

兴全可转债混合型证券投资基金  
更新招募说明书  
(2024 年 06 月 29 日更新)

基金管理人：兴证全球基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

## 重要提示

兴全可转债混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会 2004 年 3 月 9 日出具的《关于同意兴全可转债混合型证券投资基金设立的批复》（证监基金字[2004]27 号文）核准公开发行。本基金的基金合同于 2004 年 5 月 11 日正式生效，自该日起本基金管理人正式开始管理本基金。

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

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。

科创板上市的股票、北交所上市的股票都是国内依法上市的股票，属于《基金法》第七十二条第一项规定的“上市交易的股票”。本基金基金合同中的投资范围中包括国内依法发行上市的股票，且投资科创板、北交所股票均符合本基金基金合同所约定的投资目标、投资策略、投资范围、资产配置比例、风险收益特征和相关风险控制指标。本基金可根据投资目标、投资策略需要或市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于科创板、北交所股票或选择不将基金资产投资于科创板、北交所股票，并非必然投资于科创板、北交所股票。

基金管理人在投资科创板、北交所股票过程中，将根据审慎原则进行投资决策和风险管理，保持基金投资风格的一致性，并做好流动性风险管理工作。

本基金可投资科创板股票。基金资产投资于科创板股票，会面临科创板机制下因投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括但不限于市场风险、流动性风险、信用风险、集中度风险、系统性风险、政策风险等。

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

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

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

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

本次招募说明书更新内容为：

- 1、更新了“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为 2024 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 2024 年第 1 季度报告，数据截止日为 2024 年 3 月 31 日（财务数据未经审计）。本基金托管人中国工商银行股份有限公司已复核了本次更新的招募说明书基金的投资和基金的业绩相关内容。

## 目 录

|                                   |     |
|-----------------------------------|-----|
| 重要提示 .....                        | 2   |
| 一、绪言 .....                        | 6   |
| 二、释义 .....                        | 7   |
| 三、基金管理人 .....                     | 16  |
| 四、基金托管人 .....                     | 28  |
| 五、相关服务机构 .....                    | 33  |
| 六、基金的募集与基金合同的生效 .....             | 61  |
| 七、基金份额的申购、赎回 .....                | 62  |
| 八、基金的非交易过户、转托管、基金转换、冻结与质押 .....   | 71  |
| 九、基金的投资 .....                     | 73  |
| 十、基金的业绩 .....                     | 88  |
| 十一、基金的财产 .....                    | 90  |
| 十二、基金资产的估值 .....                  | 91  |
| 十三、基金的收益分配 .....                  | 96  |
| 十四、基金费用与税收 .....                  | 98  |
| 十五、基金的会计与审计 .....                 | 101 |
| 十六、基金的信息披露 .....                  | 102 |
| 十七、风险揭示 .....                     | 108 |
| 十八、基金合同的终止和基金财产的清算 .....          | 115 |
| 十九、《兴全可转债混合型证券投资基金基金合同》的摘要 .....  | 117 |
| 二十、《兴全可转债混合型证券投资基金基金托管协议》摘要 ..... | 131 |
| 二十一、对基金份额持有人的服务 .....             | 141 |
| 二十二、其他应披露事项 .....                 | 143 |
| 二十三、招募说明书的存放与查阅 .....             | 145 |
| 二十四、备查文件 .....                    | 146 |

## 一、绪言

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《基金法》）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称《运作办法》）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称《销售办法》）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称《信息披露办法》）、《深圳证券交易所上市开放式基金业务规则》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性风险规定》”）等有关法律法规以及《兴全可转债混合型证券投资基金基金合同》（以下简称基金合同）编写。

本招募说明书阐述了兴全可转债混合型证券投资基金的投资目标、策略、风险、费率等与投资人投资决策有关的全部必要事项，投资者在作出投资决策前应仔细阅读招募说明书。

本基金管理人承诺本招募说明书不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。本基金是根据本招募说明书所载明的资料申请募集的。本基金管理人没有委托或授权任何其他人提供未在本招募说明书中载明的信息，或对本招募说明书作出任何解释或者说明。

本招募说明书根据本基金的基金合同编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和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。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

## 二、释义

本招募说明书中，除非文义另有所指，下列词语或简称代表以下含义：

|               |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |
|---------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 基金或本基金：       | 指兴全可转债混合型证券投资基金                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |
| 招募说明书或本招募说明书： | 指《兴全可转债混合型证券投资基金招募说明书》及其更新                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
| 基金合同：         | 指《兴全可转债混合型证券投资基金基金合同》及对本基金合同的任何修订和补充                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
| 发售公告：         | 指《兴全可转债混合型证券投资基金发售公告》                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
| 托管协议：         | 指《兴全可转债混合型证券投资基金托管协议》及对该协议的任何修订和补充                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
| 中国：           | 指中华人民共和国（就本合同而言，不包括香港特别行政区、澳门特别行政区及台湾地区）                                                                                                                                                                                                                                                                              |
| 法律法规：         | 指中国现时有效并公布实施的法律、行政法规、行政规章及规范性文件、地方法规、地方规章及规范性文件                                                                                                                                                                                                                                                                       |
| 《证券法》：        | 指 1998 年 12 月 29 日经第九届全国人民代表大会常务委员会第六次会议通过，经 2004 年 8 月 28 日第十届全国人民代表大会常务委员会第十一次会议第一次修正，2005 年 10 月 27 日第十届全国人民代表大会常务委员会第十八次会议第一次修订，2013 年 6 月 29 日第十二届全国人民代表大会常务委员会第三次会议第二次修正，2014 年 8 月 31 日第十二届全国人民代表大会常务委员会第十次会议第三次修正，2019 年 12 月 28 日第十三届全国人民代表大会常务委员会第十五次会议第二次修订，自 2020 年 3 月 1 日起施行的《中华人民共和国证券法》及颁布机关对其不时做出的修订 |

|                            |                                                                                                                                                                                                                               |
|----------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 《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，并经 2015 年 4 月 24 日第十二届全国人民代表大会常务委员会第十四次会议《全国人民代表大会常务委员会关于修改〈中华人民共和国港口法〉等七部法律的决定》修正的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订 |
| 《运作办法》                     | 指中国证监会 2014 年 7 月 7 日颁布、同年 8 月 8 日实施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订                                                                                                                                                         |
| 《销售办法》                     | 指中国证监会 2020 年 8 月 28 日颁布、同年 10 月 1 日实施的《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订                                                                                                                                                   |
| 《信息披露管理办法》                 | 指中国证监会 2019 年 7 月 26 日颁布、2019 年 9 月 1 日起施行的，并经 2020 年 3 月 20 日中国证监会《关于修改部分证券期货规章的决定》修正的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订                                                                                                     |
| 《业务规则》：<br><br>《流动性风险管理规定》 | 指 2004 年 8 月 17 日深圳证券交易所发布并于 2004 年 8 月 17 日起施行的《深圳证券交易所上市开放式基金业务规则》<br><br>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                                                                     |
| 中国证监会：                     | 指中国证券监督管理委员会                                                                                                                                                                                                                  |



|          |                                                                                       |
|----------|---------------------------------------------------------------------------------------|
| 中国银监会：   | 指中国银行业监督管理委员会                                                                         |
| 元：       | 指人民币                                                                                  |
| 基金合同当事人： | 指受本基金合同约束，根据本基金合同享受权利并承担义务的基金管理人、基金托管人和基金份额持有人                                        |
| 基金管理人：   | 指兴证全球基金管理有限公司                                                                         |
| 基金托管人：   | 指中国工商银行股份有限公司                                                                         |
| 注册登记业务：  | 指本基金登记、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、基金交易确认、清算和结算、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等 |
| 注册登记人：   | 指办理本基金注册登记业务的机构。本基金的注册登记人是中国证券登记结算有限责任公司                                              |
| 销售机构：    | 指兴证全球基金管理有限公司及其他本基金的销售代理机构                                                            |
| 销售代理人：   | 指符合法律法规及其他有关规定要求的条件并与本基金管理人签订了销售服务代理协议，代为办理本基金销售服务业务的机构                               |
| 基金投资者：   | 指个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者的总称                                                             |
| 个人投资者：   | 指依据中华人民共和国有关法律法规规定可以投资于证券投资基金的自然人投资者                                                  |
| 机构投资者：   | 指依据中华人民共和国有关法律法规规定可以投资于证券                                                             |

|                           |                                                                                             |
|---------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------|
|                           | 投资基金的在中华人民共和国注册登记或经政府有关部门批准设立的法人、社会团体、其它组织                                                  |
| 合格境外机构投资者：<br><br>基金份额持有人 | 指根据《合格境外机构投资者境内证券投资管理暂行办法》的可投资中国境内证券市场的中国境外的机构投资者<br><br>指依法并依据本基金合同及相关法律文件合法取得并持有本基金份额的投资者 |
| 基金合同的生效：                  | 指本基金募集完成，符合本基金合同规定的条件，并获得中国证监会书面确认，基金备案手续办理完毕，本基金合同生效                                       |
| 基金合同的终止：                  | 指法律法规规定的或者本基金合同约定的基金终止事由出现时，按照本基金合同规定的程序终止本基金合同                                             |
| 基金募集期限：                   | 指本基金份额发售公告及相关公告中规定的本基金份额的发售时间段，自基金份额发售之日起最长不超过 3 个月                                         |
| 存续期：                      | 指本基金合同生效至终止之间的不定期期限                                                                         |
| 开放日：                      | 指销售机构为投资者办理基金申购、赎回等业务的工作日                                                                   |
| 工作日：                      | 指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日                                                                      |
| T 日：                      | 指销售机构在规定时间受理投资者认购、申购、赎回或其他业务申请的申请日                                                          |
| T+n 日：                    | 指自 T 日起第 n 个工作日（不包含 T 日）                                                                    |
| 申购：                       | 指在本基金存续期间，投资者向基金管理人提出申请购买                                                                   |

|         |                                                                |
|---------|----------------------------------------------------------------|
|         | 本基金份额的行为                                                       |
| 赎回：     | 指在本基金存续期间，基金份额持有人按本《基金合同》规定的条件，要求基金管理人购回其持有的全部或部分本基金份额的行为      |
| 基金转换：   | 指在本基金存续期间，本基金份额持有人将其持有的本基金份额转换为本基金管理人管理的其他基金的基金份额              |
| 系统内转托管： | 指持有人将持有的基金份额在注册登记系统内不同销售机构（网点）之间或证券登记结算系统内不同会员单位（席位）之间进行转托管的行为 |
| 跨系统转登记： | 指持有人将持有的基金份额在注册登记系统和证券登记结算系统间进行转登记的行为                          |
| 巨额赎回：   | 指基金单个开放日，基金净赎回申请超过上一日基金总份额 10% 时的情形                            |
| 投资指令：   | 指基金管理人在运用基金财产进行投资时，向基金托管人发出的资金划拨及实物券调拨等指令                      |
| 基金收益：   | 包括基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券价差、银行存款利息以及其它合法收入                       |
| 基金资产总值： | 包括基金购买的各类证券、银行存款本息、基金应收的申购款以及其他投资所形成的价值总和                      |
| 基金资产净值： | 指基金资产总值减去基金负债后的净资产值                                            |
| 基金资产估值： | 指计算评估本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                           |
| 基金账户：   | 指基金注册登记人为投资者开立的记录其持有本基金份额                                      |

|           |                                                                                                                                          |
|-----------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|           | 及其变更情况的账户                                                                                                                                |
| 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 |
| 交易账户：     | 指各销售机构为投资者开立的记录投资者通过该销售机构办理基金交易所引起的基金份额的变动及结余情况的账户                                                                                       |
| 开放式基金账户：  | 指注册登记人给投资者开立的用于记录投资者持有基金份额的账户，记录在该账户下的基金份额登记在注册登记人的注册登记系统                                                                                |
| 证券账户：     | 指注册登记人给投资者开立的用于记录投资者持有证券的账户，包括人民币普通股票账户和证券投资基金账户，记录在该账户下的基金份额登记在注册登记人的证券登记结算系统                                                           |
| 指定媒介：     | 指中国证监会指定的用以进行信息披露的全国性报刊及指定互联网网站（包括基金管理人网站、基金托管人网站、中国证监会基金电子披露网站）等媒介                                                                      |
| 不可抗力：     | 指任何无法预见、无法克服并无法避免的事件或因素，包括但不限于：相关法律、法规或规章的变更；国际、国内金融市场风险事故的发生；自然或人为破坏造成的交易系统或交易场所无法正常工作；战争或动乱等                                           |
| 基金产品资料概要： | 指《兴全可转债混合型证券投资基金基金产品资料概要》及其更新                                                                                                            |

### 三、基金管理人

#### （一）基金管理人概况

名称：兴证全球基金管理有限公司

成立日期：2003 年 9 月 30 日

住所：上海市黄浦区金陵东路 368 号

办公地址：上海市浦东新区芳甸路 1155 号浦东嘉里城办公楼 28-30 楼

法定代表人：杨华辉

联系人：何佳怡

联系电话：021-20398990

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 2024 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 67 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，中共党员，经济学博士，高级经济师。历任福建省税务局南平分局科员，兴业银行上海证券业务部负责人，兴业证券上海业务部经理，兴业银行上海分行党委委员、副行长，兴业银行杭州分行党委书记、行长，兴业国际信托有限公司党委书记、董事长等职务。现任兴业证券股份有限公司党委书记、董事长，兼任兴证全球基金管理有限公司董事长及法定代表人，十四届上海市政协委员、常委、经济和金融委员会副主任，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、财务负责人，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、财务负责人，兼任上海市第十六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。

赵思思女士，董事，1985 年生，中共党员，工商管理硕士。历任兴业证券西安东一路营业部客户经理，兴业证券理财服务中心销售服务，兴业证券西安朱雀大街营业部客服部经理、财富管理一部副总经理，兴业证券陕西分公司总经理，兴业证券上海分公司总经理等职务。现任兴业证券股份有限公司财富管理部总经理，兼任兴证期货有限公司董事。

巴斯·尼尔文先生（Bas NieuweWeme），董事，1972 年生，荷兰国籍，法学硕士。历任 ING 投资管理公司（美洲）管理委员会成员（纽约、亚特兰大、

哈特福德）、机构销售和客户服务主管，沃亚金融投资管理公司（纽约）管理委员会成员兼客户组全球主管，保德信金融公司全球投资管理客户组和机构关系组全球主管等职务。现任荷兰全球人寿保险集团管理委员会成员，全球人寿资产管理控股有限公司董事、全球行政总裁，兼任法国邮政银行资产管理公司监事会成员，荷兰美国基金会（NAF）董事会成员，美国关怀（AmeriCares）领导委员会成员，欧洲多元化项目咨询委员会委员。

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

曾建良先生（TSANG Kin Leung），董事，1978年生，中国香港，金融硕士。历任南方东英资产管理有限公司合规部合规主管，信誉金融集团有限公司综合发展部顾问（资产管理），博时基金（国际）有限公司风险、法律及合规主管等职务。现任全球人寿资产管理（亚洲）有限公司董事、香港区主管，兼任荷全私募基金管理（上海）有限公司董事长。

陆雄文先生，独立董事，1966年生，中共党员，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，兼任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，中共党员，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。

孙小宁女士，独立董事，1969年生，工商管理硕士。历任中国人民银行国际司高级项目官员，麦肯锡公司高级项目经理，国际金融公司高级投资官员，新加坡政府投资公司高级副总裁、北亚直接投资联席主管、私募股权直接投资

中国区负责人等职务。现任新加坡政府投资公司全球领导人成员、董事总经理、私募股权中国区负责人、北京办公室总经理，新加坡政府投资咨询（北京）有限公司法定代表人，兼任 TrustGo Mobile, Inc. 董事，泰康保险集团股份有限公司董事。

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

戴明仁先生（Damiaan Frans Rudolf Jacobovits de Szeged），监事，1970 年生，荷兰和瑞士双国籍，金融学硕士。历任摩根大通债券资本市场部副总裁，全球人寿保险集团集团业务发展执行副总裁兼负责人、管理委员会成员，全美人寿保险亚洲公司执行委员会成员，全美人寿百慕大公司首席执行官、亚洲执行委员会成员，全球人寿保险集团集团业务发展执行副总裁，全球人寿保险欧洲大陆公司首席财务官、欧洲大陆区执行委员会成员，全球人寿保险国际公司首席运营官、执行委员会成员等职务。现任全球人寿资产管理控股有限公司首席财务和转型官、董事，兼任同方全球人寿保险有限公司董事，全球人寿保险公司中心总顾问，毛里求斯基金会之友主席，全球人寿投资管理有限公司常务董事、行政总裁。

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，中共党员，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审计部总监兼合规管理部副总监（主持工作）、纪委办公室副主任（主持工作），兼任兴证全球资本管理（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、财务负责人。（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。

陈锦泉先生，副总经理，1977年生，中共党员，工商管理硕士。历任华安证券股份有限公司证券投资总部投资经理，平安保险资产运营中心高级组合经理，平安资产管理公司投资管理部副总经理，兴证全球基金管理有限公司兴全绿色投资混合型证券投资基金（LOF）基金经理、专户投资部总监、总经理助理等职务。现任兴证全球基金管理有限公司副总经理兼专户投资部总监、固定收益部总监、基础设施投资部总监、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、基金管理部总监、投资总监。现任兴证全球基金管理有限公司副总经理兼研究部总监、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、

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，中共党员，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

虞淼，硕士研究生。历任兴业证券股份有限公司研究员，兴证全球基金管理有限公司研究员、专户投资经理、兴全合宜灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理、兴全汇享一年持有期混合型证券投资基金基金经理。现任兴全可转债混合型证券投资基金基金经理（2019年1月16日起至今）、兴证全球兴益债券型证券投资基金基金经理（2022年8月11日起至今）。

本基金历任基金经理：

王晓明先生，于2004年09月29日至2005年10月31日期间，曾管理本基金。

杜昌勇先生，于2004年05月11日至2007年02月06日期间，曾管理本基金。

杨云先生，于2007年02月06日至2015年08月25日期间，曾管理本基金。

陈宇女士，于2015年08月25日至2017年11月09日期间，曾管理本基金。

张亚辉女士，于2015年07月13日至2019年02月21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。基金管理人公募投资决策委员会成员由以下人员组成：

庄园芳 兴证全球基金管理有限公司副董事长、总经理

谢治宇 兴证全球基金管理有限公司副总经理兼研究部总监、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

乔迁 兴证全球基金管理有限公司基金管理部总监、投资总监兼兴全商业模式优选混合型证券投资基金基金经理、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、兴全合丰三年持有期混合型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、国际业务部副总监兼兴全合泰混合型证券投资基金基金经理、兴证全球合衡三年持有期混合型证券投资基金基金经理

**上述人员之间不存在近亲属关系。**

### **（三）基金管理人的职责**

1、依法募集基金，或者委托经国务院证券监督管理机构认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；

2、办理基金备案手续；

3、对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账，进行证券投资；

4、按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；

5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

6、编制季度报告、中期报告和年度报告；

7、计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购、赎回价格；

8、办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；

9、召集基金份额持有人大会；

10、保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；

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

12、中国证监会规定的其它职责。

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

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

（7）从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；

（8）依照法律、行政法规有关规定，由国务院证券监督管理机构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有关法律、法规、规章及行业规范，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、对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) 依照有关法律、法规、规章和基金合同的规定，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和授权，确保监察稽核工作是独立的，并得到高管人员的支持，同时置备操作手册，并定期更新；

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

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

少风险；

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

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

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

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

#### 6、基金管理人关于内部合规控制声明书

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



## 四、基金托管人

### （一）基金托管人基本情况

名称：中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

成立时间：1984 年 1 月 1 日

法定代表人：廖林

注册资本：人民币 35,640,625.7089 万元

联系电话：010-66105799

联系人：郭明

### （二）主要人员情况

截至 2024 年 3 月，中国工商银行资产托管部共有员工 210 人，平均年龄 38 岁，99%以上员工拥有大学本科以上学历，高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

### （三）基金托管业务经营情况

作为中国大陆托管服务的先行者，中国工商银行自 1998 年在国内首家提供托管服务以来，秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨，依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队，严格履行资产托管人职责，为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务，展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、基本养老保险、企业年金基金、QFI 资产、QDII 资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII 专户资产、ESCROW 等门类齐全的托管产品体系，同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至 2023 年 12 月，中国工商银行共托管证券投资基金 1404 只。自 2003 年以来，本行连续二十一年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的 97 项

