

---

建信量化事件驱动股票型  
证券投资基金  
托管协议

基金管理人：建信基金管理有限责任公司

基金托管人：中国国际金融股份有限公司



建信基金  
骑

## 目 录

第一章	订立协议的目的、依据和原则	4
第二章	基金托管人和基金管理人之间的业务监督和核查	4
第三章	基金财产的保管	13
第四章	指令的发送、确认和执行	17
第五章	交易和清算交收安排	22
第六章	基金财产净值计算与会计核算	26
第七章	基金收益分配	29
第八章	信息披露	31
第九章	基金费用	32
第十章	基金份额持有人名册的保管	35
第十一章	基金有关文件和档案的保存	35
第十二章	基金托管人和基金管理人的更换	36
第十三章	禁止行为	36
第十四章	协议的变更、终止与基金财产的清算	37
第十五章	违约责任	38
第十六章	适用法律与争议解决	39
第十七章	协议的效力	39
第十八章	附则	40

## 建信量化事件驱动股票型证券投资基金托管协议

基金管理人：建信基金管理有限责任公司

住所：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心16层

法定代表人：孙志晨

成立时间：2005年9月19日

批准设立机构：中国证监会

批准设立文号：中国证监会证监基金字[2005]158号

组织形式：有限责任公司

注册资本：人民币2亿元

经营范围：基金募集、基金销售、特定客户资产管理、资产管理和中国证监会许可的其他业务

存续期限：持续经营

基金托管人：中国国际金融股份有限公司

住所：北京市建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层

法定代表人：沈如军

成立时间：1995年7月31日

基金托管业务批准文号：中国证券监督管理委员会 证监许可[2015]1441号

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币4,192,667,868元

经营范围：一、人民币特种股票、人民币普通股票、境外发行股票，境内外政府债券、公司债券和企业债券的经纪业务；二、人民币普通股票、人民币特种股票、境外发行股票，境内外政府债券、公司债券和企业债券的自营业务；三、人民币普通股票、人民币特种股票、境外发行股票，境内外政府债券、公司债券和企业债券的承销业务；四、基金的发起和管理；五、企业重组、收购与合并顾问；六、项目融资顾问；七、投资顾问及其他顾问业务；八、外汇买卖；九、境外企业、境内外商投资企业的外汇资产管理；十、同业拆借；十一、客户资产管理。十二、网上证券委托业务；十三、

融资融券业务；十四、代销金融产品；十五、证券投资基金代销；十六、为期货公司提供中间介绍业务；十七、证券投资基金托管业务；十八、经金融监管机构批准的其他业务。（依法须经批准的项目，经相关部门批准后依批准的内容开展经营活动。）

存续期限：持续经营

## 第一章 订立协议的目的、依据和原则

第一条 建信基金管理有限责任公司系一家依照中国法律合法成立并有效存续的公司，拟发起设立建信量化事件驱动股票型证券投资基金（以下简称“基金”或“本基金”）；中国国际金融股份有限公司系一家依照中国法律合法成立并有效存续的证券公司，按照相关法律、法规的规定具备担任证券投资基金托管人的资格和能力。建信基金管理有限责任公司拟担任基金的基金管理人，中国国际金融股份有限公司拟担任基金的基金托管人。

第二条 本协议的目的是明确基金管理人与基金托管人在涉及基金财产的保管、投资运作、净值计算、资金清算与交收、收益分配、信息披露及相互监督等相关事宜中的权利、义务关系，确保基金财产的安全，保护基金份额持有人的合法权益。

第三条 本协议依据《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》（以下称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下称“《运作办法》”）、《证券投资基金托管业务管理办法》、《非银行金融机构开展证券投资基金托管业务暂行规定》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下称“《信息披露办法》”）、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第7号<托管协议的内容与格式>》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性风险管理规定》”）和其他有关法律、法规、规章及《建信量化事件驱动股票型证券投资基金基金合同》，双方就基金托管人为基金提供托管服务事宜，遵循平等自愿、诚实信用原则，达成如下协议，供双方共同遵守。

## 第二章 基金托管人和基金管理人之间的业务监督和核查

第四条 基金托管人根据有关法律法规的规定以及《基金合同》的约定，对基金管理人的下列投资运作进行业务监督、核查：

(一)对基金的投资范围、投资对象进行监督。基金管理人应将拟投资的股票库、债券库等各投资品种的具体范围及时提供给基金托管人。基金管理人可以根据实际情况的变化,对各投资品种的具体范围予以更新和调整,并及时通知基金托管人。基金托管人根据上述投资范围对基金的投资进行监督;

本基金的投资范围为具有较好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会批准上市的股票)、债券(包括国内依法发行和上市交易的国债、金融债、央行票据、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、可交换债券、中期票据、短期融资券)、股指期货、国债期货、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但须符合中国证监会的相关规定。

基金的投资组合比例为:本基金投资于股票的资产不低于基金资产的80%;每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后,本基金保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券,其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金投资股指期货、国债期货以套期保值为目的,股指期货、国债期货、权证及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种或对投资比例要求有变更的,基金管理人在履行适当程序后,可以做出相应调整。

(二)基金托管人根据有关法律法规的规定及《基金合同》的约定,对下述基金投资组合比例进行监督

(1)本基金投资于股票的资产不低于基金资产的80%;

(2)每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后,现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%,其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等;

(3)本基金持有一家公司发行的证券,其市值不超过基金资产净值的10%;

(4)本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券,不超过该证券的10%;

(5)本基金持有的全部权证,其市值不得超过基金资产净值的3%;

(6)本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证,不得超过该权证的10%;

(7) 本基金在任何交易日买入权证的总金额, 不得超过上一交易日基金资产净值的0.5%;

(8) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例, 不得超过基金资产净值的10%;

(9) 本基金持有的全部资产支持证券, 其市值不得超过基金资产净值的20%;

(10) 本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例, 不得超过该资产支持证券规模的10%;

(11) 本基金管理人管理的全部证券投资基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券, 不得超过其各类资产支持证券合计规模的10%;

(12) 本基金应投资于信用级别评级为BBB以上(含BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间, 如果其信用等级下降、不再符合投资标准, 应在评级报告发布之日起3个月内予以全部卖出;

(13) 基金财产参与股票发行申购, 本基金所申报的金额不超过本基金的总资产, 本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量;

(14) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%, 本基金在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为1年, 债券回购到期后不得展期;

(15) 本基金参与股指期货、国债期货交易, 应该遵守下列要求:

1) 在任何交易日日终, 持有的买入国债期货和股指期货合约价值与有价证券市值之和不得超过基金资产净值的95%, 其中, 有价证券指股票、债券(不含到期日在一年以内的政府债券)、权证、资产支持证券、买入返售金融资产(不含质押式回购)等;

2) 在任何交易日日终, 持有的买入股指期货合约价值, 不得超过基金资产净值的10%; 在任何交易日日终, 持有的买入国债期货合约价值, 不得超过基金资产净值的15%;

3) 在任何交易日日终, 持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的20%; 在任何交易日日终, 持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的30%;

4) 本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值, 合计(轧差计算)应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定; 本基金所持有的债券(不含到期日



在一年以内的政府债券)市值和买入、卖出国债期货合约价值,合计(轧差计算)应当符合基金合同关于债券投资比例的有关约定;

5)本基金在任何交易日内交易(不包括平仓)的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的20%;本基金在任何交易日内交易(不包括平仓)的国债期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的30%;

(16)本基金投资流通受限证券应制定相关投资决策流程、风险控制制度等,并根据相关法律法规要求执行;

(17)本基金基金资产总值不得超过基金资产净值的140%;

(18)本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票,不得超过该上市公司可流通股票的15%;本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票,不得超过该上市公司可流通股票的30%;

(19)本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过资产净值的15%;因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合该比例限制的,基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资;

(20)本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的,可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致;

(21)法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他投资限制。

除上述第(2)、(12)、(19)、(20)项外,因证券、期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的,基金管理人应当在10个交易日内进行调整,但中国证监会规定的特殊情形除外。

基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在此期间,基金的投资范围和投资策略应当符合基金合同的有关约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门取消或变更上述限制,如适用于本基金,基金管理人在履行适当程序后,则本基金投资不再受相关限制或以变更后的规定为准。

(三)基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定对下述基金投资禁止行为进行监督:

根据法律法规的规定及基金合同的约定,本基金禁止从事下列行为:

- (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) 买卖其他基金份额, 但证监会另有规定的除外;
- (5) 向基金管理人、基金托管人出资;
- (6) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动;
- (7) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

法律、行政法规或监管部门取消上述禁止行为, 如适用于本基金, 则本基金投资不再受相关限制。

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券, 或者从事其他重大关联交易的, 应当符合基金的投资目标和投资策略, 遵循基金份额持有人利益优先原则, 防范利益冲突, 建立健全内部审批机制和评估机制, 按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意, 并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议, 并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

