分之零点五；
- 18、基金改聘会计师事务所；
- 19、变更基金份额发售机构；
- 20、基金更换注册登记机构；
- 21、基金开始办理申购、赎回；
- 22、基金申购、赎回费率及其收费方式发生变更；
- 23、基金发生巨额赎回并延期支付；
- 24、基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请；
- 25、基金暂停接受申购、赎回申请后重新接受申购、赎回；
- 26、中国证监会规定的其他事项。

#### **(五) 信息披露事务管理**

- 1、基金管理人、基金托管人应当指定专人负责信息披露管理事务。
- 2、基金托管人须对基金管理人编制的基金资产净值、基金份额净值、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盖章确认。
- 3、本基金的基金合同、招募说明书等公告文本在编制完成后，应存放于基金管理人和基金托管人的办公场所、注册登记中心、有关销售人及其网点，供公众查阅。投资者也可以直接登录基金管理人的网站进行查阅。基金投资人在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复印件。

## 十七、风险揭示

### （一）证券市场风险

证券市场价格受到经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素的影响，从而使本基金资产产生潜在风险，导致基金收益水平变化而产生风险，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。基金投资于可转债、国债与股票，收益水平也会随之变化，从而产生风险。

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

4、债券市场流动性风险。由于银行间债券市场深度和宽度相对较低，交易相对较不活跃，可能增大银行间债券变现难度，从而影响基金资产变现能力的风险。

5、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，其可转债价格、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。

6、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。

7、收益率曲线风险。如果基金对长、中、短期债券的持有结构与基准存在差异，长、中、短期债券的相对价格发生变化时，基金资产的收益可能低于基准。

8、市场供需风险。如果宏观经济环境、政府财政政策、市场监管政策、市场参与主体经营环境等发生变化，市场参与主体可用资金数量和债券市场可供投资的债券数量可能发生相应的变化，最终影响债券市场的供需关系，造成基金资产投资收益的变化。

9、国际竞争风险。随着中国市场开放程度的提高，上市公司的发展必然要受到国际市场同类技术或同类产品公司的强有力竞争，部分上市公司有可能不能适用新的行业形势而业绩下滑。尤其是中国加入 WTO 以后，中国境内公司将面临前所未有的市场竞争，上市公司在这些因素的影响下将存在更大不确定性。

10、本基金产品特定风险。可转债投资组合流动性风险，本基金以可转债为主要投资对象，可转债市场流动性风险的存在可能导致本基金无法按照计划构建投资组合

或者及时实现资产变现，从而影响投资目标的实现；股价波动性风险，可转债基础股票价格的波动会影响可转债认股权价值、赎回权价值、回售权价值、转股价格重置权价值等可转债内含期权价值，进而影响可转债的市场价格，导致投资收益的不确定性；转股风险，指在转股期内，可转债的基础股票价格低于转股价，导致不能获得转股收益，从而无法弥补当初付出的转股期权价值所带来的风险。

## （二）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。

## （三）流动性风险

本基金属于开放式基金，在基金的所有开放日，基金管理人都有义务接受投资者的申购、赎回。由于开放式基金在国内推出时间还不长，应对基金赎回的经验不足，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，则使基金资产变现困难，基金面临流动性风险。

## （四）本基金合同无法生效所产生的风险

自基金份额发售公告之日起三个月内，如果本基金的净认购金额达到或超过2亿元且认购户数达到或超过200人，并按规定报证监会备案后，本基金合同生效。若基金在规定时间内无法达到认购金额超过2亿元且认购户数达到或超过200人的条件，将会导致本基金合同无法生效的风险。

## （五）信用风险

基金在交易过程中发生交收违约，或者基金所投资债券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，或由于债券发行人信用质量降低导致债券价格下降，造成基金资产损失。

## （六）法律风险

由于法律法规方面的原因，某些市场行为受到限制或合同不能正常执行，导致基金资产的损失。

## （七）操作或技术风险

相关当事人在业务各环节操作过程中，因内部控制存在缺陷或者人为因素造成操作失误或违反操作规程等引致的风险，例如，越权违规交易、会计部门欺诈、交易错误、IT系统故障等风险。

在基金的各种交易行为或者后台运作中，可能因为技术系统的故障或者差错而影响交易的正常进行或者导致投资者的利益受到影响。这种技术风险可能来自基金管理公司、注册登记机构、销售机构、证券交易所、证券登记结算机构等等。

#### （八）其他风险

- 1、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；
- 2、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；
- 3、对主要业务人员如基金经理的依赖而可能产生的风险；
- 4、因业务竞争压力可能产生的风险；
- 5、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；
- 6、其他意外导致的风险。

