

证券代码：300718

证券简称：长盛轴承

公告编号：2020-058

浙江长盛滑动轴承股份有限公司 关于公司认购平凡浩善私募证券投资基金份额的公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露内容的真实、准确和完整，没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

重要内容提示：

- 1、**私募基金名称：**平凡浩善私募证券投资基金(以下简称“本基金”、“基金”具体名称以实际备案的名称为准)
- 2、**基金管理人：**浙江海宁平凡投资管理有限公司(以下简称“平凡投资”)
- 3、**基金托管人：**海通证券股份有限公司(以下简称“海通证券”)
- 4、**认购基金的金额：**不超过人民币3000万元(具体以实际认购金额为准)
- 5、**基金存续期限：**自基金合同生效之日起10年。

一、本次投资概述

浙江长盛滑动轴承股份有限公司(以下简称“公司”)，拟以自有资金认购平凡浩善私募证券投资基金份额，公司本次拟认购金额不超过人民币3000万元(具体以实际认购金额为准)，基金存续期限为自基金合同生效之日起10年。

公司于2020年12月22日召开第四届董事会第三次会议、第四届监事会第三次会议，审议通过了《关于公司认购平凡浩善私募证券投资基金份额的议案》。根据《深圳证券交易所股票上市规则》、《深圳证券交易所上市公司信息披露指引第5号——交易与关联交易》等相关规定，本次投资事项无需提交公司股东大会审议。

本次对外投资不构成同业竞争和关联交易，也不构成《上市公司重大资产重组管理办法》的重大资产重组。

二、平凡浩善私募证券投资基金的基本情况

(一) 基金管理人

- 1、企业名称：浙江海宁平凡投资管理有限公司

-
- 2、统一社会信用代码：91330481329947064C
 - 3、企业类型：有限责任公司（自然人投资或控股）
 - 4、住址：浙江省嘉兴市海宁市海宁经编产业园区经都二路2号经编大厦18层1820室
 - 5、通讯地址：北京市朝阳区朝阳区阜通东大街6号院2号方恒国际中心B座607
 - 6、注册资本：1,000万元
 - 7、法定代表人：高欣
 - 8、经营范围：投资管理；企业经营性资产管理。

（二）基金托管人

- 1、企业名称：海通证券股份有限公司
- 2、统一社会信用代码：9131000013220921X6
- 3、住址：上海市黄浦区广东路689号
- 4、通讯地址：上海市黄浦区广东路689号第30层第3002室单元
- 5、注册资本：1,306,420万元
- 6、法定代表人：周杰

三、关联关系或其他利益关系说明

平凡浩善私募证券投资基金的基金管理人、基金托管人与上市公司不存在关联关系或利益安排、与上市公司控股股东、实际控制人、董事、监事、高级管理人员不存在关联关系或利益安排、不存在直接或间接形式持有上市公司股份等情形。

公司控股股东、实际控制人、持股5%以上的股东、董事、监事、高级管理人员不参与平凡浩善私募证券投资基金份额认购、不在平凡浩善私募证券投资基金中任职。

四、合同主要内容

（一）基金的名称

平凡浩善私募证券投资基金

（二）基金的运作方式

契约型开放式

（三）基金的投资目标

本基金通过将基金投资者投入的资金加以集合运用，对资产进行专业化的管理和运用，谋求资产的稳定增值。

（四）基金的投资范围

投资于沪深交易所发行及上市的股票（包含新股申购）、港股通标的范围内的股票、沪深交易所发行及上市的存托凭证、证券交易所发行及上市的优先股、证券公司收益凭证、债券逆回购、沪深交易所质押式报价回购、银行存款（包括定期存款、协议存款、结构性存款及其他银行存款）、可转债、股指期货、股票期权、公开募集证券投资基金（包括分级基金B、ETF）、参与融资融券、以具有相应业务资格的机构做交易对手的收益互换等投资种类，如法律法规规定管理人需取得特定资质后方可投资某产品，则管理人须在获得相应资质后开展此项业务。

基金成立后备案完前，可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管理工具。

（五）本基金存续期限

本基金存续期限：10年。合同到期前经当事人协商一致可以展期，合同到期前经当事人协商一致可以展期，但有关法律、法规另有规定的除外。

（六）本基金风险等级

基于本基金的投资范围及投资策略，本基金不承诺保本及最低收益。本基金产品的风险等级为R4，适合风险承受能力等级为C（4、5）的合格投资者。（本基金产品的具体风险等级以募集机构产品评级结果为准）。

（七）预警线及止损线

本基金不设置预警线。本基金止损线为本基金份额净值0.95元。

（八）平凡浩善私募证券投资基金当事人及其权利义务

1.1、基金份额持有人的权利

（1）取得基金财产收益；

-
- (2) 取得清算后的剩余基金财产；
 - (3) 按照本合同的约定申购、赎回和转让基金份额；
 - (4) 按照本合同的约定，参加或申请召集基金份额持有人大会，行使相关职权；
 - (5) 监督基金管理人及基金托管人履行投资管理和保管义务的情况；
 - (6) 因基金管理人、基金托管人违反法律法规或本合同约定导致合法权益受到损害的，有权得到赔偿；
 - (7) 按照本合同约定的时间和方式获得基金信息披露资料；
 - (8) 在投资冷静期内，基金投资者有权全额申请退款；
 - (9) 国家有关法律法规、监管机构及本合同规定的其他权利。

