

天迪证大量化 1 号私募证券投资基金 基金合同

管理人：上海天迪资产管理有限公司

托管人：国信证券股份有限公司

目录

第一节前言	1
第二节释义	1
第三节声明与承诺	4
第四节基金的基本情况	5
第五节基金份额的初始销售	6
第六节基金的成立与备案	9
第七节基金的投资	10
第八节基金份额的申购、赎回	11
第九节投资冷静期及回访确认	15
第十节当事人及权利义务	16
第十一节基金份额持有人大会	21
第十二节基金份额的登记、转让和非交易过户	24
第十三节基金的财产	26
第十四节划款指令的发送、确认与执行	27
第十五节交易及清算交收安排	30
第十六节托管人的监督职责	32
第十七节基金财产的估值和会计核算	33
第十八节基金的费用与税收	37
第十九节基金的收益分配	41
第二十节信息披露与报告	42
第二十一节风险揭示	45
第二十二节基金合同的期限、变更、终止	45
第二十三节基金财产的清算	48
第二十四节违约责任	50
第二十五节争议的处理	51
第二十六节其他事项	52

第一节前言

(一) 订立本合同的依据、目的和原则

1. 根据《中华人民共和国合同法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《私募投资基金监督管理暂行办法》、《证券期货经营机构私募资产管理业务运作管理暂行规定》、《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》、《私募投资基金合同指引》及其他相关法律法规和行业自律规则的有关规定，本合同各方经友好协商，在平等、自愿、互利和诚实信用的基础上，特订立本合同，以兹信守。

2. 本基金合同订立的目的是为了明确投资者、管理人和托管人的权利、义务及职责，规范基金的运作，确保委托财产的安全，保护当事人各方的合法权益。

3. 本基金合同订立的原则是平等自愿、诚实信用、充分保护本合同各方当事人的合法权益。

(二) 投资者自签订基金合同之日起成为基金合同的当事人，且自其持有的全部基金份额退出基金或被转让给其他合格投资者之日起，投资者不再是基金的份额持有人和基金合同的当事人。中国证券投资基金业协会接受本基金的备案并不表明其对基金的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于基金没有风险。

(三) 本基金合同是规定各当事人之间权利义务关系的基本法律文件，其他与本基金相关的涉及各当事人之间权利义务关系的任何文件或表述，如与本基金合同有冲突，均以本基金合同为准。

(四) 若因法律法规的制定或修改导致本基金合同的内容与届时有效的法律法规的规定存在冲突，应当以届时有效的法律法规的规定为准，各方当事人应及时对本基金合同进行相应变更和调整。

第二节释义

在本合同项下，除非文义另有所指，下列词语具有以下含义：

1. 基金、本基金、本私募基金：指天迪证大量化 1 号私募证券投资基金。
2. 本基金合同、基金合同、本合同：指投资者、管理人及托管人签署的《天迪证大量化 1 号私募证券投资基金基金合同》、其附件及对该合同及附件的任何修订和补充。
3. 风险揭示书：指《天迪证大量化 1 号私募证券投资基金风险揭示书》。
4. 基金文件：指本基金合同和风险揭示书的统称。
5. 管理人、基金管理人：指上海天迪资产管理有限公司。

6. 托管人、基金托管人：指国信证券股份有限公司。
7. 代销机构：指取得基金销售业务资格且受管理人委托代为办理本基金份额销售的机构。
8. 募集机构：指管理人及代销机构的统称。
9. 注册登记机构：指接受管理人的委托，为本基金办理基金份额注册登记业务的机构。
10. 外包服务机构：指接受管理人委托，根据管理人与其签订的外包服务协议约定的服务范围，为本基金提供外包服务的机构。
11. 投资者、基金份额持有人、份额持有人：指签署本合同并按本合同约定交付认购/申购资金、取得基金份额的投资者。
12. 合格投资者：指符合《私募投资基金监督管理暂行办法》第十二条、第十三条规定的单位和个人投资者。
13. 基金财产：指本基金项下的所有财产，包括但不限于：（1）投资者认购或申购本基金份额而交付的投资本金；（2）管理人因基金财产的管理、运用、处分或者其他情形而取得的财产。基金财产独立于管理人、托管人的固有财产及其所管理、托管的其他资产。
14. 基金份额、份额：指用于计算、衡量投资者获取本基金财产权益，并承担相应风险的计量单位。基金成立时，每份基金份额的初始销售面值为人民币1元。
15. 基金财产净值：指本基金资产总值减去负债后的价值。
16. 基金份额净值： T 日基金份额净值= T 日基金财产净值 \div T 日基金份额总数（ T 日为估值核对日）。
17. 基金参考份额净值：指在基金份额净值计算的基础上，采用“虚拟清算”原则计算得到的本基金份额估计价值。基金份额参考净值是对基金份额价值的一个估计，并不代表基金份额持有人可获得的实际价值。本基金的基金参考份额净值由管理人自行估算，托管人和外包服务机构（如有）不对其进行复核，也不对其准确性承担任何责任。
18. 基金份额累计净值：指基金份额净值和基金历史上累计份额派息金额之和。
19. 托管账户：指基金托管人为本基金在具有基金托管资格的商业银行开立的银行结算账户。
20. 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“中国结算”）等相关机构的有关业务规则，为基金财产在中国结算上海分公司、深圳分公司开设的证券账户。
21. 证券交易资金账户：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，由托管人通过银证转账的方式完成资金划付。

22. 期货账户：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，由托管人通过银期转账的方式或其他约定的方式办理期货交易的出入金。

23. 募集账户：指管理人自行或委托外包服务机构开立的用于接收、存放初始销售期间或开放日/开放期投资者交付的认购/申购资金的人民币资金账户。

24. 代销归集户：指管理人委托的代销机构(如有)开立的人民币资金账户，用于接收、存放初始销售期间或开放日/开放期内，通过该代销机构认购/申购基金份额投资者所交付的认购/申购资金。

25. 初始销售期、初始销售期间：指本基金的初始销售期限。管理人可根据基金份额的认购情况，决定延长或缩短初始销售期间，并在管理人网站公告。

26. 存续期、存续期限：指基金成立日起至本基金终止日的期间。

27. 开放日/开放期：指管理人正式受理基金申购或赎回业务的工作日，包括固定开放日和临时开放日。

28. 基金成立日、合同生效日：指本合同约定的成立条件均获满足后，管理人宣布的本基金成立之日。

29. 基金终止日、合同终止日：指本基金/本合同根据本合同约定终止之日。

30. 认购：指在初始销售期间，投资者按照本合同的约定购买本基金份额的行为。

31. 申购：指在基金成立后的开放日（或开放期），投资者按照本合同的约定购买本基金份额的行为。

32. 赎回：指在基金成立后的开放日（或开放期），投资者按照本合同的规定将基金份额兑换为现金的行为。

33. 基金业协会、中国基金业协会：指中国证券投资基金业协会。

34. 中国证监会：指中国证券监督管理委员会。

35. 不可抗力：指本合同当事人不能预见、不能避免、不能克服，且在本合同签署之后发生的，使本合同当事人无法全部履行或无法部分履行本合同的任何事件，包括但不限于洪水、地震及其他自然灾害、战争、骚乱、火灾、政府征用或没收、法律法规变化、相关交易

所非正常暂停或停止交易以及非当事人所引起或能控制的计算机系统、通讯系统、网络系统、电力系统故障或其他突发事件等情形。

36. 工作日：指上海证券交易所和深圳证券交易所的正常交易日。

37. 日：除非本合同另有约定，均指工作日。

38. 元：指人民币元。

39. 《暂行办法》：指《私募投资基金监督管理暂行办法》。

40. 《暂行规定》：指《证券期货经营机构私募资产管理业务运作管理暂行规定》。

41. 《募集办法》：指《私募投资基金募集行为管理办法》。

42. 法律法规：指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、规章、司法解释及监管部门的决定、通知等。

43. 中国：指中华人民共和国，为本合同之目的，不包括香港、澳门特别行政区及台湾地区。

第三节 声明与承诺

(一) 投资者的声明与承诺

1. 投资者承诺其为符合《暂行办法》规定的合格投资者；

2. 投资者有完全及合法的权利委托管理人和托管人进行委托财产的投资管理和托管业务，没有任何其他限制性条件妨碍管理人和托管人对该委托财产行使相关权利且该权利不会为任何其他第三方所质疑；

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

4. 投资者承诺其向募集机构提供的有关投资目的、投资偏好、投资限制和风险承受能力等基本情况真实、完整、准确、合法，不存在任何重大遗漏或误导。前述信息资料如发生任何实质性变更，应当及时书面告知募集机构；

5. 投资者承诺委托资金的来源及用途合法，不得非法汇集他人资金参与本基金；

6. 投资者知晓，管理人、托管人及相关机构不应对私募财产的收益状况做出任何承诺或担保。

(二) 管理人的声明与承诺

1. 管理人已在基金业协会登记为私募基金管理人（管理人登记编码为：P1000871）；

2. 管理人声明：基金业协会为管理人和本基金办理登记备案不构成对管理人投资能力、持续合规情况的认可，不作为对基金财产安全的保证；

3. 管理人保证已在签订本合同前充分地向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；

4. 管理人已经了解投资者的风险偏好、风险认知能力和承受能力，对投资者的财务状况进行了充分评估；

5. 管理人承诺按照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金资产，但不承诺对基金活动的盈利性和最低收益做出承诺。

6. 管理人承诺已向投资者明确介绍托管人所承担的职责与义务，未对托管人所承担的责任进行虚假宣传，不以托管人名义或利用托管人的商誉进行非法募集资金、承诺投资收益等违规活动。

(三) 托管人的声明与承诺

1. 托管人承诺按照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则安全保管基金财产，并履行本合同约定的其他义务。

2. 托管人对基金财产的保管，并非对基金财产本金或收益的保证或承诺。托管人不保证基金资产本金不受损失或取得最低收益，亦不承担本基金的投资风险。管理人违背基金合同或相关法律文件的约定、处理基金事务不当使基金财产受到损失的，托管人不承担任何责任。

3. 托管人对本基金投资行为相关的尽职调查、风险评估、投资决策、投后管理或其投资回报不承担任何责任。托管人不承担任何因管理人投资所产生的有关责任，也不承担本基金投资产生的任何风险及损失。

第四节 基金的基本情况

(一) 基金的名称

天迪证大量化 1 号私募证券投资基金。

(二) 基金类型

本基金为契约型私募证券投资基金。

(三) 运作方式

定期开放。

(四) 发行总规模

本基金预计发行总规模不低于 200 万元。具体以实际募集金额为准。

(五) 投资目标

在控制风险的前提下，追求本基金财产的增值。

(六) 投资范围

参见本合同“基金的投资”章节的约定。

(七) 存续期限

本基金不设固定期限。

(八) 初始销售面值

本基金份额的初始销售面值为人民币 1.000 元/份。

(九) 托管机构

本基金的托管人为国信证券股份有限公司。

(十) 外包服务机构

本基金的外包服务机构为【国信证券股份有限公司】(外包业务登记编码为:【A00003】)。

(十一) 份额分级/分类

本基金设为均等份额，每份份额享有同等的合法权益。

第五节 基金份额的初始销售

(一) 募集机构

本基金的募集机构为管理人。

(二) 基金份额的初始销售期间

本基金初始销售期间自基金份额开始发售之日起不超过【3】个月，具体期间由管理人根据本基金合同的约定自行确定，并在管理人网站进行公告，或以管理人与投资者约定的方式通知投资者。管理人有权根据基金初始销售的实际情况自行或与代销机构协商决定缩短或延长初始销售期间，但延长后初始销售期间自基金份额开始发售之日起不得超过【6】个月。

管理人在其网站对延长或缩短初始销售期间的相关事项及时公告的，即视为履行完毕延长或缩短初始销售的程序。

(三) 基金份额的销售方式

本基金由管理人自行销售或由管理人委托的代销机构以非公开的方式进行销售。

投资者认购本基金，应与管理人和托管人签订基金合同，按基金合同规定的方式足额缴

纳认购款项。认购的具体金额和份额以管理人的确认结果为准。

(四) 基金份额的销售对象

本基金的份额仅面向符合《暂行办法》第十二条、第十三条规定的合格投资者进行发售。本基金的投资者不得超过 200 人。若法律法规将来另有规定的，从其规定。

(五) 基金份额的认购和持有限额

投资者初始认购金额不低于人民币 100 万元（不含认购费）（《暂行办法》第十三条规定的合格投资者可不受该金额限制），并可多次认购，认购期间追加认购金额应为【10】万元（不含认购费）的整数倍。

(六) 基金份额的认购费用

本基金的认购费率为 1%，认购费由募集机构收取。募集机构有权对个别投资人的认购费进行减免。

(七) 基金份额的计算

本基金采用金额认购的方式。认购份额的计算方式如下：

净认购金额 = 认购金额 / (1 + 认购费率)

认购费用 = 净认购金额 × 认购费率

认购份额 = 净认购金额 ÷ 份额初始面值

(八) 初始销售期间的认购程序

1. 认购程序

投资者办理认购业务时应提交的文件和办理手续、办理时间、处理规则等在遵守本合同规定的前提下，以募集机构的具体规定为准。

2. 认购申请的确认

募集机构受理认购申请并不表示对该申请成功的确认，而仅代表募集机构确实收到了认购申请。认购申请采取时间优先、金额优先的原则进行确认，即首先按照客户申请时间判断，先到先得，在同一时间接收的认购申请，则金额优先，即金额大的优先进行确认。申请是否有效应以管理人的确认并且基金合同生效为准。投资者应在本合同生效后与募集机构查询最终确认情况和有效认购份额。因投资者怠于查询造成的后果由投资者自行承担。

(九) 拒绝认购

出现以下情形之一，管理人可以拒绝投资者的认购：

1. 本基金认购人数达到上限或认购人交付的认购资金规模超过本合同约定的上限；
2. 由于不可抗力的原因导致本基金无法正常运作；
3. 拒绝认购申请有利于保护投资者的权益；

4. 法律、法规规定或中国证监会认定的其他情形。

如果投资者的认购被拒绝，被拒绝的认购款项将无息退还给投资者。

(十) 初始销售期间客户资金的管理

初始销售期间，管理人**不接受现金认购**，投资者应从其在中国境内银行开立的自有银行账户划款支付其认购款项。**投资人划款时需备注中注明认购的产品名称和投资人姓名。**

