

# 中欧创新未来18个月封闭运作混合型证券投资基金 上市交易公告书

## 目 录

|     |                         |    |
|-----|-------------------------|----|
| 一、  | 重要声明与提示.....            | 2  |
| 二、  | 基金概览 .....              | 3  |
| 三、  | 基金的募集与上市交易.....         | 5  |
| 四、  | 持有人户数、持有人结构及前十名持有人..... | 6  |
| 五、  | 基金主要当事人简介.....          | 7  |
| 六、  | 基金合同摘要.....             | 14 |
| 七、  | 基金财务状况（未经审计） .....      | 14 |
| 八、  | 基金投资组合.....             | 15 |
| 九、  | 重大事件揭示.....             | 19 |
| 十、  | 基金管理人承诺.....            | 19 |
| 十一、 | 基金托管人承诺.....            | 20 |
| 十二、 | 基金上市推荐人意见.....          | 20 |
| 十三、 | 备查文件目录.....             | 20 |
| 十四、 | 附件：基金合同内容摘要.....        | 22 |

# 中欧创新未来18个月封闭运作混合型证券投资基金 上市交易公告书

基金管理人：中欧基金管理有限公司  
基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司  
注册登记人：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：2021年1月21日  
公告日期：2021年1月16日

## 一、重要声明与提示

中欧创新未来18个月封闭运作混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）上市交易公告书（以下简称“本公告”）依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第1号<上市交易公告书的内容与格式>》和《上海证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制，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。

凡本上市交易公告书未涉及的有关内容，请投资者详细查阅2021年1月9日刊登于中国证券监督管理委员会规定媒介和中欧基金管理有限公司网站([www.zofund.com](http://www.zofund.com))的本基金招募说明书。

投资者在投资本基金前，需充分了解本基金的产品特性，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：市场风险、管理风险、流动性风险、策略风险、其他风险、特有风险、本基金法律文件风险收益特征表述与销售机构基金风险评价可能不一致的风险。其中特有风险包括：1、科创板的投资风险；2、投资战略配售股票风险；3、融资业务的风险；4、转融通业务的风险；5、股指期货的投资风险；6、股票期权的投资风险；7、国债期货的投资风险；8、

资产支持证券的投资风险；9、港股交易失败风险；10、汇率风险；11、境外市场的风险；12、港股投资风险；13、信用衍生品的投资风险、14、基金转型的风险；15、存托凭证的投资风险；16、基金合同生效后的前18个月为封闭运作期，在封闭运作期内，本基金不办理赎回业务；基金份额持有人在封闭运作期内面临无法赎回基金份额的风险。本基金符合上市条件后可申请基金份额上市交易，在本基金未申请上市、因不符合条件而无法上市或被终止上市等情形下，基金份额持有人持有的基金份额将无法进行二级市场交易，从而面临封闭运作期间无法退出本基金的风险。请投资者注意做好资金安排，确保投资期限与本基金运作期限相匹配；17、基金份额交易无法成交或折价的风险。

本基金为混合型基金，其预期风险收益水平高于债券型基金及货币市场基金，低于股票型基金。本基金将投资港股通标的股票，需承担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。

投资者应当认真阅读本基金《基金合同》、《招募说明书》、《基金产品资料概要》等基金法律文件，了解本基金的风险收益特征，并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断本基金是否和投资者的风险承受能力相适应。

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。基金的过往业绩并不预示其未来表现，基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。基金管理人提醒投资人注意基金投资的“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，由投资人自行承担。

## 二、 基金概览

### （一）基金名称：

中欧创新未来 18 个月封闭运作混合型证券投资基金

①基金代码：501208

②基金简称：中欧创新未来 18 个月封闭混合

③场内简称：中欧创新

④扩位简称：中欧创新未来

(二) 基金类型:

混合型

(三) 基金运作方式:

契约型

本基金合同生效后的前18个月为封闭运作期,即本基金的封闭运作期为基金合同生效日(包括基金合同生效日)至18个月后的月度对日前一日止。在封闭运作期内,本基金不办理申购与赎回业务;

本基金可在符合法律法规和上海证券交易所规定的上市条件的情况下申请上市交易。封闭运作期内本基金上市交易后,投资者可将其持有的场外基金份额通过办理跨系统转托管业务转至场内后上市交易。

封闭运作期届满后,本基金转为上市开放式基金(LOF),基金名称调整为“中欧创新未来混合型证券投资基金(LOF)”,并接受场外、场内申购和赎回。

(四) 本基金的存续期

不定期。

(五) 基金份额总额

本基金总份额为9,133,806,132.06份(截至2021年1月14日)。

(六) 基金份额净值

基金份额净值为1.2010元(截至2021年1月14日)。

(七) 本次上市交易份额

上市交易份额3,877,016.00份(截至2021年1月14日)

(八) 上市交易的证券交易所

上海证券交易所

(九) 上市交易日期

2021年1月21日

(十) 基金管理人

中欧基金管理有限公司

(十一) 基金托管人

上海浦东发展银行股份有限公司

(十二) 上市推荐人

中信证券股份有限公司

### 三、 基金的募集与上市交易

(一) 本基金上市前基金募集情况:

1、基金募集申请的核准机构和核准文号: 证监许可[2020]2281号文

基金变更注册的核准机构和核准文号: 证监许可[2020]3619号文

2、基金运作方式: 契约型、其他开放式

3、基金合同期限: 不定期

4、发售日期: 2020年9月25日至2020年9月29日

5、发售价格: 1.00 元人民币

6、发售方式: 场外发售

7、发售机构:

1) 直销机构: 中欧基金管理有限公司

2) 场外代销机构:

蚂蚁(杭州)基金销售有限公司、上海中欧财富基金销售有限公司。

8、验资机构名称: 安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)

