（上接A14版）

基金运作方式：
契约型
本基金合同生效后的前3年为封闭运作期。本基金的封闭期为基金合同生效日（包括基金合同生效日）至 3 年后的年度对日前一日止。
在封闭运作期内，本基金不办理申购、赎回业务。
封闭运作期内基金上市交易后，投资者可将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，本基金将转为上市开放式基金（LOF），基金名称调整为“大成科创主题混合型证券投资基金（LOF）”，并接受场内、场外申购和赎回。
基金存续期限：不定期
（三）基金的募集期限
募集期限自基金份额发售之日起不超过3个月。
基金管理人有权根据基金募集的实际情况按照相关程序延长或缩短发售募集期，此类变更适用于所有销售机构。基金发售募集期若经延长，最长不得超过前述募集期限。
具体规定详见本基金的基金份额发售公告及代销机构相关公告、通知。
（四）发售对象
符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、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。
（五）发售方式
本基金通过场外、场内两种方式公开发售。场外通过各销售机构的基金销售网点或以销售机构提供的其他方式公开发售，具体名单见基金份额发售公告以及基金管理人届时发布的调整销售机构的相关公告。场内通过具有基金销售业务资格的上海证券交易所会员单位发售，尚未取得基金销售业务资格、但属于上海证券交易所会员单位的其他机构，可在基金份额上市后，代理投资者通过上海证券交易所交易系统参与本基金的上市交易。
通过场外认购的基金份额登记在登记结算系统基金份额持有人开放式基金账户下；通过场内认购的基金份额登记在证券登记系统基金份额持有人上海证券账户下。
（六）认购时间
本基金发售募集期间每天的具体业务办理时间，由本基金的基金份额发售公告或各销售机构的相关公告或者通知规定。
各个销售机构在本基金发售募集期内对于机构或个人的每天具体业务办理时间可能不同，若本招募说明书或份额发售公告没有明确规定，则由各销售机构自行决定日常业务办理时间。
（七）基金份额发售面值和认购价格
本基金基金份额发售面值为人民币1.00元，认购价格为1.00元。
（八）基金份额认购限制及持有限额
1、基金投资者认购时，需按销售机构规定的方式全额缴款。
2、基金投资者在基金募集期内可以多次认购基金份额，认购费按每笔认购申请单独计算。认购一经受理不得撤销。
3、本基金场外认购、场内认购均采用金额认购的方式。本基金场外认购基金份额的单笔最低认购金额为 1.00 元，认购期间单个投资者的累计认购规模没有限制；投资者通过场内销售机构认购本基金，单笔认购申请的最低金额为 1,000 元，且认购金额必须为 1 元的整数倍。
4、单一投资者持有基金份额的比例不得达到或者超过50%，或者以其他方式变相规避50%集中度限制的情形。
5、基金管理人可根据有关法律法规的规定和市场情况，调整认购的数额限制，基金管理人最迟于调整前2日在至少一种指定媒介上予以公告。
（九）基金份额类别设置
在不违反法律法规、基金合同的约定以及对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，经与基金托管人协商一致并履行相关程序后，基金管理人可调整基金份额类别设置、调整申购费率、调低赎回费率、变更收费方式或者停止现有基金份额的销售、对基金份额分类办法及规则进行调整等，并在调整实施之日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告，不需要召开基金份额持有人大会。
（十）认购费用
本基金目前开通前端收费模式，将来根据市场发展状况和法律法规、监管机构的规定，可能增加新的收费模式。增加新的收费模式，应当按照法律法规、监管机构的规定，履行适 当的程序，并及时公告。新的收费模式的具体业务规则，请见有关公告、通知。
本基金场外认购费用如下：

认购金额（M）	认购费率
M＜100 万	1.20%
100万≤M＜200 万	1.00%
200 万≤M＜500 万	0.60%
500 万≤M	1000元/笔

