

附件1:

## 自查工作底稿（指引）

私募基金管理机构名称（盖章）：

编制人：

日期：

项目	要点	法规依据	详细自查情况	发现的问题	整改计划
一、基本要求	在初次开展资金募集、基金管理等私募基金业务活动前，是否已按照规定在基金业协会完成登记。	《私募条例》第十条；《若干规定》第二条			
	名称中是否已标明“私募基金”“私募基金管理”“创业投资”字样，经营范围中是否已标明“私募投资基金管理”“私募证券投资基金管理”“私募股权投资基金管理”“创业投资基金管理”等体现受托管理私募基金特点的字样。	《私募条例》第十条；《若干规定》第三条			
	是否直接或者间接从事民间借贷、担保、保理、典当、融资租赁、网络借贷信息中介、众筹、场外配资等任何与私募基金管理相冲突或者无关的业务，中国证券监督管理委员会（以下简称中国证监会）另有规定的除外。	《若干规定》第四条			
	出资人是否有代持、循环出资、交叉出资、层级过多、结构复杂等情形，是否存在隐瞒关联关系或者将关联关系非关联化。同一单位、个人控股或者实际控制两家及以上私募基金管理人的，是否具有设立多个私募基金管理人的合理性与必要性，是否全面、及时、准确披露各私募基金管理人业务分工，建立完善的合规风控制度。	《若干规定》第五条			
	公司及控股股东、实际控制人或者普通合伙人是否存在以下情形： （1）《私募条例》第九条规定的情形；（2）因非法集资、非法经营等重大违法行为被追究法律责任被注销登记，自被注销登记之日起未逾3年的私募基金管理人，或者为该私募基金管理人的控股股东、实际控制人、普通合伙人；（3）从事的业务与私募基金管理存在利益冲突；（4）有严重不良信用记录尚未修复。	《私募条例》第八条			
	董事、监事、高级管理人员、执行事务合伙人或者委派代表是否存在以下情形： （1）因犯有贪污贿赂、渎职、侵犯财产罪或者破坏社会主义市场经济秩序罪，被判处刑罚； （2）最近3年因重大违法违规行为被金融管理部门处以行政处罚； （3）对所任职的公司、企业因经营不善破产清算或者因违法被吊销营业执照负有个人责任的董事、监事、厂长、高级管理人员、执行事务合伙人或者委派代表，自该公司、企业破产清算终结或者被吊销营业执照之日起未逾5年； （4）所负债务数额较大，到期未清偿或者被纳入失信被执行人名单； （5）因违法行为被开除的基金管理人、基金托管人、证券期货交易所、证券公司、证券登记结算机构、期货公司以及其他机构的从业人员和国家机关工作人员； （6）因违法行为被吊销执业证书或者被取消资格的律师、注册会计师和资产评估机构、验证机构的从业人员、投资咨询从业人员，自被吊销执业证书或者被取消资格之日起未逾5年； （7）担任因非法集资、非法经营等重大违法行为被追究法律责任被注销登记的私募基金管理人的法定代表人、执行事务合伙人或者委派代表，或者负有责任的高级管理人员，自该私募基金管理人被注销登记之日起未逾3年。	《私募条例》第九条			
是否存在以下情形： （1）自行申请注销登记；（2）依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产；（3）因非法集资、非法经营等重大违法行为被追究法律责任；（4）登记之日起12个月内未备案首只私募基金；（5）所管理的私募基金全部清算后，自清算完毕之日起12个月内未备案新的私募基金；（6）国务院证券监督管理机构规定的其他情形。	《私募条例》第十四条				
二、宣传推介	是否通过报刊、电台、电视、互联网等公众传播媒体或者讲座、报告会、分析会和张贴布告、散发传单、发送手机短信、微信、博客和电子邮件等方式，向不特定对象宣传推介。	《基金法》第九十一条；《私募条例》第二十条；《私募办法》第十四条；《暂行规定》第三条；《若干规定》第六条			
	是否存在不适当宣传、误导欺诈投资者；向投资者宣传的私募基金投向与私募基金合同约定投向不符；宣传推介材料有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，包括未真实、准确、完整披露私募基金交易结构、各方主要权利义务、收益分配、费用安排、关联交易、委托第三方机构以及私募基金管理人的出资人、实际控制人等情况；是否夸大或者片面宣传基金管理人及其管理的产品、投资经理等的过往业绩；是否存在以登记备案、金融机构托管、政府出资等名义为增信手段进行误导性宣传推介。	《私募条例》第二十条；《暂行规定》第三条；《若干规定》第六条			

项目	要点	法规依据	详细自查情况	发现的问题	整改计划	
