

兴全轻资产投资混合型证券投资基金（LOF）  
更新招募说明书  
（2023 年第 1 号）

基金管理人：兴证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

## 重要提示

本基金于2011年12月31日经中国证监会证监许可[2011]2161号文核准募集。本基金基金合同于2012年4月5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《兴全轻资产投资混合型证券投资基金（LOF）更新招募说明书》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，投资人认购（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、信用风险、管理风险、流动性风险、本基金特定风险等。本基金为混合型基金产品，属于较高风险、较高收益的基金品种，其预期风险收益水平高于债券型基金及货币市场基金。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，投资者根据所持有的基金份额享受基金收益，同时承担相应的投资风险。

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。

科创板上市的股票、北交所上市的股票都是国内依法上市的股票，属于《基金法》第七十二条第一项规定的“上市交易的股票”。本基金基金合同中的投资范围中包括国内依法发行上市的股票，且投资科创板、北交所股票均符合本基金基金合同所约定的投资目标、投资策略、投资范围、资产配置比例、风险收益特征和相关风险控制指标。本基金可根据投资目标、投资策略需要或市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于科创板、北交所股票或选择不将基金资产投资于科创板、北交所股票，并非必然投资于科创板、北交所股票。基金管理人在投资科创板、北交所股票过程中，将根据审慎原则进行投资决策和风险管理，保持基金投资风格的一致性，并做好流动性风险管理工作。

本基金的投资范围包括存托凭证，除与其他仅投资于沪深市场股票的基金所面临的共同风险外，本基金还将面临中国存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险，以及与中国存托凭证发行机制相关的风险，包括存托凭证持有人与境外基础证券发行人的股东在法律地位、享有权利等方面存在差异可能引发的风险；存托凭证持有人在分红派息、行使表决权等方面的特殊安排可能引发的风险；存托协议自动约束存托凭证持有人的风险；因多地上市造成存托凭证价格差异以及波动的风险；存托凭证持有人权益被摊薄的风险；存托凭证退市的风险；已在境外上市的基础证券发行人，在持续信息披露监管方面与境内可能存在差异的风险；境内外证券交易机制、法律制度、监管环境差异可能导致的其他风险。

基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况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，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

本次招募说明书更新内容为：

- 1、更新了“基金管理人”、“基金托管人”部分的相关内容。
- 2、更新了“相关服务机构”部分的相关内容。
- 3、更新了“基金的投资”、“基金的业绩”中基金投资组合报告、基金业绩表现部分内容。

4、更新了“对基金份额持有人的服务”部分内容。

5、在“其他应披露事项”更新本期基金临时公告。

除上述内容外，本更新招募说明书所载内容截止日 2023 年 5 月 31 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 2023 年第 1 季度报告，数据截止日为 2023 年 3 月 31 日（财务数据未经审计）。本基金托管人招商银行股份有限公司已复核了本次更新的招募说明书基金的投资和基金的业绩相关内容。

## 目 录

重要提示.....	2
第一部分 绪言.....	7
第二部分 释义.....	8
第三部分 基金管理人.....	13
第四部分 基金托管人.....	25
第五部分 相关服务机构.....	32
第六部分 基金的募集.....	42
第七部分 基金合同的生效.....	43
第八部分 基金份额的上市交易.....	44
第九部分 基金份额的场外申购、赎回与转换.....	46
第十部分 基金份额的场内申购与赎回.....	59
第十一部分 基金份额的登记、系统内转托管和跨系统转托管.....	65
第十二部分 基金的投资.....	67
第十三部分 基金的业绩.....	82
第十四部分 基金的财产.....	83
第十五部分 基金资产的估值.....	85
第十六部分 基金的收益分配.....	91
第十七部分 基金的费用与税收.....	93
第十八部分 基金的会计与审计.....	95
第十九部分 基金的信息披露.....	96
第二十部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算.....	102
第二十一部分 风险揭示.....	105
第二十二部分 基金合同的内容摘要.....	112
第二十三部分 基金托管协议的内容摘要.....	129

第二十四部分	对基金份额持有人的服务 .....	148
第二十五部分	招募说明书存放及查阅方式 .....	150
第二十六部分	其他应披露事项 .....	151
第二十七部分	备查文件 .....	152

## 第一部分 绪言

《兴全轻资产投资混合型证券投资基金（LOF）招募说明书》（以下简称“招募说明书”或“本招募说明书”）依照《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集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》”）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性风险管理规定》”）以及《兴全轻资产投资混合型证券投资基金（LOF）基金合同》（以下简称“基金合同”）编写。

基金管理人承诺本招募说明书不存在任何虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。

兴全轻资产投资混合型证券投资基金（LOF）（以下简称“基金”或“本基金”）是根据本招募说明书所载明的资料申请募集的。本基金管理人没有委托或授权任何其他人提供未在本招募说明书中载明的信息，或对本招募说明书作任何解释或者说明。

本招募说明书根据本基金的基金合同编写，并经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

## 第二部分 释义

在本招募说明书中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

- 1、基金或本基金：指兴全轻资产投资混合型证券投资基金（LOF）
- 2、基金管理人：指兴证全球基金管理有限公司
- 3、基金托管人：指招商银行股份有限公司
- 4、基金合同：指《兴全轻资产投资混合型证券投资基金（LOF）基金合同》及对基金合同的任何有效修订和补充
- 5、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《兴全轻资产投资混合型证券投资基金（LOF）托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充
- 6、招募说明书或本招募说明书：指《兴全轻资产投资混合型证券投资基金（LOF）招募说明书》及其更新
- 7、基金份额发售公告：指《兴全轻资产投资混合型证券投资基金（LOF）份额发售公告》
- 8、法律法规：指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、规范性文件、司法解释、行政规章以及其他对基金合同当事人有约束力的决定、决议、通知等
- 9、《基金法》：指2003年10月28日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，经2012年12月28日第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订，自2013年6月1日起实施，并经2015年4月24日第十二届全国人民代表大会常务委员会第十四次会议《全国人民代表大会常务委员会关于修改〈中华人民共和国港口法〉等七部法律的决定》修正的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 10、《销售办法》：指中国证监会2020年8月28日颁布、同年10月1日实施的《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 11、《信息披露办法》：指中国证监会2019年7月26日颁布、同年9月1日实施的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 12、《运作办法》：指中国证监会2014年7月7日颁布、同年8月8日实



施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》及其不时作出的修订

13、《流动性风险管理规定》：指中国证监会 2017 年 8 月 31 日颁布、同年 10 月 1 日实施的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及颁布机关对其不时做出的修订

14、中国证监会：指中国证券监督管理委员会

15、银行业监督管理机构：指中国银行业监督管理委员会

16、基金合同当事人：指受基金合同约束，根据基金合同享有权利并承担义务的法律主体，包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人

17、个人投资者：指依据有关法律法规规定可投资于证券投资基金的自然人

18、机构投资者：指依法可以投资开放式证券投资基金的、在中华人民共和国境内合法注册登记并存续或经有关政府部门批准设立并存续的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织

19、合格境外机构投资者：指符合现时有效的相关法律法规规定可以投资于中国境内证券市场的中国境外的机构投资者

20、投资人：指个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人的合称

21、基金份额持有人：指依基金合同和招募说明书合法取得基金份额的投资人

22、基金销售业务：指基金管理人或代销机构宣传推介基金，发售基金份额，办理基金份额的申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务

23、销售机构：指直销机构和代销机构

24、直销机构：指兴证全球基金管理有限公司

25、代销机构：指符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金代销业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务代理协议，代为办理基金销售业务的机构，以及可通过深圳证券交易所交易系统办理基金销售业务的会员单位

26、基金销售网点：指直销机构的直销中心及代销机构的代销网点

27、会员单位：具有开放式基金代销资格，经深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的、可通过深圳证券交易所交易系统办理开放式基

金的认购、申购、赎回和转托管等业务的深圳证券交易所会员单位

28、注册登记业务：指基金登记、存管、过户、清算和结算业务，具体内容包括投资人基金账户的建立和管理、基金份额注册登记、基金销售业务的确认、清算和结算、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册、办理非交易过户业务等

29、注册登记机构：指办理注册登记业务的机构。基金的注册登记机构为兴证全球基金管理有限公司或接受兴证全球基金管理有限公司委托代为办理注册登记业务的机构

30、基金账户：指注册登记机构为投资人开立的、记录其持有的、基金管理人所管理的基金份额余额及其变动情况的账户。投资人通过场外销售机构办理基金份额的认购、申购和赎回等业务时需持有基金帐户。记录在该帐户下的基金份额登记在注册登记机构的注册登记系统

31、基金交易账户：指销售机构为投资人开立的、记录投资人通过该销售机构买卖本基金的基金份额变动及结余情况的账户

32、深圳证券帐户：指在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司开设的深圳证券交易所人民币普通股股票帐户或证券投资基金帐户。投资人通过深圳证券交易所交易系统办理场内认购、申购和赎回等业务时需持有深圳证券帐户。记录在该帐户下的基金份额登记在注册登记机构的证券登记结算系统

33、基金合同生效日：指基金募集达到法律法规规定及基金合同规定的条件，基金管理人向中国证监会办理基金备案手续完毕，并获得中国证监会书面确认的日期

34、基金募集期：指自基金份额发售之日起至发售结束之日止的期间，最长不得超过3个月

35、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限

36、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

37、T日：指销售机构在规定时间受理投资人申购、赎回或其他业务申请的工作日

38、T+n日：指自T日起第n个工作日（不包含T日）

39、开放日：指为投资人办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日

40、日：指公历日

- 41、月：指公历月
- 42、交易时间：指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段
- 43、《业务规则》：指《兴证全球基金管理有限公司证券投资基金注册登记业务规则》，是规范基金管理人所管理的证券投资基金登记结算方面的业务规则，由基金管理人和投资人共同遵守
- 44、认购：指在基金募集期内，投资人申请购买基金份额的行为
- 45、申购：指基金合同生效后，投资人根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为
- 46、赎回：指基金合同生效后，基金份额持有人按基金合同和招募说明书规定的条件要求将基金份额兑换为现金的行为
- 47、场外：不通过深圳证券交易所的交易系统办理基金份额认购、申购和赎回等业务的销售机构和场所
- 48、场内：通过深圳证券交易所的交易系统办理基金份额认购、申购和赎回等业务的销售机构和场所
- 49、注册登记系统：指中国证券登记结算有限责任公司开放式基金登记结算系统
- 50、证券登记结算系统：指中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司证券登记结算系统
- 51、基金转换：指基金份额持有人按照本基金合同和基金管理人届时有效公告规定的条件，申请将其持有的基金管理人管理的、某一基金的基金份额转换为基金管理人管理的其他基金基金份额的行为
- 52、转托管：指基金份额持有人在本基金的不同销售机构之间实施的变更所持基金份额销售机构的行为，包括系统内转托管及跨系统转托管
- 53、系统内转托管：指基金份额持有人将持有的基金份额在注册登记系统内不同销售机构（网点）之间或证券登记结算系统内不同会员单位（席位或交易单元）之间进行转登记的行为
- 54、跨系统转托管：指基金份额持有人将持有的基金份额在注册登记系统和证券登记结算系统间进行转登记的行为
- 55、定期定额投资计划：指投资人通过有关销售机构提出申请，约定每期申购日、申购金额及扣款方式，由销售机构于每期约定申购日在投资人指定银

行账户内自动完成扣款及基金申购申请的一种投资方式

56、巨额赎回：指本基金单个开放日，基金净赎回申请（赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过上一日基金总份额的 10% 的情形

57、元：指人民币元

58、基金利润：指基金利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额

59、基金资产总值：指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收申购款及其他资产的价值总和

60、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的净资产值

61、基金份额净值：指计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数

62、基金资产估值：指计算评估基金资产和负债的价值，以确定基金资产净值和基金份额净值的过程

63、流动性受限资产：指由于法律法规、监管、合同或操作障碍等原因无法以合理价格予以变现的资产，包括但不限于到期日在 10 个交易日以上的逆回购与银行定期存款（含协议约定有条件提前支取的银行存款）、停牌股票、流通受限的新股及非公开发行股票、资产支持证券、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券等

64、规定媒介：指中国证监会指定的用以进行信息披露的全国性报刊及指定互联网网站（包括基金管理人网站、基金托管人网站、中国证监会基金电子披露网站）等媒介

65、中国：指中华人民共和国，就基金合同而言，不包括香港特别行政区、澳门特别行政区和台湾地区

66、不可抗力：指基金合同当事人不能预见、不能避免且不能克服的客观事件。

67、基金产品资料概要：指《兴全轻资产投资混合型证券投资基金（LOF）基金产品资料概要》及其更新

## 第三部分 基金管理人

### 一、基金管理人概况

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28-29楼

法定代表人：杨华辉

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2023年5月31日，公司旗下已管理兴全可转债混合型证券投资基金等共58只基金，包括股票型、混合型、债券型、货币型、指数型、FOF等类型。

兴证全球基金管理有限公司总部位于上海，在北京、上海、深圳、厦门设有分公司，并成立了全资子公司——兴证全球资本管理（上海）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、审计部、风险管理部、合规管理部、投融资业务审批部、基金运营部、信息技术

部、基金管理部、研究部、专户投资部、固定收益部、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、营销服务部、国际业务部、基础设施投资部，随着公司业务发展的需要，将对业务部门进行相应的调整。

## 二、主要人员情况

### 1、董事会成员概况

杨华辉先生，董事长、法定代表人，1966年生，经济学博士，高级经济师。历任福建省税务局南平分局科员，兴业银行上海证券业务部负责人，兴业证券上海业务部经理，兴业银行上海分行党委委员、副行长，兴业银行杭州分行党委书记、行长，兴业国际信托有限公司党委书记、董事长等职务。现任兴业证券股份有限公司党委书记、董事长，兴证全球基金管理有限公司董事长、法定代表人，十四届上海市政协委员、常委，中国证券业协会第七届监事会副监事长，上海证券交易所政策咨询委员会副主任委员，福建省证券期货业协会会长，中国财富管理50人论坛理事，兴证（香港）金融控股有限公司董事局主席。

庄园芳女士，副董事长、总经理，1970年生，高级工商管理硕士。历任兴业证券股份有限公司副总裁，兴证全球基金管理有限公司董事长及法定代表人等职务。现任兴证全球基金管理有限公司副董事长、总经理，上海市第十六届人民代表大会代表，上海市黄浦区第三届人民代表大会代表，中国证券投资基金业协会监事会监事、公募基金委员会委员、养老金业务委员会委员、基金行业文化建设委员会委员，上海市基金同业公会副会长、理事、理事会社会责任专业委员会主任委员、理事会人才战略与培训专业委员会委员，上海基金业公益基金会理事长、法定代表人。

边维刚先生，董事，1970年生，经济学博士。历任中国人民银行广州分行货币信贷管理处副处长、反洗钱处处长，中国人民银行上海总部金融稳定评估处处长、反洗钱处处长，兴业银行总行私人银行部副总经理，浙江浙商产融资产管理有限公司副总裁。现任兴业证券股份有限公司上海分公司总经理。

巴斯·尼尔文先生（Bas Nieuwe Weme），董事，1972年生，荷兰国籍，法学硕士。历任 ING 投资管理公司（美洲）管理委员会成员（纽约、亚特兰大、哈特福德）、机构销售和客户服务主管，沃亚金融投资管理公司（纽约）管理委员会成员兼客户组全球主管，保德信金融公司全球投资管理客户组和机构关

系组全球主管等职务。现任荷兰全球人寿保险集团管理委员会成员，全球人寿资产管理控股有限公司董事、全球行政总裁，法国邮政银行资产管理公司监事会成员，荷兰美国基金会（NAF）董事会成员，美国关怀（AmeriCares）基金会领导委员会成员，法国邮政银行资产管理控股公司董事会成员。

万维德先生（Marc van Weede），董事，1965年生，荷兰国籍，文学硕士。历任 Forsythe International N.V. 财务经理，麦肯锡咨询公司全球副董事，荷兰全球人寿保险集团执行副总裁、全球战略与可持续发展负责人等职务。现任全球人寿资产管理控股有限公司企业发展负责人，法国邮政银行资产管理公司监事会成员，荷全私募基金管理（上海）有限公司董事，法国邮政银行资产管理控股公司董事会成员。

曾建良先生，董事，1978年生，中国香港籍，硕士学位。现任全球人寿资产管理（亚洲）有限公司董事、香港区主管，荷全私募基金管理（上海）有限公司董事长。

陆雄文先生，独立董事，1966年生，经济学博士。历任复旦大学市场营销系主任、副院长、常务副院长等职务。现任复旦大学管理学院院长、教授、博士生导师，宝山钢铁股份有限公司独立董事，摩根士丹利证券（中国）有限公司独立董事，浦发硅谷银行有限公司独立董事，中国东方航空股份有限公司独立董事，全国工商管理专业学位研究生教育指导委员会副主任委员，上海长三角商业创新研究院理事。

卢东斌先生，独立董事，1948年生，经济学博士。历任中共吉林省延吉市委办公室常委秘书，延边大学教师，日本东海大学交换研究员，中国人民大学商学院副院长等职务。已退休，现兼任中国管理现代化研究会并购重组专业委员会副主任委员。

周鹤松先生，独立董事，1968年生，工商管理硕士。历任日本学术振兴会研究员，三菱信托银行职员，通用电器资本总公司风险管理领导小组成员、DAC管理有限公司董事总经理。

公司董事会由9名董事组成，其中包括3名独立董事，未发现公司独立董事存在不良诚信记录。

## 2、监事会成员概况

黄奕林先生，监事会主席，1968年生，经济学博士。历任南方证券宏观研

究部经理，深圳证券交易所研究员，兴业证券股份有限公司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，兴证（香港）金融控股有限公司董事。

鲍茨·马吉德先生（Boaz Magid），监事，1978年生，荷兰国籍，工商管理硕士。历任荷兰合作银行集团资产管理及私人银行部风险管理和绩效分析主管、REAAL 保险公司风险管理与合规总监、SNS REAAL 公司保险财资与投资管理部董事总经理、VIVAT 保险公司董事总经理等职务。现任全球人寿保险集团荷兰公司董事、首席投资官，荷兰保险业协会财务和经济事务委员会主席，荷兰 Amvest 公司监事会成员，全球人寿咨询公司董事，全球人寿代理公司董事，全球人寿保险公司董事，全球人寿财产损害赔偿公司董事，全球人寿储蓄公司董事。

石峰先生，职工监事，1980年生，经济学硕士。历任毕马威华振会计师事务所上海分所审计部审计经理，兴证全球基金管理有限公司计划财务部负责人等职务。现任兴证全球基金管理有限公司计划财务部总监。

朱玮女士，职工监事，1982年生，法学硕士。历任中欧基金管理有限公司监察稽核部副总监、兴业基金管理有限公司法律与合规部合规总监、兴证全球基金管理有限公司监察稽核部总监助理等职务。现任兴证全球基金管理有限公司合规管理部副总监（主持工作）、审计部副总监（主持工作）、纪委办公室副主任（主持工作），兴证全球资本管理（上海）有限公司监事。

### 3、高级管理人员概况

杨华辉先生，董事长、法定代表人。（简历请参见上述董事会成员概况）

庄园芳女士，副董事长、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等职务。现任兴证全球基金管理有限公司督察长、纪委书记。

陈锦泉先生，副总经理，1977年生，工商管理硕士。历任华安证券股份有限公司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，兴证全球基金管理有限公司兴全绿色投资混合型证券投资基金（LOF）基金经理、专户投资部总监、总经理助理等职务。现任兴证全球基金管理有限公司党委副书记、副总经理兼专户投资部总监、固定收益部总监、投资经理。

谢治宇先生，副总经理，1981年生，经济学硕士。历任兴证全球基金管理有限公司研究部研究员、专户投资部投资经理、基金管理部基金经理、基金管理部投资副总监兼基金经理、基金管理部投资总监兼基金经理、公司总经理助理兼基金管理部投资总监、基金经理。现任兴证全球基金管理有限公司副总经理兼基金管理部投资总监、研究部总监、国际业务部总监、基金经理。

詹鸿飞先生，副总经理兼首席信息官，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、总监及总经理助理等职务。现任兴证全球基金管理有限公司副总经理兼首席信息官兼基金运营部总监、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等职务。现任兴证全球基金管理有限公司副总经理兼渠道部总监、上海分公司总经理、北京分公司总经理。

秦杰先生，副总经理，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师，毕马威企业咨询（中国）有限公司高级经理，兴证全球基金管理有限公司监察稽核部总监、综合管理部总监、党委办公室主任、纪委办公室主任、总经理助理、合规管理部总监，现任兴证全球基金管理有限公司副总经理兼董事会秘书、风险管理部总监、投融资业务审批部总监，兴证全球资本管理（上海）有限公司执行董事及法定代表人。

#### 4、本基金基金经理

董理先生，理学博士。历任国信智能有限公司系统工程师，嘉实基金管理

有限公司研究员、基金经理，华夏久盈资产管理有限公司投资经理、兴全社会责任混合型证券投资基金基金经理、兴全多维价值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研究部副总监、兴全轻资产投资混合型证券投资基金（LOF）基金经理（2017年11月23日起至今）、兴全趋势投资混合型证券投资基金（LOF）基金经理（2021年10月20日起至今）。

本基金历任基金经理：

陈扬帆先生，于2012年04月05日至2015年01月05日期间，曾管理本基金。

谢治宇先生，于2014年12月08日至2018年05月03日期间，曾管理本基金。

#### 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成员由以下成员组成：

庄园芳 兴证全球基金管理有限公司副董事长、总经理

谢治宇 兴证全球基金管理有限公司副总经理，兼任基金管理部投资总监、研究部总监、国际业务部总监、兴全合润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、兴全趋势投资混合型证券投资基金（LOF）基金经理

乔迁 兴证全球基金管理有限公司基金管理部副总监、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

任相栋 兴证全球基金管理有限公司基金管理部副总监、兴全合泰混合型证券投资基金基金经理、兴证全球合衡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基金收益；
- 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、按照有关规定计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购、赎回的价格；
- 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、法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他职责。

#### **四、基金管理人承诺**

- 1、基金管理人承诺基金管理人将遵守法律法规的相关规定，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，但法律法规或中国证监会另有规定的除外；
  - （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）当时有效的法律法规、中国证监会及基金合同规定禁止从事的其他行为。

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）其他法律法规、中国证监会及基金合同禁止的行为。

#### 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、审计部、合规管理部，风险管理部、审计部、合规管理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、审计部、合规管理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、审计部、合规管理部：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。公司设督察长和审计部。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。

审计部具体执行监察稽核工作，并协助督察长工作。审计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

基金管理人确知建立、维护、维持和完善内部控制制度是基金管理人董事会及管理层的责任。基金管理人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。



## 第四部分 基金托管人

### （一）基金托管人概况

#### 1、基本情况

名称：招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”）

设立日期：1987年4月8日

注册地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦

办公地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦

注册资本：252.20亿元

法定代表人：缪建民

行长：王良

资产托管业务批准文号：证监基金字[2002]83号

电话：0755-83077987

传真：0755-83195201

资产托管部信息披露负责人：张姗

#### 2、发展概况

招商银行成立于1987年4月8日，是我国第一家完全由企业法人持股的股份制商业银行，总行设在深圳。自成立以来，招商银行先后进行了三次增资扩股，并于2002年3月成功地发行了15亿A股，4月9日在上交所挂牌（股票代码：600036），是国内第一家采用国际会计标准上市的公司。2006年9月又成功发行了22亿H股，9月22日在香港联交所挂牌交易（股票代码：3968），10月5日行使H股超额配售，共发行了24.2亿H股。截至2023年3月31日，本集团总资产105,087.52亿元人民币，高级法下资本充足率17.39%，权重法下资本充足率14.41%。

2002年8月，招商银行成立基金托管部；2005年8月，经报中国证监会同意，更名为资产托管部，现下设基金券商团队、银保信托团队、养老金团队、业务管理团队、产品研发团队、风险管理团队、系统与数据团队、项目支持团队、运营管理团队、基金外包业务团队10个职能团队，现有员工192人。2002年11月，经中国人民银行和中国证监会批准获得证券投资基金托管业务资格，成为国内第一家获得该项业务资格上市银行；2003年4月，正式办理基金托管

业务。招商银行作为托管业务资质最全的商业银行，拥有证券投资基金托管、受托投资管理托管、合格境外机构投资者托管（QFII）、合格境内机构投资者托管（QDII）、全国社会保障基金托管、保险资金托管、企业年金基金托管、存托凭证试点存托人等业务资格。

