

合同编号：

**志强价值 1 号私募投资基金  
基金合同  
(202001)**

基金管理人：南京璟恒投资管理有限公司

基金托管人：招商证券股份有限公司

## 投资者承诺书

南京璟恒投资管理有限公司：

1、本人/本单位承诺符合《私募投资基金监督管理暂行办法》、《证券期货投资者适当性管理办法》、《基金募集机构投资者适当性管理实施指引（试行）》及其他法律法规、证监会规定的合格投资者标准，具有相应的风险识别能力和风险承受能力。本人/本单位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，本人/本单位应当及时书面告知基金管理人或代销机构。

2、本人/本单位承诺用于认购/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，不存在不合理的利益输送、关联交易及洗钱等情况，本人/本单位保证有完全及合法的权利委托基金管理人进行基金财产的投资管理，以及委托基金托管人进行基金财产的托管业务。

3、本人/本单位承诺已充分理解本基金合同全文，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，了解本基金的投资决策安排，愿意承担相应的投资风险。本人/本单位承认，基金管理人、基金托管人未对基金财产的收益状况做出任何承诺或担保。

4、本人/本单位承诺，基金管理人有权要求本人/本单位提供资产来源及用途合法性证明，对资产来源及用途及合法性进行调查，本人/本单位愿意配合。

5、本人/本单位承诺，本人/本单位在参与基金管理人发起设立的私募基金的投資过程中，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，与基金管理人及基金托管人无关。

承诺人（自然人）

（签字）

或：承诺人（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

## 投资者告知书

### 尊敬的投资者：

本基金通过直销机构(基金管理人)和基金管理人委托的代销机构进行销售。基金投资者认购或申购本基金，以人民币货币资金形式交付，在直销机构认购或申购的投资者须将认购资金从在中国境内开立的自有银行账户划款至募集账户，在代销机构认购或申购的投资者按代销机构的规定缴付资金。

募集账户仅用于本基金募集期间和存续期间认购、申购和赎回资金的归集与支付。募集账户是由募集账户监督机构代基金管理人开立，用于本基金募集期间和存续期间所有销售渠道的认购、申购和赎回资金收付的专用账户，并不代表募集账户监督机构接受投资者的认购、申购资金，也不表明募集账户监督机构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。在募集账户的使用过程中，除非有足够的证据证明是因募集账户监督机构的原因造成的损失外，基金管理人应就其自身操作不当等原因所造成的损失承担相关责任，募集账户监督机构对于基金管理人的投资运作不承担任何责任。

募集账户信息如下：

账户名：招商证券股份有限公司基金运营外包服务募集专户

账号：41190006851050003000270

开户行：招商银行股份有限公司深圳水榭花都支行

大额行号：308584001694

本人/机构已认真阅读《投资者告知书》，清楚认识并认可关于募集账户的上述告知内容，并愿意自行承担由此可能导致的一切风险和损失。

**基金投资者（自然人）**

（签字）

**或：基金投资者（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

一、前言.....	2
二、释义.....	2
三、声明与承诺.....	4
四、基金的基本情况.....	5
五、基金的募集.....	7
六、基金的成立与备案.....	10
七、基金的申购、赎回与转让.....	11
八、当事人及权利义务.....	17
九、基金份额持有人大会及日常机构.....	22
十、基金份额的登记.....	26
十一、基金的投资.....	27
十二、基金的财产.....	30
十三、指令的发送、确认与执行.....	31
十四、交易及清算交收安排.....	34
十五、越权交易.....	36
十六、基金财产的估值和会计核算.....	38
十七、基金的费用与税收.....	45
十八、基金的收益分配.....	49
十九、基金的信息披露与报告.....	50
二十、风险揭示.....	53
二十一、基金份额的非交易过户和冻结、解冻及质押.....	62
二十二、基金合同的成立、生效及签署.....	62
二十三、基金合同的效力.....	63
二十四、基金合同的变更、解除与终止.....	64
二十五、基金的清算.....	65
二十六、违约责任.....	66
二十七、通知与送达.....	67
二十八、法律适用和争议的处理.....	68
二十九、其他事项.....	68

## 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《私募办法》）、《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》、《私募投资基金信息披露管理办法》和《私募投资基金合同指引 1 号》（契约型私募基金合同内容与格式指引）及其他法律法规的有关规定。

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

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。本合同的当事人包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人。基金合同的当事人按照《基金法》、本合同及其他有关法律法规规定享有权利、承担义务。

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：《志强价值 1 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、招募说明书（如有）：指基金管理人按照国家有关法律、法规制定的并向基金投资者发售基金时，为其提供的、对基金情况进行说明的文件。

3、本基金：志强价值 1 号私募投资基金。

4、私募基金（简称“基金”）：指在中华人民共和国境内，以非公开方式向合格投资者募集资金设立的投资基金。

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

6、私募基金管理人（简称“基金管理人”、“管理人”）：南京璟恒投资管理有限公司。

7、私募基金托管人（简称“基金托管人”、“托管人”）：招商证券股份有限公司。

8、私募基金份额持有人（简称“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。

9、私募基金服务机构（简称“服务机构”）：接受基金管理人委托，根据与其签订的金融运营服务协议中约定的服务范围，为本基金提供份额登记业务、基金估值核算业务等服务的机构，本基金的服务机构为招商证券股份有限公司。

10、募集账户监督机构：按照相关法律规定及与管理人约定的监督内容，对其开立的募集结算资金专用账户实施有效监督，保障直销模式募集结算资金划转安全的机构，本基金的募集账户监督机构为招商证券股份有限公司。为避免歧义，对于管理人采取直销、代销两种募集方式或仅采取代销募集方式的基金，募集账户监督机构监督业务范围不包括代销机构归集投资者募集资金、向投资者划付其收益、赎回款项及剩余基金财产以及代销机构与募集账户监督机构开立的募集结算资金专用账户间的资金划转等行为的监督，前述代销机构行为涉及的资金划转安全保障职责按照代销相关法律法规及协议约定由相应主体承担责任。

11、中国证券投资基金业协会（简称“中国基金业协会”）：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、工作日：上海证券交易所、深圳证券交易所、上海期货交易所、大连商品交易所、郑州商品交易所、中国金融期货交易所的正常交易日。

13、开放日：基金管理人办理基金申购和/或赎回业务的工作日。

14、T日：本基金的开放日，包括临时开放日。

15、T+n日：T日后的第n个工作日，当n为负数时表示T日前的第n个工作日。

16、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。

17、募集账户：指“招商证券股份有限公司基金运营外包服务募集专户”，是由募集账户监督机构代基金管理人开立，用于本基金募集期间和存续期间所有销售渠道的认购、申购和赎回资金收付的专用账户。募集账户并不代表募集账户监督机构接受投资者的认购或申购资金，也不表明募集账户监督机构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。在募集账户的使用过程中，除非有足够的证据证明是因募集账户监督机构的原因造成的损失外，基金管理人应就其自身操作不当等原因所造成的损失承担相关责任，募集账户监督机构对于基金管理人的投资运作不承担任何责任。

18、托管资金专门账户（简称“托管资金账户”）：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。

19、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（或基金管理人）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。

20、证券交易资金账户：基金管理人为基金财产在证券经纪机构下属的证券营业部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。证券交易资金账户按照“第三方存管”模式与托管资金账户建立一一对应关系，由基金托管人通过银证转账的方式完成资金划付。

21、期货账户：基金管理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。期货保证金账户应与托管资金账户建立一一对应关系，基金托管人可通过银期转账或手工出入金的方式办理期货交易的出入金。

22、基金资产总值：本基金拥有的各类有价证券、银行存款本息及其他资产的价值总和。

23、基金资产净值：本基金资产总值减去负债后的价值。

24、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。

25、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。

26、募集期：指本基金的初始销售期限。

27、存续期：指本基金成立至清算之间的期限。

28、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。

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

30、赎回：指在基金开放日，基金投资者按照本合同的规定将本基金份额兑换为现金的行为。

31、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。

### 三、声明与承诺

#### （一）私募基金管理人的声明与承诺

1、私募基金管理人保证在募集资金前已在中国基金业协会登记为私募基金管理人【管理人登记编码：P1001755】。

2、私募基金管理人声明，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。

3、私募基金管理人保证已在签订本合同前揭示了相关风险；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。

4、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，不对基金活动的盈利性和最低收益作出承诺。

#### （二）私募基金托管人的声明与承诺

私募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，并履行合同约定的其他义务。

#### （三）私募基金投资者的声明与承诺

1、私募基金投资者声明其为符合《私募办法》规定的合格投资者，保证财产的来源及用途符合国家有关规定，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。

2、私募基金投资者承诺其向私募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。

3、前述信息资料如发生任何实质性变更，应当及时告知私募基金管理人或代销机构；

4、私募基金投资者知晓，私募基金管理人、私募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。

### 四、基金的基本情况

（一）基金的名称：志强价值 1 号私募投资基金。

（二）基金的运作方式：开放式。

（三）基金的投资目标和投资范围：

通过合理的股票、股票组合和股票、现金组合，达到熊市跑赢指数，牛市跟随指数的效果。在尽量控制市值回撤幅度的情况下，为投资者带来安心及稳定的回报。

投资范围请参见合同第十一章“基金的投资”。

(四) 基金的存续期限:

本基金自成立之日起计算的 20 年为固定存续期限, 20 年后的对应月对应日的前一天即为到期日, 如到期日为非工作日的, 非工作日后的第 1 个工作日视为到期日。

(五) 基金份额的初始募集面值: 人民币 1.00 元。

(六) 基金份额分类

本基金按照投资者的身份条件、管理费和业绩报酬的不同分为两个类别, 即 A 类基金份额和 B 类基金份额。两类份额分别设有不同的代码, 分开募集, 合并运作。

1、基金份额的分类

本基金分为 A 类基金份额和 B 类基金份额, 由管理人在基金投资者认购/申购基金份额时根据其属性确定其基金份额类别。

基金份额类别	身份认定	管理费率	业绩报酬
A	除 B 类以外的其他合格投资者	管理费率: 1.5%	分红、赎回及终止时提取 20% (详见第十七章)
B	本基金管理人、管理员工、管理人发行或担任投资顾问的资管产品	不收取	不收取

2、基金份额配比

本基金存续期内, A 类份额和 B 类份额没有固定的比例关系。

3、基金份额的参考净值计算

在产品存续期间, 基金管理人在基金份额净值计算的基础上, 计算不同类别基金份额净值。

(七) 基金的托管事项: 本基金财产由基金托管人进行托管。本基金托管人为招商证券股份有限公司。

(八) 基金的服务事项: 基金管理人委托招商证券股份有限公司作为本基金的服务机构, 招商证券股份有限公司在中国基金业协会登记的服务业务登记编码为 A00001。

**特别提示:** 本基金的托管人以及服务机构均由招商证券股份有限公司担任, 招商证券股份有限公司在本基金实际运作中已将其托管职能和基金服务职能进行分离, 能够按照法律法规的要求采取有效措施恰当的识别、管理、监控潜在的利益冲突。

服务机构如果以独资或者控股方式成立具有独立法人资格的从事基金服务业务的公司, 经基金管理人同意, 可由该新设立的基金服务业务公司作为本基金新的服务机构, 本合同各方无须就服务机构主体变更事项重新签署基金合同, 基金管理人将按照本合同约定的通知方式向基金份额持有人披露变更的具体内容。

(八) 基金的预警与止损:

为保护基金份额持有人的利益, 本基金将基金份额净值为 0.80 元设置为预警线, 将基金份额净值为 0.70 元设置为止损线。

当基金份额净值低于或等于预警线 0.80 元时 (该交易日称为 “R 日”), 管理人应主动对本基金所持有的投资标的采取以下风险控制措施: 在 R+2 日开始并在十个工作日内使本基金所持有的现金类资产比例不低于总值的 50% (以成本价计算), 直至基金份额净值恢复至预警线以上。如遇因持有流通受限证券等原因导致本基金财产无法及时变现的, 则变现时间顺延。

当基金份额净值低于或等于止损线 0.70 元 (该交易日称为 “D 日”) 时, 管理人在 D+2 日开始止损操作, 并在三个工作日内将持仓标的或衍生品平仓变现。该平仓操作不可逆, 在所持全部非现金类资产变现前不可停止。对于已变现部分, 根据本合同第二十五章的清算程序对基金进行清算。如遇因持有流通受限证券等原因导致本基金财产无法及时变现的, 则变现时间顺延, 待全部变现完成之日, 管理人进行二次清算。

基金的预警和止损由基金管理人负责执行, 如基金管理人:

(1) 按照或者未按照基金合同的约定采取风险控制措施和进行止损;

(2) 因管理人或其选择的经纪商未能及时提供估值所需相关数据进而导致基金份额净值无法计算而延误止损操作。

由于上述情况对基金财产或基金份额持有人造成的损失, 基金托管人不承担责任。

## 五、基金的募集

(一) 基金的募集期限、募集机构、募集对象和募集方式

1、募集期限

本基金的募集期限由基金管理人根据相关法律法规以及本合同的规定确定。基金管理人有权根据本基金销售的实际情况按照相关程序延长或缩短初始销售期, 此类变更适用于所有募集机构。延长或缩短募集期的相关信息将及时发布通知, 即视为履行完毕延长或缩短募集期的程序。

2、募集机构

本基金募集机构包括私募基金管理人 (直销机构)、基金管理人委托的在中国证监会注册取得基金销售业务资格并已成为中国证券投资基金业协会会员的机构 (代销机构)。

### 3、募集方式

本基金通过直销机构（基金管理人）和/或基金管理人委托的代销机构进行募集。本基金募集机构及其从业人员以非公开方式向投资者募集资金。

### 4、募集对象

本基金仅向符合《私募办法》规定的合格投资者发售。合格投资者包括“普通合格投资者”和“特殊合格投资者”。

“普通合格投资者”包括具备相应风险识别能力和风险承担能力，投资于单只私募基金的金额不低于 100 万元且符合下列相关标准的单位和个人：(1) 净资产不低于 1000 万元的单位；(2) 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 万元的个人。前款所称金融资产包括银行存款、股票、债券、基金份额、资产管理计划、银行理财产品、信托计划、保险产品、期货权益等。

“特殊合格投资者”包括下列投资者：(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) 依法设立并在中国基金业协会备案的投资计划；(3) 投资于所管理私募基金的私募基金管理人及其从业人员；(4) 中国证监会规定的其他投资者。

#### (二) 募集账户信息

募集账户仅用于本基金募集期间和存续期间认购、申购和赎回资金的归集与支付。募集账户是由募集账户监督机构代基金管理人开立，用于本基金募集期间和存续期间所有销售渠道的认购、申购和赎回资金收付的专用账户，并不代表募集账户监督机构接受投资者的认购、申购资金，也不表明募集账户监督机构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。