本基金基金份额的场内认购费率参照场外认购费率执行。
基金认购费用不列入基金财产，主要用于基金的市场推广、销售、登记等募集期间发生的各项费用。投资者重复认购，须按每次认购所对应的费率档次分别计费。
基金管理人及其他基金销售机构可以在不违背法律法规规定及《基金合同》约定的情形下，对基金认购费用实行一定的优惠，费率优惠的相关规则和流程详见基金管理人或其他基金销售机构届时发布的相关公告或通知。
（十一）基金认购费用的计算
本基金的场外、场内认购均采用金额认购的方式，认购金额包括认购费用和净认购金额。
1、场外认购份额和利息转份额的计算
（1）适用于比例费率：
净认购金额 = 认购金额/（1+认购费率）
认购费用 = 认购金额－净认购金额
认购份额 =（净认购金额+认购利息）/基金份额发售面值
（2）适用于固定费用：
净认购金额＝认购金额–固定认购费用
认购份额＝（净认购金额＋认购利息）/基金份额发售面值
认购份额的计算保留到小数点后2位，小数点2位以后的部分四舍五入，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。
例：某投资人投资100,000元场外认购本基金，如果认购期内认购资金获得的利息为50 元，则其可得到的基金份额计算如下：
净认购金额=100,000/（1+1.20%）=98,814.23元
认购费用=100,000－98,814.23=1,185.77元
认购份额=98,814.23/1.00+50/1.00=98,864.23份
即投资人投资100,000元认购本基金，加上认购资金在认购期内获得的利息，可得到 98,864.23份基金份额。
2、场内认购份额和利息转份额的计算
本基金的挂牌价格为人民币 1.00 元/份。
（1）认购费用适用比例费率时，认购份额的计算方法如下：
净认购金额=认购金额/（1+认购费率）
认购费用=认购金额–净认购金额
认购份额=净认购金额/基金份额发售面值
利息转份额=利息/基金份额发售面值
认购份额总额=认购份额＋利息折算的份额
（2）认购费用为固定金额时，认购份额的计算方法如下：
认购费用=固定金额
净认购金额=认购金额–认购费用
认购份额=净认购金额/基金份额发售面值
利息转份额=利息/基金份额发售面值
认购份额总额＝认购份额＋利息折算的份额
认购费用、净认购金额的计算按四舍五入方法，保留到小数点后两位，由此误差产生的收益或损失由基金资产承担。场内认购利息折算的基金份额按截位法保留到整数位，小数部分舍去归基金资产。场内认购份额计算结果先按四舍五入的原则保留到小数点后两位，再按截位法保留到整数位，小数部分对应的剩余金额退还投资者。剩余金额的计算保留到小数点后两位，小数点两位以后的部分四舍五入，由此误差产生的收益或损失由基金资产承担。
例：某投资人投资 100,000 元场内认购本基金，如果认购期内认购资金获得的利息为 50 元，则其可得到的基金份额计算如下：
净认购金额=100,000/（1+1.20%）=98,814.23 元
认购费用=100,000－98,814.23=1,185.77 元
利息折算所得份额=50/1.00=50 份
认购份额=98,814.23/1.00+50/1.00=98,864.23 份
因场内认购份额保留至整数位，故投资人认购所得份额为 98,864 份，整数位后小数部 分的认购份额对应的资金返还给投资人。
退款金额 = 0.23 元，故返还给投资人的金额为 0.23 元。
即投资人投资 100,000 元场内认购本基金份额，加上认购资金在认购期内获得的利息，可得到 98,864 份基金份额。
（十二）募集期间认购资金利息的处理方式
有效认购款项在募集期间产生的利息将折算为基金份额归基金份额持有人所有，其中利息转份额以登记机构的记录为准。
（十三）募集期内募集资金的管理
基金募集期间募集的资金应当存入专门账户，在基金募集行为结束前，任何人不得动用。
（十四）募集期间费用
基金募集期间的信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用，不得从基金财产中列支。

