

版本号：【20211110HT0031-05-00】

# 竹润乐鑫量化精选 1 号私募证券投资基金

## 基金合同

(2025 年 3 月版)

**基金管理人：上海竹润投资有限公司**

**基金托管人：中信建投证券股份有限公司**

### **重要提示**

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但投资者购买本基金并不等同于将资金作为存款存放在银行或其它存款类金融机构，基金管理人并不保证基金一定盈利，也不保证投资者的投资本金不受损失、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。**基金管理人的过往业绩并不代表未来业绩，也不代表基金管理人就本基金做出的任何承诺、保证等。**

本合同将按中国证券投资基金业协会的规定提请备案，但中国证券投资基金业协会接

---

受本合同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，不构成对基金管理人投资能力和持续合规情况的认可，也不作为对私募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。

管理人委托运营服务机构为本基金提供基金运营服务，管理人应依法承担的责任不因运营服务的外包而免除。

**根据《私募投资基金募集行为管理办法》，由基金管理人负责本基金募集工作，履行相应募集程序，并对投资者签署基金合同等法律文件真实性准确性完整性、募集行为合法合规性等负责，基金托管人和运营服务机构对基金募集行为不承担任何审核监督职责。基金管理人不因委托代销机构募集私募基金而免除基金管理人依法承担的责任。**

基金管理人提醒投资者基金投资的“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，由投资者自行承担。

# 竹润乐鑫量化精选1号私募证券投资基金风险揭示书

尊敬的投资者：

投资有风险。当您/贵机构认购或申购【竹润乐鑫量化精选1号私募证券投资基金】（下称“本基金、基金”）时，可能获得投资收益，但同时也面临着投资风险。您/贵机构在做出投资决策之前，请仔细阅读本风险揭示书和《竹润乐鑫量化精选1号私募证券投资基金基金合同（2025年3月版）》（下称“基金合同”），充分认识本基金的风险收益特征和产品特性，认真考虑基金存在的各项风险因素，并充分考虑自身的风险承受能力，理性判断并谨慎做出投资决策。除经金融监管部门批准设立的金融机构和《私募投资基金募集行为管理办法》第三十二条第一款所列投资者可以不签署本风险揭示书外，其他所有投资者均应签署本风险揭示书。

根据有关法律法规，基金管理人【上海竹润投资有限公司】及投资者分别作出如下承诺、风险揭示及声明：

## 一、基金管理人承诺

（一）基金管理人保证在募集资金前已在中国证券投资基金业协会（以下简称基金业协会）登记为基金管理人，并取得管理人登记编码。

（二）基金管理人向投资者声明，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。

（三）基金管理人保证在投资者签署基金合同前已（或已委托基金代销机构）向投资者揭示了相关风险；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；已向私募基金投资者说明有关法律法规，说明投资冷静期的制度安排、投资者的权利以及基金不适用回访制度的安排。

（四）基金管理人承诺按照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理运用基金财产，不保证基金财产一定盈利，不保证最低收益，也不保证本金不受损失或者限定损失金额和比例。

（五）基金管理人承诺遵循专业化运营的原则，除法律法规另有规定外，不得从事私募投资基金以外的业务。基金管理人保证按照诚实信用、勤勉尽责原则切实履行本基金受托管理职责，不得将应当履行的受托人责任转委托。

（六）私募基金管理人承诺根据《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》等要求，负责信息披露备份系统投资者查询账号的维护和管理，及时办理账号的开立、启用、修改和关闭。

（七）私募基金管理人承诺已在基金合同中约定基金管理人客观上丧失继续管理私募基金能力和资格的情形下的基金财产安全保障、维持基金运营或清算的应急处置预案和纠纷解决机制。基金管理人承诺，基金管理人对本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。已注销管理人资格的基金管理人应当根据《证券投资基金法》、协会相关自律规则和基金合同的约定，妥善处置本基金财产，依法保障投资者的合法权益。

## 二、风险揭示

### （一）特殊风险揭示

#### 1、基金合同与基金业协会合同指引不一致所涉风险

本基金合同是基于基金业协会发布的《私募投资基金合同指引1号（契约型私募基金合同内容与格式指引）》（以下简称《合同指引》）而制定的，如本基金的投资范围、产品结构等存在特殊约定而无法完全适用基金业协会发布的合同指引，虽然基金管理人

将在本风险揭示书中进行特别揭示，并在基金合同报送基金业协会备案时出具书面说明，但仍可能因该等特殊约定与基金业协会合同指引不一致，对投资者权益造成影响。

## **2、私募基金委托募集所涉风险（如有）**

基金管理人可委托已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基金销售机构为本基金提供募集服务，若销售机构不符合监管部门规定的资质要求、或不具备提供相关服务的条件和技能、或发生管理不善、操作失误等，或存在公开或变相公开宣传、虚假宣传、未履行合格投资者适当性审查义务、挪用侵占基金财产、以保本保收益引诱投资者购买私募基金产品等违法违规行为，将给基金投资者带来风险。

## **3、私募基金外包事项所涉风险**

基金管理人可将本私募基金份额登记、估值核算等应属本机构负责的事项、职责以服务外包等方式交由其他机构办理，因运营服务机构不符合金融监管部门规定的资质要求、或不具备提供相关服务的条件和技能、或因管理不善、技术系统故障、操作失误等，可能给基金投资者带来一定的风险。基金管理人依法应承担的职责不因委托运营服务机构而免除，投资者因运营服务机构导致的损失应向管理人直接追偿。

本基金管理人委托运营服务机构的，运营服务机构仅根据与基金管理人签署的运营服务协议（以实际签署的协议名称为准）约定的范围提供基金运营服务，不对本基金投资运作是否规范承担任何监督职责。

## **4、私募基金未在中国证券投资基金业协会履行备案手续所涉风险**

根据《合同指引》的规定及本合同约定，本基金募集完毕后，基金管理人应当向基金业协会办理基金备案手续。本基金在基金业协会完成备案后方可进行投资运作（临时投资除外）。因备案所需时间无法准确预估且投资者在此期间无法及时赎回其投资本金，本基金及投资者均存在基金备案期间错失投资机会的风险。

如本基金募集期满，不能满足基金成立条件，本基金募集期间发生的费用由基金管理人以自有财产承担，但仍存在对基金财产造成损失的潜在风险。

## **5、销售机构与基金管理人存在关联关系的风险**

基金管理人如委托销售机构作为募集机构，本基金如投资于销售机构或其关联方发行、管理的产品，或与销售机构或其关联方进行交易，此种投资、交易行为构成关联交易，虽然基金管理人将依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则按照市场公允定价进行公平交易，但仍可能存在被监管层否定的政策风险和相应的关联交易风险。若本基金投资运作中发生此类关联交易，基金管理人将及时通过约定方式向投资者进行事前、事中、事后披露。

## **6、关联交易风险**

若基金管理人运用基金财产进行关联交易，应当建立防范利益输送和利益冲突等风险控制机制，并应进行充分事前、事中信息披露，但仍可能存在未能完全遵循以基金份额持有人利益优先、平等自愿、等价有偿原则，未能完全杜绝关联方之间的利益输送，未能完全避免关联方与基金投资者之间的利益冲突，未能充分履行相关信息披露义务等相关风险。基金投资者签署本合同即表明其已经知晓且认可本基金进行关联交易时可能存在上述风险。

## **7、单一投资标的的投资风险**

本基金如主要投资单一标的，存在投资标的单一、集中度过高、流动性、投资风险无法分散的风险。

本基金如主要投资单一标的的金融产品，本基金的风险收益情况由该单一标的的投资情况决定，本基金面临的风险包括但不限于标的的管理人的经营风险和单一标的的运作风险。其中标的的管理人的经营风险指本基金所投资的标的的管理人经营不善，造成本基金投资收益下降；单一标的的运作风险包括标的的产品投资决策失误、投资经理更换、运营差错、存续期届满或由于其他原因而清盘等导致的风险。

## 8、基金维持运作机制的有关风险

基金管理人因依法解散、被依法撤销、被基金业协会公告失联、被监管机构处罚或被采取其他自律监管措施等情况导致客观上使其丧失继续管理私募投资基金的能力和资格时，为保障基金财产安全、维持基金运营、清算，本基金将通过基金份额持有人大会作出决议方式进行应急处理和纠纷解决。但若因各种原因导致本基金无法召开或无法及时召开基金份额持有人大会或基金份额持有人大会无法作出决议，则本基金的正常运营或清算无法得到保障，对基金财产造成损失的潜在风险。

本基金运作过程中，存在管理人客观丧失继续管理本基金能力的风险，尽管本合同约定了在该等情形下基金的财产安全保障、维持基金运营或清算的应急处置预案，但该等应急处置预案仍可能不能及时、有效的实施，无法完全避免基金财产或基金投资者遭受损失的风险。

基金管理人和相关当事人对本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。已注销管理人和相关当事人应当根据《证券投资基金法》、基金业协会相关自律规则和基金合同的约定，妥善处置在管基金财产，依法保障投资者的合法权益。

## 9、纠纷解决机制的风险

本基金运营过程中，本基金、基金管理人、基金托管人或基金投资者之间可能产生争议。尽管本基金合同约定了相应的争议解决机制，但该等争议解决机制不能保证争议所涉的任何一方的诉求均能得到人民法院或仲裁机构的支持，不能保证争议及时解决，也可能存在法院判决或仲裁裁决无法执行的风险。

## 10、基金募集或备案失败的风险

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。

本基金存在因管理人重大违法违规事项、不可抗力或其它原因导致本基金无法备案或备案失败的风险。

## 11、契约型私募投资基金管理人股权、非标准化资产代持等特殊风险

在本基金存续期间，当本基金投资非标准化资产（包括但不限于私募金融产品等）时，或本基金所投资的已上市公司股票因为退市等原因成为未上市公司股权时，由于本基金为契约型基金，不具备《公司法》及《公司登记管理条例》等法律法规、规范性文件要求的权利主体资格，无法以基金自身名义作为权利主体进行登记，只能采取基金管理人代为持有方式处理，基金管理人如进行不正当行为运作或违反合同约定进行运作，会对本基金投资收益产生不利影响，甚至本金发生重大损失。本基金合同的签署，即表明基金投资者已充分知悉并认可此种操作模式可能存在的潜在风险，并愿意承担此项风险。

## 12、其他特殊风险提示

### (1) 本基金的基金架构风险

**本基金不进行结构化设置，但本基金根据募集对象不同安排设置了不同类别基金份额。**本基金的份额分类安排并非结构化或分级安排，不存在一类份额为其他份额提供风险补偿的情形。不同类别基金份额资产合并运作，独立估值。因不同类别份额费用收取约定不同，可能存在不同类别的份额净值、基金份额净值各不相同的情况。基金存在整体份额净值并不代表投资者的真实收益的风险。

### (2) 本基金的投资架构的风险

在符合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

产直接投向证券类资产，或通过其他资产管理产品（含私募基金）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特定金融品种对应的投资风险，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。

### **(3) 未设预警止损线风险**

本基金未设预警止损线，在极端情况下，基金投资者投入的本金有可能出现全部损失的风险。

### **(4) 适当性相关风险**

投资者有义务保证其提供的相关信息及材料真实、准确、完整。基金管理人及其委托的代销机构评定投资者的风险承受能力、作出适当性匹配意见系基于投资者提供的相关信息及证明材料真实、准确、完整的前提下作出；如投资者提供的信息及材料不真实、不准确或不完整，存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，可能会导致投资者的风险承受能力评定、适当性匹配意见存在偏差、与实际不符的风险，基金管理人及其委托的代销机构若发现以上情况，有权拒绝为投资者提供服务或拒绝确认投资者的交易申请、业务申请，相关风险、责任、损失由投资者自行承担。

基金管理人及其委托的代销机构禁止其工作人员为影响评估结果在投资者填写基本信息表、风险承受能力评估问卷时进行提示、暗示、诱导。投资者知晓基金管理人及其委托的代销机构工作人员存在前述行为，仍遵照配合致使所提供的信息及材料不真实、不准确、不完整，或存在虚假记载、误导性陈述、重大遗漏等情形的，视为投资者违反其应履行的适当性义务，投资者应承担由此产生的后果、损失、责任。

投资者在其信息发生重要变化、可能影响基金管理人及其委托的代销机构对其作出的投资者类别划分、风险承受能力认定时，应主动告知基金管理人及其委托的代销机构，以便基金管理人及其委托的代销机构作出调整，届时投资者的交易或者购买产品的资格可能受到影响，进一步购买的操作可能存在无法进行的风险。若投资者未能及时有效告知基金管理人及其委托的代销机构，则存在适当性匹配意见与实际不符的风险，相应风险、责任、损失由投资者自行承担。

投资者或产品的信息发生变化时，基金管理人及其委托的代销机构有权主动调整投资者的投资者分类、产品的风险等级以及适当性匹配意见。基金管理人及其委托的代销机构作出主动调整的，投资者的交易或者购买产品的资格可能受到影响，进一步购买的操作可能存在无法进行的风险。

### **(5) 冷静期风险**

本基金在投资者完成购买签约与划款后设置不少于 24 小时的冷静期，冷静期届满后方可确认投资者购买成功。

基金托管人和运营服务机构不审核、不监督募集机构是否按照基金合同约定真实、准确、完整地设置或执行投资冷静期程序，如募集机构未真实、准确、完整地按照基金合同约定设置或未真实、准确、完整地执行投资冷静期程序，可能存在基金募集机构确认投资者购买基金份额的结果与投资者真实意愿不一致的风险。如投资者未在冷静期内及时提出购买本基金的异议等原因导致投资者的购买行为生效，投资者负有履行本合同约定义务的风险。

### **(6) 基金托管人监督范围未能覆盖基金全部投资运作事项的风险**

本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，基金托管人仅根据基金合同第十二章“私募基金的投资”中对投资范围、投资限制的有关约定进行事后监督，其中对于投资范围和投资限制中明确由基金管理人负责监督（或控制）的条款托管人不承担监督职责，除本合同明确约定由基金托管人对上述事项进行监督外，基金托管人对于其他事项不予监督，基金管理人违反相关投资目标、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、预警止损控制及嵌套层级等要求的，相关责任和损失由基金管理人承担，基金托管人不承担相关责任和损失。对于托管人不承担监督职责的事项，该类投资行为将严重依赖于基金管理人的自律管理，请投资者仔细阅读本合同，明确托管人的监督范围及可能带来的风险。

#### **(7) 基金管理人披露基金信息不实的风**

本基金基金托管人依照本合同约定仅对基金管理人（或其委托的运营服务机构）编制的基金份额净值、基金份额申购赎回价格、基金定期报告中的财务数据和定期更新的招募说明书（如有）中的基金财务数据进行复核。基金托管人对于基金非财务数据不承担任何复核职责，基金管理人负责确保披露的基金非财务数据的真实、准确、完整。

基金托管人对基于基金管理人提供的信息形成的报告、意见、公告等材料，对管理人提供的该等信息不承担真实性、有效性、合法性的审查责任。基金管理人披露基金信息不真实、不准确、不完整而产生的责任由基金管理人自行承担。

#### **(8) 公布净值不能反映实时净值的风险**

本基金存续期间基金管理人应按基金合同约定的估值时间、估值方法和估值频率向基金投资者提供经基金托管人复核的基金份额净值。由于计算、复核、公布流程需要时间，因此基金投资者收到的基金份额净值并不是实时净值，可能存在一定的滞后性，该净值也可能因估值方法不公允而不能真实反映基金净值，可能给基金投资者带来一定风险。

#### **(9) 以电子签名方式签署本基金合同的特别风险**

本基金合同采用电子签名方式签署的，如因签约系统故障、设备故障、通讯故障等突发事件导致投资者电子签名无效或无法电子签署，投资者可能面临基金认购/申购失败的风险。此外，若投资者未能妥善保管与身份认证有关的设备、资料以及登录密码、交易密码等相关信息的，也存在投资者电子签名被盗用的风险。

#### **(10) 临时开放日风险**

本基金存续期间如可设置临时开放日，可能存在基金净值的波动影响基金投资运作或基金赎回价格的不公允，从而导致基金投资者损失的风险。本基金因合同变更而设置的临时开放，份额持有人不同意合同变更又不申请赎回所持有的全部基金份额的，基金管理人有权对其持有的全部基金份额作强制赎回处理。基金托管人和运营服务机构不审核、不监督基金管理人是否通知投资者以及是否以约定方式及时、真实、准确、完整通知投资者临时开放日事宜。如因基金管理人未告知或未及时、真实、准确、完整全面告知投资者临时开放日事项或投资者未及时关注相关临时开放通知，可能存在部分基金投资者不能及时赎回的风险。

#### **(11) 私募基金业绩报酬安排所涉风险**

若根据基金合同约定，基金管理人可按照合同约定计提和收取业绩报酬。基金管理人计提和收取业绩报酬后，即使基金后续运作中出现亏损，基金管理人无义务退还业绩报酬。

若根据基金合同约定，投资者赎回基金份额时，基金管理人可按照单人单笔方式计算和收取业绩报酬，可能存在投资者虽整体投资亏损，但因部分赎回份额有盈利，管理人对盈利部分赎回份额仍然计提和收取了业绩报酬的情况。

若根据基金合同约定，基金管理人可在分红时提取业绩报酬的，业绩报酬将从向份额持有人分配的分红资金中扣除且不超过分红资金。鉴于收益分配方案由基金管理人自主决定，可能存在因业绩报酬在分红资金中占比过高，导致投资者实际收到的分红资金与分配方案记载不一致，甚至分红资金全部作为业绩报酬由基金管理人收取的情况。

鉴于不同的业绩报酬提取规则在计提基准、计提时点、计提频率、信息披露要求等方面存在较大差异，提示投资者特别关注基金业绩报酬安排的有关风险。

### (12) 基金收益分配的风险

本基金的收益分配章节如约定本基金可将基金未分配利润中未实现收益部分进行分配。该等分配方式可能出现基金收益分配时基金资产未变现导致托管账户中现金不足以足额支付分红款项或收益分配后基金份额净值大幅度变化等风险，前述由于分配未实现收益导致的风险由管理人负责控制。

### (13) 关于产品名称的特别提示

本基金名称中的“量化”字样，仅作为本基金投资特殊标的和投资策略的提示，并不表明其必然作为本基金主要投资标的和投资策略，量化投资策略仅是本基金可能的投资策略之一，请投资者仔细阅读基金合同相关内容，了解本基金投资范围和投资策略，理性判断并谨慎做出投资决策。

### 13、基金管理人发生重大登记信息变更所涉风险（如有）

基金管理人的控股股东、实际控制人、普通合伙人等发生变更的，基金管理人应当按照基金业协会有关规定提交材料并履行变更手续。基金管理人发生上述重大登记信息变更期间募集资金的，基金管理人应当按照基金合同约定的方式向投资者揭示变更情况，以及可能存在无法完成变更登记和基金备案手续的合规风险。

## (二) 一般风险揭示

### 1、资金损失风险

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

本基金（含A类份额、B类份额和C类份额）属于【R5】级基金产品，适合专业投资者及风险承受能力为【C5】型的普通合格投资者。

### 2、基金运营风险

基金管理人依据基金合同约定管理和运用基金财产所产生的风险，由基金财产及投资者承担。投资者应充分知晓投资运营的相关风险，其风险应由投资者自行承担。担任基金管理人或基金托管人的机构，因停业、解散、撤销、破产，或者被中国证监会、基金业协会撤销相关业务许可、责令停业整顿等原因不能履行职责或客观上丧失继续履行职责的能力，可能给投资者带来一定的风险。

### 3、流动性风险

(1) 本基金存续期间为自基金成立之日起至本基金终止之日止。在本基金存续期内，投资者可能面临资金不能退出带来的流动性风险。

根据实际投资运作情况，本基金有可能提前结束或展期结束，投资者可能因此面临投资资金不能按期退出的风险。

#### (2) 市场整体流动性风险

证券市场的流动性受到价格、成交量、投资群体等诸多因素影响，在不同状况下，其流动性表现是不均衡的，具体表现为：在某些时期成交活跃，流动性非常好，而在另一些时期，则可能成交稀少，流动性差。在市场流动性出现问题时，本基金的操作有可能发生建仓成本增加或变现困难的情况。

#### (3) 单一证券流动性风险

由于不同投资品种受到市场影响的程度不同，即使在整体市场流动性较好的情况下，一些单一投资品种仍可能出现流动性问题，这种情况的存在使得本基金在进行投资操作时，

可能难以按计划买入或卖出相应数量的证券，或买入卖出行为对证券价格产生比较大的影响，增加投资成本。这种风险在出现期货合约和个券停牌和涨跌停板等情况时表现得尤为突出。

#### 4、税收风险

##### (1) 基金增值税计提、税款追溯调整等情况的风险

本基金运作直接相关的增值税应税项目或应税行为产生的增值税及附加由基金财产承担，在基金存续期间由于税款缴纳按一个计税周期汇总计算，每日计提的应计税额与实际缴纳税额可能存在差异，并将对估值日计算和披露的基金份额净值带来一定影响。

本基金运作过程中，所适用的税收会计处理规则可能会由于国家相关税收政策或基金管理人主管税务机关相关规定调整而发生变化，由此产生的税款追溯调整计提或未来税款计提规则调整可能会对基金财产产生影响，投资者收益可能由此受到不利影响。

(2) 契约型基金所适用的税收征管法律法规可能会由于国家相关税收政策调整而发生变化，投资者收益也可能因相关税收政策调整而受到影响。

#### 5、其他风险

##### (1) 法律与政策风险

因法律法规、监管政策等的变动可能导致本基金的投资范围、投资策略等不符合届时有效的法律法规或其他政策规定，虽然基金管理人将及时跟进法律及政策变动对本基金进行相应调整，但仍存在因法律及政策变动导致本基金遭受损失的风险。

##### (2) 发生不可抗力事件的风险

1) 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；

2) 金融市场危机、行业竞争、代理商违约等超出本基金和托管人自身直接控制能力之外的风险，也可能导致本基金投资者的利益受损。

##### (3) 技术风险和操作风险

在基金财产管理运作过程中，因基金管理人、基金托管人、证券经纪机构等合作方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，可能造成违反国家法律规定或者相关合同约定、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、内幕交易、欺诈、交易错误等。

本基金使用的主经纪商交易系统具有普通证券、期货交易所交易系统具有的全部风险，同时具有程序化自动委托等量化交易的特有风险，包括但不限于政策风险、市场风险、违约风险、技术风险、系统风险、不可抗力事件产生的风险等各种风险。

##### (4) 相关机构的经营风险

基金管理人、托管人、证券期货经纪机构、运营服务机构，如在基金存续期间无法继续从事相关业务，则可能会对基金产生不利影响。

证券及期货等经纪服务商由管理人自行聘任，经纪服务商的服务水平和服务能力由管理人自行审核并承担相应责任。管理人委托的经纪服务商应向托管人提供基金参与证券、期货等交易的相关数据、对账单及凭证。若因管理人、经纪服务商或交易所、证券结算机构、股转系统等原因导致托管人未能及时、完整、准确获得交易数据、对账单或凭证，影响托管人履行投资监督、估值核算、账目核对等职责的，可能存在造成投资者财产损失的风险。

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、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的风险。基金管理人可能还同时进行自营投资，虽然基金管理人承诺将在自营业务与资产管理业务之间采取有效的隔

离措施，但仍然存在自营业务与资产管理业务之间发生利益冲突的道德风险。

### **(三) 本基金投资标的的风险揭示**

#### **1、投资标的的所涉市场风险**

证券市场价格因受各种因素的影响而引起的波动，将使基金资产面临潜在的风险。主要包括：

(1) 政策风险。货币政策、财政政策、产业政策等国家政策的变化对证券市场产生一定的影响，导致市场价格波动，影响基金收益而产生风险。

(2) 经济周期风险。证券市场是国民经济的晴雨表，而经济运行具有周期性的特点。宏观经济运行状况将对证券市场的收益水平产生影响，从而产生风险。

(3) 利率风险。金融市场利率波动会导致股票市场及债券市场的价格和收益率的变动，同时直接影响企业的融资成本和利润水平。若基金投资此类相关资产，收益水平会受到利率变化的影响。

(4) 购买力风险。本基金投资的目的是使基金资产保值增值，如果发生通货膨胀，基金投资于证券所获得的收益可能会被通货膨胀抵销，从而影响基金资产的保值增值。

(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、财务等都会导致公司盈利发生变化，从而导致基金投资收益变化。

(6) 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时的收益率的影响。具体为当利率下降时，基金从投资的固定收益证券所得的利息收入进行再投资时，将获得较以前低的收益率。

(7) 信用风险。债券发行人违约、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，信用风险也包括因证券交易对手违约而产生的证券交割风险。

#### **2、股票等权益类资产的投资风险**

##### **(1) 参与新股申购风险**

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，具体包括：1) 网上新股申购违规风险：由于某只股票的网上申购中签率持续放大，使得本基金所持有的该股票的资产比例超过了相关法律法规或合同的有关限制所导致的风险。2) 新股申购的市场风险：即使是首发新股也存在跌破发行价的可能。

