合同编号：

衍复优优中证 A500 指数增强 2 号
私募证券投资基金
基金合同

基金管理人：上海衍复投资管理有限公司

基金托管人：东方财富证券股份有限公司

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）或代销机构（如有）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资金从在中国境内开立的自有银行账户划款至直销募集账户，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。

募集账户由基金管理人委托基金服务机构开立，该账户仅用于本基金募集期间和存续期间认购、申购、赎回、分红、费用等资金的归集与支付以及基金财产清算过程中剩余资产的归集与分配。

募集账户是基金服务机构接受基金管理人委托代为提供基金服务的专用账户，并不代表基金服务机构接受投资者的认购、申购资金，也不表明基金服务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基金服务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造成的损失承担相关责任，**基金服务机构对于基金管理人的投资运作不承担任何责任。**

直销募集账户信息如下:

募集账户名称：国泰海通运营服务募集专户

募集账户账号：30213248007255

募集账户开户银行名称：平安银行股份有限公司上海分行营业部

募集账户大额支付号：307290002014

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(自然人签字或机构盖章):

法定代表人或授权代理人(签字或盖章):

日期:　　年　　月　　日

重要提示

本基金投资于证券、债券市场，基金净值会因为证券、债券市场波动等因素产生波动，投资者根据所持有的基金份额享受基金收益，同时承担相应的投资风险。本基金投资中的风险包括但不限于：因政治、经济、社会等环境因素对证券市场价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，由于基金份额持有人赎回基金产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，本基金的特定风险等，具体投资风险请详细阅读《风险揭示书》。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但投资者购买本基金并不等同于将资金作为存款存放在银行或其它存款类金融机构，基金管理人不保证基金一定盈利，也不保证投资者的本金不受损失、取得最低收益或者限定损失金额和比例。投资有风险，投资者认购、申购本基金时应认真阅读本基金的基金合同和其他交易文件（如有）。基金管理人的过往业绩不代表未来业绩，也不代表基金管理人就本基金作出任何承诺、保证等。

本基金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基金的备案并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

基金管理人提醒投资者注意基金投资的“买者自负”原则，在做出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行负担。

合格投资者承诺书

上海衍复投资管理有限公司：

1、本人/机构作为符合中国证券监督管理委员会规定的私募证券投资基金的合格投资者标准（即投资于单只私募基金的金额不低于100万元且个人投资者的金融资产不低于300万元或者最近三年个人年均收入不低于50万元，机构投资者的净资产不低于1000万元，或为监管机构认可的其他合格投资者），或符合《私募投资基金监督管理暂行办法》第十三条“视为合格投资者”的规定。

2、本人/机构具有相应的风险识别能力和风险承受能力，投资资金来源及用途符合法律法规和相关政策规定，没有非法汇集他人资金投资私募基金。且为本人/机构自己购买私募投资基金，不存在代持、不存在不合理的利益输送、关联交易及洗钱等情况；本人/机构承诺参与申购/认购本基金的资产管理产品（含私募基金）的投资者亦符合中国证券监督管理委员会规定的私募证券投资基金的合格投资者标准；本人/本机构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。如基金管理人要求本人/本机构提供资金来源及用途合法性证明，对资金来源及用途及合法性进行调查，本人/本机构愿意配合。

3、本人/机构承诺向基金管理人提供的有关投资目的、风险偏好、投资限制、财产收入情况和风险承受能力等基本情况真实、完整、准确、合法，不存在任何重大遗漏或误导。前述信息资料如发生任何实质性变更，本人/机构应当及时书面告知基金管理人或销售机构。

4、本人/机构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/机构承认，**基金管理人、基金托管人未对基金财产的收益状况及本金安全作出任何承诺或担保。**

5、本人/机构在参与贵公司发起设立的私募基金的投资过程中，如果因存在欺诈、隐瞒或其他不符合实际情况的陈述等行为所产生的一切责任，由本人/机构自行承担，与贵公司无关。

6、本人/机构承诺，基金管理人有权要求本人/机构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/机构愿意配合。

7、本人/机构承诺，如通过销售机构购买本基金份额的，本人/本机构已审核确认：销售机构已取得基金销售业务资格或代销金融产品业务资格;销售机构已接受基金管理人委托

并与基金管理人签署了有效的书面基金销售协议。

特此承诺。

投资者（自然人签字或机构盖章）：

法定代表人或授权代理人(签字或盖章)：

日期：　　年　　月　　日

目　录

一、 前言 1
二、 释义 2
三、 声明与承诺 6
四、 基金的基本情况 8
五、 基金份额的募集 9
六、 基金的成立与备案 13
七、 基金的申购、赎回和转让 15
八、 当事人及其权利义务 22
九、 基金份额持有人大会及日常机构 30
十、 基金份额的登记 34
十一、 基金的投资 35
十二、 基金的财产 40
十三、 指令的发送、确认与执行 43
十四、 交易及清算交收安排 46
十五、 越权交易 48
十六、 基金财产的估值和会计核算 52
十七、 基金的费用与税收 60
十八、 基金的收益分配 65
十九、 信息披露与报告 66
二十、 基金份额的非交易过户和冻结、解冻 71
二十一、 基金合同的成立、生效 72
二十二、 基金合同的效力、变更、解除与终止 74
二十三、 基金的清算 78
二十四、 违约责任 80
二十五、 法律适用和争议的处理 82
二十六、 其他事项 83

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典》《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《基金法》）、《私募投资基金登记备案办法》和《私募投资基金备案指引第1号——私募证券投资基金》《私募证券投资基金运作指引》（以下简称《运作指引》）《关于私募投资基金开户和结算有关问题的通知》《私募投资基金监督管理暂行办法》（以下简称《私募办法》）《私募投资基金募集行为管理办法》《私募投资基金信息披露管理办法》《关于发布私募投资基金合同指引的通知》《证券期货经营机构私募资产管理业务运作管理暂行规定》《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、充分保护本合同当事人的合法权益。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、 本合同或基金合同：《衍复优优中证A500指数增强2号私募证券投资基金基金合同》及对本合同的任何有效修订和补充。

2、 本基金：衍复优优中证A500指数增强2号私募证券投资基金。

3、 私募基金：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。

4、 基金份额持有人大会：由基金份额持有人组成，基金份额持有人的合法授权代表有权代表基金份额持有人出席会议并表决。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。

5、 基金投资者、私募基金投资者：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、 基金管理人、私募基金管理人：上海衍复投资管理有限公司。

7、 基金托管人（简称“基金托管人”）：本基金的基金托管人为东方财富证券股份有限公司。

8、 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、 中国证监会：指中国证券监督管理委员会及其派出机构。

10、 募集机构、销售机构：指私募基金管理人或在中国证监会注册取得基金销售业务资格并已经成为中国证券投资基金业协会会员的机构。

11、 基金服务机构：接受基金管理人委托，根据与其签订的基金服务协议中约定的服务范围，为本基金提供基金核算估值、募集监督、注册登记等服务的机构，本基金的基金服务机构为国泰海通证券股份有限公司。

12、 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。

13、 工作日：上海证券交易所、深圳证券交易所和北京交易所的正常交易日。

14、 开放日：本基金的开放日，包括申购开放日、赎回开放日。

15、 开放期：指投资者可以办理本基金申购、赎回或其他约定业务的工作日。

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保

管的作为本合同标的的财产。

17、 托管资金专门账户（简称“托管账户”）：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。

18、 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，本基金在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司、深圳分公司、北京分公司开设的证券账户，以及在债券登记结算机构开立的专用债券账户。

19、 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账户建立一一对应关系，由基金托管人通过银期转账的方式或其他约定的方式办理期货交易的出入金。

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、 基金资产总值：本基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金各项应收款及其他资产的价值总和。

22、 基金资产净值：本基金资产总值减去负债后的净额。本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。

23、 基金份额：基金项下所有基金受益权划分为等额的份额，每一份基金受益权为一份基金份额。

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。本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。

25、 基金份额累计净值：基金份额净值和基金历史上累计单位派息金额之和。

26、 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。

27、 募集期：指本基金的初始销售期限。

28、 存续期：指本基金成立至清算之间的期限。

29、 运作年度：按照算头不算尾原则计算，例如首个运作年度为自基金成立日至基金

成立日次年对日的前1日之间的期限，后续运作年度以此类推。

30、 投资冷静期：指自基金投资者签署基金合同完毕且交纳认购基金的款项后的【二十四小时】。销售机构在投资冷静期内不得主动联系投资者。基金投资者在投资冷静期内有权解除基金合同。根据法律法规规定、部门规章、行业自律指引规定等可豁免适用冷静期制度的个人、机构或资产管理产品可不适用投资冷静期的限制。

31、 回访确认：指销售机构在投资冷静期满后，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。销售机构在投资冷静期内进行的回访确认无效。基金投资者在销售机构回访确认成功前有权解除基金合同。未经回访确认成功，投资者交纳的认购基金款项不得由募集账户划转到基金财产账户或托管资金专门账户，私募基金管理人不得投资运作投资者交纳的认购基金款项。

32、 认购：指在募集期间，基金投资者按照本合同的约定购买本基金份额的行为。

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

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

35、 不可抗力：指本合同当事人不能预见、不能避免并不能克服的客观情况。包括但不限于《基金法》及其他有关法律法规及重大政策调整、台风、洪水、地震、流行病及其他自然灾害，战争、骚乱、火灾、政府征用、戒严、没收、恐怖主义行为、突发停电或其他突发事件、证券交易场所非正常暂停或停止交易等事件。

36、 流动性受限资产：指到期日在10个交易日以上的逆回购与银行定期存款（含协议约定有条件提前支取的银行存款）、资产支持证券（票据）、流动受限的新股以及非公开发行股票、停牌股票、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券和非金融企业债务融资工具、场外期权、收益互换、收益凭证、私募类资产管理产品（含私募基金），私募基金管理人与私募基金托管人可根据法律法规和自律规则的要求协商一致进行调整。

37、 同一资产：系《私募证券投资基金运作指引》（中基协发〔2024〕5号）第四十一条第（九）项规定，即：

（1）标准化股权类资产按照单一上市公司公开发行的股票、存托凭证，视为同一资产；

（2）标准化债权类资产按照单只债券、中央银行票据、资产支持证券、非金融企业债务融资工具，视为同一资产；

（3）非标准化债权类资产（如证券公司发行的保本型收益凭证、质押式报价回购、质押式协议回购、标准化票据）按照同一“融资主体”及其关联方视为同一资产；

（4）基金类资产按照单只证券投资基金或者资产管理产品视为同一资产；

（5）标准化期货和衍生品类资产按照单只期货或者期权合约视为同一资产；

（6）场外衍生品类资产：（1）场外期权及证券公司发行的非保本型收益凭证按照同一“交易对手方”视为同一资产；（2）收益互换按照合约挂钩具体标的视为同一资产。

如法律法规、自律规则发生变化的，以最新规则或要求为准。

38、 已投资产：指不包含银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券、货币市场基金等中国证监会认可的现金管理工具的资产，其计算口径为“本基金资产总值-上述现金管理工具资产的市值”。

三、 声明与承诺

(一) 基金投资者的声明与承诺

1、 基金投资者声明其符合相关法律法规、证监会及本合同规定的关于私募基金合格投资者的相关标准，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，保证有完全及合法的授权委托基金管理人和基金托管人进行该财产的投资管理和托管业务，保证没有任何其他限制性条件妨碍基金管理人和基金托管人对该财产行使相关权利且该权利不会为任何其他第三方所质疑。

2、 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。

3、 基金投资者承诺其向募集机构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。

4、 前述信息资料如发生任何实质性变更，应当及时书面告知募集机构。

5、 基金投资者知晓，基金管理人、基金托管人及相关机构不应对基金财产的收益状况作出任何承诺或担保。

6、基金投资者以其管理的产品投资于本基金的，投资于本基金的产品向上穿透后应确保本基金不构成违反监管要求的嵌套情形，并且不得利用本基金作为其规避投资范围、杠杆约束等监管要求的通道。

7、基金投资者如为产品，承诺投资本基金不违反《私募投资基金监督管理条例》、《运作指引》等法律法规、自律规则要求的产品嵌套层数，并承诺配合基金管理人履行必要的穿透核查义务。

8、基金投资者同意并授权管理人自行或转授权份额登记机构或委托代销机构（如有）收集、处理、保存其个人信息。

(二) 基金管理人保证已在签订本合同前充分地向基金投资者说明了有关法律法规和相关投资工具的运作市场及方式，同时揭示了相关风险；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。基金管理人承诺依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理运用基金财产，不保证基金财产一定盈利，也不保证最低收益。

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，基金管理人登记编码为【P1070325】。基金管理人声明，中国基金业协会为基金管理人和私募基金办理登记备案不构成对私募基金管理人投资能力、持续合规情况的认可，不作为对基金财产安全的保证。

基金管理人承诺，一经基金托管人要求，基金管理人立即向基金托管人提供基金管理人所持有的以反洗钱为目的的基金投资者的客户资料。

(三) 基金托管人承诺依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则，按照本合同的约定安全保管基金财产，并履行本合同约定的其他义务。

四、 基金的基本情况

(一) 基金的名称：衍复优优中证 A500 指数增强 2 号私募证券投资基金。

(二) 基金的运作方式：契约型开放式。

(三) 产品类型：权益类私募证券投资基金

(四) 基金在募集期限内的募集总额不低于人民币 3000 万元。

(五) 基金的投资目标和投资范围：

具体投资范围详见本基金合同第十一章“基金的投资”。

(六)基金的存续期限：25 年，25 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。如本基金资产规模小于 5000 万元或本基金资产全部为现金或货币基金等现金管理工具的，私募基金管理人根据基金运作情况，经提前通知全体基金份额持有人及私募基金托管人后可提前终止本基金。

合同到期前经合同当事人协商一致可以展期，但有关法律、法规另有规定的除外。

基金的提前终止详见本基金合同“基金合同的效力、变更、解除与终止”章节。

(七) 基金份额的初始募集面值：人民币 1.00 元。

(八) 基金的结构化安排（如有）：无。

(九) 基金的托管事项：

本基金的基金托管人为【东方财富证券股份有限公司】。

(十)基金的外包事项：

基金管理人接受基金投资者委托为本基金聘请基金服务机构。本基金的基金服务机构为【国泰海通证券股份有限公司】。国泰海通证券股份有限公司是经中国基金业协会正式备案的外包服务机构，具有从事基金外包业务的法定资格资质，其于中国基金业协会登记的份额登记业务外包服务和估值核算业务外包服务的备案编号为：A00005。

(十一)维持运作机制

基金管理人客观上丧失继续管理私募基金的能力时，由基金份额持有人大会接管基金的运营，决定是否更换基金管理人或对基金进行清算，在此期间基金托管人应保障基金财产安全，根据基金份额持有人大会有效决议进行资金的划付。

五、 基金份额的募集

(一) 基金份额的募集机构、募集方式、募集期间、募集对象

1、 基金的募集机构和募集方式

在中国基金业协会办理私募基金管理人登记的机构可以作为直销机构自行募集其设立的私募基金,在中国证监会注册取得基金销售业务资格并成为中国基金业协会会员的机构可以受私募基金管理人的委托作为代销机构募集私募基金。

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募集，基金管理人可以根据情况增加或减少代销机构。

基金管理人及其委托的代销机构不得向合格投资者之外的单位和个人募集资金,不得通过报刊、电台、电视、互联网等公众传播媒体或者讲座、报告会、分析会和布告、传单、手机短信、微信、博客和电子邮件等方式，向不特定对象宣传推介。依据《证券公司代销金融产品管理规定》，若基金管理人明确约定本基金购买人范围的，代销机构不能超出基金管理人确定的购买人范围销售金融产品。

2、 募集期间

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募集期,此类变更适用于所有募集机构。基金管理人延长或缩短募集期的相关信息应及时通知募集机构，即视为履行完毕延长或缩短募集期的程序。本基金完成募集并提前终止销售的,视为募集期届满。

3、 募集对象

认购本基金的基金投资者，应符合法律关于合格投资者的相关规定。

合格投资者是指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机构和个人:

（1） 净资产不低于1000万元的机构;

（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。

上述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。

（3） 特殊合格投资者包括下列投资者:

a) 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;

b) 国务院金融监督管理机构监管的机构依法发行的资产管理产品、私募基金;

c) 合格境外机构投资者、人民币合格境外机构投资者；

d) 投资于所管理私募证券基金的私募基金管理人及其员工；

e) 法律法规、中国证监会和中国基金业协会规定的其他投资者。

本条所称“私募基金管理人员工”，是指与私募基金管理人签订劳动合同并缴纳社保的正式员工，签订劳动合同或者劳务合同的外籍员工、退休返聘员工，国家机关、事业单位、政府及其授权机构控制的企业委派的高级管理人员，以及中国证监会和协会规定的其他从业人员。