9、募集资金总额及入账情况: 本次募集净认购金额为人民币 12,000,000,412.25 元; 认购款项在基金验资确认日前产生的利息共计人民币 1,815,951.00 元, 折算成基金份额共计 1,815,951.00 份, 已分别计入各基金份额持有人的基金账户, 归基金份额持有人所有。上述募集净认购资金已于 2020 年 10 月 9 日全额划入本基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司基金托管专户。

10、基金备案情况: 根据《基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》以及《中欧创新未来18个月封闭运作混合型证券投资基金基金合同》的有关规定, 本基金募集符合有关条件, 本基金管理人已向中国证监会办理完毕基金备案手续, 并于2020年10月9日获得中国证监会书面确认, 基金合同自该日起正式生效。自基金合同生效之日起, 本基金管理人正式开始管理本基金。

11、基金合同生效日: 2020年10月9日

12、基金合同生效日的基金份额总额: 12,001,816,363.25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: 上海证券交易自律监管决定书【2021】11号

2、上市交易日期: 2021年1月21日

3、上市交易的证券交易所：上海证券交易所。

4、本次上市交易的基金份额场内简称及代码：中欧创新 501208

5、本次上市交易份额：3,877,016.00份（截至2021年1月14日）

6、基金资产净值的披露：

每个交易日的次日公布本基金的基金份额净值，并在上交所行情发布系统揭示。

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

#### 四、 持有人户数、持有人结构及前十名持有人

截至2021年1月14日的本基金持有人总户数为2,230,772户，其中场内基金份额持有情况：

场内基金份额持有人户数：120户

平均每户持有的场内基金份额：32,308.47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：机构持有中欧创新为0.00份，占0.00%

场内个人投资者持有的基金份额及场内基金占总份额比例：个人持有中欧创新为3,877,016.00份，占100.00%

场内基金前十名持有人情况：

| 序号 | 持有人名称（全称） | 持有基金份额（份）  | 占场内基金份额比例（%） |
|----|-----------|------------|--------------|
| 1  | 冉默        | 500,090.00 | 12.90        |
| 2  | 吴根涛       | 344,752.00 | 8.89         |
| 3  | 李峰        | 220,041.00 | 5.68         |
| 4  | 许丹丹       | 200,040.00 | 5.16         |
| 5  | 罗梦宇       | 160,031.00 | 4.13         |
| 6  | 张景峰       | 150,027.00 | 3.87         |
| 7  | 雷娟妹       | 100,030.00 | 2.58         |
| 8  | 饶宇        | 100,020.00 | 2.58         |
| 9  | 李珂杨       | 100,018.00 | 2.58         |

|    |     |            |      |
|----|-----|------------|------|
| 10 | 李佳琪 | 100,018.00 | 2.58 |
|----|-----|------------|------|

## 五、 基金主要当事人简介

### (一) 基金管理人

1、名称： 中欧基金管理有限公司

2、法定代表人： 窦玉明

3、总经理： 刘建平

4、注册资本： 2.20亿元人民币

5、注册地址： 中国（上海）自由贸易实验区陆家嘴环路333号5层

6、设立批准文号： 证监基金字[2006]102号

7、统一社会信用代码： 91310000717866389C

8、经营范围： 基金募集、基金销售、资产管理和经中国证监会许可的其他业务。【依法须经批准的项目，经相关部门批准后方可开展经营活动】

9、存续期间： 持续经营

10、股东及其出资比例：

| 序号 | 股东名称                             | 出资额<br>(人民币万元) | 出资比例     |
|----|----------------------------------|----------------|----------|
| 1  | Unione di Banche Italiane S.p.A. | 5,500          | 25.0000% |
| 2  | 国都证券股份有限公司                       | 4,400          | 20.0000% |
| 3  | 北京百骏投资有限公司                       | 4,400          | 20.0000% |
| 4  | 上海睦亿投资管理合伙企业(有限合伙)               | 4,400          | 20.0000% |
| 5  | 窦玉明                              | 1,100          | 5.0000%  |
| 6  | 万盛基业投资有限责任公司                     | 726            | 3.3000%  |
| 7  | 周玉雄                              | 328.35         | 1.4925%  |
| 8  | 卢纯青                              | 163.8340       | 0.7447%  |
| 9  | 于洁                               | 163.8340       | 0.7447%  |
| 10 | 赵国英                              | 163.8340       | 0.7447%  |
| 11 | 方伊                               | 117.0180       | 0.5319%  |
| 12 | 关子阳                              | 117.0180       | 0.5319%  |
| 13 | 卞玺云                              | 92.4660        | 0.4203%  |

|    |     |         |         |
|----|-----|---------|---------|
| 14 | 魏博  | 87.7580 | 0.3989% |
| 15 | 郑苏丹 | 87.7580 | 0.3989% |
| 16 | 曲径  | 87.7580 | 0.3989% |
| 17 | 黎忆海 | 64.3720 | 0.2926% |
| 合计 |     | 22,000  | 100%    |

#### 11、内部组织结构及职能

公司设立了投资决策委员会、风险控制委员会、基金估值委员会、IT治理委员会等专业委员会。投资决策委员会是公司进行基金投资管理的最高投资决策机构，对基金投资的所有重大问题进行决策。风险控制委员会是公司日常运作的最高风险控制机构。基金估值委员会是规范证券投资基金估值中的公允价值定价行为的机构。IT治理委员会是完善公司IT治理工作的机构。

公司目前下设投资策略组、固定收益研究部、权益研究部、中央交易室、营销策划部、机构业务部、零售业务部、财富管理部、数据营销部、业务发展部、理财规划部、公司财务部、基金运营部、行政部、信息技术部、人力资源部、监察稽核部、风险管理部等部门，各部门主要职责如下：

