

兴业中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金
招募说明书（更新）摘要
（2020 年第 1 号）

基金管理人：兴业基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

重要提示

兴业中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金（以下简称“本基金”）由兴业聚全灵活配置混合型证券投资基金转型而来，并经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）2019 年 4 月 8 日证监许可【2019】660 号文准予变更注册。自 2019 年 5 月 27 日起，《兴业聚全灵活配置混合型证券投资基金基金合同》失效，《兴业中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金基金合同》生效，兴业聚全灵活配置混合型证券投资基金正式转型为兴业中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金。

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、基金产品资料概要经中国证监会注册，但中国证监会对兴业聚全灵活配置混合型证券投资基金转型为本基金的变更注册，并不表明其对本基金的投资价值和市场前景作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

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

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动。投资有风险，投资者申购基金时应认真阅读基金合同、本招募说明书等信息披露文件，全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性，自主判断基金的投资价值，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对申购基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。投资者在获得基金投资收益的同时，亦承担基金投资中出现的各类风险，可能包括：市场风险，信用风险，流动性风险，操作风险，管理风险，合规性风险等。本基金为债券型指数基金，其预期风险与预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。本基金主要投资于标的指数成份券及备选成份券，具有与标的指数相似的风险收益特征。

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对本基金业绩表现的保证。

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

本招募说明书中涉及的与托管相关的基金信息已经本基金托管人复核。除非另有说明，本更新招募说明书所载内容截止日为 2020 年 2 月 29 日，有关财务

数据和净值表现数据截止日为 2019 年 12 月 31 日（本招募说明书中的财务资料未经审计）。

一、基金管理人

（一）基金管理人情况

名称：兴业基金管理有限公司

住所：福建省福州市鼓楼区五四路 137 号信和广场 25 楼

办公地址：上海市浦东新区银城路 167 号 13、14 层

法定代表人：官恒秋

成立日期：2013 年 4 月 17 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监许可[2013]288 号

组织形式：有限责任公司

注册资本：12 亿元人民币

存续期限：持续经营

联系电话：021-22211888

联系人：郭玲燕

股权结构：

股东名称	出资比例
兴业银行股份有限公司	90%
中海集团投资有限公司	10%
合计	100%

（二）主要人员情况

1、董事会成员

官恒秋先生，董事长，硕士学位，高级经济师。曾任兴业银行国际业务部副总经理，兴业银行深圳分行党委副书记、副行长，兴业银行杭州分行党委书记、行长，兴业银行南京分行党委书记、行长。现任兴业基金管理有限公司党委书记、董事长。

明东先生，董事，硕士学位，高级经济师。曾先后在中远财务有限责任公司及中国远洋运输（集团）总公司资产经营中心、总裁事务部、资本运营部工作，历任中国远洋控股股份有限公司投资者关系部总经理、证券事务代表，中国远洋运输（集团）总公司/中国远洋控股股份有限公司证券事务部总经理。现任中远

海运发展股份有限公司副总经理、党委委员，中海集团投资有限公司总经理。

胡斌先生，董事，硕士学位，经济师职称。曾任兴业银行乌鲁木齐分行企业金融总部营销管理部总经理，兴业银行总行企业金融总部企业金融营销管理部总经理助理，兴业银行北京分行党委委员、行长助理，兴业银行总行投资银行部副总经理等职务。现任兴业基金管理有限公司党委委员、总经理，兼任兴业财富资产管理有限公司执行董事。

李春平先生，独立董事，博士学位，高级经济师。曾任国泰君安证券股份有限公司总裁助理，国泰基金管理有限公司总经理、执行董事，长江养老保险股份有限公司党委副书记、总裁，上海量鼎资本管理公司执行董事，上海保险交易所中保保险资产登记交易有限公司运营管理委员会主任等职。现任杭州华智融科股权投资公司总裁。

陈华锋先生，独立董事，博士学位。曾任加拿大不列颠哥伦比亚大学尚德商学院金融学助理教授，美国德州农工大学梅斯商学院金融学副教授（终身教职），清华大学五道口金融学院讲席副教授（终身教职）。现任复旦大学泛海金融学院教授、博士生导师、MBA 项目学术主任。

陈汉文先生，独立董事，博士学位。曾任厦门大学会计系主任、博士生导师，厦门大学管理学院副院长，厦门大学研究生院副院长等职。现任对外经济贸易大学国际商学院教授。

2、监事会成员

林榕辉先生，监事会主席，博士学位。曾任兴业银行总行计划资金部副总经理、信用审查部总经理、漳州分行党委书记、行长，同业业务部总经理、风险管理部总经理、研究规划部总经理、企业金融总部副总裁、金融市场总部副总裁等职务。现任兴业银行总行同业金融部总经理。

杜海英女士，监事，硕士学位。曾任中海（海南）海盛船务股份有限公司发展部科长、发展部副主任（主持工作）、发展部主任，中共中国海运（集团）总公司党校副校长，集团管理干部学院副院长等职。现任中远海运发展股份有限公司总经理助理、中海集团投资有限公司副总经理、河南远海中原物流产业发展基金管理有限公司董事长。

郎振宇先生，职工监事，本科学历。曾任天弘基金管理有限公司广州分公司

总经理助理、兴业银行股份有限公司总行资产管理部综合处副处长、兴业基金管理有限公司综合管理部副总经理、人力资源部副总经理等职。现任兴业基金管理有限公司综合管理部总经理。

楼怡斐女士，职工监事，硕士学位。曾任鞍山证券上海管理总部宏观研究员、富国基金交易部交易员、华泰柏瑞基金管理有限公司交易部交易总监。现任兴业基金管理有限公司交易部总经理兼基金运营部总经理。

