

银华科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型  
证券投资基金  
上市交易公告书

基金管理人：银华基金管理股份有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

注册登记人：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

上市日期：2020 年 1 月 7 日

公告日期：2020 年 1 月 2 日

---

## 目 录

一、重要声明与提示 .....	1
二、基金概览 .....	2
三、基金份额的募集与上市交易 .....	4
四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人情况 .....	9
五、基金主要当事人简介 .....	10
六、基金合同摘要 .....	18
七、基金财务状况 .....	50
八、基金投资组合 .....	52
九、重大事件揭示 .....	55
十、基金管理人承诺 .....	56
十一、基金托管人承诺 .....	57
十二、基金上市推荐人意见 .....	58
十三、备查文件目录 .....	59

## 一、重要声明与提示

《银华科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金上市交易公告书》（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规则》的规定编制，银华科创主题 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”）基金管理人的董事会及董事保证本公告书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。

本基金基金托管人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。

中国证监会、上海证券交易所对银华科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资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，请投资者详细查阅发布在 2019 年 6 月 17 日上海证券交易所官方网站的《银华科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》及其更新（以下简称招募说明书）。本基金招募说明书同时发布在本公司网站（[www.yhfund.com.cn](http://www.yhfund.com.cn)）。

## 二、基金概览

1、基金名称：银华科创主题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

本基金基金合同生效后的前三年为封闭运作期，封闭运作期指自基金合同生效之日起（包括基金合同生效之日）至三年后的年度对日止，其中，年度对日指某一日期在后续年度中的对应日期，如该对应日期为该年度中不存在对应日期的，或该对应日期为非工作日的，则顺延至下一工作日。

在封闭运作期内，本基金不办理申购、赎回业务，但投资人可在本基金上市交易后通过上海证券交易所卖出基金份额。

封闭运作期内基金上市交易后，投资者可将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，本基金转为上市开放式基金（LOF），基金名称调整为“银华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、本基金的存续期限为不定期

5、基金份额总额：截至2019年12月30日，本基金的基金份额总额为989,735,564.40份

6、基金份额净值：截至2019年12月30日，本基金的基金份额净值为1.1126元

7、本次上市交易的基金份额简称及其基金代码：

场内份额简称：科创银华

基金代码：501083

8、本次上市交易的基金份额254,556,124.00份

9、上市交易的证券交易所：上海证券交易所

- 10、上市交易日期：2020年1月7日
- 11、基金管理人：银华基金管理股份有限公司
- 12、基金托管人：招商银行股份有限公司
- 13、本次上市交易的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、基金份额的募集与上市交易

#### （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：中国证券监督管理委员会证监许可[2019]1011号

#### 2、基金运作方式

契约型开放式

本基金基金合同生效后的前三年为封闭运作期，封闭运作期指自基金合同生效之日起（包括基金合同生效之日）至三年后的年度对日止，其中，年度对日指某一日期在后续年度中的对应日期，如该对应日期为该年度中不存在对应日期的，或该对应日期为非工作日的，则顺延至下一工作日。

在封闭运作期内，本基金不办理申购、赎回业务，但投资人可在本基金上市交易后通过上海证券交易所卖出基金份额。

封闭运作期内基金上市交易后，投资者可将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，本基金转为上市开放式基金（LOF），基金名称调整为“银华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1日

5、发售价格：1.00元人民币

6、份额发售方式：本基金通过场外、场内两种方式公开发售

#### 7、发售机构

（1）本基金场外认购的销售机构：

1) 直销机构

银华基金管理股份有限公司北京直销中心以及银华基金管理股份有限公司网上直销交易系统。

投资人可以通过基金管理人网上直销交易系统办理本基金的开户和认购手续，具体交易细则请参阅基金管理人网站公告。

网址：[www.yhfund.com.cn](http://www.yhfund.com.cn)

## 2) 其他场外销售机构

中国建设银行股份有限公司、中国民生银行股份有限公司、中国工商银行股份有限公司、中国农业银行股份有限公司、中信银行股份有限公司、中国光大银行股份有限公司、中国邮政储蓄银行股份有限公司、交通银行股份有限公司、兴业银行股份有限公司、平安银行股份有限公司、上海浦东发展银行股份有限公司、上海银行股份有限公司、南京银行股份有限公司、江苏银行股份有限公司、青岛银行股份有限公司、杭州银行股份有限公司、东莞农村商业银行股份有限公司、长江证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、安信证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、东北证券股份有限公司、上海证券有限责任公司、中信期货有限公司、大同证券有限责任公司、国联证券股份有限公司、华龙证券股份有限公司、开源证券股份有限公司、世纪证券有限责任公司、华鑫证券有限责任公司、爱建证券有限责任公司、西南证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、中原证券股份有限公司、东海证券股份有限公司、中信证券（山东）有限责任公司、西部证券股份有限公司、中银国际证券有限责任公司、恒泰证券股份有限公司、长城证券股份有限公司、华安证券股份有限公司、万联证券有限责任公司、东莞证券股份有限公司、华宝证券有限责任公司、华泰证券股份有限公司、华福证券有限责任公司、江海证券有限公司、华林证券股份有限公司、东吴证券股份有限公司、山西证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、中国中投证券有限责任公司、海通证券股份有限公司、中国国际金融股份有限公司、大通证券股份有限公司、招商银行股份有限公司、中国银

