

兴全社会责任混合型证券投资基金 更新招募说明书摘要

(2020年5月15日更新)

基金管理人：兴证全球基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

二零二零年五月

【重要提示】

本基金于 2008 年 3 月 7 日经中国证监会证监许可[2008]356 号文核准募集。本基金基金合同于 2008 年 4 月 30 日起正式生效，自该日起兴证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。

本招募说明书是对原《兴全社会责任混合型证券投资基金招募说明书》的更新，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。

本基金基金合同、招募说明书等法律文件中涉及基金风险收益特征或风险状况的表述仅为主要基于基金投资方向与策略特点的概括性表述；而本基金各销售机构依据中国证券投资基金业协会发布《基金募集机构投资者适当性管理实施指引（试行）》及内部评级标准、将基金产品按照风险由低到高顺序进行风险级别评定划分，其风险评级结果所依据的评价要素可能更多、范围更广，与本基金法律文件中的风险收益特征或风险状况表述并不必然一致或存在对应关系。同时，不同销售机构因其采取的具体评价标准和方法的差异，对同一产品风险级别的评定也可能各有不同；销售机构还可能根据监管要求、市场变化及基金实际运作情况等适时调整对本基金的风险评级。敬请投资人知悉，在购买本基金时按照销售机构的要求完成风险承受能力与产品风险之间的匹配检验，并须及时关注销售机构对于本基金风险评级的调整情况，谨慎作出投资决策。

本基金可投资科创板股票。基金资产投资于科创板股票，会面临科创板机制下因投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括但不限于市场风险、流动性风险、信用风险、集中度风险、系统性风险、政策风险等。

投资有风险，投资者认购（或申购）基金时应认真阅读本招募说明书、基金产品资料概要，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为 2020 年 4 月 30 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 2020 年第 1 季度报告，数据截止日为 2020 年 3 月 31 日（财务数据未经审计）。本基金托管人中国建设银行股份有限公司已复核了本次更新的招募说明书中涉及托管业务的相关内容。

本招募说明书关于基金产品资料概要的编制、披露及更新等内容，将不晚于 2020 年 9 月 1 日起执行。

目 录

第一部分	基金管理人	3
第二部分	基金托管人	14
第三部分	相关服务机构	17
第四部分	基金的名称	27
第五部分	基金的类型	27
第六部分	基金的投资目标	28
第七部分	基金的投资方向	28
第八部分	基金的投资策略及投资组合管理	28
第九部分	基金业绩比较基准	37
第十部分	风险收益特征	37
第十一部分	基金投资组合报告	37
第十二部分	基金的业绩	41
第十三部分	基金费用与税收	41
第十四部分	对招募说明书更新部分的说明	43

第一部分 基金管理人

一、基金管理人概况

机构名称：兴证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：上海市浦东新区芳甸路1155号浦东嘉里城办公楼28-30楼

法定代表人：兰荣

联系人：何佳怡

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

兴证全球基金管理有限公司（成立时名为“兴业基金管理有限公司”，以下简称“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，中国证监会批复（证监许可[2008]6号），同意全球人寿保险国际公司（AEGON International B.V）受让公司股权并成为公司股东。2008年4月9日，公司完成股权转让、变更注册资本等相关手续后，公司注册资本由9800万元变更为人民币1.2亿元，其中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%。2008年7月，经中国证监会批准（证监许可[2008]888号），公司于2008年8月25日完成变更公司名称、注册资本等相关手续后，公司名称变更为“兴业全球基金管理有限公司”，注册资本增加为1.5亿元人民币，其中两股东出资比例不变。2016年12月28日，因公司发展需要，公司名称变更为“兴证全球基金管理有限公司”。2020年3月18日，公司名称变更为“兴证全球基金管理有限公司”。

截至2020年4月30日，公司旗下已管理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指数增强型基金（LOF）、兴全绿色投资混合型证券投资

资基金（LOF）、兴全精选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、兴全稳益定期开放债券型发起式债券型证券投资基金、兴全天添益货币市场基金、兴全稳泰债券型证券投资基金、兴全兴泰定期开放债券型发起式证券投资基金、兴全恒益债券型证券投资基金、兴全合宜灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、兴全祥泰定期开放债券型发起式证券投资基金、兴全安泰平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）、兴全恒裕债券型证券投资基金、兴全多维价值混合型证券投资基金、兴全恒瑞三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、兴全合泰混合型证券投资基金、兴全社会价值三年持有期混合型证券投资基金、兴全恒鑫债券型证券投资基金及兴全优选进取三个月持有期混合型基金中基金（FOF）30 只基金。

兴证全球基金管理有限公司总部位于上海，在北京、深圳、厦门、上海设有分公司，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、计划财务部、监察稽核部、风险管理部、运作保障部、基金管理部、固定收益部、研究部、专户投资部、FOF 投资与金融工程部、养老金管理部、交易部、市场部、渠道部、机构业务部、电子商务部、客户服务中心。随着业务发展的需要，公司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、党委书记、法定代表人，1960 年生，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综合处科长，兴业银行总行计划资金部副总经理，兴业银行总行证券业务部副总经理（主持工作），福建兴业证券公司总裁，兴业证券股份有限公司董事长、党委书记、总裁，兴业证券股份有限公司董事长、党委书记。现任兴证全球基金管理有限公司董事长、党委书记及法定代表人，兼任中国证券业协会监事长。

庄园芳女士，董事、总经理，1970 年生，高级工商管理硕士、经济师。历任兴业证券交易业务部干部、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，兴业创新资本管理有限公司董事、兴证国际金融集团有限公司董事、兴证投资管理有限公司执行董事，兴证全球基金管理有限公司董事长及法定代表人。现任兴证全球基金管理有限公司董事、总

经理，兼任兴业证券慈善基金会副理事长。

黄奕林先生，董事，1968年生，经济学博士。历任兴业证券股份有限公司研发中心总经理、投行总部总经理、客户资产管理部总经理、固定收益与衍生产品部总经理、总裁助理、固定收益事业总部总经理等职务。现任兴业证券股份有限公司副总裁、兴业证券股份有限公司上海证券自营分公司总经理，兼任兴证（香港）金融控股有限公司董事、兴证国际控股有限公司董事、兴证国际金融集团有限公司董事会主席、非执行董事。

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，同方全球人寿保险有限公司总经理，全球人寿保险集团执行副总裁、战略发展部负责人、全球人寿美国资产管理控股有限公司董事等职务。现任全球人寿资产管理控股有限公司企业发展负责人。

桑德·马特曼先生（Sander Maatman），董事，1969年生，荷兰国籍，硕士。历任荷兰 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，阿姆韦斯特不动产有限公司监事会成员、全球人寿美国资产管理控股有限公司董事等职务。现任全球人寿资产管理控股有限公司董事、全球首席财务官及运营官，兼任法国邮政银行资产管理有限公司监事会成员。

