

兴全可转债混合型证券投资基金

更新招募说明书摘要

基金管理人：兴业全球基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

发出日期：2014年12月

【重要提示】

兴全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《关于同意兴全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。

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

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 2014 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 2014 年第 3 季度报告，数据截止日为 2014 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、基金管理人	3
二、基金托管人	12
三、相关服务机构	16
四、基金的名称	30
五、基金的类型	31
六、基金的投资目标	31
七、基金的投资方向	31
八、基金的投资策略	31
九、基金的业绩比较基准	33
十、基金的风险收益特征	33
十一、基金的投资组合报告	34
十二、基金的业绩	38
十三、费用概览	39
十四、对招募说明书更新部分的说明	41

一、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：冯晓莲

联系电话：021-20398888

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

截止2014年11月10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（LOF）、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、兴全轻资产投资股票型证券投资基金（LOF）、兴全商业模式优选股票型证券投资基金（LOF）、兴全添利宝货币市场基金共14只基金。

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

（二）主要人员情况

1、董事、监事概况

兰荣先生，董事长，1960年生，中共党员，高级工商管理硕士、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、兴业全球基金管理有限公司董事长、中国证券业协会副会长。

郑苏芬女士，董事，1962年生，中共党员，高级工商管理硕士，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，兴业证券股份有限公司副总裁兼首席合规官。现任兴业证券股份有限公司副总裁兼财务总监（财务负责人）。

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

巴斯蒂安·范布伦先生（Bastiaan Van Buuren），董事，1971年生，荷兰国籍，经济学硕士。曾任荷兰国际集团（ING）投资管理公司亚洲区客户发展部门负责人、亚太区机构业务负责人、新加坡公司首席执行官、亚洲固定收益投资经理等职务。现任 AEGON 资产管理公司亚洲区负责人。

皮尔斯·希利尔先生（Piers Hillier），董事，1968年生，英国国籍，管理学硕士。历任英国德勤会计师事务所审计经理、伦敦施罗德投资管理公司泛欧权益投资负责人、德意志资产管理公司欧洲区权益投资负责人、West LB梅隆资产管理公司首席投资官、LV 资产管理公司首席投资官和董事会成员。现任Kames 资本公司海外权益投资负责人。

杨东先生，董事兼总经理，1970年生，高级工商管理硕士。历任福建兴业证券公

司上海业务部总经理助理，证券投资部副总经理兼上海业务部副总经理，兴业证券股份有限公司证券投资部总经理，兴业证券股份有限公司总裁助理、投资总监。现任兴业全球基金管理有限公司董事兼总经理。

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。

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

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。

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

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

李小天女士，职工监事，1982 年生，工商管理硕士。历任《南方日报》、《南方都市报》记者。现就职于兴业全球基金管理有限公司市场部。

徐涵雯女士，职工监事，1983 年生，经济学硕士。现就职于兴业全球基金管理有限公司监察稽核部。

2、高级管理人员概况

杨东先生，董事兼总经理，1970 年生，高级工商管理硕士。历任福建兴业证券公司上海业务部总经理助理，证券投资部副总经理兼上海业务部副总经理，兴业证券股

份有限公司证券投资部总经理，兴业证券股份有限公司总裁助理、投资总监。现任兴业全球基金管理有限公司董事兼总经理。

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

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

徐天舒先生，副总经理兼董事会秘书，1973年生，中共党员，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兼董事会秘书。

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4人组成：

杨 东 兴业全球基金管理有限公司董事兼总经理

杜昌勇 兴业全球基金管理有限公司副总经理兼上海兴全睿众资产管理有限公司总经理

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

董承非 兴业全球基金管理有限公司基金管理部投资总监，兴全全球视野股票型证券投资基金基金经理、兴全趋势投资混合型证券投资基金（LOF）基金经理

上述人员之间不存在近亲属关系。

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全可转债混合型证券投资基金基金经理助理；现任兴业全球基金管理有限公司固定收益部总监、本基金基金经理（2007 年 2 月 6 日起至今）、兴全保本混合型证券投资基金基金经理（2011 年 8 月 3 日起至今）、兴全货币市场证券投资基金基金经理（2014 年 6 月 10 日起）。

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。

（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) 不得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；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。