- (1) 投资策略组负责权益类资产和固定收益类资产的投资管理和风险控制。
- (2) 固定收益研究部负责研究分析债券类产品的信用评级
- (3) 权益研究部负责对宏观经济、市场动态、行业及上市公司等领域进行调查研究，为投资决策提供研究支持以及定量投资的研究、基金业绩归因分析、基金风险评价、研究员业绩考核、衍生品的研究以及数量化程序开发。
- (4) 中央交易室负责执行各项交易指令，及时向基金经理汇报市场异常交易情况以及重大消息。
- (5) 营销策划部负责公司各类产品的市场调研、产品推广、公司品牌建设以及对外交流与合作等事务。
- (6) 机构业务部负责机构客户的开发和维护。
- (7) 零售业务部负责零售客户的开发和维护。
- (8) 财富管理部负责高净值客户的财富管理。
- (9) 数据营销部负责销售支持。
- (10) 业务发展部负责基金产品的研究、设计与开发，以及基金申报材料和发行材料的

制作。

(11) 理财规划部负责日常客户服务工作、并提供销售支持及客户服务相关工作。

(12) 公司财务部负责公司的财务管理和会计核算。

(13) 基金运营部负责基金注册登记、基金直销业务办理、基金资金清算以及基金会计核算等事务。

(14) 行政部负责公司日常行政事务管理。

(15) 信息技术部负责公司信息系统的建设、维护与管理，为公司管理和业务活动提供技术支持。

(16) 人力资源部负责公司人力资源管理。

(17) 监察稽核部负责公司法务、合规监察及内部稽核审计。

(18) 风险管理部负责对公司旗下组合投资运作中的风险进行研究和控制。

12、人员情况：

截至 2020年12月31日，本基金管理人已有正式员工296人，其中管理团队共6人，他们都具有丰富的工作经验和很强的管理能力。员工中65%以上具有硕士以上学位，绝大多数的员工具有多年证券、基金从业经验。

13、信息披露负责人及咨询电话：黎忆海 021-68609600

14、基金管理业务情况：

中欧基金管理有限公司经中国证监会（证监基字[2006]102号文）批准，于2006年7月19日正式成立。股东为意大利意联银行股份有限公司、国都证券股份有限公司、北京百骏投资有限公司、上海睦亿投资管理合伙企业（有限合伙）、万盛基业投资有限责任公司及自然人股东。注册资本为2.20亿元人民币，旗下设有北京分公司、中欧盛世资产管理（上海）有限公司、上海中欧财富基金销售有限公司和中欧基金国际有限公司。截至本公告编制日，本基金管理人共管理89只开放式基金。

15、本基金基金经理：

|        |   |         |                 |
|--------|---|---------|-----------------|
| 姓名     | 周应波   | 性别      | 男               |
| 国籍     | 中国  | 毕业院校及专业 | 北京大学控制理论与控制工程专业 |
| 其他公司历任 | 平安证券有限责任公司研究员（2010.02-2011.08），华夏基金管理有限公司研究员（2011.08-2014.10） |         |                 |
| 本公司历任  | 研究员、投资经理助理、投资经理   |         |                 |

| 本公司现任          | 权益投决会委员/投资总监/基金经理           |                  |                  |
|----------------|-----------------------------|------------------|------------------|
| 本基金经理所管理基金具体情况 | 产品名称                        | 起任日期             | 离任日期             |
| 1              | 中欧时代先锋股票型发起式证券投资基金          | 2015 年 11 月 03 日 |                  |
| 2              | 中欧明睿新常态混合型证券投资基金            | 2016 年 12 月 01 日 |                  |
| 3              | 中欧时代智慧混合型证券投资基金             | 2018 年 01 月 25 日 | 2020 年 08 月 12 日 |
| 4              | 中欧远见两年定期开放混合型证券投资基金         | 2019 年 04 月 24 日 |                  |
| 5              | 中欧科创主题 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金 | 2019 年 06 月 28 日 | 2020 年 08 月 12 日 |
| 6              | 中欧互联网先锋混合型证券投资基金            | 2020 年 10 月 12 日 |                  |
| 7              | 中欧创新未来 18 个月封闭运作混合型证券投资基金   | 2020 年 10 月 9 日  |                  |

|                |   |                  |        |
|----------------|---|------------------|--------|
| 姓名             | 邵洁  | 性别               | 女      |
| 国籍             | 中国  | 毕业院校及专业          | 杜兰大学金融 |
| 其他公司历任         | 国金证券电子行业分析师（2012.06-2014.03），安信证券电子行业高级分析师（2014.04-2016.03） |                  |        |
| 本公司历任          | 研究员、基金经理助理  |                  |        |
| 本公司现任          | 基金经理  |                  |        |
| 本基金经理所管理基金具体情况 | 产品名称  | 起任日期             | 离任日期   |
| 1              | 中欧科创主题 3 年封闭运作灵活  | 2020 年 02 月 14 日 |        |

|   |                           |                  |  |
|---|---------------------------|------------------|--|
|   | 配置混合型证券投资基金               |                  |  |
| 2 | 中欧鼎利债券型证券投资基金             | 2020 年 03 月 10 日 |  |
| 3 | 中欧创新未来 18 个月封闭运作混合型证券投资基金 | 2020 年 10 月 9 日  |  |

|                |  |                  |        |
|----------------|--|------------------|--------|
| 姓名             | 刘金辉  | 性别               | 男      |
| 国籍             | 中国   | 毕业院校及专业          | 清华大学金融 |
| 其他公司历任         | 兴业全球基金管理有限公司金融工程与专题部研究员<br>(2014.07-2015.03) |                  |        |
| 本公司历任          | 研究员、基金经理助理                                   |                  |        |
| 本公司现任          | 基金经理   |                  |        |
| 本基金经理所管理基金具体情况 | 产品名称   | 起任日期             | 离任日期   |
| 1              | 中欧电子信息产业沪港深股票型证券投资基金                         | 2020 年 08 月 14 日 |        |
| 2              | 中欧创新未来 18 个月封闭运作混合型证券投资基金                    | 2020 年 10 月 9 日  |        |

