

合同编号：

利可进取一号私募投资基金  
基金合同（2019 版）

基金管理人：上海利可资产管理有限公司  
基金托管人：中信证券股份有限公司

## 风险揭示书

尊敬的投资者：

投资有风险。当您/贵机构认购或申购私募基金时，可能获得投资收益，但同时也面临着投资风险。您/贵机构在做出投资决策之前，请仔细阅读本风险揭示书和基金合同、公司章程或者合伙协议（以下统称基金合同），充分认识本基金的风险收益特征和产品特性，认真考虑基金存在的各项风险因素，并充分考虑自身的风险承受能力，理性判断并谨慎做出投资决策。

根据有关法律法规，基金管理人上海利可资产管理有限公司及投资者分别作出如下承诺、风险揭示及声明：

### 一、基金管理人承诺

（一）私募基金管理人保证在募集资金前已在中国证券投资基金业协会（以下简称中国基金业协会）登记为私募基金管理人，并取得管理人登记编码。

（二）私募基金管理人向投资者声明，中国基金业协会为私募基金管理人和私募基金办理登记备案不构成对私募基金管理人投资能力、持续合规情况的认可；不作为对基金财产安全的保证。

（三）私募基金管理人保证在投资者签署基金合同前已（或已委托基金销售机构）向投资者揭示了相关风险；已经了解私募基金投资者的风险偏好、风险认知能力和承受能力；已向私募基金投资者说明有关法律法规，说明投资冷静期、回访确认的制度安排以及投资者的权利。

（四）私募基金管理人承诺按照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理运用基金财产，不保证基金财产一定盈利，也不保证最低收益。

### 二、特殊风险揭示

（一）基金合同与中国基金业协会合同指引不一致所涉风险

本基金合同依据中国基金业协会发布的《契约型私募投资基金合同内容与格式指引》（以下简称“《指引》”）及相关法律法规制定。《指引》规定，在不违反《中华人民共和国证券投资基金法》、《私募投资基金监督管理暂行办法》以及相关法律法规的前提下，基金合同当事人可以根据实际情况约定《指引》规定内容之外的事项；《指引》中某些具体要求对基金合同当事人确不适用的，当事人可对相应内容做出合理调整和变动。本合同中对《指引》规定内容之外的部分事项进行约定，也可能存在个别内容与《指引》不一致，或不适用《指引》中个别规定的情形，可能对投资者合法权益造成影响。

## （二）基金委托募集的风险

本基金管理人可委托销售机构销售本基金，受托销售机构销售本基金时，可能存在包括但不限于如下违法违规行为而令投资者面临基金募集风险：

- 1、销售机构采用公开宣传或变相公开宣传的方式销售基金；
- 2、销售机构进行虚假宣传，或通过任何方式以保本保收益误导投资者，或推介材料存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏；
- 3、销售机构违反《私募办法》的有关规定，未审查投资者是否满足合格投资者相关条件，未对投资者的风险识别能力和风险承受能力进行鉴别，未履行投资者适当性审查义务；
- 4、销售机构可能因未在中国证监会注册取得基金销售业务资格或未成为中国基金业协会会员而不具备受托募集私募基金的资格；
- 5、销售机构从业人员可能未经合法有效授权即从事基金募集活动；
- 6、销售机构可能存在将私募基金募集结算资金归入其自有财产、挪用私募基金募集结算资金、侵占基金财产和客户资金等违法活动。

## （三）基金的业务外包风险

基金管理人将应属本机构负责的事项以服务外包委托等方式交由其他机构办理，因受托机构不符合证券监管机关规定的资质、或不具备相关的提供服务的条件、或因管理不善、操作失误等，可能给投资者带来一定的风险。

担任基金行政外包服务商的机构，因停业、解散、撤销、破产，或者被中国证监会、中国基金业协会撤销相关业务许可、责令停业整顿等原因不能履行职责，可能给投资者带来一定的风险。

## （四）未在中国基金业协会登记备案的风险

根据《指引》的规定及本合同约定，私募基金在中国基金业协会完成备案后方可进行投资运作。若基金管理人未完成基金备案，则投资者面临基金不能开始投资运作或基金违规开展投资运作的风险。

## （五）其他特殊风险

### 1、经纪服务商风险

证券及期货经纪服务商由管理人自行聘任，管理人委托其向托管人提供基金参与证券、期货交易的相关数据及凭证。若因管理人、经纪服务商或交易所、登记公司、股转系统等原因导致托管人未能及时、完整、准确获得交易数据或凭证，影响托管人履行投资监督、估值核算、账目核对等职责的，可能造成委托人财产

损失，且托管人不承担责任。

## 2、基金延期风险（若有）

本基金可能按照法律法规或合同约定延长运作期限，则委托人面临基金延期兑付、不能及时收到本金及收益、以及本金或收益随基金延期可能减少的风险。

## 3、基金的关联交易风险

基金管理人可能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其他重大利害关系的公司发行的证券或承销期内承销的证券，或从事其他重大关联交易，但需要遵循基金份额持有人利益优先的原则、防范利益冲突，符合监管机构的规定，并履行信息披露义务。

基金管理人可能运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其关联方或者与上述主体有其他重大利害关系的主体直接或间接管理或代理销售的、或提供客户服务的、或者该等主体参与投资的符合本合同投资范围规定的投资产品。但需要遵循基金份额持有人利益优先的原则、防范利益冲突，符合监管机构的规定，并履行信息披露义务。

基金投资者签署本合同即表明其已经知晓且认可本基金可能进行上述关联交易。

## 4、以扣减基金委托人份额方式提取业绩报酬的风险

在固定时点以扣减基金委托人份额的方式计提业绩报酬会导致委托人持有基金份额数的减少。就被扣减的基金份额，原委托人将丧失被扣减份额所代表的权利。被扣减的基金份额所代表的基金财产，将作为业绩报酬支付给业绩报酬收取方。

## 三、一般风险揭示

### （一）资金损失风险

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，但不保证基金财产中的认购资金本金不受损失，也不保证一定盈利及最低收益，投资者可能面临无法获得投资收益甚至遭受亏损的资金损失风险。

本基金属于【高】风险投资品种，适合风险识别、评估、承受能力【高】的合格投资者。

### （二）基金运营风险

基金管理人依据基金合同约定管理和运用基金财产所产生的风险，由基金财产及投资者承担。投资者应充分知晓投资运营的相关风险，其风险应由投资者自

担。在私募基金投资运作过程中，基金管理人的知识、经验、判断、决策、技能等，会影响其对信息的占有和对经济形势、金融市场价格走势的判断，如基金管理人判断有误、获取信息不全、或对投资工具使用不当等影响私募基金投资的收益水平，从而产生风险。

担任基金管理人或基金托管人的机构，因停业、解散、撤销、破产，或者被中国证监会、中国基金业协会撤销相关业务许可、责令停业整顿等原因不能履行职责，可能给投资者带来一定的风险。

### （三）流动性风险

私募基金投资不能迅速转变成现金，或者转变成现金会对资产价格造成重大不利影响的风险。

1、市场整体流动性相对不足。证券市场的流动性受到市场行情、投资群体等诸多因素的影响，在某些时期成交活跃，流动性好；而在另一些时期，可能成交稀少，流动性差。在市场流动性相对不足时，交易变现有可能增加变现成本，对私募基金投资造成不利影响。

2、证券市场中流动性不均匀，存在个股和个券流动性风险。由于流动性存在差异，即使市场流动性比较好的情况下，一些个股和个券的流动性可能仍然比较差，从而使得私募基金在进行个股和个券操作时，可能难以按计划买入或卖出相应的数量，或买入卖出行为对个股和个券价格产生比较大的影响，增加个股和个券的建仓成本或变现成本。

3、私募基金投资中的资产不能应付可能出现的委托人大额赎回基金份额的风险。在私募基金运作期间，可能会发生委托人大额赎回基金份额的情形，可能会产生仓位调整的困难，导致流动性风险，甚至影响收益水平。

4、本基金无固定存续期限。在本基金存续期内，投资者可能面临资金不能退出带来的流动性风险。根据实际投资运作情况，本基金有可能提前结束或延期结束，投资者可能因此面临委托资金投资收益水平下降或不能按期退出等风险。

### （四）基金募集或备案失败的风险

1、本基金的成立需符合相关法律法规及本合同的规定，本基金可能存在不能满足成立条件从而无法成立的风险。基金管理人的责任承担方式：

（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（确认基金无法成立）后 30 日内返还投资人已缴纳的款项，并加计银行同期活期存款利息。

2、本基金存在向基金业协会备案失败的风险。若备案失败，本基金合同将提前终止，按照本合同约定的基金清算程序进行清算。本基金清算完毕前将按照合同约定在基金财产中扣除相关费用。

#### （五）基金投资风险

基金投资面临的风险，包括但不限于：

##### 1、市场风险

市场风险是指投资品种的价格因受经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素影响而引起的波动，导致收益水平变化，产生风险。市场风险主要包括：

（1）政策风险。货币政策、财政政策、产业政策等国家宏观经济政策的变化对资本市场产生一定的影响，导致市场价格波动，影响私募基金投资的收益而产生风险。

（2）经济周期风险。经济运行具有周期性的特点，受其影响，私募基金投资的收益水平也会随之发生变化，从而产生风险。

（3）利率、汇率风险。利率风险是指由于利率变动而导致的资产价格和资产利息的损益。利率波动会直接影响企业的融资成本和利润水平，导致证券市场的价格和收益率的变动，使私募基金投资的收益水平随之发生变化，从而产生风险。汇率波动范围将影响国内资产价格的重估，从而影响基金资产的净值。

（4）上市公司经营风险。上市公司的经营状况受多种因素影响，如市场、技术、竞争、管理、财务等都会导致公司盈利状况发生变化。如私募基金所投资的上市公司经营不善，与其相关的证券价格可能下跌，或者能够用于分配的利润减少，从而使私募基金投资的收益下降。

（5）购买力风险。私募基金投资的收益主要通过现金形式来分配，而现金可能因为通货膨胀的影响而导致购买力下降，从而使私募基金投资的实际收益下降。

（6）再投资风险。固定收益品种获得的本息收入或者回购到期的资金，可能由于市场利率的下降面临资金再投资的收益率低于原来利率，从而对私募基金产生再投资风险。

##### 2、投资标的风险

###### （1）衍生品风险

金融衍生产品具有杠杆效应且价格波动剧烈，会放大收益或损失，在某些情

况下甚至会导致投资亏损高于初始投资金额。

若基金参与权益类收益互换交易、跨境收益互换，将可能面对交易对手的信用违约风险，同时，收益互换的方式可能间接增加基金的杠杆比例，收益互换交易具有较高收益和较高风险的特征，在提供委托人预期收益的同时也承担杠杆带来的风险。此外，若基金通过收益互换间接投资于境内外二级市场股票，境外市场股票可能不设涨跌幅限制，存在股票价格波动较大的风险。此外，若基金间接投资于境外证券市场，投资收益以外汇形式体现，受人民币与外汇间汇率变动的较大影响。如果本基金存续期间内出现人民币汇率较大波动，投资者可能会因此而遭受损失。同时，境内外市场交易日不完全一致可能导致基金投资标的止损无法操作的风险。

### 3、信用风险

信用风险是指发行人是否能够实现发行时的承诺，按时足额还本付息的风险，或者交易对手未能按时履约的风险。

（1）交易品种的信用风险。投资于公司债券、可转换债券等固定收益类产品，存在着发行人不能按时足额还本付息的风险；此外，当发行人信用评级降低时，私募基金所投资的债券可能面临价格下跌风险。

（2）交易对手的信用风险。交易对手未能履行合约，或在交易期间未如约支付已借出证券产生的所有股息、利息和分红，将使私募基金投资面临交易对手的信用风险。

### （六）税收风险

契约型基金所适用的税收征管法律法规可能会由于国家相关税收政策调整而发生变化，投资者收益也可能因相关税收政策调整而受到影响。

### （七）其他风险

1、技术风险。在私募基金投资的日常交易中，可能因为技术系统的故障或者差错而影响交易的正常进行或者导致委托人的利益受到影响。这种技术风险可能来自基金管理人、基金托管人、证券交易场所、证券登记结算机构、证券经纪商、期货经纪商等。

2、操作风险。基金相关机构在业务操作过程中，因操作失误或违反操作规程而引起的风险。

3、不可抗力风险。若遭遇不可抗力，证券市场的运行将遭受严重影响，可能导致基金资产的损失，从而带来风险。

4、法律法规、监管政策、业务规则风险。本基金存续期限内，立法机构、监管机构、行业协会、交易所、证券登记结算机构等可能对现行有效的法律、法规、规章、规范性文件、监管政策、行业规定、自律规则、业务规则等进行调整、修订、增删、废止、解释，或发布新的私募投资基金监管规范、行业规定等，则本基金合同及相关基金运作规则可能需进行相应的调整，可能对投资者权益产生影响。就上述对基金合同或基金运作规则的调整，基金管理人经与基金托管人协商一致后有权实施，基金管理人应将调整事项和内容及时通知基金委托人。

5、本基金可能面临其他不可预知、不可防范的风险。

#### 四、投资者声明

作为本私募基金的投资者，本人/机构已充分了解并谨慎评估自身风险承受能力，自愿自行承担投资本私募基金所面临的风险。本人/机构做出以下陈述和声明，并确认（自然人投资者在每段段尾“【\_\_\_\_\_】”内签名，机构投资者在本页、尾页盖章，加盖骑缝章）其内容的真实和正确：

本人/机构已仔细阅读私募基金法律文件和其他文件，充分理解相关权利、义务、本私募基金运作方式及风险收益特征，愿意承担由上述风险引致的全部后果。【\_\_\_\_\_】

本人/机构知晓，基金管理人、基金销售机构、基金托管人及相关机构不应当对基金财产的收益状况作出任何承诺或担保。【\_\_\_\_\_】

本人/机构已通过中国基金业协会的官方网站（www.amac.org.cn）查询了私募基金管理人的基本信息，并将于本私募基金完成备案后查实其募集结算资金专用账户的相关信息与打款账户信息的一致性。【\_\_\_\_\_】

在购买本私募基金前，本人/机构已符合《私募投资基金监督管理暂行办法》有关合格投资者的要求并已按照募集机构的要求提供相关证明文件。【\_\_\_\_\_】

本人/机构已认真阅读并完全理解基金合同的所有内容，并愿意自行承担购买私募基金的法律责任。【\_\_\_\_\_】

本人/机构已认真阅读并完全理解基金合同第九节“基金当事人的权利和义务”的所有内容，并愿意自行承担购买私募基金的法律责任。【\_\_\_\_\_】

本人/机构已知晓投资冷静期及回访确认的制度安排以及在此期间的权利。【\_\_\_\_\_】

本人/机构已认真阅读并完全理解基金合同第十二节“基金的投资”的所有内容，并愿意自行承担购买私募基金的法律责任。【\_\_\_\_\_】



本人/机构已认真阅读并完全理解基金合同第十九节“基金的费用与税收”中的所有内容。【\_\_\_\_\_】

本人/机构已认真阅读并完全理解基金合同第二十五节“争议的处理”中的所有内容。【\_\_\_\_\_】

本人/机构知晓，中国基金业协会为私募基金管理人和私募基金办理登记备案不构成对私募基金管理人投资能力、持续合规情况的认可；不作为对基金财产安全的保证。【\_\_\_\_\_】

本人/机构承诺本次投资行为是为本人/机构购买私募投资基金。【\_\_\_\_\_】

本人/机构承诺不以非法拆分转让为目的购买私募基金，不会突破合格投资者标准，将私募基金份额或其收益权进行非法拆分转让。【\_\_\_\_\_】

本风险揭示书的揭示事项仅为列举性质，未能详尽列明投资者参与私募基金投资所面临的全部风险和可能导致投资者财产损失的所有因素。

投资者在参与私募基金投资前，应认真阅读并理解相关业务规则、基金合同及本风险揭示书的全部内容，并确信自身已做好足够的风险评估与财务安排，避免因参与私募基金投资而遭受超过投资者承受能力的损失。

特别提示：投资者在本风险揭示书上签字或盖章，表明投资者在充分了解并谨慎评估自身风险承受能力后，已经理解并愿意自行承担参与私募基金投资的风险和损失。

基金投资者（自然人签字或机构盖章）：

日期：

经办员（签字）：

日期：

募集机构（盖章）：

日期：

## 合格投资者承诺书

上海利可资产管理有限公司：

本人/本单位作为符合中国证券监督管理委员会规定的私募投资基金的合格投资者（即具备相应风险识别能力和风险承担能力，投资于本私募基金金额不低于 100 万元，且个人投资者的金融资产不低于 300 万元或者最近三年个人年均收入不低于 50 万元，机构投资者的净资产不低于 1000 万元，或为监管机构认可的其他合格投资者），投资资金来源合法，没有非法汇集他人资金投资私募基金。本人/本单位在参与管理人发起设立的私募基金的投资过程中，如果因存在欺诈、隐瞒或其他不符合实际情况的陈述所产生的一切责任，由本人/本单位自行承担，与管理人无关。

