

# 兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）

## 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：中国农业银行股份有限公司

二〇一三年十二月

## 【重要提示】

本基金于 2010 年 8 月 9 日经中国证监会证监许可[2010]1068 号文核准募集。本基金基金合同于 2010 年 11 月 2 日起正式生效，自该日起兴业全球基金管理有限公司（以下简称“本基金管理人”）正式开始管理本基金。

本招募说明书是对原《兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF) 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。本基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

投资有风险，投资者认购（或申购）基金时应认真阅读本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 2013 年 11 月 1 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 2013 年第 3 季度报告，数据截止日为 2013 年 9 月 30 日（财务数据未经审计）。本基金托管人农业银行股份有限公司已复核了本次更新的招募说明书。

## 目 录

第一部分	基金管理人	3
第二部分	基金托管人	12
第三部分	相关服务机构	18
第四部分	基金的名称	30
第五部分	基金的类型	31
第六部分	基金的投资目标	31
第七部分	基金的投资方向	31
第八部分	基金的投资策略及投资组合管理	32
第九部分	基金的业绩比较基准	36
第十部分	基金的风险收益特征	37
第十一部分	基金的投资组合报告	37
第十二部分	基金的业绩	41
第十四部分	基金费用与税收	42
第十四部分	对招募说明书更新部分的说明	44

## 第一部分 基金管理人

### 一、基金管理人概况

机构名称：兴业全球基金管理有限公司

成立日期：2003 年 9 月 30 日

住所：上海市黄浦区金陵东路 368 号

办公地址：上海市张杨路 500 号时代广场 20 楼

法定代表人：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：人民币 1.5 亿元

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

截至 2013 年 11 月 1 日，公司旗下管理着兴全可转债混合型证券投资基金、兴全趋势投资混合型证券投资基金 (LOF)、兴全货币市场证券投资基金、兴全全球视野股票型证券投资基金、兴全社会责任股票型证券投资基金、兴全有机增长灵活配置混合型证券投资基金、兴全磐稳增利债券型证券投资基金、兴全合润分级股票型证券投资基金、兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金、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) 共 13 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、专户投资部、研究部、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

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，经济学硕士，荷兰国籍。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。

霍以礼先生（Elio Fattorini），董事，1970年生，工商管理硕士，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）。

皮尔斯·希利尔先生（Piers Hillier），董事，1968年生，管理学硕士，英国国籍。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。

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

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

郭辉先生，监事，1959 年生，经济学博士，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。

李小天女士，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，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，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。

王晓明先生，副总经理，1974 年生，经济学硕士。历任上海中技投资顾问有限公司研究员、投资部经理、公司副总经理，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助理、兴全可转债混合型证券投资基金基金经理、兴全全球视野股票型证券投资基金基金经理、投资副总监、兴全趋势投资混合型证券投资基金 (LOF) 基金经理。现任兴业全球基金管理有限公司副总经理兼投资总监。

## 3、本基金基金经理

申庆先生，1974 年生，工商管理硕士。历任兴业证券研究发展中心研究员；兴业基金管理有限公司行业研究员、兴全趋势证券投资基金 (LOF) 基金经理助理兼基金管理部总监助理。现任本基金基金经理 (2010 年 11 月 2 日起至今)。

#### 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

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

王晓明 兴业全球基金管理有限公司副总经理兼投资总监

傅鹏博 兴业全球基金管理有限公司研究部总监，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副总监，兴全全球视野股票型证券投资基金、兴全商业模式优选股票型证券投资基金 (LOF) 基金经理、兴全趋势投资混合型证券投资基金 (LOF) 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、制度执行及遵纪守法情况进行内部监察、稽核；出具监察稽核报告，报公司董事会和中国证监会，如发现公司有重大违规行为，应立即向公司董事会和中国证监会报告。

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

## (3) 内部财务控制制度

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

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

## 5、风险管理和内部风险控制措施

(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。

## 第二部分 基金托管人

### 一、基金托管人概况

#### 1、基本情况

名称：中国农业银行股份有限公司（简称中国农业银行）

住所：北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座

法定代表人：蒋超良

成立时间：2009 年 1 月 15 日

注册资本：32,479,411.7 万元人民币

存续期间：持续经营



联系电话：010-63201510

传真：010-63201816

联系人：李芳菲

中国农业银行股份有限公司是中国金融体系的重要组成部分，总行设在北京。经国务院批准，中国农业银行整体改制为中国农业银行股份有限公司并于 2009 年 1 月 15 日依法成立。中国农业银行股份有限公司承继原中国农业银行全部资产、负债、业务、机构网点和员工。中国农业银行网点遍布中国城乡，成为国内网点最多、业务辐射范围最广，服务领域最广，服务对象最多，业务功能齐全的大型国有商业银行之一。在海外，中国农业银行同样通过自己的努力赢得了良好的信誉，每年位居《财富》世界 500 强企业之列。作为一家城乡并举、联通国际、功能齐备的大型国有商业银行，中国农业银行一贯秉承以客户为中心的经营理念，坚持审慎稳健经营、可持续发展，立足县域和城市两大市场，实施差异化竞争策略，着力打造“伴你成长”服务品牌，依托覆盖全国的分支机构、庞大的电子化网络和多元化的金融产品，致力为广大客户提供优质的金融服务，与广大客户共创价值、共同成长。

