

兴全合润分级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：招商银行股份有限公司

二零一六年十二月

【重要提示】

本基金于 2010 年 2 月 21 日经中国证监会证监许可[2010] 229 号文核准募集。本基金基金合同于 2010 年 4 月 22 日起正式生效，自该日起兴业全球基金管理有限公司（以下简称“本公司”）正式开始管理本基金。

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

投资有风险，投资者认购（或申购）基金时应认真阅读本基金的招募说明书等法律文件，全面认识本基金产品的风险收益特征，充分考虑自身的风险承受能力，并对于认购（或申购）基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。基金管理人提醒投资者基金投资要承担相应风险，包括市场风险、管理风险、流动性风险、本基金特定风险、操作或技术风险、合规风险等。在投资者作出投资决策后，基金投资运作与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成本基金业绩表现的保证。基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证投资于本基金一定盈利，也不保证最低收益。

本更新招募说明书所载内容截止日 2016 年 10 月 21 日（特别事项注明除外），有关财务数据和净值表现摘自本基金 2016 年第 3 季度报告，数据截止日为 2016 年 9 月 30 日（财务数据未经审计）。本基金托管人招商银行股份有限公司已复核了本次更新的招募说明书。

目 录

第一部分	基金管理人	3
第二部分	基金托管人	13
第三部分	相关服务机构	13
第四部分	基金的名称	36
第五部分	基金的类型	36
第六部分	基金的投资目标	36
第七部分	基金的投资方向	37
第八部分	基金的投资策略及投资组合管理	37
第九部分	基金的业绩比较基准	41
第十部分	基金的风险收益特征	41
第十一部分	基金的投资组合报告	41
第十二部分	基金的业绩	45
第十三部分	基金费用与税收	46
第十四部分	对招募说明书更新部分的说明	48

第一部分 基金管理人

一、基金管理人概况

机构名称：兴业全球基金管理有限公司

成立日期：2003年9月30日

住所：上海市黄浦区金陵东路368号

办公地址：上海市张杨路500号时代广场19-20楼

法定代表人：庄园芳

联系人：江映华

联系电话：021-20398888

组织形式：有限责任公司

注册资本：人民币1.5亿元

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

截止2016年10月21日，公司旗下管理着兴全可转债混合型证券投资基金、兴全趋势投资混合型证券投资基金（LOF）、兴全货币市场证券投资基金、兴全全球视野股票型证券投资基金、兴全社会责任混合型证券投资基金、兴全有机增长灵活配置混合型证券投资基金、兴全磐稳增利债券型证券投资基金、兴全合润分级混合型证券投资基金、兴全沪深300指数增强型证券投资基金（LOF）、兴全绿色投资混合型证券投资基金（LOF）、兴全保本混合型证券投资基金、兴全轻资产投资混合型证券投资基金（LOF）、兴全商业模式优选混合型证券投资基金（LOF）、兴全添利宝货币市场基金、兴全添利宝货币市场基金、兴全新视野灵活配置定期开放混合型发

起式证券投资基金、兴全稳益债券型证券投资基金、兴全天添益货币市场基金共 17 只基金。

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

二、主要人员情况

1、董事、监事、经理及其他高级管理人员概况

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

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

万维德先生（Marc van Weede），董事，1965 年生，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。

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

杨东先生，董事兼总经理，1970 年生，高级工商管理硕士。历任福建兴业证券

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

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

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

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

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

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

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

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

2、高级管理人员概况

杨东先生，董事兼总经理，1970年生，高级工商管理硕士。历任福建兴业证券

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

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

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

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

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

郑文惠女士，副总经理，1969年生，EMBA。历任兴业证券泉州营业部财务部经理、副总经理、总经理，运营管理部总经理兼上海分公司副总经理，运营管理部总经理兼上海分公司总经理，私人财富管理总部总经理兼上海分公司总经理。现任兴业全球基金管理有限公司副总经理兼上海兴全睿众资产管理有限公司执行董事。

3、本基金基金经理

谢治宇先生，经济学硕士。2007年加入兴业全球基金管理有限公司，历任行业研究员、专户投资部投资经理。现任基金管理部副总监兼本基金基金经理（2013年1月29日起至今）、兴全轻资产投资混合型证券投资基金（LOF）基金经理（2014年12月8日起至今）。

本基金历任基金经理：

王海涛先生，于2010年5月25日至2012年2月21日期间担任本基金基金经理。

张惠萍女士，于2010年4月22日至2013年2月7日期间担任本基金基金经理。

4、投资决策委员会成员

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

杨 东 兴业全球基金管理有限公司董事兼总经理

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

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

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

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

三、基金管理人的职责

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

2、办理基金备案手续；

3、对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账，进行证券投资；

4、按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；

- 5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
- 6、编制中期和年度基金报告；
- 7、计算并公告基金资产、合润基金份额净值、合润 A 份额净值与合润 B 份额净值，确定合润基金份额申购、赎回价格；
- 8、办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；
- 9、召集基金份额持有人大会；
- 10、保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
- 11、以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
- 12、中国证监会规定的其他职责。

四、基金管理人承诺

- 1、基金管理人承诺基金管理人将根据基金合同的规定，按照招募说明书列明的投资目标、策略及限制进行基金资产的投资；
- 2、基金管理人承诺不从事违反《证券法》的行为，并承诺建立健全的内部控制制度，采取有效措施，防止违反《证券法》行为的发生；
- 3、基金管理人承诺不从事违反《基金法》的行为，并承诺建立健全的内部控制制度，采取有效措施，防止下列行为的发生：
 - (1) 承销证券；
 - (2) 向他人贷款或者提供担保；
 - (3) 从事承担无限责任的投资；
 - (4) 买卖其他基金份额，但是国务院另有规定的除外；
 - (5) 向本基金管理人、基金托管人出资或者买卖本基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；
 - (6) 买卖与本基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与本基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券；
 - (7) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
 - (8) 依照法律、行政法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他活动。
- 4、基金管理人承诺加强人员管理，强化职业操守，督促和约束员工遵守国家法律法规及行业规范，诚实信用、勤勉尽责，不从事以下活动：

