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

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
二〇一八年十二月

【重要提示】

兴全绿色投资混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)于2011年2月16日经中国证监会证监基金字[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,自该日起兴全基金管理有限公司(以下简称“本基金管理人”)正式开始管理本基金。

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

投资有风险,投资者认购(或申购)基金时应认真阅读本招募说明书,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2018年11月5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3季度报告,数据截止日为2018年9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。

第一部分 基金管理人

一、基金管理人概况
机构名称:兴全基金管理有限公司
成立日期:2003年9月30日
住所:上海市黄浦区金陵东路368号
办公地址:上海市浦东新区芳甸路1155号浦东嘉里城办公楼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11月5日,公司旗下管理着兴全可转债混合型证券投资基金、兴全趋势投资混合型证券投资基金(LOF)、兴全货币市场证券投资基金、兴全全球视野股票型证券投资基金、兴全社会责任混合型证券投资基金、兴全有机增长灵活配置混合型证券投资基金、兴全磐稳增利债券型证券投资基金、兴全合润分级混合型证券投资基金、兴全沪深300指数增强型证券投资基金(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、监事概况

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,兴业创新资本管理有限公司董事、兴证国际金融集团有限公司董事、兴证投资管理有限公司执行董事,兴全基金管理有限公司董事长及法定代表人。现任兴全基金管理有限公司董事、总经理。

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、兴业证券上海自营分公司总经理,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。

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。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,兼任英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副教授。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。

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。

陈有能女士,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人寿保险财务计划担当助理副总裁。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。

2、高级管理人员概况
兰荣先生,董事长、法定代表人。(简历请参见上述董事、监事概况)
庄园芳女士,董事、总经理。(简历请参见上述董事、监事概况)

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副总经理,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、兴全趋势投资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、兴证国际金融集团有限公司非执行董事。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。历任兴业证券股份有限公司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、兴业证券上海分公司副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、电子商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,平安资产管理公司投资管理部副总经理,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。

3、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,兴全基金管理有限公司研究员、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。现任兴全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。

4、投资决策委员会成员
本基金采用投资决策委员会领导下的基金经理负责制。公募投资决策委员会成员由以下成员组成:
庄园芳　　兴全基金管理有限公司董事、总经理
董承非　　兴全基金管理有限公司副总经理兼兴全趋势投资混合型证券投资基金(LOF)基金经理、兴全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　　兴全基金管理有限公司基金管理部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、编制半年度和年度基金报告;
7、按照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;
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,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控制制度的情况;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(简称“中国工商银行”)
注册地址:北京市西城区复兴门内大街55号
成立时间:1984年1月1日
法定代表人:易会满
注册资本:人民币35,640,625.71万元
联系电话:(010)66105799
联系人:郭明

二、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。

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2018年6月,中国工商银行共托管证券投资基金815只。自2003 年以来,本行连续十四年获得香港《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54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督机构,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。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。
(一)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。
(二)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。
(三)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。
(四)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。
(五)资产托管部内部风险控制情况
1、资产托管部内部设置专职稽核监察部门,配备专职稽核监察人员,在总经理的直接领导下,依照有关法律规章,全面贯彻落实全程监控思想,确保资产托管业务健康、稳定地发展。
2、完善组织结构,实施全员风险管理。完善的风险管理体系需要从上至下每个员工的共同参与,只有这样,风险控制制度和措施才会全面、有效。资产托管部实施全员风险管理,将风险控制责任落实到具体业务部门和业务岗位,每位员工对自己岗位职责范围内的风险负责,通过建立纵向双人制,横向多部门制的内部组织结构,形成不同部门、不同岗位相互制衡的组织结构。
3、建立健全规章制度。资产托管部十分重视内控制度的建设,一贯坚持把风险防范和控制的理念和方法融入岗位职责、制度建设和工作流程中。经过多年努力,资产托管部已经建立了一整套内部风险控制制度,包括:岗位职责、业务操作流程、稽核监察制度、信息披露制度等,覆盖所有部门和岗位,渗透各项业务环节,形成各个部门、不同岗位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日后六个月开始。
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,并以书面形式向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。

