

产品要素表

	变更前	变更后
产品名称	康曼德 003A 号主动管理型私募证券投资基金	康曼德 003A 号主动管理型私募证券投资基金
管理人	深圳市康曼德资本管理有限公司	深圳市康曼德资本管理有限公司
托管机构	中信证券股份有限公司	中信证券股份有限公司
运营服务机构	中信中证投资服务有限责任公司	中信中证投资服务有限责任公司
投资经理	丁楹先生，深圳市康曼德资本管理有限公司创始人、董事长。历任中信证券交易部经理、总经理助理；长盛基金总经理助理、投资管理部总监；中信基金投资总监、副总经理；中信建投证券交易部总经理等职。丁楹先生为中欧工商管理学院工商管理硕士、东北大学工商管理学院管理工程与科学方向博士。已通过从业资格考试，从事投资管理工作超过 22 年。个人曾直接管理超过 100 亿元资产，在国内外机构和个人投资者中拥有广泛的影响力和号召力。	丁楹先生，博士，深圳市康曼德资本管理有限公司创始人、董事长。丁楹先生历任中信证券交易部经理、总经理助理；长盛基金总经理助理、投资管理部总监；中信基金投资总监、副总经理；中信建投证券交易部总经理等职。
产品存续期	无固定存续期限	20 年
成立日	2018-04-11	2018-04-11
产品类型	混合类	混合类
风险级别	本基金属于 R4 风险投资品种，适合风险识别、评估、承受能力为 C5，C4 的合格投资者。	本基金属于 R4 风险等级的投资品种，适合专业投资者和风险识别、评估、承受能力为 C5，C4 的普通合格投资者。
开放日	本基金固定申购开放日为每个自然周的周二，接受申购申请，如对应日为非工作日，则顺延至下一个工作日；本基金固定赎回开放日为每个自然月的最后一个工作日，接受赎回申请。	本基金固定申购开放日为每周周二（遇法定节假日，则本周无固定申购开放日），固定赎回开放日为每自然月最后一个周二（遇法定节假日顺延至下一个周二，以此类推）。如申购开放日和赎回开放日重合，则该日可申购和赎回。
认/申购费	0%	本基金的申购费率为 1%，募集机构有权减免基金投资者的申购费用。申购费用不列入基金资产，其用途、支付对象等由募集机构确定。
赎回费	持有期限小于 180 天，赎回费率为 0.3%；持有期限大于等于 180 天，赎回费率为 0%；基金终止或清算，赎回费率为 0%。	持有期小于 3 个月，赎回费率为 1%；持有期大于或等于 3 个月，赎回费率为 0%
认购金额	100 万元起，每次追加认购的金额不设限制。	100 万元起，每次追加申购的金额不设限制。
预警止损	预警线为 0.8 元，平仓线为 0.7 元	本基金不设置预警和平仓机制。
投资范围	本基金主要投资于国内依法发行上市的股票及其他经中国证监会核准上市的股	本基金的投资范围为：康曼德 003 号主动管理型私募证券投资基金（以下简称“标