简·丹尼尔女士（Jane Daniel），董事，1969年生，英国国籍，具备苏格兰特许银行家协会（FCIBS）会员资格、英国特许银行家协会（ACIB）资质。历任国民西敏寺银行职员，苏格兰皇家银行公司银行业务与变革管理部高级经理、公司银行与金融市场部运营风险副主管、财富管理全球企业风险主管、全球交易服务风险主管、全球交易服务和运营风险全球主管、流动性管理与支付首席风险官、国际银行业务运营风险全球主管、国际银行业务首席运营办公室全球控制主管（董事总经理），天利投资欧洲、中东、非洲与亚太地区运营及企业风险主管、全球运营与企业风险主管兼欧洲、中东、非洲地区首席风险官等职务。现任全球人寿资产管理控股有限公司董事、全球首席风险及合规官，兼任 Kames 资本控股有限公司董事、Kames 资本有限公司非执行董事、法国邮政银行资产管理公司监事会成员、全球人寿匈牙利基金管理有限公司监事会成员。

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，兼任中国平安保险独立董事、广东华兴银行独立董事、海能达通信股份有限公司独立董事。

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，上海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，北京大成（上海）律师事务所高级合伙人。现任北京市中伦（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，DAC 财务管理（中国）有限公司董事总经理。现任 DAC 管理有限责任公司董事总经理。

2、监事会成员概况

夏锦良先生，监事会主席，1961年生，高级工商管理硕士。历任兴业证券股份有限公司资产管理部副总经理、风险管理部总经理，兴业期货有限公司总经理，兴业证券股份有限公司合规法律部总经理、合规与风险管理部总经理、合规总监兼合规与风险管理部总经理、财务负责人等职务。现任兴业证券股份有限公司董事、副总裁、首席风险官，兼任兴证（香港）金融控股有限公司董事、证通股份有限公司监事。

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公司副总经理、首席财务官。

秦杰先生，职工监事，1981年生，经济学硕士。历任毕马威华振会计师事务所助理审计经理，德勤华永会计师事务所高级咨询顾问，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，兴证全球基金管理有限公司综合管理部总监。现任兴证全球基金管理有限公司总经理助理、董事会秘书兼监察稽核部总监、风险管理部总监、投融资业务审批部总监。

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，兴证全球基金管理有限公司市场部总监助理。现任兴证全球基金管理有限公司市场部副总监。

3、高级管理人员概况

兰荣先生，董事长、党委书记、法定代表人。（简历请参见上述董事会成员概况）

庄园芳女士，董事、总经理。（简历请参见上述董事会成员概况）

杨卫东先生，督察长，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，兴证全球基金管理有限公司总经理助理兼市场部总监、副总经理兼上海分公司负责人。现任兴证全球基金管理有限公司督察长。

董承非先生，副总经理，1977年生，理学硕士。历任兴证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、基金管理部投资副总监、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、基金管理部投资总监、兴全社会责任混合型证券投资基金基金经理。现任兴证全球基金管理有限公司副总经理兼研究部总监、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。

郑文惠女士，副总经理，1969年生，高级工商管理硕士。历任兴业证券泉州营业部财务部经理、副总经理、总经理，兴业证券运营管理部总经理兼上海分公司副总经理，兴业证券运营管理部总经理兼上海分公司总经理，兴业证券私人财富管理总部总经理兼上海分公司总经理。现任兴证全球基金管理有限公司副总经理兼机构业务部总监、上海兴全睿众资产管理有限公司执行董事。

陈锦泉先生，副总经理，1977年生，工商管理硕士。历任职华安证券（原名为安徽证券）证券投资总部投资经理，平安保险资产运营中心高级组合经理，平安资产管理公司投资管理部副总经理。2010年8月加入兴证全球基金管理有限公司，历任兴全绿色投资股票型基金（LOF）基金经理，专户投资部总监兼投资经理，总经理助理兼专户投资部总监、投资经理。现任兴证全球基金管理有限公司副总经理兼专户投资部总监、固定收益部总监、投资经理。

詹鸿飞先生，副总经理暨首席信息官，1971年生，工商管理硕士。历任建设银行福建省分行信托投资公司、建设银行福建省分行直属支行电脑部职员、信贷员，兴业证券股份有限公司上海管理总部电脑部经理，兴业证券股份有限公司信息技术部总经理助理，兴证全球基金管理有限公司运作保障部副总监，运作保障部总监，总经理助理兼运作保障部总监，总经理助理兼运作保障部总监、交易部总监。现任兴证全球基金管理有限公司副总经理暨首席信息官兼运作保障部总监、交易部总监。

严长胜先生，副总经理，1972年生，高级工商管理硕士。历任武汉海尔电器股份有限公司车间、设计科、销售公司职员，华泰证券股份有限公司综合发展部高级经理，兴业证券股份有限公司研究所、战略规划小组、机构客户部副总经理，民生证券股份有限公司总裁助理、机构销售总部总经理，兴证全球基金管理有限公司总经理助理兼北京分公司总经理，总经理助理兼渠道部总监、北京分公司总经理。现任兴证全球基金管理有限公司副总经理兼渠道部总监、北京分公司总经理。

4、本基金基金经理

季文华先生，理学硕士。历任兴业证券股份有限公司证券研究分析师，嘉实基金管理有限公司研究员、基金经理。现任兴全社会责任混合型证券投资基金基金经理。

董承非先生，理学硕士。（简历请参见上述高级管理人员概况）

本基金历任基金经理：

刘兆洋先生，于2008年4月30日至2009年8月27日期间担任本基金基金经理

傅鹏博先生，于2009年1月16日至2018年3月21日期间担任本基金基金经理

董理先生，于2017年12月25日至2019年4月2日期间担任本基金基金经理

5、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。公募投资决策委员会由以下成员组成：

庄园芳 兴证全球基金管理有限公司董事、总经理

董承非 兴证全球基金管理有限公司副总经理兼研究部总监、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

谢治宇 兴证全球基金管理有限公司总经理助理、基金管理部投资总监兼兴全合润分级混合型证券投资基金基金经理、兴全合宜灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、兴全社会价值三年持有期混合型证券投资基金基金经理

上述人员之间不存在近亲属关系。

三、基金管理人的职责

- 1、依法募集基金，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、编制季度报告、中期报告和年度报告；
- 7、计算并公告基金净值信息，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：公司设立独立的风险管理部、监察稽核部，风险管理部、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，风险管理部、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) 风险管理部、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、基金托管人情况

(一) 基本情况

名称：中国建设银行股份有限公司(简称：中国建设银行)

