

# 中银证券科技创新 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：中银国际证券股份有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

登记机构：中国证券登记结算有限责任公司

上市推荐人：山西证券股份有限公司

上市地点：上海证券交易所

上市时间：2020 年 7 月 8 日

公告日期：2020 年 7 月 3 日

## 目录

一、重要声明与提示.....	1
二、基金概览.....	1
三、基金的募集与上市交易.....	2
四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人.....	4
五、基金主要当事人简介.....	5
六、基金合同摘要.....	13
七、基金财务状况.....	14
八、基金投资组合.....	15
九、重大事件揭示.....	17
十、基金管理人承诺.....	18
十一、基金托管人承诺.....	18
十二、基金上市推荐人意见.....	18
十三、备查文件目录.....	19
附件：基金合同摘要.....	20

## 一、重要声明与提示

《中银证券科技创新 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”）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〉》、《上海证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制，中银证券科技创新 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”）基金管理人中银国际证券股份有限公司（以下简称“本基金管理人”）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。本基金托管人中国农业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”）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。凡本公告未涉及的有关内容，请投资者详细查阅 2020 年 2 月 24 日发布在中国证监会基金电子披露网站（<http://eid.csrc.gov.cn/fund>）和公司基金网站（[www.bocifunds.com](http://www.bocifunds.com)）的本基金招募说明书。

基金合同生效后的前 3 年为封闭运作期。在封闭运作期内，本基金不接受基金份额的申购和赎回。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“中银证券科技创新混合型证券投资基金（LOF）”，并接受场外、场内的申购、赎回申请。

## 二、基金概览

- 1、基金名称：中银证券科技创新 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金。
- 2、基金简称：中银证券科技创新 3 年封闭混合。
- 3、基金场内交易简称：BOCI 科创。
- 4、基金扩位证券简称：中银证券科技创新。
- 5、基金代码：501095。
- 6、基金类型：混合型证券投资基金。
- 7、基金运作方式：

契约型开放式

本基金合同生效后的前三年为封闭运作期，具体封闭运作期为基金合同生效日（含基金合同生效日）起至三年后的年度对日前一日止。在封闭运作期内，本基金不接受基金份额的申购和赎回。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“中银证券科技创新混合型证券投资基金（LOF）”，并接受场外、场内的申购、赎回申请。

8、基金存续期限：不定期。

9、截至公告日前两个工作日即 2020 年 7 月 1 日基金份额总额：884,675,264.70 份。

10、截至公告日前两个工作日即 2020 年 7 月 1 日基金份额净值：1.0952 元。

11、本次上市交易份额：169,898,075.00 份。

12、上市交易的证券交易所：上海证券交易所。

13、上市交易日期：2020 年 7 月 8 日。

14、基金管理人：中银国际证券股份有限公司。

15、基金托管人：中国农业银行股份有限公司。

16、登记机构：中国证券登记结算有限责任公司。

17、上市推荐人：山西证券股份有限公司。

### 三、基金的募集与上市交易

（一）本基金募集情况

1、基金募集申请的注册机构和准予注册文号：中国证监会 2020 年 1 月 7 日证监许可[2020]73 号文。

2、基金运作方式：

契约型开放式

本基金合同生效后的前三年为封闭运作期，具体封闭运作期为基金合同生效日（含基金合同生效日）起至三年后的年度对日前一日止。在封闭运作期内，本基金不接受基金份额的申购和赎回。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“中银证券科技创新混合型证券投资基金（LOF）”，并接受场外、场内的申

购、赎回申请。

3、基金存续期限：不定期。

4、发售日期：本基金募集期自 2020 年 2 月 27 日起至 2020 年 3 月 6 日止（法定节假日不受理）。

5、发售价格：1.00 元人民币。

6、发售方式：本基金通过场内、场外两种方式公开发售。

7、发售机构

（1）场外发售机构

直销机构：中银国际证券股份有限公司直销柜台。

代销机构：中国银行股份有限公司、中银国际证券股份有限公司营业部、上海天天基金销售有限公司、北京肯特瑞基金销售有限公司、上海基煜基金销售有限公司、蚂蚁（杭州）基金销售有限公司、珠海盈米基金销售有限公司、东方财富证券股份有限公司、上海好买基金销售有限公司、北京汇成基金销售有限公司、招商银行股份有限公司、中国农业银行股份有限公司、江苏汇林保大基金销售有限公司、中信建投证券股份有限公司等。