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

5、基金经理承诺

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

五、基金管理人的风险管理与内部控制制度

1、风险管理的理念

- (1) 风险管理是业务发展的保障;
- (2) 最高管理层承担最终责任;
- (3) 分工明确、相互牵制的组织结构是前提;

- (4) 制度建设是基础;
- (5) 制度执行监督是保障。

2、风险管理的原则

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

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

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

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

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

3、风险管理和内部风险控制体系结构

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

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

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

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

(4) 风险管理委员会: 负责对基金投资运作的风险进行测量和监控;

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

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

4、内部控制制度综述

(1) 风险控制制度

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

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

(2) 监察稽核制度

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

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

(3) 内部财务控制制度

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

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

5、风险管理和内部风险控制措施

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

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

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

(4) 建立风险分类、识别、评估、报告、提示程序：建立了风险管理委员会，使用适合的程序，确认和评估与公司运作有关的风险；公司建立了自下而上的风险报告程序，对风险隐患进行层层汇报，使各个层次的人员及时掌握风险状况，从而以最快速度作出决策；

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

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

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

6、基金管理人关于内部合规控制声明书

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

第二部分 基金托管人

一、基金托管人概况

1、基本情况

名称：招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”）

成立日期：1987年4月8日

注册地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦

办公地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦

注册资本：人民币252.198亿元

法定代表人：李建红

行长：田惠宇

资产托管业务批准文号：证监基金字[2002]83号

电话：0755—83199084

传真：0755—83195201

资产托管部信息披露负责人：张燕

2、发展概况

招商银行成立于1987年4月8日，是我国第一家完全由企业法人持股的股份制商业银行，总行设在深圳。自成立以来，招商银行先后进行了三次增资扩股，并于2002年3月成功地发行了15亿A股，4月9日在上交所挂牌（股票代码：600036），是国内第一家采用国际会计标准上市的公司。2006年9月又成功发行了22亿H股，9月22日在香港联交所挂牌交易（股票代码：3968），10月5日行使H股超额配售，共发行了24.2亿H股。截至2016年6月30日，本集团总资产5.5373万亿元人民币，高级法下资本充足率13.91%，权重法下资本充足率13.90%。

2002年8月，招商银行成立基金托管部；2005年8月，经报中国证监会同意，更名为资产托管部，下设业务管理室、产品管理室、业务营运室、稽核监察室、基金外包业务室5个职能处室，现有员工60人。2002年11月，经中国人民银行和中国证监会批准获得证券投资基金托管业务资格，成为国内第一家获得该项业务资格上市银行；2003年4月，正式办理基金托管业务。招商银行作为托管业务资质最全的商业银行，拥有证券投资基金托管、受托投资管理托管、合格境外机构投资者托管（QFII）、全国社会保障基金托管、保险资金托管、企业年金基金托管等业务资格。

招商银行确立“因势而变、先您所想”的托管理念和“财富所托、信守承诺”的托管核心价值，独创“6S托管银行”品牌体系，以“保护您的业务、保护您的财富”为历史使命，不断创新托管系统、服务和产品：在业内率先推出“网上托管银行系统”、托管业务综合系统和“6心”托管服务标准，首家发布私募基金绩效分析报告，开办国内首个托管银行网站，成功托管国内第一只券商集合资产管理计划、第一只FOF、第一只信托资金计划、第一只股权私募基金、第一家实现货币市场基金赎回资金T+1到账、第一只境外银行QDII基金、第一只红利ETF基金、第一只“1+N”基金专户理财、第一家大小非解禁资产、第一单TOT保管，实现从单一托管服务商向全面投资者服务机构的转变，得到了同业认可。

经过十四年发展，招商银行资产托管规模快速壮大。2016年招商银行加大高收益托管产品营销力度，截至9月末新增托管公募开放式基金62只，新增首发公募开放式基金托管规模456.94亿元。克服国内证券市场震荡的不利形势，托管费收入、托管资产均创出历史新高，实现托管费收入36.29亿元，同比增长30.06%，托管资产余额9.42万亿元，同比增长59.41%。作为公益慈善基金的首个独立第三方托管人，成功签约“壹基金”公益资金托管，为我国公益慈善资金监管、信息披露进行有益探索，该项目荣获2012中国金融品牌「金象奖」“十大公益项目”奖；四度蝉联获《财资》“中国最佳托管专业银行”。2016年6月招商银行荣膺《财资》“中国最佳托管银行奖”，成为国内唯一获奖项国内托管银行，该行“托管通”获得国内《银行家》2016中国金融创新“十佳金融产品创新奖”；7月荣膺2016年中国资产管理【金贝奖】“最佳资产托管银行”。

二、主要人员情况

李建红先生，本行董事长、非执行董事，2014年7月起担任本行董事、董事长。英国东伦敦大学工商管理硕士、吉林大学经济管理专业硕士，高级经济师。招商局

集团有限公司董事长，兼任招商局国际有限公司董事会主席、招商局能源运输股份有限公司董事长、中国国际海运集装箱（集团）股份有限公司董事长、招商局华建公路投资有限公司董事长和招商局资本投资有限责任公司董事长。曾任中国远洋运输（集团）总公司总裁助理、总经济师、副总裁，招商局集团有限公司董事、总裁。

田惠宇先生，本行行长、执行董事，2013年5月起担任本行行长、本行执行董事。美国哥伦比亚大学公共管理硕士学位，高级经济师。曾于2003年7月至2013年5月历任上海银行副行长、中国建设银行上海市分行副行长、深圳市分行行长、中国建设银行零售业务总监兼北京市分行行长。