1.2、基金份额持有人的义务

- (1) 认真阅读本合同，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投资者资金直接或者间接投资于私募基金的，应向基金管理人充分披露上述情况及最终投资者的信息，但符合《私募投资基金监督管理暂行办法》第十三条规定的除外；
- (4) 认真阅读并签署风险揭示书；
- (5) 按照本合同约定缴纳基金份额的认购、申购款项，承担本合同约定的管理费、托管费、投资顾问费及其他相关费用；
- (6) 按照本合同约定承担基金的投资损失；
- (7) 及时、全面、准确地向基金管理人告知其投资目的、投资偏好、投资限制和风险承受能力等基本情况；

(8) 向基金管理人或私募基金募集机构提供法律法规规定的信息资料及身份证明文件，配合基金管理人或其募集机构的尽职调查与反洗钱工作。若前述资料发生变更，应及时通知管理人或募集机构；

(9) 不得违反本合同的规定干涉基金管理人的投资行为；

(10) 不得从事任何有损基金及其他基金份额持有人、基金管理人管理的其他基金及基金托管人保管的其他基金合法权益的活动；

(11) 保守商业秘密，不得泄露基金投资计划、投资意向等；

(12) 保证投资资金的来源合法，不得非法汇集他人资金投资私募基金，主动了解所投资品种的风险收益特征；

(13) 国家有关法律法规、监管机构及本合同规定的其他义务。

2.1、基金管理人的权利

(1) 按照本合同的约定，独立管理和运用基金财产；

(2) 依照本合同的约定，及时、足额获得基金管理人管理费用及业绩报酬（如有）；

(3) 依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) 根据本合同及其他有关规定，监督基金托管人；对于基金托管人违反本合同或有关法律法规规定、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) 自行销售或者委托有基金销售资格的机构销售基金，制定和调整有关基金销售的业务规则，并对销售机构的销售行为进行必要的监督；

(6) 基金管理人有权委托浙商证券股份有限公司作为基金服务机构为本基金提供资产估值等服务，并对其代理行为进行必要的监督和检查。基金管理人与基金服务机构另行签署委托服务协议（以下简称“委托服务协议”），对相关权利、义务进行约定，包括但不限于下列内容：

①基金服务机构的权利

-
- I、按照本合同及委托服务协议的规定，及时、足额获取服务报酬；
 - II、国家有关法律法规、监管机构及本合同、委托服务协议规定的其他权利。

②基金服务机构的义务

I、自委托服务协议及本合同生效之日起，按照诚实信用、勤勉尽责的原则为基金提供相关资产估值等服务；

II、在提供委托服务过程中，按照基金管理人的安排与基金托管人进行估值核对、处理估值差错及其他服务；

III、对提供委托服务过程中知晓的本基金资产净值、份额净值等数据及其他保密信息，除法律法规、本合同及其他有关规定另有规定外，不得向他人泄露；

IV、国家有关法律法规、监管机构及本合同、委托服务协议规定的其他义务。

(7) 基金管理人为保护投资者权益，在法律法规规定范围内，有权根据市场情况对本基金的总规模、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进行调整；

(8) 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；

(9) 国家有关法律法规、监管机构及本合同规定的其他权利。

2.2、基金管理人的义务

(1) 募集期限届满，管理人应当自募集期限届满之日起20个工作日内到中国证券投资基金业协会办理相关备案手续。客户资料表应包括基金投资者名称、基金投资者身份证明文件号码、通讯地址、联系电话、申购基金的金额和其他信息。管理人应于基金成立之日起两个月内完成在中国证券投资基金业协会的基金备案手续。管理人应在备案完成后五个工作日内将加盖管理人公章的备案函以快递的形式发送给基金托管人；

(2) 自本合同生效之日起，按照诚实信用、勤勉尽责的原则履行受托人义务，管理和运用基金财产；

(3) 制作调查问卷，对投资者的风险识别能力和风险承担能力进行评估，向符合法律法规规定的合规投资者非公开募集资金；

(4) 制作风险揭示书，向投资者充分揭示相关风险；

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

(6) 按规定开设和注销基金的证券账户、期货账户等投资所需账户；

(7) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产与其管理的其他基金财产和基金管理人的固有财产相互独立，对所管理的不同财产分别管理、分别记账、分别投资；

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

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

(10) 私募基金管理人聘用其他私募基金管理人担任投资顾问的，应当通过投资顾问协议明确约定双方权利义务和责任。私募基金管理人不得因委托而免去其作为基金管理人的各项职责；

