证券代码：A股600611 B股900903　股票简称：大众交通 大众B股　编号：临2023-001
债券代码：163450 188742 188985　债券简称：20大众01 21大众01 21 大众 02

大众交通（集团）股份有限公司关于子公司认购私募基金份额的公告

本公司董事会及全体董事保证本公告内容不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其内容真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

释义：

除非另有说明，以下简称在本公告中含义如下：

本公司、公司：大众交通（集团）股份有限公司

上海数讯：上海数讯信息技术有限公司

宣夜投资：上海宣夜投资管理有限公司

宣夜至信季添利四号：宣夜至信季添利四号私募证券投资基金

《宣夜至信季添利四号基金合同》：《宣夜至信季添利四号私募证券投资基金基金合同》

宣夜卓润兴安一号：宣夜卓润兴安一号私募证券投资基金

《宣夜卓润兴安一号基金合同》：《宣夜卓润兴安一号私募证券投资基金基金合同》

重要内容提示：

●投资标的名称：宣夜至信季添利四号私募证券投资基金和宣夜卓润兴安一号私募证券投资基金

●投资金额：共计人民币6000万元。其中：宣夜至信季添利四号投资1000万元；宣夜卓润兴安一号投资5000万元。

●特别风险提示：本次投资可能存在程度不等的风险，包括但不限于资金损失风险、基金运营风险、流动性风险、基金募集失败的风险、基金投资风险、税收风险、其他风险。

一、投资概述

为盘活部分存量资金，同时提升公司经营业绩，2023年1月，本公司下属子公司上海数讯和宣夜投资共同签署《宣夜至信季添利四号基金合同》和《宣夜卓润兴安一号基金合同》，上海数讯拟使用自有资金人民币1000万元认购宣夜至信季添利四号A类基金份额；拟使用自有资金人民币5000万元认购宣夜卓润兴安一号A类基金份额。

根据《公司章程》的规定，本次投资无需经过公司董事会及股东大会批准。本次投资及相关协议的签署不构成《上市公司重大资产重组管理办法》规定的重大资产重组，不构成关联交易。

二、投资协议主体的基本情况

1、基金管理人

企业名称：上海宣夜投资管理有限公司

登记注册类型：私募证券投资基金管理人

注册资本：1000万元

注册地址：上海市虹口区四平路421弄107号Q164室

成立日期：2015年6月5日

法定代表人：郭首一

私募基金管理人登记编号：P1060042

私募基金管理人登记时间：2016年11月1日

经营范围：投资管理，资产管理

最近一年主要财务数据（经审计）

单位：人民币元

项目	2021年度
资产总额	5271893.3
净资产	5169579.03
营业收入	6728539.86
净利润	2786978.86

2、基金托管人

企业名称：中信证券股份有限公司

住所：广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座

法定代表人：张佑君

三、投资标的基本情况

（一）、宣夜至信季添利四号私募证券投资基金

1、基金名称：宣夜至信季添利四号私募证券投资基金

2、基金类别：契约型非公开募集投资基金。本基金分为A类份额、B类份额，除本合同另有约定外，每份相同份额类别的份额具有同等的合法权益。

3、基金的运作方式：开放式

4、基金的投资目标和投资范围：基金投资目标详见本合同第十二节“基金的投资”第（一）条“投资目标”的约定；基金投资范围详见本合同第十二节“基金的投资”第（二）条“投资范围”的约定。

5、基金的存续期限：自本基金成立之日起10年

6、基金计划募集总额：本基金的计划募集总额为5000万元，管理人有权根据实际募集情况予以调整，基金管理人应将调整情况以本合同约定的方式之一通知已签署合同的委托人和托管人，自通知之日起本基金的计划募集总额以管理人通知的金额为准。

7、基金份额的初始募集面值：基金份额的初始募集面值为1.00元

8、基金的托管：基金的基金托管人为中信证券股份有限公司

9、基金的外包服务：本基金的行政服务机构为中信中证投资服务有限责任公司（外包业务登记编码：A00045）。

10、基金份额的分类：本基金根据不同类型的委托人，分为A类份额和B类份额。其中，管理人，管理人股东，管理人员工，管理人发行或担任投资顾问的资管产品等特定投资者为B类份额的委托人，除B类份额投资者以外的所有合格投资者均可为A类份额的委托人。

基金针对A类份额、B类份额设置不同的认/申购费、赎回费、管理费、业绩报酬收取比例，A类份额、B类份额合并运作，但分别募集，分别设置代码，分别计算和披露各类份额对应的基金份额净值和基金份额累计净值。本基金不是结构化基金，不存在一类份额为另一类份额提供风险补偿的情况。

