和美卓越私募证券投资基金

基金合同

（第三版）

基金管理人：深圳市多和美投资顾问有限公司

基金托管人：华泰证券股份有限公司

仅用于合格投资者查看

重要提示

基金资产净值会因为证券市场波动等因素产生波动，基金投资者根据所持有的基金份额享受私募基金收益，同时承担相应的投资风险。本基金投资风险包括但不限于：因整体政治、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，基金管理人在私募基金管理实施过程中产生的管理风险，本基金的特定风险等。

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，但基金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他存款类金融机构，基金管理人不保证基金一定盈利，也不保证最低收益，基金管理人的过往业绩不代表未来业绩。投资有风险，基金投资者认购、申购本基金时应认真阅读本基金的基金合同。

基金管理人可运用本基金财产进行本合同“私募基金的投资”章节中约定的关联交易，基金投资者签署本基金合同即表明其已经知晓并认可本基金可能进行上述关联交易事项。

基金管理人承诺按照法律法规的要求对本基金履行相关的备案手续，对本基金的合法合规性承担责任。中国证券投资基金业协会为基金管理人和本基金办理登记备案不构成对基金管理人投资能力、持续合规情况的认可，不作为对本基金财产安全的保证。

基金管理人提醒基金投资者基金投资的“买者自负”原则，在作出投资决策后，基金运营状况与基金资产净值变化引致的投资风险，由基金投资者自行负担。因本基金的产品设计安排、投资管理、运作模式而产生的经济责任和法律责任，由基金管理人承担。

特别提示：华泰证券提供专业机构服务平台供基金管理人向基金投资者披露基金相关信息，基金管理人可在“专业机构服务平台->投资者服务->用户管理”中为本基金投资者开立查询账号。在基金管理人为投资者成功开立查询账号后，投资者即可登录该平台查询相关信息，基金管理人在该平台披露信息的

仅用于合格投资者查看

真实性、准确性、完整性、及时性由基金管理人负责。（投资者登录网址：https://pb.htsc.com.cn/htsc-pos-is，如有变更，以华泰证券最新公告为准）。

仅用于东方财富证券代销
仅用于合格投资者查看

本基金合同当事人的基本情况：

基金份额持有人：

类型：☐ 自然人　　☐法人或其他组织

姓名（自然人填写）：

证件名称：☐身份证　☐护照　☐军官证　☐其他

证件号码：

通讯地址：

联系电话：

邮箱：

机构名称（法人或其他组织填写）：

法定代表人或授权代理人：

证件名称：☐统一社会信用代码　☐营业执照　☐组织机构代码证　☐其他

证件号码：

通讯地址：　　邮政编码：

联系人：　　联系电话：

传真：　　邮箱：

基金管理人：深圳市多和美投资顾问有限公司

法定代表人/执行事务合伙人：张益凡

住所：广东省深圳市福田区福田街道福安社区深南大道 4011 号香港中旅大厦 18 层 1803

办公地址：广东省深圳市福田区福田街道福安社区深南大道 4011 号香港中旅大厦 18 层 1803

邮编：518048

联系人：许[illegible]

联系电话：1[illegible]25628

传真：

邮箱：xuxinying@homecapital.cn

基金托管人：华泰证券股份有限公司

法定代表人：王会清

住所：南京市建邺区江东中路 228 号

办公地址：江苏省南京市建邺区江东中路 228 号

邮编：210019

客户服务联系电话：025-83389988

仅用于合格投资者查看

传真：025-83387215

仅用于东方财富证券代销
仅用于合格投资者查看

目 录

一、前 言 1
二、释 义 2
三、声明与承诺 5
四、私募基金的基本情况 9
五、私募基金的募集 11
六、私募基金的成立和备案 15
七、私募基金的申购、赎回与转让 16
八、当事人及权利义务 23
九、基金份额持有人大会及日常机构 29
十、私募基金份额的登记 36
十一、私募基金的投资 37
十二、私募基金的财产 45
十三、交易及清算交收安排 47
十四、私募基金财产的估值和会计核算 53
十五、私募基金的费用与税收 62
十六、私募基金的收益分配 67
十七、信息披露与报告 68
十八、风险揭示 73
十九、基金合同的效力、变更、解除与终止 90
二十、私募基金的清算 95
二十一、违约责任 98
二十二、争议处理 100
二十三、其他事项 100
附件一：基金认/申购单 103
附件二：基金管理人与销售机构《基金销售协议》摘要 104

仅用于合格投资者查看

一、前 言

鉴于前期本基金份额持有人、基金管理人、基金托管人已签订《和美卓越私募证券投资基金基金合同》（以下简称“原基金合同”），设立“和美卓越私募证券投资基金”，后续通过补充协议、公告或通知等合同变更文件进行了合同变更。基金管理人应当向基金份额持有人披露前述变更具体内容，如基金管理人披露变更内容不真实、不完整、不准确、不及时，托管人不承担由此产生的任何责任。现各方同意合并原基金合同及合同变更文件，形成《和美卓越私募证券投资基金基金合同（第三版）》（以下简称“本基金合同”）供签署。

本基金合同的生效不影响其生效之前本基金份额持有人、基金管理人、基金托管人依据原基金合同所享有的各项权利、履行的各项义务、承担的各项职责，本基金合同与原基金合同及其后续合同变更文件具有同等法律效力。

（一）订立本基金合同的目的、依据：

1、订立本基金合同的目的是为了明确基金合同当事人的权利义务，规范运作本私募基金，保护基金份额持有人的合法权益。

2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国民法典》（以下简称“《民法典》”）、《中华人民共和国电子签名法》（以下简称“《电子签名法》”）、《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条例》（以下简称“《私募条例》”）、《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》（以下简称“《募集办法》”）、《私募投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《契约型私募基金合同内容与格式指引》（以下简称“《合同指引》”）、《私募投资基金登记备案办法》（以下简称“《登记备案办法》”）、《私募投资基金备案指引第1号——私募证券投资基金》（以下简称“《备案指引1号》”）及其他相关规定。

（二）基金业协会接受本基金备案不能免除基金管理人按照规定真实、准确、完整、及时地披露本基金信息的法律责任，也不代表基金业协会对本基金的合规性、投资价值及投资风险做出保证和判断。基金投资者应当自行识别基金投资风险并承担投资行为可能出现的损失。

（三）本基金按照中国法律法规成立并运作，若本基金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。

仅用于合格投资者查看

二、释 义

在本基金合同中，除非文义另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

1、基金或本基金：指和美卓越私募证券投资基金。

2、基金合同或本基金合同：指《和美卓越私募证券投资基金基金合同（第三版）》及其附件以及对本基金合同的任何有效修订及补充。

3、基金合同当事人：指基金管理人、基金托管人和基金份额持有人。

4、基金投资者或投资者：指依据有关法律法规规定可以投资于私募基金的合格投资者的合称。包括个人投资者、机构投资者等。

5、基金份额持有人：指依据本基金合同，履行出资义务合法取得基金份额的基金投资者。

6、基金管理人：指深圳市多和美投资顾问有限公司。

7、基金托管人：指华泰证券股份有限公司。

8、基金服务机构：指接受基金管理人委托，为本基金提供份额登记、估值核算等服务的机构。本基金的基金服务机构为华泰证券股份有限公司，具体服务内容以基金管理人与基金服务机构签订的服务协议约定为准。

9、募集机构：指基金管理人，以及符合中国证监会规定的条件，取得基金销售业务资格并与基金管理人签订基金销售服务代理协议、接受基金管理人委托、代为办理本基金销售业务的机构（简称“销售机构”或“代销机构”）。

10、份额登记机构：指基金管理人或接受基金管理人委托代为其办理基金份额登记业务的机构。本基金的份额登记机构为华泰证券股份有限公司。

11、第三方估值基准服务机构：指经过基金业协会委托的行业专家评审并在基金业协会官方网站展示相关信息的估值数据提供机构。

12、基金账户：指份额登记机构为基金投资者开立的、记录其持有的、基金管理人所管理的基金份额余额及其变动情况的账户。

13、托管账户：即基金财产托管账户，指基金托管人以基金名义开立的用于保管、管理和运用本基金资产的专用银行账户。

14、基金募集结算资金专用账户：简称“募集专户”，指由募集机构开立或由基金管理人委托的基金服务机构开立或指定的，用于基金管理人直销基金投资者及基金销售机构、基金销售支付结算机构等基金销售相关机构资金归集的，在

仅用于合格投资者查看

基金投资者与基金财产托管账户之间划转基金认/申购、赎回、现金分红等资金的专用账户。

15、证券账户：指本基金在中国证券登记结算有限责任公司（含分公司）开设的专用证券账户，以及在中央国债登记结算有限责任公司及银行间市场清算所股份有限公司开立的有关账户及其他证券类账户。

16、基金财产：指基金投资者或基金份额持有人因认购或申购本基金的基金份额而缴纳的资金所形成的财产；基金管理人因基金财产的运用、处分或者其他情形而取得的财产，也归入基金财产。

17、基金资产总值、基金总资产：指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收款及其他资产的价值总和。

18、基金资产净值、基金净资产：指基金资产总值减去基金负债后的价值。

19、基金份额净值、单位净值：指计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数所得数值。

20、基金份额累计净值、累计单位净值：指基金份额净值与基金历史累计份额分红金额之和。

21、公允价值：指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。

22、存续期：指本基金成立至本基金终止之间的期限。

23、开放日：指为基金投资者或者基金份额持有人办理基金份额申购及/或赎回或其他业务的工作日，具体以本基金合同约定为准。

24、工作日、交易日（T 日）：指上海证券交易所、深圳证券交易所及北京证券交易所的正常交易日，T+n 日指 T 日之后的第 n 个工作日，T-n 日指 T 日之前的第 n 个工作日。

25、K 日：除本基金合同另有约定外，指在规定时间受理本基金的基金投资者或基金份额持有人申购、赎回或其他业务的开放日（包括由基金管理人设置的临时开放日），K+n 日指 K 日之后的第 n 个工作日，K-n 日指 K 日之前的第 n 个工作日。

26、认购：指基金募集期内，基金投资者按照基金合同约定申请购买本基金份额的行为。

仅用于合格投资者查看

27、申购：指基金成立后，基金投资者按照基金合同的约定申请购买本基金份额的行为。

28、赎回：指基金成立后，基金份额持有人按照基金合同的约定申请将本基金份额兑换为现金的行为。

29、元：指人民币的单位。

30、套印：指经基金管理人、基金托管人授权后，通过基金托管人指定的第三方机构批量印刷基金管理人、基金托管人印章的合同签署方式，与在纸质合同上手写签名/盖章具有同等法律效力。

31、专业机构服务平台、“行知·托管外包”：指华泰证券为基金管理人提供的在线服务平台，基金管理人可通过该平台办理基金托管相关业务，并与基金托管人进行信息交互等。华泰证券同时担任本基金的基金服务机构的，基金管理人可以使用该平台办理基金运营服务相关业务，并与基金服务机构进行信息交互等。具体网址为 https://inst.htsc.com/incos/user/login，华泰证券可依据实际情况变更。

32、资产管理产品、资管产品：指银行、信托、证券、基金、期货、保险资产管理机构、私募基金管理人等受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，包括银行非保本理财、证券期货经营机构资产管理计划、信托计划、保险资产管理产品和在基金业协会备案的私募基金等。

33、现金管理工具：指银行活期存款、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。

34、同一资产：本合同所称同一资产按照以下口径计算：

（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（如证券公司发行的本金保障型收益凭证、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。

仅用于合格投资者查看

（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：场外期权及证券公司发行的非本金保障型收益凭证按照同一“交易对手方”视为同一资产；收益互换按照合约挂钩具体标的视为同一资产。

35、不可抗力：指本基金合同成立后发生的、当事人不能预见、不能避免、不能克服的使本基金合同当事人无法全部履行或无法部分履行本基金合同的任何事件，包括但不限于台风、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、法律法规变化、相关交易场所非正常暂停或停止交易等事件以及非当事人所引起或能控制的计算机系统、通讯系统、网络系统、网银系统故障、电力系统故障或其他突发事件等情形。

36、中国证监会：指中国证券监督管理委员会及其派出机构。

37、基金业协会、中国基金业协会：指中国证券投资基金业协会。

38、法律法规：指中华人民共和国公布实施并现行有效的法律、行政法规、司法解释、部门规章及其他对基金合同当事人有约束力的规范性文件（包括但不限于监管机构、交易所、证券登记结算机构、行业协会、银行间市场等机构制订的业务规则）以及对于上述法律法规的修改和补充等。

三、声明与承诺

本基金合同各方当事人违反如下声明与承诺，造成的损失由相应当事人承担，其余各方当事人不承担任何责任。

（一）基金管理人的声明与承诺

1、基金管理人保证其为合法成立的私募基金管理机构，其从事私募基金业务的专业人员符合国家相关法律法规规定的资质条件。基金管理人保证已在基金业协会登记为私募基金管理人，登记编号为P1004868。

2、基金管理人声明：基金业协会为基金管理人私募基金办理登记备案不构成对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。投资者应当自行识别私募投资基金投资风险并承担投资行为可能出现的损失。

3、基金管理人保证已在签订本基金合同前充分地向基金投资者说明了有关

仅用于合格投资者查看

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。

4、基金管理人承诺已了解基金投资者的风险偏好、风险认知能力和承受能力，对基金投资者的财务状况已进行了充分评估。

5、基金管理人承诺遵循专业化运营原则管理和运用基金资产，不从事与私募投资基金有利益冲突的业务，恪尽职守，履行诚实信用、谨慎勤勉的义务，不得将应当履行的投资管理职责委托他人行使。

6、基金管理人承诺不对基金活动的盈利性和最低收益、本金不受损失作出承诺，或限定损失金额和比例；不通过设置增强资金、费用返还等方式调节基金收益或亏损，不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。

7、基金管理人承诺其管理的每只基金的资金单独管理、单独建账、单独核算，不开展或者参与任何形式的“资金池”业务，不存在短募长投、期限错配、分离定价、滚动发行、集合运作等违规操作。基金管理人承诺不得在本基金内部设立由不同投资者参与并投向不同资产的投资单元/子份额，规避备案义务，不公平对待投资者。

8、基金管理人承诺已向基金投资者明确介绍基金托管人所承担的职责与义务，未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的商誉进行宣传推介、承诺投资收益等违规活动。基金管理人对向基金托管人提供的一切合同、文件、资料的真实性、完整性、准确性、合法性负责。基金管理人违背基金合同或相关法律文件的约定、处理基金事务不当使基金财产受到损失的，由基金管理人承担全部责任。

9、基金管理人承诺不扰乱市场秩序，不从事洗钱交易，遵守所有适用的经济制裁和出口管制法律和法规（以下简称“制裁和管制法”）；声明与保证没有违反制裁和管制法，没有被任何有权实施经济制裁或出口管制的政府机构或国际组织（以下简称“制裁和管制机构”）以任何方式进行制裁或管制，或因制裁或管制的原因被制裁和管制机构调查、处罚或起诉。

10、基金管理人承诺应当建立健全关联交易管理制度，不得以私募基金财产与关联方进行不正当交易或者利益输送，不得通过多层嵌套或者其他方式进行隐瞒。

仅用于合格投资者查看

11、基金管理人承诺未违反与本基金投资运作相关的法律法规的要求。

（二）基金托管人的声明与承诺

1、基金托管人承诺按照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则安全保管本基金财产，并履行本基金合同约定的其他义务，但基金托管人的声明与承诺不构成对基金管理人投资能力的保证，也非对基金财产本金或收益作出保证或承诺。

2、基金托管人不承担任何因基金管理人投资所产生的有关责任，也不承担本基金投资产生的任何风险及损失。

3、基金托管人对与本基金投资行为相关的尽职调查、风险评估、投资决策、投后管理或其投资回报不承担任何责任。

（三）基金投资者的声明与承诺

1、基金投资者承诺其为符合法律法规和监管机构规定的合格投资者。

2、基金投资者承诺有完全及合法的权利委托基金管理人和基金托管人进行委托财产的投资管理和托管业务，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委托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。

3、基金投资者已充分理解本基金合同全部条款，了解相关权利、义务，了解有关法律法规及所投资基金的风险收益特征，愿意承担相应的投资风险，且投资事项符合其内部决策程序的要求。

4、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、投资限制和风险承受能力等基本情况真实、完整、准确、合法，不存在任何重大遗漏或误导。前述信息资料如发生任何实质性变更，应当及时书面告知募集机构。

5、基金投资者承诺委托资金的来源及用途合法，未非法汇集他人资金投资本基金，未使用贷款、发行债券等筹集的非自有资金参与本基金，不以非法拆分转让为目的购买本基金。

6、为履行法律法规规定的反洗钱义务，基金投资者承诺配合基金管理人、基金销售机构、基金托管人的反洗钱工作，同意并授权基金管理人或基金销售机构将基金投资者身份信息等资料提供给基金托管人及相关账户开立银行等反洗钱义务机构。

7、同意遵守所有适用的经济制裁和出口管制法律和法规（以下简称“制裁和管制法”）；声明与保证没有违反制裁和管制法，没有被任何有权实施经济制

仅用于合格投资者查看

裁或出口管制的政府机构或国际组织（以下简称“制裁和管制机构”）以任何方式进行制裁或管制，或因制裁或管制的原因被制裁和管制机构调查、处罚或起诉。

8、基金投资者知晓，基金管理人、基金托管人及相关机构不对本基金财产的本金及收益状况做出任何承诺或担保。

9、基金投资者知悉并同意，本基金运作过程中应缴纳的增值税等税费，按照国家法律法规，以基金管理人的名义缴纳，但由本基金资产承担。

10、基金投资者知晓，中国基金业协会为私募投资基金办理备案不构成对基金管理人投资能力的认可，亦不构成对基金管理人和私募投资基金合规情况的认可，不作为对私募投资基金财产安全的保证。基金投资者承诺自行识别私募投资基金投资风险并承担投资行为可能出现的损失。

（四）反腐败声明与承诺

1、本基金合同各方当事人都清楚并愿意严格遵守中华人民共和国反商业贿赂相关法律法规，各方都清楚任何形式的贿赂和贪渎行为都将触犯法律，并将受到法律的严惩。

2、任何一方不得向其他各方、其他各工作人员或其他相关人员提供、给予利益和方便或实施输送不正当利益的行为，包括但不限于：

（1）现金、购物卡、有价证券及支付凭证、通讯器材、交通工具、非低值文化用品以及其他贵重物品或者为上述物品提供代持等便利；

（2）组织参加境内外旅游、高消费娱乐、宴请、娱乐健身、非以正当开展业务之间的公开的会议等活动；

（3）提供兼职、兼职岗位或就业机会；

（4）任何借款或贷款往来；

（5）共同成立营利组织或参与利益分配；

（6）安排显著偏离公允价格的结构体、高收益、保本理财产品等交易；

（7）其他具有贿赂性质的利益。

3、如在合作过程中任何一方发现相关人员以个人名义或假借对方名义索要、收受、谋取不正当利益的，应及时通知对方。各方应积极配合相关调查、处理工作。

仅用于合格投资者查看

4、基金托管人声明：基金托管人对一切腐败行为采取零容忍态度，并一直贯彻合法经营、廉洁从业的原则。基金托管人严禁工作人员、代理人及其他相关人员提供或接受任何非法利益、索要非法利益，该等不正当行为均不被基金托管人允许或认可，不代表基金托管人行为，与基金托管人无关。基金管理人、基金投资者已明确了解基金托管人的管理要求，不得因任何腐败行为向基金托管人主张责任。

5、本约定适用于本基金合同各方当事人的员工、代理人及其他相关人员，其他相关人员包括一方工作人员以外的与本协议有直接或间接利益关系的人员，包括但不限于工作人员的亲属、朋友。

四、私募基金的基本情况

（一）私募基金的名称

和美卓越私募证券投资基金。

（二）私募基金的类型

私募证券投资基金。

（三）私募基金的运作方式

开放式。

（四）私募基金的计划募集总额

本基金计划募集 1,000 万元，具体以实际募集金额为准。

（五）私募基金的投资目标和投资范围

详见本基金合同“十一、私募基金的投资”章节。

（六）私募基金的存续期限

本基金存续期为自基金成立之日起【120】个月，如到期日为非工作日则顺延至下一个工作日。

（七）私募基金份额的初始募集面值

本基金基金份额的初始发售面值为人民币 1.00 元。

（八）基金份额类别

1、基金份额分类

本基金根据管理费、业绩报酬的费率收取标准的不同，将基金份额分为 A、B 两类基金份额，相关费率的设置及费率水平在本基金“私募基金的费用与税收”

仅用于合格投资者查看

章节列示。本基金A、B两类份额分类如下：

本基金A类基金份额供除B类基金份额投资者以外的合格投资者认/申购，B类基金份额供本基金管理人、基金管理人员工、基金管理人股东、关联方私募基金管理人、关联方私募基金管理人员工认/申购。

具体基金份额分类及投资者份额认定由基金管理人负责，并承担由此产生的责任。

本基金A、B两类基金份额分开募集、合并运作，且无份额配比限制。若在本基金存续期间，某一类基金份额的份额总数为0，则该类基金份额申购时，申购价格同申购当日的基金整体份额净值。

2、各类基金份额的份额净值计算

本基金A、B两类基金份额将分别计算基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值。基金资产净值具体计算方法为，在每个自然日，每类基金份额按照“上一自然日该类基金份额的资产净值加上估值当日该类基金份额申赎的净轧差确认金额”占“上一自然日基金资产净值加上估值当日申赎的净轧差确认金额”的比例分摊当日产生的基金整体损益（不包括当日产生的基金管理费、业绩报酬和赎回费），各类基金份额再各自承担当日产生的基金管理费、业绩报酬和赎回费（如无相关费用则无需承担）。各类基金份额净值为计算日该类别基金资产净值除以计算日该类别基金份额总数。各类基金份额累计净值计算公式为计算日该类别基金份额净值加上该类别基金份额累计分红金额。若某类基金份额发生全部赎回，在该赎回申请日至赎回确认日之前产生的损益由未赎回的份额承担。

基金资产净值、A类基金份额和B类基金份额的资产净值的计算，均保留到小数点后2位，小数点后第3位四舍五入，由此产生的误差计入基金资产。基金份额净值、A类基金份额和B类基金份额的基金份额净值的计算，均保留到小数点后4位，小数点后第5位四舍五入，由此产生的误差计入基金资产。

本基金的份额分类安排并非结构化或分级安排，不存在一类基金份额为其他基金份额提供风险补偿的情形。任意一类基金份额的申购和赎回均不影响本基金的存续，但所有类别基金份额全部被赎回的情况除外。除本基金合同约定的不同基金份额间的费率差异外，各类基金份额持有人享有相同的权利和义务。

