

托管人合同编号：GJ202412HT878833A02

管理人合同编号：

东源 A500 指数策略鑫享 1 号 私募证券投资基金 基金合同

基金管理人：东源（天津）股权投资基金管理股份有限公司

基金托管人：国金证券股份有限公司

仅用于合格投资者查看

重要提示

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

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但投资者购买本基金并不等同于将资金作为存款存放在银行或其它存款类金融机构，基金管理人不能保证基金一定盈利，也不保证最低收益。投资有风险，投资者认购、申购本基金时应认真阅读本基金的基金合同。基金管理人的过往业绩不代表未来业绩。

本合同将按中国证券投资基金业协会的规定提请备案，但中国证券投资基金业协会办理登记备案不表明对私募基金管理人的投资能力、风控合规和持续经营情况作出实质性判断，不作为对私募基金财产安全和投资者收益的保证，也不表明协会对登记备案材料的真实性、准确性、完整性作出保证。

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

仅用于合格投资者查看

合格投资者承诺书

东源（天津）股权投资基金管理股份有限公司：

本人/本单位作为符合中国证券监督管理委员会规定的私募证券投资基金的合格投资者（即个人投资者的金融资产不低于 300 万元或者最近三年个人年均收入不低于 50 万元，机构投资者的净资产不低于 1000 万元），或符合《私募投资基金监督管理暂行办法》第十三条等法律法规视为合格投资者的规定，具有相应的风险识别能力和风险承受能力，投资资金来源合法，没有非法汇集他人资金、使用贷款、发行债券等筹集的非自有资金投资私募基金。本人/本单位在参与贵公司发起设立的私募基金的投资过程中，如果因存在欺诈、隐瞒或其他不符合实际情况的陈述所产生的一切责任，由本人/本单位自行承担，与贵公司无关。

特此承诺。

投资者（自然人签字或机构盖章）：

法定代表人或授权代理人（签字或盖章）：

日期： 年 月 日

投资者告知书

尊敬的投资者：

本基金通过直销机构（基金管理人）或代销机构（如有）进行销售。基金投资者认购或申购本基金，以人民币货币资金形式交付，在直销机构认购或申购的投资者须将资金从在中国境内开立的自有银行账户划款至募集结算资金专用账户，在代销机构认购或申购的投资者按代销机构的规定缴付资金。

募集结算资金专用账户为本基金的份额登记机构负责开立的注册登记账户，并由该机构

构实施监督。该账户仅用于本基金募集期间和存续期间认购、申购、赎回、分红、费用等资金的归集与支付以及基金财产清算过程中剩余资产的归集与分配。

募集结算资金专用账户是份额登记机构接受基金管理人委托代为提供基金服务的专用账户，并不代表份额登记机构接受投资者的认购、申购资金，也不表明份额登记机构对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。在募集结算资金专用账户的使用过程中，除有足够的证据证明是因份额登记机构的原因造成的损失外，基金管理人应就其自身操作不当等原因所造成的损失承担相关责任，份额登记机构对于基金管理人的投资运作不承担任何责任。

募集结算资金专用账户信息如下：

募集账户名称：国金道富投资服务有限公司募集结算资金专用账户

募集账户账号：30205113105268

募集账户开户银行名称：平安银行上海交易所支行

任何一方对于上述募集结算资金专用账户信息的修改均不产生法律效力。国金证券股份有限公司作为上述募集结算资金专用账户的账户监督机构，仅对上述募集结算资金专用账户进行有效监督，对其他账户（包括但不限于本基金其他募集结算资金账户）不承担任何监督责任。在募集结算资金专用账户的监督过程中，除有足够的证据证明是因账户监督机构的原因造成的损失外，基金管理人应就其自身操作不当等原因所造成的损失承担相关责任，账户监督机构对于基金管理人的投资运作不承担任何责任。

本人/机构已认真阅读《投资者告知书》，清楚认识并认可关于募集结算资金专用账户的上述告知内容，并愿意自行承担由此可能导致的一切风险和损失。

基金投资者(自然人签字或机构盖章)：

法定代表人或授权代理人(签字或盖章)：

日期： 年 月 日

目 录

一、 前言	5
二、 释义	5
三、 声明与承诺	9
四、 私募基金的基本情况	10
五、 私募基金份额的募集	12
六、 私募基金的成立与备案	15
七、 私募基金的申购、赎回和转让	16
八、 当事人及其权利义务	23
九、 基金份额持有人大会及日常机构	32
十、 私募基金份额的登记	35
十一、 私募基金的投资	36
十二、 私募基金的财产	41
十三、 指令的发送、确认与执行	44
十四、 交易及清算交收安排	48
十五、 越权交易	50
十六、 私募基金财产的估值和会计核算	52
十七、 私募基金的费用与税收	62
十八、 私募基金的收益分配	68
十九、 信息披露与报告	69
二十、 风险揭示	73
二十一、 基金份额的非交易过户和冻结、解冻	73
二十二、 私募基金合同的效力、变更、解除与终止	74
二十三、 私募基金托管人和私募基金管理人的更换	80
二十四、 基金的清算	81
二十五、 违约责任	84
二十六、 法律适用和争议的处理	85
二十七、 通知与送达	86
二十八、 其他事项	86

一、前言

订立本合同的目的、依据和原则：

1、订立本合同的目的是明确本合同当事人的权利义务、规范本基金的运作、保护基金份额持有人的合法权益。

2、订立本合同的依据是《中华人民共和国民法典》《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《基金法》）和《私募投资基金登记备案办法》《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》）《私募投资基金信息披露管理办法》《私募投资基金募集行为管理办法》《证券期货经营机构私募资产管理业务运作管理暂行规定》《中国人民银行、中国银行保险监督管理委员会、中国证券监督管理委员会、国家外汇管理局关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》（以下简称《指导意见》）及其他法律法规的有关规定。

3、订立本合同的原则是平等自愿、诚实信用、充分保护基金份额持有人的合法权益。本合同是约定本合同当事人之间基本权利义务的法律文件，其他与本基金相关的涉及本合同当事人之间权利义务关系的任何文件或表述，均以本合同为准。本合同的当事人包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人。基金合同的当事人按照《基金法》、本合同及其他有关法律法规规定享有权利、承担义务。

本基金按照中国法律法规成立并运作，若本合同的内容与届时有效的法律法规的强制性规定不一致，应当以届时有效的法律法规的规定为准。

二、释义

在本合同中，除上下文另有规定外，下列用语应当具有如下含义：

1、本合同：《东源 A500 指数策略鑫享 1 号私募证券投资基金基金合同》及对本合同的任何有效修订和补充。

2、本基金：东源 A500 指数策略鑫享 1 号私募证券投资基金。

3、私募基金：指在中华人民共和国境内，以非公开方式向合格投资者募集资金设立的投资基金。

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

5、基金投资者、私募基金投资者：依法可以投资于私募基金的个人投资者、机构投资者

者以及法律法规或中国证监会允许购买私募基金的其他投资者的合称。

6、 基金管理人、私募基金管理人、管理人：东源（天津）股权投资基金管理股份有限公司。

7、 基金托管人、私募基金托管人、托管人：国金证券股份有限公司。

8、 基金份额持有人：签署本合同，履行出资义务取得基金份额的基金投资者。

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

10、 行政服务机构：接受基金管理人委托，为本基金提供份额登记和估值核算服务的机构。本基金的行政服务机构为国金道富投资服务有限公司。

11、 基金份额登记机构：基金管理人或其委托办理私募基金份额注册登记业务的机构。

12、 投资顾问：是指依法可从事资产管理业务的证券期货经营机构，以及符合监管规定的要求的私募证券投资基金管理人，根据基金合同及其他相关协议，为本基金提供投资方面的建议或意见并收取投资顾问费的机构。

13、 专业投资机构：指社会保障基金、企业年金等养老基金，慈善基金等社会公益基金；依法设立并在中国基金业协会备案的私募基金产品；受国务院金融监督管理机构监管的金融产品；投资于所管理私募基金的私募基金管理人及其从业人员。

14、 中国证券投资基金业协会（简称“基金业协会”）：基金行业相关机构自愿结成的全国性、行业性、非营利性社会组织。

15、 工作日：上海证券交易所和深圳证券交易所的正常交易日。

16、 开放日：本基金的开放日，包括申购开放日、赎回开放日。

17、 T 日：本基金的开放日。

18、 T+n 日：T 日后的第 n 个工作日，当 n 为负数时表示 T 日前的第 n 个工作日。

19、 基金财产：基金份额持有人拥有合法处分权、基金管理人管理并由基金托管人托管的作为本合同标的的财产。

20、 同一资产：标准化股权类资产按照单一上市公司公开发行的股票、存托凭证，视为同一资产；标准化债权类资产按照单只债券、中央银行票据、资产支持证券、非金融企业债务融资工具，视为同一资产；非标准化债权类资产（如证券公司发行的保本型收益凭证、质押式报价回购、质押式协议回购、标准化票据）按照同一“融资主体”及其关联方视为同一资产；基金类资产按照单只证券投资基金或者资产管理产品视为同一资产；标准化期货和衍生品类资产按照单只期货或者期权合约视为同一资产；场外期权及证券公司发行的非保本

型收益凭证按照同一“交易对手方”视为同一资产；收益互换按照合约挂钩具体标的视为同一资产。

21、流动性受限资产：指到期日在 10 个交易日以上的逆回购与银行定期存款（含协议约定有条件提前支取的银行存款）、资产支持证券（票据）、流动受限的新股、非公开发行股票、停牌股票、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券和非金融企业债务融资工具、场外衍生品、私募基金、私募资管产品的合计。

22、现金管理工具：指银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券、货币市场基金等中国证监会认可的现金管理工具。

23、托管资金专门账户（简称“托管账户”）：基金托管人为基金财产在具有基金托管资格的商业银行开立的银行结算账户，用于基金财产中现金资产的归集、存放与支付，该账户不得存放其他性质资金。

24、证券账户：根据中国证监会有关规定和中国证券登记结算有限责任公司（下称“中登公司”）等相关机构的有关业务规则，本基金在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司、深圳分公司、北京分公司开设的证券账户，以及在债券登记结算机构开立的专用债券账户。

25、证券交易资金账户：基金管理人为基金财产在证券经纪机构下属的证券营业部开立的证券交易资金账户，用于基金财产证券交易结算资金的存管、记载交易结算资金的变动明细以及场内证券交易清算。证券交易资金账户按照“第三方存管”模式与托管账户建立一一对应关系，由基金托管人通过银证转账的方式完成资金划付。

26、期货账户：基金管理人为基金财产在期货经纪机构开立的期货保证金账户，用于基金财产期货交易结算资金的存管、记载交易结算资金的变动明细以及期货交易清算。期货保证金账户应与托管账户建立一一对应关系，由基金托管人通过银期转账的方式办理期货交易的出入金。

27、募集结算资金专用账户（募集账户）：指本基金的份额登记机构接受基金管理人委托负责在商业银行开立的注册登记账户，并由账户监管机构实施监督。该账户仅用于本基金募集期间和存续期间认购、申购、赎回、分红、费用等资金的归集与支付以及基金财产清算过程中剩余资产的归集与分配，包括募集期间用于接受基金投资者的委托资金，以及账户内资金与托管资金账户、投资者收益账户及私募基金管理人（或私募基金管理人指定的第三方机构）账户的定向划转。

28、投资者收益账户：基金投资者将认购资金划入本基金募集账户后，接受赎回资金、

分红资金和清算资金时对应的反向划出账户。

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

30、基金资产净值、基金净资产：本基金资产总值减去负债后的价值。

31、整体基金份额净值：计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数所得的数值，其不代表某个特定类别份额的基金份额净值。

32、各类别基金份额净值：A 类基金份额净值是指计算日 A 类份额基金资产净值除以计算日 A 类基金份额总数，B 类基金份额净值是指计算日 B 类份额基金资产净值除以计算日 B 类基金份额总数，C 类基金份额净值是指计算日 C 类份额基金资产净值除以计算日 C 类基金份额总数。

33、基金资产估值：计算、评估基金资产和负债的价值，以确定本基金资产净值和基金份额净值的过程。

34、市值：资产的公允价值，具体以估值结果为准。

35、募集期：指本基金的初始销售期限。

36、存续期：指本基金成立日至终止日之间的期限。

37、运作年度/运作季度：按照算头不算尾原则计算，例如首个运作年度为自基金成立日至基金成立日次年对日的前 1 日之间的期限；首个运作季度为自基金成立日起三个月后的对日的前 1 日之间的期限。

38、投资冷静期：指自基金投资者签署基金合同完毕且交纳认购基金的款项后的二十四小时。销售机构在投资冷静期内不得主动联系投资者。基金投资者在投资冷静期内有权解除基金合同。基金投资者为专业投资机构的，可不适用本基金投资冷静期的规定。

39、回访确认：指销售机构在投资冷静期满后，指令本机构从事基金销售推介业务以外的人员以录音电话、电邮、信函等适当方式进行投资回访。

40、认购：指在募集期间，基金投资者按照本合同的约定购买本基金份额的行为。

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

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

43、不可抗力：指本合同当事人不能预见、不能避免、不能克服的客观情况。该等不可抗力事件包括但不限于自然灾害、地震、台风、水灾、火灾、战争、暴乱、流行病、政府行为、罢工、停工、停电、通讯失败等，非因基金管理人、基金托管人自身原因导致的技术

系统异常事故、政策法规的修改或监管要求调整等情形。因中国人民银行或其他商业银行结算系统出现故障导致结算无法进行的情形，因电信服务商原因导致资金划付的网络中断、无法使用的情形，构成不可抗力事件。

44、 资产管理产品、资管产品：指《指导意见》规定的资产管理产品，包括但不限于人民币或外币形式的银行非保本理财产品，资金信托，证券公司、证券公司子公司、基金管理公司、基金管理子公司、期货公司、期货公司子公司、保险资产管理机构、金融资产投资公司发行的资产管理产品等。

45、 A 类基金份额：面向本基金管理人、基金管理人员及其配偶、基金管理人发行管理或担任投资顾问的金融产品、基金管理人股东或其关联方、基金管理人关联方公司的员工或基金管理人关联方公司发行管理或担任投资顾问的金融产品发售的份额。

46、 B 类基金份额：面向除 A 类基金份额发售对象以外的其他产品投资者发售的份额。

47、 C 类基金份额：面向除了 A 类基金份额发售对象以外的其他合格的自然人投资者或机构投资者发售的份额。

三、 声明与承诺

(一) 基金投资者的声明与承诺

1、 基金投资者声明其符合相关法律法规、证监会及本合同规定的关于私募基金合格投资者的相关标准，其投资本基金的财产为其拥有合法所有权或处分权的资产，保证财产的来源及用途符合国家有关规定，不存在非法汇集他人资金、使用贷款、发行债券等募集的非自有资金投资的情形，保证有完全及合法的授权委托基金管理人和基金托管人进行该财产的投资管理和托管业务，保证没有任何其他限制性条件妨碍基金管理人和基金托管人对该财产行使相关权利且该权利不会为任何其他第三方所质疑。

私募基金管理人同意并承诺，为反洗钱目的，一经私募基金托管人要求，私募基金管理人应立即向私募基金托管人提供其所持有的相关客户的信息和资料。私募基金托管人接收、审阅或向有权机关提交私募基金投资者的关于反洗钱的客户资料不免除私募基金管理人应承担的反洗钱责任。如因私募基金管理人未履行相关法律法规规定的反洗钱义务而导致私募基金托管人遭受包括但不限于监管处罚在内的任何损失，私募基金管理人应向私募基金托管人承担赔偿责任。

2、 基金投资者声明已充分理解本合同全文，了解相关权利、义务，了解有关法律法规及所投资基金的风险收益特征，愿意承担相应的投资风险，本投资事项符合其投资策略

程序的要求。

3、基金投资者承诺其向募集机构提供的有关投资目的、投资偏好、投资限制、财产收入情况和风险承受能力等基本情况真实、完整、准确、合法，不存在任何重大遗漏或误导。

4、前述信息资料如发生任何实质性变更，应当及时书面告知募集机构。

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

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

基金管理人保证在募集资金前已在中国基金业协会登记为私募基金管理人，管理人登记编码为【P1000675】。基金管理人声明，中国基金业协会为基金管理人和私募基金办理登记备案不表明对私募基金管理人的投资能力、风控合规和持续经营情况作出实质性判断，不作为对私募基金财产安全和投资者收益的保证，也不表明协会对登记备案材料的真实性、准确性、完整性作出保证。

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

四、 私募基金的基本情况

(一)私募基金的名称：东源 A500 指数策略鑫享 1 号私募证券投资基金。

(二)私募基金的运作方式：契约型开放式。

(三)私募基金的财产类型：权益类。

(四)私募基金的初始实缴募集资金规模：不低于人民币【1000】万元。

(五)私募基金的投资范围：

本私募基金投资范围详见本合同“私募基金的投资”章节中“投资范围”之约定。

(六)私募基金的存续期限：自本基金成立之日起【20】年。基金成立日【20】年后的对应月对应日的前一日为到期日（若该到期日为非交易日，则顺延至下一个交易日）。本基金合同另有约定的，从其约定。基金管理人应当在本基金到期前至少 10 个工作日书面通知基金托管人和基金委托人，如拟续期的，需根据本合同约定与基金委托人、基金托管人协商

确认。

私募基金的展期（即延长基金合同期限）和提前终止详见本合同“私募基金合同的效力、变更、解除与终止”章节的约定。

（七）私募基金份额的初始面值：人民币 1.00 元。

（八）私募基金的托管事项：

本基金的托管人为国金证券股份有限公司。基金托管人已获得中国证监会核准的证券投资基金托管资格。

（九）私募基金的外包事项：

基金管理人接受基金投资者委托为本基金聘请行政服务机构。行政服务机构为本基金提供份额登记和估值核算服务。

本基金的行政服务机构为国金道富投资服务有限公司。该机构是经中国基金业协会正式备案的外包服务机构，在基金业协会的备案编号为 A00012。

（十）基金的份额类别

本基金不属于结构化产品，根据投资者身份不同分为 A 类基金份额、B 类基金份额、C 类基金份额 3 个份额类别分别发售，除本合同另有约定外，每份份额具有同等的权益：

A 类基金份额：面向本基金管理人、基金管理人员及其配偶、基金管理人发行管理或担任投资顾问的金融产品、基金管理人股东或其关联方、基金管理人关联方公司的员工或基金管理人关联方公司发行管理或担任投资顾问的金融产品发售。

B 类基金份额：面向除 A 类基金份额发售对象以外的其他产品投资者发售。

C 类基金份额：面向除了 A 类基金份额发售对象以外的其他合格的自然人投资者或机构投资者发售。

3 个份额类别在认购费、申购费、赎回费、管理费、和浮动业绩报酬的设置上不同。本基金存续期内，若某一类基金份额因该类委托人全部赎回导致该类基金份额余额为 0 时，在该类基金份额全部赎回申请日次日至赎回确认日之间发生的该类别损益（若有）及其他计算尾差（若有），归入留存的其他份额类别，但该类基金份额类别仍保留。该类基金份额后续首次接受委托人申购时，使用申请日对应开放日的基金份额净值（即基金整体份额净值）作为申购价格。3 个份额类别的基金资产合并运作，分别计算并公布各基金份额净值。不同份额之间不存在某一份额类别为其他份额类别提供风险补偿或收益保障的安排。各个份额类别之间不得相互转换。

A 类基金份额、B 类基金份额和 C 类基金份额由基金管理人自行确认，基金托管人和行

政服务机构不承担监督或者复核责任，由此产生的风险与责任与基金托管人和行政服务机构无关。

五、 私募基金份额的募集

(一) 基金份额的募集机构、募集方式、募集期限、募集对象

1、 基金的募集机构和募集方式

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）。

本基金通过直销机构（基金管理人）和/或基金管理人委托的代销机构以非公开方式向投资者募集资金。

2、 募集期限

本基金的募集期为自基金份额发售之日起【3】个月。私募基金管理人有权根据本基金销售的实际情况缩短或延长募集期，但延长期限不得超过【30】天，募集期的变更适用于所有募集机构。私募基金管理人拟缩短或延长募集期的，应于原定募集结束日前【3】个工作日发布公告，并通知基金行政服务机构。

当本基金符合法律法规规定的成立条件时，私募基金管理人可以提前终止本基金的募集。募集期限届满本基金不能成立的，基金募集失败，并按本合同“私募基金的成立与备案”章节第四条“基金募集失败的处理方式”的约定处理。

3、 募集对象

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”。

“普通合格投资者”是指具备相应风险识别能力和风险承担能力，投资于单只私募基金的金额不低于 100 万元的机构和单位，(1) 净资产不低于 1000 万元的单位；(2) 金融资产不低于 300 万元或者最近三年个人年均收入不低于 50 万元的个人。前述金融资产包括银行存款、股票、债券、基金份额、资产管理计划、银行理财产品、信托计划、保险产品、期货权益等。

“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) 国务院金融监督管理机构监管的机构依法发行的资产管理产品、私募基金；(3) 合格境外机构投资者、人民币合格境外机构投资者；(4) 投资于单只私

