

合同编号：

浦信日添月益基金 基金合同

管理人：上海恒基浦业资产管理有限公司

托管人：国泰君安证券股份有限公司

重要提示

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，管理人并不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。投资有风险，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。

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。

目录

重要提示.....	0
一、前言.....	2
二、释义.....	2
三、声明与承诺.....	4
四、基金的基本情况.....	4
五、基金的募集、成立与备案.....	5
六、基金的申购和赎回.....	6
七、当事人及权利义务.....	9
八、基金份额的登记.....	13
九、基金的投资.....	13
十、基金的财产.....	16
十一、指令的发送、确认与执行.....	17
十二、交易及清算交收安排.....	19
十三、越权交易处理.....	20
十四、基金财产的估值和净值计算.....	21
十五、基金的费用与税收.....	25
十六、基金的收益分配.....	29
十七、信息披露.....	29
十八、基金有关文件档案的保存.....	30
十九、基金份额的转让、非交易过户和冻结.....	30
二十、托管人对管理人的业务监督和核查.....	31
二十一、管理人对托管人的业务核查.....	31
二十二、基金合同的成立、生效及签署.....	32
二十三、基金合同的变更、终止.....	32
二十四、清算程序.....	33
二十五、违约责任.....	34
二十六、法律适用和争议的处理.....	35
二十七、基金合同的效力.....	36
二十八、其他事项.....	36
附件一：投资监督事项表.....	38

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、管理人、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：《浦信日添月益基金基金合同》及对本合同的任何有效修订和补充。

2、本基金：浦信日添月益基金。

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、管理人：上海恒基浦业资产管理有限公司。

6、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、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。

10、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。

11、运营服务机构：接受管理人委托，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。

12、证券经纪机构：指管理人指定且经托管人同意的证券经纪机构。

13、期货经纪机构：指管理人指定且经托管人同意的期货经纪机构。

14、交易日：指全国性证券交易所的正常交易日。

- 15、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。
- 16、开放日（如有）：管理人办理基金份额申购、赎回业务的交易日。
- 17、销售机构：指管理人及/或管理人委托的代理销售机构。
- 18、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。
- 19、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。
- 20、基金财产：基金份额持有人拥有合法处分权、管理人管理并由托管人托管的作为本合同标的的财产。
- 21、银行结算账户：简称“托管账户”，是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。
- 22、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，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。
- 23、证券交易资金账户：管理人或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。
- 24、期货账户：管理人或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。
- 25、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。
- 26、基金资产净值：本基金资产总值减去负债后的价值。
- 27、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。
- 28、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。
- 29、募集期：指本基金的初始销售期限。
- 30、存续期：指本基金成立至清算之间的期限。
- 31、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。
- 32、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。
- 33、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。
- 34、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。

35、新三板（如投）：指全国中小企业股份转让系统。

36、港股通股票（如投）：指港股通标的范围内的证券。

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管理人和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管理人和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，应当及时书面告知管理人及/或代理销售机构。基金投资者承认，管理人、托管人未对基金财产的收益状况作出任何承诺或担保。**

（二）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。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）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：浦信日添月益基金基金。

（二）基金类别：私募投资基金。

（三）基金的运作方式：契约型。

（四）私募基金的存续期限：20 年。经管理人、委托人、托管人协商一致，基金可提前终止或展期。

（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、基金的募集、成立与备案

（一）基金的募集、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，基金投资者可在募集期内的交易日认购本基金。当本基金符合法律法规规定的成立条件时，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、募集期认购的价格及方式

（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。

（2）基金认购采用金额申请的方式。

2、认购申请的确认

认购申请完成后，基金投资者不得撤销。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。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。

3、认购金额的限制

基金投资者认购金额应不低于 100 万元人民币。

法律法规另有规定的，从其规定。

4、认购的费率

本基金认购费率为 0%。

5、认购份额的计算方式

认购份额=认购金额/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，由此带来的收益和损失归入基金财产。

6、募集期间资金的处理

（1）直销处理（如有）

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：9551077700000100021

开户银行名称：招商银行股份有限公司上海龙茗路支行

大额支付号：308290003669

募集账户的资金任何人不能动用。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，募集账户中的资金仅可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。

（2）代销处理（如有）

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。

7、基金的成立

管理人应根据认购结果，将募集资金划入基金托管账户。

托管人核实资金到账情况，并向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。托管人的监督职责自基金募集期结束、基金成立后开始。

管理人应于基金成立后通知基金份额持有人。

（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，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