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

招商银行资产托管业务持续稳健发展，社会影响力不断提升，四度蝉联获《财资》“中国最佳托管专业银行”。2016年6月招商银行荣膺《财资》“中国最佳托管银行奖”，成为国内唯一获得该奖项的托管银行；“托管通”获得国内《银行家》2016中国金融创新“十佳金融产品创新奖”；7月荣膺2016年中国资产管理“金贝奖”“最佳资产托管银行”。2017年6月招商银行再度荣膺《财资》“中国最佳托管银行奖”；“全功能网上托管银行 2.0”荣获《银行家》2017中国金融创新“十佳金融产品创新奖”；8月荣膺国际财经权威媒体《亚洲银行家》“中国年度托管银行奖”。2018年1月招商银行荣膺中央国债登记结算有限责任公司“2017年度优秀资产托管机构”奖项；同月，招商银行托管大数据平台风险管理系统荣获2016-2017年度银监会系统“金点子”方案一等奖，以及中央金融团工委、全国金融青联第五届“双提升”金点子方案二等奖；3月荣膺公募基金20年“最佳基金托管银行”奖；5月荣膺国际财经权威媒体《亚洲银行家》“中国年度托管银行奖”；12月荣膺2018东方财富风云榜“2018年度最佳托管银行”、“20年最值得信赖托管银行”奖。2019年3月招商银行荣获《中国基金报》“2018年度最佳基金托管银行”奖；6月荣获《财资》“中国最佳托管机构”“中国最佳养老金托管机构”“中国最佳

零售基金行政外包”三项大奖；12月荣获2019东方财富风云榜“2019年度最佳托管银行”奖。2020年1月，荣膺中央国债登记结算有限责任公司“2019年度优秀资产托管机构”奖项；6月荣获《财资》“中国最佳托管机构”“最佳公募基金托管机构”“最佳公募基金行政外包机构”三项大奖；10月荣获《中国基金报》“2019年度最佳基金托管银行”奖。2021年1月，荣膺中央国债登记结算有限责任公司“2020年度优秀资产托管机构”奖项；1月荣获2020东方财富风云榜“2020年度最受欢迎托管银行”奖项；2021年10月，荣获国新投资有限公司“2021年度优秀托管银行奖”和《证券时报》“2021年度杰出资产托管银行天玑奖”；2021年12月，荣获《中国基金报》第三届中国公募基金英华奖“2020年度最佳基金托管银行”；2022年1月荣获中央国债登记结算有限责任公司“2021年度优秀资产托管机构、估值业务杰出机构”；9月荣获《财资》“中国最佳托管银行”“最佳公募基金托管银行”“最佳理财托管银行”三项大奖。

## （二）主要人员情况

缪建民先生，本行董事长、非执行董事，2020年9月起担任本行董事、董事长。中央财经大学经济学博士，高级经济师。中国共产党第十九届、二十届中央委员会候补委员。招商局集团有限公司董事长。曾任中国人寿保险（集团）公司副董事长、总裁，中国人民保险集团股份有限公司副董事长、总裁、董事长，曾兼任中国人民财产保险股份有限公司董事长，中国人保资产管理有限公司董事长，中国人民健康保险股份有限公司董事长，中国人民保险（香港）有限公司董事长，人保资本投资管理有限公司董事长，中国人民养老保险有限责任公司董事长，中国人民人寿保险股份有限公司董事长。

王良先生，本行执行董事、党委书记、行长。中国人民大学硕士研究生学历，高级经济师。1995年6月加入本行北京分行，自2001年10月起历任本行北京分行行长助理、副行长、行长，2012年6月任本行行长助理兼任北京分行行长，2013年11月不再兼任本行北京分行行长，2015年1月任本行副行长，2016年11月至2019年4月兼任本行董事会秘书，2019年4月至2023年2月兼任本行财务负责人，2021年8月任本行常务副行长，2021年8月-2023年4月兼任本行董事会秘书、公司秘书及香港上市相关事宜之授权代表，2022年4月18日起全面主持本行工作，2022年5月19日起任本行党委书记，2022年6月

15日起任本行行长。兼任中国支付清算协会副会长、中国银行业协会中间业务专业委员会第四届主任、中国金融会计学会第六届常务理事。

彭家文先生，本行行长助理兼财务负责人。中南财经大学国民经济计划专业本科学历，高级经济师。2001年9月加入本行，历任总行计划财务部总经理助理、副总经理，总行零售综合管理部副总经理、总经理，总行零售金融总部副总经理、副总裁、副总裁兼总行零售信贷部总经理，郑州分行行长，总行资产负债管理部总经理，2023年2月起任本行行长助理、财务负责人，兼任本行总行资产负债管理部总经理。

孙乐女士，招商银行资产托管部总经理，硕士研究生毕业，2001年8月加入招商银行至今，历任招商银行合肥分行风险控制部副经理、经理、信贷管理部总经理助理、副总经理、总经理、公司银行部总经理、中小企业金融部总经理、投行与金融市场部总经理；无锡分行行长助理、副行长；南京分行副行长，具有20余年银行从业经验，在风险管理、信贷管理、公司金融、资产托管等领域有深入的研究和丰富的实务经验。

### （三）基金托管业务经营情况

截至2023年3月31日，招商银行股份有限公司累计托管1223只证券投资基金。

### （四） 托管人的内部控制制度

#### 1、内部控制目标

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

#### 2、内部控制组织结构

招商银行资产托管业务建立三级内部控制及风险防范体系：

一级内部控制及风险防范是在招商银行总行风险管控层面对风险进行预防和控制；总行风险管理部、法律合规部、审计部独立对资产托管业务进行评估监督，并提出内控提升管理建议。

二级内部控制及风险防范是招商银行资产托管部设立风险合规管理相关团队，负责部门内部风险预防和控制，及时发现内部控制缺陷，提出整改方案，跟踪整改情况，并直接向部门总经理室报告。

三级内部控制及风险防范是招商银行资产托管部在设置专业岗位时，遵循内控制衡原则，视业务的风险程度制定相应监督制衡机制。

### 3、内部控制原则

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

（2）审慎性原则。托管组织体系的构成、内部管理制度的建立均以防范风险、审慎经营为出发点，体现“内控优先”的要求。

（3）独立性原则。招商银行资产托管部各团队、各岗位职责保持相对独立，不同托管资产之间、托管资产和自有资产之间相互分离。内部控制的检查、评价部门独立于内部控制的建立和执行部门。

（4）有效性原则。内部控制有效性包含内部控制设计的有效性、内部控制执行的有效性。内部控制设计的有效性是指内部控制的设计覆盖了所有应关注的重要风险，且设计的风险应对措施适当。内部控制执行的有效性是指内部控制能够按照设计要求严格有效执行。

（5）适应性原则。内部控制适应招商银行托管业务风险管理的需要，并能够随着托管业务经营战略、经营方针、经营理念等内部环境的变化和国家法律、法规、政策制度等外部环境的改变及时进行修订和完善。

（6）防火墙原则。招商银行资产托管部办公场地与我行其他业务场地隔离，办公网和业务网物理分离，部门业务网和全行业务网防火墙策略分离，以达到风险防范的目的。

（7）重要性原则。内部控制在实现全面控制的基础上，关注重要托管业务重要事项和高风险环节。

（8）制衡性原则。内部控制能够实现在托管组织体系、机构设置、权责分配及业务流程等方面相互制约、相互监督，同时兼顾运营效率。

### 4、内部控制措施

（1）完善的制度建设。招商银行资产托管部从资产托管业务内控管理、产品受理、会计核算、资金清算、岗位管理、档案管理和信息管理等方面制定一

系列规章制度，建立了三层制度体系，即：基本规定、业务管理办法和业务操作规程。制度结构层次清晰、管理要求明确，满足风险管理全覆盖的要求，保证资产托管业务科学化、制度化、规范化运作。

（2）业务信息风险控制。招商银行资产托管部在数据传输和保存方面有严格的加密和备份措施，采用加密、直连方式传输数据，数据执行异地实时备份，所有的业务信息须经过严格的授权方能进行访问。

（3）客户资料风险控制。招商银行资产托管部对业务办理过程中获取的客户资料严格保密，除法律法规和其他有关规定、监管机构及审计要求外，不向任何机构、部门或个人泄露。

（4）信息技术系统风险控制。招商银行对信息技术系统机房、权限管理实行双人双岗双责，电脑机房 24 小时值班并设置门禁，所有电脑设置密码及相应权限。业务网和办公网、托管业务网与全行业务网双分离制度，与外部业务机构实行防火墙保护，对信息技术系统采取两地三中心的应急备份管理措施等，保证信息技术系统的安全。

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

#### （五）基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

根据《中华人民共和国证券投资基金法》《公开募集证券投资基金运作管理办法》等有关法律法规的规定及基金合同、托管协议的约定，对基金投资范围、投资比例、投资组合等情况的合法性、合规性进行监督和核查。

在为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中，基金托管人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支付情况进行检查监督，对违反法律法规、基金合同的指令拒绝执行，并立即通知基金管理人。

基金托管人如发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定，及时以书面形式通知基金管理人进行整改，整改的时限应符合法律法规及基金合同允许的调整期限。基金管理人收到通知后应及时核对确认并以书面形式向基金托管人发出回函并改正。基金管理人对于基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管

人应报告中国证监会。

## 第五部分 相关服务机构

### 一、基金份额销售机构

#### 1、直销机构

(1) 名称：兴证全球基金管理有限公司直销中心（柜台）

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：021-20398988、021-20398889

(2) 名称：兴证全球基金网上直销平台（含微网站、APP）

交易网站：<https://trade.xqfunds.com>、[c.xqfunds.com](https://c.xqfunds.com)

客户服务电话：4006780099，（021）38824536

#### 2、场外代销机构（排序不分先后）

本公司已经与下述销售机构（排名不分先后）签订基金销售协议，投资人通过下述销售机构办理相关业务的，以下述销售机构的相关规定为准。

代销机构全称	法定代表人	注册地址	办公地址	电话	网站
招商银行股份有限公司	缪建民	中国广东省深圳市福田区深南大道 7088 号	中国广东省深圳市福田区深南大道 7088 号	95555	<a href="http://www.cmbchina.com/">http://www.cmbchina.com/</a>
兴业银行股份有限公司	吕家进	福建省福州市台江区江滨中大道 398 号兴业银行大厦	福建省福州市台江区江滨中大道 398 号兴业银行大厦	95561	<a href="https://www.cib.com.cn/">https://www.cib.com.cn/</a>
中国工商银行股份有限公司	陈四清	北京市西城区复兴门内大街 55 号	北京市西城区复兴门内大街 55 号	95588	<a href="http://www.icbc.com.cn/">http://www.icbc.com.cn/</a>
中国农业银行股份有限公司	谷澍	中国北京市东城区建国门内大街 69 号	中国北京市东城区建国门内大街 69 号	95599	<a href="http://www.abchina.com/">http://www.abchina.com/</a>
中国银行股份有限公司	刘连舸	北京市西城区复兴门内大街 1 号	北京市西城区复兴门内大街 1 号, 香港花园道 1 号中银大厦	95566	<a href="https://www.boc.cn/">https://www.boc.cn/</a>
中国建设银行股份有限公司	田国立	北京市西城区金融大街 25 号	北京市西城区金融大街 25 号, 香港中环干诺道中 3 号中国建设银行大厦 28 楼	95533	<a href="http://www.ccb.com/">http://www.ccb.com/</a>
交通银行股份有限公司	任德奇	中国(上海)自由贸易试验区银城中路 188 号	中国(上海)自由贸易试验区银城中路 188 号, 香港中环毕打街 20 号	95559	<a href="http://www.bankcomm.com/">http://www.bankcomm.com/</a>



中信银行股份有限公司	朱鹤新	北京市朝阳区光华路10号院1号楼6-30层、32-42层	北京市朝阳区光华路10号院1号楼6-30层、32-42层	95558	<a href="http://www.citicbank.com/">http://www.citicbank.com/</a>
上海浦东发展银行股份有限公司	郑杨	上海市中山东一路12号	上海市中山东一路12号	95528	<a href="https://www.spdb.com.cn/">https://www.spdb.com.cn/</a>
中国光大银行股份有限公司	李晓鹏	中国北京市西城区太平桥大街25号、甲25号中国光大中心	北京市西城区太平桥大街25号中国光大中心, 香港湾仔告士打道108号光大中心23楼	95595	<a href="http://www.cebbank.com/">http://www.cebbank.com/</a>
中国民生银行股份有限公司	高迎欣	中国北京市西城区复兴门内大街2号	北京市西城区复兴门内大街2号民生银行大厦	95568	<a href="http://www.cmbc.com.cn/">http://www.cmbc.com.cn/</a>
中国邮政储蓄银行股份有限公司	张金良	北京市西城区金融大街3号	北京市西城区金融大街3号	95580	<a href="http://www.psbc.com/cn/">http://www.psbc.com/cn/</a>
华夏银行股份有限公司	李民吉	北京市东城区建国门内大街22号	北京市东城区建国门内大街22号华夏银行大厦	95577	<a href="https://www.hxb.com.cn/">https://www.hxb.com.cn/</a>
上海银行股份有限公司	金煜	上海市浦东新区银城中路168号	上海市浦东新区银城中路168号	95594	<a href="http://www.bosc.cn/">http://www.bosc.cn/</a>
广发银行股份有限公司	王凯	广州市越秀区东风东路713号	广州市越秀区东风东路713号	95508	<a href="http://www.gcbchina.com.cn/">http://www.gcbchina.com.cn/</a>
平安银行股份有限公司	谢永林	广东省深圳市罗湖区深南东路5047号	广东省深圳市罗湖区深南东路5047号, 中国广东省深圳市福田区益田路5023号平安金融中心B座	95511	<a href="http://bank.pingan.com/">http://bank.pingan.com/</a>
宁波银行股份有限公司	陆华裕	浙江省宁波市鄞州区宁东路345号	浙江省宁波市鄞州区宁东路345号	95574	<a href="http://www.nbc.cn/">http://www.nbc.cn/</a>
江苏银行股份有限公司	夏平	江苏省南京市秦淮区中华路26号	江苏省南京市秦淮区中华路26号	95319	<a href="http://www.jsbchina.cn/">http://www.jsbchina.cn/</a>
东莞银行股份有限公司	卢国锋	东莞市莞城区体育路21号	东莞市莞城区体育路21号	956033	<a href="http://www.dongguanbank.cn/">http://www.dongguanbank.cn/</a>
江苏江南农村商业银行股份有限公司	陆向阳	常州市武进区延政中路9号	常州市武进区延政中路9号	(0519)96005	<a href="http://www.jnbank.com.cn/">http://www.jnbank.com.cn/</a>
广州农村商业银行股份有限公司	蔡建	广东省广州市黄埔区映日路9号	广东省广州市黄埔区映日路9号	95313	<a href="http://www.grcbank.com/">http://www.grcbank.com/</a>
兴业证券股份有限公司	杨华辉	福州市湖东路268号	长柳路36号7层701室	95562	<a href="http://www.xyq.com.cn">http://www.xyq.com.cn</a>
国泰君安证券股份有限公司	贺青	上海市浦东新区自由贸易试验区商城路618号	上海市静安区南京西路768号	95521	<a href="https://www.gtja.com/">https://www.gtja.com/</a>

中信建投证券股份有限公司	王常青	北京市朝阳区安立路66号4号楼	北京市朝阳区安立路66号4号楼	4008888108	<a href="https://www.csc108.com/">https://www.csc108.com/</a>
国信证券股份有限公司	张纳沙	广东省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	深圳市福田区福华一路125号国信金融大厦	95536	<a href="http://www.guosen.com.cn">www.guosen.com.cn</a>
招商证券股份有限公司	霍达	深圳市福田区福田街道福华一路111号	深圳市福田区福田街道福华一路111号	95565	<a href="http://www.cmchina.com/">http://www.cmchina.com/</a>
广发证券股份有限公司	林传辉	广东省广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街2号618室	广东省广州市天河区马场路26号广发证券大厦	95575	<a href="http://www.gf.com.cn/">http://www.gf.com.cn/</a>
中信证券股份有限公司	张佑君	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	广东省深圳市福田区中心三路8号中信证券大厦, 北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦	95548	<a href="http://www.citics.com">www.citics.com</a>
中国银河证券股份有限公司	陈亮	北京市丰台区西营街8号院1号楼7至18层	北京市丰台区西营街8号院1号楼青海金融大厦	4008-888-888、95551	<a href="http://www.chinastock.com.cn/">www.chinastock.com.cn/</a>
海通证券股份有限公司	周杰	上海市黄浦区广东路689号	上海市黄浦区广东路689号	95553	<a href="http://www.htsec.com">www.htsec.com</a>
申万宏源证券有限公司	杨玉成	上海市徐汇区长乐路989号45层	上海市徐汇区长乐路989号45层	95523	<a href="http://www.swhysc.com">www.swhysc.com</a>
长江证券股份有限公司	金才玖	湖北省武汉市江汉区淮海路88号	湖北省武汉市江汉区新华路特8号	95579	<a href="http://www.95579.com/">http://www.95579.com/</a>
安信证券股份有限公司	黄炎勋	深圳市福田区福田街道福华一路119号安信金融大厦	深圳市福田区福田街道福华一路119号安信金融大厦	95517	<a href="http://www.essence.com.cn/">http://www.essence.com.cn/</a>
湘财证券股份有限公司	高振营	长沙市天心区湘府中路198号新南城商务中心A栋11楼	长沙市天心区湘府中路198号新南城商务中心A栋11楼	95351	<a href="https://www.xcsc.com/">https://www.xcsc.com/</a>
民生证券股份有限公司	冯鹤年	中国(上海)自由贸易试验区浦明路8号	中国(上海)自由贸易试验区世纪大道1168号B座2101、2104A室	95376	<a href="https://www.msyzq.com/">https://www.msyzq.com/</a>
国元证券股份有限公司	沈和付	安徽省合肥市蜀山区梅山路18号	安徽省合肥市蜀山区梅山路18号	95578	<a href="http://www.gyzq.com.cn">www.gyzq.com.cn</a>
渤海证券股份有限公司	安志勇	天津经济技术开发区第二大街42号写字楼101室	天津市南开区水上公园东路东侧宁汇大厦A座	956066	<a href="http://www.ewww.com.cn/">http://www.ewww.com.cn/</a>
华泰证券股份有限公司	张伟	江苏省南京市建邺区江东中路228号	江苏省南京市建邺区江东中路228号	95597	<a href="http://www.htsc.com.cn">www.htsc.com.cn</a>

山西证券股份有限公司	王怡里	山西省太原市杏花岭区府西街69号山西国际贸易中心东塔楼	山西省太原市杏花岭区府西街69号山西国际贸易中心东塔楼	95573	www.sxzq.com
中信证券（山东）有限责任公司	陈佳春	青岛市崂山区深圳路222号1号楼2001	青岛市崂山区深圳路222号1号楼2001	95548	http://sd.citics.com/
东兴证券股份有限公司	李娟	北京市西城区金融大街5号(新盛大厦)12、15层	北京市西城区金融大街5号(新盛大厦)6、10、12、15、16层	95309	www.dxzq.net
东吴证券股份有限公司	范力	江苏省苏州市吴中区工业园区星阳街5号	江苏省苏州市吴中区工业园区星阳街5号	95330	http://www.dwzq.com.cn/
信达证券股份有限公司	祝瑞敏	北京市西城区闹市口大街9号院1号楼	北京市西城区闹市口大街9号院1号楼	95321	https://www.cindasc.com/
东方证券股份有限公司	金文忠	上海市黄浦区中山南路119号东方证券大厦	上海市黄浦区中山南路119号东方证券大厦,中国上海市黄浦区中山南路318号2号楼3-6层、12层、13层、22层、25-27层、29层、32层、36层、38层	95503	www.dfzq.com.cn
方正证券股份有限公司	施华	湖南省长沙市天心区湘江中路二段36号华远华中心4、5号楼3701-3717	湖南省长沙市天心区湘江中路二段36号华远华中心4、5号楼3701-3717	95571	www.foundersec.com
长城证券股份有限公司	张巍	广东省深圳市福田区福田街道金田路2026号能源大厦南塔楼10-19层	广东省深圳市福田区福田街道金田路2026号能源大厦南塔楼10-19层	95514	www.cgws.com
光大证券股份有限公司	刘秋明	上海市静安区新闸路1508号	上海市静安区新闸路1508号	95525	www.ebscn.com
中信证券华南股份有限公司	陈可可	广州市天河区临江大道395号901室(部位:自编01),1001室	广州市天河区珠江西路5号501房	95548	http://www.gzs.com.cn/
东北证券股份有限公司	李福春	吉林省长春市南关区生态大街6666号	吉林省长春市南关区生态大街6666号	86-431-85096806	www.nesc.cn
南京证券股份有限公司	李剑锋	南京市江东中路389号	南京市江东中路389号	95386	https://www.njzq.com.cn/
国联证券股份有限公司	葛小波	江苏省无锡市滨湖区金融一街8号	无锡市滨湖区金融一街8号国联金融大厦	95570	http://www.gls.com.cn/
平安证券股份有限公司	何之江	深圳市福田区福田街道益田路5023号平安金融中心B座第22-25层	深圳市福田区福田街道益田路5023号平安金融中心B座第22-25层	021-38635562, 86-755-22627723	http://www.stock.pingan.com/

华安证券股份有限公司	章宏韬	安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路198号	安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路198号	95318	<a href="http://www.hazq.com/">http://www.hazq.com/</a>
国海证券股份有限公司	何春梅	广西壮族自治区桂林市七星区辅星路13号	广西壮族自治区南宁市青秀区滨湖路46号国海大厦	86-771-5532512	<a href="http://www.ghzq.com.cn">www.ghzq.com.cn</a>
东莞证券股份有限公司	陈照星	东莞市莞城区可园南路一号	东莞市莞城区可园南路一号	95328	<a href="http://www.dgzq.com.cn">www.dgzq.com.cn</a>
中原证券股份有限公司	菅明军	河南省郑州市郑东新区商务外环路10号	河南省郑州市郑东新区商务外环路10号	95377	<a href="https://wt.ccnew.com/">https://wt.ccnew.com/</a>
国都证券股份有限公司	翁振杰	北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层	北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层	86-10-84183203	<a href="http://www.guodu.com">www.guodu.com</a>
东海证券股份有限公司	钱俊文	江苏省常州市延陵西路23号投资广场18层	江苏省号投资广场18层	95531	<a href="http://www.longone.com.cn">www.longone.com.cn</a>
中银国际证券股份有限公司	宁敏	上海市浦东新区银城中路200号中银大厦39层	上海市浦东新区银城中路200号中银大厦39层	400-620-8888	<a href="http://www.bocichina.com">www.bocichina.com</a>
恒泰证券股份有限公司	祝艳辉	内蒙古自治区呼和浩特市新城区海拉尔东街满世尚都办公商业综合楼	内蒙古自治区呼和浩特市新城区海拉尔东街满世尚都办公商业综合楼	956088	<a href="http://m.cnht.com.cn/">http://m.cnht.com.cn/</a>
国盛证券有限责任公司	徐丽峰	江西省南昌市新建区子实路1589号	江西省南昌市红谷滩新区凤凰中大道1115号北京银行营业大楼16层	956080	<a href="https://www.gszq.com/">https://www.gszq.com/</a>
华西证券股份有限公司	杨炯洋	四川省成都市高新区天府二街198号	四川省成都市高新区天府二街198号	95584	<a href="http://www.hx168.com.cn/">http://www.hx168.com.cn/</a>
申万宏源西部证券有限公司	王献军	新疆乌鲁木齐市高新区(新市区)北京南路358号大成国际大厦20楼2005室	新疆乌鲁木齐市高新区(新市区)北京南路358号大成国际大厦20楼2005室	95523	<a href="http://www.swhysc.com/">www.swhysc.com/</a>
中泰证券股份有限公司	王洪	济南市市中区经七路86号	济南市市中区经七路86号	95538	<a href="https://www.zts.com.cn/">https://www.zts.com.cn/</a>
中航证券有限公司	丛中	江西省南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号南昌国际金融大厦A栋41层	江西省南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号南昌国际金融大厦A栋41层	95335	<a href="https://www.avicsec.com/">https://www.avicsec.com/</a>
德邦证券股份有限公司	武晓春	上海市普陀区曹杨路510号南半幢9楼	上海市浦东新区福山路500号城建国际中心29楼	400-8888-128	<a href="https://www.tebon.com.cn/">https://www.tebon.com.cn/</a>
西部证券股份有限公司	徐朝晖	陕西省西安市新城区东新街319号8幢10000室	陕西省西安市新城区东新街319号8幢10000室	95582	<a href="http://www.west95582.com/">http://www.west95582.com/</a>