最佳托管银行大奖；是获得奖项最多的国内托管银行，优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

#### （四）基金托管人的内部控制制度

中国工商银行资产托管部自成立以来，各项业务飞速发展，始终保持在资产托管行业的优势地位。这些成绩的取得，是与资产托管部“一手抓业务拓展，一手抓内控建设”的做法是分不开的。资产托管部非常重视改进和加强内部风险管理工作，在积极拓展各项托管业务的同时，把加强风险防范和控制的力度，精心培育内控文化，完善风险控制机制，强化业务项目全过程风险管理作为重要工作来做。从 2005 年至今共十七次顺利通过评估组织内部控制和安全措施最权威的 ISAE3402 审阅，全部获得无保留意见的控制及有效性报告。充分表明独立第三方对我行托管服务在风险管理、内部控制方面的健全性和有效性的全面认可，也证明中国工商银行托管服务的风险控制能力已经与国际大型托管银行接轨，达到国际先进水平。目前，ISAE3402 审阅已经成为年度化、常规化的内控工作手段。”

##### 1、内部风险控制目标

保证业务运作严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，强化和建立守法经营、规范运作的经营思想和经营风格，形成一个运作规范化、管理科学化、监控制度化的内控体系；防范和化解经营风险，保证托管资产的安全完整；维护持有人的权益；保障资产托管业务安全、有效、稳健运行。

##### 2、内部风险控制组织结构

中国工商银行资产托管业务内部风险控制组织结构由中国工商银行稽核监察部门（内控合规部、内部审计局）、资产托管部内设风险控制处及资产托管部各业务处室共同组成。总行稽核监察部门负责制定全行风险管理政策，对各业务部门风险控制工作进行指导、监督。资产托管部内部设置专门负责稽核监察工作的内部风险控制处，配备专职稽核监察人员，在总经理的直接领导下，依照有关法律规章，对业务的运行独立行使稽核监察职权。各业务处室在各自职责范围内实施具体的风险控制措施。

##### 3、内部风险控制原则

（1）合法性原则。内控制度应当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的始终。

（2）完整性原则。托管业务的各项经营管理活动都必须有相应的规范程序和监督制约；监督制约应渗透到托管业务的全过程和各个操作环节，覆盖所有的部门、岗位和人员。

（3）及时性原则。托管业务经营活动必须在发生时能准确及时地记录；按照“内控优先”的原则，新设机构或新增业务品种时，必须做到已建立相关的规章制度。

（4）审慎性原则。各项业务经营活动必须防范风险，审慎经营，保证基金资产和其他委托资产的安全与完整。

（5）有效性原则。内控制度应根据国家政策、法律及经营管理的需要适时修改完善，并保证得到全面落实执行，不得有任何空间、时限及人员的例外。

（6）独立性原则。设立专门履行托管人职责的管理部门；直接操作人员和控制人员必须相对独立，适当分离；内控制度的检查、评价部门必须独立于内控制度的制定和执行部门。

#### 4、内部风险控制措施实施

（1）严格的隔离制度。资产托管业务与传统业务实行严格分离，建立了明确的岗位职责、科学的业务流程、详细的操作手册、严格的人员行为规范等一系列规章制度，并采取了良好的防火墙隔离制度，能够确保资产独立、环境独立、人员独立、业务制度和管理独立、网络独立。

（2）高层检查。主管行领导与部门高级管理层作为工行托管业务政策和策略的制定者和管理者，要求下级部门及时报告经营管理情况和特别情况，以检查资产托管部在实现内部控制目标方面的进展，并根据检查情况提出内部控制措施，督促职能管理部门改进。

（3）人事控制。资产托管部严格落实岗位责任制，建立“自控防线”、“互控防线”、“监控防线”三道控制防线，健全绩效考核和激励机制，树立“以人为本”的内控文化，增强员工的责任心和荣誉感，培育团队精神和核心

竞争力。并通过进行定期、定向的业务与职业道德培训、签订承诺书，使员工树立风险防范与控制理念。

（4）经营控制。资产托管部通过制定计划、编制预算等方法开展各种业务营销活动、处理各项事务，从而有效地控制和配置组织资源，达到资源利用和效益最大化目的。

（5）内部风险管理。资产托管部通过稽核监察、风险评估等方式加强内部风险管理，定期或不定期地对业务运作状况进行检查、监控，指导业务部门进行风险识别、评估，制定并实施风险控制措施，排查风险隐患。

（6）数据安全控制。我们通过业务操作区相对独立、数据和传真加密、数据传输线路的冗余备份、监控设施的运用和保障等措施来保障数据安全。

（7）应急准备与响应。资产托管业务建立专门的灾难恢复中心，制定了基于数据、应用、操作、环境四个层面的完备的灾难恢复方案，并组织员工定期演练。为使演练更加接近实战，资产托管部不断提高演练标准，从最初的按照预订时间演练发展到现在的“随机演练”。从演练结果看，资产托管部完全有能力在发生灾难的情况下两个小时内恢复业务。

## 5、资产托管部内部风险控制情况

（1）资产托管部内部设置专职稽核监察部门，配备专职稽核监察人员，在总经理的直接领导下，依照有关法律规章，全面贯彻落实全程监控思想，确保资产托管业务健康、稳定地发展。

（2）完善组织结构，实施全员风险管理。完善的风险管理体系需要从上至下每个员工的共同参与，只有这样，风险控制制度和措施才会全面、有效。资产托管部实施全员风险管理，将风险控制责任落实到具体业务部门和业务岗位，每位员工对自己岗位职责范围内的风险负责，通过建立纵向双人制、横向多部门制的内部组织结构，形成不同部门、不同岗位相互制衡的组织结构。

（3）建立健全规章制度。资产托管部十分重视内控制度的建设，一贯坚持把风险防范和控制的理念和方法融入岗位职责、制度建设和工作流程中。经过多年努力，资产托管部已经建立了一整套内部风险控制制度，包括：岗位职责、业务操作流程、稽核监察制度、信息披露制度等，覆盖所有部门和岗位，渗透

各项业务过程，形成各个业务环节之间的相互制约机制。

（4）内部风险控制始终是托管部工作重点之一，保持与业务发展同等地位。资产托管业务是商业银行新兴的中间业务，资产托管部从成立之日起就特别强调规范运作，一直将建立一个系统、高效的风险防范和控制体系作为工作重点。随着市场环境的变化和托管业务的快速发展，新问题、新情况不断出现，资产托管部始终将风险管理放在与业务发展同等重要的位置，视风险防范和控制为托管业务生存和发展的生命线。

#### （五）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

根据《基金法》、基金合同、托管协议和有关基金法规的规定，基金托管人对基金的投资范围和投资对象、基金投融资比例、基金投资禁止行为、基金参与银行间债券市场、基金资产净值的计算、基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等进行监督和核查，其中对基金的投资比例的监督和核查自基金合同生效之后六个月开始。

基金托管人发现基金管理人违反《基金法》、基金合同、基金托管协议或有关基金法律法规规定的行为，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应及时核对，并以书面形式对基金托管人发出回函确认。在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人存在重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正。

## 五、相关服务机构

### （一）基金发售机构

#### 1. 直销机构

（1）名称：兴证全球基金网上直销平台（含微网站、APP）

地址：上海浦东新区锦康路 308 号陆家嘴世纪金融广场 6 号楼 13 层

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. 代销机构（排名不分先后）

（1）名称：中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

法定代表人：陈四清

网址：<http://www.icbc.com.cn/>

客服电话：95588

（2）名称：中国农业银行股份有限公司

注册地址：中国北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址：中国北京市东城区建国门内大街 69 号

法定代表人：谷澍

网址：<http://www.abchina.com/>

客服电话：95599

（3）名称：中国银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号

办公地址：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

法定代表人：刘连舸

网址：<https://www.boc.cn/>

客服电话：95566

(4) 名称：中国建设银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区金融大街 25 号, 香港中环干诺道中 3 号中国建设银行大厦 28 楼

法定代表人：田国立

网址：<http://www.ccb.com/>

客服电话：95533

(5) 名称：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, 香港中环毕打街 20 号

法定代表人：任德奇

网址：<http://www.bankcomm.com/>

客服电话：95559

(6) 名称：招商银行股份有限公司

注册地址：中国广东省深圳市福田区深南大道 7088 号

办公地址：中国广东省深圳市福田区深南大道 7088 号

法定代表人：缪建民

网址：<http://www.cmbchina.com/>

客服电话：95555

(7) 名称：中信银行股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区光华路 10 号院 1 号楼 6-30 层、32-42 层

办公地址：北京市朝阳区光华路 10 号院 1 号楼 6-30 层、32-42 层

法定代表人：朱鹤新

网址：<http://www.citicbank.com/>

客服电话：95558

(8) 名称：上海浦东发展银行股份有限公司

注册地址：上海市中山东一路 12 号

办公地址：上海市中山东一路 12 号

法定代表人：郑杨

网址：<https://www.spdb.com.cn/>

客服电话：95528

（9）名称：兴业银行股份有限公司

注册地址：福建省福州市台江区江滨中大道 398 号兴业银行大厦

办公地址：福建省福州市台江区江滨中大道 398 号兴业银行大厦

法定代表人：吕家进

网址：<https://www.cib.com.cn/>

客服电话：95561

（10）名称：中国光大银行股份有限公司

注册地址：中国北京市西城区太平桥大街 25 号、甲 25 号中国光大中心

办公地址：北京市西城区太平桥大街 25 号中国光大中心, 香港湾仔告士打道 108 号光大中心 23 楼

法定代表人：李晓鹏

网址：<http://www.cebbank.com/>

客服电话：95595

（11）名称：中国民生银行股份有限公司

注册地址：中国北京市西城区复兴门内大街 2 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号民生银行大厦

法定代表人：高迎欣

网址：<http://www.cmbc.com.cn/>

客服电话：95568

（12）名称：中国邮政储蓄银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 3 号

办公地址：北京市西城区金融大街 3 号

法定代表人：张金良

网址：<http://www.psbc.com/cn/>

客服电话：95580

（13）名称：华夏银行股份有限公司



注册地址：北京市东城区建国门内大街 22 号

办公地址：北京市东城区建国门内大街 22 号华夏银行大厦

法定代表人：李民吉

网址：<https://www.hxb.com.cn/>

客服电话：95577

（14）名称：上海银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路 168 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 168 号

法定代表人：金煜

网址：<http://www.bosc.cn/>

客服电话：95594

（15）名称：江苏江南农村商业银行股份有限公司

注册地址：常州市武进区延政中路 9 号

办公地址：常州市武进区延政中路 9 号

法定代表人：陆向阳

网址：<http://www.jnbank.com.cn/>

客服电话：(0519)96005

（16）名称：江苏昆山农村商业银行股份有限公司

注册地址：江苏省昆山市前进东路 828 号

办公地址：江苏省昆山市前进东路 828 号

法定代表人：谢铁军

网址：<http://www.ksrcb.com/>

客服电话：0512-96079

（17）名称：广州农村商业银行股份有限公司

注册地址：广东省广州市黄埔区映日路 9 号

办公地址：广东省广州市黄埔区映日路 9 号

法定代表人：蔡建

网址：<http://www.grcbank.com/>

客服电话：95313

（18）名称：平安银行股份有限公司

注册地址：广东省深圳市罗湖区深南东路 5047 号

办公地址：广东省深圳市罗湖区深南东路 5047 号, 中国广东省深圳市福田区益田路 5023 号平安金融中心 B 座

法定代表人：谢永林

网址：<http://bank.pingan.com/>

客服电话：95511

(19) 名称：宁波银行股份有限公司

注册地址：浙江省宁波市鄞州区宁东路 345 号

办公地址：浙江省宁波市鄞州区宁东路 345 号

法定代表人：陆华裕

网址：<http://www.nbcb.cn/>

客服电话：95574

(20) 名称：江苏银行股份有限公司

注册地址：江苏省南京市秦淮区中华路 26 号

办公地址：江苏省南京市秦淮区中华路 26 号

法定代表人：夏平

网址：<http://www.jsbchina.cn/>

客服电话：95319

(21) 名称：渤海银行股份有限公司

注册地址：中国天津市河东区海河东路 218 号

办公地址：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

法定代表人：李伏安

网址：<http://www.cbhb.com.cn/>

客服电话：95541

(22) 名称：重庆银行股份有限公司

注册地址：重庆市江北区永平门街 6 号

办公地址：重庆市江北区永平门街 6 号

法定代表人：林军

网址：<http://www.cqcbank.com/>

客服电话：956023

(23) 名称：广发银行股份有限公司

注册地址：广州市越秀区东风东路 713 号

办公地址：广州市越秀区东风东路 713 号

法定代表人：王凯

网址：<http://www.cgbchina.com.cn/>

客服电话：95508

(24) 名称：东北证券股份有限公司

注册地址：吉林省长春市南关区生态大街 6666 号

办公地址：吉林省长春市南关区生态大街 6666 号

法定代表人：李福春

网址：[www.nesc.cn](http://www.nesc.cn)

客服电话：86-431-85096806

(25) 名称：南京证券股份有限公司

注册地址：南京市江东中路 389 号

办公地址：南京市江东中路 389 号

法定代表人：李剑锋

网址：<https://www.njzq.com.cn/>

客服电话：95386

(26) 名称：国联证券股份有限公司

注册地址：江苏省无锡市滨湖区金融一街 8 号

办公地址：无锡市滨湖区金融一街 8 号国联金融大厦

法定代表人：葛小波

网址：<http://www.glsc.com.cn/>

客服电话：95570

(27) 名称：平安证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区福田街道益田路 5023 号平安金融中心 B 座第 22-25 层

办公地址：深圳市福田区福田街道益田路 5023 号平安金融中心 B 座第 22-25 层

法定代表人：何之江

网址：<http://www.stock.pingan.com/>

客服电话：021-38635562, 86-755-22627723

(28) 名称：华安证券股份有限公司

注册地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号

办公地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号

法定代表人：章宏韬

网址：<http://www.hazq.com/>

客服电话：95318

(29) 名称：国海证券股份有限公司

注册地址：广西壮族自治区桂林市七星区辅星路 13 号

办公地址：广西壮族自治区南宁市青秀区滨湖路 46 号国海大厦

法定代表人：何春梅

网址：[www.ghzq.com.cn](http://www.ghzq.com.cn)

客服电话：86-771-5532512

(30) 名称：东莞证券股份有限公司

注册地址：东莞市莞城区可园南路一号

办公地址：东莞市莞城区可园南路一号

法定代表人：陈照星

网址：[www.dgzq.com.cn](http://www.dgzq.com.cn)

客服电话：95328

(31) 名称：中原证券股份有限公司

注册地址：河南省郑州市郑东新区商务外环路 10 号

办公地址：河南省郑州市郑东新区商务外环路 10 号

法定代表人：菅明军

网址：<https://wt.ccnew.com/>

客服电话：95377

(32) 名称：国都证券股份有限公司

注册地址：北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层

办公地址：北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层

法定代表人：翁振杰

网址：[www.guodu.com](http://www.guodu.com)

客服电话：86-10-84183203

（33）名称：东海证券股份有限公司

注册地址：江苏省常州市延陵西路 23 号投资广场 18 层

办公地址：上海市浦东新区东方路 1928 号东海证券大厦

法定代表人：王文卓

网址：[www.longone.com.cn](http://www.longone.com.cn)

客服电话：95531

（34）名称：中银国际证券股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 39 层

办公地址：上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 39 层

法定代表人：宁敏

网址：[www.bocichina.com](http://www.bocichina.com)

客服电话：400-620-8888

（35）名称：恒泰证券股份有限公司

注册地址：内蒙古自治区呼和浩特市新城区海拉尔东街满世尚都办公商业综合楼

办公地址：内蒙古自治区呼和浩特市新城区海拉尔东街满世尚都办公商业综合楼

法定代表人：祝艳辉

网址：<http://m.cnht.com.cn/>

客服电话：956088

（36）名称：东方证券股份有限公司

注册地址：上海市黄浦区中山南路 119 号东方证券大厦

办公地址：上海市黄浦区中山南路 119 号东方证券大厦, 中国上海市黄浦区中山南路 318 号 2 号楼 3-6 层、12 层、13 层、22 层、25-27 层、29 层、32 层、36 层、38 层

法定代表人：金文忠

网址：[www.dfzq.com.cn](http://www.dfzq.com.cn)

客服电话：95503

（37）名称：方正证券股份有限公司

注册地址：湖南省长沙市天心区湘江中路二段 36 号华远华中心 4、5 号楼  
3701-3717

办公地址：湖南省长沙市天心区湘江中路二段 36 号华远华中心 4、5 号楼  
3701-3717

法定代表人：施华

网址：[www.foundersc.com](http://www.foundersc.com)

客服电话：95571

（38）名称：长城证券股份有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区福田街道金田路 2026 号能源大厦南塔楼  
10-19 层

办公地址：广东省深圳市福田区福田街道金田路 2026 号能源大厦南塔楼  
10-19 层

法定代表人：张巍

网址：[www.cgws.com](http://www.cgws.com)

客服电话：95514

（39）名称：光大证券股份有限公司

注册地址：上海市静安区新闻路 1508 号

办公地址：上海市静安区新闻路 1508 号

法定代表人：刘秋明

网址：[www.ebscn.com](http://www.ebscn.com)

客服电话：95525

（40）名称：中信证券华南股份有限公司

注册地址：广州市天河区临江大道 395 号 901 室(部位:自编 01), 1001 室

办公地址：广州市天河区珠江西路 5 号 501 房

法定代表人：陈可可

网址：<http://www.gzs.com.cn/>

客服电话：95548

（41）名称：国信证券股份有限公司

注册地址：广东省深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层

办公地址：深圳市福田区福华一路 125 号国信金融大厦

法定代表人：张纳沙

网址：[www.guosen.com.cn](http://www.guosen.com.cn)

客服电话：95536

（42）名称：招商证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区福田街道福华一路 111 号

办公地址：深圳市福田区福田街道福华一路 111 号

法定代表人：霍达

网址：<http://www.cmschina.com/>

客服电话：95565

（43）名称：广发证券股份有限公司

注册地址：广东省广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街 2 号 618 室

办公地址：广东省广州市天河区马场路 26 号广发证券大厦

法定代表人：林传辉

网址：<http://www.gf.com.cn/>

客服电话：95575

（44）名称：中信证券股份有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场(二期)北座

办公地址：广东省深圳市福田区中心三路 8 号中信证券大厦, 北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦

法定代表人：张佑君

网址：[www.citics.com](http://www.citics.com)

客服电话：95548

（45）名称：中国银河证券股份有限公司

注册地址：北京市丰台区西营街 8 号院 1 号楼 7 至 18 层 101

办公地址：北京市丰台区西营街 8 号院 1 号楼青海金融大厦

法定代表人：王晟

网址：[www.chinastock.com.cn/](http://www.chinastock.com.cn/)

客服电话：4008-888-888、95551

(46) 名称：海通证券股份有限公司

注册地址：上海市黄浦区广东路 689 号

办公地址：上海市黄浦区广东路 689 号

法定代表人：周杰

网址：[www.htsec.com](http://www.htsec.com)

客服电话：95553

(47) 名称：华泰联合证券有限责任公司

注册地址：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

办公地址：深圳市福田区深南大道 4011 号中国港中旅大厦 26 楼

法定代表人：江禹

网址：<http://www.lhzq.com/>

客服电话：0755-82492010

(48) 名称：华宝证券股份有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区浦电路 370 号 2、3、4 层

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区浦电路 370 号 2、3、4 层

法定代表人：刘加海

网址：<https://www.cnhbstock.com/>

客服电话：4008209898

(49) 名称：爱建证券有限责任公司

注册地址：中国(上海)自由贸易试验区世纪大道 1600 号 1 幢 32 楼

办公地址：中国(上海)自由贸易试验区世纪大道 1600 号 1 幢 32 楼

法定代表人：祝健

网址：<https://www.ajzq.com/>

客服电话：4001-962-502

(50) 名称：国新证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区车公庄大街 4 号 2 幢 1 层 A2112 室

办公地址：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

法定代表人：张海文



网址：[www.crsec.com.cn](http://www.crsec.com.cn)

客服电话：95390

(51) 名称：财达证券股份有限公司

注册地址：石家庄市自强路 35 号

办公地址：石家庄市自强路 35 号

法定代表人：翟建强

网址：<http://www.s10000.com/>

客服电话：95363

(52) 名称：申万宏源证券有限公司

注册地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

办公地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

法定代表人：杨玉成

网址：[www.swhysc.com](http://www.swhysc.com)

