

合同编号: _____

远澜火松私募证券投资基金
基金合同
之
补充协议(202501)

基金管理人: 上海远澜私募基金管理有限公司

基金托管人: 招商证券股份有限公司

根据《中华人民共和国民法典》、《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称《基金法》)、《私募投资基金登记备案办法》和《私募投资基金监督管理暂行办法》及其他法律法规的有关规定。

现经三方协商一致,签署本补充协议(202501),对《远澜火松私募证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)的相关条款进行以下变更:

一、远澜火松私募证券投资基金基金合同修改对照明细表:

序号 1

一、前言

原条款:	现条款:
<p>2、订立本合同的依据是《中华人民共和国民法总则》、《中华人民共和国民法通则》、《中华人民共和国合同法》、《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称《基金法》)、《私募投资基金监督管理暂行办法》(以下简称《私募办法》)、《私募投资基金管理人登记和基金备案办法(试行)》、《私募投资基金募集行为管理办法》、《私募投资基金信息披露管理办法》和《私募投资基金合同指引1号》(契约型私募基金合同内容与格式指引)。</p>	<p>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条例》、《私募投资基金监督管理暂行办法》(以下简称《私募办法》)、《关于加强私募投资基金监管的若干规定》、《私募投资基金登记备案办法》、《私募投资基金募集行为管理办法》、《私募投资基金信息披露管理办法》、《私募投资基金备案指引第1号——私募证券投资基金》、《私募证券投资基金运作指引》和《私募投资基金合同指引1号》(契约型私募基金合同内容与格式指引)。</p>

序号 2

二、释义

原条款:	现条款:
<p>1、本合同:《远澜火松私募证券投资基金基金合同》及对本合同的任何有效修订和补充。</p>	<p>1、本合同、基金合同、本基金合同:《远澜火松私募证券投资基金基金合同》及对本合同的任何有效修订和补充。</p>

原条款：	现条款：
5、私募基金（简称“基金”）：指在中华人民共和国境内，以非公开方式向合格投资者募集资金设立的投资基金。	5、私募基金、私募投资基金（简称“基金”）：指在中华人民共和国境内，以非公开方式向合格投资者募集资金设立的投资基金。
原条款：	现条款：
13、工作日/交易日：上海证券交易所、深圳证券交易所、上海期货交易所、大连商品交易所、郑州商品交易所、中国金融期货交易所的共同正常交易日。	13、工作日/交易日：上海证券交易所、深圳证券交易所、北京证券交易所、上海期货交易所、大连商品交易所、郑州商品交易所、中国金融期货交易所、广州期货交易所等国务院同意设立的证券期货交易所的共同正常交易日。
原条款：	现条款：
21、证券账户：根据中国证监会有关规定和中国证券登记结算有限责任公司（下称“中登公司”）等相关机构的有关业务规则，由基金托管人（或基金管理人）为基金财产在中登公司上海分公司、深圳分公司开设的证券账户。	21、证券账户：根据中国证监会有关规定和中国证券登记结算有限责任公司（下称“中登公司”）等相关机构的有关业务规则，由基金托管人（或基金管理人）为基金财产在中登公司上海分公司、深圳分公司、北京分公司开设的证券账户。
新增条款：	
27、各类别基金份额净值：计算日各类别基金份额的资产净值除以计算日该类别基金份额总数所得的数值。	
新增条款：	
29、各类别基金份额累计净值：各类别基金份额净值和该类别基金份额历史上累计份额分红金额之和。	
删除条款：	
34、不可抗力：指本合同当事人不能预见、不能避免、不能克服的客观情况。	

<p>新增条款：</p> <p>36、不可抗力：指本合同当事人不能预见、不能避免、不能克服的客观情况，包括但不限于《基金法》及其他有关法律法规及重大政策调整、台风、洪水、地震、流行病及其他自然灾害，战争、骚乱、火灾、政府征用、戒严、没收、恐怖主义行为、突发停电或其他突发事件、证券交易场所非正常暂停或停止交易等事件。</p> <p>37、网上服务平台（服务平台）、投资人服务平台：指招商证券股份有限公司为系统化实现其为管理人、基金份额持有人提供金融运营服务、其他协议约定的托管外包服务而自主开发的在线金融运营服务的相关平台。</p>
<p>新增条款：</p> <p>39、已投资资产：指不包含银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券、货币市场基金等中国证监会认可的现金管理工具的资产，其计算口径为“本基金资产总值-上述现金管理工具资产的市值”。</p> <p>40、同一资产：指本基金应当按照《私募证券投资基金运作指引》要求采用资产组合的方式进行投资的资产，不包括银行活期存款、国债、债券通用质押式回购、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券、公开募集基金等中国证监会、中国基金业协会认可的投资品种。</p> <p>41、违约赎回：指本基金投资者（不含基金管理人及其员工跟投）赎回其持有期限在3个月内（针对认购份额的持有期起算日为基金成立日，针对申购份额的持有期起算日为申购所对应开放日，每月按30个自然日计算，含头不含尾，不含届满日当日）的基金份额的行为。</p>

序号 3

三、声明与承诺 （一）私募基金管理人的声明与承诺

<p>原条款：</p> <p>4、私募基金管理人承诺按照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理运用基金财产，不对基金活动的盈利性和最低收益作出承诺。</p>	<p>现条款：</p> <p>4、私募基金管理人承诺按照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理运用基金财产，不对基金本金不受损失或固定比例损失、基金活动的盈利性和最低收益作出承诺。</p>
<p>原条款：</p>	<p>现条款：</p>

<p>5、私募基金管理人承诺已向私募基金投资者明确介绍私募基金托管人所承担的职责与义务，未对私募基金托管人所承担的责任进行虚假宣传，私募基金管理人亦承诺不以私募基金托管人名义或利用私募基金托管人的商誉进行非法募集资金、承诺投资收益等违法违规活动。</p>	<p>5、私募基金管理人承诺已向私募基金投资者明确介绍私募基金托管人所承担的职责与义务，未对私募基金托管人所承担的责任进行虚假宣传，私募基金管理人亦承诺不以私募基金托管人名义或利用私募基金托管人的商誉进行宣传推介、非法募集资金、承诺投资收益等违法违规活动。</p>
---	--

序号 4

三、声明与承诺 (三) 私募基金投资者的声明与承诺

<p>原条款：</p>	<p>现条款：</p>
<p>2、私募基金投资者承诺其向私募基金管理人提供的有关投资目的、投资偏好、投资限制、财产收入情况和风险承受能力等基本情况真实、完整、准确、合法，不存在任何重大遗漏或误导。</p>	<p>2、私募基金投资者承诺其向私募基金管理人提供的有关个人重大信息（包括但不限于自然人的姓名、国籍、身份证件、联系方式；法人或其他组织的名称、注册地址、办公地址、其他重要联系方式、企业性质、企业资质及经营范围等基本信息；税收居民身份信息）、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。</p>
<p>原条款：</p>	<p>现条款：</p>
<p>3、前述信息资料如发生任何实质性变更，应当及时告知私募基金管理人或代销机构；</p>	<p>3、私募基金投资者承诺前述信息资料如发生任何实质性变更，应当及时告知私募基金管理人或代销机构。</p>
<p>新增条款：</p>	
<p>5、私募基金投资者知晓，中国基金业协会为私募投资基金办理备案不构成对私募基金管理人投资能力的认可，亦不构成对管理人和私募投资基金合规情况的认可，不作为对私募投资基金财产安全的保证。投资者承诺已充分知晓并与私募基金管理人确认所签署的</p>	

合同版本为最新有效的版本合同，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。

序号 5

四、基金的基本情况

新增条款：	
(二) 基金的产品类型：期货和衍生品类私募证券投资基金。	
原条款：	现条款：
(三) 基金的投资目标和投资范围： 本基金通过灵活应用多种投资策略，在充分控制基金财产风险和保证基金财产流动性的基础上，追求合理的投资回报，力争实现基金财产的长期稳健增值。 投资范围请参见合同第十一章“基金的投资”。	(四) 基金的投资目标和投资范围： 投资目标请参见合同“基金的投资”章节之“投资目标”。 投资范围请参见合同“基金的投资”章节之“投资范围”。

序号 6

四、基金的基本情况 (四) 基金的存续期限：

原条款：	现条款：
本基金自成立之日起计算的10年为固定存续期限，10年后的对应月对应日的前一天即为到期日，如到期日为非工作日的，非工作日后的第1个工作日视为到期日。	本基金自成立之日起计算的20年为固定存续期限，20年后的对应月对应日的前一天即为到期日，如到期日为非工作日的，非工作日后的第1个工作日视为到期日。

序号 7

四、基金的基本情况

原条款：
(六) 基金的分类安排 本基金按照投资者身份类别不同分为两类份额，两类份额的管理费、计提业绩报酬的比例的不同，即A类和B类，其中A类份额向管理人（上海远澜私募基金管理有限公司）、

管理员工，以及管理人所管理的其他产品募集，B类份额向除A类投资者外的其他合格投资者募集，两类份额分别设有不同的代码，分开募集，合并运作，基金各类份额将分别计算基金份额净值。

1、份额配比

本基金存续期内，A类、B类的基金份额没有固定的比例关系。

2、净值计算

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

3、基金份额的分类

本基金分为A类、B类，由管理人在基金投资者认购/申购基金份额时确定其基金份额类别。

本合同A类、B类基金份额均无业绩比较基准，基金管理人并不承诺保证基金份额持有人取得收益，也不保证基金份额持有人本金不受损失。

现条款：

(七) 基金份额的分类

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

1、基金份额的分类

本基金分为A类基金份额和B类基金份额，由管理人在基金投资者认购/申购基金份额时根据其属性确定其基金份额类别。**本基金的投资者的身份识别及份额分类由基金管理人确定，基金托管人及基金服务机构不承担监督职责，如因基金份额分类产生的问题基金托管人及基金服务机构不承担责任。**

基金 份额 类别	身份认定	认申购费	赎回费	管理费	业绩报 酬
A	本基金管理人、管理员工、管理人发行或担任投资顾问的资产管理产品（含私募基金）	不收取	收取	不收取	不收取
B	除A类以外的其他合格投资者	不收取	收取	收取	收取

2、基金份额配比

本基金存续期内，A类份额和B类份额没有固定的比例关系。

3、基金份额的参考净值计算

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

删除条款：

(八) 基金的预警与止损：

为保护基金份额持有人的利益，本基金将基金份额净值为 0.85 元设置为预警线，将基金份额净值为 0.80 元设置为止损线。

当基金份额净值低于或等于预警线 0.85 元时（该交易日称为“R 日”），管理人应主动对本基金所持有的投资标的采取以下风险控制措施：在 R+2 日开始并在十个工作日内使本基金所持有的现金类资产（包括存款、证券保证金、备付金、货币基金、债券逆回购）比例不低于基金资产净值的 80%（以成本价计算），直到基金份额净值恢复到预警线以上；如遇因持有流通受限证券等原因导致本基金财产无法及时变现的，则变现时间顺延。

当基金份额净值低于或等于止损线 0.80 元（该交易日称为“D 日”）时，管理人在 D+2 日开始止损操作，并在十个工作日内将持仓标的或衍生品平仓变现。该平仓操作不可逆，在所持全部非现金类资产变现前不可停止。对于已变现部分，根据本合同第二十五章的清算程序对基金进行清算。如遇因持有流通受限证券等原因导致本基金财产无法及时变现的，则变现时间顺延，待全部变现完成之日，管理人进行二次清算。

基金的预警和止损由基金管理人负责执行，如基金管理人：

(1)按照或者未按照基金合同的约定采取风险控制措施和进行止损；

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

由于上述情况对基金财产或基金份额持有人造成的损失，基金托管人不承担责任。

序号 8

五、基金的募集 （一）基金的募集期限、募集机构、募集对象和募集方式

<p>2、募集机构</p> <p>原条款：</p>	<p>2、募集机构</p> <p>现条款：</p>
---	---

<p>本基金募集机构包括私募基金管理人（直销机构）、基金管理人委托的在中国证监会注册取得基金销售业务资格并已成为中国证券投资基金业协会会员的机构（代销机构）。</p>	<p>本基金募集机构包括私募基金管理人（直销机构）、基金管理人委托的在中国证监会注册取得基金销售业务资格并已成为中国证券投资基金业协会会员的机构（代销机构）。基金管理人可以通过发布通知的方式增加本基金的代销机构，并向投资者披露基金销售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。</p>
<p>4、募集对象 原条款：</p>	<p>4、募集对象 现条款：</p>
<p>本基金仅向符合《私募办法》规定的合格投资者发售。合格投资者包括“普通合格投资者”和“特殊合格投资者”。</p> <p>“普通合格投资者”包括具备相应风险识别能力和风险承担能力，投资于单只私募基金的金额不低于 100 万元且符合下列相关标准的单位和个人：(1)净资产不低于 1000 万元的单位；(2)金融资产不低于 300 万元或者最近三年个人年均收入不低于 50 万元的个人。前款所称金融资产包括银行存款、股票、债券、基金份额、资产管理计划、银行理财产品、信托计划、保险产品、期货权益等。</p> <p>“特殊合格投资者”包括下列投资者： (1) 社会保障基金、企业年金等养老基金，慈善基金等社会公益基金；(2) 依法设立并在中国基金业协会备案的投资计划；(3) 投资于所管理私募基金的私募基金管理人及其从业人</p>	<p>本基金仅向符合《私募办法》规定的合格投资者发售。合格投资者包括“普通合格投资者”和“特殊合格投资者”。投资者的身份识别及购买本基金行为由基金管理人和代销机构（如有）进行控制和确认。</p> <p>“普通合格投资者”包括具备相应风险识别能力和风险承担能力，投资于单只私募基金的金额不低于 100 万元且符合下列相关标准的单位和个人：(1)净资产不低于 1000 万元的单位；(2)金融资产不低于 300 万元或者最近三年个人年均收入不低于 50 万元的个人。前款所称金融资产包括银行存款、股票、债券、基金份额、资产管理计划、银行理财产品、信托计划、保险产品、期货权益等。</p> <p>“特殊合格投资者”包括下列投资者： (1) 社会保障基金、企业年金等养老基金，慈善基金等社会公益基金；(2) 依法设立并在中</p>

<p>员；(4)中国证监会规定的其他投资者。</p> <p>如相关机构新颁布并实施关于“合格投资者”的法律、行政法规、部门规章、自律规则，则从其规定。</p>	<p>国基金业协会备案的投资计划；(3)投资于所管理私募基金的私募基金管理人及其从业人员；(4)中国证监会规定的其他投资者。</p> <p>如相关机构新颁布并实施关于“合格投资者”的法律、行政法规、部门规章、自律规则，则从其规定。</p> <p>特别地，如本基金投资于私募资管产品（含私募基金）的，则本基金不再接受私募资管产品（含私募基金）作为投资者购买本基金；如本基金接受私募资管产品（含私募基金）作为投资者购买本基金，本基金整体嵌套层级不得超过一层，法律法规、中国证监会另有规定的，经基金管理人和基金托管人协商一致后可根据相关规定依法调整。</p>
---	--

序号 9

五、基金的募集 （二）募集账户信息

<p>2、代销募集账户</p> <p>原条款：</p>	<p>2、代销募集账户</p> <p>现条款：</p>
<p>本基金代销募集账户由基金管理人委托的代销机构自行开立并自行聘请监督机构对其进行监督，代销募集账户的开户行、账户名称、账户号码及监督机构等信息以基金管理人或代销机构届时公告为准。</p>	<p>本基金代销募集账户由基金管理人委托的代销机构自行开立并自行聘请监督机构对其进行监督，代销募集账户的开户行、账户名称、账户号码及监督机构等信息以基金管理人或代销机构届时公告为准，如在本基金存续期间代销募集账户有变更的，由管理人在变更生效后通知托管人。</p>

序号 10

五、基金的募集 （三）基金份额的认购事项

<p>原条款：</p>	<p>现条款：</p>
--------------------	--------------------

<p>募集机构应当将基金初始销售期间投资者的资金存入募集结算资金专用账户，在基金初始销售行为结束前，任何机构和个人不得动用。基金成立前，认购款在募集结算资金专用账户产生的利息归入基金财产，利息金额按中国人民银行同期活期存款利率计息，具体金额以份额登记机构记录为准。利息金额在募集结算资金专用账户实际结息后应归入基金财产，基金托管人不承担监督职责。</p>	<p>募集机构应当将基金初始销售期间投资者的资金存入募集结算资金专用账户，在基金初始销售行为结束前，任何机构和个人不得动用。基金成立前，认购款在募集结算资金专用账户产生的利息归入基金财产，利息金额按中国人民银行同期活期存款利率计息，具体金额以份额登记机构记录为准。利息金额在募集结算资金专用账户实际结息后应归入基金财产，基金托管人对此不承担监督职责。</p>
---	---

序号 11

五、基金的募集 (四) 基金份额认购金额及付款期限

<p>原条款：</p>	<p>现条款：</p>
<p>投资者在募集期间的认购金额应不低于100万元人民币（不含认购费，且本合同“募集对象”中的“特殊合格投资者”不受此限），并可在管理人规定的募集期限分多次缴款，募集期间每次追加认购金额应不低于1万元人民币。</p>	<p>投资者在募集期间的认购金额应不低于100万元人民币（不含认购费，本合同“募集对象”中“特殊合格投资者”的最低认购金额按照法律法规及自律规则相关规定执行），并可在管理人规定的募集期限分多次缴款，募集期间每次追加认购金额应不低于1万元人民币（不含认购费）。</p>

序号 12

五、基金的募集 (五) 投资冷静期

<p>原条款：</p>	<p>现条款：</p>
<p>基金投资者自签署本合同且全额缴纳认购份额款项后二十四小时内为本基金的认购投资冷静期，募集机构在投资冷静期内不得主动联系基金投资者。但是，“特殊合格投资者”、专业投资机构、受国务院金融监督</p>	<p>基金投资者自签署本合同且全额缴纳购买基金款项后二十四小时内为本基金的投资冷静期，募集机构在投资冷静期内不得主动联系基金投资者。但是，“特殊合格投资者”、专业投资机构、受国务院金融监督管</p>

管理机构监管的金融产品不适用投资冷静期的限制。	理机构监管的金融产品不适用投资冷静期的限制。
-------------------------	------------------------

序号 13

五、基金的募集 (六) 回访制度

原条款:	现条款:
<p>在中国基金业协会正式要求私募基金的募集机构实施《私募投资基金募集行为管理办法》规定的回访制度之前, 本基金直销机构暂不实施该回访制度, 代销机构可自行决定是否实施该回访制度。</p> <p>在中国基金业协会正式要求私募基金的募集机构实施《私募投资基金募集行为管理办法》规定的回访制度之后, 募集机构应当在投资冷静期满后, 指令本机构从事基金销售推介业务以外的人员以录音电话、电邮、信函等适当方式进行投资回访。未经回访确认成功, 投资者缴纳的认购基金款项不得由募集结算资金专用账户划转到托管资金账户, 基金管理人不得投资运作投资者缴纳的认购基金款项。但是, “特殊合格投资者”、专业投资机构、受国务院金融监督管理机构监管的金融产品不适用本回访制度。在此情况下, 基金管理人有权根据回访制度的实施需要而变更本合同项下的相关条款, 但应提前通知基金投资者, 对基金投资者履行告知义务。</p>	<p>在中国基金业协会正式要求私募基金的募集机构实施《私募投资基金募集行为管理办法》规定的回访制度之前, 本基金直销机构暂不实施该回访制度, 代销机构可自行决定是否实施该回访制度。</p> <p>在中国基金业协会正式要求私募基金的募集机构实施《私募投资基金募集行为管理办法》规定的回访制度之后, 募集机构应当在投资冷静期满后, 指令本机构从事基金销售推介业务以外的人员以录音电话、电邮、信函等适当方式进行投资回访。未经回访确认成功, 投资者缴纳的购买基金款项不得由募集结算资金专用账户划转到托管资金账户, 基金管理人不得投资运作投资者缴纳的购买基金款项。但是, “特殊合格投资者”、专业投资机构、受国务院金融监督管理机构监管的金融产品不适用本回访制度。在此情况下, 基金管理人有权根据回访制度的实施需要而变更本合同项下的相关条款, 但应提前通知基金投资者, 对基金投资者履行告知义务。</p>

序号 14

原条款:	现条款:
<p>七、基金的申购、赎回与转让</p> <p>(一) 申购和赎回的开放日及时间</p> <p>基金投资者可在本基金开放日根据本合同相关约定申购和/或赎回本基金,但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或本合同的规定发布暂停申购和/或赎回通知时除外。基金投资者须在开放日或开放日之前的工作日的9:00-15:00内根据募集机构的规定向募集机构及其销售网点提交书面申请文件(如募集机构另有规定的,遵循募集机构相关规定办理申请提交事宜)。未提交书面申请文件的,募集机构及其销售网点有权拒绝投资者的申购或赎回申请。</p> <p>本基金固定开放日为每周四(遇法定节假日顺延至下一工作日;如本周无下一个工作日的,则本周无固定开放日),管理人可根据实际情况增设临时开放日(每个自然年度原则上不超过12个工作日,且临时开放日的设置原则上不得使基金出现连续2个工作日开放,管理人有权在基金运营及技术条件支持等情况下进行调整),具体开放日期以管理人通知为准(管理人向托管人发出申购和/或赎回指令即视为已向托管人通知增设临时开放日,因管理人未及时通知基金投资者临时开放日导致的损失,托管人不承担责任)。</p> <p>(二) 申购和赎回的办理机构</p> <p>本基金运作期间的募集机构包括直销机</p>	<p>七、基金的申购、赎回、转让与转换</p> <p>(一) 申购和赎回的开放日及时间</p> <p>基金投资者可在本基金开放日根据本合同相关约定申购和/或赎回本基金,但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或本合同的规定发布暂停申购和/或赎回通知时除外。基金投资者须在开放日或开放日之前的工作日的9:00-15:00内根据募集机构的规定向募集机构及其销售网点提交书面申请文件(如募集机构另有规定的,遵循募集机构相关规定办理申请提交事宜)。未提交书面申请文件的,募集机构及其销售网点有权拒绝投资者的申购或赎回申请。基金管理人应当进行统筹,使本基金的开放安排与本基金的产品类型、投资策略以及资产组合的流动性等相匹配。</p> <p>本基金固定开放日为每自然周的周四(遇法定节假日顺延至下一工作日,如本周无下一个工作日的,则本周无固定开放日)。</p> <p><u>其中,若涉及本基金管理人及其员工跟投基金份额的,本基金管理人及其员工跟投份额设置一定期限内不允许赎回的限制,其期限应当以6个月(针对认购份额的持有期起算日为基金成立日,针对申购份额的持有期起算日为申购所对应开放日,每月按30个自然日计算,含头不含尾,不含届满日当日)与其他份额不允许赎回期限的限制(如设</u></p>

<p>构（基金管理人）和/或基金管理人委托的代销机构。</p> <p>基金投资者应当在募集机构办理基金销售业务的营业场所或按募集机构提供的其他方式办理基金份额的申购和赎回。基金管理人可根据情况变更或增减基金代销机构，并予以通知。</p> <p>（三）申购的出资方式</p> <p>本基金的申购以人民币货币资金形式交付，基金不接受现金方式申购。</p> <p>在直销机构申购的投资者应将申购资金从在中国境内开立的自有银行账户划款至募集结算资金专用账户，在代销机构申购的投资者按代销机构的规定缴付资金。申购款在募集结算资金专用账户产生的利息归入基金财产，利息金额按中国人民银行同期活期存款利率计息，具体金额以份额登记机构记录为准。利息金额在募集结算资金专用账户实际结息后应归入基金财产，基金托管人不承担监督职责。</p> <p>（四）申购和赎回的方式、价格及程序</p> <p>1、基金投资者申购基金时，按照申购申请所对应开放日的<u>该</u>类别基金份额净值为基准计算基金份额。基金份额持有人赎回基金时，按照赎回申请所对应开放日的<u>该</u>类别基金份额净值计算赎回金额。</p> <p>2、“未知价”原则，即基金的申购价格、赎回价格以开放日收市后计算的<u>该</u>类别基金份额净值为基准进行计算。</p>	<p><u>置)孰长者为准，且本基金管理人及其员工跟投份额不得在开放日（含临时开放日）豁免 6 个月不允许赎回期限的限制（基金管理人应及时将基金管理人及员工跟投名单提供给基金服务机构，由基金服务机构协助基金管理人</u>对基金管理人及其员工跟投份额不允许赎回期限进行控制，由于基金管理人未及时提供数据导致的运营错误，基金服务机构和托管人不承担责任）。</p> <p><u>仅出现以下情形时，管理人可增设临时开放日：法律、行政法规、自律规则及有关监管政策调整、合同变更或解除等情形。临时开放日可赎回（含违约赎回）不可申购，具体开放日期以管理人通知为准，基金管理人应当在临时开放日前 2 个工作日按照本基金合同约定的方式通知全体投资者（管理人向托管人及基金服务机构发出赎回指令即视为已向托管人及基金服务机构通知增设临时开放日，因管理人未及时通知基金投资者临时开放日导致的损失，托管人及基金服务机构不承担责任）；除合同另有约定外，临时开放日赎回的份额不收取赎回费，但持有期小于 3 个月的赎回费（如有）不可以减免。</u></p> <p>当本基金上一年度日均基金资产净值低于 500 万元，或者连续 60 个交易日（自 2025 年 1 月 1 日起计算）出现基金资产净值低于 500 万元时，本基金停止申购，且基金管理人应在 5 个工作日内向投资者披露。</p> <p>（二）申购和赎回的办理机构</p>
---	--

