

# 中融创业板两年定期开放混合型证券投资基金 上市交易公告书

基金管理人：中融基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

基金登记结算机构：中国证券登记结算有限责任公司

上市地点：深圳证券交易所

上市日期：2021年2月26日

公告日期：2021年2月23日

## 目录

一、重要声明与提示.....	3
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.....	7
五、基金主要当事人简介.....	8
六、基金合同摘要.....	13
七、基金财务状况.....	13
八、基金投资组合.....	14
九、重大事件揭示.....	19
十、基金管理人承诺.....	19
十一、基金托管人承诺.....	19
十二、基金上市推荐人意见.....	20
十三、备查文件目录.....	20
附件：基金合同摘要.....	21

## 一、重要声明与提示

《中融创业板两年定期开放混合型证券投资基金上市交易公告书》（以下简称“本公告”）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《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制，中融创业板两年定期开放混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）管理人中融基金管理有限公司（以下简称“本基金管理人”或“本公司”）的董事会及董事保证本公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。

本基金托管人交通银行股份有限公司保证本公告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”）、深圳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。

凡本公告未涉及的有关内容，请投资者详细查阅刊登在中国证监会指定媒介和中融基金管理有限公司网站（[www.zrfunds.com.cn](http://www.zrfunds.com.cn)）上的本基金的基金合同、招募说明书等法律文件。

## 二、基金概览

- 1、基金名称：中融创业板两年定期开放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、定期开放式
- 4、基金场内简称：中融创业
- 5、基金代码：168207
- 6、基金份额总额：截至2021年2月19日，本基金总份额为362,219,754.23份
- 7、基金份额净值：截至2021年2月19日，本基金基金份额净值为1.1612元
- 8、本次上市交易份额：209,003,206.00份（截至2021年2月19日）

9、上市交易的证券交易所：深圳证券交易所

10、上市交易日期：2021年2月26日

11、基金管理人：中融基金管理有限公司

12、基金托管人：交通银行股份有限公司

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

14、基金份额的申购与赎回：本基金的申购与赎回将通过销售机构进行。

投资者办理基金份额场外申购和赎回业务的场所为基金管理人直销机构和基金管理人委托的其他销售机构的销售网点（具体包括交通银行股份有限公司、平安银行股份有限公司、江苏银行股份有限公司、五矿证券有限公司、中泰证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、东北证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、中信证券（山东）有限责任公司、中信建投证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、太平洋证券股份有限公司、国金证券股份有限公司、华西证券股份有限公司、申万宏源证券有限公司、平安证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、信达证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、长江证券股份有限公司、安信证券股份有限公司、方正证券股份有限公司、粤开证券股份有限公司、东方财富证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、国都证券股份有限公司、民生证券股份有限公司、东莞证券股份有限公司、大同证券有限责任公司、万联证券股份有限公司、申万宏源西部证券有限公司、恒泰证券股份有限公司、中山证券有限责任公司、华安证券股份有限公司、中银国际证券股份有限公司、中信证券华南股份有限公司、中航证券有限公司、国盛证券有限责任公司、北京植信基金销售有限公司、北京唐鼎耀华基金销售有限公司、北京晟视天下基金销售有限公司、北京恒天明泽基金销售有限公司、浦领基金销售有限公司、深圳众禄基金销售股份有限公司、上海好买基金销售有限公司、蚂蚁（杭州）基金销售有限公司、上海天天基金销售有限公司、北京钱景基金销售有限公司、浙江同花顺基金销售有限公司、诺亚正行基金销售有限公司、上海陆金所基金销售有限公司、深圳市新兰德证券投资咨询有限公司、上海长量基金销售有限公司、奕丰基金销售有限公司、北京新浪仓石基金销售有限公司、北京展恒基金销售股份有限公司、一路财富（北京）基金销售有限公司、上海利得基金销售有限公司、深圳富济基金销售有限公司、北京广源达信基金销售有限

公司、上海联泰基金销售有限公司、上海万得基金销售有限公司、北京汇成基金销售有限公司、深圳市金斧子基金销售有限公司、京东肯特瑞基金销售有限公司、万家财富基金销售（天津）有限公司、和讯信息科技有限公司、上海基煜基金销售有限公司、凤凰金信（海口）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、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、北京格上富信基金销售有限公司、厦门市鑫鼎盛控股有限公司、中证金牛（北京）投资咨询有限公司、济安财富（北京）基金销售有限公司、嘉实财富管理有限公司、宜信普泽（北京）基金销售有限公司、民商基金销售（上海）有限公司、大连网金基金销售有限公司、江苏汇林保大基金销售有限公司、北京度小满基金销售有限公司、中信期货有限公司、阳光人寿保险股份有限公司（排序不分先后）。

