
长江证券超越理财基金管家II集合资产管理合同

目 录

| | |
|---------------------------|----|
| 一、前言..... | 1 |
| 二、集合资产管理合同当事人..... | 1 |
| 三、集合计划的基本情况..... | 2 |
| 四、管理人以自有资金参与集合计划的约定..... | 5 |
| 五、推广期间委托人参与集合计划..... | 5 |
| 六、集合计划账户管理和资产托管..... | 6 |
| 七、集合计划的费用..... | 7 |
| 八、收益分配..... | 10 |
| 九、信息披露..... | 11 |
| 十、委托人的权利与义务..... | 13 |
| 十一、管理人的权利与义务..... | 14 |
| 十二、托管人的权利与义务..... | 16 |
| 十三、集合计划存续期间委托人的参与和退出..... | 17 |
| 十四、集合计划的终止和清算..... | 22 |
| 十五、风险揭示及相应风险防范措施..... | 23 |
| 十六、不可抗力..... | 23 |
| 十七、违约责任与争议处理..... | 24 |
| 十八、合同的成立与生效..... | 24 |
| 十九、合同的补充与修改..... | 25 |
| 二十、委托人、管理人、托管人签章及时间..... | 27 |

特别申明：本《长江证券超越理财基金管家 II 集合资产管理合同》（以下简称“本合同”或“管理合同”）以电子方式签订，管理人、托管人作为本合同签署方，已接受本合同项下的全部条款；委托人作为本合同的一方，以约定的电子合同、电子签名方式签署本合同，即表明委托人完全接受本合同项下的全部条款，同时本合同成立。

一、前言

为规范长江证券超越理财基金管家 II 集合资产管理计划（以下简称集合计划）运作，明确集合资产管理合同当事人的权利与义务，根据《中华人民共和国合同法》、《证券公司客户资产管理业务试行办法》（以下简称《试行办法》）、《证券公司集合资产管理业务实施细则（试行）》（以下简称《实施细则》）等法律、行政法规和中国证监会的有关规定，委托人、管理人、托管人在平等自愿、诚实信用原则的基础上订立本合同。本合同是规定当事人之间基本权利义务的法律文件，当事人按照《试行办法》、《实施细则》、集合计划说明书、本合同及其他有关规定享有权利、承担义务。

委托人承诺以真实身份参与集合计划，保证委托资产的来源及用途合法，所披露或提供的信息和资料真实，并已阅知本合同和集合计划说明书全文，了解相关权利、义务和风险，自行承担投资风险和损失。

管理人承诺以诚实守信、审慎尽责的原则管理和运用本集合计划资产，但不保证本集合计划一定盈利，也不保证最低收益。

托管人承诺以诚实守信、审慎尽责的原则履行托管职责，安全保管客户集合计划资产、办理资金收付事项、监督管理人的投资行为，但不保证本集合计划资产投资不受损失，不保证最低收益。

中国证监会对本集合计划出具了批准文件（**名称及文号**），但中国证监会对本集合计划作出的任何决定，均不表明中国证监会对本集合计划的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明参与本集合计划没有风险。

二、集合资产管理合同当事人

委托人

委托人身份资料以委托人与各推广机构签订的电子合同及电子签名约定书

中所确定的内容为准。

管理人

名称：长江证券股份有限公司
住所：湖北省武汉市新华路特 8 号
法定代表人：胡运钊
联系电话：（027）65799859

托管人

名称：招商银行股份有限公司
住所：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
法定代表人：秦晓
联系人：张燕
联系方式：（0755）83199084

三、集合计划的基本情况

（一）名称与类型

名称：长江证券超越理财基金管家Ⅱ集合资产管理计划
类型：非限定性集合资产管理计划

（二）投资范围和投资比例

1、集合计划的投资范围

本集合计划的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法公开发行的各类证券投资基金、股票类权益性资产、固定收益类资产以及中国证监会允许投资的其他金融工具。

