

---

某某-集合资产管理计划  
资产管理合同

合同编号：【 】

资产管理人：某某管理有限公司  
资产托管人：某某银行股份有限公司

---

## 目 录

第一节 前言.....	1
第二节 释义.....	3
第三节 承诺与声明.....	7
第四节 当事人及权利义务.....	10
第五节 资产管理计划的基本情况.....	17
第六节 资产管理计划份额的募集.....	19
第七节 资产管理计划的成立与备案.....	21
第八节 资产管理计划的参与、退出与转让.....	23
第九节 份额持有人大会.....	30
第十节 资产管理计划份额的登记.....	31
第十一节 资产管理计划的投资.....	32
第十二节 利益冲突及关联交易.....	41
第十三节 投资经理的指定与变更.....	43
第十四节 资产管理计划的财产.....	44
第十五节 投资指令的发送、确认与执行.....	47
第十六节 交易及清算交收安排.....	50
第十七节 越权交易的界定.....	56
第十八节 资产管理计划财产的估值和会计核算.....	58
第十九节 资产管理计划的费用与税收.....	64
第二十节 资产管理计划的收益分配.....	68
第二十一节 信息披露与报告.....	70
第二十二节 风险揭示.....	74
第二十三节 资产管理合同的变更、终止与财产清算.....	83
第二十四节 反商业贿赂.....	88
第二十五节 违约责任.....	89
第二十六节 法律适用和争议的处理.....	91
第二十七节 资产管理合同的效力.....	92
第二十八节 其他事项.....	93
附件一：授权通知书样本.....	97
附件二：投资指令样本.....	98
附件三：专用清算账户及资金划拨专用账户.....	99

## 第一节 前言

### （一）订立资产管理合同的依据、目的和原则

1. 订立本资产管理合同（以下简称“本合同”）的依据是《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》（证监会令[2018]第151号，以下简称《管理办法》）、《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》（证监会公告[2018]31号，以下简称《运作规定》）、《证券期货经营机构私募资产管理计划备案管理办法（试行）》（以下简称《备案办法》）、《证券期货投资者适当性管理办法》（以下简称《适当性办法》）、《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》（银发[2018]106号，以下简称“《指导意见》”）、《集合资产管理计划资产管理合同内容与格式指引（试行）》、《资产管理计划风险揭示书内容与格式指引（试行）》、《商业银行资产托管业务指引》（以下简称《托管业务指引》）和其他有关规定。

若因法律法规的制定或修改导致本合同的内容与届时有效的法律法规存在冲突，应当以届时有效的法律法规的规定为准，各方当事人应及时对本合同进行相应变更和调整。

2. 订立本合同的目的是在严格遵守国家有关法律法规的前提下，保护本合同各当事人合法权益，明确本合同各当事人之间权利和义务，保证本资产管理业务合法、合规及有效地进行。

3. 订立本合同的原则是平等自愿、诚实信用和公平，充分保护本合同各方当事人的合法权益，不得损害国家利益、社会公共利益和他人合法权益。

（二）资产管理人将对本资产管理计划的设立、变更、展期、终止、清算等行为向中国证券投资基金业协会（以下简称“基金业协会”）进行备案，并抄报中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）相关派出机构。

（三）基金业协会接受本资产管理计划的备案不能免除资产管理人按照规定真实、准确、完整、及时地披露产品信息的法律责任，也不代表基金业协会对本资产管理计划的合规性、投资价值及投资风险做出保证和判断。投资者应当自行识别产品投资风险并承担投资行为可能出现的损失。资产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委托财产，但不保证投资于委托财产盈利，也不保证最低收益，亦不保证委托财产本金不受亏损。

（四）本合同是规定各当事人之间权利义务关系的基本法律文件，其他与本计划相关的涉及本合同各当事人之间权利义务关系的任何文件或表述，如与本合同不一致或有冲突，均以本合同为准。

（五）本合同的当事人包括投资者、资产管理人和资产托管人。投资者、资产管理人、资产托管人自签订资产管理合同即成为资产管理合同的当事人。投资者自全部退出资产管理计划之日起，该投资者不再是资产管理计划的投资人和资产管理合同的当事人。

## 第二节 释义

（一）在本合同中，除上下文另有规定外，下列用语应当具有如下含义：

1. 资产管理计划、计划、本计划：指某某-集合资产管理计划。

2. 资产管理合同、本合同：指委托人、管理人及托管人签署的《某某-集合资产管理计划资产管理合同》及其附件，以及对该合同及附件做出的任何有效变更及补充。

3. 计划说明书：指《某某-集合资产管理计划计划说明书》，内容包括资产管理计划概况、资产管理合同的主要内容、资产管理人与资产托管人概况、投资风险揭示、初始销售期间、中国证监会规定的其他事项等。计划说明书或其他计划文件的内容与本合同的条款不一致的，以本合同的条款为准。

4. 法律法规：指中国现时有效并公布实施的法律、行政法规、行政规章及规范性文件、地方法规、地方规章及规范性文件。

5. 《合同法》：指《中华人民共和国合同法》。

6. 《基金法》：指《中华人民共和国证券投资基金法》。

7. 《指导意见》：指中国人民银行、中国银行保险监督管理委员会、中国证券监督管理委员会、国家外汇管理局于 2018 年 4 月 27 日联合印发的《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》（银发[2018]106 号）。

8. 《管理办法》：指中国证监会于 2018 年 10 月 22 日发布并施行的《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》（证监会令[2018]第 151 号）。

9. 《运作规定》：指中国证监会于 2018 年 10 月 22 日发布并施行的《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》（证监会公告[2018]31 号）。

10. 中国证监会：指中国证券监督管理委员会。

11. 基金业协会：指中国证券投资基金业协会。

12. 投资者、委托人：指签订本合同，具备相应风险识别能力和风险承担能力，投资于本资产管理计划初始金额不低于 100 万元人民币，且能够识别、判断和承担相应投资风险、符合法律法规和监管规则规定的合格投资者条件的自然人、法人、依法成立的组织或中国证监会认可的其他特定客户。

13. 资产管理人：指某某管理有限公司。

14. 资产托管人：指某某银行股份有限公司。

15. 注册登记机构：指资产管理人或其委托的经中国证监会认定可办理开放式证券投资基金份额登记业务的机构。

16. 中登公司：指中国证券登记结算有限责任公司。

17. 销售机构：指资产管理人以及符合中国证监会规定的条件，取得基金销售资格并接受资产管理人委托，代为办理本计划认购、参与、退出等业务的机构。

18. 本合同生效日：自本合同成立之日起生效。

19. 初始销售期间：指资产管理合同及计划说明书中载明，自计划份额发售之日起最长不超过 60 天。

20. 计划存续期：指本计划成立之日起至终止之间的期限。

21. 资产管理计划成立日：指资产管理计划初始募集期结束并完成验资，经资产管理人公告本计划成立之日。

22. 封闭期：资产管理计划的首个封闭期为自本合同生效日起至第一个开放日（不含该日）之间的期间，之后的封闭期为每相邻两个开放日之间的期间（不含开放日）。

23. 开放期：指资产管理计划成立后，允许投资者办理资产管理计划参与、退出业务的期间。

24. 开放日：指资产管理计划成立后，资产管理人为投资者办理计划参与、退出业务的工作日。

25. 估值日：指资产管理人对计划财产进行估值的日期。

26. 工作日、交易日：均指上海证券交易所、深圳证券交易所、中国金融期货交易所等期货交易所的正常交易日。

27. 每年：指会计年度。

28. 认购：指在资产管理计划初始销售期间，投资者按照本合同的约定购买本计划份额的行为。

29. 参与：指在资产管理计划开放日，投资者按照本合同的规定参与本计划份额的行为。

30. 退出：指在资产管理计划开放日，投资者按照本合同的规定退出本计划份额的行为。

31. 违约退出：指投资者在非合同约定的退出开放日退出资产管理计划的行为。本计划不设置违约退出。

32. 资产管理计划财产、委托财产、委托资产：指投资者拥有合法处分权、委托资产管理人管理并由资产托管人托管的作为本合同标的的财产。

33. 计划资产总值：指本资产管理计划拥有的各类有价证券、银行存款本息及其他资产的价值总和。

34. 计划资产净值：指本资产管理计划资产总值减去负债后的价值。

35. 计划份额净值：指计算日资产管理计划资产净值除以计算日资产管理计划份额总数所得的数值。

36. 资产管理计划资产估值：指计算、评估资产管理计划资产和负债的价值，以确定本资产管理计划资产净值和份额净值的过程。

37. 证券账户：根据中国证监会有关规定和中国证券登记结算有限责任公司（下称“中登公司”）等相关机构的有关业务规则，由资产托管人为本计划在中登公司上海分公司、深圳分公司开设的专用证券账户、在中央国债登记结算有限责任公司及银行间市场清算所股份有限公司开立的有关账户及其他证券类账户。

38. 资金账户、托管账户：指资产托管人根据有关规定为资产管理计划财产开立的专门用于资金清算交收的银行账户。

39. 期货保证金账户：根据中国证监会有关规定和中国金融期货交易所等相关期货交易所的有关业务规则，资产管理人为本计划在其选定的期货公司处开立的用于存放本计划期货保证金的账户，其用途包括出入金、支付期货交易结算款和相关费用等。

40. 不可抗力：指本合同当事人不能预见、不能避免、不能克服的客观情况，包括但不限于地震、台风、水灾、火灾、战争、暴乱、流行病、政府行为、罢工、停工、停电、通讯失败等，非因资产管理人、资产托管人自身原因导致的技术系统异常事故、政策法规的修改或监管要求调整等情形。因交易所、银行、登记结算机构的交易、结算系统出现故障导致的交易、结算无法进行的情形，因电信服务商原因导致资金划付的网络中断、无法使用的情形，亦构成不可抗力事件。

41. 信义义务：托管人信义义务是指托管人按恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则，根据相关法律法规和监管规定，在本资产管理合同约定范围内尽职尽责履行安全保管托管资产等托管人职责。

（二）为免歧义，本合同选项式条款前方框描黑“■”或打钩☑视为本合同

按该条款执行。



### 第三节 承诺与声明

#### （一）管理人承诺与声明

1. 在签订本合同前充分向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，并充分揭示了相关风险。

2. 已经了解投资者的风险偏好、风险认知能力和承受能力，对投资者的财务状况进行了充分评估。

3. 资产管理人承诺依照《基金法》恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用资产管理计划财产，**不保证资产管理计划一定盈利，也不保证最低收益或委托财产本金不受亏损，亦不限定投资损失金额或比例。**

4. 管理人不得接受投资者、交易对手方或其他第三方的口头承诺或与投资者、交易对手方或其他第三方私下签订补充协议。

#### （二）托管人承诺与声明

1. 按照《基金法》恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则安全保管委托财产，履行信义义务以及本合同约定的其他义务。

2. 根据法律法规、中国证监会及基金业协会的规定和本合同的约定，对管理人的投资或清算指令等进行监督。

3. 在资产管理人发生异常且无法履行管理职能时，依照法律法规及合同约定召集份额持有人大会（如有），维护投资者权益，份额持有人大会（如有）设立日常机构的除外。

4. 在管理人发生异常且无法履行管理职能时，依照法律法规及合同约定履行相应的托管职责，维护投资者权益。

5. 资产托管人保证已取得托管本资产管理计划的资质和相关的内部授权。

#### （三）投资者承诺与声明

1. 投资者符合《运作规定》合格投资者的要求，且不是管理人的董事、监事、从业人员及其配偶。

2. 投资者向管理人提供的有关投资目的、投资偏好、投资限制、财产收入情况和风险承受能力等基本情况真实、完整、准确、合法，不存在任何虚假陈述、重大遗漏或误导。前述信息资料如发生任何实质性变更，及时书面告知管理人。投资者承认，资产管理人、资产托管人未对委托财产的收益状况作出任何承诺或

担保,本合同约定的业绩报酬计提基准仅是收取业绩报酬的标准而不是资产管理人对收益状况的保证。

3. 投资者声明其符合《指导意见》、《管理办法》和《运作规定》的各项要求,包括但不限于:

(1) 投资者具备相应风险识别能力和风险承担能力,为符合要求的合格投资者:

①具有 2 年以上投资经历,且满足以下条件之一:家庭金融净资产不低于 300 万元,家庭金融资产不低于 500 万元,或者近 3 年本人年均收入不低于 40 万元。

②最近 1 年末净资产不低于 1000 万元的法人单位。

③依法设立并接受国务院金融监督管理机构监管的机构,包括证券公司及其子公司、基金管理公司及其子公司、期货公司及其子公司、在中国证券投资基金业协会(以下简称“基金业协会”)登记的私募基金管理人、商业银行、金融资产管理公司、信托公司、保险公司、保险资产管理机构、财务公司及中国证监会认定的其他机构。

④接受国务院金融监督管理机构监管的机构发行的资产管理产品。

⑤基本养老金、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,合格境外机构投资者(QFII)、人民币合格境外机构投资者(RQFII)。

⑥中国证监会视为合格投资者的其他情形。法律法规、监管规则对于合格投资者认定将来另有规定的,从其规定。

(2) 投资者承诺以真实身份和自有财产或合法募集的资金参与本计划,投资者的资金来源合法合规,不存在使用贷款、发行债券等筹集的非自有资金投资本资产管理计划的情形,且保证其参与投资本资产管理计划符合法律法规的规定及业务决策程序的要求。

(3) 投资者以其管理的资产管理产品投资本计划的声明:

投资者承诺投资本计划不存在违反监管要求的产品嵌套,以及以投资本计划规避投资范围、杠杆约束等监管要求等违法违规行为。

4. 投资者已充分理解本合同条款,了解相关权利义务,了解有关法律法规及所投资资产管理计划的风险收益特征,知晓管理人、托管人及相关机构不应对资

产管理计划的收益状况或本金不受损失做出任何承诺，本合同约定的业绩比较基准（如有）仅是投资目标而不是管理人的保证，了解“卖者尽责，买者自负”的原则，投资于本计划将自行承担投资风险。

5. 承诺投资者的初始以及追加委托资产只能从以投资者本人名义开立的同一个账户中转入管理人的直销账户。投资者承诺提取或清算的委托资产只能转入投资者初始及追加委托资产时使用的上述账户。特殊情况导致初始、追加与提取的账户名称不一致时，投资者应出具符合相关法律法规规定的书面说明。

## 第四节 当事人及权利义务

### （一）投资者

#### 1. 投资者概况

签署本合同且合同正式生效的、且认购、参与资金到达指定账户并经注册登记机构确认的投资者即为本合同的投资者。投资者的详细情况在合同签署页列示。

#### 2. 投资者的权利

（1）按照本合同的约定取得资产管理计划财产收益。

（2）参与分配清算后的剩余资产管理计划财产。

（3）按照本合同的约定参与（如有）、退出（如有）和转让（如有）资产管理计划。

（4）按照法律法规及本合同约定的时间和方式获得资产管理计划的信息披露资料。

（5）监督资产管理人及资产托管人履行投资管理和托管义务的情况。

（6）依据合同约定的时间和方式，查询委托财产的资产配置、净值变动等相关信息。

（7）资产管理计划设定为均等份额，投资者持有的每份计划份额具有同等的合法权益。

（8）依据法律法规及本合同约定，定期从管理人和托管人处获得资产管理计划及资产托管业务相关报告。

（9）国家有关法律法规、中国证监会及基金业协会规定的和本合同约定的其他权利。

#### 3. 投资者的义务

（1）认真阅读并遵守本合同，保证投资资金的来源及用途合法。

（2）接受合格投资者认定程序，如实填写风险识别能力和风险承受能力问卷，如实提供资金来源、金融资产、收入及负债情况，并对其真实性、准确性和完整性负责，签署合格投资者相关文件。

（3）除公募资产管理产品外，以合伙企业、契约等非法人形式直接或者间接投资于资产管理计划的，应向资产管理人充分披露实际投资者和最终资金来源。

（4）认真阅读并签署风险揭示书。

(5) 按照本合同的约定支付资产管理计划的管理费、业绩报酬（如有）、托管费及税费等合理费用。

(6) 按照本合同的约定，将委托财产交付管理人和托管人分别进行投资管理和资产托管。在持有的资产管理计划份额范围内，承担资产管理计划亏损或者终止的有限责任。

(7) 及时、全面、准确地向资产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、是否符合合格投资者条件等基本情况。

(8) 向资产管理人或销售机构提供法律法规规定的信息资料及身份证明文件，配合资产管理人或其销售机构就投资者风险承受能力、投资者适当性管理、非居民金融账户涉税信息尽职调查、反洗钱等事项进行的尽职调查工作。

(9) 不得违反本合同的约定干涉资产管理人的投资管理行为。

(10) 不得从事任何有损资产管理计划及其投资者、资产管理人及资产管理人管理的其他资产、资产托管人及资产托管人托管的其他资产合法权益的活动。

(11) 确保其资金来源及用途合法。符合投资者的承诺与声明中的要求。

(12) 保守商业秘密，不得泄露委托财产投资计划、投资意向等；不得利用资产管理计划相关信息进行内幕交易或者其他不当、违法的证券期货业务活动。

(13) 投资者是其他受国务院金融监督管理机构监管的机构发行的资产管理产品的，投资者保证已就收集、存储、使用、删除、销毁最终投资者个人金融信息的取得最终投资者的完全授权，且不得因收集、储存、使用、删除、销毁最终投资者个人金融信息与最终投资者产生的争议或纠纷损害资产管理人的合法权益。

(14) 国家有关法律法规、中国证监会及基金业协会规定和本合同约定的其他义务。

## (二) 资产管理人

### 1. 资产管理人概况

名称：某某管理有限公司

注册地址：上海市

办公地址：上海市

法定代表人：某某

联系人：某某

联系电话：021-00000000

## 2. 资产管理人的权利

(1) 按照本合同的约定，独立管理和运用资产管理计划财产。

(2) 依照本合同的约定，及时、足额获得资产管理人管理费用和业绩报酬（如有）。

(3) 依照有关规定和资产管理合同约定行使因资产管理计划财产投资所产生的权利。

(4) 根据本合同及其他有关规定，监督资产托管人；对于资产托管人违反本合同或有关法律法规规定的行为，对资产管理计划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，并报告中国证监会相关派出机构及基金业协会。

(5) 自行销售或者委托有基金销售资格的机构销售资产管理计划，制定和调整有关资产管理计划销售的业务规则，并对销售机构的销售行为进行必要的监督。

(6) 自行担任或者委托经中国证监会认定的可办理开放式证券投资基金份额登记业务的其他机构担任资产管理计划份额的注册登记机构，并对注册登记机构的代理行为进行必要的监督和检查。

