

合同编号：_____号

知方石灵活策略 1 号私募证券投资基金 基金合同

基金管理人：深圳知方石投资有限公司

基金托管人：华泰证券股份有限公司

年 月

重要提示

本基金投资于证券市场，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，基金管理人也不保证基金一定盈利，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接受本合同的备案并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险，不构成对基金管理人投资能力和持续合规情况的认可，不作为对基金财产安全的保证。

基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行承担。由于本基金的设计安排、管理、运作模式而产生的经济责任和法律责任，托管人、销售机构不予承担。

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)和基金管理人委托的代销机构进行销售。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认购资金从在中国境内开立的自有银行账户划款至募集账户，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。

募集账户由基金管理人委托外包服务机构开立，该账户仅用于本基金募集期间和存续期间认购、申购和赎回资金的归集与支付。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，外包服务机构对于基金管理人的投资运作不承担任何责任。

募集账户信息如下：

账户名：华泰证券股份有限公司基金运营外包业务募集专户

账号：4301010029101167479-000000429

开户行：中国工商银行股份有限公司南京新街口支行

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

风险揭示书

尊敬的投资者：

为使您更好地了解非公开募集证券投资基金（以下称私募基金）投资的风险，根据法律、行政法规和中国证券监督管理委员会（以下称中国证监会）、中国证券投资基金业协会（以下称基金业协会）有关规定，提供本风险揭示书，请认真仔细阅读，慎重决定是否参与私募基金投资。

一、了解拟参与的私募基金的风险收益特征

私募基金是在中国基金业协会履行登记手续的基金管理人接受合格投资者委托，与客户签订基金合同而成立的，基金管理人根据基金合同约定的方式、条件、要求及限制，通过特定账户管理委托资产，进行投资活动。**参与私募基金投资存在着一定的风险，基金管理人**
不承诺投资者的投资本金不受损失或者取得最低收益。

投资者在投资私募基金前，应了解私募基金的基础知识、业务特点、风险收益特征等内容，并认真听取基金管理人对相关业务规则和基金合同内容的讲解。

基金管理人管理基金财产应恪尽职守，履行诚实信用、谨慎勤勉的义务。基金管理人依据基金合同管理基金财产所产生的风险，由基金财产承担。

二、了解本基金投资的风险

本基金投资面临的风险，包括但不限于：

（一）市场风险

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

1、政策风险

因国家宏观政策（如货币政策、财政政策、行业政策、证券市场监管政策及地区发展政策等）发生变化对投资标的产生一定的影响，导致市场价格波动，从而影响本基金投资收益而产生风险。

2、经济周期风险

经济运行具有周期性的特点。随经济运行的周期性变化，证券市场的收益水平也呈周期性变化。基金财产投资于证券市场，收益水平也会随之变化，从而产生风险。

3、利率风险

金融市场利率的波动会导致证券市场价格和收益率的变动。利率直接影响着债券的价格

和收益率，影响着企业的融资成本和利润。基金财产投资于债券和股票时，其收益水平会受到利率变化的影响。

4、上市公司经营风险

上市公司的经营好坏受多种因素影响，如管理能力、财务状况、市场前景、行业竞争、人员素质等，这些都会导致上市公司的盈利发生变化。如果基金财产所投资的上市公司经营不善，其股票价格可能下跌，或者能够用于分配的利润可能减少，使基金财产投资收益下降。虽然基金财产可以通过投资多样化来分散这种非系统风险，但不能完全规避。

5、购买力风险

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

6、债券收益率曲线风险

债券收益率曲线风险是指与收益率曲线非平行移动有关的风险，单一的久期指标并不能充分反映这一风险的存在。

7、再投资风险

再投资获得的收益有时又被称做利息的利息，这一收益取决于再投资时的利率水平和再投资的策略。因未来市场利率的变化而引起给定投资策略下再投资率的不确定性为再投资风险。再投资风险反映了利率下降对固定收益证券利息收入再投资收益的影响，这与利率上升所带来的价格风险（即前面所提到的利率风险）互为消长。具体为当利率下降时，基金财产从投资的固定收益证券所得的利息收入进行再投资时，将获得比之前较少的收益率。

（二）管理风险

在基金财产管理运作过程中，基金管理人的业务资质、管理能力、相关知识和经验以及操作能力、人员流动性等对基金财产收益水平有着较大程度的影响，基金管理人的管理和操作失误可能导致基金财产受到损失。

基金管理人自身的管理水平、经营状况以及管理人人员的变化，对基金财产投资运作也有很大影响，可能导致基金财产损失，甚至导致基金终止。

基金管理人可能还同时进行自营投资，虽然基金管理人承诺将在自营业务与资产管理业务之间采取有效的隔离措施，但仍然存在自营业务与资产管理业务之间发生利益冲突的道德风险。

（三）基金管理人行使平仓权的风险

基金管理人行使基金管理人指令权时，为使本基金持有证券满足基金合同的限制和要

求，将采取变现措施乃至进行快速平仓，虽然基金管理人将以维护基金份额持有人最大利益为原则行事，但基金管理人是否能够进行变现或平仓操作以及变现或平仓价格等均受制于届时市场环境的影响，不排除发生基金管理人无法进行卖出平仓或者卖出或平仓价格可能低于市场均价的情形，从而降低基金财产的收益。

为在本基金项下现金资产不足时支付应由基金财产承担的费用及税收、分配基金收益或为进行预警止损操作等原因，基金管理人可能将快速减仓/平仓，但减仓/平仓操作能否顺利完成取决于当时的市场状况，且减仓/平仓价格可能低于市场均价，从而降低本基金的收益。

（四）流动性风险

1、本基金面临的证券市场流动性风险主要表现在几个方面：基金财产不能迅速转变成现金或变现成本很高，不能应付可能出现的基金份额持有人大额赎回的风险；证券投资中个股和个股的流动性风险等。

2、本基金设置封闭期。封闭期内禁止委托人申购或赎回基金份额。该等安排可能对基金份额持有人自身的流动性造成不利影响；本基金封闭期外的每个开放日可接受开放赎回，如市场出现大幅波动且因投资者无法随时赎回，存在导致投资者损失进一步扩大的风险。

（五）信用风险

信用风险是债务人的违约风险，主要体现在信用产品中。在基金财产投资运作中，如果基金份额持有人代表的信用研究水平不足，对信用产品的判断不准确，可能使基金财产承受信用风险所带来的损失。

（六）股指期货投资风险

1、流动性风险

本基金在股指期货市场成交不活跃时，可能在建仓和平仓股指期货时面临交易价格或者交易数量上的风险。

2、基差风险

基差是指股票指数现货价格与股指期货价格之间的差额。若产品运作中出现基差波动不确定性加大、基差向不利方向变动等情况，则可能对本基金投资产生影响。

3、合约展期风险

本基金所投资的期货合约主要包括股指期货当月和近月合约。当基金所持有的合约临近交割期限，即需要向较远月份的合约进行展期，展期过程中可能发生价差损失以及交易成本损失，将对投资收益产生影响。

4、股指期货保证金不足风险

由于股指期货价格朝不利方向变动,导致期货账户的资金低于金融期货交易所或者期货经纪机构的最低保证金要求,如果不能及时补充保证金,股指期货头寸将被强行平仓,导致无法规避对冲系统性风险,直接影响本基金收益水平,从而产生风险。

5、杠杆风险

股指期货作为金融衍生品,其投资收益与风险具有杠杆效应。若行情向不利方向剧烈变动,本基金可能承受超出保证金甚至基金财产本金的损失。

(七) 融资融券等金融衍生品投资的风险

权证、融资融券、收益互换等金融衍生品和一般金融工具面临同样的流动性风险,同时因杠杆特性,较普通金融工具面临更大的市场风险,收益互换也较一般金融工具面临更大的信用风险。在交易这一类金融衍生品时,如果不能按照约定的期限清偿债务,或标的证券价格波动导致担保物价值与其金融衍生品债务之间的比例低于维持担保比例,且不能按照约定的时间、数量追加担保物时,将面临担保物被证券公司强制平仓的风险。可能出现金融机构降低授信额度,或者提高相关警戒指标、平仓指标,可能给本基金造成经济损失。另外,受贷款基准利率调高影响,金融机构可能相应调高融资利率,本基金将面临资金成本上升的风险。

(八) 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、交易错误、IT系统故障等风险。

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

(九) 相关机构的经营风险

1、基金管理人经营风险

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

2、基金托管人经营风险

虽基金托管人相信其本身将按照相关法律法规的规定进行营运及管理,但无法保证其本身可以永久维持符合监管部门的金融监管法律法规。如在基金存续期间基金托管人无法继续

从事基金托管业务，则可能会对基金产生不利影响。

3、基金外包服务机构经营风险

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

4、证券/期货经纪机构经营风险

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

（十）提前终止或延期风险

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

本基金存续期限到期后，基金管理人和基金托管人协商一致，可延长本基金存续期限，可能造成基金份额持有人不能足额取得或不能及时取得基金收益。

（十一）其他风险

1、关联交易风险

根据基金合同，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或已投资的证券，虽然基金管理人积极遵循基金份额持有人利益优先的原则、遵守相关法律法规的规定进行操作、积极防范利益冲突，但仍可能因基金管理人运用基金财产从事关联交易被监管部门认为存在利用输送、内幕交易的风险，进而可能影响基金份额持有人的利益。此外，基金管理人运用基金财产从事关联交易时可能依照相关法律法规被限制相关权利的行使，进而可能影响基金财产的投资收益。

2、反向交易的风险

基金管理人就本基金财产进行的投资操作或基金管理人管理的其他基金项下基金管理人就该等基金财产进行的投资操作，可能发生同一基金或不同基金在同一交易日就同一投资对象进行方向相反的投资操作（以下简称“反向交易”）。

本基金或基金管理人管理的其他基金可能对同一证券进行一定同向交易和反向交易，从

而存在被监管部门和证券交易所认定为异常交易行为并进行检查、调查、查询、限制交易、冻结或者查封等的可能性。

若监管部门或证券交易所对单个基金或同一基金管理人管理的不同基金之间的反向交易进行限制，则上述监管限制生效时，即对本基金财产产生效力，从而可能影响本基金财产的投资收益甚至导致本基金财产遭受损失。

基金管理人管理的其他基金财产可能与本基金进行反向交易，虽然基金管理人积极避免产生利益冲突，但仍可能因基金管理人按照相关法律法规规定或合同约定对其管理的某只基金进行正常操作而损害本基金的利益，进而损害本基金份额持有人的利益。

