

# 兴全多维价值混合型证券投资基金 更新招募说明书

(2022年6月30日更新)

基金管理人：兴证全球基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

## 重要提示

兴全多维价值混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）根据2019年5月14日中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可【2019】873号文准予募集注册。

兴证全球基金管理有限公司（以下简称“本基金管理人”）保证《兴全多维价值混合型证券投资基金招募说明书》（以下简称“招募说明书”或“本招募说明书”）的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册，但中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的投资价值和市场前景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招募说明书、基金合同、基金产品资料概要等信息披露文件。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。

基金合同是约定基金合同当事人之间权利、义务关系的法律文件。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《中华人民共和国证券投资基金法》、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。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证投资本基金一定盈利，也不保证最低收益。

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

并须及时关注销售机构对于本基金风险评级的调整情况，谨慎作出投资决策。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者在投资本基金前，请认真阅读本招募说明书，全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对认购（或申购）基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策，获得基金投资收益，亦承担基金投资中出现的各类风险。投资本基金可能遇到的风险包括：证券市场整体环境引发的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，大量赎回或暴跌导致的流动性风险，基金投资过程中产生的操作风险，基金投资对象与投资策略引致的特有风险，等等。

本基金除了投资A股外，还可根据法律法规规定投资香港联合交易所上市的公司股票。除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临海外市场风险、股价波动较大的风险、汇率风险、港股通额度限制、港股通可投资标的范围调整带来的风险、港股通交易日设定的风险、交收制度带来的基金流动性风险、港股通标的权益分派、转换等的处理规则带来的风险、香港联合交易所停牌、退市等制度性差异带来的风险、港股通规则变动带来的风险及其他香港市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。

本基金可投资科创板股票。基金资产投资于科创板股票，会面临科创板机制下因投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有投资风险，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。

科创板上市的公司股票、北交所上市的公司股票都是国内依法上市的公司股票，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公司股票，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。

本基金是一只混合型基金，其预期风险与收益高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。

本基金基金份额分为A、C类，A类基金份额收取认（申）购费，不计提销售服务费；C类基金份额不收取认（申）购费，但计提销售服务费。

基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则，在投资人作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资人自行负责。

本次招募说明书更新内容为：

- 1、更新了“二、释义”部分的相关内容。
- 2、更新了“三、基金管理人”、“四、基金托管人”部分的相关内容。
- 3、更新了“五、相关服务机构”部分的相关内容。
- 4、更新了“六、基金的募集”部分的相关内容。
- 5、更新了“八、基金份额的申购与赎回”部分的相关内容。
- 6、更新了“九、基金的投资”、“十、基金的业绩”中基金投资组合报告、基金业绩表现部分内容。
- 7、更新了“十七、风险揭示”部分的相关内容。
- 8、更新了“二十一、对基金份额持有人的服务”部分的相关内容。
- 9、在“二十二、其他应披露事项”更新了本期基金临时公告。

除上述内容外，本招募说明书所载内容截止日2022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2022年第1季度报告，数据截止日为2022年3月31日（财务数据未经审计）。本基金托管人中国建设银行股份有限公司

已复核了本次更新的招募说明书。

## 目录

一、绪言	7
二、释义	8
三、基金管理人	13
四、基金托管人	26
五、相关服务机构	29
六、基金的募集	40
七、基金合同的生效	40
八、基金份额的申购与赎回	41
九、基金的投资	54
十、基金的业绩	65
十一、基金的财产	66
十二、基金资产估值	68
十三、基金的收益与分配	75
十四、基金的费用与税收	76
十五、基金的会计与审计	78
十六、基金的信息披露	80
十七、风险揭示	86
十八、基金合同的变更、终止与基金财产的清算	98
十九、基金合同的内容摘要	100
二十、基金托管协议的内容摘要	115
二十一、对基金份额持有人的服务	136
二十二、其他应披露事项	138
二十三、招募说明书存放及查阅方式	140
二十四、备查文件	141

## 一、绪言

《兴全多维价值混合型证券投资基金招募说明书》(以下简称“招募说明书”或“本招募说明书”)依据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称“《销售办法》”)、《公开募集证券投资基金运作管理办法》(以下简称“《运作办法》”)、《公开募集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》”)及其他有关规定以及《兴全多维价值混合型证券投资基金基金合同》(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、误导性陈述或者重大遗漏,并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。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,并经中国证监会注册。基金合同是约定基金合同当事人之间基本权利义务的法律文件,其他与本基金相关的涉及基金合同当事人之间权利义务关系的任何文件或表述,均以基金合同为准。基金合同的当事人包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人。基金投资者自依基金合同取得本基金基金份额,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。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为必要条件。基金合同当事人按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资者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。

## 二、释义

在《兴全多维价值混合型证券投资基金招募说明书》中，除非文意另有所指，下列词语具有如下含义：

- 1、基金或本基金：指兴全多维价值混合型证券投资基金
- 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：指中国建设银行股份有限公司
- 4、基金合同：指《兴全多维价值混合型证券投资基金基金合同》及对本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《兴全多维价值混合型证券投资基金托管协议》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《兴全多维价值混合型证券投资基金招募说明书》及其更新
- 7、基金份额发售公告：指《兴全多维价值混合型证券投资基金基金份额发售公告》
- 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，并经 2020 年 3 月 20 日中国证监会《关于修改部分证券期货规章的决定》修正的《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》及颁布机关对其不时做出的修订

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：指中国人民银行和/或中国银行保险监督管理委员会

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：指依法可以投资证券投资基金的、在中华人民共和国境内合法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《合格境外机构投资者境内证券投资管理暂行办法》及相关法律法规规定可以投资于在中国境内依法募集的证券投资基金的中国境外的机构投资者

20、人民币合格境外机构投资者：指按照《人民币合格境外机构投资者境内证券投资试点办法》及相关法律法规规定，运用来自境外的人民币资金进行境内证券投资的境外法人

21、投资人、投资者：指个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者和人民币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

22、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

23、基金销售业务：指基金管理人或销售机构宣传推介基金，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

24、销售机构：指直销机构和其他销售机构

- 25、直销机构：指兴证全球基金管理有限公司
- 26、其他销售机构：指符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金销售业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务协议，办理基金销售业务的机构
- 27、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和办理非交易过户等
- 28、登记机构：指办理登记业务的机构。基金的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登记业务的机构
- 29、基金账户：指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
- 30、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办理认购、申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务而引起的基金份额变动及结余情况的账户
- 31、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
- 32、基金合同终止日：指基金合同规定的基金合同终止事由出现后，基金财产清算完毕，清算结果报中国证监会备案并予以公告的日期
- 33、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
- 34、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限
- 35、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日
- 36、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开放日
- 37、T+n 日：指自 T 日起第 n 个工作日(不包含 T 日)
- 38、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（若本基金参与港股通交易且该工作日为非港股通交易日，则基金管理人可根据实际情况决定本基金是否开放申购及赎回业务，具体以届时提前发布的公告为准）

- 39、开放时间：指开放日基金接受申购、赎回或其他业务的时间段
- 40、《业务规则》：指《兴证全球基金管理有限公司开放式基金业务规则》，是规范基金管理人所管理的开放式证券投资基金登记方面的业务规则，由基金管理人和投资人共同遵守
- 41、认购：指在基金募集期内，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
- 42、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
- 43、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
- 44、基金转换：指基金份额持有人按照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且开通转换的其他基金基金份额的行为
- 45、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操作
- 46、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、申购金额及申购方式，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申购及受理基金申购申请的一种投资方式
- 47、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）超过上一开放日基金总份额的 10%
- 48、元：指人民币元
- 49、基金收益：指基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券价差、银行存款利息、已实现的其他合法收入及因运用基金财产带来的成本和费用的节约
- 50、基金资产总值：指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收款项及其他资产的价值总和
- 51、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值
- 52、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
- 53、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

54、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

55、摆动定价机制：指当开放式基金遭遇大额申购赎回时，通过调整基金份额净值的方式，将基金调整投资组合的市场冲击成本分配给实际申购、赎回的投资者，从而减少对存量基金份额持有人利益的不利影响，确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待

56、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

57、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

58、沪港股票市场交易互联互通机制：简称沪港通，是指上海证券交易所和香港联合交易所有限公司（以下简称“香港联合交易所”）建立技术连接，使内地和香港投资者可以通过当地证券公司或经纪商买卖规定范围内的对方交易所上市的股票，包括沪股通和港股通两部分

59、深港股票市场交易互联互通机制：简称深港通，是指深圳证券交易所和香港联合交易所有限公司（以下简称“香港联合交易所”）建立技术连接，使内地和香港投资者可以通过当地证券公司或经纪商买卖规定范围内的对方交易所上市的股票，包括深股通和港股通两部分

60、港股通：指内地投资者委托内地证券公司，经由上海证券交易所、深圳证券交易所或经证监会认可的机构设立的证券交易服务公司，向香港联合交易所进行申报，买卖规定范围内的香港联合交易所上市的股票

61、基金产品资料概要：指《兴全多维价值混合型证券投资基金基金产品资料概要》及其更新

### 三、基金管理人

#### （一）基金管理人概况

机构名称：兴证全球基金管理有限公司

成立日期：2003年9月30日

住所：上海市黄浦区金陵东路368号

办公地址：上海市浦东新区芳甸路1155号浦东嘉里城办公楼28-29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2022年5月27日，公司旗下已管理兴全可转债混合型证券投资基金等共49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，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，兼任兴证全球基金管理有限公司董事长及法定代表人、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董事、副董事长、总经理，兼任兴业证券慈善基金会副理事长等职务。

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财富管理部总经理，兼任兴证期货有限公司董事、兴证证券资产管理有限公司董事。

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，兼任法国邮政银行资产管理公司监事会成员等职务。

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，兼任法国邮政银行资产管理有限公司监事会成员等职务。

简·丹尼尔女士（Jane Daniel），董事，1969年生，英国国籍，具有英国特许银行家协会（ACIB）资质和苏格兰特许银行家协会（FCIBS）会员资格。历任国民西敏寺银行高级经理，苏格兰皇家银行国际银行业务首席运营办公室全球控制主管（董事总经理），天利投资运营与企业风险全球主管兼欧洲、中东、非洲地区首席风险官等职务。现任全球人寿资产管理控股有限公司董事、全球首席风险及合规官，兼任全球人寿资产管理英国控股有限公司董事及主席等职务。

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，兼任上海金桥出口加工区开发股份有限公司独立董事、宝钢股份独立董事、摩根士丹利华鑫证券有限责任公司独立董事、浦发硅谷银行独立董事、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，兼任兴证（香港）金融控股有

限公司董事、兴证国际金融集团有限公司董事会主席、非执行董事。

桑德·马特曼先生（Sander Maatman），监事，1969年生，荷兰国籍，经济学硕士。历任荷兰 Robeco 鹿特丹投资公司固定收益经理，全球人寿资产管理控股有限公司首席财务官等职务。现任全球人寿资产管理控股有限公司董事、全球首席财务官及运营官。

秦杰先生，职工监事，1981年生，经济学硕士。历任德勤华永会计师事务所助理经理，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综合管理部总监等职务。现任兴证全球基金管理有限公司总经理助理，兼任董事会秘书、合规管理部总监、风险管理部总监、投融资业务审批部总监。

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。

### 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。

郑文惠女士，副总经理，1969年生，高级工商管理硕士。历任兴业证券股份有限公司泉州营业部总经理，运营管理部总经理兼上海分公司总经理，私人财富管理总部总经理兼上海分公司总经理等职务。现任兴证全球基金管理有限公司副总经理兼兴证全球资本管理（上海）有限公司执行董事。

陈锦泉先生，副总经理，1977年生，工商管理硕士。历任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副总经理兼专户投资部总监、固定收益部总监、投资经



理。

詹鸿飞先生，副总经理兼首席信息官，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、北京分公司总经理。

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、基金经理。

#### 4、本基金基金经理

杨世进先生，药剂学硕士。历任国家知识产权局审查员；招商基金管理有限公司研究员，天治基金管理有限公司研究员，兴证全球基金管理有限公司研究部研究员、基金经理助理、兴全合宜灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金经理。现任兴全多维价值混合型证券投资基金基金经理（2021年7月16日起至今）。

本基金历任基金经理：

董理先生，于2019年6月12日至2021年7月16日期间担任本基金基金经理。

#### 5、投资决策委员会成员

本基金采用投资决策委员会领导下的基金经理负责制。基金管理人公募投资决策委员会成员由以下人员组成：

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、基金管理部投资总监、研究部总监兼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）基金管理人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于：

- （1）依法募集资金；
- （2）自《基金合同》生效之日起，根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产；
- （3）依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；
- （4）销售基金份额；
- （5）按照规定召集基金份额持有人大会；
- （6）依据《基金合同》及有关法律规规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；
- （7）在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；
- （8）选择、更换基金销售机构，对基金销售机构的相关行为进行监督和处理；
- （9）担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记机构办理基金登记业务

并获得《基金合同》规定的费用；

(10) 依据《基金合同》及有关法律的规定决定基金收益的分配方案；

(11) 在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购、赎回与转换申请；

(12) 依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使相关权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利；

(13) 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；

(14) 以基金管理人的名义，代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；

(15) 选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券/期货经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；

(16) 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、定期定额投资和非交易过户等业务规则；

(17) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于：

(1) 依法募集资金，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、谨慎勤勉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基金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，不得利用基金财产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) 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，按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；

(9) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

(10) 编制季度报告、中期报告和年度报告；

(11) 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；

(12) 保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、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，不向他人泄露；

(13) 按《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；

(14) 按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

(15) 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；

(16) 按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料 15 年以上；

(17) 确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出，并且保证投资者能够按照《基金合同》规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并在支付合理成本的前提下得到有关资料的复印件；

(18) 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；

(19) 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；

(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时，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

(21) 监督基金托管人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金托管人违反《基金合同》造成基金财产损失时，基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；

(22) 当基金管理人将其义务委托第三方处理时,应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任;

(23) 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实施其他法律行为;

(24) 基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件,《基金合同》不能生效,基金管理人承担全部募集费用,将已募集资金并加计银行同期活期存款利息在基金募集期结束后 30 日内退还基金认购人;

(25) 执行生效的基金份额持有人大会的决议;

(26) 建立并保存基金份额持有人名册;

(27) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

#### (四) 基金管理人承诺

1、本基金管理人承诺严格遵守现行有效的相关法律法规、《基金合同》和中国证监会的有关规定,建立健全内部控制制度,采取有效措施,防止违反现行有效的有关法律法规、《基金合同》和中国证监会有关规定的行为发生。

2、本基金管理人承诺严格遵守《中华人民共和国证券法》、《基金法》及有关法律法规,建立健全的内部控制制度,采取有效措施,防止下列行为发生:

- (1) 将其固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资;
- (2) 不公平地对待其管理的不同基金财产;
- (3) 利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人谋取利益;
- (4) 向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失;
- (5) 法律法规或中国证监会禁止的其他行为。

3、本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有关法律、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) 在向中国证监会报送的资料中弄虚作假;
- (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,不按照规定履行职责;

(7) 违反现行有效的有关法律法规、《基金合同》和中国证监会的有关规定，泄漏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，或利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；

(8) 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；

(9) 贬损同行，以抬高自己；

(10) 以不正当手段谋求业务发展；

(11) 有悖社会公德，损害证券投资基金人员形象；

(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) 其他法律法规以及中国证监会禁止的行为。

#### 4、基金经理承诺

(1) 依照有关法律法规和《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及其代理人、受雇人或任何第三人谋取利益；

(3) 不违反现行有效的有关法律法规、《基金合同》和中国证监会的有关规定，泄漏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，或利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；

(4) 不从事损害基金财产和基金份额持有人利益的证券交易及其他活动。

(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，风险管理部、审计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，审计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。部门负责人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的措施

(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 and 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。

## 四、基金托管人

### （一）基金托管人情况

#### 1、基本情况

名称：中国建设银行股份有限公司(简称：中国建设银行)

