

# 财通基金管理有限公司

## 财通科创主题 3 年封闭运作灵活配置混 合型证券投资基金 基金份额上市交易公告书

基金管理人：财通基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

注册登记机构：中国证券登记结算有限责任公司

上市地点：上海证券交易所

上市时间：2020 年 2 月 7 日

公告日期：2020 年 2 月 4 日

---

---

## 目 录

一、重要声明与提示.....	1
二、基金概览.....	3
三、基金的募集与上市交易.....	5
四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人.....	9
五、基金主要当事人简介.....	11
六、基金合同摘要.....	19
七、基金财务状况.....	20
八、基金投资组合.....	22
九、重大事件揭示.....	26
十、基金管理人承诺.....	27
十一、基金托管人承诺.....	28
十二、基金上市推荐人意见.....	29
十三、备查文件.....	30
附件：财通科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金基金合同内容摘要.....	31

## 一、重要声明与提示

《财通科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金基金份额上市交易公告书》（以下简称“本公告书”）依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第 1 号〈上市交易公告书的内容与格式〉》和《上海证券交易所证券投资基金上市交易规则》的规定编制，财通科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）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、误导性陈述或者重大遗漏，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。

本基金托管人中国工商银行股份有限公司保证本公告书中基金财务会计资料等内容的真实性、准确性和完整性，承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）和上海证券交易所对本基金上市交易及有关事项的意见，均不表明对本基金的任何保证。

凡本公告书未涉及的有关内容，请投资者详细查阅 2019 年 11 月 1 日登载于上海证券交易所网站和财通基金管理有限公司网站（[www.ctfund.com](http://www.ctfund.com)）的《财通科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书》（以下简称“招募说明书”）。

投资人在投资本基金前，应全面了解本基金的产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，并承担基金投资中出现的各类风险，包括市场风险、管理风险、估值风险、流动性风险、本基金的特定风险和其他风险等。本基金可以投资科创板股票，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风险，包括流动性风险、退市风险和投资集中风险等。本基金封闭运作期内可以参与科创板发行人战略配售股票投资，由此产生的投资风险与价格波动由投资者自行承担。本基金的特定风险详见招募说明书“风险揭示”章节等。

本基金基金合同生效后进入三年的封闭运作期，封闭运作期间投资者不能申购、赎回基金份额。

投资有风险，投资者认购或申购本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，充分考虑投资者自身的风险承受能力，并对于认购（或申购）基金的意愿、时机、数量等投资行为做出独立决策。

---

---

基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，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对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，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。

本基金上市交易后，基金交易价格受供求关系影响，与基金净值之间可能存在折溢价，敬请投资者关注。

## 二、基金概览

- 1、基金名称：财通科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金
- 2、基金类型：混合型
- 3、基金运作方式：契约型。

本基金合同生效后的前三年为封闭运作期，封闭运作期自基金合同生效日起至三年后的年度对日的前一日止。在封闭运作期内，本基金不办理申购、赎回业务。

封闭运作期内基金上市交易后，投资者可将在其持有的场外基金份额通过办理跨系统转托管业务转至场内后上市交易。封闭运作期届满后，即本基金基金合同生效日起满三年的对日起，本基金转为上市开放式基金（LOF），基金名称调整为“财通科创主题灵活配置混合型证券投资基金（LOF）”，并接受场外、场内申购赎回。

- 4、基金存续期限：不定期

5、基金份额的申购与赎回：本基金合同生效后的前三年为封闭运作期，在封闭运作期内，本基金不办理申购、赎回业务。

封闭运作期届满，本基金转为上市开放式基金（LOF）后，基金管理人在开放日办理基金份额的申购和赎回，具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间，但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或本基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。开放日的具体业务办理时间在招募说明书或相关公告中载明。

基金合同生效后，若出现新的证券/期货市场、证券/期货交易所交易时间变更或其他特殊情况，基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整，但应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

6、跨系统转托管：跨系统转托管是指基金份额持有人将其持有的基金份额在注册登记系统和证券登记结算系统之间进行转托管的行为。

- 7、基金份额简称：财通科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合
- 8、本次上市交易的基金份额场内简称：科创财通
- 9、基金份额交易代码：501085

---

10、基金份额总额：截至 2020 年 1 月 23 日，基金份额总额为 775,602,303.23 份

11、本次上市交易份额：244,240,585.00 份

12、基金份额净值：截至 2020 年 1 月 23 日，基金份额净值为 1.2132 元。

13、上市交易的证券交易所：上海证券交易所

14、上市交易日期：2020 年 2 月 7 日

15、基金管理人：财通基金管理有限公司

16、基金托管人：中国工商银行股份有限公司

17、基金份额注册登记机构：中国证券登记结算有限责任公司

### 三、基金的募集与上市交易

#### （一）上市前基金募集情况

1、本基金募集申请的注册机构和注册文号：2019年6月5日中国证监会证监许可〔2019〕1014号

#### 2、基金运作方式：契约型

本基金合同生效后的前三年为封闭运作期，封闭运作期自基金合同生效日起至三年后的年度对日的前一日止。在封闭运作期内，本基金不办理申购、赎回业务。

封闭运作期内基金上市交易后，投资者可将在其持有的场外基金份额通过办理跨系统转托管业务转至场内后上市交易。封闭运作期届满后，即本基金基金合同生效日起满三年的对日起，本基金转为上市开放式基金（LOF），基金名称调整为“财通科创主题灵活配置混合型证券投资基金（LOF）”，并接受场外、场内申购赎回。

#### 3、基金合同期限：不定期

4、本基金发售日期：2019年6月24日至2019年7月5日

5、份额发售方式：场外和场内两种方式公开发售

6、发售价格：基金份额初始面值为人民币1元

#### 7、发售机构：

##### （1）场外发售机构

直销机构：财通基金管理有限公司直销柜台、财通基金网上直销系统。

1) 银行销售渠道：中国工商银行股份有限公司、中国农业银行股份有限公司、交通银行股份有限公司、中国光大银行股份有限公司、上海浦东发展银行股份有限公司、平安银行股份有限公司、苏州银行股份有限公司、东亚银行（中国）有限公司、兴业银行股份有限公司

2) 证券公司销售渠道：安信证券股份有限公司、联讯证券股份有限公司、东莞证券股份有限公司、西藏东方财富证券股份有限公司、广州证券股份有限公司、第一创业证券股份有限公司、华鑫证券有限责任公司、光大证券有限责任公司、爱建证券有限责任公司、德邦证券股份有限公司、湘财证券股份有限公司、东海证券股份有限公司、中银国际证券股份有

限公司、申万宏源西部证券有限公司、信达证券股份有限公司、东吴证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、国联证券股份有限公司、平安证券股份有限公司、国海证券股份有限公司、南京证券股份有限公司、华金证券股份有限公司、东北证券股份有限公司、中泰证券股份有限公司、恒泰证券股份有限公司、国都证券股份有限公司、中山证券有限责任公司、开源证券股份有限公司、江海证券有限公司、首创证券有限责任公司、大同证券有限责任公司、方正证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、中国中投证券有限责任公司、世纪证券有限责任公司、中国银河证券股份有限公司、长江证券股份有限公司、华融证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、民生证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、联储证券有限责任公司、中信证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、国元证券股份有限公司、长城证券股份有限公司、西南证券股份有限公司、华福证券有限责任公司、招商证券股份有限公司、上海证券有限责任公司、华安证券股份有限公司、华西证券股份有限公司、东兴证券股份有限公司、英大证券有限责任公司、中信证券（山东）有限责任公司、万联证券股份有限公司、财通证券股份有限公司、宏信证券有限责任公司、九州证券股份有限公司、国金证券股份有限公司、申万宏源证券有限公司