(7) 以资产管理人的名义，代表资产管理计划行使投资过程中产生的权属登记等权利。

(8) 资产管理人有权根据市场情况对本资产管理计划的总规模、单个投资者首次参与金额、每次参与金额及持有的本计划总金额限制进行调整。

(9) 国家有关法律法规、中国证监会及基金业协会规定和本合同约定的其他权利。

## 3. 资产管理人的义务

(1) 办理资产管理计划的销售、登记、备案事宜。

(2) 按照基金业协会要求报送资产管理计划产品运行信息。

(3) 按照诚实信用、勤勉尽责的原则履行受托人义务，管理和运用资产管理计划财产。

(4) 对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。

(5) 制作风险揭示书，向投资者充分揭示相关风险。

(6) 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资产管理计划财产。

(7) 建立健全内部管理制度，保证所管理的资产管理计划财产与其管理的基金财产、其他委托财产和资产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，进行投资。聘请投资顾问的，应制定相应利益冲突防范机制；

(8) 除依据法律法规、本合同及其他有关规定外，不得为资产管理人及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作资产管理计划财产。

(9) 保守商业秘密，不得泄露资产管理计划的投资计划、投资意向等，法律法规、监管机构、司法机关另有要求、审计要求及本合同另有规定的除外。当投资者以其管理的资产管理产品投资本计划时，若依据法律法规监管规定向产品管理人披露所管理的资产管理产品的实际投资者和最终资金来源的，产品管理人必须严格保密相关信息，除用于本计划备案用途外，不得用于任何其他用途。

(10) 公平对待所管理的不同财产，不得从事任何有损资产管理计划财产及其他当事人利益的活动。

(11) 除法律法规规定情形或符合法律法规或本合同所规定条件外，不得为管理人、托管人及其关联方提供融资。

(12) 按照本合同的约定接受投资者和资产托管人的监督。

(13) 以资产管理人的名义，代表投资者利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为。

当本计划项下资产出现违约、司法冻结情形的，管理人应及时告知投资者。管理人应尽职履行管理人职责，在行使诉讼权利或者实施其他法律行为时，管理人应事先征询持有计划份额三分之二以上投资者书面同意后，方可对相关责任人采取提起诉讼、进行财产保全、申请强制执行等措施，有效维护资产管理计划资金运作安全。

(14) 召集资产管理计划份额持有人大会（如有），份额持有人大会设立日常机构（如有）的除外。

(15) 按照本合同的约定计算并向投资者报告资产管理计划份额净值。

(16) 确定资产管理计划份额参与、退出价格，采取适当、合理的措施确保

份额交易价格的计算方法符合法律法规的规定和本合同的约定。

(17) 若投资非标准化资产的，对非标准化资产和相关交易主体进行充分的尽职调查，形成书面工作底稿，并制作尽职调查报告。

(18) 按照本合同约定进行资产管理计划会计核算并编制财务会计报告。

(19) 聘请具有证券相关业务资格的会计师事务所对年度财务会计报告进行审计。

(20) 按照本合同约定确定收益分配方案，及时向投资者分配收益。

(21) 按照相关法律法规和本合同的规定，编制并向投资者披露的资产管理计划季度、年度等定期报告，向基金业协会备案，并抄报证监会相关派出机构。

(22) 办理与受托财产管理业务活动有关的信息披露事项。

(23) 建立并保存投资者名单。

(24) 组织并参加资产管理计划财产清算小组，参与资产管理财产的保管、清理、估价、变现和分配。

(25) 按照法律、行政法规和中国证监会的规定，保存资产管理计划资产管理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，保存期限自资产管理计划终止之日起不得少于 20 年。

(26) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会相关派出机构、基金业协会并通知资产托管人和投资者。

(27) 根据法律法规及监管要求和本合同的规定，向中国证监会及其他金融监管机构履行报告义务。

(28) 除必要的信息披露及监管要求外，管理人不得以托管人的名义进行营销宣传。

(29) 在发生变更本计划投资经理等可能影响投资者利益的重大事项时，应提前或在合理时间内告知投资者。

(30) 管理人应当按有关规定履行委托资产投资的信息披露等义务；资产管理计划通过专用证券账户持有上市公司股份，或者通过专用证券账户和其他证券账户合并持有上市公司股份，发生应当履行公告、报告、要约收购等法律、行政法规和中国证监会规定义务的情形时，管理人应当履行相应义务。

(31) 办理资产管理计划份额的登记事宜。

(32) 国家有关法律法规、中国证监会及基金业协会规定和本合同约定的其



他义务。

### （三）资产托管人

#### 1. 资产托管人概况

名称：某某银行股份有限公司

通信地址：上海市

负责人或授权代表：某某（代为履行法定代表人职权）

联系人：某某

联系电话：021-99998888

#### 2. 资产托管人的权利

（1）按照本合同的约定，及时、足额获得资产托管费。

（2）根据本合同及其他有关规定，监督资产管理人对资产管理计划财产的投资运作，对于资产管理人违反本合同或有关法律法规规定的行为，对资产管理计划财产及其他当事人的利益造成重大损失的情形，有权报告中国证监会相关派出机构和基金业协会并采取必要措施。

（3）按照本合同的约定，依法保管资产管理计划财产。

（4）国家有关法律法规、中国证监会及基金业协会规定的和本合同规定的其他权利。

#### 3. 资产托管人的义务

（1）安全保管资产管理计划财产。

（2）除依据法律法规、本合同及其他有关规定外，不得为资产托管人及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管资产管理计划财产。

（3）对所托管的不同资产管理计划财产分别设置账户，确保资产管理计划财产的完整与独立。

（4）公平对待所托管的不同财产，不得从事任何有损资产管理计划财产及其他当事人利益的活动。

（5）按规定开设和注销资产管理计划的资金账户、证券账户等投资所需账户。

（6）复核资产管理计划资产净值和份额净值。

（7）办理与资产管理计划托管业务活动有关的信息披露事项。

（8）根据相关法律法规和资产管理合同约定，复核资产管理人编制的资产

管理计划财产的定期报告，并出具书面意见。

(9) 编制托管年度报告，并向基金业协会备案，抄报中国证监会相关派出机构。

(10) 按照法律法规要求和本合同的约定，根据资产管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜。

(11) 管理人未按规定召集或者不能召集份额持有人大会（如有）的，由托管人召集份额持有人大会，份额持有人大会设立日常机构（如有）的除外。

(12) 保守商业秘密。除法律法规、本合同及其他有关规定另有要求外，不得向他人泄露。

(13) 按照法律、行政法规及中国证监会的有关规定，保存资产管理计划的会计账册，妥善保存资产管理计划资产托管业务活动有关的合同、协议、凭证等文件资料，保存期限自资产管理计划终止之日起不得少于 20 年。

(14) 根据法律法规及本合同的规定监督资产管理人的投资运作，资产托管人发现资产管理人的投资指令或清算指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反本合同约定的，应当拒绝执行，立即通知资产管理人并及时报告中国证监会相关派出机构和基金业协会；资产托管人发现资产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，应当立即通知资产管理人并及时报告中国证监会相关派出机构和基金业协会。

(15) 投资于《管理办法》第三十七条第（五）项规定资产时，准确、合理界定安全保管资产管理计划财产、监督管理人投资运作等职责，并向投资者充分揭示。

(16) 设立专门的资产托管部门，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉资产托管业务的专职人员，负责财产托管事宜。

(17) 根据法律法规及监管要求和本合同的规定，向中国证监会及其他金融监管机构履行报告义务。

(18) 国家有关法律法规、监管机构及本合同规定的其他义务。

## 第五节 资产管理计划的基本情况

### （一）资产管理计划的名称

资产管理计划。

### （二）资产管理计划的类别

**【固定收益类】**集合资产管理计划。

### （三）资产管理计划是否属于 FOF 或者 MOM

本计划不涉及基金中基金资产管理计划（FOF）或管理人中管理人资产管理计划（MOM），因此无需特别标识。

### （四）资产管理计划的运作方式

1. 本计划为开放式运作。

2. 本资产管理计划自成立之日起每周二、周三、周四为开放日（遇到非工作日不顺延），每个开放日均可开放计划份额的退出和参与。开放时间为开放日的 9:00 至 15:00。

### （五）资产管理计划的投资目标、主要投资方向、投资比例、产品风险等级

#### 1. 投资目标：

本计划在严格控制流动性风险的前提下，通过合理安排组合期限结构、积极选择投资工具，追求计划资产的稳健回报和稳定增值。

2. 主要投资方向：固定收益类资产、权益类资产和国债期货。

3. 投资比例：本资产管理计划为固定收益类资管计划，投资于固定收益类资产的比例不低于本计划总资产的 80%。

4. 产品风险等级：**【中低等风险】**。

### （六）资产管理计划的存续期限

1. 本计划存续期为自本计划成立日至 2021 年 12 月 31 日。本计划成立日以管理人官网发布的公告或委托人收到的电子邮件为准。

2. 如发生本合同约定的计划提前终止或展期情形时，本计划可提前终止或展期。届时资产管理人网站上发布公告或管理人向委托人指定邮箱发送电子邮件的，即视为履行了告知义务。在本计划到期前一个月，资产管理人、资产托管人和资产委托人可书面协商是否延期。

3. 当委托财产中的资产因流动性等原因无法在本计划到期前变现时，则本计

划于到期日起自动延期直至委托财产项下投资组合完全变现为止。

（七）资产管理计划的初始份额面值

资产管理计划份额的初始销售面值为人民币 1.00 元/份。

（八）资产管理计划的初始资产规模

本资产管理计划成立时委托财产的初始资产净值不得低于 1000 万元人民币，但法律法规和监管机构另有规定的除外。

（九）资产管理计划的估值与核算、信息技术系统等服务机构，列明服务机构的名称和在证券投资基金业协会登记的业务登记编码（如有）；

本计划的份额注册登记机构、信息技术系统服务机构、估值与核算机构皆为某某管理有限公司。

（十）资产管理计划的分级安排（如有）

本产品无分级安排。

（十一）其他需要订明的内容

资产管理计划应当设定为均等份额，每份计划份额具有同等的合法权益。

## 第六节 资产管理计划份额的募集

### （一）资产管理计划份额的募集期限、募集方式、募集对象

#### 1. 募集期限

本资产管理计划的募集期限自计划份额发售之日起最长不超过60天，具体时间由资产管理人根据相关法律法规以及本合同的规定确定，并在计划说明书中披露。

如果在此期限提前达到法律法规规定的投资者人数上限的，资产管理人将提前终止募集。届时，资产管理人在资产管理人网站及时公告或向委托人指定邮箱发出电子邮件，即视为履行完毕提前终止募集的程序。资产管理人发布公告或向委托人指定邮箱发出电子邮件宣布提前结束募集的，本资产管理计划自募集结束日起（不含）不再接受认购申请。

#### 2. 募集方式

本资产管理计划通过资产管理人的直销中心柜台进行销售。

投资者认购本资产管理计划前必须与资产管理人和资产托管人签订资产管理合同，按销售机构规定的方式足额缴纳认购款项。认购的具体金额和份额以注册登记机构的确认结果为准。

#### 3. 募集对象

符合相关法律法规的要求及本合同约定的合格投资者。

### （二）资产管理计划份额的认购和持有限额

认购资金应以现金形式交付。投资者在募集期间认购金额不得低于100万元人民币（不含认购费用），并可多次认购，募集期间追加认购金额不低于1万元。

### （三）资产管理计划份额的认购费用

本计划不收取认购费。

### （四）募集期间的认购程序

1. 资产管理人或代理销售机构（委托代理机构进行销售的）完成投资者尽职调查工作（含相关投资者适当性审核工作），并将相关资料提供给资产管理人。

2. 认购程序。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合同规定的前提下，以各销售机构的具体规定为准。

3. 认购申请的确认。销售机构受理认购申请并不表示对该申请是否成功的确认，而仅代表销售机构确实收到了认购申请。申请是否有效应以注册登记机构的

确认并且资产管理合同生效为准。投资者应在本合同生效后到各销售网点查询最终确认情况和有效认购份额。

认购申请一经受理，不得撤销。

#### 4. 初始募集价格

人民币 1.00 元。

#### 5. 初始募集期间利息的处理方式

认购资金在募集期间发生的利息收入按银行同期活期存款利率计算。在本计划成立后折算成相应的资产管理计划份额归委托人所有，其中利息转份额的具体数额以注册登记机构的记录为准。

#### 6. 认购份额余额的处理方式

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资产管理计划财产承担。

认购份额=（认购金额+认购利息）/募集价格。

#### （五）募集期间资金的管理

资产管理人应当将资产管理计划募集期间募集的资金存入专门账户，在资产管理计划成立前，任何机构和个人不得动用。

通过资产管理人的直销中心办理认购的委托人，应将委托资金划入资产管理人直销账户。

#### （六）资产管理人应在《计划说明书》中披露本计划直销账户。

## 第七节 资产管理计划的成立与备案

### （一）资产管理计划的成立

#### 1. 资产管理计划成立的条件

（1）本资产管理计划募集期限届满或依据本合同提前结束销售。

（2）募集过程符合法律、行政法规和中国证监会的规定，资产管理计划委托人人数至少 2 人且不超过 200 人。

（3）资产管理计划的初始募集规模合计不低于 1000 万元人民币，法律法规和监管机构另有规定的除外。

（4）符合中国证监会规定以及资产管理合同约定的其他条件。

#### 2. 资产管理计划的成立日

（1）资产管理计划的成立日为：指资产管理计划初始募集期结束并完成验资，经资产管理人公告的本计划成立之日。

（2）托管人自本计划成立之日起对管理人的投资运作进行监督。

### （二）资产管理计划的备案

1. 募集期限届满或依据本合同提前结束本计划的销售时，符合集合资产管理计划备案条件的，资产管理人应当自募集期限届满之日或依据本合同提前结束销售之日起 10 个工作日内聘请具有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。

2. 本资产管理计划在取得验资报告后，由资产管理人公告资产管理计划成立。资产管理人在资产管理计划成立之日起 5 个工作日内，将资产管理合同、投资者名单与认购金额、验资报告或者资产缴付证明等材料报中国证券投资基金业协会备案，并抄报中国证监会相关派出机构。

3. 资产管理计划完成备案前不得开展投资活动，管理人开展投资活动前，应及时向托管人发送成立公告、验资报告及计划已通过协会备案的证明材料，投资于【银行活期存款、国债、政策性金融债、地方政府债券、中央银行票据】的除外。本条所述计划完成备案前可以进行投资的标的应同时遵守本计划投资范围与投资限制约定。

4. 投资者的认购参与款项（不含认购费用）加计其在募集期形成的利息将折算为资产管理计划份额归投资者所有，其中利息转份额的具体数额以注册登记机构的记录为准。

（三）资产管理计划销售失败或不能满足成立条件的处理方式

资产管理计划销售期限届满，不能满足上述资产管理计划成立条件的，资产管理人应当：

1. 以其固有财产承担因销售行为而产生的债务和费用。
2. 在资产管理计划销售期限届满后 30 日内退还投资者已缴纳的款项，并加计银行同期活期存款利息。



## 第八节 资产管理计划的参与、退出与转让

### （一）参与和退出场所

本资产管理计划参与和退出场所为资产管理人的直销机构-营业场所，或按销售机构提供的其他方式办理参与和退出。

### （二）参与和退出的开放日和时间

本资产管理计划自成立之日起每周二、周三、周四为开放日（遇到非工作日不顺延），每个开放日均可开放计划份额的退出和参与。开放时间为开放日的 9:00 至 15:00。

**若投资者在上述约定的开放期之外申请计划份额退出，则视为违约退出。本计划不设置违约退出。**

若中国证监会有新的规定，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，资产管理人将视情况对本条规定进行相应的调整并告知投资者。**资产管理人网站上发布公告或向委托人指定邮箱发送电子邮件的，即视为履行了告知义务。**

### （三）临时开放期

在满足法律法规要求的前提下，当以下情形发生时，资产管理人增设临时开放期，且临时开放期只允许本计划现存委托人退出。

- （1）本计划存续期届满并根据本合同约定进行展期的；
- （2）资产管理人根据本合同约定对本合同进行变更的；
- （3）中国证监会或法律法规规定的其他情形。

临时开放期的具体安排以资产管理人公告或向委托人指定邮箱发出的电子邮件为准，届时资产管理人网站上发布公告或向委托人指定邮箱发送电子邮件的，即视为履行了告知义务。

### （四）参与和退出的方式、价格、程序及确认等

1. “未知价”原则，即资产管理计划的参与和退出价格以受理申请当日收市后计算的资产管理计划份额净值为基准进行计算。

2. 资产管理计划采用金额参与和份额退出的方式，即参与以金额申请，退出以份额申请。

3. 投资者办理参与、退出等业务时应提交的文件和办理手续、办理时间、处

理规则等在遵守本合同规定的前提下，以销售机构的具体规定为准。

4. 当日的参与与退出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。

5. 参与和退出申请的确认。销售机构受理参与或退出申请并不表示对该申请是否成功的确认，而仅代表销售机构确实收到了参与或退出申请。申请是否有效应以注册登记机构的确认为准。注册登记机构应在法律法规规定的时限内对投资者参与、退出申请的有效性进行确认。投资者可在销售机构办理业务后的第3个工作日至销售网点查询最终确认情况。

如将开放当日全部有效参与申请确认后，投资者总人数不超过200人，则注册登记机构对参与申请全部予以确认。如将开放当日全部有效参与申请确认后投资者总人数超过200人，则注册登记机构按照“时间优先、金额优先”的原则确认参与申请，确保本资产管理计划的委托人数不超过200人，对未予确认的参与资金予以返还。

投资者退出资产管理计划时，采用“先进先出”的方式确认退出金额；本计划在投资者退出时不计提业绩报酬，业绩报酬于计划终止时计算和分配。

6. 参与和退出申请的款项支付。参与采用全额交款方式，若资金在规定时间内未全额到账则参与不成功，已交付的委托款项将退回投资者账户。投资者退出申请成交后，资产管理人应按规定向投资者支付退出款项，退出款项在自受理投资者有效退出申请之日起不超过7个工作日内划往投资者银行账户。在发生巨额退出时，退出款项的支付办法按本合同和有关法律法规规定办理。

7. 资产管理人在不损害投资者权益的情况下可更改上述原则，但最迟应在新的原则实施前3个工作日告知投资者。**资产管理人网站发布公告或向委托人指定邮箱发出电子邮件的，即视为履行了告知义务。**

#### （五）参与和退出的金额限制

投资者在资产管理计划存续期开放日购买资产管理计划份额的，投资者应符合合格投资者标准，如投资者在提交参与申请时未持有资产管理计划份额，则首次参与金额应不低于100万元人民币（不含参与费用），在开放日内追加参与的，每次参与的金额应不低于1万元人民币。