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、基金的申购和赎回

（一）申购和赎回的时间

本基金自成立日起 15 个工作日开放申购、不开放赎回；基金投资者可在本基金开放日申购、赎回本基金。各笔基金申购份额首 7 个自然日不可赎回，本基金开放日（以下简称为 T 日或开放日）为封闭期结束后的每个工作日。基金份额赎回将在出具赎回指令后的 5 个工作日内（T+5）完成。

（二）申购和赎回的预约登记

基金投资者通过管理人申购本基金的，应在申购预约登记期间（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。申购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。若基金投资者未在申购预约登记期间内申购预约登记成功，则管理人有权拒绝基金投资者在当期开放日的申购申请。

基金份额持有人通过管理人赎回本基金的，应于赎回预约登记期间（T-9 日至 T-5 日）之间填写管理人提供的申请表进行赎回预约登记。赎回预约登记成功以管理人收到申请表并经管理人确认为准。若基金份额持有人未在赎回预约登记期间内预约登记，则管理人有权拒

绝基金份额持有人在当期开放日的赎回申请。

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。

（三）申购和赎回的方式、价格及程序

1、基金投资者申购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，同时管理人按先进先出的原则，根据基金投资者认购、申购基金份额的先后次序进行赎回确认。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、基金申购采用金额申请的方式，基金赎回采用份额申请的方式。

（四）申购和赎回申请的确认

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。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。管理人在申购预约登记期间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”的原则确认有效申购申请。超出基金投资者人数规模上限的申购申请为无效申请。

在正常情况下，份额登记机构在 T+1 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，管理人应在 T+2 日起三十日内退还投资者已缴纳的款项。

基金份额持有人赎回申请确认后，管理人将在 T+8 日（包括 T+8 日）内支付赎回款项。

（五）申购和赎回的金额限制

基金投资者首次购买金额应不低于 100 万元人民币，在开放日内追加申购的，追加金额应为 1 万元人民币起。

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，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。

（六）申购和赎回的费率

1、申购费率

本基金的申购费率为 0%。

2、赎回费率

本基金的赎回费率为 0%。

（七）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=申购金额/申购价格。

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。

2、赎回金额计算

赎回金额=赎回份数×赎回价格-应计提业绩报酬（如有）。

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。

（八）拒绝或暂停申购、暂停赎回的情形及处理

1、在如下情形下，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，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）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、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。

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，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、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。

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，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，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、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，管理人应当告知基金份额持有人。已接受的赎回申请，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，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。

（九）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，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，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管理人决定执行部分延期赎回时，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) 监督管理人及托管人履行投资管理和托管义务的情况；
- (4) 按照本合同约定的时间和方式获得基金的运作信息资料；
- (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、管理人管理的其他资产及托管人托管的其他资产合法权益的活动；
- (8) 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；
- (9) 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。
- (10) 国家有关法律法规、监管机构及本合同规定的其他义务。

(二) 管理人

1、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，监督托管人；对于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) 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、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) 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;

(8) 按照本合同的约定接受基金份额持有人和托管人的监督;

(9) 以管理人的名义, 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;

(10) 按照本合同约定向基金投资者报告基金份额净值;

(11) 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;

(12) 确保证券/期货经纪服务机构及时向托管人、运营服务机构发送结算数据、对账单等估值所需的资料;

(13) 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;

(14) 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;

(15) 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;

- (16) 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；
- (17) 妥善保管并按托管人要求及时向托管人移交基金投资者签署的基金合同原件，因管理人未妥善保管或及时向托管人移交基金合同原件导致托管人损失的，管理人应予以赔偿；
- (18) 建立并保存基金份额持有人名册，按规定向托管人提供基金份额持有人名册资料；
- (19) 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托管人和基金投资者；
- (20) 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；
- (21) 当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；
- (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) 托管人

1、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，监督管理人的投资运作，对于管理人违反法律、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，托管人对因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、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) 复核基金份额净值；
- (6) 按照本合同的约定，根据管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；
- (7) 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；
- (8) 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；
- (9) 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；

(10) 依据本合同《投资监督事项表》的约定，监督管理人的投资运作，发现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，立即通知管理人；发现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，应当立即通知管理人；

(11) 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) 管理人委托份额登记机构办理本基金的份额登记业务的，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

