

兴全磐稳增利债券型证券投资基金  
更新招募说明书  
（2023 年第 1 号）

基金管理人：兴证全球基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

## 重要提示

本基金于2009年5月11日经中国证监会证监许可[2009] 385号文核准募集。本基金基金合同于2009年7月23日起正式生效，自该日起兴证全球基金管理有限公司（以下简称“本公司”）正式开始管理本基金。

本招募说明书是对原《兴全磐稳增利债券型证券投资基金更新招募说明书》的更新，原招募说明书与本招募说明书不一致的，以本招募说明书为准。本基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

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

投资有风险，投资者认购（或申购）基金时应认真阅读本基金的招募说明书、基金产品资料概要法律文件，全面认识本基金产品的风险收益特征，充分考虑自身的风险承受能力，并对于认购（或申购）基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。基金管理人提醒投资者基金投资要承担相应风险，包括市场风险、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。在投资者作出投资决策后，基金投资运作与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责。

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

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

当本基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，基金管理人履行相应程序后，可以启用侧袋机制，具体详见基金合同和本招募说明书“侧袋机制”等有关章节。侧袋机制实施期间，基金管理人将对基金简称进行特殊标识，并不办理侧袋账户的申购赎回。请基金份额持有人仔细阅读相关内容并关注本基金启用侧袋机制时的特定风险。

本次招募说明书更新内容为：

- 1、更新了“基金管理人”、“基金托管人”部分的相关内容。
- 2、更新了“相关服务机构”部分的相关内容。
- 3、更新了“基金的投资”、“基金的业绩”中基金投资组合报告、基金业绩表现部分内容。
- 4、在“其他应披露事项”更新本期基金临时公告。

除上述内容外，本更新招募说明书所载内容截止日 2023 年 5 月 31 日（特别事项注明除外），有关财务数据和净值表现摘自本基金 2023 年第 1 季度报告，数据截止日为 2023 年 3 月 31 日（财务数据未经审计）。本基金托管人交通银行股份有限公司已复核了本次更新的招募说明书。

## 目 录

重要提示.....	2
第一部分 绪言.....	6
第二部分 释义.....	7
第三部分 基金管理人.....	12
第四部分 基金托管人.....	24
第五部分 相关服务机构.....	29
第六部分 基金的募集.....	45
第七部分 基金合同的生效.....	47
第八部分 基金份额的申购、赎回与转换.....	48
第九部分 基金的投资.....	61
第十部分 基金的业绩.....	75
第十一部分 基金的财产.....	77
第十二部分 基金资产的估值.....	79
第十三部分 基金的收益分配.....	87
第十四部分 基金费用与税收.....	89
第十五部分 基金的会计与审计.....	92
第十六部分 基金的信息披露.....	93
第十七部分 侧袋机制.....	99
第十八部分 风险揭示.....	102
第十九部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算.....	107
第二十部分 基金合同的内容摘要.....	109
第二十一部分 基金托管协议的内容摘要.....	125
第二十二部分 对基金份额持有人的服务.....	140
第二十三部分 其他应披露事项.....	142

第二十四部分	招募说明书存放及查阅方式.....	144
第二十五部分	备查文件.....	145

## 第一部分 绪言

《兴全磐稳增利债券型证券投资基金招募说明书》（以下简称“招募说明书”或“本招募说明书”）依照《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性风险管理规定》”）以及《兴全磐稳增利债券型证券投资基金基金合同》（以下简称“本合同”或“基金合同”）编写。

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

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

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

## 第二部分 释义

在本招募说明书中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

1. 基金或本基金：指兴全磐稳增利债券型证券投资基金
2. 基金管理人：指兴证全球基金管理有限公司
3. 基金托管人：指交通银行股份有限公司
4. 基金合同或本基金合同：指《兴全磐稳增利债券型证券投资基金基金合同》及对本基金合同的任何有效修订和补充
5. 托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《兴全磐稳增利债券型证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充
6. 招募说明书：指《兴全磐稳增利债券型证券投资基金招募说明书》及根据相关法律、法规、规定对招募说明书进行的更新
7. 基金份额发售公告：指《兴全磐稳增利债券型证券投资基金份额发售公告》
8. 法律法规：指中华人民共和国现行有效的法律、行政法规、部门规章及其他规范性文件以及对其做出的不时修改和补充
9. 《基金法》：指 2003 年 10 月 28 日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，并经 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 日起实施的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订
10. 《销售办法》：指中国证监会 2013 年 3 月 15 日颁布、同年 6 月 1 日实施的《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
11. 《信息披露办法》：指中国证监会 2019 年 7 月 26 日颁布、同年 9 月 1 日实施的，并经 2020 年 3 月 20 日中国证监会《关于修改部分证券期货规章的决定》修正的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
12. 《运作办法》：指中国证监会 2014 年 7 月 7 日颁布、同年 8 月 8 日实施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
13. 《流动性风险管理规定》：指中国证监会 2017 年 8 月 31 日颁布、同年 10 月 1 日实施的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及颁

布机关对其不时做出的修订

14. 中国证监会：指中国证券监督管理委员会

15. 银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银行业监督管理委员会

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

17. 个人投资者：指依据有关法律法规规定或经中国证监会核准可投资于开放式证券投资基金的自然人

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

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

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

21. 基金份额持有人：指依基金合同和招募说明书合法取得基金份额的投资人

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

23. 销售机构：指直销机构和代销机构

24. 直销机构：指兴证全球基金管理有限公司

25. 代销机构：指符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金代销业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务代理协议，代为办理基金销售业务的机构

26. 基金销售网点：指直销机构的直销中心及代销机构的代销网点

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

28. 注册登记机构：指办理注册登记业务的机构。基金的注册登记机构为



兴证全球基金管理有限公司或接受兴证全球基金管理有限公司委托代为办理注册登记业务的机构

29. 基金账户：指注册登记机构为投资人开立的、记录其持有的、基金管理人所管理的基金份额余额及其变动情况的账户

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

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

32. 基金合同终止日：指基金合同规定的基金合同终止事由出现后，基金财产清算完毕，清算结果报中国证监会备案并予以公告的日期

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

34. 存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限

35. 工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

36. T日：指销售机构在规定时间受理投资人申购、赎回或其他业务申请的工作日

37. T+n日：指自T日起第n个工作日（不包含T日）

38. 开放日：指为投资人办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日

39. 交易时间：指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段

40. 《业务规则》：指《兴证全球基金管理有限公司开放式基金业务规则》，是规范基金管理人所管理的开放式证券投资基金登记结算方面的业务规则，由基金管理人和投资人共同遵守

41. 认购：指在基金募集期内，投资人申请购买基金份额的行为

42. 申购：指基金合同生效后，投资人根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为

43. 赎回：指基金合同生效后，基金份额持有人按基金合同规定的条件要求将基金份额兑换为现金的行为

44. 基金转换：指基金份额持有人按照本基金合同和基金管理人届时有效公告规定的条件，申请将其持有的基金管理人管理的、某一基金的基金份额转换

为基金管理人管理的其他基金基金份额的行为

45. 转托管：指基金份额持有人将其基金账户内的同一基金的基金份额从一个交易帐户托管转移到另一交易帐户的行为；

46. 定期定额投资计划：指投资人通过有关销售机构提出申请，约定每期扣款日、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人指定银行账户内自动完成扣款及基金申购申请的一种投资方式

47. 巨额赎回：指本基金单个开放日，基金净赎回申请（赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过上一开放日基金总份额的 10%

48. 元：指人民币元

49. 基金收益：指基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券价差、银行存款利息、已实现的其他合法收入及因运用基金财产带来的成本和费用的节约

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

51. 基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

52. 基金份额净值：指以计算日基金资产净值除以计算日基金份额余额所得的单位基金份额的价值；

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

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

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

56. 不可抗力：指本基金合同当事人无法预见、无法抗拒、无法避免且在本基金合同由基金管理人、基金托管人签署之日后发生的，使本基金合同当事人

无法全部或部分履行本基金合同的任何事件，包括但不限于洪水、地震及其他自然灾害、战争、骚乱、火灾、政府征用、没收、恐怖袭击、传染病传播、法律法规变化、突发停电或其他突发事件、证券交易所非正常暂停或停止交易

57、基金产品资料概要：指《兴全磐稳增利债券型证券投资基金基金产品资料概要》及其更新（本招募说明书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）

58、侧袋机制：指将基金投资组合中的特定资产从原有账户分离至一个专门账户进行处置清算，目的在于有效隔离并化解风险，确保投资者得到公平对待，属于流动性风险管理工具。侧袋机制实施期间，原有账户称为主袋账户，专门账户称为侧袋账户

59、特定资产：包括：（一）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的资产；（二）按摊余成本计量且计提资产减值准备仍导致资产价值存在重大不确定性的资产；（三）其他资产价值存在重大不确定性的资产

## 第三部分 基金管理人

### 一、基金管理人概况

名称：兴证全球基金管理有限公司

设立日期：2003年9月30日

住所：上海市黄浦区金陵东路368号

办公地址：上海市浦东新区芳甸路1155号浦东嘉里城办公楼28-29楼

法定代表人：杨华辉

联系人：何佳怡

联系电话：021-20398888

组织形式：有限责任公司

注册资本：人民币1.5亿元

兴证全球基金管理有限公司（成立时名为“兴业基金管理有限公司”，以下简称“公司”）经证监基金字[2003]100号文批准于2003年9月30日成立。2008年1月，中国证监会批复（证监许可[2008]6号），同意全球人寿保险国际公司（AEGON International B.V）受让公司股权并成为公司股东。2008年4月9日，公司完成股权转让、变更注册资本等相关手续后，公司注册资本由9800万元变更为人民币1.2亿元，其中兴业证券股份有限公司的出资占注册资本的51%，全球人寿保险国际公司的出资占注册资本的49%。2008年7月，经中国证监会批准（证监许可[2008]888号），公司于2008年8月25日完成变更公司名称、注册资本等相关手续后，公司名称变更为“兴业全球基金管理有限公司”，注册资本增加为1.5亿元人民币，其中两股东出资比例不变。2016年12月28日，因公司发展需要，公司名称变更为“兴全基金管理有限公司”。2020年3月18日，公司名称变更为“兴证全球基金管理有限公司”。

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

兴证全球基金管理有限公司总部位于上海，在北京、上海、深圳、厦门设有分公司，并成立了全资子公司——兴证全球资本管理（上海）有限公司。公司总部下设投资决策委员会、风险管理委员会、综合管理部、计划财务部、审

计部、风险管理部、合规管理部、投融资业务审批部、基金运营部、信息技术部、基金管理部、研究部、专户投资部、固定收益部、FOF 投资与金融工程部、养老金管理部、交易部、市场部、渠道部、机构业务部、电子商务部、营销服务部、国际业务部、基础设施投资部，随着公司业务发展的需要，将对业务部门进行相应的调整。

## 二、主要人员情况

### 1、董事会成员概况

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

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

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

巴斯·尼尔文先生（Bas Nieuwe Weme），董事，1972 年生，荷兰国籍，法学硕士。历任 ING 投资管理公司（美洲）管理委员会成员（纽约、亚特兰大、哈特福德）、机构销售和客户服务主管，沃亚金融投资管理公司（纽约）管理

委员会成员兼客户组全球主管，保德信金融公司全球投资管理客户组和机构关系组全球主管等职务。现任荷兰全球人寿保险集团管理委员会成员，全球人寿资产管理控股有限公司董事、全球行政总裁，法国邮政银行资产管理公司监事会成员，荷兰美国基金会（NAF）董事会成员，美国关怀（AmeriCares）基金会领导委员会成员，法国邮政银行资产管理控股公司董事会成员。

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

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

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

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

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

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

## 2、监事会成员概况

黄奕林先生，监事会主席，1968年生，经济学博士。历任南方证券宏观研究部经理，深圳证券交易所研究员，兴业证券股份有限公司固定收益事业总部总经理等职务。现任兴业证券股份有限公司副总裁，兴证（香港）金融控股有限公司董事。

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

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

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

### 3、高级管理人员概况

杨华辉先生，董事长、法定代表人。（简历请参见上述董事会成员概况）

庄园芳女士，副董事长、总经理。（简历请参见上述董事会成员概况）

杨卫东先生，督察长，1968年生，中共党员，法学学士。历任陕西团省委组织部科员，海南省省委台办接待处科员，海通证券股份有限公司海口营业部负责人、大连分公司总经理，兴业证券股份有限公司资产管理部副总经理，上海凯业集团公司总裁，兴证全球基金管理有限公司总经理助理兼市场部总监、副总经理兼上海分公司负责人等职务。现任兴证全球基金管理有限公司督察长、纪委书记。

陈锦泉先生，副总经理，1977年生，工商管理硕士。历任华安证券股份有

限公司证券投资总部投资经理，平安保险资产运营中心高级组合经理，平安资产管理公司投资管理部副总经理，兴证全球基金管理有限公司兴全绿色投资混合型证券投资基金（LOF）基金经理、专户投资部总监、总经理助理等职务。现任兴证全球基金管理有限公司党委副书记、副总经理兼专户投资部总监、固定收益部总监、投资经理。

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

詹鸿飞先生，副总经理兼首席信息官，1971年生，工商管理硕士。历任建设银行福建省分行信托投资公司、建设银行福建省分行直属支行电脑部职员、信贷员，兴业证券股份有限公司上海管理总部电脑部经理，兴业证券股份有限公司信息技术部总经理助理，兴证全球基金管理有限公司运作保障部副总监、总监及总经理助理等职务。现任兴证全球基金管理有限公司副总经理兼首席信息官兼基金运营部总监、交易部总监。

严长胜先生，副总经理，1972年生，高级工商管理硕士。历任武汉海尔电器股份有限公司车间、设计科、销售公司职员，华泰证券股份有限公司综合发展部高级经理，兴业证券股份有限公司研究所、战略规划小组、机构客户部副总经理，民生证券股份有限公司总裁助理、机构销售总部总经理，兴证全球基金管理有限公司总经理助理等职务。现任兴证全球基金管理有限公司副总经理兼渠道部总监、上海分公司总经理、北京分公司总经理。

秦杰先生，副总经理，1981年生，经济学硕士。历任毕马威华振会计师事务所助理审计经理，德勤华永会计师事务所高级咨询师，毕马威企业咨询（中国）有限公司高级经理，兴证全球基金管理有限公司监察稽核部总监、综合管理部总监、党委办公室主任、纪委办公室主任、总经理助理、合规管理部总监，现任兴证全球基金管理有限公司副总经理兼董事会秘书、风险管理部总监、投融资业务审批部总监，兴证全球资本管理（上海）有限公司执行董事及法定代表人。

#### 4、本基金基金经理



张睿女士，金融学硕士。历任红顶金融工程研究中心研究部经理，申银万国证券研究所高级分析师，兴证全球基金管理有限公司研究员、固定收益部总监助理、兴全磐稳增利债券型证券投资基金基金经理、兴全货币市场证券投资基金基金经理、兴全保本混合型证券投资基金（已转型为“兴全精选混合型证券投资基金”）基金经理、兴全添利宝货币市场基金基金经理、兴全天添益货币市场基金基金经理、兴全兴泰定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。现任兴证全球基金管理有限公司固定收益部副总监、兴全磐稳增利债券型证券投资基金基金经理（2015年11月2日起至今）、兴全恒益债券型证券投资基金基金经理（2017年9月20日起至今）、兴全恒瑞三个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理（2019年6月21日起至今）。

本基金历任基金经理：

肖娟女士，于2011年01月25日至2012年03月02日期间，曾管理本基金。

李友超先生，于2009年07月23日至2012年06月29日期间，曾管理本基金。

张睿女士，于2012年04月27日至2013年07月11日期间，曾管理本基金。

毛水荣先生，于2013年06月14日至2015年12月14日期间，曾管理本基金。

#### 5、投资决策委员会成员

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

庄园芳 兴证全球基金管理有限公司副董事长、总经理

谢治宇 兴证全球基金管理有限公司副总经理，兼任基金管理部投资总监、研究部总监、国际业务部总监、兴全合润混合型证券投资基金基金经理、兴全合宜灵活配置混合型证券投资基金（LOF）基金经理、兴全社会价值三年持有期混合型证券投资基金基金经理、兴全趋势投资混合型证券投资基金（LOF）基金经理

乔迁 兴证全球基金管理有限公司基金管理部副总监、兴全商业模式优选混合型证券投资基金（LOF）基金经理、兴全新视野灵活配置定期开放混合型

## 发起式证券投资基金基金经理

任相栋 兴证全球基金管理有限公司基金管理部副总监、兴全合泰混合型证券投资基金基金经理、兴证全球合衡三年持有期混合型证券投资基金基金经理

6、上述人员之间不存在近亲属关系。

### 三、基金管理人的职责

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

2、办理基金备案手续；

3、对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账，进行证券投资；

4、按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；

5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

6、编制中期和年度报告；

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它职责。

### 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控制制度

### 1、风险管理的理念

（1）风险管理是业务发展的保障；

（2）最高管理层承担最终责任；

（3）分工明确、相互牵制的组织结构是前提；

（4）制度建设是基础；

（5）制度执行监督是保障。

### 2、风险管理的原则

（1）全面性原则：公司风险管理必须覆盖公司的所有部门和岗位，渗透各项业务过程和业务环节；

（2）独立性原则：公司设立独立的风险管理部、审计部、合规管理部，风险管理部、审计部、合规管理部保持高度的独立性和权威性，负责对公司各部门风险控制工作进行稽核和检查；

（3）相互制约原则：公司及各部门在内部组织结构的设计上要形成一种相互制约的机制，建立不同岗位之间的制衡体系；

（4）定性和定量相结合原则：建立完备的风险管理指标体系，使风险管理更具客观性和操作性；

（5）重要性原则：公司的发展必须建立在风险控制完善和稳固的基础上，内部风险控制与公司业务发展同等重要。

### 3、风险管理和内部风险控制体系结构

公司的风险管理体系结构是一个分工明确、相互牵制的组织结构，由最高管理层对风险管理负最终责任，各个业务部门负责本部门的风险评估和监控，风险管理部、审计部、合规管理部负责监察公司的风险管理措施的执行。具体而言，包括如下组成部分：

（1）董事会：负责制定公司的风险管理政策，对风险管理负完全的和最终

的责任。董事会下设执行委员会和风险控制委员会；

（2）督察长：独立行使督察权利，直接对董事会负责，及时向风险控制委员会提交有关公司规范运作和风险控制方面的工作报告；

（3）投资决策委员会：负责指导基金财产的运作、制定本基金的资产配置方案和基本的投资策略；

（4）风险管理委员会：负责对基金投资运作的风险进行测量和监控；

（5）风险管理部、审计部、合规管理部：负责对公司风险管理政策和措施的执行情况进行监察，并为每一个部门的风险管理系统的发展提供协助，使公司在一种风险管理和控制的环境中实现业务目标；