	是否向投资者承诺投资本金不受损失或者承诺最低收益；产品合同及销售材料中是否存在包含保本保收益内涵的表述，如零风险、收益有保障、本金无忧等；产品名称中是否含有“保本”字样；是否与投资者私下签订回购协议或者承诺函等文件，直接或间接承诺保本保收益；募集过程中是否存在夸大、片面宣传私募基金，包括使用安全、保本、零风险、收益有保障、高收益、本金无忧等可能导致投资者不能准确认识私募基金风险的表述，或者向投资者宣传预期收益率、目标收益率、基准收益率等类似表述；是否向投资者口头或者通过短信、微信等各种方式直接或者间接承诺保本保收益。	《私募条例》第二十条；《私募办法》第十五条；《暂行规定》第三条；《若干规定》第六条				
三、资金募集	是否向不合格投资者募集资金。合格投资者应同时满足以下条件：(1)具备相应风险识别能力和风险承受能力；(2)投资于单只私募基金的金额不低于100万元；(3)机构投资者净资产不低于1000万元；个人投资者金融资产不低于300万元或者最近三年个人年均收入不低于50万元。下列投资者视为当然的合格投资者：(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)依法设立并在基金业协会备案的投资计划；(3)投资于所管理私募基金的私募基金管理人及其从业人员；(4)证监会规定的其他投资者。	《私募条例》第十八条；《私募办法》第十二条、第十三条				
	单只基金的投资者人数是否超过法律规定的人数（有限责任公司形式基金和有限合伙企业形式基金不得超过50人；其他形式基金不得超过200人）；投资者转让基金份额的，受让人是否为合格投资者，基金份额转让后投资者人数是否符合规定。	《私募条例》第十八条；《私募办法》第十一条				
	以合伙企业、契约等非法人形式，通过汇集多数投资者的资金直接或间接投资于私募基金的，是否穿透核查最终投资者为合格投资者，是否穿透合并计算投资者人数。下列投资者不再穿透核查：(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)依法设立并在基金业协会备案的投资计划；(3)证监会规定的其他投资者。	《私募办法》第十三条				
	是否向非合格投资者销售产品，明知投资者实质不符合合格投资者标准，仍以产品销售确认；是否通过拆分基金份额或共收益权、为投资者直接或者间接提供短期借贷方式，变相突破合格投资者标准；是否为投资者提供多人拼凑、资金借贷等满足合格投资者要求的便利；是否存在通过为单一融资项目设立多只私募基金以变相突破合格投资者标准或投资者人数限制	《暂行规定》第三条；《若干规定》第六条、第七条				
	是否采取问卷调查等方式，对投资者的风险识别能力和风险承受能力进行评估；是否由投资者书面承诺符合合格投资者条件；是否制作风险揭示书，由客户签字确认。	《私募办法》第十六条				
	委托第三方机构提供投资建议的，第三方机构及其关联方是否以其自有资金或募集资金投资于结构化产品劣后级份额。	《暂行规定》第五条				
	通过代销方式销售产品的，是否与代销机构约定投资者适当性管理责任，代销机构是否采取风险评估、风险揭示及符合合格投资者条件的确认措施；是否存在委托不具有基金销售业务资格的单位或者个人从事资金募集活动；是否存在以从事资金募集活动为目的设立或者变相设立分支机构。	《私募办法》第十六条、第十七条；《若干规定》第六条				
	是否自行或者委托第三方机构对私募基金进行风险评级，并向投资者充分揭示投资风险；向投资者推介的私募基金是否与投资者的风险识别能力和风险承受能力相匹配。	《私募条例》第十九条；《私募办法》第十七条				
	基金是否及时进行备案；是否存在管理未备案的私募基金。	《私募条例》第二十三条；《私募办法》第八条；《若干规定》第六条				
	股票类、混合类结构化产品的杠杆倍数是否超过1倍，固定收益类结构化产品的杠杆倍数是否超过3倍，其他类结构化产品的杠杆倍数是否超过2倍；结构化产品的总资产占净资产的比例是否超过140%，非结构化产品的总资产占净资产的比例是否超过200%。结构化产品名称中是否包括“结构化”或“分级”字样。	《暂行规定》第四条				
是否对基金产品劣后级份额认购者的身份及风险承受能力进行充分适当的尽职调查。	《暂行规定》第四条					
是否将私募基金财产用于经营或者变相经营资金拆借、贷款等业务，是否存在要求地方政府承诺回购本金等方式变相增加政府隐性债务的情形。	《私募条例》第二十四条					
是否将投资管理职责委托他人行使。	《私募条例》第二十七条					
基金产品完成备案手续前是否参与股票公开或非公开发行。	《暂行规定》第三条					
是否直接或者间接对优先级份额认购者提供保本保收益安排，包括但不限于是否在基金合同中约定计提优先级份额收益、提前终止罚息、劣后级或者第三方机构差额补足优先级收益、计提风险保证金补足优先级收益等；是否穿透核查结构化产品投资标的，结构化产品是否嵌套投资其他结构化金融产品劣后级份额。	《暂行规定》第四条					