本人/本机构作为投资者已【详阅并充分理解】本风险揭示书及相关基金合同所提示的风险，并【自愿承担】由上述风险引致的全部后果。

本人/本机构保证，本人/本机构是【具有完全民事行为能力】的自然人/法人或者依法成立的其他组织，并且【符合】法律法规及本基金合同中关于私募证券投资基金的要求，是【合格】投资者。

[为充分提示风险，提请投资者将本段抄录在后。] 投资者抄录：

本人/本机构作为投资者已【_____】本风险揭示书及相关基金合同所提示的风险，并【_____】由上述风险引致的全部后果。

本人/本机构保证，本人/本机构是【_____】的自然人/法人或者依法成立的其他组织，并且【_____】法律法规及本基金合同中关于私募证券投资基金的要求，是【_____】投资者。

投资者（自然人）（签字）：

或：投资者（机构）（加盖公章并由法定代表人/负责人或授权代理人签字）：

日期： 年 月 日

合格投资者承诺书

深圳知方石投资有限公司：

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，或为监管机构认可的其他合格投资者)，具有相应的风险识别能力和风险承受能力，投资资金来源合法，没有非法汇集他人资金投资私募基金。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：

日 期：

本合同当事人的基本情况:

基金份额持有人:

证件(营业执照)名称:

证件(营业执照)号码:

通讯地址:

邮政编码:

电话:

传真:

基金管理人: 深圳知方石投资有限公司

法定代表人: 刘钊

办公地址: 深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 B 区 2633 室

邮编: 518000

联系人: 蒋娜

联系电话: 18603015976

传真: 0755-33955999

基金托管人: 华泰证券股份有限公司

法定代表人: 吴万善

办公地址: 江苏省南京市江东中路 228 号

邮编: 210019

联系人: 万鸣

联系电话: 025-83387210

传真: 025-83387215

目 录

一、前 言.....	1
二、释 义.....	1
三、声明与承诺.....	4
四、基金的基本情况.....	5
五、基金份额的初始销售.....	5
六、基金的成立和备案.....	7
七、基金的申购与赎回.....	8
八、当事人及权利义务.....	13
九、基金份额的注册登记.....	16
十、基金的投资.....	17
十一、基金的财产.....	20
十二、投资指令的发送、确认和执行.....	24
十三、交易及清算交收安排.....	26
十四、越权交易.....	28
十五、基金财产的估值和会计核算.....	29
十六、基金的费用与税收.....	34
十七、基金的收益分配.....	38
十八、报告义务.....	39
十九、风险揭示.....	41
二十、基金合同的变更、终止与财产清算.....	43
二十一、违约责任.....	45
二十二、争议处理.....	46
二十三、基金合同的效力.....	46
二十四、其他事项.....	47

一、前 言

(一) 订立本基金合同的目的、依据和原则

1、订立本基金合同的目的是为了明确基金合同当事人的权利义务，确保基金规范运作，保护当事人各方的合法权益。

2、订立本合同的依据是《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《私募投资基金管理人登记和基金备案办法(试行)》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、充分保护本合同各当事人的合法权益。

(二) 本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本合同各当事人之间权利义务关系的任何文件或表述，如与本合同不一致或有冲突，均以本合同为准。

(三) 本基金由基金管理人依照《基金法》、基金合同及其他有关规定募集。基金管理人依法法律法规和中国证券投资基金业协会(以下简称“基金业协会”)的规定，向基金业协会备案。但基金业协会接受本基金的备案，并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性的判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

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

二、释 义

在本合同中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

(一) 本基金：指知方石灵活策略1号私募证券投资基金。

(二) 基金合同、本合同：指《知方石灵活策略1号私募证券投资基金基金合同》及其附件以及对该合同及附件做出的任何有效变更及补充。

(三) 基金投资者/基金投资人：指依法可以投资于私募基金的合格投资者。合格投资者是指具备相应风险识别能力和承担所投资私募基金风险能力且符合相关规定条件的个人和机构，或监管机构认可的其他合格投资者。

(四) 基金份额持有人：指签署本基金合同，履行出资义务取得基金份额的基金投资者。

(五) 基金管理人：指深圳知方石投资有限公司。

(六) 基金托管人：指华泰证券股份有限公司。

(七) 外包服务机构：指接受基金管理人委托，进行估值核算等服务业务的第三方服务提供机构。本基金的外包服务机构为华泰证券股份有限公司。

(八) 法律法规：指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、部门规章及规范性文件以及对该等法律法规不时的修订和补充。

(九) 中国证监会：指中国证券监督管理委员会。

(十) 合同当事人：指基金投资者、基金托管人和基金管理人。

(十一) 代销机构：指符合中国证监会规定的条件，取得基金代销业务资格并接受基金管理人委托，代为办理本基金的认购、申购和赎回等业务的代理机构。

(十二) 注册登记机构：指基金管理人或其委托办理私募基金份额注册登记的机构。本基金的注册登记机构为华泰证券股份有限公司。

(十三) 证券账户：指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有关业务规则，由基金托管人/基金管理人为本基金在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司、深圳分公司开设的专用证券账户、在期货交易所开立的专用期货交易编码、在中央国债登记结算有限责任公司及银行间市场清算所股份有限公司开立的专用债券账户、在基金注册登记机构开立的基金账户以及其他证券注册登记机构开立的其他证券账户。

(十四) 证券交易资金账户：指基金管理人为基金财产在证券经纪机构下属的证券营业部开立的证券交易资金账户，用于基金财产证券交易结算资金的存管、记载交易结算资金的变动明细以及场内证券交易清算。证券交易资金账户按照“第三方存管”模式与托管资金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。

(十五) 托管专户：指基金托管人根据有关规定为本基金开立的专门用于清算交收的银行账户。

(十六) 募集账户：指“募集专户”，是由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，用于本基金募集期间和存续期间认购、申购和赎回资金的收付。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，外包服务机构对于基金管理人的投资运作不承担任何责任。

(十七)基金资产总值：指本基金资产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。

(十八)基金资产净值：指本基金资产总值减去负债后的价值。

(十九)基金份额净值：指计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数所得的数值。

(二十)基金资产估值：指计算、评估基金资产和负债的价值，以确定本基金资产净值和份额净值的过程。

(二十一)初始销售期：指基金合同中载明的基金初始销售期限，自基金份额发售之日起最长不超过1个月。

(二十二)存续期：指本基金成立至终止之间的期限。

(二十三)开放期：指销售机构办理基金申购、赎回等业务的期间。

(二十四)工作日：指基金管理人及基金托管人办理日常业务的营业日。

(二十五)交易日：指上海证券交易所和深圳证券交易所的正常交易日。

(二十六)认购：指基金初始销售期内，基金投资人按照本合同的约定购买本基金份额的行为。

(二十七)申购：指在基金开放期内，基金投资人按照本合同的规定申请购买本基金份额的行为。

(二十八)赎回：指在基金开放期内，基金份额持有人按照本合同的规定要求将基金份额兑换为现金的行为。

(二十九)元：指人民币元。

(三十)不可抗力：指任何不能预见、不能避免、不能克服的客观情况，包

包括但不限于《基金法》及其他有关法律法规及重大政策调整、台风、洪水、地震、流行病及其他自然灾害，战争、骚乱、火灾、政府征用、戒严、没收、恐怖主义行为、突发停电或其他突发事件、证券交易场所非正常暂停或停止交易等事件。

三、声明与承诺

（一）基金份额持有人的声明与承诺

1、基金份额持有人声明其投资本基金的财产为其拥有合法所有权或处分权的财产，保证财产的来源及用途符合国家有关规定，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基金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管理人和托管人对该基金财产行使权利且该权利不会为任何其他第三方所质疑；基金份额持有人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；本委托事项符合其业务决策程序的要求。

2、基金份额持有人确认其符合《私募投资基金监督管理暂行办法》第十二、十三条关于合格投资者的认定条件，承诺其向基金管理人提供的有关投资目的、投资偏好、投资限制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，将及时书面告知基金管理人。基金份额持有人承认，基金管理人、基金托管人未对基金财产的收益状况作出任何承诺或担保。

（二）基金管理人的声明与承诺

1、基金管理人保证已在签订本合同前充分地向基金份额持有人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。

2、基金管理人已经了解基金份额持有人的风险偏好、风险认知能力和承受能力，对基金份额持有人的财务状况进行了充分评估。

3、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本基金财产，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。

4、基金管理人承诺本产品不属于伞形信托计划，不属于场外配资产品，且符合监管机构相关法律、法规要求。

（三）基金托管人的声明与承诺

基金托管人承诺依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则安全保管本基金财产，并履行本合同约定的其他义务。

四、基金的基本情况

（一）基金的名称

知方石灵活策略1号私募证券投资基金。

（二）基金的类别

混合型投资基金。

（三）基金的运作方式

开放式运作方式。

（四）基金的投资目标

通过运用多种投资策略，在债券、期货之间灵活配置资产，并对成长、价值风格突出的股票进行均衡配置，以追求基金资产的长期稳健增值。

（五）基金的存续期限

基金成立后2年，可视情况延期，届时以具体公告为准。

（六）基金份额的初始销售面值

本基金份额的初始销售面值为1.00元/份。

（七）基金的预警及止损

为保护全体基金份额持有人的利益，本基金设置预警线和止损线。

（八）其他

本基金设定为均等份额。除基金合同另有约定外，每份基金份额具有同等的合法权益。

五、基金份额的初始销售

基金份额的初始销售应按如下规定执行：

（一）基金份额的初始销售期间

初始销售期间自基金份额发售之日起最长不超过1个月，初始销售的具体时间由基金管理人根据相关法律法规以及本基金合同的规定确定，并在本基金

投资说明书中披露。基金管理人可与代理销售机构协商后提前终止初始销售，并向特定投资者履行适当的通知程序，即视为提前终止初始销售。基金管理人发布通知提前结束初始销售的，本基金自通知所载日期之日起不再接受认购申请。

（二）基金份额的销售方式

本基金通过基金管理人委托的销售机构进行销售。具体名单以投资说明书为准。

基金份额持有人认购本基金，必须与基金管理人和基金托管人签订基金合同，按销售机构规定的方式足额缴纳认购款项。认购的具体金额和份额以注册登记机构的确认结果为准。

（三）基金份额的销售对象

能够识别、判断和承担相应投资风险的自然人、法人和依法成立的组织或中国证监会认可的其他特定客户。若法律法规将来另有规定的，从其规定。

（四）基金份额的认购和持有限额

基金份额持有人在初始销售期间的认购金额不得低于100万元人民币（不含认购费），并可多次认购，初始销售期间追加认购金额应为10万元（不含认购费）的整数倍。

（五）基金份额的认购费用

本基金不收取认购费。

（六）基金初始销售期间利息的处理方式

基金份额持有人的认购参与款项（含认购费用）在初始销售期形成的利息在基金成立后折算成相应的基金份额归基金份额持有人所有，其中利息转份额的具体数额以注册登记机构的记录为准。