- 3) 其他销售渠道：深圳市新兰德证券投资咨询有限公司、北京植信基金销售有限公司、凤凰金信（银川）基金销售有限公司、浙江同花顺基金销售有限公司、沈阳麟龙投资顾问有限公司、珠海盈米基金销售有限公司、北京汇成基金销售有限公司、上海利得基金销售有限公司、深圳市金斧子基金销售有限公司、北京唐鼎耀华基金销售有限公司、海银基金销售有限公司、宜信普泽（北京）基金销售有限公司、上海挖财基金销售有限公司、北京辉腾汇富基金销售有限公司、上海长量基金销售有限公司、深圳众禄基金销售股份有限公司、北京蛋卷基金销售有限公司、武汉市伯嘉基金销售有限公司、北京电盈基金销售有限公司、上海好买基金销售有限公司、上海凯石财富基金销售有限公司、上海万得基金销售有限公司、上海基煜基金销售有限公司、蚂蚁（杭州）基金销售有限公司、



奕丰基金销售有限公司、深圳盈信基金销售有限公司、厦门市鑫鼎盛控股有限公司、上海陆金所基金销售有限公司、诺亚正行基金销售有限公司、上海大智慧基金销售有限公司、上海天天基金销售有限公司、南京苏宁基金销售有限公司、乾道盈泰基金销售（北京）有限公司、上海汇付基金销售有限公司、天津万家财富资产管理有限公司、嘉实财富管理有限公司、一路财富（北京）基金销售股份有限公司、中证金牛（北京）投资咨询有限公司、长江期货股份有限公司、弘业期货股份有限公司、上海联泰基金销售有限公司、北京恒宇天泽基金销售有限公司、中国国际金融股份有限公司、中信期货有限公司、北京虹点基金销售有限公司

## （2）场内发售机构

本基金的场内发售机构为上海证券交易所内具有基金销售业务资格的会员单位。本基金募集结束前获得基金销售业务资格的上海证券交易所会员单位可新增为本基金的场内发售机构。具体名单可在上海证券交易所网站查询，本基金管理人就不就此事项进行公告。

8、验资机构名称：安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)

9、募集资金总额及入账情况

本次募集的净认购金额为 775,185,938.59 元人民币，认购款项在本基金验资确认日之前产生的银行利息共计 416,364.64 元人民币。本次募集所有资金已于 2019 年 7 月 10 日全额划入本基金托管专户。

本次募集有效认购户数为 42,057 户，按照每份基金份额面值 1.00 元人民币计算，本次募集资金及其产生的利息结转的基金份额共计 775,602,303.23 份，已全部计入各基金份额持有人的基金账户。

10、基金备案情况

本基金已于 2019 年 7 月 10 日验资完毕，并向中国证监会提交了验资报告，办理基金备案手续，并于 2019 年 7 月 11 日获书面确认，本基金《基金合同》自该日起正式生效。

11、基金合同生效日：2019 年 7 月 11 日

12、基金合同生效日的基金份额总额：775,602,303.23 份

## （二）基金份额上市交易的主要内容

---

1、本基金基金份额上市交易的核准机构和核准文号：上海证券交易所自律监管决定书[2020] 33 号

2、上市交易日期：2020 年 2 月 7 日

3、上市交易的证券交易所：上海证券交易所。投资者在上海证券交易所各会员单位证券营业部均可参与基金交易。

4、基金简称：财通科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合

5、场内简称：科创财通

6、交易代码：501085

7、本次上市交易份额：244,240,585.00 份

8、基金资产净值的披露：基金合同生效后，在基金份额开始上市交易前，基金管理人应当至少每周在指定网站披露一次基金份额净值和基金份额累计净值。

在基金份额上市交易后，基金管理人应当在不晚于每个工作日的次日，通过指定网站、基金销售机构网站或者营业网点披露工作日的基金份额净值和基金份额累计净值。

基金管理人应当在不晚于半年度和年度最后一日的次日，在指定网站披露半年度和年度最后一日的基金份额净值和基金份额累计净值。

9、未上市交易份额的流通规定：未上市交易的份额托管在场外，基金份额持有人将其跨系统转托管至上海证券交易所场内后即可上市流通。

## 四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人

### （一）基金份额持有情况

截至2020年1月23日，科创财通的基金份额持有人总户数为42,057户，共持有基金份额775,602,303.23份，平均每户持有的基金份额数为18,441.69份。其中场内科创财通基金份额持有人户数为3,679户，平均每户持有的场内基金份额为66,387.76份；科创财通场外基金份额持有人户数为38,378户，平均每户持有的场外基金份额为13,845.48份。

截至2020年1月23日，场内机构投资者持有的本次上市交易的基金份额为485,859.00份，占本次上市交易场内基金份额比例为0.20%；场内个人投资者持有的本次上市交易的基金份额为243,754,726.00份，占本次上市交易场内基金份额比例为99.80%。

### （二）场内基金份额前十名持有人情况(截至2020年1月23日)

序号	持有人名称	持有基金份额(份)	占场内基金份额的比例(%)
1	哈增义	8,184,153.00	3.3509%
2	舒闫红	7,003,410.00	2.8674%
3	徐建国	3,998,524.00	1.6371%
4	王维凤	2,280,048.00	0.9335%
5	傅诚	2,013,746.00	0.8245%
6	黄英	1,692,613.00	0.6930%
7	刘晓光	1,543,264.00	0.6319%
8	卓林玲	1,224,654.00	0.5014%
9	定宇	1,194,785.00	0.4892%
10	徐建英	1,194,785.00	0.4892%
11	查利平	1,194,785.00	0.4892%

### （三）基金管理人的从业人员持有本基金的情况（截至2020年1月23日）

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	3,299.10	0.0004%

（四）基金管理人的从业人员持有本基金份额总量区间情况（截至2020年1月23日）

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本基金	0
本基金基金经理持有本基金	0

## 五、基金主要当事人简介

### （一）基金管理人

#### 1、基金管理人概况

名称：财通基金管理有限公司

法定代表人：夏理芬

总经理：王家俊

注册资本：贰亿元人民币

注册地址：上海市虹口区吴淞路619号505室

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监许可【2011】840号

统一社会信用代码：91310000577433812A

经营范围：基金募集；基金销售；资产管理和中国证监会许可的其它业务

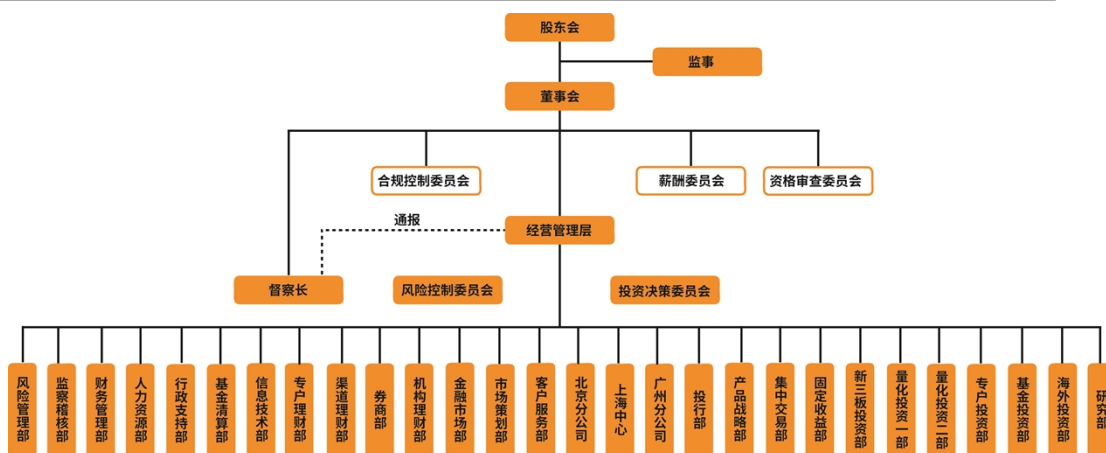
#### 2、股东及其出资比例

股东	出资额 (万元人民币)	出资比例 (%)
财通证券股份有限公司	8,000	40
杭州市实业投资集团有限公司	6,000	30
浙江瀚叶股份有限公司	6,000	30
合计	20,000	100

