

华安科创主题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：华安基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

登记结算机构：中国证券登记结算有限责任公司

上市地点：上海证券交易所

上市时间：2019年12月20日

公告日期：2019年12月17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	7
五、基金主要当事人简介	8
六、基金合同摘要	15
七、基金财务状况	15
八、基金投资组合	17
九、重大事件揭示	21
十、基金管理人承诺	21
十一、基金托管人承诺	21
十二、备查文件目录	22
附件：基金合同摘要	23

一、重要声明与提示

华安科创主题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”）上市交易公告书依据《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，华安基金管理有限公司（以下简称“本基金管理人”）的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。本基金托管人中国建设银行股份有限公司保证本报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。

凡本上市交易公告书未涉及的有关内容，请投资者详细查阅刊登在2019年5月29日《中国证券报》上的《华安科创主题3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》（以下简称“招募说明书”）。

二、基金概览

1、基金名称

华安科创主题3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金

2、基金代码及基金简称

基金代码：501073

基金简称：华安科创主题混合

场内简称：科创混合

3、基金类型

混合型证券投资基金

4、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。

在封闭运作期内，本基金不办理申购、赎回业务。

封闭运作期内基金上市交易后,投资者可将在其持有的场外基金份额通过办理跨系统转托管业务转至场内后上市交易。封闭运作期届满后,本基金转为上市开放式基金(LOF),基金名称调整为“华安智联混合型证券投资基金(LOF)”,并接受场外、场内申购赎回。

5、基金存续期限

不定期

6、基金份额总额:截至2019年12月13日,本基金的基金份额总额为988,565,281.49份。

7、基金份额净值:截至2019年12月13日,本基金的基金份额净值为1.0248元。

8、本次上市交易的基金份额总额:截至2019年12月13日,本次上市交易的基金份额总额为323,941,884.00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:2019年12月20日。

11、基金管理人:华安基金管理有限公司。

12、基金托管人:中国建设银行股份有限公司。

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、上市推荐人:

国泰君安证券股份有限公司

三、基金的募集与上市交易

(一) 本基金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【2019】935号文。

2、基金合同生效日:2019年6月11日。

3、基金运作方式:契约型。

4、基金合同期限:不定期。

5、发售日期:本基金自2019年6月5日起至2019年6月5日止进行发售。

6、发售价格:1.00 元人民币。

7、发售方式：本基金以场内和场外两种方式公开发售。

8、发售机构

（1）场外直销机构

1) 华安基金管理有限公司上海业务部

地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道8号国金中心二期31—32层

电话：（021）38969973

传真：（021）58406138

联系人：姚佳岑

2) 华安基金管理有限公司北京分公司

地址：北京市西城区金融街7号英蓝国际金融中心522室

电话：（010）57635999

传真：（010）66214061

联系人：刘雯

3) 华安基金管理有限公司广州分公司

地址：广州市天河区珠江西路8号高德置地夏广场D座504单元

电话：（020）38082891

传真：（020）38082079

联系人：林承壮

4) 华安基金管理有限公司西安分公司

地址：陕西省西安市高新区唐延路35号旺座现代城H座2503

电话：029-87651812

传真：（029）87651820

联系人：赵安平

5) 华安基金管理有限公司成都分公司

地址：成都市人民南路四段19号威斯顿联邦大厦12层1211K-1212L

电话：（028）85268583

传真：（028）85268827

联系人：郁晓珍

6) 华安基金管理有限公司沈阳业务部

地址：沈阳市沈河区北站路59号财富中心E座2103室

电话：（024）22522733

传真：（024）22521633

联系人：杨贺

7) 华安基金管理有限公司深圳业务部

地址：深圳福田区金田路2030号卓越世纪中心3号楼2008室

邮编：518000

电话：0755-82755911

联系人：唐硕

8) 华安基金管理有限公司南京业务部

地址：南京市中山南路49号商茂世纪广场19D2

电话：025-86890489

联系人：黄雷

9) 华安基金管理有限公司华东业务部

地址：福建福州鼓楼区五四路151号宏远帝豪国际大厦2307室

电话：0591-87831775

联系人：王枫

10) 华安基金管理有限公司电子交易平台

华安电子交易网站：www.huaan.com.cn

智能手机APP平台：iPhone交易客户端、Android交易客户端

华安电子交易热线：40088-50099

传真电话：（021）33626962

联系人：谢伯恩

（2）场外非直销机构

各非直销销售机构的名称和联系方式，请见附件。

（3）场内销售机构

本基金的场内发售机构为具有基金代销资格的上海证券交易所会员单位（排序不分先后）：

爱建证券有限责任公司、安信证券股份有限公司、北京高华证券有限责任公

司、渤海证券股份有限公司、财达证券股份有限公司、财富证券有限责任公司、财通证券股份有限公司、长城国瑞证券有限公司、长城证券股份有限公司、长江证券承销保荐有限公司、长江证券股份有限公司、川财证券有限责任公司、大通证券股份有限公司、大同证券有限责任公司、德邦证券股份有限公司、第一创业证券承销保荐有限责任公司、第一创业证券股份有限公司、东北证券股份有限公司、东方花旗证券有限公司、东方证券股份有限公司、东海证券股份有限公司、东吴证券股份有限公司、东兴证券股份有限公司、东亚前海证券有限责任公司、东莞证券股份有限公司、方正证券股份有限公司、高盛高华证券有限责任公司、光大证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、广州证券股份有限公司、国都证券股份有限公司、国海证券股份有限公司、国金证券股份有限公司、国开证券有限责任公司、国联证券股份有限公司、国融证券股份有限公司、国盛证券有限责任公司、国泰君安证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、国元证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、恒泰长财证券有限责任公司、恒泰证券股份有限公司、宏信证券有限责任公司、红塔证券股份有限公司、华安证券股份有限公司、华宝证券有限责任公司、华创证券有限责任公司、华福证券有限责任公司、华金证券股份有限公司、华林证券股份有限公司、华龙证券股份有限公司、华融证券股份有限公司、华泰联合证券有限责任公司、华泰证券股份有限公司、华西证券股份有限公司、华英证券有限责任公司、华菁证券有限公司、华鑫证券有限责任公司、汇丰前海证券有限责任公司、江海证券有限公司、金通证券有限责任公司、金元证券股份有限公司、九州证券股份有限公司、开源证券股份有限公司、联储证券有限责任公司、联讯证券股份有限公司、民生证券股份有限公司、摩根士丹利华鑫证券有限责任公司、南京证券股份有限公司、平安证券股份有限公司、瑞信方正证券有限责任公司、瑞银证券有限责任公司、山西证券股份有限公司、上海华信证券有限责任公司、上海证券有限责任公司、申港证券股份有限公司、申万宏源西部证券有限公司、申万宏源证券承销保荐有限责任公司、申万宏源证券有限公司、世纪证券有限责任公司、首创证券有限责任公司、太平洋证券股份有限公司、天风证券股份有限公司、万和证券股份有限公司、万联证券股份有限公司、网信证券有限责任公司、五矿证券有限公司、西部证券股份有限公司、西藏东方财富证券股份有限公司、西南证券股份有限公司、湘财证券股份有限公司、