（七）基金份额的计算

1、本基金采用金额认购的方式。认购份额的计算方式如下：

认购份额=（净认购金额+利息）/基金份额初始面值

2、认购份额的计算保留到小数点后2位，小数点后第3位四舍五入，舍去部分所代表的资产计入基金财产。

（八）初始销售期间的认购程序

1、认购程序。

基金份额持有人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，以各销售机构的具体规定为准。

2、认购申请的确认。

销售机构受理认购申请并不表示对该申请是否成功的确认，而仅代表销售机构确实收到了认购申请。认购申请一经受理，不得撤销。认购申请采取时间优先的原则进行确认，在同一时间接收的认购申请，按照金额优先的原则进行确认。申请是否有效应以注册登记机构的确认并且基金成立为准。基金份额持有人应在本基金成立后到各销售网点查询最终确认情况和有效认购份额。如遇特殊情况可由基金管理人和基金委托人协商处理。

（九）初始销售期间客户资金的管理

基金管理人应当将本基金初始销售期间投资者的资金存入专门账户，在本基金初始销售行为结束前，任何机构和个人不得动用。

（十）认购资金的交付

认购资金应以现金形式交付，投资者须从在中国境内银行开立的自有银行账户划款至基金的募集账户，并在备注中注明：“XX（投资者姓名）认购知方石灵活策略1号私募证券投资基金”。基金管理人可委托基金外包服务机构开立募集账户，该账户仅用于本基金募集期间和存续期间认购、申购和赎回资金的归集与支付。

六、基金的成立和备案

（一）基金的成立

本基金募集期结束后且符合下列基金备案条件，将全部募集资金划入托管专户，基金托管人核实资金到账情况，并向基金管理人出具资金到账通知书，基金成立。认购资金在基金成立前产生的利息按照央行人民币活期存款基准利率计算，在本基金成立后将折算为基金份额归基金投资人所有。

基金管理人于基金成立时向基金持有人和托管人发送基金成立的通知。本基金的成立日期以基金管理人向基金持有人和托管人发送的基金成立通知所载日期为准。

（二）基金的备案

1、基金备案的条件

初始销售期限届满，基金投资者总数不超过 200 人，且初始委托资产合计不低于 1000 万元人民币，但不超过 50 亿元，符合基金备案条件的，基金管理人应当在基金募集完毕之日起 20 个工作日内，通过基金业协会私募基金登记备案系统进行备案。并根据私募基金的主要投资方向注明基金类别，如实填报基金名称、资本规模、基金份额持有人、私募基金合同、基金公司章程或者合伙协议等基本信息。私募基金备案材料完备且符合要求的，基金业协会通过网站公示为私募基金办结备案手续。

2、基金初始销售失败的处理

初始销售期届满，不能满足上述备案条件的，或因不可抗力使基金合同无法备案，或因重大违法违规事项导致初始销售行为被监管机构终止的，则基金初始销售失败。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；
- （2）在初始销售期届满后 30 日内返还投资者已缴纳的款项，并加计央行人民币活期存款基准利率。

七、基金的申购与赎回

在本基金存续期间，基金份额持有人申购与赎回本基金的有关事项如下：

（一）申购与赎回场所

本基金的销售机构包括直销机构和基金管理人委托的代销机构。基金投资人应当在销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理基金份额的申购和赎回。

（二）申购与赎回的开放日和时间

本基金成立之日起 6 个月为封闭期，封闭期结束后，按下列规定开放：

本基金申购和赎回开放日为每个自然月的 18 日，若遇节假日顺延至下一个交易日（T 日，本基金运作不满 6 个月的，暂不开放。例如，基金成立日为 2 月 10 日的，则第一次开放日对应的 T 日为 8 月 18 日，若遇节假日顺延至下一个交易日）。

本基金申购与赎回开放时间为当天 9:00AM-15:00PM。

若中国证监会会有新的规定，或出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更或其他特殊情况，基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整并告知基金份额持有人。

（三）申购与赎回的原则、方式、价格及程序等

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

2、“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请。

3、基金份额持有人办理申购、赎回等业务时应提交的文件和办理手续、办理时间、处理规则等在遵守本合同规定的前提下，以各销售机构的具体规定为准。

4、当日的申购和赎回申请可以在当日开放时间结束前撤销，在当日的开放时间结束后不得撤销。

5、申购与赎回申请的确认。销售网点受理申购与赎回申请并不表示对该申请是否成功的确认，而仅代表销售网点确实收到了申购与赎回申请。申购申请采取时间优先、金额优先原则进行确认，赎回申请按先进先出的方式处理。申请是否有效应以注册登记机构的确认为准。注册登记机构应在法律法规规定的时限内对基金份额持有人申购与赎回申请的有效性进行确认。开放日提交的有效申请，基金管理人在 T+2 日进行确认，投资人可在 T+3 日后(包括该日)到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。若申购不成功，则申购款项退还给投资人。

6、申购与赎回申请的款项支付。

申购采用全额交款方式，若资金在规定时间内未全额到账则申购不成功，则为无效申请，已交付的委托款项将退回基金份额持有人自有资金银行账户；有效申购款应于 T+3 日划入基金托管专户内。

基金份额持有人赎回申请成交后，基金管理人应按规定向基金份额持有人支付赎回款项，有效赎回款项应于 T+3 日划出基金托管专户，应于 T+7 个工作日之前支付给基金份额持有人。在发生巨额赎回时，赎回款项的支付办法按本合同和有关法律法规规定处理。

7、基金管理人在不损害基金份额持有人权益的情况下可更改上述原则，但最迟应在新的原则实施前3个工作日告知基金份额持有人。

（四）申购与赎回的金额限制

基金份额持有人在开放日内追加申购的，每次申购的金额应不低于10万元人民币（不含申购费）的整数倍。

当基金份额持有人持有的基金资产净值高于100万元人民币时，基金份额持有人可以选择全部或部分赎回基金份额；选择部分赎回基金份额的，基金份额持有人在赎回后持有的基金资产净值不得低于100万元人民币。当基金管理人发现基金份额持有人申请部分赎回基金将致使其在部分赎回申请确认后持有的基金资产净值低于100万元人民币的，基金管理人有权适当减少该基金份额持有人的赎回金额，以保证部分赎回申请确认后基金份额持有人持有的基金资产净值不低于100万元人民币。

当基金份额持有人持有的基金资产净值低于100万元人民币（含100万元人民币）时，需要赎回基金的，基金份额持有人必须选择一次性全部赎回基金。

基金管理人可根据市场情况，合理调整对申购金额和赎回份额的数量限制，基金管理人进行前述调整必须提前3个工作日告知基金份额持有人。基金管理人和代理销售机构在网站公告前述调整事项即视为履行了告知义务。

（五）申购与赎回的费用

1、申购费用

本基金不收取申购费。

2、赎回费用

本基金不收取赎回费。

3、认购、申购和赎回费用均归管理人所有，由外包服务机构根据注册登记系统计算结果直接划付至管理人收款账户（同管理费收款账户）。

（六）申购份额与赎回金额计算

1、申购份额计算方法

申购份额=净申购金额÷申购价格

申购价格为开放日T日收市后基金份额净值

申购份额保留到小数点后2位，小数点后第3位四舍五入，由此产生的误差

计入基金财产。

2、赎回金额计算方法

赎回金额=赎回份数×赎回价格-赎回费

赎回价格为开放日 T 日收市后基金份额净值

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

（七）巨额赎回的认定及处理方式

1、巨额赎回的认定

基金的净份额赎回申请超过上一日基金总份额的10%，为巨额赎回。

2、巨额赎回的处理方式

当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据本基金当时的资产状况决定接受全额赎回或部分延期赎回。

（1）全额赎回

当基金管理人认为有能力兑付基金份额持有人的全部赎回申请时，按正常赎回程序执行。

（2）部分延期赎回

当基金管理人认为兑付基金份额持有人的赎回申请有困难，或认为兑付基金份额持有人的赎回申请进行的资产变现可能使基金资产净值发生较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一日基金总份额10%的前提下，对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个基金份额持有人申请赎回份额占当日申请赎回总份额的比例，确定该基金份额持有人当日受理的赎回份额；未受理部分除基金份额持有人在提交赎回申请时选择将当日未获受理部分予以撤销者外，延迟至下一开放日办理。转入下一开放日的赎回申请不享有赎回优先权，赎回价格为下一个开放日的价格，以此类推，直到全部赎回为止。若确因市场情况导致当年开放日结束时仍未完成全部赎回的办理，则可进一步延期，但应于当年开放日结束后10个工作日内完成。

当发生赎回延迟办理时，基金管理人应当及时告知基金份额持有人。

（八）拒绝或暂停申购、暂停或延缓赎回的情形及处理

1、基金管理人可以拒绝接受基金份额持有人的申购申请，具体有如下几

种情况：

- (1) 基金份额持有人达到 200 户；
- (2) 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；
- (3) 如接受该申请，将导致本基金资产总规模超过本合同约定的上限；
- (4) 因基金收益分配、或基金内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；
- (5) 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；
- (6) 法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

基金管理人决定拒绝接受某些基金份额持有人的申购申请时，申购款项将退回基金份额持有人账户。

2、基金管理人可以暂停接受基金份额持有人的申购申请，具体有如下几种情况：

- (1) 因不可抗力导致无法受理基金份额持有人的申购申请；
- (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财产净值；
- (3) 发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况；
- (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，应当告知基金份额持有人。在暂停申购的情形消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理并告知基金份额持有人。

3、基金管理人可以暂停或延缓接受基金份额持有人的赎回申请，具体有如下几种情况：

- (1) 因不可抗力导致基金管理人无法支付赎回款项。
- (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财产净值。
- (3) 发生本基金合同规定的暂停基金资产估值的情况。

(4) 法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一的，基金管理人应当及时告知基金份额持有人。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及时告知基金份额持有人。