所管理的私募基金是否直接或者间接投资于国家禁止或者限制投资的项目，不符合国家产业政策、环境保护政策、土地管理政策的项目，但证券市场投资除外。	《暂行规定》第六条；《私募办法》第三十五条；《若干规定》第十条					

项目	要点	法规依据	详细自查情况	发现的问题	整改计划
四、基金投资	是否开展或参与“资金池”业务：（1）不同基金资产进行混同运作，资金与资产无法明确对应；（2）基金产品在整个运作过程中未有合理估值的约定，且未按照合同约定向投资者进行充分适当的信息披露；（3）基金产品未单独建账、独立核算，未单独编制估值表；（4）基金产品在开放申购、赎回或滚动发行时未按照规定进行合理估值，脱离对应标的资产的实际收益率进行分离定价；（5）基金产品未进行实际投资或者投资于非标资产，仅以后期投资者的投资资金向前期投资者兑付投资本金和收益；（6）基金产品所投资资产发生不能按时收回投资本金和收益情形的，基金产品通过开放参与、退出或滚动发行的方式由后期投资者承担此类风险，但管理人进行充分信息披露及风险揭示且机构投资者书面同意的除外。	《暂行规定》第九条			
	是否存在以下行为：（1）将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，以向私募基金、私募基金投资标的及其关联方收取咨询费、手续费、财务顾问费等名义为本人或者投资者以外的人牟取利益，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投资者利益的投资活动；（7）玩忽职守，不按照监管规定或者合同约定履行职责；（8）从事内幕交易、操纵交易价格及其他不正当交易活动；（9）未对不同私募基金单独管理、单独建账、单独核算；（10）使用私募基金管理人及其关联方名义、账户代私募基金收付基金财产；（11）开展或者参与具有滚动发行、集合运作、期限错配、分离定价等特征的资金池业务；（12）以套取私募基金财产为目的，使用私募基金财产直接或者间接投资于私募基金管理人、控股股东、实际控制人及其实际控制的企业或项目等自融行为；（13）不公平对待同一私募基金的不同投资者，损害投资者合法权益；（14）私募基金收益不与投资项目的资产、收益、风险等情况挂钩，包括不按照投资标的实际经营业绩或者收益情况向投资者分红、支付收益等；（15）不按照合同约定进行投资运作或者向投资者进行信息披露；（16）交易价格严重偏离市场公允价格，损害投资者利益；（17）以利益输送为目的，与特定对象进行不正当交易，或者在不同的私募基金账户之间转移收益或亏损；（18）违背风险收益相匹配原则，利用结构化私募基金向特定一个或多个劣后级投资者输送利益。	《私募条例》第三十条；《私募办法》第二十三条；《若干规定》第九条；《暂行规定》第八条			
	是否存在从事损害私募基金财产或者投资者利益的关联交易等投资活动。是否建立健全关联交易管理制度，是否通过多层嵌套或者其他方式隐瞒关联交易，对关联交易定价方法、交易审批程序等进行规范。使用私募基金财产与关联方进行交易的，是否遵守法律、行政法规、中国证监会的规定和私募基金合同约定，防范利益冲突，投资前是否取得全体投资者或者投资者认可的决策机制决策同意，投资后是否及时向投资者充分披露信息。	《私募条例》第二十八条；《若干规定》第十一条			
五、内控及风险管理	内部风险控制制度及机制是否覆盖私募基金的募、投、管、退各个环节，制度建设是否完善，是否执行到位。是否采取措施对基金风险进行有效管理；是否存在到期无法偿付等流动性风险；对冲基金和并购基金管理人的杠杆运用是否合理。信息系统运营是否安全可靠；是否实现对风险控制指标、投资交易权限、资金流转等关键事项的前端控制与实时监控。	《私募办法》第四条；基金业协会相关自律规则			
	是否按照合同约定，将基金财产交由托管人托管，并由托管人对投资活动进行监督。基金合同约定私募投资基金不进行托管的，是否在合同中明确保障私募投资基金财产安全的制度措施和纠纷解决机制。	《基金法》第三十七条、第八十八条；《私募办法》第二十一条			
	是否妥善保存私募投资基金投资决策、交易和投资者适当性管理等方面的记录及其他相关资料。	《私募办法》第二十六条			
	是否违规使用信息系统外部接入开展交易，为违法证券期货业务活动提供系统对接或投资交易指令转发服务；是否设立伞形资产管理计划，子伞委托人（或其关联方）分别实施投资决策，共用同一资产管理计划的证券、期货账户；是否下设子账户、分账户、虚拟账户或将账户出借他人，违反账户实名制规定；是否为违法证券期货业务活动提供账户开立、交易通道、投资者介绍等服务或便利。	《暂行规定》第七条			
	私募证券投资基金管理人从业人员是否具备基金从业资格；其他类型私募基金管理人高管人员从业资格是否符合要求。	《基金法》第九条；基金业协会相关自律规则			