新时代证券股份有限公司、信达证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、银泰证券有限责任公司、英大证券有限责任公司、招商证券股份有限公司、浙商证券股份有限公司、中德证券有限责任公司、中国国际金融股份有限公司、中国民族证券有限责任公司、中国银河证券股份有限公司、中国证券金融股份有限公司、中国中投证券有限责任公司、中航证券有限公司、中山证券有限责任公司、中泰证券股份有限公司、中天国富证券有限公司、中天证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、中信证券(山东)有限责任公司、中信证券股份有限公司、中银国际证券股份有限公司、中邮证券有限责任公司、中原证券股份有限公司等。

如果会员单位有所增加或减少，请以上海证券交易所的具体规定为准。

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：本次募集净认购金额为人民币988,565,281.49元；认购款项在基金验资确认日前产生的利息共计人民币0元，折算成基金份额共计0份，已分别计入各基金份额持有人的基金账户，归基金份额持有人所有。上述募集净认购资金已于2019年6月10日全额划入本基金托管人中国建设银行股份有限公司基金托管专户。

10、基金备案情况：根据《基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》以及《华安科创主题3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金基金合同》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完毕基金备案手续，并于2019年6月11日获得中国证监会书面确认，基金合同自该日起正式生效。自基金合同生效之日起，本基金管理人正式开始管理本基金。

11、基金合同生效日：2019年6月11日

12、基金合同生效日的基金份额总额：988,565,281.49份。

（三）基金上市交易

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[2019]286号。

2、上市交易日期：2019年12月20日。

3、上市交易的证券交易所：上海证券交易所。

4、基金二级市场交易简称：科创混合。

5、基金二级市场交易代码：501073。

6、本次上市交易的基金份额总额：323,941,884.00份（截至2019年12月13日）。

7、基金资产净值的披露：

每个交易日的次日公布本基金的基金份额净值，并在上交所行情发布系统揭示。

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，基金份额持有人在符合相关办理条件的前提下将其跨系统转托管至上海证券交易所场内后即可上市流通。

9、本基金将以2019年12月19日的基金份额净值作为上市首日（即2019年12月20日）的开盘参考价。

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2019年12月13日，本基金份额持有人户数为84,790户，平均每户持有的基金份额为11,658.98份。

（二）持有人结构

场外持有人总户数74,873户，场内持有人总户数9,917户，平均每户持有的场内基金份额：32,665.31份；

场内机构投资者持有的基金份额及占场内基金总份额比例：机构持有4,110,314份，占1.27%；

场内个人投资者持有的基金份额及占场内基金总份额比例：个人持有319,831,570份，占98.73%。

（三）基金场内份额前十名持有人的情况

截至2019年12月13日，前十名基金份额持有人的情况如下表。

序号	持有人名称（全称）	持有基金份额（份）	占场内总份额比例（%）
1	方昞	3,105,414	0.96%
2	隋煜	2,341,740	0.72%

3	许强	2,102,939	0.65%
4	许强	1,947,166	0.60%
5	陈珍梅	1,947,166	0.60%
6	付卫国	1,556,193	0.48%
7	杨伟江	1,551,576	0.48%
8	霍育英	1,546,050	0.48%
9	张能鸿	1,359,122	0.42%
10	艾良华	1,208,606	0.37%

注：以上信息依据中国证券登记结算有限公司上海分公司提供的持有人信息编制。由于四舍五入的原因，占场内总份额比例分项之和与合计可能有尾差。

五、基金主要当事人简介

（一）基金管理人

- 1、名称：华安基金管理有限公司
- 2、法定代表人：朱学华
- 3、总经理：童威
- 4、注册资本：1.5亿元人民币
- 5、住所：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道8号国金中心二期31-32层
- 6、批准设立机关及设立批准文号：中国证监会证监基金字【1998】20号
- 7、工商登记注册的法人营业执照文号：3100000000062071
- 8、经营范围：基金管理业务、发起设立基金及中国证券监督管理委员会批准的其他业务。

9、股权结构

持股单位	持股占总股本比例
国泰君安证券股份有限公司	20%
上海上国投资产管理有限公司	20%
上海锦江国际投资管理有限公司	20%
上海工业投资（集团）有限公司	20%
国泰君安投资管理股份有限公司	20%

