



# 浙商科技创新一个月滚动持有混合型证 券投资基金招募说明书更新

基金管理人：浙商基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

## 【重要提示】

浙商科技创新一个月滚动持有混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）由浙商基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）依照有关法律法规发起，并经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）2020年3月26日《关于准予浙商科技创新一个月滚动持有混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可【2020】557号）准予注册。

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本基金经中国证监会注册，但中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的投资价值和市场前景做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

本基金为混合型基金，其预期风险和预期收益高于债券型基金、货币市场基金，但低于股票型基金。投资者在投资本基金前，应全面了解本基金的产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：因整体政治、经济、社会等环境因素对证券/期货市场价格产生影响的市场风险，因金融市场利率的波动而导致证券/期货市场价格和收益率变动的利率风险，因债券和票据发行主体信用状况恶化而可能产生的到期不能兑付的信用风险，因基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，因投资者连续大量赎回基金份额或交易市场流动性不足产生的流动性风险，因本基金投资的证券/期货交易市场数据传输延迟等因素影响业务处理流程造成赎回款顺延划出的风险等。

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交易的股票（包括主板、中小板、创业板、科创板及其他中国证监会允许基金投资的股票、存托凭证）、港股通标的股票、股指期货、债券（包括国债、地方政府债、政府支持机构债券、政府支持债券、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债的纯债部分、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券等）、国债期货、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具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）。

本基金可投资港股通标的股票，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括港股市场股价波动较大的风

险（港股市场实行 T+0 回转交易，且对个股不设涨跌幅限制，港股股价可能表现出比 A 股更为剧烈的股价波动）、汇率风险（汇率波动可能对基金的投资收益造成损失）、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险（在内地开市香港休市的情形下，港股通不能正常交易，港股不能及时卖出，可能带来一定的流动性风险）等。具体风险请参见本招募说明书的“风险揭示”章节。

本基金投资国内上市的科创板股票，会面临因投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括科创板上市公司股价波动较大的风险（科创板对个股每日涨跌幅限制为 20%，且新股上市后的前 5 个交易日不设置涨跌幅限制，股价可能表现出比 A 股其他版块更为剧烈的波动）、科创板上市公司退市的风险（科创板执行比 A 股其他版块更为严格退市标准，且不再设置暂停上市、恢复上市和重新上市环节，可能会对基金净值产生不利影响）、科创板股票流动性较差的风险（由于科创板投资门槛高于 A 股其他版块，整体版块活跃度可能弱于 A 股其他版块，在特殊时期存在基金交易成交等待时间较长或无法成交的可能）、本基金投资集中度相对较高的风险（本基金主要投资科技创新主题股票，该类股票的商业模式、盈利模式等可能存在一定的相似性，因此，持仓股票股价存在同向波动的可能，从而产生对基金净值不利的影响）等。

本基金的投资范围包括资产支持证券，可能给本基金带来额外风险，包括信用风险、利率风险、流动性风险、提前偿付风险、操作风险和法律风险等，由此可能给基金净值带来不利影响或损失。

本基金将股指期货纳入到投资范围当中，股指期货采用保证金交易制度，具有明显的杠杆性，当出现不利行情时，股价指数微小的变动就可能会使投资者权益遭受较大损失。股指期货采用每日无负债结算制度，如果没有在规定的时间内补足保证金，按规定将被强制平仓，可能给投资带来重大损失。

本基金将国债期货纳入到投资范围当中，国债期货采用保证金交易制度，由于保证金交易具有杠杆性，当相应期限国债收益率出现不利变动时，可能会导致投资人权益遭受较大损失。国债期货采用每日无负债结算制度，如果没有在规定的时间内补足保证金，按规定将被强制平仓，可能给投资带来重大损失。

本基金的投资范围包括存托凭证，除与其他仅投资于沪深市场股票的基金所面临的共同风险外，本基金还将面临中国存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏

损的风险，以及与中国存托凭证发行机制相关的风险。

基金合同生效后，本基金对于每份基金份额，设定一个月的滚动运作期。运作期内该基金份额不办理赎回或其他业务。每份基金份额可以在运作期到期日就该基金份额提出赎回申请。因此基金份额持有人面临在滚动运作期内不能赎回基金份额的风险。

投资人在投资本基金之前，请仔细阅读本基金的《招募说明书》和《基金合同》、基金产品资料概要等信息披露文件，全面认识本基金的风险收益特征和产品特性，并充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，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，谨慎做出投资决策。根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断基金是否和投资者的风险承受能力相适应。

基金不同于银行储蓄与债券，基金投资者有可能获得较高的收益，也有可能损失本金。投资有风险，投资者在进行投资决策前，请仔细阅读本基金的《招募说明书》及《基金合同》、基金产品资料概要。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金资产，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。本基金的过往业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现，基金管理人管理的其他基金的业绩亦不构成对本基金业绩表现的保证。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行承担。

投资者应当通过基金管理人或具有基金销售业务资格的其他机构认/申购和赎回基金，基金销售机构名单详见本招募说明书以及相关公告。

基金管理人承诺其知悉《中华人民共和国反洗钱法》、《金融机构客户身份识别和客户身份资料及交易记录保存管理办法》、《金融机构大额交易和可疑交易报告管理办法》、《中国人民银行关于加强反洗钱客户身份识别有关工作的通知》（银发〔2017〕235号）、《中国人民银行关于进一步做好受益所有人身份识别工作有关问题的通知》（银发〔2018〕164号）等反洗钱相关法律法规、监管规定，将严格遵守上述规定，不会违反任何前述规定；承诺用于投资的资金来源不属于违法犯罪所得及其收益；承诺投资的资金来源和去向不涉及洗钱、恐怖融资和逃税等行为；承诺向基金托管人出示真实有效的身份证件或者其他身份证明文件，提

供真实有效的业务性质与股权或者控制权结构、提供产品受益所有人的信息和资料，并在产品受益所有人发生变化时，及时告知基金托管人并按基金托管人要求完成更新；承诺积极履行反洗钱职责，不借助本业务进行洗钱等违法犯罪活动。基金管理人承诺基金管理人及其关联方均不属于联合国、欧盟或美国等制裁名单，及中国政府部门或有权机关发布的涉恐及反洗钱相关风险名单内的企业或个人；不位于被联合国、欧盟或美国等制裁的国家和地区。

本基金本次更新招募说明书对基金经理及基金管理人相关信息进行了更新，更新截止日为 2022 年 1 月 13 日。除非另有说明，其余所载内容截止日为 2021 年 8 月 16 日，投资组合报告为 2021 年 2 季度报告，有关财务数据和净值表现截止日为 2021 年 6 月 30 日（财务数据未经审计）。

## 目录

第一部分 绪言.....	7
第二部分 释义.....	8
第三部分 基金管理人.....	14
第四部分 基金托管人.....	26
第五部分 相关服务机构.....	31
第六部分 基金的募集.....	41
第七部分 基金合同的生效.....	42
第八部分 基金份额的申购与赎回.....	43
第九部分 基金的投资.....	55
第十部分 基金的财产.....	72
第十一部分 基金资产的估值.....	73
第十二部分 基金的收益与分配.....	80
第十三部分 基金的费用与税收.....	82
第十四部分 基金的会计与审计.....	85
第十五部分 基金的信息披露.....	86
第十六部分 风险提示.....	94
第十七部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算.....	102
第十八部分 基金合同的内容摘要.....	104
第十九部分 基金托管协议的内容摘要.....	120
第二十部分 对基金份额持有人的服务.....	141
第二十一部分 招募说明书的存放及查阅方式.....	146
第二十二部分 备查文件.....	147

## 第一部分 绪言

《浙商科技创新一个月滚动持有混合型证券投资基金招募说明书》（以下简称“招募说明书”或“本招募说明书”）依照《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性风险管理规定》”）和其他有关法律法规以及《浙商科技创新一个月滚动持有混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”或“《基金合同》”）编写。

基金管理人承诺本招募说明书不存在任何虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。浙商科技创新一个月滚动持有混合型证券投资基金（以下简称“基金”或“本基金”）是根据本招募说明书所载明的资料申请募集的。本基金管理人没有委托或授权任何其他人提供未在本招募说明书中载明的信息，或对本招募说明书作任何解释或者说明。

本招募说明书根据本基金的基金合同编写，并经中国证监会注册。基金合同是约定基金合同当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资者自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资者欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

## 第二部分 释义

在本招募说明书中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有以下含义：

- 1、基金或本基金：指浙商科技创新一个月滚动持有混合型证券投资基金
- 2、基金管理人：指浙商基金管理有限公司
- 3、基金托管人：指交通银行股份有限公司
- 4、基金合同、《基金合同》：指《浙商科技创新一个月滚动持有混合型证券投资基金基金合同》及对基金合同的任何有效修订和补充
- 5、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《浙商科技创新一个月滚动持有混合型证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充
- 6、招募说明书、《招募说明书》或本招募说明书：指《浙商科技创新一个月滚动持有混合型证券投资基金招募说明书》及其更新
- 7、基金份额发售公告：指《浙商科技创新一个月滚动持有混合型证券投资基金基金份额发售公告》
- 8、基金产品资料概要：指《浙商科技创新一个月滚动持有混合型证券投资基金基金产品资料概要》及其更新
- 9、法律法规：指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、规范性文件、司法解释、行政规章以及其他对基金合同当事人有约束力的决定、决议、通知等
- 10、《基金法》：指《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 11、《销售办法》：指《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 12、《信息披露办法》：指《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 13、《运作办法》：指《公开募集证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 14、《流动性风险管理规定》：指《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及颁布机关对其不时做出的修订
- 15、中国证监会：指中国证券监督管理委员会



16、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银行保险监督管理委员会

17、基金合同当事人：指受基金合同约束，根据基金合同享有权利并承担义务的法律主体，包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人

18、个人投资者：指依据有关法律法规规定可投资于证券投资基金的自然人

19、机构投资者：指依法可以投资证券投资基金的、在中华人民共和国境内合法登记并存续或经有关政府部门批准设立并存续的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织

20、合格境外机构投资者：指符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理暂行办法》及相关法律法规规定可以投资于在中国境内依法募集的证券投资基金的中国境外的机构投资者

21、人民币合格境外机构投资者：指按照《人民币合格境外机构投资者境内证券投资试点办法》及相关法律法规规定，运用来自境外的人民币资金进行境内证券投资的境外法人

22、投资人、投资者：指个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人的合称

23、基金份额持有人：指依基金合同和招募说明书合法取得基金份额的投资人

24、基金销售业务：指基金管理人或销售机构宣传推介基金，发售基金份额，办理基金份额的申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资计划等业务

25、销售机构：指浙商基金管理有限公司以及符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金销售业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务协议，办理基金销售业务的机构

26、登记业务：指基金登记、存管、过户、清算和结算业务，具体内容包括投资人基金账户的建立和管理、基金份额登记、基金销售业务的确认、清算和结算、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册和办理非交易过户等

27、登记机构：指办理登记业务的机构。基金的登记机构为浙商基金管理有限公司或接受浙商基金管理有限公司委托代为办理登记业务的机构

28、基金账户：指登记机构为投资人开立的、记录其持有的、基金管理人所管理的基金份额余额及其变动情况的账户

29、基金交易账户：指销售机构为投资人开立的、记录投资人通过该销售机构办理认购、申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资计划等业务而引起的基金份额变动及结余情况的账户

30、基金合同生效日：指基金募集达到法律法规规定及基金合同规定的条件，基金管理人向中国证监会办理基金备案手续完毕，并获得中国证监会书面确认的日期

31、基金合同终止日：指基金合同规定的基金合同终止事由出现后，基金财产清算完毕，清算结果报中国证监会备案并予以公告的日期

32、基金募集期：指自基金份额发售之日起至发售结束之日止的期间，最长不得超过3个月

33、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限

34、运作期起始日：对于每份基金份额，设定一个月的滚动运作期。运作期内该基金份额不办理赎回或其他业务。每份认购份额的第一个运作期起始日，指基金合同生效日；对于每份申购份额的第一个运作期起始日，指该基金份额申购确认日；对于上一运作期到期日未赎回的每份基金份额的下一运作期起始日，指该基金份额上一运作期到期日后的下一日

35、运作期到期日：对于每份基金份额，第一个运作期到期日指基金合同生效日（对认购份额而言，下同）或基金份额申购确认日（对申购份额而言，下同）1个月后的月度对日（如该月无月度对日或月度对日为非工作日，则顺延到下一工作日，下同），第二个运作期到期日为基金合同生效日或基金份额申购确认日2个月后的月度对日，以此类推

36、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

37、T日：指销售机构在规定时间受理投资人申购、赎回或其他业务申请的开放日

38、T+n日：指自T日起第n个工作日（不包含T日），n为自然数

39、开放日：指为投资人办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日（若本基金参与港股通交易且该工作日为非港股通交易日时，则基金管理人可根据实

际情况决定本基金是否开放申购、赎回及转换业务，具体以届时提前发布的公告为准)

40、开放时间：指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段

41、《业务规则》：指《浙商基金管理有限公司开放式基金业务规则》，是规范基金管理人所管理的开放式证券投资基金登记方面的业务规则，由基金管理人和投资人共同遵守

42、认购：指在基金募集期内，投资人根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为

43、申购：指基金合同生效后，投资人根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为

44、赎回：指基金合同生效后，基金份额持有人按基金合同和招募说明书规定的条件要求将基金份额兑换为现金的行为

45、基金转换：指基金份额持有人按照基金合同和基金管理人届时有效公告规定的条件，申请将其持有基金管理人管理的、某一基金的基金份额转换为基金管理人管理的其他基金基金份额的行为

46、转托管：指基金份额持有人在本基金的不同销售机构之间实施的变更所持基金份额销售机构的操作

47、定期定额投资计划：指投资人通过有关销售机构提出申请，约定每期申购日、申购金额及扣款方式，由销售机构于每期约定申购日在投资人指定银行账户内自动完成扣款及受理基金申购申请的一种投资方式

48、巨额赎回：指本基金单个开放日，基金净赎回申请（赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过上一开放日基金总份额的 10%

49、元：指人民币元

50、基金收益：指基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券价差、银行存款利息、已实现的其他合法收入及因运用基金财产带来的成本和费用的节约

51、基金资产总值：指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收款项以及其他资产的价值总和

52、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的价值

53、**基金份额净值**：指计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数

54、**基金资产估值**：指计算评估基金资产和负债的价值，以确定基金资产净值和基金份额净值的过程

55、**指定媒介**：指中国证监会指定的用以进行信息披露的全国性报刊及指定互联网网站（包括基金管理人网站、基金托管人网站、中国证监会基金电子披露网站）等媒介

56、**销售服务费**：指从基金资产中计提的，用于本基金市场推广、销售以及C类基金份额持有人服务的费用

57、**A类基金份额**：指在投资者认购/申购基金时收取认购/申购费用，并不再从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额

58、**C类基金份额**：指从本类别基金资产中计提销售服务费，并不收取认购/申购费用的基金份额

59、**流动性受限资产**：指由于法律法规、监管、合同或操作障碍等原因无法以合理价格予以变现的资产，包括但不限于到期日在10个交易日以上的逆回购与银行定期存款（含协议约定有条件提前支取的银行存款）、停牌股票、流通受限的新股及非公开发行股票、资产支持证券、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券等

60、**摆动定价机制**：指当本基金遭遇大额申购赎回时，通过调整基金份额净值的方式，将基金调整投资组合的市场冲击成本分配给实际申购、赎回的投资者，从而减少对存量基金份额持有人利益的不利影响，确保投资人的合法权益不受损害并得到公平对待

61、**不可抗力**：指基金合同当事人不能预见、不能避免且不能克服的客观事件

62、**内地与香港股票市场交易互联互通机制**：是指上海证券交易所、深圳证券交易所分别和香港联合交易所有限公司（以下简称香港联合交易所）建立技术连接，使内地和香港投资者可以通过当地证券公司或经纪商买卖规定范围内的对方交易所上市的股票，包括沪港股票市场交易互联互通机制（以下简称沪港通）和深港股票市场交易互联互通机制（以下简称深港通）

63、**港股通标的股票**：指内地投资者委托内地证券公司，经由境内证券交易

所在香港设立的证券交易服务公司，向香港联合交易所进行申报，买卖规定范围内的香港联合交易所上市的股票

## 第三部分 基金管理人

### 一、基金管理人概况

名称：浙商基金管理有限公司

住所：浙江省杭州市下城区环城北路 208 号 1801 室

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴西路 99 号万向大厦 10 楼

法定代表人：肖风

成立时间：2010 年 10 月 21 日

注册资本：3 亿元人民币

存续期间：持续经营

电话：021-60350819

传真：021-60350919

联系人：郭梦珺

股权结构：民生人寿保险股份有限公司出资比例 50%；浙商证券股份有限公司出资比例 25%；养生堂有限公司出资比例 25%。

### 二、主要人员情况

#### 1、基金管理人董事会成员

肖风先生，董事长，1961年生，中共党员，南开大学经济学博士。历任深圳证券管理办公室副处长、处长、证券办副主任；博时基金管理有限公司总裁。现任中国万向控股有限公司副董事长兼执行董事；民生人寿保险股份有限公司副董事长；万向信托股份公司董事长；民生通惠资产管理有限公司董事长；通联数据股份公司董事长；浙江股权交易中心独立董事；上海万向区块链股份公司董事长兼总经理；众安金融服务有限公司非执行董事；众安银行有限公司非执行董事和云锋金融集团有限公司非执行董事；中国万向控股有限公司区块链实验室负责人；上海分布士投资管理有限公司执行董事；鲁冠球三农扶志基金董事；通联支付网络服务股份有限公司董事；万向财务有限公司董事；万向租赁有限公司董事；矩阵元技术（深圳）有限公司董事；上海钜真金融信息服务有限公司董事；上海布沁网络科技有限公司执行董事；蓝象智联（杭州）科技有限公司董事；上海罗伯特互联网金融信息服务有限公司执行董事；上海创源科技发展有限公司董事；

HashKey Digital Asset Group Limited董事。

葛旋先生，董事，1971年生，长江商学院工商管理硕士，经济师职称。历任国信证券股份有限公司总经理助理、投资管理部副总经理/总经理、成都营业部副总经理等职务；博时基金管理有限公司总经理助理兼交易投资部总经理；鹏华基金管理有限公司总裁助理兼交易部总监；金元证券股份有限公司投资总监；华西证券有限责任公司副总裁；民生人寿保险股份有限公司独立董事、执行委员、资产管理部负责人；民生通惠资产管理有限公司总经理；祖龙娱乐有限公司独立董事。现任民生通惠资产管理有限公司董事、通惠期货有限公司董事、万向信托股份公司董事、通联数据股份公司董事。

王永刚先生，董事，1964年生，中南财经政法大学工商管理硕士。历任浙江省工行银行信托投资公司业务一部副总经理（主持工作）；广发银行杭州分行信贷五部副总经理、广发银行杭州分行清泰支行副行长、广发银行杭州分行庆春支行行长、广发银行杭州分行个人理财部总经理、广发银行总行公司银行部副总经理兼金融同业部总经理、广发银行总行信贷审查部总经理兼任贷审会主任及信贷政策委员会秘书长；华润银行广州分行（筹）负责人（总行行长助理级）。现任万向信托股份公司总裁。

熊文斌先生，董事，1983年生，武汉大学财务管理学士。历任万向精工有限公司财务管理部会计核算；万向集团首席工作室主管；万向信托股份分公司内审稽核部副总经理、人力资源部总经理；中国万向控股有限公司组织资源部执行总经理。现任民生人寿保险股份有限公司组织资源部执行总经理。

邱冠华先生，董事，1980年生，南京大学会计学硕士。曾任国泰君安证券股份有限公司研究所副所长等职务。现任浙商证券股份有限公司总裁助理兼研究所所长。

钟睽睽先生，董事，1954年生，大专。历任养生堂有限公司执行董事兼总经理、董事、董事长；农夫山泉股份有限公司董事长。现任农夫山泉股份有限公司董事长兼总经理、养生堂有限公司董事长。

章晓洪先生，独立董事，1973年生，西南政法大学法学硕士、博士。历任浙江天健会计师事务所注册会计师。现任上海市锦天城律师事务所高级合伙人；中国上市公司论坛主席；浙江财经大学中国金融研究院院长、教授及博士生导师；

中国诉讼法学研究会常务理事；中国企业联合会常务理事；中华全国律师协会金融与公司专业委员会委员；浙江省人大常委会法制工作委员会特聘专家；复旦大学法学院、浙江大学法学院、浙江工业大学法学院的客座教授或研究员。

金雪军先生，独立董事，1958年生，南开大学经济学硕士。历任浙江大学经济学院副院长等，享受国务院政府特殊津贴；浙江东方集团股份有限公司独立董事；哈尔滨高科技（集团）股份有限公司独立董事；浙江省国际金融学会会长；大地期货有限公司独立董事；新湖中宝股份有限公司监事长。现任浙江大学教授、博士生导师，浙江大学资产管理研究中心主任，浙江省公共政策研究院执行院长，杭州联合农村商业银行独立董事，华融金融租赁股份有限公司独立董事。