住所：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人：田国立

成立时间：2004 年 09 月 17 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12 号

联系人：李申

联系电话：(021)6063 7102

#### 2、主要人员情况

中国建设银行总行设资产托管业务部，下设综合处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、全球托管处、养老金托管处、新兴业务处、运营管理处、跨境托管运营处、社保及大客户处、托管应用系统支持处、合规监督处等 12 个职能处室，在安徽合肥设有托管运营中心，在上海设有托管运营中心上海分中心，共有员工 300 余人。

#### 3、基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履行托管人的各项职责，切实维护资产持有人的合法权益，为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展，中国建设银行托管资产规模不断扩大，托管业务品种不断增加，已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户

户、(R)QFII、(R)QDII、企业年金、职业年金、存托业务等产品在内的托管业务体系，是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至 2021 年三季度末，中国建设银行已托管 1120 只证券投资基金。中国建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平，赢得了业内的高度认同。截至目前，中国建设银行先后多次被《全球托管人》、《财资》、《环球金融》杂志及《中国基金报》评选为“最佳托管银行”、连续多年荣获中央国债登记结算有限责任公司（中债）“优秀资产托管机构”、银行间市场清算所股份有限公司（上清所）“优秀托管银行”奖项，并在 2017 年、2019 年、2020 年、2021 年分别荣获《亚洲银行家》颁发的“最佳托管系统实施奖”、“中国年度托管业务科技实施奖”、“中国年度托管银行（大型银行）”以及“中国最佳数字化资产托管银行”奖项。

## （二）基金托管人的内部控制制度

### 1、内部控制目标

中国建设银行托管业务确保贯彻落实国家有关法律法规及监管规定，勤勉尽责，恪尽职守，保证托管资产的安全、完整，保障所托管基金的稳健运行，维护基金份额持有人利益；规范业务操作，严格按规程进行业务处理和操作，有效管控托管业务风险；确保所披露信息的完整、及时，保证客户信息不泄漏。

### 2、内部控制组织结构

中国建设银行设有风险与内控管理委员会，负责全行风险管理与内部控制的研究、议事和协调工作。内部控制管理部门是牵头内部控制管理的职能部门，牵头内部控制体系的统筹规划、组织落实和检查评价。资产托管业务部设置专门负责内部控制工作的处室，配备了专职内控合规人员负责托管业务的内控合规工作。

### 3、内部控制原则

中国建设银行托管业务内部控制遵循全面性、重要性、制衡性、适应性和独立性原则。

（1）全面性原则。内部控制贯穿和渗透于托管业务各项流程和各个环节，覆盖所有的机构、岗位，约束所有托管业务人员。

（2）重要性原则。内部控制在全面控制的基础上，关注重要的托管业务事项和高风险托管业务领域。

（3）制衡性原则。内部控制坚持风险为本、审慎经营的理念，设立托管机

构和开办托管业务均坚持内控优先，在组织机构、权责分配、业务流程等方面形成相互制约、相互监督的机制。

(4) 适应性原则。内部控制与托管业务管理模式、业务规模、产品复杂程度、风险状况等相匹配，并根据情况变化及时调整。

(5) 独立性原则。保证客户资产与建设银行自有资产、托管的其他资产相互独立，对不同客户的资产分别设置账户、独立核算、分账管理。

#### 4、内部控制措施

(1) 托管资产保管控制。严格按照法律法规和合同约定履行托管人安全保管可控制账户内托管资产的职责，所托管资产与托管人自有资产、托管的其他资产严格分开，保证托管资产的安全、独立和完整。

(2) 授权控制。托管业务纳入全行统一的授权管理体系，严格在授权范围内执行，严禁超范围经营。明确业务处理岗位权限，各级人员在授权范围内行使职权和承担责任。明确不相容岗位，实施相应的分离措施，形成各司其职、各负其责、相互制约的工作机制。

(3) 规章制度控制。制定系统化、规范化的托管业务管理制度，并定期重检与修订，持续维持托管业务规章制度的适应性和有效性，严格保障托管业务规范运营。

(4) 流程控制。严格指令接收、清算、核算、监督的流程化管理，控制关键风险点。

(5) 信息系统控制。持续加强内控手段的新技术运用，提高内控自动化水平和有效性。

(6) 业务连续性控制。建立托管业务应急响应及恢复机制，实现对运营中断事件的快速响应和及时处置。组织开展应急演练，保障托管业务持续运营。

(7) 运营环境控制。托管业务工作环境符合监管和控制要求，运营环境独立，录音、录像及门禁持续有效。系统实现独立与隔离，建立安全的数据传输通道和数据备份机制，保障数据传输和存储安全。

(8) 员工行为管理控制。明确员工行为守则，规范员工日常行为，加强职业道德和员工操守教育，培育忠于所托、勤勉尽责的合规文化。

自 2007 年起，资产托管业务部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计，均获无保留意见，并已经成为常规化的内控工作手段。

### （三）基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

#### 1、监督方法

依照《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》、《证券投资基金托管业务管理办法》及其配套法规和基金合同、托管协议的约定，监督所托管基金的投资运作，对基金管理人运作基金的投资比例、投资范围、投资组合等情况进行监督。在日常为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中，对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对各基金费用的提取与开支情况进行检查监督。

#### 2、监督流程

基金托管人发现基金管理人的投资指令违反法律法规及基金托管协议的规定，应当拒绝执行，及时提示基金管理人，并依照法律法规的规定及时向中国证监会报告。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法规、基金托管协议规定的，应当及时提示基金管理人在规定期限内改正，并依照法律法规的规定及时向中国证监会报告。

每个工作日对基金投资运作比例等情况进行监督，如发现异常情况，向基金管理人进行风险提示，与基金管理人进行情况核实，督促其改正，并依照法律法规的规定及时向中国证监会报告。

基金管理人义务配合和协助基金托管人的监督和核查，对基金托管人发出的提示，应在规定时间内答复并改正；对基金托管人的合理疑义，应及时解释或举证；对基金托管人按照法律法规和托管协议的要求需向中国证监会报告的事项，应积极配合提供相关数据资料和制度等。

## 五、相关服务机构

### （一）基金份额销售机构

#### 1、直销机构

## (1) 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 号浦东嘉里城办公楼 30 楼

联系人：秦洋洋、沈冰心

直销联系电话：（021）20398706、20398927

传真：021-58368869、021-58368915

## (2) 兴证全球基金管理有限公司网上直销平台（含微网站、APP）

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

客服电话：400-678-0099；（021）388245362

## 2、代销机构（排名不分先后）

名称	法定代表人	地址	客服电话	网址
中国建设银行股份有限公司	田国立	注册地址：北京市西城区金融大街 25 号 办公地址：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	注册地址：中国(上海)自由贸易试验区银城中路 188 号 办公地址：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>
招商银行股份有限公司	缪建民	注册地址：中国广东省深圳市福田区深南大道 7088 号 办公地址：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>
中信银行股份有限公司	李庆萍	注册地址：北京市朝阳区光华路 10 号院 1 号楼 6-30 层、32-42 层 办公地址：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	注册地址：上海市中山东一路 12 号 办公地址：上海市中山东一路 12 号	95528	<a href="https://www.spdb.com.cn/">https://www.spdb.com.cn/</a>
兴业银行股份有限公司	高建平	注册地址：中国福建省福州市湖东路 154 号 办公地址：中国福建省福州市湖东路 154 号	95561	<a href="https://www.cib.com.cn/">https://www.cib.com.cn/</a>
中国光大银行股份有限公司	李晓鹏	注册地址：中国北京市西城区太平桥大街 25 号、甲 25 号中国光大中心 办公地址：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>

平安银行股份有限公司	谢永林	注册地址：广东省深圳市罗湖区深南东路 5047 号 办公地址：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	注册地址：浙江省宁波市鄞州区宁东路 345 号 办公地址：浙江省宁波市鄞州区宁东路 345 号	95574	<a href="http://www.nbcnb.cn/">http://www.nbcnb.cn/</a>
江苏银行股份有限公司	夏平	注册地址：江苏省南京市秦淮区中华路 26 号 办公地址：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>
兴业证券股份有限公司	杨华辉	注册地址：福州市湖东路 268 号 办公地址：长柳路 36 号 7 层 701 室	4008888123	<a href="http://www.xyzq.com.cn">http://www.xyzq.com.cn</a>
国泰君安证券股份有限公司	贺青	注册地址：上海市浦东新区自由贸易试验区商城路 618 号 办公地址：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	注册地址：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼 办公地址：北京市朝阳区安立路 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	何如	注册地址：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 办公地址：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	86-755-82130188	<a href="http://www.guosen.com.cn">www.guosen.com.cn</a>
招商证券股份有限公司	霍达	注册地址：深圳市福田区福田街道福华一路 111 号 办公地址：深圳市福田区福田街道福华一路 111 号	电话 86-755-82943666, 86-755-82960432	<a href="http://www.cmschina.com/">http://www.cmschina.com/</a>
广发证券股份有限公司	孙树明	注册地址：广东省广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街 2 号 618 室 办公地址：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	注册地址：广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场(二期)北座 办公地址：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	86-755-23835888; 86-10-60838888; 86-755-23835383; 86-10-60836030	<a href="http://www.citics.com">www.citics.com</a>

中国银河证券股份有限公司	陈共炎	注册地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座 2-6 层 办公地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座 2-6 层	95551	<a href="http://www.chinastock.com.cn/">http://www.chinastock.com.cn/</a>
海通证券股份有限公司	周杰	注册地址：上海市黄浦区广东路 689 号 办公地址：上海市黄浦区广东路 689 号	86-21-23219000	<a href="http://www.htsec.com">www.htsec.com</a>
长江证券股份有限公司	李新华	注册地址：湖北省武汉市江汉区新华路特 8 号 办公地址：湖北省武汉市江汉区新华路特 8 号	86-27-65799866	<a href="http://www.cjsc.com/">http://www.cjsc.com/</a>
安信证券股份有限公司	黄炎勋	注册地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元 办公地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元	95517	<a href="http://www.essence.com.cn/">http://www.essence.com.cn/</a>
湘财证券股份有限公司	孙永祥	注册地址：长沙市天心区湘府中路 198 号新南城商务中心 A 栋 11 楼 办公地址：长沙市天心区湘府中路 198 号新南城商务中心 A 栋 11 楼	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	注册地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 1168 号 B 座 2101、2104A 室 办公地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 1168 号 B 座 2101、2104A 室	400-619-8888	<a href="https://www.msizq.com/">https://www.msizq.com/</a>
渤海证券股份有限公司	安志勇	注册地址：天津经济技术开发区第二大街 42 号写字楼 101 室 办公地址：天津经济技术开发区第二大街 42 号写字楼 101 室	400-651-5988	<a href="http://www.bhzq.com">www.bhzq.com</a>
华泰证券股份有限公司	张伟	注册地址：江苏省南京市建邺区江东中路 228 号 办公地址：江苏省南京市建邺区江东中路 228 号	86-25-83389999	<a href="http://www.htsc.com.cn">www.htsc.com.cn</a>
山西证券股份有限公司	侯巍	注册地址：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 办公地址：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	86-351-8686668;86-351-8686905	<a href="http://www.sxzq.com">www.sxzq.com</a>
中信证券（山东）有限责任公司	姜晓林	注册地址：青岛市崂山区深圳路 222 号 1 号楼 2001 办公地址：青岛市崂山区深圳路 222 号 1 号楼 2001	95548	<a href="http://sd.citics.com/">http://sd.citics.com/</a>
东兴证券股份有限公司	魏庆华	注册地址：北京市西城区金融大街 5 号（新盛大厦）6、10、12、15、16 层 北京市西城区金融大街 5 号（新盛大厦）6、10、12、15、16 层	86-10-66555171	<a href="http://www.dxzq.net">www.dxzq.net</a>



		办公地址：北京市西城区金融大街5号(新盛大厦)6、10、12、15、16层		
东吴证券股份有限公司	范力	注册地址：江苏省苏州市吴中区工业园区星阳街5号 办公地址：江苏省苏州市吴中区工业园区星阳街5号	95330	<a href="http://www.dwzq.com.cn/">http://www.dwzq.com.cn/</a>
信达证券股份有限公司	肖林	注册地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼 办公地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼	95321	<a href="https://www.cindasc.com/">https://www.cindasc.com/</a>
东方证券股份有限公司	潘鑫军	注册地址：上海市黄浦区中山南路119号东方证券大厦 办公地址：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	86-21-63325888	<a href="http://www.dfzq.com.cn">www.dfzq.com.cn</a>
方正证券股份有限公司	施华	注册地址：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 办公地址：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	86-731-85832367	<a href="http://www.foundersc.com">www.foundersc.com</a>
长城证券股份有限公司	曹宏	注册地址：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 办公地址：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	86-755-83516072	<a href="http://www.cgws.com">www.cgws.com</a>
光大证券股份有限公司	刘秋明	注册地址：上海市静安区新闻路1508号 办公地址：上海市静安区新闻路1508号	86-21-22169914	<a href="http://www.ebscn.com">www.ebscn.com</a>
中信证券华南股份有限公司	胡伏云	注册地址：广州市天河区珠江西路5号501房 办公地址：广州市天河区珠江西路5号501房	95548	<a href="http://www.gzs.com.cn/">http://www.gzs.com.cn/</a>
东北证券股份有限公司	李福春	注册地址：吉林省长春市南关区生态大街6666号 办公地址：吉林省长春市南关区生态大街6666号	86-431-85096806	<a href="http://www.nesc.cn">www.nesc.cn</a>
南京证券股份有限公司	李剑锋	注册地址：南京市江东中路389号 办公地址：南京市江东中路389号	95386	<a href="https://www.njzq.com.cn/">https://www.njzq.com.cn/</a>
国联证券股份有限公司	姚志勇	注册地址：江苏省无锡市滨湖区金融一街8号 办公地址：无锡市滨湖区金融一街8号国联金融大厦	95570	<a href="http://www.gls.com.cn/">http://www.gls.com.cn/</a>

平安证券股份有限公司	何之江	注册地址：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 办公地址：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	86-21-38635562, 86-755-22627723	<a href="http://www.stock.pingan.com/">http://www.stock.pingan.com/</a>
华安证券股份有限公司	章宏韬	注册地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号 办公地址：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>
东莞证券股份有限公司	陈照星	注册地址：东莞市莞城区可园南路一号 办公地址：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	注册地址：河南省郑州市郑东新区商务外环路 10 号 办公地址：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	注册地址：北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层 办公地址：北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层	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	注册地址：江苏省常州市钟楼区延陵西路 23 号投资广场 18 层 办公地址：江苏省常州市钟楼区延陵西路 23 号投资广场 18 层	86-519-81595100	<a href="http://www.longone.com.cn">www.longone.com.cn</a>
恒泰证券股份有限公司	庞介民	注册地址：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 办公地址：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	0471-4962367	<a href="http://m.cnht.com.cn/">http://m.cnht.com.cn/</a>
国盛证券有限责任公司	周军	注册地址：江西省南昌市新建区子实路 1589 号 办公地址：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.gs-zq.com/">https://www.gs-zq.com/</a>
华西证券股份有限公司	杨炯洋	注册地址：四川省成都市高新区天府二街 198 号 办公地址：四川省成都市高新区天府二街 198 号	86-28-86150207	<a href="http://www.hx168.com.cn/">http://www.hx168.com.cn/</a>
中泰证券股份有限公司	李峰	注册地址：济南市市中区经七路 86 号 办公地址：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>
德邦证券股份有限公司	武晓春	注册地址：上海市普陀区曹杨路 510 号南半幢 9 楼 办公地址：上海市普陀区曹杨路 510 号	400-8888-128	<a href="https://www.tebon.com.cn/">https://www.tebon.com.cn/</a>