当投资者持有的计划资产净值高于100万元人民币时，投资者可以选择全部或部分退出资产管理计划份额；选择部分退出资产管理计划份额的，投资者在退

出后持有的计划资产净值不得低于 100 万元人民币。当资产管理人发现投资者申请部分退出资产管理计划将致使其在部分退出申请确认后持有的计划资产净值低于 100 万元人民币的，资产管理人有权适当减少该投资者的退出金额，以保证部分退出申请确认后投资者持有的计划资产净值不低于 100 万元人民币。

当投资者持有的计划资产净值低于 100 万元人民币（含 100 万元人民币）时，需要退出计划的，投资者必须选择一次性全部退出资产管理计划。

资产管理人可根据市场情况，合理调整对参与金额和退出份额的数量限制，资产管理人进行前述调整必须提前 3 个工作日告知投资者。**资产管理人就前述调整事项在网站公告或向委托人指定邮箱发出电子邮件的，即视为履行了告知义务。**

#### （六）参与和退出的费用

##### 1. 参与费用

本计划不收取参与费用。

##### 2. 退出费用

本计划不收取退出费用。

#### （七）参与份额的计算方式、退出金额的计算公式

##### 1. 参与份额的计算公式

参与份额=参与金额/参与申请受理日当日计划份额净值

参与的有效份额单位为份，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资产管理计划财产承担。

##### 2. 退出金额的计算公式

净退出金额=退出份额×退出申请受理日当日计划份额净值

退出金额的计算单位为元，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资产管理计划财产承担。

#### （八）参与资金的利息处理方式

不适用。

#### （九）巨额退出的认定及处理方式

##### 1. 巨额退出的认定

单个工作日内，本资产管理计划需处理的净退出申请总份额超过本资产管理计划上一工作日资产管理计划总份额的20%时，即认为本资产管理计划发生了

巨额退出。

## 2. 巨额退出的处理方式

出现巨额退出时，资产管理人可以根据本资产管理计划当时的资产状况决定接受全额退出或部分退出。

（1）接受全额退出：当资产管理人认为有能力兑付投资者的全部退出申请时，按正常退出程序执行。对开放日提出的退出申请，如构成巨额退出的，应当按照本资产管理合同约定全额接受退出，但退出款项支付时间可适当延长，最长不应超过15个工作日。

（2）部分延期退出：当全额兑付投资者的退出申请有困难，或兑付投资者的退出申请进行的资产变现可能使资产管理计划资产净值发生较大波动时，资产管理人可在该工作日接受部分退出申请，其余部分的退出申请在后续工作日予以受理。对于需要部分延期办理的退出申请，除投资者在提交退出申请时明确做出不参加顺延下一个工作日退出的表示外，自动转为下一个工作日退出处理，转入下一个工作日的退出申请的退出价格为下一个工作日的资产管理计划份额净值，以此类推，直到全部退出为止（如遇下一工作日为非开放日的，应全部在最后一个工作日办理）。部分退出导致投资者持有的计划份额资产净值低于100万元人民币的，资产管理人可按全额退出处理。发生部分延期退出时，资产管理人可以适当延长退出款项的支付时间，但最长不应超过15个工作日。

（3）巨额退出的价格：巨额退出的价格按照退出受理当日的资产管理计划份额净值为基准进行计算。

（4）巨额退出的顺序：办理巨额退出发生部分延迟退出时，按单个投资者申请退出份额占退出申请份额的比例，确定该投资者当日的退出份额，退出顺序与提出申请的份额和具体时间无关。

（5）巨额退出的款项支付：巨额退出的款项自退出确认之日起15个工作日内划往投资者指定账户。

（6）巨额退出的通知：当发生巨额退出并部分延期退出时，资产管理人应当在3个交易日内通知投资者，并说明有关处理方法；同时资产管理人应当报基金业协会备案。

## （十）连续巨额退出的认定及处理方式

开放期连续两个或两个以上开放日发生巨额退出，则视为本计划发生了“连

续巨额退出”。如果发生了连续巨额退出，资产管理人认为有必要，可暂停接受计划的退出申请。已经接受的退出申请可以延缓支付退出款项，但不得超过15个工作日，并应当在资产管理人的网站进行公告或向资产委托人指定邮箱发送通知。

在暂停退出的情况消除时，基金管理人应及时恢复退出业务的办理并公告。

#### （十一）延期支付及延期退出的情形和处理

不适用。

#### （十二）拒绝或暂停参与、暂停退出的情形及处理

1. 在如下情况下，资产管理人可以拒绝接受投资者的参与申请：

（1）如接受该申请，将导致本计划的投资者超过200人。

（2）根据市场情况，资产管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对资产管理计划业绩产生负面影响，从而损害现有资产管理计划投资者的利益的情形。

（3）如接受该申请，将导致本计划资产总规模超过本合同约定的上限（如有）。

（4）因资产管理计划收益分配、或资产管理计划内某个或某些证券进行权益分派等原因，使资产管理人认为短期内接受参与可能会影响或损害现有资产管理计划投资者利益的。

（5）资产管理人认为接受某笔或某些参与申请可能会影响或损害其他资产管理计划投资者利益的。

（6）法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

资产管理人决定拒绝接受某些投资者的参与申请时，参与款项将无息退回投资者账户。

2. 在如下情况下，资产管理人可以暂停接受投资者的参与申请：

（1）因不可抗力导致无法受理投资者的参与申请。

（2）证券交易场所交易时间临时停市，导致资产管理人无法计算当日资产管理计划财产净值。

（3）发生本资产管理计划合同规定的暂停资产管理计划资产估值情况。

（4）法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

资产管理人决定暂停接受全部或部分参与申请时，应当告知投资者。在暂停

参与的情形消除时，资产管理人应及时恢复参与业务的办理并告知投资者。

3. 在如下情况下，资产管理人可以暂停接受投资者的退出申请：

（1）因不可抗力导致资产管理人无法支付退出款项。

（2）证券交易场所交易时间临时停市，导致资产管理人无法计算当日资产管理计划财产净值。

（3）发生本资产管理计划合同规定的暂停资产管理计划资产估值的情况。

（4）发生连续巨额退出。

（5）法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一的，资产管理人应当及时告知投资者。已接受的退出申请，资产管理人应当足额支付；如暂时不能足额支付，应当按单个退出申请人已被接受的退出申请量占已接受的退出申请总量的比例分配给退出申请人，其余部分在后续开放日予以支付。

在暂停退出的情况消除时，资产管理人应及时恢复退出业务的办理并及时告知投资者。

4. 暂停资产管理计划的参与、退出时，资产管理人应按规定告知投资者并报基金业协会备案。

5. 暂停参与或退出期间结束，资产管理计划重新开放时，资产管理人应按规定告知投资者并报基金业协会备案。

#### （十三）大额退出的预约申请

任一委托人在开放日退出金额超过人民币 1000 万元，或退出份额超过本资产管理计划上一工作日本计划总份额的 20% 的，应当提前 2 个工作日向管理人预约申请。管理人未收到该等预约申请通知的，管理人有权拒绝该委托人的退出申请。

#### （十四）资产管理计划份额的转让

本资产管理计划存续期间内，投资者可以通过证券交易所以及中国证监会认可的其他方式，向其他符合本合同约定的合格投资者转让其持有的集合资产管理计划份额，份额转让应遵守交易场所相关规定及要求，并按规定办理份额变更登记手续，首次参与本计划的受让方应当与本计划管理人、托管人签订资产管理合同；若份额转让可能导致本计划人数超过 200 人或拟受让方无法提供真实、有效的合格投资者身份认证证明资料的，管理人有权拒绝办理份额转让。但资产管理

人不负有寻找份额受让人的义务。

受让方首次参与集合资产管理计划的，应当先与资产管理人、资产托管人签订资产管理合同。

资产管理人不得通过办理集合资产管理计划的份额转让，公开或变相公开募集资产管理计划。

资产管理人有权在法律法规的前提下，制定本资产管理计划的份额转让的相关操作规定，投资者应当按照该等操作规定进行份额转让。

#### （十五）非交易过户认定及处理方式

1. 资产管理人及注册登记机构只受理继承、捐赠、司法强制执行和经注册登记机构认可的其他情况下的非交易过户。其中：

“继承”是指投资者死亡，其持有的计划份额由其合法的继承人继承。

“捐赠”是指投资者将其合法持有的计划份额捐赠给公益性质的基金会或社会团体。

“司法强制执行”是指司法机构依据生效司法文书将投资者持有的计划份额强制划转给其他自然人、法人、社会团体或其他组织的情形。

2. 办理非交易过户业务必须提供注册登记机构规定的相关资料。符合条件的非交易过户申请自申请受理日起[ 1 ]个月内办理；申请人按注册登记机构规定的标准缴纳过户费用。

（十六）资产管理人若以自有资金参与本资产管理计划的，与其余投资者所持的份额享有同等权益、承担同等风险。资产管理人持有的计划份额比例不得超过本计划总份额的 20%，且参与本计划的持有期限不得少于 6 个月。同时，参与、退出本计划时，资产管理人应当提前 5 个工作日以邮件或公告的形式告知投资者和资产托管人。

（十七）管理人应定期将资产管理计划投资者变更情况报送基金业协会。

## 第九节 份额持有人大会

本计划不设置份额持有人大会机制。



## 第十节 资产管理计划份额的登记

（一）本资产管理计划份额的注册登记业务指本资产管理计划的登记、存管、清算和交收业务，具体内容包括投资者账户管理、份额注册登记、清算及交易确认、收益分配、建立并保管资产管理计划客户资料表等。

（二）本资产管理计划的注册登记机构为某某管理有限公司。

（三）注册登记机构履行如下职责：

1. 建立和保管投资者账户资料、交易资料、资产管理计划客户资料表等，并将客户资料表提供给资产管理人。

2. 配备足够的专业人员办理本资产管理计划的注册登记业务。

3. 严格按照法律法规和本资产管理合同规定的条件办理本资产管理计划的注册登记业务。

4. 严格按照法律法规和本资产管理合同规定计算业绩报酬，并提供交易信息和计算过程明细给资产管理人。

5. 接受资产管理人的监督。

6. 保存资产管理计划客户资料表及相关的参与和退出等业务记录 20 年以上。

7. 对投资者的账户信息负有保密义务，因违反该保密义务对投资者或资产管理计划带来的损失，须承担相应的赔偿责任，但法律法规或监管机构另有规定的除外。

8. 按本资产管理计划合同，为投资者提供资产管理计划收益分配等其他必要的服务。

9. 在法律法规允许的范围内，制定和调整注册登记业务的相关规则。

10. 法律法规规定的其他职责。

（四）全体资产管理计划份额持有人同意管理人、份额登记机构或其他份额登记义务人将集合资产管理计划投资者名称、身份信息以及集合资产管理计划份额明细等数据备份至中国证监会认定的机构。

## 第十一节 资产管理计划的投资

### （一）投资目标

本计划在严格控制流动性风险的前提下，通过合理安排组合期限结构、积极选择投资工具，追求计划资产的稳健回报和稳定增值。

### （二）投资范围

1. 本计划主要投资于法律法规和监管机构允许投资的以下几类资产：

（1）固定收益类资产：债券（利率债（国债、中央银行票据、地方政府债券、政策性金融债）、非政策性金融债、企业债、公司债、短期融资券（含超短期融资券）、中期票据、公募可转债/公募可交债），现金管理工具（银行存款、货币市场基金（非管理人旗下货币基金）、债券回购、同业存单）；

（2）权益类资产：股票（包括主板/中小板/创业板/科创板及其他经中国证监会核准上市的股票、新股申购、港股通标的股票）、股票型证券投资基金（含指数型证券投资基金）、混合型证券投资基金；

（3）商品及金融衍生品类资产：国债期货。

本计划不得投资私募可转/可交债、定向增发、股指期货。

#### 2. 投资比例

本资产管理计划为固定收益类资管计划，投资于固定收益类资产的比例不低于本计划总资产的 80%。

3. 本计划的建仓期为自计划成立日起不超过 3 个月，建仓期内不受上述比例限制。

4. 在本计划投资范围内，资产管理人 can 运用委托财产投资于管理人、托管人及前述机构的控股股东、实际控制人或者其他关联方发行的证券、管理或托管的证券投资基金或者承销期内承销的证券。投资者签署本合同即视为已经充分理解并同意资产管理人从事该等关联交易，资产管理人无需就该等具体关联交易分别取得投资者的个别授权。

5. 本资产管理计划成立后至备案完成前，管理人可以现金管理为目的，投资于【银行活期存款、国债、政策性金融债、地方政府债券、中央银行票据】。本条所述计划完成备案前可以进行投资的标的应同时遵守本计划投资范围与投资限制约定。

### （三）投资比例超限的处理方式及流程

除本合同另有约定外，因证券期货市场波动、证券发行人合并、资产管理计划规模变动等管理人之外的因素导致资产管理计划投资不符合法律、行政法规和中国证监会规定的投资比例或者合同约定的投资比例的，管理人应当在流动性受限资产可出售、可转让或者恢复交易的【10】个交易日内调整至符合相关要求。确有特殊事由未能在规定时间内完成调整的，管理人应当及时向中国证监会相关派出机构和基金业协会报告。

管理人应当根据《上海证券交易所、深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司证券交易资金前端风险控制业务规则》等有关规定，及时申报有关信息，确保申报信息真实、完整、有效，切实履行资金前端控制各项职责。证券交易所根据管理人申报的符合要求的自设额度，对其相关交易单元实施资金前端控制。

### （四）说明 FOF 产品（如是）所投资资产管理产品的选择标准

本产品不涉及 FOF 产品。

### （五）风险收益特征

本资产管理计划为属于中低等风险收益特征的投资产品，风险等级为中低等。

### （六）投资策略

#### 1. 投资策略概述

本资管计划投资策略主要为【股债混合策略】

#### 2. 具体投资策略

资产管理人运作本计划财产的决策依据、决策程序、投资管理的方法和标准为：

##### （1）大类资产配置

在大类资产配置上采用自上而下的方法，综合分析和持续跟踪基本面、政策面、市场面等多方面因素，结合全球宏观经济形势，研判国内经济的发展趋势，并在严格控制投资组合风险的前提下，分析各大类资产的预期风险收益特征，如股票市场平均股息率、市净率、不同久期的国债收益率等，确定或调整股票和允许投资的其他品种的投资比例。

##### （2）固定收益投资策略

本计划将采取积极的固定收益投资策略，在分析和判断宏观经济运行状况和

金融市场运行趋势的基础上，主要运用久期匹配策略，通过保持较高的杠杆，力争委托财产净值增长。资产管理人将以自上而下地决定债券组合久期及类属配置，同时在严谨深入的信用分析的基础上，自下而上地精选个券，严格控制组合整体的违约风险水平。

国债期货与现券组合构成多元化策略，其主要的策略类别包括：国债期货期现策略/基差交易、国债期货跨期交易、国债期货曲线交易策略等。

资产管理人将根据短期市场利率的变动情况及投资组合的流动性要求，适度投资于现金、货币基金、债券回购、银行存款、同业存单等货币市场工具，以期在保持流动性的前提下实现现金资产的保值增值。

### （3）个股精选策略

本计划通过深入的“自下而上”的企业基本面分析，致力遴选基本面优秀的企业进入投资视野，其一般具有业务清晰、战略明确、管理规范、财务透明等特征，具体而言，有以下特征：1）具有良好的公司治理结构，信息透明，注重公众股东利益和投资者关系，管理规范；2）财务状况透明稳健，主营业务收入、净利润等主要财务指标具有良好成长性；在选股中，成长性指标，例如过去三年主营收入增长率、净利润增长率、PSG、PEG等将成为本计划考察企业的重要指标；3）在生产、技术、市场、政策环境等经营层面具有一方面或几方面竞争优势；4）有清晰的增长战略，并已通过企业行为验证，同时与其现有的竞争优势相契合。

在此基础上，本计划精选具有显著行业地位的、或因基本面重大变化而预期高速成长的、或契合市场投资主题等三类的公司股票进入投资组合。本计划基于定性定量分析、动态静态指标相结合的原则，采用内在价值、相对价值、收购价值相结合的估值方法。在投资组合构建中，本计划强调基于估值、行业比较和公司发展阶段等因素综合考量的基础上来灵活调整股票的配置比例和股票组合结构配置。

### （4）基金投资策略

基于本资产管理人对基金运行规律的把握，本计划将从产品风格、历史表现收益、外部评价机构评价等三类指标来精选绩优基金进行组合管理，在严格风险管理的基础上，为资产委托人创造稳健收益。

本计划所认同的绩优基金具有以下特征：1）由历史业绩出色、发展态势良

好和拥有强大投资研究团队的基金管理公司管理；2）符合本计划的投资目标和投资限制等规定；3）拥有与本计划相似投资理念，立足于“自下而上”的基本面分析，坚持价值投资的理念。

#### （七）建仓期

本计划的建仓期为自本计划成立之日起 3 个月。

本计划建仓期的投资活动，应当符合本资产管理合同约定的投向和资产管理计划的风险收益特征。以现金管理为目的，投资于银行活期存款、国债、政策性金融债、中央银行票据、地方政府债券等中国证监会认可的投资品种的除外。

建仓期结束后，资产管理计划的资产组合应当符合法律、行政法规、中国证监会规定和合同约定的投向和比例。

#### （八）投资限制

##### 1. 投资限制

（1）本计划投资于固定收益类资产的比例不低于产品总资产的 80%，其中公募可转债/公募可交债不得超过净资产的 30%；投资于权益类资产和金融衍生品的合计投资比例合计不超过计划净资产的 20%，且计划连续半年内权益类资产配置比例不得为 0。

（2）本计划总资产不超过净资产的 200%；本计划投资资产组合久期不超过 4 年。

（3）本计划持有一家 A 股上市公司所发行股票，占该公司 A 股总股本比例不得超过 5%。

（4）若上市公司同时在境内和香港上市，计划持有一家公司发行的股票，不超过其总股本（同一家公司在境内和香港同时上市的 A+H 股合计计算）的 10%。

（5）本计划投资于单一股票，不超过计划净资产的 10%，如该股票同时在 A 股和港股上市，则合并计算。

（6）本计划投资于港股通标的股票，合计不得超过计划净资产的 10%。

（7）本计划可参与科创板打新和科创板二级市场投资，计划持有的科创板股票占比不超过计划净值的 5%。

（8）不得主动投资于被列为风险警示股票或退市整理的股票（如\*ST、ST、S、S\*ST、SST 类股票），如被动持有，应在 10 个交易日内减持完毕；不得持有三板股票。

(9) 本计划投资于单一债券(利率债除外)、基金(货币基金除外), 不超过计划净资产的 10%;

(10) 本计划投资于单一债券, 不得超过债券余额的 10%; 本计划投资于单一基金, 不超过该基金市值的 10%。

(11) 本计划投资于单一货币市场基金, 不超过计划净资产的 25%。

(12) 本计划不得持有私募债和 PPN 等流动性较差的投资品种; 不得投资永续债; 除公募基金外的其他直接参与方式, 不得投资平板玻璃、造船、多晶硅、风电设备行业的债券(公募可转债/公募可交债除外)。