##### **(2) 非公开发行股票的投资风险**

本基金如可直接或间接投资定向增发股票，因为所直接投资或间接投资的非公开发行股票自其发行结束之日起，在约定的时间内不得转让，这段时间内市场情况或上市公司运作状况的变化，将加剧投资非公开发行股票所面临的风险，从而导致本基金财产面临损失。根据现行法律法规、监管政策、交易所规则的要求，定向增发股票锁定期满后，其减持途径和数量须符合一定限制性标准，可能难以在短期之内全部实现变现，如持有的定向增发

股票数量较大，其变现过程可能超过一年，相关收益将因此受到不利影响。定向增发股票锁定期满后，对股票进行减持过程中，因证券市场或本基金所投资股票的流动性不足，或所投资股票被停牌、终止上市等情况，可能发生股票不能及时减持进而造成损失的风险。

### **(3) 港股通股票的投资风险**

本基金如投资港股通股票，由于港股通买卖的股票存在一定的范围限制，且港股通股票名单会动态调整，基金可能面临因标的证券被调出港股通标的的范围而无法继续买入的风险。港股通股票除了具有证券市场的一般风险之外，可能面临的风险包括但不限于投资范围限制与调整风险、投资额度限制风险、投资交易时间风险、停市风险、汇率风险、交易与结算规则风险、技术系统故障风险、分级结算风险以及费用与税收风险。港股通股票的具体业务规则请以相关法律法规、证券交易所业务规则等规范为准。

### **(4) 科创板股票的投资风险**

1) 市场风险：科创板上市公司集中于新一代信息技术、高端装备、新材料、新能源、节能环保及生物医药等高新技术和战略新兴产业等领域。大多数科创板上市公司为初创型公司，公司未来盈利、现金流、估值均存在不确定性，与传统二级市场投资存在差异，整体投资难度加大，个股市场风险加大。科创板个股上市交易后前五个交易日无涨跌幅限制，第六个交易日开始涨跌幅限制在正负 20% 以内，个股波动幅度较其他股票加大，市场风险随之上升。

2) 流动性风险：科创板投资者准入门槛较高，投资者数量较少，基金资产存在无法及时或以公允价格变现及其他相关流动性风险。

3) 退市风险：科创板上市公司的退市机制比 A 股其他板块更严格，且不再设置暂停上市、恢复上市和重新上市环节。一旦所投资的科创板个股进入退市流程，将面临退出难度较大、成本较高的风险。

4) 集中度风险：科创板为新设板块，初期可投标的较少，投资者容易集中投资于少量个股，市场可能存在高集中度状况，整体存在集中度风险。

5) 政策风险：国家对高新技术产业扶持力度及重视程度的变化会对科创板上市公司带来较大影响，国际经济形势变化对战略新兴产业及科创板个股也会带来政策影响。

### **(5) 存托凭证的投资风险**

本基金如可投资国内依法发行上市的存托凭证（“中国存托凭证”），除面临市场股票的共同投资风险外，本基金还将面临中国存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险，以及与中国存托凭证发行机制相关的风险，包括存托凭证持有人与境外基础证券发行人的股东在法律地位、享有权利等方面存在差异可能引发的风险；存托凭证持有人在分红派息、行使表决权等方面的特殊安排可能引发的风险；存托协议自动约束存托凭证持有人的风险；因多地上市造成存托凭证价格差异以及波动的风险；存托凭证持有人权益被摊薄的风险；存托凭证退市的风险；已在境外上市的基础证券发行人，在持续信息披露监管方

面与境内可能存在差异的风险；境内外法律制度、监管环境差异可能导致的其他风险。

#### **(6) 全国中小企业股份转让系统挂牌公司股票（含定向增发）的投资风险**

本基金如可参与全国中小企业股份转让系统挂牌交易的公司股票投资（含参与定向增发），除面临股票的共有投资风险外，还存在包括但不限于如下特定风险：

1) 公司风险：部分挂牌公司具有规模较小，对单一技术依赖度较高，受技术更新换代影响较大；对核心技术人员依赖度较高；客户集中度高，议价能力不强等特点。部分公司抗市场风险和行业风险的能力较弱，业务收入可能波动较大。

2) 流动性风险：与上市公司相比，挂牌公司股权相对集中，市场整体流动性低于证券交易所。本基金到期后，由于挂牌公司股票变现过程中可能存在无法找到合适的交易对手，致使新三板公司股票卖出价格较低或无法及时卖出，导致本基金投资本金遭受较大幅度的损失，进而导致投资者面临投资本金遭受较大亏损的风险。

3) 信息风险：挂牌公司信息披露要求和标准与上市公司存在差异，除挂牌公司所披露的信息外，投资者还需认真获取和研判其他信息，审慎做出投资决策。

4) 两网公司及退市公司股票投资的风险：本基金如参与两网公司及退市公司股票投资，将面临包括但不限于宏观风险、政策风险、经营风险、技术风险、不可抗力因素风险、退市公司风险等特殊风险，可能导致本基金投资本金面临巨大损失。

#### **(7) 北京证券交易所股票的投资风险**

本基金如可参与北京证券交易所（简称北交所）股票投资，除面临股票投资的一般风险外，还存在包括但不限于如下特定风险：

1) 市场风险：北交所主要服务创新型中小企业，企业多处于成长期，规模可能偏小，往往具有依赖核心技术人员和供应商、客户集中度高、应对外部冲击能力较弱等特点，企业上市后的持续创新能力、收入及盈利水平等仍具有较大不确定性。北交所个股涨跌幅限制大于传统二级市场股票，个股波动幅度较其他股票加大，市场风险随之上升。

2) 流动性风险：北交所整体投资门槛较高，投资者数量较少，基金资产存在无法及时或以公允价格变现及其他相关流动性风险。

3) 股票退市（或摘牌）风险：一旦本基金所投资的北交所股票进入退市（或摘牌）流程，将面临退出难度较大、成本较高的风险。

4) 集中度风险：北交所为新设板块，初期可投标的较少，投资者容易集中投资于少量个股，市场可能存在高集中度状况，整体存在集中度风险。

5) 政策风险：国家对服务创新型中小企业扶持力度及重视程度的变化会对北交所上市公司带来较大影响，国际经济形势变化对北交所上市股票也会带来政策影响。

### **3、债券等债权类资产的投资风险**

债券等固定收益类品种除存在市场风险、信用风险和流动性风险等一般风险外，还存在其自身的特定风险，包括：

### **(1) 再投资风险**

债券偿付本息后以及回购到期后可能由于市场利率的下降面临资金再投资的收益率低于原来利率。

### **(2) 债券回购的投资风险**

本基金如可参与债券正回购、逆回购，债券正回购可以增加本基金的投资杠杆率，扩大市场风险、流动性风险、利率风险等风险，同时造成较大的基金净值波动。参与债券逆回购将增加本基金的信用风险、利息损失风险、质押券风险等。此外，回购交易也存在一定的结算风险。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。

### **(3) 非公开发行业债券的投资风险**

非公开发行业债券的发行主体一般是信用资质相对较差的企业，其经营状况稳定性较低、外部融资的可得性较差，信用风险相对较高；同时由于其财务数据相对不透明，提高了及时跟踪并识别所蕴含的潜在风险的难度。其违约风险高于现有的其他信用品种，极端情况下会给投资组合带来较大的损失。

### **(4) 资产支持证券/资产支持票据的投资风险**

资产支持证券/资产支持票据的投资风险主要包括流动性风险、利率风险及评级风险等。由于资产支持证券/资产支持票据的投资收益来自于基础资产产生的现金流或剩余权益，因此资产支持证券/资产支持票据投资还面临基础资产特定原始权益人的破产风险及现金流预测风险等与基础资产相关的风险。本基金如投资资产支持证券/资产支持票据的次级/进取级/普通级/一般级/夹层级等相似性质份额（统称次级份额），由于所投资的资产支持证券/资产支持票据优先级份额享有预期收益及资产分配的优先权，导致本基金所持有的次级份额具有高的风险，极端情况下，可能遭受全部的投资损失，因此次级份额风险会得到一定程度的放大，从而表现出高收益和高风险的特征。

### **(5) 可转债、可交换债的投资风险**

可转债、可交债的投资存在波动性风险，具体表现为可转债、可交债的价格受到其相对应股票价格波动的影响，同时可转债、可交债还有信用风险和转股风险。转股风险指相对应股票价格跌破转股价，不能获得转股收益，从而无法弥补当初付出的转股期权价值。

### **(6) 私募债（含中小企业私募债）的投资风险**

本基金如投资私募债（含中小企业私募债），风险主要包括信用风险、流动性风险、市场风险等。信用风险指发债主体违约的风险，是私募债（含中小企业私募债）最大的风险。流动性风险是由于私募债（含中小企业私募债）交投不活跃导致的投资者被迫持有到期的风险。市场风险是未来市场价格（利率、汇率、股票价格、商品价格等）的不确定性带来的风险，它影响债券的实际收益率。这些风险可能会给基金净值带来一定的负面影响和损失。

#### 4、期货及衍生品类资产的投资风险

##### (1) 期货投资风险

本基金如投资期货（如股指期货、商品期货、国债期货等），可能面临的风险包括但不限于流动性风险、合约展期风险、期货保证金不足风险、基差风险（现货价格与股指期货价格之间差额的波动）等相关风险，期货投资收益与风险具有杠杆效应。若行情向不利方向剧烈变动，本基金还可能承受超出保证金甚至基金资产本金的损失。

##### (2) 期权投资风险

期权属于高风险高收益的衍生品，期权的杠杆越高，其获利或者损失的幅度也就越大。由于高杠杆特征，当出现不利行情时，所投资期权合约品种微小的变动就可能会使本私募基金遭受较大损失。期权交易还会因参与期权合约的主体地位不同、交易策略、交易及行权限制、期权流动性等方面对本基金投资产生不利影响。

##### (3) 权证投资风险

权证是一种高杠杆投资工具，在存续期间均会与标的证券的市场价格发生互动关系，标的证券市价的微小变化可能会引起权证价格的剧烈波动，进而可能使基金财产收益受到影响。权证与绝大多数标的证券不同，有一定的存续期间，且时间价值会随着到期日的临近而递减，即使标的证券市场价格维持不变，权证价格仍有可能随着时间的变化而下跌甚至会变得毫无价值。

##### (4) 收益互换、收益凭证、场外期权、利率互换等场外衍生品投资风险

1) 政策风险。监管部门可视业务开展情况对相关政策和规定进行调整，引起场外衍生品业务相关规则、运作模式变化或者市场波动等情况，从而给本基金带来损失的风险。

2) 市场风险。因政治、经济、社会等外部环境因素对股票、股票指数、期货、交易所交易基金及其组合等场外衍生品标的资产的价格、波动率、分红或相关性等因素产生影响，可能导致场外衍生品交易的基础资产价格波动，进而导致本基金场外衍生品交易出现损失。

3) 流动性风险。场外衍生品是以证券期货市场场外衍生品交易主协议及其补充协议等标准法律文本，结合交易确认书等定制的法律文本所构成的协议群，客观上流通和转让能力较差，存在因资金头寸不足导致交易资金交收失败、产品合约结构限制无法提前终止交易，或者本基金不能以合理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) 杠杆交易风险。场外衍生品的投资收益与风险具有杠杆效应。若市场行情向不利方向剧烈变动，本基金可能承受超出保证金甚至基金资产本金的全部损失。

5) 交割失败等操作风险。场外衍生品交易可能因系统故障等原因造成交割失败，但交割失败并不必然被视为违约。交割失败可能导致本基金预期的现金流安排发生不利变化而产生风险。

6) 最大可能损失风险。场外衍生品属于高风险投资品种，交易波动性强，可能获得较高收益但也可能面临较大损失。由于存在各类风险因素，在最不利情况下，本基金投资场

外衍生品的损失总额可能达到或者超过全部初始投资金额。

7) 交易对手信用风险及违约风险。如场外衍生品交易对手因停业、解散、撤销、破产,或者被有权机构撤销相关业务许可、责令停业整顿等原因不能履行场外衍生品交易中的约定义务,或因交易对手主观不履行收益互换协议,引发交易违约的信用风险,或因期权交易对手无法按时支付期权费或股票行权收益而导致的违约风险,可能给本基金造成损失。

8) 场外衍生品估值与实际价值不一致的估值风险。目前场外衍生品公允价值形成机制尚不健全,主要由交易对手方按照相关交易协议约定定期向基金管理人和基金托管人提供场外衍生品资产净值等估值数据,基金托管人不负责对场外衍生品估值数据结果进行验证。本基金持有场外衍生品资产估值数据的准确性、公允性、及时性将面临下述不利影响:因交易对手方或计算方采用的场外衍生品定价模型、估值方法、样本、参数不适当等原因导致场外衍生品合约估值和损益产生偏差,估值数据不公允;因交易对手方或计算方发生操作风险原因导致场外衍生品估值数据错误;因交易对手方或计算方未能及时、准确、完整提供场外衍生品估值数据等原因导致场外衍生品估值数据更新不及时、估值错误或估值偏差等情况;其他可能导致场外衍生品合约估值错误或偏差的情况。本基金持有的场外衍生品估值可能与实际价值产生背离,对基金开放日净值公允性、申赎价格公允性、业绩报酬计算、基金财产计算造成严重不利影响,可能给本基金及投资者造成损失。

9) 跨境收益互换、信用违约互换等场外衍生品特定投资风险。本基金如投资跨境收益互换、信用违约互换等场外衍生品,相当于间接投资境外证券市场,因境外证券市场交易日安排、涨跌幅限制、停市制度等交易规则的不同,以及投资范围、投资额度、交易结算规则、交易系统、交易费用与税收、汇率变动等规则的不同规定均会对本基金的投资造成较大影响,此外,境内外市场交易日不完全一致可能导致基金投资标的止损操作无法及时、有效执行的风险,可能会导致本基金遭受损失。

10) 其他投资风险。由于场外衍生品的流动性,交易模式、估值方法、交易程序等方面的特殊性,本基金持有的场外衍生品资产,在极端情况下可能损失全部本金,导致本基金即使设置了预警止损机制亦无法及时、有效执行预警止损操作的情况,基金资产变现后的净值可能远低于预警线和止损线。

#### **(5) 其他衍生品投资风险**

本基金如可投资新的衍生品,由于监管部门政策调整、业务规则、运作方式等发生变化,可能给投资者带来损失的风险。新的衍生品特有的交易、市场、杠杆、估值等风险,基金可能承受超出保证金甚至基金资产本金的损失。

#### **(6) 贵金属投资风险**

本基金可能投资上海黄金交易所上市交易的贵金属合约品种,贵金属价格走势受到全球经济政策和供需影响,市场波动剧烈,并且由于保证金交易的放大作用,导致本基金财产面临损失的风险。

## 5、金融产品的投资风险

本基金如可投资公募基金、私募金融产品（包括银行理财产品、保险理财产品、集合信托计划、证券公司及其资管子公司资产管理计划、保险公司及其子公司资产管理计划、期货公司及其子公司资产管理计划、基金公司及其子公司资产管理计划、私募证券投资基金等），主要投资风险如下：

### （1）净值波动或净值与实际价值不一致的风险

本基金投资金融产品时，如因基金管理人未按约定及时向托管人提供所投金融产品的净值，有可能会造成本基金估值不及时或不准确，从而对投资者或基金资产造成损失。

根据基金合同约定的估值方法，本基金投资的私募金融产品发生如下情形之一时，可能导致本基金的净值波动风险：估值日无法及时获取私募金融产品的最新估值价格；投资私募金融产品后无法及时确认，私募金融产品在投资确认前估值价格波动；估值日取得的私募金融产品最新估值价格没有或无法排除影响估值价格的因素（例如在估值日无法排除业绩报酬对估值价格的影响）；按照估值价格与私募金融产品实际变现的金额产生差异。

### （2）流动性风险

本基金所投资金融产品的开放日可能存在与本基金的开放日不一致的情形，导致本基金存在流动性风险。

### （3）嵌套风险

本基金投资私募金融产品时，如因基金管理人未按监管要求履行穿透审核职责，可能导致本基金投资上述产品不符合监管对于嵌套的规定，从而对本基金财产造成一定不利影响。

### （4）双层收费风险

本基金的份额持有人可能需要承担双层费用，即本基金费用及本基金所投资的金融产品自身需要承担的费用，例如认购费（参与费）、赎回费（退出费）、管理费、投资顾问费用（如有）、托管费及业绩报酬（如有）等，以上费用在计提时将会扣减本基金投资的上述产品的净值，从而造成本基金净值下降。

### （5）投资金融产品形成的基金财产处于托管人控制之外的风险

金融产品及其对应的实际资产并未保管在基金托管人处并已处于托管人实际控制之外，并由基金管理人进行保管。金融产品及其对应的实际资产可能由于无托管人或其托管人或管理人（含基金管理人和金融产品管理人）保管不善导致本基金受损。

### （6）底层投资标的风险

本基金所投资金融产品最终的投资品种以该产品合同约定的投资范围为准，具体可投资标的品种包括但不限于股票、债券、期货、期权、衍生品、回购、融资融券、公募基金等各种资产，前述各种底层资产的价格波动、流动性等均会最终对本基金的净值等产生重大影响。

### **(7) 分级金融产品次级/进取级/劣后级等类似份额的投资风险**

分级基金 B 类份额、私募金融产品进取级/劣后级份额等类似份额均为高杠杆金融产品，其投资收益与风险具有杠杆效应；当出现不利行情时，本基金所投资上述产品的净值会产生较大波动从而可能导致本基金遭受较大损失的风险。极端情况下，可能遭受全部的投资损失。

### **(8) 金融产品投资方式的风险**

本基金投资私募金融产品时，可以通过认购、申购方式投资，也可以通过份额受让等方式投资。本基金如以份额受让等方式投资私募金融产品时，存在受让价格与私募金融产品相应净值背离的情况，从而对本基金财产可能造成一定不利影响。本基金托管人不负责审核本基金参与私募金融产品份额转让价格的合理性及公允性，基金份额转让价格由基金管理人负责控制和确定，托管人仅依据基金管理人投资划款指令进行划款，也不承担由此导致的任何损失。

## **6、参与转融通业务的风险**

本基金如参与证券出借的，存在无法在合约到期前收回出借证券，从而影响本基金财产使用的风险；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；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；出借证券量过大无法应对基金大额赎回的风险。

## **7、参与融资融券业务的风险**

本基金如参与融资融券业务，可能面临的风险包括但不限于，因基金管理人、基金本身、政策法律变化原因，有可能导致融资融券交易被提前终止、担保物被强制平仓等风险；由于网络、通讯线路及邮递所造成的管理人无法收到有关通知，将会面临担保物被证券公司强制平仓的风险；参与融资融券将增加交易的杠杆水平，放大交易损益和本基金净值波动，本基金可能因此获得高于普通股票交易的收益，也可能因此遭受高于普通股票交易的损失。

**本风险揭示书的揭示事项仅为列举性质，未能详尽列明投资者参与私募基金投资所面临的全部风险和可能导致投资者资产损失的所有因素，投资者对其他可能存在的风险因素也应当有所了解和掌握，并确信自己已做好足够的风险评估与财务安排，避免因参与私募基金投资遭受难以承受的损失。**

## **三、投资者声明**

作为【“竹润乐鑫量化精选 1 号私募证券投资基金”】的投资者，本人/机构已充分了解并谨慎评估自身风险承受能力，自愿自行承担投资该私募基金所面临的风险。本人/机构做出以下陈述和声明，并确认（自然人投资者在每段段尾“【\_\_\_\_\_】”内签名，机构投资者在本页、尾页盖章，加盖骑缝章）其内容的真实和正确：

**1、本人/机构已仔细阅读私募基金法律文件和其他文件，充分理解相关权利、义务、本私募基金运作方式及风险收益特征，充分理解产品架构、底层标的、募集机构与管理人存在关联关系、关联交易、资金流动性及单一标的的所涉风险，愿意承担由上述风险引致的全部后果。【\_\_\_\_\_】**

2、本人/机构知晓，基金管理人、基金代销机构、基金托管人及相关机构不应当对基金财产的收益状况作出任何承诺或担保。【\_\_\_\_\_】

3、本人/机构已通过基金业协会的官方网站（www.amac.org.cn）查询了基金管理人的基本信息，并将于本私募基金完成备案后查实其募集结算资金归集专用账户的相关信息与打款账户信息的一致性。【\_\_\_\_\_】

4、在购买本私募基金前，本人/机构已符合《私募投资基金监督管理暂行办法》有关合格投资者的要求并已按照募集机构的要求提供相关证明文件。【\_\_\_\_\_】

5、本人/机构已认真阅读并完全理解基金合同的所有内容，并愿意自行承担购买私募基金的法律风险。【\_\_\_\_\_】

6、本人/机构已认真阅读并完全理解基金合同第九章“当事人的权利和义务”的所有内容，并愿意自行承担购买私募基金的法律风险。【\_\_\_\_\_】

7、本人/机构知晓，投资冷静期的制度安排以及在此期间的权利（本私募基金不适用回访制度安排）。【\_\_\_\_\_】

8、本人/机构已认真阅读并完全理解基金合同第十二章“私募基金的投资”的所有内容，并愿意自行承担购买私募基金的法律风险。【\_\_\_\_\_】

9、本人/机构已认真阅读并完全理解基金合同第十七章“私募基金的费用与税收”中的所有内容。【\_\_\_\_\_】

10、本人/机构已认真阅读并完全理解基金合同第二十四章“争议的处理”中的所有内容。【\_\_\_\_\_】

11、本人/机构知晓，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。【\_\_\_\_\_】

12、本人/机构承诺本次投资行为是为本人/机构购买私募投资基金。【\_\_\_\_\_】

13、本人/机构承诺不以非法拆分转让为目的购买私募基金，不会突破合格投资者标准，将私募基金份额或其收益权进行非法拆分转让。【\_\_\_\_\_】

14、本人/机构知晓对于本基金涉及场外投资形成的基金财产、非标准化资产和处于托管人实际控制之外的基金资产，前述基金资产由基金管理人进行保管和履行保管职责，如基金管理人保管不善或其他不道德或不履职行为可能给本基金财产造成的损失，相关损失由基金管理人承担。【\_\_\_\_\_】

15、本人/机构知晓并完全认可，本基金由募集机构负责本基金募集工作，履行相应募集程序，并对投资者签署基金合同等法律文件真实性准确性完整性、募集行为合法合规性等负责，基金托管人对基金募集行为不承担任何审核监督职责。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。【\_\_\_\_\_】

16、本人/机构已经知悉并愿意承担以电子签名方式签署本基金合同的相关风险，认可以电子签名方式签署本基金合同的法律效力。本人/机构保证妥善保管账户信息、数字证书、账户密码等电子签约相关信息，不得将电子签约信息提供给他方或告知他人使用。本人/机构确认，任何使用其电子签约相关信息进行的签约系统操作均视为本人/机构的行为。【\_\_\_\_\_】

17、本人/机构知晓本基金可参与场外衍生品（包括但不限于收益互换、收益凭证、场外期权、利率互换等）交易，知晓场外衍生品的投资风险，知悉基金托管人不负责对外场衍生品估值数据结果进行验证。场外衍生品交易情况（包括估值信息）、交易文件应当由基金管理人明确授权交易对手方、相关交易清算机构及时、准确、完整、持续向基金托管人提供。如基金托管人收到的场外衍生品交易情况（包括估值信息）存在不及时、不准确、不完整、未持续等情形的，将导致场外衍生品估值与实际价值不一致，极端情况下，可能

对基金开放日净值公允性、申赎价格公允性、业绩报酬计算、基金财产计算造成严重不利影响，由此可能产生的重大损失后果由本人/机构自行承担，与基金托管人无关。【\_\_\_\_\_】

18、本人/机构知晓本基金可能投资资产支持证券/资产支持票据次级/进取级/普通级/一般级/夹层级或前述相似性质份额，在所投资的资产支持证券/资产支持票据次级/进取级/普通级/一般级/夹层级或前述相似性质份额中，由于所投资的资产支持证券/资产支持票据享有预期收益及资产分配的优先权，导致本基金所投资的资产支持证券/资产支持票据次级/进取级/普通级/一般级/夹层级或前述相似性质份额具有高的风险，极端情况下，可能遭受全部的投资损失，因此次级(或进取级或普通级或一般级或夹层级)风险会得到一定程度的放大，从而表现出高收益和高风险的特征。【\_\_\_\_\_】

19、本人/机构知晓基金管理人根据本合同约定的合同变更程序，主动进行合同条款变更，进行合理安排允许不同意前述合同变更的份额持有人进行赎回的，如本人/机构不同意合同变更又不申请赎回所持有的全部基金份额的，基金管理人有权对本人/机构持有的全部基金份额作强制赎回处理。【\_\_\_\_\_】

基金投资者（自然人签字或机构盖章）：

日期：

经办员（签字）：

日期：

募集机构（盖章）：

日期：

## 合格投资者承诺书

### 上海竹润投资有限公司：

本人/本单位确认符合中国证券监督管理委员会规定的私募投资基金合格投资者条件（即个人投资者的金融资产不低于 300 万元人民币或者最近三年个人年均收入不低于 50 万元人民币，机构投资者的净资产不低于 1000 万元人民币，或为监管机构认可的其他合格投资者），具有相应的风险识别能力和风险承受能力，投资资金来源合法，没有非法汇集他人资金投资私募基金，且为本人/本单位自己购买私募基金，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/本单位承诺向基金管理人提供的有关投资目的、投资偏好、投资限制、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。本人/本单位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所产生的一切责任，由本人/本单位自行承担，与贵公司无关。特此承诺。

