

开元恒利 2 号私募证券投资基金

基金合同

基金管理人：深圳开元双创基金管理有限公司

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，基金投资者根据所持有的基金份额享受私募基金收益，同时承担相应的投资风险。本基金投资风险包括但不限于：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，基金管理人在私募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，但基金投资者购买本基金并不等同于将资金作为存款存放在银行或其它存款类金融机构，基金管理人不能保证基金一定盈利，也不能保证最低收益，基金管理人的过往业绩不代表未来业绩。投资有风险，基金投资者认购、申购本基金时应认真阅读本基金的基金合同。基金投资者签署本基金合同即表明已充分阅读备查文件，同意本基金投资标的，并愿意承担投资风险。

基金管理人可运用基金财产与基金管理人、基金投资者、基金管理人管理的私募基金、同一实际控制人下的其他基金管理人管理的私募基金、或者与上述主体有其他重大利害关系的关联方进行交易，基金投资者签署本基金合同即表明其已经知晓并认可本基金可能将进行上述关联交易事项。

基金管理人承诺按照法律法规的要求对本基金履行相关的备案手续，对本基金的合法合规性承担责任。中国证券投资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、持续合规情况的认可，不作为对本基金财产安全的保证。

基金管理人提醒基金投资者基金投资的“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，由基金投资者自行承担。因本基金的产品设计安排、投资管理、运作模式而产生的经济责任和法律责任，由基金管理人承担。

本基金合同当事人的基本情况:

基金份额持有人:

类型: ☐ 自然人 ☐ 法人或其他组织

姓名 (自然人填写):

证件名称: ☐ 身份证 ☐ 护照 ☐ 军官证 ☐ 其他

证件号码:

联系电话:

邮箱:

机构名称 (法人或其他组织填写):

法定代表人或授权代表:

证件名称: ☐ 统一社会信用代码 ☐ 营业执照 ☐ 组织机构代码证 ☐ 其他

证件号码:

通讯地址:

邮政编码:

联系人:

联系电话:

传真:

邮箱:

基金管理人: 深圳开元双创基金管理有限公司

法定代表人/执行事务合伙人: 甘甲裕

住所: 广东省深圳市南山区前海深港合作区前湾一路1号A栋201室 (入驻深圳市前海商务秘书公司)

办公地址: 广东省深圳市福田区滨河大道5022号联合广场A座52楼5201-1

联系人: 林子豪

联系电话: 18608680208

邮箱: luox@cathayabrainpower.com

基金托管人: 华泰证券股份有限公司

法定代表人: 张伟

住所: 南京市建邺区江东中路228号

办公地址: 江苏省南京市建邺区江东中路228号

邮编: 210019

联系人: 尹鹏

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	3
四、私募基金的基本情况	5
五、私募基金的募集	6
六、私募基金的成立和备案	10
七、私募基金的申购、赎回与转让.....	11
八、当事人及权利义务	17
九、基金份额持有人大会及日常机构.....	23
十、私募基金份额的登记	30
十一、私募基金的投资	31
十二、私募基金的财产	35
十三、交易及清算交收安排	37
十四、私募基金财产的估值和会计核算.....	42
十五、私募基金的费用与税收	49
十六、私募基金的收益分配	54
十七、信息披露与报告	55
十八、风险揭示	58
十九、基金合同的效力、变更、解除与终止.....	64
二十、私募基金的清算	68
二十一、违约责任	71
二十二、争议处理	72
二十三、其他事项	73

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, 规范运作本私募基金。

2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国合同法》(以下简称“《合同法》”)、《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《私募投资基金监督管理暂行办法》(以下简称“《私募办法》”)、《私募投资基金募集行为管理办法》(以下简称“《募集办法》”)、《私募投资基金信息披露管理办法》(以下简称“《信息披露办法》”)、《契约型私募基金合同内容与格式指引》(以下简称“《合同指引》”)及其他相关规定。

3、订立本基金合同的原则是平等自愿、诚实信用、充分保护本基金合同各当事人的合法权益。

(二) 本基金按照中国法律法规成立并运作, 若本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

在本基金合同中, 除非文意另有所指, 下列词语或简称具有如下含义:

1、基金或本基金: 指开元恒利 2 号私募证券投资基金。

2、基金合同或本基金合同: 指《开元恒利 2 号私募证券投资基金基金合同》及其附件以及对本基金合同的任何有效修订及补充。

3、基金合同当事人: 指受基金合同约束, 根据基金合同享有权利并承担义务的法律主体, 包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人。

4、基金投资者或投资者: 指依据有关法律法规规定可以投资于私募基金的合格投资者的合称。包括个人投资者、机构投资者等。

5、基金份额持有人: 指依据本基金合同, 履行出资义务合法取得基金份额的基金投资者。

6、基金管理人: 指深圳开元双创基金管理有限公司。

7、基金托管人: 指华泰证券股份有限公司。

8、基金服务机构: 指接受基金管理人委托, 根据与其签订的服务业务合作

协议约定的服务范围，为本基金提供份额登记、估值核算等业务的服务机构。

9、募集机构：指基金管理人，以及符合中国证监会规定的条件，取得基金销售业务资格并与基金管理人签订基金销售服务代理协议、接受基金管理人委托、代为办理本基金销售业务的机构（简称“销售机构”）。

10、份额登记机构：指办理基金份额登记业务的机构。份额登记机构为基金管理人或接受基金管理人委托代为办理份额登记业务的机构。

11、基金账户：指份额登记机构为基金投资者开立的、记录其持有的、基金管理人所管理的基金份额余额及其变动情况的账户。

12、托管账户：即基金财产托管账户，指基金托管人以基金名义开立的用于保管、管理和运用本基金资产的专用银行账户。

13、基金募集结算资金专用账户：简称“募集专户”，指由基金管理人开立或基金服务机构受基金管理人委托代为开立的，用于基金管理人直销基金投资者及基金销售机构、基金销售支付结算机构等基金销售相关机构资金归集的，在基金投资者与基金财产托管账户之间划转基金认/申购、赎回、现金分红等资金的专用账户。

14、基金财产：指基金投资者或基金份额持有人因认购或申购本基金的基金份额而缴纳的资金所形成的财产；基金管理人因基金财产的运用、处分或者其他情形而取得的财产，也归入基金财产。

15、存续期：指本基金成立至本基金终止之间的期限。

16、封闭期：指本基金成立后，不允许申购或赎回的一段期限。

17、开放日：指为基金投资者或者基金份额持有人办理基金份额申购及/或赎回或其他业务的工作日，具体以本基金合同约定为准。

18、工作日、交易日（T 日）：指上海证券交易所及深圳证券交易所的正常交易日，T+n 日指 T 日之后的第 n 个工作日，T-n 日指 T 日之前的第 n 个工作日。

19、K 日：除本基金合同特别说明外，指在规定时间受理本基金的基金投资者或基金份额持有人申购、赎回或其他业务的开放日（包括由基金管理人设置的临时开放日），K+n 日指 K 日之后的第 n 个工作日，K-n 日指 K 日之前的第 n 个工作日。

20、认购：指基金募集期内，基金投资者按照基金合同的约定申请购买本基

金份额的行为。

21、申购：指基金成立后，基金投资者按照基金合同的约定申请购买本基金份额的行为。

22、赎回：指基金成立后，基金份额持有人按照基金合同的约定申请将本基金份额兑换为现金的行为。

23、元：指人民币元。

24、不可抗力：指本基金合同成立后发生的、当事人不能预见、不能避免、不能克服的使本合同当事人无法全部履行或无法部分履行本合同的任何事件，包括但不限于台风、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、法律法规变化、相关交易场所非正常暂停或停止交易等事件以及非当事人所引起或能控制的计算机系统、通讯系统、网络系统、电力系统故障或其他突发事件等情形。

25、中国证监会：指中国证券监督管理委员会及其派出机构。

26、基金业协会、中国基金业协会：指中国证券投资基金业协会。

27、法律法规：指中华人民共和国公布实施并现行有效的法律、行政法规、司法解释、部门规章及其他对基金合同当事人有约束力的规范性文件（包括但不限于监管机构、交易所、证券登记结算机构、行业协会、银行间市场等机构制订的业务规则）以及对于上述法律法规的修改和补充等。

三、声明与承诺

（一）基金管理人的声明与承诺

1、基金管理人已在基金业协会登记为私募基金管理人，登记编码为P1031409。

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、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私募投资基金投资风险并承担投资行为可能出现的损失。

3、基金管理人保证已在签订本基金合同前充分地向基金投资者说明了有关法律法规和相关投资工具的运作市场及方式，同时揭示了相关风险。

4、基金管理人承诺已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已进行了充分评估。

5、基金管理人承诺遵循专业化运营原则，不从事与私募投资基金有利益冲突的业务，并承诺按照恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，履行受托管理职责，不将应当履行的受托人责任转委托。

6、基金管理人承诺不对基金活动的盈利性和最低收益、本金不受损失作出承诺，或限定损失金额和比例；不通过设置增强资金、费用返还等方式调节基金收益或亏损，不以自有资金认购的基金份额先行承担亏损的形式提供风险补偿，变相保本保收益。

7、基金管理人承诺其管理的每只基金的资金单独管理、单独建账、单独核算，不开展或者参与任何形式的“资金池”业务，不存在短募长投、期限错配、分离定价、滚动发行、集合运作等违规操作。基金管理人承诺不在本基金内部设立由不同投资者参与并投向不同资产的投资单元/子份额，规避备案义务，不公平对待投资者。

8、基金管理人承诺已向基金投资者明确介绍基金托管人所承担的职责与义务，未对基金托管人所承担的责任进行虚假宣传，不以基金托管人名义或利用基金托管人的商誉进行非法募集资金、承诺投资收益等违规活动。

9、基金管理人承诺本基金未违反与本基金投资运作相关的法律法规的要求。

（二）基金托管人的声明与承诺

1、基金托管人承诺按照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则安全保管本基金财产，并履行本基金合同约定的其他义务，但基金托管人的声明与承诺不构成对基金管理人投资能力的保证，也非对基金财产本金或收益作出保证或承诺。

2、基金托管人不承担任何因基金管理人投资所产生的有关责任，也不承担本基金投资产生的任何风险及损失。基金管理人违背基金合同或相关法律文件的约定、处理基金事务不当使基金财产受到损失的，基金托管人不承担任何责任。

3、基金托管人对本基金投资行为相关的尽职调查、风险评估、投资决策、投后管理或其投资回报不承担任何责任。

（三）基金投资者的声明与承诺

1、基金投资者承诺其为符合法律法规和监管机构规定的合格投资者。

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

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

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

5、基金投资者承诺委托资金的来源及用途合法，未非法汇集他人资金投资本基金，未使用贷款、发行债券等筹集的非自有资金参与本基金，不以非法拆分转让为目的购买本基金。

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

7、基金投资者知悉并同意，本基金运作过程中应缴纳的增值税等税费，按照国家法律法规，以基金管理人的名义缴纳，但由本基金资产承担。

四、私募基金的基本情况

（一）私募基金的名称

开元恒利2号私募证券投资基金。

（二）私募基金的类型

固定收益类证券投资基金。

（三）私募基金的运作方式

契约型开放式。

（四）私募基金的计划募集总额

本基金计划募集40,000万元，具体以实际募集金额为准。

（五）私募基金的投资目标和投资范围

详见本基金合同“十一、私募基金的投资”章节。

（六）私募基金的存续期限

本基金存续期为240个月，如本基金存续期届满最后一日为非工作日，则本

基金存续期顺延至下一工作日。

（七）私募基金份额的初始募集面值

本基金基金份额的初始发售面值为人民币 1.00 元。

（八）私募基金的结构化安排

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。

（九）私募基金的托管事项

本基金的托管机构为：华泰证券股份有限公司。

（十）私募基金服务业务事项

本基金聘请的基金服务机构为：华泰证券股份有限公司。

私募基金服务业务登记编码为：A00004。

（十一）其他需要订明的内容

无。

五、私募基金的募集

（一）私募基金的募集机构

本基金的募集机构为基金管理人或受基金管理人委托的销售机构。通过销售机构募集的，销售机构的具体名单以基金管理人届时发布的募集机构相关公告为准。

（二）私募基金的募集对象

本基金仅向符合《私募办法》规定的合格投资者募集。

（三）私募基金的募集方式

本基金以非公开方式进行募集。

（四）私募基金的募集期限

本基金募集期限的具体时间由基金管理人确定，基金投资者可在募集期限内的工作日认购本基金。基金管理人有权根据本基金销售实际情况履行相关程序后适当延长或提前结束募集，此类变更适用于本基金所有募集机构。

本基金的起始发售日期由基金管理人发布通知，即视为履行了信息披露义务；本基金的截止发售日期以基金管理人发布成立公告为准，基金管理人发布成立公告即视为履行了信息披露义务，自公告所载日期之日起不再接受认购申请。

