

鹏华科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资 基金上市交易公告书

基金管理人：鹏华基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

登记机构：中国证券登记结算有限责任公司

上市地点：上海证券交易所

上市时间：2019 年 12 月 9 日

公告日期：2019 年 12 月 4 日

目录

一、	重要声明与提示	3
二、	基金概览	3
三、	基金的募集与上市交易	4
四、	持有人户数、持有人结构及场内前十名持有人	6
五、	基金主要当事人简介	7
六、	基金合同摘要	13
七、	基金财务状况	13
八、	基金投资组合	14
九、	重大事件揭示	18
十、	基金管理人承诺	18
十一、	基金托管人承诺	18
十二、	基金上市推荐人意见	18
十三、	备查文件目录	19
附件：	鹏华科创主题3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金基金合同摘要	20

一、 重要声明与提示

鹏华科创主题3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）上市交易公告书依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《上海证券交易所证券投资基金上市交易规则》等规定编制，本基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

本基金托管人保证本报告中基金财务会计资料等内容的真实性、准确性和完整性，承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中国证监会、证券交易所对本基金上市交易及有关事项的意见，均不表明对本基金的任何保证。

本公告书第七节“基金财务状况”未经审计。

凡本上市交易公告书未涉及的有关内容，请仔细阅读2019年5月29日刊登在《上海证券报》和本公司网站（www.phfund.com）上的《鹏华科创主题3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》。

二、 基金概览

- 1、基金名称：鹏华科创主题3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金
- 2、基金类型：混合型证券投资基金
- 3、基金运作方式：契约型开放式。本基金基金合同生效后，设定一个三年的封闭期。本基金的封闭期为基金合同生效日（包括基金合同生效日）起至三年后的年度对日前一日止。在封闭运作期内，本基金不接受基金份额的申购和赎回。封闭运作期届满后，本基金转为上市开放式基金（LOF），基金名称调整为“鹏华创新成长灵活配置混合型证券投资基金（LOF）”，并接受场外、场内申购赎回。
- 4、本基金的存续期限为不定期。
- 5、基金份额总额：截至2019年12月2日，本基金的基金份额总额为988,941,407.16份
- 6、基金份额净值：截至2019年12月2日，本基金的基金份额净值为1.0429元
- 7、本次上市交易的基金份额简称及其基金代码：基金简称：科创基金，基金代码：501076
- 8、本次上市交易的基金份额总额：285,003,165.00份
- 9、上市交易的证券交易所：上海证券交易所
- 10、上市交易日期：2019年12月9日
- 11、基金管理人：鹏华基金管理有限公司
- 12、基金托管人：中国工商银行股份有限公司

13、本次上市交易的基金份额登记机构：中国证券登记结算有限责任公司

14、基金上市推荐人：国信证券股份有限公司

三、 基金的募集与上市交易

（一） 本基金募集情况

1、基金募集申请的核准机构和核准文号：中国证券监督管理委员会证监许可[2019]936号

2、基金运作方式：契约型开放式。本基金基金合同生效后，设定一个三年的封闭期。本基金的封闭期为基金合同生效日（包括基金合同生效日）起至三年后的年度对日前一日止。在封闭运作期内，本基金不接受基金份额的申购和赎回。封闭运作期届满后，本基金转为上市开放式基金（LOF），基金名称调整为“鹏华创新成长灵活配置混合型证券投资基金（LOF）”，并接受场外、场内申购赎回。

3、基金合同期限：不定期

4、发售日期：2019年6月5日

5、发售价格：1.00 元人民币

6、发售方式：场外、场内认购

7、发售机构：

（1）场内发售机构：

本基金场内发售的机构为具有基金销售业务资格并经上海证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的上海证券交易所会员单位（具体名单可在上海证券交易所网站查询）。

（2）场外发售机构：

1) 直销机构

直销机构包括鹏华基金管理有限公司直销中心、鹏华基金管理有限公司北京分公司、上海分公司、武汉分公司、广州分公司及本公司网上交易系统。

2) 销售机构

兴业银行、工商银行、建设银行、农业银行、平安银行、中信银行、浦发银行、交通银行、中国银行、福建海峡银行、南京银行、江苏江南农村商业银行、上海银行、广发银行、招商银行、东莞农商行、江苏银行、青岛银行、民生银行、爱建证券、渤海证券、财达证券、财富证券、长城证券、长江证券、大同证券、德邦证券、东北证券、东海证券、东吴证券、东兴证券、方正证券、光大证券、广发证券、广州证券、国都证券、国海证券、国金证券、国联证券、国盛证券、国泰君安、国信证券、国元证券、海通证券、恒泰证券、华安证券、华林证券、华龙证券、华融证券、华泰证券、华西证券、华鑫证券、江海证券、金

元证券、开源证券、联讯证券、民生证券、南京证券、平安证券、上海证券、申万宏源西部证券、申万宏源证券、世纪证券、首创证券、天风证券、万联证券、五矿证券、西部证券、西南证券、湘财证券、信达证券、兴业证券、英大证券、招商证券、银河证券、中投证券、中泰证券、中信建投证券、中信证券、中信证券（山东）、中原证券、安信证券、财通证券、长城国瑞证券、东莞证券、中邮证券、中信建投期货、中信期货、海银基金、浙江同花顺、蛋卷基金、盈米基金、恒天明泽、唐鼎耀华、蚂蚁（杭州）基金、苏宁基金、诺亚正行、陆金所、上海天天、百度百盈基金、众禄基金、新浪仓石基金、基煜基金、挖财基金、好买基金、植信基金、利得基金、长量基金、中正达广、浦领基金、中欧钱滚滚基金、万得基金、腾安基金。

