

兴全绿色投资混合型证券投资基金（LOF）

更新招募说明书摘要

（2020年5月16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

二〇二〇年五月

【重要提示】

本基金于2011年2月16日经中国证监会证监许可[2011]241号文核准募集。本基金基金合同于2011年5月6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《兴全绿色投资混合型证券投资基金（LOF）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。

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投资风险，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。

投资有风险，投资者认购（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 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。

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	20
第四部分	基金的名称	28
第五部分	基金的类型	28
第六部分	基金的投资目标	28
第七部分	基金的投资方向	29
第八部分	基金的投资策略及投资组合管理	29
第九部分	基金业绩比较基准	35
第十部分	基金的风险收益特征	35
第十一部分	基金的投资组合报告	35
第十二部分	基金的业绩	39
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、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、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

邹欣先生，经济学硕士。历任富国基金管理有限公司研究员，泰达宏利基金管理有限公司研究员，兴证全球基金管理有限公司研究部研究员、兴全社会责任混合型证券投资基金基金经理助理、兴全趋势投资混合型证券投资基金（LOF）基金经理。现任兴证全球基金管理有限公司研究部总监助理、兴全绿色投资混合型证券投资基金（LOF）基金经理（2017年6月29日起至今）。

本基金历任基金经理：

傅鹏博先生，于2011年5月6日至2013年1月18日期间担任本基金基金经理。

陈锦泉先生，于2011年5月6日至2015年2月3日期间担任本基金基金经理。

杨岳斌先生，于2014年12月8日至2017年7月13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以下成员组成：

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基金收益；
- 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、按照有关规定计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购、赎回的价格；
- 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、法律法规及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，但法律法规或中国证监会另有规定的除外；

(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) 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。

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授权，确保风险管理工作是独立的，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

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：陈四清

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 2019 年 9 月，中国工商银行资产托管部共有员工 208 人，平均年龄 33 岁，95%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、QFII 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 2019 年 9 月，中国工商银行共托管证券投资基金 1006 只。自 2003 年以来，本行连续十六年获得香港《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 68 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、基金托管人的职责

- 1、以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；
- 2、设立专门的基金托管部门，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；
- 3、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，确保基金财产的安全，保证其托管的基金财产与基金托管人自有财产以及不同的基金财产相互独立；对所托管的不同的基金分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金之间在名册登记、账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；
- 4、除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金财产；
- 5、保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；
- 6、按规定开设基金财产的资金账户和证券账户，按照基金合同的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；
- 7、保守基金商业秘密，除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露；
- 8、复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额申购、赎回价格；
- 9、办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；
- 10、对基金财务会计报告、季度、半年度和年度基金报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照基金合同的规定进行；如果基金管理人未执行基金合同规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；
- 11、保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料 15 年以上；
- 12、建立并保存基金份额持有人名册；
- 13、按规定制作相关账册并与基金管理人核对；
- 14、依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项；
- 15、按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金管理人、基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会；
- 16、按照法律法规和基金合同的规定监督基金管理人的投资运作；

17、参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

18、面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会和银行监管机构，并通知基金管理人；

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

20、按规定监督基金管理人按法律法规和基金合同规定履行自己的义务，基金管理人因违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金利益向基金管理人追偿；

21、执行生效的基金份额持有人大会的决议；

22、法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他义务。

五、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 年至今共十二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。

六、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。

第三部分 相关服务机构

一、基金份额销售机构

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

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（排名不分先后）

名称	法定代表人	地址	客服电话	网址
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	http://www.icbc.com.cn
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	http://www.cib.com.cn
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	http://www.abchina.com
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	http://www.cmbchina.com
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 办公地址：北京市西城区金融大街3号	95580	http://www.psbc.com
交通银行股份有限公司	彭纯	注册地址：上海市银城中路188号 办公地址：上海市银城中路188号	95559	http://www.bankcomm.com
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	http://bank.ecitic.com
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 办公地址：北京市西城区复兴门内大街2号	95568	http://www.cmbc.com.cn
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）	http://www.cebbank.com
宁波银行股份有限公司	陆华裕	注册地址：宁波市鄞州区宁南南路700号	96528（北京、上海地区962528）	http://www.nbcb.com.cn
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	http://www.spdb.com.cn
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 办公地址：深圳市深南东路5047号深圳发展银行大厦	95511-3	http://www.bank.pingan.com
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 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	http://www.hxb.com.cn