特此承诺。

投资者：

日期：

## 目 录

一、合同当事人.....	12
二、前 言.....	13
三、释 义.....	14
四、声明与承诺.....	17
五、基金的基本情况.....	18
六、基金份额的募集.....	19
七、基金的成立与备案.....	22
八、基金的申购、赎回及转让.....	23
九、基金当事人的权利和义务.....	29
十、基金份额持有人大会及日常机构.....	34
十一、基金份额的登记.....	36
十二、基金的投资.....	37
十三、投资经理的指定与变更.....	41
十四、基金的财产.....	41
十五、投资资金划款指令的发送、确认和执行.....	44
十六、资金清算交收安排.....	47
十七、越权交易处理.....	51
十八、基金资产的估值和会计核算.....	52
十九、基金的费用与税收.....	58
二十、基金的收益分配.....	64
二十一、信息披露.....	65
二十二、风险揭示.....	69
二十三、基金合同的变更、终止与基金财产清算.....	70
二十四、违约责任.....	73
二十五、争议的处理.....	74
二十六、基金合同的效力.....	74
二十七、其他事项.....	76

## 一、合同当事人

## 甲方（基金委托人）

委托人类型：自然人 法人或其他组织

姓名（自然人填写）：

证件名称：身份证 护照 军人证 其他

证件号码：

机构名称（法人或其他组织填写）：

法定代表人或授权代表：

证件名称：营业执照 组织机构代码证 事业单位登记证 其他

证件号码：

通讯地址：

邮政编码：

联系人：

座机电话：

手机：

传真：

电子邮箱：

银行结算账户（提示：在持有本基金份额期间应避免注销本账户）

开户银行：

账（卡）号：

户名：

签署本合同之基金委托人，承诺首次认购/申购如下本基金份额：

人民币 万元（大写人民币 元整）的本基金基金份额。

## 乙方（基金管理人）

名称：上海利可资产管理有限公司

法定代表人/执行事务合伙人委派代表或授权代表：王毅

住所：上海市嘉定区华亭镇浏翔公路 6899 号 1 号楼 256 室

通讯地址：上海市浦东新区世纪大道 1196 号世纪汇二座 25 层 05 单元

联系人：林冰

联系电话：021-60537797

管理人登记编码：P1007820

## 丙方（基金托管人）

名称：中信证券股份有限公司

法定代表人：张佑君

住所：广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座

通讯地址：北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦

联系人：吴俊文

联系电话：010-60836588

## 二、前 言

### （一）订立本合同的目的、依据和原则

1、订立本合同的目的是为了明确基金委托人、基金管理人和基金托管人在开展基金投资业务过程中的权利、义务及职责。

2、订立本合同的依据是《中华人民共和国合同法》（以下简称“《合同法》”）、《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《中华人民共和国证券法》（以下简称“《证券法》”）、《私募投资基金监督管理暂行办法》（以下简称“《私募办法》”）、《私募投资基金管理人登记和基金备案办法（试行）》（以下简称“《登记备案办法》”）、《私募投资基金募集行为管理办法》（以下简称“《募集行为管理办法》”）、《契约型私募投资基金合同内容与格式指引》（以下简称“《指引》”）、《证券期货经营机构私募资产管理业务运作管理暂行规定》（以下简称“《暂行规定》”）和其他有关法律、法规。若因法律、法规的制定或修改导致本合同的内容与届时有效的法律、法规的规定存在冲突或不一致，应当以届时有效的法律、法规的规定为准，基金管理人和基金托管人应协商一致后及时对本合同进行相应变更和调整，基金管理人应将变更和调整的内容通知基金委托人。

3、订立本合同的原则是平等自愿、诚实信用、公平公正、维护投资者的合法权益，不得损害国家利益和社会公共利益。

（二）本合同的当事人包括基金委托人、基金管理人和基金托管人。基金委托人自签订本合同起即成为本合同的当事人。在本合同存续期间，基金委托人自全部赎回其基金份额之日起，不再是本基金的委托人和本合同的当事人。除本合同另有约定外，每份基金份额具有同等的合法权益。

（三）中国证券投资基金业协会接受本基金的备案并不构成对私募基金管理人投资能力、持续合规情况的认可；不作为对基金财产安全的保证；不表明其对

基金的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于基金没有风险。

### 三、释 义

在本合同中，除上下文另有规定外，下列用语应具有如下含义：

<b>本基金、基金</b>	指利可进取一号私募投资基金。
<b>基金合同、本合同</b>	指基金委托人、基金管理人和基金托管人签署的《利可进取一号私募投资基金基金合同（2019 版）》及其附件，以及对该合同及附件做出的任何有效变更和补充。
<b>基金委托人、委托人、投资者、基金份额持有人、投资人、份额持有人</b>	指签订了本合同并依据本合同取得基金份额的投资者。
<b>基金管理人、管理人</b>	指上海利可资产管理有限公司。
<b>基金托管人、托管人</b>	指中信证券股份有限公司。
<b>法律法规</b>	指中华人民共和国现行有效的法律、行政法规、司法解释、地方性法规、地方政府规章、部门规章及其他规范性文件，以及包括但不限于行业协会、交易所、证券登记结算机构等制订的行业规定、自律规范、业务规则等，以及对于该等法律法规的不时修改和补充。
<b>中国证监会</b>	指中国证券监督管理委员会及其派出机构。
<b>基金业协会</b>	指中国证券投资基金业协会。
<b>金融监管部门</b>	指中国证监会、银监会、保监会等监管机构及其派出机构以及证券、基金和期货行业协会等行业自律组织。
<b>交易所</b>	指上海证券交易所、深圳证券交易所、全国中小企业股份转让系统、中国金融期货交易所、上海期货交易所、郑州商品交易所、大连商品交易所、全国银行间同业拆借中心等。
<b>基金行政服务机构、行政服务机构、行政外包服务商、注册登记机构、行政管理</b>	指基金管理人或接受基金管理人委托提供基金注册登记、销售资金结算、估值核算、信息披露等服务的机构。本基金的基金行政服务机构为中信中证投资服务有限责任公司（外包业务登记编码：A00045）。

人、资产估值机构	
募集机构、销售机构	指基金管理人或者经监管部门批准依法取得基金销售资格，并接受基金管理人委托代为办理本基金认购、申购、赎回等业务的机构（视上下文情况，亦称“代销机构”）。
监督机构	指根据《募集行为管理办法》对本基金的募集结算资金专用账户和/或资金清算专用账户进行监督的机构。
证券经纪商	指中信证券股份有限公司，基金管理人经与托管人协商一致后，可增减、变更证券经纪商，并应通过本合同规定的方式之一通知基金委托人和基金行政服务机构（如有）。本基金的证券经纪商最多不得超过两家。
期货经纪商	暂不指定，基金管理人经与托管人协商一致后，可增减、变更期货经纪商，并应通过本合同规定的方式之一通知基金委托人和行政服务机构（如有）。本基金的期货经纪商最多不得超过两家。
工作日/交易日	指上海证券交易所和深圳证券交易所的共同交易日。
成立日	指达到基金合同约定的条件，本基金依法成立的日期。
开放日	指基金管理人按照本合同约定办理基金申购或赎回业务的日期，开放日包括临时开放日。
T 日	指本基金的开放日，T+n 日指 T 日之后的第 n 个工作日，T-n 日表示 T 日之前的第 n 个工作日。
终止日	指达到基金合同约定的条件，本基金依法终止的日期。
募集期	指基金合同载明的基金募集期限。
封闭期	指本基金成立日（含）起一段时间内不允许赎回的期限。若本合同其他条款对封闭期内基金份额的申购或赎回设置另有约定的，从其约定。
基金存续期	指基金成立至终止之间的期限。
托管账户	指基金托管人根据有关规定为基金开立的、专门用于资金收付的专用银行结算账户。

<b>证券账户</b>	指由基金管理人为本基金在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司、深圳分公司开设的专用证券账户，以及在中央国债登记结算有限责任公司及银行间市场清算所股份有限公司开立的有关账户及其他证券类账户。
<b>基金账户</b>	基金注册登记机构为基金委托人开立的用于记录其持有的基金份额情况的账户。
<b>基金交易账户</b>	销售机构为基金委托人开立的记录其通过该销售机构办理基金认购、申购、赎回及转托管等业务所引起的基金份额的变动及结余情况的账户。
<b>认购</b>	指在基金募集期间，基金委托人按照本合同的规定购买基金份额的行为。
<b>申购</b>	指在基金开放日，基金委托人按照本合同的规定购买本基金份额的行为。
<b>赎回</b>	指在基金开放日，基金委托人按照本合同的规定将基金份额兑换为现金的行为。
<b>基金财产</b>	指基金委托人拥有合法所有权或处分权、委托基金管理人管理并由基金托管人托管的、作为本合同标的的财产。
<b>基金资产估值</b>	指计算、评估基金资产和负债的价值，以确定基金资产净值的过程。
<b>基金资产总值</b>	指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、证券交易结算资金、期货保证金、基金应收款以及其他资产的价值总和。
<b>基金资产净值</b>	指基金资产总值减去基金负债后的净资产值。
<b>基金份额净值</b>	指当日基金资产净值除以当日基金份额总数的数值。
<b>基金份额累计净值</b>	指基金份额净值加基金成立后每份基金份额的历史累计分红。
<b>元</b>	指人民币元。
<b>投资报告</b>	指年度报告中基金管理人对于报告期内基金投资运作等情况的说明。



## 不可抗力

指不能预见、不能避免并不能克服的客观情况，该等不可抗力事件包括但不限于地震、台风、水灾、火灾、战争、暴乱、流行病、政府行为、罢工、停工、停电、通讯失败等，非因基金管理人、基金托管人和基金行政服务机构（如有）自身原因导致的技术系统异常事故、政策法规的修改或监管要求调整等情形。因交易所、银行、登记结算机构的交易、结算系统出现故障导致的交易、结算无法进行的情形，因电信服务商原因导致资金划付的网络中断、无法使用的情形，构成不可抗力事件。

## 四、声明与承诺

（一）基金委托人声明其为符合《私募办法》规定的合格投资者，保证其投资于本基金的财产的来源及用途合法，并已充分理解本合同条款，了解相关权利义务，了解有关法律法规及所投资基金的风险收益特征，愿意承担相应的投资风险，本投资事项符合其决策程序的要求；承诺其向基金管理人提供的有关投资目的、投资偏好、投资限制、财产收入情况和风险承受能力等基本情况真实、完整、准确、合法，不存在任何重大遗漏或误导。前述信息资料如发生任何实质性变更，应当及时书面告知基金管理人或募集机构。基金委托人知晓，基金管理人、基金托管人及相关机构不应对基金财产的收益状况做出任何承诺或担保，本合同约定的业绩比较基准（如有）仅是投资业绩的比较基准而不是保证。

（二）基金管理人保证在募集资金前已在基金业协会登记为私募基金管理人（管理人登记编码：P1007820）。基金业协会为私募基金管理人和私募基金办理登记备案不构成对私募基金管理人投资能力、持续合规情况的认可；不作为对基金财产安全的保证。基金管理人保证已在签订本合同前充分地向基金委托人说明了有关法律法规和相关投资工具的运作市场及方式，同时揭示了相关风险；已经了解基金委托人的风险偏好、风险认知能力和承受能力，对基金委托人的财务状况进行了充分评估。基金管理人承诺，按照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理运用基金财产，不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

（三）基金托管人承诺按照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则安全保

管基金财产，并履行本合同约定的其他义务。

## 五、基金的基本情况

### （一）基金名称

利可进取一号私募投资基金。

### （二）基金类别

非公开募集投资基金。

本基金设定为均等份额，除本合同另有约定外，每份相同类别的份额具有同等的合法权益。

### （三）基金的运作方式

开放式。

### （四）基金的投资目标和投资范围

本基金以积极的投资组合管理为手段，并通过有效的风险防范措施，追求基金资产的长期、稳定增值，力争实现中长期基金资产的持续稳健增值。

本基金投资范围详见本合同第十二节“基金的投资”第（二）条“投资范围”的约定。

### （五）基金的存续期限

不定期。

### （六）基金的封闭期

无。

### （七）基金计划募集总额

本基金的计划募集总额为 500 万元，管理人有权根据实际募集情况予以调整，基金管理人应将调整情况以本合同约定的方式之一通知已签署合同的委托人和托管人，自通知之日起本基金的计划募集总额以管理人通知的金额为准。

### （八）基金份额的初始募集面值

本基金份额的初始募集面值为 1.00 元。

### （九）基金的托管

本基金的基金托管人为中信证券股份有限公司。

### （十）基金的外包服务

本基金的行政服务机构为中信中证投资服务有限责任公司（外包业务登记编码：A00045）。

## 六、基金份额的募集

### （一）基金份额的募集期间

本基金的募集期间（或称认购期）：自基金份额起始发售之日起最长不超过3个月。本基金的起始发售日期由基金管理人通过本合同约定的方式之一发布通知，即视为履行了信息披露义务。

符合本合同约定的基金成立条件的，基金管理人可以提前终止基金的募集。基金管理人决定调整基金募集期或者提前终止基金募集的，由基金管理人提前两个工作日通过本合同约定的方式之一发布通知，即视为履行了信息披露义务。

### （二）基金份额的认购/申购对象

投资本基金的合格投资者为符合法律法规规定，具备相应风险识别能力和风险承担能力的单位、个人、社会保障基金、企业年金等养老基金、慈善基金等社会公益基金、依法设立并在基金业协会备案的投资计划、投资于所管理私募基金的私募基金管理人及其从业人员、以及中国证监会规定的其他投资者。合格投资者累计不得超过二百人。

### （三）基金份额的募集方式

本基金由基金管理人的直销中心及/或基金管理人委托的代销机构向基金委托人销售。基金管理人可以根据需要增减、变更基金销售机构。本基金委托基金销售机构募集销售的，基金管理人应当以书面形式与基金销售机构签订基金销售协议，并将协议中关于基金管理人与基金销售机构权利义务划分以及其他涉及投资者利益的部分作为基金合同的附件。基金销售协议与作为基金合同附件的关于基金销售的内容不一致的，以基金合同附件为准。

基金管理人直销中心联系方式为：

名称：上海利可资产管理有限公司

联系地址：上海市浦东新区世纪大道1196号世纪汇二座25层05单元

联系电话：021-60537797

传真：021-60537797

销售机构可以依据本合同和本机构的规则及程序办理本基金份额销售。

### （四）认购和持有限额

本基金采取金额认购的方式。基金委托人认购本基金，必须与基金管理人签订基金合同，全额缴纳认购款项，基金委托人在募集期内可以多次认购。认购一经受理则不得撤销，但基金委托人依据本第六节“（六）投资冷静期及回访确

认”项下约定解除合同的除外。

基金委托人首次认购本基金的金额不低于 100 万元（不含认购费用），每次追加认购的金额不设限制。

#### （五）认购的具体规定

本基金募集期间，销售机构于上海证券交易所和深圳证券交易所的正常交易日的交易时间内接受投资者的认购申请。销售机构可以根据本机构的规则及程序确定具体的认购时间。

投资者在认购本基金前，须在注册登记机构开立基金账户、在销售机构开立基金交易账户。

投资者认购本基金，须向销售机构提供本人或者经办人的身份证明文件、授权文件、认购申请表格和认购资金汇款证明，接受销售机构的尽职调查，并签署《风险揭示书》和《基金合同》。销售机构在符合本合同规定的前提下，可以就认购办理手续、办理时间、办理规则等另行做出规定。投资者的认购款项需在基金募集期限届满前的正常交易日的交易时间内划入销售机构指定的募集结算资金专用账户。

销售机构对认购申请的受理并不代表该申请一定成功，投资者认购的具体金额和基金份额以注册登记机构的确认结果为准。

#### （六）投资冷静期及回访确认

1、本基金为基金委托人设置【24】小时的投资冷静期，投资冷静期自本合同签署完毕且基金委托人交纳认购基金的款项后起算。募集机构在投资冷静期内不得主动联系基金委托人。

2、募集机构应当在投资冷静期满后，指令本机构从事基金销售推介业务以外的人员以录音电话、电邮、信函等适当方式进行投资回访。回访过程不得出现诱导性陈述。募集机构在投资冷静期内进行的回访确认无效。

3、投资者在募集机构回访确认成功前有权解除本合同。投资者在该情形下解除其与管理人、托管人签订的基金合同，不属于本合同第二十三节“基金合同的变更、终止与基金财产清算”中所述“基金合同应当终止的情形”，不影响本基金的运作，不会导致本基金的清算。出现前述情形时，募集机构应当及时退还该投资者的全部认购款项。未经回访确认成功，投资者交纳的认购基金款项不得由募集结算资金专用账户划转到基金财产账户或托管资金账户，私募基金管理人不得投资运作投资者交纳的认购基金款项。

4、基金投资者属于以下情形的，不适用本款关于投资冷静期及回访确认的规定：1) 社会保障基金、企业年金等养老基金，慈善基金等社会公益基金；2) 依法设立并在基金业协会备案的私募基金产品；3) 受国务院金融监督管理机构监管的金融产品；4) 投资于所管理私募基金的私募基金管理人及其从业人员；5) 专业投资机构；6) 法律法规、证监会和基金业协会规定的其他投资者。

#### （七）基金认购费用和认购份额的计算

##### 1、认购价格

本基金按初始面值发售，认购价格为 1.00 元。

##### 2、认购费用

本基金不收取认购费用，认购费率为 0%。

##### 3、认购份额的计算

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÷基金认购价格。

有效认购款项（含认购费用）在募集期间在资金清算专用账户中形成的利息直接计入基金财产，具体金额以注册登记机构的记录为准。

认购份额计算结果按照四舍五入方法，保留到小数点后两位，因计算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）募集期内募集资金的管理

1、本基金使用基金行政服务机构的基金销售代理归集专用账户作为本基金的募集结算资金专用账户。行政服务机构仅根据与基金管理人签署的相关服务协议并按照基金管理人的指令，在资金进入该账户后进行资金划拨。