八、当事人及权利义务

本合同当事人的基本情况于本合同文首载明。

(一) 基金份额持有人

1、基金份额持有人的权利包括但不限于：

- (1) 分享基金财产收益；
- (2) 参与分配清算后的剩余基金财产；
- (3) 按照本合同的约定申购与赎回基金；
- (4) 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；
- (5) 按照本合同约定的时间和方式获得基金的运作信息资料；
- (6) 国家有关法律法规、监管机构及本合同规定的其他权利。

2、基金份额持有人的义务包括但不限于：

- (1) 遵守本合同；
- (2) 交纳购买基金份额的款项及规定的费用；
- (3) 在持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者终止的有限责任；
- (4) 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；
- (5) 向基金管理人或其代理销售机构提供法律法规规定的信息资料及身份证明文件，配合基金管理人履行反洗钱义务；
- (6) 不得违反本合同的规定干涉基金管理人的投资行为；
- (7) 不得从事任何有损基金及其投资人、基金管理人管理的其他资产及基金托管人托管的其他资产合法权益的活动；
- (8) 按照本合同的规定缴纳管理费、托管费、外包服务费及业绩报酬，并承担因基金财产运作产生的其他费用；
- (9) 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、基金管理人的权利包括但不限于：

- （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报酬；
- （3）依照有关规定行使因基金财产投资于证券所产生的权利；
- （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的行为，对基金财产及其他当事人的利益造成重大损失的，应及时采取措施制止，并报告中国证监会；
- （5）自行销售或者委托有基金销售资格的机构代理销售基金，制定和调整有关基金销售的业务规则，并对代理销售机构的销售行为进行必要的监督；
- （6）自行办理或者委托第三方机构进行注册登记、估值核算及信息披露等业务，但基金管理人依法应当承担的责任不因委托而免除；
- （7）有权委托其他机构对投资涉及的资产进行尽职调查、资产评估等；
- （8）基金管理人可以根据需要变更投资经理。投资经理变更后，基金管理人应及时通知基金份额持有人。
- （9）国家有关法律法规、监管机构及本合同规定的其他权利。

2、基金管理人的义务包括但不限于：

- （1）办理基金的备案手续；
- （2）自本合同生效之日起，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产；
- （3）配备足够的具有专业能力的人员进行投资分析、决策，并以专业化的经营方式管理和运作基金财产；
- （4）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，进行投资；
- （5）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；
- （6）办理或者委托经中国证监会认定可办理开放式证券投资基金份额登记业务的其他机构代为办理基金份额的登记事宜；

- (7) 依据本合同的约定接受基金份额持有人和基金托管人的监督；
- (8) 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；
- (9) 按照本合同的规定，编制并向基金份额持有人报送基金财产的投资报告，对报告期内基金财产的投资运作等情况做出说明；
- (10) 按照本合同的规定，编制基金业务季度及年度报告；
- (11) 计算并根据本合同的规定向基金份额持有人报告基金份额净值；
- (12) 进行基金会计核算；
- (13) 保守商业秘密，不得泄露基金的投资计划、投资意向等，监管机构另有规定的除外；
- (14) 保存基金业务活动的全部会计资料，并妥善保管有关的合同、协议、交易记录及其它相关资料；
- (15) 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；
- (16) 对相关交易主体和资产进行全面的尽职调查，形成书面工作底稿，并制作尽职调查报告；
- (17) 按本合同中约定方式自行或授权其他机构向基金托管人发送本基金财产进行各类交易的数据和信息；
- (18) 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、基金托管人的权利包括但不限于：

- (1) 依照本合同的约定，及时、足额获得资产托管费；
- (2) 根据本合同及其他有关规定，监督基金管理人对于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行为，对基金财产及其他当事人的利益造成重大损失的情形，有权报告中国证监会并采取必要措施；
- (3) 根据本合同的约定，依法保管基金财产；
- (4) 国家有关法律法规、监管机构及本合同规定的其他权利。

2、基金托管人的义务包括但不限于：

- (1) 安全保管基金财产；

(2) 设立专门的资产托管部门，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉资产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财产的托管专户、证券账户和期货账户等投资所需账户；

(6) 复核基金份额净值；

(7) 根据合同约定定期出具托管报告；

(8) 按照本合同的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；

(9) 按照法律法规及监管机构的有关规定，保存本基金业务活动有关的合同、协议、凭证等文件资料；

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

(11) 保守商业秘密。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；

(12) 按照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投资指令违反法律、行政法规和其它有关规定，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并有权报告中国证监会；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并有权报告中国证监会；

(13) 国家有关法律法规、监管机构及本合同规定的其他义务。

九、基金份额的注册登记

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

(二)本基金的注册登记业务由基金管理人或基金管理人委托的其他机构办理。基金管理人委托其他机构代为办理本基金注册登记业务的，应当与有关机构签订委托代理协议，并列明代为办理基金份额登记机构的权限和职责。

(三) 注册登记机构享有如下权利：

- 1、建立和管理基金份额持有人的基金账户；
- 2、取得注册登记费；
- 3、保管基金份额持有人开户资料、交易资料、基金份额持有人名册等；
- 4、在法律法规允许的范围内，制定和调整注册登记业务的相关规则并依法公告；
- 5、法律法规规定的其他权利。

(四) 注册登记机构承担如下义务：

- 1、配备足够的专业人员办理基金的注册登记业务；
- 2、严格按照法律法规和基金合同规定的条件办理基金的注册登记业务；
- 3、保存基金份额持有人名册及相关的申购、赎回业务记录 15 年以上；
- 4、对基金份额持有人的账户信息负有保密义务，因违反该保密义务对基金份额持有人或基金带来的损失，须承担相应的赔偿责任，但司法强制检查情形除外；
- 5、按基金合同规定为基金份额持有人提供基金收益分配等其他必要服务；
- 6、法律法规规定的其他义务。

十、基金的投资

(一) 本基金投资政策如下：

1、投资目标

通过运用多种投资策略，在债券、期货之间灵活配置资产，并对成长、价值风格突出的股票进行均衡配置，以追求基金资产的长期稳健增值。

2、投资范围

本基金投资范围包括股票(包含主板、中小板、创业板、新三板及其他经中国证监会核准上市的股票)、国内依法公开发行的各类债券、国债期货、央行票据、资产支持证券、国债回购、证券投资基金(含封闭式基金)、期货及法律法

规或中国证监会允许投资的其他金融工具。本产品可以进行融资融券、可以投资期权、可以进行港股通交易。如法律法规或监管机构以后允许投资其他品种，投资管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

3、投资策略

(1) Alpha 选股、仓位择时的纯多头策略

Alpha 选股模型主要是多因子模型，也包括其他技术分析模型。选出来的股票辅以量化择时模型和投资经理的主观判断，选择合适的模型进场/出场时间，力争做到绝对收益。

(2) Alpha 选股市场中性策略

Alpha 选股模型主要是多因子模型，也包括其他技术分析模型。与纯多头策略不同的是，市场中性策略采用股指期货对冲掉绝大部分的市场风险。

(3) CTA 策略

CTA 的全称是 Commodity Trading Advisor，泛指股指期货和商品期货的短期投机策略。

(4) 套利策略

包括期限套利、分级基金套利、统计套利、ETF 基金套利等。

(5) 其他低风险投资策略

包括新股认购、债券投资、分级基金 A 份额的投资等。

4、业绩比较基准

本基金无业绩比较基准。

5、风险收益特征

本基金的投资风险收益特征为中等风险、中等收益。

6、投资限制

(1) 不得将本基金财产投资于单一债券的数量超过该债券发行规模的 10%；

(2) 本基金财产投资于单一债券的金额不得超过基金资产净值的 20%（按市值计算）；

(3) 不得将本基金财产投资于单一股票的数量超过该股票发行规模的 10%；

(4) 本基金财产投资于单一股票的金额不得超过基金资产净值的 20%（按市值计算）；

(5) 股指期货、商品期货合约价值之和占基金资产净值的比例为 0—100%；

(6) 股票占基金资产净值的比例为 0—100%（按市值计算）；

(7) 本基金终止日前第 3 个交易日起禁止进行买入交易；

(8) 本基金终止日前的 3 个交易日持有的非现金类资产不得超过基金资产净值的 100%（按市值计算）；

(9) 法律法规、中国证监会以及基金管理人、基金托管人规定的其他投资限制。

7、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) 向他人贷款或提供担保；
- (3) 从事承担无限责任的投资；
- (4) 从事内幕交易、操纵证券价格及其他不正当的证券交易活动；
- (5) 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。

8、托管人在其可监测的范围内对投资事项进行监督。应对基金投资范围和投资对象、基金投融资比例、基金投资禁止行为等内容进行监督和检查。如基金托管人发现基金管理人的违规行为，应及时通知基金管理人，并要求其限期纠正，基金管理人收到通知后应及时核对、确认，并在限期内调整完毕，以满足法律法规及投资政策的要求。法律法规另有规定的从其规定。

9、投资政策的变更

遵循基金份额持有人利益优先的原则下，经本合同当事人之间协商一致可对投资政策进行变更，变更投资政策应签署补充协议后方可实施。投资政策变更应为调整投资组合留出必要的时间。

10、基金的预警及止损

为保护全体基金份额持有人的利益，本基金设置预警线和止损线。

- (1) 预警线：本基金预警线为基金份额净值 0.80 元。

在本基金存续期内任何一个工作日（T日）收市后，基金份额净值高于止损线且不高于预警线的（以基金管理人同基金托管人核对后的净值为准），基金管理人应在T日后的2个工作日内以电话、短信、传真或邮件的方式向全体基金份额持有人发出预警提示。

（2）止损线：本基金止损线为基金份额净值0.75元。

在本基金存续期内任何一个工作日（T日）收市后，基金份额净值不高于止损线的（以基金管理人同基金托管人核对后的净值为准），无论其后基金份额净值是否回到止损线以上，基金管理人应在T日后第二个工作日以市价将可出售的资产全部变现，或者管理人可在T日后第二个工作日15:00前追加资金，若追加资金后当日的基金份额净值等于或低于0.75元，则管理人需最迟在追加资金后的第二个工作日以市价将可出售的资产全部变现。可出售的资产全部变现后，本基金最迟在其后的五个工作日内终止，进入清算程序。

十一、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。

2、基金管理人、基金托管人因基金财产的管理、运用或者其他情形而取得的财产和收益归入基金财产。

3、基金管理人、基金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。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，基金管理人、基金托管人不得主张其债权人对基金财产强制执行。上述债权人对基金财产主张权利时，基金管理人、基金托管人应明确告知基金财产的独立性。