如本基金投资范围包括私募证券投资基金、各类私募资产管理计划的，本基金不得向其他私募证券投资基金、各类私募资产管理计划募集资金。

(二) 基金份额的认购

投资者在募集期间**扣除认购费的首次净认购金额**不得低于【100万元人民币】（不含认购费（如有）），但法律法规规定、部门规章、行业自律组织另有规定的，从其规定。募集期间可多次认购，每次追加认购时，**扣除认购费的净追加认购金额**应不低于【1万元人民币】。

(三) 基金份额的认购费用

本基金对募集期认购的客户收取认购费，认购费率为1%，计算方式如下：

认购金额=净认购金额×（1+认购费率）

认购费用=认购金额-净认购金额

认购费用归募集机构所有，募集机构有权进行减免。

(四) 认购申请的确认

基金投资者于募集期间办理认购申请，各方应当在完成合格投资者确认程序后签署私募基金合同，管理人及管理人委托的销售机构应自基金合同签署完毕且投资者交纳认购基金的款项后给予投资者不少于24小时的投资冷静期，在冷静期满后正式受理投资者的认购申请，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。认购的确认以基金份额登记机构的确认结果为准。

本基金的投资者人数规模上限为200人。基金管理人在募集期间超过可接受的人数限制的部分，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以及冷静期内解除基金合同(如不适用回访)或冷静期后回访失败(如适用回访)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。

(五) 认购份额的计算方式

认购份额=净认购金额÷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，由此产生的误差计入基金财产。

(六) 募集期间投资者资金的交付和管理

基金份额募集期间，基金投资者认购本基金，以人民币转账形式交付。基金不接受现金方式认购。投资者通过直销机构或代销机构认购的，应于本合同约定的募集期间结束前认购份额所需资金缴付至本合同约定的募集账户或按代销机构的规定缴付认购份额所需资金。

基金管理人和代销机构应当将募集期间募集的投资者资金存放于私募基金募集结算专用账户。

（1）本基金直销募集账户由本基金的基金服务机构负责开立，由【国泰海通证券股份有限公司】进行监督。该直销账户仅用于本基金募集期间和存续期间认购、申购、赎回、分红、费用等资金的归集与支付以及基金财产清算过程中剩余资产的归集与分配。在基金募集行为结束之前，任何机构和个人不得动用。

本基金直销募集账户信息请参见投资者告知书。

（2）代销处理

基金投资者通过私募基金管理人委托的代理销售机构购买基金的，应将款项划入代理销售机构指定的募集专用账户，或由代理销售机构根据投资者的购买指令从投资者账户中进行扣划。

在基金募集行为结束之前，募集资金任何人不能动用。募集资金在基金成立前产生的利息在基金成立时归入基金资产，利息金额以基金份额登记机构的记录为准。

基金托管人对划入托管账户的认购资金的完整性不负实质性审查责任。

(七) 投资冷静期及回访确认

1、 投资冷静期

本基金的投资冷静期为自基金合同签署完毕且投资者交纳认购基金的款项后起的【二十四个小时】。销售机构在投资冷静期内不得主动联系投资者。

2、 回访确认

本基金通过基金管理人直接募集的，暂不设置募集机构的回访确认制度，与基金业协会合同指引规定不一致，该不一致可能给基金投资者带来一定的风险。在本基金存续期内，如基金业协会正式要求私募基金的募集机构实施《私募投资基金募集行为管理办法》第三十一条规定的回访制度的，则募集机构应当并有权根据《私募投资基金募集行为管理办法》的规

定对届时新参与本基金的投资者实施回访制度。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。私募基金管理人进一步说明，除非届时中国基金业协会要求回访制度追溯适用，否则届时实施的回访制度不适用于实施回访制度前已参与本基金的投资者。

本基金通过代理销售机构募集的（如有），代理销售机构是否适用回访确认制度以代理销售机构规则为准。

3、 不适用投资冷静期及回访确认规定的投资者

根据法律法规规定、部门规章、行业自律指引规定等可豁免适用回访确认制度的个人、机构或资产管理产品，可不适用本基金投资冷静期及回访确认的规定。

(八) 基金募集资金利息的处理方式

募集期认购款在基金成立前产生的利息在基金成立时归入基金资产，利息金额以基金份额登记机构的记录为准。

六、 基金的成立与备案

(一) 基金合同签署的方式

本合同的签署应当采用纸质合同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。

(二) 基金成立的条件

本基金满足如下全部条件时，基金即告成立：

1、 有效签署本合同并交付认购资金的基金投资者人数不超过200人，监管部门另有规定的除外；

2、 本基金初始实缴募集资金规模不低于3000万元人民币；

3、基金托管人收到全部认购资金并核实无误后向管理人出具《资金到账通知书》。《资金到账通知书》出具的当日为本基金成立日。基金管理人应于基金成立后向基金持有人发送基金成立的通知。

(三) 基金的备案

募集期限届满，管理人应当自募集期限届满之日起20个工作日内到中国证券投资基金业协会办理相关备案手续。本基金在中国基金业协会完成备案后方可进行本合同约定的投资运作。

(四) 不能满足基金成立条件的处理方式

1、 募集期限届满，不符合基金合同生效条件的，则本基金募集失败。

2、 基金募集失败的，基金管理人应当承担下列责任：

（1） 以其固有财产承担因销售行为而产生的债务和费用；

（2） 在募集期届满后30日内返还投资者已缴纳的款项，并加计银行同期活期存款利息。

(五) 基金备案不通过的处理方式

本基金应该在基金业协会规定的期限内完成备案手续，不能满足基金备案条件的，基金管理人应及时通知基金份额持有人和基金托管人，并将基金托管人已盖章的基金合同及其他相关协议原件在基金提前终止日后10日内如数返还基金托管人。未能如数返还的，基金管理人应向基金托管人书面说明原因、去向并加盖公章。若备案不通过，且管理人决定终止时，本合同相应终止，具体终止流程参见本合同“基金的清算”章节。

(六) 基金存续期内的资产规模

本基金上一会计年度日均基金资产净值低于1000万元情形的，私募基金管理人应当在5个工作日内按照法律法规、部门规章、行业自律指引等相关要求及本基金合同相关约定向投资者进行披露；本基金上一会计年度日均基金资产净值低于500万元或者连续60个交易日出现基金资产净值低于500万元情形的，基金应当停止申购并在5个工作日内向投资者披露。本基金停止申购后连续120个交易日基金资产净值仍低于500万元情形的，应当按照本合同约定进入清算程序。

七、 基金的申购、赎回和转让

（一） 申购和赎回的场所

本基金的销售机构包括基金管理人委托的代销机构和直销机构（基金管理人）。基金投资者应当在销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理基金份额的申购和赎回。基金管理人可根据情况变更或增减基金代销机构，并予以公告。

（二） 份额锁定期

本基金设置份额锁定期，锁定期为自基金份额确认日起满 360 天（含基金管理人及其员工持有的基金份额（如有））。认购方式取得的基金份额确认日为基金成立日，申购方式取得的基金份额确认日为申购确认日，份额持有期限以赎回确认日作为终点计算，算头不算尾。

红利再投资所得份额不受上述份额锁定期的限制。

如基金份额属于私募基金管理人及其员工认购或申购的，该份额锁定期应当以 6 个月（每月按 30 个自然日计算）与上述份额锁定期（如设置）孰长者为准，并需遵循本基金合同关于持有期的起算日及到期日计算规则的相关要求（如有）。本基金管理人应当及时向托管人及基金服务机构告知购买本基金份额的员工信息及其变更，并对上述信息的真实性、准确性负责。份额登记机构以收到的信息为准进行监控。

（三） 申购和赎回的开放日及时间

1、本基金设置不同的申购开放日、赎回开放日。

本基金的申购开放日为每月的第二个周二和第四个周二，如遇节假日，则顺延至下一个交易日；本基金的赎回开放日为每月的第四个周二，如遇节假日，则顺延至下一个交易日。

基金投资者可在本基金的申购/赎回开放日申购/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约定公告暂停申购、赎回时除外。

存续期间当出现以下情形时，基金管理人可增设临时开放日供基金投资者赎回。基金管理人提前 2 个工作日在基金管理人网站公告或以本合同约定的其他形式告知前述事项即视为履行了告知义务。临时开放日仅能办理基金的赎回，可能存在业绩报酬的计提（如有）：

（1）因法律、行政法规、监管政策调整等情形，本基金合同相应内容需要进行变更；

（2）本基金合同条款发生变更或者合同解除等情形；

（3）符合法律法规规定、中国证监会和基金业协会要求的其他情形。

本基金设置临时开放日的，基金份额持有人赎回基金份额可不受本合同关于基金赎回的期限限制（私募基金管理人及其员工持有的不满 6 个月的基金份额除外），但是赎回持有期低于 90 天的份额需要按照合同约定缴纳赎回费（如有，含短期赎回费），具体赎回规则以私募管理人通知为准。

2、申购时间及赎回时间

（1）直销

拟申购基金份额的投资者应当至少于开放日前【1】个工作日（即 T-【1】，T 为当期开放日），向基金管理人提交书面申购申请。

赎回时间：拟赎回基金份额的投资者应当于开放日前【1】个工作日（即 T-【1】，T 为当期开放日），向基金管理人提交书面赎回申请。

（2）代销

基金投资者通过代销机构申购、赎回本基金时，具体规定以代销机构约定的方式为准，并由代销机构负责通知到基金投资者。

（四） 出资方式及认缴期限

本基金不接受现金申购，存续期间开放，基金投资者申购本基金，以人民币转账形式交付。投资者通过直销机构或代销机构申购的，应于本基金开放日结束前将申购份额所需资金缴付至本合同约定的募集账户或按代销机构的规定缴付申购份额所需资金。基金管理人或基金服务机构通常于申购确认后 1 个工作日内将申购资金划入基金托管账户，如涉及代销的，则根据代销机构划付申购款项时间进行后续处理。**基金托管人对划入托管账户的申购资金的完整性不负实质性审查责任，亦不对申购资金是否符合投资冷静期以及回访确认承担审查义务。**

（五） 申购和赎回的方式、价格及程序

1、 基金投资者申购基金时，按照申购申请对应的开放日的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，按照赎回申请对应的开放日的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、赎回价格以受理申请当日收市后计算的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。

（六） 申购和赎回申请的确认

在正常情况下，基金管理人在T+2日内对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。

销售机构对申购、赎回申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到申请。申购、赎回申请的确认以基金服务机构的确认结果为准。

基金投资者应根据募集机构的规定向募集机构提交书面申请文件，遵循募集机构相关规定办理申请提交事宜，未按募集机构规定和要求提交的导致申请无法送达或申购赎回失败的，管理人对此不承担任何责任。

（七） 申购和赎回的金额限制

投资者在私募基金存续期开放日购买私募基金份额的，首次购买金额应不低于 100 万元人民币（不含认/申购费）且符合合格投资者标准，扣除申购费的净追加申购金额应不低于【1 万元人民币】。但法律法规规定、部门规章、行业自律组织另有规定的，从其规定，不适用于上述规定的首次申购金额限制。

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，当投资者申请部分赎回基金份额后将致使其所持有的基金资产净值低于 100 万元，管理人应当将该基金份额持有人所持份额做全部赎回处理，该等赎回不受本合同关于基金赎回的期限限制，但应按照本合同的约定收取赎回费（如有，含短期赎回费）。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，基金管理人应当将该基金份额持有人所持份额做全部赎回处理，该等赎回不受本合同关于基金赎回的期限限制，但应按照本合同的约定收取赎回费（如有，含短期赎回费）。但法律法规规定、部门规章、行业自律组织另有规定的，从其规定，不适用于上述规定的赎回金额限制。

（八） 申购和赎回的费用

1、 申购费用

本基金的申购费率为1%，计算方法如下：

申购金额=净申购金额×（1+申购费率）

申购费用=申购金额-净申购金额

申购费用归募集机构所有，募集机构有权进行减免。

2、 赎回费用

本基金投资者持有期不足【720 天】的赎回本基金，赎回费费率为【1%】，但本基金投资者持有期满【720 天】的，赎回费费率为【0%】，计算方法如下：

赎回费=（赎回价格×赎回份额-管理人业绩报酬（如有））×赎回费率

赎回价格为赎回申请日基金份额净值。

其中，对于认购的基金份额，持有期的起算日为本基金成立日；对于申购的基金份额，持有期的起算日为申购所对应的确认日，含头不含尾。

在符合本合同约定的情形下（包括但不限于合同条款变更等情形），投资者需在临时开放日赎回基金份额的不收取上述赎回费，但在临时开放日赎回持有期低于 90 天份额的，属于短期赎回，需支付短期赎回费，短期赎回费率为 1%。

基金份额持有人赎回费（含短期赎回费）归本基金整体资产所有**且不得减免。特别地，红利再投所得份额不收取赎回费。**

（九） 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对应的开放日基金份额净值。

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=赎回份额×赎回价格-赎回费（如有）-管理人业绩报酬（如有）

赎回费=（赎回价格×赎回份额-管理人业绩报酬（如有））×赎回费率

赎回价格为赎回申请对应的开放日基金份额净值。

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。

赎回份额由基金份额登记机构根据基金份额持有人提交的赎回申请以及基金份额持有人实际持有的份额确定。

（十） 拒绝或暂停申购、暂停赎回的情形及处理

1、 在如下情形下，基金管理人可以拒绝接受基金投资者的申购申请：

（1）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的其他情形。

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

2、 在如下情形下，基金管理人可以暂停接受基金投资者的申购申请：

（1）因不可抗力导致无法受理基金投资者的申购申请的情形；

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

（3）发生本合同规定的暂停基金资产估值的情形；

（4）**本基金上一会计年度日均基金资产净值低于500万元或者连续60个交易日出现基金资产净值低于500万元情形时，基金应当停止申购，且因本情形停止申购的，本基金后续无法恢复申购；**

（5）法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

基金管理人决定暂停接受全部或部分申购申请时，应当以公告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公告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接受基金份额持有人的赎回申请：

（1）因不可抗力导致基金管理人无法支付赎回款项的情形；

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

（3）发生本合同规定的暂停基金资产估值的情形；

（4）基金管理人认为接受某笔或某些赎回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）发生连续巨额赎回且管理人认为有必要的情形；

（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，基金管理人应当以公告形式告知基金份额持有人。在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并以公告形式告知基金份额持有人。

（十一）巨额赎回的认定及处理方式

1、 巨额赎回及连续巨额赎回的认定标准

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1工作日基金总份额的【20%】时，即认为本基金发生了巨额赎回。连续2个工作日及以上发生巨额赎回时，即认为本基金发生了连续巨额赎回。

2、 巨额赎回及连续巨额赎回的处理方式

发生巨额赎回时，管理人可以根据本基金当时的资产组合状况决定全额赎回、部分顺延赎回、延期支付：

全额赎回：当管理人认为有条件支付投资者的赎回申请时，按正常赎回程序办理。

部分顺延赎回（延期赎回）：当私募基金管理人认为支付基金份额持有人的赎回申请有困难或认为因支付基金份额持有人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，私募基金管理人在当日接受赎回比例不低于上述巨额赎回的认定比例前提下，可对其余赎回申请延期办理。

大额赎回申请：本基金不设单个投资者大额赎回限制条款，但因单个投资者大额赎回导致出现巨额赎回的，则根据巨额赎回的认定和处理方式办理。

赎回顺序及赎回价格确定：选择延期赎回的，将自动转入下一交易日继续赎回，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。

赎回款项支付：当管理人认为支付投资者的赎回申请可能会对基金资产净值造成较大波动时，管理人对巨额赎回全部接受，但可根据情况适当延期赎回款项支付时间，最长不应超过 20 个工作日。延期支付赎回款项的赎回价格为基金份额持有人申请赎回开放日的基金份额净值。延期支付的赎回款项不支付利息。

发生连续巨额赎回时，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 个工作日。

3、 巨额赎回及连续巨额赎回的通知：当发生巨额赎回或连续巨额赎回并且基金管理人决定延期支付或暂停接受基金的赎回申请时，基金管理人应当在开放日后 3 个交易日内按照合同约定的方式通知基金份额持有人，并说明有关处理方法。

（十二）基金份额转让的方式和程序

1、在本基金存续期间，经基金管理人书面同意，份额持有人可以依法向合格投资者转让其持有的全部或部分基金份额，但转让完成后份额持有人持有的基金资产净值不得低于100万元，法律法规另有规定的除外。

2、基金份额的转让应符合国家有关法律法规、中国基金业协会、监管规则的要求进行份额登记，并按照管理人的要求提供相关资料并履行必要的手续。如果份额转让因不符合法律法规或基金份额登记机构的规则未办理成功的，基金份额持有人应当自行承担相应风险和损失。

3、基金份额转让期间及转让完成后，持有本基金份额的份额持有人数量合计不得超过200人。

4、办理份额转让的变更登记，管理人应向份额登记机构发送书面的基金份额转让指令及转让方与受让方已签署并由管理人确认的基金份额转让协议，管理人应确保其书面指令符合相关法律法规、监管规则以及本合同约定。份额登记机构仅对于材料完备性进行形式审核，不承担审核份额转让是否符合第2条规定的义务。