(1) 通过管理人直销渠道认购本基金份额的投资者，须从在中国境内银行开立的自有银行账户划款至本基金的募集账户。本基金的募集账户信息如下：

账户名称：天迪证大量化1号私募证券投资基金国信募集专户

银行账号：9558854000002220577

开户银行：中国工商银行深圳市深港支行

在初始销售期间结束之前，任何机构和个人不得将募集账户中的投资者认购资金挪作他用。

募集账户归属主账户集中管理，主账户名称：国信证券股份有限公司资产托管业务募集账户。

注意事项：

1、汇款时可使用网银汇款、柜台转账、支票等方式。

2、汇款时账户名称既可以选择募集账户名称，也可以使用主账户名称，汇款均有效。

3、如投资者使用“柜台转账”方式，部分银行（工行、建行等）的柜台系统会仅显示主账户名称（国信证券股份有限公司资产托管业务募集账户），仍可正常汇款。

募集账户由基金管理人委托外包服务机构开立，该账户用于本基金募集期间和存续期间认购、申购资金的归集与支付。募集账户是外包服务机构接受基金管理人委托代为提供基金服务的专用账户，并不代表外包服务机构接受投资者的认购或申购资金，也不表明外包服务机构对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。在募集账户的使用过程中，除非有足够的证据证明是因外包服务机构的原因造成的损失外，基金管理人应就其自身操作不当等原因所造成的损失承担相关责任，外包服务机构对基金管理人的投资运作不承担任何责任。

为避免歧义，对于管理人采取直销、代销两种募集方式或仅采取代销募集方式的，外包服务机构对募集账户的监督范围不包括：代销机构归集投资者募集资金、向投资者划付其收益、赎回款项及剩余基金财产、以及代销归集户向募集账户进行资金划转等行为的监督，前述代销机构行为涉及的资金划转安全保障职责按照代销相关法律法规及协议约定由相应主体承担责任。

本基金募集账户的监督机构为国信证券股份有限公司。

(十一) 初始销售期间资金利息的处理方式

投资人认购金额（不含认购费）在初始销售期间产生的利息不折算份额，在基金合同生效后计入基金资产。

(十二) 认购资金的交付

投资者应在签署本合同之后 3 个工作日内从在中国境内银行开立的自有银行账户划款至本基金的募集账户，且划款时应在备注中注明认购的基金名称及份额类别（如适用）。

第六节 基金的成立与备案

(一) 基金成立的条件

本基金初始销售期间届满，如下列条件均已获得满足，管理人有权宣布本基金成立：

1. 投资者交付的认购资金金额不低于人民币 200 万元。
2. 投资者人数不超过 200 人。

(二) 基金成立

本节第（一）款约定的条件均获满足后，管理人应将所有净认购资金划转至托管账户。所有净认购资金到达托管账户之日为基金成立日。托管人自基金成立日起履行本合同约定的托管职责。如管理人对基金成立日做出调整的，应向托管人出具成立日调整通知书。成立日调整通知书上约定的成立日应不早于净认购资金划转至托管账户之日，否则托管人有权视为无效。

(三) 基金备案

管理人应当在基金募集完成之日起 20 个工作日内根据基金业协会的规定办理相关备案手续。私募基金在中国基金业协会完成备案后方可进行投资运作。

(四) 基金初始销售失败的处理

1. 初始销售期限届满，不符合本节第（一）款约定的条件的，则本基金初始销售失败。
2. 本基金初始销售失败的，管理人应当承担下列责任：
 - (1) 以其固有财产承担因销售行为而产生的债务和费用；
 - (2) 在初始销售期间届满后【30】个工作日内退还投资者已缴纳的款项，并加计自交付之日（含该日）起至退还之日（不含该日）止的期间的银行同期活期存款利息。
3. 基金初始销售失败的，投资者应向管理人退还全部基金文件；管理人、托管人、募

集机构不得向投资者收取任何费用或主张任何报酬。

第七节 基金的投资

(一) 投资目标

在控制风险的前提下，追求本基金财产的增值。

(二) 投资范围

本基金投资范围为：

股票（包括主板、中小板、创业板上市的股票、新三板挂牌公司的股票）、场内优先股、上市公司非公开发行股票、融资融券交易、港股通、新股申购、将持有的证券作为融券标的出借给证券金融公司；

债券（包括银行间债券、交易所债券、场内可转换债券）、银行存款、现金、股票质押式回购、债券回购；

期货（包括股指期货、国债期货、商品期货）、期权、权证、收益互换；

或通过公开募集证券投资基金、基金专户、在基金业协会登记的私募基金管理人发行的契约式私募投资基金、保险公司资产管理计划、证券公司资产管理计划、集合资金信托计划、基金公司及基金子公司资产管理计划、期货公司资产管理计划等最终投资于上述标的。

资金闲置时可投资于现金、银行存款、货币基金及现金类资产管理计划、商业银行理财计划。

基金在中国基金业协会完成备案后方可进行投资运作。

(三) 投资策略

1、本产品主要使用量化 Alpha 策略：

1) 证大多因子策略框架

2) 轮动择时类策略：通过对多个投资品种间进行轮动投资、择时投资，或者既轮动又择时，以提高收益，降低风险。

3) 事件驱动类策略：通过对各种事件如股价创新高、股东增持、年报披露等事件进行统计分析研究，发现和把握事件性投资机会。

4) 其他策略，通过机器学习、数据挖掘等方法，研发相关具有较高预期收益，较低风险的阿尔法策略。

2、网下申购新股。

(四) 投资限制

1. 本基金存续期内，基金总资产与净资产的比例不得超过 200%。

(五) 投资禁止行为

本基金财产禁止从事下列行为：

1. 承销证券；
2. 从事承担无限责任的投资；
3. 利用基金资产为基金投资者之外的任何第三方谋取不正当利益、进行利益输送；
4. 从事内幕交易、操纵证券价格及其他不正当的证券交易活动；
5. 法律法规、中国证监会、基金业协会以及本合同规定禁止从事的其他行为。

(六) 投资经理的指定及变更

1. 本基金投资经理由管理人负责指定。
2. 管理人根据业务需要变更投资经理的，应在3个工作日内通知全体投资者和托管人。

(七) 业绩比较基准

无。

(八) 风险控制

无。

(九) 投资者或其授权代理人行使基金财产投资于证券所产生的权利的原则及方法：

1. 不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司的经营管理；
2. 有利于基金财产的安全与增值。

管理人按照国家有关法律法规的规定代表基金独立行使股东权利，保护投资者的利益。

(十) 其他

本基金进行投资时，管理人可以以管理人的名义代表本基金与交易对手方签订投资协议，管理人应在各类投资协议中明确是代表本基金投资，且应在各类投资协议中明确约定该项投资收益款项的回款账户为本基金托管账户（但委托贷款协议中明确约定的采取第三方监管措施的回款账户的除外）；投资协议为格式文本无法修改的，管理人应与各交易相关方（包括但不限于委贷银行、信托公司、标的企业、交易对手方等）拟定补充协议或向其出具说明函，明确原投资协议与本基金的直接关系。管理人未提供符合以上约定的投资协议、补充协议或说明函的，托管人有权拒绝执行划款指令，由此造成的损失由管理人负责。

第八节 基金份额的申购、赎回

(一) 基金份额的开放日

本基金自成立之日起，前6个月不设置固定开放日；自本基金成立之日起6个月届满后，每年2月、5月、8月、11月的最后一个交易日为固定开放日，固定开放日投资者可以申购

参与本基金，也可以申请赎回本基金。

管理人可根据市场情况设置临时开放日，临时开放日既允许申购，也允许赎回。

在本基金存续期内，除开放日外的期间为封闭期，在此期间管理人不接受投资者的申购和赎回申请。

(二) 基金份额的申购

1. 申购资格

合格投资者可按照本合同约定及募集机构的要求申请申购基金份额。

2. 申购价格

申购基金份额的，每份基金份额申购价格按当期开放日基金份额净值计算。

3. 金额要求

合格投资者在私募基金开放日申购基金份额的，首次购买金额应不低于 100 万元人民币（不含申购费）（《暂行办法》第十三条规定的合格投资者和已持有本基金份额在开放日再次申购的合格投资者可不受该金额限制），投资者追加申购的应以【10】万元人民币（不含申购费）的整数倍递增。

4. 申购费率

申购费率为 1%，申购费由募集机构收取；募集机构有权对个别投资人的申购费进行减免。

5. 申购基金份额的计算

净申购金额 = 申购金额 / (1 + 申购费率)

申购费用 = 净申购金额 × 申购费率

申购份额 = 净申购金额 ÷ 申购价格

6. 基金份额的申购方式

拟申购基金份额的投资者应当于开放日前的第【10】个工作日至开放日前【1】个工作日期间（即【T-10~T-1】，T 为当期开放日），向募集机构提交书面申购申请，并向募集账户交付申购资金。

7. 申购申请的确认

管理人于开放日后 3 个工作日内对于截至 T 日已经回访确认成功的申购申请进行确认。截至【开放日 15:00】仍未回访确认成功的申购申请，视为申购失败，募集机构应于开放日后【10】个工作日内将该投资者的全部申购款项退还投资者。

(三) 赎回

投资者可根据本合同约定及募集机构的要求申请赎回基金份额。

1. 赎回价格

赎回价格以当期开放日基金份额净值计算。

2. 赎回时间

拟在当期开放日赎回基金份额的投资者应于当期开放日前的第 10 个工作日至第 1 个工作日（即 T-10~T-1，T 为当期开放日）向募集机构提交书面赎回申请，管理人于开放日当日正式受理赎回申请。

3. 赎回限制

(1) 投资者赎回后持有的基金资产净值不得低于 100 万元，基金资产净值低于 100 万元时，必须选择一次性赎回全部基金份额，投资者未申请一次性全部赎回持有份额的，管理人应将该基金份额持有人所持全部份额做强制赎回处理。《暂行办法》第十三条列明的投资者可不适用本条款。

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

4. 赎回费率

赎回费向持有产品不满 6 个月的客户收取，费率为 3%，赎回费由募集机构收取；对持有产品超过 6 个月的客户，不收取赎回费。募集机构有权对个别投资人的赎回费进行减免。

5. 赎回金额的计算公式

赎回金额=赎回份数×赎回价格×(1-赎回费率)-业绩报酬(如有)

在投资者赎回基金份额时，根据该公式计算的赎回金额保留到小数点后两位。

6. 赎回款项的支付

(1) 投资者赎回申请经管理人确认后，管理人应在当期开放日后十个工作日内将赎回款划入投资者指定的账户。

(2) 在赎回款项划付完成当日，即视为就已赎回的基金份额已经完成清算分配；若投资者对赎回款有异议，应在赎回款到账后三个工作日内向管理人提出书面意见，否则视为投资者完全认同赎回款的计算及分配。在赎回款划付完成当日，视为该投资者就该部分赎回份额已与管理人、托管人解除合同关系，三方之间的就该部分赎回份额相关权利与义务自行终止。投资者同意，管理人、托管人无需就当期赎回事项另行出具清算报告或其他信息披露文件等。

(四) 拒绝或暂停申购、暂停赎回的情形及处理

1. 在如下情形下，管理人可以拒绝接受投资者的申购申请：

(1) 根据市场情况，管理人无法找到合适的投资品种，或存在其他如接受申购申请可能对基金业绩产生负面影响的其他情形；

(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) 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

的其他情形；

(4) 法律法规规定、经监管部门认定的或本合同约定的管理人可拒绝接受申购的其他情形。

管理人决定拒绝接受某些投资者的申购申请时，申购款项将退回投资者账户。

2. 在如下情形下，管理人可以暂停接受投资者的申购申请：

- (1) 因不可抗力导致无法受理投资者的申购申请的情形；
- (2) 相关交易场所交易时间临时停市，导致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。

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投资者。在暂停申购的情形消除时，管理人应及时恢复申购业务的办理并以公告的形式告知投资者。

3. 在如下情形下，管理人可以暂停接受或拒绝基金份额持有人根据本合同约定提起的赎回申请：

- (1) 因不可抗力导致管理人无法支付赎回款项的情形；
- (2) 相关交易场所交易时间临时停市，导致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、经监管部门认定的或本合同约定的管理人可暂停或拒绝接受赎回的其他情形。

的其他情形。

发生上述情形之一且管理人决定暂停赎回的，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，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。

在暂停赎回的情况消除时，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。

(五) 巨额赎回的认定和处理方式

1. 巨额赎回的认定

单个开放日中，净赎回申请的份额（赎回总份额扣除申购总份额后的余额）超过基金上一日总份额的 20% 时，即认为本基金发生了巨额赎回。

2. 巨额赎回的处理方式

当出现巨额赎回时，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。巨额赎回的价格由受理申请当日的基金份额净值决定。

全额赎回：当管理人认为有能力支付投资者的赎回申请时，按正常赎回程序执行。

部分顺延赎回：当基金财产支付投资者的赎回申请可能会对基金的资产净值造成较大波

动时，管理人在当日正常接受的赎回份额不低于上一日基金总份额的 20%的前提下，对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，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；份额持有人可在申请赎回时选择将当日未获受理部分予以撤销（但不得违反本合同中关于赎回后持有的基金份额最低要求），如持有人不撤销未获处理部分，未受理部分自动延迟至下一个开放日办理。转入下一个开放日的赎回申请不享有优先权，并以该工作日的基金份额净值为依据计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。部分顺延赎回不受单笔赎回最低份额数量的限制。

3. 告知客户的方式

当出现巨额赎回并发生部分顺延赎回的，管理人应及时公告。

（六）大额赎回

如委托人退出申请构成了大额退出，则委托人应向募集机构提出预约申请，即单个委托人从本基金中 1 个工作日申请退出的份额达到或超过 1 亿份（含 1 亿份），该委托人应在开放日的前【10】个工作日提出申请，否则管理人和代销机构有权拒绝其退出申请。