8、验资机构名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

9、募集资金总额及入账情况：本次募集的有效净认购金额为988,941,407.16元人民币，折合基金份额988,941,407.16份；利息结转份额0份，总确认份额为988,941,407.16份。上述有效净认购资金及认购款项在募集期间产生的利息已于2019年6月10日全额划入本基金在基金托管人中国工商银行股份有限公司开立的鹏华科创主题3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金托管专户。

本基金通过场外、场内两种方式公开发售，按照每份基金份额1.00元计算，本基金募集期间含本息共募集988,941,407.16份基金份额，其中场外认购的基金份额为703,938,242.16份；场内认购的基金份额为285,003,165.00份。

10、本基金募集备案情况：根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等相关法律、法规的规定以及《鹏华科创主题3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）的有关约定，本基金募集结果符合备案条件，鹏华基金管理有限公司（以下简称“本基金管理人”）已向中国证监会办理完毕基金备案手续，并于2019年6月10日获中国证监会书面确认，本基金合同自该日起正式生效。基金合同生效之日起，本基金管理人正式开始管理本基金。

11、基金合同生效日：2019年6月10日

12、基金合同生效日的基金份额总额：988,941,407.16份

（二）本基金上市交易的主要内容

1、基金上市交易的核准机构和核准文号：上海证券交易所自律监管决定书[2019]263号

2、上市交易日期：2019年12月9日

3、上市交易的证券交易所：上海证券交易所

4、基金简称：鹏华科创3年封闭混合（场内简称：科创基金）

5、交易代码：501076

6、本次上市交易份额：285,003,165.00份（截至2019年12月2日）

7、未上市交易份额的流通规定：未上市交易的份额托管在场外，基金份额持有人将其转托管至上海证券交易所场内后即可上市流通。

8、本基金转托管的主要内容：为了保证基金份额持有人的利益，本基金管理人已向上海证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司提出申请，为基金份额持有人从2019年12月9日起开通转托管业务的办理事宜。

四、 持有人户数、持有人结构及场内前十名持有人

（一）基金份额持有情况

截至2019年12月2日，科创基金的持有人总户数49,424户，其中场外持有人总户数39,701户，场内持有人总户数9,723户，平均每户持有的场内基金份额：29,312.27份。

截至2019年12月2日，科创基金基金份额总额：988,941,407.16份，其中场内份额：285,003,165.00份，场内机构投资者持有的基金份额及占场内基金总份额比例：机构持有3,296,209.00份，占1.16%；场内个人投资者持有的基金份额及占场内基金总份额比例：个人持有281,706,956.00份，占98.84%。

（二）截至2019年12月2日，本基金前十名场内基金份额持有人情况：

序号	持有人名称	持有科创基金份额	占场内科创基金份额比(%)
1	李桃	9,252,064.00	3.25%
2	沈永兴	6,868,104.00	2.41%
3	王红晓	5,822,898.00	2.04%
4	亓爱伟	3,270,526.00	1.15%
5	殷胜利	2,125,842.00	0.75%
6	霍尔果斯创酷互动网络科技有限公司	1,630,396.00	0.57%
7	郑惠敏	1,623,658.00	0.57%
8	高小东	1,366,668.00	0.48%
9	刘明霞	1,299,161.00	0.46%
10	于鸿	1,004,324.00	0.35%
合计		34,263,641.00	12.02%

注：由于四舍五入的原因，上表中的份额占比可能存在尾差。

以上信息依据中国证券登记结算有限责任公司提供的持有人信息编制。

(三)截至2019年12月2日,基金管理人的从业人员持有本基金份额的情况

本基金管理人的基金从业人员持有本基金份额总量为412,980.08份,占该基金总份额的比例为0.0418%。其中,本基金管理人高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有该只基金份额总量为297,346.08份,该只基金的基金经理持有该只基金份额总量为64.96份。

五、 基金主要当事人简介

(一)基金管理人

1、名称:鹏华基金管理有限公司

2、法定代表人:何如

3、总经理:邓召明

4、注册资本:1.5亿元人民币

5、注册地址:深圳市福田区福华三路168号深圳国际商会中心43层

6、设立批准文号:中国证监会证监基字[1998]31号

7、工商登记注册的法人营业执照文号:91440300708470788Q

8、经营范围:基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其他业务。

9、存续期间:持续经营

10、股东及其出资比例:公司股东由国信证券股份有限公司、意大利欧利盛资本资产管理股份公司(Eurizon Capital SGR S.p.A.)、深圳市北融信投资发展有限公司组成,三家股东的出资比例分别为50%、49%、1%。

11、内部组织结构及职能:

权益投资一部

负责公司公募基金产品、社保和专户理财投资业务。

权益投资二部

负责公司公募基金产品和专户理财投资业务。

稳定收益投资部

负责公司新股基金产品等以绝对回报为目标的公募基金和专户产品。

量化及衍生品投资部

负责公司量化公募基金产品和量化专户理财投资业务。

固定收益总部

负责公司固定收益类产品的研究与投资。

研究部

负责行业及上市公司研究,在公司既定的投资理念和研究理念的基础上,以系统性的研

究方法和高质量的研究成果为公司投资部门提供持续有效的支持工作。

集中交易室

负责及时、合规、准确地完成基金经理/投资经理下达的投资指令，防范交易风险，提供投资建议和分析报告。

国际业务部

负责 QDII 基金海外投资研究和 QFII 业务开拓，研究分析相关国际业务产品。

投资银行部

负责公司新三板和股权投资基金等相关业务工作。

产品规划部

负责制定公司产品规划与发展策略，以及产品设计、产品管理和产品研究工作，完善公司产品线，丰富公司产品储备。

监察稽核部

负责公司的法律合规、投资风控、绩效分析、风险/流程管理、稽核审计、以及信息披露。

总裁办公室

负责公司财务管理、日常行政事务管理。

人力资源部

负责公司人力资源管理工作。

登记结算部

负责安全高效地完成资产组合的估值，注册登记及资金清算业务，保障后台运作正常运行。

信息技术部

负责公司信息技术系统开发、运行和维护，为公司战略和业务发展提供全面、及时、可靠的信息技术支持。

市场发展部

负责基金销售组织和支持、渠道管理及客服管理工作。

营销策划部

负责公司品牌管理、媒体和广告管理、营销策划与销售支持等各项职能工作。

机构理财部

负责开展公募基金直销、专户理财、社保等各项机构业务的营销和服务工作。

电子商务部

负责公司电子商务平台的搭建、业务推广和公司网站、移动终端等平台的日常内容更新和运营维护，以及外部互联网金融业务合作及第三方销售机构的渠道管理工作。

渠道业务部

负责券商渠道的管理和开拓工作。

客户关系管理中心

贯彻实施公司整体营销战略，建立和维护区域营销渠道，开展各项产品销售业务，完成公司整体销售任务。

北京分公司

负责公司与北京地区各家银行、券商总部及国家相关部委的日常沟通、信息反馈工作；贯彻实施公司整体营销战略，建立和维护北京及周边区域营销渠道，开展各项产品销售业务。

上海分公司

负责贯彻实施公司整体营销战略，建立和维护浙江、江西、江苏、山东、安徽、上海及周边区域营销渠道，开展基金销售业务。

武汉分公司

负责贯彻实施公司整体营销战略，建立和维护湖北、湖南、河南、重庆等区域营销渠道，开展基金销售业务。

广州分公司

负责贯彻实施公司整体营销战略，建立和维护广东区域（除深圳）、广西、贵州及云南等区域营销渠道，开展基金销售业务。

北方营销中心

负责贯彻实施公司整体营销战略，建立和维护北京、河北、内蒙、天津、山西等区域营销渠道，开展基金销售业务。

华南营销中心

负责贯彻实施公司整体营销战略，建立和维护深圳、四川、福建、西北及新疆等区域营销渠道，开展基金销售业务。

鹏华资产管理有限公司

负责特定客户资产管理业务及中国证监会许可的其他业务

12、人员情况

截至 2019 年 9 月 30 日，公司共有员工 444 人，其中，博士占比 4.7%，硕士占比 68.5%，本科占比 24.1%，其他占比 2.7%。

13、信息披露联系人及咨询电话

张戈 0755-82825720

14、本基金基金经理

李韵怡女士，国籍中国，经济学硕士，12 年证券从业经验。曾任职于广州证券股份有限公司投资管理总部，先后担任研究员、交易员和投资经理等职务，从事新股及可转债申购、定增项目等工作；2015 年 6 月加盟鹏华基金管理有限公司，从事投研工作，现担任稳对

收益投资部基金经理。2015年07月担任鹏华弘益混合基金基金经理，2015年07月至2017年01月担任鹏华弘锐混合基金基金经理，2015年07月担任鹏华弘实混合基金基金经理，2015年07月至2017年03月担任鹏华弘华混合基金基金经理，2015年07月至2017年01月担任鹏华弘和混合基金基金经理，2015年07月担任鹏华弘鑫混合基金基金经理，2015年07月至2017年02月担任鹏华弘信混合基金基金经理，2016年06月至2018年07月担任鹏华兴泽定期开放混合基金基金经理，2016年09月担任鹏华兴润定期开放混合基金基金经理，2016年09月担任鹏华兴安定期开放混合基金基金经理，2016年09月至2018年06月担任鹏华兴实定期开放混合基金基金经理，2016年09月担任鹏华兴合定期开放混合基金基金经理，2016年12月至2018年07月担任鹏华弘樽混合基金基金经理，2017年01月担任鹏华兴惠定期开放混合基金基金经理，2019年06月担任鹏华科创3年封闭混合基金基金经理。李韵怡女士具备基金从业资格。

李君女士，国籍中国，经济学硕士，10年金融证券从业经验。历任平安银行资金交易部银行账户管理岗，从事银行间市场资金交易工作；2010年8月加盟鹏华基金管理有限公司，担任集中交易室债券交易员，从事债券研究、交易工作。2013年01月至2014年05月担任鹏华货币基金基金经理；2014年02月至2015年05月担任鹏华增值宝货币基金基金经理；2015年05月担任鹏华弘润混合基金基金经理；2015年05月至2017年02月担任鹏华弘盛混合基金基金经理；2015年05月至2017年02月担任鹏华品牌传承混合基金基金经理；2015年05月担任鹏华弘利混合基金基金经理；；2015年05月至2017年02月担任鹏华弘泽混合基金基金经理；2015年11月担任鹏华弘安混合基金基金经理；2016年05月至2019年06月担任鹏华兴利定期开放混合基金基金经理；2016年06月至2018年08月担任鹏华兴华定期开放混合基金基金经理；2016年06月至2018年08月担任鹏华兴益定期开放混合基金基金经理；2016年08月至2018年05月担任鹏华兴盛定期开放混合基金基金经理；2016年09月至2017年11月担任鹏华兴锐定期开放混合基金基金经理；2017年02月至2018年06月担任鹏华兴康定期开放混合基金基金经理；2017年05月担任鹏华聚财货币基金基金经理；2017年09月至2018年05月担任鹏华弘锐混合基金基金经理；2018年03月担任鹏华尊惠定期开放混合基金基金经理；2018年05月至2018年10月担任鹏华兴盛混合基金基金经理；2018年06月至2018年08月担任鹏华兴康混合基金基金经理；2019年06月担任鹏华科创3年封闭混合基金基金经理；2019年06月担任鹏华兴利混合基金基金经理2019年08月至今担任鹏华丰登债券型证券投资基金基金经理。李君女士具备基金从业资格。

金笑非先生，国籍中国，经济学硕士，7年金融证券从业经验。2012年7月加盟鹏华基金管理有限公司，从事行业研究工作，历任研究部基金经理助理/高级研究员，现任权益投资二