（二）、宣夜卓润兴安一号私募证券投资基金

1、基金名称：宣夜卓润兴安一号私募证券投资基金

2、基金类别：契约型非公开募集投资基金。本基金分为A类份额、B类份额，除本合同另有约定外，每份相同份额类别的份额具有同等的合法权益。

3、基金的运作方式：开放式

4、基金的投资目标和投资范围：基金投资目标详见本合同第十二节“基金的投资”第（一）条“投资目标”的约定；基金投资范围详见本合同第十二节“基金的投资”第（二）条“投资范围”的约定。

5、基金的存续期限：自本基金成立之日起10年

6、基金计划募集总额：本基金的计划募集总额为5000万元，管理人有权根据实际募集情况予以调整，基金管理人应将调整情况以本合同约定的方式之一通知已签署合同的委托人和托管人，自通知之日起本基金的计划募集总额以管理人通知的金额为准。

7、基金份额的初始募集面值：基金份额的初始募集面值为1.00元

8、基金的托管：基金的基金托管人为中信证券股份有限公司

9、基金的外包服务：本基金的行政服务机构为中信中证投资服务有限责任公司（外包业务登记编码：A00045）。

10、基金份额的分类：本基金根据不同类型的委托人，分为A类份额和B类份额。其中，管理人，管理人股东，管理人员工，管理人发行或担任投资顾问的资管产品等特定投资者为B类份额的委托人，除B类份额投资者以外的所有合格投资者均可为A类份额的委托人。

基金针对A类份额、B类份额设置不同的认/申购费、赎回费、管理费、业绩报酬收取比例，A类份额、B类份额合并运作，但分别募集，分别设置代码，分别计算和披露各类份额对应的基金份额净值和基金份额累计净值。本基金不是结构化基金，不存在一类份额为另一类份额提供风险补偿的情况。

（三）关联关系或其他利益关系说明：标的基金未直接或间接持有本公司股份；亦无增持本公司股份的计划；且与本公司不存在相关利益安排。

四、私募基金合同的主要内容

（一）、宣夜至信季添利四号私募证券投资基金

1、基金名称：

宣夜至信季添利四号私募证券投资基金

2、投资目标：

在控制风险的前提下，实现基金资产的稳健增长。

3、投资范围：

本基金的投资范围为：存托凭证（DR）、债券回购（包括债券正回购和债券逆回购）、现金、银行存款（包括定期存款、协议存款和其他银行存款）、同业存单、大额可转让定期存单、货币市场基金，交易所上市交易的期货，法律法规或中国证监会允许基金投资的其他投资品种。

如法律法规规定基金管理人需取得特定资质后方可投资某产品，则基金管理人须在获得相应资质后开展此项业务。

在本基金投资范围允许并符合相关法律法规的规定的前提下，参与银行间债券、场外期权、收益互换及未列示的其它品种，管理人需提前与托管人就清算交收、核算估值等事项达成一致意见。若管理人擅自参与上述业务的，产生的估值核算等问题，由管理人承担相关责任。

4、投资范围的变更程序

本基金拟投资于上述投资范围中未明确列示的其他投资品种或变更基金投资范围的，管理人应以传真、电话、短信、电子邮件、信件等任一方式一对一地发送投资范围变更通知函（以下简称“通知函”），至少提前三个工作日告知基金委托人，并以书面形式通知托管人。管理人需在通知函中载明投资范围变更生效日和允许赎回的开放日，所增加投资品种的风险揭示。基金管理人须在变更生效日之前设置临时开放日（通知函发出之日至变更生效日期间有允许赎回的固定开放日的除外，本次开放不受年度临时开放日次数的限制），允许不同意变更的基金委托人赎回；未在变更生效日前全部赎回份额的基金委托人视为同意前述变更。因本条项下事由的赎回申请，不受本基金合同关于份额锁定期（若有）、封闭期（若有）和巨额赎回（若有）的限制。如通知函中载明的开放日出现本合同约定的“暂停赎回或取消赎回的情形”，管理人需在前述情形解除后且在变更生效日前另设临时开放日（本次开放不受年度临时开放日次数的限制）。若上述情形在通知函载明的变更生效日前无法解除的，变更生效日应延期至前述另设的临时开放日之后。除本条约定需对变更生效日进行延期的以外，变更事项自通知函中载明的变更生效日起生效，对合同各方均具有法律效力。