3、公司高级管理人员
官恒秋先生，董事长，简历同上。

胡斌先生，总经理，简历同上。

王慧女士，督察长，本科学历。历任兴业银行信贷管理部总经理助理、副总经理，兴业银行广州分行副行长，兴业银行信用审查部总经理，兴业银行小企业部总经理，兴业银行金融市场总部风险总监、金融市场风险管理部总经理。现任兴业基金管理有限公司党委委员、督察长。

黄文锋先生，副总经理，硕士学位。历任兴业银行厦门分行鹭江支行行长、集美支行行长，兴业银行厦门分行公司业务部兼同业部、国际业务部总经理，兴业银行厦门分行党委委员、行长助理，兴业银行总行投资银行部副总经理，兴业银行沈阳分行党委委员、副行长。现任兴业基金管理有限公司党委委员、副总经理。

张顺国先生，副总经理，本科学历。历任泰阳证券上海管理总部总经理助理，深圳发展银行上海分行金融机构部副总经理、商人银行部副总经理，深圳发展银行上海分行宝山支行副行长，兴业银行上海分行漕河泾支行行长、静安支行行长、上海分行营销管理部总经理，兴业基金管理有限公司总经理助理、上海分公司总经理，上海兴晟股权投资管理有限公司总经理，兴投（平潭）资本管理有限公司执行董事。现任兴业基金管理有限公司党委委员、副总经理。

庄孝强先生，总经理助理，本科学历。历任兴业银行宁德分行计划财会部副总经理，兴业银行总行审计部福州分部业务二处副处长、上海分部业务二处副处长，兴业银行总行资产管理部总经理助理，兴业财富资产管理有限公司总经理。现任兴业基金管理有限公司党委委员、总经理助理，兼任上海兴晟股权投资管理有限公司执行董事。

4、本基金的基金经理

唐丁祥先生，上海财经大学产业经济学博士。8 年证券从业经验。2011 年 3 月至 2013 年 4 月在光大证券股份有限公司研究所担任债券分析师，内容涉及宏观利率、专题研究等；2013 年 4 月至 2013 年 8 月在申万菱信基金管理有限公司从事宏观和债券研究，内容涉及宏观利率、信用分析和可转债等研究工作；2013 年 8 月加入兴业基金管理有限公司，2019 年 2 月 19 日起担任兴业聚丰灵活配置混合型证券投资基金、兴业启元一年定期开放债券型证券投资基金的基金经理，2019 年 2 月 26 日起担任兴业福益债券型证券投资基金的基金经理，2019 年 2 月 19 日起担任兴业中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金（由兴业聚全灵活配置混合型证券投资基金转型而来）的基金经理，2019 年 6 月 26 日起担任兴业稳固收益两年理财债券型证券投资基金的基金经理，2020 年 1 月 10 日起担任兴业稳康三年定期开放债券型证券投资基金的基金经理。

5、投资策略委员会成员

胡斌先生，总经理。

黄文锋先生，副总经理。

周鸣女士，固定收益投资一部总监。

冯小波先生，固定收益投资二部总经理。

徐莹女士，固定收益投资二部副总经理兼投资总监。

腊博先生，固定收益投资一部投资总监。

陈子越先生，研究部总经理助理兼海外投资部（筹）投资总监。

6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

二、基金托管人

一、基金托管人基本情况

（一）基金托管人概况

公司法定中文名称：交通银行股份有限公司（简称：交通银行）

公司法定英文名称：BANK OF COMMUNICATIONS CO., LTD

法定代表人/负责人：任德奇

住 所：中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 号

办公地址：上海市长宁区仙霞路 18 号

邮政编码：200336

注册时间：1987 年 3 月 30 日

注册资本：742.63 亿元

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]25 号

联系人：陆志俊

电 话：95559

交通银行始建于 1908 年，是中国历史最悠久的银行之一，也是近代中国的发钞行之一。1987 年重新组建后的交通银行正式对外营业，成为中国第一家全国性的国有股份制商业银行，总部设在上海。2005 年 6 月交通银行在香港联合交易所挂牌上市，2007 年 5 月在上海证券交易所挂牌上市。根据 2019 年英国《银行家》杂志发布的全球千家大银行报告，交通银行一级资本位列第 11 位，连续五年跻身全球银行 20 强；根据 2019 年美国《财富》杂志发布的世界 500 强公司排行榜，交通银行营业收入位列第 150 位，较上年提升 18 位。

截至 2019 年 9 月 30 日，交通银行资产总额为人民币 99,328.79 亿元。2019 年 1-9 月，交通银行实现净利润（归属于母公司股东）人民币 601.47 亿元。

交通银行总行设资产托管业务中心（下文简称“托管中心”）。现有员工具有多年基金、证券和银行的从业经验，具备基金从业资格，以及经济师、会计师、工程师和律师等中高级专业技术职称，员工的学历层次较高，专业分布合理，职业技能优良，职业道德素质过硬，是一支诚实勤勉、积极进取、开拓创新、奋发向上的资产托管从业人员队伍。

（二）主要人员情况

任德奇先生，副董事长、执行董事、行长，高级经济师。

任先生 2018 年 8 月起任本行副董事长、执行董事、行长；2016 年 12 月至 2018 年 6 月任中国银行执行董事、副行长，其中：2015 年 10 月至 2018 年 6 月兼任中银香港（控股）有限公司非执行董事，2016 年 9 月至 2018 年 6 月兼任中国银行上海人民币交易业务总部总裁；2014 年 7 月至 2016 年 11 月任中国银行副行长，2003 年 8 月至 2014 年 5 月历任中国建设银行信贷审批部副总经理、风险监控部总经理、授信管理部总经理、湖北省分行行长、风险管理部总经理；1988 年 7 月至 2003 年 8 月先后在中国建设银行岳阳长岭支行、岳阳市中心支行、岳阳分行，中国建设银行信贷管理委员会办公室、信贷风险管理部工作。任先生 1988 年于清华大学获工学硕士学位。