(13) 不得将委托资产用于贷款、抵押融资或对外担保等用途。

(14) 不得将委托资产用于可能承担无限责任的投资。

(15) 不得投资于权证、商品期货、不在沪深两交易所挂牌交易的各类有价证券(银行间债券及准入标准规定的投资范围内的有价证券除外); 不可主动单独投向各类分级基金 B 份额。

(16) 国债期货仅限于套期保值策略(只能做空, 不能做多), 同时对国债期货交易实施累计损失限额管理, 即当日累计保证金余额占比不超过委托资产净值的 1%, 月度累计损失不得超过委托资产净值的 0.5%, 季度累计损失不得超过委托资产净值的 1%, 年度累计损失不得超过委托资产净值的 1.5%。如果达到上述限额后, 产品当月、当季和当年就不得再运作国债期货投资。国债期货的合约价值占净资产的比例不得超过 20%。

(17) 产品投资债券需投资主体外部评级 AA+及以上的债券(公募可转债/公募可交债发行主体可放开至 AA 级及以上; 利率债除外), 不得投资以下债券资产;

①禁止介入同时没有主体评级以及债项评级的债券(短融与超短融除外, 但要求发行人主体评级需在 AA+以上; 利率债除外); 禁止介入发行主体和担保方缺乏偿债能力, 主要依靠维好主体信用的企业外币债。

②债项评级或主体信用评级在 180 天内有下调记录或评级展望不正常(含负面、待决、观望等); 最近一年内债项评级或主体信用评级下调超过两次(含)的债券。

③根据有关债券集中排查工作以及投资者内部评级工作, 由投资者所提供的“负面清单”(主要包括排查工作中被列为退出类、减持类、重点观察类的主体,



以及投资者内部评级为不过的主体及债券)。

④近三年发行的债券或其他债务 出现违约或延迟支付本息的情形；发行人主体近三年内发生过影响本息偿付能力的重大信用事件的债券。

⑤发行主体为融资性担保公司、小额贷款公司、典当行等违约风险较高、内控风险较高、自身核心资产构成分散且金额较小的行业；被国家产业结构调整目录及人行信贷政策法规等列入禁止类目录以及国家明令淘汰和非鼓励的生产能力、工艺、产品，以及环保或安全生产条件不达标的项目主体，禁止介入；发行主体为民营企业的信用债（公募可转债/公募可交债除外），禁止介入。

⑥近一年内因信息披露不合格、违规使用募集资金等违反银行间债券市场自律规则行为，被交易商协会处以暂停业务的客户；存在因违法、违规、安全事故等被国家相关法律、法规、规章中限制融资的情况。

⑦存在以下情况的城投债：全国百强县前二十以外的县级（含）以下层级政府；所有区级平台类公司（直辖市除外）；在政府性存量债券清理甄别中存在恶意改变债权债务关系，或是有重大违约记录；在公开市场融资业务中已有存量不良融资业务的地市级行政区域。

⑧存在可预期的或正在进行的收购、兼并、重组以及整体搬迁等影响发行人经营的重大事项。

⑨对于钢铁、水泥、煤化工行业，原则上不得介入由投资者所提供的“正面清单”外的主体。

⑩以上债券如被动持有，应在 10 个交易日内减持完毕。

(18)存在多家评级公司评级结果的，主体外部评级应采用半年内孰低结果。评级公司限于中诚信证券、中诚信国际、大公、联合资信、联合信用、新世纪、鹏元、东方金诚 8 家，其中鹏元、东方金诚的债券评级下调一级使用。如后续经持有计划份额三分之二以上投资者决定调整，该限制可进行实时调整。

(19)存续期内底层资产若超出相关要求（包括但不限于持有计划份额三分之二以上投资者的要求），需在相关资产可交易之日起 10 个工作日减持至规定的范围内。

(20) 计划投资于同一资产的资金，不得超过该计划资产净值的 25%；资产管理人管理的全部集合资产管理计划投资于同一资产的资金，不得超过该资产的 25%。银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券等中

国证监会认可的投资品种除外。前述同一资产指的是单一证券。

(21) 本计划不得投资私募可转债、私募可交债、定向增发股票、股指期货。

(22) 本计划参与债券、股票、可转换公司债券、可交换公司债券等证券发行申购时，所申报的金额不得超过本计划的总资产，所申报的数量不得超过拟发行公司本次发行的总量。

(23) 本计划每日参与债券正回购或逆回购资金余额不超过上一日净资产的100%。

(24) 法律法规、中国证监会以及资产管理合同规定的其他投资限制。

非因资产管理人主观因素导致突破前述比例限制的，资产管理人应当在流动性受限资产可出售、可转让或者恢复交易的10个交易日内调整至符合要求。法律法规或监管规则另有规定的，从其规定。如法律法规或监管机构以后允许本产品投资的其他产品，投资者、资产管理人、资产托管人三方签署补充协议后，可以将其纳入投资范围。

#### (九) 投资禁止行为

- 1、禁止承销证券；
- 2、禁止违反规定向他人贷款或提供担保；
- 3、禁止从事承担无限责任的投资；
- 4、禁止从事内幕交易、操纵证券价格及其他不正当的证券交易活动；
- 5、不得主动投资于\*ST、ST等交易所特殊处理类股票；
- 6、不得投资于连续2年以上出现经营持续亏损的公司发行的证券；
- 7、不得投资于近一年被证监会调查，或者面临行政、刑事处罚的上市公司发行的股票；
- 8、不得投资于近期年报中出具“保留意见”、“否定意见”、“无法表示意见”等非标准审计意见的股票；
- 9、禁止直接投资于商业银行信贷资产；
- 10、禁止违规为地方政府及其部门提供融资，要求或者接受地方政府及其部门违规提供担保；
- 11、禁止直接或者间接投资法律、行政法规和国家政策禁止投资的行业或领域；
- 12、禁止直接或者间接投资于违反国家产业政策、环境保护政策的项目（证



券市场投资除外);

13、禁止向管理人、托管人出资;

14、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) 资产管理计划的预警和止损

##### 1. 预警线与止损线

为保护投资者利益,本资产管理计划于每个交易日估算计划份额净值,并设置初始预警线与止损线(或称平仓线):

预警线=计划份额净值达到 0.98 元(以收市后管理人计算的计划份额净值为准)

协商止损线=计划份额净值达到 0.97 元(以收市后管理人计算的计划份额净值为准)

强制止损线=计划份额净值达到 0.94 元(以收市后管理人计算的计划份额净值为准)

##### 2. 预警与止损操作

###### (1) 预警操作

若 T 日资产管理计划单位净值触及预警线,资产管理人应当在 T+1 日起,将不得新增权益类资产、商品及金融衍生品类资产的投资,并立即通过邮件、电话或者书面方式通知投资者向投资者提示风险。

###### (2) 协商止损操作

若 T 日资产管理计划单位净值触及协商止损线,管理人自 T+1 日起,应当立即通过邮件、电话或者书面方式通知投资者,持有计划份额三分之二以上投资者有权要求管理人提前终止或继续运作资管计划。

###### (3) 强制止损操作

若 T 日资产管理计划单位净值触及强制止损线,管理人自 T+1 日起,应将本计划资产中可变现资产进行不可逆的变现操作,并立即通过邮件、电话或者书面方式通知投资者,止损完毕后资产管理计划提前结束,资产管理合同提前终止,进入清算程序。

若在止损变现过程中,遇到单只或多只证券存在停牌不能及时卖出导致无法变现的情况,则要求在证券复牌后及时卖出股票。

对于本产品的预警和止损策略,托管人通过在每个估值日(T 日)结束后复

核 T 日份额净值的方式配合管理人进行预警或止损操作。

（十一）订明投资非标准化股权类资产的退出安排（如有）

本资产管理计划不涉及非标准化股权类资产投资。

（十二）本计划投资的资产组合的流动性与参与、退出安排相匹配

为确保资产管理计划所投资的资产组合的流动性与本计划参与、退出安排相匹配，本计划开放退出期内，主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过组合资产净值的 20%，且资产组合中 7 个工作日可变现资产的价值，不低于本计划资产净值的 10%。

（十三）投资政策的变更

经持有计划份额三分之二以上投资者、资产管理人和资产托管人协商一致可对投资政策进行变更，变更投资政策应以书面形式做出。投资政策变更应为调整投资组合留出必要的时间。

## 第十二节 利益冲突及关联交易

### （一）资产管理计划存在的或可能存在利益冲突的情形

投资者充分知悉并认可，资产管理计划存在的或可能存在利益冲突的情形，包括但不限于：

1. 资产管理人、资产托管人开展不同业务类型可能产生的利益冲突；

2. 资产管理人管理的其他资产管理产品（包括本计划投资经理管理的其他资管产品）基于各自投资策略需要可能与本计划存在相同、相似或相反的投资交易行为，或者在买卖同一只证券的时间上存在先后；

3. 管理人可以在遵循法律法规和相关原则的前提下运用公司自有资金进行证券投资，该等投资也可能与本计划存在相同、相似或相反的投资交易行为，或者在买卖同一只证券的时间上存在先后，不排除可能影响或限制本计划的投资运作；

4. 其他可能产生利益冲突的情况。

投资者知悉并确认，虽然管理人积极遵循投资者利益优先的原则、遵守相关法律法规的规定操作、积极防范利益冲突，但依然不能避免未来可能发生的利益冲突风险，进而可能影响投资者的利益。投资者知悉并接受利益冲突风险，本计划发生上述利益冲突情形时，无需事先取得投资者的同意。

### （二）本计划存在利益冲突的处理方式、披露方式、披露内容和披露频率

#### 1. 利益冲突的处理方式

资产管理计划在投资运作过程中存在利益冲突情形的，资产管理人应当坚持投资者利益优先原则，从充分维护投资者利益角度积极处理该等利益冲突情形，防范利益输送等违法违规行为。除法律法规规定或本合同约定外，本计划不得实施存在利益冲突的投资。

#### 2. 利益冲突的披露方式

在发生上述利益冲突时，资产管理人应当视具体利益冲突情形选择在向投资者提供的定期报告或临时报告中披露。

#### 3. 利益冲突的披露内容

在发生上述利益冲突时，资产管理人应当披露的内容包括利益冲突情形、处置方式、以及对投资者利益的影响等。

#### 4. 利益冲突的披露频率

根据本合同第二十一节“信息披露与报告”相关要求执行。

### （三）关联交易

#### 1. 关联交易的界定

关联交易指在本计划投资范围内，资产管理人可将资产管理计划财产投资于管理人及其关联方、托管人及其关联方发行的证券、资产管理产品或者承销期内承销的证券，。

重大关联交易定义：单笔交易金额超过 5000 万元，且占该组合净资产的超过 25% 的关联交易。资产管理人发行的公募基金（货币基金除外）可豁免重大关联交易。

#### 2. 关联交易禁止条款

（1）本计划不得向资产管理人、资产托管人出资；

（2）不计划不得以计划资产直接或者通过投资其他资产管理计划等间接形式，为管理人、托管人及其控股股东、实际控制人或者其他关联方提供或者变相提供融资，符合中国证监会规定的例外情形的除外；

（3）法律法规、本合同及中国证监会禁止发生的其它关联交易活动。

#### 3. 关联交易的允许

在本计划投资范围内，资产管理人可以运用委托财产投资于管理人、托管人及前述机构的控股股东、实际控制人或者其他关联方发行的证券、管理或托管的证券投资基金或者承销期内承销的证券。

4. 若本计划存续期内出现重大关联交易事项的，需有充分证据证明未损害投资者利益。管理人需在关联交易发生后的 5 个工作日及时、全面、客观地向投资者、托管人披露，并向中国证监会相关派出机构和证券投资基金业协会报告，投资于证券期货的管理人关联交易还应当向证券期货交易所报告。

（四）管理人运用计划资产从事关联交易的，应事后及时、全面、客观的向投资者和托管人进行披露。运用受托管理资产从事重大关联交易的，应事先取得持有计划份额三分之二以上投资者同意，并有充分证据证明未损害投资者利益。

### 第十三节 投资经理的指定与变更

#### （一）投资经理的指定

##### 1. 投资经理的指定

资产管理计划投资经理由资产管理人负责指定，且本投资经理与资产管理人所管理的证券投资基金的基金经理不相互兼任。

##### 2. 本计划投资经理

本资产管理计划投资经理为某某先生、某某女士。

某某先生，某某管理有限公司投资部副总经理，董事（Director），经济学学士。具有 30 年证券从业年限。具备银行间本币市场交易员资格。具备基金从业资格。

某某女士，某某管理有限公司专户投资经理，经济学硕士。具有 8 年证券从业年限。具备基金从业资格。

本计划投资经理已经依法取得基金从业资格，具有三年以上投资管理、投资研究、投资咨询等相关业务经验，具备良好的诚信记录和职业操守，且最近三年未被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚。

#### （二）投资经理的变更

资产管理人可根据业务需要变更投资经理，但需经持有计划份额三分之二以上的投资者书面同意，并在变更后以网站公告或其他方式及时告知投资者。资产管理人在其网站公告或向委托人指定邮箱发送前述调整事项邮件的，即视为履行了告知义务。

## 第十四节 资产管理计划的财产

### （一）资产管理计划财产的保管与处分

1. 资产管理计划财产的债务由资产管理计划财产本身承担责任，投资者以其出资为限对资产管理计划财产的债务承担责任。

2. 资产管理计划财产独立于资产管理人、资产托管人的固有财产，并独立于管理人管理的和托管人托管的其他财产。资产管理人、资产托管人不得将资产管理计划财产归入其固有财产。资产托管人对实际交付并控制下的计划财产承担保管职责。

3. 除本款第4项规定的情形外，资产管理人、资产托管人因资产管理计划财产的管理、运用或者其他情形而取得的财产和收益归入资产管理计划财产。

4. 资产管理人、资产托管人可以按照本合同的约定收取管理费、托管费以及本合同约定的其他费用。资产管理人、资产托管人以其固有财产承担法律责任，其债权人不得对资产管理计划财产行使请求冻结、扣押和其他权利。资产管理人、资产托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，资产管理计划财产不属于其清算财产。

5. 资产管理计划财产产生的债权不得与不属于资产管理计划财产本身的债务相互抵销。非因资产管理计划财产本身承担的债务，资产管理人、资产托管人不得主张其债权人对资产管理计划财产强制执行。上述债权人向资产管理人或资产托管人对资产管理计划财产主张权利时，资产管理人或资产托管人应明确向上述债权人告知资产管理计划财产的独立性。资产管理人如遇该情况时，应采取合理措施并及时通知投资者；资产托管人如遇该情况时，应采取合理措施并按照本合同约定通知资产管理人，并由资产管理人及时通知投资者。

### 6. 证券类资产及证券交易资金的保管

本计划投资形成的证券类资产由相关法定登记或托管机构根据法律法规的规定实行保管，沪深交易所场内证券交易结算资金由托管人保管。

### （二）资产管理计划财产相关账户的开立和管理

资产托管人按照规定开立资产管理计划财产的资金账户、证券账户等投资所需账户，资产管理人应给予必要的配合，并提供所需资料。资产管理人按照规定开立资产管理计划投资所需其他账户。证券账户和期货账户的持有人名称应当符合证券、期货登记结算机构的有关规定。账户名称具体以实际开立为准。

#### 1. 托管资金账户：

(1) 管理人、托管人为本资产管理计划单独开立托管资金账户。

(2) 托管资金账户的名称应当包含本资产管理计划名称，具体名称以实际开立为准。本资产管理计划的一切货币收支活动，包括但不限于投资、支付退出金额、支付计划收益、收取认购/参与款，均需通过该托管资金账户进行。

(3) 托管资金账户的开立和使用，限于满足开展本资产管理计划业务的需要。资产托管人和资产管理人不得假借计划的名义开立其他任何银行账户；亦不得使用计划的任何银行账户进行本资产管理计划业务以外的活动。

#### 2. 资产管理计划证券账户：

(1) 资产托管人按照规定开立资产管理计划财产的证券账户。资产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。证券账户的持有人名称应当符合证券登记结算机构的有关规定。

(2) 证券账户的开立和使用，限于满足开展本资产管理计划业务的需要。资产托管人和资产管理人不得出借和未经对方同意擅自转让计划的任何证券账户，亦不得使用计划的任何证券账户进行本资产管理计划业务以外的活动。

证券账户的开立和证券账户卡的保管由资产托管人负责，管理和运用由资产管理人负责。

#### 3. 资产托管人证券交易资金结算备付金账户：

资产托管人以资产托管人的名义在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司、深圳分公司开立证券交易资金结算备付金账户（即资金交收账户），用于办理资产托管人所托管的包括本计划财产在内的全部资产在证券交易所进行证券投资所涉及的资金结算业务。

#### 4. 定期存款账户：

计划财产投资定期存款在存款机构开立的银行账户，其预留印鉴经各方商议后预留。对于任何的定期存款投资，管理人都必须和存款机构签订定期存款协议，约定双方的权利和义务，该协议作为投资指令附件。该协议中必须有如下明确或同义条款：“存款证实书不得被质押或以任何方式被抵押，并不得用于转让和背书；本息到期归还或提前支取的所有款项必须划至托管资金账户（明确户名、开户行、账号等），不得划入其他任何账户。”如定期存款协议中未体现前述条款，托管人有权拒绝定期存款投资的投资指令。在取得存款证实书后，托管人保管证

实书正本或者复印件。管理人应该在合理的时间内进行定期存款的投资和支取事宜，若管理人提前支取或部分提前支取定期存款，若产生息差（即本计划财产已计提的资金利息和提前支取时收到的资金利息差额），该息差的处理方法由管理人和托管人双方协商解决。

#### 5. 债券账户：

（1）以管理人备案户名为准开立债券账户。

（2）管理人负责以本资产管理计划的名义申请并取得全国银行间同业拆借市场的交易资格，并代表本计划进行交易；托管人负责以计划资产的名义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开设银行间债券市场债券托管账户，并代表本计划进行债券和资金的清算。管理人、托管人应互相配合并提供相关资料。

#### 6. 开放式证券投资基金账户：

管理人负责在基金公司开设开放式证券投资基金账户。管理人在开立计划账户时应将托管资金账户作为赎回款、分红款指定收款账户。管理人及时将基金账户信息（账号等）以函件形式提交给托管人。

#### 7. 期货投资账户：

管理人、托管人应当按照相关规定开立期货资金账户，在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规定设立。