5、投资策略：

在控制风险的前提下，本基金通过程序化高频交易及流动性管理相组合达到稳定盈利。

6、投资限制：

本基金的投资组合将遵循以下限制（本基金自进入清算程序后无需遵循以下投资比例限制）：

（1）本基金投资的私募投资基金（包括有限合伙）必须有托管机构；

（2）本基金的基金资产总值占基金资产净值的比例不得超过200%；

（3）本基金不得投资非证券类私募基金管理人发行的私募投资基金（包括有限合伙）；

（4）本基金投资存款、货币型基金、国债逆回购等债权类资产在本基金总资产的占比为0-100%，投资于商品及金融衍生品的已占用保证金在本基金总资产的占比为0-95%；

（5）本基金不得主动投资流动性不足的商品期货品种；

（6）法律法规或监管部门规定的其他投资限制。

基金委托人已经知晓且确认：以上第4、5项投资限制由基金管理人自行监控，基金托管人不承担投资监督职责，若本基金在运作中违反了前述投资限制的约定，全部责任由基金管理人承担。

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

基金管理人自本基金成立之日起2个月内使本基金的投资组合比例符合上款约定。因证券市场波动、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不符合基金合同约定的投资比例的，基金管理人在10个交易日内调整完毕。如因证券暂停交易或其他非基金管理人可以控制的原因导致基金管理人不能履行调整义务的，则不受上款约定之限制，但基金管理人应当自证券恢复交易之日起的10个交易日内使本基金的投资组合比例符合上款约定。法律法规另有规定的从其规定。基金托管人对本基金的投资的监督自本基金成立之日起开始。

7、禁止行为：

为维护基金委托人的合法权益，本基金的基金管理人、基金托管人、基金销售机构及其他服务机构及其从业人员禁止从事下列行为：

（1）将其固有财产或者他人财产混同于基金财产从事投资活动；

（2）不公平地对待其管理的不同基金财产；

（3）利用基金财产或者职务之便，为本人或者委托人以外的人牟取利益，进行利益输送；

（4）侵占、挪用基金财产；

（5）泄露因职务便利获取的未公开信息，利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；

（6）从事损害基金财产和委托人利益的投资活动；

（7）玩忽职守，不按照规定履行职责；

（8）从事内幕交易、操纵交易价格及其他不正当交易活动；

（9）法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他行为。

8、利益冲突及处理

基金管理人可运用基金财产与基金管理人、基金委托人、基金管理人管理的私募投资基金、基金管理人的实际控制人控制的其他私募基金管理人管理的私募投资基金，及与上述主体有其他重大利害关系的关联方进行交易，或从事其他重大关联交易，但需要遵循基金份额持有人利益优先、平等自愿、等价有偿的原则，并防范利益冲突，符合监管机构的规定。

基金投资者签署本合同即表明其已经知晓且同意本基金可进行上述关联交易。基金管理人应当在前述关联交易实际发生后的合理时间内向基金委托人披露该等交易的进展情况，并依照本基金合同的约定履行信息披露义务。

基金份额持有人不得因本基金投资收益劣于基金管理人、基金托管人及其关联方管理的其他类似投资产品的收益，而向基金管理人或基金托管人提出任何损失或损害补偿的要求。

9、全体基金份额持有人在此授权并同意：本基金投资非证券交易所或期货交易所发行、上市的投资标的时，基金管理人有权代表本基金与相关方签署基金投资相关文件及协议，并办理相关权属登记及变更手续。基金管理人应确保投资相关文件及协议中载明本基金名称以及真实的资金来源为本基金，如确有合理理由无法载明前述内容的，基金管理人应确保向投资相对方说明真实的资金来源为本基金，并保证将投资本金及收益及时划付至本基金托管账户。

10、预警平仓机制

本基金预警线为0.9800元，平仓线为0.9700元。

当基金管理人与基金托管人核对一致的基金份额净值小于或等于预警线时，本基金触发预警机制。自该核对一致之日的下一交易日起的三个交易日内，基金管理人以本基金合同约定方式之一通知全体委托人，提示本基金触及预警线及相关风险。

当基金管理人与基金托管人核对一致的基金份额净值小于或等于平仓线时，本基金触发平仓机制。无论该核对一致之日之后的基金份额净值是否高于平仓线，基金管理人须自该核对一致之日的下一交易日起10个交易日内，完成对本基金持有的全部资产的不可逆变现，并按照本合同约定的基金清算程序进行清算。若因本基金所持有标的流通受限或其他非基金管理人可以控制的原因导致无法变现的，变现期限可相应合理延长，但基金管理人需在前述限制情形解除后及时完成变现并进行清算。