（6）业务部门：风险管理是每一个业务部门最首要的责任。部门经理对本部门的风险负全部责任，负责履行公司的风险管理程序，负责本部门的风险管理系统的开发、执行和维护，用于识别、监控和降低风险。

#### 4、内部控制制度综述

##### （1）风险控制制度

公司风险控制的目标为严格遵守国家法律法规、行业自律规定和公司各项规章制度，自觉形成守法经营、规范运作的经营思想和经营风格；不断提高经营管理水平，在风险最小化的前提下，确保基金份额持有人利益最大化；建立行之有效的风险控制机制和制度，确保各项经营管理活动的健康运行与公司财产的安全完整；维护公司信誉，保持公司的良好形象。

针对公司面临的各种风险，包括政策和市场风险，管理风险和职业道德风险，分别制定严格防范措施，并制定岗位分离制度、空间分离制度、作业流程制度、集中交易制度、信息披露制度、资料保全制度、保密制度和独立的监察稽核制度等相关制度。

##### （2）监察稽核制度

监察稽核工作是公司内部风险控制的重要环节。公司设督察长和审计部。督察长全面负责公司的监察稽核工作，可在授权范围内列席公司任何会议，调阅公司任何档案材料，对基金资产运作、内部管理、制度执行及遵规守法情况进行内部监察、稽核；出具监察稽核报告，报公司董事会和中国证监会，如发现公司有重大违规行为，应立即向公司董事会和中国证监会报告。

审计部具体执行监察稽核工作，并协助督察长工作。审计部具有独立的检

查权、独立的报告权、知晓权和建议权。具体负责对公司内部风险控制制度提出修改意见；检查公司各部门执行内部管理制度的情况；监督公司资产运作、财务收支的合法性、合规性、合理性；监督基金财产运作的合法性、合规性、合理性；调查公司内部的违规事件；协助监管机关调查处理相关事项；负责员工的离任审计；协调外部审计事宜等。

### （3）内部财务控制制度

财务管理的目的在于规范公司会计行为，保证会计资料真实、完整；加强财务管理，合理使用公司财务资源，提高公司资金的运用效率，控制公司财务风险，保护公司股东的利益，保证公司财产安全、完整和增值。

公司内部财务控制制度主要内容有：公司财务核算实行权责发生制的原则，会计使用国家许可的电算化软件。公司实行财务预算管理制度，财务室在综合各部门财务预算的基础上负责编制并报告公司总经理，经董事会批准后组织实施。各部门应认真做好财务预算的编制和实施工作。

## 5、风险管理和内部风险控制的措施

（1）建立、健全内控体系，完善内控制度：公司建立、健全了内控结构，高管人员关于内控有明确的分工，确保各项业务活动有恰当的组织 and 授权，确保监察稽核工作是独立的，并得到高管人员的支持，同时置备操作手册，并定期更新；

（2）建立相互分离、相互制衡的内控机制：建立、健全了各项制度，做到基金经理分开，投资决策分开，基金交易集中，形成不同部门，不同岗位之间的制衡机制，从制度上减少和防范风险；

（3）建立、健全岗位责任制：建立、健全了岗位责任制，使每个员工都明确自己的任务、职责，并及时将各自工作领域中的风险隐患上报，以防范和减少风险；

（4）建立风险分类、识别、评估、报告、提示程序：建立了风险管理委员会，使用适合的程序，确认和评估与公司运作有关的风险；公司建立了自下而上的风险报告程序，对风险隐患进行层层汇报，使各个层次的人员及时掌握风险状况，从而以最快速度作出决策；

（5）建立内部监控系统：建立了有效的内部监控系统，如电脑预警系统、投资监控系统，能对可能出现的各种风险进行全面和实时的监控；

（6）使用数量化的风险管理手段：采取数量化、技术化的风险控制手段，建立数量化的风险管理模型，用以提示指数趋势、行业及个股的风险，以便公司及时采取有效的措施，对风险进行分散、控制和规避，尽可能地减少损失；

（7）提供足够的培训：制定了完整的培训计划，为所有员工提供足够和适当的培训，使员工明确其职责所在，控制风险。

#### 6、基金管理人关于内部合规控制声明书

基金管理人确知建立、维护、维持和完善内部控制制度是基金管理人董事会及管理层的责任。基金管理人特别声明以上关于内部控制的披露真实、准确，并承诺将根据市场变化和公司业务发展不断完善内部控制制度。

## 第四部分 基金托管人

### 一、基金托管人基本情况

#### （一）基金托管人概况

交通银行股份有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区银城中路188号

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区银城中路188号

法定代表人：任德奇

电话：021-58781234

传真：021-58408483

联系人：高天

客服电话：95559

公司网址：[www.bankcomm.com](http://www.bankcomm.com)

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。交通银行连续13年跻身《财富》(FORTUNE)世界500强，营业收入排名第137位；列《银行家》(The Banker)杂志全球千家大银行一级资本排名第11位。

截至2023年3月31日，交通银行资产总额为人民币13.65万亿元。2023年一季度，交通银行实现净利润(归属于母公司股东)人民币203.8亿元。

交通银行总行设资产托管部（下文简称“托管部”）。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，董事长、执行董事，高级经济师。

任先生2020年1月起任本行董事长（其中：2019年12月至2020年7月代为履行行长职责）、执行董事，2018年8月至2020年1月任本行副董事长（其



中：2019年4月至2020年1月代为履行董事长职责）、执行董事，2018年8月至2019年12月任本行行长；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。

刘珺先生，副董事长、执行董事、行长，高级经济师。

刘先生2020年7月起担任本行行长；2016年11月至2020年5月任中国投资有限责任公司副总经理；2014年12月至2016年11月任中国光大集团股份公司副总经理；2014年6月至2014年12月任中国光大（集团）总公司执行董事、副总经理（2014年6月至2016年11月期间先后兼任光大永明人寿保险有限公司董事长、中国光大集团有限公司副董事长、中国光大控股有限公司执行董事兼副主席、中国光大国际有限公司执行董事兼副主席、中国光大实业（集团）有限责任公司董事长）；2009年9月至2014年6月历任中国光大银行行长助理、副行长（期间先后兼任中国光大银行上海分行行长、中国光大银行金融市场中心总经理）；1993年7月至2009年9月先后在中国光大银行国际业务部、香港代表处、资金部、投行业务部工作。刘先生2003年于香港理工大学获工商管理博士学位。

徐铁先生，资产托管部总经理。

徐铁先生2022年4月起任本行资产托管部总经理；2014年12月至2022年4月任本行资产托管部副总经理；2000年7月至2014年12月，历任交通银行资产托管部客户经理、保险与养老金部副高级经理、高级经理、保险保障业务部高级经理、总经理助理。徐先生2000年于复旦大学获经济学硕士学位。

### （三）基金托管业务经营情况

截至2023年3月31日，交通银行共托管证券投资基金731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、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、期货公司资产管理计划、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、QDIE 资金、QDLP 资金和 QFLP 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，托管部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：托管部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：托管部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：托管部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：托管部贯彻适当授权、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：托管部在岗位、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：托管部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，托管部制定了一整套严密、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。

托管部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。基金管理人对交通银行通知的违规事项未能及时纠正的，交通银行按规定报告中国证监会。

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。

## 第五部分 相关服务机构

### 一、基金份额发售机构

#### 1、直销机构

（1）名称：兴证全球基金管理有限公司直销中心（柜台）

地址：上海市浦东新区芳甸路1155号嘉里城办公楼30楼

联系人：秦洋洋、沈冰心

直销联系电话：021-20398706、021-20398927

传真号码：021-20398988、021-20398889

（2）名称：兴证全球基金网上直销平台（含微网站、APP）

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

客户服务电话：4006780099，（021）38824536

#### 2、其他销售机构（排序不分先后）

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

名称	法定代表人	注册地址	办公地址	客服电话	网址
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	95533	<a href="http://www.ccb.com/">http://www.ccb.com/</a>

			干诺道中 3 号 中国建设银行 大厦 28 楼		
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	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>
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>
中国光大银行 股份有限公司	李晓鹏	中国北京市西城 区太平桥大街 25 号、甲 25 号中 国光大中心	北京市西城区 太平桥大街 25 号中国光 大中心, 香港 湾仔告士打道 108 号光大中 心 23 楼	95595	<a href="http://www.cebbank.com/">http://www.cebbank.com/</a>
中国民生银行 股份有限公司	高迎欣	中国北京市西城 区复兴门内大街 2 号	北京市西城区 复兴门内大街 2 号民生银行 大厦	95568	<a href="http://www.cmbc.com.cn/">http://www.cmbc.com.cn/</a>
中国邮政储蓄 银行股份有限 公司	张金良	北京市西城区金 融大街 3 号	北京市西城区 金融大街 3 号	95580	<a href="http://www.psbc.com/cn/">http://www.psbc.com/cn/</a>

华夏银行股份 有限公司	李民吉	北京市东城区建 国门内大街 22 号	北京市东城区 建国门内大街 22 号华夏银 行大厦	95577	<a href="https://www.hxb.com.cn/">https://www.hxb.com.cn/</a>
上海银行股份 有限公司	金煜	上海市浦东新区 银城中路 168 号	上海市浦东新 区银城中路 168 号	95594	<a href="http://www.bosc.cn/">http://www.bosc.cn/</a>
广发银行股份 有限公司	王凯	广州市越秀区东 风东路 713 号	广州市越秀区 东风东路 713 号	95508	<a href="http://www.gbchina.com.cn/">http://www.gbchina.com.cn/</a>
平安银行股份 有限公司	谢永林	广东省深圳市罗 湖区深南东路 5047 号	广东省深圳市 罗湖区深南东 路 5047 号, 中 国广东省深圳 市福田区益田 路 5023 号平 安金融中心 B 座	95511	<a href="http://bank.pingan.com/">http://bank.pingan.com/</a>
宁波银行股份 有限公司	陆华裕	浙江省宁波市鄞 州区宁东路 345 号	浙江省宁波市 鄞州区宁东路 345 号	95574	<a href="http://www.nbc.cn/">http://www.nbc.cn/</a>
江苏银行股份 有限公司	夏平	江苏省南京市秦 淮区中华路 26 号	江苏省南京市 秦淮区中华路 26 号	95319	<a href="http://www.jsbchina.cn/">http://www.jsbchina.cn/</a>
渤海银行股份 有限公司	李伏安	中国天津市河东 区海河东路 218 号	天津市河东区 海河东路 218 号, 香港中环 国际金融中心 二期 12 楼 1201-1209 及 1215-1216 室	95541	<a href="http://www.cbhb.com.cn/">http://www.cbhb.com.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>
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)9 6005	<a href="http://www.jnbank.com.cn/">http://www.jnbank.com.cn/</a>

江苏昆山农村商业银行股份有限公司	谢铁军	江苏省昆山市前进东路 828 号	江苏省昆山市前进东路 828 号	0512-96079	<a href="http://www.ksrcb.com/">http://www.ksrcb.com/</a>
广州农村商业银行股份有限公司	蔡建	广东省广州市黄埔区映日路 9 号	广东省广州市黄埔区映日路 9 号	95313	<a href="http://www.grcbank.com/">http://www.grcbank.com/</a>
兴业证券股份有限公司	杨华辉	福州市湖东路 268 号	长柳路 36 号 7 层 701 室	95562	<a href="http://www.xyzq.com.cn">http://www.xyzq.com.cn</a>
国泰君安证券股份有限公司	贺青	上海市浦东新区自由贸易试验区商城路 618 号	上海市静安区南京西路 768 号	95521	<a href="https://www.gtja.com/">https://www.gtja.com/</a>
中信建投证券股份有限公司	王常青	北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼	北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼	4008888108	<a href="https://www.csc108.com/">https://www.csc108.com/</a>
国信证券股份有限公司	张纳沙	广东省深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层	深圳市福田区福华一路 125 号国信金融大厦	95536	<a href="http://www.guosen.com.cn">www.guosen.com.cn</a>
招商证券股份有限公司	霍达	深圳市福田区福田街道福华一路 111 号	深圳市福田区福田街道福华一路 111 号	95565	<a href="http://www.cmschina.com/">http://www.cmschina.com/</a>
广发证券股份有限公司	林传辉	广东省广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街 2 号 618 室	广东省广州市天河区马场路 26 号广发证券大厦	95575	<a href="http://www.gf.com.cn/">http://www.gf.com.cn/</a>
中信证券股份有限公司	张佑君	广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场(二期)北座	广东省深圳市福田区中心三路 8 号中信证券大厦, 北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦	95548	<a href="http://www.citics.com">www.citics.com</a>
中国银河证券股份有限公司	陈亮	北京市丰台区西营街 8 号院 1 号楼 7 至 18 层	北京市丰台区西营街 8 号院 1 号楼青海金融大厦	4008-888-888、95551	<a href="http://www.chinastock.com.cn/">www.chinastock.com.cn/</a>



海通证券股份有限公司	周杰	上海市黄浦区广东路 689 号	上海市黄浦区广东路 689 号	95553	www.htsec.com
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	http://www.lhzq.com/
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	www.swhysc.com
长江证券股份有限公司	金才玖	湖北省武汉市江汉区淮海路 88 号	湖北省武汉市江汉区新华路特 8 号	95579	http://www.95579.com/
安信证券股份有限公司	黄炎勋	深圳市福田区福田街道福华一路 119 号安信金融大厦	深圳市福田区福田街道福华一路 119 号安信金融大厦	95517	http://www.essence.com.cn/
湘财证券股份有限公司	高振营	长沙市天心区湘府中路 198 号新南城商务中心 A 栋 11 楼	长沙市天心区湘府中路 198 号新南城商务中心 A 栋 11 楼	95351	https://www.xcsc.com/
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	https://www.msza.com/
国元证券股份有限公司	沈和付	安徽省合肥市蜀山区梅山路 18 号	安徽省合肥市蜀山区梅山路 18 号	95578	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	956066	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	95597	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	陈佳春	青岛市崂山区深圳路222号1号楼2001	青岛市崂山区深圳路222号1号楼2001	95548	http://sd.citics.com/
东兴证券股份有限公司	李娟	北京市西城区金融大街5号(新盛大厦)12、15层	北京市西城区金融大街5号(新盛大厦)6、10、12、15、16层	95309	www.dxzq.net
东吴证券股份有限公司	范力	江苏省苏州市吴中区工业园区星阳街5号	江苏省苏州市吴中区工业园区星阳街5号	95330	http://www.dwzq.com.cn/
信达证券股份有限公司	祝瑞敏	北京市西城区闹市口大街9号院1号楼	北京市西城区闹市口大街9号院1号楼	95321	https://www.cindasc.com/
东方证券股份有限公司	金文忠	上海市黄浦区中山南路119号东方证券大厦	上海市黄浦区中山南路119号东方证券大厦, 中国上海市黄浦区中山南路318号2号楼3-6层、12层、13层、22层、25-27层、29层、32层、36层、38层	95503	www.dfzq.com.cn
方正证券股份有限公司	施华	湖南省长沙市天心区湘江中路二段36号华远华中心4、5号楼3701-3717	湖南省长沙市天心区湘江中路二段36号华远华中心4、5号楼3701-3717	95571	www.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	95525	www.ebscn.com
中信证券华南股份有限公司	陈可可	广州市天河区临江大道 395 号 901 室(部位:自编 01), 1001 室	广州市天河区珠江西路 5 号 501 房	95548	http://www.gzs.com.cn/
东北证券股份有限公司	李福春	吉林省长春市南关区生态大街 6666 号	吉林省长春市南关区生态大街 6666 号	86-431-85096806	www.nesc.cn
南京证券股份有限公司	李剑锋	南京市江东中路 389 号	南京市江东中路 389 号	95386	https://www.njzq.com.cn/
国联证券股份有限公司	葛小波	江苏省无锡市滨湖区金融一街 8 号	无锡市滨湖区金融一街 8 号国联金融大厦	95570	http://www.gllsc.com.cn/
平安证券股份有限公司	何之江	深圳市福田区福田街道益田路 5023 号平安金融中心 B 座第 22-25 层	深圳市福田区福田街道益田路 5023 号平安金融中心 B 座第 22-25 层	021-38635562, 86-755-22627723	http://www.stock.pingan.com/
华安证券股份有限公司	章宏韬	安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号	安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号	95318	http://www.hazq.com/
国海证券股份有限公司	何春梅	广西壮族自治区桂林市七星区辅星路 13 号	广西壮族自治区南宁市青秀区滨湖路 46 号国海大厦	86-771-5532512	www.ghzq.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.cnew.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	江苏省常州市延陵西路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	400-620-8888	www.bocichina.com
恒泰证券股份有限公司	祝艳辉	内蒙古自治区呼和浩特市新城区海拉尔东街满世尚都办公商业综合楼	内蒙古自治区呼和浩特市新城区海拉尔东街满世尚都办公商业综合楼	956088	http://m.cnht.com.cn/
国盛证券有限责任公司	徐丽峰	江西省南昌市新建区子实路1589号	江西省南昌市红谷滩新区凤凰中大道1115号北京银行营业大楼16层	956080	https://www.gszq.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	王洪	济南市市中区经七路86号	济南市市中区经七路86号	95538	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	江西省南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号南昌	95335	https://www.avicsec.com/

		昌国际金融大厦 A 栋 41 层	国际金融大厦 A 栋 41 层		
德邦证券股份 有限公司	武晓春	上海市普陀区曹 杨路 510 号南半 幢 9 楼	上海市浦东新 区福山路 500 号城建国际中 心 29 楼	400- 8888- 128	<a href="https://www.tebon.com.cn/">https://www. tebon.com.cn /</a>
西部证券股份 有限公司	徐朝晖	陕西省西安市新 城区东新街 319 号 8 幢 10000 室	陕西省西安市 新城区东新街 319 号 8 幢 10000 室	95582	<a href="http://www.west95582.com/">http://www.w est95582.com /</a>
华福证券有限 责任公司	苏军良	福建省福州市鼓 楼区鼓屏路 27 号 1#楼 3 层、4 层、5 层	上海市浦东新 区滨江大道 5129 号陆家 嘴滨江中心 N1 座	95547	<a href="https://www.hfzq.com.cn/">https://www. hfzq.com.cn/</a>
中国国际金融 股份有限公司	沈如军	北京市朝阳区建 国门外大街 1 号 国贸大厦 2 座 27 层及 28 层	北京市朝阳区 建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层	(+86- 10) 6505 1166	<a href="https://www.cicc.com/">https://www. cicc.com/</a>
财通证券股份 有限公司	章启诚	浙江省杭州市西 湖区天目山路 198 号财通双冠 大厦西楼	浙江省杭州市 西湖区天目山 路 198 号财通 双冠大厦西楼	95336	<a href="http://www.ctsec.com">www.ctsec.co m</a>
上海华信证券 有限责	陈灿辉	中国(上海)自由 贸易试验区世纪 大道 100 号环球 金融中心 9 楼	上海市黄浦区 南京西路 399 号 23F	400- 820- 5999	<a href="http://shhxzq.com/">http://shhxz q.com/</a>
华鑫证券有限 责任公司	俞洋	深圳市福田区香 蜜湖街道东海社 区深南大道 7888 号东海国际中心 一期 A 栋 2301A	上海市浦东新 区金海路 1000 号	400- 109- 9918	<a href="http://www.cfsc.com.cn/">http://www.c fsc.com.cn/</a>
瑞银证券有限 责任公司	陈安	北京市西城区金 融大街 7 号英蓝 国际金融中心 12 层、15 层	北京市西城区 金融大街 7 号 英蓝国际金融 中心 12 层、 15 层	010- 5832 8888	<a href="https://www.ubs.com/cn/sc/ubs-securities">https://www. ubs.com/cn/s c/ubs- securities</a>