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：田国立

成立时间：2004 年 09 月 17 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12 号

联系人：田 青

联系电话：(010)6759 5096

中国建设银行成立于 1954 年 10 月，是一家国内领先、国际知名的大型股份制商业银行，总部设在北京。本行于 2005 年 10 月在香港联合交易所挂牌上市(股票代码 939)，于 2007 年 9 月在上海证券交易所挂牌上市(股票代码 601939)。

2018 年末，集团资产规模 23.22 万亿元，较上年增长 4.96%。2018 年度，集团实现净利润 2,556.26 亿元，较上年增长 4.93%；平均资产回报率和加权平均净资产收益率分别为 1.13%和 14.04%；不良贷款率 1.46%，保持稳中有降；资本充足率 17.19%，保持领先同业。

2018年，本集团先后荣获新加坡《亚洲银行家》“2018年中国最佳大型零售银行奖”、“2018年中国全面风险管理成就奖”；美国《环球金融》“全球贸易金融最具创新力银行”、《银行家》“2018最佳金融创新奖”、《金融时报》“2018年金龙奖—年度最佳普惠金融服务银行”等多项重要奖项。本集团同时获得英国《银行家》、香港《亚洲货币》杂志“2018年中国最佳银行”称号，并在中国银行业协会2018年“陀螺”评价中排名全国性商业银行第一。

中国建设银行总行设资产托管业务部，下设综合与合规管理处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、养老金托管处、全球托管处、新兴业务处、运营管理处、托管应用系统支持处、跨境托管运营处、合规监督处等11个职能处室，在安徽合肥设有托管运营中心，在上海设有托管运营中心上海分中心，共有员工300余人。自2007年起，托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计，并已经成为常规化的内控工作手段。

（二）主要人员情况

蔡亚蓉，资产托管业务部总经理，曾先后在中国建设银行总行资金计划部、信贷经营部、公司业务部以及中国建设银行重组改制办公室任职，并在总行公司业务部担任领导职务。长期从事公司业务，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

龚毅，资产托管业务部资深经理（专业技术一级），曾就职于中国建设银行北京市分行国际部、营业部并担任副行长，长期从事信贷业务和集团客户业务等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

黄秀莲，资产托管业务部资深经理（专业技术一级），曾就职于中国建设银行总行会计部，长期从事托管业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

郑绍平，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行投资部、委托代理部、战略客户部，长期从事客户服务、信贷业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

原玗，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行国际业务部，长期从事海外机构及海外业务管理、境内外汇业务管理、国外金融机构客户营销拓展等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

（三）基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履行托管人的各项职责，切实维护资产持有人的合法权益，为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展，中国建设银行托管资产规模不断扩大，托管业务品种不断增加，已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、(R)QFII、(R)QDII、企业年金、存托业务等产品在内的托管业务体系，是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至 2019 年二季度末，中国建设银行已托管 924 只证券投资基金。中国建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平，赢得了业内的高度认同。中国建设银行先后 9 次获得《全球托管人》“中国最佳托管银行”、4 次获得《财资》“中国最佳次托管银行”、连续 5 年获得中债登“优秀资产托管机构”等奖项，并在 2016 年被《环球金融》评为中国市场唯一一家“最佳托管银行”、在 2017 年荣获《亚洲银行家》“最佳托管系统实施奖”。

二、基金托管人的内部控制制度

（一）内部控制目标

作为基金托管人，中国建设银行严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和本行内有关管理规定，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。

（二）内部控制组织结构

中国建设银行设有风险与内控管理委员会，负责全行风险管理与内部控制工作，对托管业务风险控制工作进行检查指导。资产托管业务部配备了专职内控合规人员负责托管业务的内控合规工作，具有独立行使内控合规工作职权和能力。

（三）内部控制制度及措施

资产托管业务部具备系统、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；业务管理严格实行复核、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；业务操作区专门设置，封闭管理，实施音像监控；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

(一) 监督方法

依照《基金法》及其配套法规和基金合同的约定，监督所托管基金的投资运作。利用自行开发的“新一代托管应用监督子系统”，严格按照现行法律法规以及基金合同规定，对基金管理人运作基金的投资比例、投资范围、投资组合等情况进行监督。在日常为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中，对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对各基金费用的提取与开支情况进行检查监督。

(二) 监督流程

1. 每工作日按时通过新一代托管应用监督子系统，对各基金投资运作比例控制等情况进行监控，如发现投资异常情况，向基金管理人进行风险提示，与基金管理人进行情况核实，督促其纠正，如有重大异常事项及时报告中国证监会。
2. 收到基金管理人的划款指令后，对指令要素等内容进行核查。
3. 通过技术或非技术手段发现基金涉嫌违规交易，电话或书面要求基金管理人进行解释或举证，如有必要将及时报告中国证监会。

第三部分 相关服务机构

一、基金份额发售机构

1、直销机构

- 兴证全球基金管理有限公司直销中心

地址：上海市浦东新区芳甸路 1155 号嘉里城办公楼 30 楼

联系人：秦洋洋、沈冰心

直销联系电话：021-20398706、021-20398927

传真：021-58368869、021-58368915

- 兴证全球基金管理有限公司网上直销平台（含微网站、APP）

交易网站：<https://trade.xqfunds.com>、c.xqfunds.com

客服电话：4006780099；（021）38824536

- 直销前置自助式平台

交易网址：<https://www.yypt.com>

<https://i.yypt.com/finance/org/home/homePage.do>

2、代销机构（排序部分先后）

名称	法定代表人	地址	客服电话	网址
中国建设银行股份有限公司	田国立	注册地址：北京市西城区金融大街25号	95533（全国）	http://www.ccb.com
兴业银行股份有限公司	高建平	办公地址：福建省福州市湖东路154号	95561	http://www.cib.com.cn
中国工商银行股份有限公司	陈四清	注册地址：北京市西城区复兴门内大街55号	95588	http://www.icbc.com.cn
中国邮政储蓄银行股份有限公司	李国华	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	95580	http://www.psbc.com
招商银行股份有限公司	李建红	注册地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦	95555	http://www.cmbchina.com
交通银行股份有限公司	彭纯	注册地址：上海市银城中路188号 办公地址：上海市银城中路188号	95559	http://www.bankcomm.com
中信银行股份有限公司	李庆萍	注册地址：北京市东城区朝阳门北大街9号	95558	http://bank.ecitic.com
中国民生银行股份有限公司	洪崎	注册地址：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	95568	http://www.cmbc.com.cn
中国银行股份有限公司	陈四清	注册地址：北京市西城区复兴门内大街1号	95566	http://www.boc.cn
上海浦东发展银行股份有限公司	高国富	注册地址：上海市中山东一路12号	95528	http://www.spdb.com.cn