本基金在风险可控的前提下，为投资者赚取稳定的收益，并满足委托人流动性需求。

(二) 投资范围

交易所和银行间上市交易的债券，包括国债、企业债券、公司债券（包括大公募、小公募、非公开发行定向公司债）、地方政府债、资产支持证券、资产支持票据、可转债、可交换债、中小企业私募债，各类金融债、次级债、中央银行票据、短期融资券、中期票据、非公开定向债务融资工具；货币市场基金、债券型公募基金、国债期货、仅以证券公司为交易对手的收益互换、银行存款（含银行协议存款、大额可转让存单）、现金、债券正逆回购、信托计划、证券公司资产管理计划、基金公司及其子公司特定客户资产管理计划。

全体基金份额持有人在此授权并同意：投资非二级市场标的时，管理人有权代表本基金与相关方签署基金投资相关文件及协议，并以管理人的名义办理相关权属登记及变更手续。但管理人应确保向投资相对方说明真实的资金来源为本基金，并保证将投资本金及收益及时返回至本基金托管账户。

本基金投资公募基金、信托计划、证券公司资产管理计划、基金公司特定客户资产管理计划等上述产品时，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，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。管理人应确保上述交易文件的始终有效性、真实性、完整性、准确性。上述产品的管理人或投资顾问为管理人的，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得进行抵押、质押、非交易过户或其他任何有损本基金投资者利益的行为。

本合同对拟投资标的的进行穿透约定的（例如投资某基金，对该基金的投向或如何运作进行约定），以该投资标的的交易/法定文件的具体约定为准。管理人负责审查本合同穿透约定与该投资标的的交易/法定文件的具体约定是否一致，如不一致但仍向托管人发出投资划款指令的，管理人保证该不一致不损害基金份额持有人的利益。托管人仅根据投资划款指令进行划款，不负责审核上述事项，不承担由此导致的损失。

（三）投资策略

本方案基本思路在于通过超配高收益低流动性资产，同时保存部分高流动性资产以实现较为温和的杠杆策略，来放大收益。从配置资产的角度，整个组合要兼顾收益和杠杆部分流动性，并在风险合理可控的前提下获得稳定的收益。

（四）投资限制

本基金财产的投资组合应遵循以下限制：

1、本基金投资的债券（短期融资券除外），长期主体或债项信用评级不低于 AA-级（含）。评级机构包括大公国际资信评估有限公司、中诚信国际信用评级有限责任公司、中诚信证券评估有限公司、联合资信评估有限公司、联合信用评级有限公司、上海远东资信评估有限公司、东方金诚国际信用评估有限公司、上海新世纪资信评估投资服务有限公司及鹏元资信评估有限公司九家评级机构；

2、法律法规、中国证监会规定的其他投资限制。

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。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管理人可以控制的原因导致管理人不能履行调整义务的，则调整期限相应顺延。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。

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）管理人可运用基金财产买卖管理人、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）投资经理

本基金投资经理简历如下：顾晓明

CFA, 香港大学 MBA 荣誉毕业生。15 年股票及 7 年期货投资经验，5 年固定收益投研经验，目前担任公司投资总监，组建公司固定收益部并负责投研及运营，擅长各类金融产品的设计及运作，包括金融对冲模型、各类金融资管方案、量化投资组合及各类固定收益型产品。

（九）投资顾问的聘任

本基金聘请中信证券股份有限公司为本基金的投资顾问。投资顾问的基本情况如下：

名称：中信证券股份有限公司

住所：北京市朝阳区亮马桥路 48 号

通讯地址：北京市朝阳区亮马桥路 48 号

邮政编码：100026

法定代表人：王东明

联系人：孔祥雨

联系电话：010-60836961

投资顾问的职责是受基金管理人委托提供本基金投资相关的建议和意见，保证投资建议合法合规，不得违反金融监管部门的要求。基金管理人根据投资顾问建议，独立判断接受或者拒绝投资顾问的投资建议，具体事宜由基金管理人与投资顾问另行签署《投资顾问合同》进行约定。除法律另有规定外，基金管理人与投资顾问间不承担连带责任。

基金委托人签署本合同即表明其已认可和同意基金管理人聘请中信证券股份有限公司作为本基金的投资顾问，并同意授权投资顾问按本基金文件约定的方式为基金管理人提供投资顾问服务。

十、基金的财产

（一）基金财产的保管与处分

1、基金财产独立于管理人、托管人的固有财产，并由托管人保管。管理人、托管人不得将基金财产归入其固有财产。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，由管理人保管相关财产或财产权利凭证的，管理人应当自行安全保管。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，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，管理人、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、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，应由管理人负责与有关当事人确定到账日期并书面通知托管人，到账日基金资产没有到达基金托管账户的，托管人应及时通知管理人采取措施进行催收。由此给基金造成损失的，管理人应负责向有关当事人追偿基金的损失。托管人对此不承担任何责任。