肖幼航女士，独立董事，1963年生，上海财经大学硕士，高级会计师，注册会计师。历任杭州市审计局副局长科员；浙江天健会计师事务所五部副经理、综合部经理；浙江南都电源动力股份有限公司财务总监；浙江中秦房地产开发有限公司副总经理；上海龙力能源投资有限公司副总经理。现任浙江同方会计师事务所副总经理。

## 2、基金管理人监事会成员

王平玉先生，监事，1951年生，大专，经济师。历任建设银行杭州分行科长、支行行长、党组副书记、副行长；养生堂有限公司总经济师。现任养生堂有限公司顾问。

徐初斌先生，监事，1976年生，硕士。历任上海证券市场部业务主管；生命人寿保险股份有限公司产品精算部项目经理；海尔纽约人寿保险有限公司产品开发部负责人；中融人寿保险股份有限公司总精算师；北大方正人寿保险有限公司总精算师；阳光人寿保险股份有限公司总精算师兼首席风险官；民生人寿保险股份有限公司副首席财务官兼精算部总经理。现任民生人寿保险股份有限公司副总经理、董事会秘书、总精算师、执行委员。

王峥先生，职工监事，1983年生，硕士。历任华宝兴业基金管理公司海外投资部投资助理，交易部交易员、高级交易员、交易主管；上海国富投资管理有限公司交易主管。现任浙商基金管理有限公司中央交易室总经理。

贾腾先生，职工监事，1988年生，硕士。曾任博时基金管理有限公司研究员。现任浙商基金管理有限公司智能权益投资部副总经理。



### 3、基金管理人高级管理人员

王瑞华女士，副总经理，1976年生，南开大学高级管理人员工商管理硕士。曾任上海凯石财富基金销售有限公司总经理、日发资产管理（上海）有限公司总经理、长盛基金管理有限公司华东区域总经理。

郭乐琦女士，督察长，1980年生，南开大学法学硕士。曾任北京中伦律师事务所上海分所律师、平安信托投资有限责任公司中台风控、北京市柳沈律师事务所律师、上海嘉路律师事务所主任律师及合伙人、平安集团投资管理委员会投资管理中心、CIO办公室PE投资管理经理。

唐生林先生，首席信息官，1980年生，北京邮电大学计算机科学与技术学士。曾任深圳市脉山龙信息技术有限公司集成部系统工程师、博时基金管理有限公司信息技术部系统运维主管、摩根士丹利华鑫基金管理有限公司信息技术部总监。现任上海聚潮资产管理有限公司执行董事暨法定代表人。

### 4、本基金基金经理

王斌先生，1986年生，中国科学院信号与信息处理专业硕士。曾任安霸半导体技术（上海）有限公司工程师。2018年5月加入浙商基金管理有限公司，目前任智能权益投资部基金经理，担任浙商科技创新一个月滚动持有混合型证券投资基金的基金经理。

### 5、投资决策委员会成员

查晓磊先生，总经理助理，1982年生，香港中文大学金融学博士。历任博时基金管理有限公司策略分析师兼投资经理助理。2015年4月加入浙商基金管理有限公司，目前任公司总经理助理。

王峥先生，投资决策委员会委员，1983年生，简历同上。

管宇先生，FOF及多元资产管理部总经理，1981年生，博士学历，历任高沃信息技术（上海）有限公司信用分析师；平安资产管理有限责任公司量化研究员；信泰人寿保险股份有限公司投资经理；华宝证券有限责任公司董事副总经理；中国平安财产保险股份有限公司战略资产配置团队经理。现任浙商基金管理有限公司FOF及多元资产管理部总经理。

欧阳健先生，总经理助理，1980年生，硕士学历，历任广发银行股份有限公司利率及衍生品产品交易主管；广发证券股份有限公司部门执行董事；国联安基

金管理有限公司部门总经理。现任浙商基金管理有限公司总经理助理、固定收益部总经理、浙商惠利纯债债券型证券投资基金的基金经理。

贾腾先生，投资决策委员会委员，1988年生，简历同上。

周锦程先生，1983年生，复旦大学西方经济学硕士。曾任德邦证券股份有限公司债券交易员、债券研究员和债券投资经理。2016年11月加入浙商基金管理有限公司。现任固定收益部总经理助理、浙商兴盛一年定期开放债券型发起式证券投资基金、浙商智多宝稳健一年持有期混合型证券投资基金、浙商智多兴稳健回报一年持有期混合型证券投资基金、浙商惠民纯债债券型证券投资基金、浙商惠睿纯债债券型证券投资基金、浙商兴永纯债三个月定期开放债券型证券投资基金、浙商丰利增强债券型证券投资基金、浙商惠丰定期开放债券型证券投资基金、浙商智多益稳健一年持有期混合型证券投资基金的基金经理。

6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

### 三、基金管理人的职责

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》及有关法律的规定决定基金收益的分配方案；

(11) 在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购、赎回和转换申请；

(12) 依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利；

(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、定期定额投资计划、非交易过户、转托管和收益分配等业务规则；

(17) 在法律法规和基金合同规定的范围内，在履行适当程序后决定和调整基金的相关费率结构和收费方式；

(18) 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。

#### 四、基金管理人的承诺

1、基金管理人承诺不从事违反《中华人民共和国证券法》的行为，并承诺建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反《中华人民共和国证券法》行为的发生；

2、基金管理人承诺不从事违反《基金法》的行为，并承诺建立健全内部风险控制制度，采取有效措施，防止下列行为的发生：

(1) 将基金管理人固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；

(2) 不公平地对待管理的不同基金财产；

(3) 利用基金财产或者职务之便为基金份额持有人以外的第三人牟取利益；

(4) 向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；

(5) 侵占、挪用基金财产；

(6) 泄露因职务便利获取的未公开信息、利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；

(7) 玩忽职守，不按照规定履行职责；

(8) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他行为。

3、基金管理人承诺严格遵守基金合同，并承诺建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反基金合同行为的发生；

4、基金管理人承诺加强人员管理，强化职业操守，督促和约束员工遵守国家有关法律法规及行业规范，诚实信用、勤勉尽责；

5、基金管理人承诺不从事其他法规规定禁止从事的行为。

#### 五、基金经理承诺

1、依照有关法律法规和基金合同的规定，本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益；

2、不利用职务之便为自己、受雇人或任何第三者牟取利益；

3、不泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密，尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息，或利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；

4、不以任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

#### 六、基金管理人的内部控制制度

##### 1、内部控制的目标

1) 保证公司经营运作严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，自觉形成守法经营、规范运作的经营思想和经营风格；

2) 防范和化解经营风险，提高经营管理效益，确保经营业务的稳健运行和受托资产的安全完整，实现公司的持续、稳定、健康发展；

3) 确保基金、公司财务及其他信息真实、准确、完整、及时；

4) 建立和健全法人治理结构，形成合理的决策、执行和监督机制。通过完善的公司治理结构和风险控制流程，保护基金持有人利益不受侵犯。

##### 2、内部控制的原则

1) 全面性原则：内部控制必须覆盖公司所有部门、岗位业务过程和业务环节，并普遍适用于公司每位员工；

2) 独立性原则：公司根据业务的需要设立相对独立的机构、部门和岗位；

3) 相互制约原则：公司内部部门和岗位的设置应当权责分明、相互制衡；

4) 有效性原则：用科学合理的内控程序和方法，建立合理的内控程序，保证内控制度的有效执行；

5) 审慎性原则：内部控制的核心是有效防范各种风险，公司组织体系的构成、内部管理制度的建立都要以防范风险、审慎经营为出发点；

6) 适时性原则：内部控制应具有前瞻性，并且必须随着公司的经营战略、经营目标等内部环境的变化和国家法律、法规、政策制度等外部环境的改变及时

进行相应的修改和完善；

7) 防火墙原则：公司基金投资、交易、研究、评估、市场开发等相关部门，应当在空间上和制度上适当分离，以达到防范风险的目的。对因业务需要知悉内部信息的人员，应制定严格的批准程序和监督措施；

8) 成本效益原则：公司通过科学有效的经营管理方法降低各种成本，提高经营效益，通过控制成本实现最佳经济效益，从而达到最佳内控效果。

### 3、内部控制的组织机构

公司内部控制的组织机构可以划分为监督系统、决策与业务执行两大系统，均有明确的层次分工和畅通的监督与执行通道，并建立完善的报告与反馈机制。

#### 1) 监督系统

公司监事会、合规与风险控制委员会、监察稽核部为公司不同层面的监督机构，构成相互独立的监督系统。

监事会依照公司法和公司章程对公司经营管理活动、董事和公司管理层的行为行使监督权。董事会下设合规与风险控制委员会，负责对公司经营管理和基金资产运作的合法、合规性进行审查、分析和评估。合规与风险控制委员会独立行使职责。监察稽核部独立于公司各业务部门和各分支机构，对各岗位、各部门、各机构、各项业务中的风险控制情况实施监督。督察长由董事会聘任，根据董事会的授权对公司的经营活动进行监督。

#### 2) 决策和执行系统

股东会、董事会、管理层及职能部门构成公司决策与业务执行系统。

股东会是公司的最高权力机构，依照法律和公司章程行使职权。股东会选举董事组成董事会。董事会依照法律和公司章程行使职权。独立董事对公司事项发表不受任何人干预的独立意见并参与表决。董事会聘任公司总经理，由总经理负责公司的日常经营管理。

公司根据独立性、防火墙以及相互制约、互为衔接的原则，设立满足公司经营运作必需的机构、部门及岗位。各部门在分工合作的基础上，明确各岗位相应的责任和职权，建立相互配合、相互制约、相互促进的工作关系。通过制定规范的岗位责任制、合理的工作标准和严格的操作程序，使各项工作规范化、程序化、标准化。

#### 4、内部控制的制度体系

公司制定合理、完备、有效并易于执行的制度体系。公司制度体系由不同层面的制度构成。按照其效力大小分为四个层面：第一个层面是公司章程，是公司经营管理遵循的最高文件；第二个层面是公司内部控制大纲，是公司制定各项基本管理制度的基础和依据；第三个层面是公司基本管理制度，公司日常运作的有针对性并较为具体的行为要求与规范；第四个层面是公司各部门根据业务的需要制定的各种规章及实施细则等。上述不同层面的控制制度的制定、修改、实施、废止应该遵循相应的程序，较高层面的制度与较低层面的制度有机联系，前者的内容指导和制约后者内容，后者的内容体现和细化前者的内容。

公司章程的修改须经股东会审议通过，监管部门核准后生效。公司内部控制大纲、公司基本管理制度的制订与修改由公司总经理提出议案，经董事会审议通过后实施。各部门的规章及实施细则由相关部门依据公司章程和内部控制大纲提出议案，经公司总经理办公会议审议通过后实施。

监察稽核部对公司基本管理制度、各部门规章及实施细则的执行情况进行日常性的检查和评价，并报公司总经理和督察长。总经理和督察长向有关部门提出改进意见由相关部门负责落实，并由监察稽核部跟踪落实情况并继续检查评估。各部门定期或不定期对涉及到本部门的公司管理制度的执行情况进行自查，并负责落实相关事项。

#### 5、内部控制的层次体系

公司内部控制的层次体系共分四层：建立一线岗位的第一道监控防线，属于单人、单岗处理业务的，必须有相应的后续监督机制；建立相关部门、相关岗位之间相互制约的工作程序作为第二道监控防线，建立业务文件在公司与托管银行之间、相关部门和相关岗位之间传递的标准，明确文字签字的授权；成立独立的监察稽核部，对各部门、各岗位各项业务全面实行监督反馈，必要时对有关部门进行不定期突击检查，形成第三道防线；董事会合规与风险控制委员会和公司风险控制委员会形成公司的第四道防线。

#### 6、基金管理人关于内部控制的声明

本公司确知建立内部控制系统、维持其有效性以及有效执行内部控制制度是本公司董事会及管理层的责任，董事会承担最终责任；本公司特别声明以上关于



内部控制的披露真实、准确，并承诺根据市场的变化和公司的发展不断完善内部控制制度。

## 第四部分 基金托管人

### 一、基金托管人基本情况

#### (一) 基金托管人概况

公司法定中文名称：交通银行股份有限公司（简称：交通银行）

公司法定英文名称：BANK OF COMMUNICATIONS CO.,LTD

法定代表人：任德奇

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

邮政编码：200336

注册时间：1987 年 3 月 30 日

注册资本：742.63 亿元

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]25 号

联系人：陆志俊

电 话：95559

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》(The Banker)杂志全球千家大银行一级资本排名第 11 位。

截至 2021 年 3 月 31 日，交通银行资产总额为人民币 11.17 万亿元。2021 年 1-3 月，交通银行实现净利润(归属于母公司股东)人民币 219.46 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。

#### (二) 主要人员情况

任德奇先生，董事长、执行董事，高级经济师。

任先生 2020 年 1 月起任本行董事长（其中：2019 年 12 月至 2020 年 7 月代为履行行长职责）、执行董事，2018 年 8 月至 2020 年 1 月任本行副董事长（其中：2019 年 4 月至 2020 年 1 月代为履行董事长职责）、执行董事，2018 年 8 月至 2019 年 12 月任本行行长；2016 年 12 月至 2018 年 6 月任中国银行执行董事、副行长，其中：2015 年 10 月至 2018 年 6 月兼任中银香港（控股）有限公司非执行董事，2016 年 9 月至 2018 年 6 月兼任中国银行上海人民币交易业务总部总裁；2014 年 7 月至 2016 年 11 月任中国银行副行长，2003 年 8 月至 2014 年 5 月历任中国建设银行信贷审批部副总经理、风险监控部总经理、授信管理部总经理、湖北省分行行长、风险管理部总经理；1988 年 7 月至 2003 年 8 月先后在中国建设银行岳阳长岭支行、岳阳市中心支行、岳阳分行，中国建设银行信贷管理委员会办公室、信贷风险管理部工作。任先生 1988 年于清华大学获工学硕士学位。

刘珺先生，副董事长、执行董事、行长，高级经济师。

刘先生 2020 年 7 月起担任本行行长；2016 年 11 月至 2020 年 5 月任中国投资有限责任公司副总经理；2014 年 12 月至 2016 年 11 月任中国光大集团股份公司副总经理；2014 年 6 月至 2014 年 12 月任中国光大（集团）总公司执行董事、副总经理（2014 年 6 月至 2016 年 11 月期间先后兼任光大永明人寿保险有限公司董事长、中国光大集团有限公司副董事长、中国光大控股有限公司执行董事兼副主席、中国光大国际有限公司执行董事兼副主席、中国光大实业（集团）有限责任公司董事长）；2009 年 9 月至 2014 年 6 月历任中国光大银行行长助理、副行长（期间先后兼任中国光大银行上海分行行长、中国光大银行金融市场中心总经理）；1993 年 7 月至 2009 年 9 月先后在中国光大银行国际业务部、香港代表处、资金部、投行业务部工作。刘先生 2003 年于香港理工大学获工商管理博士学位。

徐铁先生，资产托管部副总经理。

徐先生 2014 年 12 月起任本行资产托管部副总经理；2000 年 7 月至 2014 年 12 月，历任本行资产托管部保险与养老金部副高级经理、高级经理、保险保障业务部高级经理、总经理助理。徐先生 2000 年于复旦大学获经济学硕士学位。

### （三）基金托管业务经营情况

截至 2021 年 3 月 31 日，交通银行共托管证券投资基金 527 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、QFI 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。

## 二、基金托管人的内部控制制度

### （一）内部控制目标

交通银行严格遵守国家法律法规、行业规章及行内相关管理规定，加强内部管理，托管部业务制度健全并确保贯彻执行各项规章，通过对各种风险的识别、评估、控制及缓释，有效地实现对各项业务的风险管控，确保业务稳健运行，保护基金持有人的合法权益。

### （二）内部控制原则

1、合法性原则：托管部制定的各项制度符合国家法律法规及监管机构的监管要求，并贯穿于托管业务经营管理活动始终。

2、全面性原则：托管部建立各二级部自我监控和风险合规部风险管控的内部控制机制，覆盖各项业务、各个部门和各级人员，并渗透到决策、执行、监督、反馈等各个经营环节，建立全面的风险管理监督机制。

3、独立性原则：托管部独立负责受托基金资产的保管，保证基金资产与交通银行的自有资产相互独立，对不同的受托基金资产分别设置账户，独立核算，分账管理。

4、制衡性原则：托管部贯彻适当授权、相互制约的原则，从组织架构的设置上确保各二级部和各岗位权责分明、相互制约，并通过有效的相互制衡措施消除内部控制中的盲点。

5、有效性原则：托管部在岗位、业务二级部和风险合规部三级内控管理模式的基础上，形成科学合理的内部控制决策机制、执行机制和监督机制，通过行之有效的控制流程、控制措施，建立合理的内控程序，保障各项内控管理目标被有效执行。

6、效益性原则：托管部内部控制与基金托管规模、业务范围和业务运作环节的风险控制要求相适应，尽量降低经营运作成本，以合理的控制成本实现最佳的内部控制目标。

### （三）内部控制制度及措施

根据《证券投资基金法》、《中华人民共和国商业银行法》、《商业银行资产托管业务指引》等法律法规，托管部制定了一整套严密、完整的证券投资基金托管管理规章制度，确保基金托管业务运行的规范、安全、高效，包括《交通银行资产托管业务管理办法》、《交通银行资产托管业务风险管理办法》、《交通银行资产托管业务系统建设管理办法》、《交通银行资产托管部信息披露制度》、《交通银行资产托管业务商业秘密管理规定》、《交通银行资产托管业务从业人员行为规范》、《交通银行资产托管业务档案管理暂行办法》等，并根据市场变化和基金业务的发展不断加以完善。做到业务分工科学合理，技术系统管理规范，业务管理制度健全，核心作业区实行封闭管理，落实各项安全隔离措施，相关信息披露由专人负责。

托管部通过对基金托管业务各环节的事前揭示、事中控制和事后检查措施实现全流程、全链条的风险管理，聘请国际著名会计师事务所对基金托管业务运行进行国际标准的内部控制评审。

### 三、基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

交通银行作为基金托管人，根据《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和有关证券法规的规定，对基金的投资对象、基金资产的投资组合比例、基金资产的核算、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、基金的申购资金的到账与赎回资金的划付、基金收益分配等行为的合法性、合规性进行监督和核查。

交通银行作为基金托管人，发现基金管理人违反《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等有关证券法规和《基金合同》的行为，及时通知基金管理人予以纠正，基金管理人收到通知后及时核对确认并进行调整。交通银行有权对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人交通银行通知的违规事项未能及时纠正的，交通银行有权报告中国证监会。

交通银行作为基金托管人，发现基金管理人发生重大违规行为，有权立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正。

#### 四、其他事项

最近一年内交通银行及其负责资产托管业务的高级管理人员无重大违法违规行为，未受到中国人民银行、中国证监会、中国银保监会及其他有关机关的处罚。负责基金托管业务的高级管理人员在基金管理公司无兼职的情况。

## 第五部分 相关服务机构

### 一、基金份额发售机构

浙商基金管理有限公司

住所：浙江省杭州市下城区环城北路 208 号 1801 室

法定代表人：肖风

#### 1、浙商基金管理有限公司直销中心

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴西路 99 号万向大厦 10 楼

电话：021-60350857

传真：021-60350836

联系人：郭梦琚

网址：<http://www.zsfund.com>

客服电话：400-067-9908（免长途话费）、021-60359000

#### 2、其他销售机构

##### （1）交通银行股份有限公司

住所：上海市银城中路 188 号

办公地址：上海市银城中路 188 号

法定代表人：牛锡明

客服电话：95559

公司网址：<http://www.bankcomm.com>

##### （2）中国银河证券股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

办公地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

法定代表人：顾伟国

客服电话：4008-888-888

公司网址：<http://www.chinastock.com.cn>

##### （3）五矿证券有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路 4028 号荣超经贸中心办公楼 47 层 01 单元

办公地址：深圳市福田区金田路 4028 号荣超经贸中心办公楼 47 层 01 单元

法定代表人：黄海洲

电话:0755-82545555

邮编:518035

**(4) 北京蛋卷基金销售有限公司**

注册地址: 北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层 222507

办公地址: 北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层 222507

法定代表人: 钟斐斐

客服电话: 4000-618-518

公司网址: [www.danjuanapp.com](http://www.danjuanapp.com)

**(5) 上海联泰基金销售有限公司**

注册地址: 中国(上海)自由贸易试验区富特北路277号3层310室

办公地址: 上海市长宁区福泉北路518号8座3层

法定代表人: 尹彬彬

客服电话: 400-166-6788

公司网址: [www.66liantai.com](http://www.66liantai.com)