中国中金财富 证券有限公司	高涛	深圳市南山区粤 海街道海珠社区 科苑南路 2666 号中国华润大厦 L4601-L4608	深圳市福田区 益田路与福中 路交界处荣超 商务中心 A 栋 第 18-21 层及 第 04 层 01.02.03.05. 11.12.13.15. 16.18.19.20. 21.22.23 单 元	95532	<a href="https://www.ciccwm.com/">https://www. ciccwm.com/</a>
东方财富证券 股份有限公司	戴彦	西藏自治区拉萨 市柳梧新区国际 总部城 10 栋楼	上海市徐汇区 宛平南路 88 号金座东方财 富大厦	95357	<a href="http://www.18.cn">www.18.cn</a>
粤开证券股份 有限公司	严亦斌	广东省广州市黄 埔区经济技术开 发区科学大道 60 号开发区金控中 心 21、22、23 层	广东省广州市 黄埔区经济技术 开发区科学 大道 60 号开 发区金控中心 21、22、23 层	95564	<a href="http://www.ykzq.com/">http://www.y kzq.com/</a>
九州证券股份 有限公司	邓晖	西宁市南川工业 园区创业路 108 号	北京市朝阳区 安立路 30 号 仰山公园东一 门 2 号楼	95305	<a href="http://www.jzsec.com/">http://www.j zsec.com/</a>
国金证券股份 有限公司	冉云	四川省成都市青 羊区东城根上街 95 号	四川省成都市 青羊区东城根 上街 95 号成 证大厦 16 楼	95310	<a href="https://www.gjzq.com.cn">https://www. gjzq.com.cn</a>
华宝证券股份 有限公司	刘加海	中国（上海）自 由贸易试验区浦 电路 370 号 2、 3、4 层	中国（上海） 自由贸易试验 区浦电路 370 号 2、3、4 层	4008209 898	<a href="https://www.cnhbstock.com/">https://www. cnhbstock.co m/</a>
爱建证券有限 责任公司	祝健	中国（上海）自 由贸易试验区世 纪大道 1600 号 1 幢 32 楼	中国（上海）自 由贸易试验区 世纪大道 1600 号 1 幢 32 楼	4001- 962-502	<a href="https://www.ajzq.com/">https://www. ajzq.com/</a>

国新证券股份 有限公司	张海文	北京市西城区车 公庄大街4号2 幢1层A2112室	北京市朝阳区 朝阳门北大街 18号中国人 保寿险大厦 12-18层	95390	www.crsec.co m.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.s 10000.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. huajinsc.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) 6604567 8	http:// www.txsec.co m
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	4009200 022	http://licai ke.hexun.com
厦门市鑫鼎盛 控股有限公司	林劲	厦门市思明区鹭 江道2号第一广 场1501-1502室	厦门市思明区 鹭江道2号第 一广场1501- 1502室	400- 6533- 789	http://www.x ds.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- 6604616 6	www.huilinbd .com
上海挖财基金 销售有限公司	方磊	中国(上海)自由 贸易试验区杨高 南路759号18 层03单元	中国(上海)自 由贸易试验区 杨高南路759 号18层03单 元	021- 5081067 3	https://waca ijijin.com/
腾安基金销售 (深圳)有限 公司	谭广锋	深圳市前海深港 合作区前湾一路 1号A栋201室	深圳市南山区 海天二路33 号腾讯滨海大 厦15楼	95017	www.txfund.c om
民商基金销售 (上海)有限 公司	賁惠琴	上海市黄浦区北 京东路666号H	上海市浦东新 区张扬路707	021- 5020600 3	www.msftec.c om

		区(东座)6楼 A31室	号生命人寿大厦 32楼		
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.duxiaomafund.com
诺亚正行基金销售有限公司	吴卫国	上海市虹口区飞虹路360弄9号6层	上海市闵行区申滨南路1226号诺亚财富中心	400-821-5399	www.noahfund.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笋西社区梨园路8号HALO广场一期四层12-13室	深圳市罗湖区笋岗街道笋西社区梨园路8号HALO广场一期四层12-13室	4006-788-887	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	陶怡	上海市虹口区东大名路501号6211单元	上海市浦东新区潍坊新村街道张杨路500号华润时代广场商务楼10-14楼	400-700-9665	www.ehowbuy.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.erichfund.com



浙江同花顺基金销售有限公司	吴强	浙江省杭州市文二西路1号元茂大厦903室	浙江省杭州市余杭区五常街道同顺街18号	952555	<a href="http://www.5ifund.com">http://www.5ifund.com</a>
上海利得基金销售有限公司	李兴春	中国(上海)自由贸易试验区临港新片区海基六路70弄1号208-36室	上海市虹口区东大名路1098号浦江国际金融广场53层	400-032-5885	<a href="http://www.leadbank.com.cn/">http://www.leadbank.com.cn/</a>
泛华普益基金销售有限公司	杨远芬	成都市成华区建设路9号高地中心1101室	成都市金牛区花照壁西顺街399号西宸国际B座	400-080-3388	<a href="http://www.puyifund.com">www.puyifund.com</a>
北京汇成基金销售有限公司	王伟刚	北京市西城区宣武门外大街甲1号4层401-2	西城区宣武门外大街甲1号环球财讯中心D座4层	400-0555-728	<a href="http://www.hcfunds.com">www.hcfunds.com</a>
北京广源达信基金销售有限公司	齐剑辉	北京市西城区新街口外大街28号C座六层605室	北京市顺义区北京东航中心1号楼3层304B室	400-616-7531	<a href="http://www.niuniufund.com">http://www.niuniufund.com</a>
上海大智慧基金销售有限公司	张俊	中国(上海)自由贸易试验区杨高南路428号1号楼1102单元	中国上海市浦东新区杨高南路428号1号楼1102单元	021-20292031	<a href="http://www.wg.com.cn">www.wg.com.cn</a>
北京新浪仓石基金销售有限公司	李柳娜	北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2地块新浪总部科研楼5层518室	北京市海淀区西北旺东路10号院西区8号楼新浪总部大厦	010-62675369	<a href="http://www.xincai.com">http://www.xincai.com</a>
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	<a href="http://www.jiyufund.com.cn">www.jiyufund.com.cn</a>

上海陆金所基金销售有限公司	陈祎彬	中国（上海）自由贸易试验区源深路1088号7层	上海市浦东新区平安财富大厦7楼	400-821-9031	<a href="http://www.lufunds.com">http://www.lufunds.com</a>
珠海盈米基金销售有限公司	肖雯	珠海市横琴新区环岛东路3000号2719室	广州市海珠区阅江中路688号保利国际广场北塔33层	020-89629066	<a href="http://www.yingmi.com">www.yingmi.com</a>
中证金牛（北京）基金销售有限公司	吴志坚	北京市丰台区东管头1号2号楼2-45室	北京市西城区宣武门外大街新华社第三工作区A座4、5层	4008-909-998	<a href="http://www.jnlc.com">www.jnlc.com</a>
京东肯特瑞基金销售有限公司	邹保威	北京市海淀区知春路76号（写字楼）1号楼4层1-7-2	北京市通州区亦庄经济技术开发区科创十一街18号院京东集团总部A座15层	95118	<a href="http://kenterui.jd.com">kenterui.jd.com</a>
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://danjuanapp.com/">https://danjuanapp.com/</a>
上海华夏财富投资管理有限公司	毛淮平	上海市虹口区东大名路687号1幢2楼268号	北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座8层	400-817-5666	<a href="http://www.amcfortune.com">www.amcfortune.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.xzfuture.cn/">http://www.xzfuture.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>

玄元保险代理有限公司	马永谔	中国（上海）自由贸易试验区张杨路707号1105室	中国（上海）自由贸易试验区张杨路707号1105室	400-080-8208	www.licaimofang.com
阳光人寿保险股份有限公司	李科	海南省三亚市迎宾路360-1号三亚阳光金融广场16层	北京市朝阳区景辉街33号院1号楼阳光金融中心	95510	https://fund.sinosig.com/
中国人寿保险股份有限公司	白涛	北京市西城区金融大街16号	北京市西城区金融大街16号	95515	www.e-chinalife.com

基金管理人可根据有关法律、法规的要求，选择其他符合要求的机构代理销售本基金，并在基金管理人网站公示。

## 二、注册登记机构

名称：兴证全球基金管理有限公司

注册地址：上海市黄浦区金陵东路368号

办公地址：上海市浦东新区芳甸路1155号浦东嘉里城办公楼28楼

法定代表人：杨华辉

联系人：朱瑞立

电话：（021）20398888

传真：（021）58368858

## 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）

住所：北京东城区东长安街1号东方广场毕马威大楼8层

办公地址：上海南京西路 1266 号恒隆广场 50 楼

法定代表人：邹俊

电话：010-85085000

传真：010-85085111

经办注册会计师：王国蓓、张楠

联系人：王国蓓

## 第六部分 基金的募集

本基金由管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关规定，并经中国证监会 2009 年 5 月 11 日证监许可[2009] 385 号文核准募集。

### 一、基金类型

债券型

### 二、基金运作方式

契约型开放式

### 三、基金存续期限

不定期

### 四、募集情况

经中国证监会批准，本基金自 2009 年 7 月 1 日至 2009 年 7 月 20 日向社会公开募集。经安永大华会计师事务所有限公司验资，本次募集的净认购金额为 1,417,758,908.87 元人民币，有效认购款项在基金合同生效前产生的利息共计 184,587.00 元人民币，首次设立募集规模为 1,417,943,495.87 份基金份额，有效认购总户数为 10,897 户。经向中国证监会备案，本基金基金合同于 2009 年 7 月 23 日正式生效。

### 五、基金份额的类别

本基金根据申购费用收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。

在投资者申购基金时收取申购费用，而不计提销售服务费的，称为 A 类基金份额；在投资者申购基金份额时不收取申购费用，而是从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。

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

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

投资者在认购、申购基金份额时可自行选择基金份额类别。

在不违反法律法规、基金合同的约定以及对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，在履行适当程序后基金管理人可增加、减少或调整基金份额类别设置、对基金份额分类办法及规则进行调整、或者调整现有基金份额类别的费率水平、或者停止现有基金份额类别的销售等，并在调整实施之日前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告，不需要召开基金份额持有人大会。  
本基金不同基金份额类别之间不得互相转换。

## 第七部分 基金合同的生效

### 一、基金合同生效时间

本基金的基金合同于 2009 年 7 月 23 日正式生效。

### 二、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

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

## 第八部分 基金份额的申购、赎回与转换

### 一、申购与赎回的场所

基金的销售机构包括基金管理人和基金管理人委托的销售机构。

投资人可以在销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理基金的申购与赎回。本基金管理人可根据情况增减基金销售机构，并在基金管理人网站公示。

若基金管理人或销售机构开通电话、传真或网上交易业务的，投资人可以通过基金管理人或其指定的代销机构以电话、传真或网上交易等形式进行基金的申购和赎回，具体办法另行公告。

### 二、申购与赎回的开放日及时间

#### 1. 开放日及开放时间

本基金的开放日是指为投资人办理基金申购、赎回等业务的上海、深圳证券交易所交易日。具体业务办理时间以销售机构公布时间为准。

若出现新的证券市场或其他特殊情况，基金管理人将视情况对前述开放日及具体业务办理时间进行相应的调整并提前公告。

#### 2. 申购与赎回的开始时间

本基金的申购和赎回自基金合同生效后不超过 3 个月时间里开始办理。具体申购、赎回业务办理时间由基金管理人与销售机构约定。在确定申购开始时间与赎回开始时间后，基金管理人最迟于开放日 2 日前在至少一种规定媒介公告。

基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购、赎回或者转换。投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请的，其基金份额申购、赎回或转换价格为下次办理该类基金份额申购、赎回或转换时间所在开放日的价格。

本基金日常申购自 2009 年 8 月 11 日开始办理，日常赎回自 2009 年 8 月 11 日开始办理。

### 三、申购与赎回的限制



1、投资者通过直销柜台申购基金份额单笔最低限额为人民币 10 万元，最低追加申购金额 10 万元；通过本公司网上直销平台申购本基金单笔最低金额为人民币 10 元（含申购费），追加申购单笔最低金额为 10 元（含申购费）。除上述情况及另有公告外，基金管理人规定基金的每笔最低申购金额、每笔最低追加申购金额、最低定期定额投资金额为 0.1 元。

2、基金份额持有人在基金管理人的直销系统办理赎回时，每笔赎回申请的最低份额、每笔最低转换转出份额及单个基金账户最低持有份额为 10 份基金份额；除上述情况外，基金管理人规定本基金每笔最低赎回份额、每笔最低转换转出份额及单个基金账户最低持有份额为 0.1 份。若基金份额持有人单个基金账户中基金份额余额低于上述最低赎回份额，当基金份额持有人申请将账户中该基金全部份额赎回时，不受上述最低赎回份额限制。当基金份额持有人的某笔份额减少类业务导致单个基金账户的基金份额余额少于上述最低持有份额时，基金管理人有权将余额部分基金份额强制赎回。（份额减少类业务指赎回、转换转出、非交易过户、转托管等业务，具体种类以中登公司相关业务规则为准。）

3、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。

4、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。

5、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。

6、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。

7、基金管理人可根据市场情况，在法律法规允许的情况下，调整上述规定的申购的金额和赎回的份额的数量限制，基金管理人最迟必须在调整的 2 日前至少在一种规定媒介刊登公告。

#### 四、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该类基金份额净值为基准进行计算；

2. “金额申购、份额赎回”的原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

3. 基金份额持有人赎回基金份额，对于其持有的基金份额，基金管理人按照“先进先出”的原则处理，即对基金份额持有人在销售机构托管的份额进行赎回处理时，申购确认日期在前的基金份额先赎回，申购确认日期在后的基金份额后赎回；

4. 当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以前撤销，在基金管理人规定的时间之后不得撤销；

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，但最迟应在新的原则实施 2 日前在至少一种规定媒介予以公告。

#### 五、申购与赎回的程序

##### 1. 申购与赎回申请的提出

基金投资人须按销售机构规定的程序，在开放日的业务办理时间提出申购或赎回的申请。

投资人在提交申购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须持有足够的基金份额余额，否则所提交的申购、赎回申请无效。

##### 2. 申购与赎回申请的确认

本基金注册登记机构应以交易时间结束前收到申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日（T 日），并在 T+1 日内对该交易的有效性进行确认。T 日提

交的有效申请，投资人可在 T+2 日（包括该日）到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。

### 3. 申购与赎回申请的款项支付

申购时，采用全额缴款方式，若申购资金在规定时间内未全额到账则申购无效。若申购无效，基金管理人或基金管理人指定的代销机构将投资人已缴付的申购款项本金退还给投资人。

赎回时，当投资人赎回申请成功后，基金管理人将在 T+7 日（包括该日）内支付赎回款项。在发生巨额赎回时，款项的支付办法按照本基金合同有关条款处理。

## 六、申购费率与赎回费率

### 1、申购费率

（1）本基金 A 类基金份额收取申购费用，C 类基金份额不收取申购费用。投资者在申购本基金 A 类基金份额时缴纳申购费用，按单次申购金额采用比例计费。具体费率如下：

申购金额（M，含申购费）	费率
M<50 万	0.8%
50 万≤M<200 万	0.6%
200 万≤M<500 万	0.4%
M≥500 万	每笔 1000 元

（2）本基金的申购费用由申购人承担，可用于市场推广、销售、注册登记等各项费用，不列入基金财产。

### 2、赎回费率

投资者在赎回基金份额时，应交纳赎回费。赎回费率随赎回基金份额持有年份的增加而递减，具体费率如下：

A 类份额：

持有期限（Y）	费率
Y<7 天	1.5%
7 天≤Y<30 天	0.3%
30 天≤Y<1 年	0.1%
Y≥1 年	0

C类份额：

份额持有时间（N，为自然日）	赎回费率
N<7 日	1.5%
7 日≤N<30 日	0.1%
N≥30 日	0.0%

对持续持有期少于7日的投资者收取的赎回费全额计入基金财产，其他情况下赎回费总额的75%计入基金财产，扣除计入基金财产的部分，赎回费的其他部分用于支付注册登记费和必要的手续费。

3、基金管理人可以根据法律法规规定及基金合同调整申购费率和赎回费率，最新的申购费率和赎回费率在《招募说明书（更新）》中列示。费率如发生变更，基金管理人应在调整实施2日前在至少一种规定媒介刊登公告。

4、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，针对特定地域范围、特定行业、特定职业的投资者以及以特定交易方式(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，基金管理人在法律法规允许的条件下，可以适当调低基金申购费率和基金赎回费率。

## 七、申购份额与赎回金额的计算

### 1、基金申购份额的计算

申购费用=申购金额-申购金额/（1+申购费率）

（注：对于适用固定金额申购费的申购，申购费用=固定申购费金额）

净申购金额=申购金额-申购费用

（注：对于适用固定金额申购费的申购，净申购金额=申购金额-固定申购费金额）

申购份额=净申购金额/T 日该类基金份额净值

例：某客户投资 2,000,000.00 元申购本基金 A 类基金份额，其对应的 A 类基金份额申购费率为 0.4%，假设申购当日 A 类基金份额的基金份额净值为 1.0600 元，则其可得到的申购份额为：

申购费用=2,000,000.00-2,000,000.00/（1+0.4%）=7,968.13 元

净申购金额=2,000,000.00-7,968.13=1,992,031.87 元

申购份额=1,992,031.87/1.0600=1,879,275.35 份

即：某客户投资 2,000,000.00 元申购本基金 A 类基金份额，假设申购当日 A 类基金份额的基金份额净值为 1.0600 元，则可得到 1,879,275.35 份 A 类基金份额。