## 十八、基金合同的终止和基金财产的清算

### （一）基金合同的终止

在本基金的存续期内，出现下列情形之一的，经中国证监会批准后将终止：

- 1、存续期内，基金有效持有人数量连续 60 个工作日达不到 200 人，或连续 60 个工作日该基金资产净值低于 5,000 万元，并经基金管理人宣布终止该基金合同；
- 2、因重大违法、违规行为，该基金合同被中国证监会责令终止；
- 3、该基金合同经持有人大会表决终止；
- 4、基金管理人因解散、破产、撤销、丧失基金管理机构资格、停止营业等事由，不能继续担任本基金管理人的职务，而无其它基金管理公司承受其原有权利及义务；
- 5、基金托管人因解散、破产、撤销、丧失基金托管机构资格、停止营业等事由，不能继续担任本基金托管人的职务，而无其它托管机构承受其原有权利及义务；
- 6、由于投资方向变更引起的基金合并、撤销；
- 7、法律、法规和规章规定或中国证监会允许的其他情况。

### （二）基金清算小组

1、本基金合同终止之日起3个工作日内成立清算小组，清算小组必须在中国证监会的监督下对终止后的基金财产进行清算。在基金清算小组接管基金资产之前，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资产安全的职责。

2、基金清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有证券从业资格的注册会计师事务所、律师事务所以及中国证监会指定的人员组成。基金管理人、基金托管人以及上述会计师事务所和律师事务所应在该基金终止之日起15个工作日内将本方参加清算小组的具体人员名单函告其他各方。基金清算小组可以聘请必要的工作人员。清算小组在成立后5个工作日内应当公告。

3、基金清算小组接管基金资产后，负责基金资产的保管、清理、估价、变现和分配。基金清算小组可以依法进行必要的民事活动。

### （三）清算程序

1. 本基金合同终止后，发布基金财产清算公告；
2. 基金清算小组统一接管基金资产；
3. 对基金合同终止后的基金的资产和债券债务分别进行清理和确认；
4. 对基金合同终止后的基金资产进行估价；
5. 对基金资产进行变现；
6. 将基金清算结果报告中国证监会；
7. 以自身名义参加与基金有关的民事诉讼；
8. 公布基金合同终止后的基金清算结果公告；
9. 进行基金合同终止后的基金剩余资产的分配。

### （四）清算费用

清算费用是指清算小组在进行基金财产清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由清算小组优先从终止的基金资产中支付。

### （五）基金资产按下列顺序清偿

- 1、支付清算费用；
- 2、交纳所欠税款；
- 3、清偿终止后的基金债务；
- 4、按终止后的基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

该基金资产未按前款1至3项规定清偿前，不分配给该基金份额持有人。

### （六）基金清算的公告

基金合同终止并报中国证监会备案后 5 个工作日内在至少一种中国证监会指定的媒体上由基金清算小组公告；清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金清算结果由基金清算小组经中国证监会批准后 3 个工作日内公告。

#### （七）清算账册及文件保存

基金清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

### 十九、《兴业可转债混合型证券投资基金基金合同》的摘要

#### （一）基金份额持有人的权利和义务

##### 1、基金份额持有人的权利

- （1）分享基金财产收益；
- （2）按本《基金合同》的规定认购、申购、赎回，并在规定的时间取得有效申请的基金份额或款项；
- （3）按照规定要求召开基金份额持有人大会；
- （4）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；
- （5）参与分配清算后的剩余基金财产；
- （6）查阅或者复制公开披露的基金信息资料；
- （7）因基金管理人、基金托管人、销售机构、基金注册与过户登记人的过错导致基金份额持有人损失的求偿权；
- （8）提请基金管理人或基金托管人履行按本合同规定应尽的义务；
- （9）法律法规和《基金合同》规定的其他权利。

每份基金份额具有同等的合法权益。

##### 2、基金份额持有人的义务

- （1）遵守《基金合同》；
- （2）缴纳基金认购、申购款项及《基金合同》规定的费用；
- （3）承担基金亏损或者终止的有限责任；
- （4）不从事任何有损基金及其他基金合同当事人利益的活动；
- （5）返还在基金交易过程中因任何原因，自基金管理人、基金托管人及基金管理人的代理人处获得的不当得利；
- （6）法律法规和《基金合同》规定的其他义务。