中国农业银行是中国第一批开展托管业务的国内商业银行，经验丰富，服务优质，业绩突出，2004 年被英国《全球托管人》评为中国“最佳托管银行”。2007 年中国农业银行通过了美国 SAS70 内部控制审计，并获得无保留意见的 SAS70 审计报告，表明了独立公正第三方对中国农业银行托管服务运作流程的风险管理、内部控制的健全有效性的全面认可。中国农业银行着力加强能力建设，品牌声誉进一步提升，在 2010 年首届““金牌理财”TOP10 颁奖盛典”中成绩突出，获“最佳托管银行”奖。2010 年再次荣获《首席财务官》杂志颁发的“最佳资产托管奖”。

中国农业银行证券投资基金托管部于 1998 年 5 月经中国证监会和中国人民银行批准成立，2004 年 9 月更名为托管业务部，内设养老金管理中心、技术保障处、营运中心、委托资产托管处、保险资产托管处、证券投资基金托管处、境外资产托管处、综合管理处、风险管理处，拥有先进的安全防范设施和基金托管业务系统。

## 2、主要人员情况

中国农业银行托管业务部现有员工 140 余名，其中高级会计师、高级经济师、高级工程师、律师等专家 10 余名，服务团队成员专业水平高、业务素质好、服务能力强，高级管理层均有 20 年以上金融从业经验和高级技术职称，精通国内外证券市场的运作。



### 3、基金托管业务经营情况

截止 2013 年 9 月 30 日, 中国农业银行托管的封闭式证券投资基金和开放式证券投资基金共 176 只, 包括富国天源平衡混合型证券投资基金、华夏平稳增长混合型证券投资基金、大成积极成长股票型证券投资基金、大成景阳领先股票型证券投资基金、大成创新成长混合型证券投资基金、长盛同德主题增长股票型证券投资基金、博时内需增长灵活配置混合型证券投资基金、汉盛证券投资基金、裕隆证券投资基金、景福证券投资基金、鸿阳证券投资基金、丰和价值证券投资基金、久嘉证券投资基金、长盛成长价值证券投资基金、宝盈鸿利收益证券投资基金、大成价值增长证券投资基金、大成债券投资基金、银河稳健证券投资基金、银河收益证券投资基金、长盛中信全债指数增强型债券投资基金、长信利息收益开放式证券投资基金、长盛动态精选证券投资基金、景顺长城内需增长开放式证券投资基金、万家增强收益债券型证券投资基金、大成精选增值混合型证券投资基金、长信银利精选开放式证券投资基金、富国天瑞强势地区精选混合型证券投资基金、鹏华货币市场证券投资基金、中海分红增利混合型证券投资基金、国泰货币市场证券投资基金、新华优选分红混合型证券投资基金、交银施罗德精选股票证券投资基金、泰达宏利货币市场基金、交银施罗德货币市场证券投资基金、景顺长城资源垄断股票型证券投资基金、大成沪深 300 指数证券投资基金、信诚四季红混合型证券投资基金、富国天时货币市场基金、富兰克林国海弹性市值股票型证券投资基金、益民货币市场基金、长城安心回报混合型证券投资基金、中邮核心优选股票型证券投资基金、景顺长城内需增长贰号股票型证券投资基金、交银施罗德成长股票证券投资基金、长盛中证 100 指数证券投资基金、泰达宏利首选企业股票型证券投资基金、东吴价值成长双动力股票型证券投资基金、鹏华动力增长混合型证券投资基金、宝盈策略增长股票型证券投资基金、国泰金牛创新成长股票型证券投资基金、益民创新优势混合型证券投资基金、中邮核心成长股票型证券投资基金、华夏复兴股票型证券投资基金、富国天成红利灵活配置混合型证券投资基金、长信双利优选灵活配置混合型证券投资基金、富兰克林国海深化价值股票型证券投资基金、申万巴黎竞争优势股票型证券投资基金、新华优选成长股票型证券投资基金、金元惠理成长动力灵活配置混合型证券投资基金、天治稳健双盈债券型证券投资基金、中海蓝筹灵活配置混合型证券投资基金、长信利丰债券型证券投资基金、金元惠理丰利债券型证券投资基金、交银施罗德先锋股票证券投资基金、东吴进取策略灵活配置混合型开放式证券

投资基金、建信收益增强债券型证券投资基金、银华内需精选股票型证券投资基金 (LOF)、大成行业轮动股票型证券投资基金、交银施罗德上证 180 公司治理交易型开放式指数证券投资基金联接基金、上证 180 公司治理交易型开放式指数证券投资基金、富兰克林国海沪深 300 指数增强型证券投资基金、南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)、景顺长城能源基建股票型证券投资基金、中邮核心优势灵活配置混合型证券投资基金、工银瑞信中小盘成长股票型证券投资基金、东吴货币市场证券投资基金、博时创业成长股票型证券投资基金、招商信用添利债券型证券投资基金、易方达消费行业股票型证券投资基金、富国汇利分级债券型证券投资基金、大成景丰分级债券型证券投资基金、兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金(LOF)、工银瑞信深证红利交易型开放式指数证券投资基金、工银瑞信深证红利交易型开放式指数证券投资基金联接基金、富国可转换债券证券投资基金、大成深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金、大成深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、泰达宏利领先中小盘股票型证券投资基金、交银施罗德信用添利债券证券投资基金、东吴中证新兴产业指数证券投资基金、工银瑞信四季收益债券型证券投资基金、招商安瑞进取债券型证券投资基金、汇添富社会责任股票型证券投资基金、工银瑞信消费服务行业股票型证券投资基金、易方达黄金主题证券投资基金 (LOF)、中邮中小盘灵活配置混合型证券投资基金、浙商聚潮产业成长股票型证券投资基金、嘉实领先成长股票型证券投资基金、广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金、广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、南方保本混合型证券投资基金、交银施罗德先进制造股票证券投资基金、上投摩根新兴动力股票型证券投资基金、富兰克林国海策略回报灵活配置混合型证券投资基金、金元惠理保本混合型证券投资基金、招商安达保本混合型证券投资基金、交银施罗德深证 300 价值交易型开放式指数证券投资基金、南方中国中小盘股票指数证券投资基金 (LOF)、交银施罗德深证 300 价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金、富国中证 500 指数增强型证券投资基金 (LOF)、长信内需成长股票型证券投资基金、大成中证内地消费主题指数证券投资基金、中海消费主题精选股票型证券投资基金、长盛同瑞中证 200 指数分级证券投资基金、景顺长城核心竞争力股票型证券投资基金、汇添富信用债债券型证券投资基金、光大保德信行业轮动股票型证券投资基金、富兰克林国海亚洲 (除日本) 机会股票型证券投资基金、汇添富逆向投资股票型证券投资基金、大成新锐产业股票型证券投资基金、申万菱信中小