名称	法定代表人	地址	客服电话	网址
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	http://www.bankofshanghai.com
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) 400-709-6899 (其他)	http://www.cqcbank.com
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)	http://www.ccb.com
东莞农村商业银行股份有限公司	何沛良	注册地址: 东莞市南城路 2 号 办公地址: 东莞市南城路 2 号	961122	www.drcbank.com
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	http://www.jnbank.com
江苏银行股份有限公司	夏平	注册地址: 南京市中华路 26 号 办公地址: 南京市中华路 26 号	025-58587039	http://www.jsbchina.cn
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	http://www.boc.cn
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	http://www.xyqz.com.cn
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	http://www.gtja.com
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 办公地址: 北京市东城区朝内大街 188 号	4008888108	http://www.csc108.com
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	http://www.htsc.com.cn
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	4008-888-999 027-85808318	http://www.cjsc.com.cn
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 021-962503	http://www.htsec.com
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 4008888111	http://www.newone.com.cn
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	http://www.chinastock.com.cn

名称	法定代表人	地址	客服电话	网址
广发证券股份有限公司	孙树明	注册地址： 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	http://www.gf.com.cn
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 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	http://www.i618.com.cn
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) 962506 40088-8850 6	http://www.dfzq.com.cn
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	http://www.tebon.com.cn
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	http://www.bocichina.com
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	4008888788	http://www.ebscn.com
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	http://www.gyzq.com.cn
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	400-888-15 51	http://www.xcsc.com
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 办公地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层	95523 或 4008895523	http://www.swhysc.com
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	400-8866-5 67	http://www.avicsec.com
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	http://www.ewww.com.cn
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 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	400-887-88 27	http://www.ubssecurities.com
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 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)	http://www.hfzq.com.cn
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	http://www.zts.com.cn
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	www.ajzq.com

名称	法定代表人	地址	客服电话	网址
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	http://www.essence.com.cn/
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	http://www.hrsec.com.cn
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	http://www.guosen.com.cn
东莞证券股份有限公司	陈照星	注册地址：东莞市莞城区可园南路一号	95328	
东海证券股份有限公司	赵俊	注册地址：江苏省常州延陵西路 23 号投资广场 18 层	95531 400-8888-588	www.longone.com.cn
九州证券股份有限公司	魏先锋	注册地址：青海省西宁市南川工业园区创业路 108 号	95305	http://www.jzsec.com/
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	http://www.ecitic.com
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	http://www.cs.ecitic.com
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	http://www.cindasc.com
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	http://www.cfsc.com.cn
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	http://www.guodu.com
粤开证券股份有限公司	严亦斌	注册地址：惠州市江北东江三路 55 号广播电视新闻中心西面一层大堂和三、四层	95564	http://www.lxsec.com.cn
中信证券（华南）股份有限公司	胡伏云	注册地址：广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 19 层、20 层 办公地址：广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心主塔 5 层	95548	http://www.gzs.com.cn/
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	http://stock.pingan.com
华西证券股份有限公司	杨炯洋	注册地址：四川省成都市高新区天府二街 198 号	95584	http://www.hx168.com.cn
长城证券股份有限公司	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	400-612-8888	http://www.s10000.com
南京证券股份有限公司	步国旬	注册地址：南京市江东中路 389 号	95386	http://www.njqz.com.cn/

名称	法定代表人	地址	客服电话	网址
中国中投证券有限责任公司	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 01. 02. 03. 05. 11. 12. 13. 15. 16. 18. 19. 20. 21. 22. 23 单元	95532	www.china-invs.cn
东方财富证券股份有限公司	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 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/
民生证券股份有限公司	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.msza.com/
方正证券股份有限公司	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.foundersc.com
东兴证券股份有限公司	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 办公地址：	95309	http://www.dxzq.net/
国联证券股份有限公司	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.glsc.com.cn/
华安证券股份有限公司	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) 66045678	http://www.txsec.com
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	http://www.1234567.com.cn
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	http://licaike.hexun.com
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 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	http://www.ehowbuy.com
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	www.fund123.cn
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	http://www.5ifund.com
珠海盈米基金销售有限公司	肖雯	注册地址：珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室-3491	020-89629066	http://www.yingmi.cn