名称	法定代表人	地址	客服电话	网址
中国光大银行股份有限公司	李晓鹏	注册地址：北京市西城区复兴门外大街6号光大大厦	95595（全国）	http://www.cebbank.com
中国农业银行股份有限公司	周慕冰	注册地址：北京市东城区建国门内大街69号	95599	http://www.abchina.com
宁波银行股份有限公司	陆华裕	注册地址：宁波市鄞州区宁南南路700号	96528（北京、上海地区 962528）	http://www.nbcb.com.cn
华夏银行股份有限公司	李民吉	注册地址：北京市东城区建国门内大街22号华夏银行大厦 办公地址：北京市东城区建国门内大街22号华夏银行大厦	95577	http://www.hxb.com.cn
平安银行股份有限公司	谢永林	注册地址：深圳市深南东路5047号深圳发展银行大厦 办公地址：深圳市深南东路5047号深圳发展银行大厦	95511-3	http://www.bank.pingan.com
渤海银行股份有限公司	李伏安	注册地址：天津市河东区海河东路218号	400-888-8811	http://www.cbhb.com.cn
重庆银行股份有限公司	林军	注册地址：重庆市渝中区邹容路153号	96899（重庆） 400-709-6899（其他）	http://www.cqcbank.com
江苏昆山农村商业银行股份有限公司	张哲清	注册地址：江苏省昆山市前进东路828号	96079	http://www.ksrccb.cn
江苏江南农村商业银行股份有限公司	陆向阳	注册地址：常州市和平中路413号	96005	http://www.jnbank.cc
上海银行股份有限公司	金煜	注册地址：上海市银城中路168号	(021) 962888	http://www.bankofshanghai.com
江苏银行股份有限公司	夏平	注册地址：南京市	025-58587039	http://www.jsbchina.cn

名称	法定代表人	地址	客服电话	网址
有限公司		中华路 26 号 办公地址：南京市 中华路 26 号		
兴业证券股份有 限公司	杨华辉	注册地址：福州市 湖东路 268 号	4008888123	http://www.xyzq.com.cn
国泰君安证券股 份有限公司	杨德红	注册地址：中国 （上海）自由贸易 试验区商城路 618 号	400-8888-666	http://www.gtja.com
中信建投证券股 份有限公司	王常青	注册地址：北京市 朝阳区安立路 66 号 4 号楼 办公地址：北京市 东城区朝内大街 188 号	4008888108	http://www.csc108.com
华泰证券股份有 限公司	周易	办公地址：江苏省 南京市江东中路 228 号华泰证券大 厦	4008888168	http://www.htsc.com.cn
长江证券股份有 限公司	尤习贵	办公地址：武汉市 新华路特 8 号	4008-888-999 027-85808318	http://www.cjsc.com.cn
海通证券股份有 限公司	周杰	注册地址：上海市 广东路 689 号	4008888001 021-962503	http://www.htsec.com
招商证券股份有 限公司	霍达	办公地址：深圳市 福田区福田街道 福华一路 111 号	95565 或 4008888111	http://www.newone.com.cn
中国银河证券股 份有限公司	陈共炎	办公地址：北京市 西城区金融大街 35 号 2-6 层	4008-888-888	http://www.chinastock.com.cn
广发证券股份有 限公司	孙树明	注册地址： 办公地址：广州市 天河区天河北路 183-187 号大都 会广场 43 楼	95575	http://www.gf.com.cn
山西证券股份有 限公司	侯巍	注册地址：山西省 太原市府西街 69 号山西国贸中心 东塔楼 办公地址：山西省 太原市府西街 69	4006661618	http://www.i618.com.cn

名称	法定代表人	地址	客服电话	网址
		号山西国贸中心东塔楼		
东方证券股份有限公司	潘鑫军	注册地址：上海市中山南路 318 号 2 号楼 22 层、23 层、25-29 层	(021) 962506 40088-88506	http://www.dfzq.com.cn
德邦证券股份有限公司	武晓春	办公地址：上海市浦东新区福山路 500 号“城建国际中心” 26 楼	4008888128	http://www.tebon.com.cn
中银国际证券股份有限公司	宁敏	注册地址：上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 39F	4006208888	http://www.bocichina.com
国海证券股份有限公司	何春梅	注册地址：广西桂林市辅星路 13 号	(0771) 5539032	http://www.ghzq.com.cn
光大证券股份有限公司	周健男	注册地址：上海市静安区新闸路 1508 号 办公地址：	4008888788	http://www.ebscn.com
国元证券股份有限公司	蔡咏	注册地址：合肥市梅山路 18 号	4008888777	http://www.gyzq.com.cn
湘财证券股份有限公司	孙永祥	注册地址：长沙市天心区湘府中路 198 号新南城商务中心 A 栋 11 楼	400-888-1551	http://www.xcsc.com
申万宏源证券有限公司	李梅	注册地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层 办公地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层	95523 或 4008895523	http://www.swhysc.com
中航证券有限公司	王晓峰	注册地址：南昌市红谷中大道 1619 号南昌国际金融大厦 A 栋 41 层	400-8866-567	http://www.avicsec.com
渤海证券股份有限公司	王春峰	注册地址：天津市经济技术开发区第二大街 42 号写字楼 101 室	4006515988	http://www.ewww.com.cn

名称	法定代表人	地址	客服电话	网址
瑞银证券有限责任公司	钱于军	注册地址：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心12层、15层 办公地址：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心12层、15层	400-887-8827	http://www.ubssecurities.com
华福证券有限责任公司	黄金琳	注册地址：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	96326（福建省外请加拨0591）	http://www.hfzq.com.cn
中泰证券股份有限公司	李玮	注册地址：山东省济南市经七路86号	95538	http://www.zts.com.cn
爱建证券有限责任公司	祝健	办公地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道1600号1幢32楼	4001962502	www.ajzq.com
安信证券股份有限公司	王连志	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	95517	http://www.essence.com.cn/
华融证券股份有限公司	祝献忠	注册地址：北京市西城区金融大街8号	(010) 58568162	http://www.hrsec.com.cn
国信证券股份有限公司	何如	注册地址：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	95536	http://www.guosen.com.cn
中信证券股份有限公司	张佑君	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	95558	http://www.ecitic.com
中信证券（山东）	姜晓林	注册地址：山东省	95548	http://www.cs.ecitic.com