丁伟先生，本行副行长。大学本科毕业，副研究员。1996年12月加入本行，历任杭州分行办公室主任兼营业部总经理，杭州分行行长助理、副行长，南昌支行行长，南昌分行行长，总行人力资源部总经理，总行行长助理，2008年4月起任本行副行长。兼任招银国际金融有限公司董事长。

姜然女士，招商银行资产托管部总经理，大学本科毕业，具有基金托管人高级管理人员任职资格。先后供职于中国农业银行黑龙江省分行，华商银行，中国农业银行深圳市分行，从事信贷管理、托管工作。2002年9月加盟招商银行至今，历任招商银行总行资产托管部经理、高级经理、总经理助理等职。是国内首家推出的网上托管银行的主要设计、开发者之一，具有20余年银行信贷及托管专业从业经验。在托管产品创新、服务流程优化、市场营销及客户关系管理等领域具有深入的研究和丰富的实务经验。

三、基金托管业务经营情况

截至2016年9月30日，招商银行股份有限公司累计托管213只开放式基金及其它托管资产，托管资产为9.42万亿元人民币。

四、托管人的内部控制制度

1、内部控制目标

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

2、内部控制组织结构

招商银行资产托管业务建立三级内控风险防范体系：

一级风险防范是在总行层面对风险进行预防和控制。

二级防范是总行资产托管部设立稽核监察室，负责部门内部风险预防和控制。稽核监察室在总经理室直接领导下，独立于部门内其他业务室和托管分部、分行资产托管业务主管部门，对各岗位、各业务室、各分部、各项业务中的风险控制情况实施监督，及时发现内部控制缺陷，提出整改方案，跟踪整改情况。

三级风险防范是总行资产托管部在专业岗位设置时，必须遵循内控制衡原则，监督制衡的形式和方式视业务的风险程度决定。

3、内部控制原则

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

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

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

(4) 有效性原则。内部控制应当具有高度的权威性，任何人不得拥有不受内部控制约束的权利，内部控制存在的问题应当能够得到及时的反馈和纠正。

(5) 适应性原则。内部控制应适应我行托管业务风险管理的需要，并能随着托管业务经营战略、经营方针、经营理念等内部环境的变化和国家法律、法规、政策制度等外部环境的改变及时进行修订和完善。内部控制应随着托管业务经营战略、经营方针、经营理念等内部环境的变化和国家法律、法规、政策制度等外部环境的改变及时进行相应的修订和完善。

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

(7) 重要性原则。内部控制应当在全面控制的基础上,关注重要托管业务事项和高风险领域。

(8) 制衡性原则。内部控制应当在托管组织体系、机构设置及权责分配、业务流程等方面形成相互制约、相互监督,同时兼顾运营效率。

(9) 成本效益原则。内部控制应当权衡托管业务的实施成本与预期效益,以适当的成本实现有效控制。

4、内部控制措施

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

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

(3) 业务信息风险控制。招商银行资产托管部采用加密方式传输数据。数据执行异地同步灾备,同时,每日实时对托管业务数据库进行备份,托管业务数据每日进行备份,所有的业务信息须经过严格的授权才能进行访问。

(4) 客户资料风险控制。招商银行资产托管部对业务办理过程中形成的客户资料,视同会计资料保管。客户资料不得泄露,有关人员如需调用,须经总经理室成员审批,并做好调用登记。

(5) 信息技术系统风险控制。招商银行对信息技术系统管理实行双人双岗双责、机房 24 小时值班并设置门禁管理、电脑密码设置及权限管理、业务网和办公网、与全行业务网双分离制度,与外部业务机构实行防火墙保护等,保证信息技术系统的安全。

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

五、基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

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

基金托管人对上述事项的监督与核查中发现基金管理人的实际投资运作违反《基金法》、《运作办法》、基金合同、托管协议、上述监督内容的约定和其他有关法律法规的规定，应及时以书面形式通知基金管理人进行整改，整改的时限应符合法规允许的投资比例调整期限。基金管理人收到通知后应及时核对确认并以书面形式向基金托管人发出回函并改正。在规定时间内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对于基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人的投资指令违反《基金法》、《运作办法》、基金合同和有关法律法规规定，应当拒绝执行，立即通知基金管理人限期改正，如基金管理人未能在通知期限内纠正的，基金托管人应向中国证监会报告。

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

基金托管人发现基金管理人存在重大违规行为，应及时报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。基金管理人无正当理由，拒绝、阻挠对方根据托管协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方