募基金的私募基金管理人及其从业人员；（5）中国证监会规定的其他投资者。

特别的，如本基金投资于私募投资基金、私募资管产品的，则本基金不再接受其他私募投资基金、私募资管产品作为投资者购买本基金。投资者的身份识别及限制购买本基金行为由基金管理人和代销机构（如有）自行监控和确认。

（二）基金份额的认购金额限制

投资者在募集期间扣除认购费的首次净认购金额不得低于【100】万元人民币（法律法规、监管规定及行业自律规则另有规定的除外），并可多次认购，募集期间扣除认购费的净追加认购金额应不低于【1】万元人民币。

（三）基金份额的认购费用

本基金 A 类基金份额的认购费率为【0%】，B 类基金份额的认购费率为【0%】，C 类基金份额的认购费率为【1%】，认购费用计算方式如下：

净认购金额=认购金额/（1+各类别基金份额认购费率）

认购费用=认购金额-净认购金额

认购费由基金管理人支配使用，不列入基金财产；如果经由基金代销机构（如有）办理认购的，本基金的认购费可由基金代销机构支配，不列入基金财产，具体以基金代销协议的约定为准。

基金管理人可根据情况自行调低或豁免部分基金投资者的认购费并出具相关文件，委托基金行政服务机构办理，如果基金代销协议对基金投资者认购费的调低或豁免另有规定的，从其规定。

（四）认购申请的确认

认购申请受理完成后，不得撤销。募集机构受理认购申请并不表示对该申请成功的确认，而仅代表募集机构确实收到了认购申请。认购的确认以基金管理人的确认结果为准。

本基金的人数规模上限为 200 人。基金管理人在募集期间超过可接受的人数限制的部分，按照“时间优先、金额优先”的原则确认有效认购申请。超出基金人数规模上限的认购申请为无效申请。

通过代销机构进行认购的，人数规模控制以基金管理人和代销机构约定的方式为准。

（五）认购份额的计算方式

在募集期，基金投资者的有效认购款项在募集结算资金专用账户形成的利息（募集期利息）在基金投资者的资金到达托管账户之日折算为基金份额归基金投资者所有，其利息转份额的具体数额以份额登记机构的记录为准。

认购份额=（净认购金额+募集期利息）÷面值

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

（六）募集账户和资金的交付

基金份额募集期间，基金投资者认购本基金，应于募集机构指定的日期及方式以人民币转账形式交付。基金不接受现金方式认购。

基金投资者通过私募基金管理人直销渠道认购基金的，应将认购款划入如下募集账户：

募集账户名称：国金道富投资服务有限公司募集结算资金专用账户

募集账户账号：30205113105268

募集账户开户银行名称：平安银行上海交易所支行

任何一方对于上述募集结算资金专用账户信息的修改均不产生法律效力。在基金募集行为结束之前，募集资金任何人不能动用。对募集账户的监督由监督机构——国金证券股份有限公司负责。国金证券股份有限公司作为募集账户的账户监督机构，仅对本基金的募集账户进行监督，不对其他募集账户（如代销募集账户）承担任何责任。账户监督机构的职责以基金管理人和账户监督机构另行签订的《账户监督协议》为准。

募集账户是基金行政服务机构接受私募基金管理人委托代为提供基金服务的专用账户，并不代表基金行政服务机构接受投资者的认购或申购资金，也不表明基金行政服务机构对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。在募集账户的使用过程中，除有足够的证据证明是因基金行政服务机构的原因造成的损失外，私募基金管理人应就其自身操作不当等原因所造成的损失承担相关责任，基金行政服务机构对于私募基金管理人的投资运作不承担任何责任。在募集结算资金专用账户的监督过程中，除有足够的证据证明是因账户监督机构的原因造成的损失外，基金管理人应就其自身操作不当等原因所造成的损失承担相关责任，账户监督机构对于基金管理人的投资运作不承担任何责任。

本基金合同各方确认：基金投资者将认购资金划入本基金募集账户后对应的反向划出账户为投资者收益账户，私募基金管理人（或其委托的基金行政服务机构）只能将募集账户中的资金定向划拨至该基金对应的托管资金账户（认购、申购时）、投资者收益账户（分红、赎回、清算时）、私募基金管理人账户（划拨认购费、申购费、赎回费、业绩报酬等在本基金合同中列明的归属于管理人收取的费用时）、代销机构账户（划拨认购费、申购费、赎回费等在本基金合同中列明的归属于代销机构收取的费用时）、代销机构的募集资金募集账户（存在代销机构负责处理投资者端的分红、赎回、清算时）以及投资顾问账户（划拨本基金

合同中列明的归属于投资顾问收取的费用时）。

（七）投资冷静期及回访确认

1、投资冷静期

本基金的投资冷静期为自基金合同签署完毕且投资者交纳认购基金的款项后起的二十四个小时。销售机构在投资冷静期内不得主动联系投资者。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投资冷静期的限制。

2、募集机构的回访确认

投资者认购/申购（含追加认购或申购）本基金时，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，回访过程不得出现诱导性陈述。募集机构在投资冷静期内进行的回访确认无效。投资者在募集机构回访确认成功前有权解除基金合同或撤销认购/申购申请，但基金份额持有人追加购买基金份额的，不适用前述解除基金合同的约定，但基金份额持有人有权撤销本次认购/申购申请。出现前述情形时，募集机构应当按合同约定及时退还投资者的全部认购款项。在募集机构约定的回访时间内，未回访确认成功，本次认购/申购失败，募集机构应按合同约定及时退还投资者的全部认购/申购款项。未经回访确认成功，投资者交纳的认购/申购基金款项不得由募集账户划转到基金财产账户或托管资金账户，私募基金管理人不得投资运作投资者交纳的认购/申购基金款项。

六、 私募基金的成立与备案

（一）基金合同签署的方式

本合同的签署应当采用纸质合同及/或电子签名的方式进行，由基金管理人、基金托管人、基金投资者共同签署。

（二）基金的成立

本基金初始募集期内，当全部满足如下条件时，本基金方可成立：

- 1、单个投资者交付的净认购金额不低于 100 万元人民币，但法律法规、监管规定及行业自律规则另有规定的除外；且基金初始实缴募集资产规模不低于人民币【1000】万元人民币；
- 2、有效签署本合同并交付认购资金的基金投资者人数不少于 100 人（含），累计不超过 200 人；
- 3、投资者已过冷静期且募集机构已完成相应的募集回访确认（如有）。

本基金初始销售期结束后，基金管理人应确认上述条件全部达成，此时基金方可成立。

本基金募集期结束后，基金管理人或其委托的基金行政服务机构应将全部募集资金划入托管账户，基金托管人核实资金到账情况后，向基金管理人出具资金到账通知书，基金具体的成立日期以资金到账通知书上载明的资金到达基金托管账户的日期为准。

基金管理人应于基金成立时向本基金的基金份额持有人发布基金成立通知。基金托管人的职责自基金成立后开始。

（三）基金的备案

募集期限届满，管理人应当自募集期限届满之日起 20 个工作日内到中国证券投资基金业协会办理相关备案手续。基金在中国基金业协会完成备案后方可进行本合同约定的投资运作；基金完成备案前，可以以现金管理为目的，投资于银行活期存款、国债、中央银行票据、货币市场基金等中国证监会认可的现金管理工具。

（四）基金募集失败的处理方式

募集期限届满，如果本基金不能成立的，基金管理人应当承担下列责任：

- 1、 以其固有财产承担因销售行为而产生的债务和费用（包括但不限于合同印刷费），本合同其他章节另有约定的除外；
- 2、 在募集期届满后 30 日内退还投资者已缴纳的款项，并加计银行同期活期存款利息；
- 3、 将私募基金托管人已盖章的基金合同及其他相关协议在基金募集期限届满后 10 日内如数原件返还私募基金托管人。未能如数返还的，应向私募基金托管人书面说明原因、去向并加盖公章。

（五）基金未备案和备案未通过的处理方式

本基金应在基金业协会规定的期限内完成备案手续，不能满足基金备案条件或基金管理人放弃基金备案的，基金管理人应及时通知基金份额持有人和基金托管人。若基金管理人放弃本基金备案或本基金未能成功通过备案，本合同相应终止，管理人需及时向全体基金份额持有人披露基金终止相关公告，同时书面通知基金托管人和基金行政服务机构，并对本基金财产进行终止清算，具体终止清算流程参见本合同“基金的清算”章节。

七、 私募基金的申购、赎回、转让和转换

（一）申购和赎回的场所

本基金的销售机构包括基金管理人委托的代销机构和直销机构（基金管理人）。基金投资者应当在销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理基金

份额的申购和赎回。基金管理人可根据情况变更或增减基金代销机构，并予以公告。

（二）申购和赎回的时间

本基金无份额锁定期，本基金以设置与份额持有期限对应的短期赎回费的方式替代份额锁定期。

本基金存续期内按【周】开放申购和赎回，每【周】开放一次。本基金的开放日为本基金成立之日后每周三和每周四（如遇当天为非工作日的，则当天不开放也不顺延）。基金投资者可在本基金的开放日申购和赎回基金份额，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公告暂停申购、赎回时除外。

针对本基金管理人及员工跟投的基金份额，其份额锁定期限为【6】个月，认购份额自基金成立日起算，申购份额自申购确认日起算，红利再投资份额自红利再投确认日起算；基金份额处于锁定期限内不得赎回。管理人及其员工在认购/申购本基金时，管理人应主动告知并如实向份额登记机构提供相应证明材料。如因管理人未及时告知投资者身份、未提供或提供的用于证明自有资金及员工身份的资料不真实、不准确等影响份额登记业务的，由管理人承担相应责任。

未征得投资者同意，私募基金管理人不得擅自更改投资者认（申）购、赎回时间、频率、程序以及限制事项。

基金管理人可因法律、行政法规、监管政策调整、合同变更或解除等情形增设临时开放日，临时开放日仅允许赎回已过份额锁定期的基金份额，不得利用临时开放日进行申购。基金管理人应当在临时开放日前【2】个工作日在基金管理人网站公告或以本合同规定的其他方式通知基金份额持有人，并应使用邮件、传真或其他基金管理人和基金托管人、行政服务机构认可的方式向基金托管人和行政服务机构发送临时开放通知。管理人应自行监控并审核设置临时开放日的原因，基金托管人和行政服务机构仅根据管理人的通知进行业务办理，不负责临时开放原因及触发条件、开放形式和开放次数的审核。

（三）出资方式及认缴期限

本基金不接受现金申购，在直销机构申购的投资者应在申购有效期内将申购资金从在中国境内开立的自有银行账户划款至本合同“投资者告知书”中约定的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。

基金管理人或行政服务机构于申购确认后一个工作日内将申购资金划入基金托管账户。基金托管人对划入托管账户的申购资金的完整性不负实质性审查责任。

（四）申购和赎回的方式、价格及程序

1、“未知价”原则，即基金的申购价格、赎回价格以 A/B/C 类基金投资者提交申购或赎回申请对应的开放日收市后计算的对应类别基金份额净值为基准进行计算。

2、A/B/C 类基金投资者申购基金时，按照申购申请对应的开放日的对应类别基金份额净值为基准计算基金份额。A/B/C 类基金份额持有人赎回基金时，按照赎回申请对应的开放日的对应类别基金份额净值计算赎回金额。

3、基金申购采用金额申请的方式，基金赎回采用份额申请的方式。

4、基金份额持有人赎回基金时，基金管理人按先进先出的原则，按基金投资者认购、申购和红利再投资基金份额的时间先后次序进行顺序赎回；

5、申购期间的投资冷静期、回访确认适用本合同“私募基金份额的募集”章节中“投资冷静期及回访确认”项下关于投资冷静期及回访确认的约定。

（五）申购和赎回申请的确认

本基金的人数规模上限为 200 人。私募基金管理人在申购预约登记期间的每个交易日可接受的人数限制内，按照“时间优先、金额优先”的原则确认有效申购申请。超出基金投资者人数规模上限的申购申请为无效申请。

特别的，如本基金投资于私募投资基金、私募资管产品的，则本基金不再接受其他私募投资基金、私募资管产品作为投资者购买本基金。投资者的身份识别及限制购买本基金行为由基金管理人和代销机构（如有）自行监控和确认。

在正常情况下，基金管理人在【T+2 日】内对 T 日申购和赎回申请的有效性进行确认。若申购不成功，则申购款项退还给投资者。

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

（六）申购和赎回的金额限制

基金投资者首次申购，扣除申购费的净申购金额应不低于【100】万元人民币（法律法规、监管规定及行业自律规则另有规定的除外），已持有私募基金份额的投资者在开放日内追加申购的，扣除申购费的净追加申购金额应不低于【1 万元人民币】。

基金份额持有人持有的基金资产净值高于 100 万元的，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于 100 万元的，必须选择一次性赎回全部基金份额，基金份额持有人没有一次性全部赎回持有份额的，基金管理人应当将该基金份额持有人所持份额做全部赎回处理，该等赎回不受本合同关于基金赎回的期限限制。法律法规、监管规定及

行业自律规则另有规定的除外。

(七) 申购或赎回的资金清算

1、T 日，基金投资者进行申购或赎回申请。基金管理人或其委托的行政服务机构向基金份额登记机构发送基金资产净值等数据。

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

3、基金份额持有人赎回申请确认后，基金管理人将在【T+7 日(包括 T+7 日)】内支付赎回款项，本合同另有约定的情况除外。

(八) 申购费用和申购份额的计算

1、申购费用的计算

本基金 A 类基金份额的申购费率为【0%】，B 类基金份额的申购费率为【0%】，C 类基金份额的申购费率为【1%】，计算方法如下：

净申购金额=申购金额÷(1+各类别基金份额申购费率)

申购费用=申购金额-净申购金额

申购费用由基金管理人支配使用，不列入基金财产；如果经由基金代销机构（如有）办理申购的，本基金的申购费可由基金代销机构支配，不列入基金财产，具体以基金代销协议的约定为准。

基金管理人可根据情况自行调低或豁免部分基金投资者的申购费并出具相关文件，委托基金行政服务机构办理，如果基金代销协议对基金投资者申购费的调低或豁免另有规定的，从其规定。

2、申购份额的计算

申购份额=净申购金额÷申购价格

申购价格为申购申请对应的开放日的对应类别基金份额净值。

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

(九) 赎回费用和赎回金额的计算

投资者申请赎回本基金时须按赎回份额的持有期限缴纳相应的赎回费。

A 类基金份额的赎回费率如下：

A 类基金份额持有期 (D)	赎回费率
D<【3 个月】	【0.5%】

【3 个月】≤D<【6 个月】	【0.3%】
【6 个月】≤D<【12 个月】	【0.1%】
D≥【12 个月】	【0%】

B 类基金份额的赎回费率如下：

B 类基金份额持有期 (D)	赎回费率
D<【3 个月】	【1%】
【3 个月】≤D<【6 个月】	【0.5%】
【6 个月】≤D<【12 个月】	【0.3%】
D≥【12 个月】	【0%】

C 类基金份额的赎回费率如下：

C 类基金份额持有期 (D)	赎回费率
D<【3 个月】	【1.5%】
【3 个月】≤D<【6 个月】	【1%】
【6 个月】≤D<【12 个月】	【0.5%】
D≥【12 个月】	【0%】

备注：如以月表示，则 1 个月为 30 天，3 个月为 90 天，6 个月（半年）为 180 天，12 个月（一年）为 365 天。以认购方式取得基金份额的，持有基金份额的期限自本基金成立之日起计算；以申购方式取得基金份额的，持有基金份额的期限自申购确认之日起计算。

1、赎回金额的计算方法如下：

赎回金额=赎回份额×赎回价格-赎回费（若有）-应计提业绩报酬（若有）

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。

2、赎回费用的计算方法如下：

赎回费=（赎回份额×赎回价格-应计提业绩报酬（如有））×赎回费率

赎回价格为赎回申请对应的开放日的对应类别基金份额净值。

赎回费（如有）由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。赎回费归入本基金财产，销售机构不得减免。

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。

（十）拒绝或暂停申购、暂停赎回的情形及处理

1、在如下情形下，基金管理人可以拒绝接受基金投资者的申购申请：

(1) 根据市场情况,基金管理人无法找到合适的投资品种,或其他可能对基金业绩产生负面影响,从而损害现有基金份额持有人的利益的情形;

(2) 因基金持有的某个或某些证券进行权益分派等原因,使基金管理人认为短期内接受申购可能会影响或损害现有基金份额持有人利益的情形;

(3) 基金管理人认为接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害其他基金份额持有人利益的情形;

(4) 法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

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

2、在如下情形下,基金管理人可以暂停接受基金投资者的申购申请:

(1) 因不可抗力导致无法受理基金投资者的申购申请的情形;

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

(3) 发生本合同规定的暂停基金资产估值的情形;

(4) 法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

基金管理人决定暂停接受全部或部分申购申请时,应当以公告的形式告知基金投资者。在暂停申购的情形消除时,基金管理人应及时恢复申购业务的办理并以公告的形式告知基金投资者。

3、在如下情形下,基金管理人可以暂停接受基金份额持有人的赎回申请:

(1) 因不可抗力导致基金管理人无法支付赎回款项的情形;

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

(3) 发生本合同规定的暂停基金资产估值的情形;

(4) 基金管理人认为接受某笔或某些赎回申请可能会影响或损害其他基金份额持有人利益的情形;

(5) 连续2个开放日及以上(含本数)发生巨额赎回且基金管理人认为有必要暂停接受基金赎回申请的情形;

(6) 法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一且基金管理人决定暂停赎回的,基金管理人应当以公告形式告知基金份额持有人。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【30个工作日内】予以支付。

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

(十一) 巨额赎回的认定及处理方式

1、巨额赎回和连续巨额赎回的认定

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【30%】时，即认为本基金发生了巨额赎回。

连续两个开放日或以上，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【30%】时，即认为本基金发生了连续巨额赎回。

2、巨额赎回的处理方式

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

(1) 全额赎回：当管理人认为有条件支付投资者的赎回申请时，按正常赎回程序办理。此种情形下，为避免对剩余基金持有人产生不利影响，基金管理人可以选择临时调整赎回价格的计算精度，具体调整方案以届时管理人公告为准。

(2) 部分顺延赎回：当管理人认为支付投资者的赎回申请可能会对基金资产净值造成较大波动时，管理人在当日接受净赎回比例不低于基金总份额【30%】的前提下，对其余赎回申请予以延期办理。对于当日的赎回申请，将按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；未能受理的赎回部分，投资者可选择延期办理或撤销赎回申请。对于选择延期办理的赎回申请，管理人将在下一个赎回开放日内办理，并以该赎回开放日的基金份额净值为准计算赎回金额，依此类推，直至全部办理完毕为止。

(3) 暂停赎回：连续 2 个开放日及以上(含本数)发生巨额赎回时，如基金管理人认为有必要，可暂停接受本基金的赎回申请。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的，可以延缓支付赎回款项，并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，但不得超过 30 个工作日。

3、巨额赎回、顺延赎回、暂停赎回的通知：当发生巨额赎回并由基金管理人决定顺延赎回或暂停赎回时，基金管理人应当在基金管理人或代销机构网站专区以公告的方式通知基金份额持有人。

4、单个投资者大额赎回的认定及处理方式：本基金不设单个投资者大额赎回限制条

款，因单个投资者大额赎回导致出现巨额赎回的，根据巨额赎回的认定和处理方式办理。

（十二）基金份额的转让

基金份额持有人可通过现时或将来法律、法规或监管机构允许的方式办理转让业务，基金管理人负责对转让业务的合理合规性进行审核，经管理人审核确认能够进行份额转让后，其转让时间、规则等按照办理机构的规则执行。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。

基金份额转让相关交易及变更登记申请文件的真实性、准确性和有效性由基金管理人负责审核确认，基金行政服务机构不对基金份额转让交易的真实性、有效性、交易合理性以及价格公允性等问题承担任何责任。对于因份额转让交易虚假、无效或当事人/管理人提供的申请文件不合法、不真实、失去效力等所造成的相关影响或后果，基金行政服务机构不承担任何责任。

（十三）基金的转换

私募基金管理人可以根据相关法律法规以及本基金合同的规定决定开办本基金与私募基金管理人管理的其他基金之间的转换业务，基金份额转换可以收取一定的费用（包含基金转换费和业绩报酬（如有）），相关规则由私募基金管理人届时根据相关法律法规及本基金合同的规定制定并向全体投资者公告，并提前告知基金托管人与行政服务机构。**因管理人未提前告知基金托管人与行政服务机构造成损失的，基金托管人与行政服务机构不承担责任。**基金转换时转换入的基金投资者应满足投资者适当性审查及合格投资者确认等募集环节的相关法律法规要求，基金转换后，持有基金份额的合格投资者数量合计不得超过法定人数。

八、 当事人及其权利义务

（一）基金份额持有人

1、 基金份额持有人概况

基金投资者签署本合同，履行出资义务并取得基金份额，即成为本基金份额持有人。基金份额持有人的详细情况在合同签署页列示。

2、 基金份额持有人的权利

- （1） 取得基金财产收益；
- （2） 取得清算后的剩余基金财产；
- （3） 按照本合同的约定申购、赎回、转让基金份额（如有）以及参与基金的转换业务（如有）；