**(6) 上海陆金所基金销售有限公司**

注册地址: 上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼09单元

办公地址: 上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼

法定代表人: 郭坚

客服电话: 400-821-9031

公司网址: [www.lufunds.com](http://www.lufunds.com)

**(7) 蚂蚁(杭州)基金销售有限公司**

住所: 浙江省杭州市余杭区五常街道文一西路969号3幢5层599室

办公地址: 浙江省杭州市滨江区江南大道3588号恒生大厦12楼

法定代表人: 祖国明

客服电话: 4000-766-123

公司网址: <http://www.fund123.cn>

**(8) 诺亚正行基金销售有限公司**

住所: 上海市金山区廊下镇漕廊公路7650号205室

办公地址: 上海市浦东新区陆家嘴银城中路68号时代金融中心8楼801



法定代表人：汪静波

客服电话：400—821—5399

公司网址：<http://www.noah-fund.com>

**(9) 上海好买基金销售有限公司**

住所：上海市虹口区场中路 685 弄 37 号 4 号楼 449 室

办公地址：上海市浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 903~906 室

法定代表人：杨文斌

客服电话：400-700-9665

公司网址：<http://www.ehowbuy.com>

**(10) 上海利得基金销售有限公司**

注册地址：上海市宝山区蕴川路 5475 号 1033 号

办公地址：上海浦东新区峨山路 91 弄 61 号 10 号楼 12 楼

法定代表人：李兴春

客服电话：400-921-7755

网址：[admin.leadfund.com.cn](http://admin.leadfund.com.cn)

**(11) 上海天天基金销售有限公司**

住所：上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼二层

办公地址：上海市徐汇区龙田路 195 号 3C 座 9 楼

法定代表人：其实

客服电话：4001818188

公司网址：<http://www.1234567.com.cn>

**(12) 浙江同花顺基金销售有限公司**

住所：浙江省杭州市文二西路 1 号元茂大厦 903

办公地址：浙江省杭州市文二西路 1 号元茂大厦 903

法定代表人：李晓涛

客服电话：4008-773-772

公司网址：<http://www.5ifund.com>

**(13) 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司**

注册地址：深圳市福田区福田街道民回路 178 号华融大厦 27 层 2704

办公地址：北京市西城区宣武门外大街 28 号富卓大厦 A 座 6 层

法定代表人：洪弘

客服电话：400-166-1188

公司网址：<http://www.new-rand.cn>

**(14) 珠海盈米基金销售有限公司**

注册地址：珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室-3491

办公地址：广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 12 楼  
B1201-1203

法定代表人：肖雯

客服电话：020-89629066

公司网址：[www.yingmi.cn](http://www.yingmi.cn)

**(15) 浦领基金销售有限公司**

注册地址：北京市朝阳区望京东园四区 13 号楼 A 座 9 层 908 室

办公地址：北京市朝阳区望京浦项中心 A 座 9 层 04-08

法定代表人：聂婉君

客服电话：400-012-5899

公司网址：[www.zscffund.com](http://www.zscffund.com)

**(16) 上海基煜基金销售有限公司**

注册地址：上海市崇明县长兴镇潘园公路 1800 号 2 号楼 6153 室（上海泰和  
经济发展区）

办公地址：上海市浦东新区银城中路 488 号太平金融大厦 1503 室

法定代表人：王翔

客服电话：(021) 65370077

公司网址：[www.fofund.com.cn](http://www.fofund.com.cn)

**(17) 南京苏宁基金销售有限公司**

注册地址：江苏省南京市玄武区苏宁大道 1-5 号

办公地址：江苏省南京市玄武区苏宁大道 1-5 号

法定代表人：王锋

电话：95177

公司网站: [jinrong.suning.com](http://jinrong.suning.com)

**(18) 上海长量基金销售有限公司**

住所: 上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室

办公地址: 上海市浦东新区浦东大道 555 号裕景国际 B 座 16 层

法定代表人: 张跃伟

客服电话: 400-820-2899

公司网址: <http://www.erichfund.com>

**(19) 深圳众禄基金销售股份有限公司**

住所: 深圳市罗湖区深南东路 5047 号发展银行大厦 25 楼 I、J 单元

办公地址: 深圳市罗湖区深南东路 5047 号发展银行大厦 25 楼 I、J 单元

法定代表人: 薛峰

客服电话: 4006-788-887

公司网址: <http://www.zlfund.cn> 及 <http://www.jjmmw.com>

**(20) 北京恒天明泽基金销售有限公司**

注册地址: 北京市经济技术开发区宏达北路 10 号五层 5122 室

办公地址: 北京市朝阳区双井乐成中心 A 座 23 层

法定代表人: 梁越

客服电话: 4008-980-618

公司网址: [www.chtfund.com](http://www.chtfund.com)

**(21) 北京汇成基金销售有限公司**

注册地址: 北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108

办公地址: 北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108

法定代表人: 王伟刚

客服电话: 400-619-9059

公司网址: [www.fundzone.cn](http://www.fundzone.cn)

**(22) 北京肯特瑞基金销售有限公司**

注册地址: 北京市海淀区中关村东路 66 号 1 号楼 22 层 2603-06

办公地址: 北京市海淀区中关村东路 66 号 1 号楼 22 层 2603-06

法定代表人: 江卉

客服电话：95118

公司网址：jr.jd.com

**(23) 和耕传承基金销售有限公司**

注册地址：河南自贸试验区郑州片区（郑东）东风南路东康宁街北 6 号楼 5 楼 503

法定代表人：王旋

电话：4000-555-671

公司网站：<https://www.hgccpb.com/hg/contact>

**(24) 北京植信基金销售有限公司**

注册地址：北京市密云区兴盛南路 8 号院 2 号楼 106 室-67

法定代表人：王军辉

客服联系方式：4006-802-123

网站网址：[www.zhixin-inv.com](http://www.zhixin-inv.com)

**(25) 大连网金基金销售有限公司**

注册地址：辽宁省大连市沙河口区体坛路 22 号诺德大厦 2 层 202 室

办公地址：辽宁省大连市沙河口区体坛路 22 号诺德大厦 2 层 202 室

法定代表人：樊怀东

客服联系方式：4000-899-100

网站网址：[www.yibaijin.com](http://www.yibaijin.com)

**(26) 奕丰基金销售有限公司**

注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）

办公地址：深圳市南山区海德三道航天科技广场 A 座 17 楼 1704 室

法定代表人：TEO WEE HOWE

客服联系方式：755-8946-0500

网站网址：[www.ifastps.com.cn](http://www.ifastps.com.cn)

**(27) 江苏汇林保大基金销售有限公司**

注册地址：南京市高淳区经济开发区古檀大道 47 号

办公地址：南京市鼓楼区中山北路 2 号绿地紫峰大厦 2005 室

法定代表人：吴言林

客服联系方式：025-66046166

网站网址：www.huilinbd.com

**(28) 中证金牛（北京）投资咨询有限公司**

注册地址：北京市丰台区东管头1号2号楼2-45室

办公地址：北京市宣武门外大街甲1号新华社第三工作区5F

法定代表人：钱昊旻

客服联系方式：4008-909-998

网站网址：www.jnlc.com

**(29) 北京度小满基金销售有限公司**

注册地址：北京市海淀区西北旺东路10号院西区4号楼1层103室

法定代表人：葛新

网站：[www.baiyingfund.com](http://www.baiyingfund.com)

客户服务电话：95055-4

**(30) 北京唐鼎耀华基金销售有限公司**

注册地址：北京市延庆区延庆经济开发区百泉街10号2栋236室

办公地址：北京市朝阳区东三环北路38号院1号38层

法定代表人：张冠宇

客服电话：400-819-9868

公司网址：www.tdyhfund.com

**(31) 浙商银行股份有限公司**

住所：浙江杭州庆春路288号

办公地址：浙江杭州庆春路288号

法定代表人：张达洋

客服电话：95527

公司网址：<http://www.czbank.com>

**(32) 光大证券股份有限公司**

住所：上海市静安区新闻路1508号

办公地址：上海市静安区新闻路1508号

法定代表人：薛峰

客服电话:4008888788、95525

公司网址：<http://www.ebscn.com>

**(33) 广发证券股份有限公司**

住所：广州天河区天河北路 183-187 号大都会广场 43 楼（4301-4316 房）

办公地址：广东省广州天河北路大都会广场 5、18、19、36、38、39、41、42、43、44 楼

法定代表人：林传辉

客服电话：95575 或致电各地营业网点

公司网址：<http://www.gf.com.cn>

**(34) 阳光人寿保险股份有限公司**

注册地址：海南省三亚市迎宾路 360-1 号三亚阳光金融广场 16 层

办公地址：北京市朝阳区朝外大街乙 12 号 1 号楼昆泰国际大厦 12 层

法定代表人：李科

客户服务电话：95510

网站：<http://life.sinosig.com>

**(35) 招商银行股份有限公司招赢通平台**

注册地址：深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦

办公地址：深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦

法定代表人：缪建民

客服电话：95555

网站网址：[www.cmbchina.com](http://www.cmbchina.com)

**(36) 中国人寿保险股份有限公司**

注册地址：北京市西城区金融大街 16 号

办公地址：北京市西城区金融大街 16 号

法定代表人：王滨

网站：<http://www.e-chinalife.com>

客户服务电话：95519

**(37) 上海爱建基金销售有限公司**

注册地址：上海市黄浦区西藏中路 336 号 1806-13 室

法定代表人：马金

网站：<http://www.ajcf.com.cn>

客户服务电话：021-60608970

**(38) 兴业银行股份有限公司**

注册地址：福建省福州市湖东路 154 号

办公地址：上海市江宁路 168 号

法定代表人：高建平

客服电话：95561

公司网址：[www.cib.com.cn](http://www.cib.com.cn)

**(39) 中信建投证券股份有限公司**

住所：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址：北京市朝阳区门内大街 188 号

法定代表人：王常青

客服电话：4008888108

公司网址：<http://www.csc108.com>

**(40) 嘉实财富管理有限公司**

注册地址：中国(上海)自由贸易试验区世纪大道 8 号上海国金中心办公楼二期 27 层 2716 单元

办公地址：北京市朝阳区建国门外大街 21 号北京国际俱乐部 C 座

法定代表人：张峰

网站：<https://www.harvestwm.cn>

客户服务电话：400-021-8850

**(41) 腾安基金销售(深圳)有限公司**

注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室(入驻深圳市前海商务秘书有限公司)

办公地址：深圳市南山区高新科技园科技中一路腾讯大厦

法定代表人：刘明军

网站：[www.tenganxinxi.com](http://www.tenganxinxi.com)

客户服务电话：95017

基金管理人可根据有关法律法规，变更、增减发售本基金的销售机构，并及时公告。

## 二、登记机构

名称：浙商基金管理有限公司

住所：杭州市下城区环城北路 208 号 1801 室

法定代表人：肖风

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴西路 99 号万向大厦 10 楼

联系电话：021-60350830

传真：021-60350836

联系人：高日

## 三、出具法律意见书的律师事务所

名称：上海源泰律师事务所

注册地址：上海市浦东新区浦东南路 256 号华夏银行大厦 14 楼

办公地址：上海市浦东新区浦东南路 256 号华夏银行大厦 14 楼

负责人：廖海

电话：（021）51150298

传真：（021）51150398

联系人：刘佳

经办律师：刘佳、张雯倩

## 四、审计基金财产的会计师事务所

名称：毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：北京市东长安街 1 号东方广场毕马威大楼 8 楼

办公地址：上海市南京西路 1266 号恒隆广场 2 号楼 25 楼

法定代表人：邹俊

电话：021-22122888

传真：021-62881889

联系人：王国蓓

经办注册会计师：王国蓓、叶凯韵



## 第六部分 基金的募集

本基金的募集申请经中国证监会证监许可【2020】557号文批准注册，募集期自2020年8月31日起至2020年9月25日止。募集期内，本基金的有效认购份额为234,071,568.84份，利息结转的基金份额为21,074.20份，两项合计共234,092,643.04份基金份额。

## 第七部分 基金合同的生效

### 一、基金合同生效

本基金基金合同于2020年9月29日生效。

### 二、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

《基金合同》生效后，连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5,000 万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 60 个工作日出现前述情形的，基金管理人应当 10 个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如持续运作、转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并 6 个月内召开基金份额持有人大会进行表决。

法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。

## 第八部分 基金份额的申购与赎回

### 一、申购和赎回场所

本基金的申购与赎回将通过销售机构进行。具体的销售机构将由基金管理人在招募说明书或其他相关公告中列明。基金管理人可根据情况变更或增减销售机构，并在管理人网站公示。基金投资者应当在销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理基金份额的申购与赎回。

### 二、申购和赎回的开放日及时间

#### 1、开放日及开放时间

投资人在开放日办理基金份额的申购，在每份基金份额的运作期到期日办理该基金份额的赎回。具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间，若本基金参与港股通交易且该工作日为非港股通交易日时，则基金管理人可根据实际情况决定本基金是否开放申购、赎回及转换业务，具体以届时提前发布的公告为准，但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。

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

#### 2、申购、赎回开始日及业务办理时间

基金管理人可根据实际情况依法决定本基金开始办理申购的具体日期，具体业务办理时间在申购开始公告中规定。

自基金合同生效后，每份基金份额可以在运作期到期日就该基金份额提出赎回申请。如果基金份额持有人在当期运作期到期日未申请赎回，则自该运作期到期日下一日起，该基金份额进入下一个运作期。基金管理人自基金合同生效之日次一个月的月度对日起开始办理赎回，具体业务办理时间在赎回开始公告中规定。

在确定申购开始与赎回开始时间后，基金管理人应在申购、赎回开放日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告申购与赎回的开始时间。

投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购或转换转入申请且登记机构确认接受的，其基金份额申购或转换转入价格为下一开放日相应类别基金份

额申购或转换转入的价格；投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出赎回或转换转出申请且登记机构确认接受的，其基金份额赎回或转换转出价格为该基金份额下一运作期到期日的相应类别基金份额赎回或转换转出的价格。

如发生不可抗力或其他情形致使基金无法按时开放或需依据基金合同暂停申购与赎回业务的，基金管理人有权合理调整申购或赎回业务的办理期间并予以公告。

### 三、申购与赎回的原则

1、“未知价”原则，即任一类基金份额申购、赎回价格以申请当日收市后计算的相应类别基金份额净值为基准进行计算；

2、“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

3、当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销，基金销售机构另有规定的，以基金销售机构的规定为准；

4、基金份额持有人赎回时，基金管理人按先进先出的原则，对该基金份额持有人账户在该销售机构托管的基金份额进行处理，即先确认的份额先赎回，后确认的份额后赎回，以确定所适用的赎回费率；

5、办理申购、赎回业务时，应当遵循基金份额持有人利益优先原则，确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待。

基金管理人可在不违反法律法规的情况下，对上述原则进行调整。基金管理人必须在新规则开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

### 四、申购与赎回的程序

#### 1、申购和赎回的申请方式

投资人必须根据销售机构规定的程序，在开放日的具体业务办理时间内提出申购或赎回的申请。

#### 2、申购和赎回的款项支付

投资人申购基金份额时，必须全额交付申购款项，投资人交付申购款项，申购成立；基金份额登记机构确认基金份额时，申购生效。

基金份额持有人递交赎回申请时，赎回成立；基金份额登记机构确认赎回时，赎回生效。基金份额持有人赎回申请经本基金的登记机构确认生效后，基金管理人将指示基金托管人在法律法规规定的期限内支付赎回款项。如遇交易所或交易

市场数据传输延迟、通讯系统故障、银行数据交换系统故障或其它非基金管理人及基金托管人所能控制的因素影响业务处理流程时，赎回款项顺延至上述情形消失的下一个工作日划出。在发生巨额赎回或基金合同约定的其他暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形时，款项的支付办法参照基金合同有关条款处理。

### 3、申购和赎回申请的确认

基金管理人应以交易时间结束前受理有效申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日（T日），在正常情况下，本基金登记机构在T+1日内对该交易的有效性进行确认。T日提交的有效申请，投资人可在T+2日后（包括该日）及时到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。若申购不成立或无效，则申购款项本金退还给投资人。

基金销售机构对申购、赎回申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到申购、赎回申请。申购、赎回申请的确认以基金登记机构的确认结果为准。对于申购、赎回申请的确认情况，投资人应及时查询并妥善行使合法权利。

基金管理人在不违反法律法规的前提下，可对上述程序规则进行调整。基金管理人应在新规则开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

### 五、申购和赎回的数量限制

1、销售机构销售网点每个账户单笔申购的最低金额为1元人民币（含申购费），直销中心每个账户单笔申购最低金额为1元人民币（含申购费），详情请见当地销售机构公告。

投资人将当期分配的基金收益再投资时，不受最低申购金额的限制。

2、每个交易账户最低持有基金份额余额为1份，若某笔赎回导致单个交易账户的基金份额余额少于1份时，余额部分基金份额必须一同赎回。

3、本基金目前对单个投资人累计持有份额和单笔申购金额不设上限限制，基金管理人可以规定单个投资者累计持有的基金份额和单笔申购金额数量限制，具体规定见更新的招募说明书或相关公告，但本基金单一投资者持有基金份额数不得达到或超过基金份额总数的50%（运作过程中，因基金份额赎回等情形导致被动达到或超过50%的除外）。

4、基金管理人目前对本基金的总规模、单日申购金额和净申购比例不设上限，基金管理人可以规定本基金的总规模、单日申购金额和净申购比例上限，具体规定见更新的招募说明书或相关公告。

5、当接受申购申请对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时，基金管理人应当采取设定单一投资者申购金额上限或基金单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停基金申购等措施，切实保护存量基金份额持有人的合法权益。基金管理人基于投资运作与风险控制的需要，可采取上述措施对基金规模予以控制。具体见基金管理人相关公告。

6、基金管理人可在不违反法律法规的情况下，调整上述规定申购金额和赎回份额等数量限制，或者新增基金规模控制措施。基金管理人必须在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

#### 六、基金的申购费和赎回费

1、本基金分为 A 类和 C 类两类基金份额，两类基金份额单独设置基金代码，分别计算和公告基金份额净值。本基金各类基金份额净值的计算，均保留到小数点后 4 位，小数点后第 5 位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。遇特殊情况，经履行适当程序，可以适当延迟计算或公告。

#### 2、申购费率：

表 2：本基金基金份额的申购费率

申购金额 M（单位：元）	A 类基金份额的申购费率	C 类基金份额的申购费率
M < 100 万	0.80%	0
100 万 ≤ M < 300 万	0.60%	
300 万 ≤ M < 500 万	0.40%	
M ≥ 500 万	1,000 元/笔	

投资者在一天之内如果有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。

#### 3、赎回费率：

表 3：本基金基金份额的赎回费率

持有时间 T	A 类基金份额的赎回费率	C 类基金份额的赎回费率

T<6 个运作期	0.50%	0
T≥6 个运作期	0	0

本基金赎回费全额计入基金资产。

4、基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式，并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

5、当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律规则的规定。

6、基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情况下，在对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，根据市场情况制定基金促销计划，定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，基金管理人可以适当调低基金销售费用，或针对特定渠道、特定投资群体开展有差别费用优惠活动。

## 七、申购和赎回的数额和价格

### 1、申购份额与赎回金额、余额的处理方式

(1) 申购的有效份额为净申购金额除以当日的该类基金份额净值，有效份额单位为份，上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后 2 位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

(2) 赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以赎回申请日该类基金份额净值并扣除相应的费用，赎回金额单位为元。上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后 2 位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。

### 2、基金申购份额的计算

#### (1) A 类基金份额的申购

申购本基金 A 类基金份额时采用前端收费模式(即申购基金时缴纳申购费)，投资者的申购金额包括申购费用和净申购金额。申购 A 类基金份额的计算方式如下：

$$\text{净申购金额} = \text{申购金额} / (1 + \text{申购费率})$$

(注：对于适用固定金额申购费用的申购，净申购金额 = 申购金额 - 固定申购费用金额)

申购费用=申购金额-净申购金额

(注：对于适用固定金额申购费用的申购，申购费用=固定申购费用金额)

申购份额=净申购金额/申购当日 A 类基金份额净值

例 4：某投资者投资 10,000 元申购本基金的 A 类基金份额，对应申购费率为 0.80%，假设申购当日 A 类基金份额净值为 1.0500 元，则可得到的 A 类基金份额为：

净申购金额=10,000/(1+0.80%)=9,920.63 元

申购费用=10,000-9,920.63=79.37 元

申购份额=9,920.63/1.0500=9,448.22 份

即：该投资者投资 10,000 元申购本基金 A 类基金份额，对应申购费率为 0.80%，申购当日 A 类基金份额净值为 1.0500 元，则可得到 9,448.22 份 A 类基金份额。