（2）场内发售机构

本基金的场内发售机构为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会员单位。

（二）基金合同生效

本基金根据中国证监会 2020 年 1 月 7 日证监许可[2020]73 号文注册，自 2020 年 2 月 27 日至 3 月 6 日公开募集。普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）验资，本次募集的净认购金额为人民币 884,390,443.83 元，本次募集期间有效认购资金在基金验资确认日之前产生的利息共计人民币 284,820.87 元。上述认购资金及利息已于 2020 年 3 月 11 日全额划入本基金在基金托管人中国农业银行股份有限公司开立的本基金托管专户。

本次基金募集有效基金份额持有人户数共计 13262 户，按照每份基金份额初始面值人民币 1.0000 元计算，上述募集资金及其折算的基金份额共计 884,675,264.70 份，已全部计入各基金份额持有人基金账户，归各基金份额持有人所有。本基金合同生效前的有关法定信息披露费、会计师费、律师费不从基金财产中支付。

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《中银证券科技创新 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金基金合同》、《中银证券科技创新 3 年封闭运作灵活配置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 3 月 12 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。

在基金募集期间，本基金管理人从业人员认购持有的基金份额总额为 210138.34 份（含募集期利息结转的份额），占本基金总份额的比例 0.02%，基金管理人的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金。

### （三）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：上海证券交易所自律监管决定书[2020]170 号。
- 2、上市交易日期：2020 年 7 月 8 日。
- 3、上市交易的证券交易所：上海证券交易所。
- 4、基金场内交易简称：BOCI 科创。
- 5、基金扩位证券简称：中银证券科技创新。
- 6、基金代码：501095。
- 7、本次上市交易份额：169,898,075.00 份。
- 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，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。

## 四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人

### （一）持有人户数

截至公告日前两个工作日即 2020 年 7 月 1 日，本基金基金份额持有人户数为 13262 户，平均每户持有的基金份额为 66707.53 份。其中场内基金份额持有人户数为 2113 户，平均每户持有的场内基金份额为 80406.09 份；场外基金份额持有人户数为 11149 户，平均每户持有的场外基金份额为 64111.33 份。

### （二）持有人结构

截至公告日前两个工作日即 2020 年 7 月 1 日，机构投资者持有的本基金基金份额为 2224228.00 份，占基金总份额的 0.25%；个人投资者持有的本基金基金份额为 882,451,036.70 份，占基金总份额的 99.75%。截至公告日前两个工作日即 2020 年 7 月 1 日，基金管理人的从业人员持有本基金份额 210138.34 份，占本基金总份额的 0.02 %。

### （三）场内基金份额前十名持有人情况

截至公告日前两个工作日即 2020 年 7 月 1 日，本基金场内前十名基金份额持有人情况

如下：

序号	持有人名称（全称）	持有基金份额（份）	占总份额比例
1	欧学钢	992,468.00	0.11%
2	魏莲	992,468.00	0.11%
3	傅世雄	992,468.00	0.11%
4	池建权	992,468.00	0.11%
5	李振国	992,468.00	0.11%
6	沈瑞民	992,468.00	0.11%
7	王振江	992,468.00	0.11%
8	李祥婕	992,468.00	0.11%
9	赵悦	992,468.00	0.11%
10	赵杨洋	992,468.00	0.11%
11	丰玫	992,468.00	0.11%
12	朱雪英	992,468.00	0.11%
13	万中美	992,468.00	0.11%

注：以上信息依据中国证券登记结算有限责任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、基金管理人概况

名称：中银国际证券股份有限公司

住所：中国上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 39 层（邮政编码：200120）

法定代表人：宁敏

信息披露负责人：亓磊

客户服务电话：021-61195566，400-620-8888

传真：021-50372474

注册资本：27.78 亿元

设立批准文号：中国证监会证监机构字【2002】19 号

开展公开募集证券投资基金管理业务批准文号：中国证监会证监许可【2015】1972号  
工商登记注册的法人营业执照文号：91310000736650364G

经营范围：证券经纪；证券投资咨询；与证券交易、证券投资活动有关的财务顾问；证券承销与保荐；证券自营；证券资产管理；证券投资基金代销；融资融券；代销金融产品；公开募集证券投资基金管理业务；为期货公司提供中间介绍业务。【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】