二、基金托管人

(一) 基金托管人基本情况

名称：中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街55号

成立时间：1984年1月1日

法定代表人：姜建清

注册资本：人民币349,018,545,827元

联系电话：010-66105799

联系人：赵会军

(二) 主要人员情况

截至 2014 年 6 月末，中国工商银行资产托管部共有员工 170 人，平均年龄 30 岁，95%以上员工拥有大学本科以上学历，高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

（三）基金托管业务经营情况

作为中国大陆托管服务的先行者，中国工商银行自 1998 年在国内首家提供托管服务以来，秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨，依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队，严格履行资产托管人职责，为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务，展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、安心账户资金、企业年金基金、QFII 资产、QDII 资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII 专户资产、ESCROW 等门类齐全的托管产品体系，同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至 2014 年 6 月，中国工商银行共托管证券投资基金 380 只。自 2003 年以来，本行连续十年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的 44 项最佳托管银行大奖；是获得奖项最多的国内托管银行，优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

（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、2009、2010、2011、2012 年六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，2013 年中国工商银行资产托管部第七次通过 ISAE3402（原 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，ISAE3402 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。设立专门履行托管人职责的管理部门；直接操作人员和控制人员必须相对独立，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。

三、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）20398927、20398706
传真：（021）58368915
联系人：何佳怡、黄琳蔚
公司网站：<http://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、光大银行、中信银行、浦发银行、金华银行、浙商银行、上海农商银行、南京银行、温州银行借记卡，农业银行借记卡和准贷记卡、支付宝基金专户）（排名不分先后）
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：<http://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：<http://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：李建红
电话：（0755）82943666

传真：（0755）83195109

客户服务电话：95555

公司网站：<http://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：王洪章

客户服务电话：95533（全国）

公司网站：<http://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：<http://www.spdb.com.cn>

6) 交通银行股份有限公司

住所：上海市银城中路188号

办公地址：上海市银城中路188号

法定代表人：牛锡明

电话：021-58781234

传真：021-58408843

客户服务电话：95559

公司网站：<http://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：<http://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：<http://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：蒋超良

客服电话：95599

传真：（010）85109219

公司网站：<http://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：田国立

客户服务电话：95566

公司网站：<http://www.boc.cn>

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

客户服务统一咨询电话：96528（北京、上海地区962528）

传真：（0574）87050024

公司网站：<http://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：常振明

电话：（010）65557013

传真：（010）65550827

客户服务电话：95558

公司网站: <http://bank.ecitic.com>

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) 平安银行股份有限公司

住所(办公地址): 深圳市深南东路5047号深圳发展银行大厦

法定代表人: 孙建一

客户服务电话: 95511-3

公司网站: <http://www.bank.pingan.com>

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>

16) 中国邮政储蓄银行有限责任公司

注册地址: 北京市西城区金融大街3号

办公地址: 北京市西城区金融大街3号

法定代表人: 李国华

客户服务电话: 95580

传真: (010) 68858117

公司网站: <http://www.psbc.com>

17) 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>

18) 上海银行股份有限公司

住所: 上海市银城中路168号

法定代表人: 范一飞

客户服务电话：（021）962888

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

19) 江苏昆山农村商业银行股份有限公司

住所：江苏省昆山市前进中路219号

办公地址：江苏省昆山市前进中路219号

法定代表人：刘斌

客户服务电话：96079

公司网站：<http://www.ksrcb.cn>

20) 江苏江南农村商业银行股份有限公司

住所：江苏省常州市延陵中路668号

法定代表人：陆向阳

客户服务电话：96005

公司网站：<http://www.jnbank.cc>

● **代销券商**

1) 兴业证券股份有限公司

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：[http:// 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

公司网站：[http:// 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：<http://www.gtja.com>

4) 中信建投证券股份有限公司

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：<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：4008888168

公司网站：<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：<http://www.cjsc.com.cn>

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2-6层

法定代表人：陈有安

客服电话：4008-888-888

传真：8008201968

公司网站：<http://www.chinastock.com.cn>

8) 广发证券股份有限公司

办公地址：广州市天河区天河北路183-187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>

9) 山西证券股份有限公司

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： 95573

联系电话： （0351） 8686703

传真： （0351） 8686619

公司网站： <http://www.sxzq.net>

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： [http:// 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： <http://www.tebon.com.cn>

12) 国海证券股份有限公司

注册地址： 广西桂林市辅星路13号

法定代表人： 张雅峰

客服热线： （0771） 5539032

开放式基金业务传真： （0771） 5539033

公司网站： [http:// 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：<http://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：<http://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：<http://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：<http://www.xcsc.com>