本基金场内销售机构为深圳证券交易所内具有基金销售业务资格并经深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的会员单位。

### 三、基金的募集与上市交易

#### （一）上市前基金募集情况

1、基金募集申请的核准机构和核准文号：中国证监会证监许可〔2020〕1372号

2、基金合同生效日：2020年8月21日

3、基金运作方式：契约型、定期开放式

4、基金合同期限：不定期

5、发售日期：自2020年7月23日至2020年8月14日

6、发售价格：人民币1.00元

7、发售方式：本基金通过场外及场内两种方式公开发售。场外通过基金销售机构（包括基金管理人的直销机构及其他销售机构）公开发售。场内通过深圳证券交易所内具有基金销售业务资格并经深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的会员单位发售

8、发售机构：详见本基金管理人于2020年7月18日发布于《上海证券报》、中融基金管理有限公司官方网站([www.zrfunds.com.cn](http://www.zrfunds.com.cn))及中国证监会基金电子披

露网站（<http://eid.csrc.gov.cn/fund>）的《中融创业板两年定期开放混合型证券投资基金基金份额发售公告》

9、验资机构名称：上会会计师事务所（特殊普通合伙）

10、募集资金总额及入账情况

中融创业板两年定期开放混合型证券投资基金于 2020 年 7 月 23 日起公开募集，基金募集工作已于 2020 年 8 月 14 日结束。

本次募集期间净认购金额总额为 362,120.755.74 元人民币，有效认购款项在募集期间产生的利息共计 100,545.51 元人民币。募集资金已于 2020 年 8 月 19 日划入本基金在基金托管人交通银行股份有限公司开立的基金托管专户。

11、本基金募集备案情况

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》以及《中融创业板两年定期开放混合型证券投资基金基金合同》、《中融创业板两年定期开放混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金募集符合有关条件，本基金管理人已向中国证监会办理基金备案手续，并于 2020 年 8 月 21 日获书面确认，基金合同自该日起正式生效。自基金合同生效之日起，本基金管理人开始正式管理本基金。

（二）本基金上市交易的主要内容

1、基金上市交易的核准机构和核准文号：深圳证券交易所深证上【2021】193 号

2、上市交易日期：2021 年 2 月 26 日

3、上市交易的证券交易所：深圳证券交易所

4、上市交易份额场内简称：中融创业

5、交易代码：168207

6、本次上市交易份额：209,003,206.00 份（截至 2021 年 2 月 19 日）

7、基金净值的披露：在基金上市交易或开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当在不晚于每个开放日的次日，通过规定网站、基金销售机构网站或者营业网点披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值，并在深圳证券交易所行情发布系统揭示基金份额净值。

8、未上市交易份额的流通规定：未上市交易的基金份额托管在场外，基金份额持有人在符合相关办理条件的前提下，将其跨系统转托管至深圳证券交易所

场内后即可上市流通。

9、本基金开通跨系统转托管业务日期：2021年2月26日，具体业务按照中国证券登记结算有限责任公司的相关规定办理。

#### 四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人

##### （一）持有人户数

截至2021年2月19日，本基金持有人户数为6,937户，平均每户持有的基金份额为52,215.62份。其中场内基金份额持有人户数为2,981户，平均每户持有的基金份额为70,111.78份。

##### （二）持有人结构

1、截至2021年2月19日，个人投资者持有的本次上市交易的场内基金份额为148,987,436.00份，占本次基金份额上市交易基金份额比例为71.28%。机构投资者持有的本次上市交易的场内基金份额为60,015,770.00份，占本次基金份额上市交易基金份额比例为28.72%。

2、截至2021年2月19日，本基金管理人的从业人员持有本基金基金份额数量为1,171,653.87份，占基金总份额比例为0.3235%。本基金管理人的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金基金份额总量的数量区间为100万份以上。本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为0。

##### （三）截至2021年2月19日，前十名场内基金份额持有人情况

序号	持有人名称（全称）	持有基金份额	占场内基金份额的比例（%）
1	中融基金—银河证券—中融基金—优选配置1号资产管理计划	50,003,575.00	23.92%
2	财达证券股份有限公司	10,001,194.00	4.79%
3	王婷	3,000,058.00	1.44%
4	崔德娟	2,000,097.00	0.96%
5	曾子嘉	1,050,051.00	0.50%
6	王国爱	1,000,136.00	0.48%

7	李阿扁	1,000,136.00	0.48%
8	刘韬	1,000,126.00	0.48%
9	叶远辉	1,000,126.00	0.48%
10	杨东	1,000,087.00	0.48%
合计		71,055,586.00	34.01%