5、非现金类财产的保管

(1) 证券类资产及证券交易资金的保管

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

(2) 对于其他非现金类财产的保管，由基金托管人负责保管相关权利凭证。

基金管理人对基金财产权利行使依据的任何形式的变更，都必须提前或在变更当日通知基金托管人，并在变更后5个工作日内提交给基金托管人。

对于上述实质上由基金管理人保管的基金财产，基金管理人不得将其进行抵押或转让，并对相关财产的安全和完整负责。

(3) 基金托管人对本机构以外机构实际有效控制的基金财产不承担保管责任。

(二) 基金财产相关账户的开立和管理

基金管理人按照规定开立基金账户、基金募集账户，基金托管人应给予必要的配合，并提供所需材料。

1、基金账户的开立和管理

(1) 基金管理人负责为本基金开立所需的基金账户。

(2) 基金管理人在开立基金账户时应将托管专户作为赎回款、分红款指定收款账户。

(3) 基金管理人需及时将基金账户的开户资料信息以双方认可的方式告知基金托管人。

(4) 在基金托管人收到开户资料信息前，基金管理人不得利用该账户进行投资活动。

(5) 基金托管人有权随时向基金注册登记人查询该账户资料。基金管理人应于每季度结束后十个工作日内将开放式基金对账单发送给基金托管人。

2、基金募集期间的账户开立及管理

(1) 基金初始销售期间募集的资金应存于本基金的募集账户。该账户由基

金管理人委托外包服务机构开立，该账户仅用于本基金募集期间和存续期间认购、申购和赎回资金的归集与支付。

(2) 基金初始销售期间届满或停止初始销售时，初始销售后的基金金额、基金份额持有人人数符合相关法律法规及本合同的规定后，基金管理人应委托外包服务机构将属于基金财产的全部资金划入基金托管人开立的基金财产托管专户。

(3) 若基金初始销售期限届满，未能达到基金备案的条件，由基金管理人按规定办理退款等事宜。

3、基金财产托管专户的开立和管理

(1) 托管专户是指基金管理人、基金托管人为履行本合同在托管人指定银行为基金单独开立的银行结算账户。托管专户的名称应当包含“知方石灵活策略1号私募证券投资基金”，具体名称以实际开立为准。账户预留印鉴根据存管银行具体规定执行，相应印章由基金托管人保管。同时，托管专户的网银客户号、机构网银登陆密码、网上银行证书等均由基金托管人保管。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，均需通过该托管专户进行。基金托管人按照规定开立基金财产的托管专户，基金管理人应当在开户过程中给予必要的配合，并提供所需资料。

(2) 托管专户的开立和使用，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假借基金的名义开立其他任何银行账户；亦不得使用基金的任何银行账户进行本基金业务以外的活动。

(3) 托管专户的管理应符合有关法律法规的规定。

4、证券交易资金账户（专用资金台账账户）的开立和管理

证券交易资金账户是以基金名义在基金管理人所选择的证券公司的下属营业机构开立的账户，并与托管专户建立第三方存管关系。基金管理人应在托管专户所属银行签署《客户交易结算资金银行存管协议书》。证券交易资金账户开立后，基金管理人将专用资金账户的相关信息以双方认可的方式及时通知基金托管人。

在本合同有效期内，未经基金托管人同意，基金管理人不得注销该资金账户，也不得自行通过“第三方存管”平台从证券交易资金账户向银行结算账户（即

托管专户)划款。基金托管人负责通过银证转账方式完成资金划付。

5、证券账户的开立和管理

(1) 基金托管人按照规定开立基金财产的证券账户。基金管理人应当在开户过程中给予必要的配合,并提供所需资料。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) 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对方同意擅自转让基金的任何证券账户,亦不得使用基金的任何证券账户进行本基金业务以外的活动。

证券账户卡的保管由基金托管人负责,证券账户管理和运用由基金管理人负责。

6、期货结算账户的开立和管理

(1) 基金托管人、基金管理人应当代表本基金,按照相关规定开立期货结算账户、期货资金账户,在中国金融期货交易所获取交易编码。期货结算账户名称、期货资金账户名称及交易编码对应名称应按照规定设立。

(2) 本基金的基金管理人授权基金托管人有权选择具有期货保证金存管资格的其他商业银行办理相关银期转账业务。基金托管人通过银期转账的方式办理期货交易的出入金。

(3) 本基金的托管专户同时亦为期货结算账户。

7、投资定期存款的银行账户的开立和管理

基金财产投资定期存款在存款机构开立的银行账户,包括实体或虚拟账户,其预留印鉴由托管人保管。本着便于基金财产的安全保管和日常监督核查的原则,存款行应尽量选择基金存管银行所在地的分支机构。对于任何的定期存款投资,基金管理人都必须和存款机构签订定期存款协议,约定双方的权利和义务,该协议作为划款指令附件。该协议中必须有如下明确条款:‘存款证实书不得被质押或以任何方式被抵押,并不得用于转让和背书;本息到期归还或提前支取的所有款项必须划至托管专户(明确户名、开户行、账号等),不得划入其他任何账户’。如定期存款协议中未体现前述条款,基金托管人有权拒绝定期存款投资的划款指令。在取得存款证实书后,基金托管人保管证实书正本。基金管理人应该在合理的时间内进行定期存款的投资和支取事宜,若基金管理

人提前支取或部分提前支取定期存款，若产生息差（即本基金财产已计提的资金利息和提前支取时收到的资金利息差额），该息差的处理方法由基金管理人和基金托管人双方协商解决。

8、其他账户的开立和管理

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。新账户按有关规则管理并使用。

十二、投资指令的发送、确认和执行

（一）交易清算授权（如基金管理人已向基金托管人出具了统一授权文件，以统一授权文件为准）

1、基金管理人应指定专人向基金托管人发送投资指令。

2、基金管理人应在本基金投资运作前向基金托管人提供书面授权文件，内容包括被授权人名单、电话、传真、预留印鉴和被授权人签字样本，授权文件应注明被授权人相应的权限并加盖基金管理人公章。

3、基金托管人在收到授权通知的当日与基金管理人通过录音电话的方式确认。该授权通知应载明生效日期。

4、如基金管理人撤销或更改对指令发送人员的授权，应向基金托管人传真变更后的书面授权文件，并经电话确认后生效，原授权文件同时废止。变更后的授权文件原件应及时寄送给基金托管人。

5、基金管理人和基金托管人对授权文件负有保密义务，其内容不得向被授权人及相关操作人员以外的任何人泄露。

（二）投资指令的内容

1、投资指令是基金管理人在运用基金财产时，向基金托管人发出的资金划拨及其他款项支付的指令。基金管理人发给基金托管人的指令应写明划付款项事由、支付时间、到账时间、金额、收款账户等，加盖预留印鉴并由被授权人签字或盖章。

2、本基金托管专户发生的银行结算费用等银行费用，由基金托管人直接从托管专户中扣划，无须基金管理人出具指令。

（三）投资指令的发送、确认及执行程序

1、投资指令的发送

基金管理人发送指令应采用传真方式。经当事人协商一致可以变更或增加指令的发送方式。

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

指令发出后，基金管理人应及时以电话方式向基金托管人确认。

基金管理人向托管人发送有效划款指令时，应确保基金托管人有足够的处理时间，除需考虑资金在途时间外，还需给基金托管人留有 2 个工作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。有效划款指令是指指令要素（包括付款人、付款账号、收款人、收款账号、金额（大、小写）、款项事由、支付时间）准确无误、预留印鉴相符、相关的指令附件齐全且头寸充足的划款指令。

基金管理人应在交易结束后将同业市场债券交易成交单加盖公章后及时传真给基金托管人，并电话确认。

2、投资指令的确认

基金托管人应指定专人接收基金管理人的指令，预先通知基金管理人其名单，并与基金管理人商定指令发送和接收方式。指令到达基金托管人后，基金托管人应指定专人立即审慎验证有关内容及印鉴和签名，如有疑问应以电话形式向基金管理人确认。

3、投资指令的执行

基金托管人收到基金管理人发送的指令后，应立即依据“授权通知”的约定验证有关内容及印鉴和签名是否表面相符，复核无误后应在规定期限内执

行，不得延误。指令执行完毕后，基金托管人应及时通知基金管理人。基金管理人向基金托管人下达指令时，应确保基金财产托管专户内有足够的资金余额，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投资指令，基金托管人可不予执行，但应立即通知基金管理人，由基金管理人审核、查明原因，确认此交易指令无效。基金托管人不承担因未执行该指令造成损失的责任。资产托管人仅对《划款指令》根据被授权人预留印鉴和签名进行表面相符性的形式审查，对其真实性不承担责任。对不符合本合同约定的划款指令，资产托管人有权拒绝执行，并立即通知资产管理人进行核查。

十三、交易及清算交收安排

（一）场内交易

基金管理人应在本基金正式投资运作之前为本基金指定证券经纪商和交易席位，本基金进行场内证券投资所涉及的证券经纪商交易席位号、交易品种的费率表、证券经纪商佣金收取标准等事项在本合同的经纪操作协议中进行约定。

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

1、本基金场内证券投资的清算交割，由基金管理人选择的证券经纪商直接根据相关登记结算公司的结算规则办理。

2、基金管理人授权基金托管人保管本基金银证转账密码、银行账户密码以及相关电子证书等与资金划拨相关的信息及印鉴。

（二）开放式基金投资的清算交收安排

1、开放式基金申购（认购）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逐笔划付。基金管理人申购（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。基金管理人应实时调整当日可用资金余额。基金管理人在收到基金申购（认购）确认回单后，应立即传真至基金托管人。

2、基金管理人赎回开放式基金时，应在向基金管理公司或代销机构发出基金赎回申请书的同时将赎回申请书传真至基金托管人；基金管理人在收到赎回

确认回单后，应及时传真至基金托管人。

3、为确保本基金财产会计核算及估值的及时处理，基金管理人应于开放式基金交易（包括认购、申购、赎回、基金转换、红利再投资、现金分红等）的确认日及时获取确认单等单据的传真件，要求并督促基金管理公司于当日传真给基金管理人，基金管理人收到后应立即传真至基金托管人。

4、由于基金管理人无法及时向基金托管人提供与投资行为相关的单据（如基金、信托计划、资产管理计划认/申购、赎回的申请单和确认单、基金份额转换与配对确认单等），造成的估值偏差，基金托管人不承担责任。