17) 中航证券有限公司

住所：南昌市红谷中大道1619号南昌国际金融大厦A栋41层

法定代表人：杜航

电话：（0791）6768763

传真：（0791）6789414

客户服务电话：400-8866-567

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

18) 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：<http://www.sywg.com>

19) 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

客户服务电话：4008888777

业务传真：0551-2207114

公司网站：<http://www.gyzq.com.cn>

20) 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：<http://www.ewww.com.cn>

21) 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：<http://www.ubssecurities.com>

22) 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至10层
法定代表人：黄金琳
联系电话：（0591）87383623
传真：（0591）87383610
客户服务电话：96326（福建省外请加拨0591）
公司网站：<http://www.hfzq.com.cn>

23) 齐鲁证券有限公司

住所：山东省济南市经七路86号
法定代表人：李玮
联系电话：（0531）81283906
传真：（0531）81283900
公司网站：<http://www.qlzq.com.cn>

24) 爱建证券有限责任公司

住所：上海市世纪大道1600号32楼
法定代表人：郭林
联系电话：（021）32229888
客服电话：（021）63340678
公司网站：<http://www.ajzq.com>

25) 安信证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元
办公地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元
深圳市福田区深南大道 2008 号中国凤凰大厦 1 栋 9 层
法定代表人：牛冠兴
联系电话：（0755）82825551
传真：（0755）82558355
客服电话：4008001001
公司网站：<http://www.essence.com.cn>

26) 华融证券股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街8号
法定代表人：丁之锁

联系电话：（010）58568007

传真：（010）58568062

客服电话：（010）58568162

公司网站：<http://www.hrsec.com.cn>

27) 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>

28) 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>

29) 中信证券（浙江）有限责任公司

注册地址：浙江省杭州市滨江区江南大道588号恒鑫大厦主楼19、20层

法定代表人：沈强

统一客服电话：（0571）96598

公司网站：<http://www.bigsun.com.cn>

30) 中信万通证券有限责任公司

注册地址：山东省青岛市崂山区苗岭路29号澳柯玛大厦15层

法定代表人：杨宝林

联系人：吴忠超

统一客服电话：96577

公司网站：<http://www.zxwt.com.cn>

31) 信达证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼

法定代表人：高冠江

客户服务电话：400-800-8899

基金业务传真：010-63080978

公司网站：<http://www.cindasc.com>

32) 国都证券有限责任公司

注册地址：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层

法定代表人：常喆

客户服务电话：4008188118

基金业务传真：010-84183311

公司网站：<http://www.guodu.com>

● 其他代销机构

1) 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701

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>

2) 深圳众禄基金销售有限公司

住所：深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行大厦 25 层

法定代表人：薛峰

客户服务电话：4006-788-887

传真：0755-82080798

网站：众禄基金网 <http://www.zlfund.cn>；基金买卖网 [http:// www.jjmmw.com](http://www.jjmmw.com)

3) 上海好买基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区场中路 685 弄 37 号 4 号楼 449 室

办公地址：上海市浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 903~906 室

法定代表人：杨文斌

客服电话：400-700-9665

传真：021-68596916

网站：<http://www.ehowbuy.com>

4) 杭州数米基金销售有限公司

注册地址：浙江省杭州市余杭区仓前街道海曙路东 2 号

办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道 3588 号 12 楼

法定代表人：陈柏青

客户服务电话：4000-766-123

传真：0571-26698533

数米基金网：<http://www.fund123.cn>

5) 上海长量基金销售投资顾问有限公司

注册地址：上海浦东新区高翔路 526 号

办公地址：上海浦东大道 555 号裕景国际 B 座 16 层

法定代表人：张跃伟

客户服务电话：4000-891-289

传真：021-58787698

长量基金网：<http://www.erichfund.com>

6) 诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司

住所：上海市浦东新区陆家嘴银城中路 68 号时代金融中心 8 楼 801

法定代表人：汪静波

客户服务电话：400 - 821 - 5399

传真：021-38509777

网站：<http://www.noah-fund.com>

7) 上海天天基金销售有限公司

住所：上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼 2 层

法定代表人：其实

客户服务电话：400-1818-188

基金业务传真：021-64385308

公司网站：<http://www.1234567.com.cn>

8) 和讯信息科技有限公司

住所：北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦 10 层

法定代表人：王莉

客户服务电话：4009200022

基金业务传真：（021）20835879

公司网站: <http://licaike.hexun.com>

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) 20398858
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
执行事务合伙人: 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