根据法律法规有关基金从事的关联交易的规定, 基金管理人和基金托管人应事先相互提供与本机构有控股关系的股东或与本机构有其他重大利害关系的公司名单及其更新, 并以双方约定的方式提交, 确保所提供的关联交易名单的真实性、完整性、全面性。基金管理人有责任保管真实、完整、全面的关联交易名单, 并负责及时更新该名单。名单变更后基金管理人应及时发送基金托管人, 基金托管人应及时确认已知名单的变更。

基金托管人履行了监督职责, 基金管理人仍违反法律法规规定或基金合同约定的投资禁止行为而造成基金财产损失的, 由基金管理人承担责任, 基金托管人不承担任何责任。

(四) 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定, 对基金管理人参与银行间债券市场进行监督。基金管理人应在基金投资运作之前向基金托管人提供符合法律法规及行业标准的、经慎重选择的、本基金适用的银行间债券市场交易对手名单, 并约定各交易对手所适用的交易结算方式。基金管理人应严格按照交易对手名单



的范围在银行间债券市场选择交易对手。基金托管人监督基金管理人是否按事前提供的银行间债券市场交易对手名单进行交易。基金管理人可以每半年对银行间债券市场交易对手名单及结算方式进行更新，如基金管理人根据市场情况需要临时调整银行间债券市场交易对手名单，应将调整结果至少提前1个工作日书面通知基金托管人并向基金托管人说明理由，且应在与交易对手发生交易前3个工作日内与基金托管人协商解决。基金管理人收到基金托管人书面确认后，被确认调整的名单开始生效，新名单生效前已与本次剔除的交易对手所进行但尚未结算的交易，仍应按照协议进行结算。基金管理人负责对交易对手的资信控制，按银行间债券市场的交易规则进行交易，基金托管人则根据银行间债券市场成交单对合同履行情况进行监督，但不负责解决因交易对手不履行合同而造成的纠纷及损失，也不承担由此造成的任何法律责任及损失。如基金托管人事后发现基金管理人没有按照事先约定的交易对手或交易方式进行交易时，基金托管人应及时提醒基金管理人，基金托管人不承担由此造成的任何损失和责任。

如果基金托管人发现基金管理人与不在名单内的银行间债券市场交易对手进行交易，应及时提醒基金管理人撤销交易，经提醒后基金管理人仍执行交易并造成基金财产损失的，由基金管理人承担相应责任，基金托管人不承担责任，发生此种情形时，基金托管人有权报告中国证监会。

(五) 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金管理人投资存款银行进行监督。基金投资银行存款的，基金管理人应根据法律法规的规定及基金合同的约定，建立投资制度、审慎选择存款银行，做好风险控制；并按照基金托管人的要求配合基金托管人完成相关业务办理。基金管理人应根据法律法规及基金和合同的约定，确定符合条件的所有存款银行的名单，并及时提供给基金托管人，基金托管人应据以对基金投资银行存款的交易对手是否符合有关规定进行监督。如基金管理人未向基金托管人提供符合条件的存款银行名单，基金托管人有权不对基金投资银行存款的交易对手进行监督。

(六) 基金托管人应根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金资产净值计算、基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料（基金管理人应告知基金托管人上述宣传推介材料）中登载基金业绩表现数据等进行监督和核查。基金管理人应及时向基金托管人提供相关数据资料供基金托管人进行监督和核查。

如果基金管理人未经基金托管人的审核擅自将不实的业绩表现数据印制在宣传推

介材料上或以其他方式进行宣传推介，则基金托管人对此不承担任何责任，并有权在发现后立即报告证监会。

(七) 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资流通受限证券进行监督。

1、基金投资流通受限证券，应遵守《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》等有关法律法规规定。

2、流通受限证券，包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券，不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。

3、在首次投资流通受限证券之前，基金管理人应当制定相关投资决策流程、风险控制制度、流动性风险控制预案等规章制度。基金管理人应当根据基金流动性的需要合理安排流通受限证券的投资比例，并在风险控制制度中明确具体比例，避免基金出现流动性风险。上述规章制度须经基金管理人董事会批准。上述规章制度经董事会通过之后，基金管理人应当将上述规章制度以及董事会批准上述规章制度的决议提交给基金托管人。

4、在投资流通受限证券之前，基金管理人应至少提前一个交易日向基金托管人提供有关流通受限证券的相关信息，具体应当包括但不限于如下文件（如有）：拟发行数量、定价依据、监管机构的批准证明文件复印件、基金管理人与承销商签订的销售协议复印件、缴款通知书、基金拟认购的数量、价格、总成本、划款账号、划款金额、划款时间文件等。基金管理人应保证上述信息的真实、完整。由于基金管理人未及时向提供有关证券的具体的必要的信息，致使基金托管人无法审核认购指令而影响认购款项划拨的，基金托管人免于承担责任。

5、基金托管人在监督基金管理人投资流通受限证券的过程中，如认为因市场出现剧烈变化导致基金管理人的具体投资行为可能对基金财产造成较大风险，基金托管人有权要求基金管理人对该风险的消除或防范措施进行补充和整改，并做出书面说明。否则，基金托管人经事先书面告知基金管理人，有权拒绝执行其有关指令。因拒绝执行该指令造成基金财产损失的，基金托管人不承担任何责任，并有权报告中国证监会。

6、基金管理人应保证基金投资的流通受限证券登记存管在本基金名下，并确保基金托管人能够正常查询。因基金管理人原因产生的流通受限证券登记存管问题，造成

基金财产的损失或基金托管人无法安全保管基金财产的责任与损失，由基金管理人承担。

7、如果基金管理人未按照本协议的约定向基金托管人报送相关数据或者报送了虚假的数据，导致基金托管人不能履行托管人职责的，基金管理人应依法承担相应法律后果。除基金托管人未能依据基金合同及本协议履行职责外，因投资流通受限证券产生的损失，基金托管人按照本协议履行监督职责后不承担上述损失。

8、基金管理人对本基金投资流通受限证券的流动性风险负责，确保对相关风险采取积极有效的措施，在合理的时间内有效解决基金运作的流动性问题。如因基金巨额赎回或市场发生剧烈变动等原因而导致基金现金周转困难时，基金管理人应保证提供足额现金确保基金的支付结算，并承担所有损失。对本基金因投资流通受限证券导致的流动性风险，基金托管人不承担任何责任。如因基金管理人原因导致本基金出现损失致使基金托管人承担连带赔偿责任的，基金管理人应赔偿基金托管人由此遭受的损失。

相关法律法规对基金投资流通受限证券有新规定的，从其规定。

(八) 基金托管人发现基金管理人的投资运作及其他运作有违反相关法律法规、基金合同及本协议行为时，应及时以电话或书面形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应及时核对并以电话或书面形式回复基金托管人。限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。限期过后，基金管理人仍未纠正的；或基金托管人认为对基金财产有重大影响的事件，基金托管人有权向基金管理人住所地相关监管机构报告。

(九) 对于依据交易程序尚未成交的且基金托管人在交易前能够监控的投资指令，基金托管人发现该投资指令违反法律法规规定或者违反基金合同约定的，应当拒绝执行，立即通知基金管理人，并向证监会报告。对于此类基金托管人拒绝执行的交易行为，基金托管人在履行了对基金管理人的通知义务后，即视为完全履行了其投资监督职责。对于基金管理人此类违反《基金法》、本协议或其他有关法律法规行为造成基金财产或基金份额持有人损失的，由基金管理人承担全部责任，基金托管人免于承担责任。

(十) 若基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当立即通知基金管理人及时纠正，由此造成的损失由基金管理人承担，基金托管人在履行其通知义务后，予以免责。

(十一) 对于必须于估值完成后方可获知的监控指标或依据交易程序已经成交的投资指令, 基金托管人发现该投资指令违反法律法规或者违反基金合同约定的, 应当立即通知基金管理人, 并报告证监会, 基金托管人不承担由此产生的相关责任。

(十二) 基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查, 必须在规定时间内答复基金托管人并改正, 就基金托管人的疑义进行解释或举证, 对基金托管人按照法规要求需向证监会报送基金监督报告的, 基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

(十三) 基金托管人发现基金管理人重大违规行为, 应立即报告证监会, 同时通知基金管理人限期纠正。

(十四) 基金管理人无正当理由, 拒绝、阻挠基金托管人根据本协议规定行使监督权, 或采取拖延、欺诈等手段妨碍基金托管人进行有效监督, 情节严重或经基金托管人提出警告仍不改正的, 基金托管人应报告证监会。

#### 第五条 基金托管人对基金管理人的业务监督处理方式

##### (一) 场内交易监督

基金托管人在每个交易日次日根据接收的交易清算数据对基金管理人交易日的场内交易进行审核。如发现投资运作违反基金合同及本协议有关约定时, 在未出现透支的情况下, 基金托管人应完成与登记结算公司的一级清算, 同时通过书面形式向基金管理人出具提示函督促基金管理人限期纠正。在限期内, 基金托管人有权随时对通知事项进行复查, 督促基金管理人改正。基金管理人对于基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的, 基金托管人可报告基金管理人住所地相关监管机构。