<p>3、基金申购采用金额申请的方式，基金赎回采用份额申请的方式。</p> <p>4、基金份额持有人赎回基金时，按先进先出的原则，即基金投资者认购、申购基金份额的先后次序进行顺序赎回。具体以募集机构发送的赎回申请数据为准。</p> <p>（五）申购和赎回申请的确认</p> <p>在正常情况下，基金管理人在 T+2 日对 T 日申购和赎回申请的有效性进行确认（如遇特殊情况且在管理人和托管人技术条件支持下，管理人有权对份额确认日进行调整，并通知基金份额持有人和托管人）。若申购不成功，则申购款项退还给投资者。</p> <p>募集机构对申购、赎回的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表募集机构确实接收到申请。申购、赎回的确认以基金管理人的确认结果为准。</p> <p>（六）申购和赎回的金额限制</p> <p>基金投资者首次申购金额应不低于 100 万元人民币（不含申购费，且本合同“募集对象”中的“特殊合格投资者”不受此限），对于已持有私募基金份额的投资者在开放日内追加申购的，追加金额应不低于 1 万元人民币。</p> <p>基金份额持有人持有的基金资产净值高于 100 万元时，可以选择部分赎回基金份额，基金份额持有人在赎回后持有的基金资产净值不得低于 100 万元，基金份额持有人申请赎回基金份额时，其持有的基金资产净值低</p>	<p>本基金运作期间的募集机构包括直销机构（基金管理人）和/或基金管理人委托的代销机构。</p> <p>基金投资者应当在募集机构办理基金销售业务的营业场所或按募集机构提供的其他方式办理基金份额的申购和赎回。基金管理人可根据情况变更或增减基金代销机构，并予以通知。</p> <p>（三）申购的出资方式</p> <p>本基金的申购以人民币货币资金形式交付，基金不接受现金方式申购。</p> <p>在直销机构申购的投资者应将申购资金从在中国境内开立的自有银行账户划款至募集结算资金专用账户，在代销机构申购的投资者按代销机构的规定缴付资金。申购款在募集结算资金专用账户产生的利息归入基金财产，利息金额按中国人民银行同期活期存款利率计息，具体金额以份额登记机构记录为准。利息金额在募集结算资金专用账户实际结息后应归入基金财产，基金托管人不承担监督职责。</p> <p>（四）申购和赎回的方式、价格及程序</p> <p>1、基金投资者申购基金时，按照申购申请所对应开放日的各类别基金份额净值为基准计算基金份额；基金份额持有人赎回基金时，按照赎回申请所对应开放日的各类别基金份额净值计算赎回金额；本合同另有约定的除外。</p> <p>2、“未知价”原则，即基金的申购价格、</p>
--	---

<p>于 100 万元的，必须选择一次性赎回全部基金份额，基金份额持有人没有一次性全部赎回持有份额的，管理人将该基金份额持有人所持份额做全部赎回处理（“全部赎回处理的份额”不受基金份额不允许赎回期限的限制，但应按照本合同的约定收取赎回费（如有））。本合同“募集对象”中的“特殊合格投资者”不适用于上述规定的赎回金额限制。</p> <p>（七）申购和赎回的费用</p> <p>1、申购费用 本基金不收取申购费。</p> <p>2、赎回费用 本基金不收取赎回费。</p> <p>（八）申购份额与赎回金额的计算方式</p> <p>1、申购份额计算 $\text{申购份额} = \text{申购金额} \div \text{申购价格}$ 申购价格为申购申请所对应开放日基金该类别份额净值。</p> <p>若基金份额申购时所对应的份额类别无历史份额净值时，则以申购所对应开放日基金份额净值（基金层面）作为申购价格；若基金份额申购时所对应的份额类别已经全部赎回，且有历史份额净值时，则以申购所对应开放日基金份额净值（基金层面）作为申购价格。申购份额保留到小数点后 2 位，小数点后第 3 位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。</p> <p>2、赎回金额计算</p>	<p>赎回价格以开放日收市后计算的各类别基金份额净值为基准进行计算，本合同另有约定的除外。</p> <p>3、基金申购采用金额申请的方式，基金赎回采用份额申请或金额申请（仅限允许使用该种申请方式的直销机构和支撑该种申请方式的代销机构）的方式。针对赎回采取金额申请的，基金管理人将根据基金份额持有人的申请按照先进先出原则确认基金份额持有人本次赎回对应所持有的份额，并根据本合同约定收取相关费用（包括但不限于赎回费和业绩报酬等），当基金份额持有人金额赎回的申请金额大于其所持全部可赎回份额对应净资产（扣除相关费用之后）时，其所有可赎回份额将被全部赎回，但对于不可赎回的基金份额（如有）将按赎回失败处理（如基金份额持有人持有的剩余资产不足合同约定最低值则按照合同相关约定处理）。在计算过程中因四舍五入等尾差因素导致最终赎回确认金额与赎回申请金额不一致的，以基金管理人最终确认数据为准。</p> <p>4、基金份额持有人赎回基金时，按先进先出的原则，即基金投资者认购、申购基金份额的先后次序进行顺序赎回。具体以募集机构发送的赎回申请数据为准。</p> <p>（五）申购和赎回申请的确认</p> <p>在正常情况下，基金管理人在 T+2 日对 T 日申购和赎回申请的有效性进行确认（如遇特殊情况且在管理人和托管人技术条件支持</p>
--	---

<p>赎回金额=赎回份数×赎回价格-业绩报酬（如有）</p> <p>赎回价格为赎回申请所对应开放日该类基金份额净值。</p> <p>赎回金额保留到小数点后 2 位，小数点后第 3 位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。</p> <p>（九）拒绝或暂停申购、暂停赎回的情形及处理</p> <p>1、在如下情形下，基金管理人可以拒绝接受基金投资者的申购申请：</p> <p>退出退出份额占当日金额认购</p> <p>（1）根据市场情况，基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，从而损害现有基金份额持有人的利益的情形；</p> <p>（2）因基金持有的某个或某些证券进行权益分派等原因，使基金管理人认为短期内接受申购可能会影响或损害现有基金份额持有人利益的情形；</p> <p>（3）基金管理人认为接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害其他基金份额持有人利益的情形；</p> <p>（4）法律法规规定或经中国证监会认定或本合同约定的其他情形。</p> <p>基金管理人决定拒绝接受某些基金投资者的申购申请时，申购款项将退回基金投资者账户。</p> <p>2、在如下情形下，基金管理人可以暂停</p>	<p>下，管理人有权对份额确认日进行调整，并通知基金份额持有人和托管人）。若申购不成功，则申购款项退还给投资者。</p> <p>募集机构对申购、赎回的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表募集机构确实接收到申请。申购、赎回的确认以基金管理人的确认结果为准。</p> <p>（六）申购和赎回的金额限制</p> <p>基金投资者首次申购金额应不低于 100 万元人民币（不含申购费，本合同“募集对象”中“特殊合格投资者”的首次最低申购金额按照法律法规及自律规则相关规定执行），对于已持有私募基金份额的投资者在开放日内追加申购的，追加金额应不低于 1 万元人民币（不含申购费）。</p> <p>基金份额持有人持有的基金资产净值高于 100 万元时，可以选择部分赎回基金份额，基金份额持有人在赎回后持有的基金资产净值不得低于 100 万元，如基金份额持有人在赎回后持有的基金资产净值低于 100 万元，则基金管理人与基金份额持有人协商后可采用将剩余份额做全部赎回处理（“全部赎回处理的份额”不受基金份额不允许赎回期限的限制，但应按照本合同的约定收取赎回费（如有））或者减少基金份额持有人本次赎回份额数量使赎回后持有的基金资产净值不低于 100 万元的处理方式；基金份额持有人申请赎回基金份额时，其持有的基金资产净值低于 100 万元的，必须选择一次性赎回全</p>
---	---

<p>基金投资者的申购：</p> <p>(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；</p> <p>(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；</p> <p>(3) 本基金的证券/期货经纪商没有或未及时发送交易清算数据或对账数据、发送的交易清算数据或对账数据不完整或有误，导致无法或未能及时计算当日基金资产净值的情形；</p> <p>(4) 对于没有或未及时获取场外交易数据或场外行情数据、场外交易数据或场外行情数据不完整或有误，导致无法或未能及时计算当日基金资产净值的情形；</p> <p>(5) 发生本合同规定的暂停基金资产估值的情形；</p> <p>(6) 法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。</p> <p>基金管理人决定暂停接受全部或部分申购申请时，应当以约定的形式告知基金投资者。在暂停申购的情形消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理并以约定的形式告知基金投资者。</p> <p>3、在如下情形下，基金管理人可以暂停基金份额持有人的赎回：</p> <p>(1) 因不可抗力导致基金管理人无法支付赎回款项的情形；</p> <p>(2) 证券交易场所交易时间临时停市，</p>	<p>部基金份额，基金份额持有人没有一次性全部赎回持有份额的，管理人将该基金份额持有人所持份额做全部赎回处理（“全部赎回处理的份额”不受基金份额不允许赎回期限的限制，但应按照本合同的约定收取赎回费（如有））。法律法规及自律规则颁布并实施关于本合同“募集对象”中的“特殊合格投资者”对于上述规定的赎回金额限制的，从其规定。</p> <p>(七) 申购和赎回的费用</p> <p>1、申购费用</p> <p>本基金无申购费用。</p> <p>2、赎回费用</p> <p>赎回费=（赎回份数×赎回价格-业绩报酬（如有））×赎回费率</p> <p>赎回价格为基金赎回申请所对应开放日的基金份额净值。</p> <p>若基金份额持有时间少于3个月视为违约赎回，违约赎回费率0.5%，违约赎回费不允许减免；若基金份额持有时间大于等于3个月，不收取赎回费。</p> <p>赎回费率根据基金份额实际持有时间计算。其中，基金份额持有人认购基金，持有时间从基金成立日起计算至赎回申请所对应开放日；基金份额持有人申购基金，持有时间从申购申请所对应开放日起计算至赎回申请对应开放日；每月按30个自然日计算，含头不含尾。</p> <p>基金份额持有人赎回费归本基金资产所</p>
---	---

<p>导致基金管理人无法计算当日基金资产净值的情形：</p> <p>（3）本基金的证券/期货经纪商没有或未及时发送交易清算数据或对账数据、发送的交易清算数据或对账数据不完整或有误，导致无法或未能及时计算当日基金资产净值的情形；</p> <p>（4）对于没有或未及时获取场外交易数据或场外行情数据、场外交易数据或场外行情数据不完整或有误，导致无法或未能及时计算当日基金资产净值的情形；</p> <p>（5）发生本合同规定的暂停基金资产估值的情形；</p> <p>（6）法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。</p> <p>发生上述情形之一且基金管理人决定暂停赎回的，基金管理人应当以约定的形式告知基金份额持有人。已接受的赎回申请，基金管理人应当足额支付；如暂时不能足额支付，应当按单个赎回申请人已被接受的赎回金额占已接受的赎回总金额的比例将可支付金额分配给赎回申请人，其余部分在后续工作日予以支付。</p> <p>在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并以约定的形式告知基金份额持有人。</p> <p>（十）巨额赎回的认定及处理方式</p> <p>1、巨额赎回的认定</p> <p>单个开放日中，本基金需处理的基金净</p>	<p>有。本基金不允许减免违约赎回费。</p> <p>（八）申购份额与赎回金额的计算方式</p> <p>1、申购份额计算</p> <p>申购份额=申购金额÷申购价格</p> <p>申购价格为申购申请所对应开放日各类别基金份额的份额净值。若基金份额申购时所对应的份额类别无历史份额净值时，则以申购所对应开放日基金份额净值（基金层面）作为申购价格；若基金份额申购时所对应的份额类别已经全部赎回，且有历史份额净值时，则以申购所对应开放日基金份额净值（基金层面）作为申购价格。</p> <p>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。</p> <p>2、赎回金额计算</p> <p>赎回金额=赎回份数×赎回价格-赎回费（如有）-赎回时提取的业绩报酬（如有）</p> <p>赎回价格为赎回申请所对应开放日各类别基金份额的份额净值。</p> <p>赎回金额保留到小数点后2位，小数点后第3位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。</p> <p>（九）拒绝或暂停申购、暂停赎回的情形及处理</p> <p>1、在如下情形下，基金管理人应当拒绝接受基金投资者的申购申请：</p> <p>（1）根据市场情况，基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩</p>
---	---

<p>赎回申请份额超过本基金上一工作日基金总份额的 10%时，即认为本基金发生了巨额赎回。</p> <p>2、巨额赎回的处理方式</p> <p>如开放日提出的赎回申请构成巨额赎回，基金管理人对巨额赎回全部接受，但可根据情况适当延期赎回款项支付时间，最长不应超过 30 个工作日（在未完成基金份额持有人赎回款项的支付之前，基金管理人不得将托管资金账户的资金用于新增投资）。延期支付赎回款项的赎回价格为基金份额持有人申请赎回开放日的各类别基金份额净值。延期支付的赎回款项不支付利息。</p> <p>3、巨额赎回延迟支付的通知：当发生巨额赎回并且基金管理人决定延期支付赎回款项时，基金管理人应当通知基金份额持有人。受单笔赎回最低金额的限制。</p> <p>3、巨额赎回的公告</p> <p>当发生巨额赎回并顺延赎回时，基金管理人应通过邮寄、传真、电话或网上公告等方式在 2 个工作日内通知申请赎回的基金份额持有人和基金托管人，说明有关处理方法。</p> <p>（十一）基金份额的转让</p> <p>在不违反法律法规及监管部门的相关规定的前提下，基金份额持有人可向其他合格投资者转让基金份额。基金份额转让须按照中国基金业协会要求进行份额登记。转让期间及转让后，持有基金份额的合格投资者数量合计不得超过法定人数。</p>	<p>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；</p> <p>（2）因基金持有的某个或某些证券进行权益分派等原因，使基金管理人认为短期内接受申购可能会影响或损害现有基金份额持有人利益的情形；</p> <p>（3）基金管理人认为接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害其他基金份额持有人利益的情形；</p> <p>（4）法律法规规定或经中国证监会认定或本合同约定的其他情形。</p> <p>基金管理人决定拒绝接受某些基金投资者的申购申请时，申购款项将退回基金投资者账户。</p> <p>2、在如下情形下，基金管理人可以暂停基金投资者的申购：</p> <p>（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；</p> <p>（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；</p> <p>（3）本基金的证券/期货经纪商没有或未及时发送交易清算数据或对账数据、发送的交易清算数据或对账数据不完整或有误，导致无法或未能及时计算当日基金资产净值的情形；</p> <p>（4）对于没有或未及时获取场外交易数据或场外行情数据、场外交易数据或场外行情数据不完整或有误，导致无法或未能及时</p>
---	---

<p>1、基金份额转让的报备</p> <p>(1) 基金投资者拟将其份额转让给其他人的, 需经基金管理人同意, 并按基金管理人的要求向基金管理人履行报备义务, 由基金管理人负责审核受让方是否符合相关法律法规及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。</p> <p>(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。</p> <p>(3) 对于在受让前未持有该基金份额的投资者, 其首次受让的基金份额所对应的资产净值不低于 100 万元。</p> <p>(4) 基金管理人在接收报备后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证券投资基金份额转让相关协议(下称“转让协议”)。</p> <p>2、基金份额转让的变更登记</p> <p>(1) 基金投资者应在转让协议签订之日起 10 个工作日内, 向基金管理人申请办理基金份额的转让变更登记手续, 并提供以下材料:</p> <p>1) 各方签署的份额转让协议;</p> <p>2) 基金投资者向基金管理人申请进行基</p>	<p>计算当日基金资产净值的情形;</p> <p>(5) 发生本合同规定的暂停基金资产估值的情形;</p> <p>(6) 法律法规规定或经中国证监会认定或本合同约定的其他情形。</p> <p>基金管理人决定暂停接受全部或部分申购申请时, 应当以约定的形式告知基金投资者。在暂停申购的情形消除时, 基金管理人应及时恢复申购业务的办理并以约定的形式告知基金投资者。</p> <p>3、在如下情形下, 基金管理人可以暂停基金份额持有人的赎回:</p> <p>(1) 因不可抗力导致基金管理人无法支付赎回款项的情形;</p> <p>(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;</p> <p>(3) 本基金的证券/期货经纪商没有或未及时发送交易清算数据或对账数据、发送的交易清算数据或对账数据不完整或有误, 导致无法或未能及时计算当日基金资产净值的情形;</p> <p>(4) 对于没有或未及时获取场外交易数据或场外行情数据、场外交易数据或场外行情数据不完整或有误, 导致无法或未能及时计算当日基金资产净值的情形;</p> <p>(5) 发生本合同规定的暂停基金资产估值的情形;</p> <p>(6) 法律法规规定或经中国证监会认定</p>
--	---

<p>金份额转让报备的文件：</p> <p>3) 转让方身份证明文件（机构为营业执照；个人为身份证）；</p> <p>4) 受让方身份证明文件（机构为营业执照；个人为身份证）；</p> <p>5) 具体经办人身份证明文件及授权委托书。</p> <p>（2）基金管理人在收到上述申请文件后，及时向基金份额登记机构申请办理基金份额变更登记手续，由基金份额登记机构对管理人提交的份额转让材料进行形式审核无误后，配合办理基金份额变更登记手续。</p> <p>（3）基金份额转让相关交易及变更登记申请文件的真实性由基金管理人负责审核确认。基金份额登记机构只对收到的申请文件进行形式审查。基金份额登记机构对收到的申请文件完成形式审查，即有充分理由信赖本次基金份额转让的真实性。若因当事人提供的上述文件不合法、不真实、不完整或失去效力而影响基金份额登记机构审核或给任何第三人带来损失，基金份额登记机构不承担任何形式的责任。</p> <p>（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。</p>	<p>或本合同约定的其他情形。</p> <p>发生上述情形之一且基金管理人决定暂停赎回的，基金管理人应当以约定的形式告知基金份额持有人。已接受的赎回申请，基金管理人应当足额支付；如暂时不能足额支付，应当按单个赎回申请人已被接受的赎回金额占已接受的赎回总金额的比例将可支付金额分配给赎回申请人，其余部分在后续工作日予以支付。</p> <p>在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并以约定的形式告知基金份额持有人。</p> <p>（十）巨额赎回的认定及处理方式</p> <p>1、巨额赎回的认定</p> <p>单个开放日中，本基金需处理的基金净赎回申请份额超过本基金上一工作日基金总份额的 10%时，即认为本基金发生了巨额赎回。</p> <p>2、巨额赎回的处理方式</p> <p>当出现巨额赎回时，基金管理人可以根据本基金的资产组合状况决定采取以下处理方式：</p> <p>（1）如开放日提出的赎回申请构成巨额赎回，基金管理人对巨额赎回全部接受，但可根据情况适当延期赎回款项支付时间，最长不应超过 30 个工作日（在未完成基金份额持有人赎回款项的支付之前，基金管理人不得将托管资金账户的资金用于新增投资）。延期支付赎回款项的赎回价格为基金份额持有</p>
---	--

	<p>人申请赎回开放日的各类别基金份额的份额净值。延期支付的赎回款项不支付利息。</p> <p>(2)连续巨额赎回：若本基金连续两个开放日以上（含两个开放日）发生巨额赎回导致本基金的赎回款支付出现困难的，如基金管理人认为有必要，可暂停接受基金的赎回申请，已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，并应当通知基金份额持有人；管理人应当在下一个开放日前尽量调节本基金流动性以满足基金份额持有人在开放日的赎回需求。在本基金流动性允许的情形下，原则上管理人应在触发暂停赎回后的下个开放日恢复办理赎回，具体以管理人的通知为准。</p> <p>3、巨额赎回的通知</p> <p>当发生巨额赎回并且基金管理人决定采取延期支付赎回款项的处理方式时，基金管理人应当在基金份额确认日之后的2个工作日内按照本合同约定的方式通知申请赎回的基金份额持有人及基金托管人。</p> <p>(十一) 单个投资者大额赎回的认定、预约申请和处理方式</p> <p>本基金不单独设置单个投资者大额赎回及预约申请安排。</p> <p>(十二) 基金份额的转让</p> <p>在不违反法律法规及监管部门的相关规定的前提下，基金份额持有人可向其他合格投资者转让基金份额。基金份额转让须按照中国基金业协会要求进行份额登记。转让期间及转让后，持有基金份额的合格投资者数</p>
--	---

	<p>量合计不得超过法定人数。</p> <p>1、基金份额转让的报备</p> <p>(1) 基金投资者拟将其份额转让给其他人的，需经基金管理人同意，并按基金管理人的要求向基金管理人履行报备义务，由基金管理人负责审核受让方是否符合相关法律法规及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。</p> <p>(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。</p> <p>(3) 对于在受让前未持有该基金份额的投资者，其首次受让的基金份额所对应的资产净值不低于 100 万元。</p> <p>(4) 基金管理人在接收报备后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”）。</p> <p>2、基金份额转让的变更登记</p> <p>(1) 基金投资者应在转让协议签订之日起 10 个工作日内，向基金管理人申请办理基金份额的转让变更登记手续，并提供以下材料：</p> <p>1) 各方签署的份额转让协议；</p>
--	--

	<p>2) 基金投资者向基金管理人申请进行基金份额转让报备的文件;</p> <p>3) 转让方身份证明文件(机构为营业执照;个人为身份证);</p> <p>4) 受让方身份证明文件(机构为营业执照;个人为身份证);</p> <p>5) 具体经办人身份证明文件及授权委托书。</p> <p>(2) 基金管理人在收到上述申请文件后,及时向基金份额登记机构申请办理基金份额变更登记手续,由基金份额登记机构对管理人提交的份额转让材料进行形式审核无误后,配合办理基金份额变更登记手续。</p> <p>(3) 基金份额转让相关交易及变更登记申请文件的真实性由基金管理人负责审核确认。基金份额登记机构只对收到的申请文件进行形式审查。基金份额登记机构对收到的申请文件完成形式审查,即有充分理由信赖本次基金份额转让的真实性。若因当事人提供的上述文件不合法、不真实、不完整或失去效力而影响基金份额登记机构审核或给任何第三人带来损失,基金份额登记机构不承担任何形式的责任。</p> <p>(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。</p> <p>(十三) 基金转换</p> <p>在不违反法律法规、监管部门的相关规定以及基金份额登记机构业务能够支持的前</p>
--	--

	<p>提下，基金管理人可以根据相关法律法规以及本基金合同的约定决定开办本基金与本基金管理人或其他私募基金管理人管理的其他私募基金之间的转换业务，基金转换可以收取一定合理的转换费。基金转换业务相关规则不得对投资者的自主投资权利进行任何形式的不合理限制，且不得对本基金申购、赎回、投资、收益分配等重要约定进行变更。基金转换业务相关规则由基金管理人届时根据相关法律法规及本基金合同的约定制定并通知基金投资者，并提前告知基金托管人、基金服务机构与相关机构。</p>
--	--

序号 15

八、当事人及权利义务 （一）基金份额持有人

<p>3、基金份额持有人的义务 新增条款：</p>
<p>（13）在签署本合同前，向基金管理人书面告知自身关联方以及与自身关联方有其他重大利害关系的关联方发行的证券名单或资管产品清单或作为交易对手方的清单，并且在上述名单发生变更时，及时书面通知基金管理人；</p>

序号 16

八、当事人及权利义务 （二）基金管理人

<p>1、基金管理人概况 原条款：</p>	<p>1、基金管理人概况 现条款：</p>
<p>名称：上海远澜私募基金管理有限公司 住所：上海市奉贤区南桥镇国顺路 936 号 5 幢 通讯地址：上海市徐汇区龙田路 190 号 1 号楼 4F-5F</p>	<p>名称：上海远澜私募基金管理有限公司 住所：上海市浦东新区中国（上海）自由贸易试验区临港新片区新杨公路 1800 弄 1 号 2 幢 2987 室 通讯地址：上海市徐汇区龙田路 190 号 1</p>

<p>法定代表人：王凯</p> <p>联系人：瞿培健</p> <p>联系电话：13801707561</p> <p>传真：021-61286755</p>	<p>号楼 5 层</p> <p>法定代表人：王凯</p> <p>联系人：瞿培健</p> <p>联系电话：13801707561</p> <p>传真：021-61286755</p>
<p>2、基金管理人的权利</p> <p>原条款：</p>	<p>2、基金管理人的权利</p> <p>现条款：</p>
<p>(6) 以基金管理人的名义，代表基金与其他第三方签署基金投资相关协议文件、行使诉讼权利或者实施其他法律行为；</p>	<p>(6) 以基金管理人的名义，代表基金与其他第三方签署基金投资相关协议文件、为基金财产利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；</p>
<p>3、基金管理人的义务</p> <p>删除条款：</p>	
<p>(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；</p> <p>(3) 除依据法律法规另有规定外，不得委托第三人运作基金财产；</p>	
<p>3、基金管理人的义务</p> <p>新增条款：</p>	
<p>(2) 按照恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则履行受托人义务，按照本基金合同约定管理和运用基金财产，建立有效的风险控制制度；</p> <p>(3) 除依据法律法规另有规定外，不得委托第三人运作基金财产，不得将投资管理职责委托他人行使，不得由投资者、第三方下达投资指令或者负责投资运作，不得为投资者、证券发行人、金融机构、其他私募基金管理人、资产管理产品以及其他私募基金等第三方提供规避投资范围、杠杆约束、投资者门槛等监管要求的通道服务；</p>	
<p>3、基金管理人的义务</p> <p>原条款：</p>	<p>3、基金管理人的义务</p> <p>现条款：</p>
<p>(4) 制作或委托代销机构制作调查问卷，对投资者的风险识别能力和风险承担能</p>	<p>(4) 制作或委托代销机构制作调查问卷，以书面形式对投资者的风险识别能力和</p>