四、基金的名称

兴全可转债混合型证券投资基金

五、基金的类型

契约型开放式

六、基金的投资目标

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。

七、基金的投资方向

本基金投资范围是具有良好流动性的金融工具，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%。

八、基金的投资策略

（一）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。

(二) 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

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

(2) 资产配置

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

(3) 构建投资组合

基金经理根据对股票市场、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

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

(5) 投资指令下达

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

(6) 指令执行及反馈

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

(7) 风险控制

风险管理委员会根据市场变化对投资组合计划提出风险防范措施，监察稽核部对

投资组合计划的执行过程进行日常监督和实时风险控制，基金经理依据基金申购赎回的情况控制投资组合的流动性风险。

（8）业绩评价

金融工程与专题研究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。

（三）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“兴全可转债评价体系”，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。

九、基金的业绩比较基准

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”

十、基金的风险收益特征

本基金的风险水平处于市场低端，收益水平处于市场中高端。

十一、基金的投资组合报告

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全可转债混合型证券投资基金2014年第3季度报告，数据截至2014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	565,213,768.71	15.36
	其中：股票	565,213,768.71	15.36
2	固定收益投资	3,020,677,865.17	82.11
	其中：债券	3,020,677,865.17	82.11
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	72,460,148.55	1.97
7	其他资产	20,442,328.17	0.56
8	合计	3,678,794,110.60	100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	401,781,643.00	13.92
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	109,281,125.70	3.79
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-

G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	41,364,239.57	1.43
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	12,786,760.44	0.44
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	565,213,768.71	19.58

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	600674	川投能源	4,791,300	85,093,488.00	2.95
2	002594	比亚迪	1,073,101	52,399,521.83	1.82
3	600867	通化东宝	3,690,173	51,551,716.81	1.79
4	600066	宇通客车	2,042,730	37,238,967.90	1.29
5	600398	海澜之家	3,121,515	34,867,322.55	1.21
6	002638	勤上光电	1,900,000	34,580,000.00	1.20
7	600085	同仁堂	1,579,600	29,917,624.00	1.04
8	002439	启明星辰	1,036,996	25,095,303.20	0.87
9	600323	瀚蓝环境	1,720,302	24,015,415.92	0.83
10	000733	振华科技	1,200,000	22,560,000.00	0.78

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	100,050,000.00	3.47
	其中：政策性金融债	100,050,000.00	3.47
4	企业债券	28,516,332.00	0.99
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-

7	可转债	2,892,111,533.17	100.20
8	其他	-	-
9	合计	3,020,677,865.17	104.66

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	8,959,370	927,832,357.20	32.15
2	110015	石化转债	6,335,820	690,794,454.60	23.93
3	113005	平安转债	3,551,730	388,736,848.50	13.47
4	127002	徐工转债	1,694,361	193,092,768.28	6.69
5	110018	国电转债	1,436,610	169,117,729.20	5.86

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序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

9、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

（1）报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

（2）本基金投资股指期货的投资政策

股指期货暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

（1）本期国债期货投资政策

国债期货暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

（2）报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

（3）本期国债期货投资评价

国债期货暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

11、投资组合报告附注

(1) 本基金投资的前十名证券的发行主体中, 东莞勤上光电股份有限公司于 2013 年 5 月 3 日收到中国证券监督管理委员会《调查通知书》(粤证调查通字 13019 号), 因涉嫌信息披露违法违规被立案调查。

除上述情况外, 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	470,988.65
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	17,942,650.12
5	应收申购款	2,028,689.40
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	20,442,328.17

(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	113001	中行转债	927,832,357.20	32.15
2	110015	石化转债	690,794,454.60	23.93
3	113005	平安转债	388,736,848.50	13.47
4	127002	徐工转债	193,092,768.28	6.69
5	110018	国电转债	169,117,729.20	5.86
6	110022	同仁转债	103,384,644.90	3.58
7	110024	隧道转债	85,875,286.40	2.98
8	110012	海运转债	75,604,705.00	2.62
9	110023	民生转债	65,753,032.40	2.28
10	128003	华天转债	59,311,690.28	2.05
11	110011	歌华转债	48,572,200.20	1.68
12	110017	中海转债	20,760,000.00	0.72
13	128004	久立转债	14,977,359.58	0.52
14	113006	深燃转债	4,914,790.00	0.17
15	110019	恒丰转债	2,180,268.80	0.08
16	126729	燕京转债	1,092,282.17	0.04