第三部分 相关服务机构

一、基金份额发售机构
1、直销机构
●兴全基金管理有限公司直销中心
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
●兴全基金管理有限公司网上直销平台(含微网站、APP)(目前已开通工商银行直连、农业银行直连、建设银行直连、招商银行直连、银联通(工商银行、农业银行、建设银行、交通银行、民生银行、平安银行、邮储银行、兴业银行、光大银行、中信银行、浦发银行、南京银行、金华银行、济南银行、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(兴业银行、华夏银行)以及网上直销汇款交易)(排名不分先后)
交易网站:https://trade.xqfunds.com,c.xqfunds.com
客服电话:400-678-0099;(021)38824536
●直销前置自助式平台
交易网址:https://www.yypt.com
https://i.yypt.com/finance/org/home/homePage.do
2、代销机构
●银行类销售机构
(1) 中国工商银行股份有限公司
住所:中国北京复兴门内大街55号
办公地址:中国北京复兴门内大街55号
法定代表人:易会满
客户服务电话:95588
传真:(010)66107914
公司网站:http://www.icbc.com.cn
(2) 兴业银行股份有限公司
住所:福州市湖东路154号
法定代表人:高建平
电话:(021)52629999
客户服务热线:95561
公司网站:http://www.cib.com.cn
(3) 中国农业银行股份有限公司
住所:北京市东城区建国门内大街69号
法定代表人:周慕冰
客服电话:95599
传真:(010)85109219
公司网站:http://www.abchina.com
(4) 招商银行股份有限公司
办公地址:深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦
法定代表人:李建红
电话:(0755)82943666
传真:(0755)83195109
客户服务电话:95555
公司网站:http://www.cmbchina.com
(5) 中国邮政储蓄银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区金融大街3号
办公地址:北京市西城区金融大街3号
法定代表人:李国华
客户服务电话:95580
传真:(010)68858117
公司网站:http://www.psbc.com
(6) 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
电话:(021)58781234
传真:(021)58408483
客户服务电话:95559
公司网站:http:// www.bankcomm.com
(7) 中信银行股份有限公司
住所:北京市东城区朝阳门北大街9号
法定代表人:李庆萍
电话:(010)65557013
传真:(010)65550827
客户服务电话:95558
公司网站:http://bank.ecitic.com
(8) 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
法定代表人:洪崎
电话:(010)57092615
传真:(010)57092611
客户服务电话:95568
公司网站:http://www.cmbc.com.cn
(9)中国光大银行股份有限公司
住所(办公地址):北京市西城区复兴门外大街6号光大大厦
法定代表人:李晓鹏
客户服务电话:95595
传真:(010)68560311
公司网站:http://www.cebbank.com
(10) 宁波银行股份有限公司
住所:宁波市鄞州区宁南南路700号
法定代表人:陆华裕
客户服务电话:96528(北京、上海地区962528)
传真: (0574)87050024
公司网站:http://www.nbcb.com.cn
(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) 平安银行股份有限公司
住所(办公地址):深圳市深南东路5047号深圳发展银行大厦
法定代表人:谢永林
客户服务电话:95511-3
公司网站:http://www.bank.pingan.com
(13) 华夏银行股份有限公司
住所(办公地址):北京市东城区建国门内大街22号华夏银行大厦
法定代表人:李民吉
客户服务电话:95577
公司网站:http://www.hxb.com.cn
(14) 上海银行股份有限公司
住所:上海市银城中路168号
法定代表人:金煜
客户服务电话:(021)962888
公司网站:http:// www.bankofshanghai.com
(15) 重庆银行股份有限公司
住所:重庆市渝中区邹容路153号