（三）股指期货的清算交收安排

本基金相关期货投资的具体操作按照《期货交易资金结算三方协议》和《银期转账协议》的约定执行。

（四）股权类项目场外交易资金结算

本基金场外投资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逐笔划付。

基金管理人应将划款指令连同《股权转让合同》等相关交易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。

《股权转让合同》等交易文件中约定的其他转让条件由基金管理人负责审核，基金托管人不承担审核职责。基金管理人同时应以书面形式通知基金托管人相关收款账户名、账号、交易费率等。投资或收益分配资金必须回流到基金托管人开立的基金财产托管专户内，不得划入其他账户。

基金托管人需要查询股权转让的工商变更登记文件时，基金管理人应当按照基金托管人的要求予以提供。

（五）资金结算的注意事项

1、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。

2、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、本合同规定的指令不得拖延或拒绝执行，但银行

托管专户余额不足或基金托管人遇不可抗力情况除外。

3、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。

4、对于因本基金投资产生的应收资产，应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知基金托管人。到账日本基金财产没有到达基金托管人处的，基金托管人应及时通知基金管理人。基金管理人应采取措施向有关当事人进行催收，在此过程中给本基金财产造成损失的，基金管理人应负责向有关当事人追偿本基金财产的损失。

（六）资金、证券账目及交易记录的核对

1、交易记录的核对

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

2、资金账目的核对

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

3、证券账目的核对

对基金财产的证券账目，由相关各方根据外部第三方对账数据定期进行对账。

（七）交易数据的传输

基金管理人按与基金托管人协商确定的方式委托华泰证券向基金托管人传送柜台交易清算数据。本基金的交易数据传输具体操作按照基金管理人、基金托管人及华泰证券签订的《基金合同之经纪操作协议》的约定执行。

十四、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的规定以及违反或超出本合同

项下基金份额持有人的授权而进行的投资交易行为，包括：违反有关法律法规和本合同投资范围、投资限制等的规定进行的投资交易行为。

基金管理人应在有关法律法规和本合同规定的权限内运用基金财产进行投资管理，不得违反有关法律法规和本合同的约定，超越权限进行投资。

（二）越权交易的处理程序

1、发生上述“违反有关法律法规和本合同投资范围、投资限制等的规定进行的投资交易行为”越权交易时的处理程序。

在基金托管人行使监督职能时，发现基金管理人的投资指令违反法律法规的规定，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并有权报告中国证监会。

在基金托管人行使监督职能时，发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他规定，或者违反本合同约定的，应当立即通知基金管理人并有权报告中国证监会。

基金管理人应向基金托管人主动报告越权交易，在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

2、越权交易所发生的损失及相关交易费用由基金管理人负担，所发生的收益归本基金所有。

（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投资行为的监督的具体内容和标准按照本合同附件投资监督事项表执行。

2、基金托管人对基金财产的投资限制的监督和检查自本基金成立之日起开始。在本合同到期日前一个月内，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资产配置比例规定。

3、投资范围和投资限制的变更，本合同当事人之间应当事先签订补充协议后方可实施，并应为基金托管人调整监督事项留出必要的时间。

十五、基金财产的估值和会计核算

（一）基金财产的估值

1、估值目的

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

2、估值对象

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

3、估值时间

基金管理人在每个交易日对基金财产进行估值，T+1日完成T日估值。

4、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。

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

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

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，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日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。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整

最近交易市价，确定公允价格。

D、交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。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。

(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市价（收盘价）估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值。

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。

一期、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市价（收盘价）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。

(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，采用估值技术确定公允价值。

(4) 同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

(5) 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，以最近交易日的收盘价估值；

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

C、货币基金以成本估值，每日按前一交易日的万份收益计提红利。

(6) 期货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。

(7) 基金持有的衍生工具等其他有价证券，上市交易的按估值日的收盘价估值；估值日没有交易的，按最近交易日的收盘价估值；未上市交易的，采用

估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量的情况下，按成本估值；停止交易、但未行权的有价证券，采用估值技术确定公允价值。

(8) 银行存款、债券、回购等计息资产按照约定利率在持有期内逐日计提应收利息，在利息到账日以实收利息入账。

(9) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

(10) 如有投资场外开放式基金产品（信托计划、资产管理计划、私募基金等），管理人在每周一 15:00 前以电子邮件形式向外包服务机构和基金托管人提供上周四的产品净值，外包服务机构和托管人以此净值为准进行估值核算；如果周一管理人未在 15:00 前按时提供净值，则当天外包服务机构和托管人按照上一次管理人提供的私募产品的净值进行估值；如因此造成的估值偏差，外包服务机构和托管人不承担责任。

(11) 基金投资同业存单，按估值日第三方估值机构提供的估值净价估值；选定的第三方估值机构未提供估值价格的，按成本估值。货币市场基金按照摊余成本法原则进行账务处理，并采用上述估值价格计算“影子定价”。

(12) 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。

基金管理人承担本基金资产净值计算和基金会计核算的义务；基金托管人应根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。基金管理人调整估值方法时应及时通知基金托管人。基金托管人应认真核查基金管理人采用的估值政策和程序。当存有异议时，基金托管人有权要求基金管理人作出合理解释，通过积极商讨达成一致意见。如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，以基金管理人对本基金资产净值的计算结果为准。

6、估值程序

(1) 本基金份额净值的计算，保留到小数点后四位，小数点后第五位四舍

五入，由此产生的收益或损失由本基金财产承担。国家另有规定的，从其规定。

(2) 基金管理人在每个交易日对基金财产进行估值，T+1 日完成 T 日估值，并与基金托管人以约定的方式进行核对。估值原则应符合本合同及其他法律、法规的规定。

(3) 基金财产净值计算和会计核算的义务由基金管理人承担。因此，就与本基金财产有关的会计问题，会计责任方是基金管理人。如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致意见，以基金管理人对基金财产净值的计算结果为准。

当基金财产估值出现错误时，基金管理人和基金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。

7、暂停估值的情形

(1) 与本基金投资有关的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

(2) 因不可抗力或其它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；

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

(4) 中国证监会和本合同认定的其它情形。

8、基金份额净值的确认

基金财产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人进行复核。基金管理人每月将经基金托管人复核的上个月最后一个交易日的基金财产净值以各方认可的形式提交基金份额持有人。每个开放日基金管理人公布提取业绩报酬后的基金份额净值。

9、特殊情况的处理

(1) 基金管理人或基金托管人按估值方法进行估值时，所造成的误差不作为基金财产估值错误处理。

(2) 由于不可抗力原因，或由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误，或国家会计政策变更、市场规则变更等，基金管理人和基金托管人虽然已

经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现该错误的，由此造成的基金财产估值错误，基金管理人和基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

（二）基金财产的会计核算

- 1、基金管理人为基金财产的会计责任方；
- 2、基金财产的会计年度为公历年的1月1日至12月31日；
- 3、基金财产的会计核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位；
- 4、会计制度执行国家有关的会计制度；
- 5、本基金财产独立建账、独立核算；
- 6、基金管理人保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关规定编制基金财产会计报表；
- 7、基金托管人应定期与基金管理人就基金财产的会计核算、报表编制等进行核对。

十六、基金的费用与税收

（一）基金业务费用的种类

- 1、管理费；
- 2、托管费；
- 3、外包服务费；
- 4、业绩报酬；
- 5、基金的证券、期货交易费用及开户费用；
- 6、基金备案后与之相关的会计师费和律师费；
- 7、基金的银行汇划费用；
- 8、按照国家有关规定和本合同约定，可以在基金资产中列支的其他费用。

（二）费用计提方法、计提标准和支付方式

1、管理费

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值1%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1\% \div N$$

H: 每日应计提的管理费

E: 前一日基金资产净值

N: 当年天数

基金管理费自基金成立次日起, 每日计提, 按季支付给基金管理人。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据, 自动在下季初五个工作日内按照指定的账户路径进行资金支付, 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。

管理费收款账户如下:

户名: 深圳知方石投资有限公司

账号: 4000092209100458786

开户银行: 中国工商银行股份有限公司深圳前海支行

2、托管费

在通常情况下, 基金托管费按前一日基金资产净值 0.1% 的年费率计提。计算方法如下:

$$H=E \times 0.1\% \div N$$

H: 每日应计提的托管费

E: 前一日基金资产净值

N: 当年天数

基金托管费自基金成立次日起, 每日计提, 按季支付给基金托管人。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据, 自动在下季初五个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付, 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。

3、外包服务费

(1) 常规外包服务费

在通常情况下, 基金常规外包服务费按前一日基金资产净值 0.1% 的年费率计提。计算方法如下:

$$H=E \times 0.1\% \div N$$

H: 每日应计提的外包服务费

E: 前一日基金资产净值

N: 当年天数

基金的外包服务费自基金成立次日起, 每日计提, 按季支付给外包服务机构。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据, 自动在下季初五个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付, 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。

(2) 保底外包服务费

本基金在存续期每个自然年度的最后一月结算外包服务费用时考虑保底金额, 保底外包服务费计算公式如下:

存续期每个自然年度的最后一天应收取的保底服务费用=

$$\text{MAX}\{0, (5\text{万} \times \frac{N}{365} - \sum_1^N E_i \times 0.1\% \times \frac{1}{365})\}$$
, 其中 E 为本自然年度基金前一日的资产净值, N 为本自然年度基金存续天数。

保底外包服务费(若有)于基金存续期每个自然年度的最后一月结算外包服务费用时或基金终止时计算, 由基金管理人向基金托管人发送划款指令, 基金托管人复核后于 10 个工作日之内, 从基金财产中一次性支付给基金外包服务机构。保底外包服务费(若有)可于下一运作年度逐日摊销。

托管费和外包服务费收款账户如下:

户 名: 华泰证券股份有限公司

账 号: 506658190856

开户银行: 中国银行江苏省分行营业部

4、业绩报酬

本基金业绩报酬的计算采取“基金高水位法”: 即基金份额累计净值在每个开放日(每个自然月的 18 日, 若遇节假日顺延至下一个交易日)创造新高时, 对基金份额持有人提取超过历史开放日(每个自然月的 18 日, 若遇节假日顺延至下一个交易日)基金份额累计净值最高值部分(计提业绩报酬后)的 20% 作为业绩报酬, 并从基金资产中扣除。首个基金份额累计净值高水位为 1.00 元。

H_m : 第 m 个开放日基金管理人提取的业绩报酬(计提业绩报酬前);

($m=1,2,3,\dots$)

NAV'_m : 第 m 个开放日基金份额累计净值 (计提业绩报酬前);

NAV' : 第 n 个开放日($n < m$)基金份额累计净值的历史最高值 (计提业绩报酬后);