	是否对证券类基金产品主要业务人员及相关管理团队实施过度激励，包括但不限于以下情形：（1）未建立激励奖金递延发放机制；（2）递延周期不足3年，递延支付的激励奖金金额不足40%。	《暂行规定》第十条			
	管理可能导致利益输送或者利益冲突的不同基金的，是否建立利益输送和利益冲突防范机制，执行是否有效。	《私募办法》第二十二条			

项目	要点	法规依据	详细自查情况	发现的问题	整改计划
	管理人及其从业人员是否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。	《私募办法》第二十三条			
	私募证券投资基金管理人是否建立员工与基金之间利益冲突防范制度及机制，并定期对员工防范利益冲突行为监督检查。	《基金法》第九条；《私募办法》第四条、第二十三条			
	是否委托个人或不符合条件的第三方机构提供投资建议；是否向未提供实质服务的第三方机构支付费用或支付的费用与其提供的服务不相匹配；是否建立利益冲突防范机制，产品与第三方机构本身、与第三方机构管理或服务的产品之间是否存在利益冲突或利益输送。	《暂行规定》第五条			
六、信息披露与报送	提交的登记备案信息及其他信息材料，是否有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，是否按照规定持续履行信息披露和报送义务，确保所提交信息材料及时、准确、真实、完整。	《私募条例》第三十二条；《若干规定》第十二条			
	销售基金产品时，是否真实、准确、完整披露私募基金交易结构、各方主要权利义务、收益分配、费用安排、关联交易、委托第三方机构以及私募基金管理人的出资人、实际控制人等情况。	《暂行规定》第三条；《若干规定》第六条			
	是否按照合同约定，如实向投资者披露基金投资、资产负债、投资收益分配、基金承担的费用和业绩报酬、可能存在利益冲突情况；是否如实向投资者披露可能影响投资者合法权益的其他重大信息。	《基金法》第九十五条；《私募办法》第二十四条			
	向基金业协会报送的登记信息和备案信息是否真实、准确、完整。	《基金法》第八十九条；《私募办法》第七条、第八条；基金业协会自律规则			
	是否按照基金业协会的规定，及时填报并定期更新管理人及其从业人员的有关信息、所管理的私募基金投资运作情况和杠杆运用情况；管理人和基金发生重大事项的，是否及时向基金业协会报告。例如管理人发生重大事项的应当在10个工作日内向基金业协会报告；私募基金发生重大事项的，应当在5个工作日内向基金业协会报告。	《私募办法》第二十五条；基金业协会自律规则			
	基金合同中是否充分披露和揭示结构化设计及相应风险情况、收益分配情况、风控措施等信息。	《暂行规定》第四条			
	委托第三方机构提供投资建议的，是否在产品合同及其它材料中明确披露第三方机构身份、约定第三方机构职责，是否充分说明和揭示聘请第三方机构可能产生的特定风险。	《暂行规定》第五条			
七、投资者适当性	适当性管理的各项规章制度制定情况：（1）是否制定投资者分类制度；（2）是否制定投资者分类转化制度；（3）是否制定划分产品或服务等级制度；（4）是否制定执行适当性匹配制度；（5）是否制定定期开展自查制度或工作机制；（6）是否制定适当性档案管理制度；（7）是否制定限制不匹配销售行为制度；（8）是否制定客户回访检查制度；（9）是否制定评估与销售隔离制度；（10）是否制定适当性管理的培训考核制度和考核机制；（11）是否建立涉及适当性管理的投诉纠纷处理制度；（12）是否制定违反适当性管理的监督问责机制；（13）是否制定落实适当性管理的执业规范；（14）是否建立委托其他机构销售产品的适当性管理相关制度。				
	人员、设备配备及内部培训情况：（1）是否指定落实适当性管理的具体分工和分管领导；（2）是否设置负责适当性管理的部门；（3）是否配备适当性管理工作专职人员；（4）是否配备录音、录像及开展非现场业务的留痕设备；（5）是否组织开展《证券期货投资者适当性管理办法》内部培训。				
	向投资者销售产品或者提供服务时，是否了解投资者的下列信息：（1）自然人的姓名、住址、职业、年龄、联系方式，法人或者其他组织的名称、注册地址、办公地址、性质、资质及经营范围等基本信息；（2）收入来源和数额、资产、债务等财务状况；（3）投资相关的学习、工作经历及投资经验；（4）投资期限、品种、期望收益等投资目标；（5）风险偏好及可承受的损失；（6）诚信记录；（7）实际控制投资者的自然人和交易的实际受益人；（8）法律法规、自律规则规定的投资者准入要求相关信息；（9）其他必要信息。	《适当性办法》第六条			
	是否根据产品或服务的不同风险等级，对其适合销售产品或者提供服务的投资者类型作出判断，根据投资者的不同类型，对其适合购买的产品或者接受的服务作出判断。	《适当性办法》第十八条			