本人/本单位的投资决定是出于为自身购买私募基金而作出的，且已通过本人/本单位的内部决策程序并已取得本人/本单位同意；本人/本单位已明确知悉私募基金转让的条件和限制。

基金投资者：

自然人（签字）：

法人或其他组织（盖章）：

法定代表人或授权代表（签章）：

日期： 年 月 日

## 投资者告知书

尊敬的投资者：

本基金通过直销机构（基金管理人）或其委托的代销机构进行基金销售。本基金的募集销售、投资者适当性管理等所有基金募集行为均由管理人或其委托的代销机构负责。因管理人或其委托的代销机构违法违规开展本基金募集行为给投资者带来损失的，由基金管理人承担。基金管理人不因委托代销机构募集私募基金而免除基金管理人依法承担的责任。

基金投资者通过【基金管理人直销渠道】认购或申购本基金的，基金投资者应当将认购款或申购款以其境内开立的自有银行账户划款至【基金管理人直销渠道】募集结算资金归集专用账户。本基金【基金管理人直销渠道】募集结算资金归集专用账户由基金管理人委托运营服务机构开立，该账户仅用于本私募基金募集期间和存续期间【基金管理人直销渠道】认购、申购和赎回资金的统一归集与支付。

【基金管理人直销渠道】募集结算资金归集专用账户由运营服务机构开立，并不代表是运营服务机构受理投资者的认购或申购资金，也不表明运营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。对于投资本基金可能产生的投资损失，由基金投资者自行承担。【基金管理人直销渠道】募集结算资金归集专用账户的使用过程中，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，运营服务机构对于基金管理人的投资运作不承担任何责任。基金管理人不因委托运营服务机构为本基金提供基金运营服务，而免除基金管理人应依法承担的责任。

【基金管理人直销渠道】募集结算资金归集专用账户信息如下：

账户名：【中信建投外包专户竹润乐鑫量化精选1号】

账号：【3110710005910007885】

开户行：【中信银行北京来福士支行】

大额支付号：【302100011421】

特别提示：基金投资者如通过基金管理人委托的代销机构渠道认购或申购本基金的，基金投资者应将认购款划入第三方募集机构指定的募集结算资金归集专用账户，该账户不在运营服务机构的监督服务范围内。投资者通过基金管理人委托的代销机构渠道缴付认购或申购资金的，无需签署本投资者告知书。

本人/本机构已认真阅读上述《投资者告知书》，清楚了解并认可关于【基金管理人直销渠道】募集结算资金归集专用账户的上述告知内容，知悉运营服务机构在本产品的运作中实际承担的职责，并愿意自行承担投资本产品可能导致的一切风险和损失。

基金投资者（承诺人）：

自然人（签字）：

法人或其他组织（盖章）：

法定代表人或授权代表（签章）：

日期： 年 月 日

## 目录

重要提示.....	2
竹润乐鑫量化精选 1 号私募证券投资基金风险揭示书.....	3
合格投资者承诺书.....	22
投资者告知书.....	23
一、前言.....	25
二、释义.....	25
三、声明与承诺.....	28
四、私募基金的基本情况.....	31
五、私募基金的分级分类安排.....	32
六、私募基金的募集.....	33
七、私募基金的成立与备案.....	37
八、私募基金的申购、赎回和转让.....	38
九、当事人的权利和义务.....	46
十、基金份额持有人大会及日常机构.....	52
十一、私募基金份额的登记.....	55
十二、私募基金的投资.....	55
十三、私募基金的财产.....	61
十四、资金清算交收安排.....	63
十五、投资指令的发送、确认和执行.....	65
十六、私募基金资产的估值和会计核算.....	68
十七、私募基金的费用与税收.....	76
十八、私募基金的收益分配.....	79
十九、信息披露与报告.....	80
二十、风险揭示.....	84
二十一、私募基金合同的效力、变更、解除与终止.....	84
二十二、私募基金的清算.....	87
二十三、违约责任.....	89
二十四、争议的处理.....	90
二十五、基金维持运作机制.....	91
二十六、其他事项.....	91

## 一、前言

(一) 订立本合同的目的、依据和原则

1、订立本合同的目的是为了明确基金份额持有人、基金管理人和基金托管人作为本合同当事人的权利、义务及职责，确保基金规范运作，保护当事人各方的合法权益。

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》”）、《私募投资基金监督管理暂行办法》（以下简称“《私募办法》”）、《私募投资基金管理人登记和基金备案办法（试行）》（以下简称“《登记备案办法》”）、《私募投资基金合同指引1号（契约型私募基金合同内容与格式指引）》（以下简称“《合同指引》”）、《私募投资基金募集行为管理办法》（以下简称“《募集行为办法》”）、《私募投资基金信息披露管理办法》、《私募投资基金命名指引》、《私募投资基金备案须知（2019版）》等有权机关颁布的有关法律、法规、部门规章、自律规则等规范性文件。若因法律法规的制定或修改导致本合同的内容与届时有效的法律法规的规定存在冲突的，应当以届时有效的法律法规的规定为准，各方当事人应及时对本合同进行相应变更和调整。

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。

(二) 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，如与本合同不一致或有冲突的，均以本合同为准。本合同的当事人包括基金份额持有人、基金管理人和基金托管人。基金份额持有人自签订本合同之日起即成为本合同的当事人。在本合同存续期间，基金份额持有人自全部赎回本基金之日起，不再是本基金的份额持有人和本合同的当事人。除本合同另有约定外，每份基金份额具有同等的合法权益。

(三) 中国证券投资基金业协会接受本合同的备案并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；不表明其对基金的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于基金没有风险。

## 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、私募基金、本基金或基金：**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，并通过投资获取收益的投资基金。本基金名称为竹润乐鑫量化精选1号私募证券投资基金。

**2、基金投资者或私募基金投资者：**指符合《私募投资基金监督管理暂行办法》第12条、第13条规定的合格投资者和符合《私募投资基金募集行为管理办法》第32条规定的特殊合格投资者

**3、本合同或基金合同：**指《竹润乐鑫量化精选1号私募证券投资基金基金合同（2025年3月版）》及其附件，以及任何对其有效的修订和补充。

**4、本合同当事人或当事人：**指受本合同约束，根据本合同享有权利并承担义务的基金管理人、基金托管人和基金份额持有人。

**5、基金管理人：**指上海竹润投资有限公司。

**6、基金托管人：**指中信建投证券股份有限公司。

**7、基金份额持有人：**指签署本合同，履行约定出资义务并且取得基金份额的基金投

资者。

**8、运营服务机构：**指根据与基金管理人签订的运营服务协议约定，接受基金管理人委托，可以为本基金提供份额注册登记、基金估值等服务的机构，本基金的运营服务机构为【中信建投证券股份有限公司】（外包业务登记编码：A00016），具体服务内容以双方签订的相关协议（以实际签署的协议名称为准）为准。

**9、募集机构：**指基金管理人以及基金管理人委托的销售机构或代销机构。**销售机构或代销机构：**指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署本基金销售服务相关协议，代为办理本基金销售业务的机构。

**10、监督机构：**接受募集机构委托，对其受托范围内的募集结算资金进行监督的机构。

**11、募集结算资金：**是指由募集机构归集的，在投资者资金账户与本基金托管资金账户之间划转的往来资金。

**12、基金业协会：**指中国证券投资基金业协会。

**13、中国证监会：**指中国证券监督管理委员会。

**14、中登公司：**指中国证券登记结算有限责任公司，包括其上海分公司和深圳分公司。

**15、募集结算资金归集专用账户：**是指募集机构提供基金服务的专用账户，用于统一归集本基金募集结算资金、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。账户类型包括【基金管理人直销渠道】募集结算资金归集专用账户和第三方募集机构指定的募集结算资金归集专用账户。本基金【基金管理人直销渠道】募集结算资金归集专用账户由运营服务机构接受基金管理人委托开立。

**16、托管资金账户、托管账户：**指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的资金。

**17、证券账户：**指根据中国证监会有关规定和中登公司等相关机构的有关业务规则，由基金管理人或基金托管人为基金财产在中登公司上海分公司、深圳分公司开设的专用证券账户、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。

**18、证券交易资金账户、证券资金账户：**指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。

**19、基金财产、基金资产：**指基金份额持有人拥有合法所有权或处分权、委托基金管理人管理并由基金托管人托管的作为本合同标的的财产。

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

**21、基金资产净值：**指本基金资产总值减去负债后的价值。

**22、基金单位净值、基金份额净值、整体份额净值：**指计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数所得的数值。

**23、各类别基金份额净值：**计算日各类别基金资产净值除以计算日对应各类别基金份额总数所得的数值。

**24、基金资产估值：**指计算、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。

**25、募集期：**指本基金成立前的募集期间。

**26、存续期：**指本基金成立日至基金终止日之间的期间。

**27、交易日：**指证券交易所、期货交易所的正常交易日。

- 28、**工作日**：指基金管理人和基金托管人办理日常业务的营业日。
- 29、**开放日（如有）**：指基金管理人办理基金申购、赎回业务的工作日。
- 30、**T日**：指本基金的认购、申购、赎回、分红、投资交易等特定行为发生日。
- 31、**T+n日**：指T日后的第n个工作日，当n为负数时表示T日前的第n个工作日。
- 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规定购买本基金份额的行为。
- 34、**赎回**：指在基金开放日（含临时开放日），基金份额持有人按照本合同的规定将本基金份额兑换为现金的行为。
- 35、**基金成立日**：指基金经过推介、募集达到法律法规规定及基金合同约定的成立条件后，募集资金到达托管账户之日。
- 36、**基金合同生效日**：指满足基金合同规定的基金合同生效条件的日期。
- 37、**基金合同终止日**：指基金合同规定的基金合同终止事由出现后，基金财产清算完毕的日期。
- 38、**基金终止日**：指基金合同规定的基金合同终止事由出现后，基金停止运作的日期。
- 39、**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。
- 40、**投资冷静期**：指自本合同签署完毕且投资者交纳认购及/或申购基金的款项后起算的不少于二十四小时，该期间内募集机构不得主动联系投资者，由投资者在该期间内认真考虑自己的投资行为。
- 41、**回访确认**：指在投资冷静期满后，募集机构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的投资回访行为。**本基金管理人**不进行回访确认。
- 42、**关联关系**：一方控制、共同控制另一方或对另一方施加重大影响，以及两方或两方以上同受一方控制、共同控制或重大影响的，该两方存在关联关系。
- 43、**关联交易**：是指私募投资基金与管理人、投资者、管理人管理的私募投资基金、同一实际控制人下的其他管理人管理的私募投资基金、或者与上述主体有其他重大利害关系的关联方发生的交易行为。
- 44、**基金份额分类**：本基金存续期内根据募集对象不同将基金份额分为A类份额、B类份额和C类份额。
- 45、**A类份额**：面向除B类、C类份额投资者以外的其他合格投资者募集的基金份额。
- 46、**B类份额**：面向除C类份额投资者以外的资产管理产品（含私募基金）及机构合格投资者募集的基金份额。
- 47、**C类份额**：面向本基金管理人、本基金管理员工、本基金管理人股东（包含直接或间接持股）、本基金管理人发行的其他私募基金、本基金管理人作为投资顾问的资产管理产品（含私募基金）募集的基金份额。

### 三、声明与承诺

#### （一）基金管理人声明与承诺

- 1、基金管理人保证在募集资金前已在基金业协会登记为基金管理人（基金管理人登记编码：【P1070287】）。基金管理人向投资者特别声明：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。
- 2、基金管理人保证已在签署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进行了充分评估。基金管理人承诺依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金财产一定盈利，也不保证投资者的投资本金不受损失或者取得最低收益或者限定损失金额和比例。

3、基金管理人承诺：基金管理人实际承担投资管理职责并将采取有效措施控制风险，不进行包括但不限于异常交易、内幕交易、操纵市场、投资顾问等第三方代为进行投资决策、违规场外配资、违反账户实名制出借账户以及违规在产品账户下设立子账户、分账户、虚拟账户、刚性兑付、开展或参与资金池业务、违反基金投资嵌套层级要求等在内的任何违法违规证券活动。

4、基金管理人保证核实投资者签署合同等法律文件真实性准确性完整性、推介私募基金，发售基金份额（权益），办理基金份额（权益）认/申购（认缴）、赎回（退出）等基金募集行为符合《私募投资基金募集行为管理办法》等有关法律法规、规范性文件的规定，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。基金管理人保证在投资者签署基金合同之前，基金管理人已向其说明有关法律法规，说明投资冷静期、回访确认（若适用）、临时开放等程序性安排以及投资者的相关权利，重点揭示基金风险，并与投资者签署风险揭示书（经金融监管部门批准设立的金融机构和特殊合格投资者可以不签署风险揭示书）。基金管理人委托基金销售机构募集私募基金的，不因委托募集免除私募基金管理人依法承担的责任。

5、基金管理人委托运营服务机构为本基金提供基金运营服务的，管理人应依法承担的责任不因基金运营服务的外包而免除。因运营服务机构违法违规、违反服务协议、技术故障、操作错误等原因给基金财产造成的损失，由私募基金管理人先行承担赔偿责任。私募基金管理人再按照相关服务协议约定与服务机构进行责任分配与损失追偿。

6、基金管理人承诺遵循专业化运营的原则，除法律法规另有规定外，不会从事私募基金以外的业务。基金管理人应当按照诚实信用、勤勉尽责原则切实履行本基金受托管理职责，不得将应当履行的受托人责任转委托。

7、基金管理人承诺，基金管理人对本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。已注销管理人资格的基金管理人应当根据《证券投资基金法》、协会相关自律规则和基金合同的约定，妥善处置本基金财产，依法保障投资者的合法权益。

## （二）基金托管人声明与承诺

1、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。基金托管人仅在本合同约定范围内履行基金财产保管职责，不保证基金财产本金不受损失或一定盈利，基金托管人不承担基金财产的投资风险。对于本基金场外投资形成的基金财产、非标准化资产和处于托管人实际控制之外的基金资产，前述基金资产由基金管理人进行保管和履行保管职责，如基金管理人保管不善或存在其他不道德或不履职行为可能给本基金财产造成的全部损失由基金管理人承担。

2、基金托管人按照本基金合同的约定，对基金管理人编制的基金资产净值、基金份额净值、基金份额申购/赎回价格以及基金定期报告中有关本基金财务数据进行复核。因基金管理人未严格按照法律法规或本基金合同约定及时向基金托管人提请复核财务数据或未及时、真实、准确、完整向本基金投资者披露本基金相关信息引起的纠纷，由基金管理人承担全部责任。

3、基金管理人对于在托管过程中提供给基金托管人的一切合同、文件等资料的真实性、有效性、合法性、准确性和完整性负责。基金托管人对以上资料仅以形式审查为限，审查

上述资料的形式合法性和表面真实性，对其真实性、有效性、合法性、准确性和完整性不作实质性审查。

4、如因基金管理人违反嵌套层级要求、违反账户实名制规定、存在场外配资或投资顾问直接下达投资指令、刚性兑付、开展或参与资金池业务等违法违规行为引致的经济责任和法律责任，均由基金管理人承担。

5、如因本基金管理人、本基金证券经纪商或期货经纪商及其他相关服务机构提供的信息不及时、不真实、不准确及不完整导致本基金估值不准确及财产损失，相关责任由前述相关方承担。

6、基金托管人承诺，如同时作为本基金管理人委托的运营服务机构，已分别设立了专门的业务团队和业务系统，并严格按照法律法规、监管机构的要求对基金托管职能和运营服务职能进行有效隔离，能够识别、管理和监控潜在的利益冲突。

7、基金托管人无投资责任，由于本基金的设计安排、管理、运作模式、嵌套层级而产生的经济责任和法律责任，均由基金管理人承担。基金托管人对任何基金管理人的投资行为（包括但不限于其投资策略及投资决定）或其投资回报不承担任何责任。基金托管人不因其提供投资监督报告而承担任何因基金管理人违规投资所产生的有关责任，亦没有义务采取任何作为或者不作为以回应任何与投资监督报告有关的信息和报道。

### (三)基金投资者的声明与承诺

1、基金投资者承诺已按《私募办法》的要求向基金管理人（或基金代销机构）披露其最终投资者并声明其符合《私募办法》、相关法律法规、证监会及本合同规定的关于私募投资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。基金投资者保证财产的来源及用途符合国家有关规定，符合有关反洗钱法律、法规的要求，不存在非法汇集他人资金投资、代持基金份额等情形，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、基金投资者保证已充分理解本合同条款，了解相关权利义务，了解有关法律法规及所投资基金的风险收益特征，愿意承担相应的投资风险，且投资事项符合其业务决策程序的要求。基金投资者确认其按照本合同约定，支付认购或申购款项的行为本身即可视为具有真实购买本基金意愿，基金投资者不得以对认购或申购用语认识不清等任何理由否认其划款行为的效力。

3、基金投资者承诺其向基金管理人提供的有关投资目的、投资偏好、投资限制、财产收入情况和风险承受能力等基本情况真实、完整、准确、合法，不存在任何重大遗漏或误导。前述信息资料如发生任何实质性变更，应当及时告知基金管理人或募集机构。基金投资者知晓并认可，基金管理人、基金托管人及相关机构未对基金财产的收益状况做出任何承诺或担保。基金投资者知晓并认可，由基金管理人负责本基金募集工作，履行相应募集程序，并对投资者签署基金合同等法律文件真实性准确性完整性、募集行为合法合规性等负责，基金托管人对基金募集行为不承担任何审核监督职责。

4、基金提前终止的特别约定。根据本基金第十章的约定，提前终止基金合同的事项应当由基金份额持有人大会通过决议的方式决定，但由于基金管理人在基金运作过程中，根据基金投资运作情况，有权决定基金是否提前终止运作，一旦基金管理人决定提前终止本基金运作，本基金将启动清算终止程序，实质上也将发生基金合同提前终止的效力。全体基金投资者同意并认可，此类提前终止基金合同事项可以由管理人根据基金运作情况自行决定，不再另行召开基金份额持有人大会通过决议。

5、基金投资者确认，基金托管人投资监督和估值核算的真实性、准确性和完整性受

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

6、基金投资者承诺已经知悉并愿意承担以电子签名方式签署本基金合同的相关风险，认可以电子签名方式签署本基金合同的法律效力。基金份额持有人保证妥善保管账户信息、数字证书、账户密码等电子签约相关信息，不得将电子签约信息提供给他方或告知他人使用。基金份额持有人确认，任何使用其电子签约相关信息进行的签约系统操作均视为基金份额持有人本人的行为。

7、本合同由投资者本人签署，如果投资者为机构的，投资者保证其法定代表人、单位负责人或其授权代表有充分和完整的授权签署本合同，并在本合同上加盖机构公章。本合同经投资者正式签署后即构成对投资者合法、有效、可执行及有约束力的法律文件。

8、基金投资者签署本合同即表明其已经知晓本基金将可能进行上述关联交易及利益冲突的情形。基金份额持有人不得因本基金投资收益劣于基金管理人、基金托管人及其关联方管理的其他类似投资产品，而向基金管理人或基金托管人提出任何损失或损害赔偿的要求。

## 四、私募基金的基本情况

### （一）基金的名称

【竹润乐鑫量化精选1号私募证券投资基金】。

### （二）基金的运作方式

【定期开放式】。

### （三）基金的投资目标

同本基金合同第十二章“私募基金的投资”约定的投资目标。

### （四）基金的投资范围

同本基金合同第十二章“私募基金的投资”约定的投资范围。

### （五）基金的存续期限

【10年】，基金管理人有权根据基金运作情况提前终止本基金。

### （六）基金的封闭期与开放日

同本基金合同第八章“私募基金的申购、赎回和转让”约定的开放日。

### （七）基金份额的初始面值

本基金份额的初始面值为1.00元，认购价格为1.00元/份。除本合同另有约定外，本基金为均等份额，每份基金份额具有同等的合法权益。

### （八）基金的托管事项

本基金的托管人为【中信建投证券股份有限公司】，基金托管人的权利和义务以本基金合同的约定为准。

### （九）基金的外包事项

本基金的运营服务机构为【中信建投证券股份有限公司】（外包业务登记编码：**A00016**）。运营服务机构有关职责和提供的具体服务内容以运营服务机构与基金管理人签订的运营服务协议（以实际签署的协议名称为准）约定为准。

## 五、私募基金的分级分类安排

### (一) 基金份额分类

管理人以募集对象作为份额类别划分标准，按照募集对象不同将基金份额分为 A 类份额、B 类份额和 C 类份额。基金份额分类安排并非结构化或分级安排，不存在一类份额为其他类别份额提供风险补偿的情形。同类别基金份额划分为均等份额，均按照本合同约定享有同等合法权益。除本合同另有约定外，各类基金份额持有人享有的权利及承担的义务均相同。如本章约定事项与本合同其他章节约定不一致的，以本合同其他章节有关约定为准。

特别约定：本合同生效之日的存续投资者所持份额按本章节约定的区分规则归入相应类别，本合同生效日前一日各类别份额日终份额净值均为本合同生效日前一日日终的基金份额净值。存续份额的分类划分，以管理人的通知为准，运营服务机构不承担复核责任。

A 类份额、B 类份额和 C 类份额的具体安排如下（以本合同对应章节约定为准）：

	A 类份额	B 类份额	C 类份额
募集对象	除 B 类、C 类份额投资者以外的其他合格投资者	除 C 类份额投资者以外的资产管理产品（含私募基金）及机构合格投资者	本基金管理人、本基金管理员工、本基金管理人股东（包含直接或间接持股）、本基金管理人发行的其他私募基金、本基金管理人作为投资顾问的资产管理产品（含私募基金）
申购费率	单笔净申购金额 < 300 万元，则申购费率为 1%；300 万元 ≤ 单笔净申购金额 < 800 万元，则申购费率为 0.5%；单笔净申购金额 ≥ 800 万元，则不收取申购费用。	单笔净申购金额 < 300 万元，则申购费率为 1%；300 万元 ≤ 单笔净申购金额 < 800 万元，则申购费率为 0.5%；单笔净申购金额 ≥ 800 万元，则不收取申购费用。	单笔净申购金额 < 300 万元，则申购费率为 1%；300 万元 ≤ 单笔净申购金额 < 800 万元，则申购费率为 0.5%；单笔净申购金额 ≥ 800 万元，则不收取申购费用。
赎回费率	持有天数 (t) < 90 日，则赎回费率为 1%；持有天数	持有天数 (t) < 90 日，则赎回费率为 1%；持有天数	持有天数 (t) < 90 日，则赎回费率为 1%；持有天数

	(t) ≥90 日, 则 不收取赎回费用。	(t) ≥90 日, 则 不收取赎回费用。	(t) ≥90 日, 则不收 取赎回费用。
<b>年管理费率</b>	1%	0.8%	0%
<b>业绩报酬 提取比例</b>	20%	16%	0%

## (二) 不同类别份额的认购、申购和赎回

管理人或其委托的销售机构应当按照本合同约定对各类基金份额分别募集、分别设置基金代码。投资者认购/申购基金份额类别的有效性以管理人的确认结果为准, 因基金份额分类不真实、不准确等产生的有关争议由管理人自行解决, 托管人及运营服务机构不承担任何责任。

基金存续期间, 管理人对不同类别份额所占比例不作限制。不同类别份额的认购、申购和赎回均不影响基金正常存续, 但因投资者赎回所有类别全部份额导致基金终止的除外。

## (三) 不同类别份额的运作及估值。

基金存续期间, 不同类别基金份额对应的基金资产分类计算, 合并运作。基金存续期间, 不同类别份额按照本合同约定单独核算份额净值, 并计算基金整体份额净值。

因不同类别份额在基金费用负担等方面有所区别, 故不同类别基金份额对应份额净值不同属于正常情况。

## (四) 投资者特别承诺

投资者签署本合同即表明其已经充分知悉并同意基金份额分类有关安排, 投资者充分知悉和理解其所持有的份额类别对应的具体权利和义务。投资者充分理解其认购/申购的份额类别与其他类别份额存在的差异, 投资者不得因其持有的份额类别收益低于其他类别份额而向管理人或托管人提出任何赔偿要求。

# 六、私募基金的募集

## (一) 基金的募集期限、募集机构和募集方式、募集对象

### 1、募集期限

本基金募集期具体时间以基金管理人的通知或其他约定方式为准。基金管理人有权根据基金募集情况延长或缩短募集期, 此类变更适用于基金管理人委托的代销机构。基金管理人延长或缩短募集期的, 应当自主通过基金管理人通知或其他约定方式告知基金投资者。基金管理人通知提前结束募集的, 本基金自通知所载日期之时起不再受理认购申请。募集期限届满本基金不能成立的, 基金募集失败。**基金托管人和运营服务机构不审核、不监督基金管理人是否以约定方式及时、真实、准确、完整通知投资者缩短或延长募集期事宜。**