板指数分级证券投资基金、广发消费品精选股票型证券投资基金、鹏华金刚保本混合型证券投资基金、汇添富理财 14 天债券型证券投资基金、嘉实全球房地产证券投资基金、金元惠理新经济主题股票型证券投资基金、东吴保本混合型证券投资基金、建新社会责任股票型证券投资基金、嘉实理财宝 7 天债券型证券投资基金、富兰克林国海恒久信用债券型证券投资基金、大成月添利理财债券型证券投资基金、安信目标收益债券型证券投资基金、富国 7 天理财宝债券型证券投资基金、交银施罗德理财 21 天债券型证券投资基金、易方达中债新综合指数发起式证券投资基金(LOF)、工银瑞信信用纯债债券型证券投资基金、大成现金增利货币市场基金、景顺长城支柱产业股票型证券投资基金、易方达月月利理财债券型证券投资基金、摩根士丹利华鑫量化配置股票型证券投资基金、东方央视财经 50 指数增强型证券投资基金、交银施罗德纯债债券型发起式证券投资基金、鹏华理财 21 天债券型证券投资基金、国泰民安增利债券型发起式证券投资基金、万家 14 天理财债券型证券投资基金、华安纯债债券型发起式证券投资基金、金元惠理惠利保本混合型证券投资基金、南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、招商双债增强分级债券型证券投资基金、景顺长城品质投资股票型证券投资基金、中海可转换债券债券型证券投资基金、融通标普中国可转债指数增强型证券投资基金、大成现金宝场内实时申赎货币市场基金、交银施罗德荣祥保本混合型证券投资基金、国泰中国企业境外高收益债券型证券投资基金、富兰克林国海焦点驱动灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城沪深 300 等权重交易型开放式指数证券投资基金、广发聚源定期开放债券型证券投资基金、大成景安短融债券型证券投资基金、嘉实研究阿尔法股票型证券投资基金、新华行业轮换灵活配置混合型证券投资基金、富国目标收益一年期纯债债券型证券投资基金、汇添富高息债债券型证券投资基金、东方利群混合型发起式证券投资基金、南方稳利一年定期开放债券型证券投资基金、景顺长城四季金利纯债债券型证券投资基金、华夏永福养老理财混合型证券投资基金、嘉实丰益信用定期开放债券型证券投资基金、国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金、交银施罗德定期支付双息平衡混合型证券投资基金、光大保德信现金宝货币市场基金、易方达投资级信用债债券型证券投资基金、广发趋势优选灵活配置混合型证券投资基金、华润元大保本混合型证券投资基金、长盛双月红一年期定期开放债券型证券投资基金、富国国有企业债债券型证券投资基金。

## 二、基金托管人的内部风险控制制度说明

### 1、内部控制目标

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

### 2、内部控制组织结构

风险管理委员会总体负责中国农业银行的风险管理与内部控制工作,对托管业务风险管理和内部控制工作进行监督和评价。托管业务部专门设置了风险管理处,配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作,独立行使监督稽核职权。

### 3、内部控制制度及措施

具备系统、完善的制度控制体系,建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程,可以保证托管业务的规范操作和顺利进行;业务人员具备从业资格;业务管理实行严格的复核、审核、检查制度,授权工作实行集中控制,业务印章按规程保管、存放、使用,账户资料严格保管,制约机制严格有效;专门设置业务操作区,并实施封闭管理和音像监控;业务信息由专职信息披露人负责,防止泄密;业务实现自动化操作,防止人为事故的发生,技术系统完整、独立。

### 三、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

基金托管人通过参数设置将《基金法》、《运作办法》、基金合同、托管协议规定的投资比例和禁止投资品种输入监控系统,每日登录监控系统监督基金管理人的投资运作,并通过基金资金账户、基金管理人的投资指令等监督基金管理人的其他行为。

当基金出现异常交易行为时,基金托管人应当针对不同情况进行以下方式的处理:

- 1、电话提示。对媒体和舆论反映集中的问题,电话提示基金管理人;
- 2、书面警示。对本基金投资比例接近超标、资金头寸不足等问题,以书面方式对基金管理人进行提示;
- 3、书面报告。对投资比例超标、清算资金透支以及其他涉嫌违规交易等行为,书面提示有关基金管理人并报中国证监会。



## 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柜台

地址：上海市张杨路 500 号时代广场 20 楼

联系人：何佳怡、黄琳蔚

客户服务电话：400-678-0099、(021) 38824536

直销联系电话：(021) 20398927、20398706

传真：(021) 58368869

- 兴业全球基金管理有限公司网上直销平台(目前已开通建设银行、兴业银行、工商银行、招商银行、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>