	投资者主动要求并坚持购买风险等级高于其风险承受能力的产品或者接受相关服务的，是否确认其不属于风险承受能力最低类别的投资者，是否就产品或者服务风险高于其承受能力进行特别的书面风险警示。	《适当性办法》第十九条			
	向普通投资者销售高风险产品或者提供相关服务的，是否履行特别的注意义务，包括制定专门的工作程序，追加了解相关信息，告知特别的风险点，给予普通投资者更多的考虑时间，增加回访频次等。	《适当性办法》第二十条			
	是否根据投资者和产品或者服务的信息变化情况，主动调整投资者分类、产品或者服务分级以及适当性匹配意见，并告知投资者上述情况。	《适当性办法》第二十一条			

项目	要点	法规依据	详细自查情况	发现的问题	整改计划
	是否进行下列销售产品或者提供服务的活动： (1) 向不符合准入要求的投资者销售产品或者提供服务；(2) 向投资者就不确定事项提供确定性的判断，或者告知投资者有可能使其误认为具有确定性的意见；(3) 向普通投资者主动推介风险等级高于其风险承受能力的产品或者服务；(4) 向普通投资者主动推介不符合其投资目标的产品或者服务；(5) 向风险承受能力最低类别的投资者销售或者提供风险等级高于其风险承受能力的产品或者服务；(6) 其他违背适当性要求，损害投资者合法权益的行为。	《适当性办法》第二十一条			
	是否在向普通投资者销售产品或者提供服务前告知下列信息：(1) 可能直接导致本金亏损的事项；(2) 可能直接导致超过原始本金损失的事项；(3) 因经营机构的业务或者财产状况变化，可能导致本金或者原始本金亏损的事项；(4) 因经营机构的业务或者财产状况变化，影响客户判断的重要事由；(5) 限制销售对象权力行使期限或者可解除合同期限等全部限制内容。	《适当性办法》第二十三条			
	对投资者的告知、警示内容，是否真实、准确、完整，是否存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏；告知、警示是否采用书面形式送达投资者，并由其确认已充分理解和接受。	《适当性办法》第二十四条			
	是否综合考虑收入来源、资产状况、债务、投资者知识和经验、风险偏好、诚信状况等因素，确定普通投资者的风险承受能力，对普通投资者进行细化分类和管理。	《适当性办法》第十条			
	是否按规定对投资者进行类别转化。	《适当性办法》第十一条、第十二条			
	是否建立或者更新投资者评估数据库。	《适当性办法》第十三条			
	是否按规定了解所销售产品或者所提供服务的信息，根据风险特征和程度，对销售的产品或者提供的服务划分风险等级。	《适当性办法》第十五条、第十六条、第十七条			
	是否按规定录音录像或者采取配套留痕安排。	《适当性办法》第二十五条			
	委托销售的，是否明确告知代销方所委托产品或者提供服务的适当性管理标准和要求，以及相应法律责任。	《适当性办法》第二十六条、第二十七条、第二十八条			
	是否制定适当性内部管理制度，明确投资者分类、产品或者服务分级、适当性匹配的具体依据、方法、流程等，严格按照内部管理制度进行分类、分级，定期汇总分类、分级结果，并对每名投资者提出匹配意见；是否制定并严格落实与适当性内部管理有关的限制不匹配销售行为、客户回访检查、评估与销售隔离等风险制度，以及培训考核、执业规范、监督问责等制度机制。	《适当性办法》第二十九条			
	是否定期开展适当性自查(应当每半年开展自查)，对于自查发现的问题，是否及时向监管部门报告。	《适当性办法》第三十条			
	是否妥善保存适当性相关资料。对匹配方案、告知警示资料、录音录像资料、自查报告等的保存期限不得少于二十年。	《适当性办法》第三十二条			
	是否妥善处理适当性相关的纠纷，与投资者协商解决争议，采取必要的措施支持和配合投资者提出的调解。	《适当性办法》第三十四条			
八、程序化交易	是否真实、准确、完整、及时报告以下信息： (1) 账户基本信息，包括投资者名称、证券账户代码、指定交易或托管的证券公司、产品管理人等；(2) 账户资金信息，包括账户的资金规模及来源，杠杆资金规模及来源、杠杆率等；(3) 交易信息，包括交易策略类型及主要内容、交易指令执行方式、最高申报速率、单日最高申报笔数等；(4) 交易软件信息，包括软件名称及版本号、开发主体等；(5) 证券交易所规定的其他信息，包括证券公司、投资者联络人及联系方式等。 报告信息发生重大变更的，是否及时进行变更报告。	《管理规定》第七条			
	是否按照证券交易所的规定和委托协议的约定，将有关信息向接受其委托的证券公司报告。是否收到证券公司确认后方进行程序化交易。	《管理规定》第八条			
	是否就程序化交易制定专门的业务管理和合规风控制度，完善程序化交易指令审核和监控系统，防范和控制业务风险。负责合规风控的有关责任人员，是否对本机构程序化交易的合规性进行审查、监督和检查，并负责相关风险管理工作。	《管理规定》第十四条			