募集账户信息如下：

账户名：招商证券股份有限公司基金运营外包服务募集专户

账号：41190006851050003000270

开户行：招商银行股份有限公司深圳水榭花都支行

大额行号：308584001694

募集账户监督机构：招商证券股份有限公司

#### (三) 基金份额的认购事项

基金投资者认购本基金，以人民币货币资金形式交付。基金不接受现金方式认购，在直销机构认购的投资者须将认购资金从在中国境内开立的自有银行账户划款至募集账户，在代销机构认购的投资者按代销机构的规定缴付资金。

### 1、基金份额持有人的人数上限

本基金向合格投资者募集，合格投资者人数累计不得超过二百人。

### 2、基金份额的认购费用

投资者在本基金初始销售期认购本基金按照以下公式支付认购费：

(1) 净认购金额= 认购金额/ (1+认购费率)；

(2) 认购费用= 认购金额-净认购金额；

其中认购费率为 1%。认购费归募集机构所有。

### 3、认购申请的确认

认购申请受理完成后，不得撤销。募集机构受理认购申请并不表示对该申请成功的确认，而仅代表募集机构确实收到了认购申请。认购的确认以管理人的确认结果为准。若认购不成功，基金投资者已交付的款项将于基金成立后五个工作日内，无利息地退还基金投资者银行账户。

本基金的人数规模上限为 200 人。基金管理人在募集期间每个工作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。超出基金人数规模上限的认购申请为无效申请。

通过代销机构进行认购的，人数规模控制以基金管理人和代销机构约定的方式为准。

### 4、认购份额的计算方式

认购份额=净认购金额/认购份额初始面值。

认购份额保留到小数点后 2 位，小数点后第 3 位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

### 5、初始销售期间投资者资金的管理及利息处理方式

募集机构应当将基金初始销售期间投资者的资金存入募集账户，在基金初始销售行为结束前，任何机构和个人不得动用。基金成立前，认购款在募集账户产生的利息归入基金财产，利息金额按中国人民银行同期活期存款利率计息。

#### (四) 基金份额认购金额及付款期限

投资者在募集期间的认购金额应不低于 100 万元人民币（不含认购费，且本合同“募集对象”中的“特殊合格投资者”不受此限），并可在管理人规定的募集期限分多次缴款，募集期间每次追加认购金额应不低于 10 万元人民币。

#### (五) 投资冷静期

基金投资者自签署本基金合同且全额缴纳认购份额款项后二十四小时内为本基金的认

购投资冷静期，募集机构在投资冷静期内不得主动联系基金投资者。但是，“特殊合格投资者”、专业投资机构、受国务院金融监督管理机构监管的金融产品不适用投资冷静期的限制。

#### （六）回访制度

在中国基金业协会正式要求私募基金的募集机构实施《募集行为管理办法》规定的回访制度之前，本基金直销机构暂不实施该回访制度，代销机构可自行决定是否实施该回访制度。

在中国基金业协会正式要求私募基金的募集机构实施《募集行为管理办法》规定的回访制度之后，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。未经回访确认成功，投资者缴纳的认购基金款项不得由募集账户划转到托管资金账户，基金管理人不得投资运作投资者缴纳的认购基金款项。但是，“特殊合格投资者”、专业投资机构、受国务院金融监督管理机构监管的金融产品不适用本回访制度。在此情况下，基金管理人有权根据回访制度的实施需要而变更本合同项下的相关条款，但应提前通知基金投资者，对基金投资者履行告知义务。

## 六、基金的成立与备案

#### （一）基金合同签署的方式

投资者认购本基金，应当在与募集机构完成合格投资者确认程序后通过纸质合同和/或电子合同的方式签署本基金合同。

#### （二）基金的成立

本基金募集期结束后，将全部募集资金划入托管资金账户，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，基金成立。

基金管理人于基金成立时发布基金成立通知。

基金托管人的职责自基金成立后开始。

#### （三）募集失败的处理方式

募集期限届满，本基金未能成立的，基金管理人应当：

- 1、以其固有财产承担因销售行为而产生的债务和费用。
- 2、在募集期限届满后 30 日内返还基金投资者已缴纳的款项，并加计不低于银行同期活期存款利息。

#### （四）基金的备案

基金管理人在基金募集完毕后 20 个工作日内，向中国基金业协会履行基金备案手续。

本基金在中国基金业协会完成备案后方可进行投资运作。基金投资者可在本基金完成备案之后通过中国基金业协会网站查询本基金公示信息。

## 七、基金的申购、赎回与转让

### （一）申购和赎回的开放日及时间

基金投资者可在本基金开放日根据本合同相关约定申购和/或赎回本基金，但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或本合同的规定发布暂停申购和/或赎回通知时除外。基金投资者须在开放日或开放日之前的工作日的 9:00-15:00 内根据募集机构的规定向募集机构及其销售网点提交书面申请文件（如募集机构另有规定的，遵循募集机构相关规定办理申请提交事宜）。未提交书面申请文件的，募集机构及其销售网点有权拒绝投资者的申购或赎回申请。若法律法规、中国证监会、中国基金协会有新的规定或出现其他特殊情况，基金管理人将视情况对开放时间进行相应调整并进行通知。

本基金的开放日为每自然周周一（遇节假日顺延至下一个工作日）。管理人可根据实际情况增设临时开放日（每个自然年度原则上不超过 8 个工作日，且临时开放日的设置原则上不得使基金出现连续 2 个工作日开放，管理人有权在基金运营及技术条件支持等情况下进行调整），具体开放日期以管理人通知为准。

### （二）申购和赎回的办理机构

本基金运作期间的募集机构包括直销机构（基金管理人）和/或基金管理人委托的代销机构。

基金投资者应当在募集机构办理基金销售业务的营业场所或按募集机构提供的其他方式办理基金份额的申购和赎回。基金管理人可根据情况变更或增减基金代销机构，并予以通知。

### （三）申购的出资方式

本基金的申购以人民币货币资金形式交付，基金不接受现金方式申购。

在直销机构申购的投资者应在申购有效期内将申购资金从在中国境内开立的自有银行账户划款至募集账户，在代销机构申购的投资者按代销机构的规定缴付资金。

### （四）申购和赎回的方式、价格及程序

1、基金投资者申购基金时，按照申购申请所对应开放日的各类基金份额净值为基准计算基金份额。基金份额持有人赎回基金时，按照赎回申请所对应开放日的各类基金份额净值

计算赎回金额。

2、“未知价”原则，即基金的申购价格、赎回价格以开放日收市后计算的各类基金份额净值为基准进行计算。

3、基金申购采用金额申请的方式，基金赎回采用份额申请的方式。

4、基金份额持有人赎回基金时，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。

5、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-10日至T-1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等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，则管理人有权拒绝该投资者在本开放日的申购申请。

2) 基金份额持有人拟于开放日(T日)赎回基金时，应于T-10日至T-1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等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。若基金投资者未在上述要求时间内赎回预约登记成功，则管理人有权拒绝该基金份额持有人在本开放日的赎回申请。

(2) 代销预约程序

基金投资者通过代销机构申购、赎回本基金时，预约程序以基金管理人和代销机构约定的方式为准。

(五) 申购和赎回申请的确认

在正常情况下，基金管理人在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，则申购款项退还给投资者。

募集机构对申购、赎回的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表募集机构确实接收到申请。申购、赎回的确认以基金管理人的确认结果为准。

(六) 申购和赎回的金额限制

基金投资者首次申购金额应不低于100万元人民币(不含申购费，且本合同“募集对象”中的“特殊合格投资者”不受此限)，对于已持有私募基金份额的投资者在开放日内追加申购的，追加金额应不低于10万元人民币。

基金份额持有人持有的基金资产净值高于100万元时，可以选择部分赎回基金份额，基金份额持有人在赎回后持有的基金资产净值不得低于100万元，基金份额持有人申请赎回基金份额时，其持有的基金资产净值低于100万元的，必须选择一次性赎回全部基金份额，基金份额持有人没有一次性全部赎回持有份额的，管理人将该基金份额持有人所持份额做全部赎回处理。本合同“募集对象”中的“特殊合格投资者”不适用于上述规定的赎回金额限制。

#### （七）申购和赎回的费用

##### 1、申购费用

投资者在本基金存续期申购本基金按照以下公式支付申购费：

（1）净申购金额= 申购金额/（1+申购费率）；

（2）申购费用= 申购金额-净申购金额；

其中申购费率为1%。申购费归募集机构所有。

##### 2、赎回费用

**本基金各类别的份额按照下述方式收取赎回费：**

赎回费=（赎回份数×赎回价格-业绩报酬（如有））×赎回费率

赎回价格为赎回申请所对应开放日各类别基金份额的份额净值。

若基金份额持有时间少于6个月，赎回费率1.5%；若基金份额持有时间大于等于6个月，赎回费率0%。

赎回费率根据基金份额实际持有时间计算（算头不算尾）。其中，基金份额持有人认购基金，持有时间从基金成立日起计算至赎回申请所对应开放日；基金份额持有人申购基金，持有时间从申购申请所对应开放日起计算至赎回申请对应开放日；每月按30个自然日计算。管理人可在运作期下调赎回费率，具体以基金管理人通知为准。

基金份额持有人赎回费归管理人所有。

#### （八）申购份额与赎回金额的计算方式

##### 1、申购份额计算

申购份额=净申购金额/申购价格。

申购价格为申购申请所对应开放日各类别基金份额的份额净值。

若基金份额申购时所对应的份额类别无历史份额净值时，则以基金面值1.0000元作为申购价格；若基金份额申购时所对应的份额类别已经全部赎回，且有历史份额净值时，则以该份额类别历史最后一笔份额赎回时的份额净值作为申购价格。

申购份额保留到小数点后2位，小数点后第3位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

## 2、赎回金额计算

赎回金额=赎回份数×赎回价格-赎回费-业绩报酬（如有）

赎回价格为赎回申请所对应开放日各类别基金份额的份额净值。

赎回金额保留到小数点后 2 位，小数点后第 3 位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

### （九）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）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；

（2）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；

（3）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；

（4）法律法规规定或经中国证监会认定或本合同约定的其他情形。

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基金投资者的申购：

（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）证券交易场所交易时间临时停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值的情形；

（3）本基金的证券/期货经纪商没有或未及时发送交易清算数据或对账数据、发送的交易清算数据或对账数据不完整或有误，导致无法或未能及时计算当日基金资产净值的情形；

（4）对于没有或未及时获取场外交易数据或场外行情数据、场外交易数据或场外行情数据不完整或有误，导致无法或未能及时计算当日基金资产净值的情形；

（5）发生本合同规定的暂停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。

基金管理人决定暂停接受全部或部分申购申请时，应当以约定的形式告知基金投资者。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以约定的形式告知基金投资者。

3、在如下情形下，基金管理人可以暂停基金份额持有人的赎回：

- (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) 证券交易场所交易时间临时停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值的情形；
- (3) 本基金的证券/期货经纪商没有或未及时发送交易清算数据或对账数据、发送的交易清算数据或对账数据不完整或有误，导致无法或未能及时计算当日基金资产净值的情形；
- (4) 对于没有或未及时获取场外交易数据或场外行情数据、场外交易数据或场外行情数据不完整或有误，导致无法或未能及时计算当日基金资产净值的情形；
- (5) 发生本合同规定的暂停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。

发生上述情形之一且基金管理人决定暂停赎回的，基金管理人应当以约定的形式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，其余部分在后续工作日予以支付。

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约定的形式告知基金份额持有人。

#### (十) 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，本基金需处理的基金净赎回申请份额超过本基金上一工作日基金总份额的10%时，即认为本基金发生了巨额赎回。

##### 2、巨额赎回的处理方式

当出现巨额赎回时，基金管理人可以根据本基金的资产组合状况决定全额赎回或部分顺延赎回。

(1) 全额赎回：当基金管理人认为有能力支付投资人的全部赎回款项时，按正常赎回程序执行。

(2) 部分顺延赎回：当基金管理人认为投资人的赎回申请有困难或认为支付投资人的赎回申请可能会对基金的资产净值造成较大波动时，基金管理人应当在接受赎回比例不低于基金总份额的10%的前提下，对其余赎回申请延期予以办理。对于单个基金份额持有人的赎回申请，应当按照其申请赎回份额占当日申请赎回总份额的比例，确定该单个基金份额持有人当日办理的赎回份额；基金持有人未能赎回部分，除基金持有人在提交赎回申请时选择将当

日未获办理部分予以撤销或在下一个开放日前5个工作日予以撤销外，延迟至下一个开放日办理，赎回资金的计算应以下一个开放日的各类基金单位净值为基础。依照上述规定转入下一个开放日的赎回不享有赎回优先权，并以此类推，直到全部赎回为止。部分顺延赎回不受单笔赎回最低金额的限制。

### 3、巨额赎回的公告

当发生巨额赎回并顺延赎回时，基金管理人可通过邮寄、传真、电话或网上公告等方式在2个工作日内通知申请赎回的基金持有人和基金托管人，说明有关处理方法。

#### (十一) 基金份额的转让

在不违反法律法规及监管部门的相关规定的前提下，基金份额持有人可向其他合格投资者转让基金份额。基金份额转让须按照中国基金业协会要求进行份额登记。转让期间及转让后，持有基金份额的合格投资者数量合计不得超过法定人数。

#### 1、基金份额转让的报备

(1) 基金投资者拟将其份额转让给其他人的，需经基金管理人同意，并按基金管理人的要求向基金管理人履行报备义务，由基金管理人负责审核受让方是否符合相关法律法规及基金合同规定的合格投资者条件。若基金投资者和受让方未对转让事宜向基金管理人进行报备的，基金管理人将按照原基金份额持有人持有份额进行收益分配。

(2) 在报备时由基金管理人负责对受让方的风险识别能力和风险承担能力进行评估，并向受让方揭示基金投资风险。若经审查受让方不符合合格投资者条件，或由于本次转让可能导致基金投资者人数超过 200 人的，基金管理人有权拒绝本次转让。

(3) 对于在受让前未持有该基金份额的投资者，其首次受让的基金份额所对应的资产总值不低于 100 万元。

(4) 基金管理人在接收报备的 10 个工作日内通知基金份额登记机构，并安排基金投资者与受让方签订《私募投资基金份额转让协议》（下称“转让协议”）。

#### 2、基金份额转让的变更登记

(1) 基金投资者应在转让协议签订之日起 10 个工作日内，向基金管理人申请办理基金份额的转让变更登记手续，并提供以下材料：

- 1) 各方签署的份额转让协议；
- 2) 基金投资者向基金管理人申请进行基金份额转让报备的文件；
- 3) 转让方身份证明文件（机构为营业执照；个人为身份证）；
- 4) 受让方身份证明文件（机构为营业执照；个人为身份证）；