（二）基金财产相关账户的开立和管理

托管人按照规定开立基金财产的托管账户等投资所需账户，管理人应给予必要的配合，并提供所需资料。托管账户的开立和使用，仅限于满足本基金开展业务的需要。

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。

因业务发展而需要开立的其他账户，应由托管人或管理人根据有关法律法规的规定开立、管理和使用。

（三）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

实物证券由托管人存放于托管人或其他管理人与托管人协商一致的第三方机构的保管库。托管人对由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托管人负责保管。

（四）与基金财产有关的重大合同的保管

由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托管人、管理人保管。对于无法取得二份以上的正本的，管理人应向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。

因管理人未按本协议约定及时向托管人移交重大合同原件或复印件导致的法律责任，由

管理人自行承担。

（五）未上市企业存量股权及增发股票或股权的保管（如有）

本基金投资未在新三板挂牌或未上市企业存量及增发股票或股权，管理人及托管人不保证所投资股票或股权能最终在新三板挂牌或其他交易所上市，托管人不负责监督或审核未投资股票或股权在新三板挂牌或其他交易所上市的可能性。管理人应当在取得上述股票或股权凭证后的三个工作日内提交托管人保管及/或完成工商变更登记后的三个工作日内将相应股权变更证明提交托管人。管理人应确保上述文件的始终有效性、真实性、完整性、准确性，并负责对未提交给托管人的该等股票或股权凭证原件的安全保管。对于管理人未及时或未向托管人提交股票或股权凭证，以及未通知托管人将相关股票或股权凭证挂失、再转让等行为导致本基金财产的损失，托管人不承担责任。托管人对上述股票或股权凭证的保管并不保证该等股票或股权凭证所对应的实际资产不致灭失。托管人对股票或股权凭证对应的实际资产的真实性和合法性不承担任何责任。

十一、指令的发送、确认与执行

（一）管理人对发送指令人员的书面授权

管理人应按本合同的约定事先书面通知（以下称“授权通知”）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。管理人向托管人发出的授权通知应加盖公章。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，同时以电话形式向托管人确认；授权通知自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。管理人应在此后三个交易日内将授权通知的正本送交托管人。传真件或扫描件如与正本不一致，托管人以传真件或扫描件为准并及时通知管理人。

管理人和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，管理人向托管人发出的资金划拨指令。管理人发给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管理人用传真方式或电子邮件发送扫描件的方式向托管人发送。管理人有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（托管人）确认该指令已成功接收之时视为送达。因管理人未能及时与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，托管人不承担责任。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，管理人不得否认其效力。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。管理人在发送指令时，应为托管人留出执行指令所必需的时间。因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管理人承担。除需考虑资金在途时间外，管理人还需为托管人留有 2 小时的复核和审批时间。在每个交易日的 13:00 以后接收管理人发出的银证转账、银期转账划款指令的，托管人不保证当日完成划转流程；在每个交易日的 14:30 以后接收管理人发出的其他划款指令，托管人不保证当日完成在银行的划付流程。

托管人收到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，托管人立即与管理人指定人员进行电话联系和沟通，并要求管理人重新发送经修改的指令。管理人应将银行间市场成交单加盖公章后传真或电子邮件发送扫描件方式发送给托管人。托管人可以要求管理人传真提供相关交易凭证、合同或其他有效会计资料，以确保托管人有足够的资料来判断指令的有效性。托管人仅根据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。托管人不负责审查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，管理人应保证上述文件资料合法、真实、完整和有效。如因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托管人的审核或给任何第三人带来损失，托管人不承担任何形式的责任。

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

经管理人与托管人协商一致后，可采用除上述发送传真、电子邮件发送扫描件之外的其他方式（如电子指令接收系统）进行指令的发送、确认与执行。

（四）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

托管人发现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，并应及时通知管理人纠正，管理人收到通知后应及时核对，并予以纠正，如未及时纠正由此造成的损失由管理人承担。

（五）管理人发送错误指令的情形和处理程序

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。托管人在履行监督职能时，发现管理人的指令错误时，有权拒绝执行，并及时通知管理人改正。

（六）更换被授权人的程序

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，同时电话通知托管人。被授权人变更通知自托管人

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，托管人仍应按原约定执行指令，管理人不得否认其效力。管理人此后三个交易日内将被授权人变更通知的正本送交托管人。传真件或扫描件如与正本不一致，托管人以传真件或扫描件为准并及时通知管理人。