行股份有限公司、上海农村商业银行股份有限公司、渤海证券股份有限公司、东兴证券股份有限公司、国都证券股份有限公司、申万宏源西部证券有限公司、华西证券股份有限公司、联讯证券股份有限公司、中泰证券股份有限公司、新时代证券股份有限公司、信达证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、中天证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、财通证券股份有限公司、德邦证券股份有限公司、第一创业证券股份有限公司、方正证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、广州证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、国元证券股份有限公司、南京证券股份有限公司、平安证券股份有限公司、申万宏源证券有限公司、天风证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、浙商证券股份有限公司、首创证券有限责任公司、深圳众禄基金销售股份有限公司、上海长量基金销售投资顾问有限公司、浙江同花顺基金销售有限公司、诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司、众升财富（北京）基金销售有限公司、嘉实财富管理有限公司、北京恒天明泽基金销售有限公司、海银基金销售有限公司、上海陆金所基金销售有限公司、北京汇成基金销售有限公司、上海华夏财富投资管理有限公司、上海天天基金销售有限公司、上海好买基金销售有限公司、蚂蚁（杭州）基金销售有限公司、北京蛋卷基金销售有限公司、凤凰金信（银川）基金销售有限公司、南京苏宁基金销售有限公司、腾安基金销售（深圳）有限公司、珠海盈米基金销售有限公司、北京百度百盈基金销售有限公司、国海证券股份有限公司、国盛证券有限责任公司、湘财证券股份有限公司、北京银行股份有限公司（以上排名不分先后）

（2）本基金场内认购的销售机构：

具有基金销售业务资格并经上海证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的上海证券交易所会员，具体名单可在上交所网站查询。

8、验资机构名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

9、募集资金总额及入账情况

此次募集扣除认购费后的有效净认购金额（不含利息）为人民币989,485,368.77元，确认份额（不含利息转份额）989,485,368.77份，利息结转份额250,195.63份，总确认份额为989,735,564.40份。

上述有效净认购资金及认购款项在募集期间产生的利息已于2019年9月23日全额划入本基金的基金托管人招商银行股份有限公司开立的托管专户。

本基金通过场外、场内两种方式公开发售，按照每份基金份额1.00元计算，本基金募集期间含本息共募集989,735,564.40份基金份额，其中场外认购的基金份额为735,179,440.40份；场内认购的基金份额为254,556,124.00份。

#### 10、基金备案情况

本基金已于2019年7月3日验资完毕，当日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5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5日

12、基金合同生效日的基金份额总额：989,735,564.40份

#### （二）本基金上市交易的主要内容

1、本基金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]1号

2、上市交易日期：2020年1月7日

3、上市交易的证券交易所：上海证券交易所

4、上市交易场内份额简称：科创银华

5、交易代码：501083

6、本次上市交易份额：254,556,124.00份

7、基金资产净值的披露：基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人复核。基金管理人于每个工作日交易结束后将经过基金托管人复核的基金份额净值传给上交所，上交所于次日通过行情系统揭示。

8、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转托管至上海证券交易所场内后即可上市流通。

（三）本基金转托管的主要内容：为了保证基金份额持有人的利益，本基金管理人向上海证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司提出申请，为基金份额持有人开通了转托管业务的办理事宜，相关跨系统转托管的事项请参见本基金管理人发布的相关公告。

## 四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人情况

### （一）基金份额持有情况

截至2019年12月30日，本基金持有人总户数为62,434户，其中场内持有人总户数为3,530户，平均每户持有的基金份额为72,112.22份，场外持有人总户数为58,904户，平均每户持有的基金份额为12,480.98份。

机构投资者持有的本次上市交易的基金份额为911,356.00份，占本次上市交易基金份额比例为0.36%；个人投资者持有的本次上市交易的基金份额为253,644,768.00份，占本次上市交易基金份额比例为99.64%。

### （二）基金份额前十名持有人情况

本次上市交易的基金份额前十名持有人情况

序号	持有人名称	持有份额（份）	占场内总份额比例（%）
1	潘备	20,005,300.00	7.86%
2	罗杰	5,000,575.00	1.96%
3	徐建国	3,989,295.00	1.57%
4	朱谧	3,490,633.00	1.37%
5	郑惠敏	3,347,417.00	1.32%
6	彭哲民	3,343,694.00	1.31%
7	王维凤	2,991,971.00	1.18%
8	黄赦慈	1,994,647.00	0.78%
9	于浩洋	1,994,647.00	0.78%
10	徐建英	1,994,647.00	0.78%
	黄文礼	1,994,647.00	0.78%
合计		50,147,473.00	19.70%

### （三）截至2019年12月30日，基金管理人的从业人员持有本基金份额的情况

本基金管理人的基金从业人员持有本基金份额总量为184,643.82份，占该基金总份额的比例为0.02%。其中，本基金管理人高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有该只基金份额总量的数量区间为0，该只基金的基金经理持有该只基金份额总量的数量区间为0。

