大成科创主题3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书摘要

基金管理人:大成基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
二〇二〇年八月

重要提示

大成科创主题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")经中国证监会2019年6月6日证监许可【2019】1012号文予以注册。基金合同于2019年7月18日正式生效。

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

证券投资基金(以下简称"基金")是一种长期投资工具,其主要功能是分散投资,降低投资单一证券所带来的个别风险。基金不同于银行储蓄和债券等能够提供固定收益预期的金融工具,投资者购买基金,既可能按其持有份额分享基金投资所产生的收益,也可能承担基金投资所带来的损失。

基金分为股票基金、混合基金、债券基金、货币市场基金等不同类型,投资者投资不同类型的基金将获得不同的收益预期,也将承担不同程度的风险。一般来说,基金的收益预期越高,投资者承担的风险也越大。

本基金是混合型基金,预期收益和预期风险高于货币市场基金和债券型基金,低于股票型基金。

本基金可以投资科创板股票,投资面临科创板市场的特殊风险,包括但不限于流动性风险、退市风险、投资集中风险等。

流动性风险:科创板投资者门槛较高,流动性可能弱于A股其他板块,且机构投资者可能在特定时段对科创板个股形成一致性预期,存在基金持有股票不能正常成交的风险。

退市风险:科创板执行比A股其他板块更严格的退市标准,且不再设置暂停上市、恢复上市和重新上市环节,上市公司退市风险更大,可能对基金净值造成不利影响。

投资集中度风险:因科创板上市企业均为科技创新成长型,其商业模式、盈利风险及业绩波动等特征较为相似,基金难以通过分散投资降低投资风险,若股票价格同向波动,将引起基金净值波动。

本基金投资于证券市场,基金净值会因证券市场波动等因素产生波动。投资者在投资本基金前,应仔细阅读本基金的招募说明书及基金合同,全面认识本基金的风险收益特征和产品特性,并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断基金是否和投资者的风险承受能力相适应,充分考虑自身的风险承受能力,理性判断市场,对申购基金的意愿、时机、数量等投资行为做出独立、谨慎决策,获得基金投资收益,亦承担基金投资中出现的各类风险。

基金在投资运作过程中可能面临各种风险,既包括因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险、个别证券特有的非系统性风险、也包括基金自身的管理风险、技术风险和合规风险等。巨额赎回风险是开放式基金所特有的一种风险,若本基金单个开放日内的基金份额净赎回申请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,投资者将可能无法及时赎回持有的全部基金份额。

基金管理人承诺依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现,基金管理人管理的其他基金的业绩也不构成对本基金业绩表现的保证。投资有风险,投资人认购(或申购)基金时,请仔细阅读本基金的基金产品资料概要、招募说明书及基金合同。基金管理人提醒投资者基金投资的"买者自负"原则,在做出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险,由投资者自行负担。

本基金基金产品资料概要编制、披露与更新要求,自《信息披露办法》实施之日起一年后开始执行。

投资者应当通过本基金管理人或代销机构购买本基金,基金代销机构名单详见本基金份额发售公告。

本更新的招募说明书所载内容截止日为2020年8月18日(其中人员变动信息以公告日为准),有关财务数据和基金净值表现截止日为2020年6月30日,所列财务数据未经审计。

