

光大保德信创业板量化优选股票型证券投资基金

基金合同内容摘要

一、基金管理人、基金托管人和基金份额持有人的权利、义务

1、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、赎回与转换申请；
- 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) 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；
- 14) 选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券、期货经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；

15) 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;

16) 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) 办理基金注册或备案手续;

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

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

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

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

7) 依法接受基金托管人的监督;

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

9) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告;

10) 编制季度、半年度和年度基金报告;

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

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

2、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、证券账户以及投资所需的其他账户，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、证券账户以及投资所需的其他账户，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，因审计、法律等向外部专业

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、基金份额申购、赎回价格；

9) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

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

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

12) 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。

3、基金份额持有人的权利及义务

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) 缴纳基金认购、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各种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未设立日常机构,如今后设立基金份额持有人大会的

日常机构，按照相关法律法规的要求执行。

1、召开事由

(1) 除法律法规、中国证监会和基金合同另有规定之外，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：

- 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；
- 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百分之十以上（含百分之十）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实质性不利影响的其他事项；

13) 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) 在法律法规和基金合同规定的范围内，在对现有的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一致后修改，不需召开基金份额持有人大会：

- 1) 调低除基金管理费和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，调整收费方式或者增设新的份额类别、停止现有基金份额类别的销售、或调整现有基金份额类别的设置；
- 4) 因相应的法律法规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) 基金管理人、登记机构、基金销售机构调整有关认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务规则；

7) 基金推出新业务或服务；

8) 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。

2、会议召集人及召集方式

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

(2) 基金管理人未按规定召集或不能召开时，由基金托管人召集；

(3) 基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当由基金托管人自行召集，并自出具书面决定之日起六十日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合；

(4) 代表基金份额百分之十以上（含百分之十）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，代表基金份额百分之十以上（含百分之十）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) 代表基金份额百分之十以上（含百分之十）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百分之十以上（含百分之十）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。

3、召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

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

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

(2) 采取通讯开会方式并进行表决的情况下，由会议召集人决定在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、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。

4、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、通讯开会方式等基金合同约定的方式或法律法规、中国证监会允许的其他方式召开，会议的召开方式由会议召集人确定，基金管理人、基金托管人须为基金份额持有人行使投票权提供便利。

(1) 现场开会。由基金份额持有人本人出席或以代理投票授权委托证明委派代表出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当列席基金份额持有人大会，基金管理人或基金托管人不派代表列席的，不影响表决效力。现场

开会同时符合以下条件时，可以进行基金份额持有人大会议程：

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

2) 经核对，汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一(含二分之一)。

(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大会公告载明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大会公告载明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表决意见；基金托管人或基金管理人经通知不参加收取表决意见的，不影响表决效力；

3) 本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的，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)；

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

(3) 重新召集基金份额持有人大会的条件

若到会者在权益登记日所持有的有效基金份额低于本条第(1)款第 2) 项、第(2)款第 3) 项规定比例的，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的三个月以后、六个月以内，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，到会者所持有的有效基金份额应不小于在权益登记日基金总份额的三分之一（含三分之一）。

(4) 在不与法律法规冲突的前提下，基金份额持有人大会可通过网络、电话或其他方式召开，基金份额持有人可以采用书面、网络、电话、短信或其他方式进行表决，具体方式由会议召集人确定并在会议通知中列明。在会议召开方式上，本基金亦可采用网络、电话、短信等其他非现场方式或者以非现场方式与现场方式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。

(5) 基金份额持有人授权他人代为出席会议并表决的，授权方式可以采用书面、网络、电话、短信或其他方式，具体方式在会议通知中列明。

5、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7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。

6、表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

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

(2) 特别决议，特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方可做出。除法律法规、中国证监会另有规定，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、与其他基金合并应当以特别决议通过方为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则提交符合会议通知中规定的确认投资者身份文件的表决视为有效出席的投资者，表面符合会议通知规定的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，但应当计入出具表决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。

7、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表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。

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

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

9、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或监管规则的部分，如将来法律法规或监管规则修改导致相关内容被取消或变更的，基金管理人与托管人协商一致并提前公告后，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

1、基金收益分配原则

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

(2) 本基金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按除权日除权后的基金份额净值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；

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

(4) 每一基金份额享有同等分配权；

(5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

2、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。

3、收益分配方案的确定、公告与实施

本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核，在 2 日内在指定媒介公告并报中国证监会备案。

基金红利发放日距离收益分配基准日（即可供分配利润计算截止日）的时间不得超过 15 个工作日。

四、与基金财产管理、运用有关费用的提取、支付方式与比例

1、基金费用的种类

(1) 基金管理人的管理费；

(2) 基金托管人的托管费；

(3) 基金合同生效后与基金相关的信息披露费用；

(4) 基金合同生效后与基金相关的会计师费、律师费、仲裁费和诉讼费；

(5) 基金份额持有人大会费用；

- (6) 基金的证券、期货交易或结算费用；
- (7) 基金的银行汇划费用；
- (8) 证券、期货账户开户费用、账户维护费；
- (9) 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。

2、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 1.5%年费率计提。基金管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付，由基金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、不可抗力等，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 0.25%的年费率计提。基金托管费的计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付，由基金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、不可抗力等，支付日期顺延。

