# 兴业合润分级股票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
二零一零年十二月

[illegible]

（2）资产配置
投资决策委员会定期召开会议，并依据基金管理部、研究策划部的报告确定基金资产配置的比例；如遇重大事项，投资决策委员会及时召开临时会议作出决策。
（3）构建投资组合
基金经理根据对股票市场及债券市场的判断构建基金组合，并报投资决策委员会备案。
（4）组合的监控和调整
研究策划部协同基金经理对投资组合进行跟踪。研究员应保持对个券和个股的定期跟踪，并及时向基金经理反馈个券和个股的最新信息，以利于基金经理作出相应的调整。
（5）投资指令下达
基金经理根据投资组合方案制订具体的操作计划，并以投资指令的形式下达至集中交易室。
（6）指令执行及反馈
集中交易室依据投资指令进行操作，并将指令的执行情况反馈给基金经理。交易完成后，由交易员完成交易日志报基金经理，交易日志存档备查。
（7）风险控制
风险控制委员会根据市场变化对投资组合计划提出风险防范措施，监察稽核部对投资组合计划的执行过程进行日常监督和实时风险控制，基金经理依据基金申购赎回的情况控制投资组合的流动性风险。
（8）业绩评价
金融工程小组将定期对基金的业绩进行归因分析，找出基金投资管理的长处和不足，为日后的管理提供客观的依据。

## 第九部分 基金的业绩比较基准

本基金的业绩基准为：80%×沪深300指数+20%×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

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

## 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业合润分级股票型证券投资基金2010年第3季度报告，所载数据截至2010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 | 1,866,265,875.80 | 76.88 |
| | 其中：股票 | 1,866,265,875.80 | 76.88 |
| 2 | 固定收益投资 | 153,381,411.20 | 6.32 |
| | 其中：债券 | 153,381,411.20 | 6.32 |
| | 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 | 380,628,163.34 | 15.68 |
| 6 | 其他各项资产 | 27,101,006.74 | 1.12 |
| 7 | 合计 | 2,427,376,457.08 | 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 | 38,450,925.00 | 1.63 |
| B | 采掘业 | 47,524,000.00 | 2.01 |
| C | 制造业 | 830,755,454.30 | 35.18 |
| C0 | 食品、饮料 | 214,646,274.84 | 9.09 |
| C1 | 纺织、服装、皮毛 | 1,239,953.30 | 0.05 |
| C2 | 木材、家具 | – | – |
| C3 | 造纸、印刷 | – | – |
| C4 | 石油、化学、塑胶、塑料 | 188,633,957.21 | 7.99 |
| C5 | 电子 | 152,101,008.66 | 6.44 |
| C6 | 金属、非金属 | 151,698,234.94 | 6.42 |
| C7 | 机械、设备、仪表 | 66,591,052.31 | 2.82 |
| C8 | 医药、生物制品 | 55,844,973.04 | 2.36 |
| C99 | 其他制造业 | – | – |
| D | 电力、煤气及水的生产和供应业 | – | – |
| E | 建筑业 | 6,606,000.00 | 0.28 |
| F | 交通运输、仓储业 | 16,560,000.00 | 0.70 |
| G | 信息技术业 | 292,342,626.62 | 12.38 |
| H | 批发和零售贸易 | 207,034,973.88 | 8.77 |
| I | 金融、保险业 | 184,315,849.60 | 7.80 |
| J | 房地产业 | 160,619,198.17 | 6.80 |
| K | 社会服务业 | 8,380,025.22 | 0.35 |
| L | 传播与文化产业 | 39,787,364.61 | 1.68 |
| M | 综合类 | 33,889,458.40 | 1.43 |
| | 合计 | 1,866,265,875.80 | 79.02 |

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 | 600050 | 中国联通 | 22,999,768 | 116,838,821.44 | 4.95 |
| 2 | 600015 | 华夏银行 | 8,055,832 | 87,002,985.60 | 3.68 |
| 3 | 000869 | 张 裕 A | 712,963 | 85,548,430.37 | 3.62 |
| 4 | 000829 | 天音控股 | 5,113,539 | 83,964,310.38 | 3.56 |
| 5 | 600585 | 海螺水泥 | 3,395,300 | 76,835,639.00 | 3.25 |
| 6 | 600143 | 金发科技 | 4,679,282 | 63,591,442.38 | 2.69 |
| 7 | 600048 | 保利地产 | 4,499,857 | 55,618,232.52 | 2.36 |
| 8 | 000537 | 广宇发展 | 5,018,639 | 54,954,097.05 | 2.33 |
| 9 | 002232 | 启明信息 | 3,120,226 | 53,075,044.26 | 2.25 |
| 10 | 600352 | 浙江龙盛 | 4,769,466 | 51,557,927.46 | 2.18 |