#### 8. 募集户：

募集户开户工作和相关管理工作由资产管理人负责。本计划直销账户在《计划说明书》中列示。

委托财产存放于资产托管人开立的资金账户中的存款利率适用托管人公布的人民币同业活期存款利率。



## 第十五节 投资指令的发送、确认与执行

### （一）交易清算授权

资产管理人应向资产托管人提供预留印鉴和有权人（“授权人”）签字样本，事先书面通知（以下称“授权通知”）资产托管人有权发送投资指令的人员名单（“被授权人”）。授权通知中应包括被授权人的名单、权限、电话、传真、预留印鉴和签字样本，并注明相应的交易权限，规定资产管理人向资产托管人发送指令时资产托管人确认有权发送人员身份的方法。授权通知由授权人签字并盖章。资产管理人应电话确认资产托管人收到该授权通知。授权通知须载明授权生效日期。授权通知自通知载明的生效日期开始生效。资产托管人收到通知的日期晚于通知载明生效日期的，则通知自资产托管人收到该通知时生效。资产管理人和资产托管人对授权文件负有保密义务，其内容不得向相关人员以外的任何人泄露。

### （二）投资指令的内容

投资指令是在管理资产管理计划财产时，资产管理人向资产托管人发出的资金划拨及其他款项支付的指令。资产管理人发给资产托管人的指令应写明款项事由、付款日期、付款金额、付款及收款账户信息等，书面指令还应加盖资产管理人在授权通知中授权的印章及被授权人签字或签章。本资产管理计划财产进行的证券交易所内的证券投资不需要资产管理人发送投资指令，资产托管人以中登公司发送的交收指令进行处理。本计划资金账户发生的银行结算费用等银行费用，由资产托管人直接从资金账户中扣划，无须资产管理人出具指令。

### （三）投资指令的发送、确认和执行的时间和程序

指令由“授权通知”确定的被授权人代表管理人用托管网银、电子直联、传真或其他托管人和管理人认可的方式向托管人发送。对于采用托管网银或电子直联方式发送指令的，管理人、托管人应签署《某某银行电子直联补充协议》（以实际签约名称为准），双方应遵守该协议关于电子直联方式的具体托管操作安排。管理人有义务在发送指令后与托管人以录音电话的方式进行确认。因管理人未能及时与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，由过错方承担责任。资产托管人依照“授权通知”规定的方法及本合同约定确认指令有效后，方可执行指令。

对于被授权人依照“授权通知”发出的指令，资产管理人不得否认其效力。资产管理人应按照相关法律法规以及本合同的规定，在其合法的经营权限和交易

权限内发送投资指令，发送人应按照其授权权限发送投资指令。资产管理人在发送有效投资指令时，应为资产托管人留出执行指令所必需的时间。发送指令日须完成划款的指令，资产管理人应给资产托管人预留出距划款截至时点至少 2 个工作小时的指令执行时间。对于管理人晚于规定时点的指令，托管人尽力配合执行，但不保证执行成功。有效投资指令是指指令要素（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、预留印鉴相符、相关的指令附件齐全且头寸充足的指令。由资产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资产管理人承担相应的责任。

资产托管人收到资产管理人发送的指令后，应对投资指令进行形式审查，验证指令的要素是否齐全、审核书面指令上的签章是否和授权通知中预留的签章样本相符，复核无误后依据本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，资产托管人立即与资产管理人指定人员进行电话联系和沟通，并要求资产管理人重新发送经修改的指令。资产托管人可以要求资产管理人以电子邮件、传真或双方认可的其他方式提供相关交易凭证、合同或其他有效会计资料，以确保资产托管人有足够的资料来判断指令的有效性。

资产管理人向资产托管人下达指令时，应确保托管账户有足够的资金余额，对资产管理人在托管账户没有充足资金的情况下向资产托管人发出的指令，资产托管人有权拒绝执行，并立即通知资产管理人。

#### （四）资产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

资产托管人发现资产管理人发送的指令违反《基金法》、本合同或其他有关法律法规的规定时，不予执行，并应及时以书面形式通知资产管理人纠正，资产管理人收到通知后应及时核对，并以书面形式对资产托管人发出回函确认，由此造成的损失由资产管理人承担。

#### （五）资产管理人发送错误指令的情形和处理程序

资产管理人发送错误指令的情形包括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。资产托管人在履行监督职能时，发现资产管理人的指令错误时，有权拒绝执行，并及时通知资产管理人改正。

#### （六）撤回指令的处理程序

管理人撤回已发送至托管人的有效指令，须向托管人传真加盖预留印鉴的书面

通知并电话确认，托管人收到书面通知并得到确认后，将撤回指令作废；如果托管人在收到书面通知并得到确认时该指令已执行，则该指令为已生效的指令，不得撤回。

#### （七）更换被授权人的程序

资产管理人撤换被授权人员或改变被授权人员的权限，必须提前至少一个交易日，使用邮件发送扫描件或传真方式或资产管理人和资产托管人认可的其他方式向资产托管人发出由授权人签字和盖章的被授权人变更通知，并提供新被授权人签字样本，同时电话确认资产托管人收到该被授权人变更通知，资产托管人收到变更通知当日通过电话向资产管理人确认。被授权人变更通知须载明新授权生效日期。被授权人变更通知，自通知载明的生效时间开始生效。资产托管人收到通知的日期晚于通知载明的生效日期的，则通知自资产托管人收到该通知时生效。资产管理人在电话告知后三日内将被授权人变更通知的正本送交资产托管人。资产管理人应确保其发送给资产托管人的被授权人变更通知传真件、扫描件与原件一致，若不一致，以资产托管人收到的传真件、扫描件为准。被授权人变更通知生效后，对于已被撤换的人员无权发送的指令，或新被授权人员超权限发送的指令，资产管理人不承担责任。

#### （八）投资指令的保管

指令及相关资料若资产管理人以电子邮件发送扫描件或传真形式向资产托管人发出，则正本由资产管理人保管，资产托管人保管传真件、扫描件。当两者不一致时，以资产托管人收到的传真件、扫描件为准。

#### （九）相关责任

在正常业务受理渠道和指令规定的时间内，因资产托管人原因未能及时或正确执行符合本合同规定、合法合规的投资指令而导致资产管理计划财产受损的，资产托管人应承担相应的责任，但银行托管账户余额不足或资产托管人如遇到不可抗力的情况除外。

如果资产管理人的投资指令存在事实上未经授权、欺诈、伪造情形的，由过错方承担相关责任。

## 第十六节 交易及清算交收安排

### （一）选择代理证券买卖的证券经营机构的程序

资产管理人负责选择代理本资产管理计划财产证券买卖的证券经营机构，并与其签订专用证券交易单元租用协议。管理人应在计划运作前至少提前 2 个工作日，主动向托管人反馈参数信息并提供席位租用协议复印件，并确保提供参数的准确性与完整性。资产管理人与资产托管人配合完成交易单元的合并清算事宜，资产管理人在交易前应确认相关合并清算事宜已办结。若资产管理人在合并清算办结前交易，则相关的交收责任由资产管理人承担。

### （二）投资证券后的清算交收安排

#### 1. 资产托管人在清算和交收中的责任

本资产管理计划财产投资于证券发生的所有场内、场外交易的资金清算交割，全部由资产托管人负责办理。本资产管理计划财产所有场内证券交易的清算交割由资产托管人作为结算参与人代理所托管资产管理计划财产与中登公司进行结算，场内证券投资的应付清算款由资产托管人根据中登公司的交收指令主动从银行托管账户中扣收。

本资产管理计划财产证券投资的清算交割，由资产托管人通过中登公司上海分公司/深圳分公司、清算代理银行及其他登记结算机构办理。

对于任何原因发生的证券资金交收违约事件，相关各方应当及时协商解决。

2. 关于托管资产在证券交易所市场达成的符合中国结算公司多边净额结算要求的证券交易以及新股业务：

资产托管人、资产管理人应共同遵守中登公司制定的相关业务规则 and 规定，该等规则 and 规定自动成为本条款约定的内容。

资产管理人在投资前，应充分知晓与理解中登公司针对各类交易品种制定结算业务规则 and 规定，并遵守资产托管人为履行结算参与人的义务所制定的业务规则与规定。

资产托管人代理资产管理计划财产与中登公司完成证券交易及非交易涉及的证券资金结算业务，并承担由资产托管人原因造成的正常结算、交收业务无法完成的责任；若由于资产管理人原因造成的正常结算业务无法完成，由此造成资产托管人无法按时向中国证券登记公司支付证券清算款的相应责任以及由此给

资产托管人所造成的直接经济损失由资产管理人承担(不可抗力以及资产管理人无过错情形除外)。

资产管理人签署本合同,即视为同意资产管理人在构成资金交收违约且未能按时指定相关证券作为交收履约担保物时,资产托管人可自行向结算公司申请由结算公司协助冻结资产管理人证券账户内相应证券,无需资产管理人另行出具书面确认文件。

资产托管人遵照中登公司上海分公司和中登公司深圳分公司备付金、保证金管理办法有关规定,确定和调整该委托财产最低结算备付金、证券结算保证金限额,资产管理人应存放于中登公司的最低备付金、结算保证金日末余额不得低于资产托管人根据中登公司上海和深圳分公司备付金、保证金管理办法规定的限额。资产托管人根据中登公司上海和深圳分公司规定向委托财产支付利息。

根据中登公司托管行集中清算规则,如委托财产 T 日进行了中登公司深圳分公司 T+1DVP 卖出交易,资产管理人不能将该笔资金作为 T+1 日的可用头寸,即该笔资金在 T+1 日不可用也不可提,该笔资金在 T+2 日才能划拨至托管资金账户。

根据中国证券登记结算有限责任公司的规定,结算备付金账户内的最低备付金、交易保证金账户内的资金按月调整按季结息,因此,资产管理合同终止时,资产管理计划可能有尚存放于结算公司的最低备付金、交易保证金以及结算公司尚未支付的利息等款项。对上述款项,资产托管人将于结算公司支付该等款项时扣除相应银行汇划费用后划付至资产管理计划清算报告中指定的收款账户。资产管理合同终止后,中登根据结算规则,调增计划的结算备付以及交易保证金,资产管理人应配合资产托管人,向资产托管人及时划付调增款项,以便资产托管人履行交收职责。

### 3. 资产管理计划财产参与 T+0 交易所非担保交收债券交易的责任认定及处理程序

(1) 资产管理计划财产参与 T+0 交易所非担保交收债券交易的,资产管理人应确保有足额头寸用于上述交易,并必须于 T+0 日 14 时完成下单交易,且必须于 T+0 日 14 时之前出具有效投资指令(含不履约申报申请),并确保指令要素(包括但不限于交收金额、成交编号)与实际交收信息一致。中登业务规则允许采用 RTGS 交收的,在计划非担保交收账户可用资金充足的情况下,托管人将进行勾单处理。对于资产管理人在 14:00 后出具的投资指令,特别是需要资产托

管人进行“勾单”确认的交易，资产托管人本着勤勉尽责的原则积极处理，但不保证支付/勾单成功。如由于资产管理人的原因导致 T+0 非担保交收失败，给委托资产和资产托管人造成损失的，托管人不承担责任，资产管理人应承担赔偿责任（不可抗力以及资产管理人无过错情形除外）。T+0 交易所非担保交收业务款项不建议提前调出，如由提前调出资金到账问题引起的一切后续风险由资产管理人承担。

（2）资产管理人一旦出现交易后无法履约的情况，应在第一时间通知资产托管人。对于中国结算公司允许资产托管人指定不履约的交易品种，资产管理人应向资产托管人出具书面的取消交收指令，另，鉴于中登公司对取消交收（指定不履约）申报时间有限，资产托管人有权在电话通知资产管理人后，先行完成取消交收操作，资产管理人承诺日终前补出具书面的取消交收指令。

（3）若资产管理人未及时出具交易应付资金投资指令，或资产管理人在托管产品资金托管账户头寸不足的情况下交易，资产托管人应及时同资产管理人确认是否取消交收。若中登公司取消交收截止时点前半小时托管人未获得管理人明确答复，托管人有权主动对该笔交易进行取消交收申报，如产生损失则由资产管理人承担。

（4）对于根据结算规则不能取消交收的交易品种，如出现前述第（2）、（3）项所述情形的，资产管理人知悉并同意资产托管人有权（但并非确保）仅根据中国结算公司的清算交收数据，主动将托管产品资金托管账户中的资金划入中国结算公司用以完成当日 T+0 非担保交收交易品种的交收，资产管理人承诺在日终前向资产托管人补出具资金投资指令。

（5）发生以下因资产管理人原因所造成的情形，相关方应承担相应责任：

1）资产管理人在本计划的托管账户内的资金余额不足的情况下，向资产托管人发出的指令，资产托管人可不予执行，并立即通知资产管理人；

2）因资产管理人未在合同约定的时间前向资产托管人提交有效投资指令，导致资产托管人无法及时完成支付结算操作而使交收失败的，由过错方承担相应的责任；

3）因资产管理人所托管的产品资金不足，且占用托管人最低备付金交收成功，造成托管人实际经济损失的，则应承担相应的赔偿责任；

4）因资产管理人所托管的产品资金不足或资产管理人未在规定时间内向资

产托管人提交投资指令,且有证据证明其直接造成资产托管人托管的其他产品交收失败而给资产托管人造成直接经济损失的,资产管理人应负赔偿责任。

(6) 由于不可抗力原因,或由于证券交易所、相关证券登记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,资产管理人、资产托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查,但未能发现错误或虽然发现错误但因前述原因而无法更正的,由此造成的交易或清算交收错误,资产管理人和资产托管人免除赔偿责任,但资产管理人、资产托管人应当积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。

(7) 资产管理人已充分了解托管人结算模式下可能存在的交收风险。如资产托管人托管的其他产品资金不足或过错,进而导致资产管理人管理的产品交收失败的,则资产托管人将配合资产管理人提供相关数据等信息向其他客户追偿。

(8) 对于采用 T+0 非担保交收下实时结算(RTGS)方式完成实时交收的收款业务,管理人可根据需要在交易交收后,深圳 T+0 不晚于交收当日 14:00、上海 T+0 不晚于交收当日 15:00 向托管人发送交易应收资金收款指令,同时将相关交易证明文件传真至托管人,并与托管人进行电话确认,以便托管人将交收金额提回至资金托管账户。

4. 关于托管资产在证券交易所市场达成的符合中国结算公司 T+N 非担保结算要求的证券交易

资产管理人知悉并同意资产托管人仅根据中国结算公司的清算交收数据主动完成托管产品资金清算交收。若资产管理人出现交易后无法履约的情况,并且中国结算公司的业务规则允许资产托管人对相关交易可以取消交收的,资产管理人应及时向资产托管人出具书面的取消交收指令,并与资产托管人进行电话确认。

### (三) 开放式基金投资的清算交收安排

1. 开放式基金申购(认购)相应的资金划拨由资产托管人依据资产管理人的投资指令逐笔划付。资产管理人申购(认购)开放式基金时,应将投资指令连同基金申购(认购)申请单一并邮件或传真至资产托管人。资产托管人审核无误后,应及时将投资指令交付执行。资产管理人应实时调整当日可用资金余额。资产管理人在收到基金申购(认购)确认回单后,应立即发送至资产托管人。

2. 资产管理人赎回开放式基金时,应在向基金管理公司或代销机构发出基金赎回申请书;资产管理人在收到赎回确认回单后,应及时发送至资产托管人。

3. 为确保本计划财产会计核算及估值的及时处理, 资产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传真件, 要求并督促基金管理公司于当日传真给资产管理人, 资产管理人收到后应立即发送至资产托管人。

#### (四) 银行间交易资金结算安排

1. 资产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, 并负责解决因交易对手不履行合同或不及时履行合同而发生的纠纷。

2. 如果银行间中债综合业务平台或上海清算所客户终端系统已经生成的交易需要取消或终止, 资产管理人要书面通知资产托管人。

3. 银行间交易结算方式采用券款对付的, 托管账户与该产品在登记结算机构开立的 DVP 资金账户之间的资金调拨, 除了中债登/上清所系统自动将 DVP 资金账户资金退回至托管账户的之外, 应当由管理人出具资金投资指令, 托管人审核无误后执行。由于管理人未及时出具指令导致该产品在托管账户的头寸不足或者 DVP 资金账户头寸不足导致的损失, 托管人不承担责任。资产管理人在开立相应银行间交易账户后, 应及时通知资产托管人, 给与托管人足够时间进行运营操作准备, 双方商议一致后确认此结算安排的起始时间。

#### (五) 期货投资的清算交收安排

本计划相关期货投资的具体操作按照管理人、托管人及期货经纪机构签署的《期货投资操作备忘录》(以实际名称为准)的约定执行。

#### (六) 其他场外交易资金结算

1. 本计划场外投资相应的资金划拨由资产托管人依据资产管理人的投资指令逐笔划付。资产管理人应将投资指令连同相关投资证明文件一并传真至资产托管人。资产托管人审核无误后, 应及时将投资指令交付执行。

2. 资产管理人应确保资产托管人在执行资产管理人发送的指令时, 有足够的头寸进行交收。资产管理计划的资金头寸不足时, 资产托管人有权拒绝资产管理人发送的投资指令。资产管理人在发送投资指令时应充分考虑资产托管人的划款处理所需的合理时间。如由于资产管理人的原因导致无法按时支付证券清算款, 由此造成的损失由资产管理人承担相应的责任。

3. 在资金头寸充足的情况下, 在正常业务受理渠道和时间内, 资产托管人对资产管理人符合法律法规、本合同规定的指令不得拖延或拒绝执行, 如由于资产



托管人原因导致资产管理计划无法按时支付证券清算款，由此造成的损失由资产托管人承担，但资产托管人遇不可抗力的情况除外。

## 第十七节 越权交易的界定

### （一）越权交易的界定

越权交易是指资产管理人违反有关法律法规的规定以及违反或超出本合同约定而进行的投资交易行为，包括：

1. 违反有关法律法规和本合同规定进行的投资交易行为。
2. 法律法规禁止的超买、超卖行为。

资产管理人应在有关法律法规和本合同规定的权限内运用资产管理计划财产进行投资管理，不得违反有关法律法规和本合同的约定，超越权限管理、从事证券投资。

### （二）越权交易的处理程序

1. 违反有关法律法规和本合同规定进行的投资交易行为

资产托管人在本章第（三）款约定的投资监督事项范围内，发现资产管理人的投资指令违反法律法规的规定，或者违反本合同约定的，应当拒绝执行，立即通知资产管理人并有权及时报告中国证监会。

资产托管人在本章第（三）款约定的投资监督事项范围内，发现资产管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他规定，或者违反本合同约定的，应当立即通知资产管理人并有权及时报告中国证监会。

资产管理人应向投资者和资产托管人主动报告越权交易。在限期内，投资者和资产托管人有权随时对通知事项进行复查，督促资产管理人改正。资产管理人对资产托管人通知的越权事项未能在限期内纠正的，资产托管人应报告中国证监会。