## 五、基金主要当事人简介

### （一）基金管理人

#### 1、基本信息

名称：银华基金管理股份有限公司

法定代表人：王珠林

总经理：王立新

设立日期：2001年5月28日

注册资本：2.222亿元人民币

注册地址：广东省深圳市深南大道6008号特区报业大厦19层

办公地址：北京市东城区东长安街1号东方广场东方经贸城C2办公楼15层

设立批准文号：中国证监会证监基金字[2001]7号

统一社会信用代码：914403007109283569

经营范围：基金募集、基金销售、资产管理及中国证监会许可的其他业务

存续期间：持续经营

股东及其出资比例：

持股单位	占总股本比例
西南证券股份有限公司	44.10%
第一创业证券股份有限公司	26.10%
东北证券股份有限公司	18.90%
山西海鑫实业股份有限公司	0.90%
珠海银华聚义投资合伙企业（有限合伙）	3.57%
珠海银华致信投资合伙企业（有限合伙）	3.20%

珠海银华汇玥投资合伙企业（有限合伙）	3.22%
--------------------	-------

联系人：冯晶

电话：010-58163000

传真：010-58163090

## 2、经营概况

银华基金管理有限公司成立于2001年5月28日，是经中国证监会批准（证监基金字[2001]7号文）设立的全国性基金管理公司，注册资本为2.222亿元人民币。银华基金管理有限公司的法定名称已于2016年8月9日起变更为“银华基金管理股份有限公司”。

公司治理结构完善，经营运作规范，能够切实维护基金投资人的利益。公司董事会下设“战略委员会”、“风险控制委员会”、“薪酬与提名委员会”、“审计委员会”四个专业委员会，有针对性地研究公司在经营管理和基金运作中的相关情况，制定相应的政策，并充分发挥独立董事的职能，切实加强对公司运作的监督。

公司监事会由4位监事组成，主要负责检查公司的财务以及对公司董事、高级管理人员的行为进行监督。

公司具体经营管理由总经理负责，公司根据经营运作需要设置投资管理一部、投资管理二部、投资管理三部、量化投资部、境外投资部、FOF投资管理部、研究部、市场营销部、机构业务部、养老金业务部、交易管理部、风险管理部、产品开发部、运作保障部、信息技术部、互联网金融部、战略发展部、投资银行部、监察稽核部、内部审计部、人力资源部、公司办公室、财务行政部、深圳管理部等24个职能部门，并设有北京分公司、青岛分公司和上海分公司。此外，公司设立投资决策委员会作为公司投资业务的最高决策机构，同时下设“主动型A股投资决策、固定收益投资决策、量化和境外投资决策、养老金投资决策及基金中基金投资决策”五个专门委员会。公司投资决策委员会负责确定公司投资业务理念、投资政策及投资决策流程和风险管理。

各部门主要职能如下：

投资管理一部、投资管理二部：根据主动型A股投资决策委员会制定的原则进行投资。

投资管理三部：主要负责固定收益产品的投资、研究工作。

量化投资部：基金的投资管理（包括指数基金、ETF及主动量化基金的管理）、量化投资策略和模型研究与开发、量化产品的设计和创新、为其他部门提供金融工程支持。

研究部：负责宏观策略、行业和公司研究。

市场营销部：负责营销策划、客户服务、市场推广、产品销售、销售渠道管理工作。

机构业务部：机构业务、特定客户资产管理业务（包括特定多个客户资产管理业务）产品营销、公募基金的高端客户直销、公司大客户服务与维护等工作。

产品开发部：负责新产品开发、现有产品管理、产品管理规划等工作。

境外投资部：负责公司QDII产品的投资、研究工作，并协助QDII产品的设计、发行等工作。

FOF投资管理部：负责基金中基金（FOF）及其他资产配置型投资管理业务，探索并开发各类资管领域的新型业务等。

交易管理部：负责公司所有产品的交易管理工作。

养老金业务部：负责企业年金业务的市场开发、客户维护和产品推广；负责全国社保基金和地方社保基金等养老金业务的市场开发、客户维护和产品推广。

风险管理部：负责公司风险管理体系的建设及风险监控工作。

运作保障部：负责公司基金的注册登记、资金清算、会计核算、估值。

信息技术部：负责信息系统规划、系统开发、维护及后台运作支持工作。

互联网金融部：负责线上业务，包括产品的线上直销、智能投顾、理财服务及金融科技创新。

投资银行部：负责公司的资本运作，以及与并购、融资等投资银行业务相关的一二级市场产品设计与实施。

公司办公室：负责公司董事会相关工作，负责文档、印鉴管理，公司品牌建设、市场调研以及其他行政工作。

人力资源部：负责人力资源规划、公司组织管理与发展等。

财务行政部：负责公司财务管理、会计核算，行政、后勤等相关工作。

深圳管理部：负责公司财务管理、会计核算、税务报送，与主管机关及相关单位的联络沟通，以及其他行政工作等。

监察稽核部：负责对公司各项业务进行合规性审查，对公司经营管理和基金运作的合规性进行检查并出具合规意见，处理日常法律事务、信息披露事务等。

战略发展部：以战略发展为导向，负责国内外资管行业新动向、行业政策、市场供求、竞争对手等的调查研究；负责拟定战略发展规划和实施方案供决策层讨论和决策；负责战略发展相关方案的落地及实施。

内部审计部：根据监管规范和公司要求，负责公司各项审计工作。

北京分公司：负责所辖区域内的行政管理。

青岛分公司：负责青岛地区市场业务及所辖区域内的行政管理。

上海分公司：负责上海地区市场业务及所辖区域内的行政管理。

信息披露负责人及咨询电话：杨文辉；010-58163096。

截至2019年9月30日，我公司共有员工474人，其中已通过高管资格培训和考试的共6人，已通过基金从业资格考试（含通过高管资格考试）的共445人。

### 3、本基金的基金经理

唐能先生：硕士学位，2009年9月加盟银华基金管理有限公司，曾任行业研究员、基金经理助理职务，自2015年5月25日起担任银华和谐主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理，自2018年12月27日起兼任银华瑞泰灵活配置混合型证券投资基金基金经