若投资人选择申购 C 类基金份额，则申购份额的计算公式为：

申购份额=申购金额/T 日 C 类基金份额净值

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

申购份额=10,000/1.0500=9,523.81 份

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

## 2、基金赎回支付金额的计算

赎回总额=赎回份数×T 日该类基金份额净值

赎回费用=赎回总额×赎回费率

赎回金额=赎回总额-赎回费用

例：某客户赎回持有的 1,000,000 份 A 类基金份额，持有期限为 360 日，其对应的赎回费率为 0%，假设赎回当日 A 类基金份额净值为 1.1480 元，则其可得到的净赎回金额为：

赎回总金额=1,000,000×1.1480=1,148,000.00 元

赎回费用=1,148,000.00×0%=0 元

净赎回金额=1,148,000.00-0=1,148,000.00 元

即：某持有本基金 360 日的客户赎回持有的 1,000,000 份 A 类基金份额，假设赎回当日 A 类基金份额净值为 1.1480 元，则可得到的净赎回金额为 1,148,000.00 元。

### 3、基金份额净值计算

基金份额净值=T 日基金份额的基金资产净值/ T 日该类基金份额余额总数。

基金份额净值为计算日基金资产净值除以计算日该类基金份额余额总数，基金份额净值单位为元，计算结果保留在小数点后 4 位，小数点后第五位四舍五入，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

本基金基金份额 T 日的各类基金份额净值在当天收市后计算，并在 T+1 日内公告。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

4、申购份额的计算及余额的处理方式：本基金以申购金额为基数采用比例费率计算申购费用。申购的有效份额为净申购金额除以当日该类基金份额的基金份额净值，有效份额单位为份，申购份额的计算保留到小数点后2位，小数点后两位以后的部分舍去，舍去部分计入基金财产。

5、赎回金额的计算及处理方式：赎回金额为按实际确认的有效赎回份额以当日该类基金份额的基金份额净值为基准并扣除相应的费用，赎回金额单位为元，计算结果保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分舍去，舍去部分计入基金财产。

## 八、申购与赎回的注册登记

1、经基金销售机构同意，基金投资人提出的申购和赎回申请，在基金管理人规定的时间之前可以撤销。

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

3、投资人赎回基金成功后，基金注册登记机构在T+1日为投资人扣除权益并办理相应的注册登记手续。

4、基金管理人可在法律法规允许的范围内，对上述注册登记办理时间进行调整，并最迟于开始实施2日前依法予以公告。

## 九、拒绝或暂停申购、暂停赎回的情形及处理

1、在如下情况下，基金管理人可以拒绝或暂停接受投资人的申购申请：

1) 因不可抗力导致基金管理人无法接受投资人的申购申请；  
2) 证券交易场所在交易时间内非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；

3) 发生本基金合同规定的暂停基金财产估值情况；

4) 基金财产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，从而损害现有基金份额持有人的利益的情形；

5) 基金管理人认为有正当理由认为接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害其他基金份额持有人利益或对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时；

6) 接受某一投资者申购申请后导致其份额达到或超过基金总份额 50%以上的；

7) 申请超过基金管理人设定的基金总规模、单日净申购比例上限、单一投资者单日或单笔申购金额上限的；

8) 当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人暂停估值并采取暂停接受基金申购申请的措施；

9) 法律、法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述 1)、2)、3)、4)、8) 项情形时，基金管理人应依法公告。

如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项将退还给投资人。

在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。

2、在如下情况下，基金管理人可以暂停接受投资人的赎回申请：

1) 因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项；

2) 证券交易场所在交易时间内非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；

3) 发生巨额赎回，根据本基金合同规定，可以暂停接受赎回申请的情况；

4) 发生本基金合同规定的暂停基金财产估值情况；

5) 当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人暂停估值并采取延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请的措施；

6) 法律、法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述 1)、2)、3)、4)、5) 项情形时，基金管理人应向中国证监会备案并依法公告。



已经确认的赎回申请，基金管理人应当足额支付；如暂时不能足额支付，应当按单个赎回申请人已被接受的赎回申请量占已接受的赎回申请总量的比例分配给赎回申请人，其余部分在后续开放日由基金管理人按照实际情况制定相应的处理办法予以支付。

在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理。

3、暂停期间结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应按规定公告并报中国证监会备案。

## 十、巨额赎回的认定及处理方式

### 1. 巨额赎回的认定

巨额赎回是指在单个开放日内，本基金中基金净赎回申请份额（基金赎回申请总份额扣除申购申请总份额之余额）与净转出申请份额（基金转出申请总份额扣除转入申请总份额之余额）之和超过上一开放日基金总份额 10% 的情形。

### 2. 巨额赎回的处理方式

出现巨额赎回时，基金管理人可以根据本基金当时的资产组合状况决定接受全额赎回或部分延期赎回。

1) 接受全额赎回：当基金管理人认为有能力兑付投资人的全部赎回申请和基金间转换时，按正常赎回程序执行。

2) 部分延期赎回：当基金管理人认为该基金兑付投资者的全部赎回及转出申请有困难，或认为为实现投资者的赎回、转出申请进行的资产变现可能使基金份额净值发生较大波动时，基金管理人在当日接受赎回及转出的比例不低于上一日该基金总份额 10% 的前提下，对其余申请延期办理。对于当日的赎回及转出申请，应当按单个账户赎回或转出申请量占该基金赎回及转出申请总量的比例，确定当日受理的赎回或转出份额；未受理部分除投资者在提交申请时选择将当日未获受理部分予以撤销者外，延迟至下一开放日办理。转入下一开放日的申请不享有赎回和转出优先权并将以该下一个开放日的该类基金份额净值

为基准计算，以此类推，直到全部完成赎回和转出申请为止。部分顺延赎回不受单笔赎回最低份额的限制。

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）接受全额赎回”或“2）部分延期赎回”的约定方式与其他基金份额持有人的赎回申请一并办理。对于该基金份额持有人超过前一开放日基金总份额 40%以上的赎回申请进行延期，即与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的该类基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。但是，如该持有人在提交赎回申请时选择取消赎回，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。如该持有人在提交赎回申请时未作明确选择，其未能赎回部分作自动延期赎回处理。

当发生巨额赎回并延期办理时，基金管理人应当通过邮寄、传真等方式在 3 个工作日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，并在 2 日内编制临时报告书，并登载在规定报刊和规定网站上。

3) 暂停接受和延缓支付：本基金连续 2 个开放日以上发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受赎回申请；已经确认的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但延缓期限不得超过 20 个工作日。连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请时，基金管理人应当在 2 日内编制临时报告书，并登载在规定报刊和规定网站上。

## 十一、暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

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

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

3. 如发生暂停的时间超过1日但少于2周，暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前2日在规定媒介上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公告最近1个开放日的各类基金份额净值。

4. 如发生暂停的时间超过2周，暂停期间，基金管理人应每2周至少刊登暂停公告1次。暂停结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前2日在规定媒介上连续刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公告最近1个开放日的各类基金份额净值。

## 十二、基金转换

基金转换是指基金份额持有人按照本基金合同和基金管理人届时有效公告规定的条件，申请将其持有的基金管理人管理的、某一基金的基金份额转换为基金管理人管理的其他基金基金份额的行为。

基金管理人在本基金合同生效后的适当时候将为投资人办理基金间的转换业务，具体业务办理时间、业务规则及转换费率在基金转换公告中列明。基金管理人最迟应于转换业务开始前2日至少在一种规定媒介上刊登公告。

## 十三、基金的非交易过户与转托管

1、非交易过户是指不采用申购、赎回等基金交易方式，将一定数量的基金份额按照一定规则从某一投资人基金账户转移到另一投资人基金账户的行为，包括继承、捐赠、强制执行，及基金注册与过户登记人认可的其它行为。无论在上述何种情况下，接受划转的主体必须是合格的个人投资者或机构投资者。其中：

（1）“继承”是指基金份额持有人死亡，其持有的基金份额由其合法的继承人继承。

（2）“捐赠”仅指基金份额持有人将其合法持有的基金份额捐赠给福利性质的基金会或其他具有社会公益性质的社会团体。

（3）“强制执行”是指国家有权机关依据生效的法律文书将基金份额持有人持有的基金份额强制执行划转给其他自然人、法人、社会团体或其他组织。

基金注册登记机构可以办理的非交易过户情形，以其公告的业务规则为准。

2、办理非交易过户业务必须提供基金注册登记机构要求提供的相关资料，直接向基金注册登记机构或其指定的机构申请办理。

3、基金份额持有人在变更办理基金申购与赎回等业务的销售机构（网点）时，投资人可根据各销售机构的实际情况办理已持有基金份额的转托管。基金销售机构可以按照规定的标准收取转托管费。

#### **十四、定期定额投资计划**

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

#### **十五、基金份额的冻结、解冻及质押**

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

2、在不违反届时有效的法律法规的条件下，基金注册登记机构将可以办理基金份额的质押业务或其他业务，公布并实施相应的业务规则。

#### **十六、实施侧袋机制期间本基金的申购与赎回**

本基金实施侧袋机制的，本基金的申购和赎回安排详见招募说明书“侧袋机制”章节的规定或相关公告。

## 第九部分 基金的投资

### 一、投资目标

本基金在保证基金资产良好流动性的基础上，通过严格风险控制下的债券及其他证券产品投资，追求低风险下的稳定收益，并争取在基金资产保值的基础上，积极利用各种稳健的投资工具力争资产的持续增值。

### 二、投资范围

#### 1、投资对象

本基金主要投资于具有良好流动性的固定收益类金融工具，包括依法公开发行上市的国债、金融债、企业债、公司债、债券回购、央行票据、可转换债券、中小企业私募债券、资产支持证券、同业存单以及中国证监会允许基金投资的其他债券类金融工具。

本基金不参与定向增发或网下新股申购，也不在二级市场直接买入股票、权证等权益类资产。本基金可以参与一级市场网上新股申购、公开增发，可以持有可转债转股所得股票及可分离债分离后所得权证，由上述方式获得的股票或权证将在可交易日起 5 个交易日内全部卖出。本基金可以主动投资于纯债收益率为正的可转债，不主动投资于纯债收益率为零或为负的可转债。

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

#### 2、投资比例

本基金为债券型基金，各类资产的投资比例为：债券类证券的投资比例不低于基金资产的 80%。不含可分离债债券部分的可转债投资不超过债券类证券投资比例的 50%。股票、权证等权益类证券的投资比例为基金资产的 0%-20%，其中权证的投资比例为基金资产净值的 0%-3%。现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如果法律法规对该比例要求有变更的，以变更后的比例为准，本基金的投资范围会做相应调整。

### 三、投资策略

## 1、投资策略概述

本基金投资策略的主要着眼点为：在严格的风险控制和确保基金资产流动性的前提下，在系统性分析研究的基础上，通过对债券类属配置和目标久期的适时调整，适时合理地利用现有的企业债券等投资工具，配合套利策略的积极运用，追求低风险下的稳健收益。

本基金采取稳健的债券投资管理策略。制定具体投资策略时，自上而下考虑的因素是：基础利率、债券收益率曲线、市场波动、个券的相对价值和套利可能性。本基金采取目标久期策略、债券类属配置策略、骑乘收益曲线策略、个券选择策略、回购套利策略、企业债、公司债、可转债投资策略、积极套利策略等，构造债券组合。

## 2、债券类证券投资策略

### （1）目标久期策略

本基金采用目标久期控制原则，即根据对宏观环境中的市场、气氛和未来利率变动趋势的判断，深入分析收益率曲线与资金供求状况，通过适时选用子弹、杠铃、梯形等策略确定并控制投资组合平均剩余期限，把握买卖时机，如果预测利率将上升，可以适当降低组合的目标久期；如果预测利率将下降，则可以适当增加组合的目标久期。本基金的目标久期策略将在保证流动性的同时寻求高收益。

### （2）债券类属配置策略

债券类属配置指组合在国债、金融债、企业债、公司债、央行票据等不同债券投资品种之间的配置比例。本基金通过分析各类属的相对收益、利差变化、流动性风险、信用风险等因素来确定类属配置比例，寻找具有投资价值而且流动性优良的投资品种，增持相对低估，能给组合带来相对较高回报的类属；减持相对高估，给组合带来相对较低回报的类属，在基金资产流动性获得保证的同时取得较高的总回报。

### （3）骑乘收益曲线策略

收益曲线策略即在不同期限投资品种之间进行的配置，通过考察收益率曲线的动态变化及预期变化，寻求在一段时期内获取因收益率曲线形状变化而导致的债券价格变化所产生的超额收益。在期限配置方面，将在久期决策的基础上，在不增加总体利率风险的情况下，集中于决定期限利差变化的因素，从不

同期限的债券的相对价值变化中实现超额收益。

骑乘收益率曲线策略主要是利用收益率曲线陡峭特征。我国债券市场收益率曲线在不同时期不同期限表现出来的陡峭程度不一，为本基金实施骑乘收益率曲线策略提供了有利的市场环境。

#### （4）个券选择策略

本基金认为普通债券，包括国债、金融债、企业债和公司债的估值，主要基于收益率曲线的拟合。在正确拟合收益率曲线的基础上，及时发现偏离市场收益率的债券，并帮助找出因投资者偏好、资金供求、流动性、信用利差等导致债券价格偏离的原因；同时，基于收益率曲线可以判断出定价偏高或偏低的期限段，从而指导相对价值投资，选择投资于定价低估的债券品种。

#### （5）回购套利策略

回购套利策略是指利用回购利率低于债券收益率的情形，通过正回购将所获得资金投资于债券的策略。息差策略实际上也就是杠杆放大策略，进行放大策略时，必须考虑回购资金成本与债券收益率之间的关系，只有当债券收益率高于回购资金成本（即回购利率）时，息差策略才能取得正的收益。

#### （6）企业债券类证券投资策略

企业债券类证券（包括企业债、公司债、可分离债的债券部分）是获得较高投资收益不可忽视的一部分，也是本基金在力争在低风险下获取较高收益时将采取的主要投资策略。

企业债券类证券与国债之间的利差曲线受到经济波动与企业生命周期影响，同时，相同信用等级的债券在利差期限结构上服从凸性回归均衡的规律。内外部评级的差别与信用等级的变动会造成相对利差的波动，另外在经济上升或下降的周期中企业债券类证券的利差将缩小或扩大。本基金将密切关注企业债券类证券的市场动态和影响债券信用利差水平变化的众多因素，稳健、适时、合理、有效地运用企业债券类证券投资策略。

本基金结合对宏观经济态势的判断与企业的盈利性、成长性评估债券的信用风险，本基金将在该风险评估基础上，依据对企业所处行业的研究以及企业自身发展与偿还能力的分析选择选择符合目标久期和资产配置需要的企业债券类证券以期获得高于基准的收益。

#### （7）可转债投资策略

本基金将凭借多年的可转债投资研究力量积累进行可转债品种投资，为体现本基金较低的风险收益特征，本基金可以主动投资于纯债收益率为正的可转债；当所持某品种的可转债价格上涨、纯债收益率为负时，本基金将择机逐渐卖出该可转债或者通过转股卖出对应正股。

#### （8）中小企业私募债投资策略

由于中小企业私募债券采取非公开方式发行和交易，并限制投资人数量上限，整体流动性相对较差。同时，受到发债主体资产规模较小、经营波动性较高、信用基本面稳定性较差的影响，整体的信用风险相对较高。中小企业私募债券的这两个特点要求在具体的投资过程中，应采取更为谨慎的投资策略。本基金认为，投资该类债券的核心要点是分析和跟踪发债主体的信用基本面，并综合考虑信用基本面、债券收益率和流动性等要素，确定最终的投资决策。

#### （9）积极套利策略

由于市场环境差异、交易市场分割、市场参与者差异，以及资金供求失衡导致的利率异常差异，使得债券现券市场和回购市场上存在着套利机会。无风险套利主要包括银行间市场、交易所市场的跨市场套利和同一交易市场中不同品种的跨品种套利。

本基金在保证投资组合流动性的前提下，积极捕捉和把握无风险套利机会。寻找最佳时机，进行跨市场、跨品种操作，获得安全的超额收益。

#### （10）资产支持证券等品种投资策略

本基金将深入分析影响资产支持证券定价的多种因素，包括市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率等，辅助采用数量化定价模型，评估其内在价值进行投资。

### 3、新股申购策略

本基金主要从上市公司基本面、估值水平、市场环境三方面选择参与标的、参与规模和退出时机，并通过深入分析新股上市公司的基本面情况，结合新股发行当时的市场环境，根据可比公司股票的基本面因素和价格水平预测新股在二级市场的合理定价及其发行价格，指导新股询价，在有效识别和防范风险的前提下，获取较高的低风险收益。

未来，随着证券市场的发展、金融工具的丰富和交易方式的创新等，基金还将积极寻求其他投资机会，履行适当程序后更新和丰富组合投资策略。



#### 4、投资决策及操作流程

本基金实行投资决策委员会领导下的基金经理负责制。

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

具体的基金投资决策程序如下：

##### （1）研究策划

研究部通过自身研究及借助外部研究机构形成有关宏观分析、市场分析、收益曲线分析、券种分析、个券分析以及数据模拟的各类报告，提出本基金债券备选库的构建和目标久期调整方案，经投资研究联席会议讨论并最终决定本基金债券备选库，为本基金的投资管理提供决策依据。

##### （2）资产配置

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

##### （3）构建投资组合

基金经理根据对债券市场的判断构建基金组合，并报投资决策委员会备案。

##### （4）组合的监控和调整

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

##### （5）投资指令下达

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

##### （6）指令执行及反馈

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

##### （7）风险管理

风险管理委员会根据市场变化对投资组合计划提出风险防范措施，基金经

理依据基金申购赎回的情况控制投资组合的流动性风险。

#### （8）投资组合业绩与风险评价

FOF 投资与金融工程部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。同时，还必须对基金资产组合的投资风险进行客观的评价。定期向投资决策委员会和基金经理提供绩效、风险评估报告，以便及时调整基金投资组合。

### 四、业绩比较基准

业绩比较基准=中证全债指数×95%+同业存款利率×5%

采用该比较基准主要基于如下考虑：

中证全债指数是中证指数有限公司编制的综合反映银行间债券市场和沪深交易所债券市场的跨市场债券指数。该指数的样本由银行间市场和沪深交易所市场的国债、金融债券及企业债券组成，中证指数公司每日计算并发布中证全债的收盘指数及相应的债券属性指标，为债券投资人提供投资分析工具和业绩评价基准。考虑到本基金持有现金和到期日在一年以内的政府债券比例，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。如果上述基准指数停止计算编制或更改名称，或者今后法律法规发生变化，又或者市场推出更具权威、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经与本基金托管人协商同意后调整本基金的业绩评价基准并报中国证监会备案，并及时公告，但不需要召开基金份额持有人大会。

