

# 兴全磐稳增利债券型证券投资基金

## 更新招募说明书摘要

（2020 年 5 月 15 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：交通银行股份有限公司

2020 年 5 月

### 【重要提示】

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

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

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

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

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

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

本更新招募说明书所载内容截止日2020年4月30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2020年第1季度报告，数据截止日为2020年3月31日（财务数据未经审计）。本基金托管人交通银行股份有限公司已复核了本次更新的招募说明书。

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

## 目 录

|       |                    |    |
|-------|--------------------|----|
| 第一部分  | 基金管理人.....         | 4  |
| 第二部分  | 基金托管人.....         | 15 |
| 第三部分  | 相关服务机构.....        | 18 |
| 第四部分  | 基金的名称.....         | 26 |
| 第五部分  | 基金的类型.....         | 27 |
| 第六部分  | 基金的投资目标.....       | 27 |
| 第七部分  | 基金的投资方向.....       | 27 |
| 第八部分  | 基金投资策略和投资组合限制..... | 28 |
| 第九部分  | 基金的业绩比较基准.....     | 34 |
| 第十部分  | 基金的风险收益特征.....     | 34 |
| 第十一部分 | 基金的投资组合报告.....     | 34 |
| 第十二部分 | 基金的业绩.....         | 38 |
| 第十三部分 | 基金费用与税收.....       | 39 |
| 第十四部分 | 对招募说明书更新部分的说明..... | 41 |

## 第一部分 基金管理人

### 一、基金管理人概况

机构名称：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：兰荣

联系人：何佳怡

联系电话：021-20398888

组织形式：有限责任公司

注册资本：人民币 1.5 亿元

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

截至 2020 年 4 月 30 日，公司旗下已管理兴全可转债混合型证券投资基金、兴全趋势投资混合型证券投资基金（LOF）、兴全货币市场证券投资基金、兴全全球视野股票型证券投资基金、兴全社会责任混合型证券投资基金、兴全有机增长灵活配置混合型证券投资基金、兴全磐稳增利债券型证券投资基金、兴全合润分级混合型

证券投资基金、兴全沪深 300 指数增强型基金（LOF）、兴全绿色投资混合型证券投资基金（LOF）、兴全精选混合型证券投资基金、兴全轻资产投资混合型证券投资基金（LOF）、兴全商业模式优选混合型证券投资基金（LOF）、兴全添利宝货币市场基金、兴全新视野灵活配置定期开放混合型发起式证券投资基金、兴全稳益定期开放债券型发起式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、兴全合宜灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、兴全祥泰定期开放债券型发起式证券投资基金、兴全安泰平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）、兴全恒裕债券型证券投资基金、兴全多维价值混合型证券投资基金、兴全恒瑞三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、兴全合泰混合型证券投资基金、兴全社会价值三年持有期混合型证券投资基金、兴全恒鑫债券型证券投资基金及兴全优选进取三个月持有期混合型基金中基金（FOF）30 只基金。

兴证全球基金管理有限公司总部位于上海，在北京、深圳、厦门、上海设有分公司，并成立了全资子公司——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、计划财务部、监察稽核部、风险管理部、运作保障部、基金管理部、固定收益部、专户投资部、研究部、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、客户服务中心。随着业务发展的需要，公司将对业务部门进行相应的调整。

## 二、主要人员情况

### 1、董事、监事概况

兰荣先生，董事长、党委书记、法定代表人，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综合处科长，兴业银行总行计划资金部副总经理，兴业银行总行证券业务部副总经理（主持工作），福建兴业证券公司总裁，兴业证券股份有限公司董事长、党委书记、总裁，兴业证券股份有限公司董事长、党委书记。现任兴证全球基金管理有限公司董事长、党委书记及法定代表人，兼任中国证券业协会监事长。

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，兴证全球

基金管理有限公司董事长及法定代表人。现任兴证全球基金管理有限公司董事、总经理，兼任兴业证券慈善基金会副理事长。

黄奕林先生，董事，1968年生，经济学博士。历任兴业证券股份有限公司研发中心总经理、投行总部总经理、客户资产管理部总经理、固定收益与衍生产品部总经理、总裁助理、固定收益事业总部总经理等职务。现任兴业证券股份有限公司副总裁、兴业证券股份有限公司上海证券自营分公司总经理，兼任兴证（香港）金融控股有限公司董事、兴证国际控股有限公司董事、兴证国际金融集团有限公司董事会主席、非执行董事。

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，同方全球人寿保险有限公司总经理，全球人寿保险集团执行副总裁、战略发展部负责人、全球人寿美国资产管理控股有限公司董事等职务。现任全球人寿资产管理控股有限公司企业发展负责人。

桑德·马特曼先生（Sander Maatman），董事，1969年生，荷兰国籍，硕士。历任荷兰 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，阿姆斯特不动产有限公司监事会成员、全球人寿美国资产管理控股有限公司董事等职务。现任全球人寿资产管理控股有限公司董事、全球首席财务官及运营官，兼任法国邮政银行资产管理有限公司监事会成员。

简·丹尼尔女士（Jane Daniel），董事，1969年生，英国国籍，具备苏格兰特许银行家协会（FCIBS）会员资格、英国特许银行家协会（ACIB）资质。历任国民西敏寺银行职员，苏格兰皇家银行公司银行业务与变革管理部高级经理、公司银行与金融市场部运营风险副主管、财富管理全球企业风险主管、全球交易服务风险主管、全球交易服务和运营风险全球主管、流动性管理与支付首席风险官、国际银行业务运营风险全球主管、国际银行业务首席运营办公室全球控制主管（董事总经理），天利投资欧洲、中东、非洲与亚太地区运营及企业风险主管、全球运营与企业风险主管兼欧洲、中东、非洲地区首席风险官等职务。现任全球人寿资产管理控股有限公司董事、全球首席风险及合规官，兼任 Kames 资本控股有限公司董事、Kames 资本有限公司非执行董事、法国邮政银行资产管理公司监事会成员、全球人寿匈牙利基金管理有限公司监事会成员。

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，兼任中国平安保险独立董事、广东华兴银行独立董事、海能达通信股份有限公司独立董事。

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，北京大成（上海）律师事务所高级合伙人。现任北京市中伦（上海）律师事务所合伙人。

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，DAC 财务管理（中国）有限公司董事总经理。现任 DAC 管理有限责任公司董事总经理。