部基金经理。2016年6月起担任鹏华医药科技股票基金基金经理，2017年07月担任鹏华医疗保健股票基金基金经理，2019年06月至今担任鹏华科创主题3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金基金经理。金笑非先生具备基金从业资格。

（二）基金托管人

一、基金托管人基本情况

名称：中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街55号

成立时间：1984年1月1日

法定代表人：陈四清

注册资本：人民币35,640,625.71万元

联系电话：010-66105799

联系人：郭明

二、主要人员情况

截至2019年6月，中国工商银行资产托管部共有员工213人，平均年龄33岁，95%以上员工拥有大学本科以上学历，高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

三、基金托管业务经营情况

作为中国大陆托管服务的先行者，中国工商银行自1998年在国内首家提供托管服务以来，秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨，依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队，严格履行资产托管人职责，为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务，展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、基本养老保险、企业年金基金、QFII资产、QDII资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII专户资产、ESCROW等门类齐全的托管产品体系，同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至2019年6月，中国工商银行共托管证券投资基金977只。自2003年以来，本行连续十六年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的68项最佳托管银行大奖；是获得奖项最多的国内托管银行，优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

（三）登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

住所：北京市西城区太平桥大街 17 号

法定代表人：周明

联系电话：021-68419095

传真：021-68870311

联系人：陈文祥

（四）出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市通力律师事务所

住所：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

负责人：俞卫锋

办公地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

联系电话：021-31358666

传真：021-31358666

联系人：陈颖华

经办律师：黎明、陈颖华

（五）会计师事务所

普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

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

办公地址：上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

法定代表人：李丹

联系电话：021-23238888

传真：021-23238800

联系人：魏佳亮

经办会计师：单峰、陈熹

（六）基金上市推荐人

名称：国信证券股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层

办公地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层

法定代表人：何如

客户服务电话：95536

网址：www.guosen.com.cn

六、 基金合同摘要

基金合同的内容摘要见附件。

七、 基金财务状况

（一）基金募集期间费用

本次基金募集期间所发生的信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用，不从基金资产中支付。

（二）基金上市前重要财务事项

本基金发售后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。

（三）基金资产负债表

本基金 2019 年 12 月 2 日资产负债表如下：

资 产	2019 年 12 月 2 日	负债和所有者权益	2019 年 12 月 2 日
	余额		余额
资 产：		负债：	
银行存款	10,759,438.99	短期借款	
结算备付金	4,154,104.89	交易性金融负债	
存出保证金	111,040.21	衍生金融负债	
交易类金融资产	1,421,242,550.76	卖出回购金融资产款	429,900,000.00
其中：股票投资	464,958,550.76	应付证券清算款	19,474,428.82
债券投资	956,284,000.00	应付赎回款	
资产支持证券投资		应付管理人报酬	1,096,092.73
基金投资		应付托管费	182,682.10
衍生金融资产		应付销售服务费	
买入返售金融资产		应付交易费用	310,728.91
应收证券清算款	36,655,362.74	应付税费	93,266.45
应收利息	9,768,400.61	应付利息	145,517.30
应收股利		应付利润	
应收申购款		其他负债	72,110.82
其他资产		负债合计	451,274,827.13

		所有者权益:	
		实收基金	988,941,407.16
		未分配利润	42,474,663.91
		所有者权益合计	1,031,416,071.07
资产合计	1,482,690,898.20	负债与持有人权益总计:	1,482,690,898.20

八、 基金投资组合

截至 2019 年 12 月 2 日，本基金的投资组合如下：

(一) 基金资产组合情况

序号	项目	金额（人民币元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	464,958,550.76	31.36
	其中：股票	464,958,550.76	31.36
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	956,284,000.00	64.50
	其中：债券	956,284,000.00	64.50
	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	14,913,543.88	1.01
8	其他资产	46,534,803.56	3.14
9	合计	1,482,690,898.20	100.00

(二) 按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	1,549,800.00	0.15
C	制造业	311,202,695.28	30.17

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,897,168.46	0.18
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	8,212,300.00	0.80
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	47,505,730.28	4.61
J	金融业	53,844,999.86	5.22
K	房地产业	1,206,898.00	0.12
L	租赁和商务服务业	199,666.88	0.02
M	科学研究和技术服务业	22,848,800.00	2.22
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	13,256,492.00	1.29
R	文化、体育和娱乐业	3,234,000.00	0.31
S	综合	-	-
	合计	464,958,550.76	45.08

(三) 按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细

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	002475	立讯精密	1,190,000.00	40,162,500.00	3.89
2	300760	迈瑞医疗	158,000.00	28,495,300.00	2.76
3	600276	恒瑞医药	302,962.00	25,367,008.26	2.46
4	000661	长春高新	56,000.00	24,068,800.00	2.33
5	601318	中国平安	275,000.00	22,904,750.00	2.22
6	603259	药明康德	260,000.00	22,848,800.00	2.22
7	002008	大族激光	480,000.00	16,699,200.00	1.62
8	000651	格力电器	227,965.00	13,155,860.15	1.28
9	300699	光威复材	284,980.00	10,806,441.60	1.05
10	300750	宁德时代	120,000.00	10,452,000.00	1.01

(四) 按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
----	------	---------	--------------

1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	50,245,000.00	4.87
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	833,961,000.00	80.86
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	70,680,000.00	6.85
7	可转债（可交换债）	1,398,000.00	0.14
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	956,284,000.00	92.72

（五）按公允价值占净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	143772	18 诚通 02	800,000.00	81,320,000.00	7.88
2	155431	19 京投 03	800,000.00	80,424,000.00	7.80
3	155469	19 能源 01	700,000.00	70,231,000.00	6.81
4	136515	16 疏浚 02	600,000.00	60,360,000.00	5.85
5	155842	19 国投 03	600,000.00	60,198,000.00	5.84

