

# 光大保德信中小盘混合型证券投资基金 基金合同

基金管理人：光大保德信基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

## 目 录

一、前言 .....	2
二、释义 .....	4
三、基金的基本情况 .....	9
四、基金份额的发售 .....	10
五、基金备案 .....	12
六、基金份额的申购、赎回与转换 .....	14
七、基金合同当事人及其权利义务 .....	24
八、基金份额持有人大会 .....	32
九、基金管理人、基金托管人的更换条件和程序 .....	40
十、基金的托管 .....	43
十一、基金份额的登记 .....	44
十二、基金的投资 .....	45
十三、基金的财产 .....	57
十四、基金资产的估值 .....	59
十五、基金费用与税收 .....	65
十六、基金收益与分配 .....	67
十七、基金的会计与审计 .....	69
十八、基金的信息披露 .....	70
十九、基金合同的变更、终止与基金财产的清算 .....	76
二十、业务规则 .....	78
二十一、违约责任 .....	79
二十二、争议的处理 .....	80
二十三、基金合同的效力 .....	81
二十四、基金合同内容摘要 .....	82

## 一、前言

(一) 订立《光大保德信中小盘混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“本基金合同”)的目的、依据和原则。

### 1、订立本基金合同的目的

订立本基金合同的目的是明确本基金合同当事人的权利义务、规范光大保德信中小盘混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)的运作,保护基金投资者的合法权益。

### 2、订立本基金合同的依据

订立本基金合同的依据是《中华人民共和国合同法》、《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《公开募集证券投资基金运作管理办法》(以下简称“《运作办法》”)、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称“《销售办法》”)、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称“《信息披露办法》”)、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(以下简称“《流动性风险规定》”)和其他有关法律法规。

### 3、订立本基金合同的原则

订立本基金合同的原则是平等自愿、诚实信用、充分保护基金份额持有人的合法权益。

(二) 本基金由基金管理人依照《基金法》及相关法律法规、本基金合同和其他有关规定募集,并经中国证监会核准。中国证监会对本基金募集的核准,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。

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,但并不保证投资于本基金一定盈利,也不保证基金份额持有人的最低收益。

(三) 本基金合同是约定本基金合同当事人之间基本权利义务的法律文件,其他与本基金相关的涉及本基金合同当事人之间权利义务关系的任何文件或表述,如与本基金合同有任何冲突,均以本基金合同为准。本基金合同的当事人包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人。基金投资人自依本基金合同取得本基金基金份额,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对本基金合同的承认和接受。基金份额持有人作为本基金

合同当事人并不以在本基金合同上书面签章为必要条件。本基金合同的当事人应按照《基金法》、本基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。

（四）本基金合同应当适用《基金法》及相关法律法规，若因法律法规的修改导致本基金合同的内容与届时有效的法律法规的强制性规定不一致，应当以届时有效的法律法规的规定为准，本基金合同应及时做出相应的变更和调整，同时就该等变更或调整进行公告。

（五）本基金合同约定的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。

（六）本基金的投资范围包括存托凭证，除与其他仅投资于沪深市场股票的基金所面临的共同风险外，本基金还将面临中国存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险，以及与中国存托凭证发行机制相关的风险。

## 二、释义

本基金合同中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

- 基金或本基金：**指光大保德信中小盘混合型证券投资基金；
- 基金合同或本基金合同：**指《光大保德信中小盘混合型证券投资基金基金合同》及对本基金合同的任何有效修订和补充；
- 招募说明书：**指《光大保德信中小盘混合型证券投资基金招募说明书》及其更新；
- 基金产品资料概要：**指《光大保德信中小盘混合型证券投资基金基金产品资料概要》及其更新；
- 托管协议：**指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《光大保德信中小盘混合型证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充；
- 业务规则：**指《光大保德信基金管理有限公司开放式基金业务规则》；
- 发售公告：**指《光大保德信中小盘混合型证券投资基金份额发售公告》；
- 中国：**指中华人民共和国(仅为《基金合同》目的，不包括香港特别行政区、澳门特别行政区及台湾地区)；
- 中国证监会：**指中国证券监督管理委员会；
- 中国银监会：**指中国银行业监督管理委员会；
- 《基金法》：**指 2003 年 10 月 28 日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，2012 年 12 月 28 日经第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订，自 2013 年 6 月 1 日起实施的《中华人民共和国证券投资基金法》及立法机关对其不时做出的修订；
- 《运作办法》：**指中国证监会 2014 年 7 月 7 日颁布，同年 8 月 8 日起实施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》；
- 《销售办法》：**指中国证监会 2013 年 3 月 15 日颁布，同年 6 月 1 日起实施的《证券投资基金销售管理办法》；

**《信息披露办法》:** 指中国证监会 2019 年 7 月 26 日颁布、同年 9 月 1 日实施的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订;

**《流动性风险规定》:** 指中国证监会 2017 年 8 月 31 日颁布、同年 10 月 1 日实施的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及颁布机关对其不时做出的修订

**元:** 指人民币元;

**基金合同当事人:** 指受本基金合同约定, 根据本基金合同享受权利并承担义务的法律主体, 包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人;

**基金管理人:** 指光大保德信基金管理有限公司;

**基金托管人:** 指交通银行股份有限公司;

**基金份额持有人:** 指依照法律法规、招募说明书和基金合同合法取得基金份额的投资人;

**登记业务:** 指本基金登记、存管、过户、清算和交收业务, 具体内容包括投资人基金账户管理、基金份额登记、清算和结算、基金销售业务确认、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等;

**登记机构:** 指办理基金登记业务的机构, 本基金的登记机构为光大保德信基金管理有限公司;

**投资人:** 指个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者和法律法规或中国证监会允许购买开放式证券投资基金的其他投资者;

**个人投资者:** 指依据中华人民共和国有关法律法规及其他有关规定可以投资于开放式证券投资基金的自然人;

**机构投资者:** 指在中国境内合法登记或经有权政府部门批准设立和有效存续并依法可以投资证券投资基金的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织;

**合格境外机构投资者:** 指符合法律法规规定, 经中国证监会批准可以投资于

中国证券市场，并取得国家外汇管理局额度批准的中国境外的机构投资者；

**基金募集期：**指基金合同和招募说明书中载明，并经中国证监会核准的基金份额募集期限，自基金份额发售之日起最长不超过 3 个月；

**基金合同生效日：**指基金募集达到法律法规规定及《基金合同》约定的条件，基金管理人聘请法定机构验资并向中国证监会办理备案手续后，中国证监会的书面确认之日；

**存续期：**指本基金合同生效至终止之间的不定期期限；

**工作日：**指上海证券交易所和深圳证券交易所的正常交易日；

**发售：**指在基金募集期内，销售机构向投资者销售本基金基金份额的行为；

**认购：**指在基金募集期内，投资人按照本基金合同的规定申请购买本基金基金份额的行为；

**申购：**指在基金存续期内，投资人申请购买本基金基金份额的行为；

**赎回：**指基金存续期内，基金份额持有人按本基金合同规定的条件，要求基金管理人将其持有的本基金基金份额兑换为现金的行为；

**巨额赎回：**指在本基金单个开放日内，基金净赎回申请份额（基金赎回申请总份额扣除申购申请总份额之余额）与净转出申请份额（基金转出申请总份额扣除转入申请总份额之余额）之和超过上一开放日本基金总份额 10% 的情形；

**基金转换：**指基金份额持有人按照本基金合同和基金管理人届时有效的业务规则进行的本基金份额与基金管理人管理的、由同一登记机构办理登记的其他基金份额间的转换行为；

**转托管：**指基金份额持有人在本基金的不同销售机构之间实

	施的变更所持基金份额销售机构的操作
<b>代销机构：</b>	指接受基金管理人委托代为办理本基金认购、申购、赎回和其他基金业务的具有基金代销业务资格的机构；
<b>销售机构：</b>	指基金管理人及本基金代销机构；
<b>基金销售网点：</b>	指基金管理人的直销投资理财中心及基金代销机构的代销网点；
<b>指定媒介：</b>	指中国证监会指定的用以进行信息披露的全国性报刊及指定互联网网站（包括基金管理人网站、基金托管人网站、中国证监会基金电子披露网站）等媒介；
<b>基金账户：</b>	指登记机构为基金投资人开立的记录其持有的由该登记机构办理登记的基金份额余额及其变动情况的账户；
<b>交易账户：</b>	指销售机构为基金投资人开立的记录其持有的由该销售机构办理认购、申购、赎回、转换及转托管等业务的基金份额余额及其变动情况的账户；
<b>开放日：</b>	指基金管理人办理本基金份额申购、赎回或其他业务的上海、深圳证券交易所交易日；
<b>T 日：</b>	指销售机构在规定时间内受理投资人申购、赎回或其他业务申请的日期；
<b>T+n 日：</b>	指 T 日起（不包括 T 日）的第 n 个工作日；
<b>基金收益：</b>	指基金管理人运用基金资产投资所得股票红利、股息、债券利息、买卖证券价差、银行存款利息和其他合法收入以及因运用基金财产带来的成本或费用的节约；
<b>基金资产总值：</b>	基金资产总值是指本基金拥有的各类有价证券及票据价值、银行存款本息、债券的应计利息、基金应收的申购基金款、缴存的保证金以及其他投资所形成的价值总和；



- 基金资产净值：**指基金资产总值减去基金负债后的价值；
- 基金份额净值：**指计算日基金资产净值除以计算日基金份额余额总数后得出的基金份额的资产净值；
- 流动性受限资产：**指由于法律法规、监管、合同或操作障碍等原因无法以合理价格予以变现的资产，包括但不限于到期日在10个交易日以上的逆回购与银行定期存款（含协议约定有条件提前支取的银行存款）、停牌股票、流通受限的新股及非公开发行股票、资产支持证券、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券等；
- 基金资产估值：**指计算评估基金资产和负债的价值，以确定基金资产净值和基金份额净值的过程；
- 法律法规：**指中华人民共和国现行有效的法律、行政法规、部门规章及其他规范性文件以及对其做出的不时修改和补充；
- 不可抗力：**指基金合同当事人无法预见、无法克服、无法避免的任何事件和因素，包括但不限于洪水、地震及其他自然灾害、战争、骚乱、火灾、政府征用和没收、法律法规变化、突发停电、恐怖袭击、传染病传播、证券交易场所非正常暂停或停止交易、公众通讯设备或互联网络故障以及其他突发事件。

### 三、基金的基本情况

#### （一）基金名称

光大保德信中小盘混合型证券投资基金。

#### （二）基金的类别

混合型。

#### （三）基金的运作方式

契约型开放式。

#### （四）基金投资目标

本基金通过深入挖掘具有高成长特性或者潜力的中小盘上市公司股票，以求获取基金资产的长期增值。

#### （五）投资理念

中国拥有庞大的人口、市场及自然资源，对于真正能够顺应产业变革，迎合市场需求或者提升人们生活品质和效率的公司具有非常广阔的发展空间，而中小公司因其规模小而经营灵活的特点更易具备爆发性增长的可能。国内外的实践也表明，中小上市公司从长期来看，往往可以获得超过市场平均水平的回报。

#### （六）基金份额初始面值和认购费用

本基金份额初始面值为人民币 1.00 元。

本基金认购费率不高于认购金额的 3%，实际执行费率在招募说明书中载明。

#### （七）基金最低募集份额总额

本基金的最低募集份额总额为 2 亿份。

#### （八）基金的最高募集规模

本基金不设最高募集规模上限。

#### （九）基金存续期限

不定期。

## 四、基金份额的发售

本基金份额初始面值为 1.00 元人民币，按初始面值发售。

### （一）发售时间

本基金自获得中国证监会批准后 6 个月内开始发售，募集期自基金份额发售之日起不超过 3 个月，具体发售时间由基金管理人根据相关法律法规以及本基金合同的规定，在发售公告中确定并披露。

### （二）发售方式

本基金通过各销售机构的基金销售网点向投资人公开发售，具体情况和联系方法详见本基金发售公告。

### （三）发售对象

本基金的发售对象为个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者和法律法规或中国证监会允许购买开放式证券投资基金的其他投资者。

### （四）基金认购费用

本基金采用金额认购方法，认购费用采用外扣法计算，本基金认购费率不高于认购金额的 3%，实际执行费率在招募说明书和发售公告中载明。认购费用不列入基金财产，主要用于支付本基金的市场推广、销售、登记等基金募集期发生的各项费用。

投资人在认购本基金时缴纳认购费用，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 + 认购期利息) / 基金份额初始面值

对于适用固定金额认购费的认购：净认购金额 = 认购金额 - 认购费用

上述认购费用、认购份额以四舍五入的方法保留小数点后两位，由此误差产生的损失由基金财产承担，产生的收益归基金财产所有。

### （五）基金份额的认购和持有限制

投资人在募集期内可以多次认购基金份额，但认购申请一经受理，投资人不得撤销。

本基金募集期间内，单一投资人认购本基金，不设最高认购份额限制。

本基金存续期内，基金管理人可规定基金份额持有人在单个基金账户内持有

的本基金最低份额，具体限制参见本基金招募说明书之规定。

（六）募集期间认购资金利息的处理方式

有效认购款项在基金募集期内产生的利息将折合成基金份额，归基金份额持有人所有。基金募集期产生的利息以登记机构的记录为准。

（七）基金认购的具体规定

投资人认购原则、认购时间安排、投资人认购应提交的文件和办理的手续等事项，由基金管理人根据相关法律法规以及本基金合同的规定，在招募说明书和发售公告中确定并披露。

## 五、基金备案

### （一）基金备案的条件

基金募集期届满，本基金具备下列条件的，基金管理人应当按照规定办理验资和基金备案手续：

- 1、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；
- 2、基金份额持有人的人数不少于 200 人。

基金募集期内，本基金具备上述条件的，基金管理人可以决定停止基金发售，并按照规定办理验资和基金备案手续。

### （二）基金的备案

基金管理人应当自基金募集期届满之日或停止基金发售之日起 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，向中国证监会提交验资报告，办理基金备案手续。

### （三）基金合同的生效

- 1、自中国证监会书面确认之日起，基金备案手续办理完毕且基金合同生效；
- 2、基金管理人应当在收到中国证监会确认文件的次日予以公告；

3、本基金合同生效日前，投资人的认购款项只能存入有证券投资基金托管业务资格的商业银行的基金募集专用账户，任何人不得动用。有效认购款项在基金募集期内产生的利息将折合成基金份额，归基金份额持有人所有。基金募集期产生的利息以登记机构的记录为准。

### （四）基金募集失败的处理方式

基金募集期届满，未达到基金的备案条件，或因不可抗力使基金合同无法生效，则基金募集失败。基金管理人应当：

- 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 日内退还投资人已缴纳的认购款项，并加计银行同期存款利息。

如基金募集失败，基金管理人、基金托管人及代销机构不得请求报酬。基金管理人、基金托管人和代销机构为基金募集支付之一切费用应由各方各自承担。

### （五）基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

基金合同生效后的存续期内，连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不

满二百人或者基金资产净值低于五千万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露。连续六十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。

法律法规或监管机构另有规定的，按其规定办理。

## 六、基金份额的申购、赎回与转换

### （一）申购与赎回办理的场所

本基金的销售机构包括基金管理人和基金管理人委托的代销机构。

投资人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的申购与赎回。基金管理人可根据情况增减基金代销机构，并在基金管理人网站公示。

若基金管理人或代销机构开通电话、传真或网上交易业务的，投资人可以以电话、传真或网上交易等形式进行基金的申购和赎回，具体办法详见销售机构公告。

### （二）申购与赎回办理的开放日及时间

#### 1、开放日及业务办理时间

本基金的开放日是指为投资人办理基金申购、赎回等业务的上海、深圳证券交易所交易日。开放日具体业务办理时间在招募说明书中载明或另行公告，但具体业务办理结束时间不得晚于证券交易所交易结束时间。