投资顾问的条件和遴选程序，应符合法律法规和行业自律规则的规定和要求。基金合同中已订明投资顾问的，应列明因私募基金管理人聘请投资顾问对基金合同各方当事人权利义务产生影响的情况。私募基金运作期间，私募基金管理人提请聘用、更换投资顾问或调整投资顾问报酬的，应取得基金份额持有人大会的同意；

(11) 除依据法律法规、本合同及其他有关规定外，不得为基金管理人及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；

(12) 按照本合同的约定接受基金份额持有人和基金托管人的监督；

(13) 基金管理人应当为基金投资与基金费用支付做好资金头寸管理。因基

金在投资过程中的透支违约或无法按基金合同约定支付基金各项费用的，管理人应承担赔偿责任；

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

(15) 以基金管理人的名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；

(16) 按照本合同约定负责基金会计核算并编制基金财务会计报告；

(17) 按照本合同约定计算并向基金份额持有人报告基金份额净值；

(18) 根据法律法规和本合同的规定，对基金份额持有人进行必要的信息披露，揭示基金资产运作情况，包括编制和向基金份额持有人提供基金定期报告；

(19) 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；

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

(21) 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、协议、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；

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

(23) 按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；

(24) 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；

(25) 建立并保存投资者名册；

(26) 面临解散、依法被撤销或者被依法破产时，及时报告中国基金业协会并通知基金托管人和基金投资者；

(27) 自主履行或委托销售机构履行反洗钱管理的相关义务；

(28) 不参与非法配资活动。除经中国证监会批准外，未参与其他客户或第三方融资、融券等相关事宜；未参与场外配资活动。

(29) 未参与内幕交易、操纵市场、规避信息披露义务及其他不正当交易的活动等；未为其他外部机构或者个人非法从事证券活动提供便利；不存在与海通证券进行利益输送或者商业贿赂的情况；不存在其他违法违规行为。

(30) 严禁管理人及其实际控制人、股东、关联方或本基金代理销售机构在营销过程中利用托管人声誉就本产品资金安全性、本产品盈利能力等方面向委托人做出任何承诺，不得向投资者承诺最低收益、承诺本金不受损失、或限定损失金额和比例，如托管人通过任何途径知悉有此情形，本合同自动作废，项目终止，由此产生的委托人、托管人损失由管理人承担。

(31) 管理人不得通过设置增强资金、费用返还等方式调节基金收益或亏损，不得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。

(32) 管理人承诺每只私募基金的单独管理、单独建账、单独核算，不得开展或者参与任何形式的资金池业务，不得存在短募长投、期限错配、分离定价、滚动发行、集合运作等违规操作。

(33) 若本基金通过场外期权账户进行收益互换或场外期权投资的，管理人需要确保由有资质的第三方经纪商及时、准确、完整提供相应交易场外期权净值。

(34) 国家有关法律法规、监管机构及本合同规定的其他义务。

3.1、基金托管人的权利

(1) 按照本合同的约定，及时、足额获得托管费；

(2) 根据法律法规规定和本合同约定，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本合同或有关法律法规规定的、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) 按照本合同的约定，依法保管基金财产；

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

(5) 国家有关法律法规、监管机构及本合同规定的其他权利。

3.2、基金托管人的义务

(1) 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、合格的熟悉基金保管业务的专职人员，负责财产保管事宜；

(3) 对所保管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整与独立；

(4) 除依据法律法规、本合同及其他有关规定外，不得为基金托管人及任何第三人谋取利益，不得委托第三人保管基金财产；

(5) 按规定开设和注销基金财产的托管资金账户，托管资金账户开立及使用的相关费用由基金资产承担；

(6) 复核基金份额净值；

(7) 办理与基金保管业务有关的信息披露事项；

(8) 根据相关法律法规和本合同约定复核基金管理人编制的基金定期报告，管理人提出需求后出具书面意见；

(9) 按照本合同的约定，根据基金管理人或基金管理人委托的基金服务机构的划款指令，及时办理清算、交割事宜；

(10) 按照法律法规及监管机构的有关规定，保存基金资产管理业务活动有关的合同、协议、凭证等文件资料；

(11) 公平对待所保管的不同基金财产，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) 根据法律法规及本合同的规定监督基金管理人的投资运作，基金托管人发现基金管理人的投资或清算划款指令违反法律、行政法规和自律规则，或者违反本合同约定的，应当拒绝执行，立即通知基金管理人，并向中国证监会或基金业协会报告；基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反本合同约定的，应当立即通知基金管理人；

