

合同编号：【       】

# 益安船长计划私募证券投资基金 基金合同

基金管理人：北京益安资本管理有限公司

基金托管人：中信建投证券股份有限公司

## 重要提示

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但投资者购买本基金并不等同于将资金作为存款存放在银行或其它存款类金融机构，基金管理人并不保证基金一定盈利，也不保证投资者的投资本金不受损失、取得最低收益或者限定损失金额和比例。投资有风险，投资者认购/申购本基金时应认真阅读本基金的基金合同。**基金管理人的过往业绩（如有）并不代表未来业绩，也不代表基金管理人就本基金做出任何承诺、保证等。**

本基金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基金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的认可，亦不构成对基金管理人或本基金持续合规情况的认可，也不作为对本基金财产安全的保证。投资者应当自行识别本基金投资风险并承担本基金投资可能出现的损失。

基金管理人可委托运营服务机构为本基金提供基金运营服务。基金管理人作出该等委托的，基金管理人依法应承担的责任不因基金运营事项委托给运营服务机构而免除。

基金管理人及/或其委托的基金销售机构负责本基金募集工作，履行相应募集程序，并对投资者签署基金合同等法律文件的真实性、准确性、完整性以及募集行为的合法合规性等全权负责。对本基金的募集行为，基金托管人和运营服务机构不承担任何审核监督职责。基金管理人应当按照《私募投资基金募集行为管理办法》的要求，承担基金合同的受托责任，履行受托人义务，不得因委托募集免除其依法应当承担的责任。

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

# 益安船长计划私募证券投资基金风险揭示书

## 尊敬的投资者：

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

根据有关法律法规及监管规定，基金管理人【北京益安资本管理有限公司】及投资者分别作出如下承诺、风险揭示及声明：

### 一、基金管理人声明与承诺

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

（二）基金管理人向投资者声明，基金业协会为基金管理人和本基金办理登记备案不构成对基金管理人投资能力的认可，不构成对基金管理人和本基金持续合规情况的认可；不作为对本基金财产安全的保证，投资者应当自行识别基金投资风险并承担基金投资可能出现的损失。

（三）基金管理人保证在投资者签署基金合同前已（或已委托基金销售机构）向投资者揭示相关风险；已经了解基金投资者的风险偏好、风险认知能力和承受能力；已向基金投资者说明有关法律法规及监管规定的要求，说明投资冷静期的制度安排以及投资者的相关权利。

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

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

（六）基金管理人承诺根据《关于私募基金信息披露备份系统定向披露功能上线相关事项的通知》《私募基金信息披露备份系统定向披露功能常见问题解答》等要求，负责信披备份系统投资者查询账号的维护和管理的工作，及时办理账号的开立、启用、修改和关闭。

（七）基金管理人承诺已在基金合同中约定，基金管理人客观上丧失继续管理本基金的能力及/或资格的情形下，基金财产的安全保障措施、维持基金运营或清算的应急处置预案和纠纷解决机制。基金管理人进一步承诺，基金管理人对本基金的职责不因基金业协会依照法律法规和自律规则执行注销管理人登记等自律措施而免除。即使已被注销基金管理人资格，基金管理人承诺仍将根据《证券投资基金法》、基金业协会相关自律规则和基金合同的约定，妥善处置本基金财产，依法保障投资者的合法权益。

### 二、风险揭示

## **（一）特殊风险揭示**

### **1、基金合同与基金业协会合同指引不一致所涉风险**

本基金合同是基于基金业协会发布的《私募投资基金合同指引1号（契约型私募基金合同内容与格式指引）》（以下简称《合同指引》）而制定的，如本基金的投资范围、产品结构设计等存在特殊约定而无法完全适用基金业协会发布的《合同指引》，即使基金管理人在本风险揭示书中已进行特别揭示，并在报送基金业协会备案时也已出具书面说明，仍可能因该等特殊约定与基金业协会《合同指引》不一致而对投资者权益造成不利影响。

### **2、私募基金委托募集所涉风险（如有）**

基金管理人可委托已在中国证监会注册取得基金销售业务资格并已成为基金业协会会员的基金销售机构（以下简称销售机构）为本基金提供资金募集服务。若销售机构不符合监管部门规定的资质要求、或不具备提供相关服务的条件和技能、或发生管理不善、操作失误等，或存在公开或变相公开宣传、虚假宣传、未履行合格投资者适当性审查义务、挪用侵占基金财产、以保本及/或保收益引诱投资者购买本基金等违法违规行为的，将给基金投资者带来风险。

### **3、私募基金外包事项所涉风险**

基金管理人可将本基金份额登记、估值核算等应属基金管理人负责的事项、职责，以服务外包等方式委托基金运营服务机构办理，因运营服务机构不符合金融监管部门规定的资质要求、或不具备提供相关服务的条件和技能、或因管理不善、技术系统故障、操作失误等，可能给基金投资者带来一定的风险。基金管理人依法应承担的职责不因委托运营服务机构而免除，投资者因运营服务机构履职不当而遭受的损失应向基金管理人直接追偿。

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

### **4、私募基金未在基金业协会履行备案手续或备案失败的风险**

本基金成立后，基金管理人应当及时向基金业协会办理基金备案手续。本基金在基金业协会完成备案后方可进行投资运作（临时投资除外）。本基金备案可能受监管政策等多种因素影响，通过备案时间及是否备案成功均存在不确定性。

如本基金成立后不能及时完成备案，可能导致基金财产不能进行投资运作的风险。如本基金备案失败，本基金将按照本合同约定提前终止并进行清算，直接影响本基金设立目的的实现。

### **5、销售机构与基金管理人存在关联关系的风险（如有）**

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

### **6、关联交易风险**

若基金管理人运用基金财产进行关联交易，基金管理人承诺将建立防范利益输送和利益

冲突等风险控制机制，并进行充分事前、事中信息披露，但即使如此，仍可能存在基金管理人未能完全遵循以基金份额持有人利益优先、平等自愿、等价有偿原则，未能完全杜绝关联方之间的利益输送，未能完全避免关联方与基金投资者之间的利益冲突，未能充分履行相关信息披露义务等相关风险。基金投资者签署基金合同即表明其已经知晓且认可本基金进行关联交易时可能存在上述风险。

#### **7、单一投资标的的风险（如有）**

本基金存续期内，如基金管理人将基金财产主要或全部投资于单一标的，因投资集中度过高，极端情形下存在基金财产全部亏损的风险。

#### **8、基金维持运作机制的有关风险**

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

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

基金管理人和相关当事人对本基金的职责不因基金业协会依照法律法规和自律规则执行注销管理人登记等自律措施而免除。已注销管理人和相关当事人应当根据《证券投资基金法》、基金业协会相关自律规则和基金合同的约定，妥善处置在管基金财产，依法保障投资者的合法权益。

#### **9、基金纠纷解决机制的风险**

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

#### **10、契约型私募投资基金管理人代持的风险（如有）**

本基金存续期内，如基金管理人将基金财产投资于公司股权或者其他非标准化资产（如私募金融产品等），因契约型基金不具备《公司法》及《公司登记管理条例》等法律法规、规范性文件要求的权利主体资格，无法以本基金名义作为权利主体进行登记，只能采取以基金管理人名义代为持有方式处理。如基金管理人违法违规或者违反基金合同约定进行运作，极端情形下存在基金财产全部亏损的风险。

#### **11、通过特殊目的载体投向标的的风险（如有）**

本基金如通过特殊目的载体进行投资，投资标的的权利将登记在特殊目的载体名下，基金管理人面临无法向投资标的的直接主张权利、实现投资目的的风险。基金管理人如需向投资标的的主张权利或实现投资目的，客观上需要特殊目的载体及投资标的的配合，可能对本基金

间接持有的投资标的权益变现和处置存在严重的不利影响，极端情形下存在基金财产全部亏损的风险。

## 12、其他特殊风险揭示

### (1) 本基金的基金架构风险

本基金不进行结构化设置，也未设置份额分类安排。每份基金份额享有同等的收益分配权利，并承担同等的投资风险。

### (2) 本基金的投资架构的风险

在符合基金合同投资范围约定的前提下，基金管理人可根据其投资决策，运用基金财产直接投向证券类资产，或通过其他私募金融产品间接投资证券类资产。直接投资将使本基金直接面临所投的特定金融品种对应的投资风险，而间接投资将使本基金面临投资私募金融产品的特定风险。

### (3) 未设预警止损线风险

本基金未设预警止损线，在极端情况下，可能存在基金投资者投入的本金全部损失的风险。

### (4) 冷静期风险

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

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

### (5) 基金托管人监督范围不覆盖基金管理人全部投资运作行为的的风险

基金托管人监督范围不覆盖基金管理人全部基金投资运作行为，基金托管人仅根据基金合同第十二章“私募基金的的投资”中对投资范围、投资限制的约定，对明确约定由基金托管人履行监督职责的事项进行事后监督。除基金合同另有明确约定外，基金托管人对于其他事项不予监督。基金管理人违反投资目标、投资策略、投资限制、投资禁止行为、风险控制、增信措施控制、关联交易、预警止损控制及嵌套层级等要求的，相关责任和损失均由基金管理人承担，基金托管人不承担该等责任和损失。**对于基金托管人不承担监督职责的事项，该类投资行为将严重依赖于基金管理人的自律管理，请投资者仔细阅读基金合同，明确基金托管人的监督范围及可能带来的风险。**

### (6) 公布净值不能反映实时净值的风险

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

### (7) 以电子签名方式签署本基金合同的特别风险

本基金合同采用电子签名方式签署的，如因签约系统故障、设备故障、通讯故障等突发

事件导致投资者电子签名无效或无法完成电子签署，投资者可能面临基金认购/申购失败的风险。此外，若投资者未能妥善保管与身份认证有关的设备、资料以及登录密码、交易密码等相关信息的，也存在投资者电子签名被盗用的风险。

#### **(8) 基金开放日安排的特殊风险**

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

#### **(9) 基金收益分配的风险**

若根据基金合同约定，本基金可分配未实现收益部分的，可能出现基金收益分配时基金资产未变现导致托管账户中现金不足以足额支付分红款项或收益分配后基金份额净值大幅度变化等风险，**前述分配未实现收益的操作及可能导致的风险由基金管理人负责，与基金托管人无关。**

#### **(10) 管理人无法及时开通信息披露备份系统投资者查询账号的风险**

根据《关于私募基金信息披露备份系统定向披露功能上线相关事项的通知》、《私募基金信息披露备份系统定向披露功能常见问题解答》，基金管理人应负责“信披备份系统”投资者查询账号的维护和管理工作，及时办理账号的开立、启用、修改和关闭，投资者可登录信披备份系统查询已购买的私募基金信息披露报告。该查询账号的开通有赖于基金管理人获取投资者名称、投资者类型、有效证件类型、有效证件号码、联系邮箱等信息，若基金管理人未能完整获取上述信息，则无法及时为投资者开通信披备份系统查询账号。

### **(二) 一般风险揭示**

#### **1、资金损失风险**

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

**本基金风险等级和投资者承受能力由募集机构负责评估。**经募集机构评定，本金属于【R3】级基金产品，适合专业投资者及风险承受能力为【C3、C4、C5】型的普通合格投资者。

#### **2、基金运营风险**

基金管理人依据基金合同约定管理和运用基金财产所产生的风险，由基金财产及投资者承担。投资者应充分知晓投资运营的相关风险，其风险应由投资者自行承担。

#### **3、流动性风险**

本基金存续期内，投资者可能面临资金不能退出带来的流动性风险。市场的流动性受到市场行情、投资群体等诸多因素的影响。在市场流动性相对不足时，交易变现的变现成本有

可能增加，对私募基金投资造成不利影响。

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

#### **4、募集失败风险**

本基金的成立需符合相关法律法规的规定及合同约定，本基金可能存在不能满足成立条件从而无法成立的风险。基金管理人的责任承担方式：（1）以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用；（2）在基金募集期限届满（确认基金无法成立）后三十日内退还投资人已缴纳的款项，并加计银行同期存款利息。

#### **5、税收风险**

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

#### **6、其他风险**

包括但不限于法律与政策风险、发生不可抗力事件的风险、技术风险和操作风险、相关机构（如基金管理人、基金托管人、证券期货经纪商、运营服务机构等）运营风险等。

#### **（三）基金投资风险揭示**

**本条列举了私募基金常见的投资品种，所列品种可能超出本基金投资范围。投资者应当自行对照本基金合同“基金的投资”章节中“投资范围”条款中所列举的本基金可实际投资的具体投资品种，结合本条款关于特定投资品种的风险，以了解相应风险。**

#### **1、市场风险**

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

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

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

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

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

（5）上市公司经营风险。上市公司的经营状况受多种因素影响，如市场、技术、竞争、管理、财务等都会导致公司盈利发生变化，从而导致基金投资收益变化。

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

（7）信用风险。债券发行人违约、拒绝支付到期本息，或由于债券发行人信用质量降低导致债券价格下降的风险，信用风险也包括因证券交易对手违约而产生的证券交割风险。



## **2、股票等权益类资产的投资风险**

### **(1) 参与新股申购风险**

由于新股申购在市场特性、交易机制、投资特点和风险特性等方面与二级市场存在着一定的差别，参与新股申购存在某些特定风险，具体包括：1) 网上新股申购违规风险：由于某只股票的网上申购中签率持续放大，使得本基金所持有的该股票的资产比例超过了相关法律法规或合同的有关限制所导致的风险。2) 新股申购的市场风险：即使是首发新股也存在跌破发行价的可能。

### **(2) 非公开发行股票的投资风险**

本基金如可直接或间接投资定向增发股票，因为所直接投资或间接投资的非公开发行股票自其发行结束之日起，在约定的时间内不得转让，这段时间内市场情况或上市公司运作状况的变化，将加剧投资非公开发行股票所面临的风险，从而导致本基金财产面临损失。根据现行法律法规、监管政策、交易所规则的要求，定向增发股票锁定期满后，其减持途径和数量须符合一定限制性标准，可能难以在短期之内全部实现变现，如持有的定向增发股票数量较大，其变现过程可能超过一年，相关收益将因此受到不利影响。定向增发股票锁定期满后，对股票进行减持过程中，因证券市场或本基金所投资股票的流动性不足，或所投资股票被停牌、除牌等情况，可能发生股票不能及时减持进而造成损失的风险。

### **(3) 港股通股票的投资风险**

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

### **(4) 伦敦证券交易所证券等境外交易所证券的投资风险**

境外证券交易所证券交易业务开通后，本基金如可参与相关股票交易，由于境外证券市场交易日安排、涨跌幅限制、停市制度等交易规则的不同，以及投资范围、投资额度、交易结算规则、交易系统、交易费用与税收、汇率变动等规则的不同规定均会对本基金的投资造成较大影响，也会影响本基金的投资收益及造成投资损失。

### **(5) 科创板股票的投资风险**

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

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

3) 退市风险：科创板上市公司的退市机制比 A 股其他板块更严格，且不再设置暂停上

市、恢复上市和重新上市环节。一旦所投资的科创板个股进入退市流程，将面临退出难度较大、成本较高的风险。

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

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

#### **(6) 存托凭证的投资风险**

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

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

本基金如可参与挂牌公司股票投资，除面临股票的共有投资风险外，还存在包括但不限于如下特定风险：

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

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

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

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

#### **(8) 北京证券交易所股票的投资风险**

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

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

2) 流动性风险：北交所整体投资门槛较高，投资者数量较少，基金资产存在无法及时

或以公允价格变现及其他相关流动性风险。

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

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

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

### **3、债券等债权类资产的投资风险**

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

#### **(1) 再投资风险**

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

#### **(2) 债券回购风险**

债券回购为提升整体投资组合收益提供了可能，其主要风险包括信用风险、投资风险及波动性加大的风险，其中，信用风险指回购交易中交易对手在回购到期时，不能偿还全部或部分证券或价款，造成基金净值损失的风险；投资风险是指在进行回购操作时，回购利率大于债券投资收益而导致的风险以及由于回购操作导致投资总量放大，致使整个投资组合风险放大的风险；而波动性加大的风险是指在进行回购操作时，在对投资组合收益进行放大的同时，也对投资组合的波动性（标准差）进行了放大，即投资组合的风险将会加大。回购比例越高，风险暴露程度也就越高，对基金净值造成损失的可能性也就越大。