一、基金管理人
(一)基金管理人概况
名称:大成基金管理有限公司
住所:深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦32层
办公地址:深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦32层
设立日期:1999年4月12日
注册资本:贰亿元人民币
股权结构:公司股东为中泰信托有限责任公司(持股比例50%)、中国银河投资管理有限公司(持股比例25%)、光大证券股份有限公司(持股比例25%)三家公司。
法定代表人:吴庆斌
电话:0755-83183388
传真:0755-83199588
联系人:肖剑
(二)主要人员情况
1. 董事会成员
吴庆斌先生,董事长,清华大学法学及工学双学士。先后任职于西南证券飞虎网、北京国际信托有限责任公司、广联(南宁)投资股份有限公司等机构。2012年7月至今,任广联(南宁)投资股份有限公司董事长;2012年任职于中泰信托有限责任公司,2013年6月至今,任中泰信托有限责任公司董事长。2019年11月3日起任大成基金管理有限公司董事长。
翟斌先生,副董事长,北京大学经济学硕士。曾在深圳市建材集团、君安证券、新华信托、招商证券股份有限公司等多家机构任职,2017年8月加入光大证券股份有限公司,历任机构业务总部董事总经理、机构业务总部总经理兼私募业务部总经理,现任光大证券股份有限公司机构业务总部总经理。2019年11月3日起任大成基金管理有限公司副董事长。
谭晓冈先生,董事、总经理,哈佛大学公共管理硕士。曾在财政部、世界银行、全国社保基金理事会任职。2016年7月加入大成基金管理有限公司,2016年12月至2019年8月任大成国际资产管理有限公司总经理,2017年2月至2019年6月任大成基金管理有限公司副总经理,2019年7月起任大成基金管理有限公司总经理,2019年8月起任大成国际资产管理有限公司董事长。
李超女士,董事,华中科技大学管理学学士。2007年6月至2008年5月,任职于深圳晨星咨询有限责任公司;2008年7月至2011年8月,任德勤华永会计师事务所高级审计员;2011年8月至2018年5月,任平安信托有限责任公司稽核监察部模型团队团队经理;2018年5月至今,任中泰信托有限责任公司稽核审计部总经理。
郭向东先生,董事,中国人民大学金融学在职研究生。1996年至1998年在中国新技术创业投资公司负责法律事务;1998年至2000年在中国华融信托投资公司负责法律事务;2000年至2006年任职于中国银河证券有限责任公司法律部;2007年1月加入中国银河投资管理有限公司,任职于负债处置部;2007年7月至2013年2月,历任人力资源部负责人、风险控制部总经理、监事会办公室主任、审计部负责人,曾兼任北京银河吉星创业投资有限责任公司监事;2013年2月起任资产管理部总经理兼行政负责人。
杨晓帆先生,独立董事,香港浸会大学工商管理学士。2006年至2011年,任惠理集团有限公司高级投资分析师兼投资组合经理;2012年至2016年,任FALCON EDGE CAPITAL LP合伙人和大中华区负责人;2016年至今,任晨曦投资管理公司(ANATOLE INVESTMENT MANAGEMENT)主要创始人。
胡维翊先生,独立董事,波士顿大学国际银行与金融法硕士。1991年7月至1994年4月,任全国人大常委会办公厅研究室政治组主任科员;1994年5月至1998年8月,任北京乾坤律师事务所合伙人;2000年2月至2001年4月任北京市中凯律师事务所律师;2001年5月至今,历任北京市天铎律师事务所副主任、主任,现任北京市天铎律师事务所合伙人。
金李先生,独立董事,美国麻省理工学院金融学博士。现任北京大学光华管理学院副院长,九三学社中央常委、全国政协委员、经济委员会委员。曾在美国哈佛大学商学院任教十多年,并兼任哈佛大学费正清东亚研究中心执行理事。
黄隽女士,独立董事,中国人民大学经济学博士。现任中国人民大学应用经济学院教授、副院长。研究方向为货币政策、商业银行理论与政策、艺术品金融,出版多本专著,在经济、金融类学术核心期刊上发表多篇学术论文,具有丰富的教学和科研经验。
2.监事会成员
许国平先生,监事会主席,中国人民大学国民经济学博士。1987年至2004年先后任中国人民银行国际司处长、东京代表处代表、研究局调研员、金融稳定局办公室处长;2005年6月至2008年1月任中央汇金投资有限责任公司建行股权管理部主任;2005年8月至2016年11月任中国银河金融控股有限责任公司董事、副总经理、党委委员;2007年2月至2016年11月任中国银河投资管理有限公司董事长、总裁、党委书记;2010年6月至2014年3月兼任北京银河吉星创业投资有限责任公司董事长;2007年1月至2015年6月任中国银河证券股份有限公司董事;2014年1月至2017年6月任银河基金管理有限公司党委书记;2014年3月至2018年1月任银河基金管理有限公司董事长(至2017年11月)及法定代表人;2018年3月加入大成基金管理有限公司,任监事会主席。
邓金煌先生,职工监事,上海财经大学管理学硕士。2001年9月至2003年9月任职于株洲电力局;2003年9月至2006年1月攻读硕士学位;2006年4月至2010年5月任华为三康技术有限公司人力资源专员;2010年5月至2011年9月任招商证券人力资源部高级经理;2011年9月至2016年8月任融通基金管理有限公司综合管理部总监助理;2016年8月加入大成基金管理有限公司,任人力资源部副总监;现任大成基金管理有限公司人力资源部总监。
陈焓女士,职工监事,吉林大学法学硕士。2005年8月至2008年3月任金杜律师事务所深圳分所公司证券部律师;2008年3月加入大成基金管理有限公司,历任监察稽核部律师、总监助理;现任大成基金管理有限公司监察稽核部副总监。
3.高级管理人员情况
吴庆斌先生,董事长。简历同上。
谭晓冈先生,总经理。简历同上。
肖剑先生,副总经理,哈佛大学公共管理硕士。曾任职深圳市南山区委(政府)办公室副主任,深圳市广聚能源股份有限公司副总经理兼广聚投资控股公司执行董事、总经理,深圳市人民政府国有资产监督管理委员会副处长、处长。2014年11月加入大成基金管理有限公司,2015年1月起任公司副总经理,2019年8月起任大成国际资产管理有限公司总经理。
温智敏先生,副总经理,哈佛大学法学博士。曾任职于美国Hunton & Williams国际律师事务所纽约州执业律师。中银国际投行业务副总裁,香港三山投资公司董事总经理,标准银行亚洲有限公司董事总经理兼中国投行业务主管。2015年4月加入大成基金管理有限公司,任首席战略官,2015年8月起任公司副总经理。
周立新先生,副总经理兼首席信息官,中央党校经济管理本科。曾任新疆精河县党委办公室机要员、新疆精河县团委副书记、新疆精河县人民政府体改委副主任、新疆精河县八家户农场党委书记、新疆博尔塔拉蒙古自治州团委副书记及少工委主任、江苏省铁路发展股份有限公司办公室主任、江苏省铁路发展股份有限公司党委委员及江苏省铁路实业集团有限公司控股企业负责人、中国华闻投资控股有限公司燃气战略管理部项目经理。2005年1月加入大成基金管理有限公司,历任客户服务中心总监、市场部副总监、机构理财部总监、上海分公司总经理、客户服务部总监兼上海分公司总经理、公司助理总经理,2015年8月起任公司副总经理,2019年5月起兼任首席信息官。
姚余栋先生,副总经理,英国剑桥大学经济学博士。曾任职于国家经贸委企业司、美国花旗银行伦敦分行。曾任世界银行咨询顾问,国际货币基金组织国际资本市场部和非洲部经济学家,原黑龙江省招商局副局长,黑龙江省商务厅副厅长,中国人民银行货币政策司副司长,中国人民银行金融研究所所长。2016年9月加入大成基金管理有限公司,任首席经济学家,2017年2月起任公司副总经理。
赵冰女士,督察长,清华大学工商管理硕士。曾供职于中国证券业协会资格管理部、专业联络部、基金公司会员部,曾任中国证券业协会分析师委员会委员、基金销售专业委员会委员。曾参与基金业协会筹备组的筹备工作。曾先后任中国证券投资基金业协会投教与媒体公关部负责人、理财及服务机构部负责人。2017年7月加入大成基金管理有限公司,2017年8月起任公司督察长。
4. 基金经理
李博:工学硕士。证券从业年限10年。2009年9月至2010年8月就职于韩国SK Telecom首尔总部。2010年8月至2011年5月就职于国信证券经济研究总部,2011年5月起加入大成基金管理有限公司,曾担任电子行业、互联网传媒行业分析师、基金经理助理、股票投资部总监助理,现任股票投资部副总监。2015年4月21日起任大成互联网思维混合型证券投资基金基金经理。2015年9月29日起任大成高新技术产业股票型证券投资基金基金经理。2016年11月4日起任大成精选增值混合型证券投资基金基金经理。2019年7月18日起任大成科创主题3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。国籍:中国
谢家乐:工学硕士。证券从业年限8年。曾任华泰证券股份有限公司研究所研究员。2014年6月加入大成基金管理有限公司,曾担任研究部研究员、大成睿景灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理。2019年8月6日起任大成国家安全主题灵活配置混合型证券投资基金、大成科创主题3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2020年4月29日起任大成科技创新混合型证券投资基金基金经理。2020年7月16日起任大成创业板两年定期开放混合型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。国籍:中国
5. 公司投资决策委员会(股票投资)
公司股票投资决策委员会由8名成员组成,设股票投资决策委员会主席1名,其他委员7名,名单如下:
温智敏,公司副总经理,股票投资决策委员会主席;徐彦,基金经理,股票投资部总监,股票投资决策委员会委员;苏秉毅,基金经理,数量与指数投资部副总监,股票投资决策委员会委员;戴军,基金经理,研究部副总监,股票投资决策委员会委员;李博,基金经理,股票投资部副总监,股票投资决策委员会委员;刘旭,基金经理,股票投资部副总监,股票投资决策委员会委员;于雷,交易管理部副总监,股票投资决策委员会委员;郑刚,风险管理部总监,股票投资决策委员会委员。
上述人员之间不存在亲属关系。

