兴全基金管理有限公司
兴全恒益债券型证券投资基金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：中国工商银行股份有限公司
二零一八年十一月

重要提示

兴全恒益债券型证券投资基金（以下简称"本基金"）根据2017年7月11日中国证券监督管理委员会（以下简称"中国证监会"）证监许可【2017】1182号文准予募集注册。

本招募说明书摘要是根据《兴全恒益债券型证券投资基金基金合同》和《兴全恒益债券型证券投资基金更新招募说明书》编写，并经中国证监会核准。兴全基金管理有限公司（以下简称"本基金管理人"）保证本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注册，但中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的投资价值、收益及市场前景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，投资人认购（或申购）基金时应认真阅读本招募说明书、基金合同等信息披露文件。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。

基金合同是约定基金合同当事人之间权利、义务关系的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

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。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者在投资本基金前，请认真阅读本招募说明书，全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对认购（或申购）基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策，获得基金投资收益，亦承担基金投资中出现的各类风险。投资本基金可能遇到的风险包括：证券市场整体环境引发的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，大量赎回或暴跌导致的流动性风险，基金投资过程中产生的操作风险，因交收违约和投资债券引发的信用风险，基金投资对象与投资策略引致的特有风险，等等。

本基金可投资中小企业私募债券，其发行人是非上市中小微企业，发行方式为面向特定对象的私募发行。当基金所投资的中小企业私募债券之债务人出现违约，或在交易过程中发生交收违约，或由于中小企业私募债券信用质量降低导致价格下降等，可能造成基金财产损失。中小企业私募债券较传统企业债的信用风险及流动性风险更大，从而增加了本基金整体的债券投资风险。

本基金为债券型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金，但低于混合型基金、股票型基金，属于较低风险/收益的产品。

本基金基金份额分为 A、C 类，A类基金份额收取认（申）购费；C 类基金份额不收取认（申）购费，但计提销售服务费。

本基金单一投资者持有基金份额数不得达到或超过基金份额总数的50%，但在基金运作过程中因基金份额赎回等情形导致被动达到或超过50%的除外。

基金管理人提醒投资人基金投资的"买者自负"原则，在投资人作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资人自行负责。

本更新招募说明书所载内容截止日2018年9月19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2018年第2季度报告，数据截止日为2018年6月30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。

一、基金管理人

（一）基金管理人概况

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2018年9月19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、兴全祥泰定期开放债券型发起式证券投资基金共22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、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、董事会成员概况

兰荣先生，董事长，党委书记，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。现任兴全基金管理有限公司董事长、党委书记。

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，兴证（香港）金融控股有限公司董事，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。现任兴全基金公司董事、总经理。

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。现任兴业证券股份有限公司副总裁及兴业证券上海证券自营分公司总经理，兼任兴证国际金融集团有限公司非执行董事、兴证投资管理有限公司执行董事。

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，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及战略发展部负责人，兼任全球人寿企业中心有限公司一般代理人、全美人寿创业投资基金有限责任公司董事会咨询委员会成员、全美人寿创业投资有限责任公司董事会咨询委员会成员。

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。现任全球人寿资产管理控股有限公司首席财务官、董事，兼任全球人寿美国资产管理控股有限公司董事、阿姆斯特斯不动产有限公司监事会成员、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）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。现任全球人寿资产管理控股有限公司全球首席风险官、董事，兼任法国邮政银行资产管理公司监事会成员。

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教授。现任长江商学院金融学杰出院长讲席教授，兼任兰州银行独立董事、中国平安保险独立董事。

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。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。

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等职务。现任兴业证券股份有限公司副总裁、首席风险官、财务负责人。

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，兴全基金管理有限公司综合管理部总监。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、风险管理部总监。

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。

3、高级管理人员概况

兰荣先生，董事长、党委书记。（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、副总经理兼上海分公司负责人。现任兴全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。历任兴全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、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，兴全基金管理有限公司基金管理部投资总监。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、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、机构业务部总监兼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，平安资产管理公司资产管理部副总经理，兴全基金管理有限公司兴全绿色投资混合型证券投资基金（LOF）基金经理、总经理助理。现任兴全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、专户投资经理。

4、本基金基金经理

张睿女士，1981年生，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，兴全基金管理有限公司研究员、兴全货币市场证券投资基金基金经理、兴全保本混合型证券投资基金（已转型为"兴全精选混合型证券投资基金"）基金经理、兴全磐稳增利债券型证券投资基金、兴全添利宝货币市场基金、兴全天添益货币市场基金基金经理。现任兴全基金管理有限公司固定收益部总监助理兼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）。