10、内部组织结构及职能

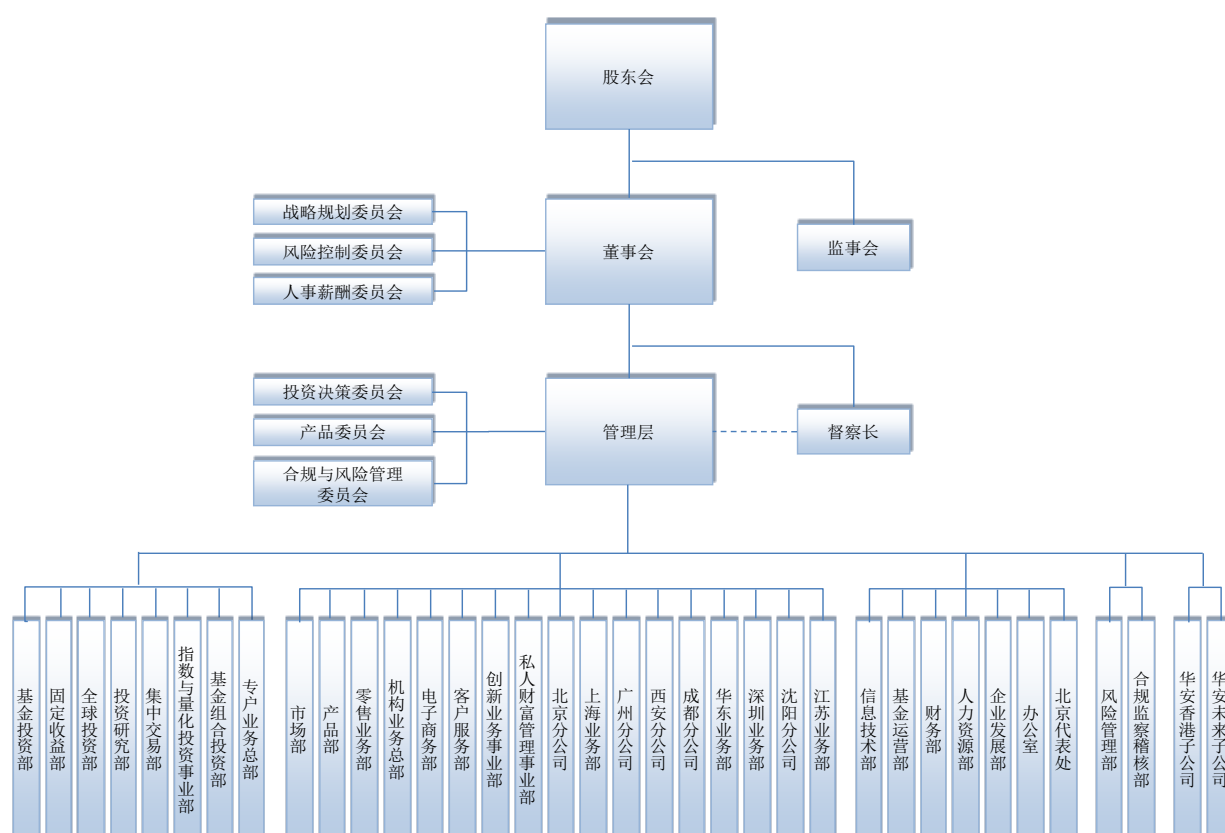
公司按照建立和完善公司治理结构的要求，设立董事会和监事会。

董事会决定公司的战略规划，强化各项审计稽核监察职能，充分保障公司基金持有人的利益，为公司的健康发展提供最佳的资源支持，并且为保护基金持有人的利益提供最佳保障。董事会由八名董事组成，其中，每一股东各推荐一名，总经理为公司董事，另两名为独立董事。董事会为股东会的执行机构，并对股东会负责。董事会下设风险控制、战略规划和人事薪酬等三个专业委员会。

监事会由三名监事组成，其中两名监事为公司职工代表，由公司职工民主选举和罢免。其余成员由股东会选举和罢免。监事会向股东会负责，并向股东会汇报工作情况。

公司实行董事会领导下的总经理负责制。总经理全面负责公司的经营管理。

公司组织架构以公司发展战略为导向而建立，主要采用管理扁平、分工明确的职能制结构，设有投资研究、市场营销、运营及后台、合规风控四大板块以及两个子公司（华安资产管理（香港）有限公司、华安未来资产管理（上海）有限公司）。公司组织架构如下图所示：



11、人员情况：

截至2019年9月30日，公司目前共有员工359人（不含香港公司），其中57.5%

具有硕士及以上学历，92.7%以上具有三年证券业或五年金融业从业经历，具有丰富的实际操作经验。所有上述人员在最近三年内均未受到所在单位及有关管理部门的处罚。公司业务由投资研究、市场营销、合规风控、后台支持等四个业务板块组成。

12、信息披露负责人：陆滢

电话：（021）38969727

13、基金管理业务情况简介：

截至2019年9月30日，华安基金管理有限公司旗下共管理127只开放式基金，资产规模达3286.7亿元人民币。旗下管理的基金包括：华安创新、华安MSCI中国A股指数增强、华安现金富利、华安宝利配置、华安上证180ETF、华安宏利、华安中小盘成长、华安策略优选、华安稳定收益、华安核心优选、华安强化收益、华安上证180ETF联接、华安动态灵活配置、华安行业轮动、华安香港精选、华安上证龙头ETF、华安上证龙头ETF联接、华安升级主题、华安大中华升级、华安可转债、华安量化多因子、华安信用四季红、华安科技动力、华安标普全球石油、华安月月鑫、华安季季鑫、华安月安鑫、华安沪深300、华安逆向策略、华安安心收益、华安日日鑫、华安添鑫中短债、华安纯债、华安保本、华安安信消费服务、华安双债添利、华安黄金ETF、华安纳斯达克100美元现钞、华安易富黄金ETF联接、华安沪深300量化增强、华安年年红、华安生态优先、华安中证细分医药ETF、华安新活力、华安大国新经济、华安安顺、华安汇财通、华安德国30(DAX)ETF、华安德国30(DAX)ETF联接、华安中证细分医药ETF联接、华安安享、华安年年盈、华安物联网主题、华安新动力、华安新丝路主题、华安智能装备主题、华安媒体互联网、华安新回报、华安新机遇、华安新优选、华安中证全指证券、华安中证银行、华安添颐、华安国企改革、华安创业板50、华安新乐享、华安安益、华安安康、华安安华、华安沪港深外延增长、华安稳固收益、华安全球美元收益A美元现汇、华安安禧灵活、华安全球美元票息A美元现汇、华安创业板50ETF、华安安进灵活配置、华安聚利18个月、华安智增精选、华安睿享定期开放、华安鼎丰、华安新瑞利、华安新恒利、华安新泰利、华安事件驱动量化策略、华安新丰利、华安沪港深通精选、华安现金宝、华安睿安、华安沪港深机会、华安文体健康主题、华安大安全、华安幸福生活、华安鼎瑞定期开放、

华安红利精选、华安安悦、华安研究精选、华安安逸半年定开、华安睿明两年定开、华安CES港股通精选100ETF、华安CES港股通精选100ETF联接、华安全球稳健配置、华安安浦、华安MSCI中国A股国际ETF、华安MSCI中国A股国际ETF联接、华安鼎益、华安创业板50ETF联接、华安中证500行业中性低波动ETF、华安制造先锋、华安中证500低波动ETF联接、华安安盛3个月定开、华安安泰定期开放、华安沪深300行业中性低波动ETF、华安双核驱动、华安低碳生活、华安沪港深优选、华安养老2030三年、华安智能生活、华安鼎信3个月定开、华安中债1-3年政策性金融债、华安安平6个月定开、华安科创主题3年、华安三菱日联日经225ETF、华安成长创新、华安中证民企成长ETF、华安安业、华安年年丰、华安现金润利浮动净值等127只开放式基金。

14、本基金基金经理

胡宜斌先生，硕士研究生，7年证券、基金行业从业经验。曾任杭州核新同花顺股份有限公司产品经理、长江证券股份有限公司研究员、上投摩根基金管理有限公司研究员，2015年5月加入华安基金，担任基金投资部基金经理助理。2015年11月起担任华安媒体互联网混合型证券投资基金的基金经理。2016年1月至2017年7月，担任华安乐惠保本混合型证券投资基金的基金经理。2016年11月起，同时担任华安睿享定期开放混合型发起式证券投资基金的基金经理。2019年5月起同时担任华安智能生活混合型证券投资基金的基金经理。