5) 具体经办人身份证明文件及授权委托书。

(2) 基金管理人在收到上述申请文件后3个工作日内, 统一向基金份额登记机构申请办理基金份额变更登记手续, 并将上述申请文件的扫描件作为附件连同管理人同意基金投资者进行份额转让的情况说明一并提供, 由基金份额登记机构进行形式审核无误后, 配合办理基金份额变更登记手续。

(3) 基金份额转让相关交易及变更登记申请文件的真实性由基金管理人负责审核确认。基金份额登记机构只对收到的申请文件进行形式审查。基金份额登记机构对收到的申请文件完成形式审查, 即有充分理由信赖本次基金份额转让的真实性。若因当事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份额登记机构审核或给任何第三人带来损失, 基金份额登记机构不承担任何形式的责任。

(4) 自本次基金份额转让完成变更登记之日起, 受让人即成为基金份额持有人, 根据基金合同拥有相关权利并承担相关义务。

## 八、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。基金份额持有人的详细情况在合同签署页列示。本基金设定为均等份额。除基金合同另有约定外, 每份份额具有同等的合法权益。

2、基金份额持有人的权利

- (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) 根据基金合同的约定, 参加或申请召集基金份额持有人大会, 行使相关职权;
- (5) 监督基金管理人履行投资管理及基金托管人履行托管义务的情况;
- (6) 按照本合同约定的时间和方式获得基金的信息披露资料;
- (7) 因基金管理人、基金托管人违反法律法规或基金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、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) 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；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，但符合本合同“募集对象”中的“特殊合格投资者”的除外；
- (3) 认真阅读并签署风险揭示书；
- (4) 保证其经办人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；
- (5) 按照基金合同约定缴纳基金份额的认购、申购款项，承担基金合同约定的管理费、托管费及其他相关费用；
- (6) 按基金合同约定承担基金的投资损失；
- (7) 向基金管理人或基金代销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代销机构的尽职调查与反洗钱工作；
- (8) 保守商业秘密，不得泄露基金的投资计划或意向等；
- (9) 不得违反本基金合同的约定干涉基金管理人的投资行为；
- (10) 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基金及基金托管人托管的其他基金合法权益的活动；
- (11) 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；
- (12) 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、基金管理人概况

名称：南京璟恒投资管理有限公司

住所：南京市鼓楼区山西路 8 号金山大厦 B 楼 8E

通讯地址：南京市鼓楼区山西路 8 号金山大厦 B 楼 8E

法定代表人：李志强

联系人：肖兵

联系电话：025-51861190

传真：025-51863487

## 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（如有）；
- (3) 按照有关规定和基金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基金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) 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；
- (6) 以基金管理人的名义，代表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；
- (7) 自行销售或者委托有基金销售资格的机构销售基金，制定和调整有关基金销售的业务规则，并对销售机构的销售行为进行必要的监督；
- (8) 国家有关法律法规、监管机构及本合同规定的其他权利。

## 3、基金管理人的义务

- (1) 履行基金管理人登记和基金备案手续；
- (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基金份额登记机构，委托其他基金份额登记机构办理注册登记业务时，对基金份额登记机构的行为进行必要的监督；
- (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) 根据相关法规及基金合同的约定，向基金托管人提供基金交易数据、投资文件及基金其他相关数据与文件，并确保提供材料的合法、真实、完整和有效；

(11) 按照基金合同约定负责基金会计核算并编制基金财务会计报告；

(12) 按照基金合同约定计算并向基金份额持有人报告基金份额净值；

(13) 根据法律法规和本基金合同的规定，对基金份额持有人进行必要的信息披露，揭示基金资产运作情况，包括编制和向基金份额持有人提供基金定期报告；

(14) 确定基金份额申购、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基金合同的约定；

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

(16) 保存基金投资业务活动的全部会计资料，并妥善保管有关的合同、交易记录及其他相关资料，保存期限自基金清算终止之日起不得少于 10 年；

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

(18) 按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；

(19) 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；

(20) 建立并保存投资者名册；

(21) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国基金业协会并通知基金托管人和基金投资者。

(22) 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、基金托管人概况

名称：招商证券股份有限公司

住址：深圳市福田区福田街道福华一路 111 号

通讯地址：深圳市福田区福田街道福华一路 111 号

法定代表人：霍达

联系电话：0755-86157588

传真：0755-82960794

网址：www.newone.com.cn

#### 2、基金托管人的权利

(1) 按照本基金合同的约定，及时、足额获得基金托管费用；

(2) 依据法律法规规定和基金合同约定，监督基金管理人对其基金财产的投资运作，对于基金管理人违反法律法规规定和基金合同约定、对基金财产及其他当事人的利益造成重大损失的情形，有权报告中国基金业协会并采取必要措施；

(3) 按照本基金合同的约定，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。

### 3、基金托管人的义务

(1) 安全保管基金财产；

(2) 具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格专职人员，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和本基金合同的约定外，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的托管资金账户、证券账户（一码通账户）等投资所需账户；

(6) 复核基金份额净值；

(7) 办理与基金托管业务有关的信息披露事项；

(8) 根据相关法律法规和基金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) 按照本基金合同的约定，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) 按照法律法规规定，妥善保存基金管理业务活动有关合同、凭证等文件资料；

(11) 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；

(12) 保守商业秘密，除法律法规规定和本基金合同约定外，不得向他人泄露本基金的有关信息；

(13) 根据相关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；

(14) 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、及本基金合同约定的，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

效的投资指令违反法律法规、及本基金合同约定的，应当立即通知基金管理人；

- (15) 按照基金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、监管机构及本合同规定的其他义务。

## 九、基金份额持有人大会及日常机构

基金份额持有人大会由基金份额持有人组成，基金份额持有人的合法授权代表有权代表基金份额持有人出席会议并表决。基金份额持有人大会不得直接参与或者干涉基金的投资管理活动。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。

本基金份额持有人大会不设日常机构。

(一) 基金份额持有人大会的召开事由

1、当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会：

- (1) 延长基金合同期限；
- (2) 提前终止基金合同；
- (3) 更换基金管理人、基金托管人、基金管理人提请聘用或更换投资顾问；
- (4) 转换基金运作方式（法律法规和中国证监会另有约定的除外）；
- (5) 提高基金管理人、基金托管人、投资顾问的报酬标准（法律法规和中国证监会另有约定的除外）；
- (6) 变更基金投资目标、投资策略（法律法规和中国证监会另有约定的除外）；
- (7) 变更基金份额持有人大会程序；
- (8) 基金管理人或基金托管人要求召开基金份额持有人大会；
- (9) 单独或合计持有本基金总份额 20%以上（含 20%）基金份额的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会；
- (10) 基金合同约定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项；
- (11) 法律法规、监管部门规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。

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。

2、以下事项可由基金管理人自行决定，不需召开基金份额持有人大会：

- (1) 调低基金管理人的管理费、业绩报酬、申购赎回费、销售服务费的费率及比例；

- (2) 投资经理的变更;
  - (3) 对本基金的认购、申购业务规则 (包括但不限于总规模、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;
  - (4) 基金合同约定的其他事项;
  - (5) 法律法规、监管部门规定可以由基金管理人自行决定的事项。
- 3、以下事项可由基金管理人和基金托管人协商后修改, 不需召开基金份额持有人大会:
- (1) 调低基金托管人及服务机构的费用报酬标准;
  - (2) 因相应的法律法规或监管机构对本合同内容与格式要求发生变动而应当对基金合同进行变更;
  - (3) 对本合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及本合同当事人权利义务关系发生变化;
  - (4) 基金合同约定的其他事项;
  - (5) 法律法规、监管部门规定可由基金管理人和基金托管人协商决定的其他事项。
- 4、除上述 1-3 项规定的事项之外, 基金管理人有权决定是否召开基金份额持有人大会审议。

## (二) 会议召集人及召集方式

- 1、除法律法规规定或本合同另有约定外, 基金份额持有人大会由基金管理人召集。
- 2、代表基金份额 20% 以上 (含 20%) 的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会, 应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集, 并书面告知提出提议的基金份额持有人代表。基金管理人决定召集的, 应当自出具书面决定之日起 30 日内召开; 基金管理人决定不召集, 代表基金份额 20% 以上 (含 20%) 的基金份额持有人有权自行召集。基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的, 应于会议召开前 10 个工作日通知基金管理人, 基金管理人有权出席基金份额持有人大会, 基金份额持有人应当予以配合, 不得阻碍基金管理人出席基金份额持有人大会。
- 3、基金份额持有人会议的召集人负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

## (三) 召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

- 1、召开基金份额持有人大会, 召集人最迟应于会议召开前 10 个工作日通知全体基金份额持有人, 基金份额持有人大会通知应至少载明以下内容:
  - (1) 会议召开的时间、地点和出席方式;
  - (2) 会议拟审议的主要事项、议事程序和表决方式;

- (3) 有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日；
- (4) 授权委托书的内容要求（包括但不限于授权代表身份、代理权限和代理有效期限等）、送达的期限、地点；
- (5) 会务联系人姓名、电话及其他联系方式；
- (6) 出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；
- (7) 召集人需要通知的其他事项。

2、采取通讯方式开会并进行表决的情况下，由会议召集人决定通讯方式和书面表决方式，并在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、书面表决意见的寄交截止时间和收取方式。

#### （四）基金份额持有人出席会议的方式

基金份额持有人大会可通过现场开会方式、通讯开会方式或法律法规及监管部门允许的其他方式召开，会议的召开方式由会议召集人确定。

1、现场开会。由基金份额持有人亲自或委派授权代表出席，现场开会时基金管理人的授权代表应当出席。基金管理人未派代表列席的，不影响表决效力。

2、通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以书面形式或会议规定的其他形式在表决截止日以前送达至召集人指定的地址。通讯开会应以书面方式或会议规定的其他形式进行表决。

3、在不与法律法规冲突的前提下，基金份额持有人大会可通过网络、电话或其他方式召开，基金份额持有人可以采用网络、电话、短信或其他方式进行表决，具体方式由会议召集人确定并在会议通知中列明。

4、基金份额持有人授权他人代为出席会议并表决的，授权方式可以采用书面、网络、电话、短信或其他方式。

5、基金份额持有人大会应当有代表 2/3 以上（含 2/3）基金份额的持有人参加，方可召开。未能满足上述条件的情况下，则召集人可另行确定并通知重新开会的时间。

#### （五）议事内容与程序

##### 1、议事内容及提案权

议事内容为关系基金份额持有人利益的重大事项。

基金份额持有人大会的召集人发出召集会议的通知后，对原有提案的修改应当在基金份额持有人大会召开前及时公告。

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

## 2、议事程序

### (1) 现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照下列第七条规定程序确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表，在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人拒不出席或主持基金份额持有人大会，不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

会议召集人应当制作出席会议人员的签名册。签名册载明参加会议人员姓名（或单位名称）、身份证明文件号码、持有或代表有表决权的基金份额、委托人姓名（或单位名称）和联系方式等事项。

### (2) 通讯开会

在通讯开会的情况下，首先由召集人提前 10 日公布提案，在所通知的表决截止日期后 2 个工作日内在监督方的监督下由召集人统计全部有效表决并形成决议。

### (六) 表决

基金份额持有人所持每份基金份额享有一票表决权。

基金份额持有人大会决议须经出席会议的基金份额持有人或其代理人所持表决权的 2/3 以上（含 2/3）通过方为有效；本基金份额为两个类别，基金份额持有人大会议事内容涉及该基金类别份额持有人权利义务及其利益的，应当取得出席会议的该基金类别的份额持有人所持表决权的 2/3（含 2/3）以上通过方为有效。如根据相关法律法规存在合理要求需要更换基金管理人、托管人的，应当经出席会议的基金份额持有人或其代理人全体通过方为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

基金份额持有人大会的各项提案或同一项提案内并列的各项议题应当分开审议、逐项表决。

### (七) 计票

#### 1、现场开会

(1) 如大会由基金管理人召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中选举一名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集，基金份额持有人大会的

主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中选举一名基金份额持有人代表担任监票人。基金管理人不出席大会的，不影响计票的效力。

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

(3) 如果会议主持人或基金份额持有人或代理人对于提交的表决结果有怀疑，可以在宣布表决结果后立即对所投票数要求进行重新清点。监票人应当进行重新清点，重新清点以一次为限。重新清点后，大会主持人应当当场公布重新清点结果。

(4) 基金管理人或基金托管人拒不出席大会的，不影响计票的效力。

## 2、通讯开会

在通讯开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监督员在基金管理人授权代表的监督下进行计票。基金管理人拒派代表对书面表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。

## (八) 生效与公告

基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效。

基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会的决议。

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

## (九) 基金份额持有人大会决议的披露

基金份额持有人大会决定的事项，应在生效之日起 5 个工作日通过在基金管理人网站公告或电子邮件、传真等形式通知全体基金份额持有人和其他相关当事人。

(十) 本基金存续期间，上述关于基金份额持有人大会召开事由、召开条件、议事程序、表决条件等规定，凡是直接引用法律法规或监管部门规定的部分，如将来法律法规或监管部门的规定修改导致相关内容被取消或变更，或者相关部分与届时有效的法律法规或监管部门的规定相冲突，则基金管理人经与基金托管人协商一致并提前公告后，可直接对本部分的相关内容进行修改和调整，无需召开基金份额持有人大会审议。

## 十、基金份额的登记

(一) 本基金的份额登记业务由基金管理人委托的服务机构代为办理。基金管理人与本基金服务机构招商证券股份有限公司签订《金融运营服务协议》，委托服务机构招商证券股

份有限公司（服务业务登记编码为 A00001）代为办理本基金份额登记业务。

服务机构应履行如下份额登记职责：

- 1、配备足够的专业人员办理本基金份额的登记业务；
- 2、严格按照法律法规和本合同规定的条件办理本基金份额的登记业务；
- 3、保存基金份额持有人名册及相关的认购、申购与赎回等业务记录 20 年以上；
- 4、对基金份额持有人的基金账户信息负有保密义务，因违反该保密义务对投资者或基金带来的损失，须承担相应的赔偿责任，但司法强制检查情形及法律法规及中国证监会规定的和本合同约定的其他情形除外；
- 5、法律法规及中国证监会规定的和本合同约定的其他义务。

（二）基金管理人依法应承担的责任不因委托而免除。

（三）全体基金份额持有人同意基金管理人、份额登记机构或其他份额登记义务人应当按照中国基金业协会的规定办理基金份额登记数据的备份。

## 十一、基金的投资

（一）投资经理：本基金的投资经理由基金管理人指定。

本基金的投资经理：李志强，1977 年出生，本科，电子工程专业。曾在江河通信、吉通通信、中信网络担任工程师工作，现任南京璟恒投资管理有限公司合伙人、总经理兼投资总监，李志强先生具备良好的经济理论基础，和扎实的证券研究经验和投资管理经验，11 年的投资经历，管理业绩持续表现良好。