### 2、募集机构和募集方式

本基金的募集机构为基金管理人(直销渠道)和基金管理人委托的代销机构。基金管

理人可以根据需要增加、变更基金代销机构。

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。基金管理人及其委托的代销机构的募集行为应当持续符合《私募投资基金募集行为管理办法》和《证券期货投资者适当性管理办法》、基金业协会适当性管理实施指引的规定。

基金管理人委托代销机构销售本基金的，代销机构应当具有基金销售业务资格，应当以书面形式签订基金销售协议（以实际签署的协议名称为准），并将协议中关于基金管理人与代销机构权利义务划分以及其他涉及投资者利益的部分在投资者签署本基金合同时一并提供给基金投资者。基金代销机构负责向投资者说明相关内容。如基金销售协议与投资者在签署本基金合同时接收到的材料中关于基金销售的内容不一致的，以投资者签署本基金合同时接收到的材料为准。

**【本基金直销机构（基金管理人）】的联系方式为：**

名称：上海竹润投资有限公司

联系地址：上海市浦东新区向城路 288 号 国华人寿金融大厦 2601、2606、2607、2608、2609 室

联系电话：17621082899

**3、募集对象**

本基金仅向符合《私募投资基金监督管理暂行办法》第 12 条、第 13 条规定的合格投资者发售，本基金的投资者不得超过 200 人。

(1) 具备相应风险识别能力和风险承受能力，投资于单只私募基金的金额不低于 100 万元且符合下列相关标准的单位和个人：

- 1) 净资产不低于 1000 万元的单位；
- 2) 金融资产不低于 300 万元或者最近三年个人年均收入不低于 50 万元的个人。

前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。

(2) 特殊合格投资者。

**基金管理人及其委托的代销机构应当在完成合格投资者确认程序后签署本基金合同。**

**特别声明：**

**基金管理人负责严格控制本基金投资嵌套层级，基金管理人委托的运营服务机构和基金托管人对于嵌套层级是否符合监管要求不承担任何监督、复核义务，也不承担因为嵌套层级不符合监管规定而导致的任何经济责任和法律责任。**

**(二) 基金的认购事项**

**1、认购价格**

本基金份额按初始面值发售，认购价格为 1.00 元/份。

**2、认购费用**

基金投资者认购本基金无需交纳认购费用。

**3、认购份额的计算方式**

认购份额=认购金额÷面值；

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

**4、认购金额**

本基金采取金额认购的方式。基金投资者认购本基金，以人民币账户转账形式交付。在直销渠道认购的投资者须将认购资金及认购费用从在中国境内开立的自有银行账户划款

至【基金管理人直销渠道】募集结算资金归集专用账户，在代销机构认购的投资者按代销机构的规定缴付资金。

投资者在募集期限的认购金额不得低于【100万元人民币】（不含认购费用，本合同“募集对象”中的“特殊合格投资者”可不受此限），并可多次认购，每次追加认购金额应不低于【1万元人民币】（不含认购费用）。

基金管理人可根据市场情况，合理调整对认购金额和追加认购金额的限制，基金管理人进行前述调整必须提前告知基金投资者。**基金管理人通过约定方式告知基金投资者前述调整事项，即视为履行了告知义务。基金托管人和运营服务机构不审核、不监督。**

#### 5、认购申请的确认

认购申请可以在冷静期满前撤销，冷静期满确认成功后的认购申请不得撤销。销售机构受理认购申请并不表示对该申请成功的确认，而仅代表销售机构确实收到了认购申请。基金管理人在募集期间每个工作日可受理的人数限制内，按照“时间优先、金额优先”的原则对冷静期满后的有效认购申请进行确认。超出基金人数规模上限的认购申请以及冷静期间撤销的认购申请为无效申请。**认购的确认以基金管理人的确认结果为准。**

**本基金不设回访确认程序。**

#### 6、付款期限

基金投资者应按照募集机构指定的日期及方式支付认购款项。认购采用全额交款方式，若资金在规定时间内未全额到账则认购不成功，视为无效申请，已交付的委托款项将退回基金投资者指定的资金账户，不计利息。签署完基金合同的投资者付款时的备注仅作为参考，不作为投资有效与否的依据。**如投资者备注不明确或错误，不影响购买意愿的真实性。基金托管人和运营服务机构不审核、不监督。**

#### 7、认购资金的管理及利息处理方式

募集期限内，投资者的认购资金应存入本基金募集结算资金归集专用账户，在基金募集期结束前，任何机构和个人不得动用，投资者认购资金所产生的利息（以同期人民银行公布的活期利率计算）不折算成份额，在基金成立后实际结息时归入基金财产。

#### 8、认购具体规定

本基金募集期间，销售机构应于上海证券交易所和深圳证券交易所的正常交易日的交易时间内受理投资者的认购申请。销售机构可以根据本机构的规则及程序确定具体的认购时间。

投资者认购本基金，须根据销售机构的要求提供本人或者其授权人的身份证明文件、授权文件、认购申请表格和认购资金汇款证明，接受销售机构的合格投资者身份调查，并签署《风险揭示书》和《基金合同》等材料。销售机构在符合本基金合同约定的前提下，可以就认购办理手续、办理时间、办理规则等另行做出规定。

销售机构对认购申请的受理并不代表该申请一定成功，投资者认购的具体金额和基金份额以基金管理人的确认结果为准。

### （三）投资冷静期

#### 1、投资冷静期的设置

(1) 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，募集机构在投资冷静期内不得主动联系投资者；

(2) 投资冷静期自基金合同签署完毕且投资者交纳认购基金的款项后起算。

#### 2、基金投资者属于以下情形的，募集机构可以不设置投资冷静期：

- (1) 特殊合格投资者；
- (2) 《证券期货投资者适当性管理办法》规定的专业机构投资者。
- (3) 法律法规、中国证监会和基金业协会规定的其他投资者。

#### **(四) 募集期间募集资金的管理**

销售机构应当在具备基金销售业务资格的商业银行、从事客户交易结算资金存管的指定商业银行或者中国证券登记结算有限责任公司开立基金的募集结算资金归集专用账户。

1、募集结算资金从投资者资金账户划出，到达本基金托管资金账户或基金财产账户之前，属于投资者的合法财产。

2、基金管理人应将基金募集期间投资者的认购资金存入专门账户，在基金募集期结束前，任何机构和个人不得动用。基金成立前，认购款在募集结算资金归集专用账户产生的利息计入基金财产，利息金额以份额注册登记机构记录为准。

3、本基金的募集结算资金归集专用账户由本基金的监督机构负责实施有效监督，并承担保障募集资金划转安全的连带责任。本基金由【基金管理人直销渠道】直销的，监督机构为【本基金的运营服务机构】。本基金由代销机构代销的，监督机构为代销机构委托的监督机构，具体内容以代销机构与其委托的其他监督机构签署的监督协议为准。

#### **4、【基金管理人直销渠道】**

(1) 基金投资者通过基金管理人直销渠道认购基金的，应将认购款划入【基金管理人直销渠道】募集结算资金归集专用账户（账户信息见《投资者告知书》）。

(2) 【基金管理人直销渠道】募集结算资金归集专用账户监督机构

中信建投证券股份有限公司作为运营服务机构，为【基金管理人直销渠道】募集结算资金归集专用账户提供管理服务，对【基金管理人直销渠道】募集结算资金实施监督。基金管理人与运营服务机构不再另行订立账户监督协议，账户监督事项以双方签订的运营服务协议的约定为准。

(3) 【基金管理人直销渠道】募集结算资金归集专用账户是运营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，并不代表运营服务机构受理投资者的认购或申购资金，也不表明运营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【基金管理人直销渠道】募集结算资金归集专用账户的使用过程中，除非有足够的证据证明是因运营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，运营服务机构对于基金管理人的投资运作不承担任何责任。

各方确认：基金管理人委托的运营服务机构不对其直销渠道以外的募集账户承担监管义务。基金投资者将投资资金划入本基金【基金管理人直销渠道】募集结算资金归集专用账户的汇出账户为投资者收益账户，基金管理人只能将【基金管理人直销渠道】募集结算资金归集专用账户中的资金定向划拨至该基金对应的托管资金账户或基金财产账户（认购、申购时）、投资者收益账户（分红、赎回、清算时）及基金管理人或基金管理人委托的代销机构的账户（划拨认购费、申购费、赎回费等在本基金合同中列明的费用时）。

#### **5、【代销机构代销渠道】**

基金投资者通过基金管理人委托的代销机构认购基金的，以代销机构发布的通知为准。

## **七、私募基金的成立与备案**

### **(一) 基金合同的签署方式**

本基金合同可采取纸质合同签署或符合《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。

### **(二) 基金成立的条件**

本基金募集期结束后，满足下列全部条件的，基金即告成立。

1、基金份额持有人人数累计不超过 200 人，由管理人负责对人数进行控制，托管人及运营服务机构不负责控制；

2、基金管理人将募集资金划入基金托管账户，初始募集资金合计不低于【100 万元人民币】，中国证监会另有规定的除外。

**基金管理人应当确保在基金业协会进行基金备案时填写的基金成立日期与募集资金到达托管账户之日一致，如不一致的，以募集资金到达托管账户之日为准，如因此造成任何损失和问题，由基金管理人自行承担或处理。**

### **(三) 基金的备案**

基金管理人应当在本基金募集完毕后 20 个工作日内，向基金业协会申请办理本基金备案手续。

私募基金备案材料完备且符合要求的，基金业协会通过网站（www.amac.org.cn）公示为私募基金办结备案手续。基金管理人应确保向基金业协会备案的基金合同及相关文件同与托管人、投资者签署的版本完全一致，否则应承担因此引发的全部后果。

### **(四) 基金备案前临时投资**

本基金备案完成后，方可进行投资运作，但本基金备案前临时投资于中国证监会认可的现金管理工具（即银行活期存款、国债、中央银行票据、货币市场基金等）除外。

### **(五) 自基金成立日起，基金托管人根据合同约定履行托管人职责。**

### **(六) 募集失败的处理方式**

本基金募集期满，不能满足上述基金成立条件，则本基金募集失败：

1、基金管理人应当以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用；

2、基金管理人应当在募集期满日起 30 个工作日内返还基金投资者已缴纳的款项，并加计银行同期活期存款利息。

3、本基金已开立基金托管账户的，如托管账户未接收募集账户划款的，基金托管人可以自行办理基金托管账户的注销；如托管账户已接收募集账户划款的，应当由基金管理人向基金托管人提交销户申请办理基金托管账户的注销。

## **八、私募基金的申购、赎回和转让**

### **(一) 申购和赎回的场所**

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

### **(二) 申购和赎回的开放日及时间**

1、基金管理人在本基金开放日办理申购、赎回本基金份额确认事宜，但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或本合同的规定通知暂停申购、赎回的除外。**基金投资者拟在当期开放日（T 日，含临时开放日）申购或赎回基金份额的，应在当期开放日截止时间前提出申购或赎回申请。业务申请受理时间以各销售机构具体通知为准。**

2、本基金的封闭期：无。

3、本基金的开放日：

### (1) 固定开放日

自本合同生效之日起，本基金固定开放日为每周二和周三（如遇非交易日均顺延至下一交易日，如顺延后开放日重叠则开放一个交易日）。

### (2) 临时开放日

本基金发生法律、行政法规、监管政策调整、基金合同变更或解除等情形的，管理人可设置临时开放日。管理人应当在临时开放日前 2 个交易日按照基金合同约定的方式通知全体投资者。

临时开放日仅办理基金份额赎回业务，管理人不得利用临时开放日安排继续认/申购（认缴）。投资者通过临时开放日赎回的基金份额，不适用本合同关于份额锁定期（如有）、预约期（如有）、封闭期（如有）和巨额赎回（如有）等约定。

(3) 基金管理人应当严格按照本合同约定设置基金开放日（含固定开放日和临时开放日），并确保及时、真实、准确、完整通知投资者临时开放日事宜。基金托管人和运营服务机构对此不承担任何审核或监督职责。

(4) 管理人更改本合同“本基金的开放日”条款中涉及时间、频率、程序以及限制事项的，管理人应当按照本合同“私募基金合同的效力、变更、解除与终止”章节中“基金合同的变更”的有关约定执行。

### (三) 出资方式及申购期限

1、本基金的申购以人民币转账形式交付，不接受现金方式申购。

#### 2、【基金管理人直销渠道】

在直销机构申购的投资者应在本次可申购开放日规定时间前将申购资金从在中国境内开立的自有银行账户划入【基金管理人直销渠道】募集结算资金归集专用账户（账户信息见投资者告知书）。投资者付款时的备注仅作为参考，不作为投资有效与否的依据。如投资者备注不明确或错误，不影响购买意愿的真实性。基金托管人和运营服务机构不审核、不监督。

#### 3、【代销机构代销渠道】

基金投资者通过基金管理人委托的代销机构申购基金的，以代销机构发布的通知为准。

### (四) 申购和赎回的原则、方式、价格及程序

1、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。

2、基金投资者申购基金时，按照当期开放日的该类基金份额净值为基准计算基金份额。基金份额持有人赎回基金时，按照当期开放日的该类基金份额净值计算赎回金额。

3、“未知价”原则，即基金的申购价格、赎回价格以当期开放日收市后计算的该类基金份额净值为基准进行计算。

4、基金份额持有人赎回基金时，基金管理人按先进先出的原则，按基金投资者认购、申购基金份额的先后次序进行顺序赎回。

5、拟在当期开放日赎回基金份额的投资者应向基金管理人提交赎回申请，基金管理人受理赎回申请的截止时间以其规定的时间为准。

6、当日赎回申请可以在当日规定时间结束前撤销。

7、申购申请可以在冷静期届满之前撤销，冷静期届满后不得撤销。

### (五) 申购和赎回申请的确认

1、对于通过申购参与本基金的基金投资者（包括首次参与以及追加参与的投资者），基金管理人及其委托的代销机构应当依据《私募投资基金募集行为管理办法》的规定，按照本基金合同第六章第（三）条的约定，履行投资者冷静期程序，并提示基金投资者在冷静期届满前有权解除基金合同。

2、在正常情况下，基金管理人在 T+2 日内对 T 日（当期开放日，含临时开放日）提交的赎回申请的有效性进行确认；在有效性确认前，管理人可在征得该赎回投资者同意的情况下适当调整其赎回申请。管理人在 T+2 日内对 T 日冷静期届满确认成功的申购申请的有效性进行确认，T+2 日（含）前撤销申购申请的，认定为申购不成功；在征得该申购投资者同意的情况下，管理人可视基金运作情况对冷静期满或不需要冷静期程序的该投资者的申购申请进行调整，包括全额或部分确认为申购不成功。若申购不成功，基金管理人应在确认不成功后 30 日内将申购款项退还给投资者。

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

4、本基金的人数规模上限为 200 人。基金管理人在申购预约登记开始后至当期开放日之前的每个交易日可受理的人数限制内，按照“时间优先、金额优先”的原则对冷静期届满的有效申购申请进行确认。超出基金投资者人数规模上限的申购申请为无效申请。

#### 5、临时开放日赎回的处理

基金份额持有人通过本基金临时开放日赎回本基金基金份额的，应当按照合同约定进行赎回，本基金管理人应当自收到基金份额持有人提出的赎回申请之日起，及时进行赎回份额的确认，并应当自赎回确认日起三个工作日内足额支付赎回款项。当发生本章第（十）条第 3 款情形时或因股票停牌等管理人以外的客观原因造成资产变现操作难以按时完成的，受影响资产应在客观原因消失后【3】个工作日内完成变现及支付。

#### （六）申购与赎回申请的款项支付

1、申购采用全额交款方式，基金投资者在提交申购申请时必须备足申购资金（含申购费）。若资金在规定时间内未全额到账则申购不成功。若申购不成功或无效，或投资者在投资冷静期内要求解除合同，基金管理人或代销机构应当将基金投资者已缴付的申购款项（含申购费）退回基金投资者指定的资金账户，不计利息。

2、基金份额持有人赎回申请确认后，基金管理人应按规定向基金份额持有人支付赎回款项，赎回款项自确认之日起 5 个工作日内支付。在发生巨额赎回时，赎回款项的支付办法按本合同和有关法律法规的规定处理。基金存在代销机构的，管理人应当自确认之日起 2 个工作日内将赎回款项从托管户最终划转至代销机构开立的募集结算资金归集专用账户；如未能在规定时间内划转相关款项，管理人应当向运营服务机构、代销机构做好解释和协调工作，并承担相关的交收责任。

3、基金管理人在不损害基金份额持有人权益的情况下可更改上述原则，但应及时告知基金份额持有人。基金管理人通过约定方式通知基金投资者前述调整事项，即视为履行了告知义务。注册登记机构对此不承担复核义务。

#### （七）申购和赎回的金额限制

1、基金投资者首次申购金额应当不低于 100 万元人民币（不含申购费用，本合同“募集对象”中的“特殊合格投资者”可不受此限）。在开放日内追加申购的，每次追加申购金额应不低于 1 万元人民币。

2、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，但赎回后持有的基金资产净值不得低于 100 万元。如投资者赎回部分基金份额后可能导致其在赎回后持有的基金资产净值不足 100 万元的，投资者应当调减赎回基金份额或者选择一次性赎回全部基金份额；基金份额持有人未申请调减赎回基金以确保满足合格投资

者条件或者未选择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（本合同“募集对象”中的“特殊合格投资者”可不受此限）。

3、基金份额持有人申请赎回基金份额时，如其持有的基金资产净值低于 100 万元，应当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。持有的基金资产净值低于 100 万元而导致剩余份额强制赎回的不受份额锁定期（如有）限制。

4、基金管理人可根据市场情况，合理调整对申购金额和赎回份额的数量限制，基金管理人进行前述调整必须提前 3 个工作日告知基金份额持有人。**基金管理人通过约定方式通知基金投资者前述调整事项，即视为履行了告知义务。**注册登记机构对此不承担复核义务。

5、基金管理人、代销机构应就“做全部赎回处理”的事项做好与基金份额持有人的沟通工作，因此引起的赎回份额纠纷，由基金管理人、代销机构自行解决并承担相关责任，注册登记机构不承担任何责任。

#### **(八) 申购和赎回的费用**

##### **1、申购费用**

**本基金申购费用收取采用外扣法，A 类份额、B 类份额和 C 类份额的申购费率标准如下：**

- (1) 单笔净申购金额 < 300 万元，则申购费率为 1%；
- (2) 300 万元 ≤ 单笔净申购金额 < 800 万元，则申购费率为 0.5%；
- (3) 单笔净申购金额 ≥ 800 万元，则不收取申购费用。

**申购费 = 净申购金额 × 申购费率**

**净申购金额 = 申购金额 ÷ (1 + 申购费率)**

其中，申购费不计入基金财产，归管理人（或销售机构）所有，管理人或销售机构有权减免。

##### **2、赎回费用**

**本基金对 A 类份额、B 类份额和 C 类份额均收取赎回费，归基金财产所有，A 类份额、B 类份额和 C 类份额赎回费率标准如下（持有天数 (t) 为自然日）：**

- (1) 若投资者赎回的基金份额持有天数：(t) < 90 日，则赎回费率为 1%。
- (2) 若投资者赎回的基金份额持有天数：(t) ≥ 90 日，则不收取赎回费用。

**如出现本合同约定的“临时开放日”情形，且投资者决定在临时开放日赎回基金份额的，该投资者无需支付赎回费用。**

**红利再投资（如有）所得份额的赎回无需支付赎回费用。**

#### **(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 = 申购金额 ÷ 申购价格**

申购价格为当期开放日该类基金份额净值。

上述公式所称申购金额不包括额外缴纳的申购费。

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。

**若基金份额申购时所对应的份额类别无历史份额净值或基金份额申购时所对应的份额类别已经全部赎回时，则以基金整体单位净值作为申购价格。**

##### **2、赎回金额计算**

**赎回金额 = 赎回份额 × 当期开放日的该类基金份额净值 - 赎回费（如有） - 管理人业绩报酬（如有）**

其中，赎回费（如有） = [赎回份额 × 当期开放日的该类基金份额净值 - 管理人业绩报酬

(如有) ]×赎回费率

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

### 3、申购、赎回资金的利息处理方式

本基金投资者申购、赎回、清算及分红资金存留募集结算资金归集专用账户期间不计息。

#### (十) 拒绝或暂停申购、暂停赎回的情形及处理

##### 1、当出现如下情形, 基金管理人可以拒绝确认基金投资者的申购申请:

- (1) 基金份额持有人达到 200 人;
- (2) 如确认该申请, 将导致本基金资产总规模超过本合同约定的上限;
- (3) 根据市场情况, 基金管理人无法找到合适的投资品种, 或出现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;
- (4) 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确认申购可能会影响或损害现有基金份额持有人利益的情形;
- (5) 基金管理人认为确认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;

- (6) 法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

基金管理人决定拒绝确认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确认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) 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确认全部或部分申购申请时, 应当以约定的形式告知基金投资者。在暂停申购的情形消除时, 基金管理人应及时恢复申购业务的办理并以约定的形式告知基金投资者。

##### 3、在如下情形下, 基金管理人可以暂停确认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开放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) 当所投资的标的因为停牌等非管理人可控原因造成无法变现的;
- (5) 证券/期货经纪服务机构未及时提供估值所需资料, 导致运营服务机构、基金托管人无法对基金资产估值的情形;
- (6) 法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一且基金管理人决定暂停赎回的, 基金管理人应当以约定形式告知基金份额持有人。已确认的赎回申请, 基金管理人应当足额支付; 如暂时不能足额支付, 应当按单个赎回申请人已被确认的赎回金额占已确认的赎回总金额的比例将可支付金额分配给赎回申请人, 其余部分在后续工作日予以支付。

在暂停赎回的情况消除时, 基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并以约定形式或其他方式告知基金份额持有人。

#### (十一) 巨额赎回的认定及处理方式

## 1、巨额赎回的认定

若本基金单个开放日内的基金份额净赎回申请(赎回申请份额总数扣除申购申请份额总数余额)超过前一交易日的基金总份额的【20%】时,即认为本基金发生了巨额赎回。

## 2、巨额赎回的处理方式

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

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

(2) 部分延期赎回:当基金管理人认为支付基金份额持有人的全部赎回申请有困难或认为因支付基金份额持有人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时,基金管理人可确认部分赎回申请,并对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请,应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例,确定当日受理的赎回份额(但未能赎回部分不足 100 万元的,应为其办理全部赎回);对于未能赎回部分,基金份额持有人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的,将自动转入下一个交易日继续赎回,直到全部赎回为止;选择取消赎回的,当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一交易日赎回申请(如有)一并处理,无优先权并以下一交易日的基金份额净值为基础计算赎回金额,以此类推,直到全部赎回为止。本基金不就延期赎回份额的相应款项计算利息。如基金份额持有人在提交赎回申请时未作明确选择,基金份额持有人未能赎回部分作自动延期赎回处理。

(3) 暂停赎回:连续 2(含)个开放日以上发生巨额赎回,如基金管理人认为有必要,可暂停确认基金的赎回申请;已经确认的赎回申请可以延缓支付赎回款项,但不得超过 20 个交易日,并应当以书面或其他形式通知赎回申请基金份额持有人。

(4) 巨额赎回的通知:当发生巨额赎回且基金管理人决定部分延期赎回或暂停赎回时,基金管理人应当在 3 个工作日内通知基金份额持有人,并说明有关处理方法。**基金管理人通过约定方式告知基金投资者前述事项,即视为履行了通知义务。基金托管人和运营服务机构不审核、不监督基金管理人是否通知投资者以及是否以约定方式及时、真实、准确、完整通知投资者发生巨额赎回及相关处理办法事宜。**

## (十二) 基金份额的转让

在不违反法律法规规定情况下,基金份额持有人所持的基金份额可在中国证监会认可的交易场所或者通过其他方式进行转让,本合同另有约定除外。基金份额受让方应当为符合监管规定及本合同约定的合格投资者,基金份额转让方在完成转让后继续持有本基金份额的,仍应符合监管规定及本合同约定的合格投资者要求,且基金份额受让后投资者人数累计不得超过法定的私募基金投资者人数上限。基金管理人将参照募集期间基金管理人或者募集机构对基金投资者的要求,对基金份额的受让方进行尽职调查、投资者适当性管理、反洗钱工作和防范利益输送的审查。基金管理人就基金份额转让协议确认后,向基金注册登记机构提供规定的相关资料,办理基金份额转让过户登记。法律法规、监管规定对基金份额转让另有规定的,从其规定。

### 1、基金份额转让的审核与报备

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

(2) 在报备时由基金管理人负责对受让方的风险识别能力和风险承担能力进行评估,并向受让方揭示基金投资风险。若经审查受让方不符合合格投资者条件,或由于本次转让

可能导致基金投资者人数超过 200 人的，基金管理人有权拒绝本次转让。

(3) 对于在受让前未持有该基金份额的投资者，其首次受让的基金份额所对应的转让价款不低于 100 万元（特殊合格投资者除外）。

(4) 基金管理人在接收报备的 10 个工作日内通知基金份额登记机构，并安排基金投资者与受让方签订私募投资基金份额转让相关协议（下称“转让协议”）。对于在受让前未持有该基金份额的投资者，还应当签署基金合同。