李欣先生，硕士研究生，9年证券、基金行业从业经验，曾在台达电子工业股份有限公司任产品研发工程师，华泰联合证券有限责任公司任研究员。2012年5月加入华安基金管理有限公司，历任投资研究部研究员，基金投资部基金经理助理。2015年7月起任华安智能装备主题股票型证券投资基金基金经理。2017年7月起任华安文体健康主题灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2018年6月起任华安中小盘成长股票型证券投资基金基金经理。2019年3月起，同时担任华安低碳生活混合型证券投资基金的基金经理。

谢昌旭先生，硕士研究生，6年金融行业从业经验，历任融通基金管理有限公司研究员、平安养老保险股份有限公司权益投资经理。2018年9月加入华安基金，2018年10月起，担任华安新丝路主题股票型证券投资基金的基金经理。2019年3月起，同时担任华安双核驱动混合型证券投资基金的基金经理。

贺涛先生，硕士研究生，21年证券、基金从业经历。曾任长城证券有限责任公司债券研究员，华安基金管理有限公司债券研究员、债券投资风险管理、固定收益投资经理。2008年4月起担任华安稳定收益债券型证券投资基金的基金经理。2011年6月起同时担任华安可转换债券债券型证券投资基金的基金经理。2012年12月至2017年6月担任华安信用增强债券型证券投资基金的基金经理。2013年6月起同时担任华安双债添利债券型证券投资基金的基金经理、固定收益部助理总监。2013年8月起担任固定收益部副总监。2013年10月至2017年7月，同时担任华安现金富利投资基金、华安月月鑫短期理财债券型证券投资基金、华安季季鑫短期理财债券型证券投资基金、华安月安鑫短期理财债券型证券投资基金的基金经理。2014年7月至2017年7月，同时担任华安汇财通货币市场基金的基金经理。2015年2月至2017年6月担任华安年年盈定期开放债券型证券投资基金的基金经理。2015年5月起担任固定收益部总监。2015年5月至2017年7月，担任华安新回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2015年9月至2018年9月，担任华安新乐享保本混合型证券投资基金的基金经理。2018年9月起，同时担任华安新乐享灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2015年12月至2017年7月，同时担任华安乐惠保本混合型证券投资基金的基金经理。2016年2月至2018年8月，同时担任华安安华保本混合型证券投资基金的基金经理。2016年7月至2019年1月，同时担任华安安进保本混合型发起式证券投资基金的基金经理。2019年1月起，同时担任华安安进灵活配置混合型发起式证券投资基金的基金经理。2016年11月起，同时担任华安睿享定期开放混合型发起式证券投资基金的基金经理。2016年11月至2017年12月，同时担任华安新希望灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2017年2月起，同时担任华安新活力灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018年2月起，同时担任华安丰利18个月定期开放债券型证券投资基金的基金经理。2019年1月起，同时担任华安安盛3个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理。

郑如熙先生，硕士研究生，15年相关从业经验。历任上海远东资信评估有限公司评级分析师、太平资产管理有限公司信用研究员、华泰证券股份有限公司投资经理、交易团队负责人，2017年5月加入华安基金，任固定收益部研究员。2017年7月起，担任华安纯债债券型发起式证券投资基金的基金经理。2018年2月至

2018年5月，同时担任华安慧增优选定期开放灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018年3月起，同时担任华安安悦债券型证券投资基金、华安安逸半年定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理。2018年11月起，同时担任华安鼎益债券型证券投资基金的基金经理。2019年1月起，同时担任华安安泰定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理。2019年4月起，同时担任华安添鑫中短债债券型证券投资基金的基金经理。

（二）基金托管人

1、托管人基本信息

名称：中国建设银行股份有限公司(简称：中国建设银行)

住所：北京市西城区金融大街25号

办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼

法定代表人：田国立

成立时间：2004年09月17日

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12号

联系人：田 青

联系电话：(010)6759 5096

中国建设银行成立于1954年10月，是一家国内领先、国际知名的大型股份制商业银行，总部设在北京。本行于2005年10月在香港联合交易所挂牌上市(股票代码939)，于2007年9月在上海证券交易所挂牌上市(股票代码601939)。

2018年末，集团资产规模23.22万亿元，较上年增长4.96%。2018年度，集团实现净利润2,556.26亿元，较上年增长4.93%；平均资产回报率和加权平均净资产收益率分别为1.13%和14.04%；不良贷款率1.46%，保持稳中有降；资本充足率17.19%，保持领先同业。

2018年，本集团先后荣获新加坡《亚洲银行家》“2018年中国最佳大型零售银行奖”、“2018年中国全面风险管理成就奖”；美国《环球金融》“全球贸易金融最具创新力银行”、《银行家》“2018最佳金融创新奖”、《金融时报》“2018

年金龙奖一年度最佳普惠金融服务银行”等多项重要奖项。本集团同时获得英国《银行家》、香港《亚洲货币》杂志“2018年中国最佳银行”称号，并在中国银行业协会2018年“陀螺”评价中排名全国性商业银行第一。

中国建设银行总行设资产托管业务部，下设综合与合规管理处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、养老金托管处、全球托管处、新兴业务处、运营管理处、托管应用系统支持处、跨境托管运营处、合规监督处等11个职能处室，在安徽合肥设有托管运营中心，在上海设有托管运营中心上海分中心，共有员工300余人。自2007年起，托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计，并已经成为常规化的内控工作手段。

2、主要人员情况

蔡亚蓉，资产托管业务部总经理，曾先后在中国建设银行总行资金计划部、信贷经营部、公司业务部以及中国建设银行重组改制办公室任职，并在总行公司业务部担任领导职务。长期从事公司业务，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

龚毅，资产托管业务部资深经理（专业技术一级），曾就职于中国建设银行北京市分行国际部、营业部并担任副行长，长期从事信贷业务和集团客户业务等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

黄秀莲，资产托管业务部资深经理（专业技术一级），曾就职于中国建设银行总行会计部，长期从事托管业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

郑绍平，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行投资部、委托代理部、战略客户部，长期从事客户服务、信贷业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

原珏，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行国际业务部，长期从事海外机构及海外业务管理、境内外汇业务管理、国外金融机构客户营销拓展等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

3、基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履行托管人的各项职责，切实维护资产持有人的合法权益，为资产委托人提供高质量的托

管服务。经过多年稳步发展，中国建设银行托管资产规模不断扩大，托管业务品种不断增加，已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、(R)QFII、(R)QDII、企业年金、存托业务等产品在内的托管业务体系，是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至2019年二季度末，中国建设银行已托管924只证券投资基金。中国建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平，赢得了业内的高度认同。中国建设银行先后9次获得《全球托管人》“中国最佳托管银行”、4次获得《财资》“中国最佳次托管银行”、连续5年获得中债登“优秀资产托管机构”等奖项，并在2016年被《环球金融》评为中国市场唯一一家“最佳托管银行”、在2017年荣获《亚洲银行家》“最佳托管系统实施奖”。