(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

(6) 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

十二、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 2014 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
2014 年第 3 季度	6.76%	0.64%	6.19%	0.54%	0.57%	0.10%
2014 年上半年度	6.79%	0.63%	2.54%	0.47%	4.25%	0.16%
2013 年度	9.84%	0.73%	-1.10%	0.68%	10.94%	0.05%
2012 年度	1.70%	0.47%	4.11%	0.44%	-2.41%	0.03%
2011 年度	-4.10%	0.51%	-2.93%	0.47%	-1.17%	0.04%
2010 年度	7.65%	0.60%	-9.46%	0.78%	17.11%	-0.18%
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 年度	-3.00 %	0.27 %	-4.37 %	0.37 %	1.37 %	-0.10 %
2004.5.11 (基金成立之日) - 2014.9.30	391.51%	0.73%	115.87%	1.34%	275.64%	-0.61%

注：2004 年度数据统计期间为 2004 年 5 月 11 日（基金合同成立之日）至 2004 年 12 月 31 日，不满一年。

十三、费用概览

（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

兴全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 ≥ 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

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。

十四、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他有关规定，并依据本基金管理人在本基金合同生效后对本基金实施的投资经营活动，对本基金管理人于 2014 年 6 月 25 日刊登《兴全可转债混合型证券投资基金更新招募说明书》进行了更新，主要更新内容如下：

（一）“重要提示”部分

更新了本招募说明书所载内容截止日及有关财务数据和净值表现截止日。

（二）“二、释义”部分

更新了《运作办法》定义

（三）“三、基金管理人”部分

更新了公司董事会组成情况、监事会组成情况、高级管理人员简介、基金经理简历。

（四）“四、基金托管人”部分

对基金托管人的基本情况、主要人员情况、基金托管业务经营情况进行了更新。

（五）“五、相关服务机构”部分

更新了个别销售机构信息，并增加“国都证券有限责任公司”作为销售机构。

（六）“七、基金份额的申购、赎回”部分

更新了个别销售机构申购金额限制。

（七）“九、基金的投资”部分

更新了“（十）基金投资组合报告”部分，数据内容截止日为 2014 年 9 月 30 日，所列财务数据未经审计。

（八）“十、基金的业绩”部分

更新了该部分数据，数据内容截止日为 2014 年 9 月 30 日。

（九）“二十二、其他应披露事项”部分

以下为自 2014 年 5 月 11 日至 2014 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	关于旗下部分基金继续参加重庆银行网上银行申购费率优惠活动的公告	2014-5-21
2	关于长期停牌股票（卫宁软件）估值方法调整的公告	2014-5-30
3	关于调整部分销售渠道申购及追加申购起点的公告	2014-6-27
4	关于调整官方淘宝店基金申购优惠费率的公告	2014-6-27
5	关于旗下部分基金参加华夏银行手机银行基金申购费率优惠活动的公告	2014-6-30
6	旗下各基金 2014 年 6 月 30 日资产净值公告	2014-7-1
7	关于旗下基金继续参加交通银行网上银行、手机银行申购优惠费率公告	2014-7-1
8	关于长期停牌股票（贝因美）估值方法调整的公告	2014-7-30
9	关于长期停牌股票（飞利信）估值方法调整的公告	2014-7-31
10	关于长期停牌股票（乐视网）估值方法调整的公告	2014-8-1
11	兴全可转债混合型证券投资基金分红公告（第四十五次）	2014-8-13
12	关于长期停牌股票（天齐锂业）估值方法调整的公告	2014-8-19
13	关于旗下部分基金投资海润光伏（600401）非公开发行的公告	2014-9-18
14	关于部分董事变更的公告	2014-9-24
15	关于官方淘宝店继续进行在售基金申购费率优惠活动的公告	2014-9-26
16	关于通过和天天基金网申购或定期定额申购旗下部分基金费率优惠活动的公告	2014-10-15
17	关于增加国都证券有限责任公司为旗下部分基金销售机构的公告	2014-10-24
18	关于通过国都证券有限责任公司申购或定期定额申购旗下部分基金费率优惠活动的公告	2014-10-24
19	关于长期停牌股票（康得新）估值方法变更的公告	2014-10-28

上述内容仅为摘要，须与本《招募说明书》（正文）所载之详细资料一并阅读。

兴业全球基金管理有限公司

2014年12月25日