## （二）基金管理人的权利与义务

### 1、基金管理人的权利

- （1）自本基金成立之日起，根据法律法规和本基金合同独立运用并管理基金资产；
- （2）依照本基金合同获得基金管理费；
- （3）销售基金份额，办理其他基金业务；
- （4）作为基金注册与过户登记人办理基金注册与过户登记业务并获得基金合同规定的费用；
- （5）依据本基金合同及有关法律规定的监督基金托管人，如认为基金托管人违反了本基金合同及国家有关法律规定，应呈报中国证监会和其它监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；
- （6）在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；
- （7）选择、委托、更换基金销售代理人，对基金销售代理人的相关行为进行监督和处理。如认为基金销售代理人违反本基金合同、基金销售与服务代理协议及国家有关法律规定，应呈报中国证监会和其它监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；
- （8）依据本基金合同及有关法律规定的决定基金收益的分配方案；
- （9）在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请；
- （10）在符合有关法律法规和基金合同的前提下，制订和调整开放式基金业务规则，决定基金的相关费率结构和收费方式；
- （11）依照《基金法》，代表基金对被投资上市公司行使股东权利；
- （12）法律、法规和基金合同规定的其它权利。

### 2、基金管理人的义务

- （1）遵守基金合同；
- （2）自基金成立之日起，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产；
- （3）设置相应的部门配备足够的专业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资产；
- （4）配备足够的专业人员办理基金份额的认购、申购与赎回业务或委托其它机构代理该项业务；
- （5）配备足够的专业人员进行基金的注册登记或委托其它机构代理该项业务；
- （6）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，保证所管理的基金资产和基金管理人的资产相互独立，保证不同基金在资产运作、财务管理等方面相互独立；

- (7) 除依据《基金法》、基金合同及其它有关规定外,不得为自己及任何第三人谋取非法利益,不得委托第三人运作基金资产;
- (8) 接受基金托管人的依法监督;
- (9) 按规定计算并公告基金资产净值及基金份额净值;
- (10) 严格按照《基金法》、基金合同及其它有关规定,履行信息披露及报告义务;
- (11) 保守基金商业秘密,不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、基金合同及其它有关规定另有规定外,在基金信息公开披露前应予保密,不向他人泄露;
- (12) 按基金合同规定向基金份额持有人分配基金收益;
- (13) 按照法律和本基金合同的规定受理申购与赎回申请,及时、足额支付赎回款项;
- (14) 不谋求对基金资产所投资的上市公司的控股和直接管理;
- (15) 依据《基金法》、基金合同及其它有关规定召集基金份额持有人大会,执行基金份额持有人大会决议;
- (16) 保存基金的会计账册、报表、记录 15 年以上;
- (17) 确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出,并且保证投资者能够按照本基金合同规定的时间和方式,随时查阅到与基金有关的公开资料,并得到有关资料的复印件;
- (18) 参加基金清算小组,参与基金资产的保管、清理、估价、变现和分配;
- (19) 面临解散、依法被撤销、破产或者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;
- (20) 因过错导致基金资产的损失时,承担赔偿责任,其过错责任不因其退任而免除;
- (21) 因基金估值错误给投资者造成损失的应先由基金管理人承担,基金管理人对其不应由其承担的责任,有权向过错人追偿;
- (22) 基金托管人因过错造成基金资产损失时,应为基金利益向基金托管人追偿;
- (23) 不得违反法律法规从事有损基金及其它基金当事人合法利益的活动;
- (24) 对所管理的不同基金财产分别设账、进行基金会计核算,编制财务会计报告及基金报告;
- (25) 法律、法规和基金合同规定的其它义务。

### (三) 基金托管人的权利与义务

#### 1、基金托管人的权利

- (1) 自本基金成立之日起，依法律法规和本基金合同的规定持有并保管基金资产；
- (2) 依本《基金合同》约定获得基金托管费及其他法定的或监管部门批准的约定收入；
- (3) 监督本基金的投资运作；
- (4) 监督基金管理人，如认为基金管理人违反了本《基金合同》及国家有关法律法规，应及时呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；
- (5) 基金管理人更换时，提名新的基金管理人；
- (6) 以基金托管人和基金联名的方式在中国证券登记结算有限公司上海分公司/深圳分公司开设证券账户；
- (7) 以基金托管人的名义开设证券交易资金账户，用于证券交易资金清算；
- (8) 以基金的名义在中央国债登记结算有限公司开设债券托管乙类账户负责基金的债券及资金的清算；
- (9) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值，如果不一致，有权拒绝签章；
- (10) 复核、审查基金管理人计算的基金收益分配方案中的财务数据，如果不一致，有权拒绝签章。
- (11) 法律法规和《基金合同》规定的其他权利。

## 2、基金托管人的义务

- (1) 遵守《基金合同》；
- (2) 依法持有基金资产；
- (3) 以诚实信用、勤勉尽责的原则安全保管基金财产；
- (4) 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，负责基金资产托管事宜；
- (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，确保基金资产的安全，保证其托管的基金资产与基金托管人自有资产以及不同的基金资产相互独立；对不同的基金分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金之间在名册登记、账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；
- (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非法利益，不得委托第三人托管基金资产；基金托管人违反此义务，利用基金资产为自己及任何第三人谋取利益的，所得利益归于基金资产，造成基金资产损失的，基金托管人应承担赔偿责任；
- (7) 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；