（四）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)

住所：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路1318号星展银行大厦507单元01室

办公地址：上海市湖滨路202号领展企业广场2座普华永道中心11楼

执行事务合伙人：李丹

联系电话：（021）23238888

传真：（021）23238800

联系人：张青萌

经办注册会计师：单峰、魏佳亮

六、基金合同摘要

基金合同的内容摘要见附件：基金合同摘要。

七、基金财务状况

（一）基金募集期间费用

本次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由本基金管理人承担，不从基金资产中列支。

(二) 基金上市前重要财务事项

本基金发售后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。

(三) 基金资产负债表

本基金截至2019年12月13日的资产负债表如下：

资 产	本期末 2019年12月13日
资 产：	
银行存款	43,075,860.98
结算备付金	2,962,018.69
存出保证金	103,414.48
交易性金融资产	1,198,146,506.19
其中：股票投资	25,132,066.69
基金投资	
债券投资	1,173,014,439.50
资产支持证券投资	
商品现货合约投资	
衍生金融资产	
买入返售金融资产	
应收证券清算款	238,182.07
应收利息	17,856,891.36
应收股利	
应收申购款	
递延所得税资产	
其他资产	
资产总计	1,262,382,873.77
负债和所有者权益	
负 债：	
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	248,500,000.00
应付证券清算款	
应付赎回款	
应付管理人报酬	432,343.95
应付托管费	72,057.32
应付销售服务费	

应付交易费用	69,839.39
应交税费	42,559.02
应付利息	38,330.28
应付利润	
递延所得税负债	
其他负债	150,334.56
负债合计	249,305,464.52
所有者权益：	
实收基金	988,565,281.49
未分配利润	24,512,127.76
所有者权益合计	1,013,077,409.25
负债和所有者权益总计	1,262,382,873.77

注：报告截止日 2019 年 12 月 13 日，基金份额净值 1.0248 元，基金份额总额 988,565,281.49 份。

八、基金投资组合

截至 2019 年 12 月 13 日，本基金的投资组合情况如下：

（一）基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	25,132,066.69	1.99
	其中：股票	25,132,066.69	1.99
2	固定收益投资	1,173,014,439.50	92.92
	其中：债券	1,173,014,439.50	92.92
	资产支持证券		
3	商品现货合约投资		
	其中：股票		
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	46,037,879.67	3.65
7	其他各项资产	18,198,487.91	1.44
8	合计	1,262,382,873.77	100.00

(二) 期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业		
B	采矿业		
C	制造业	18,131,359.46	1.79
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	17,221.60	0.00
E	建筑业		
F	批发和零售业	663,662.00	0.07
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	3,688,180.87	0.36
J	金融业	653.10	0.00
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	475,461.00	0.05
N	水利、环境和公共设施管理业	180,768.00	0.02
O	居民服务、修理和其他服务业		
P	教育		
Q	卫生和社会工作	353,547.00	0.03
R	文化、体育和娱乐业	1,586,421.00	0.16
S	综合	34,792.66	0.00
	合计	25,132,066.69	2.48

(三) 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601138	工业富联	60,000.00	1,135,200.00	0.11
2	688036	传音控股	23,066.00	950,088.54	0.09
3	688122	西部超导	15,715.00	495,965.40	0.05
4	688022	瀚川智能	12,006.00	495,247.50	0.05
5	000739	普洛药业	32,300.00	443,802.00	0.04
6	002624	完美世界	9,800.00	368,480.00	0.04
7	002475	立讯精密	10,000.00	367,000.00	0.04
8	002555	三七互娱	15,000.00	356,250.00	0.04
9	300750	宁德时代	3,800.00	353,400.00	0.03
10	603986	兆易创新	1,000.00	203,330.00	0.02

(四) 期末按券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	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券		
2	央行票据		
3	金融债券	20,376,000.00	2.01
	其中：政策性金融债	20,376,000.00	2.01
4	企业债券	1,111,796,000.00	109.74
5	企业短期融资券		
6	中期票据	40,606,000.00	4.01
7	可转债（可交换债）	236,439.50	0.02
8	同业存单		
9	其他		

10	合计	1,173,014,439.50	115.79
----	----	------------------	--------

(五) 期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券明细

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	占基金资产 净值比例 (%)
1	112413	16 兴蓉 01	900,000.00	90,819,000.00	8.96
2	155439	19 中船 01	700,000.00	70,490,000.00	6.96
3	143010	17 鲁资 01	700,000.00	70,231,000.00	6.93
4	136493	16 成渝 01	600,000.00	60,024,000.00	5.92
5	155366	19 浦集 01	500,000.00	50,575,000.00	4.99

(六) 投资组合报告附注

1 本报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体不存在被监管部门立案调查,在本报告编制日前一年内也不存在受到公开谴责、处罚的情况。

2 本基金投资前十名股票中,不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	103,414.48
2	应收证券清算款	238,182.07
3	应收股利	
4	应收利息	17,856,891.36
5	应收申购款	
6	其他应收款	
7	待摊费用	
8	其他	
9	合计	18,198,487.91

4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的 公允价值	占基金资 产净值比 例(%)	流通受限情况说 明
1	688122	西部超导	495,965.40	0.05	锁定期
2	688022	瀚川智能	495,247.50	0.05	锁定期

九、重大事件揭示

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

十、基金管理人承诺

基金管理人就基金上市交易之后履行管理人职责做出以下承诺：

（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、证券交易所的监
督管理。

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

十一、基金托管人承诺

基金托管人就本基金上市交易后履行托管人职责做出如下承诺：

（一）严格遵守《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定，设立专门的
基金托管部，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员负责基金财产托
管事宜。

（二）根据《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定，对基金的投资范
围、基金资产的投资组合比例、基金资产净值的计算、基金管理人报酬的计提和

支付、基金托管人报酬的计提和支付等行为进行监督和核查。

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

(四)基金托管人发现基金管理人有关重大违规行为,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、备查文件目录

(一)中国证监会准予华安科创主题3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金注册的文件

(二)《华安科创主题3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金基金合同》

(三)《华安科创主题3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金托管协议》

(四)《华安科创主题3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》

(五)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

备查文件存放地点为基金管理人、基金托管人的住所;投资者如需了解详细的信息,可向基金管理人、基金托管人申请查阅。

附件：基金合同摘要

第一节 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

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

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；

(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资产净值，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，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；

(13) 按《基金合同》的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有

人分配基金收益；

(14) 按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

(15) 依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

(16) 按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料 15 年以上；

(17) 确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出，并且保证投资者能够按照《基金合同》规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并在支付合理成本的条件下得到有关资料的复印件；