##### (二) 场外交易监督

基金托管人根据基金合同及本协议的规定, 对基金管理人发送给基金托管人的场外清算划款指令进行审核, 如果符合要求, 则立即执行; 如果发现基金管理人的投资行为不符合规定, 立即提示基金管理人, 并拒绝执行。

#### 第六条 基金管理人对于基金托管人的业务监督、核查

(一) 根据本协议及其他有关规定, 基金管理人就基金托管人是否安全保管基金财产、是否开设基金财产的资金账户和证券账户等投资所需账户、是否复核基金管理人计算的基金资产净值和基金份额净值、是否根据基金管理人指令办理清算交收、是否进行相关信息披露和监督基金投资运作等事项, 对基金托管人进行监督和核查。



(二) 基金管理人发现基金托管人未对基金财产实行分账管理、擅自挪用基金财产、未执行或无故延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄露基金投资信息等违反《基金法》、基金合同、本协议及其他有关规定时，基金管理人应立即以书面的方式要求基金托管人予以纠正和采取必要的补救措施。

(三) 基金管理人发现基金托管人的行为违反本协议的规定时，应以电话或书面形式通知基金托管人限期纠正，基金托管人收到通知后应及时核对并以电话或书面形式回复基金管理人。限期内，基金管理人有权随时对通知事项进行复查，督促基金托管人改正。限期过后，基金托管人仍未纠正的；或基金管理人认为对基金财产有重大影响的事件，基金管理人有权向其住所地证监会派出机构报告。

第七条 为减少业务差错，提高工作效率，基金托管人与基金管理人之间应加强对相关法律、法规、合同及投资监管方面的规定的沟通和信息数据的事先交流。

第八条 基金管理人和基金托管人有义务配合和协助对方依照本协议对基金业务执行监督、核查。基金托管人应积极配合基金管理人的核查行为，包括但不限于：提交相关资料以供基金管理人核查托管财产的完整性和真实性，在规定时间内答复基金管理人并改正。基金管理人或基金托管人无正当理由，拒绝、阻挠对方根据本协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督，情节严重或经监督方提出警示仍不改正的，监督方应报告基金管理人住所地相关监管机构。

### 第三章 基金财产的保管

#### 第九条 基金财产保管的原则

(一) 基金托管人应安全保管基金财产，未经基金管理人的合法合规指令或法律法规、《基金合同》及本协议另有规定，不得自行运用、处分、分配基金的任何财产。不属于基金托管人实际或应当有效控制下的资产及实物证券等在基金托管人保管期间的损坏、灭失，基金托管人不承担由此产生的责任。

(二) 基金财产应独立于基金管理人和基金托管人的固有财产。

(三) 除依据《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关法律法规规定外，基金托管人不得委托第三人托管基金财产。

(四) 基金托管人按照规定开设基金财产的资金账户和证券账户等投资所需账户。

(五) 对于因基金认（申）购、基金投资过程中产生的应收资产，由基金管理人

负责与有关当事人确定到账日期并书面通知基金托管人，到账日基金财产没有到达托管账户的，基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收。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损失，基金托管人对此不承担责任。

（六）基金托管人对因为基金管理人投资产生的存放或存管在基金托管人以外机构的基金资产，或交由期货公司或证券公司负责清算交收的基金资产（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，由于该等机构或该机构会员单位等本协议当事人外第三方的欺诈、疏忽、过失或破产等原因给基金资产造成的损失等不承担责任。基金托管人对基金托管人以外机构实际有效控制的证券不承担保管责任。

（七）基金管理人从事证券投资基金管理业务，应当遵循公平、诚信的原则，禁止任何形式的利益输送。由于基金管理人违反以上条款而造成基金损失的，由基金管理人承担。

#### 第十条 募集资金的归集和验资

（一）基金募集期间，投资人将认购基金而投入的货币资金存入基金管理人在具有托管资格商业银行开设的基金募集账户。在基金未完成设立和开始投资运作之前，任何人不得动用该募集账户资金。

（二）基金募集期满或停止募集时，募集的基金份额总额、基金募集金额、基金份额持有人人数符合《基金法》、《运作办法》等有关规定后，基金管理人应及时将募集的属于本基金财产的全部认购资金从募集账户转入基金托管人为本基金开立的客户资金托管专用银行账户（以下称“托管账户”）中。基金管理人应当聘请具有从事证券相关业务资格的会计师事务所进行验资并出具验资报告，出具的验资报告应由参加验资的2名以上（含2名）中国注册会计师签字方为有效。会计师事务所出具验资报告，基金管理人在监管机构备案后方可宣告基金成立，并同时将验资报告和证券投资基金备案确认函（复印件）提供给基金托管人。

（三）基金管理人应确保托管账户实际到账款项与基金验资报告金额（含利息）一致。如果发现不一致的情况，基金托管人应通知基金管理人，由基金管理人负责解决。

（四）基金成立的时间为基金管理人根据相关规定或基金合同发布基金成立公告的日期。

（五）如果在募集期满后基金未达到基金合同的生效条件，由基金管理人按基金合同规定办理退款事宜。



## 第十一条 基金相关账户的开立和管理

### (一) 基金托管账户的开立和管理

- 1、基金托管人应负责本基金的托管账户的开设和管理。
- 2、基金托管人根据基金管理人合法合规的指令办理资金收付。本基金的银行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、收取申购款，均需通过本基金的托管账户进行。
- 3、基金托管账户的开立和使用，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假借本基金的名义开立任何其他银行账户；亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。
- 4、基金托管账户的开立和管理应符合相关法律法规的有关规定。

### (二) 基金进行定期存款投资账户的开立和管理

基金管理人以基金名义在基金托管人认可的存款银行的指定营业网点开立存款账户，基金托管人负责该账户银行预留印鉴的保管和使用。在上述账户开立和账户相关信息变更过程中，基金管理人应提前向基金托管人提供开户或账户变更所需的相关资料，并对基金托管人给予积极配合和协助。

### (三) 基金证券账户

- 1、基金托管人应当以基金托管人和本基金联名的名义(具体名称以实际开立的账户名称为准)，在中国证券登记结算有限责任公司开立沪、深证券账户，用于基金场内证券投资的清算和存管。基金管理人应将开户资料准备齐全，及时交给基金托管人。
- 2、证券账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得出借和擅自转让本基金的证券账户；亦不得使用本基金的证券账户进行本基金业务以外的活动。
- 3、证券账户的开立和证券账户卡(如有)的保管由基金托管人负责，证券账户的投资管理和使用由基金管理人负责。

- 4、基金托管人以自身法人名义在中国证券登记结算有限责任公司开立结算备付金账户，并代表所托管的基金完成与中国证券登记结算有限责任公司的一级法人清算工作，基金管理人应予以积极协助。结算备付金的收取按照中国证券登记结算有限责任公司的规定执行。

### (四) 期货交易相关账户

1、基金管理人应当代表本基金，根据投资需要按照相关规定开立期货资金账户，在中国金融期货交易所获取交易编码。期货资金账户名称及交易编码对应名称应按照国家有关规定设立。完成上述账户开立后，基金管理人应以书面形式将期货公司提供的期货保证金账户的初始资金密码和保证金监控中心的登录用户名及密码告知基金托管人。资金密码和保证金监控中心登录密码重置由基金管理人进行，重置后务必及时通知基金托管人。

2、基金管理人授权基金托管人选择具有期货保证金存管资格的商业银行开立期货结算账户，办理相关银期转账业务。期货结算账户为基金的托管账户。

3、期货资金账户项下资金划拨的银期转账密码及其他相关密码由基金托管人设置和保管。

#### （五）债券托管账户的开立和管理

基金合同生效后，基金管理人负责以基金的名义申请并取得进入全国银行间同业拆借市场的交易资格；基金托管人协助基金管理人完成全国银行间债券市场准入备案；基金托管人负责完成全国银行间债券市场准入备案；基金托管人在中央国债登记结算有限责任公司和银行间市场清算所股份有限公司根据有关规定以本基金的名义为基金开设银行间债券市场债券托管账户，并由基金托管人负责基金的银行间债券市场债券及资金的清算。

#### （六）银行间市场资金结算账户

银行间市场资金结算账户是按照中央国债登记结算有限责任公司及上海清算所有关规定，以基金管理人或基金名义在相关机构开立，用于完成基金场外债券、票据的资金结算的账户。

#### （七）其他账户

本协议生效后，本基金被允许从事其他投资品种的投资业务的，涉及相关账户的开设、使用的，则基金管理人应当根据有关法律法规的规定和上述关于账户开设、使用的规定开立。新账户按有关规则管理并使用。

#### （八）基金投资的有关实物证券、银行存款定期存单的保管

基金托管人指派专人妥善保管基金实物证券、银行存款定期存单等凭证。实物证券的购买和转让，由基金托管人根据基金管理人的指令办理。基金托管人对其以外机构实际有效控制的有价凭证不承担责任。