(15) 基金托管人只对产品信息、收款账户等要件进行形式审查；

(16) 按照本合同约定制作相关账册并与基金管理人核对；

(17) 国家有关法律法规、监管机构及本合同规定的其他义务。

(九) 基金的成立与备案

1、基金成立的条件

本基金募集期内，当全部满足如下条件时，基金才能成立：

(1) 单个基金投资者交付的扣除认购费的净认购金额合计不低于100万元人民币；

(2) 有效签署本合同并交付认购资金的基金投资者人数不超过200人，监管部门另有规定的除外。

2、基金的成立

募集期届满，基金服务机构在收到基金管理人提交的成立通知书后，在成立通知书约定的划款日当日将全部认购资金划入托管账户。基金托管人收到全部认购资金并核实无误后向管理人出具《资金到账通知书》。《资金到账通知书》出具的当日为本基金成立日。基金管理人应于基金成立时在管理人网站发布基金成立公告并向基金持有人和基金托管人发送基金成立的通知。

3、基金的备案

募集期限届满，管理人应当自募集期限届满之日起20个工作日内到中国证

投资行业协会办理相关备案手续。办理相关备案手续所提供的客户资料表应包括投资者名称、投资者身份证明文件号码、通讯地址、联系电话、认购基金的金额和其他信息。管理人应在备案完成后五个工作日内将加盖管理人公章的备案函以快递的形式发送给基金托管人。本基金在中国基金业协会完成备案后方可进行本合同约定的投资运作。

（十）基金的投资

1、投资目标

本基金通过将基金投资者投入的资金加以集合运用，对资产进行专业化的管理和运用，谋求资产的稳定增值。

2.1、投资范围

本基金的投资范围包括沪深交易所发行及上市的股票（包含新股申购）、港股通标的范围内的股票、沪深交易所发行及上市的存托凭证、证券交易所发行及上市的优先股、证券公司收益凭证、债券逆回购、沪深交易所质押式报价回购、银行存款（包括定期存款、协议存款、结构性存款及其他银行存款）、可转债、股指期货、股票期权、公开募集证券投资基金（包括分级基金B、ETF）、参与融资融券、以具有相应业务资格的机构做交易对手的收益互换。

本基金成立后备案完成前，可以现金管理为目的，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。

基金管理人在满足法律法规和监管部门要求并为基金服务机构和基金托管人相关系统准备留出必要的调整时间后，可以相应调整本基金的投资范围。本基金投资范围调整的变更程序参照本合同“基金合同的效力、变更、解除与终止”章节中的相关约定。

对投资范围的监督：资产托管人根据法律法规及本合同之约定在投资监督系统可观测范围内对投资范围进行监督。

2.2、投资策略

市场中性策略，包括统计套利策略、阿尔法策略等。

2.3、投资限制

本基金将严格遵守法律法规、监管机构有关规定，合法合规操作。委托财产的运用应遵循如下规定：

1、基金总资产与净资产的比例不得超过200%；

2、股票：

投资于国内依法发行上市的股票及其他经中国证监会核准上市的股票（含科创板）、新股申购（包括网上和网下申购）合计市值为基金总资产的0~100%；本基金持有一家上市公司的股票按成本计算，不超过基金资产净值的20%；投资于一家上市公司所发行的股票，不得超过该上市公司总股本的4.9%（含），不超过该上市公司流通股本的10%（含）；不得主动投资“S”、“ST”、“*ST”、“S*ST”及“SST”类股票；

3、债券

按成本法与市值法孰低计算，投资单只可转换债券不超过基金资产总值的10%；单只可转换债券的持仓量不得超过该债券发行规模的20%。

4、基金

本基金投资于单只证券投资基金（ETF基金和货币基金除外）的成本占前一日基金资产净值的比例不得超过20%；

5、其他

按买入成本计算，投资于收益凭证、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）等货币市场工具合计市值为基金总资产的0~100%；

6、股指期货

(1) 本基金持有的未平仓股指期货合约价值（轧差）不超过基金资产净值的100%。未平仓合约价值（轧差）是指按照未平仓多头期货合约价值和未平仓空头期货合约价值之差的绝对值。

(2) 本基金持有的单一股指期货品种未平仓合约价值（轧差）不超过基金资

产净值的100%;

7、期权:

(1)本计划持有的全部义务方期权合约价值(期权合约对应标的市值)(非轧差)投资比例为资产管理计划资产总净值的0-200%;单笔义务方期权合约价值(期权合约对应标的市值)(非轧差)投资比例为资产管理计划资产总净值的0-100%;

(2)期权权利方买入额度为资产管理计划资产总净值的0-10%;合成空头单笔权利方买入额度为资产管理计划资产总净值的0-5%;

(3)持有看涨合成多头组合策略及看跌合成空头组合策略合约价值(轧差)不超过基金资产净值的100%。

8、场外衍生品

收益互换的名义本金额(按照互换标的买入时的成本)不超过基金资产净值的50%;初始杠杆比率不超过2倍(含);收益互换的单个未了结标的的名义本金累计不超过基金净资产的20%。

9、不得参与新三板股票交易(打新除外);

10、法律法规、中国证监会以及本合同规定的其他投资限制。

2.4、投资禁止行为

本基金财产禁止从事下列行为:

- 1、违反规定向他人贷款或提供担保;
- 2、从事承担无限责任的投资;
- 3、从事内幕交易、操纵证券价格、不正当关联交易及其他不正当的证券交易活动;
- 4、法律法规、中国证监会以及本合同规定禁止从事的其他行为。

(十一) 关联交易的情形及处理方法

1、关联交易的情形

基金管理人可根据本合同约定运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司发行的证券或承销期内承销的证券或已投资的证券或进行其他关联交易，本基金可能与管理人、投资者、管理人管理的私募基金、同一实际控制人下的其他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发生交易。基金管理人运用基金财产从事关联交易可能被金融监管部门认为存在利益输送、内幕交易的风险，进而可能影响基金份额持有人的利益。该类证券股价可能会出现下跌，从而使本基金收益下降，甚至带来本金损失。此外，基金管理人运用基金财产从事关联交易时可能依照相关法律法规、其他规范性文件被限制相关权利的行使，进而可能影响基金财产的投资收益。

2、关联交易的处理方式

基金份额持有人在此同意并授权基金管理人可以将基金资产投资于基金管理人及与基金管理人有关联方关系的公司发行的证券或承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易。但管理人应当遵循诚信、公平原则，以公平、合理的市场价格进行交易，避免利益冲突，禁止利益输送。交易完成5个工作日内，基金管理人应书面通知基金托管人，通过电子邮件、传真、纸质文件或网站等方式告知份额持有人，并向证券交易所报告。

(十二) 投资经理的指定与变更

投资经理：高欣

高欣先生，硕士学历，毕业于芝加哥大学工商管理专业，10年资本市场投资运作经验，曾任安信证券衍生品交易部投资总监，现任基金管理人的总经理。

基金管理人可根据业务需要变更投资经理，并在变更后及时告知基金投资者。（基金管理人在其网站、募集机构网站公告或书面通知基金投资者前述事项即视为履行了告知义务）。

(十三) 基金财产的估值和会计核算

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，并为基金份额申购、赎回提供计价依据。

2、估值时间

自本基金成立后第二个工作日起，基金管理人与基金托管人在每个工作日对前一工作日的基金财产进行估值核对。

3、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，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的市价（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第三方机构（中证指数公司）提供的相应品种的估值净价估值，估值日没有交易的，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且债券发行机构未发生影响债券价格的重大事件的，按最近交易日第三方机构（中证指数公司）提供的相应品种的估值净价估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考监管机构和行业协会估值意见，或者参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。

C、交易所上市未实行净价交易的债券（可转换债券除外）按估值日第三方机构（中证指数有限公司）提供的相应品种当日的估值全价减去债券估值全价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值基准日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日第三方机构（中证指数有限公司）提供的相应品种最近交易日的估值全价减去债券估值全价中所含的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，确定公允价值。

对在交易所上市交易的可转换债券，按其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

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、私募债，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收盘价估值；该日无交易的，以最近一日的收盘价估值。

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。

C、流通受限股票，是指明确带有一定限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票。

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

其中：FV为估值日该流通受限股票的价值；S为估值日在证券交易所上市交易的同一股票的收盘价；LoMD为该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣，该流动性折扣一般由中证指数有限公司发布提供。

(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，主要采用第三方机构（中央国债登记结算有限责任公司）提供的估值价格和估值技术。

(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) 交易所上市流通的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。未在交易所上市流通的基金，按照

估值日前一日份额净值估值，若无前一日份额净值，则按最近公布的基金份额净值估值。货币市场基金以成本估值，每日按估值日前一交易日的万份收益计提红利。

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

(7) 基金持有的衍生工具等其他有价证券，上市交易的按估值日的结算价估值；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。

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

(9) 银行存款每日计提利息，季度结息时以银行实际结息数为准冲销应收利息；证券、期货、期权资金账户内资金不计提利息，以实际结息数为准；本基金终止清算时应收未收利息计入基金终止清算净值。

(10) 对于投资的证券公司资产管理计划、期货公司资产管理计划、商业银行理财计划、基金公司及基金公司子公司资产管理计划、信托计划、保险资产管理计划、发行主体具有私募基金管理人资格的私募产品等非标类金融产品，按如下方式进行估值：如果该产品的管理人（信息披露义务人）按时公布了该产品的单位份额净值，则以估值日前一公告日公布的基金份额净值估值；其他按成本估值。

(11) 全国中小企业股份转让系统挂牌的股票

1) 全国中小企业股份转让系统挂牌的股票，且实行做市商交易的或者实行竞价交易的，以其估值日在全国中小企业股份转让系统挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，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，由管理人出具估值意见说明函，调整最

近交易市价，确定公允价格；

2) 全国中小企业股份转让系统挂牌的股票，未实行做市商交易的或者实行竞价交易的，仅进行协议转让的，则按照成本列示；

3) 全国中小企业股份转让系统挂牌的股票若涉及协议转让，且按照固定利率由转让方或第三方远期回购的，则由有证券、期货业务资质的第三方中介机构出具公允价值意见说明函。