## 2、监事会成员概况

夏锦良先生，监事会主席，1961年生，高级工商管理硕士。历任兴业证券股份有限公司资产管理部副总经理、风险管理部总经理，兴业期货有限公司总经理，兴业证券股份有限公司合规法律部总经理、合规与风险管理部总经理、合规总监兼合规与风险管理部总经理、财务负责人等职务。现任兴业证券股份有限公司董事、副总裁、首席风险官，兼任兴证（香港）金融控股有限公司董事、证通股份有限公司监事。

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公司副总经理、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顾问，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，兴证全球基金管理有限公司综合管理部总监。现任兴证全球基金管理有限公司总经理助理、董事会秘书兼监察稽核部总监、风险管理部总监、投融资业务审批部总监。

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，兴证全球基金管理有限公司市场部总监助理。现任兴证全球基金管

理有限公司市场部副总监。

### 3、高级管理人员概况

兰荣先生，董事长、党委书记、法定代表人。（简历请参见上述董事会成员概况）

庄园芳女士，董事、总经理。（简历请参见上述董事会成员概况）

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

董承非先生，副总经理，1977年生，理学硕士。历任兴证全球基金管理有限公司研究部行业研究员、兴全趋势投资混合型证券投资基金（LOF）基金经理助理、基金管理部投资副总监、兴全商业模式优选混合型证券投资基金（LOF）基金经理、兴全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、基金管理部投资总监、兴全社会责任混合型证券投资基金基金经理。现任兴证全球基金管理有限公司副总经理兼研究部总监、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。

郑文惠女士，副总经理，1969年生，高级工商管理硕士。历任兴业证券泉州营业部财务部经理、副总经理、总经理，兴业证券运营管理部总经理兼上海分公司副总经理，兴业证券运营管理部总经理兼上海分公司总经理，兴业证券私人财富管理总部总经理兼上海分公司总经理。现任兴证全球基金管理有限公司副总经理兼机构业务部总监、上海兴全睿众资产管理有限公司执行董事。

陈锦泉先生，副总经理，1977年生，工商管理硕士。历任职华安证券（原名为安徽证券）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。2010年8月加入兴证全球基金管理有限公司，历任兴全绿色投资股票型基金（LOF）基金经理，专户投资部总监兼投资经理，总经理助理兼专户投资部总监、投资经理。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、投资经理。

詹鸿飞先生，副总经理暨首席信息官，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，运作保障部总监，总经理助理兼运作保障部总监，总经理助理兼运作保障部总监、交易部总监。现任兴证全球基金管理有限公司副总经理暨首席信息官兼运作保障部总监、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兼北京分公司总经理，总经理助理兼渠道部总监、北京分公司总经理。现任兴证全球基金管理有限公司副总经理兼渠道部总监、北京分公司总经理。

#### 4、本基金基金经理

张睿女士，金融学硕士。历任红顶金融工程研究中心研究部经理，申银万国证券研究所高级分析师，兴证全球基金管理有限公司固定收益部研究员、兴全货币市场证券投资基金基金经理、兴全磐稳增利债券型证券投资基金基金经理、兴全保本混合型证券投资基金基金经理、兴全添利宝货币市场基金基金经理、兴全天添益货币市场基金基金经理、固定收益部总监助理。现任兴证全球基金管理有限公司固定收益部副总监、兴全磐稳增利债券型证券投资基金基金经理（2015年11月2日起至今）、兴全兴泰定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理（2017年9月5日起至今）、兴全恒益债券型证券投资基金基金经理（2017年9月20日起至今）、兴全恒瑞三个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理（2019年6月21日起至今）。

本基金历任基金经理：

李友超先生，于2009年7月23日至2012年6月29日期间担任本基金基金经理。

肖娟女士，于2011年1月25日至2012年3月2日期间担任本基金基金经理。

张睿女士，于2012年4月27日至2013年7月11日期间担任本基金基金经理。

毛水荣先生，于2013年6月14日至2015年12月14日期间担任本基金基金经理。

#### 5、投资决策委员会成员

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

庄园芳 兴证全球基金管理有限公司董事、总经理

董承非 兴证全球基金管理有限公司副总经理兼研究部总监、兴全趋势投资混合型证券投资基金（LOF）、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

谢治宇 兴证全球基金管理有限公司总经理助理、基金管理部投资总监兼兴全合润分级混合型证券投资基金、兴全合宜灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、兴全社会价值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，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；
- 2、办理基金备案手续；
- 3、对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账，进行证券投资；
- 4、按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；
- 5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
- 6、编制中期和年度报告；
- 7、计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购、赎回价格；
- 8、办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；
- 9、召集基金份额持有人大会；
- 10、保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
- 11、以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
- 12、中国证监会规定的其他职责。

### 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：公司设立独立的风险管理部、监察稽核部，风险管理部、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，风险管理部、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) 风险管理部、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、制度执行及遵纪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

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、基金托管人基本情况

#### （一）基金托管人概况

公司法定中文名称：交通银行股份有限公司（简称：交通银行）

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

法定代表人：任德奇

住 所：中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 号

办公地址：上海市长宁区仙霞路 18 号

邮政编码：200336

注册时间：1987 年 3 月 30 日

注册资本：742.63 亿元

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]25 号

联系人：陆志俊

电 话：95559

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

截至 2020 年 3 月 31 日，交通银行资产总额为人民币 104,543.83 亿元。2020 年 1-3 月，交通银行实现净利润(归属于母公司股东)人民币 214.51 亿元。

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

资产托管从业人员队伍。

## （二）主要人员情况

任德奇先生，董事长、执行董事，高级经济师。

任先生 2020 年 1 月起任本行董事长、执行董事，代为履行行长职责，2018 年 8 月至 2020 年 1 月任本行副董事长（其中：2019 年 4 月至 2020 年 1 月代为履行董事长职责）、执行董事，2018 年 8 月至 2019 年 12 月任本行行长；2016 年 12 月至 2018 年 6 月任中国银行执行董事、副行长，其中：2015 年 10 月至 2018 年 6 月兼任中银香港（控股）有限公司非执行董事，2016 年 9 月至 2018 年 6 月兼任中国银行上海人民币交易业务总部总裁；2014 年 7 月至 2016 年 11 月任中国银行副行长，2003 年 8 月至 2014 年 5 月历任中国建设银行信贷审批部副总经理、风险监控部总经理、授信管理部总经理、湖北省分行行长、风险管理部总经理；1988 年 7 月至 2003 年 8 月先后在中国建设银行岳阳长岭支行、岳阳市中心支行、岳阳分行，中国建设银行信贷管理委员会办公室、信贷风险管理部工作。任先生 1988 年于清华大学获工学硕士学位。