#### 3、内部组织结构及职能：

##### 1)内部组织机构

本基金管理人内部共设有风险管理部、监察稽核部、财务管理部、人力资源部、行政支持部、基金清算部、信息技术部、集中交易部、专户理财部、渠道理财部、机构理财部、券商部、金融市场部、市场策划部、客户服务部、上海中心、投行部、产品战略部、固定收益部、新三板投资部、量化投资一部、量化投资二部、专户投资部、基金投资部、研究部等职能部门，并在北京、广州设立有分公司，并设立了子公司上海财通资产管理有限公司。公司的组织架构图如下：



## 2)部门职能

**风险管理部:**对公司进行全面的风险管理，主要包括投资组合风险（研究风险、市场风险、流动性风险、信用风险、交易风险等）、业务风险（产品风险、销售风险、客户维护风险、市场推广风险、新业务风险等）、操作风险，以及财务风险和人力资源风险等，对公司运作和基金管理活动进行重点风险的监督、控制和管理；对各部门实施日常的常规风险检查；对公司的重大决策提供风险管理建议等；负责组织定期召开风险控制会议，对各类风险进行充分的揭示，并将其控制在合理的范围或者予以杜绝，以提升公司基金业绩的平稳性，并确保公司基金规模的平稳增长及后台的平稳运行，最终能让公司获取最大化的经风险调整后的收益。

**监察稽核部:**负责建立公司合规管理和风险控制体系；负责审核合同、处理法律事务；负责内部稽核审计；负责反洗钱工作；负责信息披露工作，负责开展员工的合规培训等工作，不断提高员工合规意识，防范风险，保障公司长远、稳健、高效发展。

**财务管理部:**建立健全公司的财务管理和会计核算工作并监督实施，规范公司的财务行为，按时进行公司会计账务处理，编制财务报表，定期进行财务分析，负责管理和核算公司的各项资产，按时交纳各种税款；负责公司的全面预算管理，监督、控制各部门财务预算的执行情况；负责公司自有资金流动性投资管理等。

**人力资源部:**负责公司人力资源的规划、开发与管理工作，负责拟定公司人力资源开发管理基本政策和人才队伍发展规划；协助公司领导进行企业文化建设；制订和实施公司组织架构及部门设置、调整的方案；组织人员招聘，进行岗位配置；

制订薪酬福利体系草案并提出调整建议，及时计发员工薪酬；制订公司的考核管理体系并组织考核实施；组织、安排员工的内外部学习与培训；负责管理公司人力资源基本信息和人事档案；管理员工关系及其他日常人事事务性工作。

**行政支持部：**负责公司行政后勤、外部接待、安全保卫、采购，以及办公环境日常管理；负责公司内、外部发文的起草、接收、流转，协调相关部门执行领导的工作指示；负责组织安排公司的重大会议活动，传达并跟进会议决议；起草公司工作计划、报告、总结、通知等各类公文；制定行政管理方面的制度流程；负责公司公章、档案、重要证照的保管、借阅和使用；负责办公车辆使用管理等工作。

**基金清算部：**负责公司所管理基金的基金会计工作，包括基金清算、记账、估值、划款、与托管行对帐、报表编制、对内对外数据提供；负责公司所管理的基金的资金结算工作，包括中登账户的开立及管理、资金结算银行账户的开立及管理、申购赎回相关资金的划拨及记账、数据提供；负责公司所管理的基金的注册登记工作，数据的接收及发送、数据的确认、对内对外数据提供；负责公司所管理的基金的直销中心工作；实施会计监督职能，对基金会计、资金结算、注册登记工作的合法性、合规性进行监督；负责基金清算相关数据、账簿的安全保管；负责信息披露工作中财务部分的编制与审核。

**信息技术部：**负责根据公司业务发展战略规划参与制定信息技术系统战略规划及信息技术部工作计划，并组织实施；负责信息技术系统软件及硬件设备的选型、购置、使用、维护、报废等方面的管理，确保各信息技术系统设备运转正常；负责交易业务数据及其他重要数据的备份管理并指导其他部门对重要数据进行备份；完成信息技术系统数据库的维护和支持，并为信息技术系统用户提供培训和技术支持；保障全公司信息技术系统的安全运行，为公司各部门提供技术支持，协助相关部门进行信息技术系统管理和维护；负责 IT 机房的维护和管理，定期对 IT 机房的各项设施进行检查，并记录检查日志，且做好各项安放措施；准确、完整地记录信息技术系统的运行日志，详细记载发生异常时的现象、时间、处理方式及处理结果等内容并妥善保存有关原始资料，发生技术故障按规定进行报告。

**集中交易部：**执行基金经理或投资经理的投资交易指令，实现投资组合投资

目标；按照法律、法规和公司相关业务规定，对投资组合投资行为进行监控；及时就市场情况向基金经理或投资经理进行反馈，并提出相应建议，尽可能降低交易成本；负责交易的记录、汇总、核对和报告等；开展对市场及重要投资品种运行趋势的判断分析；开展对不同投资品种交易方法和交易技术的研究；组织、协调券商的选择与评估工作；负责公司租用券商席位的管理；维护交易合作关系，扩大交易对手范围，协调公司内部和外部与交易相关的业务关系。

**专户理财部：**负责公司专户业务的开拓及维护；负责根据市场环境及公司董事会目标制定专户理财工作的销售目标、销售计划并最终达成销售目标等；负责建立部门各项规章制度、工作流程及考核办法等；负责专户客户资料档案建立、维护、保存及管理工作。

**渠道理财部：**对公司托管银行及销售主渠道选择提出合理化建议；全面负责代销渠道总部的维护、服务及上线等工作；根据市场环境及公司董事会目标制定渠道销售目标、计划等；全面负责公司渠道销售工作；制定各基金 IPO、持续销售等专项活动的销售目标、营销方案、销售策略等，并最终达成销售目标；负责协调管理各理财区渠道业务；分解销售任务、制定销售策略、分配销售资源、监督销售过程、考核销售结果等；负责指定部门各项规章制度、行为规范、考核项目及考核制度等。

**机构理财部：**负责保险公司、财务公司、上市公司、个人高端客户、QFII、券商自营、券商资管、社保基金、企业年金客户类等客户的开拓及维护；根据市场环境及公司董事会目标制定机构理财工作的销售目标、销售计划并最终达成销售目标等；负责建立部门各项规章制度、工作流程及考核办法等；负责直销客户资料档案建立、维护、保存及管理工作。

