

---

# 兴全趋势投资混合型证券投资基金（LOF）

## 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：兴业银行股份有限公司

## 重要提示

兴全趋势投资混合型证券投资基金（LOF）（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会于2005年9月8日出具的《关于同意兴全趋势投资混合型证券投资基金（LOF）设立的批复》（证监基金字[2005]156号）核准募集。本基金基金合同于2005年11月3日起正式生效，自该日起本基金管理人正式开始管理本基金。

本招募说明书是对原《兴全趋势投资混合型证券投资基金（LOF）招募说明书》的更新，原招募说明书与本招募说明书不一致的，以本招募说明书为准。兴证全球基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

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

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

投资者可在二级市场买卖基金份额，受市场供需关系等各种因素的影响，投资者

买卖基金份额有可能面临相应的折溢价风险。

投资有风险，投资人认购（或申购）基金时应认真阅读本基金的招募说明书、基金产品资料概要的法律文件，全面认识本基金产品的风险收益特征，充分考虑投资人自身的风险承受能力，并对于认购（或申购）基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。基金管理人提醒投资人基金投资要承担相应风险，包括市场风险、管理风险、流动性风险、本基金特定风险、操作或技术风险、合规风险等。在投资人作出投资决策后，基金投资运作与基金净值变化引致的投资风险，更新了“九、基金份额的申购和赎回”部分的相关内容。由投资者自行负责。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成本基金业绩表现的保证。

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

本次招募说明书更新内容为：

- 1、更新了“三、基金管理人”、“四、基金托管人”部分的相关内容。
- 2、更新了“五、相关服务机构”部分的相关内容。
- 3、更新了“九、基金份额的申购和赎回”部分的相关内容。
- 4、更新了“十一、基金的投资”、“十二、基金的业绩”中基金投资组合报告、基金业绩表现部分内容。
- 5、更新了“十九、风险揭示”部分的相关内容。
- 6、更新了“二十三、基金份额持有人的服务”部分的相关内容。
- 7、在“二十四、其他应披露事项”更新本期基金临时公告。

除上述内容外，本更新招募说明书所载内容截止日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）。本基金托管人兴业银行股份有限公司已复核了本次更新的招募说明书基金的投资和基金业绩相关内容。

## 目 录

一、绪言	4
二、释义	5
三、基金管理人	10
四、基金托管人	21
五、相关服务机构	24
六、基金的募集	32
七、基金合同的生效	33
八、基金份额的上市交易	33
九、基金份额的申购、赎回	34
十、基金份额的登记、系统内转托管和跨系统转登记	46
十一、基金的投资	47
十二、基金的业绩	60
十三、基金的财产	61
十四、基金资产的估值	62
十五、基金的收益和分配	67
十六、基金的费用与税收	68
十七、基金的会计与审计	71
十八、基金的信息披露	72
十九、风险揭示	78
二十、基金合同的终止和基金财产的清算	83
二十一、基金合同内容摘要	85
二十二、基金托管协议的内容摘要	99
二十三、基金份额持有人的服务	107
二十四、其他应披露事项	108
二十五、招募说明书存放及查阅方式	109
二十六、备查文件	110

## 一、绪言

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》）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称《运作办法》）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称《销售办法》）、《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》）、《深圳证券交易所上市开放式基金业务规则》、《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“《流动性风险规定》”）等有关法律法规以及《兴全趋势投资混合型证券投资基金（LOF）基金合同》（以下简称基金合同）编写。

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

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，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。本基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为本基金份额持有人和本基金合同当事人，其持有本基金份额的行为本身即表明其对本基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解本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

本招募说明书中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

基金或本基金：指兴全趋势投资混合型证券投资基金（LOF）

本基金合同或基金合同：指《兴全趋势投资混合型证券投资基金（LOF）基金合同》及对本基金合同的任何修订和补充

中国：指中华人民共和国（就本合同而言，不包括香港特别行政区、澳门特别行政区及台湾地区）

法律法规：指中国现时有效并公布实施的法律、行政法规、行政规章及规范性文件、地方法规、地方规章及规范性文件

《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

《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

《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

《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

《业务规则》：指2004年8月17日深圳证券交易所发布并于2004年8月17日起施行的《深圳证券交易所上市开放式基金业务规则》

《流动性风险规定》：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

招募说明书：指《兴全趋势投资混合型证券投资基金(LOF)招募说明书》及其更

新

托管协议：指基金管理人与基金托管人订立的《兴全趋势投资混合型证券投资基金(LOF)托管协议》及对托管协议的任何修订和补充

发售公告：指《兴全趋势投资混合型证券投资基金(LOF)份额发售公告》

中国证监会：指中国证券监督管理委员会

中国银监会：指中国银行业监督管理委员会

元：指人民币元

本基金合同当事人：指受本基金合同约束，根据本基金合同享有权利并承担义务的基金管理人、基金托管人和基金份额持有人

基金管理人：指兴证全球基金管理有限公司

基金托管人：指兴业银行股份有限公司

注册登记业务：指本基金的登记、存管、过户、清算和结算业务，具体内容包括投资人基金账户的建立和管理、基金份额注册登记、基金交易确认、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等

注册登记人：指办理本基金注册登记业务的机构。本基金的注册登记人是中国证券登记结算有限责任公司

销售服务代理人：指符合法律法规及其他有关规定要求的条件并与本基金管理人签订了销售服务代理协议，代为办理本基金销售服务业务的机构

销售机构：指兴证全球基金管理有限公司和销售服务代理人

个人投资者：指依据中华人民共和国有关法律法规规定可以投资于证券投资基金的自然人投资者

机构投资者：指依据中华人民共和国有关法律法规规定可以投资于证券投资基金的在中华人民共和国注册登记或经政府有关部门批准设立的法人、社会团体、其它组织

合格境外机构投资者：指根据《合格境外机构投资者境内证券投资管理暂行办法》的可投资中国境内证券市场的中国境外的机构投资者

基金投资者：指个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者的总称

基金份额持有人：指依法并依据本基金合同及相关法律文件合法取得并持有本基金份额的投资者

销售场所：指场外销售场所和场内交易场所，分别简称场外和场内

场外：指通过深圳证券交易所外的销售机构进行基金份额认购、申购和赎回的场所

场内：指通过深圳证券交易所内的会员单位进行基金份额认购、申购、赎回和上市交易的场所

注册登记系统：指中国证券登记结算有限责任公司开放式基金登记结算系统

证券登记结算系统：指中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司证券登记结算系统

基金合同的生效：指本基金募集完成，符合本基金合同规定的条件，并获得中国证监会书面确认，基金备案手续办理完毕，本基金合同生效

基金合同的终止：指法律法规规定的或者本基金合同约定的基金终止事由出现时，按照本基金合同规定的程序终止本基金合同

开放日：指为投资者办理基金申购、赎回等业务的工作日

募集期限：指本基金份额发售公告及相关公告中规定的本基金份额的发售时间段，自基金份额发售之日起最长不超过3个月

存续期：指本基金合同生效日至终止日之间的不定期期限

工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

T日：指销售机构受理投资者对本基金的认购、日常申购、赎回或办理其他基金业务的申请日

T+n日：指自T日起第n个工作日（不包含T日）

发售：指场外认购和场内认购

场外认购：指基金募集期内投资人通过场外销售机构申请购买本基金份额的行为

场内认购：指基金募集期内投资人通过场内会员单位申请购买本基金份额的行为

申购：指投资者在本基金合同生效后申请购买本基金份额的行为

赎回：指本基金份额持有人按本基金合同规定的条件，要求基金管理人购回其所持基金份额的行为

上市交易：指基金存续期间投资人通过场内会员单位以集中竞价的方式买卖基



金份额的行为

**基金转换：**指在本基金存续期间，本基金份额持有人将其持有的本基金份额转换为本基金管理人管理的其他基金的基金份额

**系统内转托管：**指持有人将持有的基金份额在注册登记系统内不同销售机构（网点）之间或证券登记结算系统内不同会员单位（席位）之间进行转托管的行为

**跨系统转登记：**指持有人将持有的基金份额在注册登记系统和证券登记结算系统间进行转登记的行为

**巨额赎回：**指基金单个开放日，基金净赎回申请超过上一日基金总份额10%时的情形

**投资指令：**指基金管理人在运用基金财产进行投资时，向基金托管人发出的资金划拨及实物券调拨等指令

**基金收益：**指本基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券价差、银行存款利息及其他合法收入

**基金资产总值：**指本基金购买的各类证券、银行存款本息、基金应收申购款及其他财产的价值总和

**基金资产净值：**指本基金资产总值减去本基金负债后的价值

**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行为

**流动性受限资产：**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

**基金账户：**指基金注册登记人为投资者开立的记录其持有本基金份额及其变更情况的账户

**交易账户：**指各销售机构为投资者开立的记录投资者通过该销售机构办理基金交易所引起的基金份额的变动及结余情况的账户

**开放式基金账户：**指注册登记人给投资者开立的用于记录投资者持有基金份额的账户，记录在该账户下的基金份额登记在注册登记人的注册登记系统

**证券账户：**指注册登记人给投资者开立的用于记录投资者持有证券的账户，包

括人民币普通股票账户和证券投资基金账户，记录在该账户下的基金份额登记在注册登记人的证券登记结算系统

指定媒介：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

不可抗力：指任何无法预见、不能避免、无法克服的事件或因素，包括：相关法律、法规或规章的变更；国际、国内金融市场风险事故的发生；自然或无人为破坏造成的交易系统或交易场所无法正常工作、战争、动乱或瘟疫等

基金产品资料概要：指《兴全趋势投资混合型证券投资基金(LOF)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

谢治宇先生，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、基金管理部投资副总监、兴全轻资产投资混合型证券投资基金（LOF）基金经理。现任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、兴全合润混合型证券投资基金基金经理（2014年12月8日起至今）、兴全合宜灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金经理（2018年1月23日起至今）、兴全社会价值三年持有期混合型证券投资基金基金经理（2019年12月26日起至今）、兴全趋势投资混合型证券投资基金（LOF）基金经理（2021年10月20日起至今）。

董理先生，理学博士。历任国信智能有限公司系统工程师，嘉实基金管理有限公司研究员、基金经理，华夏久盈资产管理有限公司投资经理，兴证全球基金管理有限公司研究部总监助理、兴全轻资产投资混合型证券投资基金（LOF）基金经理。现任兴证全球基金管理有限公司研究部副总监、兴全多维价值混合型证券投资基金

基金经理（2019年6月12日起至今）、兴全趋势投资混合型证券投资基金（LOF）基金经理（2021年10月20日起至今）。

童兰女士，经济学硕士。历任国信证券股份有限公司湖北分公司投资顾问；长江证券股份有限公司任研究员；国泰君安证券股份有限公司研究员；兴证全球基金管理有限公司研究员、研究组长。现任兴全趋势投资混合型证券投资基金（LOF）基金经理（2020年7月2日起至今）。

本基金历任基金经理：

张惠萍女士，于2008年1月31日至2010年5月4日期间担任本基金基金经理。

张光成先生，于2010年5月5日至2011年6月28日期间担任本基金基金经理。

王晓明先生，于2005年11月3日至2013年10月28日期间担任本基金基金经理。

杨岳斌先生，于2011年12月28日至2015年1月5日期间担任本基金基金经理。

侯梧先生，于2014年11月24日至2015年12月28日期间担任本基金基金经理。

邹欣先生，于2015年12月31日至2017年11月9日期间担任本基金基金经理。

乔迁女士，于2013年10月28日至2020年7月6日期间担任本基金基金经理。

董承非先生，于2013年10月28日至2021年10月20日期间担任本基金基金经理。

#### 5、投资决策委员会成员

本基金采用投资决策委员会领导下的基金经理负责制。公募投资决策委员会由以下成员组成：

庄园芳 兴证全球基金管理有限公司副董事长、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

上述人员之间不存在近亲属关系。

### **(三) 基金管理人的职责**

1、依法募集基金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；

2、办理基金备案手续；

3、对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账，进行证券投资；

4、按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；

5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

6、编制季度报告、中期报告和年度报告；

7、计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购、赎回价格；

8、办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；

9、召集基金份额持有人大会；

10、保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；

11、以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；

12、中国证监会规定的其他职责。

### **(四) 基金管理人承诺**

1、基金管理人承诺基金管理人将根据基金合同的规定，按照招募说明书列明的投资目标、策略及限制进行基金资产的投资；

2、基金管理人承诺不从事违反《证券法》的行为，并承诺建立健全的内部控制制度，采取有效措施，防止违反《证券法》行为的发生；

3、基金管理人承诺不从事违反《基金法》的行为，并承诺建立健全的内部控制制度，采取有效措施，防止下列行为的发生：

(1) 承销证券；

(2) 向他人贷款或者提供担保；

(3) 从事承担无限责任的投资；

(4) 买卖其他基金份额，但是国务院另有规定的除外；

(5) 向本基金管理人、基金托管人出资或者买卖本基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；

(6) 买卖与本基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与本基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券；

(7) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；

(8) 依照法律、行政法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他活动。

4、基金管理人承诺加强人员管理，强化职业操守，督促和约束员工遵守国家法律法规及行业规范，诚实信用、勤勉尽责，不从事以下活动：

(1) 越权或违规经营；

(2) 违反基金合同或托管协议；

(3) 故意损害基金份额持有人或其他基金相关机构的合法权益；

(4) 在包括向中国证监会报送的资料中进行虚假信息披露；

(5) 拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管；

(6) 玩忽职守、滥用职权；

(7) 泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；

(8) 除按本公司制度进行基金运作投资外，直接或间接进行其他股票投资；

(9) 协助、接受委托或以其他任何形式为其他组织或个人进行证券交易；

(10) 违反证券交易场所业务规则，利用对敲、倒仓等手段操纵市场价格，扰乱市场秩序；

(11) 贬损同行，以提高自己；

(12) 在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分；

(13) 以不正当手段谋求业务发展；

(14) 有悖社会公德，损害证券投资基金人员形象；

(15) 其他法律、行政法规禁止的行为。

#### 5、基金经理承诺

(1) 依照法律法规和基金合同的规定，本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益；

(2) 不利用职务之便为自己、受雇人或任何第三者谋取利益；

(3) 不泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密，尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；

(4) 不以任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

## **(五) 基金管理人的风险管理与内部风险控制制度**

### **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，风险管理部、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、基金托管人基本情况

#### 1、基金托管人概况

名称：兴业银行股份有限公司

注册地址：福建省福州市台江区江滨中大道398号兴业银行大厦

办公地址：上海市银城路167号

邮政编码：200120

法定代表人：吕家进

成立日期：1988年8月22日

批准设立机关和批准设立文号：中国人民银行总行，银复[1988]347号

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基金字[2005]74号

组织形式：股份有限公司

注册资本：207.74亿元人民币

存续期间：持续经营

#### 2、发展概况及财务状况

兴业银行成立于1988年8月，是经国务院、中国人民银行批准成立的首批股份制商业银行之一，总行设在福建省福州市，2007年2月5日正式在上海证券交易所挂牌上市（股票代码：601166），注册资本207.74亿元。截至2021年12月31日，兴业银行资产总额达8.60万亿元，实现营业收入2212.36亿元，同比增长8.91%，全年实现归属于母公司股东的净利润826.80亿元。

开业三十多年来，兴业银行始终坚持“真诚服务，相伴成长”的经营理念，致力于为客户提供全面、优质、高效的金融服务。

## 二、托管业务部门设置及员工情况

兴业银行股份有限公司总行设资产托管部，下设综合管理处、基金证券业务处、信托保险业务处、理财私募业务处、产品管理处、稽核监察处、投资监督管理处、运行管理处等处室，共有员工100余人，业务岗位人员均具有基金从业资格。

## 三、基金托管业务经营情况

兴业银行股份有限公司于2005年4月26日取得基金托管资格。基金托管业务批准文号：证监基金字[2005]74号。截至2021年12月31日，兴业银行共托管证券投资基金529只，托管基金的基金资产净值合计21306.55亿元，基金份额合计20247.75亿份。

## 四、基金托管人的内部控制制度

### （一）内部控制目标

严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和行内有关管理规定，守法经营、规范运作、严格监察，确保业务的稳健运行，保证基金资产的安全完整，确保有关信息的真实、准确、完整、及时，保护基金份额持有人的合法权益。

### （二）内部控制组织结构

兴业银行基金托管业务内部控制组织架构由总行内部控制委员会、总行风险管理部门、总行审计部、总行资产托管部、总行运营管理部及分行托管运营机构共同组成。各级内部控制组织依照本行相关制度对本行托管业务风险管理和内部控制实施管理。

### （三）内部控制原则

1、全面性原则：内部控制贯穿资产托管业务的全过程，覆盖各项业务和产品，以及从事资产托管业务的各机构和从业人员；

2、重要性原则：内部控制应当在全面控制的基础上，关注重要业务事项和高风险领域；

3、独立性原则：开展托管业务的部门和岗位的设置应权责分明、相对独立、相互制衡；

4、审慎性原则：内控与风险管理必须以防范风险，保证托管资产的安全与完整为出发点，“内控优先”，“制度优先”，审慎发展资产托管业务；

5、制衡性原则：内部控制应当在治理结构、机构设置及权责分配、业务流程等方面形成相互制约、相互监督，同时兼顾运营效率；

6、适应性原则：内部控制体系应同所处的环境相适应，以合理的成本实现内控目标，内部制度的制订应当具有前瞻性，并应当根据国家政策、法律及经营管理的需要，适时进行相应修改和完善；内部控制存在的问题应当能够得到及时反馈和纠正；

7、成本效益原则：内部控制应当权衡实施成本与预期效益，以适当的成本实现有效控制。

#### （四）内部控制制度及措施

1、制度建设：建立了明确的岗位职责、科学的业务流程、详细的操作手册、严格的人员行为规范等一系列规章制度。

2、建立健全的组织管理结构：前后台分离，不同部门、岗位相互牵制。

3、风险识别与评估：稽核监察处指导业务处室进行风险识别、评估，制定并实施风险控制措施。

4、相对独立的业务操作空间：业务操作区相对独立，实施门禁管理和音像监控。

5、人员管理：进行定期的业务与职业道德培训，使员工树立风险防范与控制理念，并签订承诺书。

6、应急预案：制定完备的《应急预案》，并组织员工定期演练；建立异地灾备中心，保证业务不中断。

#### 五、基金托管人对本基金管理人进行监督的方法和程序

基金托管人负有对基金管理人的投资运作行使监督权的职责。根据《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定，托管人对基金的投资对象和范围、投资组合比例、投资限制、费用的计提和支付方式、基金会计核算、基金资产估值和基金净值的计算、收益分配、申购赎回以及其他有关基金投资和运作的事项，对基金管理人进行业务监督、核查。

基金托管人发现基金管理人违反《基金法》、《运作办法》、基金合同和有关法律法规规定的行为，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应及时核对并以书面形式对基金托管人发出回函。在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对基金托管人



通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。基金托管人发现基金管理人有关重大违规行为，立即报告中国证监会，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。