第九节 投资冷静期及回访确认

（一）适用投资冷静期及回访确认的投资者

本基金的如下投资者适用本节规定的投资冷静期及回访确认机制：

1. 初始销售期，首次认购的投资者；
2. 存续期，首次申购的投资者；
3. 存续期，已经赎回全部基金份额后续又进行申购的投资者。

《募集办法》第三十二条列明的投资者不适用本节约定的投资者冷静期及回访确认机制。

（二）投资冷静期及回访确认

投资者在基金合同项下享有不少于二十四小时的投资冷静期，募集机构在投资冷静期内不得主动联系投资者；投资冷静期自基金合同签署完毕且投资者交纳认购/申购基金的款项后起算。

募集机构应当在投资冷静期满后，按照《募集办法》的要求进行投资回访确认，并以录音电话、电子邮件、书面函件等形式对是否回访确认成功予以留痕。

投资者在募集机构回访确认成功前有权以下述任一种方式解除基金合同：（1）向募集机构提交经投资者签署的书面函件要求解除合同或撤销认购/申购；（2）向募集机构指定邮箱发送电子邮件要求解除合同或撤销认购/申购；或（3）在募集机构进行回访确认时明确表示要解除合同或撤销认购/申购的，出现前述情形之一的，募集机构应当自收到投资者发送的

解除基金合同或撤销认购/申购的意思表示之日起【3】个工作日内，将投资者的全部认购/申购款项退还投资者。对于回访确认不成功的投资者，管理人有权拒绝其认购/申购申请。

未经回访确认成功的，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，管理人不得投资运作投资者交纳的认购/申购基金款项。

回访确认成功的，管理人或者销售机构需将回访确认的结果以书面通知或者约定的其他方式告知托管人及外包服务机构（如有）。

回访确认成功后，投资者不得要求解除合同或撤销认购/申购。

外包服务机构仅根据管理人的指令载明的金额和时间将认购/申购成功款项自募集账户划转到基金财产账户或托管资金账户、认购/申购失败的退回款项自募集账户划转到投资者账户或代销归集户，不负责投资者投资冷静期及回访确认程序的真实性、有效性和合法合规性进行判断。管理人应确保投资者投资冷静期及回访确认程序的真实性、有效性和合法合规性，应确保指令载明的认购/申购款项的划转真实、有效、合法合规，与投资冷静期、回访确认程序引起的相关争议和责任外包服务机构不承担任何责任，由管理人承担。但外包服务机构根据相关信息可以证明管理人的划款指令不符合相关法律法规、监管规则、自律规则或本合同的要求的，有权拒绝执行，并要求管理人纠正，管理人应承担因此造成的相关法律责任。

第十节 当事人及权利义务

（一）投资者

投资者的详细情况见本合同签署页。

（二）管理人

名称：上海天迪资产管理有限公司

住所：上海市浦东新区乳山路 227 号 264 室

法定代表人：杨荔雯

通讯地址：上海市浦东民生路 1199 弄 1 号楼 1908 室

邮政编码：200135

联系人：陈宇飞

联系电话：021-61682888-805

传真电话：021-61682999

电子邮箱：chenyufei@tempoasset.com

网站：www.zendai.com.cn

（三）托管人

名称：国信证券股份有限公司

办公地址：深圳市南山区学府路 85 号软件产业基地 1 栋 A 座 22 楼

邮政编码：518000

注册资本：82 亿元

存续期间：持续经营

法定代表人：何如

电话：0755-82130833

网站：www.guosen.com.cn

(四) 管理人的权利与义务

1. 管理人的权利

(1) 按照基金合同约定，独立管理和运用基金财产，不受基金份额持有人（不包括认购本基金份额的投资顾问，如有）的直接或间接（包括但不限于发出投资建议或投资指令等方式）影响；

(2) 按照基金合同约定，及时、足额获得管理费及业绩报酬（如有）；

(3) 按照有关规定和基金合同约定行使因基金财产投资所产生的权利；

(4) 根据基金合同及其他有关规定，监督基金托管人，对于基金托管人违反基金合同或有关法律法规规定、对基金财产及其他当事人的利益造成重大损失的，应当及时采取措施制止；

(5) 基金管理人为保护投资者权益，可以在法律法规、监管规则规定范围内，根据市场情况对本基金的认购、申购业务规则（包括但不限于基金总规模、单个投资者首次认购、申购金额、每次申购金额及持有的本基金总金额限制等，但不包括上调认购费、申购费率、调整开放日）进行调整；

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

(7) 法律法规、中国证监会及基金业协会规定的和基金合同约定的其他权利。

2. 管理人的义务

(1) 应当确保本基金的合法合规性（包括但不限于募集、设立、投资运作、收益分配、终止清算等环节的合法合规性）；

(2) 应当履行私募基金管理人登记和私募基金备案手续；

(3) 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；

(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；

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

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

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

(10) 管理人有权委托外包服务机构为其提供外包服务，并对其代理行为进行必要的监督和检查；具体的外包服务范围及双方权利义务，以管理人与外包服务机构另行签署的外包服务协议为准；

(11) 按照基金合同约定接受投资者和托管人的监督；

(12) 以管理人的名义，代表投资者利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；

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

(14) 按照基金合同约定负责基金会计核算并编制基金财务会计报告；

(15) 按照基金合同约定计算并向投资者报告基金份额净值；

(16) 根据法律法规、监管规则、自律规则的规定及基金合同的规定，对投资者进行信息披露，揭示私募基金财产运作情况，包括编制和向投资者提供基金定期报告；

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

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

(19) 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法律及法规及相关监管规则要求的期限；

(20) 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；

(21) 按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向投资者分配收益；

(22) 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；

(23) 建立并保存投资者名册；

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

(25) 管理人不得违反《暂行规定》，变相突破投资者人数限制；

(26) 法律法规、中国证监会及基金业协会规定的和基金合同约定的其他义务。

(五) 托管人的权利与义务

1. 托管人的权利

(1) 按照基金合同的约定，及时、足额获得托管费；

(2) 依据法律法规规定和基金合同约定，监督管理人对基金财产的投资运作，对于管理人违反法律法规规定或基金合同约定、对基金财产及其他当事人的利益造成重大损失的情形，有权拒绝执行，并报告相关监管机构；

(3) 按照基金合同约定，依法保管私募基金财产；

(4) 法律法规、中国证监会及基金业协会规定的和基金合同约定的其他权利。

2. 托管人的义务

托管人应就本基金履行下列义务：

(1) 安全保管基金财产；

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

(3) 对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整与独立；

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

(5) 按规定开立和注销基金财产的托管账户、证券账户等投资所需账户；

(6) 复核基金份额净值；

(7) 根据本合同“信息披露与报告”章节的约定办理与基金托管业务有关的信息披露事项；

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

(9) 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；

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

(11) 根据相关法律法规要求的保存期限，保存与私募基金管理业务活动相关的合同、协议、凭证等文件的原件或复印件；

(12) 根据相关法律法规要求的保存期限，保存私募投资基金投资业务活动的会计资料，并妥善保存有关合同、交易记录及其他资料的原件或复印件；

(13) 根据本合同约定监督管理人的投资运作，发现管理人的投资指令违反法律法规的规定及基金合同约定的，应当拒绝执行，立即通知管理人；发现管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律法规的规定及基金合同约定的，应当立即通知管理人；托管人的监

督职责范畴，具体以本合同约定为准；

- (14) 按照基金合同约定制作相关账册并与管理人核对；
- (15) 法律法规、中国证监会及基金业协会规定的和基金合同约定的其他义务。

(六) 投资者的权利与义务

1. 投资者的权利

- (1) 取得基金财产收益；
- (2) 取得清算后的剩余基金财产；
- (3) 按照基金合同的约定申购、赎回和转让基金份额；
- (4) 根据基金合同的规定，参加或申请召集基金份额持有人大会，行使相关职权；
- (5) 监督管理人、托管人履行投资管理及托管义务的情况；
- (6) 按照基金合同约定的时间和方式获得基金信息披露资料；
- (7) 因管理人、托管人违反法律法规或基金合同的约定导致合法权益受到损害的，有权得到赔偿；
- (8) 法律法规、中国证监会及基金业协会规定的和基金合同约定的其他权利。

2. 投资者的义务

- (1) 认真阅读基金合同，保证投资资金的来源及用途合法；
- (2) 接受合格投资者认定程序，如实填写风险识别能力和承担能力问卷，如实承诺资产或者收入情况，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，应向管理人充分披露上述情况及最终投资者的信息，但符合《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) 按照基金合同约定缴纳基金份额的认购、申购款项，承担基金合同约定的管理费、托管费及其他相关费用；
- (6) 按基金合同约定承担基金的投资损失；
- (7) 向管理人或募集机构提供法律法规规定的信息资料及身份证明文件，配合管理人或募集机构的尽职调查与反洗钱工作；
- (8) 保守商业秘密，不得泄露基金的投资计划或意向等；
- (9) 不得违反基金合同的约定干涉管理人的投资行为；
- (10) 不得从事任何有损基金及其投资者、管理人管理的其他基金及托管人托管的其他基金合法权益的活动；
- (11) 法律法规、中国证监会及基金业协会规定和基金合同约定的其他义务。

第十一节 基金份额持有人大会

(一) 基金份额持有人大会的组成

基金份额持有人大会由全体基金份额持有人组成。

(二) 基金份额持有人大会的召开事由

本基金存续期间，发生下列任一情形的，应当召开基金份额持有人大会：

- (1) 管理人被依法取消资产管理资格或管理人失联超过 20 个工作日；
- (2) 托管人被依法取消资产托管资格或托管人失联超过 20 个工作日；
- (3) 决定修改基金合同的重要内容，本条款指的重要内容的修改包括如下条款：
 - a) 变更基金合同存续期限，但根据本合同约定的管理人有权单方决定的情形除外；
 - b) 更换管理人、托管人；
 - c) 变更基金投资范围、投资限制、预警线、止损线、或转换基金运作方式；
 - d) 本基金与其他基金合并；
 - e) 提高管理人、托管人的报酬标准；
- (4) 管理人认为应由基金份额持有人大会决定的其他事宜；
- (5) 法律法规、中国证监会、基金业协会规定及本合同约定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。

针对前款所列事项，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做出决议，并由全体基金份额持有人在决议文件上签名、盖章。

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。

(三) 基金份额持有人大会的召集

1. 管理人召集

除法律法规规定或本合同另有约定外，基金份额持有人大会由管理人召集。

单独或合计持有基金份额总数 10% 以上（含 10%）的基金份额持有人认为有必要召开基金份额持有人大会的，可向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 30 日内召开；管理人决定不召集、或不能召集的，应通知基金份额持有人。

2. 基金份额持有人召集

(1) 单独或合计持有基金份额总数 10% 以上（含 10%）的基金份额持有人认为有必要召开基金份额持有人大会的，有权自行召集。

(2) 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

日通知管理人、注册登记机构和托管人，管理人或注册登记机构应于收到前述通知之日起 10 个工作日内向上述基金份额持有人提供基金份额持有人的名单。

3. 托管人召集

如出现管理人被依法取消私募基金管理人资格或管理人失联的情形时，托管人有权召集基金份额持有人大会。

(四) 通知

1. 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) 代理投票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。

2. 采取通讯方式开会并进行表决的情况下，由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、委托的公证机关（如有）及其联系方式和联系人、表决的截止日期、书面表决意见的寄交时间和收取方式等事项。

(五) 召开方式

1. 基金份额持有人大会的召开方式包括现场方式和通讯方式，具体召开方式由召集人决定。

2. 现场开会的，基金份额持有人应亲自或委派授权代表出席会议并按本合同约定行使表决权，授权代表参会前应向召集人出具授权委托书。管理人、托管人的授权代表应当列席会议。

3. 以通讯方式开会的，基金份额持有人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（在托管人召集会议的情形下，应送达给托管人），视为出席了会议。

(六) 基金份额持有人大会召开的条件

1. 现场开会

代表会议召开日基金份额总数二分之一以上(含二分之一)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,召集人应另行确定并通知基金份额持有人重新开会的时间和地点。

2. 通讯方式开会

出具书面意见的基金份额持有人持有的基金份额占会议召开日基金份额总数二分之一以上(含二分之一)的,通讯会议方可举行。未能满足上述条件的情况下,召集人应另行确定并通知基金份额持有人重新开会的时间。

(七) 议事程序

1. 现场方式

(1) 会议由管理人授权出席会议的代表主持召开。在管理人未能召集会议的情况下,由出席会议的基金份额持有人所代表的基金份额二分之一以上多数(不含二分之一)选举产生一名代表作为该次基金份额持有人大会的主持人。

(2) 会议主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中选举两名基金份额持有人的授权代表担任监票人。

(3) 会议主持人宣读提案,出席会议的基金份额持有人讨论并进行表决。

(4) 监票人应当在基金份额持有人表决后立即进行清点并由大会主持人当场公布计票结果。如果会议主持人对于提交的表决结果有怀疑,可以对所投票数进行重新清点;如果会议主持人未进行重新清点,而出席会议的基金份额持有人对会议主持人宣布的表决结果有异议,有权在宣布表决结果后立即要求重新清点,会议主持人应当立即重新清点并公布重新清点结果。重新清点仅限一次。

(5) 会议主持人应指定专人制作会议纪要,会议纪要应详细记录大会召开的时间、地点、出席人名单、议题和大会讨论和通过或否决的决议,并由会议主持人签名。

2. 通讯方式

(1) 召集人在公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取基金份额持有人的书面表决意见;

(2) 召集人在所通知的表决截止日期次日在公证机关监督下统计全部有效表决并形成决议。符合会议通知约定的书面表决意见视为有效表决。表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决,但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

(3) 如托管人以视频会议的方式召集份额持有人会议,可不聘请公证机关进行监督。

(八) 表决

1. 基金份额持有人大会不得对未在会议通知载明的事项进行表决。
2. 基金份额持有人所持每份基金份额享有一票表决权。
3. 基金份额持有人大会决议须经出席会议的基金份额持有人所持表决权的二分之一（含二分之一）以上通过；但是转换基金的运作方式、更换基金管理人或托管人、提前终止基金合同、与其他基金合并，应当经出席会议的基金份额持有人所持表决权的三分之二（含三分之二）以上通过，本合同另有约定的除外。
4. 基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。
5. 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。

(九) 基金份额持有人大会决议的效力

基金份额持有人大会决议自通过之日起生效，并自生效之日起对全体基金份额持有人、基金管理人以及基金托管人均有约束力。特别地，如基金管理人/基金托管人未列席基金份额持有人召集的基金份额持有人大会，则该等决议自书面通知至基金管理人/基金托管人之日起，对基金管理人/基金托管人有约束力。

