

兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金（LOF） 更新招募说明书摘要

基金管理人：兴全基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

二〇一七年十二月

【重要提示】

本基金于 2010 年 8 月 9 日经中国证监会证监许可[2010]1068 号文核准募集。本基金基金合同于 2010 年 11 月 2 日起正式生效,自该日起兴全基金管理有限公司(以下简称“本基金管理人”)正式开始管理本基金。

本招募说明书是对原《兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF) 招募说明书》的定期更新,原招募说明书与本招募说明书不一致的,以本招募说明书为准。本基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准,但中国证监会对本基金募集的核准,并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

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

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

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

本更新招募说明书所载内容截止日 2017 年 11 月 1 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 2017 年第 3 季度报告,数据截止日为 2017 年 9 月 30 日(财务数据未经审计)。本基金托管人农业银行股份有限公司已复核了本次更新的招募说明书。

目 录

第一部分	基金管理人	3
第二部分	基金托管人	13
第三部分	相关服务机构	15
第四部分	基金的名称	33
第五部分	基金的类型	33
第六部分	基金的投资目标	33
第七部分	基金的投资方向	33
第八部分	基金的投资策略及投资组合管理	34
第九部分	基金的业绩比较基准	38
第十部分	基金的风险收益特征	39
第十一部分	基金的投资组合报告	39
第十二部分	基金的业绩	39
第十四部分	基金费用与税收	44
第十四部分	对招募说明书更新部分的说明	46

第一部分 基金管理人

一、基金管理人概况

机构名称：兴全基金管理有限公司

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 号嘉里城办公楼 28-30 楼

法定代表人：兰荣

联系人：江映华

联系电话：021-20398888

组织形式：有限责任公司

注册资本：人民币 1.5 亿元

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

截至 2017 年 11 月 1 日，公司旗下管理着兴全可转债混合型证券投资基金、兴全趋势投资混合型证券投资基金(LOF)、兴全货币市场证券投资基金、兴全全球视野股票型证券投资基金、兴全社会责任混合型证券投资基金、兴全有机增长灵活配置混合型证券投资基金、兴全磐稳增利债券型证券投资基金、兴全合润分级混合型证券投资基金、兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金、兴全绿色投资混合型证券投资基金(LOF)、兴全精选混合型证券投资基金、兴全轻资产投资混合型证券投资基金(LOF)、兴全商业模式优选混合型证券投资基金(LOF)、兴全添利宝货币市场基金、兴全新视野灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金、兴全稳益债券

型证券投资基金、兴全天添益货币市场基金、兴全稳泰债券型证券投资基金、兴全兴泰定期开放债券型发起式证券投资基金、兴全恒益债券型证券投资基金共 20 只基金。

兴全基金管理有限公司总部位于上海，在北京、深圳、厦门设有分公司，并成立了全资子公司——上海兴全睿众资产管理有限公司。公司总部下设投资决策委员会、风险管理委员会、综合管理部、财务室、监察稽核部、运作保障部、基金管理部、专户投资部、固定收益部、研究部、新三板投资部、FOF 投资与金融工程部、交易室、市场部、渠道部、机构业务部、电子商务部、客户服务中心，随着公司业务发展的需要，将对业务部门进行适当的调整。

二、主要人员情况

1、董事、监事、经理及其他高级管理人员概况

兰荣先生，董事长，1960 年生，高级工商管理硕士、高级经济师。历任福建省建设银行投资处干部，福建省福兴财务公司科长，兴业银行总行计划资金部副总经理，兴业银行证券业务部副总经理，福建兴业证券公司总裁，兴业证券股份有限公司董事长、总裁，党委书记。现任兴业证券股份有限公司董事长、兴全基金管理有限公司董事长及法定代表人。

庄园芳女士，董事，总经理，1970 年生，高级工商管理硕士、经济师。历任兴业证券交易业务部干部、交易业务部总经理助理、交易业务部负责人、证券投资部副总经理、证券投资部总经理、投资总监、副总裁，兴业创新资本管理有限公司董事、兴证国际金融集团有限公司董事、兴证投资管理有限公司执行董事，兴全基金管理有限公司董事长及法定代表人。现任兴全基金管理有限公司董事、总经理。

郑城美先生，董事，1974 年生，中共党员，EMBA。曾任兴业证券股份有限公司南平滨江路营业部副总经理（主持工作）、兴业证券股份有限公司计划财务部副总经理、总经理，及兴业证券股份有限公司财务总监（财务负责人）兼计划财务部总经理等职务。现任兴业证券股份有限公司副总裁，兼董事会秘书、首席风险官。

万维德先生 (Marc van Weede)，董事，1965 年生，荷兰国籍，经济学硕士。历任 Forsythe International B.V. 财务经理，麦肯锡公司全球副董事，海康人寿保险有限公司总经理。现任全球人寿保险集团执行副总裁。

巴斯蒂安·范布伦先生 (Bastiaan Van Buuren)，董事，1971 年生，荷兰国籍，经

济学硕士。曾任荷兰国际集团 (ING) 投资管理公司亚洲区客户发展部门负责人、亚太区机构业务负责人、新加坡公司首席执行官、亚洲固定收益投资经理等职务。现任 AEGON 资产管理公司亚洲区负责人。

桑德·马特曼先生 (Sander Maatman), 董事, 1969 年生, 荷兰国籍, 硕士。曾任荷兰 Robeco 鹿特丹投资公司固定收益经理, Aegon 投资管理公司固定收益经理及产品发展部总监、Aegon 银行财务总监、Aegon 荷兰风险与资本管理负责人等职务。现任 Aegon 资产管理公司首席财务官。

欧阳辉先生, 独立董事, 1962 年生, 美国国籍, 获美国加州大学伯克利分校金融学博士和美国杜兰大学化学物理学博士学位。曾任雷曼兄弟公司、野村证券及瑞士银行的董事总经理。曾被美国北卡大学授予终生教职和任美国杜克大学副教授。现任长江商学院金融学杰出院长讲席教授。

吴明先生, 独立董事, 1977 年生, 法学双学士, 具有中国律师资格、英格兰及威尔士高等法院律师资格。曾任上海汇盛律师事务所律师, 上海亚太长城律师事务所律师, 北京中咨律师事务所上海分所合伙人。现任北京大成 (上海) 律师事务所高级合伙人。

周鹤松先生, 独立董事, 1968 年生, 工商管理硕士。曾任日本学术振兴会研究员, 三菱信托银行职员, 通用电器资本公司风险管理领导力项目成员。现任 DAC 财务管理 (中国) 有限公司董事总经理。

杜建新先生, 监事, 1959 年生, 高级工商管理硕士, 经济师。历任江西财经大学情报资料中心主任, 中国银行三明分行办公室副主任, 兴业证券股份有限公司三明营业部副总经理、上海管理总部总经理、人力资源部总经理, 兴全基金管理有限公司督察长, 兴业证券股份有限公司董事会秘书兼人力资源部总经理。

陈育能女士, 监事, 1974 年生, 工商管理硕士。历任民航快递财务会计助理经理, KPMG 助理经理, 新加坡 Prudential 担保公司财务经理, SunLife Everbright 人寿保险财务计划报告助理副总裁。现任同方全球人寿保险有限公司副总裁、首席财务官。

秦杰先生, 职工监事, 1981 年生, 经济学硕士。历任毕马威企业咨询有限公司内部审计、风险管理与合规咨询服务部门高级经理、负责人, 德勤华永会计师事务所高级咨询顾问等职务。现任兴全基金管理有限公司董事会秘书兼监察稽核部总监、综合管理部总监。