基金托管人发现基金管理人的指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当拒绝执行，立即通知基金管理人，并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投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当立即通知基金管理人，并及时向中国证监会报告。

## 五、相关服务机构

### (一) 基金发售机构

#### 1、直销机构

- 兴证全球基金管理有限公司直销中心（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

直销联系电话：021-20398706、021-20398927

直销业务传真：021-58368869、021-58368915

联系人：秦洋洋、沈冰心

公司网站：[www.xqfunds.com](http://www.xqfunds.com)

- 兴证全球基金网上直销平台（含微网站、APP）

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

客户服务电话：400-678-0099，021-38824536

#### 2、代销机构（排名不分先后）：

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

代销机构 全称	法定代 表人	注册地址	办公地址	电话	网站
------------	-----------	------	------	----	----

兴业银行股份有限公司	吕家进	福建省福州市台江区江滨中大道398号兴业银行大厦	福建省福州市台江区江滨中大道398号兴业银行大厦	95561	<a href="https://www.cib.com.cn/">https://www.cib.com.cn/</a>
中国工商银行股份有限公司	陈四清	北京市西城区复兴门内大街55号	北京市西城区复兴门内大街55号	95588	<a href="http://www.icbc.com.cn/">http://www.icbc.com.cn/</a>
中国农业银行股份有限公司	谷澍	中国北京市东城区建国门内大街69号	中国北京市东城区建国门内大街69号	95599	<a href="http://www.abchina.com/">http://www.abchina.com/</a>
中国银行股份有限公司	刘连舸	北京市西城区复兴门内大街1号	北京市西城区复兴门内大街1号,香港花园道1号中银大厦	95566	<a href="https://www.boc.cn/">https://www.boc.cn/</a>
中国建设银行股份有限公司	田国立	北京市西城区金融大街25号	北京市西城区金融大街25号,香港中环干诺道中3号中国建设银行大厦28楼	95533	<a href="http://www.ccb.com/">http://www.ccb.com/</a>
交通银行股份有限公司	任德奇	中国(上海)自由贸易试验区银城中路188号	中国(上海)自由贸易试验区银城中路188号,香港中环毕打街20号	95559	<a href="http://www.bankcomm.com/">http://www.bankcomm.com/</a>
招商银行股份有限公司	缪建民	中国广东省深圳市福田区深南大道7088号	中国广东省深圳市福田区深南大道7088号	95555	<a href="http://www.cmbchina.com/">http://www.cmbchina.com/</a>
中信银行股份有限公司	朱鹤新	北京市朝阳区光华路10号院1号楼6-30层、32-42层	北京市朝阳区光华路10号院1号楼6-30层、32-42层	95558	<a href="http://www.citicbank.com/">http://www.citicbank.com/</a>
上海浦东发展银行股份有限公司	郑杨	上海市中山东一路12号	上海市中山东一路12号	95528	<a href="https://www.spdb.com.cn/">https://www.spdb.com.cn/</a>
中国光大银行股份有限公司	李晓鹏	中国北京市西城区太平桥大街25号、甲25号中国光大中心	北京市西城区太平桥大街25号中国光大中心,香港湾仔告士打道108号光大中心23楼	95595	<a href="http://www.cebbank.com/">http://www.cebbank.com/</a>
中国民生银行股份有限公司	高迎欣	中国北京市西城区复兴门内大街2号	北京市西城区复兴门内大街2号民生银行大厦	95568	<a href="http://www.cmbc.com.cn/">http://www.cmbc.com.cn/</a>
中国邮政储蓄银行股份有限公司	张金良	北京市西城区金融大街3号	北京市西城区金融大街3号	95580	<a href="http://www.psbc.com.cn/">http://www.psbc.com.cn/</a>
华夏银行股份有限公司	李民吉	北京市东城区建国门内大街22号	北京市东城区建国门内大街22号华夏银行大厦	95577	<a href="https://www.hxb.com.cn/">https://www.hxb.com.cn/</a>
上海银行股份有限公司	金煜	上海市浦东新区银城中路168号	上海市浦东新区银城中路168号	95594	<a href="http://www.bosc.cn/">http://www.bosc.cn/</a>
平安银行股份有限公司	谢永林	广东省深圳市罗湖区深南东路5047号	广东省深圳市罗湖区深南东路5047号,中国广东省深圳市福田区益田路5023号平安金融中心B座	95511	<a href="http://bank.pingan.com/">http://bank.pingan.com/</a>
宁波银行股份有限公司	陆华裕	浙江省宁波市鄞州区宁东路345号	浙江省宁波市鄞州区宁东路345号	95574	<a href="http://www.nbcb.cn/">http://www.nbcb.cn/</a>
江苏银行股份有限公司	夏平	江苏省南京市秦淮区中华路26号	江苏省南京市秦淮区中华路26号	95319	<a href="http://www.jsbchina.cn/">http://www.jsbchina.cn/</a>
重庆银行股份有限公司	林军	重庆市江北区永平门街6号	重庆市江北区永平门街6号	956023	<a href="http://www.cqcbank.com/">http://www.cqcbank.com/</a>

东莞银行股份有限公司	卢国锋	东莞市莞城区体育路21号	东莞市莞城区体育路21号	956033	<a href="http://www.dongguanbank.cn/">http://www.dongguanbank.cn/</a>
江苏江南农村商业银行股份有限公司	陆向阳	常州市武进区延政中路9号	常州市武进区延政中路9号	(0519)96005	<a href="http://www.jnbank.com.cn/">http://www.jnbank.com.cn/</a>
广州农村商业银行股份有限公司	蔡建	广东省广州市黄埔区映日路9号	广东省广州市黄埔区映日路9号	95313	<a href="http://www.grcbank.com/">http://www.grcbank.com/</a>
兴业证券股份有限公司	杨华辉	福州市湖东路268号	长柳路36号7层701室	4008888123	<a href="http://www.xyqz.com.cn">http://www.xyqz.com.cn</a>
国泰君安证券股份有限公司	贺青	上海市浦东新区自由贸易试验区商城路618号	上海市静安区南京西路768号	95521	<a href="https://www.gtja.com/">https://www.gtja.com/</a>
中信建投证券股份有限公司	王常青	北京市朝阳区安立路66号4号楼	北京市朝阳区安立路66号4号楼	4008888108	<a href="https://www.csc108.com/">https://www.csc108.com/</a>
国信证券股份有限公司	何如	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	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	深圳市福田区福田街道福华一路111号	深圳市福田区福田街道福华一路111号	95565	<a href="http://www.cmschina.com/">http://www.cmschina.com/</a>
广发证券股份有限公司	孙树明	广东省广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街2号618室	广东省广州市天河区马场路26号广发证券大厦	95575	<a href="http://www.gf.com.cn/">http://www.gf.com.cn/</a>
中信证券股份有限公司	张佑君	广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座	广东省深圳市福田区中心三路8号中信证券大厦,北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦	95548	<a href="http://www.citics.com">www.citics.com</a>
中国银河证券股份有限公司	陈共炎	北京市丰台区西营街8号院1号楼7至18层101	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	上海市黄浦区广东路689号	上海市黄浦区广东路689号	95553	<a href="http://www.htsec.com">www.htsec.com</a>
华泰联合证券有限责任公司	江禹	深圳市前海深港合作区南山街道桂湾五路128号前海深港基金小镇B7栋401	深圳市福田区深南大道4011号中国港中旅大厦26楼	0755-82492010	<a href="http://www.lhqz.com/">http://www.lhqz.com/</a>
申万宏源证券有限公司	杨玉成	上海市徐汇区长乐路989号45层	上海市徐汇区长乐路989号45层	95523	<a href="http://www.swhysc.com">www.swhysc.com</a>
长江证券股份有限公司	李新华	湖北省武汉市江汉区新华路特8号	湖北省武汉市江汉区新华路特8号	95579	<a href="http://www.cjsc.com/">http://www.cjsc.com/</a>
安信证券股份有限公司	黄炎勋	深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元	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	长沙市天心区湘府中路198号新南城商务中心A栋11楼	长沙市天心区湘府中路198号新南城商务中心A栋11楼	95351	<a href="https://www.xcsc.com/">https://www.xcsc.com/</a>
民生证券股份有限公司	冯鹤年	中国(上海)自由贸易试验区浦明路8号	中国(上海)自由贸易试验区世纪大道1168号B座2101、2104A室	95376	<a href="https://www.msyzq.com/">https://www.msyzq.com/</a>

国元证券股份有限公司	俞仕新	安徽省合肥市蜀山区梅山路18号	安徽省合肥市蜀山区梅山路18号	95578	www.gyzq.com.cn
渤海证券股份有限公司	安志勇	天津经济技术开发区第二大街42号写字楼101室	天津市南开区水上公园东路东侧宁汇大厦A座	400-651-5988	http://www.ewww.com.cn/
华泰证券股份有限公司	张伟	江苏省南京市建邺区江东中路228号	江苏省南京市建邺区江东中路228号	86-25-83389999	www.htsc.com.cn
山西证券股份有限公司	王怡里	山西省太原市杏花岭区府西街69号山西国际贸易中心东塔楼	山西省太原市杏花岭区府西街69号山西国际贸易中心东塔楼	95573	www.sxzq.com
中信证券(山东)有限责任公司	姜晓林	青岛市崂山区深圳路222号1号楼2001	青岛市崂山区深圳路222号1号楼2001	95548	http://sd.citics.com/
东兴证券股份有限公司	魏庆华	北京市西城区金融大街5号(新盛大厦)12、15层	北京市西城区金融大街5号(新盛大厦)6、10、12、15、16层	95309	www.dxzq.net
东吴证券股份有限公司	范力	江苏省苏州市吴中区工业园区星阳街5号	江苏省苏州市吴中区工业园区星阳街5号	95330	http://www.dwzq.com.cn/
信达证券股份有限公司	肖林	北京市西城区闹市口大街9号院1号楼	北京市西城区闹市口大街9号院1号楼	95321	https://www.cindasc.com/
东方证券股份有限公司	金文忠	上海市黄浦区中山南路119号东方证券大厦	上海市黄浦区中山南路119号东方证券大厦,中国上海市黄浦区中山南路318号2号楼3-6层、12层、13层、22层、25-27层、29层、32层、36层、38层	95503	www.dfzq.com.cn
方正证券股份有限公司	施华	湖南省长沙市天心区湘江中路二段36号华远华中心4、5号楼3701-3717	湖南省长沙市天心区湘江中路二段36号华远华中心4、5号楼3701-3717	95571	www.foundersc.com
长城证券股份有限公司	张巍	广东省深圳市福田区福田街道金田路2026号能源大厦南塔楼10-19层	广东省深圳市福田区福田街道金田路2026号能源大厦南塔楼10-19层	95514	www.cgws.com
光大证券股份有限公司	刘秋明	上海市静安区新闻路1508号	上海市静安区新闻路1508号	86-21-22169914	www.ebscn.com
中信证券华南股份有限公司	胡伏云	广州市天河区临江大道395号901室(部位:自编01),1001室	广州市天河区珠江西路5号501房	95548	http://www.gzs.com.cn/
东北证券股份有限公司	李福春	吉林省长春市南关区生态大街6666号	吉林省长春市南关区生态大街6666号	86-431-85096806	www.nesc.cn
南京证券股份有限公司	李剑锋	南京市江东中路389号	南京市江东中路389号	95386	https://www.njzq.com.cn/
国联证券股份有限公司	葛小波	江苏省无锡市滨湖区金融一街8号	无锡市滨湖区金融一街8号国联金融大厦	95570	http://www.glsc.com.cn/
平安证券股份有限公司	何之江	深圳市福田区福田街道益田路5023号平安金融中心B座第22-25层	深圳市福田区福田街道益田路5023号平安金融中心B座第22-25层	电话 86-21-3863556 2,86-755-22627723	http://www.stock.pingan.com/
华安证券	章宏韬	安徽省合肥市政务文化新	安徽省合肥市政务文化新	95318	http://www.hazq.co

股份有限公司		区天鹅湖路 198 号	区天鹅湖路 198 号		m/
国海证券股份有限公司	何春梅	广西壮族自治区桂林市七星区辅星路 13 号	广西壮族自治区南宁市青秀区滨湖区 46 号国海大厦	86-771-5532512	www.ghzq.com.cn
东莞证券股份有限公司	陈照星	东莞市莞城区可园南路一号	东莞市莞城区可园南路一号	95328	www.dgzq.com.cn
中原证券股份有限公司	菅明军	河南省郑州市郑东新区商务外环路 10 号	河南省郑州市郑东新区商务外环路 10 号	95377	https://wt.ccnew.com/
国都证券股份有限公司	翁振杰	北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层	北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层	86-10-84183203	www.guodu.com
东海证券股份有限公司	钱俊文	江苏省常州市钟楼区延陵西路 23 路 23 号投资广场 18 层	江苏省号投资广场 18 层	95531	www.longone.com.cn
中银国际证券股份有限公司	宁敏	上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 39 层	上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 39 层	86-21-20328208	www.bocichina.com
恒泰证券股份有限公司	庞介民	内蒙古自治区呼和浩特市新城区海拉尔东街满世尚都办公商业综合楼	内蒙古自治区呼和浩特市新城区海拉尔东街满世尚都办公商业综合楼	956088	http://m.cnht.com.cn/
国盛证券有限责任公司	周军	江西省南昌市新建区子实路 1589 号	江西省南昌市红谷滩新区凤凰中大道 1115 号北京银行营业大楼 16 层	956080	https://www.gsyzq.com/
华西证券股份有限公司	杨炯洋	四川省成都市高新区天府二街 198 号	四川省成都市高新区天府二街 198 号	95584	http://www.hx168.com.cn/
申万宏源西部证券有限公司	王献军	新疆乌鲁木齐市高新区(新市区)北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼 2005 室	新疆乌鲁木齐市高新区(新市区)北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼 2005 室	95523	www.swhysc.com/
中泰证券股份有限公司	李峰	济南市市中区经七路 86 号	济南市市中区经七路 86 号	95538	https://www.zts.com.cn/
中航证券有限公司	丛中	江西省南昌市红谷滩新区红谷中大道 1619 号南昌国际金融大厦 A 栋 41 层	江西省南昌市红谷滩新区红谷中大道 1619 号南昌国际金融大厦 A 栋 41 层	95335	https://www.avicsec.com/
德邦证券股份有限公司	武晓春	上海市普陀区曹杨路 510 号南半幢 9 楼	上海市浦东新区福山路 500 号城建国际中心 29 楼	400-8888-128	https://www.tebon.com.cn/
西部证券股份有限公司	徐朝晖	陕西省西安市新城区东新街 319 号 8 幢 10000 室	陕西省西安市新城区东新街 319 号 8 幢 10000 室	95582	http://www.west95582.com/
华福证券有限责任公司	黄金琳	福建省福州市鼓楼区鼓屏路 27 号 1#楼 3 层、4 层、5 层	上海市浦东新区滨江大道 5129 号陆家嘴滨江中心 N1 座	95547	https://www.hfzq.com.cn/
中国国际金融股份有限公司	沈如军	北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层	北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层	(+86-10) 65051166	https://www.cicc.com/
财通证券股份有限公司	陆建强	浙江省杭州市西湖区天目山路 198 号财通双冠大厦西楼	浙江省杭州市西湖区天目山路 198 号财通双冠大厦西楼	95336	www.ctsec.com
华鑫证券有限责任公司	李军	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	注册地址 上海市浦东新区金海路 1000 号	400-109-9918	http://www.cfsc.com.cn/
中国中金	高涛	深圳市南山区粤海街道海	深圳市福田区益田路与福	95532	https://ww

财富证券有限公司		珠社区科苑南路2666号中国华润大厦 L4601-L4608	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		w.ciccwm.com/
东方财富证券股份有限公司	戴彦	西藏自治区拉萨市柳梧新区国际总部城 10 栋楼	上海市徐汇区宛平南路 88 号金座东方财富大厦	95357	www.18.cn
粤开证券股份有限公司	严亦斌	广东省广州市黄埔区经济技术开发区科学大道 60 号开发区金控中心 21、22、23 层	广东省广州市黄埔区经济技术开发区科学大道 60 号开发区金控中心 21、22、23 层	95564	http://www.ykzq.com/
九州证券股份有限公司	魏先锋	西宁市南川工业园区创业路 108 号	北京市朝阳区安立路 30 号仰山公园东一门 2 号楼	95305	http://www.jzsec.com/
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	86-28-86690021	https://www.gjzq.com.cn
爱建证券有限责任公司	祝健	中国(上海)自由贸易试验区世纪大道 1600 号 1 幢 32 楼	中国(上海)自由贸易试验区世纪大道 1600 号 1 幢 32 楼	4001-962-502	https://www.ajzq.com/
华融证券股份有限公司	张海文	北京市西城区金融大街 8 号	北京市朝阳区朝阳门北大街 18 号中国人保寿险大厦 12-18 层	95390	https://www.hrsec.com.cn/
财达证券股份有限公司	翟建强	石家庄市自强路 35 号	石家庄市自强路 35 号	95363	http://www.s10000.com/
华金证券股份有限公司	燕文波	上海市静安区天目西路 128 号 19 层 1902 室	中国(上海)自由贸易试验区杨高南路 759 号 30 层	956011	https://www.huajinsec.cn/
天相投资顾问有限公司	林义相	北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座	北京市西城区新街口外大街 28 号 C 座 505	(010) 66045678	http://www.txsec.com
和讯信息科技有限公司	章知方	北京市朝阳区朝外大街 22 号 1002 室	北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦 10 层	4009200022	http://licaike.hexun.com
厦门市鑫鼎盛控股有限公司	陈洪生	厦门市思明区鹭江道 2 号厦门第一广场西座 1501-1504 室	厦门市思明区鹭江道 2 号厦门第一广场西座 1501-1504 室	400-918-0808	http://www.xds.com.cn/
江苏汇林保大基金销售有限公司	吴言林	南京市高淳区经济开发区古檀大道 47 号	南京市鼓楼区中山北路 2 号绿地紫峰大厦 2005 室	025-66046166	www.huilind.com
上海挖财基金销售有限公司	吕柳霞	中国(上海)自由贸易试验区杨高南路 759 号 18 层 03 单元	中国(上海)自由贸易试验区杨高南路 759 号 18 层 03 单元	021-50810673	https://wacaijijin.com/
腾安基金销售(深圳)有限公司	林海峰	深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室	深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室	95017	www.tenganxinxi.com
民商基金销售(上海)有限公司	贵惠琴	上海市黄浦区北京东路 666 号 H 区(东座)6 楼 A31 室	上海市浦东新区张杨路 707 号生命人寿大厦 32 楼	021-50206003	www.msftcc.com
北京度小满基金销售有限公司	盛超	北京市海淀区西北旺东路 10 号院西区 4 号楼 1 层 103 室	北京市海淀区西北旺东路 10 号院西区 4 号楼 1 层 103 室	95055	www.duxiaomanfund.com
诺亚正行	汪静波	上海市虹口区飞虹路 360	上海市虹口区飞虹路 360	400-821-5399	http://ww