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，兴全基金管理有限公司行业研究员、兴全趋势投资混合型证券投资基金（LOF）基金经理助理、兴全全球视野股票型证券投资基金基金经理、基金管理部总监助理。现任兴全沪深300指数增强型证券投资基金（LOF）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日起至今）。

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。

固定收益公募投资决策委员会成员由以下人员组成：

庄园芳兴全基金管理有限公司董事、总经理。

张睿兴全基金管理有限公司固定收益部总监助理兼兴全磐稳增利债券型证券投资基金基金经理、兴全兴泰定期开放债券型发起式证券投资基金、兴全恒益债券型证券投资基金基金经理

翟秀华兴全添利宝货币市场基金基金经理、兴全稳益定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理、兴全天添益货币市场基金基金经理、兴全兴泰定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理、兴全祥泰定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理

公募投资决策委员会成员由以下人员组成：

庄园芳兴全基金管理有限公司董事、总经理

董承非兴全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、兴全社会责任混合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总监兼兴全合润分级混合型证券投资基金基金经理、兴全合宜灵活配置混合型证券投资基金基金经理

上述人员之间不存在近亲属关系。

（三）基金管理人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于：

（1）依法募集资金；
（2）自《基金合同》生效之日起，根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产；
（3）依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；
（4）销售基金份额；
（5）按照规定召集基金份额持有人大会；
（6）依据《基金合同》及有关法律规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；
（7）在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；
（8）选择、更换基金销售机构，对基金销售机构的相关行为进行监督和处理；
（9）担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记机构办理基金登记业务并获得《基金合同》规定的费用；
（10）依据《基金合同》及有关法律规定决定基金收益的分配方案；
（11）在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购、赎回与转换申请；
（12）依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利；
（13）在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资；
（14）以基金管理人的名义，代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
（15）选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；
（16）在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换、定期定额投资和非交易过户等业务规则；
（17）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于：

（1）依法募集资金，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）自《基金合同》生效之日起，以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产；
（4）配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；
（5）建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；
（6）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，不得委托第三人运作基金财产；
（7）依法接受基金托管人的监督；
（8）采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回的价格；
（9）进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
（10）编制季度、半年度和年度基金报告；
（11）严格按照《基金法》、《基金合同》及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；
（12）保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不向他人泄露；
（13）按《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；
（14）按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；
（15）依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；
（16）按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料15年以上；
（17）确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出，并且保证投资者能够按照《基金合同》规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并在支付合理成本的条件下得到有关资料的复印件；
（18）组织并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；
（19）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并通知基金托管人；
（20）因违反《基金合同》导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益时，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
（21）监督基金托管人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金托管人违反《基金合同》造成基金财产损失时，基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；
（22）当基金管理人将其义务委托第三方处理时，应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任；
（23）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实施其他法律行为；
（24）基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件，《基金合同》不能生效，基金管理人承担全部募集费用，将已募集资金并加计银行同期活期存款利息在基金募集期结束后30日内退还基金认购人；
（25）执行生效的基金份额持有人大会的决议；
（26）建立并保存基金份额持有人名册；
（27）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。

（四）基金管理人承诺

1、本基金管理人承诺严格遵守现行有效的相关法律法规、《基金合同》和中国证监会的有关规定，建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反现行有效的有关法律法规、《基金合同》和中国证监会有关规定的行为发生。

2、本基金管理人承诺严格遵守《中华人民共和国证券法》、《基金法》及有关法律法规，建立健全的内部控制制度，采取有效措施，防止下列行为发生：

（1）将其固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；
（2）不公平地对待其管理的不同基金财产；
（3）利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人谋取利益；
（4）向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；
（5）法律法规或中国证监会禁止的其他行为。

3、本基金管理人承诺加强人员管理，强化职业操守，督促和约束员工遵守国家有关法律、法规及行业规范，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利益；
（4）在向中国证监会报送的资料中弄虚作假；
（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，不按照规定履行职责；
（7）违反现行有效的有关法律法规、《基金合同》和中国证监会的有关规定，泄漏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，或利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；
（8）违反证券交易所业务规则，利用对敲、倒仓等手段操纵市场价格，扰乱市场秩序；
（9）贬损同行，以抬高自己；
（10）以不正当手段谋求业务发展；
（11）有悖社会公德，损害证券投资基金人员形象；
（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）其他法律法规以及中国证监会禁止的行为。

4、基金经理承诺

（1）依照有关法律法规和《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及其代理人、受雇人或任何第三人谋取利益；
（3）不违反现行有效的有关法律法规、《基金合同》和中国证监会的有关规定，泄漏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，或利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；
（4）不从事损害基金财产和基金份额持有人利益的证券交易及其他活动。