（六）按公允价值占净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

无。

（七）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

无。

（八）按公允价值占净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

（九）本基金投资的股指期货交易情况说明

9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：无。

9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目标，选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，充分考虑股指期货的风险收益特征，通过多头或空头的套期保值策略，以改善投资组合的投资效果，实现股票组合的超额收益。

（十）本基金投资的国债期货交易情况说明

10.1 本期国债期货投资政策

本基金根据风险管理的原则，以套期保值为目标，在风险可控的前提下，投资国债期货。本基金将充分考虑国债期货的流动性和风险收益特征，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，对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平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，力求实现委托财产的长期稳定增值。

10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：无。

10.3 本期国债期货投资评价

注：无。

（十一）投资组合报告附注

11.1

本基金投资的前十名证券中本期没有发行主体被监管部门立案调查的、或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

11.2

本基金投资的前十名证券没有超出基金合同规定的证券备选库。

11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（人民币元）
1	存出保证金	111,040.21
2	应收证券清算款	36,655,362.74
3	应收股利	-
4	应收利息	9,768,400.61
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	46,534,803.56

11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：无。

11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：无。

11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，投资组合报告中数字分项之和与合计项之间可能存在尾差。

九、 重大事件揭示

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

十、 基金管理人承诺

本基金管理人就基金上市交易之后履行管理人职责做出承诺：

(一) 严格遵守《基金法》及其他法律法规、《基金合同》的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。

(二) 真实、准确、完整和及时地披露定期报告等有关信息披露文件，披露所有对基金份额持有人有重大影响的信息，并接受中国证监会、上海证券交易所的监督管理。

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

十一、 基金托管人承诺

基金托管人就本基金上市交易后履行托管人职责做出如下承诺：

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

(二) 根据《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定，对基金的投资范围、基金资产的投资组合比例、基金资产净值的计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付等行为进行监督和核查。

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

(四) 基金托管人发现基金管理人重大违规行为，将立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。

十二、 基金上市推荐人意见

本基金上市推荐人为国信证券股份有限公司。上市推荐人就基金上市交易事宜出具如下意见：

1、本基金上市符合《基金法》、《上海证券交易所证券投资基金上市规则》规定的相关条件；

2、基金上市文件真实、准确、完整，符合相关规定要求，文件内所载的资料均经过核实。

十三、 备查文件目录

（一） 备查文件目录

1、中国证监会准予鹏华科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金募集的文件
2、中国证监会关于鹏华科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金备案确认的文件

3、《鹏华科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金基金合同》

4、《鹏华科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金托管协议》

4、法律意见书

5、基金管理人业务资格批件、营业执照

7、基金托管人业务资格批件、营业执照

（二） 存放地点

深圳市福田区福华三路 168 号深圳国际商会中心第 43 层鹏华基金管理有限公司。

（三） 查阅方式

投资者可在基金管理人营业时间内免费查阅，也可按工本费购买复印件，或通过本基金管理人网站（<http://www.phfund.com>）查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人鹏华基金管理有限公司，本公司已开通客户服务系统，咨询电话：4006788999/4006788533。

鹏华基金管理有限公司

2019 年 12 月 4 日

附件：鹏华科创主题3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金基金合同摘要

一、基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务

（一）基金份额持有人的权利、义务

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

- （1）分享基金财产收益；
- （2）参与分配清算后的剩余基金财产；
- （3）依法转让或者申请赎回其持有的基金份额；
- （4）按照规定要求召开基金份额持有人大会或者召集基金份额持有人大会；
- （5）出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使

表决权；

- （6）查阅或者复制公开披露的基金信息资料；
- （7）监督基金管理人的投资运作；
- （8）对基金管理人、基金托管人、基金服务机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或

仲裁；

- （9）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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

- （1）认真阅读并遵守《基金合同》、招募说明书等信息披露文件；
- （2）了解所投资基金产品，了解自身风险承受能力，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险；

- （3）关注基金信息披露，及时行使权利和履行义务；
- （4）交纳基金认购、申购款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用；
- （5）在其持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者《基金合同》终止的有限责任；
- （6）不从事任何有损基金及其他《基金合同》当事人合法权益的活动；
- （7）执行生效的基金份额持有人大会的决定；
- （8）返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；
- （9）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

（二）基金管理人的权利、义务

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

- （1）依法募集资金；

(2) 自《基金合同》生效之日起，根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产；

(3) 依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；

(4) 销售基金份额；

(5) 按照规定召集基金份额持有人大会；

(6) 依据《基金合同》及有关法律、法规规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律、法规规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；

(7) 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；

(8) 选择、更换基金销售机构，对基金销售机构的相关行为进行监督和处理；

(9) 担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记机构办理基金登记业务并获得《基金合同》规定的费用；

(10) 依据《基金合同》及有关法律、法规规定决定基金收益的分配方案；

(11) 在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请；

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

(13) 在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资；

(14) 以基金管理人的名义，代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；

(15) 选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券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、转换和非交易过户等业务规则；

(17) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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

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

(2) 办理基金备案手续；

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

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

理和运作基金财产；

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

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

(7) 依法接受基金托管人的监督；

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

(9) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

(10) 编制季度、半年度和年度基金报告；

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

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

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

(14) 按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

(25) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

(26) 建立并保存基金份额持有人名册；

(27) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

(三) 基金托管人的权利、义务

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

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

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

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

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

(5) 提议召开或召集基金份额持有人大会；

(6) 在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

(7) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

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

(1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；

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

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

拨、账册记录等方面相互独立；

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

(5) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

(6) 按规定开设基金财产的资金账户和证券账户等投资所需账户，按照《基金合同》的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；

(7) 保守基金商业秘密，除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露；

(8) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额申购、赎回价格；

(9) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

(10) 对基金财务会计报告、季度、半年度和年度基金报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照《基金合同》的规定进行；如果基金管理人未执行《基金合同》规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；