（五）私募基金份额的认购

1、基金投资者认购本基金的最低金额

基金投资者在基金募集期间的净认购金额不得低于 100 万元人民币（不含认购费（如有）），并可多次认购，基金募集期间追加净认购金额应不低于 1 万元人民币（不含认购费（如有））。

《募集办法》第三十二条约定的机构或个人可不受上述最低认购金额的限制。

2、基金份额持有人的人数上限

基金份额持有人人数上限为 200 人。

3、私募基金份额的认购费用

本基金无认购费。

通过销售机构指定的销售网点进行认购，认购费用（如有）以销售协议的约定为准。

4、私募基金募集期间利息的处理方式

基金投资者的认购参与款项（含认购费用（如有））在基金成立前产生的利息按照人民银行同期人民币活期存款基准利率计算，在基金成立后归入基金资产，具体金额以份额登记机构的记录为准。

5、私募基金份额的计算

本基金采用金额认购的方式。认购份额的计算方式如下：

认购份额 = 净认购金额 / 基金份额初始面值

上述认购份额的计算保留到小数点后2位，小数点2位以后的部分四舍五入，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

6、认购资金的交付

认购资金应以人民币货币资金形式交付，通过基金管理人认购的基金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募集结算资金专用账户。通过销售机构认购的基金投资者以销售机构相关约定为准。本基金不接受现金方式认购。

（六）私募基金募集期间的认购程序

1、认购程序

基金投资者办理认购业务时应提交的文件和办理手续、办理时间、处理规则等在遵守本基金合同约定的前提下,以基金管理人或各销售机构的具体规定为准。

2、认购申请的确认

募集机构受理认购申请并不表示对该申请是否成功的确认,而仅代表募集机构确实收到了认购申请。认购申请采取时间优先的原则进行确认,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。申请是否有效应以份额登记机构的确认并且基金成立为准。基金投资者应在本基金成立后到基金管理人或各销售网点处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投资者协商处理。

(七) 基金募集期间资金的管理

募集机构或相关合同约定的责任主体应当开立私募基金募集结算资金专用账户,本基金募集期间基金投资者的初始认购资金应当存入该专用账户,该账户仅用于本基金募集期间和存续期间认购、申购和赎回等资金的归集与支付,在基金募集行为结束前,该账户的资金任何机构和个人不得动用。私募基金募集结算资金专用账户由基金管理人开立或由基金管理人委托的基金服务机构开立或指定,并由基金管理人管理或委托基金服务机构管理。

基金募集期间届满或提前终止募集,且基金金额、基金份额持有人人数符合相关法律法规及本基金合同的约定,基金管理人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账户。

若基金募集期限届满,未能达到基金备案的条件或未在法律法规或合同约定时间内备案,由基金管理人按规定办理退款等事宜。

1、基金管理人直销

基金投资者通过基金管理人认购基金的,应将认购款划入如下基金募集结算资金专用账户:

账户名称: 开元恒利 2 号私募证券投资基金募集专户

账户号码: 32090192003970

账户开户行: 交通银行股份有限公司江苏省分行营业部

基金投资者将委托资金划入本基金募集专户的汇出账户为基金投资者收益账户,本基金向基金投资者分配收益、给付赎回款项以及分配基金清算后的剩余

基金财产等，资金将从募集专户原路返还至基金投资者收益账户。

2、募集结算资金专用账户的监督

本基金募集结算资金专用账户由华泰证券股份有限公司进行监督，基金管理人应向基金业协会报送本基金募集结算资金专用账户及其监督机构。监督机构承担保障本基金募集结算资金划转安全的连带责任。

监督机构对本基金募集专户的监督范围不包括代销机构归集基金投资者募集资金，代销机构向基金投资者划付其收益、赎回款项及剩余基金财产，以及代销归集户向募集账户进行资金划转等的行为，前述代销机构行为涉及的资金划转安全保障职责按照代销相关法律法规及协议约定由相应主体承担责任。

（八）基金投资者投资冷静期及回访确认

1、基金管理人为基金投资者设置二十四小时的投资冷静期，冷静期自基金合同签署完毕且基金投资者交纳认/申购基金的款项后起算，募集机构在投资冷静期内不得主动联系基金投资者。基金投资者在投资冷静期内，有权主动联系基金管理人解除基金合同。

2、基金管理人或基金管理人委托的销售机构应当在投资冷静期满后，指令其机构从事基金销售推介业务以外的人员以录音电话、电邮、信函等适当方式进行投资回访，回访过程不得出现诱导性陈述。募集机构在投资冷静期内进行的回访确认无效。

3、未经回访确认成功，基金投资者交纳的认购基金款项不得由募集专户划转到基金托管账户，基金管理人不得投资运作基金投资者交纳的认购及申购基金款项。

4、投资冷静期及回访确认相关义务由基金管理人或其委托的销售机构负责履行，与基金托管人无关。因基金管理人或其委托的销售机构未履行或履行不当投资冷静期及回访相关义务而导致本基金不成立或给基金投资者造成任何损失的，基金托管人不承担任何责任。

5、基金投资者属于以下情形的，可以不适用本基金合同有关投资冷静期、回访确认的约定：

- （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私募基金产品；

- (3) 受国务院金融监督管理机构监管的金融产品；
- (4) 投资于所管理私募基金的基金管理人及其从业人员；
- (5) 专业投资机构；
- (6) 法律法规、中国证监会和中国基金业协会规定的其他基金投资者。

六、私募基金的成立和备案

（一）私募基金合同的签署方式

本基金合同可采用纸质或电子的方式进行签署。

（二）私募基金的成立

本基金募集结束后，基金管理人将全部募集资金划入基金财产托管账户。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。

基金管理人向基金份额持有人和基金托管人发送基金成立的通知，基金成立。本基金的成立日期以基金管理人向基金份额持有人和基金托管人发送的基金成立通知所载日期为准。

基金托管人自基金成立之日开始履行托管人职责。

（三）私募基金的备案

基金管理人应当在基金募集完毕后 20 个工作日内，按照基金业协会相关规定履行基金备案手续。本基金在中国基金业协会完成备案后方可进行投资运作，但在本基金完成备案前，可以以现金管理为目的，投资于银行活期存款、国债、中央银行票据、货币市场基金等中国证监会认可的现金管理工具。

基金投资者可在本基金完成备案后通过中国基金业协会网站（www.amac.org.cn）查询本基金公示信息。

（四）私募基金募集失败的处理

1、募集期满，不能满足基金成立的条件，或因重大违法违规事项导致基金募集行为被监管机构终止的，则基金募集失败。基金管理人应公告基金募集失败，并应当承担下列责任：

（1）以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用；

（2）在募集期届满后 30 日内返还基金投资者已缴纳的款项，并加计银行人民币同期活期存款利息。具体以份额登记机构记录为准。

2、本基金募集失败后，基金管理人应将基金托管人已盖章的基金合同及其

他相关协议原件在基金募集期限届满后 10 日内如数返还基金托管人。未能如数返还的，应向基金托管人书面说明原因、去向并加盖公章。基金管理人应勤勉对待基金托管人已盖章的基金合同及其他相关协议的回收工作，此项义务不因基金管理人的书面说明而免除。

七、私募基金的申购、赎回与转让

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

本基金的申购和赎回将通过募集机构办理。本基金的募集机构包括基金管理人和基金管理人委托的销售机构，基金管理人可根据情况变更或增减销售机构，并予以公告。

（二）申购与赎回的开放日及时间

1、本基金无封闭期，按下列规则开放：

本基金的开放日为每周三开放申购和赎回，遇非工作日顺延。

基金存续期间内，因法律、法规或监管规定发生变化、基金合同修订等原因，基金管理人可设置临时开放日进行赎回，临时开放日不得进行申购，具体开放日期以基金管理人公告或通知为准。基金管理人应不迟于该临时开放日前一交易日 15:00 前及时通过邮件、短信等方式提前向基金投资者披露，并及时通知基金托管人及服务机构。基金托管人和服务机构不审核、不监督基金管理人是否按照约定方式及时、真实、准确、完整通知基金投资者临时开放日事宜，因基金管理人未及时通知基金投资者临时开放日而导致的损失，由基金管理人承担相应责任，基金托管人和服务机构不承担责任。

2、本基金投资者在开放日或者开放日前一工作日办理基金份额的申购或赎回业务的，具体办理时间以上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间为准，但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或本基金合同的约定公告暂停申购、赎回时除外。

3、基金合同生效后，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应提前三个工作日公告告知基金份额持有人，基金管理人在网站公告前述调整事项即视为履行了告知义务。

4、如基金投资公允价值难以确定的投资品种，基金管理人有权决定是否临时封闭运作。如封闭运作的，基金管理人应出具本基金临时封闭的公告，基金管理人在开放日前三个工作日通过本基金合同约定的方式进行公告即视为对基金份额持有人履行了告知义务，同时基金管理人需通知基金托管人与基金服务机构。若因本基金临时封闭而引起纠纷或对基金份额持有人造成损失，由基金管理人承担相应责任，基金托管人与基金服务机构不承担责任。

（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K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、按照“时间优先、金额优先”的原则，接受全部基金投资者或者基金份额持有人的申购申请，并保持基金份额持有人累计不超过200人。

4、基金份额持有人赎回基金时，按照“先进先出”的原则，依据基金份额持有人认购、申购和红利再投资基金份额的先后次序进行顺序赎回。

5、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。对于除专业投资机构以及法律法规、中国证监会、基金业协会规定的不适用冷静期及回访的基金投资者以外的其他基金投资者，申购申请撤销以募集机构的具体规定为准。

6、基金投资者办理申购、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基金合同约定的前提下，以募集机构的具体规定为准。

7、申购与赎回申请的确认

募集机构受理申购、赎回申请并不表示对该申请是否成功的确认，仅代表募集机构确实收到了申请，申请是否有效以份额登记机构的确认结果为准。

份额登记机构应在法律法规规定的时限内对基金投资者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，份额登记机构在K+2日进行确认，基金投资者可在K+3日后(含该日)到募集机构网点柜台或通过与募集机构约定的其他方式查询申请的确认情况。若申购不成功，则申购款项退还给基金投资者。

8、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，为

无效申请，已交付的委托款项将退回基金投资者自有资金银行账户；有效申购款应于K+3日内划入基金财产托管账户。

基金份额持有人赎回申请提交后，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K+3日内划出基金财产托管账户，于K+7日内支付给基金份额持有人，若因托管账户资金不足导致划款延迟，基金管理人应及时告知基金份额持有人，由此造成的损失由基金管理人承担。在发生巨额赎回时，赎回款项的支付按有关法律法规规定和本基金合同约定处理。

9、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规则，但最迟应在新的规则实施前3个工作日告知基金份额持有人，基金管理人在网站公告前述调整事项即视为履行了告知义务。

（四）申购与赎回的金额限制

1、基金投资者在基金存续期开放日购买基金份额的，首次购买金额应不低于100万元人民币（不含认/申购费（如有）），且符合合格投资者标准，已持有基金份额的基金份额持有人在存续期开放日追加购买基金份额的除外。

2、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1万元人民币（不含申购费（如有））。

3、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，基金份额持有人在部分赎回申请确认后持有的基金资产净值不得低于100万元人民币。当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，基金管理人将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。如发生巨额赎回比例确认时，参照本基金合同巨额赎回条款执行。

4、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。

5、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。

6、基金业协会《募集办法》第三十二条列明的基金投资者可不适用以上第 1、3、4 项的约定。

（五）申购与赎回的费用

1、申购费用

本基金无申购费。

2、赎回费用

本基金无赎回费。

3、申购费用（如有）和赎回费用（如有）均归基金管理人所有，基金管理人有权减免。

通过销售机构指定的销售网点进行申购及赎回，申购费用（如有）及赎回费用（如有）以销售协议的约定为准。

（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 K 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（如有） - 业绩报酬（如有）

赎回价格为开放日 K 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 30%，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 30%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,确定当日受理的赎回份额(以下称巨额赎回比例确认);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撤销。延期赎回的申请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;延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理,无优先权。

当发生部分延期赎回时,基金管理人应当及时公告告知基金份额持有人。

(3) 当发生巨额赎回比例确认时,如基金份额持有人全部赎回,则对基金份额持有人全部资产做比例确认。如基金份额持有人部分赎回,则对基金份额持有人申请赎回部分和资产净值高于 100 万元部分孰低作比例确认。

(八) 拒绝或暂停申购、暂停或延缓赎回的情形及处理

1、当发生以下情形之一时,基金管理人可以拒绝接受基金投资者的申购申请:

(1) 基金份额持有人已达到 200 名;

(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基金合同约定的上限;

(4) 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现有基金份额持有人利益的;