李小天女士，职工监事，1982 年生，工商管理硕士。历任《南方日报》、《南方都市报》记者，兴全基金管理有限公司市场部总监助理。现任兴全基金管理有限公司市场部副总监。

2、高级管理人员概况

庄园芳女士，董事，总经理，1970 年生，高级工商管理硕士、经济师。历任兴业证券交易业务部干部、交易业务部总经理助理、交易业务部负责人、证券投资部副总经理、证券投资部总经理、投资总监、副总裁，兴业创新资本管理有限公司董事、兴证国际金融集团有限公司董事、兴证投资管理有限公司执行董事，兴全基金管理有限公司董事长及法定代表人。现任兴全基金管理有限公司董事、总经理。

冯晓莲女士，督察长，1964 年生，中共党员，高级工商管理硕士、高级经济师。先后就职于新疆兵团组织部、新疆兵团驻海南办事处、海南国际信托公司，历任兴业银行党办副科长，兴业证券股份有限公司人力资源部副总经理、人力资源部总经理、合规与风险管理部总经理，兴全基金管理有限公司总经理助理。现任兴全基金管理有限公司督察长。

杨卫东先生，副总经理，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，兴全基金管理有限公司总经理助理兼市场部总监、副总经理兼市场部总监。现任兴全基金管理有限公司副总经理。

董承非先生，副总经理，1977 年生，理学硕士。历任兴全基金管理有限公司研究策划部行业研究员、兴全趋势投资混合型证券投资基金 (LOF) 基金经理助理、兴全商业模式优选混合型证券投资基金 (LOF) 基金经理、兴全全球视野股票型证券投资基金基金经理、上海兴全睿众资产管理有限公司执行董事。现任兴全基金管理有限公司副总经理兼基金管理部投资总监、兴全趋势投资混合型证券投资基金 (LOF) 基金经理，兴全新视野灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金基金经理。

傅鹏博先生，副总经理，1963 年生，经济学硕士。历任上海财经大学经济管理学系讲师，申银万国证券股份有限公司企业融资部经理，东方证券股份有限公司资产管理部负责人、研究所首席策略师、汇添富基金管理有限公司首席策略师、兴全绿色投资混合型证券投资基金 (LOF) 基金经理、总经理助理、兴全基金管理有限公司

基金管理部副总监、FOF 投资与金融工程部总监。现任兴全基金管理有限公司副总经理兼研究部总监、兴全社会责任混合型证券投资基金基金经理。

郑文惠女士，副总经理，1969 年生，EMBA。历任兴业证券泉州营业部财务部经理、副总经理、总经理，运营管理部总经理兼上海分公司副总经理，运营管理部总经理兼上海分公司总经理，私人财富管理总部总经理兼上海分公司总经理。现任兴全基金管理有限公司副总经理兼上海兴全睿众资产管理有限公司执行董事。

3、本基金基金经理

申庆先生，1974 年生，工商管理硕士。历任兴业证券研究发展中心研究员；兴业基金管理有限公司行业研究员、兴全趋势证券投资基金 (LOF) 基金经理助理兼基金管理部总监助理、兴全全球视野股票型证券投资基金基金经理。现任本基金基金经理 (2010 年 11 月 2 日起至今)、兴全恒益债券型证券投资基金基金经理 (2017 年 9 月 20 日至今)。

4、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。投资决策委员会由以下成员组成：

庄园芳 兴全基金管理有限公司董事、总经理

傅鹏博 兴全基金管理有限公司副总经理兼研究部总监、兴全社会责任混合型证券投资基金基金经理

董承非 兴全基金管理有限公司副总经理兼基金管理部投资总监、兴全趋势投资混合型证券投资基金 (LOF) 基金经理、兴全新视野灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金基金经理

吴圣涛 兴全基金管理有限公司基金管理部投资副总监兼兴全商业模式优选混合型证券投资基金 (LOF) 基金经理、兴全全球视野股票型证券投资基金基金经理

谢治宇 兴全基金管理有限公司基金管理部投资副总监兼兴全轻资产投资混合型证券投资基金 (LOF) 基金经理、兴全合润分级混合型证券投资基金基金经理

三、基金管理人的职责

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

2、办理基金备案手续；

- 3、对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账，进行证券投资；
- 4、按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；
- 5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
- 6、编制中期和年度基金报告；
- 7、计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；
- 8、办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；
- 9、召集基金份额持有人大会；
- 10、保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
- 11、以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
- 12、中国证监会规定的其他职责。

四、基金管理人承诺

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

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

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

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

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

- (1) 越权或违规经营；
- (2) 违反基金合同或托管协议；
- (3) 故意损害基金份额持有人或其他基金相关机构的合法权益；
- (4) 在包括向中国证监会报送的资料中进行虚假信息披露；
- (5) 拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管；
- (6) 玩忽职守、滥用职权；
- (7) 泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；
- (8) 除按本公司制度进行基金运作投资外，直接或间接进行其他股票投资；
- (9) 协助、接受委托或以其他任何形式为其他组织或个人进行证券交易；
- (10) 违反证券交易场所业务规则，利用对敲、倒仓等手段操纵市场价格，扰乱市场秩序；
- (11) 贬损同行，以提高自己；
- (12) 在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分；
- (13) 以不正当手段谋求业务发展；
- (14) 有悖社会公德，损害证券投资基金人员形象；
- (15) 其他法律、行政法规禁止的行为。

5、基金经理承诺

- (1) 依照法律法规和基金合同的规定，本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益；
- (2) 不利用职务之便为自己、受雇人或任何第三者谋取利益；
- (3) 不泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密，尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；
- (4) 不以任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

五、基金管理人的风险管理与内部控制制度

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: 公司设立独立的监察稽核部, 监察稽核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, 监察稽核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) 监察稽核部: 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。公司设督察长和监察稽核部。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。

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

(3) 内部财务控制制度

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

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

5、风险管理和内部风险控制的措施

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

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

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

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

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

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

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

6、基金管理人关于内部合规控制声明书

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

第二部分 基金托管人

(一) 基金托管人情况

1、基本情况

名称：中国农业银行股份有限公司（简称中国农业银行）

住所：北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座

法定代表人：周慕冰

成立日期：2009 年 1 月 15 日

批准设立机关和批准设立文号：中国银监会银监复[2009]13 号

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[1998]23 号

注册资本：32,479,411.7 万元人民币

存续期间：持续经营

联系电话：010-66060069

传真：010-68121816

联系人：林葛

中国农业银行股份有限公司是中国金融体系的重要组成部分,总行设在北京。经国务院批准,中国农业银行整体改制为中国农业银行股份有限公司并于 2009 年 1 月 15 日依法成立。中国农业银行股份有限公司承继原中国农业银行全部资产、负债、业务、机构网点和员工。中国农业银行网点遍布中国城乡,成为国内网点最多、业务辐射范围最广,服务领域最广,服务对象最多,业务功能齐全的大型国有商业银行之一。在海外,中国农业银行同样通过自己的努力赢得了良好的信誉,每年位居《财富》世界 500 强企业之列。作为一家城乡并举、联通国际、功能齐备的大型国有商业银行,中国农业银行一贯秉承以客户为中心的经营理念,坚持审慎稳健经营、可持续发展,立足县域和城市两大市场,实施差异化竞争策略,着力打造"伴你成长"服务品牌,依托覆盖全国的分支机构、庞大的电子化网络和多元化的金融产品,致力为广大客户提供优质的金融服务,与广大客户共创价值、共同成长。