（九）私募基金的托管事项

仅用于合格投资者查看

本基金的托管机构为：华泰证券股份有限公司。

（十）私募基金服务业务事项

本基金的基金服务机构为：华泰证券股份有限公司。

私募基金服务业务登记编码为：A00004。

（十一）风险收益特征

本基金属于【R4】级投资品种，适合风险识别、评估、承受能力为【C4】型及以上的合格投资者和专业投资者。管理人委托代销机构募集的，产品风险等级及投资者适当性匹配意见以代销机构的认定为准。

（十二）其他需要订明的内容

无。

五、私募基金的募集

（一）私募基金的募集机构

本基金的募集机构为基金管理人或受基金管理人委托的销售机构，销售机构应当为在中国证监会注册取得基金销售业务资格并已成为基金业协会会员的机构。基金管理人可以通过发布公告的方式增加本基金销售机构，并将基金销售协议中关于基金管理人与销售机构权利义务划分以及其他涉及投资者利益的部分向投资者披露。

（二）私募基金的募集对象

本基金仅向符合《私募办法》规定的合格投资者募集。

（三）私募基金的募集方式

本基金以非公开方式进行募集。

（四）私募基金的募集期限

本基金募集期限的具体时间由基金管理人根据法律法规及本合同约定确定，基金投资者可在募集期限内的工作日认购本基金。基金管理人有权根据本基金销售实际情况履行相关程序后适当延长或缩短募集期限，此类变更适用于本基金所有募集机构。

本基金募集期限由基金管理人发布通知或公告，即视为履行了信息披露义务，自通知或公告所载募集截止日起不再接受认购申请。

（五）私募基金份额的认购

仅用于合格投资者查看

1、基金投资者认购本基金的最低金额

基金投资者在基金募集期间的净认购金额不得低于【100】万元人民币（不含认购费（如有）），并可多次认购，基金募集期间追加净认购金额应不低于【1】万元人民币（不含认购费（如有））。

《备案指引 1 号》第七条约定的基金投资者可不受上述最低净认购金额与最低追加净认购金额的限制。

2、基金份额持有人的人数上限

基金份额持有人人数上限为 200 人。

3、私募基金份额的认购费用

本基金的认购费（如有）均归募集机构所有，募集机构有权减免。

本基金无认购费，净认购金额=认购金额。

4、私募基金募集期间利息的处理方式

基金投资者的认购参与款项（含认购费用（如有））在基金成立前产生的利息按照人民银行同期人民币活期存款基准利率计算，在基金成立后折算成相应的基金份额归基金份额持有人所有，具体数额以份额登记机构的记录为准。

5、私募基金份额的计算

本基金采用金额认购的方式。认购份额的计算方式如下：

认购份额=（净认购金额+利息）／基金份额初始面值

上述认购份额的计算保留到小数点后2位，小数点2位以后的部分四舍五入，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

6、认购资金的交付

认购资金应以人民币货币资金形式交付，通过基金管理人认购的基金投资者须从在中国境内银行开立的自有银行账户划款至基金募集结算资金专用账户。通过销售机构认购的基金投资者以销售机构相关约定为准。本基金不接受现钞方式认购。

（六）私募基金募集期间的认购程序

1、认购程序

基金投资者办理认购业务时应提交的文件和办理手续、办理时间、处理规则等在遵守本基金合同约定的前提下，以基金管理人或各销售机构的具体规定为准。

仅用于合格投资者查看

2、认购申请的确认

募集机构受理认购申请并不表示对该申请是否成功的确认，而仅代表募集机构确实收到了认购申请，申请是否有效应以份额登记机构成功确认认购份额且基金成立为准。认购申请采取时间优先的原则进行确认，在同一时间接收的认购申请，按照金额优先的原则进行确认（以下简称“时间优先、金额优先”原则）。基金投资者应在本基金成立后到基金管理人或各销售机构查询认购份额申请最终确认情况和有效认购份额。如遇特殊情况可由基金管理人和基金投资者协商处理。

（七）基金募集期间资金的管理

私募基金募集结算资金专用账户由募集机构开立或由基金管理人委托的基金服务机构开立或指定，本基金募集期间基金投资者的初始认购资金应当存入该专用账户，该账户仅用于本基金募集期间和存续期间认购、申购和赎回等资金的归集与支付，在基金募集行为结束前，该账户的资金任何机构和个人不得动用。

基金募集期限届满或提前终止募集，且基金募集金额、基金份额持有人人数符合相关法律法规及本基金合同的约定，基金管理人将属于基金财产的全部资金划入基金托管人开立的基金财产托管账户。

若基金募集期限届满，未能达到基金成立条件的或未在法律法规规定或基金合同约定时间内备案的，由基金管理人按规定办理退款等事宜。

1、基金管理人直销

基金投资者通过基金管理人认购/申购基金的，应将认购款/申购款划入如下基金募集结算资金专用账户：

账户名称：和美卓越私募证券投资基金募集专户

账户号码：3200192015049

账户开户行：交通银行股份有限公司江苏省分行营业部

基金投资者将委托资金划入本基金募集结算资金专用账户的汇出账户即为投资者收益账户，本基金收益分配款、赎回款以及清算款等将从基金募集结算资金专用账户原路返还至投资者收益账户。

基金服务机构接受基金管理人委托代为开立募集结算资金专用账户，并不代表基金服务机构接受基金投资者的认购或申购资金，也不表明基金服务机构

仅用于合格投资者查看

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。在募集结算资金专用账户的使用过程中，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所造成的损失承担相关责任，基金服务机构对基金管理人的投资运作不承担任何责任。

2、销售机构代销

基金投资者通过销售机构认购/申购基金的，以销售机构约定为准。基金管理人增加销售机构的，以基金管理人公告为准。

销售机构信息：

代销机构名称：深圳市前海排排网基金销售有限责任公司

联系人：刘有华

联系电话:13560729634

办公地址：深圳市福田区新洲南路 2008 号新洲同创汇 3 层 D303 号

代销资金归集账户名称：深圳市前海排排网基金销售有限责任公司募集结算资金专用账户

代销资金归集账户号:609578202

代销资金归集账户开户行：中国民生银行股份有限公司深圳香蜜支行

3、募集结算资金专用账户的监督

本基金募集结算资金专用账户由华泰证券股份有限公司进行监督，基金管理人应向基金业协会报送本基金募集结算资金专用账户及其监督机构。监督机构承担保障本基金募集结算资金划转安全的连带责任，资金只能定向划拨至本基金托管账户、投资者收益账户及销售机构开立的本基金销售资金归集专用账户。

监督机构对本基金募集专户的监督范围不包括销售机构归集基金投资者募集资金，销售机构向基金投资者划付其收益、赎回款项及剩余基金财产，以及销售资金归集专用账户向募集专户进行资金划转等的行为，前述销售机构行为涉及的资金划转安全保障职责按照相关法律法规及协议约定由相应主体承担责任。

（八）基金投资者投资冷静期及回访确认

1、基金管理人为基金投资者设置二十四小时的投资冷静期，冷静期自基金合同签署完毕且基金投资者交纳认/申购基金的款项后起算，募集机构在投资冷静期内不得主动联系基金投资者。基金投资者在投资冷静期内，有权主动联系基

仅用于合格投资者查看

金管理人解除基金合同。

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

在中国基金业协会正式要求私募基金的募集机构实施《募集办法》规定的回访制度之后，基金管理人或基金管理人委托的销售机构应当在投资冷静期满后，指令其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。

3、回访过程不得出现诱导性陈述。募集机构在投资冷静期内进行的回访确认无效。投资者在募集机构回访确认成功前有权解除基金合同。出现前述情形时，募集机构应当按合同约定及时退还投资者的全部认购款项。

4、投资冷静期及回访确认相关义务由基金管理人或其委托的销售机构负责履行，与基金托管人无关。因基金管理人或其委托的销售机构未履行或履行不当投资冷静期及回访相关义务而导致本基金不成立或给基金投资者造成任何损失的，基金托管人不承担任何责任。

5、基金投资者属于以下情形的，可以不适用本基金合同有关投资冷静期、回访确认的约定：

（1）社会保障基金、企业年金等养老基金，慈善基金等社会公益基金；

（2）依法设立并在中国基金业协会备案的私募基金产品；

（3）受国务院金融监督管理机构监管的金融产品；

（4）投资于所管理私募基金的基金管理人及其从业人员；

（5）专业投资机构；

（6）法律法规、中国证监会和中国基金业协会规定的其他基金投资者。

六、私募基金的成立和备案

（一）私募基金合同的签署方式

本基金合同可采用纸质或电子的方式进行签署。

（二）私募基金的成立

1、成立条件

本基金初始募集规模不低于 1000 万元人民币。

仅用于合格投资者查看

2、成立流程

本基金募集结束后，基金管理人在募集完成日将全部募集资金划入基金财产托管账户。基金托管人核实资金到账情况，并向基金管理人出具资金到账通知书。

基金管理人向基金份额持有人和基金托管人发送基金成立的通知，基金成立。本基金的成立日期以基金管理人向基金份额持有人和基金托管人发送的基金成立通知所载日期为准。

基金托管人自基金成立之日开始履行托管人职责。

（三）私募基金的备案

基金管理人应当在基金募集完毕之日起 20 个工作日内，按照基金业协会相关规定履行基金备案手续。**若因基金管理人未履行备案手续导致基金投资者或基金托管人发生损失的，基金管理人应承担赔偿责任。**

本基金在中国基金业协会完成备案后方可进行投资运作，但在本基金完成备案前，可以以现金管理为目的，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。

基金投资者可在本基金完成备案后通过中国基金业协会网站（www.amac.org.cn）查询本基金公示信息。

（四）私募基金募集失败的处理

1、募集期满，本基金不能满足成立的条件，或因重大违法违规事项导致基金募集行为被监管机构终止的，则基金募集失败。基金管理人应公告基金募集失败，并应当承担下列责任：

（1）以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用；

（2）在募集期届满后 30 日内返还基金投资者已缴纳的款项，并加计银行人民币同期活期存款利息。具体以份额登记机构记录为准。

2、本基金募集失败后，基金管理人应将基金托管人已签章的基金合同及其他相关协议原件在基金募集期限届满后 10 日内如数返还基金托管人。未能如数返还的，应向基金托管人书面说明原因、去向并签章。基金管理人应勤勉对待基金托管人已签章的基金合同及其他相关协议的回收工作，此义务不因基金管理人的书面说明而免除。

仅用于合格投资者查看

七、私募基金的申购、赎回与转让

在本基金存续期间，基金份额持有人申购与赎回本基金的有关事项如下：

（一）申购与赎回场所

本基金的申购和赎回将通过募集机构办理。

（二）申购与赎回的开放日及时间

1、本基金无封闭期，按下列规则开放：

本基金的开放日为每季度第 3 个月第 11、12、13、14、15 个工作日。

本基金单笔基金份额锁定期为【90】天，即每笔基金份额自份额确认之日起须持有【90】天后方可在开放日进行赎回。**特别地，本基金管理人及其员工认购或申购本基金份额的，其单笔基金份额锁定期为【6】个月。因红利再投资转化形成的基金份额（如有）赎回不受份额锁定期限制。本基金管理人应及时向托管人及服务机构提供投资者身份信息，投资者身份认定由基金管理人负责，基金托管人及服务机构不承担任何责任。**

基金存续期间内，因法律、行政法规或监管政策调整、基金合同变更或解除等原因，基金管理人可设置临时开放日为基金份额持有人办理赎回，临时开放日不得进行申购，具体开放日期以基金管理人公告或通知为准。基金管理人应不迟于该临时开放日前 2 个交易日 15：00 前通过邮件、短信等方式向全体基金投资者披露，并及时通知基金托管人及服务机构。基金托管人和服务机构不审核、不监督基金管理人是否按照约定方式及时、真实、准确、完整通知基金投资者临时开放日事宜，因基金管理人未及时通知基金投资者增设临时开放日而导致的损失，由基金管理人承担相应责任，基金托管人和服务机构不承担任何责任。

2、投资者在赎回申请日需要赎回基金份额的，至少提前【5】个工作日，以邮件、短信、微信、系统申请或其他书面方式通知基金管理人，由基金管理人为基金投资者办理份额赎回事宜。基金投资者如未在约定时间提前通知管理人的，基金管理人有权利根据本基金运作情况，拒绝、暂停接受办理投资者份额赎回事宜，或顺延投资者的赎回申请至下一开放日或者后续开放日。

本基金投资者提交基金份额的申购或赎回申请的具体时间为上海证券交易所、深圳证券交易所及北京证券交易所的正常交易时间，但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或本基金合同的约定暂停申购、赎回的情形除外。

3、未按照基金合同约定征得投资者同意，私募基金管理人不得擅自变改投

仅用于合格投资者查看

资者申购及赎回时间、频率、程序以及限制事项。

如前述变更不涉及本基金合同当事人权利义务变化或对基金份额持有人利益无实质不利影响的，管理人可以通过电话、短信、电子邮件、信件、专业机构服务平台等任一方式至少提前3个工作日向基金份额持有人发送变更征询函（以下简称“征询函”）。征询期内明确表达无异议的，视为基金份额持有人同意本次变更；如有份额持有人向管理人明确表达异议，管理人应设置临时开放日供份额持有人退出，该类赎回申请不受本基金合同关于份额锁定期（如有）、封闭期（如有）和巨额赎回（如有）的限制；份额持有人无意思表达或明确表达了异议，但在该临时开放日未退出的，视为认可本基金按照本次变更后形式继续运作。

管理人与全体份额持有人协商一致后，应以书面形式通知全体基金份额持有人、基金托管人及服务机构变更生效日期，变更事项自该通知中载明的变更生效日起生效，对合同各方均具有法律效力。

（三）申购与赎回的原则、方式、价格及程序等

1、“未知价”原则，即申购、赎回价格以K日计算的基金份额净值为基准进行计算。

2、“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请。

3、按照“时间优先、金额优先”的原则，接受全部基金投资者或者基金份额持有人的申购申请，并保持基金份额持有人累计不超过法律法规规定及本基金合同约定的人数上限。

4、基金份额持有人赎回基金时，按照“先进先出”的原则，依据同一基金份额持有人认购、申购和红利再投资形成的基金份额的先后次序进行顺序赎回。

5、基金投资者办理申购、赎回等业务时应提交的文件和办理手续、办理时间、处理规则等在遵守本基金合同规定的前提下，以募集机构的具体规定为准。

6、申购与赎回申请的确认

募集机构受理申购、赎回申请并不表示对该申请是否成功的确认，仅代表募集机构确实收到了申请，申请是否有效以份额登记机构的确认结果为准。

份额登记机构应在法律法规规定的时限内对基金投资者申购与赎回申请的有效性进行确认。开放日提交的有效申请，在正常情况下，份额登记机构在K+2

仅用于合格投资者查看

日内进行确认，基金投资者可在 K+3 日(含)后到募集机构网站、经营场所或通过与募集机构约定的其他方式查询申请的确认情况。

7、申购与赎回申请的款项支付

申购采用全额交款方式，若资金在规定时间内未全额到账则申购不成功，为无效申请，已交付的委托款项将退回基金投资者自有资金银行账户；有效申购款应于 K+3 日内划入基金财产托管账户。

基金投资者赎回申请确认后，基金管理人向基金投资者支付赎回款项，有效赎回款项应于 K+3 日内划出基金财产托管账户，于 K+5 日内支付给基金投资者。若因托管账户资金不足导致划款延迟，基金管理人应及时告知全体基金投资者，由此造成的损失由基金管理人承担。

（四）申购与赎回的金额限制

1、基金投资者在基金存续期开放日购买基金份额的，首次购买金额应不低于【100】万元人民币（不含认／申购费（如有）），且符合合格投资者标准，已持有基金份额的基金份额持有人在存续期开放日追加购买基金份额的除外。《备案指引 1 号》第七条列明的基金投资者可不适用本条上述约定。

2、基金份额持有人在开放日内追加申购的，每次申购的金额应不低于【1】万元人民币（不含申购费（如有））。《备案指引 1 号》第七条列明的基金投资者可不适用本条上述约定。

3、当基金份额持有人持有的基金资产净值高于 100 万元人民币时，基金份额持有人可以选择全部或部分赎回基金份额。

选择部分赎回基金份额的，基金份额持有人在部分赎回申请确认后持有的基金资产净值不得低于 100 万元人民币。当基金份额持有人申请部分赎回基金将致使其在部分赎回申请确认后持有的基金资产净值低于 100 万元人民币的，基金管理人将适当减少该基金份额持有人的赎回金额，以保证部分赎回申请确认后基金份额持有人持有的基金资产净值不低于 100 万元人民币。

选择全部赎回基金份额的，如持有的处于份额锁定期的基金资产净值低于 100 万人民币时，基金份额持有人可以一次性全部赎回基金份额。该类赎回不受份额锁定期（如有）的限制，且应按照本合同相关约定收取赎回费。

4、当基金份额持有人持有的基金资产净值低于 100 万元人民币（含 100 万

仅用于合格投资者查看

元人民币）时，需要赎回基金的，如持有的全部份额均不在锁定期内或仅有部分份额在锁定期内，基金份额持有人必须选择一次性赎回所持的全部基金份额，该类赎回不受份额锁定期（如有）的限制，且应按照本合同相关约定收取赎回费（上述赎回申请达到巨额赎回认定比例的，优先按照本基金合同巨额赎回条款执行）；如持有的全部份额均在锁定期内，该类赎回将受份额锁定期（如有）的限制。《募集办法》第三十二条列明的投资者可不适用本条上述约定。

（五）申购与赎回的费用

1、申购费用

本基金无申购费，净申购金额=申购金额。

2、赎回费用

本基金无赎回费。

3、申购费用（如有）和赎回费用（如有）均归基金募集机构所有，募集机构有权减免。

（六）申购份额与赎回金额计算

1、申购份额计算方法

申购份额=净申购金额／申购价格

申购价格为开放日 K 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、赎回金额计算方法

赎回金额=赎回份数×赎回价格-赎回费（如有）-业绩报酬（如有）

赎回价格为开放日 K 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。

（七）巨额赎回的认定及处理方式

本基金不设置巨额赎回认定。

（八）拒绝或暂停申购、暂停或延缓赎回的情形及处理

1、当发生以下情形之一时，基金管理人可以拒绝接受基金投资者的申购申请：

仅用于合格投资者查看

（1）基金份额持有人已达到法律法规规定及本基金合同约定的人数上限；

（2）根据市场情况，基金管理人认为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利益的情形；

（3）如接受该申请，将导致本基金资产总规模超过本基金合同约定的上限（如有）；

（4）基金管理人认为接受全部或部分申购或赎回申请可能会影响或损害其他基金份额持有人利益的；

（5）证券/期货经纪服务机构未及时提供估值所需资料，导致基金管理人或其委托的基金服务机构、基金托管人于开放日无法对基金资产估值的情形；

（6）因不可抗力导致基金无法正常运作的；

（7）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，应当告知基金投资者，并将申购款项退回基金投资者的账户。

2、当发生以下情形之一时，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；

（2）相关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；

（3）发生本基金合同约定的暂停基金资产估值情况；

（4）基金管理人、基金托管人、募集机构、证券/期货经纪服务机构或份额登记机构的技术故障等异常情况导致基金销售系统或基金份额登记系统或基金会计系统无法正常运行；

（5）法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一且基金管理人决定暂停接受全部或部分申购申请时，基金管理人应当及时告知基金投资者。

在暂停申购的情形消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理并告知基金投资者。

3、当发生以下情形之一时，基金管理人可以暂停或延缓接受基金份额持有人的赎回申请：

仅用于合格投资者查看

（1）因不可抗力导致基金管理人无法支付赎回款项；

（2）相关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；

（3）发生本基金合同约定的暂停基金资产估值的情况；

（4）若继续接受赎回申请将损害现有基金份额持有人利益；

（5）法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一且基金管理人决定暂停或延缓接受赎回申请时，基金管理人应当及时告知基金份额持有人。

在暂停或延缓赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并及时告知基金份额持有人。

（九）基金份额的转让

在法律法规及监管机构允许的情形下，本基金份额持有人可以向其他合格投资者转让其持有的基金份额，份额转让应遵守法律法规规定、本基金合同约定及基金管理人、份额登记机构的要求，并按规定办理份额变更登记手续。转让期间及转让后，持有基金份额的合格投资者数量合计不超过法定人数和本基金合同约定的人数。

基金份额转让相关交易及变更登记申请文件的真实性由基金管理人负责审核确认。基金管理人委托基金份额登记机构代为办理基金份额登记业务的，基金份额登记机构仅对收到的申请文件进行形式审查。基金份额登记机构对收到的申请文件完成形式审查，即有充分理由信赖本次基金份额转让的真实性。若因本基金合同当事人提供的上述文件不真实、不完整、不准确或失去效力而影响基金份额登记机构审核或给任何第三人带来损失，基金份额登记机构不承担任何形式的责任。

（十）基金份额的非交易过户

基金份额登记机构只受理继承和司法强制执行而产生的非交易过户以及份额登记机构认可、符合法律法规的其他非交易过户。

继承是指基金份额持有人死亡或被人民法院宣告死亡的，其持有的基金份额由其合法的继承人继承；司法强制执行是指司法机构依据生效司法文书将基金份额持有人持有的基金份额强制划转给其他自然人、法人或其他组织。办理非交易

仅用于合格投资者查看

过户必须按照基金份额登记机构的要求提供相关资料，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，并收取相应费用。

（十一）基金份额的冻结与解冻

基金份额登记机构只受理国家有权机关依法要求的，以及份额登记机构认可或符合法律法规的其他情况下的基金份额的冻结与解冻。基金账户或基金份额被冻结的，被冻结部分产生的权益一并冻结，被冻结部分份额仍然参与收益分配与支付，但法律法规另有规定或法院判决、裁定的除外。

当基金份额处于被冻结状态时，基金份额登记机构或其他机构应拒绝为被冻结的基金份额办理赎回、转让等业务。

（十二）基金份额的质押

本基金的基金份额不得用于质押。

八、当事人及权利义务

本基金合同各方当事人的基本情况于本基金合同文首载明。

（一）基金管理人的权利义务

1、基金管理人的权利包括但不限于：

（1）按照基金合同约定，独立管理和运用基金财产；

（2）按照基金合同约定，及时、足额获得基金管理人管理费用及业绩报酬（如有）；

（3）按照法律法规和基金合同约定行使因基金财产投资所产生的权利；

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

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

（7）选择、更换会计师事务所、律师事务所或其他为本基金提供服务的外

仅用于合格投资者查看

部机构，并对外部机构的服务行为进行必要的监督；

（8）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，并对销售机构的募集行为进行必要的监督；

（9）法律法规规定及本基金合同约定的其他权利。

2、基金管理人的义务包括但不限于：

（1）履行基金管理人登记和私募基金的备案手续；

（2）恪尽职守，按照投资者利益优先、诚实信用、谨慎勤勉的原则履行受托人义务，管理和运用基金财产，防范利益输送和利益冲突，确保基金财产的管理和运用不违反法律法规的规定。因基金管理人未满足本合同约定及履行相关承诺或义务而产生的一切责任和损失由基金管理人自行承担；