(2) C 类基金份额的申购

申购 C 类基金份额的计算方式如下：

申购份额=申购金额/申购当日 C 类基金份额净值

例 5：某投资者投资 50,000 元申购本基金的 C 类基金份额，假设申购当日 C 类基金份额净值为 1.0500 元，则可得到的 C 类基金份额为：

申购份额=50,000/1.0500=47,619.05 份

即：该投资者投资 50,000 元申购本基金 C 类基金份额，申购当日 C 类基金份额净值为 1.0500 元，则可得到 47,619.05 份 C 类基金份额。

### 3、基金赎回金额的计算

赎回金额的计算方法如下：

赎回总金额=赎回份额×赎回申请日该类基金份额净值

赎回费用=赎回总金额×该类基金份额赎回费率

净赎回金额=赎回总金额-赎回费用

例 5：某基金份额持有人在第一个运作期到期日赎回本基金 10,000 份 A 类基金份额，对应的赎回费率为 0.50%，假设赎回当日本基金 A 类基金份额净值是 1.0500 元，则其可得到的赎回金额为：

赎回总金额=10,000×1.0500=10,500.00 元



赎回费用=10,500.00×0.50%=52.50 元

净赎回金额=10,500.00-52.5=10447.50 元

即：基金份额持有人赎回 10,000 份本基金 A 类基金份额，假设赎回当日本基金 A 类基金份额净值是 1.0500 元，则其可得到的净赎回金额为 10447.50 元。

#### 4、基金份额净值计算

T 日某类基金份额净值=T 日该类基金份额的资产净值/T 日该类基金份额数量

#### 八、申购、赎回的登记

正常情况下，投资者 T 日申购基金成功后，登记机构在 T+1 日为投资者增加权益并办理登记手续，投资者在运作期到期日有权赎回该部分基金份额。

基金份额持有人 T 日赎回基金成功后，正常情况下，登记机构在 T+1 日为其办理扣除权益的登记手续。

在不违反法律法规的前提下，登记机构可以对上述登记办理时间进行调整，基金管理人应于开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

#### 九、拒绝或暂停申购的情形

发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请：

- 1、因不可抗力导致基金无法正常运作。
- 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时。
- 3、证券、期货交易所或外汇市场交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。
- 4、接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时。
- 5、基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，或发生其他损害现有基金份额持有人利益的情形。
- 6、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接受基金申购申请。
- 7、基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过 50%，或者变相规避 50%集中度的情形。
- 8、当一笔新的申购申请被确认成功，使本基金总规模超过基金管理人规定

的本基金总规模上限时；或使本基金单日申购金额或净申购比例超过基金管理人规定的当日申购金额或净申购比例上限时；或该投资者累计持有的份额超过单个投资者累计持有的份额上限时；或该投资者当日申购金额超过单个投资者单日申购金额上限时；或该投资者单笔申购金额超过单个投资者单笔申购金额上限时。

9、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述第 1、2、3、5、6、9 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受投资人申购申请时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项本金将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。

十、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项：

1、因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项。

2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时。

3、证券、期货交易所或外汇市场交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。

4、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。

5、本基金的资产组合中的重要部分发生暂停交易或其他重大事件，继续接受赎回可能会影响或损害基金份额持有人利益时。

6、发生继续接受赎回申请将损害现有基金份额持有人利益的情形时，基金管理人可暂停接受基金份额持有人的赎回申请。

7、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，基金管理人应当延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请。

8、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一且基金管理人决定暂停赎回或延缓支付赎回款项时，基金管理人应按规定报中国证监会备案，已确认的赎回申请，基金管理人应足额支付；如暂时不能足额支付，应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分可延期支付。若出现上述第 4 项所述情形，按基金合

同的相关条款处理。基金份额持有人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告。

## 十一、巨额赎回的情形及处理方式

### 1、巨额赎回的认定

若本基金单个开放日内的基金份额净赎回申请(赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额)超过前一开放日的基金总份额的 10%，即认为是发生了巨额赎回。

### 2、巨额赎回的处理方式

当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回、部分延期赎回或暂停赎回。

(1) 全额赎回：当基金管理人认为有能力支付投资人的全部赎回申请时，按正常赎回程序执行。

(2) 部分延期赎回：当基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额的 10% 的前提下，可对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理该单个账户的赎回份额；对于未能赎回部分，投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入该部分基金份额的下一个运作期到期日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与该部分基金份额的下一个运作期到期日赎回申请一并处理，无优先权并以该部分基金份额的下一个运作期到期日的相应类别基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。部分顺延赎回不受单笔赎回最低份额的限制。

(3) 若基金发生巨额赎回，在单个基金份额持有人当日赎回申请超过上一开放日基金总份额 40% 的情形下，基金管理人可以延期办理赎回申请。如基金管理人对其超过基金总份额 40% 以上的赎回申请实施延期办理，基金管理人只接受

其基金总份额 40%部分作为当日有效赎回申请,与当日的其他有效赎回申请一起,按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例,确定当日受理该单个账户的赎回份额;对于未能赎回部分,投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的,将自动转入该部分基金份额的下一个运作期到期日继续赎回,直到全部赎回为止;选择取消赎回的,当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与该部分基金份额的下一个运作期到期日赎回申请一并处理,无优先权并以该部分基金份额的下一个运作期到期日的基金份额净值为基础计算赎回金额,以此类推,直到全部赎回为止。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择,投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。部分顺延赎回不受单笔赎回最低份额的限制。但是,如该基金份额持有人在提交赎回申请时选择取消赎回,则其当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。

(4) 暂停赎回:连续 2 个开放日以上(含本数)发生巨额赎回,如基金管理人认为有必要,可暂停接受基金的赎回申请;已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项,但不得超过 20 个工作日,并应当在指定媒介上进行公告。

### 3、巨额赎回的公告

当发生上述巨额赎回并延期办理时,基金管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在 3 个交易日内通知基金份额持有人,说明有关处理方法,并在两日内在指定媒介上刊登公告。

## 十二、暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

1、发生上述暂停申购或赎回情况的,基金管理人应在规定期限内指定媒介上刊登暂停公告。

2、基金管理人可以根据暂停申购或赎回的时间,最迟于重新开放日在指定媒介上刊登重新开放申购或赎回的公告;也可以根据实际情况在暂停公告中明确重新开放申购或赎回的时间,届时不再另行发布重新开放的公告。

## 十三、基金转换

基金管理人可以根据相关法律法规以及基金合同的规定决定开办本基金与基金管理人管理的其他基金之间的转换业务,基金转换可以收取一定的转换费,相关规则由基金管理人届时根据相关法律法规及基金合同的规定制定并公告,并提前告知基金托管人与相关机构。

#### 十四、基金的非交易过户

基金的非交易过户是指基金登记机构受理继承、捐赠和司法强制执行等情形而产生的非交易过户以及登记机构认可、符合法律法规的其它非交易过户。无论在上述何种情况下，接受划转的主体必须是依法可以持有本基金基金份额的投资人。

继承是指基金份额持有人死亡，其持有的基金份额由其合法的继承人继承；捐赠指基金份额持有人将其合法持有的基金份额捐赠给福利性质的基金会或社会团体；司法强制执行是指司法机构依据生效司法文书将基金份额持有人持有的基金份额强制划转给其他自然人、法人或其他组织。办理非交易过户必须提供基金登记机构要求提供的相关资料，对于符合条件的非交易过户申请按基金登记机构的规定办理，并按基金登记机构规定的标准收费。

#### 十五、基金的转托管、质押

基金份额持有人可办理已持有基金份额在不同销售机构之间的转托管，基金销售机构可以按照规定的标准收取转托管费。

在条件许可的情况下，基金登记机构可依据相关法律法规及其业务规则，办理基金份额质押业务，并可收取一定的手续费。

#### 十六、定期定额投资计划

基金管理人可以为投资人办理定期定额投资计划，具体规则由基金管理人另行规定。投资人在办理定期定额投资计划时可自行约定每期扣款金额，每期扣款金额必须不低于基金管理人在相关公告或更新的招募说明书中所规定的定期定额投资计划最低申购金额。

#### 十七、基金份额的冻结和解冻

基金登记机构只受理国家有权机关依法要求的基金份额的冻结与解冻，以及登记机构认可、符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻。

基金份额被冻结的，被冻结部分产生的权益一并冻结，被冻结部分份额仍然参与收益分配。法律法规或监管机构另有规定的除外。

#### 十八、基金份额转让

在符合法律法规规定且条件允许的情况下，基金管理人可以根据相关业务规则受理基金份额持有人通过中国证监会认可的交易场所或者交易方式进行份额

转让的申请。具体由基金管理人提前发布公告。

## 第九部分 基金的投资

### 一、投资目标

本基金主要投资于科技创新主题中优质的上市公司股票，采用积极主动的投资策略，在合理的风险限度内，追求基金资产长期稳定增值，力争实现超越业绩基准的超额收益。

### 二、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交易的股票（包括主板、中小板、创业板、科创板及其他中国证监会允许基金投资的股票、存托凭证）、港股通标的股票、股指期货、债券（包括国债、地方政府债、政府支持机构债券、政府支持债券、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债的纯债部分、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券等）、国债期货、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

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

股票占基金资产的比例为 60% - 95%（其中，投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0%-50%），其中投资于本基金界定的科技创新主题范围内的证券比例不低于非现金资产的 80%。每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值的 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。

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、基金托管人书面协商一致并履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

### 三、投资策略

#### 1、资产配置策略

本基金基于公司自主研发的智能投研平台，对宏观经济、政策面、资金面、市场情绪等因素综合分析，对股票资产、债券资产、现金类资产等大类资产的收益特征进行前瞻性研究，形成对各类别资产未来相对表现的预判，在严控投资组

合风险的前提下，确定并适时调整基金资产中大类资产的配置比例，动态优化投资组合。

## 2、股票投资策略

### （1）科技创新主题界定

本基金界定的科技创新企业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，主要服务于符合国家战略、突破关键核心技术、市场认可度高的企业，重点关注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。具体而言：

1) 新一代信息技术领域，主要包括半导体和集成电路、电子信息、下一代信息网络、人工智能、大数据、云计算、新兴软件、互联网、物联网和智能硬件等；

2) 高端装备领域，主要包括智能制造、航空航天、先进轨道交通、海洋工程装备及相关技术服务等；

3) 新材料领域，主要包括先进钢铁材料、先进有色金属材料、先进石化化工新材料、先进无机非金属材料、高性能复合材料、前沿新材料及相关技术服务等；

4) 新能源领域，主要包括先进核电、大型风电、高效光电光热、高效储能及相关技术服务等；

5) 节能环保领域，主要包括高效节能产品及设备、先进环保技术装备、先进环保产品、资源循环利用、新能源汽车整车、新能源汽车关键零部件、动力电池及相关技术服务等；

6) 生物医药领域，主要包括生物制品、高端化学药、高端医疗设备与器械及相关技术服务等；

7) 符合科创板定位的其他领域。

与科技创新相关的企业识别是一个动态的过程，随着经济、技术的持续发展和不断创新，可能会出现新的符合科技创新主题的企业，本基金将进行持续跟踪研究，密切跟踪科技创新带来的投资机遇，积极把握以科技为创新驱动力、具备核心竞争优势的投资机会，适时对科技创新的涵盖范围进行动态调整。

### （2）个股投资策略



本基金将遵循“行业景气度向上”的基本原则，精选优质上市公司股票，具体包括：

### 1) 行业景气度跟踪

本基金充分利用公司自主研发的智能投研平台对各个行业的现状及边际变化进行跟踪，综合考虑大数据行业因子、行业财务因子和行业估值因子三个指标，采用量化模型计算行业景气度。三个指标分别是：

大数据行业因子指标：重点考虑反应行业边际变化的支付类、市场类等大数据；跟踪国内外权威机构行业数据；挖掘海外上市公司领先数据等。

行业财务因子指标：重点考虑毛利率、营业利润率、净利率、净资产收益率等指标；

行业估值因子指标：重点考虑市盈率、市销率、股息率、息税前收入与企业价值之比等；判断不同行业之间的横向估值和同一行业的历史估值水平。

根据上述计算的行业景气度进行排名，选取景气度正向变化幅度居前的行业进行重点分析，构建股票初选库。

### 2) 优质上市公司

竞争优势分析：主要关注公司产品的议价能力、技术优势、创新能力、管理优势以及资源垄断优势等多方面进行综合分析。

公司治理分析：主要关注公司治理结构是否合理、公司的关联交易是否透明、公司发展战略是否合理有效、公司高管诚信记录、大股东是否有侵占小股东利益记录等。

盈利质量分析：主要关注历史分红比例率、现金流量表健康程度，毛利率、营业利润率、净利率、总资产收益率、净资产收益率等指标来考量公司的盈利质量。

在备选股票池基础上，进一步对备选上市公司进行翔实的案头分析和深入的实地调研。

3) 估值判断：综合考虑估值对比、经营阶段、市场情绪等指标，利用多因子模型计算每只股票的因子加权得分，挑选总得分最高的若干个股构建投资组合。

估值对比：横向同业对比和纵向历史对比；多估值指标。

经营阶段：行业和公司经营周期处于边际向上周期，估值具备扩张逻辑。

市场情绪：引入智能化工具，回避短期过热情绪，加强投资的纪律性。

### （3）科创板投资策略

本基金基于公司自主研发的智能投研平台，根据科技创新企业的范畴选出备选股票池，并在此基础上从行业选择、公司评价、估值比较三个维度精选投资标的。

1) 行业选择：基于公司智能投研系统，综合考虑长期因素、短期景气度边际变化和行业估值比较三个指标，采用量化模型对行业进行排名，选取幅度居前30%的行业进行配置，构建股票备选池。

长期空间：未来潜在增长空间是否足够大；竞争格局受否稳定；投资回报率

短期景气度边际变化：判断行业爆发式点；基于支大数据判断短期行业景气度变化；

行业估值比较指标：基于公司智能投研系统，判断不同行业之间的横向估值和同一行业的历史估值水平。

2) 公司评价：对备选上市公司进行翔实的案头分析和深入的实地调研。其中本基金将重点关注具以下特征的优质上市公司：

治理结构良好，管理规范，信息透明；

拥有高效的研发体系、具备持续创新能力的上市公司

主营业务鲜明，盈利能力强，收入和利润具备成长性；

财务状况良好，具备一定的规模优势和较好的抗风险能力；

具有核心竞争优势，有良好的市场知名度和较好的品牌效应，处于行业龙头地位。

3) 估值判断：综合考虑估值对比、经营阶段、市场情绪等指标，利用多因子模型计算每只股票的因子加权得分，挑选总得分最高的若干只个股构建投资组合。

估值对比：横向同业对比和纵向历史对比；多估值指标；

经营阶段：行业和公司经营周期处于边际向上周期，估值具备扩张逻辑；

市场情绪：引入智能化工具，回避短期过热情绪，加强投资的纪律性。

#### （4）港股通标的股票投资策略

本基金可通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港股票市场。本基金将遵循上述科技创新主题相关股票的投资策略，优先将基本面健康、业绩向上弹性较大、具有估值优势的港股通标的股票纳入本基金的股票投资组合。

#### 3、存托凭证投资策略

本基金可投资存托凭证，本基金将结合对宏观经济状况、行业景气度、公司竞争优势、公司治理结构、估值水平等因素的分析判断，选择投资价值高的存托凭证进行投资。

#### 4、债券投资策略

在债券投资方面，本基金通过对宏观经济、金融政策、市场供需、市场结构变化等因素的分析，形成对未来利率走势的判断，并根据利率期限结构的变动进行期限结构的调整。同时对不同类型的债券在收益率、流动性和信用风险上存在差异，债券资产有必要配置于不同类型的债券品种以及在不同市场上进行配置，以寻求收益性、流动性和信用风险补偿间的最佳平衡点。

##### （1）久期策略

本基金通过对影响市场利率的各种因素（如宏观经济状况、货币政策走向、资金供求情况、境内外相关市场的走势等）的分析，判断市场利率变化趋势，以确定基金组合的久期目标。当预期未来市场利率水平下降时，本基金将通过增持剩余期限较长的债券等方式提高基金组合久期；当预期未来市场利率水平上升时，本基金将通过增加持有剩余期限较短债券并减持剩余期限较长债券等方式缩短基金组合久期，以规避组合跌价风险。

##### （2）期限结构配置策略

本基金将根据对利率走势、收益率曲线的变化情况的判断，适时采用哑铃型、梯形或子弹型投资策略，在长期、中期和短期债券间进行配置，以最大限度避免投资组合收益受债券利率变动的负面影响。

##### （3）类属配置策略

类属配置是指债券组合中国债、金融债、企业债、公司债、可转换债券（可分离交易可转债的纯债部分）等不同债券投资品种之间的配置比例。本基金将综合分析各类属相对收益情况、利差变化状况、信用风险评级、流动性风险管理等

因素来确定各类属配置比例，发掘具有较好投资价值的投资品种，增持相对低估并能给组合带来相对较高回报的类属，减持相对高估并给组合带来相对较低回报的类属。

#### （4）个券选择策略

本基金在个券选择上将安全性因素放在首位，优先选择高信用等级的债券品种，防范违约风险。其次，在具体的券种选择上，将根据公司的五因子定价模型，挖掘收益率明显偏高的券种，若发现该类券种主要由于市场波动原因所导致的收益率高于公允水平，则该券种价格属于相对低估，本基金将重点关注和投资此类低估品种。

#### 5、资产支持证券投资策略

本基金通过对资产支持证券资产池结构和质量的跟踪考察，分析资产支持证券底层资产信用状况变化，并预估提前偿还率变化对资产支持证券未来现金流的影响情况，评估其内在价值进行投资。

#### 6、可转换债、可交换债投资策略

本基金可投资可转换债、分离交易可转债或含赎回或回售权的债券、可交换债券等，这类债券赋予债权人或债务人某种期权，比普通的债券更为灵活。本基金将采用专业的分析和计算方法，综合考虑主体权益视角的弹性、主体债券视角的稳健性以及期权定价的均值回归的特性等因素，力求选择被市场低估的品种，获得超额收益。

#### 7、衍生产品投资策略

##### （1）股指期货投资策略

本基金在风险可控的前提下，为更好地达到本基金的投资目标，本着谨慎原则，以套期保值为目的，可投资股指期货、国债期货。若本基金投资股指期货、国债期货，将根据风险管理的原则，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货、国债期货合约进行交易，以对冲投资组合的风险、有效管理现金流量或降低建仓或调仓过程中的冲击成本等。

##### （2）国债期货投资策略

本基金为提高对利率风险管理能力，在风险可控的前提下，以套期保值为目的，本着谨慎原则参与国债期货投资。国债期货作为利率衍生品的一种，有助于

管理债券组合的久期、流动性和风险水平。本基金将按照相关法律法规的规定，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析；构建量化分析体系，对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控，在最大限度保证基金资产安全的基础上，力求实现基金资产的长期稳定增值。

#### 四、投资限制

##### 1、本基金的投资组合应遵循以下限制：

(1) 本基金投资于股票资产的比例为 60%-95%（其中，投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0%-50%），其中投资于本基金界定的科技创新主题范围内的证券比例不低于非现金资产的 80%；

(2) 每个交易日日终，在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，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、应收申购款等；

(3) 本基金持有一家公司发行的证券（同一家公司在境内和香港同时上市的，A+H 股合计计算），其市值不超过基金资产净值的 10%；

(4) 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券（同一家公司在境内和香港同时上市的，A+H 股合计计算），不超过该证券的 10%；

(5) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；

(6) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；

(7) 本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；

(8) 本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；

(9) 本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上（含 BBB）的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；

(10) 基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

(11) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；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) 本基金管理人管理的全部开放式基金（包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金）持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；

(13) 本基金资产总值不超过基金资产净值的 140%；

(14) 本基金在任何交易日日终，持有的买入国债期货合约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；若本基金不投资股指期货、国债期货，则不受上述限制；

(15) 本基金参与股指期货交易后，需遵守下列比例限制：

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%；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%；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；

(16) 本基金参与国债期货交易，需遵守下列比例限制：

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

(17) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%；因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外

的因素致使基金不符合该比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

(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) 本基金投资存托凭证的比例限制依照境内上市交易的股票执行，与境内上市交易的股票合并计算；

(20) 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)、(9)、(17)、(18)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及法律法规另有规定的除外。

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基金合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门取消或调整上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或按调整后的规定执行。

## 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) 向其基金管理人、基金托管人出资；
- (5) 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；
- (6) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循基金份

额持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

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

## 五、业绩比较基准

$65\% \times \text{中国战略新兴产业成份指数收益率} + 30\% \times \text{中债综合财富（总值）指数收益率} + 5\% \times \text{中证港股通综合指数收益率}$