客服电话：95523

(53) 名称：华金证券股份有限公司

注册地址：上海市静安区天目西路 128 号 19 层 1902 室

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 759 号 30 层

法定代表人：燕文波

网址：<https://www.huajinsc.cn/>

客服电话：956011

(54) 名称：兴业证券股份有限公司

注册地址：福州市湖东路 268 号

办公地址：长柳路 36 号 7 层 701 室

法定代表人：杨华辉

网址：<http://www.xyzq.com.cn>

客服电话：95562

(55) 名称：长江证券股份有限公司

注册地址：湖北省武汉市江汉区淮海路 88 号

办公地址：湖北省武汉市江汉区新华路特 8 号

法定代表人：金才玖

网址：<http://www.95579.com/>

客服电话：95579

(56) 名称：国投证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区福田街道福华一路 119 号安信金融大厦

办公地址：深圳市福田区福田街道福华一路 119 号安信金融大厦

法定代表人：段文务

网址：<http://www.essence.com.cn/>

客服电话：95517

(57) 名称：金通证券有限责任公司

注册地址：浙江省杭州市滨江区东信大道 66 号 5 幢 D 座 A 区 3 层

办公地址：浙江省杭州市滨江区东信大道 66 号 5 幢 D 座 A 区 3 层

法定代表人：李勇进区 3 层

网址：<http://www.cs.ecitic.com/xjt/index.html>

客服电话：95548

(58) 名称：湘财证券股份有限公司

注册地址：长沙市天心区湘府中路 198 号新南城商务中心 A 栋 11 楼

办公地址：长沙市天心区湘府中路 198 号新南城商务中心 A 栋 11 楼

法定代表人：高振营

网址：<https://www.xcsc.com/>

客服电话：95351

(59) 名称：民生证券股份有限公司

注册地址：中国(上海)自由贸易试验区浦明路 8 号

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 1168 号 B 座 2101、  
2104A 室

法定代表人：冯鹤年

网址：<https://www.msza.com/>

客服电话：95376

(60) 名称：国元证券股份有限公司

注册地址：安徽省合肥市蜀山区梅山路 18 号

办公地址：安徽省合肥市蜀山区梅山路 18 号

法定代表人：沈和付

网址：[www.gyzq.com.cn](http://www.gyzq.com.cn)

客服电话：95578

（61）名称：渤海证券股份有限公司

注册地址：天津经济技术开发区第二大街 42 号写字楼 101 室

办公地址：天津市南开区水上公园东路东侧宁汇大厦 A 座

法定代表人：安志勇

网址：<http://www.ewww.com.cn/>

客服电话：956066

（62）名称：华泰证券股份有限公司

注册地址：江苏省南京市建邺区江东中路 228 号

办公地址：江苏省南京市建邺区江东中路 228 号

法定代表人：张伟

网址：[www.htsc.com.cn](http://www.htsc.com.cn)

客服电话：95597

（63）名称：山西证券股份有限公司

注册地址：山西省太原市杏花岭区府西街 69 号山西国际贸易中心东塔楼

办公地址：山西省太原市杏花岭区府西街 69 号山西国际贸易中心东塔楼

法定代表人：王怡里

网址：[www.sxzq.com](http://www.sxzq.com)

客服电话：95573

（64）名称：中信证券（山东）有限责任公司

注册地址：青岛市崂山区深圳路 222 号 1 号楼 2001

办公地址：青岛市市南区东海西路 28 号龙翔广场东座 5 层

法定代表人：肖海峰

网址：<http://sd.citics.com/>

客服电话：95548

（65）名称：东兴证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 5 号(新盛大厦)12、15 层

办公地址：北京市西城区金融大街 5 号(新盛大厦)6、10、12、15、16 层

法定代表人：李娟

网址：[www.dxzq.net](http://www.dxzq.net)

客服电话：95309

（66）名称：东吴证券股份有限公司

注册地址：江苏省苏州市吴中区工业园区星阳街 5 号

办公地址：江苏省苏州市吴中区工业园区星阳街 5 号

法定代表人：范力

网址：<http://www.dwzq.com.cn/>

客服电话：95330

（67）名称：信达证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

办公地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

法定代表人：祝瑞敏

网址：<https://www.cindasc.com/>

客服电话：95321

（68）名称：粤开证券股份有限公司

注册地址：广州市黄埔区科学大道 60 号开发区控股中心 19、22、23 层

办公地址：广州市黄埔区科学大道 60 号开发区控股中心 19、22、23 层

法定代表人：严亦斌

网址：<http://www.ykzq.com/>

客服电话：95564

（69）名称：华源证券股份有限公司

注册地址：西宁市南川工业园区创业路 108 号

办公地址：北京市朝阳区安立路 30 号仰山公园东一门 2 号楼

法定代表人：邓晖

网址：<http://www.jzsec.com/>

客服电话：95305

（70）名称：国泰君安证券股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区自由贸易试验区商城路 618 号

办公地址：上海市静安区南京西路 768 号

法定代表人：贺青

网址：<https://www.gtja.com/>

客服电话：95521

（71）名称：国金证券股份有限公司

注册地址：四川省成都市青羊区东城根上街 95 号

办公地址：四川省成都市青羊区东城根上街 95 号成证大厦 16 楼

法定代表人：冉云

网址：<https://www.gjqz.com.cn>

客服电话：95310

（72）名称：中信建投证券股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

法定代表人：王常青

网址：<https://www.csc108.com/>

客服电话：4008888108

（73）名称：中泰证券股份有限公司

注册地址：济南市市中区经七路 86 号

办公地址：济南市市中区经七路 86 号

法定代表人：王洪

网址：<https://www.zts.com.cn/>

客服电话：95538

（74）名称：中航证券有限公司

注册地址：江西省南昌市红谷滩新区红谷中大道 1619 号南昌国际金融大厦  
A 栋 41 层

办公地址：江西省南昌市红谷滩新区红谷中大道 1619 号南昌国际金融大厦  
A 栋 41 层

法定代表人：戚侠

网址：<https://www.avicsec.com/>

客服电话：95335

（75）名称：德邦证券股份有限公司

注册地址：上海市普陀区曹杨路 510 号南半幢 9 楼

办公地址：上海市浦东新区福山路 500 号城建国际中心 29 楼

法定代表人：武晓春

网址：<https://www.tebon.com.cn/>

客服电话：400-8888-128

（76）名称：西部证券股份有限公司

注册地址：陕西省西安市新城东大街 319 号 8 幢 10000 室

办公地址：陕西省西安市新城东大街 319 号 8 幢 10000 室

法定代表人：徐朝晖

网址：<http://www.west95582.com/>

客服电话：95582

（77）名称：华福证券有限责任公司

注册地址：福建省福州市鼓楼区鼓屏路 27 号 1#楼 3 层、4 层、5 层

办公地址：上海市浦东新区滨江大道 5129 号陆家嘴滨江中心 N1 座

法定代表人：苏军良

网址：<https://www.hfzq.com.cn/>

客服电话：95547

（78）名称：中国国际金融股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层

办公地址：北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层

法定代表人：沈如军

网址：<https://www.cicc.com/>

客服电话：(+86-10) 6505 1166

（79）名称：财通证券股份有限公司

注册地址：浙江省杭州市西湖区天目山路 198 号财通双冠大厦西楼

办公地址：浙江省杭州市西湖区天目山路 198 号财通双冠大厦西楼

法定代表人：章启诚

网址：[www.ctsec.com](http://www.ctsec.com)

客服电话：95336

（80）名称：上海华信证券有限责任公司

注册地址：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

办公地址：上海市黄浦区南京西路 399 号 23F

法定代表人：陈灿辉

网址：<http://shhxzq.com/>

客服电话：400-820-5999

(81) 名称：华鑫证券有限责任公司

注册地址：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

办公地址：上海市浦东新区金海路 1000 号

法定代表人：俞洋

网址：<http://www.cfsc.com.cn/>

客服电话：400-109-9918

(82) 名称：中国中金财富证券有限公司

注册地址：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

办公地址：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心 A 栋第 18-21 层及第 04 层 01.02.03.05.11.12.13.15.16.18.19.20.21.22.23 单元

法定代表人：高涛

网址：<https://www.ciccwm.com/>

客服电话：95532

(83) 名称：东方财富证券股份有限公司

注册地址：西藏自治区拉萨市柳梧新区国际总部城 10 栋楼

办公地址：上海市徐汇区宛平南路 88 号金座东方财富大厦

法定代表人：戴彦

网址：[www.18.cn](http://www.18.cn)

客服电话：95357

(84) 名称：国盛证券有限责任公司

注册地址：江西省南昌市新建区子实路 1589 号

办公地址：江西省南昌市红谷滩新区凤凰中大道 1115 号北京银行营业大楼 16 层

法定代表人：徐丽峰

网址：<https://www.gszq.com/>

客服电话：956080

（85）名称：华西证券股份有限公司

注册地址：四川省成都市高新区天府二街 198 号

办公地址：四川省成都市高新区天府二街 198 号

法定代表人：杨炯洋

网址：<http://www.hx168.com.cn/>

客服电话：95584

（86）名称：申万宏源西部证券有限公司

注册地址：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

办公地址：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

法定代表人：王献军

网址：[www.swhysc.com/](http://www.swhysc.com/)

客服电话：95523

（87）名称：泰信财富基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区建国路乙 118 号 10 层 1206

办公地址：北京市朝阳区建国路乙 118 号 10 层 1206

法定代表人：彭浩

网址：[www.taixincf.com](http://www.taixincf.com)

客服电话：400-004-8821

（88）名称：上海基煜基金销售有限公司

注册地址：上海市黄浦区广东路 500 号 30 层 3001 单元

办公地址：上海市浦东新区银城中路 488 号太平金融大厦 1503 室

法定代表人：王翔

网址：[www.jiyufund.com.cn](http://www.jiyufund.com.cn)

客服电话：400-8205369

（89）名称：天相投资顾问有限公司



注册地址：北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座

办公地址：北京市西城区新街口外大街 28 号 C 座 505

法定代表人：林义相

网址：[http:// www.txsec.com](http://www.txsec.com)

客服电话：（010）66045678

（90）名称：和讯信息科技有限公司

注册地址：北京市朝阳区朝外大街 22 号 1002 室

办公地址：北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦 10 层

法定代表人：章知方

网址：<http://licaike.hexun.com>

客服电话：4009200022

（91）名称：玄元保险代理有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区张杨路 707 号 1105 室

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区张杨路 707 号 1105 室

法定代表人：马永谱

网址：[www.licaimofang.com](http://www.licaimofang.com)

客服电话：400-080-8208

（92）名称：阳光人寿保险股份有限公司

注册地址：海南省三亚市迎宾路 360-1 号三亚阳光金融广场 16 层

办公地址：北京市朝阳区景辉街 33 号院 1 号楼阳光金融中心

法定代表人：李科

网址：<https://fund.sinosig.com/>

客服电话：95510

（93）名称：厦门市鑫鼎盛控股有限公司

注册地址：厦门市思明区鹭江道 2 号第一广场 1501-1502 室

办公地址：厦门市思明区鹭江道 2 号第一广场 1501-1502 室

法定代表人：林劲

网址：<http://www.xds.com.cn/>

客服电话：400-6533-789

（94）名称：上海攀赢基金销售有限公司

注册地址：上海市闸北区广中西路 1207 号 306 室

办公地址：上海市陆家嘴银城中路 116 号大华银行大厦 7 楼

法定代表人：郑新林

网址：[www.pytz.cn](http://www.pytz.cn)

客服电话：021-68889082

（95）名称：上海陆金所基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区源深路 1088 号 7 层

办公地址：上海市浦东新区平安财富大厦 7 楼

法定代表人：陈祎彬

网址：<http://www.lufunds.com>

客服电话：400-821-9031

（96）名称：珠海盈米基金销售有限公司

注册地址：珠海市横琴新区环岛东路 3000 号 2719 室

办公地址：广州市海珠区阅江中路 688 号保利国际广场北塔 33 层

法定代表人：肖雯

网址：[www.yingmi.com](http://www.yingmi.com)

客服电话：020-89629066

（97）名称：上海华夏财富投资管理有限公司

注册地址：上海市虹口区东大名路 687 号 1 幢 2 楼 268 号

办公地址：北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 8 层

法定代表人：毛淮平

网址：[www.amcfortune.com](http://www.amcfortune.com)

客服电话：400-817-5666

（98）名称：北京汇成基金销售有限公司

注册地址：北京市西城区宣武门外大街甲 1 号 4 层 401-2

办公地址：西城区宣武门外大街甲 1 号环球财讯中心 D 座 4 层

法定代表人：王伟刚

网址：[www.hcfunds.com](http://www.hcfunds.com)

客服电话：400-0555-728

（99）名称：北京广源达信基金销售有限公司

注册地址：北京市西城区新街口外大街 28 号 C 座六层 605 室

办公地址：北京市顺义区北京东航中心 1 号楼 3 层 304B 室

法定代表人：齐剑辉

网址：<http://www.niuniufund.com>

客服电话：400-616-7531

（100）名称：上海大智慧基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 428 号 1 号楼 1102 单元

办公地址：中国上海市浦东新区杨高南路 428 号 1 号楼 1102 单元

法定代表人：张俊

网址：[www.wg.com.cn](http://www.wg.com.cn)

客服电话：021-20292031

（101）名称：北京新浪仓石基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期（西扩）N-1、N-2  
地块新浪总部科研楼 5 层 518 室

办公地址：北京市海淀区西北旺东路 10 号院西区 8 号楼新浪总部大厦

法定代表人：李柳娜

网址：<http://www.xincai.com>

客服电话：010-62675369

（102）名称：上海万得基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区浦明路 1500 号 8 层 M 座

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区浦明路 1500 号 8 层 M 座

法定代表人：简梦雯

网址：[www.windmoney.com.cn](http://www.windmoney.com.cn)

客服电话：400-799-1888

（103）名称：上海中欧财富基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 479 号 1008-1 室

办公地址：上海市虹口区公平路 18 号 8 栋嘉昱大厦 6 层

法定代表人：许欣

网址：<https://www.zocaifu.com/>

客服电话：400-100-2666

(104) 名称: 兴证期货有限公司

注册地址: 福州市鼓楼区温泉街道湖东路 268 号 6 层(兴业证券大厦)

办公地址: 福建省福州市鼓楼区温泉街道湖东路 268 号 6 层(兴业证券大厦)

法定代表人: 周峰

网址: <http://www.xz futures.cn/>

客服电话: 95562-5

(105) 名称: 中信期货有限公司

注册地址: 广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场(二期)北座 13 层 1301-1305、14 层

办公地址: 深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场(二期)北座 13 层 1301-1305 室、14 层

法定代表人: 竇长宏

网址: <http://www.citicsf.com/>

客服电话: 400-990-8826

(106) 名称: 京东肯特瑞基金销售有限公司

注册地址: 北京市海淀区知春路 76 号(写字楼)1 号楼 4 层 1-7-2

办公地址: 北京市通州区亦庄经济技术开发区科创十一街 18 号院京东集团总部 A 座 15 层

法定代表人: 邹保威

网址: [kenterui. jd. com](http://kenterui.jd.com)

客服电话: 95118

(107) 名称: 诺亚正行基金销售有限公司

注册地址: 上海市虹口区飞虹路 360 弄 9 号 6 层

办公地址: 上海市闵行区申滨南路 1226 号诺亚财富中心

法定代表人: 吴卫国

网址: [www.noah-fund.com](http://www.noah-fund.com)

客服电话: 400-821-5399

(108) 名称: 深圳众禄基金销售股份有限公司

注册地址: 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

办公地址：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

法定代表人：薛峰

网址：[http:// www. jjmmw. com](http://www.jjmmw.com)

客服电话：4006-788-887

（109）名称：上海天天基金销售有限公司

注册地址：上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼 2 层

办公地址：上海市徐汇区宛平南路 88 号金座东方财富大厦

法定代表人：其实

网址：[www. 1234567. com. cn](http://www.1234567.com.cn)

客服电话：95021

（110）名称：上海好买基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区东大名路 501 号 6211 单元

办公地址：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

法定代表人：陶怡

网址：[www. ehowbuy. com](http://www.ehowbuy.com)

客服电话：400-700-9665

（111）名称：蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

注册地址：浙江省杭州市余杭区五常街道文一西路 969 号 3 幢 5 层 599 室

办公地址：浙江省杭州市西湖区西溪路 556 号蚂蚁 Z 空间

法定代表人：王珺

网址：[www. fund123. cn](http://www.fund123.cn)

客服电话：4000766123

（112）名称：上海长量基金销售有限公司

注册地址：浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室

办公地址：上海市浦东新区东方路 1267 号陆家嘴金融服务广场二期 11 层

法定代表人：张跃伟

网址：[www. erichfund. com](http://www.erichfund.com)

客服电话：400-8202899

(113) 名称：浙江同花顺基金销售有限公司

注册地址：浙江省杭州市文二西路 1 号元茂大厦 903 室

办公地址：浙江省杭州市余杭区五常街道同顺街 18 号

法定代表人：吴强

网址：<http://www.5ifund.com>

客服电话：952555

(114) 名称：上海利得基金销售有限公司

注册地址：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

办公地址：上海市虹口区东大名路 1098 号浦江国际金融广场 53 层

法定代表人：李兴春

网址：<http://www.leadbank.com.cn/>

客服电话：400-032-5885

(115) 名称：江苏汇林保大基金销售有限公司

注册地址：南京市高淳区经济开发区古檀大道 47 号

办公地址：南京市鼓楼区中山北路 2 号绿地紫峰大厦 2005 室

法定代表人：吴言林

网址：[www.huilinbd.com](http://www.huilinbd.com)

客服电话：025-66046166

(116) 名称：上海挖财基金销售有限公司

注册地址：中国(上海)自由贸易试验区杨高南路 759 号 18 层 03 单元

办公地址：中国(上海)自由贸易试验区杨高南路 759 号 18 层 03 单元

法定代表人：方磊

网址：<https://wacaijijin.com/>

客服电话：021-50810673

(117) 名称：北京雪球基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区创远路 34 号院 6 号楼 15 层 1501 室

办公地址：北京市融新科技园 C 座

法定代表人：李楠

网址：<https://danjuanapp.com/>

客服电话：400-1599288

(118) 名称：嘉实财富管理有限公司

注册地址：海南省三亚市天涯区凤凰岛 1 号楼 7 层 710 号

办公地址：北京市朝阳区建国门外大街 21 号北京国际俱乐部 C 座

法定代表人：张峰

网址：<https://www.harvestwm.cn/>

客服电话：400-021-8850

(119) 名称：泛华普益基金销售有限公司

注册地址：成都市成华区建设路 9 号高地中心 1101 室

办公地址：成都市金牛区花照壁西顺街 399 号西宸国际 B 座

法定代表人：杨远芬

网址：[www.puyifund.com](http://www.puyifund.com)

客服电话：400-080-3388

(120) 名称：腾安基金销售（深圳）有限公司

注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室

办公地址：深圳市南山区海天二路 33 号腾讯滨海大厦 15 楼

法定代表人：谭广锋

网址：[www.txfund.com](http://www.txfund.com)

客服电话：95017

(121) 名称：民商基金销售（上海）有限公司

注册地址：上海市黄浦区北京东路 666 号 H 区（东座）6 楼 A31 室

办公地址：上海市浦东新区张扬路 707 号生命人寿大厦 32 楼

法定代表人：賁惠琴

网址：[www.msftec.com](http://www.msftec.com)

客服电话：021-50206003

(122) 名称：北京度小满基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区西北旺东路 10 号院西区 4 号楼 1 层 103 室

办公地址：北京市海淀区西北旺东路 10 号院西区 4 号楼 1 层 103 室

法定代表人：盛超

网址: [www.duxiaomanfund.com](http://www.duxiaomanfund.com)

客服电话: 95055

(123) 名称: 中国人寿保险股份有限公司

注册地址: 北京市西城区金融大街 16 号

办公地址: 北京市西城区金融大街 16 号

法定代表人: 白涛

网址: [www.e-chinalife.com](http://www.e-chinalife.com)

客服电话: 95515

(124) 名称: 中证金牛(北京)基金销售有限公司

注册地址: 北京市丰台区东管头 1 号 2 号楼 2-45 室

办公地址: 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

法定代表人: 吴志坚

网址: [www.jnlc.com](http://www.jnlc.com)

客服电话: 4008-909-998

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

## (二) 注册登记机构

名称: 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: 上海浦东新区锦康路 308 号陆家嘴世纪金融广场 6 号楼 13 层

法定代表人: 杨华辉

联系人: 朱瑞立

电话: (021) 20398888

传真: (021) 20398858

## (三) 出具法律意见书的律师事务所和经办律师

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：德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）