5、基金份额的转让行为不影响收益计算的连续性。

（十三）其他事项

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

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

未征得所有份额持有人同意的情况下，私募基金管理人不得擅自更改投资者认（申）购、赎回时间、频率、程序以及限制事项，如需修改上述内容，具体详见基金合同第二十二章节“基金合同的效力、变更、解除与终止”中合同变更条款。

基金管理人授权本基金服务机构【国泰海通证券股份有限公司】将基金份额登记信息在基金份额确认后 2 个工作日内提供给基金托管人。

八、 当事人及其权利义务

(一) 基金份额持有人

1、 基金份额持有人概况

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。

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。

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） 按照本合同的约定，参加或申请召集基金份额持有人大会，行使相关职权；

（5） 监督基金管理人及基金托管人履行投资管理和托管义务的情况；

（6） 因基金管理人、基金托管人违反法律法规或本合同约定导致合法权益受到损害的，有权得到赔偿；

（7） 按照本合同约定的时间和方式获得基金信息披露资料；

（8） 在投资冷静期内，基金投资者有权全额申请退款；

（9） 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） 认真阅读本合同，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，如实提供必要的资产证明文件或收入证明，并对其真实性、准确性和完整性负责，承诺为合格投资者并签署《合格投资者承诺书》；

（3） 以合伙企业、契约等非法人形式汇集多数投资者资金直接或者间接投资于私募基金的，应向基金管理人充分披露上述情况及最终投资者的信息，但根据法律法规规定、部门规章、行业自律指引规定等可豁免情形的除外；

（4） 认真阅读并签署风险揭示书；

（5） 按照本合同约定缴纳基金份额的认购、申购款项，承担本合同约定的管理费、托管费、投资顾问费及其他相关费用；

（6） 按照本合同约定承担基金的投资损失；

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

（8） 向基金管理人或私募基金募集机构提供法律法规规定的信息资料及身份证明文件，配合基金管理人或其募集机构的尽职调查与反洗钱工作。若前述资料发生变更，应及时通知管理人或募集机构；

（9） 不得违反本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保管的其他基金合法权益的活动；

（11） 保守商业秘密，不得泄露基金投资计划、投资意向等；

（12） 保证投资资金的来源合法，不得非法汇集他人资金投资私募基金，主动了解所投资品种的风险收益特征；

（13） 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；

（14） 通信地址、电话、传真、电子邮件等联系方式如有变更，应当及时通知基金管理人；

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

（16） 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：上海衍复投资管理有限公司

住所：上海市宝山区月新南路888弄175号3幢A198室

通讯地址：上海市徐汇区瑞平路275号保利西岸C座7楼

法定代表人：顾王琴

联系人：顾王琴

联系电话：021-54665022

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） 依照本合同的约定，及时、足额获得基金管理人管理费用及业绩报酬（如有）；

（3） 依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合同或有关法律法规规定、对基金财产及其他当事人的利益造成重大损失的，应当及时采取措施制止；

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

（6） 基金管理人有权委托国泰海通证券股份有限公司作为基金服务机构为本基金提供资产估值等服务，并对其服务行为进行必要的监督和检查。基金管理人与基金服务机构另行签署基金服务协议（以下简称“基金服务协议”），对相关权利、义务进行约定；

（7） 基金管理人为保护投资者权益，在法律法规规定范围内，有权根据市场情况对本基金的总规模、单个基金投资者首次认购、申购金额、每次申购金额及持有的本基金总金额限制进行调整；

（8） 以基金管理人的名义，代表本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；

（9） 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） 募集期限届满，管理人应当自募集期限届满之日起20个工作日内到中国证券投资基金业协会办理相关备案手续。

（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） 按规定开设和注销基金的证券账户、期货账户等投资所需账户；

（7） 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产与其管理的其他基金财产和基金管理人的固有财产相互独立，对所管理的不同财产分别管理、分别记账、分别投资；

（8） 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；

（9） 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；

（10） 私募基金管理人聘用其他私募基金管理人担任投资顾问的，应当通过投资顾问协议明确约定双方权利义务和责任。私募基金管理人不得因委托而免去其作为基金管理人的各项职责；

投资顾问的条件和遴选程序，应符合法律法规和行业自律规则的规定和要求。基金合同中已订明投资顾问的，应列明因私募基金管理人聘请投资顾问对基金合同各方当事人权利义务产生影响的情况。私募基金运作期间，私募基金管理人提请聘用、更换投资顾问或调整投资顾问报酬的，应取得基金份额持有人大会的同意；

（11） 除依据法律法规、本合同及其他有关规定外，不得为基金管理人及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；

（12） 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；

（13） 基金管理人应当为基金投资与基金费用支付做好资金头寸管理；

（14） 按照基金合同约定及时向托管人提供非证券类资产凭证或股权证明(包括股东名册和工商部门出具并加盖公章的权利证明文件)等重要文件（如有）；

（15） 以基金管理人的名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；

（16） 按照本合同约定负责基金会计核算并编制基金财务会计报告；

（17） 按照本合同约定计算并向基金份额持有人报告基金份额净值；

（18） 根据法律法规和本合同的约定，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；

（19） 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；

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

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

（22） 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；

（23） 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；

（24） 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；

（25） 建立并保存投资者名册；

（26） 面临解散、依法被撤销或者被依法破产时，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；

（27） 自主履行或委托销售机构履行反洗钱管理的相关义务；

（28） 不参与非法配资活动。除经中国证监会批准外，未参与其他客户或第三方融资、融券等相关事宜；未参与场外配资活动；

（29） 未参与内幕交易、操纵市场、规避信息披露义务及其他不正当交易的活动等；未为其他外部机构或者个人非法从事证券活动提供便利；不存在利益输送或者商业贿赂的情况；不存在其他违法违规行为；

（30） 严禁管理人及其实际控制人、股东、关联方或本基金代理销售机构在营销过程中利用托管人声誉就本产品资金安全性、本产品盈利能力等方面向委托人做出任何承诺，不得向投资者承诺最低收益、承诺本金不受损失、或限定损失金额和比例，如托管人通过任何途径知悉有此情形，本合同自动作废，项目终止，由此产生的委托人、托管人损失由管理人承担；

（31） 管理人不得通过设置增强资金、安全垫、费用返还等方式调节基金收益或亏损，不得以自有资金认购的基金份额先行承担亏损的形式提供风险补偿，变相保本保收益；基金接受资产管理产品投资的，私募基金管理人不得以自有资金、第三方资金直接或者间接为该资产管理产品提供风险补偿或者保本保收益安排；

（32） 管理人承诺每只私募基金的单独管理、单独建账、单独核算，不得开展或者参与任何形式的资金池业务，不得存在短募长投、期限错配、分离定价、滚动发行、集合运作等违规操作；

（33） 若本基金通过场外期权账户进行收益互换或场外期权投资的，管理人需要确保由有资质的第三方经纪商及时、准确、完整提供相应的收益互换或场外期权净值；

（34） 管理人开展债券投资交易业务（如有），应当审慎合理设置投资债券的发行人及所在地区、行业等集中度、价格偏离度、杠杆比例、主体评级、债项评级等风险控制指标，加强对债券交易的动态评估和风险管理；

（35） 管理人及其管理的私募证券投资基金、股东、合伙人、实际控制人、员工不得参与债券结构化发行，不得参与债券代持，不得直接或者变相收取债券发行人及第三方支付的承销服务、融资顾问、咨询服务、信用风险补偿等各种形式的费用或者保证金；

（36） 管理人接受其他私募基金或者资产管理产品投资时，授权基金托管人将经复核的基金估值信息提供给上层私募基金或资产管理产品的托管人；

（37） 管理人授权基金服务机构将基金份额登记信息在基金份额确认后2个工作日内提供给基金托管人；

（38） 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：东方财富证券股份有限公司

通讯地址：上海市静安区永和路118弄东方环球企业中心24号楼5楼(基金托管部)

法定代表人：戴彦

联系人：黄佳一

联系电话：021-【36531906】

传真：021-36535001

2、 基金托管人的权利

（1） 按照本合同的约定，及时、足额获得托管费；

（2） 根据法律法规规定和本合同约定，监督基金管理人对基金财产的投资运作，对于基金管理人违反本合同或有关法律法规规定的、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） 因基金管理人的违规失信行为给基金财产或者基金份额持有人造成损害的，托管人有权督促基金管理人及时予以赔偿；

（6） 国家有关法律法规、监管机构及本合同规定的其他权利。

3、 基金托管人的义务

（1） 根据本合同约定，安全保管托管账户内的基金财产，**对于已划转出托管账户的基金财产，以及处于托管人实际控制之外的资产不承担保管责任**；

（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、本合同及其他有关约定外，不得为基金托管人及任何第三人牟取利益，不得委托第三人托管基金财产；

（5） 按规定开设和注销基金财产的托管资金账户，托管资金账户开立及使用的相关费用由基金资产承担；

（6） 复核基金份额净值，**因基金管理人（或其委托的基金服务机构）未及时、全面提供基金份额净值等情况导致托管人无法履行复核净值职责的除外**；

（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本合同约定复核基金管理人编制的基金定期报告，管理人提出需求后出具书面意见；

（9） 按照本合同的约定，根据基金管理人或基金管理人委托的基金服务机构的划款指令，及时办理清算、交割事宜；

（10） 按照法律法规及监管机构的有关规定，保存基金托管业务活动有关的合同、协议、凭证等文件资料，**但因基金管理人未能按照法律规定及本合同约定及时向基金托管人提供上述文件资料或者因上述文件不真实、不准确和不完整导致的法律责任，由基金管理人自行承担**；

（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、行政法规和其他有关规定，监管机构及审计要求和基金合同约定外，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） 根据法律法规及本合同的约定监督基金管理人的投资运作，基金托管人发现基金管理人的投资或清算划款指令违反法律、行政法规、自律规则或者违反本合同约定的，应当拒绝执行，立即通知基金管理人，并向中国证监会或基金业协会报告；基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反本合同约定的，应当立即通知基金管理人，**但托管人对于委托资产进入其他资管计划后的流向及其后的任何资金运用及投资均不承担监管职责**；

（15） **基金托管人只对产品信息、收款账户等要件进行形式审查**；

（16） 按照本合同约定制作相关账册并与基金管理人核对；

（17） 国家有关法律法规、监管机构及本合同规定的其他义务。基金托管人根据上述约定独立履行相关义务，与基金管理人不构成共同受托人。

九、 基金份额持有人大会及日常机构

（一） 基金份额持有人大会的组成

基金份额持有人大会由基金份额持有人组成，基金份额持有人的合法授权代表有权代表基金份额持有人出席会议并表决。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。

（二） 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） 决定本基金采取非现金资产方式进行分配；

（2）基金管理人客观上丧失继续管理私募基金的能力时（包括基金管理人被中国证券投资基金业协会公告为失联机构或被注销私募基金管理人登记，因基金管理人依法解散、被撤销、被宣告破产等原因进入清算，被监管机构处罚或被采取其他监管或自律监管措施，且未对本基金进行清算、破产等），由基金份额持有人大会接管基金的运营，决定是否更换基金管理人或对基金进行清算，在此期间基金托管人应保障基金财产安全，根据基金份额持有人大会有效决议进行资金的划付；

（3）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）就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会；

（4） 法律法规、本合同或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。

2、 当出现或需要决定下列事由之一，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，有效决议的形式可以是经全体基金份额持有人签名或盖章的各类通知文件、纪要文件、公告文件、补充协议等：

（1） 决定提前终止基金合同(按照本合同约定的提前终止条件提前终止的情形除外)；

（2） 决定更换基金管理人、基金托管人；

（3） 决定调高基金管理人、基金托管人和基金服务机构的收费标准；

（4） 法律法规、本合同或监管部门规定的其他情形。

（三） 基金份额持有人大会日常机构

本基金不设置份额持有人大会日常机构。

本基金未来可根据相关的法律法规及中国证监会的相关规定，设立基金份额持有人大会日常机构。基金份额持有人大会及其日常机构不得直接参与或者干涉基金的投资管理活动。

（四） 基金份额持有人大会的召集

1、 基金份额持有人大会由基金管理人或基金份额持有人大会日常机构召集；

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或怠于履行召集义务的，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。基金份额持有人自行召集基金份额持有人大会的，基金管理人应当予以配合，不得阻碍、干扰。

（五） 召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

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） 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；

（4） 会务联系人姓名、电话及其他联系方式；

（5） 出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；

（6） 召集人需要通知的其他事项。

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。

（六） 召开方式、会议方式

1、 基金份额持有人大会的召开方式包括现场开会和通讯方式开会。

2、 现场开会由基金份额持有人亲自或委派授权代表出席，现场开会时基金份额持有人的授权代表应当出席。基金份额持有人授权他人代为出席会议并表决的，授权方式应采用书面方式。

3、 通讯方式开会应当以书面方式进行表决；基金份额持有人出具书面表决意见并在表决截止时间以前送达给基金管理人的，视为出席了会议。

（七） 基金份额持有人大会召开条件

1、 现场开会

代表基金份额持有人大会召开日基金总份额2/3以上（含2/3）的基金份额持有人（或其授权代表）出席会议，现场会议方可举行。基金管理人不派代表列席，不影响表决效力。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。

2、 通讯方式开会

出具书面表决意见的基金份额持有人所代表的基金份额总份额占基金份额持有人大会召开日基金总份额2/3以上（含2/3）的，通讯会议方可举行。

（八） 表决

1、 议事内容：基金份额持有人大会不得对事先未通知的议事内容进行表决。

2、 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（包括变更基金管理人的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所持表决权的2/3以上（含2/3）通过方为有效。但更换基金管理人、托管人应当经参加基金份额持有人大会的基金份额持有人全体通过。

3、基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

（九） 基金份额持有人大会决议的效力

除违反法律规定或基金合同约定外，基金管理人召集的基金份额持有人大会决议，自基金份额持有人大会通过并由基金份额持有人签署后生效，并自生效之日起对全体基金份额持有人、基金管理人均有约束力，该等决议内容通知至私募基金托管人并获得其认可之日起，对基金托管人有约束力。

除违反法律规定或基金合同约定外，基金份额持有人大会日常机构召集的基金份额持有人大会决议自通过之日起，对全体基金份额持有人有约束力；该等决议内容通知至基金管理人之日和基金托管人并获得其认可之日起，对基金管理人和托管人有约束力。

基金管理人或基金托管人无正当理由的，不得拒绝认可或执行基金份额持有人会议决议。但是以下情况下，基金管理人或基金托管人有权拒绝认可或执行基金份额持有人会议决议：

1、份额持有人会议程序不符合法律法规要求或本基金合同约定的；

2、会议召集人无法提供适当的证明文件证明份额持有人会议程序符合法律法规要求以及本基金合同约定的；

3、决议内容违反法律法规规定或本合同约定的；

4、决议内容明显无法执行的；

5、决议内容对于基金管理人、基金托管人显失公允；

6、法律法规规定或本合同约定的其他情况。

（十） 基金份额持有人大会的证明文件

基金管理人召集基金份额持有人大会并出具决议的，基金托管人有权根据具体情况要求基金管理人出具公证机构出具的公证文书、律师出具的法律意见书作为相关证明文件，以证明基金份额持有人会议的程序或内容符合法律法规的规定以及基金合同的约定。

基金份额持有人召集基金份额持有人大会并出具决议的，基金管理人或基金托管人有权根据具体情况要求基金份额持有人出具公证机构出具的公证文书、律师出具的法律意见书作为相关证明文件，以证明基金份额持有人会议的程序或内容符合法律法规的规定以及基金合同的约定。

（十一）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，应由会议召集人通过书面邮寄、电子邮件、传真、手机短信或网络通信工具等形式通知全体基金份额持有人和其他相关当事人。

（十二）基金份额持有人不同意基金份额持有人大会决议的，基金管理人应在决议函（或通知）指定的日期内增设临时赎回开放日，允许不同意决议的基金份额持有人赎回本基金；基金份额持有人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基金份额持有人大会决议。

（十三）本基金存续期间，上述关于基金份额持有人大会召开事由、召集、召开条件、议事程序、表决条件、决议的效力、决议的披露等规定，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。但因上述法律与政策变化导致决议内容违法违规的除外。

十、 基金份额的登记

(一) 本基金的注册登记业务由基金管理人委托的基金份额登记机构办理。基金份额登记机构应履行如下注册登记职责:

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) 基金管理人委托【国泰海通证券股份有限公司】办理本基金的注册登记业务,但基金管理人依法应承担的注册登记职责不因委托而免除。国泰海通证券股份有限公司是经中国基金业协会正式备案的外包服务机构,其于中国基金业协会登记的份额登记业务外包服务的备案编号为:【A00005】。