袁庆伟女士，资产托管业务中心总裁，高级经济师。

袁女士 2015 年 8 月起任本行资产托管业务中心总裁；2007 年 12 月至 2015 年 8 月，历任本行资产托管部总经理助理、副总经理，本行资产托管业务中心副总裁；1999 年 12 月至 2007 年 12 月，历任本行乌鲁木齐分行财务会计部副科长、科长、处长助理、副处长，会计结算部高级经理。袁女士 1992 年毕业于中国石油大学计算机科学系，获得学士学位，2005 年于新疆财经学院获硕士学位。

（三）基金托管业务经营情况

截至 2019 年 9 月 30 日，交通银行托管证券投资基金 436 只。此外，交通银行还托管了基金公司特定客户资产管理计划、证券公司客户资产管理计划、银行理财产品、信托计划、私募投资基金、保险资金、QDIE 资金、全国社保基金、养老保障管理基金、企业年金基金、职业年金基金、QFII 证券投资资产、RQFII 证券投资资产、QDII 证券投资资产、RQDII 证券投资资产和 QDLP 资金等产品。

二、基金托管人的内部控制制度

（一）内部控制目标

交通银行严格遵守国家法律法规、行业规章及行内相关管理规定，加强内部管理，托管中心业务制度健全并确保贯彻执行各项规章制度，通过对各种风险的识别、评估、控制及缓释，有效地实现对各项业务的风险管控，确保业务稳健运行，保护基金持有人的合法权益。

（二）内部控制原则

1、合法性原则：托管中心制定的各项制度符合国家法律法规及监管机构的监管要求，并贯穿于托管业务经营管理活动始终。

2、全面性原则：托管中心建立各二级部自我监控和风险合规部风险管控的内部控制机制，覆盖各项业务、各个部门和各级人员，并渗透到决策、执行、监督、反馈等各个经营环节，建立全面的风险管理监督机制。

3、独立性原则：托管中心独立负责受托基金资产的保管，保证基金资产与交通银行的自有资产相互独立，对不同的受托基金资产分别设置账户，独立核算，分账管理。

4、制衡性原则：托管中心贯彻适当授权、相互制约的原则，从组织架构的设置上确保各二级部和各岗位权责分明、相互制约，并通过有效的相互制衡措施消除内部控制中的盲点。

5、有效性原则：托管中心在岗位、业务二级部和风险合规部三级内控管理模式的基础上，形成科学合理的内部控制决策机制、执行机制和监督机制，通过行之有效的控制流程、控制措施，建立合理的内控程序，保障各项内控管理目标被有效执行。

6、效益性原则：托管中心内部控制与基金托管规模、业务范围和业务运作环节的风险控制要求相适应，尽量降低经营运作成本，以合理的控制成本实现最佳的内部控制目标。

（三）内部控制制度及措施

根据《证券投资基金法》、《中华人民共和国商业银行法》、《商业银行资产托管业务指引》等法律法规，托管中心制定了一整套严密、完整的证券投资基金托管管理规章制度，确保基金托管业务运行的规范、安全、高效，包括《交通银行资产托管业务管理办法》、《交通银行资产托管业务风险管理办法》、《交通银行资产托管业务系统建设管理办法》、《交通银行资产托管部信息披露制度》、《交通银行资产托管业务商业秘密管理规定》、《交通银行资产托管业务从业人员行为规范》、《交通银行资产托管业务档案管理暂行办法》等，并根据市场变化和基金业务的发展不断加以完善。做到业务分工科学合理，技术系统管理规范，业务管理制度健全，核心作业区实行封闭管理，落实各项安全隔离措施，相关信息披露由

专人负责。

托管中心通过对基金托管业务各环节的事前揭示、事中控制和事后检查措施实现全流程、全链条的风险管理，聘请国际著名会计师事务所对基金托管业务运行进行国际标准的内部控制评审。

三、基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

交通银行作为基金托管人，根据《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和有关证券法规的规定，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、基金的申购资金的到账与赎回资金的划付、基金收益分配等行为的合法性、合规性进行监督和核查。

交通银行作为基金托管人，发现基金管理人违反《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等有关证券法规和《基金合同》的行为，及时通知基金管理人予以纠正，基金管理人收到通知后及时核对确认并进行调整。交通银行有权对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人交通银行通知的违规事项未能及时纠正的，交通银行有权报告中国证监会。

交通银行作为基金托管人，发现基金管理人重大违规行为，有权立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正。

四、其他事项

最近一年内交通银行及其负责资产托管业务的高级管理人员无重大违法违规行为，未受到中国人民银行、中国证监会、中国银保监会及其他有关机关的处罚。负责基金托管业务的高级管理人员在基金管理公司无兼职的情况。

五、相关服务机构

（一）基金份额发售机构

1、直销机构

（1）名称：兴业基金管理有限公司直销中心

住所：福建省福州市鼓楼区五四路 137 号信和广场 25 楼

办公地址：上海市浦东新区银城路 167 号 13、14 层

法定代表人：官恒秋

联系人：许野

咨询电话：021-22211975

传真：021-22211997

网址：<http://www.cib-fund.com.cn>

（2）名称：网上直销系统

网址：<https://trade.cib-fund.com.cn/etrading/>

（3）名称：兴业基金微信公众号

微信号：“兴业基金”或者“cibfund”