2、集合计划的投资组合

（1）证券投资基金：国内依法公开发行的各类证券投资基金，占资产净值的 0—95%；

（2）股票类权益性资产：股票（包括一级市场申购所得股票及二级市场投资股票）、权证占资产净值的 0—30%（其中，权证不超过资产净值的 3%）；

（3）固定收益类资产：银行存款、央行票据、债券逆回购、国内依法发行的各类债券（包括中期票据、资产支持受益凭证）等，不低于资产净值的 5%。

在集合计划开放期间，银行存款金额不低于资产净值的 10%。

在符合相关法律、法规规定的情况下，本集合计划申购新股，不设申购上限，但所申报的金额不得超过本集合计划的现金总额，所申报的数量不得超过拟发行股票公司本次发行股票的总量。

委托人在此同意并授权管理人可以将集合计划的资产投资于与管理人、托管人及与管理人、托管人有关联方关系的公司发行的证券，但其投资比例应严格遵守《试行办法》的规定。交易完成 5 个工作日内，管理人应书面通知托管人，通过管理人的网站告知委托人，并向证券交易所报告。

因集合计划规模或市场变化等客观因素导致投资组合暂时未能达到上述约定比例的要求，管理人应在 10 个工作日内进行调整。

管理人有权根据相关法律、法规和集合资产管理合同的规定，自主对集合计划资产进行管理。

（三）规模

本集合计划推广期目标规模为 20 亿份（含管理人自认购份额，以及参与资金在推广期间产生的利息所转的份额），存续期不设目标规模。

（四）存续期

本集合计划不设固定存续期限。

（五）集合计划的封闭期

本集合计划自成立之日起三个月为封闭期，封闭期内不接受委托人的申购和退出申请。

封闭期满后的 5 个工作日为开放日，其后每三个自然月开放一次，开放时间为每三个自然月的最后 10 个工作日。委托人可在开放日申请参与或退出本计划。

例 1：本集合计划于 2009 年 7 月 23 日成立，则首次开放时间为 2009 年 10 月 23 日-10 月 29 日的工作日；第二次开放时间为 2009 年 12 月 18 日-12 月 31 日的工作日；以此类推。

例 2：本集合计划于 2009 年 7 月 24 日成立，则首次开放时间为 2009 年 10 月 26 日-10 月 30 日的工作日；第二次开放时间为 2010 年 1 月 18 日-1 月 29 日的工作日；以此类推。

（六）每份集合计划的面值

本集合计划单位份额面值为 1.00 元。

(七) 参与本集合计划的最低金额

委托人首次参与本集合计划的最低金额为 100,000 元（不含参与费），再次参与本集合计划的最低金额为 10,000 元。

(八) 集合计划成立的条件和日期

本集合计划的推广过程必须符合法律、行政法规和中国证监会的规定。

推广期结束时，本集合计划在委托人认购金额超过 1 亿元（不含管理人自有资金），且委托人人数不少于 2 人（不含管理人）的条件下，管理人应聘请具有证券相关业务资格的会计师事务所对本集合计划进行验资并出具验资报告，在验资合格后可以宣告集合计划成立。

推广期内，如果某日当日参与申请的份额加上已有的参与份额（包括管理人自认购份额及参与资金在推广期间产生的利息所转的份额）达到或接近 20 亿份时，且截至当日已有委托人人数不少于 2 人（不含管理人），管理人立即停止接受参与申请，并及时在管理人网站和代理推广机构网站公告停止参与申请。如果当日参与申请的份额加上已有的参与份额已经超过目标规模，则次日对参与申请的份额按照时间优先原则进行确认，以保证集合计划份额不超过目标规模。在此情形下，管理人可提前结束推广期，并及时通知推广机构和注册登记机构。管理人在验资合格后宣布本集合计划成立。

本集合计划成立前，委托人的认购款项必须存入注册登记机构的专用账户，不得动用。

在符合成立条件时，本集合计划成立。在本集合计划成立时，管理人将在其网站（www.95579.com）进行公告。本集合计划自成立之日起开始运作。

(九) 集合计划成立失败

推广期结束时，若推广过程不符合法律、行政法规和中国证监会的规定，或者委托人认购金额低于 1 亿元（不含管理人自有资金），或者委托人人数少于 2 人（不含管理人），或者推广期间发生使集合计划无法成立的不可抗力，则集合计划不能成立。