注：以上信息依据中国证券登记结算有限公司提供的持有人信息编制。

## 五、基金主要当事人简介

### （一）基金管理人

- 1、名称：中融基金管理有限公司
- 2、法定代表人：王瑶
- 3、总裁：黄震
- 4、注册资本：人民币 7.5 亿元
- 5、注册地址：深圳市福田区福田街道岗厦社区金田路 3088 号中洲大厦 3202、3203B
- 6、设立批准文号：中国证监会证监许可〔2013〕667 号
- 7、工商登记注册的法人营业执照文号：914403007178853609
- 8、经营范围：基金募集、基金销售、特定客户资产管理、资产管理和中国证监会许可的其他业务。（依法须经批准的项目，经相关部门批准后方可开展经营活动）
- 9、股权结构：中融国际信托有限公司占注册资本的 51%，上海融晟投资有限公司占注册资本的 49%
- 10、信息披露负责人：周妹云
- 11、客户服务电话：010-56517299、400-160-6000
- 12、公司组织结构与人员情况

公司目前下设部门共计二十六个，分别为：权益投资部、固收投资部、量化投资部、指数投资部、策略投资部、研究部、信评部、权益交易部、固收交易部、渠道管理总部、市场服务部、机构部、北方营销中心、华东营销中心、华南营销中心、互联网金融部、产品开发部、金融科技部、基金运营部、信息技术部、法



律合规部、风险管理部、人力资源部、总裁办公室（董事会办公室）、财务部、企划部。同时，公司在北京设立了一家分公司，并拥有一家子公司，即中融（北京）资产管理有限公司。

截至 2021 年 2 月 19 日，我公司共有员工 180 人（含借调人员），大学本科及以上学历 171 名，占员工总数 95%。

### 13、基金管理业务情况简介：

截至 2021 年 2 月 19 日，本公司已成立公募产品数量为 63 只。

序号	产品名称	类型
1	中融货币市场基金	货币型
2	中融国企改革灵活配置混合型证券投资基金	混合型
3	中融融安灵活配置混合型证券投资基金	混合型
4	中融新机遇灵活配置混合型证券投资基金	混合型
5	中融中证银行指数证券投资基金（LOF）	股票型
6	中融鑫起点灵活配置混合型证券投资基金	混合型
7	中融国证钢铁行业指数型证券投资基金	股票型
8	中融中证煤炭指数型证券投资基金	股票型
9	中融融安二号灵活配置混合型证券投资基金	混合型
10	中融稳健添利债券型证券投资基金	债券型
11	中融新经济灵活配置混合型证券投资基金	混合型
12	中融日日盈交易型货币市场基金	货币型
13	中融产业升级灵活配置混合型证券投资基金	混合型
14	中融融裕双利债券型证券投资基金	债券型
15	中融竞争优势股票型证券投资基金	股票型
16	中融融信双盈债券型证券投资基金	债券型
17	中融现金增利货币市场基金	货币型
18	中融上海清算所银行间 1-3 年高等级信用债指数发起式证券投资基金	债券型
19	中融上海清算所银行间 1-3 年中高等级信用债指数发起式证券投资基金	债券型
20	中融恒泰纯债债券型证券投资基金	债券型
21	中融鑫思路灵活配置混合型证券投资基金	混合型
22	中融物联网主题灵活配置混合型证券投资基金	混合型
23	中融量化智选混合型证券投资基金	混合型
24	中融盈泽中短债债券型证券投资基金	债券型

25	中融恒信纯债债券型证券投资基金	债券型
26	中融睿祥纯债债券型证券投资基金	债券型
27	中融核心成长灵活配置混合型证券投资基金	混合型
28	中融沪港深大消费主题灵活配置混合型发起式证券投资基金	混合型
29	中融鑫价值灵活配置混合型证券投资基金	混合型
30	中融聚商 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金	债券型
31	中融季季红定期开放债券型证券投资基金	债券型
32	中融智选红利股票型证券投资基金	股票型
33	中融聚安 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金	债券型
34	中融量化精选混合型基金中基金（FOF）	混合型基金 中基金
35	中融医疗健康精选混合型证券投资基金	混合型
36	中融聚业 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金	债券型
37	中融恒裕纯债债券型证券投资基金	债券型
38	中融聚明 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金	债券型
39	中融恒惠纯债债券型证券投资基金	债券型
40	中融央视财经 50 交易型开放式指数证券投资基金	股票型
41	中融央视财经 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	股票型
42	中融策略优选混合型证券投资基金	混合型
43	中融聚汇 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金	债券型
44	中融恒鑫纯债债券型证券投资基金	债券型
45	中融高股息精选混合型证券投资基金	混合型
46	中融睿享 86 个月定期开放债券型证券投资基金	债券型
47	中融中证 500 交易型开放式指数证券投资基金	股票型
48	中融聚通 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金	债券型
49	中融睿嘉 39 个月定期开放债券型证券投资基金	债券型
50	中融中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	股票型
51	中融恒安纯债债券型证券投资基金	债券型
52	中融智选对冲策略 3 个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金	混合型
53	中融品牌优选混合型证券投资基金	混合型
54	中融中债 1-5 年国开行债券指数证券投资基金	债券型
55	中融聚锦一年定期开放债券型发起式证券投资基金	债券型
56	中融融慧双欣一年定期开放债券型证券投资基金	债券型