2、其他销售机构

（1）中信证券（山东）有限责任公司

住所：青岛市崂山区深圳路 222 号 1 号楼 2001

法定代表人：姜晓林

办公地址：山东省青岛市市南区东海西路 28 号龙翔广场东座 2 层

邮政编码：266071

联系人：孙秋月

电话：95548

网址：sd.citics.com

（2）中信证券股份有限公司

住所：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

法定代表人：张佑君

办公地址：北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦

邮政编码：100026

联系人：杜杰

电话：95548

网址：www.cs.ecitic.com

（3） 中信期货有限公司

住所：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

法定代表人：张皓

办公地址：北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦 18 层

邮政编码：100026

联系人：刘宏莹

电话：400-990-8826

网址：www.citicsf.com/e-futures

（4） 晋商银行股份有限公司

住所：太原市长风西街 1 号丽华大厦

办公地址：山西省太原市小店区长风街 59 号

法定代表人：阎俊生

联系人：卫奕信

电话：95105588

网站：www.jshbank.com

（5） 长江证券股份有限公司

住所：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

办公地址：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

法定代表人：李新华

联系人：奚博宇

电话：95579

网站：<https://www.95579.com/>

（6） 中原银行股份有限公司

办公地址：河南省郑州市郑东新区 CBD 商务外环路 23 号中科金座大厦

邮政编码：450000

法定代表人：窦荣兴

联系人：赵栋一

电话：0371-85519823

传真：0371-85519869

客服电话：95186

网址：www.zybank.com.cn

（7）平安证券股份有限公司

住所：深圳市福田区中心区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层

办公地址：深圳市福田区中心区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层

法定代表人：何之江

联系电话：021-38637436

传真：0755-82435367

联系人：周一涵

客服电话：95511-8

公司网址：<http://stock.pingan.com>

（8）长城证券股份有限公司

办公地址：深圳市福田区深南大道 6008 号 14、16、17 楼

邮政编码：518034

法定代表人：曹宏

联系人：金夏

电话：95514

网址：www.cgws.com

（9）上海华信证券有限责任公司

住所：上海浦东新区世纪大道 100 号环球金融中心 9 楼

法定代表人：陈灿辉

办公地址：上海浦东新区世纪大道 100 号环球金融中心 9 楼

邮政编码：200003

联系人：徐璐

电话：400-820-5999

网址：<http://www.shhxzq.com>

（10）云南红塔银行股份有限公司

住所：云南省玉溪市东风南路 2 号

法定代表人：李光林

办公地址：云南省玉溪市东风南路 2 号

邮政编码：653100

联系人：倪源

电话：0877-96522

网址：www.ynhtbank.com

客服电话：0877-96522

（11）中国银河证券股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街 35 号 2-6 层

法定代表人：陈共炎

地址：北京市西城区金融大街 35 号 2-6 层

邮编：100033

联系人：辛国政

客服电话：4008-888-888

公司网址：www.chinastock.com.cn

（12）国金证券股份有限公司

住所：四川省成都市青羊区东城根上街 95 号

法定代表人：冉云

办公地址：四川省成都市青羊区东城根上街 95 号

邮政编码：610015

联系人：刘婧漪、贾鹏

电话：028-86690057、028-86690058

网址：www.gjzq.com.cn

客户服务电话：95310

（13）宁波银行股份有限公司

住所：宁波市鄞州区宁南南路 700 号

法定代表人：陆华裕

办公地址：宁波市鄞州区宁南南路 700 号

邮政编码：315100

联系人：于波涛

电话：95574

网址：www.nbcb.com.cn

（14）交通银行股份有限公司

住所：上海市银城中路 188 号

办公地址：上海市长宁区仙霞路 18 号

法定代表人：彭纯

联系电话：021-58781234

传真：021-58408483

联系人：王菁

客服电话：95559

公司网址：<http://www.bankcomm.com>

（15）江苏汇林保大基金销售有限公司

住所：南京市高淳区经济开发区古檀大道 47 号

法定代表人：吴言林

办公地址：南京市鼓楼区中山北路 105 号中环国际 1413 室

邮政编码：210000

联系人：孙平

电话：025-66046166

网址：www.huilinbd.com

（16）上海大智慧基金销售有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 428 号 1 号楼 1102、1103 单