进行有效监督，情节严重或经基金托管人提出警告仍不改正的，基金托管人应报告中国证监会。

第三部分 相关服务机构

一、基金份额发售机构

1、直销机构

- 兴业全球基金管理有限公司直销中心

地址：上海市张杨路 500 号时代广场 20 楼

联系人：何佳怡、秦洋洋、沈冰心

客户服务电话：400-678-0099、(021) 38824536

直销联系电话：(021) 20398927、20398706

传真：(021) 58368869

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

交易网站：<https://trade.xyfunds.com.cn>

客服电话：400-678-0099；(021) 38824536

2、代销机构

- 代销银行

(1) 招商银行股份有限公司

住所：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

法定代表人：李建红

电话：(0755) 83198888

传真：(0755) 83195049

客服电话：95555

公司网站：<http://www.cmbchina.com>

(2) 兴业银行股份有限公司

住所：福州市湖东路 154 号

法定代表人：高建平

电话：(021) 52629999

客户服务热线：95561

公司网站：<http://www.cib.com.cn>

(3) 中国工商银行股份有限公司

住所：中国北京复兴门内大街 55 号

办公地址：中国北京复兴门内大街 55 号

法定代表人：易会满

客户服务电话：95588

传真：(010) 66107914

公司网站：<http://www.icbc.com.cn>

(4) 中国邮政储蓄银行股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街 3 号

办公地址：北京市西城区金融大街 3 号

法定代表人：李国华

客户服务电话：95580

传真：(010) 68858117

公司网站：<http://www.psbc.com>

(5) 交通银行股份有限公司

住所：上海市银城中路 188 号

办公地址：上海市银城中路 188 号

法定代表人：牛锡明

电话：(021) 58781234

传真：(021) 58408483

客户服务电话：95559

公司网站：<http://www.bankcomm.com>

(6) 中信银行股份有限公司

住所：北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座

法定代表人：李庆萍

电话：(010) 65557013

传真：(010) 65550827

客户服务电话：95558

公司网站：<http://bank.ecitic.com>

(7) 中国民生银行股份有限公司

住所（办公地址）：北京市西城区复兴门内大街2号

法定代表人：洪崎

客户服务电话：95568

传真：(010) 57092611

公司网站：<http://www.cmbc.com.cn>

(8) 中国银行股份有限公司

住所（办公地址）：北京市西城区复兴门内大街1号

法定代表人：田国立

客户服务电话：95566

公司网站：<http://www.boc.cn>

(9) 中国农业银行股份有限公司

住所（办公地址）：北京市东城区建国门内大街69号

法定代表人：周慕冰

客户服务电话：95599

传真：(010) 85109219

公司网站：<http://www.abchina.com>

(10) 中国光大银行股份有限公司

住所：北京市西城区太平桥大街25号中国光大中心

法定代表人：唐双宁

客户服务电话：95595

传真：010-68560661

公司网站：<http://www.cebbank.com>

(11) 中国宁波银行股份有限公司

住所：宁波市鄞州区宁南南路 700 号

法定代表人：陆华裕

客户服务电话：96528, (上海地区 962528)

传真：0574-87050024

公司网站：<http://www.nbc.com.cn>

(12) 上海浦发银行股份有限公司

住所：上海市中山东一路 12 号

法定代表人：吉晓辉

客户服务电话：95528

传真：021-63604199

公司网站：<http://www.spdb.com.cn>

(13) 平安银行股份有限公司

住所（办公地址）：广东省深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行大厦

法定代表人：孙建一

客户服务电话：95511-3

公司网站：<http://www.bank.pingan.com>

(14) 华夏银行股份有限公司

住所（办公地址）：北京市东城区建国门内大街 22 号华夏银行大厦

法定代表人：吴建

客户服务电话：95577

公司网站：<http://www.hxb.com.cn>

(15) 重庆银行股份有限公司

住所：重庆市渝中区邹容路 153 号

法定代表人：马千真

客户服务电话：96899（重庆地区）、400-709-6899（其他地区）

公司网站：<http://www.cqcbank.com>

(16) 中国建设银行股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人：王洪章

客户服务电话：95533

公司网站：<http://www.ccb.com>

(17) 东莞农村商业银行股份有限公司

住所：东莞市南城路2号

办公地址：东莞市东城区鸿福东路2号东莞农商银行大厦

法定代表人：何沛良

客户服务电话：961122

公司网站：<http://www.drcbank.com>

(18) 江苏江南农村商业银行股份有限公司

住所：江苏省常州市延陵中路668号

法定代表人：陆向阳

客户服务电话：96005

公司网站：<http://www.jnbank.cc>

● 代销券商

(1) 兴业证券股份有限公司

住所：福州市湖东路268号

法定代表人：兰荣

客户服务热线：4008888123

传真：(021) 38565785

公司网站：<http://www.xyzq.com.cn>

(2) 国泰君安证券股份有限公司

住所：上海市浦东新区商城路618号

法定代表人：杨德红

电话：(021) 38676666

传真：(021) 38670666

客户服务热线：4008888666

公司网站：<http://www.gtja.com.cn>

(3) 中信建投证券股份有限公司

住所：北京市朝阳区安立路66号4号楼

法定代表人：王常青

开放式基金咨询电话：4008888108

开放式基金业务传真：(010) 85130577

公司网站：<http://www.csc108.com>

(4) 华泰证券股份有限公司

办公地址：江苏省南京市中山东路 90 号华泰证券大厦

法定代表人：周易

电话：(025) 83290979

客户咨询电话：95597

公司网站：<http://www.htsc.com.cn>

(5) 长江证券股份有限公司

住所：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

法定代表人：尤习贵

电话：(027) 65799999

传真：(027) 85481900

客户服务热线：4008-888-999 或 95579

公司网站：<http://www.cjsc.com.cn>

(6) 海通证券股份有限公司

住所：上海市广东路 689 号

法定代表人：瞿秋平(代)