#### **(3) 非公开发行债券投资风险**

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

#### **(4) 债券正回购风险**

本基金如可参与债券正回购，债券正回购为提升整体投资组合收益提供了可能，但也存在遭受损失的风险。债券正回购的主要风险包括信用风险及杠杆风险，其中，信用风险指回购交易中交易对手在回购到期时，不能偿还全部或部分证券或价款，造成本基金损失的风险；而杠杆风险是指债券正回购，在对投资组合收益进行放大的同时，也对投资组合的波动性（标准差）进行了放大，即投资组合的风险将会加大，且回购比例越高，风险暴露程度也就越高，对本基金净值造成损失的风险也就越大。

#### **(5) 资产支持证券的投资风险**

本基金如投资资产支持证券，资产支持证券具有一定的价格波动风险、流动性风险、信用风险等风险。价格波动风险指的是市场利率波动会导致资产支持证券的收益率和价格波动。流动性风险指的是受资产支持证券市场规模及交易活跃程度的影响，资产支持证券可能无法在同一价格水平上进行较大数量的买入或卖出，存在一定的流动性风险。信用风险指的基金

所投资的资产支持证券之债务人出现违约，或在交易过程中发生交收违约，或由于资产支持证券信用质量降低导致证券价格下降，造成基金财产损失。

#### **(6) 证券公司收益凭证风险**

本基金如投资收益凭证，收益凭证本金和收益的偿付挂钩特定标的，若挂钩的特定标的的价格向不利的方向变动，将可能导致本基金财产出现损失的风险。

#### **(7) 中小企业私募债券的投资风险**

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

### **4、商品及金融衍生品的投资风险**

#### **(1) 期货投资风险**

本基金如投资期货（如股指期货、商品期货、国债期货等），可能面临的风险包括但不限于流动性风险、合约展期风险、期货保证金不足风险、基差风险（现货价格与股指期货价格之间差额的波动）等相关风险，期货作为金融衍生品，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，本基金还可能承受超出保证金甚至基金资产本金的损失。

#### **(2) 期权投资风险**

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

#### **(3) 权证投资风险**

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

#### **(4) 收益互换投资风险**

1) 流动性风险。收益互换作为场外市场的交易，是以证券期货市场场外衍生品交易主协议及其补充协议等标准法律文本，结合交易确认书等定制的法律文本所构成的协议群，客观上流通和转让能力较差，存在无法及时变现或变现时间不可预测的风险。

2) 交割失败等操作风险。收益互换交易可能发生因系统故障或特殊原因造成交割失败，但交割失败并不必然被视为违约。交割失败可能导致预期的现金流安排发生变化而产生风险。

3) 最大损失可能风险。与普通金融工具相比，收益互换交易波动性强，可能获得较高收益但也可能面临较大损失，属于高风险投资品种。由于各种风险因素的存在，在最不利情况下，本基金投资收益互换的损失总额可能达到或者超过全部初始交易金额。

4) **跨境收益互换投资风险**。若基金如投资跨境收益互换，相当于间接投资境外证券市

场，境外市场股票可能不设涨跌幅限制，存在股票价格波动较大的风险。投资收益以外汇形式体现，受人民币与外汇间汇率变动的影响较大。如果本基金存续期间内出现人民币汇率较大波动，投资者可能会因此而遭受损失。此外，境内外市场交易日不完全一致可能导致基金投资标的止损无法操作的风险。

5) **收益互换等场外衍生品的估值与实际价值不一致风险。**本基金如可投资场外衍生品，由于场外衍生产品不存在如场内交易一样的竞价机制，场外衍生产品的公允价值形成机制尚不健全。场外衍生品估值价格主要由交易对手方根据相关合同约定定期提供给基金管理人和托管人，如交易对手不能及时、准确、完整提供场外衍生产品定价结果和合约具体损益变动情况，将会给本基金场外衍生产品合约的估值造成不利影响，本基金持有的场外衍生品估值可能与场外衍生品实际价值产生背离，对基金开放日净值公允性、申赎价格公允性、业绩报酬计算、基金财产计算等造成不利影响。

#### **(5) 其他金融衍生品投资风险**

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

#### **(6) 贵金属投资风险**

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

### **5、金融产品的投资风险**

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

#### **(1) 净值波动或净值与实际价值不一致的风险**

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

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

#### **(2) 流动性风险**

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

#### **(3) 嵌套风险**

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

#### **(4) 双层收费风险**

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

#### **(5) 投资金融产品形成的基金财产处于托管人控制之外的风险**

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

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

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

### **6、参与转融通业务的风险**

本基金如参与证券出借的,存在无法在合约到期前收回出借证券,从而影响本基金财产使用的风险;如果发生标的证券暂停交易或者终止上市等情况,本基金可能面临合约提前了结或者延迟了结等风险;出借的证券可能存在到期不能归还、相应权益补偿和借券费用不能支付等风险;出借证券量过大无法应对基金大额赎回的风险。

### **7、参与融资融券业务的风险**

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

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

### **三、投资者声明**

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

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

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

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

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

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

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

7、本人/机构知晓，投资冷静期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第十二章“基金的投资”的所有内容，并愿意自行承担购买私募基金的法律风险。【\_\_\_\_\_】

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

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

11、本人/机构知晓，基金业协会为基金管理人和私募基金办理登记备案不构成对基金管理人投资能力的认可，亦不构成对基金管理人和私募投资基金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。用于购买本基金份额的财产为投资者拥有合法所有权或处分权的资产，保证该等财产的来源及用途符合法律法规和相关政策规定。【\_\_\_\_\_】

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

14、本人/机构知晓对于本基金涉及场外投资形成的基金财产、非标准化资产（包括但不限于私募金融产品等）和处于托管人实际控制之外的基金资产，前述基金资产由基金管理人进行保管和履行保管职责，如基金管理人未履行恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的义务可能给本基金财产造成的损失，相关损失由基金管理人承担。【\_\_\_\_\_】

15、本人/机构知晓并完全认可，本基金由募集机构负责本基金募集工作，履行相应募集程序，并对投资者签署基金合同等法律文件真实性准确性完整性、募集行为合法合规性等负责，基金托管人对基金募集行为不承担任何审核监督职责。如因投资者签署基金合同等法律文件不真实不准确不完整、募集行为不合法合规导致的任何责任，由基金管理人自行承担。【\_\_\_\_\_】

16、本人/机构已经知悉并愿意承担以电子签名方式签署本基金合同的相关风险，认可以电子签名方式签署本基金合同的法律效力。本人/机构保证妥善保管账户信息、数字证书、

账户密码等电子签约相关信息，不得将电子签约信息提供给他方或告知他人使用。本人/机构确认，任何使用其电子签约相关信息进行的签约系统操作均视为本人/机构的行为。

【\_\_\_\_\_】

17、本人/机构知晓本基金可投资场外衍生品（包括但不限于收益互换、场外期权、利率互换等），如场外衍生品交易对手方不能及时、准确、完整提供场外衍生品资产净值、定价结果、合约具体损益变动情况等相关估值数据作为场外衍生品公允价值，本基金持有的场外衍生品估值可能与实际价值产生背离，对基金开放日净值公允性、申赎价格公允性、业绩报酬计算、基金财产计算造成不利影响，由此产生的后果由本人/机构自行承担，与基金托管人无关。【\_\_\_\_\_】

18、本人/机构知晓本基金可能投资的资产支持证券/资产支持票据次级/夹层级等类似份额均为高杠杆金融产品，其投资收益与风险具有杠杆效应；当出现不利行情时，本基金所投资上述产品的净值会产生较大波动从而可能导致本基金遭受较大损失的风险。极端情况下，可能遭受全部的投资损失。【\_\_\_\_\_】

19、本人/机构知晓基金管理人根据基金合同约定的合同变更程序，主动进行合同条款变更，如本人/机构不同意合同变更又不申请赎回所持有的全部基金份额的，基金管理人有权对本人/机构持有的全部基金份额作强制赎回处理。【\_\_\_\_\_】

本风险揭示书的揭示事项仅为列举性质，未能详尽列明投资本基金的所有风险和可能导致投资者资产损失的所有因素。本人/本机构作为投资者，在参与本基金投资前，已详阅并充分理解相关业务规则、风险揭示书及相关基金文件所提示的风险，并确信自身已做好足够的风险评估与财务安排，避免因参与私募基金投资而遭受超过自身承受能力的损失并自愿承担由上述风险引致的全部后果。

特别提示：投资者在本风险揭示书上签字，表明投资者在充分了解并谨慎评估自身风险承受能力后，已经理解并愿意自行承担参与本基金投资的风险和损失。

基金投资者（自然人签字或机构盖章）：

日期：

经办员（签字）：

日期：

募集机构（盖章）：

日期：



## 合格投资者承诺书

北京益安资本管理有限公司：

1、本人/本机构确认符合中国证监会规定的私募投资基金合格投资者条件(即投资于单只私募基金的金额不低于100万元且个人投资者的金融资产不低于300万元人民币或者最近三年个人年均收入不低于50万元人民币，机构投资者的净资产不低于1000万元人民币，或为监管机构认可的其他合格投资者)，或符合《私募投资基金监督管理暂行办法》第十三条“视为合格投资者”的规定。

2、本人/本机构具有相应的风险识别能力和风险承受能力，用于购买本基金份额的财产为本人/本机构拥有合法所有权或处分权的资产，投资资金来源及用途符合法律法规和相关政策规定，没有非法汇集他人资金投资私募基金，且为本人/本机构自己购买私募投资基金。不存在代持、不存在不合理的利益输送、关联交易及洗钱等情况，保证有完全及合法的权利委托基金管理人进行基金财产的投资管理，以及委托基金托管人进行基金财产的托管业务。如基金管理人要求本人/本机构提供资金来源及用途合法性证明，对资金来源及用途及合法性进行调查，本人/本机构愿意配合。

3、本人/本机构承诺向基金管理人提供的有关投资目的、投资偏好、投资限制、财产收入情况和风险承受能力等基本情况真实、完整、准确、合法，不存在任何重大遗漏或误导。前述信息资料如发生任何实质性变更，本人/本机构应当及时书面告知基金管理人或销售机构。

4、本人/本机构已充分理解本基金合同全文，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，了解本基金的投资决策安排，愿意承担相应的投资风险。本人/本机构承认，基金管理人、基金托管人未对基金财产的收益状况及本金安全作出任何承诺或担保。

5、本人/本机构承诺，本人/本机构在参与基金管理人发起设立的私募投资基金的投资过程中，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/本机构自行承担，与基金管理人无关。

特此承诺。

基金投资者：

自然人（签字）：

法人或其他组织（盖章）：

法定代表人或授权代表（签章）：

日期：       年    月    日

## 投资者告知书

### 尊敬的投资者：

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

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

【直销渠道】募集结算资金归集专用账户由运营服务机构开立，并不代表是运营服务机构受理投资者的认购或申购资金，也不表明运营服务机构对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。对于投资本基金可能产生的投资损失，由基金投资者自行承担。【直销渠道】募集结算资金归集专用账户的使用过程中，基金管理人应就其自身操作不当等原因所造成的损失承担相关责任，运营服务机构对于基金管理人的投资运作不承担任何责任。基金管理人不因委托运营服务机构为本基金提供基金运营服务，而免除基金管理人应依法承担的责任。

【直销渠道】募集结算资金归集专用账户信息如下：

账户名：【中信建投外包专户益安船长计划】

账号：【3110710005910008985】

开户行：【中信银行北京来福士支行】

大额支付号：【302100011421】

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

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

基金投资者（承诺人）：

自然人（签字）：

法人或其他组织（盖章）：

法定代表人或授权代表（签章）：

日期：        年     月     日

## 目录

重要提示 .....	1
益安船长计划私募证券投资基金风险揭示书 .....	2
合格投资者承诺书 .....	16
投资者告知书 .....	17
一、前言 .....	19
二、释义 .....	19
三、声明与承诺 .....	20
四、基金的基本情况 .....	22
五、基金的分级分类安排 .....	22
六、基金的募集 .....	23
七、基金的成立与备案 .....	26
八、基金的申购、赎回与转让 .....	27
九、当事人的权利和义务 .....	33
十、基金份额持有人大会及日常机构 .....	38
十一、基金份额的登记 .....	40
十二、基金的投资 .....	40
十三、基金的财产 .....	43
十四、资金清算交收安排 .....	45
十五、投资指令的发送、确认和执行 .....	47
十六、基金资产的估值和会计核算 .....	49
十七、基金的费用与税收 .....	58
十八、基金的收益分配 .....	60
十九、信息披露与报告 .....	61
二十、风险揭示 .....	64
二十一、基金合同的效力、变更、解除与终止 .....	64
二十二、基金的清算 .....	66
二十三、违约责任 .....	69
二十四、争议的处理 .....	70
二十五、其他事项 .....	70

## 一、前言

订立本合同的目的、依据和原则

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

2、订立本合同的依据是《中华人民共和国民法典》、《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）《中华人民共和国电子签名法》（以下简称《电子签名法》）《私募投资基金监督管理暂行办法》（以下简称《私募办法》）《关于加强私募投资基金监管的若干规定》《私募投资基金管理人登记和基金备案办法（试行）》《私募投资基金合同指引1号（契约型私募基金合同内容与格式指引）》（以下简称《合同指引》）《私募投资基金募集行为管理办法》（以下简称《募集行为办法》）《私募投资基金信息披露管理办法》《私募投资基金命名指引》、《私募投资基金备案须知（2019版）》等有权机关颁布的有关法律、法规、部门规章、自律规则等规范性文件。若因前述规范性文件制定或修改导致本合同的内容与届时有效的法律法规的规定存在冲突的，应当以届时有效的规范性文件的规定为准，各方当事人应及时对本合同进行相应变更和调整。

3、订立本合同的原则是平等自愿、诚实信用、充分保护本合同当事人的合法权益。

## 二、释义

在本合同中，除上下文另有规定外，下列用语应当具有如下含义：

1、**私募基金、本基金或基金**：指在中华人民共和国境内，以非公开方式向合格投资者募集资金设立的投资基金。本基金名称为益安船长计划私募证券投资基金。

2、**本合同或基金合同**：指《益安船长计划私募证券投资基金基金合同》及其附件，以及任何对其有效的修订和补充，如修订版基金合同或补充协议等。

3、**基金管理人、管理人**：指北京益安资本管理有限公司。

4、**基金托管人、托管人**：指中信建投证券股份有限公司。

5、**投资者、基金投资者、基金份额持有人**：指符合《私募办法》第12条、第13条规定的合格投资者和符合《募集行为办法》第32条及其他法律法规或监管机关要求的特殊合格投资者，签署本合同，购买并持有基金份额的个人或机构。

6、**运营服务机构**：指根据与基金管理人签订的运营服务协议约定，接受基金管理人委托，可以为基金提供份额注册登记、基金估值等服务的机构。

7、**募集机构**：指基金管理人（直销渠道）以及基金管理人委托的销售机构（代销渠道）。销售机构指取得基金销售业务资格或代销金融产品业务资格并与基金管理人签署销售服务相关协议，代为办理基金销售业务的机构。

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

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

10、**基金业协会**：指中国证券投资基金业协会。

- 11、**中国证监会**：指中国证券监督管理委员会及其派出机构。
- 12、**中登公司**：指中国证券登记结算有限责任公司，包括其上海分公司和深圳分公司和北京分公司以及不时设立的其他分公司。
- 13、**募集结算资金归集专用账户、募集账户**：指募集机构提供基金服务的专用账户，用于统一归集基金募集结算资金、向投资者分配收益、给付赎回款项以及分配基金清算后的剩余基金财产等。
- 14、**托管资金账户、托管账户**：指基金托管人为基金财产在具有基金托管资格的商业银行开立的专用银行结算账户。
- 15、**证券账户**：指基金管理人或基金托管人为基金财产在中登公司开设的专用证券账户。
- 16、**期货账户**：指基金管理人为基金财产在期货经纪商开立的期货保证金账户。
- 17、**证券交易资金账户、证券资金账户**：指基金管理人为基金财产在证券经纪商开立的证券交易资金账户。
- 18、**基金财产、基金资产**：指基金份额持有人拥有合法所有权或处分权、委托基金管理人管理并由基金托管人托管的作为本合同标的的财产。
- 19、**基金资产总值**：指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息及其他资产的价值总和。
- 20、**基金资产估值**：指计算、评估基金资产和负债的价值，以确定基金资产净值和基金份额净值的过程。
- 21、**基金资产净值**：指基金资产总值减去负债后的价值。
- 22、**基金单位净值、基金份额净值**：指估值日基金资产净值除以估值日基金份额总数所得的数值。
- 23、**募集期**：指基金成立前，由基金管理人确定的募集期间。
- 24、**存续期**：指基金成立日至基金终止日之间的期间，即基金的运作期间。
- 25、**清算期**：指基金终止日至基金清算完毕日之间的期间。
- 26、**工作日、交易日（T日）**：指证券交易所、期货交易所的正常交易日。
- 27、**开放日**：指基金管理人办理基金申购、赎回业务的工作日，包括固定开放日和临时开放日。
- 28、**认购**：指在募集期间，投资者按照本合同的约定购买基金份额的行为。
- 29、**申购**：指在基金开放日，投资者按照本合同的约定购买基金份额的行为。
- 30、**赎回**：指在基金开放日，投资者按照本合同的约定将基金份额兑换为现金的行为。
- 31、**基金成立日**：指根据基金合同约定，基金成立的日期。
- 32、**基金终止日**：指根据基金合同约定，基金终止的日期。
- 33、**不可抗力**：指本合同当事人不能预见、不能避免并不能克服的客观情况。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）基金管理人声明与承诺