袁庆伟女士，资产托管业务中心总裁，高级经济师。

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

## （三）基金托管业务经营情况

截至 2020 年 3 月 31 日，交通银行共托管证券投资基金 452 只。此外，交通银行还托管了基金公司特定客户资产管理计划、证券公司客户资产管理计划、银行理财产品、信托计划、私募投资基金、保险资金、全国社保基金、养老保障管理基金、企业年金基金、职业年金基金、QFII 证券投资资产、RQFII 证券投资资产、QDII 证券投资资产、RQDII 证券投资资产、QDIE 资金、QDLP 资金和 QFLP 资金等产品。

## 二、基金托管人的内部控制制度

### （一）内部控制目标

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

## （二）内部控制原则

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

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

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

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

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

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

## （三）内部控制制度及措施

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

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

行国际标准的内部控制评审。

### 三、基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

交通银行作为基金托管人，根据《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和有关证券法规的规定，对基金的投资对象、基金资产的投资组合比例、基金资产的核算、基金资产净值的计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付、基金的申购资金的到账与赎回资金的划付、基金收益分配等行为的合法性、合规性进行监督和核查。

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

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

### 四、其他事项

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

## 第三部分 相关服务机构

### 一、基金份额发售机构

#### 1、直销机构

- 兴证全球基金管理有限公司直销中心

地址：上海市浦东新区芳甸路 1155 号浦东嘉里城办公楼 30 楼

联系人：秦洋洋、沈冰心

直销联系电话：021-20398706、021-20398927

传真：021-58368869、021-58368915

- 兴证全球基金管理有限公司网上直销平台（含微网站、APP）

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

客服电话：400-678-0099；（021）38824536

2、其他销售机构（排序不分先后）

| 名称             | 法定代表人 | 地址                                             | 客服电话                  | 网址                                                                        |
|----------------|-------|------------------------------------------------|-----------------------|---------------------------------------------------------------------------|
| 交通银行股份有限公司     | 任德奇   | 注册地址：上海市银城中路 188 号<br>办公地址：上海市银城中路 188 号       | 95559                 | <a href="http://www.bankcomm.com">http://www.bankcomm.com</a>             |
| 兴业银行股份有限公司     | 高建平   | 办公地址：福建省福州市湖东路 154 号                           | 95561                 | <a href="http://www.cib.com.cn">http://www.cib.com.cn</a>                 |
| 中国建设银行股份有限公司   | 田国立   | 注册地址：北京市西城区金融大街 25 号                           | 95533(全国)             | <a href="http://www.ccb.com">http://www.ccb.com</a>                       |
| 中国工商银行股份有限公司   | 陈四清   | 注册地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号                         | 95588                 | <a href="http://www.icbc.com.cn">http://www.icbc.com.cn</a>               |
| 中国银行股份有限公司     | 刘连舸   | 注册地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号                          | 95566                 | <a href="http://www.boc.cn">http://www.boc.cn</a>                         |
| 中国农业银行股份有限公司   | 周慕冰   | 注册地址：北京市东城区建国门内大街 69 号                         | 95599                 | <a href="http://www.abchina.com">http://www.abchina.com</a>               |
| 招商银行股份有限公司     | 李建红   | 注册地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦                      | 95555                 | <a href="http://www.cmbchina.com">http://www.cmbchina.com</a>             |
| 中国邮政储蓄银行股份有限公司 | 李国华   | 注册地址：北京市西城区金融大街 3 号<br>办公地址：北京市西城区金融大街 3 号     | 95580                 | <a href="http://www.psbc.com">http://www.psbc.com</a>                     |
| 中国光大银行股份有限公司   | 李晓鹏   | 注册地址：北京市西城区复兴门外大街 6 号光大大厦                      | 95595(全国)             | <a href="http://www.cebbank.com">http://www.cebbank.com</a>               |
| 中信银行股份有限公司     | 李庆萍   | 注册地址：北京市东城区朝阳门北大街 9 号                          | 95558                 | <a href="http://bank.ecitic.com">http://bank.ecitic.com</a>               |
| 中国民生银行股份有限公司   | 洪崎    | 注册地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号<br>办公地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号 | 95568                 | <a href="http://www.cmbc.com.cn">http://www.cmbc.com.cn</a>               |
| 宁波银行股份有限公司     | 陆华裕   | 注册地址：宁波市鄞州区宁南路 700 号                           | 96528(北京、上海地区 962528) | <a href="http://www.nbcb.com.cn">http://www.nbcb.com.cn</a>               |
| 上海银行股份有限公司     | 金煜    | 注册地址：上海市银城中路 168 号                             | (021) 962888          | <a href="http://www.bankofshanghai.com">http://www.bankofshanghai.com</a> |