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

传真：(021)53858549

公司网站：<http://www.htsec.com>

(7) 招商证券股份有限公司

住所：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38—45 层

法定代表人：宫少林

电话：(0755) 82943666

传真：(0755) 82943636

客户服务热线：95565、4008888111

公司网站：<http://www.newone.com.cn>

(8) 中国银河证券股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街 35 号 2-6 层

法定代表人：陈有安

联系电话：(010) 66568430

客服电话：8008201968

公司网站：<http://www.chinastock.com.cn>

(9) 广发证券股份有限公司

住所：广州市天河区天河北路 183-187 号大都会广场 43 楼

法定代表人：孙树明

开放式基金咨询电话：95575 转各营业网点

开放式基金业务传真：(020) 87555305

公司网站：<http://www.gf.com.cn>

(10) 山西证券股份有限公司

办公（注册）地址：山西省太原市府西街 69 号山西国贸中心东塔楼

法定代表人：侯巍

客服电话：95573

联系电话：(0351) 8686703

传真：(0351) 8686619

公司网站：<http://www.i618.com.cn>

(11) 东方证券股份有限公司

住所：上海市中山南路 318 号 2 号楼 22 层-29 层

法定代表人：潘鑫军

电话：(021) 63325888

传真：(021) 63326173

客服热线：95503

公司网站：<http://www.dfzq.com.cn>

(12) 德邦证券股份有限公司

办公地址：上海市浦东新区福山路 500 号“城建国际中心”26 楼

法定代表人：姚文平

联系电话：(021) 68761616

传真电话：(021) 68767981

客服电话：4008888128

公司网站: <http://www.tebon.com.cn>

(13) 中银国际证券股份有限公司

住所: 上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 39 层

法定代表人: 钱卫

开放式基金咨询电话: 4006208888 或各地营业网点咨询电话

开放式基金业务传真: (021) 50372474

公司网站: <http://www.bocichina.com.cn>

(14) 国海证券股份有限公司

住所: 广西桂林市辅星路 13 号

法定代表人: 何春梅

联系电话: (0771) 5539262

传 真: (0771) 5539033

客服热线: (0771) 5539032

公司网站: <http://www.ghzq.com.cn>

(15) 光大证券股份有限公司

住所: 上海市静安区新闻路 1508 号

法定代表人: 薛峰

联系电话: (021) 22169081

传 真: (021) 22169134

客服热线: 4008888788

公司网站: <http://www.ebscn.com>

(16) 国元证券股份有限公司

住所: 合肥市寿春路 179 号

法定代表人: 蔡咏

客户服务电话: 95578

传真: (0551) 2207114

公司网站: <http://www.gyzq.com.cn>

(17) 湘财证券股份有限公司

住所: 长沙市天心区湘府中路 198 号新南城商务中心 A 栋 11 楼

法定代表人: 林俊波

电话: (021) 68634518

传真：(021) 68865680

客服电话：400-888-1551

公司网站：<http://www.xcsc.com>

(18) 申万宏源证券有限公司

住所（办公地址）：上海市徐汇区长乐路989号45层

法定代表人：李梅

电话：(021) 33389888

传真：(021) 33388224

客服电话：95523 或 4008895523

公司网站：<http://www.swhysc.com>

(19) 中航证券有限公司

住所：南昌市红谷中大道1619号南昌国际金融大厦A栋41层

法定代表人：王宜四

联系电话：(0791) 6768763

传真：(0791) 6789414

客服电话：400-8866-567

公司网站：<http://www.avicsec.com>

(20) 渤海证券股份有限公司

住所：天津经济技术开发区第二大街42号写字楼101室

法定代表人：王春峰

联系电话：(022) 28451861

传真：(022) 28451892

客服电话：4006515988

公司网站：<http://www.ewww.com.cn>

(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：程宜荪

联系电话：(010) 5832 8752

传真：(010) 5922 8748

客服电话：400-887-8827

公司网站：<http://www.ubssecurities.com>

(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

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) 中泰证券股份有限公司

注册地址：山东省济南市经七路 86 号

办公地址：山东省济南市经七路 86 号

法定代表人：李玮

联系人：吴阳

传真：(0531) 81283900

客户服务电话：95538（山东省外请加拨 0531）

公司网站：<http://www.zts.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：钱华

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

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

法定代表人：王连志

联系电话：(0755) 82825551

传真：(0755) 82558355

客服电话：4008001001

公司网站：<http://www.essence.com.cn>

(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：祝献忠

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) 东莞证券股份有限公司

住所: 广东省东莞市莞城区可园南路一号

法定代表人: 张运勇

联系电话: (0769) 22119341

传真: (0769) 22116999

客服电话: (0769) 961130

公司网站: <http://www.dgzq.com.cn>

(29) 东海证券股份有限公司

住所: 江苏省常州市延陵西路 23 号投资广场 18-19 楼

法定代表人: 朱科敏

联系电话: (0519) 88157761

传真: 0519-88157761

客服电话: 400888588、95531

公司网站: <http://www.longone.com.cn>

(30) 中信证券股份有限公司

注册地址: 广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场(二期)北座

法定代表人: 张佑君

统一客服电话: 95558

公司网站地址: <http://www.cs.ecitic.com>

(31) 中信证券(山东)有限责任公司

注册地址：山东省青岛市崂山区深圳路 222 号 1 号楼 2001

法定代表人：杨宝林

统一客服电话：95548

公司网站地址：<http://www.zxwt.com.cn>

(32) 信达证券股份有限公司

住所：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

法定代表人：张志刚

客户服务电话：400-800-8899

基金业务传真：010-63080978

公司网站：<http://www.cindasc.com>

(33) 长城证券股份有限公司

住所：深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 14、16、17 层

法定代表人：邵崇(代行)

客户服务电话：4006666888

基金业务传真：0755-83515567

公司网站：<http://www.cgws.com>

(34) 华鑫证券有限责任公司

住所：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 28 层 A01、B01(b) 单元

法定代表人：俞洋

客户服务电话：400-109-9918

基金业务传真：021-64333051

公司网站：<http://www.cfsc.com.cn>

(35) 国都证券股份有限公司

地址：北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层

法定代表人：王少华

客户服务电话：4008188118

基金业务传真：010-84183311

公司网站：<http://www.guodu.com>

(36) 联讯证券股份有限公司

住所：广东省惠州市惠城区江北东江三路 55 号

法定代表人：徐刚

客户服务电话：95564

基金业务传真：010-64408834

公司网站：<http://www.lxzq.com.cn/>

(37) 广州证券股份有限公司

住所：广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19 楼、20 楼

法定代表人：邱三发

客户服务电话：020-961303

基金业务传真：020-88836654

公司网站：<http://www.gzs.com.cn>

(38) 平安证券有限责任公司

住所：深圳市福田区中心区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层

法定代表人：谢永林

网站：<http://stock.pingan.com>

客户服务电话：4006-788-887

(39) 南京证券有限责任公司

住所：南京市玄武区大钟亭 8 号

法定代表人：步国旬

网站：<http://www.njzq.com.cn/>

客户服务电话：400-828-5888

● 其他代销机构

(1) 天相投资顾问有限公司

住所：北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座

法定代表人：林义相

联系电话：(010) 66045608

传真：(010) 66045527

客服电话：(010) 66045678

公司网站: <http://www.txsec.com>

(2) 上海天天基金销售有限公司

住所: 上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼 2 层

法定代表人: 其实

客户服务电话: 400-1818-188

基金业务传真: (021) 64385308

公司网站: <http://www.1234567.com.cn>

(3) 和讯信息科技有限公司

住所: 北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦 10 层

法定代表人: 王莉

客户服务电话: 4009200022

基金业务传真: (021) 20835879

公司网站: <http://licaike.hexun.com>

(4) 上海好买基金销售有限公司

注册地址: 上海市虹口区场中路 685 弄 37 号 4 号楼 449 室

办公地址: 上海市浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 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>

