

# 兴全合润混合型证券投资基金

## 上市交易公告书

基金管理人：兴证全球基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

注册登记机构：中国证券登记结算有限责任公司

上市地点：深圳证券交易所

上市时间：2021年1月28日

公告日期：2021年1月25日

## 目录

一、重要声明与提示 .....	3
二、基金概览.....	3
三、基金的历史沿革和上市交易 .....	4
四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人.....	6
五、基金主要当事人简介 .....	7
六、基金合同摘要 .....	12
七、基金财务状况.....	13
八、基金投资组合 .....	14
九、重大事件揭示 .....	18
十、基金管理人承诺 .....	18
十一、基金托管人承诺 .....	19
十二、备查文件目录 .....	19
附件：基金合同内容摘要 .....	20

## 一、重要声明与提示

《兴全合润混合型证券投资基金上市交易公告书》依据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称《基金法》)、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第 1 号<上市交易公告书的内容与格式>》和《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制,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、误导性陈述或者重大遗漏,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。本基金托管人保证本报告中基金财务会计资料等内容的真实性、准确性和完整性,承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。中国证监会、证券交易所对兴全合润混合型证券投资基金上市交易及有关事项的意见,均不表明对本基金的任何保证。

本公告书第七节“基金财务状况”未经审计。

凡本上市交易公告书未涉及的有关内容,请投资者详细查阅 2021 年 1 月 1 日刊登中国证监会规定媒介和兴证全球基金管理有限公司网站([www.xqfunds.com](http://www.xqfunds.com))的本基金招募说明书。

## 二、基金概览

- 1、基金名称:兴全合润混合型证券投资基金
- 2、基金简称:兴全合润混合  
场内简称:兴全合润
- 3、本次上市交易的基金份额交易代码:163406
- 4、基金份额总额:截至 2021 年 1 月 21 日,本基金的基金份额总额为 11,132,171,837.61 份。
- 5、基金份额净值:截止 2021 年 1 月 21 日,本基金的基金份额净值为 2.1714 元。
- 6、本次上市交易的基金份额总额:104,147,660.00 份(截止 2021 年 1 月 21 日)

- 7、上市交易的证券交易所：深圳证券交易所
- 8、上市交易日期：2021年1月28日
- 9、基金管理人：兴证全球基金管理有限公司
- 10、基金托管人：招商银行股份有限公司
- 11、本次上市交易的基金份额注册登记机构：中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司

### 三、基金的历史沿革和上市交易

#### （一）本基金的历史沿革

兴全合润混合型证券投资基金由兴全合润分级混合型证券投资基金终止分级运作并变更而来。

兴业合润分级股票型证券投资基金经中国证监会证监许可【2010】229号文核准募集，基金管理人为兴业全球基金管理有限公司（现更名为兴证全球基金管理有限公司），基金托管人为招商银行股份有限公司。基金自2010年3月22日至2010年4月16日进行公开募集，募集结束后基金管理人向中国证监会办理备案手续。经中国证监会书面确认，《兴业合润分级股票型证券投资基金基金合同》于2010年4月22日起正式生效。经基金管理人董事会审议通过，并经基金托管人同意和中国证监会批准，兴业合润分级股票型证券投资基金自2011年1月1日起将基金名称变更为兴全合润分级股票型证券投资基金（基金代码保持不变）。基金管理人根据《运作办法》和旗下各股票型基金《基金合同》的相关规定，经对相关风险进行审慎、充分评估，拟不变更兴全合润分级股票型证券投资基金的股票投资比例，由股票型证券投资基金变更为混合型证券投资基金。基金管理人经与基金托管人协商，并报中国证监会备案，兴全合润分级股票型证券投资基金自2015年8月7日起将基金名称变更为兴全合润分级混合型证券投资基金（基金代码保持不变）。

为落实《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》关于分级基金的整改要求，并根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》等相关法律法规的规定，

经与基金托管人协商一致，并报监管部门备案，基金管理人于 2020 年 11 月 18 日发布《关于兴全合润分级混合型证券投资基金合同先后完成了二次修订：基金管理人于 2020 年 11 月 18 日发布《关于兴全合润分级混合型证券投资基金修订基金合同的公告》，基金合同的修订内容主要为依据法律法规增加取消分级机制，此次基金合同修订自 2020 年 11 月 19 日起生效；基金管理人于 2020 年 12 月 2 日发布《关于兴全合润分级混合型证券投资基金之合润 A 份额和合润 B 份额终止运作、终止上市并修改基金合同的公告》，明确分级份额的终止上市日为 2021 年 1 月 4 日、份额折算的具体安排，并将《兴全合润分级混合型证券投资基金基金合同》修订为《兴全合润混合型证券投资基金基金合同》，修订后的《兴全合润混合型证券投资基金基金合同》于 2021 年 1 月 1 日生效，《兴全合润分级混合型证券投资基金基金合同》同时失效。《兴全合润混合型证券投资基金基金合同》生效后，兴全合润分级混合型证券投资基金的基金名称变更为“兴全合润混合型证券投资基金”。

根据《关于兴全合润分级混合型证券投资基金之合润 A 份额和合润 B 份额终止运作并修改基金合同的公告》，以 2020 年 12 月 31 日为份额折算基准日，基金管理人于在该日登记在册的合润 A 份额和合润 B 份额办理向场内兴全合润份额的折算业务，并于 2021 年 1 月 5 日在证监会规定媒介上发布了《关于兴全合润分级混合型证券投资基金之合润 A 份额和合润 B 份额基金份额折算结果的公告》。

## （二）基金份额上市交易的主要内容

- 1、本基金上市交易的核准机构和核准文号：深圳证券交易所 深证上【2021】102 号
- 2、上市交易日期：2021 年 1 月 28 日
- 3、上市交易的证券交易所：深圳证券交易所
- 4、基金场内简称：兴全合润
- 5、交易代码：163406
- 6、本次上市交易份额：104,147,660.00 份（截止 2021 年 1 月 21 日）
- 7、基金资产净值的披露：每个交易日的次日公布基金的基金份额净值，并在深圳证券交易所行情发布系统揭示。
- 8、未上市交易份额的流通规定：未上市交易的份额托管在场外，持有人将

其转托管至深圳证券交易所场内后即可上市流通。

#### 四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人

##### (一) 基金份额持有情况

截至 2021 年 1 月 21 日，兴全合润的持有人总户数 1,894,239 户，其中场外持有人总户数 1,891,887 户，场内持有人总户数 2,352 户，平均每户持有的场内基金份额：44,280.47 份。

