

合同编号：

东方港湾马拉松二号私募投资基金 基金合同

基金管理人：深圳东方港湾投资管理股份有限公司

基金托管人：国泰君安证券股份有限公司

重要提示

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但投资者购买本基金并不等同于将资金作为存款存放在银行或其它存款类金融机构，基金管理人也不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。投资有风险，基金管理人的过往业绩不代表未来业绩。

本合同（样本）将按中国证券投资基金业协会的规定提请备案，但中国证券投资基金业协会接受本合同（样本）的备案并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行承担。

风险揭示书

尊敬的投资者：

为使您更好地了解私募证券投资基金（以下称“私募基金”）投资的风险，根据法律、行政法规和中国证券监督管理委员会（以下称“中国证监会”）、中国证券投资基金业协会（以下称“基金业协会”）有关规定，提供本风险揭示书，请认真仔细阅读，慎重决定是否参与私募基金投资。

一、了解拟参与的私募基金的风险收益特征

私募基金是在中国基金业协会履行登记手续的基金管理人接受合格投资者委托，与其签订合同，根据合同约定的方式、条件、要求及限制，通过特定账户管理委托资产的活动，具有专业管理、组合投资、分散风险的优势和特点。但是，参与私募基金投资也存在着一定的风险，基金管理人承诺投资者的投资本金不受损失或者取得最低收益。

投资者在投资私募基金前，应了解私募基金的基础知识、业务特点、风险收益特征等内容，并认真听取基金管理人对相关业务规则和基金合同内容的讲解，同时确认已知晓该私募基金依据产品运作的需要制定的规则所带来的流动性或收益等风险；诸如封闭期较长、存续期间无收益分配或业绩报酬转份额等情况。

基金管理人管理基金财产应恪尽职守，履行诚实、信用、谨慎、有效管理的义务。基金管理人依据基金法律文件管理基金财产所产生的风险，由基金财产承担。基金管理人因违背基金法律文件、处理基金事务不当而造成基金财产损失的，由基金管理人以固有财产赔偿；不足赔偿时，由投资者自担。

二、了解私募基金投资的风险

私募基金投资面临的风险，包括但不限于：

（一）市场风险

证券市场价格受到经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素的影响，导致基金财产收益水平变化，产生风险，主要包括：

1、政策风险

因国家宏观政策（如货币政策、财政政策、行业政策、地区发展政策等）发生变化，导致市场价格波动而产生风险。

2、经济周期风险

随经济运行的周期性变化，证券市场的收益水平也呈周期性变化。基金财产投资于债券与上市公司的股票，收益水平也会随之变化，从而产生风险。

3、利率风险

金融市场利率的波动会导致证券市场价格和收益率的变动。利率直接影响着债券的价格和收益率，影响着企业的融资成本和利润。基金财产投资于债券和股票，其收益水平会受到利率变化的影响。

4、上市公司经营风险

上市公司的经营好坏受多种因素影响，如管理能力、财务状况、市场前景、行业竞争、人员素质等，这些都会导致企业的盈利发生变化。如果基金财产所投资的上市公司经营不善，其股票价格可能下跌，或者能够用于分配的利润减少，使基金财产投资收益下降。虽然基金财产可以通过投资多样化来分散这种非系统风险，但不能完全规避。

5、购买力风险

基金财产的利润将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，从而使基金财产的实际收益下降。

6、债券收益率曲线风险

债券收益率曲线风险是指与收益率曲线非平行移动有关的风险，单一的久期指标并不能充分反映这一风险的存在。

7、再投资风险

再投资风险反映了利率下降对固定收益证券利息收入再投资收益的影响，这与利率上升所带来的价格风险（即前面所提到的利率风险）互为消长。具体为当利率下降时，基金财产从投资的固定收益证券所得的利息收入进行再投资时，将获得比之前较少的收益率。

（二）管理风险

在基金财产管理运作过程中，基金管理人的研究水平、投资管理水平直接影响基金财产收益水平，如果基金管理人经济形势和证券市场判断不准确、获取的信息不全、投资操作出现失误，都会影响基金财产收益水平。

（三）流动性风险

基金财产需随时应对基金投资者的提取，如果基金财产不能迅速转变成现金，或者变现时对基金财产净值产生冲击成本，都会影响基金财产运作和收益水平。尤其是在基金投资者大额提取委托财产时，如果基金财产变现能力差，可能会产生基金财产仓位调整的困难，导

致流动性风险，从而影响基金财产收益。

（四）信用风险

信用风险是债务人的违约风险，主要体现在信用产品中。在基金财产投资运作中，如果基金管理人的信用研究水平不足，对信用产品的判断不准确，可能使基金财产承受信用风险所带来的损失。

（五）特定投资方法及基金资产所投资的特定投资对象可能引起的特定风险

本基金拟投资公募基金、信托计划、证券公司资产管理计划、保险资产管理计划、期货资产管理计划、基金公司特定客户资产管理计划、取得基金业协会颁发的管理人登记证书的私募管理人发行的私募证券投资基金、私募股权投资基金、私募创业投资基金等，上述产品的投资结果将直接导致本基金投资的收益或亏损。上述产品及其对应的实际资产并未保管在本基金托管人处，上述产品及其对应的实际资产可能由于其托管人或管理人保管不善导致本基金受损。

（六）操作或技术风险

相关当事人在业务各环节操作过程中，因内部控制存在缺陷或者人为因素造成操作失误或违反操作规程等引致的风险，例如，越权违规交易、会计部门欺诈、交易错误、IT 系统故障等风险。

在基金的各种交易行为或者后台运作中，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基金份额持有人的利益受到影响。这种技术风险可能来自基金管理公司、基金份额登记机构、证券/期货经纪机构、销售机构、证券交易所、登记结算机构等。

（七）相关机构的经营风险

1、基金管理人经营风险

按照我国金融监管法律规定，虽基金管理人相信其本身将按照相关法律的规定进行营运及管理，但无法保证其本身可以永久维持符合监管部门的金融监管法律。如在基金存续期间基金管理人无法继续经营基金业务，则可能会对基金产生不利影响。

2、基金托管人经营风险

按照我国金融监管法律规定，基金托管人须获得中国证监会核准的证券投资基金托管资格方可从事托管业务。虽基金托管人相信其本身将按照相关法律的规定进行营运及管理，但无法保证其本身可以永久维持符合监管部门的金融监管法律。如在基金存续期间基金托管人无法继续从事托管业务，则可能会对基金产生不利影响。

3、证券/期货经纪机构经营风险

按照我国金融监管法律规定，证券/期货经纪机构须获得中国证监会核准的证券经营资格方可从事证券业务。虽证券/期货经纪机构相信其本身将按照相关法律的规定进行营运及管理，但无法保证其本身可以永久维持符合监管部门的金融监管法律。如在基金存续期间证券/期货经纪机构无法继续从事证券/期货业务，则可能会对基金产生不利影响。

(八) 其他风险

1、基金管理人将应属本机构负责的事项以服务外包、租赁等方式交由其他机构办理，因代办机构不符合金融监管部门规定的资质要求、或不具备提供相关服务的条件和技能、或因管理不善、操作失误等，可能给基金投资者带来一定的风险。

2、战争、自然灾害等不可抗力因素的出现，将会严重影响证券市场的运行，可能导致基金财产的损失；

3、金融市场危机、行业竞争、代理商违约等超出基金管理人自身直接控制能力之外的风险，也可能导致基金投资者利益受损。

本风险揭示书的揭示事项仅为列举性质，未能详尽列明投资本基金的所有风险。本人 / 本机构作为投资者已详阅并充分理解风险揭示书及相关基金文件所提示的风险，并自愿承担由上述风险引致的全部后果。

投资者签署本风险揭示书即表明：

1、投资者已仔细阅读本风险揭示书、基金合同等法律文件，充分理解相关权利、义务、本基金运作方式及风险收益特征，愿意承担相应的投资风险，委托事项符合投资者业务决策程序的要求；投资者声明其符合相关法律法规、证监会及本合同规定的关于私募基金合格投资者的相关标准；投资者承诺向基金管理人提供的有关投资目的、投资偏好、投资限制和风险承受能力等情况真实合法、完整有效，不存在任何重大遗漏或误导性陈述，前述信息资料如发生任何实质性变更，投资者应当及时书面告知基金管理人或销售机构。

2、投资者声明用于认购/申购基金份额的财产为投资者拥有合法所有权或处分权的资产，保证该等财产的来源及用途符合法律法规和相关政策规定，不存在非法汇集他人资金投资的情形，不存在洗钱等情况，投资者保证有完全及合法的权利委托基金管理人和基金托管人进行基金财产的投资管理和托管业务。

3、投资者承认，基金管理人、基金托管人未对基金财产的收益状况作出任何承诺或担保，基金的业绩比较基准、年化收益（率）等类似表述仅是投资目标而不是基金管理人的保证。

4、投资者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基金所面临的风险。基金管理人以及代销机构已就基金情况向投资者作出了详细说明。

[为充分提示风险，提请投资者将本段抄录在后。]

投资者抄录：

本人 / 本机构作为投资者已_____风险揭示书及相关基金文件所提示的风险，并_____由上述风险引致的全部后果。

本人 / 本机构保证，本人 / 本机构是具有完全民事行为能力的自然人 / 法人或者依法成立的其他组织，并且符合法律法规及本基金合同中关于私募基金合格投资者的条件，是合格投资者。

投资者（自然人）

（签字）：

或：投资者（机构）

（加盖公章并由法定代表人/负责人或授权代表签字）：

日期： 年 月 日

目录

重要提示.....	0
风险揭示书.....	1
一、前言.....	8
二、释义.....	8
三、声明与承诺.....	10
四、基金的基本情况.....	11
五、基金的成立与备案.....	11
六、基金的认购、申购和赎回.....	13
七、当事人及权利义务.....	18
八、基金份额的登记.....	23
九、基金的投资.....	23
十、基金的财产.....	25
十一、指令的发送、确认与执行.....	26
十二、交易及清算交收安排.....	29
十三、越权交易处理.....	30
十四、基金财产的估值和净值计算.....	31
十五、基金的费用与税收.....	39
十六、基金的收益分配.....	42
十七、报告义务.....	43
十八、基金有关文件档案的保存.....	43
十九、基金份额的转让、非交易过户和冻结.....	44
二十、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查.....	45
二十一、基金管理人对于基金托管人的业务核查.....	45
二十二、基金合同的成立、生效及签署.....	46
二十三、基金合同的变更、终止.....	47
二十四、基金托管人和基金管理人的更换.....	48
二十五、清算程序.....	49
二十六、违约责任.....	50
二十七、法律适用和争议的处理.....	51
二十八、基金合同的效力.....	52
二十九、其他事项.....	52
附件一：投资监督事项表.....	55

一、前言

订立本合同的目的、依据和原则：

1、订立本合同的目的是明确本合同当事人的权利义务、规范本基金的运作、保护基金份额持有人的合法权益。

2、订立本合同的依据是《中华人民共和国民法通则》、《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》）、《私募投资基金监督管理暂行办法》（以下简称《暂行办法》）和《私募投资基金管理人登记和基金备案办法（试行）》及其他法律法规的有关规定。

3、订立本合同遵照基金份额持有人、基金管理人、基金托管人平等自愿、诚实信用的原则。本合同是约定本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合同当事人之间权利义务关系的任何文件或表述，均以本合同为准。