（二）投资目标：通过合理的股票、股票组合和股票、现金组合，达到熊市跑赢指数，牛市跟随指数的效果。在尽量控制市值回撤幅度的情况下，为投资者带来安心及稳定的回报。

（三）投资范围：本基金的投资范围包括沪深交易所上市交易的股票、债券（包括银行间债券、交易所债券、可转换债券、可交换债券）、优先股、证券回购、存款、公开募集证券投资基金（不包括非货币类 ETF 基金一级市场申购、赎回）。本基金可以参与港股通交易、新股申购。

（四）投资策略：

### 1、组合策略

我们的投资策略是以寻找一批符合“好公司、好价格、好时机”标准的企业，构建一个 20~30 支左右的成长/价值组合，按 2-3 年的时间周期衡量业绩，投资收益率不低于优秀企

业的平均增长率。通过合理的股票/股票组合和股票/现金组合，达到熊市跑赢指数，牛市跟随指数的效果。在尽量控制市值回撤幅度的情况下，为投资者带来安心及稳定的回报。

以对公司的熟悉了解程度，公司胜率赔率的大小，并考虑行业趋势来决定组合中个股的仓位，并根据公司基本面和估值的变化进行动态调整。

我们管理的资金在整个市场中只是极小一部分，公开信息也只是市场信息的一小部分，我们除了对公司的基本面、业绩、估值等进行长期的研究和积累，也需要适度观察市场的行为和提示，不能重仓逆市交易。

## 2、投资标的选择

寻找大行业，小公司，并能够提供优秀公司长大的行业。如医药、TMT、消费、高端制造等。重点关注未来需求巨大，发展阶段处于初期阶段的，或行业发展处于加速阶段的行业。

理想标的的特征：以较低的价格介入处于发展初中期的高价值公司，实现估值的提升、经营规模的不断扩大、ROE 的不断提升。

在以下几个方面寻找这类公司：广阔的市场空间、企业处于生命周期的初中期、可靠的竞争优势、低估的价格。

## 3、盈利逻辑

公司的股价=每股盈利×市盈率（估值），好的生意/行业和好的公司/经营团队/管理制度/竞争优势有利于每股盈利的增长，公司的盈利增长和体量稳定导致市场对公司相对估值的重估，宏观资金面引发的牛熊转换常常带来市场整体估值的高估或者低估。这三个因素的叠加，就是我们的盈利逻辑。

### （五）投资限制

1、本基金持有一家上市公司股票（依成本计算），不得超过基金财产净值的 20%，同时不得超过该上市公司流通市值的 10%；

2、持有一家上市公司发行的可转债（依成本计算）不得超过基金财产净值的 20%，投资于一家上市公司所发行的可转债（以成本计算），不得超过该上市公司发行可转债总额的 10%；投资于可转债（以成本计算），合计不得超过基金财产净值的 50%；

3、投资于单只基金，依买入成本计算，不得超过基金财产净值的 20%（货币基金除外）；

4、本基金持有的单只债券及优先股，按成本计算不得超过基金财产净值的 20%（申购新发行的债券除外）；

5、本基金持有一家上市公司发行股票不得超过该上市公司总股本的 5%；

6、本基金不得投资于“ST”“\*ST”、“S”、“S\*ST”、“SST”类股票，如被动投资于该类

标的，标的基金管理人从持有该类标的的交易日起，十个工作日内进行平仓；

7、本基金不得投资于中小企业私募债和退市整理板的股票；

8、本基金投资组合遵循相关法律法规或监管部门对于投资比例限制的规定。

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。除本合同另有约定外，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。

在本基金到期日前 10 个交易日内，因基金财产变现需要，本基金财产的投资比例限制可以不符合上述基金配置比例规定。

#### （六）投资禁止行为

基金管理人不得利用基金财产从事下列行为或进行如下投资运作，若由此造成基金财产、合同当事人及第三方损失的，所有责任由基金管理人承担：

- 1、违反规定向他人提供担保；
- 2、从事承担无限责任的投资；
- 3、从事内幕交易、操纵证券价格及其他不正当的证券交易活动；
- 4、法律法规、中国证监会以及本合同规定禁止从事的其他行为。

#### （七）关联交易

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。

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、或者该等主体持有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。

基金投资者签署本合同即表明其已经知晓本基金将进行上述关联交易。

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，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。

(八) 业绩比较基准

本基金不设业绩比较基准。

(九) 融资融券及其他场外证券业务的参与情况

根据本基金投资范围，本基金不参与融资融券业务；也不参与场外衍生品（包括互换、场外期权等品种）的交易。

(十) 风险收益特征：

本基金属于 R4 级（中高风险）投资品种。

(十一) 基金的预警与止损：

为保护基金份额持有人的利益，本基金将基金份额净值为 0.80 元设置为预警线，将基金份额净值为 0.70 元设置为止损线。

当基金份额净值低于或等于预警线 0.80 元时（该交易日称为“R 日”），管理人应主动对本基金所持有的投资标的采取以下风险控制措施：在 R+2 日开始并在十个工作日内使本基金所持有的现金类资产比例不低于总值的 50%（以成本价计算），直至基金份额净值恢复至预警线以上。如遇因持有流通受限证券等原因导致本基金财产无法及时变现的，则变现时间顺延。

当基金份额净值低于或等于止损线 0.70 元（该交易日称为“D 日”）时，管理人在 D+2 日开始止损操作，并在三个工作日内将持仓标的或衍生品平仓变现。该平仓操作不可逆，在所持全部非现金类资产变现前不可停止。对于已变现部分，根据本合同第二十五章的清算程序对基金进行清算。如遇因持有流通受限证券等原因导致本基金财产无法及时变现的，则变现时间顺延，待全部变现完成之日，管理人进行二次清算。

基金的预警和止损由基金管理人负责执行，如基金管理人按照或者未按照基金合同的约定采取风险控制措施和进行强制止损，由此对基金财产或基金份额持有人造成的损失，基金托管人不承担任何责任。

**基金管理人特别提示：本基金设置 0.70 元为止损线，并不代表基金管理人完成止损后基金份额净值等于 0.70 元，根据基金管理人变现操作的交易执行情况，本基金终止日基金份额净值可能低于 0.70 元。**

## 十二、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。基金托管人对实际交付并控制下的基金财产承担保管职责，对于非基金托管人保管的财产不承担责任。

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、基金托管人可以按照本合同的约定收取管理费、托管费以及本合同约定的其他费用。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基金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。

#### （二）基金财产相关账户的开立和管理

1、基金管理人或基金托管人按照规定开立基金财产的托管资金账户、证券账户（一码通账户）和期货账户等投资所需账户。证券账户和期货账户的持有人名称应当符合证券、期货登记结算机构的有关规定。开立的上述基金财产账户与基金管理人、基金托管人、基金代销机构和基金份额登记机构自有的财产账户以及其他基金财产账户相独立。

2、基金托管人以本基金的名义在商业银行开立基金的托管资金账户。本基金的一切货币收支活动，包括但不限于投资、支付赎回金额、支付基金收益，均需通过本基金的托管资金账户进行。本托管资金账户仅限于本基金使用，仅限于满足开展本基金业务的需要。

3、证券账户、期货账户以及基金投资运作有关的其他账户由基金管理人与基金托管人协商后办理。基金管理人和基金托管人不得随意假借本基金的名义开立任何其他银行账户。

### 十三、指令的发送、确认与执行

#### （一）基金管理人对预留印鉴的授权及更换被授权人的程序

基金管理人应向基金托管人提供资金划拨指令的预留印鉴。预留印鉴包括但不限于管理人预留的印章样本、有权签字人签字或名章样本。基金管理人需在预留印鉴上加盖公章。

同时，划款指令预留印鉴还需同时载明管理人投资监督联络人及联系方式，包括办公电话、移动电话、邮箱、传真和邮寄地址。

基金管理人更换预留印鉴，必须提前至少一个工作日，使用传真方式或其他基金管理人和基金托管人认可的方式向基金托管人发出由基金管理人加盖公章的预留印鉴，同时电话通知基金托管人。

基金托管人在收到预留印鉴原件或变更预留印鉴原件并经电话或邮件确认后，预留印鉴即生效。如果预留印鉴原件或变更预留印鉴原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预留印鉴原件或变更预留印鉴原件并经电话确认的时点。如生效时间早于基金托管人收到预留印鉴原件或变更预留印鉴原件并经电话确认的时点，则以基金托管人收到预留印鉴原件或变更预留印鉴原件并经电话确认的时点为预留印鉴或变更预留印鉴的生效时间。

基金管理人和基金托管人对预留印鉴负有保密义务，其内容不得向相关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写明款项事由、指令的执行时间、金额、收款账户信息等，并加盖预留印鉴。

## （三）指令的发送、确认和执行的时间及程序

### 1、指令的发送

指令由基金管理人用传真方式或其他基金管理人和基金托管人认可的方式（例如邮件等方式）向基金托管人发送。以传真方式发送的划款指令，收件人（基金托管人）确认该指令已成功接收之时视为送达。以电子邮件接收到的划款指令，托管人接收划款指令的指定邮箱接收到附有划款指令及有效附件的邮件后，视为该指令成功送达。

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，并保证划款指令及其附件的合法、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。在每个工作日的13:00以后接收基金管理人发出的银证转账、银期转账以及当日内进行场内交割的划款指令的,基金托管人不保证当日完成划转流程;在每个工作日的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。

## 2、指令的确认

基金管理人有关义务在发送指令后与托管人以电话的方式进行确认。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付所造成的损失,基金托管人不承担责任。

## 3、指令的执行

基金托管人收到基金管理人发送的指令后,应对以传真或邮件方式发送的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相符,复核无误后及时执行。若存在异议或不符,基金托管人立即与基金管理人进行电话或邮件(邮件默认为管理人发送指令的发件人邮箱)联系和沟通,并要求基金管理人重新发送经修改的指令。

基金托管人有权要求基金管理人传真或邮件提供相关交易凭证、合同或其他有效会计资料。当本基金进行场外投资,要求基金托管人从托管资金账户向指定的收款账户划款时,基金管理人需向基金托管人提供以下资料:

- (1) 基金投资交易相关文件(当事人签署版);
- (2) 收款账户证明文件;
- (3) 托管人认为必要的投资划款相关支持性文件。

基金管理人应确保所提供的上述文件合法、真实、完整和有效。

4、如基金管理人与基金托管人签署《资产托管网上综合服务协议》(简称服务协议),或基金管理人和基金托管人约定的其他服务协议等文件,并按照服务协议约定方式进行指令发送、确认及执行的,本章节相关内容以服务协议为准。服务协议中关于指令的发送、确认、执行及责任承担相关内容的未尽事宜,仍应参照本章节约定执行。

## (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指令违反《基金法》、本合同或其他有关法律法规的规定时,不予执行,并及时通知基金管理人纠正,基金管理人收到通知后应及时处理,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、指令账户信息不全或有误、预留印鉴不全或不符、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,如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) 指令的保管

指令若以传真形式发出或以邮件方式发送,则正本由基金管理人保管,基金托管人保管指令传真件或邮件发送的签署版本扫描件。当两者不一致时,以基金托管人收到的投资指令传真件或签署版本扫描件为准。

(七) 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、合法合规的划款指令,基金财产发生损失的,基金托管人不承担任何形式的责任。在正常业务受理渠道和指令规定的时间内,因基金托管人原因未能及时或正确执行符合本合同规定、合法合规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,但基金托管人如遇到不可抗力的情况除外。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,基金托管人不承担因为不执行该指令而造成的损失。

对于与预留印鉴核对无误的指令,基金管理人不得否认其效力。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规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。

#### 十四、交易及清算交收安排

(一) 选择证券经纪机构的程序

基金管理人负责选择代理本基金财产证券买卖的证券经纪机构,并与其签订证券经纪合同,基金管理人、基金托管人和证券经纪机构可就基金参与证券交易的具体事项另行签订协议。

(二) 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人代理本基金进

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。

### （三）资金、证券账目及交易记录的核对

基金管理人和基金托管人定期对资产的资金、证券账目、实物券账目、交易记录进行核对。

### （四）申购或赎回的资金清算

1、T 日，基金投资者进行申购或赎回申请。基金管理人在 T+2 日对 T 日的申购、赎回申请进行确认，并将确认的申购、赎回等数据向基金托管人传送。基金管理人、基金托管人根据确认数据进行账务处理。

2、基金份额持有人赎回申请确认后，基金管理人将在 T+5 日(包括 T+5 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。

3、基金管理人应对份额登记数据的准确性负责。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款项。

### （五）选择期货经纪机构的程序及期货投资资金清算安排

本基金投资于期货前，基金管理人负责选择为本基金提供期货交易服务的期货经纪公司，并与其签订期货经纪合同。基金管理人、基金托管人和期货公司可就基金参与期货交易的具体事项另行签订协议。

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。

#### （六）非证券交易所交易资金交收

1、对于本基金的投资及所投资的资产变现时，基金管理人应向基金托管人提交相关交易合同或协议、成交确认文件的复印件（加盖基金管理人有效印章），并通知基金托管人相关资金的到账时间。基金管理人保证以上所提供的文件资料的真实性和有效性。

2、基金管理人应指定本基金的托管资金账户为本基金投资所产生的本金、利息、投资收益以及其他收益的唯一收款账户。

3、基金托管资金账户当日若有应收款，在约定时间内未入账的，由基金管理人负责向相关当事人进行催收。

### 十五、越权交易

#### （一）越权交易的界定

越权交易是指基金管理人违反有关法律法规及本合同的规定而进行的投资交易行为，包括：(1)违反本合同约定的投资范围和投资比例限制等进行的投资交易行为；(2)法律法规禁止的超买、超卖行为。

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

#### （二）对越权交易的处理程序

##### 1、违反本合同投资范围和投资比例限制规定进行的投资交易行为

基金托管人在行使监督职责时，发现基金管理人的投资指令违反本合同约定的，应当拒绝执行，立即通知基金管理人，并有权依据相关法律法规的要求报告中国证监会或中国基金业协会。

基金托管人在行使监督职责时，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约定的，应立即通知基金管理人，并有权依据相关法律法规的要求报告中国证监会或中国基金业协会。因执行该指令造成的损失基金托管人不承担任何责任。

基金管理人应向基金托管人主动报告越权交易。基金托管人有权督促基金管理人在限期内改正并在该期限内对通知事项进行复查。基金管理人未能在限期内纠正的，基金托管人有权依据相关法律法规的要求报告中国证监会或中国基金业协会。

##### 2、法律法规禁止的超买、超卖行为。

基金托管人在行使监督职能时，如果发现基金资产投资过程中出现超买或超卖现象，应

立即提醒基金管理人，由此给基金资产造成的损失由基金管理人承担，基金托管人不承担任何责任。如果因基金管理人原因发生交易所场内超买行为，必须于发生超买行为日的下一个工作日上午 10:00 点之前完成融资，保证完成清算交收。