理，自2019年7月5日起兼任本基金基金经理。

## （二）基金托管人

### 1、基本情况

名称：招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”）

设立日期：1987年4月8日

注册地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦

办公地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦

注册资本：252.20亿元

法定代表人：李建红

行长：田惠宇

资产托管业务批准文号：证监基金字[2002]83号

电话：0755-83199084

传真：0755-83195201

资产托管部信息披露负责人：张燕

招商银行成立于1987年4月8日，是我国第一家完全由企业法人持股的股份制商业银行，总行设在深圳。自成立以来，招商银行先后进行了三次增资扩股，并于2002年3月成功地发行了15亿A股，4月9日在上交所挂牌（股票代码：600036），是国内第一家采用国际会计标准上市的公司。2006年9月又成功发行了22亿H股，9月22日在香港联交所挂牌交易（股票代码：3968），10月5日行使H股超额配售，共发行了24.2亿H股。截至2019年9月30日，集团总资产73,059.25亿元人民币，高级法下资本充足率15.44%，权重法下资本充足率12.86%。

2002年8月，招商银行成立基金托管部；2005年8月，经报中国证监会同意，更名为资产托管部，现下设业务管理团队、产品管理团队、项目管理团队、稽核监察团队、基金外包业务团队、养老金团队、系统与数据团队7个职能团队，现有员工87人。2002

年11月，经中国人民银行和中国证监会批准获得证券投资基金托管业务资格，成为国内第一家获得该项业务资格上市银行；2003年4月，正式办理基金托管业务。招商银行作为托管业务资质最全的商业银行，拥有证券投资基金托管、受托投资管理托管、合格境外机构投资者托管（QFII）、合格境内机构投资者托管（QDII）、全国社会保障基金托管、保险资金托管、企业年金基金托管、存托凭证试点存托人等业务资格。

招商银行确立“因势而变、先您所想”的托管理念和“财富所托、信守承诺”的托管核心价值，独创“6S托管银行”品牌体系，以“保护您的业务、保护您的财富”为历史使命，不断创新托管系统、服务和产品：在业内率先推出“网上托管银行系统”、托管业务综合系统和“6心”托管服务标准，首家发布私募基金绩效分析报告，开办国内首个托管银行网站，推出国内首个托管大数据平台，成功托管国内第一只券商集合资产管理计划、第一只FOF、第一只信托资金计划、第一只股权私募基金、第一家实现货币市场基金赎回资金T+1到账、第一只境外银行QDII基金、第一只红利ETF基金、第一只“1+N”基金专户理财、第一家大小非解禁资产、第一单TOT保管，实现从单一托管服务商向全面投资者服务机构的转变，得到了同业认可。

招商银行资产托管业务持续稳健发展，社会影响力不断提升，四度蝉联获《财资》“中国最佳托管专业银行”。2016年6月招商银行荣膺《财资》“中国最佳托管银行奖”，成为国内唯一获得该奖项的托管银行；“托管通”获得国内《银行家》2016中国金融创新“十佳金融产品创新奖”；7月荣膺2016年中国资产管理“金贝奖”“最佳资产托管银行”。2017年6月招商银行再度荣膺《财资》“中国最佳托管银行奖”；“全功能网上托管银行2.0”荣获《银行家》2017中国金融创新“十佳金融产品创新奖”；8月荣膺国际财经权威媒体《亚洲银行家》“中国年度托管银行奖”。2018年1月招商银行荣膺中央国债登记结算有限责任公司“2017年度优秀资产托管机构”奖项；同月，招商银行托管大数据平台风险管理系统荣获2016-2017年度银监会系统“金点子”方案一等奖，以及中央金融团工委、全国金融青联第五届“双提升”金点子方案二等奖；3月荣膺公募基

金20年“最佳基金托管银行”奖；5月荣膺国际财经权威媒体《亚洲银行家》“中国年度托管银行奖”；12月荣膺2018东方财富风云榜“2018年度最佳托管银行”、“20年最值得信赖托管银行”奖。2019年3月招商银行荣获《中国基金报》“2018年度最佳基金托管银行”奖；6月荣获《财资》“中国最佳托管机构”“中国最佳养老金托管机构”“中国最佳零售基金行政外包”三项大奖。

## 2、主要人员情况

李建红先生，招商银行董事长、非执行董事，2014年7月起担任招商银行董事、董事长。英国东伦敦大学工商管理硕士、吉林大学经济管理专业硕士，高级经济师。招商局集团有限公司董事长，兼任招商局国际有限公司董事会主席、招商局能源运输股份有限公司董事长、中国国际海运集装箱（集团）股份有限公司董事长、招商局华建公路投资有限公司董事长和招商局资本投资有限责任公司董事长。曾任中国远洋运输（集团）总公司总裁助理、总经济师、副总裁，招商局集团有限公司董事、总裁。

田惠宇先生，招商银行行长、执行董事，2013年5月起担任招商银行行长、招商银行执行董事。美国哥伦比亚大学公共管理硕士学位，高级经济师。曾于2003年7月至2013年5月历任上海银行副行长、中国建设银行上海市分行副行长、深圳市分行行长、中国建设银行零售业务总监兼北京市分行行长。