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

(四) 本基金份额登记机构应当在本基金成立后以及基金份额持有人发生变动后的次工作日按照基金托管人指定的方式向基金托管人提供更新后的基金份额持有人名册。

十一、 基金的投资

(一) 投资经理：高亢

投资经理简历：高亢，本科毕业于麻省理工学院，获得物理学和电气工程与计算机科学双学位。2010 年至 2019 年先后在 Two Sigma Investments，以及国内其他私募基金管理人等投资机构任职，具备超过 10 年的全球量化策略研发和组合管理经验。2019 年至今担任上海衍复投资管理有限公司首席投资官。

基金管理人可根据业务需要变更投资经理，并在变更后及时告知基金投资者。（基金管理人在 3 个工作日内通过其网站、募集机构网站公告或书面通知等本合同约定的信披方式通知基金投资者前述事项即视为履行了告知义务），若有份额持有人对此提出异议的，私募基金管理人应当及时通过设置临时开放日等方式供该等份额持有人赎回。

(二) 投资目标：本基金通过将基金投资者投入的资金加以集合运用，对资产进行专业化的管理和运用，谋求资产的稳定增值。

(三) 投资范围：

1、权益类资产：境内依法发行上市的股票、优先股（不包括新三板），港股通标的股票，存托凭证，股票型及混合型公开募集证券投资基金；

2、固定收益类资产：国债、地方政府债、央行票据、政策性金融债、可转换债券、债券通用质押式回购、固定收益型公开募集证券投资基金；

3、期货及衍生品类资产：在证券交易所及期货交易场所交易的期货合约、期权合约、权证；

4、其他类资产：银行活期存款、融资融券、其他类型的公开募集证券投资基金（不含商品期货型公开募集证券投资基金）。

本基金嵌套层数不超过一层，本基金接受其他私募资产管理产品（含私募基金）参与的，不得再投资除公募证券投资基金以外的其他资产管理产品（含私募基金），本基金投资于其他私募资产管理产品（含私募基金）的，所投资的资产管理产品（含私募基金）的投资范围不得包括除公募基金以外的其他资产管理产品（含私募基金）。若本基金运作情况符合法律法规、部门规章、自律规则所规定的、可豁免嵌套层级之情形时（包括但不限于接受私募母基金投资或投资私募母基金），经基金管理人与托管人协商一致，可对本基金的整体层数进行相应调整（含增加）。

本基金成立后备案完成前，可以现金管理为目的，投资于银行活期存款、国债、中央银行票据、货币市场基金等中国证监会认可的现金管理工具。无论本合同的投资范围中是否包括前述投资标的，基金管理人按照此条进行投资，均视为符合本基金的投资范围，不违反本合同的任何约定。

如法律法规或中国证监会规定基金管理人需取得特定资质后方可投资上述证券或金融衍生产品的，则基金管理人投资上述证券或金融衍生产品前应获得相应资质。

基金管理人在满足法律法规和监管部门要求并为基金服务机构和基金托管人相关系统准备留出必要的调整时间后，可以相应调整本基金的投资范围。本基金投资范围调整的变更程序参照本合同“基金合同的效力、变更、解除与终止”章节中的相关约定，若有份额持有人提出异议的，私募基金管理人应及时通过设置临时开放日等方式供其赎回。

(四) 投资策略：

本基金投资策略为中证A500指数增强策略，运用算法构建并不断迭代策略模型，通过量化方式全市场选股，建立一篮子股票组合，并对标标的指数进行风格调整与平衡，优化策略组合收益风险比，依据市场行情与基本面变化适当调整投资组合的持仓结构，以期在跟踪指数收益(Beta)的基础上，获得超越市场基准收益(Alpha)的一种投资策略。本基金投资的股票不限于【中证A500】指数成分股和备选成分股的范围。同时本基金将根据市场变化和管理人的判断，投资本基金投资范围内约定的投资品种、投资工具等，如本基金作为普通股股东可以获得该上市公司发行的可转换债券优先配售权，本基金有权根据投资安排行使该权利，此外，在满足流动性需求的基础上，本基金可选择流动性高的货币基金、债券通用质押式逆回购等工具进行现金管理，力争实现基金资产的稳步增值。可择时投资于存托凭证。

以上内容为基金管理人对于本基金全部或部分投资品种相应投资策略的阐述，不构成对于本基金投资范围、投资比例及限制或其他投资风控指标的补充，也不构成对投资收益和投资者本金不受损失的保证。同时，不代表本基金仅投资、必然投资或持续投资于上述内容中提及的特定投向和/或标的品种，基金管理人有权在符合本合同约定的投资范围、投资比例及限制的范围内选择投资任意一个或多个标的品种。

本基金投资策略由私募基金管理人制定，具体实施过程由管理人自行把握和监控，托管人不负责监控。

(五) 投资限制

本基金将严格遵守法律法规、监管机构有关规定，合法合规操作。委托财产的运用应遵循如下规定：

1、本基金投资于同一资产的资金（期货按单个期货合约占用保证金计算；场内期权买方按照单个期权合约支付的权利金市值计算，场内期权卖方按照单个期权合约占用的保证金计算同一资产；其他资产按成本与市值孰低计算）占基金资产净值的比例不超过 25%，本条监控按照穿透合并计算进行；

2、以市值计算，本基金管理人管理的全部私募证券投资基金投资于同一资产的资金，不得超过该资产的 25%，符合投资于同一资产的资金不超过该基金净资产的 25%要求的基金投资单只私募基金的资金可以不满足本条投资限制要求；本条监控按照穿透合并计算进行（基金托管人仅以管理人托管在托管人处的私募基金为限进行监督）；

3、本基金总资产与净资产的比例不得超过 120%，本条监控按照穿透合并计算进行；

4、本基金投资于股票等权益类资产的市值不低于基金已投资产 80%；

5、本基金持有的 AA 级及以下信用债（不含可转债）及流动性受限资产合计不得超过基金净资产 20%（债券评级参照债项评级，无债项评级参照主体评级，相关评级均不参考中债资信；场外衍生品按全部账户内已占用保证金计算，其他资产按成本与市值孰低计算）；

6、本管理人的实际控制人控制的私募证券基金管理人的自有资金、管理的所有私募证券投资基金、担任投资顾问的资产管理产品合计持有单一上市公司发行的股票不得超过该上市公司可流通股票的 30%，中国证监会、协会另有规定的除外（基金托管人仅以管理人托管在托管人处的私募基金为限进行监督，同一实控人名单以管理人提供的最新名单为准）；

7、法律法规、中国证监会以及本合同规定的其他投资限制。

上述第 1、2 项不包括银行活期存款、国债、债券通用质押式回购、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券、公开募集基金等中国证监会、协会认可的投资品种。

私募基金管理人可根据实际情况调整基金之投资限制，但是应当按照本合同约定的相关合同变更条款的要求对本合同进行变更，若有份额持有人提出异议的，私募基金管理人应及时通过设置临时开放日等方式供其赎回。

特别提示：本基金投资其他金融产品时（如有），基金管理人应按照监管要求对下层资产进行穿透审核，确保该金融产品的投资范围符合监管要求，确保本基金投资金融产品符合嵌套层级的监管要求。

(六) 投资禁止行为

本基金财产禁止从事下列行为：

1、 违反规定向他人贷款或提供担保；

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、不正当关联交易及其他不正当的证券交易活动；

4、 最近一个估值日经核对一致的基金资产净值低于5000万元时，新增场外期权合约以及存续合约展期（仅开展商品类场外期权交易的除外）；

5、 最近一个估值日经核对一致的基金资产净值低于1000万元时，新增收益互换合约以及存续合约展期；

6、 认购封闭式私募证券投资基金、资产管理计划；

7、 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) 关联交易的情形及处理方式

1、 关联交易的识别认定

关联交易是指本基金与基金管理人、基金管理人管理的私募投资基金、同一实际控制人下的其他基金管理人管理的私募投资基金，或其有其他重大利害关系的关联方发生的交易行为。

基金管理人运用基金财产从事关联交易可能被金融监管部门认为存在利益输送、内幕交易的风险，进而可能影响基金份额持有人的利益。该类证券股价可能会出现下跌，从而使本基金收益下降，甚至带来本金损失。此外，基金管理人运用基金财产从事关联交易时可能依照相关法律法规、其他规范性文件被限制相关权利的行使，进而可能影响基金财产的投资收益。

2、 关联交易的交易决策、对价确定和回避机制

基金管理人进行关联交易的应当遵循诚信、公平、遵循投资者利益优先和平等自愿、等价有偿的原则，符合基金的投资目标和投资策略，防范利益冲突，并建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。

基金管理人拟进行关联交易的，应当由投资决策委员会或负责投资的高层管理人员做出决策后，按照基金管理人风控制度进行审核。未通过关联交易决策审核流程的，基金管理人不得执行相关投资决策。关联交易决策审核流程中，与关联交易投资决策有利害关系的人员，如涉及相关审核岗位的，应当回避，退出对本投资决策的审核。

基金管理人进行关联交易的，买卖对价应当以公平、合理的市场价格进行确定，不得明显高于或低于交易资产实际价值，避免利益冲突，禁止利益输送。

基金投资者签署本合同即表明其已经知晓且同意本基金可进行上述关联交易，认可本基金的关联交易决策机制。基金份额持有人不得因本基金投资收益劣于基金管理人、基金托管人及其关联方管理的其他类似投资产品的收益，而向基金管理人或基金托管人提出任何损失

或损害补偿的要求。

3、 关联交易的信息披露

基金管理人运用基金资产从事关联交易的，基金管理人应当在投资后及时向基金委托人披露信息，并按照法律法规的规定和基金合同的约定履行信息披露义务。**上述关联交易决策以及披露机制由基金管理人负责执行，基金托管人对此不负有监督义务。**

(八) 风险收益特征

基于本基金的投资范围及投资策略，本基金不承诺保本及最低收益。本基金产品的风险等级为R4，适合专业投资者及风险承受能力等级为【C4、C5】的普通投资者。

本基金合同所列示之风险收益特征与风险等级为私募基金管理人根据内部制度以及标准确定。如代销机构评定的风险等级与上述风险等级不一致时，代销的客户以代销机构评定的风险等级为准，但代销机构评定结果不得低于管理人评定结果。私募基金管理人或其委托的代理销售机构（如有）有权调整风险收益特征或风险等级，但是应当按照法律法规或合同约定（如有）通知全体份额持有人。募集机构应确保所有委托人已符合投资者适当性的相关要求，管理人应自行负责确保和控制本基金的投资情况（包括但不限于管理人选择的投资标的、投资比例控制等整体综合的投资情况）符合本基金的风险等级，托管人不对前述事宜进行任何监督或承担任何责任。

(九) 业绩比较基准

本基金无业绩比较基准。

(十) 参与融资融券业务及其他场外证券业务的情况。（根据中国证监会、中国基金业协会、中国证券业协会及中证机构间报价系统股份有限公司相关规定执行）

(十一)预警线与止损线

本基金不设置预警止损机制。

(十二)结构化安排

本基金无结构化安排。

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。**基金托管人仅负责保管本基金项下托管资金账户内的资金，对于除此之外的本基金项下的其他基金财产，由基金管理人保管相关财产或财产权利凭证的，基金管理人应当自行安全保管，基金托管人不承担保管责任。**基金托管人依据基金管理人的划款指令将委托资金划出托管资金账户后至委托财产相关投资本金及收益以现金形式划回托管资金账户期间，**基金托管人不再承担资金或资产的保管职责。**对于由基金管理人负责保管的基金财产，因保管不善、挪用财产等违反法律法规、本合同约定的情形导致本基金财产损失的，均由基金管理人承担。

2、 除本款第3项规定的情形外，基金管理人、基金托管人因基金财产的管理、运用或者其他情形而取得的财产和收益，归属于基金财产。

3、 基金管理人、基金托管人、投资顾问可以按照本合同的约定收取管理费、托管费、投资顾问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，不得与基金管理人、基金托管人固有财产（即不属于私募基金财产本身）的债务相互抵销。非因基金财产本身承担的债务，基金管理人、基金托管人不得主张其债权人对基金财产强制执行。上述债权人对基金财产主张权利时，基金管理人、基金托管人应明确告知基金财产的独立性。

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

7、 对于因为基金投资产生的应收资产，应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并书面通知基金托管人，到账日期届满基金应收资产没有到达基金托管资金账户的，由此给基金造成损失的，**基金管理人应负责向有关当事人追偿基金的损失，基金托管人对此不承**

担任何责任。

(二) 基金财产相关账户的开立和管理

1、 托管账户的开立和管理

（1） 基金托管人应负责本基金有关的托管账户的开立和管理，基金管理人应配合基金托管人办理开立账户事宜并提供相关资料。

（2） 基金托管人以基金的名义在商业银行代理开设托管账户，保管基金的银行存款。该账户的开设和管理由基金托管人负责，该账户的银行预留印鉴由基金托管人刻制、保管并使用。基金托管人为本基金财产专用银行账户开立网上银行，网上银行的电子密钥和密码由基金托管人保管和使用。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、收取申购款，均需通过该账户进行。管理人在确定托管账户名称时应考虑满足三方存管、银行间市场开户要求等需要。

（3） 托管账户的开立和使用，限于满足开展保管业务的需要。基金托管人和基金管理人不得假借本基金的名义开立其他任何银行账户;亦不得使用本基金的任何银行账户进行本基金业务以外的活动。

（4） 托管账户的管理应符合《人民币银行结算账户管理办法》《现金管理暂行条例》《支付结算办法》和中国人民银行利率管理的有关规定以及其他有关规定。

2、 基金的证券账户和证券资金账户的开设和管理

（1） 基金托管人应当以基金产品的名义在中国证券登记结算有限责任公司开设证券账户，用于本基金证券投资的清算和存管，证券账户名称应当符合证券、期货登记结算机构的有关规定，以实际开立为准。

（2） 本基金证券账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得出借和未经另一方同意擅自转让本基金的任何证券账户;亦不得使用本基金的任何证券账户进行本基金业务以外的活动。

（3） 本基金证券账户的开立和证券账户卡的保管由基金托管人负责，相关账户资产的管理和运作由管理人负责。

（4） 基金托管人协助基金管理人以基金名义在证券经纪商的营业网点开立证券资金账户，并按照证券经纪商营业网点开户的流程和要求，签订相关的协议，并办理三方存管联通，基金托管人应根据基金管理人的指令，进行银转证操作，证转银操作由管理人通过证券经纪商系统完成。

（5） 交易所证券交易资金采用第三方存管模式，即用于证券交易结算资金全额存放

在基金管理人为本基金开设证券资金账户中,场内的证券交易资金的保管和清算由基金管理人所选择的证券经纪商负责。

3、 基金账户的开设和管理

（1） 基金管理人应当以基金的名义在拟投资基金的份额登记机构处开设基金账户，并在该基金的销售机构开设基金交易账户。

（2） 基金账户和基金交易账户的开立和使用限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得出借和未经另一方同意擅自转让本基金的任何基金账户或基金交易账户；亦不得使用本基金的任何基金账户或基金交易账户进行本基金业务以外的活动。

（3） 基金账户和基金交易账户的管理和使用由管理人负责。

4、 其他账户的开设和管理

因业务发展需要而开立的其他账户,应由基金托管人或管理人根据有关法律法规的规定开立。新账户按有关规则管理并使用。

开立的上述基金财产账户应与私募基金管理人、私募基金托管人、私募基金募集机构和私募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。**未经托管人书面同意，管理人变更、解除与托管资金账户之间的关联关系或增设其他关联账户给基金财产造成损失的，托管人不承担任何责任。**

对于非由基金托管人开立、管理并实际控制的账户,基金托管人不承担任何形式的职责。

5、 根据法律法规规定、监管要求及本合同约定，本基金投资运作有关账户需要由基金托管人代基金管理人办理的，基金管理人应当按照法律法规规定、监管要求及本合同约定将相关资料提供给基金托管人，并确保相关资料的合法性、真实性、完整性和有效性。**基金托管人仅根据基金管理人提供的资料进行表面相符性的形式审查**,如因基金管理人提供的相关资料不合法、不真实、不完整或失去效力而影响基金投资运作有关账户开立，给基金财产或基金投资者带来损失的，相关责任均由基金管理人承担。

十三、 指令的发送、确认与执行

（一）基金管理人对发送指令人员的书面授权

本合同签署生效后，基金管理人应向基金托管人提供资金划拨授权书（简称“授权书”），授权书中应包括被授权人的名单、电话、传真、预留印鉴和签字样本，规定基金管理人向基金托管人发送指令时基金托管人确认有权发送指令人员身份的方法以及授权文件应注明被授权人相应的权限及有效时限。授权书由基金管理人加盖公章并由法定代表人或其授权代表签署，若由授权代表签署，还应附上法定代表人的授权书。基金管理人应将授权文件以电子邮件或传真方式通知基金托管人并经电话确认后，授权文件即生效。授权文件在电子邮件或传真发出 7 个工作日内送达文件正本。**基金托管人有权拒绝非授权书中列示的电子邮箱所发送的划款指令，由此造成的相关损失，基金托管人不承担任何责任。**授权书须载明授权生效日期，授权书自载明的生效日期开始生效。基金托管人收到授权书的日期晚于载明生效日期的，则自基金托管人收到授权书时生效。基金管理人和基金托管人对授权书负有保密义务，其内容不得向相关人员以外的任何人泄露。但法律法规规定或有权机关要求的除外。