（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门、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，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）建立有效的内部监控系统：建立了足够、有效的内部监控系统，如电脑预警系统、投资监控系统，能对可能出现的各种风险进行全面和实时的监控；
（6）使用数量化的风险管理手段：采取数量化、技术化的风险控制手段，建立数量化的风险管理模型，用以提示指数趋势、行业及个股的风险，以便公司及时采取有效的措施，对风险进行分散、控制和规避，尽可能地减少损失；
（7）提供足够的培训：制定了完整的培训计划，为所有员工提供足够和适当的培训，使员工明确其职责所在，控制风险。

6、基金管理人关于内部合规控制声明书

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

二、基金托管人

（一）基金托管人基本情况

1、基金托管人概况

名称：中国工商银行股份有限公司
住所：北京市西城区复兴门内大街 55 号
法定代表人：易会满
成立时间：1984 年 1 月 1 日
组织形式：股份有限公司
注册资本：人民币 35,640,625.71 万元
存续期间：持续经营
基金托管资格批文及文号：中国证监会和中国人民银行证监基字【1998】3 号
电话：（010）66105799
联系人：郭明

2、主要人员情况

截至2018年6月，中国工商银行资产托管部共有员工212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。

3、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2018年6月，中国工商银行共托管证券投资基金874只。自2003 年以来，本行连续十五年获得香港《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61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。

（二）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；如果基金管理人有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。

（三）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。2005、2007、2009、2010、2011、2012、2013、2014、2015、2016、2017共十一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，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控目标方面的进展，并根据检查情况提出内控措施，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的目的。
（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。资产托管部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。资产托管部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，从最初的按照预定时间演练发展到现在的"随机演练"。从演练结果看，资产托管部完全有能力在发生灾难的情况下两个小时内恢复业务。

5. 资产托管部内部风险控制情况

（1）资产托管部内部设置专职稽核监察部门，配备专职稽核监察人员，在总经理的直接领导下，依照有关法律规章，全面贯彻落实全程监控思想，确保资产托管业务健康、稳定地发展。
（2）完善组织结构，实施全员风险管理。完善的风险管理体系需要从上至下每个员工的共同参与，只有这样，风险控制制度和措施才会全面、有效。资产托管部实施全员风险管理，将风险控制责任落实到具体业务部门和业务岗位，每位员工对自己岗位职责范围内的风险负责，通过建立纵向双人制、横向多部门制的内部组织结构，形成不同部门、不同岗位相互制衡的组织结构。
（3）建立健全规章制度。资产托管部十分重视内部控制制度的建设，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：资产托管业务内部控制、业务操作规程、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。

（四）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、基金托管协议或其他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有重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正。

三、相关服务机构

（一）基金份额销售机构

1、直销机构

（1）兴全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、20398927
传真：021–58368869、021–58368915

（2）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、建设银行直连、农业银行直连、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）、汇收付（华夏银行、兴业银行）及网上直销汇款交易）（排名不分先后）
交易网址：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、其他销售机构

●银行类销售机构

（1）兴业银行股份有限公司
办公地址：福建省福州市湖东路154 号
法定代表人：高建平
电话：（021）52629999
客户服务电话：95561
公司网站：http://www.cib.com.cn

（2）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

（3）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：彭纯
联系人：曹榕
电话：（021）58781234
传真：（021）58408483
客户服务电话：95559
公司网站：http:// www.bankcomm.com

(4)中国光大银行股份有限公司
注册地址：北京市西城区太平桥大街25号、甲25号中国光大中心
办公地址：北京市西城区太平桥大街25号、甲25号中国光大中心
法定代表人：李晓鹏
联系人：薛军丽
联系电话：（010）63636150
客户服务电话：95595
传真：（010）68560661
公司网站：http://www.cebbank.com

(5)中信银行股份有限公司
住所：北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座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

(6)中国银行股份有限公司
住所：中国北京市复兴门内大街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

(7)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
法定代表人：易会满
电话：（010）66107900
传真：（010）66107914
客户服务电话： 95588
公司网站：http://www.icbc.com.cn

(8)中国民生银行股份有限公司
住所：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
法定代表人：洪崎
客户服务电话：95568
传真：（010）83914283
公司网站：http://www.cmbc.com.cn

(9)平安银行股份有限公司
注册地址：广东省深圳市深南东路5047号
法定代表人：谢永林
客户服务电话：95511–3
公司网站：http://www.bank.pingan.com

（10）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

（11）上海浦东发展银行股份有限公司
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

（12）广州农村商业银行股份有限公司
注册地址：广州市天河区珠江新城华夏路1号
办公地址：广州市天河区珠江新城华夏路1号
法定代表人：王继康
客户服务电话：95313
公司网站：http://www.grcbank.com/index.html