<p>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；</p>	<p>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；</p>
<p>3、基金管理人的义务 删除条款：</p>	
<p>(5) 制作风险揭示书，向投资者充分揭示相关风险； (6) 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；</p>	
<p>3、基金管理人的义务 新增条款：</p>	
<p>(5) 履行投资者适当性义务，制作风险揭示书，以书面形式向投资者充分揭示相关风险，根据投资者的风险识别能力和风险承担能力匹配本基金的风险等级，并履行相关反洗钱义务； (6) 聘用具有相应从业经历的高级管理人员负责投资管理、风险控制、合规等工作，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；</p>	
<p>3、基金管理人的义务 新增条款：</p>	
<p>(8) 建立从业人员进行证券、私募基金等投资的申报、登记、审查、处置等管理制度和廉洁从业规范，制定有效的事前防范体系、事中管控措施和事后追责机制，建立自有资金投资管理制度和外部投资者利益绑定机制，防范利益冲突和利益输送等不当行为，确保投资者合法权益不受侵害； (9) 建立保障信息技术系统安全、数据安全的风控机制和应急管理制度，结合市场状况和自身管理能力制定并持续更新流动性风险应急预案；</p>	
<p>3、基金管理人的义务 原条款：</p>	<p>3、基金管理人的义务 现条款：</p>
<p>(12) 根据相关法规及本合同的约定，向基金托管人提供基金交易数据、投资文件</p>	<p>(14) 根据相关法规及本合同的约定，基金管理人自身或授权相关方及时向基金托</p>

<p>及基金其他相关数据与文件，并确保提供材料的合法、真实、完整和有效；</p>	<p>管人提供投资者基本信息、基金交易情况、交易数据、对账单、投资文件、交易文件、估值信息、投资标的权属变更证明材料及基金其他相关数据与文件，并确保提供材料的合法、真实、完整和有效；</p>
<p>3、基金管理人的义务 原条款：</p>	<p>3、基金管理人的义务 现条款：</p>
<p>(18) 保存基金投资业务活动的全部会计资料，并妥善保存有关的合同、交易记录及其他相关资料，保存期限自基金清算终止之日起不得少于 10 年；</p>	<p>(20) 保存基金投资业务活动的全部会计资料，并妥善保存有关的合同、交易记录及其他相关资料，保存期限自基金清算终止之日起不得少于 10 年，法律法规、监管机构、行业自律组织另有规定的从其规定；</p>
<p>3、基金管理人的义务 原条款：</p>	<p>3、基金管理人的义务 现条款：</p>
<p>(19) 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；</p>	<p>(21) 建立公平交易制度及异常交易监控机制，公平对待所管理的不同基金财产，对投资交易行为进行监控、分析、评估、核查，监督投资交易的过程和结果，保证公平交易原则的实现，不得开展可能导致不公平交易和利益输送的交易行为，不得从事任何有损基金财产及其他当事人利益的活动；</p>
<p>3、基金管理人的义务 原条款：</p>	<p>3、基金管理人的义务 现条款：</p>
<p>(25) 本合同的签署采用纸质合同的方式进行的，基金管理人应妥善保管本合同原件、按本合同约定的时间向基金托管人移交基金投资者签署的本合同原件，因基金管理人未妥善保管或及时向基金托管人移交本合</p>	<p>(27) 应确保基金合同签署版本正确有效，基金合同为基金投资者本人或其有效授权人签署。本合同的签署采用纸质合同的方式进行的，基金管理人应妥善保管本合同原件、按本合同约定的时间向基金托管人移交</p>

<p>同原件导致基金托管人损失的，基金管理人应予以赔偿，如导致基金投资者损失的，应由基金管理人予以赔偿；</p>	<p>基金投资者签署的本合同原件，因基金管理人未妥善保管或及时向基金托管人移交本合同原件导致基金托管人损失的，基金管理人应予以赔偿，如导致基金投资者损失的，应由基金管理人予以赔偿；本合同的签署采用电子合同的方式进行的，基金管理人应确保签订本基金合同所使用的电子签名符合《电子签名法》等法律法规、监管规定的相关要求；</p>
<p>3、基金管理人的义务</p>	
<p>新增条款：</p>	
<p>(29) 在本基金涉及诉讼或仲裁情况时，应当在知道或者应当知道涉诉情况的 5 个工作日内将涉诉情况通知基金托管人，如已获得相关判决、裁决或已执行判决、裁决的，应当在知道或者应当知道该情况时立即将相关情况通知基金托管人；</p>	
<p>(30) 在基金管理人出现客观上丧失继续管理私募投资基金的能力时，根据《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；</p>	
<p>(31) 将基金管理人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，管理人依法应当承担的责任不因委托而减轻或者免除；</p>	

序号 17

八、当事人及权利义务 (三) 基金托管人

<p>1、基金托管人概况</p> <p>原条款：</p>	<p>1、基金托管人概况</p> <p>现条款：</p>
<p>名称：招商证券股份有限公司</p> <p>住址：深圳市福田区福田街道福华一路 111 号</p> <p>通讯地址：深圳市福田区福田街道福华一路 111 号</p>	<p>名称：招商证券股份有限公司</p> <p>住址：深圳市福田区福田街道福华一路 111 号</p> <p>通讯地址：深圳市福田区福田街道福华一路 111 号</p>

<p>法定代表人：霍达</p> <p>联系电话：0755-86157588</p> <p>传真：0755-82960794</p> <p>网址：www.newone.com.cn</p>	<p>法定代表人：霍达</p> <p>联系电话：0755-86157588</p> <p>传真：0755-82960794</p> <p>网址：www.cmschina.com</p>
<p>3、基金托管人的义务</p> <p>原条款：</p>	<p>3、基金托管人的义务</p> <p>现条款：</p>
<p>（14）监督基金管理人的投资运作，发现基金管理人的投资指令违反法律法规、及本合同约定的，应当拒绝执行，立即通知基金管理人；发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律法规、及本合同约定的，应当立即通知基金管理人；</p>	<p>（14）监督基金管理人的投资运作，发现基金管理人的投资运作行为违反法律法规或者本合同约定的，对投资指令应当拒绝执行，立即通知基金管理人，并按规定向中国证监会、中国基金业协会报告；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或者本合同约定的，应当立即通知基金管理人，并按规定向中国证监会、中国基金业协会报告；</p>

序号 18

九、基金份额持有人大会及日常机构

<p>原条款：</p>	<p>现条款：</p>
<p>基金份额持有人大会由基金份额持有人组成，基金份额持有人的合法授权代表有权代表基金份额持有人出席会议并表决。基金份额持有人大会不得直接参与或者干涉基金的投资管理活动。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。</p>	<p>基金份额持有人大会由基金份额持有人组成，基金份额持有人的合法授权代表有权代表基金份额持有人出席会议并表决。基金份额持有人大会不得直接参与或者干涉基金的投资管理活动。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。基金份额持有人大会的召集机制参见本章节（一）至（三）款内容。</p>

序号 19

九、基金份额持有人大会及日常机构 （一）基金份额持有人大会的召开事由

原条款:	现条款:
(6) 变更基金投资目标、投资策略(法律法规和中国证监会另有约定的除外);	(6) 变更基金投资目标(法律法规和中国证监会另有约定的除外);
新增条款:	
(10) 基金管理人客观上丧失继续管理私募基金能力或者在基金管理人出现怠于履行职责或者出现重大风险等情形导致私募投资基金无法正常运作、终止;	
原条款:	现条款:
(11) 法律法规、监管部门规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。 针对前款所列事项,基金份额持有人以书面形式一致表示同意的(包括通过签署补充协议的方式),可以不召开基金份额持有人大会直接作出决议,并由全体基金份额持有人在决议文件上签名、盖章。	(12) 法律法规、监管部门规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。 针对前款所列事项,除本合同另有约定外,基金份额持有人以书面形式一致表示同意的(包括通过签署补充协议的方式),可以不召开基金份额持有人大会直接作出决议,并由全体基金份额持有人在决议文件上签名、盖章。有效决议的形式可以是经全体基金份额持有人签名或盖章的各类通知文件、纪要文件、公告文件、补充协议等。基金管理人应在决议作出之日起5个工作日内向基金份额持有人取得相关决议文件原件,并验证全体基金份额持有人的签署信息及决议文件是否真实有效。基金管理人无法验证或怠于验证决议文件签署信息真实性、有效性的,不影响该决议的执行,基金管理人应当独自承担由此产生的相应后果;在该决议执行后,基金管理人无权对该决议或所产生的结果提出无效、可撤销或索赔等任何形式的异议。
原条款:	现条款:
(1) 调低基金管理人的管理费、业绩报	(1) 调低基金管理人的管理费、投资顾

酬、申购赎回费、销售服务费的费率及比例；	问费、业绩报酬、申购费、销售服务费的费率及比例；
原条款：	现条款：
(2) 投资经理的变更；	(2) 基金管理人基本信息、投资经理的变更；
原条款：	现条款：
(3)对本基金的认购、申购业务规则(包括但不限于总规模、单个基金投资者首次认购、申购金额、每次申购金额及持有的本基金总金额限制等)进行调整；	(3)对本基金的认购、申购业务规则(包括但不限于总规模、单个基金投资者首次认购、申购金额、每次申购金额及持有的本基金总金额限制等)、基金份额的转让业务规则及基金转换业务规则进行调整；
新增条款：	
(4) 增加本基金的收益分配方式；	
原条款：	现条款：
(2) 因相应的法律法规或监管机构对本合同内容与格式要求发生变动而应当对本合同进行变更；	(2) 因相应的法律法规、监管机构、行业自律组织对本合同内容与格式要求发生变动而应当对本合同进行变更；

序号 20

九、基金份额持有人大会及日常机构 (二) 会议召集人及召集方式

原条款：	现条款：
2、代表基金份额 20%以上(含 20%)的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 30	2、代表基金份额 20%以上(含 20%)的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 30

<p>日内召开；基金管理人决定不召集，代表基金份额 20%以上（含 20%）的基金份额持有人有权自行召集。基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的，应于会议召开前 10 个工作日通知基金管理人。基金份额持有人自行召集基金份额持有人大会的，基金管理人应当予以配合，不得阻碍、干扰。</p>	<p>日内召开；基金管理人决定不召集（包括管理人客观上丧失继续管理私募投资基金的能力的情形），代表基金份额 20%以上（含 20%）的基金份额持有人有权自行召集。基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的，应于会议召开前 10 个工作日通知基金管理人。基金份额持有人自行召集基金份额持有人大会的，基金管理人应当予以配合，不得阻碍、干扰。</p>
--	--

序号 21

九、基金份额持有人大会及日常机构 （五）议事内容与程序

<p>2、议事程序 原条款：</p>	<p>2、议事程序 现条款：</p>
<p>(1) 现场开会</p> <p>在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照下列第七条规定程序确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表，在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由出席大会的基金份额持有人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人拒不出席或主持基金份额持有人大会，不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。</p>	<p>(1) 现场开会</p> <p>在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照下列第（七）款规定程序确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表，在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由出席大会的基金份额持有人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人拒不出席或主持基金份额持有人大会，不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。</p>

序号 22

九、基金份额持有人大会及日常机构 （六）表决

原条款:	现条款:
<p>基金份额持有人所持每份基金份额享有一票表决权。</p> <p>基金份额持有人大会决议须经出席会议的基金份额持有人或其代理人所持表决权的2/3以上(含2/3)通过方为有效。本基金份额为两个类别,基金份额持有人大会议事内容涉及该基金类别份额持有人权利义务及其利益的,应当取得出席会议的该基金类别的份额持有人所持表决权的2/3(含2/3)以上通过方为有效。如根据相关法律法规存在合理要求需要更换基金管理人、托管人的,应当经出席会议的基金份额持有人或其代理人全体通过方为有效。</p> <p>基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。</p> <p>基金份额持有人大会的各项提案或同一项提案内并列的各项议题应当分开审议、逐项表决。</p>	<p>基金份额持有人所持每份基金份额享有一票表决权。</p> <p>基金份额持有人大会决议须经出席会议的基金份额持有人或其代理人所持表决权的2/3以上(含2/3)通过方为有效;本基金份额为两个类别,基金份额持有人大会议事内容只涉及该基金类别份额持有人权利义务及其利益的,应当同时取得出席会议的该基金类别的份额持有人所持表决权的2/3(含2/3)以上通过方为有效。如根据相关法律法规存在合理要求需要更换基金管理人、托管人的,应当经出席会议的基金份额持有人或其代理人全体通过方为有效。</p> <p>基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。</p> <p>基金份额持有人大会的各项提案或同一项提案内并列的各项议题应当分开审议、逐项表决。</p>

序号 23

九、基金份额持有人大会及日常机构 (七) 计票

1、现场开会	1、现场开会
原条款:	现条款:
<p>(4) 基金管理人或基金托管人拒不出席大会的,不影响计票的效力。</p>	<p>(4) 基金管理人或基金托管人拒不出席或无法出席大会的,不影响计票的效力。</p>

序号 24

九、基金份额持有人大会及日常机构 (九) 基金份额持有人大会决议的披露

原条款:	现条款:
-------------	-------------

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

序号 25

十一、基金的投资

<p>原条款：</p>	<p>现条款：</p>
<p>(一) 投资经理：本基金的投资经理由基金管理人指定。</p> <p>本基金的投资经理：王凯先生，1991-1995年就读于上海交通大学，获计算机专业学士学位。1995-1999年任职于东航期货公司，先后从事计算机交易系统运维、期货市场分析咨询、入市代表、清算结算等多种工作。1999-2000年就读于中欧国际工商学院，获工商管理硕士学位。2000-2001年任职于博创投资管理公司，任投资经理。博创投资是专注于互联网行业成长期企业创投的中外合资风险投资公司。王凯先生在博创投资从事投资项目的筛选和评估、项目尽职调查、投资方案设计和项目投资后跟踪管理工作。2001-2010年任职于美国亿柏国际公司，历任上海代表处首席代表、公司商务发展副总裁。亿柏国际是提供跨国供应链管理的专业服务公司。王凯先生在亿柏国际负责公司战略规划、资本运作方案、以及分管华东地区的业务运营。2007年，王凯先生出于个人兴趣爱好，利用业余时间研究和实践期货交易，并于2011年5月创办了上海远澜私募基</p>	<p>(一) 投资经理：本基金的投资经理由基金管理人指定，投资经理应当具有股票、债券、衍生品、证券投资基金等证券投资领域的投资管理或者研究经验，具备良好的诚信记录和职业操守。</p> <p>本基金的投资经理：孔宪亮先生2012年毕业于上海交通大学，后于2014年获得美国伊利诺伊大学香槟分校核工程硕士学位，主要研究方向是应用统计学习算法进行放射性元素的识别。孔宪亮先生在研究生毕业后加入上海远澜，工作覆盖高、中、低换手量价策略研发，时序及截面因子挖掘，流程自动化等工作，因研发工作的突出贡献被晋升为公司首位员工合伙人。</p> <p>基金管理人可根据业务需要自行变更投资经理，并在变更后三个工作日内通过约定的方式告知基金份额持有人及基金托管人，并设置临时开放日允许基金份额持有人赎回。</p>

<p>金管理有限公司，担任公司的总经理和法人代表。王凯先生主要负责远澜公司的研发团队建设和制定研发战略方向。</p> <p>基金管理人可根据业务需要变更投资经理，并在变更后三个工作日通过约定的方式告知基金份额持有人及基金托管人。</p>	
<p>原条款：</p>	<p>现条款：</p>
<p>(二) 投资目标：</p> <p>本基金通过灵活应用多种投资策略，在充分控制基金财产风险和保证基金财产流动性的基础上，追求合理的投资回报，力争实现基金财产的长期稳健增值。</p>	<p>(二) 投资目标：在控制风险的前提下，实现客户资产长期、持续、稳定的增值。</p>
<p>原条款：</p>	<p>现条款：</p>
<p>(三) 投资范围：</p> <p>本基金的投资范围包括沪深交易所上市交易的品种（指股票、存托凭证、优先股、权证）、债券（包括银行间债券、交易所债券、可转换债券、可交换债券）、证券回购、存款、公开募集证券投资基金（包括分级基金B）、期货、场内期权、在交易所或银行间发行的资产支持证券和资产支持票据（但不包括次级）、证券公司收益凭证、收益互换与场外期权（在监管部门允许的前提下，仅限于证券公司及其子公司、期货公司子公司作为交易对手）。本基金可以参与融资融券交易、港股通交易、新股申购，也可以将其持有的证券作为融券标的出借给证券金融公司。</p>	<p>(三) 投资范围：权益类（股权类）：股票型公开募集证券投资基金、混合型公开募集证券投资基金；</p> <p>固定收益类（债权类）：存款（不含结构性存款）、债券通用质押式逆回购（包括国债逆回购及其他债券通用质押式逆回购）、货币型公开募集证券投资基金；</p> <p>期货和衍生品类：期货、场内期权、商品型公开募集证券投资基金；</p>

<p>本基金可投资于证券公司（含证券公司子公司）资产管理计划、期货公司（含期货子公司）资产管理计划、银行理财产品、信托计划、基金公司（含基金子公司）资产管理计划、保险公司（含保险子公司）资产管理计划、在基金业协会登记的私募证券投资基金管理人发行并由具有证券投资基金托管资格的机构托管或由具有相关资质的机构提供私募基金综合服务的契约式私募投资基金，但不可投资于上述产品的劣后级份额。</p>	
<p>原条款：</p>	<p>现条款：</p>
<p>（四）投资策略： 集合趋势交易、反转交易、市场横截面和统计交易多策略稳健组合。本基金通过持有沪深交易所上市交易的存托凭证间接投资于境外基础证券。</p>	<p>（四）投资策略：本产品主要通过对宏观数据的分析构建宏观量化模型，进行大类资产的配置，主要交易大宗商品，股票，债券和黄金，目的是捕捉大类资产的Beta收益。策略构建的理论基础来源于经典的宏观周期理论，同时策略会对于宏观风险事件进行持续的跟踪，正常情况下不需要人为干预，极端风险事件发生时将进行主观的风险控制。 本基金的投资策略不属于本基金的投资范围、投资风格、投资比例或投资限制事项，托管人对本基金的投资策略不承担监督职责。</p>
<p>原条款：</p>	<p>现条款：</p>
<p>（五）投资限制 1、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%；</p>	<p>（五）投资比例和投资限制 1、本基金投资于期货和衍生品的持仓合约价值（期货和场内期权按合约价值计算，场外期权及收益互换等场外衍生品按照估值</p>

<p>2、参与挂钩股票、股票指数收益互换的，向交易对手方缴纳的保证金比例不低于该收益互换合约名义本金的 50%；</p> <p>3、参与带敲入和敲出结构的场外期权或者收益凭证的合约名义本金不得超过基金净资产的 25%；</p> <p>4、本基金投向 AA 级及以下（债券评级参照债项评级，无债项评级参照主体评级）信用债（可转债除外）、流动性受限资产合计不得超过基金净资产 20%（其中，场外衍生品按全部账户内已占用保证金计算；其他资产按成本与市值孰低计算）；</p> <p>5、本基金的总资产不得超过净资产的 200%；</p> <p>6、本基金投资于沪深交易所上市交易的存托凭证按市值计算占基金资产总值的比例为 0%-80%；</p> <p>7、本基金投资组合遵循相关法律法规或监管部门对于投资比例限制的规定。</p> <p>基金管理人自本合同生效之日起 3 个月内使本基金的投资组合比例符合本合同的有关约定。由于包括但不限于证券、期货市场波动、上市公司合并、组合规模变动等基金管理人之外的原因导致的投资比例不符合本合同约定的投资限制或投资禁止政策，为被动超标，除法律法规或本合同另有约定外，基金管理人应在发生不符合法律法规或投资政策之日起的 10 个交易日内调整完毕。如发生证券停牌或其他非基金管理人可以控制的</p>	<p>表保证金与市值合并计算）的比例不低于本基金已投资资产 80%，且期货和衍生品账户权益超过本基金已投资资产 20%；</p> <p>2、本基金投资于同一资产的资金（期货按单品种单月份合约占用保证金计算；场内期权买方按照单品种单月份期权合约支付的权利金市值计算，场内期权卖方按照单品种单月份期权合约占用的保证金计算，场外期权按缴纳的保证金及权利金计算，收益互换按保证金计算，其他资产按成本与市值孰低计算），不得超过本基金净资产的 25%；</p> <p>3、本基金投向 AA 级及以下（债券评级参照债项评级，无债项评级参照主体评级）信用债（可转债除外）、流动性受限资产合计不得超过基金净资产 20%（其中，场外衍生品按全部账户内已占用保证金计算；其他资产按成本与市值孰低计算）；</p> <p>4、本基金的总资产不得超过净资产的 200%；</p> <p>5、本基金投资组合遵循相关法律法规或监管部门对于投资比例限制的规定。</p> <p>基金管理人自本合同生效之日起使本基金的投资组合比例符合本合同的有关约定，受证券期货市场波动、证券发行人合并、本基金规模变动等基金管理人之外的因素影响，导致本基金的投资比例不符合本合同约定的投资限制或投资禁止政策，为被动超标。除法律法规或本合同另有约定外，基金管理人应当在 20 个交易日内调整至符合要求。如</p>
---	--

<p>原因导致基金管理人不能履行调整义务的，则调整期限相应顺延。基金管理人应当自证券恢复交易之日起的 10 个交易日内调整完毕，法律、行政法规、金融监管部门另有规定的，从其规定。</p> <p>在本基金到期日前 10 个交易日内，因基金财产变现需要，本基金财产的投资比例限制可以不符合上述基金配置比例规定。</p>	<p>因资产流动性受限或其他非基金管理人可以控制的原因导致无法完成前述调整的，则调整期限相应顺延。基金管理人应当在相关资产可出售、可转让或者恢复交易后的 20 个交易日内调整至符合要求。法律、行政法规、金融监管部门另有规定的，从其规定。</p> <p>在本基金到期日前 20 个交易日内，因基金财产变现需要，本基金财产的投资比例限制可以不符合上述基金配置比例规定。</p> <p>此外，本基金参与股票、债券、可转换公司债券、可交换公司债券发行申购时，所申报的金额不得超过本基金的总资产，所申报的数量不得超过拟发行公司本次发行的总量。</p>
<p>新增条款：</p>	
<p>(六) 基金管理人层面的投资集中度控制与穿透监控</p> <p>1、本基金管理人管理的全部私募证券投资基金投资于同一资产的资金，不得超过该资产的 25%（符合“单只私募证券投资基金投资于同一资产的资金不超过该基金净资产的 25%”分散投资要求的私募证券投资基金投资单只私募基金的资金，可以不受本条款限制）；</p> <p>2、本基金管理人及其同一实际控制人控制的私募证券投资基金管理人的自有资金、管理的所有私募证券投资基金、担任投资顾问的资产管理产品合计持有单一上市公司发行的股票不得超过该上市公司可流通股票的 30%；</p> <p>3、本基金管理人管理的所有私募证券投资基金投资于同一债券的数量，不得超过该债券存续数量的 10%（因发行人行使赎回选择权或者进行债券购回，以及其他持有人行使回售选择权导致的被动超标除外）；本基金管理人及其同一实际控制人控制的私募基金管理人管理的所有私募证券投资基金投资于同一发行人及其关联方发行的债券的总数量，不得超过相关债券存续数量的 25%；国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券、可转换债券、可交换债券等中国证监会、中国基金业协会认可的投资品种可以不受本条款限制；</p>	

4、对于本基金的投资比例和投资限制明确需穿透监控计算的，如所投标的均为本基金管理人管理的其他私募基金，基金管理人应当在每个交易日核查本基金投资行为是否符合穿透监控投资限制；如所投标的涉及非本基金管理人管理的其他私募资管产品（含私募基金），基金管理人应当按照所投标的披露频率核查本基金投资行为是否符合穿透监控投资限制。

本基金管理人应对以上情形自行进行控制并满足上述管理人层面的投资集中度控制与穿透监控要求，法律法规、中国证监会、中国基金业协会另有规定的，从其规定。如因基金管理人未按照法律法规、中国证监会、中国基金业协会的规定及本合同的约定进行基金管理人层面的投资集中度控制与穿透监控，对基金财产或基金份额持有人造成的损失，由基金管理人承担责任。

原条款：	现条款：
<p>（六）投资禁止行为</p> <p>基金管理人不得利用基金财产从事下列行为或进行如下投资运作，若由此造成基金财产、合同当事人及第三方损失的，所有责任由基金管理人承担：</p> <ol style="list-style-type: none"> 1、违反规定向他人提供担保； 2、从事承担无限责任的投资； 3、从事内幕交易、操纵证券价格及其他不正当的证券交易活动； 4、通过信托计划、基金公司（含基金子公司）资产管理计划、保险公司（含保险子公司）资产管理计划投资于非标资产； 5、如涉及投资场外衍生品的，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，基金净资产低于 5000 万元；新增收益互换合约以及存续合约展期的，基金净资产低于 1000 万元； 6、法律法规、中国证监会以及本合同规 	<p>（七）投资禁止行为</p> <p>基金管理人及其从业人员不得利用基金财产从事下列行为或有如下行为，若由此造成基金财产、合同当事人及第三方损失的，所有责任由基金管理人承担：</p> <ol style="list-style-type: none"> 1、违反规定向他人提供担保； 2、从事承担无限责任的投资； 3、用于经营或者变相经营资金拆借、贷款； 4、从事内幕交易、操纵证券期货市场及其他不正当交易活动； 5、导致不公平交易或者利益输送的同日反向交易； 6、利用资金、信息、技术、策略等优势为自有资金牟取不正当利益； 7、直接或者间接侵占、挪用基金财产，将基金管理人及其从业人员的固有财产或者他人财产混同于私募基金财产；