若出现新的证券交易市场、证券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具体业务办理时间进行相应的调整并在调整前两日在指定媒介上公告。

#### 2、申购与赎回的开始时间

本基金的申购和赎回自基金合同生效后不超过 3 个月时间里开始办理。在确定申购开始时间与赎回开始时间后，基金管理人最迟于开始办理申购或赎回业务的 2 日前在中国证监会指定媒介上公告。

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、赎回或者转换。投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请的，其申购、赎回或转换价格为下次办理基金份额申购、赎回或转换时间所在开放日的价格。

### （三）申购与赎回的原则

1、“未知价”原则，即基金的申购与赎回价格以受理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”的原则，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交易时间结束前撤销，在交易时间结束后不得撤销；

4、先进先出原则，即基金管理人基金份额持有人的基金份额进行赎回处理时，认购、申购确认日期在先的基金份额先赎回，认购、申购确认日期在后的基金份额后赎回，以确定所适用的赎回费率；

5、基金管理人可根据基金运作的实际情况依法对上述原则进行调整，但最迟应在新的原则实施 2 日前在中国证监会指定媒介予以公告。

#### （四）申购与赎回的程序

##### 1、申购与赎回申请的提出

基金投资人须按销售机构规定的程序，在开放日的业务办理时间提出申购或赎回的申请。

投资人在提交申购申请时须按销售机构规定的方式备足申购资金，投资人在提交赎回申请时须持有足够的可用基金份额余额，否则所提交的申购、赎回申请无效。

##### 2、申购与赎回申请的确认

本基金登记机构应以交易时间结束前收到申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日(T 日)，并在 T+1 日内对该交易的有效性进行确认。T 日提交的有效申请，投资人可在 T+2 日起到销售网点柜台或以基金管理人、销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。基金销售机构对申购申请的受理并不代表申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到申请。申购的确认以登记机构或基金管理人的确认结果为准。

##### 3、申购与赎回申请的款项支付

申购时，采用全额缴款方式，若申购资金在规定时间内未全额到账则申购无效。若申购无效，基金管理人或基金管理人指定的代销机构将投资人已缴付的申购款项本金退还给投资人。

赎回时，当投资人赎回申请成功后，基金管理人将指示基金托管人按有关规定在 T+7 日(包括该日)内支付赎回款项。在发生巨额赎回时，款项的支付办法按照本基金合同有关条款处理。

#### （五）申购与赎回的数额限制



1、投资人在各销售机构首次申购和单次申购的最低金额以及单次赎回的最低份额，详见本基金招募说明书的规定。

2、基金管理人可以规定基金份额持有人每个交易账户的最低基金份额余额，具体规定请参见招募说明书。

3、基金管理人可以规定单个基金份额持有人累计持有的基金份额上限，具体规定请参见招募说明书。

4、当接受申购申请对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时，基金管理人应当采取设定单一投资者申购金额上限或基金单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停基金申购等措施，切实保护存量基金份额持有人的合法权益。基金管理人基于投资运作与风险控制的需要，可采取上述措施对基金规模予以控制。具体见基金管理人相关公告。

5、基金管理人可根据市场情况，调整申购金额、赎回份额及最低持有份额的数量限制，基金管理人必须在调整的 2 日前在中国证监会指定媒介上公告。

#### （六）申购与赎回的价格、费用及其用途

1、本基金的申购和赎回价格以申请当日的基金份额净值为基准进行计算，但在 15:00 点以后的申购和赎回的按下一交易日的净值计算。

2、投资人申购本基金需缴纳申购费，本基金的申购费率最高不超过申购金额的 5%。本基金实际执行的申购费率在招募说明书中载明。

3、投资人赎回本基金份额需缴纳赎回费用，本基金的赎回费率最高不超过基金份额赎回金额的 5%。本基金实际执行的赎回费率在招募说明书中载明。

4、基金管理人可以在法律法规和本基金合同规定范围内调低申购费率和赎回费率。费率如发生变更，基金管理人应在调整实施 2 日前在中国证监会指定媒介上刊登公告。

5、基金管理人可以在不违背法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行相关手续后基金管理人可以对促销活动范围内的基金投资人调低基金申购费率和基金赎回费率。

基金管理人可以在不违背法律法规规定及基金合同约定的情形下对以特定交易方式（如网上交易、电话交易等）等进行基金交易的投资者采用低于柜台费

率的申购费率。

6、申购费用由申购基金份额的基金投资人承担，不列入基金财产，用于本基金的市场推广、销售、登记等各项费用。

7、赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，其中，对持续持有期少于 7 日的投资者收取不低于 1.5% 的赎回费，并将上述赎回费全额计入基金财产。其他情形下，赎回费总额的 25% 应归入本基金财产，其余部分用于支付登记费和其他必要的手续费。

#### （七）申购份额与赎回金额的计算

##### 1、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。申购份额以申请当日基金份额净值为基准计算，计算公式如下：

$$\text{净申购金额} = \text{申购金额} / (1 + \text{申购费率})$$

$$\text{申购费用} = \text{申购金额} - \text{净申购金额}$$

$$\text{申购份额} = \text{净申购金额} / \text{T 日基金份额净值}$$

$$\text{对于适用固定金额申购费的申购：净申购金额} = \text{申购金额} - \text{申购费用}$$

以上申购费用、申购份额均按四舍五入方法，保留到小数点后两位。由此误差产生的损失由基金财产承担，产生的收益归基金财产所有。

##### 2、赎回金额的计算

本基金的赎回金额为赎回总额扣减赎回费用，以申请当日基金份额净值为基准计算，计算公式如下：

$$\text{赎回总额} = \text{T 日基金份额净值} \times \text{赎回份额}$$

$$\text{赎回费用} = \text{T 日基金份额净值} \times \text{赎回份额} \times \text{赎回费率}$$

$$\text{赎回金额} = \text{T 日基金份额净值} \times \text{赎回份额} - \text{赎回费用}$$

以上赎回费用、赎回金额均按四舍五入方法，保留到小数点后两位。由此误差产生的损失由基金财产承担，产生的收益归基金财产所有。

3、T 日的基金份额净值在当天收市后计算，并在次日公告。遇特殊情况，可以适当延迟计算或公告，并报中国证监会备案。

T 日的基金份额净值精确到 0.0001 元，小数点后第五位四舍五入，由此误差产生的损失由基金财产承担，产生的收益归基金财产所有。

#### （八）申购与赎回的登记

1、投资人申购基金成功后，基金登记机构在 T+1 日为投资人增加权益并办理登记手续，投资人自 T+2 日起有权赎回该部分基金份额。

2、投资人赎回基金成功后，基金登记机构在 T+1 日为投资人扣除权益并办理相应的登记手续。

3、基金管理人可在法律法规允许的范围内，对上述登记办理时间进行调整，并最迟于开始实施 2 日前在中国证监会指定媒介上予以公告。

#### （九）巨额赎回的认定及处理方式

##### 1、巨额赎回的认定

巨额赎回是指在单个开放日内，本基金中基金净赎回申请份额（基金赎回申请总份额扣除申购申请总份额之余额）与净转出申请份额（基金转出申请总份额扣除转入申请总份额之余额）之和超过上一开放日基金总份额 10% 的情形。

##### 2、巨额赎回的处理方式

出现巨额赎回时，基金管理人可以根据本基金当时的资产组合状况决定接受全额赎回或部分延期赎回。

（1）接受全额赎回：当基金管理人认为有能力兑付投资人的全部赎回申请和基金间转换时，按正常赎回程序执行。

（2）部分延期赎回：当基金管理人认为该基金兑付投资者的全部赎回及转出申请有困难，或认为为实现投资者的赎回、转出申请进行的资产变现可能使基金份额净值发生较大波动时，基金管理人在当日接受赎回及转出的比例不低于上一日该基金总份额 10% 的前提下，对其余申请延期办理。对于当日的赎回及转出申请，应当按单个账户赎回或转出申请量占当日该基金赎回及转出申请总量的比例，确定单个账户当日办理的赎回或转出份额；未受理部分，除基金份额持有人在提交申请时选择将当日未获受理部分予以撤销者外，延迟至下一开放日办理。转入下一开放日的申请不享有赎回和转出优先权并将以该下一个开放日的基金份额净值为基准计算，以此类推，直到全部完成赎回和转出申请为止。

但若赎回申请人中存在当日申请赎回的份额超过前一工作日基金总份额 30% 的单个赎回申请人（“大额赎回申请人”）的情形下，基金管理人应当按照保护其他赎回申请人（“小额赎回申请人”）利益的原则，优先确认小额赎回申请人

的赎回申请，具体为：如小额赎回申请人的赎回申请在当日被全部确认，则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，在仍可接受赎回申请的范围内对该等大额赎回申请人的赎回申请按比例确认，对大额赎回申请人未予确认的赎回申请延期办理。如小额赎回申请人的赎回申请在当日未被全部确认，则对全部未确认的赎回申请（含小额赎回申请人的其余赎回申请与大额赎回申请人的全部赎回申请）延期办理。延期办理的具体程序，按照本条规定的延期赎回或取消赎回的方式办理。基金管理人应当对延期办理事宜在指定媒介上刊登公告。

当发生巨额赎回并延期办理时，基金管理人应当通过邮寄、传真等方式在 3 个工作日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，在 2 日内编制临时报告书并在指定媒介上予以公告。

3、暂停接受和延缓支付：本基金连续 2 个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受赎回申请；已经确认的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但延缓期限不得超过 20 个工作日。连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请时，基金管理人应当在 2 日内编制临时报告书并在指定媒介上予以公告。

#### （十）拒绝或暂停申购、暂停赎回的情形及处理

1、在如下情况下，基金管理人可以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或基金管理人无法接受投资人的申购申请；

（2）证券交易场所在交易时间内非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；

（3）发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况；

（4）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的利益的情形；

（5）基金管理人认为接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害其他基金份额持有人利益时；

（6）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；

(7) 申请超过基金管理人设定的单笔申购的最高金额、单个投资人单日申购金额上限、本基金单日净申购比例上限、本基金总规模上限的；

(8) 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；

(9) 法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述除第(6)、(7)项以外情形时，基金管理人应根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公告。

如果投资人的申购申请被全部或部分拒绝的，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。

2、在如下情况下，基金管理人可以暂停接受投资人的赎回申请：

(1) 因不可抗力导致基金管理人不能支付赎回款项；

(2) 证券交易场所在交易时间内非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；

(3) 连续 2 个开放日以上发生巨额赎回，根据本基金合同规定，基金管理人可以暂停接受赎回申请的情况；

(4) 发生本基金合同规定的暂停基金财产估值情况；

(5) 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延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请的措施；

(6) 法律、法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形时，基金管理人应当在当日立即向中国证监会备案并予以公告。已接受的赎回申请，基金管理人将足额支付；如暂时不能足额支付的，可延期支付部分赎回款项，按每个赎回申请人已被接受的赎回申请量占已接受赎回申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分由基金管理人按照发生的情况制定相应的处理办法在后续开放日予以支付。同时，在出现上述第(3)款的情形时，对已接受的赎回申请可延期支付赎回款项，最长不超过 20 个工作日，并在指定

媒介公告。投资者在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。

暂停基金的赎回，基金管理人应及时在指定媒介上刊登暂停赎回公告。

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，并依照有关规定在指定媒介上公告。

3、暂停期间结束，基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应按规定公告。

(1) 如果发生暂停的时间为 1 天，基金管理人应于重新开放申购或赎回日在中国证监会指定媒介上刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并公告最近一个开放日的基金份额净值；

(2) 如果发生暂停的时间超过 1 天但少于 2 周，基金管理人应于重新开放申购或赎回日的前 1 个工作日在中国证监会指定媒介上刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并于重新开放申购或赎回日公告最近一个开放日的基金份额净值；

(3) 如果发生暂停的时间超过 2 周，基金管理人应在暂停期间每两周至少重复刊登暂停公告一次。暂停结束基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应最迟提前 2 日在中国证监会指定媒介上刊登基金重新开放申购或赎回的公告，并在重新开放申购或赎回日公告最近一个开放日的基金份额净值。

#### (十一) 基金转换

基金转换是指基金份额持有人在本基金存续期间按照基金管理人的规定申请将其持有的本基金基金份额全部或部分转换为基金管理人管理的、由同一登记机构办理登记的其他开放式基金份额的行为。基金管理人在本基金合同生效后的适当时候将为投资人办理基金间的转换业务，具体业务办理时间、业务规则及转换费率届时在基金转换公告中列明。基金管理人最迟应于转换业务开始前 2 天在中国证监会指定媒介上刊登公告。

#### (十二) 定期定额投资计划

定期定额投资计划，是指投资者通过有关销售机构提出申请，约定每期扣款日、扣款金额及扣款方式，由销售机构于每期约定扣款日在投资者指定银行账户内自动完成扣款及基金申购申请的一种投资方式。

在各项条件成熟的情况下，本基金可为投资人提供定期定额投资计划服务，具体实施方法以招募说明书或基金管理人具体公告为准。

### （十三）基金的非交易过户与转托管

1、非交易过户是指不采用申购、赎回等基金交易方式，将一定数量的基金份额按照一定规则从某一投资人基金账户转移到另一投资人基金账户的行为，包括继承、捐赠、司法强制执行，以及基金登记机构认可、符合法律法规的其他行为。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。其中：

（1）“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。

（2）“捐赠”仅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会或其他具有社会公益性质的社会团体。

（3）“司法强制执行”是指司法机关依据生效的司法文书将基金份额持有人持有的基金份额强制执行划转给其他自然人、法人、社会团体或其他组织。

基金登记机构可以办理的非交易过户情形，以其公告的业务规则为准。

2、办理非交易过户业务必须提供基金登记机构要求提供的相关资料，直接向基金登记机构或其指定的机构申请办理。

3、基金份额持有人在变更办理基金申购与赎回等业务的销售机构（网点）时，可根据各销售机构的实际情况办理已持有基金份额的转托管。基金销售机构可以按照其业务规则规定的标准收取转托管费。

### （十四）基金的销售

本基金的销售业务指接受投资人申请为其办理的本基金的认购、申购、赎回、转换等业务。

本基金的销售业务由基金管理人及基金管理人委托的其他符合条件的机构办理。基金管理人委托代销机构办理本基金认购、申购、赎回等销售业务的，应与代销机构签订代销协议，以明确基金管理人和代销机构之间在基金份额认购、申购、赎回等销售事宜中的权利和义务，确保基金财产的安全，保护基金投资人和基金份额持有人的合法权益。

### （十五）基金份额的冻结、解冻及质押

1、基金登记机构只受理国家有权机关依法要求的基金账户或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。

2、在有关法律法规有明确规定的情况下，本基金将可以办理基金份额的质押业务或其他业务。



## 七、基金合同当事人及其权利义务

### （一）基金管理人

#### 1、基金管理人基本情况

名称：光大保德信基金管理有限公司

住所：上海市黄浦区中山东二路 558 号外滩金融中心 1 幢，6 层

办公地址：上海市黄浦区中山东二路 558 号外滩金融中心 1 幢(北区 3 号楼)，  
6-7 层、10 层

邮政编码：200010

法定代表人：林昌

成立时间：2004 年 4 月 22 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基金字[2004]42 号

组织形式：有限责任公司

注册资本：人民币 1.6 亿元

存续期间：持续经营

经营范围：基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其他业务（涉及行政许可的凭许可证经营）

#### 2、基金管理人的权利

- （1）依法募集基金，办理基金备案手续；
- （2）自基金合同生效之日起，依照法律法规和基金合同独立管理基金财产；
- （3）根据法律法规和基金合同的规定，制订、修改并公布有关基金募集、认购、申购、赎回、转托管、基金转换、非交易过户、冻结、收益分配等方面的业务规则；
- （4）根据法律法规和基金合同的规定获得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；
- （5）在符合有关法律法规和基金合同的前提下，决定本基金的相关费率结构和收费方式；
- （6）根据法律法规和基金合同之规定销售基金份额；
- （7）依据法律法规和基金合同的规定监督基金托管人；
- （8）根据基金合同的规定选择适当的基金代销机构并有权依照代销协议对

