

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

（2020 年 5 月 19 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：中国农业银行股份有限公司

二〇二〇年五月

【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，自该日起兴证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、基金产品资料概要等法律文件，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。

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。

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 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）。本基金托管人农业银行股份有限公司已复核了本次更新的招募说明书。

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	4
第二部分	基金托管人	15
第三部分	相关服务机构	18
第四部分	基金的名称	25
第五部分	基金的类型	26
第六部分	基金的投资目标	26
第七部分	基金的投资方向	26
第八部分	基金的投资策略及投资组合管理	27
第九部分	基金的业绩比较基准	33
第十部分	基金的风险收益特征	34
第十一部分	基金的投资组合报告	34
第十二部分	基金的业绩	40
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“兴全基金管理有限公司”。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）共 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、专户投资部、固定收益部、研究部、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、董事会成员概况

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

申庆先生，工商管理硕士。历任兴业证券研究发展中心研究员；兴证全球基金管理有限公司研究部行业研究员、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、兴全全球视野股票型证券投资基金基金经理。现任本基金基金经理 (2010 年 11 月 2 日起至今)、兴全恒益债券型证券投资基金基金经理 (2017 年 9 月 20 日起至今)。

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) 基金经理、兴全社会价值三年持有期混合型证券投资基金基金经理

6、上述人员之间不存在亲属关系

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) 不得以任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

五、基金管理人的风险管理与内部控制制度

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

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：周慕冰

成立日期：2009 年 1 月 15 日

批准设立机关和批准设立文号：中国银监会银监复[2009]13 号

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[1998]23 号

注册资本：34,998,303.4 万元人民币

存续期间：持续经营

联系电话：010-66060069

传真：010-68121816

联系人：贺倩

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。自 2010 年起中国农业银行连续通过托管业务国际内控标准（ISAE3402）认证，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”。2012 年荣获第十届中国财经风云榜“最佳资产托管银行”称号；2013 年至 2017 年连续荣获上海清算所授予的“托管银行优秀奖”和中央国债登记结算有限责任公司授予的“优秀托管机构奖”称号；2015 年、2016 年荣获中国银行业协会授予的“养老金业务最佳发展奖”称号；2018 年荣获中国基金报授予的公募基金 20 年“最佳基金托管银行”奖；2019 年荣获证券时报授予的“2019 年度资产托管银行天玑奖”称号。

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，目前内设综合管理部、业务管理部、客户一部、客户二部、客户三部、客户四部、风险合规部、产品研发与信息技术部、营运一部、营运二部、市场营销部、内控监管部、账户管理部，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近 310 名，其中具有高级职称的专家 60 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

截止到 2019 年 12 月 31 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 488 只。

（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；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

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

传真号码：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：400-678-0099；(021) 38824536

2、代销机构

名称	法定代表人	地址	客服电话	网址
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
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
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

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.ceb.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.nbc.com.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
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
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
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
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
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
东莞农村商业银行股份有限公司	何沛良	注册地址：东莞市南城路 2 号 办公地址：东莞市南城路 2 号	961122	www.drcbank.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
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：南京市中华路 26 号 办公地址：南京市中华路 26 号	025-58587039	http://www.jsbc.com.cn
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

名称	法定代表人	地址	客服电话	网址
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 号山西国贸中心东塔楼	4006661618	http://www.i618.com.cn
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
光大证券股份有限公司	周健男	注册地址：上海市静安区新闻路 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

名称	法定代表人	地址	客服电话	网址
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
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
东莞证券股份有限公司	陈照星	注册地址：东莞市莞城区可园南路一号 办公地址：	95328	0
东海证券股份有限公司	赵俊	注册地址：江苏省常州延陵西路 23 号投资广场 18 层	95531 400-8888-5	www.longone.com.cn