<p>定禁止从事的其他行为。</p>	<p>8、利用基金财产以向基金投资标的及其关联方收取咨询费、手续费、财务顾问费等名义，为自身或者基金份额持有人以外的人牟取非法利益、进行利益输送；</p> <p>9、泄露因职务便利获取的未公开信息，利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的证券、期货交易活动；</p> <p>10、以套取基金财产为目的，直接或者间接投资于基金管理人、控股股东、实际控制人及其实际控制的企业或项目等自融行为；</p> <p>11、通过场外衍生品、资产管理产品等开展规避私募基金监管要求的业务；</p> <p>12、在基金净资产低于 5000 万元的情况下，新增场外期权合约以及存续合约展期的（仅开展商品类场外期权交易外）；在基金净资产低于 1000 万元的情况下，新增收益互换合约以及存续合约展期的；</p> <p>13、参与债券结构化发行，参与债券代持，直接或者变相收取债券发行人及第三方支付承销服务、融资顾问、咨询服务、信用风险补偿等各种形式的费用或者保证金；</p> <p>14、本基金接受其他私募资管产品（含私募基金）投资，或者投资于私募资管产品（含私募基金）的，本基金整体嵌套层级超过一层，法律法规、中国证监会另有规定的，经基金管理人和基金托管人协商一致后可根据相关规定依法进行调整；</p> <p>15、法律法规、中国证监会以及本合同</p>
--------------------	--

	规定禁止从事的其他行为。
<p>原条款：</p>	<p>现条款：</p>
<p>(七) 关联交易</p> <p>基金管理人可运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司发行的证券或承销期内承销的证券，但需要遵循基金份额持有人利益优先的原则、防范利益冲突。</p> <p>基金管理人可运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其关联方或者与上述主体有其他重大利害关系的主体直接或间接管理或代理销售的、或提供客户服务的、或者该等主体持有的符合本合同投资范围规定的投资产品。但需要遵循基金份额持有人利益优先的原则、防范利益冲突。</p> <p>基金投资者签署本合同即表明其已经知晓本基金将进行上述关联交易。</p> <p>基金份额持有人不得因本基金投资收益劣于基金管理人及其关联方管理的其他类似投资产品，而向基金管理人或基金托管人提出任何损失或损害补偿的要求。</p>	<p>(八) 关联交易</p> <p>1、关联交易的识别认定</p> <p>本基金的关联方指管理人、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，以及与管理人有其他重大利害关系的其他主体。其中，“其他重大利害关系的其他主体”指与本基金管理人之间具有的重要的利益依赖关系或可能存在利益冲突关系，以致可以影响管理人对本基金的投资决策的机构或人员，包括但不限于基金管理人的实际控制人、控股股东、董事、高级管理人员、普通员工及上述主体的关联方。</p> <p>基金关联交易是指基金管理人运用基金财产与自己、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、或者与其有其他重大利害关系的其他主体进行交易的行为。具体包括但不限于下列情形：（1）本基金投资于基金管理人及其控股股东、实际控制人或者其他关联方发行的证券或者承销期内承销的证券；（2）本基金投资于管理人管理的其他私募投资基金、同一实际控制人下的其他管理人管理的私募投资基金；（3）本基金与本基金关联方之间就已投标的进行转让等交易行为。为免疑义，以下情况不属于关联交易：</p> <p>（1）本基金与本基金关联方共同投资于证券</p>

	<p>期货交易所上市交易的品种；（2）本基金的关联方作为投资者投资于本基金。特别地，当本基金投资于本基金管理人作为投资顾问的资管产品（含私募基金）时，不构成法定关联方或者关联交易但存在利益冲突，管理人对于上述投资行为亦应遵循本基金合同关于关联交易的相关约定。</p> <p>本基金区分重大关联交易与一般关联交易。重大关联交易是指本基金管理人运用基金财产投资于基金管理人及其控股股东、实际控制人或者其他关联方发行的证券或者承销期内承销的证券。一般关联交易是指重大关联交易以外的关联交易。</p> <p>如相关机构新颁布并实施关于关联交易、重大关联交易和一般关联交易的法律、行政法规、部门规章、自律规则，则从其规定。</p> <p>2、关联交易的处理原则</p> <p>基金管理人可运用基金财产进行关联交易，但应当防范利益冲突，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，建立健全有效的关联交易管理制度，对关联交易定价方法、交易审批程序等进行规范。</p> <p>基金管理人不得通过多层嵌套或其他方式隐瞒关联关系或者将关联交易非关联化，不得从事损害私募基金财产或者投资者利益的关联交易等投资活动，不得利用关联关系从事不正当交易，不得以私募投资基金的财</p>
--	---

	<p>产与关联方进行利益输送、内幕交易和操纵市场等违法违规活动。</p> <p>基金管理人运用基金财产进行关联交易的，基金管理人应建立针对关联交易的关联交易决策机制、关联交易对价确定机制，并建立不得利用关联交易进行利益输送、内幕交易和操纵市场等违法违规活动的关联交易回避机制。</p> <p>3、关联交易的交易决策</p> <p>基金管理人运用基金财产进行关联交易的，基金管理人应当遵守法律、行政法规、中国证监会、中国基金业协会的规定和本基金合同约定，在涉及关联交易的交易前取得基金份额持有人认可的关于管理人管理产品关联交易的决策机制决策同意。基金管理人管理产品的关联交易决策机制如下：投资决策前由风险管理部进行关联交易审查，如涉及关联交易的，由投资管理部提起内部决议审批流程，并经风险合规委员会决议表决通过方可进行关联交易。特别地，在满足本基金合同约定的投资范围的前提下，本基金认/申购本基金管理人或同一实际控制人控制的其他私募基金管理人管理的其他私募基金构成上述所说的基金关联交易，基金管理人出具投资划款指令即表明已完成管理人公司内部关联交易决策机制而无需在事前取得所有基金份额持有人同意。</p> <p>4、关联交易的交易对价确定</p> <p>基金管理人运用基金财产进行关联交易</p>
--	---

	<p>的，由基金管理人与交易方在不违反公平交易、不进行利益输送等合法合规原则下，协商确定交易价格。在集中交易市场交易的，交易价格的影响因素主要为最近成交价格；在非集中交易市场交易的，交易价格主要由基金管理人与交易方协商；如有第三方权威机构定价的，可参考其定价。如本合同约定了关联交易所涉及交易品种的估值方法的，应在确定关联交易价格时予以参考。</p> <p>5、关联交易的回避机制</p> <p>基金管理人运用基金财产进行关联交易，在进行对价确定、交易决策及表决时，如涉及与基金管理人相关人员发生利益冲突的，相关人员应当予以回避。</p> <p>6、关联交易的信息披露</p> <p>基金管理人应当在关联交易发生前主动通知基金托管人，并在本基金发生关联交易投资后通过包括但不限于管理人报告、电子邮件或短信等管理人与投资者约定的方式及时向基金份额持有人充分披露信息。披露内容包括但不限于：关联交易发生情形与日期；关联交易涉及的关联方与对手方；关联交易涉及的交易金额。特别地，如本基金发生本合同约定的重大关联交易，基金管理人应参照本合同“基金的信息披露与报告”章节之“基金管理人重大事项信息披露的内容及频率”及时向基金投资者进行披露。</p> <p>基金管理人违反上述关联交易约定的，相关责任和损失由基金管理人承担，基金托</p>
--	--

	<p>管人不承担任何责任。</p> <p>基金投资者特此声明：基金投资者签署本合同即表明其已经知晓本基金将进行上述关联交易；基金投资者签署本合同即表明认可前述决策机制，基金管理人在投资前只需要履行内部关于产品进行关联交易的决策机制同意即可进行投资，而无须额外取得全体基金份额持有人同意；基金投资者承诺不得就上述声明提出任何质疑或主张。</p> <p>基金份额持有人不得因本基金投资收益劣于基金管理人及其关联方管理的其他类似投资产品，而向基金管理人或基金托管人提出任何损失或损害补偿的要求。</p>
--	--

序号 26

十一、基金的投资 (九) 融资融券及其他场外证券业务的参与情况

原条款：	现条款：
<p>根据本基金投资范围，本基金可参与融资融券业务，在放大投资收益的同时也放大了投资风险，同时还须支付相应的利息和费用，由此承担的风险可能远远超过普通证券交易；本基金可参与场外衍生品（包括互换、场外期权等品种）的交易，投资收益受挂钩标的的市场价格、市场利率、波动率或相关性等因素的影响，导致本基金收益产生不确定性的风险。</p>	<p>如本基金投资范围包含融资融券，则本基金可参与融资融券业务，在放大投资收益的同时也放大了投资风险，同时还须支付相应的利息和费用，由此承担的风险可能远远超过普通证券交易；如本基金投资范围包含互换、场外期权等场外衍生品，则本基金可参与场外衍生品的交易，投资收益受挂钩标的的市场价格、市场利率、波动率或相关性等因素的影响，导致本基金收益产生不确定性的风险。</p>

序号 27

十一、基金的投资

原条款:	现条款:
(十) 风险收益特征: 本基金属于 R4 级(中高风险)投资品种。	(十一) 风险收益特征 本基金属于 R4 级(中高风险)投资品种。
删除条款:	
<p>(十一) 基金的预警与止损:</p> <p>为保护基金份额持有人的利益,本基金将基金份额净值为 0.85 元设置为预警线,将基金份额净值为 0.80 元设置为止损线。</p> <p>当基金份额净值低于或等于预警线 0.85 元时(该交易日称为“R 日”),管理人应主动对本基金所持有的投资标的采取以下风险控制措施:在 R+2 日开始并在十个工作日内使本基金所持有的现金类资产(包括存款、证券保证金、备付金、货币基金、债券逆回购)比例不低于基金资产净值的 80%(以成本价计算),直到基金份额净值恢复到预警线以上;如遇因持有流通受限证券等原因导致本基金财产无法及时变现的,则变现时间顺延。</p> <p>当基金份额净值低于或等于止损线 0.80 元(该交易日称为“D 日”)时,管理人在 D+2 日开始止损操作,并在十个工作日内将持仓标的或衍生品平仓变现。该平仓操作不可逆,在所持全部非现金类资产变现前不可停止。对于已变现部分,根据本合同第二十五章的清算程序对基金进行清算。如遇因持有流通受限证券等原因导致本基金财产无法及时变现的,则变现时间顺延,待全部变现完成之日,管理人进行二次清算。</p> <p>基金的预警和止损由基金管理人负责执行,如基金管理人按照或者未按照基金合同的约定采取风险控制措施和进行强制止损,由此对基金财产或基金份额持有人造成的损失,基金托管人不承担任何责任。</p> <p>基金管理人特别提示:本基金设置 0.80 元为止损线,并不代表基金管理人完成止损后基金份额净值等于 0.80 元,根据基金管理人变现操作的交易执行情况,本基金终止日基金份额净值可能低于 0.80 元。</p>	

序号 28

十二、基金的财产 (一) 基金财产的保管与处分

原条款:	现条款:
6、基金财产产生的债权不得与不属于基金财产本身的债务相互抵销。非因基金财产	6、基金财产产生的债权不得与不属于基金财产本身的债务相互抵销。基金财产的债

<p>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。</p>	<p>务由基金财产本身承担，但法律另有规定的除外。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。</p>
<p>新增条款：</p>	
<p>7、基金管理人不得使用基金管理人及其关联方名义、账户代本基金收付基金财产。</p>	
<p>原条款：</p>	<p>现条款：</p>
<p>8、对于因为基金投资产生的应收资产，应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并书面通知基金托管人，到账日期届满基金应收资产没有到达基金托管资金账户的，由此给基金造成损失的，基金管理人应负责向有关当事人追偿基金的损失，基金托管人对此不承担任何责任。</p>	<p>9、对于因为基金投资产生的应收资产，应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期，到账日期届满基金应收资产没有到达基金托管资金账户的，由此给基金造成损失的，基金管理人应负责向有关当事人追偿基金的损失，基金托管人对此不承担任何责任。</p>

序号 29

十三、指令的发送、确认与执行 （一）基金管理人对预留印鉴的授权及更换被授权人的程序

<p>原条款：</p>	<p>现条款：</p>
<p>基金管理人应向基金托管人提供资金划拨指令的预留印鉴。预留印鉴包括但不限于管理人预留的印章样本、有权签字人签字或名章样本。基金管理人需在预留印鉴上加盖公章，对预留印鉴进行授权。</p> <p>同时，划款指令预留印鉴还需同时载明管理人投资监督联络人及联系方式，包括办公电话、移动电话、邮箱、传真和邮寄地址。</p>	<p>如果基金管理人通过除基金托管人提供的网上服务平台（以下简称“服务平台”）以及基金管理人和基金托管人认可的其他线上指令传递方式以外的形式（包括电子邮件、传真）发送划款指令，基金管理人应向基金托管人提供资金划拨指令的预留印鉴。预留印鉴包括但不限于管理人预留的印章样本、有权签字人签字或名章样本。基金管理人需</p>

<p>基金管理人更换预留印鉴，必须提前至少一个工作日，使用传真方式或其他基金管理人和基金托管人认可的方式向基金托管人发出由基金管理人加盖公章的预留印鉴扫描件和原件，同时电话通知基金托管人。</p> <p>基金托管人在收到预留印鉴扫描件、收到变更预留印鉴扫描件后，预留印鉴即生效。如果预留印鉴扫描件或变更预留印鉴扫描件中载明具体生效时间的，该生效时间不得早于基金托管人收到预留印鉴扫描件、变更预留印鉴扫描件的时点。如生效时间早于基金托管人实际收到预留印鉴扫描件、变更预留印鉴扫描件的时点，则以基金托管人收到预留印鉴扫描件或变更预留印鉴扫描件的时点为预留印鉴或变更预留印鉴的生效时间。基金管理人应在提供给基金托管人预留印鉴扫描件或变更预留印鉴扫描件后的5个工作日内将原件寄给基金托管人，由于基金管理人未将预留印鉴或变更预留印鉴原件寄给基金托管人，或原件与扫描件存在差异件而引起的风险和损失，管理人承担相应责任。</p> <p>基金管理人和基金托管人对预留印鉴负有保密义务，其内容不得向相关人员以外的任何人泄露。</p>	<p>在预留印鉴上加盖公章，对预留印鉴进行授权。对于上述线上指令传递方式出具的指令，基金托管人以及基金管理人根据双方认可的方式确认指令授权情况。</p> <p>同时，划款指令预留印鉴还需同时载明管理人投资监督联络人及联系方式，包括办公电话、移动电话、邮箱、传真和邮寄地址。</p> <p>基金管理人更换预留印鉴，必须提前至少一个工作日，使用传真方式或其他基金管理人和基金托管人认可的方式向基金托管人发出由基金管理人加盖公章的预留印鉴扫描件和原件，同时电话通知基金托管人。</p> <p>基金托管人在收到预留印鉴扫描件、收到变更预留印鉴扫描件后，预留印鉴即生效。如果预留印鉴扫描件或变更预留印鉴扫描件中载明具体生效时间的，该生效时间不得早于基金托管人收到预留印鉴扫描件、变更预留印鉴扫描件的时点。如生效时间早于基金托管人实际收到预留印鉴扫描件、变更预留印鉴扫描件的时点，则以基金托管人收到预留印鉴扫描件或变更预留印鉴扫描件的时点为预留印鉴或变更预留印鉴的生效时间。基金管理人应在提供给基金托管人预留印鉴扫描件或变更预留印鉴扫描件后的5个工作日内将原件寄给基金托管人，由于基金管理人未将预留印鉴或变更预留印鉴原件寄给基金托管人，或原件与扫描件存在差异件而引起的风险和损失，管理人承担相应责任。</p> <p>基金管理人和基金托管人对预留印鉴负</p>
---	---

	<p>有保密义务，其内容不得向相关人员以外的任何人泄露。</p>
--	----------------------------------

序号 30

十三、指令的发送、确认与执行 (二) 划款指令的内容

<p>新增条款：</p> <p>当本基金进行场外投资，要求基金托管人从托管资金账户向指定的收款账户划款时，基金管理人需向基金托管人提供以下资料：</p> <p>(1) 基金投资交易相关文件（当事人签署版（包括影印件或扫描件））；</p> <p>(2) 收款账户证明文件；</p> <p>(3) 托管人认为必要的投资划款相关支持性文件。</p> <p>基金管理人应确保所提供的上述文件合法、真实、完整和有效。</p>
--

序号 31

十三、指令的发送、确认与执行 (三) 划款指令的发送、确认和执行的时间及程序

<p>1、划款指令的发送</p> <p>原条款：</p> <p>划款指令由基金管理人通过基金托管人提供的网上服务平台（以下简称“服务平台”）、电子邮件发送扫描件、传真发送扫描件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。以传真方式发送的划款指令，收件人（基金托管人）确认该划款指令已成功接收之时视为送达。以电子邮件接收到的划款指令，托管人接收划款指令的指定邮箱接收到附有划款指令及有效附件的邮件后，视为该划款指令成功送达。</p> <p>基金管理人应按照相关法律法规以及本合同的规定，在其合法的经营权限和交易权限内发送划款指令，并保证划款指令及其附</p>	<p>1、划款指令的发送</p> <p>现条款：</p> <p>划款指令由基金管理人通过基金托管人提供的网上服务平台、电子邮件发送扫描件、传真发送扫描件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。以传真方式发送的划款指令，收件人（基金托管人）确认该划款指令已成功接收之时视为送达。以电子邮件接收到的划款指令，托管人接收划款指令的指定邮箱接收到附有划款指令及有效附件的邮件后，视为该划款指令成功送达。</p> <p>基金管理人应按照相关法律法规以及本合同的规定，在其合法的经营权限和交易权限内发送划款指令，并保证划款指令及其附</p>
--	--

<p>件的合法、真实、完整和有效。如因基金管理人提供的上述文件不合法、不真实、不完整或失去效力而影响基金托管人的审核或给任何第三人带来损失，基金托管人不承担任何形式的责任。</p> <p>基金管理人发送划款指令时，应为基金托管人留出划款执行指令所必需的时间。由基金管理人原因造成的划款指令传输不及时、未能留出足够划款所需时间，致使资金未能及时到账所造成的损失由基金管理人承担。除需考虑资金在途时间外，基金管理人还需为基金托管人留有 2 小时的复核和审批时间。在每个工作日的 13:00 以后接收基金管理人发出的银证转账、银期转账以及当日内进行场内交收的划款指令的，基金托管人不保证当日完成划转流程；在每个工作日的 14:30 以后接收基金管理人发出的其他划款指令，基金托管人不保证当日完成在银行的划付流程。</p>	<p>件的合法、真实、完整和有效。如因基金管理人提供的上述文件不合法、不真实、不完整或失去效力而影响基金托管人的审核或给任何第三人带来损失，基金托管人不承担任何形式的责任。</p> <p>基金管理人发送划款指令时，应为基金托管人留出划款指令执行所必需的时间。由基金管理人原因造成的划款指令传输不及时、未能留出足够划款所需时间，致使资金未能及时到账所造成的损失由基金管理人承担。除需考虑资金在途时间外，基金管理人还需为基金托管人留有 2 小时的复核和审批时间。在每个工作日的 13:00 以后接收基金管理人发出的银证转账、银期转账以及当日内进行场内交收的划款指令的，基金托管人不保证当日完成划转流程；在每个工作日的 14:30 以后接收基金管理人发出的其他划款指令，基金托管人不保证当日完成在银行的划付流程。</p>
<p>3、划款指令的执行</p> <p>原条款：</p>	<p>3、划款指令的执行</p> <p>现条款：</p>
<p>基金托管人有权要求基金管理人通过服务平台上传、传真或电子邮件等方式提供相关交易凭证、合同或其他有效会计资料。当本基金进行场外投资，要求基金托管人从托管资金账户向指定的收款账户划款时，基金管理人需向基金托管人提供以下资料：</p> <p>(1) 基金投资交易相关文件（当事人签署版（包括影印件或扫描件））；</p>	<p>基金托管人有权要求基金管理人通过服务平台上传、传真或电子邮件等方式提供相关交易凭证、合同或其他有效会计资料。</p> <p>如司法或行政机关等有权机关对托管资金账户资金的任何款项采取任何查封、冻结、扣押、扣划等措施，基金托管人有权根据该有权机关的要求执行，而无需为此承担任何责任。</p>

<p>(2) 收款账户证明文件;</p> <p>(3) 托管人认为必要的投资划款相关支持性文件。</p> <p>基金管理人应确保所提供的上述文件合法、真实、完整和有效。</p>	
--	--

序号 32

十三、指令的发送、确认与执行 (四) 基金托管人依照法律法规暂缓、拒绝执行指令的情形和处理程序

<p>原条款:</p>	<p>现条款:</p>
<p>基金托管人发现基金管理人发送的划款指令违反《基金法》、本合同的规定时, 不予执行, 并应及时通知基金管理人纠正, 基金管理人收到通知后应及时处理, 由此造成的损失由基金管理人承担。</p>	<p>基金托管人发现基金管理人发送的划款指令违反法律、行政法规、中国证监会及中国基金业协会规定或本合同的约定时, 不予执行, 并应及时通知基金管理人纠正, 基金管理人收到通知后应及时处理, 由此造成的损失由基金管理人承担。</p>

序号 33

十三、指令的发送、确认与执行 (六) 划款指令的保管

<p>原条款:</p>	<p>现条款:</p>
<p>划款指令若通过服务平台提交, 则以电子数据的形式保管。划款指令若以传真形式发出或以电子邮件方式发送, 则正本由基金管理人保管, 基金托管人保管指令传真件或电子邮件发送的签署版本扫描件, 当两者不一致时, 以基金托管人收到的划款指令传真件或签署版本扫描件为准。</p>	<p>划款指令若通过网上服务平台提交, 则以电子数据的形式保管。划款指令若以传真形式发出或以电子邮件方式发送, 则正本由基金管理人保管, 基金托管人保管指令传真件或电子邮件发送的签署版本扫描件, 当两者不一致时, 以基金托管人收到的划款指令传真件或签署版本扫描件为准。</p>

序号 34

十三、指令的发送、确认与执行 (七) 相关责任

<p>原条款:</p>	<p>现条款:</p>
--------------------	--------------------

<p>基金托管人正确执行基金管理人符合本合同规定的划款指令，基金财产发生损失的，基金托管人不承担任何形式的责任。在正常业务受理渠道和指令规定的时间内，因基金托管人原因未能及时或正确执行符合本合同规定、合法合规的划款指令而导致基金财产受损的，基金托管人应承担相应的责任，但托管资金账户余额不足或基金托管人如遇到不可抗力的情况除外。对基金管理人在没有充足资金的情况下向基金托管人发出的指令，基金托管人有权拒绝执行，基金托管人不承担因为不执行该指令而造成的损失。</p> <p>对于与预留印鉴核对无误的指令，基金管理人不得否认其效力。如果基金管理人的划款指令存在事实上未经授权、欺诈、伪造或未能按时提供划款指令人员的预留印鉴和签字样本等非基金托管人原因造成的情形，只要基金托管人根据本合同相关规定验证有关印鉴与签名无误（基金管理人在与基金托管人签署《资产托管网上综合服务协议》后通过网上服务平台提交的指令，任何使用基金管理人登录信息进行的操作均视为基金管理人行为，基金托管人无需审查划款指令的签章是否与预留印鉴相符），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。</p>	<p>基金托管人正确执行基金管理人符合本合同规定的划款指令，基金财产发生损失的，基金托管人不承担任何形式的责任。在正常业务受理渠道和指令规定的时间内，因基金托管人原因未能及时或正确执行符合本合同规定、合法合规的划款指令而导致基金财产受损的，基金托管人应承担相应的责任，但托管资金账户余额不足或基金托管人如遇到不可抗力的情况除外。对基金管理人在没有充足资金的情况下向基金托管人发出的指令，基金托管人有权拒绝执行，基金托管人不承担因为不执行该指令而造成的损失。</p> <p>对于通过服务平台提交或与预留印鉴核对无误的指令，基金管理人不得否认其效力。如果基金管理人的划款指令存在事实上未经授权、欺诈、伪造或未能按时提供划款指令人员的预留印鉴和签字样本等非基金托管人原因造成的情形，只要基金托管人根据本合同相关规定验证有关印鉴与签名无误（基金管理人在与基金托管人签署《资产托管网上综合服务协议》后通过网上服务平台提交的指令，任何使用基金管理人登录信息进行的操作均视为基金管理人行为，基金托管人无需审查划款指令的签章是否与预留印鉴相符），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。</p>
--	---

序号 35

十四、交易及清算交收安排 （四）申购或赎回的资金清算

原条款:	现条款:
<p>1、T日,基金投资者进行申购或赎回申请。在正常情况下,基金管理人或基金管理人委托的服务机构在T+2日对T日的申购、赎回申请进行确认(如遇特殊情况且在管理人和托管人技术条件支持下,管理人有权对份额确认日进行调整,并通知基金份额持有人和托管人),并将确认的申购、赎回等数据向基金托管人传送。基金管理人或基金管理人委托的服务机构、基金托管人根据确认数据进行账务处理。</p>	<p>1、T日,基金投资者进行申购或赎回申请。在正常情况下,基金管理人或基金管理人委托的服务机构在本合同“基金的申购、赎回、转让与转换”章节之“申购和赎回申请的确认”约定的时间对申购、赎回申请进行确认,并将确认的申购、赎回等数据向基金托管人传送。基金管理人或基金管理人委托的服务机构、基金托管人根据确认数据进行账务处理。</p>