名称	法定代表人	地址	客服电话	网址
有限责任公司		青岛市崂山区深圳路 222 号 1 号楼 2001		
信达证券股份有限公司	张志刚	注册地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼	400-800-8899	http://www.cindasc.com
国都证券股份有限公司	王少华	联系地址：北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层、10 层	4008188118	
粤开证券股份有限公司	严亦斌	注册地址：惠州市江北东江三路 55 号广播电视新闻中心西面一层大堂和三、四层	95564	http://www.lxsec.com.cn
华鑫证券有限责任公司	俞洋	注册地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 28 层 A01、B01(b) 单元	400-109-9918	http://www.cfsc.com.cn
华西证券股份有限公司	杨炯洋	注册地址：四川省成都市高新区天府二街 198 号	95584	http://www.hxl68.com.cn
平安证券股份有限公司	何之江	注册地址：深圳市福田区益田路 5033 号平安金融中心 61 层-64 层	4006-788-887	http://stock.pingan.com
南京证券股份有限公司	步国旬	注册地址：南京市江东中路 389 号	95386	http://www.njzq.com.cn/
上海华信证券有限责任公司	陈灿辉	注册地址：上海浦东新区世纪大道 100 号环球金融中心 9 楼	4008205999	http://www.shhxzq.com
长城证券股份有限公司	丁益	注册地址：深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 14、16、17 楼	400-666-6888	http://www.cgws.com/
财达证券股份有限公司	翟建强	注册地址：河北省石家庄市桥西区	400-612-8888	http://www.s10000.com

名称	法定代表人	地址	客服电话	网址
		自强路 35 号庄家 金融大厦 23 层 办公地址:		
天相投资顾问有 限公司	林义相	办公地址: 北京市 西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座	(010) 66045678	http:// www.txsec.com
深圳众禄基金销 售股份有限公司	薛峰	注册地址: 深圳市 罗湖区笋岗街道 梨园路物资控股 置地大厦 8 楼 801	4006-788-887	http://www.zlfund.cn 或 http:// www.jjmmw.com
上海好买基金销 售有限公司	杨文斌	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	400-700-9665	http://www.ehowbuy.com
蚂蚁(杭州)基金 销售有限公司	祖国明	注册地址: 杭州市 余杭区仓前街道 文一西路 1218 号 1 栋 202 室	4000766123	www.fund123.cn
上海长量基金销 售有限公司	张跃伟	注册地址: 上海浦 东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室 办公地址: 上海浦 东大道 555 号裕景 国际 B 座 16 层	4000-891-289	http://www.erichfund.com
诺亚正行基金销 售有限公司	汪静波	注册地址: 上海市 虹口区飞虹路 360 弄 9 号 3724 室	400-821-5399	http://www.noah-fund.com
上海天天基金销 售有限公司	其实	注册地址: 上海市 徐汇区龙田路 190 号 2 号楼 2 层	400-1818-188	http://www.1234567.com.cn
和讯信息科技有 限公司	王莉	注册地址: 北京市 朝阳区朝外大街 22 号 1002 室	4009200022	http://licaike.hexun.com
浙江同花顺基金 销售有限公司	凌顺平	注册地址: 浙江省 杭州市文二西路 1 号元茂大厦 903	4008-773-772	http://www.5ifund.com

名称	法定代表人	地址	客服电话	网址
上海陆金所基金销售有限公司	王之光	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	4008219031	http://www.lufunds.com
珠海盈米基金销售有限公司	肖雯	注册地址：珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491	020-89629066	http://www.yingmi.cn
北京蛋卷基金销售有限公司	钟斐斐	注册地址：北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507	4000618518	https://danjuanapp.com/
北京广源达信基金销售有限公司	齐剑辉	注册地址：北京市西城区新街口外大街28号C座六层605室	4006236060	www.niuniufund.com
上海大智慧基金销售有限公司	申健	注册地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路428号1号楼1102单元	021-20219931	https://8.gw.com.cn/
中信期货有限公司	张皓	注册地址：北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦18层	400-9908-826	http://www.citicsf.com/
厦门市鑫鼎盛控股有限公司	陈洪生	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	400-918-0808	http://www.xds.com.cn/
北京增财基金销售有限公司	罗细安	注册地址：北京市西城区南礼士路66号建威大厦1208室 办公地址：	010-67000988-6025	http://www.zcvc.com.cn/
北京肯特瑞基金销售有限公司	江卉	注册地址：北京市海淀区海淀东三街2号4层401-15	400-098-8511	http://kenterui.jd.com

名称	法定代表人	地址	客服电话	网址
		办公地址：北京市亦庄经济开发区科创十一街18号院A座17层		
上海基煜基金销售有限公司	王翔	注册地址：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）	021-65370077	
北京汇成基金销售有限公司	王伟刚	注册地址：北京市海淀区中关村大街E世界财富中心A座1108号	400-619-9059	www.hcjijin.com
上海挖财基金销售有限公司	吕柳霞	注册地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路799号5层04室	021-50810673	http://www.wacaijijin.com
腾安基金销售（深圳）有限公司	刘明军	注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室	95017	www.tenganxinxi.com
中证金牛（北京）投资咨询有限公司	钱昊旻	注册地址：北京市丰台区东管头1号2号楼2-45室 办公地址：北京市西城区宣武门外大街甲1号环球财讯中心A座5层	010-59336544	
天相投资顾问有限公司	林义相	办公地址：北京市西城区金融街19号富凯大厦B座	(010) 66045678	http:// www.txsec.com

基金管理人可根据有关法律、法规的要求，选择其他符合要求的机构代理销售本基金，并在基金管理人网站公示。

二、注册登记机构

名称：兴证全球基金管理有限公司

住所：上海市黄浦区金陵东路368号

办公地址：上海市浦东新区芳甸路 1155 号嘉里城办公楼 28 楼

法定代表人：兰荣

联系人：朱瑞立

电话：(021) 20398888

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

住所（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

经办律师：廖海、吕红

电话：(021) 51150298

传真：(021) 51150398

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：毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）

办公地址：北京市东城区东长安街 1 号东方广场毕马威大楼 8 层

执行事务合伙人：邹俊

经办注册会计师：王国蓓、张楠

电话：(021) 2212 2888

传真：(021) 6288 1889

联系人：张楠

第四部分 基金的名称

兴全社会责任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

本基金追求当期投资收益实现与长期资本增值,同时强调上市公司在持续发展、法律、道德责任等方面的履行。

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、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。

本基金为混合型基金,各类资产的投资比例为:股票投资比例为 65%-95%;债券投资比例为 0%-30%;资产支持证券占 0%-20%;权证投资比例 0%-3%;现金或者到期日在一年以内的政府债券不小于基金资产净值的 5%,其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如果法律法规对该比例要求有变更的,以变更后的比例为准,本基金的投资范围会做相应调整。

