鹏华量化策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同内容摘要

一、基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务

（一）基金份额持有人的权利、义务

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）依法转让或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）交纳基金认购、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定；

（8）返还在基金交易过程中因任何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）基金管理人的权利、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与赎回申请；

（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）在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资；

（14）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；

（15）选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商或其他为基金

提供服务的外部机构；

（16）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；

（17）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；

（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活期

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。

（三）基金托管人的权利、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， 如发现基金管理人有违反

《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，为基金开设证券账户、为基金办理证券交易资

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和证券账户，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；

（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；

如果基金管理人有未执行《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）建立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定；

（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。

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。 本基金暂不设置日常机构，日常机构的设置

和相关规则按照法律法规的有关规定进行。

（一）召开事由

1、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，

法律法规、中国证监会或基金合同另有约定的除外：

（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）提高基金管理人、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10%以上（含10%）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）对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；

（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、以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份

额持有人大会：

（1）调低除基金管理费、基金托管费外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）在法律法规和《基金合同》规定的范围内调整本基金的申购费率、

调低赎回费率或变更收费方式；

（4）在法律法规和基金合同规定的范围内，在对基金份额持有人利益无

实质性不利影响的情况下，增加、减少、调整基金份额类别设置；

（5）在法律法规和基金合同规定的范围内，在对基金份额持有人利益无

实质性不利影响的情况下，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；

（6）在法律法规和基金合同规定的范围内，在对基金份额持有人利益无

实质性不利影响的情况下，基金推出新业务或服务；

（7）因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改；

（8）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；

（9）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

以外的其他情形。

（二）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60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10%以上（含10%）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日内召开并告知基金管理人，基金管理人

应当配合。

5、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，单独或合计

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，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。

（三）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。

上接B21版）

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、书面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书面表决意见的计票进

行监督的，不影响表决意见的计票效力。

（四）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、通讯开会方式或法律法规和

监管机关允许的其他方式召开，会议的召开方式由会议召集人确定。

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证明符合法律法规、

《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）。 若到会者在权益登记日代表的有效的基金份额少于本基金在权

益登记日基金总份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大

会召开时间的3个月以后、6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在权益登记日代表的有效

的基金份额应不少于本基金在权益登记日基金总份额的三分之一（含三分之

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会

议通知载明的形式在表决截至日以前送达至召集人指定的地址。

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）到指定地点对书面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）。 若本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见， 基金

份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日基金总份额的二分之一，召

集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的3个月以后、6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

有人大会应当有代表三分之一（含三分之一）以上基金份额的持有人直接出

具书面意见或授权他人代表出具书面意见。

（4）上述第（3）项中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代理人，同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具书

面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

权委托证明符合法律法规、《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、在法律法规和监管机关允许的情况下，本基金的基金份额持有人亦可

采用其他非书面方式授权其代理人出席基金份额持有人大会；在会议召开方

式上，本基金亦可采用其他非现场方式或者以现场方式与非现场方式相结合

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。 基金份额持有人亦可以采用书面、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。

（五）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七条规定程序确定

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。

（六）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。 除本基金合同另有

约定的，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书面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，但应当计入出具书面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。

（七）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

托管人拒派代表对书面表决意见的计票进行监督的， 不影响计票和表决结

果。

（八）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。

（九）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的部分，如将来法律法规修改导致

相关内容被取消或变更的，基金管理人提前公告后，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

（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）基金可供分配利润

基金可供分配利润指截至收益分配基准日基金未分配利润与未分配利

润中已实现收益的孰低数。

（三）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。

在对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可调整

基金收益分配原则和支付方式，不需召开基金份额持有人大会。

（四）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。

（五）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个工

作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。

（六）基金收益分配中发生的费用

基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。

当投资者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自动转为基金份额。 红利

再投资的计算方法，依照《业务规则》执行。

四、与基金财产管理、运用有关费用的提取、支付方式与比例

（一）基金费用的种类

1、基金管理人的管理费；

2、基金托管人的托管费；

3、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；

4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、仲裁费、诉讼费、

公证费和认证费；

5、基金份额持有人大会费用；

6、基金的证券/期货交易费用；

7、基金的银行汇划费用；

8、证券账户开户费用、账户维护费用；

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。

（二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.50%年费率计提。 管理费的

计算方法如下：

H＝E×1.50%÷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。 托管费

的计算方法如下：

H＝E×0.25%÷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、休息日等，支付

日期顺延。

上述“一、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。

（三）不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

1、 基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支

出或基金财产的损失；

2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；

3、《基金合同》生效前的相关费用；

4、 其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用

的项目。

五、基金财产的投资目标、投资范围和投资方向

（一）投资目标

本基金通过灵活运用多种量化投资策略，在充分控制基金财产风险和保

证基金资产流动性的基础上，力争实现基金资产长期稳健的保值增值。

（二）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（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券

（含国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、次级债、

可转换债券、可交换债券等）、货币市场工具（含同业存单等）、权证、资产支

持证券、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具

（但须符合中国证监会相关规定）。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行

适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为0%－95%；每个

交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金以

及投资于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%。

如果法律法规对该比例要求有变更的，以变更后的比例为准，本基金的

投资范围会做相应调整。

（三）投资限制

1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

（1）本基金股票资产占基金资产的比例为0%－95%；

（2）每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持

不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券；

（3） 本基金持有一家公司发行的证券， 其市值不超过基金资产净值的

10%；

（4）本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该

证券的10%；

（5）本基金持有的全部权证，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%，中国证监会规定的特殊品种除外；

（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%； 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；

（15）本基金总资产不得超过基金净资产的140%；

（16）本基金仅在投资股指期货时遵守下列要求：

1）本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过

基金资产净值的10%；

2）本基金在任何交易日日终，持有的买入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；

3）本基金在任何交易日日终，持有的卖出期货合约价值不得超过基金持

有的股票总市值的20%；

4）本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧

差计算）应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定；

5）本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金

额不得超过上一交易日基金资产净值的20%；

（17）本基金投资流通受限证券，基金管理人应根据中国证监会相关规

定进行投资。 基金管理人应制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；

（18）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限

制。

除上述第（12）项外，因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等

基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金

管理人应当在10个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。

基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例

符合基金合同的有关约定。 期间，本基金的投资范围、投资策略应当符合基金

合同的约定。 基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日

起开始。

法律法规或监管部门取消上述限制，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。

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，应当符合基金的投资目标和投资策

略，遵循持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估

机制，按照市场公平合理价格执行。 相关交易必须事先得到基金托管人的同

意，并按法律法规予以披露。 重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并

经过三分之二以上的独立董事通过。 基金管理人董事会应至少每半年对关联

交易事项进行审查。

法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，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。

六、基金资产净值的计算方法和公告方式

（一）基金资产净值的计算方法

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

（二）基金资产净值的公告方式

《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、基金合同变更和终止的事由、程序以及基金财产清算方式

（一）《基金合同》的变更

1、 变更基金合同涉及法律法规规定或本合同约定应经基金份额持有人

大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。 对于可不经

基金份额持有人大会决议通过的事项，由基金管理人和基金托管人同意后变

更并公告，并报中国证监会备案。

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议生效后方可执行，

并自决议生效后两个工作日内在指定媒介公告。

（二）《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，《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。

（三）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）对基金财产进行分配。

5、基金财产清算的期限为6个月。

（四）清算费用

清算费用是指基金财产清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合

理费用，清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。

（五）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。

（六）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。

（七）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、争议解决方式

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，按照中国国际经济贸易仲裁委员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。