二、基金托管人
一、基金托管人情况
(一)基本情况
名称:中国建设银行股份有限公司(简称:中国建设银行)
住所:北京市西城区金融大街25号
办公地址:北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
法定代表人:田国立
成立时间:2004年09月17日
组织形式:股份有限公司
注册资本:贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整
存续期间:持续经营
基金托管资格批文及文号:中国证监会证监基字[1998]12号
联系人:田青
联系电话:(010)6759 5096
中国建设银行成立于1954年10月,是一家国内领先、国际知名的大型股份制商业银行,总部设在北京。本行于2005年10月在香港联合交易所挂牌上市(股票代码939),于2007年9月在上海证券交易所挂牌上市(股票代码601939)。
2018年末,集团资产规模23.22万亿元,较上年增长4.96%。2018年度,集团实现净利润2,556.26亿元,较上年增长4.93%;平均资产回报率和加权平均净资产收益率分别为1.13%和14.04%;不良贷款率1.46%,保持稳中有降;资本充足率17.19%,保持领先同业。
2018年,本集团先后荣获新加坡《亚洲银行家》"2018年中国最佳大型零售银行奖"、"2018年中国全面风险管理成就奖";英国《环球金融》"全球贸易金融最佳银行"、《银行家》"2018最佳金融创新奖"、《金融时报》"2018年全龙奖—年度最佳普惠金融服务银行"等多项重要奖项。本集团同时获《银行家》、香港《亚洲货币》杂志"2018年中国最佳银行"称号,并在中国银行业协会2018年"陀螺"评价中排名全国性商业银行第一。
中国建设银行总行设资产托管业务部,下设综合与合规管理处、基金托管处、证券托管处、理财信托股权托管处、养老金托管处、全球托管处、新兴业务处、运营管理处、跨境托管运营处、存管业务处、合规监督处等11个职能处室,在安徽合肥设有托管运营中心,在上海设有托管运营中心上海分中心,共有员工300余人。自2007年起,托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计,并已经成为常规化的内控工作手段。
(二)主要人员情况
蔡亚蓉,资产托管业务部总经理,曾先后在中国建设银行总行资金计划部、信贷经营部、公司业务部以及中国建设银行重组改制办公室任职,并在总行公司业务部担任领导职务。长期从事公司业务,具有丰富的客户服务和业务管理经验。
龚毅,资产托管业务部资深经理(专业技术一级),曾就职于中国建设银行北京市分行国际部、营业部并担任副行长,长期从事信贷业务和集团客户业务等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。
黄秀莲,资产托管业务部资深经理(专业技术一级),曾就职于中国建设银行总行会计部,长期从事托管业务管理等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。
郑绍平,资产托管业务部副总经理,曾就职于中国建设银行总行投资托管服务部、委托代理部、战略客户部,长期从事客户服务、信贷业务管理等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。
原玎,资产托管业务部副总经理,曾就职于中国建设银行总行国际业务部,长期从事海外机构及海外业务管理、境内外汇业务管理、国外金融机构客户营销拓展等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。
(三)基金托管业务经营情况
作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行,中国建设银行一直秉持"以客户为中心"的经营理念,不断加强风险管理和内部控制,严格履行托管人的各项职责,切实维护资产持有人的合法权益,为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展,中国建设银行托管资产规模不断扩大,托管业务品种不断增加,已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、(R)QFII、(R)QDII、企业年金、存托业务等产品在内的托管业务体系,是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至2019年二季度末,中国建设银行已托管924只证券投资基金。中国建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平,赢得了业内的高度认同。中国建设银行先后9次获得《全球托管人》"中国最佳托管银行"、4次获得《财资》"中国最佳次托管银行"、连续5年获得中债登"优秀资产托管机构"等奖项,并在2016年被《环球金融》评为中国市场唯一一家"最佳托管银行"、在2017年荣获《亚洲银行家》"最佳托管系统实施奖"。
二、基金托管人的内部控制制度
(一)内部控制目标
作为基金托管人,中国建设银行严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和本行内有关管理规定,守法经营、规范运作、严格监察,确保业务的稳健运行,保证基金财产的安全完整,确保有关信息的真实、准确、完整、及时,保护基金份额持有人的合法权益。
(二)内部控制组织结构
中国建设银行设有风险与内控管理委员会,负责全行风险管理与内部控制工作,对托管业务风险控制工作进行检查指导。资产托管业务部配备了专职内控合规人员负责托管业务的内控合规工作,具有独立行使内控合规工作职权和能力。
(三)内部控制制度及措施
资产托管业务部具备系统、完善的制度控制体系,建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程,可以保证托管业务的规范操作和顺利进行;业务人员具备从业资格;业务管理严格实行复核、审核、检查制度,授权工作实行集中控制,业务印章按规程保管、存放、使用,账户资料严格保管,制约机制严格有效;业务操作区专门设置,封闭管理,实施音像监控;业务信息由专职信息披露人负责,防止泄密;业务实现自动化操作,防止人为事故的发生,技术系统完整、独立。
三、基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序
(一)监督方法
依照《基金法》及其配套法规和基金合同的约定,监督所托管基金的投资运作。利用自行开发的"新一代托管应用监督子系统",严格按照现行法律法规以及基金合同规定,对基金管理人运作基金的投资比例、投资范围、投资组合等情况进行监督。在日常为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中,对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对各基金费用的提取与开支情况进行检查监督。
(二)监督流程
1.每工作日按时通过新一代托管应用监督子系统,对各基金投资运作比例控制等情况进行监控,如发现投资异常情况,向基金管理人进行风险提示,与基金管理人进行情况核实,督促其纠正,如有重大异常事项及时报告中国证监会。
2.收到基金管理人的划款指令后,对指令要素等内容进行核查。
3.通过技术或非技术手段发现基金涉嫌违规交易,电话或书面要求基金管理人进行解释或举证,如有必要将及时报告中国证监会。