57	中融价值成长 6 个月持有期混合型证券投资基金	混合型
58	中融创业板两年定期开放混合型证券投资基金	混合型
59	中融成长优选混合型证券投资基金	混合型
60	中融景瑞一年持有期混合型证券投资基金	混合型
61	中融产业趋势一年定期开放混合型证券投资基金	混合型
62	中融景颐 6 个月持有期混合型证券投资基金	混合型
63	中融行业先锋 6 个月持有期混合型证券投资基金	混合型

#### 14、本基金基金经理简介

甘传琦先生，中国国籍，毕业于北京大学金融学专业，硕士研究生学历，具有基金从业资格。2010 年 7 月至 2017 年 3 月曾任博时基金管理有限公司基金经理助理。2017 年 4 月加入中融基金管理有限公司，现任权益投资部副总经理。现任中融产业升级灵活配置混合型证券投资基金（2017 年 6 月起至今）、中融医疗健康精选混合型证券投资基金（2018 年 9 月至 2020 年 9 月）、中融沪港深大消费主题灵活配置混合型发起式证券投资基金（2018 年 2 月至 2020 年 9 月）、中融强国制造灵活配置混合型证券投资基金（2018 年 2 月至 2019 年 1 月）、中融新经济灵活配置混合型证券投资基金（2020 年 3 月起至今）、中融创业板两年定期开放混合型证券投资基金（2020 年 8 月起至今）、中融成长优选混合型证券投资基金（2020 年 11 月起至今）、中融产业趋势一年定期开放混合型证券投资基金（2020 年 12 月起至今）、中融成长优选混合型证券投资基金（2020 年 11 月起至今）、中融行业先锋 6 个月持有期混合型证券投资基金（2021 年 2 月起至今）的基金经理。

#### （二）基金托管人

##### 1、基本情况

名称：交通银行股份有限公司（简称“交通银行”）

住所：中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 号

办公地址：上海市长宁区仙霞路 18 号

注册时间：1987 年 3 月 30 日

法定代表人：任德奇

注册资本：742.63 亿元

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[1998]25 号

联系人：陆志俊

交通银行客服电话：95559

## 2、基金托管部门及主要人员情况

交通银行始建于 1908 年，是中国历史最悠久的银行之一，也是近代中国的发钞行之一。1987 年重新组建后的交通银行正式对外营业，成为中国第一家全国性的国有股份制商业银行，总部设在上海。2005 年 6 月交通银行在香港联合交易所挂牌上市，2007 年 5 月在上海证券交易所挂牌上市。交通银行连续 12 年跻身《财富》(FORTUNE)世界 500 强，营业收入排名第 162 位；列《银行家》(TheBanker)杂志全球千家大银行一级资本排名第 11 位。

截至 2020 年 9 月 30 日，交通银行资产总额为人民币 10.80 万亿元。2020 年 1-9 月，交通银行实现净利润(归属于母公司股东)人民币 527.12 亿元。

交通银行总行设资产托管部(下文简称“托管部”)。现有员工具有多年基金、证券和银行的从业经验，具备基金从业资格，以及经济师、会计师、工程师和律师等中高级专业技术职称，员工的学历层次较高，专业分布合理，职业技能优良，职业道德素质过硬，是一支诚实勤勉、积极进取、开拓创新、奋发向上的资产托管从业人员队伍。

## 3、基金托管业务经营情况

截至 2020 年 9 月 30 日，交通银行共托管证券投资基金 500 只。此外，交通银行还托管了基金公司特定客户资产管理计划、证券公司客户资产管理计划、银行理财产品、信托计划、私募投资基金、保险资金、全国社保基金、养老保障管理基金、企业年金基金、职业年金基金、QFII 证券投资资产、RQFII 证券投资资产、QDII 证券投资资产、RQDII 证券投资资产、QDIE 资金、QDLP 资金和 QFLP 资金等产品。

### (三) 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

办公地址：北京市西城区太平桥大街17号

法人代表：周明

联系人：赵亦清

电话：010-50938782

传真：010-50938828

(四) 验资机构

名称：上会会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：上海市静安区威海路 755 号文新报业大厦 25 楼