华福证券有限责任公司	苏军良	福建省福州市鼓楼区鼓屏路27号1#楼3层、4层、5层	上海市浦东新区滨江大道5129号陆家嘴滨江中心N1座	95547	<a href="https://www.hfzq.com.cn/">https://www.hfzq.com.cn/</a>
中国国际金融股份有限公司	沈如军	北京市朝阳区建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层	北京市朝阳区建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层	(+86-10) 6505 1166	<a href="https://www.cicc.com/">https://www.cicc.com/</a>
财通证券股份有限公司	章启诚	浙江省杭州市西湖区天目山路198号财通双冠大厦西楼	浙江省杭州市西湖区天目山路198号财通双冠大厦西楼	95336	<a href="http://www.ctsec.com">www.ctsec.com</a>
华鑫证券有限责任公司	俞洋	深圳市福田区香蜜湖街道东海社区深南大道7888号东海国际中心一期A栋2301A	上海市浦东新区金海路1000号	400-109-9918	<a href="http://www.cfsc.com.cn/">http://www.cfsc.com.cn/</a>
瑞银证券有限责任公司	陈安	北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心12层、15层	北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心12层、15层	010-5832 8888	<a href="https://www.ubs.com/cn/sc/ubs-securities">https://www.ubs.com/cn/sc/ubs-securities</a>
中国中金财富证券有限公司	高涛	深圳市南山区粤海街道海珠社区科苑南路2666号中国华润大厦L4601-L4608	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01.02.03.05.11.12.13.15.16.18.19.20.21.22.23单元	95532	<a href="https://www.ciccwm.com/">https://www.ciccwm.com/</a>
东方财富证券股份有限公司	戴彦	西藏自治区拉萨市柳梧新区国际总部城10栋楼	上海市徐汇区宛平南路88号金座东方财富大厦	95357	<a href="http://www.18.cn">www.18.cn</a>
粤开证券股份有限公司	严亦斌	广东省广州市黄埔区经济技术开发区科学大道60号开发区金控中心21、22、23层	广东省广州市黄埔区经济技术开发区科学大道60号开发区金控中心21、22、23层	95564	<a href="http://www.ykzq.com/">http://www.ykzq.com/</a>
九州证券股份有限公司	邓晖	西宁市南川工业园区创业路108号	北京市朝阳区安立路30号仰山公园东一门2号楼	95305	<a href="http://www.jzsec.com/">http://www.jzsec.com/</a>
国金证券股份有限公司	冉云	四川省成都市青羊区东城根上街95号	四川省成都市青羊区东城根上街95号成证大厦16楼	95310	<a href="https://www.gjzq.com.cn">https://www.gjzq.com.cn</a>
华宝证券股份有限公司	刘加海	中国（上海）自由贸易试验区浦电路370号2、3、4层	中国（上海）自由贸易试验区浦电路370号2、3、4层	4008209 898	<a href="https://www.cnhbstock.com/">https://www.cnhbstock.com/</a>
爱建证券有限责任公司	祝健	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道1600号1幢32楼	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道1600号1幢32楼	4001-962-502	<a href="https://www.ajzq.com/">https://www.ajzq.com/</a>
国新证券股份有限公司	张海文	北京市西城区车公庄大街4号2幢1层A2112室	北京市朝阳区朝阳门北大街18号中国人保寿险大厦12-18层	95390	<a href="http://www.crsec.com.cn">www.crsec.com.cn</a>

财达证券股份有限公司	翟建强	石家庄市自强路35号	石家庄市自强路35号	95363	<a href="http://www.sl0000.com/">http://www.sl0000.com/</a>
华金证券股份有限公司	燕文波	上海市静安区天目西路128号19层1902室	中国（上海）自由贸易试验区杨高南路759号30层	956011	<a href="https://www.huajinsec.cn/">https://www.huajinsec.cn/</a>
天相投资顾问有限公司	林义相	北京市西城区金融街19号富凯大厦B座	北京市西城区新街口外大街28号C座505	(010) 66045678	<a href="http://www.txsec.com">http://www.txsec.com</a>
和讯信息科技有限公司	章知方	北京市朝阳区朝外大街22号1002室	北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层	400920022	<a href="http://licaik.e.hexun.com">http://licaik.e.hexun.com</a>
厦门市鑫鼎盛控股有限公司	林劲	厦门市思明区鹭江道2号第一广场1501-1502室	厦门市思明区鹭江道2号第一广场1501-1502室	400-6533-789	<a href="http://www.xds.com.cn/">http://www.xds.com.cn/</a>
江苏汇林保大基金销售有限公司	吴言林	南京市高淳区经济开发区古檀大道47号	南京市鼓楼区中山北路2号绿地紫峰大厦2005室	025-66046166	<a href="http://www.huilinbd.com">www.huilinbd.com</a>
上海挖财基金销售有限公司	方磊	中国（上海）自由贸易试验区杨高南路759号18层03单元	中国（上海）自由贸易试验区杨高南路759号18层03单元	021-50810673	<a href="https://wacaijijin.com/">https://wacaijijin.com/</a>
腾安基金销售（深圳）有限公司	谭广锋	深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室	深圳市南山区海天二路33号腾讯滨海大厦15楼	95017	<a href="http://www.txfund.com">www.txfund.com</a>
民商基金销售（上海）有限公司	賁惠琴	上海市黄浦区北京东路666号H区（东座）6楼A31室	上海市浦东新区张杨路707号生命人寿大厦32楼	021-50206003	<a href="http://www.msftec.com">www.msftec.com</a>
北京度小满基金销售有限公司	盛超	北京市海淀区西北旺东路10号院西区4号楼1层103室	北京市海淀区西北旺东路10号院西区4号楼1层103室	95055	<a href="http://www.duxiaomanfund.com">www.duxiaomanfund.com</a>
诺亚正行基金销售有限公司	吴卫国	上海市虹口区飞虹路360弄9号6层	上海市闵行区申滨南路1226号诺亚财富中心	400-821-5399	<a href="http://www.noah-fund.com">www.noah-fund.com</a>
深圳众禄基金销售股份有限公司	薛峰	深圳市罗湖区笋岗街道笋西社区梨园路8号HALO广场一期四层12-13室	深圳市罗湖区笋岗街道笋西社区梨园路8号HALO广场一期四层12-13室	4006-788-887	<a href="http://www.jjmmw.com">http://www.jjmmw.com</a>
上海天天基金销售有限公司	其实	上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层	上海市徐汇区宛平南路88号金座东方财富大厦	95021	<a href="http://www.1234567.com.cn">www.1234567.com.cn</a>
上海好买基金销售有限公司	陶怡	上海市虹口区东大名路501号6211单元	上海市浦东新区潍坊新村街道张杨路500号华润时代广场商务楼10-14楼	400-700-9665	<a href="http://www.ehowbuy.com">www.ehowbuy.com</a>
蚂蚁（杭州）基金销售有限公司	王珺	浙江省杭州市余杭区五常街道文一西路969号3幢5层599室	浙江省杭州市西湖区西溪路556号蚂蚁Z空间	4000766123	<a href="http://www.fund123.cn">www.fund123.cn</a>

上海长量基金销售有限公司	张跃伟	浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室	上海市浦东新区东方路 1267 号陆家嘴金融服务广场二期 11 层	400-8202899	www.erichfund.com
浙江同花顺基金销售有限公司	吴强	浙江省杭州市文二西路 1 号元茂大厦 903 室	浙江省杭州市余杭区五常街道同顺街 18 号	952555	http://www.5ifund.com
上海利得基金销售有限公司	李兴春	中国(上海)自由贸易试验区临港新片区海基六路 70 弄 1 号 208-36 室	上海市虹口区东大名路 1098 号浦江国际金融广场 53 层	400-032-5885	http://www.leadbank.com.cn /
泛华普益基金销售有限公司	杨远芬	成都市成华区建设路 9 号高地中心 1101 室	成都市金牛区花照壁西顺街 399 号西宸国际 B 座	400-080-3388	www.puyifund.com
北京汇成基金销售有限公司	王伟刚	北京市西城区宣武门外大街甲 1 号 4 层 401-2	西城区宣武门外大街甲 1 号环球财讯中心 D 座 4 层	400-0555-728	www.hcfunds.com
北京广源达信基金销售有限公司	齐剑辉	北京市西城区新街口外大街 28 号 C 座六层 605 室	北京市顺义区北京东航中心 1 号楼 3 层 304B 室	400-616-7531	http://www.niuniufund.com
上海大智慧基金销售有限公司	张俊	中国(上海)自由贸易试验区杨高南路 428 号 1 号楼 1102 单元	中国上海市浦东新区杨高南路 428 号 1 号楼 1102 单元	021-20292031	www.wg.com.cn
北京新浪仓石基金销售有限公司	李柳娜	北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2 地块新浪总部科研楼 5 层 518 室	北京市海淀区西北旺东路 10 号院西区 8 号楼新浪总部大厦	010-62675369	http://www.xincai.com
上海基煜基金销售有限公司	王翔	上海市黄浦区广东路 500 号 30 层 3001 单元	上海市浦东新区银城中路 488 号太平金融大厦 1503 室	400-8205369	www.jiyufund.com.cn
上海陆金所基金销售有限公司	陈祎彬	中国(上海)自由贸易试验区源深路 1088 号 7 层	上海市浦东新区平安财富大厦 7 楼	400-821-9031	http://www.lufunds.com
珠海盈米基金销售有限公司	肖雯	珠海市横琴新区环岛东路 3000 号 2719 室	广州市海珠区阅江中路 688 号保利国际广场北塔 33 层	020-89629066	www.yingmi.com
中证金牛(北京)基金销售有限公司	吴志坚	北京市丰台区东管头 1 号 2 号楼 2-45 室	北京市西城区宣武门外大街新华社第三工作区 A 座 4、5 层	4008-909-998	www.jnlc.com
京东肯特瑞基金销售有限公司	邹保威	北京市海淀区知春路 76 号(写字楼)1 号楼 4 层 1-7-2	北京市通州区亦庄经济技术开发区科创十一街 18 号院京东集团总部 A 座 15 层	95118	kenterui.jd.com
北京雪球基金销售有限公司	李楠	北京市朝阳区创远路 34 号院 6 号楼 15 层 1501 室	北京市融新科技园 C 座	400-1599288	https://danjuanapp.com/

上海华夏财富投资管理有限公司	毛淮平	上海市虹口区东大名路687号1幢2楼268号	北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座8层	400-817-5666	www.amcfortune.com
玄元保险代理有限公司	马永谕	中国（上海）自由贸易试验区张杨路707号1105室	中国（上海）自由贸易试验区张杨路707号1105室	400-080-8208	www.licaimofang.com
兴证期货有限公司	周峰	福州市鼓楼区温泉街道湖东路268号6层（兴业证券大厦）	福建省福州市鼓楼区温泉街道湖东路268号6层（兴业证券大厦）	95562-5	http://www.xz-futures.cn/
中信期货有限公司	张皓	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13层1301-1305、14层	深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座13层1301-1305室、14层	400-990-8826	http://www.citicsf.com/
阳光人寿保险股份有限公司	李科	海南省三亚市迎宾路360-1号三亚阳光金融广场16层	北京市朝阳区景辉街33号院1号楼阳光金融中心	95510	https://fund.sinosig.com/
中国人寿保险股份有限公司	白涛	北京市西城区金融大街16号	北京市西城区金融大街16号	95515	www.e-chinalife.com

**\*上述机构已取得中国证监会颁发的基金销售业务资格证书**

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：于文强

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：0755-25987538

联系人：任瑞新

**三、出具法律意见书的律师事务所**

名称：上海市通力律师事务所

住所：上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心19层

办公地址：上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心19层

负责人：韩炯

电话：（021）31358666



传真：（021）31358600

联系人：陆奇

经办律师：安冬、陆奇

#### **四、审计基金财产的会计师事务所**

名称：毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：北京东城区东长安街1号东方广场毕马威大楼8层

办公地址：上海南京西路1266号恒隆广场50楼

执行事务合伙人：邹俊

电话：010-85085000

传真：010-85085111

经办注册会计师：王国蓓、张楠

联系人：王国蓓

## 第六部分 基金的募集

本基金由管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关规定募集，并经中国证监会 2011 年 12 月 31 日证监许可[2011]2161 号文核准募集。

### 一、基金类别

混合型

### 二、基金运作方式

契约型上市开放式

### 三、基金存续期限

不定期

### 四、募集情况

本基金经中国证监会证监许可[2011]2161 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 2012 年 2 月 27 日起至 2012 年 3 月 27 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 993,929,233.72 份，其中利息结转基金份额共计 528,103.46 份，募集户数为 12670 户。

## 第七部分 基金合同的生效

### 一、基金合同生效时间

本基金的基金合同于 2012 年 4 月 5 日正式生效。

### 二、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

《基金合同》生效后，连续 20 个工作日基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 60 个工作日出现前述情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。法律法规另有规定时，从其规定。

## 第八部分 基金份额的上市交易

基金合同生效后，基金管理人可以根据有关规定，申请本基金的基金份额上市交易。基金上市后，登记在证券登记结算系统中的基金份额可直接在深圳证券交易所上市交易；登记在注册登记系统中的基金份额可通过办理跨系统转托管业务将基金份额转托管在证券登记结算系统中，再上市交易。

### 一、上市交易的地点

深圳证券交易所。

### 二、上市交易的时间

本基金的基金份额于 2012 年 5 月 31 日开始在深圳证券交易所上市交易。

### 三、上市交易的规则

本基金上市交易遵循《深圳证券交易所交易规则》、《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》及其更新及其他有关规定。

### 四、上市交易的费用

本基金上市交易的费用按照深圳证券交易所的有关规定办理。

### 五、上市交易的行情揭示

本基金在深圳证券交易所挂牌交易，交易行情通过行情发布系统揭示。行情发布系统同时揭示基金前一交易日的基金份额净值。

### 六、上市交易的停复牌、暂停上市和终止上市

本基金的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市按照相关法律法规、中国证监会及深圳证券交易所的相关规定执行。

发生下列情形之一时，本基金应暂停上市：

- （1）基金份额持有人数连续 20 个工作日低于 1000 人；
- （2）基金总份额连续 20 个工作日低于 2 亿份；
- （3）违反国家法律、行政法规，中国证监会决定暂停本基金上市；
- （4）严重违反深圳证券交易所有关规则的；
- （5）深圳证券交易所认为须暂停上市的其他情形。

发生上述暂停上市情形时，基金管理人在接到深圳证券交易所通知后，应立即在规定媒介上刊登暂停上市公告。

暂停上市情形消除后，基金管理人可向深圳证券交易所提出恢复上市申请；

经深圳证券交易所核准后，可恢复本基金上市，并在规定媒介上刊登恢复上市公告。

#### 七、终止上市的情形和处理方式

发生下列情况之一时，本基金应终止上市交易：

- （1）自暂停上市之日起半年内未能消除暂停上市原因的；
- （2）基金合同终止；
- （3）基金份额持有人大会决定终止上市；
- （4）深圳证券交易所认为须终止上市的其他情况。

发生上述终止上市情形时，由证券交易所终止其上市交易，基金管理人报经中国证监会备案后终止本基金的上市，并在规定媒介上刊登终止上市公告。

八、相关法律法规、中国证监会及深圳证券交易所对基金上市交易的规则等相关规定内容进行调整的，本基金基金合同相应予以修改，并按照新规定执行，且此项修改无须召开基金份额持有人大会。

## 第九部分 基金份额的场外申购、赎回与转换

本章内容仅适用于本基金的场外申购和赎回业务。登记在注册登记系统中的基金份额可直接办理场外申购与赎回等场外基金业务；登记在证券登记结算系统中的基金份额可通过办理跨系统转托管业务将基金份额转托管到注册登记系统中，再办理场外申购与赎回等场外基金业务。选择后端收费模式的场外申购基金份额不能跨系统转托管，持有的基金份额不能上市交易。

### 一、场外申购和赎回场所

本基金的销售机构包括基金管理人和基金管理人委托的代销机构。具体的代销机构将由基金管理人在招募说明书或其他相关公告中列明。

基金投资人应当在销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理基金份额的申购与赎回。基金管理人可根据情况变更或增减基金代销机构，并在基金管理人网站公示。

### 二、场外申购和赎回的开放日及时间

#### 1、开放日及开放时间

投资人在开放日申请办理基金份额的申购和赎回，具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间。若上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日发生指数熔断且指数熔断至收市的，前述具体办理时间以基金管理人公告为准。但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。

基金合同生效后，若出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更或其他特殊情况，基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整，但应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

#### 2、申购、赎回开始日及业务办理时间

基金管理人自基金合同生效之日起不超过 3 个月开始办理申购，具体业务办理时间在申购开始公告中规定。

基金管理人自基金合同生效之日起不超过 3 个月开始办理赎回，具体业务办理时间在赎回开始公告中规定。

在确定申购开始与赎回开始时间后，由基金管理人在申购、赎回开始日前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购、赎回或者转换。投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请且注册登记机构确认接受的，其基金份额申购、赎回、转换价格为下一开放日基金份额申购、赎回、转换的价格。

本基金自 2012 年 5 月 31 日起办理场外日常申购、赎回业务。

### 三、场外申购和赎回的原则

1、“未知价”原则，即基金份额申购、赎回价格以申请当日收市后计算的基金份额净值为基准进行计算；

2、“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

3、当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销；

4、场外赎回遵循“先进先出”原则，即按照投资人认购、申购的先后次序进行顺序赎回；

基金管理人在不损害基金份额持有人权益的情况下，可在法律法规允许的情况下，对上述原则进行调整。基金管理人必须在新原则开始实施前按照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介公告。

### 四、场外申购和赎回的程序

#### 1、申购和赎回的申请方式

投资人必须根据销售机构规定的程序，在开放日的业务办理时间内提出申购或赎回的申请。

#### 2、申购和赎回的款项支付

投资人申购基金份额时，必须全额交付申购款项，投资人交付款项，申购申请即为有效。

投资人赎回申请成功后，基金管理人将通过注册登记机构及其相关销售机构在 T+7 日（包括该日）内将赎回款项划往基金份额持有人账户。在发生巨额赎回时，款项的支付办法参照基金合同有关条款处理。

基金管理人可以在法律法规和基金合同允许的范围内，对上述业务办理时间进行调整，基金管理人必须在调整前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

#### 3、申购和赎回申请的确认

基金管理人应以交易时间结束前受理申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日(T 日)，在正常情况下，本基金注册登记机构在 T+1 日内（包括该日）对该交易的有效性进行确认。T 日提交的有效申请，投资人应在 T+2 日后（包括该日）到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。若申购不成功，则申购款项退还给投资人。

基金销售机构对申购、赎回申请的受理并不代表申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到申请。申购、赎回的确认以注册登记机构的确认结果为准。

## 五、场外申购和赎回的限制

1、在基金管理人直销中心（柜台）进行申购时，投资人以金额申请，首笔申购的最低金额为人民币 100,000 元（含申购费），每笔追加申购的最低金额为人民币 100,000 元（含申购费）。在基金管理人网上直销系统进行申购时，投资人以金额申请，首笔申购的最低金额为人民币 10 元（含申购费），每笔追加申购的最低金额为人民币 10 元（含申购费）。除上述情况及另有公告外，基金管理人规定本基金的单笔申购、追加申购起点金额为 0.1 元（含申购费），在本基金其他销售机构进行申购时，具体办理要求以相关销售机构的交易细则为准，但不得低于基金管理人规定的最低限额。

2、基金份额持有人在基金管理人的直销中心（柜台）及网上直销系统办理赎回时，每笔赎回、转换转出申请的最低份额为 10 份，单个基金账户的最低持有份额为 10 份；除上述情况及另有公告外，基金管理人规定本基金的每笔赎回、转换转出申请的最低份额为 0.1 份，单个基金账户的最低持有份额为 0.1 份。在本基金其他销售机构进行赎回时，具体办理要求以相关销售机构的交易细则为准，但不得低于基金管理人规定的最低限额。

若基金份额持有人单个基金账户中单只基金份额余额低于上述最低赎回份额，当基金份额持有人申请将账户中该基金全部份额赎回时，不受上述最低赎回份额限制。当基金份额持有人的某笔赎回、转换转出等份额减少类业务申请导致单个交易账户的基金份额余额少于上述最低持有份额时，基金管理人有权将余额部分基金份额强制赎回。敬请投资者注意赎回份额的设置。

3、各销售机构可根据各自情况设定首次最低申购、单笔追加申购、定期定额投资金额，单笔最低赎回、转换转出及最低持有份额，除基金管理人另有公



告外，不得低于基金管理人规定的上述最低金额/份额限制。投资者在各销售机构进行投资时应以销售机构的公告为准。

4、基金管理人有权规定单一投资者单日或单笔申购金额上限，具体金额请参见更新的招募说明书或相关公告；

5、基金管理人有权规定本基金的总规模限额和单日净申购比例上限，具体规模或比例上限请参见更新的招募说明书或相关公告；

6、当接受申购申请对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时，基金管理人应当采取设定单一投资者申购金额上限或基金单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停基金申购等措施，切实保护存量基金份额持有人的合法权益，具体参见基金管理人相关公告；

7、各销售机构可根据各自情况设定最低申购、追加申购、定期定额投资金额，场外最低赎回、转换转出及最低持有份额，除本公司另有公告外，不得低于本公司规定的上述最低金额/份额限制。投资者在各销售机构进行投资时应以销售机构官方公告为准。

8、基金管理人可根据市场情况，在法律法规允许的情况下，调整上述规定的申购的金额和赎回的份额数量限制，基金管理人必须在调整前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

## 六、场外申购和赎回的费用

### 1、场外申购费用

本基金提供两种场外认购费用的支付模式。本基金在申购时收取的申购费用称为前端申购费用，在赎回时收取的申购费用称为后端申购费用。基金投资人可以选择支付前端申购费用或后端申购费用。

前端申购费用的具体费率如下：

申购金额 M（元）	费率
$M < 50$ 万	1.5%
$50 \text{ 万} \leq M < 200$ 万	0.8%
$200 \text{ 万} \leq M < 500$ 万	0.4%
$M \geq 500$ 万	每笔 1000 元

后端申购费用按持有年限逐年递减，具体费率如下：

持有年限 Y（年）	费率
$Y < 1$	1.8%
$1 \leq Y < 2$	1.0%
$2 \leq Y < 3$	0.6%
$Y \geq 3$	0

投资人在一天之内如果有多笔申购，申购费按每笔申购申请单独计算。

本基金的申购费用由投资人承担，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

2、赎回费：本基金的场外赎回费率按持有年限逐年递减，具体费率如下：

持有年限 Y	费率
$Y < 7$ 日	1.5%
$7 \text{ 日} \leq Y < 1$ 年	0.6%
$1 \text{ 年} \leq Y < 2$ 年	0.3%
$Y \geq 2$	0

本基金的赎回费用在投资人赎回本基金份额时收取。本基金的赎回费用由赎回申请人承担，不低于赎回费总额的 50% 应归基金财产，其中对持续持有期少于 7 日的投资者收取的赎回费全额计入基金财产，其余用于支付注册登记费和其他必要的手续费。

3、基金管理人可以在履行相关手续后，在基金合同约定的范围内调整申购、赎回费率或调整收费方式，并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

4、基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，针对以特定交易方式（如网上交易、电话交易等）等进行基金交易的投资人定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行必要手续后，基金管理人可以适当调低基金申购费率和基金赎回费率。

## 七、场外申购份额与赎回金额的计算公式

## 1、基金申购份额的计算

本基金场外申购采用金额申购的方式。

本基金提供两种场外申购费用的支付模式。投资人可以选择前端收费模式，即在申购时支付申购费用；也可以选择后端收费模式，即在赎回时才支付相应的申购费用，该费用随基金份额的持有时间而递减。选择后端收费模式的场外申购基金份额不能跨系统转托管，持有的基金份额不能上市交易。