基金代销机构行为进行必要的监督和检查；

(9) 自行担任基金登记机构或选择、更换基金登记代理机构，办理基金登记业务，并按照基金合同规定对基金登记代理机构进行必要的监督和检查；

(10) 在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购和赎回的申请；

(11) 在法律法规允许的前提下，为基金份额持有人的利益依法为基金进行融资融券；

(12) 依据法律法规和基金合同的规定，制订基金收益的分配方案；

(13) 按照法律法规，代表基金对被投资企业行使股东权利，代表基金行使因投资于其他证券所产生的权利；

(14) 在基金托管人职责终止时，提名新的基金托管人；

(15) 依据法律法规和基金合同的规定，召集基金份额持有人大会；

(16) 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者实施其他法律行为；

(17) 选择、更换律师、审计师、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构并确定有关费率；

(18) 法律法规、基金合同以及依据基金合同制订的其他法律文件所规定的其他权利。

### 3、基金管理人的义务

(1) 依法募集基金，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、勤勉尽责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) 配备足够的专业人员办理基金份额的认购、申购和赎回业务；

(6) 配备足够的专业人员和相应的技术设施进行基金的登记或委托其他机构代理该项业务；

(7) 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资产相互独立,对所管理的不同基金和受托资产分别管理、分别记账,进行证券投资;

(8) 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外,不得以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;

(9) 接受基金托管人依法进行的监督;

(10) 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,按照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;

(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,应予以保密,不得向他人泄露;

(13) 按基金合同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) 按照法律法规和本基金合同的规定受理申购和赎回等申请,及时、足额支付赎回和分红款项;

(15) 不谋求对上市公司的控股和直接管理;

(16) 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;

(17) 按规定保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料 15 年以上;

(18) 进行基金会计核算并编制基金的财务会计报告;

(19) 编制季度报告、中期报告和年度报告;

(20) 确保需要向基金份额持有人提供的各项文件或资料,能在规定时间内发出;保证投资人能够按照基金合同约定的时间和方式,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;

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

(22) 面临解散、依法被撤销、被依法宣告破产或者由接管人接管其资产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；

(23) 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的合法权益，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

(24) 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，应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；

(25) 不从事任何有损基金财产及本基金其他当事人利益的活动；

(26) 公平对待所管理的不同基金和受托资产，防止在不同基金和受托资产间进行有损本基金基金份额持有人的利益的资源分配；

(27) 以基金管理人的名义，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；

(28) 法律法规及基金合同规定的其他义务。

## (二) 基金托管人

### 1、基金托管人基本情况

名称：交通银行股份有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 号

法定代表人：任德奇

成立日期：1987 年 3 月 30 日

批准设立机关及批准设立文号：国务院国发(1986)字第 81 号文和中国人民银行银发 [1987] 40 号文

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[1998]25 号

组织形式：股份有限公司

注册资本：742.63 亿元人民币

存续期间：持续经营

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现；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、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项业务；提供保管箱服务；经国务院银行业

监督管理机构批准的其他业务；经营结汇、售汇业务。

## 2、基金托管人的权利

- (1) 依据法律法规和基金合同的规定安全保管基金财产；
- (2) 依照基金合同的约定获得基金托管费；
- (3) 监督基金管理人对本基金的投资运作，如托管人发现基金管理人的投资指令违反基金合同或有关法律法规的规定的，不予执行并向中国证监会报告；
- (4) 在基金管理人职责终止时，提名新的基金管理人；
- (5) 依据法律法规和基金合同的规定召集基金份额持有人大会；
- (6) 依据法律法规和基金合同的规定监督基金管理人，如认为基金管理人违反了法律法规或基金合同规定对基金财产、其他基金合同当事人的利益造成重大损失的，应及时呈报中国证监会，以及采取其他必要措施以保护本基金及相关基金合同当事人的利益；
- (7) 法律法规、基金合同规定的其他权利。

## 3、基金托管人的义务

- (1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则安全保管基金财产；
- (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资产以及不同的基金财产相互独立；对所托管的不同的基金和受托资产分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金、受托资产之间在名册登记、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》、本基金合同及其他有关规定外，不以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) 按规定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和证券账户；
- (7) 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；

(8) 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应予以保密，不得向他人泄露；

(9) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额净值及基金份额申购、赎回价格；

(10) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

(11) 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，还应说明基金托管人是否采取了适当的措施；

(12) 按规定保存有关基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料，保存基金的会计账册、报表和记录等 15 年以上；

(13) 根据有关法律法规，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；

(14) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

(15) 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；

(16) 按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会；

(17) 按照规定监督基金管理人的投资运作；

(18) 参加基金财产清算组，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、破产或者由接管人接管其资产时，及时报告中国证监会和中国银监会，并通知基金管理人；

(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，基金托管人应为基金向基金管理人追偿；

(21) 因违反基金合同导致基金财产的损失，应承担赔偿责任，其责任不因其退任而免除；

(22) 不从事任何有损基金及基金合同其他当事人利益的活动；

(23) 法律法规、本基金合同所规定的其他义务。

### (三) 基金份额持有人

1、基金投资人持有本基金基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，基金投资人自依据招募说明书、基金合同取得本基金的基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同当事人，直至其不再持有本基金的基金份额。基金份额持有人作为当事人并不以在基金合同上书面签章为必要条件。每份基金份额具有同等的合法权益。

#### 2、基金份额持有人的权利

- (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) 依法转让或者申请赎回其持有的基金份额；
- (4) 按照规定要求召开基金份额持有人大会；
- (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、登记机构、基金份额发售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼；
- (9) 法律法规、基金合同规定的其他权利。

#### 3、基金份额持有人的义务

- (1) 遵守法律法规、基金合同及其他有关规定；
- (2) 交纳基金认购、申购款项及基金合同规定的费用；
- (3) 在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；
- (4) 不从事任何有损基金及其他基金合同当事人合法利益的活动；
- (5) 执行生效的基金份额持有人大会决议；
- (6) 返还在基金交易过程中因任何原因，自基金管理人及基金管理人的代理人、基金托管人、代销机构及其他基金份额持有人处获得的不当得利；
- (7) 在办理开户、认购、申购、赎回等各项业务时，按照销售机构要求提

供真实、完整、准确、有效的客户资料；

(8) 法律法规及基金合同规定的其他义务。



## 八、基金份额持有人大会

(一)本基金的基金份额持有人大会,由本基金的基金份额持有人共同组成。本基金的基金份额持有人享有平等的表决权,每一基金份额具有一票表决权。

(二)有以下事由情形之一时,应召开基金份额持有人大会:

- 1、终止基金合同;
- 2、转换基金运作方式;
- 3、更换基金托管人;
- 4、更换基金管理人;
- 5、提高基金管理人、基金托管人的报酬标准,但根据法律法规的要求调整提高该等报酬标准的除外;
- 6、本基金与其他基金的合并;
- 7、变更基金类别;
- 8、变更基金投资目标、范围或策略(法律法规和中国证监会另有规定的除外);
- 9、变更基金份额持有人大会程序;
- 10、对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项;
- 11、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。

(三)出现以下情形之一的,可由基金管理人和基金托管人协商后修改基金合同,不需召开基金份额持有人大会:

- 1、调低基金管理费、基金托管费和其他应由基金承担的费用;
- 2、在法律法规和基金合同规定的范围内变更本基金的申购费率、调低赎回费率或变更收费方式;
- 3、因相应的法律法规发生变动而应当对基金合同进行修改;
- 4、对基金合同的修改不涉及基金合同当事人权利义务关系发生变化;
- 5、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;
- 6、除法律法规或基金合同规定应当召开基金份额持有人大会以外的其他情形。

(四)召集人和召集方式

1、除法律法规或本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。基金管理人未按规定召集或者不能召集时，由基金托管人召集。

2、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，应当自行召集。

3、代表基金份额 10%以上（含 10%，以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）的基金份额持有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。

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，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基金份额持有人大会，但应当至少提前 30 日向中国证监会备案。

5、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。

（五）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，召集人必须于会议召开日前 30 天在指定媒介上公告。基金份额持有人大会通知须至少载明以下内容：

- （1）会议召开的时间、地点和方式；
- （2）会议拟审议的主要事项；

- (3) 会议形式;
- (4) 议事程序;
- (5) 有权出席基金份额持有人大会的权益登记日;
- (6) 代理投票的授权委托书的内容要求(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;
- (7) 表决方式;
- (8) 会务常设联系人姓名、电话;
- (9) 出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续;
- (10) 召集人需要通知的其他事项。

2、采用通讯方式开会并进行表决的情况下，由召集人决定通讯方式和书面表决方式，并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、书面表达意见的寄交和收取方式及截止时间。

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书面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书面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书面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书面表决意见的计票进行监督的，不影响表决意见的计票结果。

#### (六) 基金份额持有人出席会议的方式

##### 1、会议方式

基金份额持有人大会的召开方式包括现场开会和通讯方式开会。

现场开会由基金份额持有人本人出席或通过授权委托书委派其代理人出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当出席，如基金管理人或基金托管人拒不派代表出席的，不影响表决效力。

通讯方式开会指按照本基金合同的相关规定以通讯的书面方式进行表决。

会议的召开方式由召集人确定，但决定更换基金管理人、更换基金托管人、转换基金运作方式和终止基金合同事宜必须以现场开会方式召开基金份额持有人大会。

## 2、召开基金份额持有人大会的条件

### (1) 现场开会方式

在同时符合以下条件时，现场会议方可举行：

1) 对到会者在权益登记日持有基金份额的统计显示，全部有效凭证所对应的基金份额应占权益登记日基金总份额的 50%以上（含 50%）；

2) 到会的基金份额持有人身份证明及持有基金份额的凭证、代理人身份证明、委托人持有基金份额的凭证及授权委托代理手续完备，到会者出具的相关文件符合有关法律法规和基金合同及会议通知的规定，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。

未能满足上述条件的情况下，则召集人可另行确定并公告重新开会的时间和地点，但确定有权出席会议的基金份额持有人资格的权益登记日不变。

### (2) 通讯开会方式

在同时符合以下条件时，通讯会议方可举行：

1) 召集人按本基金合同规定公布会议通知后，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和统计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代表的基金份额应占权益登记日基金总份额的 50%以上（含 50%）；

4) 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其他代表，同时提交的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，并与登记注册机构记录相符。

如果开会条件达不到上述条件，则召集人可另行确定并公告重新表决的时间，但确定有权出席会议的基金份额持有人资格的权益登记日不变。

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，否则表面符合法律法规和会议通知规定的书面表决意见即视为有效的表决，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。

#### （七）议事内容与程序

##### 1、议事内容及提案权

（1）议事内容为本基金合同规定的召开基金份额持有人大会事由所涉及的内容。

（2）基金管理人、基金托管人、单独或合并持有权益登记日本基金总份额10%以上（含10%）的基金份额持有人可以在大会召集人发出会议通知前就召开事由向大会召集人提交需由基金份额持有人大会审议表决的提案；也可以在会议通知发出后向大会召集人提交临时提案。临时提案应当在大会召开日前35天提交召集人。召集人对于临时提案应当在大会召开日前30天公布。

（3）对于基金份额持有人提交的提案（包括临时提案），大会召集人应当按照以下原则对提案进行审核：

1）关联性。大会召集人对于基金份额持有人提案涉及事项与基金有直接关系，并且不超出法律法规和基金合同规定的基金份额持有人大会职权范围的，应提交大会审议；对于不符合上述要求的，不提交基金份额持有人大会审议。如果召集人决定不将基金份额持有人提案提交大会表决，应当在该次基金份额持有人大会上进行解释和说明。

2）程序性。大会召集人可以对基金份额持有人的提案涉及的程序性问题做出决定。如将其提案进行分拆或合并表决，需征得原提案人同意；原提案人不同意变更的，大会主持人可以就程序性问题提请基金份额持有人大会做出决定，并按照基金份额持有人大会决定的程序进行审议。

（4）单独或合并持有权益登记日基金总份额10%以上（含10%）的基金份额持有人提交基金份额持有人大会审议表决的提案、基金管理人或基金托管人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，未获基金份额持有人大会审议通过，就同一提案再次提请基金份额持有人大会审议，其时间间隔不少于6个月。法律法规另有规定除外。

（5）基金份额持有人大会的召集人发出召开会议的通知后，如果需要对原有提案进行修改或增加新的提案，应当最迟在基金份额持有人大会召开日前30日公告。否则，会议的召开日期应当顺延并保证至少与公告日期有30日的间隔

期。

## 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规定程序宣布会议议事程序及注意事项，确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后在公证机关监督下进行表决，经合法执业的律师见证后形成大会决议。

大会由基金管理人授权代表主持。在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权代表主持；如果基金管理人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以所代表的基金份额 50% 以上多数选举产生一名代表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做出的决议的效力。

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)、身份证号码、住所地址、持有或代表有表决权的基金份额、委托人姓名(或单位名称)等事项。

### (2) 通讯方式开会

在通讯表决开会的方式下，首先由召集人至少提前 30 天公布提案，在所通知的表决截止日期第 2 天在公证机构监督下由召集人统计全部有效表决并形成决议。

## 3、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。

### (八) 决议形成的条件、表决方式、程序

1、基金份额持有人所持每一基金份额享有平等的表决权。

2、基金份额持有人大会决议分为特别决议和一般决议：

#### (1) 特别决议

特别决议须经出席会议的基金份额持有人及其代理人所持表决权的三分之二以上通过方为有效；更换基金管理人、更换基金托管人、转换基金运作方式、本基金与其他基金合并、终止基金合同的重大事项必须以特别决议方式通过；

#### (2) 一般决议

一般决议须经出席会议的基金份额持有人及其代理人所持表决权的 50% 以

上（含 50%）通过方为有效，除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。

3、基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会备案，并予以公告。

4、基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

5、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。

6、基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人和基金托管人均有约束力。

#### （九）计票

##### 1、现场开会

（1）如基金份额持有人大会由基金管理人或基金托管人召集，则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推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，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推举两名基金份额持有人代表与基金管理人、基金托管人授权的一名监督员共同担任监票人；但如果基金管理人和基金托管人的授权代表未出席，则大会主持人可自行选举三名基金份额持有人代表担任监票人。

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

（3）如会议主持人对于提交的表决结果有异议，可以对投票数进行重新清点；如会议主持人未进行重新清点，而出出席会议的基金份额持有人或代理人对会议主持人宣布的表决结果有异议，其有权在宣布表决结果后立即要求重新清点，会议主持人应当立即重新清点并公布重新清点结果。重新清点仅限一次。

（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参加基金份额持有人大会或拒不配合计票的，不影响计票的效力。

##### 2、通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下，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(如果基金托管人为召集人,则为基金管理人授权代表)的监督下进行计票,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。

(十) 基金份额持有人大会决议的生效与公告

1、基金份额持有人大会决定的事项自表决通过之日起生效;基金份额持有人大会通过的一般决议和特别决议,召集人应当自通过之日起5日内报中国证监会备案。

2、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。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定。

3、基金份额持有人大会决议应自生效之日起2日内由相关信息披露义务人在指定媒介公告。

法律法规或监管部门对基金份额持有人大会另有规定的,从其规定。



## 九、基金管理人、基金托管人的更换条件和程序

### （一）基金管理人和基金托管人的更换条件

#### 1、有下列情形之一的，基金管理人职责终止：

- （1）被依法取消基金管理资格；
- （2）依法解散、依法被撤销或被依法宣告破产；
- （3）被基金份额持有人大会解任；
- （4）法律法规和基金合同规定的其他情形。

#### 2、有下列情形之一的，基金托管人职责终止：

- （1）被依法取消基金托管资格；
- （2）依法解散、依法被撤销或被依法宣告破产；
- （3）被基金份额持有人大会解任；
- （4）法律法规和基金合同规定的其他情形。