办公地址：上海市静安区威海路 755 号文新报业大厦 25 楼

执行事务合伙人：张晓荣（首席合伙人）

联系人：杨伟平

联系电话：021-52920000

传真：021-52921369

经办注册会计师：陈大愚、江嘉炜

## 六、基金合同摘要

基金合同的内容摘要见附件。

## 七、基金财务状况

本基金募集结束后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。

本基金 2021 年 2 月 19 日资产负债表如下（未经审计）：

单位：人民币元

资产	本期末 2021-2-19
银行存款	49,001,255.43
结算备付金	711,034.24
存出保证金	225,059.65
交易性金融资产	383,922,719.75
其中：股票投资	381,745,245.05
基金投资	-
债券投资	2,177,474.70
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	11,137,545.70
应收利息	56,963.38

应收股利	-
应收申购款	-
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	445,054,578.15
<b>负债和所有者权益</b>	本期末 2021-2-19
<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	23,625,715.43
应付赎回款	-
应付管理人报酬	329,084.00
应付托管费	54,847.35
应付销售服务费	-
应付交易费用	359,023.99
应交税费	-
应付利息	-
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	81,448.00
负债合计	24,450,118.77
<b>所有者权益：</b>	
实收基金	362,219,754.23
未分配利润	58,384,705.15
所有者权益合计	420,604,459.38
<b>负债和所有者权益总计</b>	<b>445,054,578.15</b>

## 八、基金投资组合

截至 2021 年 2 月 19 日，本基金的投资组合如下：

### （一）基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)
----	----	-------	------------------

1	权益投资	381,745,245.05	85.77
	其中：股票	381,745,245.05	85.77
2	基金	-	-
3	固定收益投资	2,177,474.70	0.49
	其中：债券	2,177,474.70	0.49
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	49,712,289.67	11.17
7	其他资产	11,419,568.73	2.57
8	合计	445,054,578.15	100.00

(二) 按行业分类的股票投资组合

截至 2021 年 2 月 19 日，本基金按行业分类的股票投资组合如下：

1. 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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	335,146,863.07	79.68
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	8,724,084.00	2.07
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	20,116,396.54	4.78
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	-	-

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	8,406,801.00	2.00
S	综合	-	-
	合计	372,394,144.61	88.54

## 2. 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值(人民币)	占基金资产净值比例(%)
消费者常用品	9,351,100.44	2.22
合计	9,351,100.44	2.22

以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

## (三) 按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细

截至2021年2月19日,本基金按公允价值占基金资产净值比例大小排名前十名股票投资明细如下:

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	300122	智飞生物	131,600.00	24,017,000.00	5.71
2	300408	三环集团	549,500.00	23,331,770.00	5.55
3	300037	新宙邦	280,700.00	22,843,366.00	5.43
4	002466	天齐锂业	414,364.00	21,836,982.80	5.19
5	300124	汇川技术	196,015.00	20,732,506.55	4.93
6	603416	信捷电气	193,400.00	20,268,320.00	4.82
7	300726	宏达电子	288,182.00	20,083,403.58	4.77
8	300558	贝达药业	130,900.00	17,527,510.00	4.17
9	300274	阳光电源	122,700.00	13,764,486.00	3.27
10	300073	当升科技	268,000.00	13,512,560.00	3.21



## (四) 按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

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	2,177,474.70	0.52
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,177,474.70	0.52

## (五) 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

金额单位：人民币元

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	019640	20国债10	21,790.00	2,177,474.70	0.52

(六) 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

截至2021年2月19日，本基金未持有资产支持证券。

(七) 按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名贵金属投资明细  
截至2021年2月19日，本基金未持有贵金属投资。

(八) 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  
截至2021年2月19日，本基金未持有权证投资。

(九) 本基金投资的股指期货交易情况说明

截至 2021 年 2 月 19 日，本基金未持有股指期货。

(十) 本基金投资的国债期货交易情况说明

截至 2021 年 2 月 19 日，本基金未持有国债期货。

(十一) 投资组合报告附注

1、截至 2021 年 2 月 19 日，本基金投资的前十名证券的发行主体本期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、截至 2021 年 2 月 19 日，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、截至 2021 年 2 月 19 日，其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	交易保证金	225,059.65
2	应收证券清算款	11,137,545.70
3	应收股利	-
4	应收利息	56,963.38
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,419,568.73

4、持有的处于转股期的可转换债券明细

截至 2021 年 2 月 19 日，本基金未持有处于转股期的可转换债券

5、前十名股票中存在流通受限情况的说明

截至 2021 年 2 月 19 日,本基金投资的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

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

## 九、重大事件揭示

(一) 本基金管理人于2020年8月22日发布《中融创业板两年定期开放混合型证券投资基金基金合同生效公告》。

(二) 本基金管理人于2021年2月2日发布《中融基金管理有限公司关于旗下部分基金投资非公开发行股票的公告》。

## 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、深圳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《证券基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》及本基金《基金合同》、《托管协议》的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则托管基金资产。