序号 36

十五、越权交易 (一) 越权交易的界定

原条款:	现条款:
<p>本合同约定的越权交易是指基金管理人违反本合同的约定而进行的投资交易行为,包括:(1)违反本合同约定的投资范围和投资比例限制等进行的投资交易行为;(2)法律法规禁止的超买、超卖行为。</p> <p>基金管理人应在本合同规定的投资范围和投资限制权限内运用基金财产进行投资管理,不得违反本合同关于投资范围和投资限制的约定,超越权限从事投资。</p>	<p>本合同约定的越权交易是指基金管理人违反本合同的约定而进行的投资交易行为,包括:(1)违反本合同约定的投资范围和投资比例限制进行的投资交易行为;(2)法律法规禁止的超买、超卖行为。</p> <p>基金管理人应在本合同规定的投资范围和投资限制权限内运用基金财产进行投资管理,不得违反本合同关于投资范围和投资限制的约定,超越权限从事投资。</p>

序号 37

十五、越权交易 (二) 对越权交易的处理程序

原条款:	现条款:
<p>1、违反本合同投资范围和投资比例限制规定进行的投资交易行为</p>	<p>1、违反本合同投资范围和投资比例限制规定进行的投资交易行为</p>

<p>基金托管人在行使监督职责时，发现基金管理人的投资指令违反本合同约定的，应当拒绝执行，立即通知基金管理人，并有权依据相关法律法规的要求报告中国证监会或中国基金业协会。</p>	<p>基金托管人在行使监督职责时，发现基金管理人的投资指令违反本合同约定的，应当拒绝执行，立即通知基金管理人，并有权依据相关法律法规的要求报告中国证监会或中国基金业协会。</p>
<p>基金托管人在行使监督职责时，发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反本合同约定的，应立即通知基金管理人，并有权依据相关法律法规的要求报告中国证监会或中国基金业协会。因执行该指令造成的损失基金托管人不承担任何责任。</p>	<p>基金托管人在行使监督职责时，发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反本合同约定的，应立即通知基金管理人，并依据相关法律法规的要求报告中国证监会或中国基金业协会。因执行该指令造成的损失基金托管人不承担任何责任。</p>
<p>基金管理人应向基金托管人主动报告越权交易。基金托管人有权督促基金管理人在限期内改正并在该期限内对通知事项进行复查。基金管理人未能对基金托管人通知的越权事项未能在限期内纠正的，基金托管人有权依据相关法律法规的要求报告中国证监会或中国基金业协会。</p>	<p>基金管理人应向基金托管人主动报告越权交易。基金托管人有权督促基金管理人在限期内改正并在该期限内对通知事项进行复查。基金管理人未能对基金托管人通知的越权事项未能在限期内纠正的，基金托管人有权依据相关法律法规的要求报告中国证监会或中国基金业协会。</p>

序号 38

十五、越权交易 （三）基金托管人对基金管理人越权交易的监督

<p>原条款：</p>	<p>现条款：</p>
<p>(1) 本基金的投资范围： 本基金的投资范围包括沪深交易所上市交易的品种（指股票、存托凭证、优先股、权证）、债券（包括银行间债券、交易所债券、可转换债券、可交换债券）、证券回购、存款、公开募集证券投资基金（包括分级基金B）、期货、场内期权、在交易所或银行间发行的资产支持证券和资产支持票据（但不</p>	<p>(1) 本基金的投资范围： 参见合同“基金的投资”章节之“投资范围”。</p>

<p>包括次级)、证券公司收益凭证、收益互换与场外期权(在监管部门允许的前提下,仅限于证券公司及其子公司、期货公司子公司作为交易对手)。本基金可以参与融资融券交易、港股通交易、新股申购,也可以将其持有的证券作为融券标的出借给证券金融公司。</p> <p>本基金可投资于证券公司(含证券公司子公司)资产管理计划、期货公司(含期货子公司)资产管理计划、银行理财产品、信托计划、基金公司(含基金子公司)资产管理计划、保险公司(含保险子公司)资产管理计划、在基金业协会登记的私募证券投资基金管理人发行并由具有证券投资基金托管资格的机构托管或由具有相关资质的机构提供私募基金综合服务的契约式私募投资基金,但不可投资于上述产品的劣后级份额。</p>	
<p>原条款:</p>	<p>现条款:</p>
<p>(2) 本基金的投资限制:</p> <p>1) 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%;</p> <p>2) 参与挂钩股票、股票指数收益互换的,向交易对手方缴纳的保证金比例不低于该收益互换合约名义本金的 50%;</p> <p>3) 参与带敲入和敲出结构的场外期权或者收益凭证的合约名义本金不得超过基金净资产的 25%;</p> <p>4) 本基金投向 AA 级及以下(债券评</p>	<p>(2) 本基金的投资比例和投资限制:</p> <p>参见合同“基金的投资”章节之“投资比例和投资限制”。</p>

级参照债项评级，无债项评级参照主体评级) 信用债(可转债除外)、流动性受限资产合计不得超过基金净资产 20%(其中，场外衍生品按全部账户内已占用保证金计算；其他资产按成本与市值孰低计算)；

5) 本基金的总资产不得超过净资产的 200%；

6) 本基金投资于沪深交易所上市交易的存托凭证按市值计算占基金资产总值的比例为 0%-80%；

7) 本基金投资组合遵循相关法律法规或监管部门对于投资比例限制的规定。

基金管理人自本合同生效之日起 3 个月内使本基金的投资组合比例符合本合同的有关约定。由于包括但不限于证券、期货市场波动、上市公司合并、组合规模变动等基金管理人之外的原因导致的投资比例不符合本合同约定的投资限制或投资禁止政策，为被动超标，除法律法规或本合同另有约定外，基金管理人应在发生不符合法律法规或投资政策之日起的 10 个交易日内调整完毕。如发生证券停牌或其他非基金管理人可以控制的原因导致基金管理人不能履行调整义务的，则调整期限相应顺延。基金管理人应当自证券恢复交易之日起的 10 个交易日内调整完毕，法律、行政法规、金融监管部门另有规定的，从其规定。

在本基金到期日前 10 个交易日内，因基金财产变现需要，本基金财产的投资比例限

<p>制可以不符合上述基金配置比例规定。</p>	
<p>删除条款:</p>	
<p>(3) 本基金参与股票、债券、可转换公司债券、可交换公司债券发行申购时, 所申报的金额不得超过本基金的总资产, 所申报的数量不得超过拟发行公司本次发行的总量。</p>	
<p>原条款:</p>	<p>现条款:</p>
<p>(4) 法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的, 从其规定。若法律法规或监管部门取消上述限制, 本基金投资可不受上述规定限制。</p> <p>基金托管人以(1) — (4) 项为限履行监督职责, 对基金管理人的其他职责和行为不承担监督责任。</p>	<p>(3) 法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的, 从其规定。若法律法规或监管部门取消上述限制, 本基金投资可不受上述规定限制。</p> <p>基金托管人以(1) — (3) 项为限履行监督职责, 对基金管理人的其他职责和行为不承担监督责任。</p>
<p>新增条款:</p>	
<p>(3) 法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的, 从其规定。若法律法规或监管部门取消上述限制, 本基金投资可不受上述规定限制。</p> <p>对于本基金的投资比例和投资限制明确需穿透监控计算的, 在本基金投资于其他私募资产管理产品(含私募基金)后, 基金管理人应督促本基金投资标的管理人授权其托管人等服务机构, 或由其他符合基金业协会要求的交互方式和途径, 向本基金托管人提供投资标的估值表等满足基金托管人监督需求的投资组合数据。基金托管人依据本基金管理人经上述途径和频率维护的数据, 至少每自然季度一次对本基金是否满足穿透监控投资限制进行事后监控。</p>	
<p>原条款:</p>	<p>现条款:</p>
<p>3、基金托管人越权交易监督的真实性、准确性、及时性和完整性受限于管理人、证券经纪商、期货经纪商及其他中介机构提供的数据和信息, 合规投资的责任在基金管理人。基金托管人对上述机构提供信息的真实</p>	<p>3、基金托管人越权交易监督的真实性、准确性、及时性和完整性受限于管理人、证券经纪商、期货经纪商、本基金所投资资管产品(含私募基金)托管人及其他中介机构提供的数据和信息, 合规投资的责任在基金</p>

<p>性、准确性、及时性和完整性不作任何担保、暗示或表示,并对上述机构提供信息的错误、遗漏或延迟所引起的损失不承担任何责任。</p> <p>特别地,如投资比例和投资限制涉及场外期权和收益互换等场外衍生品、收益凭证等监控的,基金托管人的越权交易监督依赖于基金管理人或交易对手方提供的交易信息和行情信息,包括但不限于交易对手、合约权利金或保证金、合约名义本金、合约交易结构、合约挂钩标的等信息;由于场外衍生品和收益凭证等场外衍生品属于非标准化资产,前述交易信息和行情信息可能由于交易对手方的标准不统一,其信息口径或含义可能存在较大差异,进而影响监控结果;基金管理人应按照监管及基金业协会的要求确保相关资产交易数据的真实性、准确性、完整性和及时性,基金托管人不具体审核交易信息和行情信息,不对交易数据的真实性、准确性、完整性和及时性负责;由于前述交易数据可能不真实、不准确、不完整、不及时,或者因前述数据口径不明确等原因导致基金托管人无法监控、未能监控或监控不准确的,基金托管人不承担任何责任。</p>	<p>管理人。基金托管人对上述机构提供信息的真实性、准确性、及时性和完整性不作任何担保、暗示或表示,并对上述机构提供信息的错误、遗漏或延迟所引起的损失不承担任何责任。</p> <p>特别地,如本基金由托管资金账户直接投资于其他私募资管产品(含私募基金)时,如所投标的非本基金托管人托管,基金托管人按照本基金投资限制条款核查投资层级的,仅能依赖本基金管理人提供的投资标的合同、标的估值表等辅助材料以及本基金服务机构提供的基金份额登记信息在投资时点进行判断,无法对投资标的整个运作过程是否符合本基金整体嵌套层级进行核查和管控。如管理人提供标的合同或估值表不准确、非最新合同或估值表等其他规避或误导基金托管人核查投资层级情形导致基金托管人核查本基金整体嵌套层级不准确的,由此造成的后果由基金管理人承担。</p> <p>特别地,如本基金的投资比例和投资限制明确需穿透监控计算的,本基金投资于其他私募资产管理产品(含私募基金)时,投资标的的投资组合数据由本基金管理人负责协调维护,基金托管人穿透监控计算的准确性等依赖本基金管理人协调维护的投资标的资产组合的数据情况,基金管理人应确保数据的及时性、真实性、准确性以及完整性。因本基金管理人沟通维护投资标的投资组合数据的时效、频率、完整性、脱敏处理、披</p>
--	--

	<p>露程度等原因影响托管人穿透监控计算的，由此造成的后果由基金管理人承担。</p> <p>特别地，如投资比例和投资限制涉及场外期权和收益互换等场外衍生品、收益凭证等非标准化资产监控的，基金托管人的越权交易监督依赖于基金管理人或交易对手方提供的交易信息和行情信息（包括但不限于交易对手、合约权利金或保证金、合约名义本金、合约交易结构、合约挂钩标的等），前述交易信息和行情信息可能由于交易对手方或计算机构的标准不统一，其信息口径或含义可能存在较大差异，进而影响监控结果。</p> <p>基金管理人应按照监管及中国基金业协会的要求确保相关资产交易数据的真实性、准确性、完整性和及时性，基金托管人不具体审核交易信息和行情信息，不对交易数据的真实性、准确性、完整性和及时性负责；由于前述交易数据导致基金托管人无法监控、未能监控或监控不准确的，基金托管人不承担任何责任。</p>
<p>新增条款：</p>	
<p>4、基金托管人仅依据本合同“越权交易”章节的约定对本基金的投资范围、投资比例和投资限制进行事后监督。除法律法规另有规定或本合同明确约定外，基金托管人仅对本基金直接持仓标的是否符合本基金的投资范围、投资比例和投资限制进行监督。基金托管人的监督内容并不涵盖本合同约定投资相关的全部内容，也不涵盖整个投资过程。基金投资行为完全由基金管理人进行决策和执行，基金托管人依据本合同约定履行投资监督职责，不代表基金托管人能够阻止基金管理人越权交易行为。基金管理人投资行为违反法律法规或本合同约定导致的损失和责任由基金管理人承担，基金托管人不承担任何责任。</p>	

序号 39

十六、基金财产的估值和会计核算 (一) 基金财产的估值

<p>3、基金份额净值</p> <p>原条款:</p>	<p>3、基金份额净值</p> <p>现条款:</p>
<p>基金份额净值是指计算日基金资产净值除以计算日基金份额后的价值。本基金的基金份额净值保留到小数点后4位, 小数点后第5位四舍五入。</p>	<p>基金份额净值是指计算日基金资产净值除以计算日基金份额后的价值。本基金的基金份额净值保留到小数点后4位, 小数点后第5位四舍五入。基金管理人可以在基金服务机构及基金托管人运营支持的前提下设立巨额赎回和/或大额赎回情形下的净值精度应急调整机制。法律法规另有规定的, 从其规定。</p>
<p>4、估值目的</p> <p>原条款:</p>	<p>4、估值目的</p> <p>现条款:</p>
<p>基金财产估值目的是客观、准确地反映基金财产的价值, 并为基金份额申购、赎回提供计价依据。</p>	<p>基金财产估值目的是客观、准确地反映基金财产的价值, 及时反映金融资产的收益和风险, 并为基金份额申购、赎回提供计价依据。</p>
<p>新增条款:</p>	
<p>7、估值依据</p> <p>本基金的估值核算业务应当符合《企业会计准则》《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等中国证监会、中国基金业协会等要求私募基金适用的相关规定及本合同约定; 如无明确规定或约定的, 应由基金管理人与基金托管人基于合理审慎原则协商一致确定。</p>	
<p>7、估值方法</p> <p>原条款:</p>	<p>7、估值方法</p> <p>现条款:</p>
<p>(1) 证券交易所上市的有价证券的估值</p> <p>C、交易所上市交易的可转换债券按估值</p>	<p>(1) 证券交易所上市的有价证券的估值</p> <p>C、交易所上市交易的公开发行可转换债</p>

<p>日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大变化的，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后发生了影响公允价值计量的重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。</p>	<p>券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大变化的，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后发生了影响公允价值计量的重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。</p>
<p>7、估值方法 原条款：</p>	<p>7、估值方法 现条款：</p>
<p>(1) 证券交易所上市的有价证券的估值 交易所上市实行全价交易的债券（可转债除外），选取第三方估值机构（中证指数有限公司）提供的估值全价减去估值全价中所含的债券（税后）应收利息得到的净价进行估值。</p>	<p>(1) 证券交易所上市的有价证券的估值 交易所上市实行全价交易的债券（公开发行可转债除外），选取第三方估值机构（中证指数有限公司）提供的估值全价减去估值全价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。</p>
<p>7、估值方法 原条款：</p>	<p>7、估值方法 现条款：</p>
<p>(2) 处于特定期间的有价证券应区分如下情况处理： A、送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的收盘价估值；该日无报价的，以最近一日的收盘价估值。</p>	<p>(2) 处于特定期间的有价证券应区分如下情况处理： A、送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的收盘价估值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大变化的，以最近交易日的收盘价估值；估值日无报价且最近交易日后发生了影响公允价值计量的重大变化的，可参考类似投资品种的现行市</p>

	价及重大变化因素，调整最近交易日的收盘价，确定公允价格。
<p>7、估值方法</p> <p>新增条款：</p> <p>(2) 处于特定期间的有价证券应区分如下情况处理：</p> <p>基金管理人应当及时通知基金托管人上述股票的锁定/限售情况，如基金管理人未及时告知基金托管人锁定/限售情况的，则按照无流通受限股票的方法估值。由此造成的后果由基金管理人承担，基金托管人不承担任何责任。</p>	
<p>7、估值方法</p> <p>原条款：</p> <p>(6) 银行存款每日不计提利息，以实际结息数为准；证券、期货资金账户内资金不计提利息，以实际结息数为准，本基金终止清算时应收未收利息计入基金终止清算净值。</p>	<p>7、估值方法</p> <p>现条款：</p> <p>(6) 银行存款每日计提利息，证券资金账户内资金每日计提利息（包括普通、信用及期权账户），在利息到账日以实收利息入账，并冲减已计提部分；期货备付金账户默认不计提利息，如需调整为计提利息，基金管理人应将计息利率通过双方协商一致的方式告知基金托管人。</p>
<p>7、估值方法</p> <p>原条款：</p> <p>(7) 基金持有的公募证券投资基金按以下方法估值：</p> <p>B、未在交易所上市交易的的证券投资基金，按估值日前一交易日公布的基金份额净值估值；估值日前一交易日基金份额净值无公布的，按此前最近交易日公布的基金份额净值估值。</p>	<p>7、估值方法</p> <p>现条款：</p> <p>(7) 基金持有的公募证券投资基金按以下方法估值：</p> <p>B、未在交易所上市交易的证券投资基金，按估值日公布的基金份额净值估值；估值日基金份额净值无公布的，按此前最近交易日公布的基金份额净值估值。</p>
<p>7、估值方法</p> <p>原条款：</p>	<p>7、估值方法</p> <p>现条款：</p>

<p>(7) 基金持有的公募证券投资基金按以下方法估值：</p> <p>C、货币基金以成本列示，每日按前一交易日的万份收益计提红利。</p>	<p>(7) 基金持有的公募证券投资基金按以下方法估值：</p> <p>C、货币基金以成本列示，每日按估值日的万份收益计提红利。</p>
<p>7、估值方法</p> <p>原条款：</p>	<p>7、估值方法</p> <p>现条款：</p>
<p>(9) 期权合约，上市交易的按估值日的收盘价估值，估值日没有报价的，按当日的结算价估值。未上市交易的，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量的情况下，按成本估值。法律法规另有约定的，从其规定。</p>	<p>(9) 期权合约，上市交易的按估值日的结算价估值，若估值当日无结算价的，且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大变化的，采用最近交易日结算价估值。未上市交易的，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量的情况下，按成本估值。法律法规另有约定的，从其规定。</p>
<p>7、估值方法</p> <p>原条款：</p>	<p>7、估值方法</p> <p>现条款：</p>
<p>(10) 场外衍生品按以下方法估值：</p> <p>A、持有的利率互换根据清算机构或者（代理清算机构）提供的结算单据或者结算数据进行估值。</p> <p>B、持有的场外期权根据第三方或交易对手提供的期权合约盈亏估值结果或估值报告进行估值。第三方或交易对手无法提供估值结果或估值报告的，按成本估值。</p> <p>C、持有的权益类收益互换、跨境收益互换根据第三方或交易对手提供的估值报告进行估值。第三方或交易对手无法提供估值结果或估值报告的，按成本估值。</p> <p>D、如果不属于上述情况的，则基金管理</p>	<p>(10) 场外衍生品按以下方法估值：</p> <p>A、持有的利率互换根据清算机构或者代理清算机构提供的结算单据或者结算数据进行估值。基金管理人对清算机构或者代理清算机构提供的结算单据或者结算数据的真实性、完整性、有效性、及时性负责，如因未及时获得完整、准确及有效的结算单据、结算数据或者因结算单据、结算数据记载的信息发生变更导致本基金净值发生波动或无法反映真实资产状况造成投资者损失的，基金托管人不承担任何责任。</p> <p>B、持有的场外期权根据管理人指定的第三方或交易对手提供的期权合约盈亏估值结果或</p>

<p>人应向基金托管人提供标的产品的估值方法和估值数据，并确保提供数据的真实、完整和有效。</p> <p>E、对于投资的场外衍生品按照基金管理人提供的估值方法或估值公式进行估值，如果基金管理人认为需要调整估值方法或估值公式的，可经双方协商确认，并以基金管理人出具的具体估值方法为准。</p>	<p>估值报告进行估值。管理人应确保第三方或交易对手在获取估值日最新信息并更新相关估值数据的基础上，按照场外期权协议约定的估值方法计算提供估值日的期权合约盈亏估值结果或估值报告；如无法获取上述估值结果或报告的，管理人应及时采取必要措施以保证上述情形不会对基金估值以及基金份额申购、赎回计价依据的客观、准确性造成影响。基金管理人指定的第三方或交易对手提供的期权合约盈亏估值结果或估值报告的真实性和完整性、及时性负责，如因未及时获得完整、准确及有效的期权合约盈亏估值结果或估值报告或者期权合约盈亏估值结果或估值报告记载的信息发生变更导致本基金净值发生波动或无法反映真实资产状况造成投资者损失的，基金托管人不承担任何责任。</p> <p>C、持有的权益类收益互换、跨境收益互换根据管理人指定的第三方或交易对手提供的估值结果或估值报告进行估值。管理人应确保第三方或交易对手在获取估值日最新信息并更新相关估值数据的基础上，按照收益互换协议约定的估值方法计算提供估值日的互换合约盈亏估值结果或估值报告；如无法获取上述估值结果或报告的，管理人应及时采取必要措施以保证上述情形不会对基金估值以及基金份额申购、赎回计价依据的客观、准确性造成影响。基金管理人指定第三方或交易对手提供的估值结果或估值报告的真实</p>
---	--

	<p>性、完整性、有效性、及时性负责，如因未及时获得完整、准确及有效的估值结果或估值报告或者估值结果或估值报告记载的信息发生变更导致本基金净值发生波动或无法反映真实资产状况造成投资者损失的，基金托管人不承担任何责任。</p> <p>D、如果不属于上述情况的，则基金管理人应向基金托管人提供场外衍生品的估值方法和估值结果，并确保提供数据的真实、完整和有效。如果基金管理人认为需要调整估值方法或估值公式的，基金管理人应根据具体情况就估值目的合理制定估值方法，并将估值方法提供给基金托管人进行估值，最终以基金管理人出具的具体估值方法为准。</p> <p>(11) 收益凭证按以下方法估值：对于持有的收益凭证约定了固定收益率、本金和收益不承担特定标的价格波动市场风险的，按照约定的收益率在持有期间内每日确认收益；对于本金或收益承担特定标的价格波动的市场风险的，按照估值日收益凭证发行方提供的估值价格估值；如收益凭证发行方未能提供估值价格的，应采用估值技术确定其公允价值；在估值技术也难以可靠计量的情况下，按成本估值。基金管理人应对收益凭证发行方提供的估值价格的真实性、完整性、有效性、及时性负责，如因未及时获得完整、准确及有效的估值或者估值结果记载的信息发生变更导致本基金净值发生波动或无法反映真实资产状况造成投资者损失的，基金托管人不</p>
--	--

	<p>承担任何责任。</p>
<p>7、估值方法 新增条款：</p>	
<p>(12) 对于投资的基金管理公司及其子公司资产管理计划、证券公司及其子公司资产管理计划、信托计划、保险资产管理计划、期货资产管理计划、私募投资基金、商业银行理财产品等场外产品（以下简称“标的产品”），按如下方式进行估值：</p> <p>1) 针对标的产品入账时间处理规则：</p>	
<p>7、估值方法 原条款：</p>	<p>7、估值方法 现条款：</p>
<p>(11) 对于投资的基金管理公司及其子公司资产管理计划、证券公司及其子公司资产管理计划、信托计划、保险资产管理计划、期货资产管理计划、私募投资基金、商业银行理财产品等场外产品（以下简称“标的产品”），按如下方式进行估值：</p> <p>B、如果上述标的产品有份额净值的，以管理人按照净值提供频率提供的标的产品最新估值信息（包括份额数量、最新份额净值、权益数据等）进行估值，如果管理人没有按照净值提供频率提供最新估值信息的，则以最近一次提供的估值信息估值；如果上述标的产品有固定预期收益率且不公布份额净值，则管理人提供成本和预期收益率，以成本列示并每日加计应收利息（或应计收益）的方法进行估值，管理人未提供预期收益率的，则以成本计量；如果上述标的产品有浮动预期收益率且不公布份额净值，则以成本计量。</p>	<p>(12) 对于投资的基金管理公司及其子公司资产管理计划、证券公司及其子公司资产管理计划、信托计划、保险资产管理计划、期货资产管理计划、私募投资基金、商业银行理财产品等场外产品（以下简称“标的产品”），按如下方式进行估值：</p> <p>2) 针对标的产品净值更新处理规则：</p> <p>A、如果上述标的产品有份额净值的，以管理人按照净值提供频率提供的标的产品最新估值信息（包括份额数量、最新份额净值、权益数据等）进行估值，如果管理人没有按照净值提供频率提供最新估值信息的，则以最近一次提供的估值信息估值；如果管理人重新提供历史估值信息的，则原则上以最新提供的估值信息在其提供日估值，并不再对以往账务进行追溯调整。</p> <p>B、如果上述标的产品有固定预期收益率且不公布份额净值，则管理人提供成本和预期收益率，以成本列示并每日加计应收利息（或</p>