汪建中先生，招商银行副行长。1991年加入招商银行；2002年10月至2013年12月历任招商银行长沙分行行长，总行公司银行部副总经理，佛山分行筹备组组长，佛山分行行长，武汉分行行长；2013年12月至2016年10月任招商银行业务总监兼公司金融总部总裁，期间先后兼任公司金融综合管理部总经理、战略客户部总经理；2016年10月至2017年4月任招商银行业务总监兼北京分行行长；2017年4月起任招商银行党委委员兼北京分行行长。2019年4月起任招商银行副行长。

姜然女士，招商银行资产托管部总经理，大学本科毕业，具有基金托管人高级管理人员任职资格。先后供职于中国农业银行黑龙江省分行，华商银行，中国农业银行

深圳市分行，从事信贷管理、托管工作。2002年9月加盟招商银行至今，历任招商银行总行资产托管部经理、高级经理、总经理助理等职。是国内首家推出的网上托管银行的主要设计、开发者之一，具有20余年银行信贷及托管专业从业经验。在托管产品创新、服务流程优化、市场营销及客户关系管理等领域具有深入的研究和丰富的实务经验。

### 3、基金托管业务经营情况

截至2019年9月30日，招商银行股份有限公司累计托管510只证券投资基金。

#### （三）基金验资机构

名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

办公地址：上海市黄浦区湖滨路202号领展企业广场二座普华永道中心11楼

法定代表人：李丹

经办注册会计师：薛竞、周祎

电话：021-23238888

传真：021-23238800

联系人：周祎

## 六、基金合同摘要

### 一、基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、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人的利益；

(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、赎回和转换申请；

(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/期货所产生的权利；

(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/期货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、转托管等业务的规则；

(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/期货投资；

(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、基金份额净值，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》及其他有关法律法规或监管机构另有规定或要求外，在基金信息公开披露前应予保密，不向他人泄露，因审计、法律等外部专业顾问提供服务而向其提供的情况除外；

(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人提供的各项文件或资料在规定时间发出，并且保证投资人能够按照《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（税后）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人的利益；

(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》及其他有关法律法规或监管机构另有规定或要求外，在基金信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露，因审计、法律等外部专业顾问提供服务而向其提供的情况除外；

(8) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额申购、赎回价格；

- (9) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项;
- (10) 对基金财务会计报告、季度、半年度和年度基金报告出具意见,说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照《基金合同》的规定进行;如果基金管理人未执行《基金合同》规定的行为,还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施;
- (11) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料 15 年以上;
- (12) 建立并保存基金份额持有人名册;
- (13) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对;
- (14) 依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项;
- (15) 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和义务

基金投资人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，基金投资人自依据《基金合同》取得基金份额，即成为本基金的基金份额持有人和《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）依照法律法规及本基金合同的规定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) 缴纳基金认购、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。

本基金基金份额持有人大会不设日常机构。

若将来法律法规对基金份额持有人大会另有规定的，以届时有效的法律法规为准。

### (一) 召开事由

1、除法律法规、中国证监会另有规定或基金合同另有约定外，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（不包括本基金封闭运作期届满依据基金合同约定转为上市开放式基金（LOF））；
- (5) 调整基金管理人、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) 终止基金上市,但因基金不再具备上市条件而被上海证券交易所终止上市  
的除外;
- (10) 变更基金份额持有人大会程序;
- (11) 基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会;
- (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) 对基金合同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,当出现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) 法律法规要求增加的基金费用的收取;
- (2) 调整本基金的申购费率,变更收费方式,调低赎回费率或除基金管理费、  
基金托管费之外的其他应由基金承担的费用;
- (3) 因相应的法律法规、上海证券交易所或登记机构的相关业务规则发生变动  
而应当对《基金合同》进行修改;
- (4) 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;
- (5) 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集时，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、表决意见提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有关证明文件、受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的有关证明文件及委托人的代理投票授权委托证明及有关证明文件符合法律法规、《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二分之一（含二分之一）。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二分之一，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。通讯开会系指按照本基金合同的相关规定以召集人通知的非现场方式（包括邮寄、网络、电话、短信或其他方式）进行表决，基金份额持有人将其对表决事项的投票以召集人通知载明的非现场方式在表决截止日以前送达至召集人指定的地址或系统。

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表决意见;基金托管人或基金管理人经通知不参加收取表决意见的,不影响表决效力;

(3)本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的,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二分之一(含二分之一);若本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的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二分之一,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)基金份额的基金份额持有人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见;

(4)上述第(3)项中直接出具表决意见的基金份额持有人或受托代表他人出具表决意见的代理人,同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具表决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、在法律法规或监管机构允许的情况下,经会议通知载明,本基金亦可采用其他非现场方式或者以现场方式与非现场方式相结合的方式召开基金份额持有人大会,会议程序比照现场开会和通讯方式开会的程序进行。

4、基金份额持有人授权他人代为出席会议并表决的,在法律法规或监管机构允许的情况下,授权方式可以采用书面、网络、电话、短信或其他方式,召集人接受的具体授权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。

基金管理人、基金托管人、单独或合并持有权益登记日基金总份额 10%（含 10%）以上的基金份额持有人可以在基金份额持有人大会召集人发出会议通知前向大会召集人提交需由基金份额持有人大会审议表决的提案；也可以在会议通知发出后向大会召集人提交临时提案。