(18) 组织并参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

(19) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；

(20) 因违反《基金合同》导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益时，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

(21) 监督基金托管人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金托管人违反《基金合同》造成基金财产损失时，基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；

(22) 当基金管理人将其义务委托第三方处理时，应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任；

(23) 以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为；

(24) 基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件，《基金合同》不能生效，基金管理人承担全部募集费用，将已募集资金并加计银行同期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

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

（1）自《基金合同》生效之日起，依法律法规和《基金合同》的规定安全保管基金财产；

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

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

（4）根据相关市场规则，为基金开设资金账户、证券账户等投资所需账户、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，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业监管机构，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。

第二节 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不设日常机构。

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或基金合同另有约定的除外：

（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，但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）除外；

（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，但封闭运作期结束后依据基金合同变更为“华安智联混合型证券投资基金（LOF）”并按照基金合同约定的“华安智联混合型证券投资基金（LOF）”的投资目标、投资范围和投资策略执行的除外；

（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；

（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，以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会：

（1）调低除基金管理费、基金托管费外的其他应由基金承担的费用；

（2）法律法规要求增加的基金费用的收取；

（3）调整本基金的申购费率、调低赎回费率或变更收费方式；

（4）增加、减少或调整基金份额类别及定义；

（5）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；

（6）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；

（7）基金管理人、登记机构、基金销售机构调整有关基金认购、申购、赎回、转托管、基金交易、非交易过户等业务规则；

（8）本基金推出新业务或新服务；

（9）在不违反法律法规的情况下，调整基金的申购赎回方式；

（10）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、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。

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

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

五、议事内容与程序

1、议事内容及提案权

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

额持有人大会讨论的其他事项。

基金份额持有人大会的召集人发出召集会议的通知后,对原有提案的修改应当在基金份额持有人大会召开前及时公告。

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

2、议事程序

(1) 现场开会

在现场开会的方式下,首先由大会主持人按照下列第七条规定程序确定和公布监票人,然后由大会主持人宣读提案,经讨论后进行表决,并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表,在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下,由基金托管人授权其出席会议的代表主持;如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会,则由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的50%以上(含50%)选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人拒不出席或主持基金份额持有人大会,不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

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

(2) 通讯开会

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

六、表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议:

1、一般决议,一般决议须经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的二分之一以上(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。

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后依照《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。

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、基金托管人根据新颁布的法律法规或监管规则协商一致并提前公告后，可直接对本部分内容进行修改和调整，无需召开基金份额持有人大会审议。

第三节 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，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；登记在基金份额持有人上海证券账户下的基金份额，只能选择现金分红的方式，具体权益分配程序等有关事项遵循上海证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定；

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、若基金合同生效不满3个月则不进行收益分配；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在不违背法律法规及基金合同的规定、且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人经与托管人协商一致，可在按照监管部门要求履行适当程序后调整基金收益的分配原则，不需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。

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并报中国证监会备案。

在收益分配方案公布后，基金管理人依据具体方案的规定就支付的现金红利向基金托管人发送划款指令，基金托管人按照基金管理人的指令及时进行分红资金的划付。

六、基金收益分配中发生的费用

基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。对于场外份额，当投资者的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费时，基金登记机构可将基金份额持有人的现金红利自动转为基金份额。红利再投资的计算方法，依照《业务规则》执行。对于场内份额，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。

第四节 与基金财产管理、运用有关费用的提取、支付方式与比例

一、基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、诉讼费和仲裁费；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金的证券、期货交易费用；
- 7、基金的银行汇划费用；
- 8、基金的账户开户费用、账户维护费用；
- 9、基金上市费和年费；
- 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。

二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、封闭运作期内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，自动在次月初五个工作日内、按照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、封闭运作期内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，自动在次月初五个工作日内、按照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。

3、在本基金封闭运作期届满转为“华安智联混合型证券投资基金（LOF）”后，基金管理费、基金托管费自转为变更后的“华安智联混合型证券投资基金（LOF）”当日按下述标准开始计提：基金管理费按前一日基金资产净值的 0.70% 的年费率计提，基金托管费按前一日基金资产净值的 0.20% 的年费率计提，具体计算方式如下：

（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 0.70% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.70\% \div \text{当年天数}$$

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，自动在次月初五个工作日内、按照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 0.20% 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，自动在次月初五个工作日内、按照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。

上述“一、基金费用的种类”中除基金管理费、基金托管费之外的其他费用，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。

第五节 基金财产的投资方向和投资限制

一、投资范围

（一）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（含科创板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券（含可分离交易可

转债)、可交换债券、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、债券回购、同业存单、银行存款(包含协议存款、定期存款及其他银行存款)、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)。

本基金不投资于信用等级在 AA+ 以下的债券。

本基金的投资组合比例：本基金股票资产投资比例为基金资产的 0%-100%；投资于科创主题相关证券的比例不低于非现金基金资产的 80%。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、存出保证金、应收申购款等。股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

(二) 封闭运作期届满转为开放式运作后

本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票(包括科创板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票)、债券(包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券(含可分离交易可转债)、可交换债券、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。

本基金的投资组合比例：股票资产投资比例为 0%-45%。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，本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

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。

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) 本基金股票资产投资比例为基金资产的 0%-100%；投资于科创主题相关证券的比例不低于非现金基金资产的 80%；

(2) 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、存出保证金和应收申购款等；

(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) 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；

(6) 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；

(7) 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%；

(8) 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；

(9) 基金参与股指期货交易，应当遵守下列要求：

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) 每个交易日日终，持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和，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）、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；

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）应当符合本基金合同关于股票投资比例的有关约定；

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%；

(10) 封闭运作期内，本基金的基金资产总值不得超过基金资产净值的 200%；

(11) 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 (2)、(8) 项外，因证券/期货市场波动、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、封闭运作期届满转为开放式运作后，基金的投资组合应遵循以下限制：

(1) 本基金股票资产投资比例为基金资产的 0%—45%；

(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，本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等；

(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%；

(6) 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；

(7) 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;

(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) 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;

(14) 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;

(15) 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;

(16) 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%;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%;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;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%;

(17) 本基金资产总值不超过基金资产净值的 140%;

(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)、(6)、(7)、(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。

基金管理人应当自封闭运作期届满之日起 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,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。

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。

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。

第六节 基金资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。基金份额净值是按照每个工作日闭市后，基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算，精确到 0.0001 元，小数点后第 5 位四舍五入。基金管理人可以设立大额赎回情形下的净值精度应急调整机制。国家另有规定的，从其规定。

基金管理人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。

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，由基金管理人按照基金合同规定对外公布。

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份额净值予以公布。

第七节 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须报中国证监会备案，并自表决通过之日起生效，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。