	<p>应计收益)的方法进行估值,管理人未提供预期收益率的,则以成本计量;如果管理人重新提供固定预期收益率的,则原则上以最新提供的固定预期收益率在其提供日估值,并不再对以往账务进行追溯调整。</p>
<p>7、估值方法 新增条款:</p>	
<p>(13) 在全国中小企业股份转让系统挂牌交易的股票,以连续竞价方式或做市转让方式交易的股票,以其估值日挂牌的市价(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。以集合竞价方式交易的股票,以其成本与估值日挂牌的市价(收盘价)孰低估值;估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大变化的,以成本与最近交易日的市价(收盘价)孰低估值。如最近交易日后发生了影响公允价值计量的重大变化的,可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,由管理人出具估值意见说明函,调整最近交易市价,确定证券估值价格。</p> <p>如果未来监管机构或行业协会等出台关于全国中小企业股份转让系统挂牌上市交易股票的统一的估值标准或方法,则参照新的标准或方法。</p> <p>(14) 融资融券、转融通业务,按照融入、融出方向以及融入、融出业务对应的资金和券分别核算。参考上述对应品种的估值方法进行估值,同时核算融资融券或者转融通业务产生的利息、费用等。</p>	
<p>7、估值方法 原条款:</p>	<p>7、估值方法 现条款:</p>
<p>(13) 如基金管理人和基金托管人对基金份额净值的计算结果不能达成一致时,为避免不能按时公布的情形,以基金管理人计算或确认的结果对外公布,基金管理人应在单方面对外公告基金份额净值计算结果时注明未经基金托管人复核,而基金托管人有权将有关情况向中国证监会报告,由此给基金</p>	<p>(16) 管理人对本基金净值的计算结果应由基金托管人复核确认后再行披露。如基金管理人对外披露未经基金托管人复核确认的基金净值信息的,由此给基金投资者和基金财产造成的损失,由基金管理人承担赔偿责任。</p>

<p>投资者和基金造成的损失，由基金管理人承担赔偿责任。</p>	
<p>7、估值方法 原条款：</p>	<p>7、估值方法 现条款：</p>
<p>(14) 相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。</p> <p>基金估值核算需要的相关信息，包括但不限于场外交易信息和场外行情信息，如果托管人无法获得相关估值数据，则由管理人负责提供，并且管理人需对数据准确性、完整性和及时性负责。否则，由于上述情况导致的估值不准确、不完整或不及时，托管人不承担责任。</p>	<p>(17) 相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。</p> <p>基金估值核算需要的相关信息，包括但不限于债券质押式协议回购业务的交易文件、交易对手方及质押标的等信息、场外交易情况、场外交易信息、场外交易文件和场外行情、标的产品估值报告数据（包括但不限于收益互换、场外期权、收益凭证等估值报告）等信息，如果托管人无法获得相关估值数据，则由管理人或其授权的相关方负责提供，并且管理人需对数据准确性、完整性和及时性负责。否则，由于上述情况导致的估值不准确、不完整或不及时，托管人不承担责任。特别地，当本基金投资于公募基金、资产管理计划、信托计划、保险资产管理计划、期货资产管理计划、私募投资基金、商业银行理财产品等标的产品时，基金管理人应确保按照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提供完整、准确及有效的估值材料作为基金托管人确认该笔投资权益的依据，如因基金托管人未及时获得完整、准确及有效的并经托管人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净值发生波动或无法反映真实资产</p>

	<p>状况造成投资者损失的，基金托管人不承担任何责任；基金管理人应敦促标的产品的管理人或管理人委托的基金服务机构及时、准确、完整地向基金托管人提供标的产品的份额数量、净值、申赎情况、分红情况以及其他权益变动等估值信息，如因基金托管人未及时获得完整、准确的估值信息或估值信息发生变更致使本基金净值发生波动或无法反映真实资产状况造成基金份额持有人损失的，基金托管人不承担任何责任。特别地，当本基金投资于场外衍生品交易的，基金管理人应当在本基金下一估值日前将场外衍生品交易情况、交易文件等提供给基金托管人；基金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基金托管人提供场外衍生品交易文件并持续提供估值信息。</p>
<p>9、税收 新增条款：</p>	
<p>基金管理人作为本基金的会计责任方，应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。由于基金管理人应税判断、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错误，由此导致的税款计算风险责任由基金管理人自行承担。如因基金管理人未提供涉税信息、所管理的基金投资范围相关投资标的涉税判断以及保本判断等，造成基金托管人无法对估值结果进行复核的，基金托管人有权暂停估值复核，由此产生的责任和后果由基金管理人承担。</p>	
<p>10、估值程序 原条款：</p>	<p>10、估值程序 现条款：</p>

<p>基金日常估值由基金管理人进行，根据相关法律法规，基金管理人可以委托服务机构办理基金的估值。基金管理人或其委托的服务机构完成估值后，将估值结果以书面形式、发送电子对账数据等双方认可的其他形式送至基金托管人，基金托管人按法律法规、本合同规定的估值方法、时间、程序进行复核，复核无误后在基金管理人发送的书面估值结果上加盖业务章或者发送电子对账结果等双方认可的其他形式返回给基金管理人或其委托的服务机构；月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。</p> <p>在法律法规和中国证监会允许的情况下，基金管理人与基金托管人可以各自委托服务机构进行基金资产估值，但不改变基金管理人与基金托管人对基金资产估值各自承担的责任。</p>	<p>基金日常估值由基金管理人进行，根据相关法律法规，基金管理人可以委托服务机构办理基金的估值。基金管理人或其委托的服务机构完成估值后，将估值结果以书面形式、发送电子对账数据等双方认可的其他形式送至基金托管人，基金托管人按法律法规、本合同规定的估值方法、时间、程序进行复核，复核无误后在基金管理人发送的书面估值结果上加盖业务章或者发送电子对账结果等双方认可的其他形式返回给基金管理人或其委托的服务机构；月末、季末和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。</p> <p>在法律法规和中国证监会允许的情况下，基金管理人与基金托管人可以各自委托服务机构进行基金资产估值，但不改变基金管理人与基金托管人对基金资产估值各自承担的责任。</p>
<p>11、估值错误的处理</p> <p>原条款：</p>	<p>11、估值错误的处理</p> <p>现条款：</p>
<p>当基金净值发生计算错误超过基金净值0.5%时，视为估值错误。</p>	<p>当基金净值发生计算错误超过基金净值0.25%时，视为估值错误。</p>
<p>11、估值错误的处理</p> <p>新增条款：</p>	
<p>当基金净值发生偏差但未达到上述估值错误标准时，基金管理人可与基金托管人协商处理方式，如经双方在平等基础上充分讨论后仍无法达成一致的意见，则以管理人的处理方法为准，并由管理人承担由此而产生的责任。</p>	
<p>11、估值错误的处理</p> <p>原条款：</p>	<p>11、估值错误的处理</p> <p>现条款：</p>

<p>本合同的当事人应按照以下约定处理：</p>	<p>本合同的当事人应按照以下约定处理估值错误：</p>
<p>11、估值错误的处理 原条款：</p>	<p>11、估值错误的处理 现条款：</p>
<p>(2) 估值错误处理原则</p> <p>A、如基金管理人或基金托管人发现基金资产估值违反本合同订明的估值方法、程序的规定，导致基金净值发生计算错误超过基金净值 0.5%时，应立即通知对方，共同查明原因，协商解决；</p>	<p>(2) 估值错误处理原则</p> <p>A、如基金管理人或基金托管人发现基金资产估值违反本合同订明的估值方法、程序的规定，导致基金净值发生上述估值错误时，应立即通知对方，共同查明原因，协商解决；</p>
<p>11、估值错误的处理 新增条款：</p>	
<p>(2) 估值错误处理原则</p> <p>G、由于一方当事人提供的信息错误，另一方当事人在采取了必要合理的措施后仍不能发现该错误，进而导致净值计算错误造成基金投资者的损失，由提供错误信息的当事人一方负责赔偿；</p>	
<p>11、估值错误的处理 原条款：</p>	<p>11、估值错误的处理 现条款：</p>
<p>(3) 估值错误处理程序</p> <p>B、当基金净值发生计算错误超过基金净值 0.5%时，查明估值错误发生的原因，根据当事人协商的方法对因估值错误造成的损失进行评估；</p>	<p>(3) 估值错误处理程序</p> <p>B、查明估值错误发生的原因，根据当事人协商的方法对因估值错误造成的损失进行评估；</p>
<p>12、暂停估值的情形 删除条款：</p>	
<p>(4) 对于没有或未及时获取交易数据或行情数据、交易数据或行情数据不完整或有误时；</p>	

<p>12、暂停估值的情形</p> <p>新增条款：</p> <p>(4) 对于没有或未及时获取证券/期货经纪商等外部机构提供的估值所需材料、标的产品权益确认原始凭证、场外标的估值基准日的估值报告等估值材料或获取的估值材料有误，导致基金管理人、基金托管人无法对基金资产正常估值时；</p> <p>(5) 基金管理人或基金托管人有合理理由认为根据现有材料无法准确估值，经双方协商一致，决定暂停估值；</p>	
<p>12、暂停估值的情形</p> <p>新增条款：</p> <p>(6) 中国证监会认定的其他情形。</p> <p>如发生上述暂停估值的情形，基金托管人暂停对本基金的投资监督及定期报告的财务数据复核，自本基金恢复估值之日起，基金托管人恢复对本基金的投资监督以及定期报告的财务数据复核。</p>	
<p>13、基金份额净值的确认</p> <p>原条款：</p> <p>用于基金信息披露的基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个估值核对日计算估值日的基金份额净值并发送给基金托管人。基金托管人对份额净值计算结果复核确认后发送给基金管理人。基金份额净值由基金管理人负责对投资者公布。</p> <p>根据相关法规，基金会计责任方由基金管理人担任。因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意見，基金管理人有权按照其对基金资产净值的计算结果对外予以公布，并承担由此而产生的责任。基金托</p>	<p>13、基金份额净值的确认</p> <p>现条款：</p> <p>用于基金信息披露的基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个估值核对日计算估值日的基金份额净值并发送给基金托管人。基金托管人对份额净值计算结果复核确认后发送给基金管理人。基金份额净值由基金管理人负责对投资者公布。</p> <p>根据相关法规，基金会计责任方由基金管理人担任。在相关各方就与本基金有关的会计问题在平等基础上充分讨论后仍无法达成一致意見的情况下，如基金管理人按照其对基金资产净值的计算结果对外予以公布，应由管理人承担由此而产生的责任。</p>

管人有权将该等情况报相关监管机构备案。	
---------------------	--

序号 40

十六、基金财产的估值和会计核算

原条款：	现条款：
<p>(二) 基金的会计政策</p> <p>1、基金管理人为本基金的基金会计责任方；</p> <p>2、基金的会计年度为公历年度的1月1日至12月31日；基金首次募集的会计年度按如下原则：如果《基金合同》生效少于2个月，可以并入下一个会计年度；</p> <p>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；</p> <p>4、会计核算制度执行国家有关会计制度；</p> <p>5、本基金独立建账、独立核算；</p> <p>6、基金管理人或其委托的服务机构保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，编制会计报表；基金托管人定期与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对。</p>	<p>(二) 基金的会计核算</p> <p>1、基金的会计核算政策</p> <p>(1) 基金的会计年度为公历年度的1月1日至12月31日；</p> <p>(2) 基金核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位；</p> <p>(3) 基金财产的会计核算参照《证券投资基金会计核算业务指引》执行。</p> <p>2、基金的会计核算职责</p> <p>(1) 基金管理人、基金托管人应根据法律法规及本合同约定，对本基金财产独立建账、独立核算；</p> <p>(2) 基金管理人或其委托的服务机构保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，编制会计报表；</p> <p>(3) 基金托管人定期与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对。</p> <p>基金管理人作为本基金的基金会计责任方。在基金管理人、基金托管人对会计核算处理方法存在分歧、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的情况下，如遵循基金管理人的处理方法，应由管理人承担由此而产生的责任。</p> <p>基金管理人、基金托管人经核对发现相关各方的账目存在不符的，基金管理人和基</p>

	<p>金托管人必须及时查明原因并纠正，保证相关各方平行登录的账册记录完全相符。暂时无法查找到错账的原因而影响到基金资产净值和基金份额净值的计算和基金信息披露等业务的，如以基金管理人的账册为准，应由管理人承担由此而产生的责任。</p>
--	--

序号 41

十七、基金的费用与税收 (一) 基金费用的种类

原条款：	现条款：
8、合同文件制作、印刷费用；	8、合同文件制作、印刷费用及使用电子合同相关费用；

序号 42

十七、基金的费用与税收 (二) 费用计提方式、计提标准和支付方式

<p>1、管理费</p> <p>原条款：</p> <p>本基金只针对 B 类份额收取管理费，A 类份额不收取管理费。</p> <p>基金的 B 类份额年管理费率为 1.5%。计算方法如下：</p> $H = E \times 1.5\% \div N$ <p>H：每日应计提的 B 类份额的管理费</p> <p>E：前一日的 B 类份额的基金资产净值</p> <p>N：当年天数</p> <p>本基金的管理费每日计提，按季支付给基金管理人。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在下个自然季度起按照指定的账户路径进行资金支付，直至支付完毕，基金管理人无需再出具资金划拨指令，但应对托管资金账户的现金头寸进行管理，并自行解决由于费用自动支付可能产生的其他头寸问题。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。</p>	<p>1、管理费</p> <p>现条款：</p>
--	--

基金的年管理费率为 **S%**。计算方法如下：

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

H：每日**各类别基金份额**应计提的管理费

E：前一日的**各类别基金份额**资产净值

N：当年天数

基金份额类别	管理费率 S%
A 类份额	0
B 类份额	1.5%

本基金的管理费每日计提，按季支付给基金管理人。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在下一个自然季度起按照指定的账户路径进行资金支付，直至支付完毕，基金管理人无需再出具资金划拨指令，但应对托管资金账户的现金头寸进行管理，并自行解决由于费用自动支付可能产生的其他头寸问题。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

4、基金管理人的业绩报酬

原条款：

本基金仅针对 B 类份额收取业绩报酬，A 类份额不收取业绩报酬。

业绩报酬的计算采取“单客户单笔份额高水位法”：在两类情况下管理人将根据**B 类份额**基金份额持有人的收益情况对本基金提取业绩报酬，一类是基金份额持有人申请赎回或本基金终止时提取业绩报酬；另一类是分红时提取业绩报酬。

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

业绩报酬的计提方法如下：

当基金份额持有人申请赎回、基金分红或本基金终止时，管理人根据基金份额持有人每一基金份额的收益率（R）提取业绩报酬。经计算确认的业绩报酬从基金份额持有人赎回基金资金清算款中或分红款项中以现金支付。

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

A=赎回日、分红除权日或基金终止日**B 类份额**基金累计份额净值；

C=上一个业绩报酬提取日 B 类份额基金累计份额净值；若“上一个业绩报酬提取日”不存在，则 C 为该份额申购开放日 B 类份额基金累计份额净值（申购份额）或 B 类份额基金份额初始面值（认购份额）；

D=上一个业绩报酬提取日 B 类份额基金份额净值；若“上一个业绩报酬提取日”不存在，则 D 为该份额申购开放日 B 类份额基金份额净值（申购份额）或 B 类份额基金份额初始面值（认购份额）；

E=业绩报酬；

F=赎回份额或分红除权日持有份额；

收益率

业绩报酬计提标准为：

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

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

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

4、基金管理人的业绩报酬

现条款：

本基金仅针对 B 类份额收取业绩报酬，A 类份额不收取业绩报酬。

业绩报酬的计算采取“单客户单笔份额高水位法”：在两类情况下管理人将根据基金份额持有人的收益情况对本基金提取业绩报酬，一类是基金份额持有人申请赎回或本基金终止时提取业绩报酬；另一类是分红时提取业绩报酬。

当基金份额赎回、基金终止或分红时，管理人将提取赎回份额或分红份额当期收益的 U% 作为业绩报酬。如本次基金分红时间距上次分红时间（如有）不足 6 个月（每月按 30 个自然日计算），则本次基金分红不对基金份额计提业绩报酬。

份额类别	业绩报酬计提比例 U
A 类份额	0

B类份额	20
------	----

业绩报酬的计提方法如下：

当基金份额持有人申请赎回、基金分红或本基金终止时，管理人根据基金份额持有人每一基金份额的收益率（R）提取业绩报酬。经计算确认的业绩报酬从基金份额持有人赎回基金资金清算款中或分红款项中以现金支付。

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

A=赎回对应的开放日、分红除权日或基金终止日各份额类别的基金份额累计净值；

C=上一个业绩报酬提取日各份额类别的基金份额累计净值；若“上一个业绩报酬提取日”不存在，则C为该份额申购开放日各份额类别的基金累计份额净值（申购份额）或基金份额初始面值（认购份额）；

D=上一个业绩报酬提取日各份额类别的基金份额净值；若“上一个业绩报酬提取日”不存在，则D为该份额申购开放日各份额类别的基金份额净值（申购份额）或基金份额初始面值（认购份额）；

E=业绩报酬；

F=赎回份额或分红除权日持有份额；

$E_{i,j}$ ：上一次基金分红除权日至本次基金分红除权日的存续自然天数（算头不算尾）；

收益率 $R = \frac{A-C}{D} \times 100\%$

业绩报酬计提标准（针对分红时提取报酬须额外满足条件 $E_{i,j} \geq 6$ 个月，每月按30个自然日计算，但对首次通过分红时提取业绩报酬则无需满足本条件）：

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

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

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

至法定节假日、休息日后的第一个工作日或不可抗力结束日后的第一个工作日支付。

序号 43

十七、基金的费用与税收 (三) 不列入基金业务费用的项目

原条款:	现条款:
2、基金管理人和基金托管人处理与基金财产运作无关的事项发生的费用。	2、与基金财产运作无关的事项发生的费用。

序号 44

十七、基金的费用与税收 (五) 基金的税收

原条款:	现条款:
<p>本基金运作过程中涉及各纳税主体及扣缴主体，其纳税义务及扣缴义务按国家税收法律、法规，由其各自承担、缴纳或扣缴。</p> <p>鉴于基金管理人为本基金的利益，投资、运用委托财产过程中，可能因法律法规、税收政策的要求而成为纳税义务人，就归属于基金的投资收益、投资回报和/或本金承担纳税义务。因此，本基金运营过程中由于上述原因发生的增值税及相关附加等税负，仍由本基金委托财产承担。基金管理人有权在本基金每次收益分配前或基金清算时从基金中先行提取一定金额作为税费备用资金，具体金额由基金管理人根据届时情况确定，提取总额不得超过本基金应缴税费金额。基金管理人可能通过本基金托管账户直接缴付税费，或划付至基金管理人账户并由基金管理人依据税务部门要求完成税款申报缴纳。如果本基金托管账户受现金流动性限制无法足额现金缴纳上述税款，在征得基金份额持有</p>	<p>本基金运作过程中涉及各纳税主体及扣缴主体，其纳税义务及扣缴义务按国家税收法律、法规，由其各自承担、缴纳或扣缴。</p> <p>鉴于基金管理人为本基金的利益，投资、运用委托财产过程中，可能因法律法规、税收政策的要求而成为纳税义务人，就归属于基金的投资收益、投资回报和/或本金承担纳税义务。因此，本基金运营过程中由于上述原因发生的增值税及相关附加等税负，仍由本基金委托财产承担。基金管理人有权在本基金每次收益分配前或基金清算时从基金中先行提取一定金额作为税费备用资金，具体金额由基金管理人根据届时情况确定，提取总额不得超过本基金应缴税费金额。基金管理人可能通过本基金托管资金账户直接缴付税费，或划付至基金管理人账户并由基金管理人依据税务部门要求完成税款申报缴纳。如果本基金托管资金账户受现金流动性限制无法足额现金缴纳上述税款，在征得基金份</p>

<p>人同意的前提下，基金管理人有权要求基金份额持有人向基金托管账户提供流动性支持，以按期足额缴付/划付相关税款。如果基金管理人以固有财产垫付本基金运营过程中产生的增值税或其他税费（如有）的，则基金管理人有权从委托财产中优先受偿。本基金清算后若基金管理人被税务机关要求补缴应由委托财产承担的上述税费的，则基金管理人有权向基金份额持有人就补缴金额进行追偿。</p> <p>基金份额持有人从委托财产中获得的各项收益产生的税费，由基金份额持有人根据国家法律法规的规定自行承担。根据国家法律法规或主管税务机关规定，基金管理人应当就基金份额持有人获得收益所产生的税费履行代扣代缴义务的，则基金管理人有权根据届时有效的规定对基金份额持有人代扣代缴相关税费。基金管理人、基金托管人就其取得的基金管理费、托管费，依据法律法规规定履行各自的纳税义务。若届时国家税收相关法律法规发生调整变化，则依据其规定执行。</p>	<p>额持有人同意的前提下，基金管理人有权要求基金份额持有人向基金托管资金账户提供流动性支持，以按期足额缴付/划付相关税款。如果基金管理人以固有财产垫付本基金运营过程中产生的增值税或其他税费（如有）的，则基金管理人有权从委托财产中优先受偿。本基金清算后若基金管理人被税务机关要求补缴应由委托财产承担的上述税费的，则基金管理人有权向基金份额持有人就补缴金额进行追偿。</p> <p>基金份额持有人从委托财产中获得的各项收益产生的税费，由基金份额持有人根据国家法律法规的规定自行承担。根据国家法律法规或主管税务机关规定，基金管理人应当就基金份额持有人获得收益所产生的税费履行代扣代缴义务的，则基金管理人有权根据届时有效的规定对基金份额持有人代扣代缴相关税费。基金管理人、基金托管人就其取得的基金管理费、托管费，依据法律法规规定履行各自的纳税义务。若届时国家税收相关法律法规发生调整变化，则依据其规定执行。</p>
---	--

序号 45

十八、基金的收益分配 （二）基金收益分配原则

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

删除条款：	
<p>2、本基金在每个自然年度管理人有权决定收益分配的次数；</p> <p>3、本基金的收益分配可以采取现金分红或红利再投资等方式，本基金默认的收益分配方式为红利再投资，基金份额持有人需要修改收益分配方式，需提前通知管理人提出申请；</p>	
新增条款：	
<p>2、本基金的收益分配可以采取现金分红或红利再投资等方式，本基金默认的收益分配方式为红利再投资，基金份额持有人需要修改收益分配方式，需提前通知管理人提出申请；（如涉及红利再投资，对于红利再投资份额视作在红利再投日新增申购份额（不收取申购费），且对于基金份额持有人持有的基金份额（原份额）所获得的红利再投资份额的持有期，按原份额的持有期计算）；</p>	
原条款：	现条款：
<p>5、每一相同类别基金份额享有同等分配权；</p>	<p>4、同一类别的基金份额的每一基金份额享有同等分配权；</p>

序号 46

十八、基金的收益分配 （四）收益分配方案的确定、通知与实施

原条款：	现条款：
<p>1、本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金管理人在基金托管人复核后以约定的形式通知基金份额持有人。</p>	<p>1、本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金管理人在基金托管人复核后以本合同约定的形式通知基金份额持有人。</p>
原条款：	现条款：
<p>2、在收益分配方案通知基金份额持有人后，如涉及现金分红的方式，基金管理人依据具体方案的规定就支付的现金红利向基金托管人发送划款指令，基金托管人按照基金管理人的指令及时进行分红资金的划付；如涉及红利再投资的方式，基金份额持有人所转换的基金份额将以分红除权日的该类别基</p>	<p>2、在收益分配方案通知基金份额持有人后，如涉及现金分红的方式，基金管理人或基金管理人委托的服务机构依据具体方案的规定就支付的现金红利向基金托管人发送划款指令，基金托管人按照基金管理人或基金管理人委托的服务机构的指令及时进行分红资金的划付；如涉及红利再投资的方式，基</p>

<p>金份额净值为计算基准确定再投资份额，红利再投资所转换的基金份额将直接记入其基金账户。</p>	<p>金份额持有人所转换的基金份额将以分红除权日的各类别基金份额净值为计算基准确定再投资份额，红利再投资所转换的基金份额将直接记入其基金账户。</p>
---	---

序号 47

十九、基金的信息披露与报告

<p>原条款：</p>	<p>现条款：</p>
<p>（一）本基金的信息披露应符合《基金法》、《私募办法》、《私募投资基金信息披露管理办法》、《私募投资基金管理人登记和基金备案办法（试行）》及相关自律规则的规定。如中国证监会、中国基金业协会更新了私募基金信息披露规则或制定了其他相关规则，则从其规则执行。</p>	<p>（一）本基金的信息披露应符合《基金法》、《私募办法》、《私募投资基金信息披露管理办法》、《私募投资基金登记备案办法》、《私募证券投资基金运作指引》、《私募证券投资基金备案指引第1号——私募证券投资基金》及相关自律规则的规定。如法律法规、中国证监会、中国基金业协会更新了私募基金信息披露规则或制定了其他相关规则，则从其规则执行。基金管理人不得有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，不得对投资业绩进行预测，并应当按照规定持续履行信息披露和报送义务，确保所提交信息材料及时、准确、真实、完整。本基金信息披露的内容包括“基金管理人定期信息披露”以及“基金管理人重大事项信息披露”，具体参见本章节第（二）款与第（三）款。</p>
<p>原条款：</p>	<p>现条款：</p>
<p>（二）基金管理人定期信息披露 1、净值报告披露 基金管理人每月将经基金托管人复核的</p>	<p>（二）基金管理人定期信息披露的内容及频率 1、净值报告披露</p>