名称	法定代表人	地址	客服电话	网址
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 办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号	4008219031	http://www.lufunds.com
深圳众禄基金销售股份有限公司	薛峰	注册地址：深圳市罗湖区笋岗街道梨园路物资控股置地大厦8楼801	4006-788-887	http://www.zlfund.cn 或 http://www.jjmmw.com
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	http://www.noah-fund.com
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	https://8.gw.com.cn/
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	http://www.citicsf.com/
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	http://www.xds.com.cn/
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	https://danjuanapp.com/
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	www.niuniufund.com
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 办公地址：	010-67000988-6025	http://www.zcvc.com.cn/
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	www.jiyufund.com.cn
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 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	http://kenterui.jd.com
北京汇成基金销售有限公司	王伟刚	注册地址：北京市海淀区中关村大街E世界财富中心A座1108号	400-619-9059	www.hcjjin.com
上海挖财基金销售有限公司	吕柳霞	注册地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路799号5层04室	021-50810673	http://www.wacaijin.com
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 办公地址：上海浦东大道555号裕景国际B座16层	4000-891-289	http://www.erichfund.com

名称	法定代表人	地址	客服电话	网址
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 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） 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	http://www.xzfuture.com/
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 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 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	http://www.cicc.com/
恒泰证券股份有限公司	庞介民	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：呼和浩特市新城区海拉尔东街满世书香苑恒泰证券办公楼	956088 或 4001966188	https://www.cnht.com.cn/

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：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

客服电话：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：俞卫锋

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

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

兴全绿色投资混合型证券投资基金(LOF)

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

本基金通过挖掘绿色科技产业或公司，以及其他产业中积极履行环境责任公司的投资机会，力争实现当期投资收益与长期资本增值。

第七部分 基金的投资方向

本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括依法公开发行上市的股票（包括创业板、中小板以及其他经中国证监会批准上市的股票）、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及经中国证监会批准允许基金投资的其它金融工具（但需符合中国证监会的相关规定）。

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。

本基金为混合型基金，股票投资比例为基金资产的 60%–95%，其中，符合绿色投资理念的股票合计投资比例不低于股票资产的 80%；债券投资比例为基金资产的 5%–40%，其中本基金保留不低于基金资产净值的 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，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 基金的投资策略及投资组合管理

（一）投资策略

1、资产配置策略

在大类资产配置上，本基金采取定性与定量研究相结合，在股票与债券等资产类别之间进行资产配置。在宏观与微观层面对各类资产的价值增长能力展开综合评估，动态优化资产配置。

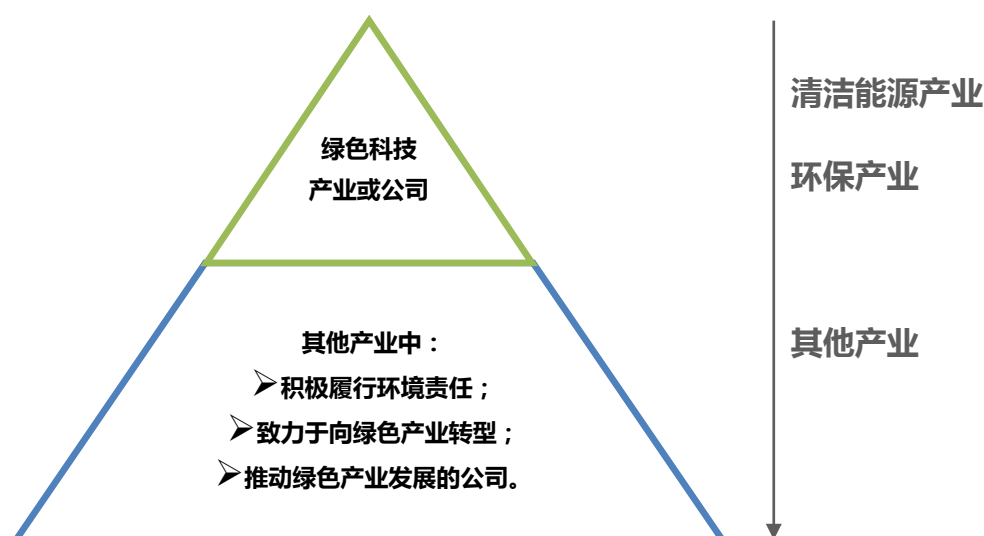
投资决策委员会将定期或根据需要召开会议，审议基金经理对于资产配置策略的分析结论，确定今后一段时间内资产配置策略，即基金投资组合中股票和其他金融品种的构成比例。基金经理执行审定后的资产配置计划。