基金份额持有人大会的召集人发出召集会议的通知后，如果需要对原有提案进行修改，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。

召集人对于基金管理人、基金托管人和基金份额持有人提交的临时提案进行审核，符合条件的应当在大会召开日 30 天前公告。大会召集人应当按照以下原则对提案进行审核：

（1）关联性。大会召集人对于提案涉及事项与基金有直接关系，并且不超出法律法规和基金合同规定的基金份额持有人大会职权范围的，应提交大会审议；对于不符合上述要求的，不提交基金份额持有人大会审议。如果召集人决定不将基金份额持有人提案提交大会表决，应当在该次基金份额持有人大会上进行解释和说明。

（2）程序性。大会召集人可以对提案涉及的程序性问题做出决定。如将提案进行分拆或合并表决，需征得原提案人同意；原提案人不同意变更的，大会主持人可就程序性问题提请基金份额持有人大会做出决定，并按照基金份额持有人大会决定的程序进行审议。

## 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规定程序宣布会议议事程序及注

意事项，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二分之一以上（含二分之一）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二分之一以上（含二分之一）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。除基金合同另有约定外，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，除非在计票时监督员及公证机关均认为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人身份文件的表决视为有效出席的投资人，表面符合会议通知规定的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，但应当计入出具表决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。

在上述规则的前提下，具体规则以召集人发布的基金份额持有人大会通知为准。

#### （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和代理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异议，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依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。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。

## 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、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，投资人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；若基金份额持有人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；红利再投资方式免收再投资的费用；

本基金场内收益分配方式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；

2、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

3、每一基金份额享有同等分配权；

4、法律法规或监管机构另有规定的，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不利影响的前提下，基金管理人可在法律法规允许的前提下，按照监管部门要求履行适当程序并与基金托管人协商一致后，酌情调整以上基金收益分配原则，并于变更实施日前在指定媒介上公告，且不需召开基金份额持有人大会。

本基金每次收益分配比例详见届时基金管理人发布的公告。

#### （四）收益分配方案

基金收益分配方案中应载明截至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，依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告并报中国证监会备案。

#### （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基金份额持有人自行承担。对于场外份额，当基金份额持有人的现金红利小于一定金额，不足以支付银行

转账或其他手续费用时，基金登记机构可将该基金份额持有人的现金红利转为基金份额。红利再投资的计算方法，依照登记机构相关业务规则执行。对于场内份额，现金分红的计算方法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。

#### 四、与基金财产管理、运用的提取、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、审计费、律师费和诉讼费、仲裁费等法律费用；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金的证券/期货交易结算费用；
- 7、基金的银行汇划费用；
- 8、基金投资相关的开户及维护费用；
- 9、基金的上市初费及上市月费；
- 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。

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 1.50% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

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，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 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、休息日等，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% 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，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

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）基金管理费和基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率和基金托管费率，此项调整需要基金份额持有人大会决议通过。基金管理人必须依照有关规定于新的费率实施日前在指定媒介上刊登公告。

#### （五）基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。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

封闭运作期内，本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（包含科创板股票、中小板股票、创业板股票及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、债券（包含国债、地方政府债券、金融债、企业（公司）债、公开发行的次级债、可转换债券（含分离交易可转债的纯债部分）、可交换债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据以及其他中国证监会允许投资的债券）、债券回购、资产支持证券、货币市场工具、同业存单、银行存款（包含定期存款、协议存款及其他银行存款）、股指期货、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）。

封闭运作期届满转为上市开放式基金（LOF）后，本基金投资于国内依法发行上市的股票（包含科创板、中小板股票、创业板股票及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、港股通标的股票、债券（包含国债、地方政府债券、金融债、企业（公司）债、公开发行的次级债、可转换债券（含分离交易可转债的纯债部分）、可交换债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据以及其他中国证监会允许投资的债券）、债券回购、资产支持证券、货币市场工具、同业存单、银行存款（包

含定期存款、协议存款及其他银行存款)、股指期货、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于其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，其投资比例遵循届时有效的法律法规和相关规定。

本基金的投资组合比例为：封闭运作期内，股票资产占基金资产的 0%-100%。其中，股票投资需符合科技创新产业及子行业的定位要求，且投资于科技创新主题的证券资产合计不低于非现金基金资产的 80%。股票投资部分可以以战略配售方式进行投资。在封闭运作期内，每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债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。前述现金资产不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。封闭运作期届满转为上市开放式基金（LOF）后，股票资产占基金资产的 0%-95%，其中投资于港股通标的股票占股票资产的比例不超过 50%，股票投资需符合科技创新产业及子行业的定位要求，且投资于科技创新主题的证券资产合计不低于非现金基金资产的 80%。本基金每个交易日日终，在扣除国债期货和股指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%的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。

如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，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

封闭运作期内本基金的投资组合应遵循以下限制：

（1）封闭运作期内，本基金股票资产投资比例为基金资产的 0%—100%，其中，股票投资需符合科技创新产业及子行业的定位要求，且投资于科技创新主题的证券资产合计不低于非现金基金资产的 80%；

(2) 在封闭运作期内，每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债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。前述现金资产不包括结算备付金、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；

(6) 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%；

(7) 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；

(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) 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%，债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；