### （二）基金管理人和基金托管人的更换程序

#### 1、基金管理人的更换程序

（1）提名：新任基金管理人由基金托管人或由单独或合计持有 10%以上（含 10%，下同）基金份额的基金份额持有人提名。

（2）决议：基金管理人职责终止的，应当依照本基金合同的规定在六个月内召开基金份额持有人大会，对更换基金管理人形成决议，新任基金管理人应当符合法律法规及中国证监会规定的资格条件。

（3）临时基金管理人：新任基金管理人产生之前，由中国证监会指定临时基金管理人。

（4）备案并公告：上述基金份额持有人大会决议自通过之日起 5 日内，由大会召集人报中国证监会备案，基金份额持有人大会决议自表决通过后方可执行。基金托管人在更换基金管理人的基金份额持有人大会决议生效后 2 日内在中国证监会指定媒介上公告。

（5）交接：基金管理人职责终止的，应当妥善保管基金管理业务资料，及时办理基金管理业务的移交手续，新基金管理人或者临时基金管理人应当及时接收。新任基金管理人应与基金托管人核对基金资产总值和净值。

（6）审计并公告：基金管理人职责终止的，应当按照规定聘请会计师事务所

所对基金财产进行审计，并将审计结果予以公告，同时报中国证监会备案，审计费用在基金财产中列支。

(7) 基金名称变更：基金管理人更换后，本基金应替换或删除基金名称中与原基金管理人有关的名称或商号字样。

## 2、基金托管人的更换程序

(1) 提名：新任基金托管人由基金管理人或由单独或合计持有 10%以上基金份额的基金份额持有人提名。

(2) 决议：基金托管人职责终止的，应当依照本基金合同的规定在六个月内召开基金份额持有人大会，对更换基金托管人形成决议，新任基金托管人应当符合法律法规及中国证监会规定的资格条件。

(3) 临时基金托管人：新任基金托管人产生之前，由中国证监会指定临时基金托管人；

(4) 备案并公告：上述更换基金托管人的基金份额持有人大会决议自通过之日起 5 日内，由大会召集人报中国证监会备案，基金份额持有人大会决议自表决通过后方可执行。基金管理人在更换基金托管人的基金份额持有人大会决议生效后 2 日内在中国证监会指定媒介上公告。

(5) 交接：基金托管人职责终止的，应当妥善保管基金财产和基金托管业务资料，及时办理基金财产和基金托管业务的移交手续，新基金托管人或者临时基金托管人应当及时接收。新任基金托管人应与基金管理人核对基金资产总值和净值。

(6) 审计并公告：基金托管人职责终止的，应当按照规定聘请会计师事务所对基金财产进行审计，并将审计结果予以公告，同时报中国证监会备案，审计费用从基金财产中列支。

## 3、基金管理人与基金托管人同时更换

(1) 提名：如果基金管理人和基金托管人同时更换，由单独或合计持有基金总份额 10%以上的基金份额持有人提名新的基金管理人和基金托管人。

(2) 决议：基金份额持有人大会应在六个月内对同时更换基金管理人和基金托管人形成决议，新任基金管理人和基金托管人应当符合法律法规及中国证监会规定的资格条件。

(3) 临时基金管理人和临时基金托管人：新任基金管理人和新任基金托管人产生之前，由中国证监会指定临时基金管理人和临时基金托管人。

(4) 备案并公告：上述基金份额持有人大会决议自通过之日起 5 日内，由大会召集人报中国证监会备案，新任的基金管理人和新任的基金托管人应在更换基金管理人和基金托管人的基金份额持有人大会决议生效后 2 日内在指定媒介上联合公告。

(5) 交接：基金管理人职责终止的，应当妥善保管基金管理业务资料，及时办理基金管理业务的移交手续，新基金管理人或者临时基金管理人应当及时接收。基金托管人职责终止的，应当妥善保管基金财产和基金托管业务资料，及时办理基金财产和基金托管业务的移交手续，新基金托管人或者临时基金托管人应当及时接收。新任基金管理人与新任基金托管人核对基金资产总值和净值。

(6) 审计并公告：基金管理人和基金托管人职责终止的，应当按照规定聘请会计师事务所对基金财产进行审计，并将审计结果予以公告，同时报中国证监会备案，审计费用从基金财产中列支。

(7) 基金名称变更：基金管理人更换后，本基金应替换或删除基金名称中与原基金管理人有关的名称或商号字样。

4、新基金管理人接收基金管理业务或新基金托管人接收基金财产和基金托管业务前，原基金管理人或原基金托管人应继续履行相关职责，并保证不做出对基金份额持有人的利益造成损害的行为。

## 十、基金的托管

本基金财产由基金托管人依法保管。基金管理人应与基金托管人按照《基金法》、本基金合同及其他有关规定订立《光大保德信中小盘混合型证券投资基金托管协议》，以明确基金管理人与基金托管人之间在基金份额持有人名册登记、基金财产的保管、基金财产的管理和运作及相互监督等相关事宜中的权利、义务及职责，确保基金财产的安全，保护基金份额持有人的合法权益。基金托管人对基金管理人业务进行监督和核查的义务自基金合同生效日起开始履行。

## 十一、基金份额的登记

(一) 本基金基金份额的登记业务指本基金登记、存管、过户、清算和交收业务，具体内容包括投资人基金账户管理、基金份额登记、清算和结算、基金销售业务确认、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等。

(二) 本基金的登记业务由基金管理人或基金管理人委托的其他符合条件的机构办理。基金管理人委托其他机构办理本基金登记业务的，应与代理机构签订委托代理协议，以明确基金管理人和代理机构在投资人基金账户管理、基金份额登记、清算和结算及基金销售业务确认、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等事宜中的权利和义务，保护基金份额持有人的合法权益。

(三) 登记机构履行如下职责

1、建立和管理投资人基金账户，保管基金份额持有人开户资料、交易资料、基金份额持有人名册等；

2、配备足够的专业人员办理本基金的登记业务；

3、严格按照法律法规和本基金合同规定的条件办理本基金的登记业务，在法律法规允许的范围内，制定和调整登记业务的相关规则；

4、接受基金管理人、基金托管人的监督；

5、保存基金份额持有人名册及相关的认购、申购与赎回等业务记录 15 年以上；

6、对基金份额持有人的基金账户信息负有保密义务，因违反该保密义务对投资人或基金带来的损失，须承担相应的赔偿责任，但司法强制检查及法律法规规定的其他情形除外；

7、按本基金合同及招募说明书的规定，为投资人办理非交易过户业务、提供其他必要的服务；

8、法律法规规定的其他职责。

(四) 登记机构履行上述职责的，有权取得登记费。

## 十二、基金的投资

### （一）投资目标

本基金通过深入挖掘具有高成长特性或者潜力的中小盘上市公司股票，以求获取基金资产的长期增值。

### （二）投资范围

本基金可投资于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、存托凭证、债券、资产支持证券、权证及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

本基金为混合型基金，股票及存托凭证资产占基金资产的比例范围为60%–95%，其他资产占基金资产的比例范围为5%–40%，权证资产占基金资产净值的比例范围为0–3%，本基金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；本基金投资于中小盘上市公司的股票占股票资产的比例不得低于80%。

此外，今后如法律法规或中国证监会允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入本基金的投资范围；如法律法规或中国证监会变更上述投资品种的比例限制，基金管理人可在履行适当程序后调整本基金的投资比例规定。

### （三）投资理念

中国拥有庞大的人口、市场及自然资源，对于真正能够顺应产业变革，迎合市场需求或者提升人们生活品质和效率的公司具有非常广阔的发展空间，而中小公司因其规模小而经营灵活的特点更易具备爆发性增长的可能。国内外的实践也表明，中小上市公司从长期来看，往往可以获得超过市场平均水平的回报。

### （四）投资策略

#### 1、资产配置策略

本基金将通过对宏观经济基本面及证券市场双层面的数据进行研究，并通过定性定量分析、风险测算及组合优化，最终形成大类资产配置决策。

首先，建立宏观指标监测体系。

本基金将通过资产配置小组,严密跟踪分析反映宏观经济运行的各项指标及证券市场层面的指标,以求把握整个宏观经济形势的未来走向和节奏,进而为本基金的资产配置决策提供支持。

具体来说,宏观经济运行指标主要包括:

(1) 宏观经济先行指标,如狭义货币供应量(M1)、广义货币供应量(M2)、财政预算、制造业采购经理指数(PMI)、大宗商品库存及价格变化等;

(2) 宏观经济状态指标,如GDP、CPI、PPI、规模以上工业企业增加值及利润和失业率等。

证券市场指标主要包括:

(1) 股票市场:估值水平及历史估值波动区间、资金供求状况、成交量及换手率等、投资者结构数据及其变化等;

(2) 债券市场:债券收益率水平、收益率曲线历史变动、流动性和资金供求状况等。

其次,对上述数据与大类资产收益率数据进行分析研究,把握其联系及规律。

本基金将运用光大保德信内部的定性和定量分析模型,将上述宏观指标(包括经济基本面及证券市场两个方面)的历史数据及大类资产收益率历史数据进行对比分析及量化回归分析,确定各类资产收益率与各类宏观经济指标和成分之间的影响模式,包括关联方向及关联度等方面。

再次,通过风险测算及组合优化,形成最终大类资产配置决策。

本基金在确立上述宏观经济指标和证券市场指标对各类资产预期收益率的影响模式后,再结合对上述宏观指标的分析预测,运用金融工程的大类资产风险测算及优化,最终确定各大类资产的配置比例。

## 2、股票投资策略

本基金将主要投资于具备高成长特性或者潜力的中小盘上市公司股票以求获取高成长带来的资本增值回报,其中基金投资的股票资产中至少80%投资于中小盘股票。

### (1) 中小盘上市公司的定义

本基金所指中小盘上市公司是指以下三类上市公司:

1) 在深圳中小板上市的公司；

2) 在创业板上市的公司；

3) 在沪深证券交易所主板上市、按股票总市值从小到大排序并相加得到的累计总市值达到主板总市值 40%的上市公司。

(2) 本基金将采用“自下而上”的策略精选中小盘个股。具体来说，本基金将通过以下定量及定性两个层面进行中小上市公司价值的挖掘：

1) 本基金将利用光大保德信中小企业价值评估模型对中小盘上市公司的价值进行初步排序。

光大保德信中小企业价值评估模型着重考察以下几个方面并进行量化赋权：

①中小企业公司市盈率 (P/E)，包括静态市盈率及预测未来两年的动态市盈率；

②上市公司基本面指标：

A. 盈利能力指标：主营业务收入增长率 ( $\Delta S$ )，盈利增长率 ( $\Delta E$ )；

B. 财务质量指标：财务杠杆 (A/E)；

C. 经营效率指标：股权回报率 (ROE)。

首先，市盈率是模型最重要的考察指标。本基金非常重视以合理的价格买入中小企业的高成长，故选用该指标作为价值评估模型的首要控制指标；

其次，加入基本面指标以控制所投资上市公司的经营风险。

具体来说，主营业务收入及盈利的边际增长率对于提升中小企业的价值非常重要，故模型加入了盈利能力指标以控制投资标的的盈利能力；

同时，中小企业相对于大型企业的财务风险更大，模型构建了上述财务质量指标以控制中小企业的财务风险。

此外，经营效率指标也将进入模型以区分中小企业的经营效率的差异。

主营业务收入增长率和盈利增长率增长数据采用未来两年盈利预测数据；其余指标采用上市公司披露的最近一个季度末的数据。

2) 同时，我们将从定性的角度对中小上市公司的价值进行进一步挖掘。具体来说，本基金将着重从以下几个方面挖掘拥有高成长特性或潜力的中小上市公司：



### ①处于行业生命周期早期或者上升阶段

中国是世界上最大的新兴市场国家，现有的产业规划布局不尽合理，政府着眼于长期可持续发展目标，已经出台了并且还将出台众多引导产业发展方向的新政策、新规划。

本基金即将挖掘那些在新兴产业发展中赢得先机，并且经受住企业初创阶段的考验，已经具备相对较为成熟的运作机制和风险抵御能力的中小企业。

对于虽未受国家政策扶植，但本基金判断也处于行业生命周期上升阶段，且公司治理规范透明、管理优秀、企业创新能力强、产品需求比较广泛的上市公司，本基金也将对其进行投资。

### ②拥有较好的技术应用前景

科技创新始终是促进现代社会不断进步的强大力量。中国已经涌现了众多科技创新型企业，随着技术进步的叠加效益的增强，制度环境的逐步改善以及资本供给的不断充实，中国必将涌现更多此类公司。

本基金将着重选取技术创新能力较强的上市公司，且其技术在应用的广度或深度上具有较大潜力的公司。从广度上主要考察该技术是否具备从单个行业拓展到多个行业，从产业链的某个环节衍生至整个链条，从多限制性到少限制性的应用等，从而可以判断其业务增长潜能；从深度上考察该技术是否具有高的进入壁垒，操作的精细化程度及效果等方面，从而判断其业务增长的可认可度和持续性。

### ③独特的商业模式

商业模式的创新将带来巨大的商机。本基金将从创新商业模式的复制性，可持续性、可盈利性等角度对具有独特商业模式的中小上市公司进行评估，选取那些具备先发优势，盈利的可持续性较强，管理团队优秀的上市公司。

### ④主导区域/细分领域

某些中小上市公司虽然处在传统产业或者产业周期的成熟阶段，但它们在区域市场或者细分行业中具有较强的竞争能力和发展能力。区域龙头企业往往在股东实力、区域文化认同、市场营销等方面具有突出的竞争力，而细分领域的龙头公司拥有该细分领域的先入优势、上下游资源优势或者低成本等。投资于该类上市公司也将为本基金带来稳健的回报。

### ⑤并购、重组潜力

中小企业天然就是并购重组的优良标的。本基金也将从行业竞争者，产业链结

构方面入手，结合本公司的信息优势对具备较强并购、重组预期的中小企业进行投资，在承担一定风险的前提下获取超额回报。

#### ⑥其他

未来出现不属于或者不完全属于上述五个层面的业务驱动因素时，本基金亦将其及时纳入研究范围，并选择在驱动因素下最具成长潜力的上市公司进行投资。

(3) 在完成中小盘上市公司定量及定性两个方面的基本面分析，进行投资组合构建时，本基金将在把握宏观经济周期性运行规律的基础上，分析市场形势变化以及未来各个行业的发展趋势，运用金融工程方法，合理调整投资组合在行业间的配置。同时，本基金还将定期采用行业偏离度和跟踪误差指标对组合的行业配置风险进行控制。

(4) 在完成行业配置的优化及风险控制后，本基金还将充分考察上市公司的流动性及股价历史波动性，利用金融工程工具进行整个投资组合的风险/收益优化及分散化投资，力图以最优的价格，承担最优的风险获得最优的回报。

(5) 在个股的买卖策略上，本基金将结合动量策略的研究，力争把握股票较佳的买卖时机，从而增强本基金的投资收益。动量策略主要研究上市公司股价变化、历史成交量、换手率等指标以求把握股价涨跌与成交量变化的规律，通过分析量价的配合情况，判断个股未来阶段性运行趋势，从而强化本基金对价值低估上市公司的买入时机及对估值已经反映投资价值或者高估的上市公司的卖出时机。

### 3、存托凭证的投资策略

本基金投资存托凭证的策略依照上述境内上市交易的股票投资策略执行。

### 4、固定收益类品种投资策略

本基金固定收益类资产的投资将在限定的投资范围内，根据国家货币政策和财政政策实施情况、市场收益率曲线变动情况、市场流动性情况来预测债券市场整体利率趋势，同时结合各具体品种的供需情况、流动性、信用状况和利率敏感度等因素进行综合分析，在严格控制风险的前提下，构建和调整债券投资组合。

在组合的久期选择方面，本基金将综合分析宏观面的各个要素，主要包括宏观经济所处周期、货币财政政策取向、市场流动性变动情况等，通过对各宏观变量的分析，判断其对市场利率水平的影响方向和程度，从而确定本基金固定收益