(5) 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>

(6) 浙江同花顺基金销售有限公司

住所: 浙江省杭州市文二西路 1 号元茂大厦 903

法定代表人: 凌顺平

客户服务热线: 4008-773-772

传真：0571-86800423

公司网站：<http://www.5ifund.com>

(7) 珠海盈米财富管理有限公司

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

室

法定代表人：肖雯

客户服务热线：020-89629066

传真：020-89629011

公司网站：<http://www.yingmi.cn>

(8) 上海陆金所资产管理有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单

元

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号

法定代表人：郭坚

联系人：宁博宇

电话：021-20665952

传真：021-22066653

客户服务电话：4008219031

网址：<http://www.lufunds.com>

(9) 诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司

住所：上海市虹口区飞虹路 360 弄 9 号 3724 室

法定代表人：汪静波

客户服务电话：400-821-5399

传真：021-38509777

网站：<http://www.noah-fund.com>

(10) 深圳众禄金融控股股份有限公司

住所：深圳市罗湖区笋岗街道梨园路物资控股置地大厦 8 楼 801

法定代表人：薛峰

网站：<http://www.zlfund.cn>

客户服务电话：4006-788-887

- (11) 北京蛋卷基金销售有限公司
住所: 北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507
法定代表人: 钟斐斐
客户服务电话: 4000618518
传真: 010-61840699
网站: <https://danjuanapp.com/>
- (12) 北京广源达信投资管理有限公司
住所: 北京市西城区新街口外大街28号C座六层605室
法定代表人: 齐剑辉
网站: [www: niuniufund.com](http://www.niuniufund.com)
客户服务电话: 4006236060
- (13) 上海大智慧财富管理有限公司
住所: 中国(上海)自由贸易试验区杨高南路428号1号楼1102、1103单元
法定代表人: 申健
网站: <https://8.gw.com.cn/>
客户服务电话: 021-20219931
- (14) 中信期货有限公司
住所: 北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦18层
法定代表人: 张磊
网站: <http://www.citicsf.com/>
客户服务电话: 400-9908-826
- (15) 厦门市鑫鼎盛控股有限公司
办公地址: 厦门市思明区鹭江道2号厦门第一广场西座1501-1504室
法定代表人: 陈洪生
网站: <http://www.xds.com.cn/>
客户服务电话: 400-918-0808
- (16) 北京增财基金销售有限公司
住所: 北京市西城区南礼士路66号建威大厦1208室

法定代表人：罗细安

客户服务电话：010-67000988-6025

传真：010-67000988

网站：<http://www.zcvc.com.cn/>

(17) 上海基煜基金销售有限公司

住所：上海市崇明县长兴镇路潘园公路 1800 号 2 号楼 6153 室（上海泰和经济发展区）

法定代表人：王翔

客户服务电话：021-65370077

传真：021-55085991

基金管理人可根据有关法律、法规的要求，选择其他符合要求的机构代理销售本基金，并及时公告。

二、注册登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

住所：北京市西城区太平桥大街 17 号

法定代表人：周明

办公地址：北京市西城区太平桥大街 17 号

联系电话：010-58598853

传真：010-58598907

联系人：任瑞新

三、出具法律意见书的律师事务所和经办律师

名称：通力律师事务所

住所（办公地址）：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

负责人：韩炯

经办律师：吕红、安冬

电话：021-31358666

传真：021-31358600

联系人：安冬

四、审计基金资产的会计师事务所和经办注册会计师

名称：德勤华永会计师事务所有限公司

办公地址：上海市延安东路 222 号 30 楼

执行事务合伙人：卢伯卿

电话：(021) 61418888

传真：(021) 63350377

经办注册会计师：陶坚、吴凌志

联系人：吴凌志

第四部分 基金的名称

兴全合润分级混合型证券投资基金

第五部分 基金的类型

契约型开放式

第六部分 基金的投资目标

本基金通过定量与定性相结合精选股票,以追求当期收益与实现长期资本增值。

第七部分 基金的投资方向

本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括依法公开发行上市的股票、国债、金融债、企业债、公司债、回购、央行票据、可转换债券、权证、资产支持证券以及经中国证监会批准允许基金投资的其它金融工具。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

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

第八部分 基金的投资策略及投资组合管理

一、投资策略

1、大类资产配置策略

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

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

2、股票选择策略

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

区间还将表现出时变性。

(1) 量化筛选

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

本基金采用市盈率（市值/净利润）、市净率（市值/净资产）、市销率（市值/营业收入）等指标考察股票的价值是否被低估。

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

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

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

(2) 定性筛选

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

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

持续的创新能力；

- 公司的行业地位、发展战略，是否具有并购价值等等。

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

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

3、权证投资策略

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

4、债券投资策略

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

二、投资决策程序

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

1、投资决策依据

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

2、决策机制与程序

本基金实行投资决策委员会领导下的基金经理负责制。

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

具体的基金投资决策程序如下：

（1）研究策划

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

（2）资产配置

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

（3）构建投资组合

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

（4）组合的监控和调整

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

（5）投资指令下达

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

（6）指令执行及反馈

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

（7）风险控制

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

（8）业绩评价

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。

第九部分 基金的业绩比较基准

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

如果指数编制单位停止计算编制该指数或更改指数名称、或有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，本基金管理人有权对此基准进行调整。业绩比较基准的变更须经基金管理人和基金托管人协商一致，并报中国证监会备案，基金管理人应在调整前 3 个工作日在至少一种中国证监会指定媒体上公告，并在更新的招募说明书中列示。