（13）江苏银行股份有限公司
注册地址：南京市中华路26号
办公地址：南京市中华路26号
法定代表人：夏平
联系人：周妍
电话：025–58587039

●券商类销售机构

(1) 上海华信证券有限责任公司
注册地址：上海市浦东新区世纪大道100号环球金融中心9楼
办公地址：上海市黄浦区南京西路399号明天广场20楼
法定代表人：陈灿辉
客户服务热线：400–820–5999
传真：021–68776977–8427
公司网站：www.shhxzq.com

（2）兴业证券股份有限公司
注册地址：福州市湖东路268号
办公地址：福州市湖东路268号
法定代表人：杨华辉
客户服务电话：4008888123
传真：（021）38565785
网站：http://www.xyzq.com.cn

（3）中信证券股份有限公司
住所：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
客户服务电话：95548
公司网站：http://www.cs.ecitic.com

（4）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
联系电话：（010）66568430
客服电话：8008201968
公司网站：http://www.chinastock.com.cn

（5）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）82133302
客服电话：95536
公司网站：http://www.guosen.com.cn

（6）华泰证券股份有限公司
住所：江苏省南京市江东中路228号
法定代表人：周易
客户服务热线：4008888168
电话：（025）83290979
传真：（025）84579763
公司网站：http:// www.htsc.com.cn

（7）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

(8)平安证券股份有限公司
住所：深圳市福田中心区金田路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

（9）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

（10）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

（11）南京证券股份有限公司
住所：南京市江东中路389号
法定代表人：步国旬
网站：http://www.njzq.com.cn/
客户服务电话：400–828–5888

（12）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
网站：http://www.csc108.com
客户服务电话：95587

（13）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
网站：http://www.htsec.com
客户服务电话：95553或4008888001

（14）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
网站：http://www.xcsc.com
客户服务电话：95351；4008881551

（15）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
网站：http://www.cgws.com
客户服务电话：4006666888

（16）中信证券（山东）有限责任公司
住所：青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼第20层
法定代表人：姜晓林
客户服务热线：95548
传真：（0532） 85022605
公司网站：www.zxwt.com.cn

（17）海通证券股份有限公司
注册地址：上海市广东路689号
法定代表人：周杰
客户服务热线：95553
公司网站：http://www.htsec.com

（18）招商证券股份有限公司
注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦38–45层
法定代表人：霍达
客户服务热线：95565
公司网站：http://www.newone.com.cn

（19）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
客户服务热线：4008888999或95579
电话：（027）63219781
传真：（027）51062920
公司网站：http:// www.95579.com

（20）国泰君安证券股份有限公司
住所： 上海市浦东新区银城中路168号
法定代表人： 杨德红
客户服务热线：95521 / 4008888666
公司网站：http://www.gtja.com

（21）山西证券股份有限公司
注册地址：山西省太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼
办公地址：山西省太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼
法定代表人：侯巍
电话： 4006661618

●其他销售机构

(1)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
网址：http://www.fund123.cn

(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)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
客户服务电话：020–89629066
传真：020–89629011
公司网站：http://www.yingmi.cn

(4)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

(5)诺亚正行基金销售有限公司
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

(6)上海陆金所基金销售有限公司
注册地址：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路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：王之光
联系人：宁博宇
电话： 021–20665952
传真： 021–22066653
客户服务电话： 4008219031
公司网站：http://www.lufunds.com

(7)深圳众禄基金销售股份有限公司
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
客户服务电话：4006–788–887
传真：0755–82080798
网站：众禄基金网 http://www.zlfund.cn；
基金买卖网http:// www.jjmmw.com

(8)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/

（9）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
客户服务电话：4006236060

(10)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

（11）上海长量基金销售投资顾问有限公司
注册地址：上海市浦东新区高翔路526号2幢220室
办公地址：上海市浦东新区东方路1267号11层
法定代表人：张跃伟
客户服务热线： 400–820–2899
传真： 021–20691861
公司网站：http://www.erichfund.com

（12）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

（13）上海挖财金融信息服务有限公司
注册地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路799号5层01、02、03室
办公地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路799号5层01、02、03室
法定代表人：胡燕亮
客户服务热线：400–711–8718
传真：021–58300279
公司网站： http://www.wacai.com

（14）北京汇成基金销售有限公司
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
办公地址：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
客户服务热线：400–619–9059
传真： 021–20691861
公司网站：www.hcjijin.com