基金销售有限公司		弄 9 号 3724 室	弄 9 号 3724 室		w.noah-fund.com
深圳众禄基金销售股份有限公司	薛峰	深圳市罗湖区笋岗街道梨园路物资控股置地大厦 8 楼 801	深圳市罗湖区笋岗街道梨园路物资控股置地大厦 8 楼 801	4006-788-887	http://www.jjmmw.com
上海天天基金销售有限公司	其实	上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼 2 层	上海市徐汇区宛平南路 88 号金座东方财富大厦	95021	www.1234567.com.cn
上海好买基金销售有限公司	杨文斌	上海市虹口区东大名路 501 号 6211 单元	上海市浦东新区潍坊新村街道张杨路 500 号华润时代广场商务楼 10、11、12 和 14 楼	400-700-9665	http://www.chowbuy.com
蚂蚁(杭州)基金销售有限公司	王珺	浙江省杭州市余杭区五常街道文一西路 969 号 3 幢 5 层 599 室	浙江省杭州市西湖区西溪路 556 号蚂蚁 Z 空间	4000766123	www.fund123.cn
上海长量基金销售有限公司	张跃伟	浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室	上海市浦东新区东方路 1267 号陆家嘴金融服务广场二期 11 层	400-8202899	www.ericfund.com
浙江同花顺基金销售有限公司	吴强	浙江省杭州市文二西路 1 号元茂大厦 903 室	浙江省杭州市余杭区五常街道同顺街 18 号	952555	http://www.5ifund.com
泛华普益基金销售有限公司	于海峰	成都市成华区建设路 9 号高地中心 1101 室	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	北京市西城区宣武门外大街甲 1 号 4 层 401-2	西城区宣武门外大街甲 1 号环球财讯中心 D 座 4 层	400-6199059	www.hcfunds.com
北京广源达信基金销售有限公司	齐剑辉	北京市西城区新街口外大街 28 号 C 座六层 605 室	北京市西城区新街口外大街 28 号 C 座六层 605 室	4006236060	http://www.niuniufund.com
上海大智慧基金销售有限公司	申健	中国(上海)自由贸易试验区杨高南路 428 号 1 号楼 1102 单元	中国上海市浦东新区杨高南路 428 号 1 号楼 1102 单元	021-20219931	www.wg.com.cn
北京新浪仓石基金销售有限公司	穆飞虎	北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2 地块新浪总部科研楼 5 层 518 室	北京市海淀区西北旺东路 10 号院西区 8 号楼新浪总部大厦	010-62675369	http://www.xincai.com
上海基煜基金销售有限公司	王翔	上海市黄浦区广东路 500 号 30 层 3001 单元	上海市浦东新区银城中路 488 号太平金融大厦 1503 室	400-8205369	www.jiyufund.com.cn
上海陆金所基金销售有限公司	陈祎彬	上海市浦东新区平安财富大厦 7 楼	上海市浦东新区平安财富大厦 7 楼	400-821-9031	http://www.lufunds.com
珠海盈米基金销售有限公司	肖雯	珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室-3491(集中办公区)	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
中证金牛(北京)投资咨询有限公司	钱昊昊	北京市丰台区东管头 1 号 2 号楼 2-45 室	北京市西城区宣武门外大街甲 1 号环球财讯中心 A 座 5 层	010-59336544	http://www.jnlc.com/
京东肯特瑞基金销	邹保威	北京市海淀区知春路 76 号(写字楼)1 号楼 4 层 1-7-2	北京市通州区亦庄经济技术开发区科创十一街 18	95118	kenterui.jd.com

售有限公司			号院京东集团总部A座15层		
北京雪球基金销售有限公司	李楠	北京市朝阳区创远路34号院6号楼15层1501室	北京市融新科技园C座	400-1599288	<a href="https://danjufunds.com/">https://danjufunds.com/</a>
兴证期货有限公司	周峰	福州市鼓楼区温泉街道湖东路268号6层(兴业证券大厦)	福建省福州市鼓楼区温泉街道湖东路268号6层(兴业证券大厦)	95562-5	<a href="http://www.xyfutures.cn/">http://www.xyfutures.cn/</a>
中信期货有限公司	张皓	广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座13层1301-1305、14层	深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座13层1301-1305室、14层	400-990-8826	<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	海南省三亚市迎宾路360-1号三亚阳光金融广场16层	北京市朝阳区朝阳门外大街乙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	北京市西城区金融大街16号	北京市西城区金融大街16号	95515	<a href="http://www.e-chinalife.com">www.e-chinalife.com</a>

上述基金销售机构均已取得中国证监会办法的基金销售业务资格证书。

基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择其他符合要求的机构代理销售本基金。销售机构可以根据情况变化增加或者减少销售城市（网点），并在基金管理人网站公示。

## （二）注册登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

注册地址：北京市西城区太平桥大街17号

办公地址：北京市西城区太平桥大街17号

法定代表人：于文强

客服电话：4008-058-058

传真：010-58598907

联系人：任瑞新

## （三）出具法律意见书的律师事务所和经办律师

名称：上海源泰律师事务所

办公地址：上海市浦东南路256号华夏银行大厦14楼

负责人：廖海

电话：021-51150298

传真：021-51150398

经办律师：廖海、吕红



联系人：廖海

#### **(四) 审计基金资产的会计师事务所和经办注册会计师**

名称：毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）

办公地址：北京市东城区东长安街1号东方广场毕马威大楼8层

执行事务合伙人：邹俊

经办注册会计师：张楠、欧梦澂

电话：（021）2212 2888

传真：（021）6288 1889

联系人：张楠

## **六、基金的募集**

### **(一) 基金募集的依据**

本基金依据《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募集。本基金募集申请于2005年9月7日已获中国证监会证监基金字[2005]156号文核准。

### **(二) 基金类型及存续期**

本基金类别：混合型

运作方式：契约型上市开放式

存续期：不定期

### **(三) 基金募集情况**

本基金经中国证监会证监基金字[2005]156号文批准，由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关规定，自2005年9月19日起至2005年10月28日向全社会公开募集。经安永大华会计师事务所验资，截止2005年11月3日，募集期募集的基金份额及利息转份额共计927,645,098.72份，募集户数为6783户。

## 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 2005 年 11 月 3 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限制

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

## 八、基金份额的上市交易

本基金的日常交易包括上市交易和申购赎回两种方式。本章是有关基金的上市交易。

### （一）上市交易的地点：深圳证券交易所

### （二）上市交易的时间：2006 年 1 月 19 日

### （三）上市交易的规则

- 1、本基金上市首日的开盘参考价为前一交易日基金份额净值;
- 2、本基金实行价格涨跌幅限制,涨跌幅比例为 10%,自上市首日起实行;
- 3、本基金买入申报数量为 100 份或其整数倍;
- 4、本基金申报价格最小变动单位为 0.001 元人民币;
- 5、本基金上市交易遵循深圳证券交易所相关业务规则的规定。

### （四）上市交易的费用

本基金上市交易的费用比照封闭式基金的有关规定办理。

### （五）上市交易的行情揭示

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

## （六）上市交易的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市

本基金的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市按照深圳证券交易所的相关业务规则执行。

## 九、基金份额的申购、赎回

### （一）场内基金份额的申购与赎回

#### 1、申购与赎回办理的场所

有基金代销业务资格且符合深圳证券交易所风险控制要求的深圳证券交易所会员单位。（具体名单见深圳证券交易所相关公告）

#### 2、申购、赎回账户

投资人通过场内申购、赎回应使用中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司开立的人民币普通股票账户或证券投资基金账户。

#### 3、申购与赎回办理的开放日及开放时间

本基金自2006年1月19日起办理场内日常申购、赎回业务。

深圳证券交易所的工作日为本基金的场内申购赎回开放日。业务办理时间为深圳证券交易所交易时间。若上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日发生指数熔断且指数熔断至收市的，前述具体办理时间以基金管理人公告为准。

#### 4、申购与赎回的原则

（1）“未知价”原则，即基金的申购与赎回价格以受理申请当日收市后计算的基金份额净值为基准进行计算。

（2）基金采用金额申购和份额赎回的方式，即申购以金额申请，赎回以份额申请。申购申报单位为1元人民币，赎回申报单位为1份基金份额。

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

#### 5、申购费率与赎回费率

##### （1）申购费

投资者场内申购需缴纳申购费用。申购费率按申购金额采用比例费率，具体费率如下：

金额 (M, 含申购费)	申购费率
M < 50 万	1.5%
50 万 ≤ M < 100 万	1.0%
100 万 ≤ M < 1000 万	0.5%
M ≥ 1000 万	每笔 1000 元

## (2) 赎回费

本基金对持续持有期少于 7 日的投资者收取 1.5% 的赎回费, 其他情况下场内赎回费率统一为 0.5%。

## 6、申购份额、赎回金额的计算方式

本基金根据基金份额净值计算申购份额和赎回金额。

### (1) 申购份额的计算方法:

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

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

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

场内申购份额保留到整数位, 不足 1 份额对应的资金返还至投资人资金帐户。

例: 某投资人通过场内投资 10000 元申购本基金, 假设申购费率为 1.5%, 申购当日基金份额净值为 1.0250 元, 则其申购费用、可得到的申购份额及返还的资金余额为:

$$\text{申购费用} = 10000 - 10000 / (1 + 1.5\%) = 147.78 \text{ 元}$$

$$\text{净申购金额} = 10000 - 147.78 = 9852.22 \text{ 元}$$

$$\text{申购份额} = 9852.22 / 1.0250 = 9611.92 \text{ 份}$$

因场内份额保留至整数份, 故投资人申购所得份额为 9611 份, 不足 1 份部分对应的申购资金返还给投资人。

$$\text{实际净申购金额} = 9611 \times 1.025 = 9851.28 \text{ 元}$$

$$\text{退款金额} = 10000 - 9851.28 - 147.78 = 0.94 \text{ 元}$$

### (2) 赎回金额的计算方法

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

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

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

赎回金总额、净赎回金额按四舍五入的原则保留到小数点后两位。

例：某投资人赎回本基金 10000 份基金份额，持有时间为 10 个月，赎回费率为 0.5%，假设赎回当日基金份额净值为 1.0250 元，则其可得净赎回金额为：

赎回总金额 =  $10000 \times 1.0250 = 10250$  元

赎回费用 =  $10250 \times 0.0050 = 51.25$  元

净赎回金额 =  $10250 - 51.25 = 10198.75$  元

即投资人赎回 10000 份基金份额，假设赎回当日基金份额净值为 1.0250 元，则可得到 10198.75 元净赎回金额。

## 7、申购与赎回的登记结算

基金申购、赎回的登记结算按照中国证券登记结算有限责任公司的有关规定办理。

### (二) 场外基金份额的申购与赎回

#### 1、申购与赎回场所

(1) 本公司直销网点（见“五、相关服务机构”部分相关内容）；

(2) 经本公司委托，具有代销本基金资格的商业银行或其他机构的营业网点（见“五、相关服务机构”部分相关内容）；

(3) 本基金管理人同时考虑在适当的时候，投资人可通过基金管理人或指定基金代销机构进行电话、传真或网上等形式的申购、赎回，具体规则由基金管理人另行确定并公告。

#### 2、申购、赎回的开放日及办理时间

本基金自 2005 年 12 月 7 日起办理场外日常申购业务，自 2006 年 1 月 19 日起办理场外日常赎回业务。

基金开放日为投资人办理基金申购、赎回等业务的工作日，即上海证券交易所、深圳证券交易所的交易日。具体业务办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的交易时间。目前，上海证券交易所、深圳证券交易所的交易时间为交易日上午：9:30-11:30，下午 1:00-3:00。若出现新的证券交易市场或证券交易所交易时间更改或其他原因，基金管理人将视情况进行相应的调整并公告。若上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日发生指数熔断且指数熔断至收市的，前述具体办理时间以基金管理人公告为准。

投资者在《基金合同》约定的日期和时间之外提出申购、赎回申请的，其基金份额申购、赎回价格为下次办理基金份额申购、赎回时间所在开放日的价格。

### 3、申购、赎回的原则

(1) “未知价”原则，即申购、赎回价格以申请当日的基金份额净值为基准进行计算。

(2) “金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以持有的基金份额申请。

(3) 赎回遵循“先进先出”原则，即按照投资人申（认）购的先后次序进行顺序赎回。

(4) 当日的申购、赎回申请可以在基金管理人规定的时间以前撤销。

(5) 基金管理人在不损害基金份额持有人权益的情况下可更改上述原则。在变更上述原则时，基金管理人必须最迟在新规则实施日前3日内在至少一种中国证监会指定的报刊和网站上公告。

### 4、申购、赎回的程序

(1) 申请方式：书面申请或销售机构规定的其他方式。

(2) 投资人在提交申购基金的申请时，须按销售机构规定的方式备足申购资金；投资人在提交赎回申请时，账户中必须有足够的基金份额余额，否则所提交的申购、赎回的申请无效而不予成交。

(3) 申购、赎回的确认与通知：T日提交的有效申请，投资人可在T+2日到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。

(4) 申购、赎回款项的支付：基金申购采用全额缴款方式。

基金份额持有人赎回申请确认后，赎回款项在T+7日内支付。发生延期支付的情形时，款项和份额的支付办法参照基金合同的有关条款处理。

(5) T日的基金份额净值在当天收市后计算，并在T+1日内公告。遇特殊情况，可以适当延迟计算或公告，并报中国证监会备案。

(6) 在基金管理人直销中心（柜台）办理基金申购时，投资人以金额申请，每个账户首笔申购的最低金额为人民币100,000元（含申购费），每笔追加申购的最低金额为人民币100,000元（含申购费）。在基金管理人网上直销系统进行申购时，每个账户首笔申购的最低金额为人民币10元（含申购费），每笔追加申购的最低金额

为人民币10元（含申购费）；每个账户单笔最低定投申购金额（不开通定投的基金除外）为人民币10元（含申购费）。

基金份额持有人在基金管理人的直销中心（柜台）及网上直销系统办理赎回时，每笔赎回申请的最低份额、单笔最低转换转出为10份基金份额，全部赎回或全部转换出持有的基金份额不受最低份额限制。

除上述情况及另有公告外，基金管理人规定单个账户单笔首次最低申购金额为0.1元（含申购费），单笔最低定投申购金额（不开通定投的基金除外）为0.1元（含申购费），单个账户单笔最低追加申购金额为0.1元（含申购费），单个账户单笔最低转换转出份额为0.1份，单个账户单笔最低赎回份额为0.1份，最低账户保有份额为0.1份。

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。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。若销售机构对于某基金某类别份额规定了最低持有份额，当基金份额持有人的某笔份额减少申请导致该类别份额余额低于最低持有份额时，基金管理人将有权对余额部分基金份额强制赎回。

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。

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

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

在不违背有关法律法规和基金合同规定的前提下，基金管理人可根据市场情况调整申购与赎回的有关数额限制，基金管理人必须在调整前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

## 5、申购、赎回的费用

### (1) 申购费率

本基金的申购费用由基金份额持有人承担，不列入基金财产，用于基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

本基金场外申购提供两种申购费用的支付模式。投资人可以选择前端收费模式，即在申购时支付认购费用；也可以选择后端收费模式，即在赎回时才支付相应的申购费用，该费用随基金份额的持有时间而递减。

投资人选择交纳前端申购费用时，具体费率如下：

金额 (M, 含申购费)	前端申购费率
$M < 50$ 万	1.5%
$50 \text{ 万} \leq M < 100$ 万	1.0%
$100 \text{ 万} \leq M < 1000$ 万	0.5%
$M \geq 1000$ 万	每笔 1000 元

投资人选择交纳后端申购费用时，具体费率如下：

持有时间 (T)	后端申购费率
$T \leq 1$ 年	1.8%
$1 \text{ 年} < T \leq 2$ 年	1.0%
$2 \text{ 年} < T \leq 3$ 年	0.5%
$T > 3$ 年	0

### (2) 赎回费率

本基金的赎回费用由基金份额持有人承担，其中对持续持有期少于7日的投资者的赎回费全额计入基金财产，其他情况下赎回费用的75%用于注册登记费及相关手续费等，25%归入基金财产。

无论投资人场外认（申）购选择前端或后端认（申）购收费模式，赎回费率均随投资人持有本基金时间的增加而递减，具体费率如下表所示：

连续持有期限 (T)	赎回费率
$T < 7$ 日	1.50%
$7 \text{ 日} \leq T \leq 1$ 年	0.50%



1年<T≤2年	0.25%
T>2年	0

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

## 6、申购份额、赎回金额的计算方式

### (1) 基金申购份额的计算

如果投资者选择交纳前端申购费用，则申购份额的计算方法如下：

#### a、前端收费的计算

如果投资者选择交纳前端申购费，则申购份额的计算方法如下：

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

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

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

申购份额计算结果保留到小数点后两位，第三位四舍五入。

例：某投资者投资10000元申购本基金，申购费率为1.5%，假设申购当日基金份额净值为1.0500元，若其选择前端收费模式则：

$$\text{申购费用} = 10000 - 10000 / (1 + 1.5\%) = 147.78 \text{元}$$

$$\text{净申购金额} = 10000 - 147.78 = 9852.22 \text{元}$$

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

即投资者投资10000元申购本基金，假设申购当日基金份额净值为1.0500元，则可获得9383.07份基金份额。

#### b、后端收费的计算

如果投资者选择交纳后端申购费，当投资者提出申购时，申购份额的计算方法如下：

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

其在赎回时需根据其持有时间按适用的后端申购费率交纳后端申购费，当投资者提出赎回时，后端申购费用的计算方法为：

后端申购费用=赎回份额×申购当日基金份额净值×后端申购费率

申购份额计算结果保留到小数点后两位，第三位四舍五入。

例：某投资人申购本基金10000元，申购当日基金份额净值为1.05元，若其选择后端收费模式，则其获得的基金份额计算如下：

申购份额=10000/1.05=9523.81份

即投资人投资10000元申购本基金，若其选择后端收费模式，可得到9523.81份基金份额，假设其持有时间为1年半，适用的后端申购费率为1.0%，则在其赎回时需要交纳的后端申购费用为：

后端申购费用=9523.81×1.05×1.0%=100元。

## (2) 基金赎回金额的计算

### a、前端收费的计算

如果投资人在申购时选择前端收费模式，则赎回份额的计算方法如下：

赎回总额=赎回份额×赎回当日基金份额净值

赎回费用=赎回总额×赎回费率

赎回金额=赎回总额-赎回费用

赎回总金额、净赎回金额按四舍五入的原则保留到小数点后两位。

例：某投资人赎回本基金10000份基金份额，持有时间为1年半，适用的赎回费率为0.25%，其在申购期间已经交纳前端认购/申购费用，假设赎回当日基金份额净值为1.025元，则：