	<p>票、新股申购（包括网上和网下申购）、债券（包括国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、可转换债券、资产支持证券、中小企业私募债券等）、证券公司发行的收益凭证、证券投资基金、基金公司资管计划（包含基金子公司资管计划）、债券回购、期货公司资管计划以及券商的资管计划等资产管理计划、信托计划、私募基金、权证、货币市场工具、参与融资融券、将持有的证券作为融券标的证券出借给证券金融公司、沪港通、深港通、金融衍生工具（包括但不限于股指期货、商品期货，个股期权、股指期权，以持牌金融机构做交易对手的收益互换、跨境收益互换、场外期权等，以及通过前述衍生工具间接投资境内境外二级市场股票等）、金融监管部门批准的跨境投资金融工具、以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他投资品种。</p>	<p>的基金”）的 A 类份额、货币市场基金、国债、中央银行票据。</p>
投资限制	<p>本基金的投资组合将遵循以下限制：</p> <ol style="list-style-type: none"> 1、本基金投资的私募投资基金（包括有限合伙）必须有托管机构； 2、本基金的基金资产总值占基金资产净值的比例不得超过 200%； 3、本基金不得投资非证券类金融产品，包括但不限于非证券类私募投资基金（包括有限合伙），基金公司子公司、期货公司、证券公司及信托公司管理/发行的非证券类资管计划、信托计划等； 4、本基金开展场外衍生品交易的，自 2024 年 8 月 1 日（含）起应当符合下列要求： <ol style="list-style-type: none"> （1）新增场外期权合约以及存续合约展期的，除仅开展商品类场外期权交易外，基金净资产不低于 5000 万元；向全部交易对手方缴纳的场外期权交易保证金和权利金合计不得超过基金净资产的 25%； （2）新增收益互换合约以及存续合约展期的，基金净资产不低于 1000 万元；参与挂钩股票、股票指数等权益类收益互换的，向交易对手方缴纳的保证金比例不低于合约名义本金的 50%； （3）参与证券公司等机构发行带敲入和敲出结构的场外期权或者收益凭证（如雪球结构衍生品）的合约名义本金不得超过基金净资产的 25%； <p>本基金参与场外衍生品交易的，基金管理人应当在本基金下一估值日前将场外衍生品交易情况、交易文件等提供给基金托管人。基金管理人签订场外衍生品交易文</p>	<p>本基金的投资组合将遵循以下限制（本条款项下投资限制所列举的涉及对具体品种的限制并不代表本基金实际可投资该种范围或品种，也不视为对本基金约定的投资范围的修改或替换，本基金实际可投资的范围以本合同约定的“投资范围”为准；本基金自进入清算程序后无需遵循以下投资比例限制）：</p> <ol style="list-style-type: none"> 1、根据《运作指引》，本基金应遵循下述投资限制： <ol style="list-style-type: none"> （1）本基金投资于存款、债券等债权类资产的市值低于本基金已投资产 80%；本基金投资于股票等股权类资产的市值低于本基金已投资产 80%；本基金投资于期货和衍生品的持仓合约价值的比例低于本基金已投资产 80%或期货和衍生品账户权益不超过本基金已投资产 20%； （2）本基金所投资的资产管理产品（包括私募基金等）不得再投资除公募证券投资基金以外的资产管理产品（包括私募基金等）； （3）本基金的总资产不得超过本基金净资产的 200%； （4）投向 AA 级及以下信用债（可转债、同业存单除外）、流动性受限资产合计不得超过基金净资产 20%（债券评级取长期债项评级、主体评级与担保人评级三类最新评级中的孰高值；收益互换和场外期权按预付金（保证金）余额和存续合约净值之和计算；其余品种按持仓市值计算）；