本基金投资组合中突出社会责任投资股票的合计投资比例不低于股票资产的 80%。

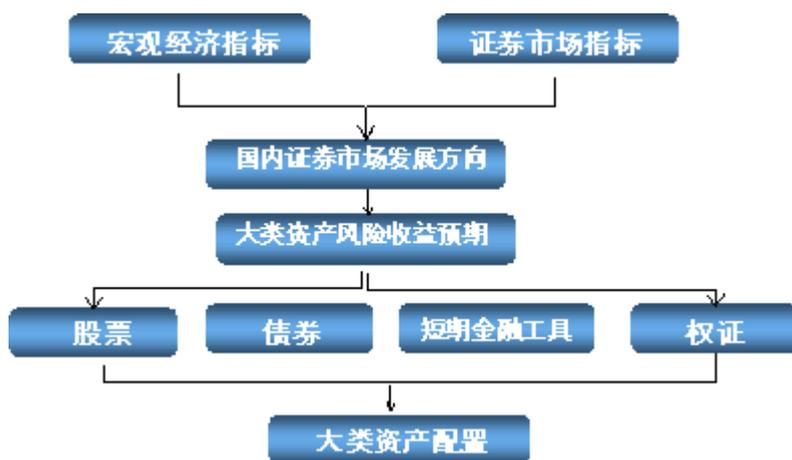
第八部分 基金的投资策略及投资组合管理

(一) 投资策略

本基金采用“自上而下”与“自下而上”相结合的投资策略。

1、大类资产配置策略

在大类资产配置上,本基金采取“自上而下”的方法,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。在宏观与微观层面对各类资产的价值增长能力展开综合评估,动态优化资产配置。



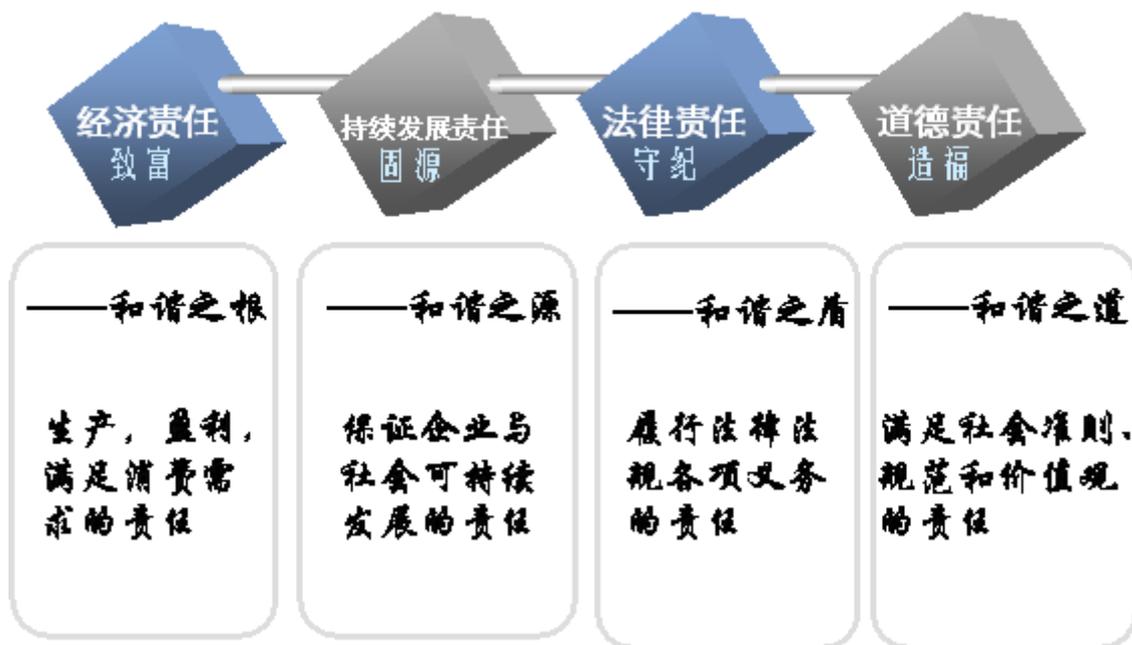
本基金通过动态跟踪海内外主要经济体的 GDP、CPI、利率等宏观经济指标，以及估值水平、盈利预期、流动性、投资者心态等市场指标，确定未来市场变动趋势。本基金通过全面评估上述各种关键指标的变动趋势，对股票、债券等大类资产的风险和收益特征进行预测。根据上述定性和定量指标的分析结果，运用资产配置优化模型，在给定收益条件下，追求风险最小化目标，最终确定大类资产投资权重，实现资产合理配置。

2、行业配置策略

在行业配置策略上，本基金根据行业所处生命周期、景气周期、行业盈利与发展趋势等因素对各行业进行评估，从中选取盈利能力较好、持续发展潜力强的行业。在此基础上，采用“兴全双层行业筛选法”进行优化调整，首先运用“消极筛选法”低配或规避在持续发展责任、法律责任、内外部道德责任履行等方面具有较差表现的行业；其次，运用“积极筛选法”超配或寻求在持续发展责任、法律责任、内外部道德责任履行等方面具有较好表现的行业，定期动态优化行业配置资产。

3、股票投资策略

本基金采用“兴全社会责任四维选股模型”精选股票。



本基金的股票选择程序如下：

首先，根据公司的经济责任表现指标，定期对股票进行初步筛选，经济责任较好的股票进入基础股票池；同时，还剔除社会责任表现指标特别差的某些公司。

在此基础上，按照经济责任、持续发展责任、法律责任、道德责任等不同社会责任对公司价值的相对贡献，对基础股票池中的股票进行二次筛选，进入备选股票池。

对于备选股票池，本基金将定期（一般一个季度）或不定期（突发事件）进行四维风险因子度量，以判断经济责任、持续发展责任、法律责任、道德责任对公司价值的相对贡献因子大小。

同时，本基金将结合研究员对公司社会责任情况的实地调研，定期、动态调整股票组合，并根据实际估值、市场环境等多种因素作出投资决策，从而构建实际股票组合。

本基金的股票选择标准为：

（1）经济责任表现

公司经济责任指公司生产、盈利、满足消费需求的责任表现，其核心是公司创造利润、实现价值的能力。公司的经济责任表现可以通过三个方面进行考察：

A. 财务指标——衡量公司创造利润的表现。

本基金主要通过估值指标（如动态市盈率 PEG、市净率 B/M 等）和增长指标（如主营业务增长率 SG、EBIT 增长率等）进行多重考察。

B. 产品与服务——衡量公司利润创造的源泉。

公司提供的产品和服务是公司实现价值的源泉，也是考察公司对社会贡献的关

键点之一。本基金要求公司所生产或营销的产品和服务具有较强的竞争力、能为公司实现利润、并提高消费者健康水平和生活质量水平，具体而言：

- 产品和服务安全、健康、环保，符合国家消费者商品安全条例；
- 实施质量控制措施和顾客满意原则；
- 对质量安全问题能迅速反应，并采取合理措施；
- 产品广告、包装与产品内容一致。