(二) 基金托管人

1、基本情况

名称：上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“浦发银行”）

法定代表人：郑杨

注册资本：293.52 亿元人民币

注册地址：上海市中山东一路 12 号

托管部负责人：孔建

信息披露负责人：胡波

电话：（021）61618888

经营范围：经中国人民银行和中国银行业监督管理委员会批准，公司主营业务主要包括：吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；办理结算；办理票据贴现；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；同业拆借；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保险箱业务；外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外币兑换；国际结算；同业外汇拆借；外汇票据的承兑和贴现；外汇借款；外汇担保；结汇、售汇；买卖和代理买卖股票以外的外币有价证券；自营外汇买卖；代客外汇买卖；资信调查、咨询、见证业务；离岸银行业务；证券投资基金托管业务；全国社会保障基金托管业务；经中国人民银行和中国银行业监督管理委员会批准经营的其他业务。

上海浦东发展银行自 2003 年开展资产托管业务，是较早开展银行资产托管服务的股份制商业银行之一。经过二十年来的稳健经营和业务开拓，各项业务发展一直保持较快增长，各项经营指标在股份制商业银行中处于较好水平。

上海浦东发展银行总行于 2003 年设立基金托管部，2005 年更名为资产托管部，2013 年更名为资产托管与养老金业务部，2016 年进行组织架构优化调整，并更名为资产托管部，目前下设证券托管处、客户资产托管处、内控管理处、业务保障处、总行资产托管运营中心（含合肥分中心）五个职能处室。

目前，上海浦东发展银行已拥有客户资金托管、资金信托保管、证券投资基金托管、全球资产托管、保险资金托管、基金专户理财托管、证券公司客户资产托管、期货公司客户资产托管、私募证券投资基金托管、私募股权托管、银行理财产品托管、企业年金托管等多项托管产品，形成完备的产品体系，可满足多领域客户、境内外市场的资产托管需求。

## 2、主要人员情况：

郑杨，男，1966 年出生，研究生学历，博士学位，高级经济师。曾任国家经贸委经济法规司调研处副处长；中国机电设备招标中心开发处处长、第七招标业务处处长；国家外汇管理局资本项目司副司长；中国人民银行上海分行党委委员、副行长、国家外汇管理局上海市分局副局长；中国人民银行上海总部党委委员、副主任兼外汇管理部主任；上海市金融工作党委副书记、市金融办主任；上海市金融工作党委书记、市金融办主任；上海市金融工作

党委书记、市地方金融监管局（市金融工作局）局长。现任上海浦东发展银行党委书记、董事长。

潘卫东，男，1966 年出生，硕士研究生，高级经济师。曾任宁波证券公司业务一部副经理；上海浦东发展银行宁波分行资财部总经理兼任北仑办事处主任、宁波分行副行长；上海浦东发展银行产品开发部总经理；上海浦东发展银行昆明分行行长、党组书记；上海市金融服务办公室挂职并任金融机构处处长；上海国际集团党委委员、总经理助理，上海国际集团党委委员、副总经理，上海国际信托有限公司党委书记、董事长；上海浦东发展银行党委委员、执行董事、副行长、财务总监。现任上海浦东发展银行党委副书记、副董事长、行长，上海国际信托有限公司董事长。

孔建，男，1968 年出生，博士研究生。历任工商银行山东省分行资金营运处副处长，上海浦东发展银行济南分行信管处总经理，上海浦东发展银行济南分行行长助理、副行长、党委书记、行长。现任上海浦东发展银行总行金融市场业务工作党委委员，资产托管部总经理。

### 3、基金托管业务经营情况

截止 2020 年 9 月 30 日，上海浦东发展银行证券投资基金托管规模为 9066.66 亿元，比去年末增加 50.53%。托管证券投资基金共 261 只。

#### （三）上市推荐人

中信证券股份有限公司

法定代表人：张佑君

客户服务电话：95548

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

#### （四）基金验资机构

名称：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

执行事务合伙人：毛鞍宁

注册地址：北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层

办公地址：北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层

经办注册会计师：王珊珊、许培菁

电话：010-58153000

## 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（未经审计）

上海证券交易所在中欧创新未来18个月封闭运作混合型证券投资基金募集期间未收取任何费用,其他各基金销售机构根据本基金招募说明书设定的费率或佣金比率收取认购费。

本基金募集结束后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。

中欧创新未来18个月封闭运作混合型证券投资基金2021年1月14日资产负债表如下:

| 项 目       | 行次 | 2021 年 1 月 14 日   |
|-----------|----|-------------------|
| <b>资产</b> |    |                   |
| 银行存款      | 1  | 878,877,471.53    |
| 结算备付金     | 2  | 125,449,191.07    |
| 存出保证金     | 3  | 38,289,471.50     |
| 交易性金融资产   | 4  | 9,417,718,876.82  |
| 其中：股票投资   | 5  | 9,416,312,876.82  |
| 基金投资      | 6  |                   |
| 债券投资      | 7  | 1,406,000.00      |
| 资产支持证券投资  | 8  |                   |
| 贵金属投资     | 9  |                   |
| 衍生金融资产    | 10 |                   |
| 买入返售金融资产  | 11 | 800,000,000.00    |
| 应收证券清算款   | 12 | 51,207,370.19     |
| 应收利息      | 13 | 2,239,445.91      |
| 应收股利      | 14 |                   |
| 应收申购款     | 15 |                   |
| 其他资产      | 16 |                   |
| 资产总计      | 17 | 11,313,781,827.02 |
| <b>负债</b> |    |                   |
| 短期借款      | 18 |                   |
| 交易性金融负债   | 19 |                   |
| 衍生金融负债    | 20 |                   |
| 卖出回购金融资产款 | 21 |                   |
| 应付证券清算款   | 22 | 333,551,027.54    |
| 应付赎回款     | 23 |                   |
| 应付管理人报酬   | 24 | 6,099,395.38      |

|            |    |                   |
|------------|----|-------------------|
| 应付托管费      | 25 | 813,252.70        |
| 应付销售服务费    | 26 | 1,626,505.43      |
| 应付交易费用     | 27 | 1,422,692.72      |
| 应交税费       | 28 | 2.83              |
| 应付利息       | 29 |                   |
| 应付利润       | 30 |                   |
| 递延所得税负债    | 31 |                   |
| 其他负债       | 32 | 119,589.02        |
| 负债合计       | 33 | 343,632,465.62    |
| 所有者权益：     |    |                   |
| 实收基金       | 34 | 9,133,806,132.06  |
| 未分配利润      | 35 | 1,836,343,229.34  |
| 所有者权益合计    | 36 | 10,970,149,361.40 |
| 负债和所有者权益总计 | 37 | 11,313,781,827.02 |