（3）制作调查问卷，对基金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，向基金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，并以专业化的经营方式管理和运作基金财产；

（6）建立健全内部制度，保证所管理的基金财产与其管理的其他基金财产和基金管理人的固有财产相互独立，对所管理的不同财产分别管理，分别记账、分别投资；

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

（8）自行担任或者委托其他机构担任基金的基金份额登记机构，委托其他基金份额登记机构办理份额登记业务时，对基金份额登记机构的行为进行必要的监督；

（9）按照基金合同约定接受基金份额持有人和基金托管人的监督；

（10）按照基金合同约定负责基金会计核算并编制基金财务会计报告；

（11）按照基金合同约定计算并向基金投资者披露基金份额净值及投资收益情况；

（12）根据法律法规与基金合同的约定，对基金份额持有人进行必要的信息披露，揭示基金资产运作相关重大事项，包括且不限于触及基金止损线或预警线、

仅用于合格投资者查看

基金收益分配事项变更、基金存续期变更或展期等情况，并保证信息披露的及时、真实、准确和完整；按照规定在基金业协会指定的私募基金信息披露备份平台备份各类信息披露报告，履行投资者查询账号的开立、维护和管理职责；

（13）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；

（14）本基金运用基金资产从事关联交易的，基金管理人应当建立健全关联交易管理制度，并向基金投资者充分披露关联交易信息；

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

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

（17）公平对待所管理的不同基金财产，不得从事任何有损基金财产及其他当事人利益的活动，不得损害国家利益、社会公共利益和他人合法权益；

（18）按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金投资者分配收益；

（19）在兑付受托资金及收益时，应当保证受托资金及收益返回基金投资者的原账户、同名账户或者合同约定的受益人账户；

（20）组织并参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

（21）建立、保存基金份额持有人名册，并及时更新，按规定向基金托管人提供；

（22）面临解散、注销，依法被撤销、吊销营业执照、责令关闭或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会、中国基金业协会并通知基金托管人和基金份额持有人；

（23）确保本基金宣传资料真实、准确、完整，不得以虚假、片面、夸大等方式宣传推介；

（24）当基金管理人将其义务委托第三方处理时，应当对第三方处理有关基金事务的行为承担最终责任；

（25）合理审慎地审查本基金合同及相关附件中基金投资者的签章及提供的

仅用于合格投资者查看

相关材料，确保上述材料的真实性、完整性、准确性、有效性，履行投资者适当性审查义务；

（26）按照基金合同的约定，召集基金份额持有人大会；

（27）履行法律法规规定的反洗钱义务，并配合基金托管人履行法律法规规定的基金托管人作为金融机构应履行的反洗钱义务；

（28）对基金的职责不因基金业协会依照法律法规和自律规则执行注销管理人登记等自律措施而免除；如基金管理人被注销登记，仍应当根据《基金法》、基金业协会相关自律规则的规定和本基金合同的约定，妥善处置本基金财产，依法保障投资者的合法权益；

（29）基金管理人聘用投资顾问机构为本基金提供证券投资建议服务的，投资顾问机构应符合《基金法》规定，基金管理人应按照法律法规规定对其资质、投资管理能力等履行尽职调查、遴选等程序，并签署投资顾问协议明确约定双方权利义务，基金管理人对本基金的投资管理职责不因委托投资顾问机构而免除；

（30）法律法规规定及本基金合同约定的其他义务。

（二）基金托管人的权利义务

1、基金托管人的权利包括但不限于：

（1）按照本基金合同的约定，及时、足额获得基金托管费用；

（2）按照法律法规规定和基金合同约定，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法律法规规定和基金合同约定，对基金财产及其他当事人的利益造成重大损失的情形，有权报告中国证监会、中国基金业协会并采取必要措施；

（3）按照基金合同约定，依法保管基金财产，除法律法规另有规定及本基金合同相关约定外，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任何责任；

（4）如基金管理人未按相关法律法规的规定办理本基金的备案手续，基金托管人有权提前终止其在本基金合同项下的法律关系；

（5）如基金管理人利用基金托管人提供的账户或服务从事洗钱或恐怖融资活动、非真实交易、非法证券活动、违反制裁和管制法、被制裁和管制机构制裁或管制，或从事法律法规禁止的其他活动的，基金托管人有权终止业务关系；

仅用于合格投资者查看

（6）法律法规规定及基金合同约定的其他权利。

2、基金托管人的义务包括但不限于：

（1）按照诚实信用、勤勉尽责的原则安全保管基金财产；

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

（3）对所托管的不同财产分别设置账户，确保基金财产的完整与独立；

（4）除依据法律法规规定和基金合同的约定外，不得为基金托管人及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金财产；

（5）按规定开设和注销基金财产托管账户等投资所需账户；

（6）复核基金份额净值；

（7）办理与基金托管业务有关的信息披露事项；

（8）根据相关法律法规规定和基金合同约定复核基金管理人编制的基金定期报告中有关基金财务报告等信息；

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

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

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

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

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

（14）监督基金管理人的投资运作，发现基金管理人的投资指令或清算指令违反法律法规的规定及基金合同约定的，应当拒绝执行，立即通知基金管理人；发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律法规的规定及基金合同约定的，应当立即通知基金管理人；

（15）按照基金合同约定制作相关账册并与基金管理人核对；

（16）法律法规规定及本基金合同约定的其他义务。

仅用于合格投资者查看

（三）基金份额持有人的权利义务

1、基金份额持有人的权利包括但不限于：

（1）取得基金财产收益；

（2）取得分配清算后的剩余基金财产；

（3）按照基金合同的约定申购、赎回和转让基金份额；

（4）根据基金合同约定，参加或申请召集基金份额持有人大会，行使相关职权；

（5）监督基金管理人履行其投资管理义务、基金托管人履行其托管义务的情况；

（6）按照基金合同约定的时间和方式获得基金信息披露资料；

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

（8）法律法规规定及本基金合同约定的其他权利。

2、基金份额持有人的义务包括但不限于：

（1）认真阅读基金合同，保证投资资金的来源及用途合法，主动了解并充分理解本基金所投资品种的风险收益特征；

（2）接受合格投资者确认程序，如实填写风险识别能力和承担能力调查问卷，如实承诺资产或者收入情况，并对其真实性、准确性和完整性负责，承诺为合格投资者并按照募集机构的要求提供相关证明文件；

（3）以合伙企业、契约等非法人形式汇集多数基金投资者资金直接或者间接投资于本基金的，应向基金管理人充分披露上述情况及最终投资者的信息，但符合法律法规规定的除外；

（4）认真阅读并签署风险揭示书，确认能够承担本基金的所有风险（包括但不限于风险揭示书所提及的风险）；

（5）基金份额持有人为个人投资者的，保证基金合同为本人签署；基金份额持有人为机构投资者的，保证其经办人享有签署包括本基金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、合同协议或约定；

（6）按照基金合同约定缴纳基金份额的认购、申购款项，承担基金合同约定的管理费、托管费及其他相关费用；

仅用于合格投资者查看

（7）按照基金合同的约定承担基金投资损失；

（8）向基金管理人或基金销售机构提供法律法规规定的真实、准确、完整、充分的信息资料及身份证明文件，配合基金管理人及/或基金销售机构的尽职调查、反洗钱、适当性管理、非居民金融账户涉税信息尽职调查审查工作，保证其向基金管理人及/或其销售机构提供的信息和资料真实、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重大变化，应当及时书面告知基金管理人及/或其销售机构；

（9）保守商业秘密，不得泄露基金的投资计划或意向等；

（10）不得违反基金合同的约定干涉基金管理人的投资行为；

（11）不得从事任何有损基金及其基金投资者、基金管理人管理的其他基金及基金托管人托管的其他基金合法权益的活动；

（12）谨慎关注自己的基金财产变动情况，保持自己的电话、电子邮件等通讯方式畅通，通讯地址有效，并及时通过有效方式查阅本基金管理人、基金托管人发布的公告、通知；

（13）申购、赎回、分配等基金交易及清算过程中因任何原因获得的不当得利，应予以返还；

（14）法律法规规定及本基金合同约定的其他义务。

九、基金份额持有人大会及日常机构

基金份额持有人大会由基金份额持有人组成，基金份额持有人的合法授权代理人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表决权。

（一）召开事由

1、当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会：

（1）延长基金合同期限；

（2）修改基金合同的重要内容或者提前终止基金合同；

（3）更换基金管理人；

（4）更换基金托管人；

（5）提高基金管理人、基金托管人的报酬标准；

（6）提请聘用、更换投资顾问或提高投资顾问报酬标准；

仅用于合格投资者查看

（7）变更基金份额持有人大会程序；

（8）转换基金运作方式；

（9）基金合同约定的其他情形。

针对上述所列事项，基金份额持有人以书面形式一致表示同意的，可以不召开基金份额持有人大会直接作出书面决议，并由全体基金份额持有人在书面决议文件上签章。有效书面决议的形式可以是经全体份额持有人签名或盖章的纪要文件、通知函、公告文件等，或经全体份额持有人签署的补充协议。

（二）本基金未设立基金份额持有人大会的日常机构，今后如需设立基金份额持有人大会的日常机构，按照相关法律法规的规定执行。

（三）会议召集人及召集方式

1、除法律法规规定或基金合同另有约定外，基金份额持有人大会由基金管理人召集；

2、代表基金份额【30】%以上（含【30】%）的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会的，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 个工作日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 30 个工作日内召开。基金管理人决定不召集，代表基金份额【30】%以上（含【30】%）的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议；基金托管人应当自收到书面提议之日起 10 个工作日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 30 个工作日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合。基金管理人、基金托管人都不召集的，代表基金份额【30】%（含）以上的基金份额持有人有权自行召集，并至少提前 10 个工作日通知基金管理人和基金托管人；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、基金托管人应当配合，不得阻碍、干扰；

3、基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，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 个工作日内决定是否召集，并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 30 个工作日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召

仅用于合格投资者查看

开的，应当由基金托管人自行召集，并自出具书面决定之日起 30 个工作日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合；

4、若出现基金管理人因失联、注销私募基金管理人登记或者出现重大风险等情形无法正常履行或者怠于履行职责导致私募基金无法正常运作、终止的，或被基金业协会列为失联（异常）机构或客观上丧失继续管理本基金的能力的，代表基金份额【30】%以上（含【30】%）的基金份额持有人有权自行召集份额持有人大会；

5、基金份额持有人会议的召集人负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

（四）召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

1、召开基金份额持有人大会，召集人应于会议召开前 10 个工作日，按本基金合同约定的信息披露渠道进行公告。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、地点和会议形式；

（2）会议拟审议的事项、议事程序和表决方式；

（3）有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日；

（4）授权委托证明的内容要求（包括但不限于代理人身份，代理权限和代理有效期限等）、送达时间和地点；

（5）会务常设联系人姓名及联系电话；

（6）出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；

（7）召集人需要通知的其他事项。

2、采取通讯开会方式并进行表决的情况下，由会议召集人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、委托的公证机关（如有）及其联系方式和联系人、书面表决意见寄交的截止时间和收取方式。

3、如召集人为基金管理人，则应另行书面通知基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为基金托管人，则应另行书面通知基金管理人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为基金份额持有人，则应另行书面通知基金管理人和基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督。基金管理人或基金托管人拒不派代表对书面表决意见的计票进行监督的，不影响表决

仅用于合格投资者查看

意见的计票效力。

（五）基金份额持有人出席会议的方式

基金份额持有人大会可通过现场开会方式或通讯开会方式等法律法规或监管机构允许的方式召开，会议的召开方式由会议召集人确定。

1、现场开会。由基金份额持有人本人出席或以代理投票授权委托证明委派代表出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代理人应当列席基金份额持有人大会，基金管理人或基金托管人不派代表列席的，不影响表决效力。现场开会同时符合以下条件，可以进行基金份额持有人大会议程：

（1）亲自出席会议者持有的基金份额凭证、受托出席会议者出具的基金份额持有人持有的基金份额凭证及基金份额持有人的代理投票授权委托证明符合法律法规、基金合同和会议通知的规定，并且持有的基金份额凭证与基金管理人持有的登记资料相符；

（2）经核对，汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的三分之二（含三分之二）。若到会者在权益登记日代表的有效的基金份额少于本基金在权益登记日基金总份额的三分之二，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的1个月以后、3个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会，到会者在权益登记日代表的有效的基金份额应不少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一（含二分之一）。

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

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

（1）召集人按基金合同约定公布会议通知后，在2个工作日内连续公布相关提示性公告；

（2）召集人按基金合同约定通知基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。召集人在基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）监督下按会议通知规定的方式收取基金份额持有人的书面表决意见；基金托管人或基金管理人经通知不参加收取书面表决意见的，不影响表决效力；

仅用于合格投资者查看

（3）直接出具书面意见或授权代理人出具书面意见的，基金份额持有人所持有的基金份额应不小于在权益登记日基金总份额的三分之二（含三分之二）。若直接出具书面意见或授权代理人出具书面意见，基金份额持有人所持有的基金份额应小于在权益登记日基金总份额的三分之二，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的 1 个月以后、3 个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会应当有代表二分之一以上（含二分之一）基金份额的持有人直接出具书面意见或授权代理人出具书面意见；

（4）上述第（3）项中直接出具书面意见的基金份额持有人提交的基金份额凭证，或基金份额持有人委托代理人提交的基金份额持有人基金份额凭证及代理投票授权委托证明应符合法律法规、基金合同和会议通知的规定，并应与基金份额登记机构记录相符。

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

4、基金份额持有人授权他人代为出席会议并表决的，授权方式可以采用书面、网络、电话、短信、微信或其他方式，具体方式在会议通知中列明。

（六）议事内容与程序

1、议事内容及提案权

议事内容应为关系基金份额持有人利益的重大事项，包括本章第（一）款列示的基金份额持有人大会召开事由以及会议召集人认为需提交基金份额持有人大会讨论的其他事项。

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

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

2、议事程序

（1）现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照下列第八条规定程序确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表，在基金管理人授权代理人未

仅用于合格投资者查看

能主持大会的情况下，由基金托管人授权其出席会议的代表主持；如果基金管理人授权代理人和基金托管人授权代理人均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的50%以上（含50%）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人拒不出席或主持基金份额持有人大会，不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

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

（2）通讯开会

在通讯开会的情况下，首先由召集人提前10个工作日公布提案，在所通知的表决截止日期后2个工作日内，由召集人统计全部有效表决，在基金管理人或基金托管人的监督下形成决议。

（七）表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

1、一般决议，一般决议须经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的50%以上（含50%）通过方为有效。除下列第2项所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过。

2、特别决议，特别决议须经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方为有效。转换基金运作方式、更换基金托管人、提前终止基金合同或延长基金合同期限以特别决议通过方为有效。更换基金管理人的，决议事项应当经所持表决权占基金份额三分之二以上的基金份额持有人通过方为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

采取通讯方式进行表决时，除非有计票记有充分的相反证据证明，否则提交符合会议通知规定的基金份额持有人身份证明文件视为有效身份文件，表面符合会议通知规定的书面表决意见视为有效表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

基金份额持有人大会的各项提案或同一项提案内并列的各项议题应当分开

仅用于合格投资者查看

审议、逐项表决。

（八）计票

1、现场开会

（1）如大会由基金管理人或基金托管人召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中选举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集或大会虽然由基金管理人或基金托管人召集，但是基金管理人或基金托管人未出席大会的，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中选举三名基金份额持有人代表担任监票人；

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

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

（4）基金管理人或基金托管人拒不出席大会的，不影响计票的效力。

2、通讯开会

在通讯开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监督员进行计票。

（九）生效与公告

基金份额持有人大会决定的事项自表决通过之日起生效，并在生效之日起5个工作日内由基金管理人通过本基金合同约定的方式书面通知基金份额持有人、基金托管人和其他相关当事人。

基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会的决议。生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人、基金托管人均具有约束力。

（十）本部分关于基金份额持有人大会召开事由、召开条件、议事程序、表决条件等规定，凡是直接引用法律法规或监管规则的部分，如将来法律法规或监

仅用于合格投资者查看

管规则修改导致相关内容被取消或变更的，基金管理人与基金托管人协商一致并提前公告后，可直接对本部分内容进行修改和调整，无需另行召开基金份额持有人大会审议。

（十一）基金份额持有人大会不得直接参与或者干涉基金的投资管理活动，但出现基金管理人被基金业协会公告失联超过 20 个工作日或本章“（三）会议召集人及召集方式”第四款中所列示的管理人客观上丧失继续管理本基金能力的情形除外。

十、私募基金份额的登记

（一）基金的份额登记业务指基金的登记、存管、清算和结算业务，具体内容包括基金份额持有人基金账户建立和管理、基金份额的份额登记、基金销售业务的确认清算和结算、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等。

（二）本基金的份额登记业务由基金管理人委托华泰证券股份有限公司办理，并与其签订服务业务合作协议。

本基金份额登记机构名称：华泰证券股份有限公司

私募基金服务业务登记编码：A00004

（三）份额登记机构享有如下权利：

1、建立和管理基金份额持有人的基金账户；

2、取得与份额登记服务相关的服务费用；

3、获得、保管基金份额持有人开户资料、交易资料、基金份额持有人名册等；

4、在法律法规允许的范围内，制定和调整份额登记业务的相关规则；

5、法律法规规定的其他权利。

（四）份额登记机构承担如下义务：

1、配备足够的专业人员办理基金的份额登记业务；

2、建立并管理基金份额持有人的基金份额账户；

3、按照法律法规和基金合同约定办理基金的份额登记业务；

4、建立并保管基金份额持有人名册及相关的申购、赎回业务记录，保管期限自基金账户销户之日起不得少于 20 年；

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

仅用于合格投资者查看

份额持有人或基金带来的损失，须承担相应的赔偿责任，但配合司法机关调查、审计机构审计等法律法规规定的情形除外；

6、按基金合同约定为基金份额持有人提供基金收益分配等其他必要服务；

7、及时向基金托管人提供基金份额持有人名册；

8、法律法规规定的其他义务。

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

（六）基金服务机构在份额登记过程中，因违法违规、违反服务协议、技术故障、操作失误等原因给基金财产造成损失的，基金管理人应承担的向基金合同其他当事人的先行赔偿责任并不因此而免除。基金管理人可按照服务协议约定与服务机构就基金份额的份额登记错误进行责任分配与损失追偿。

（七）基金管理人委托基金服务机构办理本基金的份额登记业务，但基金管理人依法应承担的份额登记职责不因委托而免除。

十一、私募基金的投资

（一）本基金投资事项

1、投资目标

追求合理的投资回报，力争实现基金财产的长期增值。

2、投资方式

本基金采用直接投向本基金合同约定的投资范围的方式。

3、投资范围

（1）国内依法发行上市的股票、港股通、存托凭证、融资融券

（2）国债、地方政府债、央行票据、可转换债券、可交换债券、资产支持证券、资产支持票据

（3）公募基金（封闭式基金、开放式基金、股票型基金、债券型基金、货币市场型基金、混合型基金）

（4）回购（交易所债券通用质押式逆回购）

（5）期货、场内期权、场外期权、收益互换、收益凭证

（6）资产管理产品（银行理财产品、信托计划（不含劣后级）、证券公司及其子公司资产管理产品、基金公司及其子公司资产管理产品、期货公司及其子公

仅用于合格投资者查看

司资产管理产品、保险公司及其子公司资产管理产品、有托管人托管的私募证券投资基金）

（7）其他（银行存款、权证、转融通、上海黄金交易所交易品种）

本基金合同相关具体投资标的定义参照国家有关法律法规的规定。

4、投资策略

本基金基于对宏观经济的判断和市场情况的变化，通过公司研究团队的深度发掘，在全球市场范围内寻找风险收益较好的股票、债券、金融衍生品和其他资管产品，从而构建进取型投资组合和稳健型投资组合。为了更好的平衡基金产品的进取性和稳健性，将按照一定比例范围灵活地进行稳定型资产和高成长型资产的组合配置，力争实现整体资产收益与风险的更优匹配。

基金将依托风险投资框架，实现主动的风险管控，持续跟踪投资标的的治理结构变化和股权层面的变动，力求及时规避或有风险。

投资策略不构成对于本基金投资范围、投资比例、投资限制及其他投资风控指标的补充，本基金也可以投向投资范围中列明的其他投资标的。本基金投资策略由基金管理人负责执行，基金托管人不承担任何责任。

5、业绩比较基准

本基金无业绩比较基准。

6、投资比例及限制

（1）本基金存续期内，基金总资产不得超过基金净资产的120%。如需按照穿透原则合并计算投资标的的资产负债情况，由管理人自行监控，托管人不承担任何责任。

(2)本基金运用资产组合的方式进行投资并符合下列要求(投资于银行活期存款、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、公募基金等中国证监会、基金业协会认可的投资品种除外)：

（1）按买入成本与市值孰低计算，本基金投资于同一资产的资金不得超过本基金净资产的25%；

（2）按买入成本与市值孰低计算，本基金管理人管理的全部私募证券投资基2金投资于同一资产(不含本基金管理人管理的产品遵照上述第1条投资的单只私募基金)的资金不得超过该资产的25%。本条由管理人自行监控，托管人不

仅用于合格投资者查看

承担任何责任。

(3)同一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、基金业协会另有规定的除外。本条由管理人自行监控，托管人不承担任何责任。

(4)本基金开展债券投资或债券质押式协议回购业务的，按买入成本与市值孰低计算，本基金投资、质押或者接受质押单一债券的资金不得超过基金净资产的10%；管理人管理的所有私募证券投资基金投资、质押或者接受质押单一债券的数量，不得超过该债券存续数量的10%。因发行人行使赎回选择权或者进行债券购回，以及其他持有人行使回售选择权导致的被动超标除外。

本基金投资、质押或者接受质押同一发行人及其关联方发行的债券资金总额，不得超过基金净资产的25%；管理人管理的所有私募证券投资基金投资、质押或者接受质押同一发行人及其关联方发行的债券的总数量，不得超过相关债券存续数量的25%。

国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券、可转换债券、可交换债券等中国证监会、基金业协会认可的投资品种不受本条前两款规定的投资比例限制。

(5)本基金开展债券质押式协议回购业务的，与单一交易对手方开展回购交易的金额不得超过基金净资产的10%(与资产管理产品(含私募基金)开展债券质押式协议回购业务的，将其管理人视为交易对手方)。国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券、可转换债券、可交换债券等中国证监会、基金业协会认可的投资品种不受本条限制。

基金管理人应当在本基金下一估值日前向基金托管人提供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托管人要求的信息。托管人仅根据管理人提供的数据进行事后监督，管理人应对提供数据的准确性、完整性和及时性负责，因管理人未及时提供相关数据或提供数据不真实、不准确、不完整导致托管人未能有效履行投资监督职责，托管人不承担任何责任。