| 名称               | 法定代表人 | 地址                                                           | 客服电话                           | 网址                                                                  |
|------------------|-------|--------------------------------------------------------------|--------------------------------|---------------------------------------------------------------------|
| 华夏银行股份有限公司       | 李民吉   | 注册地址：北京市东城区建国门内大街 22 号华夏银行大厦<br>办公地址：北京市东城区建国门内大街 22 号华夏银行大厦 | 95577                          | <a href="http://www.hxb.com.cn">http://www.hxb.com.cn</a>           |
| 平安银行股份有限公司       | 谢永林   | 注册地址：深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行大厦<br>办公地址：深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行大厦   | 95511-3                        | <a href="http://www.bank.pingan.com">http://www.bank.pingan.com</a> |
| 渤海银行股份有限公司       | 李伏安   | 注册地址：天津市河东区海河东路 218 号                                        | 400-888-8811                   | <a href="http://www.cbhb.com.cn">http://www.cbhb.com.cn</a>         |
| 上海浦东发展银行股份有限公司   | 高国富   | 注册地址：上海市中山东一路 12 号                                           | 95528                          | <a href="http://www.spdb.com.cn">http://www.spdb.com.cn</a>         |
| 重庆银行股份有限公司       | 林军    | 注册地址：重庆市渝中区邹容路 153 号                                         | 96899(重庆)<br>400-709-6899 (其他) | <a href="http://www.cqcbank.com">http://www.cqcbank.com</a>         |
| 江苏昆山农村商业银行股份有限公司 | 张哲清   | 注册地址：江苏省昆山市前进东路 828 号                                        | 96079                          | <a href="http://www.ksrcb.cn">http://www.ksrcb.cn</a>               |
| 江苏江南农村商业银行股份有限公司 | 陆向阳   | 注册地址：常州市和平中路 413 号                                           | 96005                          | <a href="http://www.jnbank.cc">http://www.jnbank.cc</a>             |
| 江苏银行股份有限公司       | 夏平    | 注册地址：南京市中华路 26 号<br>办公地址：南京市中华路 26 号                         | 025-58587039                   | <a href="http://www.jsbchina.cn">http://www.jsbchina.cn</a>         |
| 兴业证券股份有限公司       | 杨华辉   | 注册地址：福州市湖东路 268 号                                            | 4008888123                     | <a href="http://www.xyzq.com.cn">http://www.xyzq.com.cn</a>         |
| 国泰君安证券股份有限公司     | 杨德红   | 注册地址：中国（上海）自由贸易试验区商城路 618 号                                  | 400-8888-666                   | <a href="http://www.gtja.com">http://www.gtja.com</a>               |
| 中信建投证券股份有限公司     | 王常青   | 注册地址：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼<br>办公地址：北京市东城区朝内大街 188 号            | 4008888108                     | <a href="http://www.csc108.com">http://www.csc108.com</a>           |
| 华泰证券股份有限公司       | 周易    | 办公地址：江苏省南京市江东中路 228 号华泰证券大厦                                  | 4008888168                     | <a href="http://www.htsc.com.cn">http://www.htsc.com.cn</a>         |
| 长江证券股份有限公司       | 尤习贵   | 办公地址：武汉市新华路特 8 号                                             | 4008-888-999<br>027-85808318   | <a href="http://www.cjsc.com.cn">http://www.cjsc.com.cn</a>         |
| 海通证券股份有限公司       | 周杰    | 注册地址：上海市广东路 689 号                                            | 4008888001<br>021-962503       | <a href="http://www.htsec.com">http://www.htsec.com</a>             |

| 名称           | 法定代表人 | 地址                                                           | 客服电话                           | 网址                                                                      |
|--------------|-------|--------------------------------------------------------------|--------------------------------|-------------------------------------------------------------------------|
| 招商证券股份有限公司   | 霍达    | 办公地址：深圳市福田区福田街道福华一路 111 号                                    | 95565 或<br>4008888111          | <a href="http://www.newone.com.cn">http://www.newone.com.cn</a>         |
| 中国银河证券股份有限公司 | 陈共炎   | 办公地址：北京市西城区金融大街 35 号 2-6 层                                   | 4008-888-888                   | <a href="http://www.chinastock.com.cn">http://www.chinastock.com.cn</a> |
| 广发证券股份有限公司   | 孙树明   | 注册地址：<br>办公地址：广州市天河区天河北路 183-187 号大都会广场 43 楼                 | 95575                          | <a href="http://www.gf.com.cn">http://www.gf.com.cn</a>                 |
| 山西证券股份有限公司   | 侯巍    | 注册地址：山西省太原市府西街 69 号山西国贸中心东塔楼<br>办公地址：山西省太原市府西街 69 号山西国贸中心东塔楼 | 4006661618                     | <a href="http://www.i618.com.cn">http://www.i618.com.cn</a>             |
| 东方证券股份有限公司   | 潘鑫军   | 注册地址：上海市中山南路 318 号 2 号楼 22 层、23 层、25-29 层                    | (021)<br>962506<br>40088-88506 | <a href="http://www.dfzq.com.cn">http://www.dfzq.com.cn</a>             |
| 德邦证券股份有限公司   | 武晓春   | 办公地址：上海市浦东新区福山路 500 号“城建国际中心”26 楼                            | 4008888128                     | <a href="http://www.tebon.com.cn">http://www.tebon.com.cn</a>           |
| 中银国际证券股份有限公司 | 宁敏    | 注册地址：上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 39F                               | 4006208888                     | <a href="http://www.bocichina.com">http://www.bocichina.com</a>         |
| 国海证券股份有限公司   | 何春梅   | 注册地址：广西桂林市辅星路 13 号                                           | (0771)<br>5539032              | <a href="http://www.ghzq.com.cn">http://www.ghzq.com.cn</a>             |
| 光大证券股份有限公司   | 周健男   | 注册地址：上海市静安区新闻路 1508 号<br>办公地址：                               | 4008888788                     | <a href="http://www.ebscn.com">http://www.ebscn.com</a>                 |
| 国元证券股份有限公司   | 蔡咏    | 注册地址：合肥市梅山路 18 号                                             | 4008888777                     | <a href="http://www.gyzq.com.cn">http://www.gyzq.com.cn</a>             |
| 湘财证券股份有限公司   | 孙永祥   | 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                        | 400-888-1551                   | <a href="http://www.xcsc.com">http://www.xcsc.com</a>                   |
| 申万宏源证券有限公司   | 李梅    | 注册地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层<br>办公地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层       | 95523 或<br>4008895523          | <a href="http://www.swhysc.com">http://www.swhysc.com</a>               |
| 渤海证券股份有限公司   | 王春峰   | 注册地址：天津市经济技术开发区第二大街 42 号写字楼 101 室                            | 4006515988                     | <a href="http://www.ewww.com.cn">http://www.ewww.com.cn</a>             |
| 瑞银证券有限责任公司   | 钱于军   | 注册地址：北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心 12 层、15 层                        | 400-887-8827                   | <a href="http://www.ubssecurities.com">http://www.ubssecurities.com</a> |