- (4) 按照本合同的约定, 参加或申请召集基金份额持有人大会, 行使相关职权;
- (5) 监督基金管理人及基金托管人履行投资管理和托管义务的情况;
- (6) 因基金管理人、基金托管人违反法律法规或本合同约定导致合法权益受到损害的, 有权得到赔偿;
- (7) 按照本合同约定的时间和方式获得基金信息披露资料;
- (8) 国家有关法律法规、监管机构及本合同规定的其他权利。

3、基金份额持有人的义务

- (1) 认真阅读本合同, 保证投资资金的来源及用途合法;
- (2) 接受合格投资者确认程序, 如实填写风险识别能力和承担能力调查问卷, 如实承诺资产或者收入情况, 并对其真实性、准确性和完整性负责, 承诺为合格投资者;
- (3) 以合伙企业、契约等非法人形式汇集多数投资者资金直接或者间接投资于私募基金的, 应向基金管理人充分披露上述情况及最终投资者的信息, 但符合《私募投资基金监督管理暂行办法》第十三条规定的除外;
- (4) 认真阅读并签署风险揭示书;
- (5) 按照本合同约定缴纳基金份额的认购、申购款项, 承担本合同约定的管理费、托管费及其他相关费用;
- (6) 按照本合同约定承担基金的投资损失;
- (7) 及时、全面、准确地向基金管理人告知其投资目的、投资偏好、投资限制和风险承受能力等基本情况;
- (8) 向基金管理人或私募基金募集机构提供法律法规规定的信息资料及身份证明文件, 配合基金管理人或其募集机构的尽职调查与反洗钱工作。若前述资料发生变更, 应及时通知管理人或募集机构;
- (9) 不得违反本合同的规定干涉基金管理人的投资行为;
- (10) 不得从事任何有损基金及其他基金份额持有人、基金管理人管理的其他基金及基金托管人托管的其他基金合法权益的活动;
- (11) 保守商业秘密, 不得泄露基金投资计划、投资意向等;
- (12) 保证投资资金的来源合法, 主动了解所投资品种的风险收益特征;
- (13) 认购、申购、赎回、分配等基金交易过程中因任何原因获得不当得利的, 应予返还;
- (14) 保证其享有签署包括本合同在内的基金相关文件的权利, 并就签署行为已履行

必要的批准或授权手续,且履行上述文件不会违反任何对其有约束力的法律法规、公司章程、合同协议的约定;

(15) 同意并授权管理人为履行投资者适当性管理、信息披露等法律法规要求、监管部门/司法机关要求以及本合同约定或为基金运营所签署的其他合同约定的职责义务之目的,自行或委托其他机构(包括但不限于托管人、基金募集机构、基金行政服务机构等)收集、处理、使用、保存和披露投资者的个人信息,前述信息资料包括但不限于个人姓名、身份证号、电话号码、电子邮箱、认购/申购金额/份额信息以及其他可以识别投资者的各种信息。投资者应确保向管理人或管理人委托的其他机构(包括但不限于托管人、基金募集机构、基金行政服务机构等)提供真实、准确、完整、有效的信息资料,如投资者前述信息资料不完整或发生变更时,投资者应按照管理人或其委托的其他机构(包括但不限于托管人、基金募集机构、基金行政服务机构等)的要求配合完善或更新前述信息资料;

(16) 国家有关法律法规、监管机构及本合同规定的其他义务。

(二) 基金管理人

1、基金管理人概况

名称:东源(天津)股权投资基金管理股份有限公司

住所:天津市东丽区东丽湖汇智北道与汇智环路交口处东南侧智空间广场一期4号楼06层9室31号

通讯地址:北京市朝阳区望京阜通东大街远洋万和公馆3号公馆

法定代表人:杨成义

联系人:樊巧妮

联系电话:010-84782701

2、基金管理人的权利

- (1) 按照本合同的约定,独立管理和运用基金财产;
- (2) 依照本合同的约定,及时、足额获得基金管理人管理费用及业绩报酬(如有);
- (3) 依照有关规定和基金合同约定行使因基金财产投资所产生的权利;
- (4) 根据本合同及其他有关规定,监督基金托管人,对于基金托管人违反本合同或有关法律法规规定、对基金财产及其他当事人的利益造成重大损失的行为及时采取措施制止;
- (5) 自行销售或者委托有基金销售资格的机构销售基金,制定和调整有关基金销售的业务规则,并对销售机构的销售行为进行必要的监督;
- (6) 基金管理人有权委托国金道富投资服务有限公司作为行政服务机构为本基金提

供估值核算等服务，并对其代理行为进行必要的监督和检查。基金管理人与行政服务机构另行签署委托服务协议与行政管理服务确认函，对相关权利、义务进行约定，包括但不限于下列内容：

① 行政服务机构的权利

I、按照本合同、委托服务协议及行政管理服务确认函的规定，及时、足额获取服务报酬；

II、国家有关法律法规、监管机构及本合同、委托服务协议规定的其他权利。

② 行政服务机构的义务

I、自行政管理服务确认函生效之日起，按照诚实信用、勤勉尽责的原则为基金提供估值核算等服务；

II、在提供委托服务过程中，按照基金管理人的安排与基金托管人进行估值核对、处理估值差错及其他服务；

III、对提供委托服务过程中知晓的本基金资产净值、份额净值等数据及其他保密信息，除法律法规、本合同及其他有关规定另有规定外，不得向他人泄露；

IV、国家有关法律法规、监管机构及本合同、委托服务协议规定的其他义务。

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

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

(9) 为履行投资者适当性管理、信息披露等法律法规要求、监管部门/司法机关要求以及本合同约定或为基金运营所签署的其他合同约定的职责义务之目的，管理人有权自行或委托其他机构（包括但不限于托管人、基金募集机构、基金行政服务机构等）收集、处理、使用、保存和披露投资者的个人信息，前述信息资料包括但不限于个人姓名、身份证号、电话号码、电子邮箱、认购/申购金额/份额信息以及其他可以识别投资者的各种信息；若投资者人的信息资料不完整或发生变更时，管理人有权要求投资者补充完善或更新前述信息资料；

(10) 国家有关法律法规、监管机构及本合同规定的其他权利。

3、基金管理人的义务

(1) 募集期限届满，管理人应当自募集期限届满之日起 20 个工作日内到中国证

资基金业协会办理相关备案手续。管理人应于基金成立之日起两个月内完成在中国证券投资基金业协会的基金备案手续；

(2) 基金管理人应根据法律法规规定及本合同约定履行主动管理基金的职责，并在基金运作过程中按照本合同的约定进行投资决策；

(3) 自本合同生效之日起，按照诚实信用、勤勉尽责的原则履行受托人义务，管理和运用基金财产；

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

(5) 制作风险揭示书，向投资者充分揭示相关风险；

(6) 管理人或其委托的销售机构应当恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉，防范利益冲突，履行说明义务、反洗钱义务等相关义务，并按照《私募投资基金募集行为管理办法》承担特定对象确定、投资者适当性审查、私募基金推介及合格投资者确认等相关责任；

(7) 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；

(8) 按规定开设及在基金终止且收到托管人书面通知后的一个月内注销基金的证券交易资金账户、期货账户（如有）等投资所需账户；

(9) 按照本合同约定将本基金项下资金移交基金托管人保管；

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

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

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

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

私募基金管理人应建立并有效执行投资顾问的遴选程序，并按照规定选聘投资顾问。投资顾问的条件和遴选程序，应符合法律法规和行业自律规则的规定和要求。私募基金管理人应建立并有效执行防范利益冲突机制，保证本基金与投资顾问本身、其管理的或担任

投资顾问的其他产品之间不存在利益冲突或利益输送。基金合同中已订明投资顾问的，应列明因私募基金管理人聘请投资顾问对基金合同各方当事人权利义务产生影响的情况。

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

(15) 按照本合同的约定接受基金份额持有人和基金托管人的监督；

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

(17) 按照本合同约定负责基金会计核算并编制基金财务会计报告；

(18) 按照本合同约定计算并向基金份额持有人披露基金份额净值或者投资收益情况；

(19) 遵守《私募投资基金信息披露管理办法》等规定及本合同约定，及时向基金份额持有人披露定期更新的招募说明书（如有）和基金定期报告，揭示私募基金资产运作情况，包括：私募基金信息披露月度报表（如需）、季度报表、年度报表等；本基金发生法律法规规定的重大事项时，私募基金管理人应按规定及时向投资者披露；

(20) 确定基金份额申购、赎回价格，采取适当、合理的措施确定基金份额交易价格的计算方法符合法律法规的规定和基金合同的约定；

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

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

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

(24) 基金管理人应确保本基金宣传资料真实、准确、完整，不得进行虚假宣传。基金管理人制作的宣传材料涉及基金托管人的，仅可表述为“国金证券股份有限公司为本产品的基金托管人”，不得以基金托管人名义进行任何其他宣传，基金托管人有权对基金管理人及本基金宣传材料进行检查，基金管理人违反上述约定的，基金托管人有权向基金管理人追责；

(25) 公平对待所管理的不同财产，不得从事任何有损基金财产及其他当事人利益的活动；

(26) 按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；

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

(28) 建立并保存基金份额持有人名册，按规定向基金托管人提供基金份额持有人名册资料；

(29) 面临解散、依法被撤销或者被依法破产时，及时报告中国基金业协会并通知基金托管人和基金投资者；

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

(31) 本基金发生变更、展期、终止等情形，基金管理人应当按照基金业协会规定进行备案；

(32) 按照基金合同的约定进行预警止损操作（如有）；

(33) 管理人拟投资证券公司及其子公司发行的资产管理计划、基金公司（含基金子公司）特定客户资产管理计划、期货公司（含期货子公司）资产管理计划、信托计划、保险资管公司资产管理计划、银行理财产品、以及发行主体具有私募基金管理人资格且进行资产托管或保管的私募基金的，管理人应提前向托管人提交准确无误的投资信息；

托管人只对产品信息、收款账户等要件进行形式审查；

(34) 本合同的签署采用电子签名的方式进行的，基金管理人应确保基金投资者使用基金管理人或代理销售机构颁发的有效的数字证书以电子签名方式签订本合同。基金管理人应确保基金投资者签订本合同所使用的电子签名符合《中华人民共和国电子签名法》等法律法规、监管规定的相关要求。

基金投资者完成本合同签署后，基金管理人应当按基金托管人要求的格式、内容和方式向基金托管人发送基金投资者签订本合同的相关电子数据信息（以下简称“电子数据信息”），包括且不限于基金投资者身份信息、签约序列号、签约时间、电子协议版本号等。基金管理人应对向基金托管人发送的电子数据信息的真实性、准确性和完整性负责。

基金管理人向基金托管人发送的电子数据信息应符合法律法规、监管规定和基金托管人向基金管理人提出的文件保存要求，且该等电子数据信息能够有效地表现所载内容，能够可靠地保证自最终形成时起内容保持完整、未被更改，并可供基金托管人随时调取查用。如基金托管人要求基金管理人提供带有基金投资者电子签名的本合同电子签署信息的，基金管理人应按照基金托管人的要求及时提供。对于使用代销机构销售系统进行本合同电子签署的，管理人应确保平台签约的电子合同内容与基金托管人向管理人提供的基金合同内容完全一

致并对代销机构的销售行为进行必要的监督，确保其在代销过程中严格遵守《证券期货投资者适当性管理办法》、《私募投资基金募集行为管理办法》（以下简称“《募集办法》”）等关于私募基金销售的相关规定，负责投资者适当性管理，按照《募集办法》规定的特定对象确认、投资者适当性匹配、基金风险揭示、合格投资者确认、投资冷静期等程序开展私募基金的代理销售业务，同时确保电子合同、电子签名约定书、风险揭示书、投资者承诺函、投资者信息等电子文件及信息均为投资者本人真实签署。**如因管理人提供给代销的电子合同内容与基金托管人提供的不一致，则由此引发的法律纠纷或产生的法律责任，托管人不承担责任。**

（35）管理人负责向托管人提供已签署基金合同的代销客户电子签约合同数据或签署版的电子合同 PDF 文件，并应当于新投资者认/申购确认后的【十】个工作日内，通过管理人被授权人指定邮箱向本基金托管人指定邮箱 zctgcp@gjzq.com.cn 发送。如有监管部门向基金托管人例行检查的，管理人应及时配合基金托管人提供监管所需原始数据资料。

（36）本基金接受其他私募基金或者资产管理产品投资的，管理人授权本基金托管人或行政服务机构将经复核的基金估值信息提供给上层私募基金托管人，同时授权本基金行政服务机构将基金份额登记信息提供给该基金托管人。

（37）国家有关法律法规、监管机构及本合同规定的其他义务。

（三）基金托管人

1、基金托管人概况

名称：国金证券股份有限公司

住所：四川省成都市东城根上街 95 号

通讯地址：四川省成都市青羊区东城根上街 95 号 13 楼

上海市浦东新区芳甸路 1088 号 18 楼

业务联系电话：021-20527138

2、基金托管人的权利

（1）按照本合同的约定，及时、足额获得托管费；

（2）根据法律法规规定和本合同约定，监督基金管理人。基金财产的投资运作，对于基金管理人违反本合同或有关法律法规规定的、对基金财产及其他当事人的利益造成重大损失的情形，有权向中国证监会或基金业协会等监督/监管机构报告；

（3）按照本合同的约定，依法保管基金财产；

（4）除法律法规另有规定的情况外，基金托管人对因基金管理人过错造成的基金财产

损失不承担责任；

(5) 国家有关法律法规、监管机构及本合同规定的其他权利。

3、基金托管人的义务

(1) 安全保管托管账户内的基金财产；

(2) 设立专门的托管部门，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责财产托管事宜；

(3) 对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整与独立；

(4) 除依据法律法规、本合同及其他有关规定外，不得为基金托管人及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金财产；

(5) 按规定开设和注销基金的托管账户（托管账户开立及使用的相关费用由基金资产承担）；

(6) 复核基金份额净值；

(7) 办理应由托管人负责且与基金托管业务有关的信息披露事项；

(8) 根据相关法律法规和本合同约定复核基金管理人编制的基金定期报告，并出具书面意见（基金托管人仅复核私募基金定期报告中的财务数据，并对私募基金在报告期内的合规守信情况发表意见）；

(9) 按照本合同的约定，根据基金管理人或基金管理人委托的行政服务机构的划款指令和其他必要材料（如需），及时办理清算、交割事宜；

(10) 根据相关法律法规的要求，保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；

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

(12) 保守商业秘密。除法律法规、本合同及其他有关规定另有要求外，不得向他人泄露；

(13) 根据法律法规及本合同的规定监督基金管理人的投资运作，基金托管人发现基金管理人的划款指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反本合同约定的，应当拒绝执行，立即通知基金管理人；基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反本合同约定的，应当立即通知基金管理人；

(14) 按照本合同约定制作相关账册并与基金管理人核对。

九、基金份额持有人大会及日常机构

(一) 基金份额持有人大会的组成

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

(二) 基金份额持有人大会的召开事由

1、当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会：

- (1) 私募基金管理人被基金业协会公告失联超过 20 个工作日；
- (2) 私募基金管理人依法解散、注销登记、被依法撤销、被依法宣告破产、被依法取消私募基金管理人相关资质等原因导致基金管理人客观上丧失继续管理私募投资基金的能力，且管理人未按合同约定履行义务组织清算的；
- (3) 怠于履行职责导致私募基金无法正常退出的；
- (4) 法律法规、本合同或监管部门规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。

2、当出现或需要决定下列事由之一，基金份额持有人以书面形式一致表示同意的，可以不召开基金份额持有人大会直接作出决议，并由全体基金份额持有人在决议文件上签名、盖章：

- (1) 决定本基金采取非现金资产方式进行分配；
- (2) 决定基金合同期限；
- (3) 决定修改基金合同的重要内容，包括修改本基金的投资范围；
- (4) 决定更换基金管理人、基金托管人、投资顾问（如有）；
- (5) 决定调高基金管理人、基金托管人、投资顾问（如有）和行政服务机构的收费标准；
- (6) 法律法规、本合同或监管部门规定的其他情形。

(三) 基金份额持有人大会日常机构

本基金未设基金份额持有人大会日常机构。本基金未来可根据相关的法律法规及中国证监会的相关规定，设立基金份额持有人大会日常机构。

(四) 基金份额持有人大会的召集

1、基金份额持有人大会设立日常机构的，由该日常机构召集，未设立日常机构或日常机构未召集的，由基金管理人召集。

代表基金份额百分之二十（含）以上的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会，而基金份额持有人大会日常机构、基金管理人都不召集的，代表基金份额百分之二十（含）以上的基金份额持有人有权自行召集。基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人会议的，应于会议召开前 10 个工作日通知基金管理人、基金托管人，基金管理人、基金托管人有权出席基金份额持有人会议，基金份额持有人应当予以配合，不得阻碍基金管理人、基金托管人出席基金份额持有人会议。

2、召开基金份额持有人大会，召集人最迟应于会议召开前 10 个工作日通知全体基金份额持有人，基金份额持有人大会通知应至少载明以下内容：

- （1）会议召开的时间、地点和出席方式；
- （2）会议拟审议的主要事项、议事程序和表决方式；
- （3）授权委托书的内容要求（包括但不限于授权代表身份、代理权限和代理有效期限等）、送达的期限、地点；
- （4）会务联系人姓名、电话及其他联系方式；
- （5）出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；
- （6）召集人需要通知的其他事项。

3、采取通讯方式开会并进行表决的情况下，由会议召集人决定通讯方式和书面表决方式，并在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、书面表决意见的寄交截止时间和收取方式。

4、若出现私募基金管理人被基金业协会公告失联超过 20 个工作日，私募基金管理人依法解散、被依法撤销、被依法宣告破产、被依法取消私募基金管理人相关资质等原因导致职责终止且管理人未按合同约定履行义务组织清算的情形，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大会。

5、基金托管人对基金份额持有人会议的召集不负有监督义务。

（五）召开方式、会议方式

- 1、基金份额持有人大会的召开方式包括现场开会和通讯方式开会。
- 2、现场开会由基金份额持有人亲自或委派授权代表出席；现场开会时基金份额持有人的授权代表应当出席。
- 3、通讯方式开会应当以书面方式进行表决；基金份额持有人出具书面表决意见并送达给基金管理人的，视为出席了会议。

（六）基金份额持有人大会召开条件

1、 现场开会

代表基金份额持有人大会召开日基金总份额 2/3 以上（含 2/3）的基金份额持有人或代表出席会议，现场会议方可举行。未能满足上述条件的情况下，则召集人可另行确定并通知重新开会的时间。

2、 通讯方式开会

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

（七） 表决

1、 议事内容：基金份额持有人大会不得对事先未通知的议事内容进行表决。若出现基金管理人被基金业协会公告失联超过 20 个工作日或私募基金管理人依法解散、被依法撤销、被依法宣告破产、被依法取消私募基金管理人相关资质等原因导致职责终止且管理人未按合同约定履行义务组织清算的情形，基金份额持有人会议须做出本基金财产处置方案、基金清算方案等方案。

2、 基金份额持有人所持每份基金份额享有一票表决权。

3、 基金份额持有人大会决议（包括变更基金管理人的基金份额持有人大会决议）须经出席会议的基金份额持有人所持表决权的 2/3 以上通过方为有效。

4、 基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

（八） 基金份额持有人大会决议的效力

基金管理人召集的基金份额持有人大会决议，自基金份额持有人大会通过并由基金份额持有人签署后生效，并自生效之日起对全体基金份额持有人、基金管理人均有约束力。

基金份额持有人大会日常机构召集或代表基金份额百分之二十（含）以上的基金份额持有人就同一事项召集的基金份额持有人大会决议自通过生效之日起，对全体基金份额持有人有约束力；该等决议内容通知至基金管理人之日起，对基金管理人具有约束力。

（九） 基金份额持有人大会决议的披露

基金份额持有人大会决定的事项，应通过书面通知、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。

（十） 基金份额持有人不同意基金份额持有人大会决议的，基金管理人应在决议函（或通知）指定的期限内增设临时赎回开放日，允许不同意决议的基金份额持有人赎回本基金；基金份额持有人未在指定的期限内申请赎回本基金的，视为基金份额持有人同意基金份额持有人大会决议。法律法规、中国证监会、中国证券投资基金业协会或本合同另有规定的除外。

因基金管理人被基金业协会公告失联超过 20 个工作日或私募基金管理人依法解散、被依法撤销、被依法宣告破产、被依法取消私募基金管理人相关资质等原因导致职责终止的，基金份额持有人会议做出本基金财产处置方案、基金清算方案的情形不适用本款约定。

(十一) 本基金存续期间，上述关于基金份额持有人大会召开事由、召集、召开条件、议事程序、表决条件、决议的效力、决议的披露等规定，凡是直接引用法律法规或监管部门规定的部分，如将来法律法规或监管部门的规定修改导致相关内容被取消或变更，或者相关部分与届时有效的法律法规或监管部门的规定相冲突，则基金管理人经与基金托管人协商一致并提前通知后，可直接对本部分的相关内容进行修改和调整，无需召开基金份额持有人大会审议。