## 2、股权结构

截至本上市交易公告书公告日，公司股权结构如下：中银国际控股有限公司，持股比例 33.42%；中国石油集团资本有限责任公司，持股比例 14.32%；上海金融发展投资基金（有限合伙），持股比例 9.47%；云南省投资控股集团有限公司，持股比例 8.18%；江西铜业股份有限公司，持股比例 4.74%；凯瑞富海实业投资有限公司，持股比例 4.49%；中国通用技术(集团)控股有限责任公司，持股比例 4.09%；上海祥众投资合伙企业(有限合伙)，持股比例 3.69%；江苏洋河酒厂股份有限公司，持股比例 2.84%；上海郝乾企业管理中心（有限合伙），持股比例 1.89%；江西铜业集团财务有限公司，持股比例 0.95%；达濠市政建设有限公司，持股比例 0.95%；万兴投资发展有限公司，持股比例 0.95%；另，A 股公开发行普通股 10.01%。

## 3、内部组织结构及职能

序号	部门	部门职责
1	督导评审中心	负责督导巡视、采购管理和督导评审工作。
2	财务部	负责组织公司的会计核算、财务管理工作。
3	人力资源部	负责组织实施人员招聘工作，为部门及分支机构合理配置人力资源；建立并完善公司薪酬及绩效管理体系，强化激励约束机制；会同有关部门确定和调整公司组织机构、人员编制及岗位；协助各部门及营业部做好员工培训、劳动纪律管理及其他人事方面的日常事务性工作。
4	办公室	负责公司日常运转，包括公文流转、印章管理、档案管理以及公司创新、对外宣传等工作；支持公司各项业务开展，协调内部、外部以及公司各板块、部门、分支机构之间的业务关系；安排公司领导公务和公司的各项活动；为公司提供

		行政后勤服务。
5	董事会办公室	负责组织办理信息报送或者信息披露事项；完成股东会、董事会会议的筹备、文件保管及股东资料的管理，按照适用法律规定或者根据中国证监会、股东等有关单位或者个人的要求，依法提供有关资料。
6	战略规划部	负责公司战略专项研究、公司重要经营工作会议材料准备、制订年度绩效指标和目标，并测算确定年度绩效评价结果、公司经营情况分析、业务调研、信息汇编及战略费用评价等。
7	内控与法律合规部	协助公司及公司各部门识别和控制经营管理活动涉及的合规风险；协助公司及公司各部门处理经营管理活动涉及的法律事务，识别和控制相应法律风险。
8	风险管理部	负责对市场风险、信用风险、操作风险和流动性风险进行识别、测量、评估、监控和报告。
9	内核部	建立健全投资银行类业务内核制度，明确内核职责、标准和流程；建立针对各类投资银行类业务的问核制度并履行问核程序；担任内核委员会的秘书机构，协助内核委员会的日常运作；书面审核上市阶段申请材料、持续督导、受托管理及存续期管理相关报告、以及其他未经内核委员会评议的以公司名义对外报送的文件；其他针对投资银行类业务的风险合规管理职责。
10	审计部	负责对公司各部门进行内部稽核审计。
11	业务营运部	负责客户交易结算资金的清算、存管工作。
12	股权融资一部	股权业务项目营销、项目执行、合规内控、项目风险管理、部门管理及员工管理。
13	股权融资二部	股权业务项目营销、项目执行、合规内控、项目风险管理、部门管理及员工管理。
14	股权融资三部	股权业务项目营销、项目执行、合规内控、项目风险管理、部门管理及员工管理。

15	创新融资部	主要负责股权业务及主办券商推荐业务项目营销、项目执行工作。
16	定息收益部	债券业务项目营销、项目执行、合规内控、项目风险管理、部门管理及员工管理。
17	债务资本市场部	负责公司所承销债券项目的推介销售、发行定价、簿记配售及债券业务综合事务。
18	债务融资部	债券业务项目营销、项目执行、合规内控、项目风险管理、部门管理及员工管理。
19	债券战略客户部	负责战略客户债券业务项目营销、项目执行、合规内控、项目风险管理、部门管理及员工管理。
20	股权资本市场部	负责公司承揽的 IPO 及股权类再融资项目的发行承销工作，为股权融资部提供融资工具选择、产品设计、资本市场动态跟踪等研究和咨询服务，协助股权融资部进行项目承揽和新产品开发。
21	新三板督导业务部	主要负责分支机构推荐投资银行业务的承揽及承做工作。
22	综合管理部	负责统筹协调投资银行板块综合事务及对投行项目执行流程管理和质量控制。
23	业务管理部	牵头制定零售经纪业务发展规划；负责分支机构零售经纪业务的预算管理、成本管控与绩效管理；机构网点设立；零售经纪业务经营分析、业务督导；营销人员管理制度建设及人员管理；负责基础经纪业务、股票质押式回购、融资融券、新三板、港股通、股票期权、中间介绍业务、两网及退市股票转让等相关业务的制度建设与组织落实；负责信用业务的审批及流程管理、客户开发及服务；负责零售经纪业务各操作平台的日常维护和升级改造；作为第一道防线牵头对照外部监管及公司要求，进行投资者教育及适当性管理，对板块业务拓展部门及分支机构进行信用风险、操作风险、市场风险、声誉风险等合规风险管理，并检查整改。
24	财富管理部	投顾产品及金融产品研发；线下渠道客户营销开发；线下服务体系建设和品牌宣传；对线上、线下开发的及存量中高净值客户的维护、服务和产品配置；创