名称	法定代表人	地址	客服电话	网址
			88	
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/
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）有限责任公司	姜晓林	注册地址：山东省青岛市崂山区深圳路 222 号 1 号楼 2001	95548	http://www.cs.ecitic.com
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
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
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	http://www.guodu.com
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
中信证券（华南）股份有限公司	胡伏云	注册地址：广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19 层、20 层 办公地址：广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 5 层	95548	http://www.gzs.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
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
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自强路 35 号庄家金融大厦 23 层 办公地址：	400-612-8888	http://www.s10000.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.njq.com.cn/

名称	法定代表人	地址	客服电话	网址
中国中投证券 有限责任公司	高涛	注册地址：深圳市福田区益田路 与福中路交界处荣超商务中心 A 栋第 18-21 层及第 04 层 01. 02. 03. 05. 11. 12. 13. 15. 16. 1 8. 19. 20. 21. 22. 23 单元	95532	www.china-invs .cn
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
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	400-1818-1 88	http://www.123 4567.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
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	400-700-96 65	http://www.eho wbuy.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
浙江同花顺基 金销售有限公 司	吴强	注册地址：浙江省杭州市文二西 路 1 号元茂大厦 903	4008-773-7 72	http://www.5if und.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	020-896290 66	http://www.yin gmi.cn
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.luf unds.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	400-821-53 99	http://www.noa h-fund.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	4006-788-8 87	http://www.zlf und.cn 或 http:// www.jjmmw.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	021-202199 31	https://8.gw.c om.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	400-9908-8 26	http://www.cit icsf.com/

名称	法定代表人	地址	客服电话	网址
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
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.zvc.com.cn/
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	www.jiyufund.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 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	400-098-8511	http://kenterui.jd.com
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
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
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	0

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：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
客服电话：4008-058-058
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（特殊普通合伙）
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：许湘照、汪芳
联系人：汪芳

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%，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。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

一、投资策略

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投资组合，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;

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

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

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

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

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。

二、投资决策依据

- ① 国家有关法律、法规和本基金合同的有关规定;
- ② 海外及国内宏观经济环境;
- ③ 地区及行业发展状况、上市公司研究以及证券市场政策和走势;
- ④ 标的指数的编制方法及其变更、跟踪误差和下方跟踪误差的变动情况。

三、投资限制

本基金的投资组合将遵循以下限制:

- ① 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的比例不低于基金资产净值的 5%，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等，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。因法律法规限制或股票停牌等原因，导致本基金不能投资相关股票，而致使本基金不能满足上述股票投资限制的情况除外。

②本基金持有一家上市公司的股票，其市值不得超过基金资产净值的 10%；

③本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券，不得超过该证券的 10%，本基金符合中国证监会有关要求的指数化投资部分不计入该等限制；

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%；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 5%；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%；

⑤本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基金资产净值的 10%；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%；本基金管理人管理的全部基金持有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%；

⑥基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不得超过本基金的总资产，所申报的股票数量不得超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

⑦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%；

⑧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比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

⑨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%；

⑩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；

⑪如果法律法规或监管机构以后允许基金投资其它金融衍生工具时，投资比例遵从法律法规、基金合同和监管机构的规定；

⑫法律法规及中国证监会规定的其它限制；

法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的，从其规定；如法律法规或监

管部门取消上述限制性规定，履行适当程序后，本基金不受上述规定的限制。

3、投资组合比例调整

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约定。除上述第①项中“现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%”及第⑧、⑩项外，由于证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价、标的指数成分股调整等基金管理人之外的原因导致的投资组合不符合上述约定的比例，基金管理人应在 10 个交易日内进行调整，以达到标准。法律法规另有规定的从其规定。

四、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，本基金禁止从事下列行为：

- 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、向基金管理人、基金托管人出资或者买卖基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；
- 6、买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与基金管理人、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。