**金融市场部：**负责城商行、农商行等金融机构业务拓展、维护和合作创新；负责公募基金及专户产品销售工作，同时开展业务创新，深度挖掘银行同业、投行、委外、资金池等各条线的机构业务合作机会等。

**券商部：**负责券商总部的维护、服务及上线等工作；负责券商端的基金直销、代销、客户服务以及与全国各地分公司、营业部的沟通协调工作；维护全国券商代销渠道、形成定期拜访、沟通、路演以及售后维护工作等，根据市场环境及公司董事会目标制定券商端专户及公募的销售目标、销售计划并最终达成销售目标



等。市场策划部：负责公司品牌建设及管理，负责公司公共关系的开拓及维护，负责媒体关系的建立及维护；负责发布对外信息；负责公关活动的策划及举办；负责公司各类营销材料的设计及制作；负责市场调研；负责自行或委托第三方开展调研问卷及活动等；负责公司宣传材料、媒体发稿、培训课件的统一撰写；根据公司营销发展战略和产品营销计划，有效实施公司形象和基金产品的网上宣传和推介活动；负责维护好网站的基金客户及潜在客户，不断开拓新的创新服务模式，提升网站客户的忠诚度，提高网上直销交易量占比。

客户服务部：制定客户服务及电子商务工作细则，包括工作纪律、操作流程、人员考核等；拟定客户服务及电子商务发展战略及工作计划，得到批准后组织实施；制定客户服务原则和标准并执行，包括制定投诉处理办法、客户分级标准、服务标准等，塑造和维护公司的信誉及整体利益，提高客户满意度，减少客户流失；负责公司直销柜台工作，接待个人高端直销客户，协助机构直销客户下单。

上海中心：全面负责华东区域渠道销售工作，根据公司渠道销售目标，制定区域内渠道营销方案，完成区域内渠道销售任务；协助分管领导维护华东区域渠道总部，形成定期拜访、沟通制度；全面负责上海区各项规章制度、管理办法的制定并监督实施；全面负责上海区渠道人员的招聘、培训、考核及日常管理工作；协助公司各部门在华东区域开展公司各项工作。

投行部：负责搭建整合投行业务资源平台，负责对金融市场各类创新性投行业务进行研究，组织相关培训；负责研究与投资银行、商业银行相关的金融监管方面政策法规的动向；组织对相关重大事项、事件进行调研分析；负责各类行业信息的搜集，开拓与上市公司在投融资方面的业务合作机会，研究制订投融项目的投资方案，对投融项目的投资预期回报与风险进行分析和判断，提供投资操作建议；负责定增业务中有关投行事务的沟通，协调定增报价；负责制订与投行业务相关的各项制度与流程。

产品战略部：产品战略部是公司的产品战略研究与执行的部门，主要负责产品战略研究，负责公募产品、专户产品的设计及申报，负责新业务资格申请等工作。

固定收益部：负责拟订固定收益证券的研究、投资管理、风险评估、绩效考核等相关管理制度；负责公司旗下所有公募产品和专户产品的固定收益证券的投

资与管理，组织固定收益基金经理或投资经理拟定各固定收益产品的投资计划，报投资决策委员会批准组织实施；负责组织宏观策略分析师、固定收益分析师系统研究宏观经济、货币政策、财政政策以及信用产品、利率产品及其衍生产品等，为固定收益投资提供研究支持，同时向投资研究平台提交宏观经济运行报告。

**新三板投资部：**负责拟订新三板市场的研究、投资管理、风险评估、绩效考核等相关管理制度；负责公司旗下所有公募产品和专户产品的新三板证券的投资与管理，组织新三板基金经理或投资经理拟定各新三板产品的投资计划，报投资决策委员会批准组织实施；负责组织新三板各领域分析师，系统研究新三板证券及所处行业等，为新三板投资提供研究支持；负责与新三板证券投资相关的外部机构的交流与合作。

**量化投资一部、量化投资二部：**负责公司公募基金和专户产品的量化投资、指数化投资的投资管理工作；负责公司的金融工程平台，投资风险分析、投资业绩分析、数据需求、量化策略开发和量化投资研究平台的构建和维护；参与投研体系的研究工作；参与量化策略开发和研究；通过与各部门的协作，参与公司的产品设计、宣传、推介、营销、客户服务等工作。

**专户投资部：**负责公司专户投资业务的具体组织和执行，通过建立严格的内部管理制度、投资管理系统和风险控制系统，来实现风险的防范和控制，在符合法律、法规和制度的前提下，为客户资产增值最大化服务。

**基金投资部：**负责公司公募产品投资；在严格遵守国家的有关法规和公司的有关管理制度前提下，建立集中决策、独立运作、集中交易、统一管理、授权操作的运作模式，在投资决策委员会的领导下，努力实现基金合同设定的投资目标，追求实现目标的稳定性、持续性和可靠性。

**研究部：**负责通过对基本面（包括宏观经济、行业部门、上市公司等）的深入研究、结合对市场面（包括股票市场、债券市场、汇率市场、商品市场等）的综合研究，为投资决策委员会、基金经理、投资经理提供研究报告和投资建议，实现各产品的投资目标。

**北京分公司：**全面负责北方区域渠道销售工作，根据公司渠道销售目标，制定区域内渠道营销方案，完成区域内渠道销售任务；协助分管领导维护北京渠道总部，形成定期拜访、沟通制度；协助公司领导完成公司产品的报批工作及日常

与证监会、托管行等机构的联系及维护工作；全面负责北京区各项规章制度、管理辦法的制定并监督实施；全面负责北京区渠道人员的招聘、培训、考核及日常工作；协助公司各部门在北京区域开展公司各项工作。

广州分公司：全面负责广东区域渠道销售工作，根据公司渠道销售目标，制定区域内渠道营销方案，完成区域内渠道销售任务；协助分管领导维护广东区域渠道总部，形成定期拜访、沟通制度；全面负责广东区各项规章制度、管理辦法的制定并监督实施；全面负责广东区渠道人员的招聘、培训、考核及日常工作；协助公司各部门在广东区域开展公司各项工作。

#### 4、人员情况

截至2020年1月23日，公司共有员工159人，公司从业人员在本公司最近三年内均没有受到所在单位或有关管理部门的处罚。

#### 5、信息披露负责人：武祎

电话：021-2053 7888

#### 6、基金管理业务情况

截至2020年1月23日，财通基金管理有限公司旗下共管理29只基金产品，管理的基金资产净值为21,311,421,520.37元。

#### 7、本基金基金经理

金梓才先生，上海交通大学工学硕士。历任华泰资产管理有限公司投资经理助理，信诚基金管理有限公司TMT行业高级研究员。2014年8月加入财通基金管理有限公司，现任基金投资部副总监（主持工作）、基金经理。

### （二）基金托管人

#### 1、基金托管人概况

名称：中国工商银行股份有限公司

法定代表人：陈四清

注册资本：人民币 35,640,625.7089 万元

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

信息披露负责人：郭明

电话：010-66105799

#### 2、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。

### 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 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。

#### (三) 基金验资机构

名称: 安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)