七、基金的备案

一、基金备案的条件
本基金自基金份额发售之日起3个月内，在基金募集份额总额不少于2亿份，基金募集金额不少于2亿元人民币且基金认购人数不少于200人的条件下，基金募集期届满或基金管理人依据法律法规及招募说明书可以决定停止基金发售，并在10日内聘请法定验资机构验资，自收到验资报告之日起10日内，向中国证监会办理基金备案手续。
基金募集达到基金备案条件的，自基金管理人办理完毕基金备案手续并取得中国证监会书面确认之日起，《基金合同》生效；否则《基金合同》不生效。基金管理人在收到中国证监会确认文件的次日对《基金合同》生效事宜予以公告。基金管理人应将基金募集期间募集的资金存入专门账户，在基金募集行为结束前，任何人不得动用。
二、基金合同不能生效时募集资金的处理方式
如果募集期限届满，未满足基金备案条件，基金管理人应当采担下列责任：
1、以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用；
2、在基金募集期限届满后30日内返还投资者已缴纳的款项，并加计银行同期存款利息。
3、如基金募集失败，基金管理人、基金托管人及销售机构不得请求报酬。基金管理人、基金托管人和销售机构为基金募集支付之一切费用应由各方各自承担。
三、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5000万元情形的，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，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。
封闭运作期届满后，本基金将自动转为“大成科创主题混合型证券投资基金（LOF）”，不再以封闭方式运作，无需召开基金份额持有人大会。
法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。

八、基金份额的申购、赎回与转换

（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，其中场内销售机构为具有基金销售业务资格、经上海证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的会员单位；场外销售机构包括直销机构和其他场外销售机构。具体的销售网点将由基金管理人在更新的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，并于以公告。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。
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“大成科创主题混合型证券投资基金（LOF）”，并接受场内、场外申购和赎回。
（二）申购和赎回的开放日及时间
1、开放日及开放时间
本基金合同生效后的前3年为封闭运作期。
在封闭运作期内，本基金不办理申购、赎回业务。
封闭运作期届满后，本基金将转为上市开放式基金（LOF），基金管理人在开放日办理基金份额的申购和赎回，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，但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或本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或其他特殊情况，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、申购与赎回的开始时间
在本基金封闭运作期内不开放申购赎回业务。
本基金自转为上市开放式基金（LOF）之日起 30 天内开始办理场内、场外份额的申购、赎回业务，具体业务办理时间在相关公告中规定。
基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购或者赎回或者转换。开放期以及开放期办理申购与赎回业务的具体事宜见招募说明书或基金管理人届时发布的相关公告。
（三）申购与赎回的原则
1、“未知价”原则，即申购、赎回价格以申请当日收市后计算的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；
4、场外赎回遵循“先进先出”原则，即按照投资人认购、申购的先后次序进行顺序赎回；
5、投资者通过上海证券交易所交易系统办理本基金的场内申购、赎回时，需遵守上海证券交易所和登记结算机构的相关业务规则。若相关法律法规、中国证监会、上海证券交易所或登记结算有限责任公司对场内申购、赎回业务规则有新的规定，基金合同相应予以修改，并按照新规定执行，且此项修改无须召开基金份额持有人大会。
（七）申购份额与赎回支付金额的计算方式
1、申购和赎回数额、余额的处理方式
（1）申购份额余额的处理方式：申购的有效份额为净申购金额除以当日的基金份额净值，有效份额单位为份。场外申购份额计算结果按四舍五入方法，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。场内申购份额先按四舍五入的原则保留到小数点后两位，再按截位法保留到整数位，小数部分对应的金额退还投资者。
（2）赎回金额的处理方式：本基金在转为普通上市型开放式基金（LOF）之后，赎回金额计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后两位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。
2、申购份额的计算
本基金的申购金额包括申购费用和净申购金额。申购份额的计算公式为：
（1）适用于比例费率
净申购金额= 申购金额/（1+申购费率）
申购费用 = 申购金额－净申购金额
申购份额 = 净申购金额/申购当日基金份额净值
（2）适用于固定费用
申购费用=固定申购金额
净申购金额= 申购金额–固定申购费用
申购份额=净申购金额/申购当日基金份额净值
例：某投资人投资10万元申购本基金基金场外份额，假设申购当日基金份额净值为1.0170元，对应申购费率为1.5%，则其可得到的申购份额为：
净申购金额＝100,000/（1+1.5%）＝98,522.17元
申购费用＝100,000－98,814.23＝1,477.83元
申购份额 ＝ 98,814.23/1.0170 =96,875.29份
即：个人投资者投资 10 万元通过场外申购本基金，对应的申购费率为 1.50%，假设申购当日基金份额净值为 1.0170元，则其可得到96,875.29份基金份额。
例2：某投资人投资10万元申购本基金基金场内份额，假设申购当日基金份额净值为1.0170元，对应申购费率为1.5%，则其可得到的申购份额为：
净申购金额＝100,000/（1+1.5%）＝98,522.17元
申购费用＝100,000－98,814.23＝1,477.83元
申购份额 ＝ 98,814.23/1.0170 =96,875.29份（四舍五入保留到小数点后两位）=96,875（保留至整数位）
退款金额=0.29×1.0170=0.29元
实际净申购金额=98,522.17－0.29=98521.88元
即：个人投资者投资10万元通过场内申购本基金，假设申购当日基金份额净值为 1.0170元，则可得到96,875份基金份额，申购费用为1,477.83元，退款金额为 0.29 元。
3、赎回金额的计算