(十) 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。

第十二节 基金份额的登记、转让和非交易过户

(一) 基金份额的登记

管理人委托【国信证券股份有限公司】代为办理本基金的注册登记业务，并与该公司签订了服务协议，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。**注册登记机构对本基金的投资运作不承担任何责任，不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。**

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. 根据法律法规、监管规则的要求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；

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、法律法规、监管规则和本合同另有约定的其他情形除外;

5. 接受管理人的监督;

6. 法律法规及中国证监会规定的和本合同约定的其他义务。

全体基金份额持有人同意管理人、注册登记机构应当按照中国基金业协会的规定办理基金份额登记数据的备份。

(二) 基金份额的转让

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

2. 基金份额的转让应符合国家有关法律法规、监管规则的要求,并按照管理人的要求提供相关资料并履行必要的手续。

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

4. 办理份额转让的变更登记,管理人应向注册登记机构发送书面的基金份额转让指令及转让方与受让方已签署并由管理人确认的基金份额转让协议,管理人应确保其书面指令符合相关法律法规、监管规则以及本合同约定。注册登记机构仅对于材料完备性进行形式审核,不承担审核份额转让是否符合本第(二)条规定的义务。

5. 基金份额的转让行为不影响收益计算的连续性。注册登记机构有权向份额受让方按每笔转让的基金份额发行面值的 0.05%收取过户费,但单次转让交易需缴纳的转让费金额不高于人民币 1000 元。

(三) 非交易过户

1. 管理人及注册登记机构只受理继承、司法强制执行和经注册登记机构认可的其他情况下的非交易过户。其中:

“继承”是指投资者死亡,其持有的基金份额由其合法的继承人继承;

“司法强制执行”是指司法机关依据生效司法文书将投资者持有的基金份额强制划转给其他自然人、法人、社会团体或其他组织的情形。

2. 投资者办理非交易过户业务时,必须提供注册登记机构规定的相关资料。符合条件的非交易过户申请自申请受理日起 2 个月内办理。注册登记机构有权向申请人按规定的标准

收取过户费用。

(四) 基金份额转让或非交易过户的后果

投资者所持基金份额进行转让或非交易过户的，自转让完成之日起，该投资者不再是基金合同的当事人，受让人自转让完成之日起持有所受让的基金份额，并根据基金合同规定享有相应的份额利益，受让人应遵守基金合同规定，按照基金合同行使相应权利、履行相关义务、承担投资风险。

第十三节 基金的财产

(一) 基金财产的保管与处分

1. 基金财产独立于管理人、托管人的固有财产，并由托管人保管，管理人、托管人不得将基金财产归入其固有财产。

2. 除本款第3项约定的情形外，管理人、托管人因基金财产的管理、运用或者其他情形而取得的财产和收益归入基金财产。

3. 管理人、托管人可以按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。管理人、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。管理人、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。非因基金财产本身承担的债务，管理人、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，管理人、托管人应明确告知基金财产的独立性。

5. 管理人、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。

6. 托管人仅负责保管本基金项下托管账户内的现金资产。对于本基金项下未由其保管且未受其实际控制的其他资产（包括现金类资产与非现金类资产），托管人不承担保管职责，且对其安全性和完整性不承担任何责任。管理人负责保管本基金对外投资过程中形成的股权、债权、收益权等非现金资产及相关权利凭证，并应及时将相关权利凭证的复印件加盖公章后交付托管人。管理人应对本基金项下非现金资产及其权利凭证的安全和完整负责。除基金合同另有约定外，管理人不得在该等非现金资产或其权利凭证之上设置抵押、质押或其他权利负担。

7. 本基金项下，管理人代表本基金与交易对手签订投资协议、开立相关账户及办理相关登记手续，并按照投资协议的约定行使相关权利和履行相关义务。托管人对于基金对外投资而产生的风险不承担任何责任。管理人未按投资协议约定行使相关权利、履行相关义务或处分基金财产不当而使基金财产遭受损失的，托管人亦不承担任何责任。

(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) 托管人按照规定在商业银行开立与本基金有关的资金账户，管理人应配合托管人办理账户开立事宜并提供相关资料。

(2) 托管账户的开设和管理由托管人负责。本基金的一切货币收支活动，包括但不限于对外投资、支付退出金额、支付基金收益、收取申购款，均需通过该账户进行。

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

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

2. 其他账户的开设和管理

因投资运作而需要开立的其他账户，由托管人或管理人根据有关法律法规的规定开立。如该等账户是由管理人负责开立的，管理人开立此类账户后需及时通知托管人，且应保证该账户专款专用。证券账户和期货账户的持有人名称应当符合证券、期货登记结算机构的有关规定。

3. 开立的上述基金财产账户与管理人、托管人、募集机构和注册登记机构自有的财产账户以及其他基金财产账户相独立。

4. 对于非由托管人管理的账户，托管人不承担保管职责。

第十四节 划款指令的发送、确认与执行

(一) 交易清算授权

管理人应事先向托管人发送书面授权通知（以下称“授权通知”）正本，指定有权向托管人发送划款指令的被授权人员，授权通知应包括被授权人的名单、权限、预留印鉴和签章样本。授权通知应加盖管理人公章并注明生效时间，托管人在收到授权通知当日以录音电话的方式向管理人进行确认。授权通知经托管人确认后于授权通知载明的生效时间生效。但如托

管人收到授权通知的日期晚于授权通知载明的生效时间,则授权通知自托管人确认收到该授权通知之日生效。

(二) 划款指令的内容

划款指令是在管理基金财产时,管理人向托管人发出的资金划拨及其他款项支付的指令。管理人发给托管人的指令应写明本基金全称、付款方账户信息、收款方账户信息、支付日期、付款金额、事由等,加盖预留印鉴并由被授权人签字或签章。采用电子划款指令的,管理人应与托管人就指令发送的签字、内容、方式、有效性等方面另行签订协议。

(三) 划款指令的发送、确认和执行的程序和程序

划款指令由授权通知确定的有权发送人(下称“被授权人”)代表管理人用传真、电子邮件(为免歧义,本节所指“电子邮件方式”均指以电子邮件发送扫描件方式)或托管人和管理人认可的其他方式向托管人发送。管理人有义务在发送指令后与托管人以录音电话的方式进行确认。指令以获得收件人(托管人)确认该指令已成功接收之时视为送达收件人(托管人)。因管理人未能及时与托管人进行指令确认,致使资金未能及时清算所造成的损失,托管人不承担责任。托管人依照授权通知规定的方法对指令进行表面审慎验证确认指令有效后,方可执行划款指令。

对于被授权人依照授权通知发出的划款指令,管理人不得否认其效力。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,被授权人应按照其授权权限发送划款指令。管理人在发送划款指令时,应为托管人留出执行划款指令所必需的时间。管理人发送银证、银期、银行转账的有效划款指令的截止时间为每一个工作日的 13:30,发送银行转账的有效划款指令的截止时间为每一个工作日的 15:00;如管理人要求当天某一时点到账,则划款指令需提前2个工作小时发送;管理人和托管人可另行书面约定关于某一类划款指令的具体时限要求。管理人发送的划款指令不符合前述时限要求的,托管人尽力配合执行,但不保证划款成功。由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,致使资金未能及时清算所造成的损失由管理人承担。

托管人收到管理人发送的划款指令后,应对划款指令进行形式审查,复核无误后应在规定期限内及时执行,不得延误。为免歧义,托管人的形式审查义务仅限于:(1) 确认划款指令要素(限于日期、金额、收款人名称、账号、开户行、用途)齐全,指向的交易内容符合本合同约定;(2) 确认划款指令上加盖的印鉴和被授权人的签字/签章与授权通知中预留印鉴和签章样本表面相符。前述审查原则适用于本合同项下所有划款指令传真件或电子邮件。托管人不对划款指令中加盖的印鉴及被授权人签字/签章的真实性、有效性负责,因管理人提交的划款指令中加盖的印鉴或被授权人签字/签章不真实、无效产生的责任或给基金资产带来的损失由资产管理人承担,与托管人无关。

若存在异议或不符,托管人应与管理人指定人员进行电话联系和沟通,暂停划款指令的执行并要求管理人重新发送经修改的划款指令。托管人有权要求管理人以传真或电子邮件形

式提供相关交易凭证、投资协议或其他有效会计资料（上述资料应加盖管理人公章），待收齐相关资料并判断划款指令有效后重新开始执行划款指令。管理人应在合理时间内补充相关资料，并给托管人执行划款指令预留必要的执行时间。管理人应保证其提交的上述文件资料的真实、合法、完整和有效，托管人不负责审查该等文件资料的真实性、合法性、完整性和有效性。

管理人向托管人下达划款指令时，应确保本基金托管账户有足够的资金余额，对管理人在没有充足资金的情况下向托管人发出的划款指令，托管人可不予执行，并立即通知管理人，托管人不承担因为不执行该划款指令而造成损失的责任。

(四) 托管人依照法律法规暂缓、拒绝执行划款指令的情形和处理程序

托管人发现管理人发送的划款指令违反《中华人民共和国证券投资基金法》、《暂行办法》、《暂行规定》、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管理人纠正，管理人收到通知后应及时核对，并以书面形式对托管人发出回函确认，由此造成的损失由管理人承担。

(五) 管理人发送错误划款指令的情形和处理程序

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

(六) 更换被授权人的程序

管理人撤换被授权人员或改变被授权人员的权限，必须提前至少一个工作日，使用传真、电子邮件或管理人和托管人认可的其他方式向托管人发出加盖管理人公章的书面变更通知（“变更通知”），同时电话通知托管人，托管人收到变更通知当日通过录音电话方式向管理人进行确认。被授权人变更的通知须列明新授权的起始日期。变更通知的生效日期按照变更通知上列明的新授权的起始日期与托管人确认收到的日期孰晚原则确定。管理人在此后三日内将被授权人变更通知的正本送交托管人。变更通知书面正本内容与托管人收到的传真件/电子邮件不一致的，以托管人收到的传真件/电子邮件为准。

(七) 划款指令的保管

划款指令若以传真或电子邮件形式发出，则正本由管理人保管，托管人保管指令传真件或电子邮件。当两者不一致时，以托管人收到的指令传真件或电子邮件为准。

(八) 相关责任

托管人正确执行管理人发出的符合本合同约定的划款指令，基金财产发生损失的，托管人不承担任何形式的责任。在正常业务受理渠道和划款指令规定的时间内，因托管人存在过错而未能及时或正确执行符合本合同规定的划款指令而导致基金财产受损的，托管人应承担相应的责任，但托管人如遇到不可抗力的情况除外。

如果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章样本或发送划款指令时提交的文件资料不真实、不合法、不完整或失去效力等非托管人原因造成的情形，只要托管人根据本合同相关规定履行形式审核职责，托管人不承担因执行有关划款指令或拒绝执行有关划款指令而给管理人或基金财产或任何第三人带来的损失，全部责任由管理人承担，但托管人未按合同约定履行形式审核义务执行划款指令而造成损失的情况除外。

第十五节 交易及清算交收安排

一、选择证券经纪机构及证券投资资金清算安排

（一）选择代理证券买卖的证券经营机构的程序

1、管理人负责选择代理本基金财产证券买卖的证券经营机构，并与其签订证券交易委托代理协议。除非托管人书面同意，本基金的证券经营机构不得超过1家。

2、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托管人。

（二）证券交易数据发送和接收

本基金的证券交易数据传输具体操作及时间要求按照管理人、托管人及证券经纪商签订的《证券投资托管操作备忘录》的约定执行。

（三）证券交易的资金清算与交割

1、证券交易资金的清算

管理人的投资指令执行后，因本基金投资于证券发生的所有二级市场交易的清算交割，由管理人选择的证券经纪商负责办理。

2、结算方式

支付结算按中国人民银行、中国银监会、中国证券登记结算有限公司的有关规定办理。

（四）清算交割处理

资金划转的方式在符合银行资金结算的有关规定的情况下可由托管人和管理人共同商定。

二、选择场内期权经纪机构及场内期权投资资金清算安排

一般情况下，管理人应选择其聘请的证券经纪机构作为其场内期权经纪商；在此情形下，场内期权交易数据发送和接收、资金清算与交割按照本章节第一条相关约定进行处理。

若管理人聘请其证券经纪机构以外的机构作为其场内期权经纪商的，应就场内期权交易数据发送和接收、资金清算与交割事宜与场内期权经纪商、托管人另行签署书面协议。

三、选择期货经纪机构及期货投资资金清算安排

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。本基金的交易数据传输具体操作及时间要求按照管理人、托管人及期货经纪商签订的《期货投资托管操作备忘录》的约定执行。

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

四、关于银证、银期、银行转账操作的特殊安排

鉴于银证、银期、银行转账是在托管账户与证券资金账户、期货资金账户或期权资金账户之间封闭划转,为提高资金划转的效率,管理人可根据实际投资需要,向托管人申请由其自行通过交易客户端进行银证、银期、银行转账操作,由管理人自行负责跟进资金转账过程和结果,托管人可根据实际情况决定是否授权。对于已授权管理人自行操作的,转账失败的由管理人负责查明原因和解决,托管人无需负责。由基金管理人自行进行的进行银证、银期、银行转账,管理人应于转账日日终向托管人提供转账流水。

对于因银行系统等原因,无法授权管理人自行进行银证、银期、银行转账操作的,管理人根据本合同的约定出具银证、银期、银行转账指令,托管人审核通过后,将相应资金从基金托管账户划到证券/期货/期权资金账户。

未经托管人同意,管理人不对银证、银期、银行转账密码进行修改;经托管人同意后进行修改的,应立即将修改后的密码通知托管人;否则托管人对因此造成的证券、期货、期权资金账户出金交易的影响不承担任何责任。

五、银行间债券市场交易的清算和交收

对于银行间债券市场交易的划款,由管理人根据本合同的约定出具划款指令和成交单(成交单应包括债券名称、债券代码、交收金额、交收日期、对手方信息等必备要素),托管人审核通过后,将相应资金从基金托管账户划到基金银行间市场债券结算资金账户。