三、相关服务机构
(一)直销机构
名称:大成基金管理有限公司
住所:深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦32层
办公地址:深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦32层
法定代表人:吴庆斌
电话:0755-83183388
传真:0755-83199588
联系人:教姣
公司网址:www.dcfund.com.cn
大成基金客户服务热线:400-888-5558(免长途固话费)
大成基金深圳投资理财中心:
地址:深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦32层
联系人:吴海灵、关志玲、白小雪
电话:0755-22223556/22223177/22223555
传真:0755-83195235/83195242/83195232
(二)代销机构
(1)中国建设银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区金融大街25号
办公地址:北京市西城区闹市口大街1号长安兴融中心1号楼
法定代表人:田国立
联系人:王嘉朔
电话::010-66275654
传真:010-66275654
客服电话:95533
网址:www.ccb.com
(2)平安银行股份有限公司
注册地址:中国深圳市深南中路1099号
法定代表人:谢永林
电话:021-38637673
传真:0755-22197701
联系人:张莉
客户服务热线:95511-3
网址:http://bank.pingan.com
(3)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
办公地址:北京市西城区复兴门内大街55号
法定代表人:陈四清
客服电话:95588
联系人:洪渊
联系电话:010-66105799
传真:010-66107914
网址:www.icbc.com.cn
(4)中国农业银行股份有限公司
注册地址:北京市东城区建国门内大街69号
办公地址:北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座F9
法定代表人:周慕冰
联系人:贺倩
联系电话:010-66060069
传真:010-68121816
客服电话:95599
网址:www.abchina.com
(5)中国银行股份有限公司
注册地址:北京西城区复兴门内大街1号
办公地址:北京西城区复兴门内大街1号
法定代表人:刘连舸
联系人:王永民
客服电话:95566
电话:010-66594896
传真:010-66594942
网址:www.boc.cn
(6)交通银行股份有限公司
注册地址:上海市浦东新区银城中路188号
办公地址:上海市浦东新区银城中路188号
法定代表人:任德奇
联系人:王菁
电话:021-58781234
传真:021-58408483
客服电话:95559
网址:www.bankcomm.com
(7)中信银行股份有限公司
注册地址:北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座
法定代表人:李庆萍
电话:010-89937369
客服电话:95558
联系人:王晓琳
联系电话:010-89937325
传真:010-65550827
网址:www.citicbank.com
(8)上海浦东发展银行股份有限公司
注册地址:上海市浦东新区浦东南路500号
办公地址:上海市中山东一路12号
法定代表人:吉晓辉
联系人:高天、虞谷云
客服热线:95528
电话:021-61618888
传真:021-63604199
网址:www.spdb.com.cn
(9)兴业银行股份有限公司
办公地址:福州市五一中路元洪大厦25层
法定代表人:高建平
电话::021-52629999
传真:021-62569070
联系人:刘玲
客服电话:95561
网址:www.cib.com.cn
(10)中国光大银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区太平桥大街25号、甲25号中国光大中心
办公地址:北京市西城区太平桥大街25号中国光大中心
法定代表人:李晓鹏
客服电话:95595
联系人:石立平
电话:010-63639180
传真:010-68560312
网址:www.cebbank.com
(11)中国民生银行股份有限公司
注册地址:北京市东城区正义路4号
办公地址:北京市西城区复兴门内大街2号
法定代表人:洪崎
客服电话:95568
联系人:穆婷
电话:010-58560666
传真:010-83914283
网址:www.cmbc.com.cn
(12)中国邮政储蓄银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区金融大街3号
办公地址:北京市西城区金融大街3号
法定代表人:李国华
客服电话:95580
传真:010-66415194
联系人:王硕
网址:www.psbc.com
(13)北京银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区金融大街甲17号首层
办公地址:北京市西城区金融大街丙17号
法定代表人:张东宁
联系人:周黎
电话:010-66224815
传真:010-66226045
客服电话:95526
网址:www.bankofbeijing.com.cn
(14)南京银行股份有限公司
注册地址:南京市玄武区中山路288号
办公地址:南京市玄武区中山路288号
法定代表人:胡升荣
客服电话:95302
网站:www.njcb.com.cn
(15)上海银行股份有限公司
注册地址:上海市银城中路168号
法人代表:金煜
办公地址:上海市银城中路168号
联系人:汤征程
客服电话:95594
网站:www.bankofshanghai.com
(16)宁波银行股份有限公司
注册地址:宁波市江东区中山东路294号
法定代表人:陆华裕
联系人:胡技勋
电话:021-63586210
传真:021-63586215
客服电话:96528(宁波、杭州、南京、深圳、苏州、温州)、962528(北京、上海)
网址:www.nbcb.com.cn
(17)上海农村商业银行股份有限公司
注册地址:上海市浦东新区浦东大道981号
办公地址:上海市黄浦区中山东二路70号
法定代表人:冀光恒
客服电话:021-962999、400-696-2999
电话:021-61899999
传真:021-50105124
联系人:施传荣
网址:www.shrcb.com
(18)东莞银行股份有限公司
注册地址:东莞市莞城区体育路21号
法定代表人:卢国锋
联系人:朱杰霞
电话:0769-22865177
传真:0769-23156406
客服电话:956033
网址:www.dongguanbank.cn
(19)中信期货有限公司
注册地址:深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座13层1301-1305室、14层
办公地址:深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座13层1301-1305室、14层
法定代表人:张皓
联系人:刘宏莹
联系电话:010-60833754
传真:0755-83217421
客服电话:400-990-8826
网址:www.citicsf.com
(20)中国银河证券股份有限公司
注册地址:北京市西城区金融大街35号2-6层
法定代表人:陈共炎
客服电话:4008-888-888
联系人:辛国政
联系电话:010-83574507
传真:010-83574807
网址:www.chinastock.com.cn
(21)民生证券股份有限公司
地址:北京市东城区建国门内大街28号民生金融中心A座
法定代表人:余政
客服电话:95376
联系人:赵明
联系电话:010-85127622
联系传真:010-85127917
公司网址:www.mszq.com
(22)江海证券有限公司
办公地址:哈尔滨市香坊区赣水路56号
法人代表:孙名扬
电话:0451-85863726
客服热线:956007
联系人:周俊
网址:www.jhzq.com.cn
(23)渤海证券股份有限公司
注册地址:天津市经济技术开发区第二大街42号写字楼101室
法定代表人:王春峰
联系人:蔡霆
电话:022-28451991
传真:022-28451892
客服电话:4006515988
网址:WWW.EWWW.COM.CN
(24)国都证券股份有限公司
注册地址:北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层
法定代表人:王少华
客服电话:400-818-8118
联系人:黄静
电话:010-84183333
传真:010-84183311-3389
网址:www.guodu.com
(25)华融证券股份有限公司
注册地址:北京市西城区金融大街8号
法定代表人:祝献忠
联系人:李慧灵
联系电话:010-58315221
传真:010-58568062
客服电话:010-58568118、400-898-9999
网址:www.hrsec.com.cn
(26)中泰证券股份有限公司
办公地址:山东省济南市经十路20518号
法定代表人:李玮
客服电话:95538
联系人:吴阳
电话:0531-81283938
传真:0531-81283900
网址:www.zts.com.cn
(27)海通证券股份有限公司
注册地址:上海市广东路689号
法定代表人:周杰
客服电话:95553、400-888-8001
联系人:李笑鸣
电话:021-23219000
传真:021-63602722
网址:www.htsec.com
(28)兴业证券股份有限公司
住所:福州市湖东路268号
办公地址:上海市浦东新区长柳路36号
法定代表人:杨华辉
电话:021-38565547
联系人:乔琳雪
网址:www.xyzq.com.cn
客户服务电话:95562
(29)光大证券股份有限公司
办公地址:上海市静安区新闸路1508号
法定代表人:刘秋明
客服电话:95525
联系人:龚俊涛
电话:021-22169999
传真:021-22169134
网址:www.ebscn.com
(30)国泰君安证券股份有限公司
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区商城路618号
办公地址:上海市静安区南京西路768号国泰君安大厦
法定代表人:贺青
联系电话:021-38676666
传真:021-38670666
联系人:钟伟镇
网址:www.gtja.com
服务热线:95521/4008888666
(31)申万宏源证券有限公司
通讯地址:上海市徐汇区长乐路989号40层
法定代表人:李梅
客服电话:95523或4008895523
联系人:曹晔
电话:021-54033888
传真:021-54038844
网址:www.sywg.com
(32)申万宏源西部证券有限公司
注册地址:新疆乌鲁木齐市高新区(新市区)北京南路358号大成国际大厦20楼2005室
办公地址:新疆乌鲁木齐市高新区(新市区)北京南路358号大成国际大厦20楼2005室
法定代表人:韩志谦
电话:010-88085858
传真:010-88085195
联系人:李巍
客服电话:400-800-0562
网址:www.hysec.com
(33)东海证券股份有限公司
注册地址:江苏省常州延陵西路23号投资广场18层
办公地址:上海市浦东新区东方路1928号东海证券大厦
法定代表人:钱俊文
电话:021-20333333
传真:021-50498825
联系人:王一彦
客服电话:95531;400-8888-588
网址:www.longone.com.cn
(34)安信证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元
法定代表人:黄炎勋
客服电话:95517
联系人:陈剑虹