（二）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，加盖预留印鉴并由被授权人签字或签章，并按照托管人要求向托管人提供加盖管理人预留印鉴的相关附件，如合同各方已签字盖章完成的信托计划合同、资产管理计划合同等与本基金投资品种有关的合同协议等。

基金管理人应保证以上所提供的文件资料的合法性、真实性、完整性和有效性。如果基金管理人无法提供上述文件资料的，基金托管人有权拒绝执行划款指令，由此造成的损失由基金管理人负责并承担。

（三）指令的发送、确认和执行的时间及程序

指令由授权书确定的被授权人代表基金管理人用电子邮件、传真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送。基金管理人有义务在发送指令后与托管人进行确认（确认方式包括但不限于电话、邮件、短信或私募基金管理人和私募基金托管人一致认可的其他方式，下同）。传真以获得收件人（基金托管人）确认该指令已成功接收之时视为送达。如通过电子邮件发送扫描件方式发送指令，扫描件以获得收件人（私募基金托管人）确认该

指令已成功接收之时视为送达。**因基金管理人未能及时与基金托管人进行指令确认，致使资金未能及时到账所造成的损失，基金托管人不承担责任。**基金托管人依照授权书规定的方法确认指令有效并根据本合同进行审核后，方可执行指令。

对于被授权人依照授权书发出的指令，基金管理人不得否认其效力。基金管理人应按照相关法律法规以及本合同的约定，在其合法的经营权限和交易权限内发送划款指令，发送人应按照其授权权限发送划款指令。对于基金管理人采用电子传输方式发送指令的，应根据基金托管人的要求另行签订《专业机构服务平台划款指令授权书》，约定指令接收、审核、撤回等相关流程和责任。

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。

基金托管人收到基金管理人发送的指令后，应对传真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，复核无误后依据本合同约定在规定期限内及时执行，不得延误。若存在异议或不符，基金托管人立即与基金管理人指定人员进行电话联系和沟通，并要求基金管理人重新发送经修改的指令。基金托管人可以要求基金管理人传真提供相关交易凭证、合同或其他有效会计资料，以确保基金托管人有足够的资料来判断指令的有效性。

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

（四）基金托管人依照法律法规暂缓、拒绝执行指令的情形和处理程序

基金托管人发现基金管理人发送的指令违反《基金法》、本合同或其他有关法律法规的规定时，不予执行，并应及时以书面形式通知基金管理人纠正，基金管理人收到通知后应及时核对，并以书面形式对基金托管人发出回函确认，由此造成的损失由基金管理人承担。

（五）基金管理人发送错误指令的情形和处理程序

基金管理人发送错误指令的情形包括指令发送人员无权或超越权限发送指令及交割信息错误，指令中重要信息模糊不清或不全等。基金托管人在履行监督职能时，发现基金管理

人的指令错误时，有权拒绝执行，并及时通知基金管理人改正。

（六）更换被授权人的程序

基金管理人撤换被授权人员或改变被授权人员的权限，必须提前至少1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并由法定代表人或其授权代表签署的被授权人变更授权书，并提供新被授权人签字样本，同时电话通知基金托管人，基金托管人收到变更授权书当日通过电话向基金管理人确认。被授权人变更授权书须载明新授权的生效日期。被授权人变更授权书自载明的生效时间开始生效。基金托管人收到变更授权书的日期晚于载明的生效日期的，则自基金托管人收到时生效。基金管理人在电话告知后三日内将被授权人变更通知的正本送交基金托管人。被授权人变更授权书生效后，对于已被撤换的人员无权发送的指令，或新被授权人员超权限发送的指令，基金管理人不承担责任。

（七）指令的保管

指令若以传真形式发出，则正本由基金管理人保管，基金托管人保管指令传真件。当两者不一致时，以基金托管人收到的投资指令传真件为准。

（八）相关责任

基金托管人正确执行基金管理人符合本合同规定、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，但托管资金专门账户及其他账户余额不足或基金托管人如遇到不可抗力的情况除外。

如果基金管理人的划款指令存在事实上未经授权、欺诈、伪造或未能按时提供划款指令人员的预留印鉴和签字样本等非基金托管人原因造成的情形，只要基金托管人根据本合同相关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，但基金托管人未尽审核义务执行划款指令而造成损失的情况除外。

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。

基金管理人应及时将本基金财产证券交易单元号、佣金费率等基本信息以及变更情况及时以书面形式通知基金托管人和基金服务机构。

(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国证券登记结算有限责任公司(简称“中登公司”)制定的相关业务规则和规定，该等规则和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和规定。

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) 场外资金的清算交收安排

1、本基金相应的资金划拨由基金托管人依据基金管理人的划款指令执行。基金管理人应将划款指令连同相关投资证明文件一并传真至基金托管人。基金托管人审核无误后，应及时将划款指令交付执行。

2、基金管理人应确保基金托管人在执行基金管理人发送的指令时，有足够的头寸进行交收。基金的资金头寸不足时，基金托管人有权拒绝基金管理人发送的划款指令。基金管理人在发送划款指令时应充分考虑基金托管人的划款处理所需的合理时间。如由于基金管理人的原因导致无法按时支付清算款，由此造成的损失由基金管理人承担。

3、在资金头寸充足的情况下，在正常业务受理渠道和时间内，基金托管人对基金管理

人符合法律法规、本合同规定的指令不得拖延或拒绝执行，如由于基金托管人的过错导致基金无法按时支付清算款，由此造成的损失由基金托管人承担，但托管账户余额不足或基金托管人遇不可抗力的情况除外。

(四) 资金、证券账目及交易记录的核对

基金管理人或其委托的基金服务机构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。

(五) 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。基金管理人或其委托的基金服务机构和基金托管人分别计算 T 日基金资产净值、基金份额净值，并进行核对；基金管理人或其委托的基金服务机构向基金份额登记机构发送基金资产净值等数据。

2、T+2 日内，基金管理人或其委托的份额登记机构按照本合同约定计算申购份额、赎回金额，并将确认的申购、赎回数据向基金托管人传送，特殊情况除外。基金管理人或其委托的基金服务机构、基金托管人根据确认数据进行账务处理。

3、基金份额持有人赎回申请确认后，基金管理人将在【T＋9 日(包括 T+9 日)】内支付赎回款项，本合同另有约定的情况除外。（基金托管人根据基金管理人的赎回款项划款指令进行划款，将赎回款项划往基金管理人指定的份额登记机构，并由份额登记机构将赎回款项划入基金份额持有人的指定资金账户或代销机构指定的资金账户）。本基金赎回款划付产生的银行转账等手续费用由基金财产承担。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。

4、基金管理人或其委托的份额登记机构应对注册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。

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约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。本基金进入清算程序后，私募基金管理人有权对基金财产所投资证券进行变现，由此造成投资比例等不符合本合同相关约定的，不属于越权交易。

(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，发现基金管理人的划款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。基金管理人对基金托管人通知的越权事项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基金业协会。

基金托管人发现基金管理人可能存在违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反本合同约定，但难以明确界定时，有权报告基金管理人。基金管理人应在 3 个工作日内予以答复，基金管理人在 3 个工作日内未予以答复的，基金托管人有权报告中国证监会或基金业协会。

基金管理人收到上述基金托管人通知后应及时核对或纠正，并以电话、邮件或书面形式向基金托管人进行解释或举证。

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，必须于下一交易日上午 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

对投资范围的监督：基金托管人根据法律法规及本合同之约定在投资监督系统可观测范围内对投资范围进行监督。

1、 基金托管人依据本基金合同“越权交易”章节约定以及经核对一致的估值数据对基金管理人的投资行为行使监督权，对本基金的投资范围及投资限制进行监督，**不对本基金资产的最终投向、资产比例及其他投资限制是否符合本合同约定进行穿透核查，对私募基金管理人的其他职责和行为不承担监督责任。**

2、 本基金存续期间，基金托管人仅需对基金管理人投资范围和投资限制进行盘后监督，而非实时监督。**因基金管理人未依照本合同的投资范围和投资限制进行投资给基金财产或者基金份额持有人造成财产损失的，基金托管人不承担任何责任。**

3、 基金托管人仅根据其实际获得的、与本基金的资产有关的客观数据进行监督，如投资比例和投资限制涉及穿透核查或穿透合并计算的，基金管理人应当在每季初 10 个工作日内向托管人提供所投资私募基金、私募资产管理产品上季度末的估值表以及其他相关托管人认为必要的辅助性材料，托管人仅按照管理人提供的数据材料及提供频率进行事后监督，管理人应确保对所提供数据材料的真实性，准确性以及完整性负责。基金管理人未及时提供前述材料的，基金托管人不承担任何责任，并有权向中国证监会、基金业协会报告。

4、 受证券期货市场波动、证券发行人合并、私募证券投资基金规模变动等私募基金管理人之外的因素影响，导致私募证券投资基金的投资比例不符合本指引规定或者基金合同约定的，私募基金管理人应当在 20 个交易日内调整至符合要求。因资产流动性受限导致无法完成前述调整的，应当在相关资产可出售、可转让或者恢复交易后的 20 个交易日内调整至符合要求。法律法规、金融监管部门另有规定的从其规定。本基金所持股票（含新三板）、债券等因退市、摘牌、市场层级调整、港股通股票调出和调入、互联互通标的调整、送股、可转债转股、资产纳入侧袋账户、基金净值为负、资产重组及处置的特定情形的，管理人有权不进行调整。

5、 对于场外品种的投资，托管人将在划款前根据本合同 “投资指令的发送、确认与

执行”章节对相应的划款指令、投资申请书、投资协议等管理人所提供的材料是否符合投资范围、投资限制进行形式审核。场外投资是指除直接或者间接投资于中国金融期货交易所、上海期货交易所、大连商品交易所、郑州商品交易所、上海国际能源交易中心、广州期货交易所挂牌交易的期货产品，以及上海证券交易所、深圳证券交易所、北京证券交易所、上海黄金交易所挂牌交易的各种金融产品以外的产品。

本基金投资于场外期权、收益互换、收益凭证的，基金管理人应当要求交易对手方对场外衍生品交易是否涉及多空收益互换、带敲入和敲出结构等投资限制作出书面说明。基金管理人应当向基金托管人提供该前述书面材料，基金管理人拒不提供的，托管人有权拒绝执行基金管理人的相关投资指令。

6、 基金托管人对基金财产的监督和检查自本基金建账估值之日起开始，至本基金进入清算程序之日结束。托管资金账户向证券交易资金账户（含信用账户）、期货账户、银行间DVP 账户、场外衍生品保证金账户等各类资金账户进行的转账活动，不属于基金的投资活动，基金托管人对此不负有监督义务。

7、 基金托管人越权交易监督的真实性、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。**

8、 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。基金托管人按照本合同约定履行了上述越权交易监督义务的，即代表托管人对基金投资运作进行了监督。**对于基金管理人实际发生的越权交易，无论托管人是否发现，托管人对该越权交易的行为以及产生的后果和损失不承担任何补充或连带责任。**

9、 投资比例和投资限制涉及场外期权和收益互换等场外衍生品、收益凭证等监控的，基金管理人应当按照私募基金托管人认可的方式在本基金下一估值日前将场外衍生品交易情况、交易文件等提供给私募基金托管人，基金托管人的越权交易监督依赖于交易对手方提供的交易信息和行情信息，包括但不限于交易对手、合约权利金或保证金、合约名义本金、合约交易结构、合约挂钩标的、协议回购质押券以及回购交易对手等信息；由于场外衍生品和收益凭证等场外衍生品属于非标准化资产，前述交易信息和行情信息可能由于交易对手方的标准不统一，其信息口径或含义可能存在较大差异，进而影响监控结果；**基金管理人应按照监管机构及基金业协会的要求确保相关资产交易数据的真实性、准确性、完整性和及时性，**

基金托管人不具体审核交易信息和行情信息，不对交易数据的真实性、准确性、完整性和及时性负责；由于前述交易数据可能不真实、不准确、不完整、不及时，或者因前述数据口径不明确等原因导致基金托管人无法监控、未能监控或监控不准确的，基金托管人不承担任何责任；

10、 如本基金参与债券协议回购的，基金管理人应当按照私募基金托管人认可的方式在该基金下一估值日前将参与债券质押式协议回购业务的交易文件、交易对手方及质押标的等信息提供给私募基金托管人。**基金管理人拒不提供，或者提供信息有误导致托管人无法对相关交易进行监督的，基金托管人不承担任何责任，且有权向监管机构或基金业协会进行报告。**

十六、 基金财产的估值和会计核算

在本条项下，基金管理人委托基金服务机构（国泰海通证券股份有限公司）履行“基金财产的估值和会计核算”职责及其他相关职责。基金管理人与基金托管人确认，除非本条项下另有除外规定，本条项下应由基金管理人履行的职责均由基金服务机构履行。在本条项下业务实际操作过程中，基金托管人与基金服务机构对接、联系，未能联系到基金服务机构或与基金服务机构不能达成一致时，基金托管人可直接与基金管理人联系。本基金的基金会计责任方仍是基金管理人。

(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

自本基金成立后第 2 个工作日起，基金管理人与基金托管人在每个工作日对前一工作日的基金财产进行估值核对。对于非基金托管人原因造成的估值核对时效延误，基金托管人不承担责任。

3、 估值依据

估值应符合本合同、《证券投资基金会计核算业务指引》及其他法律、法规的规定，如法律法规未做明确规定的，参照证券投资基金的行业通行做法，由基金管理人与基金托管人基于合理审慎原则协商一致确定。

4、 估值对象

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

5、 估值方法

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、对在交易所上市交易的可转换债券，按其估值日收盘价进行估值；估值日没有交易的，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且债券发行机构未发生影响债券价格的重大事件的，按最近交易日收盘价估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考监管机构和行业协会估值意见，或者参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。

C、交易所上市实行全价交易的债券（本基金另有规定的除外）按估值日第三方机构（中证指数公司）提供的相应品种的估值全价估值，估值日没有交易的，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且债券发行机构未发生影响债券价格的重大事件的，按最近交易日第三方机构（中证指数公司）提供的相应品种的估值全价估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考监管机构和行业协会估值意见，或者参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。

D、交易所上市未实行全价交易的债券（本基金另有规定的除外）按估值日第三方机构（中证指数有限公司）提供的相应品种当日的估值净价并加计每百元税前应计利息作为估值全价进行估值；估值基准日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日第三方机构（中证指数有限公司）提供的相应品种最近交易日的估值净价并加计每百元税前应计利息作为估值全价进行估值。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，确定公允价值。

E、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。

F、证券交易所退市/摘牌的股票，在退市期间以退市/摘牌前该股票的最新估值价格进行估值。证券交易所退市/摘牌的可转债，在退市期间按第三方估值机构提供的相应品种当日的估值价格进行估值，第三方估值机构未提供估值日估值价格的，按第三方机构公布的最近估值日的估值价格估值。如第三方估值机构从未发布估值价的，按退市/摘牌前该可转债的最新估值价格进行估值。上述第三方机构优先采用中央国债登记结算有限责任公司（简称“中债”）提供的数据。

(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、流通受限股票，是指明确带有一定限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票。

FV = S×(1-LoMD)

其中：FV 为估值日该流通受限股票的价值；S 为估值日在证券交易所上市交易的同一股票的收盘价；LoMD 为该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣，该流动性折扣优先采用中债指数有限公司发布提供的数据。

（3） 港股通的估值

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

在基金估值日，港股通投资持有外币证券资产估值涉及到港币对人民币汇率的，参考当日日终上海证券交易所、深圳证券交易所人民币汇率中间价进行估值。

（4） 全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，主要采用第三方机构（中央国债登记结算有限责任公司）提供的估值价格和估值技术。

（5） 对于含投资人回售权的债券行使回售权的（交易所或银行间），在回售登记日至实际收款日期间选取第三方估值基准服务机构提供的相应品种的唯一估值全价或推荐估值全价，同时管理人应充分考虑发行人的信用风险变化对公允价值的影响（基金服务机构及托管人不承担相关的影响评估或评估结果的复核责任）。含投资者回售权的债券在回售登记期截止日（含当日）后未行使回售权的采用长待偿期所对应的价格进行估值。

（6） 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。

（7） 交易所上市流通的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。未在交易所上市流通的基金，按照估值日当日份额净值估值，若无当日份额净值，则按最近公布的基金份额净值估值。场外货币市场基金以成本估值，每日按估值日当日的万份收益计提红利；场内货币 ETF 基金按估值日其所在证券交易所的收盘价估值，估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值，如披露万份收益 ，每日按估值日当日的万份收益计提红利，并按照中国证券登记结算有限公司数据进行现金分红或红利再投资。