(5) 证券/期货经纪服务机构未及时提供估值所需资料,导致基金管理人或其委托的基金服务机构、基金托管人于开放日无法对基金资产估值的情形;

(6) 因不可抗力导致基金无法正常运作的；

(7) 法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

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

2、当发生以下情形之一时，基金管理人可以暂停接受基金投资者的申购申请：

(1) 因不可抗力导致无法受理基金投资者的申购申请；

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

(3) 发生本基金合同约定的暂停基金资产估值情况；

(4) 基金管理人、基金托管人、募集机构、证券/期货经纪服务机构或份额登记机构的技术故障等异常情况导致基金销售系统或基金份额登记系统或基金会计系统无法正常运行；

(5) 法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一且基金管理人决定暂停接受全部或部分申购申请时，基金管理人应当及时告知基金投资者。

在暂停申购的情形消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理并告知基金投资者。

3、当发生以下情形之一时，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：

(1) 因不可抗力导致基金管理人无法支付赎回款项；

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

(3) 发生本基金合同约定的暂停基金资产估值的情况；

(4) 连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回；

(5) 若继续接受赎回申请将损害现有基金份额持有人利益；

(6) 法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一且基金管理人决定暂停或延缓接受赎回申请时，基金管理人应当及时告知基金份额持有人。

在暂停或延缓赎回的情况消除时，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。

（九）基金份额的转让

在法律法规及监管机构允许的情形下，本基金份额持有人可以通过协议转让以及中国证监会认可的其他方式向符合条件的合格投资者转让其持有的基金份额，份额转让应遵守交易场所规则及基金管理人、份额登记机构的要求，并按规定办理份额变更登记手续。转让期间及转让后，持有基金份额的合格投资者数量合计不超过法定人数。

（十）基金份额的非交易过户

基金份额登记机构只受理继承和司法强制执行而产生的非交易过户以及份额登记机构认可、符合法律法规的其它非交易过户。无论在上述何种情况下，接受划转的主体必须是依法可以持有本基金的合格投资者。

继承是指基金份额持有人死亡或被人民法院宣告死亡的，其持有的基金份额由其合法的继承人继承；司法强制执行是指司法机构依据生效司法文书将基金份额持有人持有的基金份额强制划转给其他自然人、法人或其他组织。办理非交易过户必须按照基金份额登记机构的要求提供相关资料，对于符合条件的非交易过户申请按基金份额登记机构的规定办理，并收取相应费用。

（十一）基金份额的冻结与解冻

基金份额登记机构只受理国家有权机关依法要求的，以及份额登记机构认可或符合法律法规的其他情况下的基金份额的冻结与解冻。基金账户或基金份额被冻结的，被冻结部分产生的权益一并冻结，被冻结部分份额仍然参与收益分配与支付，但法律法规、中国证监会或法院判决、裁定另有规定的除外。

当基金份额处于被冻结状态时，基金份额登记机构或其他机构应拒绝该被冻结的基金份额的赎回、转让等业务。

（十二）基金份额的质押

本基金的基金份额不得用于质押。

八、当事人及权利义务

本基金合同各当事人的基本情况于本基金合同文首载明。

（一）基金管理人的权利义务

1、基金管理人的权利包括但不限于：

- (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) 基金管理人为保护基金投资者权益,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) 选择、更换会计师事务所、律师事务所或其他为本基金提供服务的外部机构,并对外部机构的服务行为进行必要的监督;
- (8) 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,并对销售机构的募集行为进行必要的监督;
- (9) 法律法规、中国证监会、中国基金业协会规定及本基金合同约定的其他权利。

2、基金管理人的义务包括但不限于：

- (1) 履行基金管理人登记和私募基金的备案手续;
- (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,对基金投资者的风险识别能力和风险承受能力进行评估,向符合法律法规规定的合格投资者非公开募集资金;
- (4) 制作风险揭示书,向基金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,并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，为本人或者基金投资者以外的人牟取利益，进行利益输送，不得委托第三人运作基金财产；

(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份额登记业务时，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基金份额持有人和基金托管人的监督；

(10) 按照基金合同约定及时向基金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；

(11) 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；

(12) 按照基金合同约定计算并向基金投资者披露基金份额净值或投资收益情况；

(13) 根据法律法规与基金合同的约定，对基金份额持有人进行必要的信息披露，揭示基金资产运作相关重大事项，包括且不限于触及基金止损线或预警线、基金收益分配事项变更、基金存续期变更或展期等情况；

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

(15) 本基金投资于基金管理人、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或者承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，基金管理人应当建立健全内部审批机制和评估机制，并向基金投资者充分披露信息；

(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 10 年；

(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基金收益分配方案，及时向基金投资者分配收益；

(20) 在兑付受托资金及收益时，应当保证受托资金及收益返回基金投资者的原账户、同名账户或者合同约定的受益人账户；

(21) 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；

(22) 建立、保存基金份额持有人名册，并及时更新，按规定向基金托管人提供；

(23) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国基金业协会并通知基金托管人和基金份额持有人；

(24) 确保本基金宣传资料真实、准确、完整，不得进行虚假宣传；

(25) 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；

(26) 审核本基金合同及相关附件中基金投资者的签章及提供的相关材料，确保上述材料的真实性、完整性、准确性、有效性，履行投资者适当性审查义务；

(27) 按照基金合同的约定，召集基金份额持有人大会；

(28) 履行法律法规规定的反洗钱义务，并配合基金托管人履行法律法规规定的基金托管人作为金融机构应履行的反洗钱义务；

(29) 对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；如基金管理人被注销登记，仍应当根据《基金法》、基金业协会相关自律规则的规定和本基金合同的约定，妥善处置基金财产，依法保障投资者的合法权益；

(30) 法律法规、中国证监会、中国基金业协会规定及本基金合同约定的其他义务。

(二) 基金托管人的权利义务

1、基金托管人的权利包括但不限于：

(1) 按照本基金合同的约定，及时、足额获得基金托管费用；

(2) 按照法律法规规定和基金合同约定，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法律法规规定和基金合同约定，对基金财产及其他

当事人的利益造成重大损失的情形,有权报告中国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,除法律法规另有规定外,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;

(4) 如基金管理人未按相关法律法规的规定办理本基金的备案手续,基金托管人有权提前终止其在本基金合同项下的法律关系;

(5) 法律法规、中国证监会、中国基金业协会规定及基金合同约定的其他权利。

2、基金托管人的义务包括但不限于:

(1) 按照诚实信用、勤勉尽责的原则安全保管基金财产;

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

(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) 按规定开设和注销基金财产托管账户等投资所需账户;

(6) 复核基金份额净值;

(7) 办理与基金托管业务有关的信息披露事项;

(8) 根据相关法律法规规定和基金合同约定复核基金管理人编制的基金定期报告;

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

(10) 根据法律法规规定,妥善保存基金管理业务活动有关合同、协议、凭证等文件资料;

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

(12) 保守商业秘密,除法律法规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) 监督基金管理人的投资运作，发现基金管理人的投资指令或清算指令违反法律法规的规定及基金合同约定的，应当拒绝执行，立即通知基金管理人；发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律法规的规定及基金合同约定的，应当立即通知基金管理人；

(15) 按照基金合同约定制作相关账册并与基金管理人核对；

(16) 法律法规、中国证监会、中国基金业协会规定及本基金合同约定的其他义务。

(三) 基金份额持有人的权利义务

1、基金份额持有人的权利包括但不限于：

(1) 取得基金财产收益；

(2) 取得分配清算后的剩余基金财产；

(3) 按照基金合同的约定申购、赎回和转让基金份额；

(4) 根据基金合同约定，参加或申请召集基金份额持有人大会，行使相关职权；

(5) 监督基金管理人履行其投资管理义务、基金托管人履行其托管义务的情况；

(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、中国基金业协会规定及本基金合同约定的其他权利。

2、基金份额持有人的义务包括但不限于：

(1) 认真阅读基金合同，保证投资资金的来源及用途合法；

(2) 接受合格投资者确认程序，如实填写风险识别能力和承担能力调查问卷，如实承诺资产或者收入情况，并对其真实性、准确性和完整性负责，承诺为合格投资者；

(3) 以合伙企业、契约等非法人形式汇集多数基金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，但符合法律法规规定的除外；

(4) 认真阅读并签署风险揭示书；

(5) 基金份额持有人为个人投资者的, 保证基金合同为本人签署; 基金份额持有人为机构投资者的, 保证其经办人享有签署包括本基金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;

(6) 按照基金合同约定缴纳基金份额的认购、申购款项, 承担基金合同约定的管理费、托管费及其他相关费用;

(7) 在持有的基金份额范围内, 按照基金合同的约定承担基金投资损失的有限责任;

(8) 向基金管理人或基金销售机构提供法律法规规定的真实、准确、完整、充分的信息资料及身份证明文件, 配合基金管理人或基金销售机构的尽职调查与反洗钱工作;

(9) 保守商业秘密, 不得泄露基金的投资计划或意向等;

(10) 不得违反基金合同的约定干涉基金管理人的投资行为;

(11) 不得从事任何有损基金及其基金投资者、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;

(12) 谨慎关注自己的基金财产变动情况, 保持自己的电话、电子邮件等通讯方式畅通, 通讯地址有效, 并及时通过有效方式查阅公告;

(13) 申购、赎回、分配等基金交易及清算过程中因任何原因获得的不当得利, 应予以返还;

(14) 法律法规、中国证监会、中国基金业协会规定及本基金合同约定的其他义务。

九、基金份额持有人大会及日常机构

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

(一) 召开事由

当出现或需要决定下列事由之一的, 应当召开基金份额持有人大会:

- 1、决定延长基金合同期限;
- 2、决定修改基金合同的重要内容或者提前终止基金合同;

- 3、更换基金管理人；
- 4、更换基金托管人；
- 5、提高基金管理人、基金托管人的报酬标准；
- 6、提请聘用、更换投资顾问或提高投资顾问报酬；
- 7、变更基金份额持有人大会程序；
- 8、转换基金运作方式；
- 9、基金合同约定的其他情形。

针对上述所列事项，基金份额持有人以书面形式一致表示同意的，可以不召开基金份额持有人大会直接作出书面决议，并由全体基金份额持有人在书面决议文件上签名或盖章。

(二) 本基金未设立基金份额持有人大会的日常机构，今后如需设立基金份额持有人大会的日常机构，按照相关法律法规的规定执行。

(三) 会议召集人及召集方式

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、代表基金份额 30%以上（含 30%）的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会的，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 个工作日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 30 个工作日内召开；基金管理人决定不召集，代表基金份额 30%以上（含 30%）的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起 10 个工作日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 30 个工作日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合；

3、基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，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 个工作日内决定是否召集，并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 30 个工作日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当由基金托管人自行召集，并自出具书面决定之日起 30 个工作日内召

开并告知基金管理人，基金管理人应当配合；

4、代表基金份额 30%以上（含 30%）的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，单独或合计代表基金份额 30%以上（含 30%）的基金份额持有人有权自行召集，并至少提前 30 个工作日通知基金管理人和基金托管人。基金份额持有人自行召集基金份额持有人大会的，基金管理人、基金托管人应当配合，不得阻碍、干扰；

5、若出现基金管理人被基金业协会公告失联超过 20 个工作日的情形，代表基金份额 30%以上（含 30 %）的基金份额持有人有权自行召集份额持有人大会；

6、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。

（四）召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

1、召开基金份额持有人大会，召集人应于会议召开前 10 个工作日，按本基金合同约定的信息披露渠道进行公告。基金份额持有人大会通知应至少载明以下内容：

（1）会议召开的时间、地点和会议形式；

（2）会议拟审议的事项、议事程序和表决方式；

（3）有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日；

（4）授权委托证明的内容要求（包括但不限于代理人身份，代理权限和代理有效期限等）、送达时间和地点；

（5）会务常设联系人姓名及联系电话；

（6）出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；

（7）召集人需要通知的其他事项。

2、采取通讯开会方式并进行表决的情况下，由会议召集人在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表决意见寄交的截止时间和收取方式。

3、如召集人为基金管理人，则应另行书面通知基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为基金托管人，则应另行书面通知基金管理人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为基金份额持有人，则应另行书面通知基金管理人和基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督。基金

管理人或基金托管人拒不派代表对书面表决意见的计票进行监督的,不影响表决意见的计票效力。

(五) 基金份额持有人出席会议的方式

基金份额持有人大会可通过现场开会方式或通讯开会方式等法律法规或监管机构允许的其他方式召开,会议的召开方式由会议召集人确定。

1、现场开会。由基金份额持有人本人出席或以代理投票授权委托证明委派代表出席,现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当列席基金份额持有人大会,基金管理人或基金托管人不派代表列席的,不影响表决效力。现场开会同时符合以下条件,可以进行基金份额持有人大会议程:

(1) 亲自出席会议者持有的基金份额凭证、受托出席会议者出具的基金份额持有人持有的基金份额凭证及基金份额持有人的代理投票授权委托证明符合法律法规、基金合同和会议通知的规定,并且持有的基金份额凭证与基金管理人持有的登记资料相符;

(2) 经核对,汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示,有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的三分之二(含三分之二)。若到会者在权益登记日代表的有效的基金份额少于本基金在权益登记日基金总份额的三分之二,召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的1个月以后、3个月以内,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,到会者在权益登记日代表的有效的基金份额应不少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一(含二分之一)。

2、通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以书面形式在表决截止日以前送达召集人指定的地址。通讯开会应以书面方式进行表决。

在同时符合以下条件时,通讯开会的方式视为有效:

(1) 召集人按基金合同约定公布会议通知后,在2个工作日内连续公布相关提示性公告;

(2) 召集人按基金合同约定通知基金托管人(如果基金托管人为召集人,则为基金管理人)到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。召集人在基金托管人(如果基金托管人为召集人,则为基金管理人)监督下按照会议通知规定的方式收取基金份额持有人的书面表决意见;基金托管人或基金管理人经通知不参

加收取书面表决意见的，不影响表决效力；

(3) 直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的，基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日基金总份额的三分之二（含三分之二）。若直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见，基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日基金总份额的三分之二，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的1个月以后、3个月以内，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应当有代表二分之一以上（含二分之一）基金份额的持有人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见；

(4) 上述第(3)项中直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的代理人，同时提交的持有的基金份额凭证、受托出具书面意见的代理人出具的基金份额持有人持有的基金份额凭证及基金份额持有人的代理投票授权委托证明符合法律法规、基金合同和会议通知的规定，并与基金份额登记机构记录相符。

3、在不与法律法规冲突的前提下，基金份额持有人大会可通过网络、电话或其他方式召开，基金份额持有人可以采用书面、网络、电话、短信、微信或其他方式进行表决，具体方式由会议召集人确定并在会议通知中列明。

4、基金份额持有人授权他人代为出席会议并表决的，授权方式可以采用书面、网络、电话、短信、微信或其他方式，具体方式在会议通知中列明。

(六) 议事内容与程序

1、议事内容及提案权

议事内容为关系基金份额持有人利益的重大事项，如基金合同的重大修改、决定提前终止基金合同或延长基金合同期限、更换基金管理人、更换基金托管人、法律法规及基金合同约定的其他事项以及会议召集人认为需提交基金份额持有人大会讨论的其他事项。

基金份额持有人大会的召集人发出召集会议的通知后，对原有提案的修改应当在基金份额持有人大会召开前及时公告。

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

2、议事程序

（1）现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照下列第（八）条规定程序确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表，在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权其出席会议的代表主持；如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的 50%以上（含 50%）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人拒不出席或主持基金份额持有人大会，不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

会议召集人应当制作出席会议人员的签名册。签名册载明参加会议人员姓名（或单位名称）、身份证明文件号码、持有或代表有表决权的基金份额、基金份额持有人姓名（或单位名称）和联系方式等事项。

（2）通讯开会

在通讯开会的情况下，首先由召集人提前 10 个工作日公布提案，在所通知的表决截止日期后 2 个工作日内，由召集人统计全部有效表决，在基金管理人或基金托管人的监督下形成决议。

（七）表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

1、一般决议，一般决议须经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的 50%以上（含 50%）通过方为有效。除下列第 2 项所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过。

2、特别决议，特别决议须经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方为有效。转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、提前终止基金合同或延长基金合同期限以特别决议通过方为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则提交符合会议通知中规定的确认基金份额持有人身份的文件视为有效身份文件，表面

符合会议通知规定的书面表决意见视为有效表决,表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决,但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

基金份额持有人大会的各项提案或同一项提案内并列的各项议题应当分开审议、逐项表决。

(八) 计票

1、现场开会

(1) 如大会由基金管理人或基金托管人召集,基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中选举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人;如大会由基金份额持有人自行召集或大会虽然由基金管理人或基金托管人召集,但是基金管理人或基金托管人未出席大会的,基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中选举三名基金份额持有人代表担任监票人;

(2) 监票人应当在基金份额持有人表决后立即进行清点并由大会主持人当场公布计票结果;

(3) 如果会议主持人或基金份额持有人或代理人对于提交的表决结果有怀疑,可以在宣布表决结果后立即对所投票数要求进行重新清点。监票人应当进行重新清点,重新清点以一次为限。重新清点后,大会主持人应当当场公布重新清点结果;

(4) 基金管理人或基金托管人拒不出席大会的,不影响计票的效力。

2、通讯开会

在通讯开会的情况下,计票方式为:由大会召集人授权的两名监督员进行计票。

(九) 生效与公告

基金份额持有人大会决定的事项自表决通过之日起生效,并在生效之日起5个工作日内由基金管理人通过本合同约定的方式通知基金份额持有人、基金托管人和其他相关当事人。

如果采用通讯方式进行表决,在公告基金份额持有人大会决议时,必须将公

证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。

基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会的决议。生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人、基金托管人均有约束力。

（十）本部分关于基金份额持有人大会召开事由、召开条件、议事程序、表决条件等规定，凡是直接引用法律法规或监管规则的部分，如将来法律法规或监管规则修改导致相关内容被取消或变更的，基金管理人与基金托管人协商一致并提前公告后，可直接对本部分内容进行修改和调整，无需另行召开基金份额持有人大会审议。

（十一）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，但出现基金管理人被基金业协会公告失联超过 20 个工作日的情形除外。

十、私募基金份额的登记

（一）基金的份额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、基金份额的份额登记、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）本基金的份额登记业务由基金管理人委托华泰证券股份有限公司办理，并与其签订服务业务合作协议。

本基金份额登记机构名称：华泰证券股份有限公司

私募基金服务业务登记编码：A00004

（三）份额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、取得与份额登记服务相关的服务费用；
- 3、获得、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，制定和调整份额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）份额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份额登记业务；

- 2、按照法律法规和基金合同约定办理基金的份额登记业务；
- 3、保存基金份额持有人名册及相关的申购、赎回业务记录 20 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，但司法强制检查等法律法规规定的情形除外；
- 5、按基金合同约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。

（五）本基金全体基金份额持有人同意基金管理人、份额登记机构或其他份额登记义务人按照中国基金业协会规定办理基金份额登记数据的备份。

（六）基金服务机构在份额登记过程中，因违法违规、违反服务协议、技术故障、操作失误等原因给基金财产造成损失的，基金管理人应承担的向基金合同其他当事人的先行赔偿责任并不因此而免除。基金管理人可按照服务协议约定与服务机构就基金份额的份额登记错误进行责任分配与损失追偿。

（七）基金管理人委托基金服务机构办理本基金的份额登记业务，但基金管理人依法应承担的份额登记职责不因委托而免除。

十一、私募基金的投資

（一）本基金投資事項

1、投資目標

本基金通过灵活应用多种投资策略，在充分控制风险和保证基金财产流动性的基础上，追求合理的投资回报，力争实现基金财产的长期稳健增值。

2、投資方式

本基金采用直接投资方式进行投资。

3、投資範圍

（1）现金管理类金融产品：现金、银行存款（包括银行活期存款、银行定期存款和银行协议存款等各类存款）、债券逆回购、货币市场基金；

（2）债券：包括央行票据、国债、地方政府债、企业债、公司债券(含私募债)、可转债(含私募可转债)、可交换债(含私募可交换债)、中期票据、短期融资券(含超级短期融资券)、同业存单、资产支持证券、资产支持票据、项目支持票据等债券及证券化产品；

(3) 资产管理产品：包括银行理财、基金管理公司及基金子公司资产管理计划、信托计划、期货公司及其子公司资产管理计划、证券公司及其资产管理子公司资产管理计划、保险资管计划、有托管机构托管的契约型私募证券投资基金；

(4) 债券正回购（在法律法规及相关政策允许的情况下方可进行投资）。

如本基金投资资产管理产品，基金管理人应确保所投资的资产管理产品未投资或在本基金持有期内不投资除公募证券投资基金以外的资产管理产品。

4、投资策略

本基金将采取利率策略、信用策略等积极投资策略，在控制风险的前提下，发掘和利用市场失衡提供的投资机会，以实现组合增值的目标。

5、业绩比较基准

本基金业绩比较基准为6.8%。

特别提示：该业绩比较基准仅用于本基金投资业绩的比较，并非本基金的最终收益率，更非基金管理人、基金托管人或销售机构向基金投资者保证其投资于本基金的认购资金本金不受损失或者保证其取得最低收益的承诺。本基金的收益率以实际运作情况为准。

业绩比较基准的年化收益率均单利计算。

6、投资比例及限制

(1) 本基金存续期内，基金总资产不得超过基金净资产的 200%。基金投资于其他资产管理产品时，该条投资限制由基金管理人负责监控，并承担全部责任。

(2) 本基金不得投资于资产管理产品的劣后级份额。

7、投资禁止行为

基金管理人不得利用基金财产从事下列行为或进行如下投资运作，若由此造成基金财产、合同当事人及第三方损失的，所有责任由基金管理人承担：

(1) 承销证券；

(2) 向他人贷款或提供担保，或变相从事金融机构信（存）贷业务的，或直接投向金融机构信贷资产；

(3) 从事经常性、经营性民间借贷活动，包括但不限于通过委托贷款、信托贷款等方式从事上述活动；

(4) 从事承担无限责任的投资；

(5) 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；

(6) 直接或者间接投资法律法规和国家政策禁止进行债权或股权投资的行业和领域；

(7) 与关联方进行不正当交易、利益输送、内幕交易和操纵市场，包括但不限于投资于关联方虚假项目、与关联方共同收购上市公司、向基金管理人注资等；

(8) 法律法规、中国证监会以及本基金合同约定禁止从事的其他行为。

8、基金托管人对基金管理人投资运作的监督

除相关法律法规另有规定外，基金托管人仅在其可监测的范围内对所托管基金的投资范围、投资限制承担投资监督职责。基金托管人对基金管理人进行本基金投资的监督自本基金成立之日起开始。

基金托管人投资监督的真实性、准确性、及时性和完整性受限于基金管理人及其他中介机构提供的数据和信息，合规投资的责任在基金管理人。基金托管人对上述机构提供信息的真实性、准确性、及时性和完整性不做任何担保、暗示或表示，并对上述机构提供信息的错误、遗漏或延迟所引起的损失不承担任何责任。

对于基金管理人的任何投资行为、投资策略、投资决定或由于基金产品设计缺陷或违规交易行为造成的任何损失，由基金管理人承担全部责任。

9、关联交易及处理方式

(1) 基金管理人可运用基金财产与基金管理人、基金投资者、基金管理人管理的私募基金、同一实际控制人下的其他基金管理人管理的私募基金、或者与上述主体有其他重大利害关系的关联方进行交易（下称“关联交易”），但应当符合本基金的投资目标和投资策略，遵循投资者利益优先原则和平等自愿、等价有偿的原则，防范利益冲突，建立有效的关联交易风险控制机制及健全内部审批机制与评估机制，按照市场公平合理价格执行。

(2) 基金管理人运用基金财产进行关联交易的，应建立关联交易决策机制，并采取必要的回避措施，关联方不得以任何方式干预基金管理人投资决策；基金管理人审议关联交易事项时，有利害关系的人员应当回避表决，不得代理其他人员行使表决权。

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

(4) 基金管理人运用基金财产进行关联交易前，应当将关联交易内容、关联方、处理方式等内容向基金份额持有人及基金托管人披露；在关联交易过程中，如出现可能损害投资者利益情形，应及时向基金份额持有人及基金托管人披露。基金管理人应当每季度将本基金关联交易事项向基金份额持有人及基金托管人披露。

(5) 基金投资者签署本基金合同即表明其已经知晓并认可本基金可能将进行上述关联交易事项。

10、基金的预警及止损

本基金不设置预警和止损线。

11、投资事项的变更

遵循基金份额持有人利益优先的原则下，经本基金合同当事人协商一致可对投资事项进行变更，变更投资事项应以本基金合同约定的方式进行，投资事项变更应为调整投资组合留出必要的时间。

(二) 本基金投资经理及投资顾问的指定与变更

1、投资经理

(1) 投资经理的指定

本基金投资经理由基金管理人负责指定。

(2) 投资经理基本情况

本基金投资经理为林子豪。

投资经理简历：毕业于北京理工大学，曾就职于上海诺亚财富，并在投资公司投研部担任投资经理，现任深圳开元双创基金管理有限公司投资经理。

(3) 投资经理的变更

基金管理人可根据业务需要变更投资经理，并在变更后三个工作日内通过公告的方式告知基金份额持有人、基金托管人。

基金管理人在其网站、销售机构网站公告或书面通知基金份额持有人、基金托管人前述事项即视为履行了告知义务。

2、投资顾问

本基金无投资顾问。

十二、私募基金的财产

（一）私募基金财产的保管与处分

1、私募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、基金托管人依据基金管理人的划款指令将委托资金划出托管账户后至委托财产相关投资本金及收益以现金形式划回托管账户期间，基金托管人不承担保管职责。