法定代表人:林军
客户服务电话:96899(重庆地区)、400-709-6899(其他地区)
公司网站:http://www.cqcbank.com
(16) 中国建设银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区金融大街25号
法定代表人: 田国立
电话:(010)67596084
客户服务电话:95533
公司网站:http://www.ccb.com
(17) 东莞农村商业银行股份有限公司
住所:东莞市东城区鸿福东路2号东莞农商银行大厦
法定代表人:王耀球
客户服务电话:961122
公司网站:http://www.drcbank.com
(18) 江苏江南农村商业银行股份有限公司
住所:常州市和平中路413号
法定代表人:陆向阳
客户服务电话:96005
公司网站:http://www.jnbank.cn
(19)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)兴业证券股份有限公司
住所:福州市湖东路268号
法定代表人:杨华辉
客户服务热线:4008888123
传真:(021)38565785
公司网站:http:// www.xyzq.com.cn
(2)国泰君安证券股份有限公司
住所:中国(上海)自由贸易试验区商城路618号
法定代表人:杨德红
传真:(021)38670161
客户服务热线:4008888666
公司网站:http://www.gtja.com.cn
(3)中信建投证券股份有限公司
住所:北京市朝阳区安立路66号4号楼
法定代表人:王常青
开放式基金咨询电话:4008888108
开放式基金业务传真:(010)85130577
公司网站:http://www.csc108.com
(4)华泰证券股份有限公司
办公地址:江苏省南京市江东中路228号华泰证券大厦
法定代表人:周易
电话:(025)83290979
客户咨询电话:4008888168
公司网站:http://www.htsc.com.cn
(5)长江证券股份有限公司
住所:武汉市新华路特8号长江证券大厦
法定代表人:尤习贵
电话:(027)65799999
传真:(027)85481900
客户服务热线:4008-888-999或95579
公司网站:http:// www.cjsc.com.cn
(6)海通证券股份有限公司
住所: 上海市广东路689号
法定代表人:周杰
办公电话:(021)23219000
客服电话:400-8888-001、021-962503或拨打各城市营业网点咨询电话
公司网站:http://www.htsec.com
(7)招商证券股份有限公司
住所:深圳市福田区益田路江苏大厦A座38—45层
法定代表人: 霍达
电话:(0755)82960223
传真:(0755)82943636
客户服务热线:95565、4008888111
公司网站:http://www.newone.com.cn
(8)中国银河证券股份有限公司
住所:北京市西城区金融大街35号2-6层
法定代表人:陈共炎
传真:(010)83574087
客服电话:4008888888
公司网站:http://www.chinastock.com.cn
(9)广发证券股份有限公司
住所:广州市天河区天河北路183-187号大都会广场43楼
法定代表人:孙树明
开放式基金咨询电话:95575转各营业网点
开放式基金业务传真:(020)87555305
公司网站:http://www.gf.com.cn
(10)山西证券股份有限公司
办公(注册)地址:山西省太原市府西街69号山西国贸中心东塔楼
法定代表人:侯巍
联系电话:0351-8686619
客服电话:95573
传真:(0351)8686619
公司网站:http://www.sxzq.net
(11)东方证券股份有限公司
住所:上海市中山南路318号2号楼22层、23层、25-29层
法定代表人:潘鑫军
电话:(021)63325888
传真:(021)63326173
客服热线:(021)962506或40088-88506
公司网站:http://www.dfzq.com.cn
(12)德邦证券股份有限公司
办公地址:上海市浦东新区福山路500号“城建国际中心”26楼
法定代表人: 武晓春
联系电话:(021)68761616
传真电话:(021)68767981
客服电话:4008888128
公司网站:http://www.tebon.com.cn
(13)中银国际证券股份有限公司
住所:上海市浦东新区银城中路200号中银大厦39层
法定代表人:宁敏
开放式基金咨询电话:4006208888或各地营业网点咨询电话
开放式基金业务传真:(021)50372474
公司网站:http://www.bocichina.com.cn
(14)光大证券股份有限公司
住所: 上海市静安区新闸路1508号
法定代表人:周健男