元

法定代表人：申健

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 428 号 1 号楼 1102、1103

单元

邮政编码：200127

联系人：张婷

电话：18017373527

网址：<https://www.wg.com.cn/>

（17）上海汇付基金销售有限公司

住所：上海市黄浦区黄河路 333 号 201 室 A 区 056 单元

法定代表人：金佶

办公地址：上海市徐汇区宜山路 700 号普天信息产业园 2 期 C5 栋 2 楼

邮政编码：200233

联系人：甄宝林

电话：021-34013996-0311

网址：<https://www.hotjijin.com/>

（18）天津国美基金销售有限公司

住所：天津经济技术开发区第一大街 79 号 MSDC1-28 层 2801

法定代表人：丁东华

办公地址：北京市朝阳区霄云路 26 号鹏润大厦 B 座 9 层

邮政编码：100125

联系人：常萌

电话：010-59287105

网址：<http://www.gomefinance.com.cn>

（19）北京创金启富基金销售有限公司

住所：北京市西城区白纸坊东街 2 号院 6 号楼 712 室

法定代表人：梁蓉

办公地址：北京市西城区白纸坊东街 2 号院 6 号楼 712 室

邮政编码：100053

联系人：李慧慧

电话：400-6262-818

网址：<https://www.5irich.com>

（20）一路财富（北京）基金销售股份有限公司

住所：北京市西城区阜成门大街 2 号万通新世界 A 座 2208

法定代表人：吴雪秀

办公地址：北京市海淀区宝盛里宝盛南路 1 号院奥北科技园国泰大厦 9 层

邮政编码：100000

联系人：董宣

电话：400-001-1566

网址：<https://www.yilucaifu.com/>

（21）南京途牛基金销售有限公司

住所：南京市玄武区玄武大道 699-1 号

法定代表人：宋时琳

办公地址：南京市玄武区玄武大道 699-32 号

邮政编码：210042

联系人：张士帅

电话：4007-999-999 转 3

网址：<http://jr.tuniu.com>

（22）北京唐鼎耀华基金销售有限公司

住所：北京市延庆县延庆经济开发区百泉街 10 号 2 栋 236 室

法定代表人：张冠宇

办公地址：北京市朝阳区建国门外大街 19 号 A 座 1505 室

邮政编码：100020

联系人：王丽敏

电话：400-819-9868

网址：<http://www.datangwealth.com>

（23）北京展恒基金销售股份有限公

住所：北京市顺义区后沙峪镇安富街 6 号

法定代表人：闫振杰

办公地址：北京市朝阳区安苑路 15-1 邮电新闻大厦 6 层

邮政编码：101300

联系人：李晓芳

电话：400-818-8000

网址：<https://www.myfund.com/>

（24）济安财富（北京）基金销售有限公司

住所：北京市朝阳区太阳宫中路 16 号院 1 号楼 3 层 307

办公地址：北京市朝阳区太阳宫中路 16 号院 1 号楼 3 层 307

邮政编码：100020

法定代表人：杨健

联系人：李海燕

电话：400-673-7010

网址：www.jianfortune.com

（25）南京苏宁基金销售有限公司

住所：江苏省南京市玄武区苏宁大道 1-5 号

法定代表人：王锋

办公地址：江苏省南京市玄武区苏宁大道 1-5 号

邮政编码：210042

联系人：张慧

电话：95177

网址：<http://www.snjijin.com>

（26）嘉实财富管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 8 号上海国金中心办公楼二期
53 层 5312-15 单元

法定代表人：赵学军

办公地址：北京市朝阳区建国路 91 号金地中心 A 座 6 层

邮政编码：100022

联系人：李雯

电话：400-021-8850

网址：www.harvestwm.cn

（27）扬州国信嘉利基金销售有限公司

住所：江苏省扬州市广陵新城信息产业基地 3 期 20B 栋

法定代表人：刘晓光

办公地址：江苏省扬州市邗江区文昌西路 56 号公元国际大厦 320 室

邮政编码：225100

联系人：苏曦

电话：400-021-6088

网址：<https://www.gxjlc.com/>

（28）北京蛋卷基金销售有限公司

住所：北京市朝阳区创远路 34 号院融新科技中心 C 座 17 层

法定代表人：钟斐斐

办公地址：北京市朝阳区阜通东大街 T3 A 座 19 层

邮政编码：100102

联系人：袁永姣

电话：4000-618-518

网址：<http://www.danjuanapp.com>

（29）中证金牛（北京）投资咨询有限公司

住所：北京市丰台区东管头 1 号 2 号楼 2-45 室

法定代表人：钱昊旻

办公地址：北京市宣武门外大街甲一号新华社第三工作区 A 座 5 层

邮政编码：100052

联系人：沈晨

电话：400-8909998

网址：<https://www.jnlc.com>

（30）上海挖财基金销售有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 799 号 5 层 01、02、03 室

法定代表人：吕柳霞

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 799 号 5 层 01、02、03

室

邮政编码：200127

联系人：曾芸

电话：021-50810687

网址：<http://www.wacaijijin.com>

（31）通华财富（上海）基金销售有限公司

住所：上海市虹口区同丰路 667 弄 107 号 201 室

法定代表人：沈丹义

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴世纪金融广场杨高南路 799 号 3 号楼 9 楼

邮政编码：200127

联系人：褚志朋

电话：95193

网址：<http://www.tonghuafund.com>

（32）上海基煜基金销售有限公司

住所：上海市崇明县长兴镇路潘园公路 1800 号 2 号楼 6153 室

法定代表人：王翔

办公地址：上海市杨浦区昆明路 518 号 A1002 室

邮政编码：200120

联系人：蓝杰

电话：021-65370077

网址：<http://www.jiyufund.com.cn>

（33）上海华夏财富投资管理有限公司

住所：上海市虹口区东大名路 687 号 1 幢 2 楼 268 室

法定代表人：毛淮平

办公地址：北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 8 层

邮政编码：100032

联系人：仲秋玥

电话：400-817-5666

网址：<http://www.amcfortune.com>

（34）北京肯特瑞基金销售有限公司

住所：北京市海淀区海淀东三街 2 号 4 层 401-15

法定代表人：王苏宁

办公地址：北京市亦庄经济开发区科创十一街 18 号院京东 A 座 4 层

邮政编码：100176

联系人：李丹

电话：400-098-8511

网址：<http://kenterui.jd.com>

（35）上海利得基金销售有限公司

住所：上海市宝山区蕴川路 5475 号 1033 室

法定代表人：李兴春

办公地址：上海市虹口区东大名路 1098 号浦江金融世纪广场

邮政编码：200127

联系人：陈洁

电话：400-921-7755

网址：<http://www.leadfund.com.cn>

（36）上海万得基金销售有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区福山路 33 号 11 楼 B 座