(8) 以本基金托管人的名义开立基金托管专户和证券交易资金账户，以本基金托管人及本基金联名的方式开立基金证券帐户，以基金的名义开立债券托管乙类账户，负责基金投资于证券的清算交割，执行基金管理人的划款指令，并负责办理基金名下的资金往来；

(9) 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予以保密，不得向他人泄露；

(10) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额净值；

(11) 采取适当、合理的措施，使开放式基金份额的认购、申购、赎回等事项符合本《基金合同》等有关法律文件的规定；

(12) 采取适当、合理的措施，使基金管理人用以计算开放式基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合本《基金合同》等法律文件的规定；

(13) 采取适当、合理的措施，使基金投资和融资的条件符合本《基金合同》等法律文件的规定；

(14) 按规定出具基金业绩和基金托管情况的报告，并报中国证监会和中国人民银行；

(15) 在定期报告内出具托管人意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照本《基金合同》的规定进行；如果基金管理人未执行本《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；

(16) 按有关规定，保存基金的会计账册、报表和记录等 15 年以上；

(17) 按有关规定，建立并保存基金份额持有人名册；

(18) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

(19) 依据基金管理人的指令或有关规定，将基金份额持有人的收益和赎回款项自基金托管专户划出；

(20) 参加基金清算小组，参与基金资产的保管、清理、估价、变现和分配；

(21) 监督基金管理人按本《基金合同》的规定履行自己的义务，因基金管理人过错造成基金资产损失，应代表基金向基金管理人追偿，除法律法规和本《基金合同》规定之处，基金托管人不对基金管理人承担连带责任；

(22) 因过错导致基金资产的损失时，应承担赔偿责任，其过错责任不因其退任而免除；

(23) 基金管理人因过错造成基金资产损失，应为基金利益向基金管理人追偿；

(24) 不得违反法律法规从事任何有损本基金及其他基金合同当事人合法利益的活动；

(25) 法律法规和《基金合同》规定的其他义务。

#### (四) 基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

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合法的授权代表共同组成。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。

#### 1、召开事由

当出现或需要决定下列事由之一的，经基金管理人或基金托管人或持有 10%以上（含 10%）基金份额的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）提议时，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）提高基金管理人、基金托管人的报酬标准（但根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外）；
- （4）更换基金管理人、基金托管人；
- （5）对基金当事人权利和义务产生重大影响的事项；
- （6）《基金法》、《运作办法》及其它有关法律法规、本基金合同规定的其它事项。

以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后变更，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；
- （2）在法律法规和本基金合同规定的范围内变更本基金份额的申购费率、赎回费率或收费方式；
- （3）因相应的法律、法规发生变动应当对基金合同进行变更；
- （4）对基金合同的变更不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生变化；
- （5）对基金合同的变更对基金份额持有人利益无实质性不利影响；
- （6）按照法律法规或本基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其它情形。

#### 2、召集方式

（1）除法律法规或基金合同另有规定外，基金份额持有人大会由基金管理人召集，基金份额持有人大会的权益登记日、开会时间、地点由基金管理人选择确定，在基金管理人未按规定召集或不能召集时，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十日内决定是否召集，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六十日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当自行召集并确定开会时间、地点、方式和权益登记日；

（3）代表基金份额 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十日内决定是否召集，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六十日内召开；基金管理人决定不召集，代表基金份额 10%（含 10%）以上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十日内决定是否召集，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六十日内召开；

（4）代表基金份额 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，代表基金份额 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，但应当至少提前三十日向中国证监会备案。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。

### 3、通知

召开基金份额持有人大会，召集人应当至少提前三十日在中国证监会指定的至少一种信息披露媒体公告会议通知。基金份额持有人大会通知将至少载明以下内容：

- （1）会议召开时间、地点、方式；
- （2）会议审议事项、议事程序、表决方式；
- （3）有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日；
- （4）代理投票委托书送达时间和地点；
- （5）会务常设联系人姓名、电话；
- （6）其他注意事项。

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。

### 4、会议的召开方式

#### （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；
- 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；
- 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。但决定基金管理人更换或基金托管人的更换事宜必须以现场开会方式召开基金份额持有人大会。

#### （2）基金份额持有人大会召开条件

##### 1）现场开会

必须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,有效的基金份额应当大于在代表权益登记日基金总份额的 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登记资料相符。

未能满足上述条件的情况下,则召集人可另行确定并公告重新开会的时间(至少应在 15 个工作日后)和地点,但确定有权出席会议的基金份额持有人资格的权益登记日不变。

## 2) 通讯方式开会

必须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,在两个工作日内连续公布相关提示性公告;
- B) 召集人在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;
- C) 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基金份额占在权益登记日基金总份额的 50%以上;
- D) 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其它代表,同时提交持有基金份额的凭证和受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证和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。