		南半幢 9 楼		
西部证券股份有限公司	徐朝晖	注册地址：陕西省西安市新城区东大街 319 号 8 幢 10000 室 办公地址：陕西省西安市新城区东大街 319 号 8 幢 10000 室	95582	<a href="http://www.west95582.com/">http://www.west95582.com/</a>
中国国际金融股份有限公司	沈如军	注册地址：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 办公地址：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	陆建强	注册地址：浙江省杭州市西湖区天目山路 198 号财通双冠大厦西楼 办公地址：浙江省杭州市西湖区天目山路 198 号	86-571-8782 1312	公司网站 <a href="http://www.ctsec.com">www.ctsec.com</a>
华鑫证券有限责任公司	李军	注册地址：深圳市福田区莲花街道福中社区深南大道 2008 号中国凤凰大厦 1 栋 20C-1 房 办公地址：上海市浦东新区金海路 1000 号	400-109-991 8	<a href="http://www.cfsc.com.cn/">http://www.cfsc.com.cn/</a>
中国中金财富证券有限公司	高涛	注册地址：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心 A 栋第 18-21 层及第 04 层 01. 02. 03. 05. 11. 12. 13. 15. 16. 18. 19. 20. 21. 22. 23 单元 办公地址：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心 A 栋第 18-21 层及第 04 层 01. 02. 03. 05. 11. 12. 13. 15. 16. 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	郑立坤	注册地址：西藏自治区拉萨市柳梧新区国际总部城 10 栋楼 办公地址：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	注册地址：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 办公地址：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>
国金证券股份有限公司	冉云	注册地址：四川省成都市青羊区东城根上街 95 号 办公地址：四川省成都市青羊区东城根上街 95 号成证大厦 16 楼	86-28-86690 021	<a href="https://www.gjzq.com.cn">https://www.gjzq.com.cn</a>
爱建证券有限责任公司	祝健	注册地址：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>

		办公地址：中国(上海)自由贸易试验区世纪大道1600号1幢32楼		
华融证券股份有限公司	张海文	注册地址：北京市西城区金融大街8号 办公地址：北京市西城区金融大街8号	95390	<a href="https://www.hrsec.com.cn/">https://www.hrsec.com.cn/</a>
财达证券股份有限公司	翟建强	注册地址：石家庄市自强路35号 办公地址：石家庄市自强路35号	95363	<a href="http://www.s10000.com/">http://www.s10000.com/</a>
华金证券股份有限公司	宋卫东	注册地址：上海市静安区天目西路128号19层1902室 办公地址：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.com/">https://www.huajinsec.com/</a>
江苏汇林保大基金销售有限公司	吴言林	注册地址：南京市高淳区经济开发区古檀大道47号 办公地址：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>
腾安基金销售(深圳)有限公司	刘明军	注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室 办公地址：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室	95017	<a href="http://www.tenganxinxi.com">www.tenganxinxi.com</a>
民商基金销售(上海)有限公司	賁惠琴	注册地址：上海市黄浦区北京东路666号H区(东座)6楼A31室 办公地址：上海市浦东新区张扬路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	葛新	注册地址：北京市海淀区西北旺东路10号院西区4号楼1层103室 办公地址：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	汪静波	注册地址：上海市虹口区飞虹路360弄9号3724室 办公地址：上海市虹口区飞虹路360弄9号3724室	400-821-5399	<a href="http://www.noah-fund.com">http://www.noah-fund.com</a>
深圳众禄基金销售股份有限公司	薛峰	注册地址：深圳市罗湖区笋岗街道梨园路物资控股置地大厦8楼801 办公地址：深圳市罗湖区笋岗街道梨园路物资控股置地大厦8楼801	4006-788-887	<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	注册地址：上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层 办公地址：上海市徐汇区宛平南路88号金座东方财富大厦	4001818188	<a href="http://www.1234567.com.cn">www.1234567.com.cn</a>
上海好买基金销售有限公司	杨文斌	注册地址：上海市浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦903~906室 办公地址：上海市浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦903~906室	400-700-9665	<a href="http://www.ehowbuy.com">http://www.ehowbuy.com</a>
蚂蚁(杭州)基金销售有限	祖国明	注册地址：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	4000766123	<a href="http://www.fund123.cn">http://www.fund123.cn</a>

公司		办公地址:		
上海长量基金销售有限公司	张跃伟	注册地址:浦东新区高翔路526号2幢220室 办公地址: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	注册地址:浙江省杭州市文二西路1号元茂大厦903室 办公地址:浙江省杭州市余杭区五常街道同顺街18号	952555	http://www.5ifund.com
泛华普益基金销售有限公司	于海峰	注册地址:成都市成华区建设路9号高地中心1101室 办公地址:成都市成华区建设路9号高地中心1101室	400-080-3388	www.puyifund.com
北京汇成基金销售有限公司	王伟刚	注册地址:北京市西城区宣武门外大街甲1号4层401-2 办公地址:西城区宣武门外大街甲1号环球财讯中心D座4层	400-6199059	www.hcfunds.com
上海大智慧基金销售有限公司	申健	注册地址:中国(上海)自由贸易试验区杨高南路428号1号楼1102单元 办公地址:	021-20219931	www.gw.com.cn
北京新浪仓石基金销售有限公司	穆飞虎	注册地址: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 办公地址: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	注册地址:上海市黄浦区广东路500号30层3001单元 办公地址: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	王之光	注册地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1333号 办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1333号	400-821-9031	http://www.lufunds.com
珠海盈米基金销售有限公司	肖雯	注册地址:珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491(集中办公区) 办公地址:广州市海珠区琶洲大道东路1号保利国际广场南塔1201-1203室	020-89629066	www.yingmi.cn
京东肯特瑞基金销售有限公司	王苏宁	注册地址:北京市海淀区西三旗建材城中路12号17号平房157 办公地址: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17层	95118	kenterui.jd.com
北京雪球基金销售有限公司	李楠	注册地址:北京市朝阳区创远路34号院6号楼15层1501室	400-1599288	https://danjuanapp.com/

		办公地址：北京市融新科技园 C 座		
兴证期货有限公司	周峰	注册地址：福州市鼓楼区温泉街道湖东路 268 号 6 层(兴业证券大厦) 办公地址：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	<a href="http://www.xyfutures.cn/">http://www.xyfutures.cn/</a>
中信期货有限公司	张皓	注册地址：广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场(二期)北座 13 层 1301-1305、14 层 办公地址：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	<a href="http://www.citicsf.com/">http://www.citicsf.com/</a>
阳光人寿保险股份有限公司	李科	注册地址：海南省三亚市迎宾路 360-1 号三亚阳光金融广场 16 层 办公地址：北京市朝阳区朝阳门外大街乙 12 号院 1 号昆泰国际大厦 12 层	95510	<a href="https://fund.sinosig.com/">https://fund.sinosig.com/</a>
中国人寿保险股份有限公司	王滨	注册地址：北京市西城区金融大街 16 号 办公地址：北京市西城区金融大街 16 号	95515	<a href="http://www.e-chinalife.com">www.e-chinalife.com</a>

基金管理人可根据《基金法》、《运作办法》、《销售办法》和基金合同等的规定，选择其他符合要求的机构销售本基金，并在基金管理人网站公示。

## （二）登记机构

名称：兴证全球基金管理有限公司

注册地址：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 楼

法定代表人：杨华辉

联系人：朱瑞立

电话：021-20398888

传真：021-20398858

## （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：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

办公地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

负责人：韩炯

经办律师：安冬、陆奇

电话：021-31358666

传真：021-31358600

联系人：陆奇

（四）审计基金资产的会计师事务所

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：010-8508 5000

传真：010-8508 5111

经办注册会计师：张楠、欧梦激

联系人：张楠

## 六、基金的募集

### （一）基金募集的依据

本基金由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》、基金合同及其他有关规定，经中国证监会 2019 年 5 月 14 日证监许可【2019】873 号准予募集注册。

### （二）基金类别

混合型证券投资基金

### （三）基金的运作方式

契约型开放式

### （四）基金存续期限

不定期

### （五）基金的募集情况

经中国证监会批准，本基金自 2019 年 5 月 27 日至 2019 年 6 月 6 日向社会公开募集。经德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）验资，本次募集的净认购金额为 3,995,457,683.47 元人民币，其中 A 类份额的净认购金额为 3,588,638,254.12 元人民币，C 类份额的净认购金额为 406,819,429.35 元人民币；有效认购款项在基金合同生效前产生的利息共计 1,307,051.44 元人民币，其中 A 类份额的有效认购款项在基金合同生效前产生的利息为 1,202,737.58 元人民币，C 类份额的有效认购款项在基金合同生效前产生的利息为 104,313.86 元人民币。本基金首次设立募集规模为 3,996,764,734.91 份基金份额，有效认购总户数为 53,561 户。经向中国证监会备案，本基金基金合同于 2019 年 6 月 12 日正式生效。

## 七、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 2019 年 6 月 12 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 个工作日出现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。

法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。

## 八、基金份额的申购与赎回

### （一）申购和赎回的场所

本基金的申购与赎回将通过销售机构进行。本基金销售机构为基金管理人直销机构和其他销售机构的销售网点。本基金销售机构名单参见本招募说明书“五、相关服务机构”部分相关内容或其他相关公告。

基金管理人可根据情况变更或增减销售机构，并在基金管理人网站公示。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。若基金管理人或其指定的其他销售机构开通电话、传真或网上等交易方式，投资人可通过上述方式进行申购与赎回。

### （二）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（若本基金参与港股通交易且该工作日为非港股通交易日，则基金管理人可根据实际情况决定本基金是否开放申购及赎回业务，具体以届时提前发布的公告为准），但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或本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/期货交易市场，证券/期货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，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、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、转换申请且登记机构确认接受的，其基金份额申购、赎回价格为下一开放日该类基金份额申购、赎回的价格。

本基金日常申购、赎回自 2019 年 9 月 9 日开始办理。

### （三）申购与赎回的原则

1、“未知价”原则，即申购、赎回价格以申请当日收市后计算的该类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、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、办理申购、赎回业务时，应当遵循基金份额持有人利益优先原则，确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待。

基金管理人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规则开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定进行公告。

### （四）申购与赎回的程序

#### 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，在开放日的具体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，投资人全额交付申购款项，申购成立；登记机构确认基金份额时，申购生效。

基金份额持有人递交赎回申请，赎回成立；登记机构确认赎回时，赎回生效。投资人赎回生效后，基金管理人将在 T+7 日(包括该日)内支付赎回款项。在发生巨额赎回或基金合同载明的延缓支付赎回款项的情形时，款项的支付办法参照本基金合同有关条款处理。

遇交易所或交易市场数据传输延迟、通讯系统故障、银行数据交换系统故障或其他非基金管理人及基金托管人所能控制的因素影响业务处理流程，则赎回款项划付时间相应顺延。

### 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有效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，本基金登记机构在 T+1 日内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)及时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。若申购不成立或无效，则申购款项本金退还给投资人。

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、赎回申请的确认以登记机构的确认结果为准。对于申请的确认情况，投资者应及时查询。

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，并在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

#### (五) 申购份额和赎回金额的限制

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，每个基金账户首笔申购的最低金额为人民币 100,000 元，每笔追加申购的最低金额为人民币 100,000 元。在基金管理人网上直销系统进行申购时，每个基金账户首笔申购的最低金额为人民币 10 元，每笔追加申购的最低金额为人民币 10 元。除上述情况及另有公告外，基金管理人规定每个基金账户首笔申购的最低金额为人民币 0.1 元，每笔追加申购的最低金额为人民币 0.1 元。

2. 基金管理人规定最低赎回、最低持有份额为 0.1 份。若基金份额持有人单个交易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。当某笔赎回申请导致单个基金账户的基金份额余额少于 0.1 份时，余额部分基金份额必须一同

赎回。基金份额持有人因某笔份额减少类业务导致其单个基金账户内剩余各类基金份额的基金份额低于 0.1 份时，登记系统可对该剩余的基金份额进行强制赎回处理。（份额减少类业务指赎回、转换转出、非交易过户、转托管等业务，具体种类以中登公司相关业务规则为准。）

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，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. 投资人将所申购的基金份额当期分配的基金收益转为基金份额时，不受最低申购金额的限制。

5. 基金管理人可以规定单个投资人累计持有的基金份额上限，具体规定请参见更新的招募说明书或相关公告。

6. 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。

7. 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。

8. 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。基金管理人基于投资运作与风险控制的需要，可采取上述措施对基金规模予以控制。具体见基金管理人相关公告。

9. 基金管理人可在法律法规允许的情况下，调整上述规定申购金额和赎回份额等数量限制。基金管理人必须在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

#### （六）申购和赎回的费用及其用途

##### 1. 申购费率

本基金 A 类基金份额收取申购费用，C 类基金份额不收取申购费用。

申购本基金 A 类基金份额的所有投资者的申购费率随申购金额的增加而递减，如下表所示：

申购金额（M, 含申购	申购费率
-------------	------

费)	
M<100 万	1.5%
100 万≤M<200 万	1.2%
200 万≤M<500 万	0.5%
M≥500 万	每笔 1000 元

投资人重复申购，须按每次申购所对应的费率档次分别计费。

A 类基金份额的申购费用由申购本基金 A 类基金份额的投资人承担，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、登记等各项费用。

2、本基金赎回费率随申请份额持有时间增加而递减。

本基金 A 类基金份额的赎回费率见下表：

申请份额持有时间 (N)	赎回费率
N<30 日	1.5%
30 日≤N<365 日	0.5%
365 日≤N<730 日	0.25%
N≥730 日	0

注：N 为自然日。

本基金 C 类基金份额的赎回费率见下表：

申请份额持有时间 (N)	赎回费率
N<7 日	1.5%
7 日≤N<30 日	0.5%
N≥30 日	0

注：N 为自然日。

本基金的赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。对份额持续持有时间小于 30 日的，赎回费用全部归基金财产，对份额持续持有时间大于等于 30 日但小于 90 日的，赎回费用的 75% 归基金财产，对份额持续持有时间大于等于 90 日但小于 180 日的，赎回费用的 50% 归基金财产，对份额持续持有时间大于等于 180 日的，赎回费用的 25% 归基金财产，其余用于支付市场推广、登记费和其他必要的手续费。

3. 本基金申购费在投资人申购基金份额时收取。本基金的赎回费在基金份额

持有人赎回基金份额时收取。

4. 基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式，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。

5. 当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律规则的规定。

6. 基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定且对现有基金份额持有人利益无实质性不利影响的情形下根据市场情况制定基金促销计划，定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，对存量份额无实质不利影响的前提下，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，并进行公告。

#### （七）申购金额与赎回金额的计算方式

##### 1. 申购和赎回数额、余额的处理方式

（1）申购的有效份额为净申购金额除以当日的该类基金份额净值，有效份额单位为份，上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后 2 位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

（2）赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日该类基金份额净值并扣除相应的费用，赎回金额单位为元。上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后 2 位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

##### 2. 申购份额的计算：

（1）若投资者选择 A 类基金份额，则申购份额的计算公式为：

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

（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）

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

例：某客户投资 10,000 元申购本基金的 A 类基金份额，其对应的申购费率为 1.50%，假设申购当日 A 类基金份额净值为 1.0500 元，则其可得到的申购份

额为：

$$\text{申购费用} = 10,000 - 10,000 / (1 + 1.50\%) = 147.78 \text{ 元}$$

$$\text{净申购金额} = 10,000 - 147.78 = 9852.22 \text{ 元}$$

$$\text{申购份额} = 9852.22 / 1.0500 = 9383.07 \text{ 份}$$

即：投资者投资 10,000 元申购本基金的 A 类基金份额，对应申购费率为 1.50%，假设申购当日 A 类基金份额净值为 1.0500 元，则可得到 9383.07 份 A 类基金份额。