(二) 根据《证券基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》及本基金《基金合同》、《托管协议》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、基金份额净值计算进行监督和核查；如发现基金管理人违反《证券基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》及本基金《基金合同》、《托管协议》的规定，将及时通知基金管理人纠正；基金管理人对于基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人将及时向中国证监会报告。

## 十二、基金上市推荐人意见

本基金无上市推荐人。

## 十三、备查文件目录

以下备查文件存放于基金管理人和基金托管人办公场所，投资者可在办公时间免费查阅，或通过指定的信息披露媒体、本基金管理人网站（[www.zrfunds.com.cn](http://www.zrfunds.com.cn)）查阅，但应以基金合同正本为准。

(一)中国证监会准予中融创业板两年定期开放混合型证券投资基金募集注册的文件

(二)《中融创业板两年定期开放混合型证券投资基金基金合同》

(三)《中融创业板两年定期开放混合型证券投资基金托管协议》

(四)《中融创业板两年定期开放混合型证券投资基金招募说明书》

(五)《关于申请募集中融创业板两年定期开放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。

**风险提示：**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，也不保证最低收益。敬请投资者留意投资风险。

中融基金管理有限公司

2021年2月23日

**附件：基金合同摘要****一、基金合同当事人的权利、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者的利益；
- (7) 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；
- (8) 选择、更换基金销售机构，对基金销售机构的相关行为进行监督和处理；
- (9) 担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记机构办理基金登记业务并获得基金合同规定的费用；
- (10) 依据基金合同及有关法律规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与赎回申请；
- (12) 依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利；
- (13) 在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资及转融通证券出借业务；
- (14) 以基金管理人的名义，代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
- (15) 选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商、期货经纪机构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、转换和非交易过户等业务规则;

(17) 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他权利。

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

(1) 依法募集资金,办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜;

(2) 办理基金备案手续;

(3) 自基金合同生效之日起,以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产;

(4) 配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策,以专业化的经营方式管理和运作基金财产;

(5) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度,保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立,对所管理的不同基金分别管理,分别记账,进行证券投资;

(6) 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外,不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益,不得委托第三人运作基金财产;

(7) 依法接受基金托管人的监督;

(8) 采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合基金合同等法律文件的规定,按有关规定计算并公告基金净值信息,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) 编制季度报告、中期报告和年度报告;

(11) 严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定,履行信息披露及报告义务;

(12) 保守基金商业秘密,不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外,在基金信息公开披露前应予保密,不向他人泄露;

(13) 按基金合同的约定确定基金收益分配方案,及时向基金份额持有人分配基金收益;

- (14) 按规定受理申购与赎回申请, 及时、足额支付赎回款项;
- (15) 依据《基金法》、基金合同及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会;
- (16) 按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料 15 年以上;
- (17) 确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出, 并且保证投资者能够按照基金合同规定的时间和方式, 随时查阅到与基金有关的公开资料, 并在支付合理成本的前提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人的利益;

(4) 根据相关市场规则, 为基金开设证券/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和证券/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, 但向监管机构、司法机关或因审计、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、季度报告、中期报告和年度报告出具意见，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) 从基金管理人或其委托的登记机构处接收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、《基金合同》和《托管协议》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业监督管理机构，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

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各种原因获得的不当得利；
- (9) 遵守基金管理人、基金托管人、销售机构和登记机构的相关交易及业

务规则；

(10) 提供基金管理人、基金托管人和监管机构依法要求提供的信息，以及不时的更新和补充，并保证其真实性；

(11) 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。

本基金份额持有人大会未设日常机构。在本基金存续期内，根据本基金的运作需要，基金份额持有人大会可以设立日常机构，日常机构的设立与运作应当根据相关法律法规和中国证监会的规定进行。

### (一) 召开事由

1、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，但法律法规、中国证监会和基金合同另有规定的除外：

- (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；
- (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) 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) 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；

(12) 对基金合同当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；

(13) 终止基金上市，但因基金不再具备上市条件而被深圳证券交易所终止上市的除外；

(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、在不违反法律法规规定和《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) 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、调低赎回费率、变更收费方式、调整本基金的基金份额类别的设置；

(3) 因相应的法律法规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) 调整有关基金认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务的规则；

(6) 推出新业务或服务；

(7) 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，在规定媒介公告。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。基金管理人、基金托管人须为基金份额持有人行使投票权提供便利。

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。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以书面形式或大会公告载明的其他方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大会公告载明的其他方式进行表决。

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二分之一（含二分之一）；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，并与登记机构记录相符。