（15）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

（16）天相投资顾问有限公司
注册地址：北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701
办公地址：北京市西城区金融街5号新盛大厦B座4层
法定代表人：林义相
联系电话：（010）66045608
传真：（010）66045527
客服电话：（010）66045678
天相投顾网址： http://www.txsec.com

（17）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

（18）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

（19）上海基煜基金销售有限公司
住所：上海市昆明路518号北美广场A栋1002–1003室
法定代表人：王翔
客户服务热线：400–820–5369
公司网站：https://www.jiyufund.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销售本基金，并及时公告。各销售机构的具体名单见基金管理人届时发布的调整销售机构的相关公告。

（二）登记机构
名称：兴全基金管理有限公司
注册地址：上海市黄浦区金陵东路368号
办公地址：上海市浦东新区芳甸路1155号浦东嘉里城办公楼28–30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
名称：上海市通力律师事务所
住所：上海市银城中路68号时代金融中心19楼
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：安冬、陆奇
电话：021–31358666
传真：021–31358600
联系人：陆奇

（四）审计基金资产的会计师事务所
名称：毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）
住所：北京东城区东长安街1号东方广场毕马威大楼8层
办公地址：上海南京西路1266号恒隆广场50楼
法定代表人：邹俊
电话：010–8508 5000
传真：010–8508 5111
经办注册会计师：王国蓓、张楠
联系人：王国蓓

四、基金的名称

兴全恒益债券型证券投资基金

五、基金的类型

契约型开放式

六、基金的投资目标

在严格控制风险并保持基金资产流动性的前提下，追求基金资产的稳定增值。

七、基金的投资方向

本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括国债、央行票据、金融债、地方政府债、企业债、公司债、短期融资券、超短期融资券、中期票据、资产支持证券、次级债券、可转债（含可分离交易可转债）、非公开发行公司债（含中小企业私募债、证券公司短期公司债券）、政府支持机构债券、可交换债券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具等金融工具，国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板以及其他经中国证监会核准上市的股票）、权证、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须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。

基金的投资组合比例为：本基金投资于债券比例不低于基金资产的80%，每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%。

八、基金的投资策略及投资组合管理

一、投资策略

本基金在投资中主要基于对国家财政政策、货币政策的深入分析以及对宏观经济的动态跟踪，通过主动管理投资策略，在主要配置债券资产的前提下，适当配置权益类资产，达到增强收益的目的。

1、大类资产配置策略

本基金在基金合同约定的范围内实施稳健的整体资产配置，通过对国内外宏观经济状况、市场利率走势、市场资金供求情况，以及证券市场走势、信用风险情况、风险预算和有关法律法规等因素的综合分析，评估各类资产在长、中、短期收益率的变化情况，进而在固定收益类资产、权益类资产以及货币类资产之间进行动态配置，确定资产的最优配置比例和相应的风险水平

2、债券投资组合策略

债券投资主要采取利率策略、信用策略、收益率曲线策略以及杠杆策略，力求在控制各类风险的基础上获取稳定的收益。

（1）利率策略

利率策略主要是根据对宏观经济环境判断，预测市场利率水平变动趋势，以及收益率曲线变化趋势，从而确定组合的整体久期，有效控制基金资产风险。当预测利率上升时，适当缩短投资组合的目标久期，预测利率水平降低时，适当延长投资组合的目标久期。

（2）信用策略

信用策略主要是根据不同信用等级资产的相对价值，确定资产在不同债券类属之间的配置，并通过对债券的信用分析，确定信用债的投资策略。本基金将分别采用基于信用利差曲线变化策略和基于本身信用变化的策略。

1）基于信用利差曲线变化策略

信用利差曲线的变化受宏观经济周期及市场供求两方面的影响较大，因此本基金一方面通过分析经济周期及相关市场的变化，判断信用利差曲线的变化，另方面将分析债券市场的市场容量、市场形势预期、流动性等因素对信用利差曲线的影响，综合各种因素确定信用债券总的投资比例及分行业投资比例。

2）基于信用债信用变化策略

本基金主要依靠基金管理人内部信用评级系统分析信用债的信用水平变化、违约风险及理论信用利差等。本基金信用评级体系将通过定性与定量相结合，着力分析信用券的实际信用风险，并寻求足够的收益补偿。另外，评级体现将从动态的角度，分析发行人的资产负债状况、盈利能力、现金流、经营稳定性等关键因素，进而预测信用水平的变化趋势，决定投资策略的变化。

（3）收益率曲线策略

根据收益率曲线的形态特征进行利率期限结构管理，确定组合期限结构的分布方式，合理配置不同期限品种的配置比例。通过合理期限安排，在长期、中期和短期债券间进行动态调整，在保持组合一定流动性的同时，可以从长期、中期、短期债券的价格变化中获利。