托管人通过银行间债券市场资金交收平台完成银行间债券市场交易的最终清算和交收。

六、场外交易的清算和交收

1、对于本章节第一条至第五条所述场所外的交易的清算和交收,以及相关费用的支付,由管理人按照本合同的约定出具划款指令,托管人审核通过后将资金从托管账户划付到相应的收款方账户,但本合同另有约定的除外。

2、开放式基金认购、申购、赎回的交易安排

管理人与托管人在办理开放式基金认购、申购、赎回中的权利、义务、职责遵照有关法律法规规定执行。

管理人申购(认购)开放式基金时,应将划款指令连同基金申购(认购)申请单按本合同第十四节的约定发送至托管人。托管人审核无误后,应及时将划款指令交付执行,并对划

款指令执行情况进行查询，将执行结果通知管理人。管理人应及时向销售机构索取开放式基金申购（认购）确认单并在收到后传真给托管人，以作为双方进行会计核算的依据。

管理人赎回开放式基金时，应同时向基金管理公司或代销机构和托管人发出基金赎回申请书。管理人可通过托管人提供的鑫管家平台实时查询赎回资金到账情况。管理人应及时向销售机构索取开放式基金赎回确认单，并发送给托管人，以作为双方进行会计核算的依据。对于因基金管理公司不能在约定的时间提供开放式基金交易确认凭证、分红凭证、拆分数据等，致使托管人在估值日缺乏必要的核算依据而造成的资产核算和估值差错，托管人不承担相关责任。

七、其他

因投资运作需要由管理人自行为本产品开立交易账户的，管理人须于该账户进行交易前以邮件或其他双方认可的方式告知托管人，并确保相关交易数据及时、准确的发送给托管人，因交易数据未及时提供所造成的影响，托管人不承担任何责任。

第十六节 托管人的监督职责

1. 托管人按照法律法规规定及本节约定对管理人的投资行为行使监督权，托管人对基金财产的监督和检查自本基金建账估值之日起开始。

(1) 受监督手段所限，本基金存续期间，托管人仅对【投资范围、投资限制】列明的场内品种投资进行盘后监督，而非实时监督、管控。因管理人未依照本合同约定的【投资范围、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，托管人不承担任何责任。为避免疑义，托管人受监督手段所限，在盘后监督过程中，不承担对【投资范围、投资策略、投资限制、投资禁止行为】中约定的以下事项的投资监督职责：本合同“基金的投资”章节第（三）项、第（五）项。

(2) 对于场外品种的投资，托管人将在划款前根据本合同“划款指令的发送、确认与执行”章节对相应的划款指令、投资申请书、投资协议等管理人所提供的材料是否符合【投资范围、投资限制】进行形式审核。场外投资是指除直接或者间接投资于中国金融期货交易所、上海期货交易所、大连商品交易所、郑州商品交易所挂牌交易的期货产品，以及上海证券交易所、深圳证券交易所、全国中小企业股份转让系统及上海黄金交易所挂牌交易的各种金融产品以外的产品。

(3) 托管人在投资监督职责范围内，发现产品运作中有不符合合同约定或者达到合同约定的条件时，托管人拟定《业务提示函》通过电子邮件的方式通知管理人。

2. 托管人及外包服务机构不承担对于本合同“基金的投资”章约定的第(八)项风险控制机制的执行情况进行监督的职责。

3. 托管人仅负责保管本基金项下托管账户内的现金资产,对于本基金项下未由其保管且未受其实际控制的其他资产(包括现金类资产与非现金类资产),托管人不承担保管职责,且对其安全性和完整性不承担任何责任。

4. 托管人对于本基金投资收益分配承担的复核职责仅限于:对收益分配的总金额进行复核,对于在不同类别投资者之间分配的金额和顺序是否符合合同约定不承担复核义务。

5. 对于需要外部市场公共数据支持才可以实现的投资监督,托管人不承担保证外部数据的真实、完整、准确的责任,因外部数据提供商提供数据存在瑕疵导致基金财产的损失,托管人不承担任何责任。

6. 全体投资人确认,托管人的投资监督职责以本合同约定为限,且托管人投资监督的准确性和完整性受限于证券经纪商及其他中介机构提供的数据和信息,合规投资的最终责任在管理人。

7. 托管人对管理人投资运作的监督,以投资政策及经管理人与托管人核对确认的核算估值结果为根据。

第十七节 基金财产的估值和会计核算

(一) 基金财产的估值

1. 估值目的

基金财产估值目的是客观、准确地反映基金财产的价值。

2. 估值时间

本基金的估值核对日为每周最后一个工作日、开放日、收益分配基准日、基金终止日。管理人、托管人应于估值核对日次工作日计算估值核对日的资产净值、基金份额净值。

3. 估值依据

估值应符合本合同、《证券投资基金会计核算业务指引》及其他法律、法规的规定,如法律法规未做明确规定的,参照证券投资基金的行业通行做法处理。估值数据依据合法的数据来源独立取得。

4. 估值对象

基金所拥有的股票、期货、债券、基金和银行存款本息等资产及负债。

5. 估值方法

(1) 银行存款每日计提应收利息，按本金加应收利息计入资产。

(2) 期货以估值日金融期货交易所的当日结算价估值，该日无交易的，以最近一日的当日结算价估值。

(3) 证券交易所上市的有价证券的估值

A.交易所上市的有价证券（包括股票、权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近工作日后经济环境未发生重大变化，以最近工作日的市价（收盘价）估值；如最近工作日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

B.交易所上市实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，估值日没有交易的，且最近工作日后经济环境未发生重大变化，按最近工作日的收盘价估值。如最近工作日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

C.交易所上市未实行净价交易的债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；估值日没有交易的，且最近工作日后经济环境未发生重大变化，按最近工作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。如最近工作日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

D.交易所上市不存在活跃市场的其他有价证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值；

E.交易所上市的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

(4) 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；

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

C.首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的估值方法估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

(5) 证券投资基金估值方法：

A.上市流通的证券投资基金按估值日其所在证券交易所的收盘价估值;估值日无交易的,以最近一个工作日的收盘价估值;

B.场外认购或申购的开放式基金(包括托管在场外的上市开放式基金(LOF))以估值日前一工作日基金净值估值,估值日前一工作日开放式基金份额净值未公布的,以前最近一个工作日基金净值计算。货币基金以成本估值,每日按前一工作日的万份收益计提红利。

(6)融资融券业务的估值核算方法,经管理人和托管人协商一致,按最能反应该类资产公允价值的方法估值。

(7)固定收益类产品,按照固定收益率每日计提收益;定期公布份额净值的产品,按该产品管理人于估值日前一工作日公布的份额净值进行估值,估值日前一工作日份额净值未公布的,以该产品管理人公布的此前最近一个工作日份额净值计算;既无固定收益率,也不定期公布份额净值的,按成本估值。

(8)全国银行间债券的估值采用中央国债登记结算有限责任公司或银行间市场清算所股份有限公司当日公布的估值价确定公允价值,当日未提供的,使用最近一日的债券估值价进行估值。

(9)同一债券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。

(10)持有资产支持证券等固定收益品种,采用估值技术确定公允价值。

(11)中小企业私募债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。

(12)持有回购以成本列示,按商定利率在回购期间内逐日计提应收利息。

(13)期权合约的收盘价为当日该合约的最后一笔成交价格,当日无成交的,以上一工作日收盘价为当日收盘价。期权合约挂牌首日无成交的,以交易所公布的开盘参考价作为当日收盘价。

(14)场外衍生品在工作日按照实际支付金额计入产品成本,到期日前按照成本估值。衍生品终止日按照实现的收益冲减产品成本,差额计入投资收益。

(15)全国中小企业股份转让系统挂牌的股票,以其估值日在全国中小企业股份转让系统挂牌的市价(收盘价)估值;估值日无交易、且最近工作日后经济环境未发生重大变化,以最近工作日的市价(收盘价)估值;如最近工作日后经济环境发生了重大变化的,可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易市价,确定公允价格;若监管机构或行业协会等出台有关全国中小企业股份转让系统挂牌的股票的估值方法,则以该估值方法进行估值。管理人与托管人就该估值方法达成一致后,通过网站公告的方式公告新的估值方法,无需征询投资者的意见。

(16)如存在上述估值约定未覆盖的投资品种,管理人可根据具体情况,在与托管人商议后,按最能反映该投资品种公允价值的方法估值。

如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的,管理人可根据具体

情况与托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

因核算估值需要的其他相关信息，若托管人和外包服务机构无法公开取得，应由管理人负责向托管人和外包服务机构（如有）提供，若无法提供，管理人应与托管人和外包服务机构（如有）协商解决方案。因管理人未及时提供或协商出解决方案影响估值结果的，托管人和外包服务机构（如有）不承担责任。

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。

6. 估值程序

管理人于每个估值核对日的次工作日计算估值核对日的基金财产净值、基金份额净值并以传真方式或其他管理人和托管人认可的方式发送给托管人。托管人对净值计算结果复核后盖章并以传真方式或其他管理人和托管人认可的方式传送给管理人。

7. 估值错误的处理

如管理人或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或者未能充分维护投资者利益时，应立即通知对方，共同查明原因，协商解决。

当基金资产估值出现错误时，管理人和托管人应当立即予以纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大。当基金资产估值错误偏差达到基金财产净值的 0.5% 时，管理人应该立即报告投资者，并说明采取的措施，立即更正。如管理人和托管人对基金资产净值的计算结果，虽然多次重新计算和核对尚不能达成一致时，为避免不能按时披露基金资产净值的情形，以管理人的计算结果对外披露，由此给投资者和基金财产造成的损失，托管人予以免责。

估值错误的责任人应当且仅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。因估值错误而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。

由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，进而导致基金财产净值计算错误造成投资者的损失，以及由此造成以后估值核对日基金财产净值计算顺延错误而引起的投资者的损失，由提供错误信息的当事人一方负责赔偿。

8. 暂停估值的情形

- (1) 基金管理人或基金托管人遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；
- (2) 因不可抗力或其他情形致使管理人、托管人无法准确评估基金财产价值时；
- (3) 中国证监会认定的其他情形。

9. 特殊情况的处理

- (1) 管理人按本合同约定的估值方法进行估值时，所造成的误差不作为估值错误处理。
- (2) 由于不可抗力原因，或由于证券交易所、登记结算机构、注册登记机构等发送的数据错误，管理人和托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错

误的，由此造成的基金财产估值错误，管理人和托管人可以免除赔偿责任。但管理人和托管人应当积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。

(二) 基金的会计政策

1. 管理人为本基金的主要会计责任方。
2. 本基金的会计年度为公历年度的1月1日至12月31日。
3. 基金核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位。
4. 会计制度执行国家有关会计制度。
5. 本基金单独建账、独立核算。
6. 管理人应保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照本合同约定编制会计报表。
7. 托管人定期与管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以书面方式确认。

第十八节 基金的费用与税收

(一) 基金费用的种类

1. 除非份额持有人另行支付或本合同另有约定，基金财产运作过程中发生的下列费用（“基金费用”）由基金财产承担：
 - (1) 管理人的管理费；
 - (2) 托管人的托管费；
 - (3) 外包服务机构的外包服务费；
 - (4) 管理人的业绩报酬（如有）；
 - (5) 与基金设立及运作相关的资产评估师费、会计师费、律师费等聘请中介机构的费用；
 - (6) 文件或账册的制作费、印刷费及其他费用；
 - (7) 银行账户的资金结算汇划费、账户维护费；
 - (8) 基金财产开立账户需要支付的费用；
 - (9) 基金终止时的清算费用；
 - (10) 为解决因基金财产及基金事务产生的纠纷而产生的费用，包括但不限于诉讼费、仲裁费、律师费、拍卖费及其他形式的资产处置费等费用；
 - (11) 基金财产管理、运用及处分过程中发生的税费（如有）；
 - (12) 按照国家有关法律法规规定和本合同约定，可以在基金资产中列支的其他费用。

2. 管理人负责上述各项费用的核算工作，并应妥善保管上述费用的相关单据、凭证。除非特别说明，上述费用均在发生时或根据相关的合同约定由管理人指令托管人从托管账户中支付，并按实际支出金额列入当期费用。管理人或托管人如以固有财产先行垫付基金费用的，有权根据实际发生额（以发票为准）从基金财产中优先获得补偿；尽管有本条款约定，托管人不承担垫付任何基金费用的义务。

3. 本节第（一）款第1项所述之“银行账户的资金结算汇划费、账户维护费”由开户银行自动扣划，无需管理人向托管人出具划款指令。

（二）费用计提方法、计提标准和支付方式

1. 管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金财产净值的1.5%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times R \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的管理费

E 为前一日的基金财产净值

R 为本基金的年管理费率

本基金的管理费自基金合同生效日起，每日计提，按季（为免歧义，本合同中所提及的“季/季度”均指“自然季度”）支付。管理费经管理人与托管人核对一致后，托管人于次季五个工作日内从托管账户中将该季度的管理费划至管理人指定账户。管理人应保证支付日在托管账户中预留足额资金。若托管账户余额不足支付管理费的，托管人可从本基金在证券经纪机构处开立的保证金账户中将资金划回托管账户，用于支付。以上由托管人执行的费用支付行为，无需管理人出具划款指令。管理人在执行交易决策时，需考虑费用支付对可用交易金额的影响。

管理人收款账户信息：

户名：上海天迪资产管理有限公司

账号：216082380810001

开户银行：招商银行上海分行营业部

以上收款账户如有变更的，管理人需至少提前两个工作日以告知函的形式通知托管人，账户变更生效日为托管人收到告知函的次一工作日。

2. 托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金财产净值的0.08%年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times R \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的托管费

E 为前一日的基金财产净值

R 为本基金的年托管费率

本基金的托管费自基金合同生效日起，每日计提，按季支付。托管费经管理人与托管人核对一致后，托管人于次季五个工作日内从托管账户中划至托管人指定账户。管理人应保证支付日在托管账户中预留足额资金。若托管账户余额不足支付托管费的，托管人可从本基金在证券经纪机构处开立的保证金账户中将资金划回托管账户，用于支付。以上由托管人执行的费用支付行为，无需管理人出具划款指令。管理人在执行交易决策时，需考虑费用支付对可用交易金额的影响。