上述投资比例及限制中，涉及同一发行人及其关联方的，基金托管人仅对“同一发行人”维度进行监控；涉及管理人管理的所有产品的，由基金管理人自行监

仅用于合格投资者查看

控，基金托管人不承担任何责任。

（6）本基金穿透至底层不得投资于信用债（除可转债）及质押式协议回购。本条由基金管理人自行监控，基金托管人不承担任何责任。

（7）本基金开展场外衍生品交易的，自 2024 年 8 月 1 日（含）起应当符合下列要求：

①新增场外期权合约以及存续合约展期的，除仅开展商品类场外期权交易外，基金净资产不低于 5000 万元；向全部交易对手方缴纳的场外期权交易保证金和权利金合计不得超过基金净资产的 25%；

②新增收益互换合约以及存续合约展期的，基金净资产不低于 1000 万元；参与挂钩股票、股票指数等权益类收益互换的，向交易对手方缴纳的保证金比例不低于合约名义本金的 50%；

③参与证券公司等机构发行带敲入和敲出结构的场外期权或者收益凭证（如雪球结构衍生品）的合约名义本金不得超过基金净资产的 25%；

本基金参与场外衍生品、收益凭证交易的，基金管理人应当在本基金下一估值日前向基金托管人提供场外衍生品、收益凭证的交易情况、交易文件、交易对手方确认邮件等托管人要求的材料，前述交易文件需覆盖以上投资限制所需的各种类型标识和金额数据（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、合约挂钩标的等信息）。基金合同各当事方同意并确认，基金托管人仅根据基金管理人提供的材料进行形式审核，管理人应确保所提供材料的真实性和有效性，如因管理人过错导致托管人无法有效履职的，托管人不承担任何责任。

基金托管人自 2024 年 8 月 1 日（含）起对上述涉及场外衍生品、收益凭证的条款进行监督。本基金新增场外期权合约、收益互换合约及存续合约展期的，在场外投资划款指令到达基金托管人时，基金托管人对基金净资产规模是否符合本条要求进行事中审核；本基金持有场外衍生品合约期间，基金托管人仅根据交易对手方、相关交易的清算机构或基金管理人提供的交易文件对本基金是否符合本条要求进行事后监督。基金托管人不对交易文件进行任何实质性判断，也不对其真实性、准确性、完整性、及时性和/或所载内容的专业性、正确性负责。若出现交易对手方、相关交易的清算机构或基金管理人未按时发送交易文

仅用于合格投资者查看

件、交易文件缺失、交易文件内容有误、交易文件因交易对手方的标准不统一而产生口径及含义差异、交易文件格式变化且未提前与基金托管人沟通确认、基金管理人和/或交易对手方的信息发送人、其所发送的信息未经其公司内部授权或确认等情形，导致基金托管人无法监督、未能监督或所监督内容与实际不符的，基金托管人不承担任何责任。

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。

7、投资禁止行为

基金管理人不得利用基金财产直接或间接从事下列行为或进行如下投资运作，若由此造成基金财产、合同当事人及第三方损失的，基金管理人应当依据有关法律法规规定及本基金合同约定承担责任：

（1）承销证券；

（2）向他人提供担保，经营或者变相经营资金拆借、贷款等业务，或直接投向金融机构信贷资产；

（3）从事经常性、经营性民间借贷活动，包括但不限于通过委托贷款、信托贷款等方式从事上述活动；

（4）从事承担无限责任的投资；

（5）从事内幕交易、操纵证券价格及其他不正当的证券交易活动；

（6）直接或者间接投资法律法规和国家政策禁止进行债权或股权投资的行业和领域；

（7）与关联方进行不正当交易、利益输送、内幕交易和操纵市场，包括但不限于投资于关联方虚假项目、与关联方共同收购上市公司、向基金管理人注资等；

（8）法律法规规定以及本基金合同约定禁止从事的其他行为。

8、关于基金参与收益互换的特别风险控制

如本基金参与收益互换，管理人应确保本基金存续期内不以任何形式直接

仅用于合格投资者查看

或间接参与 DMA 多空收益互换。本基金进行场外衍生品投资时，基金管理人需向托管人提供衍生品交易对手方不与本基金进行 DMA 多空收益互换的确认邮件等托管人要求的证明材料。基金合同当事方同意并确认，基金托管人仅根据管理人提供的材料进行形式审核，管理人应确保所提供材料的真实性和有效性，如因管理人过错导致托管人无法有效履职的，托管人不承担任何责任。

9、基金托管人对基金管理人投资运作的监督

除相关法律法规另有规定外，基金托管人仅在其可监测的范围内对所托管基金的投资范围、投资比例及限制承担投资监督职责。基金托管人对基金管理人进行本基金投资的监督自本基金成立之日起开始。

基金托管人投资监督的真实性、准确性、及时性和完整性受限于基金管理人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、及时性和完整性不做任何担保、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。

对于基金管理人的任何投资行为、投资策略、投资决定或因基金产品设计缺陷或违规交易行为造成的任何损失，基金托管人不承担任何责任。

10、基金管理人应当确保本基金投资嵌套层级符合法律法规的相关规定。如本基金投资于资产管理产品，基金管理人应确保所投资的资产管理产品未投资或在本基金持有期内不投资除公募证券投资基金以外的资产管理产品，相关法律法规另有规定的除外。上述关于基金嵌套层级的执行由本基金管理人自行监控，基金托管人不承担任何责任。

11、关联交易及处理方式

（1）关联交易机制

基金管理人进行关联交易应当符合本基金的投资目标和投资策略，遵循投资者利益优先原则和平等自愿、等价有偿的原则，防范利益冲突。

A、识别认定。基金管理人运用本基金财产与自己、投资者、所管理的其他私募基金、其实际控制人控制的其他私募基金管理人管理的私募基金、或者与其有重大利害关系的其他主体进行交易，即为“关联交易”。

B、对价确定。基金管理人应优先以市场价格作为基准，遵循独立交易原则，

仅用于合格投资者查看

选用合理的且被行业广泛应用的合理定价方法。基金管理人应特别关注关联交易的定价政策及定价依据，包括估值的公允性、交易标的成交价格与账面值或评估值之间的关系等。

C、交易决策。本基金从事关联交易的，由基金管理人投资决策人员根据内部关联交易管理制度进行交易决策评审和对价确定。基金管理人在评审关联交易事项时，应当对关联交易的必要性、公平性、真实意图、是否存在对投资者的不利影响等进行审查和判断，相关评审决议须经基金管理人内部评审通过，基金管理人方可执行该投资决策。

D、信息披露。基金管理人应当在关联交易前告知全体投资者，基金管理人认为有必要时，应当在关联交易前经全体投资者同意，并在必要情况下设置临时开放日供不同意该关联交易的投资者赎回。在关联交易事中或事后，基金管理人应当根据法律法规及本合同约定向投资者和托管人充分披露关联交易情况。

E、回避机制。基金管理人运用本基金财产进行关联交易的，关联方不得以任何方式干预基金管理人投资决策，有利害关系的人员应当回避表决，不得代理其他人员行使表决权。

上述关联交易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。如因本基金进行任何关联交易造成投资者损失的，基金托管人对此不承担任何责任。

（2）基金投资者签署本基金合同即视为其已充分理解并认可本款第（1）项内容，同意基金管理人可按上述关联交易决策机制进行关联交易，基金管理人无需就前述具体关联交易再另行分别取得基金投资者的授权。

12、基金的预警及止损

本基金不设置预警线和止损线。

13、投资事项的变更

遵循基金份额持有人利益优先的原则，经本基金合同当事人协商一致可对投资范围、投资比例及限制进行变更，变更上述投资事项应以本基金合同约定的方式进行，投资事项变更应为调整投资组合留出必要的时间，基金管理人须在上述变更生效日之前根据合同约定设置临时开放日允许基金份额持有人赎回，该类赎回申请不受本基金合同关于份额锁定期（如有）、封闭期（如有）和已预赎回

仅用于合格投资者查看

（如有）的限制。

（二）本基金投资经理及投资顾问的指定与变更

1、投资经理

（1）投资经理的指定

本基金投资经理由基金管理人负责指定。

（2）投资经理基本情况

姓名：张益凡

简介：张益凡，北京大学光华管理学院硕士，拥有二十五年以上的证券投资管理经验。先后就职于人民银行深圳分行、证监会深圳证监局，从事证券监管工作；2000 年任职浙江省国际信托投资公司总裁助理兼投资经理；2002 年任职国投瑞银基金管理有限公司副总经理；2006 年任职国信证券投资总监；2010 年发起成立深圳市多和美投资顾问有限公司，目前担任总经理兼投资决策委员会主席职位。

姓名：陈国富

简介：陈国富，北京大学物理学硕士，2017 年加入和美资本。在证券投资行业有 5 年以上投资经验。主要负责智能汽车与新能源等行业的研究工作。对国内高端制造行业进行长期的研究跟踪，擅长挖掘产业趋势变革带来的投资机会。

姓名：王威

简介：王威；高级研究员，巴黎综合理工学院硕士。2018 年起在花旗集团担任科技行业研究助理；2020 年起分别在天弘基金、鹏华基金担任电子行业研究员。2024 年加入和美资本。拥有多年全球科技行业研究经历。

投资经理简介由基金管理人提供，基金管理人对投资经理简历的真实性和准确性负责。

（3）投资经理的变更

基金管理人可根据基金投资运作需要变更投资经理，变更投资经理应以本基金合同第十九章第（二）条约定的方式进行，并在变更后 3 个工作日内告知基金份额持有人、基金托管人。管理人须就本次变更事项根据公告约定设置临时开放日允许基金份额持有人赎回，该类赎回申请不受本基金合同关于份额锁定期（如有）、封闭期（如有）和巨额赎回（如有）的限制。

仅用于合格投资者查看

基金管理人通过本基金合同约定的方式向基金份额持有人、基金托管人披露前述事项，即视为履行了告知义务。

2、投资顾问

本基金无投资顾问。

十二、私募基金的财产

（一）私募基金财产的保管与处分

1、私募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。

2、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账户期间，基金托管人不承担保管职责。

3、私募基金场外投资形成的财产，包括但不限于投资场外衍生品(含场外期权、收益互换等)、收益凭证等形成的脱离基金托管人实际控制的基金财产，基金托管人不承担安全保管职责，不承担任何相关责任。

4、基金管理人、基金托管人可以按基金合同的约定收取管理费、托管费以及本基金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。

5、除本款第4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，归入基金财产。

6、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。

7、私募基金财产产生的债权，不得与不属于私募基金财产本身的债务相互抵销。非因私募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私募基金财产强制执行。上述债权人对私募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。如基金财产被依法采取司法强制措施，基金托管人将依法协助司法机关处理，基金托管人不承担因基金财产被采取司法强制措施而产生的任何责任。

仅用于合格投资者查看

8、基金托管人仅负责保管本基金项下托管账户内的现金资产。对于本基金项下未由其保管且未受其实际控制的其他资产（包括现金类资产和非现金类资产），基金托管人不承担保管责任，且对于其安全性和完整性不承担任何责任。基金管理人负责保管本基金对外投资过程中形成的股权、债权等非现金资产及其相关权利凭证，并应及时将相关权利凭证的原件扫描件交付基金托管人。基金管理人应对本基金项下非现金资产及其相关权利凭证的安全和完整负责。除基金合同另有约定外，基金管理人不得在该等非现金资产或其权利凭证之上设置抵押、质押或其他权利负担。

（二）私募基金财产相关账户的开立和管理

基金托管人、基金管理人按照相关业务规定及相关合同约定，为本基金开立基金财产托管账户、证券账户和期货账户等投资所需账户。证券账户和期货账户的持有人名称和存续期限应当符合证券、期货登记结算机构等有关规定。开立的上述基金财产账户与基金管理人、基金托管人、基金销售机构和基金份额登记机构自有的财产账户以及其他基金财产账户相独立。对于非由基金托管人开立、管理并实际控制的账户，基金托管人不承担保管职责。

1、基金财产托管账户的开立和管理

（1）基金财产托管账户是指基金管理人、基金托管人为履行本基金合同由基金托管人为基金单独开立的银行结算账户。基金财产托管账户的具体名称以实际开立为准。账户预留印鉴根据存管银行具体规定执行，相应印章由基金托管人保管。同时，基金财产托管账户的网银客户号、机构网银登录密码、网上银行证书等均应交由基金托管人保管。**未经基金托管人书面同意，基金管理人擅自变更、解除基金财产相关账户与托管账户之间的关联关系或增设其他关联账户而造成损失的，基金托管人不承担任何责任。**

（2）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，均须通过该基金财产托管账户进行。本基金财产托管账户仅限于满足开展本基金投资运作需要而使用。

（3）基金托管人按照规定开立基金财产托管账户，基金管理人应当在开户过程中给予必要的配合，并提供所需资料。

（4）基金财产托管账户的开立和管理应符合有关法律法规的规定。

仅用于合格投资者查看

2、基金证券账户的开立和管理

（1）本基金证券账户由基金管理人委托基金托管人申请开立，基金管理人应当在开户过程中给予必要的配合，并提供所需资料。证券账户的管理、运用及注销由基金管理人负责。

（2）基金托管人在中国证券登记结算有限责任公司（含分公司）为本基金开立证券账户，具体账户名称以实际开立账户为准。

（3）本基金证券账户的开立和使用，仅限于满足开展本基金投资运作需要而使用。基金托管人和基金管理人不得出借或未经对方同意擅自转让基金的任何证券账户，亦不得使用基金的任何证券账户进行本基金业务以外的活动。

3、投资银行理财的银行账户的开立和管理（如有）

因基金运作需要投资银行理财产品的，须通过在本基金托管账户开立银行开通的理财交易账户购买，或直接将基金资产划转至银行理财产品的产品说明书或销售文件中约定的银行理财产品募集账户（如有）。

4、其他账户的开立和管理

因基金投资运作需开立其他账户的，可以根据法律法规规定和基金合同约定，由基金管理人与基金托管人协商后办理。负责办理开户的一方，应在相应账户开立完成后，及时以书面形式（包括但不限于专业机构服务平台、电话、邮件等双方认可的方式之一）将账户信息通知另一方。基金管理人和基金托管人不得随意假借本基金的名义开立任何其他账户。法律法规对其他相关账户的开立和管理另有规定的，从其规定办理。

仅用于合格投资者查看

十三、交易及清算交收安排

（一）选择证券、期货经纪机构的程序

基金管理人负责选择代理本基金财产进行证券买卖的证券/期货经纪机构，并与其签订证券/期货经纪相关协议，基金管理人、基金托管人和证券/期货经纪机构可就本基金参与证券/期货交易的具体事项另行签订协议。

（二）清算交收安排

1、场内交易的清算交收安排

基金管理人应在本基金正式投资运作之前为本基金指定证券经纪商交易席位，本基金进行场内证券投资所涉及的证券经纪商交易席位号、交易品种的费

率表、证券经纪商佣金收取标准等事项在本基金的经纪操作协议中进行约定。

本基金通过指定证券经纪商进行交易时有关交易数据的传输与接收、场内证券交易的资金清算与交割等事项在本基金的经纪操作协议中进行约定。

本基金进行期货或贵金属投资的，有关交易数据的传输与接收、场内证券交易的资金清算与交割等事项在本基金的期货备忘录或上海黄金交易所交易品种投资操作备忘录中进行约定。

2、场外投资的清算交收安排

本基金进行场外投资时，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连同必要的投资合同、申购（认购）申请单（如需）及基金托管人认为必要的其他材料逐笔划付。

为确保本基金财产会计核算及估值的及时处理，基金管理人应于开放式基金交易（包括认购、申购、赎回、基金转换、红利再投资、现金分红、清盘等）的确认日及时获取确认单等单据的复印件或扫描件，并提交至基金托管人。由于基金管理人无法及时向基金托管人提供与投资行为相关的单据（如基金、信托计划、资产管理计划认/申购、赎回的申请单和确认单、基金份额配对转换确认单等），造成的估值偏差，基金管理人承担全部责任。

基金托管人仅对基金管理人提交的划款指令按照本基金合同的约定进行表面一致性审查，基金托管人不负责审查基金管理人发送划款指令同时提交的其他文件资料的合法性、真实性、完整性和有效性，基金管理人应保证上述文件资料合法、真实、完整和有效。如因基金管理人提供的上述文件不合法、不真实、不完整或失去效力而影响基金托管人的审核或给基金份额持有人或任何第三人带来损失，基金托管人不承担任何责任。

3、本基金投资产生的应收资产的清算交收安排

对于因本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通知基金托管人。基金管理人应负责跟踪资金到账情况，对到账日未及时到账的，基金管理人应采取措施向有关当事人进行催收，在此过程中给本基金财产造成损失的，基金管理人应负责向有关当事人追偿本基金财产的损失。

4、申购、赎回款项清算交收安排

仅用于合格投资者查看

K+2 日内，份额登记机构将确认的申购、赎回汇总数据向基金托管人传送，基金托管人根据确认数据进行账务处理。申购、赎回款项默认采用净额结算，发生净赎回时，K+3 日内，基金托管人根据份额登记机构数据将申购赎回轧差后的净赎回款项及赎回费（如有）划付至基金管理人开立或指定的基金募集结算资金专用账户，基金管理人无需再出具资金划拨指令。款项自动划付后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。基金管理人应确保托管账户资金足额，因托管账户内留存的现金不足造成的划款延迟，由基金管理人承担全部责任。基金管理人可以变更本基金申购、赎回款项清算交收方式。

（三）资金、证券账目及交易记录的核对

1、资金账目的核对

对基金财产的资金账目，以基金管理人与基金托管人约定方式核对，确保相关各方账目相符。

2、证券账目的核对

对基金财产的证券账目，由相关各方根据外部第三方对账数据定期进行对账。

3、交易记录的核对

基金管理人定期进行交易记录的核对。在与基金托管人核对估值结果之前，必须保证所有实际交易记录与会计账簿上的交易记录完全一致。如果实际交易记录与会计账簿记录不一致，造成会计核算不完整或不真实，由此导致的损失由基金管理人承担。

（四）指令的发送、确认及执行

1、交易指令授权

（1）基金管理人应在基金投资运作前向基金托管人提供纸质或电子形式的基金划款指令授权书（简称“授权书”），授权书的格式可参考专业机构服务平台提供的模板，具体格式以管理人实际提供版本为准，但应包括被授权人的名单、权限、签章样本以及基金管理人预留印鉴样本基本要素。授权书由基金管理人加盖公章并由法定代表人/执行事务合伙人或其授权代理人签署，若由授权代理人签署，还应附上法定代表人/执行事务合伙人的授权书。授权书应载明授权生效日期，授权书自载明的生效日期开始生效。授权书模板及划款指令接收邮箱参见专业机构服务平台公告，如有更新参见专业机构服务平台最新通知。

仅用于合格投资者查看

（2）基金管理人变更被授权人或其权限和签章样本的，必须至少提前 1 个工作日，使用电子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送变更后的基金划款指令授权书，同时电话通知基金托管人。变更后的授权书自载明的生效时间开始生效，原授权书同时废止。

（3）基金托管人收到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。授权书可以以扫描件形式发出，基金管理人与基金托管人均承认电子形式授权书的法律效力，授权书以电子形式发出的，基金托管人以其收到的电子形式授权书作为其执行划款指令的依据。基金管理人和基金托管人对授权书负有保密义务。

2、基金划款指令的内容

基金划款指令是基金管理人在运用基金财产时，向基金托管人发出的资金划拨及其他款项支付的指令。有效基金划款指令是指指令书面要素（包括付款人、付款账号、收款人、收款账号、金额（大、小写）、款项事由、支付时间）准确无误、发送人员或指令签章与授权书相符、相关的指令附件齐全且头寸充足的划款指令。

3、基金划款指令的发送、确认及执行时间与程序

（1）基金划款指令的发送

基金管理人发送基金划款指令采用电子方式或基金管理人和基金托管人认可的其他方式。

（2）基金管理人应按照法律法规规定和基金合同约定，在其合法的交易权限内发送指令，被授权人应严格按照其授权权限发送指令。对于被授权人依约定程序发出的指令，基金管理人不得否认其效力。但如果基金管理人已经撤销或更改对指令发送人员的授权并且基金托管人根据本基金合同确认后，则对于此后该指令发送人员无权发送的指令或超权限发送的指令，基金托管人予以执行的，基金管理人不承担责任，由此产生的责任由基金托管人承担，授权已更改但基金管理人未根据本基金合同通知基金托管人的情况除外。

（3）基金管理人向基金托管人发送有效基金划款指令时，应确保基金托管人有足够的处理时间，除需考虑资金在途时间外，还需给基金托管人留出执行指令所必需的时间（至少为 2 个工作小时）。在每个工作日 14:30 以后接收的基金

仅用于合格投资者查看

管理人发出的银证、银信、银衍、银期转账划款指令的，基金托管人不保证当日完成划款操作；在每个工作日 16:00 以后接收的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划款操作。

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。

（4）基金托管人收到基金管理人发送的指令后，应对接收到的基金划款指令形式审查是否表面一致，即验证指令的书面要素是否齐全，若为纸质版指令，需审核发送人员或指令签章是否与授权书相符。复核无误后依据本基金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，基金托管人应及时与基金管理人相关人员沟通，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提供基金投资交易相关文件、收款账户证明文件、基金托管人认为必要的投资划款相关支持性文件，以确保基金托管人有足够的资料来判断指令的有效性。若基金管理人未及时重新发送经修改的指令或未及时按基金托管人要求提供必要的投资划款支持性文件的，基金托管人有权拒绝或暂缓执行划款指令，由此产生的后果基金托管人不承担任何责任。

本基金的所有投资交易文件，包括投资协议以及其他与该投资相关的从属协议或与履约保障有关的协议或决议（以下简称“从协议”，包括但不限于：投资协议、担保协议、保证协议、抵押协议等）的签订及生效属于基金管理人的职责，由私募基金管理人自行控制，基金托管人对此不承担复核与监督责任，上述协议亦不构成基金托管人执行基金管理人划款指令的必要前提条件。投资者签署本基金合同即视为已知悉相关风险并同意上述安排。

（5）基金管理人向基金托管人发送基金划款指令时，应确保基金财产托管账户及其他账户有足够的资金余额，对基金管理人在没有充足资金的情况下向基金托管人发出的指令，基金托管人有权拒绝执行，并及时通知基金管理人，因不执行该指令而造成的损失，由基金管理人承担全部责任。

（6）划款指令原件扫描件通过邮件方式发送的，划款原件由基金管理人保管，基金托管人保管划款指令原件扫描件；当两者不一致时，以基金托管人收到的划款指令扫描件为准。

4、电子化指令处理

仅用于合格投资者查看

若基金管理人通过基金托管人提供的专业机构服务平台等电子渠道进行指令及其他业务处理，相关业务流程及规则以相应协议内容为准，协议未约定的内容，以本基金合同约定为准。

5、场外投资指令的特别约定

全体基金份额持有人在此授权并同意：本基金在基金合同约定的投资范围内投资非证券交易所或期货交易所发行、交易的场外投资标的时，基金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，并办理相关权属登记及变更手续（如需）。基金管理人应向投资交易对手方说明资金真实来源为本基金，并保证将投资本金及收益及时返回至本基金托管账户。