办公地址：上海市延安东路 222 号 30 楼

执行事务合伙人：付建超

电话：（021）61418888

传真：（021）63350377

经办注册会计师：吴凌志、冯适

联系人：吴凌志

## 六、基金的募集与基金合同的生效

### （一）基金的募集

本基金经中国证券监督管理委员会证监基金字[2004] 27 号核准，由基金管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》、基金合同及其他有关规定募集，募集期从 2004 年 4 月 2 日起到 2004 年 4 月 30 日止，经安永大华会计师事务所验资，共募集 3,282,404,810.93 份基金份额，募集户数为 70,846 户。

### （二）基金合同的生效

本基金的基金合同已于 2004 年 5 月 11 日正式生效。

### （三）基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模限制

本基金合同生效后，连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续六十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。

## 七、基金份额的申购、赎回

### （一）申购、赎回场所

- 1、本基金管理人直销网点及网站；
- 2、受本基金管理人委托、具有销售本系列基金资格的商业银行或其它机构的营业网点；
- 3、有网上交易功能的销售机构的网站。

上述直销和代销机构的名称、住所等参见本招募说明书“五、相关服务机构（一）基金份额发售机构”。

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。销售机构可以根据情况变化增加或者减少销售城市（网点）。

### （二）申购和赎回的开放日及开放时间

1、本基金开放日为投资者办理基金申购、赎回等业务的工作日，即上海证券交易所、深圳证券交易所的交易日。开放日的具体业务办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所交易日的交易时间。目前，上海证券交易所、深圳证券交易所的交易时间为交易日上午：9:30-11:30，下午 1:00-3:00。若上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日发生指数熔断且指数熔断至收市的，前述具体办理时间以基金管理人公告为准。

投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回申请的，其基金份额申购、赎回价格为下次办理基金份额申购、赎回时间所在开放日的价格。

本基金设立以后，若出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更或其他特殊情况，基金管理人将视情况对前述开放日进行相应的调整并公告，并在实施日 3 个工作日前在至少一种证监会指定的媒体上刊登公告。

2、本基金日常申购自 2004 年 7 月 5 日开始办理，日常赎回自 2004 年 7 月 12 日开始办理。

### （三）申购、赎回的原则

1、“未知价”原则，即申购、赎回价格以受理申请当日收市后计算的基金份额净值为基准进行计算；

2、“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以持有的基金

份额申请；

3、当日的申购、赎回申请可以在基金管理人规定的时间以前撤销，在当日的交易时间结束后不得撤销；

4、基金管理人在不损害基金份额持有人权益的情况下可更改上述原则。在变更上述原则时，基金管理人必须最迟在新规则实施日前 3 个工作日在至少一种中国证监会指定的媒体上刊登公告。

#### **（四）申购、赎回的程序**

1、申请方式：书面申请、电话申请或销售人公布的其他方式。

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

3、申购、赎回的确认与通知

申购、赎回的确认与通知：T 日提交的有效申请，本基金注册登记人在 T+1 日内为投资者对该交易的有效性进行确认，投资者可在 T+2 日起到销售网点柜台或以销售人规定的其他方式查询申购与赎回的确认情况。

4、申购、赎回款项的支付

基金申购采用全额缴款方式，若申购资金在规定时间内未全额到账则申购不成功。若申购不成功或无效，申购款项将退回投资者账户。基金份额持有人赎回申请确认后，赎回款项在 T+7 日内支付。在发生延期支付的情形时，款项和份额的支付办法参照本基金合同的有关条款处理。

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

#### **（五）申购、赎回的数额限制**

1、在基金管理人直销中心（柜台）进行申购时，投资人以金额申请，每个基金账户首笔申购的最低金额为人民币 100,000 元，每笔追加申购的最低金额为 100,000 元。在基金管理人网上直销系统进行申购时，每个基金账户首笔申购的最低金额为人民币 10 元，每笔追加申购的最低金额为人民币 10 元。除上述情况外，基金管理人规定每个基金账户首笔申购的最低金额为人民币 0.1 元，每笔追加申购的最低金额为人民币 0.1 元。

2、基金份额持有人在基金管理人的直销中心（柜台）及网上直销平台（含

微网站、APP）办理本基金赎回时，每笔赎回申请的最低份额为 10 份，单个基金账户最低持有份额为 10 份。除上述情况及另有公告外，基金管理人规定本基金的每笔最低赎回份额、单个基金账户最低持有份额为 0.1 份。基金份额持有人可将其全部或部分基金份额赎回，但某笔赎回申请导致单个基金账户的基金份额余额少于 0.1 份时，基金管理人有权对余额部分基金份额进行强制赎回。

在本基金其他销售机构进行赎回时，具体办理要求以相关销售机构的交易细则为准，但不得低于基金管理人规定的最低限额，另有公告除外。

3、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。

4、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，具体金额请参见相关公告。

5、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相关公告。

6、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。

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数量限制，基金管理人必须在调整前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

8、申购份额、余额的处理方式：申购的有效份额为按实际确认的申购金额在扣除相应的费用后，以当日基金份额净值为基准计算，保留到小数点后两位，剩余部分舍去，舍去部分所代表的资产归基金所有。

9、赎回金额的处理方式：赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值为基准并扣除相应的费用，保留到小数点后两位，两位以后的部分舍去，舍去部分所代表的资产归基金所有。

## （六）申购、赎回的费用

### 1、申购费

(1) 本基金的申购遵循金额申购的原则，即申购金额中包含申购费用；费用计算原则为单笔单次收费。

| 金额（M，含申购费）      | 申购费率      |
|-----------------|-----------|
| $M < 1000$ 万    | 1.0%      |
| $M \geq 1000$ 万 | 每笔 1000 元 |

投资者选择红利自动再投资所转成的份额不收取申购费用。

(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，不列入基金资产。

## 2、赎回费

本基金的赎回遵循份额赎回的原则，基金赎回费用由投资者承担，在扣除必要的手续费后，赎回费总额的 25% 归入基金资产，但对持续持有期少于 7 日的投资者收取的赎回费全额计入基金财产。

本基金赎回费率随投资人持有本基金时间的增加而递减，具体费率如下：

| 连续持有期限（T）                             | 赎回费率  |
|---------------------------------------|-------|
| $T < 7$ 日                             | 1.5%  |
| $7 \text{ 日} \leq T \leq 1 \text{ 年}$ | 0.50% |
| $1 \text{ 年} < T \leq 2 \text{ 年}$    | 0.25% |
| $T > 2 \text{ 年}$                     | 0     |

3、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，对投资人定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，经相关监管部门核准，基金管理人可以适当调低基金申购费率和基金赎回费率。

基金管理人认为需要调整费率时，如果没有超过上述费率限额，基金管理人可自行调整；若提高本基金上述费率的上限应召开基金份额持有人大会审议。费率上限变更的，最迟将于新的费率开始实施前 3 个工作日至少在一种中国证监会指定的媒体上予以公告。

## （七）申购份额、赎回金额的计算方式

## 1、基金申购份额的计算

申购份额为申购金额减去申购费用后除以当日的基金份额净值为基准计算的申购价格，有效份额单位为份，基金份额份数保留到小数点后两位，两位以后的部分舍去，舍去部分所代表的资产归基金所有。

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

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

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

例：某投资者投资 50,000 元申购本基金，对应费率为 1%，假设申购当日基金份额净值为 1.0160 元，则其可得到的申购份额为：

$$\text{申购费用} = 50,000 - 50000 / (1 + 1\%) = 495.05 \text{ 元}$$

$$\text{净申购金额} = 50,000 - 495.05 = 49,504.95 \text{ 元}$$

$$\text{申购份额} = 49,504.95 / 1.0160 = 48,725.34 \text{ 份}$$

即：投资者投资 50,000 元申购本基金，假设申购当日基金份额净值为 1.0160 元，则可得到 48,725.34 份基金份额。

本基金管理人已于 2007 年 5 月 15 日刊登了《关于修改兴业可转债混合型基金和兴全视野股票型基金基金合同部分条款的公告》，自 2007 年 5 月 18 日起本基金采用“外扣法”计算申购份额和申购费用。

## 2、基金赎回金额的计算

赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值为基准计算的赎回价格减去赎回费用，赎回金额单位为元，赎回金额保留到小数点后两位，两位以后的部分舍去，舍去部分所代表的资产归基金所有。

$$\text{赎回费用} = (\text{赎回份额} \times \text{基金份额净值}) \times \text{赎回费率}$$

$$\text{赎回金额} = (\text{赎回份额} \times \text{基金份额净值}) - \text{赎回费用}$$

例：某投资者赎回本基金 10,000 份基金份额，持有时间为 8 个月，对应的赎回费率为 0.5%，假设赎回当日基金份额净值是 1.0160 元，则其可得到的赎回金额为：

$$\text{赎回费用} = (10000 \times 1.0160) \times 0.5\% = 50.80 \text{ 元}$$

$$\text{赎回金额} = (10000 \times 1.0160) - 50.80 = 10109.20 \text{ 元}$$

即：投资者赎回本基金 10,000 份基金份额，假设赎回当日基金份额净值是 1.0160 元，则其可得到的赎回金额为 10,109.20 元。

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

#### （八）申购、赎回的注册登记

基金投资者提出的申购、赎回申请，在当日交易时间结束前可以撤销，交易时间结束后不得撤销。

1、投资者申购基金成功后，基金注册登记人在 T+1 工作日为投资者办理注册与过户登记手续，投资者自 T+2 工作日（含该日）后有权赎回该部分基金份额；

2、投资者赎回基金成功后，基金注册登记人在 T+1 工作日为投资者办理扣除权益的注册与过户登记手续；

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

#### （九）拒绝或暂停申购、赎回的情形与处理

##### 1、拒绝或暂停申购的情形和处理

出现以下情况之一时，基金管理人可拒绝或暂停接受基金投资者的申购申请：

（1）不可抗力的原因导致基金无法正常运转；

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

（3）接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益或对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时；

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

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

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

（7）发生基金合同或招募说明书中未予载明的事项，但基金管理人有权正



理由认为需要暂停基金申购，应当报中国证监会批准；经批准后，基金管理人应当立即在中国证监会指定的信息披露媒体上刊登暂停申购公告；

（8）法律、法规、规章规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述第（1）、（2）、（6）、（7）、（8）项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受基金投资者的申购申请时，基金管理人应当立即向中国证监会备案，并应在至少一种中国证监会指定的媒体上刊登暂停公告。

## 2、拒绝或暂停赎回的情形和处理

发生下列情形之一时，基金管理人可拒绝或暂停接受基金投资者的赎回申请：

（1）不可抗力的原因导致基金无法正常运作；

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

（3）因市场剧烈波动或其它原因而出现连续两个开放日巨额赎回，导致本基金的现金支付出现困难；

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

（5）法律、法规、规章规定或中国证监会认定的其它情形。

发生上述情形之一的，基金管理人应在当日立即向中国证监会备案。已接受的赎回申请，基金管理人将足额支付；如暂时不能足额支付时，将按每个赎回申请人已被接受的赎回申请量占已接受赎回申请总量的比例分配给赎回申请人，其余部分根据基金管理人制定的原则在后续开放日予以兑付，但不得超过正常支付时间 20 个工作日，并以后续开放日的基金份额净值为依据计算赎回金额。投资者也可在申请赎回时选择当日未获受理部分予以撤销。

在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理。

## 3、其他暂停申购、赎回情形及处理方式

发生基金合同或招募说明书中未予载明的事项，但基金管理人认为有正当理由认为需要暂停接受基金申购、赎回的，应当报经中国证监会批准。经批准后，基金管理人应立即在至少一种中国证监会指定的媒体上刊登暂停公告。暂停期

间，应每两周至少刊登提示性公告一次，暂停期间结束，基金重新开放时，基金管理人应当公告最新的基金份额净值。

## （十）巨额赎回的情形及处理

### 1、巨额赎回的认定

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

### 2、巨额赎回的处理

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

（2）顺延赎回：巨额赎回申请发生时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于该基金总份额的 10%的前提下，可以对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；投资者未能赎回部分，除投资者在提交赎回申请时明确作出不参加顺延下一个开放日赎回的表示外，自动转为下一个开放日赎回处理。但投资者可在申请赎回时选择将当日未获受理部分予以撤消。转入下一开放日的赎回申请不享有赎回优先权，并将以该下一个开放日的该基金份额净值为基准计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。

（3）当基金发生巨额赎回且存在单个基金份额持有人超过前一开放日基金总份额 40%以上的赎回申请情形下，基金管理人可以对该基金份额持有人超过 40%以上的赎回申请进行延期办理，具体措施为：对于其未超过前一开放日基金总份额 40%的赎回申请，基金管理人有权根据上述“（1）全额赎回”或“（2）顺延赎回”的约定方式与其他基金份额持有人的赎回申请一并办理。对于该基金份额持有人超过前一开放日基金总份额 40%以上的赎回申请进行延期，即与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。但是，如该持有人在提交赎回申请时选择取消赎回，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。如该持有人在提交赎回申请时未作明确选择，其未能赎回部分作自动延期赎回处理。

（4）巨额赎回的公告：当发生巨额赎回和基金间转换并延期支付时，基金管理人将通过邮寄、传真或者《基金合同》、《招募说明书》规定的其他方式、

在规定的时间内通知基金投资人，说明有关处理方法。同时在至少一种中国证监会规定媒介上公告，通知投资者，并说明有关处理方法。通知和公告的时间最长不得超过三个证券交易所交易日。

（5）基金连续两个开放日以上发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受赎回申请；已经确认的赎回可以延期支付赎回款项，但不得超过正常支付时间后的 20 个工作日，并应当在中国证监会规定媒介上公告。

### （十一）暂停申购、赎回的公告及重新开放申购、赎回的公告

1、发生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、如果发生暂停的时间为一天，第二个工作日基金管理人应在至少一种中国证监会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 个开放日的基金份额净值。

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

4、如果发生暂停的时间超过两周，暂停期间，基金管理人应每两周至少重复刊登暂停公告一次；当连续暂停时间超过两个月时，可将重复刊登暂停公告的频率调整为每月一次。暂停结束基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前 3 个工作日在至少一种中国证监会规定媒介上连续刊登基金重新开放申购或赎回公告并在重新开放申购或赎回公告最近一个开放日的基金份额净值。

### （十二）定期定额投资计划

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

## 八、基金的非交易过户、转托管、基金转换、冻结与质押

### （一）非交易过户

非交易过户是指不采用申购、赎回等基金交易方式，依法将一定数量的基金份额按照一定规则从某一基金投资者基金账户转移到另一基金投资者基金账户的行为。

基金注册登记人只受理继承、捐赠、司法强制执行等情况下的非交易过户。其中继承是指基金份额持有人死亡，其持有的基金份额由其合法的继承人继承；捐赠是指基金份额持有人将其合法持有的基金份额捐赠给福利性质的基金会或社会团体；司法强制执行是指司法机关依据生效的司法文书将基金份额持有人持有的基金份额强制判决划转给其他自然人、法人、社会团体或其他组织。

办理非交易过户时必须提供注册登记机构要求提供的相关资料。符合条件的非交易过户按《开放式基金业务管理规则》的有关规定办理。申请自申请受理日起二个月内办理，并按基金注册登记人规定的标准支付过户费用。

### （二）转托管

基金份额持有人在变更办理基金申购、赎回的销售人（网点）时，销售人之间（网点）不能通存通兑的，可办理已持有基金份额的转托管，即投资者将所持有的基金份额从一个交易账户转到另一交易账户进行交易。

基金份额持有人可以以同一基金账户在多个销售机构申购（认购）基金份额，但必须在原申购（认购）的销售机构赎回该部分基金份额。投资者申购（认购）基金份额后可以向原申购（认购）基金的销售机构发出转托管指令，缴纳转托管手续费，转托管完成后投资者才可以在转入的销售机构赎回其基金份额。

投资者在转出方办理转托管手续之前，应先到转入方办理基金账户登记手续。

### （三）基金转换

基金管理人可以根据相关法律法规以及本基金合同的规定决定开办本基金与基金管理人管理的其他基金之间的转换业务，基金转换可以收取一定的转换费，相关规则由基金管理人届时根据相关法律法规及本基金合同的规定制定并公告，并提前告知基金托管人与相关机构。

#### **（四）冻结与质押**

基金注册登记人只受理司法机构依法要求的基金份额的冻结与解冻。基金份额的冻结手续、冻结方式按照基金注册登记人的相关规定办理。

在相关法律法规有明确规定的条件下，基金管理人将可以办理基金份额的质押业务或其他业务，并会同注册登记人制定、公布、实施相应的业务规则。

## 九、基金的投资

### （一）投资目标

在锁定投资组合下方风险的基础上，以有限的期权成本获取基金资产的长期稳定增值。

### （二）投资方向

本基金投资范围是具有良好流动性的金融工具，包括国内依法公开发行上市的可转换公司债券、股票、存托凭证、国债，以及法律法规允许基金投资的其他金融工具。资产配置比例为：可转债 30%~95%（其中可转债在除国债之外已投资资产中比例不低于 50%），股票不高于 30%，现金和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。

本基金管理人已于 2006 年 8 月 2 日刊登公告，即日起对兴全可转债混合型证券投资基金的资产配置比例进行调整。

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。

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%。

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。

本基金投资存托凭证的比例限制依照境内上市交易的股票进行，与境内上市交易的股票合并计算。

### （三）投资策略

#### 1、投资决策依据

（1）国家有关法律、法规和本基金合同的有关规定；

- (2) 国家宏观经济环境；
- (3) 国家货币政策、利率走势和证券市场政策；
- (4) 地区及行业发展状况；
- (5) 上市公司研究；
- (6) 证券市场的走势。

## 2、投资决策程序

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。

基金的资产配置采用自上而下的程序，个券和个股选择采用自下而上的程序，并严格控制投资风险。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、行业分析、公司分析、个券分析以及数据模拟的各类报告，提出本基金股票备选库的构建和更新方案，经投资研究联席会议讨论并最终决定本基金股票备选库，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

基金经理根据对股票市场、可转债市场和利率期限结构的判断确定可转债组合的加权平均内含收益率、久期水平和国债组合的加权平均久期水平。在此基础上根据各种定量和定性标准，以及研究部的个券和个股研究报告构建基金组合，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个股的定期跟踪，并及时向基金经理反馈个券和个股的最新信息，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）风险控制

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，风险管理部对投资组合计划的执行过程进行日常监督和实时风险控制，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）业绩评价

FOF 投资与金融工程部将定期对基金的业绩进行归因分析，找出基金投资管理的长处和不足，为日后的管理提供客观的依据。

### 3、投资组合管理

基金的资产配置采用自上而下的程序，个券（可转债，下同）和个股选择采用自下而上的程序，并严格控制投资风险。在个券选择层面，积极参与发行条款优惠、期权价值较高、公司基本面优良的可转债的一级市场申购；选择对应的发债公司具有良好发展潜力或基础股票有着较高上涨预期的可转债进行投资，以有效规避市场风险，并充分分享股市上涨的收益；运用“兴全可转债评价体系”，选择定价失衡的个券进行投资，实现低风险的套利。在个股选择层面，以“相对投资价值”判断为核心，选择所处行业发展前景良好、价值被相对低估的股票进行投资。

“兴全可转债评价体系”是指兴证全球基金管理有限公司投资团队在长期投资研究实践中形成的一套可转债评价系统，该系统的理论基础是期权的二叉树定价模型，核心功能是实现可转债的定价，此外，该系统还可实现转债和正股之间套利机会的发现，和风险指标的揭示。