电话:0755-82825551
传真:0755-82558355
网址:www.essence.com.cn
(35)中信证券股份有限公司
注册地址:广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座
法定代表人:张佑君
客服电话:010-84588888
联系人:顾凌
电话:010-60838696
传真:010-84865560
网址:www.cs.ecitic.com
(36)中信证券(山东)有限责任公司
注册地址:青岛市崂山区深圳路222号1号楼2001
办公地址:青岛市市南区东海西路28号龙翔广场东座5层
法定代表人:姜晓林
客服电话:95548
联系人:焦刚
电话:0531-89606166
传真:0532-85022605
网址:http://sd.citics.com/
(37)中信建投证券股份有限公司
注册地址:北京市朝阳区安立路66号4号楼
法定代表人:王常青
客服电话:4008888108
联系人:权唐
电话:010-85130577
传真:010-65182261
网址:www.csc108.com
(38)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
法定代表人:何如
客服电话:95536
联系人:李颖
电话:0755-82133066
传真:0755-82133952
网址:www.guosen.com.cn
(39)华福证券有限责任公司
注册地址:福州市五四路157号新天地大厦7、8层
法定代表人:黄金琳
客服电话:0591-96326
联系人:张宗锐
电话:0591-87383600
传真:0591-87841150
网址:www.gfhfzq.com.cn
(40)国金证券股份有限公司
注册地址:成都市东城根上街95号
客服电话:4006600109
联系人:刘婧漪
电话:028-86690057
传真:028-86690126
客服电话:95310
网址:www.gjzq.com.cn
(41)华宝证券有限责任公司
地址:上海市浦东新区环球金融中心57楼
法定代表人:陈林
客服电话:400-820-9898
联系人:刘闻川
电话:021-68778075
传真:021-68868117
网址:www.cnhbstock.com
(42)招商证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层
法定代表人:宫少林
客服电话:95565
联系人:黄婵君
电话:0755-82960167
传真:0755-82943636
网址:www.newone.com.cn
(43)长江证券股份有限公司
注册地址:武汉市新华路特8号长江证券大厦
法定代表人:杨泽柱
客户服务热线:95579、4008-888-999
联系人:奚博宇
电话:027-65799999
传真:027-85481900
网址:www.95579.com
(44)华泰证券股份有限公司
注册地址:南京市江东中路228号
办公地址:南京市建邺区江东中路228号华泰证券广场
法定代表人:周易
客服电话:4008-888-168、95597
联系人:庞晓芸
电话:0755-82492193
传真:0755-82492962
网址:www.htsc.com.cn
(45)方正证券股份有限公司
注册地址:湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦22-24层
法定代表人:雷杰
客服电话:95571
联系人:徐锦福
电话:010-57398062
传真:010-57398058
网址:www.foundersc.com
(46)中信证券华南股份有限公司
注册地址:广州市天河区珠江西路5号广州国际金融中心主塔19层、20层
办公地址:广州市天河区珠江西路5号广州国际金融中心主塔19层、20层
法定代表人:胡伏云
联系人:陈靖
联系电话:020-88836999
客户服务电话:95396
传真:020-88836984
网址:www.gzs.com.cn
(47)平安证券股份有限公司
办注册地址:深圳市福田区益田路5033号平安金融中心61层-64层
法定代表人:何之江
客户服务热线:95511-8
联系人:王阳
电话:021-38632136
传真:021-58991896
网址:http://stock.pingan.com
(48)华鑫证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦28层A01、B01(b)单元
办公地址:上海市肇嘉浜路750号
法定代表人:俞洋
联系人:陈敏
网站:www.cfsc.com.cn
客服电话:021-32109999;029-68918888;4001099918
(49)华西证券股份有限公司
注册地址:四川省成都市高新区天府二街198号华西证券大厦
法定代表人:杨炯洋
客户服务电话:4008888818
联系人:金达勇
电话:0755-83025723
传真:0755-83025991
网址:www.hx168.com.cn
(50)世纪证券有限责任公司
注册地址:深圳市前海深港合作区南山街道桂湾五路128号前海深港基金小镇对冲基金中心406
办公地址:深圳市福田区深南大道招商银行大厦40-42层
法定代表人:李强
客服电话:0755-83199599
联系人:袁媛
电话:0755-83199511
传真:0755-83199545
网址:www.csco.com.cn
(51)第一创业证券股份有限公司
地址:深圳市罗湖区笋岗路12号中民时代广场B座25F
法人代表:刘学民
电话:95358
网址:www.firstcapital.com.cn
(52)华林证券股份有限公司
注册地址:西藏自治区拉萨市柳梧新区察古大道1-1君泰国际B栋一层3号
办公地址:深圳市福田区民田路178号华融大厦5、6楼
法定代表人:林立
客服电话:400-188-3888
联系人:李琳
电话:0755-82707857
传真:0755-23613751
网址:www.chinalions.com
(53)中山证券有限责任公司
注册地址:深圳市南山区科技中一路西华强高新发展大楼7层、8层
办公地址:深圳市南山区科技中一路西华强高新发展大楼7层、8层
法定代表人:林炳城
电话:0755-82943755
传真:0755-82960582
客户服务电话:95329
网址:www.zszq.com
(54)粤开证券股份有限公司
注册地址:惠州市江北东江三路55号广播电视新闻中心西面一层大堂和三、四层
办公地址:深圳市福田区深南中路2002号中广核大厦北楼10层
法定代表人:严亦斌
联系人:彭莲
联系电话:0755-83331195
客户服务电话:95564
公司网址:http://www.ykzq.com
(55)宏信证券有限责任公司
办公地址:四川省成都市人民南路二段18号川信大厦10楼
法人代表人:吴玉明
客服电话:4008366366
联系人:刘文涛
电话:02886199765
传真:02886199533
网址:http://www.hx818.com
(56)南京证券股份有限公司
办公地址:南京市玄武区大钟亭8号
法定代表人:步国旬
客服电话:95386
联系人:石健
电话:025-83367888
传真:025-83364032
网址:www.njzq.com.cn
(57)国联证券股份有限公司
注册地址:江苏省无锡市县前东街168号
法定代表人:姚志勇
客服电话:4008885288
联系人:沈刚
电话:0510-82831662
传真:0510-82830162
网址:www.glsc.com.cn
(58)浙商证券股份有限公司
地址:浙江省杭州市杭大路1号黄龙世纪广场A座6-7楼
法定代表人:吴承根
联系人:张智
电话:021-64716089
客服电话:95345
网址:www.stocke.com.cn
(59)华安证券股份有限公司
注册地址:安徽省合肥市长江中路357号
法定代表人:李工
客服电话:0551-96518、400-80-96518
联系人:甘霖
电话:0551-5161821
传真:0551-5161672
网址:www.hazq.com
(60)国海证券股份有限公司
注册地址:广西南宁市滨湖路46号
办公地址:广西南宁市滨湖路46号
客服电话:95563(全国)、0771-96100(广西)
法定代表人:刘峻
联系人:覃清芳
电话:0771-5539262
传真:0771-5539033
网址:www.ghzq.com.cn
(61)东莞证券股份有限公司
注册地址:东莞市莞城区可园南路一号金源中心30楼
法定代表人:陈照星
客服电话:95328
联系人:陈士锐
电话:0769-22112151
传真:0769-22115712
网址:www.dgzq.com.cn
(62)恒泰证券股份有限公司
注册地址:内蒙古呼和浩特市新城区新华东街111号
法人代表:庞介民
客服电话:956088
联系人:魏巍
电话:0471-3953168
传真:0471-4930707
网址:www.cnht.com.cn
(63)国盛证券有限责任公司
注册地址:江西省南昌市北京西路88号江信国际金融大厦
办公地址:江西省南昌市北京西路88号江信国际金融大厦4楼
法定代表人:徐丽峰
联系人:周欣玲
电话:0791-86281305;13803512671
传真:0791-86281305
客户服务电话:956080
网址:www.gszq.com
(64)金元证券股份有限公司
注册地址:海南省海口市南宝路36号证券大厦4层(邮政编码:570206)
办公地址:深圳市深南大道4001号时代金融中心17楼(邮政编码:518034)
法定代表人:陆涛
客服电话:95372
联系人:马贤清
电话:0755-83025022
传真:0755-83025625
网址:www.jyzq.cn
(65)中航证券有限公司
注册地址:南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号国际金融大厦A座41楼
办公地址:南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号国际金融大厦A座41楼
法人代表:王宜四
客户服务热线:4008866567
联系人:戴蕾
电话:0791-86768681
传真:0791-86770178
网址:www.avicsec.com
(66)财通证券有限责任公司
注册地址:杭州市杭大路15号嘉华国际商务中心
法定代表人:沈继宁
客户联系电话:0571-96336(上海地区:962336)
联系人:乔骏
电话:0571-87925129
传真:0571-87925100
网址:www.ctsec.com
(67)广发证券股份有限公司
注册地址:广州天河区天河北路183-187号大都会广场43楼(4301-4316房)
办公地址:广东省广州天河北路大都会广场5、18、19、36、38、39、41、42、43、44楼
法定代表人:孙树明
客服电话:95575
联系人:黄岚
电话:020-87555888
传真:020-87555305
网址:www.gf.com.cn
(68)万联证券有限责任公司
注册地址:北京市海淀区北三环西路99号院1号楼15层1501
法定代表人:张建军
联系人:王鑫
联系电话:020-38286651
客服电话:400-8888-133
网址:www.wlzq.com.cn
(69)中国中金财富证券有限公司
注册地址:深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋第18层-21层及第04层01,02,03,05,11,12,13,15,16,18,19,20,21,22,23单元
办公地址:深圳市福田区益田路6003号荣超商务中心A栋第04、18层至21层
法定代表人:高涛
联系人:刘毅
客户电话:400 600 8008
电话:0755-82023442
传真:0755-82026539
网址:www.china-invs.cn
(70)联储证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区福田街道岗厦社区深南大道南侧金地中心大厦9楼