中国农业银行是中国第一批开展托管业务的国内商业银行,经验丰富,服务优质,业绩突出,2004 年被英国《全球托管人》评为中国"最佳托管银行"。2007 年中

国农业银行通过了美国 SAS70 内部控制审计,并获得无保留意见的 SAS70 审计报告,自 2010 年起中国农业银行连续通过托管业务国际内控标准 (ISAE3402) 认证,表明了独立公正第三方对中国农业银行托管服务运作流程的风险管理、内部控制的健全有效性的全面认可。中国农业银行着力加强能力建设,品牌声誉进一步提升,在 2010 年首届“金牌理财 TOP10 颁奖盛典”中成绩突出,获“最佳托管银行”奖。2010 年再次荣获《首席财务官》杂志颁发的“最佳资产托管奖”。2012 年荣获第十届中国财经风云榜“最佳资产托管银行”称号;2013 年至 2016 年连续荣获上海清算所授予的“托管银行优秀奖”和中央国债登记结算有限责任公司授予的“优秀托管机构奖”称号;2015 年、2016 年荣获中国银行业协会授予的“养老金业务最佳发展奖”称号。

中国农业银行证券投资基金托管部于 1998 年 5 月经中国证监会和中国人民银行批准成立,2014 年更名为托管业务部/养老金管理中心,内设综合管理部、业务管理部、客户一部、客户二部、客户三部、客户四部、风险合规部、产品研发与信息技术部、营运一部、营运二部、市场营销部、内控监管部、账户管理部,拥有先进的安全防范设施和基金托管业务系统。

2、主要人员情况

中国农业银行托管业务部现有员工近 140 名,其中具有高级职称的专家 30 余名,服务团队成员专业水平高、业务素质好、服务能力强,高级管理层均有 20 年以上金融从业经验和高级技术职称,精通国内外证券市场的运作。

3、基金托管业务经营情况

截止到 2017 年 9 月 30 日,中国农业银行托管的封闭式证券投资基金和开放式证券投资基金共 415 只。

(二) 基金托管人的内部风险控制制度说明

1、内部控制目标

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

2、内部控制组织结构

风险管理委员会总体负责中国农业银行的风险管理与内部控制工作,对托管业务风险管理和内部控制工作进行监督和评价。托管业务部专门设置了风险管理处,配备

了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作,独立行使监督稽核职权。

3、内部控制制度及措施

具备系统、完善的制度控制体系,建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程,可以保证托管业务的规范操作和顺利进行;业务人员具备从业资格;业务管理实行严格的复核、审核、检查制度,授权工作实行集中控制,业务印章按规程保管、存放、使用,账户资料严格保管,制约机制严格有效;业务操作区专门设置,封闭管理,实施音像监控;业务信息由专职信息披露人负责,防止泄密;业务实现自动化操作,防止人为事故的发生,技术系统完整、独立。

(三) 基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

基金托管人通过参数设置将《基金法》、《运作办法》、基金合同、托管协议规定的投资比例和禁止投资品种输入监控系统,每日登录监控系统监督基金管理人的投资运作,并通过基金资金账户、基金管理人的投资指令等监督基金管理人的其他行为。

当基金出现异常交易行为时,基金托管人应当针对不同情况进行以下方式的处理:

- 1、电话提示。对媒体和舆论反映集中的问题,电话提示基金管理人;
- 2、书面警示。对本基金投资比例接近超标、资金头寸不足等问题,以书面方式对基金管理人进行提示;
- 3、书面报告。对投资比例超标、清算资金透支以及其他涉嫌违规交易等行为,书面提示有关基金管理人并报中国证监会。

第三部分 相关服务机构

一、基金份额发售机构

1、直销机构

- 兴全基金管理有限公司直销柜台

地址:上海市浦东新区芳甸路 1155 号嘉里城办公楼 30 楼

联系人:秦洋洋、沈冰心

直销联系电话:021-20398706、021-20398927

传真号码:021-58368869、021-58368915

- 兴全基金管理有限公司网上直销平台 (含微网站、APP) (目前已开通工商银行直连、农业银行直连、建设银行直连、招商银行直连、银联通 (工商银行、农业银行、建设银行、交通银行、民生银行、平安银行、邮储银行、兴业银行、光大银行、中信银行、浦发银行、南京银行、金华银行、浙商银行、温州银行、上海农商银行)、通联支付 (工商银行、农业银行、中国银行、交通银行、建设银行、中信银行、光大银行、华夏银行、民生银行、招商银行、兴业银行、上海银行、平安银行、浦发银行) 以及网上直销汇款交易) (排名不分先后)

交易网站: <https://trade.xqfunds.com>、c.xqfunds.com

客服电话: 400-678-0099; (021) 38824536

- 直销前置自助式平台

交易网址: <https://www.yypt.com>

<https://i.yypt.com/finance/org/home/homePage.do>

2、代销机构

● 代销银行

(1) 中国农业银行股份有限公司

住所: 北京市东城区建国门内大街 69 号

法定代表人: 周慕冰

客服电话: 95599

传真: (010) 85109219

公司网站: www.abchina.com

(2) 兴业银行股份有限公司

住所: 福州市湖东路 154 号

法定代表人: 高建平

电话: (021) 52629999

客户服务热线: 95561

公司网站: <http://www.cib.com.cn>

(3) 中国工商银行股份有限公司

住所：中国北京复兴门内大街 55 号

办公地址：中国北京复兴门内大街 55 号

法定代表人：易会满

客户服务电话：95588

传真：(010) 66107914

公司网站：<http://www.icbc.com.cn>

(4) 中国邮政储蓄银行股份有限公司

住所：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：李国华

客户服务电话：95580

传真：(010) 68858117

公司网站：<http://www.psbc.com>

(5) 交通银行股份有限公司

住所：上海市银城中路 188 号

办公地址：上海市银城中路 188 号

法定代表人：牛锡明

电话：(021) 58781234

传真：(021) 58408483

客户服务电话：95559

公司网站：<http://www.bankcomm.com>

(6) 中信银行股份有限公司

住所：北京市东城区朝阳门北大街 9 号

法定代表人：李庆萍

电话：(010) 65557013

传真：(010) 65550827

客户服务电话：95558

公司网站：<http://bank.ecitic.com>

(7) 中国银行股份有限公司

住所 (办公地址): 北京市西城区复兴门内大街 1 号

法定代表人: 陈四清

客户服务电话: 95566

公司网站: <http://www.boc.cn>

(8) 中国光大银行股份有限公司

住所: 北京市西城区太平桥大街 25 号中国光大中心

法定代表人: 唐双宁

客户服务电话: 95595

传真: (010) 68560661

公司网站: <http://www.cebbank.com>

(9) 中国宁波银行股份有限公司

住所: 宁波市鄞州区宁南南路 700 号

法定代表人: 陆华裕

客户服务电话: 96528, (北京、上海地区 962528)