联系电话:(021)22169081
传真:(021)22169134
客服热线:4008888788
公司网站:http://www.ebscn.com
(15)国元证券股份有限公司
住所:合肥市梅山路18号
法定代表人:蔡咏
客户服务电话:4008888777
传真电话:(0551)2207114
公司网站:http://www.gyzq.com.cn
(16)湘财证券股份有限公司
住所:长沙市天心区湘府中路198号新南城商务中心A栋11楼
法定代表人:孙永祥
电话:(021)68634518
传真:(021)68865680
客服电话:400-888-1551
公司网站:http://www.xcsc.com
(17)申万宏源证券有限公司
住所(办公地址):上海市徐汇区长乐路989号45层
法定代表人:李梅
电话:(021)33389888
传真:(021)33388224
客服电话:95523或4008895523
公司网站:http://www.swhysc.com
(18)中航证券有限公司
住所:南昌市红谷中大道1619号南昌国际金融大厦A栋41层
法定代表人:王晓峰
联系电话:(0791)6768763
传真电话:(0755)6789414
客服电话:400-8866-567
公司网站:http:// www.scstock.com
(19)渤海证券股份有限公司
住所:天津经济技术开发区第二大街42号写字楼101室
法定代表人:王春峰
联系人:王兆权
联系电话:(022)28451861
传真:(022)28451892
客服电话:4006515988
公司网站:http:// www.ewww.com.cn
(20)瑞银证券有限责任公司
住所:北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心12层、15层
法定代表人:钱于军
联系电话:(010)5832 8752
传真:(010)5922 8748
客服电话:400-887-8827
公司网站:http://www.ubssecurities.com
(21)华福证券有限责任公司
住所:福州市五四路157号新天地大厦7、8层
办公地址:福州市五四路157号新天地大厦7至10层
法定代表人:黄金琳
联系电话:(0591)87383623
统一客户服务电话:96326(福建省外请先拨0591)
传真:(0591)87383610
公司网站:http://www.hfzq.com.cn
(22)中泰证券股份有限公司
住所:山东省济南市经七路86号
法定代表人:李玮
传真:(0531)81283900
公司网站:http://www.zts.com.cn
(23)爱建证券有限责任公司
住所:上海市世纪大道1600号32楼
法定代表人:祝健
联系电话:(021)32229888
客服电话:(021)63340678
公司网站:http://www.ajzq.com
(24)安信证券股份有限公司
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
办公地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层
法定代表人:王连志
联系电话:(0755)82825551
传真:(0755)82558355
客服电话:4008001001
公司网站:http://www.essence.com.cn
(25)华融证券股份有限公司
住所:北京市西城区金融大街8号
法定代表人:祝献忠
联系电话:(010)58568007
传真:(010)58568062
客服电话:(010)58568162
公司网站:http://www.hrsec.com.cn
(26)国信证券股份有限公司
住所:深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层
法定代表人:何如
联系电话:(0755)82130833
传真:(0755)82133952
客服电话:95536
公司网站:http://www.guosen.com.cn
(27)东莞证券股份有限公司
住所:广东省东莞市莞城区可园南路一号
法定代表人:张运勇
联系电话:(0769)22119341
传真:(0769)22116999
客服电话:(0769)961130
公司网站:http://www.dgzq.com.cn
(28)东海证券股份有限公司
住所:江苏省常州市延陵西路23号投资广场18楼
法定代表人:赵俊
联系电话:(0519)88157761
传真:(0519)88157761
客服电话:(0519)88166222 、(021)52574550、(0379)64902266
公司网站:http://www.longone.com.cn
(29)九州证券股份有限公司
住所:青海省西宁市南川工业区创业路108号
法定代表人:魏先锋
客户服务电话:95305