2、绿色投资筛选策略

（1）绿色投资的涵义与范畴

本基金所指的绿色投资涵盖了三个层次，包括清洁能源产业、环保产业、以及其他产业中积极履行环境责任、致力于向绿色产业转型、或在绿色相关产业发展过程中作出贡献的公司。其中，清洁能源产业、环保产业可统称为绿色科技产业。

图 1：绿色投资筛选策略范畴示意图



（2）多种投资方法相结合

本基金在绿色投资过程中，将以多种投资方法相结合，在追求资本长期稳定增值、获得良好回报的同时，起到维护或改善地球生态环境，推动整个社会的可持续发展的作用。

首先，本基金采用消极筛选法将对环境造成严重污染的公司列入投资禁选库中。

其次，本基金采用绿色投资积极筛选法，就上市公司环境责任的履行进行综合打分，相对排名筛选，尤其是行业内排名筛选，对那些环境责任方面在同行业中表现相对突出的公司予以优先考虑。

另外，本基金还将适当采用股东倡导方法，以提案、管理层沟通、呼吁等多种形式积极做好股东倡导，逐步在国内市场形成对上市公司绿色产业发展的外部激励约束机制。

（3）绿色投资筛选策略的评价标准

1) 本基金重点关注的绿色科技产业或公司主要包含清洁能源产业和环保产业两个层次。

首先，清洁能源产业包括但不限于：风能、太阳能、地热能、水力、生物燃料和其他替代能源及相关科技创新研究等。

其次，环保产业涉及但不限于以下几个方面：

- 节能减排：提高资源贮藏、使用及回收利用效率、减少废物排放、资源有效管理、使用回收再利用原料等；
- 水治理：提高用水利用率、水及废水处理、水运输等；
- 环境服务：环境保护咨询、绿色建筑、环境安全设备等；

- 绿色运输：相关公共交通系统，包括交运设备排放、能源效率控制技术等；
- 可持续生活：涉及自然、健康和可持续发展相关的产品或服务，包括自然和有机食物、绿色消费产品等。

2) 本基金对其他产业中积极履行环境责任、致力于向绿色产业转型、或在绿色相关产业发展过程中作出贡献的公司予以关注。在评价一个公司时，本基金考虑但不限于以下因素：

- 公司产品和服务对绿色产业的影响或益处；
- 公司运作、销售系统等方面对绿色产业的影响或益处；
- 公司环境政策和管理系统的质量；
- 公司资源管理质量，如原材料消耗、材料的回收和再利用，废物管理等；
- 公司遵守相关法律法规，尤其是与环保、科技创新等与绿色产业发展相关的法律法规；
- 公司对可能造成环境污染的项目进行及时披露并采取应对措施；
- 公司碳排放指标；
- 公司积极参与碳交易相关业务；
- 公司具有针对自身向绿色产业转型的实质性方案及措施；
- 公司拥有新能源开发、环保相关产品研发、经营等环保产业的一项或多项专利或业务；
- 公司每年有稳定的预算经费用于研发创新产品、相关捐赠等推动绿色产业发展的项目；
- 其他方面：如是否积极对客户、员工及社区等利益相关者组织与环保意识相关的推广沟通活动等。

综上所述，本基金绿色投资的主线涉及两个方面。一方面，本基金将重点关注清洁能源和环境保护等绿色科技产业；另一方面，对其他产业中积极履行环境责任、致力于向绿色产业转型、或在绿色相关产业发展过程中作出贡献的公司也予以关注。

（4）行业配置策略

本基金除运用“绿色投资筛选策略”进行股票精选外，还将辅以一定的行业配置调整策略，对各行业权重进行“绿色”优化。本基金重点关注绿色科技产业和其他产业中积极履行环境责任、致力于向绿色产业转型、或在绿色相关产业发展过程中作出贡献的公司，因此，本基金将超配绿色科技产业。

3、股票选择策略

本基金在运用“绿色投资筛选策略”的基础上，采用环境因子与公司财务等基本因子相结合，进行综合评估筛选，对那些表现相对突出的公司予以优先考虑，从而构建本基金的各级股票池。