1、基金管理人保证在募集资金前已在基金业协会登记为基金管理人（基金管理人登记编码：**【P1006100】**）。

2、基金管理人声明，基金业协会为基金管理人和本基金办理登记备案不构成对基金管理人投资能力的认可，亦不构成对管理人和本基金持续合规情况的认可，不作为对基金财产安全的保证。投资者应当自行识别本基金投资风险并承担投资行为可能出现的损失。

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基金财产，但不保证基金财产一定盈利，也不保证投资者的投资本金不受损失或者取得最低收益或者限定损失金额和比例。

4、基金管理人保证已在签署本合同前充分地向基金投资者说明了有关法律法规和相关投资工具的运作及方式，同时揭示了相关风险；已经了解基金投资者的风险偏好、风险认知能力和承受能力，对基金投资者的财务状况进行了充分评估。

5、基金管理人承诺，基金管理人实际承担投资管理职责并将采取有效措施控制风险，不开展包括但不限于欺诈、内幕交易、操纵市场、以金融机构托管为增信手段误导性宣传推介、违反账户实名制规定、刚性兑付、开展或参与资金池业务、利用基金财产自融、侵占或挪用基金财产、利益输送等法律、行政法规和中国证监会禁止的其他行为。

6、基金管理人保证已核实投资者签署基金合同等法律文件的真实性准确性完整性、推介私募基金，发售基金份额（权益），办理基金份额（权益）认/申购（认缴）、赎回（退出）等基金募集行为符合《募集行为办法》等有关法律法规、规范性文件的规定。如因投资者签署基金合同等法律文件不真实不准确不完整、募集行为不合法合规导致的任何责任，由基金管理人自行承担。

### （二）基金托管人声明与承诺

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

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

### （三）基金投资者的声明与承诺

1、基金投资者承诺其为符合《私募办法》等监管规定要求的合格投资者，保证财产的来源及用途符合国家有关规定，保证已充分理解本合同条款，了解相关权利义务，了解有关法律法规及所投资基金的风险收益特征，愿意承担相应的投资风险，且购买本基金符合其业务决策程序的要求。

2、基金投资者承诺其向基金管理人（或管理人委托的销售机构）提供的有关投资目的、投资偏好、投资限制、财产收入情况和风险承受能力等基本情况真实、完整、准确、合法，不存在任何重大遗漏或误导。前述信息资料如发生任何实质性变更，应当及时告知基金管理人或销售机构。

3、基金投资者知悉并认可，基金管理人、基金托管人及相关机构未对基金财产的收益状况做出任何承诺或担保。

4、基金投资者知悉并认可，基金业协会为本基金办理备案不构成对基金管理人投资能力的认可，亦不构成对管理人和私募投资基金合规情况的认可，不作为对私募投资基金财产安全的保证。基金投资者承诺自行识别私募投资基金投资风险并承担投资行为可能出现的损失。

5、基金投资者知悉并认可，基金管理人按照基金合同约定可能进行关联交易及利益冲突的情形。基金投资者不得因本基金投资收益劣于基金管理人及其关联方管理的其他类似投资产品，而向基金管理人或基金托管人提出任何损失或损害赔偿的要求。

## 四、基金的基本情况

### （一）基金的名称

【益安船长计划私募证券投资基金】。

### （二）基金的运作方式

【定期开放式】。

### （三）基金的投资目标

同本基金合同第十二章“基金的投资”约定的投资目标。

### （四）基金的投资范围

同本基金合同第十二章“基金的投资”约定的投资范围。

### （五）基金的存续期限

【15年】，基金管理人有权根据基金运作情况提前终止本基金。

### （六）基金的封闭期与开放日

同本基金合同第八章“基金的申购、赎回和转让”约定的开放日。

### （七）基金份额的初始面值

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

### （八）基金的托管事项

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

### （九）基金的外包事项

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

## 五、基金的分级分类安排

本基金不设置分级分类安排。本基金的基金份额设定为均等份额，每份基金份额具有同等的合法权益。

## 六、基金的募集

### （一）基金的募集期限、募集机构、募集方式和募集对象

#### 1、募集期限

本基金募集期限由基金管理人根据相关法律法规以及本合同的约定确定。基金管理人有权根据基金募集情况自主决定延长或缩短募集期，此类变更适用于管理人委托的销售机构。基金管理人延长或缩短募集期的，应当及时发布通知，即视为履行了信息披露义务。

#### 2、募集机构

本基金由募集机构负责募集销售。本基金的募集机构为基金管理人（直销渠道）和/或基金管理人委托的销售机构（代销渠道）。基金管理人可以根据需要自主决定委托、变更基金销售机构。销售机构应当取得基金销售业务资格或代销金融产品业务资格并已成为中国证券投资基金业协会会员。

募集机构的募集方式、募集对象和募集行为应当持续符合《募集行为办法》《证券期货投资者适当性管理办法》和《基金募集机构投资者适当性管理实施指引（试行）》等有关规定。募集机构应当恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉，防范利益冲突，履行说明义务、反洗钱义务等相关义务，承担特定对象确定、投资者适当性审查、私募基金推介及合格投资者确认等相关责任。

#### 3、募集方式

本基金由募集机构及其从业人员以非公开方式向投资者募集资金。

#### 4、募集对象

本基金仅由募集机构向符合《私募办法》规定的合格投资者发售，合格投资者包括普通合格投资者和特殊合格投资者。

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

特殊合格投资者包括：（1）社会保障基金、企业年金等养老基金，慈善基金等社会公益基金；（2）依法设立并在中国基金业协会备案的投资计划；（3）投资于所管理私募基金的私募基金管理人及其从业人员；（4）国务院金融监督管理部门监管的机构依法发行的资产管理产品、合格境外机构投资者、人民币合格境外机构投资者；（5）中国证监会规定的其他投资者。

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

### （二）基金的认购事项

#### 1、认购价格

本基金份额按初始面值发售，认购价格为 1.00 元/份。



## 2、认购费用

**认购费=认购金额×认购费率**

其中，认购费率为【0%】，认购费用不计入基金财产，归【基金管理人（或销售机构）】所有，基金管理人或销售机构有权酌情减免。认购费用不包含在认购金额内，投资者须在认购本基金时一并缴纳认购款项（含认购费用和认购金额）。

## 3、认购份额的计算方式

**认购份额=认购金额÷面值；**

其中，认购金额不包括额外缴纳的认购费用（如有），面值为 1.00 元/份。

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

## 4、认购金额及付款期限

本基金认购采用金额认购、全额交款方式，基金投资者在提交认购申请时必须备足认购款项。投资者在募集期间缴纳的认购金额不得低于 100 万元人民币（本合同约定的“特殊合格投资者”不受此限制），投资者可多次认购，每次追加认购金额应不低于 1 万元人民币。基金管理人可根据市场情况，在法律法规允许的情况下，合理调整对认购金额和追加认购金额的限制，基金管理人进行前述调整时必须提前告知基金投资者。

基金投资者应按照募集机构指定的日期及方式支付认购款项。投资者付款时的备注仅作参考，不影响投资者缴付款项的有效性。

## 5、认购申请的受理与确认

本基金募集期间，募集机构应于证券交易所的正常交易日的交易时间内受理投资者的认购申请。募集机构可以根据本机构的规则及程序确定具体的业务办理时间。投资者认购本基金，应当同时提供本人或者其授权人的身份证明文件、授权文件、认购申请表格和认购资金汇款证明，接受募集机构的合格投资者身份调查，并签署《风险揭示书》和基金合同等材料，具体材料以募集机构的要求为准。募集机构在符合本基金合同约定的前提下，可就认购办理手续、办理时间、办理规则等另行做出规定。

认购申请受理完成后，不得撤销。募集机构受理投资者的认购申请，不表示对该申请有效性的确认，而仅代表募集机构确实收到了认购申请。认购的有效性以基金管理人的确认结果为准。

本基金的投资者人数规模上限为 200 人。基金管理人在募集期间每个工作日可受理的人数限制内，按照“时间优先、金额优先”的原则对冷静期内未解除基金合同（如不适用回访）或冷静期后回访成功（如适用回访）的认购申请的有效性进行确认。通过管理人委托的销售机构进行认购的，人数规模控制以基金管理人和销售机构约定的方式为准。超出基金人数规模上限的认购申请以及冷静期内未解除基金合同（如不适用回访）或冷静期后回访失败（如适用回访）的认购申请为无效申请，募集机构应当按合同约定及时退还投资者的全部认购款项。

### （三）投资冷静期及回访确认

#### 1、投资冷静期

（1）本基金为基金投资者设置不少于【二十四小时】的投资冷静期，募集机构在投资

冷静期内不得主动联系投资者；

- (2) 投资冷静期自基金合同签署完毕且投资者交纳完毕认购款项后起算；
- (3) 投资者有权在投资冷静期内解除基金合同。

**2、基金投资者属于以下情形之一的，不适用投资冷静期的约定：**

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

**3、本基金不设置回访程序。**

**(四) 募集期间募集资金的管理**

1、基金管理人应将基金募集期间投资者的认购款项存入募集结算资金归集专用账户，在基金募集期结束前，任何机构和个人不得动用。基金成立前，认购款项在募集结算资金归集专用账户产生的利息计入基金财产，利息金额按中国人民银行同期活期存款利率计息，利息金额以份额注册登记机构记录为准。基金托管人不承担监督职责。

**2、认购款项收款账户**

(1) 基金投资者通过直销渠道认购基金的，应将认购款项划入【直销渠道】募集结算资金归集专用账户（账户信息载于《投资者告知书》）。

（【直销渠道】募集结算资金归集专用账户是运营服务机构接受基金管理人委托代为提供基金服务的专用账户，并不代表运营服务机构受理投资者的认购或申购资金，也不表明运营服务机构对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。在【直销渠道】募集结算资金归集专用账户的使用过程中，除非有足够的证据证明是因运营服务机构的原因造成的损失外，基金管理人应就其自身操作不当等原因所造成的损失承担相关责任，运营服务机构对于基金管理人的投资运作不承担任何责任。

基金投资者将认购资金划入本基金【直销渠道】募集结算资金归集专用账户的汇出账户为投资者收益账户，基金管理人只能将【直销渠道】募集结算资金归集专用账户中的资金定向划拨至该基金对应的托管资金账户（认购、申购时）、投资者收益账户（分红、赎回、清算时）及募集机构的账户（划拨认购费、申购费、赎回费等在本基金合同中列明的费用时）。

(2) 基金投资者通过基金管理人委托的销售机构认购基金的，应将款项划入代理销售机构指定的募集专用账户，或由代理销售机构根据投资者的购买指令从投资者账户中进行扣划，以销售机构的实际业务办理流程为准。

**3、账户监督机构**

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

(2) 基金管理人委托的运营服务机构不对代销渠道的募集账户承担监管义务。本基金通过管理人委托的销售机构销售的，【代销渠道】募集结算资金的监督机构为销售机构委托的其他监督机构，具体监督事项以销售机构与其委托的其他监督机构签署的监督协议为

准。

## 七、基金的成立与备案

### （一）基金合同的签署方式

本基金合同可采取纸质合同签署或符合《电子签名法》等法律法规、监管规定有关要求的电子签名方式签署，电子签名与签署纸质合同具有同等法律效力。

### （二）基金成立的条件

本基金募集期结束后，满足下列全部条件的，基金即告成立。

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

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

**募集资金到达托管账户之日即为基金成立日。**

### （三）基金的备案

本基金满足基金成立条件的，基金管理人应当在本基金募集完毕后 20 个工作日内，按照基金业协会要求，办理本基金备案手续，并确保向基金业协会提供的备案材料和信息的真实、准确、完整。

**若本基金备案失败，基金合同提前终止并按照本合同约定的基金清算程序进行清算。**

### （四）基金备案前临时投资

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

### （五）募集失败的处理方式

募集期限届满，本基金未能成立的，基金管理人应当：

1、以其自有财产承担因募集行为而产生的债务和费用；

2、在募集期满日起 30 个工作日内返还基金投资者已缴纳的所有认购款项，并加计银行同期活期存款利息。

本基金已开立基金托管账户的，如托管账户未接收募集账户划款的，基金托管人有权自行办理基金托管账户的注销；如托管账户已接收募集账户划款的，基金管理人应当按基金托管人要求向其提交销户申请，配合托管人办理基金托管账户的注销。

**（六）自基金成立日起，基金托管人根据合同约定履行托管人职责。基金募集事项与基金托管人及基金运营服务机构无关，如因本基金募集机构违规违约等原因（包括但不限于募集机构未履行通知程序、未遵守投资冷静期及/或回访程序等），导致有权机关认定本基金募集资金划转行为存在全部或部分无效、基金未有效成立、基金未及时成立或基金实际不满足成立条件等情形引发纠纷或致使投资者遭受损失的，由基金管理人承担全部责任，基金托管人及运营服务机构不承担任何责任。**

## 八、基金的申购、赎回与转让

### （一）申购和赎回的募集机构、募集方式和募集对象

同本基金合同第六章“基金的募集”第（一）约定的募集机构、募集方式和募集对象。

### （二）申购和赎回的开放日及时间

#### 1、本基金的封闭期

无。

#### 2、本基金的开放日

基金管理人在本基金开放日办理申购、赎回基金份额确认事宜，但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或本合同的约定通知暂停申购、赎回确认的除外。基金投资者拟在当期开放日（T日）申购或赎回基金份额的，应在当期开放日截止时间内提出申购或赎回申请。业务申请受理时间以募集机构具体通知为准。

##### （1）固定开放日

本基金固定开放日为自基金成立后每周周一、周三和周五，如遇节假日则顺延至下一工作日。

##### （2）临时开放日

出现以下情形之一时，管理人可设置临时开放日：

- 1）管理人根据本合同第二十一章第（三）条1款约定，被动变更本合同的；
- 2）管理人根据本合同第二十一章第（三）条2款或第3款约定，主动变更本合同的；
- 3）管理人根据本合同第十七章第（二）条4款约定，在收益分配时计提业绩报酬的；
- 4）在对全体基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，管理人根据基金投资者申请或本基金的实际运作情况，自主设置临时开放日的。

基金管理人在临时开放日仅办理基金份额赎回业务，不办理基金份额申购业务。根据上述第1）至3）项情形办理赎回的基金份额，不受本合同关于份额锁定期（若有）、封闭期（若有）和巨额赎回（若有）的限制。

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

### （三）申购和赎回的预约

本基金不设置申购申请和赎回申请的预约机制。

### （四）申购和赎回的方式、价格、程序及确认

#### 1、申购和赎回的原则、方式、价格及程序

（1）基金申购采用金额申请的方式，基金赎回采用份额申请的方式。基金投资者申购基金时，按照申购申请对应的当期开放日的基金份额净值为基准计算基金份额。基金份额持有人赎回基金时，按照赎回申请对应的当期开放日的基金份额净值计算赎回金额。

（2）“未知价”原则，即基金的申购价格、赎回价格以当期开放日当日的基金份额净值为基准进行计算。

（3）基金份额持有人赎回基金时，基金管理人按先进先出的原则，按基金投资者认购、申购和红利再投资所得基金份额（如有）的先后次序进行顺序赎回。具体以募集机构记录的

赎回申请数据为准。

(4) 基金投资者在提交申购申请时须按照募集机构规定的方式全额支付申购款项，在提交赎回申请时须持有足够的基金份额余额，否则所提交的申购、赎回申请无效而不予确认。

(5) 申购申请和赎回申请受理完成后，不得撤销。募集机构受理投资者的申购申请、赎回申请，不表示对该申请有效性的确认，而仅代表募集机构确实收到了申请。

(6) **申购申请、赎回申请的有效性以基金管理人的确认结果为准。**除本合同另有约定外，基金管理人一般应当在 T+2 日内对 T 日受理的申购申请、赎回申请的有效性进行确认；在有效性确认前，管理人可在征得该申购、赎回投资者同意的情况下适当调整其申购、赎回申请，但不得违反法律法规及本合同约定。