场外申购份额计算结果保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。具体计算方法如下：

### 1) 前端收费模式

当申购费用适用比例费率时，申购份数的计算方法如下：

$$\text{申购费用} = \text{申购金额} - \text{申购金额} / (1 + \text{申购费率})$$

（注：对于适用固定金额申购费的申购，申购费用=固定申购费金额）

$$\text{净申购金额} = \text{申购金额} - \text{申购费用}$$

（注：对于适用固定金额申购费的申购，净申购金额=申购金额-固定申购费金额）

$$\text{申购份额} = \text{净申购金额} / \text{T 日基金份额净值}$$

例：某投资人投资 10,000 元以前端收费方式申购本基金，其对应费率为 1.5%，假设申购当日基金份额净值为 1.128 元，则其可得到的基金份额计算如下：

$$\text{申购费用} = 10,000 - 10,000 / (1 + 0.015) = 147.78 \text{ 元}$$

$$\text{净申购金额} = 10,000 - 147.78 = 9,852.22 \text{ 元}$$

$$\text{申购份额} = 9,852.22 / 1.128 = 8,734.23 \text{ 份}$$

即投资人投资 10,000 元以前端收费方式申购本基金，假设申购当日基金份额净值为 1.128 元，可得到 8,734.23 份基金份额。

### 2) 后端收费模式

$$\text{申购份额} = \text{申购金额} / \text{申购当日基金份额净值}$$

当投资人提出赎回时，后端申购费用的计算方法为：

$$\text{后端申购费用} = \text{赎回份额} \times \text{申购日基金份额净值} \times \text{后端申购费率}$$

例：某投资人投资 10,000 元以后端收费方式申购本基金，假设申购当日基金份额净值为 1.128 元，则其可得到的基金份额计算如下：

申购份额=10,000/1.128=8,865.25 份

即投资人投资 10,000 元以后端收费方式申购本基金，假设申购当日基金份额净值为 1.128 元，可得到 8,865.25 份基金份额。

## 2、基金赎回金额的计算

①如果投资人在申购时选择前端收费模式，则赎回份额的计算方法如下：

赎回金额以当日基金份额净值为基准计算，计算结果以四舍五入的方式保留到小数点后 2 位。

赎回总金额=赎回份额×赎回当日基金份额净值

赎回费用=赎回总金额×赎回费率

净赎回金额=赎回总金额-赎回费用

例 1：某基金份额持有人持有以前端收费方式认购或申购的本基金份额 10,000 份一年后（未满 2 年）决定赎回，对应的赎回费率为 0.3%，假设赎回当日基金份额净值是 1.148 元，则可得到的净赎回金额为：

赎回总金额=10,000×1.148=11,480 元

赎回费用=11,480×0.3%=34.44 元

净赎回金额=11,480-34.44=11,445.56 元

即：某基金份额持有人持有以前端收费方式认购或申购的本基金份额 10,000 份一年后（未满 2 年）赎回，假设赎回当日基金份额净值是 1.148 元，则可得到的净赎回金额为 11,445.56 元。

②如果投资人在申购时选择后端收费模式，则赎回份额的计算方法如下：

赎回总额=赎回份额×赎回当日基金份额净值

后端申购费用=赎回份额×申购日基金份额净值×后端申购费率

赎回费用=赎回总额×赎回费率

赎回金额=赎回总额-后端（认）申购费用-赎回费用

赎回金额单位为元，赎回金额按四舍五入的原则保留到小数点后两位。

基金赎回份额的计算公式由基金管理人确定，如有变更，以最新的公告或招募说明书为准。

例 2：某基金份额持有人持有以后端收费方式认购的本基金份额 10,000 份一年后（未满 2 年）决定赎回，对应的赎回费率为 0.3%，对应的后端认购费率为 0.8%。假设赎回当日基金份额净值是 1.148 元，则可得到的净赎回金额为：

赎回总金额 =  $10,000 \times 1.148 = 11,480$  元

赎回费用 =  $11,480 \times 0.3\% = 34.44$  元

后端认购费用 =  $10,000 \times 1.000 \times 0.8\% = 80.00$  元

净赎回金额 =  $11,480 - 34.44 - 80.00 = 11,365.56$  元

即：某基金份额持有人持有以后端收费方式认购的本基金份额 10,000 份一年后（未满 2 年）赎回，假设赎回当日基金份额净值是 1.148 元，则可得到的净赎回金额为 11,365.56 元。

例 3：某基金份额持有人持有以后端收费方式申购的本基金份额 10,000 份一年后（未满 2 年）决定赎回，对应的赎回费率为 0.3%，对应的后端申购费率为 1.0%。假设申购当日基金份额净值为 1.100 元，赎回当日基金份额净值是 1.148 元，则可得到的净赎回金额为：

赎回总金额 =  $10,000 \times 1.148 = 11,480$  元

赎回费用 =  $11,480 \times 0.3\% = 34.44$  元

后端申购费用 =  $10,000 \times 1.100 \times 1.0\% = 110.00$  元

净赎回金额 =  $11,480 - 34.44 - 110.00 = 11,335.56$  元

即：某基金份额持有人持有以后端收费方式申购的本基金份额 10,000 份一年后（未满 2 年）赎回，假设申购当日基金份额净值为 1.100 元，赎回当日基金份额净值是 1.148 元，则可得到的净赎回金额为 11,335.56 元。

3、T 日的基金份额净值在当天收市后计算，并在 T+1 日内公告。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。本基金基金份额净值的计算，保留到小数点后 3 位，小数点后第 4 位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

#### 4、申购份额、余额的处理方式：

申购的有效份额为按实际确认的申购金额在扣除相应的费用后，以当日基金份额净值为基准计算，场外申购份额计算结果保留到小数点后 2 位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

#### 5、赎回金额的处理方式：

赎回金额为按实际确认的有效赎回份额以当日基金份额净值为基准并扣除相应的费用，赎回金额计算结果保留到小数点后 2 位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

## 八、场外申购和赎回的注册登记

1、投资人 T 日申购基金成功后，正常情况下，注册登记机构在 T+1 日为投资人增加权益并办理注册登记手续，投资人自 T+2 日起有权赎回该部分基金份额。

2、投资人 T 日赎回基金成功后，正常情况下，注册登记机构在 T+1 日为投资人扣除权益并办理相应的注册登记手续。

3、基金管理人可在法律法规允许的范围内，对上述注册登记办理时间进行调整，但不得实质影响投资人的合法权益，并最迟于开始实施前 3 个工作日在规定媒介上公告。

## 九、拒绝或暂停接受申购申请的情形及处理方式

发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受基金投资人的申购申请：

- （1）因不可抗力导致基金无法正常工作；
- （2）证券交易所在交易时间临时停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；
- （3）基金管理人认为接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益或对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时；
- （4）基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或可能对基金业绩产生负面影响，从而损害现有基金份额持有人的利益；
- （5）发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况；
- （6）接受某一投资者申购申请后导致其份额达到或超过基金总份额 50% 以上的；
- （7）申请超过基金管理人设定的基金总规模、单日净申购比例上限、单一投资者单日或单笔申购金额上限的；
- （8）当前一估值日基金资产净值 50% 以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人暂停估值并采取暂停接受基金申购申请的措施；
- （9）法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述除第（3）、（6）、（7）项以外的暂定申购情形且基金管理人决定暂停申购时，基金管理人应当根据有关规定在规定媒介上刊登暂停申购公

告。如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。

发生上述情形之一的，基金的转入申请按同样的方式处理。

#### 十、暂停赎回或者延缓支付赎回款项的情形及处理方式

发生下列情形时，基金管理人可暂停接受基金投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项：

- （1）因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项；
- （2）证券交易场所交易时间临时停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；
- （3）连续 2 个或 2 个以上开放日发生巨额赎回，导致本基金的现金支付出现困难；
- （4）发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况；
- （5）当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人暂停估值并采取延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请的措施；
- （6）法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形时，基金管理人应在当日立即向中国证监会备案。已成功确认的赎回申请，基金管理人应按时足额支付；如暂时不能足额支付，应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分可延期支付。

#### 十一、巨额赎回的情形及处理方式

##### 1、巨额赎回的认定

若本基金单个开放日内的基金份额净赎回申请（赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过上一开放日的基金总份额的 10%，即认为发生了巨额赎回。

##### 2、巨额赎回的处理方式

当出现巨额赎回时，基金管理人可以根据本基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分顺延赎回。

1) 全额赎回：当基金管理人认为有能力支付投资人的全部赎回申请时，按正常赎回程序执行。

2) 部分顺延赎回：当基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为支付投资人的赎回申请可能会对基金的资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一日基金总份额的 10%的前提下，对其余赎回申请延期予以办理。对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；对于未能赎回部分，投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。

当基金发生巨额赎回且存在单个基金份额持有人超过前一开放日基金总份额 40%以上的赎回申请情形下，基金管理人可以对该基金份额持有人超过 40%以上的赎回申请进行延期办理，具体措施为：对于其未超过前一开放日基金总份额 40%的赎回申请，基金管理人有权根据上述“1) 全额赎回”或“2) 部分顺延赎回”的约定方式与其他基金份额持有人的赎回申请一并办理。对于该基金份额持有人超过前一开放日基金总份额 40%以上的赎回申请进行延期，即与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。但是，如该持有人在提交赎回申请时选择取消赎回，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。如该持有人在提交赎回申请时未作明确选择，其未能赎回部分作自动延期赎回处理。对于场内赎回部分，当日未获受理的赎回申请将自动撤销而不会延至下一开放日办理。

3) 暂停赎回：本基金连续 2 个开放日以上发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受赎回申请；已经确认的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过 20 个工作日，并应当规定媒介上进行公告。



3、巨额赎回的公告：当发生上述延期赎回并延期办理时，基金管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在3个交易日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，并在2日内在规定媒介上刊登公告。

## 十二、暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

（1）发生上述暂停申购或赎回情况的，基金管理人应在规定期限内在规定媒介上刊登暂停公告。

（2）暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前在规定媒介刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并在重新开放申购或赎回日公告最近一个工作日的基金份额净值。

## 十三、基金的转换

基金管理人可以根据相关法律法规以及基金合同的规定决定开办本基金与基金管理人管理的其他基金之间的转换业务，基金转换可以收取一定的转换费，相关规则由基金管理人届时根据相关法律法规及基金合同的规定制定并公告，并提前告知基金托管人与相关机构。

## 十四、定期定额投资计划

基金管理人可以为投资人办理定期定额投资计划，具体规则由基金管理人另行规定。投资人在办理定期定额投资计划时可自行约定每期扣款金额，每期扣款金额必须不低于基金管理人在相关公告或更新的招募说明书中所规定的定期定额投资计划最低申购金额。

## 十五、基金的非交易过户

基金的非交易过户是指注册登记机构受理继承、捐赠和司法强制执行而产生的非交易过户以及注册登记机构认可、符合法律法规的其它非交易过户。无论在上述何种情况下，接受划转的主体必须是依法可以持有本基金基金份额的投资人。

注册登记机构只受理继承、捐赠、司法强制执行和经注册登记机构认可的其他情况下的非交易过户。其中，“继承”指基金份额持有人死亡，其持有的基金份额由其合法的继承人继承；“捐赠”指基金份额持有人将其合法持有的

基金份额捐赠给福利性质的基金会或社会团体的情形；“司法强制执行”是指司法机构依据生效司法文书将基金份额持有人持有的基金份额强制划转给其他自然人、法人、社会团体或其他组织。无论在上述何种情况下，接受划转的主体应符合相关法律法规和基金合同规定的持有本基金份额的投资人的条件。办理非交易过户必须提供注册登记机构要求提供的相关资料。

注册登记机构受理上述情况下的非交易过户，其他销售机构不得办理该项业务。

对于符合条件的非交易过户申请按相关业务规则的有关规定办理。

## **十六、其他情形**

基金份额冻结、解冻的业务，由注册登记机构办理。

注册登记机构只受理国家有关机关依法要求的基金份额的冻结与解冻以及注册登记机构认可的其他情况的基金份额的冻结与解冻。基金份额被冻结的，被冻结部分产生的权益按照法律法规的要求来决定是否冻结。在国家有权机关作出决定之前，被冻结部分产生的权益先行一并冻结。被冻结部分份额仍然参与收益分配与支付。

## 第十部分 基金份额的场内申购与赎回

本章内容仅适用于本基金通过深圳证券交易所会员单位办理的场内申购和赎回业务。登记在证券登记结算系统中的基金份额可直接办理场内申购、赎回业务；登记在注册登记系统中的基金份额可通过办理跨系统转托管业务将基金份额转托管到证券登记结算系统中，再办理场内申购、赎回业务。选择后端收费模式的场外申购基金份额不能跨系统转托管，持有的基金份额不能上市交易。

### 一、场内申购和赎回的办理场所

深圳证券交易所具有相应业务资格的会员单位（具体名单见本基金相关业务公告）。

### 二、申购与赎回的账户

投资人通过场内申购、赎回应使用中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司开立的人民币普通股票账户或证券投资基金账户（账户开立的具体事项参见本基金份额发售公告认购开户相关内容）。

### 三、场内申购和赎回的开放日及开放时间

#### 1、开放日及开放时间

投资人在开放日办理基金份额的申购和赎回，具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间，但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。

基金合同生效后，若出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更或其他特殊情况，基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整，但应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

#### 2、申购与赎回的开始时间

基金管理人自基金合同生效之日起不超过3个月开始办理申购，具体业务办理时间在申购开始公告中规定。

基金管理人自基金合同生效之日起不超过3个月开始办理赎回，具体业务办理时间在赎回开始公告中规定。

在确定申购开始与赎回开始时间后，基金管理人应在申购、赎回开放日前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告申购与赎回的开始时间。

基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购或者赎回或者转换。投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请的，其基金份额申购、赎回、转换价格为下一开放日基金份额申购、赎回、转换的价格。

本基金自2012年5月31日起办理场内日常申购、赎回业务。

#### 四、场内申购和赎回的原则

1、“未知价”原则，即基金份额申购、赎回价格以申请当日收市后计算的基金份额净值为基准进行计算；

2、“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请。申购和赎回申报单位以深圳证券交易所的规定为准；

3、当日的申购与赎回申请可以在当日交易结束时间前撤销，在当日的交易时间结束后不得撤销。

4、赎回遵循“先进先出”原则，即按照投资人认购、申购的先后次序进行顺序赎回；

5、投资人通过深圳证券交易所交易系统办理本基金的场内申购、赎回时，需遵守深圳证券交易所的相关业务规则；

基金管理人在不损害基金份额持有人权益的情况下，可根据基金运作的实际情况依法对上述原则进行调整。基金管理人必须在新原则开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

#### 五、场内申购和赎回的程序

##### 1、申购和赎回的申请方式

基金投资人需遵循深圳证券交易所场内申购赎回相关业务规则，在开放日的业务办理时间内提出申购或赎回的申请。投资人在申购本基金时须按业务办

理单位规定的方式备足申购资金。投资人在提交赎回申请时，其账户内必须有足够的基金份额余额，否则所提交的申购、赎回申请无效而不予成交。

## 2、申购和赎回申请的确认

T日规定时间受理的申请，正常情况下，注册登记机构在T+1日内（包括该日）为投资人对该交易的有效性进行确认，在T+2日后（包括该日）投资人应向销售机构或以销售机构规定的其他方式查询申购与赎回的成交情况。

基金销售机构对申购、赎回申请的受理并不代表申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到申请。申购、赎回的确认以注册登记机构的确认结果为准。

## 3、申购和赎回的款项支付

申购采用全额缴款方式，若申购资金在规定时间内未全额到账则申购不成功，若申购不成功或无效，申购款项将退回投资人账户。由此产生的利息等损失由投资人自行承担。

投资人T日赎回申请成功后，基金管理人将通过注册登记机构及其相关基金销售机构在T+7日（包括该日）内将赎回款项划往基金份额持有人账户。

## 六、场内申购和赎回的数额限制

1、投资人通过业务办理单位场内申购本基金，单笔最低申购金额为1,000元；场内赎回本基金的数额限制，参照深交所相关业务规则办理。

2、基金管理人有权规定单一投资者单日或单笔申购金额上限，具体金额请参见更新的招募说明书或相关公告。

3、基金管理人有权规定本基金的总规模限额和单日净申购比例上限，具体规模或比例上限请参见更新的招募说明书或相关公告。

4、当接受申购申请对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时，基金管理人应当采取设定单一投资者申购金额上限或基金单日净申购比例上

限、拒绝大额申购、暂停基金申购等措施，切实保护存量基金份额持有人的合法权益，具体参见基金管理人相关公告。

5、基金管理人、深圳证券交易所或中国证券登记结算有限责任公司可根据市场情况，在不违反相关法律法规规定的前提下，调整上述限制。基金管理人必须在调整前依照《信息披露办法》的有关规定中国证监会指定的媒体上刊登公告。

## 七、场内申购和赎回的费用

1、本基金场内申购费率如下：

申购金额 M（元）	费率
$M < 50$ 万	1.5%
$50 \text{ 万} \leq M < 200 \text{ 万}$	0.8%
$200 \text{ 万} \leq M < 500 \text{ 万}$	0.4%
$M \geq 500 \text{ 万}$	每笔 1000 元

投资人在一天之内如果有多笔申购，申购费按每笔申购申请单独计算。本基金的申购费用应在投资人申购基金份额时收取。本基金的申购费用由投资人承担，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

2、赎回费：本基金对持续持有期少于 7 日的投资者收取不少于 1.5% 的赎回费；对持续持有期不少于 7 日的投资者，本基金的场内赎回费率为固定值 0.6%。

本基金的赎回费用在投资人赎回本基金份额时收取。本基金的赎回费用由赎回申请人承担。本基金对持续持有期少于 7 日的投资者收取的赎回费全额计入基金财产，其他情况下，不低于赎回费总额的 50% 应归基金财产，其余用于支付注册登记费和其他必要的手续费。

3、基金管理人和基金托管人协商后，可以根据基金和同的相关约定调整费率或收费方式，基金管理人最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介公告。

4、基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，针对以特定交易方式(如网上交易、电话交易等)等进行基金交易的投资者定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行必要手续后，基金管理人可以适当调低基金申购费率和基金赎回费率。

## 八、场内申购份额和赎回金额的计算

### 1、基金申购份额的计算

当申购费用适用比例费率时，申购份数的计算方法如下：

申购费用=申购金额-申购金额/（1+申购费率）

（注：对于适用固定金额申购费的申购，申购费用=固定申购费金额）

净申购金额=申购金额-申购费用

（注：对于适用固定金额申购费的申购，净申购金额=申购金额-固定申购费金额）

申购份额=净申购金额/T 日基金份额净值

申购份额计算结果按截尾法保留到整数位，整数位后小数部分的份额对应的资金返还至投资人资金账户。

例：某投资人通过场内投资 10,000 元申购本基金，对应的申购费率为 1.5%，假设申购当日基金份额净值为 1.025 元，则其申购手续费、可得到的申购份额及返还的资金余额为：

申购费用=10,000-10,000/（1+1.5%）=147.78 元

净申购金额=10,000/-147.78=9,852.22 元

$$\text{申购份额} = 9,852.22 / 1.025 = 9,611.92 \text{ 份}$$

因场内申购份额保留至整数份，故投资人申购所得份额为 9,611 份，整数位后小数部分的申购份额对应的资金返还给投资人。具体计算公式为：

$$\text{实际净申购金额} = 9,611 \times 1.0250 = 9,851.28 \text{ 元}$$

$$\text{退款金额} = 10,000 - 9,851.28 - 147.78 = 0.94 \text{ 元}$$

即：投资人投资 10,000 元从场内申购本基金，假设申购当日基金份额净值为 1.025 元，则其可得到基金份额 9,611 份，退款 0.94 元。

## 2、基金赎回金额的计算

$$\text{赎回总金额} = \text{赎回份额} \times \text{赎回当日基金份额净值}$$

$$\text{赎回费用} = \text{赎回总金额} \times \text{赎回费率}$$

$$\text{净赎回金额} = \text{赎回总金额} - \text{赎回费用}$$

赎回金额计算结果保留到小数点后 2 位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

例：某投资人从场内赎回本基金 10,000 份基金份额，持续持有期不少于 7 日，赎回费率为 0.6%，假设赎回当日基金份额净值为 1.148 元，则其可得净赎回金额为：

$$\text{赎回总金额} = 10,000 \times 1.1480 = 11,480 \text{ 元}$$



赎回费用 =  $11,480 \times 0.6\% = 68.88$  元

净赎回金额 =  $11,480 - 68.88 = 11,411.12$  元

即：投资人从深圳证券交易所场内赎回本基金 10,000 份基金份额，持续持有期不少于 7 日，假设赎回当日基金份额净值为 1.148 元，则可得到的净赎回金额为 11,411.12 元。

## 九、场内申购与赎回的注册登记

本基金场内申购和赎回的注册与过户登记业务，按照深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的有关规定办理。

十、办理本基金份额场内申购、赎回业务应遵守深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的有关业务规则。若相关法律法规、中国证监会、深圳证券交易所或中国证券登记结算有限责任公司对场内申购、赎回业务规则有新的规定，将按新规定执行。

十一、有关基金份额净值的计算、拒绝或暂停申购、暂停赎回或者延缓支付赎回款项、巨额赎回的情形及处理方式、重新开放申购或赎回的公告、基金的转换、定期定额投资计划、基金的非交易过户及基金的冻结与解冻等请参见基金合同中关于“基金份额的场外申购和赎回”部分的相关规定以及深圳证券交易所的有关规定，并据此执行。

# 第十一部分 基金份额的登记、系统内转托管和跨系统转托管

## 一、基金份额的登记

本基金的份额采用分系统登记的原则。场外认购或申购买入的基金份额登记在注册登记系统持有人开放式基金账户下；场内认购、申购或上市交易买入

的基金份额登记在证券登记结算系统持有人证券账户下。登记在证券登记结算系统中的基金份额既可以在深圳证券交易所上市交易，也可以直接申请场内赎回。登记在注册登记系统中的基金份额可申请场外赎回。

## 二、系统内转托管

1、系统内转托管是指基金份额持有人将持有的基金份额在注册登记系统内不同代销机构之间或证券登记结算系统内不同会员单位之间进行转登记的行为。

2、基金份额登记在注册登记系统的基金份额持有人在变更办理基金赎回业务的销售机构（网点）时，销售机构（网点）之间不能通存通兑时的，可办理已持有基金份额的系统内转托管。

具体办理方法参照相关业务规则的有关规定以及基金代销机构的业务规则。

## 三、跨系统转托管

1、跨系统转托管是指基金份额持有人将持有的基金份额在注册登记系统和证券登记结算系统之间进行转登记的行为。

2、场外选择后端收费模式的投资人不能跨系统转托管到场内。

3、本基金跨系统转托管的具体业务按照中国证券登记结算有限公司的相关规定办理。

## 第十二部分 基金的投资

### 一、投资目标

本基金以挖掘“轻资产公司”为主要投资策略，力求获取当前收益及实现长期资本增值。

### 二、投资范围和投资比例

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及存托凭证（包括中小板、创业板以及其他经中国证监会核准上市的股票及存托凭证）、债券、货币市场工具、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（但需符合中国证监会的相关规定）。

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，股票投资比例为基金资产的 60%-95%，其中，符合轻资产投资理念的股票合计投资比例不低于股票资产的 80%；债券、货币市场工具、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（但需符合中国证监会的相关规定）投资比例为基金资产的 5%-40%，其中本基金保留不低于基金资产净值的 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，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。

### 三、投资策略

#### 1、资产配置策略

在大类资产配置上，本基金采取定性与定量研究相结合，在股票与债券等资产类别之间进行资产配置。

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

投资决策委员会将定期或根据需要召开会议，审议基金经理对于资产配置

策略的分析结论，确定今后一段时间内资产配置策略，即基金投资组合中股票和其他金融品种的构成比例。基金经理执行审定后的资产配置计划。

## 2、“轻资产公司”筛选策略

### （1）“轻资产公司”的内涵与范畴

本基金将公司资源分为轻资产与重资产两类，轻资产通常是指公司的管理经验、企业品牌、客户关系、人力资本等无形资产，与之相对应的，重资产通常是指固定资产等有形资产。

轻资产经营是指不过多依赖固定资产或有形资产投资来实现业务扩张的商业模式。对应的，“轻资产公司”通常是指经营所占用资本较少，通常所依赖的固定资产资本较少的一类公司。基金认为在固定资产等投入资本给定的情况下，公司经营所获回报越高，那么轻资产对回报的贡献就越大。