基金预警和平仓机制的启动及操作由基金管理人负责执行，对于基金管理人按照或者未按照基金合同的约定执行，由此对基金财产或基金委托人造成的损失，基金托管人不承担任何责任。

11、越权交易处理

（1）越权交易的界定

越权交易是指基金管理人违反法律法规或本合同约定的投资交易行为。

基金管理人应在法律法规或本合同约定的权限内运用基金财产进行投资管理，不得违反前述范围，超越权限进行投资。

（2）越权交易的处理程序

基金托管人发现基金管理人的投资划款指令或实际投资运作违反法律法规的规定或本合同的约定，应及时以电话提醒、电子邮件或其他书面通知等任一方式通知基金管理人限期纠正。基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查。基金管理人收到通知后应在下一工作日前及时核对并以书面或电子邮件形式给基金托管人发出回函，就基金托管人的疑义进行解释或举证，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内，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，基金托管人有权报告金融监管部门。基金管理人应赔偿因其越权交易行为而致使基金委托人和基金托管人遭受的损失。

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法规的规定或本合同的约定，应当立即通知基金管理人，由此造成的损失由基金管理人承担。

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

（3）越权交易的例外

非因基金管理人主动投资行为导致的下列不符合法律法规或合同约定的情形不构成本章所述越权交易，应当属于被动超标，因被动超标而对基金财产造成的损失由基金财产承担：

①由于基金管理人可控制之外的原因导致投资比例不符合法律法规或本合同约定的，包括但不限于证券市场波动、上市公司合并、已投资持有的证券在持有期间信用评级下降、上市公司受到金融监管部门处罚或谴责、上市公司股票被特别处理、上市公司年度财务审计报告未被出具标准无保留意见等。发生前述情形时，基金管理人应在相应证券可交易之日起10个交易日内调整完毕，因证券停牌或其他非基金管理人可以控制的原因，调整时限可相应合理延长。

②本合同终止前10个交易日内，基金管理人有权对基金财产所投资证券进行变现，由此造成投资比例、投资范围不符合合同约定的。

③法律法规或本合同对被动超标另有规定的从其规定。

12、估值依据和方法

本基金按照《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》、《证券投资基金股指期货投资会计核算业务细则（试行）》、《证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）》等金融监管部门制定的基金估值相关业务规则办理基金资产估值。

（1）证券交易所上市有价证券的估值方法（如适用）

（2）处于未上市期间的有价证券的估值方法（如适用）

（3）证券投资基金的估值方法（如适用）

（4）期货的估值方法（如适用）

（5）交易所上市交易的期权的估值方法（如适用）

（6）资产管理计划、私募投资基金或信托计划的估值方法（以下简称“标的产品”）（如适用）

（7）收益互换的估值方法（如适用）

（8）场外期权的估值方法（如适用）

（9）收益凭证的估值方法（如适用）

（10）新三板的估值方法（如适用）

（11）港股通的估值方法（如适用）

（12）黄金现货交易的估值方法（如适用）

（13）利率互换的估值方法（如适用）

（14）融资融券、转融通的估值方法（如适用）

（15）银行间债券市场的估值方法（如适用）

（16）债券回购（如适用）

（17）其他资产的估值方法（如适用）

（18）如基金管理人与基金托管人，协商一致认为按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，或上述方法无法满足估值需要时，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方法估值。

（19）对于估值方法中涉及标的产品的净值信息和虚拟净值信息（若有）、标的估值报告数据（包括但不限于收益互换、场外期权、收益凭证等估值报告）的，托管人仅根据管理人或其委托的第三方提供的信息和数据进行估值，管理人或其委托的第三方应确保标的产品的份额净值和虚拟份额净值、标的估值报告的估值\减值计量的真实性、准确性、完整性以及适用性。标的品种若有使用摊余成本法的计量，管理人应确保该类品种符合摊余成本法适用条件，充分合理评估信用风险和适用的预期信用损失模型，并及时做好信用监控、方法模型参数等评估工作，通知托管人进行减值计量。如因管理人或其委托的第三方提供数据错误或未能按时评估等造成估值结果不准确或不及时并对本合同其他当事人和基金财产造成损失的，基金管理人应当承担赔偿责任或向数据提供方进行追偿，托管人不承担责任。

（20）如基金管理人或基金托管人发现对基金财产的估值违反本合同项下订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金委托人利益时，应立即通知对方，共同查明原因，双方协商解决。

（21）相关法律、行政法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

13、费用计提方法、计提标准和支付方式：

（1）管理人的管理费

本基金仅针对A类份额收取管理费，B类份额不收取管理费。本基金A类份额的年管理费率为0.5%。本基金某类份额的管理费分别从该类基金资产净值中扣除，支付给基金管理人。