4、本基金按照中国法律法规成立并运作，若本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。

二、释义

在本合同中，除上下文另有规定外，下列用语应当具有如下含义：

1、本合同：《东方港湾马拉松二号私募投资基金基金合同》及对本合同的任何有效修订和补充。

2、本基金：东方港湾马拉松二号私募投资基金。

3、私募投资基金：以非公开方式向合格投资者募集资金设立的投资基金。

4、基金投资者：依法可以投资于私募投资基金的个人投资者、机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买私募投资基金的其他投资者的合称。

5、基金管理人、管理人：深圳东方港湾投资管理股份有限公司。

6、基金托管人、托管人：国泰君安证券股份有限公司。

7、基金份额持有人：签署本合同，履行出资义务取得基金份额的基金投资者。

8、法律法规：指中国公布实施并现时有效的法律、行政法规、部门规章及规范性文件。

9、中国证监会：中国证券监督管理委员会。

10、金融监管部门：指负责金融市场监管的机关和投资基金行业自律组织。

11、中国证券投资基金业协会（简称“基金业协会”）：基金行业相关机构自愿结成的全

国性、行业性、非营利性社会组织。

12、运营服务机构：接受基金管理人委托，根据与其签订的金融外包服务协议中约定的服务范围，为本基金提供份额注册登记、基金估值等服务的机构，本基金的运营服务机构为国泰君安证券股份有限公司。

13、证券经纪机构：指国泰君安证券股份有限公司。

14、期货经纪机构：无。

15、交易日：上海证券交易所和深圳证券交易所的正常交易日。

16、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。

17、开放日（如有）：基金管理人办理基金份额申购、赎回业务的交易日。

18、销售机构：指基金管理人及/或基金管理人委托的代理销售机构。

19、T日：本基金在规定的时间内受理基金投资者申购、赎回等业务申请及其他与本基金有关的事项发生的日期。

20、T+n日：T日后的第n个交易日（n为整数），当n为负数时表示T日前的第n个交易日。

21、基金财产：基金份额持有人拥有合法处分权、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。

22、银行结算账户：简称“托管账户”，是基金托管人为基金财产在具有基金托管资格的商业银行开立的银行专用结算账户，用于基金财产中现金资产的归集、存放与支付，该账户不得存放其他性质资金。

23、证券账户：根据中国证监会有关规定和中国证券登记结算有限责任公司（下称“中登公司”）等相关机构的有关业务规则，由基金托管人为基金财产在中登公司上海分公司、深圳分公司开设的证券账户。

24、证券交易资金账户：基金管理人或基金托管人为基金财产在证券经纪机构开立的证券交易资金账户，用于基金财产证券交易结算资金的存管、记载交易结算资金的变动明细以及场内证券交易清算。

25、期货账户：基金管理人或基金托管人为基金财产在期货经纪机构开立的期货保证金账户，用于基金财产期货交易结算资金的存管、记载交易结算资金的变动明细以及期货交易清算。

26、基金资产总值：本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、各种应收款项及其他资产的价值总和。

27、基金资产净值：本基金资产总值减去负债后的价值。

28、基金份额净值：计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数所得的数值。

29、基金资产估值：计算、评估基金资产和负债的价值，以确定本基金资产净值和基金份额净值的过程。

30、募集期：指本基金的初始销售期限。

31、存续期：指本基金成立至清算之间的期限。

32、认购：指在募集期间，基金投资者按照本合同的约定购买本基金份额的行为。

33、申购：指基金成立后，在基金开放日，基金投资者按照本合同的规定购买本基金份额的行为。

34、赎回：指基金成立后，在基金开放日，基金份额持有人按照本合同的规定将本基金份额兑换为现金的行为。

35、不可抗力：指本合同当事人不能预见、不能避免、不能克服的客观情况。该等不可抗力事件包括但不限于自然灾害、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，非因管理人、托管人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。因中国人民银行银行间结算系统出现故障导致银行间的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。

三、声明与承诺

(一)基金投资者声明其投资本基金的财产为其拥有合法所有权或处分权的资产，保证财产的来源及用途符合国家有关规定，不存在非法汇集他人资金投资的情形，不存在不合理的利益输送、关联交易及洗钱等情况，保证有完全及合法的授权委托基金管理人和基金托管人进行该财产的投资管理和托管业务，保证没有任何其他限制性条件妨碍基金管理人和基金托管人对该财产行使相关权利且该权利不会为任何其他第三方所质疑；基金投资者声明已充分理解本合同全文，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，本投资事项符合其业务决策程序的要求；基金投资者承诺其向基金管理人及/或代理销售机构提供的有关投资目的、投资偏好、投资限制和风险承受能力等信息和资料真实、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及/或代理销售机构。基金投资者承认，基金

管理人、基金托管人未对基金财产的收益状况作出任何承诺或担保。

(二)基金管理人保证已在签订本合同前充分地向基金投资者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。基金管理人承诺依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,不保证基金财产一定盈利,也不保证最低收益。

(三)基金托管人承诺以诚实守信、审慎尽责的原则履行托管职责,根据本合同约定安全保管基金资产、办理资金收付事项、监督管理人投资行为,但不保证基金资产投资不受损失,不保证最低收益。

四、基金的基本情况

(一)基金的名称:东方港湾马拉松二号私募投资基金。

(二)基金类别:私募证券投资基金。

(三)基金的运作方式:契约型。

(四)基金的存续期限:永续。

(五)基金份额的面值:本基金份额的面值为1.00元,认购价格为1.00元/份。

本基金为均等份额,除本合同另有约定外,每份基金份额具有同等的合法权益。

五、基金的成立与备案

(一)基金的成立

本基金的募集期(或称认购期、发行期)应符合法律法规的规定。当本基金符合法律法规规定的成立条件时,基金管理人可以终止本基金的募集。募集期限届满本基金不能成立的,本基金合同不生效。

1、募集期间的处理

(1)直销处理(如有)

本基金募集期内,基金投资者通过管理人直销渠道认购基金的,应将认购款划入如下募集账户:

账户名称:国泰君安证券股份有限公司运营外包专户

账号:4159000000107770041

开户银行名称:招商银行上海分行龙茗路支行

大额支付号 308290003669

募集账户的资金任何人不能动用。对募集账户的监控由基金管理人负责。托管人的监督职责自基金募集期结束、基金成立后开始。基金投资者将委托资金划入本基金募集账户的汇出账户为投资者收益账户，基金管理人只能将募集账户中的资金定向划拨至该基金对应的托管账户（认购、申购时）、投资者收益账户（分红、赎回时）及管理人账户（向管理人账户划拨认购费、申购费、赎回费等在本基金合同中列明的费用时），募集账户的监管以管理人与国泰君安证券股份有限公司签署的相关协议为准。

本基金募集期结束后，管理人应根据认购结果，将募集账户募集资金划入基金托管账户。托管人的监督职责自基金募集期结束、基金成立后开始。

（2）代销处理（如有）

本基金募集期内，基金投资者通过管理人委托的代理销售机构认购基金的，应将认购款划入代理销售机构指定的账户，或由代理销售机构根据投资者的认购指令从投资者账户中进行扣划。

本基金募集期结束后，代理销售机构根据认购结果，将代销资金从代理销售机构的基金销售结算专用账户划入基金托管账户。

2、募集期结束后的处理

本基金募集期结束后，基金托管人核实资金到账情况，并向基金管理人出具资金到账通知书，基金即告成立。基金募集期间认购资金利息在募集期结束时归入基金资产，利息金额以基金托管账户实际收到的为准。

基金管理人应于基金成立时发布基金成立公告。

（二）基金募集失败的处理方式

如果募集期限届满，本基金不能成立的，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、在基金募集期限届满后 30 日内退还投资者已缴纳的款项，并加计银行同期活期存款利息；
- 3、将托管人已盖章的基金合同及其他相关协议在基金募集期限届满后 10 日内如数原件返还托管人。未能如数返还的，应向托管人书面说明原因、去向并加盖公章。

（三）基金的备案

基金管理人在基金成立后 20 个工作日内，向基金业协会办理基金备案手续。

六、基金的认购、申购和赎回

（一）认购、申购和赎回的场所

本基金的销售机构为直销机构（基金管理人）及/或基金管理人委托的代理销售机构。管理人可以根据需要委托、增加、变更代理销售机构。

基金投资者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份额的认购、申购和赎回。

（二）认购、申购和赎回的时间

基金投资者可在募集期内的交易日认购本基金。本基金自成立日起6个月内为封闭期，封闭期内不开放申购赎回；基金投资者可在本基金开放日申购、赎回本基金。本基金开放日（以下简称为T日或开放日）为封闭期结束之后的下一个月最后一个交易日及之后每季度最后一个交易日。基金管理人可根据基金运作需求增设临时开放日，具体以基金管理人公告为准。

（三）出资方式及认缴期限

基金投资者认购、申购本基金，以人民币货币资金形式交付。

基金投资者认购本基金，应在募集期内将认购资金汇入基金管理人及/或代理销售机构指定账户；基金投资者通过基金管理人申购本基金的，应在T-4日至T日内进行申购预约登记，并将申购资金汇入本基金募集账户；基金份额持有人通过基金管理人赎回本基金的，应于T-9日至T-5日之间填写基金管理人提供的申请表进行赎回预约登记。基金投资者通过代理销售机构申购、赎回本基金的，应在开放日提交申购、赎回申请，不必进行预约登记。

（四）认购、申购和赎回的方式、价格及程序

1、基金投资者认购基金时，按照面值（人民币1.00元）为基准计算基金份额，申购则按当期开放日的基金份额净值计算申购份额。若开放日为期间，则当期开放日为基金投资者提交申购申请的开放日。

2、基金份额持有人赎回基金时，按照当期开放日的基金份额净值计算赎回金额，同时基金管理人按先进先出的原则，按基金投资者认购、申购基金份额的先后次序进行顺序赎回确认。若开放日为期间，则当期开放日为基金投资者提交赎回申请的开放日。

3、基金认购、申购采用金额申请的方式，基金赎回采用份额申请的方式。

（五）认购、申购和赎回申请的确认

认购、申购和赎回申请受理完成后，不得撤销。销售机构受理申请并不表示对该申请成

功的确认，而仅代表销售机构确实收到了申请。认购、申购和赎回申请的确认以份额登记机构的确认结果为准。

本基金的人数规模上限为 200 人，并按《暂行办法》第十三条的规定合并计算投资者人数。基金管理人在募集期的每个交易日可接受的人数限制内，按照“时间优先、金额优先”的原则确认有效认购申请。超出基金投资者人数规模上限的认购申请为无效申请。