客服电话：400-678-0099; (021) 38824536

#### 2、代销机构

- 代销银行

##### (1) 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：[www.abchina.com](http://www.abchina.com)

##### (2) 兴业银行股份有限公司

住所：福州市湖东路 154 号

法定代表人：高建平

电话：(021) 52629999

客户服务热线：95561

公司网站: <http://www.cib.com.cn>

(3) 中国工商银行股份有限公司

住所: 中国北京复兴门内大街 55 号

办公地址: 中国北京复兴门内大街 55 号

法定代表人: 姜建清

客户服务电话: 95588

传真: (010) 66107914

公司网站: <http://www.icbc.com.cn>

(4) 中国邮政储蓄银行股份有限公司

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: 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>

(7) 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>

(8) 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>

(9) 中国宁波银行股份有限公司

住所: 宁波市鄞州区宁南南路 700 号

法定代表人: 陆华裕

客户服务电话: 96528, (北京、上海地区 962528)

传真: (0574) 87050024

公司网站: <http://www.nbc.com.cn>

(10) 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>

(11) 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: [www.bank.pingan.com](http://www.bank.pingan.com)

(12) 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>

(13) 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>

(14) 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>

(15) 中国民生银行股份有限公司

住所 (办公地址): 北京市西城区复兴门内大街 2 号

法定代表人: 董文标

客户服务电话: 95568

传真: (010) 57092611

公司网站: <http://www.cmbc.com.cn>

(16) 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>

(17) 招商银行股份有限公司

住所: 深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

法定代表人: 傅育宁

联系人: 邓炯鹏

电话: (0755) 83198888

传真: (0755) 83195109

客服电话: 95555

公司网站: <http://www.cmbchina.com>

## ● 代销券商

### (1) 兴业证券股份有限公司

住所: 福州市湖东路 268 号

法定代表人: 兰荣

客户服务热线: 4008888123

传真: (021) 38565785

公司网站: <http://www.xyzq.com.cn>

### (2) 国泰君安证券股份有限公司

住所: 上海市浦东新区商城路 618 号

法定代表人: 万建华

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: 吴万善

电话: 83290979

客户咨询电话: 95597

公司网站: <http://www.htsc.com.cn>

(5) 长江证券股份有限公司

住所: 武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

法定代表人: 胡运钊

电话: (027) 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: 上海市淮海中路 98 号

法定代表人: 王开国

办公电话: (021) 23219000

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

公司网站: <http://www.htsec.com>

(7) 招商证券股份有限公司

住所: 深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38—45 层

法定代表人: 宫少林

电话: (0755) 82943666

传真: (0755) 82943636

客户服务热线: 95565、4008888111

公司网站: <http://www.newone.com.cn>

(8) 中国银河证券股份有限公司

住所: 北京市西城区金融大街 35 号 2-6 层

法定代表人: 陈有安

传真: (010) 66568430

客服电话: 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) 山西证券有限责任公司

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) 德邦证券有限责任公司

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) 中银国际证券有限责任公司

住所: 上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 39 层

法定代表人: 许刚

开放式基金咨询电话: 4006208888 或各地营业网点咨询电话

开放式基金业务传真: (021) 50372474

公司网站: <http://www.bocichina.com.cn>

(14) 光大证券股份有限公司

住所: 上海市静安区新闻路 1508 号

法定代表人: 徐浩明

联系电话: (021) 22169081

传真: (021) 22169134

客服热线: 4008888788

公司网站: <http://www.ebscn.com>

(15) 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

传真电话: (0551) 2207114

公司网站: <http://www.gyzq.com.cn>

(16) 湘财证券有限责任公司

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>

(17) 申银万国证券股份有限公司

住所 (办公地址): 上海市常熟路 171 号

法定代表人: 储晓明

电话: (021) 54033888

传真: (021) 54035333

客服电话: (021) 962505

公司网站: <http://www.sywg.com.cn>



(18) 中航证券有限公司

住所: 南昌市红谷中大道 1619 号南昌国际金融大厦 A 栋 41 层

法定代表人: 杜航

联系电话: (0791) 6768763

传真电话: (0791) 6789414

客服电话: 400-8866-567

公司网站: <http://www.avicsec.com>

(19) 渤海证券股份有限公司

住所: 天津经济技术开发区第二大街 42 号写字楼 101 室

法定代表人: 杜庆平

联系电话: (022) 28451861

传真: (022) 28451892

客服电话: 4006515988

公司网站: <http://www.ewww.com.cn>

(20) 瑞银证券有限责任公司

住所: 北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心 12 层、15 层

法定代表人: 刘弘

联系电话: (010) 5832 8752

传真: (010) 5922 8748

客服电话: 400-887-8827

公司网站: <http://www.ubssecurities.com>

(21) 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>

(22) 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) 68889155

传真: (0531) 68889752

客户服务电话: 95538

公司网站: <http://www.qlzq.com.cn>

(23) 爱建证券有限责任公司

住所: 上海市世纪大道 1600 号 32 楼

法定代表人: 郭林

联系电话: (021) 32229888

客服电话: (021) 63340678

公司网站: <http://www.ajzq.com>

(24) 安信证券股份有限公司

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

法定代表人: 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>

(25) 华融证券股份有限公司

住所: 北京市西城区金融大街 8 号

法定代表人: 宋德清

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>

(26) 国信证券股份有限公司

住所: 深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层

法定代表人: 何如

联系电话: (0755) 82130833

传真: (0755) 82133952

客服电话: 95536

公司网站: <http://www.guosen.com.cn>

(27) 东莞证券有限责任公司

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

客户服务电话：961130

公司网站：<http://www.dgzq.com.cn>

(28) 东海证券有限责任公司

住所：江苏省常州市延陵西路 23 号投资广场 18-19 楼

法定代表人：朱科敏

联系电话：(0519) 88157761

传真：(0519) 88157761

客服电话：4008888588、95531

公司网站：<http://www.longone.com.cn>

(29) 长城证券有限责任公司

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：黄耀华

客户服务电话：400666888

公司网站：<http://www.cgws.com>

(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：王东明

统一客服电话：95558

公司网站地址：<http://www.cs.ecitic.com>

(31) 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

统一客服电话：95548

公司网站地址：<http://www.zxwt.com.cn>

(32) 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>

(33) 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: 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>