中国战略新兴产业成份指数是由中证指数有限公司编制，选取节能环保产业、新一代信息技术产业、生物产业、高端装备制造产业、新能源产业、新材料产业、新能源汽车产业、数字创意产业、高技术服务业等领域具有代表性的 100 家上市公司，采用自由流通股本加权方式，以反映中国战略新兴产业上市公司的整体走势。

中债综合财富（总值）指数由中央国债登记结算有限责任公司编制的反映中国债券市场总体走势的代表性指数。该指数的样本券覆盖我国银行间市场和交易所市场，成份债券包括国债、央行票据、金融债、企业债券、短期融资券等几乎所有债券种类，具有广泛的市场代表性，能够反映债券市场总体走势。中债综合财富（总值）指数是以债券全价计算的指数值，考虑了付息日利息再投资因素，即在样本券付息时将利息再投资计入指数之中。

中证港股通综合指数由中证指数有限公司编制，选取符合港股通资格的普通股作为样本股，采用自由流通市值加权计算，以反映港股通范围内上市公司的整体状况和走势。

本基金对中国战略新兴产业成份指数、中债综合财富（总值）指数和中证港股通综合指数分别赋予 65%、30%和 5%的权重，符合本基金的配置理念和投资特性。本基金管理人认为，该业绩比较基准目前能够忠实地反映本基金的风险收益特征。

如果指数编制单位停止计算编制以上指数或更改指数名称、或今后法律法规



发生变化、或有更适当的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出、或市场上出现更加适用于本基金的业绩比较基准的指数时，本基金管理人可以根据本基金的投资范围和投资策略，调整基金的业绩比较基准，但应在取得基金托管人同意后报中国证监会备案，并及时公告，无须召开基金份额持有人大会审议。

## 六、风险收益特征

本基金为混合型基金，其长期平均风险和预期收益率理论上高于债券型基金、货币市场基金，但低于股票型基金。本基金将投资于港股通标的股票，需面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

## 七、基金管理人代表基金行使股东或债权人权利的处理原则及方法

- 1、不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司的经营管理；
- 2、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东或债权人权利，保护基金份额持有人的利益；
- 3、有利于基金财产的安全与增值；
- 4、不通过关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利害关系的第三人牟取任何不当利益。

## 八、基金投资组合报告

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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

### 1、报告期末基金资产组合情况

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	366,385,512.87	85.75
	其中：股票	366,385,512.87	85.75
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	58,303,879.10	13.65
8	其他资产	2,575,688.22	0.60
9	合计	427,265,080.19	100.00

## 2、报告期末按行业分类的股票投资组合

### (1) 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

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	263,035,460.78	65.21
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,020.39	0.00
E	建筑业	809,926.44	0.20
F	批发和零售业	67,112.46	0.02
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	75,216,821.91	18.65
J	金融业	34,721.10	0.01
K	房地产业	6,610.74	0.00
L	租赁和商务服务业	49,470.30	0.01
M	科学研究和技术服务业	2,112,356.00	0.52
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	341,345,500.12	84.63

### (2) 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
A 基础材料	-	-
B 消费者非必需品	2,056,391.18	0.51
C 消费者常用品	-	-
D 能源	-	-
E 金融	-	-
F 医疗保健	11,716,601.69	2.90
G 工业	-	-
H 信息技术	11,267,019.88	2.79
I 电信服务	-	-
J 公用事业	-	-
K 房地产	-	-
合计	25,040,012.75	6.21

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）；

本基金 GICS 数据由上海恒生聚源数据服务有限公司提供。

### 3、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	603986	兆易创新	161,586	30,362,009.40	7.53
2	002415	海康威视	394,727	25,459,891.50	6.31
3	688099	晶晨股份	221,285	24,828,177.00	6.16
4	300327	中颖电子	278,082	23,700,928.86	5.88
5	002236	大华股份	996,811	21,032,712.10	5.21
6	002230	科大讯飞	271,002	18,314,315.16	4.54
7	002241	歌尔股份	420,300	17,963,622.00	4.45
8	603501	韦尔股份	54,599	17,580,878.00	4.36
9	688036	传音控股	76,307	15,986,316.50	3.96
10	002475	立讯精密	326,160	15,003,360.00	3.72

### 4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

### 5、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

### 6、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 7、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资 明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 8、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明 细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 9、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### (1) 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

##### (2) 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

#### 10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### (1) 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

##### (2) 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

##### (3) 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

#### 11、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受到调查以及处罚的情况的 说明

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

##### (2) 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

##### (3) 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	1,535,164.26
2	应收证券清算款	-

3	应收股利	-
4	应收利息	14,295.39
5	应收申购款	1,026,228.57
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	2,575,688.22

(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

(6) 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占资产或净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

## 十二、基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

(1) 本基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

浙商科创一个月滚动持有混合 A

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2020.9.29-2020.12.31	12.08%	1.15%	13.66%	0.93%	-1.58%	0.22%
2021.1.1-2021.3.31	0.03%	1.96%	-3.63%	1.64%	3.66%	0.32%
2021.4.1-2021.6.30	34.35%	1.42%	13.09%	1.01%	21.26%	0.41%

浙商科创一个月滚动持有混合 C

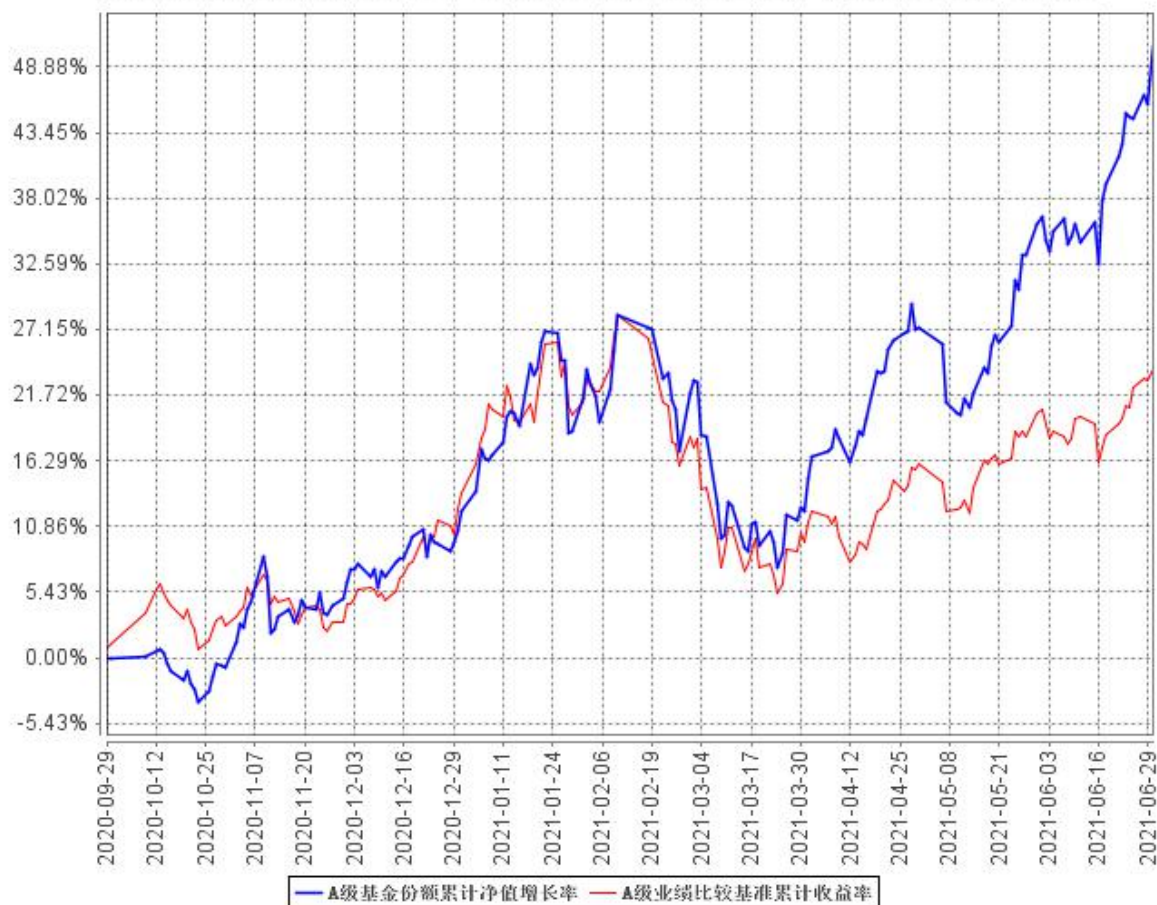
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2020.9.29-2020.12.31	12.00%	1.15%	13.66%	0.93%	-1.66%	0.22%
2021.1.1-2021.3.31	-0.02%	1.96%	-3.63%	1.64%	3.61%	0.32%
2021.4.1-2021.6.30	34.29%	1.42%	13.09%	1.01%	21.20%	0.41%

注：本基金的业绩比较基准： $65\% \times$ 中国战略新兴产业成份指数收益率 $+30\%$

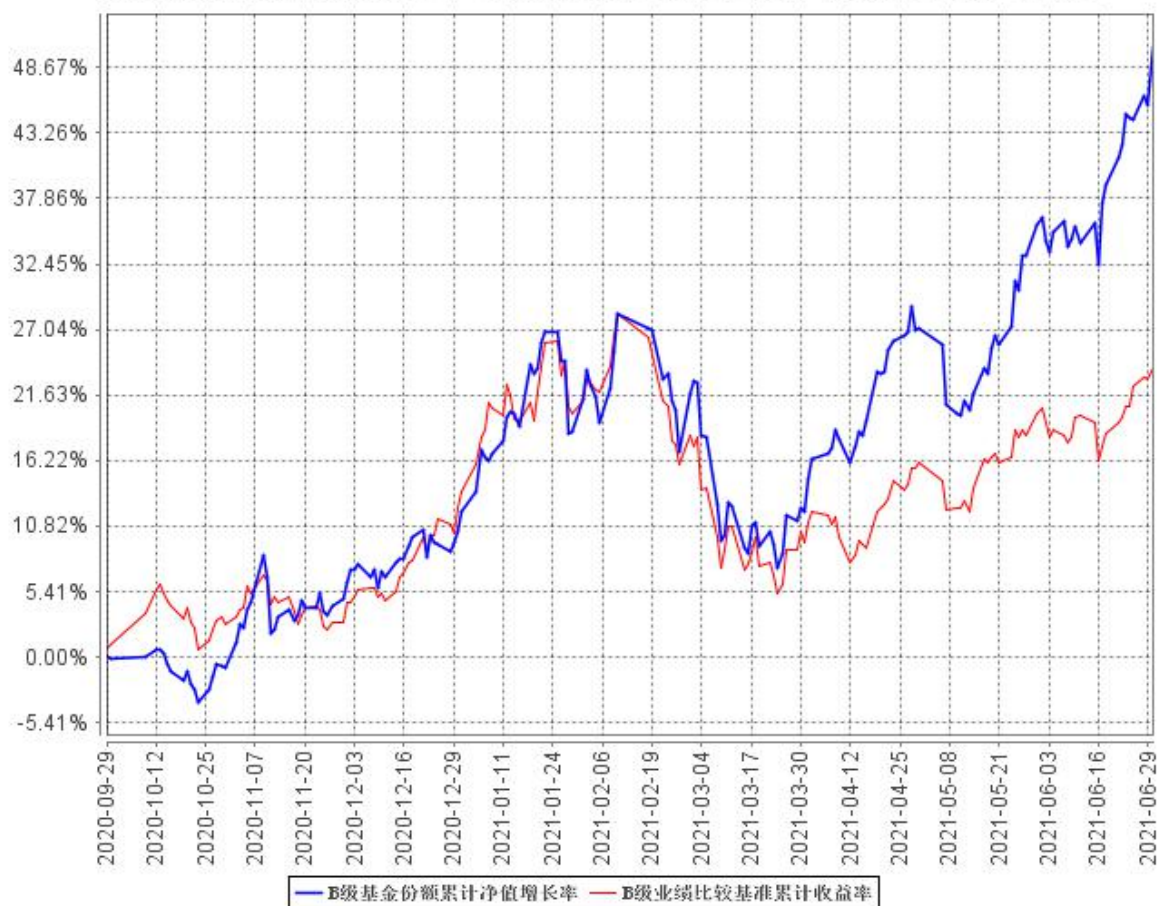
$\times$ 中债综合财富（总值）指数收益率 $+5\% \times$ 中证港股通综合指数收益率。

(2) 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

**A级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图**



**B级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图**



注：1、本基金基金合同生效日为2020年9月29日，基金合同生效日至本报告期末，本基金生效时间未满一年。

2、本基金建仓期为6个月，建仓期结束时各项资产配置比例应符合基金合同约定。

## 第十部分 基金的财产

### 一、基金资产总值

基金资产总值是指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收款项及其他资产的价值总和。

### 二、基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

### 三、基金财产的账户

基金托管人根据相关法律法规、规范性文件为本基金开立资金账户、证券账户以及投资所需的其他专用账户。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金销售机构和基金登记机构自有的财产账户以及其他基金财产账户相独立。

### 四、基金财产的保管和处分

本基金财产独立于基金管理人、基金托管人和基金销售机构的财产，并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人、基金登记机构和基金销售机构以其自有的财产承担其自身的法律责任，其债权人不得对本基金财产行使请求冻结、扣押或其他权利。除依法律法规和《基金合同》的规定处分外，基金财产不得被处分。

基金管理人、基金托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，基金财产不属于其清算财产。基金管理人管理运作基金财产所产生的债权，不得与其固有资产产生的债务相互抵销；基金管理人管理运作不同基金的基金财产所产生的债权债务不得相互抵销。非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。



## 第十一部分 基金资产的估值

### 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、债券、股指期货、国债期货、资产支持证券、同业存单、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。

(一)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。

(二)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。

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

### 四、估值方法

## 1、证券交易所上市的有价证券的估值

(1) 除本部分另有约定的品种外，交易所上市的股票等，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，最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

(2) 交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（基金合同另有规定的除外），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。

(3) 交易所上市交易的可转换债券，按估值日收盘全价减去债券收盘价中所含的债券应计利息（税后）得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息（税后）得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，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；交易所上市实行全价交易的债券（可转债除外），选取第三方估值机构提供的估值全价减去估值全价中所含的债券（税后）应收利息得到的净价进行估值。

(4) 交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。交易所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。

## 2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

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

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

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

4、持有的银行定期存款或通知存款以本金列示，按协议或合同利率逐日确认利息收入。

5、同业存单按估值日第三方估值机构提供的估值净价估值，选定的第三方估值机构未提供估值价格的，按成本估值。

6、股指期货合约、国债期货合约以估值当日结算价进行，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。

7、债券回购：持有的回购协议以成本列示，按商定利率在实际持有期间内逐日计提利息。

8、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。

9、港股通投资持有外币证券资产估值涉及到港币、美元、英镑、欧元、日元等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。

10、本基金投资存托凭证的比例限制依照境内上市交易的股票执行，与境内上市交易的股票合并计算。

11、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。

12、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。

13、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，按照基金管理人对基金净值信息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以及因该交易日基金资产净值计算顺延错误而引起的损失，由基金管理人负责赔付。

## 五、估值程序

1、由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值。各类基金份额净值是按照每个工作日闭市后，该类基金资产净值除以当日该类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，由此产生的误差计入基金财产。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。

基金管理人应每个工作日计算基金资产净值及各类基金份额净值，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，将各类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，由基金管理人按规定对外公布。

## 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。当任一类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。

基金合同的当事人应按照以下约定处理：

### 1、估值错误类型

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

“估值错误处理原则”给予赔偿，承担赔偿责任。

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

## 2、估值错误处理原则

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

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

(3) 因估值错误而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但估值错误责任方仍应对估值错误负责。如果由于获得不当得利的当事人不返还或不全部返还不当得利造成其他当事人的利益损失（“受损方”），则估值错误责任方应赔偿受损方的损失，并在其支付的赔偿金额的范围内对获得不当得利的当事人享有要求交付不当得利的权利；如果获得不当得利的当事人已经将此部分不当得利返还给受损方，则受损方应当将其已经获得的赔偿额加上已经获得的不当得利返还的总和超过其实际损失的差额部分支付给估值错误责任方。

(4) 估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

## 3、估值错误处理程序

估值错误被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

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

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

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

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

#### 4、基金份额净值估值错误处理的方法如下：

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

(2) 错误偏差达到该类基金份额净值的 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；错误偏差达到该类基金份额净值的 0.5% 时，基金管理人应当公告，并报中国证监会备案。

(3) 当基金份额净值计算差错给基金和基金份额持有人造成损失需要进行赔偿时，基金管理人和基金托管人应根据实际情况界定双方承担的责任，经确认后按以下条款进行赔偿：

① 本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，与本基金有关的会计问题，如经双方在平等基础上充分讨论后，尚不能达成一致时，按基金管理人的建议执行，由此给基金份额持有人和基金财产造成的损失，由基金管理人负责赔付。

② 若基金管理人计算的基金份额净值已由基金托管人复核确认后公告，由此给基金份额持有人造成损失的，应根据法律法规的规定对投资者或基金支付赔偿金，就实际向投资者或基金支付的赔偿金额，基金管理人与基金托管人按照管理费率及托管费率的比例各自承担相应的责任。

③ 如基金管理人和基金托管人对基金份额净值的计算结果，虽然多次重新计算和核对，尚不能达成一致时，为避免不能按时公布基金份额净值的情形，以基金管理人的计算结果对外公布，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。

④ 由于基金管理人提供的信息错误（包括但不限于基金申购或赎回金额等），进而导致基金份额净值计算错误而引起的基金份额持有人和基金财产的损失，由基金管理人负责赔付。

(4) 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。如果行业另有通行做法，基金管理人和基金托管人应本着平等和保护基金份额持有人利益的原则进行协商。

#### 七、暂停估值的情形

1、基金投资所涉及的证券、期货交易市场或外汇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、法律法规、中国证监会或基金合同认定的其他情形。

#### 八、基金净值的确认

基金资产净值和各类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各类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，由基金管理人按照规定对基金净值予以公布。

#### 九、特殊情况的处理

1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第 11 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、登记结算机构及存款银行等第三方机构发送的数据错误，或国家会计政策变更、市场规则变更等非基金管理人与基金托管人原因，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。

## 第十二部分 基金的收益与分配

### 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损益后的余额。

### 二、基金可供分配利润

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

### 三、基金收益分配原则

1、在符合有关基金分红条件的前提下，基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的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；

3、基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最少为1次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的20%；

5、本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

6、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份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，基金管理人经与基金托管人协商一致可调整基金收益的分配原则和支付方式，不需召开基金份额持有人大会审议。

### 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，依据相关规定进行公告。



## 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自动转为相应类别的基金份额。红利再投资的计算方法，依照《业务规则》执行。

## 第十三部分 基金的费用与税收

### 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、C类基金份额计提的销售服务费；
- 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、诉讼费和仲裁费；
- 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、基金的账户开户费用、账户维护费用；
- 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，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休日或不可抗力等，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0.10%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日或不可抗力等，支付日期顺延。

### 3、基金销售服务费

本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.20%。本基金销售服务费将专门用于本基金的销售与基金份额持有人服务，基金管理人将在基金年度报告中对该项费用的列支情况作专项说明。

销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.20% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

基金销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付。若遇法定节假日、公休日或不可抗力等，支付日期顺延。

上述“一、基金费用的种类”中第 4-11 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、费用调整

基金管理人和基金托管人协商一致并履行适当程序后,可按照基金发展情况,并根据法律法规规定和基金合同约定针对全部或部分份额类别调整基金管理费用、基金托管费用或基金销售服务费用等相关费用。

#### 五、基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体,其纳税义务按国家税收法律、法规执行。基金财产投资的相关税收,由基金份额持有人承担,基金管理人或者其他扣缴义务人按照国家有关税收征收的规定代扣代缴。

## 第十四部分 基金的会计与审计

### 一、基金会计政策

1、基金管理人为本基金的基金会计责任方；

2、基金的会计年度为公历年度的1月1日至12月31日；基金首次募集的会计年度按如下原则：如果《基金合同》生效少于2个月，可以并入下一个会计年度披露；

3、基金核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位；

4、会计制度执行国家有关会计制度；

5、本基金独立建账、独立核算；

6、基金管理人及基金托管人各自保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关规定编制基金会计报表；

7、基金托管人每月与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以托管协议约定方式确认。

### 二、基金的年度审计

1、基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相互独立的具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所及其注册会计师对本基金的年度财务报表进行审计。

2、会计师事务所更换经办注册会计师，应事先征得基金管理人同意。

3、基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所，须通报基金托管人。更换会计师事务所需依照《信息披露办法》有关规定在指定媒介公告。

## 第十五部分 基金的信息披露

一、本基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《流动性风险管理规定》、《基金合同》及其他有关规定。相关法律法规关于信息披露的披露方式、登载媒介、报备方式等规定发生变化时，本基金从其最新规定。