赎回总额=10000×1.025=10250元

赎回费用=10250×0.25%=25.63元

赎回金额=10250-25.63=10224.37元

即投资者赎回10000份基金份额，采用前端收费方式，可得到10224.37元赎回金额。

### b、后端收费的计算

如果投资人在申购时选择后端申购模式，则赎回份额的计算方法如下：

赎回总额=赎回份额×赎回当日基金份额净值

后端申购费用=赎回份额×申购当日基金份额净值×后端申购费率

赎回费用=赎回总额×赎回费率

赎回金额=赎回总额-后端申购费用-赎回费用

赎回金额单位为元，赎回金额按四舍五入保留到小数点后两位。

例：某投资人赎回本基金10000份基金份额，持有时间为1年半，适用的赎回费率为0.25%，假设申购当日基金份额净值为1.05元，赎回当日基金份额净值为1.25元，采用后端收费方式，则：

赎回总额=10000×1.25=12500元

后端申购费用=10000×1.05×1.0%=105元

赎回费用=12500×0.25%=31.25元

赎回金额=12500-105-31.25=12363.75元

即投资人赎回10000份基金份额，采用后端收费方式，可得到12363.75元赎回金额。

### (3) 基金份额净值的计算

基金份额净值等于当日基金资产净值除以基金总份额。

## 7、申购、赎回的注册登记

投资人申购基金成功后，基金注册登记机构在T+1日自动为投资人登记权益并办理注册登记手续，投资人在T+2日（含该日）后有权赎回该部分基金份额。投资人赎回本基金成功后，基金注册登记机构在T+1日自动为投资人扣除权益并办理注册登记手续。

基金管理人可以在法律法规允许的范围内，对上述注册登记办理时间进行调整，但不得实质影响投资者的合法权益，并最迟于开始实施前3个工作日在至少一种中国证监会指定的媒体上公告。

### (三) 拒绝或暂停申购、赎回的情形与处理

1、出现以下情况之一时，基金管理人可拒绝或暂停接受基金投资人的申购：

(1) 不可抗力；

(2) 证券交易所交易时间非正常停市或其他情形，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；

(3) 基金管理人认为市场缺乏合适的投资机会，继续接受申购和基金转换可能对已有基金份额持有人利益产生损害；

(4) 接受某一投资者申购申请后导致其份额达到或超过基金总份额50%以上

的；

(5) 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；

(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暂停接受基金申购申请的措施；

(7) 法律法规规定或中国证监会认定的其他暂停申购的情形；

(8) 基金管理人、基金托管人、基金销售代理人或基金注册登记人的技术保障和人员支持等不充分；

(9) 基金管理人认为会严重损害已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的其他申购。

发生上述(1)、(2)、(6)、(7)-(9)项暂停申购情形时,基金管理人应当在至少一种中国证监会指定的媒体上刊登暂停申购公告。

2、发生下列情形之一时,基金管理人可拒绝或暂停接受基金投资人的赎回：

(1) 不可抗力；

(2) 证券交易所交易时间非正常停市或其他情形,导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；

(3) 连续两个开放日发生巨额赎回；

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

(5) 法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形时,基金管理人应在当日向中国证监会备案,已确认的赎回,基金管理人将足额按时支付；如暂时不能足额支付,可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人,未支付部分可延期支付,在后续开放日予以支付,但不得超过正常支付时间20个工作日。

暂停期间,每两周至少刊登一次提示性公告。以上情形消除后,暂停期间结束,基金重新开放赎回业务时,基金管理人应公告最近一个工作日的基金份额净值。

#### (四) 巨额赎回的情形及处理

## 1、巨额赎回的认定

基金单个开放日，本基金净赎回申请（赎回申请总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过上一日本基金总份额的10%时，即认为发生了巨额赎回。

## 2、巨额赎回的处理

(1) 全额赎回：当基金管理人认为有能力兑付投资人的赎回申请时，按正常赎回程序执行。

(2) 顺延赎回：巨额赎回申请发生时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于本基金总份额的10%的前提下，可以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；赎回未受理部分可延迟至下一个开放日办理，但投资人可在申请赎回时选择将当日未获受理部分予以撤销。转入下一开放日的赎回申请不享有赎回优先权，并将以下一个开放日的本基金份额净值为基准计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。场内的赎回申请在遇到巨额赎回时不予办理延期赎回，当日未获受理部分予以撤销。

发生巨额赎回并延期支付时，基金管理人将通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式、在3个交易日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法。并在2日内在至少一种中国证监会指定的信息披露报刊和网站上公告。

(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）顺延赎回”的约定方式与其他基金份额持有人的赎回申请一并办理。对于该基金份额持有人超过前一开放日基金总份额40%以上的赎回申请进行延期，即与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。但是，如该持有人在提交赎回申请时选择取消赎回，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。如该持有人在提交赎回申请时未作明确选择，其未能赎回部分作自动延期赎回处理。对于场内赎回部分，当日未获受理的赎回申请将自动撤销而不会延至下一开放日办理。

(4) 基金连续两个开放日以上发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂

停接受赎回申请；已经确认的赎回申请可以延期支付赎回款项，但不得超过正常支付时间后的20个工作日，并应当在中国证监会指定的信息披露媒体上公告。

#### **(五) 其他暂停申购和赎回的情形及处理方式**

发生基金合同或招募说明书中未予载明的事项，但基金管理人无正当理由认为需要暂停基金申购、赎回申请的，应当报经中国证监会批准。基金管理人应当在至少一种中国证监会指定的媒体上刊登暂停公告。

#### **(六) 暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告**

发生上述暂停申购或赎回情况的，基金管理人应在2日内向中国证监会及规定的派出机构备案并在指定媒介上刊登暂停公告。

如果发生暂停的时间为一天，基金管理人应在第2个工作日在至少一种中国证监会指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个工作日的基金份额净值。

如果发生暂停的时间超过一天但少于两周，暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应在前3个工作日内在至少一种中国证监会指定媒介上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并在重新开放申购或赎回日公告最近1个工作日的基金份额净值。

如果发生暂停的时间超过两周，暂停期间，基金管理人应每两周至少重复刊登暂停公告一次；当连续暂停时间超过两个月时，可将重复刊登暂停公告的频率调整为每月一次。暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应在前3个工作日内在至少一种中国证监会指定媒介上连续刊登基金重新开放申购或赎回公告并在重新开放申购或赎回日公告最近1个工作日的基金份额净值。

#### **(七) 基金的非交易过户**

对于投资者深圳证券账户中的上市开放式基金份额（登记在深圳证券登记系统），若因遗产继承需要办理非交易过户业务，有关当事人可比照流通股或封闭式基金非交易过户的现有规定到中国结算深圳分公司业务柜台办理相关手续。

对于投资者开放式基金账户中的上市开放式基金份额（登记在TA系统），因继承、捐赠，以及其他原因需进行基金份额的转让，由有关当事人到中国结算公司业务柜台办理相关手续。

#### **(八) 基金的冻结**

注册登记人只受理国家有权机关依法要求的基金份额的冻结与解冻。基金份额被冻结的，被冻结部分产生的权益一并冻结。

### **(九) 基金转换**

基金管理人可以根据相关法律法规以及本基金合同的规定决定开办本基金与基金管理人管理的其他基金之间的转换业务，基金转换可以收取一定的转换费，相关规则由基金管理人届时根据相关法律法规及本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) 定期定额投资计划**

定期定额投资计划指投资者通过有关销售机构提出申请，约定每期扣款日、扣款金额及扣款方式，由销售机构于每期约定扣款日在投资者指定银行账户内自动完成扣款及基金申购申请的一种投资方式。基金管理人已于2006年8月4日开始可适时推出旗下部分基金定期定额投资计划，具体规则详见由基金管理人于2006年8月4日在指定媒介刊登的《兴业基金管理有限公司关于旗下基金开办定期定额投资业务的公告》及相关公告。

### **(十一) 其他特殊交易**

在相关法律法规有明确规定的条件下，基金管理人还可办理除上述业务以外的其他特殊交易业务。

## **十、基金份额的登记、系统内转托管和跨系统转登记**

### **(一) 基金份额的登记**

1、本基金的份额采用分系统登记的原则。场外认购或申购买入的基金份额登记在注册登记系统持有人开放式基金帐户下；场内认购、申购或上市交易买入的基金份额登记在证券登记结算系统持有人证券帐户下。

2、登记在证券登记结算系统中的基金份额既可上市交易，也可直接申请赎回。

### **(二) 系统内转托管**

1、系统内转托管是指基金份额持有人将持有的基金份额在注册登记系统内不同销售机构（网点）之间或证券登记结算系统内不同会员单位（席位）之间进行转托管的行为。

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

3、基金份额登记在证券登记结算系统的基金份额持有人在变更办理上市交易的会员单位（席位）时，可办理已持有基金份额的系统内转托管。

### **（三）跨系统转登记**

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

2、场外选择后端收费模式的投资人不能跨系统转登记到场内。

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

## **十一、基金的投资**

### **（一）投资目标**

本基金为把握投资对象的明确趋势、实现最优化的风险调整后的投资收益的基金产品。具体而言：本基金管理人采用多维趋势分析系统来判断投资对象的综合趋势，并采取适度灵活资产配置的方法，来实现以下目标：

- 1、把握中长期可测的确定收益，同时增加投资组合收益的确定性和稳定性；
- 2、分享中国上市公司高速增长带来的资本增值；
- 3、减少决策的失误率，实现最优化的风险调整后的投资收益。

### **（二）投资对象和投资范围**

#### **1、投资对象**

根据法律法规的规定，本基金的投资范围为在中华人民共和国境内依法发行上市交易的股票及存托凭证和固定收益证券（包括各种债券和货币市场工具）以及中国证监会规定的其他证券品种和法律法规允许的金融工具。具体投资对象将根据多维趋势分析系统来确定。

#### **2、投资范围**

在大类资产配置层面，本基金的配置比例为：固定收益类证券的投资比重为 0%—65%，股票的投资比重为 30%—95%；现金或者到期日在一年以内的政府债券不



低于5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。法律法规另有规定时，从其规定。

本基金投资组合至少将拒绝下列股票：

- 1) 存在终止上市风险或者已终止上市的公司；
- 2) 卷入严重法律纠纷，且诉讼未决的；
- 3) 信息披露严重不规范、不透明的；
- 4) 财务数据存在明显疑问的。

### **(三) 投资策略与投资组合构建**

本基金的投资策略主要体现在资产配置和单个投资品种选择两个层面。本基金总体的投资策略可以被概括为：根据对股市趋势分析的结论实施灵活的大类资产配置；运用兴全多维趋势分析系统，对公司成长趋势、行业景气趋势和价格趋势进行分析，并运用估值把关来精选个股。在固定收益类证券投资方面，本基金主要运用“兴全固定收益证券组合优化模型”，在固定收益资产组合久期控制的条件下追求最高的投资收益率。

兴全多维趋势分析系统（IMTAS）简介

#### **1、趋势分析系统的本质与作用**

事物都是相互联系、因果互动的。同样证券市场涨跌都有特定的因素在推动它。多维趋势分析系统就是分析投资对象涨跌因果关系与未来价格趋势的决策分析系统。该系统特别注重从多个趋势角度印证趋势分析结果的有效性。

#### **2、趋势分析的前提假设**

“兴全趋势分析系统”是本基金趋势投资和趋势预测的主要依据。建立多维趋势预测系统是基于下列影响有价证券价格波动因素的前提假设：

第一，从外部的因素分析，股票价格波动取决于证券市场整体发展趋势以及所在行业趋势的变化。证券市场中能够长时间与市场或行业发展趋势逆向而行的股票很少。

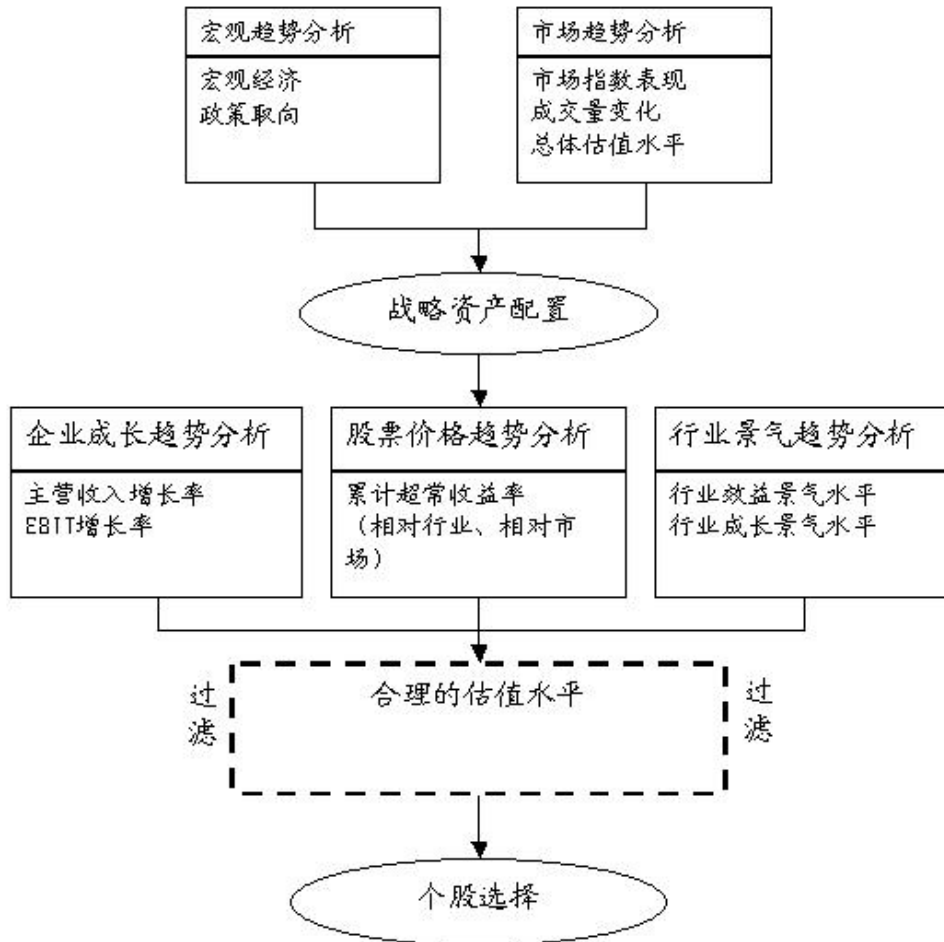
第二，从内部因素分析，投资对象价格变化取决于公司基本面及其自身估值水平。

第三，价格趋势是综合趋势的重要组成部分，是对部分未知或者隐含信息的提示，能够作为提醒投资机会与投资错误的依据。

### 3、兴全多维趋势分析系统的结构

兴全多维趋势分析系统（industrial multiple trend analysis system）的结构是按照投资对象由上至下分类，通过股市趋势分析来确定大类资产配置；根据公司成长趋势、行业景气趋势和价格趋势分析，并运用估值把关来精选个股。

兴全趋势分析系统的结构图



#### (四) 投资限制

本基金的投资限制：

- 1、本基金投资于一家上市公司股票，其市值不超过该基金资产净值的10%；
- 2、本基金与由本基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券总和不超过该证券的10%；
- 3、本基金参与股票发行申购所申报的金额不得超过本基金的总资产，所申报的股票数量不得超过拟发行股票公司本次的股票发售总量；

4、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；

5、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%；

6、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；

7、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；

8、不违反基金合同中对投资比例、投资策略等的约定；

9、中国证监会规定的其他比例限制。

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

除上述第4、6项外，因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合上述比例规定的，基金管理人可以在10个交易日内进行调整，以使基金投资符合上述规定。法律法规或中国证监会对上述比例另有规定时，从其规定。

#### **(五) 本基金的建仓期**

本基金的建仓期为本基金合同生效之日起最迟不超过6个月。

#### **(六) 业绩比较基准**

本基金的业绩比较基准： $\text{沪深300指数} \times 50\% + \text{中证国债指数} \times 45\% + \text{同业存款利率} \times 5\%$

本基金采用沪深300指数作为股票投资部分的业绩比较基准主要是因为沪深300指数选取了A股市场上规模最大、流动性最好的300只股票作为其成份股，对沪深市场的覆盖度高，具有良好的市场代表性。中证国债指数是一个全面反映国债

市场（包括银行间、上交所、深交所）的综合性指数，也是债券品种中比较基准的参考。基于本基金的股票、债券和现金比例，选用该业绩比较基准能够忠实反映本基金的风险收益特征。

如果市场推出更具权威、且更能够表征本基金风险收益特征的指数，则本基金管理人将视情况调整本基金的业绩评价基准，并及时公告。

### **（七）风险收益特征**

本基金的投资理念是“顺势而为”，只有当趋势确定，而且是各种趋势得到相互印证后，才采取相应的投资行动，尽可能地降低投资失误的可能性，加强组合收益的确定性。因此本基金在混合型基金大类中属于强调控制风险，中高风险，中高回报的基金产品。

### **（八）投资程序**

基金投资组合的管理采用投资决策委员会领导下的基金经理负责制。基金的资产配置和行业配置采用自上而下的程序，个股选择采用自下而上的程序，严格控制投资风险。以下是投资决策的各个具体环节。

#### **1、战略性（大类）资产配置决策**

投资决策委员会将定期或根据需要召开会议，审议宏观研究员与基金经理根据股市趋势的分析结论，确定今后一段时间内资产配置策略，即基金投资组合中股票和其他金融品种的构成比例。基金经理执行审定后的资产配置计划。

#### **2、行业资产配置决策**

首先，研究部对各行业进行趋势定位，投资决策委员会根据各行业趋势定位的结论，并在行业配置的规定范围之内初步决定今后一段时间内对一些行业的配置比例；

其次，基金经理可以适当调整投资决策委员会提出的初步行业配置权重，但对投资决策委员会决定的权重调整不得高于 20%，且不得超越本基金合同规定的行业配置比例；

第三，投资决策委员会建立严格的考核程序对基金经理主动调整行业权重的合理性进行考核，并根据考核结果在不超过前条所述的权重调整幅度内具体确定基金经理对行业权重进行调整的权限。

#### **3、股票投资组合决策**

基金经理根据投资决策委员会关于大类资产配置和行业资产配置的决议，并根据个股趋势定位自主选择投资对象和投资时机，对超过权限范围的投资计划调整及时报告投资总监或投资决策委员会审议。

研究员保持对组合内上市公司的定期跟踪与调研，并每周向基金经理部反馈上市公司的最新动态和个股的趋势变化，以利于基金经理作出相应的投资决策。

#### 股票选择模型：兴全多维趋势分析系统 IMTAS

“兴全多维趋势分析系统”（industrial multiple trend analysis system）是本基金趋势投资和趋势预测的主要依据。兴全多维趋势分析系统的结构是按照投资对象由上至下分类，通过股市趋势分析来确定大类资产配置；根据公司成长趋势、行业景气趋势和价格趋势分析，并运用估值把关来精选个股。

#### 股票选择标准

成长性趋势选股标准。公司成长性趋势是反映上市公司综合趋势的主要因素之一。本基金选用标准化的息税前利润 EBIT 增长率与标准化的主营收入增长率两项指标来反映上市公司的相对增长率指标。凡是 EBIT 增长率或主营收入增长率增长处于行业内前 1/3 的公司都将作为成长趋势良好的公司入选一级基础股票库。本基金计算公司成长趋势指标的时间区间为每年中期和末期向前追溯 1 年。