基金行政服务机构的基金销售代理归集专用账户

开户银行：中信银行北京瑞城中心支行

账号：3110710011154018410

账户名称：利可进取一号私募投资基金募集专户

大额支付号：302100011681

上述募集结算资金专用账户的监督机构为：中信证券股份有限公司（“中信证券”）。为避免疑义，中信证券仅对存放于上述账户内的资金承担监督职责。

全体基金委托人特别知悉且确认：根据监督机构与管理人签署的私募基金账户监督协议或者含有账户监督内容的其他协议（以下简称“监督协议”），在特

定条件下监督机构有权单方面解除监督协议，自监督协议解除之日起不再担任本基金募集结算资金专用账户监督机构；管理人应自行负责及时更换新的监督机构，并在上述事项发生之日起三个工作日内以本合同约定的方式之一告知全体基金委托人。

2、基金管理人应当将基金募集期间客户的认购资金存入本基金的注册登记机构开立的资金清算专用账户，在基金募集行为结束前，任何机构和个人不得动用。

注册登记机构的资金清算专用账户为：

开户银行：中信银行北京瑞城中心支行

账号：8110701013200381180

账户名称：中信中证投资服务有限责任公司注册登记专户

大额支付号：302100011681

上述资金清算专用账户的监督机构为：中信证券股份有限公司（“中信证券”）。为避免疑义，中信证券仅对存放于上述账户内的资金承担监督职责。

全体基金委托人特别知悉且确认：根据监督机构与管理人签署的私募基金账户监督协议或者含有账户监督内容的其他协议（以下简称“监督协议”），在特定条件下监督机构有权单方面解除监督协议，自监督协议解除之日起不再担任本基金资金清算专用账户监督机构；管理人应自行负责及时更换新的监督机构，并在上述事项发生之日起三个工作日内以本合同约定的方式之一告知全体基金委托人。

## 七、基金的成立与备案

### （一）基金合同的签署

在投资者签署基金合同之前，募集机构应当向其说明有关法律法规，说明投资冷静期、回访确认（若适用）等程序性安排以及投资者的相关权利，重点揭示本基金风险，并与投资者签署风险揭示书。双方在完成合格投资者确认程序后方可签署本基金合同。

### （二）基金成立的条件

- 1、基金初始资产不低于 100 万元；
  - 2、基金委托人的数量累计不超过 200 人，金融监管部门另有规定的除外。
- 基金募集期满或提前终止募集时，本基金符合以上条件的，基金管理人应

当指令注册登记机构将除认购费用以外的认购资金全部转入基金托管账户。基金托管人收到前述认购资金后应向基金管理人出具现金资产到账确认书（附件 1），基金管理人应在收到托管人的该等现金资产到账确认书当日以扫描或传真形式向托管人及基金行政服务机构（如有）出具载明基金成立日期并加盖管理人公章的“基金成立通知书”（附件 2），前述载明的基金成立日期须为出具该等基金成立通知书的当日，并同时通过本合同约定的方式之一向基金委托人发布基金成立公告，宣布本基金成立，“基金成立通知书”载明的日期为本基金成立之日。若托管人收到的“基金成立通知书”的复印件或扫描件与原件不一致，以托管人收到的“基金成立通知书”的复印件或扫描件的记载为准。

基金托管人收到基金成立通知书并经核对托管账户内全部资金到账日期、规模、期限等信息记载无误后，开始履行托管职责。

### （三）基金的备案

符合基金成立条件的，由基金管理人自基金募集完毕后 20 个工作日内向基金业协会申请办理基金备案手续。若本基金备案失败，基金合同提前终止并按照本合同约定的基金清算程序进行清算。

本基金在基金业协会完成备案后方可进行投资运作。

### （四）不能满足基金成立条件的处理方式

基金募集期限届满，不能满足基金成立条件的，基金管理人应当承担下列责任：

- 1、以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用；
- 2、在募集期限届满后 30 日内返还委托人已缴纳的款项，并加计银行同期活期存款利息。

## 八、基金的申购、赎回及转让

### （一）申购和赎回场所

本基金的申购和赎回将通过基金管理人的直销中心及/或基金管理人委托的代销机构办理。基金管理人可根据情况变更或增减基金销售机构。基金委托人可以在销售机构的营业场所或者按照销售机构提供的其他方式办理基金的申购与赎回。

### （二）申购和赎回的开放日和时间

本基金成立后每个自然月最后一个工作日开放申购和赎回。

本基金可增加临时开放日，临时开放日（包括封闭期内的临时开放日）可接受投资者的申购和赎回申请。若增加临时开放日基金管理人应与托管人协商一致后至少提前 3 个工作日通知所有基金份额持有人及行政服务机构（若有），如果未及时通知行政服务机构造成的问题，行政服务机构不负责。本基金临时开放日不得将连续 2 个工作日设为开放日。

基金委托人在开放日申请办理基金份额的申购和赎回，具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间。但基金管理人根据法律法规、金融监管部门的要求或本合同的规定通知暂停申购、赎回时除外。

若出现证券交易市场、证券交易所变更交易时间，或者发生影响本基金正常运作的重大事项等特殊情况下，基金管理人有权视情况对前述开放日进行相应的调整，并通知基金委托人。基金管理人提前 3 个工作日通过本合同约定的方式之一通知基金委托人，即视为履行了告知义务。

### （三）申购和赎回的原则

1、本基金申购和赎回采用未知价原则，即基金的申购价格和赎回价格以开放日的基金份额净值为基准进行计算。

2、本基金采用金额申购和份额赎回的方式，即申购以金额申请，赎回以份额申请。

3、基金份额的赎回遵循“先进先出”原则，即按照基金委托人认购、申购和红利再投资的先后次序进行赎回。

4、当日的申购、赎回申请可以在当日开放时间结束前（即交易日 15:00 前）撤销，在当日的开放时间结束后不得撤销。

5、基金管理人在不损害基金委托人权益的情况下可更改上述原则，但最迟应在新的原则实施前 3 个工作日按本合同约定通过有效途径告知基金委托人。

### （四）申购和赎回的程序

#### 1、申购和赎回的申请

基金委托人办理申购、赎回等业务应提交本人或经办人的身份证明文件、授权文件、业务申请表等文件。基金委托人申购基金份额的，应当接受销售机构的尽职调查，并签署《风险揭示书》和《基金合同》，但基金委托人在提交申购申请时已持有本基金份额的除外。销售机构在遵守法律法规及本合同规定的前提下，可以另行规定办理手续、办理时间、处理规则等。

基金委托人在提交申购申请时须按照销售机构规定的方式全额支付申购资



金，在提交赎回申请时须持有足够的基金份额余额，否则所提交的申购、赎回申请无效而不予确认。

基金委托人提交申购申请时系首次购买本基金份额的，按照本合同第六节“（六）投资冷静期及回访确认”约定的内容享有投资冷静期。若本合同签约各方协商一致适用回访确认制度的，募集机构应当按照本合同第六节“（六）投资冷静期及回访确认”约定的内容对基金委托人进行投资回访。

## 2、申购和赎回申请的确认及办理机构

申购和赎回申请的办理机构为销售机构。

销售机构受理申购和赎回申请并不表示对该申请是否成功的确认，而仅代表销售机构确实收到了申购或赎回申请。申请是否有效以注册登记机构的确认为准。

销售机构将交易时间结束前收到的申购和赎回申请作为当日申请处理，其他申购和赎回申请在下一工作日处理。如下一工作日不是开放日，则该申请无效。注册登记机构在 T+2 日内对该交易的有效性进行确认。申购申请采取“时间优先、金额优先”原则进行确认，赎回申请按“先进先出”的方式处理，对超过本基金规定的委托人人数的申购申请不予确认。基金委托人可在注册登记机构确认交易申请后的下一个工作日在销售机构查询申请的最终确认情况。

## 3、申购和赎回申请的款项支付

申购采用全额交款方式，若资金在规定时间内未全额到账则申购不成功。若申购不成功或无效，销售机构将基金委托人已缴付的申购款项本金退回基金委托人指定的银行结算账户。

基金委托人赎回申请确认后，基金管理人应按规定向基金委托人支付赎回款项。正常情况下，赎回款项于 T+5 日内划往基金委托人指定的银行结算账户。在发生交易确认延期或巨额赎回时，赎回款项的支付办法按本合同和有关法律法规的规定处理。

### （五）申购和赎回的金额限制

1、基金委托人提交申购申请前未持有本基金份额的，申购金额应不低于 100 万元（不含申购费用），且符合合格投资者标准。

已持有基金份额的基金委托人追加申购基金份额的，每次申购的最低金额不设限制。

2、基金委托人持有的基金资产净值高于 100 万元时，可以选择全部或部分赎回基金份额；选择部分赎回基金份额的，基金委托人在赎回后持有的基金资产

净值不得低于 100 万元。当基金管理人发现基金委托人申请部分赎回基金份额将致使其在部分赎回申请确认后持有的基金资产净值低于 100 万元的，基金管理人有权适当减少该基金委托人的赎回份额，直至该赎回申请确认后，基金委托人持有的基金资产净值不低于 100 万元。

当基金委托人申请赎回基金份额时，所持有的基金资产净值低于 100 万元（含 100 万元）的，基金委托人必须选择一次性全部赎回基金份额。基金委托人没有一次性全部赎回持有份额的，基金管理人将对其所持份额作全部赎回处理。

《私募办法》第十三条列明的“视为合格投资者”的情形可不适用本款约定。

3、基金管理人可以根据市场情况、本基金运作情况，在法律法规允许的情况下，调整上述规定的数量或比例限制。在调整前，基金管理人必须提前 3 个工作日通过本合同约定的方式之一通知基金委托人。

#### （六）申购、赎回的费用

##### 1、申购费

本基金不收取申购费用，申购费率为 0%。

##### 2、赎回费

本基金不收取赎回费用，赎回费率为 0%。

#### （七）申购份额与赎回金额的计算方式

##### 1、基金申购份额的计算

净申购金额=申购总金额÷（1+申购费率）

申购费用=申购金额-净申购金额

申购份额=净申购金额÷T 日基金份额净值。

申购份额计算结果按照四舍五入方法，保留到小数点后两位，因计算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、基金净赎回金额的计算

赎回总额=赎回份数×T 日基金份额净值-业绩报酬

赎回费用=赎回总额×赎回费率

净赎回金额=赎回总额-赎回费用

赎回金额计算结果以人民币元为单位，按照四舍五入方法，保留到小数点后两位，因计算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）拒绝或暂停申购的情形

出现以下情形之一，基金管理人可以拒绝或暂停申购：

- 1、本基金的基金委托人人数达到上限 200 人；
- 2、不可抗力的原因导致本基金无法正常工作；
- 3、证券交易所在交易时间非正常停市；
- 4、发生本合同规定的暂停基金资产估值情况；
- 5、根据市场情况，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，从而损害现有基金委托人的利益的情形；
- 6、因基金收益分配、或基金持有的某个或某些证券进行权益分派等原因，使基金管理人认为短期内接受申购可能会影响或损害现有基金委托人利益的情形；
- 7、基金管理人认为接受某笔或某些申购会有损于现有基金委托人利益，或违反有关法律法规；
- 8、法律法规规定或金融监管部门认定的或本合同约定的其他情形。

若基金委托人的申购被拒绝，被拒绝的申购款项本金将退还给基金委托人。

基金管理人决定暂停接受基金申购申请时，应当通过本合同约定的方式之一告知基金委托人。在暂停申购的情形消除时，基金管理人应及时恢复办理基金申购业务，并以本合同约定的方式之一告知基金委托人。

#### （九）暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

出现以下情形之一，基金管理人可以暂停赎回或延缓支付赎回款项：

- 1、不可抗力的原因导致本基金无法正常工作；
- 2、证券交易所在交易时间非正常停市；
- 3、发生本合同规定的暂停基金资产估值情况；
- 4、当所投资的标的因为停牌等非管理人可控原因造成无法变现的；
- 5、法律法规规定、金融监管部门认定或本合同约定的其他情形。

基金管理人决定暂停接受基金赎回申请或延缓支付赎回款项时，应当通过本合同约定的方式之一至少提前 3 个工作日告知基金委托人，已接受的赎回申请，基金管理人应当足额或者按照已接受的赎回申请量占已接受的赎回申请总量的比例分配支付，其余部分延期支付赎回款项或取消赎回。

基金管理人决定延缓支付赎回款项的，由管理人按照本合同约定的方式通过有效途径及时通知委托人支付时间，赎回价格为当次赎回对应的开放日基金份额净值。

在暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形消除时，基金管理人应及时恢复办理

基金赎回业务，并以本合同约定的方式之一告知基金委托人。

#### （十）巨额赎回的认定及处理方式

##### 1、巨额赎回的认定

指本基金单个开放日，基金净赎回申请份额超过上一日基金总份额的 10% 为巨额赎回。

基金的净赎回申请份额是指赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额。

##### 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状况决定采取全额赎回或者部分延期赎回。

###### （1）全额赎回

当基金管理人认为有能力支付基金委托人的赎回申请时，按正常赎回程序执行。

###### （2）部分延期赎回或取消赎回

当基金管理人认为支付基金委托人的赎回申请有困难或认为支付基金委托人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一日基金总份额的 10% 的前提下，对其余赎回申请延期办理或予以取消。对于当日的赎回申请，按单个委托人赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；未能赎回部分，由基金委托人在提交赎回申请时选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获赎回的部分申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以该开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。如基金委托人在提交赎回申请时未作明确选择，按照自动延期赎回处理。

##### 3、巨额赎回的通知

当发生上述延期赎回或取消赎回时，基金管理人应当通过本合同约定的方式之一，在开放日结束后的 3 个工作日内及时告知基金委托人，说明有关处理方法。

#### （十一）非交易过户的认定及处理方式

1、基金管理人及注册登记机构只受理继承、司法强制执行和经注册登记机构认可的其他情况下的非交易过户。其中：

继承是指基金委托人死亡，其持有的基金份额由其合法的继承人继承的情形。

司法强制执行是指司法机构依据生效的司法文书将基金委托人持有的基金份额强制划转给其他自然人、法人、社会团体或其他组织的情形。

2、申请人办理非交易过户业务应当提供注册登记机构规定的相关资料。符合条件的非交易过户申请自申请受理日起两个月内办理。申请人按照注册登记机构的规定缴纳相关税款和费用。

#### （十二）基金份额的转让

在不违反法律法规规定情况下，基金份额持有人所持有的基金份额可在中国证监会认可的交易场所或者通过其他方式进行转让，本合同另有约定除外。基金份额受让方应当为符合监管规定及本合同约定的合格投资者，基金份额转让方在完成转让后继续持有本基金份额的，仍应符合监管规定及本合同约定的合格投资者要求，且基金份额受让后投资者人数累计不得超过法定的私募基金投资者人数上限。基金管理人就基金份额转让协议确认后，基金注册登记机构根据基金管理人确认的结果办理基金份额转让过户登记。法律法规、监管规定对基金份额转让另有规定的，从其规定。

#### （十三）基金份额的转托管

基金委托人可以将已持有的基金份额在不同销售机构之间办理转托管，销售机构可以按照规定的标准收取转托管费。如果出现基金管理人、注册登记机构、办理转托管的销售机构因技术系统功能限制或其它合理原因，可以暂停或者拒绝基金委托人的转托管申请。

#### （十四）其他情形

基金账户和基金份额的冻结、解冻业务，由注册登记机构办理。基金注册登记机构只受理国家有关机关依法办理以及注册登记机构认可的其他情况的基金账户或基金份额的冻结、解冻。

基金账户或基金份额被冻结的，被冻结基金份额所产生的权益一并冻结，法律法规、中国证监会或法院判决、仲裁裁决另有规定的除外。当基金份额处于冻结状态时，注册登记机构或其他相关机构应拒绝该部分基金份额的赎回、转出、非交易过户以及基金份额的转托管申请。

## 九、基金当事人的权利和义务

### （一）基金委托人

### 1、基金委托人的基本信息

基金委托人自签订本合同起即成为本合同的当事人。基金委托人的详细情况在本合同的“一、合同当事人”页列示。

### 2、基金委托人的权利

- (1) 取得基金财产收益；
- (2) 取得清算后的剩余基金财产；
- (3) 按照本合同的约定申购、赎回和转让基金份额；
- (4) 按照本合同约定，参加或申请召集基金份额持有人大会，行使相关职权；
- (5) 监督基金管理人及基金托管人履行投资管理和托管义务的情况；
- (6) 按照本合同约定的时间和方式获得基金信息披露资料；
- (7) 因基金管理人、基金托管人违反法律法规或本合同的约定导致合法权益受到损害的，有权得到赔偿；
- (8) 国家有关法律法规及本合同约定的其他权利。

### 3、基金委托人的义务

- (1) 认真阅读基金合同，保证投资资金的来源及用途合法；
- (2) 接受合格投资者确认程序，如实填写风险识别能力和承担能力调查问卷，如实承诺资产或者收入情况，并对其真实性、准确性和完整性负责，承诺为合格投资者；
- (3) 以合伙企业、契约等非法人形式汇集多数投资者资金直接或者间接投资于本基金的，应向基金管理人充分披露上述情况及最终投资者的信息，但符合《私募办法》第十三条规定的除外；
- (4) 认真阅读并签署风险揭示书；
- (5) 按照本合同约定缴纳基金份额的认购、申购款项，承担本合同约定的管理费、托管费及其他相关费用；
- (6) 按照本合同约定承担基金的投资损失；
- (7) 及时、全面、准确地向基金管理人告知其投资目的、投资偏好、投资限制、财产收入和风险承受能力等基本情况；
- (8) 向基金管理人或募集机构提供法律法规规定的信息资料及身份证明文件，配合基金管理人或其募集机构的尽职调查、投资者适当性管理和反洗钱工作；
- (9) 保守商业秘密，不得泄露私募基金的投资或意向等；