办公地址:北京市朝阳区安定路5号院3号楼中建财富国际中心27层联储证券
法定代表人:吕春卫
联系人:丁倩云
联系电话:010-86499427 13051859661
传真:0755-23947482
客服电话:400-620-6868
网址:http://www.lczq.com/
(71)上海好买基金销售有限公司
注册地址:上海市虹口区场中路685弄37号4号楼449室
办公地址:上海市浦东新区浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦903~906
法定代表人:杨文斌
客服电话:400-700-9665
联系人:张茹
联系电话:021-58870011
传真:021-68596916
网址:www.ehowbuy.com
(72)蚂蚁(杭州)基金销售有限公司
注册地址:浙江省杭州市西湖区万塘路18号黄龙时代广场B座6F
法人代表:陈柏青
联系人:韩爱彬
电话:021-60897840
传真:0571-26697013
客服电话:4000-766-123
网址:www.fund123.cn
(73)上海长量基金销售有限公司
办公地址:上海市浦东新区东方路1267号11层
法定代表人:张跃伟
客服电话:4008202899
联系人:邱燕芳
电话:021-20691931
传真:021-20691861
网址:www.erichfund.com
(74)浙江同花顺基金销售有限公司
注册地址:杭州市西湖区文二西路1号元茂大厦903室
办公地址:浙江省杭州市西湖区翠柏路7号电子商务产业园2号楼
法人代表:凌顺平
联系人:林海明
电话:0571-88911818-8580
传真:0571-88911818-8002
客服电话:4008-773-772
网站地址:www.5ifund.com
(75)上海基煜基金销售有限公司
住所:上海市崇明县长兴镇路潘园公路1800号2号楼6153室(上海泰和经济发展区)
办公地址:上海市杨浦区昆明路518号a1002室
法定代表人:王翔
联系人:安彬
客服电话:400-820-5369
网址:www.jiyufund.com.cn
(76)上海凯石财富基金销售有限公司
注册地址:上海市黄浦区西藏南路765号602-115室
法定代表人:陈继武
客服电话:400-643-3389
联系人:葛佳蕊
电话:021-63333319
传真:021-63332523
网址:www.vstonewealth.com
(77)北京蛋卷基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507
法定代表人:钟斐斐
客服电话:4000618518
联系人:袁永娇
电话:010-61840688
传真:010-61840699
网址:https://danjuanapp.com
(78)南京苏宁基金销售有限公司
注册地址:南京市玄武区苏宁大道1-5号
办公地址:南京市玄武区苏宁大道1-5号
法定代表人:王锋
客服电话:95177
网址:https://www.snjijin.com/
(79)上海利得基金销售有限公司
注册地址:上海市宝山区蕴川路5475号1033室
办公地址:上海市浦东新区峨山路91弄61号1幢14层
法定代表人:李兴春
传真:021-50583633
电话:021-50583533
客服电话:400-921-7755
网址:www.leadfund.com.cn
(80)上海联泰基金销售有限公司
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区富特北路277号3层310室
办公地址:上海市长宁区福泉北路518号8座3层
邮编:200335
法定代表人:燕斌
联系人:兰敏
电话:021-52822063
传真:021-52975270
客服电话:400-166-6788
公司网址:www.66zichan.com
(81)北京度小满基金销售有限公司
注册地址:北京市海淀区西北旺东路10号院西区4号楼1层103室
法定代表人:葛新
办公地址:北京市海淀区西北旺东路10号院西区4号楼
机构联系人:孙博超
联系人电话:010-59403028
联系人传真:010-59403027
客户服务电话:95055-4
公司网址:www.baiyingfund.com
(82)上海陆金所基金销售有限公司
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路1333号14楼09单元
法定代表人:王之光
办公地址:中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路1333号14楼09单元
联系人:宁博宇
客服电话:4008219031
网站:www.lufunds.com
(83)珠海盈米基金销售有限公司
注册地址:珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491
法定代表人:肖雯
办公地址:广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔12楼B1201-1203
联系人:黄敏嫦
网站:www.yingmi.cn
客服电话:020-89629066
(84)奕丰基金销售有限公司
注册地址:深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室(入住深圳市前海商务秘书有限公司)
办公地址:深圳市南山区海德三路航天科技广场A座17楼1704室
法定代表人:TEO WEE HOWE
联系人:叶健
电话:0755-89460507
传真:0755-21674453
客服电话:400-684-0500
网址:www.ifastps.com.cn
(85)深圳市金斧子基金销售有限公司
注册地址:深圳市南山区粤海街道科技园中区科苑路15号科兴科学园B栋3单元11层
办公地址:深圳市南山区粤海街道科苑路科兴科学园B3单元7楼
法定代表人:赖任军
联系人:刘昕霞
电话:0755-29330513
传真:0755-26920530
客服电话:400-9302-888
网址:https://www.jfz.com/
(86)上海万得基金销售有限公司
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区福山路33号11楼B座
办公地址:上海市浦东新区浦明路1500号万得大厦11楼
法定代表人:黄祎
联系人:徐亚丹
联系电话:021-50712782
传真:021-50710161
客服电话:400-799-1888
网址:www.520fund.com.cn
(87)深圳市新兰德证券投资咨询有限公司
注册地址:深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006号
法定代表人:杨懿
办公地址:深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006号
联系人:张燕
联系电话:010-58325388*1588
网站:www.new-rand.cn
客服电话:400-166-1188
(88)和讯信息科技有限公司
注册地址:北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层
法定代表人:王莉
联系人:刘洋
联系电话:021-20835785
传真:021-20835879
客服电话:400-920-0022
网址:http://licaike.hexun.com
(89)深圳众禄基金销售股份有限公司
注册地址:深圳市罗湖区笋岗街道梨园路物资控股置地大厦8楼801
法定代表人:薛峰
联系人:童彩平
电话:0755-33227950
传真:0755-82080798
网址:www.zlfund.cn
客服电话:4006-788-887
(90)上海天天基金销售有限公司
注册地址:上海市徐汇区龙田路195号3C座9楼
法人代表:其实
联系人:潘世友
电话:021-54509998
传真:021-64383798
客服电话:400-1818-188
网址:www.1234567.com.cn
(91)上海挖财基金销售有限公司
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区杨高南路799号5楼01、02、03室
法定代表人:冷飞
客服电话:021-50810673
网址:www.wacaijijin.com
(92)腾安基金销售(深圳)有限公司
注册地址:深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室(入驻深圳市前海商务秘书有限公司)
办公地址:深圳市南山区高新科技园科技中一路腾讯大厦11层
法人代表:刘明军
公告联系人:谭广峰
公告电话:95017-1-8
公告传真:0755-86013399
客服电话:95017
网址:www.tenganxinxi.com
(93)诺亚正行基金销售有限公司
注册地址:上海市虹口区飞虹路360弄9号3724室
法定代表人:汪静波
办公地址:上海市杨浦区昆明路508号北美广场B座12楼
联系人:徐诚
联系电话:021-38509639
网站:www.noah-fund.com
客服电话:400-821-5399
(94)嘉实财富管理有限公司
注册地址:上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心办公楼二期53层5312-15单元
法定代表人:赵学军
电话:010-65215588
传真:010-85712195
联系人:李雯
联系人邮箱:liwen@harvestwm.cn
客服电话:400-021-8850
网址:www.harvestwm.cn
(95)北京唐鼎耀华基金销售有限公司
注册地址:北京市延庆县延庆经济开发区百泉街10号2栋236室
法定代表人:张冠宇
客服电话:400-819-9868
联系人:王丽敏
电话:010-85932810
网址:www.tdyhfund.com
(96)北京虹点基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区工人体育场北路甲2号裙房2层222单元
办公地址:北京市朝阳区工人体育场北路甲2号裙房2层222单元
法定代表人:胡伟
传真:010-65951887
电话:010-65951887
客服电话:400-618-0707
网址:www.hongdianfund.com
(97)方德保险代理有限公司
注册地址:北京市东城区东直门南大街3号楼7层711
办公地址:北京市东城区东直门南大街3号楼7层711
法定代表人:林柏均
联系人:胡明哲
联系电话:010-56203275
传真:010-68091380
客服电话:010-64068617
网址:www.jhjfund.com
基金管理人可根据有关法律、法规的要求,选择其他符合要求的机构代理销售本基金,并及时公告。
(三)登记机构
名称:中国证券登记结算有限责任公司
注册地址:北京市西城区金融大街27号投资广场23层
办公地址:北京市西城区金融大街27号投资广场23层
法定代表人:周明
联系人:赵亦清
电话:(010)50938782
传真:(010)50938907
(四)律师事务所和经办律师
名称:北京市金杜律师事务所
注册地址:北京市朝阳区东三环中路7号财富中心写字楼A座40层
办公地址:北京市朝阳区东三环中路7号财富中心写字楼A座40层
负责人:王玲
电话:0755-22163333
传真:0755-22163390
经办律师:沈娜、冯艾
联系人:冯艾
(五)会计师事务所和经办注册会计师
名称:普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
住所:中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼
办公地址:上海市黄浦区湖滨路202号企业天地2号楼普华永道中心11楼
执行事务合伙人:李丹
电话:021-23238888
传真:021-23238800
联系人:陈薇瑶
经办注册会计师:张振波、陈薇瑶