## 八、 基金投资组合

截止到2021年1月14日，中欧创新未来18个月封闭运作混合型证券投资基金的投资组合如下：

### （一）期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目                | 金额(元)             | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|-------------------|---------------|
| 1  | 权益投资              | 9,416,312,876.82  | 83.23         |
|    | 其中：股票             | 9,416,312,876.82  | 83.23         |
| 2  | 基金投资              |                   |               |
| 3  | 固定收益投资            | 1,406,000.00      | 0.01          |
|    | 其中：债券             | 1,406,000.00      | 0.01          |
|    | 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          | 800,000,000.00    | 7.07          |
|    | 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      | 1,004,326,662.60  | 8.88          |
| 8  | 其他资产              | 91,736,287.60     | 0.81          |
| 9  | 合计                | 11,313,781,827.02 | 100.00        |

### （二）期末按行业分类的股票投资组合

#### 1、 报告期末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              | 4,081,282,865.62 | 37.20        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | -                | -            |
| E  | 建筑业              | -                | -            |
| F  | 批发和零售业           | -                | -            |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 302,630,775.63   | 2.76         |
| H  | 住宿和餐饮业           | -                | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 1,374,552,124.55 | 12.53        |
| J  | 金融业              | 702,490,414.48   | 6.40         |
| K  | 房地产业             | -                | -            |
| L  | 租赁和商务服务业         | -                | -            |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 15,464.40        | 0.00         |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | 63,573.51        | 0.00         |
| O  | 居民服务、修理和其他服务业    | -                | -            |
| P  | 教育               | 8,637.64         | 0.00         |
| Q  | 卫生和社会工作          | -                | -            |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | -                | -            |
| S  | 综合               | -                | -            |
|    | 合计               | 6,461,043,855.83 | 58.90        |

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(元)          | 占基金资产净值比例(%) |
|---------|------------------|--------------|
| 消费者非必需品 | 1,030,486,122.24 | 9.39         |
| 信息技术    | 802,473,440.00   | 7.32         |
| 电信服务    | 994,648,543.55   | 9.07         |
| 医疗保健    | 127,660,915.20   | 1.16         |
| 合计      | 2,955,269,020.99 | 26.94        |

(三) 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 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  | H00700 | 腾讯控股       | 1,786,400.00  | 939,034,879.55 | 8.56 |
| 2  | H02382 | 舜宇光<br>学科技 | 5,000,000.00  | 802,473,440.00 | 7.32 |
| 3  | 002415 | 海康威视       | 13,836,708.00 | 792,013,165.92 | 7.22 |
| 4  | 601318 | 中国平安       | 8,238,424.00  | 702,490,414.48 | 6.40 |
| 5  | 300454 | 深信服        | 2,342,620.00  | 606,296,955.40 | 5.53 |
| 6  | 000725 | 京东方 A      | 83,269,041.00 | 584,548,667.82 | 5.33 |
| 7  | 600660 | 福耀玻璃       | 10,391,652.00 | 565,617,618.36 | 5.16 |
| 8  | 600406 | 国电南瑞       | 17,525,917.00 | 482,137,976.67 | 4.39 |
| 9  | H00175 | 吉利汽车       | 16,000,000.00 | 438,228,992.00 | 3.99 |
| 10 | H03690 | 美团-W       | 1,580,000.00  | 413,224,554.24 | 3.77 |

(四) 期末按券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<br>(%) |
|----|-----------|--------------|------------------|
| 1  | 国家债券      |              |                  |
| 2  | 央行票据      |              |                  |
| 3  | 金融债券      |              |                  |
|    | 其中：政策性金融债 |              |                  |
| 4  | 企业债券      |              |                  |
| 5  | 企业短期融资券   |              |                  |
| 6  | 中期票据      |              |                  |
| 7  | 可转债（可交换债） | 1,406,000.00 | 0.01             |
| 8  | 同业存单      |              |                  |
| 9  | 其他        |              |                  |
| 10 | 合计        | 1,406,000.00 | 0.01             |

(五) 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

| 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<br>比例（%） |
|----|--------|------|--------|--------------|------------------|
| 1  | 113616 | 韦尔转债 | 14,060 | 1,406,000.00 | 0.01             |

(六) 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。

(七) 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。

(八) 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。

(九) 期末本基金投资的股指期货交易情况说明

1、 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

本基金将以套期保值为主要目的，参与股指期货的投资。本基金投资股指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合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本。

(十) 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

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的，参与国债期货的投资。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。基金管理人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。

2、 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持有国债期货。

3、 本期国债期货投资评价

本基金投资国债期货以套期保值为目的，以回避市场风险。故国债期货空头的合约价值主要与债券组合的多头价值相对应。基金管理人通过动态管理国债期货合约数量，以萃取相应债券组合的超额收益。

(十一) 投资组合报告附注

- 1、本基金投资的前十名证券的发行主体本报告期内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、处罚的情形。
- 2、本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选库之外的股票。
- 3、其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额(元)         |
|----|---------|---------------|
| 1  | 存出保证金   | 38,289,471.50 |
| 2  | 应收证券清算款 | 51,207,370.19 |
| 3  | 应收股利    |               |
| 4  | 应收利息    | 2,239,445.91  |
| 5  | 应收申购款   |               |
| 6  | 其他应收款   |               |
| 7  | 待摊费用    |               |
| 8  | 其他      |               |
| 9  | 合计      | 91,736,287.60 |