(11) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料 15 年以上；

(12) 建立并保存基金份额持有人名册；

(13) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

(14) 依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项；

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

(16) 按照法律法规和《基金合同》的规定监督基金管理人的投资运作；

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

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

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

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

(21) 执行生效的基金份额持有人大会的决定；

(22) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

二、基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

基金份额持有人大会由基金份额持有人组成，基金份额持有人的合法授权代表有权代表基金份额持有人出席会议并表决。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。本基金暂不设置日常机构，日常机构的设置和相关规则按照法律法规的有关规定进行。

(一) 召开事由

1、当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会，法律法规、中国证监会或基金合同另有约定的除外：

(1) 终止《基金合同》；

(2) 更换基金管理人；

(3) 更换基金托管人；

(4) 转换基金运作方式，但本基金封闭运作期届满依据基金合同约定转为鹏华创新成长灵活配置混合型证券投资基金（LOF）除外；

(5) 调整基金管理人、基金托管人的报酬标准，但封闭运作期结束后依据基金合同变更为“鹏华创新成长灵活配置混合型证券投资基金（LOF）”并按照基金合同约定的“鹏华创新成长灵活配置混合型证券投资基金（LOF）”的基金费率执行的除外；

(6) 变更基金类别；

(7) 本基金与其他基金的合并；

(8) 变更基金投资目标、范围或策略，但封闭运作期结束后依据基金合同变更为“鹏华创新成长灵活配置混合型证券投资基金（LOF）”并按照基金合同约定的“鹏华创新成长灵活配置混合型证券投资基金（LOF）”的投资目标、投资范围和投资策略执行的除外；

(9) 变更基金份额持有人大会程序；

(10) 基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；

(11) 终止基金上市，但因本基金不再具备上市条件而被上海证券交易所终止上市的情形除外；

(12) 单独或合计持有本基金总份额 10%以上（含 10%）基金份额的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会；

(13) 对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；

(14) 法律法规、《基金合同》或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。

2、在法律法规规定和《基金合同》约定的范围内且对基金份额持有人利益无实质性不利

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

- (1) 调低除基金管理费、基金托管费外其他应由基金承担的费用；
- (2) 法律法规要求增加的基金费用的收取；
- (3) 调整本基金的申购费率、调低赎回费率或变更收费方式；
- (4) 增加、减少、调整基金份额类别设置；
- (5) 基金管理人、登记机构、基金销售机构调整有关认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务规则；
- (6) 基金推出新业务或服务；
- (7) 因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改；
- (8) 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；
- (9) 按照法律法规和《基金合同》规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

(二) 会议召集人及召集方式

1、除法律法规规定或《基金合同》另有约定外，基金份额持有人大会由基金管理人召集。

2、基金管理人未按规定召集或不能召开时，由基金托管人召集。

3、基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当由基金托管人自行召集，并自出具书面决定之日起 60 日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合。

4、代表基金份额 10% 以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，代表基金份额 10% 以上（含 10%）的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开。并告知基金管理人，基金管理人应当配合。

5、代表基金份额 10% 以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持

有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，单独或合计代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人有权自行召集，并至少提前 30 日报中国证监会备案。基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的，基金管理人、基金托管人应当配合，不得阻碍、干扰。

6、基金份额持有人会议的召集人负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

（三）召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

1、召开基金份额持有人大会，召集人应于会议召开前 30 日，在指定媒介公告。基金份额持有人大会通知应至少载明以下内容：

（1）会议召开的时间、地点和会议形式；

（2）会议拟审议的事项、议事程序和表决方式；

（3）有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日；

（4）授权委托证明的内容要求（包括但不限于代理人身份，代理权限和代理有效期限等）、送达时间和地点；

（5）会务常设联系人姓名及联系电话；

（6）出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；

（7）召集人需要通知的其他事项。

2、采取通讯开会方式并进行表决的情况下，由会议召集人决定在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表决意见寄交的截止时间和收取方式。

3、如召集人为基金管理人，还应另行书面通知基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为基金托管人，则应另行书面通知基金管理人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为基金份额持有人，则应另行书面通知基金管理人和基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督。基金管理人或基金托管人拒不派代表对书面表决意见的计票进行监督的，不影响表决意见的计票效力。

（四）基金份额持有人出席会议的方式

基金份额持有人大会可通过现场开会方式、通讯开会方式或法律法规、监管机构允许的其他方式召开，会议的召开方式由会议召集人确定。

1、现场开会。由基金份额持有人本人出席或以代理投票授权委托证明委派代表出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当列席基金份额持有人大会，基金管理人或基金托管人不派代表列席的，不影响表决效力。现场开会同时符合以下条件时，可以进行基金份额持有人大会议程：

(1) 亲自出席会议者持有基金份额的凭证、受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托书符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的登记资料相符；

(2) 经核对，汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一（含二分之一）。若到会者在权益登记日代表的有效的基金份额少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的3个月以后、6个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会到会者在权益登记日代表的有效的基金份额应不少于本基金在权益登记日基金总份额的三分之一（含三分之一）。

2、通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以书面形式或基金合同约定的其他方式在表决截止日以前送达至召集人指定的地址。通讯开会应以书面方式或基金合同约定的其他方式进行表决。

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

(1) 会议召集人按《基金合同》约定公布会议通知后，在2个工作日内连续公布相关提示性公告。

(2) 召集人按基金合同约定通知基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。会议召集人在基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取基金份额持有人的书面表决意见；基金托管人或基金管理人经通知不参加收取书面表决意见的，不影响表决效力。

(3) 本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的，基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日基金总份额的二分之一（含二分之一）；若本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日基金总份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的3个月以后、6个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会应当有代表三分之一以上（含三分之一）基金份额的持有人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见。

(4) 上述第(3)项中直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的代理人，同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具书面意见的代理人出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托书符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规