4) 如果未来监管机构或行业协会等出台关于全国中小企业股份转让系统挂牌的股票的统一的估值标准或方法，则参照新的标准或方法。基金管理人须在更改估值方法前至少提前十个工作日发函与基金托管人对估值方法的修改进行确认，并提前一个工作日将修改估值方法的声明通知到基金份额持有人，即视为对本基金的基金份额持有人尽了告知义务，不再征询基金份额持有人意见。

(12) 若本基金通过场外期权账户进行收益互换或场外期权投资的，应由有资质的第三方经纪商提供相应交易场外期权净值，并于当日（工作日）12:00前提供前一工作日场外期权净值；无法及时提供的，则按最近场外期权净值进行估值。同时管理人应确保经纪商所发送的交易数据和信息的完整性、准确性和真实性，如内容不完整、不准确、不及时或不真实，由此造成的损失由管理人承担相应责任。

(13) 如存在上述估值约定未覆盖的投资品种，基金管理人可根据具体情况，在与基金托管人商议后，按最能反映该投资品种公允价值的方法估值。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。

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

如基金管理人或基金托管人发现基金估值违反本合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时，应立即通知对方，共同查明原因，双方协商解决。根据有关法律法规，基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担

任,因此,就与本基金有关的会计问题,如经相关各方在平等基础上充分讨论后,仍无法达成一致的意見,以基金管理人對基金资产净值的计算结果为准。

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、场外衍生品等场外产品和业务,如果管理人(或管理人委托第三方机构)提供最新份额净值(或最新标的净值),应确保提供数据的准确性和及时性,如果由于管理人提供净值数据的错误导致产品净值发生错误,由管理人承担相应责任。

因前述估值方法安排而产生的任何责任均由管理人自行承担,与基金托管人、基金服务机构无关。

6、估值程序

基金日常估值由基金管理人进行。基金管理人完成估值后,将估值结果加盖业务公章以书面形式或者双方认可的其他形式送至基金托管人,基金托管人按法律法规、本合同规定的估值方法、时间、程序进行复核,复核无误后在基金管理人传真的书面估值结果上加盖业务章或者双方认可的其他形式返回给基金管理人;月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

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

7、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。当基金净值发生计算错误超过基金净值0.5%时,视为估值错误。

本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、基金份额登记机构、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，按如下估值错误处理原则和处理程序执行。

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。

自然灾害、突发事件、以及因技术原因引起的差错，若系同行业现有技术水平不能预见、不能避免、不能克服，则属不可抗力，由于不可抗力造成基金份额持有人的交易资料灭失或被错误处理或造成其他差错，因不可抗力原因出现差错的当事人不对其他当事人承担赔偿责任，但因该差错取得不当得利的当事人仍应负有返还不当得利的义务。

（2）估值错误处理原则

A、如基金管理人或基金托管人发现基金资产估值违反本合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定，导致基金净值发生计算错误超过基金净值的0.5%时，应立即通知双方，共同查明原因，协商解决；

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

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；

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、基金管理人按本合同约定的估值方法进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理；

G、按法律法规规定的其他原则处理估值错误。

（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、当基金资产净值发生计算错误超过基金资产净值的0.5%时，查明估值错误发生的原因，根据当事人协商的方法对因估值错误造成的损失进行评估；

C、根据估值错误处理原则或当事人协商的方法，对估值错误进行处理；

D、前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。

8、暂停估值的情形

(1) 基金投资所涉及的证券交易场所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

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

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

(4) 中国证监会认定的其他情形。

9、基金资产净值的确认

用于向基金份额持有人报告的基金资产净值由基金管理人负责计算，基金托管人进行复核。如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，由基金管理人出具说明函，按照基金管理人对基金资产净值的计算结果为准。

10、特殊情况处理

(1) 私募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，私募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，私募基金管理人和基金托管人可以免除赔偿责任。但私募基金管理人、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。

11、基金的会计政策

(1) 基金管理人为本基金的基金会计责任方；

(2) 基金的会计年度为公历年度的1月1日至12月31日；基金首次募集的会计年度按如下原则：如果《基金合同》生效少于2个月，可以并入下一个会计年度；

(3) 基金核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位；

(4) 会计制度执行国家有关会计制度；

(5) 本基金独立建账、独立核算；

(6) 基金管理人及基金托管人各自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会计报表。

(十四) 基金的费用与税收

1、基金费用的种类

(1) 基金管理人的管理费；

(2) 基金托管人的托管费；

(3) 基金服务机构的基金服务费

(4) 基金管理人的业绩报酬；

(5) 基金的证券交易费用及各类账户开户费用(包括但不限于印鉴刻制费、账户开立费、网银U盾费、网银证书年费等)；

(6) 为基金募集、运营、审计、法律顾问、投资顾问等提供服务的基金服务机构的相应服务费；

(7) 基金年度审计费；

(8) 基金的银行汇划费、银行账户维护费；

(9) 基金合同印刷费；

(10) 按照国家有关规定和本合同约定，可以在基金资产中列支的其他费用。

2、费用计提方法、计提标准和支付方式

2.1. 管理费

(1) 基金的管理费率为1.5%/年。

计算方法如下：

$$A=E\times C\div N$$

A：每日应计提的管理费

C：年管理费率

E：前一日的基金资产净值

N：当年天数

本基金的管理费自基金成立日起，每日计提，按季支付。支付日为每自然季前5个工作日内，支付上一自然季管理费。管理费支付时，基金管理人向基金托管人发送支付指令，基金托管人复核后从基金财产中一次性划出。如基金管理人授权基金托管人划付费用的，按附件四相关内容执行。