截至 2021 年 1 月 21 日，兴全合润基金份额总额：11,132,171,837.61 份，其中场内份额：104,147,660.00 份，场内机构投资者持有的基金份额及占场内基金总份额及比例：机构持有 11,211,144.00 份,占 10.76%；场内个人投资者持有的基金份额及占场内基金总份额及比例：个人持有 92,936,516.00 份,占 89.24%。

##### (二) 基金场内份额前十名持有人情况（截止 2021 年 1 月 21 日）

序号	持有人名称	持有份额（份）	占场内总份额比例
1	陈力	3,700,000.00	3.55%
2	王辉	3,400,000.00	3.26%
3	无锡同聚福企业管理有限公司	3,132,510.00	3.01%
4	华泰证券股份有限公司客户信用交易担保证券账户	2,737,588.00	2.63%
5	黄岳川	2,181,525.00	2.09%
6	忻存艳	1,895,034.00	1.82%
7	吴婷婷	1,701,769.00	1.63%
8	侯举超	1,431,233.00	1.37%
9	张兴会	1,334,517.00	1.28%
10	广发证券股份有限公司客户信用交易担保证券账户	1,320,622.00	1.27%

注：由于四舍五入的原因，占场内总份额比例分项之和与合计可能有尾差。

##### (三) 截至 2021 年 1 月 21 日，基金管理人的从业人员持有本基金份额的情况

本基金管理人的基金从业人员持有本基金份额总量为 49,418,413.19 份，占该基金总份额的比例为 0.44%。其中，本基金管理人高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有本基金份额总量的数量区间为 100 万份以上；本基金的基金

经理持有本基金份额总量的数量区间为 100 万份以上。因本基金基金经理同时也是本基金管理人基金投资部门负责人，故上述统计有重合部分。

注：以上信息依据中国证券登记结算有限责任公司提供的持有人信息编制。

## 五、基金主要当事人简介

### （一）基金管理人

- 1、名称：兴证全球基金管理有限公司
- 2、注册地址：上海市黄浦区金陵东路 368 号
- 3、法定代表人：杨华辉
- 4、总经理：庄园芳
- 5、成立时间：2003 年 9 月 30 日
- 6、注册资本：1.5 亿元人民币
- 7、设立批准文号：中国证监会 证监基金字 [2003] 100 号
- 8、工商登记注册的统一社会信用代码：913100007550077618
- 9、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（涉及许可经营的凭许可证经营）
- 10、存续期间：持续经营
- 11、股东及其出资比例：兴业证券股份有限公司（51%）、全球人寿保险国际公司 AEGON International B.V.（49%）
- 12、内部组织结构及职能

兴证全球基金管理有限公司总部位于上海，在北京、深圳、厦门、上海设有分公司，并成立了全资子公司——兴证全球资本（上海）管理有限公司。公司总部下设投资决策委员会、风险管理委员会、综合管理部、计划财务部、合规管理部、审计部、风险管理部、投融资业务审批部、信息技术部、基金运营部、基金管理部、固定收益部、研究部、专户投资部、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。随着业务发展的需要，公司将对业务部门进行相应的调整。

综合管理部：负责公司人员招募、培训、绩效考核、薪酬福利等人力资源工

作；负责公司职场维护、办公用品采购、各种会议组织等综合行政工作。

计划财务部：负责公司日常财务运作、预算管理、税收筹划、工商税务、固有资金管理等工作。

合规管理部：负责法务、信息披露、反洗钱工作。

风险管理部：负责监督检查旗下投资组合运作的合规情况及投资风险控制情况。

审计部：负责监察稽核、合规控制工作。

信息技术部：负责公司各类核心业务系统及其他相关信息系统的开发和建设工作，组织和实施信息系统软硬件的运维管理工作，建立和完善公司信息系统和数据安全体系，建设公司大数据、人工智能等金融科技应用等工作。

基金运营部：负责日常基金注册登记业务，与基金销售机构间清算资金的核算及费用划拨，基金相关结算资金和托管账户的开设、维护、变更及相关开户资料的管理，进行公司所管理的基金和专户资产的估值核算等工作。

基金管理部：负责主动股票策略投资，对股票投资中重点行业、板块及其投资比例范围等提出指导性意见，决定重点投资品种的额度和比例，审定基金投资组合方案。

固定收益部：负责根据投资决策委员会制定的投资原则和计划进行组合管理，向交易部下达投资指令，及时向投资决策委员会提供市场动态信息。

专户投资部：负责特定客户资产管理产品投资。

研究部：负责开展宏观经济研究、债券研究、行业与公司研究，为基金和专户的投资决策提供建议和依据。

FOF 投资与金融工程部：负责产品设计、投资业绩评价、量化支持、FOF 投资研究及热点专题研究。

交易部：负责组织、制定和执行交易计划；执行基金投资部的交易指令、记录并保存每日投资交易情况，保持与各证券交易商的联系并控制相应的交易额度，负责基金交易席位的安排、交易量管理等。

市场部：负责公司品牌建设、市场营销等。

渠道部：负责建设、管理和维护代销渠道，提高代销渠道的销售意愿和能力，达成公司新基金产品的发行和持续销售工作的销售任务，提升公司的品牌影响力。

机构业务部：负责机构客户的开发和服务工作，完成公司下达的销售目标任务。

电子商务部：负责公司网站、网上交易等互联网业务层面的营销推广、产品管理及日常运营，营销活动的发起和实施、电子支付渠道管理、互联网金融客户服务管理、互联网金融业务应急管理。

营销服务部：负责组织客户服务人员开展各项客户服务工作，为基金持有人、渠道客户经理、潜在客户通过电话、在线、邮件、账单、短信等方式的各类客户服务工作，提高客户满意度，为市场营销提供后台服务支持。

北京、深圳、厦门、上海分公司：负责所辖区域基金销售、与当地监管部门联络等工作。

### 13、人员情况

截至 2021 年 1 月 21 日，公司共有员工 289 人，所有人员在最近三年内均没有受到所在单位或有关管理部门的处罚。

14、信息披露负责人及咨询电话：杨卫东，（021）20398888

### 15、基金管理业务情况

截至 2021 年 1 月 21 日，公司旗下已管理兴全可转债混合型证券投资基金、兴全趋势投资混合型证券投资基金（LOF）、兴全货币市场证券投资基金、兴全全球视野股票型证券投资基金、兴全社会责任混合型证券投资基金、兴全有机增长灵活配置混合型证券投资基金、兴全磐稳增利债券型证券投资基金、兴全合润混合型证券投资基金、兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF）、兴全绿色投资混合型证券投资基金（LOF）、兴全精选混合型证券投资基金、兴全轻资产投资混合型证券投资基金（LOF）、兴全商业模式优选混合型证券投资基金（LOF）、兴全添利宝货币市场基金、兴全新视野灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金、兴全稳益定期开放债券型发起式证券投资基金、兴全天添益货币市场基金、兴全稳泰债券型证券投资基金、兴全兴泰定期开放债券型发起式证券投资基金、兴全恒益债券型证券投资基金、兴全合宜灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、兴全祥泰定期开放债券型发起式证券投资基金、兴全安泰平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）、兴全恒裕债券型证券投资基金、兴全多维价值混合型证券投资基金、兴全恒瑞三个月定期开放债券型发起式证券