（4）杠杆策略

杠杆放大操作即以组合现有债券为基础，利用回购等方式融入低成本资金，并购买具有较高收益的债券，以期获取超额收益的操作方式。本基金将对回购利率与债券收益率、存款利率等进行比较，判断是否存在利差套利空间，从而确定是否进行杠杆操作。进行杠杆放大策略时，基金管理人将严格控制信用风险及流动性风险。

3、可转换债券投资策略

由于可转债兼具债性和股性，其投资风险和收益介于股票和债券之间，可转债相对价值分析策略通过分析不同市场环境下其股性和债性的相对价值，把握可转债的价值走向，选择相应券种，从而获取较高投资收益。

本基金将选择公司基本面优良、具有较高上涨潜力的可转换债券进行投资，并采用期权定价模型等数量化估值工具评定其投资价值，以合理价格买入并持有。本基金持有的可转换债券可以转换为股票。

4、资产支持证券投资策略

对于包括资产抵押贷款支持证券（ABS）、住房抵押贷款支持证券（MBS）等在内的资产支持证券，本基金将综合考虑市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率等因素，研究资产支持证券的收益和风险匹配情况，在严格控制风险的基础上选择投资对象，追求稳定收益。

5、中小企业私募债投资策略

由于中小企业私募债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。

6、国债期货投资策略

国债期货作为利率衍生品的一种，有助于管理债券组合的久期、流动性和风险水平。基金管理人将按照相关法律法规的规定，以套期保值为目的，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析。基金管理人构建量化分析体系，对国债期货和现货基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控，在最大限度保证基金资产安全的基础上，力求实现基金资产的长期稳定增值。

7、股票投资策略

在严格控制风险、保持资产流动性的前提下，本基金将适度参与股票等权益类资产的投资，以增加基金收益。

本基金通过选择基本面良好、流动性高、风险低、具有中长期上涨潜力的股票进行分散化组合投资，控制流动性风险和非系统性风险，追求股票投资组合的长期稳定增值。

8、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。

二、投资限制

1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

（1）本基金投资于债券比例不低于基金资产的80%；
（2）每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券；
（3）本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的10%；
（4）本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的10%；
（5）本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的3%；
（6）本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的10%；
（7）本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的0.5%；
（8）本基金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%；
（9）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%；
（10）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%；
（11）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%；
（12）本基金应投资于信用级别评级为BBB以上(含BBB)的资产支持证券。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；
（13）基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；
（14） 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%；在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为1年，债券回购到期后不展期；
（15）本基金参与国债期货交易，还须遵守以下限制：
1）在任何交易日日终，持有的买入国债期货合约价值，不得超过基金资产净值的15%；
2）在任何交易日日终，持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的30%；
3）本基金所持有的债券（不含到期日在一年以内的政府债券）市值和买入、卖出国债期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于债券投资比例的有关约定；
4）本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的国债期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 30%；
（16）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%；
（17）基金资产总值不得超过基金资产净值的140%；
（18）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

除第（12）项外，因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在10个交易日内进行调整，但法律法规规定的特殊情形除外。

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有关约定。在上述期间内，本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门取消或调整上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或按调整后的规定执行，但须提前公告。

2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

（1）承销证券；
（2）违反规定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，但是中国证监会另有规定的除外；
（5）向其基金管理人、基金托管人出资；
（6）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；
（7）法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先的原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

法律、行政法规或监管部门取消或变更上述禁止性规定，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或按变更后的规定执行。

九、基金的业绩比较基准

本基金业绩比较基准：

中国债券总指数收益率×80%+沪深 300 指数收益率×20%。

中国债券总指数由中央国债登记结算有限责任公司于 2003 年1月1日编制发布，样本涵盖交易所、银行间市场记帐式国债（固定、浮动利率）、金融债。

沪深300指数是由中证指数有限公司编制发布、表征 A 股市场走势的权威指数。该指数是由上海和深圳证券市场中选取 300 只 A 股作为样本编制而成的成份股指数。本基金选择该指数来衡量 A 股股票投资部分的绩效。

本基金的业绩比较基准根据本基金投资风格和策略特点设置，能够准确反映产品的风险收益特征，便于基金管理人合理衡量比较本基金的业绩表现。

如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，基金管理人可以根据具体情况，依据维护基金份额持有人合法权益的原则，经与基金托管人协商一致且在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告，而无需召开基金份额持有人大会。

十、基金的风险收益特征

本基金为债券型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金，但低于混合型基金、股票型基金，属于较低风险/收益的产品。