#### （1）资产配置策略

投资决策委员会定期或不定期召开投资决策委员会会议，在分析宏观经济、政策变化以及证券市场总体趋势的基础上，结合有关法律法规，确定今后一段



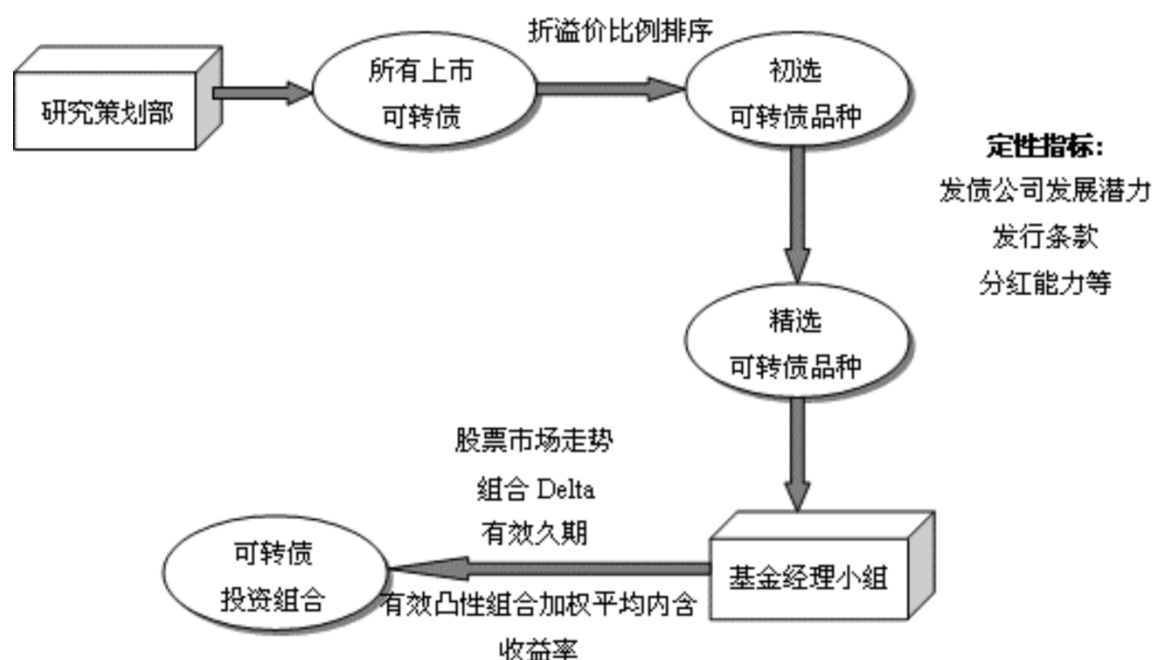
时间内基金资产的具体配置策略，即基金投资组合中可转债、股票、国债和现金的具体构成比例，以及可转债组合中股性与债性的配置。

## （2）可转债投资策略

本基金将着重对可转债对应的基础股票的分析与研究，对那些有着较好盈利能力或成长前景的上市公司的转债进行重点投资。同时依据科学、完善的“兴全可转债评价体系”选择具有较高投资价值的个券进行投资，并根据内含收益率、折溢价比率、久期、凸性等因素构建可转债投资组合。

可转债不同于一般的企业债券，其投资人具有在一定条件下转股、回售的权利，因此其理论价值应当等于作为普通债券的基础价值加上可转债内含期权价值。可转债的基础价值是实现下方风险锁定的基础，计算可转债的基础价值，只需按照同期企业债券的收益率水平对可转债到期日内的最大可回收利息、本金（包括持有到期的利息补偿）进行贴现即可。对可转债内含期权价值的定价是“兴全可转债评价体系”中的核心，其主要与基础股票的价格预期、发行条款、发债上市公司基本面等要素有关。可转债内含期权定价分析主要分为二叉树定价模型分析和定性分析两个部分，其中：二叉树定价模型属量化分析过程，也是期权定价的基础；定性分析是基于无法量化的发行条款、发债公司基本面，基础股票特点等要素对期权价值进行再分析，是对二叉树定价模型的再完善，以提高可转债定价的合理性。

可转债投资组合的构建流程如下：



### （3）可转债转换为基础股票的策略

当发生以下情况时，本基金将把相关的可转债转换为基础股票：在转股期内，当发生本基金所持有可转债的实际转股价格明显低于基础股票市场交易价格时，即存在明显的市场套利机会时，本基金将通过转股实现获益；当存在可转债在变现过程中可能出现较大的变现损失时，本基金将通过转股来保障基金资产的流动性；当由于基础股票价格上涨且满足赎回触发条件时，本基金将通过转股来保障已有收益；其他通过转股能够有效保障或提升基金份额持有人利益的情况。

本基金原则上不长期持有由可转债转换而得的基础股票。

### （4）债券投资策略

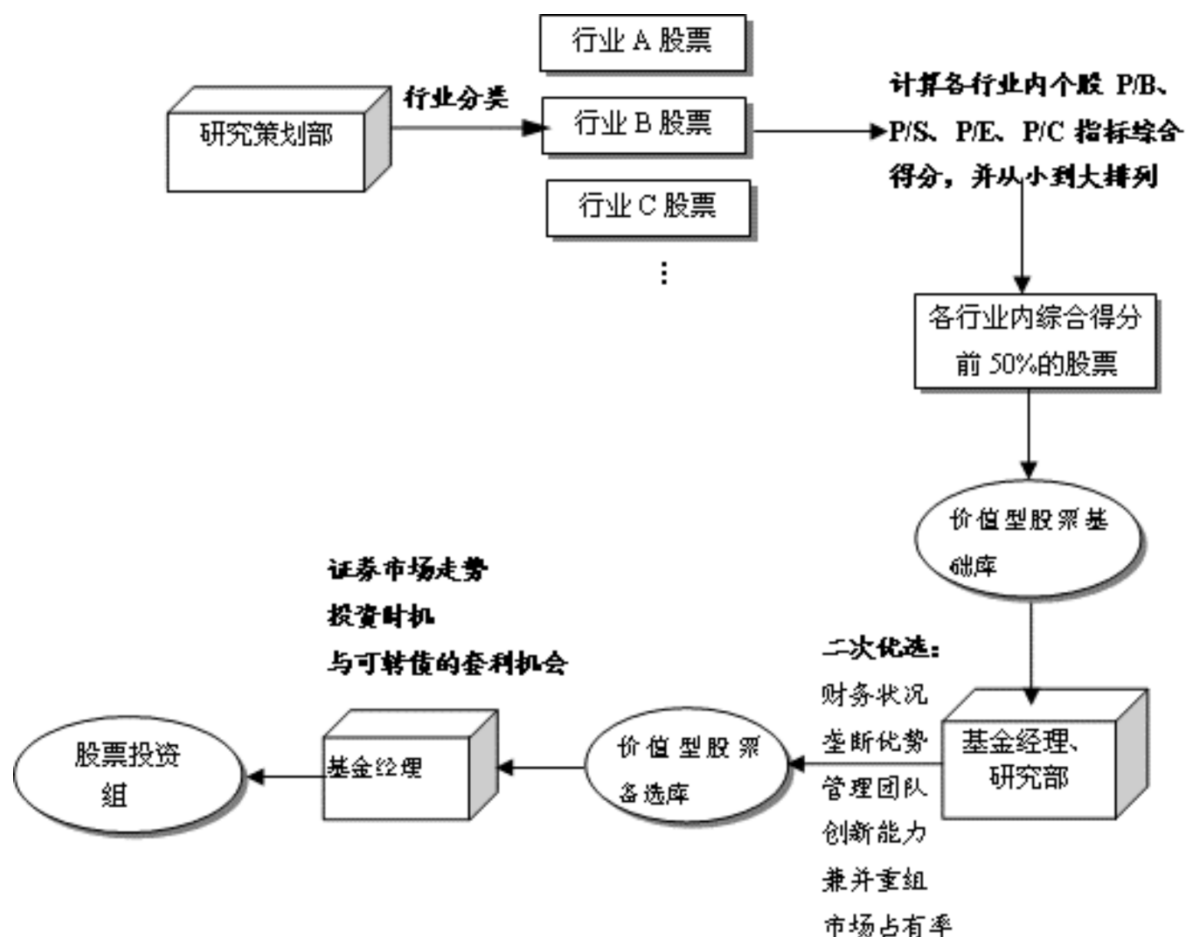
本基金管理人所要投资的债券包括国债、企业债、金融债等。在债券投资中主要基于对国家财政政策、货币政策的深入分析以及对宏观经济的动态跟踪，运用利率预期、收益率曲线预测等策略，通过科学的数量分析构造有效的债券投资组合，以久期和凸性为主要的投资管理工具，进行长期投资，并适当进行波段操作。

### （5）股票投资策略

在股票投资中，本基金将坚持选择不同行业中价值型股票特征较为明显的个股，并确立以“相对投资价值”判断为核心，强调将定量的股票筛选和定性

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

股票投资组合的构建流程如下：



#### （6）存托凭证投资策略

对于存托凭证投资，依照上述上市交易的股票投资策略执行。

#### （四）业绩比较基准

本基金业绩比较基准为：“80%×中证可转换债券指数+15%×沪深 300 指数+5%×同业存款利率”

经与托管银行中国工商银行股份有限公司协商一致，并报中国证监会批准，已自 2015 年 1 月 26 日起将本基金的业绩比较基准调整为“80%×中证可转换债券指数+15%×沪深 300 指数+5%×同业存款利率”。

在制定业绩比较基准过程中，考虑到指数的代表性和实用性，选取中证可

转换债券指数和沪深 300 指数分别作为可转债业绩和股票业绩的比较基准。

“中证可转换债券指数”是国内较权威的可转债指数，编制原则具有严肃性，能够较好的反映可转债市场变化。沪深 300 指数代表效果较好。

### （五）投资限制

1、本基金投资组合在遵守法律、法规、中国证监会及《基金合同》规定的投资限制的同时，还将遵守基金管理人内设风险管理部所制定的投资对象限制。

2、本基金投资组合符合以下规定：

（1）本基金投资于一家上市公司股票的比例不超过该基金资产净值的 10%；

（2）本基金与由本基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券总和不超过该证券的 10%；

（3）遵守法律、法规、中国证监会及本基金合同所规定的其他比例限制。

3、本基金禁止从事下列行为：

（1）投资于其他基金；

（2）将基金资产用于抵押、担保、资金拆借或者贷款；

（3）以本基金的名义使用不属于本基金名下的资金买卖证券；

（4）从事证券信用交易；

（5）以基金资产进行房地产投资；

（6）从事可能使基金资产承担无限责任的投资；

（7）将基金资产投资于与基金托管人或者基金管理人有关联关系的公司发行的证券；

（8）违反证券交易所业务规则，进行内幕交易，利用对敲、倒仓等行为来操纵和扰乱市场价格，通过关联交易损害基金份额持有人的利益；

（9）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；

（10）法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定时从其规定。

### （六）基金投资组合报告

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

本基金的托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在

虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据取自兴全可转债混合型证券投资基金 2024 年第 1 季度报告，数据截至 2024 年 3 月 31 日，本报告财务资料未经审计师审计。

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              | 822,835,451.23   | 27.16        |
|    | 其中：股票             | 822,835,451.23   | 27.16        |
| 2  | 基金投资              | -                | -            |
| 3  | 固定收益投资            | 1,870,001,115.59 | 61.72        |
|    | 其中：债券             | 1,870,001,115.59 | 61.72        |
|    | 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      | 336,705,849.45   | 11.11        |
| 8  | 其他资产              | 460,178.57       | 0.02         |
| 9  | 合计                | 3,030,002,594.84 | 100.00       |

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

(1) 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别       | 公允价值（元）        | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------|----------------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业   | -              | -            |
| B  | 采矿业        | 54,472,099.66  | 1.81         |
| C  | 制造业        | 524,759,387.64 | 17.47        |
| D  | 电力、热力、燃气及水 | 64,606,043.64  | 2.15         |

|   |               |                |       |
|---|---------------|----------------|-------|
|   | 生产和供应业        |                |       |
| E | 建筑业           | -              | -     |
| F | 批发和零售业        | 16,788,667.32  | 0.56  |
| G | 交通运输、仓储和邮政业   | -              | -     |
| H | 住宿和餐饮业        | -              | -     |
| I | 信息传输、软件和技术服务业 | 27,883,329.04  | 0.93  |
| J | 金融业           | 28,715,858.48  | 0.96  |
| K | 房地产业          | 76,454,426.26  | 2.55  |
| L | 租赁和商务服务业      | 29,124,025.60  | 0.97  |
| M | 科学研究和技术服务业    | 15,750.21      | 0.00  |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 15,863.38      | 0.00  |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | -              | -     |
| P | 教育            | -              | -     |
| Q | 卫生和社会工作       | -              | -     |
| R | 文化、体育和娱乐业     | -              | -     |
| S | 综合            | -              | -     |
|   | 合计            | 822,835,451.23 | 27.39 |

(2) 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

3、期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

(1) 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量<br>(股) | 公允价值<br>(元) | 占基金资产净值比例<br>(%) |
|----|------|------|-----------|-------------|------------------|
|----|------|------|-----------|-------------|------------------|

|    |        |      |           |               |      |
|----|--------|------|-----------|---------------|------|
| 1  | 600048 | 保利发展 | 6,614,602 | 60,391,316.26 | 2.01 |
| 2  | 600398 | 海澜之家 | 6,705,783 | 60,352,047.00 | 2.01 |
| 3  | 002223 | 鱼跃医疗 | 1,113,601 | 38,196,514.30 | 1.27 |
| 4  | 002475 | 立讯精密 | 1,242,716 | 36,548,277.56 | 1.22 |
| 5  | 601899 | 紫金矿业 | 2,106,263 | 35,427,343.66 | 1.18 |
| 6  | 600900 | 长江电力 | 1,411,684 | 35,193,282.12 | 1.17 |
| 7  | 600690 | 海尔智家 | 1,351,110 | 33,710,194.50 | 1.12 |
| 8  | 300750 | 宁德时代 | 176,100   | 33,487,176.00 | 1.11 |
| 9  | 002078 | 太阳纸业 | 2,146,200 | 31,248,672.00 | 1.04 |
| 10 | 002027 | 分众传媒 | 4,466,400 | 29,120,928.00 | 0.97 |

#### 4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种      | 公允价值（元）          | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|------------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | —                | —            |
| 2  | 央行票据      | —                | —            |
| 3  | 金融债券      | 151,618,401.64   | 5.05         |
|    | 其中：政策性金融债 | 151,618,401.64   | 5.05         |
| 4  | 企业债券      | —                | —            |
| 5  | 企业短期融资券   | —                | —            |
| 6  | 中期票据      | —                | —            |
| 7  | 可转债（可交换债） | 1,718,382,713.95 | 57.21        |
| 8  | 同业存单      | —                | —            |
| 9  | 其他        | —                | —            |
| 10 | 合计        | 1,870,001,115.59 | 62.25        |

#### 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 | 230211 | 23 国开 11 | 1,500,000 | 151,618,401.64 | 5.05 |
| 2 | 110081 | 闻泰转债     | 1,304,380 | 134,367,328.61 | 4.47 |
| 3 | 123107 | 温氏转债     | 740,710   | 91,396,105.43  | 3.04 |
| 4 | 113050 | 南银转债     | 667,860   | 76,112,619.16  | 2.53 |
| 5 | 110073 | 国投转债     | 637,860   | 68,665,698.90  | 2.29 |

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：本基金本报告期末未持有贵金属。

8、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

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股指期货交易情况说明

(1) 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

无。

(2) 本基金投资股指期货的投资政策

股指期货暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(1) 本期国债期货投资政策

国债期货暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

(2) 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

(3) 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货，故此项不适用。

11、投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，并



且未在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

(2) 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

(3) 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额（元）      |
|----|---------|------------|
| 1  | 存出保证金   | 159,898.60 |
| 2  | 应收证券清算款 | —          |
| 3  | 应收股利    | —          |
| 4  | 应收利息    | —          |
| 5  | 应收申购款   | 300,279.97 |
| 6  | 其他应收款   | —          |
| 7  | 待摊费用    | —          |
| 8  | 其他      | —          |
| 9  | 合计      | 460,178.57 |

(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    | 134,367,328.61 | 4.47         |
| 2  | 123107 | 温氏转债    | 91,396,105.43  | 3.04         |
| 3  | 113050 | 南银转债    | 76,112,619.16  | 2.53         |
| 4  | 110073 | 国投转债    | 68,665,698.90  | 2.29         |
| 5  | 113060 | 浙 22 转债 | 62,967,143.46  | 2.10         |
| 6  | 113043 | 财通转债    | 48,937,303.89  | 1.63         |
| 7  | 113045 | 环旭转债    | 46,547,509.06  | 1.55         |
| 8  | 110059 | 浦发转债    | 45,734,102.96  | 1.52         |
| 9  | 113062 | 常银转债    | 45,499,523.19  | 1.51         |
| 10 | 110075 | 南航转债    | 45,287,825.87  | 1.51         |
| 11 | 128081 | 海亮转债    | 41,915,404.64  | 1.40         |
| 12 | 127045 | 牧原转债    | 40,979,213.70  | 1.36         |
| 13 | 113052 | 兴业转债    | 40,205,500.13  | 1.34         |
| 14 | 127086 | 恒邦转债    | 38,897,940.91  | 1.29         |

|    |        |       |               |      |
|----|--------|-------|---------------|------|
| 15 | 113044 | 大秦转债  | 38,833,943.48 | 1.29 |
| 16 | 123213 | 天源转债  | 32,166,962.72 | 1.07 |
| 17 | 110079 | 杭银转债  | 31,928,573.76 | 1.06 |
| 18 | 127089 | 晶澳转债  | 30,679,123.83 | 1.02 |
| 19 | 127085 | 韵达转债  | 30,125,333.17 | 1.00 |
| 20 | 123119 | 康泰转2  | 29,604,625.53 | 0.99 |
| 21 | 127070 | 大中转债  | 28,768,174.61 | 0.96 |
| 22 | 123190 | 道氏转02 | 27,859,226.77 | 0.93 |
| 23 | 113602 | 景20转债 | 25,439,599.11 | 0.85 |
| 24 | 113663 | 新化转债  | 23,450,158.99 | 0.78 |
| 25 | 118034 | 晶能转债  | 22,192,176.81 | 0.74 |
| 26 | 118019 | 金盘转债  | 19,225,288.99 | 0.64 |
| 27 | 123158 | 宙邦转债  | 18,300,734.75 | 0.61 |
| 28 | 127084 | 柳工转2  | 17,885,428.21 | 0.60 |
| 29 | 123178 | 花园转债  | 17,709,405.34 | 0.59 |
| 30 | 123035 | 利德转债  | 17,607,495.83 | 0.59 |
| 31 | 111017 | 蓝天转债  | 17,594,309.72 | 0.59 |
| 32 | 128128 | 齐翔转2  | 17,250,708.50 | 0.57 |
| 33 | 123101 | 拓斯转债  | 17,122,869.05 | 0.57 |
| 34 | 110091 | 合力转债  | 17,089,333.87 | 0.57 |
| 35 | 128142 | 新乳转债  | 17,076,518.05 | 0.57 |
| 36 | 123172 | 漱玉转债  | 16,544,096.03 | 0.55 |
| 37 | 113606 | 荣泰转债  | 15,844,100.17 | 0.53 |
| 38 | 113563 | 柳药转债  | 14,464,567.19 | 0.48 |
| 39 | 111000 | 起帆转债  | 14,073,911.72 | 0.47 |
| 40 | 113661 | 福22转债 | 13,625,210.59 | 0.45 |
| 41 | 128141 | 旺能转债  | 13,118,926.04 | 0.44 |
| 42 | 123169 | 正海转债  | 12,217,533.17 | 0.41 |
| 43 | 118023 | 广大转债  | 11,899,449.83 | 0.40 |
| 44 | 110077 | 洪城转债  | 11,738,362.97 | 0.39 |
| 45 | 128097 | 奥佳转债  | 11,256,729.07 | 0.37 |

|    |        |         |               |      |
|----|--------|---------|---------------|------|
| 46 | 113058 | 友发转债    | 11,176,839.85 | 0.37 |
| 47 | 110085 | 通 22 转债 | 11,088,844.48 | 0.37 |
| 48 | 118029 | 富淼转债    | 11,086,716.14 | 0.37 |
| 49 | 128135 | 洽洽转债    | 10,972,549.01 | 0.37 |
| 50 | 118031 | 天 23 转债 | 10,957,087.15 | 0.36 |
| 51 | 127078 | 优彩转债    | 10,937,462.66 | 0.36 |
| 52 | 113059 | 福莱转债    | 10,683,911.59 | 0.36 |
| 53 | 110068 | 龙净转债    | 10,224,733.77 | 0.34 |
| 54 | 128144 | 利民转债    | 9,875,796.24  | 0.33 |
| 55 | 123127 | 耐普转债    | 9,856,528.08  | 0.33 |
| 56 | 128137 | 洁美转债    | 9,682,728.96  | 0.32 |
| 57 | 113618 | 美诺转债    | 9,506,199.22  | 0.32 |
| 58 | 127088 | 赫达转债    | 9,437,041.95  | 0.31 |
| 59 | 127018 | 本钢转债    | 9,035,602.53  | 0.30 |
| 60 | 127063 | 贵轮转债    | 8,849,108.62  | 0.29 |
| 61 | 110090 | 爱迪转债    | 7,684,313.29  | 0.26 |
| 62 | 127059 | 永东转 2   | 6,689,332.81  | 0.22 |
| 63 | 113615 | 金诚转债    | 5,239,766.19  | 0.17 |
| 64 | 127020 | 中金转债    | 5,181,005.18  | 0.17 |
| 65 | 118025 | 奕瑞转债    | 4,644,515.98  | 0.15 |
| 66 | 118024 | 冠宇转债    | 4,344,201.19  | 0.14 |
| 67 | 113582 | 火炬转债    | 4,304,110.65  | 0.14 |
| 68 | 113671 | 武进转债    | 3,995,536.49  | 0.13 |
| 69 | 113021 | 中信转债    | 3,608,296.23  | 0.12 |
| 70 | 110062 | 烽火转债    | 3,202,270.15  | 0.11 |
| 71 | 111011 | 冠盛转债    | 3,070,648.61  | 0.10 |
| 72 | 123056 | 雪榕转债    | 2,065,672.61  | 0.07 |
| 73 | 113061 | 拓普转债    | 2,049,887.25  | 0.07 |
| 74 | 118030 | 睿创转债    | 1,944,346.98  | 0.06 |