若法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，履行适当程序后，本基金投资可不受上述规定限制。

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×95%+同业存款利率×5%

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。

。

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)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	4,878,555,604.37	86.67
	其中：股票	4,878,555,604.37	86.67
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	472,510,591.11	8.39
	其中：债券	472,510,591.11	8.39
	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	82,749,454.00	1.47
8	其他资产	194,952,347.00	3.46
9	合计	5,628,767,996.48	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	3,158,940.00	0.06
B	采矿业	137,847,054.46	2.58
C	制造业	1,852,441,123.41	34.62
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	82,280,770.78	1.54
E	建筑业	101,787,156.77	1.90
F	批发和零售业	50,816,240.74	0.95
G	交通运输、仓储和邮政业	153,239,712.68	2.86
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	384,062,852.94	7.18
J	金融业	1,521,395,594.04	28.43
K	房地产业	183,191,911.15	3.42
L	租赁和商务服务业	103,933,104.47	1.94
M	科学研究和技术服务业	600,582.13	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	46,273,336.00	0.86
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	53,307,596.64	1.00
S	综合	-	-
	合计	4,674,335,976.21	87.35

(2) 积极投资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	1,081,029.60	0.02
B	采矿业	13,051,372.85	0.24
C	制造业	135,789,425.61	2.54
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	14,659.45	0.00
E	建筑业	1,026,921.00	0.02
F	批发和零售业	9,155,840.61	0.17
G	交通运输、仓储和邮政业	184,527.00	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,701,096.72	0.09
J	金融业	4,733,947.42	0.09
K	房地产业	7,457,132.43	0.14
L	租赁和商务服务业	1,565,950.00	0.03
M	科学研究和技术服务业	493,032.24	0.01

N	水利、环境和公共设施管理业	23,425,844.36	0.44
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	1,538,848.87	0.03
S	综合	-	-
	合计	204,219,628.16	3.82

(3) 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

(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	601318	中国平安	4,410,923	305,103,543.91	5.70
2	601601	中国太保	7,313,822	206,396,056.84	3.86
3	600519	贵州茅台	158,000	175,538,000.00	3.28
4	000895	双汇发展	4,207,521	165,355,575.30	3.09
5	002558	巨人网络	9,880,000	156,667,700.00	2.93
6	000100	TCL 科技	39,188,800	155,285,632.00	2.90
7	002773	康弘药业	3,856,347	150,517,861.21	2.81
8	600036	招商银行	4,082,200	131,773,416.00	2.46
9	601336	新华保险	3,235,559	128,775,248.20	2.41
10	000938	紫光股份	3,850,000	126,828,100.00	2.37

(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	600195	中牧股份	3,488,800	45,598,616.00	0.85
2	300450	先导智能	1,108,000	41,505,680.00	0.78
3	601200	上海环境	1,880,098	22,053,549.54	0.41
4	002821	凯莱英	121,418	20,846,256.42	0.39
5	600704	物产中大	1,238,800	5,946,240.00	0.11

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	273,195,479.80	5.11
	其中: 政策性金融债	273,195,479.80	5.11
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)	199,315,111.31	3.72
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	472,510,591.11	8.83

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	500,000	50,570,000.00	0.95
2	108602	国开 1704	390,550	39,090,149.50	0.73
3	132018	G 三峡 EB1	333,880	36,616,619.60	0.68
4	108801	进出 1901	359,880	36,103,161.60	0.67
5	170205	17 国开 05	300,000	30,039,000.00	0.56

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	384,433.03
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	6,785,813.30
5	应收申购款	187,782,100.67
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	194,952,347.00

(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	110051	中天转债	18,243,091.00	0.34
2	132015	18 中油 EB	12,796,851.60	0.24
3	132014	18 中化 EB	12,119,925.60	0.23
4	113020	桐昆转债	4,870,740.00	0.09
5	113527	维格转债	2,750,191.80	0.05
6	110041	蒙电转债	2,275,600.00	0.04
7	132013	17 宝武 EB	2,130,571.10	0.04
8	113525	台华转债	2,117,599.20	0.04
9	113026	核能转债	1,673,828.80	0.03
10	113021	中信转债	1,663,305.00	0.03
11	113011	光大转债	1,223,695.00	0.02