		新业务拓展及重点营销活动的策划与组织推广；营销服务人员专业培训。
25	网络金融部	牵头制定公司数字化网络金融建设规划，并推动落实；搭建场景化、智能化、有品牌影响力的营销服务平台；负责线上全量客户营销和产品销售，建设覆盖全客户的标准化线上服务体系，并对大众客户提供多样化的线上资产管理服务；承担零售经纪条线信息系统重点项目建设的综合管理职能；此外，还负责客户服务中心相关工作。
26	资产管理部	主要对私募资产管理计划等资产管理产品以及投资顾问业务的受托资产进行专业管理，为客户提供专业投资管理、投资顾问服务。
27	机构理财部	负责资产管理产品、公募基金、投资顾问业务的机构客户拓展。
28	市场营销部	负责资产管理产品、公募基金的渠道销售、营销策划与市场推广。
29	基金管理部	负责公募基金产品的投资管理；
30	产品部	负责资产管理产品的开发规划、研究论证、产品设计、合同报批、中台支持等；负责相关信息披露，各类数据的统计分析，相关业务档案的管理等；负责信息系统建设与规划及内部业务系统的开发和运行服务。
31	研究与交易部	跟踪宏观经济运行与政策调控的整体趋势，负责为公募基金管理业务、资产管理业务等投资业务提供策略研究、行业研究、公司研究等；负责组织和执行交易计划。
32	信评与投资监督部	负责为公募基金管理业务、资产管理业务提供信用研究等支持；负责资产证券化业务的存续期管理等；负责资产管理业务、公募基金管理业务的合规管理和投资监督工作。
33	机构业务部	通过股票销售、研究报告推荐、定制化产品研发、销售，为机构客户提供研究咨询、投资顾问和交易代理服务。
34	研究部	主要负责证券市场的各项研究工作，撰写各类研究报告，就研究成果向客户和市场进行推广；为公司机构客户以及高端零售客户提供研究支持；为投资银行

		板块一级市场业务提供研究支持；根据公司要求，完成专项研究课题和研究报告。
35	证券投资部	专门从事为公司买卖股票、证券投资基金及中国证监会认可的其他证券的业务。
36	资金管理部	负责开辟融资渠道，扩大负债规模，优化融资成本，增加财务弹性；在满足资产业务资金需求的同时，实现资产与负债在期限、利率、现金流等方面的合理匹配。
37	金融衍生品部	负责衍生品业务的日常运营和管理工作，负责衍生品团队的建设；负责制定公司衍生品业务策略，研发各类场内、场外衍生品相关创新业务，开发衍生品量化交易和风险管理模型等。
38	信息技术部	主要负责对公司信息技术系统和技术基础设施的功能、架构、配置、接口以及信息安全策略进行统一规划；负责公司 IT 发展战略的制订；负责标准化场内交易业务 IT 需求管理；负责公司 IT 预算的编制和监督执行；负责对公司信息系统风险及 IT 安全生产进行管理和检查监督；负责公司分支机构信息系统及技术人员的管理工作；负责公司 IT 基础设施系统建设与管理、网络及安全管理、业务应用系统运行管理；负责公司办公桌面系统技术支持及数据备份管理等工作。
39	金融科技部	主要负责推进科技赋能各项工作，提升业务运转效率、经营管理水平、投资风控水平及科技竞争力；负责进行数字金融发展规划与落地；负责进行数字金融项目的方案设计与实施管理；负责开展数据治理、数据赋能工作；负责承接适合自研的软件系统开发需求。

#### 4、人员情况

截至 2020 年 6 月，中银证券公募基金管理业务相关员工共有 161 人，其中本科及以上学历人数占比 63%，证券从业年限满 3 年或金融从业年限满 5 年的占比 84%。

#### 5、基金管理业务情况

截至 2020 年 6 月 30 日，本管理人共管理二十一只证券投资基金，包括：中银证券价值精选灵活配置混合型证券投资基金（原中银证券保本 1 号混合型证券投资基金）、中银证券健康产业灵活配置混合型证券投资基金、中银证券现金管家货币市场基金、中银证券安进债券型证券投资基金、中银证券瑞益定期开放灵活配置混合型证券投资基金、中银证券安弘债