在正常情况下，份额登记机构在 T+2 日对 T 日申购和赎回申请的有效性进行确认。若申购不成功，基金管理人应在 T+2 日起三十日内返还投资者已缴纳的款项。

基金份额持有人赎回申请确认后，基金管理人将在 T+8 日（包括 T+8 日）内支付赎回款项。在发生巨额赎回时，款项的支付办法参照本合同有关条款处理。

（六）认购、申购和赎回的金额限制

基金投资者首次净认购、净申购金额应不低于 100 万元人民币，在开放日内追加申购的，追加金额应不低于 1 万元人民币。

基金份额持有人赎回后持有的基金财产不得低于 100 万元，低于 100 万元时，基金管理人有权将该基金份额持有人所持份额做强制赎回处理。

（七）认购、申购和赎回的费率

1、认购、申购费率

本基金认购费率为 1%、申购费率为 1%。

2、赎回费率

本基金份额持有期限低于 12 个月的，赎回费率为 1%，基金份额持有期在 12 个月及以上的赎回费率为 0。

（八）认购、申购份额与赎回金额的计算方式

1、认购份额计算

认购份额=认购金额/（1+认购费率）/面值。

认购费用=认购金额*认购费率/（1+认购费率）。

净认购金额=认购金额/（1+认购费率）。

认购份额保留到小数点后 2 位，小数点后第 3 位四舍五入，由此带来的收益和损失归入基金财产。

2、申购份额计算

申购份额=申购金额/（1+申购费率）/申购价格。

申购费用=申购金额*申购费率/（1+申购费率）。

净申购金额=申购金额/（1+申购费率）。

申购份额的计算保留到小数点后 2 位，小数点后第 3 位四舍五入，由此带来的收益和损失归入基金财产。

3、赎回金额计算

赎回金额=赎回份数×赎回价格-赎回费用（如有）-应计提业绩报酬（如有）。

赎回费用（如有）由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。

赎回金额的计算保留到小数点后 2 位，小数点后第 3 位四舍五入，由此带来的收益和损失归入基金财产。

（九）申购和赎回的预约申请方式

1、直销预约程序

（1）基金投资者拟于开放日（T 日）申购基金时，应于 T-4 日至 T 日之间填写基金管理人提供的申请表进行申购预约登记，并将申请表以传真、扫描后发送电子邮件或者邮寄的方式送达基金管理人处。预约登记成功以基金投资者已签署基金合同并且申购资金到达本募集账户为准，或基金管理人认可的其他方式。若基金投资者未在上述要求时间内申购预约登记成功，则该基金投资者在本开放日的申购申请为无效申请。

（2）基金份额持有人拟于开放日（T 日）赎回基金时，应于 T-9 日至 T-5 日之间填写基金管理人提供的申请表进行赎回预约登记，并将申请表以传真、扫描后发送电子邮件或者邮寄的方式送达基金管理人处。预约登记成功以基金管理人收到申请表并经基金管理人确认为准，或基金管理人认可的其他方式。若基金份额持有人未在上述要求时间内赎回预约登记成功，则该基金份额持有人在本开放日的赎回申请为无效申请。

2、人数达到上限时的申购预约处理

本基金的人数规模上限为 200 人。基金管理人在申购预约登记期间（T-4 日至 T 日）每个交易日可接受的人数限制内，按照“时间优先、金额优先”的原则确认有效申购预约登记。超出基金人数规模上限的申购预约申请为无效申请。

（十）拒绝或暂停申购、暂停赎回的情形及处理

1、在如下情形下，基金管理人可以拒绝接受基金投资者的申购申请：

（1）本基金的基金份额持有人人数达到上限200人；

（2）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，从而损害现有基金份额持有人的利益的情形；

(3) 因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份额持有人利益的情形；

(4) 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的情形；

(5) 证券/期货经纪服务机构未及时提供估值所需资料，导致运营服务机构、基金托管人于开放日无法对基金资产估值的情形。

(6) 法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

基金管理人决定拒绝接受某些基金投资者的申购申请时，申购款项将退回基金投资者账户。

2、在如下情形下，基金管理人可以暂停接受基金投资者的申购申请：

(1) 因不可抗力导致无法受理基金投资者的申购申请的情形；

(2) 证券交易场所停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值的情形；

(3) 发生本合同规定的暂停基金资产估值的情形；

(4) 证券/期货经纪服务机构曾发生过未提供且申购日前未补全估值所需资料，导致运营服务机构、基金托管人无法对基金资产进行正常估值的情形。

(5) 法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

基金管理人决定暂停接受全部或部分申购申请时，应当告知基金投资者。在暂停申购的情形消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理并告知基金投资者。

3、在如下情形下，基金管理人可以暂停接受基金份额持有人的赎回申请：

(1) 因不可抗力导致基金管理人无法支付赎回款项的情形；

(2) 证券交易场所停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值的情形；

(3) 发生本合同规定的暂停基金资产估值的情形；

(4) 证券/期货经纪服务机构曾发生过未提供且申购日前未补全估值所需资料，导致运营服务机构、基金托管人无法对基金资产进行正常估值的情形。

(5) 法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一的，基金管理人应当告知基金份额持有人。已接受的赎回申请，基金管理人应当足额支付；如暂时不能足额支付，应当按单个赎回申请人已被接受的赎回金额占已接受的赎回总金额的比例将可支付金额分配给赎回申请人，其余部分在后续交易日予以支付。

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以公告形式告知基

金份额持有人。

(十一) 巨额赎回的认定及处理方式

1、巨额赎回的认定

单个开放日中,本基金需处理的净赎回申请份额超过本基金上一交易日基金总份额的20%时,即认为本基金发生了巨额赎回。

2、巨额赎回的处理方式

当基金出现巨额赎回时,基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎回。

(1) 全额赎回:当基金管理人认为有能力支付基金份额持有人的全部赎回申请时,按正常赎回程序执行。

(2) 部分延期赎回:当基金管理人认为支付基金份额持有人的赎回申请有困难或认为因支付基金份额持有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交易日基金总份额的20%的前提下,可对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请,应当按单个账户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;对于未能赎回部分,基金份额持有人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的,将自动转入下一个交易日继续赎回,直到全部赎回为止;选择取消赎回的,当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一交易日赎回申请(如有)一并处理,无优先权并以下一交易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。本基金不就延期赎回份额的相应款项计算利息。如基金份额持有人在提交赎回申请时未作明确选择,基金份额持有人未能赎回部分作自动延期赎回处理。

(3) 暂停赎回: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,可暂停接受基金的赎回申请;已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项,但不得超过20个交易日,并应当以书面或其他形式通知赎回申请基金份额持有人。

3、巨额赎回部分延期赎回的通知:当发生巨额赎回并且基金管理人决定执行部分延期赎回时,基金管理人应当选择信函、电话、手机短信、电子邮件、网站公告等方式之一,在开放日结束后的三个交易日内通知基金份额持有人,并说明相关处理方法。

七、当事人及权利义务

（一）基金份额持有人

1、基金份额持有人概况

基金投资者签署本合同，履行出资义务并取得基金份额，即成为本基金份额持有人。

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）按照本合同的约定申购和赎回基金；
- （4）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；
- （5）按照本合同约定的时间和方式获得基金的运作信息资料；
- （6）国家有关法律法规、监管机构及本合同规定的其他权利。

3、基金份额持有人的义务

（1）基金份额持有人应认真阅读本合同及《说明书》（如有），并保证委托资金的来源及用途合法；

（2）按照本合同约定划付委托资金，承担本合同约定的管理费、托管费及因基金运作产生的其他费用；

（3）按本合同约定承担基金的投资损失；

（4）及时、全面、准确地向基金管理人告知其投资目的、投资偏好、投资限制和风险承受能力等基本情况；

（5）向基金管理人及/或代理销售机构提供法律法规规定的真实、准确、完整、充分的信息资料及身份证明文件，配合基金管理人及/或代理销售机构进行的尽职调查与反洗钱工作；

（6）不得违反本合同的约定干涉基金管理人的投资行为；

（7）不得从事任何有损基金及其他基金份额持有人、基金管理人管理的其他资产及基金托管人托管的其他资产合法权益的活动；

（8）保守商业秘密，不得泄露基金投资计划、投资意向等；

（9）申购、赎回、分配等基金交易过程中因任何原因获得不当得利的，应予返还；

（10）保证其享有签署包括本合同在内的基金相关文件的权利，并就签署行为已履行必要的批准或授权手续，且履行上述文件不会违反任何对其有约束力的法律法规、公司章程、

合同协议的约定。

(11) 国家有关法律法规、监管机构及本合同规定的其他义务。

(二) 基金管理人

1、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) 依照本合同的约定，及时、足额获得基金管理人报酬；

(3) 依照有关规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的行为，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) 自行销售或者委托代理销售机构销售基金，制定和调整有关基金销售的业务规则，并对销售行为进行必要的监督；

(6) 自行担任或者委托其他份额登记机构办理份额登记业务，委托其他份额登记机构办理份额登记业务时，对份额登记机构的代理行为进行必要的监督和检查；

(7) 基金管理人有权根据市场情况对本基金的总规模、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进行调整；

(8) 以基金管理人的名义，在管理和运用基金财产时代表基金签署相关协议，办理相关权利登记变更等手续；

(9) 按照国家法律法规为基金的利益对基金债务人行使债权人的权利，为基金的利益行使因基金财产投资于债权资产所产生的权利；

(10) 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实施其他法律行为；

(11) 选择、更换会计师事务所、律师事务所或其他为基金提供服务的外部机构；

(12) 在符合国家相关法律法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、和非交易过户的业务规则；

(13) 国家有关法律法规、监管机构及本合同规定的其他权利。

2、基金管理人的义务

(1) 按规定开设和注销基金的证券资金账户、期货账户等投资所需账户，办理基金的备案手续；

(2) 自本合同生效之日起，按照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产；

- (3) 按照本合同规定将本基金项下资金移交基金托管人保管；
- (4) 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；
- (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；
- (6) 除依据法律法规、本合同及其他有关规定外，不得为基金管理人及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；
- (7) 自行销售或者委托代理销售机构销售基金，制定和调整有关基金销售的业务规则，并对销售行为进行必要的监督；
- (8) 办理或者委托其他基金份额登记机构代为办理基金份额的份额登记事宜；
- (9) 按照本合同的约定接受基金份额持有人和基金托管人的监督；
- (10) 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者实施其他法律行为；
- (11) 按照本合同约定向基金投资者报告基金份额净值；
- (12) 确定基金份额申购、赎回价格，采取适当、合理的措施使确定基金份额交易价格的方法符合法律、行政法规的规定和本合同的约定；
- (13) 确保证券/期货经纪服务机构及时向基金托管人、运营服务机构发送结算数据、对账单等估值所需的资料；
- (14) 保守商业秘密，不得泄露基金的投资计划、投资意向等，监管机构另有规定的除外；
- (15) 保存基金资产管理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；
- (16) 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；
- (17) 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；

(18)本合同的签署采用纸质合同的方式进行的,应妥善保管并按私募基金托管人要求,于基金合同签署完成后的 60 日内,及时向私募基金托管人移交基金投资者签署的基金合同原件,因私募基金管理人未妥善保管或未及时向私募基金托管人移交基金合同原件导致私募基金托管人损失的,私募基金管理人应予以赔偿;

本合同的签署采用电子签名的方式进行的,应确保基金投资者使用私募基金管理人、代理销售机构或其委托的具备相应资质的第三方认证机构颁发的有效的数字证书以电子签名方式签订本合同。私募基金管理人应确保基金投资者签订本合同所使用的电子签名符合《中华人民共和国电子签名法》等法律法规、监管规定的相关要求。

基金投资者完成本合同签署后,私募基金管理人、代理销售机构应当按私募基金托管人要求的格式、内容和方式向私募基金托管人发送基金投资者签订本合同的相关电子数据信息(以下简称“电子数据信息”),包括且不限于基金投资者身份信息、签约序列号、签约时间、电子协议版本号等。私募基金管理人或代理销售机构应对向私募基金托管人发送的电子数据信息的真实性、准确性和完整性负责。