传真: (0574) 87050024

公司网站: <http://www.nbcb.com.cn>

(10) 上海浦发银行股份有限公司

住所: 上海市中山东一路 12 号

法定代表人: 高国富

客户服务电话: 95528

传真: (021) 63604199

公司网站: <http://www.spdb.com.cn>

(11) 平安银行股份有限公司

住所 (办公地址): 广东省深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行大厦

法定代表人: 谢永林

客户服务电话: 95511-3

公司网站: www.bank.pingan.com

(12) 华夏银行股份有限公司

住所 (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: 李明吉

客户服务电话：95577

公司网站：<http://www.hxb.com.cn>

(13) 中国建设银行股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人：田国立

客户服务电话：95533

公司网站：<http://www.ccb.com>

(14) 重庆银行股份有限公司

住所：重庆市渝中区邹容路 153 号

法定代表人：甘为民

客户服务电话：96899（重庆地区）、400-709-6899（其他地区）

公司网站：<http://www.cqcbank.com>

(15) 中国民生银行股份有限公司

住所（办公地址）：北京市西城区复兴门内大街 2 号

法定代表人：洪崎

客户服务电话：95568

传真：(010) 57092611

公司网站：<http://www.cmbc.com.cn>

(16) 东莞农村商业银行股份有限公司

住所：东莞市东城区鸿福东路 2 号东莞农商银行大厦

法定代表人：王耀球

客户服务电话：961122

公司网站：<http://www.drcbank.com>

(17) 招商银行股份有限公司

住所：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

法定代表人：李建红

联系人：邓炯鹏

电话：(0755) 83198888

传真：(0755) 83195109

客服电话：95555

公司网站：<http://www.cmbchina.com>

(18) 上海银行股份有限公司

住所：上海市浦东新区银城中路 168 号

法定代表人：金煜

网站：<http://www.bankofshanghai.com>

客户服务电话：95594

● 代销券商

(1) 兴业证券股份有限公司

住所：福州市湖东路 268 号

法定代表人：兰荣

客户服务热线：4008888123

传真：(021) 38565785

公司网站：<http://www.xyzq.com.cn>

(2) 国泰君安证券股份有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区商城路 618 号

法定代表人：杨德红

传真：(021) 38670666

客户服务热线：4008888666

公司网站：<http://www.gtja.com.cn>

(3) 中信建投证券股份有限公司

住所：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

法定代表人：王常青

开放式基金咨询电话：4008888108

开放式基金业务传真：(010) 85130577

公司网站：<http://www.csc108.com>

(4) 华泰证券股份有限公司

办公地址：江苏省南京市江东中路 228 号

法定代表人：周易

电话：83290979

客户咨询电话：95597

公司网站：<http://www.htsc.com.cn>

(5) 长江证券股份有限公司

住所：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

法定代表人：尤习贵

电话：(027) 65799999

传真：(027) 85481900

客户服务热线：4008-888-999 或 95579

公司网站：<http://www.cjsc.com.cn>

(6) 海通证券股份有限公司

住所：上海市广东路 689 号

法定代表人：周杰

办公电话：(021) 23219000

客服电话：400-8888-001、(021) 962503 或拨打各城市营业网点咨询电话

公司网站：<http://www.htsec.com>

(7) 招商证券股份有限公司

住所：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38—45 层

法定代表人：霍达

电话：(0755) 82943666

传真：(0755) 82943636

客户服务热线：95565、4008888111

公司网站：<http://www.newone.com.cn>

(8) 中国银河证券股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街 35 号 2-6 层

法定代表人：陈共炎

传真：(010) 66568430

客服电话：8008201968

公司网站：<http://www.chinastock.com.cn>

(9) 广发证券股份有限公司

住所：广州市天河区天河北路 183-187 号大都会广场 43 楼

法定代表人：孙树明

开放式基金咨询电话：95575 转各营业网点

开放式基金业务传真：(020) 87555305

公司网站：<http://www.gf.com.cn>

(10) 山西证券股份有限公司

办公（注册）地址：山西省太原市府西街 69 号山西国贸中心东塔楼

法定代表人：侯巍

客服电话：95573

联系电话：(0351) 8686703

传真：(0351) 8686619

公司网站：<http://www.i618.com.cn>

(11) 东方证券股份有限公司

住所：上海市中山南路 318 号 2 号楼 22 层、23 层、25-29 层

法定代表人：潘鑫军

电话：(021) 63325888

传真：(021) 63326173

客服热线：95503

公司网站：<http://www.dfzq.com.cn>

(12) 德邦证券股份有限公司

住所：上海市曹杨路 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

联系电话：(021) 68761616

传真电话：(021) 68767981

客服电话：4008888128

公司网站: <http://www.tebon.com.cn>

(13) 中银国际证券有限责任公司

住所: 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

开放式基金咨询电话: 4006208888 或各地营业网点咨询电话

开放式基金业务传真: (021) 50372474

公司网站: <http://www.bocichina.com.cn>

(14) 光大证券股份有限公司

住所: 上海市静安区新闻路 1508 号

法定代表人: 薛峰

联系电话: (021) 22169081

传真: (021) 22169134

客服热线: 4008888788

公司网站: <http://www.ebscn.com>

(15) 国元证券股份有限公司

住所: 合肥市梅山路 18 号

法定代表人: 蔡咏

客户服务电话: 95578

传真电话: (0551) 2207114

公司网站: <http://www.gyzq.com.cn>

(16) 湘财证券股份有限公司

住所: 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: 林俊波

电话: (021) 68634518

传真: (021) 68865680

客服电话: 400-888-1551

公司网站: <http://www.xcsc.com>

(17) 申万宏源证券有限公司

住所 (办公地址): 上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

法定代表人：李梅

电话：(021) 33389888

传真：(021) 33388224

客服电话：95523 或 4008895523

公司网站：<http://www.swhysc.com>

(18) 中航证券有限公司

住所：南昌市红谷中大道 1619 号南昌国际金融大厦 A 栋 41 层

法定代表人：王宜四

联系电话：(0791) 6768763

传真电话：(0791) 6789414

客服电话：400-8866-567

公司网站：<http://www.avicsec.com>

(19) 渤海证券股份有限公司

住所：天津经济技术开发区第二大街 42 号写字楼 101 室

法定代表人：王春峰

联系电话：(022) 28451861

传真：(022) 28451892

客服电话：4006515988

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

(20) 瑞银证券有限责任公司

住所：北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心 12 层、15 层

法定代表人：方婷

联系电话：(010) 5832 8752

传真：(010) 5922 8748

客服电话：400-887-8827

公司网站：<http://www.ubssecurities.com>

(21) 华福证券有限责任公司

住所：福州市五四路 157 号新天地大厦 7、8 层

法定代表人：黄金琳

联系电话：(0591) 87383623

传真：(0591) 87383610

客户服务电话：96326（福建省外请加拨 0591）

公司网站：<http://www.hfzq.com.cn>

(22) 中泰证券股份有限公司

住所：山东省济南市经七路 86 号

法定代表人：李玮

传真：(0531) 81283900

客户服务电话：95538

公司网站：<http://www.zts.com.cn>

(23) 爱建证券有限责任公司

住所：上海市世纪大道 1600 号 32 楼

法定代表人：祝建

联系电话：(021) 32229888

客服电话：(021) 63340678

公司网站：<http://www.ajzq.com>

(24) 安信证券股份有限公司

住所：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元

法定代表人：王连志

联系电话：(0755) 82825551

传真：(0755) 82558355

客服电话：4008001001

公司网站：<http://www.essence.com.cn>

(25) 华融证券股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街 8 号

法定代表人：祝献忠

联系电话：(010) 58568007

传真：(010) 58568062

客服电话：(010) 58568162

公司网站：<http://www.hrsec.com.cn>

(26) 国信证券股份有限公司

住所：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

法定代表人：何如

联系电话：(0755) 82130833

传真：(0755) 82133952

客服电话：95536

公司网站：<http://www.guosen.com.cn>

(27) 东莞证券股份有限公司

住所：广东省东莞市莞城区可园南路一号

法定代表人：张运勇

联系电话：(0769) 22119341

传真：(0769) 22116999

客户服务电话：961130

公司网站：<http://www.dgzq.com.cn>

(28) 东海证券股份有限公司

住所：江苏省常州市延陵西路 23 号投资广场 18 楼