基金管理人要求基金托管人从托管账户向指定的场外投资标的收款账户划款时，基金管理人应向基金托管人提交必要的交易文件。如基金管理人无法提供上述交易文件的，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自行承担。基金管理人应确保上述交易文件始终合法合规、真实完整、准确有效。如因基金管理人提供的上述文件不合法合规、不真实、不完整、不准确或失去效力而影响基金托管人履职或给基金份额持有人或任何第三人带来损失，基金托管人不承担任何责任。如本基金所投标的产品的管理人或本基金投资顾问为基金管理人或其关联方的，基金管理人承诺不存在任何利益输送行为。在持有上述场外投资标的期间，投资标的的交易文件如有任何变更的，基金管理人应确保该等变更不得损害本基金份额持有人利益；基金管理人对上述场外投资标的不得进行质押、质押、非交易过户或其他任何有损本基金份额持有人利益的行为。

（五）基金托管人依法暂缓、拒绝执行基金划款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基金划款指令违反法律法规规定或基金合同约定时，将不予执行，并应及时以书面形式（包括但不限于专业机构服务平台、电话、邮件等双方认可的方式）通知基金管理人纠正，基金管理人收到通知后应及时核对，并以书面形式与基金托管人确认，由此造成的损失由基金管理人承担。

（六）基金管理人发送错误基金划款指令的情形和处理程序

基金管理人发送错误基金划款指令的情形包括指令发送人员无权或超越权限发送指令、交割指令信息错误，指令中重要信息模糊不清或不全等。基金托管

仅用于合格投资者查看

人在履行监督职能时，发现基金管理人的指令错误的，有权拒绝或暂缓执行，并及时通知基金管理人改正。

（七）相关责任

基金托管人正确执行基金管理人发送的有效划款指令，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有效划款指令而导致基金财产受损的，基金托管人应承担相应的责任，但基金财产托管账户及其他账户余额不足或基金托管人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、变造等非基金托管人原因造成的情形时，只要基金托管人根据基金合同相关约定验证有关印鉴与签名无误，因基金托管人正确执行该指令而给基金管理人或基金财产或任何第三人造成的损失，由基金管理人承担全部责任。

十四、私募基金财产的估值和会计核算

（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，并为基金份额的申购与赎回等提供计价依据。

2、估值对象

本基金财产项下所有的股票、权证、债券、基金、期货、银行存款本息、应收款项和其他投资等资产及负债。

3、估值日

本基金的估值日为证券交易场所的交易日以及国家法律法规规定需要对外披露基金资产净值的非交易日。

4、估值时间

基金管理人与基金托管人在每个估值日对基金财产进行估值，T+1 日完成 T 日估值。

5、估值依据

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

仅用于合格投资者查看

6、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

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，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

（2）处于未上市期间的有价证券的估值

A、送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市价（收盘价）估值；该日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

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。

C、流通受限股票（是指在发行时明确一定期限限售期的股票，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），可按以下公式确定估值日该流通受限股票的价值：

FV = S×(1-LoMD)

其中：

FV：估值日该流通受限股票的价值

S：估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值

LoMD：该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣（采用第三方估值基准服务机构提供的流通受限股票流动性折扣）

（3）固定收益品种的估值

A、同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处市场分别估值。

B、交易所上市交易、挂牌转让的固定收益品种（可转换债券和可交换债券除外）选取估值日第三方估值基准服务机构（如中证指数）提供的相应品种对应

仅用于合格投资者查看

的估值数据估值。

C、交易所上市交易的可转换债券和可交换债券，按估值日收盘价估值。估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，以最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后发生了影响公允价值计量的重大变化的，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。

D、银行间市场的固定收益品种应依据第三方估值基准服务机构（如中央国债登记结算有限责任公司等）公布的收益率曲线及估值价格。

E、对于未上市或未挂牌转让且不存在活跃市场的固定收益品种，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定其公允价值。

F、对于发行人已破产、发行人未能按时足额偿付本金或利息，或者有其他可靠信息表明本金或利息无法按时足额偿付的债券投资品种，应依据第三方估值基准服务机构提供的价格区间中的【中性/中观】估值数据估值。如第三方估值基准服务机构未提供价格区间，则采用其提供的推荐价格估值。

在任何情况下，基金管理人如采用上述固定收益品种估值方法对基金资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果基金管理人认为按上述固定收益品种估值方法对基金资产进行估值不能客观反映其公允价值，基金管理人应在综合考虑市场成交价、市场报价、流动性、收益率曲线等多种因素的基础上，与基金托管人商定后做出适当调整，按最能反映公允价值的价格估值。

（4）公募证券投资基金估值方法

A、上市流通的证券投资基金按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，以最近交易日的收盘价估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

B、未上市流通的其他开放式证券投资基金按估值日公布的前日基金份额净值估值，当日未公布的，以最新能获取的基金份额净值估值。如果估值日前未曾公布过基金份额净值，按成本进行估值。

C、场外货币基金以成本估值，每日按前一交易日的万份收益计提红利。

D、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

仅用于合格投资者查看

交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，以最近交易日的收盘价估值，每日按前一交易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。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

（5）期货、场内期权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。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。法律法规另有规定的，从其规定。

（6）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，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的结算价估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。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。

对于场外衍生品的估值，包括但不限于场外期权、收益互换等，其交易数据、持仓数据及估值数据等都由基金管理人指定的第三方（证券公司等交易对手方或计算方）提供。**基金服务机构和基金托管人仅根据基金管理人指定的第三方（证券公司等交易对手方或计算方）提供的或其他经本基金管理人与本基金托管人协商一致的方式所获取的数据进行账务处理，基金服务机构和基金托管人对该数据的及时性、真实性、有效性、准确性以及基于上述数据不及时、不真实、不准确而产生的估值结果不承担任何责任。**

（7）银行存款、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、应付利息，在结息日以实收、实付利息入账。

（8）收益凭证如由发行方提供估值的，则根据收益凭证发行方提供的估值基准日的估值报告估值，基金管理人应确保在本基金每个开放日对应的估值日内向基金托管人提供收益凭证发行方出具的最新估值报告，如基金管理人未向基金托管人提供收益凭证发行方出具的最新估值报告，则以基金管理人最近一次提供的估值报告进行估值；如估值报告无法提供的，则由基金管理人与基金托管人根据本金与收益结算条款协商估值方法（其中包含按成本估值）。**基金管理人对收**

仅用于合格投资者查看

益凭证发行方提供的估值价格的真实性、完整性、有效性、及时性负责，如因未及时获得完整、准确及有效的收益凭证估值或其估值结果记载的信息发生变更导致本基金净值发生波动或无法反映真实资产状况造成投资者损失的，基金托管人不承担任何责任。

（9）对于本基金投资的证券公司及其子公司、基金管理公司及其子公司、期货公司及其子公司、商业银行及其理财子公司、信托公司、保险资产管理机构、金融资产投资公司及其他已获国务院金融监督管理机构核准设立的金融机构管理的资产管理产品（以下简称“标的产品”），按如下方式进行估值：

A、如基金管理人在上述标的产品权益确认日及时提供了标的产品管理人或份额登记机构出具的权益确认原始凭证，则在确认日当天以原始凭证为依据入账；如上述主体无法在权益确认日及时提供标的产品的权益确认原始凭证，则在基金托管人确认收到原始凭证的日期进行入账；由此给基金份额持有人造成的损失，由基金管理人承担全部责任。

B、如上述产品有份额净值的，基金管理人至少应按照本基金开放频率（封闭式产品至少按周）提供标的产品管理人、托管人或运营服务机构等出具的标的产品的最新份额净值，并可根据实际操作提高份额净值提供频率。**本基金托管人和基金服务机构仅接受按如下方式提供的数据并以此进行账务处理：a.标的产品的管理人、托管人或运营服务机构直接提供的数据；b.本基金管理人核实无误后发送的经标的产品托管人或运营服务机构用印的数据；c.其他经本基金管理人与本基金托管人协商一致的方式所获取的数据。**本基金估值日未提供标的产品最新份额净值的，则以最近一次提供的标的产品份额净值估值。**本基金托管人和基金服务机构对上述数据的及时性、真实性、有效性、准确性以及基于上述数据不及时、不真实、不准确性产生的估值结果不承担任何责任。**

（10）对于本基金投资的私募基金管理人发行的私募证券投资基金（以下简称“标的基金”），按以下方法估值：

A、如基金管理人在上述标的基金权益确认日及时提供了标的基金份额登记机构出具的权益确认原始凭证，则在确认日当天以原始凭证为依据入账；如上述主体无法在权益确认日及时提供标的基金的权益确认原始凭证，则在基金托管人确认收到原始凭证的日期进行入账；由此给基金份额持有人造成的损失，由基金

仅用于合格投资者查看

管理人承担全部责任。

B、针对标的基金的净值更新，基金管理人应要求标的基金管理人委托其托管人或其基金服务机构等第三方机构至少按照本基金开放频率提供标的基金的最新份额净值，并可根据实际操作提高份额净值提供频率。**本基金托管人和基金服务机构仅接受按如下方式提供的数据并以此进行账务处理：a.标的基金托管人或标的基金服务机构直接提供的数据；b.本基金管理人核实无误后发送的经上述机构用印的数据；c.其他经本基金管理人与本基金托管人协商一致的方式所提供的数据；**本基金估值日未提供标的基金最新份额净值的，则以最近一次提供的标的基金份额净值估值。**本基金托管人和基金服务机构对上述数据的及时性、真实性、有效性、准确性以及基于上述数据不及时、不真实、不准确性产生的估值结果不承担任何责任。**

（11）基金投资同业存单，按估值日第三方估值基准服务机构提供的估值净价估值；选定的第三方估值基准服务机构未提供估值价格的，按成本估值。

（12）如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，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，基金管理人需及时向基金份额持有人发布估值方法调整公告。

基金管理人调整估值方法时应及时通知基金托管人，基金托管人应认真核查基金管理人采用的估值政策和程序。当存有异议时，基金托管人有权要求基金管理人作出合理解释，并通过积极商讨达成一致意见。

（13）相关法律法规以及监管机构有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按最新规定估值。

如基金管理人或基金托管人发现基金估值违反本基金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。基金估值核算需要的相关信息，包括但不限于场外交易信息和场外行情信息，如基金托管人无法获得，则由基金管理人负责提供，并对数据真实性、完整性、准确性和及时性负责。否则，由于上述情况导致的估值不准确、不完整或不及时，由基金管理人承担全部责任。

7、估值程序

（1）基金份额净值是按照每个工作日闭市后，基金资产净值除以当日基金

仅用于合格投资者查看

份额的余额数量计算，精确到 0.0001 元，小数点后第 5 位四舍五入。法律法规另有规定的，从其规定。

（2）基金管理人应于每个估值日对基金资产估值。但基金管理人根据法律法规或本基金合同的约定暂停估值时除外。基金管理人每 T+1 日完成对基金资产 T 日估值后，与基金托管人以约定的方式进行核对。估值原则应符合本基金合同约定及其他法律法规的规定。

（3）在法律法规和中国证监会允许的情况下，基金管理人和基金托管人可以各自委托服务机构进行估值，但不改变基金管理人和基金托管人对基金资产估值各自承担的责任。

8、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。当基金资产净值计算错误超过基金资产净值 0.5%时，视为基金份额净值错误，本基金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、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，过错的责任人应当对由于该估值错误遭受损失的当事人（“受损方”）的直接损失按下述“估值错误处理原则”给予赔偿，承担赔偿责任。

基金服务机构在估值的过程中，因违法违规、违反服务协议、非因不可抗力引起的技术故障、操作失误等原因给基金财产造成损失的，基金管理人应承担的向基金合同的其他当事人的先行赔偿责任并不因此而免除。基金管理人可按照服务协议约定与基金服务机构就估值错误进行责任分配与损失追偿。

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、价格计算差错等。

（2）估值错误处理原则

A、估值错误已发生，但尚未给当事人造成损失的，估值错误责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正估值错误发生的费用由估值错误责任方承担；由于估值错误责任方未及时更正已产生的估值错误，给当事人造成损失的，由估值错误责任方对直接损失承担赔偿责任；若估值错误责任方已经积极协调，并且

仅用于合格投资者查看

有协助义务的当事人有足够的时间进行更正而未更正，则其应当承担相应赔偿责任。估值错误责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认，确保估值错误已得到更正。

B、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。

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。但估值错误责任方仍应对估值错误负责。如果由于获得不当得利的当事人不返还或不全部返还不当得利造成其他当事人的利益损失（“受损方”），则估值错误责任方应赔偿受损方的损失，并在其支付的赔偿金额的范围内对获得不当得利的当事人享有要求交付不当得利的权利；如果获得不当得利的当事人已经将此部分不当得利返还给受损方，则受损方应当将其已经获得的赔偿额加上已经获得的不当得利返还的总和超过其实际损失的差额部分支付给估值错误责任方。

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、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、查明估值错误发生的原因，列明所有的当事人，并根据估值错误发生的原因确定估值错误的责任方；

C、根据估值错误处理原则或当事人协商的方法对因估值错误造成的损失进行评估；

D、根据估值错误处理原则或当事人协商的方法由估值错误的责任方进行更正和赔偿损失；

E、根据估值错误处理的方法，需要修改份额登记机构有关数据的，由份额登记机构进行更正，并就估值错误的更正向有关当事人进行确认；

F、前述内容如法律法规或监管机构另有规定的，从其规定处理。

仅用于合格投资者查看

9、暂停估值的情形

（1）与本基金投资有关的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

（2）基金合同约定的估值数据提供机构未能提供估值所需资料，或基金托管人有合理理由认为根据现有材料无法准确估值，导致基金管理人（或其委托的基金服务机构）、基金托管人无法对基金资产进行正常估值时；

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

（4）占基金相当比例的投资品种的估值出现重大转变，基金管理人决定延迟估值的情形；

（5）基金管理人认为属于紧急事故的任何情况，导致基金管理人不能出售或评估基金财产的；

（6）中国证监会和本基金合同认定的其他情形。

10、基金份额净值的确认

用于基金信息披露的基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人进行复核。**根据相关法规，基金会计责任方为基金管理人，因此与本基金相关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致意见，以基金管理人对基金财产净值的计算结果为准。**

11、特殊情况的处理

（1）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，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，基金管理人和基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应当积极采取必要的措施消除或减轻由此造成的影响。

（3）如发生本基金合同约定的暂停估值情形超20个工作日，或本基金托管人评估认为本基金存在估值错误、估值不公允的，或托管人认为有必要的等情形，则基金托管人有权拒绝或暂停执行基金管理人的划款指令。基金份额持

仅用于合格投资者查看

有人以及基金管理人充分理解并认可，基金托管人系基于维护基金份额持有人利益的目的暂停划款，但暂停划款可能导致基金无法继续进行投资活动从而导致基金财产发生损失，基金份额持有人、基金管理人承诺不得以此为由要求基金托管人承担相关赔偿责任。

如在本基金暂停估值情形发生之日起20个工作日内本基金仍未恢复估值的，或本基金托管人评估认为本基金存在估值错误、估值不公允的，或托管人认为有必要的等情形，则基金托管人有权报送中国证监会相关派出机构和基金业协会。

（二）私募基金财产的会计政策

1、基金管理人为基金财产的会计责任方。

2、基金财产的会计年度为公历年的1月1日至12月31日。

3、基金财产的会计核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位。

4、基金会计核算按照国家有关的会计制度执行。

5、本基金财产独立建账、独立核算。

6、基金管理人或其委托的基金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，按照有关规定编制基金财产会计报表。

7、基金托管人应定期与基金管理人就基金财产的会计核算、报表编制等进行核对。

十五、私募基金的费用与税收

（一）基金财产支付的费用种类

1、基金管理人的基金管理费；

2、基金管理人的业绩报酬；

3、基金托管人的托管费；

4、基金服务机构的服务费；

5、基金销售服务费；

6、投资顾问费；

7、基金相关账户的开立及维护费用、银行汇划费用、证券、期货交易费用；

8、基金备案后与之相关的审计费、律师费、仲裁费、诉讼费及因争议产生的其他合理费用；

仅用于合格投资者查看

9、基金销售签约相关费用（包括纸质合同印刷费用、电子合同服务费用等）；

10、基金运营过程中发生的增值税及附加税费；

11、基金终止时的清算费用；

12、召开基金份额持有人大会等相关费用；

13、按照国家有关规定和本基金合同约定，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、基金管理人的管理费

（1）基金管理费

本基金 A 类基金份额管理费如下：

A 类基金份额基金管理费按前一日 A 类基金份额资产净值【1】%的年费率计提。计算方法如下：

H＝E×【1】%÷N

H：A 类基金份额每日应计提的基金管理费

E：A 类基金份额前一日基金资产净值

N：当年天数

本基金 B 类基金份额管理费如下：

本基金B类基金份额无管理费。

基金管理费自基金成立次日起，按日计提，按自然季支付给基金管理人。

基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在下个自然季度起按照指定的账户路径进行资金支付，直至支付完毕，基金管理人无需再出具资金划拨指令。基金管理人应确保托管账户资金足额，因托管账户内留存的现金不足造成的划款延迟，由基金管理人承担全部责任。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时与基金托管人协商解决。

（2）业绩报酬

本基金 A 类基金份额业绩报酬如下：

①业绩报酬提取的时间

本基金采用“单个投资者单份额高水位法”。在基金收益分配、基金份额持有人赎回 A 类基金份额或者基金终止时进行业绩报酬的提取。本基金连续两次计

仅用于合格投资者查看

提业绩报酬的间隔期不应短于 6 个月，基金管理人在基金份额持有人赎回 A 类基金份额时或在本基金清盘日计提业绩报酬的，可不受上述间隔期的限制。

②业绩报酬提取的方法

单个基金份额持有人单笔 A 类基金份额投资业绩报酬计算公式如下：

PFij＝Fij×(NAV1′－HWMij)×20%

PFij：本计提日第 i 个基金份额持有人第 j 笔 A 类基金份额投资的业绩报酬；

Fij：本计提日第 i 个基金份额持有人第 j 笔 A 类基金份额投资的基金份额；提取赎回业绩报酬时为基金份额持有人赎回的 A 类基金份额；提取收益分配业绩报酬时为基金份额持有人参与收益分配的 A 类基金份额；合同终止时的业绩报酬为基金份额持有人合同终止时的全部 A 类基金份额。

NAV1′：本计提日 A 类基金份额累计净值；

HWMij：第 i 个基金份额持有人第 j 笔 A 类基金份额投资的高水位，为该笔份额上一次提取业绩报酬时的 A 类基金份额累计净值；若该笔份额还未提取过业绩报酬，则为该笔份额对应的认购价格或申购时的 A 类基金份额累计净值；

如果上述计算基金投资者单位基金份额获得的收益为负或者为零，则业绩报酬为零。

赎回业绩报酬从基金份额持有人赎回资金中扣除；收益分配业绩报酬从基金份额持有人收益分配资金中进行扣除（如果基金份额持有人本次收益分配的金额小于应计提的业绩报酬时，则本次计提的业绩报酬为该基金份额持有人的收益分配资金）；合同终止时业绩报酬直接从基金清算资金中扣除。上述业绩报酬在收益分配、赎回基金份额及基金终止清算后 10 个工作日内，由基金托管人根据基金管理人出具的划款指令支付给基金管理人。

注：单个基金份额持有人单笔投资业绩报酬保留到小数点后 2 位，小数点后第 3 位四舍五入。

本基金 B 类基金份额无业绩报酬。

基金管理人的管理费及业绩报酬收款账户信息如下：

户　名：【深圳市多和美投资顾问有限公司】

账　号：【755916862910301】

开户银行：【招商银行深圳中央商务支行】

仅用于合格投资者查看

2、基金托管人的托管费

基金托管费年费率为【0.01】%。计算方法如下：

H=E×【0.01】%÷N

H：每日应计提的托管费

E：前一日基金资产净值

N：当年天数

基金托管费自基金成立次日起，按日计提，按自然季支付给基金托管人。

基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在下个自然季度起按照指定的账户路径进行资金支付，直至支付完毕，基金管理人无需再出具资金划拨指令。基金管理人应确保托管账户资金足额，因托管账户内留存的现金不足造成的划款延迟，由基金管理人承担全部责任。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

基金托管人的托管费收款账户信息如下：

户　名：华泰证券股份有限公司

账　号：491068633089

开户银行：中国银行江苏省分行营业部

3、基金服务机构的服务费

基金服务费年费率为【0.01】%。计算方法如下：

H=E×【0.01】%÷N

H：每日应计提的服务费

E：前一日基金资产净值

N：当年天数

基金服务费自基金成立次日起，按日计提，按自然季支付给基金服务机构。

基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在下个自然季度起按照指定的账户路径进行资金支付，直至支付完毕，基金管理人无需再出具资金划拨指令，基金管理人应确保托管账户资金足额，因托管账户内留存的现金不足造成的划款延迟，由基金管理人承担全部责任。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

基金服务机构的服务费收款账户信息如下：

仅用于合格投资者查看

户 名：华泰证券股份有限公司

账 号：491068633089

开户银行：中国银行江苏省分行营业部

4、其他费用的支付方法

基金财产托管账户发生的银行结算费用等银行费用，由基金托管人直接从托管账户中扣划，无须基金管理人出具指令。

基金存续期间投资所发生的交易手续费、印花税等有关证券交易税费，作为交易成本直接扣除。

基金证券账户等开户费用，由基金托管人直接从托管账户中扣划，无须基金管理人出具指令。

上述“（一）基金财产支付的费用种类”中的其他相关费用根据有关法律法规及相应协议约定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

（三）不列入基金财产费用的项目

1、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；

2、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；

3、其他根据相关法律法规规定不得列入基金费用的项目。

（四）基金税收

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，但本基金运作过程中应缴纳的增值税及附加税等以基金管理人名义缴纳的税费由本基金财产承担。**基金份额持有人应自行缴纳的税收，由基金份额持有人负责，基金管理人不承担代扣代缴或纳税的义务。**相关法律法规或税务机关规定基金管理人在向基金份额持有人交付利益分配款前须履行代扣代缴任何税费的，基金管理人应当按照相关规定予以代扣代缴，无须事先征得基金份额持有人的同意。**如因国家税收法律法规或税务主管部门相关规定发生变化，导致本基金需要追溯缴纳税款的，基金管理人应提前告知全体基金份额持有人，并于变化确认之日书面通知基金托管人及服务机构一次性在基金财产中计提，在约定时间内由基金管理人出具指令以指定的账户路径进行资金支付；导致本基金未来计税方案**

仅用于合格投资者查看

发生变化的，自变化确认之日起适用。若在基金份额持有人赎回或本基金清算后，税务监管机构要求基金管理人垫付或补缴应由本基金或基金份额持有人承担的税费，基金管理人垫付或补缴后，有权向基金份额持有人追偿。