管理费的计算公式为：H＝E×R÷N

H：每日应计提的管理费；

E：前一日的该类份额基金资产净值；

R：该类份额的年管理费率；

N：当年的实际天数。

本基金的管理费自基金成立日起，每日计提，按季支付。当季应收管理费由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自行在下季初十个工作日内扣收，并按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具划款指令。基金管理人应于每季初五个工作日内在托管账户备足应支付的管理费。费用扣划后，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）基金托管人的托管费

本基金的年托管费率为0.01%。

托管费的计算公式为：H＝E×R÷N

H：每日应计提的托管费；

E：前一日的基金资产净值；

R：年托管费率；

N：当年的实际天数。

本基金的托管费自基金成立日起，每日计提，按季支付。当季应收托管费由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自行在下季初十个工作日内扣收，并按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具划款指令。基金管理人应于每季初五个工作日内在托管账户备足应支付的托管费。费用扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

（3）基金管理人收取的业绩报酬

本基金仅针对A类份额计提业绩报酬，B类份额不计提业绩报酬。本基金A类份额业绩报酬按照以下方式计提：

本基金业绩报酬计提基准日分为该类份额的除息日（若有）、赎回申请日和基金终止日。业绩报酬计提日为分红确认日（若有）、赎回确认日和基金终止确认日。若某次分红（若有）对应的除息日与该类份额上一个发生业绩报酬计提对应的除息日间隔期短于3个月时，则该次分红的除息日及其对应的分红确认日（若有）不计提业绩报酬。

管理人将根据委托人每笔投资的期间年化收益率（R），当期间年化收益率大于4.5%时，对所有收益按照60%的比例收取业绩报酬，且计提后该笔份额的期间年化收益率不低于4.5%。

①业绩报酬计提原则

A、委托人每笔参与份额分别计算期间年化收益率并计提业绩报酬。

B、在符合业绩报酬计提条件时，在分红确认日（若有）、赎回确认日和基金终止确认日计提业绩报酬。

C、分红确认日（若有）提取业绩报酬的，业绩报酬从分红资金中扣除且不超过该类分红资金。在赎回确认日和终止确认日提取业绩报酬的，业绩报酬从赎回资金或清算资金中扣除。

D、在赎回确认日和基金终止确认日，业绩报酬按委托人赎回份额或基金终止时持有份额计算。如赎回份额为一笔认购/申购份额的一部分，则将该赎回份额单独核算业绩报酬，而该笔认购/申购份额的剩余部分不受影响。

②业绩报酬计提方法

业绩报酬的计提，以该笔份额上一个发生业绩报酬计提的业绩报酬计提基准日（简称“上一个业绩报酬计提基准日”）至本次业绩报酬计提基准日的期间为基准。上一个业绩报酬计提基准日，如委托人该笔份额未发生业绩报酬计提，认购所得的份额，以本基金成立日为准；申购所得的份额，以申购申请对应的开放日为准；分红所得的份额（若有），以红利再投资对应的除息日为准。委托人赎回时，按照“先进先出”法，分别计算每一笔认购/申购/红利再投资份额（若有）应收的业绩报酬。

A、期间年化收益率的计算公式R=[（P1-P0）÷P0x]×（365÷T）×100%

其中：R=期间年化收益率

P1=本次业绩报酬计提基准日的该类基金份额累计净值

P0=上一个业绩报酬计提基准日的该类基金份额累计净值

P0x=上一个业绩报酬计提基准日的该类基金份额净值

T=上一个发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日（含）到本次业绩报酬计提日（不含）的天数

B、管理人以超额比例的方式提取业绩报酬，具体计算公式如下：

期间年化收益率	收取比例	业绩报酬计算公式
R≤4.5%	0	E=0
4.5%＜R	60%	E=min[N×P0x×R×60%×(T÷365),N×P0x×(R-4.5%)×(T÷365)]