<p>上月最后一个交易日的基金份额净值以各方认可的形式提交基金份额持有人。</p> <p>2、季度报告披露</p> <p>本基金存续期间，基金管理人应当在每季度结束之日起10个工作日内向投资者披露季度报告，季度报告应包括基金资产净值、基金份额净值、主要财务指标以及投资组合情况等信息。</p> <p>3、年度报告披露</p> <p>本基金存续期间，基金管理人应当在每年结束之日起4个月以内，向基金投资者披露年度报告，年度报告应包括以下信息：</p> <p>(1) 报告期末基金资产净值、基金份额净值和基金份额总额；</p> <p>(2) 本基金的财务情况；</p> <p>(3) 本基金投资运作情况和运用杠杆情况；</p> <p>(4) 基金投资者账户信息，包括实缴出资额、未缴出资额以及报告期末所持有基金份额总额等；</p> <p>(5) 投资收益分配和损失承担情况；</p> <p>(6) 基金管理人取得的管理费和业绩报酬，包括计提基准、计提方式和支付方式；</p> <p>(7) 本合同约定的其他信息。</p>	<p>基金管理人每月将经基金托管人复核的上月最后一个交易日的基金份额净值以各方认可的形式提交基金份额持有人。</p> <p>2、季度报告披露</p> <p>本基金存续期间，基金管理人应当在每季度结束之日起10个工作日内向投资者披露季度报告，季度报告应包括基金资产净值、基金份额净值、主要财务指标以及投资组合情况等信息。</p> <p>3、年度报告披露</p> <p>本基金存续期间，基金管理人应当在每年结束之日起4个月以内，向基金投资者披露年度报告，年度报告应包括以下信息：</p> <p>(1) 报告期末基金资产净值、基金份额净值和基金份额总额；</p> <p>(2) 本基金的财务情况；</p> <p>(3) 本基金投资运作情况和运用杠杆情况；</p> <p>(4) 基金投资者账户信息，包括实缴出资额、未缴出资额以及报告期末所持有基金份额总额等；</p> <p>(5) 投资收益分配和损失承担情况；</p> <p>(6) 基金管理人取得的管理费和业绩报酬，包括计提基准、计提方式和支付方式；</p> <p>(7) 本合同约定的其他信息。</p>
<p>原条款：</p>	<p>现条款：</p>
<p>(三) 基金管理人重大事项信息披露</p> <p>发生以下重大事项的，基金管理人应在5个工作日内（本合同另有约定的除外）及时</p>	<p>(三) 基金管理人重大事项信息披露的内容及频率</p> <p>发生以下重大事项的，基金管理人应在</p>

<p>向基金投资者披露：</p> <p>1、本基金名称、注册地址、组织形式发生变更的；</p> <p>2、投资范围和投资策略发生重大变化的；</p> <p>3、变更基金管理人或托管人的；</p> <p>4、基金管理人的法定代表人、执行事务合伙人（委派代表）、实际控制人发生变更的；</p> <p>5、触及本基金止损线或预警线的；</p> <p>6、管理费率、托管费率发生变化的；</p> <p>7、本基金收益分配事项发生变更的；</p> <p>8、本基金触发巨额赎回的；</p> <p>9、本基金存续期变更或展期的；</p> <p>10、本基金发生清盘或清算的；</p> <p>11、发生重大关联交易事项的；</p> <p>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；</p> <p>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；</p> <p>14、本合同约定的可能存在的利益冲突以及可能影响投资者合法权益的其他重大事项。</p>	<p>10个工作日内（本合同另有约定的除外）及时向基金投资者披露：</p> <p>1、本基金名称、注册地址、组织形式发生变更的；</p> <p>2、投资范围、投资策略、投资比例和投资限制发生重大变化的；</p> <p>3、变更基金管理人或托管人或基金服务机构的；</p> <p>4、基金管理人的法定代表人、执行事务合伙人（委派代表）、实际控制人发生变更的；</p> <p>5、触及本基金止损线或预警线的；</p> <p>6、基金费用（包括但不限于管理费率、托管费率、基金服务费用、业绩报酬等）发生变化的；</p> <p>7、本基金收益分配原则和收益分配事项发生变更的；</p> <p>8、本基金触发巨额赎回且不能满足赎回要求的；</p> <p>9、本基金存续期变更或展期的；</p> <p>10、本基金发生清盘或清算的；</p> <p>11、发生重大关联交易事项的；</p> <p>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；</p> <p>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、仲裁的；</p> <p>14、基金管理人获知基金管理人的股东、合伙人、实际控制人拟发生变更导致实际控</p>
--	---

	<p>制权发生变更的；</p> <p>15、本合同约定的可能存在的利益冲突、影响基金运行以及可能影响投资者利益的其他重大事项。</p>
<p>新增条款：</p>	
<p>(四) 基金特定情形信息披露</p> <p>本基金存续期间，发生以下特定情形的，基金管理人应及时向基金投资者及相关方披露：</p> <p>1、本基金上一年度日均基金资产净值低于 1000 万元但不低于 500 万元的，基金管理人应当在 5 个工作日内向投资者披露本基金后续运作可能出现“上一年度日均基金资产净值低于 500 万元，或者连续 60 个交易日出现基金资产净值低于 500 万元”的情形导致停止申购及后续可能出现“停止申购后连续 120 个交易日基金资产净值仍低于 500 万元从而进入清算程序”情形的潜在影响及相关安排；</p> <p>2、本基金上一年度日均基金资产净值低于 500 万元，或者连续 60 个交易日出现基金资产净值低于 500 万元情形的，基金管理人应当在 5 个工作日内向投资者披露；</p> <p>3、本基金所投债券（如有）的价格偏离度等指标出现异常情形的，基金管理人应当在 10 个工作日内向投资者披露；</p> <p>4、本基金接受其他私募基金或者资产管理产品投资的，基金管理人应当授权本基金托管人将经复核的基金估值信息提供给上层私募基金托管人。基金管理人应当授权本基金服务机构将基金份额登记信息在基金份额确认后 2 个工作日内提供给该基金托管人。</p>	

序号 48

十九、基金的信息披露与报告 (四) 定期报告的复核流程

<p>原条款：</p>	<p>现条款：</p>
<p>本基金的定期报告包含《私募投资基金信息披露管理办法》及《私募投资基金信息披露内容与格式指引 1 号》规定的月度报告（如有）、季度报告和年度报告。</p> <p>基金定期报告的编制由基金管理人进</p>	<p>本基金的定期报告包含《私募投资基金信息披露管理办法》及《私募投资基金信息披露内容与格式指引 1 号》规定的月度报告（如有）、季度报告和年度报告。</p> <p>基金定期报告的编制由基金管理人进</p>

<p>行，根据相关法律法规，基金管理人可以委托服务机构办理定期报告的编制。基金管理人或其委托的服务机构完成定期报告数据的编制后，将定期报告的数据以书面形式、电子核对数据等或双方认可的其他形式送至基金托管人，基金托管人对定期报告上的净值月报、主要财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等财务数据相关内容进行复核，复核无误后将复核结果以双方认可的方式反馈给基金管理人或其委托的服务机构。如基金管理人或其委托的服务机构未及时将定期报告数据提供至基金托管人进行复核，由此造成的任何后果，基金托管人不承担责任。</p>	<p>行，根据相关法律法规，基金管理人可以委托服务机构办理定期报告的编制。基金管理人或其委托的服务机构完成定期报告数据的编制后，将定期报告的数据以书面形式、电子核对数据等或双方认可的其他形式送至基金托管人，基金托管人对定期报告上的净值月报、主要财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等财务数据相关内容进行复核，复核无误后将复核结果以双方认可的方式反馈给基金管理人或其委托的服务机构，上述复核结果反馈后即视为已完成基金托管人对定期报告的复核流程。如基金管理人或其委托的服务机构未及时将定期报告数据提供至基金托管人进行复核，由此造成的任何后果，基金托管人不承担责任。基金管理人不得对基金定期报告中基金托管人已复核的财务数据进行单方面修改，如基金管理人使用未经基金托管人复核的或基金管理人自行篡改的财务数据进行信息披露，所产生的问题及任何后果均由基金管理人承担，基金托管人不承担责任。基金管理人对管理人报告、临时报告、定期报告内除财务数据以外的其他披露事项中所披露内容的真实、准确性承担责任，基金托管人对此部分内容不承担责任。</p>
--	--

序号 49

十九、基金的信息披露与报告

<p>原条款：</p>	<p>现条款：</p>
<p>(五) 向境内基金投资者募集的本基金</p>	<p>(六) 向境内基金投资者募集的本基金</p>

<p>信息披露文件应当采用中文文本，应当尽量采用简明、易懂的语言进行表述。同时采用外文文本的，信息披露义务人应当保证两种文本内容一致。两种文本发生歧义时，以中文文本为准。</p>	<p>信息披露文件应当采用中文文本，应当尽量采用简明、易懂的语言进行表述。同时采用外文文本的，基金管理人应当保证两种文本内容一致。两种文本发生歧义时，以中文文本为准。</p>
<p>原条款：</p>	<p>现条款：</p>
<p>（六）基金托管人应当按照中国证监会以及中国基金业协会的规定和本合同的约定，对基金管理人编制的基金资产净值、基金份额净值、基金份额申购赎回价格、基金定期报告和定期更新的招募说明书（如有）等向投资者披露的基金相关财务数据进行复核确认；基金托管人须进行复核的信息仅限于其在履行职责过程中制作或者获取的，以一定形式记录、保存的信息及数据。如基金管理人没有按照中国证监会、中国基金业协会的规定及本合同的约定或其他相关法律法规规定履行信息披露义务，基金托管人不承担责任。</p>	<p>（七）基金托管人应当按照中国证监会以及中国基金业协会的规定和本合同的约定，对基金管理人编制的基金资产净值、基金份额净值、基金份额申购赎回价格、基金定期报告和定期更新的招募说明书（如有，基金管理人需提前将更新的招募说明书发送至基金托管人）等向投资者披露的与基金相关财务数据进行复核确认；基金托管人须进行复核的信息仅限于其在履行职责过程中制作或者获取的，以一定形式记录、保存的信息及财务数据。如基金管理人没有按照中国证监会、中国基金业协会的规定及本合同的约定或其他相关法律法规规定履行信息披露义务，基金托管人不承担责任。</p>
<p>原条款：</p>	<p>现条款：</p>
<p>（七）向基金份额持有人披露及基金份额持有人信息查询的方式</p> <p>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。</p> <p>1、传真、电子邮件或短信</p> <p>如基金份额持有人留有传真号、电子邮</p>	<p>（八）向基金份额持有人信息披露的方式及基金份额持有人信息查询的途径</p> <p>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。</p> <p>1、传真、电子邮件或短信</p> <p>如基金份额持有人留有传真号、电子邮</p>

<p>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。</p> <p>2、邮寄服务</p> <p>基金管理人可向基金份额持有人邮寄年度报告等有关本基金的信息。基金份额持有人在募集机构留存的通信地址为送达地址。通信地址如有变更，基金份额持有人应当及时以书面方式或以基金管理人规定的其他方式通知基金管理人。</p> <p>3、基金管理人网站</p> <p>基金管理人可通过基金管理人网站向基金份额持有人提供报告和信息查询，内容包括但不限于净值报告、季度报告、年度报告。</p> <p>4、基金管理人指定的其他信息披露途径或方式</p> <p>基金管理人可通过基金管理人指定的其他信息披露途径或方式向基金份额持有人提供报告和信息查询，内容包括但不限于净值报告、季度报告、年度报告，报告和信息的真实性、准确性、合法性、及时性由基金管理人负责。</p> <p>5、其他中国证监会以及中国基金业协会规定的信息披露途径或方式。</p>	<p>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。</p> <p>2、邮寄服务</p> <p>基金管理人可向基金份额持有人邮寄年度报告等有关本基金的信息。基金份额持有人在募集机构留存的通信地址为送达地址。通信地址如有变更，基金份额持有人应当及时以书面方式或以基金管理人规定的其他方式通知基金管理人。</p> <p>3、基金管理人网站</p> <p>基金管理人可通过基金管理人网站向基金份额持有人提供报告和信息查询，内容包括但不限于净值报告、季度报告、年度报告、重大事项报告。</p> <p>4、基金管理人指定的其他信息披露途径或方式</p> <p>基金管理人可通过基金管理人指定的其他信息披露途径或方式向基金份额持有人提供报告和信息查询，内容包括但不限于净值报告、季度报告、年度报告、重大事项报告，报告和信息的真实性、准确性、合法性、及时性由基金管理人负责。特别地，基金份额持有人可要求基金管理人为其开通“投资人服务平台”用户权限（由基金管理人在基金服务机构提供的平台上自行开立并管理），供基金份额持有人获取定期信息披露报告；其中，“投资人服务平台”的开通、信息披露报告内容的真实性均由基金管理</p>
---	---

	<p>人负责，基金托管人及基金服务机构不承担基金管理人对投资者信息披露的相关职责。</p> <p>5、其他中国证监会以及中国基金业协会规定的信息披露途径或方式</p> <p>投资者可以登录中国基金业协会指定的“私募基金信息披露备份系统”查询其已购买的私募基金信息披露报告，信息披露报告内容的真实性和准确性由基金管理人负责。基金管理人负责中国基金业协会指定的“私募基金信息披露备份系统”投资者查询账号的维护和管理工 作，包括投资者查询账号开 立、启用、修改和关闭等。投资者可使用在基金管理人处留存手机号码或电子邮箱获取的基金管理人登记编码、投资者账号和初始密码进行登录。基金管理人应在“私募基金信息披露备份系统”中向投资者提供本机构维护定向披露功能的联系人信息。如投资者在系统登录、报告查阅时遇到问题，或对基金管理人在“私募基金信息披露备份系统”的报告备份情况存在疑虑，可通过系统中基金管理人留存的定向披露功能联系人联系方式与基金管理人进行沟通。</p>
<p>原条款：</p>	<p>现条款：</p>
<p>（八）向中国基金业协会提供的报告</p> <p>基金管理人、基金托管人应当根据中国证监会和中国基金业协会的要求履行报告义务。</p> <p>私募基金管理人应当按照规定通过中国基金业协会指定的私募基金信息披露备份平</p>	<p>（九）向中国证监会、中国基金业协会提供的报告与信息</p> <p>基金管理人、基金托管人应当根据中国证监会和中国基金业协会的要求履行报告义务。</p> <p>私募基金管理人应当按照规定通过中国</p>

<p>台报送信息。在投资者信息披露查询功能开放之后，投资者可以登录中国基金业协会指定的私募基金信息披露备份平台查询其购买基金产品的相关信息。全体份额持有人同意私募基金管理人或其他信息披露义务人应当按照中国基金业协会的规定对基金信息披露信息进行备份。</p>	<p>基金业协会指定的私募基金信息披露备份平台报送信息。全体份额持有人同意私募基金管理人或其他信息披露义务人应当按照中国基金业协会的规定对基金信息披露信息进行备份。</p>
--	--

序号 50

二十、风险揭示 (一) 特殊风险揭示

<p>删除条款：</p>
<p>4、未在中国基金业协会登记备案的风险</p> <p>基金管理人在基金募集完毕后 20 个工作日内向中国基金业协会办理基金备案手续。基金面临因未能在中国基金业协会履行备案手续导致基金财产不能进行投资运作的风险。</p> <p>5、流动性风险</p> <p>本基金预计存续期限为基金成立之日起[10]年结束。在本基金存续期内，投资者可能面临资金不能退出带来的流动性风险。</p> <p>在单个开放日发生巨额赎回时，基金管理人依据基金合同的约定可能采取延期支付赎回款的操作，赎回申请投资者因此面临不能按时足额获得赎回款项的风险。</p> <p>根据实际投资运作情况，本基金有可能提前结束或延期结束，投资者可能因此面临委托资金不能按期退出等风险。</p>
<p>新增条款：</p>
<p>4、未在中国基金业协会履行登记备案手续或未能通过协会备案所涉风险</p> <p>基金管理人在基金募集完毕后 20 个工作日内向中国基金业协会办理基金备案手续。基金面临因未能在中国基金业协会履行备案手续导致基金财产不能进行投资运作的风险。基金面临中国基金业协会不予备案导致终止基金合同并对基金财产进行清算的风险。</p> <p>5、产品架构所涉风险</p> <p>根据本合同的份额分类安排，本基金按募集对象身份不同将基金份额分成 A 类份额和 B 类份额，两类基金份额均存在不盈利甚至亏损的可能，投资者需了解对应份额的收费情</p>

<p>况，因份额分类产生的相关风险以及自身认/申购的份额类别后选择参与。</p> <p>本基金的份额分类不是结构化分级，本基金管理人或托管人不对各类份额承诺最低收益、承诺本金不受损失，限定损失金额和比例。</p>	
<p>原条款：</p>	<p>现条款：</p>
<p>6、关联交易风险</p> <p>本基金可投资于由基金管理人、基金托管人或其关联方管理的产品或者与基金管理人、基金托管人或其关联方进行交易，这构成基金管理人与本基金的关联交易，存在关联交易风险。</p>	<p>6、关联交易风险</p> <p>本基金管理人可能存在运用基金财产与自己、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、或者与其有其他重大利害关系的其他主体进行交易的行为，若基金管理人运用基金财产进行关联交易，应当遵守法律、行政法规、中国证监会的规定、中国基金业协会的自律规则和本基金合同约定，建立关联交易管理制度，不得以私募投资基金的财产与关联方进行利益输送、内幕交易和操纵市场等违法违规活动，但仍可能存在未能完全遵循基金份额持有人利益优先的原则、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份额持有人之间的利益冲突、未能履行管理人内部决策机制决策同意、未能遵循本合同约定的关联交易对价确定原则确定交易价格、相关人员未能有效执行关联交易回避机制、未能向基金份额持有人及时履行相关信息披露义务等相关风险。</p>
<p>删除条款：</p>	
<p>7、份额分类特殊风险</p> <p>根据本合同的份额分类安排，本基金按照投资者身份类别不同分为A、B类份额，各类基金份额均存在不盈利甚至亏损的可能，投资者需了解对应份额的收费情况、因份额分类</p>	

产生的相关风险以及自身认/申购的份额类别后选择参与。

本基金的份额分类不是结构化分级，各类份额之间不提供任何风险保障及补偿。本基金成立时或运行过程中可能并不存在 A 类或 B 类份额的情况。

新增条款：

7、未进行组合投资风险

本基金可能未进行组合投资而投资于某一或某类投资标的的比例较高，则存在投资风险无法分散的风险；相比更为多元的投资组合，较不多元的投资组合可能令本基金更易受到单一经济、市场、监管环境或所投资标的产品的管理人投资能力相关风险的影响，若相对重仓的单一策略、发行人、行业、市场或者特定投资类型出现价值下跌，本基金可能遭受严重亏损；一旦所投资的标的投资收益较低或亏损时，将直接传导到本基金，影响本基金的投资收益，甚至导致本基金的投资者可能出现投资本金亏损的风险。

8、纠纷解决机制风险

本基金运营过程中，基金管理人、基金托管人或基金份额持有人之间可能产生争议。尽管本基金合同约定了可通过协商、调解、仲裁途径解决争议，但该等争议解决机制不能保证争议能够解决或者所涉的任何一方的诉求均能得到仲裁机构的支持，也可能存在仲裁裁决无法执行的风险。

9、业绩报酬采用“分红时提取方式”的风险

本基金业绩报酬采用“分红时提取方式”，如在基金进行收益分配时满足本合同约定的业绩报酬计提条件，则通过在分红款中扣除业绩报酬的方式提取业绩报酬，将导致基金份额持有人每一份基金份额实际获得的收益分配款少于管理人出具分配公告的每一份基金份额的分配金额（极端情况下有可能出现所有的收益分配金额均作为业绩报酬导致基金份额持有人不获得任何收益分配款的情况）。存在管理人在基金份额处于不允许赎回期限（如有）时通过分红方式计提业绩报酬的可能；也存在基金份额持有人赎回基金份额时可能会出现净值下跌但管理人已经提取了业绩报酬的情况。

序号 51

二十、风险揭示 （二）一般风险揭示

新增条款：

3、流动性风险

<p>本基金预计存续期限为基金成立之日起 20 年结束。在本基金存续期内，投资者可能面临资金不能退出带来的流动性风险。</p> <p>在单个开放日发生巨额赎回时，基金管理人依据基金合同的约定可能采取延期支付赎回款的操作，赎回申请投资者因此面临不能按时足额获得赎回款项的风险。</p> <p>根据实际投资运作情况，本基金有可能提前结束或延期结束，投资者可能因此面临委托资金不能按期退出等风险。</p>
<p>4、税收风险</p> <p>新增条款：</p> <p>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，并将对本基金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。</p> <p>6、基金份额申购赎回模式风险</p> <p>当基金份额持有人采取金额申请方式发起赎回申请时，可能存在计算过程中因四舍五入等尾差因素导致最终赎回确认金额与赎回申请金额不一致的风险。</p>

序号 52

二十、风险揭示 (三) 基金投资风险揭示

<p>1、市场风险</p> <p>原条款：</p> <p>(1) 股票投资风险主要包括：</p> <p>4) 本基金可投资于科创板股票，科创板股票发行采用注册制，在上市门槛、公司盈利能力、发行价格、减持制度、交易机制、涨跌幅限制以及退市制度等方面与其他 A 股板块的股票不同，可能导致本基金净值波动更大。</p>	<p>1、市场风险</p> <p>现条款：</p> <p>(1) 股票投资风险主要包括：</p> <p>4) 本基金可投资于科创板及创业板股票，科创板及创业板股票发行采用注册制，在上市门槛、公司盈利能力、公司股权架构、发行价格、减持制度、交易机制、涨跌幅限制以及退市制度等方面与其他 A 股板块的股票不同，可能导致本基金净值波动更大；</p>
--	---

<p>1、市场风险</p> <p>新增条款：</p> <p>(1) 股票投资风险主要包括：</p> <p>5) 本基金可投资于北京证券交易所上市交易的股票，北京证券交易所上市交易的股票可能存在较高的流动性风险且日间交易不活跃，因此可能会面临估值不公允且无法及时变现的风险；北京证券交易所上市交易的股票可能实行高于沪深交易所的涨跌幅限制，当出现不利行情时，本基金所投资北京证券交易所上市交易的股票可能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。</p>	
<p>5、金融衍生品及资产管理产品投资风险</p> <p>新增条款：</p> <p>(3) 场外衍生品风险（如有）</p> <p>4) 估值风险</p> <p>在估值日因第三方或场外衍生品的交易对手提供的估值结果或估值报告异常导致本基金净值波动的风险，或因无法获得第三方或交易对手提供的估值结果或估值报告而由管理人采取的估值方法计算的结果与实际价值产生差异的风险。场外衍生品不存在如场内交易一样的竞价机制，其公允价值形成机制尚不健全。场外衍生品估值价格主要由交易对手方或计算机构根据相关合同约定定期提供给基金管理人和基金托管人，如交易对手方或计算机构不能及时、准确提供场外衍生品定价结果和合约具体损益变动情况，本基金持有的场外衍生品估值可能与其实际价值产生背离，对基金财产的及时、准确估值造成不利影响。</p>	
<p>5、金融衍生品及资产管理产品投资风险</p> <p>原条款：</p> <p>(4) 资产管理产品风险（如有）</p> <p>分级基金 B 以及信托计划/资管计划/私募基金劣后级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。</p>	<p>5、金融衍生品及资产管理产品投资风险</p> <p>现条款：</p> <p>(4) 资产管理产品风险（如有）</p> <p>深交所对符合以下条件的基金实行 20% 的涨跌幅限制：(1) 跟踪指数成份股仅为创业板股票或其他实行 20% 涨跌幅限制股票的指数型 ETF、LOF；(2) 基金合同约定投资于创业板股票或其他实行 20% 涨跌幅限制股票的资产占非现金基金资产比例不低于 80% 的 LOF；</p>

	<p>信托计划/资管计划/私募基金劣后级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。</p>
<p>8、基金本身面临的风险</p> <p>原条款：</p>	<p>8、基金本身面临的风险</p> <p>现条款：</p>
<p>(5) 基金止损风险</p> <p>本基金达到止损线时，由于基金管理人强制止损带来的净值损失。</p> <p>当基金份额净值达到止损线 0.80 元时，基金管理人将进行强制止损，将持仓标的或衍生品平仓变现，可能导致基金终止时基金份额净值低于 0.80 元。</p>	<p>(5) 基金无预警止损风险</p> <p>本基金未设置预警线和平仓线，由于投资品种价格可能持续向不利方向变动、投资品种市场剧烈波动等原因，委托财产存在全部亏损的风险。</p>
<p>10、净值波动风险</p> <p>原条款：</p>	<p>10、净值波动风险</p> <p>现条款：</p>
<p>按照本合同第十六章的估值方法，当本基金投资于基金管理公司及其子公司资产管理计划、证券公司及其子公司资产管理计划、信托计划、保险资产管理计划、期货公司资产管理计划、私募投资基金、商业银行理财产品，有如下情形之一时：</p>	<p>按照本合同“基金财产的估值和会计核算”章节的估值方法，当本基金投资于基金管理公司及其子公司资产管理计划、证券公司及其子公司资产管理计划、信托计划、保险资产管理计划、期货公司资产管理计划、私募投资基金、商业银行理财产品，有如下情形之一时：</p>
<p>新增条款：</p>	
<p>16、贵金属投资风险（如有）</p> <p>本基金如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。</p>	

17、投资全国中小企业股份转让系统挂牌股票的特定风险（如有）

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

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

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

（4）收盘价未能真实反映公允价格以及价格波幅较大的风险：目前全国中小企业股份转让系统的股票依然采取做市交易方式或集合竞价交易方式之一进行交易，交易量相对于主板市场而言较小，且涨跌幅限制大于沪深证券交易所上市交易的股票，容易导致其价格显著偏离其内在价值，存在收盘价未能真实反映公允价格以及价格波幅较大而导致亏损的风险。