十一、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恒益债券型证券投资基金2018年第2季度报告，所载数据截至2018年6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	201,812,881.25	7.94
	其中：股票	201,812,881.25	7.94
2	基金投资	–	–
3	固定收益投资	2,252,516,548.15	88.59
	其中：债券	2,252,516,548.15	88.59
	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	37,342,098.51	1.47
8	其他资产	51,049,325.79	2.01
9	合计	2,542,720,853.70	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	662,000.00	0.04
B	采矿业	2,778,000.00	0.15
C	制造业	86,973,455.37	4.71
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,476,157.78	0.08
E	建筑业	–	–
F	批发和零售业	2,040,000.00	0.11
G	交通运输、仓储和邮政业	–	–
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,505,322.30	0.08
J	金融业	100,662,945.80	5.45
K	房地产业	5,715,000.00	0.31
L	租赁和商务服务业	–	–
M	科学研究和技术服务业	–	–
N	水利、环境和公共设施管理业	–	–
O	居民服务、修理和其他服务业	–	–
P	教育	–	–
Q	卫生和社会工作	–	–
R	文化、体育和娱乐业	–	–
S	综合	–	–
	合计	201,812,881.25	10.93

（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

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	600195	中牧股份	1,580,000	30,731,000.00	1.66
2	601988	中国银行	7,000,000	25,270,000.00	1.37
3	601328	交通银行	4,280,000	24,567,200.00	1.33
4	601997	贵阳银行	1,558,000	19,256,880.00	1.04
5	002821	凯莱英	200,000	17,446,000.00	0.94
6	002228	合兴包装	3,432,494	15,274,598.30	0.83
7	601009	南京银行	1,400,000	10,822,000.00	0.59
8	000403	ST生化	282,431	8,464,457.07	0.46
9	600015	华夏银行	1,018,084	7,584,725.80	0.41
10	600873	梅花生物	1,750,000	7,315,000.00	0.40

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	19,974,000.00	1.08
2	央行票据	–	–
3	金融债券	80,046,000.00	4.33
	其中：政策性金融债	80,046,000.00	4.33
4	企业债券	943,295,909.20	51.07
5	企业短期融资券	311,968,000.00	16.89
6	中期票据	611,114,000.00	33.09
7	可转债（可交换债）	286,118,638.95	15.49
8	同业存单	–	–
9	其他	–	–
10	合计	2,252,516,548.15	121.96

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	112384	16歌尔01	1,000,000	98,800,000.00	5.35
2	136264	16隆基01	800,000	79,600,000.00	4.31
3	112472	16裕同01	795,000	77,281,950.00	4.18
4	180404	18农发04	600,000	60,180,000.00	3.26
5	1480408	14临沂科技债	700,000	58,870,000.00	3.19

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）其他资产构成

序号	名称	金额（人民币元）
1	存出保证金	49,263.96
2	应收证券清算款	1,019,680.51
3	应收股利	–
4	应收利息	49,936,680.88
5	应收申购款	43,700.44
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	51,049,325.79

（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	110041	蒙电转债	29,002,995.00	1.57
2	132004	15国盛EB	25,107,300.00	1.36
3	128032	双环转债	21,642,321.06	1.17
4	110033	国贸转债	15,114,518.70	0.82
5	123003	蓝思转债	13,883,260.86	0.75
6	113013	国君转债	10,131,000.00	0.55
7	132002	15天集EB	7,469,000.00	0.40
8	110034	九州转债	7,371,285.00	0.40
9	128024	宁行转债	7,226,981.85	0.39
10	128022	众信转债	6,766,047.26	0.37
11	128016	雨虹转债	6,380,361.92	0.35
12	128021	兄弟转债	6,128,556.54	0.33
13	128015	久其转债	5,556,844.80	0.30
14	113009	广汽转债	5,181,409.00	0.28
15	127004	模塑转债	5,128,421.58	0.28
16	123006	东财转债	4,811,281.08	0.26
17	128019	久立转2	3,476,614.35	0.19
18	110040	生益转债	3,092,333.60	0.17
19	128023	亚太转债	2,891,975.10	0.16
20	113016	小康转债	2,281,000.00	0.12
21	132008	17山高EB	2,110,434.00	0.11
22	128028	赣锋转债	2,074,201.50	0.11
23	123004	铁汉转债	1,336,029.15	0.07
24	113008	电气转债	1,002,800.00	0.05
25	128020	水晶转债	778,428.75	0.04
26	113015	隆基转债	722,992.00	0.04
27	132005	15国资EB	52,651.20	0.00
28	128030	天康转债	9,033.75	0.00

（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	002228	合兴包装	15,274,598.30	0.83	非公开发行流通受限