E=某笔份额对应的业绩报酬

N=委托人该笔认（申）购或红利再投资（若有）在分红权益登记日所持的份额数，或其在本次赎回日赎回的份额数，或其在基金终止时所持的份额数

C、将所有笔数的业绩报酬加总，得到总的业绩报酬（∑E）。

∑E=E1+E2+E3+.....+En

其中的n为所对应的份额笔数。

业绩报酬由注册登记机构负责计算，基金托管人不对计算结果进行复核。

③业绩报酬的支付方式

基金管理人于业绩报酬计提日起三个工作日内向基金托管人发送业绩报酬划款指令，基金托管人按照指令从基金财产中一次性支付给基金管理人。

（4）为基金募集、运营、审计、法律顾问等提供服务的基金服务机构的服务费（若有）

本基金的年行政服务费率为0.01%。

行政服务费的计算公式为：H＝E×R÷N

H：每日应计提的行政服务费；

E：前一日的基金资产净值；

R：年行政服务费率；

N：当年的实际天数。

本基金的行政服务费自基金成立日起，每日计提，按季支付。当季应收行政服务费由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自行在下季初十个工作日内扣收，并按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具划款指令。基金管理人应于每季初五个工作日内在托管账户备足应支付的行政服务费。费用扣划后，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。

14、基金收益分配原则

（1）在本基金存在可供分配利润的前提下，基金管理人有权决定是否对基金进行收益分配，收益分配的比例亦由基金管理人决定；

（2）收益分配方为采取现金分红或红利再投资等两种方式。红利再投资是将某类份额的现金红利按照基金分红除息日的该类基金份额净值自动转为该类基金份额；本基金默认采用现金分红；

（3）本基金允许变更分红方式；

允许变更收益分配方式的，基金委托人应当通过基金销售机构提交申请，由注册登记机构进行处理；

当次分红确认的方式按照委托人在权益登记日之前最后一次选择的分红方式为准，若未选择则按照本基金默认的分红方式执行。委托人如需修改分红方式，应于权益登记日前一工作日的交易时间结束前（即交易日15:00前）办理变更手续，委托人在权益登记日前一个工作日超过交易时间提交的修改分红方式的申请对本次收益分配无效，自下一次收益分配起生效；

（4）某类份额基金收益分配后对应的该类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的某类基金份额净值减去每单位该类份额收益分配金额后不能低于面值；

（5）同一份额类别的每一基金份额享有同等分配权；

（6）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4次；

（7）法律法规另有规定的，从其规定。

15、违约责任

（1）基金合同各方当事人在实现各自权利、履行各自义务的过程中，违反法律法规规定或者本合同约定的，应当各自承担相应的责任；给基金财产或者基金合同其他当事人造成损失的，应当分别对各自的行为所造成的损失依法承担赔偿责任。本合同能够继续履行的，应当继续履行。

（2）发生下列情况的，当事人可以免除相应的责任：

①不可抗力；

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

③基金管理人由于按照本合同约定的投资原则行使或不行使其投资权而造成的损失；

④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财产造成的损失；

⑤基金委托人未能事前就其关联证券或其他禁止交易证券明确告知基金管理人，致使基金财产发生违规投资行为的，基金管理人和基金托管人均不承担任何责任；

⑥无论本合同其他条款如何约定，就本合同项下的基金托管人责任而言，基金托管人履行了本合同所明确约定属于托管人的义务的，对本基金的任何风险或损失，托管人不承担任何责任；

⑦如管理人、第三人对托管人所承担的责任进行虚假宣传，或以托管人名义或利用托管人商誉进行募集资金、承诺投资收益等违规活动，托管人不承担任何责任。

（3）本合同当事一方造成违约后，其他当事方应当采取适当措施防止损失的扩大；没有采取适当措施致使损失扩大的，不得就扩大的损失要求赔偿。守约方因防止损失扩大而支出的合理费用由违约方承担。

（4）责任划分

如果基金管理人和基金托管人其中一方违约，给基金资产造成损失的，应由违约方就直接损失进行赔偿，守约方有权接受基金委托人委托向违约方追偿；如果基金管理人和基金托管人两方都违反合同，给基金资产造成损失的，无论本合同或任何相关合同、书面约定有任何其它相反的约定，在任何情况下，在托管人和管理人之间的最终责任的分配和承担上，由双方分别根据其过错程度承担各自应负的赔偿责任。

（5）违约赎回

本基金不接受违约赎回。

16、争议的处理

对于因本合同的订立、内容、履行和解释或与本合同有关的争议，合同当事人应尽量通过协商、调解途径解决。不愿或者不能通过协商、调解解决的，任何一方均有权将争议提交北京仲裁委员会根据该会届时有效的仲裁规则，适用普通程序进行仲裁，仲裁的地点在北京市。仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力。仲裁费用由败诉方承担。

本合同受中华人民共和国法律（为本合同之目的，在此不包括香港、澳门特别行政区和台湾地区法律）管辖。

（二）、宣夜卓润兴安一号私募证券投资基金

1、基金名称：

宣夜卓润兴安一号私募证券投资基金

2、投资目标：

在控制风险的前提下，实现基金资产的稳健增长。

3、投资范围：

本基金的投资范围为：存托凭证（DR）、债券回购（包括债券正回购和债券逆回购）、现金、银行存款（包括定期存款、协议存款和其他银行存款）、同业存单、大额可转让定期存单、货币市场基金、债券型公募基金，法律法规或中国证监会允许基金投资的其他投资品种。