私募基金托管人收到的电子数据信息应符合法律法规、监管规定和私募基金托管人向私募基金管理人或代理销售机构提出的文件保存要求,且该等电子数据信息能够有效地表现所载内容,能够可靠地保证自最终形成时起内容保持完整、未被更改,并可供私募基金托管人随时调取查用。如私募基金托管人要求私募基金管理人或代理销售机构提供带有基金投资者电子签名的本合同电子签署信息的,私募基金管理人或代理销售机构应按照私募基金托管人的要求及时提供。

(19)建立并保存基金份额持有人名册,按规定向基金托管人提供基金份额持有人名册资料;

(20)面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时,及时报告金融监管部门并通知基金托管人和基金投资者;

(21)因违反本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时,应承担赔偿责任,其赔偿责任不因其退出而免除;

(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)国家有关法律法规、监管机构及本合同规定的其他义务。

(三) 基金托管人

1、基金托管人的权利

- (1) 按照本合同的约定，及时、足额获得托管费；
- (2) 依据法律、行政法规规定和本合同《投资监督事项表》（附件一）的约定，监督基金管理人的投资运作，对于基金管理人违反法律、行政法规规定和本合同约定、对基金财产及其他当事人的利益造成重大损失的情形，有权报告中国证监会并采取必要措施；
- (3) 按照本合同的约定，依法保管基金财产；
- (4) 除法律法规另有规定的情况外，基金托管人对因基金管理人过错造成的基金财产损失不承担责任；
- (5) 国家有关法律法规、监管机构及本合同规定的其他权利。

2、基金托管人的义务

- (1) 根据本合同的约定安全保管基金财产；
- (2) 设立专门的托管部门，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、本合同及其他有关规定外，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的托管账户、证券账户等投资所需账户；
- (6) 复核基金份额净值；
- (7) 按照本合同的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；
- (8) 按照法律法规及监管机构的有关规定，保存基金资产管理业务活动有关的合同、协议、凭证等文件资料；
- (9) 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；
- (10) 保守商业秘密。除法律法规、本合同及其他有关规定另有要求外，不得向他人泄露；
- (11) 依据本合同《投资监督事项表》的约定，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本合同《投资监督事项表》约定的，应当拒绝执行，立即通知基金管理人；发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反本合同《投资监督事项表》约定的，应当立即通知基金管理人；
- (12) 国家有关法律法规、监管机构及本合同规定的其他义务。

八、基金份额的登记

(一) 本基金的份额登记业务由基金管理人或其委托的份额登记机构办理。份额登记机构应履行如下份额登记职责：

- 1、建立和保管基金份额持有人账户资料、交易资料、基金投资者资料表；
- 2、配备足够的专业人员办理本基金的份额登记业务；
- 3、严格按照法律法规和本合同规定的条件办理本基金的份额登记业务；
- 4、按照法律法规的要求，保存基金投资者资料表及相关的申购和赎回等业务记录；
- 5、对基金份额持有人的账户信息负有保密义务，因违反该保密义务对基金份额持有人或基金带来的损失，须承担相应的赔偿责任，但法律法规或监管机构另有规定的除外；
- 6、法律法规及本合同规定的其他职责。

(二) 基金管理人委托份额登记机构办理本基金的份额登记业务的，基金管理人依法应承担的份额登记职责不因委托而免除。

九、基金的投资

(一) 投资目标

本基金在深入研究的基础上构建投资组合，在严格控制投资风险的前提下，力求获得长期稳定的投资回报。

(二) 投资范围

本基金的投资范围仅限于东方港湾马拉松一号私募投资基金, 闲置资金可投资于货币市场基金、现金及银行存款（含定期存款等）。本基金投资东方港湾马拉松一号私募投资基金时，管理人应向托管人提交全套交易文件，交易文件应载明真实的资金来源为本基金，并明确上述产品到期或赎回后本金及收益将返回至本基金托管账户，如确有真实原因致使交易文件不能载明上述内容的，本基金管理人应在上述产品到期或赎回后将本金及收益返回至本基金托管账户。上述产品的管理人或投资顾问为本基金管理人的，本基金管理人承诺不进行任何利益输送的行为。在持有上述产品期间，上述产品的交易文件有任何变更的，管理人应负责审查同意该变更的行为不得损害本基金投资者实际利益；在持有上述产品期间，管理人对上述产品不的进行抵押、质押、非交易过户等任何有损本基金投资者利益的行为。

(三) 投资策略

本基金将根据宏观经济分析和整体市场估值水平的变化自上而下的进行资产配置，在降

低市场风险的同时追求更高收益。

（四）投资限制

本基金参与申购新股，申报的金额不得超过本基金的总资产，申报的数量不得超过拟发行股票公司本次发行股票的总量。

本基金财产的投资组合应遵循以下限制：

基金管理人自本合同生效之日起 3 个月内使本基金的投资组合比例符合本合同的有关约定。由于包括但不限于证券、期货市场波动、上市公司合并、组合规模变动等基金管理人之外的原因导致的投资比例不符合本合同约定的投资限制或投资禁止政策，为被动超标。基金管理人应在发生不符合法律法规或投资政策之日起的 10 个交易日内调整完毕。如发生证券停牌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，则调整期限相应顺延。基金管理人应当自证券恢复交易之日起的 10 个交易日内调整完毕，法律、行政法规、金融监管部门另有规定的，从其规定。

（五）投资禁止行为

本基金财产禁止从事下列行为：

- 1、承销证券；
- 2、违反法律、行政法规规定，向他人贷款或者提供担保；
- 3、从事承担无限责任的投资；
- 4、利用基金资产为基金投资者之外的任何第三方谋取不正当利益、进行利益输送；
- 5、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；
- 6、依照法律、行政法规等有关规定，由金融监管部门规定禁止的其他活动。

基金管理人应根据国家法律、行政法规及相关规定，保证本基金资金投资运作的合法合规性。

（六）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，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，并按监管要求适时披露相关信息。

（七）止损线

本基金不设置止损线。

（八）风险收益特征

基于本基金的投资范围及投资策略，本基金不承诺保本及最低收益，属预期风险较高、预期收益较高的投资品种，适合具有风险识别、评估、承受能力的合格投资者。

（九）业绩比较基准

本基金业绩比较基准为同期沪深 300 指数。

如果相关法律、行政法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，经基金管理人与基金托管人协商，本基金可以在基金业协会备案后变更业绩比较基准并及时公告。

十、基金的财产

（一）基金财产的保管与处分

1、基金财产独立于基金管理人、基金托管人的固有财产，并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人不得将基金财产归入其固有财产。基金托管人负责保管本基金项下托管账户内的资金，对于除此之外的本基金项下的其他基金财产，由基金管理人保管相关财产或财产权利凭证的，基金管理人应当自行安全保管。基金托管人对实际交付并控制下的基金财产承担保管职责，对于证券登记机构、期货经纪公司或结算机构等非基金托管人保管的财产不承担责任。

2、托管期间，如相关监管机构或法规对非现金类基金财产的保管事宜另有规定的，从其规定。

3、对于本基金的投资事宜，根据相关法律规定，可能出现基金管理人代表本基金签订相关协议、开立相关账户及办理相关手续等情况，基金托管人对于因此而产生的风险不承担责任。

4、除本合同另有约定外，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。

5、基金托管人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和独立。

6、对于因为基金投资产生的应收资产和基金申购过程中产生的应收资产，应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并书面通知基金托管人，到账日基金资产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。由此给基金造成损失的，基金管理人应负责向有关当事人追偿基金的损失。基金托管人对此不承担任何责任。

（二）基金募集资金的验证

本基金募集期结束后，基金管理人应将募集到的全部资金存入基金托管人为基金开立的托管账户。

(三) 基金财产相关账户的开立和管理

基金托管人按照规定开立基金财产的托管账户、证券账户等投资所需账户，基金管理人应给予必要的配合，并提供所需资料。

基金管理人为基金财产在证券经纪机构开立证券交易资金账户，用于基金财产证券交易结算资金的存管、记载交易结算资金的变动明细以及场内证券交易清算。托管人和管理人不得出借或转让证券账户、证券交易资金账户，亦不得使用证券账户或证券交易资金账户进行本基金业务以外的活动。

(四) 基金财产投资的有关实物证券、银行存款定期存单等有价凭证的保管

实物证券由基金托管人存放于基金托管人或其他基金管理人与基金托管人协商一致的第三方机构的保管库。实物证券的购买和转让，由基金托管人根据基金管理人的指令办理。基金托管人对由基金托管人以外机构实际有效控制的本基金资产不承担保管责任。

银行存款定期存单等有价凭证由基金托管人负责保管。

(五) 与基金财产有关的重大合同的保管

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分别由基金托管人、基金管理人保管。对于无法取得二份以上的正本的，基金管理人应向基金托管人提供加盖授权业务章的合同复印件或原件的扫描件，未经双方协商或未在合同约定范围内，合同原件不得转移。

因基金管理人未按本协议约定及时向基金托管人移交重大合同原件或复印件导致的法律责任，由基金管理人自行承担。

十一、指令的发送、确认与执行

(一) 基金管理人对发送指令人员的书面授权

基金管理人应按本合同的约定事先书面通知（以下称“授权通知”）基金托管人有权发送指令的人员名单、签字样本、预留印鉴和启用日期，注明相应的权限，并约定基金管理人向基金托管人发送指令时基金托管人确认有权发送人员（以下简称“被授权人”）身份的方法。基金管理人向基金托管人发出的授权通知应加盖公章。基金管理人将加盖公章的授权通知通过传真或电子邮件发送扫描件方式发出后，同时以电话形式向基金托管人确认；授权通知自基金托管人收到传真或扫描件并电话确认后，方视为通知送达。授权通知在送达后，自其载明的启用日期开始生效，通知送达的日期晚于载明的启用日期的，则通知送达时生效。基金管理人应在此后三个交易日内将授权通知的正本送交基金托管人。传真件或扫描件如与

正本不一致，基金托管人以传真件或扫描件为准并及时通知基金管理人。

基金管理人和基金托管人对授权文件负有保密义务，其内容不得向授权人及相关操作人员以外的任何人泄露。

（二）指令的内容

指令是在管理基金财产时，基金管理人向基金托管人发出的资金划拨及其他款项支付的指令。基金管理人发给基金托管人的指令应按双方约定的样本写明款项事由、指令的执行时间、金额、收款账户信息等，加盖预留印鉴并由被授权人签字或签章。

（三）指令的发送、确认和执行的时间及程序

指令由授权书确定的被授权人代表基金管理人用传真方式或电子邮件发送扫描件的方式向基金托管人发送。基金管理人义务在发送指令后与托管人以电话的方式进行确认。传真或扫描件以获得收件人（基金托管人）确认该指令已成功接收之时视为送达。因基金管理人未能及时与基金托管人进行指令确认，致使资金未能及时到账所造成的损失，基金托管人不承担责任。基金托管人依照授权书约定的方法确认指令有效后，方可执行指令。