本基金的赎回金额计算公式为：
赎回费用=赎回份额×赎回当日该类基金份额净值×赎回费率
赎回金额=赎回份额×赎回当日该类基金份额净值(赎回费用
例：某投资人申购本基金基金份额，持有3个月赎回10万份，赎回费率为0.5%，假设赎回当日基金份额净值是1.0170元，则其可得到的赎回金额为：
赎回费用＝100,000×1.0170×0.5%＝508.50元
赎回金额=100,000×1.0170－508.50＝101,191.50元
4、本基金基金份额净值的计算
本基金份额净值的计算，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。在基金份额上市交易前，基金管理人应当至少每周公告一次基金份额净值。在基金份额上市交易后，基金管理人应当在每个工作日的次日，通过其网站、上市的证券交易所、基金份额发售网点以及其他媒介，披露工作日的基金份额净值和基金份额累计净值。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。
（八）拒绝或暂停申购的情形
本基金转为开放式运作以后，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，基金管理人可暂停接受投资人的申购申请。
3、证券/期货交易所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%集中度的情形时。
6、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，从而损害现有基金份额持有人利益的情形。
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，基金管理人应当采取暂停接受基金申购申请的措施。
8、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、6、7、8项暂停申购情形时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒体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。
（九）暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形
本基金转为开放式运作以后，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，基金管理人可暂停接收投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项。
3、证券/期货交易所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、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。
6、当前一个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，基金管理人应当采取延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请的措施。
7、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、7项情形时，基金管理人应在当日报中国证监会备案，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于以撤销。出现暂停赎回或延缓支付赎回款项时，场内赎回申请按照上海证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的有关业务规则办理。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）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、巨额赎回的场外处理方式
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或部分延期赎回。
（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，将自动转入下一个开放日继续赎回，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。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放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。
（3）若本基金发生巨额赎回且发生单个开放日内单个基金份额持有人申请赎回的基金份额占前一开放日基金总份额的比例超过10%时，本基金管理人有权对该单个基金份额持有人超过前一开放日基金总份额10%的赎回申请，与当日其他赎回申请一起，按上述（1）或（2）方式处理。如下一开放日，该单一基金份额持有人剩余未赎回部分仍日超出前一开放日基金总份额10%的，继续按前述规则处理，直至该单一基金份额持有人单个开放日内申请赎回的基金份额占前一开放日基金总份额的比例低于10%。
（4）暂停赎回：连续2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，并应当在指定媒体上进行公告。
3、巨额赎回的场内处理方式
当出现巨额赎回时，场内赎回申请按照上海证券交易所和中国证券登记结算 有限责任公司的有关业务规则办理。
4、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，同时在指定媒体上刊登公告。
（十一）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，基金管理人当日应立即向中国证监会备案，并在规定期限内在指定媒介上刊登暂停公告。
2、如发生暂停的时间为1日，基金管理人应于重新开放日，在指定媒介上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公布最近1个开放日的基金份额净值。
3、若暂停时间超过 1 日，基金管理人可以根据《信息披露办法》自行确定 公告的增加次数，但基金管理人须依照《信息披露办法》，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，或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，届时可不再另行发布重新开放的公告。。
（十二）基金转换
基金管理人可以根据相关法律法规以及本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本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。
（十三）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。
（十四）基金的转托管
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。本基金的转托管包括系统内转托管和跨系统转托管。
1、系统内转托管
（1）系统内转托管是指基金份额持有人将持有的基金份额在登记结算系统内不同销售 机构之间或证券登记系统内不同会员单位之间进行转托管的行为。
（2）在封闭运作期届满转型后，基金份额登记在登记结算系统的基金份额持有人在变 更办理基金份额赎回业务的销售机构时，须办理已持有基金份额的系统内转托管。
（3）在封闭运作期届满转型后，基金份额登记在证券登记系统的基金份额持有人在变 更办理基金份额场内赎回或基金份额上市交易的会员单位时，须办理已持有基金份额的系统内转托管。
2、跨系统转托管
（1）跨系统转托管是指基金份额持有人将持有的基金份额在登记结算系统和证券登记 系统之间进行转托管的行为。
（2）跨系统转托管的具体业务按照中国证券登记结算有限责任公司及上海证券交易所 的相关规定办理。
（3）基金销售机构可以按照相关规定向基金份额持有人收取转托管费。
（4）处于募集期内的基金份额不能办理跨系统转托管。
（十五）定期定额投资计划
在封闭运作期届满转型后，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。
（十六）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与支付。法律法规另有规定的除外。
（十七）基金份额的转让
在法律法规允许且条件具备的情况下，基金管理人可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中请并由登记机构办理基金份额的过户登记。基金管理人拟受理基金份额转让业务的，将提前公告，基金份额持有人应根据基金管理人公告的业务规则办理基金份额转让业务。
（十八）其他业务
如相关法律法规允许基金管理人办理基金份额的质押业务或其他基金业务，基金管理人可制定相应的业务规则并开展相关业务，并依照《信息披露办法》的有关规定进行公告。