3. 在法律法规和监管机关允许的情况下，经会议通知载明，本基金的基金份额持有人亦可采用其他非书面方式授权其代理人出席基金份额持有人大会。在会议召开方式上，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。基金份额持有人或其代理人可以采用书面、网络、电话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。

#### (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 日内在规定媒介上公告。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的部分，如将来法律法规修改导致相关内容被取消或变更的，基金管理人提前公告后，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、本基金场外收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利按除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

本基金的场内份额的收益分配方式仅为现金分红；

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、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在不违反法律法规、基金合同的约定以及对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可在与基金托管人协商一致，并按照监管部门要求履行适当程序后对基金收益分配原则进行调整，但应于变更实施日在规定媒介公告。

#### （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，依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介公告。

#### （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。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用时，基金登记机构可将基金份额持有人的现金红利按除权日的基金份额净值自动转为基金份额。红利再投资的计算方法，依照《业务规则》执行。对于场内份额，现金分红的计算方法等有关事项遵循深圳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、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、基金上市初费用和上市月费；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、诉讼费、仲裁费；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金的证券/期货交易费用；
- 8、基金的银行汇划费用；
- 9、基金相关账户的开户及维护费用；
- 10、因投资港股通标的股票而产生的各项合理费用；
- 11、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1.50%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。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动于次月前 5 个工作日内、按照基金管理人授权指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

## 2、基金托管人的托管费

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动于次月前 5 个工作日内、按照基金管理人授权指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。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—11 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、基金财产的投资范围和投资限制

### （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（包括中小板、创业板以及其他经中国证监会批准发行上市的股票）、港股通标的股票、债券（包括国债、地方政府债、政府支持机构债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债的纯债部分等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、衍生工具（包括股指期货、国债期货、股票期权）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）。

本基金将根据法律法规的规定参与融资、转融通证券出借业务。

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。

本基金的投资组合比例为股票资产占基金资产的比例为 60%-100%（在开放期前两个月和后两个月以及开放期内基金投资不受该比例限制），其中，港股通标的股票占股票资产的比例为 0%-50%，投资于创业板的股票资产占非现金资产的比例不低于 80%；封闭期内，每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约、股票期权需缴纳的交易保证金后，本基金应当保持不低于交易保证金一倍的现金；开放期内，每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约、股票期权需缴纳的交易保证金后，本基金保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。

如未来法律法规或监管机构对投资比例要求有变更的，基金管理人在履行适当程序后，可以做出相应调整。

### （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）本基金的投资组合比例为股票资产占基金资产的比例为 60%-100%（在开放期前两个月和后两个月以及开放期内基金投资不受该比例限制），其中，港股通标的股票占股票资产的比例为 0%-50%，投资于创业板的股票资产占非现金

资产的比例不低于 80%；

(2) 封闭期内，每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约、股票期权需缴纳的交易保证金后，本基金应当保持不低于交易保证金一倍的现金；开放期内，每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约、股票期权需缴纳的交易保证金后，本基金保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等；

(3) 本基金所投资战略配售股票锁定期到期日不得超过当前封闭期到期日；

(4) 本基金持有一家公司发行的证券，其市值（若同时持有一家公司发行的 A 股和 H 股，则为 A 股与 H 股合计市值）不超过基金资产净值的 10%；

(5) 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（若同时持有一家公司发行的 A 股和 H 股，则为 A 股与 H 股合计市值）的 10%；

(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%，债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；

(13) 封闭期内，本基金总资产不得超过基金净资产的 200%；开放期内，本基金的基金总资产不得超过基金净资产的 140%；

(14) 本基金参与股指期货、国债期货交易，应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) 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%；

5) 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%；

6) 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%；

7) 基金所持有的债券（不含到期日在一年以内的政府债券）市值和买入、卖出国债期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于债券投资比例的有关约定；

8) 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%；

9) 封闭期内，在任何交易日日终，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 100%；开放期内，在任何交易日日终，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；

（15）本基金参与股票期权交易的，需遵守下列投资比例限制：

1) 本基金因未平仓的期权合约支付和收取的权利金总额不得超过基金资产净值的 10%；

2) 本基金开仓卖出认购期权的，应持有足额标的证券；开仓卖出认沽期权的，应持有合约行权所需的全额现金或交易所规则认可的可冲抵期权保证金的现金等价物；

3) 本基金未平仓的期权合约面值不得超过基金资产净值的 20%。其中，合约面值按照行权价乘以合约乘数计算；

（16）本基金参与融资的，每个交易日日终，本基金持有的融资买入股票与

其他有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%；

(17) 本基金在封闭期内，参与转融通证券出借业务的证券资产不得超过基金资产净值的 50%，出借到期日不得超过封闭期到期日，中国证监会认可的特殊情形除外；因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合本条规定的，基金管理人不得新增出借业务；