	进行程序化交易，因不可抗力、意外事件、重大技术故障、重大人为差错等突发性事件，可能引发重大异常波动或影响证券交易正常进行的，是否立即采取暂停交易、撤销委托等处置措施。	《管理规定》第十五条			

项目	要点	法规依据	详细自查情况	发现的问题	整改计划
	用于程序化交易的技术系统是否符合证券交易所的规定，具备有效的验资验券、权限控制、阈值管理、异常监测、错误处理、应急处置等功能，保障安全持续稳定运行。使用相关技术系统是否按照前款要求进行充分测试，并按照规定报告测试记录。	《管理规定》第十六条			
	是否利用证券公司系统对接非法经营证券业务，是否违规招揽投资者或者处理第三方交易指令，是否违规转让、出借自身投资交易系统或者为第三方提供系统接入。	《管理规定》第十九条			
	使用证券交易所增值行情信息的，是否按照规定缴纳费用。	《管理规定》第二十条			
	进行高频交易前，是否报告高频交易系统服务器所在地、系统测试报告、系统发生故障时的应急方案等信息。	《管理规定》第二十二条			
	私募证券投资基金的初始实缴募集资金规模是否低于1000万元，是否通过投资者短期赎回基金份额等方式，规避前述实缴规模要求。基金上一年度日均基金资产净值低于1000万元的，是否在5个工作日内向投资者披露下列潜在影响及相关安排。上一年度日均基金资产净值低于500万元，或者连续60个交易日出现基金资产净值低于500万元情形的，是否停止申购并在5个工作日内向投资者披露；停止申购后连续120个交易日基金资产净值仍低于500万元的，是否进入清算程序。	《运作指引》第四条			
	是否履行投资者适当性义务，向合格投资者推荐适当的产品。基金的风险等级是否与风险收益特征相匹配。基金投资者风险评级是否低于基金风险等级。	《运作指引》第五条			
	是否按要求披露基金及其业绩相关信息，披露的基金业绩信息包括但不限于存续期间完整的历史净值、历史规模、投资策略、投资经理等。除已履行特定对象确定程序的合格投资者、符合规定的基金评价机构外，是否向不存在私募证券投资基金销售委托关系的机构或者个人提供基金净值等业绩相关信息。是否按照客观、真实、准确、完整的原则展示私募证券投资基金过往业绩，是否将规模小于1000万元、成立期限少于6个月的私募证券投资基金过往业绩用作宣传、销售、排名，是否以误导投资者为目的的选择性展示部分基金业绩、基金部分运作周期的业绩，是否展示未经私募基金托管人复核的基金业绩，是否对少于6个月周期的基金业绩进行排名。基金投资者仅为私募基金管理人或者其股东、合伙人、实际控制人、员工的，在基金宣传、销售、排名时，是否一并披露该情况。	《运作指引》第六条			
	基金合同中约定的开放安排是否与基金的产品类型、投资策略以及资产组合的流动性等相匹配。封闭式私募证券投资基金的存续期限是否小于1年，并在基金合同中约定定期分红安排。封闭式私募证券投资基金是否接受开放式私募证券投资基金、资产管理产品投资，接受封闭式私募证券投资基金、资产管理产品投资时，是否确保上层基金、资产管理产品到期日晚于本基金到期日。开放式私募证券投资基金是否明确投资者申购、赎回的程序、时间、次数及限制事项。开放式私募证券投资基金至多每周开放一次申购、赎回，每次开放是否超过2天。基金合同中是否约定，投向AA级及以下信用债（可转债除外）、流动性受限资产合计超过基金净资产20%的，至多每季度开放一次申购、赎回，每次开放不得超过5天。开放式私募证券投资基金设置临时开放日的，是否符合中国证监会和协会的相关规定。是否引导投资者关注基金长期业绩，强化对投资者短期投资行为的管理。基金合同中是否约定不少于3个月的份额锁定期或者与基金份额持有期限对应的短期赎回费用安排，收取的赎回费用是否归属基金财产。管理人及其员工跟投本管理人管理的私募证券投资基金的，其份额锁定期是否少于6个月。	《运作指引》第七条			
	是否通过设置增强资金、安全垫、费用返还等方式调节基金收益或者亏损，是否以自有资金认购的基金份额先行承担亏损等形式提供风险补偿。基金接受资产管理产品投资或者私募基金管理人担任资产管理产品投资顾问的，管理人是否以自有资金、第三方资金直接或者间接为该资产管理产品提供风险补偿或者保本保收益安排。	《运作指引》第十一条			
	基金是否采用资产组合的方式进行投资并符合下列要求（银行活期存款、国债、债券通用质押式回购、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券、公开募集基金等中国证监会、协会认可的投资品种除外）：(1) 单只私募证券投资基金投资于同一资产的资金，不得超过该基金净资产的25%（符合《运作指引》第十三条规定的除外）；(2) 同一私募基金管理人管理的全部私募证券投资基金投资于同一资产的资金，不得超过该资产的25%。 符合第(1)项分散投资要求的私募证券投资基金投资单只私募基金的资金，可以不受第(2)项规定的投资比例限制。	《运作指引》第十二条			