## 2、申购申请的确认及款项支付

投资者申购本基金的，募集机构应当按照本合同第六章第（三）条“投资冷静期及回访确认”约定执行投资冷静期及回访确认（如有）程序，但基金投资者在提交申购申请时已持有本基金份额的除外。投资者申购本基金的，应当同时提供本人或者其授权人的身份证明文件、授权文件、申购申请表格和申购资金汇款证明，接受募集机构的合格投资者身份调查，并签署《风险揭示书》和基金合同等材料，具体材料以募集机构的要求为准，但基金投资者在提交申购申请时已持有本基金份额的除外。

申购采用全额交款方式，以人民币账户转账形式交付。基金投资者在提交申购申请时必须备足申购款项。若资金在规定时间内未全额到账则视为无效申请，基金管理人不予确认。投资者付款时的备注仅作为参考，不影响投资者缴付款项的有效性。

基金投资者通过直销渠道申购基金的，投资者应在本次可申购开放日规定时间前将申购款项从在中国境内开立的自有银行账户划入【**直销渠道**】**募集结算资金归集专用账户（账户信息见投资者告知书）**。基金投资者通过代销渠道申购基金的，出资方式 and 申购期限以销售机构发布的通知为准。

**本基金的基金份额持有人规模上限为 200 人。**基金管理人应当在当期开放日可受理的人数限制内，按照“时间优先、金额优先”的原则，按照本合同约定对申购申请的有效性进行确认。超出基金投资者人数规模上限的申购申请为无效申请。

若出现无效申购申请、本合同约定的拒绝或暂停申购情形、或者首次购买本基金的投资者按照本合同第六章第（三）条“投资冷静期及回访确认”的约定解除合同任一情形的，募集机构应当及时将基金投资者已缴付的全部申购款项退回基金投资者指定的资金账户，不计利息。

## 3、赎回申请的确认及款项支付

基金管理人确认赎回申请有效后，基金管理人应按本合同约定及时向基金份额持有人支付赎回款项，赎回款项自确认之日起 5 个工作日内支付。发生暂定确认赎回申请、巨额赎回时，基金管理人应当按本合同约定办理赎回款项的支付。

基金存在销售机构的，管理人应当自赎回申请确认之日起 2 个工作日内将赎回款项从托管账户划转至销售机构开立的募集结算资金归集专用账户；如管理人未能在规定时间内划转相关款项，管理人应当向运营服务机构、销售机构以及投资者做好解释和协调工作，并承担相关的交收责任，托管人对此不承担责任。

基金管理人应当及时合理安排基金资产的变现，并及时向投资者分配赎回款项。如因基金管理人未及时变现基金财产、未及时分配基金赎回款项、将赎回款项新增投资等导致募集账户未收到赎回款项或者无法及时分配赎回款项的，由基金管理人承担全部违约责任。基金托管人和运营服务机构对此不承担监督或复核义务。

4、基金管理人在遵守法律法规、本合同约定且不损害基金份额持有人权益的情况下，可以另行规定办理手续、办理时间、处理规则等，但应及时告知基金份额持有人。基金管理人通过约定方式通知基金投资者前述调整事项，即视为履行了告知义务。基金托管人和运营服务机构对此不承担监督或复核义务。

#### （五）申购和赎回的金额限制

##### 1、申购的金额限制

投资者首次申购缴纳的申购金额不得低于 100 万元人民币（本合同约定的“特殊合格投资者”不受此限制），但基金投资者在提交申购申请时已持有本基金份额的除外。投资者在同一开放日可多次申购，每次追加申购金额应不低于 1 万元人民币。投资者付款时的备注仅作参考，不影响投资者缴付款项的有效性。

##### 2、赎回的份额限制

基金份额持有人持有的基金资产净值高于 100 万元时，可以选择部分赎回基金份额，但赎回后持有的基金资产净值不得低于 100 万元。如投资者赎回部分基金份额后可能导致其在赎回后持有的基金资产净值不足 100 万元的，投资者应当调减赎回基金份额或者选择一次性赎回全部基金份额；基金份额持有人未申请调减赎回基金以确保满足合格投资者条件或者未选择一次性全部赎回持有份额的，基金管理人应当将该基金份额持有人所持份额（包括尚在锁定期的份额）做全部赎回处理（本合同约定的“特殊合格投资者”不受此限制）。

募集机构应当就“做全部赎回处理”的事项做好与基金份额持有人的沟通工作，因此引起的赎回份额纠纷，由基金管理人自行解决并承担相关责任，基金托管人和运营服务机构不承担任何责任。

3、基金管理人可根据市场情况，在法律法规允许的情况下，合理调整对申购金额、追加申购金额和赎回份额的限制，基金管理人进行前述调整时必须提前告知基金投资者。基金管理人通过约定方式通知基金投资者前述调整事项，即视为履行了告知义务。基金托管人和运营服务机构对此不承担监督或复核义务。

#### （六）申购和赎回的费用

##### 1、申购费用

本基金不收取申购费用。

##### 2、赎回费用

本基金不收取赎回费用。

#### （七）申购份额与赎回金额的计算方式

##### 1、申购份额计算

申购份额=申购金额÷申购价格

其中，申购金额不包括额外缴纳的申购费（如有），申购价格为当期开放日基金份额净值。

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

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

其中，赎回费用（如有）=【赎回份额×当期开放日的基金份额净值-管理人业绩报酬（如有）】×赎回费率

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

## 3、申购、赎回资金的利息处理方式

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

### （八）拒绝或暂停申购、暂停赎回的情形及处理

**1、出现如下情形之一的，基金管理人可以拒绝确认基金投资者的申购申请：**

- （1）基金份额持有人人数已达到 200 人；
- （2）如确认该申请，将导致本基金资产总规模超过本合同约定的上限；
- （3）根据市场情况，基金管理人无法找到合适的投资品种，或出现其他可能对基金业绩产生负面影响，从而损害现有基金份额持有人的利益的；
- （4）因基金持有的某个或某些证券进行权益分派等原因，使基金管理人认为短期内确认申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益的；
- （5）基金管理人认为确认某笔或某些申购申请可能会影响或损害其他基金份额持有人利益的；
- （6）法律法规规定或经中国证监会等有权机关认定的其他情形。

**基金管理人决定拒绝确认申购申请时，应当及时通知相关基金投资者，并将基金投资者的申购款项退回基金投资者指定的基金账户。**

**2、出现如下情形之一的，基金管理人可以暂停确认基金投资者的申购申请：**

- （1）因不可抗力导致无法确认基金投资者的申购申请的；
- （2）证券交易所交易时间临时停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值的；
- （3）发生本合同约定的暂停基金资产估值情形的；
- （4）法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

**基金管理人决定暂停确认申购申请时，应当及时通知基金投资者。在暂停确认申购的情形消除时，基金管理人应及时恢复申购申请的确认并及时通知基金投资者。**

**3、出现如下情形之一的，基金管理人可以暂停确认基金份额持有人的赎回申请：**

- （1）因不可抗力导致基金管理人无法支付赎回款项的；
- （2）证券交易所交易时间临时停市，导致基金管理人无法计算开放日基金资产净值的；
- （3）发生本合同约定的暂停基金资产估值情形的；
- （4）当基金所投资的标的因为停牌等非管理人可控原因造成无法变现的；
- （5）证券/期货经纪商未及时提供估值所需资料，导致运营服务机构、基金托管人无法

核对基金资产估值的情形；

(6) 法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

基金管理人决定暂停赎回的，基金管理人应当及时通知基金份额持有人。已确认的赎回申请，基金管理人应当足额支付；如暂时不能足额支付，基金管理人应当按单个赎回申请人已被确认的赎回金额占已确认的赎回总金额的比例将可支付金额分配给赎回申请人，其余部分在后续工作日予以支付。在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并及时通知基金份额持有人。

#### (九) 巨额赎回的认定及处理方式

##### 1、巨额赎回的认定

若本基金单个开放日内的基金份额净赎回申请(赎回申请份额总数扣除申购申请份额总数余额)超过前一交易日的基金总份额的50%时，即认为本基金发生了巨额赎回。

##### 2、巨额赎回的处理方式

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

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

(2) 部分赎回：当基金管理人认为支付基金份额持有人的全部赎回申请有困难或认为因支付基金份额持有人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，基金管理人可确认部分赎回申请，并对其余赎回申请延期或取消办理。对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额（但未能赎回部分不足100万元的，应为其办理全部赎回）；对于未能赎回部分，基金份额持有人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被确认无效。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请（如有）一并处理，无优先权并以下一开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。本基金不就延期赎回份额的相应款项计算利息。如基金份额持有人在提交赎回申请时未作明确选择，基金份额持有人未能赎回部分申请自动按照延期赎回处理。

(3) 暂停赎回：连续2个开放日及以上发生巨额赎回的，如基金管理人认为有必要，可暂停确认基金的赎回申请；已经确认的赎回申请可以延期支付赎回款项，但不得超过20个交易日。

(4) 巨额赎回的通知：当发生巨额赎回且基金管理人决定部分赎回或暂停赎回时，基金管理人应当在3个交易日内通知相关基金份额持有人，并说明有关处理方法。基金管理人通过约定方式告知基金投资者前述事项，即视为履行了通知义务。

基金托管人和运营服务机构不审核、不监督基金管理人是否通知投资者以及是否以约定方式及时、真实、准确、完整通知投资者发生巨额赎回及相关处理办法事宜。

#### (十) 基金份额的转让

在不违反法律法规规定情况下，基金份额持有人所持的基金份额可在中国证监会认可的交易场所或者通过其他方式进行转让，本合同另有约定除外。基金管理人亦可以根据相关法



法律法规规定、本合同约定，为基金份额持有人办理基金份额的转让业务。基金份额受让方应当为符合监管规定及本合同约定的合格投资者，基金份额转让方在完成转让后继续持有本基金份额的，仍应符合监管规定及本合同约定的合格投资者要求，且基金份额受让后投资者人数累计不得超过法定的基金投资者人数上限。

基金管理人将参照募集期间募集机构对基金投资者的要求，对基金份额的受让方进行尽职调查、投资者适当性管理、反洗钱工作和防范利益输送的审查。基金管理人对基金份额转让协议确认后，应向基金注册登记机构提供规定的相关资料，办理基金份额转让过户登记。法律法规、监管规定对基金份额转让另有规定的，从其规定。如果份额转让因不符合法律法规或基金注册登记机构的规则未办理成功的，基金份额持有人应当自行承担相应风险和损失。

### **(十一) 其他业务办理**

#### **1、基金份额的非交易过户**

(1) 非交易过户是指不采用申购、赎回等交易方式，将一定数量的基金份额按照一定的规则从某一基金份额持有人账户转移到另一基金份额持有人账户的行为。非交易过户包括继承、捐赠、司法强制执行以及基金份额登记机构认可、符合法律法规的其他类型。办理非交易过户必须提供基金份额登记机构要求提供的相关资料。

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

#### **2、基金份额的冻结与解冻**

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

基金注册登记账户或基金份额被冻结的，被冻结基金份额所对应的权益一并冻结，法律法规、中国证监会及其他有权机关或法院判决、裁定另有规定的除外。当基金份额处于冻结状态时，基金管理人或其他相关机构应拒绝该部分基金份额的赎回、转出、非交易过户以及基金份额的转托管申请。

#### **3、基金份额的转销售机构**

基金管理人可以根据相关法律法规规定、本合同约定，为基金份额持有人办理基金份额的转销售机构业务。基金份额持有人可以将已持有的基金份额在不同销售机构之间办理转销售机构业务，销售机构可以按照规定的标准收取转托销售机构费。如果出现基金管理人、注册登记机构、办理转销售机构因技术系统功能限制或其它合理原因，可以暂停或者拒绝基金份额持有人的转销售机构申请。

#### **4、基金份额的转换**

基金管理人可以根据相关法律法规规定、本合同约定，为基金份额持有人办理基金份额的基金转换业务。基金份额持有人可在本基金存续期间按照基金管理人的规定申请将其持有的本基金份额全部或部分转换为本基金管理人管理的、由同一基金份额登记机构办理注册登记的其它私募基金份额。基金管理人在本基金合同生效后为基金份额持有人办理基金间的转换业务，本基金份额转换为另外一只基金份额的，基金份额持有人需签署新的基金合同并遵

从另外一只基金合同的相关约定。管理人可就基金转换向投资者收取一定的转换费。基金转换的相关业务规则由注册登记机构根据相关法律法规及本基金合同的约定制定。

## 九、当事人的权利和义务

### （一）基金份额持有人

#### 1、基金份额持有人的基本信息

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

#### 2、基金份额持有人的权利

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

#### 3、基金份额持有人的义务

- （1）认真阅读基金合同，保证投资资金的来源及用途合法；
- （2）接受合格投资者认定程序，如实填写风险识别能力和承担能力问卷，如实承诺资产或者收入情况，如实提供必要的资产证明文件或收入证明，并对其真实性、准确性和完整性负责，承诺为合格投资者并签署《合格投资者承诺书》；
- （3）以合伙企业、契约等非法人形式汇集多数投资者资金直接或者间接投资于本基金的，应向基金管理人充分披露上述情况及最终投资者的信息，但符合《私募办法》第十三条规定的除外；
- （4）认真阅读并签署风险揭示书；
- （5）按照基金合同约定缴纳基金份额的认购、申购款项及规定的费用，承担基金合同约定的管理费、托管费及其他相关费用；
- （6）按照基金合同约定承担基金的投资损失；
- （7）向基金募集机构提供法律法规规定的信息资料及身份证明文件，配合募集机构的尽职调查与反洗钱工作；
- （8）保守商业秘密，不得泄露基金的投资计划或意向等；
- （9）不得违反基金合同的约定干涉基金管理人的投资行为；
- （10）不得从事任何有损基金及其他投资者、基金管理人管理的其他基金及基金托管人托管的其他基金合法权益的活动；
- （11）保证其享有签署包括本合同在内的基金相关文件的权利，并就签署行为已履行必

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

(12) 法律法规、中国证监会及基金业协会规定和基金合同约定的其他义务。

## **(二) 基金管理人**

### **1、基金管理人的基本信息**

名称：北京益安资本管理有限公司

住所：北京市朝阳区建国路 93 号院 A 座 8 层 1006 号-1

法定代表人/执行事务合伙人委派代表/负责人：刘意

联系人：谢莹

通讯地址：山东省济南市历下区龙奥西路银丰财富广场 C 座 22 层

联系电话：18663768653

### **2、基金管理人的权利**

(1) 按照基金合同约定，独立管理和运用基金财产；

(2) 按照基金合同约定，及时、足额获得基金管理人管理费用及业绩报酬（如有）；

(3) 按照有关规定和基金合同约定行使因基金财产投资所产生的权利；

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

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

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

(7) 自行销售或者委托有基金销售资格的机构销售基金，制定和调整有关基金销售的业务规则，并对销售机构的销售行为进行监督，但基金管理人依法应当承担的责任不因委托而免除；

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

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

(10) 依据本合同及有关法律法规规定决定基金收益的分配方案；

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

(12) 法律法规、中国证监会及基金业协会规定的和基金合同约定的其他权利。

### **3、基金管理人的义务**

(1) 履行基金管理人登记和私募基金备案手续；

(2) 按照诚实信用、勤勉尽责的原则履行受托人义务，管理和运用基金财产；

(3) 制作调查问卷，对投资者的风险识别能力和风险承担能力进行评估，向符合法律

法规规定的合格投资者非公开募集资金；

(4) 制作风险揭示书，向投资者充分揭示相关风险；

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

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

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

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

(9) 按照基金合同约定接受投资者和基金托管人的监督；

(10) 对本基金场外投资形成的基金财产、非标准化资产（包括但不限于私募金融产品等）和处于托管人实际控制之外的基金资产履行保管职责；

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

(12) 按照基金合同约定负责基金会计核算并编制基金财务会计报告；

(13) 按照基金合同约定计算并向投资者报告基金份额净值；

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

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

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

(17) 保存基金投资业务活动的全部会计资料，并妥善保存有关的合同、交易记录及其他相关资料，保存期限自基金清算终止之日起不得少于 20 年，法律法规另有规定的，从其规定；