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

（9） 基金持有的衍生工具等其他有价证券，上市交易的按估值日的结算价估值；估值日没有交易的，按最近交易日的结算价估值；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；停止交易、但未行权的有价证券，采用估值技术确定公允价值。

（10） 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。

（11） 银行存款按日计息，在利息到账日以实收利息入账，并冲减已计提部分；证券资金账户、期货账户保证金默认不计提利息，以实际结息为准，如需调整为计提利息，管理人应将计息利率通过双方协商一致的方式告知托管人。

（12） 退市/摘牌股票于全国中小企业股份转让系统两网及退市板块重新挂牌的,以其估值日挂牌的市价（收盘价）与退市/摘牌前该股票的最新估值价格孰低进行估值，估值日无交易的，以最近交易日的市价（收盘价）与退市/摘牌前该股票的最新估值价格孰低进行估值

（13） 当退市/摘牌可转换债券进入全国中小企业股份转让系统两网及退市板块转让的，以及于全国中小企业股份转让系统两网及退市板块新增买入的标的，按第三方估值机构提供的相应品种当日的估值价格进行估值，第三方估值机构未提供估值日估值价格的，按第三方机构公布的最近估值日的估值价格估值。如第三方估值机构从未发布估值价的，按退市/摘牌前该标的的最新估值价格进行估值，以及于全国中小企业股份转让系统两网及退市板块新增买入的标的按成本估值，即该标的的估值价格=（现存持仓数量中于退市前结存的数量*退市日前最新估值价格+现存持仓数量中于重新挂牌后买入数量*买入成本）/现存持仓数量。上述第三方机构优先采用中央国债登记结算有限责任公司（简称“中债”）提供的数据。对于基金管理公司及其子公司的特定资产管理计划、证券公司集合资产管理计划、保险资产管理计划、期货资产管理计划、信托计划、商业银行及商业银行理财子理财计划、私募证券投资基金，估值方式具体如下：

(i) 如在标的产品权益确认日当天收到了标的产品权益确认原始凭证的，则在标的产品权益确认日当天以权益确认原始凭证为依据入账；如无法在权益确认日当天提供收到标的产品的权益确认原始凭证的，则以收到标的产品权益确认原始凭证的提供日当天进行入账，且不对历史账务进行追溯调整；

（ii）按份额净值计价的投资标的，按照标的产品的最新份额净值估值，未提供最新份额净值的，以最近一次得到的标的产品份额净值进行估值；

（iii）如标的产品披露“虚拟份额净值”的（即份额净值扣除预估业绩报酬后得到的份额净值），本基金管理人可选择使用标的产品的“虚拟份额净值”对本基金进行估值,选择使用“虚拟份额净值”进行本基金估值，则后续不能再进行更改。

（iv）按面值及每万份收益计价的投资标的，以成本列示，按标的产品公布的最新每万份收益计提收益。

（v）所投资的底层产品的管理人应当授权其托管机构将已复核的基金估值信息及时提供给托管人；

（vi）如不属于上述情况的，则管理人可与托管人协商一致，按最能反映该投资标的公允价值的方法估值。

（14） 本基金参与场外衍生品交易的，按估值日其交易对手方提供的交易文件中体现的估值信息估值。基金管理人签订场外衍生品交易合约时，应当明确授权由交易对手方、相关交易的清算机构在本基金下一估值日前通过邮件等托管人认可的方式向基金托管人提供估值日当日最新的场外衍生品交易文件，并持续提供相关估值信息。基金管理人应确保上述估值数据的真实、完整和有效，如内容不完整、不准确、不及时或不真实，由此造成的损失由基金管理人承担相应责任。

（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，在与基金托管人商议后，按最能反映该投资品种公允价值的方法估值。如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

（16） 相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

如基金管理人或基金托管人发现基金估值违反本合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时，应立即通知对方，共同查明原因，双方协商解决。根据有关法律法规，基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，以基金管理人对基金资产净值的计算结果为准。如以基金管理人计算或确认的结果对外公布，**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，由基金管理人承担相应责任。

6、 估值程序

基金日常估值由基金管理人进行。基金管理人完成估值后，将估值结果加盖业务公章以书面形式或者双方认可的其他形式送至基金托管人，基金托管人按法律法规、本合同规定的估值方法、时间、程序进行复核，复核无误后在基金管理人传真的书面估值结果上加盖业务章或者双方认可的其他形式返回给基金管理人；月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

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

7、 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。当基金资产净值发生计算错误超过基金资产净值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。

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的0.5%时，应立即通知双方，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、当基金资产净值发生计算错误超过基金资产净值的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。

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） 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） 中国证监会认定的其他情形。

9、 基金资产净值的确认

用于向基金份额持有人报告的基金资产净值由基金管理人负责计算，基金托管人进行复核。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，**按照基金管理人对基金资产净值的计算结果为准，由此给资产投资者和基金财产造成的损失，私募基金托管人不承担任何责任。**

10、 特殊情况处理

（1）私募基金管理人或基金托管人按估值方法进行估值时，所造成的误差不作为基金财产估值错误处理。

（2）**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，私募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，但未能发现该错误的，由此造成的基金财产估值错误，私募基金管理人和基金托管人可以免除赔偿责任。但私募基金管理人、基金托管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；

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、 私募基金管理人或其委托的外包服务机构应保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，编制会计报表；私募基金托管人应定期与私募基金管理人就私募基金的会计核算、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、 基金管理人的管理费

2、 基金托管人的托管费;

3、 基金服务机构的基金服务费;

4、 基金销售服务费;

5、 投资顾问的投资顾问费;

6、 基金管理人的业绩报酬;

7、 基金的证券交易费用及各类账户开户费用（包括但不限于印鉴刻制费、账户开立费、网银U盾费、网银证书年费等）;

8、 为基金募集、运营、审计、法律顾问、投资顾问等提供服务的基金服务机构的相应服务费;

9、 基金年度审计费;

10、 基金的银行汇划费、银行账户维护费;

11、 与本基金销售、签约有关的费用（包括纸质合同印刷费用（如有）、投资者适当性管理费用（如有）、电子合同服务费用（如有）等）;

12、 本基金投资运作直接相关应税项目或应税行为产生的增值税及附加税费;

13、 基金终止时的清算费用;

14、 召开基金份额持有人大会等相关费用;

15、 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）费用计提方法、计提标准和支付方式

1、管理费

（1）基金的管理费率为1%/年。

计算方法如下:

A＝E×C÷N

A：每日应计提的管理费

C：年管理费率

E：前一自然日的基金资产净值

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。管理费支付时，基金管理人向基金托管人发送支付指令，基金托管人复核后从基金财产中一次性划出。

（2）管理费的收款账户

户名：上海衍复投资管理有限公司

账号：121934563710601

开户银行：招商银行股份有限公司上海华灵支行

2、托管费

（1）基金的年托管费率为基金资产净值0.03%/年。

计算方法如下：

H＝E×R÷N

H：每日应计提的托管费

R：年托管费率

E：前一自然日的基金资产净值

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。托管费支付时，基金管理人向基金托管人发送支付指令，基金托管人复核后从基金财产中一次性划出。

3、基金服务费

（1）基金的年基金服务费率为基金资产净值0.01%/年。

计算方法如下：

H＝E×R÷N

H：每日应计提的基金服务费

R：年基金服务费率

E：前一自然日的基金资产净值

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，按季支付给基金服务机构。基金服务费支付时，基金管理人向基金托管人发送支付指令，基金托管人复核后从基金财产中一次性划出。

基金服务机构收取基金服务费的银行账户为：

户名：国泰海通证券股份有限公司

账号：415900000010916

开户行：招商银行股份有限公司上海张江支行

大额支付号：308290003492

4、销售服务费

本基金销售服务费率为1%/年。

计算方法如下：

A＝E x C÷N

A：每日应计提的销售服务费

C：年销售服务费率

E：前一自然日的基金资产净值

N：当年天数

本基金的销售服务费自基金成立日起，每日计提，按季支付。销售服务费支付时，基金管理人向基金托管人发送支付指令。基金托管人仅核对与估值表上已计提的销售服务费金额是否一致，核对一致后从基金财产中一次性划出。

5、基金管理人的业绩报酬

（1）本基金业绩报酬计提基准B=期间中证A500指数收益率。

（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 6 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。

（3）业绩报酬的计算：业绩报酬的计算采用单个投资者单笔绝对收益差额法计提，即基金份额持有人每笔所持份额或赎回份额绝对收益率为正且大于业绩报酬计提基准时，对超出业绩报酬计提基准的收益按25%比例进行计提，且每笔份额可提取的业绩报酬上限为（T1×R）。

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

期间中证A500指数（000510.SH）收益率=（Hn - H0）/ H0　×100%

Hn为本次业绩报酬计提基准日对应的中证A500指数收盘价；

H0为上一个业绩报酬成功计提基准日对应的中证A500指数收盘价。

Tn =本次业绩报酬计提基准日的基金份额累计净值；

T0=上一个业绩报酬成功计提基准日的基金份额累计净值；

T1 =上一个业绩报酬成功计提基准日的基金份额净值；

如果没有成功计提过业绩报酬，则通过认购和在启用日当日及启用日之前的申购开放日获得的份额，H0、T0、T1 分别取启用日对应的中证 A500 指数收盘价、max{启用日份额累计净值，参与日份额累计净值}及该份额累计净值所对应日期的份额净值（认购份额的参与日为基金成立日，申购份额的参与日为申购申请日）（启用日为本基金启用指数增强业绩报酬之日，**私募基金管理人应在启用日当日以书面方式通知全体基金份额持有人及运营服务机构，运营服务机构对此不负责监督**），在启用日之后通过申购获得的基金份额，H0、T0、T1 分别取申购申请日对应的中证 A500 指数收盘价、份额累计净值及份额净值。

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=（Tn - T0）/ T1 ×100%；

业绩报酬计提的条件为：

在 R≤ 0 时，不提取业绩报酬。

在 R> 0 时：

当 0%<R -B 时，对超出业绩报酬计提基准部分提取 25%的业绩报酬，且每笔份额可提取的业绩报酬上限为（T1×R），即 E=Min{K×T1×（R-B）×25%，K×T1×R}；

当 R-B≤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（如有）收取账户为本合同约定的私募基金管理人管理费收取账户。

6、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，由基金托管人根据基金管理人的指令从基金财产中支付。

（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运作无关的事项发生的费用。

3、私募基金募集结算专用账户的账户开户费、网银开户费、资金结算汇划费、账户维护费等，由账户管理方承担。

4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

（四）费用调整

基金管理人、基金托管人协商一致，可下调管理费率、托管费率及销售服务费率，本基金基金服务费调低、免除，经私募基金管理人和基金服务机构协商一致后通知私募基金托管人。需调高管理费率、托管费率、基金服务费及销售服务费时，需取得所有投资者书面同意。

（五）基金的税收

本基金运作过程中涉及基金本身支付税费的，基金托管人凭基金管理人指令和相关税费单据（若有）进行资金划拨。

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。依据相关法律法规或税务机关的认定，基金投资及运营过程中发生增值税等应税行为，以管理人为纳税主体，或由管理人代扣代缴的，除本基金已列明的基金管理业务费用（如管理费、托管费等）由各收费方自行缴纳外，基金管理人有权以基金资产予以缴纳或代扣代缴，且无需事先征得委托人的同意。应由委托人自行缴纳的税费，基金管理人不承担代扣代缴或纳税的义务。

基金管理人在向委托人交付相关收益或资产后，税务机关要求基金管理人就已交付收益或资产缴纳相关税费的，委托人必须按照基金管理人要求进行补缴，由此导致委托人收益减少的，委托人不得要求管理人以任何方式向其返还或补偿所补缴的税费。

十八、 基金的收益分配

（一）可供分配利润的构成

本私募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及未实现收益的部分。

私募基金收益包括：基金投资所得红利、股息、债券利息、证券投资收益、证券持有期间的公允价值变动、银行存款利息以及其他收入。因运用基金财产带来的成本或费用的节约计入收益。

（二）收益分配原则

1、每一基金份额享有同等分配权。

2、收益分配的基准日为可供分配利润的计算截止日。

3、基金收益分配基准日的私募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1元。

4、法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

（三）收益分配方案的确定与通知

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

1、在本基金存续期内，基金投资者可选择现金分红或者将收益转换为份额的方式进行，默认方式为收益转换为份额，基金投资者需要修改收益分配方式的，需提前通知销售机构提出申请。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。

2、如涉及收益转换为份额，对于收益转换份额不受本合同中关于基金份额不允许赎回期限（如有）的限制，且对收益转换为份额不收取赎回费（如有）

3、本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金管理人在基金托管人复核后以本合同约定的形式通知基金份额持有人。

4、基金投资者选择将收益转换为份额单位时，由管理人委托份额登记机构进行相应份额登记。

十九、 信息披露与报告

一、 信息披露义务人

本基金信息披露义务人为基金管理人。

基金管理人委托销售机构代为披露本基金相关信息的，在收到基金管理人发送、通知或公告的信息披露文件后，由销售机构按照法律法规及本合同约定进行信息披露。

基金管理人委托第三方机构代为披露信息的，其作为信息披露义务人应当承担的责任和信息披露义务不因委托第三方机构而免除。基金管理人委托第三方代为进行信息披露，授权基金份额登记机构将数据传输给第三方。

基金管理人不得有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并应当按照法律法规、有权机关规定持续履行信息披露和报送义务，应当保证所披露信息的真实性、准确性、完整性和及时性。因信息披露不真实、不准确、不完整或不及时等原因造成的争议或损失由基金管理人负责解决并承担相应的法律责任。**如基金管理人未按照法律法规、金融监管部门相关规定及本基金合同约定履行信息披露义务的，或者基金管理人向基金份额持有人披露的信息未经基金托管人复核，或披露的信息与托管人所复核信息不一致的，基金托管人不承担任何责任。**

二、 运作期报告

(一)定期报告

根据《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，本基金定期报告包括月度报告（如有）、季度报告和年度报告：

1、 季度报告

基金管理人应当在每季度结束之日起在协会规定的时限内，向投资者披露经基金托管人复核后的基金份额净值、主要财务指标以及投资组合情况等信息。

2、 年度报告

基金管理人应当在每年度四月底之前，编制完成基金年度报告并经基金托管人复核，向基金份额持有人披露报告期末基金净值和基金份额总额、基金的财务情况、基金投资运作情况和运用杠杆情况、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）、投资收益分配和损失承担情况、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）、可能存在的利益冲突情况以及可能影响基金投资者合法权益的其他重大信息。

3、 月度报告

本基金资产规模金额达到5000万元以上时，基金管理人应当在每月结束之日起5个工作日以内向份额持有人披露经基金托管人复核后的基金份额净值信息。

4、 定期报告的复核流程

基金管理人负责编制基金的定期报告，基金管理人可以根据相关法律法规基金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，基金托管人对定期报告上财务数据相关内容进行复核。**如基金管理人或其委托的服务机构未及时将定期报告数据提供至基金托管人进行复核，由此造成的任何后果，基金托管人不承担责任。**

(二) 基金净值的披露

本基金成立后，基金管理人应【每季度】向基金份额持有人披露基金单位净值。基金管理人或基金管理人委托的服务机构提出复核申请后，由基金托管人复核。

(三)临时报告

基金管理人应在以下重大事项发生后，及时向投资者进行报告。

1、 基金合同约定的存续期限、投资范围、投资策略、投资限制、收益分配原则、基金费用等重要事项发生变更；

2、 基金名称、投资经理、注册地址、组织形式发生变更的；

3、 变更基金管理人、基金托管人或基金服务机构（基金服务机构、募集监督机构）的；

4、 管理人的法定代表人、执行事务合伙人（委派代表）、实际控制人发生变更的；

5、 触及基金止损线或预警线的；

6、 基金触发巨额赎回且无法满足全部赎回申请的；

7、 基金发生清盘或清算的；

8、 发生重大关联交易事项的；

9、 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；

10、 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、财产纠纷的；

11、 金额占基金净资产50%及以上的项目不能正常退出的；

12、 自2025年1月1日起，基金上一年度日均基金资产净值低于1000万元的；

13、 自2025年1月1日起，基金上一年度日均基金资产净值低于500万元的；

14、 自2025年1月1日起，基金资产净值连续60个交易日低于500万的；

15、 开展债券投资交易业务，投资债券的价格偏离度等风险控制指标出现异常情形时。

16、 对基金持续运行、投资者利益、资产净值产生重大影响的其他事件；

17、 基金合同发生重大变化的。

如发生上述1、3、6、10、11、16、17项重大事项的，管理人应当在10个工作日内向协会报送相关事项并向投资者披露。如发生上述第15项重大事项的，管理人应当及时向投资者披露，并按要求向证券交易场所报告。