## **2、基金份额转让的变更登记**

(1) 基金投资者应在转让协议签订之日起 10 个工作日内，向基金管理人申请办理基金份额的转让变更登记手续，并提供各方签署的份额转让协议和基金合同（如有）。

(2) 基金管理人在收到上述申请文件后 3 个工作日内，统一向基金份额登记机构申请办理基金份额变更登记手续，并将份额转让协议的扫描件提供给基金份额登记机构，由其进行形式审核无误后，配合办理基金份额变更登记手续。

(3) 基金份额转让相关交易及变更登记申请文件的真实性及尽职调查、投资者适当性管理、反洗钱工作和防范利益输送的审查由基金管理人负责审核确认。基金份额登记机构只对收到的申请文件进行形式审查。基金份额登记机构对收到的申请文件完成形式审查，即有充分理由信赖本次基金份额转让的真实性。若因当事人提供的上述文件不合法、不真实、不完整或失去效力而影响基金份额登记机构审核或给任何第三人带来损失，基金份额登记机构不承担任何形式的责任。

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

### **(十三) 基金份额的转销售机构**

不违反法律法规，规范性文件禁止性规定前提下，基金份额持有人可以将已持有的基金份额在不同销售机构之间办理转销售机构业务，销售机构可以按照规定的标准收取转托销售机构费。如果出现基金管理人、注册登记机构、办理转销售机构因技术系统功能限制或其它合理原因，可以暂停或者拒绝基金份额持有人的转销售机构申请。

### **(十四) 基金转换**

不违反法律法规，规范性文件禁止性规定前提下，基金份额持有人可以进行基金转换，基金转换是指基金份额持有人在本基金存续期间按照基金管理人的规定申请将其持有的本基金份额全部或部分转换为本基金管理人管理的、由同一份额登记机构办理注册登记的其它私募基金份额的行为。基金管理人在本基金合同生效后为基金份额持有人办理基金间的转换业务，本基金份额转换为另外一只基金份额的，基金份额持有人需签署新的合同并遵从另外一只基金合同的相关约定。基金转换可以收取一定的转换费。基金转换的相关业务规则由注册登记机构根据相关法律法规及本基金合同的规定制定。

### **(十五) 其他情形**

#### **1、基金份额的非交易过户**

(1) 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基金份额登记机构要求提供的相关资料。

(2) 申请人办理非交易过户业务应当向基金管理人提出业务申请，向基金管理人提供注册登记机构规定的相关资料。符合条件的非交易过户申请自申请受理日起 60 日内办理。申请人按照注册登记机构的规定缴纳相关税款和费用。

#### **2、基金份额的冻结与解冻**

本基金的基金份额冻结与解冻包括但不限于人民法院、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事项。

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，基金管理人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。

## 九、当事人的权利和义务

### （一）基金份额持有人

#### 1、基金份额持有人的基本信息

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) 按照基金合同的约定申购、赎回和转让基金；
- (4) 根据基金合同的约定，参加或申请召集基金份额持有人大会，行使相关职权；
- (5) 监督基金管理人、基金托管人履行投资管理及托管义务的情况；
- (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、中国证监会及基金业协会规定的和基金合同约定的其他权利。

#### 3、基金份额持有人的义务

- (1) 认真阅读基金合同，保证投资资金的来源及用途合法；
- (2) 接受合格投资者认定程序，如实填写风险识别能力和承担能力问卷，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《私募办法》第十三条规定的除外；
- (4) 认真阅读并签署风险揭示书；
- (5) 按照基金合同约定缴纳基金份额的认购、申购款项及规定的费用，承担基金合同约定的管理费、托管费及其他相关费用；
- (6) 按照基金合同约定承担基金的投资损失；
- (7) 向基金管理人或基金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；
- (8) 保守商业秘密，不得泄露基金的投资计划或意向等；
- (9) 不得违反基金合同的约定干涉基金管理人的投资行为；
- (10) 不得从事任何有损基金及其投资者、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；
- (11) 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；

(12) 法律法规、中国证监会及基金业协会规定和基金合同约定的其他义务。

## **(二) 基金管理人**

### **1、基金管理人的基本信息**

名称：上海竹润投资有限公司

住所：上海市嘉定区安亭镇黄渡许家村许家路 209 号 4 幢 1030 室

联系人：董燕

通讯地址：上海市浦东新区向城路 288 号 国华人寿金融大厦  
2601、2606、2607、2608、2609 室

联系电话：17621082899

### **2、基金管理人的权利**

(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) 根据基金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；

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

(8) 自行担任或者委托第三方机构进行注册登记、估值核算及信息披露等业务，并对第三方机构的代理行为进行监督和检查，但基金管理人依法应当承担的责任不因委托而免除；

(9) 基金管理人有权减免归属基金管理人部分投资者的认购费、申购费、赎回费；

(10) 依据本合同及有关法律法规规定决定基金收益的分配方案；

(11) 对基金份额持有人进行尽职调查或委托代理销售机构对基金份额持有人进行尽职调查，要求基金份额持有人提供相关证明文件、资料，并在上述文件和资料发生变更时，及时提交变更后的相关文件与资料；

(12) 法律法规、中国证监会及基金业协会规定的和基金合同约定的其他权利。

### **3、基金管理人的义务**

(1) 履行基金管理人登记和私募基金备案手续；

(2) 按照诚实信用、勤勉尽责的原则履行受托人义务，管理和运用基金财产；

(3) 制作调查问卷，对投资者的风险识别能力和风险承担能力进行评估，向符合法律法规规定的合格投资者非公开募集资金；

(4) 制作风险揭示书，向投资者充分揭示相关风险；

(5) 配备足够的具有专业能力的人员进行投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；

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

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

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

(9) 按照基金合同约定接受投资者和基金托管人的监督；

(10) 对本基金场外投资形成的基金财产、非标准化资产和处于托管人实际控制之外的基金资产履行保管职责；

(11) 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)等重要文件扫描件（或复印件）（如有）；

(12) 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；

(13) 按照基金合同约定计算并向投资者报告基金份额净值；

(14) 根据法律法规与基金合同的规定，对投资者进行必要的信息披露，揭示基金资产运作情况，包括编制和向投资者提供基金定期报告；

(15) 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合同的约定；

(16) 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；

(17) 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 20 年，法律法规另有规定的，从其规定；

(18) 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；

(19) 按照基金合同的约定确定私募基金收益分配方案，及时向投资者分配收益；

(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) 建立并保存投资者名册；

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

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

(24) 本合同的签署采用纸质合同的方式进行的，妥善保管并按基金托管人要求及时向基金托管人移交基金投资者签署的基金合同原件，因基金管理人未妥善保管或未及时向基金托管人移交基金合同原件导致基金托管人损失的，基金管理人应予以赔偿；

(25) 本合同采用电子签名方式签署的，基金管理人应确保签约系统得到托管人认可，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《中华人民共和国电子签名法》等法律法规、监管规定的相关要求。

基金投资者以电子签名方式签署基金合同后，基金管理人应当按基金托管人要求的格式、内容和方式及时、准确、完整地向基金托管人发送基金投资者签署本合同的相关电子数据信息（以下简称“电子数据信息”），包括且不限于基金投资者身份信息、签约序列号、签约时间、电子协议版本号等。基金管理人应对向基金托管人发送的电子数据信息的真实性、准确性、完整性和合法合规性负责。

(26) 确保本基金的募集行为、运作行为符合相关法律法规规定；

(27) 因违反本合同导致基金财产的损失或损害基金份额持有人的合法权益时，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退出而免除；

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

(29) 基金管理人应确保本基金宣传资料真实、准确、完整，不得进行虚假宣传。基

金管理人制作的宣传材料涉及基金托管人的，仅可表述为“中信建投证券为本产品的基金托管人”，不得以基金托管人名义进行任何其他宣传，基金托管人有权对基金管理人及本基金宣传材料进行检查，基金管理人违反上述约定的，基金托管人有权向基金管理人追责；

(30) 基金管理人应当确保在基金业协会“资产管理业务综合报送平台”填报基金备案信息与本基金合同内容的一致性。并保证填报信息的真实性、准确性和完整性，并自行承担因此导致的责任。

(31) 法律法规、中国证监会及基金业协会规定的和基金合同约定的其他义务。

### **(三) 基金托管人**

#### **1、基金托管人概况**

名称：中信建投证券股份有限公司

住所：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

联系人：邱珂磊

联系电话：010-56161929

通讯地址：北京市朝阳区景辉街 16 号院 1 号楼泰康集团大厦 8 层中信建投证券托管部

#### **2、基金托管人的权利**

(1) 按照合同的约定，及时、足额获得基金托管费用；

(2) 依据法律法规规定和合同约定，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；

(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) 安全保管基金财产；

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

(3) 对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整与独立；

(4) 除依据法律法规规定和基金合同的约定外，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) 按规定开立和注销基金财产的托管资金账户、证券账户、期货账户等投资所需账户（基金管理人和基金托管人对此另有约定的，从其约定）；

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

(7) 按照法律法规的规定及基金合同的约定办理与基金托管业务有关的信息披露事项；

(8) 根据相关法律法规和基金合同约定复核基金管理人编制的基金定期报告（基金托管人仅复核基金定期报告中的财务数据），因基金管理人(或其委托的运营服务机构)未及时、全面提供基金定期报告导致托管人无法履行复核净值职责的除外；

(9) 按照基金合同约定，根据基金管理人或其授权人的划款指令，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，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移交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) 在管理人发生异常且无法履行管理职责时，托管人应当按照法律法规及基金合同约定履行托管职责，维护投资者权益；

(15) 监督基金管理人的投资运作，依据基金合同的约定发现基金管理人的投资指令违反法律法规和自律规则以及基金合同约定的，应当拒绝执行，立即通知基金管理人，并有权报告证监会（或其派出机构）或基金业协会；发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律法规及基金合同约定的，应当立即通知基金管理人，并有权报告证监会（或其派出机构）或基金业协会。

(16) 按照基金合同约定制作相关账册并与基金管理人核对。

## 十、基金份额持有人大会及日常机构

### （一）基金份额持有人大会组成

基金份额持有人的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（不区分优先、普通、进取、劣后份额）具有同等的投票权。

若将来法律法规对基金份额持有人大会另有规定的，以届时有效的法律法规为准。

本基金份额持有人大会不设置日常机构。

### （二）基金份额持有人大会的召开事由

1、当本基金出现下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会（合同其它章节另有约定除外）：

- (1) 决定延长基金合同期限；
- (2) 决定修改基金合同的重要内容或者提前终止基金合同；
- (3) 决定更换基金管理人、基金托管人或投资顾问（如有）；
- (4) 提高调整基金管理人、基金托管人和投资顾问（如有）的报酬标准；
- (5) 转换基金运作方式；
- (6) 变更基金份额持有人大会程序；
- (7) 基金管理人要求召开基金份额持有人大会；
- (8) 单独或合计持有 10%以上（含 10%）基金份额的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会；
- (9) 选举基金份额持有人代表；
- (10) 对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；
- (11) 法律法规和基金合同约定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。

针对前款所列事项，如全体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决议文件上签名、盖章。

### （三）基金份额持有人大会的运作事项

#### 1、会议召集人和召集方式

- (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) 单独或合计持有 10%以上（含 10%）基金份额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会议的，应当向私募基金管理人提出书面提议。私募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。私募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；私募基金管理人决定不召集，代表基金份额 10%以上（含 10%）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会议的，应于会议召开前 10 个工作日通知私募基金管理人，私募基金管理人有权出席基金份额持有人会议，基金份额持有人应当予以配合，不得阻碍私募基金管理人出席基金份额持有人会议。

(3) 若出现私募基金管理人被基金业协会公告失联超过 20 个工作日的情形，单独或合计持有 10%以上（含 10%）基金份额的基金份额持有人有权自行召集份额持有人大会。

(4) 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。

(5) 基金托管人对基金管理人和基金份额持有人召集持有人大会依法予以配合。

## 2、会议的召开通知

(1) 召开基金份额持有人大会，召集人应于会议召开前 10 日告知本合同各方当事人。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，由会议召集人决定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、召开会议的方式和条件

基金份额持有人大会可通过现场开会方式、通讯开会方式（视频会议、电话会议等）或法律法规或监管机构允许的其他方式召开，会议的召开方式由会议召集人确定。

(1) 现场开会。由基金份额持有人本人出席或以代理投票授权委托证明委派代表出席。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委派代表出席会议，现场会议方可举行。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) 通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以书面形式或大会公告载明的其他方式在表决截至日以前送达至召集人指定的地址。通讯开会应以书面方式或大会公告载明的其他方式进行表决。出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总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。

## 4、表决

(1) 表决事项：召集人发出召集会议的通知后，应当在基金份额持有人大会召开前及时告知基金合同各方当事人本次持有人大会的议事内容。基金份额持有人大会不得对事先未通知的表决事项进行表决。

(2) 本基金份额持有人持有的每一份基金份额（不区分优先、进取、普通、劣后份

额)拥有同等的投票权。

(3) 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 以上通过方为有效;但更换基金管理人、基金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。

(4) 基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

(5) 采取通讯方式进行表决时,除非在计票时有充分的相反证据证明,否则提交符合会议通知中规定的确认投资者身份文件的表决视为有效出席的投资者,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。

#### 5、决议的效力和披露

基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。基金份额持有人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和基金托管人之日起,对基金管理人和基金托管人有约束力。基金管理人或基金托管人拒不执行生效的基金份额持有人大会的决议的,可由基金份额持有人代表代为履行。

6、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有效的法律法规或监管部门的规定相冲突,则基金管理人经与基金托管人协商一致并提前通知后,可直接对本部分的相关内容进行修改和调整,无需召开基金份额持有人大会审议。

7、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,但出现基金管理人依法解散、被依法撤销、被基金业协会公告失联、被监管机构处罚或被采取其他强制措施等基金管理人丧失基金管理能力等情形除外。

#### 8、特别约定

(1) 基金管理人因依法解散、被依法撤销、被基金业协会公告失联、被监管机构处罚或被采取其他自律监管措施等情况导致客观上使其丧失继续管理私募投资基金的能力和资格时,为保障基金财产安全、维持基金运营、清算,本基金将通过基金份额持有人大会作出决议方式进行应急处理和纠纷解决。

(2) 如出现基金管理人依法解散、被依法撤销、被基金业协会公告失联、被监管机构处罚或被采取其他强制措施等基金管理人客观上丧失继续管理私募投资基金的能力和资格时,基金管理人以自有资金投资本基金的,其持有的基金份额对基金份额持有人大会决议事项不再享有表决权,本章节中有关持有人大会召集、表决等条款中基金份额(或称基金总份额)均是指剔除基金管理人持有的基金份额以外的基金份额(或称基金总份额)。

(3) 基金管理人以其管理的其他基金投资本基金的,基金管理人应确保已就对其他基金份额持有人具有实质性不利影响的重大事项充分征得其他基金份额持有人同意,基金管理人未征得其他基金份额持有人同意的,不影响基金管理人代表其他基金对决议事项进行投票表决的效力。

## 十一、私募基金份额的登记

### (一) 基金的注册登记业务

本基金的注册登记业务指基金的登记、存管、清算和结算业务，服务内容可以包括基金注册登记账户建立和管理、基金份额登记、基金交易确认、资金清算、权益分配、保管基金持有人名册等。

### (二) 基金注册登记办理机构

本基金的注册登记业务由基金管理人或其委托的运营服务机构办理。办理基金份额登记业务的机构基本职责可以包括：建立并管理投资者的基金账户、负责基金份额的登记及资金结算、基金交易确认、代理发放红利、保管投资者名册、法律法规或服务协议规定的其他职责。

**运营服务机构办理基金份额登记业务的，以运营服务机构与基金管理人签订的运营服务协议（以实际签署的协议名称为准）约定为准。**

### (三) 其他事项

1、基金管理人委托运营服务机构为本基金提供基金份额注册登记服务的，管理人应依法承担的责任不因基金运营服务的外包而免除。

2、本基金全体基金份额持有人同意基金管理人、运营服务机构或其他份额登记义务人按照基金业协会的规定办理基金份额登记数据的备份。

## 十二、私募基金的投资

### (一) 投资经理

本基金的投资经理由管理人指定。管理人保证投资经理下述简介内容合法、真实、准确，保证投资经理已取得基金从业资格并在基金业协会完成注册，并且不存在任何任职禁止或任职冲突的情况。

#### 1、投资经理及简介：

乐征楠先生，2013年6月毕业于华东师范大学，获金融硕士学位。2013年7月至2014年12月，历任财通证券股份有限公司研究员、投资经理；2014年12月至2016年4月，历任财通证券资产管理有限公司研究员、投资经理，2016年4月至2019年5月，任财通证券股份有限公司高级项目经理；2019年6月至今，任上海竹润投资有限公司执行董事。

乐征侨先生，2014年6月毕业于南昌大学。2014年8月至2015年11月，任北京协成友联科技有限公司投资专员，2015年12月至2017年6月，任上海南天电脑系统有限公司投资研究员，2017年7月至2018年4月，任杭州迪普科技有限公司投资研究主管，2018年5月至2020年7月，任中诚宝捷思货币经纪有限公司货币经纪人，2020年8月至今，历任上海竹润投资有限公司研究员。

#### 2、投资经理变更程序

管理人可根据业务需要自主决定变更投资经理。管理人应当在投资经理变更后按照本合同约定及时通知投资者及托管人，并保障投资者赎回的权利（如设置临时开放日允许不同意的投资者赎回）。

### (二) 投资目标

在严格控制投资风险的前提下，力争为基金投资者创造稳健的收益和回报。

### (三) 投资范围

1、国内依法发行的股票、全国中小企业股份转让系统挂牌交易的公司股票、存托凭证、

香港交易所及各类境外交易所发行（或上市或交易或允许投资）的各类投资品种和投资工具、公募证券投资基金、债券及各种固定收益类品种（包括但不限于国债、央行票据、政策性金融债、金融债、地方政府债、公司债、企业债、可转债、可交换债、分离交易的可转债、中小企业私募债、永续债、次级债、二级资本债、项目收益债、双创债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、同业存单、非公开定向债务融资工具等）、资产支持证券、资产支持票据、货币市场工具（货币市场基金等）、正回购和逆回购、债券质押式协议回购、融资融券、转融通、期货、场内期权、权证、收益互换、场外期权、报价回购、其他经国务院同意设立的交易场所交易的其他标准化交易品种和投资工具、其他监管机构认定（或允许投资）的交易品种和投资工具；

2、私募金融产品：集合信托计划、证券公司及其资管子公司资产管理计划、基金公司及其子公司资产管理计划、保险公司及其子公司资产管理计划、期货公司及其子公司资产管理计划、私募基金管理机构发行的并且有基金托管人进行托管的私募证券投资基金（含本基金管理人发行的私募证券投资基金）。

**特别约定：本基金投资金融产品时，管理人负责按照监管要求对下层资产（即标的金融产品）的投资范围进行穿透审核，确保标的金融产品的投资范围符合监管要求和本合同对其投资范围特殊约定（如有），并确保本基金投资金融产品符合嵌套层级的监管要求；本基金投资场外衍生品时，管理人负责按照监管要求对场外衍生品挂钩标的及其他事项等进行审核，确保所投资的场外衍生品符合监管要求和本合同对其特殊约定（如有）；如本基金通过份额转让等方式投资金融产品时，基金份额转让价格由基金管理人负责控制和确定。托管人对前述管理人负责事项不承担任何审核或监督职责，托管人仅依据管理人投资划款指令进行划款，也不承担由此导致的任何损失。**

本基金变更投资范围的，管理人应当按照本合同“基金合同的效力、变更、解除与终止”章节中“基金合同的变更”的有关约定执行，并保障投资者赎回的权利（如设置临时开放日允许不同意的投资者赎回）。

#### （四）投资策略

##### 1、量化投资策略

本基金主要通过机器学习模型和对股票因子特征的研究，致力于捕捉市场短期失效带来的盈利空间，在充分控制投资风险的前提下，在以下几个层面通过量化选股的投资策略进行投资，力求实现基金资产的长期、稳定增值。

（1）投资逻辑层面：在策略维度上，同时注重基本面量化模型和高频统计套利模型，并将两者进行结合。一方面，选择基本面优质且被机构看好的公司，争取赚取长期持股的收益。另一方面，通过量价因子尽量刻画股票的技术面特征，以便更准确把握股票的买卖时间点。

（2）模型层面：模型结合股票市场的高噪音和时序性的特征自主研发而成，致力于用多个子模型从不同的角度来刻画市场投资逻辑，并通过因子之间的优胜劣汰和风格轮动来捕捉市场的投资机会，提升模型对不同市场风格的普适性，尽量减少单个子模型的失效概率。

（3）Alpha 因子层面：团队维护的 Alpha 因子库覆盖股票的日频交易数据相关因子、股票定期报告衍生因子、分析师报告衍生因子、事件驱动合成因子、股票高频数据相关因子以及互联网和舆情数据因子等。

（4）策略配置层面：模型采取将低频因子和高频因子在底层训练和子模型合成两个维度进行融合，而非在策略配置层面。该方式试图保留基本面因子的多头端表现和高频因子的空头端优势，在某些市场阶段可以形成策略互补的效果，使得策略更稳健。

（5）行业配置层面：量化行业配置模型综合考虑行业的景气度、估值、资金流、价量

和机构行为等视角，由多个相关性较低、具备显著超额收益能力的子模型，形成综合的行业配置信号，以此对部分行业进行适当的高配和低配。

(6) 组合管理层面：团队运作的 Alpha 量化策略通过自主研发的风险模型和组合优化模型得到日内实时的投资组合在多个不同时间段对持仓进行调仓。在投资组合优化的过程中主要严格控制的风险因子为规模因子、Beta 因子、流动性因子、波动率因子、动量因子、反转因子、估值和行业因子等，将主要市场风险因子以及行业因子相对于基准指数的暴露程度控制在一定范围之内，动态调整投资组合。

## 2、其他策略

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，力争实现基金资产的稳步增值。

以上内容为私募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或部分投资策略的阐述，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。本基金存续期间，私募基金管理人也将根据市场情况及时动态调整相关品种的投资策略。

**特别说明：本基金投资策略的制定、执行和调整均由管理人独立负责。托管人不对管理人是否调整投资策略、是否严格按照投资策略开展基金投资运作、是否就投资策略调整履行信息披露义务等有关事项承担监督或者复核职责。**

### (五) 投资限制

本基金财产的投资组合应遵循以下限制：

- 1、按市值计算，本基金投资单一货币市场基金的市值占基金总资产的比例不超过 100%。
- 2、本基金总资产占净资产的比例不得超过 200%。
- 3、按成本计算，本基金直接持有的基础层及创新层股票合计不得超过本基金净资产的 20%。
- 4、自 2024 年 8 月 1 日起本基金开展场外衍生品交易的，应符合下列要求：

(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%，但经管理人核实并确认全部投资者均为符合中国证监会规定的专业投资者且单个投资者投资金额不低于 1000 万元（穿透认定）的封闭式私募证券投资基金除外；

**特别约定：**本基金参与场外衍生品交易的，管理人应当在该基金下一估值日前将场外衍生品交易情况、交易文件等提供给托管人。管理人签订场外衍生品交易文件时，应当明确授权由交易对手方、相关交易的清算机构在该基金下一估值日前直接向托管人提供场外衍生品交易文件并持续提供估值信息。如因管理人（或交易对手方、相关交易的清算机构

等)未提供/未及时向托管人提供前述材料或者向托管人提供虚假或不完整材料,导致基金估值结果存在不及时、不准确、不完整、未持续等情形的,全部责任由管理人承担,与托管人无关。

5、不得投资于法律法规、中国证监会规定的禁止或限制的投资事项。

托管人除依据上述投资限制中第1条的约定承担监督职责外,上述投资限制中其他全部投资限制条款均由管理人自行控制,托管人不承担监督职责。同时对于本基金投资私募基金产品/场外衍生品等时,如需要穿透进行监督的,穿透监督职责由管理人承担,托管人不承担穿透监督职责。上述投资限制中如涉及新股新债申购的申报金额与数量、盘中监控、交易策略类等监控事项的,由管理人自行监控,托管人不承担投资监督职责。

特别地,非因管理人原因导致的投资范围、投资比例及投资限制不符合法律法规规定及本合同约定的投资范围、投资比例及投资限制,为被动超标。全体投资者一致同意,发生被动超标的,不构成管理人违反合同约定的投资范围、投资比例及投资限制的情形。因被动超标而对基金财产造成的损失由基金财产承担。

发生被动超标的,管理人原则上应当自被动超标发现日起或所持流动性受限标的可变现日的20个交易日内完成调整,但本基金所持标的发生股票(含新三板)、债券等因股票退市、摘牌、上市、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、债券评级下调、债券发行人违约、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。

本基金变更投资比例限制的,管理人应当按照本合同“基金合同的效力、变更、解除与终止”章节中“基金合同的变更”的有关约定执行,并保障投资者赎回的权利(如设置临时开放日允许不同意的投资者赎回)。