2. 法律法规禁止的超买、超卖行为

资产托管人在行使监督职能时，如果发现资产管理计划财产投资证券过程中出现超买或超卖现象，应立即提醒资产管理人，由资产管理人负责解决，由此给资产托管人及资产管理计划财产造成的损失由资产管理人承担。如果因非资产托管人的原因发生超买行为，资产管理人必须于 T+1 日上午 10:00 前完成备足头寸并划入托管账户，确保完成清算交收。

3. 非因资产管理人主观因素（包括但不限于证券市场波动、上市公司合并、资产管理计划规模变动等资产管理人之外的因素）导致本计划投资突破投资比例

和投资限制的，资产管理人应当在流动性受限资产可出售、可转让或者恢复交易的 10 个交易日内调整完毕。法律法规、中国证监会等监管部门另有规定的从其规定。

4. 越权交易所发生的损失及相关交易费用由资产管理人负担，所发生的收益归本资产管理计划财产所有。

5. 管理人出现违反投资范围、投资比例、投资策略、投资限制及投资禁止等情况，应以风险准备金等方式承担赔偿责任投资者损失等违约责任。

### （三）托管人对管理人投资运作的监督

1. 托管人对下列资产管理计划的投资事项及管理人投资行为进行监督：

（1）对资产管理计划约定的投资范围和投资比例进行监督；

（2）对资产管理计划约定的投资限制和投资禁止进行监督。

2. 托管人对计划财产的投资监督和检查自本合同生效之日起开始执行。托管人在本合同约定范围内，对资产管理计划的直接投资履行监督职能。

3. 管理人应当及时、准确、完整地向托管人提供履行投资监督所需的数据和信息，托管人投资监督的真实性、准确性和完整性受限于管理人、证券经纪商及其他中介机构提供的数据和信息。

4. 管理人经托管人催告仍不按约定与托管人对账，导致托管人无法及时履行投资监督职责，由此造成的损失由过错方依法承担。

5. 如需托管人对资产管理计划关联交易进行监督的，管理人应于合同生效前提供关联方名单，并在合同期限内根据变化及时更新关联方名单。若管理人没有及时提供关联方信息，导致托管人无法及时对关联方证券进行监督，所产生的一切后果由过错方依法承担。

6. 如因投资需要或法律法规修改导致托管人监督事项发生变化的，各方除履行必要的合同变更流程外，还应为托管人调整监督事项留出必要的时间。

## 第十八节 资产管理计划财产的估值和会计核算

### （一）资产管理计划财产的估值

#### 1. 估值目的

资产管理计划财产估值目的是客观、准确地反映资产管理计划财产的价值，并为计划份额的参与和退出等提供计价依据。

#### 2. 估值时间及估值程序

本资产管理计划的估值日为相关的证券交易场所的正常交易日，以及国家法律法规规定的需要进行估值的非交易日。资产管理人与资产托管人估值核对日为每个交易日。

资产管理人可使用电子直连方式、电子邮件、传真等资产管理人与资产托管人双方认可的方式与资产托管人进行计划财产估值核对，并应优先使用电子直连方式与资产托管人进行计划财产估值核对。

#### 3. 估值依据

估值应符合本合同、《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。

资产管理计划资产净值是指资产管理计划资产总值减去负债后的价值。资产管理计划资产净值的计算保留到小数点后2位，小数点后第3位四舍五入。资产份额净值的计算保留到小数点后4位，小数点后第5位四舍五入。

资产管理计划资产净值计算和会计核算的义务由资产管理人承担。因此，就与资产管理计划财产有关的会计问题，本资产管理计划财产的会计责任方为资产管理人。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，以资产管理人对资产管理计划资产净值的计算结果为准，由此造成的直接损失由资产管理人承担相应的赔偿责任。

#### 4. 估值对象

资产管理计划所拥有的金融资产及负债。

#### 5. 估值方法

本计划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、除本合同另有约定外，交易所上市的有价证券（包括股票等），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。委托资产所持有的股票若出现长期停牌，除与资产管理人所管理的公募基金产品同步进行估值调整外，本计划不单独对其进行估值调整。

B、交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（本基金合同另有规定的除外），选取估值日第三方估值机构提供的相应品种对应的估值净价估值；

交易所上市交易的可转换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；

交易所上市实行全价交易的债券（可转债除外），选取第三方估值机构提供的估值全价减去估值全价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。

C、对于在银行间上市交易的固定收益品种，按照中债金融估值中心有限公司提供的相应品种对应的估值净价估值。

D、对于部分特殊证券（第三方估值机构未提供价格的，基本面发生重大变化或债券发生重大违约等因素导致价格不公允的证券），资产管理人与资产托管人协商一致后，采用估值技术确定公允价值。

（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，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、在发行时明确一定期限限售期的股票，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，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

(3) 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。

#### (4) 证券投资基金的估值

##### A、上市证券投资基金的估值

(i) 非货币市场基金按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；

(ii) 无市价的场内货币市场基金按照实际增加的份额数量确认收益；有市价的场内货币市场基金按收盘价估值，并按照实际增加的份额数量确认收益；

(iii) 若估值日无交易，且最近交易日后市场环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后市场环境发生了重大变化的，可使用最新的基金份额净值为基础或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。

##### B、非上市证券投资基金的估值

(i) 非交易所上市的开放式基金（包括场外登记的 LOF、ETF 等），以其【估值日前一日】基金份额净值估值；

(ii) 货币市场基金和货币型理财基金，按【估值日前一日】基金管理公司公布的每万份收益估值；

(iii) 估值日不公布开放式基金份额净值的，以前最近公布的基金份额净值估值；尚未公布过基金份额净值的，按成本估值。

##### C、基金分红除权、拆分和折算等情况的估值

如果所投资基金前一估值日至估值日期间发生分红除权、拆分或折算，管理人根据基金份额净值或收盘价、单位基金份额分红金额、折算拆分比例、持仓份额等因素合理确定公允价值。(5) 银行存款、回购等固定收益工具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。

(6) 期货以估值日期货交易所的当日结算价估值，该日无交易的，以最近一日的结算价估值。

(7) 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，资产管理人可根据具体情况与资产托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

(8) 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。

## 6. 估值错误的处理

如资产管理人或资产托管人发现计划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或者未能充分维护投资者利益时，应立即通知对方，共同查明原因，协商解决。

当计划资产估值错误偏差达到计划财产净值的 0.5% 时，资产管理人和资产托管人应该立即更正并在定期报告中报告投资者。资产管理人计算的计划财产净值已由资产托管人复核确认、但因资产估值错误给投资者造成损失的，由资产管理人与资产托管人按照过错程度各自承担相应的责任。

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，进而导致计划财产净值计算错误造成投资者的损失，以及由此造成以后交易日计划财产净值计算顺延错误而引起的投资者的损失，由提供错误信息的当事人一方负责赔偿。

由于证券交易所及其注册登记公司发送的数据错误，或其他不可抗力等原因，资产管理人和资产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或虽然发现但因前述原因而无法更正的，由此造成的计划资产估值错误，资产管理人和资产托管人免除赔偿责任。但资产管理人和资产托管人应当积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。

资产管理人按本合同第 5 款第（7）项的约定进行估值时，所造成的误差不作为计划资产估值错误处理。

## 7、估值调整的情形与处理

（1）对于存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的投资品种，估值日无交易，且有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对估值价格进行调整，确定公允价值。此外，资产管理人估值不应考虑本计划大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

（2）对不存在活跃市场的投资品种，应优先使用可观察输入值，在无法获得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，可以使用不可观察输入值；

（3）如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，使潜在估值调整对前一估值日的计划资产净值的影响在 0.5% 以上的，应对估值进行调整并确定公允价值。

(4) 当计划持有特定资产且存在或潜在大额退出申请时，资产管理人经与资产托管人协商，并咨询会计师事务所的专业意见后，在资产管理人和资产托管人相关系统准备就绪，业务流程完备的情况下，可以依照法律法规的约定，对本计划启用侧袋机制。上述特定资产包括：

(i) 无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性的资产；

(ii) 按摊余成本计量且计提资产减值准备仍导致资产价值存在重大不确定性的资产；

(iii) 其他资产价值存在重大不确定性的资产。

#### 8. 暂停估值的情形

(1) 计划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资产管理人、资产托管人无法准确评估资产管理计划财产价值时；

(3) 占资产管理计划相当比例的投资品种的估值出现重大转变，而资产管理人为保障投资者的利益，决定延迟估值的情形；

(4) 中国证监会认定的其他情形。

#### 9. 资产管理计划份额净值的确认

用于向投资者报告的计划份额净值由资产管理人负责计算，资产托管人进行复核。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，按照资产管理人对计划财产净值的计算结果为准。

资产管理计划财产净值即计划财产净值，是指计划资产总值减去负债后的价值。资产净值的计算保留到小数点后 2 位，小数点后第 3 位四舍五入。计划资产份额净值的计算保留到小数点后 4 位，小数点后第 5 位四舍五入。

#### (二) 资产管理计划的会计政策

资产管理计划的会计政策比照证券投资基金现行政策执行：

1. 资产管理人为本计划的主要会计责任方。
2. 本计划的会计年度为公历年度的 1 月 1 日至 12 月 31 日。
3. 计划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. 本计划单独建账、独立核算。
6. 资产管理人及资产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，按照本合同约定编制会计报表。
7. 资产托管人定期与资产管理人就资产管理计划的会计核算、报表编制等进行核对并以书面方式或经资产管理人与资产托管人认可的其他方式确认。

## 第十九节 资产管理计划的费用与税收

### （一）资产管理业务费用的种类

1. 管理人的管理费；
2. 托管人的托管费；
3. 资产管理人依据本合同收取的业绩报酬；
4. 计划财产划拨支付的银行费用；
5. 证券交易费用（包括但不限于印花税、过户费、经手费、证管费、开放式基金的认购/申购费及赎回费等）；
6. 委托办理专用证券账户的开立、使用、转换和注销等手续费，委托办理证券在投资者普通证券账户与专用证券账户之间的划转的费用；
7. 本合同生效以后与委托财产运作相关的或者为维护投资者利益支出的会计师费、律师费、诉讼费、仲裁费和财产保全费等合理费用；
8. 按照国家有关规定和本合同约定，可以在委托财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. 管理人的管理费

资产管理计划财产的年管理费率为【0.20%】。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的管理费

E 为前一日的计划财产净值，首日按本计划成立规模计算。

本计划的管理费自资产管理计划成立之日起，每日计提，按季支付。管理人于每个季度结束后的次月首日起（含）5 个工作日内向托管人发送集合计划管理费划付指令，托管人复核后于 5 个工作日内从集合计划资产中一次性支付给管理人。若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

资产管理人的账户信息如有变更，资产管理人可单独决定而无须变更本合同，但须在账户信息变更生效前至少三个工作日通知资产托管人。

#### 2. 托管人的托管费

资产管理计划财产的年托管费率为【0.03%】。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的托管费

E 为前一日的计划财产净值，首日按本计划成立规模计算

本计划的托管费自资产管理计划成立之日起，每日计提，按季支付。管理人于每个季度结束后的次月首日起（含）5 个工作日内向托管人发送集合计划管理费划付指令，托管人复核后于 5 个工作日内从集合计划资产中一次性支付给托管人。若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

### 3.业绩报酬

业绩报酬计算方法如下：

年化收益率	业绩报酬提取比例
0%-【5】%（含 5%）	0
【5】%以上（年化单利）	【20】%

具体公式如下：

（1）如果  $A_n \leq B_n^1$ ，则业绩报酬为 0；

（2）如果  $A_n > B_n^1$ ，则计算公式为：业绩报酬 =  $(A_n - B_n^1) \times \text{【20】\%}$ ；

其中：

$A_n$  为本计划终止时的归属于每个投资者的资产净值。

$B_n^1$  为根据业绩报酬计提基准收益率计算的对应每个委托人的组合资产净值，其计算方法为：

$$B_n^1 = \sum_{t=0}^n C_t \times \left(1 + \frac{D_t}{365} \times \text{【5】\%}\right)$$

$C_0$  为每个投资者的认购或首次参与金额。

$C_t$  为每个投资者的第  $t$  笔现金流量净额（仅包括投资者参与或退出产生的现金流量，不包括组合运营的资金流动，投资者参与时  $C_t$  为参与金额，是正值；投资者退出时， $C_t$  为退出金额，是负值）。

$D_t$  为每个投资者的第  $t$  笔现金流发生日距离本计划终止日的自然天数（包括本计划终止日当天，但不包括第  $t$  笔现金流发生当日）。

业绩报酬在本计划终止后 5 个工作日内由资产管理人向资产托管人发送投资指令，资产托管人复核后 5 个工作日内从委托财产中一次性支付给资产管理人。

业绩报酬由资产管理人负责计算，由托管人复核后确定，托管人根据管理人的投资指令进行划款。管理人应及时向托管人提供复核管理人业绩报酬所需的相关数据材料，托管人仅根据管理人提供的数据材料对业绩报酬的计算结果进行复

核。

管理人接收业绩报酬账户信息与管理费账户信息一致。

#### 4.其他费用的支付

资产管理计划银行资金账户发生的银行结算费用等银行费用，由托管人直接从资金账户中扣划，无须管理人出具指令。

资产管理计划运作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。

资产管理计划存续期间发生的信息披露费、与资产管理计划相关的律师费和会计师费、以及按照国家有关规定可以列入的其他费用等，由托管人根据有关法规及相应协议的规定，根据管理人的指令，按费用实际支出金额从资产管理计划资产中支付，列入资产管理计划费用。

#### 5.不得列入资产管理计划财产费用的项目

资产管理计划成立前发生的费用，以及存续期间发生的与募集有关的费用，不得在计划资产中列支。

管理人和托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或资产管理计划财产的损失，以及处理与资产管理计划财产运作无关事项或不合理事项所发生的费用等不得列入资产管理计划的费用。

#### 6.费率的调整

管理人和托管人与持有计划份额三分之二以上投资者协商一致后，可根据市场发展情况调低资产管理费率和资产托管费率，修改本合同并报基金业协会备案。

### （三）资产管理业务的税收

1、委托财产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和税收政策执行。委托财产运作中产生的税款，由委托财产承担。相关法律法规和税收政策未规定管理人和/或托管人有代扣代缴义务的，管理人和托管人不进行代扣代缴。

2、关于增值税问题的约定，（1）对于本计划已列明的资产管理业务费用（例如管理人收取管理费、托管人收取托管费等）产生的增值税，由各收款方自行承担并缴纳，（2）对于依据财政部和国家税务总局《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》（财税【2016】140号文）及《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》（财税【2017】2号文）及其后续颁布的具体征

收管理办法等相关文件（若有）中规定的“资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人”而需缴纳的增值税，管理人按规定需缴纳的该部分增值税由委托财产承担，具体缴纳方式依据法律法规及监管政策确定。

## 第二十章 资产管理计划的收益分配

资产管理计划收益分配政策比照证券投资基金现行政策执行。

### （一）可供分配利润的构成

本资产管理计划可供分配利润为截至收益分配基准日计划未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

资产管理计划收益包括：计划投资所得红利、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。因运用计划财产带来的成本或费用的节约计入收益。

### （二）收益分配原则

1. 每一计划份额享有同等分配权。
2. 本资产管理计划收益分配方式为现金分红。
3. 在符合有关计划收益分配条件的前提下，本计划收益每年最多分配4次；具体的分配时间、分配方案以资产管理人的公告为准。
4. 收益分配的基准日为可供分配利润的计算截止日。
5. 计划收益分配基准日的计划份额净值减去每单位计划份额收益分配金额后不能低于面值。
6. 计划当期收益应先弥补上期亏损后，方可进行当期收益分配。
7. 若本合同生效不满3个月则可不进行收益分配。
8. 法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

### （三）收益分配方案的确定与通知

计划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、计划收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。

计划收益分配方案由资产管理人拟定，并由资产托管人复核后确定，计划资产管理人按法律法规的规定向基金业协会备案并告知投资者。

本计划存续期间不进行收益分配，投资者通过计划存续期间的申请退出份额和计划终止时的清算分配实现退出。

### （四）收益分配的执行方式

在收益分配方案公布后，资产管理人依据具体方案的规定就支付的现金收益向资产托管人发送投资指令，资产托管人按照资产管理人的指令及时进行现金收

益的划付。

## 第二十一节 信息披露与报告

（一）管理人应向投资者提供下列信息披露文件：

- 1.本合同和风险揭示书；
- 2.资产管理计划净值、份额净值；
- 3.资产管理计划定期报告，至少包括季度报告和年度报告；
- 4.重大事项的临时报告；
- 5.资产管理计划清算报告；
- 6.中国证监会规定的其他事项

管理人应确保投资者能够按照本合同约定的时间和方式查阅或者复制所披露的信息资料。

（二）资产管理计划运作期间，管理人应向投资者披露以下信息：

### 1.每日报告

管理人应每日提供估值信息，做好净值监测，【T+1】日向投资者披露一次经托管人复核的计划 T 日资产净值和份额净值。管理人应于【T+1】向投资者提供一次 T 日经托管人复核的估值表和持仓明细信息报告。当出现净值大幅度变化时，应及时向投资者说明波动情况和原因。

### 2.月度报告

管理人应【每月】向投资者提交一次经托管人复核的产品运作报告，简要说明产品投资运作及持仓情况并通过线下人工对账等方式按月定时与投资者进行份额确认。

### 3.季度报告

管理人应于每季度结束之日起一个月内披露季度报告，披露报告期内资产管理计划运作及投资策略情况，详细说明市场状况、产品投资运作情况、业绩表现、策略吻合度及归因分析、未来投资规划等。资产管理计划成立不足三个月或者存续期间不足三个月的，管理人可以不编制当期的季度报告。

季度报告应当同时包括但不限于管理人履职报告、托管人履职报告、资产管理计划投资表现、资产管理计划投资组合报告、资产管理计划运用杠杆情况（如有）、资产管理计划支付的管理费/托管费/业绩报酬（如有）等费用的计提基准/



计提方式和支付方式、资产管理计划投资收益分配情况、投资经理变更、重大关联交易等涉及投资者权益的重大事项以及中国证监会及基金业协会规定的其他事项。

#### 4.年度报告

管理人应于每年度结束之日起一个月内披露年度报告,年度报告内容应包括但不限于下列信息:

- 1) 管理人履职报告;
- 2) 托管人履职报告;
- 3) 资产管理计划投资表现;
- 4) 资产管理计划投资组合报告;
- 5) 资产管理计划运用杠杆情况(如有);
- 6) 资产管理计划财务会计报告;
- 7) 资产管理计划支付的管理费、托管费、业绩报酬(如有)等费用的计提基准、计提方式和支付方式;
- 8) 资产管理计划投资收益分配情况;
- 9) 投资经理变更、重大关联交易等涉及投资者权益的重大事项;
- 10) 中国证监会规定的其他事项。