(14) 本基金在封闭运作期内总资产不得超过基金净资产的 200%；

(15) 本基金参与股指期货交易，需遵守下列投资比例限制：

1) 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%；

2) 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%；

3) 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；

4) 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) 本基金参与国债期货交易，需遵守下列投资比例限制：

1) 本基金在任何交易日日终，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) 本基金在任何交易日日终，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%；

4) 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）应当符合本基金合同关于债券投资比例的有关约定；

(17) 封闭运作期内，本基金参与股指期货或国债期货交易，在每个交易日日终，本基金持有的买入股指期货和国债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%；其中，有价证券指股票、债券（不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;

(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。

除上述第(2)、(5)、(12)项另有约定外,因证券/期货市场波动、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,但中国证监会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本基金合同生效之日起开始。

如果法律法规或监管部门对上述投资组合比例限制进行变更的,本基金在履行适当程序后,可相应调整投资比例限制规定。

法律法规或监管部门取消上述限制,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。

封闭运作期届满转为上市开放式基金(LOF)后,本基金的投资组合应遵循以下限制:

(1) 股票资产占基金资产的0%-95%,其中投资于港股通标的股票的比例占股票资产的0%-50%,股票投资需符合科技创新产业及子行业的定位要求,且投资于科技创新主题证券资产合计不低于非现金基金资产的80%;

(2) 每个交易日日终,在扣除国债期货和股指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%的现金或到期日在一年以内的政府债券,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(同一家公司在内地和香港同时上市的A+H股合计计算),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(同一家公司在内

地和香港同时上市的 A+H 股合计计算), 不超过该证券的 10%;

(5) 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%;

(6) 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%;

(7) 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%;

(8) 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%;

(9) 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%;

(10) 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;

(11) 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;

(12) 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;

(13) 本基金参与股指期货, 遵循以下中国证监会规定的投资限制:

1) 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%;

2) 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%；

3) 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；

4) 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%；

（14）本基金参与国债期货交易，需遵守下列投资比例限制：

1) 本基金在任何交易日日终，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) 本基金在任何交易日日终，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%；

4) 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）应当符合本基金合同关于债券投资比例的有关约定；

（15）在每个交易日日终，本基金持有的买入国债期货和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；

（16）本基金基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%；

（17）本基金投资流通受限证券，基金管理人应根据中国证监会相关规定与基金托管人在基金托管协议中明确基金投资流通受限证券的比例，根据比例进行投资。基金管理人应制订严格的投资决策流程和风险控制制度，防范流动性风险、法律风险和操作风险等各种风险。

(18) 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该比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

(19) 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；

(20) 法律法规及中国证监会规定和基金合同约定的其他投资比例限制。

除上述第(2)、(10)、(18)、(19)项外，因证券/期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动或港股通额度已满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，但中国证监会规定的特殊情形除外。

基金管理人应当自转型之日起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。

如果法律法规或监管部门对上述投资组合比例限制进行变更的，本基金在履行适当程序后，可相应调整投资比例限制规定。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，本基金在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制。

## 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，但是法律法规或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其他重大利害关系的公司发行的证券或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限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制或以变更后的规定为准。

#### 六、基金财产净值的计算方法和公告方式

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

基金合同生效后，在封闭期内，在基金份额上市交易前，基金管理人应当至少每周公告一次基金份额净值和基金份额累计净值。

基金份额上市交易后，基金管理人应当在每个交易日的次日，通过其网站、基金份额销售网点以及其他媒介，披露基金份额净值和基金份额累计净值。

在开放期内，基金管理人应当在每个开放日的次日，通过其网站、基金份额销售网点以及其他媒介，披露开放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。

封闭运作期届满转为上市开放式基金（LOF）后，在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当在每个开放日的次日，通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介，披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。

#### 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基金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的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，并自决议生效后依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。若法律法规发生变化，则以变化后的规定为准。

### （二）基金合同的终止事由

有下列情形之一的，并在履行相关程序后，《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：《基金合同》终止事由出现后，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、具有从事证券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、在基金财产清算过程中，基金管理人和基金托管人应各自履行职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同和托管协议规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

4、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。

5、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。

6、基金财产清算的期限为 6 个月。

基金管理人应在 6 个月内办理基金财产的清算事宜，基金财产清算小组可根据基金财产的情况确定清算期限；在特殊情况下，若截至清算期限届满日，本基金仍持有流通受限证券的（包括但不限于未到期回购等），基金管理人可在该等证券可流通后进行二次清算。本基金的清算期限自动顺延至全部基金财产清算完毕之日。

(四) 清算费用

清算费用是指基金财产清算小组在进行基金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，律师事务所出具法律意见书后，由基金财产清算小组报中国证监会备案并公告。

#### （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，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，仲裁地点为北京市，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力。除非仲裁裁决另有规定，仲裁费用由败诉方承担。

争议处理期间，当事人应恪守基职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行《基金合同》和托管协议规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

《基金合同》受中国法律（为本基金合同之目的，不包括香港特别行政区、澳门特别行政区和台湾地区法律）管辖，并按其解释。

#### 九、基金合同存放地和投资人取得基金合同的方式

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

## 七、基金财务状况

本基金募集期间发生的信息披露费、会计师费、律师费及其他费用由基金管理人承担，不从基金财产列支。

本基金基金合同生效后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。

本基金 2019 年 12 月 30 日资产负债表（未经审计）如下：

银华科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金	
2019 年 12 月 30 日资产负债表	
(除特别注明外，金额单位为人民币元)	
<b>资产</b>	
银行存款	112,901,018.24
结算备付金	9,597,155.58
存出保证金	309,450.54
交易性金融资产	995,468,594.47
其中：股票投资	995,468,594.47
债券投资	
资产支持证券投资	
衍生金融资产	
买入返售金融资产	
应收证券清算款	
应收股利	
应收利息	28,901.29
应收申购款	
其他资产	