2.2. 托管费

(1) 基金的年托管费率为基金资产总值0.04%/年。

计算方法如下：

$$H=E\times R\div N$$

H：每日应计提的托管费

R：年托管费率

E：前一日的基金资产总值

N：当年天数

本基金的托管费自基金成立日起，每日计提，按季支付。支付日为每自然季前5个工作日内，支付上一自然季托管费。托管费支付时，基金管理人向基金托管人发送支付指令，基金托管人复核后从基金财产中一次性划出。如基金管理人

授权基金托管人划付费用的，按附件四相关内容执行。

2.3. 基金服务费

(1) 基金的年基金服务费率按基金资产总值0.06%/年。

计算方法如下：

$$H=E \times R \div N$$

H：每日应计提的基金服务费

R：年基金服务费率

E：前一日的基金资产总值

N：当年天数

本基金的基金服务费自基金成立日起，每日计提，按季支付给基金服务机构。支付日为每自然季前5个工作日内，支付上一自然季基金服务费。基金服务费支付时，基金管理人向基金托管人发送支付指令，基金托管人复核后从基金财产中一次性划出。如基金管理人授权基金托管人划付费用的，按附件四相关内容执行。

2.4. 基金管理人的业绩报酬

(1) 业绩报酬的计提原则

业绩报酬提取时点分为分红时提取、赎回时提取和合同终止时提取；分红、赎回、终止时计提相应从分红款、赎回款或清算款中扣除（分红金额不足以扣除业绩报酬时以分红款为限）。

分红时提取业绩报酬，基准日为分红除权日；赎回时提取业绩报酬，基准日为赎回日；合同终止时提取业绩报酬，基准日为合同终止日。

除投资者赎回基金份额或基金在清算时，连续两次计提业绩报酬的间隔期不应短于3个月。

(2) 业绩报酬的计算方法

单个基金份额持有人单笔投资基金份额业绩报酬计算公式如下：

$$PF_{i,j} = \text{MAX}\{0, F_{i,j} \times (\text{NAV}' - \text{HWM}_{i,j}) \times 20\%\}$$

$PF_{i,j}$: 本计提日第i个基金份额持有人第j笔投资的业绩报酬;

$F_{i,j}$: 分红时点提取时, 表示第i个基金份额持有人第j笔投资的基金份额;
赎回和合同终止提取时, 表示赎回份额;

NAV' : 本业绩报酬计提日基金份额累计净值;

$\text{HWM}_{i,j}$: 第i个基金份额持有人第j笔投资的高水位, 为该笔份额上一次成功提取业绩报酬时的基金份额累计净值。若该笔份额还未成功提取过业绩报酬, 则为该笔份额认购/申购时的基金份额累计净值;

某计提日计提的业绩报酬总额为该计提日所有单个基金份额持有人各笔投资业绩报酬之和。某计提日单个基金份额持有人计提的业绩报酬总额为该基金份额持有人持有的各笔投资业绩报酬之和。存续期间分红转份额部分作为新增申购份额处理。

(3) 业绩报酬的收取时间

对于非合同终止时提取业绩报酬的情形, 业绩报酬由基金管理人于提取基准日起5个工作日内向基金托管人发送划付指令, 经基金托管人复核后于3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, 支付日期顺延。

合同终止时相应业绩报酬的支付时间。

3、不列入本计划费用的项目

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

(2) 基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用。

(3) 私募基金募集结算专用账户的账户开户费、网银开户费、资金结算汇划费、账户维护费等, 由账户管理方承担。

(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。

4、税收

本基金运作过程中涉及基金本身支付税费的，基金托管人凭基金管理人指令和相关税费单据（若有）进行资金划拨。

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。依据相关法律法规或税务机关的认定，基金投资及运营过程中发生增值税等应税行为，以管理人为纳税主体，或由管理人代扣代缴的，除本基金已列明的基金管理业务费用（如管理费、托管费等）由各收费方自行缴纳外，基金管理人有权以基金资产予以缴纳或代扣代缴，且无需事先征得委托人的同意。应由委托人自行缴纳的税费，基金管理人不承担代扣代缴或纳税的义务。

基金管理人在向委托人交付相关收益或资产后，税务机关要求基金管理人就已交付收益或资产缴纳相关税费的，委托人必须按照基金管理人要求进行补缴，由此导致委托人收益减少的，委托人不得要求管理人以任何方式向其返还或补偿所补缴的税费。