在具体的量化指标选择上，本基金可通过品牌指标（如市场占有率、行业集中度、品牌渗透率等）和质量指标（如产品合格率、产品返修率等）等进行考察。

C. 治理结构——衡量利润创造的保证。

本基金从多个角度考察公司的治理状况：信息披露程度和强度、董事会的独立性及多样性、执行赔偿、是否关心股东利益等。对那些管理结构较差，委托-代理制度混乱、以及在大股东操纵、内部人控制、担保欺骗、行受贿等方面存在可疑或违法行为的公司，本基金将不予投资。相反，本公司寻求具有以下特征的公司：

- 具有多样化且独立的董事会；
- 具有健全、可操作性强的、责权利明确的公司管理治理规则，能保证内控的贯彻实施；
- 具有完善的风险管理和内部人监督体系；
- 能强化信息披露，保证公司的透明度；
- 注重培养健康、有道德的公司文化

同时，本基金通过股东制衡表现（如大股东持股比例、股东持股量的集中度等）、管理层激励表现（如是否实施股权激励制度、高管人员的持股比例等）等具体量化指标方面进行考察。

（2）其他责任表现

A. 持续发展责任——保证企业与社会可持续发展的责任。

本基金通过两方面对公司进行考察：

一方面是环保责任，即公司保护和利用现有资源的责任履行情况。在评估公司环境保护方面的表现时，本基金要求公司：

- 始终遵守国家及所在地方政府的环境政策和条例；
- 有专门为保护环境及提高资源利用效率的方案及措施；
- 每年有稳定的预算经费用于环境保护及治理；

除上述三个基本标准外，本基金更偏好于满足以下一个或多个要求的公司：

- 公司本身拥有新能源开发、环保相关产品研发、经营等环保产业的一项或多项业务。
- 实施独创性的有效防止污染、节约自然资源的环境保护方案，以表明公司正走在可持续发展的道路上；
- 高层管理者具有环境保护意识和责任，并对那些在环境保护上做出成绩者给与奖赏；
- 对可能造成环境污染的项目进行披露，并采取措施把污染降低到最低程度。

在量化指标选择上，本基金可通过计算公司的单位收入能耗、单位工业产值主要污染物排放量、环保投资率、横向比较公司在同行业的环保表现等方法，评估公司的环保责任表现。

另一方面是创新责任，即公司研发、创造新产品、新资源的责任。

从公司来看，其研发能力、业务创新实力与公司的长期绩效紧密相关；从社会来看，一国的科研与创新能力是实现社会可持续发展的关键点，因此，公司的创新能力表现也是本基金重点关注的因素之一。本基金寻求满足以下一个或多个要求的公司：

- 拥有一项或多项在本行业具有先进水平的自主研发技术；
- 每年新产品推出的速度和数量居行业前列；
- 制订有切实可行的政策，奖励在创新方面做出突出贡献的员工；
- 每年有稳定的经费专用于公司产品或服务的研发、创新。

在量化指标的选择上，本基金可通过两大类指标考察公司的创新能力：一是创新产出指标，如新产品产值率、专利水平等项；二是创新潜力指标，包括技术创新投入率、技术开发人员比率等项。

B. 法律责任——履行法律法规各项义务的责任。

本基金通过两方面对公司进行考察：

一方面是税收责任，即公司按照有关法律法规的规定，照章纳税和承担政府规定的其他责任义务。具体看来，本基金要求公司：

- 积极配合政府的干预和监督，不逃税、偷税、漏税或非法避税；
- 依照各项法律制度及时地缴税、纳税；
- 不存在挤占挪用国家税款的违法行为。

在具体的量化指标上，本基金可通过资产纳税率、税款上缴率等指标对该项进行考察。

另一方面是雇主责任，即公司承担对职工的福利、安全、教育等方面义务的责任。具体看来，本基金要求公司：

- 严格遵守政府建立的各项劳动政策法规和制度条例，提供完备的员工利益保障；

- 具有完备的员工健康安全保障体系以及良好的安全性表现记录；

- 强调使用法律来保障劳资双方的合法权益。

在具体的量化指标上，本基金可通过工资支付率、法定福利支付率、社保提取率、社保支付率等指标对该项进行考察。

C. 道德责任——满足社会准则、规范和价值观、回报社会的责任。

本基金通过两方面对公司进行考察：

一方面是内部道德责任。即公司对内部员工的福利、未来发展等方面所承担的责任。本基金寻求满足以下要求的公司：

- 实施良好的员工培训计划，树立健康的劳工关系以及劳资共赢的观念；

- 建立效益挂钩的绩效制度与利益分享的激励机制。

在具体的量化指标选择上，可以通过员工培训支出比率、员工人均年培训经费、员工工资增长率、就业贡献率等指标对该项进行考察。

另一方面是外部道德责任。即公司对社会慈善事业和其他公益事业的社会责任。本基金所投资的公司须有良好的反馈社会意识，积极投身于有益于国家和社会和谐发展的项目和产业，积极参与公益事业，主动把企业发展与社会发展融为一体，实现企业与社会共同发展。具体而言，本基金偏好于满足以下一个或多个要求的公司：

- 坚定支持所在地的建设和活动，与公司所在地居民和社区的各类发展组织具有良好的合作关系；

- 参与国家政策积极引导、大力提倡的投资项目或产业；

- 参与国家政策积极引导、大力提倡的投资项目或产业（如西部开发等）；

- 在公司慈善、员工自愿者计划、弱势群体扶助等公益方面有较完善的实施计划及良好表现。

在具体的量化指标选择上,本基金可通过捐赠收入比率等指标对该项进行考察。

本基金在精选股票的同时强调以下两个原则:一是行业内社会责任的相对表现;二是辅以优化行业配置策略调整最终的股票投资组合,以避免过高的行业配置风险。

本基金以四维社会责任综合指标作为投资评价依据,将定期(一般一个季度)或不定期(突发事件)进行社会责任指标度量,并对不符合下述标准的股票予以剔除:一是相关指标发生变化导致其综合社会责任指标排名下降,不再符合相应股票组合入选标准的股票;二是发生重大、突发事件,导致某项指标严重违反本基金设定的社会责任标准的股票。剔除的股票品种池将及时告知托管行。

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积极投资策略,发现、确认并利用市场失衡实现组合增值。这些积极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。

本基金还将凭借多年的可转债投资研究力量积累进行可转债品种投资,着重对可转债的发行条款、对应基础股票进行分析与研究,重点关注那些有着较好盈利能力或成长前景的上市公司的可转债,并依据科学、完善的“兴全可转债评价体系”选择具有较高投资价值的个券进行投资。