法定代表人：黄祎

办公地址：上海市浦东新区浦明路 1500 号万得大厦 11 楼

邮政编码：200120

联系人：徐亚丹

电话：400-821-0203

网址：<http://www.520fund.com.cn>

（37）深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

住所：深圳市福田区华强北路赛格科技园 4 栋 10 层 1006 室

法定代表人：洪弘

办公地址：北京市西城区宣武门外大街 28 号富卓大厦 7 层

邮政编码：100032

联系人：文雯

电话：400-166-1188

网址：<http://www.jrj.com.cn>

（38）北京汇成基金销售有限公司

住所：北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108 室

法定代表人：王伟刚

办公地址：北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108 室

邮政编码：100190

联系人：王骁骁

电话：400-619-9059

网址：<http://www.hcjijin.com>

（39）上海长量基金销售有限公司

住所：上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室

法定代表人：张跃伟

办公地址：上海市浦东新区东方路 1267 号 11 层

邮政编码：200120

联系人：张佳琳

电话：400-820-2899

网址：<http://www.erichfund.com>

（40）诺亚正行基金销售有限公司

住所：上海市虹口区飞虹路 360 弄 9 号 3724 室

法定代表人：汪静波

办公地址：上海市杨浦区昆明路 508 号北美广场 B 座 12 楼

邮政编码：200082

联系人：李娟

电话：400-821-5399

网址：<http://www.noah-fund.com>

（41）深圳众禄基金销售股份有限公司

住所：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦 8 楼

法定代表人：薛峰

办公地址：深圳市罗湖区梨园路 8 号 HALO 广场 4 楼

邮政编码：518028

联系人：童彩平

电话：4006-788-887

网址：<http://www.zlfund.cn>

（42）上海天天基金销售有限公司

住所：上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼 2 层

法定代表人：其实

办公地址：上海市徐汇区宛平南路 88 号 26 层

邮政编码：200235

联系人：王超

电话：4001818188

网址：<http://www.1234567.com.cn>

（43）上海好买基金销售有限公司

住所：上海市虹口区欧阳路 196 号 26 号楼 2 楼 41 号

法定代表人：杨文斌

办公地址：上海市浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 903~906 室

邮政编码：200120

联系人：张茹

电话：400-700-9665

网址：<http://www.ehowbuy.com>

（44）蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

住所：浙江省杭州市余杭区仓前街道文一西路 1218 号 1 幢 202 室

法定代表人：祖国明

办公地址：上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 27F

邮政编码：200135

联系人：韩爱彬

电话：4000-766-123

网址：<http://www.fund123.cn/>

（45）浙江同花顺基金销售有限公司

住所：浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦 903 室

法定代表人：吴强

办公地址：浙江省杭州市翠柏路 7 号杭州电子商务产业园 2 号楼 2 楼

邮政编码：310012

联系人：董一锋

电话：4008-773-772

网址：<http://www.5ifund.com>

（46）上海联泰基金销售有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区富特北路 277 号 3 层 310 室

法定代表人：尹彬彬

办公地址：上海市长宁区福泉北路 518 号 8 座 3 层

邮政编码：200335

联系人：兰敏

电话：400-166-6788

网址：<http://www.66zichan.com>

（47）上海凯石财富基金销售有限公司

住所：上海市黄浦区西藏南路 765 号 602-115 室

法定代表人：陈继武

办公地址：上海市黄浦区延安东路 1 号凯石大厦 4 楼

邮政编码：200001

联系人：王哲宇

电话：4006-433-389

网址：www.vstonewealth.com

（48）北京虹点基金销售有限公司

住所：北京市朝阳区工人体育馆北路甲 2 号裙房 2 层 222 单元

法定代表人：何静

办公地址：北京市朝阳区东三环北路 17 号恒安大厦 10 层

邮政编码：100026

联系人：陈铭洲

电话：400-618-0707

网址：<https://www.hongdianfund.com/>

（49）武汉市伯嘉基金销售有限公司

住所：武汉市江汉区泛海国际 SOH07 栋 23 层 01、04 号

法定代表人：陶捷

办公地址：武汉市江汉区泛海国际 SOH07 栋 23 层 01、04 号

邮政编码：430000

联系人：陆锋

电话：4000279899

网址：<http://www.buyfunds.cn/>

（50）上海陆金所基金销售有限公司

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元

法定代表人：王之光

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼

邮政编码：200120

联系人：程晨

电话：4008219031

网址：<http://www.lufunds.com>

（51）珠海盈米基金销售有限公司

住所：珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室-3491

法定代表人：肖雯

办公地址：广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 12 楼

邮政编码：510308

联系人：吴煜浩

电话：020-89629066

网址：<http://www.yingmi.cn>

（52）兴业银行股份有限公司钱大掌柜

住所：福州市湖东路 154 号

法定代表人：高建平

办公地址：上海市浦东新区银城路 167 号兴业银行大厦 17 层

邮政编码：200120

联系人：禾青

电话：40018-95561

网址：<https://www.yypt.com>

其他销售机构具体名单详见基金份额发售公告以及基金管理人届时发布的调整销售机构的相关公告。

（二）登记机构

名称：兴业基金管理有限公司

住所：福建省福州市鼓楼区五四路 137 号信和广场 25 楼

办公地址：上海市浦东新区银城路 167 号 13、14 层

法定代表人：官恒秋

设立日期：2013 年 4 月 17 日

联系电话：021-22211899

联系人：金晨

（三）出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市通力律师事务所

住所：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

办公场所：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

负责人：俞卫锋

电话：021-31358666

传真：021-31358600

联系人：陈颖华

经办律师：黎明、陈颖华

（四）审计基金财产的会计师事务所

名称：毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：北京市东城区东长安街 1 号毕马威大楼八层

主要经营场所：上海市静安区南京西路 1266 号恒隆广场二期 25 楼

法定代表人：邹俊

电话：：（021） 2212 2888

传真：（021） 6288 1889

联系人：黄小熠

经办注册会计师：黄小熠、叶凯韵

四、基金的名称

兴业中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金

五、基金的类型

债券型指数证券投资基金

六、基金的投资目标

紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。在正常市场情况下，本基金力争追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年化跟踪误差控制在 4%以内。