（七）指令的保管

指令若以传真或扫描件形式发出，则正本由管理人保管，托管人保管指令传真件或扫描件。当两者不一致时，以托管人收到的指令传真件或扫描件为准。

（八）相关责任

托管人正确执行管理人符合本合同规定的划款指令，基金财产发生损失的，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，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托管人如遇到不可抗力的情况除外。

如果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托管人原因造成的情形，只要托管人根据本合同相关约定验证有关印鉴与签名无误，托管人不承担因正确执行有关指令而给管理人或基金财产或任何第三人带来的损失，全部责任由管理人承担。

十二、交易及清算交收安排

（一）基金投资交易所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。

2、证券交易所证券资金结算

托管人、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。

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；若由于管理人原因造成的正常结算业务无法完成，责任由管理人承担。

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）投资期货的清算与交收（如有）

管理人负责选择代理本基金期货买卖的期货经纪机构，并与托管人及期货经纪机构，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管理人选定的期货经纪机构负责办理，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机构的资金不行使保管职责,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机构承担资金安全保管责任。

(三) 其他交易的清算与交收

其他交易的清算与交收由托管人依据管理人符合本合同约定的有效资金划拨指令和其他相关文件进行资金划拨。

(四) 无法按时清算的责任认定及处理程序

管理人应保证托管人在执行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,托管人有权拒绝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。管理人在发送资金划拨指令时应充分考虑托管人的划款处理时间,一般为2个工作小时。托管人不承担由于管理人指令传输不及时、未能留出足够的划款时间及其它非托管人原因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,托管人对管理人符合法律、行政法规和本合同约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管理人或其指定的份额登记机构负责。

2、管理人或其委托的份额登记机构应将每个开放日的申购、赎回数据传送给托管人。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。托管人应及时查收申购资金的到账情况并根据管理人指令及时划付赎回及转换款项。

3、管理人应在T+5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,托管人应及时通知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。管理人负责向责任方追偿基金的损失。

4、管理人应在T+7日之前向托管人发送赎回的划拨指令。托管人依据划款指令在T+8日(包含赎回产生的应付费用)内划至管理人指定账户。管理人应及时通知托管人划付。若赎回金额未能如期划拨,由此造成的损失,由责任方承担。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。

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。

托管人对管理人的投资行为行使监督权。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管理人负担，所发生的收益归本基金财产所有。

（三）托管人投资监督的真实性、准确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，合规投资的责任在管理人。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）托管人无投资责任，对任何管理人的投资行为（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。托管人按照本合同约定履行了投资监督义务的，不对管理人的行为承担任何补充或连带责任。托管人不会因为提供投资监督报告而承担任何因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，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

管理人与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

估值应符合法律、法规及本合同的规定，如未做明确规定的，应由管理人（或管理人委托的运营服务机构）与托管人协商一致确定。

4、估值对象

基金拥有的所有资产及负债。

5、估值依据和方法

（1）固定收益证券的估值

①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，按最近交易日的收盘价估值。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，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。交易所上市的资产支持证券，选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值，如第三方估值机构不发布估值价的，采取估值技术确定公允价值。当上述债券品种发生违约时，管理人应当及时通知托管人进行估值方法调整，如因管理人未及时通知导致托管人未及时调整的，不视为估值错误。

对在全国银行间债券市场交易的固定收益品种（包括但不限于债券、资产支持证券、非公开定向债务融资工具、同业存单等投资品种），选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值。如第三方估值机构不发布估值价的，采取估值技术确定公允价值。

特别地，上述选用第三方估值机构提供的估值价进行估值的固定收益品种，其中：证券交易所固定收益品种优先按照中证指数有限公司（简称“中证”）提供的估值净价估值，银行间固定收益品种优先按照中央国债登记结算有限责任公司（简称“中债”）提供的估值净价估值。若管理人需调整前述对应第三方机构的，则以书面形式通知托管人。

②现金类资产按成本列示。

③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。

④未上市债券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。

（2）基金估值方法：

①同一基金分别在两个或两个以上市场交易、登记的，按照所处市场的公允价值分别估值。

②在证券交易所交易、登记的上市流通封闭式基金、ETF 基金、场内登记的 LOF 基金等，以其估值日在证券交易所挂牌的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值。在场外交易、登记的开放式基金（含场外登记的 LOF 基金）按前一日基金份额净值估值；如果估值日分红确认，则按前一日基金份额净值减单位分红额后的差额估值。前一日未公布基金份额净值的，以最近公布的基金份额净值估值；在基金首次公布份额净值之前按照购入成本估值。