## (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。

十、基金的业绩

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

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

本基金合同生效日 2004 年 5 月 11 日，基金业绩截止日 2024 年 3 月 31 日。  
本基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表

| 阶段      | 净值增长率①  | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③    | ②-④    |
|---------|---------|-----------|------------|---------------|--------|--------|
| 2013 年度 | 9.84%   | 0.73%     | -1.10%     | 0.68%         | 10.94% | 0.05%  |
| 2014 年度 | 53.29%  | 1.07%     | 51.92%     | 0.98%         | 1.37%  | 0.09%  |
| 2015 年度 | 6.70%   | 1.63%     | -20.00%    | 2.82%         | 26.70% | -1.19% |
| 2016 年度 | 0.93%   | 0.48%     | -10.90%    | 0.74%         | 11.83% | -0.26% |
| 2017 年度 | 7.62%   | 0.40%     | 2.96%      | 0.45%         | 4.66%  | -0.05% |
| 2018 年度 | -5.79%  | 0.60%     | -4.98%     | 0.67%         | -0.81% | -0.07% |
| 2019 年度 | 24.75%  | 0.63%     | 25.51%     | 0.72%         | -0.76% | -0.09% |
| 2020 年度 | 19.33%  | 0.88%     | 8.20%      | 0.79%         | 11.13% | 0.09%  |
| 2021 年度 | 16.17%  | 0.71%     | 13.82%     | 0.57%         | 2.35%  | 0.14%  |
| 2022 年度 | -13.11% | 0.68%     | -11.25%    | 0.67%         | -1.86% | 0.01%  |

|                           |                |       |             |       |            |            |
|---------------------------|----------------|-------|-------------|-------|------------|------------|
| 2023 年度                   | -<br>5.55<br>% | 0.45% | -2.09%      | 0.42% | -<br>3.46% | 0.03%      |
| 2024 年第 1 季度              | -<br>1.21<br>% | 0.75% | -0.17%      | 0.53% | -<br>1.04% | 0.22%      |
| 自基金合同成立起至 2024 年 3 月 31 日 | 911.61%        | 0.79% | 174.76<br>% | 1.04% | 736.85%    | -<br>0.25% |

## 十一、基金的财产

### （一）基金财产的构成

基金财产包括所拥有的各类证券价值、银行存款本息和基金应收的申购基金款以及其他投资所形成的价值总和。

### （二）基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后净资产值。

### （三）基金财产的账户

本基金资产使用以基金托管人名义开立的基金托管专户和证券交易资金账户，并以基金托管人和“兴全可转债混合型证券投资基金”联名的方式开立基金证券账户、由基金托管人在中央国债登记结算有限责任公司开设债券托管乙类账户。

本基金的专用账户与基金管理人、基金托管人、基金销售代理人 and 基金注册登记人自有的资产账户以及其他基金资产账户严格分开、相互独立。本条将根据中国证券登记结算有限公司账户改革的要求实时修订。

### （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和基金托管人的固有财产，并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人不得将基金财产归入其固有财产。

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

3、基金管理人、基金托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，基金财产不属于其清算财产；基金管理人、基金托管人以其自有的资产承担法律责任，其债权人不得对基金资产行使请求冻结、扣押或其它权利。

4、非因本基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。

5、除依据《证券投资基金法》、基金合同及其它有关规定处分外，基金财产不得被处分。

## 十二、基金资产的估值

### （一）估值目的

基金资产估值的目的是客观、准确地反映每只基金资产价值。依据经基金资产估值后确定的基金资产净值而计算出的基金份额净值，是计算基金申购、赎回的基础。

### （二）估值日

本基金的估值日为相关的证券交易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

本基金所拥有的股票、债券、银行存款本息等资产。

### （四）估值程序

基金日常估值由基金管理人进行。基金管理人完成估值后，将估值结果加盖业务公章以书面形式加密传真至基金托管人，基金托管人按法律法规、《基金合同》规定的估值方法、时间、程序进行复核，复核无误后在基金管理人传真的书面估值结果上加盖业务公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。

### （五）估值方法

本基金的估值按照以下方法进行：

#### 1、证券交易所上市的有价证券的估值

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

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

（3）交易所上市未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中



所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

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

2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

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

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

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

3、因持有股票而享有的配股权，从配股除权日起到配股确认日止，如果收盘价高于配股价，按收盘价高于配股价的差额估值。收盘价等于或低于配股价，则估值为零。停止交易、但未行权的权证，采用估值技术确定公允价值。

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

5、同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

6、本基金投资存托凭证的估值核算，依照境内上市交易的股票执行。

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

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

根据《基金法》，基金管理人计算并公告基金资产净值，基金托管人复核、审查基金管理人计算的基金资产净值。因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人对基金资产净值的计算结果对外予以公布。

#### （六）基金份额净值的确认及错误的处理方式

基金份额净值的计算保留到小数点后4位，小数点后第5位四舍五入。当估值或份额净值计价错误实际发生时，基金管理人应当立即纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大。当错误达到或超过基金资产净值的0.25%时，基金管理人应报中国证监会备案；当估值错误偏差达到基金份额净值的0.5%时，基金管理人应当公告，并报中国证监会备案。

因基金估值错误给投资者造成损失的，应先由基金管理人承担，基金管理人对其不应由其承担的责任，有权向过错人追偿。关于差错处理，本合同的当事人按照以下约定处理：

##### 1、差错类型

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

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

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

##### 2、差错处理原则

（1）差错已发生，但尚未给当事人造成损失时，差错责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正差错发生的费用由差错责任方承担；由于差错责任方未及时更正已产生的差错，给当事人造成损失的由差错责任方承担；若差错责任方已经积极协调，并且有协助义务的当事人有足够的时间进行更正而未更

正，则其应当承担相应赔偿责任。差错责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认，确保差错已得到更正。

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

（3）因差错而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但差错责任方仍应对差错负责，如果由于获得不当得利的当事人不返还或不全部返还不当得利造成其他当事人的利益损失（“受损方”），则差错责任方应赔偿受损方的损失，并在其支付的赔偿金额的范围内对获得不当得利的当事人享有要求交付不当得利的权利；如果获得不当得利的当事人已经将此部分不当得利返还给受损方，则受损方应当将其已经获得的赔偿额加上已经获得的不当得利返还的总和超过其实际损失的差额部分支付给差错责任方。

（4）差错调整采用尽量恢复至假设未发生差错的正确情形的方式。

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

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

（7）按法律法规规定的其他原则处理差错。

3、差错处理程序差错被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

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

（2）根据差错处理原则或当事人协商的方法对因差错造成的损失进行评估；

（3）根据差错处理原则或当事人协商的方法由差错的责任方进行更正和赔偿损失；

（4）根据差错处理的方法，需要修改基金注册登记机构的交易数据的，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；

(5) 基金管理人及基金托管人基金份额净值计算错误偏差达到基金份额净值的 0.25% 时，基金管理人应当报告中国证监会；基金管理人及基金托管人基金份额净值计算错误偏差达到基金份额净值的 0.5% 时，基金管理人应当公告并报中国证监会备案。

### **(七) 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、托管人无法准确评估基金资产价值时；
- 3、当前一估值日基金资产净值 50% 以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，基金管理人经与基金托管人协商一致的；
- 4、中国证监会规定的其他情形。

### **(八) 特殊情形的处理**

- 1、基金管理人按估值方法的第 7 项进行估值时，所造成的误差不作为基金份额净值错误处理。
- 2、由于证券交易所及其登记结算公司发送的数据错误，或由于其他不可抗力原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人、基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

## 十三、基金的收益分配

### （一）基金收益的构成

基金收益包括基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券价差、银行存款利息以及其他收入。因运用基金资产带来的成本或费用的节约计入基金收益。

### （二）基金净收益

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

### （三）基金收益分配原则

1、基金收益分配采用现金方式，投资者可选择获取现金红利或者将现金红利按红利权益登记日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资（下称“再投资方式”）；如果投资者没有明示选择，则视为选择现金分红方式；

2、在满足分配条件下，本基金收益每年至少分配一次。成立不满 3 个月，则不进行收益分配。期中分配由基金管理人另行公告，年度分配在基金会计年度结束后 4 个月内完成；

3、基金当年收益弥补上一年度亏损后，才可进行当年收益分配；

4、如果基金投资当期出现亏损，则可不进行收益分配；

5、基金收益分配比例不低于净收益的 90%；

6、基金中每一基金份额享有同等分配权；

7、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；

8、上述规定若根据国家法律、法规以及中国证监会规定发生调整时，经中国证监会核准后公告，无须召开持有人大会；

9、法律、法规或监管机构另有规定的从其规定。

### （四）基金收益分配方案

本基金收益分配方案中应载明基金收益的范围、基金净收益、基金收益分配对象、分配原则、分配时间、分配数额及比例、分配方式、支付方式及有关手续费等内容。

### （五）基金收益分配方案的确定与公告

本基金的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，

依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介公告。

#### **（六） 收益分配中发生的费用**

红利分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者的现金红利小于 1 元，为降低投资者的转账成本，保障基金份额持有人利益，基金注册登记人可将投资者的现金红利按红利发放日的基金份额净值自动转为基金份额。自动再投资的计算方法，依照《开放式基金业务规则》的有关规定执行。

本基金管理人已于 2007 年 5 月 25 日刊登《关于修改兴业可转债混合型证券投资基金招募说明书收益分配相关内容的公告》，自 2007 年 5 月 25 日将投资者现金分红自动转为基金份额的现金红利下限由 100 元变更为 1 元，详情请见具体公告。

## 十四、基金费用与税收

### （一）与基金运作有关的费用

#### 1、基金管理费

本基金的管理费提取。按前一日的基金资产净值乘以相应的管理费年费率来计算，计算方法如下：

$$H=E \times I \div \text{当年天数}$$

H：为每日应计提的基金管理费，E：为前一日基金资产净值，I：基金的管理费年费率

本基金的管理费年费率为 1.2%。

基金管理人的管理费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人于次月前 2 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

#### 2、基金托管费

本基金的托管费，按前一日的基金资产净值乘以托管费年费率来计算，计算方法如下：

$$H=E \times I \div \text{当年天数}$$

H：为每日应支付的基金托管费，E：为前一日的基金资产净值，I：基金的托管费年费率

兴全可转债混合型证券投资基金的托管费年费率为 0.2%。

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人于次月前 2 个工作日内从基金资产中一次性支取。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

#### 3、与基金运作有关的其他费用

主要包括：基金的证券交易费用、基金合同生效后的基金信息披露费用、基金合同生效后的与基金相关的会计师费和律师费、基金份额持有人大会费用、以及其它按照国家有关规定可以在基金资产中列支的其它费用。该等费用由基金托管人根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额，列入当前基金费用。

#### 4、经基金管理人与基金托管人协商一致，可以酌情调低基金管理人的报酬

及基金托管费，并报中国证监会核准后公告，无须召开基金份额持有人大会通过。

## （二）与基金销售有关的费用

### 1、申购费

（1）本基金的申购遵循金额申购的原则，即申购金额中包含申购费用；费用计算原则为单笔单次收费。

本基金的申购费率：

| 金额（M，含申购费）      | 申购费率      |
|-----------------|-----------|
| $M < 1000$ 万    | 1.0%      |
| $M \geq 1000$ 万 | 每笔 1000 元 |

投资者选择红利自动再投资所转成的份额不收取申购费用。

（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，不列入基金资产。

### 2、赎回费

本基金的赎回遵循份额赎回的原则，基金赎回费用由投资者承担，在扣除必要的手续费后，赎回费总额的 25% 归入基金资产，但对持续持有期少于 7 日的投资者收取的赎回费全额计入基金财产。

本基金赎回费率随投资人持有本基金时间的增加而递减，具体费率如下：

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

3、本基金实际执行费率在上述范围内由基金管理人决定，并在招募说明书或公开说明书中进行公告。基金管理人认为需要调整费率时，如果没有超过上述费率限额，基金管理人可自行调整；若提高本基金上述费率的上限应召开基金份额持有人大会审议。费率上限变更的，最迟将于新的费率开始实施前 3 个



工作日至少在一种中国证监会指定的媒体上予以公告。

### **（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本基金资产的损失，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。基金成立前的相关费用，包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费等不列入基金费用。

### **（四）费用调整**

基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率或基金托管费率。调高基金管理费率或基金托管费率，须召开基金份额持有人大会审议；调低基金管理费率或基金托管费率，无须召开基金份额持有人大会。

### **（五）基金税收**

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规履行。

## 十五、基金的会计与审计

### （一）基金会计政策

1、基金管理人为本基金的基金会计责任方，基金管理人也可以委托基金托管人或者具有证券从业资格的独立的会计师事务所担任基金会计，但该会计师事务所不能同时从事本基金的审计业务；

2、基金的会计年度为公历每年1月1日至12月31日；

3、基金核算以人民币为记账本位币，记账单位是人民币元；

4、会计制度执行国家有关的会计制度；

5、本基金独立建账、独立核算；

6、基金管理人及基金托管人各自保留完整的基金会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关规定编制基金会计报表；

7、基金托管人每月与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以书面方式确认；

8、上述规定因国家法律、法规或政策变化而发生调整时，经中国证监会核准后公告，无须召开基金份额持有人大会。

### （二）基金审计

1、本基金管理人聘请具有从事证券、期货相关业务资格的会计师事务所及其具有证券从业资格的注册会计师对基金进行基金年度财务会计报告进行审计。会计师事务所及其注册会计师与基金发起人、基金管理人、基金托管人相互独立，并具有从事证券相关业务资格；

2、会计师事务所更换经办注册会计师时，须事先征得基金管理人和基金托管人同意；

3、基金管理人（或基金托管人）认为有充足理由更换会计师事务所，经基金托管人（或基金管理人）同意后可以更换。更换会计师事务所需在5个工作日内在至少一种中国证监会指定的媒体上公告。

## 十六、基金的信息披露

本基金的信息披露严格按照《基金法》的规定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、《基金合同》及其他有关规定。本基金的信息披露事项将在至少一种中国证监会指定的媒体上公告。

### 信息披露义务人

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

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

本基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内，将应予披露的基金信息通过中国证监会指定的全国性报刊（以下简称“规定报刊”）及指定互联网网站（以下简称“规定网站”）等媒介披露，并保证基金投资者能够按照《基金合同》约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。

### 本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息，不得有下列行为：

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

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。

### 公开披露的信息包括：

#### （一）招募说明书、《基金合同》、基金托管协议、基金产品资料概要

1、《基金合同》是界定《基金合同》当事人的各项权利、义务关系，明确基金份额持有人大会召开的规则及具体程序，说明基金产品的特性等涉及基金投资者重大利益的事项的法律文件。

2、基金招募说明书应当最大限度地披露影响基金投资者决策的全部事项，说明基金认购、申购和赎回安排、基金投资、基金产品特性、风险揭示、信息披露及基金份额持有人服务等内容。本基金管理人按照《基金法》及相关法律法规、实施准则和本《基金合同》编制并公告招募说明书。

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

3、基金托管协议是界定基金托管人和基金管理人在基金财产保管及基金运作监督等活动中的权利、义务关系的法律文件。

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

#### 5、份额发售公告

本基金管理人按照《基金法》及相关法律法规、实施准则的有关规定编制并发布份额发售公告。

#### 6、定期报告，包括年度报告、中期报告、季度报告。

（1）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）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) 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。

## 7、基金净值信息

《基金合同》生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周在规定网站披露一次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。

## 8、基金份额申购、赎回价格

基金管理人应当在《基金合同》、招募说明书等信息披露文件上载明基金份额申购、赎回价格的计算方式及有关申购、赎回费率，并保证投资者能够在基金销售机构网站或营业网点查阅或者复制前述信息资料。

## 9、临时报告

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

前款所称重大事件，是指可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格

产生重大影响的下列事件：

- （1）基金份额持有人大会的召开及决定的事项；
- （2）《基金合同》终止、基金清算；
- （3）转换基金运作方式、基金合并；
- （4）更换基金管理人、基金托管人、基金份额登记机构，基金改聘会计师事务所；
- （5）基金管理人委托基金服务机构代为办理基金的份额登记、核算、估值等事项，基金托管人委托基金服务机构代为办理基金的核算、估值、复核等事项；
- （6）基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；
- （7）基金管理人变更持有百分之五以上股权的股东、基金管理人的实际控制人变更；
- （8）基金募集期延长或提前结束募集；
- （9）基金管理人的高级管理人员、基金经理和基金托管人专门基金托管部门负责人发生变动；
- （10）基金管理人的董事在最近 12 个月内变更超过百分之五十，基金管理人、基金托管人专门基金托管部门的主要业务人员在最近 12 个月内变动超过百分之三十；
- （11）涉及基金财产、基金管理业务、基金托管业务的诉讼或仲裁；
- （12）基金管理人或其高级管理人员、基金经理因基金管理业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚，基金托管人或其专门基金托管部门负责人因基金托管业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚；
- （13）基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易事项，但中国证监会另有规定的除外；
- （14）基金收益分配事项；
- （15）管理费、托管费、申购费、赎回费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；
- （16）基金份额净值计价错误达基金份额净值百分之零点五；
- （17）本基金开始办理申购、赎回；

- (18) 本基金发生巨额赎回并延期办理;
- (19) 本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项;
- (20) 本基金暂停接受申购、赎回申请或者重新接受申购、赎回申请;
- (21) 发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时;
- (22) 基金信息披露义务人认为可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的其他事项或中国证监会规定的其他事项。

#### 10、澄清公告

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

#### 11、基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决定的事项,应当依法报中国证监会备案,并予以公告。

#### 12、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。

#### 13、中国证监会规定的其他信息。

### (二) 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。

### （三）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。投资者也可以直接登录基金管理人的网站进行查阅。对投资者按上述方式所获得的文件及其复印件，基金管理人和基金托管人应保证与所公告的内容完全一致。

### （四）本基金信息披露事项以法律法规规定及本章节约定的内容为准。



## 十七、风险揭示

### （一）证券市场风险

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

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

2、经济周期风险。随经济运行的周期性变化，证券市场的收益水平也呈周期性变化。基金投资于可转债、国债与股票，收益水平也会随之变化，从而产生风险。

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

4、债券市场流动性风险。由于银行间债券市场深度和宽度相对较低，交易相对较不活跃，可能增大银行间债券变现难度，从而影响基金资产变现能力的风险。

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

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

7、收益率曲线风险。如果基金对长、中、短期债券的持有结构与基准存在差异，长、中、短期债券的相对价格发生变化时，基金资产的收益可能低于基准。

8、市场供需风险。如果宏观经济环境、政府财政政策、市场监管政策、市场参与主体经营环境等发生变化，市场参与主体可用资金数量和债券市场可供投资的债券数量可能发生相应的变化，最终影响债券市场的供需关系，造成基

金资产投资收益的变化。

9、国际竞争风险。随着中国市场开放程度的提高，上市公司的发展必然要受到国际市场同类技术或同类产品公司的强有力竞争，部分上市公司有可能不能适用新的行业形势而业绩下滑。尤其是中国加入 WTO 以后，中国境内公司将面临前所未有的市场竞争，上市公司在这些因素的影响下将存在更大不确定性。