(10) 不得违反本合同的约定干涉基金管理人的投资行为；

(11) 不得从事任何有损本基金及其委托人、基金管理人管理的其他基金资产及基金托管人托管的其他基金资产合法权益的活动；

(12) 谨慎关注自己的财产变动情况，保持自己的电话、电子邮件等通讯方式畅通，并及时查阅网站公告；

(13) 国家有关法律法规规定及本合同约定的其他义务。

## (二) 基金管理人

### 1、基金管理人的基本信息

名称：上海利可资产管理有限公司

住所：上海市嘉定区华亭镇浏翔公路 6899 号 1 号楼 256 室

通讯地址：上海市浦东新区世纪大道 1196 号世纪汇二座 25 层 05 单元

法定代表人/执行事务合伙人委派代表或授权代表：王毅

联系人：林冰

联系电话：021-60537797

### 2、基金管理人的权利

(1) 按照本合同的约定，独立管理和运用基金财产；

(2) 按照本合同的约定，及时、足额获得基金管理人管理费用及业绩报酬（若有）；

(3) 按照有关规定及本合同约定行使因基金财产投资所产生的权利；

(4) 根据本合同及其他有关规定，监督基金托管人；对于基金托管人违反本合同或有关法律法规规定、对基金财产及其他当事人的利益造成重大损失的，应当及时采取措施制止；

(5) 自行销售或者委托有基金销售资格的机构销售本机构发起设立和管理的基金，制定和调整有关基金销售的业务规则，并对销售机构的销售行为进行必要的监督；

(6) 基金管理人为保护投资者权益，可以在法律法规规定范围内，根据市场情况对本基金的认购、申购业务规则（包括但不限于基金总规模、单个基金投资者首次认购、申购金额、每次申购金额及持有的本基金总金额限制等）进行调整；

(7) 以基金管理人的名义，代表私募基金与其他第三方签署基金投资相关协议文件、行使诉讼权利或者实施其他法律行为；

(8) 国家有关法律法规规定及本合同约定的其他权利。

### 3、基金管理人的义务

(1) 履行基金管理人登记和办理基金的备案手续；

(2) 按照诚实信用、勤勉尽责的原则履行受托人义务，管理和运用基金财产；

(3) 制作调查问卷，对投资者的风险识别能力和风险承担能力进行评估，向符合法律法规规定的合格投资者非公开募集资金；

(4) 制作风险揭示书，向投资者充分揭示相关风险；

(5) 配备足够的具有专业能力的人员进行投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；

(6) 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与其管理的其他基金财产和基金管理人的固有财产相互独立，对所管理的不同财产分别管理，分别记账，分别投资；

(7) 不得利用基金财产或者职务之便，为本人或者投资者以外的人牟取利益，进行利益输送；

(8) 自行担任或者委托其他机构担任基金的注册登记机构，委托其他注册登记机构办理注册登记业务时，对注册登记机构的行为进行必要的监督；

(9) 除依据法律法规或本合同另有约定外，不得委托第三人运作基金财产；

(10) 按规定开立和注销基金财产的证券账户、期货账户等投资所需账户；

(11) 按照本合同的约定接受基金委托人和基金托管人的监督；

(12) 根据法律法规规定与本合同的约定，向基金委托人进行必要的信息披露，揭示本基金资产运作情况，包括编制和向投资者提供基金定期报告；

(13) 按照合同约定计算并向基金委托人报告基金份额净值；

(14) 确定基金份额的申购、赎回价格，采取适当、合理的措施确定基金份额交易价格的计算方法符合法律法规的规定和合同的约定；

(15) 按照本合同约定负责基金会计核算并编制基金财务会计报告；

(16) 保守商业秘密，不得泄露基金的投资计划、投资意向等，法律法规另有规定的除外；

(17) 保存基金投资业务活动的全部会计资料，并妥善保存有关的合同、协议、交易记录及其他相关资料，保存期限自私募基金清算终止之日起不得少于10年，法律法规另有规定的，从其规定；



(18) 公平对待所管理的不同财产，不得从事任何有损基金财产及其他当事人利益的活动；

(19) 按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金委托人分配收益；

(20) 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；

(21) 建立并保存基金份额持有人名册；

(22) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告基金业协会并通知基金托管人和基金委托人；

(23) 国家有关法律法规规定及本合同约定的其他义务。

### （三）基金托管人

#### 1、基金托管人的基本信息

名称：中信证券股份有限公司

住所：广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座

通讯地址：北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦

法定代表人：张佑君

联系人：吴俊文

联系电话：010-60836588

#### 2、基金托管人的权利

(1) 按照本合同约定，及时、足额获得基金托管费；

(2) 根据本合同及其他有关规定，监督基金管理人对于基金财产的投资运作，对于基金管理人违反本合同或有关法律法规规定的行为，对基金财产及基金委托人的利益造成重大损失的情形，有权报告金融监管部门并采取必要措施；

(3) 按照本合同的约定，依法保管基金财产；

(4) 国家有关法律法规规定及本合同约定的其他权利。

#### 3、基金托管人的义务

(1) 安全保管基金财产；

(2) 设立专门的资产托管部门，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的专职人员，负责基金财产托管事宜；

(3) 对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整与独立；

(4) 除依据法律法规规定及本合同约定外，不得为基金托管人及任何第三

人谋取利益，不得委托第三人托管基金财产；

（5）按规定开设和注销基金财产的托管资金账户，协助基金管理人开立和注销基金财产的证券账户、期货账户等投资所需账户；

（6）复核基金份额净值；

（7）根据相关法律法规及本合同约定办理与基金托管业务有关的信息披露事项；

（8）根据法律法规及本合同约定复核基金管理人编制的基金定期报告，并定期出具书面意见；

（9）按照本合同约定，根据基金管理人或其授权人的资金划拨指令，及时办理清算、交割事宜；

（10）依据法律法规规定，妥善保存基金管理业务活动有关的合同、协议、凭证等文件资料；

（11）依据法律法规要求的保存期限，保存基金投资业务活动的全部会计资料，并妥善保存有关的合同、交易记录及其他相关资料；

（12）公平对待所托管的不同基金财产，不得从事任何有损基金财产及其他当事人利益的活动；

（13）保守商业秘密。除法律法规规定及本合同约定外，不得向他人泄露本基金的有关信息；

（14）根据法律法规及本合同的规定监督基金管理人的投资运作，发现基金管理人的投资指令违反法律法规规定，或者违反本合同约定的，应当拒绝执行，立即通知基金管理人；基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律法规规定，或者违反本合同约定的，应当立即通知基金管理人；

（15）按照本合同约定制作相关账册并与基金管理人核对；

（16）国家有关法律法规规定及本合同约定的其他义务。

## 十、基金份额持有人大会及日常机构

### （一）基金份额持有人大会的组成

本基金之基金份额持有人大会由全体基金份额持有人组成。

### （二）应当召开基金份额持有人大会的情形

- 1、决定延长本合同期限；
- 2、决定修改本合同的重要内容或者提前终止本合同；
- 3、决定更换基金管理人或基金托管人；

- 4、决定提高基金管理人、基金托管人的报酬标准；
- 5、本基金运作期间，基金管理人提请聘用、更换投资顾问或提高投资顾问报酬（若有）；
- 6、决定转换基金的运作方式；
- 7、其他可能对基金份额持有人权利义务产生重大影响的情形，或本合同约定的其他情形。

针对前款所列事项，基金份额持有人以书面形式一致表示同意的，可以不召开基金份额持有人大会直接作出决议，并由全体基金份额持有人在决议文件上签名、盖章。

### （三）基金份额持有人大会日常机构

#### 1、基金份额持有人大会可设立日常机构，行使下列职权：

- （1）召集基金份额持有人大会；
- （2）提请更换基金管理人或基金托管人；
- （3）监督基金管理人的投资运作、基金托管人的托管活动；
- （4）提请调整基金管理人、基金托管人的报酬标准；
- （5）本合同约定的其他职权。

#### 2、基金份额持有人大会日常机构的选举、人员构成及更换程序

基金份额持有人大会设立日常机构的，其人员构成、更换等应当由基金份额持有人大会表决选举产生。选举或更换结果应由管理人通过本合同约定的方式之一告知全体委托人和托管人。

### （四）基金份额持有人大会的运作

#### 1、会议召集及通知

基金份额持有人大会设立日常机构的，由该日常机构召集；未设立日常机构或日常机构未召集的，由基金管理人召集。基金管理人未按规定召集或者不能召开的，由基金托管人召集。

代表基金份额百分之二十（含）以上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，而基金份额持有人大会的日常机构、基金管理人、基金托管人都不召集的，代表基金份额百分之二十（含）以上的基金份额持有人有权自行召集。

召开基金份额持有人大会，召集人应当至少提前十个工作日通知基金份额持有人大会的召开时间、会议形式、审议事项、议事程序和表决方式等事项。基金

份额持有人大会不得就未经公告的事项进行表决。

## 2、会议召开方式及条件

基金份额持有人大会可以采取现场方式召开，也可以采取通讯等方式召开。每一基金份额具有一票表决权，基金份额持有人可以委托代理人出席基金份额持有人大会并行使表决权。

基金份额持有人大会应当有代表三分之二（含）以上基金份额的持有人参加，方可召开。参加基金份额持有人大会的持有人的基金份额低于前款规定比例的，召集人可以在原通知的基金份额持有人大会召开时间后，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二（含）以上基金份额的持有人参加，方可召开。

## 3、审议事项表决

基金份额持有人大会就审议事项作出决定，应当经参加大会的基金份额持有人所持表决权的三分之二（含）以上通过；但是，转换基金的运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、提前终止基金合同、本合同其他条款对基金财产清算需经持有人大会决议另有约定的，应当经参加大会的基金份额持有人所持表决权的全部通过。

## 4、决议的披露

基金份额持有人大会决定的事项，应通过本合同约定的方式之一通知全体基金份额持有人、基金托管人、基金行政服务机构（如有）和其他相关当事人。

### （五）其他

基金份额持有人大会及其日常机构不得直接参与或者干涉基金的投资管理活动。

## 十一、基金份额的登记

### （一）基金注册登记业务

本基金的注册登记业务指基金的登记、存管、清算和结算业务，具体内容包括基金账户建立和管理、基金份额登记、基金交易确认、资金清算、权益分配、保管基金份额持有人名册等。

### （二）基金注册登记办理机构

基金管理人委托可办理私募基金份额登记业务的其他机构代为办理私募基金份额登记业务的，应当与有关机构签订委托代理协议。

基金管理人委托基金行政服务机构办理本基金的注册登记业务。本基金注册

登记机构为中信中证投资服务有限责任公司（外包业务登记编码：A00045）。

（三）注册登记机构的权利

- 1、建立和管理基金委托人的基金账户；
- 2、取得注册登记费用和其他相关费用；
- 3、保管基金委托人的开户资料、交易资料、基金份额持有人名册等；
- 4、在法律法规允许的范围内，制定和调整注册登记业务的业务规则；
- 5、法律法规规定的其他权利。

（四）注册登记机构的义务

- 1、配备足够的专业人员办理本基金的注册登记业务；
- 2、严格按照法律法规和本合同的规定办理基金的注册登记业务；
- 3、依法保存基金委托人名册；
- 4、对基金委托人的基金账户信息负有保密义务，因违反保密义务对基金带来损失的，须承担相应的赔偿责任，法律法规规定的情形除外；
- 5、按本合同的规定为基金委托人办理基金份额的转托管、非交易过户、司法强制执行等业务，并提供其他必要服务；
- 6、接受基金管理人的监督；
- 7、法律法规和本合同规定的其他义务。

（五）基金份额登记数据的备份

全体基金份额持有人同意私募基金管理人、注册登记机构或其他份额登记义务人按照基金业协会的规定办理基金份额登记数据的备份。

## 十二、基金的投资

（一）投资目标

本基金以积极的投资组合管理为手段，并通过有效的风险防范措施，追求基金资产的长期、稳定增值，力争实现中长期基金资产的持续稳健增值。

（二）投资范围

本基金主要投资于国内依法发行上市的股票及其他经中国证监会核准上市的股票、新股申购（包括网上和网下申购）、债券（包括国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、可转换债券、资产支持证券、中小企业私募债券等）、中信证券股份有限公司发行的收益凭证、证券投资基金、基金公司资管计划（包含基金子公司资管计划）、债券回购、期货公司资管计划以及券商的资管计划等资产管理计划、信托计划、私募基金、权证、货币市场工具、参与融资融

券、将持有的证券作为融券标的证券出借给证券金融公司、沪港通、深港通、金融衍生工具（包括但不限于股指期货、商品期货，个股期权、股指期货，以持牌金融机构做交易对手的收益互换、跨境收益互换、场外期权等，以及通过前述衍生工具间接投资境内境外二级市场股票等）、金融监管部门批准的跨境投资金融工具、以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他投资品种。

如法律法规规定基金管理人需取得特定资质后方可投资某产品，则基金管理人须在获得相应资质后开展此项业务。

对于变更基金投资范围的，管理人应以传真、电话、短信、邮件、信件等任一方式一对一地发送投资范围变更通知函（以下简称“通知函”），至少提前【十】个工作日告知基金委托人，并以书面形式通知托管人。管理人需在通知函中载明投资范围变更生效日和允许赎回的开放日。基金管理人须在变更生效日之前设置临时开放日（通知函发出之日起至变更生效日期间有允许赎回的固定开放日的除外，本次开放不受年度临时开放日次数的限制），允许不同意变更的基金委托人赎回；未在变更生效日前全部赎回份额的基金委托人视为同意前述变更。因本条项下事由的赎回申请，不受本基金合同关于份额锁定期（如有）、封闭期（如有）和巨额赎回（如有）的限制。如通知函中载明的开放日出现本合同约定的“暂停赎回或取消赎回的情形”，管理人需在前述情形解除后且在变更生效日前另设临时开放日（本次开放不受年度临时开放日次数的限制）。若上述情形在通知函载明的变更生效日前无法解除的，变更生效日应延期至前述另设的临时开放日之后。除本条约定需对变更生效日进行延期的以外，变更事项自通知函中载明的变更生效日起生效，对合同各方均具有法律效力。

参与银行间债券、期权、收益互换及未列示的其它品种，管理人需提前与托管人、行政服务机构就清算交收、核算估值等事项达成一致意见后方可参与。若未经托管人及行政服务机构同意，管理人擅自参与上述业务的，产生的估值核算等问题，行政服务机构及托管人不承担责任。

### （三）投资策略

“核心品种+板块配置+仓位匹配”是投资策略的重要组成，以核心品种为基础，不断地优化组合是管理人贯穿投资过程始终的策略。不同类型的投资标的适合不同的交易策略，对于弱周期的品种，左侧交易的策略比较适合，对于周期性较强的品种，右侧交易比较适合。

### （四）投资限制

1、本基金投资于存款、债券等债权类资产的比例不低于【80】%。（基金委托人已经知晓且确认：本条投资限制由基金管理人自行监控，基金托管人不承担投资监督职责。）

2、本基金投资的私募投资基金（包括有限合伙）必须有托管机构；

3、本基金的基金资产总值占基金资产净值的比例不得超过 200%；

4、本基金不得投资非证券类金融产品，包括但不限于非证券类私募投资基金（包括有限合伙），基金公司子公司、期货公司、证券公司及信托公司管理/发行的非证券类资管计划、信托计划等；

5、法律法规或监管部门规定的其他投资限制。

**基金委托人已经知晓且确认：以上第【1】项投资限制由基金管理人自行监控，基金托管人不承担投资监督职责。**

以上投资限制中，如涉及新股、新债申购的申报金额与数量、盘中监控、交易策略类等监控事项的，由基金管理人自行监控，基金托管人不承担投资监督职责。

基金管理人自本基金成立之日起使本基金的投资组合比例符合上款约定。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的，基金管理人在 10 个交易日内调整完毕。如因证券暂停交易或其他非基金管理人可以控制的原因导致基金管理人不能履行调整义务的，则不受上款约定之限制，但基金管理人应当自证券恢复交易之日起的 10 个交易日内使本基金的投资组合比例符合上款约定。法律法规另有规定的从其规定。

#### （五）禁止行为

为维护基金委托人的合法权益，本基金的基金管理人、基金托管人、基金销售机构及其他服务机构及其从业人员禁止从事下列行为：

1、将其固有财产或者他人财产混同于基金财产从事投资活动；

2、不公平地对待其管理的不同基金财产；

3、利用基金财产或者职务之便，为本人或者投资者以外的人牟取利益，进行利益输送；

4、侵占、挪用基金财产；

5、泄露因职务便利获取的未公开信息，利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；

- 6、从事损害基金财产和投资者利益的投资活动；
- 7、玩忽职守，不按照规定履行职责；
- 8、从事内幕交易、操纵交易价格及其他不正当交易活动；
- 9、法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他行为。

#### （六）利益冲突及处理

基金管理人可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其他重大利害关系的公司发行的证券或承销期内承销的证券，或从事其他重大关联交易，但需要遵循基金份额持有人利益优先的原则、防范利益冲突，符合监管机构的规定，并履行信息披露义务。