四、基金的名称
本基金名称:大成科创主题3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金。
五、基金的类型
本基金类型:混合型证券投资基金
六、基金的运作方式
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
七、基金的投资目标
(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)封闭运作期届满转型后投资目标
在控制风险的前提下,把握市场机会,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。
八、基金的投资范围
(一)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、同业存单、银行存款(包含协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、股指期货、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。
(二)封闭运作期届满转型后基金的投资范围
基金封闭运作期届满转型后,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、央行票据、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债券、地方政府债券、中期票据、可转换债券(含分离交易可转债)、短期融资券、超短期融资券等)、资产支持证券、银行存款(包括协议存款、定期存款)、同业存单、债券回购、货币市场工具,以及股指期货、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。
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:转为上市开放式基金(LOF)后,股票占基金资产的比例为60%-95%,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%,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,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不低于基金资产净值的5%。
九、基金的投资策略
(一)封闭期投资策略
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外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。如果由于申购赎回、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运用所影响的上市企业。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拆解进行详细计算,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/FCF和P/OCF;P/FCF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集于自由现金流的公司;而OCF和FCF相比,OCF可操控的空间较小,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,医药行业企业需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,创新药板块还没有盈利,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估值方法难以对生物科技公司进行估值,需要利用管线估值法,根据不同研发管线进行估值,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能力,以及实现这上述两点的确定性。基金管理人将通过深入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能力的确定性水平。
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。重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,可使用市销率(Price/Sales)进行估值。具体估值定价策略如下:
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重资产成长型企业:以税息折旧及摊销前利润(EBITDA)或现金流替代盈利进行估值。对于重资产、高折旧的公司,企业盈利增长可能滞后于营收增长,EV/EBITDA方法较为适用,还原折旧前的盈利能力计算估值。对于资本投入更大的领域,如云计算、电商等,企业盈利可能连续多年无法释放,但营收增长、现金流等指标已经显著改善,可采用公司价值/自由现金流量乘数(EV/FCF)以及市销率进行估值。
③转型企业:企业业务转型可能导致估值倍数乃至估值方法的显著变化,将根据个案进行具体分析选择合适的估值方法。
④早期企业:采用长期市场空间折现法。对于大赛道上的早期企业,营收、利润、现金流都难以使用传统估值方法,采用一级市场风险投资的投资逻辑,关注赛道规模和未来市场空间。
(4)战略配售投资策略
本基金参与股票战略配售投资时,本基金剩余封闭期应长于战略配售获配股票的最长锁定期及减持期。
本基金基于对宏观经济、资本市场以及科技创新发展趋势的分析和理解,通过对科创型公司的深入研究,精选具有估值优势和成长优势的科创型公司进行投资,以战略配售方式参与具有长期发展潜力的优质公司,分享公司成长及价值实现的红利。对优质公司的衡量主要从公司所在行业的发展特点及公司的行业地位、公司的核心竞争力、公司的经营能力和治理结构等方面,以及公司的盈利能力、增长能力、偿债能力、营运能力以及估值水平等方面进行分析。
战略配售投资策略,以"赛道、企业、价格"打分评价体系为主要依据:
1)全面覆盖科创板鼓励的五大新兴方向,对其中的绝大部分标的积极参与询价、报价、定价;在对投资标的所处赛道、公司业务充分研究的基础上,尽可能广泛地把握住战略配售的机会;
2)通过赛道、公司评价,结合价格,对标的进行筛选,重点投资核心赛道的优质公司,适当投资次核心赛道的优质公司,对非核心赛道的非优质公司进行适当跟踪;
3)经过产业链充分调研,研究公司业务和管理层,分析估值,投资向经过考验的优质公司集中,核心赛道的优质公司给予加强权重系数。
(5)固定收益投资策略
本基金固定收益投资将以利率债及高等级的信用债券投资为主。具体投资策略上,在对拟投资个券进行严格的信用风险评估前提下,以持有到期的方式精选信用债券进行投资,同时还将积极把握各类债券的交易性投资机会。
首先,根据宏观经济分析、资金面动向分析和投资人行为分析判断未来利率期限结构变化,并充分考虑组合的流动性管理的实际情况,配置债券组合的久期;其次,结合信用分析、流动性分析、税收分析等确定债券组合的类属配置;再次,在上述基础上利用债券定价技术,进行个券选择,选择被低估的债券进行投资。结合对未来市场利率预期运用久期管理策略、收益率曲线策略、信用债券投资策略等多种积极管理策略,通过严谨的研究发现价值被低估的债券和市场投资机会,构建收益稳定、流动性良好的债券组合。
(6)股指期货投资策略
本基金投资股指期货将以投资组合避险和有效管理为目的,通过套期保值策略,对冲系统性风险,应对组合构建与调整中的流动性风险,力求风险收益的优化。
在构建套期保值组合过程中,基金管理人通过对股票组合的结构分析,分离组合的系统性风险(beta)及非系统性风险。基金管理人将关注股票组合beta值的易变性以及股指期货与指数之间基差波动对套期保值策略的干扰,通过大量数据分析与量化建模,确立最优保值比率。
在套期保值过程中,基金管理人将不断精细和不断修正套保策略,动态管理套期保值组合。主要工作包括:基于合理的保证金管理策略严格进行保证金管理;对投资组合beta系数的实时监控,全程评估套期保值的效果和基差风险,当组合beta值超过事先设定的beta容忍度时,需要对套期保值组合进行及时调整;进行股指期货合约的提前平仓或展期决策管理。
(7)国债期货投资策略
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。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。国债期货相关投资遵循法律法规及中国证监会的规定。
(四)封闭运作期投资限制
1.组合限制
在封闭运作期,本基金的投资组合应遵循以下限制:
(1)封闭期内股票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%;
(2)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;
(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%;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%;
(5)本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%,债券回购最长期限为1年,债券回购到期后不得展期;
(7)本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的,可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致;
(8)封闭期内,本基金的基金资产总值不得超过基金资产净值的200%;
(9)本基金参与股指期货或国债期货交易,应当遵守下列要求:
1)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%;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%;
2)在封闭期内每个交易日日终,持有的买入股指期货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)、买入返售金融资产(不含质押式回购)等;
3)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%;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%;
4)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个交易日基金资产净值的20%;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%;
5)封闭期内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)占基金资产的比例为0%-100%;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;
(10)法律法规及中国证监会规定的其他投资比例限制。
除上述(7)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。法律法规或监管部门另有规定时,从其规定。
本基金投资流通受限证券,基金管理人应根据中国证监会相关规定进行投资。基金管理人应制定严格的投资决策流程和风险控制制度,防范流动性风险、法律风险和操作风险等各种风险。
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。期间,本基金的投资范围、投资策略应当符合本基金合同的约定。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上述限制,如适用于本基金,则本基金投资不再受相关限制。
(二)封闭运作期届满转型后基金的投资
1.投资目标
在控制风险的前提下,把握市场机会,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。
2.封闭运作期届满转型后基金的投资范围
基金封闭运作期届满转型后,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、央行票据、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债券、地方政府债券、中期票据、可转换债券(含分离交易可转债)、短期融资券、超短期融资券等)、资产支持证券、银行存款(包括协议存款、定期存款)、同业存单、债券回购、货币市场工具,以及股指期货、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。
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:转为上市开放式基金(LOF)后,股票占基金资产的比例为60%-95%,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%,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,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不低于基金资产净值的5%。
3、封闭运作期届满转型后基金的投资策略
(1)大类资产配置策略
本基金通过定性分析与定量分析相结合的方法分析全球宏观经济、各主要经济体及行业的基本面和资本市场发展趋势,综合考量宏观经济发展前景,评估各类资产的预期收益与风险,合理确定本基金在股票、债券、现金等各类别资产上的投资比例,并随着各类资产风险收益特征的相对变化,适时做出动态调整。
(2)股票投资策略
本基金的股票策略采取"自上而下"与"自下而上"相结合的积极管理策略。公司研究包括定性研究和定量研究两个方面,定性研究方面分析公司发展战略、资源与能力、治理结构等方面的情况,评判公司的行业竞争地位以及业绩驱动因素;定量研究方面运用主营业务收入、EBITDA、净利润等的预期增长率指标,结合公司营运指标(如固定资产周转率等)以及经营杠杆指标,对公司盈利的持续增长前景进行综合评价。
科创主题界定: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运用所影响的上市企业。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)债券投资策略
本基金的债券投资采取稳健的投资管理方式,获得与风险相匹配的投资收益,以实现在一定程度上规避股票市场的系统性风险和保证基金资产的流动性。本基金通过分析未来市场利率趋势及市场信用环境变化方向,综合考虑不同券种收益率水平、信用风险、流动性等因素,构造债券投资组合。在实际的投资运作中,本基金将运用久期控制策略、收益率曲线策略、类别选择策略、个券选择策略等多种策略,获取债券市场的长期稳定收益。
(4)资产支持证券投资策略
本基金将分析资产支持证券的资产特征,估计违约率和提前偿付比率,并利用收益率曲线和期权定价模型,对资产支持证券进行估值。本基金将通过对资产支持证券基础资产及结构设计的研究,结合多种定价模型,严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资,以降低流动性风险。
(5)股指期货投资策略
本基金投资股指期货将以投资组合避险和有效管理为目的,通过套期保值策略,对冲系统性风险,应对组合构建与调整中的流动性风险,力求风险收益的优化。
在构建套期保值组合过程中,基金管理人通过对股票组合的结构分析,分离组合的系统性风险(beta)及非系统性风险。基金管理人将关注股票组合beta值的易变性以及股指期货与指数之间基差波动对套期保值策略的干扰,通过大量数据分析与量化建模,确立最优保值比率。
在套期保值过程中,基金管理人将不断精细和不断修正套保策略,动态管理套期保值组合。主要工作包括:基于合理的保证金管理策略严格进行保证金管理;对投资组合beta系数的实时监控,全程评估套期保值的效果和基差风险,当组合beta值超过事先设定的beta容忍度时,需要对套期保值组合进行及时调整;进行股指期货合约的提前平仓或展期决策管理。
(6)国债期货投资策略
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。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。
4、投资限制
1)封闭运作期届满转型后基金的投资组合应遵循以下限制:
1)本基金股票占基金资产的比例为60%-95%,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%;
2)每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,保持不低于基金资产净值5%的现金(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;
3)本基金持有一家公司发行的证券,其市值不超过基金资产净值的10%;
4)本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券,不超过该证券的10%;
5)本基金管理人管理的全部开放式基金(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前款所规定比例限制的,基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资;
7)本基金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10%;
8)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%;
9)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%;
10)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%;
11)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;
12)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;
13)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%;债券回购最长期限为1年,债券回购到期后不得展期;
14)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;
15)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%;
c)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%;
d)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;
e)本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值,合计(轧差计算)应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定;
16)本基金参与国债期货交易,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%,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%;
b)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)应当符合本基金投资范围中关于债券投资的投资比例;
c)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%;
17)基金总资产不得超过基金净资产的140%;
18)法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。
除上述第2)、6)、11)、14)项外,因证券市场波动、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。
基金管理人应当自转型为普通上市型开放式基金(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。期间,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修改或取消上述限制,如适用于本基金,基金管理人在与托管人协商后,则本基金投资不再受相关限制,自动遵循变更后的规定,并且该项调整不需要召开基金份额持有人大会。
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上述限制,如适用于本基金,则本基金投资不再受相关限制。
十、基金的业绩比较基准
基金的业绩比较基准:中国战略新兴产业成份指数收益率*60%+中债综合全价指数收益率*40%。
如果指数编制单位变更或停止上述标的指数的编制及发布,或者上述标的指数由其他指数替代,或由于指数编制方法等重大变更导致上述指数不宜继续作为标的指数,或者证券市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出时,本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则,通过适当的程序变更本基金的标的指数,并同时更换本基金名称与业绩比较基准。
十一、基金的风险收益特征
本基金是混合型基金,预期收益和预期风险高于货币市场基金和债券型基金,低于股票型基金。
本基金封闭运作期内可以投资战略配售股票,需参与并接受发行人战略配售股票,由此产生的投资风险与价格波动由投资者自行承担。
十二、基金投资组合报告
基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。
基金托管人中国建设银行根据本基金合同规定,于2020年7月28日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
本投资组合报告所载数据取自本基金2020年2季度报告,数据截至日为2020年6月30日,本报告中所列财务数据未经审计。
1.1 报告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	1,312,176,627.25	88.14
	其中:股票	1,312,176,627.25	88.14
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	173,872,459.41	11.68
8	其他资产	2,693,020.34	0.18
9	合计	1,488,742,107.00	100.00