| 名称             | 法定代表人 | 地址                                                    | 客服电话               | 网址                                                                  |
|----------------|-------|-------------------------------------------------------|--------------------|---------------------------------------------------------------------|
|                |       | 办公地址：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心12层、15层                      |                    |                                                                     |
| 华福证券有限责任公司     | 黄金琳   | 注册地址：福州市五四路157号新天地大厦7、8层<br>办公地址：福州市五四路157号新天地大厦7至10层 | 96326（福建省外请加拨0591） | <a href="http://www.hfzq.com.cn">http://www.hfzq.com.cn</a>         |
| 中泰证券股份有限公司     | 李玮    | 注册地址：山东省济南市经七路86号                                     | 95538              | <a href="http://www.zts.com.cn">http://www.zts.com.cn</a>           |
| 爱建证券有限责任公司     | 祝健    | 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                      | 4001962502         | <a href="http://www.ajzq.com">www.ajzq.com</a>                      |
| 安信证券股份有限公司     | 王连志   | 注册地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元                   | 95517              | <a href="http://www.essence.com.cn/">http://www.essence.com.cn/</a> |
| 华融证券股份有限公司     | 祝献忠   | 注册地址：北京市西城区金融大街8号                                     | （010）58568162      | <a href="http://www.hrsec.com.cn">http://www.hrsec.com.cn</a>       |
| 国信证券股份有限公司     | 何如    | 注册地址：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                    | 95536              | <a href="http://www.guosen.com.cn">http://www.guosen.com.cn</a>     |
| 中航证券有限公司       | 王晓峰   | 注册地址：南昌市红谷中大道1619号南昌国际金融大厦A栋41层                       | 400-8866-567       | <a href="http://www.avicsec.com">http://www.avicsec.com</a>         |
| 中信证券股份有限公司     | 张佑君   | 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                      | 95558              | <a href="http://www.ecitic.com">http://www.ecitic.com</a>           |
| 中信证券（山东）有限责任公司 | 姜晓林   | 注册地址：山东省青岛市崂山区深圳路222号1号楼2001                          | 95548              | <a href="http://www.cs.ecitic.com">http://www.cs.ecitic.com</a>     |
| 信达证券股份有限公司     | 张志刚   | 注册地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼                                | 400-800-8899       | <a href="http://www.cindasc.com">http://www.cindasc.com</a>         |
| 国都证券股份有限公司     | 王少华   | 联系地址：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层、10层                       | 4008188118         | <a href="http://www.guodu.com">http://www.guodu.com</a>             |
| 华鑫证券有限责任公司     | 俞洋    | 注册地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦28层A01、B01(b)单元                | 400-109-9918       | <a href="http://www.cfsc.com.cn">http://www.cfsc.com.cn</a>         |
| 平安证券股份有限公司     | 何之江   | 注册地址：深圳市福田区益田路5033号平安金融中心61层-64层                      | 4006-788-887       | <a href="http://stock.pingan.com">http://stock.pingan.com</a>       |
| 华西证券股份         | 杨炯洋   | 注册地址：四川省成都市高新区                                        | 95584              | <a href="http://www.hx">http://www.hx</a>                           |

| 名称               | 法定代表人 | 地址                                                                                                 | 客服电话                  | 网址                        |
|------------------|-------|----------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------|---------------------------|
| 有限公司             |       | 天府二街 198 号                                                                                         |                       | 168.com.cn                |
| 上海华信证券<br>有限责任公司 | 陈灿辉   | 注册地址：上海浦东新区世纪大道 100 号环球金融中心 9 楼                                                                    | 4008205999            | http://www.shhxzq.com     |
| 长城证券股份<br>有限公司   | 丁益    | 注册地址：深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 14、16、17 楼                                                            | 400-666-6888          | http://www.cgws.com/      |
| 财达证券股份<br>有限公司   | 翟建强   | 注册地址：河北省石家庄市桥西区自强路 35 号庄家金融大厦 23 层<br>办公地址：                                                        | 400-612-8888          | http://www.s10000.com     |
| 南京证券股份<br>有限公司   | 步国旬   | 注册地址：南京市江东中路 389 号                                                                                 | 95386                 | http://www.njzq.com.cn/   |
| 东海证券股份<br>有限公司   | 赵俊    | 注册地址：江苏省常州延陵西路 23 号投资广场 18 层                                                                       | 95531<br>400-8888-588 | www.longone.com.cn        |
| 东方财富证券<br>股份有限公司 | 陈宏    | 办公地址：上海市徐汇区宛平南路 88 号金座东方财富大厦                                                                       | 95357                 | www.18.cn                 |
| 西部证券股份<br>有限公司   | 徐朝晖   | 注册地址：陕西省西安市新城区东大街 319 号 8 幢 10000 室<br>办公地址：陕西省西安市新城区东大街 319 号 8 幢 10000 室                         | 95582                 | http://www.westsecu.com/  |
| 中国中金财富<br>证券有限公司 | 高涛    | 注册地址：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<br>01.02.03.05.11.12.13.15.16.18.19.20.21.22.23 单元 | 95532                 | http://www.ciccwm.co      |
| 民生证券股份<br>有限公司   | 冯鹤年   | 注册地址：北京市东城区建国门内大街 28 号民生金融中心 A 座 16 层--18 层                                                        | 95376                 | https://www.msizq.com/    |
| 方正证券股份<br>有限公司   | 施华    | 注册地址：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                                                       | 86-731-85832367       | http://www.foundersec.com |
| 东兴证券股份<br>有限公司   | 魏庆华   | 注册地址：北京市西城区金融大街 5 号(新盛大厦)12、15 层<br>办公地址：                                                          | 95309                 | http://www.dxzq.net/      |
| 国联证券股份<br>有限公司   | 姚志勇   | 注册地址：江苏省无锡市滨湖区金融一街 8 号                                                                             | 95570                 | http://www.glscc.com.cn/  |
| 华安证券股份<br>有限公司   | 章宏韬   | 注册地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号                                                                        | 95318                 | http://www.hazq.com/      |
| 天相投资顾问<br>有限公司   | 林义相   | 办公地址：北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座                                                                        | (010)<br>66045678     | http://www.txsec.com      |