(十二) 基金份额持有人大会及其日常机构不得直接参与或者干涉基金的投资管理活动，但出现私募基金管理人被基金业协会公告失联超过 20 个工作日或私募基金管理人依法解散、被依法撤销、被依法宣告破产、被依法取消私募基金管理人相关资质等原因导致职责终止的情形时，可由份额持有人大会对基金财产处置进行决议。

十、 私募基金份额的登记

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

- 1、 配备足够的专业人员办理本基金份额的登记业务；
- 2、 严格按照法律法规和本合同规定的条件办理本基金份额的登记业务；
- 3、 保存基金份额持有人名册及相关的认购、申购与赎回等业务记录 20 年以上；
- 4、 对基金份额持有人的基金账户信息负有保密义务，因违反该保密义务对投资者或基金带来的损失，须承担相应的赔偿责任，但司法强制检查情形及法律法规及中国证监会规定的和本合同约定的其他情形除外；
- 5、 法律法规及中国证监会规定的和本合同约定的其他义务。

(二) 基金管理人委托国金道富投资服务有限公司办理本基金的注册登记业务，但基金管理人依法应承担的注册登记职责不因委托而免除。

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

(四) 基金管理人授权份额登记机构将基金份额登记信息提供给基金托管人。

十一、 私募基金的投資

(一) 投資範圍：

本基金允許投資的金融工具包括：

1. 固定收益類資產：現金、銀行存款（包括定期存款、協議存款和其他銀行存款）、貨幣市場基金、交易所債券通用質押式逆回購、債券型公募基金；
2. 期貨和衍生品類資產：國內交易所上市交易的期貨、交易所上市標準化期權合約；
3. 權益類資產：國內交易所發行上市的股票（含新股申購及定增）、港股通標的範圍內的股票、存托憑證、股票型公募基金；

本基金投資的產品的基金管理人或投資顧問（如有）為私募基金管理人的，基金管理人承諾不進行任何利益輸送的行為；在持有上述產品期間，上述產品的交易文件有任何變更的，基金管理人應保證該變更的行為不得損害本基金投資者實際利益；在持有上述產品期間，基金管理人對上述產品不得進行抵押、質押、非交易過戶或其他任何有損本基金投資者利益的行為。

本合約對擬投資標的的進行穿透約定的（例如投資某基金，對該基金的投向或如何運作進行約定），以該投資標的的交易/法定文件的具体約定為準，但私募基金管理人仍應確保本基金合同中穿透約定內容的真實性、準確性和完整性。私募基金管理人負責審查本合約穿透約定與該投資標的的交易/法定文件的具体約定是否一致。私募基金託管人僅根據投資劃款指令進行劃款，不負有審核上述事項的義務，不承擔由此導致的損失。

基金管理人在滿足法律法規和監管部門要求並為行政服務機構和基金託管人相關系統準備留出必要的調整時間後，可以按照本合約“私募基金合約的效力、變更、解除與終止”章節中約定的合同變更相關程序進行合同變更後調整投資範圍。除本合約另有約定外，如管理人对投資範圍進行調整，需提前取得全體基金份額持有人的一致同意，並按“私募基金合約的效力、變更、解除與終止”章節的約定變更基金合約。對於不同意變更投資範圍的基金份額持有人，管理人應設置臨時開放口以保障該基金份額持有人退出本基金的權利。

(二) 投資目標：本基金在深入研究的基礎上構建投資組合，在嚴格控制投資風險的前提下，力求獲得長期穩定的投資回報。

(三) 投資策略：

本基金為 A500 策略，以跟蹤對標中證 A500 指數(000510)並獲得收益作為主要投資目的，選股池為全市場符合交易標準的股票，採用多因子和機器學習相結合的投資體系，將傳

统的基本面、分析师一致预期、盈利预测，以及前沿的舆情、新闻、高频量价数据进行线性和非线性的因子组合，并通过自研组合优化器严格控制投资组合在风险、行业上的暴露、波动率以及跟踪误差。再由数十个差异化、低相关性的子策略叠加，力求整合出可以超越对标指数表现的股票组合，同时通过分散化持仓，降低投资组合的回撤风险。

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

其他策略：识别具有良好发展前景的行业，并自下而上挖掘各类优质金融资产，构建各类金融资产投资组合。

上述策略为本基金的主要投资策略，根据市场机会的把握，本基金管理人可同时使用上述策略，也可能只使用上述其中一个策略。需要说明的是，上述策略描述中涉及的策略并非为投资策略的全部，仅为本基金投资策略中的部分可选策略。

以上内容不构成对于本基金投资范围、投资限制或其他风险控制措施的补充。本基金投资策略由私募基金管理人制定，具体实施过程由基金管理人自行把握和监控，基金托管人不负责监控。

(四) 投资限制

本基金财产的投资组合应遵循以下限制（本基金自清算之日起无需遵循以下投资比例限制）：

- 1、 本基金不得投向未经金融机构（商业银行、证券公司）托管或保管的资管产品；
- 2、 本基金不得投资未在中国基金业协会备案的合伙企业份额；
- 3、 （1）本基金直接投向 AA 级及以下信用债（可转债除外）、流动性受限资产合计不得超过基金净资产的 20%；（2）本基金总资产占净资产的比例不得超过 200%；
- 4、 本基金直接投资于同一资产的资金（按成本与市值孰低法计算）不得超过基金净资产的 25%，银行活期存款、国债、债券通用质押式回购、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券、公开募集基金等中国证监会、协会认可的投资品种除外；
- 5、 同一私募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（按成本与市值孰低法计算）不得超过该资产的 25%，银行活期存款、国债、债券通用质押式回购、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券、公开募集基金等中国证监会、协会认可的投资品种除外。本条投资限制条款由私募基金管理人自行监控；
- 6、 本基金直接投资于股票等权益类资产的比例不低于基金已投资资产的 80%；已投资资产

不包含现金管理工具；

7、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%，中国证监会、协会另有规定的除外。本条投资限制条款由私募基金管理人自行监控，私募基金托管人不进行投资监督。

以上投资限制中，如涉及新股新债申购的申报金额与数量、盘中监控、交易策略类等监控事项的，由私募基金管理人自行监控，私募基金托管人不进行投资监督。

除本合同另有约定外，如管理人需对投资比例限制进行调整的，则需提前取得全体基金份额持有人的一致同意，并按“私募基金合同的效力、变更、解除与终止”章节的约定变更基金合同。对于不同意变更投资比例限制的基金份额持有人，管理人应设置临时开放日以保障该基金份额持有人退出本基金的权利。

由于包括但不限于证券、期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动等私募基金管理人之外的原因致使基金投资比例不符合本合同约定的投资限制，为被动超标，私募基金管理人应在 20 个交易日内调整完毕。如因证券停牌、资产流动性受限或其他非私募基金管理人可以控制的原因导致私募基金管理人不能履行调整义务的，经书面通知私募基金托管人后，则调整期限相应顺延。私募基金管理人应当自流动性受限资产可出售、可转让或者恢复交易的 20 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 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。

托管人对基金管理人的投资行为行使投资监督权，托管人仅依据本基金合同“越权交易”章节约定对本基金合同“附件二：投资监督事项表”中明确约定的投资范围、投资限制及投资比例进行监督。

(五) 投资禁止行为

本基金财产禁止从事下列行为：

- 1、违反规定向他人贷款或提供担保；
- 2、从事承担无限责任的投资；
- 3、从事内幕交易、操纵证券价格、不正当关联交易及其他不正当的证券交易活动；
- 4、法律法规、中国证监会以及本合同规定禁止从事的其他行为。

(六) 关于嵌套规则的特殊约定

私募基金管理人应当按照法律、行政法规、中国证监会及协会规定的投资层级要求，自

行控制本基金嵌套层级不得超过一层,符合中国证监会出台的母基金规则条件的产品可以豁免一层嵌套。后续法律、行政法规、中国证监会及协会规定的投资层级要求有变化的,管理人与托管人可以协商一致后以公告形式对合同条款进行调整。**因违规嵌套产生的责任由基金管理人承担。**

(七) 关联交易

1、关联交易的识别认定:基金关联交易是指本私募投资基金与管理人、投资者、管理人管理的私募投资基金、同一实际控制人下的其他管理人管理的私募投资基金、或者与上述主体有其他重大利害关系的关联方发生的交易行为。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。

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和平等自愿、等价有偿的原则,建立有效的关联交易风险控制机制。

2、关联交易的定价确认:关联交易应遵循平等自愿、等价有偿的原则,关联交易的价格或取费原则上不偏离市场独立第三方的标准(含市场公允价或第三方机构评估价等);对于难以比较市场价格或定价受到限制的关联交易,根据公平善意的原则,结合关联交易类型、标的情况、交易相对方等综合因素确定价格。

3、关联交易的交易决策:基金管理人进行关联交易的,应当由管理人投资交易相关部门发起内部审批流程,提交管理人合规风控部门进行关联交易审查。审查部门应当按照适用法律规定、相关监管机构要求及管理人内部控制制度的规定,判断该等关联交易事项是否符合规定,确保按照市场公开合理价格执行。

4、关联交易的回避机制:在进行投资决策以及审查过程中,关联方不得以任何方式干预基金管理人投资决策,如相关决策、审核人员为相关交易的关联人或与相关交易存在利害关系的,应当予以回避。

5、关联交易的信息披露:若私募基金在存续过程中涉及以上关联交易的,管理人应当根据相关规定向投资者进行信息披露,并主动提前通知托管人。管理人应当及时对所涉及关联交易进行事前、事中信息披露,披露和通知内容包括但不限于关联交易的交易对手(如有)、投资标的、投资金额、交易时间等,披露和通知频率按关联交易实际发生频率。上述关联交易决策以及披露机制由基金管理人负责执行,基金托管人对此不负有监督义务。

合同各方确认，基金托管人不对关联交易的限制承担投资监督职责，不对关联交易是否存在利益输送、不公平交易等情形承担监督职责。基金管理人违反基金合同关于关联交易的约定或者存在利益输送、不公平交易等情形的，相关责任和损失由基金管理人承担，基金托管人不承担任何责任。

基金投资者签署本合同即表明其已经知晓本基金将可能进行上述关联交易。私募基金投资者不得因本基金进行上述关联交易或投资收益劣于基金管理人、基金托管人及其关联方管理的其他类似投资产品，而向基金管理人或基金托管人提出任何损失或损害补偿的要求。

(八) 预警止损机制

本基金不设置预警线和止损线。

(九) 本基金投资非证券交易所或期货交易所发行、上市的投资标的时，基金份额持有人在此授权并同意：基金管理人有权代表本基金与相关方签署基金投资相关文件及协议，并以基金管理人的名义办理相关权属登记及变更手续。但基金管理人应确保向投资相关方说明真实的资金来源为本基金，并保证将投资款项及收益及时返回至本基金托管资金账户。

(十) 风险收益特征

基于本基金的投资范围及投资策略，本基金不承诺保本及最低收益，属预期风险【R4】的投资品种，适合具有【C4、C5】风险识别、评估、承受能力的合格投资者。

(十一) 业绩比较基准

本基金无业绩比较基准。

(十二) 投资经理：

本基金的基金经理已取得基金从业资格并在中国基金业协会完成注册。

姓名：杨成义

简介：杨成义，毕业于东北财经大学，经济学硕士，清华大学特聘教授。先后就职于君安证券、华夏证券和大通证券从事投资管理业务。

姓名：刘玉琛

简介：美国新常春藤金融工程硕士，曾就职于华尔街量化基金 GSA Capital Partners 从事美股日频量化研究，回国后曾在百亿量化私募和自营团队等机构担任基金经理、投研总监，擅长市场中性、量化选股、指数增强、股票多空等量化策略，有累计多年的国内外股票量化产品全流程实盘投资管理及量化团队搭建经验。

基金管理人可根据业务需要自行决定更换投资经理，在变更后三个工作日通过约定的方

式向基金份额持有人进行公告，并按相关监管要求及时进行信息披露和报送。对于不同意投资经理变更的基金份额持有人，管理人应设置临时开放日允许投资者赎回。

(十三) 投资顾问的聘任

本基金暂不聘请投资顾问。

十二、 私募基金的财产

(一) 基金财产的保管与处分

1、 基金财产独立于基金管理人、基金托管人的固有财产，并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人不得将基金财产归入其固有财产。基金托管人对实际交付并控制下的基金财产承担保管职责，对于非基金托管人保管的财产不承担责任。

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

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

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

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

6、 托管期间，如相关监管机构或法规对基金财产的保管事宜另有规定的，从其规定。

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

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，到账日基金资产没有到达基金托管人账户的，由此给基金造成损失的，基金管理人应负责向有关当事人追偿基金的损失，基金托管人对此不承担任何责任。

(二) 基金财产相关账户的开立和管理

1、 托管账户的开设和管理

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

(2) 基金托管人以基金的名义在商业银行代理开设托管账户,保管基金的银行存款。该账户的开设和管理由基金托管人负责,该账户的银行预留印鉴(如有)由基金托管人刻制、保管并使用。本基金的一切货币收支活动,包括但不限于投资、支付赎回金额、支付基金收益、收取申购款,均需通过该账户进行。管理人在确定托管账户名称时应考虑满足三方存管、银行间市场开户要求等需要。

(3) 托管账户的开立和使用,限于满足开展托管业务的需要。基金托管人和基金管理人不得假借本基金的名义开立其他任何银行账户;亦不得使用本基金的任何银行账户进行本基金业务以外的活动——特别地,为避免托管账户被银行置为久悬账户而使托管账户被冻结和限制使用,托管人可以根据实际情况自行从其公司财务账户临时划拨不超过 100 元的小额资金至托管账户以保障托管账户的正常可使用状态,该笔小额资金在划付至托管账户的当日同时由托管人自行按原路返回进行反向划付。托管人基于前述情况下的小额资金划付而发生的托管账户相关的银行汇划费用由基金财产承担,管理人无需另行出具划付指令。同时,因该类小额资金划付对基金现金头寸的影响,托管人无需承担任何责任。

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

2、 基金的证券账户和证券交易资金账户的开设和管理(如有)

(1) 基金托管人应当在中国证券登记结算有限责任公司开设证券账户,用于本基金证券投资的清算和存管,基金管理人应当在开户过程中给予必要的配合,并提供所需资料。证券账户的持有人名称应当符合证券登记结算机构的有关规定。

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

(3) 本基金证券账户的开立由基金托管人负责,证券账户的保管由基金托管人负责,相关账户的管理和使用由管理人负责。

(4) 基金管理人负责以基金名义在证券经纪商的营业网点开立证券交易资金账户,并按照证券经纪商营业网点开户的流程和要求,签订相关的协议,并办理三方存管,在基金运

作期间，未经托管人书面同意，管理人不得变更证券资金账户与托管账户之间的第三方存管签约关系，亦不得注销证券交易资金账户。基金托管人应根据基金管理人或其委托的第三方的指令，进行银证转账的操作。**因基金管理人自行进行银证转账等业务操作导致的一切后果，均由基金管理人自行承担，与基金托管人无关。**

3、 期货账户的开立和管理（如有）

基金管理人应为本基金在期货公司开立期货资金账户，用于存放本基金期货保证金，期货公司为本基金申请期货交易编码。基金管理人在办理期货保证金账户开户、申请交易编码、银期转账开通手续时，应将在托管人开立的期货保证金银行结算专户即托管账户指定为本基金期货资产账户对应的唯一银行结算账户，未经基金托管人书面同意，基金管理人不得变更本基金期货保证金账户对应的银行结算账户。

基金托管人负责期货保证金银行结算专户的管理和资金划拨工作。基金托管人依据基金管理人或其委托的第三方的指令负责办理托管账户与期货资金账户之间的银期转账。**因基金管理人自行进行银期转账等业务操作导致的一切后果，均由基金管理人自行承担，与基金托管人无关。**

4、 基金账户的开设和管理（如有）

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

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

（3）基金账户和基金交易账户的管理和使用由管理人负责。

5、 债券托管专户的开设和管理（如有）

基金合同生效后，基金管理人和基金托管人相互配合，根据中国人民银行及中央国债登记结算有限责任公司、银行间清算所股份有限公司的有关规定，在债券登记结算机构开立债券托管账户，并代表基金财产进行银行间市场债券的结算。管理人负责基金财产在银行间市场的债券交易，托管人负责银行间债券交割与资金划拨。

6、 其他账户的开设和管理

因业务发展而需要开立的其他账户，应由基金托管人或基金管理人根据有关法律法规的规定开立、管理和使用。如该账户是由基金管理人负责开立的，基金管理人开立此账户后需及时通知托管人，且应保证该账户专款专用。相应的投资回款及收益，也由基金管理人负

责及时原路划回托管资金账户。对于非由基金托管人开立、管理并实际控制的账户，基金托管人不承担保管职责。

（三）与基金财产有关的重大合同的保管

由基金管理人代表基金签署的与基金有关的重大合同的原件分别由基金托管人、基金管理人保管。对于无法取得二份以上的正本的，基金管理人应向基金托管人提供加盖公章或授权业务章的合同复印件或原件的扫描件，未经双方协商或未在合同约定范围内，合同原件不得转移。

因基金管理人未按本协议约定及时向基金托管人移交重大合同原件或复印件导致的法律责任，由基金管理人自行承担。

十三、指令的发送、确认与执行

除非合同另有除外规定，对于本章节所约定的所有内容包括但不限于本章“（一）发送指令人员的书面授权”、“（三）指令的发送、确认和执行的时间及程序”等，基金管理人全权委托行政服务机构代为执行相关操作，行使相应权利，履行相应义务，并承担行政服务机构行为所带来的法律后果。行政服务机构与私募基金托管人依据本章节约定所发生的各项业务对接，均视同私募基金托管人与私募基金管理人直接进行的业务对接，具有同等法律效力。基金托管人依照法律和合同执行行政服务机构发送的指令视同执行基金管理人发送的指令，私募基金托管人不对此产生的法律后果承担任何责任。当私募基金管理人需要变更对行政服务机构的委托授权内容或撤销对行政服务机构的委托授权时，可以在与托管人协商一致后以出具公告函的形式相应变更委托授权内容等。当出现委托授权内容变更或撤销对行政服务机构的委托授权时，本章下文中第（一）至第（六）款内容中涉及的由行政服务机构承担的职责或工作相应进行变更。如后续管理人撤销对行政服务机构的委托授权并由基金管理人直接通过基金托管人电子服务平台发送电子指令的，基金管理人应向基金托管人提供授权文件等相关材料，由基金托管人为基金管理人的被授权人在电子服务平台配置相关操作权限。

（一）发送指令人员的书面授权

行政服务机构向托管人提供资金划拨的预留印鉴、授权书签字样本以及资金划拨授权书（简称“授权书”）。授权书由行政服务机构加盖国金道富投资服务有限公司清算业务专用章。

（二）指令的内容

指令是在管理基金财产时，基金管理人向基金托管人发出的资金划拨及其他款项支付的指令。基金管理人发给基金托管人的指令应写明款项事由、指令的执行时间、金额、收款账户信息等。如提交纸质指令，需加盖预留印鉴并由被授权人签字或签章。

当本基金进行场外投资，基金管理人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，基金管理人应向基金托管人提供以下资料：

- (1) 基金投资交易相关文件（当事人签署版）；
- (2) 收款账户证明文件；
- (3) 私募基金托管人认为必要的投资划款相关支持性文件。

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。**如果基金管理人无法提供上述文件的，基金托管人有权拒绝执行投资划款指令，由此造成的损失由基金管理人负责并承担。**

(三) 指令的发送、确认和执行的时间及程序

指令由授权书确定的被授权人代表基金管理人用传真、邮件、数据接口、电子平台或其他经基金托管人认可的方式向基金托管人发送。指令以基金托管人成功接收指令之时视为送达。

对于基金托管人收到的行政服务机构发送的划款指令，基金管理人不得否认其效力。基金管理人应按照相关法律法规以及本合同的规定，在其合法的经营权限和交易权限内发送划款指令，发送人应按照其授权权限发送划款指令。基金管理人在发送指令时，应为基金托管人留出执行指令所必需的时间。由基金管理人原因造成的指令传输不及时、未能留出足够划款所需时间，致使资金未能及时到账所造成的损失由基金管理人承担。为保证基金托管账户所在银行有足够存款头寸可以满足款项划付，管理人应于转账日前一天 17 点以前，将次日转款金额预估通知基金托管人，并由基金托管人向银行及时预报资金头寸。除需考虑资金在途时间外，基金管理人还需为基金托管人留有 2 小时的复核和审批时间。在每个工作日的 13:00 以后接收基金管理人发出的银证转账、银期转账划款指令的，基金托管人不保证当日完成划转流程；在每个工作日的 14:30 以后接收基金管理人发出的其他划款指令，基金托管人不保证当日完成在银行的划付流程。

基金托管人收到基金管理人发送的指令后，应对划款指令进行形式审查。对于管理人直接通过托管人电子服务平台发送的电子划款指令，基金托管人应审核划款指令必要要素是否齐备即电子指令是否已注明款项事由、指令的执行时间、金额、收款账户信息等。在进行场外投资时，管理人在发送电子划款指令的同时需发送加盖预留印鉴和被授权人签字或签章的