法定代表人：赵俊

联系电话：(0519) 88157761

传真：(0519) 88157761

客服电话：4008888588、95531

公司网站：<http://www.longone.com.cn>

(29) 长城证券股份有限公司

住所：深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 16、17 层

法定代表人：丁益

客户服务电话：4006668888

公司网站：<http://www.cgws.com>

(30) 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

法定代表人：张佑君

统一客服电话：95558

公司网站地址：<http://www.cs.ecitic.com>

(31) 中信证券（山东）有限责任公司

住所：山东省青岛市崂山区深圳路 222 号 1 号楼 2001

法定代表人：姜晓林

客户服务热线：95548

传真：(0532) 85022605

公司网站：<http://www.citicssd.com>

(32) 信达证券股份有限公司

住所：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

法定代表人：张志刚

客户服务电话：400-800-8899

基金业务传真：010-63080978

公司网站：<http://www.cindasc.com>

(33) 华鑫证券有限责任公司

住所：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 28 层 A01、B01(b) 单元

法定代表人：俞洋

客户服务电话：400-109-9918

基金业务传真：021-64333051

公司网站：<http://www.cfsc.com.cn>

(34) 国都证券股份有限公司

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：王少华

客户服务电话：4008188118

基金业务传真：010-84183311

公司网站：<http://www.guodu.com>

(35) 联讯证券股份有限公司

住所：广东省惠州市惠城区江北东江三路 55 号

法定代表人：徐刚

客户服务电话：95564

基金业务传真：010-64408834

公司网站：<http://www.lxzq.com.cn>

(36) 广州证券股份有限公司

住所：广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19 楼、20 楼

法定代表人：邱三发

客户服务电话：020-961303

基金业务传真：020-88836654

公司网站：<http://www.gzs.com.cn>

(37) 平安证券股份有限公司

住所：深圳市福田区中心区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层

法定代表人：刘世安

网站：<http://stock.pingan.com>

客户服务电话：4006-788-887

(38) 华西证券股份有限公司

住所：四川省成都市高新区天府二街 198 号华西证券大厦

法定代表人：杨炯洋

网站：<http://www.hx168.com.cn>

客户服务电话：95584

(39) 财达证券股份有限公司

住所：河北省石家庄市桥西区自强路 35 号庄家金融大厦 23 层

法定代表人：翟建强

网站：<http://www.s10000.com/>

客户服务电话：400-612-8888

● 其他代销机构

(1) 天相投资顾问有限公司

住所：北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座

法定代表人：林义相

联系电话：(010) 66045608

传真：(010) 66045527

客服电话：(010) 66045678

公司网站：<http://www.txsec.com>

(2) 上海天天基金销售有限公司

住所：上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼 2 层

法定代表人：其实

客户服务电话：400-1818-188

基金业务传真：(021) 64385308

公司网站：<http://www.1234567.com.cn>

(3) 和讯信息科技有限公司

住所：北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦 10 层

法定代表人：王莉

客户服务电话：4009200022

基金业务传真：(021) 20835879

公司网站：<http://licaike.hexun.com>

(4) 上海好买基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区场中路 685 弄 37 号 4 号楼 449 室

办公地址：上海市浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 903~906 室

法定代表人：杨文斌

客服电话：400-700-9665

传真：(021) 68596916

网站：<http://www.ehowbuy.com>

(5) 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仓前街道文一西路 1218 号 1 幢 202 室

法定代表人：陈柏青

客户服务电话：4000-766-123

数米基金网：<http://www.fund123.cn>

(6) 浙江同花顺基金销售有限公司

住所：浙江省杭州市文二西路 1 号元茂大厦 903

法定代表人：凌顺平

客户服务热线：4008-773-772

传真：0571-86800423

公司网站：<http://www.5ifund.com>

(7) 珠海盈米财富管理有限公司

住所：广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 12 楼 1201-1203

室

法定代表人：肖雯

客户服务热线：020-89629066

传真：020-89629011

公司网站：<http://www.yingmi.cn>

(8) 上海陆金所资产管理有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号

法定代表人：郭坚

客户服务电话：4008219031

传真：021-22066653

网址：<http://www.lufunds.com>

(9) 诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司

住所：上海市虹口区飞虹路 360 弄 9 号 3724 室

法定代表人：汪静波

客户服务电话：400-821-5399

传真：021-38509777

网站：<http://www.noah-fund.com>

(10) 深圳众禄金融控股股份有限公司

住所：深圳市罗湖区笋岗街道梨园路物资控股置地大厦 8 楼 801

法定代表人：薛峰

网站：<http://www.zlfund.cn>

客户服务电话：4006-788-887

(11) 上海大智慧财富管理有限公司

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

单元

法定代表人：申健

网站：<https://8.gw.com.cn/>

客户服务电话：021-20219931

(12) 中信期货有限公司

住所：北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦 18 层

法定代表人：张磊

网站: <http://www.citicsf.com/>

客户服务电话: 400-9908-826

(13) 厦门市鑫鼎盛控股有限公司

办公地址: 厦门市思明区鹭江道 2 号厦门第一广场西座 1501-1504 室

法定代表人: 陈洪生

网站: <http://www.xds.com.cn/>

客户服务电话: 400-918-0808

(14) 北京蛋卷基金销售有限公司

住所: 北京市朝阳区阜通东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层 222507

法定代表人: 钟斐斐

客户服务电话: 4000618518

传真: 010-61840699

网站: <https://danjuanapp.com/>

(15) 北京广源达信投资管理有限公司

住所: 北京市西城区新街口外大街 28 号 C 座六层 605 室

法定代表人: 齐剑辉

网站: [www: niuniufund.com](http://www.niuniufund.com)

客户服务电话: 4006236060

(16) 北京增财基金销售有限公司

住所: 北京市西城区南礼士路 66 号建威大厦 1208 室

法定代表人: 罗细安

客户服务电话: 010-67000988-6025

传真: 010-67000988

网站: <http://www.zcvc.com.cn/>

(17) 上海基煜基金销售有限公司

住所: 上海市崇明县长兴镇路潘园公路 1800 号 2 号楼 6153 室 (上海泰和
经济发展区)

法定代表人: 王翔

客户服务电话: 021-65370077

传真：021-55085991

(18) 北京肯特瑞财富管理有限公司

注册地址：北京市海淀区海淀东三街 2 号 4 层 401-15

办公地址：北京市亦庄经济开发区科创十一街 18 号院 A 座 17 层

法定代表人：陈超

客户服务热线：400 098 8511

传真：89188000

公司网站：<http://kenterui.jd.com>

(19) 北京汇成基金销售有限公司

住所：北京市海淀区中关村大街 E 世界财富中心 A 座 1108 号

法定代表人：王伟刚

网站：www.hcjijin.com

客户服务电话：400-619-9059

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，并及时公告。

二、注册登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

住所：北京市西城区太平桥大街 17 号

法定代表人：周明

办公地址：北京市西城区太平桥大街 17 号

联系电话：4008-058-058

传真：010-58598907

联系人：任瑞新

三、出具法律意见书的律师事务所和经办律师

名称：通力律师事务所

住所（办公地址）：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

负责人：韩炯

经办律师：吕红、安冬

电话：021-31358666

传真：021-31358600

联系人：安冬

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有限公司（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：卢伯卿

电话：(021) 61418888

传真：(021) 63350377

经办注册会计师：许湘照、汪芳

联系人：汪芳

第四部分 基金的名称

兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF)

第五部分 基金的类型

契约型上市开放式

第六部分 基金的投资目标

本基金采用指数复制结合相对增强的投资策略，即通过指数复制的方法拟合、跟踪沪深 300 指数，并在严格控制跟踪误差和下方跟踪误差的前提下进行相对增强的组合管理，谋求基金资产的长期增值。本基金力争日均跟踪误差不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 7.75%，日均下方跟踪误差不超过 0.3%，年下方跟踪误差不超过 4.75%。