| 名称             | 法定代表人 | 地址                                                                | 客服电话         | 网址                                                                |
|----------------|-------|-------------------------------------------------------------------|--------------|-------------------------------------------------------------------|
| 上海好买基金销售有限公司   | 杨文斌   | 注册地址：上海市虹口区场中路685弄37号4号楼449室<br>办公地址：上海市浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦903~906室 | 400-700-9665 | <a href="http://www.ehowbuy.com">http://www.ehowbuy.com</a>       |
| 蚂蚁（杭州）基金销售有限公司 | 祖国明   | 注册地址：杭州市余杭区仓前街道文一西路1218号1栋202室                                    | 4000766123   | <a href="http://www.fund123.cn">www.fund123.cn</a>                |
| 上海长量基金销售有限公司   | 张跃伟   | 注册地址：上海浦东新区高翔路526号2幢220室<br>办公地址：上海浦东大道555号裕景国际B座16层              | 4000-891-289 | <a href="http://www.erichfund.com">http://www.erichfund.com</a>   |
| 诺亚正行基金销售有限公司   | 汪静波   | 注册地址：上海市虹口区飞虹路360弄9号3724室                                         | 400-821-5399 | <a href="http://www.noah-fund.com">http://www.noah-fund.com</a>   |
| 上海天天基金销售有限公司   | 其实    | 注册地址：上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层                                           | 400-1818-188 | <a href="http://www.1234567.com.cn">http://www.1234567.com.cn</a> |
| 和讯信息科技有限公司     | 王莉    | 注册地址：北京市朝阳区朝外大街22号1002室                                           | 4009200022   | <a href="http://licaike.hexun.com">http://licaike.hexun.com</a>   |
| 浙江同花顺基金销售有限公司  | 吴强    | 注册地址：浙江省杭州市文二西路1号元茂大厦903                                          | 4008-773-772 | <a href="http://www.5ifund.com">http://www.5ifund.com</a>         |
| 上海陆金所基金销售有限公司  | 王之光   | 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<br>办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号     | 4008219031   | <a href="http://www.lufunds.com">http://www.lufunds.com</a>       |
| 北京蛋卷基金销售有限公司   | 钟斐斐   | 注册地址：北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507                                | 4000618518   | <a href="https://danjuanapp.com/">https://danjuanapp.com/</a>     |
| 北京广源达信基金销售有限公司 | 齐剑辉   | 注册地址：北京市西城区新街口外大街28号C座六层605室                                      | 4006236060   | <a href="http://www.niuniufund.com">www.niuniufund.com</a>        |
| 上海大智慧基金销售有限公司  | 申健    | 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                               | 021-20219931 | <a href="https://8.gw.com.cn/">https://8.gw.com.cn/</a>           |
| 中信期货有限公司       | 张皓    | 注册地址：北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦18层                                       | 400-9908-826 | <a href="http://www.citicsf.com/">http://www.citicsf.com/</a>     |
| 厦门市鑫鼎盛控股有限公司   | 陈洪生   | 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                                | 400-918-0808 | <a href="http://www.xds.com.cn/">http://www.xds.com.cn/</a>       |

| 名称               | 法定代表人 | 地址                                                                   | 客服电话              | 网址                                                                  |
|------------------|-------|----------------------------------------------------------------------|-------------------|---------------------------------------------------------------------|
| 北京肯特瑞基金销售有限公司    | 江卉    | 注册地址：北京市海淀区海淀东三街2号4层401-15<br>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          | 400-098-8511      | <a href="http://kenterui.jd.com">http://kenterui.jd.com</a>         |
| 北京增财基金销售有限公司     | 罗细安   | 注册地址：北京市西城区南礼士路66号建威大厦1208室<br>办公地址：                                 | 010-67000988-6025 | <a href="http://www.zcvc.com.cn/">http://www.zcvc.com.cn/</a>       |
| 上海基煜基金销售有限公司     | 王翔    | 注册地址：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）                          | 021-65370077      | <a href="http://www.jiyufund.com.cn">www.jiyufund.com.cn</a>        |
| 腾安基金销售（深圳）有限公司   | 刘明军   | 注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室                                          | 95017             | <a href="http://www.tenganxinxi.com">www.tenganxinxi.com</a>        |
| 中证金牛（北京）投资咨询有限公司 | 钱昊旻   | 注册地址：北京市丰台区东管头1号2号楼2-45室<br>办公地址：北京市西城区宣武门外大街甲1号环球财讯中心A座5层           | 010-59336544      |                                                                     |
| 兴证期货有限公司         | 周峰    | 注册地址：福建省鼓楼区温泉街道湖东路268号6层（兴业证券大厦）<br>办公地址：福建省鼓楼区温泉街道湖东路268号6层（兴业证券大厦） | 95562 转 5         | <a href="http://www.xz-futures.com/">http://www.xz-futures.com/</a> |
| 江苏汇林保大基金销售有限公司   | 吴言林   | 注册地址：南京市高淳区经济开发区古檀大道47号<br>办公地址：南京市鼓楼区中山北路2号绿地紫峰大厦2005室              | 025-66046166      |                                                                     |
| 中国国际金融股份有限公司     | 沈如军   | 注册地址：北京市朝阳区建国门外大街1号国贸大厦2座27-28层<br>办公地址：北京市朝阳区建国门外大街1号国贸大厦2座27-28层   | 010-65051166      | <a href="http://www.cicc.com/">http://www.cicc.com/</a>             |
| 中国人寿保险股份有限公司     | 王滨    | 注册地址：北京市西城区金融大街16号                                                   | 95519             | <a href="http://www.e-chinalife.com">www.e-chinalife.com</a>        |

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

## 二、注册登记机构

名称：兴证全球基金管理有限公司

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 楼

法定代表人：兰荣

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

住所（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

经办律师：廖海、吴军娥

电话：(021) 51150298

传真：(021) 51150398

联系人：廖海

### 四、审计基金资产的会计师事务所和经办注册会计师

名称：毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）

办公地址：北京市东城区东长安街 1 号东方广场毕马威大楼 8 层

执行事务合伙人：邹俊

经办注册会计师：王国蓓、张楠

电话：(021) 2212 2888

传真：(021) 6288 1889

联系人：张楠

## 第四部分 基金的名称

兴全磐稳增利债券型证券投资基金

## 第五部分 基金的类型

契约型开放式

## 第六部分 基金的投资目标

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

## 第七部分 基金的投资方向

### 1、投资对象

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

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

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

### 2、投资比例

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

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

## 第八部分 基金投资策略和投资组合限制

### （一）投资策略

#### 1、投资策略概述

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

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

#### 2、债券类证券投资策略

##### （1）目标久期策略

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

##### （2）债券类属配置策略

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

##### （3）骑乘收益曲线策略

收益曲线策略即在不同期限投资品种之间进行的配置，通过考察收益率曲线的

动态变化及预期变化，寻求在一段时期内获取因收益率曲线形状变化而导致的债券价格变化所产生的超额收益。在期限配置方面，将在久期决策的基础上，在不增加总体利率风险的情况下，集中于决定期限利差变化的因素，从不同期限的债券的相对价值变化中实现超额收益。