F_m : 第 m 个开放日基金份额数。

当 $NAV'_m > NAV'$ 时, $H_m = (NAV'_m - NAV') \times F_m \times 20\%$;

当 $NAV'_m \leq NAV'$ 时, $H_m = 0$ 。

(注: 第一次提取业绩报酬时 $NAV' = 1.00$ 元)

业绩报酬归管理人所有, 在每个开放日或本基金清算时由基金管理人负责计算, 从基金资产或清算财产中扣除后支付基金管理人。每个业绩报酬计提日后 4 个工作日内由基金管理人向基金托管人发送业绩报酬划付指令, 基金托管人根据基金管理人指令要求进行支付。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的, 顺延至法定节假日、休息日后的第一个工作日或不可抗力结束日后的第一个工作日支付。

业绩报酬的收款账户如下:

户 名: 深圳知方石投资有限公司

账 号: 4000092209100458786

开户银行: 中国工商银行股份有限公司深圳前海支行

5、其他费用的计提方法

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

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

基金证券账户等开户费用, 由基金托管人和基金管理人确认后直接从托管专户中扣划, 无须基金管理人出具指令。

基金存续期间发生的信息披露费、与基金相关的律师费和会计师费、以及按照国家有关规定可以列入的其他费用等, 由基金托管人根据有关法规及相应

协议的规定，按照基金管理人的指令，按费用实际支出金额从基金资产中支付，列入基金费用。

（三）费率的调整

基金管理人和基金托管人与基金份额持有人协商一致后，可根据市场发展情况调整资产管理费率、资产托管费率和外包服务费率。

（四）不列入基金业务费用的项目

基金成立前的推广费用、律师费、会计师费和信息披露费用，不得列入基金费用。

基金存续期间发生的与推广有关的费用。

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，以及处理与本基金财产运作无关的事项发生的费用等不列入基金的费用。

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计划费用的项目。

（五）税收

合同各方当事人根据国家法律法规的规定，履行纳税义务。

十七、基金的收益分配

本基金在存续期内按如下规则进行收益分配。

（一）基金利润的构成

基金利润指基金利息收入、投资收益、公允价值变动损益和其他收入扣除相关费用后的余额，基金已实现收益指基金利润减去公允价值变动损益后的余额。

（二）基金可供分配利润

基金可供分配利润指截至收益分配基准日（即可供分配利润计算截至日）资产负债表中基金未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

（三）基金收益分配原则

1、在符合有关基金分红条件的前提下，基金管理人有权决定在符合有关基金分红条件的前提下是否对基金进行收益分配，收益分配的比例亦由基金管理人决定。

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

本基金默认采用现金分红。

3、本基金允许变更分红方式。

如允许基金委托人变更默认收益分配方式的，应当通过基金销售机构提交申请，由注册登记机构进行处理。

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

5、每一基金份额享有同等分配权；

6、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

（四）收益分配方案

基金收益分配方案中应载明截止收益分配基准日的可供分配利润、基金收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。

（五）收益分配方案的确定、通知与实施

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

十八、报告义务

（一）运作期报告

1、基金管理人向基金委托人提供的报告种类、内容和提供时间

（1）年度报告

基金管理人应当在每年结束之日起 3 个月内，编制完成基金年度报告并经基金托管人复核，向基金委托人披露投资状况、投资表现、风险状况等信息。基金管理人应于每年结束之日起 50 日内完成年度报告，并将年度报告提供基金托管人复核，基金托管人在收到后 20 日内完成复核，并将复核结果书面通知基金管理人。基金托管人在基金年度报告中出具托管人报告，对报告期内托管人是否尽职尽责履行义务以及管理人是否遵规守约等情况作出声明。

若基金成立不足 3 个月，基金管理人可以不编制年度报告。

（2）份额净值报告

基金管理人每月将经基金托管人复核的上个月最后一个交易日的基金财产净值以各方认可的形式提交基金份额持有人，若因基金托管人原因无法复核或无法及时复核的，基金管理人在报告份额净值时，应如实告知基金委托人。

（3）临时报告

发生本合同约定的、可能影响基金份额持有人利益的重大事项时，基金管理人、基金托管人应按照法律法规和监管机构的有关规定，及时进行报告。具体的重大事项包括但不限于如下：

①投资经理发生变动。

②涉及基金管理人、基金财产、资产托管业务的诉讼。

③基金管理人、基金托管人托管业务部门与本合同项下基金财产相关的行为受到监管部门的调查。

④基金管理人及其董事、总经理及其他高级管理人员、投资经理受到严重行政处罚，基金托管人的托管业务或托管业务部门负责人受到严重行政处罚。

⑤法律法规和监管机构规定的其他事项。

2、向基金份额持有人提供报告及基金份额持有人信息查询的具体方式

基金管理人向基金份额持有人提供的报告，按照相关法律法规通过以下至少一种方式进行。基金管理人通过以下至少一种方式进行披露信息即视为履行了告知义务。基金份额持有人可以通过本合同约定的方式查询相关信息。

（1）基金管理人网站

定期报告、临时报告等有关本基金的信息将在基金管理人网站上披露，基金份额持有人可随时查阅。

（2）邮寄服务

基金管理人或代销机构向基金份额持有人邮寄定期报告、临时报告等有关本基金的信息。基金份额持有人在本合同签署页上填写的通信地址为送达地址。通信地址如有变更，基金份额持有人应当及时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）传真或电子邮件

如基金份额持有人在基金认购、参与或退出等业务时留有传真号、电子邮箱等联系方式的，基金管理人也可通过传真、电子邮件、电报等方式将报告信息告知基金份额持有人。如基金份额持有人上述联系方式若发生变更应当及时

通知基金管理人。

3、基金托管人向基金份额持有人提供基金托管情况查询的方式

基金托管报告置于托管人办公地点备查，基金份额持有人可在营业时间前来查询。

（二）向监管机构提供的报告

1、基金管理人应当根据基金业协会的规定，及时填报并定期更新管理人及其从业人员的有关信息、所管理私募基金的运作情况和杠杆运用情况；应将发生重大事项的临时报告于10个工作日内向基金业协会报告。

2、基金管理人应于每个会计年度结束后的4个月内，向基金业协会报送经会计师事务所审计的年度财务报告和所管理私募基金年度投资运作基本情况。

十九、风险揭示

基金投资将可能面临下列各项风险，包括但不限于：

（一）市场风险

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

1、政策风险

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

2、经济周期风险

随经济运行的周期性变化，证券市场的收益水平也呈周期性变化。基金财产投资于债券与上市公司的股票，收益水平也会随之变化，从而产生风险。

3、利率风险

金融市场利率的波动会导致证券市场价格和收益率的变动。利率直接影响着债券的价格和收益率，影响着企业的融资成本和利润。基金财产投资于债券，其收益水平会受到利率变化的影响。

4、上市公司经营风险

上市公司的经营好坏受多种因素影响，如管理能力、财务状况、市场前景、行业竞争、人员素质等，这些都会导致企业的盈利发生变化。如果基金财产所投资的上市公司经营不善，其股票价格可能下跌，或者能够用于分配的利

润减少，使基金财产投资收益下降。虽然基金财产可以通过投资多样化来分散这种非系统风险，但不能完全规避。

5、购买力风险

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

6、债券收益率曲线风险

债券收益率曲线风险是指与收益率曲线非平行移动有关的风险，单一的久期指标并不能充分反映这一风险的存在。

7、再投资风险

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

（二）管理风险

在基金财产管理运作过程中，基金管理人的知识、技能、经验、判断等主观因素会影响其对相关信息和经济形势、证券价格走势的判断，从而影响基金财产收益水平。

（三）流动性风险

在市场或个股流动性不足的情况下，基金管理人可能无法迅速、低成本地调整投资计划，从而对基金收益造成不利影响。在基金份额持有人提出追加或减少基金财产时，可能存在现金不足的风险和现金过多过带来的收益下降风险。

（四）信用风险

本基金交易对手方发生交易违约或者基金持仓债券的发行人拒绝支付债券本息，导致基金财产损失。

（五）特定的投资方法及基金所投资的特定投资对象可能引起的特定风险

本基金的投资范围包含了股票、证券投资基金等较高风险类的投资对象，收益水平会随之变化，进而产生风险。

（六）操作风险

该风险指在业务各环节操作过程中，因内部控制存在缺陷或人为因素造成

操作失误以及违反操作规程等引致的风险，包括越权违规交易、会计部门欺诈、交易错误、IT系统故障等风险。

（七）其他风险

战争、自然灾害、政府行为等不可抗力可能导致基金财产有遭受损失的风险，以及证券市场、基金管理人、基金托管人可能因不可抗力无法正常工作，从而有影响基金财产的提取的风险。

二十、基金合同的变更、终止与财产清算

（一）基金合同的变更

全体基金份额持有人、基金管理人和基金托管人协商一致后，可对基金合同内容进行变更，但本合同约定基金管理人有权与基金托管人协商一致后变更合同内容的情形除外，包括：

- 1、基金认购、申购、赎回的原则、时间、业务规则等变更。
- 2、因相应的法律法规或监管机构对本合同内容与格式要求发生变动而应当对基金合同进行变更。
- 3、对基金合同的变更不涉及合同当事人权利义务关系发生重大变化。
- 4、对基金合同的变更对基金份额持有人利益无实质性不利影响。

基金管理人可与基金托管人协商后修改基金合同，并由基金管理人按照本合同的约定向基金份额持有人披露变更的具体内容。

对基金合同任何形式的变更、补充，基金管理人应当在变更或补充发生之日起5个工作日内向基金业协会报告。

（二）基金合同的终止

基金合同终止的情形包括下列事项：

- 1、基金份额持有人人数少于1人；
- 2、基金管理人被依法取消私募基金管理人资格的；
- 3、基金管理人依法解散、被依法撤销或被依法宣告破产的；
- 4、基金托管人依法解散、被依法撤销或被依法宣告破产的；
- 5、经全体基金份额持有人、基金管理人和基金托管人协商一致决定终止的；
- 6、法律法规和本合同规定的其他情形。

（三）基金合同终止后财产的清算

1、基金财产清算小组

（1）本合同终止后，基金管理人应立即组织成立清算小组。清算小组成员由基金管理人、基金托管人组成。清算小组可以聘用必要的工作人员。

（2）基金财产清算小组职责：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。

2、基金财产清算程序

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

（1）基金合同终止时，由基金财产清算小组统一接管财产；

（2）对基金财产进行清理和确认；

（3）对基金财产进行估价和变现；

（4）制作清算报告；

（5）将清算报告报监管机构备案（如相关法律法规规定的）并报告基金份额持有人；

（6）对基金剩余财产进行分配。

3、清算费用的来源和支付方式

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

4、基金财产清算剩余资产的分配

（1）本基金终止时已计提但尚未支付的管理费、托管费和外包服务费等，经清算小组复核后从清算财产中支付。本基金提前终止时，如当年收取的基金外包服务费不足5万，则按照当年保底费用5万收取。