投资基金、兴全合泰混合型证券投资基金、兴全社会价值三年持有期混合型证券投资基金、兴全恒鑫债券型证券投资基金、兴全优选进取三个月持有期混合型基金中基金（FOF）、兴全优选进取三个月持有期混合型基金中基金（FOF）、兴全沪港深两年持有期混合型证券投资基金、兴全汇享一年持有期混合型证券投资基金、兴全合丰三年持有期混合型证券投资基金、兴全恒祥 88 个月定期开放债券型证券投资基金、兴全安泰稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）、兴全安泰积极养老目标五年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、兴全合兴两年封闭运作混合型证券投资基金（LOF）共 37 只基金。

#### 16、本基金基金经理

谢治宇先生，经济学硕士。2007 年加入兴证全球基金管理有限公司，历任行业研究员、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。现任总经理助理、基金管理部投资总监兼本基金基金经理（2013 年 1 月 29 日起至今）、兴全合宜灵活配置混合型证券投资基金基金经理（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（2019 年 12 月 26 日起至今）。

#### （二）基金托管人

1. 名称：招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”）
2. 设立日期：1987 年 4 月 8 日
3. 注册地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
4. 办公地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
5. 注册资本：252.20 亿元
6. 法定代表人：缪建民
7. 行长：田惠宇
8. 资产托管业务批准文号：证监基金字[2002]83 号
9. 电话：0755—83199084
10. 传真：0755—83195201
11. 资产托管部信息披露负责人：张燕
12. 主要人员情况

缪建民先生，本行董事长、非执行董事，2020 年 9 月起担任本行董事、董

事长。中央财经大学经济学博士，高级经济师。十九届中央候补委员。招商局集团有限公司董事长。曾任中国人寿保险（集团）公司副董事长、总裁，中国人民保险集团股份有限公司副董事长、总裁、董事长，曾兼任中国人民财产保险股份有限公司董事长，中国人保资产管理有限公司董事长，中国人民健康保险股份有限公司董事长，中国人民保险（香港）有限公司董事长，人保资本投资管理有限公司董事长，中国人民养老保险有限责任公司董事长，中国人民人寿保险股份有限公司董事长。

田惠宇先生，本行行长、执行董事，2013年5月起担任本行行长、本行执行董事。美国哥伦比亚大学公共管理硕士学位，高级经济师。曾于2003年7月至2013年5月历任上海银行副行长、中国建设银行上海市分行副行长、深圳市分行行长、中国建设银行零售业务总监兼北京市分行行长。

汪建中先生，本行副行长。1991年加入本行；2002年10月至2013年12月历任本行长沙分行行长，总行公司银行部副总经理，佛山分行筹备组组长，佛山分行行长，武汉分行行长；2013年12月至2016年10月任本行业务总监兼公司金融总部总裁，期间先后兼任公司金融综合管理部总经理、战略客户部总经理；2016年10月至2017年4月任本行业务总监兼北京分行行长；2017年4月起任本行党委委员兼北京分行行长。2019年4月起任本行副行长。

刘波先生，招商银行资产托管部总经理。硕士研究生毕业，1999年7月加盟招商银行至今，历任招商银行重庆分行干部、总行计划财务部副经理、经理、高级经理、总行资产负债管理部总经理助理、深圳分行党委委员、行长助理、副行长等职务，具有20余年银行从业经验，在资产负债管理、资本管理、资产证券化、统计分析、金融同业、资产托管等领域有深入的研究和丰富的实务经验。

### 13. 基金托管业务经营情况

截至2020年9月30日，招商银行股份有限公司累计托管690只证券投资基金。

#### （三）登记机构

1. 名称： 中国证券登记结算有限公司
2. 住所： 北京市西城区太平桥大街17号
3. 法定代表人： 周明

4. 办公地址：北京市西城区太平桥大街 17 号
5. 电话：010-58598853
6. 传真：010-58598907
7. 联系人：丁志勇

#### **(四) 出具法律意见书的律师事务所**

1. 名称：上海市通力律师事务所
2. 住所：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼
3. 负责人：韩炯
4. 办公地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼
5. 联系电话：021-31358666
6. 传真：021-31358666
7. 联系人：陆奇
8. 经办律师：安冬、陆奇

#### **(五) 基金验资机构**

1. 名称：德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）
2. 住所：上海市延安东路 222 号 30 楼
3. 办公地址：上海市延安东路 222 号 30 楼
4. 法定代表人：曾顺福
5. 电话：(021) 61418888
6. 传真：(021) 63350377
7. 经办注册会计师：史曼、汪芳
8. 联系人：汪芳

## **六、基金合同摘要**

基金合同的内容摘要见附件。

## 七、基金财务状况

本基金基金合同生效后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。

兴全合润混合型证券投资基金截止 2021 年 1 月 21 日资产负债表(未经审计)

如下:

单位：人民币元

资产	本期末 2021 年 1 月 21 日
<b>资产：</b>	
银行存款	1,508,891,713.32
结算备付金	21,714,387.54
存出保证金	2,910,256.97
交易性金融资产	
其中：股票投资	21,613,752,806.60
基金投资	
债券投资	1,224,232,667.88
资产支持证券投资	
衍生金融资产	
贵金属投资	
买入返售金融资产	
应收证券清算款	
应收利息	17,423,567.67
应收股利	
应收申购款	95,464,638.75
递延所得税资产	
其他资产	
资产总计	24,484,390,038.73
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末 2021 年 1 月 21 日</b>
<b>负债：</b>	
短期借款	
交易性金融负债	
衍生金融负债	
卖出回购金融资产款	
应付证券清算款	166,460,088.95
应付赎回款	118,304,949.11
应付管理人报酬	19,136,240.77
应付托管费	3,189,373.48
应付销售服务费	