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

#### （4）个券选择策略

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

#### （5）回购套利策略

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

#### （6）企业债券类证券投资策略

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

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

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

### （7）可转债投资策略

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

### （8）中小企业私募债投资策略

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

### （9）积极套利策略

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

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

### （10）资产支持证券等品种投资策略

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

## 3、新股申购策略

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

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

## 4、投资决策及操作流程

本基金实行投资决策委员会领导下的基金经理负责制。

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

具体的基金投资决策程序如下：

#### （1）研究策划

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

#### （2）资产配置

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

#### （3）构建投资组合

基金经理根据对债券市场的判断构建基金组合，并报投资决策委员会备案。

#### （4）组合的监控和调整

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

#### （5）投资指令下达

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

#### （6）指令执行及反馈

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

#### （7）风险管理

风险管理委员会根据市场变化对投资组合计划提出风险防范措施，基金经理依据基金申购赎回的情况控制投资组合的流动性风险。

#### （8）投资组合业绩与风险评价

FOF 投资与金融工程部定期对基金投资组合进行投资绩效评估，研究在一段时期内基金投资组合的变化及由此带来的收益与损失，并对基金业绩进行有效分解。

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

## （二）投资禁止行为与限制

### 1、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，本基金禁止从事下列行为：

- （1）承销证券；
- （2）向他人贷款或提供担保；
- （3）从事承担无限责任的投资；
- （4）买卖其他基金份额，但国务院另有规定的除外；
- （5）向基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或债券；
- （6）买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者其基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券；
- （7）从事内幕交易、操纵证券价格及其他不正当的证券交易活动；
- （8）当时有效的法律法规、中国证监会及基金合同规定禁止从事的其他行为。

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

### 2、投资组合限制

本基金的投资组合将遵循以下限制：

- （1）本基金债券类证券的投资比例不低于基金资产的 80%。不含可分离债债券部分的可转债投资不超过债券类证券投资比例的 50%。股票、权证等权益类证券的投资比例为基金资产的 0%-20%。现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。
- （2）本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%；
- （3）本基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%，本基金管理人管理的全部基金持有同一权证的比例不超过该权证的 10%。投资于其他权证的投资比例，遵从法规或监管部门的相关规定；
- （4）本基金投资于信用级别评级为 BBB 以上（含 BBB）的资产支持证券，持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的

10%。投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的10%。本基金管理人管理的全部证券投资基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的10%。本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的20%，中国证监会规定的特殊品种除外。本基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起3个月内予以全部卖出。

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

(6) 在银行间市场进行债券回购融入的资金余额不超过基金资产净值的40%；

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

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

(9) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合本条规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

(10) 本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的15%；本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的30%；

(11) 本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致；

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

### 3、投资组合比例调整

基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。由于证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的原因导致的投资组合不符合上述约定的比例，基金

管理人应在 10 个交易日内进行调整，以达到标准。法律法规另有规定的从其规定。

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

## 第九部分 基金的业绩比较基准

业绩比较基准=中证全债指数×95%+同业存款利率×5%

## 第十部分 基金的风险收益特征

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

## 第十一部分 基金的投资组合报告

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

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

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

本投资组合报告所载数据取自兴全磐稳增利债券型证券投资基金 2020 年第 1 季度报告，所载数据截至 2020 年 3 月 31 日，本报告中所列财务数据未经审计。

### 1、报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目     | 金额（元）            | 占基金总资产的比例（%） |
|----|--------|------------------|--------------|
| 1  | 权益投资   | -                | -            |
|    | 其中：股票  | -                | -            |
| 2  | 基金投资   | -                | -            |
| 3  | 固定收益投资 | 4,291,385,998.30 | 97.90        |
|    | 其中：债券  | 4,291,385,998.30 | 97.90        |

|   |                   |                  |        |
|---|-------------------|------------------|--------|
|   | 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      | 39,351,379.91    | 0.90   |
| 8 | 其他资产              | 52,514,594.52    | 1.20   |
| 9 | 合计                | 4,383,251,972.73 | 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

本基金本报告期末未持有股票。

### (2) 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

本基金本报告期末未持有股票。

## 4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种      | 公允价值（元）          | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|------------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | -                | -            |
| 2  | 央行票据      | -                | -            |
| 3  | 金融债券      | 539,592,000.00   | 14.36        |
|    | 其中：政策性金融债 | 539,592,000.00   | 14.36        |
| 4  | 企业债券      | 718,516,300.00   | 19.13        |
| 5  | 企业短期融资券   | 551,969,000.00   | 14.69        |
| 6  | 中期票据      | 866,914,000.00   | 23.08        |
| 7  | 可转债（可交换债） | 1,320,469,698.30 | 35.15        |
| 8  | 同业存单      | 293,925,000.00   | 7.82         |
| 9  | 其他        | -                | -            |
| 10 | 合计        | 4,291,385,998.30 | 114.24       |

## 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  | 200201    | 20 国开 01      | 1,600,000 | 160,784,000.00 | 4.28         |
| 2  | 111986969 | 19 汉口银行 CD107 | 1,500,000 | 147,210,000.00 | 3.92         |
| 3  | 110059    | 浦发转债          | 1,280,420 | 136,006,212.40 | 3.62         |

|   |           |              |           |                |      |
|---|-----------|--------------|-----------|----------------|------|
| 4 | 101560065 | 15 中铝 MTN003 | 1,300,000 | 132,678,000.00 | 3.53 |
| 5 | 110053    | 苏银转债         | 1,100,200 | 123,409,434.00 | 3.29 |

#### 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。

#### 10、投资组合报告附注

(1) 本基金投资的前十名证券的发行主体本期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) 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   | 49,040.54     |
| 2  | 应收证券清算款 | -             |
| 3  | 应收股利    | -             |
| 4  | 应收利息    | 51,620,466.42 |
| 5  | 应收申购款   | 845,087.56    |
| 6  | 其他应收款   | -             |
| 7  | 待摊费用    | -             |
| 8  | 其他      | -             |
| 9  | 合计      | 52,514,594.52 |