基金增值税及附加税费自基金成立次日起，按基金管理人提供的计税方案和实际交易结果每日计提，按照计税方案中报税频率支付。基金管理人应在基金增值税按报税频率结转后的15个工作日内向基金托管人发送基金增值税费划款指令，基金托管人复核后于划款指令约定日期从基金财产中支付。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延至下一个工作日。基金管理人应确保本基金计税方案符合国家相关法律法规及税务监管机构相关规定，基金托管人及服务机构仅根据基金管理人提供的计税方案进行账务处理，并有权要求基金管理人提供必要的免税证明、承诺函等文件。**因基金管理人未提供真实、准确的计税方案，或本基金计税方案发生变化但基金管理人未及时、准确通知基金托管人，由此造成的问题和争议由基金管理人与全体基金份额持有人协商解决，基金托管人及服务机构不承担任何责任。**费用扣划后，基金管理人应进行核对，并按相关规定及时申报缴纳相关税费，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。基金管理人应确保托管账户资金足额，因托管账户内留存的现金不足造成的划款延迟，由基金管理人承担全部责任。

基金管理人代收付增值税及附加税费的账户信息如下：

户　　名：【深圳市多和美投资顾问有限公司】

账　　号：【755916862910301】

开户银行：【招商银行深圳中央商务支行】

（五）本基金管理人或其委托的第三方服务机构收费账户信息如有变更，基金管理人须在相关账户信息变更后通过书面形式（包括但不限于专业机构服务平台、邮件等双方认可的方式之一）及时告知基金托管人，具体账户信息以基金管理人最新通知为准。因基金管理人未提供或未及时提供准确、完整的费用收款账户信息，从而导致基金托管人无法进行相应费用划付的，由此产成的后果基金托管人不承担任何责任。

十六、私募基金的收益分配

本基金在存续期内按如下规则进行收益分配。

仅用于合格投资者查看

（一）基金利润的构成

基金利润指基金利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额。

（二）基金收益分配原则

1、基金管理人有权决定在符合有关基金收益分配条件的前提下是否对基金进行收益分配以及收益分配的基准、分配比例、分配次数、分配时间等内容。

2、本基金默认分红方式为【现金分红】，本基金允许变更分红方式。

基金份额持有人如需变更默认收益分配方式的，应当通过募集机构提交申请，经基金管理人确认后，由份额登记机构进行处理。

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

4、每一基金份额享有同等分配权。

5、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

基金收益分配方案以基金管理人发布的公告为准，收益分配方案中应载明截止收益分配基准日的可供分配利润、基金收益分配对象、分配方式、分配时间、分配数额及比例等内容。

在符合基金收益分配条件的前提下，本基金的收益分配不超过【12】次/年。本条由基金管理人自行控制，基金托管人及基金服务机构对此不承担任何责任。

（四）收益分配方案的确定、通知

本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核，由基金管理人以约定的方式告知基金份额持有人。

（五）收益分配的执行方式

基金的收益分配可以采取现金分红或红利再投资等方式。红利再投资是指将现金红利按照基金分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额。

在基金管理人对收益分配方案进行公告后，基金管理人依据具体方案的规定就支付的现金红利向基金托管人发送划款指令，基金托管人依照基金管理人的指令及时进行分红资金的划付。

十七、信息披露与报告

仅用于合格投资者查看

本基金的信息披露应符合《信息披露办法》、基金合同及其他有关规定。相关法律法规关于信息披露的规定发生变化时，按最新规定执行。**基金管理人应当根据相关法律法规及本基金合同的约定，履行本基金信息披露职责，基金定期报告、临时报告等向基金份额持有人信息披露材料的编制和披露均由基金管理人负责。**

（一）基金管理人信息披露的种类、内容、披露时间和职责

1、基金管理人定期信息披露

（1）月度报告

当本基金管理规模金额达到 5000 万以上时，基金管理人应当自规模金额达到 5000 万之日起，持续在每月结束后 5 个工作日内向基金份额持有人披露基金资产净值的情况。

（2）季度报告

本基金存续期间，基金管理人应当在每季度结束之日起 10 个工作日内向基金份额持有人披露基金资产净值、主要财务指标、投资组合情况和其他重要信息。

（3）年度报告

本基金存续期间，基金管理人应当在每年结束之日起 4 个月内向基金份额持有人披露年度报告，年度报告应包括以下信息：

A、报告期末基金资产净值和基金份额总额；

B、基金的财务情况；

C、基金投资运作情况、资产负债情况和运用杠杆情况；

D、基金投资者账户信息，包括实缴出资额、未缴出资额以及报告期末所持有基金份额总额等；

E、投资收益分配和损失承担情况；

F、基金承担的费用和业绩报酬（如有）；

G、可能存在的利益冲突、关联交易，及可能影响基金投资者合法权益的其他重大信息（如有）；

H、法律法规规定及基金合同约定的其他信息。

2、基金管理人重大事项临时披露

本基金发生以下重大事项的，基金管理人应按照法律法规要求的时间向基金

仅用于合格投资者查看

业协会报送相关事项并向基金份额持有人披露。

A、基金名称、注册地址、组织形式发生变更的；

B、基金合同发生重大变化的，或者投资范围、投资策略和投资限制发生重大变化的；

C、变更基金管理人、基金托管人或基金服务机构的；

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

E、触及或取消基金止损线或预警线的；

F、管理费率、托管费率发生变化的；

G、基金收益分配事项发生变更的；

H、基金触发巨额赎回且不能满足赎回要求的，或者投资金额占本基金净资产50%及以上的项目不能正常退出的；

I、基金存续期变更或展期的；

J、基金发生清盘或清算的；

K、发生重大关联交易事项的；

L、私募基金管理人及其法定代表人、董事、监事、高级管理人员、执行事务合伙人或其委派代表或者从业人员等因重大违法违规行为受到行政处罚、行政监管措施和纪律处分措施，或者因违法犯罪活动被立案调查或者追究法律责任的；

M、私募基金管理人及其控股股东、实际控制人、普通合伙人、主要出资人业务经营、财务状况发生重大变化，或者出现重大信息安全事故，可能引发私募基金管理人经营风险，严重损害投资者利益的；

N、私募基金管理人及其管理的私募基金涉及重大诉讼、仲裁等法律纠纷，可能影响正常经营或者损害投资者利益的；

O、私募基金管理人出现重大负面舆情，可能对市场秩序或者投资者利益造成严重影响；

P、对本基金持续运行、基金投资者利益、基金资产净值产生重大影响的其他事件；

Q、法律法规规定的、本基金合同约定的其他情形。

（二）基金托管人对披露信息的复核

仅用于合格投资者查看

基金托管人对基金管理人编制的基金资产净值、基金份额净值、基金份额申购赎回价格、基金定期报告中的财务数据进行复核。**基金托管人对于基金非财务数据不承担任何复核职责。因基金管理人未提供或未及时提供基金托管人履行复核职责所必须的材料等客观因素，从而导致基金托管人无法进行相应复核或未能及时复核的，由此造成的后果基金托管人不承担任何责任。基金管理人不得使用未经基金托管人复核的基金财务数据进行信息披露，也不得对已经基金托管人复核的基金财务数据进行单方面修改，因上述基金管理人原因导致信息披露不真实、不准确、不完整或不及时的，或基金管理人未按法律法规规定或本基金合同约定履行信息披露义务，从而给基金份额持有人造成损失的，由基金管理人承担全部责任，基金托管人不承担任何责任。**

（三）基金管理人向基金份额持有人披露及基金份额持有人信息查询的方式

基金管理人应当采取以下一种或多种方式向基金份额持有人提供信息披露报告或进行相关通知，基金管理人通过以下一种或多种方式向基金份额持有人进行信息披露的，即视为履行了告知义务。为保护基金份额持有人利益，对于法律法规要求必须向基金份额持有人披露的事项，基金管理人应当优先使用基金业协会私募基金信息披露备份系统或基金服务机构提供的系统进行信息披露。基金份额持有人有权要求基金管理人采取以下任一方式之一对其进行信息披露。

1、基金管理人网站

定期报告、临时报告等有关本基金的信息可在基金管理人网站上披露。

2、邮寄服务

基金管理人或销售机构可以向基金份额持有人邮寄定期报告、临时报告等有关本基金的信息。基金份额持有人在本基金合同当事人的基本情况页上填写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通知基金管理人。

3、传真、电子邮件或短信

如基金份额持有人在基金认购、申购或赎回等业务时留有传真号、电子邮箱或手机号等联系方式的，基金管理人也可通过传真、电子邮件、短信等方式将报告信息告知基金份额持有人。联系方式如有变更，基金份额持有人应及时通知基

仅用于合格投资者查看

金管理人。

4、基金业协会私募基金信息披露备份系统

在基金份额持有人向基金管理人提供邮箱等联系信息后，基金管理人应当为基金份额持有人在基金业协会“私募基金信息披露备份系统”（以下简称“信披备份系统”）开立和维护投资者查询账号，供基金份额持有人在信披备份系统中查看本基金相关披露信息。

5、基金服务机构提供的系统

基金管理人可使用基金服务机构提供的专业机构服务平台向基金份额持有人披露信息，基金管理人负责为基金份额持有人开立和维护查询账号，基金份额持有人可根据本基金管理人授权登录该用户服务平台查询基金份额净值、定期报告等披露信息。**基金服务机构仅向基金管理人提供本基金信息发布的途径或方式，本基金信息披露义务人为基金管理人，基金份额持有人通过上述专业机构服务平台查询的本基金信息均取决于基金管理人的披露情况，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，基金托管人及服务机构不承担任何责任。**

6、基金合同当事人约定的其他方式。

（四）基金托管人向基金份额持有人披露信息的方式

基金托管人可使用专业机构服务平台向基金份额持有人披露信息。基金管理人负责为基金份额持有人开立和维护查询账号，基金份额持有人可根据本基金管理人授权登录该用户服务平台查询基金托管人公告。

（五）向基金业协会报送信息披露数据

基金管理人应当按照规定通过中国基金业协会指定的私募基金信息披露备份平台报送信息。

基金管理人过往业绩以及本基金运行情况将以基金管理人向私募基金信息披露备份平台报送的数据为准。

（六）信息披露特别申明

本基金全体基金份额持有人同意基金管理人或其他信息披露义务人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。

基金管理人应当妥善保管本基金信息披露的相关文件资料，保存期限自基金

仅用于合格投资者查看

清算终止之日起不得少于 10 年。

十八、风险揭示

本基金投资将可能面临下列各项风险，包括但不限于：

（一）基金的特殊风险

1、基金合同与中国基金业协会《合同指引》不一致所涉风险

基金业协会针对基金合同条款内容发布了《合同指引》，本基金合同虽已在能够满足本基金投资需要的前提下涵盖了《合同指引》明确要求的条款，但《合同指引》主要为概括性、原则性约定，本基金合同具体条款约定不可避免的比《合同指引》更为复杂具体，也可能存在与《合同指引》不一致的情形。基金投资者应当认真阅读本基金合同，理解本基金合同的全部条款，独立做出是否签署本基金合同的决定。

2、委托募集所涉风险

基金管理人将应属本机构负责募集事项委托其他机构办理，基金管理人应对销售机构进行审慎调查，了解销售机构的内部控制情况、信息管理平台建设、账户管理制度、销售人员能力和持续营销能力，并可将调查结果作为选择销售机构的重要依据。如销售机构与基金管理人存在关联关系，可能会影响基金管理人对销售机构审慎调查的有效性。如因销售机构存在不符合监管机构规定的资质要求、或不具备提供相关服务的条件和技能、或因管理不善、操作失误等，或存在违法违规地公开宣传私募基金产品、虚假宣传私募基金产品、以保本保收益引诱基金投资者购买私募基金产品的行为，可能给基金投资者带来风险。

3、私募基金服务事项所涉风险

基金管理人将本基金份额登记、估值核算应属本机构负责的事项以服务外包等方式交由私募基金服务机构办理，因服务机构不符合监管机构的资质要求、或不具备提供相关服务的条件和技能、或因管理不善、技术系统故障、操作失误等，可能给基金投资者带来风险。

4、投资单一投资标的所涉风险

本基金可能投资于单一标的，相关市场宏观调控政策、财政税收政策、产业政策、法律法规、经济周期的变化等都可能影响所投资的单一标的运作状况，进而影响本基金的运作，因而本基金的投资者将面临投资收益和风险主要取决于本

仅用于合格投资者查看

基金所投资的单一投资标的运作情况的风险。

5、投资流动性较低标的所涉风险

本基金如投向定增股票、场外衍生品、私募债、违约债、封闭式基金等流动性较低标的，可能因缺乏交易对手方或因标的未开放、未到期等原因而无法及时卖出。当市场出现大幅波动且投资标的无法及时变现时，存在导致基金资产亏损的风险。

6、投向境外投资标的的风险

本基金如投向境外投资标的，境外证券市场整体表现受到经济运行情况、货币/财政政策、产业政策、税法、汇率、交易规则、结算以及其他运作风险等多种因素的影响，上述因素的波动和变化可能会使基金资产面临潜在风险。此外，投资境外市场的成本、波动性也可能高于国内市场。

7、私募基金未在中国基金业协会履行登记备案手续所涉风险

基金管理人在基金募集完毕后 20 个工作日内向中国基金业协会办理基金备案手续。如因基金管理人未履行备案手续或者私募基金不符合备案要求等原因致使基金备案失败，则将导致私募基金不能投资运作的风险。

8、关联交易风险

基金管理人运用基金财产进行关联交易的，可能存在基金管理人隐瞒关联关系或者将关联交易非关联化，或以基金财产与关联方进行利益输送、内幕交易和操纵市场等违法违规活动的风险，或存在基金管理人已建立的针对关联交易的决策机制和回避安排失效，或存在基金管理人未按法律法规规定和本基金合同约定及时向基金份额持有人披露关联交易的风险。

9、使用电子合同的风险

本基金合同采用电子签名方式签署的，可能存在因网络中断或不运作、传送安全系统失灵、系统遭受非法入侵等多种因素造成数据的损坏或丢失。

10、基金份额分类的风险

本基金对基金份额进行分类，不同类别基金份额承担的费用不同，可能导致不同类别基金份额持有人获得的投资损益不同。

本基金各类别基金份额净值差异除了受各类别基金份额费用不同影响外，还会受各类别基金份额确认时点、份额配比等因素的影响。开放日提交的有效认/申购申请，份额登记机构通常在 K+2 日内进行确认，如在 K+1 日本基金基金

仅用于合格投资者查看

资产净值发生较大波动，可能会导致不同类别基金份额净值出现明显差异。

举例：如私募基金根据基金管理费费率收取标准的不同，将基金份额分为 A、B 两类基金份额，其中 A 类基金份额不计提管理费，B 类基金份额计提管理费。K 日为私募基金申购开放日，当日 A 类基金份额净值为 1.0000 元，尚无已确认的 B 类基金份额。K 日本基金仅受理了 B 类基金份额参与申请，申购价格为申购当日的 A 类基金份额的价格（即申购价格为 1.0000 元）。如份额登记机构在 K+2 日对申购份额进行确认，如 K+1 日私募基金基金资产净值发生较大波动，可能会出现如下情形：

K+1 日基金资产发生较大投资损失：由于 K+1 日尚无已确认的 B 类基金份额，上述投资损失全部由 A 类基金份额承担，导致 K+1 日 A 类基金份额净值显著下跌；

K+2 日基金资产产生投资收益：B 类基金份额于 K+2 日确认，上述投资收益由 A 类基金份额与 B 类基金份额共同分享。由于 B 类基金份额不承担 K+1 日基金资产投资损失、但却分享了 K+2 日基金资产投资收益，因此 K+2 日 B 类基金份额净值会高于 A 类基金份额净值。

虽然 A 类基金份额不计提管理费，B 类基金份额计提管理费，但上述情形导致 K+2 日 B 类基金份额净值高于 A 类基金份额净值。基金投资者应当充分了解本基金份额类别的相关设置，防止因未能理解各类基金份额的情况而影响投资决策。

基金份额净值	K 日	K+1 日	K+2 日
A 类基金份额净值	1.0000 元	0.9700 元	0.9900 元
B 类基金份额净值	无确认基金份额	无确认基金份额	1.0200 元

（注意：以上仅为举例说明，并非本基金份额分类情况及真实份额净值。）

11、基金托管人监督范围不能涵盖基金全部投资运作事项的风险

在法律法规及本基金合同允许的范围内，基金托管人监管范围并不涵盖基金管理人全部投资管理行为，基金托管人仅根据法律法规及基金合同中对投资范围、投资比例及限制的有关约定进行监督，其中对于明确由基金管理人负责监督（或控制）的条款（如有）和未明确由基金托管人负责监督（或控制）的条款（如有）基金托管人均不承担监督职责，基金管理人违反相关投资范围、投资策略、投资禁止行为、风险控制、增信措施、关联交易、投资限制、预警

仅用于合格投资者查看

止损控制等要求的，相关责任和损失由基金管理人承担，基金托管人在不存在过错的前提下不承担任何责任和损失。对于基金托管人不承担监督职责的事项，该类投资行为将依赖于基金管理人的自律管理，请投资者详细阅读本合同，理解基金托管人的监督范围及可能带来的风险。

12、基金管理人未及时开通信息披露备份系统投资者查询账号的风险

根据《关于私募基金信息披露备份系统定向披露功能上线相关事项的通知》、《私募基金信息披露备份系统定向披露功能常见问题解答》，基金管理人负责协会信披备份系统投资者查询账号的维护和管理工作，及时办理账号的开立、启用、修改和关闭，投资者可登录信披备份系统查询已购买的私募基金信息披露报告。该查询账号的开通有赖于基金管理人获取投资者名称、投资者类型、有效证件类型、有效证件号码、联系邮箱等信息，若基金管理人未能完整获取上述信息，则无法及时为投资者开通信披备份系统查询账号。

13、基金管理人控股股东、实际控制人、普通合伙人变更后尚未在基金业协会完成变更手续的风险（如有）

基金管理人如已变更控股股东、实际控制人、普通合伙人且尚未在基金业协会完成变更手续，可能存在以下风险：

（1）因基金管理人未按规定及时向基金业协会履行变更手续，或虽履行变更手续但不符合基金业协会登记备案要求的，存在无法完成变更登记、被基金业协会采取暂停办理其私募基金备案或注销其管理人资格等自律措施的风险。

（2）基金管理人控股股东、实际控制人、普通合伙人的变更往往伴随着其核心投资团队或运营团队的变更，如无法完成变更登记，可能涉及相关人员的重新选聘，进而影响基金管理人经营管理稳定性及后续持续合规展业，可能对本基金运作造成不利影响。

（二）基金的一般风险

1、资金损失风险

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金财产中的认购资金本金不受损失，也不保证一定盈利及最低收益。

2、基金运营风险

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

仅用于合格投资者查看

基金投资者自担。

3、流动性风险

在本基金存续期内或到期后，基金投资者可能面临资金不能退出或不能及时退出带来的流动性风险。一方面，在特定阶段、特定市场环境下，某些投资品种可能出现流动性不佳的情况，基金管理人建仓或进行组合调整时，可能由于特定投资标的流动性相对不足而无法按预期的价格买进或卖出，由此可能影响到基金投资收益的实现。另一方面，基金要应对投资者的赎回，如果基金资产不能迅速变现，或者变现时对基金资产净值产生冲击成本，都会影响基金运作和收益水平。尤其是在投资者巨额赎回委托财产时，如果基金变现能力差，可能会产生基金仓位调整的困难，导致流动性风险，从而影响基金收益。

本基金设置【份额锁定期】。该等安排可能对基金份额持有人自身的流动性造成不利影响，如市场出现大幅波动且基金份额持有人无法及时赎回，存在导致基金份额持有人损失进一步扩大的风险。

4、基金特定投资架构及底层标的风险

在符合本基金合同投资范围约定的前提下，基金管理人可根据其投资决策，运用基金财产直接投向标的资产，或通过其他资产管理产品间接投资证券类资产。直接投资将使本基金直接面临所投的标的资产对应的投资风险，而间接投资将使本基金面临投资资产管理产品的特定风险。

5、基金无法成立的风险

本基金的成立需符合相关法律法规的规定，本基金可能存在不能满足成立条件从而无法成立的风险。

6、暂停估值的风险

如出现本基金合同约定的暂停估值情形，在暂停估值期间基金管理人和托管人不对本基金进行估值，则基金份额没有赎回价格，从而将导致投资者无法赎回。同时，在本基金合同约定的暂停估值情形下如基金管理人继续进行投资，将无法客观、准确、及时地评估投资盈亏情况和基金财产的价值。暂停估值期间，基金托管人也将无法正常履行投资监督、定期报告财务数据的复核责任。

7、税收风险

契约型基金所适用的税收征管法律法规可能会由于国家相关税收政策调整

仅用于合格投资者查看

而发生变化，基金投资者收益也可能因相关税收政策调整而受到影响。

8、政策风险

因国家相关法律法规、监管政策发生变化，导致基金所从事的相关业务、项目、投资标的等被暂停或禁止而产生风险。

9、市场风险

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

（1）市场政策风险

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

（2）经济周期风险

经济运行的周期性变化，会对基金财产投资的收益水平产生影响的风险。

（3）利率风险

金融市场利率的波动会导致市场价格和收益率的变动。利率直接影响着债券的价格和收益率，影响着企业的融资成本和利润。基金若投资此类相关资产，其收益水平存在受利率变化影响的风险。

（4）购买力风险

基金财产的利润将主要通过现金形式来分配，而现金可能因为通货膨胀的影响而导致购买力下降，从而使基金财产的实际收益下降。

（5）再投资风险

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

（6）赎回风险

因基金持有的证券停牌或其他投资标的无法取得公允价值，基金投资者在赎回产品时，未赎回投资者在后续赎回时较现行赎回投资者承担更大的产品净值波动风险，存在该部分持续持有投资者在后期赎回时可能出现损失的风险。

10、管理风险

在基金财产管理运作过程中，基金管理人的业务资质、管理能力、管理水平、

仅用于合格投资者查看

相关知识和经验、经营状况以及操作能力、人员流动性等对基金财产收益水平有着较大程度的影响，基金管理人的管理和操作失误可能导致基金财产受到损失。

基金管理人可能还同时进行自营投资，虽然基金管理人应当在自营业务与资产管理业务之间采取有效的隔离措施，但仍然可能存在自营业务与资产管理业务之间发生利益冲突的风险。

11、信用风险

基金所涉及的直接或间接交易对手若违约，存在可能对本基金的收益产生影响的风险。

12、操作或技术风险

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

在基金的各种交易行为或者后台运作中，可能因为技术系统的故障或者差错而影响交易的正常进行或者导致基金份额持有人的利益受到影响。这种技术风险可能来自基金管理人、基金托管人、基金份额登记机构、证券/期货经纪机构、销售机构、证券交易所、登记结算机构等。