股票价格趋势选股标准。股票价格趋势指标是不可忽略的一项趋势指标。这是因为投资人观察市场的视角永远是十分有限的，市场的变化永远领先于投资人对市场的认识。而价格指数经常可以有效提示投资机会或风险。本基金将相对涨跌幅度（ $RI$ ）作为判断价格变化趋势的指标，并主要选取经过标准化后的相对分类的  $RI$  和相对股票市场的  $RI$  来判别价格变化趋势。具体计算如下：

➤ 相对分类的  $RI = (\text{个股的涨跌幅度} / \text{行业的涨跌幅度}) / \sigma$

➤ 相对股票市场的  $RI = (\text{个股涨跌幅度} / \text{股指的涨跌幅度}) / \sigma$

凡是相对分类的  $RI$  或相对股票市场的  $RI$  处于行业内前 1/3 的公司都将作为价格趋势良好的公司入选一级基础股票库。本基金目前计算公司成长趋势指标的时间区间为 3 个月。

行业景气趋势选股标准。景气度也称之为景气指数，是用于综合反映某一特定调查群体或某一社会经济现象所处的状态与发展趋势的一种指标。本基金以权威机构国务院发展研究中心定期颁布的《中国产业发展景气报告》、《月度景气分析报

告》、《深度行业研究报告》，以及《行业预测报告》为依据，主要来评价各行业以及宏观经济的景气度状况。行业景气水平分通过行业增长景气水平与效益景气水平两维进行衡量。凡是行业增长景气水平与效益景气水平都处于适中以上的上市公司自动入选一级基础股票库。

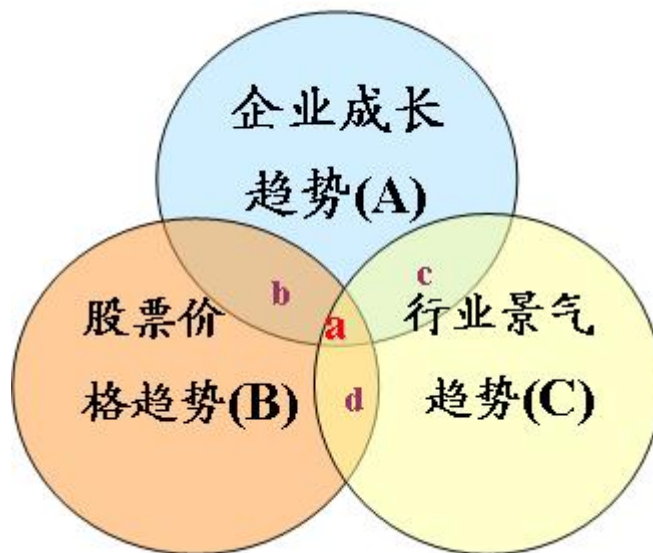
#### 1) 一级基础股票库

一级基础股票库的集合为根据上述三种趋势选股标准所选择出来的个股的集合。即凡是 EBIT 增长率或主营收入增长率增长处于行业内前 1/3 的公司，和凡是相对分类的  $RI$  或相对股票市场的  $RI$  处于行业内前 1/3 的公司，或者行业增长景气水平与效益景气水平都处于适中以上的上市公司的集合。以上文字表述可以体现为下图中区域 A、区域 B 和区域 C 的总合。

#### 2) 二级基础股票库

二级基础股票库的形成将主要依据趋势相互印证的理念。文字表述为至少符合两种趋势要求的股票将入选二级股票备选库。以上文字表述可以体现为下图中区域 b、区域 c 和区域 d 的总合。

图：趋势投资基金股票库构成示意图



图中：

- 区域 A 表示符合企业成长趋势的股票集合；
- 区域 B 表示符合价格趋势的股票集合；
- 区域 C 表示符合行业景气趋势的股票集合；

- 区域 b 为 A 与 B 的交集；
- 区域 c 为 A 与 C 的交集；
- 区域 d 为 B 与 C 的交集；
- 区域 a 为 A、B、C 的交集。

### 3) 股票备选库

在通过趋势定位形成股票基础库的基础上，本基金将通过估值分析来判断在当前价格水平下的投资品种是否具有吸引力，以作为构建股票备选库的依据。

上市公司的估值水平具有相对合理性的特点，即在不同状态下的估值水平对价值判断的指导意义是不同的。因此，本基金不苛求股票价格的绝对低估，强调估值水平的合理性，凡不高于合理估值标准的股票均可入选备选库。本基金主要估值指标主要选取相对指标，包括 PE、PB、PS 等指标从以下方面来把握估值的合理性：

- 相对于市场整体估值水平是否合理；
- 相对于同行业中其他公司估值水平是否合理。
- 相对于国际上同类公司估值水平是否合理。

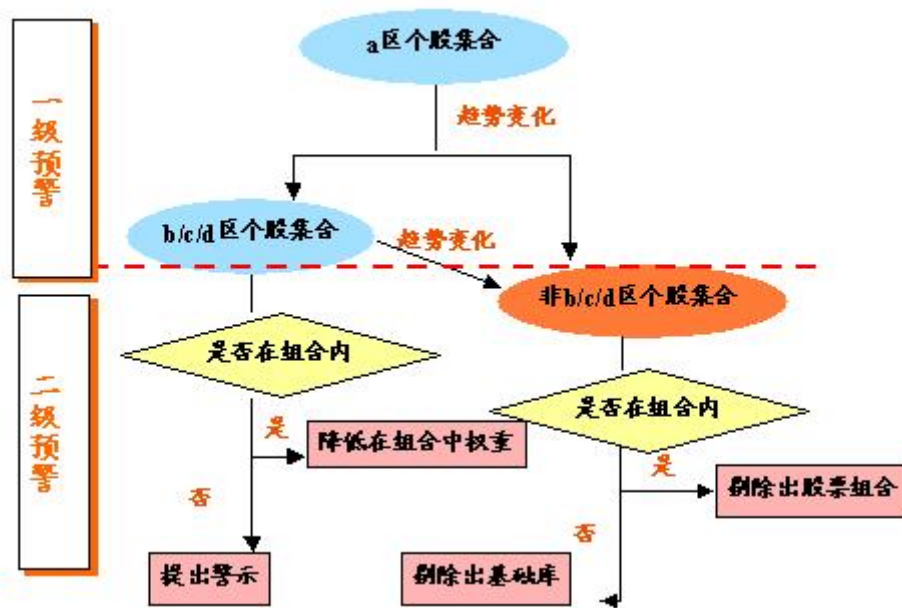
#### (1) 股票组合调整

研究部对股票备选库中的个股采用实地调研等方式进行广泛和深入的研究，形成研究报告，并进行投资论证。基金经理根据研究策划部的投资建议并结合证券市场的股票走势和投资时机，最终确定所要投资的个股。

鉴于上市公司股票价格变化、财务数据变化、所处行业景气状况的变化以及研究员与基金经理的调研信息和价值判断都将直接影响到本基金的股票库与股票组合的调整，因此本基金建立了股票组合预警系统以确保组合调整的及时性。

该系统分为两级预警系统。第一级为二级基础库中的最优部分即 a 区股票滑入 b、c、d 区。第二级预警为二级基础库中个股的即 b、c、d 区滑出 b、c、d 区。

根据本基金的二级预警系统，公司各级股票库将实时刷新，及时提醒各种趋势发生变化的个股，从而达到及时调整投资组合，规避投资风险的目的。



#### 4、存托凭证投资决策

对于存托凭证投资，依照上述上市交易的股票组合投资决策执行。

#### 5、债券投资组合决策

基金经理在投资决策委员会确定的债券组合久期和投资原则之下，运用“兴全固定收益证券组合优化模型”对中、长、短期的固定收益品种组合进行优化配置，建立债券投资组合。

#### 6、投资指令的下达与执行及反馈

基金经理根据投资组合方案制订具体的操作计划，并以投资指令的形式下达至交易部。交易部依据投资指令具体执行股票和债券买卖操作，并将指令的执行情况反馈给基金经理并提供建议，以便基金经理及时调整交易策略。

#### 7、基金业绩与风险评估

由 FOF 投资与金融工程部负责定期对基金投资组合进行投资绩效评估，研究在一段时期内基金投资组合的变化及由此带来的收益与损失，并对基金业绩进行有效分解，以便能更好地评估资产配置、行业配置、个股选择各自对基金业绩的贡献度。同时，FOF 投资与金融工程部还必须对基金资产组合的投资风险进行客观的评价，在此基础上对基金经风险调整后的业绩进行评估。FOF 投资与金融工程部定期向投资决策委员会和基金经理提供绩效评估报告，以便及时调整基金投资组合。

### (九) 基金的禁止行为



本基金禁止从事下列行为：

- 1、承销证券；
  - 2、向他人贷款或者提供担保；
  - 3、从事承担无限责任的投资；
  - 4、买卖其他基金份额，但是国务院另有规定的除外；
  - 5、向其基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券，法律法规另有规定的除外；
  - 6、买卖与其基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与其基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，法律法规另有规定的除外；
  - 7、从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
  - 8、依照法律、行政法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他活动。
- 法律法规另有规定的，从其规定。

#### （十）基金管理人代表基金行使股东权利的原则及方法

基金管理人将按照国家有关规定代表基金独立行使股东权利，保护基金份额持有人的利益。基金管理人在代表基金行使股东或债权人权利时应遵守以下原则：

- 1、不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司或发债公司的经营管理；
- 2、有利于基金财产的安全与增值，有利于保护基金份额持有人的合法权益。

#### （十一）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。

本基金的托管人兴业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趋势投资混合型证券投资基金（LOF）2022年第1季度报告，数据截至2022年3月31日，本报告所列财务数据未经审计。

#### 1、报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	21,770,095,686.76	89.66

	其中：股票	21,770,095,686.76	89.66
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	821,825.36	0.00
	其中：债券	821,825.36	0.00
	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	2,488,441,205.76	10.25
8	其他资产	21,361,690.02	0.09
9	合计	24,280,720,407.90	100.00

## 2、报告期末按行业分类的股票投资组合

### (1) 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	23,655,240.00	0.10
C	制造业	10,589,324,067.04	43.82
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,107,989,365.41	12.86
E	建筑业	1,060,093,904.30	4.39
F	批发和零售业	353,377,140.08	1.46
G	交通运输、仓储和邮政业	98,503,490.10	0.41
H	住宿和餐饮业	194,781,840.00	0.81
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,589,749,143.31	6.58
J	金融业	15,120,085.00	0.06
K	房地产业	3,795,702,712.12	15.71
L	租赁和商务服务业	35,060,121.00	0.15
M	科学研究和技术服务业	29,003,475.56	0.12
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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	877,735,102.84	3.63
S	综合	-	-

合计	21,770,095,686.76	90.10
----	-------------------	-------

(2) 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

3、期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

(1) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600048	保利发展	140,977,404	2,495,300,050.80	10.33
2	601985	中国核电	203,827,802	1,653,043,474.22	6.84
3	600011	华能国际	166,051,848	1,147,418,269.68	4.75
4	002138	顺络电子	39,850,334	1,018,574,537.04	4.22
5	002049	紫光国微	4,818,413	985,558,195.02	4.08
6	600745	闻泰科技	11,481,372	933,435,543.60	3.86
7	300413	芒果超媒	28,168,649	877,735,102.84	3.63
8	600703	三安光电	30,237,649	719,051,293.22	2.98
9	002230	科大讯飞	13,899,738	647,310,798.66	2.68
10	300769	德方纳米	1,088,692	619,139,140.40	2.56

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	821,825.36	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	821,825.36	0.00

5、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113053	隆22转债	6,710	821,825.36	0.00

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

**7、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细**  
贵金属暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

**8、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细**  
本基金本报告期末未持有权证。

**9、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**

**(1) 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**  
股指期货暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

**(2) 本基金投资股指期货的投资政策**

股指期货暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

**10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

**(1) 本期国债期货投资政策**

国债期货暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

**(2) 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细**

本基金本报告期末未持有国债期货。

**(3) 本期国债期货投资评价**

国债期货暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

**11、投资组合报告附注**

**(1) 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形**

本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，并且未在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

**(2) 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库**

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

**(3) 其他资产构成**

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	5,255,558.29
2	应收证券清算款	6,752,546.47
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	9,353,585.26
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	21,361,690.02

**(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

本基金本报告期末未持有处于转股期的可交换债券。

**(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限的情况。

**(6) 投资组合报告附注的其他文字描述部分**

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## 十二、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2005年11月3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**

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	-18.03%	1.51%	-7.15%	0.74%	-10.88%	0.77%
2021年度	3.74%	0.98%	0.38%	0.59%	3.36%	0.39%
2020年度	48.00%	1.31%	14.92%	0.70%	33.08%	0.61%
2019年度	42.69%	1.11%	19.53%	0.61%	23.16%	0.50%
2018年度	-17.64%	1.23%	-9.74%	0.66%	-7.90%	0.57%
2017年度	25.29%	0.66%	9.60%	0.32%	15.69%	0.34%
2016年度	-1.78%	0.99%	-4.12%	0.71%	2.34%	0.28%
2015年度	43.07%	1.60%	7.67%	1.22%	35.40%	0.38%
2014年度	36.41%	0.91%	25.87%	0.59%	10.54%	0.32%
2013年度	8.00%	1.03%	-1.76%	0.69%	9.76%	0.34%
2012年度	5.47%	0.87%	5.62%	0.62%	-0.15%	0.25%
自基金合同成	2,068.25%	1.21%	236.20%	0.83%	1,832.05%	0.38%

立起至2022年3 月31日						
-------------------	--	--	--	--	--	--

### 十三、基金的财产

#### (一) 基金资产总值

基金资产总值是指运用基金募集资金购买的各类有价证券、银行存款本息和基金应收的申购基金款以及其他投资形成的价值总和。

#### (二) 基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值，包括有价证券、银行存款本息、应收款项以及待摊费用等。

#### (三) 基金财产的账户

本基金以基金托管人的名义开立基金托管专户和证券交易资金结算账户用于基金的资金结算业务，并以基金托管人和基金联名的方式开立基金证券账户、以基金的名义开立银行间债券托管账户，并报中国证监会备案。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注册登记人自有的资产账户以及其他基金财产账户相独立。

#### (四) 基金财产的保管与处分

1、基金财产独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。基金管理人、基金托管人不得将基金财产归入其固有财产。

2、基金管理人、基金托管人因基金财产的管理、运用或者其他情形而取得的财产和收益，归入基金财产。

3、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。

4、基金财产的债权，不得与基金管理人、基金托管人固有财产的债务相抵销；不同基金财产的债权债务，不得相互抵销。

5、非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。

6、除依据法律法规、基金合同及其他有关规定处分外，基金财产不得被处分。

## 十四、基金资产的估值

### （一）估值日

本基金的估值日为相关证券交易场所的正常交易日。

### （二）估值方法

#### 1、股票估值方法：

（1）上市流通的股票，按估值日其在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化的，以最近交易日的收盘价估值；估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。如有充足证据表明最近交易日收盘价不能真实地反映公允价值的，应对最近交易日的收盘价进行调整，确定公允价值进行估值。

2008年9月16日，本基金管理人发布《兴全基金管理有限公司关于长期停牌股票等没有市价的投资品种估值问题的公告》，本基金自2008年9月16日起，采取指数收益法对长期停牌股票等没有市价的投资品种进行估值，若未来市场环境发生变化，本基金管理人也可采用其他合理的估值方法进行估值。

#### （2）未上市股票的估值：

（a）送股、转增股、配股和公开增发新股等发行未上市股票，按估值日其在证券交易所挂牌的同一股票的以第（1）条确定的估值价格进行估值。

（b）首次发行未上市的股票，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，按成本计量。

（c）首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按估值日其所在证券交易所上市的同一股票的以第（1）条确定的估值价格进行估值。

（d）非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定的公允价值进行估值。

#### （3）国家有最新规定的，按其规定进行估值。

## 2、债券估值办法：

(1) 证券交易所市场实行净价交易的债券按估值日收盘价估值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化的，以最近交易日的收盘价估值；估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。如有充足证据表明最近交易日收盘价不能真实地反映公允价值的，应对最近交易日的收盘价进行调整，确定公允价值进行估值。

(2) 证券交易所市场未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化的，按最近交易日债券收盘价减去所含的最近交易日债券应收利息后的净价进行估值；估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价（净价）及重大变化因素，调整最近交易日收盘价（净价），确定公允价值进行估值。如有充足证据表明最近交易日收盘价（净价）不能真实地反映公允价值的，应对最近交易日的收盘价(净价)进行调整，确定公允价值进行估值。

(3) 首次发行未上市债券采用估值技术确定的公允价值进行估值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本计量。

(4) 在全国银行间债券市场交易的债券，采用估值技术确定其公允价值进行估值。

(5) 同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

(6) 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

## 3、权证估值方法

(1) 交易所上市的权证，按估值日其在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化的，以最近交易日的收盘价估值；估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。如有充足证据表明最近交易日收盘价不能真实地反映公允价值的，应对最近交易日的收盘价进行调整，确定公允价值进行估值。

(2) 首次发行未上市的权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可



靠计量公允价值的情况下，按成本计量。

(3) 停止交易、但未行权的权证，采用估值技术确定公允价值进行估值。

(4) 因持有股票而享有的配股权证，以配股除权日起到配股确认日止，若收盘价高于配股价，则按收盘价和配股价的差额进行估值，若收盘价低于配股价，则估值为零。

(5) 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

#### 4、资产支持证券的估值方法

(1) 交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券，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，按成本进行后续计量。

(2) 全国银行间市场交易的资产支持证券，采用估值技术确定其公允价值进行估值。

(3) 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

#### 5、本基金投资存托凭证的估值核算，依照境内上市交易的股票执行。

6、如有充足理由表明按上述规定不能客观反映相关投资品种的公允价值的，基金管理人应根据具体情况，在与基金托管人商议后，按最能恰当反映其公允价值的方法估值。即使存在上述情况，基金管理人若采用上述股票估值方法和债券估值方法的规定方法为基金资产进行了估值，仍应被认为采用了适当的估值方法。

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

### (三) 估值对象

本基金所拥有的股票、债券、股息红利、债券利息和银行存款本息以及权证等其他资产。

### (四) 估值程序

基金日常估值由基金管理人进行。用于公开披露的基金资产估值由基金管理人完成估值后，将估值结果加盖业务公章以书面形式报告给基金托管人，基金托管人按照本基金合同、托管协议规定的估值方法、时间与程序进行复核，基金托管人复核无误后签字返回给基金管理人；月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

### (五) 估值错误的确认及处理方式

1、基金份额净值的计算精确到 0.0001 元，小数点后第五位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