公司网站:http://www.jzsec.com
(30)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
联系电话:(010)84683893
传真:(010)84685560
客服电话:95558
公司网站: http://www.cs.ecitic.com
(31)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2001
法定代表人:姜晓林
客户服务热线:95548
传真:(0532) 85022605
公司网站:http://www.zxwt.com.cn
(32)信达证券股份有限公司
住所:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
法定代表人:张志刚
客户服务电话:400-800-8899
基金业务传真:010-63080978
公司网站:http://www.cindasc.com
(33)华鑫证券有限责任公司
住所:深圳市福田区金田路4018号安联大厦28层A01、B01(b) 单元
法定代表人:俞洋
客户服务电话:400-109-9918
基金业务传真:021-64333051
公司网站:http:// www.cfsc.com.cn
(34)国都证券股份有限公司
地址:北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层
法定代表人:王少华
客户服务电话: 4008188118
基金业务传真:010-84183311
公司网站:http://www.guodu.com
(35)联讯证券股份有限公司
住所:广东省惠州市惠城区江北东江三路55号
法定代表人:徐刚
客户服务电话:95564
基金业务传真:010-64408834
公司网站: http://www.lxzq.com.cn
(36)广州证券股份有限公司
住所:广州市天河区珠江西路5号广州国际金融中心主塔19楼、20楼
法定代表人:邱三发
客户服务电话:020-961303
基金业务传真:020-88836654
公司网站:http://www.gzs.com.cn
(37)平安证券股份有限公司
住所:深圳市福田中心区金田路4036号荣超大厦16-20层
法定代表人:何之江
网站:http://stock.pingan.com
客户服务电话:4006-788-887
(38)华西证券股份有限公司
住所:四川省成都市高新区天府二街198号华西证券大厦
法定代表人:杨炯洋
网站:http://www.hx168.com.cn
客户服务电话:95584
(39)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14、16、17层
法定代表人:丁益
网站:http://www.cgws.com
客户服务电话:400-666-6888
(40)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
(41)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:95386
(42)中国中投证券有限责任公司
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
法定代表人:高涛
网站:http://www.china-invs.cn
客服电话:95532
●其他销售机构
(1)天相投资顾问有限公司
住所:北京市西城区金融街19号富凯大厦B座
法定代表人:林义相
联系电话:(010)66045522
传真:(010)66045500
客服电话:(010)66045678
公司网站:http://www.txsec.com
(2)上海天天基金销售有限公司
住所:上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层
法定代表人:其实
客户服务电话: 400-1818-188
基金业务传真:021-64385308
公司网站:http://www.1234567.com.cn
(3)和讯信息科技有限公司
住所:北京市朝阳区朝外大街22号1002室
法定代表人:王莉
客户服务电话: 4009200022
基金业务传真:(021)20835879
公司网站:http://licaike.hexun.com
(4)上海好买基金销售有限公司
注册地址:上海市虹口区场中路685弄37号4号楼449室
办公地址:上海市浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦903~906室
法定代表人:杨文斌
客服电话:400-700-9665
传真:(021)68596916
网站: http://www.ehowbuy.com
(5)蚂蚁(杭州)基金销售有限公司
注册地址:浙江省杭州市余杭区五常街道文一西路969号3幢5层599室