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

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

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

(21) 建立并保存投资者名册；

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

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

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

(25) 本合同采用电子签名方式签署的，基金管理人应确保签约系统得到托管人认可，并确保基金投资者签署本合同所使用的签约系统、电子签名符合《电子签名法》等法律法规、监管规定的相关要求。

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

(26) 确保本基金的募集行为、投资运作行为符合相关法律法规规定；

(27) 因违反本合同导致基金财产的损失或损害基金份额持有人的合法权益时，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其不再担任本基金管理人而免除；

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

(29) 基金管理人应确保本基金宣传资料真实、准确、完整，不得进行虚假宣传。基金管理人制作的宣传材料涉及基金托管人的，仅可表述为“中信建投证券为本产品的基金托管人”，不得有其他有关托管人的表述，不得以基金托管人名义进行任何其他宣传，基金托管人有权对基金管理人及本基金宣传材料进行检查，基金管理人违反上述约定的，基金托管人有权向基金管理人追责；

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

(31) 基金管理人委托销售机构募集私募基金的，应当以书面形式签订基金销售协议，并将协议中关于基金管理人与基金销售机构权利义务划分以及其他涉及投资者利益的部分作为本基金合同的附件；

(32) 法律法规、中国证监会及基金业协会规定的和基金合同约定的其他义务。

### **(三) 基金托管人**

#### **1、基金托管人概况**

名称：中信建投证券股份有限公司

住所：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

法定代表人：王常青

联系人：高涵

联系电话：010-56161929

通讯地址：北京东城区朝内大街 2 号凯恒中心 B 座 10 层

#### **2、基金托管人的权利**

(1) 按照合同的约定，及时、足额获得基金托管费用；

(2) 依据法律法规规定和合同约定，监督基金管理人对基金财产的投资运作，对于基金管理人违反法律法规规定和合同约定、对基金财产及其他当事人利益造成重大损失的情形，有权报告基金业协会并采取必要措施；

(3) 按照基金合同约定，依法保管基金财产；

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

(5) 因基金管理人的违规失信行为给基金财产或者基金份额持有人造成损害的，托管人有权督促基金管理人及时予以赔偿；

(6) 国家有关法律法规、监管机构及本合同约定的其他权利。

### **3、基金托管人的义务**

(1) 按照基金合同约定，依法安全保管基金财产；

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

(3) 对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整与独立；

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

(5) 按规定开立和注销基金财产的托管资金账户、证券账户、期货账户等投资所需账户（基金管理人和基金托管人对此另有约定的，从其约定）；

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

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

(8) 对基金管理人编制的基金定期报告中的财务数据进行复核，但因基金管理人未及时、全面提供相关基金定期报告导致托管人无法履行前述复核净值职责的除外；

(9) 按照基金合同约定，根据基金管理人或其授权人的划款指令，及时办理清算、交割事宜；

(10) 根据法律法规规定，妥善保存基金托管业务活动有关合同、协议、凭证等文件资料，但因基金管理人未能按照法律规定及本合同约定及时向基金托管人提供上述文件资料或者因上述文件不真实、不准确和不完整导致的法律责任，由基金管理人自行承担；

(11) 公平对待所托管的不同基金财产，不得从事任何有损基金财产及本合同其他当事人合法权益的活动；

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

(13) 根据相关法律法规要求的保存期限，保存基金投资业务活动的全部会计资料，并妥善保存有关的合同、交易记录及其他相关资料；

(14) 在管理人发生异常且无法履行管理职责时，托管人应当按照法律法规及基金合同约定履行托管职责，维护投资者合法权益；

(15) 监督基金管理人的投资运作，发现基金管理人的投资指令违反法律法规、自律规则或基金合同约定的，应当拒绝执行，立即通知基金管理人，并有权报告证监会（或其派出机构）或基金业协会；发现依据交易程序已经生效的基金管理人投资指令违反法律法规或基金合同约定的，应当立即通知基金管理人，并有权报告证监会（或其派出机构）或基金业协会；

(16) 按照基金合同约定制作相关账册并与基金管理人核对。

## 十、基金份额持有人大会及日常机构

### （一）基金份额持有人大会组成

#### 本基金份额持有人大会不设置日常机构。

基金份额持有人的授权代表有权代表基金份额持有人出席本基金份额持有人大会并表决。基金份额持有人持有的每一基金份额（不区分优先、普通、进取、劣后份额）享有同等的投票权。

### （二）基金份额持有人大会的召开事由

1、除本合同另有约定外，当本基金出现下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会：

（1）决定修改基金合同的重要内容，涉及对基金份额持有人权利和义务产生重大不利影响的事项；

（2）决定更换基金管理人、基金托管人或投资顾问（如有）；

（3）提高基金管理人、基金托管人和投资顾问（如有）的报酬标准；

（4）出现基金管理人客观上丧失继续管理本基金的能力和资格的情形；

（5）法律法规和基金合同约定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。

针对前款所列事项，如全体基金份额持有人以书面形式一致表示同意的，可以不召开基金份额持有人大会而直接作出书面决议，并由全体基金份额持有人在决议文件上签名、盖章。

### （三）基金份额持有人大会的运作事项

#### 1、会议召集人和召集方式

（1）除法律法规规定或基金合同另有约定外，基金份额持有人大会由基金管理人召集。

（2）单独或合计持有 10%以上（含 10%）基金份额的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人会议的，应当向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；基金管理人决定不召集（包括管理人客观上丧失继续管理私募投资基金能力的情形），代表基金份额 10%以上（含 10%）的基金份额持有人有权自行召集。基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人会议的，应于会议召开前 10 个工作日通知基金管理人，基金管理人有权出席基金份额持有人会议，基金份额持有人应当予以配合，不得阻碍基金管理人出席基金份额持有人会议。

（3）基金份额持有人会议的召集人负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

（4）基金托管人对基金管理人和基金份额持有人召集基金份额持有人大会事宜，依法予以配合。

#### 2、会议的召开通知

（1）召开基金份额持有人大会，召集人应于会议召开前 10 日通知本合同各方当事人基金份额持有人大会的召开时间、召开方式、会议形式、审议事项、议事程序和表决方式等事项。

（2）采取通讯开会方式并进行表决的情况下，由会议召集人决定在会议通知中说明本

次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、联系方式、联系人以及书面表决意见寄交的截止时间和收取方式。

### 3、召开会议的方式和条件

基金份额持有人大会可通过以下一种或多种方式召开：现场开会方式、通讯开会方式（视频会议、电话会议等）或法律法规或监管机构允许的其他方式召开，并可以采用现场及/或通讯，以及法律法规或监管机构允许的其他方式就审议事项进行表决。会议的召开方式由会议召集人确定。

每一基金份额具有一票表决权，基金份额持有人可以委托代理人出席基金份额持有人大会并行使表决权。基金份额持有人大会应当有代表三分之二（含）以上基金份额的持有人参加，方可有效召开。参加基金份额持有人大会的持有人的基金份额低于前款规定比例的，召集人可以在原通知的基金份额持有人大会召开时间后，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会，仍应当有代表三分之二（含）以上基金份额的持有人参加，方可有效召开。

### 4、审议事项表决

（1）基金份额持有人大会就召开事由第（1）、（3）、（5）项作出决议的，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）以上通过；

（2）基金份额持有人大会就召开事由第（2）项作出决议的，应当经出席会议的全体基金份额持有人全票通过；

（3）基金份额持有人大会就召开事由第（4）项作出决议的，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）以上通过。

### 5、决议的效力和披露

基金管理人召集的基金份额持有人会议决议，自决议通过之日起生效，并自生效之日起对全体基金份额持有人、基金管理人、基金托管人产生约束力。

基金份额持有人召集的基金份额持有人大会决议，自决议通过之日起对全体基金份额持有人产生约束力；该等决议内容自通知至基金管理人和基金托管人之日起，对基金管理人和基金托管人产生约束力。基金管理人或基金托管人拒不执行生效的基金份额持有人大会决议的，可由基金份额持有人代表代为执行。

6、基金份额持有人大会不得直接参与或者干涉基金的投资管理活动，但基金管理人出现客观上丧失继续管理本基金的能力或资格，为保障基金财产安全、维持基金运营、清算，基金份额持有人大会以有效决议方式进行应急处理和纠纷解决的情形除外。

### 7、特别约定

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

（2）基金管理人以其管理的其他基金投资本基金的，基金管理人应确保已就对其他基金份额持有人具有实质性不利影响的重大事项充分征得其他基金份额持有人同意，但基金



管理人未征得其他基金份额持有人同意的，不影响基金管理人代表该等其他基金以份额持有人身份对决议事项进行投票表决的效力。

## 十一、基金份额的登记

### （一）基金的注册登记业务

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

### （二）基金注册登记办理机构

本基金的注册登记业务由基金管理人或其委托的运营服务机构办理。

【中信建投证券股份有限公司】（外包业务登记编码：A00016）作为基金管理人委托的运营服务机构，依据与基金管理人签署的运营服务协议（以实际签署的协议名称为准），在受托范围内办理基金注册登记业务。

### （三）其他事项

1、基金管理人委托运营服务机构办理基金份额注册登记业务的，管理人依法应承担的责任不因其委托运营服务机构而免除。因运营服务机构违法违规、违反服务协议、技术故障、操作错误等原因给基金财产造成的损失，由基金管理人先行承担赔偿责任。基金管理人再按照相关服务协议约定与服务机构进行责任分配与损失追偿。

2、全体基金份额持有人一致同意，基金管理人及/或其委托的运营服务机构或其他份额登记义务人按照基金业协会的规定办理基金份额登记数据的备份。

## 十二、基金的投资

### （一）投资经理

本基金的投资经理由基金管理人指定。

投资经理及简介：王晓婷，益安资本基金经理，拥有8年以上证券、期货、基金交易经历，对趋势性交易机会有敏锐的判断和把握能力，擅长基本面分析，熟练运用各种分析模型，在绝对收益和相对收益领域有丰富的投资经验。

管理人保证其指定的投资经理上述简介内容的合法性、真实性、准确性，同时保证其指定的投资经理已取得基金从业资格并在基金业协会完成注册，并且不存在任何任职禁止或任职冲突的情况。基金管理人可根据业务需要变更投资经理，但应当在变更后三个工作日通知基金份额持有人及基金托管人。

### （二）投资目标

在严格控制投资风险的前提下，力争为基金投资者创造稳健的收益和回报。

### （三）投资范围

国内依法发行上市的股票、国债、可转债、可交换债、货币市场工具（货币市场基金、现金管理类资产管理计划等）、正回购和逆回购、融资融券、转融通。

#### **（四）投资策略**

##### **1、权益类资产投资策略**

本基金根据中国经济社会的结构性变化和趋势性规律，采取自上而下方式投资国内依法发行上市的股票等。

##### **2、其他策略**

本基金将根据市场变化和管理人的判断，投资本基金投资范围内约定的投资品种、投资工具等，力争实现基金资产的稳步增值。

#### **（五）投资限制**

本基金财产的投资组合应遵循以下限制：

- 1、按市值计算，本基金投资单一货币市场基金的市值占基金总资产的比例不超过 100%。
- 2、本基金总资产占净资产的比例不得超过 200%。
- 3、不得投资于法律法规、中国证监会规定的禁止或限制的投资事项。

**基金托管人除依据上述投资限制中第 1 条的约定承担监督职责外，上述投资限制中其他全部投资限制条款均由基金管理人自行控制，基金托管人不承担监督职责。同时对于本基金投资私募金融产品时，如需要穿透进行监督的，穿透监督职责由基金管理人承担，基金托管人不承担穿透监督职责。**

**特别约定：上述投资限制中如涉及新股新债申购的申报金额与数量、盘中监控、交易策略类等监控事项的，由基金管理人自行监控，基金托管人不承担投资监督职责。**

非因基金管理人原因导致的投资比例不符合法律法规规定及本基金合同约定的投资限制，为被动超标，因被动超标而对基金财产造成的损失由基金财产承担。发生被动超标时，基金管理人应在发生不符合法律法规或投资政策之日起的 10 个交易日内调整完毕，如因标的的证券暂停交易或其他非基金管理人可以控制的原因导致基金管理人不能履行调整义务的，则不受上述调整期限之限制，但基金管理人应当自相关标的的证券恢复交易之日起的 10 个交易日内使本基金的投资比例符合本基金合同约定的投资比例。法律法规另有规定的从其规定。

#### **（六）投资禁止行为**

基金管理人禁止通过本基金财产从事下列行为：

- 1、承销证券；
- 2、违反规定向他人贷款或提供担保；
- 3、从事承担无限责任的投资；
- 4、从事内幕交易、操纵证券价格及其他不正当的证券交易活动；
- 5、向基金管理人、基金托管人出资；
- 6、利用基金资产为基金份额持有人之外的任何第三方谋取不正当利益或者进行利益输送；
- 7、法律法规、中国证监会以及本合同约定禁止从事的其他行为。

#### **（七）关联交易及利益冲突的情形及处理方式**

##### **1、本基金可能存在关联交易和利益冲突的情形**

本基金关联交易，是指基金管理人运用基金财产与基金管理人、基金托管人、基金投资者、基金管理人管理的私募投资基金、基金管理人的实际控制人控制的其他私募基金管理人

管理的私募投资基金，及与上述主体有其他重大利害关系的关联方发生的交易行为等。

## 2、关联交易和利益冲突的处理方式

基金管理人可运用基金财产开展关联交易，但需要遵循基金份额持有人利益优先的原则和平等自愿、等价有偿的原则，防范利益冲突，在符合法律法规和监管政策的前提下，建立健全内部审批机制、评估机制及回避机制等关联交易风险控制机制。

基金管理人不得隐瞒关联关系或者将关联交易非关联化，不得以本基金的财产与关联方进行利益输送、内幕交易和操纵市场等违法违规活动。

## 3、决策机制及信息披露安排

基金管理人运用基金财产进行关联交易的，基金管理人应建立针对关联交易的特殊决策机制，并建立不得利用关联交易进行利益输送、内幕交易和操纵市场等违法违规活动的关联交易回避机制。

4、本基金开展重大关联交易的，基金管理人负责关联交易的报告和向投资者进行事前、事中披露，以及针对关联交易建立并执行特殊决策机制和回避安排等。

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

## （八）基金托管人投资监督事项的界定

### 1、投资监督期间

基金托管人履行投资监督职责期间，为自本基金成立之日起至本基金存续期满之日。

### 2、投资监督范围

基金托管人仅根据本合同第十二章“私募基金的投资”中对投资范围、投资限制的有关约定进行事后监督，其中本合同中明确约定由基金管理人负责监督或控制的事项，托管人不承担监督职责。

除本合同明确约定由基金托管人负责监督的事项外，基金托管人对于其他事项不予监督。基金管理人如违反相关投资目标、投资策略、投资禁止行为、风险控制、增信措施（如有）、关联交易、投资限制、预警止损控制（如有）及嵌套层级等要求的，相关责任和损失均由基金管理人承担，基金托管人不承担相关责任和损失。对于托管人不承担监督职责的事项，该类投资行为将严重依赖于基金管理人的自律管理，请投资者详细阅读本合同，知悉理解托管人的监督范围及可能带来的风险。

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

4、基金管理人对本基金募集、投资运作及清算等环节中提供给基金托管人的一切合同、文件等资料的真实性、有效性、合法性、准确性和完整性负责。基金托管人对以上资料仅以形式审查为限，审查上述资料的形式合法性和表面真实性，对其真实性、有效性、合法性、准确性和完整性不作实质性审查。

### 5、如本基金所持有的投资标的拟在全国中小企业股份转让系统挂牌或在证券交易所

上市时，基金管理人应当在投资标的正式挂牌或上市前书面通知基金托管人，并负责股票确权过户等工作。若基金管理人未（或未及时）通知基金托管人或未将股票登记在本基金名下，由此产生的基金财产损失和后果全部由基金管理人承担，基金托管人不承担任何责任。

#### （九）风险收益特征

本基金风险等级和投资者承受能力由募集机构负责评估。经募集机构评定，本基金属于【R3】级基金产品，适合专业投资者及风险承受能力为【C3、C4、C5】型的普通合格投资者。

#### （十）预警止损机制

本基金不设置预警止损机制。

#### （十一）业绩比较基准

本基金无业绩比较基准。

#### （十二）参与融资融券及其他场外证券业务的情况（如有）

根据本合同约定的投资范围，本基金如可参与融资融券及其他场外证券业务，在放大投资收益的同时也放大了投资风险，同时还须支付相应的利息和费用，由此承担的风险可能远远超过普通证券交易。