应付交易费用	3,979,796.51
应交税费	147.14
应付利息	
应付利润	
递延所得税负债	
其他负债	448,164.57
负债合计	311,518,760.53
<b>所有者权益：</b>	
实收基金	11,132,171,837.61
未分配利润	13,040,699,440.59
所有者权益合计	24,172,871,278.20
负债和所有者权益总计	24,484,390,038.73

## 八、基金投资组合

截止到 2021 年 1 月 21 日，兴全合润混合型证券投资基金的投资组合如下：

(一) 期末（2021 年 1 月 21 日）基金资产组合情况

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	21,613,752,806.60	88.28
	其中：股票	21,613,752,806.60	88.28
2	基金投资		
3	固定收益投资	1,224,232,667.88	5.00
	其中：债券	1,224,232,667.88	5.00
	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	1,530,606,100.86	6.25
8	其他各项资产	115,798,463.39	0.47
9	合计	24,484,390,038.73	100.00

(二) 期末（2021 年 1 月 21 日）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

金额单位：人民币元

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	117,487,606.17	0.49
B	采矿业		
C	制造业	14,432,894,699.72	59.71
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	225,223,888.95	0.93
E	建筑业		
F	批发和零售业	44,096,320.48	0.18
G	交通运输、仓储和邮政业	241,045,293.60	1.00
H	住宿和餐饮业	212,717,229.80	0.88
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,371,493,295.45	5.67
J	金融业	3,276,422,881.46	13.55
K	房地产业	8,458.10	0.00
L	租赁和商务服务业		
M	科学研究和技术服务业	514,359,526.11	2.13
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	273,215,559.24	1.13
R	文化、体育和娱乐业	904,788,047.52	3.74
S	综合		
	合计	21,613,752,806.60	89.41

2、报告期末（2021年1月21日）按行业分类的港股通投资股票投资组合无。

（三）期末（2021年1月21日）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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	市值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600690	海尔智家	44,520,296	1,513,690,064.00	6.26%
2	600031	三一重工	30,249,683	1,264,436,749.40	5.23%
3	601318	中国平安	14,906,036	1,258,665,679.84	5.21%
4	601166	兴业银行	47,434,091	1,110,432,070.31	4.59%
5	002415	海康威视	15,185,794	959,742,180.80	3.97%
6	300413	芒果超媒	9,996,056	904,743,028.56	3.74%
7	600309	万华化学	6,901,874	782,948,586.56	3.24%
8	000895	双汇发展	15,327,608	745,931,447.60	3.09%
9	000333	美的集团	7,016,251	702,326,725.10	2.91%

10	002594	比亚迪	2,952,016	695,258,808.32	2.88%
----	--------	-----	-----------	----------------	-------

(四) 期末 (2021 年 1 月 21 日) 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	714,315,473.40	2.96
2	央行票据		
3	金融债券	472,901,000.00	1.96
	其中: 政策性金融债	472,901,000.00	1.96
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)	37,016,194.48	0.15
8	同业存单		
9	其他		
10	合计	1,224,232,667.88	5.06

(五) 期末 (2021 年 1 月 21 日) 债券投资前五名明细

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	019640	20 国债 10	4,213,860.00	421,175,307.00	1.74%
2	019645	20 国债 15	2,918,560.00	293,140,166.40	1.21%
3	018013	国开 2004	1,726,660.00	172,666,000.00	0.71%
4	180203	18 国开 03	1,500,000.00	150,480,000.00	0.62%
5	200406	20 农发 06	1,000,000.00	99,910,000.00	0.41%

(六) 报告期末 (2021 年 1 月 21 日) 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 (2021 年 1 月 21 日) 未持有资产支持证券。

(七) 报告期末 (2021 年 1 月 21 日) 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 (2021 年 1 月 21 日) 未持有贵金属。

(八) 报告期末 (2021 年 1 月 21 日) 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 (2021 年 1 月 21 日) 未持有权证。

(九) 报告期末 (2021 年 1 月 21 日) 本基金投资的股指期货交易情况说明

1、 报告期末 (2021 年 1 月 21 日) 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。

(十) 报告期末 (2021 年 1 月 21 日) 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 (2021 年 1 月 21 日) 本基金投资的国债期货持仓和损益明细  
国债期货暂不属于本基金的投资范围, 故此项不适用。

3、 本期国债期货投资评价

国债期货暂不属于本基金的投资范围, 故此项不适用。

(十一) 投资组合报告附注

1、 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

本基金投资的前十名证券发行主体本期没有被监管部门立案调查的, 在报告编制日 (2021 年 1 月 21 日) 前一年内也未受到公开谴责、处罚。

2、 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

截至 2021 年 1 月 21 日基金投资的前十名股票均属于基金合同规定备选股票库之内的股票。

3、 期末 (2021 年 1 月 21 日) 其他资产构成

序号	名称	金额 (人民币元)
1	存出保证金	2,910,256.97
2	应收证券清算款	
3	应收股利	
4	应收利息	17,423,567.67
5	应收申购款	95,464,638.75
6	其他应收款	
7	待摊费用	
8	其他	
9	合计	115,798,463.39

#### 4、期末（2021年1月21日）持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	113579	健友转债	35,850.00	4,213,809.00	0.02%
2	113021	中信转债	9,530.00	1,002,460.70	0.00%
3	127012	招路转债	7,000.00	740,670.00	0.00%
4	113026	核能转债	3,100.00	325,872.00	0.00%
5	123022	长信转债	1,180.00	184,316.00	0.00%
6	127013	创维转债	1,300.00	131,209.00	0.00%

#### 5、期末（2021年1月21日）前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	000895	双汇发展	236,012,476.40	0.98	非公开发行流通受限

#### 6、投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## 九、重大事件揭示

本基金自合同生效至上市交易公告书公告前未发生对基金份额持有人有较大影响的重大事件。

## 十、基金管理人承诺

本基金管理人就本基金上市交易之后履行管理人职责做出如下承诺：

（一）严格遵守《基金法》及其他法律法规、基金合同的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。

（二）真实、准确、完整和及时地披露定期报告等有关信息披露文件，披露所有对基金份额持有人有重大影响的信息，并接受中国证监会、证券交易所的监督管理。

(三)在知悉可能对基金价格产生误导性影响或引起较大波动的任何公共传播媒介中出现的或者在市场上流传的消息后,将及时予以公开澄清。

## 十一、基金托管人承诺

基金托管人就本基金上市交易后履行托管人职责做出如下承诺:

(一)严格遵守《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定,设立专门的基金托管部,配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员负责基金财产托管事宜。

(二)根据《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定,对基金的投资范围、基金资产的投资组合比例、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等行为进行监督和核查。