七、基金的投资范围

本基金主要投资于标的指数成份债券和备选成份债券。为更好地实现基金的投资目标，本基金会少量投资于其他债券（含国债、政策性金融债、地方政府债、央行票据等）、债券回购、同业存单、银行存款、货币市场工具及中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

本基金不投资股票、权证等权益类资产。

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

基金的投资组合比例为：本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%；投资标的指数成份券和备选成份券的比例不低于本基金非现金基金资产的 80%；本基金保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

八、基金的投资策略

（一）投资策略

本基金为指数型基金，原则上采用完全复制法，按照成份债券在中债 1-3 年政策性金融债指数中的基准权重构建指数化投资组合。

（1）资产配置策略

本基金以追求标的指数长期增长的稳定收益为宗旨，在降低跟踪误差和控制流动性风险的双重约束下构建指数化的投资组合。本基金跟踪标的指数成份债券和备选成份债券的资产比例不低于本基金非现金基金资产的 80%。

（2）债券投资策略

基于基金流动性管理和有效利用基金资产的需要，本基金将投资于流动性较好的国债等债券，保证基金资产流动性，提高基金资产的投资收益。本基金将根据宏观经济形势、货币政策、证券市场变化等分析判断未来利率变化，结合债券定价技术，进行个券选择。

1) 完全复制策略

本基金主要采取完全复制法构建基金债券投资组合，并根据标的指数成份债券及其权重的变动而进行相应的调整。

2) 替代性策略

当成份债券市场流动性不足或因法规规定本基金不能投资关联方债券等情况导致本基金无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人将通过投资备选成份债券为主，并辅以非成份债券等金融工具来构建替代组合进行跟踪复制。

在正常市场情况下，基金管理人力争本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的年跟踪误差不超过 4%。如因指数编制规则或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。

（二）基金的投资管理流程

1、决策依据

- 1) 国家有关法律、法规和《基金合同》的规定；
- 2) 以维护基金份额持有人利益为基金投资决策的准则；

3) 国内宏观经济发展态势、微观经济运行环境、证券市场走势、政策指向及全球经济因素分析。

2、投资管理程序

1) 投资基础研究

对于债券投资，分析师通过宏观经济、货币政策和债券市场的分析判断，开展标的指数跟踪、成份债券选成份债券等相关信息的搜集与分析、流动性分析、误差及其归因分析等工作，为本基金投资管理提供决策依据。

2) 资产配置会议

本基金管理人定期召开资产配置会议，讨论基金的资产组合，形成资产配置建议。

3) 构建投资组合

投资决策委员会在基金合同规定的投资框架下，审议并确定基金资产配置方案，并审批重大单项投资决定。

基金经理在投资决策委员会的授权下，根据本基金的资产配置要求，参考资产配置会议、投研会议讨论结果，制定基金的抽样复制计划和具体个券投资组合，在其权限范围进行基金的日常投资组合管理工作。

4) 交易执行

基金经理制定具体的操作计划并通过交易系统或书面指令形式向中央交易室发出交易指令。中央交易室依据投资指令具体执行买卖操作，并将指令的执行情况反馈给基金经理。

5) 投资组合监控与调整

基金经理负责向投资决策委员会汇报基金投资执行情况，监察稽核部对基金投资进行日常监督，风险管理员负责完成内部的基金业绩和风险评估。基金经理根据标的指数的每日变动情况，结合成份债券等的基本面、流动性、基金申购赎回的现金流量等情况，以及基金投资绩效评估结果等，对基金投资组合进行动态监控和调整优化，密切跟踪标的指数。

九、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为： $95\% \times$ 中债 1-3 年政策性金融债（全价）指数收益率 $+5\% \times$ 银行活期存款利率（税后）

如果指数发布机构变更或者停止上述标的指数编制及发布，或者上述标的指数由其他指数代替，或由于指数编制方法等重大变更导致上述指数不宜继续作为标的指数，或证券市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出时，本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则，通过适当的程序变更本基金的标的指数，并同时更换本基金的基金名称与业绩比较基准。若标的指数、业绩比较基准变更对基金投资无实质性影响（包括但不限于编制机构变更、指数更名等），则无需召开基金份额持有人大会，基金管理人可在取得基金托管人同意后变更标的指数和业绩比较基准，报中国证监会备案并及时公告。

十、基金的风险收益特征

本基金为债券型指数基金，其风险收益预期高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。本基金主要投资于标的指数成份券及备选成份券，具有与标的指数相似的风险收益特征。

十一、基金投资组合报告

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人交通银行股份有限公司，根据本基金合同规定，复核了本投资组合报告，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据取自本基金2019年第4季度报告，所载数据截至2019年12月31日，本报告中所列财务数据未经审计。

1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,526,839,717.50	97.66
	其中：债券	2,526,839,717.50	97.66
	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	10,400,639.52	0.40
8	其他资产	50,196,288.12	1.94
9	合计	2,587,436,645.14	100.00

2 报告期末按行业分类的股票投资组合

2.1 报告期末（指数投资）按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

3.1 报告期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

3.2 积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

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	2,526,839,717.50	104.03
	其中：政策性金融债	2,526,839,717.50	104.03
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）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,526,839,717.50	104.03

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	160206	16国开06	2,800,000	281,064,000.00	11.57
2	180412	18农发12	2,000,000	202,020,000.00	8.32
3	190202	19国开	1,800,000	180,846,000.00	7.45

		02	0	0.00	
4	170206	17国开 06	1,600,00 0	164,048,00 0.00	6.75
5	180409	18农发 09	1,600,00 0	163,296,00 0.00	6.72