（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。

十二、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2017年9月20日，基金业绩截止日2018年6月30日。

兴全恒益债券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
2018年2季度	–0.93%	0.18%	–0.63%	0.25%	–0.30%	–0.07%
2018年上半年度	0.89%	0.16%	–0.27%	0.23%	1.16%	–0.07%
2017年度	0.23%	0.04%	–0.02%	0.16%	0.25%	–0.12%
自基金合同成立起至2018年6月30日	1.12%	0.13%	–0.28%	0.21%	1.40%	–0.08%

兴全恒益债券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
2018年2季度	–1.05%	0.18%	–0.63%	0.25%	–0.42%	–0.07%
2018年上半年度	0.67%	0.16%	–0.27%	0.23%	0.94%	–0.07%
2017年度	0.11%	0.04%	–0.02%	0.16%	0.13%	–0.12%
自基金合同成立起至2018年6月30日	0.78%	0.13%	–0.28%	0.21%	1.06%	–0.08%

注：2017年度数据统计期间为2017年9月20日（基金合同成立之日）至2017年12月31日，不满一年。

十三、基金的费用与税收

（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、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、诉讼费和仲裁费；
6、基金份额持有人大会费用；
7、基金的证券、期货交易费用；
8、基金的银行汇划费用；
9、基金的账户开户费用、账户维护费用；
10、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。

（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0.70%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H＝E×0.70%÷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。由基金管理人与基金托管人核对一致后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月首日起5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、公休假或不可抗力等，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0.20%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

H＝E× 0.20%÷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。由基金管理人与基金托管人核对一致后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假或不可抗力等，支付日期顺延。

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×0.40%÷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

基金销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人与基金托管人核对一致后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性划出，由登记机构代收，登记机构收到后按相关合同规定支付给基金销售机构。若遇法定节假日、公休假或不可抗力等，支付日期顺延。

上述"（一）基金费用的种类"中第4－10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；
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）基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

十四、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2018年5月4日刊登《兴全恒益债券型证券投资基金更新招募说明书》进行了更新，主要更新内容如下：

一、"重要提示"部分

增加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、"三、基金管理人"部分

更新了基金管理人概况、主要人员情况。

三、"四、基金托管人"部分

更新了基金托管人概况、托管业务经营情况。

四、"五、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、"九、基金的投资"部分

新增了"八、基金投资组合报告"部分，数据内容取自本基金2018年第2季度报告，数据截止日为2018年6月30日，所列财务数据未经审计。

六、"十、基金的业绩"部分

新增了此部分内容，数据截止日为2018年6月30日。

七、"二十一二、其他应披露事项"部分

以下为自2018年3月20日至2018年9月19日，本基金刊登于《中国证券报》、《上海证券报》和公司网站的基金公告。

序号	事项名称	披露日期
1	关于解聘副总经理的公告	2018–03–21
2	关于修改旗下部分基金基金合同、托管协议的公告	2018–03–23
3	关于旗下部分基金将收取短期赎回费的提示性公告	2018–03–23
4	关于继续参加工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	2018–03–28
5	关于旗下基金参加交通银行手机银行申购及定期定额投资优惠费率的公告	2018–03–30
6	关于调整部分旗下基金在银河证券费率优惠活动的公告	2018–04–13
7	关于旗下基金所持证券（中兴通讯）调整估值价的公告	2018–04–19
8	关于增聘副总经理的公告	2018–05–11
9	关于网上直销开通"汇收付"业务的公告	2018–05–16
10	关于调整旗下基金在国泰君安证券费率优惠活动的公告	2018–05–28
11	关于高级管理人员变更的公告	2018–06–13
12	关于旗下基金所持证券（中兴通讯）调整估值价的公告	2018–06–14
13	关于长期停牌股票（康得新）估值方法调整的公告	2018–06–20
14	关于长期停牌股票（天齐锂业）估值方法调整的公告	2018–06–21
15	关于调整网上直销基金转换、赎回转购优惠费率的公告	2018–06–23
16	关于旗下基金参加交通银行手机银行渠道基金申购及定期定额投资申购费率优惠和暂停网上银行申购费率优惠活动的公告	2018–06–30
17	旗下各基金2018年6月30日资产净值公告	2018–07–02
18	关于调整部分旗下基金在招商证券费率优惠活动的公告	2018–07–13
19	关于调整部分旗下基金在工商银行费率优惠活动的公告	2018–07–19
20	关于长期停牌股票（隆平高科）估值方法调整的公告	2018–08–18
21	关于增加江苏银行股份有限公司为旗下基金销售机构的公告	2018–09–05

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
2018年11月3日