3、基金管理人、基金托管人可以按基金合同的约定收取管理费、托管费以及本基金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、除本款第3项规定的情形外，基金管理人、基金托管人因基金财产的管理、运用或者其他情形而取得的财产和收益，归入基金财产。

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、私募基金财产产生的债权，不得与不属于私募基金财产本身的债务相互抵销。非因私募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私募基金财产强制执行。上述债权人对私募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。

7、基金托管人仅负责保管本基金项下托管账户内的现金资产。对于本基金项下未由其保管且未受其实际控制的其他资产（包括现金类资产和非现金类资产），基金托管人不承担保管责任，且对于其安全性和完整性不承担任何责任。基金管理人负责保管本基金对外投资过程中形成的股权、债权等非现金资产及其相关权利凭证，并应及时将相关权利凭证的原件扫描件交付基金托管人。基金管理人应对本基金项下非现金资产及其相关权利凭证的安全和完整负责。除基金合同另有约定外，基金管理人不得在该等非现金资产或其权利凭证之上设置抵押、质押或其他权利负担。

（二）私募基金财产相关账户的开立和管理

基金托管人、基金管理人按照相关业务规定并依据双方所签署的基金合同，为本基金开立基金财产托管账户、证券账户和期货账户等投资所需账户。证券账户和期货账户的持有人名称和存续期限应当符合证券、期货登记结算机构等有关规定。开立的上述基金财产账户与基金管理人、基金托管人、基金销售机构和基金份额登记机构自有的财产账户以及其他基金财产账户相独立。

1、基金财产托管账户的开立和管理

（1）基金财产托管账户是指基金管理人、基金托管人为履行本基金合同由基金托管人为基金单独开立的银行结算账户。基金财产托管账户的名称应当包含“开元恒利2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，基金财产托管账户的网银客户号、机构网银登陆密码、网上银行证书等均由基金托管人保管。

（2）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，均需通过该基金财产托管账户进行。本基金财产托管账户仅限于本基金使用，仅限于满足开展本基金业务的需要。

（3）基金托管人按照规定开立基金财产托管账户，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。

（4）基金财产托管账户的开立和管理应符合有关法律法规的规定。

2、基金证券账户的开立和管理

（1）基金证券账户的开立由基金托管人负责，账户资产的管理和运用由基金管理人负责。

（2）基金托管人在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司、深圳分公司、北京分公司为基金开立基金证券账户，具体账户名称以实际开立账户为准。

（3）基金托管人按照规定开立基金证券账户，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。

（4）基金证券账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得出借或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。

3、投资银行理财的银行账户的开立和管理

因基金运作需要投资银行理财产品的，须通过本基金托管账户所在开户行开通理财交易账户购买。

4、其他账户的开立和管理

因基金投资运作需开立其他账户的，可以根据法律法规和基金合同的约定，由基金管理人与基金托管人协商后办理。负责办理开户的一方，应在相应账户开立完成后，及时以书面或其他双方认可的方式将账户信息通知另一方。基金管理人和基金托管人不得随意假借本基金的名义开立任何其他账户。法律法规等有关规定对其他相关账户的开立和管理另有规定的，从其规定办理。

十三、交易及清算交收安排

（一）选择证券、期货经纪机构的程序

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机构、期货经纪机构，并与其签订证券经纪、期货经纪相关协议，基金管理人、基金托管人和证券经纪机构、期货经纪机构可就本基金参与证券交易、期货交易的具体事项另行签订协议。

（二）清算交收安排

1、场内交易的清算交收安排

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基金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的传输与接收、场内证券交易的资金清算与交割等事项在本基金的经纪操作协议中进行约定。

本基金进行期货或贵金属投资的，有关交易数据的传输与接收、场内证券交易的资金清算与交割等事项在本基金的期货备忘录或上海黄金交易所交易品种投资操作备忘录中进行约定。

2、场外基金投资的清算交收安排

（1）场外基金申购（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连同基金合同、申购（认购）申请单及基金托管人认为必要的其他材料逐笔划付。

（2）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复印件或扫描件，并提交至基金托管人。

（3）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、基金份额配对转换确认单等），造成的估值偏差，基金管理人承担全部责任。

3、其他场外投资的清算交收安排

其他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连同必要的投资合同等划款证明文件逐笔划付。基金托管人仅对基金管理人提交的划款指令按照本基金合同的约定进行表面一致性审查，基金托管人不负责审查基金管理人发送划款指令同时提交的其他文件资料的合法性、真实性、完整性和有效性，基金管理人应保证上述文件资料合法、真实、完整和有效。如因基金管理人提供的上述文件不合法、不真实、不完整或失去效力而影响基金托管人的审核或给基金份额持有人或任何第三人带来损失，由基金管理人承担全部责任。

4、本基金投资产生的应收资产的清算交收安排

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。基金管理人应负责跟踪资金到账情况，对到账日未及时到账的，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。

5、申购、赎回款项清算交收安排

K+2 日，份额登记机构将确认的申购、赎回汇总数据向基金托管人传送，基金托管人根据确认数据进行账务处理。申购、赎回款项采用净额结算，发生净赎回时，K+3 日，基金托管人根据份额登记机构数据将申购赎回轧差后的净赎回款项及赎回费（如有）划付至基金管理人开立或指定的基金募集结算资金专用账户，基金管理人无需再出具资金划拨指令。款项自动划付后，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。基金管理人应确保托管账户资金足额，因托管账户内留存的现金不足造成的划款延迟，由基金管理人承担全部责任。

（三）资金、证券账目及交易记录的核对

1、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，确保相关各方账目相符。

2、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。

3、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。

（四）指令的发送、确认及执行

1、交易清算授权

（1）基金管理人应在基金投资运作前向基金托管人提供书面或电子基金划款指令授权书（简称“授权书”），授权书中应包括被授权人的名单、权限、签字样本或签章样本以及基金管理人预留印鉴，规定基金管理人向基金托管人发送指令时基金托管人确认有权发送指令人员身份的方法。授权书由基金管理人加盖公章并由法定代表人/执行事务合伙人或其授权代表签署，若由授权代表签署，还应附上法定代表人/执行事务合伙人的授权书。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。

（2）基金管理人撤换或更改对被授权指令发送人员的权限，必须至少提前1个工作日，使用电子方式或其他基金管理人和基金托管人认可的方式向基金托管人发送变更后的新基金划款指令授权书（简称“新授权书”），同时电话通知基金托管人。新授权书自载明的生效时间开始生效，原授权文件同时废止。

（3）基金托管人收到授权书或新授权书的日期晚于载明的生效日期的，则自基金托管人收到时生效。授权书或新授权书可以以扫描件形式发出，基金管理人与基金托管人均承认电子形式（新）授权书的法律效力，（新）授权书以电子形式发出的，基金托管人以其收到的电子形式（新）授权书作为其执行划款指令的依据。基金管理人和基金托管人对授权书负有保密义务，其内容不得向相关人员以外的任何人泄露。

2、基金划款指令的内容

基金划款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。有效基金划款指令是指指令书面要素（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、发送人员或指令签章与授权书相符、相关的指令附件齐全且头寸充足的划款指令。

3、基金划款指令的发送、确认及执行时间与程序

（1）基金划款指令的发送

基金管理人发送基金划款指令采用电子方式或基金管理人和基金托管人认可的其他方式。

（2）基金管理人应按照法律法规规定和基金合同约定，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基金合同确认后，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，基金托管人予以执行的，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，授权已更改但基金管理人未根据本基金合同通知基金托管人的情况除外。

（3）基金管理人向基金托管人发送有效基金划款指令时，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出执行指令所必需的时间（至少为2个工作小时）。在每个工作日14:30以后接收的基金管理人发出的银证、银信、银行、银期转账划款指令的，基金托管人不保证当日完成划款操作；在每个工作日16:00以后接收的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划款操作。

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）基金托管人收到基金管理人发送的指令后，应对接收到的基金划款指令形式审查是否表面一致，即验证指令的书面要素是否齐全、发送人员或指令签章是否与授权书相符，而对于基金划款指令的真实性、合法性不作审查。复核无误后依据本基金合同约定在规定期限内及时执行，不得延误。若存在异议或不符，

基金托管人应及时与基金管理人相关人员通过双方认可的方式沟通联系，并要求基金管理人重新发送经修改的指令。基金托管人可以要求基金管理人以双方认可的方式提供基金投资交易相关文件、收款账户证明文件、基金托管人认为必要的投资划款相关支持性文件，以确保基金托管人有足够的资料来判断指令的有效性。

(5) 基金管理人向基金托管人发送基金划款指令时，应确保基金财产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，并及时通知基金管理人，因不执行该指令而造成的损失，由基金管理人承担全部责任。

(6) 划款指令原件扫描件通过邮件方式发送的，则原件由基金管理人保管，基金托管人保管划款指令原件扫描件；当两者不一致时，以基金托管人收到的划款指令扫描件为准。

4、电子化指令处理

若基金管理人通过基金托管人提供的管理人服务平台等电子渠道进行指令及其他业务处理，相关业务流程及规则以相应协议内容为准，协议未约定的内容，以本基金合同约定为准。

(五) 基金托管人依法暂缓、拒绝执行基金划款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基金划款指令违反法律法规规定或基金合同约定时，不予执行，并应及时以书面或其他双方认可的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，并以书面或其他双方认可的形式与基金托管人确认，由此造成的损失由基金管理人承担。

(六) 基金管理人发送错误基金划款指令的情形和处理程序

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

(七) 相关责任

基金托管人正确执行基金管理人发送的有效划款指令，基金财产发生损失的，基金托管人不承担任何形式的责任。在正常业务受理渠道和指令规定的时间内，因基金托管人原因未能及时或正确执行有效划款指令而导致基金财产受

损的，基金托管人应承担相应的责任，但基金财产托管账户及其他账户余额不足或基金托管人遇到不可抗力情况除外。

如果基金管理人的划款指令存在事实上未经授权、欺诈、伪造、变造等非基金托管人原因造成的情形时，只要基金托管人根据基金合同相关约定验证有关印鉴与签名无误，因基金托管人正确执行该指令而给基金管理人或基金财产或任何第三人造成的损失，由基金管理人承担全部责任，但基金托管人未尽形式审核义务执行划款指令而造成损失的情况除外。

十四、私募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、银行存款本息、应收款项和其他投资等资产及负债。

3、估值日

本基金的估值日为证券交易场所的交易日以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非交易日。

4、估值时间

基金管理人与基金托管人在每个估值日对基金财产进行估值，T+1 日完成 T 日估值。

5、估值依据

估值应符合本基金合同、《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。

6、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。

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，以最新能获取的基金份额净值估值。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、场外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；

D、场内货币 ETF 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，每日按前一交易日的万份收益计提红利，并按照中国证券登记结算有限公司数据进行现金分红或红利再投资。

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

(8) 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，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。

对于场外衍生品的估值，包括但不限于场外期权、收益互换等，其交易数据、持仓数据及估值数据等都由基金管理人指定的第三方（证券公司等交易对手方或计算方）提供。基金服务机构和基金托管人仅根据基金管理人指定的第三方（证券公司等交易对手方或计算方）提供的数据进行账务处理，对该数据真实性、有效性及基于数据产生的估值结果不承担任何责任。

(9) 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、应付利息，在结息日以实收、实付利息入账。

(10) 对于投资的基金管理公司及其子公司资产管理计划、证券公司及其子

公司资产管理计划、信托计划、保险资产管理计划、期货资产管理计划、私募投资基金、收益凭证等场外产品（以下简称“标的产品”），按如下方式进行估值：

A、如基金管理人在上述标的产品权益确认日及时提供了权益确认原始凭证，则在确认日当天以原始凭证为依据入账；如基金管理人无法在权益确认日及时提供上述产品的权益确认原始凭证，则在基金托管人确认收到原始凭证的日期进行确认；由此给基金份额持有人造成的损失，由基金管理人承担全部责任。

B、如上述产品有份额净值的，基金管理人按周（具体以实际操作为准）提供标的产品的最新份额净值，基金服务机构和基金托管人以此净值为准进行估值；如基金管理人未按约定净值提供频率提供最新份额净值，则以最近一次提供的份额净值估值；如因此造成的估值偏差，由基金管理人承担全部责任。如所投资的标的产品同时由华泰证券股份有限公司提供托管及私募基金服务业务服务的，则按估值日的当日标的产品份额净值估值。