### 二、信息披露义务人

本基金信息披露义务人包括基金管理人、基金托管人、召集基金份额持有人大会的基金份额持有人及其日常机构等法律、行政法规和中国证监会规定的自然人、法人和非法人组织。

本基金信息披露义务人以保护基金份额持有人利益为根本出发点，按照法律法规和中国证监会的规定披露基金信息，并保证所披露信息的真实性、准确性、完整性、及时性、简明性和易得性。

本基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内，将应予披露的基金信息通过中国证监会指定的全国性报刊（以下简称“指定报刊”）和指定互联网网站（以下简称“指定网站”，包括基金管理人网站、基金托管人网站、中国证监会基金电子披露网站）等媒介披露，并保证基金投资者能够按照《基金合同》约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。

三、本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息，不得有下列行为：

- 1、虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏；
- 2、对证券投资业绩进行预测；
- 3、违规承诺收益或者承担损失；
- 4、诋毁其他基金管理人、基金托管人或者基金销售机构；
- 5、登载任何自然人、法人和非法人组织的祝贺性、恭维性或推荐性文字；
- 6、中国证监会禁止的其他行为。

四、本基金公开披露的信息应采用中文文本。同时采用外文文本的，基金信息披露义务人应保证不同文本的内容一致。不同文本之间发生歧义的，以中文文本为准。

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。

### 五、公开披露的基金信息

公开披露的基金信息包括：

（一）基金招募说明书、《基金合同》、基金托管协议、基金产品资料概要

1、《基金合同》是界定《基金合同》当事人的各项权利、义务关系，明确基金份额持有人大会召开的规则及具体程序，说明基金产品的特性等涉及基金投资者重大利益的事项的法律文件。

2、基金招募说明书应当最大限度地披露影响基金投资者决策的全部事项，说明基金认购、申购和赎回安排、基金投资、基金产品特性、风险揭示、信息披露及基金份额持有人服务等内容。《基金合同》生效后，基金招募说明书的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金招募说明书并登载在指定网站上；基金招募说明书其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金招募说明书。

3、基金托管协议是界定基金托管人和基金管理人在基金财产保管及基金运作监督等活动中的权利、义务关系的法律文件。

4、基金产品资料概要是基金招募说明书的摘要文件，用于向投资者提供简明的基金概要信息。《基金合同》生效后，基金产品资料概要的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金产品资料概要，并登载在指定网站及基金销售机构网站或营业网点；基金产品资料概要其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金产品资料概要。

（二）基金份额发售公告

基金管理人应当就基金份额发售的具体事宜编制基金份额发售公告。

基金募集申请经中国证监会注册后，基金管理人在基金份额发售的三日前，将基金份额发售公告、基金招募说明书提示性公告和基金合同提示性公告登载在指定报刊上，将基金份额发售公告、基金招募说明书、基金产品资料概要、基金合同和基金托管协议登载在指定网站上，其中基金产品资料概要还应当登载在基金销售机构网站或营业网点；基金托管人应当同时将基金合同、基金托管协议登载在指定网站上。

（三）《基金合同》生效公告

基金管理人应当在收到中国证监会确认文件的次日在指定报刊和指定网站

上登载《基金合同》生效公告。

#### （四）基金净值信息

《基金合同》生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周在指定网站披露一次各类基金份额净值和各类基金份额累计净值。

在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，通过指定网站、基金销售机构网站或者营业网点披露开放日的各类基金份额净值和各类基金份额累计净值。

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

#### （五）基金份额申购、赎回价格

基金管理人应当在《基金合同》、招募说明书等信息披露文件上载明基金份额申购、赎回价格的计算方式及有关申购、赎回费率，并保证投资者能够在基金销售机构网站或营业网点查阅或者复制前述信息资料。

#### （六）基金定期报告，包括基金年度报告、基金中期报告和基金季度报告

基金管理人应当在每年结束之日起三个月内，编制完成基金年度报告，将年度报告登载在指定网站上，并将年度报告提示性公告登载在指定报刊上。基金年度报告中的财务会计报告应当经过具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计。

基金管理人应当在上半年结束之日起两个月内，编制完成基金中期报告，将中期报告登载在指定网站上，并将中期报告提示性公告登载在指定报刊上。

基金管理人应当在季度结束之日起 15 个工作日内，编制完成基金季度报告，将季度报告登载在指定网站上，并将季度报告提示性公告登载在指定报刊上。

《基金合同》生效不足 2 个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、中期报告或者年度报告。

如报告期内出现单一投资者持有基金份额达到或超过基金总份额 20% 的情形，为保障其他投资者的权益，基金管理人至少应当在定期报告“影响投资者决策的其他重要信息”项下披露该投资者的类别、报告期末持有份额及占比、报告期内持有份额变化情况及本基金的特有风险，中国证监会认定的特殊情形除外。

基金管理人应当在基金年度报告和中期报告中披露基金组合资产情况及其



流动性风险分析等。

法律法规或中国证监会另有规定的，从其规定。

#### （七）临时报告

本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在两日内编制临时报告书，并登载在指定报刊和指定网站上。

前款所称重大事件，是指可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的下列事件：

- 1、基金份额持有人大会的召开及决定的事项；
- 2、基金合同终止、基金清算；
- 3、基金扩募、延长基金合同期限；
- 4、转换基金运作方式、基金合并；
- 5、更换基金管理人、基金托管人、基金份额登记机构，基金改聘会计师事务所；
- 6、基金管理人委托基金服务机构代为办理基金的份额登记、核算、估值等事项，基金托管人委托基金服务机构代为办理基金的核算、估值、复核等事项；
- 7、基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；
- 8、基金管理人变更持有百分之五以上股权的股东、基金管理人的实际控制人变更；
- 9、基金募集期延长或提前结束募集；
- 10、基金管理人高级管理人员、基金经理和基金托管人专门基金托管部门负责人发生变动；
- 11、基金管理人的董事在最近 12 个月内变更超过百分之五十，基金管理人、基金托管人专门基金托管部门的主要业务人员在最近 12 个月内变动超过百分之三十；
- 12、涉及基金财产、基金管理业务、基金托管业务的诉讼或仲裁；
- 13、基金管理人或其高级管理人员、基金经理因基金管理业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚，基金托管人或其专门基金托管部门负责人因基金托管业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚；
- 14、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事项，中国证监会另有规定的情形除外；

15、基金收益分配事项；

16、管理费、托管费、销售服务费、申购费、赎回费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；

17、任一类基金份额净值计价错误达该类基金份额净值百分之零点五；

18、本基金开始办理申购、赎回；

19、本基金发生巨额赎回并延期办理；

20、本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项；

21、本基金暂停接受申购、赎回申请或重新接受申购、赎回申请；

22、基金管理人采用摆动定价机制进行估值；

23、调整基金份额类别的设置；

24、基金推出新业务或服务；

25、发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时；

26、基金信息披露义务人认为可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的其他事项或中国证监会规定的其他事项。

#### （八）澄清公告

在《基金合同》存续期限内，任何公共媒介中出现的或者在市场上流传的消息可能对基金份额价格产生误导性影响或者引起较大波动，以及可能损害基金份额持有人权益的，相关信息披露义务人知悉后应当立即对该消息进行公开澄清，并将有关情况立即报告中国证监会。

#### （九）基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会备案，并予以公告。

#### （十）清算报告

基金合同终止的，基金管理人应当依法组织基金财产清算小组对基金财产进行清算并作出清算报告。基金财产清算小组应当将清算报告登载在指定网站上，并将清算报告提示性公告登载在指定报刊上。

#### （十一）投资股指期货的信息披露

基金管理人应当在基金季度报告、基金中期报告、基金年度报告等定期报告

和招募说明书（更新）等文件中披露股指期货交易情况，包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标等，并充分揭示股指期货交易对基金总体风险的影响以及是否符合既定的投资政策和投资目标等。

#### （十二）投资资产支持证券的信息披露

基金管理人应在基金年报及半年报中披露本基金持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占基金净资产的比例和报告期内所有的资产支持证券明细。基金管理人应在基金季度报告中披露本基金持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占基金净资产的比例和报告期末按市值占基金净资产比例大小排序的前 10 名资产支持证券明细。

#### （十三）投资于非公开发行股票等流通受限证券的信息

基金管理人应在基金投资非公开发行股票后两个交易日内，在中国证监会指定媒介披露所投资非公开发行股票的名称、数量、总成本、账面价值，以及总成本和账面价值占基金资产净值的比例、锁定期等信息。

本基金有关投资流通受限证券比例如违反有关限制规定，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，基金管理人应在两日内编制临时报告书，予以公告。法律法规或监管部门另有规定时，从其规定。

#### （十四）投资国债期货的信息披露

基金管理人应当在基金季度报告、基金中期报告、基金年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露国债期货交易情况，包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标等，并充分揭示国债期货交易对基金总体风险的影响以及是否符合既定的投资政策和投资目标等。

#### （十五）投资港股通标的股票的信息披露

基金管理人应当在基金年度报告、基金中期报告和基金季度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中按届时有效的法律法规或监管机构的要求披露港股通标的股票的投资情况。

#### （十六）中国证监会规定的其他信息

### 六、信息披露事务管理

基金管理人、基金托管人应当建立健全信息披露管理制度，指定专门部门及高级管理人员负责管理信息披露事务。

基金信息披露义务人公开披露基金信息，应当符合中国证监会相关基金信息披露内容与格式准则等法规规定。

基金托管人应当按照相关法律法规、中国证监会的规定和《基金合同》的约定，对基金管理人编制的基金资产净值、各类基金份额净值、基金份额申购赎回价格、基金定期报告、更新的招募说明书、基金产品资料概要、基金清算报告等公开披露的相关基金信息进行复核、审查，并向基金管理人进行书面或电子确认。

基金管理人、基金托管人应当在指定报刊中选择一家报刊披露本基金信息。基金管理人、基金托管人应当向中国证监会基金电子披露网站报送拟披露的基金信息，并保证相关报送信息的真实、准确、完整、及时。

基金管理人、基金托管人除依法在指定媒介上披露信息外，还可以根据需要在其他公共媒介披露信息，但是其他公共媒介不得早于指定媒介披露信息，并且在不同媒介上披露同一信息的内容应当一致。

基金管理人、基金托管人除按法律法规要求披露信息外，也可着眼于为投资者决策提供有用信息的角度，在保证公平对待投资者、不误导投资者、不影响基金正常投资操作的前提下，自主提升信息披露服务的质量。具体要求应当符合中国证监会及自律规则的相关规定。前述自主披露如产生信息披露费用，该费用不得从基金财产中列支。

为基金信息披露义务人公开披露的基金信息出具审计报告、法律意见书的专业机构，应当制作工作底稿，并将相关档案至少保存到《基金合同》终止后 10 年。

#### 七、信息披露文件的存放与查阅

依法必须披露的信息发布后，基金管理人、基金托管人应当按照相关法律法规规定将信息置备于各自住所，供社会公众查阅、复制。

八、当出现下述情况时，基金管理人和基金托管人可暂停或延迟披露基金信息：

- 1、不可抗力；
- 2、基金投资所涉及的证券、期货市场或外汇市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；
- 3、法律法规规定、中国证监会或基金合同认定的其他情形。

九、本基金信息披露事项以法律法规规定及本章节约定的内容为准。

## 第十六部分 风险提示

本基金投资运作过程中面临的主要风险有：市场风险、管理风险、流动性风险、本基金特有的风险及其他风险。

### 一、市场风险

本基金主要投资于证券/期货市场，证券/期货市场价格受到宏观经济因素、政治环境、投资者风险偏好和市场流动性等各种因素的变化而波动，从而产生市场风险，这种风险主要包括：

#### 1、政策风险

因国家宏观政策（如货币政策、财政政策、行业政策、地区发展政策等）发生变化，导致市场价格波动而产生风险。

#### 2、经济周期风险

随着经济运行的周期性变化，证券市场的收益水平也呈周期性变化。基金投资于债券与上市公司的股票，收益水平也会随之变化，从而产生风险。

#### 3、利率风险

金融市场利率的波动会导致证券市场价格和收益率的变动。利率直接影响着债券的价格和收益率，引起基金收益水平的变化。特别是短期利率变化以及货币市场投资工具市场价格的相关波动，会影响基金组合投资业绩。

#### 4、债券收益率曲线风险

债券收益率曲线变动风险是指与收益率曲线非平行移动有关的风险，单一的久期指标并不能充分反映这一风险的存在。

#### 5、再投资风险

市场利率下降将影响固定收益类证券利息收入的再投资收益率，这与利率上升所带来的价格风险互为消长。

### 二、管理风险

在基金管理运作过程中，基金管理人的研究水平、投资管理水平直接影响基金收益水平，如果基金管理人经济形势和证券市场判断不准确、获取的信息不全、投资决策操作出现失误，都会影响基金的收益水平。

### 三、流动性风险

本基金将面临因市场交易量不足，导致证券不能迅速、低成本地转变为现金

的风险。流动性风险还包括由于本基金出现投资者大额赎回，致使本基金没有足够的现金应付基金赎回支付的要求所引致的风险。

#### （1）基金申购、赎回安排

本基金对于每份基金份额，设定一个月的滚动运作期。运作期内该基金份额不办理赎回或其他业务。每份基金份额可以在运作期到期日就该基金份额提出赎回申请。如果基金份额持有人在当期运作期到期日未申请赎回，则自该运作期到期日下一日起，该基金份额进入下一个运作期。为切实保护存量基金份额持有人的合法权益，遵循基金份额持有人利益优先原则，基金管理人将合理控制基金份额持有人集中度，审慎确认申购赎回业务申请，包括但不限于：

1) 当接受申购申请对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时，基金管理人应当采取设定单一投资者申购金额上限或基金单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停基金申购等措施，切实保护存量基金份额持有人的合法权益。基金管理人基于投资运作与风险控制的需要，可采取上述措施对基金规模予以控制。具体见基金管理人相关公告。

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

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，并暂停接受基金申购申请、基金赎回申请或延缓支付赎回款项。

投资人具体请参见基金合同“第六部分、基金份额的申购与赎回”中的“五、申购和赎回的数量限制”、“六、申购和赎回的价格、费用及其用途”、“七、拒绝或暂停申购的情形”及“八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形”以及本招募说明书“第八部分 基金份额的申购与赎回”中的“五、申购和赎回的数量限制”、“六、基金的申购费和赎回费”、“九、拒绝或暂停申购的情形”及“十、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形”的相关规定，详细了解本基金的申购以及赎回安排。

#### （2）拟投资市场、行业及资产的流动性风险评估

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交

易的股票（包括主板、中小板、创业板、科创板及其他中国证监会允许基金投资的股票、存托凭证）、港股通标的股票、股指期货、债券（包括国债、地方政府债、政府支持机构债券、政府支持债券、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债的纯债部分、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券等）、国债期货、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具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）。

本基金的投资标的为具有良好流动性的金融工具，以具有良好流动性的股票和债券为主，一般情况下具有较好的流动性。同时，基金管理人将根据历史经验和现实条件，制定出现金持有量的上下限计划，在该限制范围内进行现金比例调控或现金与证券的转化。基金管理人会进行标的的分散化投资并结合对各类标的资产的预期流动性合理进行资产配置，以防范流动性风险。

### （3）巨额赎回情形下的流动性风险管理措施

基金出现巨额赎回情形下，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况或巨额赎回份额占比情况决定全额赎回或部分延期赎回。基金出现连续巨额赎回情形的，基金管理人可以暂停赎回，对于已经接受的赎回申请，可以延缓支付赎回款项。基金出现巨额赎回情形下，如本基金单个基金份额持有人在单个开放日申请赎回基金份额超过基金总份额一定比例以上的，基金管理人有权对其超过该比例以上的赎回申请采取延期办理的措施。

投资人具体请参见基金合同“第六部分 基金份额的申购与赎回”中的“九、巨额赎回的情形及处理方式”以及本招募说明书“第八部分 基金份额的申购与赎回”中的“十一、巨额赎回的情形及处理方式”的相关规定。

### （4）实施备用的流动性风险管理工具的情形、程序及对投资者的潜在影响

基金管理人经与基金托管人协商一致，在确保投资者得到公平对待的前提下，可依照法律法规及基金合同的约定，综合运用各类流动性风险管理工具，对赎回申请等进行适度调整。基金管理人可以采取备用的流动性风险管理应对措施，包括但不限于：

#### 1) 暂停接受赎回申请

投资人具体请参见基金合同“第六部分 基金份额的申购与赎回”中的“八、暂



停赎回或延缓支付赎回款项的情形”和本招募说明书“第八部分 基金份额的申购与赎回”中的“十、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形”，详细了解本基金暂停接受赎回申请的情形及程序。在此情形下，投资人的部分或全部赎回申请可能被拒绝，同时投资人完成基金赎回时的基金份额净值可能与其提交赎回申请时的基金份额净值不同。

#### 2) 延缓支付赎回款项

投资人具体请参见基金合同“第六部分 基金份额的申购与赎回”中的“八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形”和“九、巨额赎回的情形及处理方式”和本招募说明书“第八部分 基金份额的申购与赎回”中的“十、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形”和“十一、巨额赎回的情形及处理方式”，详细了解本基金延缓支付赎回款项的情形及程序。在此情形下，投资人接收赎回款项的时间将可能比一般正常情形下有所延迟。

#### 3) 暂停基金估值

投资人具体请参见基金合同“第十四部分 基金资产估值”中的“七、暂停估值的情形”和本招募说明书“第十一部分 基金资产的估值”中的“七、暂停估值的情形”，详细了解本基金暂停估值的情形及程序。在此情形下，投资人没有可供参考的基金份额净值，同时赎回申请可能被暂停接受，或被延缓支付赎回款项。

#### 4) 摆动定价

当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。当基金采用摆动定价时，投资者申购或赎回基金份额时的基金份额净值，将会根据投资组合的市场冲击成本而进行调整，使得市场的冲击成本能够分配给实际申购、赎回的投资者，从而减少对存量基金份额持有人利益的不利影响，确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待。

#### 5) 中国证监会认定的其他措施。

### 四、本基金的特定风险

1、本基金为混合型基金，股票占基金资产的比例为 60% - 95%（其中，投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0%-50%），其中投资于本基金界定的科技创新主题范围内的证券比例不低于非现金资产的 80%。因此本基金无法完全规避股票市场整体下跌的系统性风险，在市场大幅上涨时也不能保证基金净值能

够完全跟随或超越市场上涨幅度。

## 2、金融衍生品投资风险

金融衍生品是一种金融合约，对其价值的评价主要源自于对挂钩资产的价格与价格波动的预期。投资于衍生品需承受市场风险、信用风险、流动性风险、操作风险和法律风险等。由于衍生品通常具有杠杆效应，价格波动比标的工具更为剧烈，有时候需要承担比投资标的资产更高的风险。并且衍生品定价相当复杂，不适当的估值有可能使基金资产面临相应的估值风险。

股指期货采用保证金交易制度，具有明显的杠杆性，当出现不利行情时，股价指数微小的变动就可能会使投资者权益遭受较大损失。股指期货采用每日无负债结算制度，如果没有在规定的时间内补足保证金，按规定将被强制平仓，可能给投资带来重大损失。

国债期货采用保证金交易制度，由于保证金交易具有杠杆性，当相应期限国债收益率出现不利变动时，可能会导致投资人权益遭受较大损失。国债期货采用每日无负债结算制度，如果没有在规定的时间内补足保证金，按规定将被强制平仓，可能给投资带来重大损失。

## 3、资产支持证券投资风险

本基金的投资范围包括资产支持证券，可能给本基金带来额外风险，包括信用风险、利率风险、流动性风险、提前偿付风险、操作风险和法律风险等，由此可能给基金净值带来不利影响或损失。

## 4、科创板投资风险

本基金投资国内上市的科创板股票，会面临因投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括不限于如下特殊风险：

（1）科创板上市公司股价波动较大的风险。科创板对个股每日涨跌幅限制为 20%，且新股上市后的前 5 个交易日不设置涨跌幅限制，股价可能表现出比 A 股其他版块更为剧烈的波动；

（2）科创板上市公司退市的风险。科创板执行比 A 股其他版块更为严格退市标准，且不再设置暂停上市、恢复上市和重新上市环节，可能会对基金净值产生不利影响；

（3）科创板股票流动性较差的风险。由于科创板投资门槛高于 A 股其他版

块，整体板块活跃度可能弱于 A 股其他板块；科创板机构投资者占比较大，板块股票存在一致性预期的可能性高于 A 股其他板块，在特殊时期存在基金交易成交等待时间较长或无法成交的可能；

(4) 本基金投资集中度相对较高的风险。本基金主要投资科技创新主题股票，该类股票的商业模式、盈利模式等可能存在一定的相似性，因此，持仓股票股价存在同向波动的可能，从而产生对基金净值不利的影响。