1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
1.2.1 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	1,476,906.91	0.10
B	采矿业	-	-
C	制造业	830,690,323.13	56.51
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,766.32	0.00
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	8,004,948.88	0.54
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	64,201,070.11	4.37
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	180,729,093.00	12.30
M	科学研究和技术服务业	36,862,849.80	2.51
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	190,198,669.10	12.94
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,312,176,627.25	89.27

1.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合
无。
1.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

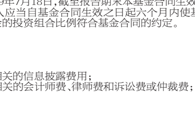
序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	300595	欧普康视	1,708,582	118,473,075.88	8.06
2	601888	中国中免	722,484	111,284,210.52	7.57
3	603882	金域医学	1,211,907	108,465,676.50	7.38
4	688029	南微医学	415,880	100,867,535.20	6.86
5	002127	南极电商	3,280,344	69,444,882.48	4.72
6	300529	健帆生物	919,550	63,908,725.00	4.35
7	688036	传音控股	878,016	62,339,136.00	4.24
8	300768	迪普科技	1,301,266	60,235,603.14	4.10
9	603658	安图生物	368,900	59,924,116.00	4.08
10	300750	宁德时代	338,900	59,090,604.00	4.02

1.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合
无。
1.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细
无。
1.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细
无。
1.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细
无。
1.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
无。
1.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
1.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
无。
1.9.2 本基金投资股指期货的投资政策
无。
1.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
1.10.1 本期国债期货投资政策
无。
1.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
无。
1.10.3 本期国债期货投资评价
无。
1.11 投资组合报告附注
1.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现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
本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现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。
1.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库
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股票库之外的股票。
1.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	835,689.21
2	应收证券清算款	1,828,671.61
3	应收股利	-
4	应收利息	28,659.52
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,693,020.34

1.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
无。
1.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
无。
1.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分
由于四舍五入原因,分项之和与合计可能有尾差。
十三、基金的业绩
基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。
(一)自基金合同生效日(2019年7月18日)至2020年6月30日以来完整会计年度的基金份额净值增长率以及与同期业绩比较基准收益率的比较:

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2019.7.18-2019.12.31	13.21%	0.84%	10.72%	0.63%	2.49%	0.21%
2020.1.1-2020.6.30	50.41%	2.14%	19.46%	1.15%	30.95%	0.99%
2019.7.18-2020.6.30	70.28%	1.64%	32.27%	0.93%	38.01%	0.71%

(二)自基金合同生效以来基金份额净值的变动情况,并与同期业绩比较基准的变动的比较:
大成科创主题3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金累计份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2019年7月18日至2020年6月30日)

注:1、本基金合同生效日为2019年7月18日,截至报告期末本基金合同生效未满一年。
2、本基金合同规定,基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。建仓期结束时,本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。
十四、基金的费用与税收
(一)基金费用的种类
1、基金管理人的管理费;
2、基金托管人的托管费;
3、《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、律师费和诉讼费或仲裁费;
5、基金份额持有人大会费用;
6、基金的证券、期货交易费用;
7、基金的银行汇划费用;
8、基金上市初费及年费;
9、账户开户费用、账户维护费用;
10、按照国家有关规定和《基金合同》约定,可以在基金财产中列支的其他费用。
(二)基金费用计提方法、计提标准和支付方式
1、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×1.20%÷当年天数
H为每日应计提的管理费
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,由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据,自动在月初5个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付,基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。费用自动扣划后,基金管理人应进行核对,如发现数据不符,及时联系基金托管人协商解决。
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×0.20%÷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,由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据,自动在月初5个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付,基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。费用自动扣划后,基金管理人应进行核对,如发现数据不符,及时联系基金托管人协商解决。
上述"(一)基金费用的种类中第3-10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)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。
十五、对招募说明书更新部分的说明
本招募说明书依据《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》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《流动性风险管理规定》及其他有关法律法规的要求,对2019年10月23日公布的《大成科创主题3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书》进行了更新,主要更新的内容如下:
根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》,更新了"重要提示"、"绪言"、"三、基金管理人"、"四、基金托管人"、"五、相关服务机构"、"六、基金的募集"、"七、基金份额的申购、赎回与转换"、"九、基金的投资"、"十、基金的业绩"、"二十二、其他应披露的事项"、"二十三、对招募说明书更新部分的说明"。

大成基金管理有限公司
2020年8月18日