上述“1、基金费用的种类”中第（3）—（9）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。

3、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

(1)基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致费用支出或基金财产的损失；

(2)基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；

(3)基金合同生效前的相关费用；

(4)其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

五、基金财产的投资方向和投资限制

1、投资目标

本基金主要投资于在创业板上市的股票，在严格控制风险和保持良好流动性的前提下，本基金通过运用量化投资策略，进行积极的组合优化，力争实现超越业绩比较基准的投资收益。

2、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（含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、金融债、公司债、证券公司短期公司债券、企业债、地方政府债、次级债、中小企业私募债券、可转换公司债券（含可分离交易可转债）、中期票据、央行票据及其他经中国证监会允许投资的债券）、货币市场工具、资产支持证券、债券回购、银行存款、权证、股指期货、股票期权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：投资于股票资产不低于基金资产的 80%，其中投资于创业板上市公司证券的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合约和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有的现金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%；前述现金资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。权证投资比例为基金资产净值的 0-3%；如法律法规或中国证监会变更上述投资品种的比例限制，基金管理人在履行适当

程序后以变更后的比例为准，本基金的投资比例会做相应调整。

3、投资限制

(1) 组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

1) 本基金股票资产不低于基金资产的 80%，其中投资于创业板上市公司证券的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和股票期权合约需缴纳的交易保证金以后，保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券。前述现金资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

3) 本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%；

4) 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；

5) 本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；

6) 本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；

7) 本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%；

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) 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；

14) 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；

15) 基金总资产不得超过基金净资产的 140%；

本基金参与股指期货投资，需遵循下列 16) -20) 的投资组合限制：

16) 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%；

17) 在任何交易日日终，持有的买入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）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；

18) 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%；

19) 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%；

20) 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规定；

本基金参与股票期权交易，需遵守下列 21) -23) 的投资组合限制：

21) 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%；

22) 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；

23) 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；

24) 本基金持有单只中小企业私募债券，其市值不得超过该基金资产净值的 10%；

25) 本基金持有单只证券公司短期公司债券，其市值不得超过本基金资产净值的 10%；

26) 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%；

27) 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本款所规定比例限制的，本基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

28) 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；

29) 本基金投资流通受限证券，基金管理人应事先根据中国证监会相关规定，与基金托管人在基金托管协议中明确基金投资流通受限证券的比例，根据比例进行投资。基金管理人应制订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；

30) 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。

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，除第 2)、12)、27)、28) 项外，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但法律法规或中国证监会规定的特殊情形除外。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在上述期间内，本基金的投资范围、投资策略应当符合本基金合同的约定。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。

如果法律法规或监管部门对本基金合同约定投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制，不需要经基金份额持有人大会审议，但须提前公告。

(2) 禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

1) 承销证券；

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

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券, 或者从事其他重大关联交易的, 应当符合本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, 则本基金投资不再受相关限制或按调整后的规定执行。

六、基金资产净值的计算方法和公告方式

1、基金资产净值的计算方法

(1) 基金资产总值

基金资产总值是指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收款项以及其他资产总和。

(2) 基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

(3) 估值方法

1) 证券交易所上市的非固定收益品种的估值

交易所上市的非固定收益品种(包括股票、权证等), 以其估值日在证券交易所挂牌的市价(收盘价)估值; 估值日无交易的, 最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的, 以最近交易日的市价(收盘价)估值; 如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的, 可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因

素，调整最近交易市价，确定公允价格。

2) 交易所市场交易的固定收益品种的估值

a) 对在交易所市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种(另有规定的除外)，选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值；

b) 对在交易所市场上市交易的可转换债券，按照每日收盘价作为估值全价；

c) 对在交易所市场挂牌转让的资产支持证券和私募证券，估值日不存在活跃市场时采用估值技术确定其公允价值进行估值。如成本能够近似体现公允价值，应持续评估上述做法的适当性，并在情况发生改变时做出适当调整。

3) 银行间市场交易的固定收益品种，选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值。

4) 同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

5) 处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

a) 送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的估值方法估值；该日无交易的，以最近一日的市价(收盘价)估值；

b) 首次公开发行未上市的股票和权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值；

c) 流通受限的股票，包括非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等(不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票)，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值；

d) 对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值；

e) 对银行间市场未上市，且第三方估值机构未提供估值价格的债券，按成本估值。

6) 本基金投资股指期货合约，一般以估值当日结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。

7) 本基金投资股票期权合约，一般以估值当日结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算

价估值。如有相关法律法规以及监管部门相关规定，按其规定内容进行估值。

8) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

9) 当本基金发生大额申购或赎回情形时，本基金管理人可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。

10) 相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

如基金管理人或基金托管人发现基金估值违反基金合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时，应立即通知对方，共同查明原因，双方协商解决。

根据有关法律法规，基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人对外公布的结果予以公布。

2、基金资产净值、基金份额净值

基金合同生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周公告一次基金资产净值和基金份额净值。

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

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

七、基金合同解除和终止的事由、程序以及基金财产清算方式

1、基金合同的终止事由

有下列情形之一的，在履行相关程序后，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。

2、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。

3、清算费用

清算费用是指基金财产清算小组在进行基金财产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剩余财产中支付。

4、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。

5、基金财产清算的公告

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

6、基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

八、争议的处理和适用的法律

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

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

基金合同受中国法律管辖。

九、基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

基金合同可印制成册，供投资者在基金管理人、基金托管人、销售机构的办公场所和营业场所查阅。