## 5、港股投资风险

本基金可投资港股通标的的股票，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，具体风险包括但不限于：

### (1) 港股通投资限制

本基金将按照政策相关规定投资于香港市场，在市场进入、投资额度、可投资对象、税务政策等方面都有一定的限制，而且此类限制可能会不断调整，这些限制因素可能对本基金买入交易、进入或退出当地市场造成障碍，从而对投资收益以及正常的申购赎回产生直接或间接的影响。

### (2) 汇率风险

投资港股通标的的股票，在交易时间内提交订单依据的港币买入参考汇率和卖出参考汇率，并不等于最终结算汇率。港股通交易日日终，中国证券登记结算有限责任公司进行净额换汇，将换汇成本按成交金额分摊至每笔交易，确定交易实际适用的结算汇率。故本基金投资面临汇率风险，汇率波动可能对基金的投资收益造成损失。

(3) 香港市场交易规则有别于内地 A 股市场规则，参与香港股票投资还将面临包括但不限于如下特殊风险：

1) 港股市场实行 T+0 回转交易，且对个股不设涨跌幅限制，港股股价可能表现出比 A 股更为剧烈的股价波动；

2) 只有内地和香港两地均为交易日且能够满足结算安排的交易日才为港股通交易日，在内地开市香港休市的情形下，港股通不能正常交易，港股不能及时卖出，可能带来一定的流动性风险；

3) 香港出现台风、黑色暴雨或者联交所规定的其他情形时，香港联合交易所将可能停市，投资者将面临在停市期间无法进行交易的风险；出现境内证券交

易服务公司认定的交易异常情况时，境内证券交易服务公司将可能暂停提供部分或者全部港股通服务，投资者将面临在暂停服务期间无法进行港股通交易的风险。

4) 投资者因港股通股票权益分派、转换、上市公司被收购等情形或者异常情况，所取得的港股通股票以外的香港联合交易所上市证券，可以通过港股通卖出，但不得买入，交易所另有规定的除外；因港股通股票发行人供股、港股通股票权益分派或者转换等情形取得的香港联合交易所上市股票的认购权利在香港联合交易所上市的，可以通过港股通卖出，但不得买入，其行权等事宜按照中国证监会、中国登记结算有限责任公司的相关规定处理；因港股通股票权益分派、转换或者上市公司被收购等所取得的非香港联合交易所上市证券，不得通过港股通买入或卖出。

5) 代理投票。由于中国登记结算有限责任公司是在汇总投资者意愿后再向香港中央结算有限公司提交投票意愿，中国登记结算有限责任公司对投资者设定的意愿征集期比香港中央结算有限公司的征集期稍早结束；投票没有权益登记日的，以投票截止日的持有作为计算基准；投票数量超出持有数量的，按照比例分配持有基数。以上所述因素可能会给本基金投资带来特殊交易风险。

#### 6、投资于存托凭证的风险

本基金的投资范围包括存托凭证，除与其他仅投资于沪深市场股票的基金所面临的共同风险外，本基金还将面临存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险，以及与存托凭证发行机制相关的风险，包括存托凭证持有人与境外基础证券发行人的股东在法律地位、享有权利等方面存在差异可能引发的风险；存托凭证持有人在分红派息、行使表决权等方面的特殊安排可能引发的风险；存托协议自动约束存托凭证持有人的风险；因多地上市造成存托凭证价格差异以及波动的风险；存托凭证持有人权益被摊薄的风险；存托凭证退市的风险；已在境外上市的基础证券发行人，在持续信息披露监管方面与境内可能存在差异的风险；境内外法律制度、监管环境差异可能导致的其他风险。

#### 五、其他风险

1、因基金业务快速发展而在制度建设、人员配备、内控制度建立等方面不完善而产生的风险；

2、对主要业务人员如基金经理的依赖而可能产生的风险；

- 3、因业务竞争压力可能产生的风险；
- 4、战争、自然灾害等不可抗力可能导致基金资产的损失，影响基金收益水平，从而带来风险；
- 5、其他意外导致的风险。

## 第十七部分 基金合同的变更、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表决通过之日起生效，自生效后方可执行，自决议生效后依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

### 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、具有从事证券、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具有证券、期货相关业务资格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。

#### 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。

## 第十八部分 基金合同的内容摘要

### 一、基金管理人、基金托管人、基金份额持有人的权利和义务

#### (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、赎回和转换申请；
- (12) 依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利；
- (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、定期定额投资计划、非交易过户、转托管和收益分配等业务规则；

(17) 在法律法规和基金合同规定的范围内，在履行适当程序后决定和调整基金的相关费率结构和收费方式；

(18) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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

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

(2) 办理基金备案手续；

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

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

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

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

(7) 依法接受基金托管人的监督；

(8) 采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金净值信息，确定基金份额申购、赎回的价格；

(9) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

(10) 编制季度、中期和年度基金报告；

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

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

向他人泄露，因向审计、法律等外部专业顾问提供的情况除外；

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

(14) 按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

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

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

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

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

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

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

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

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

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

(24) 基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件，《基金合同》不能生效，基金管理人承担全部募集费用，将已募集资金并加计银行同期活期存款利息在基金募集期结束后 30 日内退还基金认购人；

(25) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

(26) 建立并保存基金份额持有人名册；

(27) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

## (二) 基金托管人的权利与义务

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

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

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

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

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

(5) 提议召开或召集基金份额持有人大会；

(6) 在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

(7) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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

(1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；

(2) 设立专门的基金托管部门，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；

(3) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，确保基金财产的安全，保证其托管的基金财产与基金托管人自有财产以及不同的基金财产相互独立；对所托管的不同的基金分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金之间在账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；

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

(5) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

(6) 按规定开设基金财产的资金账户、证券账户、期货结算账户等投资所

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) 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) 按照法律法规和《基金合同》的规定监督基金管理人的投资运作；

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

(18) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会和银行监管机构，并通知基金管理人；

(19) 因违反《基金合同》导致基金财产损失时，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

(20) 按规定监督基金管理人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，基金管理人因违反《基金合同》造成基金财产损失时，应为基金份额持有人

利益向基金管理人追偿；

- (21) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；
  - (22) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。
- (三) 基金份额持有人的权利和义务

同一类别的每份基金份额具有同等的合法权益。

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

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

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的义务包括但不限于：

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

- (8) 返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；
- (9) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

## 二、基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

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

本基金份额持有人大会暂不设日常机构。

### (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、中国证监会或《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或提高基金销售服务费；
- (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) 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) 法律法规要求增加或调整的基金费用的收取；
- (2) 在法律法规和《基金合同》规定的范围内调整本基金的申购费率、调低赎回费率、调低基金销售服务费率、调整基金份额分类办法及规则、停止现有基金份额类别的销售、新增、减少或调整基金份额类别或变更收费方式；
- (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) 调整有关认购、申购、赎回、转换、定期定额投资计划、基金交易、非交易过户、转托管、转让、质押、收益分配等业务规则；
- (6) 基金推出新业务或服务；
- (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的有关证明文件、受托出席会议者出示的委托人的代理投票授权委托证明及有关证明文件符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并且有关证明文件与基金登记机构记录资料相符；

（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或系统。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，同时提交的有关证明文件、受托出具表决意见的代理人出示的委托人的代理投票授权委托证明及有关证明文件符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并与基金登记机构记录相符。

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

4、基金份额持有人授权他人代为出席会议并表决的，授权及（或）表决方式可以采用书面、网络、电话、短信或其他方式，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。除法律法规另有规定或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异议，可以在宣布表决结果后立即对所投票数要求进行重新清点。监票人应当进行重新清点，重新清点以一次为限。重新清点后，大会主持人应当当场公布重新清点结果。

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

#### 2、通讯开会

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

### （八）生效与公告

基金份额持有人大会的决议，召集人应当自通过之日起5日内报中国证监会备案。

基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。

基金份额持有人大会决议自生效之日起依照《信息披露办法》的有关规定在

指定媒介上公告。

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

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

### 三、基金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表决通过之日起生效,自生效后方可执行,自决议生效后依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

#### (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、具有从事证券、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具有证券、期货相关业务资格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。

(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。

#### 四、争议的处理和适用的法律

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，基金合同当事人应尽量通过协商、调解途径解决，如经友好协商未能解决的，任何一方均有权将争议提交上海国际经济贸易仲裁委员会，按照其届时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为上海市。仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力。除非仲裁裁决另有决定，仲裁费用由败诉方承担。

争议处理期间，各方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《基金合同》之目的，在此不包括香港、澳门特别行政区和台湾地区法律）管辖并从其解释。

#### 五、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。

## 第十九部分 基金托管协议的内容摘要

### 一、托管协议当事人

#### （一）基金管理人

名称：浙商基金管理有限公司

住所：浙江省杭州市下城区环城北路 208 号 1801 室

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴西路 99 号万向大厦 10 楼

法定代表人：肖风

成立时间：2010 年 10 月 21 日

批准设立机关：中国证监会

批准设立文号：中国证监会证监许可【2010】1312 号

注册资本：3 亿元人民币

组织形式：有限责任公司

存续期间：持续经营

经营范围：基金募集、基金销售、资产管理、中国证监会许可的其他业务

#### （二）基金托管人

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

法定代表人：任德奇

成立时间：1987 年 3 月 30 日

批准设立机关及批准设立文号：国务院国发(1986)字第 81 号文和中国人民银行银发 [1987] 40 号文

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[1998]25 号

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项业务；提供保管箱服务；经国务院银行业监督管理机构批准的其他业务；经营结汇、售汇业务。

注册资本：742.63 亿元人民币



组织形式：股份有限公司

存续期间：持续经营

## 二、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

### （一）基金托管人对基金管理人的投资行为行使监督权

1. 基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》和本协议的约定，对基金的投资范围、投资对象进行监督。

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交易的股票（包括主板、中小板、创业板、科创板及其他中国证监会允许基金投资的股票、存托凭证）、港股通标的股票、股指期货、债券（包括国债、地方政府债、政府支持机构债券、政府支持债券、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债的纯债部分、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券等）、国债期货、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

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

股票占基金资产的比例为 60% - 95%（其中，投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0%-50%），其中投资于本基金界定的科技创新主题范围内的证券比例不低于非现金资产的 80%。每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值的 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。

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、基金托管人书面协商一致并履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

2. 基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》和本协议的约定，对基金投资比例进行监督。

根据《基金合同》的约定，本基金投资组合比例应遵循以下限制：

（1）本基金投资于股票资产的比例为 60%-95%（其中，投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0%-50%），其中投资于本基金界定的科技创新主题范围

内的证券比例不低于非现金资产的 80%；

(2) 每个交易日日终，在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，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、应收申购款等；

(3) 本基金持有一家公司发行的证券（同一家公司在境内和香港同时上市的，A+H 股合计计算），其市值不超过基金资产净值的 10%；

(4) 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券（同一家公司在境内和香港同时上市的，A+H 股合计计算），不超过该证券的 10%；

(5) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；

(6) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；

(7) 本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；

(8) 本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；

(9) 本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上（含 BBB）的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；

(10) 基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

(11) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；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) 本基金管理人管理的全部开放式基金（包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金）持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；

(13) 本基金资产总值不超过基金资产净值的 140%；

(14) 本基金在任何交易日日终，持有的买入国债期货合约和股指期货合约

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；若本基金不投资股指期货、国债期货，则不受上述限制；

（15）本基金参与股指期货交易后，需遵守下列比例限制：

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%；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%；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；

（16）本基金参与国债期货交易，需遵守下列比例限制：

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

（17）本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%；因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合该比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

（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）本基金投资存托凭证的比例限制依照境内上市交易的股票执行，与境内上市交易的股票合并计算；

（20）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）、（9）、（17）、（18）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及法律法规另有规定的除外。

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基金合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门取消或调整上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或按调整后的规定执行。

3. 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同和本协议的约定，对基金投资禁止行为进行监督。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) 向其基金管理人、基金托管人出资；
- (5) 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；
- (6) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

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

4. 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同和本协议的约定，对基金管理人参与银行间债券市场进行监督。

(1) 基金托管人依据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定对于基金管理人参与银行间市场交易时面临的交易对手资信风险进行监督。

基金管理人向基金托管人提供符合法律法规及行业标准的银行间市场交易对手的名单。基金托管人在收到名单后 2 个工作日内电话或回函确认收到该名单。基金管理人应定期和不定期对银行间市场现券及回购交易对手的名单进行更新。基金托管人在收到名单后 2 个工作日内电话或书面回函确认，新名单自基金托管人确认当日生效。新名单生效前已与本次剔除的交易对手所进行但尚未结算的交易，仍应按照协议进行结算。

(2) 基金管理人参与银行间市场交易时，有责任控制交易对手的资信风险，由于交易对手资信风险引起的损失，基金管理人应当负责向相关责任人追偿。

5. 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同和本协议的约定，对基金管理人选择存款银行进行监督。

基金投资银行定期存款的，基金管理人应根据法律法规的规定及基金合同的约定选择符合条件的存款银行，基金托管人根据托管协议的约定对基金投资银行存款是否符合有关规定进行监督。

本基金投资银行存款应符合如下规定：

(1) 基金管理人、基金托管人应当与存款银行建立定期对账机制，确保基金银行存款业务账目及核算的真实、准确。

(2) 基金管理人与基金托管人应根据相关规定，就本基金银行存款业务另行签订书面协议，明确双方在相关协议签署、账户开设与管理、投资指令传达与执行、资金划拨、账目核对、到期兑付、文件保管以及存款证实书的开立、传递、保管等流程中的权利、义务和职责，以确保基金财产的安全，保护基金份额持有人的合法权益。

(3) 基金托管人应加强对基金银行存款业务的监督与核查，严格审查、复核相关协议、账户资料、投资指令、存款证实书等有关文件，切实履行托管职责。

(4) 基金管理人与基金托管人在开展基金存款业务时，应严格遵守《基金法》、《运作办法》等有关法律法规，以及国家有关账户管理、利率管理、支付结算等的各项规定。

6. 基金托管人对基金投资流通受限证券的监督

(1) 基金投资流通受限证券，应遵守《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》等有关法律法规规定。

(2) 此处流通受限证券的释义与上文中流通受限资产有所不同，包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券，不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。

(3) 基金管理人应在基金首次投资流通受限证券前，向基金托管人提供经基金管理人董事会批准的有关基金投资流通受限证券的投资决策流程、风险控制制度。基金投资非公开发行股票，基金管理人还应提供基金管理人董事会批准的流动性风险处置预案。上述资料应包括但不限于基金投资流通受限证券的投资额度和投资比例控制情况。基金管理人应至少于首次执行投资指令之前两个工作日将上述资料书面发至基金托管人，保证基金托管人有足够的时间进行审核。基金托管人应在收到上述资料后两个工作日内，以书面或其他双方认可的方式确认收到上述资料。

(4) 基金投资流通受限证券前，基金管理人应向基金托管人提供符合法律法规要求的有关书面信息，包括但不限于拟发行证券主体的中国证监会批准文件、发行证券数量、发行价格、锁定期，基金拟认购的数量、价格、总成本、总成本占基金资产净值的比例、已持有流通受限证券市值占资产净值的比例、资金划付时间等。基金管理人应保证上述信息的真实、完整，并应至少于拟执行投资指令前两个工作日将上述信息书面发至基金托管人，保证基金托管人有足够的时间进行审核。

(5) 基金托管人应对基金管理人提供的有关书面信息进行审核，基金托管人认为上述资料可能导致基金投资出现风险的，有权要求基金管理人在投资流通受限证券前就该风险的消除或防范措施进行补充书面说明，并保留查看基金管理人风险管理部门就基金投资流通受限证券出具的风险评估报告等备查资料的权利。否则，基金托管人有权拒绝执行有关指令。因拒绝执行该指令造成基金财产损失的，基金托管人不承担任何责任，并有权报告中国证监会。

如基金管理人和基金托管人无法达成一致，应及时上报中国证监会请求解决。

如果基金托管人切实履行监督职责，则不承担任何责任。

#### 7. 基金托管人对基金投资中期票据的监督

基金管理人在投资中期票据前，须根据法律、法规、监管部门的规定，制定严格的关于投资中期票据的风险控制制度和流动性风险处置预案，并书面提供给基金托管人，基金托管人依据上述文件对基金管理人投资中期票据的比例进行监督。

如未来有关监管部门发布的法律法规对证券投资基金投资中期票据另有规定的，从其约定，基金管理人应及时书面通知基金托管人。

基金托管人有权监督基金管理人在相关基金投资中期票据时的法律法规遵守情况，有关制度、信用风险、流动性风险处置预案的完善情况，有关比例限制的执行情况。基金托管人发现基金管理人的上述事项违反法律法规和基金合同以及本协议的规定，有权及时以书面形式通知基金管理人纠正。基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查。基金管理人应按相关托管协议要求向基金托管人及时发出回函，并及时改正。基金托管人有权随时对所通知事项进行复查，督促基金管理人改正。如果基金管理人违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人有权报告中国证监会。

8. 基金托管人根据法律法规的规定及《基金合同》和本协议的约定，对基金投资其他方面进行监督。

(二) 基金托管人应根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金资产净值计算、各类基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确认、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等进行监督和核查。如果基金管理人未经基金托管人的审核擅自将不实的业绩表现数据印制在宣传推介材料上，则基金托管人对此不承担任何责任，并有权在发现后报告中国证监会。

(三) 基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查，在规定时间内答复并改正，就基金托管人的合理疑义进行解释或举证。对基金托管人按照法规要求需向中国证监会报送基金监督报告的，基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

基金托管人发现基金管理人的投资指令或实际投资运作违反《基金法》及其他有关法规、《基金合同》和本协议规定的行为，应及时以书面形式通知基金管

理人限期纠正，基金管理人收到通知后应及时核对，并以电话或书面形式向基金托管人反馈，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人有权报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时通知基金管理人在限期内纠正。

基金托管人发现基金管理人的指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反《基金合同》约定的，应当视情况暂缓或拒绝执行，立即通知基金管理人，并有权向中国证监会报告。

基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反《基金合同》约定的，应当立即通知基金管理人，并有权向中国证监会报告。

### 三、基金管理人对于基金托管人的业务核查

根据《基金法》及其他有关法规、《基金合同》和本协议规定，基金管理人对于基金托管人履行托管职责的情况进行核查，核查事项包括但不限于基金托管人是否安全保管基金财产、开立基金财产的资金账户、证券账户、期货结算账户及债券托管账户等投资所需账户，是否及时、准确复核基金管理人计算的基金资产净值和各类基金份额净值，是否根据基金管理人指令办理清算交收，是否按照法规规定和《基金合同》规定进行相关信息披露和监督基金投资运作等行为。

基金管理人定期和不定期地对基金托管人保管的基金资产进行核查。基金托管人应积极配合基金管理人的核查行为，包括但不限于：提交相关资料以供基金管理人核查托管财产的完整性和真实性，在规定时间内答复并改正。

基金管理人发现基金托管人未对基金资产实行分账管理、擅自挪用基金资产、未执行或无故延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄露基金投资信息等违反《基金法》、《基金合同》、本协议及其他有关规定的，应及时以书面形式通知基金托管人在限期内纠正，基金托管人收到通知后应及时核对并以书面形式对基金管理人发出回函。在限期内，基金管理人有权随时对通知事项进行复查，督促基金托管人改正。基金托管人对基金管理人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金



管理人应报告中国证监会。对基金管理人按照法规要求需向中国证监会报送基金监督报告的，基金托管人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

基金管理人发现基金托管人有重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时通知基金托管人在限期内纠正。

#### 四、基金财产的保管

##### （一）基金财产保管的原则

1. 基金托管人应安全保管基金财产，未经基金管理人的指令，不得自行运用、处分、分配基金的任何资产。

2. 基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。

3. 基金托管人按照规定开立基金财产的资金账户、证券账户、期货结算账户和债券托管账户等投资所需账户。

4. 基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整和独立。

5. 对于因为基金投资产生的应收资产和基金申购过程中产生的应收资产，应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知基金托管人，到账日基金资产没有到达基金银行存款账户的，基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收。由此给基金造成损失的，基金管理人应负责向有关当事人追偿基金的损失。基金托管人应予以必要的协助和配合，但对此不承担任何责任。

##### （二）基金募集资产的验证

基金募集期满或基金提前结束募集之日起 10 日内，由基金管理人聘请具有从事证券、期货相关业务资格的会计师事务所进行验资，出具验资报告，出具的验资报告应由参加验资的 2 名以上（含 2 名）中国注册会计师签字有效。验资完成，基金管理人应将募集到的全部资金存入基金托管人为基金开立的基金银行存款账户中，基金托管人在收到资金当日出具相关证明文件。

##### （三）基金的银行存款账户的开立和管理

1. 基金托管人应负责本基金银行存款账户的开立和管理。

2. 基金托管人以本基金的名义在其营业机构开立基金的银行存款账户，并根据基金管理人合法合规的指令办理资金收付。本基金的银行预留印鉴由基金托管人保管和使用。

3. 本基金银行存款账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得假借本基金的名义开立其他任何银行存款账户；亦不得使用基金的任何银行存款账户进行本基金业务以外的活动。