基金管理人可运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其关联方或者与上述主体有其他重大利害关系的主体直接或间接管理或代理销售的、或提供客户服务的、或者该等主体参与投资的符合本合同投资范围规定的投资产品。但需要遵循基金份额持有人利益优先的原则、防范利益冲突，符合监管机构的规定，并履行信息披露义务。

基金投资者签署本合同即表明其已经知晓且认可本基金可能进行上述关联交易。

基金份额持有人不得因本基金投资收益劣于基金管理人、基金托管人及其关联方管理的其他类似投资产品的收益，而向基金管理人或基金托管人提出任何损失或损害补偿的要求。

#### （七）业绩比较基准

沪深 300 指数。

#### （八）风险收益特征

本基金不承诺保本及最低收益，属预期风险【高】、预期收益【高】的投资品种，适合具有相应风险识别、评估、承受能力的合格投资者。

#### （九）预警平仓机制

无。

#### （十）基金的融资、融券及其他场外证券业务（如有）

本基金可以根据有关法律法规和政策的规定参与融资融券，将持有的证券作为融券标的证券出借给中国证券金融公司。

（十一）就本第十二节“基金的投资”约定内容，由基金管理人具体负责操作，基金托管人依据本合同投资范围和投资限制的约定对基金管理人进行事后监



督。

### 十三、投资经理的指定与变更

#### （一）投资经理的指定和变更程序

基金投资经理由基金管理人负责指定。基金管理人可根据业务需要变更投资经理，并在变更后及时告知基金委托人。

基金管理人自投资经理变更之日起 3 个工作日内通过本合同约定的方式之一通知基金委托人，即视为履行了告知义务。

#### （二）投资经理简历及兼职情况

本基金的投资经理由【王胤良】担任。投资经理简介如下：

王胤良，上海理工大学学士学位，目前担任上海利可资产管理有限公司投资经理。研究功底扎实，加入上海利可资产管理有限公司以来主要负责产品管理和具体品种研究，曾管理了利可系列的多个产品，均取得较好的业绩回报。

### 十四、基金的财产

#### （一）基金财产的保管与处分

1、基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产，由基金托管人托管。基金管理人、基金托管人不得将基金财产归入其固有财产。基金托管人对存放于托管账户中的基金财产承担保管职责。

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入基金财产。

3、基金管理人、基金托管人以其固有财产承担法律责任，其债权人不得对基金财产行使请求冻结、扣押和其他权利。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财产。

4、基金管理人、基金托管人不得违反法律法规的规定和本合同约定擅自将基金资产用于抵押、质押、担保或设定任何形式的优先权或其他第三方权利；

5、基金财产产生的债权不得与不属于基金财产本身的债务相互抵销。非因基金财产本身承担的债务，基金管理人、基金托管人不得主张其债权人对基金财产强制执行。上述债权人对基金财产主张权利时，基金管理人、基金托管人应明确告知基金财产的独立性。

6、基金管理人、基金托管人可以按本合同的约定收取管理费、业绩报酬、

托管费以及本合同约定的其他费用。

## （二）基金财产相关账户的开立和管理

### 1、基金募集账户的开立及管理

基金募集期间，募集的资金应存于基金管理人指定的专门账户。

基金募集期满或停止募集时，符合相关法律法规和本合同规定的，基金管理人指令注册登记机构将属于基金财产的全部资金划入基金托管人开立的基金托管账户。

基金募集期限届满，未能达到基金成立的条件，由基金管理人按规定办理退款等事宜（如已缴纳认购款项）。

### 2、基金托管账户的开立和管理

基金托管人以基金的名义在具有托管业务资格的商业银行开立银行存款账户，作为本基金托管账户，并根据基金管理人的指令办理资金收付。本基金托管账户的银行预留印鉴为“中信证券股份有限公司托管业务结算专用章”加基金托管人有权人名章。基金托管账户的开户资料及预留印鉴对应印章由基金托管人保管和使用。

本基金托管期间的一切货币收支活动，包括但不限于投资、支付基金费用、划付基金投资收益等，均需通过该账户进行。基金托管账户按照与资金存管银行商定的存款利率计息。

基金托管账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得假借本基金的名义开立任何其他银行存款账户；亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。

基金托管账户的开立和管理应符合相关法律法规的有关规定。

### 3、基金普通证券账户和资金账户的开立和管理

基金管理人在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司、深圳分公司为本基金开立证券账户，账户名称为基金管理人与基金联名。

基金证券账户的开立和使用，仅限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得出借或转让基金证券账户，亦不得使用基金证券账户进行本基金业务以外的活动。

基金证券账户卡的保管由基金托管人负责。账户资产的管理和运作由基金管理人负责。

本基金采用“第三方存管”+“托管”模式存管证券交易结算资金，基金管

理人负责在证券经纪商处开设基金专用证券资金账户，并与基金托管账户建立第三方存管签约关系，在基金运作期间，未经基金托管人书面同意，不得变更基金专用证券资金账户与托管账户之间的第三方存管签约关系。

本基金由证券经纪商完成基金的日常证券交易的资金结算工作，相关结算规则依据沪深证券交易所、全国中小企业股份转让系统等市场和证券登记公司的规定执行，交易佣金参照基金管理人与证券经纪商约定的费率实施。

#### 4、基金信用证券账户和资金账户的开立和管理

本基金在符合监管机构、证券交易所和证券经纪商规定的参与融资融券交易的基本条件，已开通客户交易结算资金第三方存管且通过证券经纪商的融资融券交易资质审核并与之签订融资融券业务合同后，可申请开立信用账户。

基金管理人在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司、深圳分公司为本基金开立信用账户，具体账户名称与普通证券账户名称一致，其中上海信用证券账户需指定证券经纪商融资融券业务专用交易单元。

本基金采用“第三方存管”+“托管”模式存管信用账户资金，基金管理人负责在证券经纪商处开设基金信用资金账户，并与基金托管账户建立信用资金第三方存管签约关系，在基金运作期间，未经基金托管人书面同意，不得变更基金信用资金账户与托管账户之间的第三方存管签约关系。

#### 5、期货交易账户和期货保证金账户的开设和管理

基金管理人和基金托管人相互配合，根据期货交易所、中国期货保证金监控中心和期货保证金存管银行有关规定，通过期货经纪商开立期货交易账户和期货保证金账户。期货交易账户和期货保证金账户的开立和使用、期货出入金及期货交易等根据基金管理人、基金托管人与期货经纪商签署的相关协议执行。

#### 6、其他账户的开立和管理

本基金被允许从事符合法律法规规定和基金合同约定的其他投资品种的投资业务时，如果涉及相关账户的开设和使用，由基金管理人或托管人根据有关法律法规的规定和基金合同的约定，开立有关账户。该账户按有关规则使用并管理。法律法规等有关规定对相关账户的开立和管理另有规定的，从其规定办理。基金财产投资的有关实物证券、银行存款开户证实书等有价凭证由基金托管人存放于基金托管人的保管库，保管凭证由基金托管人持有。实物证券、银行定期存款证实书等有价凭证的购买和转让，按基金管理人和基金托管人双方约定办理。

#### 7、基金财产账户的独立性

本基金的上述基金财产账户与基金管理人、基金托管人、基金募集机构和注册登记机构自有的财产账户以及其他基金财产账户相独立。

### （三）与基金财产有关的重大合同的保管

1、与基金财产有关的重大合同的签署，由基金管理人负责。由基金管理人代表基金签署的与基金有关的重大合同的原件由基金管理人保管。重大合同包括但不限于基金合同、证券经纪服务协议、期货交易结算服务协议、基金行政管理服务协议（如有）、清算报告等。

2、重大合同的保管期限为本基金清算终止之日起 10 年，法律法规另有规定的，从其规定。

3、与基金财产有关的重大合同，根据需要由基金托管人以基金的名义签署的，由基金管理人以传真或其他方式下达签署指令（含有效授权内容），合同原件由基金托管人保管，但基金托管人应将该合同原件的复印件盖章（骑缝章）后，交基金管理人一份。如该合同需要加盖基金管理人公章，则基金管理人至少应保留一份合同原件。

## 十五、投资资金划款指令的发送、确认和执行

### （一）基金管理人对发送指令人员的书面授权

基金管理人应事先以书面通知（以下简称“授权文件”）的形式通知基金托管人有权发送指令的被授权人的人员名单、指令用章的预留印鉴样本及被授权人签字样本、名章样本，授权文件（附件 3）应注明被授权人的权限及有效时限。授权文件由基金管理人法定代表人/执行事务合伙人委派代表或授权签字人签字并加盖公章，若由授权签字人签署，还应附上法定代表人/执行事务合伙人委派代表授权书。

基金管理人将授权文件以传真或邮件发送扫描件的方式通知基金托管人并经与基金托管人电话或邮件确认收到且对文件内容无异议后，授权文件即生效，基金管理人应在传真件或扫描件发出后七个工作日内送达文件正本。正本与传真件或扫描件不符的，以托管人收到的传真件或扫描件为准。如果授权文件中载明具体生效时间的，该生效时间不得早于基金托管人收到授权文件传真件或扫描件并经与基金管理人电话确认无异议的时点。否则以基金托管人收到授权文件传真件或扫描件并经与基金管理人电话确认无异议的时点为授权文件的生效时间。

基金管理人和基金托管人对授权文件负有保密义务，其内容不得向被授权人

及必要操作人员以外的任何人泄露。但法律法规规定或有权机关要求的除外。

## （二）资金划款指令的内容

指令是基金管理人在运用基金资产时，向基金托管人发出的资金划拨及其他款项支付的指令。基金管理人发送给基金托管人的划款指令（附件 4）应写明以下要素：划付模式、资金用途、支付时间、金额、账户信息等，加盖预留印鉴并由被授权人签字或加盖名章（以上内容统称为“指令的书面要素”）。

## （三）指令的发送、确认和执行的程序和程序

指令由被授权人代表基金管理人用加密传真的方式或基金托管人和基金管理人确认的其他方式向基金托管人发送。基金管理人义务在发送指令后及时与基金托管人进行录音电话确认，指令自该等确认后生效。对于因基金管理人未能及时与基金托管人进行指令确认，致使资金未能及时划拨所造成的损失，基金托管人不承担任何责任。基金托管人依照本合同下述的方法对指令进行表面一致性的形式审核后，方可执行指令。

对于被授权人发出的指令，基金管理人不得否认其效力。基金管理人应按照有关法律法规和本合同的规定，在其合法的经营权限和交易权限内发送划款指令，被授权人应按照其授权权限发送划款指令。如果基金管理人已经撤销或更改对被授权人员的授权，并且基金托管人根据本合同确认后，则对于此后该划款指令发送人员无权发送的指令，或超权限发送的指令，基金托管人不予执行，授权已更改但未经基金托管人确认的情况下，指令已执行的，托管人不承担责任。

基金管理人发送指令后应当给基金托管人预留足够的执行时间，场外及时发送指令的截止时间为当天的 15:00，银证转账、银期转账指令的截止发送时间为当天的 13:00，如遇特殊情况晚于截止时间，基金托管人尽量完成，但不承担因基金管理人迟延发送指令造成的任何损失，如基金管理人要求当天某一时点到账，则交易结算指令需提前 2 个工作小时发送且应符合前述发送指令的截止时间（工作时间：工作日 9:00-11:30，13:00-17:00）。基金管理人向基金托管人发送划款指令时，应确保基金托管账户、证券账户等基金专用账户内有足够的资金余额，对超头寸的划款指令，基金托管人可不予执行，但应立即通知基金管理人，由此造成的损失由基金管理人承担，基金托管人不承担责任。

基金托管人仅对基金管理人提交的按照前述约定已经生效的指令按照前述指令的书面要素进行表面一致性的形式审查，形式审查的方式限于验证指令的前述书面要素是否齐全、审核指令用章和签发人的签名或名章是否与预留印鉴样本、

被授权人的签字样本或名章样本相符、操作权限是否与授权文件一致，当托管人验证相符后，应开始执行指令；基金托管人不负责审查基金管理人发送指令同时提交的其他文件资料的合法性、真实性、完整性和有效性及与指令的一致性，基金管理人应保证上述文件资料合法、真实、完整和有效以及与指令的一致性。如因基金管理人提供的上述文件不合法、不真实、不完整或失去效力或与指令不一致而影响基金托管人的审核从而给基金财产或给任何第三人带来损失，基金托管人不承担任何形式的责任。若指令与授权文件中预留印鉴样本、签字样本、名章样本、权限等要素不符的，基金托管人无义务执行指令，在该等情况下，基金托管人立即与基金管理人指定人员进行电话联系和沟通，并要求基金管理人重新发送经修改的指令，就基金管理人修改后重新发送的指令，基金托管人将按照前述指令确认、审查程序重新进行表面一致性形式审查，基金托管人经审查无误的，才开始执行指令，对于前述情形导致的任何延误或后果，基金托管人不承担任何责任。

#### （四）基金管理人发送错误指令的情形和处理程序

基金管理人发送错误指令的情形包括：指令违反法律法规或基金合同有关规定，指令发送人员无权或超越权限发送指令及交割信息错误，指令中重要信息模糊不清或指令要素不全等。

基金托管人在履行监督职能时，发现基金管理人的指令错误时，有权拒绝执行，并及时通知基金管理人改正。基金管理人撤回已发送至基金托管人的有效指令，须向基金托管人传真或电子邮件发送加盖公章或预留印鉴的书面说明函并电话确认，基金托管人收到说明函并得到确认后，将撤回指令作废；如果基金托管人在收到说明函并得到确认时该指令已执行，则基金托管人不承担因执行该指令而造成损失的责任。

#### （五）基金托管人依照法律法规、本基金合同暂缓、拒绝执行指令的情形和处理程序

基金托管人发现基金管理人发送的指令违反法律法规、本基金合同的相关规定，不予执行，并应及时以书面形式通知基金管理人纠正。基金管理人收到通知后应及时核对，并以书面形式对基金托管人发出回函确认，基金管理人未予书面回函确认的，视为同意基金托管人的处理，由此造成的损失由基金管理人承担。

基金托管人对执行基金管理人形式上符合相关法律法规、基金合同规定的指令对基金财产造成的损失不承担赔偿责任。

#### （六）基金托管人未按照基金管理人指令执行的处理方法

在正常业务受理渠道和指令规定的时间内，基金托管人由于故意或重大过失，未按照基金管理人发送的符合法律法规及本合同约定的指令执行并对基金财产或投资人造成损失的，由基金托管人承担对直接损失部分相应的责任，但银行托管账户余额不足或基金托管人遇到不可抗力情况除外。

#### （七）更换被授权人员的程序

基金管理人更换被授权人、更改或终止对被授权人的授权，应至少提前【3】个工作日将新的授权文件以传真件或电子邮件发送扫描件的方式通知基金托管人，并在基金托管人收到新授权文件传真件或扫描件并电话确认对新授权文件内容无异议后生效，原授权文件同时废止。基金管理人应在传真件或邮件发出后七个工作日内送达授权文件正本。文件正本与传真件或扫描件不一致的，以托管人收到的传真件或扫描件为准，由此产生的责任由基金管理人承担。

#### （八）指令的保管

指令正本由基金管理人保管，基金托管人保管指令传真件或扫描件。当两者不一致时，以基金托管人收到的划款指令传真件或扫描件为准。

#### （九）相关责任

基金托管人正确执行基金管理人符合法律法规及本合同约定的划款指令，基金资产发生损失的，基金托管人不承担任何形式的责任。

如果基金管理人的划款指令存在事实上未经授权、欺诈、伪造或未能按时提供或更新被授权人员的预留印鉴或签字样本等非基金托管人原因造成的情形，只要基金托管人根据本合同约定履行形式审查义务，基金托管人不承担因执行有关指令而给基金管理人、基金资产或任何第三方带来的损失，全部责任由基金管理人自行承担，但基金托管人未按本合同约定履行形式审查义务即执行划款指令而造成损失的情况除外。

## 十六、资金清算交收安排

### （一）交易所证券交易的结算交收安排

1、基金管理人负责选择代理基金在沪深证券交易所能同时进行普通证券交易和信用交易（如有）的证券经纪商，并承担相应责任。

本基金在证券交易所场内交易的证券和资金结算交割，由证券经纪商办理并承担相应责任。

基金管理人选聘证券经纪商后，应与被选择的证券经纪商另行签订相关协议，明确基金在证券交易所进行的各类证券交易、信用交易、资金结算、交收过程中双方涉及的权利和义务，保障基金财产的安全。

基金管理人应委托证券经纪商向基金托管人提供基金证券交易结算的相关数据及凭证，以及其他涉及基金财产的信息，包括但不限于证券资金账户内资金余额的计息情况或利率变动、相关证券交易费用参数及其调整等。基金托管人依据证券经纪商提供的材料履行合同约定的相关职责。基金管理人有权监督证券经纪商尽职履责。若因管理人、证券经纪服务商或交易所、登记公司、股转系统等原因导致托管人未能及时、完整、准确获得交易数据、凭证或相关信息，影响托管人按照合同约定履行投资监督、估值核算、账目核对等职责的，托管人不承担责任。

基金管理人应负责向托管人及时提供必要的经纪服务商业务经办信息及其调整情况，以便托管人自经纪服务商处接收相关资料。

## 2、交易所证券交易资金结算的核对

基金管理人、托管人依据交易数据在各自的系统中进行清算并与证券经纪商提供的证券资金账户对账单进行核对。双方核对交易清算金额如果发现差异时按以下方式处理：

当日证券清算发生差异的，管理人或托管人发现问题后即刻通知对方并查明差异原因，如是管理人或托管人差错，则差错方自行调整，并将结果通知对方；如是证券经纪商差错，则管理人应要求证券经纪商及时调整，管理人和托管人按照实际发生金额处理。