如法律法规规定基金管理人需取得特定资质后方可投资某产品，则基金管理人须在获得相应资质后开展此项业务。

在本基金投资范围允许并符合相关法律法规的规定的前提下，参与银行间债券、场外期权、收益互换及未列示的其它品种，管理人需提前与托管人就清算交收、核算估值等事项达成一致意见。若管理人擅自参与上述业务的，产生的估值核算等问题，由管理人承担相关责任。

4、投资范围的变更程序

本基金拟投资于上述投资范围中未明确列示的其他投资品种或变更基金投资范围的，管理人应以传真、电话、短信、电子邮件、信件等任一方式一对一地发送投资范围变更通知函（以下简称“通知函”），至少提前三个工作日告知基金委托人，并以书面形式通知托管人。管理人需在通知函中载明投资范围变更生效日和允许赎回的开放日，所增加投资品种的风险揭示。基金管理人须在变更生效日之前设置临时开放日（通知函发出之日至变更生效日期间有允许赎回的固定开放日的除外，本次开放不受年度临时开放日次数的限制），允许不同意变更的基金委托人赎回；未在变更生效日前全部赎回份额的基金委托人视为同意前述变更。因本条项下事由的赎回申请，不受本基金合同关于份额锁定期（若有）、封闭期（若有）和巨额赎回（若有）的限制。如通知函中载明的开放日出现本合同约定的“暂停赎回或取消赎回的情形”，管理人需在前述情形解除后且在变更生效日前另设临时开放日（本次开放不受年度临时开放日次数的限制）。若上述情形在通知函载明的变更生效日前无法解除的，变更生效日应延期至前述另设的临时开放日之后。除本条约定需对变更生效日进行延期的以外，变更事项自通知函中载明的变更生效日起生效，对合同各方均具有法律效力。

5、投资策略：

在控制风险的前提下，本基金通过程序化交易及流动性管理相组合达到稳定盈利。

6、投资限制：

本基金的投资组合将遵循以下限制（本基金自进入清算程序后无需遵循以下投资比例限制）：

（1）本基金投资的私募投资基金（包括有限合伙）必须有托管机构；

（2）本基金的基金资产总值占基金资产净值的比例不得超过200%；

（3）本基金不得投资非证券类私募基金管理人发行的私募投资基金（包括有限合伙）；

（4）本基金投资于货币市场基金的市值不得低于基金资产总值的40%；

（5）法律法规或监管部门规定的其他投资限制。

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

基金管理人自本基金成立之日起2个月内使本基金的投资组合比例符合上款约定。因证券市场波动、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不符合基金合同约定的投资比例的，基金管理人在10个交易日内调整完毕。如因证券暂停交易或其他非基金管理人可以控制的原因导致基金管理人不能履行调整义务的，则不受上款约定之限制，但基金管理人应当自证券恢复交易之日起的10个交易日内使本基金的投资组合比例符合上款约定。法律法规另有规定的从其规定。基金托管人对本基金的投资的监督自本基金成立之日起开始。

7、禁止行为：

为维护基金委托人的合法权益，本基金的基金管理人、基金托管人、基金销售机构及其他服务机构及其从业人员禁止从事下列行为：

（1）将其固有财产或者他人财产混同于基金财产从事投资活动；

（2）不公平地对待其管理的不同基金财产；

（3）利用基金财产或者职务之便，为本人或者委托人以外的人牟取利益，进行利益输送；

（4）侵占、挪用基金财产；

（5）泄露因职务便利获取的未公开信息，利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；

（6）从事损害基金财产和委托人利益的投资活动；

（7）玩忽职守，不按照规定履行职责；

（8）从事内幕交易、操纵交易价格及其他不正当交易活动；

（9）法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他行为。

8、利益冲突及处理

基金管理人可运用基金财产与基金管理人、基金委托人、基金管理人管理的私募投资基金、基金管理人的实际控制人控制的其他私募基金管理人管理的私募投资基金，及与上述主体有其他重大利害关系的关联方进行交易，或从事其他重大关联交易，但需要遵循基金份额持有人利益优先、平等自愿、等价有偿的原则，并防范利益冲突，符合监管机构的规定。