4. 基金托管人可以通过申请开通本基金银行账户的企业网上银行业务进行资金支付，并使用交通银行企业网上银行（简称“交行网银”）办理托管资产的资金结算汇划业务。

5. 基金银行存款账户的管理应符合银行业监督管理机构的有关规定。

#### （四）基金证券交收账户、资金交收账户的开立和管理

基金托管人以基金托管人和本基金联名的方式在中国证券登记结算有限责任公司开立证券账户。

基金证券账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得出借和未经对方同意擅自转让基金的任何证券账户；亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。

基金管理人不得对基金证券交收账户、资金交收账户进行证券的超卖或超买。

基金证券账户的开立和证券账户卡的保管由基金托管人负责，账户资产的管理和运用由基金管理人负责。

基金托管人以基金托管人的名义在中国证券登记结算有限责任公司开立结算备付金账户即资金交收账户，用于证券交易资金的结算。基金托管人以本基金的名义在基金托管人处开立基金的证券交易资金结算的二级结算备付金账户。

#### （五）债券托管账户的开立和管理

1. 基金合同生效后，基金管理人负责向人民银行进行备案，并在备案通过后由基金托管人负责在中央国债登记结算有限责任公司及银行间市场清算所股份有限公司以本基金的名义开立债券托管账户，并由基金托管人负责基金的债券及资金的清算。基金管理人负责申请基金进入全国银行间同业拆借市场进行交易，由基金管理人在中国外汇交易中心开设同业拆借市场交易账户。

2. 基金管理人代表基金签订全国银行间债券市场债券回购主协议，协议正本由基金管理人保存。

#### （六）其他账户的开立和管理

若中国证监会或其他监管机构在托管协议订立日之后允许基金从事其他投

资品种的投资业务，涉及相关账户的开立、使用的，由基金管理人协助基金托管人根据有关法律法规的规定和《基金合同》的约定，开立有关账户。该账户按有关规则使用并管理。

（七）基金财产投资的有关实物证券、银行存款定期存单等有价凭证的保管  
实物证券由基金托管人存放于基金托管人的保管库。实物证券的购买和转让，由基金托管人根据基金管理人的指令办理。基金托管人对由基金托管人以外机构实际有效控制的本基金资产不承担保管责任。

银行存款定期存单等有价凭证由基金托管人负责保管。

（八）与基金财产有关的重大合同的保管

由基金管理人代表基金签署的与基金有关的重大合同的原件分别由基金托管人、基金管理人保管，相关业务程序另有限制除外。除本协议另有规定外，基金管理人在代表基金签署与基金有关的重大合同时，应尽可能保证持有二份以上的正本，以便基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件，基金管理人应及时将正本送达基金托管人处。合同的保管期限按照国家有关规定执行。

对于无法取得二份以上的正本的，基金管理人应向基金托管人提供加盖授权业务章的合同传真件，未经双方协商或未在合同约定范围内，合同原件不得转移。

## 五、基金资产净值计算和会计核算

（一）基金资产净值及基金份额净值的计算与复核

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基金合同的规定暂停估值时除外。估值原则应符合《基金合同》、《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及其他法律、法规的规定。基金资产净值和各类基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人复核。基金管理人应于每个工作日交易结束后计算当日的基金资产净值和各类基金份额净值，以约定方式发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核后，将复核结果反馈给基金管理人，由基金管理人将基金资产净值和基金份额净值予以公布。

估值对象：基金所拥有的股票、债券、股指期货、国债期货、资产支持证券、同业存单、银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。

本基金按以下方法估值：

## 1. 证券交易所上市的有价证券的估值

(1) 除本部分另有约定的品种外，交易所上市的股票等，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，最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

(2) 交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（基金合同另有规定的除外），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。

(3) 交易所上市交易的可转换债券，按估值日收盘全价减去债券收盘价中所含的债券应计利息（税后）得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息（税后）得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，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；交易所上市实行全价交易的债券（可转债除外），选取第三方估值机构提供的估值全价减去估值全价中所含的债券（税后）应收利息得到的净价进行估值。

(4) 交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。交易所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。

## 2. 处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

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

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

(3) 在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票，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. 全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值。

4. 持有的银行定期存款或通知存款以本金列示，按协议或合同利率逐日确认利息收入。

5. 同业存单按估值日第三方估值机构提供的估值净价估值，选定的第三方估值机构未提供估值价格的，按成本估值。

6. 股指期货合约、国债期货合约以估值当日结算价进行，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。

7. 债券回购：持有的回购协议以成本列示，按商定利率在实际持有期间内逐日计提利息。

8. 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。

9. 港股通投资持有外币证券资产估值涉及到港币、美元、英镑、欧元、日元等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。

10. 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

11. 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。

12. 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，按照基金管理人对外予以公布，由此给基金份额持有人和基金造成的损失以及因该交易日基金资产净值计算顺延错误而引起的损失，由基金管理人负责赔付。

## （二）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。当任一类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。

各当事人应按照以下约定处理：

### 1. 估值错误类型

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

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

### 2. 估值错误处理原则

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

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

（3）因估值错误而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但估值错误责任方仍应对估值错误负责。如果由于获得不当得利的当事人不返还或不全部返还不当得利造成其他当事人的利益损失（“受损方”），则估值错误责任方应赔偿受损方的损失，并在其支付的赔偿金额的范围内对获得不当得利的当事人享有要求交付不当得利的权利；如果获得不当得利的当事人已经将此部分不当得利返还给受损方，则受损方应当将其已经获得的赔偿额加上已经获得的不当得利返还的总和超过其实际损失的差额部分支付给估值错误责任方。

(4) 估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

### 3. 估值错误处理程序

估值错误被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

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

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

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

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

### 4. 基金份额净值估值错误处理的方法如下：

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

(2) 错误偏差达到该类基金份额净值的 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；错误偏差达到该类基金份额净值的 0.5% 时，基金管理人应当公告，并报中国证监会备案。

(3) 当基金份额净值计算差错给基金和基金份额持有人造成损失需要进行赔偿时，基金管理人和基金托管人应根据实际情况界定双方承担的责任，经确认后按以下条款进行赔偿：

① 本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，与本基金有关的会计问题，如经双方在平等基础上充分讨论后，尚不能达成一致时，按基金管理人的建议执行，由此给基金份额持有人和基金财产造成的损失，由基金管理人负责赔付。

② 若基金管理人计算的基金份额净值已由基金托管人复核确认后公告，由此给基金份额持有人造成损失的，应根据法律法规的规定对投资者或基金支付赔偿金，就实际向投资者或基金支付的赔偿金额，基金管理人与基金托管人按照管理费率及托管费率的比例各自承担相应的责任。

③ 如基金管理人和基金托管人对基金份额净值的计算结果，虽然多次重新计算和核对，尚不能达成一致时，为避免不能按时公布基金份额净值的情形，以基

基金管理人的计算结果对外公布，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。

④由于基金管理人提供的信息错误（包括但不限于基金申购或赎回金额等），进而导致基金份额净值计算错误而引起的基金份额持有人和基金财产的损失，由基金管理人负责赔付。

（4）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。如果行业另有通行做法，双方当事人应本着平等和保护基金份额持有人利益的原则进行协商。

### （三）基金会计制度

按国家有关部门制定的会计制度执行。

### （四）基金账册的建立

基金管理人和基金托管人在《基金合同》生效后，应按照双方约定的同一记账方法和会计处理原则，分别独立地设置、登录和保管本基金的全套账册，对双方各自的账册定期进行核对，互相监督，以保证基金财产的安全。若双方对会计处理方法存在分歧，应以基金管理人的处理方法为准。

### （五）会计数据和财务指标的核对

双方应每个交易日核对账目，如发现双方的账目存在不符的，基金管理人和基金托管人必须及时查明原因并纠正，确保核对一致。若当日核对不符，暂时无法查找到错账的原因而影响到基金净值信息的计算和公告的，以基金管理人的账册为准。

### （六）基金定期报告的编制和复核

基金财务报表由基金管理人和基金托管人每月分别独立编制。月度报表的编制，应于每月终了后 5 个工作日内完成。定期报告文件应按中国证监会的要求公告。季度报告的编制，应于每季度终了后 15 个工作日内完成，并将季度报告登载在指定网站上，将季度报告的提示性公告登载在指定报刊上；《基金合同》生效后，基金招募说明书的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金招募说明书并登载在指定网站上；基金招募说明书其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金招募说明书；中期报告在基金会计年度前 6 个月结束后的两个月内公告；年度报告在



会计年度结束后三个月内公告。如果基金合同生效不足 2 个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、中期报告或者年度报告。

基金管理人在月初 3 个工作日内完成上月度报表的编制，将盖章后的月度报表提供基金托管人；基金托管人收到后在 2 个工作日内进行复核，并将复核结果及时以书面或其他双方约定的方式通知基金管理人。对于季度报告、中期报告、年度报告等定期报告，基金管理人和基金托管人应在上述监管部门规定的时间内完成编制、复核及公告。基金托管人在复核过程中，发现双方的报表存在不符时，基金管理人和基金托管人应共同查明原因，进行调整，调整以双方认可的账务处理方式为准。如果基金管理人与基金托管人不能于应当发布公告之日前就相关报表达达成一致，基金管理人有权按照其编制的报表对外发布公告，基金托管人有权就相关情况报证监会备案。

基金托管人在对财务报表、季度报告、中期报告或年度报告复核完毕后，可以出具复核确认书（盖章）或以其他双方约定的方式确认，以备有权机构对相关文件审核检查。

## 六、基金份额持有人名册的保管

基金管理人可委托基金登记机构登记和保管基金份额持有人名册。基金份额持有人名册的内容包括但不限于基金份额持有人的名称和持有的基金份额。

基金份额持有人名册，包括基金募集期结束时的基金份额持有人名册、基金权益登记日的基金份额持有人名册、基金份额持有人大会登记日的基金份额持有人名册、每年最后一个交易日的基金份额持有人名册，由基金登记机构负责编制和保管，并对基金份额持有人名册的真实性、完整性和准确性负责。保存期限自基金账户销户之日起不少于 20 年。

基金管理人应根据基金托管人的要求定期和不定期向基金托管人提供基金份额持有人名册。

（一）基金管理人于《基金合同》生效日及《基金合同》终止日后 10 个工作日内向基金托管人提供由登记机构编制的基金份额持有人名册；

（二）基金管理人于基金份额持有人大会权益登记日后 5 个工作日内向基金托管人提供由登记机构编制的基金份额持有人名册；

（三）基金管理人于每年最后一个交易日后 10 个工作日内向基金托管人提

供由登记机构编制的基金份额持有人名册；

（四）除上述约定时间外，如果确因业务需要，基金托管人与基金管理人商议一致后，由基金管理人向基金托管人提供由登记机构编制的基金份额持有人名册。

基金托管人以电子版形式妥善保管基金份额持有人名册，并定期刻成光盘备份，保存期限为15年，法律法规或监管机构另有规定除外。基金托管人不得将所保管的基金份额持有人名册用于基金托管业务以外的其他用途，并应遵守保密义务。若基金管理人或基金托管人由于自身原因无法妥善保管基金份额持有人名册，应按有关法规规定各自承担相应的责任。

## 七、争议解决方式

各方当事人同意，因托管协议而产生的或与托管协议有关的一切争议，托管协议当事人应尽量通过协商、调解途径解决，如经友好协商未能解决的，任何一方均有权将争议提交上海国际经济贸易仲裁委员会，按照其届时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为上海市。仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力。除非仲裁裁决另有决定，仲裁费用由败诉方承担。

争议处理期间，各方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》和托管协议规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

托管协议受中国法律（不含港澳台地区法律）管辖并从其解释。

## 八、基金托管协议的变更、终止与基金财产的清算

### （一）基金托管协议的变更

本协议双方当事人经协商一致，可以对协议进行修改。修改后的新协议，其内容不得与《基金合同》的规定有任何冲突。修改后的新协议，应报中国证监会备案。

### （二）基金托管协议的终止

#### 1. 《基金合同》终止；

2. 基金托管人解散、依法被撤销、破产，被依法取消基金托管资格或因其他事由造成其他基金托管人接管基金财产；

3. 基金管理人解散、依法被撤销、破产，被依法取消基金管理资格或因其他事由造成其他基金管理人接管基金管理权；

4.发生《基金法》、《销售办法》、《运作办法》或其他法律法规规定和基金合同约定的终止事项。

### （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。在基金财产清算小组接管基金财产之前，基金管理人和基金托管人应按照《基金合同》和本协议的规定继续履行保护基金资产安全的职责。

（1）基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券、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。

（2）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。

#### 2.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。

3. 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。

#### 4.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。

#### 5.基金剩余财产的分配

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。

#### 6.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具有证券、期货相关业务资格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。

#### 7.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。

## 第二十章 对基金份额持有人的服务

基金管理人承诺为基金份额持有人提供一系列的服务。以下是主要的服务内容，基金管理人根据基金份额持有人的需要和市场的变化，有权增加、修改这些服务项目：

### 一、基金份额持有人注册与过户登记服务

基金管理人为基金份额持有人提供注册与过户登记服务。基金登记机构配备先进、高效的电脑系统及通讯系统，准确、及时地为基金投资者办理基金账户、基金份额的登记、管理、托管与转托管，基金份额持有人名册的管理，权益分配时红利的登记、派发，基金交易份额的清算过户和基金交易资金的交收等服务。

### 二、账务寄送服务

#### 1、基金份额持有人的投资记录

在从基金销售机构获取投资者准确的邮政地址和邮政编码的前提下，基金管理人将负责寄送基金开户确认书、基金认购成交确认书、基金交易对账单。

基金交易对账单包括季度对账单与年度对账单。季度对账单在季度结束后的15个工作日内向本季度有交易的基金份额持有人以书面形式寄送；年度对账单在年度结束后的20个工作日内对所有基金份额持有人以书面形式寄送。基金份额持有人可自行选择寄送或不寄对账单。

#### 2、其他相关的信息资料

其他相关的信息资料指不定期寄送的基金资讯材料，如基金季刊、基金新产品或新服务的相关材料、基金经理报告、客户服务问答等。

### 三、红利再投资服务

本基金收益分配时，基金份额持有人可以选择将所获红利再投资于本基金，登记机构将其所获红利按红利再投日的基金份额净值自动转为基金份额，且不收取任何申购费用。基金份额持有人可以自行选择更改基金分红方式。

### 四、短信及电邮服务

#### 1、手机短信服务

基金份额持有人可以通过基金管理人网站和客户服务热线人工应答预留手机号码,按需要定制短信内容并选择发送频率,基金管理人将根据定制要求提供相应服务。

## 2、电子邮件服务

投资者在申请开立基金管理人基金账户时如预留电子邮件地址并通过基金管理人网站定制电子邮件服务,可自动获得相应服务,包括但不限于基金份额净值、基金资讯信息、基金分红提示信息、定期基金报告和不定期公告等。

## 五、电话咨询服务

### 1、自动语音服务

电话中心自动语音系统提供 24 小时查询服务,投资者可通过电话自助方式,查询基金代码、基金份额净值、基金产品介绍等信息,也可以查询到基金账户余额、分红信息、交易记录等个人账户信息。

### 2、人工电话服务

人工电话服务时间为每周一至周五的上午 9:00—11:30,下午 13:00—17:00。投资者可以通过拨打客服热线获取业务资讯、信息查询、服务投诉等服务。

### 3、基金客户留言服务

在非人工服务时间或暂时无法接通人工电话时,基金份额持有人可以通过电话留言的方式将疑问、建议告知,同时留下有效的联系方式,客服人员将进行回复。

## 六、网站客户服务

### 1、个人账户查询服务

基金份额持有人在使用基金账号登录后,可以查询基金持有情况、分红信息和交易记录,也可以更新邮件地址、邮政编码、联系电话等个人信息。

### 2、投资理财咨询服务

投资者可通过网站客服互动栏目与客服人员进行交流,实时解决基金投资理财中所碰到的疑惑。

### 3、电子信息定制服务

投资者可以通过网站查询及定制基金净值、产品信息、公告、动态等资讯类信息及电子账单、交易确认短信等账务变动类信息。

网址：[www.zsfund.com](http://www.zsfund.com)

## 七、客户投诉处理

基金份额持有人可以通过基金管理人提供的网上投诉栏目、电话中心、信函、电子邮件、传真等渠道对基金管理人和基金销售机构所提供的服务进行投诉。

## 八、服务渠道

- 1、基金管理人网址：[www.zsfund.com](http://www.zsfund.com)
- 2、客户服务电话：4000-679-908、021-60359000
- 3、客户服务传真：021-60350919
- 4、客户服务信箱：[services@zsfund.com](mailto:services@zsfund.com)

九、如本招募说明书存在任何您/贵机构无法理解的内容，请通过上述联系方式联系基金管理人。请确保投资前，您/贵机构已经全面理解了本招募说明书。

## 第二十一部分 其他应披露事项

序号	公告事项	披露日期
1	浙商科技创新一个月滚动持有混合型证券投资基金基金合同	2020/8/28
2	浙商科技创新一个月滚动持有混合型证券投资基金托管协议	2020/8/28
3	浙商科技创新一个月滚动持有混合型证券投资基金基金招募说明书	2020/8/28
4	浙商科技创新一个月滚动持有混合型证券投资基金产品资料概要	2020/8/28
5	浙商科技创新一个月滚动持有混合型证券投资基金基金份额发售公告	2020/8/28
6	浙商基金管理有限公司关于新增浙商银行股份有限公司为浙商 科技创新一个月滚动持有混合型证券投资基金销售机构的公告	2020/9/15
7	浙商基金管理有限公司关于新增光大证券股份有限公司为浙商 科技创新一个月滚动持有混合型证券投资基金销售机构的公告	2020/9/16
8	浙商基金管理有限公司关于新增广发证券股份有限公司为浙商 科技创新一个月滚动持有混合型证券投资基金销售机构的公告	2020/9/24
9	浙商基金管理有限公司关于浙商科技创新一个月滚动持有混合型证券投资基金可投资科创板股票的公告	2020/9/30
10	浙商科技创新一个月滚动持有混合型证券投资基金基金合同生效公告	2020/9/30
11	浙商基金管理有限公司 关于聘任基金经理助理的公告	2020/10/9
12	浙商科技创新一个月滚动持有混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告	2020/10/28
13	浙商基金管理有限公司关于旗下部分基金修订基金合同、托管协议的公告	2020/11/6
14	浙商科技创新一个月滚动持有混合型证券投资基金基金合同	2020/11/6
15	浙商科技创新一个月滚动持有混合型证券投资基金托管协议	2020/11/6
16	浙商科技创新一个月滚动持有混合型证券投资基金产品资料概要（更新）	2020/11/11
17	浙商科技创新一个月滚动持有混合型证券投资基金基金招募说明书更新	2020/11/11
18	浙商科技创新一个月滚动持有混合型证券投资基金限制大额申购、定期定额投资、转换转入业务的公告	2020/12/22
19	浙商科技创新一个月滚动持有期混合型证券投资基金分红公告	2020/12/22
20	浙商科技创新一个月滚动持有混合型证券投资基金 2020 年第 4 季度报告	2021/1/22



21	浙商基金管理有限公司关于旗下部分基金在直销渠道开展费率优惠活动的公告	2021/3/18
22	浙商基金管理有限公司关于旗下部分基金参加招商银行股份有限公司招赢通平台费率优惠活动的公告	2021/3/26
23	浙商科技创新一个月滚动持有混合型证券投资基金 2020 年年度报告	2021/3/30
24	浙商科技创新一个月滚动持有混合型证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	2021/4/21
25	浙商科技创新一个月滚动持有混合型证券投资基金 2021 年第 2 季度报告	2021/7/21

## 第二十二部分 招募说明书的存放及查阅方式

依法必须披露的信息发布后，基金管理人、基金托管人应当按照相关法律法规规定将信息置备于各自住所，供社会公众查阅、复制。投资人在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复制件或复印件。投资者也可在基金管理人指定的网站上进行查阅。

基金管理人和基金托管人保证文本的内容与公告的内容完全一致。

## 第二十三部分 备查文件

以下备查文件存放在基金管理人的办公场所，在办公时间可供免费查阅。

(一)中国证监会准予浙商科技创新一个月滚动持有混合型证券投资基金募集的文件

(二)《浙商科技创新一个月滚动持有混合型证券投资基金基金合同》

(三)《浙商科技创新一个月滚动持有混合型证券投资基金托管协议》

(四)基金管理人业务资格批件、营业执照

(五)基金托管人业务资格批件、营业执照

(六)关于申请募集浙商科技创新一个月滚动持有混合型证券投资基金之法律意见书

(七)中国证监会要求的其他文件

查阅方式：投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。