2、经基金管理人计算并经基金托管人复核后，基金管理人和基金托管人应采取必要、适当、合理的措施确保基金财产估值的准确性和及时性。

3、当基金份额净值计价出现错误时，基金管理人应当立即公告、予以纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大。当错误偏差达到或超过基金资产净值的 0.25% 时，基金管理人应报中国证监会备案；当错误偏差达到基金份额净值的 0.5% 时，基金管理人应当公告，并报中国证监会备案。

#### 4、差错类型

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

上述差错的主要类型包括但不限于：资料申报差错、数据传输差错、数据计算差错、系统故障差错、下达指令差错等；对于因技术原因引起的差错，若系同行业现有技术水平无法预见、无法避免、无法抗拒，则属不可抗力。

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

#### 5、差错处理原则

因基金估值错误给投资人造成损失的，基金管理人和基金托管人应当分别对各自的行为承担赔偿责任；因共同行为给基金财产或者基金份额持有人造成损害的，基金管理人和基金托管人应当承担连带赔偿责任。没有过错的一方承担了赔偿责任的，有权根据过错原则，向过错人追偿，本基金合同的当事人应按照以下约定处理：

(1) 差错已发生，但尚未给当事人造成损失时，差错责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正差错发生的费用由差错责任方承担；由于差错责任方未及时更正已产生的差错，给当事人造成损失的由差错责任方承担；若差错责任方已经积极协调，并且有协助义务的当事人有足够的时间进行更正而未更正，则其应当承担相应赔偿责任。差错责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认，确保差错已得

到更正。

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

(3) 因差错而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但差错责任方仍应对差错负责, 如果由于获得不当得利的当事人不返还或不全部返还不当得利造成其他当事人的利益损失 (“受损方”), 则差错责任方应赔偿受损方的损失, 并在其支付的赔偿金额的范围内对获得不当得利的当事人享有要求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差错责任方。

(4) 差错调整采用尽量恢复至假设未发生差错的正确情形的方式。

(5) 如果因基金管理人过错造成基金资产损失时, 基金托管人应为基金的利益向基金管理人追偿, 如果因基金托管人过错造成基金资产损失时, 基金管理人应为基金的利益向基金托管人追偿。除基金管理人和托管人之外的第三方造成基金资产的损失, 由基金管理人负责向差错方追偿。

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

(7) 按法律法规规定的其他原则处理差错。

## 6、差错处理程序

差错被发现后, 有关的当事人应当及时进行处理, 处理的程序如下:

(1) 查明差错发生的原因, 列明所有当事人, 根据差错发生的原因确定差错责任方;

(2) 根据差错处理原则或当事人协商的方法对因差错造成的损失进行评估;

(3) 根据差错处理原则或当事人协商的方法由差错的责任方进行更正和赔偿损失;

(4) 根据差错处理的方法, 需要修改注册登记人的交易数据的, 由注册登记人进行更正, 并就差错的更正向有关当事人进行确认;

(5)基金管理人及基金托管人基金资产净值计算错误偏差达到或超过基金资产净值的0.25%时,基金管理人应报中国证监会备案;错误偏差达到基金资产净值0.5%时,基金管理人应公告,并报中国证监会备案。

#### **(六) 暂停估值的情形及处理**

- 1、基金投资所涉及的证券交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时;
- 2、因其他任何不可抗力致使基金管理人无法准确评估基金财产价值时;
- 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、符合法律法规规定的其它情况。

#### **(七) 特殊情形的处理**

由于不可抗力原因,或由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误,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,由此造成的基金财产估值错误,基金管理人和基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

## **十五、基金的收益和分配**

#### **(一) 基金收益的构成**

- 1、买卖证券差价;
- 2、基金投资所得红利、股息、债券利息;
- 3、存款利息;
- 4、其他收入。

因运用基金财产带来的成本或费用的节约应计入收益。

#### **(二) 基金净收益**

基金净收益为基金收益扣除按照国家有关规定可以在基金收益中扣除的费用后的余额。

#### **(三) 基金收益分配原则**

- 1、在符合有关基金分红条件的前提下,基金收益每年至少分配一次,最多 6

次，基金每次收益分配比例最低不低于已实现收益的 60%，但若基金合同生效不满 3 个月则可不进行收益分配；

2、场外投资人可以选择现金分红或红利再投资（即基金份额持有人将所获分配的现金收益按照本基金合同有关基金份额申购的约定转为基金份额）；场内投资人只能选择现金分红；本基金分红的默认方式为现金分红；

3、基金当期收益应先弥补前期亏损后，才可进行当期收益分配；

4、每一基金份额享有同等分配权；

5、法律、法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### **（四）基金收益分配方案的确定与公告**

基金收益方案中应载明基金收益的范围、基金净收益、基金收益分配对象、分配原则、分配时间、分配数额及比例、分配方式、支付方式等内容。

本基金收益分配方案由基金管理人拟定，由基金托管人复核，在中国证监会指定媒介上公告。

#### **（五）基金收益分配中发生的费用**

1、 红利分配采用红利再投资方式的，免收申购费用。

2、收益分配时所发生的银行转帐或其他手续费用由基金份额持有人自行承担。

## **十六、基金的费用与税收**

### **（一）基金运作费用的种类**

1、基金管理人的管理费；

2、基金托管人的托管费；

3、基金的证券交易费用；

4、基金合同生效后的本基金信息披露费用；

5、基金合同生效后与本基金相关的会计师费和律师费；

6、基金份额持有人大会费用；

7、按照国家有关规定可以列支的其它费用。

### **（二）基金运作费用计提方法、计提标准和支付方式**

1、基金管理人的管理费

本基金管理费按基金前一日的基金资产净值的 1.5% 的年费率计提，具体计算方

法如下：

$$H=E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

H：为每日应计提的基金管理费；

E：为前一日基金财产净值。

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人按照基金管理人划款指令于次月前两个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

## 2、基金托管人的托管费

本基金的基金托管费按基金前一日的基金资产净值的 0.25% 的年费率计提，具体计算方法如下：

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

H：为每日应计提的基金托管费；

E：为前一日基金财产净值。

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人于次月的前两个工作日内从基金财产中一次性支取。

3、上述（一）3 至 7 项费用由基金托管人根据有关法规及相应协议的规定，按费用实际支出金额支付，列入当期基金费用，由基金托管人从基金财产中支付。基金合同生效前的验资费(会计师费)、律师费、信息披露费用从基金认购费用中列支。

4、经基金管理人与基金托管人协商一致，可以酌情调低基金管理费率及基金托管费率，并报中国证监会核准后公告，无须召开基金份额持有人大会通过。

## （三）与基金销售有关的费用

### 1、申购费

本基金的申购包括柜台（场外）申购和深圳证券交易所（场内）申购两种方式。投资人场外申购的申购费率按申购金额分段设定如下：

投资人选择交纳前端申购费用时，具体费率如下：

金额（M，含申购费）	前端申购费率
M < 50 万	1.5%
50 万 ≤ M < 100 万	1.0%
100 万 ≤ M < 1000 万	0.5%
M ≥ 1000 万	每笔 1000 元

投资人选择交纳后端申购费用时，具体费率如下：

持有时间 (T)	后端申购费率
$T \leq 1$ 年	1.8%
$1 \text{ 年} < T \leq 2$ 年	1.0%
$2 \text{ 年} < T \leq 3$ 年	0.5%
$T > 3$ 年	0

选择场内申购的只能选择交纳前端申购费用方式，投资人场内申购的申购费率由深圳证券交易所会员单位按照基金招募说明书中约定的场外申购的申购费率设定。

## 2、赎回费

投资人场外赎回的赎回费率按时间分段设定如下：

连续持有期限 (T)	赎回费率
$T < 7$ 日	1.50%
$7 \text{ 日} \leq T \leq 1$ 年	0.50%
$1 \text{ 年} < T \leq 2$ 年	0.25%
$T > 2$ 年	0

本基金对持续持有期少于 7 日的投资者收取 1.5% 的赎回费，其他情况下场内赎回的赎回费率统一为 0.5%。

说明：① 认购期持有期限起始日为基金合同生效日；申购期持有期限起始日为基金申购的注册登记日。持有期限的截止日为基金赎回的注册登记日。② 对持续持有期少于 7 日的投资者的赎回费全额计入基金财产，其他情况下赎回费用的 75% 用于注册登记费及相关手续费等，25% 归入基金财产。

3、基金转换费详见届时的基金转换公告。

## 4、申购赎回费率的调整

基金管理人可以在基金合同规定的范围内调整申购费用和赎回费用标准，调整后的申购费用和赎回费用标准在最新的招募说明书中列示。上述费用标准如发生变更，基金管理人最迟应于新的费用标准实施前 3 个工作日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

## 5、其他费用

其他基金费用根据有关法规及相关协议规定，按费用实际支出金额，列入当期费用，从基金财产中支付。基金合同生效前的验资费、律师费、基金合同、招募说明书、基金份额发售公告等信息披露费用由基金管理人承担。

#### **(四) 不列入基金费用的项目**

基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或本基金财产的损失，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金合同生效之前的验资费、律师费、会计师费和信息披露费用不得从基金财产中列支。

#### **(五) 基金税收**

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体应依据国家有关法律法规依法纳税。

## **十七、基金的会计与审计**

### **(一) 基金会计政策**

- 1、基金管理人为基金会计责任方；
- 2、基金的会计年度为公历每年1月1日至12月31日；
- 3、基金核算以人民币为记账本位币，记账单位是人民币元；
- 4、会计制度执行国家有关的会计制度；
- 5、各基金独立建账、独立核算；
- 6、基金管理人及基金托管人各自保留完整的基金会计帐目、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书面方式确认。

### **(二) 基金审计**

1、本基金管理人聘请与基金管理人和基金托管人相独立并具有证券、期货相关从业资格的会计师事务所及其注册会计师对基金年度财务报表进行审计。会计师事务所及其注册会计师与基金管理人、基金托管人相互独立，并具有从事证券、期货相关业务资格。

2、会计师事务所更换经办注册会计师，须事先征得基金管理人和基金托管人同意。



3、基金管理人（或基金托管人）认为有充足理由更换会计师事务所，须经基金托管人（或基金管理人）同意，在2日内编制完成更换会计师事务所的临时报告，并登载在指定报刊和指定网站上。

## 十八、基金的信息披露

### （一）基金信息披露的原则

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

### （二）信息披露义务人

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

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

基金信息披露义务人应当在中国证监会规定的时间内，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“指定报刊”）及指定互联网网站（以下简称“指定网站”）等媒介披露，并保证投资人能够按照基金合同约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。

### （三）本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息，不得有下列行为：

- 1、虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏；
- 2、对证券投资业绩进行预测；
- 3、违规承诺收益或者承担损失；
- 4、诋毁其他基金管理人、基金托管人或者基金销售机构；
- 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、基金募集申请经中国证监会核准后,基金管理人应当在基金份额发售的3日前,将招募说明书、基金合同摘要登载在指定报刊和网站上;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指定报刊和网站上。

3、基金管理人应当在基金合同生效的次日在指定报刊和网站上登载基金合同生效公告。

4、《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。

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指定网站上;基金招募说明书其他信息发生变更的,基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的,基金管理人不再更新基金招募说明书。

基金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。

#### 5、基金份额上市交易公告书

基金份额获准在证券交易所上市交易时,基金管理人应当在基金份额上市交易的3个工作日前,将基金份额上市交易公告书登载在指定报刊和网站上。

## 6、基金产品资料概要

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,并登载在指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。

## 7、定期报告

基金定期报告由基金管理人按照法律法规和中国证监会颁布的有关证券投资基金信息披露内容与格式的相关文件的规定编制,由基金托管人复核。基金定期报告与公告包括年度报告、中期报告、季度报告。

(1) 基金年度报告: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,将年度报告登载在指定网站上,并将年度报告提示性公告登载在指定报刊上。基金年度报告中的财务会计报告应当经过具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计。

(2) 基金中期报告: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,将中期报告登载在指定网站上,并将中期报告提示性公告登载在指定报刊上。

(3) 基金季度报告:基金管理人应当在每个季度结束之日起15个工作日内,编制完成基金季度报告,将季度报告登载在指定网站上,并将季度报告提示性公告登载在指定报刊上。

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

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

## 8、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指定网站披露一次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, 通过指定网站、基金销售机构网站或者营业网点披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。

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

#### 9、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。

#### 10、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, 并记载在指定报刊和指定网站上。

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

- (1) 基金份额持有人大会的召开及决定的事项;
- (2) 《基金合同》终止、基金清算、基金终止上市交易;
- (3) 转换基金运作方式、基金合并;
- (4) 更换基金管理人、基金托管人、基金份额登记机构, 基金改聘会计师事务所;
- (5) 基金管理人委托基金服务机构代为办理基金的份额登记、核算、估值等事项, 基金托管人委托基金服务机构代为办理基金的核算、估值、复核等事项;
- (6) 基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更;
- (7) 基金管理人变更持有百分之五以上股权的股东、基金管理人的实际控制人变更;

(8) 基金募集期延长或提前结束募集；

(9) 基金管理人的高级管理人员、基金经理和基金托管人专门基金托管部门负责人发生变动；

(10) 基金管理人的董事在最近12个月内变更超过百分之五十，基金管理人、基金托管人专门基金托管部门的主要业务人员在最近12个月内变动超过百分之三十；

(11) 涉及基金财产、基金管理业务、基金托管业务的诉讼或仲裁；

(12) 基金管理人或其高级管理人员、基金经理因基金管理业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚，基金托管人或其专门基金托管部门负责人因基金托管业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚；

(13) 基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易事项，但中国证监会另有规定的除外；

(14) 基金收益分配事项；

(15) 管理费、托管费、申购费、赎回费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；

(16) 基金份额净值计价错误达基金份额净值百分之零点五；

(17) 本基金开始办理申购、赎回；

(18) 本基金发生巨额赎回并延期办理；

(19) 本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项；

(20) 本基金暂停接受申购、赎回申请或者重新接受申购、赎回申请；

(21) 发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时；

(22) 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。

## 11、澄清公告

在基金合同期限内,任何公共传播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引起较大波动，以及可能损害基金份额持有人权益的，相关的信息披露义务人知悉后应当立即对该消息进行公开澄清，并将有关情况立即报告中国证监会、基金上市交易的证券交易所。

#### 12、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。

#### 13、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指定网站上，并将清算报告提示性公告登载在指定报刊上。

#### 14、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律规定。

基金托管人应当按照相关法律法规、中国证监会的规定和《基金合同》的约定，对基金管理人编制的基金资产净值、基金份额净值、基金份额申购赎回价格、基金定期报告、更新的招募说明书、基金产品资料概要、基金清算报告等公开披露的相关基金信息进行复核、审查，并向基金管理人进行书面或电子确认。

基金管理人、基金托管人应当在指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指定媒介上披露信息外，还可以根据需要在其他公共媒介披露信息，但是其他公共媒介不得早于指定媒介、基金上市交易的证券交易所网站披露信息，并且在不同媒介上披露同一信息的内容应当一致。

为基金信息披露义务人公开披露的基金信息出具审计报告、法律意见书的专业机

构，应当制作工作底稿，并将相关档案至少保存到《基金合同》终止后10年。

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

#### （七）信息披露文件的存放与查阅

依法必须披露的信息发布后，基金管理人、基金托管人应当按照相关法律法规规定将信息置备于各自住所、基金上市交易的证券交易所，供社会公众查阅、复制。

（八）本基金信息披露事项以法律法规规定及本章节约定的内容为准。

## 十九、风险揭示

### （一）市场风险

证券市场价格受到经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素的影响，导致基金收益水平变化而产生风险，主要包括：

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

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

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

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

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

## **(二) 管理风险**

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

## **(三) 流动性风险**

本基金属于开放式基金，在基金的所有开放日，基金管理人都有义务接受投资人的申购和赎回。由于开放式基金在国内发展历史不长，应对基金赎回的经验不足，加之中国股票市场波动性较大，在市场下跌时经常出现交易量急剧减少的情况，如果在这时出现较大数额的基金赎回申请，则使基金财产变现困难，基金面临流动性风险。

### **(1) 基金申购、赎回安排**

投资人具体请参见基金合同“第六节 基金的交易、申购与赎回”和本招募说明书“九、基金份额的申购、赎回”，详细了解本基金的申购以及赎回安排。

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

### **(2) 拟投资市场、行业及资产的流动性风险评估**

本基金的投资范围包括在中华人民共和国境内依法发行、上市交易的股票及存托凭证和固定收益证券（包括各种债券和货币市场工具）以及中国证监会规定的其他证券品种和法律法规允许的金融工具。

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

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；因多地上市造成存托凭证价格差异以及波动的风险；存托凭证持有人权益被摊薄的风险；存托凭证退市的风险；已在境外上市的基础证券发行人，在持续信息披露监管方面与境内可能存在差异的风险；境内外证券交易机制、法律制度、监管环境差异可能导致的其他风险。

### (3) 巨额赎回情形下的流动性风险管理措施

当本基金发生巨额赎回情形时，基金管理人可以采用以下流动性风险管理措施：

(a) 暂停接受赎回申请；(b) 延缓支付赎回款项；(c) 中国证监会认定的其他措施。

### (4) 实施备用的流动性风险管理工具的情形、程序及对投资者的潜在影响

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

#### (a) 暂停接受赎回申请

投资人具体请参见基金合同“第六节 基金的交易、申购与赎回”中“二、基金份额的申购与赎回”的“（四）拒绝或暂停申购、赎回的情形与处理”和“（五）巨额赎回的情形及处理”，详细了解本基金暂停接受赎回申请的情形及程序。

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

基金份额净值可能与其提交赎回申请时的基金份额净值不同。

#### (b) 延缓支付赎回款项

投资人具体请参见基金合同“第六节 基金的交易、申购与赎回”中“二、基金份额的申购与赎回”的“（四）拒绝或暂停申购、赎回的情形与处理”和“（五）巨额赎回的情形及处理”，详细了解本基金延缓支付赎回款项的情形及程序。

在此情形下，投资人收到赎回款项的时间将可能比一般正常情形下有所延迟。

#### (c) 收取短期赎回费

本基金对持续持有期少于 7 日的投资者收取不低于 1.5 % 的赎回费，并将上述赎回费全额计入基金财产。

#### (d) 暂停基金估值

投资人具体请参见基金合同“第十四节 基金资产的估值”中的“（七）暂停估值的情形”，详细了解本基金暂停估值的情形及程序。

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

#### (e) 中国证监会认定的其他措施。

### (四) 投资策略风险

本基金重点投资于资源类上市公司，虽然资源的长期价值将不断提升，但在经济发展的各阶段，部分资源类行业的周期性变化可能会带来资源产品价格的波动，进而影响到资源类上市公司的经济效益，给投资带来一定的不确定性，从而形成策略风险。本基金以对资源类行业作为重点配置对象，也面临行业投资过于集中而带来的投资风险。

### (五) 上市交易的风险

本基金将在发售结束后在深圳证券交易所挂牌上市，由于上市期间可能因信息披露导致基金停牌，投资人在停牌期间不能买卖基金份额，产生风险；同时，可能因上市后交易对手不足导致基金流动性风险；另外，本基金存在暂停上市或终止上市的可能。