③未上市的封闭式基金按估值日的净值估值，若估值日未公布净值，按最近公布的净值估值。

④货币市场基金按照该基金公布的每万份收益逐日计提收益。

（3）其他资产的估值方法

其他资产按照国家有关规定或行业约定进行估值。

（4）国家对估值方法有最新规定的，按其规定进行估值。

（5）如管理人认为上述估值方法对产品财产进行估值不能客观反映其公允价值的，管

理人在综合考虑市场各因素的基础上,可根据具体情况与托管人商定后,按最能反映公允价值的价格估值。

(6) 如资产管理人或资产托管人发现对委托财产的估值违反本合同项下订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护资产委托人利益时,应立即通知对方,共同查明原因,双方协商解决。”

6、估值程序

基金日常估值由管理人进行。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托管人,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,管理人与托管人可以各自委托第三方机构进行基金资产估值,但不改变管理人与托管人对基金资产估值各自承担的责任。

7、估值错误的处理

管理人和托管人将采取必要、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 4 位以内(含第 4 位)发生计算错误时,视为估值错误。

本基金运作过程中,如果由于管理人、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 前向管理人、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,管理人应协调证券/期货经纪机构解决;

B、如管理人或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 4 位以内(含第 4 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、管理人和托管人由于各自技术系统设置而产生的净值计算尾差，以管理人计算结果为准；
- G、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，管理人应当立即予以纠正，通报托管人，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 4 位以内（含第 4 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。

8、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、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管理人、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 0.0001 元，小数点后第五位四舍五入。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，管理人和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，管理人和托管人免除赔偿责任。但管理人和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

管理人和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，管理人和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）管理人、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）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）托管人应定期与管理人就基金财产的会计核算、报表编制等进行核对。

（4）管理人、托管人对会计处理方法存在分歧，应以管理人的处理方法为准。

（5）管理人、托管人经对账发现相关各方的账目存在不符的，管理人和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、基金的管理费；

2、基金的托管费；

3、基金的投资顾问费；

4、基金的销售费；

5、基金的运营服务费；

6、基金的业绩报酬；

7、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；

8、基金财产开立账户需要支付的费用；

9、基金财产的证券、期货交易费用；

10、基金运作期间发生的会计师费、律师费；

11、与本基金有关的印刷费用；

12、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、基金的管理费

本基金的管理费率为年费率 0.15%。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，按季支付。管理人在此授权托管人于下季度前十个交易日之内，从基金财产中一次性支付至管理人如下账户：

管理人账户名称：上海恒基浦业资产管理有限公司

管理人账号：31001520313050028654

管理人开户银行名称：中国建设银行股份有限公司上海浦东分行

2、基金的托管费

本基金的托管费率为年费率 0.04%。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，按季支付。管理人在此授权托管人于下季度前十个交易日之内，从基金财产中一次性支付至托管人收费账户。

3、基金的投资顾问费

本基金的投资顾问费率为年费率 0.15%。在通常情况下，基金投资顾问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

本基金的投资顾问费自基金成立日起，每日计提，按季支付。管理人在此授权托管人于下季度前十个交易日之内，从基金财产中一次性支付至投资顾问如下账户：

投资顾问账户名称：中信证券股份有限公司

投资顾问账号：7116810187000000121

投资顾问开户银行名称：中信银行北京瑞城中心支行

4、基金的销售费

本基金的销售费率为年费率 0.32%。在通常情况下，基金销售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：

$$H=E \times \text{年销售费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金销售费

E 为前一日基金资产净值

本基金的销售费自基金成立日起，每日计提，按季支付。由管理人于下季度前十个工作日内出具划款指令给托管人，托管人复核指令无误后三个工作日内从基金资产中一次性支付给基金直销或代销机构收费账户：

销售机构账户名称：上海天天基金销售有限公司

销售机构账号：024 601 421 0000 828

销售机构开户银行名称：民生银行上海广场支行

销售机构账户名称：上海恒基浦业资产管理有限公司

销售机构账号：31001520313050028654

销售机构开户银行名称：中国建设银行股份有限公司上海浦东分行

5、基金的运营服务费

本基金的运营服务费率按年费率 0.04%。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，按季支付。管理人于此授权托管人于下季度前十个交易日之内，从基金财产中一次性支付至基金运营服务机构收费账户。

6、基金的业绩报酬

(1) 本基金业绩报酬计提基准为年化 4%。

(2) 业绩报酬的计提基准日：投资者赎回日、分红权益登记日、基金清算日。本基金连续两次成功计提业绩报酬基准日的间隔不应短于 3 个月，投资者赎回日、基金清算日以及合同约定的其他业绩报酬计提基准日遇非交易日顺延的情况除外。本基金的业绩报酬计提日为投资者赎回确认日、分红确认日、基金清算确认日。