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

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|----------------|--------------|----------|
| 1  | 300454 | 深信服  | 513,560,000.00 | 4.68         | 大宗交易流通受限 |

6、投资组合报告附注的其他文字描述部分

本报告中因四舍五入原因，投资组合报告中市值占总资产或净资产比例的分项之和与合计可能存在尾差。

## 九、 重大事件揭示

本基金自合同生效至上市交易期间未发生对基金份额持有人有较大影响的重大事件。

## 十、 基金管理人承诺

本基金管理人就本基金上市交易之后履行管理人职责做出如下承诺：

(一)严格遵守《基金法》及其他法律法规、基金合同的规定,以诚实信用、勤勉尽责的原

则管理和运用基金资产。

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

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

## 十一、 基金托管人承诺

基金托管人就本基金上市交易后履行托管人职责做出如下承诺:

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

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

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

(四)基金托管人发现基金管理人重大违规行为,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

本基金上市推荐人就基金上市交易事宜出具意见如下:

(一)本基金上市符合《中华人民共和国证券投资基金法》、《上海证券交易所证券投资基金上市规则》规定的相关条件;

(二)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

本基金备查文件包括下列文件:

(一)中国证监会准予中欧创新未来18个月封闭运作混合型证券投资基金注册的文件;

- (二) 中欧创新未来18个月封闭运作混合型证券投资基金基金合同；
- (三) 中欧创新未来18个月封闭运作混合型证券投资基金托管协议；
- (四) 中欧创新未来18个月封闭运作混合型证券投资基金招募说明书；
- (五) 法律意见书；
- (六) 基金管理人业务资格批件和营业执照；
- (七) 基金托管人业务资格批件和营业执照；
- (八) 中国证监会要求的其他文件。

存放地点：基金管理人的住所

查阅方式：基金投资者可在营业时间免费查阅，或通过指定的信息披露媒体、本基金管理人网站([www.zofund.com](http://www.zofund.com))查阅。

中欧基金管理有限公司

2021年1月16日

## 十四、 附件：基金合同内容摘要

### 一、基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务

#### （一）基金份额持有人的权利与义务

基金投资者持有本基金基金份额的行为即视为对基金合同的承认和接受，基金投资者自依据基金合同取得基金份额，即成为本基金份额持有人和基金合同的当事人，直至其不再持有本基金的基金份额。基金份额持有人作为基金合同当事人并不以在基金合同上书面签章或签字为必要条件。

每份基金份额具有同等的合法权益。

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

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

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

- （1）认真阅读并遵守基金合同、招募说明书等信息披露文件；
- （2）了解所投资基金产品，了解自身风险承受能力，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险；
- （3）关注基金信息披露，及时行使权利和履行义务；
- （4）交纳基金认购、申购款项及法律法规和基金合同所规定的费用；

- (5) 在其持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者基金合同终止的有限责任；
- (6) 不从事任何有损基金及其他基金合同当事人合法权益的活动；
- (7) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；
- (8) 返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；
- (9) 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他义务。

## (二) 基金管理人的权利与义务

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

- (1) 依法募集资金；
- (2) 自基金合同生效之日起，根据法律法规和基金合同独立运用并管理基金财产；
- (3) 依照基金合同收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；
- (4) 销售基金份额；
- (5) 按照规定召集基金份额持有人大会；
- (6) 依据基金合同及有关法律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规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；
- (7) 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；
- (8) 选择、更换基金销售机构，对基金销售机构的相关行为进行监督和处理；
- (9) 担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记机构办理基金登记业务并获得基金合同规定的费用；
- (10) 依据基金合同及有关法律规规定决定基金收益的分配方案；
- (11) 在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请；
- (12) 依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利；
- (13) 在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资；
- (14) 以基金管理人的名义，代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
- (15) 选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商、期货经纪机构或其他为基金提供服务的外部机构；
- (16) 在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换和非交易过户等业务规则；

(17) 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他权利。

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

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

(2) 办理基金备案手续；

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

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

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

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

(7) 依法接受基金托管人的监督；

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

(9) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

(10) 编制季度报告、中期报告和年度报告；

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

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

能够按照基金合同规定的时间和方式,随时查阅到与基金有关的公开资料,并在支付合理成本的前提下得到有关资料的复印件;

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

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

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

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

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

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

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

(25) 执行生效的基金份额持有人大会的决议;

(26) 建立并保存基金份额持有人名册;

(27) 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他义务。

(三) 基金托管人的权利与义务

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

(1) 自基金合同生效之日起,依法律法规和基金合同的规定安全保管基金财产;

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

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

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

(5) 提议召开或召集基金份额持有人大会;

(6) 在基金管理人更换时,提名新的基金管理人;

(7) 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他权利。

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

(1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；

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

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

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

(5) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

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

(7) 保守基金商业秘密，除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，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、季度报告、中期报告和年度报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照基金合同的规定进行；如果基金管理人未执行基金合同规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；

(11) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料 20 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。

## 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，法律法规和中国证监会另有规定或基金合同另有约定的除外：

- (1) 终止基金合同；
- (2) 更换基金管理人；
- (3) 更换基金托管人；
- (4) 转换基金运作方式；
- (5) 调整基金管理人、基金托管人的报酬标准和提高基金销售服务费，但法律法规要求调整该等报酬标准或提高销售服务费率的除外；
- (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；
- (9) 变更基金份额持有人大会程序；
- (10) 基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；
- (11) 单独或合计持有本基金总份额 10%以上（含 10%）基金份额的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）就同一事项书面要求召开基金份额持有人

大会；

(12) 对基金合同当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；

(13) 终止基金上市，但因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除外；

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

2、在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) 调低基金销售服务费和除基金管理费、基金托管费以外的其他应由基金承担的费用；