（1）定量指标

本基金运用静态与动态数据相结合的方式考察股票的成长质量和可持续性，选择那些被低估且有稳定持续增长潜力的股票。

在考察个股的估值水平时，本基金考察企业贴现现金流以及内在价值贴现，结合市盈率（PE）、市净率（PB）、市销率（PS）等指标考察股票的价值是否被低估。本基金认为高成长性的股票，尤其是绿色科技产业通常具有高市盈率，但高市盈率又往往意味着对该股票的高估值。因而本本基金在个股选择中会强调对成长性和估值水平的甄别。

本基金采用年复合营业收入增长率、盈利增长率、息税前利润增长率、净资产收益率、以及现金流量增长率等指标综合考察上市公司的成长性。

在盈利水平方面，本基金对盈利速度和盈利质量并重，而不单纯追求上市公司盈利的速度。本基金重点考察主营业务收入、经营现金流、盈利波动程度三个关键指标，以衡量具有高质量持续增长的公司。具体而言，营业收入增长率/应收账款增长率（GAR/GSales）、核心营业利润与净资产比例（CE/Equity）、经营性现金流与核心营业利润比例（CFF0/CE）等核心指标都将被运用到盈利水平的度量上。

（2）定性指标

在定性指标方面，本基金综合考察科技创新能力、商业模式、管理团队等等因素，并据此给以相应的折溢价水平，并最终股票合理价格区间。

本基金认为公司的研发及科技创新能力与其长期绩效紧密相关，一个公司的科研与创新能力是实现企业履行环境责任的关键点，也是绿色产业发展的源泉；而且好的绿色产业商业模式才是决定公司能否持续经营的根本；当然，公司持续的技术创新与保持有活力的商业模式，都需要优秀的团队与员工的积极参与。

本基金还将定期（一般一个季度）或不定期（突发事件）根据本基金“绿色投资筛选策略”和“股票选择策略”进行重新评估，结合上市公司披露财报、社会责任报告、媒体公开信息、第三方评价机构和环保绿色组织提供的数据、以及内部研究员的实地调研，丰富环境责任指标监控体系，定期、动态调整本基金的各级股票池。

并综合结合上述多种因素作出投资决策，从而构建实际股票组合。

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，主要运用的投资策略为：正股价值发现驱动的杠杆投资策略、组合套利策略以及复制性组合投资策略等。

4、债券投资策略

本基金将采取久期偏离、收益率曲线配置和类属配置、无风险套利、杠杆策略和个券选择策略等投资策略，发现、确认并利用市场失衡实现组合增值。这些投资策略是在遵守投资纪律并有效管理风险的基础上作出。

（二）投资组合限制

本基金的投资组合将遵循以下限制：

- a、持有一家上市公司的股票，其市值不得超过基金资产净值的 10%；
- b、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%；
- c、本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；
- d、本基金在任何交易日买入权证的总金额，不超过上一交易日基金资产净值的 0.5%，基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%，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%。法律法规或中国证监会另有规定的，遵从其规定；
- e、现金或到期日不超过 1 年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；
- f、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%；
- g、本基金持有的同一（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%；
- h、本基金管理人管理的全部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%；
- i、本基金财产参与股票发行申购，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；
- j、本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过该基金资产净值的 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；

k、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%；

1、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；

m、本基金不得违反《基金合同》关于投资范围和投资比例的约定；

n、相关法律法规以及监管部门规定的其它投资限制。

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

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。除上述 e、j、l 项外，由于证券市场波动、上市公司合并或基金规模变动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不在限制之内，但基金管理人应在 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。

2、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，但法律法规或中国证监会另有规定的除外；

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与基金管理人、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。

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

第九部分 基金业绩比较基准

本基金业绩比较基准：80%×沪深 300 指数+20%×中证国债指数。

第十部分 基金的风险收益特征

本基金为混合型基金产品，属于较高预期风险、较高预期收益的基金品种，其预期风险收益水平高于债券型基金及货币市场基金，低于股票型基金，属于中高预期风险、中高预期收益的基金产品。

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。

基金托管人中国工商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绿色投资混合型证券投资基金 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	495,815,611.07	89.91
	其中：股票	495,815,611.07	89.91
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	35,683,421.14	6.47
	其中：债券	35,683,421.14	6.47
	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	12,647,902.36	2.29