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、基金财产清算小组成员：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、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。

第八节 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，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。仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力。除非仲裁裁决另有决定，仲裁费用由败诉方承担。

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

《基金合同》受中国法律管辖。

第九节 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。

附件：场外非直销销售机构名单

1、中国建设银行股份有限公司

客户服务电话：95533

网址：www.ccb.com

2、交通银行股份有限公司

网址：www.bankcomm.com

客服电话：95559

3、招商银行股份有限公司

客户服务电话：95555

网址：www.cmbchina.com

4、中信银行股份有限公司

客户服务电话：95558

网址：bank.ecitic.com

5、上海浦东发展银行股份有限公司

客户服务电话：95528

网址：www.spdb.com.cn

6、中国光大银行股份有限公司

客户服务电话：95595

网址：www.cebbank.com

7、中国民生银行股份有限公司

客户服务电话：95568

网址：www.cmbc.com.cn

8、中国邮政储蓄银行股份有限公司

客户服务电话：95580

网址：www.psbc.com

9、北京银行股份有限公司

客户服务电话：95526

网址：www.bankofbeijing.com.cn

10、上海银行股份有限公司

客户服务电话：（021）95594

网址：www.bankofshanghai.com

11、平安银行股份有限公司

客服电话：95511

网址：bank.pingan.com

12、上海农村商业银行股份有限公司

客服电话：（021）962999

网址：www.srcb.com

13、宁波银行股份有限公司

客户服务电话：95574

网址：www.nbcb.com.cn

14、青岛银行股份有限公司

客户服务电话:400-66-96588

网址:www.qdccb.com/

15、东莞银行股份有限公司

客户服务电话：4001196228

网址：www.dongguanbank.cn

16、南京银行股份有限公司

客户服务电话：95302

公司网址：www.njcb.com.cn

17、东莞农村商业银行股份有限公司

客服电话：961122

公司网站：www.drcbank.com

18、河北银行股份有限公司

客户服务电话：400-612-9999

网站：www.hebbank.com

19、江苏江南农村商业银行股份有限公司

客户服务电话：96005

网址：www.jnbank.com.cn

20、长沙银行股份有限公司

客服电话：0731-96511（国内）/40067-96511（国际）

公司网址：www.cscb.cn

21、苏州银行股份有限公司

客服电话：96067

网站：www.suzhoubank.com

22、东亚银行（中国）有限公司

客户服务电话：95382

网址：www.hkbea.com.cn

23、福建海峡银行股份有限公司

客户服务热线:400-893-9999

公司网站:www.fjhxbank.com

24、中国工商银行股份有限公司

客户服务电话：95588

网址：www.icbc.com.cn

25、中国农业银行股份有限公司

客户服务电话：95599

网址：www.abchina.com

26、中国银行股份有限公司

客户服务电话：95566

网址：www.boc.cn

27、上海天天基金销售有限公司

电话：4001818188

网址：www.1234567.com.cn

28、上海好买基金销售有限公司

电话：400-700-9665

网址：www.ehowbuy.com

29、上海长量基金销售有限公司

客户服务电话：400-820-2899

网址: www.e-rich.com.cn

30、北京恒天明泽基金销售有限公司

客服电话: 4008980618

网址: www.chtfund.com/

31、海银基金销售有限公司

客户服务电话: 400-808-1016

网址: <http://www.fundhaiyin.com>

32、上海陆金所基金销售有限公司

客户服务电话: 400-866-6618

网址: <https://www.lu.com/>

33、上海联泰资产管理有限公司

客户服务电话: 400-046-6788

网址: www.66zichan.com

34、珠海盈米基金销售有限公司

客户服务电话: 020-89629066

网站: www.yingmi.cn

35、中欧钱滚滚基金销售（上海）有限公司

客户服务电话: 400-700-9700

公司网址: www.qiangungun.com

36、上海利得基金销售有限公司

客户服务电话: 400-921-7755

网址: www.leadbank.com.cn

37、中证金牛（北京）投资咨询有限公司

客户服务电话: 4008909998

网址: www.jnlc.com

38、上海凯石财富基金销售有限公司

客户服务电话: 4000 178 000

网址: www.lingxianfund.com

39、江海证券有限公司

客户服务电话：40066-62288

40、奕丰基金销售有限公司

客户服务电话：400-684-0500

公司网站：www.ifastps.com.cn

41、北京蛋卷基金销售有限公司

客户服务电话：4000618518

传真：010-61840699

网站：https://danjuanapp.com/

42、上海万得基金销售有限公司

客户服务电话：400-821-0203

43、西藏东方财富证券股份有限公司

客户服务电话：021-54509999

公司网站：www.eastmoney.com

44、上海挖财基金销售有限公司

客户服务电话：021-50810673

网址：www.wacaijijin.com

45、济安财富(北京)资本管理有限公司

客户服务电话：400-075-6663（济安财富官网） 400-071-6766（腾讯财经）

公司网站：www.jianfortune.com

46、上海基煜基金销售有限公司

公司网站：www.jiyufund.com.cn/

客户服务电话：400-820-5369

47、泛华普益基金销售有限公司

客户服务电话：4008-588-588

48、嘉实财富管理有限公司

客户服务电话：4000218850

公司网站：www.harvestwm.cn

49、深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

客户服务电话：4001161188

网址: <https://8.jrj.com/>

50、北京肯特瑞财富投资管理有限公司

客服电话: 个人业务:95118 企业业务: 400-088-8816

公司网址: <http://fund.jd.com>

51、蚂蚁(杭州)基金销售有限公司

电话: 4000-766-123

网址: www.fund123.cn

52、南京苏宁基金销售有限公司

客户服务电话: 95177

53、诺亚正行基金销售有限公司

电话: 400-821-5399

网址: www.noah-fund.com

54、上海通华财富基金销售有限公司

客服电话: 95156

公司网址: www.tonghuafund.com

55、宜信普泽(北京)基金销售有限公司

网址: <http://www.yixinfund.com/>

客服电话: 400-6099-200

56、北京百度百盈基金销售有限公司

电话: 010-61952703

传真: 010-61951007

57、深圳市金斧子基金销售有限公司

客户服务电话: 400-930-0660

公司网址: www.jfzinv.com

58、腾安基金销售(深圳)有限公司

网址 tenganxinxi.com

客服电话 0755-86013388转65864

59、开源证券股份有限公司