### （九）与基金资产有关的重大合同的保管

由基金管理人代表基金签署的与基金有关的重大合同原件分别由基金托管人、基金管理人保管。除本协议另有规定外，基金管理人在代表基金签署与基金有关的重大合同时应当保证基金一方持有两份以上的正本，以便基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。基金管理人应在重大合同签署后及时将重大合同传真给基金托管人，并在三十个工作日内将正本送达基金托管人处。如上述合同只有一份正本，先由基金管理人取得，并将该合同的复印件加盖基金管理人公章及时送达基金托管人保管。未经双方协商一致，合同原件不得转移。基金管理人向基金托管人提供的合同传真件与基金管理人留存原件不一致的，以传真件为准。重大合同原件应存放于基金管理人和基金托管人各自文件保管部门15年以上。

因基金管理人将自己保管的与本基金有关的重大合同在未经基金托管人书面同意的情况下，用于抵押、质押、担保或债权转让或作其他处分而造成本基金资产损失的，由基金管理人负责，基金托管人予以免责。

## 第四章 指令的发送、确认和执行

### 第十二条 基金管理人发送指令人员的授权

（一）基金管理人应当事先向基金托管人发出书面通知（以下称“授权通知”），载明基金管理人有权发送指令的人员名单（以下称“指令发送人员”）、联系方式及各人员的业务权限范围，并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的人员身份的方法。基金管理人应向基金托管人提供指令发送人员的人名印鉴的预留印鉴样本和签字样本。

（二）基金管理人向基金托管人发出的授权通知应加盖公章并由法定代表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的授权书。基金管理人向基金托管人进行指令和授权人员的电话确认，授权通知在基金托管人收到电话确认的当日生效。基金管理人将加盖公章的授权书通过传真或电子邮件发送扫描件方式发出后，同时以电话形式向基金托管人确认；授权书自基金托管人收到并电话确认后，方视为通知送达。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，则自基金托管人收到授权书时生效。基金管理人应在此后3个工作日内将授权书的正本送交基金托管人。传真件或扫描件如与

正本不一致，基金托管人以传真件或扫描件为准并及时通知基金管理人。

（三）基金管理人和基金托管人对授权通知及其更改负有保密义务，其内容不得向指令发送人员及相关操作人员以外的任何人披露或泄露，但法律法规规定或有权机关另有要求的除外。

### 第十三条 指令的内容

（一）指令包括基金管理人在运作基金财产时，向基金托管人发出的资金划拨书面文书，包括付款指令（含赎回、收益分配、转换转出款支付、场外投资、费用支付等）及其他款项支付指令等。

（二）基金管理人发给基金托管人的指令应写明款项事由、支付时间、收款人开户银行、收款人账户名称、收款人账号、划款金额等要素信息，加盖预留印鉴并由被授权人签字或盖章。基金管理人在发送指令时应充分考虑基金托管人执行指令所需的合理时间。

### 第十四条 指令的发送、确认和执行

#### （一）指令的发送

1、指令需有授权通知确定的预留印鉴和签字或盖章，并由有权发送指令人员在指令上签字或盖章后，代表基金管理人用传真或邮件的方式向基金托管人发送并电话通知基金托管人指定人员。

2、基金管理人应按照《基金法》、《运作办法》、《基金合同》和有关法律法规的规定，在其合法的经营权限和交易权限内，并依据相关业务规则发送指令。基金管理人义务在发送指令后及时与基金托管人进行电话确认，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不由基金托管人承担。

3、基金托管人应指定专人接收基金管理人的指令，并预先通知基金管理人接收人名单和联系方式。

4、基金管理人在发送指令时，应最晚于基金管理人所要求的划款时点前两个小时向基金托管人发送投资划款指令并确认，基金管理人应为基金托管人执行划款指令留出必要时间，基金管理人向基金托管人发送要求当日支付的场外划款指令的最晚时间为每个工作日的 15:00。划款指令到达时间以基金托管人认定该划款指令为有效划款指令的时间为准。基金托管人不承担因指令传输不及时、基金管理人未能给基金托管人留出足够的划款时间，致使资金未能及时到账可能造成的损失。

5、基金管理人应在交易时间内将全国银行间交易成交单加盖预留印鉴后及时传真给基金托管人，并电话确认。

## （二）指令的确认

1、基金托管人在接收指令后，应对划款指令进行表面一致性的形式审查，验证指令的书面要素是否齐全、审核印鉴和签名是否和预留印鉴和签名样本相符，操作权限是否与授权文件一致。如发现问题，应及时通知基金管理人。对于指令发送人员发出的指令，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有权签署、发送指令人员的授权，并且书面通知基金托管人且生效的，则对于此后该类相关人员无权发送的指令，或超权限发送的指令，基金管理人不承担责任。基金托管人仅根据基金管理人提供的授权文件进行表面相符性的形式审查，对其真实性不承担责任。

2、基金托管人可以要求基金管理人邮件或传真提供资金用途说明文件、资金运作说明书（如有）、相关交易凭证、合同或其他相关凭证、有效会计资料等；以确保基金托管人有足够的资料来判断指令的有效性。资金运作说明书应写明款项事由、金额、收款账户明细等，并加盖预留印鉴。若基金管理人提供的相关凭证为复印件，则也应加盖预留印鉴。如果基金管理人未能按照要求提交资料导致基金托管人无法判断指令的有效性从而未能执行指令的，基金托管人不对基金财产的损失承担任何形式的责任。基金托管人不负责审查基金管理人发送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的合法、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、不完整或没有效力而影响基金托管人的形式审查或给任何第三人带来损失，基金托管人不承担任何形式的责任。

3、基金管理人应在成交后将场外交易相关凭证经有权人员加盖印章或授权人签字后及时邮件或传真给基金托管人。

## （三）指令的执行

1、基金托管人确认指令有效后，方可执行指令。

2、基金托管人在复核后应在规定期限内执行适当的指令，不得延误。指令执行完毕后，基金托管人应通知基金管理人。基金托管人发现基金管理人的指令违反法律法规规定或者基金合同约定的，基金托管人不予执行，并通知基金管理人要求其变更或撤销相关指令，若基金管理人在基金托管人发出上述通知后仍未变更或撤销相关指令，基金托管人应当拒绝执行，并向相关监管机构报告。

3、相关登记结算机构向基金托管人发送的结算通知视为基金管理人向基金托管



人发出的有效指令，基金托管人应予以执行。

4、基金管理人向基金托管人下达指令时，应确保基金资金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投资指令、赎回、分红资金等的划拨指令，基金托管人可不予执行，但应立即通知基金管理人，由基金管理人审核、查明原因，出具书面文件确认此交易指令无效。在及时通知后，基金托管人不承担因未执行该指令造成损失的责任。基金管理人确认该指令不予取消的，资金备足并通知基金托管人的时间视为指令收到时间。

5、基金托管人对执行基金管理人的合法指令对基金财产造成的损失不承担赔偿责任。

#### （四）指令的保管

指令正本由基金管理人保管，基金托管人保管业务指令扫描件或传真件。当两者不一致时，以基金托管人收到的业务指令扫描件或传真件为准。

#### 第十五条 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主要包括：指令违反法律法规和基金合同、指令要素错误、无投资行为的指令、预留印鉴错误、指令发送人员无权或超越权限发送指令及交割信息错误，指令中重要信息模糊不清或不全等情形。

基金托管人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。对基金管理人更正并重新发送后的指令经基金托管人核对确认后方能执行。

基金管理人撤回已发送的指令时，须向基金托管人出具加盖公章及预留印鉴的说明并通过录音电话确认，基金托管人在收到说明函并确认后应将指令作废；如基金托管人在收到说明或得到确认时该指令已经执行，则基金托管人不承担因为执行该指令而造成的损失责任。

#### 第十六条 基金托管人依照法律法规暂缓、拒绝执行指令的情形和处理程序

基金托管人发现基金管理人的指令违反法律法规规定或者基金合同约定，应当不予执行，并立即书面通知基金管理人要求其变更或撤销相关指令，若基金管理人在基金托管人发出上述通知后仍未变更或撤销相关指令，基金托管人应当拒绝执行，并向证监会报告。如相关交易已生效，则应通知基金管理人在10个工作日内纠正，并报告证监会。对于基金托管人事前难以监督的交易行为，基金托管人在事后履行了对基金管理人的通知以及向证监会的报告义务后，即视为完全履行了其投资监督职责。对于基金管理人违反《基金法》、《运作办法》、《基金合同》、本协议或其他有关法律法规的



规定造成基金财产损失的，由基金管理人承担全部责任，基金托管人免于承担责任。

基金管理人向基金托管人下达指令时，应确保基金的银行存款账户有足够的资金余额，确保基金的证券账户有足够的证券余额。对超头寸的指令，以及超过证券账户证券余额的指令，基金托管人可不予执行，但应立即通知基金管理人，由此造成的损失，由基金管理人承担。

#### 第十七条 基金托管人未按照基金管理人指令执行的处理方法

基金托管人因未正确执行基金管理人合法合规的指令，致使本基金的利益受到损害，基金托管人应承担相应的责任，但仅限于赔偿直接经济损失。除此之外，基金托管人对执行基金管理人的合法合规指令对基金造成的损失不承担任何责任。