对于被授权人依照“授权通知”发出的指令，基金管理人不得否认其效力。基金管理人应按照相关法律法规以及本合同的规定，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。基金管理人在发送指令时，应为基金托管人留出执行指令所必需的时间。由基金管理人原因造成的指令传输不及时、未能留出足够划款所需时间，致使资金未能及时到账所造成的损失由基金管理人承担。除需考虑资金在途时间外，基金管理人还需为基金托管人留有 2 小时的复核和审批时间。在每个交易日的 13:00 以后接收基金管理人发出的银证转账、银期转账划款指令的，基金托管人不保证当日完成划转流程；在每个交易日的 14:30 以后接收基金管理人发出的其他划款指令，基金托管人不保证当日完成在银行的划付流程。

基金托管人收到基金管理人发送的指令后，应对传真或扫描划款指令进行形式审查，验证指令的书面要素是否齐全、审核印鉴和签名是否和预留印鉴和签名样本表面相符，复核无误后依据本合同约定在规定期限内及时执行，不得延误。若存在异议或不符，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。基金管理人应将银行间市场成交单加盖印章后传真或电子邮件发送扫描件方式发送给基金托管人。基金托管人可以要求基金管理人传真提供相关交易凭证、合同或其他有效会计资料，以确保基金托管人有足够的资料来判断指令的有效性。基金托管人仅根据基金管理人的授权文件对指令进行表面相符性的形式审查，对其真实性不承担责任。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，基金管理人应保证上述文件资料合法、真实、完整和有效。如因基金管理人提供的上述文件不合法、不真实、不完整或失去效力而影响基金托管人的审核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。

基金管理人向基金托管人下达指令时，应确保托管账户及其他账户有足够的资金余额，对基金管理人在没有充足资金的情况下向基金托管人发出的指令，基金托管人有权拒绝执行，并立即通知基金管理人，基金托管人不承担因为不执行该指令而造成的损失。

（四）基金托管人依照法律法规暂缓、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场外指令违反本合同《投资监督事项表》的约定时，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，由此造成的损失由基金管理人承担。

（五）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。

（六）更换被授权人的程序

基金管理人撤换被授权人员或改变被授权人员的权限，必须提前至少三个交易日，向基金托管人以传真或电子邮件发送扫描件方式发送加盖公章的被授权人变更通知（包括姓名、权限、预留印鉴和签字样本等），注明启用日期，同时电话通知基金托管人。被授权人变更通知自基金托管人收到传真或扫描件并电话确认后，方视为通知送达。被授权人变更通知在送达后，自其载明的启用日期起开始生效。通知送达的日期晚于载明的启用日期的，则通知送达时生效，原授权文件同时废止。被授权人变更通知生效前，基金托管人仍应按原约定执行指令，基金管理人不得否认其效力。基金管理人在此后三个交易日内将被授权人变更通知的正本送交基金托管人。传真件或扫描件如与正本不一致，基金托管人以传真件或扫描件为准并及时通知基金管理人。

（七）指令的保管

指令若以传真或扫描件形式发出，则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指令传真件或扫描件为准。

（八）相关责任

基金托管人正确执行基金管理人符合本合同规定的划款指令，基金财产发生损失的，基

金托管人不承担任何形式的责任。在遵循本合同约定的业务受理渠道及在指令预留处理的时间内，因基金托管人原因未能及时或正确执行符合本合同规定的划款指令而导致基金财产受损的，基金托管人应承担相应的责任，但托管账户及其他账户余额不足或基金托管人如遇到不可抗力的情况除外。

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划款指令人员的预留印鉴和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相关约定验证有关印鉴与签名无误，基金托管人不承担因正确执行有关指令而给基金管理人或基金财产或任何第三人带来的损失，全部责任由基金管理人承担。

十二、交易及清算交收安排

（一）场内交易的资金清算交收安排

1、基金投资证券后的清算交收安排

（1）本基金通过证券经纪机构进行的交易由证券经纪机构作为结算参与者代理本基金进行结算；本基金其他证券交易由基金托管人或相关机构负责结算。

（2）证券交易所证券资金结算

基金托管人、基金管理人应共同遵守中登公司制定的相关业务规则 and 规定，该等规则 and 规定自动成为本条款约定的内容。

基金管理人在投资前，应充分知晓与理解中登公司针对各类交易品种制定结算业务规则 and 规定。

证券经纪机构代理本基金财产与中登公司完成证券交易及非交易涉及的证券资金结算业务，并承担由证券经纪机构原因造成的正常结算、交收业务无法完成的责任；若由于基金管理人原因造成的正常结算业务无法完成，责任由基金管理人承担。

（3）对于任何原因发生的证券资金交收违约事件，相关各方应当及时协商解决。

（二）非证券交易所交易资金清算与交收

场外资金汇划由基金托管人凭基金管理人符合本合同约定的有效资金划拨指令和相关投资合同（如有）进行资金划拨。

（三）期货投资资金清算与交收（如有）

基金管理人负责选择代理本基金期货买卖的期货经营机构，并与基金托管人及期货公司，就期货保证金保管、期货交易、出入金、数据发送等事项签订协议，明确各方的权利义务。

本基金投资于期货发生的资金交割清算由基金管理人选定的期货经纪公司负责办理，基金托管人对由于期货交易所期货保证金制度和清算交割的需要而存放在期货经纪公司的资金不行使保管职责，基金管理人应在期货经纪协议或其他协议中约定由选定的期货经纪公司承担资金安全保管责任。

（四）无法按时清算的责任认定及处理程序

基金管理人应保证基金托管人在执行基金管理人发送的资金划拨指令时，基金托管账户上有充足的资金。资金头寸不足时，基金托管人有权拒绝基金管理人发送的资金划拨指令，并视托管账户资金余额足够时为指令送达时间。基金管理人在发送资金划拨指令时应充分考虑基金托管人的划款处理时间，一般为2个工作小时。基金托管人不承担由于基金管理人指令传输不及时、未能留出足够的划款时间，致使资金未能及时到账所造成的损失。在基金财产资金头寸充足的情况下，基金托管人对基金管理人符合法律、行政法规和本合同规定的指令不得拖延或拒绝执行。

（五）申购、赎回的资金清算和数据传递的时间、程序及当事人的责任界定

1、基金份额申购、赎回的确认及清算由基金管理人或其指定的份额登记机构负责。

2、基金管理人或其委托的份额登记机构应将每个开放日的申购、赎回数据传送给基金托管人。基金管理人应对传递的申购、赎回数据的真实性、准确性、完整性负责。基金托管人应及时查收申购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换款项。

3、基金管理人应在T+3日前将申购净额（不包含申购费）划至托管账户。如申购净额未能如期到账，基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收，由此给基金造成损失的，由责任方承担。基金管理人负责向责任方追偿基金的损失。

4、基金管理人应在T+4日之前向基金托管人发送赎回的划拨指令。基金托管人依据划款指令在T+5日（包含赎回产生的应付费用）内划至基金管理人指定账户。基金管理人应及时通知基金托管人划付。若赎回金额未能如期划拨，由此造成的损失，由责任方承担。基金管理人负责向责任方追偿基金的损失。

十三、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、行政法规和其他有关规定或本合同约定的投资交易行为，以及法律法规禁止的超买、超卖行为。

基金管理人应在本合同约定的权限内运用基金财产进行投资管理,不得违反本合同的约定,超越权限从事投资。

基金托管人对基金管理人的投资行为行使监督权。基金托管人根据《投资监督事项表》的约定,对本基金的投资进行监督。

(二) 越权交易的处理程序

1、违反有关法律法规和本合同规定进行的投资交易行为

托管人发现管理人的投资指令违反法律法规的规定,或者违反本合同约定的,有权拒绝执行,通知管理人并有权报告中国证监会。

托管人发现管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他规定,或者违反本合同约定的,有权通知管理人并有权报告中国证监会。

管理人应向基金份额持有人和托管人主动报告越权交易。在限期内,基金份额持有人和托管人有权随时对通知事项进行复查,督促管理人改正。管理人对基金份额持有人和托管人通知的越权事项未能在限期内纠正的,托管人有权报告中国证监会。

2、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)基金托管人投资监督的真实性、准确性和完整性受限于基金管理人、证券经纪商、期货经纪商及其他中介机构提供的数据和信息,合规投资的责任在基金管理人。基金托管人对这些机构的信息的真实性、准确性和完整性不作任何担保、暗示或表示,并对上述机构提供的信息的错误和遗漏所引起的损失不承担任何责任。

(四)基金托管人无投资责任,对任何基金管理人的投资行为(包括但不限于其投资策略及决定)或其投资回报或由于基金产品设计缺陷或越权交易造成的任何损失不承担任何责任。基金托管人按照本合同约定履行了投资监督义务的,不对基金管理人的行为承担任何补充或连带责任。基金托管人不会因为提供投资监督报告而承担任何因基金管理人违规投资所产生的有关责任,也没有义务去采取任何手段回应任何与投资监督报告有关的信息和报道。但如果收到基金份额持有人的书面指示,基金托管人将对投资监督报告所述的违规行为提供有关资料。

十四、基金财产的估值和净值计算

(一) 基金财产的估值

1、估值目的

基金财产估值目的是客观、准确地反映基金财产的价值，并为基金份额申购、赎回提供计价依据。

2、估值时间

基金管理人与基金托管人应于交易日次一交易日对基金估值核算结果进行核对。

3、估值依据

估值应符合本合同、《证券投资基金会计核算业务指引》及其他法律、法规的规定，如法律法规未做明确规定的，参照证券投资基金的行业通行做法处理。

4、估值对象

基金所拥有的股票、债券、权证、基金、其他衍生工具和银行存款本息、应收款项、其他投资等资产及负债。

5、估值方法

(1) 证券交易所上市的有价证券的估值

A、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，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且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。

B、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，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且债券发行机构未发生影响债券价格的重大事件的，按最近交易日的收盘价估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考监管机构和行业协会估值意见，或者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。

C、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得到的净价进行估值；估值日没有交易的，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且债券发行机构未发生影响债券价格的重大事件的，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含截止最近交易日的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考监管机构和行业协会估值意见，或者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。

D、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:

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

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) 因持有股票而享有的配股权,采用估值技术确认公允价值。在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下,按成本估值。

(4) 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。

(5) 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。

(6) 期货以估值日的结算价估值,若估值当日无结算价的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化的,采用最近交易日结算价估值。法律法规另有规定的,从其规定。

(7) 托管户内的银行存款、证券及期货资金账户内资金等资产,有产生利息的每日按预期利率(有合同约定的按合同约定,无合同约定的按央行同期利率)计提应计利息,实际到账金额以银行、券商、期货商等结息日结息入账金额为准;本基金终止清算时应收未收利息计入基金终止清算净值;其他诸如债券、回购等计息资产按照约定利率在持有期内逐日计提应收利息,在利息到账日以实收利息入账。

(8) 基金持有的公募证券投资基金估值

A、持有的交易所基金(包括封闭式基金、上市开放式基金(LOF)等),按估值日其所在证券交易所的收盘价估值;估值日无交易的,以最近交易日的收盘价估值;如果估值日无交易,且最近交易日后经济环境发生了重大变化的,将参考监管机构或行业协会有关规定,或者类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易日收盘价,确定公允价值进行估值。

B、持有的场外基金(包括托管在场外的上市开放式基金(LOF)),按估值日前一交易日的基金份额净值估值;估值日前一交易日基金份额净值无公布的,按此前最近交易日的基金

份额净值估值。

C、持有的货币市场基金以成本列示，每日按基金管理公司公布的最近交易日的每万份收益计提收益。红利日结型货币与红利月结型货币基金则均于实际收到红利时，根据确认数量或金额调整并确认损益。