(三)基金托管人发现基金管理人的行为违反《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定,将及时以书面形式通知基金管理人限期纠正,并在限期内,随时对通知事项进行复查,督促基金管理人改正。

(四)基金托管人发现基金管理人重大违规行为,将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。

## 十二、备查文件目录

本基金备查文件包括下列文件:

- (一)中国证监会准予兴全合润分级股票型证券投资基金募集注册的文件;
- (二)兴全合润分级混合型证券投资基金基金合同;
- (三)兴全合润分级混合型证券投资基金托管协议;
- (四)兴全合润混合型证券投资基金基金合同;
- (五)兴全合润混合型证券投资基金托管协议;
- (六)法律意见书;

(七) 基金管理人业务资格批件、营业执照;

(八) 基金托管人业务资格批件和营业执照;

(九) 中国证监会要求的其他文件。

存放地点: 基金管理人和基金托管人的住所

查阅方式: 基金投资者可在营业时间免费查阅, 或通过指定的信息披露媒体、本基金管理人网站 (<http://www.xqfunds.com>) 查阅。

兴证全球基金管理有限公司

2021 年 1 月 25 日

## 附件: 基金合同内容摘要

### 一、基金合同当事人及权利义务

#### (一) 基金管理人

##### 1、基金管理人简况

名称: 兴证全球基金管理有限公司

住所: 上海市黄浦区金陵东路 368 号

法定代表人: 杨华辉

成立日期: 2003 年 9 月 30 日

批准设立机关及批准设立文号: 中国证监会证监基字[2003]100 号

组织形式: 有限责任公司

注册资本: 1.5 亿元人民币

存续期限: 持续经营

联系电话: (021) 20398888

##### 2、基金管理人的权利与义务

1)、根据《基金法》及其他有关法律法规，基金管理人的权利为：

(1) 自本基金合同生效之日起，依照有关法律法规和本基金合同的规定独立运用并管理基金财产；

(2) 依照基金合同获得基金管理费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入；

(3) 依照有关规定行使因基金财产投资于证券所产生的权利；

(4) 在符合有关法律法规的前提下，制订和调整有关基金申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务的规则，在法律法规和本基金合同规定的范围内决定和调整基金的相关费率结构和收费方式；

(5) 根据本基金合同及有关规定监督基金托管人，对于基金托管人违反了本基金合同或有关法律法规规定的行为，对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应及时呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金及相关当事人的利益；

(6) 在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购和赎回申请；

(7) 在法律法规允许的前提下，为基金份额持有人的利益依法为基金进行融资、融券；

(8) 自行担任或选择、更换注册登记机构，获取基金份额持有人名册，并对注册登记机构的代理行为进行必要的监督和检查；

(9) 选择、更换代销机构，并依据销售代理协议和有关法律法规，对其行为进行必要的监督和检查；

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

(11) 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；

(12) 依法召集基金份额持有人大会；

(13) 法律法规、中国证监会、基金合同以及依据基金合同制订的其他法律文件所规定的其他权利。

2)、根据《基金法》及其他有关法律法规，基金管理人的义务为：

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

- (2) 办理基金备案手续;
- (3) 自基金合同生效之日起,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产;
- (4) 配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策,以专业化的经营方式管理和运作基金财产;
- (5) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度,保证所管理的基金财产和管理人的财产相互独立,对所管理的不同基金分别管理,分别记账,进行证券投资;
- (6) 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外,不得为自己及任何第三人谋取利益,不得委托第三人运作基金财产;
- (7) 依法接受基金托管人的监督;
- (8) 计算并公告基金份额净值信息,确定基金份额申购、赎回价格;
- (9) 采取适当合理的措施使计算基金份额申购、赎回和注销价格的方法符合基金合同等法律文件的规定;
- (10) 按规定受理申购和赎回申请,及时、足额支付赎回款项;
- (11) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告;
- (12) 编制季度报告、中期报告和年度报告;
- (13) 严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定,履行信息披露及报告义务;
- (14) 保守基金商业秘密,不得泄露基金投资计划、投资意向等,除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外,在基金信息公开披露前应予保密,不得向他人泄露;
- (15) 依据《基金法》、基金合同及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会;
- (16) 按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;
- (17) 保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料;
- (18) 以基金管理人名义,代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为;

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

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

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

(22) 按规定向基金托管人提供基金份额持有人名册资料；

(23) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产或由接管人接管其资产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；

(24) 执行生效的基金份额持有人大会决议；

(25) 不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；

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

(27) 法律法规、中国证监会和基金合同规定的其他义务。

## (二) 基金托管人

### 1、基金托管人简况

名称：招商银行股份有限公司

住所：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

法定代表人：李建红

成立时间：1987 年 4 月 8 日

批准设立机关和批准设立文号：中国人民银行银复字（1986）175 号文、银复（1987）86 号文

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币 252.20 亿元

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：证监基金字[2002]83 号

### 2、基金托管人的权利与义务

1)、根据《基金法》及其他有关法律法规，基金托管人的权利为：

(1) 依基金合同约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入;

(2) 监督基金管理人对本基金的投资运作;

(3) 自本基金合同生效之日起, 依法保管基金资产;

(4) 在基金管理人更换时, 提名新任基金管理人;

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

(6) 依法召集基金份额持有人大会;

(7) 按规定取得基金份额持有人名册资料;

(8) 法律法规和基金合同规定的其他权利。

2)、根据《基金法》及其他有关法律法规, 基金托管人的义务为:

(1) 安全保管基金财产;

(2) 设立专门的基金托管部, 具有符合要求的营业场所, 配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员, 负责基金财产托管事宜;

(3) 对所托管的不同基金财产分别设置账户, 确保基金财产的完整与独立;

(4) 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外, 不得为自己及任何第三人谋取利益, 不得委托第三人托管基金财产;

(5) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证;

(6) 按规定开设基金财产的资金账户和证券账户;

(7) 保守基金商业秘密, 除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外, 在基金信息公开披露前应予保密, 不得向他人泄露;

(8) 对基金财务会计报告、季度报告、中期报告和年度报告出具意见, 说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照基金合同的规定进行; 如果基金管理人未执行基金合同规定的行为, 还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施;

(9) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料;