项目	要点	法规依据	详细自查情况	发现的问题	整改计划
九、私募证券基金运作	基金的总资产是否超过该基金净资产的200%,是否通过场外衍生品等工具规避杠杆限制,是否参与场外配资。基金投向AA级及以下信用债(可转债除外)、流动性受限资产合计超过该基金净资产20%的,总资产是否超过该基金净资产的120%(全部投资者均为符合中国证监会规定的专业投资者且单个投资者投资金额不低于1000万元(穿透认定)的封闭式私募证券投资基金除外)。	《运作指引》第十五条			
	同一实际控制人控制的私募证券投资基金管理人的自有资金、管理的所有私募证券投资基金、担任投资顾问的资产管理产品合计持有单一上市公司发行的股票是否超过该上市公司可流通股票的30%。	《运作指引》第十六条			
	基金开展场外衍生品交易的,是否以国务院金融管理部门认可的机构为交易对手方,是否符合下列要求: (1)新增场外期权合约以及存续合约展期的,除仅开展商品类场外期权交易外,基金净资产不低于5000万元;向全部交易对手方缴纳的场外期权交易保证金和权利金合计不得超过基金净资产的25%; (2)新增收益互换合约以及存续合约展期的,基金净资产不低于1000万元;参与挂钩股票、股票指数等权益类收益互换的,向交易对手方缴纳的保证金比例不低于合约名义本金的50%; (3)参与证券公司等机构发行带敲入和敲出结构的场外期权或者收益凭证(如雪球结构衍生品)的合约名义本金不得超过基金净资产的25%,全部投资者均为符合中国证监会规定的专业投资者且单个投资者投资金额不低于1000万元(穿透认定)的封闭式私募证券投资基金除外; (4)基金及其投资者均不存在份额分级安排; (5)不得将场外衍生品交易异化为股票、债券等场内标的的杠杆融资工具,不得为基金销售机构向自然人投资者销售特定结构的场外衍生品提供通道服务,不得为投资者提供规避场外衍生品交易要求的通道服务。 基金参与场外衍生品交易的,管理人是否在该基金下一估值日前将场外衍生品交易情况、交易文件等提供给托管人。签订场外衍生品交易文件时是否明确授权由交易对手方、相关交易的清算机构在该基金下一估值日前直接向托管人提供场外衍生品交易文件并持续提供估值信息。	《运作指引》第十七条			
	是否参与债券结构化发行,是否参与债券代持,是否直接或者变相收取债券发行人及第三方交付的承销服务、融资顾问、咨询服务、信用风险补偿等各种形式的费用或者保证金。	《运作指引》第十八条			
	开展债券投资的,是否符合下列规定:单一私募证券投资基金投资于同一债券的数量,不得超过该债券存续数量的10%。私募基金管理人管理的所有私募证券投资基金投资于同一债券的数量,不得超过该债券存续数量的10%,因发行人行使赎回选择权或者进行债券购回,以及其他持有人行使回售选择权导致的被动超标除外。 单只私募证券投资基金投资于同一发行人及其关联方发行的债券资金总额,不得超过基金净资产的25%。同一实际控制人控制的私募基金管理人管理的所有私募证券投资基金投资于同一发行人及其关联方发行的债券的总数量,不得超过相关债券存续数量的25%。私募证券投资基金开展债券质押式协议回购业务的,质押或者接受质押单一债券的集中度适用本条前两款规定,与单一交易对手方开展回购交易的金额不得超过基金净资产的10%,私募基金管理人应当在该基金下一估值日前将参与债券质押式协议回购业务的交易文件、交易对手方及质押标的等信息提供给私募基金托管人。国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券、可转换债券、可交换债券等中国证监会、协会认可的投资品种可以不受本条前三款规定的投资比例限制。	《运作指引》第十九条			

项目	要点	法规依据	详细自查情况	发现的问题	整改计划
	<p>主要开展程序化交易的私募证券投资基金,是否满足下列要求:</p> <p>(1)就程序化交易制定专门的业务管理和合规风控制度,完善程序化交易指令审核和监控系统,防范和控制业务风险;</p> <p>(2)用于程序化交易的技术系统具备证券期货交易所规定的基本功能,按照要求进行充分测试,保障持续稳定运行;</p> <p>(3)建立并有效执行程序化交易策略的研发、测试、验证、合规审查、上线等业务流程;</p> <p>(4)建立健全流动性、持股比例集中度、杠杆、交易频率、期现匹配、风格暴露、瞬时大额成交等投资交易的风控制度并有效执行;</p> <p>(5)保存历史交易记录,算法或策略的文字说明等投资决策、交易涉及资料,保存期限自基金清算结束之日起不得少于20年;</p> <p>(6)按照证券期货交易所程序化交易报告制度履行相关手续,不得以规避报告制度等监管要求为目的的分拆私募证券投资基金;</p> <p>(7)因不可抗力、意外事件、重大技术故障、重大人为差错等突发性事件,可能引发重大异常波动或者影响证券期货交易正常进行的,立即采取暂停交易、撤销委托等处置措施,并及时向其委托的证券公司或者期货公司报告;</p> <p>(8)中国证监会、协会、证券期货交易所规定的其他要求。</p>	《运作指引》第二十一条			