#### 1) 轻资产是公司独特能力与核心优势

以基于资源的观点（View Based on Resource）看，轻资产应该具有稀缺性、不易模仿性、不可替代性等等特征。进一步，轻资产还应具有异质性，也即轻资产公司因拥有其他公司缺乏的资源而获得竞争优势；这种异质性还因轻易不能在行业间完全复制与流动而具有持续性。

#### 2) 轻资产经营是一种商业模式

从轻资产经营对于公司发展的本质来理解，本基金认为轻资产经营体现了一种致力于充分挖掘公司所拥有的所有生产要素潜能和作用的商业模式和战略理念。在本质上，相比于传统的商业模式，轻资产经营模式是指不过多依赖固定资产等重资产投资来实现业务扩张的模式，而是发挥公司所特有的资源、能力，以此摆脱重资产为企业带来的高成本和低效率问题，从而获得更有利并持续的竞争优势。

#### 3) 轻资产运营既强调资产的轻重，也强调资本管理与运营效率的提高

本基金认为应从两个层面考察公司的轻资产经营能力，既强调轻资产相对重资产对公司回报的贡献比较；也强调其所拥有资产的管理水平与效率的提高。

### （2）“轻资产公司”筛选体系的基本框架

本基金认为轻资产经营是公司独特商业模式，而轻资产是该类公司的重要、乃至独特的资源要素。具体而言，从轻资产要素来源层面，包括人力资本、商誉、品牌、研发创新能力、组织管理乃至组织文化等等要素。

### 1) 品牌

一家公司的品牌要素是最轻的资产，是一种无形资产，高度的品牌价值能够使一个企业立于不败之地，使得公司的现金流和净利润比较稳定，同时其也是最难以建设和运用的轻资产要素，良好的品牌需要公司的长期经营。

品牌经营上可采用商誉，Adv/Sales（广告费用/销售收入）指标，市场占有率指标，品牌覆盖率指标，重复购买率等指标来衡量。

通过公司品牌树立与推广而形成的良好客户认可度，将成为公司的竞争优势，使得公司较之同行获得更高的毛利率、净利率水平，更快的销售周转率，从而轻资产创造的价值越大。

### 2) 人力资本与研发创新

人力资本发挥的作用与智慧是一家公司研发与创新的最终源泉，除了拥有一批优秀的研发创新，以及管理人才之外，充满活力与鼓励创新精神的组织文化也是重要保障。研发与创新要素是一家公司实现核心竞争力的关键体现，不但包括产品研发，还涉及管理、服务等方面的技术或模式的创新。更广泛意义上，在熊彼特的创新理论框架下，涉及的层面包括产品创新、技术创新、市场创新、资源配置创新、组织创新等等。

表现在公司运营层面上，可以通过合理的研发人员、管理人才配比、研发投入占主营业务收入比例等指标评估公司的研发与创新能力。

### 3) 渠道控制与供应链关系

供应链关系维系或渠道控制能力的强弱，除了公司品牌效应发挥作用外，是否拥有高效率、高质量、利益共享、激励约束共容的渠道管理机制至关重要。

本基金认为供应链管理能力强弱，体现了一个公司与上游供货商和下游客户关系的好坏，可以直接影响该公司的应收账款周转率与应付账款周转率，从而影响其净现金流与净利润。

### 4) 资产运营效率与管理水平

轻资产公司绝非排斥固定资产、营运资本等的资本投入，而是强调如何在公司经营过程中提高其所拥有的固定资产、营运资本的运营效率与管理水平。在其他条件不变的情况下，固定资产等的资产运营效率与管理水平越高，则单位资产所获得的回报也就越高。

本基金以固定资产周转率、固定资产折旧水平与政策等指标来考察固定资

产运营效率与管理水平；以应收账款、应付账款、存货周转率与政策等指标来考察营运资本效率与管理水平。

#### 5) 组织管理与组织文化

良好的组织管理水平与组织文化决定了公司营运模式和应变能力，有弹性、好研发与好学习的组织能减少管理成本、提高资产配置能力，从而提高包括轻资产、重资产在内的资产运营效率，并提高公司整体营运效率。

#### (3) 轻资产公司的经营业绩度量

在具体的公司营运过程中，各类资产要素及其营运效率通常是作为一个整体而对公司盈利产生贡献。

本基金认为通过对固定资产等重资产经营占比，贡献占比等等这些可以具体量化的指标，可以反过来对轻资产的经营业绩进行度量。本基金选择以下指标进行具体度量：固定资产/净资产或总资产比例（FA/NA、FA/TA）、销售收入/固定资产（Sale/FA）以及投入资本报酬率（ROIC）等。

其中，固定资产占净资产以及总资产的比例越低，公司营运所需的（最）重资产比例越低；而销售收入/固定资产比例越高，则表明单位固定资产所获取的经营收入就越高，反之，公司轻资产对收入的贡献也就越高；投入资本报酬率则是反映公司运用资源的能力，是现金税后净营业利润与投入资本之比，其中投入资本包括固定资产净额、净营运资金以及其他资产。与 ROE 相比，ROIC 综合考虑了公司财务杠杆以及股权与债权等财务成本，因此是比 ROE 更准确反映公司价值创造能力。

本基金认为尽管轻资产公司的盈利水平具有一定可持续性，但现实中的公司盈利仍不免受到行业发展趋势，供需关系，经济周期、宏观政策，甚至是会计政策（比如存货或折旧政策影响）等多种因素影响，因此，本基金通过考察经行业调整的指标，以及采用长期（比如三年或五年长期平均）指标平滑行业以及时间周期的影响。

本基金认为单纯通过一两个指标无法准确地衡量一家公司的绩效，因此，本基金还以其他财务指标进行综合考察。比如：固定资产周转率、应收账款周转率、总资产周转率；ROE、销售净利润率、企业税率、折旧、权益/总资产、广告费用/销售收入、广告费用/总营业费用、研发费用/销售收入等。同时，也将对一些需通过实地调研的定性指标如品牌影响力、研发投入、人力资本情况

等综合进行考量。

综上所述，本基金运用多重指标因子，综合评估判断，最终筛选出各行业内的轻资产公司予以关注和投资。

#### （4）轻资产公司的估值

任何公司都应该以合适的价格购买，因此，在选择出轻资产公司后，应当选择适当的估值方法对公司进行估值。

各种估值模型各具优劣，本基金选择 EVA（经济附加值）模型作为主要估值模型，原因在于 EVA 以价值创造（超额报酬）为核心，衡量了扣除资本占用费用后公司经营产生的利润，因此是度量经营效率和资本使用效率的综合指标。根据 EVA 模型（ $EVA = \text{投入资本} \times (\text{ROIC} - \text{WACC})$ ），公司合理价值等于未来预期的超额回报贴现之和，本基金认为公司股价围绕合理价值在一定区间波动，但价格与价值在长期必然趋同。

本基金认为轻资产经营是一种商业模式，而优秀的轻资产公司也绝非通过几个财务指标，而至估值模型就能筛选出来的，更何况，还应该仔细辨别那些“伪轻资产公司”，这类公司通常善于利用财务信息粉饰业绩、鼓吹轻资产经营模式的转型，过于注重广告、营销，盲目进行研发投入，品牌建设等。

因此，本基金注重结合实地调研，深入理解公司商业模式，定量定性相结合，综合判断，以选择出优秀的轻资产公司进行投资。

### 3、行业配置策略

本基金选择那些优秀的轻资产公司进行投资，在行业配置上，本基金除积极配置于那些在产品、服务以及业务属性上具有轻资产特征的行业。

在具体的行业选择上，本基金将重点关注包括金融、服务、科技、传媒、文化娱乐、教育、物流、零售等等在内的第三产业或服务业，这些行业的共同特点通常是占用较少的固定资产，而更多的提供服务、致力于品牌建设等等。

在长期内，本基金的行业配置并不过于追求与基准的行业配置保持平衡，也不过于追求对某些个别行业的显著集中配置。但在实际的选股过程中，可投资标的可能会过于集中于个别行业，本基金将对行业配置进行优化，为避免实际投资过程中的长期显著行业偏离导致的风险。

### 4、存托凭证投资策略

对于存托凭证投资，依照上述上市交易的股票投资策略执行。

#### 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。

#### 6、债券投资策略

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

### 四、投资决策程序

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

#### 1、投资决策依据

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

#### 2、决策机制与程序

本基金实行投资决策委员会领导下的基金经理负责制。

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

具体的基金投资决策程序如下：

#### （1）研究策划

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



库，为本基金的投资管理提供决策依据。

#### （2）资产配置

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

#### （3）构建投资组合

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

#### （4）组合的监控和调整

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

#### （5）投资指令下达

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

#### （6）指令执行及反馈

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

#### （7）风险控制

风险管理委员会根据市场变化对投资组合计划提出风险防范措施，风险管理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

FOF 投资与金融工程部将定期对基金的业绩进行归因分析，找出基金投资管理的长处和不足，为日后的管理提供客观的依据。

### 五、业绩比较基准

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

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 个工作日在中国证监会规定媒介上公告，并在更新的招募说明书中列示，而无需召开基金份额持有人大会。

## 六、风险收益特征

本基金为混合型基金产品，属于较高风险、较高收益的基金品种，其预期风险收益水平高于债券型基金及货币市场基金。

## 七、投资组合限制与禁止行为

除另有说明外，以下投资限制及禁止行为适用于本基金存续的全部期间。

### 1、投资组合限制

本基金的投资组合将遵循以下限制：

（1）本基金股票投资比例为基金资产的 60%-95%；债券、货币市场工具、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（但需符合中国证监会的相关规定）投资比例为基金资产的 5%-40%；

（2）保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

（3）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%；

（4）本基金管理人管理的全部基金持有一家发行的证券，不超过该证券的 10%；

（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%；

（6）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%；

（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%；

（9）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%；

（10）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%；

（11）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%；

（12）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；

（13）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；

（14）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%；

（15）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；

（16）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%；

（17）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；

（18）本基金投资存托凭证的比例限制依照境内上市交易的股票进行，与境内上市交易的股票合并计算；

（19）相关法律法规以及监管部门规定的其它投资限制。

如果法律法规或监管部门对上述约定的投资组合比例规定进行变更的，以变更后的规定为准。有关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。

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。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

除上述（2）、（12）、（15）、（17）项外，由于证券市场波动、上市公司合并或基金规模变动等基金管理人之外的原因导致的投资组合不符合上述约

定的比例不在限制之内，但基金管理人应在 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。

## 2、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。

## 八、基金管理人代表基金行使股东权利及债权人权利的处理原则及方法

- 1、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东权利及债权人权利，保护基金份额持有人的利益；
- 2、不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司的经营管理；
- 3、有利于基金财产的安全与增值；
- 4、不通过关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利害关系的第三人牟取任何不当利益。

## 九、基金的融资、融券

本基金可以按照国家有关法律法规和政策的规定进行融资融券。

## 十、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。

基金托管人招商银行根据本基金合同规定，复核了本投资组合报告，保证

复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据取自兴全轻资产投资混合型证券投资基金（LOF）2023年第1季度报告，所载数据截至2023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	4,069,057,364.09	87.30
	其中：股票	4,069,057,364.09	87.30
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	21,211,990.19	0.46
	其中：债券	21,211,990.19	0.46
	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	495,013,413.23	10.62
8	其他资产	75,645,980.25	1.62
9	合计	4,660,928,747.76	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	23,973,680.00	0.52
C	制造业	2,506,070,456.85	54.00

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	230,799,979.54	4.97
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	124,686,945.96	2.69
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	536,092,721.92	11.55
J	金融业	-	-
K	房地产业	647,360,051.28	13.95
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	73,528.54	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	4,069,057,364.09	87.68

(2) 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：无。

3、期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

(1) 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	600048	保利发展	30,917,608	436,865,801.04	9.41

2	002138	顺络电子	16,241,538	424,391,387.94	9.14
3	002371	北方华创	1,103,197	293,284,922.45	6.32
4	300567	精测电子	2,544,109	167,275,166.75	3.60
5	002036	联创电子	10,670,693	136,478,163.47	2.94
6	600131	国网信通	6,802,363	135,639,118.22	2.92
7	688777	中控技术	1,299,881	134,992,641.85	2.91
8	600027	华电国际	22,999,986	133,169,918.94	2.87
9	001979	招商蛇口	9,325,820	127,017,668.40	2.74
10	002415	海康威视	2,794,580	119,216,782.80	2.57

#### 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	-	-
	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（可交换债）	21,211,990.19	0.46
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	21,211,990.19	0.46

#### 5、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	123176	精测转2	119,174	15,969,691.48	0.34

2	132026	G 三峡 EB2	49,050	5,242,298.71	0.11
---	--------	----------	--------	--------------	------

**6、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资产支持证券投资明细**

注：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**

注：贵金属暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

**8、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权证投资明细**

注：本基金本报告期末未持有权证。

**9、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**

注：股指期货暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

**（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**

注：国债期货暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

**（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是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形**

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）基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库**

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	968,857.92
2	应收证券清算款	73,267,792.51
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,409,329.82
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	75,645,980.25

**(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

注：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**

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

**(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。

### 第十三部分 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 2012 年 4 月 5 日，基金业绩截止日 2023 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
2023 年第 1 季度	-0.49%	0.88%	3.88%	0.68%	-4.37%	0.20%
2022 年度	-26.22%	1.40%	-16.90%	1.02%	-9.32%	0.38%
2021 年度	18.67%	1.22%	-2.80%	0.94%	21.47%	0.28%
2020 年度	40.05%	1.52%	22.40%	1.14%	17.65%	0.38%
2019 年度	41.46%	1.23%	29.44%	0.99%	12.02%	0.24%
2018 年度	-15.30%	1.31%	-19.20%	1.07%	3.90%	0.24%
2017 年度	27.48%	0.88%	16.73%	0.51%	10.75%	0.37%
2016 年度	-7.55%	1.65%	-8.32%	1.12%	0.77%	0.53%
2015 年度	101.66%	2.34%	7.36%	1.99%	94.30%	0.35%
2014 年度	37.58%	1.83%	42.92%	0.97%	-5.34%	0.86%
2013 年度	38.45%	1.94%	-6.35%	1.12%	44.80%	0.82%
2012 年度	0.90%	0.85%	2.90%	0.95%	-2.00%	-0.10%
2012 年 4 月 5 日 （基金合同生效日）至 2023 年 3 月 31 日止期间	567.77%	1.53%	69.96%	1.12%	497.81%	0.41%

注：2012 年度数据统计期间为 2012 年 4 月 5 日（基金合同生效日）至 2012 年 12 月 31 日止期间。

## 第十四部分 基金的财产

### 一、基金资产总值

基金资产总值是指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收申购款以及其他资产的价值总和。

其构成主要有：

- 1、银行存款及其应计利息；
- 2、结算备付金及其应计利息；
- 3、根据有关规定缴纳的保证金及其应收利息；
- 4、应收证券交易清算款；
- 5、应收申购款；
- 6、股票投资及其估值调整；
- 7、债券投资及其估值调整和应计利息；
- 8、权证投资及其估值调整；
- 9、其他投资及其估值调整；
- 10、其他资产等。

### 二、基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的净资产值。

### 三、基金财产的账户

本基金财产以基金名义开立银行存款账户，以基金托管人的名义开立证券交易清算资金的结算备付金账户，以基金托管人和本基金联名的方式开立基金证券账户，以本基金的名义开立银行间债券托管账户。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金销售机构和注册登记机构自有的财产账户以及其他基金财产账户相独立。

### 四、基金财产的保管和处分

基金财产独立于基金管理人、基金托管人和代销机构的固有财产，并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人因基金财产的管理、运用或者其他情形而取得的财产和收益归入基金财产。基金管理人、基金托管人可以按基金合同的约定收取管理费、托管费以及其他基金合同约定的费用。基金财产的债权、不得与基金管理人、基金托管人固有财产的债务相抵销，不同基金财产的债权

债务，不得相互抵销。基金管理人、基金托管人以其自有资产承担法律责任，其债权人不得对基金财产行使请求冻结、扣押和其他权利。

基金管理人、基金托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，基金财产不属于其清算财产。

除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定处分外，基金财产不得被处分。非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。

## 第十五部分 基金资产的估值

### 一、估值目的

基金资产估值的目的是客观、准确地反映基金资产是否保值、增值，依据经基金资产估值后确定的基金资产净值而计算出的基金份额净值，是计算基金申购与赎回价格的基础。

### 二、估值日

本基金的估值日为相关的证券交易所的正常营业日以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非营业日。

### 三、估值对象

基金所拥有的股票、权证、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等金融资产和金融负债。

### 四、估值程序

1、基金份额净值是按照每个工作日闭市后，基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算，精确到0.001元，小数点后第四位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

每个工作日计算基金资产净值及基金份额净值，并按规定公告。

2、基金管理人应每个工作日对基金资产估值。基金管理人每个工作日对基金资产估值后，将基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

### 五、估值方法

本基金按以下方式进行估值：

#### 1、证券交易所上市的有价证券的估值

（1）交易所上市的有价证券（包括股票、权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

（2）交易所上市实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

（3）交易所上市未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

（4）交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。交易所上市的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

（1）送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市价（收盘价）估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值。

（2）首次公开发行未上市的股票、债券和权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

（3）首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的市价（收盘价）估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

3、全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值。

4、同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

5、本基金投资存托凭证的估值核算，依照境内上市交易的股票执行。

6、如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

7、相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

如基金管理人或基金托管人发现基金估值违反基金合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时，应立即通知对方，共同查明原因，双方协商解决。

根据有关法律法规，基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任。因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意見，按照基金管理人对于基金资产净值的计算结果对外予以公布。

## 六、估值错误的处理

基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当基金份额净值小数点后3位以内（含第3位）发生差错时，视为基金份额净值错误。

基金合同的当事人应按照以下约定处理：

### 1、差错类型

本基金运作过程中，如果由于基金管理人或基金托管人、或注册登记机构、或代销机构、或投资人自身的过错造成差错，导致其他当事人遭受损失的，过错的责任人应当对由于该差错遭受损失当事人（“受损方”）的直接损失按下述“差错处理原则”给予赔偿。

上述差错的主要类型包括但不限于：资料申报差错、数据传输差错、数据计算差错、系统故障差错、下达指令差错等；对于因技术原因引起的差错，若系同行业现有技术水平不能预见、不能避免、不能克服，则属不可抗力，按照下述规定执行。

由于不可抗力原因造成投资人的交易资料灭失或被错误处理或造成其他差错，因不可抗力原因出现差错的当事人不对其他当事人承担赔偿责任，但因该差错取得不当得利的当事人仍应负有返还不当得利的义务。

### 2、差错处理原则

（1）差错已发生，但尚未给当事人造成损失时，差错责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正差错发生的费用由差错责任方承担；由于差错责任方未及时更正已产生的差错，给当事人造成损失的，由差错责任方对直接损失

承担赔偿责任；若差错责任方已经积极协调，并且有协助义务的当事人有足够的时间进行更正而未更正，则其应当承担相应赔偿责任。差错责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认，确保差错已得到更正。

（2）差错的责任方对有关当事人的直接损失负责，不对间接损失负责，并且仅对差错的有关直接当事人负责，不对第三方负责。

（3）因差错而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但差错责任方仍应对差错负责。如果由于获得不当得利的当事人不返还或不全部返还不当得利造成其他当事人的利益损失（“受损方”），则差错责任方应赔偿受损方的损失，并在其支付的赔偿金额的范围内对获得不当得利的当事人享有要求返还不当得利的权利；如果获得不当得利的当事人已经将此部分不当得利返还给受损方，则受损方应当将其已经获得的赔偿额加上已经获得的不当得利返还的总和超过其实际损失的差额部分支付给差错责任方。

（4）差错调整采用尽量恢复至假设未发生差错的正确情形的方式。

（5）差错责任方拒绝进行赔偿时，如果因基金管理人过错造成基金财产损失时，基金托管人应为基金的利益向基金管理人追偿，如果因基金托管人过错造成基金财产损失时，基金管理人应为基金的利益向基金托管人追偿。基金管理人和基金托管人之外的第三方造成基金财产损失，并拒绝进行赔偿时，由基金管理人负责向差错方追偿；追偿过程中产生的有关费用，应列入基金费用，从基金资产中支付。

（6）如果出现差错的当事人未按规定对受损方进行赔偿，并且依据法律法规、基金合同或其他规定，基金管理人自行或依据法院判决、仲裁裁决对受损方承担了赔偿责任，则基金管理人有权向出现过错的当事人进行追索，并有权要求其赔偿或补偿由此发生的费用和遭受的直接损失。

（7）按法律法规规定的其他原则处理差错。

### 3、差错处理程序

差错被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

（1）查明差错发生的原因，列明所有的当事人，并根据差错发生的原因确定差错的责任方；

（2）根据差错处理原则或当事人协商的方法对因差错造成的损失进行评估；



（3）根据差错处理原则或当事人协商的方法由差错的责任方进行更正和赔偿损失；

（4）根据差错处理的方法，需要修改基金注册登记机构交易数据的，由注册登记机构进行更正，并就差错的更正向有关当事人进行确认。

#### 4、基金份额净值差错处理的原则和方法如下：

（1）基金份额净值计算出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，通报基金托管人，并采取合理的措施防止损失进一步扩大。

（2）错误偏差达到基金份额净值的 0.25%时，基金管理人应当通报基金托管人并报中国证监会备案；错误偏差达到基金份额净值的 0.5%时，基金管理人应当公告、通报基金托管人并报中国证监会备案。

（3）因基金份额净值计算错误，给基金或基金份额持有人造成损失的，应由基金管理人先行赔付，基金管理人按差错情形，有权向其他当事人追偿。

（4）基金管理人和基金托管人由于各自技术系统设置而产生的净值计算尾差，以基金管理人计算结果为准。

（5）前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。

### 七、暂停估值的情形

1、基金投资所涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停交易时；

2、因不可抗力或其它情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；

3、占基金相当比例的投资品种的估值出现重大转变，而基金管理人为保障投资人的利益，决定延迟估值；

4、当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，基金管理人经与基金托管人协商一致的；

5、法律法规、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

### 八、特殊情形的处理

1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第 6 项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。

2、由于不可抗力原因，或由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误，或国家会计政策变更、市场规则变更等，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应当积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。

## 第十六部分 基金的收益分配

### 一、基金利润的构成

基金利润指基金利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额，基金已实现收益指基金利润减去公允价值变动收益后的余额。

### 二、基金可供分配利润

基金可供分配利润指截至收益分配基准日基金未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

### 三、基金收益分配原则

1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为6次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的60%；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；（本基金场内份额的分红方式只能是现金分红。）

3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

4、每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在不影响基金份额持有人利益的情况下，基金管理人可在法律法规允许的前提下酌情调整以上基金收益分配原则，此项调整不需要召开基金份额持有人大会，但应于变更实施日前在规定媒介上公告。法律、法规或监管机构另有规定的，基金管理人在履行适当程序后，将对上述基金收益分配原则进行调整。

### 四、收益分配方案

基金收益分配方案中应载明截止收益分配基准日的可供分配利润、基金收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。

### 五、收益分配方案的确定、公告与实施

本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核，依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介公告。

基金红利发放日距离收益分配基准日（即可供分配利润计算截止日）的时间不得超过 15 个工作日。

#### **六、基金收益分配中发生的费用**

基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资人自行承担。当投资人的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，注册登记机构可将基金份额持有人的现金红利自动转为基金份额。

## 第十七部分 基金的费用与税收

### 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、基金合同生效后与基金相关的信息披露费用；
- 4、基金合同生效后与基金相关的会计师费、律师费；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金的证券交易费用；
- 7、基金的银行汇划费用；
- 8、基金上市费用；
- 9、按照国家有关规定和基金合同约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

### 二、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

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.5%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 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、公休假等，支付日期顺延。

#### 2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向

基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

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。

### 三、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

- 1、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；
- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
- 3、基金合同生效前的相关费用；
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

### 四、费用调整

基金管理人和基金托管人可协商酌情降低基金管理费和基金托管费，此项调整不需要基金份额持有人大会决议通过。基金管理人必须最迟于新的费率实施日前按照《信息披露办法》的规定在规定媒介上刊登公告。