13、本基金纠纷解决机制相关风险

本基金合同在订立、履行和解释过程中可能发生争议，合同当事人可以通过协商或者调解予以解决。当事人不愿通过协商、调解解决或者协商、调解不成的，可能发生诉讼或仲裁风险。

（二）本基金投资标的的相关风险

1、投资于股票的风险包括但不限于：

（1）国家货币政策、财政政策、产业政策等的变化对证券市场产生一定的影响，导致股票市场价格水平变动；

（2）宏观经济运行周期性波动，可能对股票市场的收益水平产生影响；

（3）上市公司的经营状况受多种因素影响，如市场、技术、竞争、管理、财务等都会导致公司盈利发生变化，从而导致股票价格波动；

（4）本基金如投资于科创板股票，存在的风险包括但不限于：

A、科创板企业可能存在首次公开发行前未能连续盈利、公开发行并上市时尚未盈利、有累计未弥补亏损等情形，因此上市后的持续创新能力、主营业务发

仅用于合格投资者查看

展的可持续性、公司收入及盈利水平等仍具有较大不确定性，可能存在上市后仍无法盈利、持续亏损、无法进行利润分配等情形；

B、科创板新股询价、定价、配售等环节由机构投资者主导。同时，因科创板企业普遍具有技术新、前景不确定、业绩波动大、风险高等特征，市场可比公司较少，发行定价难度较大，科创板股票上市后可能存在股价波动的风险；

C、科创板股票竞价交易相较于其他板块设置较宽的涨跌幅限制，其特殊交易规则可能导致的股价波动偏大；科创板股票交易盘中临时停牌情形和严重异常波动股票核查制度与上交主板市场规定不同。

（5）由于新股申购在市场特性、交易机制、投资特点和风险特性等方面与二级市场存在着一定的差别，参与新股申购存在某些特定风险，包括但不限于：

由于某只股票的网上申购中签率持续放大，本基金面临所持有的该股票的资产比例超过了相关法律法规或本基金合同的有关限制的风险；首发新股在可上市流通后，可能出现大量变现，导致不能以较低成本变现，或跌破发行价的风险；新股申购获配股票可能存在锁定期，在遇到市场或所投股票出现不利波动时，可能出现基金管理人难以根据市场判断对投资组合进行调整，进而导致基金资产损失的风险。

（6）本基金如投资于定向增发股票，存在的风险包括但不限于：

所投定增股票上市后，可能出现大量变现，导致不能以较低成本变现，或跌破发行价的风险；定向增发股票往往有一定锁定期，在遇到市场或所投股票出现不利波动时，可能出现基金管理人难以根据市场判断对投资组合进行调整，存在导致基金资产损失的风险。

（7）本基金如投资于北京证券交易所股票，存在的风险包括但不限于：

A、股价涨跌风险：北京证券交易所在证券发行、交易、投资者适当性等方面与沪深证券交易所的制度规则存在一定差别，包括北京证券交易所竞价交易较沪深证券交易所设置了更宽的涨跌幅限制，可能导致较大的股票价格波动。

B、流动性风险：北京证券交易所上市企业规模较小，部分企业股权较为集中，日间交易相对不活跃，可能导致基金面临无法及时变现的风险。

C、中小企业经营风险：北京证券交易所上市企业为创新型中小企业，该类企业往往具有规模小、对技术依赖高、迭代快、议价能力不强等特点，抗市场风险和行业风险能力较弱，存在因产品、经营模式、相关政策变化而出现经营失败

仅用于合格投资者查看

的风险。

D、上市公司退市风险：根据北京证券交易所退市制度，上市企业退市情形可能相对较多，一旦所投资的上市企业进入退市流程，有可能退入新三板创新层或基础层挂牌交易，或转入退市公司板块，对基金净值可能将造成不利影响。

2、投资于权证的风险包括但不限于：

权证与股票不同，具有财务杠杆效应，本基金投资该品种时，存在短时间内遭受全额或者巨额损失的风险。

3、投资于债券的风险包括但不限于：

（1）市场平均利率水平变化导致债券价格变化的风险；

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

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

（4）本基金如投资于可转换债券、可交换债券，在未转换/交换前，具有债券投资风险；完成转换/交换后，则面临股票投资所具有风险。

4、投资于债券回购的风险包括但不限于：

债券回购主要风险包括信用风险、投资风险及波动性加大的风险等。其中，信用风险指回购交易中交易对手在回购到期时，不能偿还全部或部分证券或价款，造成基金净值损失的风险；投资风险是指在进行回购操作时，回购利率大于债券投资收益而导致的风险以及由于回购操作导致投资总量放大，致使整个投资组合风险放大的风险；而波动性加大的风险是指在进行回购操作时，在对投资组合收益进行放大的同时，也对投资组合的波动性（标准差）进行了放大，即投资组合的风险将会加大。回购比例越高，风险暴露程度也就越高，对基金净值造成损失的可能性也就越大。

5、参与期货交易风险包括但不限于：

如本基金进行期货合约、标准化期权合约等场内期货交易的，无论基金管理人是否出于投机目的，由于期货交易的高杠杆性等特征，进行期货交易无论在任何情况下均具有较高的风险。

（1）基金管理人并非期货交易所会员，以期货交易所会员（即期货经纪商）之客户的身份参与期货交易，可能存在因期货经纪人违规经营、管理疏忽、资金

仅用于合格投资者查看

能力出现问题等原因而导致本基金蒙受损失；

（2）期货交易所实行保证金制度、当日无负债结算制度、涨跌停板制度、持仓限额和大户持仓报告制度、风险准备金制度以及国务院期货监督管理机构规定的其他风险管理制度。本基金可能因保证金不足而被采取限制开仓、强制平仓，进而可能给本基金造成重大损失；本基金所委托的期货经纪商除接受本基金委托外，还可能同时接受其他主体的委托，本基金所委托的期货经纪商发生保证金不足时将被采取限制开仓、强制平仓等措施，而这种不足不一定是本基金的保证金不足造成的，还可能是上述期货经纪商进行其他主体的委托操作所造成的，但即便如此本基金也可能因此受到重大损失；为及时缴纳保证金，本基金可能紧急变现部分基金财产，在上述情况下，该部分基金财产的变现可能并非以最优价格进行，从而造成本基金的损失；本基金及本基金所委托的期货经纪商可能被实行强制结算，一旦本基金或本基金所委托的交易所会员被强制结算、可能给本基金财产造成损失；

（3）期货交易具有高杠杆性的特征，当出现不利行情时，本基金所投资期货或标准化期权合约品种微小的变动就可能使本基金遭受较大损失；

（4）在市场剧烈变化的情况下，基金管理人可能难以或无法对持有的未平仓合约进行平仓。这类情况将可能导致保证金无法弥补全部损失，本基金必须承担由此导致的全部损失。同时本基金将承受合约当天无法平仓而价格变动的风险；

（5）相关期货交易所可能对交易品种的套期保值或套利实行额度管理，本基金如进行某期货交易品种的套期保值或套利交易的，可能因无法申请到额度或无法及时获得额度而不能开展相关交易；

（6）相比于其他交易品种，期货交易可能更加频繁，频繁操作将增加基金管理人、期货经纪商等相关方的操作风险。

6、投资于场内期权的特别风险包括但不限于：

如本基金作为期权合约的买方，当出现不利行情时，如本基金选择不执行期权则本基金可能损失权利金/期权费及相应的时间成本，如本基金选择执行期权则可能因为不利行情因素导致本基金投资遭受损失；如本基金作为期权合约的卖方，出现不利行情时，期权合约买方往往选择执行期权，本基金可能因所持期权价格受不利行情影响而产生较大的损失。

7、参与融资融券交易的风险包括但不限于：

仅用于合格投资者查看

融资融券投资具有证券类产品普通证券交易所具备的政策风险、市场风险、违约风险、证券公司业务资格合法性风险、系统风险等各种风险。同时，融资融券放大投资规模会给本基金资产带来比普通证券交易更大的风险。融资融券对各类风险的放大效应与负债比例相关，融资融券负债比例越大，基金资产面临的风险也相应越大。在从事融资融券交易期间，如果不能按照约定的期限清偿债务，或上市证券价格波动导致日终清算后维持担保比例低于警戒线，且不能按照约定的时间、数量追加担保物时，将面临担保物被证券公司强制平仓的风险，由此可能给基金资产造成损失。

8、投资于港股通交易的风险包括但不限于：

因沪、深、港股票市场在投资环境、投资者结构以及交易标的等方面都存在一定差异，参与港股通交易可能面临如下风险：

（1）市场联动风险：由于在港股市场上外汇资金自由流动，海外资金的流动与港股价格之间表现出高度相关性，因此，投资者在参与港股市场交易时受到全球宏观经济和货币政策变动导致的系统风险相对更大。

（2）股价波动风险：由于港股市场的特殊交易机制和交易规则，加之香港市场结构性产品和衍生品种类相对丰富以及做空机制的存在，因此，港股通个股的股价受到意外事件驱动的影响而表现出股价波动的幅度相对A股更为剧烈，可能增加本基金净值的波动性。

（3）汇率风险：本基金在交易时间内提交订单依据的港币买入参考汇率和卖出参考汇率，并不等于最终结算汇率。港股通交易日日终进行净额换汇，本基金可能需额外承担买卖结算汇率报价点差和汇率波动所带来的损失；同时根据港股通交易规则，本基金在每日买卖港股申请时将参考汇率买入/卖出价冻结相应的资金，将因此而遭遇资金被额外占用进而降低基金投资效率以及因汇率大幅波动引起账户透支的风险。

（4）个股流动性风险：本基金可能因为港股通可投资标的范围的调整而不能及时买入目标投资标的，而面临错失投资机会的风险。与A股市场中小市值股票的成交较为活跃不同，在香港市场，部分中小市值港股成交量相对较少，缺乏流动性，若重仓持有此类股票可能面临小量抛盘即导致股价大幅下跌的风险。

（5）额度限制风险：港股通业务存在每日额度和总额度限制，本基金将面临不能通过港股通进行买入交易的风险。

仅用于合格投资者查看

（6）交易成本风险：参与港股投资，除因股票交易而发生的佣金、交易征费、交易费、交易系统费、印花税、过户费等税费，在不进行交易时也可能要继续缴纳证券组合费等各项费用，从而导致交易成本上升。

（7）其他风险：包括因港股通交收制度带来的基金流动性风险、港股通规则变动带来的风险、香港联合交易所停牌及退市等制度性差异带来的风险等。

9、投资于资产支持证券/资产支持票据的风险包括但不限于：

（1）与基础资产相关风险：基础资产及底层资产现金流预测不准确，或相关交易不能按时如期完成，或基础资产价值大幅下降等，都会使得现金流规模受到不利影响，资产支持证券/资产支持票据持有人的利益会遭受损失；

（2）与资产支持证券/资产支持票据相关的风险：资产支持证券/资产支持票据存续期间，可能面临信用评级下调的风险，或增信措施义务人无法履约的风险，将会对资产支持证券/资产支持票据的投资价值和投资者的预期收益的实现产生不利影响。

（3）资产支持证券/资产支持票据虽然可以进行转让流通。在交易对手有限的情况下，可能面临无法在合理的时间内以合适价格出售的风险。

10、投资于收益凭证等证券公司柜台交易品种的风险包括但不限于：

（1）市场风险：因柜台产品价格的变动导致基金资产损失的可能性。

（2）信用风险：柜台产品发行人不能或不愿履行法定或协议约定义务与承诺而导致投资损失的风险。柜台产品发行、柜台产品风险评估等环节风险控制不力，以及柜台交易期间发行人信用质量恶化或客户资产管理不善等都可导致柜台交易业务信用风险。

（3）流动性风险：投资于柜台产品因缺乏交易对手方而无法达成卖出意愿并及时变现，从而导致本基金遭受损失。

（4）合规风险：投资者参与柜台业务可能面临反洗钱和隔离墙等方面的合规风险。

11、投资于公募证券投资基金、商业银行理财产品、资产管理计划、私募证券投资基金、信托计划等资产管理产品的风险包括但不限于：

（1）该等资产管理产品的基金管理人在进行投资时，如出现判断有误、获取信息不全、或对投资工具使用不当，或未勤勉尽责进行投资管理等情形，将对本基金的收益甚至本金安全造成不利影响。

仅用于合格投资者查看

（2）本基金投资于该等资产管理产品时，若该等资产管理产品实际投资范围超出约定范围，或资产管理产品变更其投资范围（可能无需经基金管理人同意），均可能给本基金造成不利影响。

（3）本基金投资于该等资产管理产品时，基金管理人投资管理能力及其聘请的投资顾问（如有）的投资建议水平，均会对资产管理产品的收益水平产生重大影响，进而影响本基金的收益水平。

（4）资产管理产品可能并非随时开放申购、赎回，其申购、赎回的限制可能给本基金的流动性造成影响，也可能造成本基金不能及时执行预警止损机制（如有）的风险。

（5）资产管理产品本身将会收取一定的费用，虽然该等费用可能并非直接在本基金项下列支，但相比较于投资者直接对资产管理产品进行投资的情况，投资者通过投资于本基金间接投资于资产管理产品，实质上同时承担了本基金、资产管理产品项下的费用。

（6）部分资产管理产品可能具有结构化特征，杠杆比例一般高于普通资产管理产品，投资于该类产品可能导致本基金的收益和损失均将被放大。

12、投资场外金融衍生品的风险包括但不限于：

（1）政策风险：场外金融衍生品（包括但不限于收益互换（如有）、场外期权（如有）等）交易属于创新业务，监管机构可能对相关政策和规定进行调整，引起场外金融衍生品交易业务相关规定、运作方式变化或者证券、外汇市场波动，从而给场外金融衍生品投资者带来风险。

（2）市场风险：由于由整体政治、经济、社会等环境因素对股票、股票指数、期货、交易型开放式基金及其组合等标的资产的价格、波动率、分红或相关性等因素的变化，导致场外金融衍生品交易的基础资产价格波动，从而导致投资者交易的损失。

（3）流动性风险：场外金融衍生品流通转让能力较差，可能影响到基金投资收益的实现；此外，还存在资金头寸不足导致交易资金交收失败的风险，或由于产品结构的约定而在到期日前无法提前终止交易的风险，或者不能以合理的价格及时对冲合约或将合约平仓而可能导致损失的风险。

（4）利率风险：金融市场利率的波动会导致证券市场价格和收益率的变动，使场外金融衍生品交易的收益水平受到相应的影响。

仅用于合格投资者查看

（5）上市公司经营风险：上市公司的经营状况受多种因素影响，如市场、技术、竞争、管理、财务等会导致公司盈利状况发生变化。场外金融衍生品交易的基础资产为股票时，如果上市公司经营状况变化，其股价可能受到影响，从而影响场外金融衍生品的价值。

（6）损失被放大风险：在发生最不利情况下，投资可能无法取得收益，并可能面临损失本金或者权利金及履约保障品的风险，这一损失可能超过全部履约保障品且无上限。场外金融衍生品卖出交易的风险一般高于买入交易的风险。卖方虽然能获得权利金，但也因承担行权履约义务而面临由于合约标的价格波动，可能承受远高于该笔权利金的损失且无上限。

（7）交易对手不能履约的风险：交易对手因停业、解散、撤销、破产，或者被有权机构撤销相关业务许可、责令停业整顿等原因不能履行场外金融衍生品交易，可能给投资者带来风险。

（8）履约保障品不能任意取回的风险：一般来说，参与者向交易对手方提供场外金融衍生品交易的履约保障品后，只有在符合履约保障协议约定的条件下，方可提取履约保障品，从而给投资者带来履约保障品不能任意取回的风险。

（9）履约保障品被处置的风险：场外金融衍生品投资者应当按照双方签订的场外金融衍生品交易协议的相关约定履行权利、承担义务，当符合履约保障协议等相关协议、文件约定的条件时，交易对手方可以按照交易协议约定就参与者所提供的履约保障品做相应处置或采取违约救济措施，以其偿还参与者因违反协议约定而产生的支付义务、债务，在相应金额范围内投资者将无法取回履约保障品。

（10）提前终止等法律风险：场外金融衍生品的合约存续期内可能发生提前终止等事件，导致双方提前终止交易，并因此遭受经济损失。

（11）交割失败等操作风险：场外金融衍生品可能发生因系统故障或特殊原因造成交割失败，但交割失败并不必然被视为违约。交割失败可能导致预期的现金流安排发生变化而产生风险。

（12）信用风险：在场外金融衍生品交易和结算过程中，因交易对手不能或不愿履行合同承诺而导致损失的可能性。包括但不限于：交易对手不按约定履行合同、因交易对手原因导致结算失败、向交易对手提交的用于履约担保的资产被司法等机关冻结或强制执行、交易对手被暂停或终止场外金融衍生品交易资格、

仅用于合格投资者查看

交易对手进入风险处置或破产程序等。

13、参与转融通证券出借交易的风险包括但不限于：

（1）证券出借交易可能存在的信用风险、市场风险、流动性风险、权益补偿风险、操作风险、政策风险、技术风险等各类风险。

（2）证券出借后，无法在合约到期前提前收回出借证券，从而可能影响基金财产的使用。

（3）证券出借期间，如果发生标的证券暂停交易或者终止上市等情况，本基金可能面临合约提前了结或者延迟了结等风险。

（4）本基金出借的证券，可能存在到期不能归还、相应权益补偿和借券费用不能支付等风险。

14、投资于存托凭证的风险包括但不限于：

（1）存托凭证与基础证券所代表的权利在范围和行使方式等方面存在差异，且存托凭证本身受到证券交易普遍具有的宏观经济风险、政策风险、市场风险、不可抗力风险等影响，由此可能给基金资产净值带来不利影响或损失。

（2）本基金通过持有红筹公司的存托凭证，不是红筹公司登记在册的股东，不能以股东身份直接行使股东权利，仅能根据存托协议的约定，通过存托人享有并行使分红、投票等权利。

（3）存托凭证存续期间，对应的基础证券等财产可能出现被质押、司法冻结、强制执行等情形，本基金将可能存在失去应有权利的风险，并增加了信用风险和流动性风险。存托凭证存续期间，存托凭证项目内容可能发生重大、实质变化，红筹公司和存托人可能对存托协议作出修改，更换存托人、更换托管人、存托凭证主动退市等。

（4）存托凭证退市的，本基金可能面临存托人无法根据存托协议的约定卖出基础证券的风险，本基金持有的存托凭证无法转到境内其他市场进行公开交易或者转让，存托人无法继续按照存托协议的约定为本基金提供相应服务等风险。

15、投资于上海黄金交易所交易品种的风险包括但不限于：

（1）因受国内国际各种政治、经济因素，以及各种突发事件的影响，黄金和白银的价格可能会发生剧烈波动。

（2）在某个交易品种达到涨跌停板的情况下，会出现买入或卖出无法成交的可能，本基金持有的保证金可能损失殆尽且不足以弥补交易亏损。

仅用于合格投资者查看

（四）本基金产品设计相关风险

1、不设置止损机制的风险

本基金不设止损机制，本基金存续期内如大幅亏损且未及时止损，基金投资者可能损失全部本金。

2、不设置巨额赎回认定的风险

本基金不设置巨额赎回认定。该等安排可能导致基金组合资产的变现能力与基金份额持有人赎回需求不匹配的情况，存在基金管理人难以以合理价格及时变现基金资产的风险；基金份额持有人大额赎回后，可能导致基金净值波动较大，进而影响存量基金份额持有人的利益。

3、资产管理产品净值提供不及时、不准确对产品净值影响风险

本基金投资资产管理产品的，如基金管理人或其指定机构就资产管理产品所提供的净值不及时、不准确，可能会对本基金资产净值的准确性产生影响。

4、单个投资者单份额高水位法计提业绩报酬的风险

本基金采用“单个投资者单份额高水位法”计提业绩报酬，如基金投资者分次认购、申购份额，在业绩报酬计提时点可能存在部分份额亏损、部分份额盈利的情况。基金管理人仅就盈利份额按基金合同约定计提业绩报酬，不会就亏损份额进行补偿，将导致基金投资者收益减少甚至亏损本金的风险。管理人计提业绩报酬后，如后续运作过程中发生基金份额净值下降甚至亏损时，已计提的业绩报酬不予退还。

5、在收益分配日计提业绩报酬的风险

本基金在收益分配日计提业绩报酬，对于单个基金投资者，可能存在业绩报酬金额大于或者等于收益分配金额的情况，基金投资者面临在该收益分配日无法实际获得收益分配的风险。

6、基金存续期内不进行收益分配的风险

本基金存续期内由基金管理人决定是否进行收益分配，如基金管理人决定不进行收益分配，基金投资者只能在赎回基金份额时或基金合同终止时取得投资收益，面临一定的流动性风险；且若存续期内基金份额净值发生波动或出现亏损，基金投资者在基金终止时可能面临基金份额净值回撤甚至无法获得投资收益的风险。

7、费用支付的风险

仅用于合格投资者查看

（1）费用自动支付的风险。按本基金合同的约定自动支付相关费用可能导致托管账户资金余额不足，可能存在无法及时支付投资款、收益分配款、赎回款等款项的风险，管理人应充分知悉上述风险并提前对托管账户收支做好合理安排。

（2）费用支付不及时的风险。本基金相关费用计提后可能未及时从基金资产中实际支付，未支付费用将随基金财产继续管理运作，存在进一步扩大基金净值波动的风险。

（五）相关机构的经营风险

1、基金管理人经营风险

虽然基金管理人相信其本身将按照相关法律法规的规定进行营运及管理，但无法保证其本身可以永久维持符合监管机构的金融监管法律法规。如在基金存续期间基金管理人无法继续经营基金管理业务，则可能会对基金产生不利影响。

2、基金托管人经营风险

虽然基金托管人相信其本身将按照相关法律法规的规定进行营运及管理，但无法保证其本身可以永久维持符合监管机构的金融监管法律法规。如在基金存续期间基金托管人无法继续从事基金托管业务，则可能会对基金产生不利影响。

3、基金服务机构经营风险

虽基金服务机构相信其本身将按照相关法律法规的规定进行营运及管理，但无法保证其本身可以永久维持符合监管机构的金融监管法律法规。如在基金存续期间基金服务机构无法继续从事基金服务业务，则可能会对基金产生不利影响。

4、证券/期货经纪机构经营风险

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

（六）其他风险

1、提前终止风险

发生基金合同约定的情形或其他法定情形时，基金管理人将按照法律法规、基金合同以及其他规定提前终止本基金，可能造成基金份额持有人不能足额取得

仅用于合格投资者查看

基金收益。

2、律师费用支付风险

本基金运作过程中可能引发诉讼、仲裁事项并需聘请专业律师，基金管理人聘请律师等相关费用将从基金资产中支付，而律师费与诉讼、仲裁事项本身复杂程度、律师专业水平等因素相关，可能出现支付的律师费金额或频次较高的情况。