（十五）基金的收益分配

1、可供分配利润的构成

本私募基金可供分配利润为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。

私募基金收益包括：基金投资所得红利、股息、债券利息、证券投资收益、证券持有期间的公允价值变动、银行存款利息以及其他收入。因运用基金财产带来的成本或费用的节约计入收益。

2、收益分配原则

- （1）每一基金份额享有同等分配权。
- （2）本基金每个运作年度收益分配次数不超过2次。
- （3）收益分配的基准日为可供分配利润的计算截止日。

(4) 基金收益分配基准日的私募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1元。

(5) 基金当期收益应先弥补上期亏损后，方可进行当期收益分配。

(6) 法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

3、收益分配方案的确定与通知

基金收益分配方案中应载明截至收益分配基准日的可供分配利润、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。

(1) 在本基金存续期内，基金投资者可选择现金分红或者将收益转换为份额的方式进行，默认方式为现金分红，由基金投资者和基金管理人于收益分配日前5个工作日商定分红方案。

(2) 基金投资者选择将收益转换为份额单位时，由管理人根据分红方案制作份额明细表，3个工作日内委托注册登记机构进行相应份额登记。

五、本次投资的目的和对公司的影响

1、本次投资的目的

本次投资旨在利用闲置自有资金购买平凡浩善私募证券投资基金份额，进一步拓展公司的投资渠道，以期通过所投资项目谋取回报。公司将借助投资管理机构的专业能力、经验和资源，提高资金使用效率，充分发挥投资平台的作用，提升公司综合竞争力。

2、本次投资对公司的影响

本次投资的资金来源为公司自有资金，不会对公司日常生产经营造成重大影响，投资领域与上市公司主营业务不存在协同关系，不会影响主营业务的正常发展，不会对公司财务状况和经营成果造成重大影响。合作事项不会导致同业竞争或关联交易。

六、审批流程

1、董事会审议程序

2020年12月22日公司召开第四届董事会第三次会议，审议通过了《关于公司认购平凡浩善私募证券投资基金份额的议案》。

2、监事会审议程序

2020年12月22日公司召开第四届监事会第三次会议，审议通过了《关于公司认购平凡浩善私募证券投资基金份额的议案》。

3、独立董事独立意见

公司目前经营情况良好，财务状况稳健，自有资金充裕。在保证日常经营运作资金需求且有效控制投资风险的前提下，公司使用闲置自有资金购买平凡浩善私募证券投资基金份额，有利于进一步提高公司资金使用效率，增加投资收益，对公司主营业务发展没有重大影响，对公司当期及未来财务状况和经营成果没有重大影响，符合相关法律、法规、公司章程及公司《对外投资管理制度》的约定，不存在损害公司及全体股东利益，特别是中小股东利益的情形。

因此，全体独立董事一致同意公司使用闲置自有资金购买平凡浩善私募证券投资基金份额。

七、承诺事项

1、公司控股股东、实际控制人、持股5%以上的股东、董事、监事、高级管理人员未参与本基金份额认购、未在基金公司任职。

2、公司承诺在参与认购平凡浩善私募证券投资基金份额后的十二个月内（涉及分期出资的，为分期出资期间及全部出资完毕后的十二个月内），不使用闲置募集资金暂时补充流动资金、将募集资金投向变更为永久性补充流动资金（不含节余募集资金）、将超募资金用于永久性补充流动资金或者归还银行贷款。

3、本次公司参与认购基金份额事项不存在导致同业竞争或关联交易的情形。

八、风险提示

公司本次拟参与的平凡浩善私募证券投资基金属于中高风险投资品种，存在以下风险：

1、本基金投资领域与上市公司主营业务不存在协同关系，在运营过程中存在运营风险及资金损失风险，不能保证基金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、基金的投资品种价格因受经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素影响而引起的波动，导致收益水平变化产生的风险；

3、该基金产品的成立需符合相关法律法规的规定，可能存在不能满足成立条件从而无法成立的风险；

4、可能面临其他风险如流动性风险、税收风险及法律与政策风险、发生不可抗力事件的风险等其他风险。

公司将对参与基金份额认购事宜进行持续跟踪、分析，及时了解该基金产品投资方向及运营情况，加强监督，并提前做好资金管理安排，确保公司投资资金的安全性和收益性；公司将密切关注该基金的后续运作情况，并将及时按照《深圳证券交易所上市公司信息披露指引第5号——交易和关联交易》披露相关进展情况，敬请广大投资者理性投资，注意风险。

九、备查文件

- 1、浙江长盛滑动轴承股份有限公司第四届董事会第三次会议决议；
- 2、浙江长盛滑动轴承股份有限公司第四届监事会第三次会议决议；
- 3、浙江长盛滑动轴承股份有限公司独立董事关于四届董事会第三次会议相关事项的独立意见。

特此公告。

浙江长盛滑动轴承股份有限公司董事会

2020年12月23日