资产管理计划成立不足3个月以及资产管理计划存续期间不足3个月的,资产管理人可以不编制当期年度报告。

#### 5.临时报告

发生本合同约定或可能影响投资者利益的重大事项时,在事项发生之日立即向投资者披露。

若发生包括但不限于以下事项或其它可能影响投资者利益的重大事项时,资产管理人应及时履行信息披露和报告的义务,并在事项发生之日立即向投资者提供相应事项专项说明的临时报告:1) 净值收益率表现连续3个月未达到业绩基准,同时回撤水平高于市场中位数水平;2) 产品单月回撤超过3%的情况(策略本身未触及止损线);3) 触及止损线等风险监控指标;4) 计划中发生亏损的投资业务规模较大及其他重大事项的情况。管理人应在临时报告中及时说明情况及原因,对管理组合后期发展提出明确解决意见,并根据委托人要求做好风险处置工作。

对发现违背投资策略进而出现策略飘移的情形,投资者可立即要求管理人做出解释和整改。若本计划在存续期间出现异常交易行为,管理人应及时履行信息披露并告知投资者,对造成产品发生亏损的异常交易行为管理人应承担相应责任。

此外,管理人应与投资者保持实时沟通,有效把握市场动态,根据委托人要求及时提供投资明细,并配合委托人做好管理人评价工作。若产品出现法律法规、监管政策、自律规则和本合同约定的重大不利情况,管理人应及时履行信息披露和报告的义务,并向委托人提供相应事项的专项说明。

#### 6. 托管人履职报告(以下称“托管报告”)

(1) 托管人履职报告作为管理人季度报告、年度报告内容的一部分,由托管人完成管理人季度报告、年度报告的复核工作后,确定托管人履职报告内容并向管理人反馈,同时在管理人、托管人协商一致的季度报告、年度报告上盖章确认,由管理人根据本合同约定的方式向投资者披露。托管人履职报告内容包括托管人履职情况、对管理人投资运作的监督情况及有关报告财务数据的复核意见等。

(2) 管理人应当在每季度结束后 20 日内向托管人提供其编制的季度报告、当期财务会计报告(如有)供托管人复核,托管人复核管理人季度报告、当期财务会计报告中的财务数据后,于 10 日内向管理人反馈复核意见。

(3) 管理人应当在每年度结束后两个月内向托管人提供其编制的年度报告、当期财务会计报告供托管人复核,托管人复核管理人年度报告、当期财务会计报告中的财务数据后,于一个月内向管理人反馈复核意见。

(4) 因资产管理计划成立不足三个月或者存续期间不足三个月,管理人未编制资产管理计划当期的季度报告和年度报告的,托管人不编制当期托管人履职报告。

#### (三) 向投资者提供报告及投资者信息查询的具体方式

##### 1. 投资者信息查询范围

投资者可根据本合同约定的时间和方式查阅或复制计划所披露的信息资料。

##### 2. 投资者向管理人查询信息的方式

管理人通过以下至少一种方式进行披露信息即视为履行了告知义务,投资者可通过以下方式向管理人查阅本合同约定披露的信息资料:

##### (1) 管理人网站

《资产管理合同》、《计划说明书》、定期报告、临时报告等有关本资产管理

计划的信息将在资产管理人网站上披露，投资者可随时查阅。

资产管理人网站：[www.baidu.com](http://www.baidu.com)

## （2）邮寄服务

管理人或代销机构向投资者邮寄定期报告等本合同约定披露的信息资料。投资者在本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，投资者应当及时以书面方式或以管理人规定的其他方式通知管理人。

## （3）传真或电子邮件

管理人可通过向投资者指定邮箱发送电子邮件的方式将本合同约定披露的信息资料告知投资者。

# 3.投资者向托管人查询信息的方式

（1）投资者可通过电话、传真或电子邮件等联系方式，经由管理人向托管人查询有关信息披露资料。

（2）对于管理人向投资者提供的文件材料中不在托管人复核职责范围内的信息，应由管理人保证该等信息的真实性、有效性、合法性。

（3）对于因管理人未提供或未及时提供应由托管人复核的相关信息披露文件等客观因素，导致托管人无法履行或无法按时履行相应复核职责的，由此产生的相关责任由过错方依法承担。

（五）管理人的控股股东、实际控制人或者其他关联方参与资产管理计划，应向投资者充分披露。

## （六）管理人、托管人向监管机构的报告

管理人、托管人应当在每年度结束之日起四个月内，分别编制私募资产管理业务管理年度报告和私募资产管理业务托管年度报告，并报中国证监会相关派出机构和基金业协会备案。

## 第二十二节 风险揭示

计划投资可能面临下列各项风险，包括但不限于：

### （一）资产管理计划面临的一般风险

#### 1、本金损失风险

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计划财产，但不保证计划财产本金不受损失，也不保证一定盈利及最低收益。

在发生揭示的风险及其他尚不能预知的风险而导致本计划项下计划财产重大损失的，投资者可能发生委托本金损失的风险。

本计划属于中低等风险投资品种。

#### 2、市场风险

证券市场价格因受各种因素的影响而引起的波动，主要表现为股票投资风险和债券投资风险，从而使计划资产面临潜在的风险。

##### （1）股票投资风险主要包括：

1) 国家货币政策、财政政策、产业政策等的变化对证券市场产生一定的影响，导致市场价格水平波动的风险。

2) 宏观经济运行周期性波动，对股票市场的收益水平产生影响的风险。

3) 上市公司的经营状况受多种因素影响，如市场、技术、竞争、管理、财务等都会导致公司盈利发生变化，从而导致股票价格变动的风险。

##### （2）债券投资风险主要包括：

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。

##### （3）管理风险

在实际操作过程中，资产管理人可能限于知识、技术、经验等因素而影响其对相关信息、经济形势和证券价格走势的判断，其精选出的投资品种的业绩表现不一定持续优于其他投资品种。

##### （4）流动性风险

在市场或个股流动性不足的情况下，以及投资于信用债、同业存款等固定收

益资产时，由于信用债流动性不佳或者存款未到期等原因，资产管理人可能无法迅速、低成本地调整投资计划，从而对计划收益造成不利影响。

在投资者退出或参与资产管理计划财产时，可能存在现金不足的风险和现金过多带来的收益下降风险。

本资产管理计划自成立之日起每周二、周三、周四为开放日（遇到非工作日不顺延），每个开放日均可开放计划份额的退出和参与。在非开放期内不开放参与和退出，投资者可能面临在本计划非开放退出期内资金不能退出带来的流动性风险。

当本计划出现巨额退出或连续巨额退出等本合同约定情形，资产管理人有权暂停退出、延期退出或延期支付退出款项，该等情形的发生将直接影响投资者投资变现。

#### （5）信用风险

交易对手方未能实现交易时的承诺，按时足额还本付息的风险，或者交易对手未能按时履约的风险。

若在债券存续期内，发行人所处的宏观经济、政策、行业环境等方面存在的不可预见或不能控制的客观因素，以及发行人自身的生产经营存在的不确定性，将可能导致发行人自身的盈利及获现能力减弱无法按期支付本息，使投资者面临一定的偿付风险。

#### （6）募集失败风险

初始募集期限届满，若本计划不符合成立条件，则存在募集失败的风险，在资产管理计划募集期限届满后 30 日内退还客户已缴纳的款项，并加计银行同期活期存款利息。

#### （7）关联交易风险

在本计划投资范围内，资产管理人可以运用委托财产投资于管理人、托管人及前述机构的控股股东、实际控制人或者其他关联方发行的证券、管理或托管的证券投资基金或者承销期内承销的证券。

虽然资产管理人积极遵循投资者利益优先的原则、遵守相关法律法规的规定进行操作、积极防范利益冲突，但仍可能因资产管理人运用委托财产从事关联交易被监管部门认为存在利益输送、内幕交易的风险，进而可能影响投资者的利益。该类证券价格可能会出现下跌，从而使本计划收益下降，甚至带来本金损失。

此外，资产管理人运用计划财产从事关联交易时可能依照相关法律法规、监管机构、自律组织的规定被限制相关权利的行使，进而可能影响委托财产的投资收益。

(二)特定的投资方法及资产管理计划财产所投资的特定投资对象可能引起的特定风险

本委托资产可能将面临下列各项特定风险，包括但不限于：

1、上市公司经营风险

如果被投资的上市公司企业经营管理不善甚至亏损，可能会造成股票价值贬值，并最终对资产管理计划财产的份额价值造成负面影响。

2、上市公司股价波动风险

上市公司股价可能随宏观经济环境、上市公司自身经营状况以及股票市场风险而波动，进而对资产管理计划财产份额的收益实现造成负面影响。

3、不能完成备案的风险

本计划成立后需在基金业协会进行备案。除非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、地方政府债券等中国证监会认可的投资品种外，资产管理计划在完成基金业协会备案前不得开展投资活动。

因此，即使本计划成立，并不意味着本计划必然能获得基金业协会的备案。而该等备案过程可能会受到相应监管政策的影响，包括备案时间所需时间、能否通过备案都存在一定的不确定性。

如果在计划成立后不能及时完成备案，将可能导致本计划错过市场行情或投资机会；如果本计划在成立后无法获得基金业协会的备案，则将直接影响本计划设立目的的实现。当出现无法通过基金业协会备案的情形，本计划提前终止，由此直接影响投资者参与本计划的投资目的。

4、资产管理合同与证券投资基金业协会合同指引不一致所涉风险

本资产管理合同是基于中国证券投资基金业协会发布的《集合资产管理计划资产管理合同内容与格式指引（试行）》而制定的，资产管理人对合同指引相关内容做出了合理的调整以及增加了其他内容，导致本资产管理合同与中国基金业协会合同指引可能存在不一致的风险。投资人应当认真阅读本合同，理解本合同的全部条款，独立做出是否签署本合同的决定。

5、资产管理计划份额转让所涉风险

本资产管理计划存续期间内，若条件成熟，经资产管理人同意，投资者可以通过证券交易所以及中国证监会认可的其他方式，向其他符合本合同约定的合格投资者转让其持有的集合资产管理计划份额。但资产管理人不负有寻找份额受让人的义务。因此，投资者在资产管理计划份额转让过程中，可能会存在份额转让失败的风险。

## 6、科创板投资风险

本计划可以投资国内上市的科创板股票，会面临科创板机制下因投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括不限于如下特殊风险：

### （1）科创板上市公司股价波动较大的风险

1) 科创板企业所处行业和业务往往具有研发投入规模大、盈利周期长、技术迭代快、风险高以及严重依赖核心项目、核心技术人员、少数供应商等特点，企业上市后的持续创新能力、主营业务发展的可持续性、公司收入及盈利水平等仍具有较大不确定性。

2) 科创板股票竞价交易设置较宽的涨跌幅限制，对个股每日涨跌幅限制为20%，且新股上市后的前5个交易日不设置涨跌幅限制，股价可能表现出比A股其他板块更为剧烈的波动。

3) 科创板新股发行价格、规模、节奏等坚持市场化导向，询价、定价、配售等环节由机构投资者主导。科创板新股发行全部采用询价定价方式，询价对象限定在证券公司等七类专业机构投资者，而个人投资者无法直接参与发行定价；初步询价结束后，科创板发行人预计发行后总市值不满足其在招股说明书中明确选择的市值与财务指标上市标准的，将按规定中止发行。同时，科创板企业普遍具有技术新、前景不确定、业绩波动大、风险高等特征，市场可比公司较少，传统估值方法可能不适用，发行定价难度较大，科创板股票上市后可能存在股价波动的风险。

（2）科创板企业可能存在首次公开发行前最近3个会计年度未能连续盈利、公开发行并上市时尚未盈利、有累计未弥补亏损等情形，可能存在上市后仍无法盈利、持续亏损、无法进行利润分配等情形。

### （3）科创板企业所适用的规则与上交所主板市场存在差异

1) 科创板股票网上发行比例、网下向网上回拨比例、申购单位、投资风险特别公告发布等与目前上交所主板股票发行规则存在差异。科创板上市公司的股

权激励制度更为灵活，包括股权激励计划所涉及的股票比例上限和对象有所扩大、价格条款更为灵活、实施方式更为便利。实施该等股权激励制度安排可能导致公司实际上市交易的股票数量超过首次公开发行时的数量。

2) 相对于主板上市公司，科创板股票上市首日即可作为融资融券标的，与上交所主板市场存在差异。

3) 科创板股票交易盘中临时停牌情形和严重异常波动股票核查制度与上交所主板市场规定不同。

4) 首次公开发行股票时，发行人和主承销商可以采用超额配售选择权，不受首次公开发行股票数量条件的限制，即存在超额配售选择权实施结束后，发行人增发股票的可能性。

5) 科创板股票交易的单笔申报数量、最小价格变动单位、有效申报价格范围等与上交所主板市场股票交易存在差异。

6) 投资者需关注科创板股票交易方式包括竞价交易、盘后固定价格交易及大宗交易，不同交易方式的交易时间、申报要求、成交原则等存在差异。科创板股票大宗交易，不适用上交所主板市场股票大宗交易中固定价格申报的相关规定。

7) 科创板制度允许上市公司设置表决权差异安排。上市公司可能根据此项安排，存在控制权相对集中，以及因每一特别表决权股份拥有的表决权数量大于每一普通股份拥有的表决权数量等情形，而使普通投资者的表决权利及对公司日常经营等事务的影响力受到限制。出现《上海证券交易所科创板股票上市规则》以及上市公司章程规定的情形时，特别表决权股份将按 1:1 的比例转换为普通股份。股份转换自相关情形发生时即生效，并可能与相关股份转换登记时点存在差异。

(4) 符合相关规定的红筹企业可以在科创板上市。

红筹企业在境外注册，可能采用协议控制架构，在信息披露、分红派息等方面可能与境内上市公司存在差异。红筹公司注册地、境外上市地等地法律法规对当地投资者提供的保护，可能与境内法律为境内投资者提供的保护存在差异。同时，红筹企业可以发行股票或存托凭证在科创板上市。存托凭证由存托人签发、以境外证券为基础在中国境内发行，代表境外基础证券权益。红筹公司存托凭证持有人实际享有的权益与境外基础证券持有人的权益虽然基本相当，但不能等同于直接持有境外基础证券。



(5) 科创板上市公司退市的风险。

科创板退市制度较主板更为严格，退市时间更短，退市速度更快；退市情形更多，新增市值低于规定标准、上市公司信息披露或者规范运作存在重大缺陷导致退市的情形；执行标准更严，明显丧失持续经营能力，仅依赖与主业无关的贸易或者不具备商业实质的关联交易维持收入的上市公司可能会被退市。

(6) 科创板股票流动性较差的风险。

由于科创板投资门槛高于 A 股其他板板块，整体板块活跃度可能弱于 A 股其他板块；科创板机构投资者占比较大，板块股票存在一致性预期的可能性高于 A 股其他板块，在特殊时期存在基金交易成交等待时间较长或无法成交的可能。

(7) 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）、科创板监管规则、交易规则、自律规则等正常发生变化，可能导致包括但不限于市场价格波动、股票流动性受限等风险。

(8) 上述揭示事项仅为列举性质，未能详尽列明资产管理计划参与科创板投资所面临的全部风险和可能导致资产管理计划资产损失的所有因素。

7、本计划可投资于港股通标的股票的投资风险：

由于本计划可投资相关股票市场交易互联互通机制试点允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票（即“港股通标的股票”）的，将承担汇率风险以及境外市场的风险。

(1) 委托财产通过“港股通”投资于香港市场，在市场进入、投资额度、可投资对象、税务政策等方面都有一定的限制，而且此类限制可能会不断调整，这些限制因素的变化可能对委托财产进入或退出当地市场造成障碍，从而对投资收益以及正常的追加和提取产生直接或间接的影响。

(2) 香港市场交易规则有别于内地 A 股市场规则，此外，在港股通下参与香港股票投资还将面临包括但不限于如下特殊风险：

1) 香港市场证券交易价格并无涨跌幅上下限的规定，因此每日涨跌幅空间相对较大；

2) 只有内地和香港两地均为交易日且能够满足结算安排的交易日才为港股通交易日；

3) 香港出现台风、黑色暴雨或者联交所规定的其他情形时，联交所将可能

停市，投资者将面临在停市期间无法进行港股通交易的风险；出现境内证券交易服务公司认定的交易异常情况时，境内证券交易服务公司可能暂停提供部分或者全部港股通服务，投资者将面临在暂停服务期间无法进行港股通交易的风险。

4) 投资者因港股通股票权益分派、转换、上市公司被收购等情形或者异常情况，所取得的港股通股票以外的联交所上市证券，只能通过港股通卖出，但不得买入，证券交易所另有规定的除外；因港股通股票权益分派或者转换等情形取得的联交所上市股票的认购权利在联交所上市的，可以通过港股通卖出，但不得行权；因港股通股票权益分派、转换或者上市公司被收购等所取得的非联交所上市证券，可以享有相关权益，但不得通过港股通买入或卖出。

5) 代理投票。由于中国结算是汇总投资者意愿后再向香港结算提交投票意愿，中国结算对投资者设定的意愿征集期比香港结算的征集期稍早结束；投票没有权益登记日的，以投票截止日的持有作为计算基准；投票数量超出持有数量的，按照比例分配持有基数。

#### 8、可转换债券的风险

本计划投资的可转换债券，无法完全规避发债主体特别是可转换债券的发债主体的信用质量变化造成的信用风险；如果债券市场出现整体下跌，将无法完全避免债券市场系统性风险；

另外可转换债券的条款相对于普通债券和股票而言更为复杂，忽视这些条款导致的事件可能为委托财产带来损失。例如，当可转换债券的价格明显高于其赎回价格时，若本计划未能在转债被赎回前转股或卖出，则可能产生不必要的损失。

#### 9、基金投资风险

计划可投资于经中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金，净值表现将受其投资的其他基金表现之影响，并须承担投资其他基金有关的风险，其中包括市场、利率、货币、经济、流动性和政治等风险。

#### （三）增值税相关风险揭示

财政部、国家税务总局财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》第四条规定：“资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。”鉴于资产管理计划合同中资产管理人收取的管理费并不包括资产管理计划运营过程中发生的税款，本资产管理计划运营过程中需要缴纳增值税及其附加税的，将由投资者承担并从资产管理

计划资产中支付，因此可能增加投资者的投资税费成本。

#### （四）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。

在计划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投资者的利益受到影响。这种技术风险可能来自基金管理公司、注册登记机构、销售机构、证券交易所、证券注册登记机构等。

在托管人履行投资监督义务过程中，因为交易习惯或者现有的技术等条件所限，托管人事实上可能难以及时、有效履行合同约定的投资监督义务。投资者在签订本合同时已充分知悉该风险，并完全理解和接受可能由该风险导致出现的经济损失。