券型证券投资基金、中银证券汇宇定期开放债券型发起式证券投资基金、中银证券聚瑞混合型证券投资基金、中银证券祥瑞混合型证券投资基金、中银证券汇嘉定期开放债券型发起式证券投资基金、中银证券安誉债券型证券投资基金、中银证券汇享定期开放债券型发起式证券投资基金、中银证券新能源灵活配置混合型证券投资基金、中银证券安源债券型证券投资基金、中银证券中高等级债券型证券投资基金、中银证券安泽债券型证券投资基金、中银证券科技创新 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金、中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、中银证券安沛债券型证券投资基金、中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、中银证券汇远一年定期开放债券型发起式证券投资基金。

## 6、本基金基金经理简介

吴文钊，硕士研究生。2008 年 2 月至 2010 年 2 月任职于恒泰证券股份有限公司，担任行业研究员；2010 年 3 月至 2011 年 1 月任职于东海证券有限责任公司，担任行业研究员；2011 年 2 月至 2015 年 4 月任职于国金证券股份有限公司，担任行业研究员；2015 年 5 月加入中银国际证券股份有限公司，现任中银证券安弘债券型证券投资基金、中银证券健康产业灵活配置混合型证券投资基金、中银证券科技创新 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

阳桦，硕士研究生。2008 年 7 月至 2009 年 6 月任职于富邦证券（上海代表处），担任行业研究员；2009 年 7 月至 2010 年 6 月任职于中山证券有限责任公司，担任行业研究员；2010 年 6 月加入中银国际证券股份有限公司，担任行业研究员、投资经理，现任中银证券祥瑞混合型证券投资基金、中银证券价值精选灵活配置混合型证券投资基金、中银证券科技创新 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金、中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、中银证券中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。

## （二）基金托管人

### 1、基金托管人基本情况

名称：中国农业银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座

法定代表人：周慕冰

成立日期：2009 年 1 月 15 日

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[1998]23 号

批准设立机关及批准设立文号：中国银监会银监复[2009]13 号

组织形式：股份有限公司

注册资本：34,998,303.4 万元人民币

存续期间：持续经营

中国农业银行股份有限公司是中国金融体系的重要组成部分,总行设在北京。经国务院批准,中国农业银行整体改制为中国农业银行股份有限公司并于2009年1月15日依法成立。中国农业银行股份有限公司承继原中国农业银行全部资产、负债、业务、机构网点和员工。中国农业银行网点遍布中国城乡,成为国内网点最多、业务辐射范围最广,服务领域最广,服务对象最多,业务功能齐全的大型国有商业银行之一。在海外,中国农业银行同样通过自己的努力赢得了良好的信誉,每年位居《财富》世界500强企业之列。作为一家城乡并举、联通国际、功能齐备的大型国有商业银行,中国农业银行一贯秉承以客户为中心的经营理念,坚持审慎稳健经营、可持续发展,立足县域和城市两大市场,实施差异化竞争策略,着力打造“伴你成长”服务品牌,依托覆盖全国的分支机构、庞大的电子化网络和多元化的金融产品,致力为广大客户提供优质的金融服务,与广大客户共创价值、共同成长。

中国农业银行是中国第一批开展托管业务的国内商业银行,经验丰富,服务优质,业绩突出,2004年被英国《全球托管人》评为中国“最佳托管银行”。2007年中国农业银行通过了美国SAS70内部控制审计,并获得无保留意见的SAS70审计报告。自2010年起中国农业银行连续通过托管业务国际内控标准(ISAIE3402)认证,表明了独立公正第三方对中国农业银行托管服务运作流程的风险管理、内部控制的健全有效性的全面认可。中国农业银行着力加强能力建设,品牌声誉进一步提升,在2010年首届“金牌理财”TOP10颁奖盛典”中成绩突出,获“最佳托管银行”奖。2010年再次荣获《首席财务官》杂志颁发的“最佳资产托管奖”。2012年荣获第十届中国财经风云榜“最佳资产托管银行”称号;2013年至2017年连续荣获上海清算所授予的“托管银行优秀奖”和中央国债登记结算有限责任公司授予的“优秀托管机构奖”称号;2015年、2016年荣获中国银行业协会授予的“养老金业务最佳发展奖”称号;2018年荣获中国基金报授予的公募基金20年“最佳基金托管银行”奖;2019年荣获证券时报授予的“2019年度资产托管银行天玑奖”称号。