### 五、风险收益特征

本基金是债券型证券投资基金，预计长期平均风险与收益低于股票型、混合型以及可转债证券投资基金，高于货币市场基金。

### 六、投资禁止行为与限制

#### 1、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，本基金禁止从事下列行为：

- （1）承销证券；
- （2）向他人贷款或提供担保；
- （3）从事承担无限责任的投资；
- （4）买卖其他基金份额，但国务院另有规定的除外；

(5) 向基金管理人、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债券；

(6) 买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者其基金管理人、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、操纵证券价格及其他不正当的证券交易活动；

(8) 当时有效的法律法规、中国证监会及基金合同规定禁止从事的其他行为。

若法律法规或监管部门取消上述限制，履行适当程序后，本基金投资可不受上述规定限制。

## 2、投资组合限制

本基金的投资组合将遵循以下限制：

(1) 本基金债券类证券的投资比例不低于基金资产的 80%。不含可分离债债券部分的可转债投资不超过债券类证券投资比例的 50%。股票、权证等权益类证券的投资比例为基金资产的 0%-20%。现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

(2) 本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%；

(3) 本基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%，本基金管理人管理的全部基金持有同一权证的比例不超过该权证的 10%。投资于其他权证的投资比例，遵从法规或监管部门的相关规定；

(4) 本基金投资于信用级别评级为 BBB 以上（含 BBB）的资产支持证券，持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%。投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%。本基金管理人管理的全部证券投资基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%。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%，中国证监会规定的特殊品种除外。本基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出。

(5) 进入全国银行间同业市场的基金管理公司的债券回购最长期限为 1 年，

债券回购到期后不得展期；

（6）在银行间市场进行债券回购融入的资金余额不超过基金资产净值的 40%；

（7）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，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；

（8）本基金投资于单只中小企业私募债占基金资产净值比例不得超过 5%；本基金投资于中小企业私募债的比例合计不得超过基金资产净值的 30%；本基金与由本基金管理人管理的其他基金投资于同一家公司发行的中小企业私募债券，不得超过该券发行总量的 10%；

（9）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；

（10）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%；

（11）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；

（12）《基金法》及其他有关法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的，从其规定。

### 3、投资组合比例调整

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。由于证券市场波动、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原因导致的投资组合不符合上述约定的比例，基金管理人应在 10 个交易日内进行调整，以达到标准。法律法规另有规定的从其规定。

对于因基金份额拆分、大比例分红等集中持续营销活动引起的基金净资产规模在 10 个交易日内增加 10 亿元以上的情形，而导致证券投资比例低于基金

合同约定的，基金管理人履行相关程序后可将调整时限从 10 个交易日延长到 3 个月。

### 七、基金管理人代表基金行使股东权利的处理原则及方法

- 1、不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司的经营管理；
- 2、有利于基金财产的安全与增值；
- 3、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东权利，保护基金投资者的利益。
- 4、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使债权人权利，保护基金投资者的利益。

### 八、基金的融资

若将来法律法规允许基金融资，本基金可以根据届时有效的有关法律法规进行融资。

### 九、侧袋机制的实施和投资运作安排

当基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，根据最大限度保护基金份额持有人利益的原则，基金管理人经与基金托管人协商一致，并咨询会计师事务所意见后，可以依照法律法规及基金合同的约定启用侧袋机制，无需召开基金份额持有人大会审议。

侧袋机制实施期间，本部分约定的投资组合比例、投资策略、组合限制、业绩比较基准、风险收益特征等约定仅适用于主袋账户。

侧袋账户的实施条件、实施程序、运作安排、投资安排、特定资产的处置变现和支付等对投资者权益有重大影响的事项详见招募说明书“侧袋机制”章节的规定。

### 十、基金投资组合报告

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

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

本投资组合报告所载数据取自兴全磐稳增利债券型证券投资基金 2023 年第 1 季度报告，所载数据截至 2023 年 3 月 31 日，本报告中所列财务数据未经审计。

## 1、报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,794,888,237.88	96.80
	其中：债券	1,794,888,237.88	96.80
	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	20,605,423.69	1.11
8	其他资产	38,705,227.21	2.09
9	合计	1,854,198,888.78	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

注：本基金本报告期末未持有股票。

## (2) 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有股票。

## 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

注：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	74,315,455.38	4.50
2	央行票据	-	-
3	金融债券	369,583,946.17	22.40
	其中：政策性金融债	133,274,122.24	8.08
4	企业债券	113,825,273.97	6.90
5	企业短期融资券	255,166,398.45	15.46
6	中期票据	107,010,367.01	6.49
7	可转债（可交换债）	874,986,796.90	53.03
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,794,888,237.88	108.78

#### 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	1928006	19 工商银行二级 01	900,000	91,264,662.30	5.53
2	110081	闻泰转债	720,580	81,863,850.06	4.96
3	072210130	22 东方证券 CP001	800,000	80,889,792.88	4.90
4	2128025	21 建设银行二级 01	600,000	61,523,654.79	3.73
5	220411	22 农发 11	600,000	60,343,660.27	3.66

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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

注：贵金属暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

## 8、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资 明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

## 9、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### （1）本期国债期货投资政策

国债期货暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

### （2）报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：国债期货暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

### （3）本期国债期货投资评价

国债期货暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

## 10、投资组合报告附注

### （1）本基金投资的前十名证券的发行主体本期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	20,790.35
2	应收证券清算款	8,037,088.58
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	30,647,348.28
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	38,705,227.21

### （4）报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例
----	------	------	---------	-----------



				(%)
1	110081	闻泰转债	81,863,850.06	4.96
2	113043	财通转债	57,873,572.82	3.51
3	113623	凤 21 转债	57,044,586.85	3.46
4	113044	大秦转债	56,458,356.17	3.42
5	113052	兴业转债	40,541,315.07	2.46
6	110067	华安转债	37,163,723.29	2.25
7	127044	蒙娜转债	25,334,009.82	1.54
8	127056	中特转债	23,149,887.79	1.40
9	110072	广汇转债	23,028,997.68	1.40
10	110045	海澜转债	22,799,338.90	1.38
11	127061	美锦转债	20,989,466.20	1.27
12	127033	中装转 2	19,461,146.74	1.18
13	128131	崇达转 2	19,438,881.25	1.18
14	113616	韦尔转债	19,128,360.16	1.16
15	128136	立讯转债	18,883,117.62	1.14
16	127018	本钢转债	18,704,638.17	1.13
17	123090	三诺转债	18,656,683.10	1.13
18	113608	威派转债	18,565,038.63	1.13
19	123101	拓斯转债	18,322,994.47	1.11
20	123099	普利转债	16,548,192.33	1.00
21	132020	19 蓝星 EB	16,502,071.67	1.00
22	110089	兴发转债	16,338,521.64	0.99
23	113013	国君转债	15,669,719.18	0.95
24	123117	健帆转债	15,477,476.32	0.94
25	128133	奇正转债	15,411,153.54	0.93
26	127005	长证转债	12,870,169.74	0.78
27	113627	太平转债	12,580,725.81	0.76
28	127026	超声转债	12,396,919.84	0.75
29	127032	苏行转债	11,823,489.54	0.72
30	128116	瑞达转债	10,001,371.06	0.61

31	123088	威唐转债	9,913,578.38	0.60
32	113519	长久转债	9,521,764.38	0.58
33	110086	精工转债	9,228,307.19	0.56
34	110062	烽火转债	8,987,138.54	0.54
35	123104	卫宁转债	8,714,151.27	0.53
36	127025	冀东转债	7,784,715.40	0.47
37	123126	瑞丰转债	7,475,693.05	0.45
38	113624	正川转债	5,570,473.57	0.34
39	123039	开润转债	5,103,206.60	0.31
40	123132	回盛转债	4,580,666.33	0.28
41	113632	鹤21转债	4,018,747.05	0.24
42	118005	天奈转债	3,603,981.18	0.22
43	127051	博杰转债	3,428,926.03	0.21
44	123113	仙乐转债	3,294,189.86	0.20
45	113650	博22转债	1,848,121.65	0.11
46	127046	百润转债	1,591,561.10	0.10
47	127068	顺博转债	1,109,025.48	0.07

**(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

**(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。

## 第十部分 基金的业绩

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本基金合同生效日 2009 年 7 月 23 日，基金业绩截止日 2023 年 3 月 31 日。

兴全磐稳债券 A:

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
2023 年一季度	2.29%	0.16%	0.93%	0.04%	1.36%	0.12%
2022 年度	-0.53%	0.18%	3.33%	0.07%	-3.86%	0.11%
2021 年度	10.93%	0.20%	5.38%	0.05%	5.55%	0.15%
2020 年度	2.12%	0.25%	2.92%	0.09%	-0.80%	0.16%
2019 年度	6.88%	0.16%	4.74%	0.05%	2.14%	0.11%
2018 年度	5.13%	0.07%	8.43%	0.07%	-3.30%	0.00%
2017 年度	1.90%	0.07%	-0.28%	0.06%	2.18%	0.01%
2016 年度	3.58%	0.08%	1.94%	0.09%	1.64%	-0.01%
2015 年度	13.67%	0.26%	6.23%	0.07%	7.44%	0.19%
2014 年度	36.39%	0.51%	8.96%	0.15%	27.43%	0.36%
2013 年度	-2.26%	0.21%	1.73%	0.05%	-3.99%	0.16%
2012 年度	4.71%	0.14%	3.86%	0.04%	0.85%	0.10%
自基金合同生效起至 2023 年 3 月 31 日	117.75%	0.22%	69.26%	0.07%	48.49%	0.15%

## 兴全磐稳债券 C:

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2023年一季度	2.19%	0.16%	0.93%	0.04%	1.26%	0.12%
2022年度	-0.92%	0.18%	3.33%	0.07%	-4.25%	0.11%
2021年度	10.46%	0.20%	5.38%	0.05%	5.08%	0.15%
2020年度	1.71%	0.25%	2.92%	0.09%	- 1.21%	0.16%
2019年度	0.59%	0.17%	0.10%	0.01%	0.49%	0.16%
自基金合同生效（2019年12月27）起至2023年3月31日	14.42%	0.21%	13.22%	0.07%	1.20%	0.14%

注：自2019年12月27日起增设兴全磐稳增利债券型证券投资基金C类份额，2019年度数据为C类份额成立至2019年12月31日数据，不满一年。

## 第十一部分 基金的财产

### 一、基金资产总值

基金资产总值是指本基金购买的各类证券及票据价值、银行存款本息、债券的应计利息、基金应收的申购基金款、缴存的保证金以及其他投资所形成的价值总和。

其构成主要有：

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

### 二、基金资产净值

本基金基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

### 三、基金财产的账户

本基金以“兴全磐稳增利债券型证券投资基金”的名义在基金托管人营业机构开立本基金的银行存款托管账户；以基金托管人的名义在中国证券登记结算有限责任公司开立基金结算备付金账户，以“兴全磐稳增利债券型证券投资基金”的名义在基金托管人托管系统中开立二级结算备付金账户；以基金托管人和“兴全磐稳增利债券型证券投资基金”联名的方式在中国证券登记结算有限责任公司开立证券账户、以“兴全磐稳增利债券型证券投资基金”的名义开立银行间债券托管账户并报中国人民银行备案。开立的上述基金财产账户与基金管理人、基金托管人、基金代销机构和基金注册登记机构自有的财产账户以及其他基金财产账户相独立。

如国家相关法律法规调整，基金管理人和基金托管人有权依据新规定执行。

### 四、基金财产的保管及处分

1、本基金财产独立于基金管理人及基金托管人的固有财产，并由基金托管人保管。

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范围。

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。非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。

## 第十二部分 基金资产的估值

### 一、估值目的

基金资产的估值目的是客观、准确地反映基金财产的价值，并为基金份额的申购与赎回提供计价依据。

### 二、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。

### 三、估值对象

基金所拥有的股票、债券、权证和银行存款本息、应收款项和其他投资等资产及负债。

### 四、估值方法

#### 1、股票估值方法

1) 上市流通股股票按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，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) 未上市股票的估值：

① 首次发行的股票，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，按成本估值。

② 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种股票的以第1)条确定的估值价格进行估值。

③ 送股、转增股、配股和公开增发新股等方式发行的股票，按估值日该上市公司在证券交易所挂牌的同一种股票的以第1)条确定的估值价格进行估值。

④ 非公开发行有明确锁定期的股票按如下方法进行估值：

A、估值日在证券交易所上市交易的同一股票的以第1)条确定的估值价格低于非公开发行股票初始取得成本时，应采用在证券交易所上市交易的同一股票的以第1)条确定的估值价格作为估值日该非公开发行股票的价值；

B、估值日在证券交易所上市交易的同一股票的以第1)条确定的估值价格高于非公开发行股票初始取得成本时，应按下列公式确定估值日该非公开发行股票的价值：

$$FV=C+(P-C)\times(D1-Dr)/D1$$

其中：FV为估值日该非公开发行股票的价值；C为该非公开发行股票初始取得成本（因权益业务导致市场价格除权时，应于除权日对其初始取得成本作相应调整）；P为估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价；D1为该非公开发行股票锁定期所含的交易所的交易天数；Dr为估值日剩余锁定期，即估值日至锁定期结束所含的交易所的交易天数，不含估值日当天。

3) 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

## 2、债券估值方法

1) 在证券交易所市场挂牌交易的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，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) 在证券交易所市场挂牌交易的未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值，估值日没有交易的，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,按成本估值。

4)在银行间债券市场交易的债券根据行业协会指导的处理标准或意见并综合考虑市场成交价、市场报价、流动性及收益率曲线等因素确定其公允价值进行估值。

5)国家有最新规定的,按其规定进行估值。

### 3、权证估值方法

上市流通权证按估值日其所在证券交易所的收盘价估值;估值日无交易的,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。

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,按成本估值。

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。

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。

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

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,按成本估值。

全国银行间市场交易的资产支持证券，根据行业协会指导的处理标准或意见并综合考虑市场成交价、市场报价、流动性及收益率曲线等因素确定其公允价值进行估值。

国家有最新规定的，按其规定进行估值。

#### 5、股票指数期货合约的估值方法：

股票指数期货合约以结算价格进行估值。

国家有最新规定的，按其规定进行估值。

#### 6、中小企业私募债估值方法

中小企业私募债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。

#### 7、同业存单的估值方法

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

#### 8、其他资产的估值方法

其他资产按国家有关规定进行估值。

8、在任何情况下，基金管理人如采用上述估值方法对基金财产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如基金管理人认为上述估值方法对基金财产进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人在综合考虑市场各因素的基础上，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。

基金管理人、基金托管人发现基金估值违反基金合同订明的估值方法、程序以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，发现方应及时通知对方，以约定的方法、程序和相关法律法规的规定进行估值，以维护基金份额持有人的利益。

根据《基金法》，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，基金管理人有权按照其对基金净值的计算结果对外予以公布。

## 五、估值程序

基金日常估值由基金管理人同基金托管人一同进行。各类基金份额净值由基金管理人完成估值后，将估值结果以书面形式报给基金托管人，基金托管人按基金合同规定的估值方法、时间、程序进行复核，基金托管人复核无误后签章返回给基金管理人。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。

## 六、暂停估值的情形

- 1、基金投资所涉及的证券交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；
- 2、因不可抗力或其他情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金财产价值时；
- 3、占基金相当比例的投资品种的估值出现重大转变，而基金管理人为保障投资人的利益，已决定延迟估值；
- 4、如出现基金管理人认为属于紧急事故的任何情况，会导致基金管理人不能出售或评估基金资产的；
- 5、当特定资产占前一估值日基金资产净值 50%以上的，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停估值；
- 6、中国证监会和基金合同认定的其他情形。

## 七、基金份额净值的计算

$T$  日基金份额净值 =  $T$  日该类基金资产净值 /  $T$  日该类基金总份额余额

各类基金份额净值的计算，精确到 0.0001 元，小数点第五位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

## 八、估值错误的处理

- 1、当基金财产的估值导致某一类基金份额净值小数点后四位内（含第四位）发生差错时，视为基金份额净值估值错误。

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财产估值的准确性、及时性。当估值或基金份额净值计价出现错误实际发生时，基金管理人应当立即予以纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；计价错误达

到或超过该类基金资产净值的 0.25%时，基金管理人应通报基金托管人，并报告中国证监会；计价错误达到该类基金份额净值的 0.5%时，基金管理人应通报基金托管人，按本基金合同的规定进行公告，并报中国证监会备案。

## 2、差错类型

本基金运作过程中，如果由于基金管理人、基金托管人、注册登记机构、代销机构或投资人自身的原因造成差错，导致其他当事人遭受损失的，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。

## 3、差错处理原则

因基金估值错误给投资人造成损失的应由基金管理人和基金托管人依照法律法规的规定予以承担。基金管理人或基金托管人对不应由其承担的责任，有权向责任人追偿。本基金合同的当事人应将按照以下约定的原则处理基金估值差错。

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，由此造成或扩大的损失由差错责任方和未更正方依法分别各自承担相应的赔偿责任。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；

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；

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，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；

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；

如果因基金管理人原因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，如果因基金托管人原因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。除基金管理人和托管人之外的第三方造成基金财产的损失，由基金管理人负责向差错方追偿；

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，基金管理人或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，则基金管理人或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；按法律法规规定的其他原则处理差错。

#### 4、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：

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；

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；

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；

根据差错处理的方法，需要修改基金注册登记机构的交易数据的，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；

基金管理人及基金托管人计价错误达到该类基金份额净值 0.5%时，基金管理人应当公告，并报中国证监会备案。

### **九、特殊情形的处理**

1、基金管理人按本条第（四）项第（7）条款进行估值时，所造成的误差不作为基金份额净值错误处理。

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，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。

### **十、实施侧袋机制期间的基金资产估值**

本基金实施侧袋机制的，应根据本部分的约定对主袋账户资产进行估值并披露主袋账户的基金净值信息，暂停披露侧袋账户份额净值。

## 第十三部分 基金的收益分配

### 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。

### 二、收益分配原则

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

2、本基金收益每年最多分配 12 次，每次基金收益分配比例不低于期末可供分配利润的 50%。基金的收益分配比例应当以期末可供分配利润为基准计算。期末可供分配利润指期末本基金资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数；

3、若基金合同生效不满 3 个月则可不进行收益分配；

4、本基金收益分配方式分为两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利按除息日的基金份额净值自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

基金实施收益分配的，基金红利发放日距离收益分配基准日，即期末可供分配利润计算截止日，不得超过 15 个工作日。

5、基金收益分配后基金份额净值不能低于基金份额的面值。即基金收益基准日的各类基金份额的基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于基金份额的面值。

6、法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

### 三、收益分配方案

基金收益分配方案应载明本基金期末可供分配利润、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与公告**

基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人核实后确定，基金管理人应在2日内公告。

#### **五、收益分配中发生的费用**

1、收益分配采用红利再投资方式免收再投资的费用；采用现金分红方式，则可从分红现金中提取一定的数额或者比例用于支付注册登记作业手续费，如收取该项费用，具体提取标准和方法在招募说明书或其他公告中列示。