纸质指令扫描件作为附件。基金管理人应确保电子指令与签章版纸质指令扫描件的一致性。如不一致，基金托管人有权拒绝执行，但因不一致所造成的损失由管理人自行承担。

基金管理人以邮件、传真、数据接口等电子指令以外其他方式发送的划款指令的，基金管理人需要在划款指令上加盖预留印鉴并由被授权人签字或签章。基金托管人应验证指令的书面要素是否齐全、审核印鉴和签名是否和预留印鉴和签名样本相符，复核无误后依据本合同约定在规定期限内及时执行，不得延误。

若存在异议或不符，基金托管人立即与基金管理人指定人员进行电话沟通和联系，并要求基金管理人重新发送经修改的指令。基金托管人可以要求基金管理人传真提供相关交易凭证、合同或其他有效会计资料，以确保基金托管人有足够的资料来判断指令的有效性。私募基金管理人应将银行间市场成交单加盖印章后提供给私募基金托管人。**基金托管人仅对基金管理人发送指令进行表面相符性的形式审查，对其真实性不承担责任。基金托管人不负责审查基金管理人发送指令时提交的其他文件资料的合法性、真实性、完整性和有效性，基金管理人应保证上述文件资料合法、真实、完整和有效。如因基金管理人提供的上述文件不合法、不真实、不完整或失去效力而影响基金托管人的审核或给任何第三人带来损失，基金托管人不承担任何形式的责任。**

基金托管人仅根据基金管理人发送的符合本合同约定的划款指令及投资主协议进行资金划付。其他与该投资相关的从协议或与履约保障有关的协议或决议（以下简称“从协议”，包括但不限于：股东会决议、担保协议、保证协议、抵押协议等协议）的签订及生效属于基金管理人的投资管理职责，由基金管理人自行控制，基金托管人对此不承担复核与监督责任，亦不构成基金托管人执行基金管理人划款指令的必要前提条件。投资者签署本基金合同即视为已了解相关风险并同意上述安排。

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

（四）基金托管人依照法律法规暂缓、拒绝执行指令的情形和处理程序

基金托管人发现基金管理人发送的指令违反《基金法》、本合同或其他有关法律法规的规定时，不予执行，并应及时以书面形式通知基金管理人纠正。基金管理人收到通知后应及时核对，并以书面形式对基金托管人发出回函确认，由此造成的损失由基金管理人承担。划款指令违反法律规定或本合同约定造成基金财产损失的，由基金管理人承担全部责任，基金托管人不承担责任。

(五) 基金管理人发送错误指令的情形和处理程序

基金管理人发送错误指令的情形包括指令发送人员无权或超越权限发送指令及交割信息错误,指令中重要信息模糊不清或不全等。基金托管人在履行监督职能时,发现基金管理人的指令错误时,有权拒绝执行,并及时通知基金管理人改正。

(六) 更换被授权人的程序

行政服务机构撤换被授权人或改变被授权人的权限,必须提前至少两个工作日,使用邮件、传真或其他基金管理人和基金托管人认可的方式向基金管理人和基金托管人发出被授权人变更通知并预留新的被授权人的印鉴或签字样本。被授权人变更通知由行政服务机构加盖国金道富投资服务有限公司清算业务专用章。基金托管人在收到被授权人变更通知的两个工作日内向行政服务机构确认。被授权人变更通知还须载明授权变更生效日期,被授权人变更通知自载明的生效日期开始生效。基金托管人收到被授权人变更通知的日期晚于载明生效日期的,则自基金托管人收到被授权人变更通知时生效。基金管理人对于行政服务机构的被授权人变更通知有异议的,应在被授权人变更通知载明的生效日期前一个工作日向基金托管人发出书面异议。被授权人变更通知载明的生效日期前一个工作日,基金管理人未向基金托管人提出书面异议的,视为基金管理人同意该被授权人变更通知,并自愿承担该授权人变更通知所带来的法律后果。(基金托管人唯一指定接收基金管理人书面异议的邮箱地址为:

zctghk@gjq.com.cn)

(七) 指令的保管

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

指令若以邮件形式发出,则正本由基金管理人保管,基金托管人保管指令扫描件。当两者不一致时,以基金托管人收到的划款指令邮件扫描件为准。

指令若以数据接口方式发出的,则正本由基金管理人保管,基金托管人保管电子指令。当两者不一致时,以基金托管人收到的电子指令为准。

指令若通过托管人电子服务平台发出的,则划款指令以托管人系统保管的电子数据为准。

(八) 相关责任

基金托管人正确执行基金管理人符合本合同规定、合法合规的划款指令,基金财产发生损失的,基金托管人不承担任何形式的责任。基金管理人若未及时将基金合同和托管协议(如有)签署完成并回寄给基金托管人,基金托管人有权暂停托管户划款,基金托管人

不承担与此相关的任何责任。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，但托管账户及其他账户余额不足或基金托管人如遇到不可抗力情况除外。

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

十四、 交易及清算交收安排

（一）选择证券经纪机构的程序（如有）

基金管理人负责选择代理本基金财产证券买卖的证券经纪机构，并与其签订证券经纪合同，基金管理人、基金托管人和证券经纪机构可就基金参与证券交易的具体事项另行签订协议。

基金管理人应及时将本基金财产证券交易单元号、佣金费率等基本信息以及变更情况及时以书面形式通知基金托管人和行政服务机构。如管理人未及时告知，基金托管人和行政服务机构将以证券经纪机构提供交易数据和对账单为准进行估值，由此产生的相关责任由管理人承担。

（二）证券经纪机构负责的清算交收安排（如有）

1、本基金通过证券经纪机构进行的场内或场外交易由证券经纪机构作为结算参与人代理本基金进行结算，本基金其他证券交易由基金托管人或相关机构负责结算。

2、 证券交易所证券资金结算

基金托管人、基金管理人应共同遵守中国证券登记结算有限责任公司（简称“中登公司”）制定的相关业务规则 and 规定，该等规则和规定自动成为本条款约定的内容。

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

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

3、基金管理人通过在证券经纪机构开立的证券资金账户直接进行场外投资的,由证券经纪机构作为结算参与人代理本基金进行结算,并承担由证券经纪机构原因造成的正常结算、交收业务无法完成的责任;若由于基金管理人原因造成的正常结算业务无法完成,责任由基金管理人承担。基金管理人应当保证证券经纪机构向基金托管人发送场外投资信息及资金清算信息的真实性、准确性、完整性和及时性。

4、管理人如投资交易港股通,应在每个经纪商进行首次交易的当日(T日),最迟不晚于T+1日书面通知托管人及基金行政服务机构。对于管理人未及时书面通知而造成的影响或后果(包括但不限于基金账务核算的追溯调整、申赎交易确认结果的调整、基金的信批结果调整等),均由管理人自行承担全部相关风险和责任,托管人及基金行政服务机构不承担责任。

5、对于任何原因发生的证券资金交收违约事件,相关各方应当及时协商解决。

(三) 基金托管人负责的场外资金的清算交收安排(如有)

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

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

3、在资金头寸充足的情况下,在正常业务受理渠道和时间内,基金托管人对基金管理人符合法律法规及本合同规定的指令不得拖延或拒绝执行,如由于基金托管人的过错导致基金无法按时支付清算款,由此造成的损失由基金托管人承担,但托管账户余额不足或基金托管人遇不可抗力的情况除外。

(四) 资金、证券账目及交易记录的核对

基金管理人或其委托的行政服务机构和基金托管人定期对资产的资金、证券账目、实物券账目、交易记录进行核对。

(五) 选择期货经纪机构及期货投资资金清算安排(如有)

本基金投资于期货前,基金管理人负责选择为本基金提供期货交易服务的期货经纪公司,并与其签订期货经纪合同。基金管理人、基金托管人和期货公司可就基金参与期货交易的具体事项另行签订协议。

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

十五、越权交易

（一）越权交易的界定

越权交易是指基金管理人违反有关法律法规及本合同的规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。

基金管理人应在本合同规定的权限内运用基金资产进行投资管理，不得违反本合同的约定，超越权限从事投资。

（二）对越权交易的处理程序

- 1、违反本合同投资范围和投资比例限制规定进行的投资交易行为

基金托管人在行使监督职责时，发现基金管理人的划款指令违反本合同约定的，应当拒绝执行，立即通知基金管理人，并有权依据相关法律法规的要求报告中国证监会或基金业协会。

基金托管人在行使监督职责时，发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反本合同约定的，应立即通知基金管理人，并有权依据相关法律法规的要求报告中国证监会或基金业协会。因执行该指令造成的损失基金托管人不承担任何责任。

基金管理人应向基金托管人主动报告越权交易。基金托管人有权督促基金管理人在限期内改正并在该限期内对通知事项进行复查。基金管理人对于基金托管人通知的越权事项未能在限期内纠正的，基金托管人有权依据相关法律法规的要求报告中国证监会或基金业协会。

- 2、法律法规禁止的超买、超卖行为

基金托管人在行使监督职能时，如果发现基金资产投资过程中出现超买或超卖现象，应立即提醒基金管理人，由此给基金资产造成的损失由基金管理人承担，基金托管人不承担任何责任。如果因基金管理人原因发生交易所场内超买行为，必须于下一交易日上午 10:00 点之前完成融资，保证完成清算交收。

- 3、越权交易所发生的损失及相关交易费用由管理人负担，所发生的收益归基金资产

所有。

(三) 基金托管人对基金管理人投资运作的监督

1、 基金托管人对基金管理人的投资行为行使监督权。基金托管人仅以《投资监督事项表》为限进行投资监督，对基金管理人的其他职责和行为不进行投资监督。

2、 基金托管人对基金财产的监督和检查自本基金成立之日起开始，至本基金清算之日起终止监督。

3、 本基金进入清算程序后，私募基金管理人有权对基金财产所投资证券进行变现，由此造成投资比例等不符合投资政策规定的，不属于越权交易。

4、 经基金份额持有人、基金托管人及基金管理人协商一致，可就投资范围和投资限制等投资政策做出调整进行变更，相关变更应为投资监督流程以及行政服务机构的估值调整留出充足的时间。

5、 私募基金托管人投资监督工作的真实性、准确性、及时性和完整性受限于私募基金管理人、证券经纪商、期货经纪商及其他机构提供的数据、信息以及基金估值结果的真实性、准确性、及时性和完整性。私募基金托管人对上述机构提供的数据、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。因上述机构提供的数据和信息错误、遗漏或延迟以及其他非因私募基金托管人原因导致基金估值结果不真实、不准确、不及时或不完整并进而影响私募基金托管人投资监督工作的真实性、准确性、及时性和完整性的，私募基金托管人不承担任何责任。

6、 私募基金托管人无投资责任，对私募基金管理人的任何投资行为（包括但不限于其投资策略及决定）或其投资回报或由于基金产品设计缺陷或越权交易造成的任何损失不承担任何责任。私募基金托管人不对私募基金管理人的行为承担任何补充或连带责任。私募基金托管人不会因为提供投资监督报告而承担任何因私募基金管理人违规投资所产生的有关责任，也没有义务去采取任何手段回应任何与投资监督报告有关的信息和报道。

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

8、 基金管理人运用私募基金财产投资标的资产，由于“标的资产的公允价格未能及时提供，待提供时如导致基金跌破预警线或止损线（如有）”或“非托管人因素导致的估值延误，进而影响投资监督及时性或准确性的”，基金托管人不对“未及时或未准确履行

投资监督职责以及进行相关投资监督提示而导致的任何风险”承担责任。

9、基金管理人通过在证券经纪机构开立的证券资金账户直接进行的场外投资应当符合基金的投资范围、投资比例、投资限制。经合同各方当事人协商一致，基金托管人有权但无义务对于上述场外投资进行投资监督，基金托管人无需因未进行上述投资的投资监督而承担任何责任。

(四) 通知与送达

以上基金托管人对基金管理人的通知，可采用电子邮件或双方约定的其他方式（包括但不限于电话、函件、传真、短信等方式）。

基金管理人接收投资监督通知的具体联系方式（包括但不限于联系人姓名、电子邮箱及电话号码）由基金管理人在本基金成立之前提供给基金托管人。

发送电子邮件的，邮件发送至指定电子邮箱即为送达；如因邮箱原因（包括但不限于变更或注销等）导致发送失败的，邮箱发送之时视为送达。

基金管理人承诺，变更上述接收投资监督通知联系方式的，应当提前三个工作日书面通知基金托管人，基金托管人接收管理人联系方式变更的专用邮箱为：zctgtj@gjq.com.cn，基金管理人在发送变更邮件后应通过电话告知这一变更。在基金托管人收到变更通知前，按照原送达地址进行送达仍然视为有效送达。

十六、 私募基金财产的估值和会计核算

行政服务机构国金道富投资服务有限公司接受基金管理人委托，根据与基金管理人签署的委托服务协议及行政管理服务确认函履行约定的“私募基金财产的估值和会计核算”职责及其他相关职责。基金管理人与基金托管人确认，私募基金托管人与行政服务机构进行的业务对接、业务商讨及业务核对等均视为与基金管理人进行业务对接、业务商讨及业务核对等同等等的效力。

(一) 基金财产的估值

1、 基金资产总值

基金资产总值是指其所购买的各类证券、银行存款及利息、基金各项应收款以及其他资产的价值总和。

2、 基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的净额。本基金资产净值保留小数点后 2 位，小数点后第 3 位四舍五入。

3、 基金份额净值

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。本基金份额净值保留到小数点后【3】位，小数点后第【4】位四舍五入。

4、 估值目的

基金财产估值目的是客观、准确地反映基金财产的价值，并为基金份额申购、赎回提供计价依据。

5、 估值时间

自本基金成立后第二个交易日起，基金管理人与基金托管人在每个交易日对前一交易日的基金财产进行估值并完成估值核对。

对于非托管人原因造成的估值核对时效延误，托管人不承担与延误相关的责任。

6、 估值依据

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

7、 估值对象

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

8、 估值方法

本基金按以下方式进行估值：

1、 证券交易所上市的有价证券的估值

A、交易所上市的有价证券（包括股票、权证、存托凭证等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，以最近一个交易日的市价（收盘价）估值。港股通的汇率使用沪深交易所公布的港币对人民币汇率中间价。如估值日为沪深交易所节假日且香港交易所交易日的，取沪深交易所公布的最近交易日的汇率，如有调整，由基金管理人与基金托管人另行协商约定。

B、交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（除可转换债券外），按估值日第三方估值机构（此处指中证指数有限公司）提供的相应品种当日的估值全价进行估值。如固定收益品种实行全价交易的（除可转换债券外），按估值日第三方估值机构（此处指中证指数有限公司）提供的唯一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；第三方估值机构未提供价格的，按投资成本核算。如管理人判断需采用估值技术确定公允价值

的，应及时将公允价值的计算依据、方法及结果通知托管人执行。

C、交易所上市可转换债券按估值日收盘价减去可转换债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日无交易的，按最近交易日可转换债券收盘价减去债券收盘价中所含截止最近交易日的债券应收利息得到的净价进行估值。

D、交易所未上市或未挂牌的固定收益品种、或不存在活跃市场的固定收益品种（包括但不限于资产支持证券、私募债等），主要采用第三方机构提供的估值价格，如第三方估值机构未提供价格的，按投资成本核算。如管理人判断需采用估值技术确定公允价值的，应及时将公允价值的计算依据、方法及结果通知托管人执行。

E、对于上述本款 A、C 项所述的证券交易所上市交易的有价证券，估值日无交易或停牌的，如基金管理人判断最近交易日后经济环境发生了重大变化，应参考监管机构和行业协会估值意见，或参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。基金管理人应及时将相关判断及确定公允价值的依据、方法及结果通知基金托管人执行。

F、证券交易所上市交易的有价证券发生摘牌、退市等情形，以其摘牌、退市前最后一次估值价格进行估值。如基金管理人判断需采用估值技术确定公允价值的，应及时将相关判断及确定公允价值的依据、方法及结果通知基金托管人执行。

采用上述方法进行估值核算处理后，基金托管人视为已经完全履行了基金合同约定的估值核算相关义务，并对此造成的基金财产和份额持有人的相关损益不承担责任。

(2) 处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

A、送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的估值方法估值；该日无交易的，以最近一个交易日的收盘价估值。

B、首次公开发行未上市的股票、债券、资产支持证券等，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值；

C、对于有明确锁定期或在发行时明确限售期的股票（不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限的股票），包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股票、首次公开发行网下配售限售期的股票、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，在获取确定的锁定期/限售期起始日前以证券交易所挂牌的同一股票的收盘价估值，该日无交易的，以最近交易日的收盘价估值；自获取确定的锁定期/限售期起始日起（含），按以下公式确定估值日该流通受限股的价值：

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

其中：

FV：估值日该流通受限股票的价值

S：估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值

LoMD：该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣——该流动性折扣由中央国债登记结算有限责任公司（简称“中债”）提供。当估值日中债未提供该流动性折扣时，则优先采用最近一次已提供的流动性折扣进行估值处理；如中债从未提供该流通受限股票的流动性折扣，则在中债提供流动性折扣前按估值日流通受限股票在证券交易所上市交易的同一股票的市价（收盘价）估值，如当日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值。如中债无法提供折扣数据，由管理人与托管人协商一致后，按最能反映公允价值的方法进行估值。

特别地，管理人需及时将锁定/限售情况书面明确通知基金行政服务机构和基金托管人。如基金管理人未及时告知或中债未提供限售文件信息的，则按照无流通受限股票的方法估值。因管理人未及时通知所产生的相关责任或损失，基金行政服务机构和基金托管人均免于承担责任。

（3）全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，主要采用第三方机构（此处指中央国债登记结算有限责任公司）提供的估值价格和估值技术。如第三方估值机构（此处指中央国债登记结算有限责任公司）不提供估值价的，按投资成本核算。如管理人判断需采用估值技术确定公允价值的，应及时将公允价值的计算依据、方法及结果通知托管人执行。采用上述方法进行估值核算处理后，基金托管人视为已经完全履行了基金合同约定的估值核算相关义务，并对由此造成的基金财产和基金持有人的相关损益不承担责任。

（4）对于含投资者回售权的固定收益品种，行使回售权的，在回售登记日至实际收款日期间选取第三方估值机构提供的相应品种的唯一估值价格或推荐估值价格估值，同时应充分考虑发行人的信用风险变化对公允价值的影响。回售登记期截止日（含当日）后未行使回售权的按照长待偿期所对应的价格进行估值。

（5）同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

（6）交易所上市流通的基金按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值。未在交易所上市流通的基金，按前一估值日份额净值估值，若无前一日份额净值，则按最近公布的基金份额净值估值。货币市场基金按成本估值，每日按前一交易日的万份收益计提红利。本基金产品投资场外开放式基金的，如管理人（或基金行政服务机构）在标的开放式基金权益确认日提供了权益确认原始凭证，则在确认日当天以原

始凭证为依据入账；如管理人（而非行政服务机构）无法在权益确认日提供上述标的基金的权益确认原始凭证，则在原始凭证提供日进行确认，且不对历史已核对确认账务追溯调整，管理人（而非行政服务机构）明确书面申请并愿意承担相关责任且经托管人同意的除外。

（7） 债券、回购等计息资产，按照约定利率在持有期内逐日计提应收利息，在利息到账日以实收利息入账，若有差异则于实收利息到账日计入损益。本基金开展债券质押式协议回购业务的，私募基金管理人应当在本基金下一估值日前将参与债券质押式协议回购业务的交易文件、交易对手方及质押标的等信息提供给私募基金托管人。

（8） 银行存款每日计提利息，计提的利息与实际收到存在差异则于实收利息到账日计入损益；证券、期货、期权资金账户内资金不计提利息，以实际结息数为准。

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

（10） 上海黄金交易所挂牌的贵金属现货实盘合约，以其估值日在上海黄金交易所挂牌的收盘价估值。若估值当日无收盘价的，以最近交易日收盘价估值。法律法规另有规定的，从其规定。

上海黄金交易所挂牌的贵金属现货延期和即期交收合约，以其估值日在上海黄金交易所挂牌的结算价估值。若估值当日无结算价的，以最近交易日结算价估值。法律法规另有规定的，从其规定。

（11） 对于场外期权、场外收益互换等场外衍生品交易（若有），其估值遵循如下原则和方法：

A、基金管理人在投资交易时，应授权交易对手方或指定第三方在基金下一个估值日前直接向基金托管人提供准确、完整的场外衍生品交易情况和交易文件；在合约到期结算时，应及时提供准确完整的到期结算单。

B、场外期权、场外收益互换根据交易对手方或指定第三方提供的估值基准日的合约盈亏估值结果或价值报告确认合约损益及保证金。如交易对手方或指定第三方从未提供合约盈亏估值结果或价值报告的，基金管理人需与交易对手方协商采用合适的估值技术确定其公允价值。

C、基金管理人需敦促交易对手方或指定第三方按照本合同约定的估值核对日提供合约价值报告等相关估值信息。基金管理人（而非行政服务机构）需确保其交易对手方或指定第三方机构提供的上述估值数据的准确、公允、完整。

D、基金托管人仅根据其收到的估值数据进行估值且对该等数据不负有任何复核、检验义务。因基金管理人未能及时提交真实、准确、完整的交易文件、结算清单或者交易对手方或指定第三方机构提供的估值数据的不准确、不公允、不完整或不及时导致估值暂停、申赎暂停或估值不准确的，由此产生的责任由基金管理人（非行政服务机构）承担，基金托管人不承担任何责任。