执行事务合伙人: 毛鞍宁

住所: 北京市东城区东长安街 1 号东方广场东方经贸城安永大楼(东三办公楼) 16 层

办公地址: 上海市世纪大道 100 号环球金融中心 50 楼

公司电话: (021) 2228 8888

公司传真: (021) 2228 0000

签章会计师: 蒋燕华、骆文慧

业务联系人: 蒋燕华

---

---

## 六、基金合同摘要

详见本公告书附件。

## 七、基金财务状况

### （一）基金募集期间费用

本基金募集期间的信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用，不得从基金财产中列支。

### （二）基金上市前重要财务事项

本基金发售后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。

### （三）基金资产负债表

本基金截至2020年1月23日资产负债表如下：

单位：人民币元

资产	资产期末余额
<b>资产：</b>	
银行存款	83,131,835.62
结算备付金	1,134,626.91
存出保证金	248,125.25
交易性金融资产	857,543,072.00
其中：股票投资	857,543,072.00
基金投资	-
债券投资	-
资产支持证券投资	-
贵金属投资	-
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	-
应收证券清算款	182,887.47
应收利息	45,699.47
应收股利	-
应收申购款	-
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	942,286,246.72
<b>负债与所有者权益</b>	<b>负债期末余额</b>
<b>负债：</b>	
短期借款	-
交易性金融负债	-
衍生金融负债	-
卖出回购金融资产款	-

应付证券清算款	-
应付赎回款	-
应付管理人报酬	825,121.65
应付托管费	137,520.30
应付销售服务费	-
应付交易费用	173,796.05
应交税费	-
应付利息	-
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	193,196.71
负债合计	1,329,634.71
<b>所有者权益：</b>	
实收基金	775,602,303.23
未分配利润	165,354,308.78
所有者权益合计	940,956,612.01
负债和所有者权益总计	942,286,246.72

## 八、基金投资组合

截至2020年1月23日,财通科创主题3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金的投资组合如下:

### (一) 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	857,543,072.00	91.01
	其中: 股票	857,543,072.00	91.01
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中: 债券	-	-
	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	84,266,462.53	8.94
8	其他资产	476,712.19	0.05
9	合计	942,286,246.72	100.00

### (二) 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	749,142,817.05	79.62
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	-	-
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	57,243,198.73	6.08
J	金融业	-	-
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	120,861.20	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	30,465.80	0.00
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	51,005,729.22	5.42
S	综合	-	-
	合计	857,543,072.00	91.14

(三) 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	300502	新易盛	1,400,000.00	72,660,000.00	7.72
2	002384	东山精密	2,500,000.00	71,750,000.00	7.63
3	300433	蓝思科技	3,360,213.00	69,489,204.84	7.38
4	603160	汇顶科技	200,000.00	67,612,000.00	7.19
5	002241	歌尔股份	2,624,900.00	61,973,889.00	6.59
6	300394	天孚通信	1,601,640.00	60,525,975.60	6.43
7	603986	兆易创新	195,763.00	55,400,929.00	5.89
8	600183	生益科技	2,220,000.00	53,990,400.00	5.74
9	002273	水晶光电	2,928,934.00	48,708,172.42	5.18
10	300570	太辰光	1,670,000.00	45,624,400.00	4.85

(四) 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

---

本基金本报告期末未持有债券。

(五)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债券投资明细  
本基金本报告期末未持有债券。

(六)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。

(七)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。

(八)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权证投资明细  
本基金本报告期末未持有权证。

(九) 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合约。

2、 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货交易，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。本基金在进行股指期货交易时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。

(十) 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

本基金暂不投资国债期货。

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合约。

3、 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

(十一) 投资组合报告附注

- 1、报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。
- 2、报告期内，本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。
- 3、其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	248,125.25
2	应收证券清算款	182,887.47
3	应收股利	-
4	应收利息	45,699.47
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	476,712.19

#### 4、报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 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，本报告中涉及比例计算的分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## 九、重大事件揭示

本基金自合同生效至上市交易公告书公告前未发生对基金份额持有人有较大影响的重大事件。

---

---

## 十、基金管理人承诺

本基金管理人就基金上市交易之后履行管理人职责做出承诺：

（一）严格遵守《基金法》及其他法律法规、基金合同的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。

（二）真实、准确、完整和及时地披露定期报告等有关信息披露文件，披露所有对基金份额持有人有重大影响的信息，并接受中国证监会、证券交易所的监督管理。

（三）在知悉可能对基金价格产生误导性影响或引起较大波动的任何公共传播媒介中出现的或者在市场上流传的消息后，将及时予以公开澄清。

---

---

## 十一、基金托管人承诺

基金托管人就本基金上市交易后履行托管人职责做出如下承诺：

（一）严格遵守《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定，设立专门的基金托管部，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。

（二）根据《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定，对基金的投资范围、基金资产的投资组合比例、基金资产净值的计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付等行为进行监督和核查。

（三）基金托管人发现基金管理人的行为违反《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定，将及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，并在限期内，随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。

（四）基金托管人发现基金管理人重大违规行为，将立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。

---

---

## 十二、基金上市推荐人意见

本基金上市推荐人为广发证券股份有限公司

广发证券股份有限公司作为本基金上市推荐人出具如下意见：

1、本基金上市符合《基金法》、《上海证券交易所证券投资基金上市规则》规定的相关条件。

2、基金管理人提交上市推荐人的基金上市文件真实、准确、完整，符合相关规定要求，文件内所载的资料均经过核实。

---

---

## 十三、备查文件

### （一）备查文件目录

- 1、中国证监会准予财通科创主题3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金募集注册的文件。
- 2、《财通科创主题3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金基金合同》。
- 3、《财通科创主题3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金托管协议》。
- 4、法律意见书。
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照。
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照。
- 7、中国证监会要求的其他文件。

### （二）存放地点

备查文件存放于基金管理人和基金托管人的住所。

### （三）查阅方式

投资者可到基金管理人和基金托管人的办公场所、营业场所及网站免费查阅备查文件。

财通基金管理有限公司

二〇二〇年二月四日



## 附件：财通科创主题3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金 基金合同内容摘要

### 一、基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利与义务

#### （一）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、更换基金服务机构，对基金服务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）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；

（14）选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商、期货经纪机构

或其他为基金提供服务的外部机构；

(15) 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、非交易过户、转托管和定期定额投资等业务规则；

(16) 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净值信息，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、中期和年度基金报告；

(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，因向审计、法律等外部专业顾问提供的情况除外；

(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。

(二) 基金托管人的权利与义务

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

(1) 自基金合同生效之日起，依法律法规和基金合同的规定安全保管基金财产；

(2) 依基金合同约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他费用；

(3) 监督基金管理人对本基金的投资运作，如发现基金管理人违反基金合同及国家法律法规行为，对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金投资者的利益；

(4) 根据相关市场规则，为基金开设资金账户、证券账户、期货账户等投资所需账户，为基金办理证券、期货交易资金清算；

(5) 提议召开或召集基金份额持有人大会；

(6) 在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

(7) 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，基金托管人的义务包括但不限于：

(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、证券账户和期货账户等投资所需账户，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，因向审计、法律等外部专业顾问提供的情况除外；

(8) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额净值、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、中期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) 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管理人、基金份额持有人依法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，应为基金份额持有人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）基金份额持有人的权利与义务

基金投资者持有本基金基金份额的行为即视为对基金合同的承认和接受，基金投资者自依据基金合同取得基金份额，即成为本基金份额持有人和基金合同的当事人，直至其不再持有本基金的基金份额。基金份额持有人作为基金合同当事人并不以在基金合同上书面签章或签字为必要条件。