(10) 按照基金合同的约定, 根据基金管理人的投资指令, 及时办理清算、

交割事宜；

(11) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

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

(13) 按照规定监督基金管理人的投资运作；

(14) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

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

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

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

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

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

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

(21) 执行生效的基金份额持有人大会决议；

(22) 不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；

(23) 建立并保存基金份额持有人名册；

(24) 法律法规、中国证监会和基金合同规定的其他义务。

(三) 基金份额持有人

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

本基金每份基金份额具有同等的合法权益。

1)、根据《基金法》及其他有关法律法规，基金份额持有人的权利为：

- (1) 分享基金财产收益;
- (2) 参与分配清算后的剩余基金财产;
- (3) 依法申请赎回其持有的基金份额;
- (4) 按照规定要求召开或自行召集基金份额持有人大会;
- (5) 出席或者委派代表出席基金份额持有人大会,对基金份额持有人大会审议事项行使表决权;
- (6) 查阅或者复制公开披露的基金信息资料;
- (7) 监督基金管理人的投资运作;
- (8) 对基金管理人、基金托管人、基金份额销售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼;
- (9) 法律法规和基金合同规定的其他权利。

2)、根据《基金法》及其他有关法律法规,基金份额持有人的义务为:

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

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

## **二、基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则**

基金份额持有人大会由基金份额持有人或基金份额持有人的合法授权代表共同组成。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。

### **(一) 召开事由**

1、当出现或需要决定下列事由之一的,应当召开基金份额持有人大会:

- (1) 提前终止基金合同;

- (2) 转换基金运作方式;
- (3) 变更基金类别;
- (4) 变更基金投资目标、投资范围或投资策略(法律法规或中国证监会另有规定的除外);
- (5) 变更基金份额持有人大会程序;
- (6) 更换基金管理人、基金托管人;
- (7) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准,但法律法规要求提高该等报酬标准的除外;
- (8) 本基金与其他基金的合并;
- (9) 单独或合计持有本基金份额 10% 以上(含 10%)的基金份额持有人(以基金管理人收到提议当日的基金份额计算,下同)提议时,就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会;
- (10) 对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的其他事项;
- (11) 法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

2、出现以下情形之一的,可由基金管理人和基金托管人协商后修改基金合同,不需召开基金份额持有人大会:

- (1) 调低基金管理费、基金托管费和其他应由基金承担的费用,法律法规要求增加基金费用收取;
- (2) 在法律法规和本基金合同规定的范围内变更收费方式、申购费率、调低赎回费率;
- (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本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) 按照法律法规或本基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

## (二) 会议召集人及召集方式

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

2、基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的,应当向基金管理人

提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人就同一事项仍认为有必要召开的，应当自行召集。

3、单独或合计代表基金份额 10%以上（含 10%）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，单独或合计代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开。

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

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。

### （三）召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

1、基金份额持有人大会的召集人（以下简称“召集人”）负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。召开基金份额持有人大会，召集人必须于会议召开日前 30 天在指定媒介公告。基金份额持有人大会通知须至少载明以下内容：

- （1）会议召开的时间、地点；
- （2）会议拟审议的主要事项；
- （3）会议形式；
- （4）议事程序；
- （5）有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人权益登记日；
- （6）代理投票的授权委托书的内容要求（包括但不限于代理人身份、代理

权限和代理有效期限等)、送达时间和地点;

(7) 表决方式;

(8) 会务常设联系人姓名、电话;

(9) 出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续;

(10) 召集人需要通知的其他事项。

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

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

(四) 基金份额持有人出席会议的方式

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,但基金管理人或基金托管人的更换必须以现场开会方式召开基金份额持有人大会。

(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,如基金管理人或基金托管人拒不派代表出席的,不影响表决效力。

(3) 通讯方式开会指按照本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。

2、召开基金份额持有人大会的条件

(1) 现场开会方式

在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,全部有效凭证所对应

的基金份额应占权益登记日基金份额的 50%以上（含 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和基金合同及会议通知的规定，并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的注册登记资料相符。

## （2）通讯开会方式

在同时符合以下条件时，通讯会议方可举行：

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

2) 召集人按基金合同规定通知基金托管人或/和基金管理人（分别或共同称为“监督人”）到指定地点对书面表决意见的计票进行监督；

3) 召集人在监督人和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，如基金管理人或基金托管人经通知拒不到场监督的，不影响表决效力；

4) 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占权益登记日基金份额的 50%以上（含 50%）；

5) 直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的代理人提交的持有基金份额的凭证、授权委托书等文件符合法律法规、基金合同和会议通知的规定，并与注册登记机构记录相符。

## （五）议事内容与程序

### 1、议事内容及提案权

（1）议事内容为本基金合同规定的召开基金份额持有人大会事由所涉及的内容。

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

（3）对于基金份额持有人提交的提案，大会召集人应当按照以下原则对提

案进行审核:

关联性。大会召集人对于基金份额持有人提案涉及事项与基金有直接关系,并且不超出法律法规和基金合同规定的基金份额持有人大会职权范围的,应提交大会审议;对于不符合上述要求的,不提交基金份额持有人大会审议。如果召集人决定不将基金份额持有人提案提交大会表决,应当在该次基金份额持有人大会上解释和说明。

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做出决定。如将其提案进行分类表决,需征得原提案人同意;原提案人不同意变更的,大会主持人可就程序性问题提请基金份额持有人大会做出决定,并按照基金份额持有人大会决定的程序进行审议。

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

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

## 2、议事程序

### (1) 现场开会

在现场开会的方式下,首先由大会主持人按照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,经合法执业的律师见证后形成大会决议。

大会由召集人授权代表主持。基金管理人为召集人的,其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所持表决权的 50%以上(含 50%)选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。

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

单位名称)等事项。

## (2) 通讯方式开会

在通讯表决开会的方式下,首先由召集人提前30日公布提案,在所通知的表决截止日期后第2个工作日在公证机关及监督人的监督下由召集人统计全部有效表决并形成决议。如监督人经通知但拒绝到场监督,则在公证机关监督下形成的决议有效。

3、基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

## (六) 决议形成的条件、表决方式、程序

1、基金份额持有人所持每份基金份额享有平等的表决权。

2、基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议:

### (1) 一般决议

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

### (2) 特别决议

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

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

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

5、基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

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

## (七) 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推举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集，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推举两名基金份额持有人代表与基金管理人、基金托管人共同授权的一名监督员共同担任监票人；但如果基金管理人和基金托管人的授权代表未出席，则大会主持人可自行选举三名基金份额持有人代表担任监票人。

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

(3) 如大会主持人对于提交的表决结果有异议，可以对投票数进行重新清点；如大会主持人未进行重新清点，而出席大会的基金份额持有人或代理人对大会主持人宣布的表决结果有异议，其有权在宣布表决结果后立即要求重新清点，大会主持人应当立即重新清点并公布重新清点结果。重新清点仅限一次。