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排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

9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金投资范围不包含股指期货。

9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资范围不包含股指期货。

10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

10.1 本期国债期货投资政策

本基金投资范围不包含国债期货。

10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金投资范围不包含国债期货。

10.3 本期国债期货投资评价

本基金投资范围不包含国债期货。

11 投资组合报告附注

11.1 报告期内，本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求，未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期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。

11.2 本基金为债券型基金，未涉及股票相关投资。

11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	2,763.15
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	50,162,925.07
5	应收申购款	30,599.90
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	50,196,288.12

11.4 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可转换债券。

11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

11.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

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。

下述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

本基金合同生效日2019年5月27日，基金业绩截止日2019年12月31日。

历史各时间段基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较

兴业中债1-3年政策性金融债A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
自基金合同生效日 (2019年5月27日)起 至2019年12月31日 止期间	2.23%	0.04%	1.38%	0.03%	0.85%	0.01%

兴业中债1-3年政策性金融债C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
自基金合同生效日 (2019年5月27日)起 至2019年12月31日 止期间	1.67%	0.03%	1.41%	0.03%	0.26%	0.00%

注：1、兴业聚全灵活配置混合型证券投资基金自2019年4月30日起至2019年5月26日以通讯方式召开基金份额持有人大会，于2019年5月27日表决通过了《关于兴业聚全灵活配置混合型证券投资基金转型为兴业中债1-3年政策性金融债指数证券投资基金有关事项的议案》。根据基金份额持有人大会决议，兴业聚全灵活配置混合型证券投资基金正式转型为兴业中债1-3年政策性金融债指数证券投资基金，本次大会决议自2019年5月27日生效。详见基金管理人在指定媒介发布的公告。

2、本基金转型后的业绩比较基准为：95%*中债1-3年政策性金融债（全价）指

数收益率+5%*银行活期存款利率（税后）。

3、转型后，本基金自2019年5月27日起增设C级，C级份额自2019年6月5日起存续，

4、基金的过往业绩并不预示其未来表现

十三、基金的费用与税收

（一）基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、基金的标的指数许可使用费；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金的证券交易费用；
- 8、基金的银行汇划费用；
- 9、证券账户开户费用、银行账户维护费用；
- 10、C 类基金份额的销售服务费；
- 11、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

（二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.15% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.05% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

3、指数许可使用费

指数许可使用费从基金合同生效日的后一日开始计算；基金成立的首个季度费用按照基金合同生效日所在季度剩余自然日计提。收取期间为基金合同生效日的后一日至指数使用许可协议有效期止。

本基金按照基金管理人与标的指数许可方所签订的指数使用许可协议中所规定的指数许可使用费计提方法支付指数许可使用费。在通常情况下，基金合同生效后的指数许可服务费按前一日的基金资产净值的万分之一点五（1.5 个基点）的年费率计提，计算方法如下：

$$H=E \times 0.015\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应付的基金合同生效后服务费

E 为前一日的基金资产净值

指数许可使用费每日计提，按季支付。从基金成立的第二个季度起，指数许可使用费的收取下限为每季度人民币伍万元，基金设立当年，不足一季度的，根据实际天数按比例计算。如果指数使用许可协议约定的指数许可使用费的计算方法、费率和支付方式等发生调整，本基金将采用调整后的方法或费率计算指数使用费。基金管理人应在招募说明书及其更新中披露基金最新适用的方法。

4、C 类基金份额的销售服务费

本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务年费率为 0.10%，按前一日 C 类基金资产净值的 0.10% 年费率计提。

销售服务费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为前一日 C 类基金份额的基金资产净值

销售服务费每日计算，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划付指令，经基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中划出，由基金管理人代收后按照相关协议支付给各个基金销售机构。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

上述“（一）基金费用的种类”中第 4-9、11 项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

（三）不列入基金费用的项目

1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；

2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；

3、本基金由兴业聚全灵活配置混合型证券投资基金转型而来，基金合同生效前发生的相关费用按照《兴业聚全灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的相关约定处理；

4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

（四）基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。基金财产投资的相关税收，由基金份额持有人承担，基金管理人或者其他扣缴义务人按照国家有关税收征收的规定代扣代缴。鉴于基金管理人为本基金的利益投资、运用基金财产过程中，可能因法律法规、税收政策的要求而成为纳税义务人，就归属于基金的投资收益、投资回报和/或本金承担纳税义务。因此，本基金运营过程中由于上述原因发生的增值税等税负，仍由本基金财产承担，届时基金管理人可能通过本基金财产账户直接缴付，或划付至基金管理人账户并由基金管理人依据税务部门要求完成税款申报缴纳。若届时相关法律法规另有规定的，从其规定。

十二、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书（更新）依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及其它有关法律法规的要求，对本基金管理人于 2019 年 11 月 15 日刊登的《兴业中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金招募说明书（2019 年第 1 号）》进行了更新，并根据基金管理人在《基金合同》生效后对本基金实施的投资经营活动进行了内容的补充和更新，主要补充和更新的内容如下：

- 1、在“重要提示”部分，更新了本基金招募说明书内容的截止日期以及相关财务数据的截至日期。
- 2、在“三、基金管理人”部分，更新了基金管理人的主要人员情况。
- 3、在“五、相关服务机构”部分，更新了直销联系人、其他销售机构、会计师事务所的信息。
- 4、在“九、基金的投资”部分，更新了基金投资组合报告的内容。
- 5、在“十、基金的业绩”部分，更新了基金业绩表现的内容。
- 6、在“二十二、其他应披露事项”部分，更新了基金管理人在招募说明书更新期间刊登的与本基金相关的公告。

兴业基金管理有限公司

2020 年 3 月 31 日