每份基金份额具有同等的合法权益。

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的权利包括但不限于：

- （1）分享基金财产收益；
- （2）参与分配清算后的剩余基金财产；
- （3）依法转让或者申请赎回其持有的基金份额；
- （4）按照规定要求召开基金份额持有人大会或者召集基金份额持有人大会；
- （5）出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；
- （6）查阅或者复制公开披露的基金信息资料；
- （7）监督基金管理人的投资运作；
- （8）对基金管理人、基金托管人、基金服务机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁；
- （9）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，基金份额持有人的义务包括但不限于：

- （1）认真阅读并遵守基金合同、招募说明书等信息披露文件；
- （2）了解所投资基金产品，了解自身风险承受能力，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险；
- （3）关注基金信息披露，及时行使权利和履行义务；
- （4）交纳基金认购、申购款项及法律法规和基金合同所规定的费用；
- （5）在其持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者基金合同终止的有限责任；
- （6）不从事任何有损基金及其他基金合同当事人合法权益的活动；

- (7) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；
- (8) 返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；
- (9) 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。

## 二、基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

基金份额持有人大会由基金份额持有人组成，基金份额持有人的合法授权代表有权代表基金份额持有人出席会议并表决。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。

本基金未设立基金份额持有人大会的日常机构，如今后设立基金份额持有人大会的日常机构，日常机构的设立按照相关法律法规的要求执行。

### （一）召开事由

1、除法律法规、基金合同、中国证监会另有规定外，当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会：

- (1) 终止基金合同；
- (2) 更换基金管理人；
- (3) 更换基金托管人；
- (4) 转换基金运作方式，但不包括本基金封闭运作期届满后转为上市开放式基金（LOF）；
- (5) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准；
- (6) 变更基金类别；
- (7) 本基金与其他基金的合并；
- (8) 变更基金投资目标、范围或策略；
- (9) 变更基金份额持有人大会程序；
- (10) 基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；
- (11) 终止基金上市，但因本基金不再具备上市条件而被上海证券交易所终止上市的情形除外；
- (12) 单独或合计持有本基金总份额 10%以上（含 10%）基金份额的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会；
- (13) 对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；

(14) 法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。

2、在法律法规规定和基金合同约定的范围内且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会：

(1) 调低基金管理费、基金托管费或其他由基金财产承担的费用；

(2) 法律法规要求增加的基金费用的收取；

(3) 在法律法规和基金合同规定的范围内调整本基金的申购费率、调低赎回费率或变更收费方式，增加、取消或者调整基金份额类别的设置；

(4) 因相应的法律法规发生变动而应当对基金合同进行修改；

(5) 对基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及基金合同当事人权利义务关系发生重大变化；

(6) 基金管理人、基金登记机构、基金销售机构在法律法规规定或中国证监会许可的范围内调整有关基金认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管、定期定额投资等业务的规则；

(7) 在对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金推出新业务或服务；

(8) 按照法律法规和基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

(二) 会议召集人及召集方式

1、除法律法规规定或基金合同另有约定外，基金份额持有人大会由基金管理人召集。

2、基金管理人未按规定召集或不能召开时，由基金托管人召集。

3、基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当由基金托管人自行召集，并自出具书面决定之日起 60 日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合。

4、代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项书面要



求召开基金份额持有人大会，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合。

5、代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，单独或合计代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人有权自行召集，并至少提前 30 日报中国证监会备案。基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的，基金管理人、基金托管人应当配合，不得阻碍、干扰。

6、基金份额持有人会议的召集人负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

（三）召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

1、召开基金份额持有人大会，召集人应于会议召开前 30 日，在指定媒介公告。基金份额持有人大会通知应至少载明以下内容：

- （1）会议召开的时间、地点和会议形式；
- （2）会议拟审议的事项、议事程序和表决方式；
- （3）有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日；
- （4）授权委托证明的内容要求（包括但不限于代理人身份，代理权限和代理有效期限等）、送达时间和地点；
- （5）会务常设联系人姓名及联系电话；
- （6）出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；
- （7）召集人需要通知的其他事项。

2、采取通讯开会方式并进行表决的情况下，由会议召集人决定在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表决意见寄交的截止时间和收取方式。

3、如召集人为基金管理人，还应另行书面通知基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为基金托管人，则应另行书面通知基金管理人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为基金份额持有人，则应另行书面通知基金管理人和基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督。基金管理人或基金托管人拒不派代表对书面表决意见的计票进行监督的，不影响表决意见的计票效力。

#### （四）基金份额持有人出席会议的方式

基金份额持有人大会可通过现场开会方式、通讯开会方式或法律法规、监管机构允许的其他方式召开，会议的召开方式由会议召集人确定。

1、现场开会。由基金份额持有人本人出席或以代理投票授权委托证明委派代表出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当列席基金份额持有人大会，基金管理人或基金托管人不派代表列席的，不影响表决效力。现场开会同时符合以下条件时，可以进行基金份额持有人大会议程：

（1）亲自出席会议者持有基金份额的凭证、受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、基金合同和会议通知的规定，并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的登记资料相符；

（2）经核对，汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的 50%（含 50%）；若到会者在权益登记日代表的有效的基金份额少于本基金在权益登记日基金总份额的 50%，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的 3 个月以后、6 个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会到会者在权益登记日代表的有效的基金份额应不少于本基金在权益登记日基金总份额的三分之一（含三分之一）。

2、通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以书面形式或会议通知载明的其他形式在表决截止日以前送达至召集人指定的地址。通讯开会应以书面方式或会议通知载明的其他形式进行表决。

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

（1）会议召集人按基金合同约定公布会议通知后，在 2 个工作日内连续公

布相关提示性公告；

(2) 召集人按基金合同约定通知基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。会议召集人在基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取基金份额持有人的书面表决意见；基金托管人或基金管理人经通知不参加收取书面表决意见的，不影响表决效力；

(3) 本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的，基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日基金总份额的50%（含50%）；若本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日基金总份额的50%，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的3个月以后、6个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会应当有代表三分之一以上（含三分之一）基金份额的持有人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见；

(4) 上述第(3)项中直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的代理人，同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具书面意见的代理人出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、基金合同和会议通知的规定，并与基金登记机构记录相符；

3、在不与法律法规冲突的前提下，基金份额持有人大会可通过网络、电话或其他方式召开，基金份额持有人可以采用书面、网络、电话、短信或其他方式进行表决，具体方式由会议召集人确定并在会议通知中列明。

4、基金份额持有人授权他人代为出席会议并表决的，授权方式可以采用书面、网络、电话、短信或其他方式，具体方式在会议通知中列明。

(五) 议事内容与程序

#### 1、议事内容及提案权

议事内容为关系基金份额持有人利益的重大事项，如基金合同的重大修改、决定终止基金合同、更换基金管理人、更换基金托管人、与其他基金合并、法律法规及基金合同规定的其他事项以及会议召集人认为需提交基金份额持有人大会讨论的其他事项。

基金份额持有人大会的召集人发出召集会议的通知后，对原有提案的修改应

当在基金份额持有人大会召开前及时公告。

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

## 2、议事程序

### （1）现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照下列第（七）条规定程序确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表，在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权其出席会议的代表主持；如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的 50%以上（含 50%）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人拒不出席或主持基金份额持有人大会，不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

会议召集人应当制作出席会议人员的签名册。签名册载明参加会议人员姓名（或单位名称）、身份证明文件号码、持有或代表有表决权的基金份额、委托人姓名（或单位名称）和联系方式等事项。