托管人指定的接收托管费的银行账户信息如下：

账户名称：国信证券股份有限公司

账号： 7442710187000001914

开户行：中信银行香蜜湖支行

3. 外包服务机构的外包服务费

本基金的外包服务费按前一日基金财产净值的 0.08% 年费率计提。外包服务费的计算方法如下：

$H = E \times R \div \text{当年天数}$

H 为每日应计提的外包服务费

E 为前一日的基金财产净值

R 为本基金的年外包服务费率

本基金的外包服务费自基金合同生效日起，每日计提，按季支付。外包服务费经管理人与托管人核对一致后，托管人于次季五个工作日内从托管账户中划至外包服务机构指定账户。管理人应保证支付日在托管账户中预留足额资金。若托管账户余额不足支付外包服务费的，托管人可从本基金在证券经纪机构处开立的保证金账户中将资金划回托管户，用于支付。以上由托管人执行的费用支付行为，无需管理人出具划款指令。管理人在执行交易决策时，需考虑费用支付对可用交易金额的影响。

外包服务机构指定的接收外包服务费的银行账户信息如下：

账户名称：国信证券股份有限公司

账号： 7442710187000001914

开 户 行：中信银行香蜜湖支行

4. 业绩报酬

本基金业绩报酬计提基准日为基金固定开放日、份额赎回日，收益分配基准日和基金终止日。

本基金在开放日提取业绩报酬，对于非赎回份额，以扣减基金份额持有人份额的方式提取，对于赎回份额，以扣除赎回资金的方式提取；在收益分配基准日提取业绩报酬，业绩报酬从投资者的分红中扣除；在基金终止日提取业绩报酬，业绩报酬从投资者的清算资金中扣除。

单个基金份额持有人单笔投资基金份额业绩报酬计算公式如下：

$$PF_{i,j} = F_{i,j} \times (NAV_1 - HWM_{i,j}) \times 20\%$$

$$\Delta S_{i,j} = \frac{PF_{i,j}}{NAV}$$

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

$F_{i,j}$ ：第 i 个基金份额持有人第 j 笔投资的基金份额；

NAV_1 ：本计提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，为该笔份额上一次提取业绩报酬时的基金份额累计净值；若该笔份额还未提取过业绩报酬，则 $HWM_{i,j}$ 为该笔份额认购/申购时基金份额净值

$\Delta S_{i,j}$ ：对于固定开放日未赎回的份额提取业绩报酬时，第 i 个基金份额持有人第 j 笔投资提取的业绩报酬对应的应调减份额；

NAV ：本计提日基金份额单位净值。

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 笔投资提取的业务报酬为零，基金管理人就该笔投资不提取业绩报酬。

某计提日提取的业绩报酬总额为该计提日所有单个投资者各笔投资业绩报酬之和（包括以扣减基金份额方式收取的，从赎回资金、分红资金或清算资金中扣除的业绩报酬，下同）。某计提日单个基金份额持有人计提的业绩报酬总额为该投资者持有的各笔投资业绩报酬之和。

管理人的业绩报酬的计算和复核工作由管理人完成，托管人不承担复核业绩报酬的责任。由管理人向托管人发送划付指令，托管人于收到指令后 5 个工作日内从基金资产中一次性支

付给管理人。

管理费、托管费、外包服务费、业绩报酬等基金费用若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

(三) 不列入基金业务费用的项目

1. 管理人和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. 管理人和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、中国证监会及基金业协会的有关规定不得列入基金费用的项目。

(四) 基金的税收

1. 管理人和托管人根据国家法律法规规定，履行纳税义务。
2. 份额持有人从基金财产中获得的各项收益，由份额持有人根据国家法律法规的规定，自行办理纳税申报并履行纳税义务。管理人不代扣代缴企业所得税和个人所得税（法律另有规定的除外）。

第十九节 基金的收益分配

(一) 可供分配利润构成

本基金可供分配利润的构成为本基金已实际实现的投资收益减去全部应由基金财产承担的税赋和费用后的余额。

(二) 收益分配原则

1. 本基金存续期内，由管理人决定是否进行收益分配以及收益分配的次数；
2. 本基金由管理人决定收益分配基准日及收益分配发放日；
3. 本基金每一份额享有同等的分配权；
4. 收益分配基准日基金的份额净值减去每份额收益分配金额后不能低于 1.00；
5. 收益分配比例：由管理人根据基金运作情况决定；
6. 法律、法规或监管部门另有规定的从其规定。

（三） 收益分配方式

本基金的收益分配方式为现金分红，每位投资者获得的分红收益金额保留小数点后 2 位，第 3 位四舍五入，由此产生的差额部分计入基金资产的损益。

（四） 收益分配方案的确定与公告

存续期内，进行收益分配的，管理人应计算可供分配利润，并拟定基金收益分配方案，收益分配方案须载明可供分配利润、分配对象、收益分配基准日、收益分配发放日、分配数额、分配方式等内容。管理人应将分配方案发送给托管人，托管人在收到之日起 5 个工作日内完成复核，由管理人按本合同“信息披露”章节约定的方式及时向份额持有人披露经复核的收益分配方案。

托管人仅对收益分配的总金额进行复核，对于在不同投资者之间分配的金额和顺序是否符合合同约定不承担复核义务。

（五） 收益分配方案的执行

管理人依据收益分配方案的规定向托管人发送划款指令，托管人按照管理人的指令及时将可供分配款项划付至基金募集账户或外包服务机构开立的清算账户，由管理人或其委托的募集账户/清算账户监督机构向投资者划付具体分配款项。

第二十章 信息披露与报告

一、信息披露义务人

本私募基金的信息披露义务人为管理人，除非本合同另有约定，管理人应承担《私募投资基金信息披露管理办法》规定的信息披露义务人的全部职责。

二、管理人的信息披露

（一） 管理人的信息披露的内容和频率

1. 基金成立公告

管理人应在本基金成立后 5 个工作日内在管理人网站就本基金的成立进行公告。

2. 季度报告

自基金成立之日起,管理人于每季度结束之日起 10 个工作日内向投资者披露基金净值、主要财务指标以及投资组合情况等信息。管理人应于每季度结束之日起 7 个工作日内将上述待披露信息发送给托管人,托管人应于 3 个工作日内完成复核。

3. 年度报告

自基金成立之日起,管理人于每个自然年度结束之日起 4 个月内向投资者披露本私募基金年度报告,报告应包括如下内容:

- (1) 报告期末本私募基金净值和基金份额总额;
- (2) 本私募基金的财务情况;
- (3) 本私募基金投资运作情况;
- (4) 本私募投资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;
- (5) 投资收益分配和损失承担情况;
- (6) 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。

私募基金成立不满 3 个月的,不编制当期的私募基金年度报告。管理人应于每个自然年度结束之日起 70 个工作日内编制完成本私募基金年度报告,并发送给托管人,托管人应于收到本私募基金年度报告之日起 10 个工作日内完成复核。

4. 净值报告

若本私募基金管理规模金额达到 5000 万元以上的,管理人应于基金存续期间内每月结束后的 5 个工作日内向投资者披露最近估值核对日的基金份额净值。

5. 临时报告

发生以下重大事项的,管理人应当及时向投资者披露:

- (1) 本私募基金名称、注册地址、组织形式发生变更的;
- (2) 投资范围和投资策略发生重大变化的;
- (3) 变更本私募基金管理人或托管人的;
- (4) 管理人的法定代表人、执行事务合伙人(委派代表)、实际控制人发生变更的;
- (5) 触及本私募基金止损线或预警线(如有)的;
- (6) 管理费率、托管费率或本合同约定的其他费率发生变化的;
- (7) 本私募基金收益分配事项发生变更的;
- (8) 本私募基金触发巨额赎回的;
- (9) 本私募基金存续期变更或展期的;

- (10) 本私募基金发生清盘或清算的；
- (11) 本私募基金发生重大关联交易事项的；
- (12) 本私募基金管理人、实际控制人、高管人员涉嫌重大违法违规行为或正在接受监管部门或自律管理部门调查的；
- (13) 涉及私募基金管理业务、基金财产、基金托管业务的重大诉讼、仲裁；
- (14) 影响投资者利益的其他重大事项。

6. 清算报告

管理人应于基金终止后做出处理基金事务的清算报告,经托管人复核后向投资者进行披露。全体投资者同意管理人可出具未经审计的清算报告。

7. 其他

管理人应承担相关法律法规、监管规则以及《私募投资基金信息披露管理办法》要求的其他信息披露义务。

(二) 管理人的信息披露的方式

本基金的信息披露,管理人可选择下列任何一种或多种方式进行:

(1) 管理人网站

在管理人网站上披露定期报告、临时报告等有关本基金的信息。

(2) 邮寄服务

管理人向份额持有人邮寄定期报告、临时报告等有关本基金的信息。份额持有人在本合同签署页填写的通信地址为送达地址。通信地址如有变更,份额持有人应当及时通知管理人。

(3) 传真、电子邮件、短信、微信

如份额持有人留有传真号、电子邮箱、电话号码等联系方式的,管理人也可通过传真、电子邮件短信、微信等方式将报告信息通知份额持有人。

(三) 披露信息的备份

全体份额持有人同意管理人按照基金业协会的规定对基金披露的有关信息进行备份。

三、托管人的信息披露

(一) 托管人的信息披露的内容

- (1) 托管人托管业务部门负责人变动；
- (2) 托管人发生涉及基金托管业务的重大诉讼或者仲裁；
- (3) 相关法律法规、监管规则以及《私募投资基金信息披露管理办法》明确要求由

托管人独立承担的其他信息披露义务。

（二） 托管人的信息披露的方式

托管人可选择下列任何一种或多种方式进行信息披露：

- （1） 在托管人网站上披露；
- （2） 托管人委托管理人向投资者披露。

如托管人选择委托管理人进行披露，管理人应按照托管人的要求向投资者进行披露。

（三） 净值披露

托管人有权在其网站上披露本基金的净值，但管理人是本基金的信息披露责任方，托管人不承担披露本基金净值的义务。

第二十一节 风险揭示

本基金的风险揭示详见附件一《风险揭示书》。

第二十二节 基金合同的期限、变更、终止

（一） 基金合同的成立与生效

1. 基金合同的成立

基金合同是约定合同当事人之间权利义务关系的法律文件。本合同由管理人及托管人先行以纸质形式签署，经管理人加盖公章、托管人加盖合同专用章以及双方法定代表人或法定代表人授权的代理人签字或盖章后即在管理人及托管人之间成立，双方各保留一份原件。各方同意，托管人自行保存的经双方签署的纸质版本在本基金项下具有优先效力，若任何一方当事人实际签署的合同条款与托管人自行保存的纸质版本不一致的，以托管人保管的版本为准。

投资者认购、参与本基金的，可采用电子签约方式或纸质版合同签约方式签署合同；由管理人负责安排投资者具体签署合同，托管人不参与投资者签署基金合同流程。

采用电子签约方式签署合同的投资者,管理人应将已经管理人和托管人签署的合同版本上传到指定电子交易系统。投资者为法人的,其法定代表人或授权人在指定的电子交易系统中点击确认本合同之日起,本合同成立。投资者为自然人的,经投资者本人或授权的代理人在指定的电子交易系统点击确认本合同之日起,本合同成立。

采用纸质版合同签约方式签署合同的投资者,投资者为法人的,本合同经投资者在已经托管人及管理人签署的基金合同版本上加盖公章、且其法定代表人或法定代表人授权的代理人签字之日起成立;投资者为自然人的,本合同经投资者本人或授权的代理人在已经托管人及管理人签署的基金合同版本上签字之日起成立。

2. 基金合同的生效

在初始销售期签署本合同,且其认购资金足额到达托管账户的投资者,其合同自基金成立之日起生效;在开放日申购参与本基金,签署本合同,且其中购资金足额到达托管账户的投资者,其合同生效日以申购资金到达托管账户日与申购份额确认之日孰晚为准。

3. 基金合同自生效之日起对投资者、管理人、托管人具有同等的法律约束力。投资者承诺认可并同意接受本基金电子合同文本与纸质版文本具有同等法律效力,认可并同意接受电子签约方式具备法律效力。投资者一经确认电子合同文本,不得以任何理由主张电子合同文本或电子签名或电子签约方式无效。

(二) 基金合同的期限

基金合同的存续期限与本私募基金的存续期限一致,自生效之日起算;但本基金合同生效期届满后基金财产的清算、违约责任、争议的处理等条款继续有效。

(三) 基金合同的变更

1. 以下合同变更事项可由管理人自行决定:

- (1) 投资经理的变更;
- (2) 基金份额认购/申购的原则、时间、业务规则等设置(不包括上调认购费、申购费率、开放日的变更等涉及投资者权利、义务的条款);
- (3) 法律法规、中国证监会、基金业协会规定及本合同约定的可以由管理人自行决定的其他事项。

2. 以下合同变更事项可由管理人和托管人协商一致后决定:

- (1) 调低管理人、托管人的报酬标准;
- (2) 因法律法规、中国证监会、基金业协会的相关规定发生变化而需要对基金合同进

行变更；

(3) 对本合同的修改，对基金份额持有人利益无实质性不利影响或不会导致本合同当事人权利义务关系发生变化；

(4) 法律法规、中国证监会、基金业协会规定可由管理人和托管人协商决定的其他事项。

3. 除上述第 1 项、第 2 项约定的情形以及根据本基金合同约定需要召开基金份额持有人大会决定的事项外，应通过如下任一方式变更基金合同：

(1) 基金合同的变更获得管理人、托管人及所有份额持有人一致书面同意；或

(2) 管理人就基金合同变更获得托管人的书面同意后，在其官方网站就基金合同变更内容进行公告，投资者不同意合同变更的，可在管理人公告明确的时间内退出本私募基金，投资者未在管理人公告明确的时间内申请退出的，视为同意合同变更，投资者退出本私募基金后，其对合同补充或修改的异议将不影响合同的变更，投资者同意，无论其是否提出退出申请，管理人变更合同的行为均不应被视为或裁定为管理人的违约行为。

4. 基金合同发生变更、补充的，管理人应当按照基金业协会的要求及时向基金业协会报告。

(四) 基金的终止

发生下列任一情形的，本基金终止：

1. 基金预计存续期限届满而未延期的；
2. 基金份额持有人大会决定终止的；
3. 管理人、托管人职责终止，在 6 个月内没有新管理人、新托管人承接的；
4. 法律法规和本合同规定的其他情形。