如表决截止日前(含当日)未达到上述要求,则召集人可另行确定并公告重新表决的时间(至少应在 15 个工作日后),但确定有权出席会议的基金份额持有人资格的权益登记日不变。

## 5、议事内容与程序

### (1) 议事内容及提案权

- 1) 议事内容仅限于本基金合同第四部分“一、召开事由”中所指的关系基金份额持有人利益的重大事项;
- 2) 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;
- 3) 基金管理人、基金托管人、持有权益登记日基金总份额 10%或以上的基金份额持有人可以在大会召集人发出会议通知前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(临时提案只适用于现场方式开会),临时提案最迟应当在大会召开日前 15 日提交召集人;召集人对于临时提案应当最迟在大会召开日前 10 日公告;

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

- A) 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；
- B) 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作出决定。如将其提案进行分拆或合并表决，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作出决定，并按照基金份额持有人大会决定的程序进行审议。

5) 基金份额持有人大会的召集人发出召集会议的通知后，如果需要对原有提案进行变更，应当最迟在基金份额持有人大会召开日前 10 日公告。否则，会议的召开日期应当顺延并保证至少与公告日期有 10 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，在公证机构的监督下形成大会决议。

基金管理人召集大会时，由基金管理人授权代表主持；基金托管人召集大会时，由基金托管人授权代表主持；代表基金份额 10% 以上（含 10%）的基金份额持有人召集大会时，由出席大会的基金份额持有人和代理人以所代表的基金份额 50% 以上多数选举产生一名代表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、住所地址、持有或者代表有表决权的基金份额、委托人姓名（或单位名称）等事项。

### 2) 通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下，由召集人在会议通知中提前 30 日公布提案，在所通知的表决截止日期第二日统计全部有效表决，在公证机构监督下形成决议。

## 6、表决

（1）基金份额持有人所持每份基金份额享有一票表决权。

（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基金份额持有人及代理人所持表决权的 50% 以上通过方为有效；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；

2) 特别决议：特别决议须经出席会议的基金份额持有人及代理人所持表决权的三分之二以上通过方可作出。涉及基金管理人更换、基金托管人更换、转换基金运作方式、终止基金合同的合同变更必须以特别决议的方式通过方为有效。

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。

(3) 基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

(4) 对于通讯开会方式的表决，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无效表决。

(5) 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。

## 7、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选举两名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选举三名代表担任监票人；

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，并由公证机关对其计票过程予以公证；

3) 如果大会主持人对于提交的表决结果有怀疑，可以对所投票数进行重新清点；如果大会主持人对于提交的表决结果没有怀疑，而出席会议的其他人员对大会主持人宣布的表决结果有异议，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督员在基金托管人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。

## 8、生效与公告

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五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。

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的决定。

基金份额持有人大会决议自生效之日起两个工作日内在中国证监会指定的至少一种信息披露媒体公告。

## 二十、《兴业可转债混合型证券投资基金基金托管协议》摘要

### （一）托管协议当事人

#### 1、基金管理人

基金管理人名称：兴业基金管理有限公司<sup>①</sup>

注册地址：上海市黄浦区金陵东路 368 号

法定代表人：郑苏芬<sup>②</sup>

注册资本：9800 万元人民币<sup>③</sup>

组织形式：有限责任公司（国内合资）

经营范围：发起设立基金；基金管理业务

营业期限：持续经营

#### 2、基金托管人

名称：中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

法定代表人：姜建清

电话：（010）66106912

传真：（010）66106904

成立时间：1984 年 1 月 1 日

组织形式：股份有限公司

批准设立机关和设立文号：国务院《关于中国人民银行专门行使中央银行职能的决定》（国发[1983]146 号）

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币 334,018,850,026 元

存续期间：持续经营

经营范围：办理人民币存款、贷款、同业拆借业务；国内外结算；办理票据承兑、贴现、转贴现、各类汇兑业务；代理资金清算；提供信用证服务及担保；代理销

<sup>①</sup>公司名称已变更为“兴业全球基金管理有限公司”

<sup>②</sup>法定代表人已变更为“兰荣”

<sup>③</sup>注册资本已变更为“1.5 亿元”