### 五、基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

## 第十八部分 基金的会计与审计

### 一、基金会计政策

- 1、基金管理人为本基金的会计责任方；
- 2、本基金的会计年度为公历每年的1月1日至12月31日；
- 3、基金的会计核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位；
- 4、会计制度执行国家有关的会计制度；
- 5、本基金独立建账、独立核算；
- 6、基金管理人及基金托管人各自保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关规定编制基金会计报表；
- 7、基金托管人定期与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并书面确认。

### 二、基金的审计

- 1、基金管理人聘请具有从事证券、期货相关业务资格的会计师事务所及其注册会计师对本基金年度财务报表及其他规定事项进行审计。会计师事务所及其注册会计师与基金管理人、基金托管人相互独立。
- 2、会计师事务所更换经办注册会计师时，应事先征得基金管理人同意。
- 3、基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所，须通报基金托管人。更换会计师事务所需依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介公告。

## 第十九部分 基金的信息披露

一、本基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、基金合同及其他有关规定。

### 二、信息披露义务人

本基金信息披露义务人包括基金管理人、基金托管人、召集基金份额持有人大会的基金份额持有人及其日常机构等法律、行政法规和中国证监会规定的自然人、法人和非法人组织。

本基金信息披露义务人以保护基金份额持有人利益为根本出发点，按照法律法规和中国证监会的规定披露基金信息，并保证所披露信息的真实性、准确性、完整性、及时性、简明性和易得性。

本基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内，将应予披露的基金信息披露事项通过中国证监会指定的全国性报刊（以下简称“规定报刊”）及指定互联网网站（以下简称“规定网站”）等媒介披露，并保证基金投资人能够按照基金合同约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。

### 三、本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息，不得有下列行为：

- 1、虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏；
- 2、对证券投资业绩进行预测；
- 3、违规承诺收益或者承担损失；
- 4、诋毁其他基金管理人、基金托管人或者基金份额发售机构；
- 5、登载任何自然人、法人和非法人组织的祝贺性、恭维性或推荐性的文字；
- 6、中国证监会禁止的其他行为。

四、本基金公开披露的信息应采用中文文本。如同时采用外文文本的，基金信息披露义务人应保证不同文本的内容一致。不同文本之间发生歧义的，以中文文本为准。

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。

### 五、公开披露的基金信息

公开披露的基金信息包括：

- （一）招募说明书、基金产品资料概要



基金招募说明书应当最大限度地披露影响基金投资人决策的全部事项，说明基金认购、申购和赎回安排、基金投资、基金产品特性、风险揭示、信息披露及基金份额持有人服务等内容。基金合同生效后，基金招募说明书的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金招募说明书并登载在规定网站上；基金招募说明书其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金招募说明书。

基金产品资料概要是基金招募说明书的摘要文件，用于向投资者提供简明的基金概要信息。《基金合同》生效后，基金产品资料概要的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金产品资料概要，并登载在规定网站及基金销售机构网站或营业网点；基金产品资料概要其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金产品资料概要。

## （二）基金合同

基金合同是界定基金合同当事人的各项权利、义务关系，明确基金份额持有人大会召开的规则及具体程序，说明基金产品的特性等涉及基金投资人重大利益的事项的法律文件。

## （三）托管协议

基金托管协议是界定基金托管人和基金管理人在基金财产保管及基金运作监督等活动中的权利、义务关系的法律文件。

基金管理人应在基金份额发售的 3 日前，将基金招募说明书、基金合同摘要登载在规定媒介上；基金管理人、基金托管人应将基金合同、托管协议登载在各自网站上。

## （四）基金份额发售公告

基金管理人应当就基金份额发售的具体事宜编制基金份额发售公告，并在披露招募说明书的当日登载于规定媒介上。

## （五）基金合同生效公告

基金管理人将在基金合同生效的次日在规定媒介上登载基金合同生效公告。

## （六）基金净值信息

1、本基金的基金合同生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人将至少每周在规定网站披露一次基金份额净值和基金份额累计净值；

2、在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人将在每个开放日的次日，通过规定网站、基金销售机构网站或者营业网点披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值；

3、基金管理人应当在不晚于半年度和年度最后一日的次日，在规定网站披露半年度和年度最后一日的基金份额净值和基金份额累计净值。

#### （七）基金份额申购、赎回价格

基金管理人应当在本基金的基金合同、招募说明书等信息披露文件上载明基金份额申购、赎回价格的计算方式及有关申购、赎回费率，并保证投资人能够在基金销售机构网站或营业网点查阅或者复制前述信息资料。

#### （八）基金定期报告，包括基金年度报告、基金中期报告、基金季度报告

1、基金管理人应当在每年结束之日起三个月内，编制完成基金年度报告，将年度报告登载在规定网站上，并将年度报告提示性公告登载在规定报刊上。基金年度报告中的财务会计报告应当经过具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计；

2、基金管理人应当在上半年结束之日起两个月内，编制完成基金中期报告，将中期报告登载在规定网站上，并将中期报告提示性公告登载在规定报刊上；

3、基金管理人应当在季度结束之日起 15 个工作日内，编制完成基金季度报告，将季度报告登载在规定网站上，并将季度报告提示性公告登载在规定报刊上；

4、基金合同生效不足 2 个月的，本基金管理人可以不编制当期季度报告、中期报告或者年度报告。

5、如报告期内出现单一投资者持有基金份额数的比例超过基金份额总数 20%的情形，为保障其他投资者权益，基金管理人应当在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告“影响投资者决策的其他重要信息”项下披露该投资者的类别、报告期末持有份额及占比、报告期内持有份额变化情况及本基金的特定风险。

6、本基金持续运作过程中，应当在基金年度报告和中期报告中披露基金组合资产情况及其流动性风险分析等。

#### （九）临时报告

本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在 2 日内编制临时报告书，

并登载在规定报刊和规定网站上。

前款所称重大事件，是指可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的下列事件：

- 1、基金份额持有人大会的召开及决定的事项；
- 2、《基金合同》终止、基金清算、基金终止上市交易；
- 3、转换基金运作方式、基金合并；
- 4、更换基金管理人、基金托管人、基金份额登记机构，基金改聘会计师事务所；
- 5、基金管理人委托基金服务机构代为办理基金的份额登记、核算、估值等事项，基金托管人委托基金服务机构代为办理基金的核算、估值、复核等事项；
- 6、基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；
- 7、基金管理人变更持有百分之五以上股权的股东、基金管理人的实际控制人变更；
- 8、基金募集期延长或提前结束募集；
- 9、基金管理人的高级管理人员、基金经理和基金托管人专门基金托管部门负责人发生变动；
- 10、基金管理人的董事在最近 12 个月内变更超过百分之五十，基金管理人、基金托管人专门基金托管部门的主要业务人员在最近 12 个月内变动超过百分之三十；
- 11、涉及基金财产、基金管理业务、基金托管业务的诉讼或仲裁；
- 12、基金管理人或其高级管理人员、基金经理因基金管理业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚，基金托管人或其专门基金托管部门负责人因基金托管业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚；
- 13、基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有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，或者从事其他重大关联交易事项，但中国证监会另有规定的除外；
- 14、基金收益分配事项；
- 15、管理费、托管费、申购费、赎回费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；
- 16、基金份额净值计价错误达基金份额净值百分之零点五；

- 17、本基金开始办理申购、赎回；
- 18、本基金发生巨额赎回并延期办理；
- 19、本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项；
- 20、本基金暂停接受申购、赎回申请或重新接受申购、赎回申请；
- 21、基金上市交易公告；
- 22、本基金发生涉及申购、赎回事项调整，或潜在影响投资人赎回等重大事项；
- 23、基金信息披露义务人认为可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的其他事项或中国证监会或基金合同规定的其他事项。

#### （十）澄清公告

在基金合同存续期限内，任何公共媒体中出现的或者在市场上流传的消息可能对基金份额价格产生误导性影响或者引起较大波动，以及可能损害基金份额持有人权益的，相关信息披露义务人知悉后应当立即对该消息进行公开澄清，并将有关情况立即报告中国证监会、基金上市交易的证券交易所。

#### （十一）基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报国务院证券监督管理机构核准或者备案，并予以公告。

#### （十二）清算报告

基金合同终止的，基金管理人应当依法组织基金财产清算小组对基金财产进行清算并作出清算报告。基金财产清算小组应当将清算报告登载在规定网站上，并将清算报告提示性公告登载在规定报刊上。

#### （十三）中国证监会规定的其他信息

### 六、信息披露事务管理

基金管理人、基金托管人应当建立健全信息披露管理制度，指定专门部门及高级管理人员负责管理信息披露事务。

基金信息披露义务人公开披露基金信息，应当符合中国证监会相关基金信息披露内容与格式准则等法规的规定。

基金托管人应当按照相关法律法规、中国证监会的规定和基金合同的约定，对基金管理人编制的基金资产净值、基金份额净值、基金份额申购赎回价格、基金定期报告、更新的招募说明书、基金产品资料概要、基金清算报告等公开

披露的相关基金信息进行复核、审查，并向基金管理人进行书面或电子确认。

基金管理人应当在规定报刊中选择一家报刊披露本基金信息。基金管理人、基金托管人应当向中国证监会基金电子披露网站报送拟披露的基金信息，并保证相关报送信息的真实、准确、完整、及时。

基金管理人、基金托管人除依法在规定媒介上披露信息外，还可以根据需要其他公共媒体披露信息，但是其他公共媒体不得早于规定媒介、基金上市交易的证券交易所网站披露信息，并且在不同媒介上披露同一信息的内容应当一致。

为基金信息披露义务人公开披露的基金信息出具审计报告、法律意见书的专业机构，应当制作工作底稿，并将相关档案至少保存到基金合同终止后 10 年。

基金管理人、基金托管人除按法律法规要求披露信息外，也可着眼于为投资者决策提供有用信息的角度，在保证公平对待投资者、不误导投资者、不影响基金正常投资操作的前提下，自主提升信息披露服务的质量。具体要求应当符合中国证监会及自律规则的相关规定。前述自主披露如产生信息披露费用，该费用不得从基金财产中列支。

#### **七、信息披露文件的存放与查阅**

依法必须披露的信息发布后，基金管理人、基金托管人应当按照相关法律法规规定将信息置备于各自住所、基金上市交易的证券交易所，供社会公众查阅、复制。基金管理人和基金托管人应保证上述文本的内容与公告的内容完全一致。

八、本基金信息披露事项以法律法规规定及本章节约定的内容为准。

## 第二十部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算

### 一、基金合同的变更

1、以下变更基金合同的事项应经基金份额持有人大会决议通过：

- （1）更换基金管理人；
- （2）更换基金托管人；
- （3）转换基金运作方式；
- （4）提高基金管理人、基金托管人的报酬标准（法律法规、中国证监会要求提高该等报酬标准的除外）；
- （5）变更基金类别；
- （6）变更基金投资目标、范围或策略（法律法规和中国证监会另有规定的除外）；
- （7）本基金与其他基金的合并；
- （8）变更基金份额持有人大会召开程序；
- （9）终止基金合同；
- （10）其他可能对基金当事人权利和义务产生重大影响的事项。

但出现下列情况时，可不经基金份额持有人大会决议，由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告，并报中国证监会备案：

- （1）调低基金管理费、基金托管费；
- （2）法律法规要求增加的基金费用的收取；
- （3）在法律法规和基金合同规定的范围内调整本基金的申购费率、赎回费率或收费方式；
- （4）因相应的法律法规发生变动而应当对基金合同进行修改；
- （5）对基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及基金合同当事人权利义务关系发生重大变化；
- （6）除按照法律法规和基金合同规定应当召开基金份额持有人大会的以外的其他情形。

2、关于基金合同变更的基金份额持有人大会决议经中国证监会核准生效后方可执行，基金管理人应自中国证监会核准日起在规定媒介公告。

### 二、基金合同的终止

有下列情形之一的，基金合同应当终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止的；
- 2、基金管理人、基金托管人职责终止，在 6 个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；
- 3、基金合同约定的其他情形；
- 4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

### 三、基金财产的清算

#### 1、基金财产清算组

（1）基金财产清算小组：自出现基金合同终止事由之日起 30 个工作日内成立清算小组，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。

（2）基金财产清算小组的组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

（3）基金财产清算小组的职责：基金财产清算组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算组可以依法进行必要的民事活动。

#### 2、基金财产清算程序

基金合同终止，应当按法律法规和基金合同的有关规定对基金财产进行清算。基金财产清算程序主要包括：

- （1）基金合同终止后，由基金财产清算小组统一接管基金财产；
- （2）对基金财产和债权债务进行清理和确认；
- （3）对基金财产进行估值和变现；
- （4）制作清算报告；
- （5）聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- （6）将清算报告报中国证监会备案并公告。
- （7）对基金财产进行分配；

### 四、清算费用

清算费用是指基金财产清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。

## 五、基金财产清算剩余资产的分配

依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

## 六、基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金合同终止并报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组进行公告。

## 七、基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。



## 第二十一部分 风险揭示

### 一、投资于本基金的主要风险

#### 1、市场风险

本基金主要投资于证券市场，而各种证券的市场价格受到经济因素、政治因素、投资人心理和交易制度等各种因素的影响，导致基金收益水平的不确定性。市场风险主要包括：政策风险、利率风险、上市公司经营风险、购买力风险，主要包括：

##### （1）政策风险：

因国家宏观政策（如货币政策、财政政策、行业政策、地区发展政策等）发生变化，导致市场价格波动而产生风险。

##### （2）经济周期风险：

随经济运行的周期性变化，证券市场的收益水平也呈周期性变化。基金投资于国债与上市公司的股票，收益水平也会随之变化，从而产生风险。

##### （3）利率风险：

金融市场利率的波动会导致证券市场价格和收益率的变动。利率直接影响着国债的价格和收益率，影响着企业的融资成本和利润。基金投资于国债和股票，其收益水平会受到利率变化的影响。

##### （4）上市公司经营风险：

上市公司的经营好坏受多种因素影响，如管理能力、财务状况、市场前景、行业竞争、人员素质等，这些都会导致企业的盈利发生变化。如果基金所投资的上市公司经营不善，其股票价格可能下跌，或者能够用于分配的利润减少，使基金投资收益下降。虽然基金可以通过投资多样化来分散这种非系统风险，但不能完全规避。

##### （5）购买力风险：

基金的利润将主要通过现金形式来分配，而现金可能因为通货膨胀的影响而导致购买力下降，从而使基金的实际收益下降。

**（6）本基金可投资科创板股票。科创板股票具有下列投资风险，敬请投资者注意：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。

投资科创板股票存在的风险包括：

#### ①市场风险

科创板个股集中来自新一代信息技术、高端装备、新材料、新能源、节能环保及生物医药等高新技术和战略新兴产业领域。大多数企业为初创型公司，企业未来盈利、现金流、估值均存在不确定性，与传统二级市场投资存在差异，整体投资难度加大，个股市场风险加大。

科创板个股上市前五日无涨跌幅限制，第六日开始涨跌幅限制在正负 20% 以内，个股波动幅度较其他股票加大，市场风险随之上升。

#### ②流动性风险

科创板整体投资门槛较高，个人投资者必须满足交易满两年并且资金在 50 万以上才可参与，二级市场上个人投资者参与度相对较低，机构持有个股大量流通盘导致个股流动性较差，基金组合存在无法及时变现及其他相关流动性风险。

#### ③信用风险

科创板试点注册制，对经营状况不佳或财务数据造假的企业实行严格的退市制度，科创板个股存在退市风险。

#### ④集中度风险

科创板为新设板块，初期可投标的较少，投资者容易集中投资于少量个股，市场可能存在高集中度状况，整体存在集中度风险。

#### ⑤系统性风险

科创板企业均为市场认可度较高的科技创新企业，在企业经营及盈利模式上存在趋同，所以科创板个股相关性较高，市场表现不佳时，系统性风险将更为显著。

#### ⑥政策风险

国家对高新技术产业扶持力度及重视程度的变化会对科创板企业带来较大影响，国际经济形势变化对战略新兴产业及科创板个股也会带来政策影响。

(7) 本基金投资北交所股票所带来的特有风险, 包括但不限于:

#### ①市场风险

北交所个股集中来自新一代信息技术、高端装备、新材料、新能源、节能

环保及生物医药等高新技术和专精特新产业领域。大多数企业为初创型公司，企业未来盈利、现金流、估值均存在不确定性，与传统二级市场投资存在差异，整体投资难度加大，个股市场风险加大。北交所个股上市首日无涨跌停限制，第二日开始涨跌幅限制在正负30%以内，个股波动幅度较其他上市公司股票加大，市场风险随之上升。

#### ②流动性风险

北交所整体投资门槛较高，二级市场上个人投资者参与度相对较低，可能由于持股分散度不足导致个股流动性较差，基金组合存在无法及时变现及其他相关流动性风险。

#### ③信用风险

北交所试点注册制，对经营状况不佳或财务数据造假的企业实行严格的退市制度，北交所个股存在退市风险。

#### ④集中度风险

北交所为新设交易所，初期可投标的较少，投资者容易集中投资于少量个股，市场可能存在高集中度状况，整体存在集中度风险。

#### ⑤系统性风险

北交所上市公司平移自新三板精选层，从历史来看整体估值受政策阶段性影响较大，所以北交所个股估值相关性较高，政策空窗期或市场表现不佳时，系统性风险将更为显著。

#### ⑥政策风险

国家对高新技术、专精特新企业扶持力度及重视程度的变化会对北交所企业带来较大影响，国际经济形势变化对专精特新产业及北交所个股也会带来政策影响。

(8) 本基金的投资范围包括存托凭证，除与其他仅投资于沪深市场股票的基金所面临的共同风险外，还将面临中国存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险，以及与中国存托凭证发行机制相关的风险，包括存托凭证持有人与境外基础证券发行人的股东在法律地位、享有权利等方面存在差异可能引发的风险；存托凭证持有人在分红派息、行使表决权等方面的特殊安排可能引发的风险；存托协议自动约束存托凭证持有人的风险；因地上市造成存托凭证价格差异以及波动的风险；存托凭证持有人权益被摊薄的风险；存托凭证退

市的风险；已在境外上市的基础证券发行人，在持续信息披露监管方面与境内可能存在差异的风险；境内外证券交易机制、法律制度、监管环境差异可能导致的其他风险。

## 2、信用风险

基金在交易过程中可能发生交收违约或者所投资债券的发行人违约、拒绝支付到期本息的情况，从而导致基金财产损失。

## 3、管理风险

在基金管理运作过程中基金管理人的知识、经验、判断、决策、技能等，会影响其对信息的占有和对经济形势、证券价格走势的判断，从而影响基金收益水平。因此，本基金的收益水平与本基金管理人的管理水平、管理手段和管理技术等相关性较大。因此本基金可能因为基金管理人的因素而影响基金收益水平。

## 4、流动性风险

本基金属于开放式基金，基金管理人都有义务接受投资人的申购、赎回和基金间转换。由于应对基金赎回和基金间转换的经验不足，加之中国股票市场波动性较大，在市场下跌时经常出现交易量急剧减少的情况，如果在这时出现较大数额的基金赎回和基金间转换申请，则使基金资产变现困难，基金面临流动性风险。

### （1）基金申购、赎回安排

投资人具体请参见基金合同“六、基金份额的申购与赎回”和本招募说明书“第九部分 基金份额的场外申购、赎回与转换”、“第十部分 基金份额的场内申购与赎回”，详细了解本基金的申购以及赎回安排。

在本基金发生流动性风险时，基金管理人可以综合利用备用的流动性风险管理工具以减少或应对基金的流动性风险，投资者可能面临赎回申请被暂停接受、赎回款项被延缓支付、被收取短期赎回费、基金估值被暂停等风险。

### （2）拟投资市场、行业及资产的流动性风险评估

本基金的投资范围包括依法公开发行上市的股票及存托凭证（包括中小板、创业板以及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具、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（但需符合中国证监会的相关规定）。

标的资产大部分为标准化债券金融工具，一般情况下具有较好的流动性，同时，本基金严格控制开放期内投资于流动受限资产的投资品种比例。除此之外，本基金管理人将根据历史经验和现实条件，制定出现金持有量的上下限计划，在该限制范围内进行现金比例调控或现金与证券的转化。本基金管理人会进行标的的分散化投资并结合对各类标的资产的预期流动性合理进行资产配置，以防范流动性风险。

### （3）巨额赎回情形下的流动性风险管理措施

当本基金发生巨额赎回情形时，基金管理人可以采用以下流动性风险管理措施：（a）暂停接受赎回申请；（b）延缓支付赎回款项；（c）中国证监会认定的其他措施。

### （4）实施备用的流动性风险管理工具的情形、程序及对投资者的潜在影响

基金管理人经与基金托管人协商，在确保投资者得到公平对待的前提下，可依照法律法规及基金合同的约定，综合运用各类流动性风险管理工具，对赎回申请等进行适度调整，作为特定情形下基金管理人流动性风险的辅助措施，包括但不限于：

#### （a）暂停接受赎回申请

投资人具体请参见基金合同“六、基金份额的申购与赎回”中的“9、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形”和“10、巨额赎回的情形及处理方式”，详细了解本基金暂停接受赎回申请的情形及程序。

在此情形下，投资人的部分或全部赎回申请可能被拒绝，同时投资人完成基金赎回时的

基金份额净值可能与其提交赎回申请时的基金份额净值不同。

#### （b）延缓支付赎回款项

投资人具体请参见基金合同“六、基金份额的申购与赎回”中的“9、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形”和“10、巨额赎回的情形及处理方式”，详细了解本基金延缓支付赎回款项的情形及程序。

在此情形下，投资人收到赎回款项的时间将可能比一般正常情形下有所延迟。

#### （c）收取短期赎回费

本基金对持续持有期少于 7 日的投资者收取不低于 1.5 %的赎回费，并将

上述赎回费全额计入基金财产。

（d）暂停基金估值

投资人具体请参见基金合同“十五、基金资产的估值”中的“（六）暂停估值的情形”，详细了解本基金暂停估值的情形及程序。

在此情形下，投资人没有可供参考的基金份额净值，同时赎回申请可能被延期办理或被暂停接受，或被延缓支付赎回款项。

（e）中国证监会认定的其他措施。

## 5、其他风险

- （1）因技术因素而产生的风险，如电脑系统不可靠产生的风险；
- （2）因基金业务快速发展而在制度建设、人员配备、内控制度建立等方面不完善而产生的风险；
- （3）因人为因素而产生的风险，如内幕交易、欺诈行为等产生的风险；
- （4）对主要业务人员如基金经理的依赖而可能产生的风险；
- （5）因业务竞争压力可能产生的风险；
- （6）战争、自然灾害等不可抗力可能导致基金资产的损失，影响基金收益水平，从而带来风险；
- （7）其他意外导致的风险。

## 6、本基金的特定风险

（1）本基金为混合型基金，在投资管理中会至少维持 60%的股票投资比例，不能完全规避市场下跌的风险和个股风险，在市场上涨时也不能保证基金净值能够完全跟随或超越市场涨幅。

（2）在股票资产配置上，本基金主要投资于符合轻资产投资理念的公司股票，而市场整体并不全部符合本基金的选股标准。在特定的投资期间之内，本基金的收益率可能会与市场整体产生偏差。

（3）基金经理主观判断错误的风险；

（4）其他风险。本基金可以投资权证，权证是金融衍生品的一种，具有高杠杆、高风险、高收益的特征，风险较大。

## 二、声明

- 1、投资人投资于本基金，须自行承担投资风险；
- 2、除基金管理人直接办理本基金的销售外，本基金还通过招商银行股份有限公司

限公司等基金代销机构代理销售，基金管理人与基金代销机构都不能保证其收益或本金安全。

## 第二十二部分 基金合同的内容摘要

### 一、基金合同当事人及权利义务

#### （一）基金管理人

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 号浦东嘉里城办公楼 28-30 楼

法定代表人：杨华辉

设立日期：2003 年 9 月 30 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基字[2003]100 号

组织形式：有限责任公司

注册资本：1.5 亿元人民币

存续期限：持续经营

联系电话：（021）20398888

#### （二）基金托管人

名称：招商银行股份有限公司（简称：招商银行）

住所：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

办公地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

邮政编码：518040

法定代表人：缪建民

成立时间：1987 年 4 月 8 日

基金托管业务批准文号：证监基金字[2002]83 号

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；办理结算；办理票据贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券；同业拆借；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保管箱服务。外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外币兑换；国际结算；结汇、售汇；同业外汇拆借；外汇票据的承兑和贴现；外汇借款；外汇担保；发行和代理发行股票以外的外币有价证券；买卖和代理买卖股票以外的外币有价证券；自营和代客外汇买卖；资信调查、咨询、见证业务；离岸金融业务。经中国人民银行批准的其他业务。