法定代表人:陈柏青
客户服务电话:4000-766-123
网址:http://www.fund123.cn
(6)浙江同花顺基金销售有限公司
住所:浙江省杭州市文二西路1号元茂大厦903
法定代表人:凌顺平
客户服务热线:4008-773-772
传真:0571-86800423
公司网站:http://www.5ifund.com
(7)珠海盈米基金销售有限公司
住所:珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491
法定代表人:肖雯
客户服务热线:020-89629066
传真:020-89629011
公司网站:http://www.yingmi.cn
(8)上海陆金所基金销售有限公司
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
传 真:021-22066653
客户服务电话: 4008219031
网址:http://www.lufunds.com
(9)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
(10)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
(11)上海大智慧财富管理有限公司
住所:中国(上海)自由贸易试验区杨高南路428号1号楼1102单元
法定代表人:申健
网站:https://8.gw.com.cn/
客户服务电话:021-20219931
(12)中信期货有限公司
住所:北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦18层
法定代表人:张皓
网站:http://www.citicsf.com/
客户服务电话:400-9908-826
(13)厦门市鑫鼎盛控股有限公司
办公地址: 厦门市思明区鹭江道2号厦门第一广场西座1501-1504室
法定代表人: 陈洪生
网站:http://www.xds.com.cn/
客户服务电话:400-918-0808
(14)北京蛋卷基金销售有限公司
住所:北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507
法定代表人:钟斐斐
客户服务电话:4000618518
传真:010-61840699
网站:https://danjuanapp.com/
(15)北京广源达信基金销售有限公司
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
(16)北京增财基金销售有限公司
住所:北京市西城区南礼士路66号建威大厦1208室
法定代表人:罗细安
客户服务电话:010-67000988-6025
传真:010-67000988
网站:http://www.zcvc.com.cn/
(17)上海基煜基金销售有限公司
住所:上海市崇明县长兴镇路潘园公路1800号2号楼6153室(上海泰和经济发展区)
法定代表人:王翔
客户服务电话:021-65370077
传真:021-55085991
(18)北京肯特瑞基金销售有限公司
注册地址:北京市海淀区中关村东路66号1号楼22层2603-06
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:江卉
客户服务热线:400 098 8511
传真:89188000
公司网站:http://kenterui.jd.com
(19)北京汇成基金销售有限公司
住所:北京市海淀区中关村大街E世界财富中心A座1108号
法定代表人:王伟刚
网站:www.hcjijin.com
客户服务电话:400-619-9059
(20)上海挖财基金销售有限公司
住所: 中国(上海)自由贸易试验区杨高南路799号5楼01、02、03室
法定代表人:胡燕亮
网站:http://www.wacaijijin.com
客户服务电话:021-50810673
(21)上海长量基金销售投资顾问有限公司
住所:上海市浦东新区高翔路526号2幢220室
法定代表人:张跃伟
网站:http://www.erichfund.com
客户服务电话:4008202899
(22)中证金牛(北京)投资咨询有限公司
注册地址:北京市丰台区东管头1号2号楼2-45室
办公地址:北京市西城区宣武门外大街甲1号环球财讯中心A座5层
法定代表人:钱昊旻
联系人:沈晨
电话:010-59336544
基金管理人可根据有关法律、法规的要求,选择其他符合要求的机构代理销售本基金,并及时公告。
二、注册登记机构
名称:中国证券登记结算有限责任公司
住所:北京市西城区太平桥大街17号
法定代表人:周明
办公地址:北京市西城区太平桥大街17号
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