定，并与基金登记机构记录相符。

3、在法律法规和监管机关允许的情况下，本基金的基金份额持有人亦可采用其他非书面方式授权其代理人出席基金份额持有人大会；在会议召开方式上，本基金亦可采用其他非现场方式或者以现场方式与非现场方式相结合的方式召开基金份额持有人大会，会议程序比照现场开会和通讯方式开会的程序进行。基金份额持有人亦可以采用书面、网络、电话、短信或其他方式进行表决，具体方式由会议召集人确定并在会议通知中列明。

（五）议事内容与程序

1、议事内容及提案权

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

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

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

2、议事程序

（1）现场开会

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

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

（2）通讯开会

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

（六）表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

1、一般决议，一般决议须经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）通过方为有效；除下列第 2 项所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过。

2、特别决议，特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方可做出。除本基金合同另有约定的，转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、终止《基金合同》、本基金与其他基金合并以特别决议通过方为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则提交符合会议通知中规定的确认投资者身份文件的表决视为有效出席的投资者，表面符合会议通知规定的书面表决意见视为有效表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

基金份额持有人大会的各项提案或同一项提案内并列的各项议题应当分开审议、逐项表决。

（七）计票

1、现场开会

（1）如大会由基金管理人或基金托管人召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中选举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集或大会虽然由基金管理人或基金托管人召集，但是基金管理人或基金托管人未出席大会的，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中选举三名基金份额持有人代表担任监票人。基金管理人或基金托管人不出席大会的，不影响计票的效力。

（2）监票人应当在基金份额持有人表决后立即进行清点并由大会主持人当场公布计票结果。

（3）如果会议主持人或基金份额持有人或代理人对于提交的表决结果有怀疑，可以在宣布表决结果后立即对所投票数要求进行重新清点。监票人应当进行重新清点，重新清点以一次为限。重新清点后，大会主持人应当当场公布重新清点结果。

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

响计票的效力。

2、通讯开会

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

（八）生效与公告

基金份额持有人大会的决议，召集人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会备案。

基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。

基金份额持有人大会决议自生效之日起 2 日内在指定媒介上公告。如果采用通讯方式进行表决，在公告基金份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。

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

（九）本部分关于基金份额持有人大会召开事由、召开条件、议事程序、表决条件等规定，凡是直接引用法律法规的部分，如将来法律法规修改导致相关内容被取消或变更的，基金管理人按照《信息披露管理办法》的规定公告后，可直接对本部分内容进行修改和调整，无需召开基金份额持有人大会审议。

三、基金收益分配原则、执行方式

（一）基金利润的构成

基金利润指基金利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额，基金已实现收益指基金利润减去公允价值变动收益后的余额。

（二）基金可供分配利润

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

（三）基金收益分配原则

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

2、本基金场外收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现

金分红；本基金场内收益分配方式为现金分红；

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

4、每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可调整基金收益分配原则和支付方式，不需召开基金份额持有人大会。

（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，在 2 日内在指定媒介公告并报中国证监会备案。

（六）基金收益分配中发生的费用

基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。对于场外份额，当投资者的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金登记机构可将基金份额持有人的现金红利自动转为基金份额（不受封闭运作期限限制）。红利再投资的计算方法，依照《业务规则》执行。对于场内份额，遵循上海证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定。

四、与基金财产管理、运用有关费用的提取、支付方式与比例

（一）基金费用的种类

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

9、基金上市费及年费；

10、因投资港股通标的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、封闭运作期管理费和托管费的计提方式

①基金管理人的管理费

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

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 2 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 2 个工作日内支付。

②基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.20% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 2 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 2 个工作日内支付。

2、封闭运作期届满转型后管理费和托管费的计提方式

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，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，

经基金托管人复核后于次月首日起 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 2 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 2 个工作日内支付。

②基金托管人的托管费

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 2 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 2 个工作日内支付。

上述“一、基金费用的种类”中第 3—11 项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

（三）不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

- 1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致费用支出或基金财产的损失；
- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
- 3、《基金合同》生效前的相关费用；
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

（四）基金税收

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

五、基金财产的投资目标、投资范围和投资方向

（一）封闭运作期投资目标

本基金在科学严谨的资产配置框架下，研选科创主题的股票、债券等投资标的，力争实现基金资产的长期稳健增值。

（二）封闭运作期投资范围

封闭运作期内，本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板、科创板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具、股指期货、国债期货以及经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。

基金的投资组合比例为：封闭运作期内，股票资产占基金资产的比例为 0%-100%，投资于科创主题相关的证券占非现金基金资产的比例不低于 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。其中，股票投资部分可以以战略配售的方式进行投资。

如果法律法规对该比例要求有变更的，以变更后的比例为准，本基金的投资范围会做相应调整。

（三）封闭运作期投资限制

1、组合限制

封闭运作期内基金的投资组合应遵循以下限制：

（1）封闭运作期内，股票资产占基金资产的比例为 0%-100%，投资于科创主题相关的证券占非现金基金资产的比例不低于 80%；

（2）封闭运作期内，每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

（3）本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%；

（4）本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的基金品种可以不受此条款规定的比例限制；

（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 15%；

(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) 封闭运作期内,本基金资产总值不超过基金资产净值的 200%;

(12) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%,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;

(13) 本基金参与股指期货交易,应当遵守下列要求:

a. 本基金在任何交易日日终,持有的买入股指期货合约价值,不得超过基金资产净值的 10%;

b. 本基金在任何交易日日终,持有的买入股指期货合约和国债期货合约价值与有价证券市值之和,不得超过基金资产净值的 100%。其中,有价证券指股票、债券(不含到期日在一年以内的政府债券)、资产支持证券、买入返售金融资产(不含质押式回购)等;

c. 本基金在任何交易日日终,持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%;

d. 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;

e. 本基金在任何交易日内交易(不包括平仓)的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%;