九、基金份额的上市交易

一、基金份额的上市
1、上市交易的地点
上海证券交易所。
2、上市交易的时间
基金合同生效后，具备下列条件的，基金管理人可依据《上海证券交易所证券投资基金上市规则》，向上海证券交易所申请本基金份额上市：
（1）基金募集金额不低于2 亿元人民币；
（2）基金份额持有人不少于1,000 人；
（3）《上海证券交易所证券投资基金上市规则》规定的其他条件。
3、上市交易公告
基金上市前，基金管理人应与上海证券交易所签订上市协议书。基金获准在上海证券交易所上市的，基金管理人应依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上刊登上市交易公告书。
二、上市交易的规则
本基金基金份额在上海证券交易所的上市交易需遵循《上海证券交易所证券投资基金上市规则》、《上海证券交易所交易规则》等其他有关规定。
三、上市交易的费用
基金份额上市交易的费用按照上海证券交易所有关规定办理。
四、上市交易的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市
本基金基金份额的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市按照相关法律法规、中国证监会及上海证券交易所的相关规定执行。
五、本基金转为普通上市型开放式基金（LOF）后，基金份额在上海证券交易所上市交易的相关规定执行。
六、本基金转为普通上市型开放式基金（LOF）后，基金份额在上海证券交易所上市交易的规则等相关规定内容进行调整的，基金合同相应予以修改，且此项修改无须召开基金份额持有人大会审议。
七、若上海证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司增加了基金上市交易的新功能，本基金管理人可以在履行适当的程序后为本基金增加办理相应的新业务。