● 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>

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

二、注册登记机构

名称: 中国证券登记结算有限责任公司

住所: 北京西城区金融大街 27 号投资广场 23 层

法定代表人: 金颖

办公地址: 北京西城区金融大街 27 号投资广场 23 层

联系电话: 010-58598853

传真: 010-58598907

联系人: 任瑞新

### 三、出具法律意见书的律师事务所和经办律师

名称: 通力律师事务所

住所 (办公地址): 上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

负责人: 韩炯

经办律师: 吕红、安冬

电话: 021-31358666

传真: 021-31358600

联系人: 安冬

### 四、审计基金资产的会计师事务所和经办注册会计师

名称: 安永华明会计师事务所

办公地址: 北京市东城区东长安街 1 号东方广场东方经贸城安永大楼 16 层

法定代表人: 葛明

电话: 010-58153000

传真: 010-85188298

经办注册会计师: 徐艳、蒋燕华

联系人: 蒋燕华

## 第四部分 基金的名称

兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF)

## 第五部分 基金的类型

契约型上市开放式

## 第六部分 基金的投资目标

本基金采用指数复制结合相对增强的投资策略，即通过指数复制的方法拟合、跟踪沪深 300 指数，并在严格控制跟踪误差和下方跟踪误差的前提下进行相对增强的组合管理，谋求基金资产的长期增值。本基金力争日均跟踪误差不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 7.75%，日均下方跟踪误差不超过 0.3%，年下方跟踪误差不超过 4.75%。

## 第七部分 基金的投资方向

本基金采用指数复制法进行指数化投资，并结合相对增强的投资策略，追求接近或超越沪深 300 指数所代表的 A 股市场平均收益率水平，为投资者提供一个投资沪深 300 指数的有效投资工具，力争使投资者充分分享中国经济增长和证券市场发展的成果。

本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括投资于国内依法发行上市的股票、债券、权证以及经中国证监会批准允许本基金投资的其它金融工具。法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金投资于股票资产占基金资产的比例为 90%-95%，投资于标的指数成份股、备选成份股的资产占基金资产的比例不低于 90%。现金、债券资产以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的比例为 5%-10%，其中现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。权证及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。



## 第八部分 基金的投资策略及投资组合管理

本基金采用指数复制结合相对增强的投资策略，即通过指数复制的方法拟合、跟踪沪深 300 指数，并在严格控制跟踪误差和下方跟踪误差的前提下进行相对增强的组合管理。指数复制法，即按照标的指数的成份股构成及其权重构建基金股票组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。如因特殊情况导致基金无法获得足够数量的股票时，基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合，追求尽可能贴近标的指数的表现。在严格控制跟踪误差和下方跟踪误差的前提下，本基金还将采取相对增强的投资策略，通过基本面分析对指数成份股权重进行优化调整，并辅以其他增强策略，以求提高本基金的投资收益率。

### 1、资产配置策略

本基金为增强型指数基金，股票投资比例为基金资产的 90%-95%，其中沪深 300 指数的成份股及其备选成份股的投资比例不低于基金资产的 90%。除非因分红或基金持有人赎回或申购等原因，本基金将保持相对固定的股票投资比例，通过结合公司投研团队的基本面研究及数量化投资技术，控制与标的指数的跟踪误差和下方跟踪误差，追求接近或超过标的指数的表现。

### 2、股票投资策略

本基金股票资产投资采用指数增强复制策略，即根据沪深 300 指数成份股的基准权重构建股票投资组合，并根据成份股及其权重的变动而进行相应调整；同时，在严格控制跟踪误差和下方跟踪误差的前提下，本基金将剔除或低配部分明显高估的标的指数成份股，并辅以量化增强及其他辅助增强策略，以期达到增强投资的目的。

#### (1) 指数复制策略 (Index Replication Strategy)

本基金通过指数复制策略进行指数化投资。通常情况下，指数复制策略是指根据标的指数成份股在指数中的权重来确定成份股的买卖数量。在买卖成份股的过程中，尤其在基金建仓期间，本基金可采取适当方法，以降低交易成本。

在特殊情况下，本基金可以选择其他股票或股票组合用来替换标的指数中的股票，这些情况包括但不限于以下情形：①因法律法规的限制或股票停牌等原因，导致本基金不能投资相关股票；②因本基金资产规模过大，导致本基金持有股票比例过高；③标的指数成份股流动性严重不足等。

进行替换遵循的原则如下：①从标的指数成份股及其备选成份股当中选择用以替换的股票；②用以替换的股票与被替换的股票属于同一行业；③用以替换的股票具有较好的流动性；④替换后，该成份股所在行业在基金股票资产组合中的权重与标的指数中该行业权重基本一致；⑤用以替换的股票或股票组合与被替换的股票在考察期内日收益率序列风险收益特征力争高度相关，能较好地代表被替代股票的收益率波动情况；⑥在同一行业中，如无法找到用以替换的股票或者买不到足够用以替换的股票，本基金将考虑跟踪误差和投资者利益等因素，从标的指数成份股及其备选成份股当中，选择用以替换的股票或股票组合。