## 2、通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监票人在监督人派出的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；如监督人经通知但拒绝到场监督，则大会召集人可自行授权三名监票人进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。

(八) 基金份额持有人大会决议报中国证监会核准或备案后的公告时间、方式

1、基金份额持有人大会通过的一般决议和特别决议，召集人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会核准或者备案。基金份额持有人大会决定的事项自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效。

2、生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人、基金托管人均有约束力。基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会决议。

3、基金份额持有人大会决议应自生效之日起 2 日内在指定媒介公告。如果采用通讯方式进行表决，在公告基金份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、

公证机构、公证员姓名等一同公告。

(九)法律法规或中国证监会对基金份额持有人大会另有规定的,从其规定。

### 三、与基金财产管理、运用有关费用的提取、支付方式与比例

#### (一) 基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费;
- 2、基金托管人的托管费;
- 3、基金财产划拨支付的银行费用;
- 4、基金合同生效后的基金信息披露费用;
- 5、基金份额持有人大会费用;
- 6、基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费;
- 7、基金的证券交易费用;
- 8、依法可以在基金财产中列支的其他费用。

(二)上述基金费用由基金管理人在法律法规规定的范围内参照公允的市场价格确定,法律法规另有规定时从其规定。

#### (三) 基金费用计提方法、计提标准和支付方式

##### 1、基金管理人的管理费

在通常情况下,基金管理费按前一日基金资产净值的 1.5%年费率计提。计算方法如下:

$$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费, E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人,若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。

##### 2、基金托管人的托管费

在通常情况下,基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25%年费率计提。计算方法如下:

$$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费, E 为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管

费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人,若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。

3、除管理费和托管费之外的基金费用,由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定,按费用支出金额支付,列入或摊入当期基金费用。

#### (四) 不列入基金费用的项目

基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失,以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金合同生效前所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付。

(五)基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率和基金托管费率。降低基金管理费率和基金托管费率,无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须最迟于新的费率实施日2日前在指定媒介上刊登公告。

#### (六) 基金税收

本基金运作过程中的各纳税主体,其纳税义务按国家税收法律法规履行。

### 四、基金收益分配原则

#### (一) 收益的构成

本基金合同项下基金收益指基金利润,包括:

- 1、利息收入。
- 2、公允价值变动收入。
- 3、投资收益。
- 4、其他收入。

基金已实现收益为基金利润减去公允价值变动后的余额。因运用基金财产带来的成本或费用的节约应计入收益。

基金期末可供分配利润,采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

#### (二) 收益分配原则

- 1、在符合有关基金分红条件的前提下,基金管理人可进行收益分配;
- 2、本基金场外收益分配方式分两种:现金分红与红利再投资,登记在登记结算系统基金份额持有人开放式基金账户下的基金份额,持有人可选择现金红利

或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；登记在证券登记系统基金份额持有人证券账户下的基金份额，只能选择现金分红的方式，具体权益分配程序等有关事项遵循深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定；

3、每一基金份额享有同等分配权；

4、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

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

### （三）收益分配方案

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

### （四）收益分配方案的确定、公告与实施

本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核，依据相关规定进行公告。

### （五）基金收益分配中发生的费用

基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金登记机构可将基金份额持有人的现金红利自动转为基金份额。红利再投资的计算方法，依照《业务规则》执行。

## 五、基金财产的投资方向和投资限制

### （一）投资范围和投资比例

本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括依法公开发行上市的股票、国债、金融债、企业债、公司债、回购、央行票据、可转换债券、权证、资产支持证券以及经中国证监会批准允许基金投资的其它金融工具。

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。

本基金为混合型基金，股票投资比例为基金资产的 60%-95%；债券投资比例为基金资产的 5%-40%；权证投资比例为基金资产净值的 0%-3%；资产支持证

券比例为基金资产净值的 0%-20%；本基金保留不低于基金资产净值的 5%的现金和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。

## （二）投资限制

### 投资组合限制与禁止行为

除另有说明外，以下投资限制及禁止行为适用于本基金存续的全部期间。

#### 1、组合限制

本基金在投资策略上兼顾投资原则以及本基金的固有特点，通过分散投资降低基金财产的非系统性风险，保持基金组合良好的流动性。基金的投资组合将遵循以下限制：

（1）本基金持有一家上市公司的股票，其市值不超过基金资产净值的 10%；

（2）本基金与本基金管理人管理的其他基金持有一家上市公司发行的证券，不得超过该证券的 10%；

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

（4）本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%；

（5）本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；

（6）本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；

（7）本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券不得超过基金资产净值的 10%；本基金持有的全部资产支持证券其市值不得超过基金资产净值的 20%；本基金管理人管理的全部基金持有同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；

（8）本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；

（9）本基金股票投资占基金资产的比例为 60%-95%，债券投资占基金资产的比例为 5%-40%；权证投资比例为基金资产净值的 0%-3%；资产支持证券比例为基金资产净值的 0%-20%；

（10）本基金保留不低于基金资产净值的 5%的现金和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；

(11) 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；

(12) 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%；

(13) 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；

(14) 本基金不得违反基金合同中有关投资范围、投资比例的规定；

(15) 有关法律法规以及监管部门规定的其它投资限制。

如法律法规或监管部门取消上述限制性规定，本基金管理人在履行适当程序后，则本基金不受上述规定的限制。

除上述第(10)、(11)、(13)项外，因证券市场变化、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合上述规定的比例或者基金合同约定的投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内调整完毕。

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。除投资资产配置比例外，基金托管人对基金的投资比例的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

## 2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

- (1) 承销证券；
- (2) 向他人贷款或者提供担保；
- (3) 从事承担无限责任的投资；
- (4) 买卖其他基金份额，但法律法规或中国证监会另有规定的除外；

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

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

(7) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动;

(8) 依照法律法规、中国证监会及基金合同规定禁止的其他活动;

(9) 法律法规或监管部门取消上述限制,如适用于本基金,则本基金投资不再受相关限制。

## 六、基金资产净值的计算方法和公告方式

### (一) 估值日

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

### (二) 估值方法

本基金按以下方式进行估值:

#### 1、证券交易所上市的有价证券的估值

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

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

(3) 交易所上市未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息(自债券计息起始日或上一付息日至估值当日的利息)得到的净价进行估值;估值日没有交易的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化,按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进