售业务；代理发行、代理承销、代理兑付政府债券；代收代付业务；代理证券投资基金清算业务（银证转账）；保险代理业务；代理政策性银行、外国政府和国际金融机构贷款业务；保管箱服务；发行金融债券；买卖政府债券、金融债券；证券投资基金、企业年金托管业务；企业年金受托管理服务；年金账户管理服务；开放式基金的注册登记、认购、申购和赎回业务；资信调查、咨询、见证业务；贷款承诺；企业、个人财务顾问服务；组织或参加银团贷款；外汇存款；外汇贷款；外币兑换；出口托收及进口代收；外汇票据承兑和贴现；外汇借款；外汇担保；发行、代理发行、买卖或代理买卖股票以外的外币有价证券；自营、代客外汇买卖；外汇金融衍生业务；银行卡业务；电话银行、网上银行、手机银行业务；办理结汇、售汇业务；经国务院银行业监督管理机构批准的其他业务。

## （二）基金托管人与基金管理人之间的业务监督、核查

1、根据《基金法》、《基金合同》、本协议和有关证券法规的规定，基金托管人对基金的投资对象、基金资产的投资组合比例、基金资产的核算、基金资产净值的计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金申购资金的到账和赎回资金的划付、基金收益分配、基金的融资条件等行为的合法性、合规性进行监督和核查，其中对基金的投资比例的监督和检查自本基金成立之后六个月开始。

基金托管人发现基金管理人违反《基金法》、《基金合同》、本协议或有关证券法规规定的行为，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应及时核对，并以书面形式对基金托管人发出回函确认。在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对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具有重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正。

2、根据《基金法》、《基金合同》、本协议及其他有关规定，基金管理人就基金托管人是否及时执行基金管理人的划款指令、是否擅自动用基金资产、是否按时将分配给基金份额持有人的收益划入分红派息账户等事项，对基金托管人进行监督和核查。

基金管理人定期对基金托管人保管的基金资产进行核查。基金管理人发现基金托管人未对基金资产实行分账管理、擅自挪用基金资产、因基金托管人的过错导致基金资产灭失、减损或处于危险状态的，基金管理人应立即以书面的方式要求基金托管人予以纠正并采取必要的补救措施。基金管理人有权要求基金托管人赔偿基金因此所遭受的损失。

基金管理人发现基金托管人的行为违反《基金法》、《基金合同》、本协议或有关证券法规的规定，应及时以书面形式通知基金托管人限期纠正，基金托管人收到通

知后应及时核对并以书面形式对基金管理人发出回函。在限期内，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。基金托管人对基金管理人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金管理人应报告中国证监会。

基金管理人发现基金托管人有重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时通知基金托管人限期纠正。

3、基金管理人和基金托管人有义务配合和协助对方依照本协议对基金业务执行监督、核查。基金管理人或基金托管人无正当理由，拒绝、阻挠对方根据本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，情节严重或经监督方提出警告仍不改正的，监督方应报告中国证监会。

### （三）基金资产保管

#### 1、基金资产保管的原则

基金托管人依法持有基金资产，应安全保管所收到的基金的全部资产。基金资产应独立于基金管理人、基金托管人的自有资产。

基金托管人必须为基金设立独立的账户，与基金托管人的其他业务和其他基金的托管业务实行严格的分账管理。

基金托管人应安全、完整地保管基金资产；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。

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托管人，到账日基金资产没有到达托管人处的，托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收。由此给基金造成损失的，基金管理人应负责向有关当事人追偿基金的损失。

对于基金申（认）购过程中产生的应收资产，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，到账日基金资产没有到达托管人处的，基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收。由此给基金造成损失的，基金管理人应负责向有关当事人追偿基金的损失。

#### 2、基金成立时募集资金的验证

认购期内销售机构按销售与服务代理协议的约定，将认购资金划入基金发起人在银行开设的“兴业基金管理有限公司基金专户”。基金设立募集期满，由基金发起人聘请具有从事证券业务资格的会计师事务所进行验资，出具验资报告，出具的验资报告应由参加验资的2名以上（含2名）中国注册会计师签字有效。验资完成，基金发起人应将募集到的全部资金存入基金托管人为基金开立的基金托管专户中，基金托管人在收到资金当日出具基金资产接收报告。

#### 3、投资者申购资金和赎回资金的划付

基金申购、赎回的款项采用净额交收的结算方式。

基金托管人应及时查收申购资金是否到账，对于未准时到账的资金，应及时通知基金管理人，由基金管理人负责催收。

因投资者赎回而应划付的款项，基金托管人应根据基金管理人的指令进行划付

#### 4、基金的银行账户的开设和管理

基金托管人以基金托管人的名义在其营业机构开设基金托管专户，保管基金的银行存款。该账户的开设和管理由基金托管人承担。本基金的一切货币收支活动，均需通过基金托管人的基金托管专户进行。

基金托管专户的开立和使用，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。

基金托管专户的管理应符合《银行账户管理办法》、《现金管理条例》、《中国人民银行利率管理的有关规定》、《关于大额现金支付管理的通知》、《支付结算办法》以及中国人民银行的其它规定。