十、基金的投资

（一）封闭运作期投资目标
本基金将灵活运用多种投资策略，通过充分挖掘科技创新相关上市公司的投资机会以及债券投资，力争为基金份额持有人创造长期稳健的投资回报。
（二）封闭运作期投资范围
本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（含主板、中小板、创业板、科创板及其他中国证监会允许的其他证券市场品种）、债券（包括国债、政策性金融债、中央银行票据、信用等级在 AAA （含）以上的债券（除短期融资券）、非金融企业债务融资工具及信用等级在A-1的短期融资券等）、债券回购、回业存单、银行存款（包含协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。
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 0%－ 100%，其中投资于科创主题的证券资产比例不低于非现金基金资产的80%，封闭期内每个交易日日终在扣除股指期货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。
（三）封闭运作期投资策略
在封闭运作期内，本基金主要包括资产配置策略、战略配售策略、固定收益投资策略及其他策略等。
（1）资产配置策略
本基金将密切关注股票、债券市场的运行状况与风险收益特征，通过自上而下的定性分析和定量分析，综合分析宏观经济形势、国家政策、市场流动性和估值水平等因素，判断金融市场运行趋势和不同资产类别在经济周期的不同阶段的相对投资价值，对各大类资产的风险收益特征进行评估，制定股票、债券、现金等大类资产之间的配置比例、调整原则和调整范围。
本基金在3年封闭运作期内，除本基金基金合同生效日起6个月的建仓期以及本基金封闭期结束前六个月的期间以外，本基金通过战略配售投资的股票投资比例主要依据股票基准指数整体估值水平在历史数据中的分位值排位，相应调整仓位，有效控制下行风险。其中，股票基准指数为中证500指数，估值水平主要使用股票基准指数的市净率P/B。如果由于中购赎回、市场波动等原因致使通过战略配售投资外的股票投资比例连续10个工作日不符合目标配置要求，基金管理人应在第 10 个工作日当日起 20 个工作日内使基金的股票投资比例达到下述约定，但由于本基金持有的战略配售股票处于锁定期无法卖出的情形除外：

上月末中证500指数市净率P/B在过去10年每日市净率P/B中的分位数	本月通过战略配售投资外的股票资产占基金资产净值的比例下限	本月通过战略配售投资外的股票资产占基金资产净值的比例上限
10%分位及以上	0%	40%
10%分位至25%分位（含）	15%	60%
25%分位至75%分位（含）	35%	80%
75%分位以下	50%	100%