投资组合久期的合理范围。

在确定固定收益投资组合的具体品种时,本基金将根据市场对于个券的市场成交情况,对各个目标投资对象进行利差分析,包括信用利差,流动性利差,期权调整利差(OAS),并利用利率模型对利率进行模拟预测,选出定价合理或被低估,到期期限符合组合构建要求的固定收益品种。

#### (1) 类属资产配置策略

对类属资产配置进行决策的主要依据是对不同债券资产类收益与风险的估计和判断。我们基于对未来的宏观经济和利率环境的研究和预测,根据国债、金融债等不同品种的信用利差变动情况,以及各品种的市场容量和流动性情况,通过情景分析的方法,判断各个债券资产类属的预期回报,在不同债券品种之间进行配置。具体考量指标包括收益率分析、利差分析、信用等级分析和流动性分析,以此确定各类属资产的相对收益和风险因素,并以此进行投资判断依据。

#### (2) 组合久期调整策略

在确定了组合的整体久期后,组合将基于宏观经济研究和债券市场跟踪,结合收益率曲线的拟合和波动模拟模型,对未来的收益率曲线移动进行情景分析,从而根据不同期限的收益率变动情况,在长期、中期和短期债券间进行配置,以期在收益率曲线调整的过程中获得较好收益。

#### (3) 信用利差策略

随着债券市场的发展,企业债和公司债的发行将快速发展,我们预计大批优质企业将在交易所或者银行间市场发行债券。在这种情况下,本基金将通过对行业经济周期、发行主体内外部评级和市场利差分析等判断,加强对企业债、资产抵押债券等新品种的投资,并通过对信用利差的分析和管理,获取超额收益。

#### (4) 跨市场套利投资策略

目前的我国的债券市场分成交易所和银行间两个投资市场,其参与主体、资金量、交易模式等方面均存在较大的差异,本基金将关注银行间市场和交易所市场之间的利差波动情况,以博取跨市场的套利机会。

### 5、权证及其他品种投资策略

本基金在权证投资中将对权证标的证券的基本面进行研究,结合期权定价量化模型估算权证价值,主要考虑运用的策略有:价值挖掘策略、杠杆策略、双向权证策略、获利保护策略和套利策略等。

同时，法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，如股指期货、期权等衍生品等，本基金若认为有助于基金进行风险管理和组合优化的，可依据法律法规的规定履行适当程序后，运用金融衍生产品进行投资风险管理。

本基金管理人可以依据维护投资人合法权益的原则，根据证券市场实际情况对上述投资策略及投资组合构建流程进行非实质性的调整，此类变更不需经过基金份额持有人大会通过。

## （五）投资决策

### 1、投资依据

本基金管理人将主要依据下述因素决定基金资产配置和具体证券的买卖：

符合基金份额持有人利益最大化的原则；

国家有关法律法规，基金合同及公司章程的有关规定；

国家宏观经济环境及其对证券市场的影响；

国家货币政策、产业政策以及证券市场政策；

各行业、地区发展状况；

上市公司财务状况、行业环境、市场需求状况及其当前市场价格；

证券市场资金供求状况及未来走势。

### 2、投资管理程序

本基金强调团队式的投资管理机制，这是国际成熟投资理念及本土长期投资经验的集中体现。在强调深入挖掘投研团队集体智慧的同时，各层次的投资决策主体各司其职，明确权限设置及分工，对投资决策过程进行严格的风险管理。

（1）投资决策委员会是基金管理人负责宏观投资决策和投资监督的机构，确定投资原则、投资方向和投资范围；制定投资决策流程及权限设置；决定业绩比较基准的变更；决定对基金经理的投资授权并审核批准超出基金经理投资权限的投资项目；定期对投资流程及投资决定进行审查。

投资决策委员会将通过定期决策，确定资产的战略配置比例。投资决策委员会由总经理、副总经理、投资总监、基金经理、研究总监等人员组成。

投资决策委员会的主席由总经理担任，一般每月召开例会，如发生重大事宜，投资决策委员会召开临时会议做出相应决策；

（2）首席投资总监负责资产配置小组及投资组合委员会的日常管理。资产

配置小组由首席投资总监、基金经理、研究总监、首席策略分析师以及宏观研究员等人组成，一般每月召开例会，并提出下个月的资产配置建议，资产配置所需的风险收益的测算工作由金融工程小组负责；投资组合委员会由首席投资总监、投资总监、基金经理以及其他相关研究人员组成，一般每周召开例会，决定投资组合构建的具体方案，对日常投资流程和投资决策进行审查；评估投资流程中的各个因素以便进一步优化整个流程，及时适应市场环境的变化。

(3) 基金经理充分考虑资产配置小组及行业研究员、债券研究员的投资建议，其主要负责投资组合的日常管理，使投资组合的风险收益特征符合既定目标。基金经理着重关注宏观经济及行业景气状况及未来变动趋势，与资产配置小组探讨行业的投资评级，关注上市公司盈利变化。此外，基金经理对于需要重点投资的个股进行估值定价，并向投资组合委员会提出建议；

(4) 高级宏观研究员侧重于宏观经济研究及债券研究，负责投资组合中债券部分的构建及日常管理；

(5) 金融工程师着重关注量化研究，关注证券估值及预期收益率预测，每日将股票基本数据导入多因素数量模型，由数量模型预估股票预期收益率，作为投资组合构建的重要依据；

(6) 行业研究员着重评估数据质量及可靠度，通过走访公司，对上市公司商业运营模式、公司治理情况、盈利状况及成长性、管理者能力和诚信度等基本因素进行综合评估，并结合定量分析与定性分析对上市公司进行评级，为投资组合优化提供个股选择的建议；债券研究员负责研究宏观经济，央行货币政策，监测并分析影响收益率曲线变动的因素，为各类债券定价并提出投资债券投资建议；

(7) 投资组合委员会在内部和外部研究报告的基础上，经过集体讨论决定和论证，决定目标投资组合，报投资决策委员会审议批准；

(8) 目标投资组合经投资决策委员会批准后，由基金经理负责实施，下达交易指令到交易部；

(9) 交易部依据投资指令制定交易策略，统一执行投资交易计划，进行具体交易，并将指令的执行情况反馈给基金经理。投资组合决定权必须与交易下单权严格分离；

(10)基金管理人管理层下属的风险控制工作委员会根据市场变化对投资组合计划提出风险防范措施。监察稽核部对计划的执行过程进行日常监督和实时风险控制，投资组合方案执行完毕，基金经理负责向风险控制工作委员会，投资决策委员会及投资组合委员会提出总结报告；

(11)金融工程小组定期和不定期对基金进行投资表现绩效分析及风险评估，并提供相关报告，帮助投资团队和风险控制委员会及时了解基金收益主要来源及投资策略实施效果，投资组合风险水平及风险来源，从而及时调整投资组合，使其风险收益水平符合既定目标。

基金管理人有权在确保基金份额持有人利益的前提下根据实际情况对上述投资程序进行调整。

#### (六) 业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为  $75\% \times \text{中证 700 指数收益率} + 25\% \times \text{中证全债指数收益率}$ 。

中证 700 指数是由中证指数有限公司编制，其成份股是由中证 500 和中证 200 成份股一起构成，该指数综合反映沪深证券市场内中小市值公司的整体状况，这一特征与本基金中小盘的风格特征较为吻合。

如果上述基准指数停止计算编制或更改名称，或者今后法律法规发生变化，又或者市场推出更具权威、且更能够表征本基金风险收益特征的指数，则本基金管理人将视情况经与本基金托管人协商同意后，基金管理人可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告，但不需要召开基金份额持有人大会。

#### (七) 风险收益特征

本基金为混合型基金，主要以具有高成长特性或者潜力的中小盘上市公司股票为投资对象，属于证券投资基金中预期收益和风险均较高的品种，其预期收益和风险高于债券型基金及货币市场基金。

#### (八) 投资禁止行为与限制

##### 1、禁止用本基金财产从事以下行为

- (1) 承销证券；
- (2) 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，但是国务院另有规定的除外；

(5) 向本基金的基金管理人、基金托管人出资或者买卖本基金的基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；

(6) 买卖与本基金的基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与本基金的基金管理人、基金托管人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；

(7) 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；

(8) 依照法律法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他活动。

如法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，本基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制。

## 2、基金投资组合比例限制

(1) 本基金投资于中小盘上市公司的股票占股票资产的比例不得低于 80%。

本基金所指中小盘上市公司是指以下三类上市公司：

1) 在深圳中小板上市的公司；

2) 在创业板上市的公司；

3) 在沪深证券交易所主板上市、按股票总市值从小到大排序并相加得到的累计总市值达到主板总市值 40%的上市公司。

(2) 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%；

(3) 本基金与基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券总和，不超过该证券的 10%；

(4) 本基金股票资产占基金资产的比例范围为 60%-95%，其他资产占基金资产的比例范围为 5%—40%，权证资产占基金资产净值的比例范围为 0—3%，本基金投资于中小盘上市公司的股票占股票资产的比例不低于 80%；

(5) 本基金参与股票发行申购，所申报的金额不超过本基金总资产，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) 在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不展期；

(7) 在银行间市场进行债券回购融入的资金余额不超过基金资产净值的

40%;

(8) 基金的投资组合中保留的现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计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;

(9) 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%; 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%; 本公司管理的全部基金持有的同一权证, 不得超过该权证的 10%。其他权证的投资比例, 遵从法律法规或监管部门的相关规定;

(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%; 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%; 本公司管理的全部证券投资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%, 中国证监会规定的特殊品种除外。本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, 将在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出。

(12) 流通受限证券投资遵照《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》(证监基金字[2006]141 号) 及相关规定执行;

(13) 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;

(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%；

（16）基金总资产不得超过基金净资产的百分之一百四十；

（17）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；

（18）法律法规、基金合同及中国证监会规定的其他比例限制。

3、法律法规或监管部门修改或取消上述限制规定（第（3）项除外）时，本基金不受上述投资组合限制并相应修改限制规定。

（九）投资组合比例调整

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约定。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不符合基金合同约定的投资比例规定的，除第（8）、（11）、（13）、（14）项外，基金管理人应当在 10 个工作日内进行调整，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。

## 十三、基金的财产

### （一）基金资产总值

基金资产总值是指本基金拥有的各类有价证券及票据价值、银行存款本息、债券的应计利息、基金应收的申购基金款、缴存的保证金以及其他投资所形成的价值总和。

其构成主要有：

- 1、银行存款及其应计利息；
- 2、结算备付金及其应计利息；
- 3、根据有关规定缴存的保证金及其应收利息；
- 4、应收证券交易清算款；
- 5、应收申购基金款；
- 6、股票投资及其估值调整；
- 7、债券投资及其估值调整和应计利息；
- 8、其他投资及其估值调整；
- 9、其他资产等。

### （二）基金资产净值

本基金基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

### （三）基金财产的账户

基金托管人以本基金的名义在其营业机构开立本基金的银行存款托管账户；以基金托管人的名义在中国证券登记结算有限责任公司开立基金结算备付金账户，以本基金的名义在基金托管人托管系统中开立二级结算备付金账户；以基金托管人和本基金联名的方式在中国证券登记结算有限责任公司开立证券账户，以本基金的名义开立银行间债券托管账户并报中国人民银行备案。开立的上述基金财产账户与基金管理人、基金托管人、代销机构和登记机构自有的财产账户以及其他基金财产账户相独立。

如国家相关法律法规调整，基金管理人和基金托管人有权依据新规定执行。

### （四）基金财产的保管及处分

1、本基金财产独立于基金管理人及基金托管人的固有财产，并由基金托管人保管。

2、基金管理人、基金托管人因基金财产的管理、运用或者其他情形而取得的财产和收益，归基金财产。

3、基金管理人、基金托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，基金财产不属于其清算范围。

4、基金财产的债权不得与基金管理人、基金托管人固有财产的债务相抵销；不同基金财产的债权债务，不得相互抵销。非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定处分外，基金财产不得被处分。

## 十四、基金资产的估值

### （一）估值目的

基金资产的估值目的是客观、准确地反映基金财产的价值，并为基金份额的申购与赎回提供计价依据。

### （二）估值日

本基金的估值日为基金合同生效后相关的证券交易场所的正常营业日以及法律法规规定需要对外披露基金净值的非营业日。

### （三）估值对象

基金所拥有的股票、存托凭证、债券、权证和银行存款本息、应收款项和其他投资等资产。

### （四）估值方法

#### 1、证券交易所上市的有价证券的估值

（1）交易所上市的有价证券（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，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，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）交易所上市实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，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；

（3）交易所上市未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息（自债券计息起始日或上一起息日至估值当日的利息）得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，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；

（4）交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。交易所上市的资产支持证券，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。

2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

(1) 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市价（收盘价）估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值；

(2) 首次公开发行未上市的股票、债券和权证，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。

(3) 首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的市价（收盘价）估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

3、全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值。

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、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。

6、本基金投资存托凭证的估值核算，依照境内上市交易的股票进行。

7、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，基金净值信息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，按照基金管理人计算的结果对外予以公布。若以基金管理人的计算结果对外公布引发的估值差错造成实际损失时，基金托管人不承担赔偿责任。

(五) 估值程序

基金日常估值由基金管理人同基金托管人一同进行。基金份额净值由基金管理人完成估值后，将估值结果以书面形式报给基金托管人，基金托管人按基金合同规定的估值方法、时间、程序进行复核，基金托管人复核无误后签章返回给基金管理人，由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

#### （六）暂停估值的情形

- 1、基金投资所涉及的证券交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；
- 2、因不可抗力或其他情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金财产价值时；
- 3、占基金相当比例的投资品种的估值出现重大转变，而基金管理人为保障基金份额持有人的利益，决定延迟估值时；
- 4、出现基金管理人认为属于紧急事故的情况，导致基金管理人不能出售或评估基金资产时；
- 5、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，基金管理人应当暂停基金估值；
- 6、中国证监会和基金合同认定的其他情形。

#### （七）基金份额净值的计算

$T \text{ 日基金份额净值} = T \text{ 日基金资产净值} / T \text{ 日基金总份额余额}$

基金份额净值的计算，精确到 0.0001 元，小数点第五位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

#### （八）估值错误的处理

1、当基金财产的估值导致基金份额净值小数点后四位内（含第四位）发生差错时，视为基金份额净值估值错误。基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金财产估值的准确性、及时性。当估值或基金份额净值计价出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；当计价错误达到或超过基金份额净值的 0.25%时，基金管理人应通报基金托管人，并报中国证监会备案；计价错误达到基金份额净值的 0.5%时，基金管理人应通报基金托管人，按本基金合同的规定进行公告，并报告中国证监会。

## 2、差错类型

本基金运作过程中，如果由于基金管理人、基金托管人、登记机构、代理销售机构或投资人自身的原因造成差错，导致其他当事人遭受损失的，责任人应当对由于该差错遭受损失的当事人（“受损方”）按下述“差错处理原则”给予赔偿。

上述差错的主要类型包括但不限于：资料申报差错、数据传输差错、数据计算差错、系统故障差错、下达指令差错等；对于因技术原因引起的差错，若系同行业现有技术水平无法预见、无法避免、无法抗拒，则属不可抗力。

由于不可抗力原因造成投资人的交易资料灭失、被错误处理或造成其他差错，因不可抗力原因出现差错的当事人不对其他当事人承担赔偿责任，但因该差错取得不当得利的当事人仍应负有返还不当得利的义务。

## 3、差错处理原则

因基金估值错误给投资人造成损失的应由基金管理人和基金托管人依照法律法规的规定予以承担。基金管理人或基金托管人对不应由其承担的责任，有权向责任人追偿。本基金合同的当事人应将按照以下约定的原则处理基金估值差错。