本合同一经签署即表明投资者已经知悉上述条款并接受此种情形下产生的流动性风险。

(12) 持有券商收益凭证，如收益凭证投资协议中有明确保本型且有预期或固定收益率的，按成本列示并每日加计应收利息（或应计收益）进行估值；如凭证发行方提供定期价值报告的，按其提供的最近一次定期价值报告估值；如没有预期或固定收益率且无法提供定期价值报告的，则根据投资双方关于本金和收益的结算条款，经管理人与托管人协商一致后，按最能反映公允价值的方法进行估值（包括按历史成本估值的情形）。

(13) 对于投资的证券公司资产管理计划、期货公司资产管理计划、商业银行理财产品、基金公司及其子公司资产管理计划、信托计划、私募证券投资基金产品，其估值时遵循如下原则和方法：

A、如管理人在上述标的产品权益确认日提供了权益确认原始凭证，则在确认日当天以原始凭证为依据入账；如管理人无法在权益确认日提供上述产品的权益确认原始凭证，则在原始凭证提供日进行入账，且不对历史已核对确认账务追溯调整。

B、如果上述标的产品有份额净值的，以管理人指定的第三方机构（包括标的产品管理人、标的产品运营服务机构或托管人，以下简称“第三方机构”）按照标的产品份额净值的披露频率提供标的产品最新份额净值进行估值。如第三方机构可提供投资标的产品虚拟份额净值（虚拟份额净值指的是在非业绩报酬提取日剔除截至该估值日内含的业绩报酬后计算得到的份额净值）且管理人确认使用该虚拟份额净值进行估值的，由管理人书面确认后启用第三方机构按照标的产品虚拟份额净值披露频率提供的虚拟份额净值进行估值，托管人有权就其收到的虚拟份额净值提出异议。

如果投资私募证券投资基金，本基金原则上只接受标的产品运营服务机构或托管人提供的份额净值及相关估值信息。如果第三方机构未按照标的产品的份额净值/虚拟份额净值披露频率提供标的产品的最新份额净值/最新虚拟份额净值，则以第三方机构最近一次提供的标的产品份额净值/虚拟份额净值进行估值。管理人需持续评估上述做法的适当性，包括但不限于采取最近一次份额净值/虚拟份额净值继续估值的公允性、合理性，并在评估后与托

管人协商进行调整。

如果上述标的产品有固定预期收益率且不公布份额净值的,则根据成本和固定预期收益率对产品进行估值;因前述估值方法安排而产生的任何责任均由管理人自行承担,与托管人、行政服务机构无关。

C、如果持有证券公司发行的集合类现金资产管理计划且标的产品管理人或本基金管理人指定的第三方机构每日提供万份收益的,则该标的产品每日以前一交易日的万份收益计提红利。如经基金管理人确认无法提供万份收益,则以成本估值,在实际收到红利时确认收益。

D、本基金开放日、收益分配基准日,如第三方机构未及时提供最新估值信息导致本基金开放申购赎回、收益分配暂停或延迟的,基金管理人应当负责及时告知全体份额持有人。

标的产品的虚拟份额净值的真实性、准确性以及适用性由基金管理人负责,本基金托管人及基金行政服务机构对此不承担任何责任。

E、如果不属于上述情况的,则管理人指定的第三方机构应向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,托管人按管理人提供的数据进行估值。

F、管理人应敦促指定的第三方机构及时、准确、完整地提供标的产品的份额数量、申购赎回情况、分红情况以及其他权益变动等估值信息,并确保上述估值信息的真实性和有效性。如因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,托管人、行政服务机构不承担任何责任。

(14) 本基金合同如未另做说明,则对交易所市场流通交易的证券来说,第三方估值机构主要指中证指数有限公司;对于银行间市场流通交易的有价证券来说,第三方估值机构主要指中央国债登记结算有限责任公司。

(15) 如存在上述估值约定未覆盖的投资品种、上述估值方法无法覆盖的估值情形或按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的,基金管理人有权根据具体情况与基金托管人商定后,调整估值方法或估值机制以按最能反映公允价值的价格估值并由基金管理人负责及时进行公告。基金管理人调整估值方法时应及时通知基金托管人。当存有异议时,基金托管人有权要求基金管理人作出合理解释。如经双方在平等基础上充分讨论后,无法达成一致意见的,以基金管理人对基金资产净值的计算结果为准。由此给基金份额持有人或本基金造成的损失由基金管理人承担。如基金管理人未及时发送特定品种估值方法说明、估值数据或估值结果给托管人,造成的估值延误或估值错误,由此给基金份额持有人或本

基金造成的损失由基金管理人承担。

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

如基金管理人或基金托管人发现基金估值违反本合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时，应立即通知对方，共同查明原因，双方协商解决。

本基金管理人或其委托的基金行政服务机构、基金托管人根据本章第（一）款“基金财产的估值”中第 8 条“估值方法”的第（1）至（15）项约定进行估值核算即视为进行了公允估值——对于其中某些标的约定采用成本法估值的，可能存在按成本对投资标的的估值与标的实际或变现时的价值偏离较大，从而出现估值日的基金份额净值未能真实反映基金实际投资风险以及净值波动较大的情况，基金投资者一经签署本合同即视为已知晓此类风险并自愿承担由此产生的影响或后果。

9、估值程序

基金日常估值由基金管理人进行。基金管理人完成估值后，将估值结果以书面形式或者双方认可的其他形式送至基金托管人，基金托管人按法律法规、本合同规定的估值方法、时间、程序进行复核，复核无误后在基金管理人传真的书面估值结果上加盖业务章或者双方认可的其他形式返回给基金管理人。基金管理人应及时核查复核结果，如对复核结果存在异议的，应当及时联系基金托管人共同查明原因。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

在法律法规和中国证监会允许的情况下，基金管理人可以委托合格的第三方机构进行基金资产估值并执行估值有关的操作事项，但不改变基金管理人对于基金资产估值原本应承担的责任。

10、估值信息提供

(1) 本基金投资于公募基金、资产管理产品或私募基金管理人发行的私募基金等投资标的时，基金管理人应在标的产品合同等相关协议约定的确权时效内或本基金开放日前，向基金托管人提供完整、准确及有效的估值材料，作为基金托管人和行政服务机构确认该笔投资权益的依据。

(2) 本基金投资于资产管理产品或私募基金管理人发行的私募基金等投资标的时，基金管理人应当授权并敦促所投标的资产的基金托管人或基金服务机构直接向本基金托管人提供经复核的基金估值信息。

(3) 本基金接受其他私募基金或者资产管理产品投资的，管理人授权本基金托管人或行政服务机构将经复核的基金估值信息提供给上层私募基金托管人。

11、估值错误的处理

基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当基金资产净值发生计算错误超过基金资产净值 0.5% 时，视为估值错误。

本合同的当事人应按照以下约定处理：

(1) 估值错误类型

本基金运作过程中，如果由于基金管理人、基金托管人、证券/期货等交易经纪机构、证券交易所、基金份额登记机构、销售机构或基金投资者自身的过错造成估值错误，导致其他当事人遭受损失的，按如下估值错误处理原则和处理程序执行。

上述估值错误的主要类型包括但不限于：资料申报差错、数据传输差错、数据计算差错、系统故障差错、下达指令差错等。

自然灾害、突发事件、以及因技术原因引起的差错，若系同行业现有技术水平不能预见、不能避免、不能克服，则属不可抗力，由于不可抗力造成基金份额持有人的交易资料灭失或被错误处理或造成其他差错，因不可抗力原因出现差错的当事人不对其他当事人承担赔偿责任，但因该差错取得不当得利的当事人仍应负有返还不当得利的义务。

(2) 估值错误处理原则

A、如基金管理人或基金托管人发现基金资产估值违反本合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定，导致基金资产净值发生计算错误超过基金资产净值的 0.5% 时，应立即通知双方，共同查明原因，协商解决；

B、估值错误的责任人应当对由于该估值错误遭受损失的直接当事人的直接损失承担赔偿责任；估值错误的责任人应对有关当事人的直接损失负责，不对间接损失负责，并且仅对估值错误的有关直接当事人负责，不对第三方负责；

C、因估值错误而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务；

D、估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式；

E、基金管理人和基金托管人由于各自技术系统设置而产生的净值计算尾差，以基金管理人计算结果为准；

F、基金管理人或其委托的行政服务机构、基金托管人按本合同约定的估值方法进行估值时，所造成的误差视为估值错误；

G、基金管理人负责督促证券/期货交易经纪机构向基金托管人和行政服务机构及时准确

发送当日交易结算数据、对账单等估值所需材料，因证券/期货等交易经纪机构未及时准确发送估值所需材料而导致估值差错时，基金托管人及行政服务机构不对此承担任何责任，基金管理人应及时协调证券/期货经纪机构解决；

H、按法律法规规定的其他原则处理估值错误。

(3) 估值错误处理程序

估值错误被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

A、基金份额净值计算出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，通报基金托管人，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；

B、当基金资产净值发生计算错误超过基金资产净值的 0.5% 时，查明估值错误发生的原因，根据当事人协商的方法对因估值错误造成的损失进行评估；

C、根据估值错误处理原则或当事人协商的方法，对估值错误进行处理；

D、前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。

12、暂停估值的情形

(1) 基金投资所涉及的证券交易场所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

(2) 证券/期货交易经纪服务机构等中介机构、基金管理人或其指定的第三方机构未能按行政服务机构或基金托管人的要求提供估值所需资料，导致行政服务机构、基金托管人无法对基金资产进行正常估值时；

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

(4) 占基金相当比例的投资品种的估值出现重大转变，而基金管理人为保障基金投资者的利益，决定延迟估值的情形；

(5) 基金投资的资管产品市值占本基金全部资产净值的比例超过 10% 时，如果发生超过约定时间 15 个工作日仍然无法获取所投资管产品的估值价格，为防范使用长期未更新的价格可能产生的估值结果偏离以及由此可能产生的信息披露误导，基金行政服务机构、托管人或基金管理人有权决定暂停估值；

(6) 私募基金管理人或私募基金托管人有合理理由认为根据现有的材料无法准确估值的情形；

(7) 中国证监会认定的其他情形。

13、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，自本规定恢复估值之日起，基金托管人恢复对本基金的投资监督。如发生暂停估值，由基金管理人负责

及时履行相关信息披露义务。基金行政服务机构及基金托管人不对暂停估值的相关影响和后果承担任何责任。

14、基金资产净值的确认

根据有关法律法规，基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由私募基金管理人担任，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，仍无法达成一致意见时，以基金管理人对于基金资产净值的计算结果为准。由此造成的影响或后果，基金行政服务机构及私募基金托管人不承担任何责任。

15、特殊情况处理

(1) 私募基金管理人、基金行政服务机构或基金托管人按本章前述第 8 条“估值方法”所约定的估值方法进行估值时，视为进行了公允估值，所造成的误差不作为基金财产估值错误处理。

(2) 由于不可抗力原因，或由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误，或国家会计政策变更、市场规则变更等，私募基金管理人或其委托的行政服务机构和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现该错误的，由此造成的基金财产估值错误，私募基金管理人或其委托的行政服务机构和基金托管人可以免除赔偿责任。但私募基金管理人或其委托的行政服务机构、基金托管人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

(二) 基金的会计政策

- 1、基金管理人为本基金的基金会计主要责任方；
- 2、基金的会计年度为公历年度的 1 月 1 日至 12 月 31 日；基金首次募集的会计年度按如下原则：如果基金成立至公历年度末少于 2 个月，可以并入下一个会计年度；
- 3、基金核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位；
- 4、会计制度执行国家有关会计制度；
- 5、本基金独立建账、独立核算；
- 6、基金管理人及基金托管人各自保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关规定编制基金会计报表。

十七、 私募基金的费用与税收

(一) 基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、行政服务机构的行政服务费；
- 4、浮动业绩报酬（如有）；
- 5、基金的证券、期货交易费用（如有）及各类账户开户费用（包括但不限于印鉴刻制费、账户开立费、网银 U 盾费、网银证书年费等）；
- 6、银行账户的资金结算汇划费、账户维护费、询证费等各类银行收取的费用；
- 7、基金成立后与之相关的会计师费、律师费、诉讼费、仲裁费、财产保全费及财产保全保险费（如有）；
- 8、基金年度审计费（如有）；
- 9、基金运作有关的增值税；
- 10、与本基金有关的印刷费用（如有）、电子签约费用（如有）；
- 11、按照国家有关规定和本合同约定，可以在基金资产中列支的其他费用。

（二）费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

本基金 A 类基金份额的年管理费率为【0%】，B 类基金份额的年管理费率为【1%】，C 类基金份额的年管理费率为【1.5%】，计算方法如下：

$$H=E \times \text{【年管理费率】} \div 365$$

H：每日应计提的各类别基金份额的管理费

$$E=\max(0, \text{前一自然日的各类别份额基金资产净值})$$

本基金的管理费自基金成立日起，每日计提，按季支付给基金管理人。

基金托管人有权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，前 10 个工作日以内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。若因托管账户内留存的资金不足造成的划付延迟，托管人不承担相应责任。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

2、基金托管人的托管费

本基金的年托管费率为【0.02%】，计算方法如下：

$$H=E \times \text{【年托管费率】} \div 365$$

H: 每日应计提的托管费

E: $\max(0, \text{前一自然日的基金资产净值})$

本基金的托管费自基金成立日起, 每日计提, 按季支付给基金托管人。

基金托管人有权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, 前 10 个工作日以内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。若因托管账户内留存的资金不足造成的划付延迟, 托管人不承担相应责任。费用自动扣划后, 基金管理人应进行核对, 如发现数据不符, 及时联系基金托管人协商解决。

非因基金托管人的原因导致基金目的不能实现或本基金终止的, 基金托管人已收取的托管费无需返还。

3、行政服务机构的行政服务费

本基金的年行政服务费率为【0.02%】, 计算方法如下:

$H = E \times \text{【年行政服务费率】} \div 365$

H: 每日应计提的行政服务费

E: $\max(0, \text{前一自然日的基金资产净值})$

本基金的行政服务费自基金成立日起, 每日计提, 按季支付给行政服务机构。

基金托管人有权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, 前 10 个工作日以内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。若因托管账户内留存的资金不足造成的划付延迟, 托管人不承担相应责任。费用自动扣划后, 基金管理人应进行核对, 如发现数据不符, 及时联系基金托管人协商解决。

非因行政服务机构的原因导致基金目的不能实现或本基金终止的, 行政服务机构已收取的行政服务费无需返还。

4、浮动业绩报酬

(1) 本基金 A 类基金份额不计提业绩报酬。

(2) 本基金针对 B 类基金份额和 C 类基金份额计提业绩报酬。如无特别说明, 本项下计提业绩报酬的“基金份额持有人”指“B 类基金份额持有人”和“C 类基金份额持有人”, “基金份额”指“B 类基金份额”和“C 类基金份额”, 业绩报酬的计提方式如下:

① 业绩报酬的提取时间

基金管理人将根据高水位净值法对单个基金份额持有人单笔投资基金份额在【收益分配时、赎回基金份额时、基金终止时】（以下简称为“计提日”）分别提取业绩报酬。本基金业绩报酬计提基准日（以下简称“计提基准日”）分为【收益分配基准日、赎回申请对应的开放日、基金终止日】。连续两次计提业绩报酬的时间间隔不低于 6 个月，投资者赎回基金份额时计提、基金终止时计提及发生业绩报酬计提时因非交易日导致延迟计提的情况除外。对因计提间隔期约束而导致业绩报酬无法收取的影响或后果，基金托管人、基金行政服务机构不承担责任。

在收益分配时提取业绩报酬，业绩报酬从投资者的分红资金中扣除且不超过分红资金；在赎回基金份额时提取业绩报酬，业绩报酬从投资者的赎回资金中扣除；在基金终止时提取业绩报酬，业绩报酬从投资者的清算资金中扣除；

② 业绩报酬的计算

第 i 个基金份额持有人持有的第 j 笔投资的期间年化收益率 $R_{i,j} = (NAV_1 - HWM_{i,j}) / HWM_0 \times 365 / T \times 100\%$ ，则业绩报酬计提的条件为：

	业绩报酬计提比例 (K%)
B 类基金份额业绩报酬计提比例	10%
C 类基金份额业绩报酬计提比例	20%

当 $R_{i,j} \leq 【0\%】$ 时，不计提业绩报酬；

当 $R_{i,j} > 【0\%】$ 时，管理人对期间年化收益率超过【0%】的部分提取【K%】作为业绩报酬，

$$PF_{i,j} = F_{i,j} \times (R_{i,j} - 【0\%】) \times HWM_0 \times 【K\%】 \times T / 365;$$

$PF_{i,j}$ ：本计提基准日第 i 个基金份额持有人第 j 笔投资的业绩报酬；

$F_{i,j}$ ：【收益分配、基金终止】提取时，表示在本计提基准日第 i 个基金份额持有人持有的第 j 笔投资的基金份额余额；赎回提取时，表示在本计提基准日第 i 个投资者赎回份额中第 j 笔投资的基金份额；

NAV_1 ：本计提基准日基金份额累计净值；

$HWM_{i,j}$ ：第 i 个基金份额持有人第 j 笔投资的高水位，为该笔份额最近一次成功提取业绩报酬时对应的业绩报酬计提基准日的基金份额累计净值；若该笔份额还未提取过业绩报酬，则 $HWM_{i,j}$ 为该笔份额成立日/申购申请日/除权除息日的基金份额累计净值。

HWM_0 ：为该笔份额最近一次成功提取业绩报酬时对应的业绩报酬计提基准日的基金份额净值；若该笔份额还未提取过业绩报酬，则 HWM_0 为该笔份额成立日/申购申请日/除权除息日的基金份额净值；

T：第 i 个基金份额持有人第 j 笔投资最近一个成功计提业绩报酬的计提日到本计提日的份额持有天数；若该笔份额还未提取过业绩报酬，则以该笔份额的份额成立日/申购的份额确认日或红利再投日起算；

如果 $PF_{i,j}$ 计算结果为负或者为零，则该计提日第 i 个基金份额持有人第 j 笔投资提取的业绩报酬为零，基金管理人就该笔投资不提取业绩报酬。

某计提日基金管理人计提的业绩报酬总额为该计提日所有单个基金份额持有人各笔投资业绩报酬之和。某计提日单个基金份额持有人计提的业绩报酬总额为该基金份额持有人持有的各笔投资业绩报酬之和。

业绩报酬金额的计算保留到小数点后 2 位，小数点后第 3 位四舍五入，由此带来的收益和损失归入基金资产。

基金托管人不对业绩报酬的计算和计提承担任何责任，业绩报酬由【私募基金管理人或其委托的基金行政服务机构】负责计算及复核。

③ 业绩报酬支付

私募基金管理人在单个基金份额持有人【分红或赎回或清算】款项（以下简称“退出金额”）中分别予以相应扣除，即退出金额支付日，私募基金托管人根据私募基金管理人的指令将退出金额（含业绩报酬）划拨到基金募集账户，私募基金管理人或其委托的基金行政服务机构将管理人所有的业绩报酬支付给私募基金管理人后，将剩余的退出金额支付给基金份额持有人。

5、上述（一）中所列其他费用根据有关法规及相关协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。其中，印鉴刻制费/股东卡开户费用若由托管人在开立托管账户或开立股东卡时先行垫付，自基金成立后由托管人自动从基金资产中扣划，基金管理人无需再出具资金划拨指令。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。

6、在托管人系统可支持的情形下，托管人可以向管理人书面告知的形式调整对上述（一）中所列示的管理费、行政服务费、投顾费（若有）以及托管费的指令发送模式——即管理人免于出具划款指令，托管人根据与管理人或其委托服务机构核对一致的金额，按照上述费用条款的支付时点（若该时点的托管账户现金余额不足则顺延至下一工作日直至划完

毕)、支付频率以及附件所列示的费用账户(账户若有变更则以变更函为准)执行费用款项的划付。另外,划付当天若发生托管账户现金余额不足,则托管人可自行从证券资金账户/期货备付金账户等自动调转相应金额的现金资产,管理人可无需为此出具划款指令。费用扣划后,私募基金管理人应进行核对,如发现数据不符,及时联系私募基金托管人协商解决。

(三) 不列入基金业务费用的项目

- 1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失。
- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用。
- 3、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

(四) 费用调整

基金管理人有权调低本基金的管理费。

基金管理人调低基金托管人、行政服务机构、投资顾问(如有)的收费标准,须分别取得基金托管人、行政服务机构、投资顾问(如有)的同意。

基金管理人、基金托管人、行政服务机构与基金份额持有人协商一致,可根据市场发展情况按本合同相关约定调高管理费率、托管费率和行政服务费率。

(五) 基金的税收

1、根据国家税收法律、法规相关要求,本基金运营过程中如发生增值税应税行为,使得本基金管理人成为增值税纳税人的,源于本基金增值税应税行为而形成的增值税及其附加税费等相关税负由本基金资产承担。相关税款由基金管理人计算后向基金托管人出具划款指令,由基金托管人划付至基金管理人指定的税款缴纳专用账户并由基金管理人负责完成相关税款申报和缴纳,基金托管人仅负责执行指令划付,不对税款的实际申报和缴纳承担任何责任。