## 十三、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、基金托管人仅负责保管本基金托管账户内的现金资产。对于本基金场外投资形成的基金财产、非标准化资产（包括但不限于私募金融产品等）和处于托管人实际控制之外的基金资产，由基金管理人负责履行保管职责，基金托管人不承担保管责任。对于由基金管理人负责保管的基金财产，因保管不善、挪用财产等违反法律法规、本合同约定的情形导致本基金财产损失的，均由基金管理人承担。

3、除本款第4项规定的情形外，基金管理人、基金托管人因基金财产的管理、运用或者其他情形而取得的财产和收益，归基金财产。

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

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

6、基金财产产生的债权，不得与基金管理人、基金托管人固有财产的债务相互抵销，不得与不属于私募基金财产本身的债务相互抵销。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。

## **（二）非现金类财产的保管**

### **1、证券类资产及证券交易资金的保管**

本基金投资形成的证券类资产，由相关法定登记或托管机构根据法律法规的规定实行第三方保管，基金托管人不承担财产保管职责；证券交易结算资金由相关证券经纪商和存管银行保管。对于基金管理人擅自变更证券经纪商或存管银行，未及时足额向托管账户转回证券交易结算资金，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等原因造成的基金财产损失，相关责任均由基金管理人承担。

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

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

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

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

## **（三）基金财产相关账户的开立和管理**

### **1、账户开立和管理的基本原则**

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

### **2、基金托管账户的开立和管理**

基金托管人在具有基金托管资格的商业银行为本基金开立托管账户，账户名称以实际开立为准，并根据中国人民银行规定计息。托管账户的银行预留印鉴为“基金托管人财务专用章”加基金托管人授权代表人名章，预留印鉴由基金托管人保管和使用。本基金的一切货币收支活动，包括但不限于投资、支付赎回金额、支付基金收益、支付相关费用，均需通过本基金的托管账户进行。本托管账户仅限于本基金使用，并仅限于满足开展本基金业务的需要。

### **3、证券账户和证券资金账户的开立和管理**

基金管理人或基金托管人在中登公司为基金开立证券账户，账户名称以实际开立为准。证券账户的开立和使用，仅限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得出借或转让证券账户，亦不得使用证券账户进行本基金业务以外的活动。

证券账户和证券资金账户资产的管理和运作均由基金管理人负责。

本基金采用“第三方存管”+“托管”模式存管证券交易结算资金，基金管理人负责在

证券公司开设基金证券交易资金账户，并通知基金托管人与开立的基金托管账户建立第三方存管关系，同时三方存管的银证转账密码应及时通知基金托管人并由其掌握，在基金运作期间，不得变更基金证券交易资金账户与托管账户之间的第三方存管关系，未经托管人同意，基金管理人对该资金账户项下的证券资产进行转托管和撤指定给基金财产造成损失的，相关责任均由基金管理人承担。

#### **4、基金期货交易编码和期货资金账号的开立和管理（如有）**

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

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

**5、与基金投资运作有关的其他账户由基金管理人与基金托管人协商后办理。对于非由基金托管人开立、管理并实际控制的账户，基金托管人不承担任何形式的职责。**

**6、根据法律法规规定、监管要求及本合同约定，本基金投资运作有关账户需要由基金托管人代基金管理人办理的，基金管理人应当按照法律法规规定、监管要求及本合同约定将相关资料提供给基金托管人，并确保相关资料的合法性、真实性、完整性和有效性。基金托管人仅根据基金管理人提供的资料进行表面相符性的形式审查，如因基金管理人提供的相关资料不合法、不真实、不完整或失去效力而影响基金投资运作有关账户开立，给基金财产或基金投资者带来损失的，相关责任均由基金管理人承担。**

**7、对于本基金的投资事宜，根据相关法律规定，可能出现基金管理人代表本基金签订相关协议、开立相关账户及办理相关手续等情况，基金托管人对于因此而产生的风险或损失不承担责任。对于因基金投资产生的应收资产，应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并书面通知基金托管人，到账日期届满基金应收资产没有到达基金托管资金账户的，由此给基金造成损失的，基金管理人应负责向有关当事人追偿基金的损失，基金托管人对此不承担任何责任。**

#### **（四）基金财产投资的有关实物证券有价凭证的保管**

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

## **十四、资金清算交收安排**

### **（一）选择证券经纪商的程序**

基金管理人负责选择代理本基金财产证券买卖的证券经纪商，并与其签订相关合同，基金管理人、基金托管人和证券经纪商可就基金参与证券交易的具体事项另行签订经纪服务协议或其他协议。

## **（二）证券投资资金清算交收安排**

1、本基金通过证券经纪商进行的交易由证券经纪商作为结算参与人代理本基金进行结算；本基金其他证券交易由基金托管人或相关机构负责结算。基金托管人对存放在证券经纪公司的资金无保管职责，基金管理人应在证券经纪服务协议或其他协议中约定由选定的证券经纪公司承担资金安全保管责任。

2、证券交易所证券资金结算

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

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

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

6、对于任何原因发生的证券资金交收违约事件，相关各方应当及时协商解决，与托管人无关。

## **（三）期货投资资金清算与交收**

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

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

## **（四）资金、证券账目及交易记录的核对**

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

## **（五）申购或赎回的资金清算**

1、基金份额申购申请、赎回申请的确认及资金清算均由基金管理人负责。

2、基金管理人应将其确认后的每个开放日（T日）的基金申购、赎回数据，传送给基金托管人。基金管理人对其基金申购、赎回数据的真实性、准确性、完整性负责。基金托管人应及时查收申购资金的到账情况，并根据基金管理人指令及时划付赎回款项。

3、基金管理人应在T+5日前将申购净额（不包含申购费）划至托管资金账户。如申购净额未能如期到账，由此给基金造成损失的，由基金管理人承担。基金管理人承担赔偿责任后可向责任方追偿的损失。

4、除本合同另有约定外，基金管理人应在赎回确认日后在本合同约定的赎回款项支付时效内向基金托管人发送赎回的划拨指令并保证托管资金账户预留足额资金，基金托管人依据划款指令划至基金管理人指定账户。涉及销售机构赎回资金的交收，基金管理人应在与销售机构约定的赎回资金交收日之前向基金托管人发送赎回的划拨指令并保证托管资金账户

预留足额资金,若基金管理人无法在与销售机构约定的赎回资金交收日完成资金交收而引起销售机构及其投资者相关损失的,由基金管理人承担。若赎回金额未能如期划拨,由此给基金造成损失的,由基金管理人承担。基金管理人承担赔偿责任后可向责任方追偿的损失。

5、基金托管人仅接受基金管理人或基金管理人委托的运营服务机构的赎回指令,并根据赎回指令办理赎回款项的划付。因基金管理人拒绝确认基金投资者的赎回申请、未及时足额划付赎回款项引起的纠纷或产生的任何损失和赔偿,托管人不承担任何责任。

#### **(六) 非证券交易所交易资金清算与交收**

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

## **十五、投资指令的发送、确认和执行**

### **(一) 基金管理人发送指令人员的书面授权**

基金管理人应在首次资金划拨前向基金托管人提供书面授权书(以下简称授权书),授权书中应包括被授权人的名单、权限、预留印鉴或签字样本,规定基金管理人向基金托管人发送划款指令时基金托管人确认有权发送指令人员(以下简称被授权人)身份的方法。授权书应注明被授权人的权限并由基金管理人加盖公章。管理人以传真件或扫描件发出授权书后,应向托管人进行电话确认,以保证托管人及时收到。授权书须载明授权生效日期,授权书自载明的生效日期开始生效。基金托管人收到授权书的日期晚于载明生效日期的,则授权书自基金托管人实际收到日对基金托管人生效。管理人在发出授权书的传真件或扫描件后三个工作日内,应将授权书正本送交托管人。如正本与传真件或扫描件不同,以基金托管人收到的传真件或扫描件为准。基金管理人和基金托管人对授权书负有保密义务,其内容不得向相关操作人员以外的任何人泄露。

### **(二) 划款指令的内容**

划款指令是指基金管理人在管理基金财产时向基金托管人发出的资金划拨的指令。基金管理人发给基金托管人的划款指令应写明款项事由、指令的执行时间、金额、收款账户信息等,加盖预留印鉴并由被授权人签字或签章(以上内容统称为“指令的书面要素”)。

当本基金进行场外投资,基金管理人还应向基金托管人提供以下资料作为指令附件(1)投资合同及其附件(签署版);(2)收款方账户相关证明文件(如有);(3)基金托管人认为必要的投资划款相关支持性文件。

**基金管理人应保证以上所提供的文件资料的合法性、真实性、完整性和有效性。如果基金管理人无法提供上述文件资料的,基金托管人有权拒绝执行划款指令,由此造成的损失由基金管理人负责并承担。**

### **(三) 划款指令的发送、确认及执行时间与程序**

划款指令及其附件资料(如有)由授权书确定的被授权人代表基金管理人,用电子邮件、传真方式或基金管理人和基金托管人认可的其他方式向基金托管人发送。基金管理人<sup>有</sup>义务在发送指令后与托管人以电话的方式进行确认。发送的指令以基金托管人电话确认该指令已成功接收之时视为送达。因基金管理人未能及时与基金托管人进行指令确认,致使资金未能



及时到账所造成的损失，基金托管人不承担责任。基金托管人依照授权书规定的方法，对指令的预留印鉴、签字样本等表面一致性审核无误，确认指令有效后，方可执行指令。

对于被授权人依照授权书发出的投资指令，基金管理人不得否认其效力。基金管理人应按照相关法律法规以及本合同的约定，在其合法的经营权限和交易权限内发送投资指令，发送人应按照其授权权限发送投资指令，并保证划款指令及其附件的合法、真实、完整和有效。

基金管理人在发送指令时，应为基金托管人留出执行指令所必需的时间。由于基金管理人的原因造成的指令传输不及时、未能留出足够划款所需时间，致使资金未能及时到账所造成的损失，由基金管理人承担。除需考虑资金在途时间外，基金管理人还需为基金托管人留出至少 2 个工作小时的指令处理时间。在每个工作日的 13:30 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 15:00 以后接收基金管理人发出的其他投资指令，基金托管人不保证当日完成在银行的划付流程。

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

基金托管人仅根据基金管理人的授权文件对指令进行表面相符性的形式审查，对其真实性不承担责任。形式审查的方式限于验证指令的书面要素是否齐全、审核指令用章和签发人的签名或名章是否与预留印鉴样本、被授权人的签字样本或名章样本相符、操作权限是否与授权文件一致。基金托管人不负责审查基金管理人发送指令时一并提交的其他文件资料的合法性、真实性、完整性和有效性，基金管理人应保证上述文件资料合法、真实、完整和有效。如因基金管理人提供的上述文件资料不合法、不真实、不完整，或失去效力，进而影响基金托管人的审核，就此给基金财产或任何第三人带来损失的，均由基金管理人承担。

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

若指令存在与授权文件中预留印鉴样本、签字样本、名章样本、权限等要素不符的，基金托管人无义务执行指令，在该等情况下，基金托管人立即与基金管理人指定人员进行电话联系和沟通，并要求基金管理人重新发送经修改的指令。就基金管理人修改后重新发送的指令，基金托管人将按照前述指令的确认、审查程序重新进行表面一致性的形式审查。基金托管人认为审查无误的，才开始执行指令，对于因前述情形造成的任何延误或后果，相关责任均由基金管理人承担。

#### **（四）基金托管人暂缓、拒绝执行指令的情形和处理程序**

基金托管人发现基金管理人发送的投资指令违反法律法规、自律规则以及基金合同约定的，可拒绝执行，并应及时以书面形式通知基金管理人纠正，基金管理人收到通知后应及时

核对，并以书面形式对基金托管人发出回函确认，由此造成的损失由基金管理人承担。

#### **（五）基金管理人发送错误指令的情形和处理程序**

基金管理人发送错误指令的情形包括指令发送人员无权或超越权限发送投资指令、交割信息错误、指令中重要信息模糊不清或不全等。基金管理人若修改或要求停止执行已经发送的指令，应先与托管人电话联系，若托管人还未执行，管理人应重新发送修改指令或在原指令上注明“停止执行”字样并由指令发送人员签字，托管人收到修改或停止执行的指令后，将按新指令执行；若托管人已执行原指令，则应与管理人电话说明，因基金托管人已执行该指令而造成的损失均由基金管理人承担。基金托管人在履行监督职能时，以通常合理的注意义务，发现基金管理人的指令错误时，有权拒绝执行，并及时通知基金管理人改正。

#### **（六）更换被授权人的程序**

基金管理人撤换被授权人员或变更被授权人员的权限时，必须提前至少一个工作日，并通过传真方式、电子邮件扫描件方式或其他基金管理人和基金托管人双方认可的方式，向基金托管人发出由基金管理人加盖公章的变更授权书（以下简称新授权书），同时致电基金托管人确认其已收悉。新授权书须载明生效日期，但如基金托管人实际收到新授权书的日期晚于其载明之生效日期的，则新授权书自基金托管人实际收到时对基金托管人生效。基金管理人应在致电基金托管人确认其收悉新授权书传真件/扫描件后三日内将新授权书正本送交基金托管人。如正本与传真件或扫描件不同，以基金托管人收到的传真件或扫描件为准。新授权书生效后，对于已被撤换的人员无权发送的指令，或新被授权人员超越授权权限发送的指令，基金管理人无过错的，基金管理人不承担责任。

#### **（七）划款指令的保管**

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

#### **（八）相关责任**

**基金托管人正确执行基金管理人发出的符合本合同约定、合法合规的划款指令，基金财产发生损失的，相关损失均由基金财产承担。**在正常业务受理渠道和指令规定的时间内，因基金托管人过错导致未能及时或正确执行符合本合同约定、合法合规的划款指令，致使基金财产受损的，基金托管人应承担相应责任，但托管账户或其他账户余额不足，或基金托管人遇到不可抗力等非可归责于托管人过错的情形除外。

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

## **十六、基金资产的估值和会计核算**

基金管理人（或其委托的运营服务机构）、基金托管人双方对本基金财产分别建账、独立核算，并指定专门人员负责基金财产的会计核算、资产估值与账册保管。基金管理人委托

基金运营服务机构为本基金提供资产估值服务，双方的权利义务以双方签订有关协议的约定为准，基金管理人依法应当承担的责任不因该等委托而免除。

### （一）基金财产的估值

#### 1、基金资产总值

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

#### 2、基金资产净值

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

#### 3、基金份额净值

基金份额净值是指计算日基金资产净值除以计算日基金份额后的数值。本基金的基金份额净值保留到小数点后3位，小数点后第4位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

根据有关法律法规，基金资产净值计算和会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的会计责任方为基金管理人。因此，**就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，以基金管理人对基金资产净值的计算结果为准，由此造成的损失，私募基金托管人不承担任何责任。**

本基金的份额净值以基金存续期内经基金管理人（或其委托的运营服务机构）和基金托管人核对完毕的估值结果进行确认。

#### 4、估值目的

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

#### 5、估值时间

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

#### 6、估值依据

估值应符合本合同、《证券投资基金会计核算业务指引》等金融监管部门制定的基金估值相关业务规则办理基金资产估值。

#### 7、估值对象

基金所拥有的股票、债券、基金、回购、银行存款本息、应收款项和其他投资等资产及负债。

#### 8、估值方法

本基金按以下方式进行估值：

##### （1）证券交易所上市的有价证券的估值

1) 交易所上市的有价证券（包括股票、权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，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；估值日无交易的，如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考监管机构和行业协会估值意见，或者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。证券交易所退市/摘牌的股票，以退市/摘牌该股票最后

一次市值进行估值。

2) 交易所上市实行净价交易的债券选取估值日第三方估值机构(此处指中证指数有限公司)提供的相应品种对应的估值净价估值。如第三方估值机构不发布估值价的,按成本估值。

3) 交易所上市实行全价交易的债券(可转债除外),选取估值日第三方估值机构(中证指数有限公司)提供的估值全价减去估值全价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。

4) 交易所上市交易的可转换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;估值基准日没有报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大变化的,按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。

5) 交易所上市的资产支持证券和私募债,选取第三方机构(此处指中证指数有限公司)提供的估值价格和估值技术;如第三方估值机构不发布估值价的,按成本估值。

6) 当上述债券品种发生违约时,管理人应当及时通知托管人进行估值方法调整,如因管理人未及时通知导致托管人未及时调整的,不视为估值错误。

(2) 处于未上市期间的有价证券的估值:

1) 送股、转增股、配股和公开增发的新股,按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的估值方法估值;该日无交易的,以最近一日的市价(收盘价)估值。

2) 首次公开发行未上市的股票、债券、权证、退市后重新上市或换市场上市的股票,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。

3) 流通受限股票(是指在发行时明确一定期限限售期的股票,包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份等,不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券以及全国中小企业股份转让系统的股票等流通受限股票),可按以下公式确定估值基准日该流通受限股票的价值:

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

其中:

FV: 估值基准日该流通受限股票的价值

S: 估值基准日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值

LoMD: 该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣。

其中: LoMD 采用第三方机构(如中证指数有限公司)提供的流通受限股票流动性折扣。

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

对于基金业协会规定的流通受限股票估值取值中的“流通受限股票的流动性折扣”,当估值日第三方估值机构未提供该流动性折扣时,则优先采用距当前最近一个交易日第三方估值机构提供的流动性折扣进行估值处理;若第三方估值机构从未提供该流通受限股票的流动性折扣,则按估值日该流通受限股票在证券交易所上市交易的同一股票的市价(收盘价)估值;该日无交易的,以最近一日的市价(收盘价)估值。

(3) 全国中小企业股份转让系统转让或交易的股票的估值

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

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

3) 全国中小企业股份转让系统退市/摘牌的股票，以退市/摘牌该股票最后一次市值进行估值。

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

(4) 全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，主要采用第三方估值机构（此处指中央国债登记结算有限责任公司）提供的估值价格和估值技术。当上述债券品种发生违约时，管理人应当及时通知托管人进行估值方法调整，如因管理人未及时通知导致托管人未及时调整的，不视为估值错误，托管人不承担责任。

(5) 同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

(6) 基金持有的公开募集证券投资基金的估值

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

2) 持有的场外开放式基金（包括上市开放式基金（LOF）的场外份额），按估值日前一交易日的基金份额净值估值；估值日前一交易日基金份额净值未公布的，按此前最近交易日的基金份额净值估值。

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

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

(7) 期货按照期货交易所估值日的结算价估值，若估值当日无结算价的，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。

(8) 基金持有的场内期权衍生工具，按估值日的结算价估值；估值日没有交易的，按最近交易日的结算价估值；未上市交易的衍生工具等有价证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量的情况下，按成本估值。

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

(10) 银行存款、证券资金账户内资金及债券等计息资产按照约定利率在持有期内逐日计提应收利息，在利息到账日以实收利息入账，并冲减已计提部分。期货资金账户内资金不

计提利息，以实际结息数为准。

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

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

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

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

2) 如标的产品有虚拟份额净值（指按照标的产品业绩报酬计算方法预提业绩报酬后得到的份额净值，包括仅供参考的虚拟份额净值）且管理人确认使用该虚拟份额净值（包括仅供参考的虚拟份额净值）进行估值的，以信息披露义务人或本基金管理人按照提供的标的产品最新虚拟份额净值（包括仅供参考的虚拟份额净值）进行估值，不能提供虚拟份额净值（包括仅供参考的虚拟份额净值）的，按照上述1)约定的估值方法以份额净值估值。如信息披露义务人或本基金管理人未提供标的产品最新虚拟份额净值（包括仅供参考的虚拟份额净值）的，则以信息披露义务人或本基金管理人最近一次提供的虚拟份额净值进行估值。

(14) 债权、股权收益权、债权收益权按成本法估值。

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

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

(17) 上述估值方法,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。如存在上述估值约定未覆盖的投资品种,或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,按与基金托管人双方商议后的估值方法或估值机制估值(将加盖管理人公章的估值调整说明函递交托管人),前述估值机制调整包括但不限于启用侧袋估值机制等。如基金管理人(或其委托的运营服务机构)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,协商解决。根据有关法律法规,基金份额净值计算和会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的会计责任方由基金管理人担任。因此,就与本基金有关的会计问题,如经相关各方在平等基础上充分讨论后,仍无法达成一致意见,为避免不能按时披露的情形,以基金管理人计算或确认的结果为准,基金管理人应在单方面对外披露基金份额净值计算结果时注明未经基金托管人复核,基金托管人不承担由此导致的损失。

## 9、估值材料的交互要求

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

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

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

**如因本基金管理人或投资标的的信息披露义务人未及时按上述约定向基金托管人或运营服务机构提供估值材料的,本基金开放日份额净值不得作为办理基金份额申购、赎回的依据。如基金托管人或运营服务机构未及时获得完整、准确及有效的、并经托管人或运营服务机构认可的估值材料,或估值材料记载的信息发生变更,致使本基金申购、赎回及日常净值发生波动或无法反映真实资产状况造成投资者损失的,基金托管人不承担任何责任。**

## 10、特殊估值方法

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

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

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

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

## 11、估值程序

基金日常估值由基金管理人（或其委托的运营服务机构）进行。基金管理人（或其委托的运营服务机构）完成估值后，以双方认可的形式（如电子对账、录音电话、传真、邮件等）与基金托管人核对估值结果，基金托管人按本合同约定的估值方法、时间、程序进行复核，复核无误后以双方认可的形式（如电子对账、录音电话、传真、邮件等）返回基金管理人（或其委托的运营服务机构）；月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

在法律法规和中国证监会允许的情况下，基金管理人与基金托管人可以各自委托第三方机构进行基金资产估值，但不免除基金管理人与基金托管人对基金资产估值各自承担的责任。

## 12、估值错误的处理

当基金资产估值计算偏离达到基金份额净值的0.5%时，视为估值错误。估值错误的类型主要包括但不限于：资料申报差错、数据传输差错、数据计算差错、系统故障差错、下达指令差错、不可抗力等。

### （1）估值错误处理原则

1) 基金管理人应督促证券/期货经纪商向基金托管人及运营服务机构及时发送交易结算数据、对账单等估值所需材料，因证券/期货经纪商未及时、准确发送估值所需材料等原



因导致估值错误发生的，基金管理人应协调证券/期货经纪商解决；

2) 因不可抗力，证券交易所及中登公司发送的数据错误，或国家会计政策变更、市场规则变更等原因导致估值错误发生的，基金管理人（或其委托的运营服务机构）和基金托管人免除赔偿责任，但基金管理人（或其委托的运营服务机构）和基金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；

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

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

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

6) 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，由基金管理人负责代表基金向取得不当得利的当事方追偿；

7) 估值错误调整应当采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式；

8) 基金管理人（或其委托的运营服务机构）和基金托管人按本合同约定的估值方法进行估值时，所造成的误差不作为估值错误处理；基金管理人（或其委托的运营服务机构）和基金托管人由于各自技术系统设置而产生的净值计算尾差，不作为估值错误处理，以基金管理人计算结果为准；

9) 前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。如果行业另有通行做法，基金管理人和基金托管人应本着平等和保护基金份额持有人利益的原则进行协商。

## **(2) 估值错误处理程序**

估值错误被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

1) 基金份额净值计算出现错误时，基金管理人（或其委托的运营服务机构）应当立即纠正，通报基金托管人，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；

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

3) 根据估值错误处理原则或基金管理人和基金托管人协商一致的方法，对估值错误进行处理；

4) 前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。如果行业另有通行做法，基金管理人和基金托管人应本着平等和保护基金份额持有人利益的原则进行协商。

## **13、暂停估值的情形**

(1) 基金投资所涉及的证券交易场所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

(2) 证券/期货经纪服务机构/场外衍生品交易对手方或第三方等机构未能提供估值所需资料，导致基金管理人（或其委托的运营服务机构）或基金托管人无法对基金资产进行正常估值时；

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

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

(5) 本基金管理人（或其委托的运营服务机构）或托管人有合理理由认为根据现有的材料无法准确估值的情形；

(6) 对于没有或未及时获取交易数据、行情数据或投资标的估值数据；交易数据或行情数据或投资标的估值数据不完整或有误时；

(7) 发生上述情形的，基金管理人（或其委托的运营服务机构）和托管人未达成一致意见的情形；

(8) 金融监管部门和本合同认定的其他情形。

#### **14、资金账册的建立**

基金管理人（或其委托的运营服务机构）和基金托管人应各自独立建立资金账册，定期核对。若双方对会计处理方法存在分歧，应以基金管理人的处理方法为准。

#### **15、税务处理**

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

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

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

#### **(二) 基金的会计核算**

1、基金管理人为本基金的基金会计责任方。

2、本基金财产的会计年度为每年1月1日至12月31日。

3、记账本位币为人民币，记账单位为元。

4、基金财产的会计核算按《证券投资基金会计核算业务指引》执行。

5、本基金应独立建账、独立核算；基金管理人或其委托的运营服务机构应保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，编制会计报表。

6、基金管理人（或其委托的运营服务机构）应定期与基金托管人就基金的会计核算、报表编制等进行核对。因基金管理人（或其委托的运营服务机构）未按合同约定履行会计核算和报表编制义务等客观因素，导致基金管理人（或其委托的运营服务机构）未按时与基金托管人进行核对或基金托管人无法按时进行相应复核的，托管人不承担由此产生的后果和责任。

7、基金管理人委托运营服务机构办理前述会计核算、估值核对等事项的，由基金管理人就运营服务机构履行该等事项的情况向基金投资者和基金托管人承担责任，基金管理人依法应承担的职责不因委托其他机构办理而免除。

## 十七、基金的费用与税收

### （一）基金费用的种类

- 1、管理费；
- 2、托管费；
- 3、运营服务费；
- 4、业绩报酬；
- 5、基金的证券交易费用及开户费用；
- 6、基金的银行汇划费用；
- 7、与基金相关的诉讼仲裁费、资产评估师费、会计师费、审计费、律师费、电子签约服务费、基金合同等相关合同制作费及其他费用；
- 8、按照国家有关规定和本合同约定，可以在基金资产中列支的其他费用。

### （二）费用计提方法、计提标准和支付方式

#### 1、管理费

基金的年管理费率为 0.4%，以前一日基金资产净值为基础计提。计算方法如下：

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

H：每日应计提的管理费

E：前一日的基金资产净值

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

基金管理人收取管理费的银行账户为：

户名：北京益安资本管理有限公司

开户行：中国民生银行济南历山支行

账号：696613448

#### 2、托管费

基金的年托管费率为 0.015%，以前一自然日基金资产净值为基础计提。计算方法如下：

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

H：每日应计提的托管费

E：前一日的基金资产净值

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

基金管理人应于每季首月在基金托管账户中备足应支付的托管费。

**基金托管人收取托管费的银行账户为：**

开户行：工商银行北京东城支行营业室

账户名称：中信建投证券股份有限公司

账号：0200080719027304381

**3、运营服务费**

基金的年运营服务费率为0.015%，以前一自然日基金资产净值为基础计提。计算方法如下：

$H = E \times \text{年运营服务费率} \div 365$

**H：每日应计提的运营服务费**

**E：前一日基金资产净值**

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

**基金运营服务机构收取运营服务费的银行账户为：**

开户行：工商银行北京东城支行营业室

账户名称：中信建投证券股份有限公司

账号：0200080719027304381

**4、业绩报酬**

本基金不收取业绩报酬。

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

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

7、基金各项费用的支付方式基金管理人可以单方面变更，以基金管理人向基金托管人出具的相关授权文件为准。

**（三）不列入基金业务费用的项目**

1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失。

2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用。

3、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

**（四）费用调整**

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

**（五）基金的税收**

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

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

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

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

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

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

基金投资者必须自行缴纳的税收由基金投资者负责，基金管理人或托管人不承担代扣代缴或纳税的义务。如依据相关法律法规或税务机关的规定，基金管理人在向基金投资者交付利益或资产前须代扣代缴任何税费的，基金管理人按照相关规定予以代扣代缴，无需事先征得基金投资者的同意，且基金投资者不得要求基金管理人以任何方式向其返还或补偿该等税费。

## 十八、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）基金未分配利润

基金收益分配的基准为未分配利润，基金未分配利润指截至收益分配基准日（即未分配利润计算截至日）基金资产净值与实收资本的差额。

### （二）收益分配原则

1、每一基金份额享有同等分配权。

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

知基金管理人的，按照默认收益分配方式进行分配。

3、基金收益分配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。

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

5、法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

### **（三）收益分配方案的确定与通知**

基金收益分配方案中应载明截至收益分配基准日的分配时间、分配金额、分配方式等内容。

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

### **（四）收益分配方案的执行**

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

## **十九、信息披露与报告**

（一）本基金的信息披露应符合有权机关颁布的有关法律、法规、部门规章、自律规则等规范性文件规定及本合同的约定。有关法律、法规、部门规章、自律规则等规范性文件关于信息披露的规定发生变更时，本基金从其最新规定。

### **（二）基金管理人为本基金信息披露义务人**

基金管理人委托第三方机构代为披露信息的，其作为信息披露义务人依法应当承担的责任和信息披露义务不因委托而免除。

基金管理人不得有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并应当按照法律法规、有权机关规定持续履行信息披露和报送义务，确保所提交信息材料及时、准确、真实、完整。基金管理人保证披露的所有信息（包括基金财务信息及非财务信息）的真实性、准确性完整性和及时性。因披露基金信息不真实、不准确、不完整、不及时给基金财产和基金投资者造成的任何损失，由基金管理人承担全部责任。

### **（三）基金管理人披露基金信息，不得有下列行为：**

- 1、公开披露或者变相公开披露；
- 2、虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏；
- 3、对投资业绩进行预测；
- 4、违规承诺收益或者承担损失；
- 5、诋毁其他基金管理人、基金托管人或者基金销售机构；
- 6、登载任何自然人、法人或者其他组织的祝贺性、恭维性或推荐性的文字；
- 7、法律、行政法规、中国证监会、基金业协会禁止的其他行为。

### **（四）运作期报告**

## 1、基金管理人向基金份额持有人提供的报告种类、内容和提供时间

### (1) 月度净值披露（如有）

如本基金为私募证券投资基金，则需按照以下要求进行基金月度净值披露：

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

### (2) 季度报告

基金管理人（或其委托的运营服务机构）应当在基金业协会要求的截止时间之前，编制完成基金季度报告并确保其中的财务数据为已经基金托管人复核（托管人仅复核本基金净值、主要财务指标（如有）、财务会计报告（如有）及投资组合的财务数据），由基金管理人向基金份额持有人披露基金净值、主要财务指标以及投资组合情况以及其他法律法规规定和本合同约定的信息。

### (3) 年度报告

基金管理人（或其委托的运营服务机构）应当在基金业协会要求的截止时间之前，编制完成基金年度报告并确保其中的财务数据为已经基金托管人复核（托管人仅复核本基金净值、主要财务指标（如有）、财务会计报告（如有）及投资组合的财务数据），由基金管理人向基金份额持有人披露报告期末基金净值和基金份额总额、基金的财务情况、基金投资运作情况和运用杠杆情况、投资者账户信息（包括实缴出资额、未缴出资额以及报告期末所持有基金份额总额）、投资收益分配和损失承担情况、基金管理人取得的管理费和业绩报酬（包括计提基准、计提方式和支付方式）以及其他法律法规规定和本合同约定的信息。

### (4) 临时报告

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

重大事项包括但不限于：

- 1) 基金名称、注册地址、组织形式发生变更的；
- 2) 基金合同发生重大变化的；
- 3) 变更基金管理人和托管人的；
- 4) 管理人的法定代表人、执行事务合伙人（委派代表）、实际控制人发生变更的；
- 5) 触及基金止损线或预警线的；
- 6) 管理费率、托管费率发生变化的；
- 7) 基金收益分配事项发生变更的；
- 8) 基金触发巨额赎回的；
- 9) 基金存续期变更或展期的；
- 10) 基金发生清盘或清算的；
- 11) 发生重大关联交易或交易可能存在利益冲突的；
- 12) 基金管理人、实际控制人、高管人员涉嫌重大违法违规行为或正在接受监管部门或自律管理部门调查的；
- 13) 涉及私募基金管理业务、基金财产、基金托管业务的重大诉讼、仲裁；

14) 投资金额占基金净资产 50%及以上的项目不能正常退出的;

15) 对基金持续运行、投资者利益、资产净值产生重大影响的其他事件。

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

## **2、向基金份额持有人提供报告及基金份额持有人信息查询的方式**

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

### **(1) 传真、电子邮件或短信**

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

### **(2) 邮寄服务**

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

### **(3) 基金管理人网站**

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

### **(4) 基金业协会指定的信息披露平台**

基金份额持有人可登录基金业协会指定的私募基金信息披露备份系统 (<https://pfid.amac.org.cn>) 进行信息查询。基金管理人应当根据基金业协会自律监管规定要求, 负责私募基金信息披露备份系统定向披露功能投资者查询账号日常维护及管理工作。