(五) 基金合同的解除

根据本合同约定适用投资冷静期及回访确认机制的投资者在募集机构回访确认成功前有权以下述任一种方式解除基金合同：(1) 向募集机构提交经投资者签署的书面函件要求解除合同或撤销认购/申购申请；(2) 向募集机构指定邮箱发送电子邮件要求解除合同或撤销认购/申购申请；或 (3) 在募集机构进行回访确认时明确表示要解除合同或撤销认购/申购申请。但《募集办法》第三十二条列明的投资者不享有本条款规定的解除权。

第二十三节 基金财产的清算

（一） 清算日

本基金终止后，应当按照法律法规和本合同的有关约定对基金财产进行清算。本基金终止日即基金财产清算之日。

（二） 基金财产清算小组

1. 基金财产清算小组成员由管理人、托管人组成。清算小组可以聘用必要的工作人员。
2. 基金财产清算小组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。
3. 清算小组各成员的具体职责以本节约定为准，本节未约定的，清算小组成员可以书面形式进行补充约定。

（三） 基金财产清算的程序

1. 基金终止后，由清算小组统一接管基金财产；
2. 对基金财产进行清理和确认；
3. 对基金财产进行变现；
4. 制作清算报告；
5. 对基金剩余财产进行分配。

（四） 基金财产清算报告的告知安排

管理人应于基金终止日后【10】个工作日内完成基金财产的清理、确认、评估和变现等事宜，编制清算报告并发送给托管人。托管人于收到清算报告后5个工作日内完成复核并发送回管理人。管理人应于收到后【5】个工作日内按照本合同“信息披露章节”约定的方式向份额持有人披露清算报告。

（五） 清算费用

清算费用是指基金财产清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。清算费用包括但不限于：

1. 聘请会计师、律师，以及其他工作人员所发生的报酬；
2. 基金财产的保管、清理、估价、变现和分配产生的费用；
3. 信息披露所发生的费用；

4. 诉讼仲裁所发生的费用；
5. 其他与清算事项相关的费用。

(六) 基金清算剩余财产的分配

管理人依据基金财产清算的分配方案,将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、应由基金承担的税款、基金其他费用及债务后,按照本合同约定进行分配。分配顺序如下:

1. 支付清算费用;
2. 缴纳所欠税款;
3. 支付管理费、托管费、外包服务费等基金相关费用;
4. 清偿基金债务;
5. 剩余基金财产扣减应计提的业绩报酬后(如有)按各份额持有人的份额比例进行分配;
6. 向管理人支付业绩报酬(如有)。

特别地,如分配时托管账户中的现金不足以按照上述顺序进行分配时,优先用于支付顺序在前的分配项目。

除交易所、登记结算机构、开户银行等自动扣缴的费用外,基金财产的分配由管理人向托管人出具划款指令,由托管人复核后办理支付。未免疑义,托管人仅按照管理人的指令及时将可供向份额持有人分配的款项划付至基金募集账户或外包服务机构开立的清算账户,由管理人或其委托代销机构向投资者进行具体分配。

自基金终止日至基金财产向份额持有人实际分配之日的期间,基金财产产生且未被列入基金清算财产的存款利息,用于支付基金财产清算、分配期间产生的银行手续费等,若有结余,归管理人所有;若不足,由管理人支付。

(七) 二次清算

若本基金的部分投资标的不能在本节第(四)项约定的期限内变现完毕的,管理人将本基金届时已完成变现的部分资产按照本合同的约定进行清算。对于其余未能变现的资产,管理人有义务继续变现,变现完成后,管理人进行二次清算并分配。管理人应制定二次清算方案,该方案应经托管人认可,并按照清算报告的披露程序向基金份额持有人进行披露。

二次清算期间,管理人、托管人不计提管理费、托管费,管理人不再进行投资运作。二次清算流程同一次清算。

本基金持有多个未能按期变现投资标的的,管理人可按本条款约定进行多次变现及清算。

(八) 基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件应由管理人按照法律法规、相关监管规则的要求保存。

(九) 基金财产相关账户的注销

基金财产清算完毕后，托管人按照规定注销基金财产的托管账户及其他投资所需账户，管理人应给予必要的配合。

第二十四节 违约责任

(一) 违约责任

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。管理人、托管人在履行各自职责的过程中，违反法律法规规定或本合同约定，给基金财产或基金份额持有人造成损失的，应当分别对各自的行为依法承担赔偿责任，但因各自职责以外的事由与其他当事人承担连带赔偿责任。

(二) 免责条款

1. 管理人及/或托管人不对下列情形下基金财产遭受的损失承担任何责任：

(1) 管理人及/或托管人按照中国证监会、基金业协会的规定或当时有效的法律法规作为或不作为而造成的损失等；

(2) 在没有故意或重大过失的情况下，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) 托管人对因基金对外投资产生的存放或存管在托管人以外机构的基金财产由于该等机构或该机构会员单位等本合同当事人外第三方的欺诈、疏忽、过失或破产等原因给基金财产造成的损失等；

(4) 管理人对因基金对外投资产生的存放或存管在托管人以外机构的基金资产，在谨慎挑选并要求保证基金财产安全的前提下，就该机构对基金财产的安全保管义务及该机构或该机构会员单位等本合同当事人外第三方的欺诈、疏忽、过失或破产等原因给基金财产造成的损失等；

(5) 托管人不负责本基金投资项目的审核义务，对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 and 法律责任，托管人不予承担。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：基金初始销售期间存放于募集账户的资金；由于基金收益分配及清算而已经从托管账户划拨出的资金；由于投资从托管账户划拨出的资金及所购买的资产等。托管资产离开托管账户后发生损失的，托管人不承担任何责任。由于非托管人的过错致使其保管的资产发生毁损或灭失的，托管人不承担赔偿责任。

(6) 不可抗力；

(7) 法律法规规定及本合同约定的其他情况。

2. 份额持有人理解基金财产的投资、运作、托管面临本合同《风险揭示书》中列举的各类风险，管理人及托管人就委托财产面临的上述固有风险免于承担责任。

3. 本合同签署之后发生的不可抗力事件导致合同当事人无法全部履行或部分履行本合同的，任何一方当事人不承担违约责任，但是，各方当事人应当在合理范围内勤勉尽责，以降低此类事件对基金财产和其他当事人的影响。

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

(四) 本合同所指“损失”均为直接损失。

(五) 本合同任何一方未经其他方事先书面同意，不得使用其他方的商标、标识、商业信息等知识产权，否则守约方有权解除本合同并向违约方追究责任。

(六) 托管人仅承担法律法规规定以及本合同约定的相关责任及义务。如管理人对托管人所承担的责任进行虚假宣传，或以托管人名义或利用托管人商誉进行非法募集资金、承诺投资收益等违规活动，托管人有权向管理人追究违约责任和侵权责任。

第二十五节 争议的处理

(一) 法律适用

本合同的订立、生效、履行、修改、终止及对本合同项下条款的解释，均适用中国法律。

(二) 争议处理

各方当事人同意，因本合同而产生的或与本合同有关的一切争议，合同当事人应尽量通过协商、调解途径解决。经友好协商未能解决的，应提交华南国际经济贸易仲裁委员会，根据该会当时有效的仲裁规则在深圳进行仲裁。仲裁裁决是终局性的，并对各方当事人具有约束力，除裁决另有约定外，仲裁费由败诉方承担。

争议处理期间，合同当事人仍应履行本合同规定的义务，继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同约定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

第二十六节 其他事项

(一) 基金合同的解除或终止，不影响“基金财产的清算”条款、“违约责任”条款、“争议的处理”条款的效力。

(二) 本合同约定的管理人/托管人接收款项或支付款项的日期若不是工作日，顺延至其后的第一个工作日。

(三) 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联系的通讯地址或联络方式；投资者通讯地址或联络方式发生变化，应及时以书面文件形式通知管理人；若投资者未及时将有关变化及时通知管理人，投资者应对由此而造成的影响和损失负责。

(四) 投资者认购的划出账户与接受本基金分配的划入账户，必须为以投资者名义开立的同一个账户。若因特殊原因导致投资者接受本基金分配的划入账户信息发生变化，投资者应及时到管理人处办理变更手续，并出具符合法律法规规定的书面说明，否则投资者应对由此而造成的影响和损失负责。

(五) 本合同如有未尽事宜，由合同各方当事人按有关法律法规、中国证监会、基金业协会的规定协商解决。各方当事人对本合同的任何有效修改、补充均是本合同的有效组成部分，与本合同具有同等的法律效力。

(六) 风险揭示书为本合同的组成部分，和本合同具有同等法律效力。

(七) 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，对本合同所有条款均无异议，并对当事人之间的法律关系及有关权利、义务和责任条款的法律含义有

准确无误的理解。

(八) 本合同壹式叁份，各方各执壹份，每份正本具有同等法律效力。

(以下无正文，为本合同签署部分)

(投资者应务必确保填写的资料正确有效,如因填写错误导致的任何损失,管理人和托管人不承担任何责任)

投资者请填写:

(一) 投资者信息

1. 自然人

姓名:

证件名称: 身份证军官证护照

证件号码:

通讯地址:

邮编:

联系电话:

电子邮箱:

投资者授权之代理人:

证件名称: 身份证军官证护照

证件号码:

通讯地址:

邮编:

联系电话:

电子邮箱:

2. 法人或其他组织

名称:

营业执照号码:

组织机构代码证号码:

(本页无正文, 为《天迪证大量化1号私募证券投资基金基金合同》签署页)

投资者:

法定代表人或授权签字人:

管理人: 上海天迪资产管理有限公司

法定代表人或授权代理人:

托管人: 国信证券股份有限公司

法定代表人或授权代理人:

签署日期: 年 月 日

附件一

天迪证大量化 1 号私募证券投资基金

风险揭示书

为维护投资者的利益，上海天迪资产管理有限公司（“管理人”）在此提示投资者在签署《天迪证大量化 1 号私募证券投资基金基金合同》（“基金合同”）前特别注意如下事项：

一、请投资者仔细阅读本风险揭示书、基金合同以及其他备查文件，确保投资者对本基金有充分、全面的了解，并对其签署该等法律文件并加入本基金后的所有权利、义务有明确的认识，独立自主做出是否签署该等文件的决定。

二、本私募基金面临包括但不限于以下风险：

（一） 基金合同与基金业协会合同指引不一致所涉风险

（1）《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）》

中还有一些具体细节要求对基金合同当事人确不适用，故基金管理人对相应内容做出了合理调整和变动，但对投资者的实际权益无重大实质不利影响，不在此详细列出，请投资者在签署基金合同前仔细阅读合同条款。

（二） 无法按意愿获得收益甚至亏损本金的风险

管理人、托管人均不保证本私募基金投资人获得最低收益或基金本金不受损失，因此，本私募基金投资者面临无法按意愿获得收益甚至亏损本金的风险。

本基金属于[高]风险投资品种，适合风险识别、评估、承受能力[高]的合格投资者。

（三） 不设预警止损机制的风险

本私募基金不设预警止损机制，本基金存续期内如大幅亏损，投资者可能损失全部本金。

（四） 关联交易风险

本基金可能投资于由基金管理人或其关联方管理的产品或者与基金管理人或其关联方管理的其他产品或管理人自身进行交易，管理人确认其已建立防范利益输送和利益冲突的机制，确认该等交易安排合法合规、不存在利益输送等违法违规行；但该等交易仍构成基金

管理人与本基金的关联交易，存在利益冲突风险。

(五) 基金合同变更风险

管理人有可能按照本合同约定的程序和方式变更本合同条款，该等变更不一定与投资者意愿一致，投资者可能面临本合同条款变更的风险。

(六) 退出受限的风险

本基金除开放日外的其他时间封闭运行，不接受委托人的退出申请，委托人面临在投资期内无法按意愿退出的风险。

(七) 本私募基金提前终止的风险

如发生本合同约定的情形，本私募基金存续期限将相应提前终止，投资者面临无法按预期获得收益或无法按意愿退出投资的风险。

(八) 基金存续期内不进行收益分配的风险

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

(九) 基金募集失败风险

如基金初始销售期间届满，不符合本合同约定的基金成立条件的，管理人将宣布基金募集失败，并向投资者返还其交付的认购资金及相应的利息。

(十) 基金未能在基金业协会备案的风险

本基金可能面临管理人在基金成立后未能完成在基金业协会备案手续或迟延完成备案手续，从而导致本基金无法投资或迟延投资，给投资者造成损失的风险。

(十一) 投资标的的相关风险

1. 投资于股票的风险包括但不限于：

- (1) 国家货币政策、财政政策、产业政策等的变化对证券市场产生一定的影响，导致市场价格水平波动的风险；

- (2) 宏观经济运行周期性波动，对股票市场的收益水平产生影响的风险；
 - (3) 上市公司的经营状况受多种因素影响，如市场、技术、竞争、管理、财务等都会导致公司盈利发生变化，从而导致股票价格变动的风险。
2. 投资于债券的风险包括但不限于：
- (1) 市场平均利率水平变化导致债券价格变化的风险；
 - (2) 债券市场不同期限、不同类属债券之间的利差变动导致相应期限和类属债券价格变化的风险；
 - (3) 债券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，或由于债券发行人信用质量降低导致债券价格下降的风险。
3. 投资于金融衍生品的风险包括但不限于：
- (1) 本私募基金将投资于商品期货、股指期货、国债期货、期权等金融衍生品。无论管理人是否出于投机目的对金融衍生品进行投资，由于金融衍生品的高杠杆性等特征，对金融衍生品的投资无论在任何情况下均具有较高的风险；
 - (2) 管理人并非期货交易所会员，以期货交易所会员（即期货经纪人）之客户的身份参与期货交易，可能存在因期货经纪人违规经营、管理疏忽、资金能力出现问题等原因而导致本私募基金蒙受损失；
 - (3) 期货交易所实行保证金制度、当日无负债结算制度、涨跌停板制度、持仓限额和大户持仓报告制度、风险准备金制度以及国务院期货监督管理机构规定的其他风险管理制度。本私募基金可能因保证金不足而被采取限制开仓、强制平仓，进而可能给本私募基金造成重大损失；本私募基金所委托的交易所会员除接受本私募基金委托外，还可能同时接受其他主体的委托，本私募基金所委托的交易所会员发生保证金不足时将被采取限制开仓、强制平仓等措施，而这种不足不一定是本私募基金的保证金不足造成的，还可能是上述交易所会员进行其他主体的委托操作所造成的，但即便如此本私募基金也可能因此受到重大损失；为及时缴纳保证金，本私募基金可能紧急变现部分私募基金财产，在上述情况下，该部分私募基金财产的变现可能并非以最优价格进行，从而造成本私募基金的损失。本私募基金及本私募基金所委托的交易所会员可能被实行强制结算，一旦本私募基金或本私募基金所委托的交易所会员被强制结算、可能给本私募基金财产造成损失；