基金投资者签署本合同即表明其已经知晓且同意本基金可进行上述关联交易。基金管理人应当在前述关联交易实际发生后的合理时间内向基金委托人披露该等交易的进展情况，并依照本基金合同的约定履行信息披露义务。

基金份额持有人不得因本基金投资收益劣于基金管理人、基金托管人及其关联方管理的其他类似投资产品的收益，而向基金管理人或基金托管人提出任何损失或损害补偿的要求。

9、全体基金份额持有人在此授权并同意：本基金投资非证券交易所或期货交易所发行、上市的投资标的时，基金管理人有权代表本基金与相关方签署基金投资相关文件及协议，并办理相关权属登记及变更手续。基金管理人应确保投资相关文件及协议中载明本基金名称以及真实的资金来源为本基金，如确有合理理由无法载明前述内容的，基金管理人应确保向投资相对方说明真实的资金来源为本基金，并保证将投资本金及收益及时划付至本基金托管账户。

10、预警平仓机制

本基金预警线为0.9800元，平仓线为0.9700元。

当基金管理人与基金托管人核对一致的基金份额净值小于或等于预警线时，本基金触发预警机制。自该核对一致之日的下一交易日起的三个交易日内，基金管理人以本基金合同约定方式之一通知全体委托人，提示本基金触及预警线及相关风险。

当基金管理人与基金托管人核对一致的基金份额净值小于或等于平仓线时，本基金触发平仓机制。无论该核对一致之日之后的基金份额净值是否高于平仓线，基金管理人须自该核对一致之日的下一交易日起10个交易日内，完成对本基金持有的全部资产的不可逆变现，并按照本合同约定的基金清算程序进行清算。若因本基金所持有标的流通受限或其他非基金管理人可以控制的原因导致无法变现的，变现期限可相应合理延长，但基金管理人需在前述限制情形解除后及时完成变现并进行清算。

基金预警和平仓机制的启动及操作由基金管理人负责执行，对于基金管理人按照或者未按照基金合同的约定执行，由此对基金财产或基金委托人造成的损失，基金托管人不承担任何责任。

11、越权交易处理

（1）越权交易的界定

越权交易是指基金管理人违反法律法规或本合同约定的投资交易行为。

基金管理人应在法律法规或本合同约定的权限内运用基金财产进行投资管理，不得违反前述范围，超越权限进行投资。

（2）越权交易的处理程序

基金托管人发现基金管理人的投资划款指令或实际投资运作违反法律法规的规定或本合同的约定，应及时以电话提醒、电子邮件或其他书面通知等任一方式通知基金管理人限期纠正。基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查。基金管理人收到通知后应在下一工作日前及时核对并以书面或电子邮件形式给基金托管人发出回函，就基金托管人的疑义进行解释或举证，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内，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，基金托管人有权报告金融监管部门。基金管理人应赔偿因其越权交易行为而致使基金委托人和基金托管人遭受的损失。

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法规的规定或本合同的约定，应当立即通知基金管理人，由此造成的损失由基金管理人承担。

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

（3）越权交易的例外

非因基金管理人主动投资行为导致的下列不符合法律法规或合同约定的情形不构成本章所述越权交易，应当属于被动超标，因被动超标而对基金财产造成的损失由基金财产承担：

①由于基金管理人可控制之外的原因导致投资比例不符合法律法规或本合同约定的，包括但不限于证券市场波动、上市公司合并、已投资持有的证券在持有期间信用评级下降、上市公司受到金融监管部门处罚或谴责、上市公司股票被特别处理、上市公司年度财务审计报告未被出具标准无保留意见等。发生前述情形时，基金管理人应在相应证券可交易之日起10个交易日内调整完毕，因证券停牌或其他非基金管理人可以控制的原因，调整时限可相应合理延长。

②本合同终止前10个交易日内，基金管理人有权对基金财产所投资证券进行变现，由此造成投资比例、投资范围不符合合同约定的。

③法律法规或本合同对被动超标另有规定的从其规定。

12、估值依据和方法

本基金按照《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》、《证券投资基金股指期货投资会计核算业务细则（试行）》、《证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）》等金融监管部门制定的基金估值相关业务规则办理基金资产估值。

（1）证券交易所上市有价证券的估值方法（如适用）

（2）处于未上市期间的有价证券的估值方法（如适用）

（3）证券投资基金的估值方法（如适用）

（4）期货的估值方法（如适用）

（5）交易所上市交易的期权的估值方法（如适用）

（6）资产管理计划、私募投资基金或信托计划的估值方法（以下简称“标的产品”）（如适用）

（7）收益互换的估值方法（如适用）

（8）场外期权的估值方法（如适用）

（9