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

一、投资理念
本基金认为投资于绿色科技产业或公司在获得良好回报的同时,亦能维护或改善地球生态环境,推动整个社会的可持续发展。在投资决策中,本基金除关注那些绿色科技产业或公司,还关注在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。
二、投资范围
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面因子相结合,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格是否被低估。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(CFFO/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;而在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的。
二、投资限制
(一)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。
(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%;
l、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。

第九部分 基金的业绩比较基准

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2018年第3季度报告,所载数据截至2018年9月30日,本报告中所列财务数据未经审计。

1、报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	346,764,173.18	80.20
	其中:股票	346,764,173.18	80.20
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	39,196,049.60	9.07
	其中:债券	39,196,049.60	9.07
	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	45,117,884.14	10.44
8	其他各项资产	1,271,465.55	0.29
9	合计	432,349,572.47	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	16,991,921.36	4.16
B	采矿业	8,559,664.00	2.10
C	制造业	171,637,770.89	42.07
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	16,226,373.61	3.98
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	8,739,310.20	2.14
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	24,498,056.90	6.00
J	金融业	84,648,035.18	20.75
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	15,463,041.04	3.79
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	346,764,173.18	84.99

(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	601318	中国平安	548,147	37,548,069.50	9.20
2	603960	克来机电	1,325,916	37,165,425.48	9.11
3	601601	中国太保	849,384	30,161,625.84	7.39
4	601012	隆基股份	1,984,228	28,176,037.60	6.91
5	000661	长春高新	108,879	25,804,323.00	6.32
6	002299	圣农发展	1,038,626	16,991,921.36	4.16
7	600984	建设机械	3,049,465	16,772,057.50	4.11
8	600406	国电南瑞	947,600	16,725,140.00	4.10
9	300012	华测检测	2,647,781	15,463,041.04	3.79
10	000400	许继电气	1,127,822	10,409,797.06	2.55

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	30,147,000.00	7.39
	其中:政策性金融债	30,147,000.00	7.39
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)	9,049,049.60	2.22
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	39,196,049.60	9.61

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	180404	18农发04	300,000	30,147,000.00	7.39
2	132015	18中油EB	60,660	6,075,705.60	1.49
3	132009	17中油EB	23,000	2,380,500.00	0.58
4	127005	长证转债	6,200	592,844.00	0.15

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	444,985.69
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	757,658.57
5	应收申购款	68,821.29
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,271,465.55

(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	132009	17中油EB	2,380,500.00	0.58
2	127005	长证转债	592,844.00	0.15

(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2011年5月6日,基金业绩截止日2018年9月30日。

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2018年第3季度	-6.28%	1.40%	-1.48%	1.08%	-4.80%	0.32%
2018年上半年度	-12.38%	1.31%	-9.52%	0.92%	-2.86%	0.39%
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2018年9月30日	88.11%	1.52%	17.89%	1.17%	72.21%	0.35%

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:
$H = E \times 1.5\% \div$ 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:
$H = E \times 0.25\% \div$ 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体上公告。
五、基金税收
本基金运作过程中涉及的各纳税主体,其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

第十四部分 对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书根据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称《基金法》)、《证券投资基金运作管理办法》(以下简称《运作办法》)、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称《销售办法》)、《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称《信息披露办法》)及其他有关规定,并依据本基金管理人在本基金合同生效后对本基金实施的投资经营活动,对本基金管理人于2018年6月20日刊登的《兴全绿色投资混合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
更新了本招募说明书所载内容截止日及有关财务数据和净值表现截止日。
二、“第三部分 基金管理人”
更新了基金管理人概况、主要人员情况。
三、“第五部分 相关服务机构”
更新了个别销售机构情况;新增销售机构2家。
四、“第十二部分 基金的投资”
更新了“基金投资组合报告”部分,数据内容截止日为2018年9月30日,所列财务数据未经审计。
五、“第十三部分 基金的业绩”
更新了基金投资业绩,数据内容截止日为2018年9月30日。
六、“第二十五部分 其他应披露事项”部分
以下为自2018年5月6日至2018年11月5日,本基金刊登于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站的基金公告。

序号	事项名称	披露日期
1	兴全基金管理有限公司关于增聘副总经理的公告	2018-05-11
2	关于网上直销开通“汇收付”业务的公告	2018-05-16
3	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
4	关于高级管理人员变更的公告	2018-06-13
5	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
6	关于长期停牌股票(康得新)估值方法调整的公告	2018-06-20
7	关于长期停牌股票(天齐锂业)估值方法调整的公告	2018-06-21
8	关于调整网上直销部分基金转换赎回转购优惠费率的公告	2018-06-23
9	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
10	兴全基金管理有限公司旗下各基金2018年6月30日资产净值的公告	2018-07-02
11	关于调整旗下部分基金在招商证券费率优惠活动的公告	2018-07-13
12	关于调整旗下部分基金在中国工商银行费率优惠活动的公告	2018-07-23
13	关于长期停牌股票(隆平高科)估值方法调整的公告	2018-08-18
14	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
15	关于旗下基金在九州证券开通定投业务及参加申购费率优惠活动的公告	2018-09-17
16	关于调整网上直销部分基金转换、赎回转购优惠费率的公告	2018-09-20
17	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活动的公告	2018-09-29
18	关于长期停牌股票(奥马电器)估值方法调整的公告	2018-10-20
19	关于增加中证金牛(北京)投资咨询有限公司为旗下基金销售机构的公告	2018-10-29

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12月20日