注：
1、“10%分位”指将截止上月末过去10年中证500指数市净率P/B从大到小进行排序，排位在该数列的前10%。
2、“10%分位至25%分位（含）”指将截止上月末过去10年中证500指数市净率P/B从大到小进行排序，排位在该数列的前10%至前25%（含25%）区间内。
3、“25%分位至75%分位（含）”指将截止上月末过去10年中证500指数市净率P/B从大到小进行排序，排位在该数列的前25%至前75%（含75%）区间内。
4、“75%分位以下”指将截止上月末过去10年中证500指数市净率P/B从大到小进行排序，排位在该数列的后25%。
本基金将科学把握建仓节奏，遵守投资策略，适时控制仓位，力求通过仓位控制进一步降低基金资产收益的波动性。如果今后法律法规发生变化，或者指数编制单位停止计算编制上述指数或更改指数名称、或者市场上出现更加适合用于本基金上述策略的指数出现或随着市场环境、相关政策的不断变化，上述策略或 使用的基准指数发生不再适用，在履行适当程序后，本基金将根据实际情况进行相应调整并及时公告。
（2）科创主题股票的定义
本基金主要投资于具备科技创新特性，与科技创新主题相关的行业以及受益于科技创新相关政策颁布实施以及相关技术进步所带来的上市企业。科技创新特性主要体现为面向世界科技前沿、面向经济主战场、面向国家重大需求。
基于科技创新主题，本基金主要投资以下领域的企业：
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。
（3）科创板股票投资策略
针对科创板上市股票的投资分析将基于科创板上市要求的5套标准，按照不同的公司类型选用不同指标进行分析：
标准1：“市值+净利润”或“市值+净利润+营业收入”，预计市值不低于人民币10亿元，最近两年净利润均为正且累计净利润不低于人民币5,000万元；预计市值不低于人民币10亿元，最近一年净利润为正且营业收入不低于人民币1亿元；
满足“市值+净利润”要求的企业，可能已经具备较稳定的净利润水平，未来业绩和净利率可预测性高、行业也逐渐偏成熟型，此类企业用P/E或EV/EBITDA进行估值分析；
满足“市值+净利润+营业收入”要求的企业，可能有已经稳定的主营业务，只是盈利水平波动幅度较大，此类公司也适用于P/E估值法研究；如果利润少或者波动大但营业收增速快，也可适用于P/S（总市值/销售额）和EV/SALES估值法；此类公司分析的核心在于营业收入的计算。对于部分公司而言，未来营业收入测算可利用预计的年复合增长率进行计算；对于另外一部分公司而言，未来营业收入需通过微观层面的指标进行详细计算，如电商平台、在线旅游服务公司等。
标准2：“市值+营业收入+研发投入”，预计市值不低于人民币15亿元，最近一年营业收入不低于人民币2亿元，最近三年研发投入合计占最近三年营业收入的比例不低于15%；
标准3：“市值+营业收入+经营活动现金流”，预计市值不低于人民币20亿元，最近一年营业收入不低于人民币3亿元，最近三年经营活动产生的现金流量净额累计不低于人民币1亿元；
满足“标准2：市值+营业收入+研发投入”和“标准3：市值+营业收入+经营活动现金流”要求的企业，适用于成长股典型的估值分析方法，如P/PCF和EV/OCF；P/PCF适用于盈利水平波动大但产生现金的能力稳定且自由现金流为正的公司，以及将公司运营目标聚焦于自由现金流的公司；而OCF和PCF相比，OCF可操控空间较小，更能真实反映企业经营效益。
标准4：“市值+营业收入”，预计市值不低于人民币30亿元，最近一年营业收入不低于人民币3亿元；
满足“市值+营业收入”要求的企业，一般是利润少或者波动大但营收增速快，可能是高营业收入增速与负净利润并存的企业，也可能是采用的盈利水平评判指标并非传统的利润表项目，而是一些特殊的指标，比如电商平台的GMV。多采用P/S（总市值/销售额）和EV/SALES估值进行分析研究。
标准5：“市值+技术优势”，预计市值不低于人民币40亿元，主要业务或产品需经国家有关部门批准，市场空间大，目前已取得阶段性成果，医药行业企业至少有一项核心产品获准开展二期临床试验，其他符合科创板定位的企业需具备明显的技术优势并满足相应条件。
满足“市值+技术优势”要求的，目前主要是创新药企业，创新药企属于发展生命周期较长，存在高投资高风险高回报的生物科技行业公司，创新药板块还存在盈利、不同管线研发进程不同、商品化可能性不同，所带来的市场价值也不同，传统的 DCF估值没有办法准确的对生物科技公司进行估值，需要利用管线估值法，根据不同业务管线进行计算，可以带来更准确的估值，进而驱动进一步投资。
除上述分析指标外，基金管理人还将根据科创板上市规则的变化及市场环境的不同，灵活调整具体的分析指标及研究框架。
科创板股票的选股标准、估值和定价的策略具体如下：
1）选股标准；
在科创板上市公司中，本基金优先选择投资于市场空间逐步放大、稳态市场空间远超目前行业整体水平、具备较强的竞争壁垒、拥有竞争对手长期难以挑战的市场地位的公司。科创板公司主要处于公司生命周期的初创和成长阶段，初创期公司的投入资本回报率（ROIC）小于加权平均资本成本（WACC），成长期的公司的投入资本回报率开始攀升，逐步超越加权平均资本成本，进而达到顶峰并维持一段时间。科创板股票投资策略的核心是研究和研判公司投入资本回报率的最大值以及持续性，以及实现这上述两点的确定性。基金管理人将通过深入研究分析公司的市场空间、竞争壁垒核心驱动力和外部环境变化带来的公司发展路径变动等，明确科创板上市公司的资本回报率最大值以及持续性力的确定性水平。
在行业研究或公司财务分析上，将通过以下分析几点选择科创板股票：
① 收入、资本性支出（Capital Expenditure）、现金流、销量、用户数、政策等变化趋势及重要节点；
② 市场空间驱动因素的动态变化，自由现金流充裕度；
③ 投入资本回报率提升速度和存续时间。
2）估值和定价
商业模式相对稳定的成熟型公司适用于可以公司市盈率（PE）估值法。高速成长型公司辅以市盈率相对盈利增长比率（PEG）估值法。面资产成长型公司兼顾企业价值倍数（EV/EBITDA）方法，还原企业折旧前的盈利水平进行估值。对于盈利偏弱但现金流优秀的企业的通用估值方法。企业估值水平受到公司的业务属性的影响，可能带来PEG 折价或溢价。
① 成熟型和成长型企业：PE、PEG 是最常见的估值方法。以企业盈利为基数，考虑盈利增速的PE、PEG 法适用于成熟型和成长型企业的通用估值方法。企业估值水平受到公司的业务属性的影响，可能带来PEG 折价或溢价。
② 成长型企业：以税息折旧及