(六) 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。

### (七) 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。

### (八) 其他风险

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

## 二十、基金合同的终止和基金财产的清算

### (一) 基金合同的终止

出现下列情形之一的，基金合同应当终止：

- 1、基金合同期限届满而未延期的；
- 2、基金份额持有人大会决定终止的；

3、基金管理人、基金托管人职责终止，在六个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；

4、基金合同约定的其他情形。

基金合同终止时，基金管理人应当组织清算组对基金财产进行清算。清算组由基金管理人、基金托管人以及相关的中介服务机构组成。自基金合同终止之日起，与基金有关的所有交易应立即停止。在基金清算小组组成并接管基金财产之前，基金管理人和基金托管人应按照基金合同和托管协议的规定继续履行保护基金财产安全的职责。

清算小组作出的清算报告经会计师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，报中国证监会备案并公告。

清算后的剩余基金财产，应当按照基金份额持有人所持份额比例进行分配。

## **(二) 基金财产清算小组**

1、自出现基金合同终止事由之日起 30 个工作日内成立基金财产清算小组，清算小组必须在中国证监会的监督下对基金财产进行清算。

2、基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有证券从业资格的注册会计师事务所、律师事务所以及中国证监会指定的人员组成。基金管理人、基金托管人以及上述会计师事务所和律师事务所应在基金合同终止之日起 15 个工作日内将本方参加清算小组的具体人员名单函告其他各方。基金财产清算小组可以聘请必要的工作人员。

3、基金财产清算小组接管基金财产后，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。

## **(三) 基金财产清算小组的职责**

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以基金的名义进行必要的民事活动。

## **(四) 清算程序**

- 1、基金合同终止后，由基金财产清算小组统一接管基金；
- 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、对基金财产进行分配；

5、制作清算报告；

6、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；

7、将清算报告报中国证监会备案并公告。

#### **(五) 清算费用**

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

#### **(六) 基金财产按下列顺序清偿**

1、支付清算费用；

2、交纳所欠税款；

3、清偿基金债务；

4、按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

基金财产未按前款 1 至 3 项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

#### **(七) 基金财产清算的公告**

基金财产清算报告经会计师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，报中国证监会备案后，按照有关规定予以公告。

#### **(八) 清算账册及文件的保存**

基金财产清算账册及文件由基金托管人保存 15 年以上。

## **二十一、基金合同内容摘要**

### **(一) 基金份额持有人的权利和义务**

1、基金份额持有人权利

(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) 按照规定要求召开或召集基金份额持有人大会；

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

- (6) 查阅或者复制公开披露的基金信息资料；
- (7) 监督基金管理人的投资运作；
- (8) 对基金管理人、基金托管人、基金份额发售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼；
- (9) 法律法规规定的和基金合同约定的其他权利。

## 2、基金份额持有人的义务

- (1) 遵守基金合同；
- (2) 缴纳基金认购、申购款项及按照规定支付相应费用；
- (3) 在持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者基金合同终止的有限责任；
- (4) 不从事任何有损基金及基金份额持有人合法利益的活动；
- (5) 返还在基金交易过程中因各种原因，自基金管理人、基金托管人及基金管理人的代理人处获得的不当得利；
- (6) 执行生效的基金份额持有人大会决议；
- (7) 法律法规和基金合同规定的其他义务。

## (二) 基金管理人的权利和义务

### 1、基金管理人的权利

- (1) 依法申请并募集基金，自基金合同生效之日起，依照法律及基金合同的规定运用并管理基金财产；
- (2) 依照基金合同收取基金管理费及其他约定和法定的费用；
- (3) 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或国家有关法律规定，致使基金财产或基金份额持有人利益产生重大损失的，应呈报中国证监会和中国银监会，必要时应采取措施保护基金投资者的利益；
- (4) 在符合有关法律法规的前提下，决定基金的相关费率结构和收费方式，但本基金合同规定应由基金份额持有人大会批准的，从其规定；
- (5) 发售基金份额，收取认购、申购和基金转换费用；
- (6) 召集基金份额持有人大会；
- (7) 代表本基金对其所投资的企业依法行使股东权利；
- (8) 行使因投资于其它证券所产生的权利；
- (9) 担任注册登记人或委托其他合法机构担任注册登记人；

(10) 委托合法的销售代理机构，并对其销售服务代理行为进行监督；根据法律法规和基金合同的规定，制订、修改并公布有关基金募集、认购、申购、赎回、转托管、基金转换、非交易过户、冻结、收益分配等方面的业务规则；

(11) 在基金合同规定的情形出现时，决定暂停受理基金份额的申购、赎回和基金转换；

(12) 决定基金收益的分配方案；

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

(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) 根据基金合同的规定提名新基金托管人；

(16) 有关法律法规和基金合同规定的其他权利。

## 2. 基金管理人的义务

(1) 遵守基金合同；

(2) 自基金合同生效之日起，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理并运用基金财产；

(3) 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；

(4) 配备足够的专业人员办理基金份额的认购、申购、赎回和基金转换业务或委托其他机构代理该项业务；

(5) 配备足够的专业人员进行基金的注册登记或委托其它机构代理该项业务；

(6) 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；

(7) 确保所管理的基金财产和基金管理人的自有资产相互独立，确保所管理的每只基金在资产运作、财务管理等方面相互独立；

(8) 除法律法规和基金合同另有规定外，不得为自己及任何第三人谋取利益，不得转托第三人运作基金财产；

(9) 依法接受基金托管人的监督；

(10) 按规定计算并公告基金份额的认购、申购、赎回和基金转换价格的方法；

(11) 按照法律法规、基金合同及其他有关规定，履行信息披露和报告义务；



(12) 保守基金商业秘密，除法律法规及基金合同另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不得向他人泄露；但因遵守和服从司法机构、中国证监会或其他监管机构的判决、裁决、决定、命令而做出的披露或为了基金审计的目的而做出的披露不应视为基金管理人违反基金合同规定的保密义务；

(13) 按约定向基金份额持有人分配基金收益；

(14) 按约定受理申购、赎回和基金转换申请，及时、足额支付赎回款项和转换后的基金份额；

(15) 不谋求对上市公司的控股和直接管理；

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

(17) 保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料 15 年以上；

(18) 确保需要向基金投资人提供的各项文件或资料在规定的时间内发出；并且保证投资人能够按照招募说明书规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并得到有关资料的复印件；

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

(20) 当面临解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其财产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；

(21) 基金管理人因违反本基金合同规定处分基金财产，或者因违背本基金合同规定的管理职责、处理基金事务不当而致使基金财产或基金份额持有人的利益受到损失的，应采取适当、合理的方式向基金投资人进行赔偿，其违约责任不因其退任而免除；

(22) 基金托管人因违反基金合同约定造成基金财产损失时，基金管理人应为基金向基金托管人追偿；

(23) 不从事任何有损基金及基金其他当事人利益的活动；

(24) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

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

- (26) 执行生效的基金份额持有人大会决议；
- (27) 有关法律法规和基金合同规定的其他义务。

### (三) 基金托管人的权利和义务

#### 1、基金托管人的权利

- (1) 依法持有并保管基金财产；
- (2) 依照基金合同的规定，取得基金托管费；
- (3) 依法监督基金的投资运作；
- (4) 根据基金合同的规定提名新基金管理人；
- (5) 提议召开基金份额持有人大会；
- (6) 法律法规和基金合同规定的其他权利。

#### 2、基金托管人的义务

- (1) 遵守基金合同，依法持有基金财产；
- (2) 以诚实信用、勤勉尽责的原则安全保管基金的全部资产；
- (3) 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、合格的熟悉基金托管业务专职人员从事基金财产托管事宜；
- (4) 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相互独立；对其托管不同基金分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金之间在名册登记、账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；
- (5) 除法律法规及基金合同另有规定外，不得为自己及任何第三人谋取利益，不得转托第三人托管基金财产；
- (6) 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；
- (7) 以基金托管人的名义在基金托管人处开设基金托管专户，保管基金的银行存款；以托管人和本基金联名的方式在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司和深圳分公司开立一个或多个证券账户；以托管人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；以基金的名义在中央国债登记结算有限责任公司开设银行间债券市场债券托管账户，并代表基金进行债券和资金的清算。严格执行基金管理人的投资指令，认真办理基金投资于证券的清算交割及基金名下的资金往来；
- (8) 保守基金商业秘密，除法律法规及本基金合同另有规定外，在基金信息公

开披露前应予保密，不得向他人泄露；

(9) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值或基金份额净值；

(10) 采取适当、合理的措施使开放式基金份额的认购、申购、赎回和基金转换等事项符合基金合同等有关法律文件规定；

(11) 采取适当、合理的措施使基金管理人用以计算开放式基金份额的认购、申购、赎回、基金转换的方法符合基金合同等有关法律文件规定；

(12) 采取适当、合理的措施使基金投资和融资的条件符合基金合同等有关法律文件规定；

(13) 按规定出具基金业绩和基金托管情况的报告，并报中国银监会和中国证监会；

(14) 按照法律法规和基金合同的约定监督基金管理人的投资运作，在定期报告内出具托管人意见，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；

(15) 按有关规定，建立并保存基金份额持有人名册；

(16) 按规定制作相关账册并与基金管理人及时核对；

(17) 按照有关规定，保存基金的会计账册、报表和记录 15 年以上；

(18) 依据基金管理人的指令或有关规定，将基金份额持有人的基金收益和赎回款项支付到专用账户；

(19) 参加基金清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

(20) 面临解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产时，及时报告中国证监会和中国银监会，并通知基金管理人；

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

(22) 因违反基金合同导致基金财产的损失，应承担赔偿责任，其违约责任不因其退任而免除；

(23) 监督基金管理人按基金合同的规定履行自己的义务，因基金管理人违约造成基金财产损失时，应为基金向基金管理人追偿；

(24) 执行生效的基金份额持有人大会决议；

(25) 不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；

(26) 有关法律法规和基金合同规定的其他义务。

#### (四) 基金份额持有人大会

1、基金份额持有人大会由基金份额持有人或基金份额持有人合法授权的代表共同组成。

##### 2、召开事由

(1) 有以下事由情形之一时，应召开基金份额持有人大会：

1) 修改基金合同，但基金合同另有约定的除外；

2) 提前终止基金合同；

3) 变更基金类别；

4) 变更基金投资目标、范围或策略；

5) 变更基金份额持有人大会程序；

6) 更换基金管理人；

7) 更换基金托管人；

8) 本基金与其它基金合并；

9) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外；

10) 单独或合计持有本基金 10%以上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）就涉及本基金的同一事项以书面方式提议召开基金份额持有人大会；

11) 基金管理人或基金托管人就涉及本基金的事项提议召开基金份额持有人大会；

12) 法律、法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

(2) 以下情况不需召开基金份额持有人大会，由基金管理人和基金托管人协商后进行修改：

1) 调低基金管理费、基金托管费，其他应由基金承担的费用；

2) 在基金合同规定的范围内变更基金的申购费率、赎回费率、基金转换费率或收费方式；

3) 因相应的法律、法规发生变动必须对基金合同进行修改；

- 4) 对基金合同的修改不涉及基金合同当事人权利义务关系发生变化；
- 5) 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；
- 6) 按照法律法规或基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

### 3、召集人和召集方式

(1) 除法律法规另有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，开会的时间、地点、方式和权益登记日由基金管理人确定；

(2) 基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知基金托管人。

基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当自行召集并确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

(3) 代表基金份额 10% 以上的基金份额持有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% 以上的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。

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

(4) 代表基金份额 10% 以上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，代表基金份额 10% 以上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。

(5) 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。

### 4、召开基金份额持有人大会的通知

召开基金份额持有人大会，召集人应当至少提前 30 天在中国证监会指定的至

少一种报刊和网站上公告通知。基金份额持有人大会通知至少应载明以下内容：

- (1) 会议召开的时间、地点和方式；
- (2) 会议拟审议的主要事项、议事程序；
- (3) 出席基金份额持有人大会的权益登记日；
- (4) 代理投票授权委托书送达时间和地点；
- (5) 会务常设联系人姓名、电话；
- (6) 如采用通讯表决方式，则载明投票表决的截止日以及表决票的送达地址；
- (7) 采取通讯方式开会并进行表决的情况下，由召集人决定通讯方式和书面表决方式，并在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表决意见的寄交和收取方式。

## 5、召开方式

### (1) 会议方式

- 1) 基金份额持有人大会的召开方式包括现场开会和通讯方式开会；
- 2) 现场开会由基金份额持有人本人出席或通过授权委托书委派其代理人出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当出席；
- 3) 通讯方式开会指按照基金合同的相关规定以通讯的书面方式进行表决；
- 4) 会议的召开方式由召集人确定。但决定基金管理人更换或基金托管人更换的事项必须以现场开会方式召开基金份额持有人大会。

### (2) 召开基金份额持有人大会的条件

- 1) 现场开会必须同时符合以下条件时，现场会议方可举行：
  - ①对到会者在权益登记日持有基金份额的统计显示，有效的基金份额不少于代表权益登记日基金总份额的 50%；
  - ②到会的基金份额持有人身份证明及持有基金份额的凭证、代理人身份证明、委托人持有基金份额的凭证及授权委托代理手续完备，到会者出具的相关文件符合有关法律法规、基金合同及会议通知的规定。
- 2) 通讯方式开会必须同时符合以下条件时，通讯会议方可举行：
  - ①本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额不少于代表权益登记日基金总份额的 50%；
  - ②直接出具书面意见的基金份额持有人和受托代表他人出具书面意见的其他代

表，同时提交的基金份额持有人身份证明及持有基金份额的凭证、代理人身份证明及授权委托书代理手续完备，出具的相关文件符合有关法律法规、基金合同及会议通知的规定；

对于通讯开会方式的表决，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则表面符合法律、法规和会议通知规定的书面表决意见即视为有效的表决；表决意见模糊不清或相互矛盾的视为无效表决。代理人在通讯方式开会中进行表决时，应向召集人同时提交有关基金份额持有人出具的有效授权委托书；

③基金份额持有人大会召集人在公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取和统计基金份额持有人的书面表决意见；

④会议通知公布前报中国证监会备案。

## 6、审议事项与程序

### (1) 议事内容及提案权

基金份额持有人大会不得就未经公告的事项进行表决。

基金管理人、基金托管人、单独或合计持有基金份额 10%以上基金份额持有人可以在大会召集人发出会议通知前向大会召集人提交需由基金份额持有人大会审议表决的提案；也可以在会议通知发出后向大会召集人提交临时提案，临时提案最迟应当在大会召开日前 10 日提交召集人。

基金份额持有人大会的召集人发出召集现场会议的通知后，对原有审议事项的修改及增加临时提案应当在基金份额持有人大会召开日 5 日前公告。

对于基金份额持有人提交的提案（包括临时提案），大会召集人应当按照以下原则对提案进行审核：

1) 关联性。大会召集人对于基金份额持有人提案涉及事项与本基金有直接关系，并且不超出法律、法规和本基金合同规定的基金份额持有人大会职权范围的，应提交大会审议；对于不符合上述要求的，不提交基金份额持有人大会审议。

如果召集人决定不将基金份额持有人提案提交大会表决，应当在该次基金份额持有人大会上解释和说明。

2) 程序性。大会召集人可以对基金份额持有人的提案涉及的程序性问题作出决定。如将其提案进行分拆或合并表决，需征得原提案人同意；原提案人不同意变更的，大会主持人可以就程序性问题提请基金份额持有人大会作出决定，并按照基金

份额持有人大会决定的程序进行审议。

单独或合并持有权利登记日基金总份额 10%以上的基金份额持有人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，未获基金份额持有人大会审议通过，就同一提案再次提请基金份额持有人大会审议，需由单独或合并持有权利登记日基金总份额 20%以上的基金份额持有人提交；基金管理人或基金托管人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，未获得基金份额持有人大会审议通过，就同一提案再次提请基金份额持有人大会审议，其时间间隔不少于六个月。

## (2) 议事程序

### 1) 现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照规定程序宣布会议议事程序及注意事项，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，后形成大会决议。

大会由基金管理人授权代表主持。在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权代表主持；如果基金管理人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以所代表的基金份额 50%以上多数选举产生一名代表作为该次基金份额持有人大会的主持人。

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

### 2) 通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下，由召集人在开会通知中公告审议事项、具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表决意见寄交的截止时间和收取方式等。在所通知的表决截止日期第二日统计全部有效表决，在公证机关监督下形成决议。

## 7、表决

(1) 基金份额持有人所持每份基金份额享有一票表决权。

(2) 基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议。

### 1) 一般决议

对一般决议须经出席会议的基金份额持有人及代理人所持表决权的 50%以上都



通过方为有效；除下列2)所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过。

## 2) 特别决议

转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、提前终止基金合同为特别决议事项，应当经参加大会的基金份额持有人所持表决权的三分之二以上通过。

(3) 基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

(4) 采取通讯开会方式进行表决时，符合会议通知规定的书面表决意见视为有效表决。

(5) 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。

## 8、计票

### (1) 现场开会

1) 如基金份额持有人大会由基金管理人或基金托管人召集，则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，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三名代表担任监票人；

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) 如果大会主持人对于提交的表决结果有怀疑，可以对所投票数进行重新清点；如果大会主持人未进行重新清点，而出席会议的基金份额持有人或者代理人对大会主持人宣布的表决结果有异议，有权在宣布表决结果后立即要求进行重新清点，监票人应当立即重新清点，重新清点仅限一次。重新清点后，大会主持人应当当场公布重新清点结果。

计票过程由公证机关予以公证。

### (2) 通讯开会

在通讯方式开会的条件下，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的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证，并在公告基金份额持有人大会决议时公告公证书全文、公证机关及公证员姓名。

## 9、生效与公告

基金份额持有人大会表决通过的事项，召集人应当自通过之日起5日内报中国证监会核准或者备案。

基金份额持有人大会决议自经中国证监会核准或者备案之日起生效，法律法规及中国证监会另有规定的除外。基金管理人在基金份额持有人大会决议生效之日起2日内在至少一种指定报刊和网站公告。

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

### **(五) 基金合同变更和终止的事由及程序**

1、变更基金合同应召开基金份额持有人大会，基金合同变更的内容应经基金份额持有人大会决议同意。

有以下事由情形之一时，应召开基金份额持有人大会：

- (1) 修改基金合同，但基金合同另有约定的除外；
- (2) 提前终止基金合同；
- (3) 变更基金类别；
- (4) 变更基金投资目标、范围或策略；
- (5) 变更基金份额持有人大会程序；
- (6) 更换基金管理人；
- (7) 更换基金托管人；
- (8) 本基金与其它基金合并；
- (9) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外；
- (10) 单独或合计持有本基金10%以上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）就涉及本基金同一事项以书面方式提议召开基金份额持有人大会；
- (11) 基金管理人或基金托管人就涉及本基金的事项提议召开基金份额持有人大会；
- (12) 法律、法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