3、越权交易所发生的损失及相关交易费用由管理人负担，所发生的收益归本基金资产所有。

### （三）基金托管人对基金管理人投资运作的监督

1、基金托管人对基金管理人的投资行为行使监督权，具体投资监督事项如下：

#### （1）本基金的投资范围：

本基金的投资范围包括沪深交易所上市交易的股票、债券（包括银行间债券、交易所债券、可转换债券、可交换债券）、优先股、证券回购、存款、公开募集证券投资基金（不包括非货币类 ETF 基金一级市场申购、赎回）。本基金可以参与港股通交易、新股申购。

#### （2）本基金的投资限制：

1) 本基金持有一家上市公司股票（依成本计算），不得超过基金财产净值的 20%，同时不得超过该上市公司流通市值的 10%；

2) 持有一家上市公司发行的可转债（依成本计算）不得超过基金财产净值的 20%，投资于一家上市公司所发行的可转债（依成本计算），不得超过该上市公司发行可转债总额的 10%；投资于可转债（以成本计算），合计不得超过基金财产净值的 50%；

3) 投资于单只基金，依买入成本计算，不得超过基金财产净值的 20%（货币基金除外）；

4) 本基金持有的单只债券及优先股，按成本计算不得超过基金财产净值的 20%（申购新发行的债券除外）；

5) 本基金持有一家上市公司发行股票不得超过该上市公司总股本的 5%；

6) 本基金不得投资于“ST”“\*ST”、“S”、“S\*ST”、“SST”类股票，如被动投资于该类标的，标的基金管理人从持有该类标的的交易日起，十个工作日内进行平仓；

7) 本基金不得投资于中小企业私募债和退市整理板的股票；

8) 本基金投资组合遵循相关法律法规或监管部门对于投资比例限制的规定。

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。除本合同另有约定外，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 个工作日内调整完毕。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。

在本基金到期日前10个交易日内，因基金财产变现需要，本基金财产的投资比例限制可以不符合上述基金配置比例规定。

(3) 本基金参与股票发行申购时，所申报的金额不得超过本基金的总资产，所申报的股票数量不得超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

(4) 法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的，从其规定。若法律法规或监管部门取消上述限制，本基金投资可不受上述规定限制。

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本基金不符合本合同约定的投资比例的，基金管理人应当在合理期限内调整完毕。

相关法律法规另有规定除外，基金托管人以(1) — (4)项为限履行投资监督职责，对基金管理人的其他职责和行为不承担监督责任。

基金托管人对基金管理人进行本基金投资的监督和检查自本合同生效之日起开始。

2、投资范围或投资限制变更，基金管理人应以书面形式通知基金托管人，并应与基金托管人重新协商调整投资监督事项。

3、基金托管人投资监督的真实性、准确性、及时性和完整性受限于管理人、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。基金托管人对上述机构提供信息的真实性、准确性、及时性和完整性不作任何担保、暗示或表示，并对上述机构提供信息的错误、遗漏或延迟所引起的损失不承担任何责任。

4、对于基金管理人的任何投资行为、投资策略、投资决定或由于基金产品设计缺陷或越权交易造成的任何损失，基金托管人不承担任何责任。

## 十六、基金财产的估值和会计核算

### (一) 基金财产的估值

#### 1、基金资产总值

基金资产总值是指其所购买的各项证券、银行存款及利息、基金各项应收款以及其他资产的价值总和。

#### 2、基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的净额。本基金基金资产净值保留到小数点

后 2 位，小数点后第 3 位四舍五入。

### 3、基金份额净值

基金份额净值是指计算日基金资产净值除以计算日基金份额后的价值。本基金的基金份额净值保留到小数点后 4 位，小数点后第 5 位四舍五入。

### 4、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。

### 5、估值时间

基金管理人与基金托管人对每个交易日的基金财产进行估值，估值核对日为每周第三个交易日。如遇收益分配基准日、基金开放日、基金终止日，则需对收益分配基准日、基金开放日和基金终止日的估值结果进行核对。另外，管理人向托管人协商后，可要求对其他交易日的估值结果进行核对。

### 6、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。

### 7、估值方法

本基金按以下方式进行估值：

#### (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选取估值日第三方估值机构提供的相应品种对应的估值净价估值，具体估值机构由基金管理人与托管人另行协商约定。

C、交易所上市交易的可转换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，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；

交易所上市实行全价交易的债券（可转债除外），选取第三方估值机构提供的估值全价减去估值全价中所含的债券（税后）应收利息得到的净价进行估值。

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收盘价估值；该日无交易的，以最近一日的收盘价估值。

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。

D、非公开发行有明确锁定期的股票，按以下方法估值：

如果估值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日该非公开发行股票的价值；

如果估值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 为估值日该非公开发行有明确锁定期的股票的价值；C 为该非公开发行有明确锁定期的股票的初始取得成本（因权益业务导致市场价格除权时，应于除权日对其初始取得成本做相应调整）；P 为估值日在证券交易所上市交易的同一股票的收盘价； $D_l$  为该非公开发行有明确锁定期的股票锁定期所含的交易所的交易天数； $D_r$  为估值日剩余锁定期，即估值日至锁定期结束所含的交易所的交易天数（不含估值日当天）。

(3) 全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，主要采用第三方机构提供的估值价格和估值技术。

(4) 同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

(5) 上市流通的证券投资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。其他公开募集的证券投资基金按最近交易日的基金份额净值估值。货币基金以成本估值，每日按前一交易日的万份收益计提红利。

(6) 期货合约、贵金属现货合约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) 期权合约，上市交易的按估值日的收盘价估值，估值日没有交易的，按最近交易日的收盘价估值；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。

(8) 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。

(9) 银行存款每日不计提利息，以实际结息数为准；证券、期货资金账户内资金不计提利息，以实际结息数为准，本基金终止清算时应收未收利息计入基金终止清算净值。

(10) 中小企业私募债按照成本估值。

(11) 对于投资的权益类证券收益互换，按照管理人提供的估值方法或估值公式进行估值，如果管理人认为需要调整估值方法或估值公式的，可经双方协商确认，并以管理人出具的具体估值方法为准。

(12) 对于投资的基金管理公司及其子公司资产管理计划、证券公司及其子公司资产管理计划、信托计划、保险资产管理计划、期货资产管理计划、私募投资基金等场外产品（以下简称“标的产品”），按如下方式进行估值：

①如管理人在上述标的产品权益确认日提供了权益确认原始凭证，则在确认日当天以原始凭证为依据入账；如管理人无法在权益确认日提供上述产品的权益确认原始凭证，则在原始凭证提供日进行确认，并不再对以往账务进行追溯调整；

②如果上述产品有份额净值的，以管理人按照净值提供频率提供的标的产品最新份额净值进行估值，如果管理人没有按照净值提供频率提供最新份额净值的，则以最近一次提供的份额净值估值；如果上述产品有预期收益率且不公布份额净值，则管理人提供成本和预期收益率，以成本列示并每日加计应收利息（或应计收益）的方法进行估值，管理人未提供预期收益率的，则以成本计量；

③如果不属于上述情况的，则基金管理人应向基金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。

(13) 全国中小企业股份转让系统挂牌上市交易的股票，因交易方式不同导致其被合理估值的程度不同，本基金采取保守原则估值。具体方法如下：

①全国中小企业股份转让系统挂牌并进行做市交易的股票，以其估值日在全国中小企业股份转让系统挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，由管理人出具估值意见说明函，调整最近交易市价，确定证券估值价格；

②全国中小企业股份转让系统挂牌的股票若涉及协议转让，按照成本列示；

③如果未来监管机构或行业协会等出台关于全国中小企业股份转让系统挂牌上市交易股票的统一的估值标准或方法，则参照新的标准或方法。

④如有确凿证据表明按上述规定不能客观反映基金公允价值的，管理人可根据具体情况，在综合考虑市场成交价、市场报价、流动性、收益率曲线等多种因素基础上，在与托管人商议后，按最能反映基金资产公允价值的方法估值。

⑤基金管理人须在更改估值方法前至少提前十个工作日发函与托管人对估值方法的修改进行确认，并提前一个工作日在基金管理人网站发布修改估值方法公告，即视为对本基金份额持有人尽了告知义务，不再征询基金份额持有人意见。

(14) 对于投资的有限合伙份额，按照实际划款金额作为成本进行估值，收益按到期实际金额入账。

(15) 如存在上述估值约定未覆盖的投资品种，基金管理人可根据具体情况制定估值方法，并将估值方法提供给托管人进行估值。如管理人认为上述估值方法不合适，可就相关估值方法进行修改，并将修改后的方法提前通知托管人进行估值。

(16) 如基金管理人和基金托管人对基金份额净值的计算结果不能达成一致时，为避免不能按时公布的情形，以基金管理人的计算或确认结果对外公布，基金管理人应在单方面对外公告基金份额净值计算结果时注明未经基金托管人复核，而基金托管人有权将有关情况向中国证监会报告，由此给基金投资者和基金造成的损失，由基金管理人承担赔偿责任。

(17) 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。

基金估值核算需要的相关信息，包括但不限于场外交易信息和场外行情信息，如果托管人无法获得相关估值数据，则由管理人负责提供，并对数据准确性、完整性和及时性负责。否则，由于上述情况导致的估值不准确、不完整或不及时，托管人不承担责任。

## 8、汇率

若港股通估值计算中涉及港币的，将以上海（深圳）证券交易所估值日终公布的港币对人民币中间价【（买入结算汇兑比率+卖出结算汇兑比率）/2】估值。涉及其他货币的，如上海（深圳）证券交易所估值日提供了该币种兑人民币的汇率，则取该汇率，如未有提供，以双方协商一致的原则确定汇率。

## 9、税收

对于按照中国法律法规和基金投资所在地的法律法规规定应交纳的各项税金，本基金将按权责发生制原则进行估值；对于因税收规定调整或其他原因导致基金实际交纳税金与估算的应交税金有差异的，基金将在相关税金调整日或实际支付日进行相应的估值调整。

## 10、估值程序

基金日常估值由基金管理人进行，根据相关法律法规，基金管理人可以委托服务机构办理基金的估值。基金管理人或其委托的服务机构完成估值后，将估值结果以书面形式、发送电子对账数据等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发送的书面估值结果上加盖业务章或者发送电子对账结果等双方认可的其他形式返回给基金管理人或其委托的服务机构；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服务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。

## 11、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。当基金净值发生计算错误超过基金净值0.5%时，视为估值错误。

本合同的当事人应按照以下约定处理：

### （1）估值错误类型

本基金运作过程中，如果由于基金管理人、基金托管人、证券交易所、基金服务机构、募集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。

上述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。

自然灾害、突发事件、以及因技术原因引起的差错，若系同行业现有技术水平不能预见、不能避免、不能克服，则属不可抗力，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、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,导致基金净值发生计算错误超过基金净值0.5%时,应立即通知对方,共同查明原因,协商解决;

B、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;估值错误的责任人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;

C、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;

D、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;

E、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;

F、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;

G、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、当基金净值发生计算错误超过基金净值0.5%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。

12、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) 因不可抗力或其他情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金财产价值时;

(3) 占基金相当比例的投资品种的估值出现重大转变,而基金管理人为保障基金投资者的利益,决定延迟估值的情形;

(4) 对于没有或未及时获取交易数据或行情数据、交易数据或行情数据不完整或有误时；

(5) 中国证监会认定的其他情形。

### 13、基金份额净值的确认

用于基金信息披露的基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个估值核对日计算估值日的基金份额净值并发送给基金托管人。基金托管人对份额净值计算结果复核确认后发送给基金管理人。基金份额净值由基金管理人负责对投资者公布。

根据相关法规，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，基金管理人有权按照其对基金资产净值的计算结果对外予以公布，并承担由此而产生的责任。基金托管人有权将该等情况报相关监管机构备案。

### 14、特殊情况的处理

由于不可抗力、系统等原因，或由于证券交易所、登记结算公司或证券经纪商发送的数据错误，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。但基金管理人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

## (二) 基金的会计政策

1、基金管理人为本基金的基金会计责任方；

2、基金的会计年度为公历年度的1月1日至12月31日；基金首次募集的会计年度按如下原则：如果《基金合同》生效少于2个月，可以并入下一个会计年度；

3、基金核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位；

4、会计核算制度执行国家有关会计制度；

5、本基金独立建账、独立核算；

6、基金管理人或其委托的服务机构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；基金托管人定期与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对。

## 十七、基金的费用与税收

### (一) 基金费用的种类

- 1、管理费；
- 2、托管费；
- 3、基金服务费；
- 4、业绩报酬；
- 5、基金的证券、期货交易费用及账户开户费用；
- 6、基金备案后与之相关的会计师费和律师费；
- 7、基金的银行汇划费用；
- 8、合同文件制作、印刷费用；
- 9、按照国家有关规定和本合同约定，可以在基金资产中列支的其他费用。

(二) 费用计提方式、计提标准和支付方式

1、管理费

**本基金不对 B 类基金份额收取管理费，对 A 类基金份额按照下述方式收取管理费：**

**A 类基金份额**的年管理费率为 1.5%。计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% \div N$$

H：每日 **A 类基金份额**应计提的管理费

E：前一日的 **A 类基金份额**资产净值

N：当年天数

本基金的管理费自基金成立日起，每日计提，按季支付给基金管理人。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在下一个自然季度初十五个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。费用自动扣划后，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。

2、托管费

基金的年托管费率为 0.1%。计算方法如下：

$$H = E \times 0.1\% \div N$$

H：每日应计提的托管费

E：前一日的基金资产净值

N：当年天数

本基金的托管费自基金成立日起，每日计提，按季支付给基金托管人。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在下一个自然季度初十五个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。费用自动扣划后，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。

### 3、基金服务费

本基金份额登记、基金估值核算等服务费用，年费率为0.1%。计算方法如下：

$$H=E \times 0.1\% \div N$$

H：每日应计提的基金服务费

E：前一日基金资产净值

N：当年天数

本基金的基金服务费自基金成立日起，每日计提，按季支付给服务机构。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在下一个自然季度初十五个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。费用自动扣划后，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。

### 4、基金管理人的业绩报酬

**本基金仅对A类份额持有人提取业绩报酬。**

**本基金对A类份额持有人按照以下方式计提业绩报酬：**

本基金采用单客户单笔投资高水位净值法进行业绩报酬计提。在两类情况下管理人将根据A类基金份额持有人的收益情况对本基金提取业绩报酬，一类是A类基金份额持有人申请赎回或本基金终止时提取业绩报酬；另一类是分红时提取业绩报酬。