第七部分 基金的投资方向

本基金采用指数复制法进行指数化投资，并结合相对增强的投资策略，追求接近或超越沪深 300 指数所代表的 A 股市场平均收益率水平，为投资者提供一个投资沪深 300 指数的有效投资工具，力争使投资者充分分享中国经济增长和证券市场发

展的成果。

本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括投资于国内依法发行上市 的股票、债券、权证以及经中国证监会批准允许本基金投资的其它金融工具。法律 法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可 以将其纳入投资范围。

本基金投资于股票资产占基金资产的比例为 90%-95%，投资于标的指数成份股、 备选成份股的资产占基金资产的比例不低于 90%。现金、债券资产以及中国证监 会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的比例为 5%-10%，其中现金或者到期日 在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。权证及其他金融工具的投资比例 符合法律法规和监管机构的规定。

第八部分 基金的投资策略及投资组合管理

本基金采用指数复制结合相对增强的投资策略，即通过指数复制的方法拟合、 跟踪沪深 300 指数，并在严格控制跟踪误差和下方跟踪误差的前提下进行相对增强 的组合管理。指数复制法，即按照标的指数的成份股构成及其权重构建基金股票组 合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。如因特殊情况导致基金 无法获得足够数量的股票时，基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的 实际投资组合，追求尽可能贴近标的指数的表现。在严格控制跟踪误差和下方跟踪 误差的前提下，本基金还将采取相对增强的投资策略，通过基本面分析对指数成份 股权重进行优化调整，并辅以其他增强策略，以求提高本基金的投资收益率。

1、资产配置策略

本基金为增强型指数基金，股票投资比例为基金资产的 90%-95%，其中沪深 300 指数的成份股及其备选成份股的投资比例不低于基金资产的 90%。除非因分红或基 金持有人赎回或申购等原因，本基金将保持相对固定的股票投资比例，通过结合公 司投研团队的基本面研究及数量化投资技术，控制与标的指数的跟踪误差和下方跟 踪误差，追求接近或超过标的指数的表现。

2、股票投资策略

本基金股票资产投资采用指数增强复制策略，即根据沪深 300 指数成份股的基 准权重构建股票投资组合，并根据成份股及其权重的变动而进行相应调整；同时， 在严格控制跟踪误差和下方跟踪误差的前提下，本基金将剔除或低配部分明显高估

的标的指数成份股，并辅以量化增强及其他辅助增强策略，以期达到增强投资的目的。

(1) 指数复制策略 (Index Replication Strategy)

本基金通过指数复制策略进行指数化投资。通常情况下，指数复制策略是指根据标的指数成份股在指数中的权重来确定成份股的买卖数量。在买卖成份股的过程中，尤其在基金建仓期间，本基金可采取适当方法，以降低交易成本。

在特殊情况下，本基金可以选择其他股票或股票组合用来替换标的指数中的股票，这些情况包括但不限于以下情形：①因法律法规的限制或股票停牌等原因，导致本基金不能投资相关股票；②因本基金资产规模过大，导致本基金持有股票比例过高；③标的指数成份股流动性严重不足等。

进行替换遵循的原则如下：①从标的指数成份股及其备选成份股当中选择用以替换的股票；②用以替换的股票与被替换的股票属于同一行业；③用以替换的股票具有较好的流动性；④替换后，该成份股所在行业在基金股票资产组合中的权重与标的指数中该行业权重基本一致；⑤用以替换的股票或股票组合与被替换的股票在考察期内日收益率序列风险收益特征力争高度相关，能较好地代表被替代股票的收益率波动情况；⑥在同一行业中，如无法找到用以替换的股票或者买不到足够用以替换的股票，本基金将考虑跟踪误差和投资者利益等因素，从标的指数成份股及其备选成份股当中，选择用以替换的股票或股票组合。

根据现有法律法规，本基金不能投资于基金托管人发行的股票，本基金将遵循以下原则对基金托管人发行的股票进行替换：①从其他银行股中选择用以替换的股票或股票组合；②用以替换的股票或股票组合与标的指数中被替换股票的权重基本一致；③用以替换的股票或股票组合与被替换股票的风险收益特征力争高度相关，能较好地代表基金托管人发行股票的收益率波动情况。若未来法律法规取消上述限制，本基金可将基金托管人发行的股票纳入投资范围。

(2) 股票增强策略 (Equity-based Enhancement Strategy)

本基金在控制跟踪误差和下方跟踪误差，加强风险管理的基础上，进行适度的增强性投资。本基金采取基于基本面的个股相对增强投资策略，即剔除或低配部分标的指数成份股，用其他股票或股票组合进行替换，同时辅以其他辅助增强策略，以求获取超额投资收益。

增强性投资会加大投资组合相对于基准的偏离度，因此本基金采用“跟踪误差”

和“下方跟踪误差”这两类指标对投资组合进行监控与评估，进而对增强性投资加以约束，以力争日均跟踪误差不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 7.75%，日均下方跟踪误差不超过 0.3%，年下方跟踪误差不超过 4.75%。

A、基于基本面的增强 (Fundamental-based Enhancement)

鉴于中国股票市场的低效性，存在部分股票估值不合理的现象，本基金将通过对标的指数成份股及其备选成份股的基本面分析，剔除或低配部分标的指数成份股，以达到增强组合收益的效果。具体而言，本基金将剔除或低配具备以下一项或多项特征的股票：

① 基本面较差，缺乏核心竞争力，经营业绩下滑；

② 目前股价水平明显高于中长期估值水平，在可比公司中，股票相对估值偏高；

③ 股价涨幅严重透支其现有业绩支持的股票；

④ 其他特殊个股，例如预期将从指数中剔除的个股、面临重大的不利行政处罚或司法诉讼的个股、有充分而合理的理由认为其市场价格被操作的个股等。

⑤ 本基金还对沪深 300 指数成份股及其备选成份股的流动性指标进行评估，在严格控制跟踪误差和下方跟踪误差的前提下，剔除或低配流动性较差的个股。

为达到基金投资比例的要求，本基金将对上述被剔除或低配的个股进行替换，该替换策略将遵循指数复制策略当中的替换原则。

B、量化增强策略 (Quantitative Enhancement)

本基金采用 Alpha 多因子模型，在严格控制跟踪误差和下方跟踪误差的前提下，优化指数成分股权重，作为指数增强投资中的参考。

本基金选取价值、成长、盈利、市场特征四大类因子，建立 Alpha 多因子模型。大类因子由一系列单因子组成，其中价值因子主要是指股票的绝对和相对估值水平，包括市盈率、市净率、市销率、EV/EBITDA 等指标；成长因子主要包括上市公司主营业务收入、现金流、净利润等指标的历史增长和预测增长；盈利因子主要包括上市公司毛利率、净利润率、净资产收益率等指标的绝对和相对水平；市场特征因子主要包括股票价格的动量/反转趋势、股票的规模因子以及其他风格因子。

通过 Alpha 多因子模型，本基金对沪深 300 指数成分股进行综合评分，并根据评分结果，在严格控制跟踪误差和下方跟踪误差的前提下，对沪深 300 指数成分股进行权重优化，作为指数增强投资中的参考。

C、其他辅助增强 (Other Enhancement)

本基金还可采取以下辅助增强策略，以期在控制风险的前提下，获取超额收益。本基金可投资预期将纳入指数的个股，以及新股发行、增发或配股在内的具有重大投资机会的股票，以增强基金的投资收益。