(2) 法律法规要求增加的基金费用的收取；

(3) 调整本基金的申购费率、调低赎回费率或变更收费方式、调整本基金的基金份额类别的设置；

(4) 因相应的法律法规、上海证券交易所或登记机构的相关业务规则发生变动而应当对基金合同进行修改；

(5) 对基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及基金合同当事人权利义务关系发生重大变化；

(6) 按照法律法规和基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

## (二) 会议召集人及召集方式

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

2、基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集。

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

4、代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管

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

5、代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，单独或合计代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人有权自行召集，并至少提前 30 日报中国证监会备案。基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的，基金管理人、基金托管人应当配合，不得阻碍、干扰。

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

（三）召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

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

- （1）会议召开的时间、地点和会议形式；
- （2）会议拟审议的事项、议事程序和表决方式；
- （3）有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日；
- （4）授权委托证明的内容要求（包括但不限于代理人身份，代理权限和代理有效期限等）、送达时间和地点；
- （5）会务常设联系人姓名及联系电话；
- （6）出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；
- （7）召集人需要通知的其他事项。

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

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

#### （四）基金份额持有人出席会议的方式

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

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

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

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

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

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

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

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

（3）本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的，基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日基金总份额的二分之一（含二分之一）；若本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日

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

（4）上述第（3）项中直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的代理人，同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具书面意见的代理人出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、基金合同和会议通知的规定，并与基金登记机构记录相符。

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，具体方式由会议召集人确定并在会议通知中列明。

4、在会议召开方式上，本基金亦可采用其他非现场方式或者以现场方式与非现场方式相结合的方式召开基金份额持有人大会，会议程序比照现场开会和通讯方式开会的程序进行。

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

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

## （七）计票

### 1、现场开会

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

额持有人代表担任监票人。基金管理人或基金托管人不出席大会的，不影响计票的效力。

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

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

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

## 2、通讯开会

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

## (八) 生效与公告

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

基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。

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

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

## (九) 实施侧袋机制期间基金份额持有人大会的特殊约定

若本基金实施侧袋机制，则相关基金份额或表决权的比例指主袋份额持有人和侧袋份额持有人分别持有或代表的基金份额或表决权符合该等比例，但若相关基金份额持有人大会召集和审议事项不涉及侧袋账户的，则仅指主袋份额持有人持有或代表的基金份额或表决权符合该等比例：

1、基金份额持有人行使提议权、召集权、提名权所需单独或合计代表相关基金份额 10% 以上（含 10%）；

2、现场开会的到会者在权益登记日代表的基金份额不少于本基金在权益登记日相关基金份额的二分之一（含二分之一）；

3、通讯开会的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相关基金份额的二分之一（含二分之一）；

4、在参与基金份额持有人大会投票的基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日相关基金份额的二分之一、召集人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）相关基金份额的持有人参与或授权他人参与基金份额持有人大会投票；

5、现场开会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；

6、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；

7、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。

同一主侧袋账户内的每份基金份额具有平等的表决权。

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

### 三、基金收益分配原则、执行方式

#### （一）基金利润的构成

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

#### （二）基金可供分配利润

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

#### （三）基金收益分配原则

1、本基金场外收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利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；

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

- 3、每一基金份额享有同等分配权；
- 4、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在不违反法律法规且对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可对基金收益分配原则进行调整，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 日内在规定媒介公告。

#### （六）基金收益分配中发生的费用

基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。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。红利再投资的计算方法，依照《业务规则》执行。对于场内份额，现金分红的计算方法等有关事项遵循上海证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定。

#### （七）实施侧袋机制期间的收益分配

本基金实施侧袋机制的，侧袋账户不进行收益分配，详见招募说明书的规定。

### 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、基金的相关账户的开户及维护费用；
- 10、因投资港股通标的股票而产生的各项合理费用；
- 11、按照国家有关规定和基金合同约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

## （二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

### 1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.50% 的年费率计提。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

基金管理费每日计算，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前 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、公休假等，支付日期顺延。

### 2、基金托管人的托管费

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，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前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

### 3、基金的销售服务费

本基金的销售服务费按前一日基金资产净值的 0.40% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的销售服务费

E 为前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计算，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前 5 个工作日内从

基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假等，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）实施侧袋机制期间的基金费用

本基金实施侧袋机制的，与侧袋账户有关的费用可以从侧袋账户中列支，但应待侧袋账户资产变现后方可列支，有关费用可酌情收取或减免，但不得收取管理费，详见招募说明书的规定。

### （五）基金税收

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

## 五、基金财产的投资方向和投资限制

### （一）投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板、科创板、存托凭证以及其他经中国证监会允许发行上市的股票）、港股通标的股票、债券（包括国债、地方政府债、政府支持机构债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、现金、衍生工具（包括国债期货、股指期货、股票期权等）、信用衍生品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）。本基金可以根据有关法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，

可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：

封闭运作期内，本基金投资组合中股票投资比例为基金资产的 60%-100%，投资于创新未来主题相关股票不低于非现金基金资产的 80%；港股通标的股票投资比例不超过全部股票资产的 50%；在封闭运作期结束前 2 个月的期间内，本基金投资不受上述比例限制。每个交易日日终在扣除国债期货、股指期货和股票期权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（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）。

## （二）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）本基金投资组合中股票投资比例为基金资产的 60%-100%，投资于创新未来主题相关股票不低于非现金基金资产的 80%；港股通标的股票投资比例不超过全部股票资产的 50%；

（2）每个交易日日终在扣除国债期货、股指期货和股票期权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（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（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）基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

（6）本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；本基金在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；

（7）封闭运作期内，本基金的基金总资产不得超过基金净资产的 200%；

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

（9）本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；

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

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

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

(13) 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方开展逆回购交易的，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；

(14) 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%；同一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%；

(15) 本基金参与国债期货、股指期货交易后，需遵守下列投资比例限制：

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

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

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

4) 本基金在任何交易日日终，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%；

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

6) 本基金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%；

7) 封闭期内，本基金在任何交易日日终，持有的买入国债期货和股指期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 100%，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；