但出现下列情况时，可不经基金份额持有人大会决议，由基金管理人和基金托

管人就变更内容协商一致后公布，并报中国证监会备案：

(1) 因相应的法律、法规发生变动并属于基金合同必须遵照进行变更的情形；

(2) 基金合同的变更并不导致基金合同当事人权利义务发生变化的；

(3) 因为当事人名称、注册地址、法定代表人变更，当事人分立、合并等原因导致基金合同内容必须作出相应变动的。

2、除依基金合同和依现行有效的有关法律法规，对基金合同的变更须基金份额持有人大会决议通过和须报中国证监会核准以外的情形，经基金管理人和基金托管人同意可对基金合同进行变更后公布，并报中国证监会备案。

### 3、基金合同的终止

有下列情形之一的，基金合同终止：

(1) 基金合同期限届满而未延期的；

(2) 基金份额持有人大会决定终止的；

(3) 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；

(4) 基金合同约定的其他情形。

基金合同终止时，基金管理人应当组织清算组对基金财产进行清算。清算组由基金管理人、基金托管人以及相关的中介服务机构组成。自基金合同终止之日起，与基金有关的所有交易应立即停止。在基金清算小组组成并接管基金财产之前，基金管理人和基金托管人应按照基金合同和托管协议的规定继续履行保护基金财产安全的职责。

清算小组作出的清算报告经会计师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，报中国证监会备案并公告。

清算后的剩余基金财产，应当按照基金份额持有人所持份额比例进行分配。

### (六) 争议的解决

基金合同各方当事人因基金合同而产生的或与基金合同有关的一切争议，如经协商或调解未能解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，仲裁地点在北京，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力。

### (七) 基金合同存放地和投资人取得基金合同的方式

本基金合同可印制成册，存放于基金管理人和基金托管人的办公场所、注册登记人、基金销售机构处，投资人可在营业时间免费查阅。基金投资人在支付工本费后，可在合理时间内取得基金合同的复印件。对投资人按上述方式所获得的文件及其复印件，基金管理人和基金托管人保证与所公告文本的内容完全一致。

## 二十二、基金托管协议的内容摘要

### （一）托管协议当事人

#### 1、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号浦东嘉里城办公楼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：中国证监会

批准设立文号：证监基金字[2003]100号

注册资本：1.5亿元人民币

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

组织形式：有限责任公司

营业期限：持续经营

#### 2、基金托管人（或简称“托管人”）

名称：兴业银行股份有限公司

注册地址：福州市湖东路154号

办公地址：福州市湖东路154号

法定代表人：吕家进

注册日期：1988年7月20日

注册资本：50亿元人民币

基金托管业务批准文号：证监基金字[2005]74号

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；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；提供保险箱服务；经国务院银行业监督管理机构批准的其他业务。本行经中国人民银行批准，可以经营结汇、售汇业务。（以上范围凡涉及国家专项专营规定从其规定）

组织形式：股份有限公司

营业期限：持续经营

## **（二）基金托管人和基金管理人之间的业务监督、核查**

### **1、基金托管人对基金管理人的业务监督、核查**

根据《基金法》、《运作办法》、《基金合同》及其他有关规定，基金托管人应对基金的投资对象、基金资产的投资组合比例、基金资产的核算、基金资产净值的计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付、基金费用的支付、基金的申购与赎回、基金收益分配、基金的融资条件等行为的合法性、合规性进行监督和核查。

（1）基金托管人发现基金管理人违反《基金法》、《运作办法》、《基金合同》和有关法律法规规定的行为，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应及时核对并以书面形式对基金托管人发出回函。在限期内，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。

（2）基金托管人发现基金管理人的指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反《基金合同》约定的，应当拒绝执行，立即通知基金管理人，并及时向中国证监会报告。

（3）基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反《基金合同》约定的，应当立即通知基金管理人，并及时向中国证监会报告。按照规定监督基金管理人的投资运作。

（4）如基金托管人认为基金管理人的作为或不作为违反了法律法规、《基金合同》或本托管协议，基金托管人应呈报中国证监会和其他监管部门，有权利并有义务行使法律法规、《基金合同》或本托管协议赋予的基金托管人的任何及所有权利和救济措施，以保护基金资产的安全和基金投资者的利益，包括但不限于就更换基

基金管理人事宜召集基金份额持有人大会、代表基金对因基金管理人的过错造成的基金财产的损失向基金管理人索赔。

## 2、基金管理人基金托管人的业务监督、核查

根据《基金法》、《运作办法》、《基金合同》及其他有关规定，基金管理人就基金托管人是否及时执行基金管理人的指令、是否将基金财产和固有财产分账管理、是否擅自动用基金财产、是否按时将分配给基金份额持有人的收益划入分红派息账户等事项，对基金托管人进行监督和核查。

(1) 基金管理人定期对基金托管人保管的基金财产进行核查。基金管理人发现基金托管人未对基金财产实行分账管理、擅自挪用基金财产、因基金托管人的过错导致基金财产灭失、减损或处于危险状态的，基金管理人应立即以书面的方式要求基金托管人予以纠正并采取必要的补救措施。基金管理人有权要求基金托管人赔偿基金因此所遭受的损失。

(2) 基金管理人发现基金托管人的行为违反《基金法》、《运作办法》、《基金合同》和有关法律、法规的规定，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对基金管理人发出回函。在限期内，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。基金托管人对基金管理人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金管理人应报告中国证监会。

(3) 如基金管理人认为基金托管人的作为或不作为违反了法律法规、《基金合同》或本托管协议，基金管理人应呈报中国证监会和其他监管部门，有权利并有义务行使法律法规、《基金合同》或本托管协议赋予的基金管理人的任何及所有权利和救济措施，以保护基金财产的安全和基金投资者的利益，包括但不限于就更换基金托管人事宜召集基金份额持有人大会、代表基金对因基金托管人的过错造成的基金财产的损失向基金托管人索赔。

## (三) 基金财产保管

### 1、基金财产保管的原则

基金托管人应安全保管所收到的基金的全部财产。

基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。

基金托管人必须按照规定为基金资产开立独立的资金账户和证券账户，与基金托管人的其他业务和其他基金的托管业务实行严格的分账管理。

基金托管人应安全、完整地保管基金财产；未经基金管理人的正当指令，不得自行运用、处分、分配基金的任何财产。属于基金托管人实际有效控制下的实物证券在基金托管人保管期间的损坏、灭失，由此产生的责任应由基金托管人承担。

对于因为基金投资、基金申（认）购过程中产生的应收资产，应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知托管人，到账日基金资产没有到达托管人处的，托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收。由此给基金造成损失的，基金管理人应负责向有关当事人追偿基金的损失。

## 2、募集资金的验证

认购期内销售机构按销售与服务代理协议的约定，将认购资金划入基金认购专户。基金募集期满或基金宣布停止募集时，由基金管理人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，出具的验资报告应由参加验资的2名以上（含2名）中国注册会计师签字有效。

基金管理人应将属于本基金财产的全部资金存入基金托管人为基金开立的基金托管专户中，并确保划入的资金与验资确认金额相一致。基金托管人在收到资金当日出具基金财产接收报告，开始履行托管人基金财产保管职责。

## 3、申购资金、赎回资金和转换资金的划付

基金申购、赎回和转换的款项采用单笔净额交收的结算方式，净额在T+3日上午11:00前交收。

基金托管人应及时查收申购（转入）资金是否到账，对于未准时到账的资金，应及时通知基金管理人，由基金管理人负责处理相关事宜。

因投资者赎回（转出）而应划付的款项，基金托管人应根据基金管理人的指令进行划付，如基金托管专户有足够的资金，基金托管人应按时拨付；因基金托管专户没有足够的资金，导致基金托管人不能按时拨付，如系基金管理人的原因造成，责任由基金管理人承担，基金托管人不承担垫款义务。

## 4、基金的银行账户的开设和管理

基金托管人以基金托管人的名义在基金托管人处开设基金托管专户，保管基金的银行存款。该基金托管专户是指基金托管人在集中托管模式下，代表所托管的基金与中国证券登记结算有限责任公司进行一级结算的专用账户。基金托管专户由基金托管人负责管理。本基金的一切货币收支活动，包括但不限于投资、支付赎回金

额、支付基金收益、收取申购款等，均需通过基金托管人的基金托管专户进行。

基金托管专户的开立和使用，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其他任何银行账户；亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。

基金托管专户的管理应符合《中华人民共和国票据法》、《银行账户管理办法》、《现金管理条例》、《中国人民银行利率管理的有关规定》、《关于大额现金支付管理的通知》、《支付结算办法》以及中国人民银行的其它规定。

#### 5、基金证券账户和资金账户的开设和管理

基金托管人以基金托管人和本基金联名的方式在中国证券登记结算有限公司上海分公司/深圳分公司开设证券账户。

基金证券账户的开立和使用，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出借和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。

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上海分公司/深圳分公司开立基金证券交易资金账户，用于证券清算。

#### 6、债券托管乙类账户的开设和管理

(1) 基金合同生效后，基金管理人负责申请与全国银行间同业拆借中心交易系统联网交易。基金托管人负责在中央国债登记结算有限责任公司以基金的名义开设债券托管乙类账户，并由基金托管人负责基金的债券的后台匹配及资金的清算。

(2) 根据中国银行业监督管理机构、中国外汇交易中心和中央国债登记结算有限责任公司的有关规定，基金管理人和基金托管人应一起负责为基金对外签订全国银行间国债市场回购主协议，正本由基金托管人保管，基金管理人保存副本。

#### 7、基金资产投资的有关实物证券的保管

实物证券由基金托管人存放于托管银行的保管库；也可存入中央国债登记结算有限责任公司或中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司或票据营业中心的代保管库。保管凭证由基金托管人持有。实物证券的购买和转让，由基金托管人根据基金管理人的指令及上述登记公司有关规定办理。

#### 8、与基金财产有关的重大合同的保管



与基金投资有关的重大合同的签署，除本协议另有规定外，由基金管理人负责。合同原件由基金管理人保管，同时传真给托管人。保管期限按照国家有关规定执行。

与基金财产有关的重大合同，根据基金的需要以基金的名义签署。合同原件由基金托管人保管；但涉及有关费用支付的合同在费用支付时，管理人应传真与托管人作为划款指令的依据。

#### **(四) 基金资产净值计算与会计复核**

##### **1、基金资产净值的计算和复核**

(1) 基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。基金份额净值是指计算日基金资产净值除以计算日基金份额总份额后的价值。

(2) 基金管理人应每日对基金资产估值。估值原则应符合《基金合同》、《证券投资基金会计核算办法》及其他法律、法规的规定。用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人复核。基金管理人应于每个工作日交易结束后计算当日的基金资产净值并以加密传真方式发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核后，签名、盖章并以加密传真方式传送给基金管理人，由基金管理人公布。

##### **2、净值差错处理**

因基金估值错误给投资者造成损失的应先由基金管理人承担，基金管理人对其不应由其承担的责任，有权向过错人追偿。

当基金管理人计算的基金份额净值已由基金托管人复核确认后公告的，由此造成的投资者或基金的损失，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，由基金管理人与基金托管人按照双方过错程度承担赔偿责任。

由于一方当事人提供的信息错误，另一方当事人在采取了必要合理的措施后仍不能发现该错误，进而导致基金份额净值计算错误造成投资者或基金的损失，以及由此造成以后交易日基金份额净值计算顺延错误而引起的投资者或基金的损失，由提供错误信息的当事人一方负责赔偿。

由于证券交易所及其登记结算公司发送的数据错误，或由于其他不可抗力原因，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，但是未能发现该错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人可以免

除赔偿责任。但基金管理人和基金托管人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

针对净值差错处理，如果法律法规或证监会有新的规定，则按新的规定执行；如果法律法规或证监会没有明确规定，在不违背法律法规且不损害投资者利益的前提下，相关各方当事人应本着平等互利的原则重新协商确定处理原则。

当基金管理人计算的基金份额净值与基金托管人的计算结果不一致时，相关各方应本着勤勉尽责的原则重新计算核对，如果最后仍无法达成一致，应以基金管理人的计算结果为准对外公布，由此造成的损失以及因该交易日基金份额净值计算顺延错误而引起的损失由基金管理人承担赔偿责任，但有权向相关责任方追偿。

### 3、基金账册的建账和对账

基金管理人和基金托管人在基金合同生效后，应按照相关各方约定的同一记账方法和会计处理原则，分别独立地设置、登录和保管本基金的全套账册，对相关各方各自的账册定期进行核对，互相监督，以保证基金资产的安全。若双方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。

经对账发现相关各方的账目存在不符的，基金管理人和基金托管人必须及时查明原因并纠正，保证相关各方平行登录的账册记录完全相符。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。

### 4、基金财务报表与报告的编制和复核

基金财务报表由基金管理人和基金托管人每月分别独立编制。月度报表的编制，应于每月终了后5个工作日内完成。

基金管理人在季度结束之日起15个工作日内完成季度报告编制并公告；在上半年结束之日起两个月内完成中期报告编制并公告；在每年结束之日起三个月内完成年度报告编制并公告。若法律、法规或中国证监会的规定发生变化，按新的规定办理。

基金管理人在季度报告完成当日，将有关报告及时提供基金托管人复核，基金托管人在收到后5日内进行复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在半年度报告完成当日，将有关报告及时提供基金托管人复核，基金托管人在收到后10日内进行复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在年度报告完成

当日，将有关报告及时提供基金托管人复核，基金托管人在收到后15日内复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金托管人在复核过程中，发现相关各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，调整以相关各方认可的账务处理方式为准。核对无误后，基金托管人在基金管理人提供的报告上加盖公章，相关各方各自留存一份。

基金托管人在对财务会计报告、中期报告或年度报告复核完毕后，需盖章确认或出具相应的复核确认书，或进行电子确认，以备有权机构对相关文件审核时提示。管理人、托管人可以采取双方认可的其他形式办理本基金相关报告或报表的确认、复核事项。

#### **(五) 基金份额持有人名册的登记与保管**

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金管理人委托中国证券登记结算有限责任公司担任本基金的注册登记人，基金份额持有人名册，包括基金募集期结束时的基金份额持有人名册、基金权益登记日的基金份额持有人名册、基金份额持有人大会登记日的基金份额持有人名册、每月最后一个交易日的基金份额持有人名册由注册登记机构负责制定。基金注册登记机构对基金份额持有人名册负保管义务。

#### **(六) 争议的处理和适用法律**

相关各方当事人同意，因本协议而产生的或与本协议有关的一切争议，除经友好协商可以解决的，应提交中国国际经济贸易仲裁委员会根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁的地点在北京，仲裁裁决是终局性的并对相关各方均有约束力，仲裁费用由仲裁裁决决定。

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

本协议受中国法律管辖。

#### **(七) 托管协议的修改和终止**

1、本协议相关各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。修改后的新协议向中国证监会办理完必要的备案手续后生效。

2、发生以下情况，本托管协议终止：

- (1) 《基金合同》终止；
- (2) 因基金托管人解散、依法被撤销、破产或其他事由造成本基金更换基金托管人；
- (3) 因基金管理人解散、依法被撤销、破产或其他事由造成本基金更换基金管理人；
- (4) 发生《基金法》或其他法律法规规定的终止事项。

## 二十三、基金份额持有人的服务

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

### 一、通知服务

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

### 二、在线服务

基金管理人利用自己的网站提供实时在线客服咨询服务。

### 三、网上交易（手机 APP）服务

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

### 四、资讯服务

投资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公司网站。

#### 1、营销服务部电话

客服热线：400-678-0099、021-38824536

## 2、互联网站

公司网站：<http://www.xqfunds.com>

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

## 3、在线客服：

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

## 4、微信公众号

官方微信号：xyfunds

## 五、信息定制服务

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

## 六、投诉受理

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

基金管理人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。

## 二十四、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/或公司网站的基金公告。

序号	事项名称	披露日期
1	关于旗下部分基金投资长电科技(600584)非公开发行股票的公告	2021-05-06
2	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	2021-06-16
3	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	2021-06-17
4	关于调整网上直销基金转换、赎回转购、汇款交易优惠费率的公告	2021-06-18
5	关于调整旗下基金在交通银行股份有限公司费率优惠活动的	2021-07-01

	公告	
6	关于调整旗下部分基金在长江证券最低定期定额投资金额的公告	2021-07-23
7	关于放开我司转换补差费折扣及开展网上直销平台基金转换补差费率优惠活动的公告	2021-08-04
8	关于旗下深交所基金新增扩位简称的公告	2021-08-21
9	关于调整旗下部分基金在工商银行定期定额投资费率优惠活动的公告	2021-08-30
10	关于调整旗下基金在山西证券股份有限公司费率优惠活动的公告	2021-09-13
11	关于兴全趋势投资混合型证券投资基金（LOF）基金经理变更的公告	2021-10-19
12	关于兴全趋势投资混合型证券投资基金（LOF）暂停接受一百万元以上申购（含定投）、转换转入申请的公告	2021-11-10
13	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	2021-11-24
14	关于旗下所有采取后端收费模式的基金份额暂停通过网上直销系统办理部分业务的公告	2021-11-26
15	关于调整网上直销基金转换、赎回转购、汇款交易优惠费率的公告	2021-12-10
16	关于增加申万宏源西部证券为旗下部分基金销售机构的公告	2021-12-13
17	兴全趋势投资混合型证券投资基金（LOF）分红公告	2021-12-14
18	关于旗下公开募集证券投资基金投资北交所股票的风险提示性公告	2021-12-24
19	关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具相关会计准则工作的公告	2022-01-05
20	关于调整旗下部分基金单笔最低交易限额的公告	2022-01-06
21	关于副总经理离任的公告	2022-01-21
22	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	2022-01-26
23	关于使用自有资金自购旗下偏股型公募基金壹亿元的公告	2022-01-27
24	关于公司副总经理任职的公告	2022-01-28
25	关于增加华安证券为旗下部分基金销售机构并调整旗下部分基金在部分销售机构费率优惠活动的公告	2022-04-18
26	关于增加兴业银行为旗下部分基金销售机构的公告	2022-05-06
27	关于终止瑞银证券有限责任公司办理旗下部分基金相关销售业务的公告	2022-05-20

## 二十五、招募说明书存放及查阅方式

本基金招募说明书存放于基金管理人和基金托管人的办公场所、注册登记人、

基金销售机构处，投资人可在营业时间免费查阅。基金投资人在支付工本费后，可在合理时间内取得招募说明书的复印件。对投资人按上述方式所获得的文件及其复印件，基金管理人和基金托管人保证与所公告文本的内容完全一致。

投资人还可以直接登录基金管理人的网站([www.xqfunds.com](http://www.xqfunds.com))查阅和下载招募说明书。

## 二十六、备查文件

本基金备查文件包括下列文件：

- 1、中国证监会核准本基金募集的文件；
- 2、《兴全趋势投资混合型证券投资基金（LOF）基金合同》；
- 3、《兴全趋势投资混合型证券投资基金登记结算服务协议》；
- 4、《兴全趋势投资混合型证券投资基金（LOF）托管协议》；
- 5、法律意见书；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 8、中国证监会要求的其他文件。

兴证全球基金管理有限公司

2022年6月30日