3、权证投资策略

本基金将综合考虑权证定价模型、市场供求关系、交易制度设计等多种因素对权证进行投资，以提高投资效率，增强基金的投资收益。

4、债券投资策略

本基金债券投资部分以保证基金资产流动性、提高基金投资收益为主要目标，主要投资于到期日一年以内的政府债券、金融债等。

在法律法规许可时，本基金可基于谨慎原则运用其他相关金融工具，对基金投资组合进行管理。

5、股票指数化投资日常投资组合管理

(1) 定期调整

根据标的指数的编制规则及调整公告，本基金在指数成份股调整生效前，分析并确定组合调整策略，及时进行投资组合的优化调整，尽量减少标的指数成份股变动所带来的跟踪误差和下方跟踪误差。

(2) 不定期调整

A、若出现标的指数成份股临时调整的情形，本基金管理人将密切关注样本股票的调整，并及时制定相应的投资组合调整策略。

B、跟踪标的指数成份股及其备选成份股公司信息，包括股本变化、分红、配股、增发、停牌、复牌，以及其他重大信息，分析这些信息对指数的影响，并根据这些信息确定基金投资组合的每日交易策略。

C、根据本基金的申购和赎回情况，结合基金的现金头寸管理，制定交易策略以应对基金的申购赎回，从而有效跟踪标的指数。

D、本基金将参与一级市场新股认购和上市公司增发或配股，由此得到的股票将在其规定持有期之后的 10 个交易日内全部卖出，其中标的指数成份股及其备选成份股和将要成为成份股或备选股的除外。

E、因本基金基金合同约定的基金管理人之外的原因导致投资组合超出基金合同的约定时，基金管理人将在 10 个交易日内进行调整，以符合有关限制规定。

(3) 跟踪误差的监控与管理

本基金对标的指数的跟踪目标是：力争使得基金净值增长率与业绩比较基准收益率之间的日平均跟踪误差不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 7.75%，日平均下方跟踪误差不超过 0.3%，年下方跟踪误差不超过 4.75%。每日对基金组合与业绩比较基准的收益率偏离度进行跟踪，每月末、季度末定期分析基金跟踪误差变化情况及其原因，并给出优化跟踪误差的基金管理方案。日均跟踪误差和日均下方跟踪误差的计算公式如下：

$$\text{日均跟踪误差} = \sqrt{\frac{\sum_{i=1}^n (r_i - \bar{r})^2}{n-1}}, \text{ 其中}$$

r_i = 第 i 日基金份额净值收益率 - 第 i 日业绩比较基准收益率；

$$\bar{r} = \frac{\sum_{i=1}^n r_i}{n}, \text{ } n \text{ 为考察的天数。}$$

$$\text{日均下方跟踪误差} = \sqrt{\frac{\sum_{i=1}^n (r_i - \bar{r})^2}{n-1}}, \text{ 其中}$$

r_i = Min (0, 第 i 日基金份额净值收益率 - 第 i 日业绩比较基准收益率)；

$$\bar{r} = \frac{\sum_{i=1}^n r_i}{n}, \text{ } n \text{ 为考察的天数。}$$

年跟踪误差和年下方跟踪误差的计算公式如下：

年跟踪误差 = 日均跟踪误差 $\times \sqrt{K}$ ，其中 K 为一年的实际交易天数；

年下方跟踪误差 = 日均下方跟踪误差 $\times \sqrt{K}$ ，其中 K 为一年的实际交易天数。

第九部分 基金的业绩比较基准

本基金的业绩基准为：沪深 300 指数 $\times 95\%$ + 同业存款利率 $\times 5\%$

如果指数编制单位停止计算编制该指数或更改指数名称、或有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，本基金管理人有权对此基准进行调整。业绩比较基准的变更须经基金管理人和基金托管人协商一致，并报中国证监会备案，基

基金管理人应在调整前 3 个工作日在至少一种中国证监会指定媒体上公告，并在更新的招募说明书中列示。

第十部分 基金的风险收益特征

本基金属于股票型基金，预期风险与预期收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数增强型基金，跟踪标的指数市场表现，追求接近或超越沪深 300 指数所代表的市场平均收益，是股票基金中处于中等风险水平的基金产品。

第十一部分 基金的投资组合报告

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

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

本投资组合报告所载数据取自兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF) 2017 年第 3 季度报告，所载数据截至 2017 年 9 月 30 日，本报告中所列财务数据未经审计。

1、报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额 (元)	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	934,148,356.99	93.20
	其中：股票	934,148,356.99	93.20
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	54,152,814.00	5.40
	其中：债券	54,152,814.00	5.40
	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	7,200,000.00	0.72
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	2,228,186.02	0.22
8	其他资产	4,560,292.26	0.45
9	合计	1,002,289,649.27	100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

(1) 指数投资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	457,430.20	0.05
B	采矿业	36,959,458.61	3.71
C	制造业	244,046,597.51	24.48
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	28,415,515.45	2.85
E	建筑业	36,622,116.44	3.67
F	批发和零售业	19,198,578.86	1.93
G	交通运输、仓储和邮政业	24,473,424.92	2.46
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	27,548,650.19	2.76
J	金融业	394,064,814.26	39.53
K	房地产业	43,351,521.10	4.35
L	租赁和商务服务业	26,071,702.00	2.62
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	5,043,075.44	0.51
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	5,030,023.44	0.50
S	综合	-	-
	合计	891,282,908.42	89.41

(2) 积极投资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	11,347,613.60	1.14
C	制造业	24,274,855.77	2.44
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	656,589.34	0.07
E	建筑业	111,387.76	0.01
F	批发和零售业	799,037.79	0.08
G	交通运输、仓储和邮政业	25,571.91	0.00
H	住宿和餐饮业	263,697.20	0.03
I	信息传输、软件和信息技术服务业	340,758.72	0.03
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	447,174.00	0.04
M	科学研究和技术服务业	471,006.14	0.05
N	水利、环境和公共设施管理业	2,836,613.26	0.28
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	115,299.99	0.01
R	文化、体育和娱乐业	1,175,843.09	0.12
S	综合	-	-
	合计	42,865,448.57	4.30

(3) 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

无。

3、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
1	601318	中国平安	1,208,000	65,425,280.00	6.56
2	601601	中国太保	1,568,800	57,935,784.00	5.81
3	600036	招商银行	1,068,800	27,307,840.00	2.74
4	601628	中国人寿	968,800	26,874,512.00	2.70
5	601328	交通银行	3,938,883	24,893,740.56	2.50
6	600015	华夏银行	2,458,800	22,793,076.00	2.29
7	600741	华域汽车	998,889	22,524,946.95	2.26
8	600690	青岛海尔	1,478,838	22,315,665.42	2.24
9	601166	兴业银行	1,288,800	22,283,352.00	2.24
10	601009	南京银行	2,678,800	21,189,308.00	2.13

(2) 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资
明细

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
1	601699	潞安环能	738,800	7,572,700.00	0.76
2	000800	一汽轿车	518,000	7,127,680.00	0.72
3	600873	梅花生物	718,834	4,600,537.60	0.46
4	601200	上海环境	112,768	2,785,369.60	0.28
5	002821	凯莱英	42,818	2,578,071.78	0.26

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	49,404,000.00	4.96

	其中：政策性金融债	49,404,000.00	4.96
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	4,748,814.00	0.48
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	54,152,814.00	5.43

5、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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	150406	15 农发 06	100,000	10,000,000.00	1.00
2	170401	17 农发 01	100,000	9,986,000.00	1.00
3	170207	17 国开 07	100,000	9,969,000.00	1.00
4	150414	15 农发 14	100,000	9,968,000.00	1.00
5	108601	国开 1703	95,000	9,481,000.00	0.95

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

9、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

（1）报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

（2）本基金投资股指期货的投资政策

股指期货暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

（1）本期国债期货投资政策

国债期货暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

（2）报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

(3) 本期国债期货投资评价

国债期货暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

11、投资组合报告附注

(1) 本基金投资的前十名证券的发行主体本期末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) 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 (人民币元)
1	存出保证金	186,698.19
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	809,257.88
5	应收申购款	3,564,336.19
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,560,292.26