8) 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；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；

(16) 本基金若参与股票期权交易的，需遵守下列投资比例限制：

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

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

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

(17) 基金若参与融资的，任何交易日日终，本金融资买入股票与其他有价证券市值之和，不得超过基金资产的 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；

(18) 本基金不得持有信用保护卖方属性的信用衍生品，持有的信用衍生品的名义本金不得超过本基金对应受保护债券面值的 100%；

(19) 本基金投资于同一信用保护卖方的各类信用衍生品的名义本金合计不得超过基金资产净值的 10%。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不符合前述所规定比例限制的，基金管理人应在 3 个月之内进行调整；

(20) 本基金参与转融通证券出借业务的，在任何交易日日终，参与转融通证券出借交易的资产不得超过基金资产净值的 50%，出借到期日不得超过本基金封闭运作期到期日。因证券市场波动、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不符合前款规定的，基金管理人不得新增出借业务；

(21) 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；

(22) 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)、(12)、(13)、(19)、(20) 情形之外，因证券/期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的，从其规定。

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照调整后的规定执行。

## 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) 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其他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的原则，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，则本基金投资按照取消或调整后的规定执行。

(三) 封闭运作期届满转为“中欧创新未来混合型证券投资基金（LOF）”之后的投资

### 1、投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板、科创板、存托凭证以及其他经中国证监会允许发行上市的股票）、港股通标的股票、债券（包括国债、地方政府债、政府支持机构债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、现金、衍生工具（包括国债期货、股指期货、股票期权等）、信用衍生品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）。

本基金可以参与融资业务。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可

以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：

本基金投资组合中股票投资比例为基金资产的 60%–95%，投资于创新未来主题相关股票不低于非现金基金资产的 80%；港股通标的股票投资比例不超过全部股票资产的 50%；每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，保持现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%。如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

## 2、组合限制

### （1）组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

1) 本基金投资组合中股票投资比例为基金资产的 60%–95%，投资于创新未来主题相关股票不低于非现金基金资产的 80%；港股通标的股票投资比例不超过全部股票资产的 50%；

2) 每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，保持现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%；

3) 本基金持有一家公司发行的证券，其市值（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%；

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

7) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；

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

9) 本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超

过其各类资产支持证券合计规模的 10%；

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

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

12) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；本基金在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；

13) 本基金资产总值不得超过基金资产净值的 140%；

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

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

16) 本基金参与国债期货、股指期货交易后，需遵守下列投资比例限制：

① 本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的 10%；

② 本基金在任何交易日日终，持有的买入国债期货合约价值，不得超过基金资产净值的 15%；

③ 本基金在任何交易日日终，持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%；

④ 本基金在任何交易日日终，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%；

⑤ 本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%；

⑥ 本基金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%；

⑦ 封闭期结束后，本基金在任何交易日日终，持有的买入国债期货和股指期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%，其中，有价证券指股票、债券（不含

到期日在一年以内的政府债券)、资产支持证券、买入返售金融资产(不含质押式回购)等;

⑧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;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) 本基金若参与股票期权交易的,需遵守下列投资比例限制:

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

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

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

18) 基金若参与融资的,任何交易日日终,本基金融资买入股票与其他有价证券市值之和,不得超过基金资产的 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;

19) 本基金不得持有信用保护卖方属性的信用衍生品,持有的信用衍生品的名义本金不得超过本基金对应受保护债券面值的 100%;

20) 本基金投资于同一信用保护卖方的各类信用衍生品的名义本金合计不得超过基金资产净值的 10%。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不符合前述所规定比例限制的,基金管理人应在 3 个月之内进行调整;

21) 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;

22) 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)、10)、14)、15)、20) 情形外,因证券/期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的,基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整,但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的,从其规定。

基金管理人应当自转型为上市开放式基金(LOF)之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在上述期间内,本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本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照调整后的规定执行。

## （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) 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其他重大利害关系的公司发行的证券或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，则本基金投资按照取消或调整后的规定执行。

## 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式

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

### （二）基金资产净值的公告方式

基金合同生效后，在封闭运作期内，基金上市交易前，基金管理人应当至少每周公告在规定网站披露一次基金份额净值和基金份额累计净值。

基金上市交易后，基金管理人应当在不晚于每个开放日的次日，通过规定网站、基金销售机构网站或者营业网点，披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。

封闭运作期届满转为上市开放式基金（LOF）后，基金管理人应当在不晚于每个开放日的次日，通过规定网站、基金销售机构网站或者营业网点，披露开放日的基金份额净值和基

金份额累计净值。

如因不满足上市条件而终止上市且本基金根据基金合同约定变更为非上市基金，在封闭运作期内，基金管理人应至少每周在规定网站披露一次基金份额净值和基金份额累计净值；在封闭运作期届满后，基金管理人应当在不晚于每个开放日的次日，通过规定网站、基金销售机构网站或者营业网点，披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。

基金管理人应当在不晚于半年度和年度最后一日的次日，在规定网站披露半年度和年度最后一日的基金份额净值和基金份额累计净值。

## 七、基金合同解除和终止的事由、程序以及基金财产的清算方式

### （一）基金的合并

本基金与其他基金合并，应当按照法律法规规定的程序进行。

### （二）基金合同的变更

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

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

### （三）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。

### （四）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。

(五) 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。

(六) 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。

(七) 基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组进行公告，基金财产清算小组应当将清算报告登载在规定网站上，并将清算报告提示性公告登载在规定报刊上。

(八) 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，法律法规或监管部门另有规定的除外。

#### 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，除经友好协商可以解决的，应提交上海国际经济贸易仲裁委员会，根据该会届时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁的地点在上海，仲裁裁决是终局性的并对相关各方均有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

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

本基金合同适用中华人民共和国法律（为本基金合同之目的，在此不包括香港、澳门特别行政区和台湾地区法律），并从其解释。

#### 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。