#### （五）沪深市场证券交易资金前端风险控制相关风险

根据证券交易所、中登公司的相关规定，证券交易所、中登公司根据最高额度和自设额度对资产管理人的关联交易单元的全天净买入申报金额总量实施额度管理，并对资产管理人实施前端控制，其中，最高额度为按照证券交易所、中登公司对于最高额度的定义计算的额度，自设额度为资产管理人自行申报的低于最高额度的额度，自设额度应低于最高额度。如果本计划或资产管理人管理的其他资产管理计划下的某笔交易导致资产管理人关联交易单元全天净买入申报金额达到或超过自设额度的，证券交易所将拒绝接受该笔交易及该关联交易单元后续竞价交易买入申报，本计划的相关投资交易将无法成功申报。尽管资产管理人可在规定时间内通过资产托管人向中登公司申请盘中紧急调整最高额度或自设额度，但调整能否成功取决于是否在申请时间内、中登公司及证券交易所是否同意等诸多因素，并且调整完成需要一段时间，此时本计划仍然存在无法及时完成投资的风险。因上述原因可能导致资产管理人无法完成投资，继续影响本计划投资收益、给委托资产造成损失。因不可抗力、意外事件、技术故障、重大差错等原因导致资金前端控制出现异常的，证券交易所、中登公司可以采取调整额度、暂停实施资金前端控制、限制交易单元交易权限等处置措施。因资金前端控制异常情况及证券交易所、中登公司采取的相应措施可能影响资产管理人的投资，继而影响委托资产的投资收益、给委托资产造成损失。

#### （六）其他风险

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，可能导致计划资产的损失。金融市场危机、行业竞争、代理机构违约等超出资产管理人自身直接控制能力之外的风险，可能导致投资者利益受损。

## 第二十三节 资产管理合同的变更、终止与财产清算

### （一）本合同变更的条件、程序等

1.因法律法规或中国证监会、基金业协会的相关规定、要求发生变化必须变更本合同的，管理人可以与托管人、持有计划份额三分之二以上投资者协商后修改本合同，管理人和托管人、投资者应签署书面变更合同。

2.因其他原因需要变更本合同的，经持有计划份额三分之二以上投资者、管理人和托管人协商一致，后采取签署书面变更合同形式对本合同内容进行变更，本合同另有约定的除外。资产管理计划改变投向和比例的，应当事先取得持有计划份额三分之二以上投资者同意。

3.管理人应当合理保障合同变更后投资者选择退出资产管理计划的权利。

（二）本合同发生变更的，管理人应按照基金业协会要求及时向基金业协会备案，并抄报中国证监会相关派出机构。

### （三）管理人和托管人的更换

#### 1.管理人的更换

（1）管理人被依法撤销资产管理业务资格或者依法解散、被撤销、宣告破产，资产管理计划由其他管理人承接。

#### （2）更换程序

1）选定管理人：新管理人由托管人和持有计划份额三分之二以上投资者协商选定，新管理人应当符合法律法规及中国证监会规定的资格条件，新管理人、投资者、托管人应签订新的资产管理合同；

2）交接：管理人职责终止的，应当妥善保管计划管理业务资料，及时办理计划管理业务的移交手续，新管理人应当及时接收，并与托管人核对计划资产总值；

3）审计：原管理人职责终止的，应当按照法律法规规定聘请会计师事务所对计划财产进行审计，并将审计结果向委托人披露，同时报基金业协会备案，审计费用在计划财产中列支；

4）计划名称变更：管理人更换后，如果原任或新管理人要求，应按其要求替换或删除计划名称中与原任管理人有关的名称字样。

#### 2.托管人的更换

（1）托管人被依法撤销基金托管资格或者依法解散、被撤销、宣告破产，

资产管理计划由其他托管人承接。

## （2）更换程序

1) 选定托管人：新托管人由管理人和持有计划份额三分之二以上投资者协商选定，新托管人应当符合法律法规及中国证监会规定的资格条件，新托管人、投资者、托管人应签订新的资产管理合同；

2) 交接：托管人职责终止的，应当妥善保管计划托管业务资料，及时办理计划托管业务的移交手续，新托管人应当及时接收，并与管理人核对计划资产总值；

3) 审计：原托管人职责终止的，应当按照法律法规规定聘请会计师事务所对计划财产进行审计，并将审计结果向委托人披露，同时报基金业协会备案，审计费用在计划财产中列支；

4) 计划名称变更：托管人更换后，如果原任或新托管人要求，应按其要求替换或删除计划名称中与原任托管人有关的名称字样。

## 3.管理人与托管人同时更换的条件和程序

如果发生管理人和托管人同时更换情形，委托人可决定终止本计划，或确定新的管理人和托管人，管理人和托管人的更换分别按上述程序进行。

4.新管理人接收计划管理业务或新托管人接收计划财产和计划托管业务前，原管理人或原托管人应继续履行相关职责，并保证不做出对委托人的利益造成损害的行为。

（四）资产管理计划到期后，如各方当事人协商一致并签署书面展期合同，可以展期，展期应符合以下条件：

1.资产管理计划运作规范，管理人、托管人未违反法律、行政法规、中国证监会规定和本合同的约定；

2.资产管理计划展期没有损害投资者利益的情形；

3.符合资产管理计划的成立条件；

4.经资产管理人和资产托管人一致同意后，由管理人以官网公告（或管理人向委托人出具的其它书面通知文件）的形式履行通知义务后；

5.中国证监会规定的其他条件。

（五）发生下列情形，资产管理计划终止：

1.资产管理计划存续期限届满且不展期，且资产已全部变现；

- 2.经持有计划份额三分之二以上投资者决定终止的；
- 3.管理人被依法撤销资产管理业务资格或者依法解散、被撤销、宣告破产，且在六个月内没有新的管理人承接；
- 4.托管人被依法撤销基金托管资格或者依法解散、被撤销、宣告破产，且在六个月内没有新的托管人承接；
- 5.未在基金业协会完成备案或不予备案的情形；
- 6.如本资产管理计划存续规模低于人民币 1000 万元的，资产管理人经与持有计划份额三分之二以上投资者、资产托管人协商一致，可提前终止本计划。
- 7.触发止损而提前终止的情形；
- 8.本计划存续期间内，持续五个工作日投资者少于 2 人的；
- 9.法律、行政法规、中国证监会规定及本合同约定的其他情形。

发生管理人被依法撤销资产管理业务资格或者依法解散、被撤销、宣告破产情形时，托管人有权立即对托管账户采取止付措施。

管理人应当自资产管理计划终止之日起五个工作日内报基金业协会备案，并抄报中国证监会相关派出机构，前述第（5）项约定的情形除外。

#### （六）资产管理计划的清算

资产管理计划在发生终止情形之日起五个工作日内开始组织清算资产管理计划资产：

##### 1.资产管理计划财产清算小组

（1）资产管理计划财产清算小组成员由管理人和托管人组成。清算小组可以聘用必要的工作人员。

（2）资产管理计划财产清算小组负责计划财产的保管、清理、估价、变现和分配。资产管理计划财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。

##### 2.资产管理计划财产清算的程序：

- （1）本计划终止时，由资产管理计划财产清算小组统一接管财产；
- （2）对资产管理计划财产进行清理和确认；
- （3）对资产管理计划财产进行估价和变现；
- （4）制作清算报告；
- （5）对资产管理计划剩余财产进行分配。

##### 3.清算费用的来源和支付方式

清算费用是指资产管理计划财产清算小组在进行计划财产清算过程中发生的所有合理费用、清算费用由资产管理计划财产清算小组优先从计划财产中支付。

#### 4.资产管理计划财产清算及剩余资产的分配

(1) 资产管理计划终止时已计提但尚未支付的管理费、托管费等，经清算小组复核后从清算财产中支付。

(2) 依据资产管理计划财产清算的分配方案，将计划财产清算后的全部剩余资产扣除清算费用后向委托人进行分配，将全部财产交还投资者自行管理。清算过程中如涉及非现金类资产的分配，由管理人负责办理有关财产移交事宜。

(3) 在计划财产移交前，由托管人负责保管。清算期间，任何当事人均不得运用该财产。清算期间的收益归属于计划财产，发生的保管费用由被保管的计划财产承担。因委托人原因导致计划财产无法转移的，托管人和管理人可以在协商一致后按照有关法律法规进行处理。

#### 5.计划到期未变现的处理方式

当委托财产中的资产因流动性等原因无法在本计划到期前变现时，则本计划于到期日起自动延期直至委托财产项下投资组合完全变现为止，管理人应于延期期间积极处置为变现资产，该情形下延期期间管理人和托管人不再收取管理费和托管费。

#### 6.资产管理计划延期清算处理方式

因资产管理计划延期从而导致清算延期的，资产管理计划终止后，资产管理人应按照本合同的约定履行相应的清算职责，及时进行相应清算。资产管理计划因委托财产流动性受限等原因延期清算的，管理人应当及时向中国证监会相关派出机构和基金业协会报告。

#### 7.资产管理计划财产清算报告的告知安排

管理人应在本计划终止之日起五个工作日内开始组织清算资产管理计划财产，及时编制委托财产清算报告，在资产管理计划清算结束后五个工作日内将清算结果以书面形式报告投资者，并报证券投资基金业协会备案，抄报中国证监会相关派出机构。

8.资产管理计划财产清算完毕后，各方当事人根据监管机构、账户开立机构要求办理资产管理计划证券账户、托管账户和其他账户的注销手续，各方应当积



极配合。托管人按照规定注销资产管理计划财产的托管账户等投资所需账户，管理人应给予必要的配合。

9.资产管理计划财产清算账册及文件的保存，说明资产管理计划财产清算账册及文件由管理人保存 20 年以上。

## 第二十四节 反商业贿赂

（一）合同各方都清楚并愿意严格遵守中华人民共和国反商业贿赂的法律规定，各方都清楚任何形式的贿赂和贪渎行为都将触犯法律，并将受到法律的严惩。

（二）合同各方均不得向合同中任何一方或任何一方的人员或其他相关人员索要、收受、提供、给予合同约定外的任何利益，包括但不限于明扣、暗扣、现金、购物卡、实物、有价证券、旅游或其他非物质性利益等，但如该利益属于行业惯例或通常做法，则须在合同中明示。

（三）合同各方严格禁止各方人员的任何商业贿赂行为。各方人员发生本节列示的任何一种行为，都是违反合同各方公司制度的，都将受到各方公司制度和国家法律的惩处。

（四）合同各方郑重提示：各方或各方人员为了本合同之目的与其他方人员或本合同以外的任何第三方发生本节所列示的任何一种行为，该等行为都是违反国家法律的行为，并将受到国家法律的惩处。

（五）因一方或一方经办人违反上述规定，给对方造成损失的，应承担损害赔偿 responsibility。

（六）本节所称“其他相关人员”是指合同各方人员以外的与合同有直接或间接利益关系的人员，包括但不限于该人员的父母、配偶、子女、同事等。

## 第二十五节 违约责任

（一）当事人违反本合同，应当承担违约责任，给合同其他当事人造成损失的，应当承担赔偿责任；如属本合同当事人双方或多方当事人的违约，根据实际情况，由违约方分别承担各自应负的违约责任。资产管理人或资产托管人任一方不因另一方的失职行为而给计划财产或投资者造成的损失向投资者承担连带责任。但是发生下列情况，当事人应当免责：

1. 资产管理人和/或资产托管人按照中国证监会的规定或当时有效的法律法规的作为或不作为而造成的损失等。

2. 在没有故意或重大过失的情况下，资产管理人由于按照本合同规定的投资原则而行使或不行使其投资权而造成的损失等。

3. 投资者未能事前就其关联证券或其他禁止交易证券明确告知资产管理人致使资产管理计划财产发生违规投资行为的，资产管理人与资产托管人均不承担任何责任。

4. 证券交易所、中登公司实施证券交易资金前端风险控制，资产托管人、投资者同意由资产管理人自行决定向证券交易所申报的资金前端控制自设额度，因资产管理人关联交易单元的全天净买入申报金额总量达到或超过自设额度，导致本计划下的交易申报不成功、投资无法实现的，资产管理人及资产托管人免责。因证券交易所、中登公司实施资金前端控制出现异常及在在异常情况下证券交易所、中登公司采取的相应措施造成计划资产损失的，资产管理人及资产托管人免责。

5. 资产管理人、资产托管人对因所引用的第三方（包括但不限于交易所、中登公司、经纪商及其他中介机构等）提供的信息和/或数据的真实性、准确性和完整性存在瑕疵所造成的损失不承担任何责任。

6. 本合同任何一方应保证本合同规定必须由其提供的信息、数据真实完整，并承担相应的法律责任。但如果该当事人方提供的信息和数据不真实或不完整是由于本合同任何另一方提供的信息不完整和不真实所造成的，由此导致的后果由初始过错方承担，该当事人不承担违约责任。

7. 投资者理解委托财产的投资、运作、托管面临本合同“风险揭示”章节中列举的各类风险，资产管理人及资产托管人就委托财产面临的上述固有风险

免于承担责任。

#### 8. 不可抗力。

（二）在发生一方或多方违约的情况下，在最大限度地保护投资者利益的前提下，本合同能够继续履行的应当继续履行。非违约方当事人在职责范围内有义务及时采取必要的措施，防止损失的扩大。没有采取适当措施致使损失进一步扩大的，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。

（三）一方依据本合同向另一方赔偿的损失，仅限于**直接经济损失**。

（四）本资产管理计划未能通过备案的，不视为任何一方违约，投资者的资金按照本合同的约定返还给投资者。

## 第二十六节 法律适用和争议的处理

有关本合同的签署和履行而产生的任何争议及对本合同项下条款的解释,均适用中华人民共和国法律法规(为本合同之目的,在此不包括香港、澳门特别行政区及台湾地区法律法规),并按其解释。

各方当事人同意,因本合同而产生的或与本合同有关的一切争议,合同当事人应尽量通过协商、调解途径解决。经友好协商未能解决的,应提交上海国际经济贸易仲裁委员会根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁,仲裁地点为上海,仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力,仲裁费由败诉方承担。

争议处理期间,合同当事人应恪守各自的职责,继续忠实、勤勉、尽责地履行资产管理合同规定的义务,维护投资者的合法权益。

## 第二十七节 资产管理合同的效力

（一）资产管理合同是约定资产管理合同当事人之间权利义务关系的法律文件。投资者为法人的，本合同自投资者、资产管理人和资产托管人加盖公章或合同专用章以及各方法定代表人或授权代表签章或盖章之日起成立；投资者为自然人的，本合同自投资者本人签章或授权的代理人签章、资产管理人和资产托管人加盖公章或合同专用章以及各方法定代表人或授权代表签章之日起成立。投资者通过销售机构以电子形式签署本合同的，与投资者签署纸质版资产管理合同具备同等法律效力，投资者均受本合同约束。本合同于成立之日起生效。

（二）本合同自生效之日起对投资者、资产管理人、资产托管人具有同等的法律约束力。

（三）本合同的有效期为自合同生效之日起至资产管理人将本计划的清算结果报证券投资基金业协会备案，并抄报中国证监会相关派出机构之日终止。如本计划存续期间，投资者在开放日申请退出本计划的，本合同自全部投资者将其持有的本计划全部份额退出完成之日终止。如发生相关法律法规规定及本合同约定的提前终止情形的，本合同应当提前终止。

（四）投资者自签订资产管理合同即成为资产管理合同的当事人。在本计划存续期间，投资者自全部退出资产管理计划之日起，该投资者不再是资产管理计划的投资人和资产管理合同的当事人。

## 第二十八节 其他事项

本合同如有未尽事宜，由合同当事人各方按有关法律法规和规定协商解决。

本合同一式叁份，资产管理人执壹份，投资者执壹份，资产托管人执壹份，每份具有同等的法律效力。

（以下无正文）

(本页无正文,为《某某-集合资产管理计划资产管理合同》委托人认购签署页)

**委托人请填写(务必确保填写的资料正确有效,如因填写错误导致的任何损失,资产管理人和资产托管人不承担任何责任):**

(一) 投资者

1. 自然人

姓名:

证件名称: 身份证☐、军官证☐、护照☐

证件号码:

2. 法人或其他组织

名称:

营业执照号码:

组织机构代码证号码:

法定代表人或负责人:

联系地址:

邮编:

联系电话:

联系人:

3. 资产管理产品

资产管理产品的名称:

银行理财产品编码:

理财产品账户(即本计划的委托人指定账户,用于计划资金进出)

发行机构名称:

营业执照号码:

组织机构代码证号码:

法定代表人或授权代表:

通讯地址:

住所:

联系电话:

联系人:



## （二）投资者认购金额

人民币 元整 (¥ )

### (三) 投资者账户

投资者认购、参与计划的划出账户与退出计划的划入账户，必须为以投资者名义开立的同一个账户。特殊情况导致认购、参与和退出计划的账户名称不一致时，投资者应出具符合相关法律法规规定的书面说明并提供相关证明。账户信息如下：

账户名称:

账号：

开户银行名称:

96

## 附件一：授权通知书样本

## 授权通知书样本

资产托管人 ( ):

我公司将于 XXXX 年 XX 年 XX 日正式启用此份运营授权书，该授权书适用于  
我公司管理的由贵行托管的“ ”，签字及印章样本如下：

文件类型	审核签发人员	预留业务公章
付款指令/ 收款通知	(A) 签字或样章	
	(B) 签字或样章	
核算估值结果 /会计处理事项 /其他事项	(A) 签字或样章	
	(B) 签字或样章	
密押公式 (可选)		

贵行凭此签字及印章审核我公司的投资指令及托管运营相关的其他业务文书的有效性。如有更改，我公司将另行通知。

资产管理人 ( )  
年 月 日

附件二：投资指令样本

投资指令样本

编号： 201×年第 × 号	
指令日期：201× 年× 月 × 日	
某某银行资产托管部：	
敬请贵部/行根据以下提供的收款人名称、开户行、账号、到账日期和划款金额划款。	
到账日期：	
收款人：	
开户行：	
账 号：	
划款金额(小写)：	
划款金额(大写)：	
划款用途：	
备注：	
资产管理人签章：	资产托管人签章：
审批人：	审批人：
复核人：	复核人：
经办人：	经办人：

重要提示：接此通知后，应按照指令立即操作。

附件三：专用清算账户及资金划拨专用账户

专用清算账户及资金划拨专用账户

注意：账户如有变更，请及时通知相关各方。

托管专户

账户名：

账号：

开户银行：

投资者交付/提取委托财产的账户

账户名：

账号：

开户银行：

管理费收款账户/业绩报酬收款账户

户 名：某某管理有限公司

开 户 行：中国银行某某支行

银行账号：888889999999

大额支付号：

托管费收款账户

户 名：

开 户 行：

账 号：

附件四：投资者指定联系人名单

【某某-集合资产管理计划】的投资者指定以下联系人名单，用以接收及发送本资产管理计划项下业务相关的邮件。

自然人/机构	指定联系人	联系电话	接收及发送邮箱