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 | 147,015,000.00 | 6.23 |
| 3 | 金融债券 | – | – |
| | 其中：政策性金融债 | – | – |
| 4 | 企业债券 | – | – |
| 5 | 企业短期融资券 | – | – |
| 6 | 可转债 | 6,366,411.20 | 0.27 |
| 7 | 其他 | – | – |
| 8 | 合计 | 153,381,411.20 | 6.49 |

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 | 1001043 | 10央行票据43 | 1,500,000 | 147,015,000.00 | 6.23 |
| 2 | 126630 | 铜陵转债 | 46,040 | 6,366,411.20 | 0.27 |

6、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有资产支持证券。
7、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。
8、投资组合报告附注
（1）本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，并且未在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。
（2）本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。
（3）其他各项资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 3,570,400.72 |
| 2 | 应收证券清算款 | 22,312,125.39 |
| 3 | 应收股利 | – |
| 4 | 应收利息 | 1,044,874.68 |
| 5 | 应收申购款 | 144,198.96 |
| 6 | 其他应收款 | – |
| 7 | 待摊费用 | 29,406.99 |
| 8 | 其他 | – |
| 9 | 合计 | 27,101,006.74 |

（4）报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。
（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。

## 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2010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 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 2010年第3季度 | 13.24% | 1.11% | 11.78% | 1.05% | 1.46% | 0.06% |
| 2010年上半年度 | –7.80% | 0.90% | –16.68% | 1.48% | 8.88% | –0.58% |
| 自基金合同成立起至2010年9月30日 | 4.41% | 1.04% | –6.87% | 1.28% | 11.28% | –0.24% |