#### 第十八条 被授权人及授权权限的变更

(一) 基金管理人若对授权通知的内容进行修改(包括但不限于指令发送人员的名单的修改及/或权限的修改)，应当至少提前1个工作日通知基金托管人；修改授权通知的文件应由基金管理人加盖公章并由法定代表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的授权书，并注明对授权通知内容进行修改的生效时间。基金管理人应对授权通知的修改应当以扫描件或传真的形式发送给基金托管人，同时电话通知基金托管人，基金托管人收到变更通知后电话向基金管理人确认。基金管理人接到基金托管人的电话确认视为通知已送达基金托管人。基金管理人应对授权通知的内容的修改在修改授权通知的文件注明的生效时间开始生效。基金管理人在电话告知后三个工作日内将被授权人变更通知的正本送交基金托管人。文件正本与传真件或扫描件不一致的，以基金托管人收到的传真件或扫描件为准，由此产生的责任由基金管理人承担。

(二) 基金托管人更换接收基金管理人指令的人员，应提前通知基金管理人。

#### 第十九条 其他事项

(一) 基金管理人下达的指令必须要素齐全，词语准确，基金管理人下达的指令要素不全或语意模糊的，基金托管人有权附注相应的说明后立即将指令退还给基金管理人，要求其重新下达有效的指令。

(二) 除因其自身原因致使基金的利益受到损害而负赔偿责任外，基金托管人按照法律法规、本协议的规定执行基金管理人指令而引起的本基金任何损失，均由基金管理人负责。

(三) 基金托管人因正确、及时、合法执行基金管理人投资指令而产生的相关法

律责任，由基金管理人承担，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，基金托管人因故意或过失错误执行或未及时执行基金管理人指令而使基金利益受到损害或产生的相关法律责任，由基金托管人承担。

（四）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致使资金未能及时清算所造成的损失由基金管理人承担。因基金管理人原因造成的传输不及时、未能留出足够执行时间、未能及时与基金托管人进行指令确认致使资金未能及时清算或交易失败所造成的损失由基金管理人承担。

（五）基金托管人根据本协议相关规定履行形式审查职责，如果基金管理人的指令存在事实上未经授权、欺诈、伪造或未能及时提供授权通知等情形，基金托管人不承担因执行有关指令或拒绝执行有关指令而给基金管理人或基金资产或相关第三方带来的直接损失，全部责任由基金管理人承担。

## 第五章 交易和清算交收安排

### 第二十条 选择代理证券、期货买卖的证券、期货经营机构

（一）基金管理人负责根据相关标准以及内部管理制度对有关证券经营机构进行考察后确定代理本基金证券买卖证券经营机构，使用其交易单元作为基金的交易单元，并承担相应责任。基金管理人和被选定的证券经营机构签订委托协议，基金管理人应提前通知基金托管人，并依据基金托管人要求提供相关资料，以便基金托管人申请办理接收结算数据手续。基金管理人应根据有关规定将基金交易单元号、佣金费率等基本信息以及变更情况及时以书面形式通知基金托管人。

（二）基金管理人负责选择代理本基金期货交易的期货经纪机构，并与其签订期货经纪合同，其他事宜根据法律法规、《基金合同》的相关规定执行，若无明确规定的，可参照有关证券买卖、证券经纪机构选择的规则执行。

1、基金管理人所选择的期货公司负责办理委托资产的期货交易的清算交割。

2、基金管理人应责成其选择的期货公司通过深证通向基金托管人及基金管理人发送以保证金监控中心格式显示本产品成交结果的交易结算报告及参照保证金监控中心格式制作的显示本产品期货保证金账户权益状况的交易结算报告。经基金托管人同意，可采用电子邮件的传送方式作为应急备份方式传输当日交易结算数据。

正常情况下当日交易结算报告的发送时间应在交易日当日的 17:00 之前。因交易

所原因而造成数据延迟发送的，基金管理人应及时通知基金托管人，并在恢复后告知期货公司立即发送至基金托管人，并电话确认数据接收状况。若期货公司发送的期货数据有误，重新向基金管理人、基金托管人发送的，基金管理人应责成期货公司在发送新的期货数据后立即通知基金托管人，并电话确认数据接收状况。

3、基金管理人应责成其选择的期货公司对发送的数据的准确性、完整性、真实性负责。由于交易结算报告的记载事项出现与实际交易结果和权益不符造成本产品估值计算错误的，应由基金管理人负责向数据发送方追偿，基金托管人不承担责任。

#### 第二十一条 交易单元安排

(一) 基金管理人负责安排专用交易单元用于本基金的投资运作，并将用于基金交易的专用交易单元向相关机构（包括但不限于证券交易所和登记结算公司）备案。

(二) 基金在证券交易所的投资交易活动，应当集中在专用交易单元上进行。

#### 第二十二条 证券交易的资金清算交收

(一) 因本基金投资于证券发生的所有场内、场外交易的清算交割，全部由基金托管人根据相关业务规则负责办理。

(二) 本基金证券投资场内交易的清算交割，由基金托管人根据相关登记结算公司的结算规则办理。

(三) 本基金证券投资场外交易的清算交割，由基金托管人根据相关结算要求办理。每个交易日日终，基金托管人收取登记结算公司和证券交易所、银行间债券市场、基金公司、期货公司等所有交易市场发送的基金交易数据、权益数据以及对账等数据，完整、准确地读入资产托管业务系统中。

(四) 基金托管人在履行投资监督职能时，如果发现基金投资证券过程中出现越权交易，应立即提醒基金管理人，由基金管理人负责处理，由此给基金及基金托管人造成的损失由基金管理人承担。基金管理人同意在发生以上情形时，基金托管人应按照中国证券登记结算有限责任公司的有关规定办理。

(五) 基金管理人应保证在交收日（T+1日）10:00前基金托管账户有足够的资金用于交易所的证券交易资金清算，如基金的资金头寸不足则基金托管人应按照中国证券登记结算有限责任公司的有关规定办理。

(六) 基金管理人应保证基金托管人在执行基金管理人发送的划款指令时，基金托管账户或资金交收账户上有充足的资金。基金的资金头寸不足时，基金托管人有权

拒绝基金管理人发送的划款指令，由此造成的损失，由基金管理人负责赔偿。基金管理人在发送划款指令时应充分考虑基金托管人的划款处理时间。对于要求当天到账的指令，应在当天15:00前发送；对于要求当天某一时点到账，则指令需提前2个工作小时发送。对于新股申购网下公开发行业务，基金管理人应在网下申购缴款日(T日)的前一日下班前将新股申购指令发送给基金托管人，指令发送时间最迟不应晚于T日上午10:00时。对于超出以上限制时间的指令，基金托管人应尽力执行，但不保证划款成功。

(七) 对上海证券交易所认购权证行权交易，基金管理人应于行权日15:00前将需要交付的行权金额及费用书面通知基金托管人，基金托管人在16:00前支付至登记结算公司指定账户。

(八) 对于中国证券登记结算有限责任公司实行T+0非担保交收的业务，基金管理人应在交易日14:00将划款指令发送至基金托管人。

(九) 定期存款、协议存款等存款类业务办理全部提前支取、部分提前支取或到期支取时，基金管理人需提前发送投资指令或支取说明至基金托管人处，并为基金托管人预留合理业务处理时间。通常情况下，如果存单的存款银行与基金托管人同城，应预留不低于2个工作日；如果存单存款银行与基金托管人不同城的，应预留不低于5个工作日。特殊情况下，双方协商处理。

(十) 在基金资金头寸充足的情况下，基金托管人对基金管理人符合法律法规、《基金合同》、本协议的指令不得以不合理拖延或拒绝执行。

(十一) 因基金管理人指令传输不及时，致使资金未能及时划入中登公司所造成的损失由基金管理人承担，包括赔偿在深圳市场引起其他托管客户交易失败、赔偿因占用中登深圳公司最低备付金带来的利息损失。

(十二) 如基金新增投资范围或投资品种，基金管理人和基金托管人应以双方接受的方式商定运作流程。

### 第二十三条 交易记录、资金和证券账目的对账

(一) 基金管理人与基金托管人定期对每日交易记录进行核对，在与基金托管人核对估值结果之前，基金管理人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，基金托管人不承担责任。

(二) 对基金的资金、证券账目，由双方定期对账，确保双方账目相符。

(三) 对实物券账目，每月月末双方进行账目核对。



## 第二十四条 认购、申购、赎回及转换的业务安排

(一) T日, 投资者进行基金申购、赎回和转换申请, 基金管理人和基金托管人分别计算基金资产净值, 并进行核对; 基金管理人将双方盖章确认的或基金管理人决定采用的基金份额净值以基金份额净值公告的形式传真至相关信息披露媒介。

(二) T+1日, 份额登记机构根据T日基金份额净值计算申购份额、赎回金额及转换份额, 更新基金份额持有人数据库, 并将确认的申购、赎回及转换数据向基金托管人、基金管理人传送。基金管理人、基金托管人根据确认数据进行账务处理。