中国农业银行证券投资基金托管部于1998年5月经中国证监会和中国人民银行批准成立,目前内设综合管理部、业务管理部、客户一部、客户二部、客户三部、客户四部、风险合规部、产品研发与信息技术部、营运一部、营运二部、市场营销部、内控监管部、账户管理部,拥有先进的安全防范设施和基金托管业务系统。

## 2、主要人员情况

中国农业银行托管业务部现有员工近 310 名，其中具有高级职称的专家 60 名，服务团队成员专业水平高、业务素质好、服务能力强，高级管理层均有 20 年以上金融从业经验和高级技术职称，精通国内外证券市场的运作。

### 3、基金托管业务经营情况

截止到 2019 年 12 月 31 日，中国农业银行托管的封闭式证券投资基金和开放式证券投资基金共 488 只。

#### （三）基金上市推荐人

名称：山西证券股份有限公司

住所：山西省太原市府西街 69 号山西国际贸易中心东塔楼

办公地址：山西省太原市府西街 69 号山西国际贸易中心东塔楼

法定代表人：侯巍

电话：0351-8686966

传真：0351-8686667

联系人：张美丽

网址：www.i618.com.cn

客户服务电话：95573

#### （四）验资机构

名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼

办公地址：上海市黄浦区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼

执行事务合伙人：李丹

联系电话：（021）23238888

传真：（021）23238800

经办注册会计师：张振波、叶尔甸

联系人：叶尔甸

## 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

### （一）基金募集期间费用

本基金募集期间所发生的信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用，不从基金财产中列支。

### （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

截至公告前两个工作日即 2020 年 7 月 1 日，本基金的资产负债表如下（未经审计）：

金额单位：人民币元

资产	期末余额	负债和所有者权益	期末余额
<b>资 产：</b>		<b>负债：</b>	
银行存款	86,714,385.20	短期借款	-
结算备付金	3,772,167.35	交易性金融负债	-
存出保证金	328,071.86	衍生金融负债	-
交易性金融资产	889,477,326.17	卖出回购金融资产款	-
其中：股票投资	889,477,326.17	应付证券清算款	9,703,950.84
债券投资	-	应付赎回款	-
资产支持	-	应付赎回费	-
证券投资	-	应付管理人报酬	939,371.04
基金投资	-	应付托管费	156,561.86
衍生金融资产	-	应付销售服务费	-
买入返售金融资产	-	应付交易费用	539,179.85
应收证券清算款	-	应付税费	-
应收利息	26,283.22	应付利息	-
应收股利	-	应付利润	-
应收申购款	-	其他负债	68,339.04
其他资产	-	<b>负债合计</b>	11,407,402.63
		<b>所有者权益：</b>	
		实收基金	884,675,264.70
		未分配利润	84,235,566.47
		<b>所有者权益合计</b>	968,910,831.17
<b>资产合计：</b>	980,318,233.80	<b>负债与持有人权益总计：</b>	980,318,233.80

## 八、基金投资组合

截至公告前两个工作日即 2020 年 7 月 1 日（本基金合同自 2020 年 3 月 12 日起生效，本报告期自 2020 年 3 月 12 日至 2020 年 7 月 1 日），本基金的投资组合情况如下：

### （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	889,477,326.17	90.73
	其中：股票	889,477,326.17	90.73
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	90,486,552.55	9.23
8	其他资产	354,355.08	0.04
9	合计	980,318,233.80	100.00

### （二）按行业分类的股票投资组合

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	712,629,223.11	73.55
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	12,122,515.20	1.25
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	145,601,709.19	15.03
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	19,123,878.67	1.97

N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	889,477,326.17	91.80

(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投资明细

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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000063	中兴通讯	1,916,900	76,196,775.00	7.86
2	601231	环旭电子	2,113,377	45,754,612.05	4.72
3	002384	东山精密	1,537,711	45,731,525.14	4.72
4	300115	长盈精密	1,921,513	44,521,456.21	4.60
5	002065	东华软件	3,302,271	40,915,137.69	4.22
6	300433	蓝思科技	1,359,399	39,762,420.75	4.10
7	300088	长信科技	3,455,465	39,565,074.25	4.08
8	300136	信维通信	706,761	37,924,795.26	3.91
9	300383	光环新网	1,420,200	37,706,310.00	3.89
10	002241	歌尔股份	1,146,100	33,236,900.00	3.43