当A类基金份额赎回、基金终止或分红时，管理人将提取赎回份额或分红份额当期收益的20%作为业绩报酬。

业绩报酬的计提方法如下：

当A类基金份额持有人申请赎回、基金分红或本基金终止时，管理人根据A类基金份额持有人每一A类基金份额的收益率（R）提取业绩报酬。经计算确认的业绩报酬从A类基金份额持有人赎回基金资金清算款中或分红款项中以现金支付。

其中，基金分红时基金参与份额（红利转投份额）的参与日重定为上一个业绩报酬提取日。当分红款少于提取业绩报酬时，则管理人提取的业绩报酬以分红款为限。如分红和赎回同日发生时，当分红款少于业绩报酬，管理人提取的业绩报酬也以分红款为限。

A=赎回日对应的开放日、分红除权日或基金终止日A类基金累计份额净值；

t：**本次业绩报酬（201901）变更生效前最近一次业绩报酬计提日**（由管理人于变更生效日当天提供给份额注册登记机构）；

S：t日计提完业绩报酬后的A类基金份额累计净值（由管理人于变更生效日当天提供

给份额注册登记机构)；

C: 1) 若份额申购申请时间早于 t 日, 则首次计提业绩报酬时 C 为 S, 后续计提业绩报酬时 C 为上一次提取业绩报酬时的 A 类基金份额累计净值;

2) 若份额申购申请时间晚于 t 日, 则 C 为该笔份额上一次提取业绩报酬时的 A 类基金份额累计净值; 若该笔份额还未提取过业绩报酬, 则 C 为该笔份额申购时 A 类基金份额累计净值;

D: 与 C 取数时间相同的对应 A 类基金份额净值;

E=业绩报酬;

F=赎回份额或分红除权日持有份额;

$$\text{收益率} R = \frac{A-C}{D} \times 100\%$$

业绩报酬计提标准为:

当  $R > 0\%$  时, 对超过 0% 的收益部分提取 20% 的业绩报酬, 即  $E = F \times (A - C) \times 20\%$ ;

如果管理人已经提取业绩报酬, 即使 A 类基金份额持有人赎回时净值有所下跌, 则该部分已提取的业绩报酬将不退还基金份额持有人。

业绩报酬在 A 类基金份额持有人分红、赎回时或本基金清算时由基金管理人负责计算, 基金托管人不承担复核义务。业绩报酬从基金份额持有人的赎回资金、分红款或清算资金中扣除后支付, 由基金管理人向基金托管人发送业绩报酬划付指令, 基金托管人根据基金管理人指令要求进行支付。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的, 顺延至法定节假日、休息日后的第一个工作日或不可抗力结束日后的第一个工作日支付。

5、上述(一)中所列其他费用根据有关法规及相关协议规定, 按费用实际支出金额列入当期费用, 由基金托管人从基金财产中支付。其中, 证券账户开户费若由托管人在开户时先行垫付, 自证券账户开户一个月内由托管人自动从基金资产中扣划, 基金管理人无需再出具资金划拨指令。费用自动扣划后, 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。

其中, 基金管理人费用收入银行账户信息如下(账户信息如有变更, 管理人可单独决定而无须变更本基金合同, 但须在账户信息变更生效时通知基金托管人):

**户名: 南京璟恒投资管理有限公司**

**账号: 125905280710903**

**开户行: 招商银行南京分行湖南路支行**

(三) 不列入基金业务费用的项目

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

2、基金管理人和基金托管人处理与基金财产运作无关的事项发生的费用。

3、其他根据相关法律法规及监管机构的有关规定不得列入基金费用的项目。

(四) 费率调整

基金管理人与基金托管人协商一致，可下调托管费率和基金服务费率。

对上述费率的调整生效后，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。

(五) 基金的税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

## 十八、基金的收益分配

(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) 基金收益分配原则

1、在符合有关基金分红条件的前提下，基金管理人有权决定是否对基金进行收益分配，收益分配的基准、时间、比例亦由基金管理人决定；

2、本基金在每个自然年度最多分配4次；

3、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，本基金默认的收益分配方式为现金分红，基金份额持有人需要修改收益分配方式，需提前通知管理人提出申请；

4、基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位各类基金份额收益分配金额后不能低于面值；

5、每一相同类别的基金份额享有同等分配权；

6、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

(三) 收益分配方案

基金收益分配方案中应载明截止收益分配基准日的可供分配利润、基金收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。

#### （四）收益分配方案的确定、通知与实施

1、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后以约定的形式通知基金份额持有人。

2、在收益分配方案通知基金份额持有人后，针对现金分红的方式，基金管理人依据具体方案的规定就支付的现金红利向基金托管人发送划款指令，基金托管人按照基金管理人的指令及时进行分红资金的划付；针对红利再投资的方式，基金份额持有人所转换的基金份额将以分红除权日的各类基金份额净值为计算基准确定再投资份额，红利再投资所转换的基金份额将直接记入其基金账户。。

### 十九、基金的信息披露与报告

（一）本基金的信息披露应符合《基金法》、《私募办法》、《私募投资基金信息披露管理办法》、《私募投资基金管理人登记和基金备案办法（试行）》等法律法规及相关自律规则的规定。如中国证监会、中国基金业协会更新了私募基金信息披露规则或制定了其他相关规则，则从其规则执行。

#### （二）基金管理人定期信息披露

##### 1、净值报告披露

基金管理人每月将经基金托管人复核的上月最后一个交易日的基金份额净值以各方认可的形式提交基金份额持有人。

##### 2、季度报告披露

本基金存续期间，基金管理人应当在每季度结束之日起 10 个工作日内向投资者披露季度报告，季度报告应包括基金资产净值、基金份额净值、主要财务指标以及投资组合情况等信息。

##### 3、年度报告披露

本基金存续期间，基金管理人应当在每年结束之日起 4 个月以内，向基金投资者披露年度报告，年度报告应包括以下信息：

- （1）报告期末基金资产净值、基金份额净值和基金份额总额；
- （2）本基金的财务情况；
- （3）本基金投资运作情况和运用杠杆情况；
- （4）基金投资者账户信息，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) 基金合同约定的其他信息。

(三) 基金管理人重大事项信息披露

发生以下重大事项的，基金管理人应在 5 个工作日内（基金合同另有约定的除外）及时向基金投资者披露：

1、本基金名称、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、基金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、触及本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、本基金收益分配事项发生变更的；

8、本基金触发巨额赎回的；

9、本基金存续期变更或展期的；

10、本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、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、基金合同约定的可能存在的利益冲突以及可能影响投资者合法权益的其他重大事项。

(四) 定期报告的复核流程

本基金的定期报告包含《私募投资基金信息披露管理办法》及《私募投资基金信息披露内容与格式指引 1 号》规定的月度报告（如有）、季度报告和年度报告。

基金定期报告的编制由基金管理人进行，根据相关法律法规，基金管理人可以委托服务机构办理定期报告的编制。基金管理人或其委托的服务机构完成定期报告数据的编制后，将定期报告的数据以书面形式、电子核对数据等或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的规定对定期报告上的净值月报、主要财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行复核，复核无误后将复核结果以双方认可的方

式反馈给基金管理人或其委托的服务机构。

(五) 向境内基金投资者募集的本基金信息披露文件应当采用中文文本, 应当尽量采用简明、易懂的语言进行表述。同时采用外文文本的, 信息披露义务人应当保证两种文本内容一致。两种文本发生歧义时, 以中文文本为准。

(六) 基金托管人应当按照相关法律法规、中国证监会以及中国基金业协会的规定和基金合同的约定, 对基金管理人编制的基金资产净值、基金份额净值、基金份额申购赎回价格、基金定期报告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。如基金管理人没有按照中国证监会、中国基金业协会的规定及基金合同的约定或其他相关法律法规规定履行信息披露义务, 托管人不承担责任。

(七) 向基金份额持有人披露及基金份额持有人信息查询的方式

基金管理人有权采用下列一种或多种方式向基金份额持有人提供报告或进行相关通知。

1、传真、电子邮件或短信

如基金份额持有人留有传真号、电子邮箱或手机号等联系方式, 基金管理人可通过传真、电子邮件或短信等方式将报告信息告知基金份额持有人。

2、邮寄服务

基金管理人可向基金份额持有人邮寄年度报告等有关本基金的信息。基金份额持有人在募集机构留存的通信地址为送达地址。通信地址如有变更, 基金份额持有人应当及时以书面方式或以基金管理人规定的其他方式通知基金管理人。

3、基金管理人网站

基金管理人可通过基金管理人网站向基金份额持有人提供报告和信息查询, 内容包括但不限于净值报告、季度报告、年度报告。

4、基金管理人指定的其他信息披露途径或方式

基金管理人可通过基金管理人指定的其他信息披露途径或方式向基金份额持有人提供报告和信息查询, 内容包括但不限于净值报告、季度报告、年度报告。

5、其他中国证监会以及中国基金业协会规定的信息披露途径或方式。

(八) 向中国基金业协会提供的报告

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

私募基金管理人应当按照规定通过中国基金业协会指定的私募基金信息披露备份平台报送信息。在投资者信息披露查询功能开放之后, 投资者可以登录中国基金业协会指定的私

募基金信息披露备份平台查询其购买基金产品的相关信息。全体份额持有人同意私募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信息披露信息进行备份。

## 二十、风险揭示

基金投资可能面临下列各项风险，包括但不限于：

### （一）特殊风险揭示

1、本基金合同是基于中国基金业协会发布的《私募投资基金合同指引 1 号》（契约型私募基金合同内容与格式指引）而制定的，管理人对合同指引相关内容做出了合理的调整以及增加了其他内容，导致基金合同与中国基金业协会合同指引不一致的风险。

2、基金管理人可以委托在中国证监会注册取得基金销售业务资格并已成为中国基金业协会会员的机构（以下简称代销机构）募集本基金，代销机构可能存在违法违规地公开宣传基金产品、虚假宣传基金产品、以保本保收益引诱投资者购买基金产品导致基金投资者合法权益受损的风险。

3、基金管理人将本基金份额登记、估值核算等运营服务事项委托给招商证券股份有限公司办理，因服务机构经营风险、技术系统故障、操作失误等，可能使得基金服务事项发生差错，给本基金运营带来风险。

4、基金管理人在基金募集完毕后 20 个工作日内向中国基金业协会办理基金备案手续。基金因未在中国基金业协会履行登记备案手续导致基金财产不能进行投资运作的风险。

### （二）一般风险揭示

#### 1、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。

本基金属于 R4 级（中高风险）投资品种。

#### 2、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。

#### 3、流动性风险

本基金预计存续期限为基金成立之日起[20]年结束。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。

在单个开放日发生巨额赎回时，基金管理人依据基金合同的约定可能采取部分顺延赎回的操作（部分顺延赎回份额的赎回资金以下一开放日各类基金份额净值为基础，与申请赎回开放日基金份额净值可能存在较大差异），赎回申请投资者因此面临不能按时足额获得赎回款项的风险。

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不能按期退出等风险。

#### 4、募集失败风险

本基金的成立需符合相关法律法规的规定，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）后三十日内退还投资人已缴纳的款项，并加计银行同期存款利息。

#### 5、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。

#### 6、其他风险

包括但不限于法律与政策风险、发生不可抗力事件的风险、技术风险和操作风险等。

#### 7、本基金份额划分为 A、B 类份额

本基金的基金份额根据认申购及持有主体的不同及费用收取情况的不同分为两个类别，即 A 类基金份额和 B 类基金份额。本基金设置的 A 和 B 类基金份额并不属于优先、劣后安排，也不具备安全垫或结构化安排的性质。

### （三）基金投资风险揭示

#### 1、市场风险

证券市场价格因受各种因素的影响而引起的波动，将使基金资产面临潜在的风险。市场风险可以分为股票投资风险和债券投资风险。

（1）股票投资风险主要包括：

- 1) 国家货币政策、财政政策、产业政策等的变化对证券市场产生一定的影响，导致市场价格水平波动的风险；
- 2) 宏观经济运行周期性波动，对股票市场的收益水平产生影响的风险；

3) 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发生变化,从而导致股票价格变动的风险。

(2) 债券投资风险主要包括:

1) 市场平均利率水平变化导致债券价格变化的风险;

2) 债券市场不同期限、不同类属债券之间的利差变动导致相应期限和类属债券价格变化的风险;

3) 债券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息,或由于债券发行人信用质量降低导致债券价格下降的风险。

2、基金管理人管理风险

在实际操作过程中,基金管理人可能限于知识、技术、经验等因素而影响其对相关信息、经济形势和证券价格走势的判断,其精选出的投资品种的业绩表现不一定持续优于其他投资品种。

3、流动性风险

在市场或个股流动性不足的情况下,基金管理人可能无法迅速、低成本地调整投资计划,从而对基金收益造成不利影响。

在基金份额持有人提出追加或减少基金财产时,可能存在现金不足的风险和现金过多带来的收益下降风险。

4、信用风险

本基金交易对手方发生交易违约或者基金持仓债券的发行人拒绝支付债券本息,导致基金财产损失。

5、金融衍生品投资风险

(1) 期货投资风险

1) 流动性风险

本基金在期货市场成交不活跃时,可能在建仓和平仓期货时面临交易价格或者交易数量上的风险。

2) 基差风险

基差是指现货价格与期货价格之间的差额。若产品运作中出现基差波动不确定性加大、基差向不利方向变动等情况,则可能对本基金投资产生影响。

3) 合约展期风险

本基金所投资的期货合约主要包括期货当月和近月合约。当基金所持有的合约临近交割

期限,即需要向较远月份的合约进行展期,展期过程中可能发生价差损失以及交易成本损失,将对投资收益产生影响。

#### 4) 期货保证金不足风险

由于期货价格朝不利方向变动,导致期货账户的资金低于期货交易所或者期货经纪商的最低保证金要求,如果不能及时补充保证金,期货头寸将被强行平仓,导致无法规避对冲系统性风险,直接影响本基金收益水平,从而产生风险。

#### 5) 杠杆风险

期货作为金融衍生品,其投资收益与风险具有杠杆效应。若行情向不利方向剧烈变动,本基金可能承受超出保证金甚至基金资产本金的损失。

### (2) 利率互换风险(如有)

利率互换交易的风险主要来自于两个方面,一是内部风险,二是外部风险。内部风险主要是由于基金管理人对市场预测不当,导致的投资决策风险;外部风险包括交易对手无法履行利率互换协议,引发交易违约的信用风险,金融标的价格不利变动导致的价格风险,市场供求失衡、交易不畅导致的流动性风险等。

### (3) 场外衍生品风险(如有)

#### 1) 政策风险

场外衍生品(包括互换、场外期权)属于创新业务,监管部门可视业务的开展情况对相关政策和规定进行调整,引起场外衍生品(包括互换、场外期权)业务相关规定、运作方式变化或者证券市场波动,从而给投资者带来损失的风险。