2、收益分配时发生的银行转账等手续费用由基金份额持有人自行承担；如果基金份额持有人所获现金红利不足支付前述银行转账等手续费用，或者现金红利低于基金管理人规定的数额的，注册登记机构自动将该基金份额持有人的现金红利按分红权益再投资日经除权后的该类基金份额净值为计算基准转为相应类别的基金份额。

#### **六、实施侧袋机制期间的收益分配**

本基金实施侧袋机制的，侧袋账户不进行收益分配，详见招募说明书“侧袋机制”章节的规定。



## 第十四部分 基金费用与税收

### 一、基金费用的种类

1. 基金管理人的管理费；
2. 基金托管人的托管费；
3. C类基金份额的销售服务费；
4. 基金的证券交易费用；
5. 基金合同生效以后与基金相关的信息披露费用；
6. 基金份额持有人大会费用；
7. 基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费；
8. 按照国家有关规定可以列入的其他费用。

### 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

本基金的管理费率为年费率 0.70%。

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的年费率计提。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，逐日累计至每个月月末，按月支付。于次月首日起 15 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

本基金的托管费率为年费率 0.20%。

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的年费率计提。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 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。于次月首日起

15个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。

### 3. C类基金份额的销售服务费

本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额的销售服务费年费率为0.40%。本基金销售服务费将专门用于本基金的市场推广、销售与基金份额持有人服务。

C类基金份额的销售服务费按前一日C类基金份额资产净值的0.40%年费率计提。计算方法如下：

$$H=E\times 0.40\%\div \text{当年天数}$$

H为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E为C类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计提，逐日累计至每个月月末，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，基金托管人复核后于次月首日起15个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人，由基金管理人代付给销售机构。

4. 本条第一款第4至第8项费用由基金管理人和基金托管人根据有关法规及相应协议的规定，列入当期基金费用。

### 三、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。基金合同生效之前的律师费、会计师费和信息披露费用等不得从基金财产中列支。

### 四、基金管理费和基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人可协商酌情调低基金管理费和基金托管费，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前2日在至少一种规定媒介上刊登公告。

### 五、其他费用

按照国家有关规定和基金合同约定，基金管理人可以在基金财产中列支其他的费用，并按照相关的法律法规的规定进行公告或备案。

### 六、实施侧袋机制期间的基金费用

本基金实施侧袋机制的，与侧袋账户有关的费用可以从侧袋账户中列支，

但应待侧袋账户资产变现后方可列支，有关费用可酌情收取或减免，但不得收取管理费，详见招募说明书“侧袋机制”章节的规定。

## 七、税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，依照国家法律法规的规定履行纳税义务。

## 第十五部分 基金的会计与审计

### 一、基金的会计政策

1. 基金的会计年度为公历每年1月1日至12月31日。
2. 基金核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位。
3. 会计制度按国家有关的会计制度执行。
4. 本基金独立建账、独立核算。
5. 本基金会计责任人为基金管理人。
6. 基金管理人应保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关规定编制基金会计报表，基金托管人定期与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以书面方式确认。

### 二、基金年度审计

1. 基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相独立的、具有从事证券、期货相关业务资格的会计师事务所及其注册会计师等机构对基金年度财务报表及其他规定事项进行审计；
2. 会计师事务所更换经办注册会计师，应事先征得基金管理人和基金托管人同意；
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。基金管理人应在更换会计师事务所后在2日内公告。

## 第十六部分 基金的信息披露

### 一、披露原则

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

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

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

基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内，将应予披露的基金信息通过中国证监会指定的全国性报刊（以下简称“规定报刊”）及指定互联网网站（以下简称“规定网站”）等媒介披露，并保证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。

本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息，不得有下列行为：

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

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。

### 二、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规定媒介上；基金管理人、基金托管人应当将基金合同、托管协议登载在各自公司网站上。

（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规定媒介上。

（3）基金管理人应当在基金合同生效的次日在规定媒介上登载基金合同生效公告。

（4）基金合同生效后，基金招募说明书的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金招募说明书并登载在规定网站上；基金招募说明书其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金招募说明书。

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

### 三、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单独编制，由基金托管人复核。基金定期报告，包括基金年度报告、基金中期报告和基金季度报告。

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

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

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

公告登载在规定报刊上。

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

如报告期内出现单一投资者持有基金份额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。

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。

#### **四、基金净值公告**

基金合同生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周在规定网站披露一次基金份额净值和基金份额累计净值。

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

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

#### **五、临时报告**

基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在 2 日内编制临时报告书，并登载在规定报刊和规定网站上。

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

- （1）基金份额持有人大会的召开及决定的事项；
- （2）基金合同终止、基金清算；
- （3）转换基金运作方式、基金合并；
- （4）更换基金管理人、基金托管人、基金份额登记机构，基金改聘会计师事务所；
- （5）基金管理人委托基金服务机构代为办理基金的份额登记、核算、估值等事项，基金托管人委托基金服务机构代为办理基金的核算、估值、复核等事

项；

（6）基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；

（7）基金管理人变更持有百分之五以上股权的股东、基金管理人的实际控制人变更；

（8）基金募集期延长或提前结束募集；

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

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

（11）涉及基金财产、基金管理人、基金托管业务的诉讼；

（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）基金开始办理申购、赎回；

（18）基金发生巨额赎回并延期办理；

（19）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）基金暂停接受申购、赎回申请或者重新接受申购、赎回申请；

（21）本基金发生涉及申购、赎回事项调整，或潜在影响投资人赎回等重大事项；

（22）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。

## 六、澄清公告



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

#### 七、清算报告

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

#### 八、实施侧袋机制期间的信息披露

本基金实施侧袋机制的，相关信息披露义务人应当根据法律法规、基金合同和招募说明书的规定进行信息披露，详见招募说明书“侧袋机制”章节的规定。

#### 九、中国证监会规定的其他信息

##### 十、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。

#### **十一、信息披露文件的存放与查阅**

依法必须披露的信息发布后，基金管理人、基金托管人应当按照相关法律法规规定将信息置备于各自住所，供社会公众查阅、复制。在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复印件。

基金管理人和基金托管人应保证文本的内容与所公告的内容完全一致。

十二、本基金信息披露事项以法律法规规定及本章节约定的内容为准。

## 第十七部分 侧袋机制

### 一、侧袋机制的实施条件

当基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，根据最大限度保护基金份额持有人利益的原则，基金管理人经与基金托管人协商一致，并咨询会计师事务所意见后，可以依照法律法规及基金合同的约定启用侧袋机制。

基金管理人应当在启用侧袋机制后及时发布临时公告，并在五个工作日内聘请侧袋机制启用日发表意见且符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所进行审计并披露专项审计意见。

### 二、实施侧袋机制期间基金份额的申购与赎回

1、启用侧袋机制当日，基金登记机构以基金份额持有人的原有账户份额为基础，确认相应侧袋账户基金份额持有人名册和份额；当日收到的申购申请，按照启用侧袋机制后的主袋账户份额办理；当日收到的赎回申请，仅办理主袋账户的赎回申请并支付赎回款项。

2、实施侧袋机制期间，基金管理人不得办理侧袋账户份额的申购、赎回和转换；同时，基金管理人按照基金合同和招募说明书的约定办理主袋账户份额的赎回，并根据主袋账户运作情况确定是否暂停申购。

3、除基金管理人应按照主袋账户的份额净值办理主袋账户份额的申购和赎回外，本招募说明书“基金份额的申购与赎回”部分的申购、赎回规定适用于主袋账户份额。巨额赎回按照单个开放日内主袋账户份额净赎回申请超过前一开放日主袋账户总份额的 10% 认定。

### 三、实施侧袋机制期间的基金投资

侧袋机制实施期间，招募说明书“基金的投资”部分约定的投资组合比例、投资策略、组合限制、业绩比较基准、风险收益特征等约定仅适用于主袋账户。基金管理人计算各项投资运作指标和基金业绩指标时仅需考虑主袋账户资产。

基金管理人原则上应当在侧袋机制启用后 20 个交易日内完成对主袋账户投资组合的调整，因资产流动性受限等中国证监会规定的情形除外。

基金管理人不得在侧袋账户中进行除特定资产处置变现以外的其他投资操作。

### 四、实施侧袋机制期间的基金估值

本基金实施侧袋机制的，基金管理人和基金托管人应对主袋账户资产进行估值并披露主袋账户的基金净值信息，暂停披露侧袋账户份额净值。侧袋账户的会计核算应符合《企业会计准则》的相关要求。

## 五、实施侧袋账户期间的基金费用

1、本基金实施侧袋机制的，管理费和托管费按主袋账户基金资产净值作为基数计提。

2、与处置侧袋账户资产相关的费用可从侧袋账户中列支，但应待侧袋账户资产变现后方可列支，且不得收取管理费。

## 六、侧袋账户中特定资产的处置变现和支付

特定资产以可出售、可转让、恢复交易等方式恢复流动性后，基金管理人应当按照基金份额持有人利益最大化原则，采取将特定资产予以处置变现等方式，及时向侧袋账户份额持有人支付对应变现款项。

侧袋机制实施期间，无论侧袋账户资产是否全部完成变现，基金管理人都应当及时向侧袋账户全部份额持有人支付已变现部分对应的款项。若侧袋账户资产无法一次性完成处置变现，基金管理人在每次处置变现后均应按照相关法律法规要求及时发布临时公告。

侧袋账户资产全部完成变现并终止侧袋机制后，基金管理人应及时聘请符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所进行审计并披露专项审计意见。

## 七、侧袋机制的信息披露

### 1、临时公告

在启用侧袋机制、处置特定资产、终止侧袋机制以及发生其他可能对投资者利益产生重大影响的事项后基金管理人应及时发布临时公告。

### 2、基金净值信息

基金管理人应按照招募说明书“基金的信息披露”部分规定的基金净值信息披露方式和频率披露主袋账户份额的基金份额净值和各类基金份额累计净值。实施侧袋机制期间本基金暂停披露侧袋账户份额净值。

### 3、定期报告

侧袋机制实施期间，基金管理人应当在基金定期报告中披露报告期内侧袋账户相关信息，基金定期报告中的基金会计报表仅需针对主袋账户进行编制。

会计师事务所对基金年度报告进行审计时，应对报告期内基金侧袋机制运行相关的会计核算和年度报告披露等发表审计意见。

## 第十八部分 风险揭示

### 一、投资于本基金的主要风险

#### 1、市场风险

本基金为证券投资基金，证券市场的变化将影响到基金的业绩。因此，宏观和微观经济因素、国家政策、市场变动、券种与个券业绩的变化、投资者风险收益偏好和市场流动程度等影响证券市场的各种因素将影响到本基金业绩，从而产生市场风险，这种风险主要包括：

##### 1) 利率风险

由于利率发生变化和波动使得证券价格和证券利息产生波动，从而影响到基金业绩。利率风险是债券投资所面临的主要风险。

##### 2) 信用风险

当证券发行人不能够实现发行时所做出的承诺，按时足额还本付息的时候，就会产生信用风险。信用风险主要来自于发行人和担保人。一般认为：国债的信用风险可以视为零，而其他债券的信用风险可根据专业机构的信用评级确定。当证券的信用等级发生变化时，可能会产生证券的价格变动，从而影响到基金资产。

##### 3) 政策风险

因国家的各项政策，如财政政策、货币政策、产业政策、地区发展政策等发生变化，导致证券市场波动而影响基金投资收益，产生风险。

##### 4) 再投资风险

再投资获得的收益又被称做利息的利息，这一收益取决于再投资时的市场利率水平和再投资的策略。未来市场利率的变化可能会引起再投资收益的不确定性并可能影响到基金投资策略的顺利实施。

##### 5) 购买力风险

基金持有人收益将主要通过现金形式来分配，而现金可能因为通货膨胀因素而使其购买力下降。

#### 2、管理风险

本基金可能因为基金管理人和基金托管人的管理水平、手段和技术等因素，而影响基金收益水平。这种风险可能表现在基金整体的投资组合管理上，例如

资产配置、类属配置不能达到预期收益目标；也可能表现在个券的选择不能符合本基金的投资风格和投资目标等。

### 3、流动性风险

本基金面临的流动性风险主要表现在几个方面：建仓成本控制不力，建仓时效不高；基金资产变现能力差，或变现成本高；在投资者大额赎回时缺乏应对手段；证券投资中个券的流动性风险等。这些风险的主要形成原因是：

#### 1) 市场整体流动性问题。

证券市场的流动性受到价格、投资群体等诸多因素的影响，在不同状况下，其流动性表现是不均衡的，具体表现为：在某些时期成交活跃，流动性非常好，而在另一些时期，则可能成交稀少，流动性差。在市场流动性出现问题时，本基金的操作有可能发生建仓成本增加或变现困难的情况。这种风险在发生大额申购和大额赎回时表现尤为突出。

#### 2) 市场中流动性不均匀，存在个券流动性风险。

由于不同投资品种受到市场影响的程度不同，即使在整体市场流动性较好的情况下，一些单一投资品种仍可能出现流动性问题，这种情况的存在使得本基金在进行投资操作时，可能难以按计划买入或卖出相应数量的证券，或买入卖出行为对证券价格产生比较大的影响，增加基金投资成本。这种风险在出现个券和个券停牌和涨跌停板等情况时表现得尤为突出。

#### 3) 基金申购、赎回安排

投资人具体请参见基金合同“六、基金份额的申购、赎回与转换”和本招募说明书“第八部分 基金份额的申购、赎回与转换”，详细了解本基金的申购以及赎回安排。

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

#### 4) 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具有良好流动性的固定收益类金融工具，包括依法公开发行上市的国债、金融债、企业债、公司债、债券回购、央行票据、可转换债券、中小企业私募债券、资产支持证券、同业存单以及中国证监会允许基

金投资的其他债券类金融工具。

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。

#### 5) 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。

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

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

##### （a）暂停接受赎回申请

投资人具体请参见基金合同“六、基金份额的申购、赎回与转换”中“（十）拒绝或暂停申购、暂停赎回的情形及处理”和“（九）巨额赎回的认定及处理方式”，详细了解本基金暂停接受赎回申请的情形及程序。

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

基金份额净值可能与其提交赎回申请时的基金份额净值不同。

##### （b）延缓支付赎回款项

投资人具体请参见基金合同“六、基金份额的申购、赎回与转换”中“（十）拒绝或暂停申购、暂停赎回的情形及处理”和“（九）巨额赎回的认定及处理方式”，详细了解本基金延缓支付赎回款项的情形及程序。

在此情形下，投资人收到赎回款项的时间将可能比一般正常情形下有所延迟。

##### （c）收取短期赎回费



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

（d）暂停基金估值

投资人具体请参见基金合同“十四、基金资产的估值”中的“（六）暂停估值的情形”，详细了解本基金暂停估值的情形及程序。

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

（e）启用侧袋机制

侧袋机制是一种流动性风险管理工具，是将特定资产分离至专门的侧袋账户进行处置清算，并以处置变现后的款项向基金份额持有人进行支付，目的在于有效隔离并化解风险。但基金启用侧袋机制后，侧袋账户份额将停止披露基金份额净值，并不得办理申购、赎回和转换，仅主袋账户份额正常开放赎回，因此启用侧袋机制时持有基金份额的持有人将在启用侧袋机制后同时持有主袋账户份额和侧袋账户份额，侧袋账户份额不能赎回，其对应特定资产的变现时间具有不确定性，最终变现价格也具有不确定性并且有可能大幅低于启用侧袋机制时的特定资产的估值，基金份额持有人可能因此面临损失。

实施侧袋机制期间，因本基金不披露侧袋账户份额的净值，即便基金管理人在基金定期报告中披露报告期末特定资产可变现净值或净值区间的，也不作为特定资产最终变现价格的承诺，因此对于特定资产的公允价值和最终变现价格，基金管理人不承担任何保证和承诺的责任。

基金管理人将根据主袋账户运作情况合理确定申购政策，因此实施侧袋机制后主袋账户份额存在暂停申购的可能。

启用侧袋机制后，基金管理人计算各项投资运作指标和基金业绩指标时仅需考虑主袋账户资产，并根据相关规定对分割侧袋账户资产导致的基金净资产减少进行按投资损失处理，因此本基金披露的业绩指标不能反映特定资产的真实价值及变化情况。

（f）中国证监会认定的其他措施。

#### 4、本基金投资策略所特有的风险

本基金属于债券型基金，将维持较高的债券持仓比例。如果债券市场出现整体下跌，本基金的净值表现将受到影响。

在债券投资中，本基金特有的风险主要来自两个方面：一是对宏观经济趋势、政策以及债券市场基本面研究是否准确、深入。二是对企业类债券的优选和判断是否科学、准确。基本面研究及企业类债券分析的错误均可能导致所选择的证券不能完全符合本基金的预期目标。三是本基金所投资的企业类债券承载的信用风险要高于高信用等级的债券（如国债），若债券发行人出现违约、不能按时或全额支付本金和利息，将导致基金资产损失，发生信用风险。

## 5、其他风险

### 1) 技术风险

当计算机、通讯系统、交易网络等技术保障系统或信息网络支持出现异常情况，可能导致基金日常的申购赎回无法按正常时限完成、注册登记系统瘫痪、核算系统无法按正常时限显示产生净值、基金的投资交易指令无法及时传输等风险。

### 2) 大额申购/赎回风险

本基金是开放式基金，基金规模将随着投资者对基金单位的申购与赎回而不断变化，若是由于投资者的连续大量申购而导致基金管理人在短期内被迫持有大量现金；或由于投资者的连续大量赎回而导致基金管理人被迫抛售所持有的证券以应付基金赎回的现金需要，则可能使基金资产净值受到不利影响。

### 3) 顺延或暂停赎回风险

因为市场剧烈波动或其他原因而连续出现巨额赎回，并导致基金管理人的现金支付出现困难，基金投资者在赎回基金单位时，可能会遇到部分顺延赎回或暂停赎回等风险。

### 4) 其他风险

战争、自然灾害等不可抗力可能导致基金资产有遭受损失的风险，以及证券市场、基金管理人及基金代销机构可能因不可抗力无法正常工作，从而产生影响基金的申购和赎回按正常时限完成的风险。

## 二、声明

1、投资者投资于本基金，须自行承担投资风险；

2、除基金管理人直接办理本基金的销售外，本基金还通过交通银行股份有限公司等基金代销机构代理销售，基金管理人与基金代销机构都不能保证其收益或本金安全。

## 第十九部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算

### 一、基金合同的变更

1. 基金合同变更涉及基金合同第八节第（二）项规定的对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的，应经基金份额持有人大会决议同意。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，并自中国证监会核准或出具无异议意见之日起生效。