(四) 按债券品种分类的债券投资组合

截至 2020 年 7 月 1 日，本基金未持有债券。

(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

截至 2020 年 7 月 1 日，本基金未持有债券。

(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 2020 年 7 月 1 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 2020 年 7 月 1 日，本基金未持有贵金属。

(八) 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

截至 2020 年 7 月 1 日，本基金未持有权证。

(九) 本基金投资的股指期货交易情况说明

1、本基金投资的股指期货持仓和损益明细

截至 2020 年 7 月 1 日，本基金未持有股指期货。

## 2、本基金投资股指期货的投资政策

截至 2020 年 7 月 1 日，本基金未持有股指期货。

### (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

截至 2020 年 7 月 1 日，本基金未持有国债期货。

#### 2、报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

截至 2020 年 7 月 1 日，本基金未持有国债期货。

#### 3、本期国债期货投资评价

截至 2020 年 7 月 1 日，本基金未持有国债期货。

### (十一) 投资组合报告附注

1、本基金投资的前十名证券的发行主体本期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、基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

3、其他各项资产构成

金额单位：人民币元

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	328,071.86
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	26,283.22
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	354,355.08

#### 4、持有的处于转股期的可转换债券明细

截至 2020 年 7 月 1 日，本基金未持有可转换债券。

#### 5、前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金于 2020 年 7 月 1 日，前十名股票中不存在流通受限情况。

## 九、重大事件揭示

本基金自基金合同生效至上市交易期间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、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》、《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《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《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《中华人民共和国证券投资基金法》、《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) 本基金上市文件真实、准确、完整,符合相关法规的要求,文件所载明的资料均经过核实。

## 十三、备查文件目录

### (一) 备查文件目录

- 1、中国证监会准予本基金注册的批复
- 2、《中银证券科技创新 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《中银证券科技创新 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
- 4、《中银证券科技创新 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》
- 5、法律意见书
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 7、基金托管人业务资格批件、营业执照

### (二) 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人处。

### (三) 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅备查文件。在支付工本费后,可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

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。销售机构根据法规要求对投资者类别、风险承受能力和基金的风险等级进行划分,并提出适当性匹配意见。投资者投资于本基金前应认真阅读本基金的基金合同和招募说明书等基金法律文件,全面认识基金产品的风险收益特征,在了解产品情况及听取销售机构适当性意见的基础上,根据自身的风险承受能力、投资期限和投资目标,对基金投资作出独立决策,选择合适的基金产品。敬请投资者注意投资风险。

中银国际证券股份有限公司

二〇二〇年七月三日

## 附件：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）基金份额持有人的权利与义务

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、法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、法规规定，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、法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、赎回或转换申请；
- (12) 依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使相关权利，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、转融通证券出借；
- (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、收益分配和非交易过户等的业务规则；
- (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、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。

(三) 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，为基金开设证券账户、资金账户等投资所需账户、为基金办理证券交易资金清算；

(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。

## 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、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、中国证监会另有规定的除外：

- (1) 终止《基金合同》（基金合同另有约定的除外）；
- (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) 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) 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) 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、调低赎回费率或变更收费方式、调整份额类别设置、停止现有基金份额类别的销售或者增设本基金的基金份额类别，但需履行相关程序；

(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) 在本基金封闭运作期届满转为“中银证券科技创新混合型证券投资基金（LOF）”后，按照基金合同约定调整投资目标、投资范围、投资策略、投资限制等；

(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变化；

(6) 基金管理人、销售机构、登记机构在法律法规规定的范围内调整有关基金认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务的规则；

(7) 基金管理人在履行相关程序后于中国证监会允许的范围内推出新业务或服务；

(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基金合同约定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基金合同约定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，并与基金登记注册机构记录相符。

3、在法律法规和监管机关允许的情况下，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并行使表决权，具体方式在会议通知中列明。

4、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。

## (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。

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的事由、召开条件、议事程序和表决条件等内容，凡是直接引用法律法规或监管规定的部分，如法律法规或监管规定修改导致相关内容被取消或变更的，基金管理人与基金托管人协商一致并提前公告后，可直接对该部分内容进

行修改或调整，无需召开基金份额持有人大会。

### 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，本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，若《基金合同》生效不满3个月则可不进行收益分配。

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资。登记在登记结算系统下的基金份额，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；登记在证券登记系统下的基金份额，只能选择现金分红的方式，具体收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、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；

4、每一基金份额享有同等分配权，如本基金在未来条件成熟时，增减基金份额类别，则同一类别内每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在不违反法律法规规定与基金合同约定且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人可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酌情调整以上基金收益分配原则，此项调整不需要召开基金份额持有人大会，但应于变更实施日前在指定媒介公告。法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### （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用时，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（不受封闭运作期限限制）。红利再投资的计算方法，依照《业务规则》执行。对于场内份额，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、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