### （二）交易所期货交易的资金清算交收安排

基金管理人负责选择代理基金期货买卖的期货经纪商，并与基金托管人及期货经纪商就期货保证金保管、出入金、期货交易、结算数据发送及清算交收安排等事项，签订相关协议，明确各方的权利义务。基金投资期货交易清算及资金交割事宜根据签署协议内容办理，并由该期货经纪商负责。

本基金在期货交易所交易的保证金清算交割，通过期货经纪商办理并承担相应责任，无须基金管理人向基金托管人另行出具划款指令。

### （三）非交易所交易的资金清算交收安排

场外资金汇划由基金托管人凭基金管理人的有效划款指令和相关投资合同（如有）进行资金划拨。



资金清算为支付税费的，基金托管人审核付款用途符合本合同约定后，凭基金管理人指令和相关税费单据（若有）进行资金划拨。

本基金托管账户发生的银行结算费用、银行账户维护费等银行费用，由基金托管人直接从托管账户中扣划，无须基金管理人出具划款指令。

#### （四）资金、证券账目及实物账目的核对

基金管理人和基金托管人每交易日核对基金资金账目和证券账目，确保双方账目相符。实物账目的核对方式和内容由基金管理人和基金托管人协商确定。

#### （五）基金申购和赎回业务处理的基本规定

1、基金申购和赎回的确认、清算由基金管理人或其委托的注册登记机构负责。

2、基金管理人或其委托的注册登记机构应将每个开放日的申购和赎回的数据传送给基金托管人，并对传递的申购和赎回数据的真实性负责。基金托管人应及时查收申购及转入资金的到账情况并根据基金管理人指令及时划付赎回及转出款项。

3、基金管理人或其委托的注册登记机构应保证不晚于每个开放日（T日）后的两个工作日（T+2日）15:00前向基金托管人发送该开放日的上述有关数据，并保证相关数据的准确、完整。

4、基金管理人或其委托的注册登记机构应通过与基金托管人建立的加密系统发送有关数据（包括电子数据和盖章生效的纸质清算汇总表），如因各种原因，该系统无法正常发送，双方可协商解决处理方式。基金管理人或其委托的注册登记机构向基金托管人发送的数据，双方各自按有关规定保存。

5、如基金管理人委托其他机构办理本基金的注册登记业务，应保证上述相关事宜按时进行。否则，由基金管理人承担相应的责任。

#### 6、关于清算专用账户的设立和管理

由注册登记机构开立资金清算专用账户，用于办理基金申购、赎回及分红资金的归集、存放与交收。

7、对于申购过程中产生的应收款，应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知基金托管人，到账日应收款没有到达基金托管账户的，基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收，由此造成基金财产损失的，基金管理人应负责向有关当事人追偿基金财产的损失。

#### 8、赎回和分红资金划拨规定

拨付赎回款或进行基金分红时，如基金托管账户有足够的资金，基金托管人应根据基金管理人的指令按时拨付。如基金托管账户内资金不足，由基金管理人承担相关的责任，基金托管人不承担垫款义务。

#### 9、资金指令

除申购款项到达基金托管账户需双方按约定方式对账外，与投资有关的付款、赎回和分红资金划拨时，基金管理人需向基金托管人下达指令。基金管理人在下达指令时，应为基金托管人留出必需的划款时间。

资金指令的格式、内容、发送、接收和确认方式等与资金划款指令相同。

#### （六）申购、赎回净额结算

基金托管账户与资金清算专用账户之间的资金结算遵循“全额清算、净额交收”的原则，每日按照托管账户应收资金与应付资金的差额来确定托管账户净应收额或净应付额，以此确定资金交收额。当存在托管账户净应收额时，基金管理人或其委托的注册登记机构应在资金划款日 12:00 之前从资金清算专用账户划到基金托管账户；当存在托管账户净应付额时，基金管理人应在资金划款日上一工作日将划款指令发送给基金托管人，基金托管人按基金管理人的划款指令将托管账户净应付额在资金划款日 16:00 之前划往资金清算专用账户。

#### （七）基金转换

1、在本基金与基金管理人管理的其它基金开展转换业务之前，基金管理人应函告基金托管人并就相关事宜进行协商。

2、基金托管人将根据基金管理人传送的基金转换数据进行账务处理，具体资金清算和数据传递的时间、程序等经基金管理人、基金托管人协商一致后按照约定内容执行。

#### （八）基金现金分红

1、基金管理人将其拟定的分红方案通知基金托管人。

2、基金管理人对其基金分红进行账务处理并核对后，向基金托管人发出现金分红的划款指令，基金托管人应及时将资金划入基金管理人委托的注册登记机构开立的资金清算专用账户。

3、基金管理人委托的注册登记机构根据管理人拟定的分红方案将分红款划入销售机构或行政服务机构的募集结算资金专用账户，由销售机构或行政服务机构将分红款划往基金委托人指定的银行结算账户。

## 十七、越权交易处理

### （一）越权交易的界定

越权交易是指基金管理人违反法律法规或本合同约定的投资交易行为。

基金管理人应在法律法规或本合同约定的权限内运用基金财产进行投资管理，不得违反前述范围，超越权限从事投资。

### （二）越权交易的处理程序

基金托管人发现基金管理人的投资指令或实际投资运作违反法律法规或本合同的规定，应及时以电话提醒、邮件、书面通知等任一方式通知基金管理人限期纠正。基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查。基金管理人收到书面、电话、邮件通知后应在下一工作日前及时核对并以书面或邮件形式给基金托管人发出回函，就基金托管人的疑义进行解释或举证，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对于基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告金融监管部门。基金管理人应赔偿因其违反法律法规或本合同而致使基金委托人和基金托管人遭受的损失。

基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的指令违反法律法规或本合同的规定，应当立即通知基金管理人，由此造成的损失由基金管理人承担。

越权交易所发生的损失及相关交易费用由基金管理人负担，所发生的收益归本基金财产所有。

### （三）越权交易的例外

非因基金管理人主动投资行为导致的下列不符合法律法规或合同约定的情形不构成本章所述越权交易，应当属于被动超标，因被动超标而对基金财产造成的损失由基金财产承担：

- 1、由于基金管理人可控制之外的原因导致投资比例不符合法律法规或本合同约定的为被动超标，不属于越权交易，包括但不限于证券市场波动、上市公司合并、已投资持有的证券在持有期间信用评级下降、上市公司受到金融监管部门处罚或谴责、上市公司股票被特别处理、上市公司年度财务审计报告未被出具标准无保留意见等。发生被动超标时，基金管理人应在相应证券可交易之日起 10 个交易日内调整完毕，因证券停牌或其他非基金管理人可以控制的原因，调整时限可相应合理延长。

- 2、本合同终止前 10 个交易日内，基金管理人有权对基金财产所投资证券进

行变现，由此造成投资比例、投资范围不符合合同约定的，视为被动超标，不属于越权交易。

3、法律法规对被动超标另有规定的从其规定。

## 十八、基金资产的估值和会计核算

### （一）基金资产的估值

#### 1、估值目的

基金资产估值的目的是客观、准确地反映基金资产是否保值、增值，依据经基金资产估值后确定的基金资产净值而计算出的基金份额净值，是计算基金申购和赎回价格的基础。

#### 2、估值对象

估值对象包括基金财产项下所有的有价证券及其权益、银行存款本息、应收款项、其他投资资产和负债等。

#### 3、估值时间及程序

本基金对基金存续期内的每个交易日和基金清算期间的每个工作日收市后的基金资产进行估值，该对应日为估值基准日。基金管理人于估值基准日后的第一个工作日（即估值日）进行估值，并将估值结果发送给基金托管人；基金托管人复核后，将复核结果反馈给基金管理人和管理人授权可以接收估值结果的人。前述核对过程采用电子邮件方式或者双方认可的其他方式进行。

#### 4、估值依据和方法

本基金按照《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》、《证券投资基金股指期货投资会计核算业务细则（试行）》等金融监管部门制定的基金估值相关业务规则办理基金资产估值。

##### （1）证券交易所上市有价证券的估值方法（如适用）

证券交易所上市的有价证券（包括股票、权证等），以其估值基准日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值基准日无交易的，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。

证券交易所上市实行净价交易的债券按估值基准日市价（收盘价）估值，估值基准日没有交易的，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。

证券交易所上市未实行净价交易的债券按估值基准日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；估值基准日没有交易的，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。

证券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的估值方法（如适用）

a. 送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值基准日在证券交易所挂牌的同一股票的估值方法估值。

b. 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。

c. 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估值方法估值。

d. 通过非公开发行等其他方式获取且有明确锁定期的股票，按以下方法估值：  
估值基准日在证券交易所上市交易的同一股票的收盘价低于非公开发行股票初始取得成本时，可采用在证券交易所上市交易的同一股票的收盘价作为估值基准日该非公开发行股票的价值；

估值基准日在证券交易所上市交易的同一股票的收盘价高于非公开发行股票初始取得成本时，可按下列公式确定估值基准日该非公开发行股票的价值：

$$FV = C + (P - C) \times \frac{D_l - D_r}{D_l}$$

其中：FV 为估值基准日该非公开发行股票的价值；C 为该非公开发行股票的初始取得成本；P 为估值基准日在证券交易所上市交易的同一股票的收盘价； $D_l$  为该非公开发行股票锁定期所含的交易天数； $D_r$  为估值基准日剩余锁定期，即估值基准日至锁定期结束所含的交易天数（不含估值基准日当天）

(3) 证券投资基金的估值方法（如适用）

a. 上市流通的证券投资基金按估值基准日所在证券交易所的收盘价估值；估值基准日无交易的，以最近一个交易日的收盘价估值。

b. 开放式基金（包括托管在场外的上市开放式基金 LOF）以估值基准日前一工作日基金单位净值估值，估值基准日前一工作日单位净值未公布的，以前最近一个工作日基金单位净值计算。货币基金以成本估值，按估值基准日前一交易日的万份收益计提红利，估值基准日前一交易日没有每万份收益的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近公告的基金每万份收益估值。

#### （4）期货的估值方法（如适用）

期货合约按照期货交易所估值基准日的结算价估值，若估值基准日当日无结算价的，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。法律法规另有规定的，从其规定。

（5）资产管理计划、私募投资基金或信托计划的估值方法（以下简称“标的产品”）（如适用）

a. 如管理人在标的产品权益确认日当天提供了标的产品权益确认原始凭证的，则托管人在标的产品权益确认日当天以权益确认原始凭证为依据入账；如管理人无法在权益确认日当天提供标的产品的权益确认原始凭证的，则托管人在管理人提供标的产品权益确认原始凭证的提供日当天进行入账，且不对历史账务进行追溯调整；

b. 如标的产品有份额净值的，以管理人按照标的产品份额净值的披露频率提供的标的产品最新份额净值进行估值，如管理人未按照标的产品净值披露频率提供标的产品最新份额净值的，则以管理人最近一次提供的标的产品份额净值进行估值；

c. 如不属于上述情况的，则管理人应向托管人提供标的产品的估值方法和估值数据，并确保提供数据的真实、完整和有效，托管人按管理人提供的数据进行估值。

#### （6）收益互换的估值方法（如适用）

收益互换根据第三方提供的估值基准日的估值结果每个估值日更新保证金和合约损益。权益类收益互换、跨境收益互换以交易对手提供的估值报告为准进行估值。第三方或交易对手无法提供估值结果或估值报告的，按成本估值。

#### （7）场外期权的估值方法（如适用）

场外期权根据第三方提供的估值基准日的估值结果每个估值日更新保证金

和合约损益。以交易对手提供的估值报告为准进行估值。第三方或交易对手无法提供估值结果或估值报告的，按成本估值。

（8）新三板的估值方法（如适用）

在中小企业股份转让系统挂牌交易的股票按估值基准日的收盘价估值，估值基准日无交易的，以最近交易日的收盘价估值，挂牌后未交易的或者未挂牌的股票按持有成本估值。

（9）港股通的估值方法（如适用）

在基金估值基准日，港股通投资的股票按其在港交所的收盘价估值；估值基准日无交易的，以最近交易日的收盘价估值。

在基金估值基准日，港股通投资持有外币证券资产估值涉及到港币对人民币汇率的，可参考当日中国人民银行或其授权机构公布的人民币汇率中间价，或其他可以反映公允价值的汇率进行估值。

（10）黄金现货交易的估值方法（如适用）

黄金现货实盘合约按估值基准日金交所的当日收盘价估值，估值基准日无交易的，以最近收盘价估值。

黄金现货延期交收合约按估值基准日金交所的当日结算价估值，估值基准日无交易的，以最近结算价估值。

（11）利率互换的估值方法（如适用）

利率互换按照清算机构或者代理清算机构提供的每个估值基准日的结算单据或者结算数据在每个估值日更新保证金和合约损益。

（12）融资融券、转融通的估值方法（如适用）

按照融入、融出以及资金和券分别核算。参考股票、债券、基金等估值方法；同时核算融资融券或者转融通业务产生的利息、费用等。

（13）银行间债券市场的估值方法（如适用）

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，主要采用第三方机构提供的估值价格和估值技术。

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。

（14）其他资产的估值方法（如适用）

银行账户存款和证券资金账户内资金按商定利率在实际持有期间内逐日计提利息，在利息到账日以实收利息入账，并冲减已计提部分。

（15）如基金管理人与基金托管人，协商一致认为按上述方法进行估值不能

客观反映其公允价值的，或上述方法无法满足估值需要时，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方法估值。

(16) 如基金管理人或基金托管人发现对基金财产的估值违反本合同项下订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金委托人利益时，应立即通知对方，共同查明原因，双方协商解决。

(17) 相关法律、行政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。

#### 5、基金份额净值的确认

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值，基金份额净值等于计算日基金资产净值除以计算日基金份额总额的数值。基金份额净值的计算保留到小数点后 3 位，小数点后第 4 位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

基金资产净值和基金份额净值计算和会计核算的义务由基金管理人承担。如经基金管理人和基金托管人在平等基础上充分讨论后，仍对基金份额净值无法达成一致意见，以基金管理人的计算结果为准。

#### 6、估值错误的处理

(1) 当基金份额净值小数点后 3 位以内（含第 3 位）发生差错时，视为基金估值错误。

##### (2) 估值错误的处理原则

估值错误已发生，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，由差错责任方对直接损失承担赔偿责任；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，则其应当承担相应赔偿责任。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。

##### (3) 估值错误的处理方法

a. 本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，与本基金有关的会计问题，如经基金管理人和基金托管人在平等基础上充分讨论后，尚不能达成一致时，按基金管理人的建议执行，由此给基金委托人和基金财产造成的损失，由基金管理人负责赔付。

b. 基金管理人计算的基金资产净值和基金份额净值已由基金托管人复核确认，但因估值错误给基金委托人造成损失的，由基金管理人与基金托管人按照过



错各自承担相应的责任。因估值导致基金份额净值出现错误时，基金管理人应当立即纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大。

c. 如基金管理人和基金托管人对基金资产净值和基金份额净值的计算结果，虽然多次重新计算和核对仍不能达成一致时，为避免不能按时披露净值的情形，以基金管理人的计算结果对外披露，由此给基金委托人和基金造成的损失，基金托管人予以免责。

d. 由于一方当事人提供的信息错误，另一方当事人在采取了必要合理的措施后仍不能发现该错误，进而导致净值计算错误造成基金委托人的损失，以及由此造成以后交易日净值计算顺延错误而引起的基金委托人的损失，由提供错误信息的当事人一方负责赔偿。

e. 由于证券交易所及证券登记结算公司发送的数据错误，或由于其他不可抗力原因，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，但是未能发现该错误的，由此造成的估值错误，基金管理人和基金托管人可以免除赔偿责任，但双方应当积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。

f. 基金管理人、基金托管人按“估值依据和方法”第（15）项进行估值时，所造成的误差不作为估值错误处理。

g. 基金管理人和基金托管人由于各自技术系统设置而产生的净值计算尾差，以基金管理人计算结果为准。

h. 前述内容如法律、行政法规或监管机构另有规定的，按其规定处理。如果行业另有通行做法，基金管理人和基金托管人应本着平等和保护基金委托人利益的原则进行协商。

## 7、暂停估值的情形

（1）基金投资所涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

（2）因不可抗力或其它情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估本基金资产价值时；

（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委托人的利益，已决定延迟估值；

（4）相关金融监管部门规定或本合同约定的其他情形。

## （二）基金财产的会计核算

1、本基金财产的会计年度为每年1月1日至12月31日。

2、记账本位币为人民币，记账单位为元。

3、基金财产的会计核算按《证券投资基金会计核算业务指引》执行。

4、资产账册的建立

私募基金管理人或其委托的行政服务机构应保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，编制会计报表。

基金管理人和基金托管人应按照相关双方约定的同一记账方法和会计处理原则，分别独立的设置、记录和保管基金财产的全套账册，并定期进行核对，互相监督，以保证基金财产的安全。若双方对会计处理方法存在分歧，应以基金管理人的处理方法为准。

经对账发现相关各方的账目存在不符的，基金管理人和基金托管人必须及时查明原因并纠正，保证相关各方的账册记录完全相符。暂时无法查找到错账的原因而影响到基金资产净值和基金份额净值的计算和披露的，以基金管理人的账册为准。