#### (六) 投资禁止行为

- 1、承销证券;
- 2、违反规定向他人贷款或提供担保;
- 3、从事承担无限责任的投资;
- 4、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;
- 5、向基金管理人、基金托管人出资;
- 6、利用基金资产为基金份额持有人之外的任何第三方谋取不正当利益或者进行利益输送;
- 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) 关联交易及利益冲突的情形及处理方式

1、基金管理人可运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人、投资顾问、代销机构及其控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司发行的证券或承销期内承销的证券,但需要遵循基金份额持有人利益优先的原则和平等自愿、等价有偿的原则、防范利益冲突,在符合法律法规和监管政策的前提下,建立健全内部审批机制、评估机制及回避机制等关联交易风险控制机制,按照市场公平合理价格执行,并履行信息披露义务。

2、基金管理人可运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人、投资顾问、代销机构及其关联方或者与上述主体有其他重大利害关系的主体直接或间接管理或代理销售的、或提供投资顾问等服务的、或者该等主体持有的符合本合同投资范围规定的投资产品。但需要遵循基金份额持有人利益优先的原则和平等自愿、等价有偿的原则、防范利益冲突,在符合法律法规和监管政策的前提下,建立健全内部审批机制、评估机制及回避机制等关联交易风险控制机制,按照市场公平合理价格执行,并履行信息披露义务。

3、如本基金涉及关联交易的,基金管理人负责关联交易的报告和事前、事中披露,

以及针对关联交易的特殊决策机制和回避安排等。基金管理人应当在基金备案时提交证明底层资产估值公允的材料（如有）、有效实施的关联交易风险控制机制、不损害投资者合法权益的承诺函等相关文件。

4、合同各方确认，基金托管人不对上述关联交易有关限制的执行承担投资监督职责，不对上述关联交易是否存在利益输送、不公平交易等情形承担监督职责，基金管理人违反上述关联交易限制的，相关责任和损失由基金管理人承担，基金托管人不承担任何责任。

#### （八）风险收益特征

本基金（含A类份额、B类份额和C类份额）属于【R5】级基金产品，适合专业投资者及风险承受能力为【C5】型的普通合格投资者。

募集机构应当严格按照法律法规有关规定及募集机构内部制度规定，自行负责准确、合理评估本基金风险等级和投资者风险承受能力（包括投资者是否属于专业投资者或专业投资机构），以及根据实际情况更新评估。

募集机构更新本基金风险等级和投资者风险承受能力的，应当按照法律法规有关规定及本合同约定的方式及时通知投资者及托管人，并对更新评估后风险等级不匹配的投资者作出合理的退出安排。

#### （九）预警止损机制

本基金不设置预警止损机制。

#### （十）业绩比较基准

本基金无业绩比较基准。

#### （十一）基金托管人投资监督事项的约定

本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，基金托管人仅根据基金合同第十二章“私募基金的投资”中对投资范围、投资限制的有关约定进行事后监督，其中对于投资范围和投资限制中明确由基金管理人负责监督（或控制）的条款托管人不承担监督职责，除本合同明确约定由基金托管人对上述事项进行监督外，基金托管人对于其他事项不予监督，基金管理人违反相关投资目标、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、预警止损控制（如有）及嵌套层级等要求的，相关责任和损失由基金管理人承担，基金托管人不承担相关责任和损失。

基金托管人投资监督的及时性、准确性和完整性受限于基金管理人、证券经纪商以及其他中介机构提供的数据和信息，基金托管人不对前述机构所提供信息的及时性、准确性和完整性作任何担保、暗示或表示，也不对因上述机构提供信息的存在瑕疵而所引发的损失承担任何责任。

基金托管人不对基金管理人的任何投资行为承担责任，也不因提供投资监督而承担任何因基金管理人违规投资所产生的有关责任。

对于托管人不承担监督职责的事项，该类投资行为将严重依赖于基金管理人的自律管理，请投资者详细阅读本合同，明确托管人的监督范围及可能带来的风险。

## 十三、私募基金的财产

### （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。但本基金场外投资形成的基金财产、非标准化资产和处于托管人实际控制之外的基金资产则由基金管理人进行保管和履行保管职责，如基金管理人保管不善或存在其他不道德或不履职行为导致本基金财产造成损失均

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，归基金财产。

3、基金管理人、基金托管人可以按照本合同的约定收取管理费、托管费以及本合同约定的其他费用。基金管理人、基金托管人以其固有财产承担法律责任，其债权人不得对基金财产行使请求冻结、扣押和其他权利。基金管理人、基金托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，基金财产不属于其清算财产。

4、基金管理人、基金托管人不得违反法律法规的规定和基金合同约定擅自将基金资产用于抵押、质押、担保或设定任何形式的优先权或其他第三方权利。

5、基金财产产生的债权，不得与基金管理人、基金托管人固有财产的债务相互抵销，不得与不属于私募基金财产本身的债务相互抵消。非因基金财产本身承担的债务，基金管理人、基金托管人不得主张其债权人对基金财产强制执行。上述债权人对基金财产主张权利时，基金管理人、基金托管人应明确告知基金财产的独立性。

## **(二) 非现金类财产的保管**

### **1、证券类资产及证券交易资金的保管**

本基金投资形成的证券类资产，由相关法定登记或托管机构根据法律法规的规定实行第三方保管，基金托管人不承担财产保管职责；证券交易结算资金由相关证券经纪商和存管银行保管。对于在未经基金托管人事前书面同意的情况下基金管理人自行变更证券经纪商或存管银行造成的损失，及因证券经纪商原因导致证券交易结算资金无法正常转账支取造成的损失，相关责任均由基金管理人承担。

### **2、对于其他非现金类财产的保管，由基金管理人负责保管相关权利凭证。**

本基金投资管理过程中形成的其他非现金类基金财产，由基金管理人保管相关权利凭证及行使依据并负责及时勤勉行使相关权利，并负责该等款项的收回与将收回的任何款项及时归入基金财产。基金管理人应及时将相关权利凭证及行使依据的复印件加盖公章后交付基金托管人，托管人不对任何非现金类财产形成的权利行使行为、行使结果承担任何责任，如基金管理人未提供或未及时提供上述材料给托管人，托管人不承担任何责任。

对于上述非现金类的基金财产，除基金合同另有约定外，基金管理人不得将其进行抵押或转让或作出任何其有违基金合同约定的其他处分，并对相关财产的安全和完整负责，托管人对此不承担责任。

基金管理人对其对基金财产权利行使依据的任何形式的变更，都必须提前或在变更当日书面通知基金托管人，并及时提交给基金托管人。权利变更的法律后果由基金管理人承担，若给基金财产造成损失的，基金管理人对本基金承担赔偿责任。

## **(三) 基金财产相关账户的开立和管理**

### **1、账户开立和管理的基本原则**

基金托管人按照规定开立基金财产的托管账户，基金管理人应给予必要的配合；证券账户、期货账户（如有）等投资所需账户由基金管理人或基金托管人开立，另一方应给予必要的配合，并提供所需资料，证券账户、期货账户（如有）等投资所需账户的持有人名称应当符合证券、期货登记结算机构等相关机构的有关规定。开立的上述基金财产账户与基金管理人、基金托管人自有的财产账户以及其他基金财产账户相互独立。

### **2、基金托管账户的开立和管理**

基金托管人在具有基金托管资格的商业银行为本基金开立托管账户，账户名称以实际开立为准，并根据中国人民银行规定计息。托管账户的银行预留印鉴为“基金托管人财务专用章”加基金托管人有权人名章，预留印鉴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、支付相关费用，均需通

过本基金的托管账户进行。本托管账户仅限于本基金使用，并仅限于满足开展本基金业务的需要。

### **3、基金证券账户和证券资金账户的开立和管理**

基金管理人或基金托管人在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司、深圳分公司或北京分公司为基金开立证券账户，账户名称以实际开立为准。基金证券账户的开立和使用，仅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或转让基金证券账户，亦不得使用基金证券账户进行本基金业务以外的活动。

由基金托管人代基金管理人向中国证券登记结算有限责任公司申请开立证券账户的，由基金管理人按照中国证券登记结算有限责任公司的要求将相关资料提供给基金托管人，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，基金托管人不负责审查基金管理人提供的文件资料的合法性、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中国证券登记结算有限责任公司的审核进而给基金资产或任何第三人带来损失，相关责任均由基金管理人承担。

账户资产的管理和运作由基金管理人负责。

本基金采用“第三方存管”+“托管”模式存管证券交易结算资金，基金管理人负责在证券公司开设基金证券交易资金账户，并通知基金托管人与开立的基金托管账户建立第三方存管关系，同时三方存管的银证转账密码应及时通知基金托管人并由其掌握，在基金运作期间，不得变更基金证券交易资金账户与托管账户之间的第三方存管关系，未经托管人同意，不得对该资金账户项下的证券资产进行转托管和撤指定。

### **4、基金期货交易编码和期货资金账号的开立和管理（如有）**

基金管理人在期货经纪服务机构为基金申请开立期货交易编码和期货资金账号，账户名称以实际开立为准。基金期货交易编码和期货资金账号的开立和使用，仅限于满足本基金开展期货交易业务的需要。基金托管人和基金管理人不得出借或转让基金期货交易编码和期货资金账号，亦不得使用基金期货交易编码和期货资金账号进行本基金业务以外的活动。期货资金账户必须与托管账户建立唯一对应银期转账关系。

本基金在开展期货业务之前，基金管理人、基金托管人、期货经纪服务机构应签订三方操作备忘录，明确各方在本基金的期货账户开立、资金划拨、期货交易、结算及风险控制等方面的责任、权利和义务。

### **5、与基金投资运作有关的其他账户由基金管理人与基金托管人协商后办理。**

#### **（四）基金财产投资的有关实物证券有价凭证的保管**

实物证券由基金管理人或其指定的机构进行保管。基金托管人对由基金托管人以外机构实际有效控制的本基金资产不承担保管责任。

**（五）基金托管人根据本合同约定对基金财产的监督和检查自本基金成立之日起开始，至本基金进入清算程序之日起终止监督。**

## **十四、资金清算交收安排**

### **（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，并与其签订相关合同，基金管理人、基金托管人和证券经纪机构可就基金参与证券交易的具体事项另行签订协议。

### **（二）证券投资资金清算交收安排**

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。基金托管人对存放在证券经纪公司的资金不行使保管职责，基金管理人应在证券经纪服务协议或其他协议中约定由选定的证券经纪公司承担资金安全保管责任。

## 2、证券交易所证券资金结算

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

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

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

3、对于任何原因发生的证券资金交收违约事件，相关各方应当及时协商解决。

## **(三) 期货投资资金清算与交收**

本基金如投资期货，基金管理人应在投资前负责选择为本基金提供期货交易服务的期货经纪公司，并与其签订期货经纪合同。基金管理人、基金托管人和期货公司等可就本基金参与股指期货交易的具体事项另行签订协议。

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

## **(四) 资金、证券账目及交易记录的核对**

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

## **(五) 申购或赎回的资金清算**

1、基金份额申购、赎回的确认及清算由基金管理人负责。

2、基金管理人应将每个开放日（T日）的申购、赎回数据传送给基金托管人。基金管理人应对传递的申购、赎回数据的真实性、准确性、完整性负责。基金托管人应及时查收申购资金的到账情况并根据基金管理人指令及时划付赎回及转换款项。

3、基金管理人应在T+5工作日前将申购净额（不包含申购费）划至托管资金账户。如申购净额未能如期到账，由此给基金造成损失的，由责任方承担。基金管理人负责向责任方追偿基金的损失。

4、基金管理人应在赎回确认后5个交易日内向基金托管人发送赎回的划拨指令并保证托管资金账户预留足额资金，基金托管人依据划款指令划至基金管理人指定账户。涉及代销机构赎回资金的交收，基金管理人应在与代销机构约定的赎回资金交收日之前向基金托管人发送赎回的划拨指令并保证托管资金账户预留足额资金，若基金管理人无法在与代销机构约定的赎回资金交收日完成资金交收而引起代销机构及其投资者相关损失，由基金管理人承担。若赎回金额未能如期划拨，由此造成的损失，由责任方承担，基金管理人负责向责任方追偿基金的损失。

## **(六) 非证券交易所交易资金清算与交收**

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

## 十五、投资指令的发送、确认和执行

### （一）交易清算授权

基金管理人应在首次资金划拨前向基金托管人提供书面授权书（以下简称“授权书”），授权书中应包括被授权人的名单、权限、预留印鉴或签字样本，规定基金管理人向基金托管人发送划款指令时基金托管人确认有权发送指令人员（以下简称“被授权人”）身份的方法。授权书应注明被授权人的权限并由基金管理人加盖公章。管理人发出授权通知后向托管人电话确认，以保证托管人及时收到。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，则授权书自基金托管人收到时对基金托管人生效。管理人在此后三个工作日内将授权通知的文件原件送交托管人。如正本与传真件或扫描件不同，以基金托管人收到的传真件或扫描件为准。基金管理人和基金托管人对授权书负有保密义务，其内容不得向相关操作人员以外的任何人泄露。

### （二）划款指令的内容

划款指令是指基金管理人在管理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。基金管理人发给基金托管人的划款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（以上内容统称为“指令的书面要素”）。

### （三）划款指令的发送、确认及执行时间与程序

划款指令由授权书确定的被授权人代表基金管理人用传真方式或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。基金管理人有权在发送指令后与托管人以电话的方式进行确认。发送的指令以获得收件人（基金托管人）电话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对指令的预留印鉴、签字样本等表面一致性审核无误，指令有效后，方可执行指令。

对于被授权人依照授权书发出的投资指令，基金管理人不得否认其效力。基金管理人应按照相关法律法规以及本合同的规定，在其合法的经营权限和交易权限内发送投资指令，发送人应按照其授权权限发送投资指令。基金管理人在发送指令时，应为基金托管人留出执行指令所必需的时间。由于基金管理人的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至少 2 个工作小时的指令处理时间。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投资指令，基金托管人不保证当日完成在银行的划付流程。

基金托管人仅对基金管理人提交的按照前述约定已经生效的指令按照前述指令的书面要素进行表面一致性的形式审查，形式审查的方式限于验证指令的前述书面要素是否齐全、审核指令用章和签发人的签名或名章是否与预留印鉴样本、被授权人的签字样本或名章样本相符、操作权限是否与授权文件一致，当托管人验证相符后，应开始执行指令；基金托管人不负责审查基金管理人发送指令同时提交的其他文件资料的合法性、真实性、完整性和有效性或与指令的一致性，基金管理人应保证上述文件资料合法、真实、完整和有效以及指令的一致性。如因基金管理人提供的上述文件不合法、不真实、不完整或失去效力或与指令不一致而影响基金托管人的审核或给任何第三人带来损失，相关责任均由基金管理人承担。若指令存在与授权文件中预留印鉴样本、签字样本、名章样本、权限等要素不符

的，基金托管人无义务执行指令，在该等情况下，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，就基金管理人修改后重新发送的指令，基金托管人将按照前述指令确认、审查程序进行重新进行表面一致性形式审查，基金托管人认为审查无误的，才开始执行指令，对于前述情形因此造成的任何延误或后果，相关责任均由基金管理人承担。

基金管理人向基金托管人下达投资指令时，应确保托管账户及其他账户有足够的资金余额，对基金管理人在没有充足资金的情况下向基金托管人发出的指令，基金托管人有权拒绝执行，并立即通知基金管理人，因此造成的损失均由基金管理人承担。

管理人若修改或要求停止执行已经发送的指令，应先与托管人电话联系，若托管人还未执行，管理人应重新发送修改指令或在原指令上注明“停止执行”字样并由指令发送人员签字，托管人收到修改或停止执行的指令后，将按新指令执行；若托管人已执行原指令，则应与管理人电话说明，因基金托管人已执行该指令而造成的损失均由基金管理人承担。

**基金托管人仅根据基金管理人的授权文件对指令进行表面相符性的形式审查，对其真实性不承担责任。基金托管人不负责审查基金管理人发送指令同时提交的其他文件资料的合法性、真实性、完整性和有效性，基金管理人应保证上述文件资料合法、真实、完整和有效。如因基金管理人提供的上述文件不合法、不真实、不完整或失去效力而影响基金托管人的审核或给任何第三人带来损失，均由基金管理人承担。**

基金托管人仅根据基金管理人发送的符合本合同约定的划款指令及投资主协议进行资金划付。其他与该投资相关的从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：股东会决议、担保协议、保证协议、抵押协议等协议）的签订及生效属于基金管理人的投资管理职责，由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，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。

#### **（四）基金托管人依法暂缓、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投资指令违反法律法规、自律规则以及基金合同约定的，可拒绝执行，并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投资指令、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，以通常合理的注意义务，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时，必须提前至少一个工作日，使用传真方式或其他基金管理人和基金托管人认可的方式向基金托管人发出由基金管理人加盖公章的变更授权书，同时电话与基金托管人确认收到。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，则被授权人变更授权书自基金托管人收到时对基金托管人生效。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。如正本与传真件或扫描件不同，以基金托管人收到的传真件或扫描件为准。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，基金管理人无过错的，基金管理人不承担责任。

#### **（七）划款指令的保管**

划款指令若以传真或扫描件形式发出，则正本由基金管理人保管，基金托管人保管指

令传真件或扫描件。当两者不一致时，以基金托管人收到的划款指令传真件或扫描件为准。

#### **(八) 相关的责任**

基金托管人正确执行基金管理人符合本合同约定、合法合规的划款指令，基金财产发生损失的，相关损失均由基金财产承担。在正常业务受理渠道和指令规定的时间内，因基金托管人过错导致未能及时或正确执行符合本合同约定、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，但托管账户及其他账户余额不足或基金托管人遇到不可抗力等非可归责于托管人过错的情况除外。

如果基金管理人的划款指令存在事实上未经授权（包括已被撤换的人员无权发送的指令、新被授权人员超权限发送的指令等）、欺诈、伪造或未能按时提供划款指令人员的预留印鉴和签字样本等非基金托管人原因造成的情形，只要基金托管人根据本合同相关规定验证有关印鉴与签名无误，基金托管人不承担因正确执行有关指令而给基金管理人或基金财产或任何第三人带来的损失，全部责任由基金管理人承担。

## **十六、私募基金资产的估值和会计核算**

### **(一) 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。基金份额申购、赎回价格应当按照基金估值后确定的基金份额净值计算。

### **(二) 估值时间及估值程序**

基金存续期内，管理人(或其委托的运营服务机构)与托管人于每个工作日（即估值日）对前一工作日（即估值基准日）的基金财产进行估值，并于每周第一个工作日核对上周最后一个工作日的基金份额净值。**对于非托管人原因造成的估值核对时效延误，托管人不承担责任。**

基金日常估值由管理人负责，除根据法律法规规定或本合同约定暂停估值外，管理人应于每个工作日对基金资产估值。基金资产总值、基金资产净值和基金份额净值等由管理人负责计算，托管人负责复核。管理人(或其委托的运营服务机构)应于每个工作日将基金估值结果，以双方认可的方式（如书面形式、电子对账、录音电话、传真、电子邮件等）发送给托管人。托管人对基金估值结果复核后，以双方认可的方式（如书面形式、电子对账、录音电话、传真、电子邮件等）将复核结果反馈给管理人(或其委托的运营服务机构)，由管理人负责信息披露。管理人应当披露经由托管人复核无误的估值结果。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。

当相关法律法规或本合同约定的估值方法不能客观反映基金财产公允价值时，管理人可根据具体情况，并与托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值，所造成的误差不作为基金财产估值错误处理。

**在符合法律法规规定的情况下，管理人可委托运营服务机构，办理本基金的资产估值和会计核算，并根据管理人的委托与托管人办理资产估值和会计核算业务的交互。管理人**

委托运营服务机构办理前述会计核算、估值核对及业务交互等事项的，由管理人就运营服务机构履行该等事项的情况向投资者和托管人承担责任，管理人依法应承担的基金估值核算等职责不因委托其他机构办理而减轻或免除。

### （三）估值对象

本基金持有的股票、债券、基金、回购、银行存款本息、应收款项和其他投资等所有资产及负债。

### （四）估值依据和估值方法

本基金按照《证券投资基金会计核算业务指引》等法律法规规定及本合同约定办理基金资产估值。本基金有关基金资产按以下方式进行估值：

#### 1、股票等权益类资产估值方法

##### （1）证券交易所上市的有价证券的估值

1) 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，以最近交易日的市价（收盘价）估值。证券交易所摘牌的股票，摘牌期间以该股票的最后市价（收盘价）进行估值，亦可采用根据最后市价（收盘价）部分或全部减值的价格予以估值，在挂牌交易场所挂牌转让后按挂牌交易场所的收盘价估值，亦可采用对该收盘价部分或全部减值的价格予以估值。

##### （2）处于未上市期间的有价证券的估值：

1) 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估值方法估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值。

2) 首次公开发行未上市的股票、权证按成本估值。

3) 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等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券以及全国中小企业股份转让系统的股票等流通受限股票），可按以下公式确定估值基准日该流通受限股票的价值：

$$FV = S \times (1 - LoMD)$$

其中：FV：估值基准日该流通受限股票的价值；S：估值基准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，采用第三方估值机构（如中证指数有限公司）提供的数据。

管理人应当及时通知托管人上述流通受限股票的锁定/限售情况，如因管理人未及时告知托管人锁定/限售情况的，则托管人按照无流通受限股票的方法估值，即托管人按照证券交易所挂牌的同一股票的市价（收盘价）估值，由此造成的后果托管人不承担任何责任。

对于基金业协会规定的流通受限股票估值取值中的“流通受限股票的流动性折扣”，当估值日第三方估值机构未提供该流动性折扣时，则优先采用距当前最近一个交易日第三

方估值机构提供的流动性折扣进行估值处理；若第三方估值机构从未提供该流通受限股票的流动性折扣，则按估值日该流通受限股票在证券交易所上市交易的同一股票的市价（收盘价）估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值。

### （3）全国中小企业股份转让系统转让或交易的股票的估值

1) 对于在全国中小企业股份转让系统挂牌的股票，且实行做市商交易的或者实行竞价（包含集合竞价和连续竞价）交易的，以其估值日在全国中小企业股份转让系统挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，以最近交易日的市价（收盘价）估值。

2) 全国中小企业股份转让系统挂牌的股票，未实行做市商交易的或未实行竞价（包含集合竞价和连续竞价）交易的，按成本估值。

3) 全国中小企业股份转让系统退市的股票，以该股票的最后市价（收盘价）进行估值，亦可采用根据最后市价（收盘价）部分或全部减值的价格予以估值。

4) 如果未来监管机构或行业协会等出台关于全国中小企业股份转让系统挂牌股票的估值标准或方法，则参照新的标准或方法估值。

（4）本基金所投资的股权标的可参考基金业协会发布的《私募投资基金非上市股权投资估值指引（试行）》中规定的估值方法，管理人应定期评估相关方法的要求及适用条件。若管理人使用指引中相关估值方法进行估值的，应在本基金投资股权标的之后的首个估值核对日之前通知托管人和运营服务机构所投股权标的采用的估值方法，并在估值价格发生变化时及时通知托管人和运营服务机构进行股权估值价格调整。如管理人在本基金投资股权标的之后的首个估值核对日之前未提供股权投资标的估值价格及估值依据，则托管人和运营服务机构默认以股权投资标的实际划款金额作为成本估值。管理人对股权标的的估值价格公允性承担最终责任。

## 2、债券等债权类资产估值方法

### （1）证券交易所上市的固定收益品种的估值

1) 交易所上市交易或挂牌转让的债券、资产支持证券等固定收益品种（可转债除外）选取估值日第三方估值机构（此处指中证指数有限公司）提供的相应品种对应的估值全价估值。

2) 交易所上市交易的可转换债券按估值日收盘价进行估值；估值日没有交易的，以最近交易日收盘价估值。

3) 如遇第三方估值机构（此处指中证指数有限公司）提供交易所上市交易或挂牌转让的债券、资产支持证券等固定收益品种特殊估值价格的，按照其提供的推荐价格估值。管理人应当及时通知托管人债券违约，如因管理人未及时通知导致托管人未及时调整的，不视为估值错误。

### （2）首次公开发行未上市的债券，按成本估值。

(3) 全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，主要采用第三方估值机构（此处指中债金融估值中心有限公司）提供的相应品种对应的估值全价估值；如遇第三方估值机构（此处指中债金融估值中心有限公司）提供特殊估值价格的，按照其提供的推荐价格估值。管理人应当及时通知托管人债券违约，如因管理人未及时通知导致托管人未及时调整的，不视为估值错误，托管人不承担责任。

(4) 同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

(5) 本基金投资同业存单的，按估值日第三方估值基准服务机构（此处指中债金融估值中心有限公司）提供的相应品种对应的估值全价估值；如遇第三方估值机构（此处指中债金融估值中心有限公司）提供特殊估值价格的，按照其提供的推荐价格估值。

(6) 持有的回购以成本列示，按回购利率在回购期间内逐日计提应收或应付利息。

(7) 银行存款、证券交易资金账户内资金及债券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，并冲减已计提部分。期货资金账户内资金不计提利息，以实际结息数为准。