根据现有法律法规，本基金不能投资于基金托管人发行的股票，本基金将遵循以下原则对基金托管人发行的股票进行替换：①从其他银行股中选择用以替换的股票或股票组合；②用以替换的股票或股票组合与标的指数中被替换股票的权重基本一致；③用以替换的股票或股票组合与被替换股票的风险收益特征力争高度相关，能较好地代表基金托管人发行股票的收益率波动情况。若未来法律法规取消上述限制，本基金可将基金托管人发行的股票纳入投资范围。

## （2）股票增强策略（Equity-based Enhancement Strategy）

本基金在控制跟踪误差和下方跟踪误差，加强风险管理的基础上，进行适度的增强性投资。本基金采取基于基本面的个股相对增强投资策略，即剔除或低配部分标的指数成份股，用其他股票或股票组合进行替换，同时辅以其他辅助增强策略，以求获取超额投资收益。

增强性投资会加大投资组合相对于基准的偏离度，因此本基金采用“跟踪误差”和“下方跟踪误差”这两类指标对投资组合进行监控与评估，进而对增强性投资加以约束，以力争日均跟踪误差不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 7.75%，日均下方跟踪误差不超过 0.3%，年下方跟踪误差不超过 4.75%。

### A、基于基本面的增强（Fundamental-based Enhancement）

鉴于中国股票市场的低效性，存在部分股票估值不合理的现象，本基金将通过对标的指数成份股及其备选成份股的基本面分析，剔除或低配部分标的指数成份股，以达到增强组合收益的效果。具体而言，本基金将剔除或低配具备以下一项或多项特征的股票：

- ①基本面较差，缺乏核心竞争力，经营业绩下滑；
- ②目前股价水平明显高于中长期估值水平，在可比公司中，股票相对估值偏高；

③股价涨幅严重透支其现有业绩支持的股票;

④其他特殊个股,例如预期将从指数中剔除的个股、面临重大的不利行政处罚或司法诉讼的个股、有充分而合理的理由认为其市场价格被操作的个股等。

⑤本基金还对沪深 300 指数成份股及其备选成份股的流动性指标进行评估,在严格控制跟踪误差和下方跟踪误差的前提下,剔除或低配流动性较差的个股。

为达到基金投资比例的要求,本基金将对上述被剔除或低配的个股进行替换,该替换策略将遵循指数复制策略当中的替换原则。

#### B、量化增强策略 (Quantitative Enhancement)

本基金采用 Alpha 多因子模型,在严格控制跟踪误差和下方跟踪误差的前提下,优化指数成分股权重,作为指数增强投资中的参考。

本基金选取价值、成长、盈利、市场特征四大类因子,建立 Alpha 多因子模型。大类因子由一系列单因子组成,其中价值因子主要是指股票的绝对和相对估值水平,包括市盈率、市净率、市销率、EV/EBITDA 等指标;成长因子主要包括上市公司主营业务收入、现金流、净利润等指标的历史增长和预测增长;盈利因子主要包括上市公司毛利率、净利润率、净资产收益率等指标的绝对和相对水平;市场特征因子主要包括股票价格的动量/反转趋势、股票的规模因子以及其他风格因子。

通过 Alpha 多因子模型,本基金对沪深 300 指数成分股进行综合评分,并根据评分结果,在严格控制跟踪误差和下方跟踪误差的前提下,对沪深 300 指数成分股进行权重优化,作为指数增强投资中的参考。

#### C、其他辅助增强 (Other Enhancement)

本基金还可采取以下辅助增强策略,以期在控制风险的前提下,获取超额收益。本基金可投资预期将纳入指数的个股,以及新股发行、增发或配股在内的具有重大投资机会的股票,以增强基金的投资收益。

#### 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,以提高投资效率,增强基金的投资收益。

#### 4、债券投资策略

本基金债券投资部分以保证基金资产流动性、提高基金投资收益为主要目标,主要投资于到期日一年以内的政府债券、金融债等。

在法律法规许可时,本基金可基于谨慎原则运用其他相关金融工具,对基金投

投资组合进行管理。

#### 5、股票指数化投资日常投资组合管理

##### (1) 定期调整

根据标的指数的编制规则及调整公告，本基金在指数成份股调整生效前，分析并确定组合调整策略，及时进行投资组合的优化调整，尽量减少标的指数成份股变动所带来的跟踪误差和下方跟踪误差。

##### (2) 不定期调整

A、若出现标的指数成份股临时调整的情形，本基金管理人将密切关注样本股票的调整，并及时制定相应的投资组合调整策略。

B、跟踪标的指数成份股及其备选成份股公司信息，包括股本变化、分红、配股、增发、停牌、复牌，以及其他重大信息，分析这些信息对指数的影响，并根据这些信息确定基金投资组合的每日交易策略。

C、根据本基金的申购和赎回情况，结合基金的现金头寸管理，制定交易策略以应对基金的申购赎回，从而有效跟踪标的指数。

D、本基金将参与一级市场新股认购和上市公司增发或配股，由此得到的股票将在其规定持有期之后的 10 个交易日内全部卖出，其中标的指数成份股及其备选成份股和将要成为成份股或备选股的除外。