(四) 其他披露信息

1、 投资单一上市公司发行的股票涉及《证券法》第六十三条规定的公告或者报告义务的，基金管理人应当及时向基金份额持有人披露；

2、 基金投资境外资产的，基金管理人应当向基金份额持有人充分披露跨境投资架构、投资路径和资金跨境流动等相关风险；

3、 基金运用杠杆进行交易的，基金管理人应当向基金份额持有人持续披露杠杆运用情况及可能存在的投资风险；

4、 基金开展衍生品交易的，基金管理人应当向基金份额持有人充分披露挂钩标的、保证金金额及比例、对手方及可能存在的投资风险；

5、 基金发生关联交易的，基金管理人应当及时向基金份额持有人披露执行关联交易制度、关联方、关联交易金额及占比等情况；

6、 基金底层资产存在重大损失风险等可能影响基金运行和基金份额持有人利益的重大事项，基金管理人应当及时向基金份额持有人披露。

三、 信息披露方式

基金管理人应当至少采用下列一种或多种方式向基金份额持有人提供报告、发送通知或基金份额持有人查询本基金信息：

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、电子邮件或手机短信等方式将定期报告、临时报告和单位净值等有关本基金的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定期报告、临时报告和单位净值等有关本基金的信息。基金份额持有人在销售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、微信公众号等方式

基金管理人可通过基金管理人网站、微信公众号等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、重大事项报告。基金管理人微信公众号的微信号：yanfuinvestments，基金管理人官方网站地址：https://yanfuinvestments.com。

4、私募基金管理人可通过代销机构的网站、APP、公众号或代销机构指定的其他方式向基金份额持有人提供报告和信息查询。

5、基金管理人将在基金业协会私募基金信息披露备份系统为基金委托人开通查询账号，基金委托人可登录该系统查询本基金的相关报告和信息。如因份额持有人不配合或不可抗力，而使管理人无法获取为份额持有人开通查询功能所需相关信息，并由此导致份额持有人无法在私募基金信息披露备份平台查询相关信息的情况，或因投资者怠于登录投资者查询账号，导致投资者未通过备份系统获取有关披露信息的，管理人不承担相关责任。

6、基金管理人指定的其他信息披露途径或方式

基金管理人通过上述方式之一通知基金份额持有人，即视为履行了告知义务。

四、 基金管理人披露基金信息，不得存在以下行为：

1、 向不特定对象披露私募证券投资基金的净值、收益等信息；

2、 虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏；

3、 对投资业务进行预测；

4、 违规承诺收益或承担损失；

5、 诋毁其他基金管理人、基金托管人或者基金销售机构；

6、 登载任何自然人、法人或者其他组织的祝贺性、恭维性或推荐性的文字；

7、 采取不具有可比性、公平性、准确性、权威性的数据来源和方法进行业绩比较，任意使用“业绩最佳”、“规模最大”等相关措辞；

8、 披露未经私募基金托管人复核的净值、份额或其他按照本合同约定需要基金托管人复核的相关报告等信息，或者披露的信息与基金托管人所复核信息不一致；

9、 法律、行政法规、中国证监会和中国基金业协会禁止的其他行为。

五、 向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、中国证监会和基金业协会的要求履行报告义务。

六、 信息披露资料保存年限

基金管理人应当妥善保管报告的相关文件资料，保存期限自基金清算终止之日起不得少于10年。

七、 基金管理人应当按照基金业协会规定通过基金业协会指定的私募基金信息披露备份平台报送信息。基金管理人应当在私募基金信息披露备份平台为投资者开立账户并告知投资者。基金份额持有人同意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。如因份额持有人不配合或不可抗力，而使管理人无法获取为份额持有人开通查询功能所需相关信息，并由此导致份额持有人无法在私募基金信息披露备份平台查询相关信息的情况，或因投资者怠于登录投资者查询账号，导致投资者未通过备份系统获取有关披露信息的，管理人不承担相关责任。

八、 如果中国基金业协会等金融监管部门对私募投资基金信息披露规定进行修订或/和更新，则本基金的信息披露事项约定以金融监管部门修订或/和更新后的规定为准。

二十、 基金份额的非交易过户和冻结、解冻

(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、司法强制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注册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，依据继承事实申请非交易过户的，应当提供继承公证文件；

“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、社会团体或其他组织的情形。

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。

二十一、 基金合同的签署、成立和生效

(一) 合同的签署、成立和生效

1、 合同的签署

本基金合同可由当事人采取纸质合同方式签署或当事人通过符合《电子签名法》等法律法规、监管规定有关要求的电子签名方式签署。电子签名与签署纸质合同具有同等法律效力。

（1）采用纸质合同（包括套印版的纸质合同）方式签署

本合同采用纸质合同（包括套印版纸质合同）方式签署的，基金投资者为机构（法人或其他组织）的，本合同自当事人各方法定代表人或授权代表签字（含签章）并加盖公章或合同专用章之日起成立并生效。基金投资者为自然人的，本合同自基金投资者本人签字或授权代表签字、基金管理人和基金托管人分别加盖公章或合同专用章及其法定代表人或授权代表签字（含签章）之日起成立并生效。

本合同采用纸质合同方式签署的，亦可采用套印托管人或/及管理人公章（或合同专用章）、法定代表人/执行事务合伙人或授权代表签字（或盖章）的套印版纸质合同方式与基金投资者进行签署，套印版纸质合同的生效及法律效力等同于基金管理人和基金托管人直接签署。基金投资者签署本合同，即表示对套印版纸质合同方式予以认可和接受。

基金管理人负责保证募集行为合法合规性，保证基金投资者签署基金合同等法律文件的真实性、准确性、完整性。如因投资者签署合同等法律文件不真实不准确不完整、募集行为不合法合规导致的任何责任，由基金管理人自行承担。

针对每一个投资者，基金合同一式【叁】份，各当事人各执【壹】份，每份合同均具有同等的法律效力。基金管理人应当妥善保管并按托管人要求及时向其移交经投资者签署完毕的基金合同原件。

（2）采用电子签名方式签署

本合同采用电子签名方式签署的，自各方当事人以符合《电子签名法》等法律法规、监管规定要求的电子签名方式签署完毕之日起生效。

基金管理人负责确保签约系统得到基金托管人认可，并确保基金投资者签署本合同所使用的签约系统、电子签名符合《电子签名法》等法律法规、监管机关及自律组织的相关要求。基金管理人负责确保提供给基金托管人的电子数据信息的真实性、准确性、完整性、及时性和合法合规性。

2、 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公告成立。

3、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） 本基金依法以及根据本合同约定有效成立，对本合同各方具有法律效力。

基金合同自生效之日起对私募基金管理人、私募基金托管人、投资者具有同等的法律约束力。本合同生效后，任何一方都不得单方解除。本合同另有约定的除外。合同生效后各方不得通过签订补充协议、修改合同等方式约定保证资产投资收益、承担基金财产投资收益、承担投资损失,或排除投资者自行承担投资风险。否则该等条款在任何情况下都不发生效力，任何一方不得依据该等条款向管理人或托管人主张权利。

(二) 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销售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。

二十二、 基金合同的效力、变更、解除与终止

(一) 基金合同的效力

1、 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。本合同的签署采用电子签名方式的，自基金管理人、基金托管人及基金份额持有人均以电子签名方式签署本合同之日起成立，或自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，基金份额持有人以电子签名方式签署本合同之日起成立。基金份额持有人通过电子签名方式确认同意接受本基金合同、风险揭示书、合格投资者承诺书或其他文书的，与基金份额持有人在纸质文件上签名或者盖章具有同等法律效力。当满足“基金合同的签署、成立和生效”章节中基金合同生效的条件后，本合同生效。

2、 本合同一式【叁】份，当事人各执【壹】份，每份合同均具有同等的法律效力。

3、 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。

4、 本合同有效期为基金合同生效日至基金合同终止日。

(二) 基金合同的变更

1、 非因法律法规和自律规则发生变化的原因导致合同变更时，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、私募基金管理人和基金托管人协商一致并签署补充协议，可对本合同内容进行变更。

当本合同各方当事人完成补充协议签署后，私募基金管理人应当及时通知私募基金托管人。因私募基金管理人未及时通知导致合同变更未及时生效的，私募基金托管人对由此造成的基金财产损失不承担赔偿责任；

私募基金管理人应确保全体基金份额持有人已签署补充协议且其意思表示真实有效，私募基金托管人对此不承担任何审核、监督义务。若发生任何基金份额持有人未签署或其签署的真实性、有效性存在问题，对本基金、任何基金份额持有人或私募基金管理人造成损失的，

私募基金托管人不承担赔偿责任。

（2）如基金合同的变更不涉及本基金合同当事人权利义务发生变化（含降低管理费、业绩报酬、变更投资经理）或对基金份额持有人利益无实质不利影响的或本合同另行约定的，私募基金管理人可单方面与私募基金托管人协商一致后修改基金合同，并由私募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。

（3）**对于根据法律法规和本合同的约定可不经基金份额持有人大会决议通过的事项，私募基金管理人、私募基金托管人就本合同拟变更事项及变更方式协商一致后可采用征询意见函变更模式对本合同内容进行变更。**

私募基金管理人就本合同变更事项以书面或电子方式向基金份额持有人发送合同变更征询意见函，但是该合同变更征询意见函的内容须事先征得私募基金托管人同意。基金份额持有人应在征询意见函指定的日期内按指定的形式回复意见。基金份额持有人未在征询意见函指定的日期内按指定的形式回复意见或回复意见不明确的，视为同意本次变更（征询意见函另有约定的除外）。

私募基金管理人应当于征询意见期满后指定相应开放日（含临时开放日），不同意本次征询意见函的基金份额持有人应于指定开放日赎回本基金，**该等赎回可不受本合同关于基金赎回的期限限制（私募基金管理人及其员工持有的不满 6 个月的基金份额除外），但是赎回持有期低于 90 天的份额需要按照合同约定缴纳赎回费（如有，含短期赎回费），具体赎回规则以私募管理人通知为准。**

只要基金份额持有人未在征询意见函指定的开放日全部赎回本基金的（即使基金委托人表明过不同意），均视为基金委托人同意本次变更。根据本基金合同约定以及行业实际操作，委托人若因不同意征询函变更内容拟赎回基金份额的，应向销售机构提交赎回申请并由销售机构负责办理赎回相关事项。如因委托人自身或销售机构原因导致未能及时办理赎回的，基金管理人、基金托管人与行政服务机构不承担任何赔偿责任。

由基金管理人向基金托管人出具盖章的合同变更生效通知后，可于变更生效之日起三个工作日内通知全体份额持有人变更生效。**本次合同变更事项自合同变更生效通知载明的变更生效之日起，对全体基金份额持有人、管理人及托管人均具有法律拘束力。**

私募基金托管人对征询意见函（或通知）是否有效送达、份额持有人的回复是否为其真实意思表示和后续赎回操作不承担任何审核、监督义务。若因此造成任何一方损失，私募基金托管人不承担赔偿责任。

自合同变更生效之日起，对合同各方均具有法律效力。私募基金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。

2、 法律法规和自律规则发生变化需要对本合同进行变更的，基金管理人可与基金托管人协商后修改基金合同，并由基金管理人按照本合同的约定向基金份额持有人披露变更的具体内容。

3、 如本基金合同根据前述条款约定发生任何变更，且存在新增投资者拟申购本基金份额，私募基金管理人应当确保新增投资者签署变更后的基金合同或附有变更文件的原基金合同。如果新增投资者签署的基金合同条款与变更后的基金合同不一致，私募基金托管人对此不承担任何责任。

4、 若本合同的变更事项涉及存续期限、投资范围、投资策略、投资限制、收益分配原则 、基金费用、托管人变更、行政服务机构变更等法律法规规定、中国证监会和基金业协会要求基金管理人设置临时开放日或保障基金委托人赎回权利的（变更内容有利于基金委托人的除外），以及按本合同约定的变更程序需要设置临时开放日的，基金管理人应设置临时开放日允许基金份额持有人赎回基金份额或其他保障投资者赎回本基金权利的措施。

5、 基金合同的解除

如本基金募集机构实施回访制度的，投资者在募集机构回访确认成功前有权解除基金合同。如本基金募集机构未实施回访制度的，投资者在冷静期内有权解除基金合同。出现前述情形时，募集机构应当按照合同约定及时退还投资者的全部认购款项。

(三) 基金合同终止的情形包括下列事项：

1、 基金管理人依法解散、被依法撤销、被依法宣告破产，或被依法取消私募投资基金管理人相关资质，且在六个月内没有新基金管理人承接的；

2、 基金托管人依法解散、被依法撤销、被依法宣告破产，或被依法取消基金托管业务资格，且在六个月内没有新基金托管人承接的；

3、 基金合同期限届满而未延期；

4、 本基金在基金业协会备案未通过的；

5、 全体基金份额持有人申请赎回所持有的全部基金份额的，且无在途申购申请的；

6、 基金份额持有人大会决定提前终止；

7、 经全体基金份额持有人、私募基金管理人和私募基金托管人协商一致而提前终止的；

8、 基金规模净值在停止申购后连续 120 个交易日低于 500 万元的；

9、 如本基金资产规模小于 5000 万元或本基金资产全部为现金或货币基金等现金管理工具的，私募基金管理人根据基金运作情况，经提前通知全体基金份额持有人及私募基金托

管人后可提前终止本基金；

10、 法律法规、中国证监会、中国基金业协会和本合同规定的其他情形。

二十三、 基金的清算

(一) 清算小组

1、 自基金合同终止之日起30个工作日内成立清算小组。

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

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

(二) 清算程序

1、 基金合同终止后，由清算小组统一接管基金财产；

2、 对基金财产和债权债务进行清理和确认；

3、 对基金财产进行估值和变现；

4、 制作清算报告；

5、 对基金财产进行分配。

(三) 清算费用

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

(四) 基金财产清算过程中剩余资产的分配

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后，按基金份额持有人持有的基金份额比例分配给基金份额持有人。基金合同另有约定的除外。

(五) 未能变现的证券处理

若本基金在终止之日有未能流通变现的证券和基金管理公司及其子公司资产管理计划、证券公司资产管理计划、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、场外衍生品等场外产品和业务，基金管理人可对此制定二次清算方案，该方案应经基金托管人认可，并披露给基金份额持有人。基金管理人应根据二次清算方案的规定，对前述未能流通变现的在可流通变现后进行二次清算，并将变现后的资产按照基金份额持有人拥有份额的比例或本合同的约定，以货币形式全部分配给基金份额持有人；

对基金进入清算程序后，不再计提管理费、托管费、基金服务费（注册登记费、募集监

督费、估值核算费）、销售服务费等各项费用。**对于因二次清算造成的基金清算财产的延期支付，基金托管人不承担任何责任。**

(六)清算报告的告知安排

基金清算程序开始后的30个交易日内，私募基金管理人应确定基金剩余财产的首次分配方案，完成私募基金财产清算报告的制作。

(七)基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及文件由基金管理人保存10年以上。

(八) 清算未尽事宜

本合同中关于基金清算的未尽事宜以清算报告或基金管理人公告为准。

如基金管理人因失联等原因无法参与清算小组的,其在清算小组中的相关权利和义务可由基金份额持有人代表代为履行。基金份额持有人代表由基金份额持有人大会选举产生。

本基金进入清算程序后，不得新增募集、不得新增投资，基金管理人应当立即告知本基金的相关经纪商和服务机构，并要求其予以监督及配合。如基金托管人发现本基金进入清算期后新增募集或新增投资的，应当通知基金管理人退回新增募集的资金、对新增投资进行变现，并有权报告中国证监会、基金业协会，由此产生的收益归入清算财产，**造成的损失由基金管理人承担，基金托管人不承担连带或者补充赔偿责任。**

二十四、 违约责任

(一)当事人违反本合同，应当承担违约赔偿责任，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；因共同行为给其他当事人造成损害的，应当承担连带赔偿责任。**但是发生下列情况之一的，当事人应当免于承担违约责任：**

1、 基金管理人及/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、 基金托管人不负责委托财产投资项目的审核义务，对基金管理人的任何投资行为（包括但不限于其投资策略、决定）及其投资回报不承担任何责任。由于本基金的设计安排、管理、运作模式而产生的任何经济责任和法律责任，基金托管人不予承担。基金托管人对托管账户之外的资产不行使保管职责，包括但不限于：基金募集期间存放于募集账户的资金；由于基金收益分配及清算而已经从托管账户划拨出的资金；由于投资从托管账户划拨出的资金及所购买的资产等。保管资产离开托管账户后发生损失的，基金托管人不承担任何责任。由于非基金托管人的过错致使其保管的资产发生毁损或灭失的，基金托管人不承担赔偿责任。本合同的履行涉及基金托管人赔偿责任的，基金托管人承担的全部累计赔偿数额上限不超过基金托管人本年度已经收取的托管费。