基金业协会不对信息披露报告的内容进行核实和审查, 信息披露报告内容的真实性和准确性由基金管理人自行负责。

### **(五) 向基金业协会提供的报告**

基金管理人、基金托管人应当根据中国证监会和基金业协会的要求各自履行报告义务。

基金管理人应当按照法律法规、中国证监会和基金业协会的要求, 规定通过基金业协会指定的私募基金信息披露备份平台报送信息。

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

### **(七) 基金托管人办理的基金托管业务有关信息披露事项**

除法律法规、中国证监会和基金业协会等监管机关另有规定外, 基金托管人依据本合同办理与基金托管业务有关的信息披露事项, 仅包括基金托管人向上述监管机关履行的定期或不定期报告义务, 以及仅对基金管理人(或其委托的运营服务机构)编制的基金份额净值、基金份额申购赎回价格、基金定期报告和定期更新的招募说明书(如有)中的基金财务数据进行复核。

因基金管理人(或其委托的运营服务机构)未真实、准确、完整、及时提供上述基金财务数据, 导致基金托管人复核不准确或不及时的相关责任由基金管理人自行承担。基金非财务数据由基金管理人自行负责编制和披露, 基金托管人对于基金非财务数据不承担任何形式的复核职责。因信息披露不真实、不准确、不完整或不及时等原因造成的争议或损



失，由基金管理人负责解决并承担相应的法律责任。

## 二十、风险揭示

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

(二) 签署本基金合同前，投资者应当仔细阅读本合同全文及《益安船长计划私募证券投资基金风险揭示书》，知悉并理解其中列示的基金可能面临的各项风险。《益安船长计划私募证券投资基金风险揭示书》揭示的事项仅为列举性质，未能详尽列明投资者参与私募基金投资所面临的全部风险和可能导致投资者资产损失的所有因素。投资者在参与私募基金投资并签署本合同前，应认真阅读并理解相关业务规则、基金合同及风险揭示书的全部内容，并确保自身已做好足够的风险评估与财务安排，避免因参与私募基金投资而遭受超过自身风险承受能力的损失。

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

特别提示：一经签署本基金合同，即视为投资者已充分了解并谨慎评估自身风险承受能力，理解并愿意自行承担参与私募基金投资的风险和损失。无论投资者是否签署《益安船长计划私募证券投资基金风险揭示书》，该《益安船长计划私募证券投资基金风险揭示书》均作为本基金合同一部分，与本基金合同具有同等法律效力。

## 二十一、基金合同的效力、变更、解除与终止

### (一) 基金合同的效力

#### 1、合同的成立和生效

基金合同是约定基金合同当事人之间权利义务关系的法律文件，本合同的当事人包括基金份额持有人、基金管理人和基金托管人。本合同自各方当事人签署完毕之日起成立，并自签署完毕日与投资者缴款日孰早之日起生效，对各方当事人具有同等的法律约束力。

#### 2、合同的签署

本基金合同可由当事人采取纸质合同（包括套印版纸质合同）方式签署或当事人通过符合《电子签名法》等法律法规、监管规定有关要求的电子签名方式签署。电子签名与签署纸质合同具有同等法律效力。

##### (1) 采用纸质合同（包括套印版的纸质合同）方式签署

本合同采用纸质合同（包括套印版纸质合同）方式签署的，基金投资者为机构（法人或其他组织）的，本合同自当事人各方法定代表人或授权代表签字（含签章）并加盖公章或合同专用章之日起成立并生效。基金投资者为自然人的，本合同自基金投资者本人签字或授权代表签字、基金管理人和基金托管人分别加盖公章或合同专用章及其法定代表人或授权代表

签字（含签章）之日起成立并生效。

本合同采用纸质合同方式签署的，亦可采用套印托管人或/及管理人公章（或合同专用章）、法定代表人/执行事务合伙人或授权代表签字（或盖章）的套印版纸质合同方式与基金投资者进行签署，套印版纸质合同的生效及法律效力等同于基金管理人和基金托管人直接签署。基金投资者签署本合同，即表示对套印版纸质合同方式予以认可和接受。

**基金管理人负责保证募集行为合法合规性，保证基金投资者签署基金合同等法律文件的真实性、准确性、完整性。如因投资者签署合同等法律文件不真实不准确不完整、募集行为不合法合规导致的任何责任，由基金管理人自行承担。**

针对每一个投资者，基金合同一式叁份，各当事人各执壹份，每份合同均具有同等的法律效力。基金管理人应当妥善保管并按托管人要求及时向其移交经投资者签署完毕的基金合同原件。

## **（2）采用电子签名方式签署**

本合同采用电子签名方式签署的，自各方当事人以符合《电子签名法》等法律法规、监管规定要求的电子签名方式签署完毕之日起生效。

基金管理人负责确保签约系统得到基金托管人认可，并确保基金投资者签署本合同所使用的签约系统、电子签名符合《电子签名法》等法律法规、监管机关及自律组织的相关要求。基金管理人负责确保提供给基金托管人的电子数据信息的真实性、准确性、完整性、及时性和合法合规性。

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

## **（二）基金合同的有效期限**

本合同有效期为自基金合同生效日起至基金合同终止日止。

## **（三）基金合同的变更**

1、因法律法规或中国证监会、基金业协会等监管机构、行业自律组织规则发生变化而需变更基金合同的，基金管理人可以与托管人协商一致后修改基金合同，并由基金管理人按照合同约定及时向投资者披露变更的具体内容。为免歧义，按照本条约定进行的基金合同变更，无需召集基金份额持有人大会。

2、非因法律法规或中国证监会、基金业协会等监管机构、行业自律组织规则发生变化而需变更基金合同的，如拟变更内容对本合同当事人权利义务将产生实质不利影响的，可通过以下任何一种方式变更基金合同：

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

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

（3）经基金托管人书面同意后，基金管理人可以向全体基金份额持有人发送征询意见函（以实际名称为准），就基金合同拟变更事宜向全体基金份额持有人征求意见。征询意见函（以实际名称为准）载明的征询意见期届满后，如至少一名投资者同意合同变更的，基金管理人应及时向基金托管人出具盖章的合同变更生效通知（基金合同变更生效日以该生效通知载明的生效日期为准），并在基金合同变更生效日起【三】个工作日内通知相关基金份额

持有人合同变更生效的结果。基金管理人应当对不同意合同变更或未按照征询意见函（以实际名称为准）要求回复意见的基金份额持有人作出合理的退出安排。

3、非因法律法规或中国证监会、基金业协会等监管机构、行业自律组织规则发生变化而需变更基金合同的，如拟变更内容对基金份额持有人权利义务无实质不利影响的，基金管理人与基金托管人协商一致后即可变更基金合同，基金管理人应及时向基金托管人出具盖章的合同变更生效通知，基金合同变更生效日以该生效通知载明的生效日期为准，基金管理人应当按照本合同的约定及时向基金份额持有人披露变更的具体内容。

4、自基金合同变更生效日起，基金合同变更对合同各方当事人均具有法律效力。已持有基金份额的投资者按照本合同约定同意合同变更的，无需另行签署补充协议或修订版基金合同等书面协议，但按照上述第2（1）种方式进行基金合同变更的除外。基金合同变更生效日起，基金管理人应当要求新取得基金份额的投资者，签署变更后的基金合同，具体签署文件以基金管理人和基金托管人一致同意的文件形式为准。基金管理人应当确保新投资者签署的书面文件与基金合同变更后的内容实质一致。

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

#### （四）基金合同的解除

自本合同生效日起，除基金投资者可依据本合同“第六章基金的募集第（三）条投资冷静期及回访确认”约定的条件解除本合同外，任何一方当事人均不得单方解除。

#### （五）基金合同终止事由

除本合同另有约定外，基金合同终止事由还包括下列情形：

1、基金存续期限届满且未展期的；

2、基金管理人因依法解散、被依法撤销、被基金业协会公告失联、被监管机构处罚或被采取其他自律监管措施等情况导致客观上使其丧失继续管理私募投资基金的能力和资格时，基金份额持有人大会作出决议终止本基金，或自前述情形发生之日起六个月内没有新基金管理人承接的；

3、基金管理人根据基金运作、市场行情等情况自主决定终止基金的；

4、基金托管人依法解散、被依法撤销或被依法宣告破产或被依法取消基金托管资格，且自前述情形发生之日起六个月内没有新的托管人承接的；

5、本基金已成立但基金业协会不予备案的，基金管理人应当终止基金合同；

6、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；

7、基金份额持有人大会决议终止的；

8、法律法规规定的其他情形。

## 二十二、基金的清算

### （一）清算小组的组成及职责

自基金合同终止事由发生之日（以下简称基金终止日）起5个工作日内，基金管理人应当终止基金投资运作，及时发布基金清算公告并通知全体份额持有人和基金托管人。基

金管理人应当在清算公告中明确基金合同具体终止事由及基金终止日。

自基金终止日起，本基金进入清算期，基金管理人负责成立清算组及时启动清算程序，并不得进行任何新增投资运作。如因基金管理人未及时启动清算程序，或存在基金终止日后仍然新增投资等违反清算程序约定事项，进而导致基金财产损失的，全部责任由基金管理人承担，基金托管人不承担监督职责。

#### 1、清算组的组成

基金管理人应当自基金终止日起 30 个工作日内发起成立清算小组。清算小组成员由基金管理人、基金托管人组成。清算小组可以聘用必要的工作人员。如出现符合本章约定的“管理人无法履行清算职责的应急处置”事项的，基金份额持有人大会应当及时作出决议，按照本章节约定，代为履行基金管理人职责，组织基金清算工作。

#### 2、清算小组的职责

清算小组负责基金清算资产的保管、清理、估价、变现和分配。清算小组可以依法以基金的名义进行必要的民事活动。清算小组成员具体职责如下：

##### （1）基金管理人职责：

- 1) 基金资产变现；
- 2) 除交易所、银行等自动扣收的费用外，对清算期间资金支付出具划款指令；
- 3) 出具会计报表；
- 4) 清算期间的会计核算；
- 5) 编制清算报告并签章；
- 6) 配合基金托管人账户注销工作；
- 7) 向基金份额持有人发布清算公告、清算报告；
- 8) 将清算报告报中国证券投资基金业协会备案；
- 9) 履行与基金管理人义务相关的其他职责。

##### （2）基金托管人职责

- 1) 保管基金托管账户内的现金资产；
- 2) 依据基金管理人清算指令，进行资金划付；
- 3) 复核基金管理人出具的清算报告中的基金财务数据。

##### （二）清算程序

- 1、基金合同终止后，由基金管理人主导统一接管基金财产，基金托管人予以配合；
- 2、由基金管理人负责基金财产和债权债务进行清理和确认；
- 3、由基金管理人负责基金财产进行估值；
- 4、由基金管理人负责基金财产进行变现，基金管理人应该在基金资产处于可变现状态时及时完成资产的全部变现，托管人对此不承担监督义务，如因基金管理人未及时将基金资产变现或清算过程中新增投资造成基金份额持有人损失的，全部责任由基金管理人承担；
- 5、基金管理人负责制作清算报告（附销户申请）并交由基金托管人，基金托管人对本基金合同约定的需由托管人复核的基金财务数据进行复核，由基金管理人负责将基金清算结果及时通知基金投资者；
- 6、基金管理人负责基金剩余财产进行分配；

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

### （三）清算费用及支付方式

清算费用是指在进行基金财产清算过程中发生的以下合理费用，包括但不限于：

- 1、基金资产的保管、清理、估价、变现和分配产生的费用；
- 2、诉讼仲裁所发生的费用；
- 3、其他与清算事项相关的费用。

清算费用由基金管理人从基金资产中优先支付。

### （四）基金财产清算剩余资产的分配

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

- 1、支付基金财产清算费用；
- 2、缴纳基金所欠税款；
- 3、清偿基金债务（含托管费、运营服务和管理费）；
- 4、如有余额，按照本合同约定的收益分配原则分配给基金份额持有人。

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

### （五）基金财产清算报告的告知安排

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

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

### （六）基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及文件由基金管理人保存 20 年以上。

### （七）基金财产清算其他事宜

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

2、**基金管理人无法履行清算职责的应急处置。**如因基金管理人依法解散、被依法撤销

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

3、**清算未尽事宜。**本合同中关于基金清算的未尽事宜以清算报告或基金管理人通知为准。

## 二十三、违约责任

(一) 本合同当事人违反本合同约定,应当承担相应的责任,给其他当事人造成损失的,应当承担赔偿责任。如当事人双方或多方均违反本合同约定,各违约方应当分别承担赔偿责任,该赔偿责任不构成连带责任。本合同能够继续履行的应当继续履行。

(二) 发生下列情况之一的,有关当事人应当免于承担违约责任:

1、不可抗力;

2、基金管理人和/或基金托管人按照有效的法律法规或金融监管部门的规定作为或不作为而造成的损失;

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

4、基金份额持有人未能事前就其关联证券或其他禁止交易证券明确告知基金管理人,致使基金财产发生违规投资行为的;

5、基金托管人由于按照基金管理人符合本合同约定的有效指令执行而造成的损失等;

6、基金托管人对存放或存管在基金托管人以外机构的基金资产(包括投资其他证券投资基金、信托计划、证券公司资产管理计划、保险资产管理计划、期货资产管理计划、基金公司/基金子公司资产管理计划等形成的基金资产),或交由商业银行、证券经纪商、期货经纪商等其他机构负责清算交收的基金财产(包括但不限于期货保证金账户内的资金、期货合约等)及其收益,因该等机构欺诈、疏忽、过失、破产等原因给基金财产带来的损失等;

7、各方当事人因第三方(包括但不限于交易所、中登公司、证券经纪商、期货经纪商等)发送或提供的数据错误给本基金资产造成的损失等;

8、基金管理人和/或基金托管人因自身不可控制的因素导致业务出现差错,基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查,但是未能发现错误的或虽发现错误但因前述原因无法及时更新的,由此造成的基金财产或基金投资者损失;

9、因基金管理人提供给基金托管人的基金合同内容或基金投资者签署行为、内容、结果不真实,或基金管理人未及时或未将投资者签署的基金合同或未签署的基金合同及时寄送基金托管人导致基金财产或基金投资者损失的,基金托管人不承担赔偿责任;

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

(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。守约方因防止损失扩大而

支出的合理费用由违约方承担。

(四) 一方当事人因违反本合同约定向其他方当事人赔偿的损失,仅限于直接经济损失。

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

## 二十四、争议的处理

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

(二) 各方当事人同意,因本合同而产生的或与本合同有关的一切争议,合同当事人应尽量通过协商、调解途径解决。经友好协商未能解决的,任何一方当事人均应当向基金托管人注册地有管辖权的人民法院提起诉讼。

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

## 二十五、其他事项

### (一) 基金维持运作机制

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

2、基金管理人无法履行清算职责的应急处置。如因基金管理人依法解散、被依法撤销或被依法宣告破产,被基金业协会公告失联等基金管理人客观上丧失履行基金清算职责的能力时,基金份额持有人有权根据本基金合同约定召集基金份额持有人大会形成基金清算决议,基金托管人依据基金份额持有人大会的清算决议进行清算。如因基金份额持有人大会未形成或未及时形成相关决议,导致本基金未清算或未及时清算等情形,致使基金财产及/或投资者遭受损失的,基金托管人不承担责任。

3、基金管理人和相关当事人对本基金的职责不因基金业协会依照法律法规和自律规则执行注销管理人资格等自律措施而免除。已被注销资格的管理人和相关当事人仍应当根据《基金法》、协会相关自律规则和基金合同的约定,妥善处置本基金的基金财产,依法保障投资者的合法权益。

### (二) 通知和送达

除本合同另有约定外，本合同的通知在下列日期视为送达被通知方：

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

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

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

（四）本合同如有未尽事宜，由合同当事人按有关法律法规的规定协商解决。

（以下无正文）





（本页无正文，为《益安船长计划私募证券投资基金基金合同》签署页。）

基金投资者：

自然人（签字）：

法人或其他组织（盖章）：

法定代表人或授权代表（签章）：

签署日期：       年    月    日

基金管理人：北京益安资本管理有限公司（盖章）

法定代表人或执行事务合伙人委派代表或授权代理人（签章）：

签署日期：       年    月    日

基金托管人：中信建投证券股份有限公司（盖章）

法定代表人或授权代理人（签章）：

签署日期：       年    月    日