#### 2) 市场风险

市场风险是指由于场外衍生品(包括互换、场外期权)中挂钩标的的市场价格、市场利率、波动率或相关性等因素的变化,导致投资者收益不确定的风险。

#### 3) 交易对手不能履约的风险

交易对手因停业、解散、撤销、破产,或者被有权机构撤销相关业务许可、责令停业整顿等原因不能履行场外衍生品(包括互换、场外期权)中约定的义务,可能给投资者带来损失的风险。

#### 6、特定的投资方法及基金财产所投资的特定投资对象可能引起的特定风险

本基金采取的投资策略可能存在使基金收益不能达到投资目标或者本金损失的风险。

#### 7、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、基金服务机构、募集机构、证券交易所、证券注册登记机构等。

#### 8、基金本身面临的风险

##### (1) 法律及违约风险

在本基金的运作过程中，因基金管理人、基金托管人、证券经纪机构等合作方违反国家法律规定或者相关合同约定而可能对基金财产带来风险。

##### (2) 购买力风险

本基金的目的是基金财产的增值，如果发生通货膨胀，则投资于证券所获得的收益可能会被通货膨胀抵消，从而影响到基金财产的增值。

##### (3) 管理人不能承诺基金利益的风险

基金利益受多项因素影响，包括证券市场价格波动、投资操作水平、国家政策变化等，基金既有盈利的可能，亦存在亏损的可能。根据相关法律法规规定，管理人不对基金的投资人作出保证本金及其收益的承诺。

##### (4) 基金终止的风险

如果发生本合同所规定的基金终止的情形，管理人将卖出基金财产所投资之全部品种，并终止基金，由此可能导致基金财产遭受损失。

##### (5) 基金止损风险

本基金达到止损线时，由于基金管理人强制止损带来的净值损失。

当基金份额净值达到止损线 0.70 元时，基金管理人将进行强制止损，将持仓标的或衍生品平仓变现，可能导致基金终止时基金份额净值低于 0.70 元。

#### 9、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、期货经纪商经营风险

按照我国金融监管法律规定，证券、期货公司须获得中国证监会核准的证券、期货经营资格方可从事证券、期货业务。虽证券、期货经纪商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、期货经纪商无法继续从事证券、期货业务，则可能会对基金产生不利影响。

## 10、关联交易风险（如有）

本基金可投资于由基金管理人、基金托管人或其关联方管理的产品或者与基金管理人、基金托管人或其关联方进行交易，这构成基金管理人与本基金的关联交易，存在关联交易风险。

## 11、净值波动风险

按照本合同第十六章的估值方法，当本基金投资于基金管理公司及其子公司资产管理计划、证券公司及其子公司资产管理计划、信托计划、保险资产管理计划、期货公司资产管理计划、私募投资基金、有限合伙份额，有如下情形之一时：

- （1）估值日无法及时获取上述投资品种的最新估值价格；
  - （2）投资上述品种后无法及时确认，上述投资品种在投资确认前估值价格波动；
  - （3）估值日取得的上述投资品种的最新估值价格没有或无法排除影响估值价格的因素（例如在估值日无法排除业绩报酬对估值价格的影响）；
  - （4）按照预期收益率反应的估值价格与实际兑付的收益产生差异；
- 可能导致本基金的净值波动风险。

## 12、融资融券交易风险（如有）

### （1）可能放大投资损失的风险

融资融券业务具有杠杆效应，它在放大投资收益的同时也必然放大投资风险。将股票作为担保品进行融资融券交易时，既需要承担原有的股票价格下跌带来的风险，又得承担融资买入或融券卖出股票带来的风险，同时还须支付相应的利息和费用，由此承担的风险可能远远超过普通证券交易。

### （2）特有的卖空风险

融资融券交易中的融券交易存在着与普通证券截然不同的风险——卖空风险。普通证券

投资发生的损失是有限的，最多不会超过本基金投入的全部本金，但是融券交易的负债在理论上可以无限扩大，因为证券上涨的幅度是没有上限的，而证券涨得越多，融券负债的规模就越大。

### （3）利率变动带来的成本加大风险

如果在从事融资融券交易期间，中国人民银行规定的同期贷款基准利率调高，证券公司将相应调高融资利率或融券费率，投资成本也因为利率的上调而增加，将面临融资融券成本增加的风险。

### （4）通知送达风险

在融资融券交易过程中，相关信息的通知送达至关重要。《融资融券合同》中通常会约定通知送达的具体方式、内容和要求。当证券公司按照《融资融券合同》要求履行了通知义务后即视为送达，则若未能关注到通知内容并采取相应措施，就可能因此承担不利后果。

### （5）强制平仓风险

融资融券交易中，本基金与证券公司间除了普通交易的委托买卖关系外，还存在着较为复杂的债权债务关系，以及由于债权债务产生的信托关系和担保关系。证券公司为保护自身债权，对本基金信用账户的资产负债情况实时监控，在一定条件下可以对本基金担保资产执行强制平仓。

### （6）提前了结债务的风险

在融资融券交易中，证券公司可能在融资融券合同中与本基金约定提前了结融资融券债务的条款，本基金在从事融资融券交易期间，如果发生融资融券标的证券范围调整、标的证券暂停交易或终止上市等情况，根据本基金与证券公司签订的合同条款，本基金将可能面临被证券公司提前了结融资融券交易的风险，并可能由此给本基金造成损失。

### （7）监管风险

在融资融券交易出现异常或市场出现系统性风险时，监管部门、证券交易所和证券公司都将可能对融资融券交易采取相应措施，例如提高可充抵保证金证券的折算率、融资或融券保证金比例、维持担保比例和强制平仓的条件等，以维护市场平稳运行。这些措施将可能给本基金带来杠杆效应降低、甚至提前进入追加担保物或强制平仓状态等潜在损失。

## 13、港股通交易风险（如有）

### （1）投资范围限制与调整风险

通过港股通买卖的股票存在一定的范围限制，且港股通股票名单会动态调整。投资者应当关注最新的港股通股票名单。对于被调出的港股通股票，自调整之日起，投资者将不得再

行买入。

#### (2) 投资额度限制风险

港股通业务试点期间存在每日额度。在香港联合交易所有限公司（以下简称“联交所”）开市前阶段，当日额度使用完毕的，新增的买单申报将面临失败的风险；在联交所持续交易时段，当日额度使用完毕的，当日投资者将面临不能通过港股通进行买入交易的风险。

#### (3) 投资交易日风险

只有沪港（深港）两地均为交易日且能够满足结算安排的交易日才为港股通交易日，具体以上海（深圳）证券交易所在其指定网站公布的日期为准。圣诞前夕（12月24日）、元旦前夕（12月31日）或除夕日为港股通交易日的，港股通仅有半天交易，且当日为非交易日。

#### (4) 停市风险

香港出现台风、黑色暴雨或者联交所规定的其他情形时，联交所将可能停市，投资者将面临在停市期间无法进行港股通交易的风险；出现上海（深圳）证券交易所认定的交易异常情况时，上海（深圳）证券交易所将可能暂停提供部分或者全部港股通服务，投资者将面临在暂停服务期间无法进行港股通交易的风险。

#### (5) 汇率风险

投资者在交易时间内提交订单依据的港币买入参考汇率和卖出参考汇率，并不等于最终结算汇率。港股通交易日日终，中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中国结算”）进行净额换汇，将换汇成本按成交金额分摊至每笔交易，确定交易实际适用的结算汇率。

#### (6) 交易与结算规则风险

港股通股票不设置涨跌幅限制，投资者应当关注因此可能产生的风险；与内地证券市场相比，联交所在订单申报的最小交易价差、每手股数、申报最大限制等方面存在一定的差异，投资者应当关注因此可能产生的风险；通过港股通业务获得的香港证券市场免费一档行情，与付费方式获得的行情相比，在刷新频率、档位显示等方面存在差异，投资者应当关注依此进行投资决策的风险；香港证券市场与内地证券市场在证券资金的交收期安排上存在差异，港股通交易的交收期为T+2日。若投资者卖出证券，在交收完成前仍享有该证券的权益。若投资者买入证券，在交收完成后才享有该证券的权益，港股通交易的交收可能因香港出现台风或黑色暴雨等发生延迟交收；对于在联交所上市公司派发的现金红利，由于中国结算需要在收到香港中央结算有限公司（以下简称“香港结算”）派发的外币红利资金后进行换汇、清算、发放等业务处理，投资者通过港股通业务获得的现金红利将会较香港市场有所延后。

对于在联交所上市公司派发的红股，中国结算在收到香港结算派发红股到账当日或次日进行业务处理，相应红股可于处理日下一港股通交易日上市交易。投资者红股可卖首日均较香港市场晚一个港股通交易日；由于香港市场的费用收取或汇率的大幅波动等原因，可能会引起投资者账户的透支，投资者应当对账户内的余额进行关注。

#### （7）技术系统风险

港股通交易中若联交所与上海（深圳）证券交易所之间的报盘系统或者通信链路出现故障，可能导致15分钟以上不能申报和撤销申报，投资者应当关注因此可能产生的风险。

#### （8）费用与税收风险

香港市场收费标准与内地市场收费标准不同，香港地区与内地在税收安排方面也存在差异，投资者买卖港股通股票，应当按照香港市场有关规定交纳相关费用，并按照香港地区相关规定缴纳税款。

### 14、投资全国中小企业股份转让系统挂牌股票的特定风险（如有）

（1）公司风险：全国中小企业股份转让系统挂企业具有规模较小，对单一技术依赖度较高，受技术更新换代影响较大；对核心技术人员依赖度较高；客户集中度高，议价能力不强等特点。企业抗市场风险和行业风险的能力较弱，业务收入可能波动较大。同时，每个在全国中小企业股份转让系统挂牌企业获得的相关政策扶持也有一定的差异，政策持续性具有不确定性，对企业中长期发展会有一定程度的影响。

（2）流动性风险：全国中小企业股份转让系统本身存在较大的流动性风险，日间交易不活跃。且与上市公司相比，全国中小企业股份转让系统挂牌企业股权相对集中，市场整体流动性低于沪深证券交易所。可能存在建仓时间较长，并在投资后，不能及时变现的风险。

（3）信息风险：全国中小企业股份转让系统挂牌企业信息披露要求和标准低于上市公司，存在无法及时、准确获取全国中小企业股份转让系统挂牌企业最新经营信息和财务信息的风险。

（4）价格波幅较大的风险。目前全国中小企业股份转让系统交易量较小，主要以协议转让和做市转让为主，且无涨跌幅限制，存在价格波幅较大而导致亏损的风险。

### 15、其他风险

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，可能导致基金资产的损失。金融市场危机、行业竞争、代理机构违约等超出基金管理人自身直接控制能力之外的风险，可能导致基金份额持有人利益受损。

## 二十一、基金份额的非交易过户和冻结、解冻及质押

### （一）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、司法执行以及基金份额登记机构认可、符合法律法规的其他类型。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投资者。

继承是指基金份额持有人死亡，其持有的基金份额由其合法的继承人继承；捐赠指基金份额持有人将其合法持有的基金份额捐赠给福利性质的基金会或社会团体；司法强制执行是指司法机构依据生效司法文书将基金份额持有人持有的基金份额强制划转给其他自然人、法人或其他组织。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。

### （二）基金份额的冻结与解冻

本基金的基金份额冻结与解冻只包括人民法院、人民检察院、公安机关及其他国家有权机构依法要求的基金份额冻结与解冻事项，以及基金份额登记机构认可、符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻。

### （三）基金份额的质押

在不违反届时有效的法律法规的条件下，基金份额登记机构将可以办理基金份额的质押业务或其他业务，公布并实施相应的业务规则。

## 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

本合同文本由基金管理人、基金托管人、基金投资者共同签署后合同即告成立。

#### 2、合同生效

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基金管理人确认成功，基金投资者获得基金份额；

(3) 本基金依法有效成立。

本合同生效后，对本合同各方具有法律效力，任何一方都不得单方解除。

(二) 合同的签署

1、本合同的签署应当采用纸质合同和/或电子合同的方式进行，由基金管理人、基金托管人、基金投资者共同签署。

如基金管理人、基金托管人及基金投资者通过电子合同方式签署本基金合同，基金管理人、基金托管人及基金投资者认可电子合同的法律效力。若本基金使用的电子合同平台完成基金电子合同签署的，并不代表电子合同平台提供方承担基金销售、募集以及合同的订立、效力、履行等相关职责。

2、基金投资者在签署合同后方可进行认购、申购。

(三) 经基金管理人确认有效的基金投资者认购、申购、赎回本基金的申请材料或数据电文和各推广机构出具的本基金认购、申购、赎回业务受理有关凭证等为本合同的附件，是本合同的有效组成部分，与本合同具有同等的法律效力。

## 二十三、基金合同的效力

(一) 基金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。基金份额持有人为法人的，本合同自基金份额持有人、基金管理人和基金托管人加盖公章（或合同专用章）以及三方法定代表人或授权代表签章或盖章之日起成立；基金份额持有人为自然人的，本合同自基金份额持有人本人签章或授权的代理人签章、基金管理人和基金托管人加盖公章（或合同专用章）以及双方法定代表人或授权代表签章之日起成立。当满足第二十二章中基金合同生效的条件后，本合同生效。

(二) 本合同自生效之日起对基金份额持有人、基金管理人、基金托管人具有同等的法律约束力。

(三) 在本基金存续期，基金投资者自全部赎回其持有基金份额之日起，不再是本基金的份额持有人和基金合同的当事人。

(四) 本合同有效期为基金合同生效日至基金合同终止日。

## 二十四、基金合同的变更、解除与终止

(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,可采用以下三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、对于根据法律法规和本合同的规定可不经基金份额持有人大会决议通过的事项,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约定的方式向基金份额持有人发布合同变更征询意见函(或通知)。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(基金管理人可设置临时开放日,且本条约定不受本合同“基金的申购、赎回与转让”中关于基金开放日及基金份额不允许赎回期限的限制);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工作日开始生效,对合同各方均具有法律效力。

3、基金合同约定的其他方式。

基金管理人负责就基金合同变更事项向基金份额持有人进行沟通与确认。基金合同变更事项生效后,基金管理人应及时向基金托管人出具盖章的合同变更生效通知并保证其真实性和有效性。

(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。在此种情况下,基金合同的变更无需私募基金份额持有人同意。但基金管理人应当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) 对基金合同进行重大的变更、补充,基金管理人应当在变更或补充发生之日起5个工作日内向中国基金业协会报告。

(四) 基金合同的解除

在中国基金业协会要求正式实施《私募投资基金募集行为管理办法》规定的回访制度后,投资者在募集机构回访确认成功前有权解除基金合同。出现前述情形时,募集机构应当及时退还投资者的全部认购款项。但是,对于“特殊合格投资者”、专业投资机构、受国务院金融监督管理机构监管的金融产品而言,该等基金投资者、基金管理人与基金托管人合法签署完毕且认购或首次申购资金实际交付后,该等基金投资者不得单方解除本合同。