（1）差错已发生，但尚未给当事人造成损失时，差错责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正差错发生的费用由差错责任方承担；由于差错责任方未及时更正已产生的差错，给当事人造成损失的由差错责任方承担；若差错责任方已经积极协调，并且有协助义务的当事人有足够的时间进行更正而未更正，由此造成或扩大的损失由差错责任方和未更正方依法分别各自承担相应的赔偿责任。差错责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认，确保差错已得到更正；

（2）差错的责任方对可能导致有关当事人的直接损失负责，不对间接损失负责，并且仅对差错的有关直接当事人负责，不对第三方负责；

（3）因差错而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但差错责任方仍应对差错负责，如果由于获得不当得利的当事人不返还或不全部返还不当得利造成其他当事人的利益损失，则差错责任方应赔偿受损方的损失，并在其支付的赔偿金额的范围内对获得不当得利的当事人享有要求交付不当得利的权利；如果获得不当得利的当事人已经将此部分不当得利返还给受损方，则受损方应当将其已经获得的赔偿额加上已经获得的不当得利返还的总和超过其实际

损失的差额部分支付给差错责任方；

(4) 差错调整采用尽量恢复至假设未发生差错的正确情形的方式；

(5) 差错责任方拒绝进行赔偿时，如果因基金管理人原因造成基金财产损失时，基金托管人应为基金的利益向基金管理人追偿，如果因基金托管人原因造成基金财产损失时，基金管理人应为基金的利益向基金托管人追偿。除基金管理人和托管人之外的第三方造成基金财产的损失，由基金管理人负责向差错方追偿；追偿过程中产生的有关费用，应列入基金费用，从基金资产中支付；

(6) 如果出现差错的当事人未按规定对受损方进行赔偿，并且依据法律法规、本基金合同或其他规定，基金管理人或基金托管人自行或依据法院判决、仲裁裁决对受损方承担了赔偿责任，则基金管理人或基金托管人有权向出现差错的当事人进行追索，并有权要求其赔偿或补偿由此发生的费用和遭受的损失；

(7) 按法律法规规定的其他原则处理差错。

#### 4、差错处理程序

差错被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

(1) 查明差错发生的原因，列明所有当事人，根据差错发生的原因确定差错责任方；

(2) 根据差错处理原则或当事人协商的方法对因差错造成的损失进行评估；

(3) 根据差错处理原则或当事人协商的方法由差错的责任方进行更正和赔偿损失；

(4) 根据差错处理的方法，需要修改基金登记机构的交易数据的，由基金登记机构进行更正，并就差错的更正向有关当事人进行确认；

(5) 基金管理人及基金托管人计价错误达到或超过基金份额净值的 0.25% 时，基金管理人应通报基金托管人，并报中国证监会备案；计价错误达到基金份额净值的 0.5% 时，基金管理人应通报基金托管人，按本基金合同的规定进行公告，并报告中国证监会。

#### (九) 特殊情形的处理

1、基金管理人按本条第(四)项第 5 条款进行估值时，所造成的误差不作为基金份额净值错误处理。

2、由于不可抗力原因，或由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误，



或国家会计政策变更、市场规则变更等，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，由此造成的基金财产估值错误，基金管理人和基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人及基金托管人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

## 十五、基金费用与税收

### （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、基金的证券交易费用；
- 4、基金合同生效以后的与基金相关的信息披露费用；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金合同生效以后的与基金相关的会计师费和律师费；
- 7、基金财产中列支的银行汇划费用；
- 8、按照国家有关规定可以列入的其他费用。

上述费用从基金财产中支付。

### （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

本基金的管理费率为年费率 1.5%。

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

#### 2、基金托管人的基金托管费

本基金的托管费率为年费率 0.25%。

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$$

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，逐日累计至每个月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。

3、本条第（一）款第 3 至第 8 项费用由基金管理人和基金托管人根据有关法规及相应协议的规定，列入或摊入当期基金费用。

#### （三）不列入基金费用的项目

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，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金合同生效之前的律师费、会计师费和信息披露费用等不得从基金财产中列支。

#### （四）基金管理费和基金托管费的调整

在符合相关法律法规和履行了必备的程序的条件下，基金管理人和基金托管人可协商酌情调低基金管理费和基金托管费，无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须最迟于新的费率实施日前 2 日在中国证监会指定媒介上刊登公告。

#### （五）其他费用

按照国家有关规定和基金合同约定，基金管理人可以在基金财产中列支其他的费用，并按照相关的法律法规的规定进行公告或备案。

#### （六）税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，依照国家法律法规的规定履行纳税义务。

## 十六、基金收益与分配

### （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）收益分配原则

本基金收益分配应遵循下列原则：

- 1、本基金的每份基金份额享有同等分配权；
- 2、在符合有关基金分红条件的前提下，每年最多分配 4 次，每次基金收益分配比例不低于期末（期末指当次分红时的可供分配利润计算截止日，下同）可供分配利润的 50%（期末可供分配利润指期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数）；
- 3、若基金合同生效不满 3 个月则可不进行收益分配；
- 4、本基金收益分配方式分为两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利按权益登记日除权后的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；
- 5、基金红利发放日距离收益分配基准日（即期末可供分配利润计算截至日）的时间不得超过 15 个工作日；
- 6、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；
- 7、收益分配时发生的银行转账等手续费用由基金份额持有人自行承担。当基金份额持有人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按权益登记日除权后的基金份额净值自动转为基金份额。
- 8、法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

### （三）收益分配方案

基金收益分配方案中应载明基金收益的范围、基金期末可供分配利润、基金收益分配对象、分配原则、分配时间、分配数额及比例、分配方式、支付方式及有关手续费等内容。

### （四）收益分配方案的确定与公告

基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人核实后确定，基金管理人依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

在收益分配方案公布后，基金管理人依据具体方案的规定就支付的现金红利向基金托管人发送划款指令，基金托管人应按照基金管理人的指令及时进行分红资金的划付。

#### （五）收益分配中发生的费用

收益分配时发生的银行转账等手续费用由基金份额持有人自行承担。当基金份额持有人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按权益登记日除权后的基金份额净值自动转为基金份额。

## 十七、基金的会计与审计

### （一）基金会计政策

- 1、基金的会计年度为公历每年1月1日至12月31日。
- 2、基金核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位。
- 3、会计制度按国家有关的会计制度执行。
- 4、本基金独立建账、独立核算。
- 5、本基金会计责任人为基金管理人。
- 6、基金管理人应保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关规定编制基金会计报表，基金托管人定期与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以书面方式确认。

上述规定因国家法律、法规或政策变化而发生调整时，经中国证监会核准后公告，无须召开基金份额持有人大会。

### （二）基金年度审计

- 1、基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相独立的、具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所及其注册会计师对基金年度财务报表及其他规定事项进行审计；
- 2、会计师事务所更换经办注册会计师，应事先征得基金管理人同意；
- 3、基金管理人认为有充足理由更换会计师事务所，须通报基金托管人。基金管理人应在更换会计师事务所后在2日内在中国证监会指定媒介公告。

## 十八、基金的信息披露

### （一）信息披露要求

基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、基金合同及其他有关规定。

基金管理人、基金托管人和其他基金信息披露义务人应当以保护基金份额持有人利益为根本出发点，依法披露基金信息，并保证所披露信息的真实性、准确性、完整性、及时性、简明性和易得性。

### （二）信息披露义务人

本基金信息披露义务人包括基金管理人、基金托管人、召集基金份额持有人大会的基金份额持有人等法律法规和中国证监会规定的自然人、法人和非法人组织。

基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内，将应予披露的基金信息通过中国证监会指定的全国性报刊（以下简称“指定报刊”）和指定互联网网站（以下简称“指定网站”，包括基金管理人网站、基金托管人网站、中国证监会基金电子披露网站）等媒介披露，并保证投资人能够按照基金合同约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。

（三）本基金信息披露义务人承诺在公开披露基金信息的过程中不得有下列行为：

- 1、虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏；
- 2、对证券投资业绩进行预测；
- 3、违规承诺收益或者承担损失；
- 4、诋毁其他基金管理人、基金托管人或者基金销售机构；
- 5、登载任何自然人、法人和非法人组织的祝贺性、恭维性或推荐性文字；
- 6、中国证监会禁止的其他行为。

### （四）信息披露文本

本基金公开披露的信息应采用中文文本。如同时采用外文文本的，基金信息

披露义务人应保证不同文本的内容一致。不同文本之间发生歧义的，以中文文本为准。

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。

## （五）公开披露的基金信息

### （1）基金募集信息披露

1、基金募集申请经中国证监会核准后，基金管理人应当在基金份额发售的3日前，将招募说明书、基金合同摘要登载在指定媒介上；基金管理人、基金托管人应当将基金合同、基金托管协议登载在各自公司网站上。

2、基金管理人应当就基金份额发售的具体事宜编制基金份额发售公告，并在披露招募说明书的当日登载于指定媒介上。

3、基金管理人应当在基金合同生效的次日在指定媒介上登载基金合同生效公告。

4、基金合同生效后，基金招募说明书的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金招募说明书并登载在指定网站上；基金招募说明书其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金招募说明书。

5、基金产品资料概要是基金招募说明书的摘要文件，用于向投资者提供简明的基金概要信息。基金合同生效后，基金产品资料概要的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金产品资料概要，并登载在指定网站及基金销售机构网站或营业网点；基金产品资料概要其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金产品资料概要。

### （2）定期报告

基金定期报告由基金管理人按照法律法规和中国证监会颁布的有关证券投资基金信息披露内容与格式的相关文件的规定单独编制，由基金托管人复核。基金定期报告，包括基金年度报告、基金中期报告和基金季度报告。

1、基金年度报告：基金管理人应当在每年结束之日起三个月内，编制完成基金年度报告，将年度报告登载在指定网站上，并将年度报告提示性公告登载在



指定报刊上。基金年度报告中的财务会计报告应当经过具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计。

2、基金中期报告：基金管理人应当在上半年结束之日起两个月内，编制完成基金中期报告，将中期报告登载在指定网站上，并将中期报告提示性公告登载在指定报刊上。

3、基金季度报告：基金管理人应当在每个季度结束之日起 15 个工作日内，编制完成基金季度报告，将季度报告登载在指定网站上，并将季度报告提示性公告登载在指定报刊上。

4、基金合同生效不足 2 个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、中期报告或者年度报告。

基金管理人应当在基金年度报告和中期报告中披露基金组合资产情况及其流动性风险分析等。

报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金总份额 20% 的情形，为保障其他投资者权益，基金管理人至少应当在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告文件中“影响投资者决策的其他重要信息”项下披露该投资者的类别、报告期末持有份额及占比、报告期内持有份额变化情况及本基金的特有风险，中国证监会认定的特殊情形除外。

### （3）基金净值信息

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在指定网站披露一次基金份额净值和基金份额累计净值。

在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当在不晚于每个开放日的次日，通过指定网站、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，在指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。

### （4）基金份额申购、赎回价格

基金管理人应当在基金合同、招募说明书等信息披露文件上载明基金份额申购、赎回价格的计算方式及有关申购、赎回费率，并保证投资者能够在基金销售机构网站或营业网点查阅或者复制前述信息资料。

### （5）临时报告与公告

基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在 2 日内编制临时报告书，并登载在指定报刊和指定网站上。

前款所称重大事件，是指可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的下列事件：

- 1、基金份额持有人大会的召开及决定的事项；
- 2、终止基金合同、基金清算；
- 3、转换基金运作方式、基金合并；
- 4、更换基金管理人、基金托管人、基金份额登记机构，基金改聘会计师事务所；
- 5、基金管理人委托基金服务机构代为办理基金的份额登记、核算、估值等事项，基金托管人委托基金服务机构代为办理基金的核算、估值、复核等事项；
- 6、基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；
- 7、基金管理人变更持有百分之五以上股权的股东、基金管理人的实际控制人变更；
- 8、基金募集期延长；
- 9、基金管理人的高级管理人员、基金经理和基金托管人专门基金托管部门负责人发生变动；
- 10、基金管理人的董事在最近 12 个月内变更超过百分之五十，基金管理人、基金托管人专门基金托管部门的主要业务人员在最近 12 个月内变动超过百分之三十；
- 11、涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼或者仲裁；
- 12、基金管理人或其高级管理人员、基金经理因基金管理业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚，基金托管人或其专门基金托管部门负责人因基金托管业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚；
- 13、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事项，但中国证监会另有规定的除外；
- 14、基金收益分配事项；
- 15、管理费、托管费、申购费、赎回费等费用计提标准、计提方式和费率发

生变更；

- 16、基金份额净值计价错误达基金份额净值 0.5%；
- 17、基金开始办理申购、赎回；
- 18、基金发生巨额赎回并延期办理；
- 19、基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项；
- 20、基金暂停接受申购、赎回申请或重新接受申购、赎回申请；
- 21、发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时；
- 22、基金信息披露义务人认为可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的其他事项或中国证监会规定的其他事项。

#### （6）澄清公告

在基金存续期内，任何公共媒介中出现的或者在市场上流传的消息可能对基金份额价格产生误导性影响或者引起较大波动，以及可能损害基金份额持有人权益的，相关信息披露义务人知悉后应当立即对该消息进行公开澄清，并将有关情况立即报告中国证监会。

#### （7）清算报告

基金合同终止的，基金管理人应当依法组织基金财产清算小组对基金财产进行清算并作出清算报告。基金财产清算小组应当将清算报告登载在指定网站上，并将清算报告提示性公告登载在指定报刊上。

#### （8）基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会备案，并予以公告。

#### （9）中国证监会规定的其他信息

### （六）信息披露事务管理

基金管理人、基金托管人应当建立健全信息披露管理制度，指定专门部门及高级管理人员负责管理信息披露事务。

基金信息披露义务人公开披露基金信息，应当符合中国证监会相关基金信息披露内容与格式准则等法规规定。

基金托管人应当按照相关法律法规、中国证监会的规定和基金合同的约定，对基金管理人编制的基金资产净值、基金份额净值、基金份额申购赎回价格、基

金定期报告、更新的招募说明书、基金产品资料概要、基金清算报告等公开披露的相关基金信息进行复核、审查，并向基金管理人进行书面或电子确认。

基金管理人、基金托管人应当在指定报刊中选择一家报刊披露本基金信息。基金管理人、基金托管人应当向中国证监会基金电子披露网站报送拟披露的基金信息，并保证相关报送信息的真实、准确、完整、及时。

基金管理人、基金托管人除依法在指定媒介上披露信息外，还可以根据需要在其他公共媒介披露信息，但是其他公共媒介不得早于指定媒介披露信息，并且在不同媒介上披露同一信息的内容应当一致。

基金管理人、基金托管人除按法律法规要求披露信息外，也可着眼于为投资者决策提供有用信息的角度，在保证公平对待投资者、不误导投资者、不影响基金正常投资操作的前提下，自主提升信息披露服务的质量。具体要求应当符合中国证监会及自律规则的相关规定。前述自主披露如产生信息披露费用，该费用不得从基金财产中列支。

为基金信息披露义务人公开披露的基金信息出具审计报告、法律意见书的专业机构，应当制作工作底稿，并将相关档案至少保存到基金合同终止后 10 年。

#### （七）信息披露文件的存放与查阅

依法必须披露的信息发布后，基金管理人、基金托管人应当按照相关法律法规规定将信息置备于公司住所，供社会公众查阅、复制。

#### （八）本基金信息披露事项以法律法规规定及本章节约定的内容为准。

## 十九、基金合同的变更、终止与基金财产的清算

### （一）基金合同的变更

1、基金合同变更涉及本基金合同第八节第（二）项规定的对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的，应经基金份额持有人大会决议通过。变更基金合同的基金份额持有人大会决议须报中国证监会备案，自表决通过之日起生效，并自决议生效后依照有关规定在指定媒介上公告。