本集合计划不能成立时，本集合计划管理人承担全部推广费用，在集合计划推广期结束后 15 个工作日内通过注册登记机构把已募集资金加计同期利息（以

注册登记机构的记录为准) 退还给委托人, 退还完毕后各方互不承担其他责任。

四、管理人以自有资金参与集合计划的约定

(一) 参与金额和比例

管理人以自有资金认购本集合计划推广期截止日委托人所认购集合计划资产总额的 3%, 但不超过 5800 万元, 并承担相应义务和享有约定的权利。

(二) 管理人承诺在本集合计划存续期内不得提前退出

集合计划存续期内, 管理人不得收回参与的自有资金。同时, 管理人不再追加自有资金投入。自有资金参与份额存续期所取得的收益以现金分红方式归管理人所有, 不转增份额。

(三) 管理人自有资金的收益分配

管理人自有资金认购的份额享有与其他委托人份额相同的分红和收益权。

五、推广期间委托人参与集合计划

(一) 推广期间委托人参与集合计划的时间

推广期指本集合计划自开始推广到推广完成之间的时间段。本集合计划将在中国证监会对本计划出具了批准文件之日起 6 个月内开始推广, 在 60 个工作日内完成集合计划的推广、设立活动, 具体时间见有关公告。

(二) 推广期间委托人参与集合计划的方式

推广期间委托人通过认购的方式参与本集合计划。

(三) 推广期间委托人参与集合计划的价格

本集合计划单位份额面值为人民币 1.00 元, 推广期委托人按面值认购集合计划。

(四) 委托人参与集合计划的金额限制

委托人在推广期间和存续期间可以多次参与本集合计划。首次参与本集合计划的最低金额不得低于 100,000 元 (不含参与费), 再次参与本集合计划的最低金额为 10,000 元。

委托人参与本集合计划遵循“金额认购、全额预缴”原则。即委托人以金额数目参与认购本集合计划, 并缴足所申请认购的金额与参与费用。

（五）委托人参与本集合计划的程序

1、委托人指定以本人名义开立的账户（指代销银行的银行账户或者证券营业部的资金账户）作为办理本集合计划合同项下支付参与资金及收取退出资金和收益等款项的账户，委托人承诺在本集合计划合同有效期内，不得撤销该账户，并妥善保管账户资料，由于委托人账户原因造成退出资金和收益不能及时划入上述委托人指定账户及造成的损失，由委托人承担，管理人和托管人不承担责任。

2、委托人书面形式同意以电子签名的方式签署《长江证券超越理财基金管家 II 集合资产管理合同》后，既可以到集合计划推广机构指定营业网点的柜台申请参与集合计划，也可登陆推广机构指定网络系统以自主下单的方式申请参与集合计划。参与申请经管理人确认后，构成本合同的有效组成部分。

3、委托人提交的参与申请，经管理人确认后，可到办理网点或网络查询参与确认情况。

4、委托人可多次参与本集合计划，参与一经受理不得撤销。

（六）参与费

本集合计划按照认购金额规模收取参与费，该费用前端收取（即委托人在参与集合计划时缴纳参与费），具体费率如下：

| 参与金额 N 万（含参与费） | N<100 | 100≤N<500 | 500≤N<1000 | 1000≤N |
|----------------|-------|-----------|------------|----------|
| 认购费率 | 1% | 0.8% | 0.5% | 1000 元/笔 |

（七）参与份额的计算

委托人在推广期间参与本计划的认购资金按照注册登记机构的计息标准计息，所产生利息在本集合计划成立时按集合计划单位份额面值折算成集合计划份额，归委托人所有。

净认购金额=认购金额÷（1+参与费率）

参与费=认购金额-净认购金额

认购份额=（净认购金额+认购资金利息）÷单位份额面值

认购份额的计算保留到小数点后两位，小数点两位以后部分四舍五入，由此产生的误差归入集合计划财产。

六、集合计划账户管理和资产托管

（一）资金账户

资金账户指委托人在推广机构开设的资金账户，用于委托人参与、退出本集合计划的资金划款。委托人在本合同有效期内，不得注销、变更该专用账户，如因故造成变更或撤销账户的，委托人应及时将情况通知推广机构，并根据推广机构的要求履行相应的手续，否则由此产生的损失由委托人承担。