组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币 252.198 亿元

存续期间：持续经营

### （三）基金份额持有人

投资人自依基金合同、招募说明书取得基金份额即成为基金份额持有人和基金合同当事人，直至其不再持有本基金的基金份额，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的完全承认和接受。基金份额持有人作为基金合同当事人并不以在基金合同上书面签章或签字为必要条件。

### （四）基金管理人的权利

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金管理人的权利为：

- 1、自本基金合同生效之日起，依照有关法律法规和本基金合同的规定独立运用基金财产；
- 2、依照基金合同获得基金管理费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入；
- 3、发售基金份额；
- 4、依照有关规定行使因基金财产投资于证券所产生的权利；
- 5、在符合有关法律法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务的规则，在法律法规和本基金合同规定的范围内决定和调整基金的除调高托管费率和管理费率之外的相关费率结构和收费方式；
- 6、根据本基金合同及有关规定监督基金托管人，对于基金托管人违反了本基金合同或有关法律法规规定的行为，对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应及时呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金及相关当事人的利益；
- 7、在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购和赎回申请；
- 8、在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资、融券；
- 9、自行担任或选择、更换注册登记机构，获取基金份额持有人名册，并对注册登记机构的代理行为进行必要的监督和检查；
- 10、选择、更换代销机构，并依据基金销售服务代理协议和有关法律法规，对其行为进行必要的监督和检查；

11、选择、更换律师、审计师、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；

12、在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；

13、依法召集基金份额持有人大会；

14、法律法规和基金合同规定的其他权利。

#### （五）基金管理人的义务

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金管理人的义务为：

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、自基金合同生效之日起，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产；

4、配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；

5、建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；

6、除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；

7、依法接受基金托管人的监督；

8、计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购、赎回价格；

9、采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合基金合同等法律文件的规定；

10、按规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

11、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

12、编制季度报告、中期报告和年度报告；

13、严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；

14、保守基金商业秘密，不得泄露基金投资计划、投资意向等，除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，

不得向他人泄露；

15、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；

16、依据《基金法》、基金合同及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

17、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；

18、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；

19、组织并参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

20、因违反基金合同导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

21、基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；

22、按规定向基金托管人提供基金份额持有人名册资料；

23、面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；

24、执行生效的基金份额持有人大会决议；

25、不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；

26、依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利，不谋求对上市公司的控股和直接管理；

27、法律法规、中国证监会和基金合同规定的其他义务。

#### （六）基金托管人的权利

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金托管人的权利为：

1、依基金合同约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入；

2、监督基金管理人对本基金的投资运作；

3、自本基金合同生效之日起，依法保管基金资产；

4、在基金管理人更换时，提名新任基金管理人；

5、根据本基金合同及有关规定监督基金管理人，对于基金管理人违反本基金合同或有关法律法规规定的行为，对基金资产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应及时呈报中国证监会；

- 6、依法召集基金份额持有人大会；
- 7、按规定取得基金份额持有人名册资料；
- 8、法律法规和基金合同规定的其他权利。

#### （七）基金托管人的义务

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金托管人的义务为：

- 1、安全保管基金财产；
- 2、设立专门的基金托管部，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；
- 3、对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整与独立；
- 4、除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金财产；
- 5、保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；
- 6、按规定开设基金财产的资金账户和证券账户；
- 7、保守基金商业秘密，除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不得向他人泄露；
- 8、对基金财务会计报告、季度报告、中期报告和年度报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照基金合同的规定进行；如果基金管理人未执行基金合同规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；
- 9、保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
- 10、按照基金合同的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；
- 11、办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；
- 12、复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额净值和基金份额申购、赎回价格；
- 13、按照规定监督基金管理人的投资运作；
- 14、按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

15、依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项；

16、按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会；

17、因违反基金合同导致基金财产损失，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

18、基金管理人因违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金向基金管理人追偿；

19、参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

20、面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会和银行业监督管理机构，并通知基金管理人；

21、执行生效的基金份额持有人大会决议；

22、不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；

23、建立并保存基金份额持有人名册；

24、法律法规、中国证监会和基金合同规定的其他义务。

#### （八）基金份额持有人的权利

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金份额持有人的权利为：

1、分享基金财产收益；

2、参与分配清算后的剩余基金财产；

3、依法申请赎回其持有的基金份额；

4、按照规定要求召开基金份额持有人大会；

5、出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；

6、查阅或者复制公开披露的基金信息资料；

7、监督基金管理人的投资运作；

8、对基金管理人、基金托管人、基金份额发售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼；

9、法律法规和基金合同规定的其他权利。

每份基金份额具有同等的合法权益。

### （九）基金份额持有人的义务

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金份额持有人的义务：

- 1、遵守法律法规、基金合同及其他有关规定；
- 2、交纳基金认购、申购款项及法律法规和基金合同所规定的费用；
- 3、在持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者基金合同终止的有限责任；
- 4、不从事任何有损基金及其他基金份额持有人合法权益的活动；
- 5、执行生效的基金份额持有人大会决议；
- 6、返还在基金交易过程中因任何原因，自基金管理人及基金管理人的代理人、基金托管人、代销机构、其他基金份额持有人处获得的不当得利；
- 7、法律法规和基金合同规定的其他义务。

（十）本基金合同当事各方的权利义务以本基金合同为依据，不因基金财产账户名称而有所改变。

## 二、基金持有人大会

（一）基金份额持有人大会由基金份额持有人组成，基金份额持有人的合法授权代表有权代表基金份额持有人出席会议并表决。基金份额持有人持有的每一基金份额具有平等的投票权。

### （二）召开事由

1、当出现或需要决定下列事由之一的，经基金管理人、基金托管人或持有基金份额 10%以上(含 10%，下同)的基金份额持有人(以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同)提议时，应当召开基金份额持有人大会：

- （1）终止基金合同；
- （2）更换基金管理人
- （3）更换基金托管人；
- （4）转换基金运作方式；
- （5）提高基金管理人、基金托管人的报酬标准（法律法规和中国证监会另有规定的除外）；
- （6）变更基金类别；
- （7）本基金与其他基金的合并；
- （8）变更基金投资目标、投资范围或投资策略（法律法规和中国证监会另有规定的除外）；

- (9) 变更基金份额持有人大会程序；
- (10) 基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；
- (11) 对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；
- (12) 法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。

2、出现以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会：

- (1) 调低基金管理费、基金托管费；
- (2) 法律法规要求增加的基金费用的收取；
- (3) 在法律法规和基金合同规定的范围内调整本基金的申购费率、赎回费率或收费方式；
- (4) 因相应的法律法规发生变动而应当对基金合同进行修改；
- (5) 对基金合同的修改基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及基金合同当事人权利义务关系发生重大变化；
- (6) 按照法律法规和基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的以外的其他情形。

### （三）会议召集人和召集方式

1、除法律法规或基金合同另有约定外，基金份额持有人大会由基金管理人召集。基金管理人未按规定召集或者不能召集时，由基金托管人召集。

2、基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当自行召集。

3、代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。基

金托管人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开。

4、代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，单独或合计代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人有权自行召集，并至少提前 30 日向中国证监会备案。基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的，基金管理人、基金托管人应当配合，不得阻碍、干扰。

5、基金份额持有人会议的召集人负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

#### （四）召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

1、召开基金份额持有人大会，召集人必须于会议召开日前 30 日，在规定媒介公告。基金份额持有人大会通知须至少载明以下内容：

- （1）会议召开的时间、地点和会议形式；
- （2）会议拟审议的事项、议事程序和表决方式；
- （3）有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人权益登记日；
- （4）授权委托书的内容要求（包括但不限于代理人身份，代理权限和代理有效期限等）、送达时间和地点；
- （5）会务常设联系人姓名及联系电话；
- （6）出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；
- （7）召集人需要通知的其他事项。

2、采用通讯方式开会并进行表决的情况下，由召集人决定通讯方式和书面表决方式，并在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表决意见寄交的截止时间和收取方式。

3、如召集人为基金管理人，还应另行书面通知基金托管人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督；如召集人为基金托管人，则应另行书面通知基金管理人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督；如召集人为基金份额持有人，则应另行书面通知基金管理人和基金托管人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。基金管理人或基金托管人拒不派代表对书面表决意见的计票进



行监督的，不影响表决意见的计票效力。

#### （五）基金份额持有人出席会议的方式

基金份额持有人大会可通过现场开会方式、通讯开会方式或法律法规和监管机关允许的其他方式召开，会议的召开方式由会议召集人确定。

1、现场开会。由基金份额持有人本人出席或以代理投票授权委托书委派代表出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当列席基金份额持有人大会，基金管理人或托管人不派代表列席的，不影响表决效力。现场开会同时符合以下条件时，可以进行基金份额持有人大会议程：

（1）亲自出席会议者持有基金份额的凭证、受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托书符合法律法规、基金合同和会议通知的规定，并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的登记资料相符；

（2）经核对，汇总到会者出示的在权利登记日持有基金份额的凭证显示，有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的 50%（含 50%）。

2、通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以书面形式在表决截至日以前送达至召集人指定的地址。通讯开会应以书面方式进行表决。

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

（1）会议召集人按基金合同规定公布会议通知后，在 2 个工作日内连续公布相关提示性公告；

（2）召集人按基金合同规定通知基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。会议召集人在基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取基金份额持有人的书面表决意见；基金托管人或基金管理人经通知不参加收取书面表决意见的，不影响表决效力；

（3）本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的，基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日基金总份额的 50%（含 50%）；

（4）上述第（3）项中直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的代理人，同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具书面意见的代理人出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托书

符合法律法规、基金合同和会议通知的规定，并与基金注册登记机构记录相符，并且委托人出具的代理投票授权委托书符合法律法规、基金合同和会议通知的规定；

（5）会议通知公布前报中国证监会备案。

采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则提交符合会议通知中规定的确认投资者身份文件的表决视为有效出席的投资者；表面符合法律法规和会议通知规定的书面表决意见即视为有效的表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

3、在法律法规或监管机构允许的情况下，经会议通知载明，基金份额持有人也可以采用网络、电话或其他方式进行表决，或者采用网络、电话或其他方式授权他人代为出席会议并表决。

（六）议事内容与程序

1、议事内容及提案权

议事内容为关系基金份额持有人利益的重大事项，如基金合同的重大修改、决定终止基金合同、更换基金管理人、更换基金托管人、与其他基金合并、法律法规及基金合同规定的其他事项以及会议召集人认为需提交基金份额持有人大会讨论的其他事项。

基金管理人、基金托管人、单独或合并持有权益登记日基金总份额 10%（含 10%）以上的基金份额持有人可以在大会召集人发出会议通知前向大会召集人提交需由基金份额持有人大会审议表决的提案；也可以在会议通知发出后向大会召集人提交临时提案，临时提案应当在大会召开日至少 35 个工作日前提交召集人并由召集人公告。

基金份额持有人大会的召集人发出召集会议的通知后，对原有提案的修改应当在基金份额持有人大会召开日 30 个工作日前公告。

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

召集人对于基金管理人、基金托管人和基金份额持有人提交的临时提案进行审核，符合条件的应当在大会召开日 30 个工作日前公告。大会召集人应当按照以下原则对提案进行审核：

（1）关联性。大会召集人对于提案涉及事项与基金有直接关系，并且不超

出法律法规和基金合同规定的基金份额持有人大会职权范围的，应提交大会审议；对于不符合上述要求的，不提交基金份额持有人大会审议。如果召集人决定不将基金份额持有人提案提交大会表决，应当在该次基金份额持有人大会上解释和说明。

（2）程序性。大会召集人可以对提案涉及的程序性问题做出决定。如将提案进行分拆或合并表决，需征得原提案人同意；原提案人不同意变更的，大会主持人可以就程序性问题提请基金份额持有人大会做出决定，并按照基金份额持有人大会决定的程序进行审议。

单独或合并持有权利登记日基金总份额 10%（含 10%）以上的基金份额持有人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，或基金管理人或基金托管人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，未获基金份额持有人大会审议通过，就同一提案再次提请基金份额持有人大会审议，其时间间隔不少于 6 个月。法律法规另有规定除外。

基金份额持有人大会的召集人发出召开会议的通知后，如果需要对原有提案进行修改，应当最迟在基金份额持有人大会召开前 30 日公告。否则，会议的召开日期应当顺延并保证至少与公告日期有 30 日的间隔期。

## 2、议事程序

### （1）现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照下列第七条规定程序确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表，在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权其出席会议的代表主持；如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的 50%以上（含 50%）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人不出席或主持基金份额持有人大会，不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

会议召集人应当制作出席会议人员的签名册。签名册载明参加会议人员姓名（或单位名称）、身份证号码、持有或代表有表决权的基金份额、委托人姓名（或单位名称）等事项。

### （2）通讯开会

在通讯开会的情况下，首先由召集人提前 30 日公布提案，在所通知的表决截止日期后 2 个工作日内在公证机关监督下由召集人统计全部有效表决，在公证机关监督下形成决议。

（七）决议形成的条件、表决方式、程序

1、基金份额持有人所持每份基金份额享有一票表决权。

2、基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

（1）一般决议

一般决议须经出席会议的基金份额持有人或其代理人所持表决权的 50%以上（含 50%）通过方为有效，除下列（2）所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过；

（2）特别决议

特别决议应当经出席会议的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方可作出；涉及更换基金管理人、更换基金托管人、转换基金运作方式、终止基金合同必须以特别决议通过方为有效。

3、基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会核准或者备案，并予以公告。

4、采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则表面符合法律法规和会议通知规定的书面表决意见即视为有效的表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

5、基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

6、基金份额持有人大会的各项提案或同一项提案内并列的各项议题应当分开审议、逐项表决。

（八）计票

1、现场开会

（1）如大会由基金管理人或基金托管人召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中选举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集或大会虽然由基金管理人或基金托管人召集，但是基金管理人或基金托管人未出席大会的，基金份额持有人大会的主持人应当在会

议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中选举三名基金份额持有人代表担任监票人。基金管理人或基金托管人不出席大会的，不影响计票的效力。

（2）监票人应当在基金份额持有人表决后立即进行清点并由大会主持人当场公布计票结果。

（3）如果会议主持人或基金份额持有人或代理人对于提交的表决结果有怀疑，可以在宣布表决结果后立即对所投票数要求进行重新清点。监票人应当进行重新清点，重新清点以一次为限。重新清点后，大会主持人应当当场公布重新清点结果。

（4）计票过程应由公证机关予以公证，基金管理人或基金托管人拒不出席大会的，不影响计票的效力。

## 2、通讯开会

在通讯开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人授权代表（若由基金托管人召集，则为基金管理人授权代表）的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。基金管理人或基金托管人拒派代表对书面表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。

## （九）生效与公告

基金份额持有人大会的决议，召集人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会核准或者备案。

基金份额持有人大会的决议自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效。

基金份额持有人大会决议自生效之日起 2 个工作日内在规定媒介上公告。如果采用通讯方式进行表决，在公告基金份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。

基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会的决议。

生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人、基金托管人均有约束力。

（十）法律法规或监管部门对基金份额持有人大会另有规定的，从其规定。

## 三、基金合同解除和终止的事由、程序

### （一）基金合同的变更

1、以下变更基金合同的事项应经基金份额持有人大会决议通过：

- （1）更换基金管理人；
- （2）更换基金托管人；
- （3）转换基金运作方式；
- （4）提高基金管理人、基金托管人的报酬标准（法律法规、中国证监会要求提高该等报酬标准的除外）；
- （5）变更基金类别；
- （6）变更基金投资目标、范围或策略（法律法规和中国证监会另有规定的除外）；
- （7）本基金与其他基金的合并；
- （8）变更基金份额持有人大会召开程序；
- （9）终止基金合同；
- （10）其他可能对基金当事人权利和义务产生重大影响的事项。

但出现下列情况时，可不经基金份额持有人大会决议，由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告，并报中国证监会备案：

- （1）调低基金管理费、基金托管费；
- （2）法律法规要求增加的基金费用的收取；
- （3）在法律法规和基金合同规定的范围内调整本基金的申购费率、赎回费率或收费方式；
- （4）因相应的法律法规发生变动而应当对基金合同进行修改；
- （5）对基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及基金合同当事人权利义务关系发生重大变化；
- （6）除按照法律法规和基金合同规定应当召开基金份额持有人大会的以外的其他情形。

2、关于基金合同变更的基金份额持有人大会决议经中国证监会核准生效后方可执行，基金管理人应自中国证监会核准日起在规定媒介公告。

（二）本基金合同的终止

有下列情形之一的，基金合同应当终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止的；
- 2、基金管理人、基金托管人职责终止，在6个月内没有新基金管理人、新

基金托管人承接的；

- 3、基金合同约定的其他情形；
- 4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

### （三）基金财产的清算

#### 1、基金财产清算组

（1）基金财产清算小组：自出现基金合同终止事由之日起 30 个工作日内成立清算小组，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。

（2）基金财产清算小组的组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

（3）基金财产清算小组的职责：基金财产清算组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算组可以依法进行必要的民事活动。

#### 2、基金财产清算程序

基金合同终止，应当按法律法规和本基金合同的有关规定对基金财产进行清算。基金财产清算程序主要包括：

- （1）基金合同终止后，由基金财产清算小组统一接管基金财产；
- （2）对基金财产和债权债务进行清理和确认；
- （3）对基金财产进行估值和变现；
- （4）制作清算报告；
- （5）聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- （6）将清算报告报中国证监会备案并公告。
- （7）对基金财产进行分配；

#### 4、清算费用

清算费用是指基金财产清算组在进行基金财产清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算组优先从基金财产中支付。

#### 5、基金财产清算剩余资产的分配

依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的

基金份额比例进行分配。

#### 6、基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金合同终止并报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组进行公告。

#### 7、基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

### 四、争议解决方式

对于因基金合同的订立、内容、履行和解释或与基金合同有关的争议，基金合同当事人应尽量通过协商、调解途径解决。不愿或者不能通过协商、调解解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为深圳市。仲裁裁决是终局的，对各方当事人均有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

争议处理期间，基金合同当事人应恪守各自的职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

本基金合同受中国法律管辖。

### 五、基金合同存放地和投资人取得基金合同的方式

本基金合同可印制成册，供投资人在基金管理人、基金托管人、销售机构的办公场所查阅，投资者也可按工本费购买基金合同复制件或复印件，但内容应以基金合同正本为准。



## 第二十三部分 基金托管协议的内容摘要

### 一、基金托管协议当事人

#### （一）基金管理人

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 号浦东嘉里城办公楼 28-30 楼

法定代表人：杨华辉

设立日期：2003 年 9 月 30 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基字[2003]100 号

组织形式：有限责任公司

注册资本：1.5 亿元人民币

存续期限：持续经营

联系电话：（021）20398888

经营范围：基金募集；基金销售；资产管理以及中国证监会许可的其它业务。

#### （二）基金托管人

名称：招商银行股份有限公司（简称：招商银行）

住所：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

办公地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

邮政编码：518040

法定代表人：缪建民

成立时间：1987 年 4 月 8 日

基金托管业务批准文号：证监基金字[2002]83 号

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；办理结算；办理票据贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券；同业拆借；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保管箱服务。外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外币兑换；国际结算；结汇、售汇；同业外汇拆借；外汇票据的承兑和贴现；外汇借款；外汇担保；发行和代理发行股票以外的外币有价证券；买卖和代理买卖股票以外的外币有价证

券；自营和代客外汇买卖；资信调查、咨询、见证业务；离岸金融业务。经中国人民银行批准的其他业务。

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币 252.198 亿元

存续期间：持续经营

## 二、基金托管人对基金管理人的业务监督、核查

（一）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资范围、投资对象进行监督。

1、本基金将投资于以下金融工具：

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 的股票及存托凭证（包括中小板、创业板以及其他经中国证监会核准上市 的股票及存托凭证）、债券、货币市场工具、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（但需符合中国证监会的相关规定）。

2、本基金不得投资于相关法律、法规、部门规章及《基金合同》禁止投资的投资工具。

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

对基金管理人发送的不符合基金合同规定的投资行为，基金托管人可以拒绝执行，并书面通知基金管理人；对于已经执行的投资，基金托管人发现该投资行为不符合基金合同的规定的，基金托管人应书面通知基金管理人进行整改，并将该情况报告中国证监会。

（二）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资、融资比例进行监督。基金合同明确约定基金投资风格或证券选择标准的，基金管理人应事先向基金托管人提供投资品种池，以便基金托管人对基金实际投资是否符合基金合同关于证券选择标准的约定进行监督。

本基金的投融资比例：

本基金为混合型基金，股票投资比例为基金资产的 60%-95%，其中，符合轻资产投资理念的股票合计投资比例不低于股票资产的 80%；债券、货币市场工具、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（但需符合中国证监会的相关规定）投资比例为基金资产的 5%-40%，其中本

基金保留不低于基金资产净值的 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金投资组合遵循以下投资限制：

（1）本基金股票投资比例为基金资产的 60%-95%；债券、货币市场工具、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（但需符合中国证监会的相关规定）投资比例为基金资产的 5%-40%；

（2）保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

（3）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%；

（4）本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；

（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%；

（6）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%；

（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%；

（9）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%；

（10）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%；

（11）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%；

（12）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；

（13）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；

（14）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%；

（15）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；

（16）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%；

（17）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；

（18）本基金投资存托凭证的比例限制依照境内上市交易的股票进行，与境内上市交易的股票合并计算；

（19）相关法律法规以及监管部门规定的其它投资限制。

如果法律法规或监管部门对上述约定的投资组合比例规定进行变更的，以变更后的规定为准。有关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。

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（2）、（12）、（15）、（17）项外，由于证券市场波动、上市公司合并或基金规模变动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不在限制之内，但基金管理人应在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。

基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

（三）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对本托管协议第十五条第九款基金投资禁止行为进行监督。基金托管人通过事后监督方

式对基金管理人基金投资禁止行为和关联交易进行监督。根据法律法规有关基金禁止从事关联交易的规定，基金管理人和基金托管人应事先相互提供与本机构有控股关系的股东、与本机构有其他重大利害关系的公司名单及有关关联方发行的证券名单。基金管理人和基金托管人有责任确保关联交易名单的真实性、准确性、完整性，并负责及时将更新后的名单发送给对方。

若基金托管人发现基金管理人与关联交易名单中列示的关联方进行法律法规禁止基金从事的关联交易时，如基金托管人提醒基金管理人后仍无法阻止关联交易发生时，基金托管人有权向中国证监会报告。对于基金管理人已成交的关联交易，基金托管人事前无法阻止该关联交易的发生，只能进行事后结算。基金托管人不承担由此造成的损失，并向中国证监会报告。

（四）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金管理人参与银行间债券市场进行监督。基金管理人应在基金投资运作之前向基金托管人提供符合法律法规及行业标准的、经慎重选择的、本基金适用的银行间债券市场交易对手名单并约定各交易对手所适用的交易结算方式。基金管理人有责任确保及时将更新后的交易对手名单发送给基金托管人，否则由此造成的损失应由基金管理人承担。基金管理人应严格按照交易对手名单的范围在银行间债券市场选择交易对手。基金托管人监督基金管理人是否按事前提提供的银行间债券市场交易对手名单进行交易。在基金存续期间基金管理人可以调整交易对手名单，但应将调整结果至少提前一个工作日书面通知基金托管人。新名单确定前已与本次剔除的交易对手所进行但尚未结算的交易，仍应按照协议进行结算。如基金管理人根据市场需要临时调整银行间债券交易对手名单及结算方式的，应向基金托管人说明理由，并在与交易对手发生交易前 3 个交易日内与基金托管人协商解决。

基金管理人负责对交易对手的资信控制，按银行间债券市场的交易规则进行交易，并负责解决因交易对手不履行合同而造成的纠纷及损失。若未履约的交易对手在基金管理人确定的时间内仍未承担违约责任及其他相关法律责任的，基金管理人可以对相应损失先行予以承担，然后再向相关交易对手追偿。基金托管人则根据银行间债券市场成交单对合同履行情况进行监督。如基金托管人事后发现基金管理人没有按照事先约定的交易对手进行交易时，基金托管人应及时提醒基金管理人，基金托管人不承担由此造成的任何损失和责任。

（五）本基金投资流通受限证券，应遵守《关于规范基金投资非公开发行证券行为的紧急通知》、《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》等有关法律法规规定。