(三) 基金托管账户与“基金清算账户”间实行申购T+2日、赎回T+3日清算交收。

(四) 基金托管账户与“基金清算账户”间的资金清算遵循“净额清算、净额交收”的原则, 即按照托管账户当日应收资金(包括申购资金及基金转换转入款)与托管账户应付额(含赎回资金、赎回费、基金转换转出款及转换费)的差额来确定托管账户净应收额或净应付额, 以此确定资金交收额。当存在托管账户净应收额时, 基金管理人负责将托管账户净应收额在T+2日15:00前从“基金清算账户”划到基金托管账户; 当存在托管账户净应付额时, 基金托管行按基金管理人的划款指令将托管账户净应付额在T+3日12:00前划到“基金清算账户”。

(五) 基金管理人未能按上款约定将托管账户净应收额全额、及时汇至基金托管账户, 由此产生的责任应由该基金管理人承担; 基金托管人未能按上款约定将托管账户净应付额全额、及时汇至“基金清算账户”, 由此产生的责任应由基金托管人承担(不可抗力或基金托管人无过错的除外)。

(六) 基金管理人应将每个开放日的申购、赎回、转换开放式基金的数据传送给基金托管人。基金管理人应对传递的申购、赎回、转换开放式基金的数据真实性负责。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。划付赎回款、转换转出款等款项和费用时, 如基金资金账户有足够的资金, 基金托管人应按时划付; 因基金资金账户没有足够的资金, 导致基金托管人不能按时划付, 基金托管人不承担责任, 责任由基金管理人承担, 基金托管人不承担垫款义务。

(七) 对于基金申购、转换过程中产生的应收款, 应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知基金托管人, 到账日应收款没有到达基金资金账户的, 基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收, 由此造成基金损失的, 基金管理人应负责向有关当事人追偿基金的损失。

(八) 基金清算账户由登记机构负责开立和管理。

(九) 转换业务视同发生了一笔申购和一笔赎回业务, 按照申购和赎回的资金清算规则进行结算。

(十) 如基金管理人委托其他机构办理本基金的登记业务, 应保证上述相关事宜按时进行。否则, 由基金管理人承担相应的责任。

## 第六章 基金财产净值计算与会计核算

### 第二十五条 估值目的

本基金财产估值的目的是客观、准确地反映基金财产的价值。经基金财产估值后确定的基金份额净值, 是进行信息披露、计算申购和赎回基金的基础。

### 第二十六条 估值对象

基金所拥有的股票、权证、债券和银行存款本息、股指期货合约、国债期货合约、应收款项、其它投资等资产及负债。

### 第二十七条 估值方法

(一) 基金财产的估值, 参照相关规定及基金合同中约定的估值方法进行。如有确凿证据表明按前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。

(二) 如基金管理人或基金托管人发现基金估值违反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。

### 第二十八条 基金财产净值的计算和复核

(一) 基金管理人应定期对基金财产估值。用于基金信息披露的基金净值和基金份额净值由基金管理人负责计算, 基金托管人复核。

(二) 基金管理人应于每个估值日结束后计算得出当日的基金份额净值, 并以约定形式发送给基金托管人。

(三) 基金托管人按基金合同规定的估值方法、时间、程序进行复核, 复核无误后反馈给基金管理人, 由基金管理人对外公布。

#### (四) 基金财产估值错误的处理

1、当基金财产的估值导致基金净值小数点后4位以内(含第4位)发生差错时,



视为基金财产估值错误。

2、当基金财产估值出现错误时，基金管理人和基金托管人应采取必要、适当合理的措施确保基金财产估值的准确性、及时性，基金管理人应当立即对估值错误予以纠正，将估值错误通报基金托管人，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；当估值错误达到或超过基金份额净值的 0.25% 时，基金管理人应当通报基金托管人并报证监会备案；当估值错误偏差达到基金份额净值的 0.5% 时，基金管理人应当立即通报基金托管人，向证监会报告并应当公告。

3、当基金份额净值计算差错给基金和基金份额持有人造成损失需要进行赔偿时，基金管理人和基金托管人应根据实际情况界定双方承担的责任，经确认后按以下条款进行赔偿：

(1) 本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，与本基金有关的会计问题，如经双方在平等基础上充分讨论后，尚不能达成一致时，按基金管理人的建议执行，由此给基金份额持有人和基金财产造成的损失，由基金管理人负责赔付。

(2) 若基金管理人计算的基金份额净值已由基金托管人复核确认后公告，而且基金托管人未对计算过程提出疑义或要求基金管理人书面说明，基金份额净值出错且造成基金份额持有人损失的，应根据法律法规的规定对投资者或基金支付赔偿金额，就实际向投资者或基金支付的赔偿金额，基金管理人与基金托管人按照管理费和托管费的比例各自承担相应的责任。

(3) 如基金管理人和基金托管人对基金份额净值的计算结果，虽然多次重新计算和核对，尚不能达成一致时，为避免不能按时公布基金份额净值的情形，以基金管理人的计算结果对外公布，由此给基金份额持有人和基金造成的损失，由基金管理人负责赔付。

(4) 由于基金管理人提供的信息错误（包括但不限于基金申购或赎回金额等），进而导致基金份额净值计算错误而引起的基金份额持有人和基金财产的损失，由基金管理人负责赔付。

4、基金管理人或基金托管人按基金合同“估值方法”的第 8 项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。

5、由于不可抗力，或证券、期货交易所、登记结算公司发送的数据错误等原因，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免除赔偿责

任。但基金管理人和基金托管人应当积极采取必要的措施消除或减轻由此造成的影响。

6、由于一方当事人提供的信息错误，另一方当事人在采取了必要合理的措施后仍不能发现该错误，进而导致基金份额净值计算错误、造成基金份额持有人或基金的损失，以及由此造成以后交易日基金份额净值计算顺延错误而引起的基金份额持有人或基金的损失，由责任方负责赔偿。

7、针对净值差错处理，如果法律法规或证监会有新的规定，则按新的规定执行；如果行业有通行做法，在不违背法律法规且不损害投资者利益的前提下，当事人应本着平等和保护基金份额持有人利益的原则重新协商确定处理原则。

### 第二十九条 基金会计制度

本基金的会计核算按国家有关部门规定的会计制度执行，国家无明确规定的，由基金管理人和基金托管人根据《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》及国家有关的会计制度和业内通行做法协商确定。基金管理人和基金托管人应遵循双方约定的同一记账方法和会计处理原则，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。基金会计核算责任人由基金管理人承担。

### 第三十条 基金账册的建账和对账

(一) 基金管理人和基金托管人在本基金成立后，应按照双方约定的同一记账方法和会计处理原则，分别独立地设置、登录和保管本基金的全套电子账册，对各自的账册定期进行核对，互相监督，以保证基金资产的安全。基金管理人与基金托管人对基金账册每月核对一次。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。

(二) 双方应定期核对账目，如发现双方的账目存在不符的，基金管理人和基金托管人必须及时查明原因并纠正，保证双方平行登录的账册记录完全相符。基金管理人按日编制基金估值表，与基金托管人核对，从而核对证券交易账目。基金托管人办理基金的资金收付、证券实物出入库所获得的凭证，由基金托管人保管原件并记账，按时附指令回执和单据复印件交基金管理人核实。基金管理人与基金托管人对基金账册每月核对一次。经对账发现双方的账目存在不符的，基金管理人和基金托管人应及时查明原因并纠正，保持双方的账册记录完全相符。若当日核对不符，暂时无法查找到错帐的原因而影响到基金净值信息的计算和公告的，以基金管理人的账册为准。

### 第三十一条 基金财务报表与报告的编制和复核

(一) 基金财务报表由基金管理人和基金托管人每月分别独立编制。月度报表的

编制，应于每月终了后5个工作日内完成。基金管理人在月度报表完成当日，将报表盖章后提供给基金托管人复核；基金托管人在收到后应在3个工作日内进行复核，并将复核结果书面通知基金管理人。

(二) 基金管理人在每个季度结束之日起15个工作日内完成季度报告编制并公告；在会计年度半年终了后两个月内完成中期报告编制并公告；在会计年度结束后三个月内完成年度报告编制并公告。

(三) 基金管理人每个季度终了后7个工作日内完成季度报告，并将有关报告提供基金托管人复核，基金托管人在收到日起7个工作日内进行复核，并将复核结果书面通知基金管理人。

(四) 基金管理人在会计半年终了后30个工作日内完成中期报告，并将有关报告提供基金托管人复核，基金托管人在收到日起30个工作日内进行复核，并将复核结果书面通知基金管理人。

(五) 基金管理人在会计年度结束后45个工作日内完成年度报告，并将有关报告提供基金托管人复核，基金托管人在收到日起45个工作日内复核，并将复核结果书面通知基金管理人。

(六) 基金托管人在复核过程中，发现双方的报表存在不符时，基金管理人和基金托管人应共同查明原因，进行调整，调整以双方认可的账务处理方式为准；若双方无法达成一致，则以基金管理人的账务处理为准。核对无误后，基金托管人在基金管理人提供的报告上加盖业务印鉴或者出具加盖托管业务部门公章的复核意见书，双方各自留存一份，以备有权机构对相关文件审核时提示。