#### 5、基金证券账户证券交易资金账户的开设和管理

基金托管人以基金托管人和本基金联名的方式在中国证券登记结算有限公司上海分公司/深圳分公司开设证券账户。

基金证券账户的开立和使用，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出借和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。

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上海分公司/深圳分公司开立基金证券交易资金账户，用于证券清算。

#### 6、债券托管乙类账户的开设和管理

(1) 基金成立后，基金管理人负责向中国证监会和中国人民银行申请基金进入全国银行间同业拆借市场进行交易。由基金管理人在中国外汇交易中心开设同业拆借市场交易账户，由基金托管人在中央国债登记结算有限责任公司开设债券托管乙类账户，并由基金托管人负责基金的后台匹配及资金的清算。

(2) 同业拆借市场交易账户和债券托管账户根据中国人民银行、中国外汇交易中心和中央国债登记结算有限责任公司的有关规定，由基金管理人和基金托管人签订补充协议，进行使用和管理。基金管理人和基金托管人应一起负责为基金对外签订全国银行间国债市场回购主协议，正本由基金托管人保管，基金管理人保存副本。

#### 7、基金资产投资的有关实物证券的保管

实物证券由基金托管人存放于托管银行的保管库；也可存入中央国债登记结算有限责任公司或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。保管凭证由基金托管人持有。实物证券的购买和转让，由基金托管人根据基金管理人的指令办理。托管人对由托管人以外机构实际有效控制的证券不承担责任。

#### 8、与基金资产有关的重大合同的保管

与基金投资有关的重大合同的签署，除本协议另有规定外，由基金管理人负责。合同原件由基金管理人保管。保管期限按照国家有关规定执行。

与基金资产有关的重大合同，根据基金的需要以基金的名义签署。合同原件由基金托管人保管；但涉及有关费用支付的合同在费用支付时，管理人应传真与托管人作为划款指令的依据。

### （四）基金资产净值计算和核算

1、基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。基金份额净值是指计算日基金资产净值除以计算日基金总份额后的价值。

2、基金管理人应每日对基金资产估值。

3、用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人复核。

4、基金管理人应每日对基金资产估值。用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人复核。基金管理人应于每个工作日交易结束后计算当日的基金资产净值，并以加密传真方式发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核后，签名、盖章并以加密传真方式传送给基金管理人，由基金管理人对外公布。

5、根据《基金法》，开放式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，基金管理人有权按照其对基金净值的计算结果对外予以公布。

### （五）基金份额持有人名册的登记与保管

基金份额持有人名册，包括基金设立募集期结束时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由基金过户与注册登记人负责制定。基金过户与注册登记人对基金份额持有人名册负保管义务。

### （六）争议的处理和适用法律

相关各方当事人同意，因本协议而产生的或与本协议有关的一切争议，除经友好协商可以解决的，应提交中国国际经济贸易仲裁委员会根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁的地点在北京，仲裁裁决是终局性的并对相关各方均有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

争议处理期间，相关各方当事人应恪守基金管理人和基金托管人职责，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。

本协议受中国法律管辖。

### （七）托管协议的修改和终止

1、本协议相关各方当事人经协商一致，可以对协议进行修改。修改后的新协议，其内容不得与《基金合同》的规定有任何冲突。修改后的新协议，报中国证监会批准后生效。

2、发生以下情况，本托管协议终止：

（1）基金或《基金合同》终止；

（2）因基金托管人解散、依法被撤销、破产或其他事由造成本基金更换基金托管人；

（3）因基金管理人解散、依法被撤销、破产或其他事由造成本基金更换基金管理人；

（4）发生《基金法》或其他法律法规规定的终止事项。

## 二十一、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，投资者也可以选择获取不获取邮寄对账单服务。此外，基金管理人还向客户寄送《兴业基金投资纵览》。对于新开户申购的客户，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

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 [trade.xyfunds.com.cn](http://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

投资者如果想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（免长话费）、021-38824536

传 真：021-58367239

### 2、互联网站

公司网址：<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净值、基金管理人的相关公告、电子对账单等信息。