### （2）通讯开会

在通讯开会的情况下，首先由召集人提前 30 日公布提案，在所通知的表决截止日期后 2 个工作日内在公证机关监督下由召集人统计全部有效表决，在公证机关监督下形成决议。

### （六）表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

1、一般决议，一般决议须经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的 50%以上（含 50%）通过方为有效；除下列第 2 项所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过。

2、特别决议，特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方可做出。除法律法规、中国证监会另有规定或本合同另有规定外，转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、终止基金合同、本基金与其他基金合并应当以特别决议通过方为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则提交符合会议通知中规定的确认投资者身份文件的表决视为有效出席的投资者，表面符合会议通知规定的书面表决意见视为有效表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

基金份额持有人大会的各项提案或同一项提案内并列的各项议题应当分开审议、逐项表决。

### （七）计票

#### 1、现场开会

（1）如大会由基金管理人或基金托管人召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中选举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集或大会虽然由基金管理人或基金托管人召集，但是基金管理人或基金托管人未出席大会的，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中选举三名基金份额持有人代表担任监票人。基金管理人或基金托管人不出席大会的，不影响计票的效力。

（2）监票人应当在基金份额持有人表决后立即进行清点并由大会主持人当场公布计票结果。

（3）如果会议主持人或基金份额持有人或代理人对于提交的表决结果有怀疑，可以在宣布表决结果后立即对所投票数要求进行重新清点。监票人应当进行重新清点，重新清点以一次为限。重新清点后，大会主持人应当当场公布重新清点结果。

（4）计票过程应由公证机关予以公证，基金管理人或基金托管人拒不出席大会的，不影响计票的效力。

#### 2、通讯开会

在通讯开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人授权代表（若由基金托管人召集，则为基金管理人授权代表）的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。基金管理人或基金托管人拒派代

表对书面表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。

#### （八）生效与公告

基金份额持有人大会的决议，召集人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会备案。

基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。

基金份额持有人大会决议自生效之日起 2 日内在指定媒介上公告。如果采用通讯方式进行表决，在公告基金份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。

基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会的决议。生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人、基金托管人均有约束力。

（九）本部分关于基金份额持有人大会召开事由、召开条件、议事程序、表决条件等规定，凡是直接引用法律法规或监管规则的部分，如将来法律法规或监管规则修改导致相关内容被取消或变更的，基金管理人经与基金托管人协商一致并提前公告后，可直接对本部分内容进行修改和调整，无需召开基金份额持有人大会审议。

### 三、基金收益分配原则、执行方式

#### （一）基金利润的构成

基金利润指基金利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额，基金已实现收益指基金利润减去公允价值变动收益后的余额。

#### （二）基金可供分配利润

基金可供分配利润指截至收益分配基准日基金未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

#### （三）基金收益分配原则

1、在符合有关基金分红条件的前提下，基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准。

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资。登记在基金份额持有人开放式基金账户下的基金份额，投资者可选择现金红利或将现金红利自动

转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。登记在基金份额持有人上海证券账户下的基金份额，只能选择现金分红的方式，具体权益分配程序等有关事项遵循上海证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定。

3、每一基金份额享有同等分配权。

4、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在不违反法律法规且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人在履行适当程序后，可对基金收益分配原则进行调整。

#### （四）收益分配方案

基金收益分配方案中应载明截止收益分配基准日的可供分配利润、基金收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。

#### （五）收益分配方案的确定、公告与实施

本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核，按规定在指定媒介公告。

#### （六）基金收益分配中发生的费用

基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。对于场外份额，当投资者的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费时，基金登记机构可将基金份额持有人的现金红利自动转为基金份额。红利再投资的计算方法，依照《业务规则》执行；对于场内份额，按照上海证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定处理。

### 四、与基金财产管理、运用有关费用的提取、支付方式与比例

#### （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、仲裁费和诉讼费；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金的证券、期货交易费用；

- 7、基金的银行汇划费用；
- 8、基金的上市初费和月费；
- 9、基金的开户费用、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 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

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

### 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

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

上述“（一）基金费用的种类”中第 3—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。基金财产投资的相关税收，由基金份额持有人承担，基金管理人或者其他扣缴义务人按照国家有关税收征收的规定代扣代缴。

### 五、基金财产的投资方向和投资限制

#### （一）投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括科创板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券（含分离交易的可转债）、可交换债券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括定期存款、协议存款、通知存款等）、同业存单、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他证券品种。

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

本基金封闭运作期内，股票投资占基金资产的比例为 0%-100%，投资于科创主题相关证券的比例不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金。

转为上市开放式基金（LOF）后，股票投资占基金资产的比例为 0%-95%，其中，投资于科创主题相关证券的比例不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付

金、存出保证金、应收申购款等。

如法律法规或中国证监会变更上述投资品种的比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

## （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）本基金封闭运作期内，股票投资占基金资产的比例为 0%-100%，投资于科创主题相关证券的比例不低于非现金基金资产的 80%；转为上市开放式基金（LOF）后，股票投资占基金资产的比例为 0%-95%，其中，投资于科创主题相关证券的比例不低于非现金基金资产的 80%；

（2）本基金封闭运作期内，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金；转为上市开放式基金（LOF）后，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例合计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；

（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%；

（6）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%；

（7）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%；

（8）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%；

（9）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；

(10) 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;

(11) 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%; 本基金在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为 1 年, 债券回购到期后不得展期;

(12) 本基金在任何交易日日终, 持有的买入股指期货合约价值, 不得超过基金资产净值的 10%;

(13) 在封闭运作期内, 本基金在任何交易日日终, 持有的买入股指期货合约价值与有价证券市值之和, 不得超过基金资产净值的 100%; 转为上市开放式基金 (LOF) 后, 本基金在任何交易日日终, 持有的买入股指期货合约价值与有价证券市值之和, 不得超过基金资产净值的 95%; 其中, 有价证券指股票、债券 (不包含到期日在一年以内的政府债券)、资产支持证券、买入返售金融资产 (不含质押式回购) 等;

(14) 本基金在任何交易日日终, 持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%;

(15) 本基金在任何交易日内交易 (不包括平仓) 的股指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 20%;

(16) 本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值, 合计 (轧差计算) 应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定;

(17) 在封闭运作期内, 本基金的基金总资产不得超过基金净资产的 200%; 转为上市开放式基金 (LOF) 后, 本基金的基金总资产不得超过基金净资产的 140%;

(18) 转为上市开放式基金 (LOF) 后, 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%; 转为上市开放式基金 (LOF) 后, 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%;

(19) 转为上市开放式基金 (LOF) 后, 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%; 因证券市场波动、上市公司股票停

牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合本款所规定比例限制的，本基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

(20) 转为上市开放式基金（LOF）后，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；

(21) 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。

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，除上述（2）、（9）、（19）、（20）项的情形外，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的，从其规定。

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本基金合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门取消或变更上述限制，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以变更后的规定为准。

## 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。

法律法规或监管部门取消或变更上述限制或禁止行为，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，本基金投资不再受相关限制或以变更后的规定为准。

## 六、基金资产净值的计算方法和公告方式

### （一）估值日

本基金的估值日为本基金相关的证券、期货交易场所的交易日以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非交易日。

### （二）估值对象

基金所拥有的股票、股指期货合约、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。

### （三）估值原则

基金管理人在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，应符合《企业会计准则》、监管部门有关规定。