	合计		
8	其他各项资产	7,317,299.74	1.33
9	合计	551,464,234.31	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	2,730,684.00	0.50
B	采矿业	4,611,024.00	0.85
C	制造业	274,765,900.80	50.78
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	5,730,304.00	1.06
G	交通运输、仓储和邮政业	35,925,431.00	6.64
H	住宿和餐饮业	2,440,698.00	0.45
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,295,071.00	1.90
J	金融业	15,538,758.71	2.87
K	房地产业	105,134,698.44	19.43
L	租赁和商务服务业	11,803,610.00	2.18
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	2,622,435.38	0.48
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	24,216,995.74	4.48
S	综合	-	-
	合计	495,815,611.07	91.63

(2) 报告期末按行业分类的沪股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

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	601012	隆基股份	2,298,778	57,101,645.52	10.55
2	000002	万科A	1,988,324	51,000,510.60	9.43
3	000651	格力电器	902,300	47,100,060.00	8.70
4	600060	海信视像	4,835,432	45,356,352.16	8.38
5	600048	保利地产	2,203,332	32,763,546.84	6.06

6	600026	中远海能	3,280,200	24,601,500.00	4.55
7	300413	芒果超媒	563,386	24,216,995.74	4.48
8	000656	金科股份	2,246,300	17,880,548.00	3.30
9	002773	康弘药业	396,580	15,617,320.40	2.89
10	000625	长安汽车	1,145,600	12,120,448.00	2.24

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	30,159,000.00	5.57
	其中：政策性金融债	30,159,000.00	5.57
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可转换债）	5,524,421.14	1.02
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	35,683,421.14	6.59

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	190211	19国开11	300,000	30,159,000.00	5.57
2	113020	桐昆转债	21,440	2,486,396.80	0.46
3	113552	克来转债	13,090	1,611,379.00	0.30
4	128098	康弘转债	7,382	944,674.54	0.17
5	113549	白电转债	4,280	481,970.80	0.09

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) 其他各项资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	181,386.72
2	应收证券清算款	6,393,785.16
3	应收股利	-
4	应收利息	410,847.78
5	应收申购款	331,280.08
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,317,299.74

(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	113020	桐昆转债	2,486,396.80	0.46

(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	300413	芒果超媒	4,018,000.00	0.74	大宗流通受限

(6) 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

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 2011 年 5 月 6 日，基金业绩截止日 2020 年 3 月 31 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
2020 年 1 季度	-2.52%	2.14%	-7.23%	1.54%	4.71%	0.60%
2019 年度	55.89%	1.18%	29.44%	0.99%	26.45%	0.19%
2018 年度	-22.06%	1.37%	-19.20%	1.07%	-2.86%	0.30%
2017 年度	4.30%	0.86%	16.73%	0.51%	-12.43%	0.35%
2016 年度	-9.61%	1.67%	-8.32%	1.12%	-1.29%	0.55%
2015 年度	28.26%	2.73%	7.36%	1.99%	20.90%	0.74%
2014 年度	44.03%	1.20%	42.92%	0.97%	1.11%	0.23%
2013 年度	43.87%	1.39%	-6.35%	1.12%	50.22%	0.27%
2012 年度	1.44%	1.00%	6.90%	1.02%	-5.46%	-0.02%
2011 年度	-9.90%	0.75%	-19.55%	1.04%	9.65%	-0.29%
自基金合同成立起至 2020 年 3 月 31 日	171.26%	1.50%	28.33%	1.17%	142.93%	0.33%

注：2011 年度数据统计期间为 2011 年 5 月 6 日（基金合同成立之日）至 2011 年 12 月 31 日，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、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
 - 4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
 - 5、基金份额持有人大会费用；
 - 6、基金的证券交易费用；
 - 7、基金的银行汇划费用；
 - 8、基金上市费用；
 - 9、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。
- 本基金终止清算时所发生费用，按实际支出额从基金财产总值中扣除。

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

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.5%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 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、公休假等，支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金

托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

上述“一、基金费用的种类”中第 3—8 项费用，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期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

三、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

- 1、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；
- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
- 3、《基金合同》生效前的相关费用，包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费用等费用；
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

四、费用调整

基金管理人和基金托管人协商一致后，可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率、基金销售费率等相关费率。

调高基金管理费率、基金托管费率或基金销售费率等费率，须召开基金份额持有人大会审议；调低基金管理费率、基金托管费率或基金销售费率等费率，无须召开基金份额持有人大会。

基金管理人必须最迟于新的费率实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在至少一种指定媒介上公告。

五、基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

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“第九部分 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“第十二部分 基金的投资”中投资组合报告及“第十三部分 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 16 日