(2) 若投资人选择申购 C 类基金份额，则申购份额的计算公式为：

$$\text{申购份额} = \text{申购金额} / \text{T 日 C 类基金份额净值}$$

例：某客户投资 10,000.00 元申购本基金的 C 类基金份额，假设申购当日 C 类基金份额净值为 1.0500 元，则可得到的申购份额为：

$$\text{申购份额} = 10,000 / 1.0500 = 9,523.81 \text{ 份}$$

即：投资者投资 10,000 元申购本基金的 C 类基金份额，假设申购当日 C 类基金份额净值为 1.0500 元，可得到 9523.81 份 C 类基金份额。

3. 赎回金额的计算：

赎回金额的计算方法如下：

$$\text{赎回总金额} = \text{赎回份额} \times \text{T 日该类基金份额的基金份额净值}$$

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

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

例：某客户赎回持有的 1,000,000 份 A 类基金份额，持有期限为 731 日，其对应的赎回费率为 0%，假设赎回当日 A 类基金份额净值为 1.1480 元，则其可得到的净赎回金额为：

$$\text{赎回总金额} = 1,000,000 \times 1.1480 = 1,148,000.00 \text{ 元}$$

$$\text{赎回费用} = 1,148,000.00 \times 0\% = 0 \text{ 元}$$

$$\text{净赎回金额} = 1,148,000.00 - 0 = 1,148,000.00 \text{ 元}$$

即：某持有本基金 A 类基金份额 731 日的客户赎回持有的 1,000,000 份基金份额，假设赎回当日 A 类基金份额净值为 1.1480 元，则可得到的净赎回金额为 1,148,000.00 元。

例：某客户赎回持有的 1,000,000 份 C 类基金份额，持有期限为 20 日，其

对应的赎回费率为 0.5%，假设赎回当日 C 类基金份额净值为 1.1490 元，则其可得到的净赎回金额为：

赎回总金额=1,000,000×1.1490=1,149,000.00 元

赎回费用=1,149,000.00×0.5%=5745 元

净赎回金额=1,149,000.00-5745= 1,143,255.00 元

即：某持有本基金 C 类基金份额 20 日的客户赎回持有的 1,000,000 份基金份额，假设赎回当日 C 类基金份额净值为 1.1490 元，则可得到的净赎回金额为 1,143,255.00 元。

#### 4. 基金份额净值的计算

由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值。计算公式为：

计算日某类基金份额净值=计算日该类基金份额的基金资产净值/计算日该类基金份额总数

本基金份额净值的计算，保留到小数点后 4 位，小数点后第 5 位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。T 日的各类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，经履行适当程序，可以适当延迟计算或公告。

#### （八）基金份额的登记

投资人申购基金成功后，登记机构在 T+1 日为投资人登记权益并办理登记手续，投资人自 T+2 日（含该日）后有权在赎回该部分基金份额。

投资人赎回基金成功后，登记机构在 T+1 日为投资人办理扣除权益的登记手续。

基金管理人可以在法律法规允许的范围内，对上述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公告。

#### （九）拒绝或暂停申购的情形

发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请：

- 1、因不可抗力导致基金无法正常运作。
- 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受



投资人的申购申请。

3、证券/期货交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。

4、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。

5、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，或其他可能对基金业绩产生负面影响，或发生其他损害现有基金份额持有人利益的情形。

6、基金管理人、基金托管人、基金销售机构或登记机构的异常情况导致基金销售系统、基金登记系统或基金会计系统无法正常运行。

7、基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有基金份额数的比例达到或者超过基金份额总数的 50%，或者有可能导致投资者变相规避前述 50%比例要求的情形。

8、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情形。

9、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。

10、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述第 1、2、3、5、6、9、10 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停申购申请时，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全部或部分拒绝的，被拒绝的申购款项本金将退还给投资人。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。

#### （十）暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

发生下列情形时，基金管理人可暂停接受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、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项。

3、证券/期货交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基

金资产净值。

4、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。

5、发生继续接受赎回申请将损害现有基金份额持有人利益的情形时，基金管理人可暂停接受基金份额持有人的赎回申请。

6、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。

7、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（第 4 项除外）之一且基金管理人决定暂停接受基金份额持有人的赎回申请或延缓支付赎回款项时，基金管理人应在当日报中国证监会备案，已确认的赎回申请，基金管理人应足额支付；如暂时不能足额支付，未支付部分可延期支付。若出现上述第 4 项所述情形，按基金合同的相关条款处理。基金份额持有人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告。

#### （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）超过前一开放日的基金总份额的 10%，即认为是发生了巨额赎回。

##### 2、巨额赎回的处理方式

当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎回。

（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）部分延期赎回：当基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金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开放日基金总份额 10%的前提下，可对其余赎回申请延期办理。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该类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。部分延期赎回不受单笔赎回最低份额的限制。

(3) 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）部分延期赎回”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该类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。

(4) 暂停赎回：连续 2 个开放日以上(含本数)发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受基金的赎回申请；已经接受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，并应当在规定媒介上进行公告。

### 3、巨额赎回的公告

当发生上述巨额赎回并延期办理时，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，并于 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，基金管理人应依据相关规定进行公告。

2、如发生暂停的时间为 1 日，基金管理人应于重新开放日，在规定媒介上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公布最近 1 个开放日的各类基金份额净值。

3、如发生暂停的时间超过 1 日，基金管理人可以根据暂停申购或赎回的时

间，依照《信息披露办法》的有关规定，最迟于重新开放日在规定媒介上刊登重新开放申购或赎回的公告，并公布最近 1 个开放日的各类基金份额净值；也可以根据实际情况在暂停公告中明确重新开放申购或赎回的时间，届时不再另行发布重新开放的公告。

### （十三）基金转换

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且开通转换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）基金份额的转让

在法律法规允许且条件具备的情况下，基金管理人可受理基金份额持有人通过中国证监会认可的交易场所或者交易方式进行份额转让的申请并由登记机构办理基金份额的过户登记。基金管理人拟受理基金份额转让业务的，将提前公告，基金份额持有人应根据基金管理人公告的业务规则办理基金份额转让业务。

### （十五）基金的非交易过户

基金的非交易过户是指基金登记机构受理继承、捐赠和司法强制执行等情形而产生的非交易过户以及登记机构认可、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。

继承，是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；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、法人或其他组织。

办理非交易过户必须提供基金登记机构要求提供的相关资料，对于符合条件的非交易过户申请按基金登记机构的规定办理，并按基金登记机构规定的标准收费。

### （十六）基金转托管

基金份额持有人可办理已持有基金份额在不同销售机构之间的转托管，基金

销售机构可以按照规定的标准收取转托管费。

#### （十七）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申购金额，每期申购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。

#### （十八）基金份额的冻结、解冻和质押

基金登记机构只受理国家有权机关依法要求的基金份额的冻结与解冻，以及登记机构认可、符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻。基金份额被冻结的，被冻结部分产生的权益一并冻结，被冻结部分份额仍然参与收益分配与支付。法律法规或基金合同另有规定的除外。

如相关法律法规允许基金管理人办理基金份额的质押业务或其他基金业务，基金管理人将制定和实施相应的业务规则。

## 九、基金的投资

### 一、投资目标

本基金在有效控制投资组合风险的前提下,力求实现资产净值的长期稳健增值。

### 二、投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票及存托凭证(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票及存托凭证)、沪港股票市场交易互联互通机制试点允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票、深港股票市场交易互联互通机制试点允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票、债券(包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、可转换债券、分离交易可转债的纯债部分、可交换债券、央行票据、中期票据、证券公司发行的短期债券、短期融资券、超短期融资券等)、债券回购、货币市场工具、银行存款、同业存单、资产支持证券、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。

本基金将根据法律法规的规定参与融资业务。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。

基金的投资组合比例为:股票资产投资比例为基金资产的60%—95%(其中投资于港股通标的股票的比例占股票资产的0—50%);每个交易日日终在扣除股指期货国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后,本基金应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的5%,其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

### 三、投资策略

本基金的投资策略可以细分为资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略以及其他品种的投资策略等。

#### 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、投资者心态等市场指标，确定未来市场变动趋势。本基金通过全面评估上述各种关键指标的变动趋势，对股票、债券等大类资产的风险和收益特征进行预测。

## 2、股票投资策略

本基金通过结合证券市场趋势，并以基本面研究为基础，自下而上多维度精选基本面良好，具有较好盈利能力和市场竞争力的公司，寻找股票的超预期机会。在评估个股的估值水平时，本基金考察企业贴现现金流以及内在价值贴现，结合市盈率（市值/净利润）、市净率（市值/净资产）、市销率（市值/营业收入）等指标衡量股票的价值是否被低估，并且基于公司所属的不同行业，将采取不同的估值方法，以此寻找不同行业的股票合理价格区间，并动态根据上述指标的演变进行价格区间的调整。同时，本基金采用年复合营业收入增长率、盈利增长率、息税前利润增长率、净资产收益率以及现金流量增长率等指标综合考察上市公司的成长性。在盈利水平方面，本基金重点考察主营业务收入、经营现金流、盈利波动程度三个关键指标，以衡量具有高质量持续增长的公司。

在定性指标方面，本基金综合考察诸如成长模式、轻资产经营方式、商业模式、行业壁垒以及渠道控制力、公司治理等方面，从而给以相应的折溢价水平，并最终确定股票合理价格区间。

除此之外，本基金更注重通过研究团队的上市公司实地调研获得最新、最为准确的信息，及时跟踪和调整各级股票库，并最终确定具体的投资品种。

## 3、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。

## 4、债券投资策略

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

## 5、股指期货投资策略

基金管理人可运用股指期货，以提高投资效率更好地达到本基金的投资目标。本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。

#### 6、国债期货投资策略

本基金投资国债期货以套期保值为目的，以回避市场风险。故国债期货空头的合约价值主要与债券组合的多头价值相对应。基金管理人通过动态管理国债期货合约数量，以萃取相应债券组合的超额收益。

#### 7、港股投资策略

本基金将仅通过沪港股票市场交易互联互通机制及深港股票市场交易互联互通机制投资于香港股票市场，不使用合格境内机构投资者(QDII)境外投资额度进行境外投资。本基金将重点关注：

- (1) A股稀缺性行业和个股；
- (2) 具有持续领先优势或核心竞争力的企业，这类企业应具有良好成长性或为市场龙头；
- (3) 符合内地政策和投资逻辑的主题性行业个股；
- (4) 与A股同类公司相比具有估值优势的公司。

#### 8、资产支持证券投资策略

对于资产支持证券，本基金将综合考虑市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率等因素，研究资产支持证券的收益和风险匹配情况，在严格控制风险的基础上选择投资对象，追求稳定收益。

### 四、投资限制

#### 1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

- (1) 本基金股票投资占基金资产的比例为60%-95%（其中，投资于港股通标的股票的比例占股票资产的0%-50%）；
- (2) 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；
- (3) 每个交易日日终，在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证



金后，本基金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，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

(4) 本基金持有一家公司发行的证券，其市值（同一家公司在境内和香港市场同时上市的 A+H 股合并计算）不超过基金资产净值的 10%；

(5) 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券（同一家公司在境内和香港市场同时上市的 A+H 股合并计算），不超过该证券的 10%；

(6) 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%；

(7) 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%；

(8) 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%；

(9) 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%；

(10) 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；

(11) 本基金总资产不得超过基金净资产的 140%；

(12) 本基金参与国债期货、股指期货交易，需遵守下列投资比例限制：

1) 本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的 10%；本基金在任何交易日日终，持有的买入国债期货合约价值，不得超过基金资产净值的 15%；

2) 本基金在任何交易日日终，持有的买入国债期货和股指期货合约价值和有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%；其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；

3) 本基金在任何交易日日终，持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%；本基金在任何交易日日终，持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的 30%；

4) 本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值, 合计(轧差计算)应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定; 本基金所持有的债券(不含到期日在一年以内的政府债券)市值和买入、卖出国债期货合约价值, 合计(轧差计算)应当符合基金合同关于债券投资比例的有关约定;

5) 本基金在任何交易日内交易(不包括平仓)的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%; 本基金在任何交易日内交易(不包括平仓)的国债期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 30%;

(13) 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%; 本基金在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为 1 年, 债券回购到期后不得展期;

(14) 本基金参与融资的, 每个交易日日终, 本基金持有的融资买入股票与其他有价证券市值之和, 不得超过基金资产净值的 95%;

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

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

(17) 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;

(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) 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他投资限制。

除上述第(3)、(10)、(16)、(17)项外, 因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的, 基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整, 但中国证

监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的，从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在上述期间内，本基金的投资范围、投资策略应当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本基金合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门取消或调整上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或按调整后的规定执行，但须提前公告。

## 2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

- (1) 承销证券；
- (2) 违反规定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) 向其基金管理人、基金托管人出资；
- (6) 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；
- (7) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

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的，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先的原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

法律、行政法规或监管部门取消上述禁止性规定，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制。

## 五、业绩比较基准

本基金业绩比较基准： $\text{沪深 300 指数收益率} \times 60\% + \text{恒生指数收益率（使用估值汇率折算）} \times 20\% + \text{中债综合（全价）指数收益率} \times 20\%$

其中，沪深 300 指数是由上海证券交易所和深圳证券交易所授权，由中证指数有限公司开发的中国 A 股市场指数，它的样本选自沪深两个证券市场，覆盖了大部分流通市值，其成份股票为中国 A 股市场中代表性强、流动性高的股票，能够反映 A 股市场总体发展趋势。

恒生指数是由恒生指数服务有限公司编制，以香港股票市场中的 50 家上市股票为成份股样本，以其发行量为权数的加权平均股价指数，是反映香港股市价格趋势最有影响的一种股价指数。

中债综合（全价）指数由中央国债登记结算有限公司编制，旨在综合反映债券全市场整体价格和投资回报情况，是具有代表性的债券市场指数。

本基金业绩比较基准目前能够忠实地反映本基金的风险收益特征。如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准时，本基金可以变更业绩比较基准，但应与托管人协商一致，在履行适当程序后报中国证监会备案，并在中国证监会指定的媒介上及时公告，无需召开基金份额持有人大会。

## 六、风险收益特征

本基金是一只混合型基金，其预期风险与收益高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。

本基金除了投资 A 股外，还可根据法律法规规定投资香港联合交易所上市的股票。除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、香港市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。

## 七、基金管理人代表基金行使相关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相关权利，保护基金份额持有人的利益；

2、不谋求对上市公司的控股；

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。

## 八、基金投资组合报告

本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。

本基金的托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，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多维价值混合型证券投资基金 2022 年第 1 季度报告，数据截至 2022 年 3 月 31 日，本报告财务资料未经审计师审计。

### 8.1 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	2,365,299,163.53	83.65
	其中：股票	2,365,299,163.53	83.65
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	21,263,184.63	0.75
	其中：债券	21,263,184.63	0.75
	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	436,207,953.43	15.43
8	其他资产	4,994,668.92	0.18
9	合计	2,827,764,970.51	100.00

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 213,921,405.32 元，占净值比例 7.63%。

### 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 8.2.1 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	117,006,049.00	4.17
C	制造业	1,563,805,109.58	55.80
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	205,387,381.19	7.33

E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	12,216.96	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	38,632,309.80	1.38
H	住宿和餐饮业	63,283,754.34	2.26
I	信息传输、软件和信息技术服务业	52,737,979.74	1.88
J	金融业	-	-
K	房地产业	54,256,797.00	1.94
L	租赁和商务服务业	17,127,185.96	0.61
M	科学研究和技术服务业	26,465.94	0.00
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	15,752.10	0.00
R	文化、体育和娱乐业	39,086,756.60	1.39
S	综合	-	-
	合计	2,151,377,758.21	76.76

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
原材料	-	-
非日常生活消费品	67,993,942.99	2.43
日常消费品	-	-
能源	-	-
金融	-	-
医疗保健	8,128,753.23	0.29
工业	36,300,807.60	1.30
信息技术	-	-
通信服务	-	-
公用事业	101,497,901.50	3.62
房地产	-	-
合计	213,921,405.32	7.63

注：以上分类采用全球行业分类标准（Global Industry Classification Standard, GICS）。

### 8.2.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600745	闻泰科技	1,371,885	111,534,250.50	3.98
2	600438	通威股份	2,249,085	96,013,438.65	3.43