(14) 本基金参与国债期货交易,应当遵守下列要求:

a. 本基金在任何交易日日终,持有的买入国债期货合约价值,不得超过基金资产净值的 15%;

b. 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 100%。其中,有价证券指股票、债券(不含到期日在一年

以内的政府债券)、资产支持证券、买入返售金融资产(不含质押式回购)等;

c.本基金在任何交易日日终,持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的 30%;

d.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;

e.本基金在任何交易日内交易(不包括平仓)的国债期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 30%;

(15) 本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票,不得超过该上市公司可流通股票的 15%; 本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票,不得超过该上市公司可流通股票的 30%; 完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的开放式基金以及中国证监会认定的特殊投资组合可不受前述比例限制;

(16) 本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的,可接受质押品的资质要求应当与本基金合同约定的投资范围保持一致;

(17) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

除上述第(2)、(9)、(16)项情形之外,因证券、期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的,基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整,但中国证监会规定的特殊情形除外。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在上述期间内,本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门取消上述限制,如适用于本基金,基金管理人在履行适当程序后,则本基金投资不再受相关限制。

2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益,基金财产不得用于下列投资或者活动:

- (1) 承销证券;
- (2) 违反规定向他人贷款或者提供担保;
- (3) 从事承担无限责任的投资;
- (4) 买卖其他基金份额,但是中国证监会另有规定的除外;
- (5) 向其基金管理人、基金托管人出资;
- (6) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动;

(7) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

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

法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，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。

(四) 封闭运作期满转型为“鹏华创新成长灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)”的投资

1、投资目标

在严格控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金资产的长期稳健增值。

2、投资范围

本基金封闭运作期届满转型后，本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板、科创板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的香港联合交易所上市的股票（以下简称“港股通标的股票”）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具、股指期货、国债期货以及经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。

基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 30%-95%，且投资于港股通标的股票占股票资产的比例不超过 50%，每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金以及投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如果法律法规对该比例要求有变更的，以变更后的比例为准，本基金的投资范围会做相应

调整。

3、基金的投资限制

组合限制

(1) 股票资产占基金资产的比例为 30%-95%，且投资于港股通标的股票占股票资产的比例不超过 50%；

(2) 每个交易日日终在扣除股指期货合约和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；

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

(4) 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券（同一家公司在内地和香港同时上市的 A+H 股合计计算），不超过该证券的 10%；完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的基金品种可以不受此条款规定的比例限制；

(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 15%；

(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) 基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%；

(12) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%，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；

(13) 本基金参与股指期货交易，应当遵守下列要求：

a.本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的10%；

b.本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约和国债期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的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；

c.本基金在任何交易日日终，持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的20%；

d.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；

e.本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的20%；

（14）本基金参与国债期货交易，应当遵守下列要求：

a.本基金在任何交易日日终，持有的买入国债期货合约价值，不得超过基金资产净值的15%；

b.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；

c.本基金在任何交易日日终，持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的30%；

d.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；

e.本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的国债期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的30%；

（15）本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的15%；本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的30%；完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的开放式基金以及中国证监会认定的特殊投资组合可不受前述比例限制；

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

(17) 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；

(18) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资比例限制。

除上述第(2)、(9)、(16)、(17)项情形之外，因证券、期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。

基金管理人应当自封闭运作期届满之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在上述期间内，本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制。

禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

- (1) 承销证券；
- (2) 违反规定向他人贷款或者提供担保；
- (3) 从事承担无限责任的投资；
- (4) 买卖其他基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；
- (5) 向其基金管理人、基金托管人出资；
- (6) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- (7) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

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

六、基金资产净值的计算方法和公告方式

(一) 基金资产净值的计算方法

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

(二) 基金资产净值的公告方式

1、 封闭运作期内

《基金合同》生效后，基金上市交易前，基金管理人应当至少每周公告一次基金资产净值和基金份额净值。

基金上市交易后，基金管理人应当在每个交易日的次日，通过网站、上海证券交易所、基金份额销售网点以及其他媒介，披露基金份额净值和基金份额累计净值。基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值和基金份额净值。基金管理人应当在前款规定的市场交易日的次日，将基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定媒介上。

2、 封闭运作期届满转型上市开放式基金（LOF）

在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当在每个开放日的次日，通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介，披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。

基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值和基金份额净值。基金管理人应当在前款规定的市场交易日的次日，将基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定媒介上。

七、基金合同变更和终止的事由、程序以及基金财产清算方式

（一）《基金合同》的变更

1、变更基金合同涉及法律法规规定或本合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。对于法律法规规定和基金合同约定可不经基金份额持有人大会决议通过的事项，由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告，并报中国证监会备案。

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议自生效后方可执行，自决议生效后两日内在指定媒介公告。

（二）《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，经履行相关程序后，《基金合同》应当终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止的；
- 2、基金管理人、基金托管人职责终止，在 6 个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；
- 3、《基金合同》约定的其他情形；
- 4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

（三）基金财产的清算

1、基金财产清算小组：自出现《基金合同》终止事由之日起 30 个工作日内成立清算小组，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。

2、基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

3、基金财产清算小组职责：基金财产清算小组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。

4、基金财产清算程序：

(1) 《基金合同》终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；

(2) 对基金财产和债权债务进行清理和确认；

(3) 对基金财产进行估值和变现；

(4) 制作清算报告；

(5) 聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；

(6) 将清算报告报中国证监会备案并公告；

(7) 对基金剩余财产进行分配。

5、基金财产清算的期限为 6 个月，但因本基金所持证券的流动性受到限制而不能及时变现的，清算期限相应顺延。

(四) 清算费用

清算费用是指基金财产清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。

(五) 基金财产清算剩余资产的分配

依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

(六) 基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组进行公告。

(七) 基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

八、争议解决方式

各方当事人同意，因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局的，对各方当事人均有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

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

《基金合同》受中国法律管辖。

九、基金合同存放地和投资者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。