1、本协议所称的流通受限证券，包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券，不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。

本基金可以投资经中国证监会批准的非公开发行证券，且限于由中国证券登记结算有限责任公司或中央国债登记结算有限责任公司负责登记和存管的，并可在证券交易所或全国银行间债券市场交易的证券。

基金不得投资未经中国证监会批准的非公开发行证券。

基金参与非公开发行证券的认购，不得预付任何形式的保证金，法律法规或中国证监会另有规定的除外。

基金不得投资有锁定期但锁定期不明确的证券，且锁定期不得超过本基金的剩余期限。

2、基金管理人应在基金首次投资流通受限证券前，向基金托管人提供经基金管理人董事会批准的有关基金投资流通受限证券的投资决策流程、风险控制制度。基金投资非公开发行股票，基金管理人还应提供基金管理人董事会批准的流动性风险处置预案。上述资料应包括但不限于基金投资流通受限证券的投资额度和投资比例控制情况。

基金管理人应至少于首次执行投资指令之前两个工作日将上述资料书面发至基金托管人，保证基金托管人有足够的时间进行审核。基金托管人应在收到上述资料后两个工作日内，以书面或其他双方认可的方式确认收到上述资料。

基金管理人对本基金投资受限证券的流动性风险负责，确保对相关风险采取积极有效的措施，在合理的时间内有效解决基金运作的流动性问题。如因基金巨额赎回或市场发生剧烈变动等原因而导致基金现金周转困难时，基金管理人应保证提供足额现金确保基金的支付结算，并承担所有损失。对本基金因投资受限证券导致的流动性风险，基金托管人不承担任何责任。

3、基金投资流通受限证券前，基金管理人应向基金托管人提供符合法律法规要求的有关书面信息，包括但不限于拟发行证券主体的中国证监会批准文

件、发行证券数量、发行价格、锁定期，基金拟认购的数量、价格、总成本、应划付的认购款、资金划付时间等。基金管理人应保证上述信息的真实、完整，并应至少于拟执行投资指令前两个工作日将上述信息书面发至基金托管人，保证基金托管人有足够的时间进行审核。

由于基金管理人未及时提供有关证券的具体的必要的信息，致使托管人无法审核认购指令而影响认购款项划拨的，基金托管人免于承担责任。

4、基金托管人依照法律法规、《基金合同》、《托管协议》审核基金管理人投资流通受限证券的行为。如发现基金管理人违反了《基金合同》、《托管协议》以及其他相关法律法规的有关规定，应及时通知基金管理人，并呈报中国证监会，同时采取合理措施保护基金投资人的利益。基金托管人有权对基金管理人的违法、违规以及违反《基金合同》、《托管协议》的投资指令不予执行，并立即通知基金管理人纠正，基金管理人不予纠正或已代表基金签署合同不得不执行时，基金托管人应向中国证监会报告。

（六）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金资产净值计算、基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等进行监督和核查。

（七）基金托管人发现基金管理人的上述事项及投资指令或实际投资运作违反法律法规、基金合同和本托管协议的规定，应及时以电话提醒或书面提示等方式通知基金管理人限期纠正。基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查。基金管理人收到通知后应及时核对并回复基金托管人，对于收到的书面通知，基金管理人应以书面形式给基金托管人发出回函，就基金托管人的疑义进行解释或举证，说明违规原因及纠正期限。在上述规定期限内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

（八）基金管理人义务配合和协助基金托管人依照法律法规、基金合同和本托管协议对基金业务执行核查。包括但不限于：对基金托管人发出的提示，基金管理人应在规定时间内答复并改正，或就基金托管人的疑义进行解释或举证；对基金托管人按照法律法规、基金合同和本托管协议的要求需向中国

证监会报送基金监督报告的事项，基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

（九）若基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当立即通知基金管理人及时纠正，由此造成的损失由基金管理人承担。

（十）基金托管人发现基金管理人有关重大违规行为，应及时报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正。

### 三、基金管理人对于基金托管人的业务监督、核查

（一）基金管理人对于基金托管人履行托管职责情况进行核查，核查事项包括基金托管人安全保管基金财产、开设基金财产的资金账户和证券账户、复核基金管理人计算的基金资产净值和基金份额净值、根据基金管理人指令办理清算交收、相关信息披露和监督基金投资运作等行为。

（二）基金管理人发现基金托管人擅自挪用基金财产、未对基金财产实行分账管理、未执行或无故延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄露基金投资信息等违反《基金法》、基金合同、本协议及其他有关规定时，应及时以书面形式通知基金托管人限期纠正。基金托管人收到书面通知后应在下一个工作日及时核对并以书面形式给基金管理人发出回函，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内，基金管理人有权随时对通知事项进行复查，督促基金托管人改正。

（三）基金托管人有义务配合和协助基金管理人依照法律法规、基金合同和本托管协议对基金业务执行核查，包括但不限于：对基金管理人发出的书面提示，基金托管人应在规定时间内答复并改正，或就基金管理人的疑义进行解释或举证；基金托管人应积极配合提供相关资料以供基金管理人核查托管财产的完整性和真实性。

（四）基金管理人发现基金托管人有关重大违规行为，应及时报告中国证监会，同时通知基金托管人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。

### 四、基金财产的保管

（一）基金财产保管的原则

- 1、基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。
- 2、基金托管人应安全保管基金财产。



3、基金托管人按照规定开设基金财产的资金账户和证券账户。

4、基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整与独立。

5、基金托管人根据基金管理人的指令，按照基金合同和本协议的约定保管基金财产。未经基金管理人的正当指令，不得自行运用、处分、分配基金的任何资产。不属于基金托管人实际有效控制下的实物证券在基金托管人保管期间的损坏、灭失，由此产生的责任基金托管人不承担。

6、对于因为基金投资产生的应收资产，应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知基金托管人，到账日基金财产没有到达基金账户的，基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收。基金管理人未及时催收给基金财产造成损失的，基金管理人应负责向有关当事人追偿基金财产的损失。

7、基金托管人应安全、完整地保管基金资产；未经基金管理人的正当指令，不得自行运用、处分、分配基金的任何资产。不属于基金托管人实际有效控制下的实物证券的损坏、灭失，基金托管人不承担责任。

8、资产托管人对因为资产管理人投资产生的存放或存管在资产托管人以外机构的委托财产，或交由期货公司或证券公司负责清算交收的委托资产（包括但不限于期货保证金账户内的资金、期货合约等）及其收益；由于该等机构或该机构会员单位等本合同当事人外第三方的欺诈、疏忽、过失或破产等原因给委托财产造成的损失等不承担责任。

9、除依据法律法规和基金合同的规定外，基金托管人不得委托第三人托管基金财产。

## （二）基金募集期间及募集资金的验资

1、基金募集期间募集的资金应开立“基金募集专户”。该账户由基金管理人开立并管理。

2、基金募集期满或基金停止募集时，募集的基金份额总额、基金募集金额、基金份额持有人人数符合《基金法》、《运作办法》等有关规定后，基金管理人应将募集到的基金财产的全部资金划入基金托管人为基金开立的基金托管资金账户，同时在规定时间内，基金管理人应聘请具有从事证券相关业务资格的会计师事务所进行验资，出具验资报告。出具的验资报告由参加验资的2名或2名以上中国注册会计师签字方为有效。

3、若基金募集期限届满，未能达到基金备案的条件，由基金管理人按规定办理退款等事宜。

### （三）基金银行账户的开立和管理

1、基金托管人以基金的名义在其营业机构开立基金的银行账户，保管基金的银行存款，并根据基金管理人的指令办理资金收付。本基金的银行预留印鉴由基金托管人刻制、保管和使用。

2、基金银行账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得假借本基金的名义开立任何其他银行账户；亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。

3、基金银行账户的开立和管理应符合法律法规及银行业监督管理机构的有关规定。

### （四）基金证券账户和结算备付金账户的开立和管理

1、基金托管人在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司、深圳分公司为基金开立基金托管人与基金联名的证券账户。

2、基金证券账户的开立和使用，仅限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得出借或未经对方同意擅自转让基金的任何证券账户，亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。

3、基金证券账户的开立和证券账户卡的保管由基金托管人负责，账户资产的管理和运用由基金管理人负责。

4、基金托管人以基金托管人的名义在中国证券登记结算有限责任公司开立结算备付金账户，并代表所托管的基金完成与中国证券登记结算有限责任公司的一级法人清算工作，基金管理人应予以积极协助。结算备付金、结算互保基金、交收价差资金等的收取按照中国证券登记结算有限责任公司的规定执行。

5、若中国证监会或其他监管机构在本托管协议订立日之后允许基金从事其他投资品种的投资业务，涉及相关账户的开立、使用的，若无相关规定，则基金托管人比照上述关于账户开立、使用的规定执行。

### （五）债券托管专户的开设和管理

基金合同生效后，基金托管人根据中国人民银行、中央国债登记结算有限责任公司的有关规定，以基金的名义在中央国债登记结算有限责任公司开立债券托管账户，并代表基金进行银行间市场债券的结算。

#### （六）其他账户的开立和管理

1、因业务发展需要而开立的其他账户，可以根据法律法规和基金合同的规定，由基金管理人协助基金托管人按照有关法律法规和本合同的约定协商后开立。新账户按有关规定使用并管理。

2、法律法规等有关规定对相关账户的开立和管理另有规定的，从其规定办理。

#### （七）基金财产投资的有关有价凭证等的保管

基金财产投资的有关实物证券等有价凭证按约定由基金托管人存放于基金托管人的保管库，或存入中央国债登记结算有限责任公司、中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司或票据营业中心的代保管库，实物保管凭证由基金托管人持有。实物证券等有价凭证的购买和转让，由基金托管人根据基金管理人的指令办理。基金托管人对由上述存放机构及基金托管人以外机构实际有效控制的有价凭证不承担保管责任。

#### （八）与基金财产有关的重大合同的保管

由基金管理人代表基金签署的、与基金财产有关的重大合同的原件分别由基金管理人、基金托管人保管。除本协议另有规定外，基金管理人代表基金签署的与基金财产有关的重大合同应保证基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。基金管理人应在重大合同签署后及时将重大合同传真给基金托管人，并在三十个工作日内将正本送达基金托管人处。因基金管理人发送的合同传真件与事后送达的合同原件不一致所造成的后果，由基金管理人负责。重大合同的保管期限为基金合同终止后 15 年。

### 五、基金资产净值计算与复核

#### （一）基金资产净值的计算、复核与完成的时间及程序

##### 1、基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的净资产值。

基金份额净值是指基金资产净值除以基金份额总数，基金份额净值的计算，精确到 0.001 元，小数点后第四位四舍五入，国家另有规定的，从其规定。

基金管理人每个工作日计算基金资产净值及基金份额净值，经基金托管人复核，按规定公告。

## 2、复核程序

基金管理人每工作日对基金资产进行估值后，将基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

3、根据有关法律法规，基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致意见的，按照基金管理人对外公布的基金净值的计算结果予以公布。

### （二）基金资产估值方法和特殊情形的处理

#### 1、估值对象

基金所拥有的股票、权证、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等金融资产和金融负债。

#### 2、估值依据及原则

估值应符合基金合同、《证券投资基金会计核算业务指引》、证监会会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、中国证监会[2008]38号公告《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》及其他法律、法规的规定，如法律法规未做明确规定的，参照证券投资基金的行业通行做法处理。估值数据依据合法的数据来源独立取得。对于固定收益类投资品种的估值应依据中国证券业协会基金估值工作小组的指导意见及指导价格估值。

#### 估值的基本原则：

（1）对存在活跃市场的投资品种，如估值日有市价的，应采用市价确定公允价值。估值日无市价，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，应采用最近交易市价确定公允价值。如估值日无市价，且最近交易日后经济环境发生了重大变化且证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，使潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在0.25%以上的，应参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值的，应对最近交易的市价进行调整，确定公允价值。

（2）对不存在活跃市场的投资品种，应采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。运用估值技术

得出的结果，应反映估值日在公平条件下进行正常商业交易所采用的交易价格。采用估值技术确定公允价值时，应尽可能使用市场参与者在定价时考虑的所有市场参数，并应通过定期校验，确保估值技术的有效性。

有充足理由表明按以上估值原则仍不能客观反映相关投资品种的公允价值的，基金管理人应根据具体情况与托管人进行商定，按最能恰当反映公允价值的价格估值。

### 3、具体投资品种估值方法

#### （1）证券交易所上市的有价证券的估值

1) 交易所上市的有价证券（包括股票、权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

2) 交易所上市实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

3) 交易所上市未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

4) 交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。交易所上市的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

#### （2）处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

1) 送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市价（收盘价）估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值；

2) 首次公开发行未上市的股票、债券和权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

3) 首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的市价（收盘价）估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

(3) 全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值。

(4) 同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

(5) 本基金投资存托凭证的估值核算，依照境内上市交易的股票执行。

(6) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

(7) 相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

如基金管理人或基金托管人发现基金估值违反基金合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时，应立即通知对方，共同查明原因，双方协商解决。

根据有关法律法规，基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任。因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人对基金净值的计算结果对外予以公布。

#### 4、特殊情形的处理

基金管理人、基金托管人按估值方法的第（6）项进行估值时，所造成的误差不作为基金份额净值错误处理。

##### （三）基金份额净值错误的处理方式

(1) 当基金份额净值小数点后3位以内(含第3位)发生差错时，视为基金份额净值错误；基金份额净值出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，通报基金托管人，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；错误偏差达到基金份额净值的0.25%时，基金管理人应当通报基金托管人并报中国证监会备案；错

误偏差达到基金份额净值的0.5%时，基金管理人应当公告，通报基金托管人并报中国证监会备案；当发生净值计算错误时，由基金管理人负责处理，由此给基金份额持有人和基金造成损失的，应由基金管理人先行赔付，基金管理人按差错情形，有权向其他当事人追偿。

（2）当基金份额净值计算差错给基金和基金份额持有人造成损失需要进行赔偿时，基金管理人和基金托管人应根据实际情况界定双方承担的责任，经确认后按以下条款进行赔偿：

①本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，与本基金有关的会计问题，如经双方在平等基础上充分讨论后，尚不能达成一致时，按基金管理人的建议执行，由此给基金份额持有人和基金财产造成的损失，由基金管理人负责赔付。

②若基金管理人计算的基金份额净值已由基金托管人复核确认后公告，由此给基金份额持有人造成损失的，应根据法律法规的规定对投资者或基金支付赔偿金，就实际向投资者或基金支付的赔偿金额，基金管理人与基金托管人按照过错程度各自承担相应的责任。

③如基金管理人和基金托管人对基金份额净值的计算结果，虽然多次重新计算和核对或对基金管理人采用的估值方法，尚不能达成一致时，为避免不能按时公布基金份额净值的情形，以基金管理人的计算结果对外公布，由此给基金份额持有人和基金造成的损失，由基金管理人负责赔付。

④由于基金管理人提供的信息错误（包括但不限于基金申购或赎回金额等），进而导致基金份额净值计算错误而引起的基金份额持有人和基金财产的损失，由基金管理人负责赔付。

（3）由于不可抗力原因，或由于证券交易所或登记结算公司发送的数据错误，或国家会计政策变更、市场规则变更等，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误而造成的基金份额净值计算错误，基金管理人、基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。

（4）基金管理人和基金托管人由于各自技术系统设置而产生的净值计算尾差，以基金管理人计算结果为准。

（5）前述内容如法律法规或者监管部门另有规定的，从其规定。如果行业另有通行做法，双方当事人应本着平等和保护基金份额持有人利益的原则进行协商。

#### （四）暂停估值与公告基金份额净值的情形

（1）基金投资所涉及的证券交易所遇法定节假日或因其他原因暂停交易时；

（2）因不可抗力或其他情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；

（3）占基金相当比例的投资品种的估值出现重大转变，而基金管理人为保障投资人的利益，决定延迟估值；

（4）当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，基金管理人经与基金托管人协商一致的；

（5）中国证监会和基金合同认定的其他情形。

#### （五）基金会计制度

按国家有关部门规定的会计制度执行。

#### （六）基金账册的建立

基金管理人和基金托管人在基金合同生效后，应按照双方约定的同一记账方法和会计处理原则，分别独立地设置、登录和保管本基金的全套账册，对相关各方各自的账册定期进行核对，互相监督，以保证基金资产的安全。若基金管理人和基金托管人对会计处理方法存在分歧，应以基金管理人的处理方法为准。若当日核对不符，暂时无法查找到错账的原因而影响到基金净值的计算和公告的，以基金管理人的账册为准。

#### （七）基金财务报表与报告的编制和复核

##### 1、财务报表的编制

基金财务报表由基金管理人编制，基金托管人复核。

##### 2、报表复核



基金托管人在收到基金管理人编制的基金财务报表后，进行独立的复核。核对不符时，应及时通知基金管理人共同查出原因，进行调整，直至双方数据完全一致。

### 3、财务报表的编制与复核时间安排

基金管理人、基金托管人应当在每月结束后 5 个工作日内完成月度报表的编制及复核；在每个季度结束之日起 15 个工作日内完成基金季度报告的编制；在上半年结束之日起两个月内完成基金中期报告的编制及复核；在每年结束之日起三个月内完成基金年度报告的编制及复核。基金托管人在复核过程中，发现双方的报表存在不符时，基金管理人和基金托管人应共同查明原因，进行调整，调整以国家有关规定为准。基金年度报告的财务会计报告应当经过具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计。基金合同生效不足两个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、中期报告或者年度报告。

（八）基金管理人应每季度向基金托管人提供基金业绩比较基准的基础数据和编制结果。

## 六、基金份额持有人名册的登记与保管

基金份额持有人名册至少应包括基金份额持有人的名称、证件号码和持有的基金份额。基金份额持有人名册由基金注册登记机构根据基金管理人的指令编制和保管，基金管理人和基金托管人应分别保管基金份额持有人名册，保存期不少于 15 年。如不能妥善保管，则按相关法律法规承担责任。

在基金托管人要求或编制中期报告和年报前，基金管理人应将有关资料送交基金托管人，不得无故拒绝或延误提供，并保证其真实性、准确性和完整性。基金管理人和托管人不得将所保管的基金份额持有人名册用于基金托管业务以外的其他用途，并应遵守保密义务。

## 七、托管协议的变更、终止与基金财产的清算

### （一）托管协议的变更程序

本协议双方当事人经协商一致，可以对协议进行修改。修改后的新协议，其内容不得与基金合同的规定有任何冲突。基金托管协议的变更报中国证监会核准或备案后生效。

### （二）基金托管协议终止出现的情形

#### 1、基金合同终止；

2、基金托管人解散、依法被撤销、破产或由其他基金托管人接管基金资产；

3、基金管理人解散、依法被撤销、破产或由其他基金管理人接管基金管理权；

4、发生法律法规或基金合同规定的终止事项。

### （三）基金财产的清算

#### 1、基金财产清算组

（1）基金财产清算小组：自出现《基金合同》终止事由之日起30个工作日内成立清算小组，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。

（2）基金财产清算小组的组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

（3）基金财产清算小组的职责：基金财产清算组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算组可以依法进行必要的民事活动。

#### 2、基金财产清算程序

基金合同终止，应当按法律法规和基金合同的有关规定对基金财产进行清算。基金财产清算程序主要包括：

（1）《基金合同》终止后，由基金财产清算小组统一接管基金财产；

（2）对基金财产和债权债务进行清理和确认；

（3）对基金财产进行估值和变现；

（4）制作清算报告；

（5）聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；

（6）将清算报告报中国证监会备案并公告。

（7）对基金财产进行分配；

#### 3、清算费用

清算费用是指基金财产清算组在进行基金财产清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算组优先从基金财产中支付。

#### 4、基金财产清算剩余资产的分配

依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

#### 5、基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于《基金合同》终止并报中国证监会备案后5个工作日内由基金财产清算小组进行公告。

#### 6、基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存15年以上。

### 八、争议解决方式

因本协议产生或与之相关的争议，双方当事人应通过协商、调解解决，协商、调解不能解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，仲裁地点为深圳市，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

争议处理期间，双方当事人应恪守基金管理人和基金托管人职责，各自继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同和本托管协议规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

本协议受中国法律管辖。

---

[1]  
基金管理人联系电话变更为“20398888”

## 第二十四部分 对基金份额持有人的服务

基金管理人承诺为基金份额持有人提供一系列的服务。以下是主要的服务内容，基金管理人将根据基金份额持有人的需要和市场的变化，增加或变更服务项目。主要服务内容如下：

### 一、通知服务

通知基金份额持有人的内容包括短信账单、电子对账单等服务。对于订制手机短信对账单的客户，本公司将每月向账单期内有份额余额的客户发送，方便投资人快速获得账户信息。对于订制电子对账单的客户，本基金管理人将每季度或每月通过 E-MAIL 向账单期内有交易或期末有余额的客户发送上个月或季度基金交易对账单，以方便投资者快速获得交易信息。

### 二、在线服务

基金管理人利用自己的网站提供实时在线客服咨询服务。

### 三、网上交易（手机 APP）服务

本基金管理人已开通个人投资者网上交易业务。个人投资者通过基金管理人网站 <https://trade.xqfunds.com> 及手机客户端可以办理基金认购、申购、赎回、分红方式修改、账户资料修改、交易密码修改、交易申请查询和账户资料查询等各类业务。

### 四、资讯服务

投资人如果想了解申购与赎回的交易情况、基金账户余额、基金产品与服务等信息，可拨打基金管理人营销服务部电话或登录公司网站。

#### 1、营销服务部电话

客服热线：400-678-0099、021-38824536

#### 2、互联网站

公司网站：<http://www.xqfunds.com>

电子信息：[service@xqfunds.com](mailto:service@xqfunds.com)

#### 3、在线客服：

通过官网“[www.xqfunds.com](http://www.xqfunds.com)”、官方 APP“兴证全球基金”或微网站“[m.xqfunds.com](http://m.xqfunds.com)”点击“在线客服”

#### 4、微信公众号

官方微信号：xyfunds

## 五、信息定制服务

向基金份额持有人提供免费的手机短信和电子邮件信息定制服务。通过定制，基金份额持有人可以通过手机短信收到本公司发送的基金净值、短信对账单，并可通过电子邮件收到基金净值、我司的相关公告、电子对账单等信息。

## 六、投诉受理

投资人可以拨打基金管理人营销服务部电话，或通过本公司网站留言的投诉栏目、书信、电子邮件等渠道对本公司和销售网点所提供的服务进行投诉。

基金管理人承诺为基金份额持有人提供一系列的服务。基金管理人根据基金份额持有人的需要和市场的变化，有权增加或变更服务项目。

## 第二十五部分 招募说明书存放及查阅方式

本基金招募说明书存放在基金管理人、基金托管人的办公场所和营业场所，投资人可免费查阅。在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

## 第二十六部分 其他应披露事项

以下为自 2022 年 6 月 1 日至 2023 年 5 月 31 日，本基金刊登于《证券时报》和公司网站等规定网站的基金公告。

序号	事项名称	披露日期
1	关于调整旗下部分基金在华融证券股份有限公司费率优惠活动的公告	2022-07-11
2	关于旗下部分基金投资金博股份(688598)非公开发行股票的公告	2022-08-04
3	关于增加华宝证券股份有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	2022-09-27
4	关于增加玄元保险代理有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	2022-09-28
5	关于增加上海利得基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	2022-11-09
6	关于调整网上直销部分基金转换赎回转购优惠费率的公告	2022-12-06
7	关于增加上海华夏财富投资管理有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	2023-03-23
8	关于增加旗下部分基金销售机构的公告	2023-04-27
9	关于在网上直销平台开展旗下部分养老目标基金 Y 类基金份额申购费率优惠活动的公告	2023-05-05

## 第二十七部分 备查文件

- 一、中国证监会核准兴全轻资产投资混合型证券投资基金（LOF）募集的文件
- 二、关于申请募集兴全轻资产投资混合型证券投资基金（LOF）之法律意见书
- 三、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- 四、基金托管人业务资格批件和营业执照
- 五、《兴全轻资产投资混合型证券投资基金（LOF）基金合同》
- 六、《兴全轻资产投资混合型证券投资基金（LOF）托管协议》
- 七、中国证监会规定的其他文件

以上第（四）项备查文件存放在基金托管人的办公场所，其他文件存放在基金管理人的办公场所、营业场所。基金投资人在营业时间内可免费查阅，在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

兴证全球基金管理有限公司

2023年6月30日