3、不可抗力

战争、自然灾害等不可抗力因素的出现，将会严重影响证券市场的运行，可能导致基金资产的损失，从而带来风险。

本风险揭示的揭示事项仅为列举性质，未能详尽列明基金投资者参与本基金投资所面临的全部风险和可能导致基金投资者资产损失的所有因素。基金投资者签署本基金合同，即视为已认可并逐项确认了本风险揭示章节所列明的各项风险，能够在充分理解本基金、投资活动的性质及风险的基础上自主作出投资决策，并承担由此产生的风险和损失。

十九、基金合同的效力、变更、解除与终止

（一）基金合同的成立与生效

1、基金合同的成立

本基金合同的签署应当采用纸质合同或电子合同的形式进行。本合同由私募基金管理人、私募基金托管人、基金投资者共同签署后合同即告成立。

本合同采用纸质合同形式签署的，托管人或管理人均可采用手写签名/盖章或通过托管人指定机构套印印章的方式进行签署，托管人或管理人使用托管人指定机构套印印章签署与在纸质合同上手写签名/盖章具有同等法律效力。本合同采用电子合同形式签署的，电子签名与在纸质合同上手写签名/盖章具有同等法律效力，无需再另行签署纸质合同。

在基金份额持有人、基金管理人、基金托管人完成三方基金合同签署前，基金托管人可依据与基金管理人两方已完成签署的基金合同实施基金财产托管账户开立等本基金运作前的准备工作。基金管理人、基金托管人两方签署的基金合同应与基金份额持有人、基金管理人、基金托管人三方签署的基金合同一致。

2、基金合同的生效

本基金合同生效应当同时满足如下条件：

仅用于合格投资者查看

（1）本基金合同经基金投资者、基金管理人与基金托管人合法签署；

（2）基金投资者认购或申购资金实际交付并经份额登记机构确认成功，基金投资者获得本基金份额；

（3）本基金依法并根据本基金合同约定成立。

3、基金合同的效力

（1）本基金合同自生效之日起对各基金合同当事人具有同等的法律约束力。

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

（3）本基金合同采用纸质合同方式签署的，除需当事人签名、当事人需填写的基本信息要素或本基金合同中明确要求当事人填写部分可手写以外，非经基金管理人、基金托管人书面同意，基金投资者不得擅自增加任何手写条款，未经基金管理人及基金托管人书面同意的手写条款无效。

（二）基金合同的变更

1、因法律法规或中国证监会、中国基金业协会的相关规定发生变化需要变更基金合同的，基金管理人可以与基金托管人协商后修改基金合同，并由基金管理人按照基金合同约定及时向基金份额持有人披露变更的具体内容，即视为基金份额持有人认可本次变更的具体内容。

2、非因法律法规及有关政策变化的原因需要变更基金合同重要内容的，可选择以下方式之一进行变更：

（1）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或对基金份额持有人利益无实质不利影响的，基金管理人可与基金托管人协商一致后，由基金管理人按照本基金合同的约定向基金份额持有人披露变更的具体内容，法律法规及本合同另有规定的除外。

（2）全体基金份额持有人、基金管理人和基金托管人协商一致。

（3）按照本基金合同的约定召开基金份额持有人大会决议通过。

（4）相关法律法规规定和基金合同约定的其他方式。

3、基金合同重大事项发生变更的，基金管理人应当及时将变更生效时间书面告知基金委托人，基金管理人应按照中国基金业协会要求向中国基金业协会报告。

仅用于合格投资者查看

本基金发生《登记备案办法》第五十五条规定的信息变更的，基金管理人应当以本合同约定的方式向投资者披露并采取设置临时开放日或者其他保障投资者赎回私募证券基金权利的措施，法律法规另有规定的除外。

（三）基金合同的解除

1、基金投资者投资冷静期合同解除

本基金为基金投资者设置不少于二十四小时的投资冷静期。

投资冷静期自基金合同签署完毕且交纳认／申购基金款项后起算，基金投资者在投资冷静期内有权解除基金合同。

出现前述情形时，募集机构应当按基金合同约定及时退还基金投资者的全部认／申购款项。

基金份额持有人追加申购资金的，对于其已经持有的基金份额不适用于前款关于基金合同解除的约定。

根据本基金合同约定，不适用投资冷静期情形的基金投资者不适用于前款关于基金合同解除的约定。

2、基金投资者回访确认前的合同解除

如本基金募集机构设有并实施回访制度，则基金投资者在募集机构回访确认成功前有权解除基金合同。出现前述情形时，募集机构应当按基金合同约定及时退还基金投资者的全部认/申购款项。在募集机构约定的回访时间内，未回访确认成功，募集机构有权解除基金合同并按基金合同约定及时退还基金投资者的全部认/申购款项。

根据本基金合同约定，如本基金募集机构暂不实施回访制度，或不适用回访确认情形的基金投资者不适用于前款关于基金合同解除的约定。

3、存在制裁或管制情况下的合同解除

如在本基金合同生效后，本基金合同各方当事人任意一方被制裁和管制机构进行制裁或管制，且该等制裁或管制将使本合同项下的交易可能违反任何适用的法律法规，或者本基金合同的目的无法实现，则其他各方当事人有权即时终止权利义务的履行、解除合同，且不应因此承担任何进一步的义务或责任。

（四）基金合同的终止

基金合同终止的情形包括但不限于下列事项：

仅用于合格投资者查看

1、全体基金份额持有人赎回全部基金份额的；

2、基金管理人被依法取消私募基金管理人资格的；

3、基金托管人被依法取消证券投资基金托管业务资格的；

4、基金管理人依法解散、被依法撤销或被依法宣告破产的；

5、基金托管人依法解散、被依法撤销或被依法宣告破产的；

6、基金合同期限届满且不展期；

7、基金份额持有人大会决定终止的；

8、经基金管理人、基金托管人、基金份额持有人协商一致而提前终止的；

9、本基金向中国基金业协会备案失败的；

10、法律法规规定和本基金合同约定的其他情形。

（五）基金托管人的辞任

发生下列情形时，经基金托管人书面通知基金管理人，基金管理人在规定期限内仍未予以纠正的，基金托管人有权提出辞任：

1、发生可能会对本基金财产安全或正常运行产生重大不利影响的事件，致使基金托管人无法履行托管义务或对基金托管人产生重大不利影响；

2、基金管理人违反法律法规规定及本基金合同约定，以基金托管人名义或利用基金托管人商誉进行推广或宣传。

基金托管人因上述原因辞任的，应以书面方式通知基金管理人，说明辞任的决定和理由后，由信息披露义务人按照本基金合同信息披露章节约定，向全体基金份额持有人进行信息披露。基金托管人辞任的，基金管理人应在收到书面通知后的九十日内落实继任基金托管人。基金托管人应该协助完成替换的相关交接工作，将托管资金移交至继任基金托管人，保证基金平稳运行。**基金托管人按上述程序辞任不视为违约，不承担任何责任。**

基金管理人未按上述约定落实继任基金托管人的，基金托管人有权采用止付措施，由此产生的损失由基金管理人全部承担。

（六）基金维持运作机制

1、基金管理人被基金业协会注销私募基金管理人资格，基金管理人应按照本基金合同信息披露章节约定，向全体基金份额持有人进行信息披露，并在信息披露后的 60 日内召开份额持有人大会，提前终止本基金合同或落实继任基金管

仅用于合格投资者查看

理人。

2、基金管理人因失联、注销私募基金管理人登记或者出现重大风险等情形无法履行或者怠于履行职责导致私募基金无法正常退出的，或被基金业协会列为失联（异常）机构或客观上丧失继续管理本基金的能力的，基金份额持有人可按照法律法规规定及本基金合同约定召开份额持有人大会（决策机制、召集主体、表决方式、表决程序、表决比例等参照本基金合同“基金份额持有人大会及日常机构”章节关于特别决议的相关约定执行），并可进行下列处置措施：

（1）变更基金管理人

新基金管理人可由基金份额持有人大会选聘，在变更过程中涉及基金托管人的相关事宜，基金托管人应提供必要的协助与配合。

（2）成立专项机构或者委托会计师事务所、律师事务所等中介服务机构

基金份额持有人大会决议可成立专项机构负责处置基金财产，专项机构可由基金份额持有人大会推举代表、基金托管人、会计师事务所或律师事务所等中介服务机构组成；基金份额持有人大会也可直接委托会计师事务所、律师事务所等中介服务机构处置基金财产。上述机构应基于保护投资者合法权益角度，行使下列职权：

A、清理核查私募基金资产情况；

B、制定、执行清算退出方案；

C、管理、处置、分配基金财产；

D、依法履行解散、清算、破产等法定程序；

E、代表私募基金进行纠纷解决；

F、中国证监会、基金业协会规定或者基金合同约定的其他职权。

本基金通过前款规定的成立专项机构方式退出的，专项机构应当及时向基金业协会报送专项机构组成情况、相关会议决议、财产处置方案、基金清算报告和相关诉讼仲裁情况等。

本基金进入清算处置阶段后，如基金管理人被基金业协会从失联（异常）机构名单中移除或恢复继续管理本基金能力的，对于在其被列入为失联（异常）机构或客观上丧失继续管理本基金能力期间，对基金份额持有人大会、专项机构和受托中介服务机构签署的与本基金相关的法律文件、行使诉讼权利、处分基金财

仅用于合格投资者查看

产或者为本基金实施的其他有关法律行为均予以认可，且不得否认其效力。

3、若按照基金合同约定，本基金已经根据本款上述决策机制履行完变更基金管理人的程序，但未获得少数份额持有人同意变更的，本基金管理人或专项机构应当保障少数份额持有人退出其持有的全部基金份额的权利。

（七）基金合同的回收

本基金合同及其变更文件（包括但不限于新版基金合同、补充协议等法律文件，下同）采用纸质或者电子方式进行签署的，由基金管理人负责组织基金投资者签署。如采用纸质合同方式进行签署，基金管理人需妥善保管并及时向基金托管人移交本合同当事人签署的属于基金托管人的基金合同及其变更文件原件。

基金投资者知悉并确认：

本基金合同及其变更文件（如有）均由基金管理人负责组织基金投资者签署，基金投资者应在签署基金合同及其变更文件（如有）后将认购款/申购款划入本基金募集结算资金专用账户。因发生以下情形，导致基金投资者或基金托管人产生任何损失的，由基金管理人自行承担责任，托管人不承担任何责任：

（1）基金投资者未签署、未完整签署或未准确签署本基金合同或其变更文件的；

（2）基金管理人未妥善保管本基金合同或其变更文件的；

（3）基金管理人未及时向基金托管人移交已签署完毕的本基金合同或其变更文件原件的；

（4）其他由于基金管理人原因导致的情形。

仅用于合格投资者查看

二十、私募基金的清算

（一）私募基金财产的清算

1、私募基金财产清算小组

（1）基金管理人应自出现基金合同终止事由之日起5个工作日内组织成立清算小组对私募基金财产进行清算。清算小组成员由基金管理人、基金托管人组成。清算小组可以聘用必要的工作人员。

（2）私募基金财产清算小组的职责为负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配，依法进行必要的民事活动。

2、清算小组成员职责

基金管理人职责包括：

（1）资产变现；

（2）除交易所、银行等自动扣收的费用外，对清算期间资金支付出具划款指令；

（3）出具会计报表；

（4）清算期间的会计核算；

（5）编制清算报告并签章；

（6）配合基金托管人账户注销工作；

（7）代表基金财产清算小组聘请会计师事务所、律师事务所；

（8）向基金份额持有人发布清算通知、清算报告；

（9）按照法律法规要求向基金业协会报送清算报告等信息；

（10）作为清算组对外文书签署主体进行文书签署；

（11）履行与基金管理人义务相关的其他职责等。

基金托管人职责包括：

（1）清算期间的现金类基金财产保管；

（2）对基金管理人划款指令进行形式审核后，依据划款指令进行资金划付；

（3）基金财产资金等账户的注销；

（4）复核清算报告中的财务数据；

（5）履行与基金托管人义务相关的其他职责等。

基金管理人应当按照本合同约定及时组织清算小组并及时完成全部基金资产的变现。基金管理人不得通过延长基金合同期限或清算期限等方式怠于履行清算义务。因基金管理人未及时组织清算或未及时履行本条上述基金管理人职责而导致基金财产损失或对投资者权益产生不利影响的，基金托管人和服务机构不承担任何责任。

3、私募基金财产清算程序

基金合同终止，本基金应当按法律法规规定和基金合同的有关约定对基金财产进行清算。基金财产清算程序主要包括：

（1）基金合同终止时，基金管理人发布清盘公告；

（2）对基金财产进行清理和确认；

仅用于合格投资者查看

（3）对基金财产进行估价和变现；

（4）制作清算报告；

（5）对基金剩余财产进行分配。

4、清算费用的来源和支付方式

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

5、私募基金财产清算剩余资产的分配

（1）依据基金清算报告，从清算财产中支付本基金合同终止时已计提但尚未支付的管理费用、托管费和服务费等。全部剩余资产扣除清算费用后，按基金份额持有人持有的基金份额比例以现金形式进行分配，本基金合同另有约定的除外。如本基金清算时出现基金财产不足以支付各项费用及负债的情况，基金管理人应当向基金托管人和基金服务机构补足本基金应支付而未支付的基金托管费和基金服务费。

（2）本基金进入清算程序后，不得以私募基金名义新增募集、投资等与清算无关的经营活动，基金管理人应对本基金持有的全部资产进行不可逆变现。因基金管理人新增投资造成基金财产损失的，基金管理人应自行承担相应责任，基金托管人对此不承担任何责任。

如本基金合同终止时有未能流通变现的资产，基金管理人与基金托管人按照清盘公告约定计提管理费、托管费和服务费等费用，并继续按本基金合同约定的估值方法进行估值。基金管理人在该资产可流通变现时应及时变现，在支付相关费用后按基金份额持有人持有的基金份额比例进行再次分配并履行相应的告知义务，直至所有基金资产全部清算完毕。

（3）清算期间，任何当事人均不得运用基金财产。清算期间的收益归属于基金财产，发生的保管费用由被保险的基金财产承担。因基金份额持有人原因导致基金资产无法转移的，基金托管人和基金管理人可以在协商一致后按照有关法律法规进行处理。

（4）基金到期日（含提前终止日），非现金类资产的保管和转移由基金管理人及基金份额持有人自行负责，并承担全部责任。

6、私募基金财产清算报告的告知安排

仅用于合格投资者查看

清算过程中的有关重大事项须及时报告基金份额持有人。基金管理人应当在基金清算程序开始后及时完成可变现的全部资产的不可逆变现，并编制基金清算报告。经基金托管人复核清算报告中财务数据后，由基金管理人向基金份额持有人披露。**基金份额持有人在此同意，上述报告不再另行审计，法律法规或监管机构要求必须进行审计的除外。**

7、私募基金财产清算账册及文件的保存

私募基金财产清算账册及文件由基金管理人保存 10 年以上。

（二）私募基金财产相关账户的注销

私募基金财产清算完毕后，基金管理人注销其负责开立的各类投资交易的资金账户及其下挂的证券账户、期货交易编码等，基金托管人注销其负责开立的基金的托管账户等，在此过程中相互应给予必要的配合。

（三）清算未尽事宜

本基金合同中关于基金清算的未尽事宜以清算报告或基金管理人公告为准。

二十一、违约责任

（一）基金管理人、基金托管人在履行各自职责的过程中，违反法律法规的规定或者本基金合同约定，给基金财产或者基金份额持有人造成损害的，应当分别对各自的行为依法承担赔偿责任；因共同行为给基金财产或者基金份额持有人造成损害的，应当承担连带赔偿责任。基金托管人承担的最大赔偿责任以其在本基金合同项下收取的费用为限。

但发生下列情况的，当事人可以免责：

1、在本基金合同成立之日后发生的不可抗力事件，导致合同当事人无法全部履行或部分履行本基金合同的，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基金合同时，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基金合同，该方不能减轻或免除相应责任。

2、基金管理人和/或基金托管人按照当时有效的法律法规或监管机构的规定作为或不作为而造成的损失等。

3、基金管理人由于按照本基金合同约定的投资原则行使或不行使其投资权

仅用于合格投资者查看

而造成的损失等。

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

5、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。

6、基金管理人、基金托管人对由于第三方（包括但不限于交易所、中国证券登记结算有限责任公司、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。

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基金投资者自身违法违规原因明确告知基金管理人，致使基金财产发生违规投资行为的，基金管理人及基金托管人均不承担任何责任。

（二）在发生一方或多方违约的情况下，在最大限度地保护基金份额持有人利益的前提下，本基金合同能继续履行的，应当继续履行。

（三）本基金合同一方当事人造成违约后，其他当事人应当采取适当措施防止损失的扩大；没有采取适当措施致使损失扩大的，不得就扩大的损失要求赔偿。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。

（四）因一方当事人违约而导致其他当事人损失的，基金份额持有人应先于其他受损方获得赔偿。

（五）由于基金管理人、基金托管人不可控制的因素导致业务出现差错，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现错误的，由此造成基金财产或基金份额持有人损失，基金管理人和基金托管人可以免除赔偿责任。但是基金管理人和基金托管人应积极采取必要的措施消除或减轻由此造成的影响。

（六）基金托管人仅承担本基金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宣传推介、承诺投资收益等违规活动。

（七）一方依据本基金合同向另一方赔偿的损失，仅限于直接损失。

仅用于合格投资者查看

二十二、争议处理

（一）争议处理方式

有关本基金合同的签署和履行而产生的任何争议及对本基金合同项下条款的解释，均适用中华人民共和国法律法规。

凡因本基金合同引起的或与本基金合同有关的任何争议，由合同当事人通过友好协商解决，协商不成时，均有权向托管人住所地有管辖权的人民法院提起诉讼，并由败诉方承担相对方为维护自身合法权益支付的一切合理费用，包括但不限于诉讼费、保全费、公证费、公告费、鉴定费、拍卖费、差旅费、通讯费、律师费等。

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

（二）文书送达

本基金合同各方在“本基金合同当事人的基本情况”所列明的通讯地址（以下称为“送达地址”）可用于接收对方或人民法院/仲裁机构发送的各类信函、法律文书（以下统称“文书”），并持续适用于本基金合同履行期间、人民法院/仲裁机构审理和执行期间。

本基金合同当事人或人民法院/仲裁机构为合同的履行、变更、解除和争议解决，按送达地址向各方邮寄相关文书时，若因各方确认的上述送达地址不准确、有变更未及时书面通知（含以公告方式作出的通知）、或拒绝签收等原因，导致文书未被实际接收的，文书退回之日视为送达之日，即视为实际送达。各方对上述送达地址发生变更时，应及时书面通知相对方，在相对方收到有关变更通知之前，相对方依据变更前的送达地址或方式所作出的送达视为有效。

二十三、其他事项

（一）本基金合同各方当事人应对签署和履行本基金合同过程中所接触和获取的其他方当事人的数据、信息和其他涉密信息承担保密义务，非经其他方当事人同意，不得以任何方式向第三人泄露或用于非本基金合同之目的（法律法规或司法监管机构另有规定、审计需要及本基金合同约定的情形除外）。本保密义务不因基金合同终止而终止。

仅用于合格投资者查看

（二）基金管理人同意：在其受到（或可能受到）任何制裁和管制机构制裁或管制的情况下，或因制裁或管制的原因被制裁和管制机构调查、处罚或起诉的情况下，应立即通知基金托管人，并与基金托管人积极沟通协商解决或替代方案。在基金托管人需要时，配合基金托管人或其委托中介机构开展的经济制裁与出口管制合规尽职调查，及时提供所需的协助和回复，并将提供基金托管人或其委托中介机构合理要求的相关信息和文件资料，必要时可对基金管理人的业务场所进行访问或对基金管理人员工进行访谈。

（三）如果根据制裁和管制法，该些制裁和管制法包括但不限于交易各方所在地、履行合同相关地、美国、英国、中国内地和香港等司法管辖区以及联合国、欧盟等国际组织关于制裁和出口管制的有关法律法规、决议、指令、命令，存在以下基金合同各方当事人控制以外的情况，均属于本合同项下的不可抗力事项之一：

1、任何一方或相关国家与地区被有权实施经济制裁或出口管制的政府机构或国际组织（以下简称“制裁和管制机构”）制裁或管制；

2、任何一方继续履行本合同的义务可能导致违反制裁和管制法；

3、基于制裁和管制法的规定任何一方无法、不可能、受妨碍或延误履行本合同的义务。

（四）除本基金合同另有约定外，任何与本基金合同有关的通知、报告应以书面形式作出。本基金合同各方在“本基金合同当事人的基本情况”所列明的邮箱及通讯地址及本基金合同约定的其他信息传递方式均被视为有效。

（五）其他涉及基金合同各方当事人之间权利义务关系的任何文件或表述，如与本基金合同不一致或有冲突，均以本基金合同为准。

本基金合同如有未尽事宜，由合同当事人各方按有关法律法规规定协商解决。

（六）本基金合同一式叁份，基金管理人、基金托管人和基金投资者各持壹份。

仅用于合格投资者查看

本页无正文，为《和美卓越私募证券投资基金基金合同（第三版）》签署页

基金投资者签署声明：本人已阅读了本基金合同，并已特别注意字体加黑、加粗、加大、下划线或外框等以特别标识提示注意的内容，且在签署本基金合同时，基金管理人、基金托管人已对本人做了相应说明。对于未能理解的合同条款，本人应当主动通过本基金合同载明的联系方式或其他可以联系到管理人或托管人的方式向其进行咨询。本人对基金合同所有条款不存在任何疑义和歧义，并对各方有关权利、义务和责任已准确无误理解。

基金投资者：　　（签章）

法定代表人/执行事务合伙人或授权代理人：

基金管理人：深圳市多和美投资顾问有限公司（章）

法定代表人/执行事务合伙人或授权代理人：

基金托管人：[redacted]证券股份有限公司（章）

法定代表人或授权代理人：

签署日期：　　年　　月　　日

仅用于合格投资者查看

附件一：基金认/申购单

（重要提示：本《认/申购单》仅供基金投资者向基金管理人或其委托的销售机构提交基金认/申购申请所用，认/申购单所填内容由基金投资者、基金管理人或其委托的销售机构自行确认，本《认/申购单》的填写不影响本基金合同的法律效力。基金管理人或其委托的销售机构有权自行变更《基金认/申购单》格式和填写要素，但应至少保留可以识别基金投资者身份信息和认/申购金额等购买本基金和确认基金份额所必须列明的基本信息，《基金认/申购单》以基金投资者在基金管理人或其委托的销售机构处认/申购时所填写的格式和内容为准，基金托管人及基金服务机构不承担任何责任。《基金认/申购单》可以采用电子文件形式签署，并与纸质文件形式签署具有同等法律效力。）

和美卓越私募证券投资基金		
一、基金投资者信息		
名称：		
证件类型：		
证件号码：		
地址：		
联系方式：		
认/申购金额：	大写：人民币 （ ）元整	
	小写:¥( )	
二、基金投资者账户信息		
账户名称：		
账号：		
开户银行：		

投资者签名：

日期：

仅用于合格投资者查看