12	110053	苏银转债	1,181,150.10	0.02
13	113537	文灿转债	857,900.40	0.02
14	128022	众信转债	837,200.00	0.02
15	113028	环境转债	823,451.40	0.02
16	127012	招路转债	757,260.00	0.01
17	127005	长证转债	722,672.00	0.01
18	113025	明泰转债	549,628.20	0.01
19	113027	华钰转债	448,113.60	0.01
20	110057	现代转债	417,118.80	0.01
21	113022	浙商转债	320,212.00	0.01
22	128057	博彦转债	305,152.00	0.01
23	123020	富祥转债	297,720.00	0.01
24	127006	敖东转债	268,432.49	0.01
25	128055	长青转 2	264,990.00	0.00
26	113534	鼎胜转债	235,643.20	0.00
27	113528	长城转债	227,952.80	0.00
28	128062	亚药转债	221,553.50	0.00
29	110056	亨通转债	220,168.40	0.00
30	113024	核建转债	209,925.10	0.00
31	110052	贵广转债	207,812.50	0.00
32	128059	视源转债	201,792.00	0.00
33	132012	17 巨化 EB	178,002.00	0.00
34	123022	长信转债	171,937.80	0.00
35	127013	创维转债	157,027.00	0.00
36	128064	司尔转债	155,140.70	0.00
37	128075	远东转债	148,135.00	0.00
38	110058	永鼎转债	143,954.50	0.00
39	113530	大丰转债	127,506.60	0.00
40	123023	迪森转债	122,554.00	0.00
41	110042	航电转债	96,382.80	0.00
42	110055	伊力转债	88,872.00	0.00
43	127011	中鼎转 2	58,980.00	0.00
44	113543	欧派转债	12,180.00	0.00
45	123026	中环转债	3,304.26	0.00
46	110043	无锡转债	3,226.20	0.00
47	128036	金农转债	1,899.50	0.00
48	110038	济川转债	1,159.40	0.00
49	113505	杭电转债	1,098.80	0.00

(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

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	002558	巨人网络	140,057,700.00	2.62	大宗交易购入 流通受限
2	000938	紫光股份	124,355,700.00	2.32	大宗交易购入 流通受限
3	000100	TCL 科技	70,876,000.00	1.32	大宗交易购入 流通受限
4	002773	康弘药业	29,273,063.25	0.55	大宗交易购入 流通受限

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

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限的情况。

(6) 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

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 2020 年 3 月 31 日。

兴全沪深 300A:

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 年第 1 季度	-10.31%	1.84%	-9.49%	1.86%	-0.82%	-0.02%
2019 年度	39.23%	1.15%	34.16%	1.18%	5.07%	-0.03%

2018 年度	-16.95%	1.27%	-24.10%	1.27%	7.15%	0.00%
2017 年度	31.84%	0.64%	20.65%	0.60%	11.19%	0.04%
2016 年度	0.69%	1.28%	-10.61%	1.33%	11.30%	-0.05%
2015 年度	9.51%	2.44%	5.72%	2.36%	3.79%	0.08%
2014 年度	57.16%	1.20%	48.72%	1.15%	8.44%	0.05%
2013 年度	-4.64%	1.35%	-7.14%	1.32%	2.50%	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 2020 年 3 月 31 日	90.70%	1.37%	7.45%	1.38%	83.25%	-0.01%

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。

兴全沪深 300C:

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 年第 1 季度	-10.40%	1.84%	-9.49%	1.86%	-0.91%	-0.02%
2019 年度	16.05%	0.83%	13.16%	0.86%	2.89%	-0.03%
自基金合同成立起至 2020 年 3 月 31 日	3.98%	1.21%	2.43%	1.23%	1.55%	-0.02%

注：自 2019 年 6 月 5 日起增设兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF) C 类份额（代码：007230），C 类份额 2019 年度数据统计期间为 2019 年 6 月 5 日至 2019 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、基金财产划拨支付的银行费用；
- 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：

$H = E \times 0.016\% / \text{当年天数}$ （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 日前在指定媒介上刊登公告。

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。

兴证全球基金管理有限公司

2020年5月19日