5、基金财务报表与报告的编制和复核

基金管理人应及时完成财务报表和报告编制，并提供基金托管人复核；基金托管人在复核过程中，发现双方的报表存在不符时，基金管理人和基金托管人应共同查明原因，按照有关规定进行调整，直至双方数据完全一致。

（三）基金管理人可以委托经金融监管部门认可的其他机构担任基金估值机构，办理本基金的会计核算和资产估值，本基金的估值机构为中信中证投资服务有限责任公司，但基金管理人依法应当承担的责任不因委托而免除。基金管理人应当与基金估值机构签订协议。

## 十九、基金的费用与税收

（一）从基金财产中列支的基金费用

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、基金管理人的业绩报酬；
- 4、基金行政服务机构的行政服务费；
- 5、银行账户的资金结算汇划费、账户维护费；
- 6、基金财产开立账户需要支付的费用；
- 7、基金财产的证券交易费用；

- 8、基金运作期间发生的会计师费、律师费；
- 9、基金合同的文件制作、印刷费用；
- 10、按照法律法规及本合同的约定可以在基金财产中列支的其他费用。

（二）不列入基金财产的费用项目

基金募集期间的推介材料设计和制作费、会计师费、律师费以及其他费用由基金管理人支付，不得从基金财产中列支。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，以及处理与本基金财产运作无关的事项发生的费用等不列入基金财产的费用。

（三）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

本基金的管理费从基金财产中列支，支付给基金管理人。

本基金的年管理费率为1%。管理费的计算公式为：

$$H=E \times 1\% \div N$$

H：每日应计提的管理费；

E：前一日的基金资产净值；

N：当年的实际天数。

本基金的管理费自基金成立日起，每日计提，按季支付。当季应收管理费由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自行在下季初十个工作日内于基金财产中扣收，并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。基金管理人应于每季初五个工作日内在基金托管账户备足应支付的管理费。费用扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

管理人收取管理费的银行账户为：

户名：上海利可资产管理有限公司

账号：121913589810801

开户银行：招商银行上海市长宁支行

大额支付号：308290003394

2、基金托管人的托管费

本基金的年托管费率为0.100%。托管费的计算公式为：

$$H=E \times 0.100\% \div N$$

H：每日应计提的托管费；

E: 前一日的基金资产净值;

N: 当年的实际天数。

本基金的托管费自基金成立日起, 每日计提, 按季支付。当季应收托管费由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据, 自行在下季初十个工作日内于基金财产中扣收, 并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。基金管理人应于每季初五个工作日内在基金托管账户备足应支付的托管费。费用扣划后, 基金管理人应进行核对, 如发现数据不符, 及时联系基金托管人协商解决。

本基金存续每满一个自然年度（1 月 1 日至 12 月 31 日）的, 年度托管费合计应不低于 1 万元, 如年度托管费不足 1 万元时, 基金管理人和基金托管人将在每个自然年度 12 月 31 日或基金清算日核算前述两者的差额并在基金资产中列支。

基金在当个自然年度存续不满一年的, 当年应付年度托管费金额应不低于 1 万元 $\times$ （基金在当年的存续天数 $\div$ 当年实际天数）, 如年度托管费不足上述金额时, 基金管理人和基金托管人将在每个自然年度 12 月 31 日或基金清算日核算前述两者的差额并在基金资产中列支。

基金托管人收取托管费的银行账户为:

户名: 中信证券股份有限公司

账号: 7116810187000000370

开户银行: 中信银行北京瑞城中心支行

大额支付号: 302100011681

### 3、基金管理人收取的业绩报酬

本基金业绩报酬计提基准日分为固定计提基准日、除息日（若有）、赎回申请日和基金终止日, 其中固定计提基准日为半年度、年度末月（即 6 月、12 月）最后一个工作日。

在本基金固定计提确认日、分红确认日（若有）、赎回确认日和基金终止确认日, 管理人将根据委托人的期间年化收益率（R）, 对期间年化收益率超过 6% 以上部分按照 40% 的比例收取管理人业绩报酬（以下简称“业绩报酬”）。

#### （1）业绩报酬计提原则

① 委托人每笔参与份额分别计算期间年化收益率并计提业绩报酬。在符合业绩报酬计提条件时, 在本基金固定计提确认日、分红确认日（若有）、赎回确认日和基金终止确认日计提业绩报酬。

②在固定计提确认日，对基金委托人持有的未赎回基金份额计算业绩报酬，通过强制扣减等值基金份额的方式进行提取，并将扣减的基金份额以现金形式向基金管理人支付业绩报酬。

③基金分红确认日（若有）提取业绩报酬的，业绩报酬从分红资金中扣除且不超过分红资金。在赎回确认日和基金终止确认日提取业绩报酬的，业绩报酬从赎回资金或清算资金中扣除。

④在赎回确认日和基金终止确认日，业绩报酬按委托人赎回份额或基金终止时持有份额计算。如赎回份额为一笔认购/申购份额的一部分，则将该赎回份额单独核算业绩报酬，而该笔认购/申购份额的剩余部分不受影响。

## （2）业绩报酬计提方法

业绩报酬计提基准日为本基金的固定计提基准日、除息日（若有）、赎回申请日和基金终止日。业绩报酬计提日为本基金的固定计提确认日、基金分红确认日（若有）、赎回确认日和基金终止确认日。业绩报酬的计提，以上一个发生业绩报酬计提的业绩报酬计提基准日至本次业绩报酬计提基准日的期间为基准。上一个业绩报酬计提基准日，如委托人该笔份额未发生业绩报酬计提，认购所得的份额，以本基金成立日为准；申购所得的份额，以申购申请对应的开放日为准；分红所得的份额（若有），以红利再投资对应的除息日为准。委托人赎回时，按照“先进先出”法，分别计算每一笔认购/申购/红利再投资份额（若有）应收的管理人业绩报酬。

### ①期间年化收益率的计算公式

$$R = [(P1 - P0) \div P0x] \times (365 \div T) \times 100\%$$

其中：

R=期间年化收益率

P1=本次业绩报酬计提基准日的份额累计净值

P0 =上一个业绩报酬计提基准日的份额累计净值

P0x=上一个业绩报酬计提基准日的份额净值

T=上一个业绩报酬计提日（含）到本次业绩报酬计提日（不含）的天数

### ②管理人以超额比例的方式提取业绩报酬，具体计算公式如下：

期间年化收益率	收取比例	管理人业绩报酬计算公式
$R \leq 6\%$	0	$E = 0$

$6\% < R$	40%	$E = N \times P0_x \times (R - 6\%) \times 40\% \times (T \div 365)$
-----------	-----	--

$E$ =某笔份额对应的管理人业绩报酬

$N$ =委托人该笔认（申）购或红利再投资（若有）在分红权益登记日所持的份额数，或其在本次赎回日赎回的份额数，或其在本基金终止时所持的份额数，或其在本基金计提基准日的份额数

③将所有笔数的管理人业绩报酬加总，得到总的管理人业绩报酬（ $\Sigma E$ ）。

$$\Sigma E = E_1 + E_2 + E_3 + \dots + E_n$$

其中的  $n$  为所对应的份额笔数。

④在固定计提确认日，对未赎回基金份额计算业绩报酬，按照本次计提基准日的基金份额净值将业绩报酬折算为等值的基金份额，从对应的认购/申购记录中强制扣减相应数量的基金份额。

业绩报酬折算为等值的基金份额的计算公式如下：

$$F = E_x \div P1_x$$

$F$ =某笔份额应强制扣减的基金份额数；

$E_x$ =某笔份额在固定计提基准日应计提的业绩报酬；

$P1_x$  =本次计提基准日的基金份额净值。

业绩报酬由注册登记机构负责计算，基金托管人不对计算结果进行复核。

### （3）业绩报酬的支付方式

基金管理人于业绩报酬计提日起三个工作日内向基金托管人发送业绩报酬划款指令，基金托管人按照指令从基金财产中一次性支付给基金管理人。

基金管理人收取业绩报酬的银行账户为：

户名：上海利可资产管理有限公司

账号：121913589810801

开户银行：招商银行上海市长宁支行

大额支付号：308290003394

4、为基金募集、运营、审计、法律顾问等提供服务的基金服务机构的服务费（若有）

#### （1）基金行政服务机构的行政服务费

本基金的年行政服务费率为 0.100%。行政服务费的计算公式为：

$$H=E \times 0.100\% \div N$$

H：每日应计提的行政服务费；

E：前一日的基金资产净值

N：当年的实际天数。

本基金的行政服务费自基金成立日起，每日计提，按季支付。当季应收行政服务费由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自行在下季初十个工作日内于基金财产中扣收，并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。基金管理人应于每季初五个工作日内在基金托管账户备足应支付的行政服务费。费用扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

本基金存续每满一个自然年度（1月1日至12月31日）的，年度行政服务费合计应不低于1万元，如年度行政服务费不足1万元时，基金管理人和基金托管人将在每个自然年度12月31日或基金清算日核算前述两者的差额并在基金资产中列支。

基金在当个自然年度存续不满一年的，当年应付年度行政服务费金额应不低于1万元 $\times$ （基金在当年的存续天数 $\div$ 当年实际天数），如年度行政服务费不足上述金额时，基金管理人和基金托管人将在每个自然年度12月31日或基金清算日核算前述两者的差额并在基金资产中列支。

基金行政服务机构收取行政服务费的银行账户为：

户名：中信中证投资服务有限责任公司

账号：8110301013600013601

开户银行：中信银行深圳分行营业部

大额支付号：302584044108

5、上述（一）中其他项费用，由基金管理人根据有关法律法规及相应协议的规定，在费用发生时，直接列入当期费用。

#### 6、费率的调整

除本合同其他条款对费率的调整另有约定外，本合同各项费率的调整需经合同当事人协商一致。

#### （四）税收

本合同各方当事人应根据国家法律法规规定，履行纳税义务。

基金委托人必须自行缴纳的税收由基金委托人负责，基金管理人或托管人不

承担代扣代缴或纳税的义务。如依据相关法律法规或税务机关的规定，基金管理人在向基金委托人交付利益或资产前须代扣代缴任何税费的，基金管理人按照相关规定予以代扣代缴，无需事先征得基金委托人的同意，且基金委托人不得要求基金管理人以任何方式向其返还或补偿该等税费。

## 二十、基金的收益分配

本基金收益分配政策依据现行法律法规及本合同的约定执行。本基金在存续期内按如下规则进行收益分配。

### （一）基金利润的构成

基金利润指基金利息收入、投资收益、公允价值变动损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损益后的余额。

### （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（即可供分配利润计算截止日）资产负债表中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、在本基金存在可供分配利润的前提下，基金管理人有权决定是否对基金进行收益分配，收益分配的比例亦由基金管理人决定；

2、收益分配分为采取现金分红或红利再投资等两种方式。红利再投资是将现金红利按照基金分红除息日的基金份额净值自动转为基金份额；

本基金默认采用【现金分红】；

3、本基金【允许】变更分红方式

允许变更收益分配方式的，基金委托人应当通过基金销售机构提交申请，由注册登记机构进行处理；

当次分红确认的方式按照委托人在权益登记日之前最后一次选择的分红方式为准，若未选择则按照本基金默认的分红方式执行。委托人如需修改分红方式，应于权益登记日前一工作日的交易时间结束前（即交易日 15:00 前）办理变更手续，委托人在权益登记日前一个工作日超过交易时间提交的修改分红方式的申请对本次收益分配无效，自下一次收益分配起生效；

4、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；

5、每一基金份额享有同等分配权；



6、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为【4】次；

7、法律法规另有规定的，从其规定。

#### （四）收益分配方案

基金收益分配方案中应载明截至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、通知与执行

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，由基金管理人以约定的方式告知基金委托人。

收益分配的执行参见本合同第十六节“资金清算交收安排”第（八）条“基金现金分红”。

## 二十一、信息披露

（一）本基金的信息披露应符合法律法规的有关规定及本合同的约定。相关法律法规关于信息披露的规定发生变化时，本基金从其最新规定。

#### （二）信息披露义务人

本基金信息披露义务人为基金管理人。

基金管理人委托第三方机构代为披露信息的，其作为信息披露义务人依法应当承担的责任和信息披露义务不因委托而免除。

基金管理人应当保证所披露信息的真实性、准确性和完整性。

#### （三）本基金应披露的基金信息包括：

- 1、基金合同；
- 2、招募说明书等宣传推介文件；
- 3、基金销售协议中的主要权利义务条款（如有）；
- 4、基金的投资情况；
- 5、基金的资产负债情况；
- 6、基金的投资收益分配情况；
- 7、基金承担的费用和业绩报酬安排；
- 8、可能存在的利益冲突、关联交易；
- 9、涉及私募基金管理业务、基金财产、基金托管业务的重大诉讼、仲裁；
- 10、中国证监会以及基金业协会规定的可能影响投资者合法权益的其他重大

信息；

11、法律法规规定及本合同约定的其他事项。

（四）基金托管人应当按照相关法律法规的规定和本合同的约定，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、基金定期报告和定期更新的招募说明书（如有）等向投资者披露的基金相关信息进行复核确认。

（五）基金管理人披露基金信息，不得有下列行为：

- 1、公开披露或者变相公开披露；
- 2、虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏；
- 3、对投资业绩进行预测；
- 4、违规承诺收益或者承担损失；
- 5、诋毁其他基金管理人、基金托管人或者基金销售机构；
- 6、登载任何自然人、法人或者其他组织的祝贺性、恭维性或推荐性的文字；
- 7、采用不具有可比性、公平性、准确性、权威性的数据来源和方法进行业绩比较，任意使用“业绩最佳”、“规模最大”等相关措辞；
- 8、法律、行政法规、中国证监会、基金业协会禁止的其他行为。

（六）基金募集期间的信息披露

本基金募集期间，基金管理人应在宣传推介材料中向投资者披露如下信息：

- 1、基金的基本信息：基金名称、基金架构、基金类型、基金注册地（如有）、基金募集规模、最低认缴出资额（如有）、基金运作方式、基金的存续期限、基金联系人和联系信息、基金托管人；
- 2、基金管理人基本信息：基金管理人名称、注册地/主要经营地址、成立时间、组织形式、基金管理人在基金业协会的登记备案情况；
- 3、基金的投资信息：基金的投资目标、投资策略、投资方向、业绩比较基准（如有）、风险收益特征等；
- 4、基金的募集期限；
- 5、基金估值政策、程序和定价模式；
- 6、基金合同的主要条款：出资方式、收益分配和亏损分担方式、管理费标准及计提方式、基金费用的承担方式、基金业务报告和财务报告提交制度等；
- 7、基金的申购和赎回安排；
- 8、基金管理人最近三年的诚信情况说明；

## 9、其他事项。

### （七）基金运作期间的信息披露

#### 1、年度报告

基金管理人应当在每年度结束后 2 个月内，编制完成基金财产年度报告并发送给基金托管人以供复核。基金托管人应当在收到年度报告后 2 个月内完成复核，并将复核结果通知基金管理人。

基金管理人应当在每年结束之日起 4 个月内通过本合同约定的方式向基金委托人披露包含以下信息的年度报告：

- （1）报告期末基金净值和基金份额总额；
- （2）基金的财务情况；
- （3）基金投资运作情况和运用杠杆情况；
- （4）委托人账户信息，包括实缴出资额、未缴出资额以及报告期末所持有基金份额总额等；
- （5）投资收益分配和损失承担情况；
- （6）基金管理人取得的管理费和业绩报酬，包括计提基准、计提方式和支付方式；
- （7）本合同约定的其他信息。

#### 2、季度报告和月度报告（如有）

基金管理人应当在每季度结束之日起 10 个工作日内向委托人披露基金净值、主要财务指标以及投资组合情况等信息。

如本基金的基金募集规模或管理规模金额达到 5000 万元以上的，基金管理人应当持续在每月结束之日起 5 个工作日内向委托人披露基金净值信息。

#### 3、基金份额净值报告

本基金成立后，基金管理人应【每月】向基金委托人公布一次经基金托管人复核的基金份额净值。

#### 4、临时报告

本基金发生重大事件，基金管理人应当在 5 个工作日内编制临时报告书，通过本合同约定的方式之一向委托人报告。

前款所称重大事件包括：

- （1）基金名称、注册地址、组织形式发生变更的；
- （2）投资范围和投资策略发生重大变化的；

- (3) 变更基金管理人或托管人的；
- (4) 管理人的法定代表人、执行事务合伙人（委派代表）、实际控制人发生变更的；
- (5) 触及基金止损线或预警线的；
- (6) 管理费率、托管费率发生变化的；
- (7) 基金收益分配事项发生变更的；
- (8) 基金触发巨额赎回的；
- (9) 基金存续期变更或展期的；
- (10) 基金发生清盘或清算的；
- (11) 发生重大关联交易事项的；
- (12) 基金管理人及其实际控制人、高管人员涉嫌重大违法违规行为或正在接受监管部门或自律管理部门调查的；
- (13) 涉及私募基金管理业务、基金财产、基金托管业务的重大诉讼、仲裁；
- (14) 基金合同约定的影响投资者利益的其他重大事项。

(八) 基金管理人进行信息披露的方式

基金管理人向基金委托人提供报告、发送通知或者基金委托人向基金管理人查询本基金的相关信息，均可通过以下至少一种方式进行：

1、信函

基金管理人以邮寄信函方式向基金委托人提供定期报告、临时报告、信息查询结果、本基金运作的重要通知。基金管理人以基金委托人在签署基金合同时提供的通信地址为邮寄信函的送达地址，在基金管理人寄出信函三个工作日后未被退回的，视为将相关信息送达基金委托人。