（2）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后，按基金的投资人持有的基金份额比例以现金形式进行分配，本合同另有约定的除外。

（3）如本基金终止时有未能流通变现的证券，基金管理人与基金托管人继续按规定计提管理费、托管费和外包服务费等费用，其估值方法继续按本合同的规定计算。清算小组在该证券可流通变现时应及时变现，在支付相关费用后按基金的投资人持有的基金份额比例进行再次分配并履行相应的告知义务，直

至所有未能流通变现的证券全部清算完毕。

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

(5) 资产委托到期日（含提前到期日），非现金类资产的保管和转移由基金管理人及基金份额持有人自行负责，基金托管人不承担责任。

5、基金财产清算报告的告知安排

清算过程中的有关重大事项须及时报告基金份额持有人。清算小组在本基金终止后 10 个工作日内编制基金清算报告，经基金托管人审核无误后报监管部门备案（如相关法律法规规定的）并报告基金份额持有人。基金份额持有人在此同意，上述报告不再另行审计，除非法律法规或监管部门要求必须进行审计的。

6、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 15 年以上。

(四) 基金财产相关账户的注销

基金财产清算完毕后，基金托管人按照规定注销基金的托管专户、证券账户和期货账户，基金管理人应给予必要的配合。

(五) 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。

二十一、违约责任

(一) 合同当事人违反合同，应当承担违约责任。给其他当事人造成经济损失的，应当承担赔偿责任。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，本合同能继续履行的，应当继续履行。

(二) 基金管理人、基金托管人在履行各自职责的过程中，违反法律法规的规定或者本合同约定，给基金财产或者基金份额持有人造成损害的，应当分别对各自的行为依法承担赔偿责任；因共同行为给基金财产或者基金份额持有人造成损害的，应当承担连带赔偿责任。但是发生下列情况的，当事人可以免责：

1、不可抗力；

2、基金管理人和/或基金托管人按照当时有效的法律法规或中国证监会的规定作为或不作为而造成的损失等；

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

(三)本合同一方当事人造成违约后，其他当事人应当采取适当措施防止损失的扩大；没有采取适当措施致使损失扩大的，不得就扩大的损失要求赔偿。非违约方因防止损失扩大而支出的合理费用由违约方承担。

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

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

(六)基金托管人仅承担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，更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。

二十二、争议处理

(一)对于因本合同的订立、内容、履行和解释或与本合同有关的争议，合同当事人可以通过协商或者调解予以解决。当事人不愿通过协商、调解解决或者协商、调解不成的，向有管辖权的人民法院提起诉讼。

(二)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。

(三)本合同受中华人民共和国法律管辖。

二十三、基金合同的效力

(一)本合同是约定合同当事人之间权利义务关系的法律文件。基金份额持有人为法人的，本合同经基金份额持有人、基金管理人和基金托管人加盖公章

以及各方法定代表人或法定代表人授权的代理人签字之日起成立并生效；基金份额持有人为自然人的，本合同经基金份额持有人本人签字或授权的代理人签字、基金管理人和基金托管人加盖公章以及双方法定代表人或法定代表人授权的代理人签字之日起成立并生效。

(二)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。

(三)本合同有效期为基金合同生效日至基金合同终止日。

二十四、其他事项

(一)本合同各方当事人应对签署和履行本合同过程中所接触和获取的其他方当事人的数据、信息和其它涉密信息承担保密义务，非经其他方当事人同意，不得以任何方式向第三人泄露或用于非本合同之目的（法律法规或司法监管部门要求的除外）。本保密义务不因合同终止而终止。

(二)如将来中国证监会对基金合同的内容与格式有其他要求的，基金份额持有人、基金管理人和基金托管人应立即展开协商，根据中国证监会的相关要求修改本合同的内容和格式。

(三)除本合同另有约定外，任何与本合同有关的通知、报告应以书面形式作出，由本合同一方以专人递送给其他当事人，或以传真、邮递方式发出。

(四)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。

(五)本合同一式叁份，基金份额持有人执壹份，基金管理人执壹份，基金托管人执壹份，每份具有同等的法律效力。

(六)本合同的签署采用纸质合同的方式进行，由基金管理人、基金托管人、基金投资者共同签署。三方签署的合同原件由基金管理人、基金投资者持有。基金托管人保留基金管理人、基金托管人两方签署的合同原件一份，内容与三方签署的合同保持一致。基金管理人应妥善保存三方签署的合同原件。基金托管人需要查询三方签署的合同原件的，基金管理人应当按照基金托管人的要求予以提供。

（请基金投资者务必确保填写的资料正确有效，如因填写错误导致的任何损失，基金管理人和基金托管人不承担任何责任）

基金投资者请填写：

（一）基金投资者

1、自然人

姓名：

证件名称：身份证、军官证、护照

证件号码：

2、法人或其他组织

名称：

营业执照号码：

组织机构代码证号码：

法定代表人或负责人：

（二）基金投资人认购（申购）金额

人民币 _____元整（¥ _____）

（三）基金投资人账户

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

账户信息如下：

账户名称：

账号：

开户银行名称：

本页无正文，为《知方石灵活策略1号私募证券投资基金基金合同》签署页

基金份额持有人： (章)

法定代表人或授权人：

基金管理人：深圳知方石投资有限公司 (章)



法定代表人或授权人：



基金托管人：华泰证券股份有限公司 (章)

法定代表人或授权人：

签署日期： 年 月 日

知方石灵活策略1号私募证券投资基金基金合同之补充协议

鉴于基金份额持有人、基金管理人、基金托管人三方签署了《知方石灵活策略1号私募证券投资基金基金合同》（以下简称“原合同”）。经友好协商，基金份额持有人、基金管理人、基金托管人三方就原合同中的相关事项达成一致意见，特订立以下补充协议。

本补充协议中的所有术语，除非另有说明，否则其定义与原合同中的定义相同。

一、将原合同中“十、基金的投资 6、投资限制”下的内容：

- (1)不得将本基金财产投资于单一债券的数量超过该债券发行规模的 10%；
- (2) 本基金财产投资于单一债券的金额不得超过基金资产净值的 20%（按市值计算）；
- (3)不得将本基金财产投资于单一股票的数量超过该股票发行规模的 10%；
- (4) 本基金财产投资于单一股票的金额不得超过基金资产净值的 20%（按市值计算）；
- (5) 股指期货、商品期货合约价值之和占基金资产净值的比例为 0—100%；
- (6) 股票占基金资产净值的比例为 0—100%（按市值计算）；
- (7) 本基金终止日前第 3 个交易日起禁止进行买入交易；
- (8) 本基金终止日前的第 3 个交易日持有的非现金类资产不得超过基金资产净值的 100%（按市值计算）；
- (9) 法律法规、中国证监会以及基金管理人、基金托管人规定的其他投资限制。

修改为：

- (1)不得将本基金财产投资于单一债券的数量超过该债券发行规模的 10%；
- (2) 本基金财产投资于单一债券的金额不得超过基金资产净值的 20%（按市值计算）；
- (3)不得将本基金财产投资于单一股票的数量超过该股票发行规模的 10%；
- (4) 本基金财产投资于单一股票的金额不得超过基金资产净值的 20%（按市值计算）；

- (5) 期货合约总价值（轧差计算）占基金资产净值的比例为0 - 200%；
- (6) 本基金终止日前第3个交易日起禁止进行买入交易；
- (7) 本基金终止日前的第3个交易日持有的非现金类资产不得超过基金资产净值的100%（按市值计算）；
- (8) 法律法规、中国证监会规定的其他投资限制。

二、将原合同中“附件一：投资监督事项表 投资限制”相关内容据本补充协议第一条内容进行相应修改。

三、本补充协议自全体基金份额持有人、基金管理人和基金托管人法定代表人或授权代表签字或盖章并加盖公章或合同专用章之日起成立并生效，为原合同不可分割的组成部分，与原合同具有同等法律效力。

除本补充协议中明确所做修改的条款之外，原合同的其余部分应完全继续有效。

本补充协议与原合同冲突的，以本补充协议为准；本补充协议未约定的以原合同为准。

四、本补充协议一式叁份，本协议当事人各执一份，每份协议具有同等法律效力。

（以下无正文）

（此页无正文，为《知方石灵活策略1号私募证券投资基金基金合同之补充协议》签署页）

基金份额持有人： （章）

法定代表人或授权人：

基金管理人：深圳知方石投资有限公司（章）



法定代表人或授权人：



基金托管人：华泰证券股份有限公司（章）

法定代表人或授权人：

签署日期： 年 月 日

附件一：

投资监督事项表

序号	监督项目	监督内容
一	投资范围	本基金投资范围包括股票（包含主板、中小板、创业板、新三板及其他经中国证监会核准上市的股票）、国内依法公开发行的各类债券、央行票据、资产支持证券、国债回购、证券投资基金（含封闭式基金）、期货及法律法规或中国证监会允许投资的其他金融工具。本产品可以进行融资融券、可以投资期权、可以进行港股通交易。如法律法规或监管机构以后允许投资其他品种，投资管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。
二	投资限制	<p>（1）不得将本基金财产投资于单一债券的数量超过该债券发行规模的10%；</p> <p>（2）本基金财产投资于单一债券的金额不得超过基金资产净值的20%（按市值计算）；</p> <p>（3）不得将本基金财产投资于单一股票的数量超过该股票发行规模的10%；</p> <p>（4）本基金财产投资于单一股票的金额不得超过基金资产净值的20%（按市值计算）；</p> <p>（5）股指期货、商品期货合约价值之和占基金资产净值的比例为0—100%；</p> <p>（6）股票占基金资产净值的比例为0—100%（按市值计算）；</p> <p>（7）本基金终止日前第3个交易日起禁止进行买入交易；</p> <p>（8）本基金终止日前的3个交易日持有的非现金类资产不得超过基金资产净值的100%（按市值计算）；</p> <p>（9）法律法规、中国证监会以及基金管理人、基金托管人规定的其他投资限制。</p>

备注：

- 1、本投资监督事项表内的事项由基金托管人负责监督。
- 2、如果投资品种和监督比例需要调整，必须经过基金管理人和基金托管人确认。