2、除上述第 1 项规定的情形外，经基金管理人和基金托管人同意可对基金合同的内容进行变更，该等变更应当在 2 日内由基金管理人进行公告并报中国证监会备案。

### （二）基金合同的终止

有下列情形之一的，本基金合同终止：

- 1、基金份额持有人大会决定终止；
- 2、基金管理人职责终止，在六个月内没有新基金管理人承接的；
- 3、基金托管人职责终止，在六个月内没有新基金托管人承接的；
- 4、法律法规和基金合同规定的其他情形。

### （三）基金财产的清算

1、基金合同终止，应当按法律法规和本基金合同的有关规定对基金财产进行清算。

#### 2、基金财产清算组

（1）自基金合同终止之日起 30 个工作日内由基金管理人组织成立基金财产清算组，在基金财产清算组接管基金财产之前，基金管理人和基金托管人应按照基金合同和托管协议的规定继续履行保护基金财产安全的职责。

（2）基金财产清算组成员由基金管理人、基金托管人、基金登记机构、具有证券、期货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。基金财产清算组可以聘用必要的工作人员。

（3）基金财产清算组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算组可以依法进行必要的民事活动。

#### 3、清算程序

- （1）基金合同终止后，发布基金财产清算公告；

- (2) 基金合同终止后，由基金财产清算组统一接管基金财产；
- (3) 基金财产清算组根据基金财产的情况确定清算期限；
- (4) 基金财产清算组对基金财产进行清理和确认；
- (5) 对基金财产进行评估和变现；
- (6) 基金清算组做出清算报告；
- (7) 会计师事务所对清算报告进行审计；
- (8) 律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- (9) 将基金清算结果报告中国证监会；
- (10) 公布基金财产清算结果；
- (11) 对基金剩余财产进行分配。

#### 4、清算费用

清算费用是指基金财产清算组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金清算组优先从基金财产中支付。

#### 5、基金剩余财产的分配

基金财产按如下顺序进行清偿：

- (1) 支付基金财产清算费用；
- (2) 缴纳基金所欠税款；
- (3) 清偿基金债务；
- (4) 清算后如有余额，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

基金财产未按前款（1）—（3）项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

#### 6、基金财产清算的公告

清算小组成立后 2 日内应就清算小组的成立进行公告；清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算组做出的清算报告经具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，报中国证监会备案并公告。

7、基金财产清算账册及文件由基金托管人保存 15 年以上。

## 二十、业务规则

本基金合同当事人应遵守《光大保德信基金管理有限公司开放式基金业务规则》（简称“业务规则”）。业务规则由基金管理人在符合法律法规及基金合同规定的前提下制定、修改和解释。

## 二十一、违约责任

（一）基金管理人、基金托管人在履行各自职责的过程中，违反《基金法》等法律法规的规定或者基金合同的约定，给基金财产或者基金份额持有人造成损害的，应当分别对各自的行为依法承担赔偿责任；因共同行为给基金财产或者基金份额持有人造成损害的，应当承担连带赔偿责任。

（二）由于基金合同当事人违反基金合同，给其他基金合同当事人造成损失的，应当承担赔偿责任。当发生下列情况时，当事人可以免责：

1、基金管理人及基金托管人按照当时有效的法律法规、市场交易规则或中国证监会的规定作为或不作为而造成的损失等；

2、在没有故意或过失的情况下，基金管理人由于按照本基金合同规定的投资原则行使或不行使其投资权所造成的损失等；

3、不可抗力。

（三）在发生一方或者多方当事人违约的情况下，基金合同能够履行的应当继续履行。

（四）本合同当事人一方违约后，其他当事人应当采取适当措施防止损失的扩大；没有采取适当措施致使损失扩大的，不得就扩大的损失要求赔偿。守约方因防止损失扩大而支出的合理费用由违约方承担。

（五）由于基金管理人、基金托管人不可控制的因素导致业务出现差错，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现错误的，由此造成基金财产或投资人损失，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但是基金管理人和基金托管人应积极采取必要的措施消除由此造成的影响。



## 二十二、争议的处理

(一) 本基金合同适用中华人民共和国法律并从其解释。

(二) 本基金合同的当事人之间因本基金合同产生的或与本基金合同有关的争议可首先通过友好协商或调解解决。自一方书面要求协商解决争议之日起六十日内如果争议未能以协商或调解方式解决，则任何一方有权将争议提交上海国际经济贸易仲裁委员会，根据提交仲裁时该会届时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地在上海市。仲裁裁决是终局的，对仲裁各方当事人均具有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

(三) 除争议所涉内容之外，本基金合同的其他部分应当由本基金合同当事人继续履行。

## 二十三、基金合同的效力

（一）本基金合同是约定基金当事人之间、基金与基金当事人之间权利义务关系的法律文件。本基金合同经基金管理人和基金托管人加盖公章以及双方法定代表人或授权代表签字，在基金募集结束，基金备案手续办理完毕，并获中国证监会书面确认后生效。

（二）本基金合同自生效之日起对包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人在内的基金合同各方当事人具有同等的法律约束力。

（三）本基金合同的有效期限自其生效之日起至本基金财产清算结果报中国证监会备案并公告之日止。

（四）本基金合同正本一式六份，除上报有关监管机构一式二份外，基金管理人、基金托管人各持有二份，每份具有同等的法律效力。

（五）基金合同可印制成册，存放在基金管理人和基金托管人住所，供投资人查阅，基金合同条款及内容应以基金合同正本为准。

（六）本基金合同如有未尽事宜，由本基金合同当事人各方按有关法律法规和规定协商解决。

## 二十四、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

#### 1、基金份额持有人的权利、义务

（1）基金投资人持有本基金基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，基金投资人自依据招募说明书、基金合同取得本基金的基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同当事人，直至其不再持有本基金的基金份额。基金份额持有人作为当事人并不以在基金合同上书面签章为必要条件。每份基金份额具有同等的合法权益。

#### （2）基金份额持有人的权利

- 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) 依法转让或者申请赎回其持有的基金份额；
- 4) 按照规定要求召开基金份额持有人大会；
- 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、登记机构、基金份额发售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼；
- 9) 法律法规、基金合同规定的其他权利。

#### （3）基金份额持有人的义务

- 1) 遵守法律法规、基金合同及其他有关规定；
- 2) 交纳基金认购、申购款项及基金合同规定的费用；
- 3) 在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；
- 4) 不从事任何有损基金及其他基金合同当事人合法利益的活动；
- 5) 执行生效的基金份额持有人大会决议；
- 6) 返还在基金交易过程中因任何原因，自基金管理人及基金管理人的代理人、基金托管人、代销机构及其他基金份额持有人处获得的不当得利；
- 7) 在办理开户、认购、申购、赎回等各项业务时，按照销售机构要求提供

真实、完整、准确、有效的客户资料；

8) 法律法规及基金合同规定的其他义务。

## 2、基金管理人的权利、义务

### (1) 基金管理人的权利

1) 依法募集基金，办理基金备案手续；

2) 自基金合同生效之日起，依照法律法规和基金合同独立管理基金财产；

3) 根据法律法规和基金合同的规定，制订、修改并公布有关基金募集、认购、申购、赎回、转托管、基金转换、非交易过户、冻结、收益分配等方面的业务规则；

4) 根据法律法规和基金合同的规定获得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；

5) 在符合有关法律法规和基金合同的前提下，决定本基金的相关费率结构和收费方式；

6) 根据法律法规和基金合同之规定销售基金份额；

7) 依据法律法规和基金合同的规定监督基金托管人；

8) 根据基金合同的规定选择适当的基金代销机构并有权依照代销协议对基金代销机构行为进行必要的监督和检查；

9) 自行承担基金登记机构或选择、更换基金登记代理机构，办理基金登记业务，并按照基金合同规定对基金登记代理机构进行必要的监督和检查；

10) 在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购和赎回的申请；

11) 在法律法规允许的前提下，为基金份额持有人的利益依法为基金进行融资融券；

12) 依据法律法规和基金合同的规定，制订基金收益的分配方案；

13) 按照法律法规，代表基金对被投资企业行使股东权利，代表基金行使因投资于其他证券所产生的权利；

14) 在基金托管人职责终止时，提名新的基金托管人；

15) 依据法律法规和基金合同的规定，召集基金份额持有人大会；

16) 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者实施其他法律行为；

17) 选择、更换律师、审计师、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构并确定有关费率；

18) 法律法规、基金合同以及依据基金合同制订的其他法律文件所规定的其他权利。

## (2) 基金管理人的义务

1) 依法募集基金，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、勤勉尽责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) 配备足够的专业人员办理基金份额的认购、申购和赎回业务；

6) 配备足够的专业人员和相应的技术设施进行基金的登记或委托其他机构代理该项业务；

7) 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资产相互独立，对所管理的不同基金和受托资产分别管理、分别记账，进行证券投资；

8) 除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得以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；

9) 接受基金托管人依法进行的监督；

10) 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，按照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；

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，应予以保密，不得向他人泄露；

- 13) 按基金合同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) 按照法律法规和本基金合同的规定受理申购和赎回等申请, 及时、足额支付赎回和分红款项;
- 15) 不谋求对上市公司的控股和直接管理;
- 16) 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;
- 17) 按规定保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料 15 年以上;
- 18) 进行基金会计核算并编制基金的财务会计报告;
- 19) 编制季度报告、中期报告和年度报告;
- 20) 确保需要向基金份额持有人提供的各项文件或资料, 能在规定时间内发出; 保证投资人能够按照基金合同约定的时间和方式, 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;
- 21) 组织并参加基金财产清算组, 参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配;
- 22) 面临解散、依法被撤销、被依法宣告破产或者由接管人接管其资产时, 及时报告中国证监会并通知基金托管人;
- 23) 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的合法权益, 应承担赔偿责任, 其赔偿责任不因其退任而免除;
- 24) 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, 应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿;
- 25) 不从事任何有损基金财产及本基金其他当事人利益的活动;
- 26) 公平对待所管理的不同基金和受托资产, 防止在不同基金和受托资产间进行有损本基金基金份额持有人的利益的资源分配;
- 27) 以基金管理人的名义, 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;
- 28) 法律法规及基金合同规定的其他义务。

### 3、基金托管人的权利、义务

#### (1) 基金托管人的权利

- 1) 依据法律法规和基金合同的规定安全保管基金财产；
- 2) 依照基金合同的约定获得基金托管费；
- 3) 监督基金管理人对本基金的投资运作，如托管人发现基金管理人的投资指令违反基金合同或有关法律法规的规定的，不予执行并向中国证监会报告；
- 4) 在基金管理人职责终止时，提名新的基金管理人；
- 5) 依据法律法规和基金合同的规定召集基金份额持有人大会；
- 6) 依据法律法规和基金合同的规定监督基金管理人，如认为基金管理人违反了法律法规或基金合同规定对基金财产、其他基金合同当事人的利益造成重大损失的，应及时呈报中国证监会，以及采取其他必要措施以保护本基金及相关基金合同当事人的利益；
- 7) 法律法规、基金合同规定的其他权利。

#### (2) 基金托管人的义务

- 1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则安全保管基金财产；
- 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资产以及不同的基金财产相互独立；对所托管的不同的基金和受托资产分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金、受托资产之间在名册登记、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》、本基金合同及其他有关规定外，不以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) 按规定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和证券账户；
- 7) 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；

- 8) 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应予以保密，不得向他人泄露；
- 9) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额净值及基金份额申购、赎回价格；
- 10) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；
- 11) 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，还应说明基金托管人是否采取了适当的措施；
- 12) 按规定保存有关基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料，保存基金的会计账册、报表和记录等 15 年以上；
- 13) 根据有关法律法规，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；
- 14) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；
- 15) 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；
- 16) 按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会；
- 17) 按照规定监督基金管理人的投资运作；
- 18) 参加基金财产清算组，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、破产或者由接管人接管其资产时，及时报告中国证监会和中国银监会，并通知基金管理人；
- 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，基金托管人应为基金向基金管理人追偿；
- 21) 因违反基金合同导致基金财产的损失，应承担赔偿责任，其责任不因其退任而免除；
- 22) 不从事任何有损基金及基金合同其他当事人利益的活动；
- 23) 法律、法规、本基金合同所规定的其他义务。



(二) 基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

1、本基金的基金份额持有人大会，由本基金的基金份额持有人共同组成。本基金的基金份额持有人享有平等的表决权，每一基金份额具有一票表决权。

2、有以下事由情形之一时，应召开基金份额持有人大会：

- (1) 终止基金合同；
- (2) 转换基金运作方式；
- (3) 更换基金托管人；
- (4) 更换基金管理人；
- (5) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，但根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外；
- (6) 本基金与其他基金的合并；
- (7) 变更基金类别；
- (8) 变更基金投资目标、范围或策略（法律法规和中国证监会另有规定的除外）；
- (9) 变更基金份额持有人大会程序；
- (10) 对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；
- (11) 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。

3、出现以下情形之一的，可由基金管理人和基金托管人协商后修改基金合同，不需召开基金份额持有人大会：

- (1) 调低基金管理费、基金托管费和其他应由基金承担的费用；
- (2) 在法律法规和基金合同规定的范围内变更本基金的申购费率、调低赎回费率或变更收费方式；
- (3) 因相应的法律法规发生变动而应当对基金合同进行修改；
- (4) 对基金合同的修改不涉及基金合同当事人权利义务关系发生变化；
- (5) 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；
- (6) 除法律法规或基金合同规定应当召开基金份额持有人大会以外的其他情形。

4、召集人和召集方式

(1) 除法律法规或本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。基金管理人未按规定召集或者不能召集时，由基金托管人召集。

(2) 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，应当自行召集。

(3) 代表基金份额 10%以上（含 10%，以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）的基金份额持有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。

(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，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基金份额持有人大会，但应当至少提前 30 日向中国证监会备案。

(5) 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。

#### 5、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，召集人必须于会议召开日前 30 天在指定媒介上公告。基金份额持有人大会通知须至少载明以下内容：

- 1) 会议召开的时间、地点和方式；
- 2) 会议拟审议的主要事项；

- 3) 会议形式;
- 4) 议事程序;
- 5) 有权出席基金份额持有人大会的权益登记日;
- 6) 代理投票的授权委托书的内容要求(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;
- 7) 表决方式;
- 8) 会务常设联系人姓名、电话;
- 9) 出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续;
- 10) 召集人需要通知的其他事项。

(2) 采用通讯方式开会并进行表决的情况下, 由召集人决定通讯方式和书面表决方式, 并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、书面表达意见的寄交和收取方式及截止时间。

(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书面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书面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书面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书面表决意见的计票进行监督的, 不影响表决意见的计票结果。

## 6、基金份额持有人出席会议的方式

### (1) 会议方式

基金份额持有人大会的召开方式包括现场开会和通讯方式开会。

现场开会由基金份额持有人本人出席或通过授权委托书委派其代理人出席, 现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当出席, 如基金管理人或基金托管人拒不派代表出席的, 不影响表决效力。

通讯方式开会指按照本基金合同的相关规定以通讯的书面方式进行表决。

会议的召开方式由召集人确定, 但决定更换基金管理人、更换基金托管人、转换基金运作方式和终止基金合同事宜必须以现场开会方式召开基金份额持有人大会。

## (2) 召开基金份额持有人大会的条件

### 1) 现场开会方式

在同时符合以下条件时，现场会议方可举行：

①对到会者在权益登记日持有基金份额的统计显示，全部有效凭证所对应的基金份额应占权益登记日基金总份额的 50%以上（含 50%）；

②到会的基金份额持有人身份证明及持有基金份额的凭证、代理人身份证明、委托人持有基金份额的凭证及授权委托代理手续完备，到会者出具的相关文件符合有关法律法规和基金合同及会议通知的规定，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。

未能满足上述条件的情况下，则召集人可另行确定并公告重新开会的时间和地点，但确定有权出席会议的基金份额持有人资格的权益登记日不变。

### 2) 通讯开会方式

在同时符合以下条件时，通讯会议方可举行：

①召集人按本基金合同规定公布会议通知后，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和统计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代表的基金份额应占权益登记日基金总份额的 50%以上（含 50%）；