3	002049	紫光国微	450,351	92,114,793.54	3.29
4	600021	上海电力	9,361,901	90,810,439.70	3.24
5	002250	联化科技	5,370,432	73,252,692.48	2.61
6	600116	三峡水利	6,537,915	72,897,752.25	2.60
7	000739	普洛药业	2,198,656	68,729,986.56	2.45
8	300034	钢研高纳	1,925,403	65,959,330.68	2.35
9	002920	德赛西威	504,928	63,933,983.36	2.28
10	603707	健友股份	2,032,334	63,774,640.92	2.28

注：对于同时在 A+H 股上市的股票，合并计算公允价值参与排序，并按照不同股票分别披露。

### 8.3 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）	21,263,184.63	0.76
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	21,263,184.63	0.76

### 8.4 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	110075	南航转债	109,820	13,603,105.53	0.49
2	110085	通 22 转债	59,940	7,660,079.10	0.27

### 8.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 8.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

贵金属暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

**8.7 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权证投资明细**

本基金本报告期末未持有权证。

**8.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明****8.8.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

本基金本报告期末未持有股指期货。

**8.8.2 本基金投资股指期货的投资政策**

基金管理人可运用股指期货，以提高投资效率更好地达到本基金的投资目标。本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。

**8.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明****8.9.1 本期国债期货投资政策**

本基金投资国债期货以套期保值为目的，以回避市场风险。故国债期货空头的合约价值主要与债券组合的多头价值相对应。基金管理人通过动态管理国债期货合约数量，以萃取相应债券组合的超额收益。

**8.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细**

本基金本报告期末未持有国债期货。

**8.9.3 本期国债期货投资评价**

本基金本报告期末未持有国债期货。

**8.10 投资组合报告附注****1) 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明**

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超出基金合同规定的备选股票库情况的说明**

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	601,894.21
2	应收证券清算款	-



3	应收股利	115,559.88
4	应收利息	-
5	应收申购款	4,277,214.83
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,994,668.92

#### 4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	110075	南航转债	13,603,105.53	0.49

#### 5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	300034	钢研高纳	31,274,000.00	1.12	大宗交易购入流通受限

#### 6) 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## 十、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 2019 年 6 月 12 日，基金业绩截止日 2022 年 3 月 31 日。

本基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表

兴全多维价值 A

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	①-③	②-④

				④		
2022年第1季度	-16.54%	1.57%	-10.05%	1.27%	-6.49%	0.30%
2021年度	31.10%	1.19%	-5.79%	0.87%	36.89%	0.32%
2020年度	44.60%	1.53%	14.02%	1.08%	30.58%	0.45%
2019年度（基金合同生效：2019年6月12日）	10.74%	0.63%	7.11%	0.66%	3.63%	-0.03%
2019.6.12（基金合同生效日）至2022年3月31日	75.20%	1.28%	3.51%	0.96%	71.69%	0.32%

## 兴全多维价值C

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
2022年第1季度	-16.66%	1.57%	-10.05%	1.27%	-6.61%	0.30%
2021年度	30.32%	1.19%	-5.79%	0.87%	36.11%	0.32%
2020年度	43.74%	1.53%	14.02%	1.08%	29.72%	0.45%
2019年度（基金合同生效：2019年6月12日）	10.27%	0.63%	7.11%	0.66%	3.16%	-0.03%
2019.6.12（基金合同生效日）至2022年3月31日	72.14%	1.28%	3.51%	0.96%	68.63%	0.32%

## 十一、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、银行存款本息和基金应收款项以及其他资产的价值总和。

#### （二）基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

#### （三）基金财产的账户

基金托管人根据相关法律法规、规范性文件为本基金开立资金账户、证券账户以及投资所需的其他专用账户。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金销售机构和基金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

本基金财产独立于基金管理人、基金托管人和基金销售机构的财产，并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人、基金登记机构和基金销售机构以其自有的财产承担其自身的法律责任，其债权人不得对本基金财产行使请求冻结、扣押或其他权利。除依法律法规和《基金合同》的规定处分外，基金财产不得被处分。

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。基金管理人管理运作基金财产所产生的债权，不得与其固有资产产生的债务相互抵销；基金管理人管理运作不同基金的基金财产所产生的债权债务不得相互抵销。非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。

## 十二、基金资产估值

### （一）估值日

本基金的估值日为本基金相关的证券交易场所的交易日以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非交易日。

### （二）估值对象

基金所拥有的股票、债券、股指期货合约、国债期货合约和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。

### （三）估值原则

基金管理人在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，应符合《企业会计准则》、监管部门有关规定。

1、对存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的投资品种，在估值日有报价的，除会计准则规定的例外情况外，应将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量。估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种形同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

2、对不存在活跃市场的投资品种，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

3、如经济环境发生重大变化或证券发行人发生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，应对估值

进行调整并确定公允价值。

#### （四）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或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，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或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，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）交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种，选取估值日第三方估值机构提供的相应品种对应的估值净价估值，具体估值机构由基金管理人与基金托管人另行协商约定；

（3）交易所上市交易的可转换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；

交易所上市实行全价交易的债券（可转债除外），选取第三方估值机构提供的估值全价减去估值全价中所含的债券（税后）应收利息得到的净价进行估值；

（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估值方法估值；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，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）对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券，对存在活跃市场的情况下，应以活跃市场上未经调整的报价作为计量日的公允价值；对于活跃市场

报价未能代表计量日公允价值的情况下，应对市场报价进行调整以确认计量日的公允价值；对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下，则应采用估值技术确定其公允价值。

(4) 流通受限股票，包括非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

3、银行间市场交易的固定收益品种，选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值。

4、同一债券或股票同时在两个或两个以上市场交易的，按债券或股票所处的市场分别估值。

5、证券公司发行的短期债券，选取估值日第三方估值机构提供的相应品种对应的估值净价估值。

6、同业存单按估值日第三方估值机构提供的估值净价估值；选定的第三方估值机构未提供估值价格的，按成本估值。

#### 7、投资证券衍生品的估值方法

(1) 因持有股票而享有的配股权，采用估值技术确定公允价值进行估值。在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本进行估值。

(2) 股指期货合约以估值日金融期货交易所的当日结算价估值，该日无交易的，以最近一日的结算价估值。

(3) 国债期货合约，一般以估值当日结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。

#### 8、存款的估值方法

持有的银行定期存款或通知存款以本金列示，按协议或合同利率逐日确认利息收入。如提前支取或利率发生变化，管理人及时进行账务调整。

9、在基金估值日，港股通投资的股票按其在港交所的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值。

在基金估值日，港股通投资持有外币证券资产估值涉及到港币对人民币汇率的，可参考当日中国人民银行或其授权机构公布的人民币汇率中间价，或其他可以反映公允价值的汇率进行估值。

若本基金现行估值汇率不再发布或发生重大变更，或市场上出现更为公允、更适合本基金的估值汇率时，基金管理人与基金托管人协商一致后可根据实际情况调整本基金的估值汇率，并及时报中国证监会备案，无需召开基金份额持有人大会。

10、当发生大额申购或赎回情形时，可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。

11、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。

12、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。

13、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，按照基金管理人对于基金资产净值的计算结果对外予以公布。

#### （五）估值程序

1、各类基金份额净值是按照每个工作日闭市后，该类基金份额的基金资产净值除以当日该类基金份额的余额数量计算，两类基金份额净值均精确到0.0001元，小数点后第5位四舍五入。基金管理人可以设立大额赎回情形下的净值精度应急调整机制。国家另有规定的，从其规定。

基金管理人应每个工作日计算基金资产净值及各类基金份额的基金份额净值，并按规定进行公告。

2、基金管理人应每个工作日对基金资产估值。但基金管理人根据法律法规或本基金合同的规定暂停估值时除外。基金管理人每个工作日对基金资产估值后，将各类基金份额的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，由基金管理人按约定对外公布。

## （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。当某一类基金份额净值小数点后4位以内(含第4位)发生估值错误时，视为基金份额净值错误。

本基金合同的当事人应按照以下约定处理：

### 1、估值错误类型

本基金运作过程中，如果由于基金管理人或基金托管人、或登记机构、或销售机构、或投资人自身的过错造成估值错误，导致其他当事人遭受损失的，过错的责任人应当对由于该估值错误遭受损失当事人（“受损方”）的直接损失按下述“估值错误处理原则”给予赔偿，承担赔偿责任。

上述估值错误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。

### 2、估值错误处理原则

（1）估值错误已发生，但尚未给当事人造成损失时，估值错误责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正估值错误发生的费用由估值错误责任方承担；由于估值错误责任方未及时更正已产生的估值错误，给当事人造成损失的，由估值错误责任方对直接损失承担赔偿责任；若估值错误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。估值错误责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认，确保估值错误已得到更正。

（2）估值错误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，并且仅对估值错误的有关直接当事人负责，不对第三方负责。

（3）因估值错误而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但估值错误责任方仍应对估值错误负责。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”），则估值错误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交付不当得利的权利；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估值错误责任方。



(4) 估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

### 3、估值错误处理程序

估值错误被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

(1) 查明估值错误发生的原因，列明所有的当事人，并根据估值错误发生的原因确定估值错误的责任方；

(2) 根据估值错误处理原则或当事人协商的方法对因估值错误造成的损失进行评估；

(3) 根据估值错误处理原则或当事人协商的方法由估值错误的责任方进行更正和赔偿损失；

(4) 根据估值错误处理的方法，需要修改基金登记机构交易数据的，由基金登记机构进行更正，并就估值错误的更正向有关当事人进行确认。

### 4、基金份额净值估值错误处理的方法如下：

(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) 错误偏差达到该类基金份额净值的 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；错误偏差达到该类基金份额净值的 0.5% 时，基金管理人应当公告，并报中国证监会备案。

(3) 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。如果行业有通行做法，在不违背法律法规且不损害投资者利益的前提下，基金管理人、基金托管人应本着平等和保护基金份额持有人利益的原则重新协商确定处理原则。

### (七) 暂停估值的情形

1、基金投资所涉及的证券、期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

2、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；

3、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；

4、法律法规、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

#### （八）基金净值的确认

用于基金信息披露的基金资产净值和各类基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个开放日交易结束后计算当日的基金资产净值和各类基金份额净值并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人，由基金管理人对基金净值按约定予以公布。

#### （九）特殊情况的处理

1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第 12 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，或由于证券/期货交易所、登记结算公司等发送的数据错误等原因，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消除或减轻由此造成的影响。

### 十三、基金的收益与分配

#### （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、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

2、基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；

3、由于本基金A类基金份额不收取销售服务费，而C类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可分配收益将有所不同。本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

4、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在符合法律法规及基金合同约定，并对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可对基金收益分配原则进行调整，不需召开基金份额持有人大会。

#### 四、收益分配方案

基金收益分配方案中应载明截至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，依据相关规定进行公告。

#### 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者自行承担。当投资者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，基金登记机构可将基金份额持有人的现金红利自动转为相应类别的基金份额。红利再投资的计算方法，依照《业务规则》执行。

## 十四、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、C类基金份额的销售服务费；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、诉讼费和仲裁费；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金的证券、期货交易费用；
- 8、基金的银行汇划费用；
- 9、基金的账户开户费用、账户维护费用；
- 10、投资港股通标的股票的相关费用；
- 11、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1.50%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

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。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初5个工作日内、按照指定的账户

路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休假或不可抗力等，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。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休假或不可抗力等，支付日期顺延。

## 3、C 类基金份额的销售服务费

本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.60%。本基金销售服务费将专门用于本基金的市场推广、销售与基金份额持有人服务。

C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值的 0.60% 年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.60\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。销售服务费由登记机构代收，登记机构收到后按相关合同规定支付给基金销售机构。若遇法定节假日、公休假或不可抗力等，支付日期顺延。

上述“一、基金费用的种类”中第 4—11 项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

### （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）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。基金财产投资的相关税收，由基金份额持有人承担，基金管理人或者其他扣缴义务人按照国家有关税收征收的规定代扣代缴。

## 十五、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基金会计责任方；
- 2、基金的会计年度为公历年度的1月1日至12月31日；基金首次募集的会计年度按如下原则：如果《基金合同》生效少于2个月，可以并入下一个会计年度披露；
- 3、基金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、基金托管人每月与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以托管协议约定的方式确认。

### （二）基金的年度审计

1、基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相互独立的具有证券、期货相关从业资格的会计师事务所及其注册会计师对本基金的年度财务报表进行审计。

2、会计师事务所更换经办注册会计师，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。

## 十六、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》、《流动性风险管理规定》、《基金合同》及其他有关规定。相关法律法规关于信息披露的规定发生变化时，本基金从其最新规定。

### （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，并保证基金投资者能够按照《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、期货投资业绩进行预测；
- 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销售机构；
- 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。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：

### 1、基金招募说明书、《基金合同》、基金托管协议、基金产品资料概要

（1）《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者重大利益的事项的法律文件。

（2）基金招募说明书应当最大限度地披露影响基金投资者决策的全部事项，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。

（3）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。

（4）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。

基金募集申请经中国证监会注册后，基金管理人在基金份额发售的3日前，将基金招募说明书、《基金合同》摘要登载在规定媒介和网站上；基金管理人、基金托管人应当将《基金合同》、基金托管协议登载在网站上。

### 2、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。

### 3、《基金合同》生效公告

基金管理人应当在收到中国证监会确认文件的次日在规定媒介上登载《基金合同》生效公告。

4、基金净值信息《基金合同》生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周在规定网站披露一次各类基金份额的基金份额净值和基金份额累计净值。

在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当在不晚于每个开放日的次日，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各类基金份额的基金份额净值和基金份额累计净值。

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各类基金份额的基金份额净值和基金份额累计净值。

#### 5、基金份额申购、赎回价格

基金管理人应当在《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，并保证投资者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。

#### 6、基金定期报告，包括基金年度报告、基金中期报告和基金季度报告

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。

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。

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。

《基金合同》生效不足 2 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。

如报告期内出现单一投资者持有基金份额达到或超过基金总份额 20% 的情形，为保障其他投资者的权益，基金管理人至少应当在定期报告“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有风险，中国证监会认定的特殊情形除外。

基金管理人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。

## 7、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；
- (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、销售服务费、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) 基金份额净值估值错误达该类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、赎回申请或者重新接受申购、赎回申请；

(21) 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；

(22) 调整基金份额类别的设置；

(23) 基金管理人采用摆动定价机制进行估值；

(24) 基金推出新业务或服务；

(25) 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规定的其他事项。

## 8、澄清公告

在《基金合同》存续期限内，任何公共媒介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。

## 9、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，应当依法报中国证监会备案，并予以公告。

## 10、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。

11、基金管理人应当在基金季度报告、基金中期报告、基金年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露股指期货交易情况，包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标等，并充分揭示股指期货交易对基金总体风险的影响以及是否符合既定的投资政策和投资目标等。

12、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和招募说明书（更新）等文件中披露国债期货交易情况，包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标等，并充分揭示国债期货交易对本基金总体风险的影响以及是否符合既定的投资政策和投资目标。

13、基金管理人应在基金年报及中期报告中披露其持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占基金净资产的比例和报告期内所有的资产支持证券明细。基金管理人应在基金季度报告中披露其持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占基金净资产的比例和报告期末按市值占基金净资产比例大小排序的前 10 名资产支持证券明细。

14、基金应当在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露参与融资交易情况，包括投资策略、业务开展情况、损益情况、风险及其管理情况等。

15、基金应当在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露本基金参与港股通交易的相关情况。

16、基金应当在临时公告和在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告中及时披露投资证券公司发行的短期债券的情况。

17、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、各类基金份额的基金份额净值、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、基金托管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介披露信息，但是其他公共媒介不得早于规定媒介披露信息，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，供社会公众查阅、复制。

#### （八）暂停或延迟信息披露的情形

- 1、不可抗力；
- 2、发生暂停估值的情形；
- 3、法律法规、中国证监会规定或基金合同认定的其他情形。

（九）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。

## 十七、风险揭示

证券投资基金（以下简称“基金”）是一种长期投资工具，其主要功能是分散投资，降低投资单一证券所带来的个别风险。基金不同于银行储蓄和债券等能够提供固定收益预期的金融工具，投资者购买基金，既可能按其持有份额分享基金投资所产生的收益，也可能承担基金投资所带来的损失。