- (4) 金融衍生品具有高杠杆性的特征，当出现不利行情时，本私募基金所投资期货合约品种微小的变动就可能使本私募基金遭受较大损失；
- (5) 在市场剧烈变化的情况下，管理人可能难以或无法将持有的未平仓合约平仓。这类情况将导致保证金有可能无法弥补全部损失，本私募基金必须承担由此导致的全部损失。同时本私募基金将面临期货合约无法当天平仓而价格变动的风险；
- (6) 相关交易所可能对交易品种的套期保值或套利实行额度管理，本私募基金如拟进行某交易品种的套期保值或套利交易的，可能因无法申请额度或无法及时获得额度而不能开展相关交易；
- (7) 相比于其他交易品种，金融衍生品的投资交易可能更加频繁，频繁操作将可能增加管理人、期货经纪人等相关方操作失误的可能性，存在操作风险。

4. 投资于股指期货的特别风险包括但不限于：

除本说明书上述提示的“投资于金融衍生品的风险”外，投资于股指期货还存在以下特别风险：作为股指期货合约标的的股票指数受股票交易市场价格波动的影响，从而给股指期货的投资带来风险。

5. 投资于国债期货的特别风险包括但不限于：

除本说明书上述提示的“投资于金融衍生品的风险”外，投资于国债期货还存在以下特别风险：

- (1) 为进行国债期货的交割，投资者需要提供符合交易所要求的可交割国债，如管理人未能在国债期货合约到期前进行平仓，则需要购入/接受相关的可交割国债以满足交割的需求，或者需要以差额补偿的方式了结未平仓合约，甚至有可能因持仓不满足交割要求而需要支付额外的违约金/补偿金等；
- (2) 国债期货的合约标的为国债，与以较综合性的股票指数为标的的股指期货相比，以国债合约作为合约标的的国债期货的价格更容易受市场部分投资者或某一市场消息的影响而发生价格或持续或较大幅度的波动，从而给国债期货的投资带来风险。

6. 投资于期权的特别风险包括但不限于：

除本说明书上述提示的“投资于金融衍生品的风险”外，投资于期权，还存在以下特别风险：

- (1) 期权属于高风险高收益的金融衍生品，由于高杠杆特征，当出现不利行情时，所投资期权合约品种微小的变动就可能会使本私募基金遭受较大损失；
- (2) 如本私募基金作为期权合约的买方，当出现不利行情时，如本私募基金选择不执行期权则本私募基金可能损失权利金/期权费及相应的时间成本，如本私募基金选择执行期权则可能因为不利行情因素导致本私募基金投资遭受损失；如本私募基金作为期权合约的卖方，当出现不利行情时，期权合约买方往往选择不执行期权，本私募基金可能由于所持期权价格受不利行情影响而产生较大的损失。

7. 参与融资融券交易包括但不限于如下风险：

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

8. 投资于港股通交易的风险

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

- (1) 市场联动风险：与内地 A 股市场相比，由于在港股市场上外汇资金自由流动，海外资金的流动与港股价格之间表现出高度相关性，因此，投资者在参与港股市场交易时受到全球宏观经济和货币政策变动导致的系统风险相对更大。
- (2) 股价波动风险：由于港股市场实行 T+0 交易机制，而且不设涨跌幅限制，加之香港市场结构性产品和衍生品种类相对丰富，因此，港股通个股的股价受到意外事件驱动的影响而表现出股价波动的幅度相对 A 股更为剧烈，投资者持仓的风险相对较大。
- (3) 汇率风险：本基金在交易时间内提交订单依据的港币买入参考汇率和卖出参考汇率，并不等于最终结算汇率。港股通交易日日终，中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中国结算”）进行净额换汇，将换汇成本按成交金额分摊至

每笔交易，确定交易实际适用的结算汇率，可能存在港币汇率兑人民币波动的风险。

- (4) 个股流动性风险：本基金可以通过港股通买卖的股票存在一定的范围限制，且港股通股票名单会动态调整。对于被调出的港股通股票，自调整之日起，本基金将不得再行买入。

且不同于在内地市场中小市值股票的成交较为活跃，在香港市场，部分中小市值港股成交量则相对较少，流动较为缺乏。因此，若重仓持有此类股票，则可能因缺乏交易对手，进而面临小量抛盘即导致股价大幅下降的风险。

- (5) 额度限制风险：港股通业务试点期间存在每日额度和总额度限制。总额度余额少于一个每日额度的，上交所证券交易服务公司自下一港股通交易日起停止接受买入申报，本集合计划将面临不能通过港股通进行买入交易的风险；在香港联合交易所有限公司（以下简称“联交所”）开市前阶段，当日额度使用完毕的，新增的买单申报将面临失败的风险；在联交所持续交易时段，当日额度使用完毕的，当日本基金将面临不能通过港股通进行买入交易的风险。

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

9. 投资于证券投资基金、商业银行理财计划、证券公司资产管理计划、基金公司及其子公司特定客户资产管理计划、期货公司资产管理计划、私募投资基金等理财产品的风险包括但不限于：

该等理财产品的管理人在进行投资时，如出现判断有误、获取信息不全、或对投资工具使用不当，或未勤勉尽责进行投资管理等情形，将对本私募基金的收益甚至本金安全造成不利影响。

10. 权证、收益互换等证券公司柜台市场交易业务的风险

(1) 市场风险。柜台业务的市场风险是指因柜台产品价格的变动导致损失的可能性。该类市场风险是指投资者或公司因使用自有资金参与柜台产品销售或交易，从而面临所持柜台产品价格波动的风险。

(2) 信用风险。柜台业务信用风险是指柜台产品发行人不能或不愿履行法定或协议约定义务与承诺而导致投资损失的可能性。柜台产品发行、柜台产品风险评估等环节风险控制

不力,以及柜台交易期间发行人信用质量恶化或客户资产管理不善等都可导致柜台交易业务信用风险。

(3) 操作风险。操作风险是指负责柜台业务相关工作的部门或个人因故意或疏忽而导致相关工作在合法性、合规性、适当性方面存在瑕疵,导致公司或客户利益受到损害的可能性。

(4) 流动性风险。柜台业务具有低流动性特征,公司柜台市场建设初期以私募产品为主,市场流动性受到限制。流动性风险是指持有柜台产品的投资者因缺乏交易对手方而无法达成卖出意愿及时变现,从而导致投资者利益受损的可能性。

(5) 合规风险。柜台业务的合规风险主要体现在参与柜台业务的特定投资者反洗钱和隔离墙等方面的风险。参与柜台业务的特定投资者反洗钱风险;公司开展柜台业务的隔离墙风险。

(十二) 法律和政策风险

1. 在本基金存续期限内,国家法律法规的变化,货币政策、财政政策、产业政策的调整,以及政府对金融市场、市场宏观调控和监管政策的调整,都可能影响基金财产安全及收益。

2. 本基金可能因法律法规、监管政策及监管机关禁止或限制本基金项下财产管理运用方式等原因无法成立或运作。

3. 目前尚未出台要求私募基金管理人为自然人基金份额持有人代扣代缴个人所得税的规定,但不排除将来有关部门要求管理人为自然人基金份额持有人代扣代缴个人所得税的可能性。如果税收政策发生变化,本基金份额持有人可能面临缴纳额外税负的风险。

(十三) 市场风险

经济运行具有周期性的特点,宏观经济运行状况和金融市场利率的波动以及市场的波动等,均可能影响本基金收益的实现,从而增加基金投资的风险。

(十四) 购买力风险

基金财产通过现金形式来分配,而现金可能因为通货膨胀的影响而导致购买力下降,从而使投资者的实际收益下降。

(十五) 流动性风险

在市场或本基金所投资项目流动性不足的情况下,管理人可能无法如期足额收回投资并对投资者进行分配,从而可能导致投资者遭受损失。

(十六) 收益率波动风险

本基金财产投资收益受多项因素影响,既有盈利的预期,亦存在亏损的可能。而且,如基金到期时,资产尚未变现,亦无法进行现金清算分配。根据相关法律法规规定,管理人不能保证本基金一定盈利,也不保证最低收益。

(十七) 信用风险

本基金收益的实现须依赖于相关当事方签订的各项交易文件的正常履行。其间牵涉的合同当事人较多,任一当事人因任何原因不履行其与管理人签订的相关协议项下的义务、保证责任时,均可能导致本基金财产遭受损失。管理人和托管人并不保证各合同当事人能够完全履行相关协议或遵守相关法规,也不保证投资者将不因任一方之违约而减少收益。

(十八) 管理风险

在基金财产管理运作过程中,管理人的研究水平、投资管理水平直接影响基金财产收益水平,如果管理人对经济形势和投资范围判断不准确、获取的信息不全、投资操做出现失误,都会影响基金财产的收益水平。

(十九) 托管风险

如托管人未按照法律法规规定或基金合同约定履行托管职责,可能导致本基金财产遭受损失。

出现故障或基金销售人员存在操作失误,也可能对本基金以及基金投资者造成不利影响。

(二十) 外包事项所涉风险

如外包服务机构未按照法律法规规定或外包服务协议约定履行外包职责,可能导致本基金财产遭受损失。

(二十一) 操作或技术风险

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

在本基金的各种交易行为或者后台运作中,可能因为技术系统的故障或者差错而影响交易的正常进行或者导致基金投资者的利益受到影响,例如 IT 系统故障等风险。这种技术风险可能来自管理人、注册登记机构、募集机构、外包服务机构、托管人等。

(二十二) 管理人/托管人不能继续履行职责的风险

如在基金存续期间管理人/托管人因停业、解散、撤销、破产,或者被监管部门撤销相关业务许可而不能继续履行基金合同项下的职责,可能会对基金产生不利影响。

(二十三) 税收风险

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

(二十四) 其他风险

战争、自然灾害等不可抗力因素的出现,将可能导致基金资产遭受损失。金融市场危机、行业竞争等超出管理人自身直接控制能力之外的风险,可能导致基金份额持有人利益受损。

特别提示:

即使管理人已对可能存在的风险进行了揭示,但本基金仍可能存在未能揭示的风险,投资者交付的投资本金存在部分亏损甚至全部亏损的可能。同时本基金项下管理人的过往业绩不代表该基金未来运作的实际效果,该产品仅适合具有【高】风险识别能力和风险承受能力的投资者认购/申购,份额持有人应充分认识加入本基金的投资风险,管理人不保证最低收益或基金本金不受损失。

为此,根据《中华人民共和国合同法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《私募投资基金监督管理暂行办法》、《私募投资基金管理人登记和基金备案办法(试行)》及其他相关法律法规和行业自律规则的有关规定,管理人郑重申明如下:

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

(二) 管理人向投资者声明,中国证券投资基金业协会为管理人和私募基金办理登记备案不构成对管理人投资能力、持续合规情况的认可;不作为对基金财产安全的保证。

(三) 本基金具有一定的投资风险,仅适合风险识别、评估、承受能力【高】的合格投资者。管理人或托管人对本基金财产的盈亏不提供任何承诺,不保证一定盈利,也不保

证最低收益。

(四) 投资者应以自己合法所有的资金认购基金份额,不得非法汇集他人资金参与本基金, 并应对认购资金享有合法、完整的所有权和支配权。

(五) 投资者应已就签署及履行基金合同获得了有关法律法规及公司章程(如适用)规定的一切必要的批准、许可或授权。

(六) 管理人按基金合同约定管理、运用和处分基金财产所产生的风险,由基金财产承担。管理人违背基金合同约定或处理基金事务不当而造成基金财产损失的,由管理人以固有财产赔偿;不足赔偿时,由投资者自担。

(七) 在签署风险揭示书和基金合同前,投资者应仔细阅读风险揭示书、基金合同及其他有关信息,独立且谨慎地做出是否签署的决策。投资者在风险揭示书和基金合同上签字,即表明:

1. 投资者已认真阅读并准确理解基金合同、风险揭示书以及所有备查文件,了解本基金可能存在的风险,且愿意依法承担相应的投资风险。

2. 管理人/托管人已按投资者的要求对基金合同中免除或限制管理人/托管人责任的内容予以充分的解释和说明。

投资者确认:

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

1、本人/机构已仔细阅读私募基金法律文件和其他文件,充分理解相关权利、义务、本私募基金运作方式及风险收益特征,愿意承担由上述风险引致的全部后果。【_____】

2、本人/机构知晓,基金管理人、基金销售机构、基金托管人及相关机构不应当对基金财产的收益状况做出任何承诺或担保。【_____】

3、本人/机构已通过中国基金业协会的官方网站(www.amac.org.cn)查询了私募基金管

理人的基本信息,并将于本私募基金完成备案后查实其募集结算资金专用账户的相关信息与打款账户信息的一致性。【_____】

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

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

6、本人/机构已认真阅读并完全理解基金合同中关于“当事人及权利义务”的所有内容,并愿意自行承担购买私募基金的法律责任。【_____】

7、本人/机构知晓,投资冷静期及回访确认的制度安排以及在此期间的权利。【_____】

8、本人/机构已认真阅读并完全理解基金合同中“基金的投资”的所有内容,并愿意自行承担购买私募基金的法律责任。【_____】

9、本人/机构已认真阅读并完全理解基金合同中“基金的费用与税收”中的所有内容。【_____】

10、本人/机构已认真阅读并完全理解基金合同中“争议的处理”中的所有内容。【_____】

11、本人/机构知晓,中国基金业协会为私募基金管理人和私募基金办理登记备案不构成对私募基金管理人投资能力、持续合规情况的认可;不作为对基金财产安全的保证。【_____】

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

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

基金投资者(自然人签字或机构盖章):

日期:

经办员（签字）：

日期：

募集机构（盖章）：

日期：