E、因本基金基金合同约定的基金管理人之外的原因导致投资组合超出基金合同的约定时，基金管理人将在 10 个交易日内进行调整，以符合有关限制规定。

##### (3) 跟踪误差的监控与管理

本基金对标的指数的跟踪目标是：力争使得基金净值增长率与业绩比较基准收益率之间的日平均跟踪误差不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 7.75%，日平均下方跟踪误差不超过 0.3%，年下方跟踪误差不超过 4.75%。每日对基金组合与业绩比较基准的收益率偏离度进行跟踪，每月末、季度末定期分析基金跟踪误差变化情况及其原因，并给出优化跟踪误差的基金管理方案。日均跟踪误差和日均下方跟踪误差的计算公式如下：

$$\text{日均跟踪误差} = \sqrt{\frac{\sum_{i=1}^n (r_i - \bar{r})^2}{n-1}}, \text{ 其中}$$

$r_i$  = 第  $i$  日基金份额净值收益率 - 第  $i$  日业绩比较基准收益率；

$$\bar{r} = \frac{\sum_{i=1}^n r_i}{n}, \quad n \text{ 为考察的天数。}$$

$$\text{日均下方跟踪误差} = \sqrt{\frac{\sum_{i=1}^n (r_i - \bar{r})^2}{n-1}}, \quad \text{其中}$$

$r_i = \text{Min}(0, \text{第 } i \text{ 日基金份额净值收益率} - \text{第 } i \text{ 日业绩比较基准收益率})$ ;

$$\bar{r} = \frac{\sum_{i=1}^n r_i}{n}, \quad n \text{ 为考察的天数。}$$

年跟踪误差和年下方跟踪误差的计算公式如下:

年跟踪误差 = 日均跟踪误差  $\times \sqrt{K}$ , 其中  $K$  为一年的实际交易天数;

年下方跟踪误差 = 日均下方跟踪误差  $\times \sqrt{K}$ , 其中  $K$  为一年的实际交易天数。

## 第九部分 基金的业绩比较基准

本基金的业绩基准为: 沪深 300 指数  $\times 95\%$  + 同业存款利率  $\times 5\%$

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

本基金属于股票型基金，预期风险与预期收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数增强型基金，跟踪标的指数市场表现，追求接近或超越沪深 300 指数所代表的市场平均收益，是股票基金中处于中等风险水平的基金产品。

## 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。

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

本投资组合报告所载数据取自兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF) 2013 年第 3 季度报告，所载数据截至 2013 年 9 月 30 日，本报告中所列财务数据未经审计。

### 1、报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额 (元)	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	1,336,912,127.97	94.38
	其中：股票	1,336,912,127.97	94.38
2	固定收益投资	61,126,549.97	4.32
	其中：债券	61,126,549.97	4.32
	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	16,772,970.37	1.18
6	其他资产	1,648,289.48	0.12
7	合计	1,416,459,937.79	100.00

### 2、报告期末按行业分类的股票投资组合

#### (1) 指数投资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	4,141,161.79	0.29
B	采矿业	105,569,198.37	7.49
C	制造业	398,697,169.13	28.28
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	37,019,330.75	2.63
E	建筑业	46,936,427.23	3.33
F	批发和零售业	50,457,482.08	3.58
G	交通运输、仓储和邮政业	29,337,602.98	2.08
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	14,710,124.58	1.04
J	金融业	494,442,949.75	35.07
K	房地产业	64,072,622.95	4.54
L	租赁和商务服务业	10,924,561.68	0.77
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	9,836,787.28	0.70
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	4,413,663.22	0.31
S	综合	1,568,546.18	0.11
	合计	1,272,127,627.97	90.22

## (2) 积极投资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	16,120,000.00	1.14
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
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	1,620,000.00	0.11
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	47,044,500.00	3.34
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
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	64,784,500.00	4.59

### 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

(1) 期末指数投资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	600016	民生银行	6,314,196	60,363,713.76	4.28
2	601318	中国平安	1,671,170	59,660,769.00	4.23
3	600036	招商银行	5,200,875	56,793,555.00	4.03
4	600000	浦发银行	4,820,768	48,641,549.12	3.45
5	601166	兴业银行	4,309,985	48,142,532.45	3.41
6	000895	双汇发展	981,829	45,605,957.05	3.23
7	601328	交通银行	8,294,096	35,664,612.80	2.53
8	601088	中国神华	1,534,281	25,576,464.27	1.81
9	000933	神火股份	4,658,084	25,572,881.16	1.81
10	000002	万科 A	2,764,056	25,235,831.28	1.79

(2) 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资  
 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	000732	泰禾集团	3,970,000	47,044,500.00	3.34
2	000919	金陵药业	1,770,000	14,744,100.00	1.05
3	000721	西安饮食	300,000	1,620,000.00	0.11
4	002219	独一味	35,000	697,200.00	0.05
5	600775	南京熊猫	110,000	678,700.00	0.05

### 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	59,834,000.00	4.24
2	央行票据	-	-
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	中期票据	-	-
7	可转债	1,292,549.97	0.09
8	其他	-	-
9	合计	61,126,549.97	4.34

#### 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	130002	13 付息国债 02	400,000	39,916,000.00	2.83
2	130007	13 付息国债 07	200,000	19,918,000.00	1.41
3	110024	隧道转债	11,500	1,170,585.00	0.08
4	110023	民生转债	1,000	105,810.00	0.01
5	128002	东华转债	130	16,154.97	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名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 8、报告期末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。

#### 9、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。

#### 10、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	171,266.75
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	148,458.50
4	应收利息	1,046,939.89
5	应收申购款	281,624.34
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,648,289.48

(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	110023	民生转债	105,810.00	0.01

(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

① 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

② 报告期末积极投资前五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	000721	西安饮食	1,620,000.00	0.11	非公开发行
2	600775	南京熊猫	678,700.00	0.05	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 11 月 2 日，基金业绩截止日 2013 年 9 月 30 日。