	<p>开放式私募证券投资基金是否设置预警线、止损线。是否按照要求向协会报送预警线、止损线相关情况。</p> <p>开放式私募证券投资基金的基金合同中是否明确约定基金巨额赎回和连续巨额赎回的认定标准、赎回顺序、赎回价格确定、赎回款项支付、告知投资者方式,以及投资者大额赎回的预约申请等事宜,相关约定是否符合公平、合理的原则。</p>	《运作指引》第二十四条、第二十五条			
	基金是否按照法律、行政法规、中国证监会等有关规定进行托管。	《运作指引》第二十六条			
	<p>是否建立从业人员进行证券、私募基金等投资的申报、登记、审查、处置等管理制度和廉洁从业规范,制定有效的事前防范体系、事中管控措施和事后追责机制,防止从业人员或者其他利益相关方违规从事投资,严格防范内幕交易、市场操纵、利用未公开信息交易、利益冲突和利益输送等不当行为,确保投资者合法权益不受侵害。</p> <p>是否建立公平交易制度及异常交易监控机制,公平对待所管理的不同私募证券投资基金,对投资交易行为进行监控、分析、评估、核查,监督投资交易的过程和结果,保证公平交易原则的实现,是否开展可能导致不公平交易和利益输送的交易行为。</p> <p>是否严格控制同日反向交易,严格禁止可能导致不公平交易或者利益输送的同日反向交易。</p> <p>是否在风险可测、可控、可承受的前提下开展自有资金投资,建立自有资金投资管理制度和外部投资者利益绑定机制,确保自有资金投资的安全性、流动性,是否影响私募基金管理人及其所管理私募证券投资基金的正常运营。是否公平对待自有资金投资与其管理的私募证券投资基金或者担任投资顾问的资产管理产品投资,是否利用资金、信息、技术、策略等优势为自有资金牟取不正当利益,防范利益冲突,严禁利益输送。</p> <p>是否建立保障信息技术系统安全、数据安全的风控机制和应急管理制度,确保网络和信息安全管理能力、风险控制能力、软硬件及人员配置与交易策略、业务规模、业务复杂程度等相匹配,确保信息技术系统持续稳定运行,不得影响证券期货交易所信息系统安全。</p> <p>是否结合市场状况和自身管理能力制定并持续更新流动性风险应急预案,明确预案触发情景、应急程序与措施等。</p>	《运作指引》第三十一条、第三十二条、第三十三条、第三十四条、第三十五条			
	是否按照法律、行政法规、中国证监会和协会规定以及基金合同的约定向投资者进行信息披露,并保证所披露信息的真实性、准确性、完整性和及时性。	《运作指引》第三十六条			
	<p>开展私募证券投资基金业务是否通过场外衍生品、资产管理产品等规避私募基金监管要求。</p> <p>是否履行受托管理职责,是否由投资者、第三方下达投资指令或者负责投资运作,是否为投资者、证券发行人、金融机构、其他私募基金管理人、资产管理产品以及其他私募基金等第三方提供规避投资范围、杠杆约束、投资者门槛等监管要求的通道服务。</p>	《运作指引》第三十八条			



项目	要点	法规依据	详细自查情况	发现的问题	整改计划
<p>说明：</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1. 本底稿中《基金法》是指2015年4月24日修正的《中华人民共和国证券投资基金法》；</li> <li>2. 本底稿中《私募条例》是指2023年9月1日起施行的《私募投资基金监督管理条例》；</li> <li>3. 本底稿中《私募办法》是指2014年8月21日起施行的《私募投资基金监督管理暂行办法》；</li> <li>4. 本底稿中《暂行规定》是指2016年7月18日起施行的《证券期货经营机构私募资产管理业务运作管理暂行规定》；</li> <li>5. 本底稿中《适当性办法》是指2017年7月1日起施行的《证券期货投资者适当性管理办法》；</li> <li>6. 本底稿中《若干规定》是指2021年1月8日起施行的《关于加强私募投资基金监管的若干规定》；</li> <li>7. 本底稿中《管理规定》是指2024年10月8日起施行的《证券市场程序化交易管理规定(试行)》；</li> <li>8. 本底稿中《运作指引》是指2024年8月1日起施行的《私募证券投资基金运作指引》；</li> <li>9. 请根据本底稿逐项自查，如实详细填写自查过程、结果等情况，应做到重点突出、条理清晰；在自查中发现存在相关问题的，需将问题及原因描述清楚，应针对所发现的问题制定切实可行的整改计划，应按照整改计划切实防范和化解风险隐患。</li> </ol>					