注：2010年上半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6月30日，不满六个月。

## 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×年管理费率÷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×年托管费率÷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2010年3月18日刊登《兴业合润分级股票型证券投资基金招募说明书》进行了更新，主要更新内容如下：
一、“重要提示”部分
增加了本基金的基金合同生效日期等内容，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
1、增加了公司旗下基金——兴业合润分级股票型证券投资基金、兴业沪深300指数增强型证券投资基金（LOF）。
2、对公司部门设置进行了更新。
3、对基金管理人的个别董事、高级管理人员的任职情况进行了更新。
4、新增1名基金经理，并更新了相关信息。
5、新增2名投资决策委员会成员。
三、“第四部分 基金托管人”部分
对基金托管人的概况、托管业务经营情况和主要人员情况进行了更新。
四、“第五部分 相关服务机构”部分
1、更新了直销机构的电子直销信息。
2、对个别销售代理机构的相关情况进行了更新。
五、“第七部分 基金的募集”部分
删除募集方式、募集期限、认购费用等内容，调整为“本基金经中国证监会证监许可[2010]229号文批准，由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关规定，自2010年3月22日起至2010年4月16日向全社会公开募集。经安永华明会计师事务所验资，募集期募集的基金份额及利息转份额共计3,328,967,444.30份，其中利息结转基金份额共计1,126,495.76份，募集户数为37,556户。”。
六、“第八部分 基金合同的生效”部分
删除基金合同生效条件和不能生效时资金的处理方式等内容，调整为“本基金的基金合同于2010年4月22日正式生效。”。
七、“第九部分 合润A份额与合润B份额的上市与交易”部分
增加基金上市交易时间“2010年5月31日。”。
八、“第十部分 合润基金份额的场外申购、赎回与转换”部分
增加了本基金开放日常申购和赎回的时间。
九、“第十一部分 合润基金份额的场内申购与赎回”部分
增加了本基金开放日常申购和赎回的时间。
十、“第十二部分 运作期内的场内份额配对转换”部分
增加了本基金开通配对转换业务的时间。
十一、“第十四部分 基金的投资”部分
增加了“十、基金投资组合报告”部分，数据内容取自本基金2010年第3季度报告，数据截止日为2010年9月30日，所列财务数据未经审计。
十二、“第十五部分 基金的业绩”部分
增加了此部分内容，数据截止日为2010年9月30日。
十三、“第二十九部分 对基金份额持有人的服务”
对“通知服务”部分内容进行了更新。
十四、“第三十部分 其他应披露事项”部分
以下为自2010年3月19日至2010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 | 兴业合润分级股票型证券投资基金上网发售提示性公告 | 2010-3-22 |
| 2 | 关于开通中国工商银行借记卡基金网上直销业务（含定投）的公告 | 2010-4-2 |
| 3 | 关于运用固有资金认购兴业合润分级股票型证券投资基金的公告 | 2010-4-8 |
| 4 | 兴业合润分级股票型证券投资基金基金合同生效公告 | 2010-4-23 |
| 5 | 兴业合润分级股票型证券投资基金之基础份额开放申购、赎回业务的公告 | 2010-5-19 |
| 6 | 关于兴业合润分级股票型证券投资基金开通定期定额投资业务及定投费率优惠的公告 | 2010-5-19 |
| 7 | 关于兴业合润分级股票型基金参加部分代销机构网上交易等系统申购费率优惠活动的公告 | 2010-5-19 |
| 8 | 关于兴业合润分级股票型基金在部分销售机构开通转换业务的公告 | 2010-5-19 |
| 9 | 关于兴业合润分级股票型证券投资基金场外认购投资者办理跨系统转托管业务的公告 | 2010-5-19 |
| 10 | 关于兴业合润分级股票型证券投资基金调整部分代销机构定期定额投资、转换业务的公告 | 2010-5-22 |
| 11 | 关于兴业合润分级股票型证券投资基金调整部分代销机构转换业务的公告 | 2010-5-25 |
| 12 | 关于增聘兴业合润分级股票型证券投资基金基金经理的公告 | 2010-5-25 |
| 13 | 兴业合润分级股票型证券投资基金开通份额配对转换的公告 | 2010-5-26 |
| 14 | 兴业合润分级股票型证券投资基金之A份额与B份额基金份额上市交易公告书 | 2010-5-26 |
| 15 | 关于旗下基金参加华融证券费率优惠活动的公告 | 2010-5-29 |
| 16 | 兴业合润分级股票型证券投资基金之A份额、B份额上市交易提示性公告 | 2010-5-31 |
| 17 | 关于兴业合润分级股票型证券投资基金增加份额配对转换办理机构的公告 | 2010-6-1 |
| 18 | 关于旗下部分基金在华夏银行开通兴业趋势投资基金与兴业合润分级基金间转换业务的公告 | 2010-6-1 |
| 19 | 关于旗下部分基金在国信证券开通转换业务的公告 | 2010-6-3 |
| 20 | 关于兴业合润分级股票型证券投资基金增加份额配对转换办理机构的公告 | 2010-6-3 |
| 21 | 关于增加申银万国证券为办理旗下基金定期定额投资业务代销机构的公告 | 2010-6-24 |
| 22 | 关于旗下基金参加安信证券网上申购费率优惠活动的公告 | 2010-6-25 |
| 23 | 关于旗下基金参加浦发银行基金定投申购费率优惠活动的公告 | 2010-6-30 |
| 24 | 关于旗下部分基金参加交通银行网上银行基金申购费率优惠活动的公告 | 2010-6-30 |
| 25 | 关于继续参加邮储银行网上银行申购费率优惠活动的公告 | 2010-6-30 |
| 26 | 旗下各基金2010年上半年度资产净值公告 | 2010-7-1 |
| 27 | 关于长期停牌股票估值政策调整及对基金资产净值影响的公告 | 2010-7-1 |
| 28 | 关于旗下基金代销机构名称变更的公告 | 2010-7-10 |
| 29 | 关于开展中国农业银行金穗卡基金网上直销申购费率优惠活动的公告 | 2010-8-20 |
| 30 | 关于长期停牌股票估值政策调整及对基金资产净值影响的公告 | 2010-8-31 |
| 31 | 关于旗下基金2010年半年度报告的更正公告 | 2010-9-1 |
| 32 | 关于兴业合润分级股票型证券投资基金增加份额配对转换办理机构的公告 | 2010-9-1 |
| 33 | 关于旗下基金所持有的中国平安(601318)股票估值方法变更的公告 | 2010-9-3 |
| 34 | 关于旗下部分基金参加华泰证券定期定额申购费率优惠活动的公告 | 2010-9-18 |
| 35 | 关于网上直销平台开通一户多卡功能的公告 | 2010-9-28 |

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
2010年12月6日