2、电话或传真

基金管理人以电话、传真方式向基金委托人提供信息查询结果、本基金运作的重要通知。基金管理人以基金委托人在签署基金合同时提供的联系电话为联系方式。在工作日交易时间内，基金管理人三次拨打电话、每次拨出时间不少于 20 秒的，视为将相关信息送达基金委托人。

3、电子邮件或手机短信

基金管理人以电子邮件或手机短信方式向基金委托人提供定期报告、临时报告、信息查询结果、本基金运作的重要通知。基金管理人以基金委托人在签署基金合同时提供的电子邮件或手机电话为联系方式。在基金管理人发出电子邮件

或手机短信一个工作日未被退回的，视为将相关信息送达基金委托人。

#### 4、网站通知

基金管理人通过本机构、基金行政服务机构或销售机构的网站或者金融监管部门指定媒体向基金委托人提供定期报告、临时报告、本基金运作的重要通知。在基金管理人发布相关信息三个工作日视为将相关信息送达基金委托人。

基金委托人的通信地址、电话、传真、电子邮件等联系方式如有变更，应当及时通知基金管理人。

#### （九）信息备份

全体份额持有人同意本基金管理人或其他信息披露义务人应当按照中国基金业协会的规定对基金披露信息进行备份。

#### （十）其他

信息披露同时采用中文文本和英文文本的，基金管理人应当保证两种文本内容一致，若有不一致，以中文文本为准。

基金管理人应当妥善保管本基金信息披露的相关文件资料，保存期限自基金清算终止之日起不得少于 10 年。

基金管理人、基金托管人、基金投资者及其他相关机构应当依法对所获取的私募基金非公开披露的全部信息、商业秘密、个人隐私等信息承担保密义务。

## 二十二、风险揭示

本基金的设立、运作及终止清算依据《中华人民共和国合同法》、《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《私募投资基金监督管理暂行办法》、《私募投资基金管理人登记和基金备案办法（试行）》、《私募投资基金募集行为管理办法》、《契约型私募投资基金合同内容与格式指引》等现行有效的法律法规和本合同约定执行。

基金管理人在管理、运用或处分基金财产过程中，可能面临各项风险。基金委托人在签署本合同前，应当仔细阅读本合同全文及《风险揭示书》，知悉并理解其中列示的基金可能面临的各项风险。《风险揭示书》的揭示事项仅为列举性质，未能详尽列明投资者参与私募基金投资所面临的全部风险和可能导致投资者资产损失的所有因素。基金委托人在参与私募基金投资并签署本合同前，应认真阅读并理解相关业务规则、基金合同及风险揭示书的全部内容，并确保自身已做好足够的风险评估与财务安排，避免因参与私募基金投资而遭受超过

自身风险承受能力的损失。

**特别提示：基金委托人签署本合同及《风险揭示书》即表明已充分了解并谨慎评估自身风险承受能力，理解并愿意自行承担参与私募基金投资的风险和损失。**

## 二十三、基金合同的变更、终止与基金财产清算

### （一）基金合同的变更

1、除本合同另有约定外，经全体基金委托人、基金管理人和基金托管人协商一致后，可对本合同内容进行变更。

2、有下列情形之一的，由基金管理人与基金托管人协商一致后对本合同相关内容进行变更：

（1）资金划拨指令有关事宜、清算交收业务规则、估值方法及核对的时间和程序、调低从本基金资产列支由托管人、行政服务机构（如有）收取的费用的标准等相关内容的变更；

（2）因有权机构对法律法规的修订、变更、解释、新增、废止等导致本合同与之存在冲突或不一致的，应当以届时有效的法律法规为准对本合同进行相应变更和调整。

3、在与本第二十三节第（一）条第 2 款项下约定不冲突的前提下，有下列情形之一的，基金管理人有权单方变更合同的相关内容，若基金管理人进行任何单方面变更，应及时将变更内容以经基金管理人有权签字人签字并加盖公章的方式书面告知基金托管人，基金托管人收到该等书面告知后，基金管理人作出的变更始对基金托管人发生效力：

（1）本基金认购、申购、赎回的受理时间和业务规则的变更；

（2）调低从本基金资产列支由管理人、销售机构（如有）、投资顾问（如有）收取的费用的标准；

（3）按照法律法规的规定或本合同的约定，基金管理人有权变更本合同的其他情形。

4、基金管理人应当及时将基金合同变更的具体内容和生效时间告知基金委托人，并根据基金业协会的要求就基金合同重大事项变更向基金业协会报告。基金管理人提前 3 个工作日通过本合同约定的方式之一通知基金委托人，即视为履行了告知义务。

## （二）基金合同应当终止的情形

- 1、若本合同约定了基金存续期限，该期限届满而未延期的；
- 2、本基金向基金业协会办理基金备案失败；
- 3、基金份额持有人大会决定终止；
- 4、基金管理人、基金托管人职责终止，在六个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接；
- 5、基金委托人赎回全部基金份额导致本基金的基金份额总数为零的；
- 6、基金管理人依法解散、被依法撤销或被依法宣告破产，或丧失基金管理人资格的；
- 7、基金托管人依法解散、被依法撤销或被依法宣告破产，或丧失基金托管人资格，且基金管理人和基金委托人未就另行聘请基金托管人达成一致意见的；
- 8、经全体基金委托人、基金管理人和基金托管人协商一致决定终止的；
- 9、法律法规规定和本合同约定的其他情形。

## （三）基金财产清算小组

1、基金管理人需自基金合同终止事由发生之日起 15 个工作日内发起基金清算程序，由基金管理人和基金托管人组织成立清算小组。清算小组可以聘请必要的工作人员。如发生本节第（二）条第 4、6、7 款情形的，由持有人大会对清算小组的成立及基金清算的相关事宜进行决议。

2、清算小组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配，清算小组可以依法进行必要的民事活动。

## （四）基金财产清算的程序

- 1、清算小组对基金资产进行清理和确认；
- 2、对基金资产进行估价；
- 3、基金管理人负责对基金资产进行变现；
- 4、基金管理人负责制作清算报告，并交由基金托管人进行复核；
- 5、参加与基金财产有关的民事诉讼或仲裁；
- 6、在基金清算完毕后 5 个工作日内将清算报告报送金融监管部门；
- 7、清算报告报送金融监管部门后的 3 个工作日内，基金管理人将基金清算结果通知基金委托人；
- 8、进行基金剩余资产的分配。

## （五）清算费用

清算费用是指清算小组在进行基金清算过程中发生的以下合理费用，包括但不限于：

- 1、基金资产的保管、清理、估价、变现和分配产生的费用；
- 2、诉讼仲裁所发生的费用；
- 3、其他与清算事项相关的费用。

清算费用由清算小组从本基金资产中列支，由基金托管人根据基金管理人的指令将相关款项划至指定账户。

#### （六）基金清算剩余财产的分配

- 1、除本合同另有约定外，基金财产按下列顺序清偿：

- （1）支付清算费用；
- （2）交纳所欠税款；
- （3）清偿基金债务；
- （4）按基金委托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，不分配给基金委托人。

- 2、除本合同各方当事人另有约定外，基金财产分配采取现金方式。基金托管人根据基金管理人的指令将基金财产划至指定账户。

基金财产因持有的证券的流动性受限，需在基金终止后进行证券变现的，对基金终止后的每日资产净值，基金管理人与基金托管人继续按合同约定计提管理费、托管费等各项费用，直至最后一次清算日为止。该部分基金财产变现并计提相关费用后按基金委托人持有的基金份额比例进行分配，同时可收取业绩报酬（如本合同已明确约定业绩报酬的收取）。基金管理人应在剩余基金财产变现后 3 个工作日内向基金托管人发送指令，基金托管人按指令将剩余基金财产划至指定账户。

#### （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管理人保存 10 年以上，法律法规或监管机构另有要求的，从其规定。

#### （八）基金财产相关账户的注销

基金财产清算完毕后，基金托管人按照规定注销基金财产的托管账户，基金管理人按照规定注销证券账户、期货账户等投资所需账户。



## 二十四、违约责任

（一）基金合同各方当事人在实现各自权利、履行各自义务的过程中，违反法律法规规定或者本合同约定，应当各自承担相应的责任；给基金财产或者基金合同其他当事人造成的损失，应当分别对各自的行为所造成的损失依法承担赔偿责任。本合同能够继续履行的，应当继续履行。

（二）发生下列情况的，当事人可以免除相应的责任：

1、不可抗力；

2、基金管理人和/或基金托管人按照有效的法律法规或金融监管部门的规定或本合同的规定作为或不作为而造成的损失；

3、基金管理人由于按照本合同约定的投资原则行使或不行使其投资权而造成的损失；

4、基金委托人未能事前就其关联证券或其他禁止交易证券明确告知基金管理人，致使基金财产发生违规投资行为的，基金管理人和基金托管人均不承担任何责任。

（三）本合同当事一方造成违约后，其他当事方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。

（四）责任划分

1、如果基金管理人和基金托管人其中一方违约，给基金资产造成损失的，应由违约方就直接损失进行赔偿，守约方有权接受基金委托人委托向违约方追偿；如果基金管理人和基金托管人两方都违反合同，给基金资产造成损失的，无论本合同或任何相关合同、书面约定有任何其它相反的约定，在任何情况下，在托管人和管理人之间的最终责任的分配和承担上，由双方分别根据其过错程度承担各自应负的赔偿责任；若一方先行承担了应由另一方根据其过错应承担的责任，该方有权向另一方追偿。

2、若两个以上（含两个）管理人共同管理本基金，给投资者造成损失的，所有管理人应承担连带责任。就管理人之间的内部责任划分，由各管理人按各自过错承担相应的责任。

（五）违约赎回

本基金不接受违约赎回。

## 二十五、争议的处理

对于因本合同的订立、内容、履行和解释或与本合同有关的争议，合同当事人应尽量通过协商、调解途径解决。不愿或者不能通过协商、调解解决的，任何一方均有权将争议提交北京仲裁委员会根据该会届时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁的地点在北京市。仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力。仲裁费用由败诉方承担。

本合同受中华人民共和国法律管辖。

## 二十六、基金合同的效力

（一）本合同为 2017 年 10 月 30 日在中国证券投资基金业协会备案的《利可进取一号私募投资基金基金合同》及其补充协议的修改版，本合同自生效之日起取代委托人、基金管理人上海利可资产管理有限公司与基金托管人签署的《利可进取一号私募投资基金基金合同》及补充协议。

基金管理人和托管人可就本基金涉及托管的事宜另行签署托管协议，以托管协议的约定为准。

（二）本基金合同的成立、生效及执行

### 1、本基金合同的成立

本合同是约定基金合同当事人之间权利义务关系的法律文件，基金委托人为法人或其他组织的，本合同自当事人各方法定代表人/执行事务合伙人委派代表或授权代表签字（或盖章）并加盖公章或合同专用章之日起成立，本合同另有约定的除外；基金委托人为自然人的，本合同自基金委托人本人或授权代表签字（或盖章）、其他当事人加盖公章或合同专用章以及法定代表人/执行事务合伙人委派代表或授权代表签字（或盖章）之日起成立。

### 2、本基金合同的生效

本基金合同生效应当同时满足如下条件：

（1）所有基金委托人均与基金管理人、基金托管人合法签署完毕本基金合同；

（2）基金管理人于【2019】年【7】月【1】日（含本日）前将全部基金合同原件实际寄送至基金托管人指定办公地址（北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦）（为避免歧义，寄送至基金托管人处的日期或本基金合同中表述为基金托管人“收到”的约定都以基金托管人实际签收的日期为准，下同）。

基金托管人未在本款约定的期限内收到本基金合同原件的，则自该约定的期限届满之日的次日（含当日）起，基金托管人签章失效且各方已签署的基金合同不发生法律效力。

当同时满足上述（1）-（2）项条件后，本基金合同自基金管理人将全部基金合同原件实际寄送至本基金合同约定的基金托管人办公场所并经基金托管人实际签收之日（送达日）起的五个工作日内，由托管人从前述日期内择日确定本基金合同的生效日。如基金管理人分批寄送的，以最后一份原件寄送至基金托管人处为送达日。基金托管人应在确定本基金合同生效日后通知基金管理人。由基金管理人通过基金合同约定的方式通知全体委托人。

本基金合同不满足生效条件的，基金管理人应当在确定本基金合同不满足生效条件之日的【3】个工作日内将本基金合同未生效的相关事宜通过基金合同规定的方式通知已签署本基金合同的基金委托人。

### 3、本基金合同变更内容的执行

本基金合同生效当日，基金管理人应当将本基金合同生效事宜，包括但不限于生效日期（即本基金合同开始执行的日期）等通过基金合同规定的方式通知基金委托人、基金托管人及行政服务机构，同时向基金托管人就前述内容出具加盖基金管理人公章的书面通知。

### 4、在本基金合同生效后新增委托人首次申购本基金签署本基金合同的生效

本基金合同在符合本第二十六节第（二）条第 2 款生效条件后，新增委托人首次申购本基金的，本基金合同自该委托人、基金管理人、基金托管人按本第二十六节第（二）条第 1 款完成签署后成立且同时生效。

（三）本合同是约定基金合同当事人之间权利义务关系的法律文件，基金委托人为法人或其他组织的，本合同自当事人各方法定代表人/执行事务合伙人委派代表或授权代表签字（或盖章）并加盖公章或合同专用章之日起生效，本合同另有约定的除外；基金委托人为自然人的，本合同自基金委托人本人或授权代表签字（或盖章）、其他当事人加盖公章或合同专用章以及法定代表人/执行事务合伙人委派代表或授权代表签字（或盖章）之日起生效。

（四）本合同一式三份，当事人各执一份。每份合同均具有同等的法律效力。

（五）本合同自生效之日起对当事人各方具有同等的法律约束力。

（六）本合同有效期

本合同的有效期限为不定期，与基金存续期限一致。

## 二十七、其他事项

金融监管部门或行业自律组织对非公开募集投资基金合同的内容与格式的要求有所变更并适用于本合同的，本合同当事人各方应立即协商，根据金融监管部门或行业自律组织的相关要求修改本合同的内容和格式。

本合同如有未尽事宜，由合同当事人各方按有关法律法规的规定协商解决。

（以下无正文）

（本页无正文，为利可进取一号私募投资基金基金合同（2019版）签署页）

基金委托人：

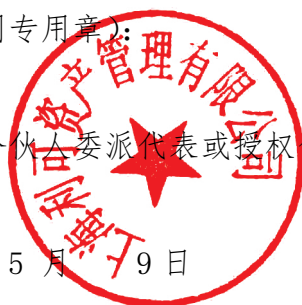
法定代表人或授权代表（签字或盖章）：

签署日期： 年 月 日

基金管理人（公章/合同专用章）：

法定代表人/执行事务合伙人委派代表或授权代表（签字或盖章）：

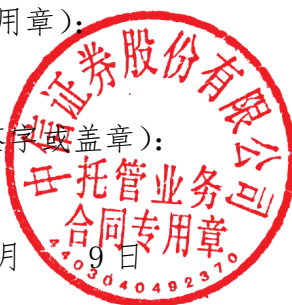
签署日期： 2019 年 5 月 9 日



基金托管人（公章/合同专用章）：

法定代表人或授权代表（签字或盖章）：

签署日期： 2019 年 5 月 9 日



## 附件 1：现金资产到账确认书（样本）

【管理人名称】：

【基金合同全称】（编号：【】）项下托管账户：

户 名：

账 号：

开户银行：

于【】年【】月【】日收到现金资产【大写】元整，即¥【小写】元（以大写金额为准）。

中信证券股份有限公司  
（托管业务结算专用章）

【】年【】月【】日







## 附件 3：授权文件（样本）

中信证券股份有限公司：

根据【基金合同名称】，我公司授权以下人员代表我公司向你司发送划款指令。现将指令发送用章样本及有关人员签字样本、名章样本及相应权限留给你司，请在使用时核验。上述被授权人在授权范围内向你司发送指令的真实性、准确性及合法性由我公司负全部责任。

姓名	权限	签字样本	名章样本
	经办 A		
	经办 B		
	复核 A		
	复核 B		
指令 发送 用章	(预留印鉴)		
备注：1. 指令发送用章须与个人签字或个人名章同时出具，方为有效； 2. 权限类型：经办、复核； 3. 本授权的生效时限：自【】年【】月【】日之当日生效，至【】年【】日【】日之次日起失效；			

基金管理人：【】

(公章)

法定代表人/执行事务合伙人委派代表（或授权代表）签

字：

【】年【】月【】日

## 附件 4：划款指令（样本）

重要提示：接此划款指令后，若审核无误应按照指令条款进行划款。

编号：【】；【】年【】月【】日；第【】页，共【】页			
划付模式：			
请于【】年【】月【】日【】时前支付下列款项：			
金额大写：人民币【】元			
金额小写：¥【】			
管理人填写	付	账户类型：	收
	方	<input type="checkbox"/> 银行账户 <input type="checkbox"/> 证券资金账	方
	账	户	账
	户	<input type="checkbox"/> 期货资金账户	户
	信	户名：	信
	息	账号：	息
	开户机构：		开户机构：
资金用途：			
备注： 附件共__页			
指令用章		经办：	
		复核：	
托管人填写	处理意见或结果（附件共__页）：		经办：
	<input type="checkbox"/> 对授权人员身份进行复核		
	<input type="checkbox"/> 对预留印鉴进行复核		
	<input type="checkbox"/> 其他		
		审批：（盖业务章）	