第十部分 基金的风险收益特征

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

第十一部分 基金的投资组合报告

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

基金托管人招商银行根据本基金合同规定，复核了本投资组合报告，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据取自兴全合润分级混合型证券投资基金 2016 年第 3 季度报告，所载数据截至 2016 年 9 月 30 日，本报告中所列财务数据未经审计。

1、报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	3,846,458,697.04	88.17
	其中：股票	3,846,458,697.04	88.17
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	223,677,782.10	5.13
	其中：债券	223,677,782.10	5.13
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	265,376,697.31	6.08
8	其他各项资产	27,135,442.33	0.62
9	合计	4,362,648,618.78	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	91,396,919.85	2.10
B	采矿业	164,314,559.40	3.78
C	制造业	2,405,192,415.20	55.34
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	132,757,877.63	3.05
E	建筑业	88,564,411.57	2.04
F	批发和零售业	177,581,170.27	4.09
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	308,619,695.31	7.10
J	金融业	177,223.18	0.00
K	房地产业	139,949,920.34	3.22
L	租赁和商务服务业	57,720,013.79	1.33
M	科学研究和技术服务业	280,184,490.50	6.45
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	3,846,458,697.04	88.51

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	300054	鼎龙股份	10,647,538	260,119,353.34	5.99
2	300012	华测检测	16,849,955	227,474,392.50	5.23
3	600584	长电科技	11,690,594	226,914,429.54	5.22
4	002425	凯撒文化	7,367,700	175,684,634.00	4.04
5	600309	万华化学	7,901,290	162,450,522.40	3.74
6	000403	ST生化	4,201,286	142,801,711.14	3.29
7	000568	泸州老窖	4,542,933	141,194,357.64	3.25
8	000423	东阿阿胶	2,356,600	140,217,700.00	3.23
9	300271	华宇软件	5,976,375	121,678,995.00	2.80
10	002582	好想你	3,101,340	120,704,152.80	2.78

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	207,199,280.20	4.77
2	央行票据	-	-
3	金融债券	16,325,345.90	0.38
	其中：政策性金融债	16,325,345.90	0.38
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	153,156.00	0.00
8	同业存款	-	-
9	其他	-	-
10	合计	223,677,782.10	5.15

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	019533	16国债05	1,115,510	111,684,861.20	2.57

2	019539	16国债11	954,190	95,514,419.00	2.20
3	070208	07国开08	100,000	9,983,000.00	0.23
4	018002	国开1302	59,070	6,342,345.90	0.15
5	113010	江南转债	1,200	153,156.00	0.00

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

(2) 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

(3) 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,470,443.24
2	应收证券清算款	13,812,163.23
3	应收股利	-
4	应收利息	2,803,384.17
5	应收申购款	9,049,451.69
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	27,135,442.33

(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	113010	江南转债	153,156.00	0.00

(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	002425	凯撒文化	36,768,116.00	0.85	非公开发行

(6) 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

第十二部分 基金的业绩

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

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

本基金合同生效日 2010 年 4 月 22 日，基金业绩截止日 2016 年 9 月 30 日。

阶段	净值增长	净值增长	业绩比较	业绩比较基	① - ③	② - ④
----	------	------	------	-------	-------	-------

	率①	率标准差 ②	基准收益 率③	准收益率标 准差④		
2016年第3季度	4.86%	0.86%	3.01%	0.64%	1.85%	0.22%
2016年上半年度	-6.65%	2.24%	-11.95%	1.48%	5.30%	0.76%
2015年度	87.34%	2.30%	7.36%	1.99%	79.98%	0.31%
2014年度	38.33%	1.06%	42.92%	0.97%	-4.59%	0.09%
2013年度	32.44%	1.08%	-6.35%	1.12%	38.79%	-0.04%
2012年度	2.80%	1.33%	6.90%	1.02%	-4.10%	0.31%
2011年度	-20.91%	1.23%	-19.24%	1.04%	-1.67%	0.19%
2010年度	8.44%	1.28%	-2.42%	1.33%	10.86%	-0.05%
2010年4月22日(基金合同生效日)至2016年9月30日止期间	196.17%	1.51%	9.81%	1.28%	186.36%	0.23%

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

第十三部分 基金费用与税收

一、基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、基金财产拨划支付的银行费用；
- 4、基金合同生效后的基金信息披露费用；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费；
- 7、基金的证券交易费用；
- 8、依法可以在基金财产中列支的其他费用。

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

三、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

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

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

H 为每日应计提的基金管理费，E 为前一日基金资产净值

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

2、基金托管人的托管费

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

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

H 为每日应计提的基金托管费，E 为前一日基金资产净值

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

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

四、不列入基金费用的项目

基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金合同生效前所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付。

五、基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率和基金托管费率。降低基金管理费率和基金托管费率，无须召开基金份额持有人大会。基金

管理人必须最迟于新的费率实施日 2 日前在指定媒体上刊登公告。

六、基金税收

本基金运作过程中的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律法规履行。

第十四部分 对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书根据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称《基金法》)、《证券投资基金运作管理办法》(以下简称《运作办法》)、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称《销售办法》)、《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称《信息披露办法》)及其他有关规定，并依据本基金管理人在本基金合同生效后对本基金实施的投资经营活动，对本基金管理人于 2016 年 6 月 4 日刊登《兴全合润分级混合型证券投资基金更新招募说明书》进行了更新，主要更新内容如下：