客服电话: 400-860-8866

公司网址：www.kysec.cn

60、国泰君安证券股份有限公司

客户服务电话：95521

网址：www.gtja.com

61、中信证券股份有限公司

客户服务电话：0755-23835888

网址：www.cs.ecitic.com

62、申万宏源证券有限公司

客户服务电话：（021）96250500

网址：www.swhysc.com

63、万联证券有限责任公司

客户服务电话：400-8888-133

网址：www.wlzq.com.cn

64、渤海证券股份有限公司

客户服务电话：400-651-5988

公司网站：www.ewww.com.cn

65、中信证券（山东）有限责任公司

客户服务电话：95548

网址：www.zxwt.com.cn

66、新时代证券股份有限公司

客户服务电话：400-698-9898

网址：www.xsdzq.cn

67、平安证券股份有限公司

电话：4008866338

客户服务电话：95511-8

网址：stock.pingan.com

68、财富证券有限责任公司

客户服务电话：4008835316/ 95317

网址：www.cfzq.com

69、国都证券股份有限公司

客户服务电话：400-818-8118

网址：www.guodu.com

70、东海证券股份有限公司

客户服务电话：95531

网址：www.longone.com.cn

71、中银国际证券有限责任公司

客户服务电话：021-4006208888

网址：www.bocichina.com

72、申万宏源西部证券有限公司

客户服务电话：4008000562

公司网址：www.swhysc.com

73、中信期货有限公司

客户服务电话:400-990-8826

网址:www.citicsf.com

74、中信建投证券股份有限公司

客户服务电话：95587

网址：www.csc108.com

75、华金证券股份有限公司

网址：<http://www.huajinsc.cn>

76、华鑫证券有限责任公司

客服电话：021—32109999

网址：<http://www.cfsc.com.cn>

77、中泰证券股份有限公司

客户服务电话：95538

网址：<http://www.zts.com.cn/>

78、宏信证券有限责任公司

客服电话: 4008-366-366

网址：<http://www.hxzq.cn>

79、光大证券股份有限公司

客户服务电话: 95525、4008888788

网站: www.ebscn.com

80、湘财证券股份有限公司

客户服务电话: 95351/400-888-1551

网址: www.xcsc.com

81、华林证券股份有限公司

客户服务电话: 400-188-3888

公司网站: <http://www.chinalions.com/>

82、方正证券股份有限公司

客户服务电话: 0731-95571

网址: www.foundersc.com

83、兴业证券股份有限公司

客户服务电话: 95562

网址: www.xyzq.com.cn

网址: www.jhzq.com.cn

84、国海证券股份有限公司

客户服务电话: 95563

网址: www.ghzq.com.cn

85、浙江同花顺基金销售有限公司

客户服务电话: 4008-773-772

网址: www.5ifund.com

86、北京格上富信投资管理有限公司

客户服务电话: 010-82350618

公司网址: www.igesafe.com

87、浦领基金销售有限公司

客户服务电话: 400-012-5899

公司网站: www.zscffund.com

88、一路财富（北京）基金销售有限公司

客服电话：400-001-1566

公司网址：www.yilucaifu.com

89、北京唐鼎耀华基金销售有限公司

网址：www.tdyhfund.com

电话：400-819-9868

90、北京植信基金销售有限公司

客服电话：4006802123

公司网址：www.zhixin-inv.com

91、凤凰金信（银川）投资管理有限公司

客服电话：400-810-5919

网址：http://www.fengfd.com

92、深圳众禄基金销售股份有限公司

电话：4006788887

网址：www.jjmmw.com， www.zlfund.cn

93、国信证券股份有限公司

客户服务电话：95536

网址：www.guosen.com.cn

94、招商证券股份有限公司

客户服务电话：95565

网址：www.newone.com.cn、

95、广发证券股份有限公司

网址：www.gf.com.cn

客户服务电话：95575

96、中国银河证券股份有限公司

客户服务电话：4008-888-888

网址：www.chinastock.com.cn

97、海通证券股份有限公司

客户服务电话：95553 4008888001

网址：www.htsec.com

98、长江证券股份有限公司

客户服务电话: 95579

网址: www.cjsc.com

99、安信证券股份有限公司

客户服务电话: 4008001001

网址: www.essence.com.cn

100、民生证券股份有限公司

客服电话: 4006198888

网址: www.msyzq.com

101、国元证券股份有限公司

咨询电话: 95578

网址: www.gyzq.com.cn

102、华泰证券股份有限公司

客服电话: 95597, 400-889-5597

网址: www.htsc.com.cn

103、山西证券股份有限公司

客户服务电话: 95573

网址: www.sxzq.net

104、信达证券股份有限公司

网址: www.cindasc.com

客户服务电话: 95321

105、长城证券股份有限公司

客户服务电话: 4006666888

网址: www.cgws.com

106、广州证券股份有限公司

客服电话: 95396

网址: www.gzs.com.cn

107、东莞证券股份有限公司

客户服务电话: 0769-95328

网址：www.dgzq.com.cn

108、国盛证券有限责任公司

电话：4008222111

网址：www.gsstock.com

109、华西证券股份有限公司

客户服务电话:95584

网址:www.hx168.com.cn

110、第一创业证券股份有限公司

客户服务电话：95358

网址：www.firstcapital.com.cn

111、德邦证券股份有限公司

网址：www.tebon.com.cn

客户服务电话：4008888128

112、西部证券股份有限公司

客户服务电话：95582

网站：www.westsecu.com

113、华福证券有限责任公司

客户服务电话：96326

网址：www.hfzq.com.cn

114、华龙证券股份有限公司

客户服务电话：0931-4890619

网址：www.hlzq.com

115、财通证券股份有限公司

客服电话：95336

网址：www.ctsec.com

116、中金财富证券有限责任公司

咨询电话：95532；4006008008

网址：www.china-invs.cn

117、中山证券有限责任公司

客服电话：95329

网址：<http://www.zszq.com/>

118、红塔证券股份有限公司

客户服务电话：0871-63577930

网址：www.hongtazq.com

119、联讯证券股份有限公司

客户服务电话：95564

公司网站：www.lxsec.com

120、国金证券股份有限公司

客户服务电话：95310

公司网站：www.gjzq.com.cn

121、东北证券股份有限公司

客服电话：95360

公司网站：www.nesc.cn

122、上海证券有限责任公司

客服电话：4008-918-918

公司网站：www.962518.com

123、国联证券股份有限公司

客服电话：95570

国联证券网址：www.glsc.com.cn

124、浙商证券股份有限公司

客户服务电话：95345

网址：www.stocke.com.cn

125、财达证券股份有限公司

传真：0311-66006414

网址：www.s10000.com

126、天风证券股份有限公司

客户服务电话：028-86712334

网址：www.tfzq.com

127、泉州银行股份有限公司

客户服务电话: 400-889-6312

网址: www.qzccbank.com/n

基金管理人可根据情况变更或增减场外销售机构, 并在官网公示。