本基金是混合型基金，其预期风险与收益高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。

本基金除了投资A股外，还可根据法律法规规定投资香港联合交易所上市的股票。除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、香港市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。

投资人应当认真阅读本基金基金合同、招募说明书等基金法律文件，了解本基金的风险收益特征，并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断本基金是否和投资人的风险承受能力相适应，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险。

基金管理人提醒投资人在作出投资决策后，须了解并自行承担以下风险：

### （一）本基金的主要风险

本基金面临包括但不限于以下风险：

#### 1、市场风险

市场风险是指投资品种的价格因受经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素影响而引起的波动，导致收益水平变化，产生风险。市场风险主要包括：

##### （1）政策风险

货币政策、财政政策、产业政策和证券市场监管政策等国家政策的变化对证券市场产生一定的影响，可能导致证券价格波动，从而影响收益。

##### （2）经济周期风险

证券市场受宏观经济运行的影响，而经济运行具有周期性的特点，而周期性的经济运行表现将对证券市场的收益水平产生影响，从而对本基金的收益产生影响。

##### （3）利率风险

利率风险是指由于利率变动而导致的证券价格和证券利息的损益。利率波动会直接影响企业的融资成本和利润水平，导致证券市场的价格和收益率的变动，使基金收益水平随之发生变化，从而产生风险。

##### （4）上市公司经营风险

上市公司的经营状况受多种因素影响，如市场、技术、竞争、管理、财务因素等都会导致公司盈利发生变化，从而导致基金投资收益变化。

### （5）衍生品风险

金融衍生产品具有杠杆效应且价格波动剧烈，会放大收益或损失，在某些情况下甚至会导致投资亏损高于初始投资金额。

### （6）购买力风险

投资者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，从而使投资者的实际收益下降。

## 2、管理风险

在基金运作过程中，基金管理人的知识、经验、判断、决策、技能等，会影响其对信息的获取和对经济形势、金融市场价格走势的判断，如基金管理人判断有误、获取信息不全、或对投资工具使用不当等影响基金的收益水平，从而产生风险。

## 3、流动性风险

流动性风险主要包括以下两个方面：一方面是指在市场或个券、个股流动性不足的情况下，基金管理人可能无法迅速、低成本地变现或调整基金投资组合的风险。另一方面是指本基金面临大量赎回而无法及时变现其资产而造成的风险。

### （1）基金申购、赎回安排

投资人具体请参见基金合同“第六部分、基金份额的申购与赎回”和本招募说明书“八、基金份额的申购与赎回”，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、基金采用摆动定价等风险。

### （2）拟投资市场、行业及资产的流动性风险评估

#### 1) 投资市场、行业的流动性风险

本基金主要投资于国内依法发行上市的股票及存托凭证、沪港股票市场交易互联互通机制试点允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票、深港股票市场交易互联互通机制试点允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票、债券、债券回购、货币市场工具、银行存款、同业存单、股指期货、国债期货、资产支持证券等。上述资产均存在规范的交易场所，运作时间长，市场透



明度较高，运作方式规范，历史流动性状况良好，正常情况下能够及时满足基金变现需求，保证基金按时应对赎回要求。极端市场情况下，上述资产可能出现流动性不足，导致基金资产无法变现，从而影响投资者按时收到赎回款项。根据过往经验统计，绝大部分时间上述资产流动性充裕，流动性风险可控，当遇到极端市场情况时，基金管理人会按照基金合同及相关法律法规要求，及时启动流动性风险应对措施，保护基金投资者的合法权益。

此外，本基金在投资运作过程中的行业配置较为灵活，在综合考虑宏观因素及行业基本面的前提下进行配置，不以投资于某单一行业为投资目标，行业分散度较高，受到单一行业流动性风险的影响较小。

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) 投资资产的流动性风险

本基金针对流动性较低资产的投资进行了严格的限制，以降低基金的流动性风险：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%。

### (3) 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：

1) 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，基金管理人应当采取延缓支付赎回款项或暂停接受基金申购赎回申请的措施。基金份额持有人存在不能及时赎回基金份额的风险。

2) 若本基金发生了巨额赎回，基金管理人有可能采取部分延期赎回的措施以应对巨额赎回，具体措施请见基金合同及招募说明书中“基金份额的申购与

赎回”部分“巨额赎回的处理方式”。因此在巨额赎回情形发生时，基金份额持有人存在不能及时赎回基金份额的风险。

3) 本基金A、C类基金份额对持续持有期少于7日的投资人，收取1.5%的赎回费，并将上述赎回费全额计入基金财产。赎回费在投资者赎回基金份额时收取。在此情形下，投资人进行基金赎回时的成本将增加。

4) 当本基金发生大额申购或赎回情形时，本基金管理人可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。当日参与申购和赎回交易的投资者存在承担申购或者赎回产生的交易及其他成本的风险。

#### 4、信用风险

基金在交易过程中发生交收违约，或者基金所投资债券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，或由于债券发行人信用质量降低导致债券价格下降，造成基金资产损失的风险。

#### 5、技术风险

在基金的日常交易中，可能因为技术系统的故障或者差错而影响交易的正常进行或者导致基金投资者的利益受到影响。这种技术风险可能来自基金管理人、基金托管人、证券/期货交易所、证券/期货登记结算机构等。

#### 6、操作风险

基金管理人、基金托管人、证券/期货交易所、证券/期货登记结算机构等在业务操作过程中，因操作失误或违反操作规程而引起的风险。

#### 7、本基金参与债券回购的风险

债券回购为提升整体基金组合收益提供了可能，但也存在一定的风险。债券回购的主要风险包括信用风险、投资风险及波动性加大的风险，其中，信用风险指回购交易中交易对手在回购到期时，不能偿还全部或部分证券或价款，造成基金净值损失的风险；投资风险是指在进行回购操作时，回购利率大于债券投资收益而导致的风险以及由于回购操作导致投资总量放大，致使整个组合风险放大的风险；而波动性加大的风险是指在进行回购操作时，在对基金组合收益进行放大的同时，也对基金组合的波动性（标准差）进行了放大，即基金组合的风险将会加大。回购比例越高，风险暴露程度也就越高，对基金净值造成损失的可能性也就越大。

## 8、参与股指期货的风险

(1) 本基金使用股指期货的目的主要是套期保值, 风险较纯粹投机要小, 总体可控。但由于股票多头和股指期货空头头寸在流动性、风险收益特征及交易规则上的不同可能造成两个头寸对相同市场风险的反应存在差异, 尤其是对大幅度的市场波动反应不一定完全同步, 从而加大投资组合市场价值的短期风险。

(2) 股指期货采用保证金交易的特征使投资组合的空头头寸在股指期货上涨时需要追加保证金, 如果无法及时补足保证金将面临空头头寸被平仓的风险。由于在股指上升过程中股票多头的流动性一般很强, 可及时卖出获取现金, 故空头头寸被强制平仓的风险非常之小。

(3) 使用股指期货对冲市场风险的过程中, 委托财产可能因为股指期货合约与标的指数价格波动不一致而面临期现基差风险。在需要将期货合约展期时, 合约平仓时的价格与下一个新合约开仓时的价格之差也存在不确定性, 面临跨期基差风险。但总体而言, 基差风险绝对值较小, 属于可控、可知、可承担的风险。

## 9、参与国债期货的风险

(1) 杠杆性风险。国债期货交易采用保证金交易方式, 潜在损失可能成倍放大, 具有杠杆性风险。

(2) 到期日风险。国债期货合约到期时, 如本基金仍持有未平仓合约, 交易所将按照交割结算价将本基金持有的合约进行现金交割, 本基金存在无法继续持有到期合约的可能, 具有到期日风险。国债期货合约采取实物交割方式, 如本基金未能在规定期限内如数交付可交割国债或者未能在规定期限内如数缴纳交割贷款, 将构成交割违约, 交易所将收取相应的惩罚性违约金。

(3) 强制平仓风险。如本基金参与交割不符合交易所或者期货公司相关业务规定, 期货公司有权不接受本基金的交割申请或对本基金的未平仓合约强行平仓, 由此产生的费用和结果将由基金承担。

(4) 使用国债期货对冲市场风险的过程中, 委托财产可能因为国债期货合约与合约标的价格波动不一致而面临期现基差风险。在需要将期货合约展期时, 合约平仓时的价格与下一个新合约开仓时的价格之差也存在不确定性, 面临跨

期基差风险。

10、本基金的投资范围包括资产支持证券。资产支持证券存在信用风险、利率风险、流动性风险、提前偿付风险、操作风险和法律风险等。

(1) 信用风险也称为违约风险，它是指资产支持证券参与主体对它们所承诺的各种合约的违约所造成的可能损失。从简单意义上讲，信用风险表现为证券化资产所产生的现金流不能支持本金和利息的及时支付而给投资者带来损失。

(2) 利率风险是指资产支持证券作为固定收益证券的一种，也具有利率风险，即资产支持证券的价格受利率波动发生变动而造成的风险。

(3) 流动性风险是指资产支持证券不能迅速、低成本地变现的风险。

(4) 提前偿付风险是指若合同约定债务人有权在产品到期前偿还，则存在由于提前偿付而使投资者遭受损失的可能性。

(5) 操作风险是指相关各方在业务操作过程中，因操作失误或违反操作规程而引起的风险。

(6) 法律风险是指因资产支持证券交易结构较为复杂、参与方较多、交易文件较多，而存在的法律风险和履约风险。

11、本基金投资港股通标的股票所带来的特有风险,包括但不限于:

(1) 海外市场风险

本基金在参与港股市场投资时将受到全球宏观经济和货币政策变动等因素所导致的系统性风险。

(2) 股价波动较大的风险

港股市场实行T+0回转交易机制(即当日买入的股票,在交收前可以于当日卖出),同时对个股不设涨跌幅限制,加之香港市场结构性产品和衍生品种类相对丰富以及做空机制的存在;港股股价受到意外事件影响可能表现出比A股更为剧烈的股价波动,本基金的波动风险可能相对较大。

(3) 汇率风险

本基金在交易时间内提交订单依据的港币买入参考汇率和卖出参考汇率,并不等于最终结算汇率,港股通交易日日终,中国证券登记结算有限责任公司进行净额换汇,将换汇成本按成交金额分摊至每笔交易,确定交易实际适用的结算汇率,本基金可能需额外承担买卖结算汇率报价点差所带来的损失;同时

根据港股通的规则设定，本基金在每日买卖港股申请时将参考汇率买入/卖出价冻结相应的资金，该参考汇率买入价和卖出价设定上存在比例差异，以抵御该日汇率波动而带来的结算风险，本基金将因此而遭遇资金被额外占用进而降低基金投资效率的风险，以及因汇率大幅波动引起账户透支的风险。

#### （4）港股通额度限制

现行的港股通规则，对港股通设有总额度以及每日额度上限的限制。本基金可能因为港股通市场总额度或每日额度不足，而不能买入看好之投资标的进而错失投资机会的风险。

#### （5）港股通可投资标的范围调整带来的风险

现行的港股通规则，对港股通可投资的港股范围进行了限制，并定期或不定期调整具体的可投资标的。对于调出在投资范围的港股，只能卖出不能买入。本基金可能因为港股通可投资标的范围的调整而不能及时买入看好的投资标的，而错失投资机会的风险。

#### （6）港股通交易日设定的风险

根据现行的港股通规则，只有内地和香港两地均为交易日且能够满足结算安排的交易日才为港股通交易日，存在港股通交易日不连贯的情形（如内地市场因放假等原因休市而香港市场照常交易但港股通不能如常进行交易），而导致基金所持的港股组合在后续港股通交易日开市交易中集中体现市场反应而造成其价格波动骤然增大，进而导致本基金所持港股组合在资产估值上出现波动增大的风险。

#### （7）交收制度带来的基金流动性风险

由于香港市场实行T+2日（T日买卖股票，资金和股票在T+2日才进行交收）的交收安排，本基金在T日（港股通交易日）卖出股票，T+2日（港股通交易日，即为卖出当日之后第二个港股通交易日）才能在香港市场完成清算交收，卖出的资金在T+3日才能回到人民币资金账户。因此交收制度的不同以及港股通交易日的设定原因，本基金可能面临卖出港股后资金不能及时到账，而造成支付赎回款日期比正常情况延后而给投资者带来流动性风险。

#### （8）港股通标的权益分派、转换等的处理规则带来的风险

根据现行的港股通规则，本基金因所持港股通股票权益分派、转换、上市

公司被收购等情形或者异常情况，所取得的港股通股票以外的香港联交所上市证券，只能通过港股通卖出，但不得买入；因港股通股票权益分派或者转换等情形取得的香港联交所上市股票的认购权利在联交所上市的，可以通过港股通卖出，但不得行权；因港股通股票权益分派、转换或者上市公司被收购等所取得的非联交所上市证券，可以享有相关权益，但不得通过港股通买入或卖出。

本基金存在因上述规则，利益得不到最大化甚至受损的风险。

#### （9）香港联合交易所停牌、退市等制度性差异带来的风险

香港联交所规定，在交易所认为所要求的停牌合理而且必要时，上市公司方可采取停牌措施。此外，不同于内地A股市场的停牌制度，联交所对停牌的具体时长并没有量化规定，只是确定了“尽量缩短停牌时间”的原则；同时与A股市场存在退市可能的上市公司根据其财务状况在证券简称前加入相应标记（例如，ST及\*ST等标记）以警示投资者风险的做法不同，在香港联交所市场没有风险警示板，联交所采用非量化的退市标准且在上市公司退市过程中拥有相对较大的主导权，使得联交所上市公司的退市情形较A股市场相对复杂。因该等制度性差异，本基金可能存在因所持个股遭遇非预期性的停牌甚至退市而给基金带来损失的风险。

#### （10）港股通规则变动带来的风险

本基金是在港股通机制和规则下参与香港联交所证券的投资，受港股通规则的限制和影响；本基金存在因港股通规则变动而带来基金投资受阻或所持资产组合价值发生波动的风险。

#### （11）其他可能的风险

除上述显著风险外，本基金参与港股通投资，还可能面临的其他风险，包括但不限于：

①除因股票交易而发生的佣金、交易征费、交易费、交易系统费、印花税、过户费等税费外，在不进行交易时也可能要继续缴纳证券组合费等项费用，本基金存在因费用估算不准而导致账户透支的风险；

②在香港市场，部分中小市值港股成交量则相对较少，流动较为缺乏，本基金投资此类股票可能因缺乏交易对手而面临个股流动性风险；

③在本基金参与港股通交易中若香港联交所与内地交易所的证券交易服务

公司之间的报盘系统或者通信链路出现故障，可能导致15分钟以上不能申报和撤销申报的交易中断风险；

④存在港股通香港结算机构因极端情况下无法交付证券和资金的结算风险；另外港股通境内结算实施分级结算原则，本基金可能面临以下风险：1) 因结算参与者未完成与中国结算的集中交收，导致本基金应收资金或证券被暂不交付或处置；2) 结算参与人对本基金出现交收违约导致本基金未能取得应收证券或资金；3) 结算参与者向中国结算发送的有关本基金的证券划付指令有误的导致本基金权益受损；4) 其他因结算参与者未遵守相关业务规则导致本基金利益受到损害的情况。

此外，本基金可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于港股或选择不将基金资产投资于港股，本基金并非必然投资港股。

## 12、本基金投资科创板股票所带来的特有风险

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。

13、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。

### 14、其他风险

（1）战争、自然灾害等不可抗力因素的出现，将会严重影响证券市场的运行，可能导致委托资产的损失，从而带来风险。

（2）基金管理人因停业、解散、撤销、破产，或者被中国证监会撤销相关业务许可等原因不能履行职责，可能导致委托资产的损失，从而带来风险。

### （二）声明

1、本基金未经任何一级政府、机构及部门担保。投资者自愿投资于本基金，须自行承担投资风险。

2、本基金通过销售机构公开销售，但是，基金并不是销售机构的存款或负债，也没有经销售机构担保或者背书，销售机构并不能保证其收益或本金安全。

## 十八、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、变更基金合同涉及法律法规规定或基金合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。对于法律法规规定和基金合同约定可不经基金份额持有人大会决议通过的事项，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。