D、场内申购获得的 ETF 基金按转出股票价值+现金替代+现金差额-可收替代确认成本，其中，转出股票价值按估值日各转出股票收盘价计算；基金公司未公布估值日现金替代的，按基金公司公布的估值日预估现金部分计算，并于估值日现金差额公布后调整 ETF 基金成本；可收替代款于收到退补数据后调整 ETF 基金成本；如果现金差额公布日或者退补数据公布日，已无 ETF 持仓，该部分差额直接计入产品收益。场内赎回 ETF 基金获得的成分股票按当日收盘价，如果停牌取最近日收盘价确认成本，管理人应按日向托管机构提供退补数据；持有的 ETF 基金，按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考监管机构或行业协会有关规定，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。

E、场内持有的分级基金的母基金，按照取得成本确认成本。母基金能够在交易所交易的，按照第本款第 A) 项规定的方法估值；不能在交易所交易的，按照估值日的基金份额净值估值；估值日基金份额净值无公布的，按此前最近交易日的基金份额净值估值。对持有的合同约定有拆分合并或折算条款的基金，仍采用估值日前基金公司最近公布的单位净值进行估值。

F、持有的基金处于封闭期的，按照最新公布的份额净值估值；没有公布份额净值的，按照成本估值。

(9) 基金持有的期权衍生工具，按估值日的结算价估值；估值日没有交易的，按最近交易日的结算价估值；非上市交易的有价证券诸如场外期权，股票收益权互换等，参考期货关于成本、估值增值的有关计量处理方法，其他未上市交易的，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量的情况下，按成本估值；股票质押式回购在交易确认日按成本确认账面价值，有明确预期利率的按预期利率每天计提应收利息。

(10) 本基金持有的商业银行理财产品、信托计划、证券公司资产管理计划、保险资产管理计划、期货资产管理计划、基金公司（含子公司）特定客户资产管理计划、私募基金等有确定收益率或预期收益率的类固定收益产品，按成本列示，并每日加计应收利息（或应计收益）进行估值；其它非公开交易的产品，按照最新公布的份额净值估值；没有公布份额净值的，按照成本估值。

(11) 在全国中小企业股份转让系统挂牌上市交易，以做市转让方式上市交易的股票，以其估值日挂牌的市价（收盘价）估值，估值日无交易的，以最近交易日的市价（收盘价）估值。在全国中小企业股份转让系统挂牌，以协议转让方式上市交易的股票按成本估值。

(12) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映公允价值的，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原则进行估值。

(13) 上述估值方法，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本合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时，应立即通知对方，共同查明原因，双方协商解决。根据有关法律法规，基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，以基金管理人对于基金资产净值的计算结果为准。

6、特殊估值原则

基金对外投资中，对投资于无法从公开或客观渠道（包括沪深交易所、中债登及中证指数公司及标的发行方公开网站等）获取公允价格的投资标的时，若管理人无法按投资标的合同协议中约定的披露时间或投资发生后 7 个工作日内提供估值核算所需的客观资料，包括但不限于估值价格、权益确认书等，则管理人的估值外包方及托管人有权按如下原则进行会计处理：

(1) 标的证券为首次发行的，权益确认时间默认为投资款项划出的第 2 天，确认当天以成本入账，并自确认日起按成本估值。当后续管理人提供了权益（或份额）确认凭据或最新的公允价格时，托管人及估值外包方不再对以往账务进行调整，仅在提供凭据当天，以当天日期为准按提供的凭据资料一次性调整或确认相关权益及损益；

(2) 标的证券为已经发行在运作的，权益确认时间默认为投资款项划出的第 2 天，确认当天以成本或当天已获取到的成本入账，并自确认日起按成本或已获取到的最新公允价格估值。当后续管理人提供了权益（或份额）确认凭据或最新的公允价格时，托管人及估值外包方不再对以往账务进行调整，仅在提供凭据当天，以当天日期为准按提供的凭据资料一次性调整或确认相关权益及损益；

当按上述原则进行会计时，估值外包方或托管人邮件提示管理人即视为履行了估值调整的告知义务。采用上述会计原则进行估值核算处理后，估值外包方及托管人视为完全履行了基金合同约定的估值核算相关义务，并对由此造成的基金财产和基金持有人的相关损益不承

担责任。

7、如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映公允价值的，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原则进行估值。

8、上述估值方法，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本合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时，应立即通知对方，共同查明原因，双方协商解决。根据有关法律法规，基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，以基金管理人计算的基金资产净值的结果为准。

9、估值程序

基金日常估值由基金管理人进行。基金管理人完成估值后，将估值结果加盖业务公章以书面形式或者双方认可的其他形式送至基金托管人，基金托管人按法律法规、本合同规定的估值方法、时间、程序进行复核，复核无误后在基金管理人以传真或电子邮件发送扫描件方式发送的书面估值结果上加盖业务章或者双方认可的其他形式返回给基金管理人；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。

在法律法规和中国证监会允许的情况下，基金管理人与基金托管人可以各自委托第三方机构进行基金资产估值，但不改变基金管理人与基金托管人对基金资产估值各自承担的责任。

10、估值错误的处理

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资产估值的准确性、及时性。当基金份额净值小数点后3位以内（含第3位）发生计算错误时，视为估值错误。

本基金运作过程中，如果由于基金管理人、基金托管人、证券/期货经纪机构、证券交易所、份额登记机构、销售机构或基金投资者自身的过错造成估值错误，导致其他当事人遭受损失的，按如下估值错误处理原则和处理程序执行：

（1）估值错误类型

估值错误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。

由于不可抗力造成基金份额持有人的交易资料灭失或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。

(2) 估值错误处理原则

A、证券/期货经纪机构应于每个交易日 21:00 前向基金管理人、基金托管人发送当日交易结算数据、对账单等估值所需材料,因证券/期货经纪机构未及时发送而导致估值差错时,基金管理人应协调证券/期货经纪机构解决;

B、如基金管理人或基金托管人发现基金资产估值违反本合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定,导致基金份额净值小数点后 3 位以内(含第 3 位)发生计算错误时,应立即通知双方,共同查明原因,协商解决;

C、估值错误的责任人应当对由于该估值错误遭受损失的直接当事人的直接损失承担赔偿责任;估值错误的责任方对有关当事人的直接损失负责,不对间接损失负责,并且仅对估值错误的有关直接当事人负责,不对第三方负责;

D、因估值错误而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务;

E、估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式;

F、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;

G、基金管理人按本合同约定的估值方法进行估值时,所造成的误差不作为基金资产估值错误处理;

H、按法律法规规定的其他原则处理估值错误。

(3) 估值错误处理程序

估值错误被发现后,有关的当事人应当及时进行处理,处理的程序如下:

A、基金份额净值计算出现错误时,基金管理人应当立即予以纠正,通报基金托管人,并采取合理的措施防止损失进一步扩大;

B、当基金份额净值小数点后 3 位以内(含第 3 位)发生计算错误时,查明估值错误发生的原因,根据当事人协商的方法对因估值错误造成的损失进行评估;

C、根据估值错误处理原则或当事人协商的方法,对估值错误进行处理;

D、前述内容如法律法规或监管机关另有规定的,从其规定处理。

11、暂停估值的情形

(1) 基金投资所涉及的证券交易场所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时;

(2) 证券/期货经纪服务机构未能提供估值所需资料,导致运营服务机构、基金托管人无法对基金资产进行正常估值时;

(3) 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；

(4) 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投资者的利益，决定延迟估值的情形；

(5) 金融监管部门和本合同认定的其他情形。

(二) 基金份额净值的计算

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。基金份额净值是按照每个交易日闭市后，基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算，精确到 0.001 元，小数点后第四位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

(三) 特殊情况的处理

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，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人和基金托管人应当积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。

(四) 资产账册的建立

基金管理人和基金托管人在本合同生效后，应按照相关各方约定的同一记账方法和会计处理原则，分别独立的设置、登录和保管基金财产的全套账册，对相关各方各自的账册定期进行核对，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，保证相关各方平行登录的账册记录完全相符。

(五) 基金财产的会计核算

基金的会计政策比照证券投资基金现行政策执行。

1、会计年度、记账本位币和会计核算制度

(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。

2、会计核算方法

(1) 基金管理人、基金托管人应根据有关法律、行政法规和基金投资者的相关规定，对基金财产独立建账、独立核算。

- (2) 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，编制会计报表。
- (3) 基金托管人应定期与基金管理人就基金财产的会计核算、报表编制等进行核对。
- (4) 基金管理人、基金托管人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；
- (5) 基金管理人、基金托管人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，保证相关各方平行登录的账册记录完全相符。

十五、基金的费用与税收

(一) 与基金运作有关的费用

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、基金的运营服务费；
- 4、基金管理人的业绩报酬；
- 5、银行账户的资金结算汇划费、账户维护费、询证费等各类银行收取的费用；
- 6、基金财产开立账户需要支付的费用；
- 7、基金财产的证券、期货交易费用；
- 8、基金运作期间发生的会计师费、律师费；
- 9、与本基金有关的印刷费用；
- 10、按照法律、行政法规的规定及本合同的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

本基金的管理费率为年费率 1.5%。在通常情况下，基金管理费按前一自然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

本基金的管理费自基金成立日起，每日计提，按月支付。基金管理人在此授权基金托管人于下月前三个交易日之内，从基金财产中一次性支付至基金管理人如下账户：

管理人账户名称：深圳东方港湾投资管理股份有限公司

管理人账号：755905136410601

管理人开户银行名称：招商银行深圳车公庙支行

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费率为年费率 0.1%。在通常情况下，基金托管费按前一自然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 为前一日基金资产净值

本基金的托管费自基金成立日起，每日计提，按月支付。基金管理人在此授权基金托管人于下月前三个交易日之内，从基金财产中一次性支付至基金托管人收费账户。

自基金成立日起，如托管费每自然年度累计计提不足 10 万元，托管费按 10 万元计算，（自然年度不足 365 天的按实际天数折算比较），管理人在此授权托管人直接将差额部分于次年初（或委托期届满后）三个交易日内，从基金财产中一次性扣除支付至托管人收费账户。

3、基金的运营服务费

本基金的运营服务费率年费率为 0.1%。在通常情况下，基金运营服务费按前一自然日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times \text{年运营服务费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金运营服务费

E 为前一日基金资产净值

本基金的运营服务费自基金成立日起，每日计提，按月支付。基金管理人在此授权基金托管人于下月前三个交易日之内，从基金财产中一次性支付至基金运营服务机构收费账户。

自基金成立日起，如运营服务费每自然年度累计计提不足 5 万元，运营服务费按 5 万元计算，（自然年度不足 365 天的按实际天数折算比较），管理人在此授权托管人直接将差额部分于次年初（或委托期届满后）三个交易日内，从基金财产中一次性扣除支付给运营服务机构。

4、基金管理人业绩报酬

业绩报酬的计算采用单个投资者单笔高水位净值法，即当业绩报酬计提基准日（投资者赎回日、基金分红日、基金清算日）的基金份额累计净值大于上次计提日（首次计提时，则为参与日份额累计净值）时，分别计算每个基金份额持有人所持有份额在上一计提基准日至本次计提日持有期间的基金份额累计净值增长差额，对超过上次成功计提日基金份额累计净