10、本基金产品特定风险。可转债投资组合流动性风险，本基金以可转债为主要投资对象，可转债市场流动性风险的存在可能导致本基金无法按照计划构建投资组合或者及时实现资产变现，从而影响投资目标的实现；股价波动性风险，可转债基础股票价格的波动会影响可转债认股权价值、赎回权价值、回售权价值、转股价格重置权价值等可转债内含期权价值，进而影响可转债的市场价格，导致投资收益的不确定性；转股风险，指在转股期内，可转债的基础股票价格低于转股价，导致不能获得转股收益，从而无法弥补当初付出的转股期权价值所带来的风险。

## （二）管理风险

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

## （三）流动性风险

本基金属于开放式基金，在基金的所有开放日，基金管理人都有义务接受投资者的申购、赎回。由于开放式基金在国内推出时间还不长，应对基金赎回的经验不足，加之中国股票市场波动性较大，在市场下跌时经常出现交易量急剧减少的情况，如果在这时出现较大数额的基金赎回，则使基金资产变现困难，基金面临流动性风险。

### （1）基金申购、赎回安排

投资人具体请参见基金合同“第八部分基金的申购与赎回”和本招募说明书“七、基金份额的申购、赎回”，详细了解本基金的申购以及赎回安排。

在本基金发生流动性风险时，基金管理人可以综合利用备用的流动性风险管理工具以减少或应对基金的流动性风险，投资者可能面临赎回申请被暂停接

受、赎回款项被延缓支付、被收取短期赎回费、基金估值被暂停等风险。

## （2）拟投资市场、行业及资产的流动性风险评估

本基金的投资范围包括具有良好流动性的金融工具，包括国内依法公开发行的可转换公司债券、股票、存托凭证、国债，以及法律法规允许基金投资的其他金融工具。

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

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

## （3）巨额赎回情形下的流动性风险管理措施

当本基金发生巨额赎回情形时，基金管理人可以采用以下流动性风险管理措施：（a）暂停接受赎回申请；（b）延缓支付赎回款项；（c）中国证监会认定的其他措施。

## （4）实施备用的流动性风险管理工具的情形、程序及对投资者的潜在影响

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

**（a）暂停接受赎回申请**

投资人具体请参见基金合同“第五部分基金份额的上市交易、申购与赎回”的“二、基金份额的场外申购和赎回”中“（十）暂停赎回或者延缓支付赎回款项的情形及处理方式”和“（十一）巨额赎回的情形及处理方式”，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“第八部分基金的申购与赎回”中的“九、拒绝或暂停申购、赎回的情况及处理方式”和“十、巨额赎回的情形及处理方式”，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“第十四部分基金资产估值”中的“七、暂停估值的情形”，详细了解本基金暂停估值的情形及程序。

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

**（e）中国证监会认定的其他措施。****（四）本基金合同无法生效所产生的风险**

自基金份额发售公告之日起三个月内，如果本基金的净认购金额达到或超过2亿元且认购户数达到或超过200人，并按规定报证监会备案后，本基金合同生效。若基金在规定时间内无法达到认购金额超过2亿元且认购户数达到或超过200人的条件，将会导致本基金合同无法生效的风险。

**（五）信用风险**

基金在交易过程中发生交收违约，或者基金所投资债券之发行人出现违约、

拒绝支付到期本息，或由于债券发行人信用质量降低导致债券价格下降，造成基金资产损失。

#### （六）法律风险

由于法律法规方面的原因，某些市场行为受到限制或合同不能正常执行，导致基金资产的损失。

#### （七）操作或技术风险

相关当事人在业务各环节操作过程中，因内部控制存在缺陷或者人为因素造成操作失误或违反操作规程等引致的风险，例如，越权违规交易、会计部门欺诈、交易错误、IT 系统故障等风险。

在基金的各种交易行为或者后台运作中，可能因为技术系统的故障或者差错而影响交易的正常进行或者导致投资者的利益受到影响。这种技术风险可能来自基金管理公司、注册登记机构、销售机构、证券交易所、证券登记结算机构等等。

（八）本基金可投资科创板股票。科创板股票具有下列投资风险，敬请投资者注意：

基金资产投资于科创板股票，会面临科创板机制下因投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括但不限于市场风险、流动性风险、信用风险、集中度风险、系统性风险、政策风险等。

投资科创板股票存在的风险包括：

##### ①市场风险

科创板个股集中来自新一代信息技术、高端装备、新材料、新能源、节能环保及生物医药等高新技术和战略新兴产业领域。大多数企业为初创型公司，企业未来盈利、现金流、估值均存在不确定性，与传统二级市场投资存在差异，整体投资难度加大，个股市场风险加大。

科创板个股上市前五日无涨跌幅限制，第六日开始涨跌幅限制在正负 20% 以内，个股波动幅度较其他股票加大，市场风险随之上升。

##### ②流动性风险

科创板整体投资门槛较高，个人投资者必须满足交易满两年并且资金在 50 万以上才可参与，二级市场上个人投资者参与度相对较低，机构持有个股大量流通盘导致个股流动性较差，基金组合存在无法及时变现及其他相关流动性风

险。

### ③信用风险

科创板试点注册制，对经营状况不佳或财务数据造假的企业实行严格的退市制度，科创板个股存在退市风险。

### ④集中度风险

科创板为新设板块，初期可投标的较少，投资者容易集中投资于少量个股，市场可能存在高集中度状况，整体存在集中度风险。

### ⑤系统性风险

科创板企业均为市场认可度较高的科技创新企业，在企业经营及盈利模式上存在趋同，所以科创板个股相关性较高，市场表现不佳时，系统性风险将更为显著。

### ⑥政策风险

国家对高新技术产业扶持力度及重视程度的变化会对科创板企业带来较大影响，国际经济形势变化对战略新兴产业及科创板个股也会带来政策影响。

（九）本基金投资北交所股票所带来的特有风险,包括但不限于：

#### （1）市场风险

北交所个股集中来自新一代信息技术、高端装备、新材料、新能源、节能环保及生物医药等高新技术和专精特新产业领域。大多数企业为初创型公司，企业未来盈利、现金流、估值均存在不确定性，与传统二级市场投资存在差异，整体投资难度加大，个股市场风险加大。北交所个股上市首日无涨跌停限制，第二日开始涨跌幅限制在正负 30%以内，个股波动幅度较其他上市公司股票加大，市场风险随之上升。

#### （2）流动性风险

北交所整体投资门槛较高，二级市场上个人投资者参与度相对较低，可能由于持股分散度不足导致个股流动性较差，基金组合存在无法及时变现及其他相关流动性风险。

#### （3）信用风险

北交所试点注册制，对经营状况不佳或财务数据造假的企业实行严格的退市制度，北交所个股存在退市风险。

#### （4）集中度风险

北交所为新设交易所，初期可投标的较少，投资者容易集中投资于少量个股，市场可能存在高集中度状况，整体存在集中度风险。

#### （5）系统性风险

北交所上市公司平移自新三板精选层，从历史来看整体估值受政策阶段性影响较大，所以北交所个股估值相关性较高，政策空窗期或市场表现不佳时，系统性风险将更为显著。

#### （6）政策风险

国家对高新技术、专精特新企业扶持力度及重视程度的变化会对北交所企业带来较大影响，国际经济形势变化对专精特新产业及北交所个股也会带来政策影响。

#### （十）其他风险

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

## 十八、基金合同的终止和基金财产的清算

### （一）基金合同的终止

在本基金的存续期内，出现下列情形之一的，经中国证监会批准后将终止：

1、存续期内，基金有效持有人数量连续 60 个工作日达不到 200 人，或连续 60 个工作日该基金资产净值低于 5,000 万元，并经基金管理人宣布终止该基金合同；

2、因重大违法、违规行为，该基金合同被中国证监会责令终止；

3、该基金合同经持有人大会表决终止；

4、基金管理人因解散、破产、撤销、丧失基金管理机构资格、停止营业等事由，不能继续担任本基金管理人的职务，而无其它基金管理公司承受其原有权利及义务；

5、基金托管人因解散、破产、撤销、丧失基金托管机构资格、停止营业等事由，不能继续担任本基金托管人的职务，而无其它托管机构承受其原有权利及义务；

6、由于投资方向变更引起的基金合并、撤销；

7、法律、法规和规章规定或中国证监会允许的其他情况。

### （二）基金清算小组

1、本基金合同终止之日起 3 个工作日内成立清算小组，清算小组必须在中国证监会的监督下对终止后的基金财产进行清算。在基金清算小组接管基金资产之前，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。

2、基金清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有证券从业资格的注册会计师事务所、律师事务所以及中国证监会指定的人员组成。基金管理人、基金托管人以及上述会计师事务所和律师事务所应在该基金终止之日起 15 个工作日内将本方参加清算小组的具体人员名单函告其他各方。基金清算小组可以聘请必要的工作人员。清算小组在成立后 5 个工作日内应当公告。

3、基金清算小组接管基金资产后，负责基金资产的保管、清理、估价、变现和分配。基金清算小组可以依法进行必要的民事活动。

### （三）清算程序



- 1、本基金合同终止后，发布基金财产清算公告；
- 2、基金清算小组统一接管基金资产；
- 3、对基金合同终止后的基金的资产和债券债务分别进行清理和确认；
- 4、对基金合同终止后的基金资产进行估价；
- 5、对基金资产进行变现；
- 6、将基金清算结果报告中国证监会；
- 7、以自身名义参加与基金有关的民事诉讼；
- 8、公布基金合同终止后的基金清算结果公告；
- 9、进行基金合同终止后的基金剩余资产的分配。

#### **（四）清算费用**

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

#### **（五）基金资产按下列顺序清偿**

- 1、支付清算费用；
- 2、交纳所欠税款；
- 3、清偿终止后的基金债务；
- 4、按终止后的基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

该基金资产未按前款 1 至 3 项规定清偿前，不分配给该基金份额持有人。

#### **（六）基金清算的公告**

基金合同终止并报中国证监会备案后 5 个工作日内在至少一种中国证监会指定的媒体上由基金清算小组公告；清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金清算结果由基金清算小组经中国证监会批准后 3 个工作日内公告。

#### **（七）清算账册及文件保存**

基金清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

## 十九、《兴全可转债混合型证券投资基金基金合同》的摘要

### （一）基金份额持有人的权利和义务

#### 1、基金份额持有人的权利

- （1）分享基金财产收益；
- （2）按本《基金合同》的规定认购、申购、赎回，并在规定的时间取得有效申请的基金份额或款项；
- （3）按照规定要求召开基金份额持有人大会；
- （4）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；
- （5）参与分配清算后的剩余基金财产；
- （6）查阅或者复制公开披露的基金信息资料；
- （7）因基金管理人、基金托管人、销售机构、基金注册与过户登记人的过错导致基金份额持有人损失的求偿权；
- （8）提请基金管理人或基金托管人履行按本合同规定应尽的义务；
- （9）法律法规和《基金合同》规定的其他权利。

每份基金份额具有同等的合法权益。

#### 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）承担基金亏损或者终止的有限责任；
- （4）不从事任何有损基金及其他基金合同当事人利益的活动；
- （5）返还在基金交易过程中因任何原因，自基金管理人、基金托管人及基金管理人的代理人处获得的不当得利；
- （6）法律法规和《基金合同》规定的其他义务。

### （二）基金管理人的权利与义务

#### 1、基金管理人的权利

- （1）自本基金成立之日起，根据法律法规和本基金合同独立运用并管理基金资产；
- （2）依照本基金合同获得基金管理费；

(3) 销售基金份额，办理其他基金业务；

(4) 作为基金注册与过户登记人办理基金注册与过户登记业务并获得基金合同规定的费用；

(5) 依据本基金合同及有关法律规定的监督基金托管人，如认为基金托管人违反了本基金合同及国家有关法律规定，应呈报中国证监会和其它监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；

(6) 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；

(7) 选择、委托、更换基金销售代理人，对基金销售代理人的相关行为进行监督和处理。如认为基金销售代理人违反本基金合同、基金销售与服务代理协议及国家有关法律规定，应呈报中国证监会和其它监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；

(8) 依据本基金合同及有关法律规定的基金收益的分配方案；

(9) 在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请；

(10) 在符合有关法律法规和基金合同的前提下，制订和调整开放式基金业务规则，决定基金的相关费率结构和收费方式；

(11) 依照《暂行办法》、《试点办法》，代表基金对被投资上市公司行使股东权利；

(12) 法律、法规和基金合同规定的其它权利。

## 2、基金管理人的义务

(1) 遵守基金合同；

(2) 自基金成立之日起,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产；

(3) 设置相应的部门配备足够的专业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资产；

(4) 配备足够的专业人员办理基金份额的认购、申购与赎回业务或委托其它机构代理该项业务；

(5) 配备足够的专业人员进行基金的注册登记或委托其它机构代理该项业务；

(6) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金资产和基金管理人的资产相互独立，保证不同基金在资产运作、

财务管理等方面相互独立；

（7）除依据《暂行办法》、《试点办法》、基金合同及其它有关规定外，不得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资产；

（8）接受基金托管人的依法监督；

（9）按规定计算并公告基金净值信息；

（10）严格按照《暂行办法》、《试点办法》、基金合同及其它有关规定，履行信息披露及报告义务；

（11）保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《暂行办法》、《试点办法》、基金合同及其它有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不向他人泄露；

（12）按基金合同规定向基金份额持有人分配基金收益；

（13）按照法律和本基金合同的规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

（14）不谋求对基金资产所投资的上市公司的控股和直接管理；

（15）依据《暂行办法》、《试点办法》、基金合同及其它有关规定召集基金份额持有人大会，执行基金份额持有人大会决议；

（16）保存基金的会计账册、报表、记录 15 年以上；

（17）确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出，并且保证投资者能够按照本基金合同规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并得到有关资料的复印件；

（18）参加基金清算小组，参与基金资产的保管、清理、估价、变现和分配；

（19）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；

（20）因过错导致基金资产的损失时，承担赔偿责任，其过错责任不因其退任而免除；

（21）因基金估值错误给投资者造成损失的应先从基金管理人承担，基金管理人对不应由其承担的责任，有权向过错人追偿；

（22）基金托管人因过错造成基金资产损失时，应为基金利益向基金托管人追偿；

(23) 不得违反法律法规从事有损基金及其它基金当事人合法利益的活动;

(24) 对所管理的不同基金财产分别设账、进行基金会计核算, 编制财务会计报告及基金报告;

(25) 法律、法规和基金合同规定的其它义务。

### **(三) 基金托管人的权利与义务**

#### **1、基金托管人的权利**

(1) 自本基金成立之日起, 依法律法规和本基金合同的规定持有并保管基金资产;

(2) 依本《基金合同》约定获得基金托管费及其他法定的或监管部门批准的约定收入;

(3) 监督本基金的投资运作;

(4) 监督基金管理人, 如认为基金管理人违反了本《基金合同》及国家有关法律法规, 应及时呈报中国证监会和其他监管部门, 并采取必要措施保护基金投资者的利益;

(5) 基金管理人更换时, 提名新的基金管理人;

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

(7) 以基金托管人的名义开设证券交易资金账户, 用于证券交易资金清算;

(8) 以基金的名义在中央国债登记结算有限公司开设债券托管乙类账户负责基金的债券及资金的清算;

(9) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值, 如果不一致, 有权拒绝签章;

(10) 复核、审查基金管理人计算的基金收益分配方案中的财务数据, 如果不一致, 有权拒绝签章。

(11) 法律法规和《基金合同》规定的其他权利。

#### **2、基金托管人的义务**

(1) 遵守《基金合同》;

(2) 依法持有基金资产;

(3) 以诚实信用、勤勉尽责的原则安全保管基金财产;

(4) 设立专门的基金托管部, 具有符合要求的营业场所, 配备足够的、合

格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金资产托管事宜；

（5）建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，确保基金资产的安全，保证其托管的基金资产与基金托管人自有资产以及不同的基金资产相互独立；对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；

（6）除依据《暂行办法》、《试点办法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得为自己及任何第三人谋取非法利益，不得委托第三人托管基金资产；基金托管人违反此义务，利用基金资产为自己及任何第三人谋取利益的，所得利益归于基金资产，造成基金资产损失的，基金托管人应承担赔偿责任；

（7）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；

（8）以本基金托管人的名义开立基金托管专户和证券交易资金账户，以本基金托管人及本基金联名的方式开立基金证券账户，以基金的名义开立债券托管乙类账户，负责基金投资于证券的清算交割，执行基金管理人的划款指令，并负责办理基金名下的资金往来；

（9）保守基金商业秘密，除《暂行办法》、《试点办法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露；

（10）复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额净值；

（11）采取适当、合理的措施，使开放式基金份额的认购、申购、赎回等事项符合本《基金合同》等有关法律文件的规定；

（12）采取适当、合理的措施，使基金管理人用以计算开放式基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合本《基金合同》等法律文件的规定；

（13）采取适当、合理的措施，使基金投资和融资的条件符合本《基金合同》等法律文件的规定；

（14）按规定出具基金业绩和基金托管情况的报告，并报中国证监会和中国人民银行；

（15）在定期报告内出具托管人意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照本《基金合同》的规定进行；如果基金管理人未执行本《基金合同》规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；

（16）按有关规定，保存基金的会计账册、报表和记录等 15 年以上；

- (17) 按有关规定，建立并保存基金持有人名册；
- (18) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；
- (19) 依据基金管理人的指令或有关规定，将基金份额持有人的收益和赎回款项自基金托管专户划出；
- (20) 参加基金清算小组，参与基金资产的保管、清理、估价、变现和分配；
- (21) 监督基金管理人按本《基金合同》的规定履行自己的义务，因基金管理人过错造成基金资产损失，应代表基金向基金管理人追偿，除法律法规和本《基金合同》规定之处，基金托管人不对基金管理人承担连带责任；
- (22) 因过错导致基金资产的损失时，应承担赔偿责任，其过错责任不因其退任而免除；
- (23) 基金管理人因过错造成基金资产损失，应为基金利益向基金管理人追偿；
- (24) 不得违反法律法规从事任何有损本基金及其他基金合同当事人合法权益的活动；
- (25) 法律法规和《基金合同》规定的其他义务。

#### **(四) 基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则**

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

##### **1、召开事由**

当出现或需要决定下列事由之一的，经基金管理人或基金托管人或持有 10% 以上（含 10%）基金份额的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）提议时，应当召开基金份额持有人大会：

- (1) 提前终止基金合同；
- (2) 转换基金运作方式；
- (3) 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）；
- (4) 更换基金管理人、基金托管人；
- (5) 对基金当事人权利和义务产生重大影响的事项；
- (6) 《基金法》、《运作办法》及其它有关法律法规、本基金合同规定的

其它事项。

以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后变更，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；
- （2）在法律法规和本基金合同规定的范围内变更本基金份额的申购费率、赎回费率或收费方式；
- （3）因相应的法律、法规发生变动应当对基金合同进行变更；
- （4）对基金合同的变更不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生变化；
- （5）对基金合同的变更对基金份额持有人利益无实质性不利影响；
- （6）按照法律法规或本基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其它情形。

## 2、召集方式

（1）除法律法规或基金合同另有规定外，基金份额持有人大会由基金管理人召集，基金份额持有人大会的权益登记日、开会时间、地点由基金管理人选择确定，在基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集；

（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十日内决定是否召集，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六十日内召开；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%）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十日内决定是否召集，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六十日内召开；基金管理人决定不召集，代表基金份额 10%（含 10%）以上的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起十日内决定是否召集，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六十日内召开；

（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，但应当至少提前三十日向中国证监会备案。基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的，基金管理人、基金托管人应当配合，不得阻碍、干扰。

### 3、通知

召开基金份额持有人大会，召集人应当至少提前三十日在中国证监会指定的至少一种信息披露媒体公告会议通知。基金份额持有人大会通知将至少载明以下内容：

1. 会议召开时间、地点、方式；
2. 会议审议事项、议事程序、表决方式；
3. 有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日；
4. 代理投票委托书送达时间和地点；
5. 会务常设联系人姓名、电话；
6. 其他注意事项。

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。

### 4、会议的召开方式

#### （1）会议方式

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

#### （2）基金份额持有人大会召开条件

##### 1) 现场开会

必须同时符合以下条件时，现场会议方可举行：

A. 对到会者在权益登记日持有基金份额的统计显示，有效的基金份额应当大于在代表权益登记日基金总份额的 50%；

B. 到会的基金份额持有人身份证明及持有基金份额的凭证、代理人身份证明、委托人持有基金份额的凭证及授权委托代理手续完备，到会者出具的相关文件符合有关法律法规和基金合同及会议通知的规定，并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的登记资料相符。

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（至少应在 15 个工作日后）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) 通讯方式开会