(3) 业绩报酬的计算：采用单个投资者单笔投资年化收益差额法计提，即基金份额持有人每笔所持份额或赎回份额在持有期（即下述计算公式中的“T”）的年化收益率（R）大于业绩报酬计提基准时，对超出业绩报酬计提基准的持有期差额收益按 60% 比例进行计提。

业绩报酬的具体计算及支付如下：

1) 赎回、基金清算时提取业绩报酬

T_n = 本次业绩报酬计提基准日的基金份额累计净值；

T_0 = 认购或申购日（以下简称“参与日”）或该基金份额持有人最近一次成功计提业绩报酬基准日（以下简称“最近报酬日”）的基金份额累计净值；

T_1 = 参与日或最近报酬日的基金份额净值；

T = 该基金份额持有人该笔份额的最近一次业绩报酬成功计提的基准日（含）（若该基金份额持有人的该笔份额未成功计提过业绩报酬的，则认购所得份额为基金成立日，申购所得

份额为申购日）至本次业绩报酬计提的基准日（不含）之间的实际天数；

E =业绩报酬；

B =业绩报酬计提基准；

K =本次业绩报酬计提基准日赎回份额数量（赎回时）或持有的份额数量（非赎回时）；

$R = (T_n - T_0) / T_1 \times 365 / T \times 100\%$ ；

业绩报酬计提的条件为（ R 为年化收益率）：

当 $R - B > 0$ 时，对超出业绩报酬计提基准部分提取 60% 的业绩报酬，即 $E = K \times T_1 \times (R - B) \times T / 365 \times 60\%$ ；

当 $R - B \leq 0$ 时，不提取业绩报酬。

2) 分红提取业绩报酬

当发生分红时，私募基金管理人先按“赎回、基金清算时提取业绩报酬”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；当分红金额不足以扣除业绩报酬时，以分红金额为限进行扣除。

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

业绩报酬由私募基金管理人或运营服务机构负责计算及复核，并由私募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，私募基金托管人根据私募基金管理人的指令将退出金额（含业绩报酬）划拨到基金募集账户，私募基金管理人扣除归其所有的应计提业绩报酬后，将剩余的退出金额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。

7、上述（一）款中7到11项费用，由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），管理人在此授权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，管理人授权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。

8、为提高资金划付效率，费用扣划当日，如托管账户余额不足，管理人在此授权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

管理人和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、以及应当由管理人和托管人承担的费用等不列入基

金财产的费用。

（四）费用调整

本基金各项费用调低，经管理人和托管人协商一致即可；若各项费用需调高，则应由管理人、托管人与全体基金份额持有人协商一致。

（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。

十六、基金的收益分配

（一）基金收益分配原则和方式

1、基金利润的构成

基金利润是指基金的利息收入、投资收益、公允价值变动及其他收入等基金运作产生的各项收入扣除管理费、托管费、运营服务等基金运作产生的各项费用后的余额。

2、基金可供分配利润

基金可供分配利润指截至收益分配基准日基金的累计未分配利润，包括未分配利润中的已实现收益和未实现收益。

3、基金收益分配后基金份额净值不得低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

4、本基金的收益分配方式为现金方式或红利再投资方式。

本基金默认采用现金方式，收益分配时的具体方式以管理人出具的收益分配方案为准。

5、同等基金份额享有同等分配权；

6、本基金存续期内收益分配比例、分配次数、分配时间和分配金额由私募基金管理人确定。

（二）基金收益分配方案的确定与通知

基金收益分配方案由私募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。

私募基金管理人应当于分红权益登记日前，将基金收益分配方案通知私募基金托管人和基金份额持有人。

（三）基金收益分配的执行

私募基金托管人根据私募基金管理人的收益分配方案和提供的红利金额的数据，在红利发放日将相应款项划拨至募集账户。

十七、信息披露

（一）管理人应根据法律法规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）管理人、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）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，管理人和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

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，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。

管理人和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。

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

管理人或托管人变更后，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，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）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。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

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、托管人对管理人的业务监督和核查

（一）托管人对管理人的投资行为行使监督权

托管人根据《投资监督事项表》的约定，对管理人的投资行为进行监督。

（二）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。如果管理人未经托管人的审核擅自使用不实的业绩表现数据，托管人对此不承担任何责任。