如果基金管理人与基金托管人不能于应当发布通告之日前就相关报表达成一致，基金管理人有权按照其编制的报表对外发布通告，由此产生的信息披露错误，基金托管人不承担责任，基金托管人有权就相关情况报证监会备案。

## 第七章 基金收益分配

### 第三十二条 基金利润构成

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，基金已实现收益指基金利润减去公允价值变动收益后的余额。

### 第三十三条 基金可供分配利润

基金可供分配利润指截至收益分配基准日基金未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

### 第三十四条 收益分配原则

(一) 在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为12次,每次收益分配比例不得低于基金收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的10%,若基金合同生效不满3个月可不进行收益分配;

(二) 本基金收益分配方式分两种:现金分红与红利再投资,投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资;若投资者不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红;

(三) 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;

(四) 本基金每一基金份额享有同等分配权;

(五) 法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

第三十五条 收益分配对象为权益登记日在基金注册登记机构登记在册的基金份额持有人。

### 第三十六条 收益分配方案的内容

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

### 第三十七条 收益分配中发生的费用

基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额,不足以支付银行转账或其他手续费用时,基金登记机构可将基金份额持有人的现金红利自动转为基金份额。红利再投资的计算方法,依照《业务规则》执行。

### 第三十八条 收益分配方案的制订与复核

收益分配方案由基金管理人于收益分配日之前根据基金合同的相关规定拟定,并经基金托管人复核,基金托管人应于收到收益分配方案后完成对收益分配方案的复核,并将复核意见反馈给基金管理人,复核通过后基金管理人应当将收益分配方案在指定媒介公告;如果基金管理人与基金托管人不能于收益分配日之前就收益分配方案达成

一致，基金托管人有义务将收益分配方案及相关情况的说明提交证监会备案并书面通知基金管理人，在上述文件提交完毕之日起基金管理人有权对外公告其拟订的收益分配方案，且基金托管人有义务协助基金管理人实施该收益分配方案，但有证据证明该方案违反法律法规及基金合同的除外。

### 第三十九条 收益分配方案的实施

基金管理人向基金托管人下达收益分配的付款指令，基金托管人按指令将收益分配的全部资金划入基金管理人的指定账户。基金管理人在下达指令时，应给基金托管人留出必需的划款时间。在红利发放日，登记机构根据基金份额持有人选择的分配方式进行处理，将现金分红划入基金份额持有人指定的银行账户，红利再投资形成份额计入基金份额持有人基金账户。

## 第八章 信息披露

### 第四十条 保密义务

(一) 除按照相关法律法规和基金合同及相关监管机构关于基金信息披露的有关规定以及审计需要进行披露以外，基金管理人和基金托管人对基金的有关信息均应恪守保密的义务。基金管理人与基金托管人对基金的任何信息，不得在其对外披露之前，先行对双方以外的任何机构、组织和个人泄露。

(二) 基金管理人和基金托管人除了为履行法律法规、基金合同及本协议规定的义务所必要之外，不得为其他目的使用、利用其所知悉的基金的保密信息，并且应当将保密信息限制在为履行前述义务而需要了解该保密信息的职员范围之内。

(三) 如下情况不应视为基金管理人或基金托管人违反保密义务：

- 1、非因基金管理人和基金托管人的原因导致保密信息被披露、泄露或公开；
- 2、基金管理人和基金托管人依据法律、法规、监管规定或为遵守和服从法院判决、仲裁裁决或证监会等监管机构的命令、决定所做出的信息披露或公开；
- 3、向所聘的审计、法律等外部专业顾问提供的以及本协议另有约定的情况。

### 第四十一条 基金管理人和基金托管人在信息披露中的职责和信息披露程序

(一) 基金管理人和基金托管人应根据相关法律法规、基金合同的规定各自承担相应的信息披露职责。基金管理人和基金托管人负有积极配合、互相督促、彼此监督、保证其履行按照法定方式和时限披露的义务。



(二) 基金的信息披露主要包括基金招募说明书、基金合同、托管协议、基金产品资料概要、基金份额发售公告、基金合同生效公告、基金净值信息、基金份额申购、赎回价格、基金定期报告(包括基金年度报告、基金中期报告和基金季度报告),以及临时报告、澄清公告、基金份额持有人大会决议、清算报告及中国证监会规定的其他信息。基金年度报告中的财务会计报告需经具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计后,方可披露。

(三) 基金托管人应当按照相关法律法规、证监会的规定和基金合同的约定,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、管理人向基金托管人提供的更新的招募说明书、基金产品资料概要、基金清算报告等公开披露的相关基金信息进行复核、审查,并向基金管理人进行书面或电子确认。

(四) 基金年报中的财务会计报告部分,经有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计后,方可披露。

(五) 对于因不可抗力等原因导致基金信息的暂停或延迟披露的(如暂停估值),基金管理人应及时向证监会报告,并与基金托管人协商采取补救措施。不可抗力等情形消失后,基金管理人和基金托管人应及时恢复办理信息披露。

(六) 对于法律、法规和证监会规定的本基金需披露的信息,基金管理人和基金托管人负有积极配合、互相督促、彼此监督,保证其履行按照法定方式和时限披露的义务。

#### 第四十二条 基金托管人报告

基金托管人应按《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《流动性风险管理规定》和其他有关法律法规的规定于每个上半年度结束后两个月内、每个会计年度结束后三个月内在基金中期报告及年度报告中分别出具基金托管人报告。

#### 第四十三条 信息披露文件的存放和查阅

(一) 依法必须披露的信息发布后,基金管理人、基金托管人应当按照相关法律法规规定将信息置备于公司住所,供社会公众查阅、复制。基金管理人、基金托管人应为文本存放、基金份额持有人查询有关文件提供必要的场所和其他便利。

(二) 基金管理人和基金托管人应保证文本的内容与所公告的内容完全一致。

## 第九章 基金费用



第四十四条 下列与基金有关的费用可以从基金财产中列支：

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、基金合同生效后与基金相关的信息披露费用；
- 4、基金合同生效后与基金相关的会计师费、律师费、诉讼费和仲裁费；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金的相关账户的开户及维护费用；
- 7、基金的证券、期货交易费用；
- 8、基金的银行汇划费用；按照国家有关规定和基金合同约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

(二) 基金管理人的管理费

- 1、本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.5% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值。

(三) 基金托管人的托管费

- 1、本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

(四) 不列入基金费用的项目

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资产的损失，基金合同生效前的相关费用以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。其他不列入基金费用的具体项目，依据有关规定执行，并在基金合同中明确。

(五) 基金的税收。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。

#### （六）其他费用的计提方法

1、基金投资运作期间所发生的经手费、证管费、过户费、印花税、交易单元费和证券结算风险基金和期货交易交割手续费等，直接计入投资成本或者作为当期费用，其费率由基金管理人根据有关政策法规确定。证券交易佣金于发生日结转。佣金的计算以基金管理人计算结果为准。

2、银行结算费用、账户维护费用，在发生时一次性计入基金费用。

3、银行间市场账户维护费，按银行间市场规定的金额，在发生时一次性计入基金费用。

4、期货结算账户管理费，在发生时一次性计入基金费用。

5、开户费、银行间交易相关费用、转托管费用、登记机构收取的相关费用等基金运营过程中发生的相关费用，在发生时一次性计入基金费用。

6、在基金存续期间投资所发生的，与基金相关的审计费、会计师费、律师费、仲裁费、信息披露费以及按照国家有关规定可以列入的其他费用等，在相应的会计期间，按直线法在每个自然日内平均摊销；如果金额较小，不影响基金份额净值的，或者无法对应到相应会计期间，可以一次性进入基金费用。

7、与基金运营有关的其他费用，如果金额较小，不影响基金份额净值的，或者无法对应到相应会计期间，可以一次性进入基金费用；如果金额较大，影响基金份额净值的，并且可以对应到相应会计期间，应该在该会计期间内按直线法摊销。

#### （七）管理费、托管费的复核和支付程序

1、基金托管人对基金管理人计提的管理费、托管费等，根据本协议和基金合同的有关规定进行复核，核对无误后通知基金管理人。

2、基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。基金管理人与基金托管人核对一致后，基金托管人将核对无误的管理费于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力等致使无法按时支付的，支付日期顺延。

3、基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。基金管理人与基金托管人核对一致后，基金托管人将核对无误的托管费于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假等致使无法按时支付的，支付日期顺延。

4、基金托管人发现基金管理人违反有关法律法规的有关规定和《基金合同》、本

协议的约定，从基金财产中列支费用，有权要求基金管理人做出书面解释，如果基金托管人认为基金管理人无正当或合理的理由，可以拒绝支付。

## 第十章 基金份额持有人名册的保管

### 第四十五条 基金份额持有人名册的内容

(一) 基金份额持有人名册的内容包括但不限于基金份额持有人的名称和持有的基金份额。

(二) 基金份额持有人名册包括以下几类：

- 1、基金募集期结束时的基金份额持有人名册；
- 2、分红权益登记日的基金份额持有人名册；
- 3、基金份额持有人大会登记日的基金份额持有人名册；
- 4、每半年度最后一个交易日的基金份额持有人名册。