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议自生效后方可执行，并自决议生效后两日内在规定媒介公告。

### （二）《基金合同》的终止事由

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

#### 4、基金财产清算程序：

（1）《基金合同》终止情形出现时，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) 对基金剩余财产进行分配。

5、基金财产清算的期限为 6 个月，但因本基金所持证券的流动性受到限制而不能及时变现的，清算期限可相应顺延。

#### (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剩余财产中支付。

#### (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财产清算报告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。

## 十九、基金合同的内容摘要

(一) 基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务

### 1、基金份额持有人的权利与义务

基金投资者持有本基金基金份额的行为即视为对《基金合同》的承认和接受，基金投资者自依据《基金合同》取得基金份额，即成为本基金份额持有人和《基金合同》的当事人，直至其不再持有本基金的基金份额。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。

同一类别每份基金份额具有同等的合法权益。本基金 A 类基金份额与 C 类基金份额由于基金份额净值的不同，基金收益分配的金额以及参与清算后的剩余基金财产分配的数量将可能有所不同。

根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的权利包括但不限于：

- (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) 依法转让或者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或者召集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、基金服务机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁；
- (9) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的义务包括但不限于：

- (1) 认真阅读并遵守《基金合同》、招募说明书等信息披露文件；
- (2) 了解所投资基金产品，了解自身风险承受能力，自主判断基金的投资

价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险；

- (3) 关注基金信息披露，及时行使权利和履行义务；
- (4) 缴纳基金认购、申购款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用；
- (5) 在其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；
- (6) 不从事任何有损基金及其他《基金合同》当事人合法权益的活动；
- (7) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；
- (8) 返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；
- (9) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

## 2、基金管理人的权利与义务

根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于：

- (1) 依法募集资金；
- (2) 自《基金合同》生效之日起，根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产；
- (3) 依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；
- (4) 销售基金份额；
- (5) 按照规定召集基金份额持有人大会；
- (6) 依据《基金合同》及有关法律的规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；
- (7) 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；
- (8) 选择、更换基金销售机构，对基金销售机构的相关行为进行监督和处理；
- (9) 担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记机构办理基金登记业务并获得《基金合同》规定的费用；
- (10) 依据《基金合同》及有关法律的规定决定基金收益的分配方案；
- (11) 在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购、赎回与转换申

请：

(12) 依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使相关权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利；

(13) 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；

(14) 以基金管理人的名义，代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；

(15) 选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券/期货经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；

(16) 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、定期定额投资和非交易过户等业务规则；

(17) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于：

(1) 依法募集资金，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、谨慎勤勉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基金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，不得利用基金财产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) 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，按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；

- (9) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
- (10) 编制季度报告、中期报告和年度报告；
- (11) 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；
- (12) 保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、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，不向他人泄露；
- (13) 按《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；
- (14) 按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；
- (15) 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；
- (16) 按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料 15 年以上；
- (17) 确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出，并且保证投资者能够按照《基金合同》规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并在支付合理成本的前提下得到有关资料的复印件；
- (18) 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；
- (19) 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；
- (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时，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
- (21) 监督基金托管人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金托管人违反《基金合同》造成基金财产损失时，基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；
- (22) 当基金管理人将其义务委托第三方处理时，应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任；
- (23) 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实施其

他法律行为；

(24) 基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件，《基金合同》不能生效，基金管理人承担全部募集费用，将已募集资金加计银行同期活期存款利息在基金募集期结束后 30 日内退还基金认购人；

(25) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

(26) 建立并保存基金份额持有人名册；

(27) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

### 3、基金托管人的权利与义务

根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的权利包括但不限于：

(1) 自《基金合同》生效之日起，依法律法规和《基金合同》的规定安全保管基金财产；

(2) 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费用；

(3) 监督基金管理人对本基金的投资运作，如发现基金管理人违反《基金合同》及国家法律法规行为，对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金投资者的利益；

(4) 根据相关市场规则，为基金开设资金账户、证券账户等投资所需的其他账户，为基金办理证券、期货交易资金清算；

(5) 提议召开或召集基金份额持有人大会；

(6) 在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

(7) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的义务包括但不限于：

(1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；

(2) 设立专门的基金托管部门，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) 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，确保基金财产的安全，保证其托管的基金财产与基金托管人自有财产以及不同的



基金财产相互独立；对所托管的不同的基金分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金之间在账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；

(4) 除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得利用基金财产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、证券账户等投资所需的其他账户，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；

(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予以保密，不得向他人泄露，但向审计、法律等外部专业顾问提供的除外；

(8) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额净值、基金份额申购、赎回价格；

(9) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

(10) 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；

(11) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料 15 年以上；

(12) 从基金管理人或其委托的登记机构处接收并保存基金份额持有人名册；

(13) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

(14) 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；

(15) 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管理人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

(16) 按照法律法规和《基金合同》的规定监督基金管理人的投资运作；

(17) 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；

(18) 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监管机构，并通知基金管理人；

(19) 因违反《基金合同》导致基金财产损失时，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

(20) 监督基金管理人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金管理人因违反《基金合同》造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金管理人追偿；

(21) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

(22) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

(二) 基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

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拥有平等的投票权。

本基金份额持有人大会不设日常机构。

#### 1、召开事由

除法律法规和中国证监会另有规定外，当出现或需要决定下列事由之一的，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) 调整基金管理人、基金托管人的报酬标准或提高销售服务费；
- (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、范围或策略；
- (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) 单独或合计持有本基金总份额 10%以上（含 10%）基金份额的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会；

(12) 对基金合同当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；

(13) 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、在法律法规和《基金合同》规定的范围内且在对现有基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，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) 法律法规要求增加的基金费用的收取；

(2) 调整本基金的申购费率、调低赎回费率或销售服务费、变更收费方式或调整基金份额类别设置、对基金份额分类办法及规则进行调整；

(3) 因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改；

(4) 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；

(5) 基金管理人、登记机构、基金销售机构调整有关认购、申购、赎回、转换、基金交易、非交易过户、转托管等业务规则；

(6) 基金推出新业务或服务；

(7) 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其他情形。

## 2、会议召集人及召集方式

(1) 除法律法规规定或《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。

(2) 基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集。

(3) 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，应当由基金托管人自行召集，并自出具书面决定之日起 60 日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合。

(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书面要求召开基金份额持有人大会，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 日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合。

（5）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 日报中国证监会备案。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。

（6）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。

### 3、召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

召开基金份额持有人大会，召集人应于会议召开前 30 日，在规定媒介公告。基金份额持有人大会通知应至少载明以下内容：

- （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的权益登记日；
- （4）授权委托证明的内容要求（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。

采取通讯开会方式并进行表决的情况下，由会议召集人决定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、表决意见寄交的截止时间和收取方式。

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表决意见的计票进行监督的，不影响表决意见的计票效力。

#### 4、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、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。

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证明委派代表出席，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，基金管理人或基金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证明符合法律法规、《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益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二分之一（含二分之一）。若到会者在权益登记日代表的有效的基金份额少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的3个月以后、6个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会到会者在权益登记日代表的有效的基金份额应不少于本基金在权益登记日基金总份额的三分之一（含三分之一）。

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或大会公告载明的其他方式在表决截止日以前送达至召集人指定的地址。通讯开会应以书面方式或大会公告载明的其他方式进行表决。

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》约定公布会议通知后，在2个工作日内连续公布相关提示性公告；

(2) 召集人按基金合同约定通知基金托管人（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表决意见;基金托管人或基金管理人经通知不参加收取表决意见的,不影响表决效力;

(3) 本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的,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二分之一(含二分之一);若本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日基金总份额的二分之一,召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的3个月以后、6个月以内,就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会应当有代表三分之一以上(含三分之一)基金份额的持有人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见;

(4) 上述第(3)项中直接出具表决意见的基金份额持有人或受托代表他人出具表决意见的代理人,同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具表决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证明符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定,并与基金登记机构记录相符。

在法律法规和监管机关允许的情况下,本基金的基金份额持有人亦可采用其他非书面方式授权其代理人出席基金份额持有人大会,授权方式可以采用书面、网络、电话、短信或其他方式,具体方式由会议召集人确定并在会议通知中列明;在会议召开方式上,本基金亦可采用其他非现场方式或者以现场方式与非现场方式相结合的方式召开基金份额持有人大会,会议程序比照现场开会和通讯方式开会的程序进行。基金份额持有人可以采用书面、网络、电话、短信或其他方式进行表决,具体方式由会议召集人确定并在会议通知中列明。

## 5、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前及时公告。

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。

## (2) 议事程序

### 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拒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)、身份证明文件号码、持有或代表有表决权的基金份额、委托人姓名(或单位名称)和联系方式等事项。

### 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。

## 6、表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

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,一般决议须经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的二分之一以上(含二分之一)通过方为有效;除下列第 2 项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,特别决议应当经参加大会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)通过方可做出。转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、终止《基金合同》、本基金与其他基金合并以特

别决议通过方为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

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，表面符合会议通知规定的表决意见视为有效表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具表决意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

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。

## 7、计票

### 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。

### 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



表对表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。

## 8、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 日内报中国证监会备案。

基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。

基金份额持有人大会决议自生效之日起 2 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。

9、本部分关于基金份额持有人大会召开事由、召开条件、议事程序、表决条件等规定，凡是直接引用法律法规或监管规则的部分，如将来法律法规或监管规则修改导致相关内容被取消或变更的，基金管理人提前公告后，可直接对本部分内容进行修改和调整，无需召开基金份额持有人大会审议。

### （三）基金合同解除和终止的事由、程序

#### 1、《基金合同》的变更

变更基金合同涉及法律法规规定或本基金合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。对于法律法规规定和基金合同约定可不经基金份额持有人大会决议通过的事项，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。

关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议自生效后方可执行，并自决议生效后两日内在规定媒介公告。

#### 2、《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，经履行相关程序后，《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。

### 3、基金财产的清算

**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。

**基金财产清算小组组成：**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。

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

#### 基金财产清算程序：

(1) 《基金合同》终止情形出现时，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) 对基金剩余财产进行分配。

基金财产清算的期限为 6 个月，但因本基金所持证券的流动性受到限制而不能及时变现的，清算期限可相应顺延。

### 4、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剩余财产中支付。

### 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财产清算报告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期限不少于 15 年。

### （四）争议解决方式

各方当事人同意，因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议，如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。仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局的，对各方当事人均有约束力。仲裁费由败诉方承担。

争议处理期间，基金管理人和基金托管人应恪守各自职责，各自继续忠实、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。

《基金合同》受中国法律（为本基金合同之目的，在此不包括香港、澳门特别行政区和台湾地区的有关规定）管辖。

### （五）基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

《基金合同》可印制成册，供投资者在基金管理人、基金托管人、销售机构的办公场所和营业场所查阅。

## 二十、基金托管协议的内容摘要

### （一）基金管理人

名称：兴证全球基金管理有限公司

注册地址：上海市黄浦区金陵东路 368 号

办公地址：上海市浦东新区芳甸路 1155 号嘉里城办公楼 28-29 楼

邮政编码：201204

法定代表人：杨华辉

成立日期：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

存续期间：持续经营

经营范围：基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其他业务

## （二）基金托管人

名称：中国建设银行股份有限公司(简称：中国建设银行)

住所：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

邮政编码：100033

法定代表人：田国立

成立日期：2004 年 09 月 17 日

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[1998]12 号

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

存续期间：持续经营

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期、长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现；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、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事银行卡业务；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；经中国银行业监督管理委员会等监管部门批准的其他业务。

## 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。《基金合同》明确约定基金投资风格或证券选择标准的，基金管理人应按照基金托管人要求的格式提供投资品种池，以便基金托管人运用相关技术系统，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，对存在疑义的事项进行核查。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的

股票及存托凭证（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票及存托凭证）、沪港股票市场交易互联互通机制试点允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票、深港股票市场交易互联互通机制试点允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票、债券（包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、可转换债券、分离交易可转债的纯债部分、可交换债券、央行票据、中期票据、证券公司发行的短期债券、短期融资券、超短期融资券等）、债券回购、货币市场工具、银行存款、同业存单、资产支持证券、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

本基金将根据法律法规的规定参与融资业务。

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。

基金的投资组合比例为：股票资产投资比例为基金资产的 60%—95%（其中投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0-50%）；每个交易日日终在扣除股指期货国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

（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。基金托管人按下述比例和调整期限进行监督：

1. 本基金股票投资占基金资产的比例为 60%-95%（其中，投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0%-50%）；

2. 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；

3. 每个交易日日终，在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金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，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

4. 本基金持有一家公司发行的证券，其市值（同一家公司在境内和香港市场同时上市的 A+H 股合并计算）不超过基金资产净值的 10%；

5. 本基金管理人管理且由本基金托管人托管的全部基金持有一家公司发行

的证券（同一家公司在境内和香港市场同时上市的 A+H 股合并计算），不超过该证券的 10%；

6. 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%；

7. 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%；

8. 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%；

9. 本基金管理人管理且由本基金托管人托管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%；

10. 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；

11. 本基金总资产不得超过基金净资产的 140%；

12. 本基金参与国债期货、股指期货交易，需遵守下列投资比例限制：

（1）本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的 10%；本基金在任何交易日日终，持有的买入国债期货合约价值，不得超过基金资产净值的 15%；

（2）本基金在任何交易日日终，持有的买入国债期货和股指期货合约价值和有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%；其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；

（3）本基金在任何交易日日终，持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%；本基金在任何交易日日终，持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的 30%；

（4）本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定；本基金所持有的债券（不含到期日在一年以内的政府债券）市值和买入、卖出国债期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于债券投资比例的有关约定；

（5）本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金

额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%；本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的国债期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 30%；

13. 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%；本基金在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；

14. 本基金参与融资的，每个交易日日终，本基金持有的融资买入股票与其他有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%；

15. 本基金管理人管理且由本基金托管人托管的全部开放式基金（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%；本基金管理人管理且由本基金托管人托管的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；

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

17. 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；

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. 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他投资限制。

本基金在进行期货投资之前，应与基金托管人、期货公司三方一同就期货开户、清算、估值、交收等事宜另行签署《期货投资托管操作三方备忘录》。

除上述第 3、10、16、17 项外，因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的，从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合

基金合同的有关约定。在上述期间内，本基金的投资范围、投资策略应当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。

法律法规或监管部门取消或调整上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或按调整后的规定执行，但须提前公告。

（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通过事后监督方式进行监督。

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的，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先的原则，防范利益冲突，相关交易必须事先得到基金托管人的同意，并履行信息披露义务。

（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供的银行间债券市场交易对手名单进行交易。基金管理人可以每半年对银行间债券市场交易对手名单及结算方式进行更新，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情况需要临时调整银行间债券市场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个工作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，基金托管人不承担由此造成的任何法律责任及损失。若未履约的交易对手在基金托管人与基金管理人确定的时间前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或交易方式进行交易时，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）基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金管理人投资流通受限证券进行监督。

基金管理人投资流通受限证券，应事先根据中国证监会相关规定，明确基金投资流通受限证券的比例，制订严格的投资决策流程和风险控制制度，防范流动性风险、法律风险和操作风险等各种风险。基金托管人对基金管理人是否遵守相关制度、流动性风险处置预案以及相关投资额度和比例等的情况进行监督。

1. 本基金投资的流通受限证券须为经中国证监会批准的非公开发行股票、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。本基金不投资有锁定期但锁定期不明确的证券。

本基金投资的流通受限证券限于可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，并可在证券交易所或全国银行间债券市场交易的证券。

本基金投资的流通受限证券应保证登记存管在本基金名下，基金管理人负责相关工作的落实和协调，并确保基金托管人能够正常查询。因基金管理人原因产生的流通受限证券登记存管问题，造成基金托管人无法安全保管本基金资产的责任与损失，及因流通受限证券存管直接影响本基金安全的责任及损失，由基金管理人承担。