(五) 基金合同终止的情形包括下列事项:

1、基金管理人、基金托管人职责终止,且在六个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的,导致基金管理人、基金托管人职责终止的原因包括但不限于以下:

- (1) 基金管理人依法解散、被依法撤销或被依法宣告破产的;
- (2) 基金管理人被依法取消私募投资基金管理人相关资质的;
- (3) 基金托管人依法解散、被依法撤销或被依法宣告破产的;
- (4) 基金托管人被依法取消基金托管资格的;

2、私募基金合同期限届满而未延期的;

3、基金份额持有人大会决定终止的;

4、法律法规和本合同规定的其他情形。

## 二十五、基金的清算

(一) 基金财产清算小组

1、自基金合同终止之日起 30 个工作日内成立基金财产清算小组。

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

(二) 基金财产清算程序

1、基金合同终止后,由基金财产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

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

(四) 基金财产清算过程中剩余资产的分配

依据基金财产清算的分配方案,将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费

用及各项负债后，按照基金份额持有人拥有的基金份额比例或基金合同的约定进行分配。其中，在基金清算时免收基金份额持有人的赎回费用（若有）。

（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的通知为准。

（六）基金财产清算报告

本基金完成清算后，基金财产清算小组应编制基金财产清算报告，加盖基金管理人和基金托管人公章或业务章后以约定的方式通知基金份额持有人。

（七）基金财产清算账册及文件由私募基金管理人保存10年以上。

（八）基金财产相关账户的注销

基金财产清算完毕后，基金托管人及基金管理人应按照交易所、银行的有关规定注销托管资金专门账户、证券账户和期货账户等投资所需账户。

## 二十六、违约责任

（一）当事人违反本合同，应当承担违约责任，给合同其他当事人造成损失的，应当承担赔偿责任；如属本合同当事人双方或多方当事人的违约，根据实际情况，由违约方分别承担各自应负的违约责任。但是发生下列情况，当事人应当免责：

1、基金管理人及和/或基金托管人按照中国证监会的规定或当时有效的法律法规的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，或交由商业银行、期货公司、证券公司等其他机构负责清算交收的委托资产（包括但不限于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、本协议各方对由于第三方（包括但不限于交易所、中登公司、经纪商等）发送或提供的数据错误给本基金资产造成的损失等。

6、不可抗力。

（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投资人损失，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但是基金管理人和基金托管人应积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

（四）一方依据本合同向另一方赔偿的损失，仅限于直接损失。

（五）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。

## 二十七、通知与送达

本合同的规定需要发出的任何通知、要求、需要、主张和其他联络内容等，基金管理人除了可通过管理人或代销机构的网站以公告的方式进行通知的事项外，还可以当面递交、传真、快递、挂号信、电子邮件或短信的方式送至本合同各方当事人。

被送达方为基金管理人的，送达至本合同当事人信息页规定的基金管理人的联系地址或基金管理人按本合同的规定变更后的联系地址，即视为送达；被送达方为基金托管人的，送达至本合同当事人信息页规定的基金托管人的联系地址或基金托管人按本合同的规定变更后的联系地址，即视为送达；被送达方为基金份额持有人的，送达至其在募集机构预留的联系地址为或其按照本合同规定变更后的联系地址，即视为送达。

任何一方在任何时间改变接收通知所用的地址、电子邮箱、传真号码或手机号码都应立即将该变更书面通知另一方；如果该变更通知未能送达，递交给上述收件人或地址的通知或联络应视为被正常发送和接收。

所有该等通知和其他联络均应视为已被收到：（1）当面递交的，于递交时收到；（2）邮寄或快递的，则寄出五个工作日视为收到；（3）传真递交的，传真机报告确认时视为收到；（4）电子邮件发送的，收件方服务器接收视为收到；（5）短信发送的，发送方发送成功视为收到。

## 二十八、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。合同当事人不愿通过协商、调解解决或者协商、调解未能解决的,应提交深圳国际仲裁院申请仲裁,仲裁地在深圳,以该会当时有效的仲裁规则为准,仲裁裁决是终局性的,并对各方当事人具有约束力,除裁决另有规定外,仲裁费由败诉方承担。

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

## 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)

(请基金份额持有人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,基金管理人和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、其他 \_\_\_\_\_

证件号码:

2、法人或其他组织

名称:

营业执照号码/统一社会信用代码:

组织机构代码证号码:

法定代表人或负责人:

(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,基金份额持有人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:

(三) 认购份额

A类份额                       B类份额

(四) 认购/初始申购金额

签署本合同之基金投资者,承诺认购/初始申购如下金额(不含额外缴纳认/申购费):

人民币¥ \_\_\_\_\_ (大写人民币 \_\_\_\_\_ 元整)。

如涉及额外缴纳认/申购费,则额外缴纳的认/申购费为:

人民币¥ \_\_\_\_\_ (大写人民币 \_\_\_\_\_ 元整)。



**附件一：基金代销合同的主要内容**

**（摘自《基金代销合同》）**

**甲方（委托方）：**南京璟恒投资管理有限公司

**住所：**南京市鼓楼区山西路8号金山大厦B楼8E

**法定代表人：**李志强

**乙方（代理人）：**招商证券股份有限公司

**住所：**深圳市益田路江苏大厦38-46层

**法定代表人：**霍达

**（一）甲方的权利和义务**

**甲方享有如下权利：**

1. 根据法律法规，委托乙方办理金融产品代销业务及按照本协议规定的条件和程序解除本协议。
2. 要求乙方严格按照本协议及具体金融产品代销补充协议、金融产品招募相关合同文书的规定，办理金融产品代销有关事宜，有权随时向乙方了解代销事务的进展情况，并对乙方的代销业务开展情况进行监督。
3. 根据自身业务需要选择除乙方以外的其他代销机构销售金融产品。
4. 法律法规、具体金融产品代销补充协议以及本协议规定的其他权利。

**甲方负有如下义务：**

1. 甲方具有国家有关部门及其授权机构批准的金融产品发行资质，保证委托乙方代销的金融产品符合法律法规规则的要求。甲方对金融产品的发行和管理，应当合法合规，遵循平等、自愿、公平、诚实信用的原则，不得损害投资者的合法权益。若因甲方违规操作给乙方或乙方客户造成任何损失，由甲方承担全部赔偿责任。
2. 甲方应向乙方提供与金融产品代销业务有关的全部信息和资料（包括但不限于金融产品说明书、金融产品合同、金融产品推介材料、《适当性管理办法》第十六条、十七条规定的金融产品分级考虑因素等），并保证所提供的资料及信

息真实、准确、完整，不得夸大过往的管理水平和收益水平。相关信息和资料发生变更的，甲方应在相关信息和资料变更前\_\_3\_\_个工作日内以书面形式告知乙方。如因甲方提供的信息和资料造成客户误解，由此造成的损失和责任，由甲方承担。

3. 甲方应按照乙方的要求，及时提供与金融产品代销业务有关、有助于乙方进行风险甄别材料，包括但不限于内控制度、资产状况、财务报表、尽调报告、资质证明和承诺协议等材料。

4. 依法制定并向乙方告知金融产品适当性管理标准和要求（作为本协议附件）。

5. 甲方应承担合格客户的最终甄别责任，自行独立对客户的资信、风险承受能力和认购资金来源进行审慎判断，乙方的判断并不减轻或免除甲方的审查义务。

6. 甲方有义务保证代销相关金融产品相关的账户管理、注册登记和清算工作的正常、高效进行，有义务对乙方代销金融产品的业务提供协助，并与乙方一同对客户进行高质量的售后服务，共同提高客户服务品质。

7. 甲方有义务按照本协议及具体金融产品代销补充协议规定的标准、方式和时间，向乙方支付销售代理费用。

8. 甲方对代销过程中涉及到乙方或乙方客户的商业秘密负有保密义务，并且该保密义务不因本协议的终止而终止。在任何时候，未经乙方的许可甲方皆不得泄密（但甲方根据有关法律、法规、规章的要求或经双方约定应予公开的除外）。

9. 甲方应按照约定的数据传输时间及时、准确地向乙方传输账户和交易确认的数据。

10. 金融产品发行过程中，如发生有可能影响代理销售工作开展的事项，甲方应在该事项发生之日起\_\_3\_\_个工作日内及时通知乙方。

11. 若出现可能影响金融产品兑付情况的重大事件，包括但不限于资金投向的标的可能遭受重大损失，资金使用方财务状况严重恶化，担保方或者担保品出现异常情况等，甲方应当在获知有关情况后1个工作日内即向乙方披露，并自披露之日起3个工作日内向乙方书面提出甲方拟采取的应对措施。

12. 乙方客户与甲方之间发生的纠纷以及乙方客户对甲方所提供的服务提出的异议，均由甲方自行解决并承担由此所产生的全部责任。

13. 因甲方原因产生的乙方客户投诉，甲方必须及时妥善处理，并向乙方反

馈处理结果。

14. 如因甲方原因导致金融产品被撤销、金融产品合同无效或被解除或甲方提供的信息和材料存在虚假或违法违规等情况，由甲方承担一切责任。在此情形下，甲方仍应按本协议约定向乙方支付相关代销报酬，并依法承担因此给乙方造成的损失。

15. 除甲方按照法律法规规则履行信息披露义务外，未经乙方书面授权，甲方不得以任何方式与乙方客户联系。如乙方客户直接与甲方联系，甲方有义务通知乙方，经乙方同意后可与乙方客户沟通，沟通内容应形成文字记录并于三个工作日内转交乙方留档。甲方在向乙方客户推介甲方其他金融产品、服务时须事先告知乙方，并通过乙方代销及提供相关后续服务。

16. 甲方承诺按照法律法规规则规定的信息披露内容、披露频率、披露方式、披露渠道承担金融产品信息披露义务。

17. 甲方承诺甲方及其实际控制人、高级管理人员、投资经理，以及受同一实际控制人控制的其他机构，在乙方代销任一产品准入及产品存续期间，如发生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，或被监管机关或自律组织采取行政处罚、行政监管措施、纪律处分，或涉及产品投资与管理、产品托管业务的重大诉讼、仲裁，或中国证监会以及中国基金业协会规定的的影响投资者合法权益的情形，应主动向乙方及乙方客户披露。如甲方存在故意或重大过失未向乙方或乙方客户披露的，甲方同意乙方采取包括但不限于终止代销合作等措施，并独立承担给乙方及乙方客户造成的损失。

18. 如甲方委托乙方代销的金融产品买卖甲方及其控股股东、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，或者买卖前述主体直接或间接管理或代理销售的、或者该等主体持有的投资产品，应遵循基金份额持有人利益优先的原则，防范利益冲突，并在达成具体金融产品销售协议时、或相关买卖行为发生之日起\_\_3\_\_个交易日内向乙方、乙方客户进行披露。

19. 甲方应于每个自然周第\_\_3\_\_个交易日、收益分配日、金融产品开放日以及本金融产品终止日定期向乙方披露金融产品的净值，甲方保证向乙方披露的金融产品的净值真实、准确。

20. 甲方授权托管人向乙方披露金融产品的净值，发送金融产品预警、止损

的相关通知。

21. 甲方应按照金融产品合同约定的预警线、止损线进行降低仓位、平仓等止损操作。如违反金融产品合同的约定，甲方应承担给乙方、乙方客户造成的损失。

22. 法律法规规则、具体金融产品代销补充协议及本协议规定的其他义务。

## **(二) 乙方的权利和义务**

### **乙方享有如下权利：**

1. 乙方有权在本协议以及具体产品代销补充协议规定的范围内，根据甲方提供的资料和信息等，独立确定自身的销售策略、销售网点安排，办理金融产品销售代理业务。

2. 甲方不按本协议要求向乙方提供代销金融产品的信息和资料或提供的信息和资料不完整的，乙方有权拒绝为甲方代销金融产品。乙方有权审查、核实甲方提供的金融产品信息和资料，并有权敦促甲方对上述材料中不符合相关法律法规规则和乙方要求之处进行更正或补充。

3. 乙方有权按照本协议及其具体金融产品代销补充协议规定的标准、方式和时间，取得金融产品代销费用。

4. 乙方有权根据乙方客户偏好和风险程度等因素，自主选择推介某个金融产品。

5. 在签订本协议后，乙方仍可自主选择其他公司进行合作，销售其他公司的同类金融产品。

6. 若甲方发生乙方所代销金融产品合同范围以外的过错，而给金融产品客户或乙方造成的损失，乙方有权要求甲方承担相应责任。

7. 乙方有权不为所代销的金融产品垫付任何费用或资金。

8. 乙方对于收到的乙方客户就甲方或其金融产品的投诉，有权敦促甲方及时进行妥善处理。

9. 如甲方违反金融产品合同预警线、止损线的约定不进行降低仓位、平仓止损操作，乙方有权督促甲方按照金融产品合同的约定进行降低仓位、平仓操作，并有权向乙方客户披露、向监管机关报告甲方的违约行为。甲方应承担因其违约

行为给乙方、乙方客户造成的损失。

10. 法律法规、具体金融产品代销补充协议及本协议规定的其他权利。

**乙方负有如下义务：**

1. 严格遵循法律法规规则之规定和具体金融产品代销补充协议、金融产品合同及本协议的规定，办理金融产品销售代理业务，勤勉、尽责地履行销售代理人的职责。

2. 乙方根据销售业务需要配备足够的、合格的销售人员，在甲方的协助下，对销售人员做好培训，并采取有效手段和方式，保障金融产品代理销售交易业务的正常、高效进行，为乙方客户提供优质的客户服务。同时协助甲方妥善处理客户查询、咨询、投诉等客户服务工作。

3. 对代销业务涉及到的甲方的商业秘密，乙方负有保密义务，并且该保密义务不因本协议的终止而终止。任何时候，未经甲方许可，乙方不得泄密（有关法律法规规则另有规定或者经双方约定应予公开的除外）。

4. 乙方接受甲方对代理销售业务的监督。

5. 乙方应根据所代销金融产品的风险性质，协助甲方充分向乙方客户揭露风险信息，并按照届时有有效的、已公开披露的信息客观介绍所代销的金融产品及有关业务办理程序，不得对金融产品的投资回报做任何保证或承诺，或提供任何超出已公开披露的信息范围的解释或说明。

6. 乙方在代销业务开展过程中，如业务系统需接入第三方机构的业务系统，所涉及的技术接口、技术规范应当经甲乙双方和第三方机构协商一致。具体技术标准，由附件或补充协议规定。

7. 乙方应严格执行甲方依法制定的金融产品适当性管理标准和要求，承担乙方客户投资者评估、合格投资者确认、适当性匹配等适当性义务。

8. 法律法规、具体产品代销补充协议及本协议规定的其他义务。