(8) 股权收益权、债权收益权按成本法估值。

### **3、期货及衍生品类资产估值方法**

(1) 期货按照期货交易所估值日的结算价估值，若估值当日无结算价的，采用最近交易日结算价估值。

(2) 基金持有的场内期权衍生工具，按估值日的结算价估值；估值日没有交易的，按最近交易日的结算价估值；未上市交易的衍生工具等有价值证券，按成本估值。

(3) 贵金属现货实盘合约按估值日金交所的当日收盘价估值，估值基准日无交易的，以最近收盘价估值。

(4) 贵金属延期交收合约，以其估值日在金交所的当日结算价估值。若估值当日无结算价的，以最近结算价估值。

(5) 基金持有的本金保障型固定收益类的收益凭证，按成本列示并每日加计应收利息（或应计收益）进行估值；持有的非本金保障型固定收益类的收益凭证、场外收益互换或场外期权等场外衍生品，依第三方或交易对手方以邮件、传真等形式提供的估值数据进行估值；若第三方或交易对手方无法及时提供最新的估值数据，按最近一次的估值数据进行估值；若第三方或交易对手方无法提供相关估值数据的，按历史成本估值；若不属于上述情况的，则管理人应向托管人提供场外衍生品的估值数据，并保证提供数据的真实、完整、有效。托管人不对管理人、第三方或交易对手方提供的的数据结果进行验证，如因数据提供错误或未能按时提供估值数据造成估值结果有误或延误，由管理人承担责任。

### **4、金融产品类资产估值方法**

(1) 基金持有的公开募集证券投资基金的估值

1) 上市流通的证券投资基金按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值。

2) 持有的场外开放式基金（包括上市开放式基金（LOF）的场外份额），按估值日当日的基金份额净值估值；估值日当日基金份额净值未公布的，按此前最近交易日的基金份额净值估值。

3) 持有的货币市场基金以成本列示，按估值日前一交易日的万份（百份）收益计提收益，估值日前一交易日没有每万份（百份）收益的，按最近公告的基金每万份（百份）收益估值。红利日结型货币基金与红利月结型货币基金则均于实际收到红利时，根据确认数量或金额调整并确认损益。管理人负责及时将货币市场基金的份额确认单、基金账户对账单及红利再投数据等估值核算资料及时提供给托管人和运营服务机构。

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

(2) 本基金持有的商业银行理财产品、基金公司及其子公司资产管理计划、证券公司及其资管子公司资产管理计划、保险公司及其子公司资产管理计划、期货公司及期货子公司资产管理计划、私募基金、有限合伙份额、集合信托计划等私募金融产品，按如下方式进行估值：

1) 如果标的产品信息披露义务人（标的产品管理人或其委托的运营服务机构、标的产品托管人）按时提供了该产品的份额数量、份额净值、资产净值、收益率或每万份（百份）收益等估值信息，则以最近提供的上述估值信息进行估值；其中保本型固定收益类产品，按成本列示，并每日加计应收利息（或应计收益）进行估值；按份额净值或资产净值计价的投资标的，按照标的产品信息披露义务人提供的最新份额净值或资产净值估值；如果标的产品运营服务机构和托管人均由中信建投证券股份有限公司担任，则这类产品按照标的产品托管人和运营服务机构核对后的净值等估值信息进行估值；如果标的产品信息披露义务人、管理人均无法提供上述估值信息，按照成本估值。基金对外投资中，如标的产品信息披露义务人未提供且不能在公开或客观渠道获取投资标的的份额净值等上述估值信息的，则管理人须督促标的产品信息披露义务人或管理人须及时向托管人或运营服务机构提供上述估值信息作为估值依据，并保证所提供的信息真实、完整、准确。**托管人不对标的产品信息披露义务人和管理人提供的数据进行验证，如因数据提供错误或未能按时提供投资标的的公允价格等估值信息造成估值结果有误或不及时，管理人自行承担由此产生的后果和影响，托管人不承担任何责任。**

2) 如标的产品有虚拟份额净值（指按照标的产品业绩报酬计算方法预提业绩报酬后得到的份额净值，包括仅供参考的虚拟份额净值）且管理人使用该虚拟份额净值（包括仅供参考的虚拟份额净值）进行估值的，以标的产品信息披露义务人或管理人按照提供的标的

产品最新虚拟份额净值（包括仅供参考的虚拟份额净值）进行估值，不能提供虚拟份额净值（包括仅供参考的虚拟份额净值）的，按照上述 1）约定的估值方法以份额净值估值。如标的产品信息披露义务人或管理人未提供标的产品最新虚拟份额净值（包括仅供参考的虚拟份额净值）的，则以标的产品信息披露义务人或管理人最近一次提供的虚拟份额净值进行估值。

#### 5、估值材料的交互要求

(1) 本基金投资于公募基金、私募金融产品等投资标的时，管理人应在标的产品合同等相关协议约定的确权时效内或本基金开放日前，向托管人和运营服务机构提供完整、准确及有效的估值材料，作为基金托管人和运营服务机构确认该笔投资权益的依据。

(2) 本基金管理人应敦促投资标的的管理人、投资标的的管理人委托的运营服务机构、托管人或本基金管理人及时、准确、完整地在本基金托管人或运营服务机构提供场外投资标的的份额数量、净值、申赎情况、分红情况以及其他权益变动等估值信息。

(3) 本基金持有场外衍生品（包括但不限于场外收益互换、场外期权、非本金保障型收益凭证、信用衍生品等）合约的（如涉及），为确保申购、赎回开放日及日常估值日净值复核工作的准确性，以保护全体投资者的利益，管理人应敦促交易对手方及时向基金托管人及运营服务机构提供该等衍生品的估值数据。

(4) 本基金接受其他私募金融产品（上层产品）投资的，管理人授权托管人将经复核的基金估值信息提供给上层产品托管人。管理人授权运营服务机构将基金份额登记信息在基金份额确认后 2 个工作日内提供给上层产品托管人。

**如因管理人或投资标的的信息披露义务人未及时按上述约定向基金托管人或运营服务机构提供估值材料的，本基金开放日份额净值不得作为办理基金份额申购、赎回的依据。如基金托管人或运营服务机构未及时获得完整、准确及有效的、并经托管人或运营服务机构认可的估值材料，或估值材料记载的信息发生变更，致使本基金申购、赎回及日常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。**

#### 6、本基金估值方法特别约定

##### (1) 特殊估值方法

基金对外投资中，对投资于无法从公开或客观渠道（包括交易所、中债金融估值中心有限公司、中证指数有限公司及标的发行方公开网站等）获取投资标的的公允价格或权益份额确认等估值信息的，若投资标的的管理人、投资标的的管理人委托的运营/行政服务机构或托管人（本章节统称为信息披露义务人）或管理人未按合同协议中约定的披露时间或投资发生后 7 个工作日内提供估值核算所需的客观资料，包括但不限于估值价格、权益份额确认书、收益率、每万份（百份）收益、账户对账单、红利再投或现金分红等，则托管人和运营服务机构有权按如下原则进行会计处理：

1) 投资标的为首次发行的, 权益确认时间默认为投资款项划出的下一工作日, 确认当天以成本入账, 并自确认日起按成本估值。当后续管理人提供了权益(或份额)确认凭据、对账单或最新的公允价格等估值核算所需的客观资料, 托管人及运营服务机构不再对以往账务进行调整, 仅在提供凭据当天, 以当天日期为准按提供的凭据资料一次性调整或确认相关权益及损益;

2) 投资标的为已经发行在运作的, 权益确认时间默认为投资款项划出的下一工作日, 确认当天以成本或当天已获取到的成本入账, 并自确认日起按成本或已获取到的最新公允价格估值。当后续管理人提供了权益(或份额)确认凭据、对账单或最新的公允价格等估值核算所需的客观资料, 托管人及运营服务机构不再对以往账务进行调整, 仅在提供凭据当天, 以当天日期为准按提供的凭据资料一次性调整或确认相关权益及损益。

3) 托管人不对管理人及其指定的估值核算资料提供方的数据结果进行验证, 如因数据提供错误或不及时造成估值结果有误或延误, 管理人自行承担由此产生的后果和影响, 托管人不承担任何责任。当采用上述会计原则进行估值核算处理后, 托管人视为完全履行了本合同约定的估值核算相关义务, 并对由此造成的基金财产和投资者的相关损益不承担责任。

(2) 本合同约定的基金财产估值方法, 相关法律法规另有规定的, 从其规定。如有新增事项, 按国家最新规定估值。如存在本合同约定的估值方法无法覆盖或者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投资品种, 管理人可按与托管人双方协商一致的估值方法或估值机制估值(将加盖管理人公章的估值调整说明函递交托管人或在管理人平台上提交相关估值调整), 前述估值机制调整包括但不限于启用侧袋估值机制等。

### (五) 估值错误的处理

当基金资产估值计算偏离达到或超过基金份额净值的0.5%时, 视为估值错误。管理人和托管人应当按照以下约定处理:

#### 1、估值错误类型

本基金运作过程中, 如果由于管理人或托管人、或登记机构、或销售机构、或投资人自身的过错造成估值错误, 导致其他当事方遭受损失的, 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。上述估值错误的类型主要包括但不限于: 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、不可抗力等。

#### 2、估值错误处理原则

1) 管理人应督促证券/期货经纪商向托管人及运营服务机构及时发送交易结算数据、对账单等估值所需材料, 因证券/期货经纪商未及时、准确发送估值所需材料等原因导致估值错误发生的, 管理人负责协调证券/期货经纪商解决及追偿;

2) 因基金资产估值违反本合同订明的估值方法、程序的约定等原因导致估值错误发生的,发现方应立即通知对方,共同查明原因,协商解决,托管人承担的赔偿金额以收取的托管费为上限;

3) 如管理人和托管人对基金资产净值和基金份额净值的计算结果,虽然多次重新计算和核对仍不能达成一致时,为避免不能按时披露净值的情形,以管理人的计算结果对外披露,由此给投资者和基金财产造成的损失,应当由管理人自行承担全部赔偿责任,托管人不承担任何责任;

4) 估值错误的责任人对有关当事方的直接损失承担赔偿责任,不对间接损失负责;估值错误的责任人仅对估值错误的有关直接当事人负责,不对第三方负责;

5) 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。由管理人负责代表基金向取得不当得利的当事方追偿;

6) 估值错误调整应当采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式,估值错误责任方应对更正的情况向有关当事方进行确认,确保估值错误已得到更正;

7) 前述内容如法律法规另有规定的,从其规定处理。如果行业另有通行做法,管理人和托管人应本着平等和保护投资者利益的原则进行协商。

### **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:

1) 发生估值错误时,管理人应当立即纠正,通报托管人,并采取合理的措施防止损失进一步扩大;

2) 管理人应当及时查明估值错误发生的原因,根据与托管人协商一致的方法对因估值错误造成的损失进行评估;

3) 根据估值错误处理原则或管理人和托管人协商一致的方法,对估值错误进行处理,由估值错误责任方进行更正和赔偿损失,其他相关方应提供必要配合;

4) 前述内容如法律法规另有规定的,从其规定处理。如果行业另有通行做法,管理人和托管人应本着平等和保护投资者利益的原则进行协商。

### **(六) 暂停估值的情形**

(1) 基金投资所涉及的证券交易场所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时;

(2) 证券/期货经纪商、场外衍生品交易对手方或第三方等机构未能提供估值所需资料,导致管理人或托管人无法对基金资产进行正常估值时;

(3) 因发生不可抗力或其他客观情形,致使管理人或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公允价值存在重大不确定性,为保障投资者的利益,管理人或托管人决定暂停估值的;

(5) 管理人或托管人有合理理由认为根据现有的材料无法准确估值的；

(6) 基金估值所涉交易数据、行情数据或投资标的估值数据不存在，数据提供不及时、不准确或不完整的；

(7) 管理人和托管人未达成一致意见的其他情形；

(8) 法律法规规定和本合同约定的应暂停估值的其他情形。

#### **(七) 基金份额净值的确认**

本基金的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，由此产生的误差计入基金财产。本基金的基金份额净值保留到小数点后 4 位，小数点后第 5 位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

**根据有关法律法规规定，基金份额净值计算和会计核算的义务由管理人承担。本基金的会计责任方由管理人担任。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，仍无法达成一致意见，为避免不能按时披露的情形，以管理人计算或确认的结果为准并由管理人负责信息披露，管理人应在单方面对外披露基金份额净值计算结果时注明未经托管人复核，托管人不承担由此导致的损失。**

#### **(八) 特殊情形的处理**

(1) 管理人和托管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估值错误处理；

(2) 管理人（或其委托的运营服务机构）和托管人由于各自技术系统设置而产生的净值计算尾差，不作为估值错误处理，以管理人（或其委托的运营服务机构）计算结果为准；

(3) 因不可抗力，证券交易所及中国结算等发送的数据错误，或国家会计政策变更、市场规则变更等非管理人或托管人原因，管理人和托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误或即使发现错误但因前述原因无法及时更正的，由此造成的估值错误，管理人和托管人免除赔偿责任，但管理人和托管人应当积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响；

(4) 对于因税收规定调整或其他原因导致基金实际交纳税金与估值计提的应交税金有差异的，基金将在相关税金调整日或实际支付日进行相应的估值调整。相关估值调整不作为基金资产估值错误处理：

1) 管理人作为本基金的会计责任方，应与税务机关确定各类税金的涉税判断、计算方法和处理方案并做出估值判断。由于管理人应税判断、计算方法或处理方案选择问题造成的净值差异不属于估值差错，由此导致的税款计算风险责任由管理人自行承担。如因管理人未提供涉税信息、所管理的基金投资范围中列明的相关投资标的涉税判断等，造成托管人无法对估值结果进行复核的，托管人有权暂停估值复核，由此产生的责任和后果由管理人承担。

2) 若税收政策调整,以税收政策为准,导致基金实际缴纳税金与估值核算的应交税金产生差异的,不属于估值差错,基金原则上在相关税金调整确定时进行相应调整。

3) 投资者和管理人在此确认:若管理人有关各类税金的涉税判断、计算方法、处理方案或估值判断存在错误,或与国家税务法规、政策及各级税务主管部门或其他有权机构的要求、认定结果不一致的,由此造成的损失和后果,托管人不承担任何责任。

#### (九) 基金的会计政策

##### 1、会计年度、记账本位币和会计核算制度

- (1) 管理人为本基金的基金会计责任方。
- (2) 本基金财产的会计年度为公历年度的每年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) 基金财产的会计核算按《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等有关规定执行。

##### 2、会计核算方法

(1) 管理人、托管人根据法律法规规定及本合同约定,对基金财产各自独立建立资金账册、独立核算。如双方对会计处理方法存在分歧的,以管理人的处理方法为准。由此造成的损失,托管人不承担任何责任;

(2) 管理人应保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算,编制基金会计报表。

(3) 管理人(或其委托的运营服务机构)应定期与托管人就基金的会计核算、报表编制等进行核对。因管理人(或其委托的运营服务机构)未按合同约定履行会计核算和报表编制义务等原因,导致托管人无法按时进行相应复核的,托管人不承担任何责任。

## 十七、私募基金的费用与税收

#### (一) 基金费用的种类

- 1、管理费;
- 2、托管费;
- 3、运营服务费;
- 4、业绩报酬;
- 5、基金的证券交易费用及开户费用;
- 6、基金的银行汇划费用;
- 7、与基金相关的诉讼仲裁费、资产评估师费、会计师费、审计费、律师费、电子签约服务费、基金合同等相关合同制作费及其他费用;
- 8、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

基金A类份额年管理费率为1%,B类份额年管理费率为0.8%,C类份额年管理费率为

为 0%，以前一自然日基金资产净值为基础计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{该类份额年管理费率} \div 365$$

**H：该类份额每日应计提的管理费**

**E：前一日该类份额的基金资产净值**

本基金的管理费自本合同生效之日起，每日计提，按季（自然季）支付。当季应收管理费由基金托管人根据与基金管理人（或其委托的运营服务机构）核对一致的财务数据，自行在次季度首月于基金财产中支付至基金管理人收费账户，基金管理人无需再出具划款指令。基金管理人应于每季首月在基金托管账户中备足应支付的管理费。

## 2、托管费

基金的年托管费率为 0.01%，以前一自然日基金资产净值为基础计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.01\% \div 365$$

**H：每日应计提的托管费**

**E：前一日的基金资产净值**

本基金的托管费自本基金成立之日起，每日计提，按季（自然季）支付。当季应收托管费由基金托管人根据与基金管理人（或其委托的运营服务机构）核对一致的财务数据，自行在次季度首月于基金财产中支付至基金托管人收费账户，基金管理人无需再出具划款指令。基金管理人应于每季首月在基金托管账户中备足应支付的托管费。

## 3、运营服务费

基金的年运营服务率为 0.01%，以前一自然日基金资产净值为基础计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.01\% \div 365;$$

**H 为每日应计提的运营服务费**

**E 为前一日基金资产净值**

本基金的运营服务费自本基金成立之日起，每日计提，按季（自然季）支付。当季应收运营服务费由基金托管人根据与基金管理人（或其委托的运营服务机构）核对一致的财务数据，自行在次季度首月于基金财产中支付至运营服务机构收费账户，基金管理人无需再出具划款指令。基金管理人应于每季首月在基金托管账户中备足应支付的运营服务费。

## 4、业绩报酬

### (1) 业绩报酬的计提原则：

本基金 A 类份额业绩报酬计提比例为 20%。

本基金 B 类份额业绩报酬计提比例为 16%。

本基金 C 类份额业绩报酬计提比例为 0%。

在满足本合同约定的业绩报酬收取条件情况下，业绩报酬从投资者赎回资金、收益分配（基金分红）资金或者基金清算资金中提取。本基金业绩报酬计提基准为基金份额赎回、基金分红或者基金清算的增值部分（包含收益分配部分和净值增长部分）。

投资者所持基金份额部分或全部赎回时，业绩报酬按投资者赎回份额计算。如投资者赎回份额为一笔参与份额的一部分，则将该部分赎回份额直接进行核算；若投资者在赎回前多次参与，则赎回时对份额采取“先进先出”的原则进行计算。

本基金分配收益（分红）时，业绩报酬按分红时所有投资者所持该类基金份额累计净值增值部分计算。业绩报酬将从向投资者分配的分红资金中扣除且总额不超过分红资金，

存在投资者实际收到的现金分红款或获得的红利转投份额，少于管理人披露的分配方案中载明的分红金额的情形，极端情况下投资者实际收到的现金分红款或获得的红利转投份额为0。

同样，如本次收益分配成功计提业绩报酬后，下一次业绩报酬计提时所使用的“上一次计提业绩报酬时该类基金份额累计净值”、“上一次计提业绩报酬时该类基金份额净值”、“上一次计提业绩报酬时点”将是本次成功计提后累计净值、净值及计提时点，这也就导致了：如某个投资者本次分配金额不足以覆盖其所持基金份额全部增值部分对应的应收业绩报酬，管理人将以该投资者本次应分配金额为限收取业绩报酬，未收取部分不再收取。

**基金终止清算时，所有投资者视同全部赎回，业绩报酬按基金终止时所有投资者各自所持全份额计算。**

## (2) 业绩报酬的计算公式

$$PF_i = \sum_{j=1}^n PF_{ij}$$
$$PF_{ij} = \begin{cases} (NAV_e - HWM_{ij}) \times \text{该类份额业绩报酬计提比例} \times F_{ij}, & \text{当 } NAV_e > HWM_{ij} \text{ 时} \\ 0, & \text{当 } NAV_e \leq HWM_{ij} \text{ 时} \end{cases}$$

其中：

$PF_i$ ：第  $i$  个投资者本次赎回/分红/清盘计提的全部业绩报酬；

$PF_{ij}$ ：本计提日第  $i$  个投资者第  $j$  笔投资的业绩报酬，其中分红时以该笔投资实际分红金额为限；

$F_{ij}$ ：第  $i$  个投资者本次赎回/分红/清盘对应的第  $j$  笔投资的基金份额数；

$NAV_e$ ：该投资者本次赎回开放日/除权除息日/清盘日该类基金份额累计净值；

$HWM_{ij}$ ：第  $i$  个投资者第  $j$  笔投资的上一次计提业绩报酬时该类基金份额累计净值；若该笔份额还未计提过业绩报酬，则  $HWM_{ij}$  为该笔份额认购/申购时该类基金份额累计净值。

计算出的  $PF_i$  从赎回资金/分红资金/清盘资金中扣除。

管理人在每个赎回确认日、分红处理日或清算结束之日应提取的总的业绩报酬为依据上述计算公式计算的针对每个投资者应提取的业绩报酬加总。

**除权除息日**：根据基金分红情况，对本次分红业务进行账务处理的日期，分红后除权除息日当天的净值下降。除权除息日具体以管理人发布分红公告中确定的日期为准。

**赎回确认日**：对份额持有人赎回份额金额确认的日期。

**分红处理日**：基金分红，对本次分红业务进行明细确认的日期。分红处理日具体以管理人发布分红公告中确定的日期为准。

本基金上述业绩报酬归管理人所有，托管人不承担复核义务，管理人在投资者赎回、

分红或清算时从其赎回、分红或清算款项（以下简称退出金额）中分别予以相应扣除。

本基金连续两次业绩报酬计提的间隔期应不短于 6 个月（以收益分配基准日（如有）、固定计提基准日（如有）计算间隔期，如因节假日顺延导致的间隔小于 6 个月的除外），但因管理人在投资者赎回基金份额时或在私募投资基金清算时计提业绩报酬的，可不受上述间隔期的限制，也不纳入间隔期考虑范围。**管理人应自行控制本基金连续两次业绩报酬计提基准日之间的间隔，托管人及运营服务机构对此不承担任何形式的复核、监督义务。**

5、上述（一）中所列其他费用根据有关法规及相关协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人依据基金管理人指令从基金财产中支付。

6、上述约定由基金托管人可自行划款的各项费用，基金管理人应于每季首月初在基金托管账户中备足头寸直至各项费用自动支付完成，若托管人在自行支付费用时发生余额不足或收款账户信息有误等情况导致未能支付成功的情况，托管人将顺延至下个支付周期累计进行自动划付。

### **（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、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**

本基金各项费用调低，经基金管理人和基金托管人协商一致即可；若某项费用需调高，则应按照本合同第二十一章第（三）条基金合同的变更约定处理。

### **（五）基金的税收**

根据国家税收法律、法规相关要求，本私募基金运营过程中如发生增值税应税行为，使得本私募基金管理人成为增值税纳税人的，源于本私募基金增值税应税行为而形成的增值税及其附加税费等相关税负由本基金资产承担。相关税款由私募基金管理人（或其委托的运营服务机构）计算后向私募基金托管人出具划款指令，由私募基金托管人划付至私募基金管理人账户并由私募基金管理人依据税务部门要求完成相关税款申报缴纳。

**本基金清算后，如私募基金管理人被税务机关要求补缴由本私募基金增值税应税行为而形成的应由本基金资产承担的增值税及其附加税费等相关税负的，私募基金管理人有权向私募基金投资者就补缴金额进行追索。**

本基金运作过程中涉及除增值税及其附加税费以外的各纳税主体、扣缴主体，其纳税义务、扣缴义务按国家税收法律、法规执行。

如未来本私募基金所适用的税收征管法律法规及具体执行方式由于国家相关税收政策、私募基金管理人主管税务机关指导意见、中国证监会相关规定、行业指引、自律规则及有关政策调整而发生变化，则私募基金管理人提前通知后，可直接对本私募基金合同中涉及的相关内容进行修改和调整。

本合同项下应由基金财产承担的费用均为包含增值税的含税价，但当事人另有约定的除外。

本合同项下应由基金财产承担的费用，相关发票开具事宜，以届时有效的法律、法规、规章或者相关部门的有关规定处理。本基金运作过程中涉及各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

基金投资者必须自行缴纳的税收由基金投资者负责，基金管理人不承担代扣代缴或纳税的义务。如依据相关法律法规或税务机关的规定，基金管理人在向基金投资者交付利益

或资产前须代扣代缴任何税费的，基金管理人按照相关规定予以代扣代缴，无需事先征得基金投资者的同意，且基金投资者不得要求基金管理人以任何方式向其返还或补偿该等税费。

## 十八、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。

### （一）基金利润

基金收益分配的基准为基金利润，基金利润指截至收益分配基准日（即基金利润计算截至日）基金利息收入、投资收益、公允价值变动损益和其他收入等基金运作产生的各项收入扣除管理费、托管费、运营服务等基金运作产生的各项费用后的余额。

### （二）收益分配原则

1、每一基金份额享有同等分配权。

2、本基金收益分配方式为现金分红或红利再投资，默认收益分配方式为现金分红。收益分配时发生的银行转账等手续费用由基金份额持有人自行承担。基金管理人应当在收益分配方案中明确约定份额持有人选择收益分配方式具体安排，基金份额持有人有权根据收益分配方案约定，向管理人申请变更具体的收益分配方式，基金份额持有人在收到收益分配方案通知后，应当在除权除息日前以书面方式选择收益分配方式并通知基金管理人，如未及时通知基金管理人的，按照默认收益分配方式进行分配。

3、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、法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