## （六）投诉受理

投资人可以拨打基金管理人客户服务中心电话，或通过基金管理人网站留言的投诉栏目、书信、电子邮件等渠道对基金管理人和销售网点所提供的服务进行投诉。

## 二十二、其他应披露事项

以下为自 2010 年 5 月 11 日至 2010 年 11 月 10 日，本基金刊登于《中国证券报》、《上海证券报》和公司网站的基金公告。

| 序号 | 事项名称                                     | 披露日期      |
|----|------------------------------------------|-----------|
| 1  | 关于兴业可转债混合型证券投资基金继续暂停接受伍万元以上申购、转入申请的提示性公告 | 2010-5-17 |
| 2  | 兴业可转债混合型证券投资基金第三十八次分红公告                  | 2010-5-28 |
| 3  | 关于旗下基金参加华融证券费率优惠活动的公告                    | 2010-5-29 |
| 4  | 关于增加国信证券为旗下基金代销机构的公告                     | 2010-6-3  |
| 5  | 关于增加国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           | 2010-6-3  |
| 6  | 关于旗下部分基金在国信证券开通转换业务的公告                   | 2010-6-3  |
| 7  | 关于旗下部分基金参加农业银行网上银行基金申购费率优惠活动的公告          | 2010-6-4  |
| 8  | 关于兴业可转债混合型证券投资基金继续暂停接受伍万元以上申购、转入申请的提示性公告 | 2010-6-17 |
| 9  | 关于增加申银万国证券为办理旗下基金定期定额投资业务代销机构的公告         | 2010-6-24 |
| 10 | 关于旗下基金参加安信证券网上申购费率优惠活动的公告                | 2010-6-25 |
| 11 | 关于旗下基金参加浦发银行基金定投申购费率优惠活动的公告              | 2010-6-30 |
| 12 | 关于旗下部分基金参加交通银行网上银行基金申购费率优惠活动的公告          | 2010-6-30 |
| 13 | 关于继续参加邮储银行网上银行申购费率优惠活动的公告                | 2010-6-30 |
| 14 | 关于恢复兴业可转债混合型证券投资基金伍万元以上申购和转换转入业务的公告      | 2010-7-1  |
| 15 | 旗下各基金 2010 年上半年度资产净值公告                   | 2010-7-1  |
| 16 | 关于旗下基金代销机构名称变更的公告                        | 2010-7-10 |
| 17 | 关于增加渤海银行为旗下部分基金代销机构的公告                   | 2010-7-22 |
| 18 | 关于旗下部分基金在渤海银行开通转换业务的公告                   | 2010-7-22 |
| 19 | 关于在渤海银行开通旗下部分基金定期定额投资业务的公告               | 2010-7-22 |
| 20 | 关于旗下部分基金参加渤海银行费率优惠活动的公告                  | 2010-8-5  |
| 21 | 关于开展中国农业银行金穗卡基金网上直销申购费率优惠活动的公告           | 2010-8-20 |
| 22 | 关于旗下部分基金继续参加农业银行网上银行基金申购费率优惠活动的公告        | 2010-8-31 |
| 23 | 关于旗下基金 2010 年半年度报告的更正公告                  | 2010-9-1  |
| 24 | 关于某媒体报道本公司参与浦发“定增”巨亏错误报道的澄清公告            | 2010-9-16 |
| 25 | 关于旗下部分基金参加华泰证券定期定额申购费率优惠活动的公告            | 2010-9-18 |
| 26 | 关于网上直销平台开通一户多卡功能的公告                      | 2010-9-28 |

|    |                                            |            |
|----|--------------------------------------------|------------|
| 27 | 关于兴业可转债混合型证券投资基金暂停接受三万元以上申购及转换转入申请的公告      | 2010-10-11 |
| 28 | 兴业可转债混合型证券投资基金第四十次分红公告                     | 2010-10-18 |
| 29 | 关于增加长江证券为办理旗下基金定期定额投资业务代销机构的公告             | 2010-10-22 |
| 30 | 关于兴业可转债混合型证券投资基金继续暂停接受三万元以上申购及转换转入申请的提示性公告 | 2010-10-25 |
| 31 | 关于旗下部分基金投资南方航空（600029）非公开发行股票的公告           | 2010-11-4  |
| 32 | 关于旗下部分基金投资恒源煤电（600971）非公开发行股票的公告           | 2010-11-6  |
| 33 | 关于调整直销柜台首次申购起点的公告                          | 2010-11-11 |
| 34 | 关于中国农业银行金穗卡基金网上直销申购费率优惠活动展期的公告             | 2010-11-11 |

## 二十三、招募说明书的存放与查阅

本招募说明书存放于基金管理人和基金托管人的办公场所、注册登记中心、有关销售人及其网点，投资者可在办公时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

基金管理人和基金托管人保证文本的内容与公告的内容完全一致。

## 二十四、备查文件

投资者如果需要了解更详细的信息，可向基金管理人、基金托管人或销售代理人申请查阅以下文件：本基金备查文件包括下列文件：

- 1、中国证监会批准基金设立的文件
- 2、《兴业可转债混合型证券投资基金基金合同》
- 3、销售代理协议
- 4、注册登记协议
- 5、《兴业可转债混合型证券投资基金托管协议》
- 6、法律意见书
- 7、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- 8、基金托管人业务资格批件和营业执照
- 9、中国证监会要求的其他文件

兴业全球基金管理有限公司

签署日期：2010年12月25日