本基金投资流通受限证券，不得预付任何形式的保证金。

2. 基金管理人投资非公开发行股票，应制订流动性风险处置预案并经其董事会批准。风险处置预案应包括但不限于因投资流通受限证券需要解决的基金投资比例限制失调、基金流动性困难以及相关损失的应对解决措施，以及有关异常情况的处置。基金管理人应在首次投资流通受限证券前向基金托管人提供基金投资非公开发行股票相关流动性风险处置预案。

基金管理人对本基金投资流通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。对本基金因投资流通受限证券导致的流动性风险，基金托管人不承担任何责任。如因基金管理人原因导致本基金出现损失致使基金托管人承担连带赔偿责任的，基金管理人应赔偿基金托管人由此遭受的损失。

3. 本基金投资非公开发行股票，基金管理人应至少于投资前三个工作日向基金托管人提交有关书面资料，并保证向基金托管人提供的有关资料真实、准确、完整。有关资料如有调整，基金管理人应及时提供调整后的资料。上述书面资料包括但不限于：

(1) 中国证监会批准发行非公开发行股票的批准文件。

(2) 非公开发行股票有关发行数量、发行价格、锁定期等发行资料。

(3) 非公开发行股票发行人与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签订的证券登记及服务协议。

(4) 基金拟认购的数量、价格、总成本、账面价值。

4. 基金管理人应在本基金投资非公开发行股票后两个交易日内，在中国证监会指定媒体披露所投资非公开发行股票的名称、数量、总成本、账面价值，以及总成本和账面价值占基金资产净值的比例、锁定期等信息。

本基金有关投资流通受限证券比例如违反有关限制规定，在合理期限内未能进行及时调整，基金管理人应在两个工作日内编制临时报告书，予以公告。

5. 基金托管人根据有关规定有权对基金管理人进行以下事项监督：

(1) 本基金投资流通受限证券时的法律法规遵守情况。

(2) 在基金投资流通受限证券管理工作方面有关制度、流动性风险处置预案的建立与完善情况。

(3) 有关比例限制的执行情况。

(4) 信息披露情况。

6. 相关法律法规对基金投资流通受限证券有新规定的，从其规定。

(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。基金管理人收到书面通知后应在下一工作日前及时核对并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，并保证在规定期限内及时改正。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。

（八）基金管理人应积极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。对基金托管人发出的书面提示，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，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存在重大违规行为，应及时报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。基金管理人无正当理由，拒绝、阻挠对方根据本托管协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督，情节严重或经基金托管人提出警告仍不改正的，基金托管人应报告中国证监会。

### 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、证券账户以及投资所需的其他专用账户、复核基金管理人计算的基金资产净值和各类基金份额净值、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。基金托管人收到通知后应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。基金托管人应积极配合基金管理人的核查行为，包括但不限于：提交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，在规定时间内答复基金管理人并改正。

（三）基金管理人发现基金托管人有重大违规行为，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。基金托管人无正当理由，拒绝、阻挠对方根据本协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督，情节严重或经基金管理人提出警告仍不改正的，基金管理人应报告中国证监会。

#### 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、证券账户以及投资所需的其他专用账户。
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. 基金托管人按照《基金合同》和本协议的约定保管基金财产，如有特殊情况双方可另行协商解决。基金托管人未经基金管理人的指令，不得自行运用、处分、分配本基金的任何资产（不包含基金托管人依据中国证券登记结算有限责任公司结算数据完成场内交易交收、开户银行或交易/登记结算机构扣收交易费、结算费和账户维护费等费用）。
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。由此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，基金托管人对此不承担任何责

任。

7. 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存于基金管理人在基金托管人的营业机构开立的“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，基金管理人应将属于基金财产的全部资金划入基金托管人开立的基金银行账户，同时在规定时间内，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《基金合同》生效的条件，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. 基金托管人可以本基金的名义在其营业机构开立基金的银行账户，并根据基金管理人合法合规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银行业监督管理机构的有关规定。

4. 在符合法律法规规定的条件下，基金托管人可以通过基金托管人专用账户办理基金资产的支付。

#### （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。

证券账户开户费由基金管理人先行垫付，待本基金启始运营后，基金管理人可向基金托管人发送划款指令，将代垫开户费从本基金托管资金账户中扣还基金管理人。

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、结算保证金、交收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以及基金管理人与基金托管人签署的《托管银行证券资金结算协议》执行。

5. 账户注销时，由基金管理人依据中国证券登记结算公司相关规定，委托有交易关系的证券公司负责办理。销户完成后，基金管理人需将相关证明提供至基金托管人。账户注销期间如需基金托管人提供配合的，基金托管人应予以配合。

6. 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，基金管理人负责以基金的名义申请并取得进入全国银行间同业拆借市场的交易资格，并代表基金进行交易；基金托管人根据中国人民银行、银行间市场登记结算机构的有关规定，在银行间市场登记结算机构开立债券托管账户，持有人账户和资金结算账户，并代表基金进行银行间市场债券的结算。基金管理人和基金托管人共同代表基金签订全国银行间债券市场债券回购主协议。

#### （六）其他账户的开立和管理

1. 在本托管协议订立日之后，本基金被允许从事符合法律法规规定和《基金合同》约定的其他投资品种的投资业务时，如果涉及相关账户的开设和使用，由基金管理人协助托管人根据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定，开立有关账户。该账户按有关规则使用并管理。

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、银行存款开户证实书等有价凭证由基金托管人存放于基金托管人的保管库，也可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/北京分公司或票据营业中心的代保管库，保管凭证由基金托管人持有。实物证券、银行定期存款证实书等有价凭证的购买和转让，按基金管理人和基金托管人双方约定办理。基金托管人对由基金托管人以外机构实际有效控制或保管的资产不承担任何责任。

### （八）与基金财产有关的重大合同的保管

与基金财产有关的重大合同的签署，由基金管理人负责。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包括但不限于基金年度审计合同、基金信息披露协议及基金投资业务中产生的重大合同，基金管理人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以加密方式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。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. 基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的金额。各类基金份额净值是按照每个工作日闭市后，该类基金份额的基金资产净值除以当日该类基金份额的余额数量计算，两类基金份额净值均精确到 0.0001 元，小数点后第 5 位四舍五入。基金管理人可以设立大额赎回情形下的净值精度应急调整机制。国家另有规定的，从其规定。基金管理人应每个工作日计算基金资产净值及各类基金份额的基金份额净值，并按规定进行公告。

2. 基金管理人应每个工作日对基金资产估值。但基金管理人根据法律法规或本基金合同的规定暂停估值时除外。基金管理人每个工作日对基金资产估值后，将各类基金份额的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，由基金管理人按约定对外公布。

### （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、债券、股指期货合约、国债期货合约和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。

## 2. 估值方法

本基金所持有的投资品种，按如下原则进行估值：

### (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或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，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或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，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交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种，选取估值日第三方估值机构提供的相应品种对应的估值净价估值，具体估值机构由基金管理人与基金托管人另行协商约定；

③交易所上市交易的可转换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；

交易所上市实行全价交易的债券（可转债除外），选取第三方估值机构提供的估值全价减去估值全价中所含的债券（税后）应收利息得到的净价进行估值；

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估值方法估值；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，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对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券，对存在活跃市场的情况下，应以活跃市场上未经调整的报价作为计量日的公允价值；对于活跃市场报价未能代表计量日公允价值的情况下，应对市场报价进行调整以确认计量日的公允价值；对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下，则采用估值技术确定公允价值。

④流通受限股票，包括非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

(3) 银行间市场交易的固定收益品种，选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值。

(4) 同一债券或股票同时在两个或两个以上市场交易的，按债券或股票所处的市场分别估值。

(5) 证券公司发行的短期债券，选取估值日第三方估值机构提供的相应品种对应的估值净价估值。

(6) 同业存单按估值日第三方估值机构提供的估值净价估值；选定的第三方估值机构未提供估值价格的，按成本估值。

(7) 投资证券衍生品的估值方法

①因持有股票而享有的配股权，采用估值技术确定公允价值进行估值。在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本进行估值。

②股指期货合约以估值日金融期货交易所的当日结算价估值，该日无交易的，以最近一日的结算价估值。

③国债期货合约，一般以估值当日结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。

(8) 存款的估值方法

持有的银行定期存款或通知存款以本金列示，按协议或合同利率逐日确认利息收入。如提前支取或利率发生变化，管理人及时进行账务调整。

(9) 在基金估值日，港股通投资的股票按其在港交所的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值。

在基金估值日，港股通投资持有外币证券资产估值涉及到港币对人民币汇率的，可参考当日中国人民银行或其授权机构公布的人民币汇率中间价，或其他可以反映公允价值的汇率进行估值。

若本基金现行估值汇率不再发布或发生重大变更，或市场上出现更为公允、更适合本基金的估值汇率时，基金管理人与基金托管人协商一致后可根据实际情况调整本基金的估值汇率，并及时报中国证监会备案，无需召开基金份额持有人大会。

(10) 当发生大额申购或赎回情形时，可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。

(11) 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。

(12) 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。

(13) 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，仍无法达成一致意见的，基金管理人向基金托管人出具加盖公章的书面说明后，按照基金管理人对基金净值的计算结果对外予以公布。

### 3. 特殊情形的处理

基金管理人、基金托管人按估值方法的第(12)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。

由于不可抗力，或由于证券/期货交易所、登记结算公司等发送的数据错误等原因，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消除或减轻由此造成的影响。

### （三）基金份额净值错误的处理方式

1. 当某一类基金份额净值小数点后4位以内(含第4位)发生估值错误时，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；错误偏差达到该类基金份额净值的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；错误偏差达到该类基金份额净值的0.5%时，基金管理人应当公告，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. 当某一类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各类基金份额净值已由基金托管人复核确认后公告，而且基金托管人未对计算过程提出疑义或要求基金管理人书面说明，某一类基金份额净值出错且造成基金份额持有人损失的，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管理费和托管费的比例各自承担相应的责任。

(3) 如基金管理人和基金托管人对各类基金份额净值的计算结果，虽然多次重新计算和核对，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），进而导致某一类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. 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。

4. 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，在不违背法律法规且不损害投资者利益的前提下，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重新协商确定处理原则。

#### （四）暂停估值的情形

1. 基金投资所涉及的证券、期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

2. 因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；

3. 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；

4. 法律法规、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

基金管理人进行基金会计核算并编制基金财务会计报告。基金管理人独立地设置、记录和保管本基金的全套账册。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

###### （1）报表的编制

基金管理人应当在每月结束后 5 个工作日内完成月度报表的编制；在季度结束之日起 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；在每年结束之日起三个月内完成基金年度报告的编制。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。《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。

## (2) 报表的复核

基金管理人应及时完成报表编制，将有关报表提供基金托管人复核；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。

基金管理人应留足充分的时间，便于基金托管人复核相关报表及报告。

(八) 基金管理人应在编制季度报告、中期报告或者年度报告之前及时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和持有的基金份额。基金份额持有人名册由基金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。

## 八、托管协议的修改与终止

### (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备案。

### (二) 托管协议终止的情形

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

#### 4. 基金财产清算程序：

- (1) 《基金合同》终止情形出现时，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) 对基金剩余财产进行分配。

5. 基金财产清算的期限为 6 个月，但因本基金所持证券的流动性受到限制而不能及时变现的，清算期限可相应顺延。

#### 6. 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剩余财产中支付。

#### 7. 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。

#### 8. 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财产清算报告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。

#### 9. 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至少 15 年。

## 二十一、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电子对账单或手机短信对账单。基金管理人根据持有人账单订制情况，对于定制电子对账单的持有人，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基金交易对账单，以方便投资人快速获得交易信息；对于订制手机短信对账单的客户，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。

### （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以及与基金经理的定期在线交流服务。

### （三）网上交易服务

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> 可以办理基金认购、申购、赎回、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

投资者如果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基金管理人网站。

营销服务部电话

客服热线：400-678-0099，021-38824536

传真：021-58367239

互联网站网址：<http://www.xqfunds.com>

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

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”



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基金管理人发送的基金净值、短信对账单，并可通过电子邮件收到基金净值、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，或通过基金管理人网站留言的投诉栏目、书信、电子邮件等渠道对基金管理人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。

（七）如本招募说明书存在任何您/贵机构无法理解的内容，请通过上述方式联系基金管理人。请确保投资前，您/贵机构已经全面理解了本招募说明书。

## 二十二、其他应披露事项

以下为自 2021 年 5 月 1 日至 2022 年 5 月 31 日，本基金刊登于《证券时报》和基金管理人网站等规定网站的基金公告。

序号	事项名称	披露日期
1	关于增加北京新浪仓石基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	2021 年 6 月 16 日
2	关于增加泛华普益基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	2021 年 6 月 17 日
3	关于调整网上直销部分基金转换/赎回转购/汇款交易优惠费率的公告	2021 年 6 月 18 日
4	关于增加信达证券为旗下部分基金销售机构的公告	2021 年 7 月 15 日
5	兴全多维价值混合型证券投资基金基金经理变更公告	2021 年 7 月 16 日
6	关于旗下部分基金投资芒果超媒（300413）非公开发行股票的公告	2021 年 8 月 21 日
7	关于增加旗下部分基金销售机构并调整旗下基金在东方证券费率优惠活动的公告	2021 年 11 月 24 日
8	关于调整网上直销部分基金转换、赎回转购、汇款交易优惠费率的公告	2021 年 12 月 10 日
9	关于调整兴全多维价值混合型证券投资基金在北京汇成基金销售有限公司费率优惠活动的公告	2021 年 12 月 21 日
10	关于旗下基金投资关联方承销可转换公司债券的公告	2021 年 12 月 30 日
11	关于调整旗下部分基金单笔最低交易限额的公告	2022 年 1 月 6 日
12	关于增加旗下部分基金销售机构的公告	2022 年 1 月 19 日
13	关于增加平安银行为兴全多维价值混合型证券投资基金销售机构的公告	2022 年 1 月 24 日
14	关于我司旗下基金参与腾安基金销售赎回费率优惠活动的公告	2022 年 1 月 26 日
15	关于增加旗下部分基金销售机构的公告	2022 年 2 月 16 日
16	关于调整兴全多维价值混合型证券投资基金在上海天天基金销售有限公司费率优惠活动的公告	2022 年 2 月 24 日
17	关于增加旗下部分基金销售机构的公告	2022 年 3 月 8 日
18	关于增加旗下部分基金销售机构的公告	2022 年 3 月 15 日
19	关于增加南京银行为旗下部分基金销售机构的公告	2022 年 3 月 21 日
20	关于增加财达证券为旗下部分基金销售机构的公告	2022 年 4 月 11 日

21	关于增加兴业银行为旗下部分基金销售机构的公告	2022年5月6日
----	------------------------	-----------

### 二十三、招募说明书存放及查阅方式

本招募说明书存放在本基金管理人、基金托管人和基金销售机构的住所，投资者可在办公时间免费查阅；也可按工本费购买复印件，但应以正本为准。投资人也可以直接登录本基金管理人的网站进行查阅。

基金管理人和基金托管人保证文本的内容与所公告的内容完全一致。

## 二十四、备查文件

1. 中国证监会准予兴全多维价值混合型证券投资基金募集注册的文件；
2. 《兴全多维价值混合型证券投资基金基金合同》；
3. 《兴全多维价值混合型证券投资基金托管协议》；
4. 关于申请募集注册兴全多维价值混合型证券投资基金的法律意见书；
5. 基金管理人业务资格批件和营业执照；
6. 基金托管人业务资格批件和营业执照；
7. 中国证监会要求的其他文件。

基金托管人业务资格批件和营业执照存放在基金托管人处；基金合同、托管协议及其余备查文件存放在基金管理人处。投资人可在营业时间免费到存放地点查阅，也可按工本费购买复印件。

兴证全球基金管理有限公司

2022年6月