## (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  | 110053 | 苏银转债     | 123,409,434.00 | 3.29         |
| 2  | 110051 | 中天转债     | 56,519,515.80  | 1.50         |
| 3  | 113021 | 中信转债     | 49,652,855.00  | 1.32         |
| 4  | 113508 | 新风转债     | 49,424,968.80  | 1.32         |
| 5  | 132006 | 16 皖新 EB | 43,380,000.00  | 1.15         |
| 6  | 110045 | 海澜转债     | 39,103,624.40  | 1.04         |
| 7  | 113011 | 光大转债     | 36,183,900.00  | 0.96         |
| 8  | 113026 | 核能转债     | 35,901,104.40  | 0.96         |
| 9  | 113019 | 玲珑转债     | 34,161,491.70  | 0.91         |
| 10 | 113013 | 国君转债     | 30,559,097.70  | 0.81         |
| 11 | 113528 | 长城转债     | 30,479,632.80  | 0.81         |
| 12 | 113537 | 文灿转债     | 25,479,179.40  | 0.68         |
| 13 | 128066 | 亚泰转债     | 25,120,049.92  | 0.67         |
| 14 | 110041 | 蒙电转债     | 22,015,292.20  | 0.59         |
| 15 | 128064 | 司尔转债     | 21,702,882.05  | 0.58         |
| 16 | 110047 | 山鹰转债     | 21,517,937.00  | 0.57         |
| 17 | 128048 | 张行转债     | 18,770,107.32  | 0.50         |
| 18 | 113022 | 浙商转债     | 17,916,844.00  | 0.48         |
| 19 | 127005 | 长证转债     | 16,317,584.08  | 0.43         |
| 20 | 132014 | 18 中化 EB | 16,146,300.60  | 0.43         |
| 21 | 120002 | 18 中原 EB | 15,765,400.00  | 0.42         |
| 22 | 113017 | 吉视转债     | 15,003,800.00  | 0.40         |
| 23 | 110033 | 国贸转债     | 11,593,263.80  | 0.31         |
| 24 | 113519 | 长久转债     | 11,210,699.10  | 0.30         |
| 25 | 127006 | 敖东转债     | 10,293,524.45  | 0.27         |
| 26 | 113025 | 明泰转债     | 10,157,400.00  | 0.27         |
| 27 | 128021 | 兄弟转债     | 10,032,393.12  | 0.27         |
| 28 | 113530 | 大丰转债     | 9,852,881.80   | 0.26         |
| 29 | 113014 | 林洋转债     | 8,517,864.60   | 0.23         |
| 30 | 128032 | 双环转债     | 8,262,683.55   | 0.22         |
| 31 | 113020 | 桐昆转债     | 7,346,699.50   | 0.20         |
| 32 | 110048 | 福能转债     | 5,744,077.50   | 0.15         |
| 33 | 123023 | 迪森转债     | 5,404,208.80   | 0.14         |

## (5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

## (6) 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## 第十二部分 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 2009 年 7 月 23 日，基金业绩截止日 2020 年 3 月 31 日。

兴全磐稳债券 A:

| 阶段                        | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③    | ②—④    |
|---------------------------|--------|-----------|------------|---------------|--------|--------|
| 2020 年 1 季度               | 1.58%  | 0.26%     | 2.78%      | 0.11%         | -1.20% | 0.15%  |
| 2019 年度                   | 6.88%  | 0.16%     | 4.74%      | 0.05%         | 2.14%  | 0.11%  |
| 2018 年度                   | 5.13%  | 0.07%     | 8.43%      | 0.07%         | -3.30% | 0.00%  |
| 2017 年度                   | 1.90%  | 0.07%     | -0.28%     | 0.06%         | 2.18%  | 0.01%  |
| 2016 年度                   | 3.58%  | 0.08%     | 1.94%      | 0.09%         | 1.64%  | -0.01% |
| 2015 年度                   | 13.67% | 0.26%     | 6.23%      | 0.07%         | 7.44%  | 0.19%  |
| 2014 年度                   | 36.39% | 0.51%     | 8.96%      | 0.15%         | 27.43% | 0.36%  |
| 2013 年度                   | -2.26% | 0.21%     | 1.73%      | 0.05%         | -3.99% | 0.16%  |
| 2012 年度                   | 4.71%  | 0.14%     | 3.86%      | 0.04%         | 0.85%  | 0.10%  |
| 2011 年度                   | -3.72% | 0.22%     | 3.63%      | 0.06%         | -7.35% | 0.16%  |
| 2010 年度                   | 3.20%  | 0.11%     | 1.94%      | 0.06%         | 1.26%  | 0.05%  |
| 自基金合同生效起至 2020 年 3 月 31 日 | 91.89% | 0.22%     | 53.81%     | 0.08%         | 38.08% | 0.14%  |

注：2009 年年度数据统计期间为 2009 年 7 月 23 日（基金合同成立之日）至 2009 年 12 月 31 日，不满一年。

兴全磐稳债券 C:

| 阶段                                                   | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③    | ②-④   |
|------------------------------------------------------|--------|-----------|------------|---------------|--------|-------|
| 2020 年 1 季度                                          | 1.48%  | 0.26%     | 2.78%      | 0.11%         | -1.30% | 0.15% |
| 2019 年度                                              | 0.59%  | 0.17%     | 0.10%      | 0.01%         | 0.49%  | 0.16% |
| 自基金合同生效<br>(2019 年 12 月 27)<br>起至 2020 年 3 月 31<br>日 | 2.08%  | 0.26%     | 2.88%      | 0.10%         | -0.80% | 0.16% |

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

### 第十三部分 基金费用与税收

#### 一、基金费用的种类

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

#### 二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

##### 1. 基金管理人的管理费

本基金的管理费率为年费率 0.70%。

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。于次月首日起 15 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

## 2. 基金托管人的托管费

本基金的托管费率为年费率 0.20%。

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。于次月首日起 15 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。

## 3. C 类基金份额的销售服务费

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

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

$H = E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

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

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

## 三、不列入基金费用的项目

基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财

产的损失，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金合同生效之前的律师费、会计师费和信息披露费用等不得从基金财产中列支。

#### 四、基金管理费和基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人可协商酌情调低基金管理费和基金托管费，无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须最迟于新的费率实施日前 2 日在至少一种指定媒介上刊登公告。

#### 五、其他费用

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

#### 六、税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，依照国家法律法规的规定履行纳税义务。

### 第十四部分 对招募说明书更新部分的说明

本次招募说明书更新内容为：

- 1、更新了“第三部分 基金管理人”相关信息；
- 2、更新了“第八部分 基金份额的场外申购、赎回与转换”中的申购、赎回金额限制相关内容；
- 3、更新了“第九部分 基金的投资”中投资组合报告及“第十部分 基金的业绩”，相关数据截止日期为 2020 年 3 月 31 日。
- 4、根据相关规定，将招募说明书中“指定媒介”修改为“规定媒介”，将“指定报刊”修改为“规定报刊”，将“指定网站”修改为“规定网站”。

兴证全球基金管理有限公司

2020 年 5 月 15 日