另外,对于公司发行的各类债券,本基金将参考“兴全社会责任四维选股模型”对相关公司进行筛选。

5、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。

本基金将在进行充分风险控制和遵守中国证监会相关法律法规规定的基础上,投资于未来出现的新投资品种。

二、投资限制

1、组合限制

本基金在投资策略上兼顾投资原则以及开放式基金的固有特点,通过分散投资降低基金财产的非系统性风险,保持基金组合良好的流动性。基金的投资组合将遵循以下限制:

- (1) 本基金持有一家上市公司的股票,其市值不超过基金资产净值的 10%;

- (2) 本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；
- (3) 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司的证券，不超过该证券的 10%；
- (4) 本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；
- (5) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；
- (6) 本基金不得违反本基金合同关于投资范围和投资比例的约定。本基金为混合型基金，各类资产的投资比例为：股票投资比例为 65%–95%；债券投资比例为 0%–30%；资产支持证券占 0%–20%；权证投资比例为 0%–3%；现金或者到期日在一年以内的政府债券不小于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金投资组合中突出社会责任投资股票的合计投资比例不低于股票资产的 80%。
- (7) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；
- (8) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；
- (9) 本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；
- (10) 本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；
- (11) 本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上（含 BBB）的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；
- (12) 基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；
- (13) 本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%；
- (14) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合本条规定的比例限制，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

(15) 本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票,不得超过该上市公司可流通股票的 15%; 本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票,不得超过该上市公司可流通股票的 30%;

(16) 本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的,可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致;

(17) 如果法律法规对本基金合同约定投资组合比例限制进行变更的,以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制,如适用于本基金,则本基金投资不再受相关限制。

除上述第(6)项中“现金或者到期日在一年以内的政府债券不小于基金资产净值的 5%”及第(11)、(14)、(16)项外,因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的,基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。

2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益,基金财产不得用于下列投资或者活动:

- (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) 依照法律法规有关规定,由中国证监会规定禁止的其他活动。
- (9) 法律法规或监管部门取消上述限制,如适用于本基金,则本基金投资不再

受相关限制。

第九部分 基金业绩比较基准

业绩比较基准=80%×沪深 300 指数+20%×中证国债指数

第十部分 风险收益特征

本基金为混合型基金，其基本风险收益特征为较高风险，较高回报。

第十一部分 基金投资组合报告

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。

基金托管人中国建设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社会责任混合型证券投资基金 2020 年第 1 季度报告，所载数据截至 2020 年 3 月 31 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	4,796,620,458.59	92.95
	其中：股票	4,796,620,458.59	92.95
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	295,590,832.43	5.73
	其中：债券	295,590,832.43	5.73
	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	53,221,472.97	1.03
8	其他资产	15,097,597.69	0.29
9	合计	5,160,530,361.68	100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

(1) 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	2,930,940,845.96	57.22
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	269,417,163.31	5.26
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	372,282,953.17	7.27
J	金融业	325,882,109.32	6.36
K	房地产业	218,025,000.00	4.26
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	589,872,685.06	11.52
R	文化、体育和娱乐业	90,199,701.77	1.76
S	综合	-	-
	合计	4,796,620,458.59	93.65

(2) 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

无。

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	002773	康弘药业	12,200,062	479,015,525.21	9.35

2	600763	通策医疗	4,223,777	455,238,685.06	8.89
3	300750	宁德时代	3,100,000	373,209,000.00	7.29
4	300699	光威复材	7,281,004	358,189,368.28	6.99
5	002912	中新赛克	1,965,289	295,834,953.17	5.78
6	601933	永辉超市	26,308,400	269,398,016.00	5.26
7	600036	招商银行	7,000,000	225,960,000.00	4.41
8	600872	中炬高新	4,646,134	222,085,205.20	4.34
9	000002	万科A	8,500,000	218,025,000.00	4.26
10	002415	海康威视	7,500,000	209,250,000.00	4.09

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	252,850,000.00	4.94
	其中：政策性金融债	252,850,000.00	4.94
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）	42,740,832.43	0.83
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	295,590,832.43	5.77

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	170209	17国开09	2,500,000	252,850,000.00	4.94
2	128098	康弘转债	333,319	42,654,832.43	0.83
3	128100	搜特转债	860	86,000.00	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) 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	1,943,299.25
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	5,770,865.23
5	应收申购款	7,383,433.21
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	15,097,597.69

(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

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	300699	光威复材	46,840,000.00	0.91	大宗交易购入流通受限
2	002773	康弘药业	30,966,936.75	0.60	大宗交易购入流通受限

(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 2008 年 4 月 30 日，基金业绩截止日 2020 年 3 月 31 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
2020 年 1 季度	-2.88%	2.26%	-7.23%	1.54%	4.35%	0.72%
2019 年度	44.33%	1.27%	29.44%	0.99%	14.89%	0.28%
2018 年度	-32.49%	1.69%	-19.20%	1.07%	-13.29%	0.62%
2017 年度	41.26%	1.16%	16.73%	0.51%	24.53%	0.65%
2016 年度	-7.38%	1.87%	-8.32%	1.12%	0.94%	0.75%
2015 年度	68.18%	2.78%	8.02%	1.95%	60.16%	0.83%
2014 年度	15.25%	1.19%	39.55%	0.94%	-24.30%	0.25%

2013 年度	18.08%	1.43%	-3.86%	1.09%	21.94%	0.34%
2012 年度	11.49%	1.11%	6.78%	1.00%	4.71%	0.11%
2011 年度	-25.49%	1.09%	-20.16%	1.04%	-5.33%	0.05%
2010 年度	6.60%	1.31%	-8.03%	1.25%	14.63%	0.06%
自基金合同成立起至 2020 年 3 月 31 日	307.14%	1.59%	17.75%	1.30%	289.39%	0.29%

注：2008 年度数据统计期间为 2008 年 4 月 30 日（基金合同成立之日）至 2008 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、在中国证监会规定允许的前提下，本基金可以从基金财产中计提销售服务费，具体计提方法、计提标准在招募说明书或相关公告中载明；
- 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，但应报中国证监会批准。基金管理人必须最迟于新的费率实施2日前在指定媒介上刊登公告。

六、与基金销售有关的费用

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“第八部分 基金份额的申购、赎回与转换”中的“六、申购费率和赎回费率”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

本次招募说明书更新内容为：

- 1、更新了招募说明书“三、基金管理人”中的相关信息；
- 2、更新了招募说明书“九、基金的投资”中基金的投资组合报告；
- 3、更新了招募说明书“十、基金的业绩”中基金的业绩。
- 4、根据相关规定，将招募说明书中“指定媒介”修改为“规定媒介”，将“指定报刊”修改为“规定报刊”，将“指定网站”修改为“规定网站”。

兴证全球基金管理有限公司

2020年5月15日