1、对存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的投资品种，在估值日有报价的，除会计准则规定的例外情况外，应将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量。估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

2、对不存在活跃市场的投资品种，应采用在当前情况下适用并且有足够可

利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

3、如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，使潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在 0.25%以上的，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### （四）估值方法

##### 1、证券交易所上市的有价证券的估值

（1）交易所上市的有价证券（包括股票等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

（2）交易所上市实行净价交易的债券按估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值；

（3）交易所上市未实行净价交易的债券按估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的估值全价减去估值全价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；

（4）交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。交易所上市的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

##### 2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

（1）送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的估值方法估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值；

（2）首次公开发行未上市的股票、债券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值；

（3）在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股

票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

### 3、金融衍生品的估值

(1) 评估金融衍生品价值时，应当采用市场公认或者合理的估值方法确定公允价值；

(2) 股指期货合约一般以估值当日结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。

4、全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用第三方估值机构提供的价格数据估值。同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

5、如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

6、当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。

7、相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

如基金管理人或基金托管人发现基金估值违反基金合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时，应立即通知对方，共同查明原因，双方协商解决。

根据有关法律法规，基金净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人对于基金净值的计算结果对外予以公布。

### (五) 估值程序

1、基金份额净值是按照每个工作日闭市后，基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算，精确到 0.0001 元，小数点后第 5 位四舍五入。基金管理人可以设立大额赎回情形下的净值精度应急调整机制。国家另有规定的，从其规定。

每个工作日计算基金资产净值及基金份额净值，并按规定公告。

2、基金管理人应每个工作日对基金资产估值。但基金管理人根据法律法规或本基金合同的规定暂停估值时除外。基金管理人每个工作日对基金资产估值后，将基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

#### （六）估值错误的处理

基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当基金份额净值小数点后4位以内(含第4位)发生估值错误时，视为基金份额净值错误。

本基金合同的当事人应按照以下约定处理：

##### 1、估值错误类型

本基金运作过程中，如果由于基金管理人或基金托管人、或登记机构、或销售机构、或投资人自身的过错造成估值错误，导致其他当事人遭受损失的，过错的责任人应当对由于该估值错误遭受损失当事人(“受损方”)的直接损失按下述估值错误处理原则”给予赔偿，承担赔偿责任。

上述估值错误的主要类型包括但不限于：资料申报差错、数据传输差错、数据计算差错、系统故障差错、下达指令差错等。

##### 2、估值错误处理原则

(1) 估值错误已发生，但尚未给当事人造成损失时，估值错误责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正估值错误发生的费用由估值错误责任方承担；由于估值错误责任方未及时更正已产生的估值错误，给当事人造成损失的，由估值错误责任方对直接损失承担赔偿责任；若估值错误责任方已经积极协调，并且有协助义务的当事人有足够的时间进行更正而未更正，则其应当承担相应赔偿责任。估值错误责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认，确保估值错误已得到更正。

(2) 估值错误的责任方对有关当事人的直接损失负责，不对间接损失负责，并且仅对估值错误的有关直接当事人负责，不对第三方负责。

(3) 因估值错误而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但估值错误责任方仍应对估值错误负责。如果由于获得不当得利的当事人不返还或不全部返还不当得利造成其他当事人的利益损失(“受损方”)，则估值错误责任



方应赔偿受损方的损失，并在其支付的赔偿金额的范围内对获得不当得利的当事人享有要求交付不当得利的权利；如果获得不当得利的当事人已经将此部分不当得利返还给受损方，则受损方应当将其已经获得的赔偿额加上已经获得的不当得利返还的总和超过其实际损失的差额部分支付给估值错误责任方。

(4) 估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

### 3、估值错误处理程序

估值错误被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

(1) 查明估值错误发生的原因，列明所有的当事人，并根据估值错误发生的原因确定估值错误的责任方；

(2) 根据估值错误处理原则或当事人协商的方法对因估值错误造成的损失进行评估；

(3) 根据估值错误处理原则或当事人协商的方法由估值错误的责任方进行更正和赔偿损失；

(4) 根据估值错误处理的方法，需要修改基金登记机构交易数据的，由基金登记机构进行更正，并就估值错误的更正向有关当事人进行确认。

### 4、基金份额净值估值错误处理的方法如下：

(1) 基金份额净值计算出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，通报基金托管人，并采取合理的措施防止损失进一步扩大。

(2) 错误偏差达到基金份额净值的 0.25% 时，基金管理人应当通报基金托管人并报中国证监会备案；错误偏差达到基金份额净值的 0.5% 时，基金管理人应当公告、通报基金托管人并报中国证监会备案。

(3) 前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。

### (七) 暂停估值的情形

1、基金投资所涉及的证券、期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

2、因不可抗力致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；

3、当前一估值日基金资产净值 50% 以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停估值；

#### 4、中国证监会和基金合同认定的其它情形。

##### （八）基金净值的确认

基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个工作日交易结束后计算当日的基金资产净值和基金份额净值并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人，由基金管理人对基金净值予以公布。

##### （九）特殊情形的处理

1、基金管理人按本部分估值方法规定的第 5 项条款进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。

2、由于证券、期货交易所及登记结算机构发送的数据错误，或由于其他不可抗力原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人和基金托管人应当积极采取必要的措施消除或减轻由此造成的影响。

### 七、基金合同解除和终止的事由、程序以及基金财产清算方式

#### （一）基金合同的变更

1、变更基金合同涉及法律法规规定或本合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。对于法律法规规定和基金合同约定可不经基金份额持有人大会决议通过的事项，由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告，并报中国证监会备案。

2、关于基金合同变更的基金份额持有人大会决议自生效后方可执行，自决议生效后两日内在指定媒介公告。

#### （二）基金合同的终止事由

有下列情形之一的，经履行相关程序后，基金合同应当终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止的；
- 2、基金管理人、基金托管人职责终止，在 6 个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；
- 3、基金合同约定的其他情形；

4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

### （三）基金财产的清算

1、基金财产清算小组：自出现基金合同终止事由之日起 30 个工作日内成立清算小组，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。

2、基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有证券、期货相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

3、基金财产清算小组职责：基金财产清算小组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。

4、基金财产清算程序：

- （1）基金合同终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；
- （2）对基金财产和债权债务进行清理和确认；
- （3）对基金财产进行估值和变现；
- （4）制作清算报告；
- （5）聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- （6）将清算报告报中国证监会备案并公告；
- （7）对基金剩余财产进行分配。

5、基金财产清算的期限为 6 个月，但因本基金所持证券的流动性受到限制而不能及时变现的，清算期限相应顺延。

### （四）清算费用

清算费用是指基金财产清算小组在进行基金财产清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算小组优先从基金剩余财产中支付。

### （五）基金财产清算剩余资产的分配

依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

### （六）基金财产清算的公告

---

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组进行公告。

**（七）基金财产清算账册及文件的保存**

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

**八、争议解决方式**

各方当事人同意，因基金合同而产生的或与基金合同有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，应提交中国国际经济贸易仲裁委员会根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为北京，仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力。除非仲裁裁决另有规定，仲裁费由败诉方承担。

争议处理期间，基金合同当事人应恪守各自的职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

基金合同受中国法律管辖。

**九、基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式**

基金合同正本一式六份，除上报有关监管机构一式二份外，基金管理人、基金托管人各持有二份，每份具有同等的法律效力。

基金合同可印制成册，供投资者在基金管理人、基金托管人、销售机构的办公场所和营业场所查阅。