④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其他代表，同时提交的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，并与登记注册机构记录相符。

如果开会条件达不到上述条件，则召集人可另行确定并公告重新表决的时间，但确定有权出席会议的基金份额持有人资格的权益登记日不变。

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，否则表面符合法律法规和会议通知规定的书面表决意见即视为有效的表决，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。

## 7、议事内容与程序

### (1) 议事内容及提案权

1) 议事内容为本基金合同规定的召开基金份额持有人大会事由所涉及的内容。

2) 基金管理人、基金托管人、单独或合并持有权益登记日本基金总份额 10% 以上（含 10%）的基金份额持有人可以在大会召集人发出会议通知前就召开事由向大会召集人提交需由基金份额持有人大会审议表决的提案；也可以在会议通知发出后向大会召集人提交临时提案。临时提案应当在大会召开日前 35 天提交召集人。召集人对于临时提案应当在大会召开日前 30 天公布。

3) 对于基金份额持有人提交的提案（包括临时提案），大会召集人应当按照以下原则对提案进行审核：

①关联性。大会召集人对于基金份额持有人提案涉及事项与基金有直接关系，并且不超出法律法规和基金合同规定的基金份额持有人大会职权范围的，应提交大会审议；对于不符合上述要求的，不提交基金份额持有人大会审议。如果召集人决定不将基金份额持有人提案提交大会表决，应当在该次基金份额持有人大会上进行解释和说明。

②程序性。大会召集人可以对基金份额持有人的提案涉及的程序性问题做出决定。如将其提案进行分拆或合并表决，需征得原提案人同意；原提案人不同意变更的，大会主持人可以就程序性问题提请基金份额持有人大会做出决定，并按照基金份额持有人大会决定的程序进行审议。

4) 单独或合并持有权利登记日基金总份额 10% 以上（含 10%）的基金份额持有人提交基金份额持有人大会审议表决的提案、基金管理人或基金托管人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，未获基金份额持有人大会审议通过，就同一提案再次提请基金份额持有人大会审议，其时间间隔不少于 6 个月。法律法规另有规定除外。

5) 基金份额持有人大会的召集人发出召开会议的通知后，如果需要对原有提案进行修改或增加新的提案，应当最迟在基金份额持有人大会召开日前 30 日公告。否则，会议的召开日期应当顺延并保证至少与公告日期有 30 日的间隔期。

## (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规定程序宣布会议议事程序及注意事项，确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后在公证机关监督下进行表决，经合法执业的律师见证后形成大会决议。

大会由基金管理人授权代表主持。在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权代表主持；如果基金管理人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以所代表的基金份额 50% 以上多数选举产生一名代表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做出的决议的效力。

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)、身份证号码、住所地址、持有或代表有表决权的基金份额、委托人姓名(或单位名称)等事项。

### 2) 通讯方式开会

在通讯表决开会的方式下，首先由召集人至少提前 30 天公布提案，在所通知的表决截止日期第 2 天在公证机构监督下由召集人统计全部有效表决并形成决议。

(3) 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。

## 8、决议形成的条件、表决方式、程序

(1) 基金份额持有人所持每一基金份额享有平等的表决权。

(2) 基金份额持有人大会决议分为特别决议和一般决议：

### 1) 特别决议

特别决议须经出席会议的基金份额持有人及其代理人所持表决权的三分之二以上通过方为有效；更换基金管理人、更换基金托管人、转换基金运作方式、本基金与其他基金合并、终止基金合同的重大事项必须以特别决议方式通过；

### 2) 一般决议

一般决议须经出席会议的基金份额持有人及其代理人所持表决权的 50% 以上(含 50%) 通过方为有效，除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。

(3) 基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会备案，并予以公告。

(4) 基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

(5) 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。

(6) 基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人和基金托管人均有约束力。

## 9、计票

### (1) 现场开会

1) 如基金份额持有人大会由基金管理人或基金托管人召集，则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推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，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推举两名基金份额持有人代表与基金管理人、基金托管人授权的一名监督员共同担任监票人；但如果基金管理人和基金托管人的授权代表未出席，则大会主持人可自行选举三名基金份额持有人代表担任监票人。

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

3) 如会议主持人对于提交的表决结果有异议，可以对投票数进行重新清点；如会议主持人未进行重新清点，而出席会议的基金份额持有人或代理人对会议主持人宣布的表决结果有异议，其有权在宣布表决结果后立即要求重新清点，会议主持人应当立即重新清点并公布重新清点结果。重新清点仅限一次。

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参加基金份额持有人大会或拒不配合计票的，不影响计票的效力。

### (2) 通讯方式开会

在通讯方式开会的情况下，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(如果基金托管人为召集人，则为基金管理人授权代表)的监

督下进行计票，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。

#### 10、基金份额持有人大会决议的生效与公告

(1) 基金份额持有人大会决定的事项自表决通过之日起生效；基金份额持有人大会通过的一般决议和特别决议，召集人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会备案。

(2) 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。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定。

(3) 基金份额持有人大会决议应自生效之日起 2 日内由相关信息披露义务人在指定媒介公告。

法律法规或监管部门对基金份额持有人大会另有规定的，从其规定。

#### (三) 基金收益分配原则、执行方式

##### 1、收益分配原则：

(1) 本基金的每份基金份额享有同等分配权；

(2) 在符合有关基金分红条件的前提下，每年最多分配 4 次，每次基金收益分配比例不低于期末（期末指当次分红时的可供分配利润计算截止日，下同）可供分配利润的 50%（期末可供分配利润指期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数）；

(3) 若基金合同生效不满 3 个月则可不进行收益分配；

(4) 本基金收益分配方式分为两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利按权益登记日除权后的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

(5) 基金红利发放日距离收益分配基准日（即期末可供分配利润计算截至日）的时间不得超过 15 个工作日；

(6) 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；

(7) 收益分配时发生的银行转账等手续费用由基金份额持有人自行承担。当基金份额持有人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按权益登记日除权后的基金份额净值自动转为基金份额。

(8) 法律法规或监管机构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基金收益的范围、基金期末可供分配利润、基金收益分配对象、分配原则、分配时间、分配数额及比例、分配方式、支付方式及有关手续费等内容。

## 3、收益分配方案的确定与公告

基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人核实后确定，基金管理人依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

在收益分配方案公布后，基金管理人依据具体方案的规定就支付的现金红利向基金托管人发送划款指令，基金托管人应按照基金管理人的指令及时进行分红资金的划付。

## 4、收益分配中发生的费用

收益分配时发生的银行转账等手续费用由基金份额持有人自行承担。当基金份额持有人的现金红利小于一定金额，不足于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按权益登记日除权后的基金份额净值自动转为基金份额。

(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) 基金的证券交易费用；
- (4) 基金合同生效以后的与基金相关的信息披露费用；
- (5) 基金份额持有人大会费用；
- (6) 基金合同生效以后的与基金相关的会计师费和律师费；
- (7) 基金财产中列支的银行汇划费用；
- (8) 按照国家有关规定可以列入的其他费用。

上述费用从基金财产中支付。

## 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

本基金的管理费率为年费率 1.5%。

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

### (2) 基金托管人的基金托管费

本基金的托管费率为年费率 0.25%。

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$$

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，逐日累计至每个月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。

(3) 本条第（一）款第（3）至第（8）项费用由基金管理人和基金托管人根据有关法规及相应协议的规定，列入或摊入当期基金费用。

## 3、不列入基金费用的项目

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，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金合同生效之前的律师费、会计师费和信息披露费用等不得从基金财产中列支。

## 4、基金管理费和基金托管费的调整

在符合相关法律法规和履行了必备的程序的条件下，基金管理人和基金托管人可协商酌情调低基金管理费和基金托管费，无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须最迟于新的费率实施日前 2 日在中国证监会指定媒介上刊登公告。

#### 5、其他费用

按照国家有关规定和基金合同约定，基金管理人可以在基金财产中列支其他的费用，并按照相关的法律法规的规定进行公告或备案。

#### （五）基金财产的投资方向和投资限制

##### 1、投资目标

本基金通过深入挖掘具有高成长特性或者潜力的中小盘上市公司股票，以求获取基金资产的长期增值。

##### 2、投资范围

本基金可投资于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、存托凭证、债券、资产支持证券、权证及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

本基金为混合型基金，股票及存托凭证资产占基金资产的比例范围为 60%—95%，其他资产占基金资产的比例范围为 5%—40%，权证资产占基金资产净值的比例范围为 0—3%，本基金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；本基金投资于中小盘上市公司的股票占股票资产的比例不得低于 80%。

此外，今后如法律法规或中国证监会允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入本基金的投资范围；如法律法规或中国证监会变更上述投资品种的比例限制，基金管理人可在履行适当程序后调整本基金的投资比例规定。

##### 3、投资禁止行为与限制

###### （1）禁止用本基金财产从事以下行为

- 1) 承销证券；
- 2) 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，但是国务院另有规定的除外；

5) 向本基金的基金管理人、基金托管人出资或者买卖本基金的基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；

6) 买卖与本基金的基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与本基金的基金管理人、基金托管人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；

7) 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；

8) 依照法律法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他活动。

如法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，本基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制。

## (2) 基金投资组合比例限制

1) 本基金投资于中小盘上市公司的股票占股票资产的比例不得低于 80%。

本基金所指中小盘上市公司是指以下三类上市公司：

①在深圳中小板上市的公司；

②在创业板上市的公司；

③在沪深证券交易所主板上市、按股票总市值从小到大排序并相加得到的累计总市值达到主板总市值 40%的上市公司。

2) 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%；

3) 本基金与基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券总和，不超过该证券的 10%；

4) 本基金股票资产占基金资产的比例范围为 60%-95%，其他资产占基金资产的比例范围为 5%-40%，权证资产占基金资产净值的比例范围为 0-3%，本基金投资于中小盘上市公司的股票占股票资产的比例不低于 80%；

5) 本基金参与股票发行申购，所申报的金额不超过本基金总资产，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) 在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不展期；

7) 在银行间市场进行债券回购融入的资金余额不超过基金资产净值的 40%；

8) 基金的投资组合中保留的现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例

合计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；

9) 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%；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%；本公司管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%。其他权证的投资比例，遵从法律法规或监管部门的相关规定；

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%；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%；本公司管理的全部证券投资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%，中国证监会规定的特殊品种除外。本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，将在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；

12) 流通受限证券投资遵照《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》（证监基金字[2006]141 号）及相关规定执行；

13) 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；

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%；

16) 基金总资产不得超过基金净资产的百分之一百四十；

17) 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；

18) 法律法规、基金合同及中国证监会规定的其他比例限制。

(3) 法律法规或监管部门修改或取消上述限制规定(第3)项除外)时,本基金不受上述投资组合限制并相应修改限制规定。

#### 4、投资组合比例调整

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约定。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不符合基金合同约定的投资比例规定的,除第8)、11)、13)、14)项外,基金管理人应当在10个工作日内进行调整,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。

#### (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

基金资产总值是指本基金拥有的各类有价证券及票据价值、银行存款本息、债券的应计利息、基金应收的申购基金款、缴存的保证金以及其他投资所形成的价值总和。

##### (2) 基金资产净值

本基金基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

$T$ 日基金份额净值= $T$ 日基金资产净值/ $T$ 日基金总份额余额

基金份额净值的计算,精确到0.0001元,小数点第五位四舍五入。国家另有规定的,从其规定。

##### (3) 估值方法

##### 1) 证券交易所上市的有价证券的估值

①交易所上市的有价证券(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,且最近交易日后经济环境未发生重大变化,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交易所上市实行净价交易的债券按估值日收盘价估值,估值日没有交易的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化,按最近交易日的收盘价估值。如

最近交易日后经济环境发生了重大变化的，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；

③交易所上市未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息（自债券计息起始日或上一起息日至估值当日的利息）得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，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；

④交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。交易所上市的资产支持证券，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。

2) 处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

①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市价（收盘价）估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值；

②首次公开发行未上市的股票、债券和权证，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。

③首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的市价（收盘价）估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

3) 全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值。

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) 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。

6) 本基金投资存托凭证的估值核算，依照境内上市交易的股票进行。

7) 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，基金净值信息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基金净值信息的计算结果对外予以公布。若以基金管理人的计算结果对外公布引发的估值差错造成实际损失时，基金托管人不承担赔偿责任。

## 2、基金净值信息的公告方式

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在指定网站披露一次基金份额净值和基金份额累计净值。

在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当在不晚于每个开放日的次日，通过指定网站、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，在指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、程序以及基金财产清算方式

### 1、基金合同的变更

（1）基金合同变更涉及本基金合同第八节第（二）项规定的对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的，应经基金份额持有人大会决议通过。变更基金合同的基金份额持有人大会决议须报中国证监会备案，自表决通过之日起生效，并自决议生效后依照有关规定在指定媒介上公告。

（2）除上述第（1）项规定的情形外，经基金管理人和基金托管人同意可对基金合同的内容进行变更，该等变更应当在2日内由基金管理人进行公告并报中国证监会备案。

### 2、基金合同的终止

有下列情形之一的，本基金合同终止：

- （1）基金份额持有人大会决定终止；



- (2) 基金管理人职责终止，在六个月内没有新基金管理人承接的；
- (3) 基金托管人职责终止，在六个月内没有新基金托管人承接的；
- (4) 法律法规和基金合同规定的其他情形。

### 3、基金财产的清算

(1) 基金合同终止，应当按法律法规和本基金合同的有关规定对基金财产进行清算。

#### (2) 基金财产清算组

1) 自基金合同终止之日起 30 个工作日内由基金管理人组织成立基金财产清算组，在基金财产清算组接管基金财产之前，基金管理人和基金托管人应按照基金合同和托管协议的规定继续履行保护基金财产安全的职责。

2) 基金财产清算组成员由基金管理人、基金托管人、基金登记机构、具有证券、期货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。基金财产清算组可以聘用必要的工作人员。

3) 基金财产清算组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算组可以依法进行必要的民事活动。

#### (3) 清算程序

- 1) 基金合同终止后，发布基金财产清算公告；
- 2) 基金合同终止后，由基金财产清算组统一接管基金财产；
- 3) 基金财产清算组根据基金财产的情况确定清算期限；
- 4) 基金财产清算组对基金财产进行清理和确认；
- 5) 对基金财产进行评估和变现；
- 6) 基金清算组做出清算报告；
- 7) 会计师事务所对清算报告进行审计；
- 8) 律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- 9) 将基金清算结果报告中国证监会；
- 10) 公布基金财产清算结果；
- 11) 对基金剩余财产进行分配。

#### (4) 清算费用

清算费用是指基金财产清算组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，

清算费用由基金清算组优先从基金财产中支付。

#### (5) 基金剩余财产的分配

基金财产按如下顺序进行清偿：

- 1) 支付基金财产清算费用；
- 2) 缴纳基金所欠税款；
- 3) 清偿基金债务；
- 4) 清算后如有余额，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

基金财产未按前款 1)－3) 项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

#### (6) 基金财产清算的公告

清算小组成立后 2 日内应就清算小组的成立进行公告；清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算组做出的清算报告经具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，报中国证监会备案并公告。

(7) 基金财产清算账册及文件由基金托管人保存 15 年以上。

#### (八) 争议解决方式

1、本基金合同适用中华人民共和国法律并从其解释。

2、本基金合同的当事人之间因本基金合同产生的或与本基金合同有关的争议可首先通过友好协商或调解解决。自一方书面要求协商解决争议之日起六十日内如果争议未能以协商或调解方式解决，则任何一方有权将争议提交上海国际经济贸易仲裁委员会，根据提交仲裁时该会届时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地在上海市。仲裁裁决是终局的，对仲裁各方当事人均具有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

3、除争议所涉内容之外，本基金合同的其他部分应当由本基金合同当事人继续履行。

#### (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、基金代销机构和登记机构的办公场所和营业场所查阅；投资者也可按工本费购买基金合同复印件或复印件，但内容应以基金合同正本为准。