#### （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、基金上市初费及上市年费；
- 9、账户开户费用、账户维护费用；
- 10、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

#### （二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

##### 1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.20%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.20\% \div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起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0.20%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E\times 0.20\%\div \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起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

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（含中小板、创业板、科创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、地方政府债券、金融债券、企业债券、公司债券、中央银行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持债券、政府支持机构债券、可转换债券、可分离交易可转债、可交换债券及非金融企业债务融资工具等）、债券回购、资产支持证券、同业存单、银

行存款（包含协议存款、通知存款、定期存款）、货币市场工具、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金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

本基金在封闭运作期内可根据相关法律法规和基金合同的约定参与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。

封闭运作期内，本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为0%-100%，其中投资于本基金界定的科技创新主题相关证券占非现金基金资产的比例不低于80%，投资于同业存单的比例不高于基金资产的20%。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，本基金应当保持不低于交易保证金一倍的现金。其中现金不包括结算备付金、存储保证金、应收申购款等。

封闭运作期届满转为开放式运作后，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%-95%，其中投资于本基金界定的科技创新主题相关证券占非现金基金资产的比例不低于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，应当保持不低于基金资产净值的5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。

本基金所指科技创新主题相关证券主要是指坚持面向世界科技前沿、面向经济主战场、面向国家重大需求的科技创新，主要投资于包括符合国家战略、突破关键核心技术、市场认可度高，属于新一代信息技术、高端装备、新材料、新能源、节能环保以及生物医药等高新技术产业和战略性新兴产业，属于互联网、大数据、云计算、人工智能和制造业深度融合等方面的科技创新上市公司。

如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、封闭运作期内基金的投资组合应遵循以下限制：

（1）在封闭运作期内，股票资产占基金资产的比例为0-100%，其中投资于本基金界定的科技创新主题相关证券占非现金基金资产的比例不低于80%；

（2）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%；

（3）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%；

（4）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%；

(5) 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%；

(6) 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%；

(7) 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%；

(8) 本基金应投资于信用评级为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；

(9) 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；

(10) 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%，进入全国银行间同业市场进行债券回购的最长期限为1年，债券回购到期后不得展期；

(11) 本基金参与股指期货交易后，应当符合下列投资限制：

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%。

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；

③ 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%。

④ 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规定；

⑤ 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%；

⑥ 本基金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；

(12) 封闭运作期内，本基金资产总值不超过基金资产净值的200%；

(13) 本基金投资于同业存单的比例不高于基金资产的20%；

(14) 在封闭运作期内，本基金参与转融通证券出借业务的，出借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运作期到期日；

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前述规定的，基金管理人不得新增出借业务；

(15) 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(8)、(14)项情形之外，因证券/期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在10个交易日内进行调整，但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。

2、封闭运作期届满转为上市开放式基金（LOF）后，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比例为60%-95%，其中投资于科技创新主题相关证券占非现金基金资产的比例不低于80%；

(2) 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，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评级评级为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%，进入全国银行间同业市场进行债券回购的最长期限为1年，债券回购到期后不得展期；

(12) 本基金参与股指期货交易，应当符合下列投资限制：

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；

③ 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%。

④ 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规定；

⑤ 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%；

(13) 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%；

(14) 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；

(15) 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本基金合同约定的投资范围保持一致；

(16) 本基金资产总值不超过基金资产净值的140%；

(17) 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）、（9）、（14）、（15）项情形之外，因证券/期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，

基金管理人应当在10个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。

基金管理人应当自封闭运作期届满转为上市开放式基金（LOF）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封闭运作期届满转为上市开放式基金（LOF）之日起开始。

### 3、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。

4、法律法规或监管部门对本基金合同所述投资比例、投资限制、组合限制、禁止行为等作出强制性调整的，本基金应当按照法律法规或监管部门的规定执行；如法律法规或监管部门修改或调整涉及本基金的投资比例、投资限制、组合限制、禁止行为等，且该等调整或修改属于非强制性的，在履行适当程序后，可按照法律法规或监管部门调整或修改后的规定执行。

## 六、基金资产净值的计算方法和公告方式

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。但如遇特殊情况，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。

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，由基金管理人按基金合同和相关法律法规的规定对外公布。

## 七、基金合同变更和终止的事由、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，仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局性的并对各方当事人均有约束力。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（为本合同之目的，不含港澳台地区法律）管辖。

#### **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。