(18) 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；

(19) 本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股股票，不得超过该上市公司可流通股股票的 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股票，不得超过该上市公司可流通股股票的 30%；

(20) 开放期内，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前款所规定比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

(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。

除上述第(2)、(10)、(18)、(20)项另有约定外，因证券市场波动、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，以变更后的规定为准。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。

## 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。

如法律、行政法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

## 六、基金资产估值

### （一）估值日

本基金的估值日为本基金相关的证券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、衍生工具、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、证券交易所上市的权益类证券的估值

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、处于未上市期间的权益类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和债券，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、交易所市场交易的固定收益品种的估值

(1) 交易所上市交易或挂牌转让的不含权固定收益品种，选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值；

(2) 交易所上市交易或挂牌转让的含权固定收益品种，选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价进行估值；

(3) 交易所上市交易的可转换债券以每日收盘价作为估值全价；

(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。交易所市场挂牌转让的资产支持证券，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；

(5) 对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券，对存在活跃市场的情况下，应以活跃市场上未经调整的报价作为估值日的公允价值；对于活跃市场报价未能代表估值日公允价值的情况下，应对市场报价进行调整以确认估值日的公允价值；对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下，应采用估值技术确定其公允价值。

### 4、全国银行间市场交易品种的估值

对全国银行间市场上不含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值。对银行间市场上含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价估值。对于含投资人回售权的固定收益品种，回售登记期截止日（含当日）后未行使回售权的按照长待偿期所对应的价格进行估值。对银行间市场未上市，且第三方估值机构未提供估值价格的债券，在发行利率与二级市场利率不存在明显差异，未上市期间市场利率没有发生大的变动的情况下，按成本估值。

5、同一证券同时在两个或两个以上市场交易的，按证券所处的市场分别估值；

6、因持有股票而享有的配股权，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；

7、本基金外币资产价值计算中，涉及主要货币对人民币汇率的，应当以基金估值日中国人民银行或其授权机构公布的人民币汇率中间价为准；

8、股指期货合约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；

9、国债期货合约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。如法律法规今后另有规定的，从其规定；

10、股票期权合约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；

11、本基金参与转融通证券出借业务的，将按照法律法规及行业协会的相关规定进行估值。

12、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；

13、当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；

14、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，基金资产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，由此给基金份额持有人和基金造成的损失，由基金管理人负责赔付，基金托管人不承担由此造成的损失。

#### （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。如遇特殊情况，为保护基金份额持有人利益，基金管理人与基金托管人协商一致，可阶段性调整基金份额净值计算精度并进行相应公告，无需召开基金份额持有人大会审议。国家另有规定的，从其规定。

基金管理人于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。如遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

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。

(5) 按法律法规规定的其他原则处理估值错误。

### 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，需要修改登记机构交易数据的，由登记机构进行更正，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 0.50% 时，基金管理人应当公告，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

用于基金信息披露的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信息予以公布。

#### （九）特殊情况的处理方法

1. 基金管理人或基金托管人按估值方法的第 12 项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。

2. 由于不可抗力，或证券/期货交易所、登记结算公司、存款银行等机构发送的数据错误等原因，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、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、基金合同变更、终止与基金财产的清算

#### （一）基金合同的变更

1. 变更基金合同涉及法律法规规定或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 2 日内在规定媒介公告。

#### （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、符合《中华人民共和国证券法》规定的注册会计师、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符合《中华人民共和国证券法》规定的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，基金财产清算小组应当将清算报告登载在规定网站上，并将清算报告提示性公告登载在规定报刊上。



### （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，若自一方书面提出协商解决争议之日起 60 日内争议未能以协商方式解决的，应提交中国国际经济贸易仲裁委员会根据该会届时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁的地点为北京市，仲裁裁决是终局性的并对相关各方均有约束力。除非仲裁裁决另有规定，仲裁费用和律师费用由败诉方承担。

争议处理期间，基金管理人、基金托管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。

基金合同适用于中华人民共和国（就本基金合同而言，不包括香港特别行政区、澳门特别行政区和台湾地区）法律并从其解释。

## 九、基金合同的效力

基金合同是约定基金合同当事人之间权利义务关系的法律文件。

1、基金合同经基金管理人、基金托管人双方盖章以及双方法定代表人或授权代表签字或盖章并在募集结束后经基金管理人向中国证监会办理基金备案手续，并经中国证监会书面确认后生效。

2、基金合同的有效期限自其生效之日起至基金财产清算结果报中国证监会备案并公告之日止。

3、基金合同自生效之日起对包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人在内的基金合同各方当事人具有同等的法律约束力。

4、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。

5、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。