(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	132001	14 宝钢 EB	3,405,255.00	0.34
2	113011	光大转债	1,164,339.00	0.12

(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

① 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

② 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	002821	凯莱英	2,578,071.78	0.26	新股锁定

(6) 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

第十二部分 基金的业绩

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

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

本基金合同生效日 2010 年 11 月 2 日，基金业绩截止日 2017 年 9 月 30 日。

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
2017 年第 3 季度	6.24%	0.60%	4.41%	0.56%	1.83%	0.04%
2017 年上半年度	16.04%	0.58%	10.24%	0.54%	5.80%	0.04%
2016 年度	0.69%	1.28%	-10.61%	1.33%	11.30%	-0.05%
2015 年度	9.51%	2.44%	5.72%	2.36%	3.79%	0.08%
2014 年度	57.16%	1.20%	48.72%	1.15%	8.44%	0.05%
2013 年度	-4.64%	1.35%	-7.14%	1.32%	2.50%	0.03%
2012 年度	9.40%	1.19%	7.30%	1.22%	2.10%	-0.03%
2011 年度	-19.79%	1.14%	-23.82%	1.23%	4.03%	-0.09%
2010 年度	-3.80%	0.60%	-9.42%	1.62%	5.62%	-1.02%
自基金合同成立起至 2017 年 9 月 30 日	71.96%	1.41%	11.21%	1.43%	60.75%	-0.02%

注：2010 年度数据统计期间为 2010 年 11 月 2 日（基金合同成立之日）至 2010 年 12 月 31 日，不满一年。

第十四部分 基金费用与税收

一、基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、基金财产拨划支付的银行费用；
- 4、基金合同生效后的基金信息披露费用；

- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费；
- 7、基金的证券交易费用；
- 8、与基金使用相关指数有关的费用；
- 9、依法可以在基金财产中列支的其他费用。

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

三、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的 0.8% 年费率计提。计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金管理费，E 为前一日基金资产净值

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

2、基金托管人的托管费

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的 0.15% 年费率计提。计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金托管费，E 为前一日基金资产净值

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

3、基金指数使用费用

基金管理人可与指数许可方签订书面协议，约定指数使用的费用及支付方式。指数使用费用包括指数许可使用固定费和指数许可使用基点费。其中，指数许可使用固定费是为获取使用指数开发基金而支付的一次性费用，不列入基金费用；每季度指数许可使用基点费的下限为 5 万元，在通常情况下，指数许可使用基点费按前一日的基金资产净值的 0.016% 年费率计提，从基金财产中列支，每日计算，逐日累

计，按季支付，计算方法如下：

$H = E \times 0.016\% / \text{当年天数}$ （H 为每日应付的指数许可使用基点费，E 为前一日的基金资产净值）

4、上述一中 3 到 8 项费用由基金托管人根据其他有关法律法规及相应协议的规定，按费用支出金额支付，列入或摊入当期基金费用。

四、不列入基金费用的项目

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

五、基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率和基金托管费率。基金管理人必须最迟于新的费率实施 2 日前在指定媒体上刊登公告。

六、与基金销售有关的费用

本基金认购费的费率水平、计算公式、收取方式和使用方式请详见本招募说明书“第六部分 基金的募集”中“八、基金的面值、认购价格和认购费用”中的相关规定。

本基金的申购费、赎回费的费率水平、计算公式、收取方式和使用方式请详见本招募说明书“第九部分 基金份额的场外申购与赎回”中的“六、场外申购和赎回的费用”中的相关规定。

七、基金税收

基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定，履行纳税义务。

第十四部分 对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书根据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《基金法》）、《证券投资基金运作管理办法》（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》）、《证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称《信息披露办法》）及其他有关规定，并依据本基金管理人在本基金合同生效后对本基金实施的投资经营活动，对本基金管理人于 2017 年 6 月 16 日刊登《兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF) 更新招募说明书》进行了更新，主要更新内容如下：

一、“重要提示”部分

更新了本招募说明书所载内容截止日及有关财务数据和净值表现截止日。

二、“第三部分 基金管理人”部分

更新了基金管理人基本情况；更新了基金管理人个别董事简介；更新了高级管理人员概况；更新了基金经理概况；更新了基金投资决策委员会成员概况。

三、“第四部分 基金托管人”部分

更新了基金托管人的基金托管业务经营情况。

四、“第五部分 相关服务机构”部分

更新了直销机构、个别销售机构情况；新增销售机构 1 家。

五、“第十二部分 基金的投资”部分

更新了“十三、基金投资组合报告”部分，数据内容取自本基金 2017 年第 3 季度报告，数据截止日为 2017 年 9 月 30 日，所列财务数据未经审计。

六、“第十三部分 基金的业绩”部分

更新了此部分内容，数据截止日为 2017 年 9 月 30 日。

七、“第二十六部分 其他应披露事项”部分

以下为自 2017 年 5 月 2 日至 2017 年 11 月 1 日，本基金刊登于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站的基金公告。

序号	事项名称	披露日期
1	关于长期停牌股票（华录百纳）估值方法调整的公告	2017/5/12
2	关于旗下基金参与中泰证券网上交易系统委托、手机证券委托软件申购手续费费率优惠的公告	2017/5/26
3	关于设立厦门分公司的公告	2017/6/2
4	关于长期停牌股票（欧菲光）估值方法调整的公告	2017/6/8
5	关于网上直销限时开展基金定期转换费率优惠活动的公告	2017/6/9
6	关于调整网上直销部分基金转换优惠费率的公告	2017/6/28
7	关于对我司旗下 FOF 特定客户资产管理计划通过直销柜台申赎旗下部分基金免除相关费用的公告	2017/6/28
8	关于旗下基金参与交通银行手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续费率优惠的公告	2017/7/1
9	关于旗下部分基金继续参加交通银行网上银行基金申购费率优惠活动的公告	2017/7/1
10	旗下各基金 2017 年 6 月 30 日资产净值公告	2017/7/1
11	关于董事长及法定代表人变更的公告	2017/7/13

12	关于总经理变更的公告	2017/7/13
13	关于对我司旗下FOF特定客户资产管理计划通过直销中心进行基金转换免除相关费用的公告	2017/7/14
14	关于旗下部分基金参加华泰证券基金申购费率优惠活动的公告	2017/8/1
15	关于长期停牌股票（八一钢铁）估值方法调整的公告	2017/8/4
16	关于增加北京汇成基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	2017/8/10
17	关于网上直销开通微网站功能的公告	2017/8/10
18	关于钱大掌柜新增上线旗下部分基金的公告	2017/8/22
19	关于旗下基金参与江南农村商业银行网上交易系统委托、手机APP委托软件申购手续费费率优惠的公告	2017/9/8
20	关于长期停牌股票（康得新）估值方法调整的公告	2017/9/8
21	关于新增上海基煜基金销售有限公司为兴全恒益债券型证券投资基金的销售机构及我司管理的部分基金参与上海基煜费率优惠的公告	2017/9/13
22	关于旗下基金参与平安银行网上交易系统、手机APP委托软件等交易渠道申购手续费费率优惠的公告	2017/10/11
23	关于旗下基金参加安信证券定期定额申购费率优惠活动的公告	2017/10/19
24	关于旗下基金参加湘财证券申购费率优惠活动的公告	2017/10/27

上述内容仅为摘要，须与本《招募说明书》（正文）所载之详细资料一并阅读。

兴全基金管理有限公司

2017年12月16日