行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

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

2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

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

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

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

3、交易所停止交易等非流通品种的估值。因持有股票而享有的配股权，以及停止交易、但未行权的权证，采用估值技术确定公允价值。

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

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

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

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

根据有关法律法规，基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，因此，就与本基金有关的会

计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人对于基金资产净值的计算结果对外予以公布。

### （三）估值对象

基金所拥有的股票、权证、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。

### （四）估值程序

1、基金份额净值是按照每个开放日闭市后，基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算，精确到 0.0001 元，小数点后第 5 位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。每个工作日计算基金资产净值及基金份额净值，并按规定公告。

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

### （五）基金份额净值的计算

本基金 T 日基金份额净值 = T 日闭市后的基金资产净值 / T 日基金份额数量。

基金份额净值的计算，保留到小数点后 4 位，小数点后第 5 位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

T 日的基金份额净值在当天收市后计算，并在下一日内公告。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

### （六）估值错误的处理

基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当基金份额净值小数点后 4 位以内（含第 4 位）内发生差错时，视为基金份额净值错误。

本基金合同的当事人应按照以下约定处理：

#### 1、差错类型

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

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

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

## 2、差错处理原则

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

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

(3) 因差错而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但差错责任方仍应对差错负责。如果由于获得不当得利的当事人不返还或不全部返还不当得利造成其他当事人的利益损失（“受损方”），则差错责任方应赔偿受损方的损失，并在其支付的赔偿金额的范围内对获得不当得利的当事人享有要求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) 差错责任方拒绝进行赔偿时，如果因基金管理人过错造成基金财产损失时，基金托管人应为基金的利益向基金管理人追偿，如果因基金托管人过错造成基金财产损失时，基金管理人应为基金的利益向基金托管人追偿。基金管理人和基金托管人之外的第三方造成基金财产损失，并拒绝进行赔偿时，由基金管理人负责向差错方追偿；追偿过程中产生的有关费用，应列入基金费用，从基金

资产中支付。

(6) 如果出现差错的当事人未按规定对受损方进行赔偿, 并且依据法律法规、基金合同或其他规定, 基金管理人自行或依据法院判决、仲裁裁决对受损方承担了赔偿责任, 则基金管理人有权向出现差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) 如果出现差错的当事人未按规定对受损方进行赔偿, 并且依据法律法规、基金合同或其他规定, 基金托管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, 则基金托管人有权向出现差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。

(8) 按法律法规规定的其他原则处理差错。

### 3、差错处理程序

差错被发现后, 有关的当事人应当及时进行处理, 处理的程序如下:

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

(2) 根据差错处理原则或当事人协商的方法对因差错造成的损失进行评估;

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

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

### 4、基金份额净值差错处理的原则和方法如下:

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

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

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

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

(5) 前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。

(七) 暂停估值的情形

- 1、基金投资所涉及的证券市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；
- 2、因不可抗力或其它情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；
- 3、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、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

(八) 特殊情况的处理

- 1、基金管理人按估值方法的第 6 项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理；
- 2、由于不可抗力原因，或由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误，或国家会计政策变更、市场规则变更等，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

## 七、基金合同的变更、终止与基金财产的清算

(一) 基金合同的变更

1、以下基金合同变更内容对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的，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。

- (1) 提前终止基金合同；
- (2) 转换基金运作方式；
- (3) 变更基金类别；
- (4) 变更基金投资目标、投资范围或投资策略（法律法规或中国证监会另有规定的除外）；
- (5) 变更基金份额持有人大会程序；
- (6) 更换基金管理人、基金托管人；

(7) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准。但根据适用的相关规定提高该等报酬标准的除外；

(8) 本基金与其他基金的合并；

(9) 对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的其他事项；

(10) 法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

但出现下列情况之一时，可不经基金份额持有人大会决议，由基金管理人和基金托管人同意变更后公布，并报中国证监会备案：

(1) 调低基金管理费、基金托管费和其他应由基金承担的费用，法律法规要求增加基金费用收取；

(2) 在法律法规和本基金合同规定的范围内变更收费方式、申购费率、调低赎回费率；

(3) 因相应的法律法规及交易所的有关规则发生变动必须对基金合同进行修改；

(4) 经中国证监会允许，基金推出新业务或服务；

(5) 经中国证监会允许，基金管理人、基金注册登记机构、代销机构在法律法规规定的范围内调整有关基金申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务的规则；

(6) 对基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生变化；

(7) 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；

(8) 按照法律法规或本基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

2、关于变更基金合同的基金份额持有人大会决议应报中国证监会核准或备案，并于中国证监会核准或出具无异议意见后生效执行，并自生效之日起2日内在至少一种指定媒介公告。

(二) 本基金合同的终止

有下列情形之一的，本基金合同经中国证监会核准后将终止：

1、基金份额持有人大会决定终止的；

2、基金管理人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金管理人的职务，而在6个月内无其他适当的基金管理公司承接其原有权利义务；

3、基金托管人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金托管人的职务，而在6个月内无其他适当的托管机构承接其原有权利义务；

4、中国证监会规定、基金合同规定的其他情况。

### （三）基金财产的清算

#### 1、基金财产清算组

（1）基金合同终止时，成立基金财产清算组，基金财产清算组在中国证监会的监督下进行基金清算。

（2）自基金合同终止之日起30个工作日内由基金管理人组织成立基金财产清算组，基金财产清算组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算组可以聘用必要的工作人员。

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

#### 2、基金财产清算程序

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

- （1）基金合同终止后，发布基金财产清算公告；
- （2）由基金财产清算组统一接管基金财产；
- （3）对基金财产进行清理和确认；
- （4）对基金财产进行估价和变现；
- （5）基金财产清算组制作清算报告；
- （6）聘请会计师事务所对清算报告进行审计；
- （7）聘请律师事务所出具法律意见书；
- （8）将基金财产清算结果报告中国证监会；
- （9）公布基金财产清算结果；
- （10）对基金剩余财产进行分配；
- （11）基金财产清算的期限为6个月。

#### 3、清算费用

清算费用是指基金财产清算组在进行基金财产清算过程中发生的所有合理

费用，清算费用由基金财产清算组优先从基金财产中支付。

#### 4、基金财产清算后剩余资产的分配

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）-（3）项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

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

#### 5、基金财产清算的公告

基金财产清算公告于基金合同终止并报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算组公告；清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算结果经会计师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，由基金财产清算组报中国证监会备案并公告。

#### 6、基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

### 八、争议的处理和适用的法律

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

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

本基金合同受中华人民共和国法律管辖。

### 九、基金合同的存放地和投资者取得基金合同的方式

基金合同可印制成册，供投资者在基金管理人、基金托管人、销售机构的办

公场所和营业场所查阅，但其效力应以基金合同正本为准。