5、在基金收益分配基准日基金份额净值符合本合同约定的收益分配标准的情况下，基金管理人可根据基金运作需要自行决定是否分配收益，并在符合本合同约定标准的前提下决定具体分配额度。

### （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基金收益分配对象、分配时间、分配金额、分配方式等内容。

基金收益分配方案由基金管理人拟定，基金管理人按法律法规和合同约定告知基金份额持有人。

### （四）收益分配方案的执行

在收益分配方案公布后，基金管理人依据具体方案的规定就支付的现金收益向基金托管人发送划付指令，基金托管人按照基金管理人的指令及时进行现金收益的划付。

## 十九、信息披露与报告

（一）本基金的信息披露应符合法律法规的有关规定及本合同的约定。相关法律法规关于信息披露的规定发生变化时，本基金从其最新规定。

### （二）基金管理人为本基金信息披露义务人

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依法应当承担的责任和信息披露义务不因委托而免除。

基金管理人保证所披露的基金财务数据，均为经基金托管人复核无误的财务数据。基金管理人应当保证所披露信息（包括基金财务信息及非财务信息）的真实性、准确性和完

整性，基金管理人披露基金信息不真实、不准确、不完整而产生的责任由基金管理人自行承担。

**(三) 基金管理人披露基金信息，不得有下列行为：**

- 1、公开披露或者变相公开披露；
- 2、虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏；
- 3、对投资业绩进行预测；
- 4、违规承诺收益或者承担损失；
- 5、诋毁其他基金管理人、基金托管人或者基金代销机构；
- 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、采用不具有可比性、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、法律、行政法规、中国证监会、基金业协会禁止的其他行为。

**(四) 基金募集期间的信息披露**

本基金募集期间，基金管理人应在宣传推介材料中向投资者披露如下信息：

- 1、基金的基本信息：基金名称、基金架构、基金类型、基金注册地（如有）、基金募集规模、最低认缴出资额（如有）、基金运作方式、基金的存续期限、基金联系人和联系信息、基金托管人；
- 2、基金管理人基本信息：基金管理人名称、注册地/主要经营地址、成立时间、组织形式、基金管理人在基金业协会的登记备案情况；
- 3、基金的投资信息：基金的投资目标、投资策略、投资方向、业绩比较基准（如有）、风险收益特征等；
- 4、基金的募集期限
- 5、基金估值政策、程序和定价模式；
- 6、基金合同的主要条款：出资方式、收益分配和亏损分担方式、管理费标准及计提方式、基金费用的承担方式、基金业务报告和财务报告提交制度等；
- 7、基金的申购和赎回安排；
- 8、基金管理人最近三年的诚信情况说明；
- 9、其他事项。

**(五) 运作期报告**

**1、基金管理人向基金份额持有人提供的报告种类、内容和提供时间**

**(1) 月度净值披露（如有）**

如本基金为私募证券投资基金，则需按照以下要求进行基金月度净值披露：

本基金存续期间内，基金规模达到 5000 万元以上的，基金管理人应当自满足基金规模达到 5000 万元之日起，持续在每月结束之日起 5 个工作日内向基金份额持有人披露基金净值信息。

**(2) 季度报告**

基金管理人（或其委托的运营服务机构）应当在每季度结束之日起 10 个工作日内，编制完成基金季度报告并确保其中的财务数据为已经基金托管人复核（托管人仅复核本基金财务数据），由基金管理人向基金份额持有人披露基金净值、主要财务指标以及投资组合情况以及其他法律法规规定和本合同约定的信息。

**(3) 年度报告**

基金管理人（或其委托的运营服务机构）应当在每个会计年度结束之日起 4 个月内，编制完成基金年度报告并确保其中的财务数据为已经基金托管人复核（托管人仅复核本基金财务数据），由基金管理人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）、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）以及其他法律法规规定和本合同约定的信息。

#### **(4) 临时报告**

**发生法律法规规定及本合同约定的、可能影响基金份额持有人利益的重大事项时，基金管理人应按照法律法规和中国证监会的有关规定，及时向投资者进行披露。**

重大事项包括但不限于：

- 1) 基金名称、注册地址、组织形式发生变更的；
- 2) 基金合同发生重大变化的；
- 3) 变更基金管理人和托管人的；
- 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) 管理费率、托管费率发生变化的；
- 7) 基金收益分配事项发生变更的；
- 8) 基金触发巨额赎回的；
- 9) 基金存续期变更或展期的；
- 10) 基金发生清盘或清算的；
- 11) 发生重大关联交易或交易可能存在利益冲突的；
- 12) 基金管理人、实际控制人、高管人员涉嫌重大违法违规行为或正在接受监管部门或自律管理部门调查的；
- 13) 涉及私募基金管理业务、基金财产、基金托管业务的重大诉讼、仲裁；
- 14) 投资金额占基金净资产 50%及以上的项目不能正常退出的；
- 15) 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。

**本基金发生上述第 2) 项、第 3) 项、第 8) 项、第 13) 项、第 14) 项、第 15) 项重大事项的，管理人应当在 5 个工作日内向协会报送相关事项并向投资者披露。**

#### **2、向基金份额持有人提供报告及基金份额持有人信息查询的方式**

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

##### **(1) 传真、电子邮件或短信**

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

##### **(2) 邮寄服务**

基金管理人可向基金份额持有人邮寄年度报告等有关本基金的信息。基金份额持有人在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**

基金管理人通过基金管理人网站向基金份额持有人提供报告和信息查询，内容包括净值报告等。

##### **(4) 基金业协会指定的信息披露平台**

基金份额持有人可以在相关条件具备时，登录基金业协会指定的私募基金信息披露备份平台进行信息查询。

#### **(六) 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各自履

行报告义务。

基金管理人应于相关条件具备时，按照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。

**(七) 本基金全体份额持有人同意基金管理人或其他信息披露义务人按照基金业协会的规定对基金信息披露信息进行备份。**

**(八) 基金托管人办理的基金托管业务有关信息披露事项**

本基金合同约定，托管人有义务办理与基金托管业务有关的信息披露事项。除法律法规、中国证监会和基金业协会等监管机关另有规定外，基金托管人办理与基金托管业务有关的信息披露事项，仅包括基金托管人向上述监管机关履行的定期或不定期报告义务，以及依照本合同约定仅对基金管理人（或其委托的运营服务机构）编制的基金份额净值、基金份额申购赎回价格、基金定期报告和定期更新的招募说明书（如有）中的基金财务数据进行复核。基金托管人对于基金非财务数据不承担任何复核职责。基金管理人负责确保所披露的所有基金信息真实、准确、完整，并确保披露的财务数据已经托管人复核。

基金托管人对基于基金管理人提供的信息形成的报告、意见、公告等材料，对管理人提供的该等信息不承担真实性、有效性、合法性的审查责任。因基金产品设计、运营以及基金管理人提供的信息不真实、不准确、不完整而产生的责任由基金管理人自行承担，基金托管人不承担任何担保责任。因基金管理人（或其委托的运营服务机构）未提供或未及时进行基金份额净值、月度（如有）、季度、年度报告等客观因素导致基金托管人无法进行相应复核或未能及时复核的，基金托管人将不承担复核责任。

## 二十、风险揭示

**(一) 本基金主要风险包括市场风险、信用风险、流动性风险、基金相关当事人在业务各环节的操作或技术风险、外包事项所涉风险、未在基金业协会备案风险、金融衍生品投资风险（如有）、基金产品提前结束风险、特定的投资方法及基金财产所投资的特定投资对象可能引起的特定风险及不可抗力风险等。本基金风险揭示内容详见《竹润乐鑫量化精选1号私募证券投资基金风险揭示书》。**

**(二) 签署本基金合同前，投资者应当仔细阅读本合同全文及《竹润乐鑫量化精选1号私募证券投资基金风险揭示书》，知悉并理解其中列示的基金可能面临的各项风险。**

《竹润乐鑫量化精选1号私募证券投资基金风险揭示书》揭示的事项仅为列举性质，未能详尽列明投资者参与私募基金投资所面临的全部风险和可能导致投资者资产损失的所有因素。投资者在参与私募基金投资并签署本合同前，应认真阅读并理解相关业务规则、基金合同及风险揭示书的全部内容，并确保自身已做好足够的风险评估与财务安排，避免因参与私募基金投资而遭受超过自身风险承受能力的损失。

**(三) 经金融监管部门批准设立的金融机构和特殊合格投资者可以不签署风险揭示书。**

**特别提示：一经签署本基金合同，即视为投资者已充分了解并谨慎评估自身风险承受能力，理解并愿意自行承担参与私募基金投资的风险和损失。无论投资者是否签署《竹润乐鑫量化精选1号私募证券投资基金风险揭示书》。《竹润乐鑫量化精选1号私募证券投资**

《基金风险揭示书》作为本基金合同一部分，与本基金合同具有同等法律效力。

## 二十一、私募基金合同的效力、变更、解除与终止

### （一）基金合同的效力

#### 1、合同的成立和生效

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，本合同的当事人包括基金份额持有人、基金管理人和基金托管人。本合同自各方当事人签署完毕之日起成立并生效，对各方当事人具有同等的法律约束力。

#### 2、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）采用纸质合同方式签署

本合同采用纸质合同（包括套印版的纸质合同）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（或盖章）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加盖公章或合同专用章以及法定代表人或授权代表签字（或盖章）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。

基金管理人负责保证募集行为合法合规性，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。

基金合同一式叁份，当事人各执壹份，每份合同均具有同等的法律效力。基金管理人应当妥善保管并及时向基金托管人移交需由基金托管人保管的基金合同原件。

##### （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、监管规定有关要求的电子签名方式签署本合同之日起生效。

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。

3、基金管理人和基金托管人双方可就基金托管事项具体操作事宜，另行签署相关协议。

### （二）基金合同的有效期限

本合同有效期为自基金合同生效日起至基金合同终止日止。

### （三）基金合同的变更

1、因法律法规或中国证监会、基金业协会等相关监管机关和行业自律组织的相关规定变化需要变更基金合同的，基金管理人可以与托管人协商后修改基金合同，并由基金管理人按照合同约定及时向投资者披露变更的具体内容。

2、非因法律法规或中国证监会、基金业协会等相关监管机关和行业自律组织的相关规

定变化需要变更基金合同的，如基金合同拟变更内容对本基金合同当事人权利义务关系产生重大影响的，基金管理人可采用以下三种方式中的一种变更基金合同：

(1) 可以采用全体基金份额持有人、基金管理人和基金托管人三方协商一致同意，以补充协议或签署修订版基金合同等书面形式，协议变更基金合同。

(2) 基金管理人可以根据本合同第十章“基金份额持有人大会及日常机构”约定，召集基金份额持有人大会，通过基金份额持有人大会决议的方式，决定变更基金合同。

(3) 经基金托管人书面同意后，基金管理人可以向全体基金份额持有人发送征询意见函（以实际名称为准），就基金合同拟变更事宜向全体基金份额持有人征求意见。

**基金管理人应当对不同意合同变更或未按照征询意见函（以实际名称为准）要求回复意见的基金份额持有人作出合理的退出安排。自基金合同变更生效日起，如上述基金份额持有人未主动申请赎回其持有的全部基金份额的，基金管理人应当及时进行合理安排并强制赎回上述基金份额持有人所持全部份额。**

征询意见函（以实际名称为准）通知的征询意见期满后，基金管理人应及时向基金托管人出具盖章的合同变更生效通知，基金合同变更生效日以该生效通知为准，并在基金合同变更生效日起【三】个工作日内通知全体基金份额持有人合同变更生效的结果。

**基金合同变更生效日起，基金合同变更对合同各方当事人均具有法律效力。采用上述第（2）种、第（3）种方式变更基金合同内容的，基金合同变更生效日前，已取得本基金份额的基金份额持有人无需另行签署补充协议或修订版基金合同等书面协议；基金合同变更生效日起，新取得本基金份额的基金份额持有人，应当签署补充协议或修订版基金合同等书面协议。基金管理人负责确保补充协议或签署修订版基金合同等书面协议与基金合同变更内容实质一致。**

3、非因法律法规或中国证监会、基金业协会等相关监管机关和行业自律组织的相关规定变化需要变更基金合同的，如基金合同拟变更内容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。

4、对本合同任何形式的变更、补充，基金管理人应当在变更或补充发生之日起5个工作日内按照基金业协会要求及时向基金业协会报告。

#### **（四）基金合同的解除**

**自本合同生效日起，基金投资者除依据本合同第六章“私募基金的募集”和第八章“私募基金的申购、赎回和转让”约定的条件解除本合同外，任何一方当事人均不得单方解除。**

#### **（五）基金合同终止事由**

除本合同另有约定外，合同终止事由还包括下列情形：

- 1、基金成立后存续期限届满，且存续期间届满未展期的；
- 2、管理人依法解散、被依法撤销或被依法宣告破产，且自前述情形发生之日起六个月内没有新的管理人承接的；
- 3、管理人出现客观上丧失继续管理本基金能力或怠于履行管理职责的情形时，基金份额持有人大会作出决议终止基金的；
- 4、管理人根据基金运作、市场行情等情况自主决定终止基金的；
- 5、托管人依法解散、被依法撤销或被依法宣告破产或被依法取消基金托管资格，且自前述情形发生之日起六个月内没有新的托管人承接的；
- 6、基金已成立，但向基金业协会办理备案失败的；
- 7、经全体投资者、管理人和托管人协商一致决定终止的；
- 8、基金份额持有人大会决议终止的；

9、全体投资者赎回其持有的全部基金份额，且不存在有效申购申请的；

10、基金存续期间触及止损线（如有）的；

11、管理人因基金出现“基金上一年度日均基金资产净值低于 500 万元，或者基金资产净值连续 60 个交易日低于 500 万元的情形”停止申购之日起，基金资产净值连续 120 个交易日低于 500 万元的（“上一年度日均规模”、“连续 60 个交易日”的初始起算时间为 2025 年 1 月 1 日）；

12、法律法规规定的其他情形。

## 二十二、私募基金的清算

### （一）清算小组的组成及职责

本合同约定的基金终止事由发生之日（以下简称“基金终止日”）起五个工作日内，基金管理人应当及时通知全体份额持有人并向基金托管人通知本基金终止运作，并向基金托管人发送本基金的清算公告。基金管理人应当在清算公告中明确基金具体终止事由及基金终止日。自基金终止日起，基金管理人负责成立清算组及时启动清算程序，并不得进行任何新增投资。如因基金管理人未及时启动清算程序或基金终止日后仍然新增投资等违反清算程序约定事项并导致基金财产损失的，全部责任由基金管理人承担，基金托管人不承担监督职责。

**本基金的清算事宜，基金托管人仅负责对托管账户资金进行保管和对分配方案中涉及本基金合同约定的需由托管人承担复核义务的基金财务数据进行复核。**

#### 1、清算组的组成

基金管理人应当自基金终止日起 30 个工作日内发起成立清算小组。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。如出现符合本章约定的“管理人无法履行清算职责的应急处置”事项的，基金份额持有人大会应当及时作出决议，按照本章节约定，代为履行基金管理人职责事项。

#### 2、清算小组的职责

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。清算小组成员具体职责如下：

##### （1）基金管理人职责：

- 1) 基金资产变现；
- 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) 向基金份额持有人发布清算公告、清算报告；
- 8) 将清算报告报中国证券投资基金业协会备案，
- 9) 履行与基金管理人义务相关的其他职责。

##### （2）基金托管人职责

- 1) 依据基金管理人划款指令，进行资金划付；
- 2) 复核基金管理人出具的清算报告中的基金财务数据。

### （二）清算程序

1、基金合同终止后，由清算小组牵头人基金管理人主导统一接管基金财产，基金托管

人予以配合；

2、由基金管理人对基金财产和债权债务进行清理和确认；

3、由基金管理人对基金财产进行估值；

4、由基金管理人负责对基金财产进行变现，基金管理人应该在基金资产处于可变现状态时及时完成资产的全部变现，托管人对此不承担监督义务，如因基金管理人未及时将基金资产变现造成基金份额持有人损失的，全部责任由基金管理人承担；

5、基金管理人制作清算报告（附销户申请）并交由基金托管人，基金托管人对本基金合同约定的需由托管人复核的基金财务数据进行复核，由基金管理人负责将基金清算结果通知基金投资者；

6、由基金管理人对基金剩余财产进行分配；

7、基金管理人和基金托管人应负责注销各自开立的基金相关账户，账户注销过程当中，各方当事人应给与必要的配合和协助，其中基金管理人负责注销交易账户，并将交易账户销户回执发送托管人审核，以确保基金交易账户全部注销、基金资产全部转回托管账户。

### （三）清算费用及支付方式

清算费用是指在进行基金财产清算过程中发生的以下合理费用，包括但不限于：

1、基金资产的保管、清理、估价、变现和分配产生的费用；

2、诉讼仲裁所发生的费用；

3、其他与清算事项相关的费用。

清算费用由基金管理人从基金资产中优先支付。

### （四）基金财产清算剩余资产的分配

除本合同各方当事人另有约定外，基金财产分配采取现金方式。基金托管人根据基金管理人的指令将基金财产划至指定账户。基金财产清算后的剩余资产按如下顺序进行分配：

1、支付基金财产清算费用；

2、缴纳基金所欠税款；

3、清偿基金债务（含托管费、运营服务和管理费）；

4、如有余额，按照本合同约定的收益分配原则分配给基金份额持有人。

**5、未能流通变现资产的处理。**如本基金终止时因持有流通受限证券、投资的产品封闭期（含限售期、锁定期）超过基金存续期或其它原因导致本基金财产无法及时变现的，基金管理人应当于本基金终止后对基金财产进行清算并先行分配已变现部分。待上述未能及时变现的资产可以变现时，基金管理人应当及时完成剩余可变现基金资产的变现操作后进行后续清算，并在支付相关费用后按基金的投资者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，直至所有未能及时变现的资产全部清算完毕，对于清算过程中已变现基金清算财产的延期支付及基金管理人未及时将可变现资产进行变现的，全部责任由基金管理人承担，基金托管人不承担监督及其他任何责任。**基金终止日至基金资产全部清算完毕之日期间，本基金继续计提托管费、运营服务费，其计提方法继续按照本合同的约定执行，其估值方法继续按本合同的规定计算；在此期间，本基金不再计提管理费。**

### （五）基金财产清算报告的告知安排

基金管理人应当在基金终止日起 30 个工作日内编制基金清算报告，经基金托管人对本合同中约定的需由托管人复核的基金财务数据复核无误后，由基金管理人报告基金份额持有人，基金管理人通过约定方式通知基金投资者，即视为履行了告知义务。

基金管理人应当将清算过程中的有关重大事项及时报告基金份额持有人。基金份额持有人一致同意，基金财产清算报告不再另行审计，除非法律法规或监管部门要求必须进行审计。

### （六）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 20 年以上。

### **(七) 基金财产清算其他事宜**

**1、基金财产相关账户的注销。**基金财产清算完成前，基金管理人应负责注销本基金资金账户、证券账户、期货账户等相关账户；基金财产清算完成后，基金托管人按照基金管理人的销户申请文件注销基金的托管账户，基金管理人应给予必要的配合。

**2、基金管理人无法履行清算职责的应急处置。**如因基金管理人依法解散、被依法撤销或被依法宣告破产，被基金业协会宣告失联等基金管理人客观上丧失履行基金清算职责的能力时，基金托管人依据基金份额持有人大会的决议进行清算。如基金份额持有人大会未形成或未及时形成相关决议导致本基金清算不及时造成的任何损失，基金托管人不承担责任。

**3、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通知为准。

## **二十三、违约责任**

(一) 基金份额持有人、基金管理人和基金托管人在实现各自权利、履行各自义务的过程中，违反法律法规规定或者本合同约定，应当承担相应的责任；如给基金财产或者基金合同其他当事人造成的损失，应当分别对各自的行为依法承担赔偿责任。本合同能够继续履行的应当继续履行。

(二) 发生下列情况的，当事人可以免除相应的责任：

- 1、不可抗力；
- 2、基金管理人和/或基金托管人按照有效的法律法规或金融监管部门的规定作为或不作为而造成的损失；
- 3、基金管理人由于按照本合同约定的投资原则行使或不行使其投资权而造成的损失；
- 4、基金份额持有人未能事前就其关联证券或其他禁止交易证券明确告知基金管理人，致使基金财产发生违规投资行为的，基金管理人均不承担任何责任。
- 5、基金托管人由于按照基金管理人符合本合同约定的有效指令执行而造成的损失等。
- 6、基金托管人对存放或存管在基金托管人以外机构的基金资产（包括投资其他证券投资基金、信托计划、证券公司资产管理计划、保险资产管理计划、期货资产管理计划、基金公司/基金子公司资产管理计划等形成的基金资产），或交由商业银行、证券经纪机构、期货经纪机构等其他机构负责清算交收的基金财产（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。
- 7、基金管理人、基金托管人对由于第三方（包括但不限于交易所、中登公司等）发送或提供的数据错误给本基金资产造成的损失等。

(三) 本合同当事一方造成违约后，其他当事方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。守约方因防止损失扩大而支出的合理费用由违约方承担。

(四) 一方依据本合同向另一方赔偿的损失，仅限于直接经济损失。

(五) 基金托管人及基金运营服务机构仅分别依据本合同和与基金管理人签订的《运营服务协议》承担相关责任及义务，基金管理人不得对基金托管人及基金运营服务机构所承担的责任进行虚假宣传，更不得以基金托管人及基金运营服务机构名义或利用基金托管人及基金运营服务机构商誉进行非法募集资金、承诺投资收益等违规活动。

(六) 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或虽发现错误但因前述原因无法及时更新的，由此造成基金财产或基金投资者损失，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但是基金管理人和基金托管人应积极采取必要的措施消除或减轻由此造成的影响。

## 二十四、争议的处理

(一) 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。

(二) 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，任何一方均应当向基金托管人注册地有管辖权的人民法院提起诉讼。

(三) 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。

## 二十五、基金维持运作机制

(一) 基金管理人因依法解散、被依法撤销、被依法宣告破产、被基金业协会公告失联、被监管机构处罚或被采取其他自律监管措施等情况导致其客观上丧失继续管理本基金的能力和资格时，基金管理人应妥善处置本基金财产并及时完成相关资产变现，基金托管人应当按照本合同约定履行保管托管账户中基金资产的义务，基金份额持有人有权根据本合同约定，召集基金份额持有人大会，对安全保障基金财产、维持基金运营或基金清算的应急处置预案或纠纷解决机制等作出决议。

(二) 基金管理人无法履行清算职责的应急处置。如因基金管理人依法解散、被依法撤销或被依法宣告破产，被基金业协会公告失联等基金管理人客观上丧失履行基金清算职责的能力时，基金份额持有人有权根据本基金合同约定召集基金份额持有人大会形成基金清算决议，基金托管人依据基金份额持有人大会的清算决议进行清算。如基金份额持有人大会未形成或未及时形成相关决议导致本基金清算不及时造成的任何损失，基金托管人不承担责任。

(三) 基金管理人和相关当事人对本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。已注销管理人和相关当事人应当根据《证券投资基金法》、协会相关自律规则和基金合同的约定，妥善处置在管基金财产，依法保障投资者的合法权益。

## 二十六、其他事项

(一) 除本合同另有约定外，本合同的通知在下列日期视为送达被通知方：

- 1、专人送达：通知方取得的被通知方签收单所示日；
- 2、快递：被通知方在签收单上签收所示日；
- 3、传真：被通知方收到成功发送的传真并电话确认之日。

4、电子邮件：通知方成功发送被通知方电子邮件之日。

通讯地址或联络方式发生变化的一方（简称“变动方”），应提前 5 个工作日以书面形式通知其他各方。如果变动方未将有关变化及时通知其他各方，变动方应对由此而造成的影响和损失承担责任。

（二）金融监管部门对非公开募集投资基金合同的内容与格式的要求有所变更并适用于本合同的，本合同当事人应立即协商，根据金融监管部门的相关要求修改本合同的内容和格式。

（三）本合同各方当事人应对签署和履行本合同过程中所接触和获取的其他方当事人的数据、信息和其它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合同之目的（法律法规或司法、监管部门要求的除外）。本保密义务不因本合同终止而终止。

（四）本合同如有未尽事宜，由合同当事人按有关法律法规的规定协商解决。

（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

1、自然人

姓名:

证件名称: 身份证、军官证、护照

证件号码:

联系电话:

联系地址:

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:

联系电话:

联系地址:

(二) 基金投资者账户

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

账户名称:

账号:

开户银行名称:

(三) 认购/申购份额

A类份额

B类份额

C类份额

(四) 认购/申购金额

签署本合同之基金投资者,承诺将合法可支配的资金人民币【           】元,大写人民币【           】元整(含认购/申购费)认购/申购本基金。

(本页无正文，为《竹润乐鑫量化精选1号私募证券投资基金基金合同（2025年3月版）》签署页。)

**基金投资者：**

**自然人（签字）：**

**法人或其他组织（盖章）：**

**法定代表人或授权代表（签章）：**

**签署日期：** 年 月 日

**基金管理人：上海竹润投资有限公司（盖章）**

**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：中信建投证券股份有限公司（盖章）**

**法定代表人或授权代理人（签章）：**

**签署日期：** 年 月 日