<b>资产总计</b>	<b>1, 118, 305, 120. 12</b>
<b>负债及所有者权益</b>	
<b>负债</b>	
应付证券清算款	14, 602, 963. 45
应付管理人报酬	1, 328, 809. 89
应付托管费	221, 468. 31
应付交易费用	894, 333. 99
应付税费	
应付赎回款	
其他负债	79, 554. 76
<b>负债合计</b>	<b>17, 127, 130. 40</b>
<b>所有者权益</b>	
实收基金	989, 735, 564. 40
未分配利润	111, 442, 425. 32
<b>所有者权益合计</b>	<b>1, 101, 177, 989. 72</b>
<b>负债及所有者权益总计</b>	
<b>负债及所有者权益总计</b>	<b>1, 118, 305, 120. 12</b>
截至 2019 年 12 月 30 日，银华科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金的基金份额净值为 1. 1126 元。	

## 八、基金投资组合

截至公告前两个工作日即 2019 年 12 月 30 日，银华科创主题 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）基金资产组合情况

资产类别	金额（元）	占基金总资产的比例
股票	995,468,594.47	89.02%
债券		
权证		
资产支持证券		
买入返售金融资产		
银行存款和清算备付金合计	122,498,173.82	10.95%
应收申购款		
其他资产	338,351.83	0.03%
<b>合计</b>	<b>1,118,305,120.12</b>	<b>100.00%</b>

注：由于四舍五入的原因，“占基金总资产的比例”分项之和与合计可能有尾差。

### （二）按行业分类的股票投资组合

序号	行业分类	股票市值（元）	市值占基金资产净值比例
A	农、林、牧、渔业	10,945,644.64	0.99%
B	采矿业		
C	制造业	483,259,524.63	43.89%
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,987,241.74	0.18%
E	建筑业		
F	批发和零售业	13,057,250.00	1.19%
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	321,043,159.63	29.15%
J	金融业	1,370,948.70	0.12%
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	21,558,549.69	1.96%
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	15,675,498.00	1.42%
Q	卫生和社会工作	25,356,806.50	2.30%
R	文化、体育和娱乐业	101,213,970.94	9.19%
S	综合		
	合计	995,468,594.47	90.40%

(三) 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	期末市值(元)	占基金资产净值比例
1	002410	广联达	2,287,550	76,198,290.50	6.92%
2	000661	长春高新	118,227	51,533,967.03	4.68%
3	600570	恒生电子	559,445	43,306,637.45	3.93%
4	002624	完美世界	957,715	42,091,574.25	3.82%
5	000651	格力电器	633,000	41,512,140.00	3.77%
6	603444	吉比特	125,200	37,866,740.00	3.44%
7	300357	我武生物	748,937	32,331,610.29	2.94%
8	002555	三七互娱	1,201,720	32,266,182.00	2.93%
9	300413	芒果超媒	831,625	28,890,652.50	2.62%
10	300433	蓝思科技	2,033,922	28,047,784.38	2.55%

(四) 期末按债券品种分类的债券投资组合

2019年12月30日,本基金未持有债券。

(五) 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

2019年12月30日,本基金未持有债券。

(六) 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  
投资明细

2019年12月30日,本基金未持有资产支持证券。

(七) 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

2019年12月30日,本基金未持有权证。

(八) 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

2019年12月30日,本基金本报告期末未持有股指期货。

2019年12月30日,本基金本报告期内未进行股指期货交易。

(九) 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在本报告期内没有出现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、自基金合同生效日至 2019 年 12 月 30 日，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、其他资产构成如下：

序号	其他资产	金额（元）
1	存出保证金	309,450.54
2	应收证券清算款	
3	应收股利	
4	应收利息	28,901.29
5	应收申购款	
6	其它应收款	
7	待摊费用	
8	其它	
合计		338,351.83

4、报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

2019 年 12 月 30 日，本基金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

2019 年 12 月 30 日，本基金投资的前十名股票中不存在流通受限情况。

## 九、重大事件揭示

本基金自合同生效至本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

本基金管理人就本基金上市交易之后履行管理人职责做出如下承诺：

（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、上海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

基金托管人就基金上市交易后履行托管人职责做出承诺：

（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，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

本基金上市推荐人就基金上市交易事宜出具意见如下：

（一）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；

（二）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、备查文件目录

下列文件存放在本基金管理人和托管人的办公场所，投资者可在办公时间免费查阅；也可按工本费购买本基金合同复制件或复印件，但应以基金合同正本为准。

（一）中国证监会关于准予银华科创主题3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金注册的批复文件；

（二）《银华科创主题3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；

（三）《银华科创主题3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》；

（四）《银华科创主题3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；

（五）《关于申请募集银华科创主题3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金之法律意见书》；

（六）基金管理人业务资格批件、营业执照；

（七）基金托管人业务资格批件、营业执照；

（八）中国证监会要求的其他文件。

银华基金管理股份有限公司

2020年1月2日