2. 除上述第1项规定的情形外，经基金管理人和基金托管人同意可对基金合同的内容进行变更，该等变更应当在2日内由基金管理人进行公告并报中国证监会备案。

### 二、本基金合同的终止

有下列情形之一的，本基金合同终止：

1. 基金份额持有人大会决定终止；
2. 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、基金托管人承接的；
3. 法律法规和基金合同规定的其他情形。

### 三、基金财产的清算

1. 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。

#### 2. 基金财产清算组

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，在基金财产清算组接管基金财产之前，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。

基金财产清算组成员由基金管理人、基金托管人、基金注册登记机构、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。

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。

#### 3. 清算程序

基金合同终止后，由基金财产清算组统一接管基金财产；

基金财产清算组根据基金财产的情况确定清算期限；

基金财产清算组对基金财产进行清理和确认；

对基金财产进行评估和变现；

基金清算组作出清算报告；

会计师事务所对清算报告进行审计；

律师事务所对清算报告出具法律意见书；

将基金清算结果报告中国证监会；

公布基金清算公告；

基金剩余财产进行分配。

#### 4. 清算费用

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

#### 5. 基金剩余财产的分配

基金财产按如下顺序进行清偿：

支付基金财产清算费用；

缴纳基金所欠税款；

清偿基金债务；

清算后如有余额，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

#### 6. 基金财产清算的公告

清算小组成立后 2 日内应就清算小组的成立进行公告；清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算组做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，报中国证监会批准并公告。

7. 基金财产清算账册及文件由基金托管人保存 15 年以上。

## 第二十部分 基金合同的内容摘要

### 一、基金合同当事人及权利义务

#### 1、基金管理人

##### （1）基金管理人的权利

依法募集基金，办理基金备案手续；

自基金合同生效之日起，基金管理人依照法律法规和基金合同独立管理基金财产；

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；

根据法律法规和基金合同的规定获得基金管理费；在符合有关法律法规和基金合同的前提下，决定本基金的相关费率结构和收费方式；

根据法律法规和基金合同之规定销售基金份额，收取认购费、申购费、基金赎回手续费及其它法律法规规定的费用；

依据法律法规和基金合同的规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了法律法规或基金合同规定对基金财产、其它基金合同当事人的利益造成重大损失的，应及时呈报中国证监会和中国银监会，以及采取其它必要措施以保护本基金及相关基金合同当事人的利益；

根据基金合同的规定选择适当的基金代销机构并有权依照代销协议对基金代销机构行为进行必要的监督和检查；

自行担任基金注册登记机构或选择、更换基金注册登记代理机构，办理基金注册登记业务，并按照基金合同规定对基金注册登记代理机构进行必要的监督和检查；

在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购和赎回的申请；

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；

依据法律法规和基金合同的规定，制订基金收益的分配方案；

按照法律法规，代表基金对被投资企业行使股东权利，代表基金行使因投资于其它证券所产生的权利；

在基金托管人职责终止时，提名新的基金托管人；

依据法律法规和基金合同的规定，召集基金份额持有人大会；

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；

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并确定有关费率；

法律法规、基金合同以及依据基金合同制订的其它法律文件所规定的其它权利。

## （2）基金管理人的义务

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；

办理基金备案手续；

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；

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；

配备足够的专业人员办理基金份额的认购、申购和赎回业务；

配备足够的专业人员和相应的技术设施进行基金的注册登记或委托其他机构代理该项业务；

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

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

接受基金托管人依法进行的监督；

采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回价格的方法符合基金合同等法律文件的规定，按照有关规定计算并公告基金份额净值，确定基金份额申购、赎回的价格；

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；

保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、

基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前，应予以保密，不得向他人泄露；

按基金合同确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配基金收益；

按照法律法规和本基金合同的规定受理申购和赎回申请，及时、足额支付赎回和分红款项；

不谋求对上市公司的控股和直接管理；

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；

按规定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；

进行基金会计核算并编制基金的财务会计报告；

编制中期和年度基金报告；

确保需要向基金份额持有人提供的各项文件或资料，在规定时间内发出；保证投资人能够按照基金合同约定的时间和方式，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；

组织并参加基金财产清算组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

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并通知基金托管人；

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的合法权益，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

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；

不从事任何有损基金财产及本基金其他当事人利益的活动；

公平对待所管理的不同基金，防止在不同基金间进行有损本基金份额持有人的利益及资源分配；

以基金管理人的名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为；

法律法规及基金合同规定的其他义务。

## 2、基金托管人

### （1）基金托管人的权利

依据法律法规和基金合同的规定安全保管基金财产；

依照基金合同的约定获得基金托管费；

监督基金管理人对本基金的投资运作，如托管人发现基金管理人的投资指令违反基金合同或有关法律法规的规定的，不予执行并向中国证监会报告；

在基金管理人职责终止时，提名新的基金管理人；

依据法律法规和基金合同的规定召集基金份额持有人大会；

依据法律法规和基金合同的规定监督基金管理人，如认为基金管理人违反了法律法规或基金合同规定对基金财产、其它基金合同当事人的利益造成重大损失的，应及时呈报中国证监会，以及采取其它必要措施以保护本基金及相关基金合同当事人的利益；

法律法规、基金合同规定的其它权利。

## （2）基金托管人的义务

以诚实信用、勤勉尽责的原则安全保管基金财产；

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

建立健全内部控制、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资产以及不同的基金财产相互独立；对所托管的不同的基金分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金之间在名册登记、账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；

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

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；

按规定开设基金财产的资金账户和证券账户；

按照基金合同的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；

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以保密，不得向他人泄露；

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

办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；



对基金财务会计报告、中期和年度基金报告出具意见，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，还应说明基金托管人是否采取了适当的措施；

按规定保存有关基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料，保存基金的会计账册、报表和记录等 15 年以上；

根据有关法律法规，建立并保存基金份额持有人名册；

按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

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、基金转换转出款项；

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；

按照规定监督基金管理人的投资运作；

参加基金财产清算组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

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；

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

因违反基金合同导致基金财产的损失，应承担赔偿责任，其责任不因其退任而免除；

不从事任何有损基金及基金合同其他当事人利益的活动；

法律、法规、本基金合同和依据本基金合同制定的其他法律文件所规定的其他义务。

### **3、基金份额持有人**

#### **（1）基金份额持有人的权利**

- 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、代销机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼；
- 9) 法律法规、基金合同规定的其它权利。

(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、申购款项及基金合同规定的费用；
- 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利益的活动；
- 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、基金托管人及代销机构处获得的不当得利；
- 7) 法律法规及基金合同规定的其他义务。

## 二、基金份额持有人大会

1、本基金的基金份额持有人大会，由本基金的基金份额持有人共同组成。

2、有以下事由情形之一时，应召开基金份额持有人大会：

- (1) 终止基金合同；
- (2) 转换基金运作方式；
- (3) 更换基金托管人；
- (4) 更换基金管理人；
- (5) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，但根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外；
- (6) 本基金与其它基金的合并；
- (7) 变更基金类别；
- (8) 变更基金投资目标、范围或策略；
- (9) 变更基金份额持有人大会程序；
- (10) 对基金当事人权利和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它应当召开基金份额持有人大会的事项。

### 3、以下情况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、基金销售服务费；
- （2）在法律法规和基金合同规定的范围内变更本基金的申购费率、赎回费率或收费方式；
- （3）因相应的法律法规发生变动而应当对基金合同进行修改；
- （4）对基金合同的修改不涉及基金合同当事人权利义务关系发生变化；
- （5）对基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响；
- （6）除法律法规或基金合同规定应当召开基金份额持有人大会以外的其它情形。

### 4、召集人和召集方式

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

（4）代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，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。

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

## 5、召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

（1）召开基金份额持有人大会，召集人必须于会议召开日前 40 天在规定媒介公告。基金份额持有人大会通知须至少载明以下内容：

- 1) 会议召开的时间、地点和方式；
- 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权益登记日；
- 6) 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、书面表达意见的寄交和收取方式及截止时间。

（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。

## 6、基金份额持有人出席会议的方式

### （1）会议方式

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。

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。

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。

会议的召开方式由召集人确定，但决定更换基金管理人或基金托管人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，有效的基金份额应占权益登记日基金总份额的 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书代理手续完备，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登记资料相符。

未能满足上述条件的情况下，则召集人可另行确定并公告重新开会的时间和地点，但确定有权出席会议的基金份额持有人资格的权益登记日不变。

### 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 召集人在基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取和统计基金份额持有人的书面表决意见；

③ 本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额应占权益登记日基金总份额的 50%以上（含 50%）；

④ 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其他代表，同时提交的持有基金份额的凭证符合法律法规、基金合同和会议通知的规定，并与登记注册机构记录相符。

如果开会条件达不到上述条件，则召集人可另行确定并公告重新表决的时间，但确定有权出席会议的基金份额持有人资格的权益登记日不变。

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。

## 7、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以及召集人认为需提交基金份额持有人大会讨论的其他事项。

2) 基金管理人、基金托管人、单独或合并持有权益登记日本基金总份额 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前 35 天提交召集人。召集人对于临时提案应当在大会召开日前 30 天公布。

3) 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：

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。

4) 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、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。

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或增加新的提案，应当最迟在基金份额持有人大会召开日前 30 日

公告。否则，会议的召开日期应当顺延并保证至少与公告日期有 30 日的间隔期。

## （2）议事程序

### 1) 现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照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，经讨论后在公证机关监督下进行表决，经合法执业的律师见证后形成大会决议。

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

在通讯表决开会的方式下，首先由召集人提前 30 天公布提案，在所通知的表决截止日期第 2 天在公证机构监督下由召集人统计全部有效表决并形成决议。

（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。

## 8、决议形成的条件、表决方式、程序

（1）基金份额持有人所持每一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及其代理人所持表决权的 50%以上（含 50%）通过方为有效，除下小项规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过；

### 2) 特别决议

特别决议须经出席会议的基金份额持有人及代理人所持表决权的三分之二以上通过方为有效；更换基金管理人、更换基金托管人、转换基金运作方式、终止基金合同等重大事项必须以特别决议方式通过。

（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）基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

（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。

## 9、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 3 名基金份额持有人担任监票人。

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) 如会议主持人对于提交的表决结果有怀疑，可以对投票数进行重新清点；如会议主持人未进行重新清点，而出席会议的基金份额持有人或代理人对会议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，会议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。

4) 计票过程应由公证机关予以公证，基金管理人或基金托管人拒不参加基金份额持有人大会或拒不配合计票的，不影响计票的效力。

### （2）通讯方式开会

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（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人授权代表）的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。基金管理人或基金托管人拒派代表对书面表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。

## 10、基金份额持有人大会决议的生效与公告

（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的决定。

（3）基金份额持有人大会决议应自核准或备案后 2 日内由相关信息披露义务人在至少一种规定媒介公告。

#### 11、实施侧袋机制期间基金份额持有人大会的特殊约定

若本基金实施侧袋机制，则相关基金份额或表决权的比例指主袋份额持有人和侧袋份额持有人分别持有或代表的基金份额或表决权符合该等比例，但若相关基金份额持有人大会召集和审议事项不涉及侧袋账户的，则仅指主袋份额持有人持有或代表的基金份额或表决权符合该等比例：

（1）基金份额持有人行使提议权、召集权、提名权所需单独或合计代表相关基金份额 10%以上（含 10%）；

（2）现场开会的到会者在权益登记日代表的基金份额不少于本基金在权益登记日相关基金份额的二分之一（含二分之一）；

（3）通讯开会的直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日相关基金份额的二分之一（含二分之一）；

（4）若参与基金份额持有人大会投票的基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日相关基金份额的二分之一，召集人在原公告的基金份额持有人大会召开时间的 3 个月以后、6 个月以内就原定审议事项重新召集的基金份额持有人大会应当有代表三分之一以上（含三分之一）相关基金份额的持有人参与或授权他人参与基金份额持有人大会投票；

（5）现场开会由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）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；

（6）一般决议须经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）通过；

（7）特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过。

侧袋机制实施期间，基金份额持有人大会审议事项涉及主袋账户和侧袋账户的，应分别由主袋账户、侧袋账户的基金份额持有人进行表决，同一主侧袋账户内的每份基金份额具有平等的表决权。表决事项未涉及侧袋账户的，侧袋

账户份额无表决权。

侧袋机制实施期间，关于基金份额持有人大会的相关规定以本节特殊约定内容为准，本节没有规定的适用本部分的相关规定。

### 三、《基金合同》的变更、终止与基金财产的清算

#### 1、基金合同的变更

（1）基金合同变更涉及本基金合同第八节第（二）项规定的对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的，应经基金份额持有人大会决议同意。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，并自中国证监会核准或出具无异议意见之日起生效。

（2）除上述第（1）项规定的情形外，经基金管理人和基金托管人同意可对基金合同的内容进行变更，该等变更应当在 2 日内由基金管理人进行公告并报中国证监会备案。

#### 2、基金合同的终止

有下列情形之一的，本基金合同终止：

- （1）基金份额持有人大会决定终止；
- （2）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、基金托管人承接的；
- （3）法律法规和基金合同规定的其他情形。

#### 3、基金财产的清算

（1）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。

##### （2）基金财产清算组

1) 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，在基金财产清算组接管基金财产之前，基金管理人和基金托管人应依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。

2) 基金财产清算组成员由基金管理人、基金托管人、基金注册登记机构、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。

### （3）清算程序

- 1) 基金合同终止后，由基金财产清算组统一接管基金财产；
- 2) 基金财产清算组根据基金财产的情况确定清算期限；
- 3) 基金财产清算组对基金财产进行清理和确认；
- 4) 对基金财产进行评估和变现；
- 5) 基金清算组作出清算报告；
- 6) 会计师事务所对清算报告进行审计；
- 7) 律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- 8) 将基金清算结果报告中国证监会；
- 9) 公布基金清算公告；
- 10) 基金剩余财产进行分配。

### （4）清算费用

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

### （5）基金剩余财产的分配

基金财产按如下顺序进行清偿：

- 1) 支付基金财产清算费用；
- 2) 缴纳基金所欠税款；
- 3) 清偿基金债务；
- 4) 清算后如有余额，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

### （6）基金财产清算的公告

清算小组成立后 2 日内应就清算小组的成立进行公告；清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算组做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，报中国证监会批准并公告。

（7）基金财产清算账册及文件由基金托管人保存 15 年以上。

## 四、争议的处理

1、本基金合同适用中华人民共和国法律并从其解释。

2、本基金合同的当事人之间因本基金合同产生的或与本基金合同有关的争议可首先通过友好协商或调解解决。自一方书面要求协商解决争议之日起六十日内如果争议未能以协商或调解方式解决，则任何一方有权将争议提交中国国

际经济贸易仲裁委员会上海分会，根据提交仲裁时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为上海。仲裁裁决是终局的，对仲裁各方当事人均具有约束力。

3、除争议所涉内容之外，本基金合同的其他部分应当由本基金合同当事人继续履行。

#### **五、基金合同存放地点和查询办法**

基金合同可印制成册，存放在基金管理人和基金托管人住所，供投资人查阅，基金合同条款及内容应以基金合同正本为准。

## 第二十一部分 基金托管协议的内容摘要

### 一、基金托管协议当事人

#### （一）基金管理人

名称：兴证全球基金管理有限公司

住所：上海市黄浦区金陵东路 368 号

办公地址：上海市浦东芳甸路 1155 号浦东嘉里城办公楼 28-29 楼

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

经营范围：发起、设立、登记、管理和销售经证监会批准的基金，并处理基金单位的销售、申购、赎回和登记，管理经证监会批准的其他种类的资产和投资组合；经证监会批准的其他业务。

注册资本：1.5 亿元人民币

组织形式：有限责任公司

存续期间：持续经营

#### （二）基金托管人

名称：交通银行股份有限公司（简称：交通银行）

住所：中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 号（邮政编码：200120）

办公地址：上海市长宁区仙霞路 18 号（邮政编码：200336）

法定代表人：任德奇

成立日期：1987 年 3 月 30 日

批准设立机关及批准设立文号：国务院国发(1986)字第 81 号文和中国人民银行银发 [1987] 40 号文

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字 [1998] 25 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；代理收付款项业务；提供保管箱服务；经各监督管理部门或者机构批准的其他业务（以许可批复文件为准）；经营结汇、售

汇业务。（依法须经批准的项目，经相关部门批准后方可开展经营活动）。

注册资本：742.63 亿元人民币

组织形式：股份有限公司

存续期间：持续经营

## 二、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

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

根据《基金合同》的约定，本基金主要投资于具有良好流动性的固定收益类金融工具，包括依法公开发行上市的国债、金融债、企业债、公司债、债券回购、央行票据、可转换债券、中小企业私募债券、资产支持证券、同业存单以及中国证监会允许基金投资的其他债券类金融工具。

本基金不参与定向增发或网下新股申购，也不在二级市场直接买入股票、权证等权益类资产。本基金可以参与一级市场网上新股申购、公开增发，可以持有可转债转股所得股票及可分离债分离后所得权证，由上述方式获得的股票或权证将在可交易日起 5 个工作日内全部卖出。本基金可以主动投资于纯债收益率为正的可转债，不主动投资于纯债收益率为零或为负的可转债。

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

基金托管人运用相关技术系统，对基金实际投资是否符合基金合同的相关约定进行监督，对存在疑义的事项进行核查。

基金托管人发现基金管理人的投资有超出以上范围的行为，应及时以书面形式通知基金管理人在 10 个工作日内纠正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在 10 个工作日内纠正的，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，应立即报告中国证监会，同时通知基金管理人在 10 个工作日内纠正。

（二）基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金投资、融资比例进行监督。

根据《基金合同》的约定，本基金投资组合比例应符合以下规定：

（1）本基金债券类证券的投资比例不低于基金资产的 80%。不含可分离债债券部分的可转债投资不超过债券类证券投资比例的 50%。股票、权证等权益

类证券的投资比例为基金资产的 0%-20%。现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

（2）本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%；

（3）本基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%，本基金管理人管理的全部基金持有同一权证的比例不超过该权证的 10%。投资于其他权证的投资比例，遵从法规或监管部门的相关规定；

（4）本基金投资于信用级别评级为 BBB 以上（含 BBB）的资产支持证券，持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%。投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%。本基金管理人管理的全部证券投资基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%。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%，中国证监会规定的特殊品种除外。本基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出。

（5）进入全国银行间同业市场的基金管理公司的债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；

（6）在银行间市场进行债券回购融入的资金余额不超过基金资产净值的 40%；

（7）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，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；

（8）本基金投资于单只中小企业私募债占基金资产净值比例不得超过 5%；本基金投资于中小企业私募债的比例合计不得超过基金资产净值的 30%；本基金与由本基金管理人管理的其他基金投资于同一家公司发行的中小企业私募债券，不得超过该券发行总量的 10%；

（9）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；

（10）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%；

（11）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；

（12）《基金法》及其他有关法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的，从其规定。

如果法律法规对上述投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。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。