### 第四十六条 基金份额持有人名册的提供

对于每半年度最后一个交易日的基金份额持有人名册，基金管理人应在每半年度结束后5个工作日内定期向基金托管人提供。对于基金募集期结束时的基金份额持有人名册、基金权益登记日的基金份额持有人名册以及基金份额持有人大会登记日的基金份额持有人名册，基金管理人应在相关的名册生成后5个工作日内向基金托管人提供。

### 第四十七条 基金份额持有人名册的保管

基金托管人应妥善保管基金份额持有人名册。如基金托管人无法妥善保存持有人名册，基金管理人应及时向证监会报告，并代为履行保管基金份额持有人名册的职责。基金托管人应对基金管理人由此产生的合理保管费给予补偿。

## 第十一章 基金有关文件和档案的保存

第四十八条 基金管理人和基金托管人应按各自职责完整保存基金的投资活动的原始凭证、记账凭证、基金账册、交易记录和重要合同等文件档案及相应的电子文档，按照法律法规或者基金合同的规定期限进行保管。

第四十九条 基金合同的正本由基金管理人保留。除本协议另有约定之外，基

金托管人负责保管有关合同的复印件。

## 第十二章 基金托管人和基金管理人的更换

第五十条 基金管理人职责终止后，仍应妥善保管基金管理业务资料，并与新任基金管理人或临时基金管理人及时办理基金管理业务的移交手续。基金托管人应给予积极配合，并与新任基金管理人或临时基金管理人核对基金资产总值和净值。

第五十一条 基金托管人职责终止后，仍应妥善保管基金财产和基金托管业务资料，并与新任基金托管人或临时基金托管人及时办理基金财产和基金托管业务的移交手续。基金管理人应给予积极配合，并与新任基金托管人或临时基金托管人核对基金资产总值和净值。

第五十二条 其他事宜见基金合同的相关约定。

## 第十三章 禁止行为

第五十三条 基金管理人、基金托管人不得进行《基金法》第二十条、第三十八条禁止的行为、不得进行《基金法》第七十三条禁止的投资或活动，不得进行现行法律法规、证监会以及基金合同和本协议中禁止的其他任何行为。

第五十四条 除法律法规及相关监管机构另有规定，基金管理人、基金托管人不得为自身和除基金份额持有人以外的任何第三人谋取利益。基金管理人、基金托管人的高级基金管理人员和其他从业人员不得相互兼职。

第五十五条 基金管理人与基金托管人对基金经营过程中任何尚未按有关法规规定的方式公开披露的信息，不得对他人泄露，但依据法律法规、监管规定或因司法、行政等机关要求对外提供，向所聘请的审计、法律等外部专业顾问提供的以及本协议另有约定的除外。

第五十六条 基金管理人不得在没有充足资金的情况下向基金托管人发出投资指令和赎回、分红资金的划拨指令，也不得违规向基金托管人发出指令。基金托管人对基金管理人的符合本协议规定的指令不得拖延和拒绝执行。

第五十七条 除根据基金管理人指令或基金合同另有规定的，基金托管人不得动用或处分基金财产。

## 第十四章 协议的变更、终止与基金财产的清算

第五十八条 双方当事人经协商一致，可以对协议进行修改。修改后的新协议，其内容不得与基金合同的规定有任何冲突，且应当报证监会备案。

第五十九条 发生以下情况，本协议终止：

- (一) 基金合同终止；
- (二) 基金托管人解散、依法被撤销、破产或由其他基金托管人接管基金资产；
- (三) 基金管理人解散、依法被撤销、破产或由其他基金管理人接管基金管理权；
- (四) 法律法规、证监会或基金合同规定的其他事项。

第六十条 基金财产清算小组

- (一) 在基金合同约定的期限内成立基金财产清算小组；
- (二) 基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有证券、期货相关业务资格的注册会计师组成、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘请必要的工作人员；

在基金财产清算过程中，基金管理人和基金托管人应各自履行职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同和托管协议规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

(三) 基金清算小组负责本基金资产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算小组可以依法以基金的名义进行必要的民事活动。

第六十一条 基金清算程序

- (一) 基金合同终止情形出现时，基金财产清算小组统一接管基金财产；
- (二) 对基金财产和债权债务进行清理和确认；
- (三) 对基金财产进行估值和变现；
- (四) 制作清算报告；
- (五) 聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- (六) 将清算报告报证监会备案并公告；
- (七) 对基金财产进行分配；

第六十二条 基金财产清算的期限为6个月。



### 第六十三条 清算费用

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

第六十四条 依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除财产清算费用、交纳所欠税款、清偿基金债务后，将基金剩余财产按照基金份额持有人拥有份额的比例进行分配。

## 第十五章 违约责任

### 第六十五条 违约责任

(一) 一方当事人未履行或者未完全履行本协议的，由违约的一方承担违约责任；若双方当事人均有违约情形，根据实际情况，由双方当事人分别承担各自应负的违约责任。

(二) 因本协议当事人违约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。

(三) 由于一方当事人（“违约方”）的违约行为，给另一方当事人（“守约方”）造成任何损失，违约方应赔偿守约方由此发生的直接损失。

### 第六十六条 免责的范围

(一) 不可抗力；

(二) 基金管理人及/或基金托管人按照当时有效的法律法规或证监会的规定作为或不作为而造成的损失；

(三) 基金管理人由于按照基金合同规定的投资原则进行投资或不投资而造成的损失；

(四) 在已经履行基金托管人应履行的义务的情况下，基金托管人执行基金管理人的生效业务指令对基金财产造成的损失，基金托管人免责；

(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投资人损失，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但是基金管理人和基金托管人应积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响；

(六) 在资金交收日, 基金资金账户资金首先用于除新股申购以外的其他资金交收义务, 交收完成后资金余额方可用于新股申购。如果因此资金不足造成新股申购失败或者新股申购不足, 基金托管人不承担任何责任。如基金份额持有人因此提出赔偿要求, 相关法律责任和损失由基金管理人承担;

(七) 法律法规、基金合同、招募说明书或本协议规定可免责的其他事项。

## 第十六章 适用法律与争议解决

第六十七条 本协议适用中华人民共和国(为本协议之目的, 不含台湾、香港、澳门地区)法律管辖并从其解释。

### 第六十八条 争议解决

(一) 双方同意, 因本协议而产生的或与本协议有关的一切争议, 如经友好协商未能解决的, 应提交中国国际经济贸易仲裁委员会, 按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为北京市。

(二) 除提交仲裁的争议之外, 当事人仍应履行本协议的其他规定。争议处理期间, 双方当事人应恪守基金管理人和基金托管人职责, 各自继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同和托管协议规定的义务, 维护基金持有人的合法权益。

(三) 仲裁裁决是终局的, 对仲裁各方当事人均具有约束力。除非仲裁裁决另有规定, 仲裁费由败诉方承担。

## 第十七章 协议的效力

第六十九条 基金管理人在向证监会申请发售基金份额时提交的基金托管协议草案, 应经本协议当事人双方盖章以及双方法定代表人或授权代表签章, 协议当事人双方根据证监会的意见修改托管协议草案。托管协议以证监会注册的文本为正式文本。

第七十条 本协议自基金合同成立之日起成立, 自基金合同生效之日起生效。自生效之日对协议当事人具有同等的法律约束力。本协议的有效期限自其生效之日起至该金财产清算结果报证监会备案并公告之日为止。

## 第十八章 附则

第七十一条 如发生有权司法机关依法冻结基金份额持有人的基金份额时,基金管理人应予以配合,承担司法协助义务。

第七十二条 除本协议有明确定义外,本协议的用语定义适用基金合同的约定。本协议未尽事宜,当事人依据基金合同、有关法律法规等规定协商办理。

第七十三条 本协议生效后,若相关法律法规修订导致本协议相关内容与修订后的法律法规规定相冲突的,应按新修订的法律法规办理,本协议其他内容及条款继续有效。

第七十四条 本协议任何一条款被认定非法、无效或不可强制执行,不影响本协议其他条款的有效性及可强制执行性。

第七十五条 除非另有规定,一方未行使或延迟行使其在本协议项下的权利并不构成对这些权利的放弃;单一或部分行使这些权利并不排斥任何其他权利的行使。

第七十六条 本协议标题仅为提示而设,不应影响对本协议的解释。

第七十七条 本协议一式六份,协议双方各执两份,上报监管部门两份,每份具有同等法律效力。

第七十八条 本协议未尽事宜,当事人依据基金合同、有关法律、法规和规定协商办理。

(本页以下无正文)

(本页无正文,为《建信量化事件驱动股票型证券投资基金托管协议》签字页)

基金管理人(盖章): 建信基金管理有限责任公司



法定代表人或授权签字人:

张颖

基金托管人(盖章): 中国国际金融股份有限公司



法定代表人或授权签字人:

张之印

签署日期: 2019年12月4日