2、本基金清算后,如基金管理人被税务机关要求补缴由本基金增值税应税行为而形成的应由本基金资产承担的增值税及其附加税费等相关税负的,基金管理人有权向基金份额持有人就补缴金额进行追索。

3、本基金运作过程中涉及除增值税及其附加税费以外的其他税负,相关纳税主体、扣缴主体的纳税义务、扣缴义务按国家税收法律、法规执行。

4、如将来本基金所适用的税收征管法律法规及具体执行方式由于国家相关税收政策、基金管理人主管税务机关指导意见、中国证监会相关规定、行业指引、自律规则及监管政策调整而发生变化,则基金管理人经与基金托管人协商一致并由基金管理人提前进行公告后,

可直接对本基金合同中涉及的相关内容进行修改和调整。基金管理人如因计税方案改变而要求对历史已核对确认账务追溯调整，由此导致的相关风险，基金托管人不承担任何责任。

十八、 私募基金的收益分配

基金收益分配是指将本基金的累计未支付利润根据持有基金份额的数量按比例向基金份额持有人进行分配。

（一）基金收益分配原则和方式

1、基金收益分配的基准为基金的累计未支付利润。基金的累计未支付利润是指基金的利息收入、投资收益、公允价值变动收益及其他收入等基金运作产生的各项收入扣除管理费、托管费、行政服务费等基金运作产生的各项费用后的余额。

2、本基金收益分配方式为现金分红或分红转投资。投资者可选择现金红利或将现金红利按除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是【现金分红】。

选择现金分红分配方式的，基金管理人向基金托管人发送划付指令及红利计算明细表并加盖管理人公章，基金托管人根据指令将现金红利款划往份额登记机构，并由份额登记机构将现金红利款划往基金份额持有人的指定资金账户（默认为投资者收益账户）或相应的销售机构，由销售机构划入基金份额持有人的指定资金账户。现金红利款在分红权益登记日后七个工作日内划转到基金份额持有人账户。

选择红利转投资分配方式的，分红资金按除权日的份额净值转成相应的基金份额计入基金份额持有人账户。红利转投资形成的基金份额计算保留到小数点后两位，小数点后第三位四舍五入，由此产生的差额部分计入基金资产的损益。红利转投资增加基金份额的，不受本基金规模上限的限制。

3、同等基金份额的享有同等分配权；

4、本基金存续期内收益分配比例、分配次数、分配时间和分配金额由管理人确定。

（二）基金收益分配方案的确定与通知

基金收益分配方案由私募基金管理人根据本合同制定，包括基金收益分配的范围、分配对象、分配原则、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。

私募基金管理人应当于基金收益分配登记日前，将基金收益分配方案交由私募基金托管人复核。私募基金托管人应于收到收益分配方案后完成对收益分配方案的复核，并将复核意见书面通知私募基金管理人（或私募基金管理人委托的份额登记机构）。复核通过后，私募

基金管理人通过网站公告等方式通知基金份额持有人收益分配方案。

十九、信息披露与报告

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

一、基金管理人信息披露的种类、内容和披露频率

运作期报告

(一) 定期报告

1、 季度报告

基金管理人应当在每季度结束之日起 10 个工作日内(出现证监会、基金业协会等监管/监督机构公告可延迟报送的情形时除外),向投资者披露经基金托管人复核的基金份额净值、主要财务指标以及投资组合情况等信息。

2、 年度报告

基金管理人应当在每年度四月底之前(出现证监会、基金业协会等监管/监督机构公告可延迟报送的情形时除外),编制完成基金年度报告并经基金托管人复核,向基金份额持有人披露报告期末基金净值和基金份额总额、基金的财务情况、基金投资运作情况和运用杠杆情况、投资者账户信息(包括实缴出资额、未缴出资额以及报告期末所持有基金份额总额等)、投资收益分配和损失承担情况、基金管理人取得的管理费和业绩报酬(包括计提基准、计提方式和支付方式)、可能存在的利益冲突情况以及可能影响基金投资者合法权益的其他重大信息。

如基金业协会制定了新的私募基金信息披露规则,则从其规则执行。

3、 基金净值的披露

本基金资产规模金额达到 5000 万元以上时,基金管理人应当在每月结束之日起 5 个工作日内(出现证监会、基金业协会等监管/监督机构公告可延迟报送的情形时除外)向份额持有人披露经基金托管人复核后的基金份额净值信息。

4、 定期报告的复核流程

前述基金定期报告的编制由基金管理人进行,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,基金托管人仅复核私募基金定期报告中的财务数据,并对私募基金在报告期内的合规守信情况发表意见,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的,由此造成的任何后果,基金托管人不承担责任。**

(二) 临时报告

基金管理人应在以下重大事项发生后按照中国基金业协会等金融监督或监管部门的相关规定,在十个工作日内向投资者进行披露,并根据协会要求向协会履行变更手续:

- 1、 基金名称、注册地址、组织形式发生变更的;
- 2、 投资范围、投资策略和投资限制发生重大变化的;
- 3、 变更基金管理人、托管人、行政服务机构或投资顾问(如有)的;
- 4、 管理人的法定代表人、执行事务合伙人(委派代表)、实际控制人发生变更的;
- 5、 触及基金止损线(如有)或预警线(如有)的;
- 6、 管理费率、托管费率、行政服务费率、投资顾问费率(如有)发生变化的;
- 7、 基金收益分配事项发生变更的;
- 8、 基金触发巨额赎回的(如有);
- 9、 投资金额占基金净资产 50%及以上的项目不能正常退出的;
- 10、 基金存续期变更的;
- 11、 基金发生清盘或清算的;
- 12、 发生重大关联交易事项的;
- 13、 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;
- 14、 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;
- 15、 基金上一年度日均资产净值低于 1000 万元的,基金管理人应当在 5 个工作日内向投资者披露潜在影响及相关安排;
- 16、 因基金上一年度日均资产净值低于 500 万元或连续 20 个交易日出现基金资产净值低于 500 万元而导致基金停止申购的,基金管理人应当在 5 个工作日内向投资者披露;
- 17、 基金合同约定的影响投资者利益的其他重大事项;
- 18、 私募基金管理人及其控股股东、实际控制人、主要出资人业务运营、财务状况发生重大变化,或者出现重大信息安全事故,可能引发私募基金管理人经营风险,严重损害投

资者利益；

19、在基金运作期间如果管理人发生涉及司法执行、刑事或民事赔偿案件时，应在发生起 5 个工作日内向投资者披露并书面通知托管人和行政服务机构。

二、私募基金托管人的信息披露义务仅限于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，对私募基金管理人（或其委托的基金行政服务机构）编制且向投资者披露的基金资产净值、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）的财务相关数据进行复核确认。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的或者基金管理人披露信息或发布报告前未主动将相关信息或报告提供至基金托管人复核的，基金托管人不承担任何责任。除法律明确规定以外，基金托管人不承担除本合同“信息披露与报告”章节明确约定以外的其他任何信息披露义务。

三、信息披露的方式及基金份额持有人信息查询的途径

基金管理人应当至少采用下列一种或多种方式向基金份额持有人提供报告或进行相关通知。基金管理人通过以下一种或多种方式向基金份额持有人进行信息披露的，即视为履行了告知义务。为保护基金份额持有人利益，对于法律法规要求必须向基金份额持有人披露的事项，基金管理人应当优先使用基金业协会私募基金信息披露备份系统或基金服务机构提供的系统进行信息披露。

1、传真、电子邮件或短信

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

2、邮寄服务

基金管理人可向基金份额持有人邮寄年度报告等有关本基金的信息。基金份额持有人在销售机构留存的通信地址为送达地址。通信地址如有变更，基金份额持有人应当及时以书面方式或以基金管理人规定的其他方式通知基金管理人。

3、基金管理人网站

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

4、行政服务机构投资人服务平台

基金管理人可通过国金道富提供的服务平台（包括但不限于投资者服务平台、微信小程序

序、微信公众号等，以下统称“服务平台”），向投资者提供信息查询。投资者可根据基金管理人的授权，登录服务平台进行信息查询，投资者通过服务平台查询的基金信息的内容和范围取决于基金管理人的披露和授权情况。

本基金的信息披露义务人为基金管理人，行政服务机构仅为服务平台的运营方，非履行基金信息披露的义务人，不代替基金管理人完成信息披露的工作。服务平台展示的相关业务信息（包括但不限于定期报告、临时报告等）均经基金管理人授权、确认、制作或发布，业务信息的真实性、准确性、完整性、合法合规性、及时性、有效性由管理人负责，行政服务机构对服务平台展示内容有误或投资者下载内容有误等导致的任何后果不承担责任。

5、基金托管人服务平台

基金管理人如通过国金证券“金善托”托管服务平台（<https://zctg.gjqzq.com.cn>）查询或下载基金相关信息、数据或报表等，仅作为基金托管人向管理人提供的附加增值服务，基金托管人仅作为服务平台的运营方，非履行基金信息披露的义务人。**基金管理人通过该平台获取的任何信息，仅适用于向本基金托管人提交业务申请或确认，或与基金托管人进行业务信息核对，基金托管人不对其他用途或作用承担任何责任。**

6、私募基金信息披露备份系统

本基金管理人将按照《私募投资基金信息披露管理办法》及《私募基金信息披露内容与格式指引》规定，在私募基金信息披露备份系统（<https://pfid.amac.org.cn>）披露私募基金相关信息，并按照从投资者或代销机构（如有）获取的开通投资者查询账号所需必备信息，及时为基金投资者办理查询账号的开立、启用、修改、关闭和日常维护。

除按照《基金法》、《私募办法》、《私募投资基金信息披露管理办法》中关于基金信息披露的有关规定及本合同进行披露以外，私募基金管理人和私募基金托管人对披露前的基金信息、从对方获得的业务信息应予保密，不得向任何第三方泄露。法律、法规另有规定的以及因本基金审计需要的情形除外。

五、向监管机构提供的报告

基金管理人、基金托管人应当根据法律法规、中国证监会和基金业协会的要求履行报告义务。

六、信息披露资料保存年限

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

七、基金份额持有人同意基金管理人或其他信息披露义务人应当按照中国基金业协会的

规定对基金信息披露信息进行备份。

二十、 风险揭示

本基金的设立、运作及终止清算依据《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》）和《私募投资基金登记备案办法》及其配套指引、《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》、《私募投资基金信息披露管理办法》、《私募投资基金募集行为管理办法》、《证券期货经营机构私募资产管理业务运作管理暂行规定》、《中国人民银行、中国银行保险监督管理委员会、中国证券监督管理委员会、国家外汇管理局关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》等现行有效的法律法规和本合同约定执行。

基金管理人在管理、运用或处分基金财产过程中，可能面临各项风险。基金委托人在签署本合同前，应当仔细阅读本合同全文及《风险揭示书》，知悉并理解其中列示的基金可能面临的各项风险。《风险揭示书》的揭示事项仅为列举性质，未能详尽列明投资者参与私募基金投资所面临的全部风险和可能导致投资者资产损失的所有因素。基金委托人在参与私募基金投资并签署本合同前，应认真阅读并理解相关业务规则、基金合同及风险揭示书的全部内容，并确保自身已做好足够的风险评估与财务安排，避免因参与私募基金投资而遭受超过自身风险承受能力的损失。

特别提示：基金委托人签署本合同及《风险揭示书》即表明已充分了解并谨慎评估自身风险承受能力，理解并愿意自行承担参与私募基金投资的风险和损失。

二十一、 基金份额的非交易过户和冻结、解冻

（一）基金份额的非交易过户

非交易过户是指不采用申购、赎回等交易方式，将一定数量的基金份额按照一定的规则从某一基金份额持有人账户转移到另一基金份额持有人账户的行为。非交易过户包括继承、捐赠、司法执行以及基金份额登记机构认可、符合法律法规的其他类型。办理非交易过户必须提供基金份额登记机构要求提供的相关资料，接收划转的主体必须是依法可以持有本基金份额的投资者。

继承是指基金份额持有人死亡，其持有的基金份额由其合法的继承人继承；捐赠指基金份额持有人将其合法持有的基金份额捐赠给福利性质的基金会或社会团体；司法强制执行是指司法机构依据生效司法文书将基金份额持有人持有的基金份额强制划转给其他自然人、法人或其他组织。办理非交易过户必须提供基金份额登记机构要求提供的相关资料，并符合

条件的非交易过户申请按基金份额登记机构的规定办理,并按基金份额登记机构规定的标准收费。

(二) 基金份额的冻结与解冻

本基金的基金份额冻结与解冻只包括人民法院、人民检察院、公安机关及其他国家有权机构依法要求的基金份额冻结与解冻事项,以及基金份额登记机构认可、符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻。

二十二、 私募基金合同的效力、变更、解除与终止

(一) 基金合同的效力

1、 本合同及后续可能陆续生效的新增补充类协议(以下统称为“补充协议”,如有)是约定基金合同当事人之间权利义务关系的法律文件,基金投资者为法人或其他组织的,本合同及补充协议(如有)自当事人各方法定代表人/执行事务合伙人或授权代表签字(或盖章)并加盖公章或合同专用章成立,且投资者一方的基金认(申)购款到达本合同及补充协议(如有)约定的募集账户方始生效,本合同及补充协议(如有)另有约定的除外;基金投资者为自然人的,本合同及补充协议(如有)自基金委托人本人或授权代表签字(或盖章)、其他当事人加盖公章或合同专用章以及法定代表人/执行事务合伙人或授权代表签字(或盖章)成立,且投资者一方的基金认(申)购款到达本合同及补充协议(如有)约定的募集账户方始生效。

2、 本基金完整的基金合同版本由基金合同本身以及补充协议共同组成。合同各方完成全部有效基金合同构成文件(含补充协议)签署后,本基金合同才符合成立条件。**基金托管人履行托管人职责的依据是现行有效完整的基金合同(含补充协议)。**投资者因管理人过错或者其他原因导致签署的基金合同(含补充协议)版本不真实、不准确、不完整的,不能构成基金管理人、投资者主张基金托管人存在违约、侵权或其他不当行为的事由。

3、 本合同的签署采用电子签名的方式进行的,由基金管理人、基金托管人、基金投资者签署。基金投资者电子签名与在纸质合同上手写签名或盖章具有同等法律效力,无须另行签署纸质合同。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。

基金管理人通过委托的第三方机构(包括提供电子合同签署服务的机构,以及管理人委托的代销机构)安排投资者完成电子合同签署的,基金管理人承担电子合同签署版本确认的管理职责。基金管理人应当通过委托代理协议或其他有效方式约束第三方机构,确保通过

第三方机构签署的电子合同版本与基金管理人和基金托管人确认的定稿合同内容保持一致。若电子合同签署版本（含补充协议）不完整或者与基金管理人和基金托管人确认的定稿合同（含补充协议）内容不一致的，以基金管理人和基金托管人确认的定稿合同（含补充协议）内容为准，由此引发的风险与损失由管理人承担，基金托管人不承担与此相关的任何责任，如因此给托管人造成任何损失，管理人应予以赔偿。经基金管理人确认有效的基金投资者认购、申购、赎回本基金的申请材料或数据电文和各销售机构出具的本基金认购、申购、赎回业务受理有关凭证等为本合同的附件，是本合同的有效组成部分，与本合同具有同等的法律效力。

管理人承担电子合同回收与存档管理职责。管理人应当要求第三方机构将电子合同签约数据提供至托管人，提供时间不得晚于签署完成后的 10 个工作日。若第三方机构未能在上述约定时限内提供电子合同签约数据或提供数据有误的，由此引发的风险与损失由管理人承担，如因此给托管人造成任何损失，管理人应予以赔偿。

4、 本合同的签署采用纸质合同的方式进行的，由基金管理人、基金托管人、基金投资者共同签署，一式三份，基金管理人、基金托管人和基金投资者各持一份。如基金投资者在募集期认购或在存续期内的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现行有效完整的基金合同版本和补充协议（如有）；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和补充协议（如有）为最新有效的基金合同版本（含补充协议）。基金投资者签署基金合同版本（含补充协议）不完整或者与基金管理人和基金托管人确认的定稿合同内容（含补充协议）不一致的，以基金管理人和基金托管人确认的定稿合同（含补充协议）内容为准，由此引发的风险与损失由管理人承担，基金托管人不承担与此相关的任何责任，如因此给托管人造成任何损失，管理人应予以赔偿。基金管理人应在基金成立日或基金开放期完成合同及补充协议（如有）签署后的十个工作日内，将每个基金投资者签署的其中一份纸质合同及补充协议（如有）寄送给基金托管人。基金托管人在收到基金管理人寄送的合同的前提下，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，收集和核对投资者签署的纸质合同不构成基金托管人的义务，也不构成基金托管人依据现行有效完整基金合同版本（含补充协议）履行基金托管人职责的先决条件。

若管理人未在本合同约定的时限内向托管人寄送投资者签署完成的基金合同及补充协议（如有），或投资者签署的基金合同存在问题的，包括但不限于签署版合同及补充协议（如有）与定稿合同及补充协议（如有）相对比内容不真实、不准确、不完整，合

同丢失或非投资者本人签署合同等，由此产生的所有损失、责任及不利后果均由管理人承担，托管人不承担责任。

5、 本合同自生效之日起对基金份额持有人、基金管理人、基金托管人具有同等的法律约束力。

6、 本合同有效期为基金合同生效日至基金合同终止日。

7、 基金投资者在基金合同和补充协议（如有）签署完成后方可进行认购、申购。投资者实际完成缴款即视为对于管理人和托管人共同定稿的现行有效完整基金合同及补充协议（如有）效力的认可。

基金投资者签署合同及补充协议（如有）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。

（二）基金合同的变更

1、 非因法律法规、中国证监会相关规定、行业指引、自律规则及有关政策发生变化的原因而导致合同变更时，可采用以下三种方式中的一种进行基金合同变更。

（1）如基金合同的变更不涉及本基金合同当事人权利义务发生变化或对基金份额持有人利益无实质不利影响的，私募基金管理人可与私募基金托管人协商一致后修改基金合同，并由私募基金管理人按照本合同的约定向基金份额持有人披露变更的具体内容。

（2）全体基金份额持有人、私募基金管理人和私募基金托管人协商一致并签署补充协议后对本合同内容进行变更。当本合同各方当事人完成补充协议签署后，私募基金管理人应当将补充协议原件回寄给基金托管人，出具书面函件通知私募基金托管人。因私募基金管理人未及时回寄补充协议原件导致合同变更未及时生效的，私募基金托管人对由此造成的损失不承担赔偿责任。

私募基金管理人应确保全体基金份额持有人已签署补充协议且投资者签署的补充协议版本内容真实有效。若发生任何基金份额持有人未签署补充协议或其已签署补充协议版本的真实性、有效性存在问题而对本基金、基金份额持有人或私募基金管理人造成损失的，由管理人承担相关责任，私募基金托管人对补充协议的签署不承担任何审核、监督义务。

（3）私募基金管理人、私募基金托管人首先就本合同变更事项及变更方式达成一致。私募基金管理人就本合同变更事项以书面或电子方式向基金份额持有人发送合同变更征询意见函（或通知），但是该合同变更征询意见函（或通知）的内容须事先征得私募基金托管人同意。基金份额持有人应在征询意见函（或通知）指定的日期内按指定的形式回复意见。

私募基金份额持有人同意变更的，应在征询意见函（或通知）指定的日期内明确回复。

基金份额持有人未在指定日期内回复意见或回复意见不明确的,视为基金份额持有人不同意合同变更。私募基金托管人对征询意见函(或通知)是否有效送达、份额持有人的回复是否为其真实意思表示和后续赎回等操作不承担任何审核、监督义务。若因此造成任何一方损失,私募基金托管人不承担赔偿责任。

征询意见期满,由私募基金管理人安排临时开放日允许不同意合同变更的基金份额持有人赎回其已过份额锁定期的基金份额。变更事项自该临时开放日的次交易日起开始生效,对合同各方均具有法律效力。

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

2、因法律法规、中国证监会相关规定、行业指引、自律规则及有关政策发生变化需要对本合同进行变更的,私募基金管理人可与私募基金托管人协商一致后直接修改基金合同,并由私募基金管理人按照本合同的约定向基金份额持有人披露变更的具体内容。

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

4、基金合同重大事项发生变更的,私募基金管理人应按照中国基金业协会要求自变更之日起 10 个工作日内向中国基金业协会备案。

(三) 基金合同的解除

未设置回访确认程序的,本基金为投资者设置二十四小时的投资冷静期,冷静期自基金合同签署完毕且投资者交纳认购/申购基金的款项之时起算,投资者在冷静期内有权解除基金合同。出现前述情形时,募集机构应当按合同约定及时无息退还投资者的全部认购及/或申购款项。

基金份额持有人追加购买基金份额的,对于其已经持有的基金份额不适用于前款关于基金合同解除的约定。对于追加购买部分的基金份额,基金份额持有人在冷静期内有权撤销相应的追加购买申请,募集机构应当按合同约定及时无息退还投资者追加购买基金的款项。