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	① - ③	② - ④
2013 年第 3 季度	11.25%	1.38%	9.02%	1.36%	2.23%	0.02%
2013 年上半年	-12.18%	1.45%	-12.11%	1.42%	-0.07%	0.03%
2012 年度	9.40%	1.19%	7.30%	1.22%	2.10%	-0.03%
2011 年度	-19.79%	1.14%	-23.82%	1.23%	4.03%	-0.09%
2010 年度	-3.80%	0.60%	-9.42%	1.62%	5.62%	-1.02%
自基金合同成立起至 2013 年 9 月 30 日	-17.53%	1.21%	-29.05%	1.30%	11.52%	-0.09%

注：2010 年度数据统计期间为 2010 年 11 月 2 日（基金合同成立之日）至 2010 年 12 月 31 日，不满一年。

## 第十四部分 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、与基金使用相关指数有关的费用；
- 9、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 0.8% 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 0.15% 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、基金指数使用费用

基金管理人可与指数许可方签订书面协议，约定指数使用的费用及支付方式。指数使用费用包括指数许可使用固定费和指数许可使用基点费。其中，指数许可使用固定费是为获取使用指数开发基金而支付的一次性费用，不列入基金费用；每季度指数许可使用基点费的下限为 5 万元，在通常情况下，指数许可使用基点费按前一日的基金资产净值的 0.016% 年费率计提，从基金财产中列支，每日计算，逐日累计，按季支付，计算方法如下：

$H = E \times 0.016\% \div \text{当年天数}$ （H 为每日应付的指数许可使用基点费，E 为前一日的基金资产净值）

4、上述一中 3 到 8 项费用由基金托管人根据其他有关法律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。基金管理人必须最迟于新的费率实施 2 日前在指定媒体上刊登公告。**

#### **六、与基金销售有关的费用**

本基金认购费的费率水平、计算公式、收取方式和使用方式请详见本招募说明书“第六部分 基金的募集”中“八、基金的面值、认购价格和认购费用”中的相关规定。

本基金的申购费、赎回费的费率水平、计算公式、收取方式和使用方式请详见本招募说明书“第九部分 基金份额的场外申购与赎回”中的“六、场外申购和赎回的费用”中的相关规定。

#### **七、基金税收**

基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定，履行纳税义务。

## **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 2013 年 6 月 15 日刊登《兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF) 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、“第二部分 释义”部分**

更新了“基金转换”的定义。

### **三、“第三部分 基金管理人”部分**

1、更新了公司董事会、监事会成员，更换了两名董事，增加了一名职工监事；

并更新了个别董事、监事的简历。

- 2、更新了个别高级管理人员的基本情况。
- 3、更新了个别投资决策委员会成员的简历。

#### 四、“第四部分 基金托管人”部分

更新了基金托管人主要人员情况、基金托管业务经营情况。

#### 五、“第五部分 相关服务机构”部分

- 1、更新了基金管理人的网上直销关联银行卡。
- 2、更新了个别销售机构相关信息。
- 3、增加“信达证券股份有限公司”作为销售代理机构。

#### 六、“第九部分 基金份额的场外申购与赎回”部分

增加了本公司网上直销平台申购及追加申购起点的规定。

#### 七、“第十二部分 基金的投资”部分

更新了“十三、基金投资组合报告”部分，数据内容取自本基金 2013 年第 3 季度报告，数据截止日为 2013 年 9 月 30 日，所列财务数据未经审计。

#### 八、“第十三部分 基金的业绩”部分

更新了此部分内容，数据截止日为 2013 年 9 月 30 日。

#### 九、第二十二部分 基金合同的内容摘要

更新了基金托管人简况

#### 十、“第二十六部分 其他应披露事项”部分

以下为自 2013 年 5 月 2 日至 2013 年 11 月 1 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	关于旗下基金持有的“上海家化”股票估值调整的公告	2013-5-16
2	关于增加信达证券股份有限公司为旗下部分基金代销机构的公告	2013-5-17
3	关于旗下部分基金参加信达证券基金申购或定期定额投资费率优惠活动的公告	2013-5-17
4	关于长期停牌股票（长信科技）估值政策调整的公告	2013-5-22
5	关于暂停接受银联通顺德农商行网上直销业务申请的公告	2013-6-7
6	关于长期停牌股票（新华医疗）估值政策调整的公告	2013-6-8

7	关于长期停牌股票（华策影视）估值政策调整的公告	2013-6-14
8	关于长期停牌股票（美的电器）估值政策调整的公告	2013-6-25
9	关于在直销渠道开通旗下基金跨 TA 转换业务的公告	2013-6-26
10	关于调整网上直销平台基金转换业务费率的公告	2013-6-26
11	关于旗下部分基金继续参加交通银行网上银行、手机银行基金申购费率优惠活动的公告	2013-6-29
12	旗下各基金 2013 年 6 月 28 日资产净值公告	2013-6-29
13	关于旗下部分基金投资南京熊猫（600775）非公开发行股票的公告	2013-7-4
14	关于旗下部分基金投资西安饮食（000721）非公开发行股票的公告	2013-7-9
15	关于长期停牌股票（掌趣科技）估值政策调整的公告	2013-7-24
16	关于调整网上直销平台申购及追加申购起点的公告	2013-8-5
17	关于增加上海天天基金销售有限公司为旗下部分基金代销机构的公告	2013-8-5
18	关于通过上海天天基金销售有限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	2013-8-5
19	关于部分董事变更的公告	2013-8-6
20	关于长期停牌股票（奥飞动漫）估值政策调整的公告	2013-8-27
21	关于调整网上直销基金转换优惠费率的公告	2013-9-25

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

2013 年 12 月 16 日