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、证券经纪商、期货经纪商等其他机构负责清算交收的基金财产（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、破产等原因给基金财产带来的损失等。

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

(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)本基金的基金托管人仅承担法定的以及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,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，否则基金托管人有权解除合同，并向基金管理人追究违约责任和侵权责任。

二十五、 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。

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。

二十六、 其他事项

(一) 声明条款

各当事人声明：在签署本合同时，各当事人已仔细阅读本合同及基金说明书，对本合同及基金说明书所有条款均无异议，并对当事人之间的基金关系及有关权利、义务和责任条款的法律含义有准确无误的理解。

(二) 基金合同中约定的通讯地址或联络方式即为管理人处理基金事务过程中与投资者（或基金份额持有人）联系的通讯地址或联络方式；投资者（或基金份额持有人）通讯地址或联络方式发生变化，应自发生变化之日起十天内以书面文件形式通知管理人，若在基金期限届满前发生变化，应在两天内以书面文件形式通知管理人；若投资者（或基金份额持有人）未将有关变化及时通知管理人，投资者（或基金份额持有人）应对由此而造成的影响和损失负责。

(三) 若基金份额持有人账户信息发生变化，基金份额持有人须及时到管理人处办理变更手续，否则，基金份额持有人应对由此而造成的影响和损失负责。

(四) 在产品托管期间，托管人有权收集和保存份额持有人信息。托管人对收集和保存的份额持有人信息的使用，仅限于履行合同义务以及根据法律法规、司法机关和监管机构规定的义务。托管人不得收集与托管服务无关或以任何方式向其他机构、个人提供份额持有人信息，不得购买、使用非法获取或来源不明的份额持有人数据，不得允许或者配合其他机构、个人截取、留存份额持有人信息。

本合同如有未尽事宜，由合同当事人各方按有关法律法规和规定协商解决。

（以下无正文）

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

基金投资者请填写：

(一) 基金投资者基本信息

1、 自然人

姓名：

证件名称：身份证□、军官证□、护照□

证件号码：□□□□□□□□□□□□□□□□□□

联系地址：

邮编：

联系电话：

电子邮箱：

2、 法人或其他组织

名称：

营业执照号码：

组织机构代码证号码：

法定代表人或负责人：

住所：

联系地址：

邮编：

联系人：

联系电话：

电子邮箱：

(二) 基金投资者认购/申购金额

净认购/申购资金：人民币　　元整（小写金额￥　　）。

认购/申购费用：人民币　　元整（小写金额￥　　）。

认购/申购资金的支付方式：　　□划款

(三) 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、申购和赎回的账户名称不一致时，基金投资者应出具符合相关法律法规规定的书面说明。账户信息如下:

账户名称:

账　　号:

开户银行名称:

（本页无正文，为衍复优优中证A500指数增强2号私募证券投资基金基金合同签署页。）

基金投资者：

自然人（签字）： **或** **法人或其他组织（盖章）：**

法定代表人或授权代表（签字）：

签署日期： 年 月 日 **签署日期：** 年 月 日

基金管理人（盖章）： 上海衍复投资管理有限公司

法定代表人或授权代理人（签章）：

签署日期： 年 月 日

基金托管人（盖章）： 东方财富证券股份有限公司

法定代表人或授权代理人（签章）：

签署日期： 年 月 日

附件一：基金管理人与基金管理人委托的基金代理销售机构权利义务

甲方：上海天天基金销售有限公司

乙方：上海衍复投资管理有限公司

一、甲方的权利和义务

1、甲方的权利：

（1）根据国家法律、法规及其他有关规定，接受乙方委托办理基金代理销售业务，及按照本协议规定的条件和程序解除本协议。

（2）有权获得代理销售产品或者服务的信息，包括产品和服务的风险特征和程度，风险等级资料、私募基金的推介资料、乙方经营活动中的重大变化（包括但不限于乙方存在的对甲方履行本协议下义务具有重要影响的有关信息），有权获得乙方对甲方代理销售业务的支持。

（3）在本协议约定的范围内，根据基金合同和销售计划等资料，独立制定甲方的销售策略、业务流程，安排非公开的销售网点（包括通过互联网等非现场的方式和平台），办理基金代理销售业务。

（4）有权安排乙方人员参加路演，但对路演的管理应符合法律法规、监管规定、自律规范及其他有关规定。

（5）有权拒绝执行乙方不符合相关法律法规规定和私募投资基金相关法律文件约定的业务要求。

（6）有权向乙方获得基金运作期间需披露的信息，并有权获得约定需由甲方向投资者披露的各项信息。

（7）按照本协议及补充协议规定的标准、方式和时间，足额取得基金销售服务费。

（8）在与乙方合作代销乙方基金的同时，有权选择代理销售乙方以外的其他基金管理人发行的基金。

（9）对因乙方的过错或者过失，监管处罚而给投资者及/或甲方造成的损失，有权要求乙方立即纠正，并承担损失赔偿责任。

（10）甲方仅作为私募投资基金的销售机构，不承担为该私募投资基金垫付任何资金的义务。

（11）乙方同时委托甲方以外的其他符合条件的机构代理销售同一个基金时，甲方有权请求乙方披露其他代销机构的名单。

（12）有权按照本协议规定的条件和程序解除本协议。

（13）甲方有权选择适用本公司的产品风险评级标准及结果（但不得低于乙方的产品风险评级标准及结果）、客户回访标准、销售适当性标准等，产品风险评级标准以甲乙双方标准孰高者为准。

（14）法律法规、自律规则、本协议及补充协议规定的其他权利。

2、甲方的义务：

（1）在符合监管要求、风险可控下，整合内部资源为乙方提供品牌宣传服务。

（2）严格依照国家法律法规及其他关于私募基金销售的有关规定、依照基金合同及本协议的约定，办理基金代理销售业务，勤勉、尽责地履行基金代理销售职责。

（3）采取有效手段和方式，保障基金代理销售业务的正常、高效进行，并为通过甲方认购、申购基金的投资者提供客户服务。

（4）甲方在为乙方代销私募基金时，需依照《适当性办法》、《适当性指引》、《募集办法》等规定，履行法定义务；就特定投资者而言，甲方可以按规定豁免履行相关义务，但不得损害乙方的利益。

（5）甲方使用乙方制作的基金销售宣传推介资料，推介材料的内容应当如实披露基金产品的基本信息，与基金合同保持一致；如有不一致，甲方应当向投资者特别说明，并以基金合同记载的信息为准。

（6）对于乙方提供的私募基金宣传推介资料，甲方应向经过了特定对象确定程序的合格投资者提供。甲方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短信的方式进行投资回访。

（8）甲方持有并保存通过甲方认购/申购乙方私募基金的投资者联络信息的，应代乙方向该等投资者履行通知和/或信息披露义务。甲方应在乙方提供所需通知和/或披露的文件及信息后的一个工作日内，真实、准确、完整、一致地将该等文件及信息通知投资者或对投资者进行信息披露。

乙方向甲方披露信息的邮箱：

operation@yanfuinvestments.com；bussiness@yanfuinvestments.com

甲方接收乙方披露信息的邮箱 ： gonggao@eastmoney.cn

如在合理期限内，甲方未能向其负责代销的全部投资者进行披露，或未取得投资者已获悉相关文件或信息的回执或其他可留痕文件的，甲方应书面通知乙方，协同乙方采取其他补救措施。

（9）当发生特定情形时，如乙方被有权监管机构问询时，乙方应向甲方披露该等具体情形，并有权合理主张甲方在此情形下向乙方披露认购/申购乙方私募基金的特定投资者的

信息，以保证乙方能履行自身的义务；甲方应向乙方提供配合并请求乙方提供有权监管机构问询的证明材料。

（10）甲方应当依法对所获取的私募基金非公开披露的全部信息、商业秘密、投资者的商业秘密及个人隐私等信息负有保密义务，除法律法规、自律规则和基金合同另有规定的，不得以任何方式对外披露。

（11）甲方应确保代销的单只私募基金的投资者人数累计不得超过《证券投资基金法》、《公司法》、《合伙企业法》等法律规定的特定数量。

（12）甲方应采取有效手段，确保及时、足额办理基金代理销售的资金交收。

（13）甲方应建立完善的客户服务制度和流程，向通过甲方认购/申购基金的投资者提供持续服务。但在持续服务过程中需要乙方履行法律法规规定义务和提供协助的，乙方应当本着诚实信用原则履行义务并给予及时全面的协助。若因乙方过错或过失导致甲方、投资者发生纠纷或产生经济损失，乙方应向甲方、投资者赔偿经济损失。

（14）未经乙方书面同意，甲方不得将本协议项下甲方的代理销售业务转包或变相转包。

（15）甲方不得利用与基金相关的未公开信息进行任何违法活动。

（16）因甲方故意或重大过失导致与基金投资者产生的客户纠纷，应由甲方妥善解决。但如有任何已经发生或潜在发生的客户纠纷与乙方相关的，甲方应在知道或应当知道之日起及时以书面方式告知乙方，乙方应当配合甲方处理相应纠纷，并分别按照各自的过错承担相应的责任。

（17）非经乙方事先书面同意，甲方不得以乙方的名义采取其他与基金募集或销售无关的其他任何行动。

（18）甲方应遵守法律法规、证监会、基金业协会的规定进行基金推介，包括但不限于：向特定对象进行基金推介；不得公开推介或变相公开推介基金；不得以任何方式承诺保本保收益；不得夸大或片面推介基金；进行投资者风险评级，向投资者推介风险匹配的基金产品；在投资者签署基金合同前应进行风险揭示、合格投资者确认。

（19）在本协议有效期内，甲方若同时受托代销其他证券投资基金，不得对本协议项下基金采取任何形式的歧视性宣传和销售政策。

（20）甲方因基金销售业务被监管机构作出不予延续其基金销售业务许可证有效期的决定（如适用），被监管机构暂停办理本协议项下基金销售业务，被监管机构撤销注册的、被注销业务许可证、丧失经营能力、无法继续展业等影响或可能影响履约能力的情形的，应当将该等情形及时通知乙方。

（21）甲方承诺从业人员的基金从业资格符合法律法规的要求，并建立健全并有效执行内部控制与风险管理机制。

（22）法律法规、自律规则、基金合同、本协议及补充协议规定的其他义务。

二、乙方的权利和义务

1、乙方的权利：

（1）乙方在委托甲方代销基金产品前，有权对甲方资质进行审慎性审查，并对甲方提供的相关信息和资料进行审查，甲方应当予以必要配合。

（2）根据国家法律、法规及其他有关规定和本协议的约定，委托甲方办理基金代理销售业务及按照本协议规定的条件和程序解除本协议。

（3）要求甲方严格按照国家法律法规、基金合同、公司章程或者合伙协议（以下统称“基金合同”）、本协议及补充协议的规定，办理基金代理销售有关事宜，并以合理的方式和时间对甲方的代理销售业务开展情况进行监督；在必要情形下，可要求甲方提供可证明其依法合规代销的留痕记录以保护乙方的利益。对因甲方的过错或重大过失而给产品、投资者及乙方造成的损失，有权要求甲方承担相应责任。

（4）根据自身业务需要，有权同时委托甲方以外的其他符合条件的机构代理销售同一个基金。

（5）根据法律法规、基金合同的规定，有权拒绝确认通过甲方进行的某一笔或某一段时间内的认购、申购、赎回或其他业务申请，但必须在一个工作日内向甲方和投资者书面说明事实和理由。

（6）甲方应在本协议确定的代理权限范围内开展各项业务，乙方对甲方在本协议约定范围外的无权、越权代理行为不承担责任。

（7）法律法规、自律规则、本协议及补充协议规定的其他权利。

2、乙方的义务：

（1）乙方应按照甲方尽职调查的要求向甲方提供相关资料，包括但不限于营业执照、法人信息、关键研究人员信息、公司品牌、管理团队、高管信息、发展战略、投资策略、基金特点、流动性、杠杆情况、结构复杂性、投资方向、投资范围、过往业绩、风控措施、风险揭示以及备案私募基金的其他信息等，乙方积极配合甲方的尽调访谈并提供便利，乙方保证向甲方就产品和服务风险等级的有关情况做客观完整的陈述，乙方保证本方、高级管理人员、基金经理的陈述（如有）和所提供的资料及信息真实、准确、完整、及时。乙方及其人员所提供的资料及信息不存在虚假记载、误导性陈述、重大遗漏、不正当披露信息情形。

（2）基于具体合作意向，向甲方报送代销产品的开放日（T日）净值、每周净值；净

值报送方式具体由双方协商确定; 因乙方报送净值错误而造成相关损失的, 由乙方自行负责, 与甲方无关。如给甲方造成损失的，还应当赔偿甲方所遭受的损失。如造成投资者损失的，乙方应当赔偿投资者所遭受的损失。

（3）乙方应依法完成基金的备案。

（4）乙方作为私募基金管理人应当向投资人履行受托人义务，承担基金合同的受托责任。乙方委托甲方代理销售基金，不得因委托销售免除乙方作为私募基金管理人应当承担的法定责任和约定义务。

（5）乙方应当制作并向甲方提供与基金代理销售业务相关的基金合同、销售计划、风险揭示文件、乙方品牌、发展战略、投资策略、管理团队、高管信息以及由基金业协会公示的已备案私募基金的基本信息等资料。乙方应当向甲方并通过甲方向投资者披露的上述信息包括推介资料，应当保证内容的合法合规性、真实性、完整性、准确性和及时性。

（6）乙方应当向甲方提供证监会《证券期货投资者适当性管理办法》第十六条、第十七条规定的划分产品或者服务风险等级时分级考虑因素、产品或者服务风险等级评估结果、需要甲方和投资者审慎评估风险等级的真实材料。乙方应当向甲方就产品和服务风险等级的有关情况做客观完整的陈述，保证本方的陈述和所提供的资料及信息真实、准确、完整、及时。乙方不提供上述规定的信息；或者提供信息违背真实准确完整及时原则，存在虚假记载、误导性陈述、重大遗漏、不正当披露信息情形的，甲方有权拒绝为乙方代销产品或提供服务，因此而产生的法律责任和经济损失应当由乙方承担。

（7）乙方应当制定并告知甲方其所委托的产品的适当性管理标准和要求，甲方应严格执行，但法律、行政法规、中国证监会其他规章另有规定的除外。

（8）乙方在自行担任基金份额登记机构或委托其他机构办理基金份额登记业务期间，乙方应采取有效手段和方式，保障基金份额登记业务的正常、高效进行，积极配合甲方的基金代理销售工作。

（9）乙方采取有效手段和方式促使基金份额登记机构与甲方的接收和传输数据的接口通畅；按照规范要求和约定时间及时、准确地向甲方传输账户和交易确认的数据。

（10）乙方向甲方的销售人员提供必要的培训, 培训内容包括但不限于乙方公司简况、公司品牌、管理团队、高管信息、发展战略、投资策略、基金特点、流动性、杠杆情况、结构复杂性、投资方向、投资范围、过往业绩、风控措施、风险揭示以及备案私募基金的其他信息。

（11）乙方委托甲方销售的私募基金系有限合伙型基金的，应当由双方另行协商确定开立私募基金募集结算资金专用账户（以下简称“募集账户”），用于统一归集私募基金募

集结算资金、向投资者分配收益、给付赎回款项以及分配基金清算后的剩余基金财产等，确保资金封闭和原路返还。

（12）按照本协议或补充协议约定的标准、方式和时间，及时足额付给甲方销售服务费。

（13）对甲方在业务办理过程中提供的投资者信息、交易数据、甲方商业秘密等资料和信息负有保密义务，不得将甲方提供的相关投资者的资料透露给任何第三方。即使本协议终止，乙方仍负有保密义务，但法律法规另有规定或乙方通过其他合法途径获悉的除外。

（14）乙方有义务建立健全信息披露管理制度，指定专人负责管理信息披露事务，依据《披露办法》的要求向投资者披露信息，并及时向甲方提供需由甲方向投资者披露的信息，且应保证相关信息的真实性、准确性、完整性。

（15）乙方有义务建立完善的客户服务制度和流程，通过甲方向经由甲方认购、申购基金的客户提供持续服务。

（16）如因乙方金融产品设计、运营向通过甲方认购/申购的投资者提供的信息数据错误或不及时等乙方原因导致甲方、投资者发生纠纷或产生损失，乙方应负责解决纠纷并向甲方和投资者赔偿损失，同时乙方应当配合甲方向投资者做好释明工作，避免甲方声誉受损。

（17）在甲方向通过甲方认购、申购基金的投资者提供持续服务过程中，乙方向甲方提供持续业务支持。

（18）乙方及私募基金运作中可能影响甲方代理销售和服务事项的，应当在影响事项发生后二个工作日内书面通知甲方。

（19）不得利用甲方提供的相关资产委托人的资料进行直接营销或用于甲方指定用途以外的任何目的。

（20）法律法规、自律规则、本协议及补充协议规定的其他应当由基金管理人承担的义务。