一、“重要提示”部分

更新了本招募说明书所载内容截止日及有关财务数据和净值表现截止日。

二、“第三部分 基金管理人”部分

对基金管理人的法定代表人、基本情况、主要人员情况等进行了更新。

三、“第四部分 基金托管人”部分

对基金托管人的基本情况、托管业务经营情况进行了更新。

四、“第五部分 相关服务机构”部分

更新了个别销售机构简介，新增销售机构 10 家。

五、“第十四部分 基金的投资”部分

更新了“十、基金投资组合报告”部分，数据内容取自本基金 2016 年第 3 季度报告，数据截止日为 2016 年 9 月 30 日，所列财务数据未经审计。

六、“第十五部分 基金的业绩”部分

更新了此部分内容，数据截止日为 2016 年 9 月 30 日。

七、“第二十九部分 对基金份额持有人的服务”部分

更新了此部分内容。

八、“第三十部分 其他应披露事项”部分

以下为自2016年4月22日至2016年10月21日,本基金刊登于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站的基金公告。

序号	事项名称	披露日期
1	关于兴全合润分级混合型证券投资基金办理定期份额折算、分拆业务期间合润A份额、合润B份额停牌的公告	2016-4-22
2	关于长期停牌股票(鼎龙股份)估值方法调整的公告	2016-4-22
3	关于兴全合润分级混合型证券投资基金定期份额折算、分拆结果及恢复交易的公告	2016-4-25
4	关于兴全合润分级混合型证券投资基金之A份额、B份额定期份额折算、分拆后次日前收盘价调整的公告	2016-4-25
5	关于旗下部分基金投资宝新能源(000690)非公开发行股票的公告	2016-4-27
6	关于调整招商银行借记卡基金网上直销优惠费率的公告	2016-4-29
7	关于官方淘宝店和支付宝基金支付渠道关闭基金申购等业务的公告	2016-5-5
8	关于调整诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司基金定投起点的公告	2016-5-9
9	关于董事长及法定代表人变更的公告	2016-5-9
10	关于旗下部分基金投资凯撒股份(002425)非公开发行股票的公告	2016-5-10
11	关于开通网上直销通联支付业务的公告	2016-5-11
12	关于长期停牌股票(利欧股份)估值方法调整的公告	2016-5-11
13	关于旗下部分基金参加民生银行基金通申购费率优惠活动的公告	2016-5-12
14	关于长期停牌股票(唐德影视)估值方法调整的公告	2016-5-17
15	关于调整旗下基金在珠海盈米财富管理有限公司基金定投起点的公告	2016-5-19
16	关于调整网上直销基金转换优惠费率的公告	2016-6-3
17	关于旗下部分基金投资通裕重工(300185)非公开发行股票的公告	2016-6-8
18	关于长期停牌股票(广电运通)估值方法调整的公告	2016-6-15
19	关于在上海陆金所资产管理有限公司开通旗下部分基金定期定额投资业务的公告	2016-6-17
20	关于调整开放式基金开户证件类型类型的公告	2016-6-21
21	关于旗下基金继续参加交通银行网上银行、手机银行申购优惠费率的公告	2016-6-28
22	关于调整诺亚正行申购、定投金额下限的公告	2016-6-23
23	关于增加众禄金融为旗下部分基金销售机构的公告	2016-6-23
24	旗下各基金2016年6月30日资产净值公告	2016-7-1
25	关于兴全合润分级混合型证券投资基金暂停接受一百万元以上申购和转换转入申请的公告	2016-7-1
26	关于调整“通联支付”部分银行卡网上直销申购费率的公告	2016-7-5
27	关于增加平安证券有限责任公司为旗下部分基金销售机构的公告	2016-7-15

28	关于在工商银行开通基金转换业务的公告	2016-7-18
29	关于调整旗下部分基金在工商银行基金转换业务的公告	2016-7-19
30	关于增加南京证券有限责任公司为旗下部分基金销售机构的公告	2016-7-20
31	关于增加上海大智慧财富管理有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	2016-7-26
32	关于旗下部分基金投资比亚迪（002594）非公开发行股票的公告	2016-7-26
33	关于增加中信期货有限公司为旗下基金销售机构的公告	2016-7-26
34	关于增加厦门市鑫鼎盛控股有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	2016-7-29
35	关于调整旗下部分基金在指定销售机构的申购、定投、最低赎回、转换转出及最低持有份额限制的公告	2016-7-29
36	关于增加蛋卷基金为旗下部分基金销售机构的公告	2016-8-8
37	关于增加北京广源达信投资管理有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	2016-8-8
38	关于旗下基金参加中信证券线上交易平台“信e投”基金申购费率优惠活动的公告	2016-8-11
39	关于长期停牌股票（西藏城投）估值方法调整的公告	2016-8-16
40	关于增加北京增财基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	2016-8-19
41	关于调整旗下基金在长江证券定期定额申购起点金额的公告	2016-8-19
42	关于旗下部分基金投资博威合金（601137）非公开发行股票的公告	2016-8-20
43	关于调整旗下基金在兴业银行股份有限公司申购及定期定额申购起点金额的公告	2016-8-25
44	关于旗下部分基金投资东旭光电（000413）非公开发行股票的公告	2016-8-27
45	关于旗下部分基金投资市北高新（600604）非公开发行股票的公告	2016-9-2
46	关于增加上海基煜基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	2016-9-2
47	关于调整旗下基金在中信建投证券申购、定期定额申购起点金额及参加申购费率优惠活动的公告	2016-9-5
48	关于旗下部分基金投资利欧股份（002131）非公开发行股票的公告	2016-9-10
49	关于旗下部分基金投资万林股份（603117）非公开发行股票的公告	2016-9-10
50	关于调整网上直销部分基金转换优惠费率的公告	2016-9-19
51	关于旗下基金参加交通银行手机银行申购及定期定额投资优惠费率的公告	2016-9-20
52	关于旗下部分基金投资龙宇燃油（603003）非公开发行股票的公告	2016-9-30

上述内容仅为摘要，须与本《招募说明书》（正文）所载之详细资料一并阅读。

兴业全球基金管理有限公司

2016年12月6日