C、如果不属于上述情况的，则基金管理人应向基金托管人提供标的产品的估值方法和估值数据，并确保提供数据的真实、完整、准确和有效。

（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。

（12）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，基金管理人需及时向基金份额持有人发布估值方法调整公告。

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，并通过积极商讨达成一致意见。

（13）相关法律法规以及监管机构有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按最新规定估值。

如基金管理人或基金托管人发现基金估值违反本基金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。基金估值核算需要的相关信息，包括但不限于场外交易信息和场外行情信息，如基金托管人无法获得，则由基金管理人负责提供，并对数据真实性、完整性、准确性和及时性负责。否则，由于上述情

况导致的估值不准确、不完整或不及时，由基金管理人承担全部责任。

7、估值程序

(1) 基金份额净值是按照每个工作日闭市后，基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算，精确到 0.0001 元，小数点后第 5 位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

(2) 基金管理人应于每个估值日对基金资产估值。但基金管理人根据法律法规或本基金合同的约定暂停估值时除外。基金管理人每 T+1 日完成对基金资产 T 日估值后，与基金托管人以约定的方式进行核对。估值原则应符合本基金合同约定及其他法律、法规的规定。

(3) 在法律法规和中国证监会允许的情况下，基金管理人和基金托管人可以各自委托服务机构进行估值，但不改变基金管理人和基金托管人对基金资产估值各自承担的责任。

8、估值错误的处理

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

本基金合同的当事人应按照以下约定处理：

(1) 估值错误类型

本基金运作过程中，如果由于基金管理人、基金托管人、证券交易所、份额登记机构、销售机构或基金投资者自身的过错造成估值错误，导致其他当事人遭受损失的，过错的责任人应当对由于该估值错误遭受损失的当事人（“受损方”）的直接损失按下述“估值错误处理原则”给予赔偿，承担赔偿责任。

基金服务机构在估值的过程中，因违法违规、违反服务协议、技术故障、操作失误等原因给基金财产造成损失的，基金管理人应承担的向基金合同的其他当事人的先行赔偿责任并不因此而免除。基金管理人可按照服务协议约定与基金服务机构就估值错误进行责任分配与损失追偿。

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

(2) 估值错误处理原则

A、估值错误已发生，但尚未给当事人造成损失时，估值错误责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正估值错误发生的费用由估值错误责任方承担；由于估值错误责任方未及时更正已产生的估值错误，给当事人造成损失的，由估值错误责任方对直接损失承担赔偿责任；若估值错误责任方已经积极协调，并且有协助义务的当事人有足够的时间进行更正而未更正，则其应当承担相应赔偿责任。估值错误责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认，确保估值错误已得到更正。

B、估值错误的责任方对有关当事人的直接损失负责，不对间接损失负责，并且仅对估值错误的有关直接当事人负责，不对第三方负责。

C、因估值错误而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但估值错误责任方仍应对估值错误负责。如果由于获得不当得利的当事人不返还或不全部返还不当得利造成其他当事人的利益损失（“受损方”），则估值错误责任方应赔偿受损方的损失，并在其支付的赔偿金额的范围内对获得不当得利的当事人享有要求交付不当得利的权利；如果获得不当得利的当事人已经将此部分不当得利返还给受损方，则受损方应当将其已经获得的赔偿额加上已经获得的不当得利返还的总和超过其实际损失的差额部分支付给估值错误责任方。

D、估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

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

F、按法律法规规定的其它原则处理估值错误。

（3）估值错误处理程序

估值错误被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

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

B、查明估值错误发生的原因，列明所有的当事人，并根据估值错误发生的原因确定估值错误的责任方；

C、根据估值错误处理原则或当事人协商的方法对因估值错误造成的损失进行评估；

D、根据估值错误处理原则或当事人协商的方法由估值错误的责任方进行更

正和赔偿损失；

E、根据估值错误处理的方法，需要修改份额登记机构交易数据的，由份额登记机构进行更正，并就估值错误的更正向有关当事人进行确认；

F、前述内容如法律法规或监管机构另有规定的，从其规定处理。

9、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) 占基金相当比例的投资品种的估值出现重大转变，而基金管理人为了保障基金份额持有人的利益，决定延迟估值的情形；

(5) 中国证监会和本基金合同认定的其它情形。

10、基金份额净值的确认

用于基金信息披露的基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人进行复核。根据相关法规，基金会计责任方为基金管理人，因此就与本基金相关的会计问题，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，以基金管理人对基金财产净值的计算结果为准。

11、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) 私募基金财产的会计政策

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、基金会计核算按照国家有关的会计制度执行。
- 5、本基金财产独立建账、独立核算。
- 6、基金管理人或其委托的基金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，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。

十五、私募基金的费用与税收

（一）基金财产支付的费用种类

- 1、基金管理人的基金管理费；
- 2、基金管理人的业绩报酬；
- 3、基金托管人的托管费；
- 4、基金服务机构的服务费；
- 5、基金销售服务费；
- 6、投资顾问费；
- 7、基金相关账户的开立及维护费用、银行汇划费用、证券、期货交易费用；
- 8、基金备案后与之相关的会计师费、律师费、仲裁费、诉讼费及因争议产生的其他合理费用；
- 9、邮寄费、通讯费、信息披露费用；
- 10、基金销售签约相关费用(包括纸质合同印刷费用、电子合同服务费用等)；
- 11、基金运营过程中发生的增值税；
- 12、基金终止时的清算费用；
- 13、基金份额持有人大会开立等相关费用；
- 14、按照国家有关规定和本基金合同约定，可以在基金资产中列支的其他费用。

（二）费用计提方法、计提标准和支付方式

- 1、基金管理人的管理费
- （1）基金管理费

基金管理费按前一日基金资产净值 0.3% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.3\% \div N$$

H：每日应计提的基金管理费

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，按日计提，按自然季支付给基金管理人。

基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在下个自然季度起按照指定的账户路径进行资金支付，直至支付完毕，基金管理人无需再出具资金划拨指令。基金管理人应确保托管账户资金足额，因托管账户内留存的现金不足造成的划款延迟，由基金管理人承担全部责任。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

（2）业绩报酬

①业绩报酬提取的时间

在基金收益分配、基金份额持有人赎回基金或者基金终止时进行业绩报酬的提取。

本基金连续两次计提业绩报酬的间隔期不应短于 3 个月，基金管理人在基金份额持有人赎回基金份额时或在本基金清盘日计提业绩报酬的，可不受上述间隔期的限制。

②业绩报酬提取的方法

业绩报酬（R）的计提方法：

如果 $r < 6.8\%$ ，则 $R=0$

如果 $r \geq 6.8\%$ ，则 $R=F \times C \times r \times 60\% \times T/365$ ，业绩报酬提取后的 r 不得低于

6.8%

$$r = \frac{C_T - C_0}{C} \times \frac{365}{T} \times 100\%$$

C_T = 本次业绩报酬计提日的份额累计单位净值

C_0 = 上一次业绩报酬计提日的份额累计单位净值；若该笔份额还未提取过业绩报酬，则为该笔份额对应的认购价格或申购时的份额累计净值

C = 上一次业绩报酬计提日的份额净值

F = 提取业绩报酬的份额

$r = \text{客户每笔份额年化收益率}$

$T = \text{上一次业绩报酬计提日至本次业绩报酬计提日的自然日天数}$ ；若该笔份额还未提取过业绩报酬，则为成立日或申购确认日至本次业绩报酬计提日的自然日天数

如果上述计算基金投资者单位基金份额获得的收益为负或者为零，则业绩报酬为零。

赎回业绩报酬从基金份额持有人赎回资金中扣除；收益分配业绩报酬从基金份额持有人收益分配资金中进行扣除（如果基金份额持有人本次收益分配的金额小于应计提的业绩报酬时，则本次计提的业绩报酬为该基金份额持有人的收益分配资金）；合同终止时业绩报酬直接从基金清算资金中扣除。上述业绩报酬在赎回基金份额、收益分配及基金终止清算后 10 个工作日内，由基金托管人根据基金管理人出具的划款指令支付给基金管理人。

注：单个基金份额持有人单笔投资业绩报酬保留到小数点后 2 位，小数点后第 3 位四舍五入。

基金管理人的管理费及业绩报酬收款账户信息如下：

户 名：深圳开元双创基金管理有限公司

账 号：1086 1000 0002 4143 8

开户银行： 华夏银行深圳分行天安支行

2、基金托管人的托管费

基金托管费按前一日基金资产净值 0.03% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.03\% \div N$$

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，按日计提，按自然季支付给基金托管人。

基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在下个自然季度起按照指定的账户路径进行资金支付，直至支付完毕，基金管理人无需再出具资金划拨指令。基金管理人应确保托管账户资金足额，因托管账户内留存的现金不足造成的划款延迟，由基金管理人承担全部责任。费用自动扣划后，基金管理人应

进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

基金托管人的托管费收款账户信息如下：

户 名：华泰证券股份有限公司

账 号：491068633089

开户银行：中国银行江苏省分行营业部

3、基金服务机构的服务费

基金服务费按前一日基金资产净值 0.02% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.02\% \div N$$

H：每日应计提的服务费

E：前一日基金资产净值

N：当年天数

基金服务费自基金成立次日起，按日计提，按自然季支付给基金服务机构。

基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在下个自然季度起按照指定的账户路径进行资金支付，直至支付完毕，基金管理人无需再出具资金划拨指令，基金管理人应确保托管账户资金足额，因托管账户内留存的现金不足造成的划款延迟，由基金管理人承担全部责任。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

基金服务机构的服务费收款账户信息如下：

户 名：华泰证券股份有限公司

账 号：491068633089

开户银行：中国银行江苏省分行营业部

4、其他费用的计提方法

基金财产托管账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账户中扣划，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，由基金托管人直接从托管账户中扣划，无须基金管理人出具指令。

上述“（一）基金财产支付的费用种类”中的其他相关费用根据有关法律法

规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

（三）不列入基金财产费用的项目

- 1、基金存续期间发生的与推广有关的费用；
- 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、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；
- 4、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）基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行，但本基金运作过程中应缴纳的增值税等以基金管理人名义缴纳的税费由本基金财产承担。基金份额持有人应自行缴纳的税收，由基金份额持有人负责，基金管理人不承担代扣代缴或纳税的义务。相关法律法规或税务机关规定基金管理人在向基金份额持有人交付利益或资产前须履行代扣代缴任何税费的，基金管理人应当按照相关规定予以代扣代缴，无需事先征得基金份额持有人的同意。如因国家税收法律、法规变化，税务监管机构要求基金管理人垫付或补缴应由本基金或基金份额持有人承担的税费，基金管理人垫付或补缴后，有权向基金份额持有人追偿。

基金增值税费自基金成立次日起，按基金管理人提供的计税方案和实际交易结果每日计提，按照计税方案中报税频率支付。由基金管理人在基金增值税按报税频率结转后的十五个工作日内向基金托管人发送基金增值税费划款指令，基金托管人复核后于划款指令约定日期从基金财产中一次性支付。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。费用扣划后，基金管理人应进行核对，并按相关规定及时申报缴纳增值税，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。基金管理人应确保托管账户资金足额，因托管账户内留存的现金不足造成的划款延迟，由基金管理人承担全部责任。

基金管理人代收付增值税费的账户信息如下：

户 名：深圳开元双创基金管理有限公司

账 号：1086 1000 0002 4143 8

开户银行：华夏银行深圳分行天安支行

十六、私募基金的收益分配

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、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额。

（二）基金收益分配原则

1、基金管理人有权决定在符合有关基金收益分配条件的前提下是否对基金进行收益分配以及收益分配的基准、分配比例、分配次数、分配时间等内容。

2、本基金默认分红方式为现金分红，本基金允许变更分红方式。

基金份额持有人如需变更默认收益分配方式的，应当通过募集机构提交申请，经基金管理人确认后，由份额登记机构进行处理。

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、每一基金份额享有同等分配权。

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

基金收益分配方案以基金管理人发布的公告为准，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、分配方式、分配时间、分配数额及比例等内容。

（四）收益分配方案的确定、通知

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。

（五）收益分配的执行方式

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。

在基金管理人就收益分配方案进行公告后，基金管理人依据具体方案的规定就支付的现金红利向基金托管人发送划款指令，基金托管人按照基金管理人的指

令及时进行分红资金的划付。

十七、信息披露与报告

本基金的信息披露应符合《私募投资基金信息披露管理办法》、基金合同及其他有关规定。相关法律法规关于信息披露的规定发生变化时,按最新规定执行。

(一) 基金管理人信息披露的种类、内容、披露时间和职责:

1、月度报告

基金管理规模金额达到 5000 万以上时,基金管理人应当自规模金额达到 5000 万之日起,持续在每月结束后 5 个工作日内向基金份额持有人披露基金净值的情况。

2、季度报告

基金运行期间,基金管理人应当在每季度结束之日起 10 个工作日内向基金份额持有人披露基金净值、主要财务指标、投资组合情况和其他重要信息。

3、年度报告

基金运行期间,基金管理人应当在每年结束之日起 4 个月内向基金份额持有人披露以下信息:

A、报告期末基金净值和基金份额总额;

B、基金的财务情况;

C、基金投资运作情况、资产负债情况和运用杠杆情况;

D、基金投资者账户信息,包括实缴出资额、未缴出资额以及报告期末所持有基金份额总额等;

E、投资收益分配和损失承担情况;

F、基金承担的费用和业绩报酬(如有);

G、可能存在的利益冲突、关联交易以及可能影响基金投资者合法权益的其他重大信息;

H、法律法规规定及基金合同约定的其他信息。

4、重大事项披露

发生以下重大事项的,基金管理人须按照法律法规规定以及本基金合同约定在 5 个工作日内向基金业协会报送并向基金份额持有人披露:

A、基金名称、注册地址、组织形式发生变更的;

- B、基金合同发生重大变化的、投资范围和投资策略发生重大变化的；
- C、变更基金管理人或基金托管人的；
- D、基金管理人的法定代表人、执行事务合伙人（委派代表）、实际控制人发生变更的；
- E、触及基金止损线或预警线的；
- F、管理费率、托管费率发生变化的；
- G、基金收益分配事项发生变更的；
- H、基金触发巨额赎回的；
- I、基金存续期变更或展期的；
- J、基金发生清盘或清算的；
- K、发生重大关联交易事项的；
- L、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机构或自律管理部门调查的；
- M、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、财产纠纷及相关费用支付情况；
- N、投资金额占本基金净资产 50%及以上的项目不能正常退出的；
- O、对本基金持续运行、基金投资者利益、基金资产净值产生重大影响的其他事件；
- P、合同约定的影响基金投资者利益的其他重大事件。

5、基金管理人应当根据相关法律法规、部门规章及本基金合同的约定定期向基金投资者披露经基金托管人复核的基金份额净值及其他重要信息。

（二）基金管理人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信息披露报告或通知，按照相关法律法规通过以下至少一种方式进行，即视为履行了告知义务。基金份额持有人可以通过本基金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

基金管理人或销售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基金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、电子邮件或短信

如基金份额持有人有在基金认购、申购或赎回等业务时留有传真号、电子邮箱或手机号等联系方式的,基金管理人也可通过传真、电子邮件、短信等方式将报告信息告知基金份额持有人。联系方式如有变更,基金份额持有人应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。

4、基金份额持有人、基金管理人、基金托管人约定的其他方式。

(三) 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

基金托管报告置于基金托管人办公地点备查,基金份额持有人可在营业时间内前往查询。

(四) 基金托管人对披露信息的复核责任

基金托管人应当按照相关法律法规、中国证监会以及中国基金业协会的规定和本基金合同的约定,对基金管理人编制的基金资产净值、基金份额净值、基金份额申购赎回价格、基金定期报告等向基金投资者披露的基金相关信息进行复核确认。

对于已经基金托管人复核确认的信息,如基金管理人进行不真实、不准确或不完整的披露,由此给基金份额持有人利益造成的损失,由基金管理人承担全部责任。

(五) 向基金业协会报送信息披露数据

基金管理人应当按照规定通过中国基金业协会指定的私募基金信息披露备份平台报送信息。

基金管理人过往业绩以及本基金运行情况将以基金管理人向私募基金信息披露备份平台报送的数据为准。

基金投资者可以登录中国基金业协会指定的私募基金信息披露备份平台进行信息查询。

（六）信息披露特别申明

本基金全体基金份额持有人同意基金管理人或其他信息披露义务人按照中国基金业协会的规定对基金信息披露信息进行备份。

基金管理人应当妥善保管本基金信息披露的相关文件资料，保存期限自基金清算终止之日起不得少于 10 年。

十八、风险揭示

本基金投资将可能面临下列各项风险，包括但不限于：

（一）基金的特殊风险

1、基金合同与中国基金业协会《合同指引》不一致所涉风险

本基金合同是基于中国基金业协会发布的《私募投资基金合同指引 1 号》（契约型基金合同内容与格式指引）而制定的，基金管理人对本基金合同相关条款做出了调整，导致本基金合同可能存在与中国基金业协会《合同指引》不一致的风险。

2、私募基金服务外包事项所涉风险

基金管理人将本基金份额登记、估值核算应属本机构负责的事项以服务外包等方式交由私募基金服务机构办理，因服务机构不符合监管机构的资质要求、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风险。

3、投资单一投资标的所涉风险

本基金可能投资于单一标的，相关市场宏观调控政策、财政税收政策、产业政策、法律法规、经济周期的变化等都可能影响所投资的单一标的的运作状况，进而影响本基金的运作，因而本基金的投资者将面临投资收益和风险主要取决于本基金所投资的单一投资标的的运作情况的风险。

4、私募基金未在中国基金业协会履行登记备案手续所涉风险

基金管理人在基金募集完毕后 20 个工作日内向中国基金业协会办理基金备案手续。如因基金管理人未履行备案手续或者私募基金不符合备案要求等原因致使基金备案失败，则将导致私募基金不能投资运作的风险。

5、关联交易风险

基金管理人运用基金财产进行关联交易的，可能存在基金管理人隐瞒关联

关系或者将关联交易非关联化，或以私募投资基金的财产与关联方进行利益输送、内幕交易和操纵市场等违法违规活动的风险，或存在基金管理人已建立的针对关联交易的决策机制和回避安排失效，或存在基金管理人未按法律法规规定和本基金合同约定及时向基金份额持有人披露关联交易的风险。

（二）基金的一般风险

1、资金损失风险

基金管理人依照恪尽职守、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。

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，由基金财产及基金投资者承担。基金投资者应充分知晓投资运营的相关风险，其风险应由基金投资者自担。

3、流动性风险

本基金预计存续期限为基金成立之日起至结束并清算完毕为止。在本基金存续期内，基金投资者可能面临资金不能退出带来的流动性风险。

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，基金投资者可能因此面临委托资金不能按期退出等风险。

4、基金无法成立的风险

本基金的成立需符合相关法律法规的规定，本基金可能存在不能满足成立条件从而无法成立的风险。

5、税收风险

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

6、政策风险

因国家相关法律法规、监管政策发生变化，导致基金所从事的相关业务、项目被暂停或禁止而产生风险。

7、市场风险

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）市场政策风险

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

经济运行的周期性变化，会对基金财产投资的收益水平产生影响的风险。

（3）利率风险

金融市场利率的波动会导致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。基金若投资此类相关资产，其收益水平存在受利率变化影响的风险。

（4）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。

（5）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。

（6）赎回风险

因基金持有的证券停牌或其他投资标的无法取得公允价值，基金投资者在赎回产品时，未赎回投资者在后续赎回时较现行赎回投资者承担更大的产品净值波动风险，该部分持续持有投资者在后期赎回时可能出现损失的风险。

8、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、管理水平、相关知识和经验、经营状况以及操作能力、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的风险。

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。

9、信用风险

基金所涉及的直接或间接交易对手若违约，有可能对本基金的收益产生影响

的风险。

10、操作或技术风险

相关当事人在业务各环节操作过程中，因内部控制存在缺陷或者人为因素造成操作失误或违反操作规程等引致的风险，例如，越权违规交易、会计部门欺诈、交易错误、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人、基金托管人、基金份额登记机构、证券/期货经纪机构、销售机构、证券交易所、登记结算机构等。

11、本基金纠纷解决机制相关风险

本基金合同在订立、内容、履行和解释过程中可能发生争议，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，可能发生诉讼或仲裁风险。

（三）本基金投资标的的相关风险

1、投资于债券的风险包括但不限于：

（1）市场平均利率水平变化导致债券价格变化的风险；

（2）债券市场不同期限、不同类属债券之间的利差变动导致相应期限和类属债券价格变化的风险；

（3）债券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，或由于债券发行人信用质量降低导致债券价格下降的风险。

2、投资于债券回购的风险包括但不限于：

（1）债券逆回购

一般情况下，债券逆回购是一种风险较低、流动性较强的品种，但极端情况下也存在以下风险：

机会成本风险，如果其他投资收益率更高，则债券回购存在机会成本损失；

系统性风险，经济萧条时，所有投资产品收益下降，债券回购也不例外。

（2）债券正回购

债券正回购具有放大投资规模的杠杆效应，可能会扩大产品的投资风险；如果到期不能及时还款，将面临较大的合规风险。

3、投资于资产支持证券、资产支持票据的风险包括但不限于：

(1) 与基础资产相关风险：基础资产及底层资产现金流预测不准确，或相关交易不能按时如期完成，或基础资产价值大幅下降等，都会使得专项计划的现金流规模受到不利影响，资产支持证券、资产支持票据持有人的利益会遭受损失；

(2) 与资产支持证券、资产支持票据相关的风险：资产支持证券、资产支持票据存续期间，可能面临信用评级下调的风险，或增信措施义务人无法履约的风险，将会对资产支持证券、资产支持票据的投资价值和投资者的预期收益的实现产生不利影响。

资产支持证券、资产支持票据虽然可以在交易所进行转让流通。在交易对手有限的情况下，资产支持证券/资产支持票据人可能面临无法在合理的时间内以合适价格出售的风险。

4、投资于公募证券投资基金、商业银行理财产品、资产管理计划、私募证券投资基金、信托计划等资产管理产品的风险包括但不限于：

(1) 该等资产管理产品的基金管理人在进行投资时，如出现判断有误、获取信息不全、或对投资工具使用不当，或未勤勉尽责进行投资管理等情形，将对本基金的收益甚至本金安全造成不利影响；

(2) 本基金投资于该等资产管理产品时，仅能于投资时对资产管理产品的产品合同约定的投资范围是否符合本基金合同约定进行判断，若该等资产管理产品实际投资范围超出约定范围，或资产管理产品变更其投资范围（可能无需经基金管理人同意），均可能给本基金造成不利影响；

(3) 本基金投资于该等资产管理产品时，基金管理人投资管理能力及其聘请的投资顾问（如有）的投资建议水平，均会对资产管理产品的收益水平产生重大影响，进而影响本基金的收益水平；

(4) 资产管理产品可能并非随时开放申购、赎回，其申购、赎回的限制可能给本基金的流动性造成影响，也可能造成本基金不能及时执行预警止损机制（如有）；

(5) 资产管理产品本身将会收取一定的费用，虽然该等费用可能并非直接在本基金项下列支，但相比较于基金份额持有人直接对资产管理产品进行投资的情况，基金份额持有人通过投资于本基金间接投资于资产管理产品，实质上同时承担了本基金、资产管理产品项下的费用。

（四）本基金的特定风险

1、不设止损机制的风险

本基金不设止损机制，本基金存续期内如大幅亏损，基金投资者可能损失全部本金。

2、巨额赎回的风险

本基金在非开放日不接受委托人的退出申请，在触发基金合同约定的巨额赎回条款时，基金管理人或销售机构可能部分顺延投资人的赎回申请，委托人面临在投资期内无法按意愿退出的风险。

3、资产管理产品净值提供不及时、不准确对产品净值影响风险

本基金投资金融产品的，如基金管理人或其指定机构就资产管理产品所提供的净值不及时、不准确，可能会对本基金净值的准确性产生影响。

4、在收益分配日计提业绩报酬的风险

本基金在收益分配日计提业绩报酬，对于单个基金投资者，可能存在业绩报酬金额大于或者等于收益分配金额的情况，基金投资者面临在该收益分配日无法实际获得收益分配的风险。

5、基金存续期内不进行收益分配的风险

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

（五）相关机构的经营风险

1、基金管理人经营风险

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机构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

虽然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机构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、基金服务机构经营风险

虽基金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机构的金融监管法律法规。如在基金存续期间基金服务机构无法继续从事基金服务业务,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

按照法律法规规定,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机构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。

(六) 其他风险

1、提前终止风险

发生基金合同约定的情形或其他法定情形时,基金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。

2、律师费用支付风险

本基金运作过程中可能引发诉讼、仲裁事项并需聘请专业律师,基金管理人聘请律师等相关费用将从基金资产中支付,而律师费与诉讼、仲裁事项本身复杂程度、律师专业水平等因素相关,可能出现支付的律师费金额或频次较高的情况。

3、不可抗力

战争、自然灾害等不可抗力因素的出现,将会严重影响证券市场的运行,可能导致基金资产的损失,从而带来风险。

本风险揭示的揭示事项仅为列举性质,未能详尽列明基金投资者参与本基金投资所面临的全部风险和可能导致基金投资者资产损失的所有因素。

十九、基金合同的效力、变更、解除与终止

(一) 基金合同的成立与生效

1、基金合同的成立

本基金合同采用纸质合同的方式进行签署的,由基金管理人、基金托管人、基金投资者共同签署后合同即告成立:

(1) 基金投资者为机构投资者的，本基金合同自基金投资者、基金管理人和基金托管人加盖公章/合同专用章以及三方法定代表人/执行事务合伙人或授权代表签章之日起成立；

(2) 基金投资者为个人投资者的，本基金合同自基金投资者本人签章、基金管理人和基金托管人加盖公章/合同专用章以及双方法定代表人/执行事务合伙人或授权代表签章之日起成立。

本基金合同采用电子签名的方式进行签署的，基金管理人、基金托管人、基金投资者三方以电子签名方式签署本基金合同后成立。

在基金份额持有人、基金管理人、基金托管人完成三方基金合同签署前，基金托管人可依据与基金管理人两方已完成签署的基金合同实施基金财产托管账户开立等本基金运作前的准备工作。基金管理人、基金托管人两方签署的基金合同应与基金份额持有人、基金管理人、基金托管人三方签署的基金合同一致。

2、基金合同的生效

本基金合同生效应当同时满足如下条件：

(1) 本基金合同经基金投资者、基金管理人与基金托管人合法签署；

(2) 基金投资者认购或申购资金实际交付并经份额登记机构确认成功，基金投资者获得本基金份额；

(3) 本基金依法并根据本基金合同约定成立。

3、基金合同的效力

(1) 本基金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。

(2) 在本基金存续期，基金份额持有人自全部赎回其持有基金份额之日起，不再是本基金的份额持有人和基金合同的当事人。

(3) 本基金合同采用纸质合同方式签署的，除需当事人签名、当事人需填写的基本信息要素或本基金合同中明确要求当事人填写部分可手写以外，非经基金管理人、基金托管人书面同意，基金投资者不得擅自增加任何手写条款，未经基金管理人及基金托管人书面同意的手写条款无效。

(二) 基金合同的变更

1、因法律法规或中国证监会、中国基金业协会的相关规定发生变化需要变

更基金合同的，基金管理人可以与基金托管人协商后修改基金合同，并由基金管理人按照基金合同约定及时向基金份额持有人披露变更的具体内容。

2、非因法律法规及有关政策变化的原因需要变更基金合同重要内容的，可选择以下方式之一进行变更：

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

（2）全体基金份额持有人、基金管理人和基金托管人协商一致。

（3）按照本基金合同的约定召开基金份额持有人大会决议通过。

（4）相关法律法规规定和基金合同约定的其他方式。

3、基金合同重大事项发生变更的，基金管理人应按照中国基金业协会要求向中国基金业协会报告。

（三）基金合同的解除

1、基金投资者投资冷静期合同解除

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。

投资冷静期自基金合同签署完毕且交纳认 / 申购基金款项后起算，基金投资者在投资冷静期内有权解除基金合同。

出现前述情形时，募集机构应当按基金合同约定及时退还基金投资者的全部认 / 申购款项。

基金份额持有人追加申购资金的，对于其已经持有的基金份额不适用于前款关于基金合同解除的约定。

2、基金投资者回访确认前的合同解除

基金投资者在募集机构回访确认成功前有权解除基金合同。出现前述情形时，募集机构应当按基金合同约定及时退还基金投资者的全部认 / 申购款项。在募集机构约定的回访时间内，未回访确认成功，募集机构有权解除基金合同并按基金合同约定及时退还基金投资者的全部认 / 申购款项。

（四）基金合同的终止

基金合同终止的情形包括但不限于下列事项：

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、基金托管人被依法取消证券投资基金托管业务资格的；
- 4、基金管理人依法解散、被依法撤销或被依法宣告破产的；
- 5、基金托管人依法解散、被依法撤销或被依法宣告破产的；
- 6、基金合同期限届满而未延期；
- 7、基金份额持有人大会决定终止的；
- 8、经基金管理人、基金托管人、基金份额持有人协商一致而提前终止的；
- 9、本基金向中国基金业协会备案失败的；
- 10、法律法规规定和本基金合同约定的其他情形。

（五）基金托管人的辞任

发生下列情形时，经基金托管人书面通知基金管理人，基金管理人在规定期限内仍未予以纠正的，基金托管人有权提出辞任：

（1）发生可能会对本基金财产安全或正常运行产生重大不利影响的事件，致使基金托管人无法履行托管义务或对基金托管人产生重大不利影响；

（2）基金管理人违反法律法规规定及本基金合同约定，以基金托管人名义或利用基金托管人商誉进行推广或宣传。

基金托管人因上述原因辞任的，应以书面方式通知基金管理人，说明辞任的决定和理由后，由信息披露义务人按照本基金合同信息披露章节约定，向全体基金份额持有人进行信息披露。基金托管人辞任的，基金管理人应在收到书面通知后的九十日内落实继任基金托管人。基金托管人应该协助完成替换的相关交接工作，将托管资金移交至继任基金托管人，保证基金平稳运行。基金托管人按上述程序辞任不视为违约，不承担任何责任。

基金管理人未按上述约定落实继任基金托管人的，基金托管人有权采用止付措施，由此产生的损失由基金管理人全部承担。

（六）基金维持运作机制

1、基金管理人被基金业协会注销私募基金管理人资格，基金管理人应按照本基金合同信息披露章节约定，向全体基金份额持有人进行信息披露，并在信息披露后的 60 日内召开份额持有人大会，提前终止本基金合同或落实继任基金管理人。

2、基金管理人被基金业协会列为失联（异常）机构或客观上丧失继续管理本基金的能力的，基金份额持有人可按照法律法规规定及本合同约定召开份额持有人大会并组织成立清算小组，清算小组可由基金份额持有人大会推举代表、基金托管人组成。在清算过程中涉及基金托管人的相关事宜，基金托管人应提供必要的协助与配合。

若管理人被基金业协会从失联（异常）机构名单中移除或恢复继续管理本基金能力的，对于在其被认定为失联（异常）机构或客观上丧失继续管理本基金能力期间，对基金份额持有人大会、清算小组签署的与本基金相关的协议文件、行使诉讼权利、处分基金财产或者实施其他有关的法律行为均予以认可。

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

（七）基金合同的回收

本基金合同采用纸质合同的方式进行签署的，基金管理人应妥善保管并按基金托管人要求及时向基金托管人移交属于基金托管人三方签署的合同原件。因基金管理人未妥善保管或未及时向基金托管人移交已签署完毕且符合基金合同约定的签署方式的基金合同原件导致基金托管人任何相关损失的，基金管理人应予以全额赔偿。

二十、私募基金的清算

（一）私募基金财产的清算

1、私募基金财产清算小组

（1）基金管理人应自出现基金合同终止事由之日起 10 个工作日内组织成立清算小组。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）私募基金财产清算小组的职责为负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配，依法进行必要的民事活动。

2、清算小组成员职责

基金管理人职责包括：

（1）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) 代表基金财产清算小组聘请会计师事务所、律师事务所；
- (8) 向基金份额持有人发布清算通知、清算报告；
- (9) 本合同终止事由发生之日起5个工作日内向基金业协会报告；
- (10) 作为清算组对外文书签署主体进行文书签署；
- (11) 履行与基金管理人义务相关的其他职责等。

基金托管人职责包括：

- (1) 清算期间的现金类基金财产保管；
- (2) 对基金管理人划款指令进行形式审核后，依据划款指令进行资金划付；
- (3) 基金财产资金等账户的注销；
- (4) 复核基金管理人出具清算报告中的财务数据；
- (5) 履行与基金托管人义务相关的其他职责等。

3、私募基金财产清算程序

基金合同终止，本基金应当按法律法规规定和基金合同的有关约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，基金管理人发布清盘公告；
- (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。

4、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。

5、私募基金财产清算剩余资产的分配

(1) 本基金合同终止时已计提但尚未支付的管理费、托管费和服务费等，经清算小组复核后从清算财产中支付。

(2) 依据基金财产清算分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除私募基金财产清算费用后，按基金份额持有人持有的基金份额比例以现金形式进行分配，本基金合同另有约定的除外。如本基金清算时出现基金财产不足以支付各项费用及负债的情况，基金管理人应当向基金托管人和基金服务机构补足本基金应支付而未支付的基金托管费和基金服务费。

(3) 本基金进入清算程序后，不得新增投资，基金管理人应对本基金持有的非现金类资产进行不可逆变现。如本基金合同终止时有未能流通变现的证券，基金管理人与基金托管人按照清盘公告约定计提管理费、托管费和服务费等费用，并继续按本基金合同约定的估值方法进行估值。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份额持有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) 清算期间，任何当事人均不得运用基金财产。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) 基金资产到期日（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，并承担全部责任。

6、私募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。基金管理人在本基金合同终止后 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机构备案（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机构要求必须进行审计。

7、私募基金财产清算账册及文件的保存

私募基金财产清算账册及文件由基金管理人保存 10 年以上。

(二) 私募基金财产相关账户的注销

私募基金财产清算完毕后，基金管理人注销其负责开立的各类投资交易的资

金账户及其下挂的证券账户、期货交易编码等，基金托管人注销其负责开立的基金的托管账户等，在此过程中相互应给予必要的配合。

（三）清算未尽事宜

本基金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）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基金合同约定，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、在本基金合同签署之日后发生的不可抗力事件，导致合同当事人无法全部履行或部分履行本基金合同的，任何一方当事人不承担违约责任。

但是一方因不可抗力不能履行本基金合同时，应及时通知另一方，并在合理期限内提供受到不可抗力影响的证明，同时采取适当措施防止基金资产损失扩大。任何一方当事人延迟履行合同义务后，发生了上述不可抗力事件致使合同当事人无法全部或部分履行本基金合同，该方不能减轻或免除相应责任。

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监管机构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基金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等。

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

5、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，或交由商业银行、证券经纪机构、期货经纪机构等其他机构负责清算交收的委托资产（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、破产等原因给委托资产带来的损失等。

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

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

(二) 在发生一方或多方违约的情况下，在最大限度地保护基金份额持有人利益的前提下，本基金合同能继续履行的，应当继续履行。

(三) 本基金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基金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。

(七) 一方依据本基金合同向另一方赔偿的损失，仅限于直接损失。

二十二、争议处理

(一) 争议处理方式

有关本基金合同的签署和履行而产生的任何争议及对本基金合同项下条款的解释，均适用中华人民共和国法律法规。

凡因本基金合同引起的或与本基金合同有关的任何争议，由合同当事人通过友好协商解决，协商不成时，均有权向托管人住所地有管辖权的人民法院提起诉讼，并由败诉方承担相对方为维护自身合法权益支付的一切合理费用，包括但不限于诉讼费、仲裁费、保全费、公证费、公告费、鉴定费、拍卖费、差旅费、通讯费、律师费等。

争议处理期间，基金合同当事人应恪守职责，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）文书送达

本基金合同各方用于接收对方或人民法院/仲裁机构发送的各类纸质或电子数据通知、信函、法律文书的邮寄地址、指定收件人、电话号码、电子邮箱、传真等信息（以下统称“送达地址”）以“本基金合同当事人的基本情况：”下所列示的信息为准，并持续适用于本基金合同履行期间、人民法院/仲裁机构审理和执行期间。

合同各方当事人或人民法院/仲裁机构为合同的履行、变更、解除和争议解决，按本合同记载的联系方式向各方邮寄、发送相关文书时，若因各方确认的上述联系方式不准确、有变更未及时书面告知、或拒绝签收等原因，导致文书未被实际接收的，文书退回之日视为送达之日，并发生法律上规定的诉讼文书送达效果。各方对上述送达信息发生变更时，应及时书面通知相对方，在相对方收到有关变更通知之前，相对方依据变更前的地址或方式所作出的送达视为有效。

二十三、其他事项

（一）本基金合同各方当事人应对签署和履行本基金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基金合同之目的（法律法规或司法监管机构另有规定、审计需要及本基金合同约定情形除外）。本保密义务不因基金合同终止而终止。

（二）除本基金合同另有约定外，任何与本基金合同有关的通知、报告应以书面形式作出，由本基金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。

（三）其他涉及基金合同各当事人之间权利义务关系的任何文件或表述，如与本基金合同不一致或有冲突，均以本基金合同为准。

本基金合同如有未尽事宜，由合同当事人各方按有关法律法规和规定协商解决。

（四）本基金合同一式叁份，基金管理人、基金托管人和基金投资者各持壹份。

本页无正文，为《开元恒利2号私募证券投资基金基金合同》签署页

基金投资者： (自然人签字或机构盖章)

法定代表人/执行事务合伙人或授权人：

基金管理人： 深圳开元双创基金管理有限公司（章）

法定代表人/执行事务合伙人或授权人：

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