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

托管人发现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管理人纠正，管理人收到通知后应及时核对，并以电话或书面形式向托管人反馈，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，托管人有权随时对通知事项进行复查，督促管理人改正。

二十一、管理人对托管人的业务核查

根据《基金法》及其他有关法规和本合同规定，管理人对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、准确复核管理人计算的基金资产净值和基金份额净值,是否根据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。

管理人定期和不定期地对托管人保管的基金资产进行核查。托管人应积极配合管理人的核查行为,包括但不限于:提交相关资料以供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。

管理人发现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托管人在限期内纠正,托管人收到通知后应及时核对并以书面形式对管理人发出回函。在限期内,管理人有权随时对通知事项进行复查,督促托管人改正。对管理人按照法规要求需向监管机构报送基金监督报告的,托管人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

管理人发现托管人有重大违规行为,应通知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,由管理人、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、管理人与托管人合法签署;
- (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) 合同的签署

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

2、基金投资者在签署合同后方可进行认购、申购。

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、管理人和托管人协商一致并签署补充协议后对本合同内容进行变更。

2、管理人、托管人首先就本合同拟变更事项达成一致。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），并在管理人公司网站上发布该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）指定的日期内明确回复。基金份额持有人未在指定日期内回复意见或回复意见不明确的，视为基金份额持有人同意合同变更。征询意见期满，由管理人安排临时开放日并强制赎回所有不同意合同变更的基金份额持有人所持全部份额（本条约定不受本合同“基金的认购、申购和赎回”中关于基金赎回的期限限制）。变更事项自该临时开放日的次交易日起开始生效，对合同各方均具有法律效力。

变更事项生效后，管理人应及时向托管人出具盖章的合同变更生效通知，并于三个工作日内发布合同变更的公告。管理人应按法律法规及中国证券投资基金业协会的规定及时办理相关备案手续。

（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，管理人可与托管人协商后修改基金合同，并由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、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、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、经全体基金份额持有人、管理人、托管人协商一致而提前终止的；
- 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、清算程序

（一）清算小组

- 1、自基金合同终止情形发生之日起 30 个交易日内成立清算小组。
- 2、清算小组成员由管理人、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、清算小组成立后，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应计提业绩报酬（如有）。

（五）二次清算

因持有流通受限证券、投资的产品封闭期（含限售期、锁定期）超过基金存续期等原因导致本基金财产无法及时变现的，管理人应对基金财产进行清算并先行分配已变现部分。待上述资产可以变现时，管理人完成剩余基金资产的变现操作。本基金自全部非现金资产全部变现完成之日终止，管理人届时进行二次清算，并将该部分财产另行分配给全体基金份额持有人。二次清算期间，管理人、托管人继续计提管理费、托管费。二次清算流程同一次清算。

（六）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管理人公告为准。

二十五、违约责任

（一）管理人、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、管理人和/或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、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、托管人由于按照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、托管人对存放或存管在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、管理人、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管理人，致使基金财产发生违规投资行为的，管理人及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）由于管理人、托管人不可控制的因素导致业务出现差错，管理人和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或虽发现错误但因前述原因无法及时更新的，由此造成基金财产或基金投资者损失，管理人和托管人免除赔偿责任。但是管理人和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）托管人仅承担本合同约定的相关责任及义务，管理人不得对托管人所承担的责任进行虚假宣传，更不得以托管人名义或利用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。

二十六、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。

二十七、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。

二十八、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）

（本页无正文，为《浦信日添月益基金基金合同》签署页，请各当事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，管理人和托管人不承担任何责任。）

基金投资者：

自然人（签字）：

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： _____

或机构（盖章）：

营业执照号码： _____

法定代表人或授权代表（签字）：

管理人：上海恒基浦业资产管理有限公司

法定代表人/执行事务合伙人或授权代表：



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：



陈忠义

签署日期： 年 月 日

附件一：投资监督事项表**投资监督事项表**

托管人根据本表对基金资产的投资进行监督，但托管人不承担投资责任。

（一）投资范围

见本合同第九章“投资范围”。

（二）投资限制

见本合同第九章“投资限制”。

（三）投资监督程序

1、场内交易：托管人根据经核对的估值数据对管理人的场内交易进行事后监督。如发现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，托管人应及时以书面形式通知管理人进行纠正；管理人收到通知后及时核查，并以电话或书面形式向托管人进行解释或举证。

2、场外交易：托管人根据《投资监督事项表》规定，对管理人发送给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管理人，并有权拒绝执行；如指令已生效，则托管人依指令进行划款，同时以书面形式通知管理人进行纠正。

（四）止损

本基金不设置止损线。