因证券市场波动、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比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。

对于因基金份额拆分、大比例分红等集中持续营销活动引起的基金净资产规模在 10 个交易日内增加 10 亿元以上的情形，而导致证券投资比例低于基金合同约定的，基金管理人履行相关程序后可将调整时限从 10 个交易日延长到 3 个月。

法律法规另有规定的从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。法律法规或监管部门修改或取消上述限制规定时，本基金相应修改其投资组合限制规定。

基金托管人依照上述规定对本基金的投资组合限制及调整期限进行监督。

基金托管人发现基金管理人的投资有超出有关法律法规的规定及基金合同的约定的基金投融资比例限制的行为，应及时以书面形式通知基金管理人在 10 个工作日内纠正。基金管理人未能在 10 个工作日内纠正的，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存在重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时通知基金管理人在 10 个工作日内纠正。

（三）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投



资禁止行为进行监督。基金财产不得用于下列投资或者活动。

承销证券；

向他人贷款或者提供担保；

从事承担无限责任的投资；

买卖其他基金份额，但国务院另有规定的除外；

向基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人行的股票或债券；

买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者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；

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；

当时有效的法律法规、中国证监会及基金合同规定禁止从事的其他行为。

若法律法规或监管部门取消上述限制，履行适当程序后，本基金投资可不受上述规定限制。

根据法律法规有关基金禁止从事的关联交易的规定，基金合同生效后 2 个工作日内，基金管理人和基金托管人应相互提供与本机构有控股关系的股东或者与本机构有其他重大利害关系的公司名单，以上名单发生变化的，应及时予以更新并通知对方。

基金托管人发现基金管理人以上投资禁止行为的，应及时以书面形式通知基金管理人在 10 个工作日内纠正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在 10 个工作日内纠正的，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重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时通知基金管理人在 10 个工作日内纠正。

（四）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金管理人参与银行间债券市场进行监督。

1. 基金托管人依据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定对于基金管理人参与银行间市场交易时面临的交易对手资信风险进行监督。

基金管理人向基金托管人提供符合法律法规及行业标准的银行间市场交易对手的名单。基金托管人在收到名单后 2 个工作日内电话或书面回函确认收到该名单。基金管理人应定期或不定期对银行间市场现券及回购交易对手的名单

进行更新，基金托管人于收到名单后 2 个工作日内电话或书面回函确认收到后，对名单进行更新。基金管理人收到基金托管人书面确认后，被确认调整的名单开始生效，新名单生效前已与本次剔除的交易对手所进行但尚未结算的交易，仍应按照协议进行结算。

2. 基金管理人参与银行间市场交易时，有责任控制交易对手的资信风险，由于交易对手资信风险引起的损失，基金管理人应当负责向相关责任人追偿。

（五）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金管理人选择存款银行进行监督。

基金投资银行定期存款的，基金管理人应根据法律法规的规定及基金合同的约定，确定符合条件的所有存款银行的名单，并及时提供给基金托管人，基金托管人应据以对基金投资银行存款的交易对手是否符合有关规定进行监督。

本基金投资银行存款应符合如下规定：

基金管理人、基金托管人应当与存款银行建立定期对账机制，确保基金银行存款业务账目及核算的真实、准确。

2. 基金管理人与基金托管人应根据相关规定，就本基金银行存款业务另行签订书面协议，明确双方在相关协议签署、账户开设与管理、投资指令传达与执行、资金划拨、账目核对、到期兑付、文件保管以及存款证实书的开立、传递、保管等流程中的权利、义务和职责，以确保基金资产的安全，保护基金份额持有人的合法权益。

3. 基金托管人应加强对基金银行存款业务的监督与核查，严格审查、复核相关协议、账户资料、投资指令、存款证实书等有关文件，切实履行托管职责。

4. 基金管理人与基金托管人在开展基金存款业务时，应严格遵守《基金法》、《运作办法》等有关法律法规，以及国家有关账户管理、利率管理、支付结算等的各项规定。

基金托管人发现基金管理人在选择存款银行时有违反有关法律法规的规定及基金合同的约定的行为，应及时以书面形式通知基金管理人在 10 个工作日内纠正。基金管理人对于基金托管人通知的违规事项未能在 10 个工作日内纠正的，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存在重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时通知基金管理人在 10 个工作日内纠正或拒绝结算。

（六）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同和本协议的约定，对基金管理人投资中小企业私募债进行监督。

基金管理人根据法律、法规、监管部门的规定，本着审慎、勤勉尽责的原则，针对中小企业私募债券的投资，制定了相关风险控制制度及决策流程，以规范对中小企业私募债券的投资决策流程、风险控制，并与基金托管人签订《基金投资中小企业私募债风险控制补充协议》。

基金管理人已将经董事会备案的相应风险控制制度及决策流程提供给基金托管人，若基金管理人对相关制度进行修订，应及时提供给基金托管人。基金托管人应依据届时有效的制度文件及基金合同、本托管协议的约定，对基金管理人投资中小企业私募债券是否遵守相关制度、决策流程、流动性风险处置预案以及相关投资额度和投资比例、投资限制进行监督。

如今后法律法规对基金投资中小企业私募债券另有规定的，从其规定。

（七）基金托管人根据法律法规的规定及《基金合同》的约定，对基金投资其他方面进行监督。

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

（九）基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查，在规定时间内答复并改正，就基金托管人的疑义进行解释或举证。对基金托管人按照法规要求需向中国证监会报送基金监督报告的，基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

基金托管人发现基金管理人的投资指令或实际投资运作违反《基金法》及其他有关法律法规、《基金合同》和本协议规定的行为，应及时以书面形式通知基金管理人在 10 个工作日内纠正，并通知基金管理人收到通知后应及时核对，并以电话或书面形式向基金托管人反馈，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在 10 个工作日内，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 10 个工作日内纠正的，基金托管人有权报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人重大违规行为，应立即报告中国证监会，同

时通知基金管理人在 10 个工作日内纠正。

基金托管人发现基金管理人的指令违反法律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指令违反法律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。

（十）当基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，根据最大限度保护基金份额持有人利益的原则，基金管理人经与基金托管人协商一致，并咨询会计师事务所意见后，可以依照法律法规及基金合同的约定启用侧袋机制，无需召开基金份额持有人大会审议。

侧袋机制实施期间，本基金的投资组合比例、投资策略、组合限制、业绩比较基准、风险收益特征等约定仅适用于主袋账户。

侧袋账户的实施条件、实施程序、运作安排（包括但不限于对基金赎回的影响、信息披露、费用列支等）、投资安排、特定资产的处置变现和支付等对投资者权益有重大影响的事项详见基金合同和招募说明书的规定。

基金托管人依照相关法律法规的规定以及基金合同和招募说明书的约定，对侧袋机制启用、特定资产处置和信息披露等方面进行复核和监督。

### 三、基金管理人对基金托管人的业务核查

根据《基金法》及其他有关法律法规、《基金合同》和本协议规定，基金管理人对基金托管人履行托管职责的情况进行核查，核查事项包括但不限于基金托管人是否安全保管基金财产、开立基金财产的资金账户/证券账户和债券托管账户、是否及时准确复核基金管理人计算的基金资产净值和各类基金份额净值、是否根据基金管理人指令办理清算交收、相关信息披露和监督基金投资运作等行为、如遇问题是否及时反馈、是否按照法律法规、《基金合同》和本协议规定进行相关信息披露和监督基金投资运作等行为以及是否对非公开信息保密。

基金管理人定期和不定期地对基金托管人保管的基金资产进行核查。基金托管人应积极配合基金管理人的核查行为，包括但不限于：提交相关资料以供基金管理人核查托管财产的完整性和真实性，在规定时间内答复并改正。

基金管理人发现基金托管人未对基金资产实行分账管理、擅自挪用基金资产、未执行或无故延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄露基金投资信息等违反《基金法》、《基金合同》、本协议及其他有关规定的，应及时以书面形式通知基金托管人在 10 个工作日内纠正，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 10 个工作日内，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 10 个工作日内纠正的，基金管理人应报告中国证监会。

基金管理人发现基金托管人有重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时通知基金托管人在 10 个工作日内纠正。

#### 四、基金财产的保管

##### （一）基金财产保管的原则

##### 1. 基金托管人应安全保管基金财产。

基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。

基金托管人按照规定开立基金财产的资金账户、证券账户和债券托管账户。

基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整和独立。

基金托管人应安全、完整地保管基金资产；未经基金管理人的指令，不得自行运用、处分、分配基金的任何资产。

对于因为基金投资产生的应收资产和基金申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基金托管人，到账日基金资产没有到达基金托管人处的，基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收。由此给基金造成损失的，基金管理人应负责向有关当事人追偿基金的损失。如果因基金托管人未能履行上述及时通知的义务给基金造成损失，基金托管人对此应承担相应责任；如果基金托管人履行了及时通知的义务，基金托管人对此不承担任何责任。

##### （二）基金合同生效时募集资产的验证

基金募集期满之日起 10 日内，募集的基金份额总额、基金募集金额、基金份额持有人人数符合《基金法》、《运作办法》等有关规定后，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。验资完成，基金管理人应将募集到的全部资金存入基金托管人为基金开立的基金银行存款账户中，基金托管人在收到资金当日出具相关证明文件。

### （三）基金的银行存款账户的开立和管理

基金托管人应负责兴全磐稳增利债券型证券投资基金银行存款账户的开立和管理。

基金托管人以本基金的名义在其营业机构开立本基金的银行存款账户，并根据中国人民银行的规定计息。本基金的银行预留印鉴由基金托管人制作、保管和使用。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，均需通过本基金的银行存款账户进行。

本基金银行存款账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得假借基金的名义开立其他任何银行存款账户；亦不得使用基金的任何银行存款账户进行基金业务以外的活动。

基金托管人可以通过申请开通本基金银行账户的企业网上银行业务进行资金支付，并使用交通银行企业网上银行（简称“交通银行网银”）办理托管资产的资金结算汇划业务。

基金银行存款账户的管理应符合《中华人民共和国票据法》、《人民币银行账户结算管理办法》、《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》以及其他有关规定。

基金托管人应严格管理基金在基金托管人处开立的银行存款账户，及时核查基金银行存款账户余额。

### （四）基金证券交收账户、资金交收账户的开立和管理

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责任公司开立证券账户。

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。

若中国证监会或其他监管机构在本托管协议订立日之后允许基金从事其他投资品种的投资业务，涉及相关账户的开立、使用的，若无相关规定，则基金

托管人比照并遵守上述关于账户开立、使用的规定。

基金托管人以基金托管人的名义在中国证券登记结算有限责任公司开立结算备付金账户，用于证券交易资金的结算。

基金托管人以本基金的名义在托管人处开立基金的证券交易资金结算的二级结算备付金账户。

#### （五）债券托管账户的开立和管理

募集资金验资后，基金托管人负责在中央国债登记结算有限责任公司以本基金的名义开立债券托管账户，并由基金托管人负责基金的债券及资金的清算。在上述手续办理完毕后，由基金托管人向中国人民银行进行报备。

基金管理人和基金托管人共同代表基金签订全国银行间债券市场债券回购主协议，协议正本由基金托管人保管，协议副本由基金管理人保存。

#### （六）基金实物证券、银行存款定期存单等有价凭证的保管

实物证券由基金托管人存放于托管银行的保管库，应与非本基金的其他实物证券分开保管；也可存入登记结算机构的代保管库，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办理。基金托管人对由基金托管人以外机构实际有效控制的证券不承担保管责任。

银行存款定期存单等有价凭证由基金托管人负责保管。

#### （七）与基金财产有关的重大合同的保管

由基金管理人代表基金签署的与基金有关的重大合同的原件分别由基金托管人、基金管理人保管，相关业务程序另有限制除外。除本协议另有规定外，基金管理人在代基金签署与基金有关的重大合同时应尽可能保证持有二份以上的正本，以便基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件，基金管理人应及时将正本送达基金托管人处。合同的保管期限按照国家有关规定执行。

对于无法取得二份以上的正本的，基金管理人应向基金托管人提供加盖授权业务章的合同传真件，未经双方协商或未在合同约定范围内，合同原件不得转移。

### 五、基金资产净值计算和会计核算

#### （一）基金资产净值及基金份额净值的计算与复核

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。各类基金份额净值是指计算日该类基金份额的基金资产净值除以计算日该类基金份额的基金总份额

后的价值。

基金管理人应每工作日对基金资产估值。用于基金信息披露的基金资产净值和各类基金份额的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和各类基金份额的基金份额净值，盖章后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盖章后，将复核结果以加密传真通知基金管理人，由基金管理人对外公布。待条件成熟后，双方可协商采用电子对账方式。

根据《基金法》，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，基金管理人有权按照其对基金净值的计算结果对外予以公布。

## （二）净值差错处理

当发生净值计算错误时，由基金管理人负责处理，由此给基金份额持有人和基金造成损失的，由基金管理人对外承担赔偿责任。基金托管人应根据实际情况界定双方承担的责任，经确认后按以下条款进行赔偿。

如采用本协议第八章“基金资产估值、基金资产净值计算与复核”中估值方法的第 1—5 项进行处理时，若基金管理人净值计算出错，基金托管人在复核过程中没有发现，且造成基金份额持有人损失的，由双方共同承担赔偿责任，其中基金管理人承担 50%，基金托管人承担 50%；

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

基金管理人、基金托管人按估值方法的第 7 项进行估值时，所造成的误差不能作为基金份额净值错误处理。

由于交易所及登记结算公司发送的数据错误，有关会计制度变化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，如果法律法规或中国证监会有新的规定，则按新的规定执行；如果行业有通行做法，在不违背法律法规且不损害投资者利益的前提下，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。

### （三）基金账册的建立

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

### （四）会计数据和财务指标的核对

双方应每个交易日核对账目，如发现双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。

## 六、基金份额持有人名册的保管

基金管理人可委托基金注册登记机构登记和保管基金份额持有人名册。基金份额持有人名册的内容包括但不限于持有人的名称和持有的基金份额。

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、每年最后一个交易日的基金份额持有人名册，由基金注册登记机构负责编制和保管，并对持有人名册的真实性、完整性和准确性负责。

基金管理人应根据基金托管人的要求定期或不定期向基金托管人提供基金份额持有人名册。

基金托管人以电子版形式妥善保管基金份额持有人名册，并定期刻成光盘备份，保存期限为15年。基金托管人不得将所保管的基金份额持有人名册用于基金托管业务以外的其他用途，并应遵守保密义务。

## 七、托管协议的变更、终止与基金财产的清算

### （一）基金托管协议的变更

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，应报中国证监会核准。

## （二）基金托管协议的终止

《基金合同》终止；

基金托管人解散、依法被撤销、破产，被依法取消基金托管资格或因其他事由造成其他基金托管人接管基金财产；

基金管理人解散、依法被撤销、破产，被依法取消基金管理资格或因其他事由造成其他基金管理人接管基金管理权。

发生《基金法》、《销售办法》、《运作办法》或其他法律法规规定的终止事项。

## （三）基金财产的清算

### 基金财产清算组

在基金财产清算组接管基金财产之前，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资产安全的职责。

基金财产清算组组成：基金财产清算组成员由基金管理人、基金托管人、基金注册登记机构、具有从事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。

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

### 基金财产清算程序

《基金合同》终止后，由基金财产清算组统一接管基金财产；

基金财产清算组根据基金财产的情况确定清算期限；

基金财产清算组对基金财产进行清理和确认；

对基金财产进行评估和变现；

基金清算组作出清算报告；

会计师事务所对清算报告进行审计；

律师事务所对清算报告出具法律意见书；

将基金清算报告中国证监会；

公布基金清算公告；

对基金剩余财产进行分配。

### 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。

基金剩余财产的分配

基金财产按如下顺序进行清偿

支付基金财产清算费用；

缴纳基金所欠税款；

清偿基金债务；

清算后如有余额，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

基金财产清算的公告

清算小组成立后 2 日内应就清算小组的成立进行公告；清算过程中的有关重大事项须及时公告。基金财产清算组做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，报中国证监会批准并公告。

基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

## 八、争议解决方式

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，应通过友好协商或者调解解决。托管协议当事人不愿通过协商、调解解决或者协商、调解不成的，任何一方当事人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，根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁的地点在上海，仲裁裁决是终局性的并对相关各方均有约束力，仲裁费用由败诉方承担。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。

本协议受中华人民共和国法律管辖。

## 第二十二部分 对基金份额持有人的服务

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

### 一、通知服务

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

### 二、在线服务

基金管理人利用自己的网站提供实时在线客服咨询服务。

### 三、网上交易（手机 APP）服务

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

### 四、资讯服务

投资者如果想了解申购与赎回的交易情况、基金账户余额、基金产品与服务等信息，可拨打基金管理人客户服务中心电话或登录基金管理人网站。

#### 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基金管理人发送的基金净值、短信对账单，并可通过电子邮件收到基金管理人的基金净值、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客户服务中心电话，或通过本公司网站留言的投诉栏目、书信、电子邮件等渠道对基金管理人和销售网点所提供的服务进行投诉。基金管理人根据基金份额持有人的需要和市场的变化，有权增加或变更服务项目。

## 第二十三部分 其他应披露事项

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

序号	事项名称	披露日期
1	关于调整旗下部分基金在华融证券股份有限公司费率优惠活动的公告	2022-07-11
2	关于增加平安证券为旗下部分基金销售机构的公告	2022-09-06
3	关于增加国新证券为旗下部分基金销售机构的公告	2022-09-13
4	关于增加旗下部分基金销售机构的公告	2022-09-16
5	关于增加华宝证券股份有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	2022-09-27
6	关于增加玄元保险代理有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	2022-09-28
7	关于增加渤海证券股份有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	2022-11-09
8	关于增加上海利得基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	2022-11-09

9	关于增加旗下部分基金销售机构的公告	2022-11-17
10	关于增加中泰证券股份有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	2022-11-18
11	关于增加中国中金财富证券有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	2022-11-25
12	关于调整网上直销部分基金转换赎回申购优惠费率的公告	2022-12-06
13	关于增加中银国际证券股份有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	2022-12-16
14	关于增加广发银行股份有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	2023-02-28
15	关于增加上海华夏财富投资管理有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	2023-03-23
16	关于增加中国工商银行股份有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	2023-05-18

## 第二十四部分 招募说明书存放及查阅方式

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



## 第二十五部分 备查文件

- 一、中国证监会核准兴全磐稳增利债券型证券投资基金募集的文件
- 二、关于申请募集兴全磐稳增利债券型证券投资基金之法律意见书
- 三、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- 四、基金托管人业务资格批件和营业执照
- 五、《兴全磐稳增利债券型证券投资基金基金合同》
- 六、《兴全磐稳增利债券型证券投资基金托管协议》
- 七、中国证监会规定的其他文件

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

兴证全球基金管理有限公司

2023年6月30日