值部分按20%比例进行计提。

业绩报酬的具体计算及支付如下：

(1) 赎回提取业绩报酬

$$E = \begin{cases} \text{当 } NAV_n \leq NAV_h \text{ 时, } 0 \\ \text{当 } NAV_n > NAV_h \text{ 时, } (NAV_n - NAV_h) \times S \times R, \end{cases}$$

其中：E 为当前基准日应计提的业绩报酬；

NAV_n 为当前基准日未扣除当期应计提业绩报酬前的基金份额累计净值；

NAV_h 为上次成功计提日基金份额累计净值（历史未计提，则为参与日份额累计净值）；

S 为当前基准日单个基金份额持有人赎回或持有的单笔份额；

R=20%，为业绩报酬提取比例

(2) 分红提取业绩报酬

当发生分红时，管理人在分红前先按“退出提取业绩报酬”的方法计算每个基金份额持有人的应计提业绩报酬金额，然后在派发分红时从分红金额中扣除业绩报酬；当分红金额不足于扣除业绩报酬时，以分红金额为限进行扣除。

业绩报酬采用按账户计提的方式，多次申赎的基金份额在确定份额参与日或最近报酬日时采用“先进先出”法。

业绩报酬的计算保留到小数点后 2 位，小数点后第 3 位四舍五入，由此带来的收益和损失归入基金资产

(3) 业绩报酬的支付

业绩报酬由基金管理人负责计算及复核，并由基金管理人在单个基金份额持有人分红或赎回或清算款项（以下简称“退出金额”）中分别予以相应扣除，即退出金额支付日，基金托管人根据基金管理人的指令将退出金额（含业绩报酬）划拨给基金管理人，基金管理人扣除归其所有的应计提业绩报酬后，剩余的退出金额由基金管理人支付给基金份额持有人。

业绩报酬收取账户为本合同约定的管理人管理费收取账户或管理人的以其名义开立的其他银行结算账户。

5、上述（一）款中5到9项费用，由基金托管人在费用发生时，直接由基金财产支付，列入当期费用。

如该费用属于托管人先行垫付的（包括但不限于由第三方收取的与基金运作相关的股东账户开户、银行询证及汇划等费用），基金管理人在此授权基金托管人于本基金成立后从基金财产中一次性扣划至托管人账户。上述垫付费用扣划当日，如托管账户余额不足，基金管

理人授权基金托管人从证券或期货资金账户转账入托管账户，授权转账金额为上述费用金额（如存在银行汇划手续费则增加该项金额）。管理人不再另行出具划付指令。

6、为提高资金划付效率，费用扣划当日，如托管账户余额不足，基金管理人在此授权基金托管人从证券或期货资金账户转账入托管账户，授权转账金额为上述费用的实际金额。

（三）不列入基金业务费用的项目

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、处理与本基金财产运作无关的事项发生的费用、以及应当由基金管理人和基金托管人承担的费用等不列入基金财产的费用。

（四）费用调整

基金管理人、基金托管人与基金份额持有人协商一致，可根据市场发展情况调整管理费率、托管费率等费率。

（五）基金的税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体、扣缴主体，其纳税义务、扣缴义务按国家税收法律、法规执行，由其各自承担、缴纳或扣缴。

十六、基金的收益分配

基金收益分配是指将本基金的可分配收益根据持有基金份额的数量按比例向基金份额持有人进行分配。

（一）基金收益由买卖证券价差、股息、基金红利、债券利息、银行存款利息以及其他合法收入构成。

（二）基金收益分配原则和方式

- 1、本基金默认采用现金方式；
- 2、同等基金份额的享有同等分配权；
- 3、基金收益分配日的基金份额净值减去每份基金份额收益分配金额后不能低于基金面值；
- 4、当期收益先弥补上一年度亏损后，方可进行当年收益分配；
- 5、本基金存续期内是否分配收益、收益分配比例和分配金额由基金管理人确定；
- 6、本基金的收益分配可以采取现金分红或红利再投资等方式。红利再投资是将现金红利按照基金分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额；

7、基金份额持有人可以选择收益分配方式。基金份额持有人变更收益分配方式的，应当通过基金销售机构提交申请，由基金份额登记机构进行处理。

（三）基金收益分配方案的确定

基金收益分配方案由基金管理人根据本合同制定，包括基金收益分配的范围、分配对象、分配原则、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。

基金管理人应当于基金收益分配登记日前，将基金收益分配方案交由基金托管人复核。基金托管人应于收到收益分配方案后完成对收益分配方案的复核，并将复核意见书面通知基金管理人。复核通过后，基金管理人通过网站公告等方式通知基金份额持有人收益分配方案。

基金托管人根据基金管理人的收益分配方案和提供的现金红利金额的数据，在红利发放日进行处理。如果基金份额持有人选择红利转基金份额，基金份额登记机构进行红利转基金份额的账务处理。

十七、报告义务

（一）基金管理人应根据法律规律规定以书面或电子等方式向基金投资者披露基金份额净值。

（二）基金管理人、基金托管人应当根据法律法规、中国证监会和基金业协会的要求履行报告义务。

（三）基金管理人向基金投资者提供报告及基金投资者信息查询的方式

基金管理人通过书面或电子方式向基金份额持有人提供信息查询。

（四）信息保密

除按照《基金法》、《暂行办法》中关于基金信息披露的有关规定及本合同进行披露以外，基金管理人和基金托管人对披露前的基金信息、从对方获得的业务信息应予保密，不得向任何第三方泄露。法律、法规另有规定的以及审计需要的除外。

十八、基金有关文件档案的保存

基金管理人应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，基金托管人应保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料。

基金管理人和基金托管人应按各自职责完整保存原始凭证、记账凭证、基金账册、会计报告、交易记录和重要合同等，保存期限为自基金清算终止之日起 20 年。

基金管理人签署重大合同文本后，应及时将合同文本正本送达基金托管人处。基金管理人应及时将与本基金账务处理、资金划拨等有关合同、协议以传真或电子邮件发送扫描件方式发送给基金托管人。

基金管理人或基金托管人变更后，未变更的一方有义务协助接任人接收基金的有关文件。

十九、基金份额的转让、非交易过户和冻结

（一）基金份额的转让

本基金成立后，基金管理人可以按照法律法规的规定及合同的约定办理基金份额转让事宜。

1、办理条件

基金份额持有人持有本基金份额的，有权申请基金份额的全部或部分转让。

基金份额的受让人应满足法律法规及本合同规定的合格投资者标准，签署相应基金份额转让协议和基金合同。受让人未满足上述要求的，管理人不得为其办理基金份额转让事宜。

2、申请程序

（1）基金管理人在收到基金份额持有人的转让申请后，已经确定受让人的，协助转让方及受让方签署份额转让协议，办理受让方基金合同签署事宜。

（2）份额转让协议签署完成后，管理人将转让协议、转让申请书、受让方签署的基金合同递交基金份额登记机构。

（3）基金份额登记机构根据转让协议及转让申请书约定的时间、份额及价格，办理份额过户和资金结算。

（4）本基金的人数规模上限为 200 人。基金管理人在申请期间每个交易日可接受的人数限制内，按照“时间优先、金额优先”的原则确认有效转让申请。超出基金人数规模上限的转让申请为无效申请。

3、份额转让

（1）基金投资者首次净受让金额应不低于 100 万元人民币。

（2）基金份额的转让由份额登记机构按照见款付券的原则办理份额过户和资金结算，相关资金的划转通过份额登记机构专用账户实现。

（二）基金份额的非交易过户

非交易过户是指不采用申购、赎回等交易方式，将一定数量的基金份额按照一定的规则

从某一基金份额持有人账户转移到另一基金份额持有人账户的行为。非交易过户包括继承、捐赠、司法执行以及份额登记机构认可、符合法律法规的其他非交易过户。办理非交易过户必须提供基金份额登记机构要求提供的相关资料，接收划转的主体必须是依法可以持有本基金份额的合格投资者。

办理非交易过户必须提供基金份额登记机构要求提供的相关资料，对于符合条件的非交易过户申请按基金份额登记机构的规定办理，并按基金份额登记机构规定的标准收费。

（三）基金份额的冻结与解冻

经人民法院、人民检察院、公安机关及其他有权机构就基金份额冻结与解冻事项依法要求，以及基金份额登记机构认可、符合法律法规的其他情况下，本基金的基金份额方可冻结与解冻。

二十、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

（一）基金托管人对基金管理人的投资行为行使监督权

基金托管人根据《投资监督事项表》的约定，对基金管理人的投资行为进行监督。

（二）基金托管人应根据有关法律、法规的规定及基金合同的约定，对基金资产净值计算、基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确认、基金收益分配等进行监督和核查。如果基金管理人未经基金托管人的审核擅自使用不实的业绩表现数据，基金托管人对此不承担任何责任。

（三）基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查，在规定时间内答复并改正，就基金托管人的疑义进行解释或举证。对基金托管人按照法规要求需向监管机构报送基金监督报告的，基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

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本合同《投资事项监督表》的，应当拒绝执行，立即通知基金管理人。管理人指令依据交易程序已生效的，托管人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，并以电话或书面形式向基金托管人反馈，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在限期内，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。

二十一、基金管理人对于基金托管人的业务核查

根据《基金法》及其他有关法规和本合同规定，基金管理人对于基金托管人履行托管职责

的情况进行核查，核查事项包括但不限于基金托管人是否安全保管基金财产、开立基金财产的托管账户和证券账户及债券托管账户，是否及时、准确复核基金管理人计算的基金资产净值和基金份额净值，是否根据基金管理人指令办理清算交收，是否按照法规规定和本合同规定进行相关信息披露和监督基金投资运作等行为。

基金管理人定期和不定期地对基金托管人保管的基金资产进行核查。基金托管人应积极配合基金管理人的核查行为，包括但不限于：提交相关资料以供基金管理人核查托管财产的完整性和真实性，在规定时间内答复并改正。

基金管理人发现基金托管人未对基金资产实行分账管理、擅自挪用基金资产、未执行或无故延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄露基金投资信息等违反《基金法》、本合同及其他有关规定的，应及时以书面形式通知基金托管人在限期内纠正，基金托管人收到通知后应及时核对并以书面形式对基金管理人发出回函。在限期内，基金管理人有权随时对通知事项进行复查，督促基金托管人改正。对基金管理人按照法规要求需向监管机构报送基金监督报告的，基金托管人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

基金管理人发现基金托管人有重大违规行为，应通知基金托管人在限期内纠正。

二十二、基金合同的成立、生效及签署

（一）合同的成立、生效

1、合同成立

本合同的签署采用纸质合同方式进行的，由私募基金管理人、私募基金托管人、基金投资者共同签署后合同即告成立。

本合同的签署采用电子签名方式进行的，基金投资者以电子签名方式签署本合同后本合同即告成立。基金投资者电子签名与在纸质合同上手写签名或盖章具有同等法律效力，无须另行签署纸质合同。

本合同生效应当同时满足如下条件：

- （1）本合同经基金投资者、基金管理人与基金托管人合法签署；
- （2）基金投资者认购或申购资金实际交付并经份额登记确认成功，基金投资者获得基金份额。

本合同生效后，任何一方都不得单方解除。

(二)本合同的签署采用纸质合同的方式进行的,由私募基金管理人、私募基金托管人、基金投资者共同签署,一式三份,私募基金管理人、私募基金托管人和基金投资者各持一份。私募基金管理人应妥善保管并按私募基金托管人要求及时向私募基金托管人移交三方签署的合同原件。