	<p>件时，应当明确授权由交易对手方、相关交易的清算机构在本基金下一估值日前直接向基金托管人提供场外衍生品交易文件并持续提供估值信息。</p> <p>基金管理人承诺确保本基金在实际投资运作中符合本条投资限制的约定，并负责主动协调交易对手方按时向基金托管人提供准确、完整的估值信息，交易对手方未按时提供或提供不完整的由基金管理人负责补充提供，基金管理人需确保交易文件和估值信息的真实性、准确性、完整性和及时性。前述交易文件和估值信息需覆盖以上投资限制所需的各种类型标识和金额数据（包括但不限于交易对手、合约权利金或保证金、合约名义本金、合约交易结构、合约挂钩标的等信息）。</p> <p>基金托管人自 2024 年 8 月 1 日（含）起对本条款进行监督。本基金新增场外期权合约、收益互换合约及存续合约展期的，在场外投资划款指令到达基金托管人时，基金托管人对基金净资产规模是否符合本条要求进行事中审核；本基金持有场外衍生品合约期间，基金托管人仅根据交易对手方、相关交易的清算机构或基金管理人提供的交易文件和估值信息对本基金是否符合本条要求进行事后监督。基金托管人不对交易文件和估值信息进行任何实质性判断，也不对其真实性、准确性、完整性、及时性和/或所载内容的专业性、正确性负责。若出现交易对手方、相关交易的清算机构或基金管理人未按时发送交易文件和估值信息、交易文件和估值信息底层数据缺失、交易文件和估值信息内容有误、交易文件和估值信息因交易对手方的标准不统一产生口径及含义而导致存在差异的、交易文件和估值信息格式变化且未提前与基金托管人沟通确认、基金管理人和/或交易对手方的信息发送人、其所发送的信息未经其公司内部授权或确认等情形，导致基金托管人无法监督、未能监督或所监督内容与实际不符的，基金托管人不承担任何责任。</p> <p>5、法律法规或监管部门规定的其他投资限制。</p>	<p>（5）本基金投资的私募投资基金（包括有限合伙）必须有托管机构；</p> <p>（6）以市值计，本基金投资于康曼德 003 号主动管理型私募证券投资基金的比例不低于基金净资产的 90%（含）；</p> <p>以上条款中，涉及资产范围、资产分类和计算口径等以合同释义部分为准。所投资资产为资产管理产品的，除涉及本合同约定的穿透合并计算的情形外，仅当所投资资产管理产品在本托管人处托管的情况下托管人履行监督职责。</p> <p>本基金直接投资于除公募基金以外的资产管理产品（资产管理产品亦包括私募基金等产品，下同）的，基金管理人对本条有关《运作指引》约定的股权类资产、债权类资产、期货和衍生品类资产占已投资资产的比例限制，本基金投资于同一资产的比例限制，本基金投资于同一债券的比例限制，以及本基金嵌套层级，应原则上至少每个季度进行一次穿透合并计算。所投资资产管理产品为私募证券投资基金的，基金管理人负责协调所投私募基金的管理人授权其托管人直接向本基金托管人提供该私募基金的四级估值表；投资除公募基金和私募基金以外的资产管理产品的，基金管理人负责协调该资产管理产品的管理人直接向本基金托管人提供该资产管理产品的四级估值表。基金托管人在完整地接收本基金所投资资产管理产品同一交易日的四级估值表后进行穿透合并计算，计算时仅以该估值表中的信息为准。如果法律法规或金融监管部门对前述需向基金托管人提供并作为穿透合并计算依据的估值信息（如四级估值表）、相关数据信息的提供方式、穿透合并计算频率等事项另有要求的，从其规定。</p> <p>2、本基金不得投资非证券类私募投资基金（包括有限合伙）；</p> <p>3、法律法规或监管部门规定的其他投资限制。</p>
产品费用	<p>管理费：1%。</p> <p>托管费：0.05%，年度托管费合计应不低于 1.5 万元</p> <p>行政服务费：0.05%，年度行政服务费合计应不低于 1.5 万元</p>	<p>本基金的年管理费率为 1%。</p> <p>本基金的年托管费率为 0.015%。</p> <p>本基金的年行政服务费率为 0.015%。</p>

业绩报酬	<p>本基金业绩报酬计提基准日分为除息日（若有）、赎回申请日和基金终止日。业绩报酬计提日为分红确认日（若有）、赎回确认日和基金终止确认日。若某次分红（若有）对应的除息日与本基金上一个发生业绩报酬计提对应的除息日间隔期短于【3】个月时，则该次分红的除息日及其对应的分红确认日（若有）不计提业绩报酬。</p> <p>管理人将根据委托人每笔投资的期间年化收益率(R)，对期间年化收益率超过 0% 以上部分按照 20%的比例收取业绩报酬。</p>	<p>本基金业绩报酬计提基准日分为除息日（若有）、赎回申请日和基金终止日。业绩报酬计提日为分红确认日（若有）、赎回确认日和基金终止确认日。若某次分红（若有）对应的除息日与本基金上一个发生业绩报酬计提对应的除息日间隔期短于【6】个月时，则该次分红的除息日及其对应的分红确认日不计提业绩报酬。</p> <p>本基金在分红确认日提取业绩报酬，业绩报酬从委托人的分红资金中扣除且不超过分红资金（若有）；在赎回确认日提取业绩报酬，业绩报酬从委托人的赎回资金中扣除；在基金终止确认日提取业绩报酬，业绩报酬从委托人的清算资金中扣除。</p> <p>本基金业绩报酬的提取比例（Y）为 20%。</p>
------	---	--

更新日期：2025 年 11 月 25 日