序号 53

二十二、基金合同的成立、生效及签署 （二）合同的签署

原条款：	现条款：
<p>1、本合同的签署应当采用纸质合同和/或电子合同的方式进行，由基金管理人、基金托管人、基金投资者共同签署。</p> <p>如基金管理人、基金托管人及基金投资者签署纸质合同时，应签署一式三份。基金管理人应在基金募集期或基金开放期完成后的十个工作日内，将基金投资者签署的其中一份纸质合同寄送给基金托管人，基金托管</p>	<p>1、本合同的签署应当采用纸质合同和/或电子合同的方式进行，由基金管理人、基金托管人、基金投资者共同签署。如基金投资者在本基金开放日申购本基金且本基金在存续期涉及合同变更的，基金管理人须确保投资者签署根据变更生效内容调整后的有效的基金合同版本；与此同时，基金投资者也应在签署时向管理人确认所签署的合同版本</p>

<p>人在收到基金管理人寄送的本合同的前提下，尽合理努力保管投资者签署的纸质合同。因基金托管人收集基金投资者签署的纸质合同存在客观局限性，保管投资者签署的纸质合同不构成基金托管人的义务。</p> <p>如基金管理人、基金托管人及基金投资者通过电子合同方式签署本合同，基金管理人、基金托管人及基金投资者认可电子合同的法律效力。若本基金使用的电子合同平台完成基金电子合同签署的，并不代表电子合同平台提供方承担基金销售、募集以及合同的订立、效力、履行等相关职责。</p>	<p>为最新有效的基金合同版本。</p> <p>如基金管理人、基金托管人及基金投资者签署纸质合同时，应签署一式三份。基金管理人应在基金募集期或基金开放期完成后的十个工作日内，将基金投资者签署的其中一份纸质合同寄送给基金托管人，基金托管人在收到基金管理人寄送的本合同的前提下，尽合理努力保管投资者签署的纸质合同。因基金托管人收集基金投资者签署的纸质合同存在客观局限性，保管投资者签署的纸质合同不构成基金托管人的义务。</p> <p>如基金管理人、基金托管人及基金投资者通过电子合同方式签署本合同，基金管理人应确保签订本基金合同所使用的电子签名符合《电子签名法》等法律法规、监管规定的相关要求。若本基金使用的电子合同平台完成基金电子合同签署的，并不代表电子合同平台提供方承担基金销售、募集以及合同的订立、效力、履行等相关职责。</p> <p>基金投资者签署合同由基金管理人负责，如因基金投资者在签署纸质合同和/或电子合同过程中产生的问题及造成的损失，基金托管人不承担任何责任。</p>
--	---

序号 54

二十三、基金合同的效力

<p>原条款：</p>	<p>现条款：</p>
<p>(一) 本合同是约定基金合同当事人之间权利义务关系的法律文件。基金份额持有人为法人的，本合同自基金份额持有人、基</p>	<p>(一) 本合同是约定基金合同当事人之间权利义务关系的法律文件。基金份额持有人为法人的，本合同自基金份额持有人、基</p>

<p>金管理人和基金托管人加盖公章（或合同专用章）以及三方法定代表人或授权代表签章或盖章之日起成立；基金份额持有人为自然人的，本合同自基金份额持有人本人签章或授权的代理人签章、基金管理人和基金托管人加盖公章（或合同专用章）以及双方法定代表人或授权代表签章之日起成立。当满足第二十二章中本合同生效的条件后，本合同生效。</p>	<p>金管理人和基金托管人加盖公章（或合同专用章）以及三方法定代表人或授权代表签章或盖章之日起成立；基金份额持有人为自然人的，本合同自基金份额持有人本人签章或授权的代理人签章、基金管理人和基金托管人加盖公章（或合同专用章）以及双方法定代表人或授权代表签章之日起成立。当满足本合同“基金合同的成立、生效及签署”章节中关于本合同生效的条件后，本合同生效。</p>
--	---

序号 55

二十四、基金合同的变更、解除与终止

原条款：	现条款：
<p>2、对于根据法律法规和本合同的规定可不经基金份额持有人大会决议通过的事项，基金管理人、基金托管人首先就本合同拟变更事项达成一致。基金管理人就本合同变更事项以约定的方式向基金份额持有人发布合同变更征询意见函（或通知）。基金份额持有人应在征询意见函（或通知）指定的日期内按指定的形式回复意见。基金份额持有人不同意变更的，应在征询意见函（或通知）指定的日期内赎回本基金（基金管理人可设置临时开放日，且本条约定不受本合同“基金的申购、赎回与转让”中关于基金开放日及基金份额不允许赎回期限的限制，且本次临时开放赎回的份额不收取赎回费（如有，由管理人出具相关指令，基金服务机构根据管理人指令进行处理））；基金份额持有人未在指定日期内回复意见或未在指定的日期</p>	<p>2、对于根据法律法规和本合同的规定可不经基金份额持有人大会决议通过的事项，基金管理人、基金托管人首先就本合同拟变更事项达成一致。基金管理人就本合同变更事项以约定的方式向基金份额持有人发布合同变更征询意见函（或通知）。基金份额持有人应在征询意见函（或通知）指定的日期内按指定的形式回复意见。基金份额持有人不同意变更的，应在征询意见函（或通知）指定的日期（基金管理人可设置临时开放日）内赎回本基金；基金份额持有人未在指定日期内回复意见或未在指定的日期内赎回本基金的，视为基金份额持有人同意合同变更。基金管理人于合同变更征询函指定日期届满之后向基金托管人出具合同变更生效说明函。变更事项自征询意见函（或通知）指定的日期届满的次工作日开始生效，对合同各</p>

<p>内赎回本基金的，视为基金份额持有人同意合同变更。变更事项自征询意见函（或通知）指定的日期届满的次工作日开始生效，对合同各方均具有法律效力。</p>	<p>方均具有法律效力。</p>
<p>3、本合同约定的其他方式。 原条款：</p>	<p>3、本合同约定的其他方式。 现条款：</p>
<p>基金管理人负责就本合同变更事项向基金份额持有人进行沟通与确认。本合同变更事项生效后，基金管理人应及时向基金托管人出具盖章的合同变更生效通知并保证其真实性和有效性。</p>	<p>特别地，如本基金发生下列事项的变更时，基金管理人应设置临时开放日允许基金份额持有人赎回基金份额或者其他保障投资者赎回本基金权利的措施（如在本基金正常的开放日允许基金份额持有人赎回基金份额，具体以管理人通知为准），但变更内容有利于投资者的除外：（1）基金合同约定的存续期限、投资范围、投资策略、投资限制、收益分配原则、基金费用等事项变更；（2）基金托管人变更；（3）基金服务机构变更；（4）影响本基金运行和投资者利益的其他重大事项发生变更。</p> <p>基金管理人负责就本合同变更事项向基金份额持有人进行沟通与确认。本合同变更事项生效后，基金管理人应及时向基金托管人出具盖章的合同变更生效通知并保证其真实性和有效性；同时，基金管理人应确保变更事项生效后按照本合同的约定向基金份额持有人披露。</p>

序号 56

二十四、基金合同的变更、解除与终止

<p>原条款：</p>	<p>现条款：</p>
-------------	-------------

<p>(二) 法律法规或中国证监会的相关规定发生变化需要对本合同进行变更的, 基金管理人可与基金托管人协商后修改本合同。在这种情况下, 本合同的变更无需私募基金份额持有人同意。但基金管理人应当按照本合同的约定向基金份额持有人披露变更的具体内容。</p>	<p>(二) 法律法规、中国证监会、中国基金业协会的相关规定发生变化需要对本合同进行变更的, 基金管理人可与基金托管人协商后修改本合同。在这种情况下, 本合同的变更无需私募基金份额持有人同意。但基金管理人应当按照本合同的约定向基金份额持有人披露变更的具体内容。</p>
<p>原条款:</p>	<p>现条款:</p>
<p>(三) 对本合同进行重大的变更、补充, 基金管理人应当在变更或补充发生之日起 5 个工作日内向中国基金业协会报告。</p>	<p>(三) 管理人应确保合同变更生效日之后确认申购份额的投资者所签署合同版本为根据变更内容调整后的有效基金合同版本; 对本合同进行重大的变更、补充, 基金管理人应当在变更或补充发生之日按照法律法规、中国证监会或中国基金业协会的规定向中国基金业协会报告以及履行变更手续。</p>

序号 57

二十四、基金合同的变更、解除与终止 (四) 合同的解除

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

本合同。	
------	--

序号 58

二十四、基金合同的变更、解除与终止 (五) 合同终止的情形包括下列事项:

新增条款:
2、本基金未能成功通过中国基金业协会备案;
删除条款:
4、法律法规和本合同规定的其他情形。
新增条款:
5、本基金全体基金份额持有人申请赎回所持有的所有基金份额,且无在途申购申请的;
6、经本基金全体基金份额持有人、基金管理人、基金托管人协商一致决定终止基金合同的;
7、本基金出现上一年度日均基金资产净值低于 500 万元,或者连续 60 个交易日基金资产净值低于 500 万元(自 2025 年 1 月 1 日起计算)的情形之后,连续 120 个交易日基金资产净值仍低于 500 万元的;
8、法律、行政法规、中国证监会、中国基金业协会和本合同规定的其他情形。

序号 59

二十五、基金的清算 (一) 基金财产清算小组

原条款:	现条款:
1、自本合同终止之日起 30 个工作日内成立基金财产清算小组。	1、自本合同终止之日起 30 个工作日内由基金管理人组织成立基金财产清算小组,在基金管理人无法履行职责时,基金份额持有人按照本基金合同的约定召开份额持有人大会,并根据基金份额持有人大会作出的有效决议指定相关主体负责。
新增条款:	
基金管理人的职责如下:向基金份额持有人及时披露基金清算事宜;确保本基金进入清算程序后,不得新增募集、不得新增投资;组织成立清算小组;进行资产变现;出具清	

算期间资金支付的相关指令；进行清算期间的会计核算；负责编制清算报告；负责对基金财产进行分配；发起基金财产相关账户的注销申请；按照规定将清算报告、清算承诺函（如涉及）、清算公告（如涉及）等信息向中国基金业协会进行报送；其他清算期间与基金管理人义务相关的职责。

基金托管人的职责如下：参与清算小组；复核基金管理人出具的清算报告中的财务数据；复核清算期间基金管理人资金支付相关指令，按照管理人相关指令或者清盘报告相关约定进行资金划付；配合管理人进行基金财产托管资金账户等账户的注销；本基金进入清算程序后，对不得新增募集、不得新增投资的行为进行监督。

基金管理人应在本基金清算条件成就时及时组织清算，不得通过单方延长基金合同期限的方式怠于履行清算义务。基金管理人未按照合同约定及时组织清算小组对基金财产进行清算或未履行上述基金管理人职责而导致基金财产或对投资者权益产生不利影响的，或未有正当理由延期清算的，由基金管理人承担赔偿责任。

由于基金托管人缺少对托管资金账户资金以外的基金资产的变现、交易等操作权限，基金托管人无法主动启动基金的清算程序，并且在清算过程中无法决定基金资产变现的价格、时间、方式等要素，因此就本基金的清算事宜，基金托管人仅履行本合同约定的基金托管人清算职责。

序号 60

二十五、基金的清算 （二）基金财产清算程序

5、对基金财产进行分配。

新增条款：

特别地，本基金进入清算程序后，不得新增募集、不得新增投资。

序号 61

二十五、基金的清算 （四）基金财产清算过程中剩余财产的分配

原条款：	现条款：
依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余财产扣除基金财产清算费用及各项负债后，按照基金份额持有人拥有的基金份额比例或本合同的约定进行分	依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余财产扣除基金财产清算费用及各项负债后，按照基金份额持有人拥有的基金份额比例或本合同的约定进行分

<p>配。其中，在基金清算时免收基金份额持有人的赎回费用（若有）。如本基金清算时出现基金财产不足以支付各项费用及负债的情况，基金管理人应当向基金托管人和基金服务机构补足本基金应支付而未支付的托管费和基金服务费。</p> <p>因持有流通受限证券、投资的产品封闭期（含限售期、锁定期）超过基金存续期等原因导致本基金财产无法及时变现的，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。待上述资产可以变现时，基金管理人及时完成剩余可变现基金资产的变现操作后进行二次清算，并将该部分财产另行分配给全体基金份额持有人。本基金持有多个流通受限的证券及投资产品的，基金管理人按本款约定进行多次变现及清算。二次及多次清算期间，基金管理人、基金托管人、基金服务机构不计提管理费、托管费、基金服务费。二次及多次清算流程同一次清算。</p>	<p>配，可以以货币资金方式分配给基金份额持有人，或者经基金份额持有人同意，以实物资产方式分配给基金份额持有人。其中，在基金清算时免收基金份额持有人的赎回费用（若有）。如本基金清算时出现基金财产不足以支付各项费用及负债的情况，基金管理人应当向基金托管人和基金服务机构补足本基金应支付而未支付的托管费和基金服务费。</p> <p>因持有流通受限证券、投资的产品封闭期（含限售期、锁定期）超过基金存续期等原因导致本基金财产无法及时变现的，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。待上述资产可以变现时，基金管理人及时完成剩余可变现基金资产的变现操作后进行二次清算，并将该部分财产另行分配给全体基金份额持有人。本基金持有多个流通受限的证券及投资产品的，基金管理人按本款约定进行多次变现及清算。二次及多次清算期间，基金管理人、基金托管人、基金服务机构不计提管理费、托管费、基金服务费。二次及多次清算流程同一次清算。因二次及多次清算时间安排不合理导致的基金份额持有人纠纷由基金管理人负责解决，基金托管人不承担任何责任。</p>
---	--

序号 62

二十五、基金的清算 （六）基金财产清算报告

<p>原条款：</p>	<p>现条款：</p>
-------------	-------------

<p>本基金完成清算后，基金财产清算小组应编制基金财产清算报告，加盖基金管理人和基金托管人公章或业务章后以约定的方式通知基金份额持有人。</p>	<p>本基金完成清算后，基金财产清算小组应编制基金财产清算报告，加盖基金管理人和基金托管人公章或业务章后由基金管理人以约定的方式通知基金份额持有人。基金管理人应当自本基金清算完成之日起 10 个工作日内向协会报送清算报告等信息。</p>
--	--

序号 63

二十六、违约责任

<p>删除条款：</p>
<p>6、不可抗力。</p>
<p>新增条款：</p>
<p>6、不可抗力。</p> <p>7、无论本合同其他条款如何约定，就本合同项下的基金托管人责任而言，基金托管人履行了本合同所明确约定属于托管人的义务的，对本基金的任何风险或可能存在的潜在（投资）损失，基金托管人不承担任何责任。</p>

序号 64

二十六、违约责任

<p>新增条款：</p>
<p>（六）基金管理人或代销机构以任何形式向基金投资者提供的本金收益承诺将构成刚兑而无效。</p>

序号 65

二十七、通知与送达

<p>原条款：</p>	<p>现条款：</p>
<p>本合同的规定需要发出的任何通知、要求、需要、主张和其他联络内容等，基金管理人除了可通过管理人或代销机构的网站以公告的方式进行通知的事项外，还可以当面</p>	<p>本合同规定的需要发出的任何通知、要求、需要、主张和其他联络内容等，基金管理人除了可通过管理人或代销机构的网站以公告的方式进行通知的事项外，还可以当面</p>

<p>递交、传真、快递、挂号信、电子邮件或短信的方式送至本合同各方当事人。</p> <p>被送达方为基金管理人的，送达至本合同当事人信息页规定的基金管理人的联系地址或基金管理人按本合同的规定变更后的联系地址，即视为送达；被送达方为基金托管人的，送达至本合同当事人信息页规定的基金托管人的联系地址或基金托管人按本合同的规定变更后的联系地址，即视为送达；被送达方为基金份额持有人的，送达至其在募集机构预留的联系地址为或其按照本合同规定变更后的联系地址，即视为送达。</p> <p>任何一方在任何时间改变接收通知所用的地址、电子邮箱、传真号码或手机号码都应立即将该变更书面通知另一方；如果该变更通知未能送达，递交给上述收件人或地址的通知或联络应视为被正常发送和接收。</p> <p>所有该等通知和其他联络均应视为已被收到：（1）当面递交的，于递交时收到；（2）邮寄或快递的，则寄出五个工作日视为收到；（3）传真递交的，传真机报告确认时视为收到；（4）电子邮件发送的，收件方服务器接收视为收到；（5）短信发送的，发送方发送成功视为收到。</p>	<p>递交、传真、快递、挂号信、电子邮件或短信的方式送至本合同各方当事人。</p> <p>被送达方为基金管理人的，送达至本合同当事人信息页规定的基金管理人的联系地址或基金管理人按本合同的规定变更后的联系地址，即视为送达；被送达方为基金托管人的，送达至本合同当事人信息页规定的基金托管人的联系地址或基金托管人按本合同的规定变更后的联系地址，即视为送达；被送达方为基金份额持有人的，送达至其在募集机构预留的联系地址或其按照本合同规定变更后的联系地址，即视为送达。</p> <p>任何一方在任何时间改变接收通知所用的地址、电子邮箱、传真号码或手机号码都应立即将该变更书面通知另一方；如果该变更通知未能送达，递交给上述收件人或地址的通知或联络应视为被正常发送和接收。</p> <p>所有该等通知和其他联络均应视为已被收到：（1）当面递交的，于递交时收到；（2）邮寄或快递的，则寄出五个工作日视为收到；（3）传真递交的，传真机报告确认时视为收到；（4）电子邮件发送的，收件方服务器接收视为收到；（5）短信发送的，发送方发送成功视为收到。</p>
--	---

序号 66

二十九、其他事项

<p>新增条款：</p> <p>（一）基金维持运作机制</p> <p>在基金管理人出现客观上丧失继续管理私募投资基金的能力的情形，或者在基金管理</p>

人出现怠于履行职责，或者基金管理人出现重大风险等情形导致私募投资基金无法正常运行、终止时，基金份额持有人可以按照本基金合同的约定召开基金份额持有人大会，并根据基金份额持有人大会作出的有效决议进行基金清算或者更换基金管理人的相应程序。基金管理人对私募投资基金的职责不因出现客观上丧失继续管理私募投资基金能力的情形而免除。在基金管理人发生异常且无法履行管理职责时，基金托管人应当按照法律法规及本合同约定履行托管职责，维护投资者合法权益。出现客观上丧失继续管理私募投资基金的能力的管理人应当根据《基金法》、中国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。其中，基金管理人客观上丧失继续管理私募投资基金的能力的情形包括但不限于以下：

(1) 基金管理人依法解散、被依法撤销或被依法宣告破产；

(2) 基金管理人被依法取消私募投资基金管理人相关资质且管理人已实际无法持续履行管理人相应职责的；

(3) 基金管理人失联、被中国基金业协会公示为失联或存在潜在失联风险，且实际无任何办公人员可持续履行管理人相应职责的；

(4) 基金管理人出现重大风险等情形无法履行管理人相应职责的。

上述基金份额持有人大会决议内容包括：

1、基金份额持有人大会决议进行基金清算

根据基金份额持有人大会决议由基金份额持有人代表或成立专项机构或指定的第三方（如会计师事务所、律师事务所等中介服务机构）代替管理人作为清算小组成员进行清算：

(1) 决议授权或委托基金份额持有人代表或指定的第三方代替基金管理人对本基金所持有场内投资标的进行平仓变现，取得本基金在证券、期货经纪商处开设的证券账号权限（包括交易及资金划付权限）并执行变现操作；(2) 决议授权或委托基金份额持有人代表或指定的第三方代替基金管理人对本基金所持有场外投资标的进行变现，向投资标的管理人或对手方提交赎回或平仓变现指令；(3) 决议授权或委托基金份额持有人代表或指定的第三方替基金管理人执行出具向托管资金账户划付的指令以及履行基金管理人在清算环节的相关职责。

2、基金份额持有人大会决议更换基金管理人

根据基金份额持有人大会决议更换基金管理人的，新基金管理人、基金托管人和投资者重新签署基金合同，并由新基金管理人履行基金合同约定的基金管理人相应职责。

对上述进行基金清算或者更换基金管理人事项，可以按照本基金合同的约定召开基金份额持有人大会并形成对应的决议执行，相关决策机制、召集主体、表决方式、表决程序、表决比例参见合同“基金份额持有人大会及日常机构”章节；如经由 2/3 以上有表决权的基金份额持有人以书面形式一致表示同意的，可以不召开基金份额持有人大会，直接作出决定，并在决定文件上签名或盖章。

特别地，如本基金通过成立专项机构或者委托会计师事务所、律师事务所等中介服务机构的方式退出的，应当及时向中国基金业协会报送专项机构组成情况、相关会议决议、财产处置方案、基金清算报告和相关诉讼仲裁情况等。如本基金按照本合同约定的程序履行完成更换管理人程序，但未获少数投资者同意变更的，本基金应当制定少数投资者权益保障机制（在履行完本次变更管理人程序后的 10 个工作日内设置临时开放日让不同意更换管理人的基金份额持有人赎回其基金份额，临时开放日不受本合同“基金的申购、赎回、转让与转换”中关于基金份额不允许赎回期限的限制（如有）；如本基金因特殊原因无法设置临时开放日让不同意的基金份额持有人赎回，管理人也可制定其他少数投资者权益保障机制，具体以管理人通知为准），保证公平对待所有投资者，确保基金份额权益不因管理人变更受到影响。

（二）管理人实际控制权发生变更的处理方式

如本基金管理人的股东、合伙人、实际控制人拟发生变更导致实际控制权发生变更的，本基金管理人履行以下内部决策程序：按照本合同约定履行对投资者的信息披露事宜；自变更之日起 30 个工作日内向协会履行变更手续，提交专项法律意见书，就变更事项出具法律意见；本基金在上述变更期间募集资金的，由管理人向投资者通过风险揭示书向投资者进行特别揭示；如在履行变更手续不符合协会要求而被采取暂停办理其私募基金备案的自律管理措施或被协会终止办理变更信息登记的，由管理人通知基金份额持有人并设置临时开放日让基金份额持有人赎回其基金份额，临时开放日不受本合同“基金的申购、赎回、转让与转换”中关于基金份额不允许赎回期限的限制（如有）。

本补充协议生效后，管理人应及时按照上述新条款约定的规则提交存续份额的类别划分方案，注册登记机构以管理人的指令为准处理。

如本协议完成签署时间晚于产品净值跌破止损线后 10 个工作日，则投资人签署本协议即代表知悉并同意管理人在产品净值跌破止损线超过 10 个工作日仍未进行止损清盘的行为，并不因此向管理人和托管人追究法律责任。投资人签署本协议即代表知悉并同意管理人可

在本协议生效前设置临时开放日（该临时开放日可与固定开放日重合）为投资者办理赎回（无论本基金当前是否已经触及止损），前述赎回行为不受基金份额不允许赎回期限的限制且不收取赎回费（如有）。

针对变更生效时的存续份额：

本次合同变更生效后首次提取业绩报酬高水位为该笔份额上一个成功提取业绩报酬的份额累计净值/份额净值（若“上一个成功提取业绩报酬的提取日”不存在，则为该份额申购开放日所对应的份额累计净值/份额净值（申购份额）或基金份额初始面值（认购份额），而非本次合同变更生效日当日所对应的份额累计净值/份额净值；自本次合同变更生效日起适用本次合同变更生效后的业绩报酬计提比例及业绩报酬计提基准（如有）。

如本次合同变更生效后该笔份额首次计提业绩报酬的时间距离该笔份额上一次成功提取业绩报酬的时间少于6个月（每月按30个自然日计算），则在该次业绩报酬计提日不对该笔份额提取业绩报酬（基金份额持有人赎回基金份额或在基金清算时提取业绩报酬的，不受上述间隔期的限制）。

如本协议签署时间晚于原合同到期日，本协议生效后，基金存续期限自原合同到期日起追溯进行调整。本基金投资人均知悉本基金在本补充协议生效前于原合同到期日到期，并承诺不因此向管理人和托管人追究有关此合同变更的责任。

二、本补充协议生效后，即成为基金合同不可分割的组成部分，与原合同具有同等的法律效力。除本补充协议中明确所作修改的条款之外，基金合同的其余部分应完全继续有效。本补充协议与基金合同有冲突的，以本补充协议为准；本补充协议未尽事宜，以基金合同为准。

三、本补充协议生效后，新投资者签订的基金合同将在基金合同中就上述条款直接调整，新投资者无需签订补充协议；基金管理人须确保申购投资者签署根据变更生效内容调整后的最新有效的基金合同，如因投资者在签署纸质合同和/或电子合同过程中产生的问题及造成的损失，基金托管人不承担任何责任。

四、本补充协议自各方签署完成之日起生效，并持续有效至基金合同终止日。

五、本补充协议生效后，基金管理人应根据法律法规、中国证监会、基金业协会以及基金合同的要求及时履行报告义务以及向投资者披露。若由于基金管理人未及时将各基金投资者的签署情况告知基金托管人而导致托管人无法确定补充协议生效时间，由此造成的

任何形式的纠纷与托管人无关，在无充分文件证明补充协议生效时间前，托管人将严格按照原协议履行其托管职责，并于确定生效后按照生效后内容履行托管职责。若因管理人未预留足够的时间寄送/传递生效文件，导致托管人收到生效文件时间晚于本协议生效时间需追溯调整的，管理人应对追溯调整期的风险进行管控以及信披，因前述原因导致的法律后果由管理人承担，托管人不承担任何责任。

六、本补充协议一式叁份，合同当事人各执壹份，每份具有同等的法律效力。

（以下无正文）