设置回访确认程序的,投资者在募集机构回访确认成功前有权解除基金合同。出现前述情形时,募集机构应当按合同约定及时无息退还投资者的全部认购及/或申购款项。在募集

机构约定的回访时间内，未回访确认成功，本次认购/申购失败，募集机构应按合同约定及时无息退还投资者的全部认购及/或申购款项。

基金份额持有人追加购买基金份额的，对于其已经持有的基金份额不适用于前款关于基金合同解除的约定。对于追加购买部分的基金份额，基金份额持有人在募集机构回访确认成功前有权撤销相应的追加购买申请，募集机构应当按合同约定及时无息退还投资者追加购买基金的款项。

(四) 基金合同终止的情形包括下列事项：

1、 私募基金管理人依法解散、被依法撤销、被依法宣告破产、被依法取消私募基金管理人相关资质等原因导致基金管理人职责终止的；

2、 私募基金管理人被基金业协会公告失联超过 20 个工作日的；

3、 私募基金托管人依法解散、被依法撤销、被依法宣告破产的或被依法取消基金托管资格等原因导致职责终止，在六个月内没有新基金托管人承接；

4、 本基金未能成功通过私募基金备案的；

5、 基金存续期间，所有投资者全部赎回所持份额的；

6、 基金管理人根据基金运作情况，基于自己的商业判断自行决定终止基金合同的；

7、 经全体基金投资者、基金管理人、基金托管人协商一致决定终止基金合同的；

8、 本基金跌破止损线（如有）；

9、 本基金合同期限已满而未延期的；

10、 基金份额持有人大会决定终止的；

11、 任一工作日发生“基金资产净值等于或低于 0”的情形时；

12、 因基金上一年度日均资产净值低于 500 万元或连续 60 个交易日出现基金资产净值低于 500 万元而导致基金停止申购且停止申购后连续 120 个交易日基金资产净值仍低于 500 万元的；

13、 法律法规和本合同规定的其他情形。

本合同终止后，本合同项下份额持有人大会条款、清算条款、违约责任条款、争议解决条款、保密条款仍然有效。

(五) 基金维持运作机制

基金管理人被基金业协会列为失联（异常）机构、被基金业协会注销私募基金管理人资格或客观上丧失继续管理本基金的能力、因私募基金管理人依法解散、注销登记、被宣告破产等原因进入清算时，或者怠于履行职责导致私募基金无法正常退出的，基金份额

持有人可以按照法律法规规定及本基金合同约定召开份额持有人大会（召集主体、决策机制、表决方式、表决程序、表决比例等相关事项详见基金合同中“基金份额持有人大会及日常机构”章节的相关约定执行），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。上述基金份额持有人大会决议包括：

1、基金份额持有人大会决议进行基金清算

（1）根据基金份额持有人大会决议由基金份额持有人代表代替管理人作为清算小组成员进行清算：决议授权或委托基金份额持有人代表代替基金管理人对本基金所持有场内投资标的的进行平仓变现，取得本基金在证券、期货经纪商处开设的账号权限（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代替基金管理人对本基金所持有场外投资标的的进行变现，向投资标的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。

（4）基金份额持有人代表在清算时应行使下列职权：

A、清理核查私募基金资产情况；

B、制定、执行清算退出方案；

C、管理、处置、分配基金财产；

D、依法履行解散、清算、破产等法定程序；

E、代表私募基金进行纠纷解决；

F、中国证监会、协会规定或者基金合同约定的其他职权。

（5）清算完成后，基金份额持有人代表应当及时向基金业协会报送相关会议决议、财产处置方案、基金清算报告和相关诉讼仲裁情况等。具体清算情况详见基金合同中“基金的清算”章节。

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，新基金管理人可由基金份额持有人大会选聘。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，具体详见基金合同“私募基金管理人及私募基金管理人的更换”的约定。

若管理人被基金业协会从失联（异常）机构名单中移除或恢复继续管理本基金能力的，对于在其被认定为失联（异常）机构或客观上丧失继续管理本基金能力期间，对基金份额持

有人大会、清算小组签署的与本基金相关的协议文件、行使诉讼权利、处分基金财产或者实施其他有关的法律行为均予以认可。

基金托管人应按照法律法规规定和本基金合同约定履行托管职责，维护基金份额持有人合法权益。

二十三、 私募基金托管人和私募基金管理人的更换

(一) 私募基金托管人的更换

1、私募基金托管人职责终止的条件

有下列情形之一的，私募基金托管人职责终止：

- (1) 私募基金托管人被依法取消基金托管资格；
- (2) 私募基金托管人依法解散、依法被撤销或被依法宣告破产；
- (3) 私募基金托管人被基金份额持有人大会解任；
- (4) 法律、法规规定的其他情形。

2、私募基金托管人的更换程序

原私募基金托管人职责终止后，可由私募基金管理人指定新私募基金托管人，或者由基金份额持有人以书面形式一致表示同意并作出决议在六个月内选任新私募基金托管人。在新私募基金托管人产生前，私募基金管理人可指定临时私募基金托管人。

(1) 提名：新任私募基金托管人由私募基金管理人或代表 10%以上基金份额的私募基金份额持有人提名。

(2) 决议：基金份额持有人以书面形式一致表示同意并对更换私募基金托管人形成决议。

(3) 临时私募基金托管人：新任私募基金托管人产生之前，可由私募基金管理人指定临时私募基金托管人。

(4) 备案：上述更换私募基金托管人的基金份额持有人一致表示同意的书面决议自生效之日起 10 个工作日内，由私募基金管理人报中国基金业协会备案。

(5) 交接：私募基金托管人职责终止的，该托管人应当妥善保管基金财产和基金托管业务资料，并有义务及时配合新私募基金托管人办理基金财产和基金托管业务的移交手续，新私募基金托管人或者临时私募基金托管人应当及时接收。新任私募基金托管人与私募基金管理人应及时核对移交的基金资产总值和净值。

3、原私募基金托管人职责终止后，新私募基金托管人或临时私募基金托管人

财产和基金托管业务前，原私募基金托管人和私募基金管理人需采取审慎措施确保基金财产的安全，不对基金份额持有人的利益造成损失，并有义务协助新私募基金托管人或临时私募基金托管人尽快交接基金资产。

(二) 私募基金管理人的更换

1、私募基金管理人职责终止的条件

有下列情形之一的，私募基金管理人职责终止：

- (1) 私募基金管理人被依法取消私募基金管理人相关资质；
- (2) 私募基金管理人依法解散、依法被撤销或被依法宣告破产；
- (3) 私募基金管理人被基金份额持有人大会解任；
- (4) 法律、法规规定的其他情形。

2、私募基金管理人的更换程序

私募基金管理人因被基金份额持有人大会解任导致私募基金管理人职责终止的，参照上述私募基金托管人的更换原则进行。因其他原因导致私募基金管理人职责终止的，本基金合同终止，基金份额持有人会议须做出本基金财产处置方案、基金清算方案。

二十四、 基金的清算

(一) 清算小组

1、 本基金合同终止情形发生之日(以下简称“基金终止日”)私募基金管理人应立即通知私募基金托管人本基金终止，并在基金终止日起五个交易日内通知全体份额持有人并向私募基金托管人送达书面通知。若存在多次清算的情况，则管理人需及时书面通知私募基金托管人和全体份额持有人后续每个具体清算日期。**本基金进入清算程序后，不得进行任何新增投资行为、不得新增募集，基金托管人、经纪商等服务机构应当予以监督及配合。基金终止日后私募基金管理人仍然新增投资并因此造成份额持有人损失的，私募基金管理人应当承担全部赔偿责任。**

私募基金管理人应当负责及时按照本合同的约定启动清算程序，如因私募基金管理人未及时启动清算程序造成份额持有人损失的，私募基金管理人应当承担全部赔偿责任。全体份额持有人已经知悉并认可：由于私募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，私募基金托管人无法启动基金的清算程序，并且无法在清算过程中决定基金其他资产变现的价格、时间、方式等要素，因此就本基金的清算事宜，私募基金托管人仅负责对托管资金账户资金进行保管和对分配方案进行复核。

2、自基金合同终止之日起 30 个工作日内成立清算小组。

3、清算小组成员由基金管理人（在管理人失联或管理人职责终止等管理人无法正常履职的异常情形下由基金份额持有人大会决议明确的机构或人员代为履行基金管理人责任）、基金托管人等相关人员组成。清算小组可以聘用必要的工作人员。

4、清算小组中，基金管理人负责对托管账户之外的基金清算资产的保管、清理、估价、变现并制定分配方案；基金托管人仅负责对托管账户内的现金类基金财产进行保管并对分配方案进行复核。清算小组可以依法以基金的名义进行必要的民事活动。

（二）清算程序

1、清算小组成立后，由基金管理人负责接管托管账户之外的基金财产；由基金托管人接管托管账户内的基金财产；

2、由基金管理人负责基金财产和债权债务进行清理和确认；

3、由基金管理人负责基金财产进行估值和变现；**除非取得全体基金份额持有人、托管人书面同意，基金管理人应当在清算资产处于可变现状态时及时完成资产的全部变现，托管人对此不承担监督义务；**

4、由基金管理人制作清算报告；

5、由基金管理人负责基金财产进行分配，托管人对资产分配进行必要的监督；

6、由基金管理人负责及时以公告等形式通知基金份额持有人清算财产变现情况。

（三）清算费用

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

（四）基金财产清算过程中剩余资产的分配

基金清算过程中，基金财产按如下顺序进行清偿：

1、支付基金财产清算费用；

2、缴纳基金所欠税款；

3、清偿基金债务（包括应付未付的管理费、行政服务费、托管费等各项费用）；

4、前述事项清算后如有余额，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配并分别扣除应计提业绩报酬（如有）。

（五）二次或多次清算

因持有流通受限证券、投资的产品封闭期（含限售期、锁定期）超过基金存续期限等原因导致本基金财产无法及时变现的，私募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，私募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，私募基金管理人按本款约定进行多次变现及清算。二次或多次清算期间，私募基金管理人、私募基金托管人、行政服务机构不计提管理费、托管费、行政服务费。清算流程同一次清算。对于因二次或多次清算造成的基金清算财产的延期支付，托管人不承担任何责任。

若本基金在存续期截止时所投项目未能获得合适退出途径，经基金托管人、全部基金份额持有人同意后，本基金可以以非现金形式向各基金份额持有人分配剩余资产。若本基金进行非现金分配，基金管理人应负责协助各基金份额持有人办理所分配资产的转让登记手续，并协助各投资者根据相关法律、法规履行受让该等资产所涉及的信息披露义务。法律或政府主管部门要求基金份额持有人必须为该转让登记亲自签署相关法律文件的，投资者应按基金管理人的通知签署相关转让登记所需法律文件。

(六) 清算报告的告知安排

基金管理人在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。私募证券基金开始清算但预计 3 个月内无法完成清算的，基金管理人还应当自清算开始之日起 10 个工作日内向协会报送清算承诺函、清算公告等信息。基金管理人在本基金终止后 30 个工作日内，通过管理人网站、书面通知、电子邮件、传真等形式负责向基金份额持有人披露经管理人、托管人双方盖章的清算报告。

(七) 基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及文件由基金管理人保存 10 年以上。

(八) 基金相关账户的注销

基金管理人在基金资产变现完毕、相关权益结清后 5 个工作日内完成证券交易资金账户（如有）和期货资金账户（如有）的注销，并向基金托管人出具销户确认通知书；与本基金相关的其他账户也应于本基金变现完毕、相关权益结清后及时完成注销。

账户注销过程当中，各方当事人应给予必要的配合和协助。

如因管理人未及时注销证券/期货/信用/衍生品等资金账户导致托管人无法及时注销托管账户的，由此产生的包括但不限于托管账户被中国人民银行置为久悬户、预留清算费用的尾款未能及时清算分配等责任或风险，均由管理人承担。如因托管账户未能及时注销而影响托管人权益的，托管人将对管理人予以追责。

(九) 清算未尽事宜

本合同中关于基金清算的未尽事宜以清算报告或基金管理人公告为准。

(十) 特殊情形

如因基金管理人失联或管理人职责终止等无基金管理人履职的情形导致本基金合同终止的，则基金托管人依据基金份额持有人大会的决议进行清算，如基金份额持有人大会未形成相关决议导致本基金无法及时清算的，基金托管人不承担责任。

二十五、 违约责任

(一) 当事人违反本合同，应当承担违约责任，给合同其他当事人造成损失的，应当承担赔偿责任；如属本合同当事人双方或多方当事人的违约，根据实际情况，由违约方分别承担各自应负的违约责任。但是发生下列情况，当事人应当免责：

1、 基金管理人和/或基金托管人按照中国证监会的规定或当时有效的法律法规的作为或不作为而造成的损失等。

2、 基金管理人由于按照本合同规定的投资原则而行使或不行使其投资权而造成的损失等。

3、 基金托管人由于执行基金管理人符合本合同约定的有效指令而造成的损失等。

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

5、 基金管理人、基金托管人对由于第三方（包括但不限于交易所、中登公司、中国期货市场监管中心等）发送或提供的数据错误给本基金资产造成的损失等。

6、 基金投资者未能事前就其关联证券或其他禁止交易证券等投资者自身违法违规原因明确告知基金管理人，致使基金财产发生违规投资行为的，基金管理人及基金托管人均不承担任何责任。

7、 对于基金运作中涉及基金投资者须提供的业务资料（包括但不限于投资者提供的

说明函、征询意见函回执、风险揭示函回执等），由管理人负责催要/收。管理人向基金行政服务机构和托管人提供扫描件或传真件的，前述扫描件或传真件的真实性及有效性概由管理人负责。基金行政服务机构和托管人对扫描件或传真件仅进行形式/外观上的比对或检查，并在比对或检查无误后据此办理相关业务。因管理人提供虚假或被篡改的扫描件或传真件所产生的相关损失，由基金管理人承担全部赔偿责任，基金行政服务机构和托管人不承担任何责任。

8、不可抗力。

(二) 在发生一方或多方违约的情况下，在最大限度地保护基金份额持有人利益的前提下，本合同能够继续履行的应当继续履行。非违约方当事人有义务及时采取必要的措施，防止损失的扩大。没有采取适当措施致使损失进一步扩大的，不得就扩大的损失要求赔偿。非违约方因防止损失扩大而支出的合理费用由违约方承担。

(三) 由于基金管理人、基金托管人不可控制的因素导致业务出现差错，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现错误的，由此造成基金财产或投资者损失，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但是基金管理人和基金托管人应积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

(四) 一方依据本合同向另一方赔偿的损失，仅限于直接损失。

(五) 本基金的基金托管人仅承担法定的以及本合同约定的相关责任及义务，基金管理人不得对基金托管人所承担的责任进行虚假宣传，不得以基金托管人名义或利用基金托管人商誉进行非法募集资金、承诺投资收益等违规活动，否则基金托管人有权解除合同，并向基金管理人追究违约责任和侵权责任。

二十六、法律适用和争议的处理

有关本合同的签署和履行而产生的任何争议及对本合同项下条款的解释，均适用中华人民共和国法律法规（为本合同之目的，在此不包括香港、澳门特别行政区及台湾地区法律法规），并按其解释。

各方当事人同意，因本合同而产生的或与本合同有关的一切争议，合同当事人应尽量通过协商、调解途径解决。经友好协商未能解决的，任何一方均有权向本合同签订地有管辖权的人民法院提起诉讼，本合同约定在成都市青羊区签订。

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

二十七、 通知与送达

除本合同另有约定外，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。

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。

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。

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。

基金合同约定的或销售机构预留中的通讯地址或联络方式即为管理人处理基金事务过程中与托管人、投资人联系的通讯地址或联络方式；托管人、投资人通讯地址或联络方式发生变化，应自发生变化之日起 10 日内以书面文件形式通知管理人，若在基金期限届满前发生变化，应在 2 个工作日内以书面形式通知管理人；若托管人、投资人未将有关变化及时通知管理人，托管人、投资人应对由此而造成的影响和损失负责。

二十八、 其他事项

（一）申明条款

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

本合同除基金投资者手写其基本信息、认购/申购金额信息、投资者账户信息以及投资者手写签名以外，任何一方以手写方式在本合同中增减、修改的任何内容不构成本合同的组成部分，不对本合同任何一方产生法律效力。

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

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

本合同如有未尽事宜，由合同当事人各方按有关法律法规和规定协商解决。

（以下无正文）

仅用于合格投资者查看

(请基金投资者务必使用正楷字体逐项清晰填写,并确保填写的资料正确有效,如因填写错误导致的任何损失,基金管理人和基金托管人不承担任何责任)

基金投资者请填写:

(一) 基金投资者基本信息

1、 自然人

姓名:

证件名称: 身份证 ☐、军官证 ☐、护照 ☐、港澳台回乡证或台胞证 ☐、其他 ☐

证件号码:

联系地址:

联系电话:

电子邮箱:

2、 法人或其他组织

名称:

统一社会信用代码:

住所:

联系地址:

法定代表人或负责人:

联系人:

联系电话:

电子邮箱:

(二) 基金投资者认购/申购金额

认购/初始申购金额(不含额外缴纳的认购/申购费): ☐A ☐B ☐C

人民币(大写): _____ 万元整

人民币(小写): ¥ _____。

(三) 基金投资者账户

基金投资者认购、申购基金的划出账户与赎回基金的划入账户,必须为以基金投资者名义开立的同一个账户。特殊情况导致认购、申购和赎回的账户名称不一致时,基金投资者应出具符合相关法律法规规定的书面说明。基金投资者为其他资产管理产品的,需将其他资产管理产品的托管资金账户或专门的财产资金账户作为认购、申购基金的划出账户与赎回基金的划入账户。账户信息如下:

账户名称:

账 号:

开户银行名称:

（本页无正文，为东源 A500 指数策略鑫享 1 号私募证券投资基金基金合同签署页。）

基金托管人郑重提醒您：为保护自身合法权益，基金投资者签署本协议前请务必扫描本页二维码，进入“国金证券合同协议核验小程序”自行核验拟签署基金合同版本的有效性和完整性！如拟签署基金合同版本与小程序公示版本有任何不一致，请拨打我司的客服热线 95310，联系资产托管部。

基金投资者：

自然人（签字）：

或

法人或其他组织（盖章）：

法定代表人或授权代表（签字）：

签署日期： 年 月 日

签署日期： 年 月 日

基金管理人：东源（天津）股权投资基金管理股份有限公司

法定代表人或授权代理人：

签署日期： 年 月 日

基金托管人：国金证券股份有限公司

法定代表人或授权代理人：

签署日期： 年 月 日

附件一：重要账户信息

【管理费和业绩报酬】收款账户

私募基金管理人账户名称：东源（天津）股权投资基金管理股份有限公司

私募基金管理人账号：273963589023

私募基金管理人开户银行全称：中国银行股份有限公司天津东丽支行

大额支付号（人民银行系统行号）：

【增值税】缴纳账户

增值税缴纳账户户名：东源（天津）股权投资基金管理股份有限公司

增值税缴纳账户账号：273963589023

增值税缴纳账户开户银行全称：中国银行股份有限公司天津东丽支行

【托管费】收款账户

私募基金托管人账户名称：国金证券股份有限公司

私募基金托管人账号：5100 1870 8360 5060 5761

私募基金托管人开户银行全称：建行成都新华支行

大额支付号（人民银行系统行号）：1056 5100 0604

【行政服务费】收款账户

行政服务机构账户名称：国金道富投资服务有限公司

行政服务机构账号：1219 1318 6810 295

行政服务机构开户银行全称：招商银行上海分行花木支行

大额支付号（人民银行系统行号）：3082 9000 3530

附件二：投资监督事项表

投资监督事项表

私募基金托管人以本表为限对基金资产的投资进行监督，但私募基金托管人不承担投资责任。

（一）投资范围

【以”私募基金的投资”章节（一）投资范围为准】

（二）投资限制

- 1、本基金不得投向未经金融机构（商业银行、证券公司）托管或保管的资管产品；
- 2、本基金不得投资未在中国基金业协会备案的合伙企业份额；
- 3、（1）本基金直接投向 AA 级及以下信用债（可转债除外）、流动性受限资产合计不得超过基金净资产的 20%；（2）本基金总资产占净资产的比例不得超过 200%；
- 4、本基金直接投资于同一资产的资金（按成本与市值孰低法计算）不得超过基金净资产的 25%，银行活期存款、国债、债券通用质押式回购、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券、公开募集基金等中国证监会、协会认可的投资品种除外；
- 5、本基金直接投资于股票等权益类资产的比例不低于基金已投资资产的 80%；已投资资产不包含现金管理工具；

（三）投资监督程序

私募基金托管人根据经核对的估值数据对私募基金管理人的投资运作进行事后监督。如发现私募基金管理人的投资运作存在违反《投资监督事项表》的规定时，私募基金托管人应以邮件或其他私募基金托管人与私募基金管理人共同认可的方式通知私募基金管理人进行纠正；私募基金管理人收到通知后及时核查，以电话或书面形式向私募基金托管人进行解释或举证，并在基金合同规定限期内及时进行调整。私募基金管理人未能在限期内纠正的，私募基金托管人有权依据相关法律法规的要求报告中国证监会或基金业协会。

（四）止损机制

本基金不设置【预警线、止损线】。