必须同时符合以下条件时，通讯会议方可举行：

A. 召集人按基金合同规定公布会议通知后，在两个工作日内连续公布相关提示性公告；

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

C. 本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额占在权益登记日基金总份额的 50%以上；

D. 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它代表，同时提交持有基金份额的凭证和受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证和授权委托书等文件符合法律法规、基金合同和会议通知的规定。

如表决截止日前（含当日）未达到上述要求，则召集人可另行确定并公告重新表决的时间（至少应在 15 个工作日后），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。

## 5、议事内容与程序

### （1）议事内容及提案权

1) 议事内容仅限于本基金合同第四部分“一、召开事由”中所指的关系基金份额持有人利益的重大事项；

2) 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；

3) 基金管理人、基金托管人、持有权益登记日基金总份额 10%或以上的基金份额持有人可以在大会召集人发出会议通知前向大会召集人提交需由基金份

额持有人大会审议表决的提案，也可以在会议通知发出后向大会召集人提交临时提案（临时提案只适用于现场方式开会），临时提案最迟应当在大会召开日前 15 日提交召集人；召集人对于临时提案应当最迟在大会召开日前 10 日公告；

4) 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：

A. 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进行解释和说明；

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

5) 基金份额持有人大会的召集人发出召集会议的通知后，如果需要对原有提案进行变更，应当最迟在基金份额持有人大会召开日前 10 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 10 日的间隔期。

## （2）议事程序

### 1) 现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照规定程序宣布会议议事程序及注意事项，确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，在公证机构的监督下形成大会决议。

基金管理人召集大会时，由基金管理人授权代表主持；基金托管人召集大会时，由基金托管人授权代表主持；代表基金份额 10% 以上（含 10%）的基金份额持有人召集大会时，由出席大会的基金份额持有人和代理人以所代表的基金份额 50% 以上多数选举产生一名代表作为该次基金份额持有人大会的主持人。

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

### 2) 通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下，由召集人在会议通知中提前 30 日公布提案，在所通知的表决截止日期第二日统计全部有效表决，在公证机构监督下形成决议。

## 6、表决

(1) 基金份额持有人所持每份基金份额享有一票表决权。

(2) 基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议

1) 一般决议：一般决议须经出席会议的基金份额持有人及代理人所持表决权的 50%以上通过方为有效；除下列(2)所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过；

2) 特别决议：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可作出。涉及基金管理人更换、基金托管人更换、转换基金运作方式、终止基金合同的合同变更必须以特别决议的方式通过方为有效。

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。

(3) 基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

(4) 对于通讯开会方式的表决，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则表面符合法律法规和会议通知规定的书面表决意见即视为有效的表决；表决意见模糊不清或相互矛盾的视为无效表决。

(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。

## 7、计票

(1) 现场开会

1) 如基金份额持有人大会由基金管理人或基金托管人召集，则基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中选举两名代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中选举三名代表担任监票人；

2) 监票人应当在基金份额持有人表决后立即进行清点，由大会主持人当场公布计票结果，并由公证机关对其计票过程予以公证；

3) 如果大会主持人对于提交的表决结果有怀疑，可以对所投票数进行重新

清点；如果大会主持人对于提交的表决结果没有怀疑，而出席会议的其他人员对大会主持人宣布的表决结果有异议，有权在宣布表决结果后立即要求重新清点，大会主持人应当立即重新清点并公布重新清点结果。重新清点仅限一次。

## （2）通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人授权代表的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。

## 8、生效与公告

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五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。

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。

基金份额持有人大会决议自生效之日起两个工作日内在中国证监会指定的至少一种信息披露媒体公告。

## （五）基金的终止与清算

### 1、基金的终止

有下列情形之一的，本基金经中国证监会批准后将终止：

（1）存续期间内，基金份额持有人数量连续 60 个工作日达不到 100 人，或连续 60 个工作日基金资产净值低于人民币 5，000 万元，基金管理人将宣布本基金终止；

（2）基金经持有人大会表决终止的；

（3）因重大违法、违规行为，基金被中国证监会责令终止的；

（4）基金管理人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任本基金管理人的职务，而无其它适当的基金管理公司承受其原有权利及义务；

（5）基金托管人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任本基金托管人的职务，而无其它适当的托管机构承受其原有权利及义务；

（6）由于投资方向变更引起的基金合并、撤销；

（7）中国证监会允许的其它情况。

### 2、基金清算小组

(1) 自基金终止之日起 3 个工作日内成立清算小组，基金清算小组必须在中国证监会的监督下进行基金清算；

(2) 基金清算小组成员由基金发起人、基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、具有从事证券法律业务资格的律师以及中国证监会指定的人员组成。基金清算小组可以聘请必要的工作人员；

(3) 基金清算小组负责基金资产的保管、清理、估价、变现和分配。基金清算小组可以依法进行必要的民事活动。

### 3、基金清算程序

- (1) 基金终止后，发布基金清算公告；
- (2) 由基金清算小组统一接管基金资产；
- (3) 对基金资产和债权债务进行清理和确认；
- (4) 对基金资产进行估值和变现；
- (5) 将基金清算结果报告中国证监会；
- (6) 发布基金清算结果公告；
- (7) 对基金资产进行分配。

### 4、清算费用

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

### 5、基金清算的公告

基金终止并报中国证监会备案后的 5 个工作日内由基金清算小组公告；清算过程中的有关重大事项应及时公告；基金清算结果由基金清算小组报经中国证监会批准后 3 个工作日内公告。

### 6、基金清算帐册及文件的保存

基金清算帐册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

## (六) 争议的处理和适用的法律

各方当事人同意，因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，应提交中国国际经济贸易仲裁委员会根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁的地点在北京，仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力，仲裁费由败诉方承担。本《基金合同》受中国法律管辖。

（七）本《基金合同》存放在基金管理人和基金托管人的营业场所，投资者可免费查阅；也可按工本费购买本《基金合同》印制件或复印件；如涉及争议事项需协商、仲裁或诉讼的，《基金合同》条款及内容应以《基金合同》正本为准。

## 二十、《兴全可转债混合型证券投资基金基金托管协议》摘要

### （一）托管协议当事人

#### 1、基金管理人

基金管理人名称：兴证全球基金管理有限公司

注册地址：上海市黄浦区金陵东路 368 号

法定代表人：杨华辉

注册资本：1.5 亿元人民币

组织形式：有限责任公司

经营范围：基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其他业务

营业期限：持续经营

#### 2、基金托管人

名称：中国工商银行

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号（100032）

法定代表人：廖林

电话：（010）66105799

联系人：郭明

成立时间：1984 年 1 月 1 日

组织形式：国有独资企业

注册资本：人民币 35,640,625.71 万元

批准设立机关和设立文号：国务院《关于中国人民银行专门行使中央银行职能的决定》

存续期间：持续经营

经营范围：人民币存款、贷款、结算业务；居民储蓄业务；信托贷款、投资业务；金融租赁业务；外汇存款；外汇汇款；外汇投资；在境内、外发行或代理发行外币有价证券；贸易、非贸易结算；外币票据贴现；外汇放款；买卖或代理买卖外汇及外币有价证券；境内、外外汇借款；外汇及外币票据兑换；外汇担保；保管箱业务；征信调查、咨询服务；证券投资基金托管；社保基金托管；企业年金托管；委托资产托管；信托资产托管；基本养老保险个人账户



基金托管；农村社会保障基金托管；投资连接保险产品的托管；收支账户的托管；合格境外机构投资者（QFII）境内证券投资托管。

## （二）基金托管人与基金管理人之间的业务监督、核查

1、根据《暂行办法》、《试点办法》、《基金契约》、本协议和有关证券法规的规定，基金托管人对基金的投资对象、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、基金申购资金的到账和赎回资金的划付、基金收益分配、基金的融资条件等行为的合法性、合规性进行监督和核查，其中对基金的投资比例的监督和检查自本基金成立之后六个月开始。

基金托管人发现基金管理人违反《暂行办法》、《试点办法》、《基金契约》、本协议或有关证券法规规定的行为，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应及时核对，并以书面形式对基金托管人发出回函确认。在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对于基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

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限期纠正。

2、根据《暂行办法》、《试点办法》、《基金契约》、本协议及其他有关规定，基金管理人就基金托管人是否及时执行基金管理人的划款指令、是否擅自动用基金资产、是否按时将分配给基金持有人的收益划入分红派息账户等事项，对基金托管人进行监督和核查。

基金管理人定期对基金托管人保管的基金资产进行核查。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、因基金托管人的过错导致基金资产灭失、减损或处于危险状态的，基金管理人应立即以书面的方式要求基金托管人予以纠正并采取必要的补救措施。基金管理人有权要求基金托管人赔偿基金因此所遭受的损失。

基金管理人发现基金托管人的行为违反《暂行办法》、《试点办法》、《基金契约》、本协议或有关证券法规的规定，应及时以书面形式通知基金托管人限期纠正，基金托管人收到通知后应及时核对并以书面形式对基金管理人发出回函。在限期内，基金管理人有权随时对通知事项进行复查，督促基金托

管人改正。基金托管人对基金管理人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金管理人应报告中国证监会。

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限期纠正。

3、基金管理人和基金托管人有义务配合和协助对方依照本协议对基金业务执行监督、核查。基金管理人或基金托管人无正当理由，拒绝、阻挠对方根据本协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督，情节严重或经监督方提出警告仍不改正的，监督方应报告中国证监会。

### （三）基金资产保管

#### 1、基金资产保管的原则

基金托管人依法持有基金资产，应安全保管所收到的基金的全部资产。基金资产应独立于基金管理人、基金托管人的自有资产。

基金托管人必须为基金设立独立的账户，与基金托管人的其他业务和其他基金的托管业务实行严格的分账管理。

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

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

对于基金申（认）购过程中产生的应收资产，应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知基金托管人，到账日基金资产没有到达托管人处的，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。

#### 2、基金成立时募集资金的验证

认购期内销售机构按销售与服务代理协议的约定，将认购资金划入基金发起人在银行开设的“兴证全球基金管理有限公司基金专户”。基金设立募集期满，由基金发起人聘请具有从事证券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，基金发起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托管专户中，基金托管人在收到资金当日出具基金资产接收报告。

### 3、投资者申购资金和赎回资金的划付

基金申购、赎回的款项采用净额交收的结算方式。

基金托管人应及时查收申购资金是否到账，对于未准时到账的资金，应及时通知基金管理人，由基金管理人负责催收。

因投资者赎回而应划付的款项，基金托管人应根据基金管理人的指令进行划付。

### 4、基金的银行账户的开设和管理

基金托管人以基金托管人的名义在其营业机构开设基金托管专户，保管基金的银行存款。该账户的开设和管理由基金托管人承担。本基金的一切货币收支活动，均需通过基金托管人的基金托管专户进行。

基金托管专户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得假借本基金的名义开立任何银行账户；亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。

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

### 5、基金证券账户证券交易资金账户的开设和管理

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

基金证券账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得出借和未经对方同意擅自转让基金的任何证券账户；亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。

基金托管人以基金托管人的名义在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司开立基金证券交易资金账户，用于证券清算。

### 6、债券托管乙类账户的开设和管理

（1）基金成立后，基金管理人负责向中国证监会和中国人民银行申请基金

进入全国银行间同业拆借市场进行交易。由基金管理人在中国外汇交易中心开设同业拆借市场交易账户，由基金托管人在中央国债登记结算有限责任公司开设债券托管乙类账户，并由基金托管人负责基金的后台匹配及资金的清算。

(2) 同业拆借市场交易账户和债券托管账户根据中国人民银行、中国外汇交易中心和中央国债登记结算有限责任公司的有关规定，由基金管理人和基金托管人签订补充协议，进行使用和管理。基金管理人和基金托管人应一起负责为基金对外签订全国银行间国债市场回购主协议，正本由基金托管人保管，基金管理人保存副本。

#### 7、基金资产投资的有关实物证券的保管

实物证券由基金托管人存放于托管银行的保管库；也可存入中央国债登记结算有限责任公司或中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司或票据营业中心的代保管库。保管凭证由基金托管人持有。实物证券的购买和转让，由基金托管人根据基金管理人的指令办理。托管人对由托管人以外机构实际有效控制的证券不承担责任。

#### 8、与基金资产有关的重大合同的保管

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

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

### (四) 基金资产净值计算和核算

#### 1、基金资产净值的计算和复核

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

基金管理人应每日对基金资产估值。用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人复核。基金管理人应于每个工作日交易结束后计算当日的基金资产净值，并以加密传真方式发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核后，签名、盖章并以加密传真方式传送给基金管理人，由基金管理人对外公布。

本基金按以下方式进行估值：

(1) 证券交易所上市的有价证券的估值

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

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

3) 交易所上市未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

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

(2) 处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

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

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

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

(3) 因持有股票而享有的配股权，从配股除权日起到配股确认日止，如果收盘价高于配股价，按收盘价高于配股价的差额估值。收盘价等于或低于配股

价，则估值为零。停止交易、但未行权的权证，采用估值技术确定公允价值。

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

(5) 同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

(6) 本基金投资存托凭证的估值核算，依照境内上市交易的股票执行。

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

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

根据《基金法》，基金管理人计算并公告基金资产净值，基金托管人复核、审查基金管理人计算的基金资产净值。因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人对于基金资产净值的计算结果对外予以公布。

## 2、净值差错处理

当基金管理人计算的基金单位净值已由基金托管人复核确认后公告的，由此造成的投资者或基金的损失，应根据法律法规的规定对投资者或基金支付赔偿金，就实际向投资者或基金支付的赔偿金额，基金管理人和基金托管人应按照管理费率 and 托管费率的比例各自承担相应的责任。

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

由于证券交易所及其登记结算公司发送的数据错误，或由于其他不可抗力原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人和基金托管人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

针对净值差错处理，如果法律法规或证监会有新的规定，则按新的规定执

行；如果行业有通行做法，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。

当基金管理人计算的基金单位净值与基金托管人的计算结果不一致时，相关各方应本着勤勉尽责的态度重新计算核对，如果最后仍无法达成一致，应以基金管理人的计算结果为准对外公布，由此造成的损失以及因该交易日基金单位净值计算顺延错误而引起的损失由基金管理人承担赔偿责任，基金托管人不负赔偿责任。

### 3、基金账册的建账和对账

基金管理人和基金托管人在基金成立后，应按照相关各方约定的同一记账方法和会计处理原则，分别独立地设置、登录和保管本基金的全套账册，对相关各方各自的账册定期进行核对，互相监督，以保证基金资产的安全。若双方对会计处理方法存在分歧，应以基金管理人的处理方法为准。

经对账发现相关各方的账目存在不符的，基金管理人和基金托管人必须及时查明原因并纠正，保证相关各方平行登录的账册记录完全相符。若当日核对不符，暂时无法查找到错账的原因而影响到基金资产净值的计算和公告的，以基金管理人的账册为准。

### 4、基金财务报表与报告的编制和复核

基金财务报表由基金管理人和基金托管人每月分别独立编制。月度报表的编制，应于每月终了后 5 日内完成；投资组合公告每季公布一次，应按法律法规的要求公告；《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。基金管理人应当在上半年结束之日起两个月内，编制完成基金中期报告，将中期报告登载在规定网站上，并将中期报告提示性公告登载在规定报刊上；基金管理人应当在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。

基金管理人在月度报表完成当日，对报表加盖公章后，以加密传真方式将有关报表提供基金托管人复核；基金托管人在 5 日内立即进行复核，并将复核结果及时书面通知基金管理人。基金管理人在中期报告完成当日，将有关报告

提供基金托管人复核，基金托管人在收到后 30 日内进行复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金管理人在年度报告完成当日，将有关报告提供基金托管人复核，基金托管人在收到后 30 日内复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金托管人在复核过程中，发现相关各方的报表存在不符时，基金管理人和基金托管人应共同查明原因，进行调整，调整以相关各方认可的账务处理方式为准。核对无误后，基金托管人在基金管理人提供的报告上加盖公章，相关各方各自留存一份。

基金托管人在对中报或年报复核完毕后，需出具相应的复核确认书，以备有权机构对相关文件审核时提示。

### **（五）基金份额持有人名册的登记与保管**

基金持有人名册，包括基金设立募集期结束时的基金持有人名册、基金权益登记日的基金持有人名册、基金持有人大会登记日的基金持有人名册、每月最后一个交易日的基金持有人名册由基金过户与注册登记人负责制定。基金过户与注册登记人对基金持有人名册负保管义务。

### **（六）争议的处理和适用法律**

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

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《基金契约》和托管协议规定的义务，维护基金持有人的合法权益。

本协议受中国法律管辖。

### **（七）托管协议的修改和终止**

1、本协议相关各方当事人经协商一致，可以对协议进行修改。修改后的新协议，其内容不得与《基金契约》的规定有任何冲突。修改后的新协议，报中国证监会批准后生效。

2、发生以下情况，本托管协议终止：

- （1）基金或《基金契约》终止；
- （2）因基金托管人解散、依法被撤销、破产或其他事由造成本基金更换基



金托管人；

（3）因基金管理人解散、依法被撤销、破产或其他事由造成本基金更换基金管理人；

（4）发生《暂行办法》、《试点办法》或其他法律法规规定的终止事项。

## 二十一、对基金份额持有人的服务

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

### （一）通知服务

通知基金份额持有人的内容包括短信账单、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

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 [trade.xqfunds.com](http://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，可拨打基金管理人营销服务部电话或登录公司网站。

#### 1、营销服务部电话

客服热线：400-678-0099（免长话费）、021-38824536

#### 2、互联网站

公司网址：<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，并可通过电子邮件收到基金净值、基金管理人的相关公告、电子对账单等信息。

### **（六）投诉受理**

投资人可以拨打基金管理人营销服务部电话，或通过基金管理人网站留言的投诉栏目、书信、电子邮件等渠道对基金管理人和销售网点所提供的服务进行投诉。

## 二十二、其他应披露事项

以下为自 2023 年 6 月 1 日至 2024 年 5 月 31 日，本基金刊登于规定报刊和规定网站的基金公告。

| 序号 | 公告事项                                   | 法定披露日期     |
|----|----------------------------------------|------------|
| 1  | 关于调整网上直销部分基金转换/赎回转购优惠费率的公告             | 2023-06-06 |
| 2  | 关于增加旗下部分基金销售机构的公告                      | 2023-06-14 |
| 3  | 关于旗下部分基金投资钧达股份（002865）非公开发行股票的公告       | 2023-06-20 |
| 4  | 兴证全球基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告     | 2023-07-08 |
| 5  | 兴证全球基金管理有限公司关于旗下部分基金基金合同、招募说明书更新的提示性公告 | 2023-07-10 |
| 6  | 关于增加嘉实财富管理有限公司为旗下部分基金销售机构的公告           | 2023-07-10 |
| 7  | 关于旗下部分基金投资曼卡龙（300945）非公开发行股票的公告        | 2023-07-25 |
| 8  | 关于开通我司旗下基金在腾安基金基金转换业务的公告               | 2023-08-11 |
| 9  | 关于使用固有资金自购旗下权益类公募基金五千万的公告              | 2023-08-21 |
| 10 | 关于旗下部分基金投资日盈电子（603286）非公开发行股票的公告       | 2023-10-25 |
| 11 | 关于旗下部分基金投资梦百合（603313）非公开发行股票的公告        | 2023-11-15 |
| 12 | 关于旗下部分基金投资国海证券（000750）非公开发行股票的公告       | 2023-11-18 |
| 13 | 关于旗下部分基金投资安孚科技（603031）非公开发行股票的公告       | 2023-12-09 |
| 1  | 关于客服中心(含直销中心)变更办公地址的公告                 | 2024-01-05 |

|        |                   |            |
|--------|-------------------|------------|
| 4      |                   |            |
| 1<br>5 | 关于增加旗下部分基金销售机构的公告 | 2024-01-11 |

## 二十三、招募说明书的存放与查阅

本招募说明书存放于基金管理人和基金托管人的办公场所、注册登记中心、有关销售人及其网点，投资者可在办公时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

基金管理人和基金托管人保证文本的内容与公告的内容完全一致。

## 二十四、备查文件

投资者如果需要了解更详细的信息，可向基金管理人、基金托管人或销售机构申请查阅以下文件：本基金备查文件包括下列文件：

- 1、中国证监会批准基金设立的文件
- 2、《兴全可转债混合型证券投资基金基金合同》
- 3、销售代理协议
- 4、注册登记协议
- 5、《兴全可转债混合型证券投资基金托管协议》
- 6、法律意见书
- 7、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- 8、基金托管人业务资格批件和营业执照
- 9、中国证监会要求的其他文件

兴证全球基金管理有限公司

2024年6月29日