本合同的签署采用电子签名的方式进行的,由基金投资者签署。私募基金管理人与私募基金托管人双方同时签署纸质合同,纸质合同原件一式贰份,由私募基金管理人与私募基金托管人各执壹份,私募基金管理人确保投资者以电子签名方式签署的合同内容与私募基金管理人和私募基金托管人签署的纸质合同内容保持一致。

二十三、基金合同的变更、终止

(一)非因法律、法规及有关政策发生变化的原因而导致合同变更时,可采用以下两种方式中的一种进行基金合同变更。

1、全体基金份额持有人、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、基金管理人、基金托管人首先就本合同拟变更事项达成一致。基金管理人就本合同变更事项以书面或电子方式向基金份额持有人发送合同变更征询意见函(或通知),但是该合同变更征询意见函(或通知)的内容须事先征得基金托管人同意。基金份额持有人应在征询意见函(或通知)指定的日期内按指定的形式回复意见。基金份额持有人不同意变更的,应在征询意见函(或通知)指定的日期内赎回本基金(基金份额持有人因不同意变更合同而申请赎回基金份额的,不受本合同“基金的认购、申购和赎回”中关于份额锁定期的期限限制);基金份额持有人未在指定日期内回复意见或未在指定的日期内赎回本基金的,视为基金份额持有人同意合同变更。变更事项自征询意见函(或通知)指定的日期届满的次交易日开始生效,对合同各方均具有法律效力。

(二)法律法规或中国证监会的相关规定发生变化需要对本合同进行变更的,基金管理人可与基金托管人协商后修改基金合同,并由基金管理人按照本合同的约定向基金份额持有人披露变更的具体内容。

(三)基金合同终止的情形包括下列事项:

- 1、合同期限届满而未延期的;
- 2、基金管理人依法解散、被依法撤销或被依法宣告破产的;

- 3、管理人被依法取消私募投资基金管理人相关资质，且未能依法律法规及本合同的规定选任新的管理人；
- 4、基金托管人依法解散、被依法撤销或被依法宣告破产的；
- 5、托管人被依法取消基金托管资格，且未能依法律法规及本合同的规定选任新的托管人；
- 6、按照本条第（一）款约定的任何一种变更合同的方式而提前终止的；
- 7、本基金达到止损线（如有）且完成平仓操作的；
- 8、法律法规和本合同规定的其他情形。

二十四、基金托管人和基金管理人的更换

（一）基金托管人的更换

1、基金托管人职责终止的条件

有下列情形之一的，基金托管人职责终止：

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

2、基金托管人的更换程序

原基金托管人职责终止后，可由基金管理人指定新基金托管人，或者由基金份额持有人大会在六个月内选任新基金托管人。在新基金托管人产生前，基金管理人可指定临时基金托管人。

（1）提名：新任基金托管人由基金管理人或代表 10%以上基金份额的基金份额持有人提名。

（2）决议：基金份额持有人大会对更换基金托管人形成决议。

（3）临时基金托管人：新任基金托管人产生之前，可由基金管理人指定临时基金托管人。

（4）备案：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，由基金管理人报中国基金业协会备案。

（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。新任基金托管人与基金管理人核对基金资产总值和净值。

(6) 审计并通知: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,并将审计结果告知基金份额持有人,审计费用在基金财产中列支。

3、原基金托管人职责终止后,新基金托管人或临时基金托管人接受基金财产和基金托管业务前,原基金托管人和基金管理人需采取审慎措施确保基金财产的安全,不对基金份额持有人的利益造成损失,并有义务协助新基金托管人或临时基金托管人尽快交接基金资产。

(二) 基金管理人的更换

基金管理人更换的具体办法,由国务院证券监督管理机构依照托管人更换的原则制定。国务院证券监督管理机构对基金管理人更换的具体办法有规定的,从其规定,无规定的,参照上述基金托管人的更换原则进行。

二十五、清算程序

(一) 清算小组

1、自基金合同终止之日起 30 个交易日内成立清算小组。

2、清算小组成员由基金管理人、基金托管人等相关人员组成。清算小组可以聘用必要的工作人员。

3、清算小组负责基金清算资产的保管、清理、估价、变现和分配。清算小组可以依法以基金的名义进行必要的民事活动。

(二) 清算程序

1、基金合同终止后,由清算小组统一接管基金财产;

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、对基金财产进行分配。

(三) 清算费用

清算费用是指清算小组在进行基金财产清算过程中发生的所有合理费用,清算费用由清算小组优先从基金资产中支付。

(四) 基金财产清算过程中剩余资产的分配

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并分别扣除归基金管理人所有的应计提业绩报酬（如有）。

（五）清算未尽事宜

本合同中关于基金清算的未尽事宜以清算报告或基金管理人公告为准。

二十六、违约责任

（一）基金管理人、基金托管人、基金投资者在实现各自权利、履行各自义务的过程中，违反法律、行政法规的规定或者本合同约定，应当承担相应的责任；给基金财产或者本合同其他当事人造成的直接损失，应当分别对各自的行为依法承担赔偿责任。本合同能够继续履行的应当继续履行。但是发生下列情况，当事人可以免除相应的责任：

1、基金管理人和/或基金托管人按照有效的法律、行政法规或金融监管部门的规定作为或不作为而造成的损失等。

2、基金管理人由于按照本合同规定的投资原则而行使或不行使其投资权而造成的损失等。

3、基金托管人由于按照基金管理人符合本合同约定的有效指令执行而造成的损失等。

4、基金托管人对存放或存管在基金托管人以外机构的基金资产（包括但不限于投资其他证券投资基金、信托计划、证券公司资产管理计划、保险资产管理计划、期货资产管理计划、基金公司特定客户资产管理计划形成的基金资产），或交由商业银行、证券经纪机构、期货经纪机构等其他机构负责清算交收的委托资产（包括但不限于期货保证金账户内的资金、期货合约等）及其收益，因该等机构欺诈、疏忽、过失、破产等原因给委托资产带来的损失等。

5、基金管理人、基金托管人对由于第三方（包括但不限于交易所、中登公司、中国期货市场监控中心等）发送或提供的数据错误给本基金资产造成的损失等。

6、对于无法预见、无法抗拒、无法避免且在本合同签署之日后发生的不可抗力事件，导致合同当事人方无法全部履行或部分履行本合同的，任何一方当事人不承担违约责任。但

是一方因不可抗力不能履行本合同时，应及时通知另一方，并在合理期限内提供受到不可抗力影响的证明，同时采取适当措施防止基金资产损失扩大。任何一方当事人延迟履行合同义务后，发生了上述不可抗力事件致使合同当事人无法全部或部分履行本合同，该方不能减轻或免除相应责任。

7、基金投资者未能事前就其关联证券或其他禁止交易证券等投资者自身违法违规原因明确告知基金管理人，致使基金财产发生违规投资行为的，基金管理人及基金托管人均不承担任何责任。

(二) 在发生一方或多方违约的情况下，在最大限度地保护基金份额持有人利益的前提下，本合同能够继续履行的应当继续履行。非违约方当事人在职责范围内有义务及时采取必要的措施，防止损失的扩大。没有采取适当措施致使损失进一步扩大的，不得就扩大的损失要求赔偿。非违约方因防止损失扩大而支出的合理费用由违约方承担。

(三) 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基金投资者损失，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或减轻由此造成的影响。

(四) 基金托管人仅承担本合同约定的相关责任及义务，基金管理人不得对基金托管人所承担的责任进行虚假宣传，更不得以基金托管人名义或利用基金托管人商誉进行非法募集资金、承诺投资收益等违规活动。

(五) 一方依据本合同向另一方赔偿的损失，仅限于直接损失。

二十七、法律适用和争议的处理

有关本合同的签署和履行而产生的任何争议及对本合同项下条款的解释，均适用中华人民共和国法律法规（为本合同之目的，在此不包括香港、澳门特别行政区及台湾地区法律法规），并按其解释。

各方当事人同意，因本合同而产生的或与本合同有关的一切争议，合同当事人应尽量通过协商、调解途径解决。经友好协商未能解决的，应提交上海仲裁委员会金融仲裁院，根据该会届时有有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁的地点在上海市。仲裁费用由败诉方承担。

二十八、基金合同的效力

- (一) 当满足本基金合同约定生效的条件后，本合同生效。
- (二) 在本合同存续期间，基金份额持有人自全部提取基金份额之日起，不再是基金的投资者和本基金合同的当事人。
- (三) 本合同有效期为基金合同生效日至基金合同终止日。

二十九、其他事项

本合同如有未尽事宜，由合同当事人各方按有关法律法规和规定协商解决。

(以下无正文)

（请基金投资者务必确保填写的资料正确有效，如因填写错误导致的任何损失，基金管理人、基金托管人不承担任何责任）

基金投资者请填写：

（一）基金投资者

1、自然人

姓名：

证件名称：身份证、军官证、护照、港澳台回乡证或台胞证

证件号码：

联系地址：

联系电话：

电子邮箱：

2、机构

名称：

营业执照号码：

组织机构代码证号码：

法定代表人或负责人：

联系地址：

联系电话：

电子邮箱：

（二）基金投资者账户

基金投资者认购、申购基金的划出账户与赎回基金的划入账户，必须为以基金投资者名义开立的同一个账户。特殊情况导致认购、申购和赎回基金的账户名称不一致时，基金投资者应出具符合相关法律法规规定的书面说明并提供相关证明。账户信息如下：

账户名称：

账号：

开户银行名称：

(本页无正文, 为《东方港湾马拉松二号私募投资基金基金合同》签署页。)

基金投资者:

自然人(签字):

或 机构(盖章):

法定代表人或授权代表(签字):

签署日期: 年 月 日

基金管理人: 深圳东方港湾投资管理股份有限公司

法定代表人/执行事务合伙人或授权代表

签署日期: 年 月 日



基金托管人: 国泰君安证券股份有限公司

法定代表人或授权代表:

签署日期: 年 月 日



陈忠文

附件一：投资监督事项表

投资监督事项表

基金托管人根据本表对基金资产的投资范围、投资限制、止损线（如有）进行监督，但基金托管人不承担投资责任。

（一）投资范围

本基金的投资范围仅限于东方港湾马拉松一号私募投资基金, 闲置资金可投资于货币市场基金、现金及银行存款（含定期存款等）。

（二）投资限制

本基金参与申购新股，申报的金额不得超过本基金的总资产，申报的数量不得超过拟发行股票公司本次发行股票的总量。

（三）投资监督程序

1、场内交易：基金托管人在每个交易日（T日）后第二个交易日（T+2日）根据接收的交易清算数据对基金管理人每个交易日（T日）的场内交易进行审核。如发现基金管理人的投资运作存在违反《投资监督事项表》规定的越权行为时，基金托管人应及时以书面形式通知基金管理人进行纠正；基金管理人收到通知后及时核查，并以电话或书面形式向基金托管人进行解释或举证。

2、场外交易：基金托管人根据《投资监督事项表》规定，对基金管理人发送给基金托管人的场外清算划款指令进行审核，如果符合要求，则立即执行；如果发现基金管理人的投资行为不符合规定，则在指令未生效的情况下应立即提示基金管理人，并有权拒绝执行；如指令已生效，则基金托管人依指令进行划款，同时以书面形式通知基金管理人进行纠正。

（四）止损

本基金不设置止损线。