（二）集合计划托管银行账户开立与管理

托管人对本集合计划资产单独设置账户，托管账户名称为“长江证券超越理财基金管家Ⅱ集合资产管理计划”，用于办理本集合计划参与及退出资金、收益分配等资金往来相关业务。托管银行账户与管理人、托管人和推广机构自有资金账户以及其他集合计划资金账户相互独立。

（三）集合计划证券账户的开立与管理

托管人为本集合计划开立专门的证券账户，证券账户名称为：“长江证券-招行-长江证券超越理财基金管家Ⅱ集合资产管理计划”。

（四）集合计划证券交易资金账户的开立和管理

托管人以集合计划托管人的名义在中国证券登记结算有限责任公司上海、深圳分公司开立并管理集合计划证券交易资金账户，用于证券和资金的清算。

管理人和托管人对本集合计划资产独立核算、分账管理，保证本集合计划资产与其自有资产、其他客户资产、其他集合计划的资产相互独立。

（五）资产托管

本集合计划资产交由托管人负责托管，管理人与托管人必须按照《试行办法》、《实施细则》、本合同及其他有关规定签订托管协议，托管人的托管职责以托管协议的约定为准。

七、集合计划的费用

（一）集合计划费用的种类

- 1、集合计划管理人的管理费；
- 2、集合计划托管人的托管费；
- 3、集合计划管理人的业绩报酬；
- 4、开放式基金的申（认）购费及赎回费；

- 5、集合计划的证券交易费用；
- 6、集合计划存续期间的会计师费和律师费；
- 7、集合计划的信息披露费用；
- 8、因集合计划资金划付支付给银行的划拨费用等；
- 9、按照法律法规及本合同规定可以列支的其他费用。

(二) 集合计划费用计提方法、计提标准和支付方式

1、管理人管理费计提和支付

管理人管理费按前一日集合计划资产净值的 1% 年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 1\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的管理费

E 为前一日集合计划资产净值

管理费每日计提，按月支付。由管理人向托管人发送管理费划付指令，经托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从集合计划资产中一次性支付给管理人。

2、托管人托管费计提和支付

托管人托管费按前一日集合计划资产净值的 0.2% 年费率计提，计算方法如下：

$$K = E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

K 为每日应计提的托管费

E 为前一日的集合计划资产净值

托管费每日计提，按月支付。由管理人向托管人发送托管费划付指令，托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从集合计划资产中一次性支付给托管人。

3、管理人业绩报酬的提取和支付

管理人在本集合计划分红日、份额退出日和计划终止日计提业绩报酬。业绩报酬计提标准为，计提份额期间收益率 R_i 超过业绩报酬标准部分的 20% 作为管理人的业绩报酬。

(1) 期间收益率 R_i 的计算方式：

$$R_i = \frac{A - P_i + D_i}{P_i} \times 100\%$$

其中 A 为业绩报酬计提日集合计划的单位净值，P_i 为份额 i 的期初成本，D_i 为份额 i 的期间分红。

① 若份额 i 之前未被计提过业绩报酬，则 P_i=份额 i 认购（或申购）成本价，D_i=份额 i 认购（申购）以来已经发生的累计分红金额。

② 若份额 i 之前被计提过业绩报酬，则 P_i=份额 i 最近一次发生业绩报酬计提并分红后的单位净值，D_i=份额 i 最近一次发生业绩报酬计提并分红后已经发生的累计再次分红金额。

(2) 业绩报酬的计算方法：

$$\text{单位份额业绩报酬 } S_i = A \cdot \text{Max}\left\{ \left[R_i - \sum_{j=1}^k \lambda_j * t_j \right] * 20\%, 0 \right\}$$

其中 λ_j 为份额 i 在本次业绩报酬计提期间所历经的第 j 个业绩报酬标准。业绩报酬标准取 1 月 1 日可得的最新的中国人民银行公布并执行的金融机构人民币三年定期存款利率，该标准每年 1 月 1 日调整一次，集合计划成立日的业绩报酬标准取成立日可得的最新的中国人民银行公布并执行的金融机构人民币三年定期存款利率。

k 表示份额在本次业绩报酬计提期间所历经的业绩报酬标准个数；

t_j 为份额 i 在本次业绩报酬计提期间历经 λ_j 的持续时间（单位为年）。

单位份额业绩报酬的计算结果保留到小数点后四位，小数点后第五位四舍五入。

(3) 业绩报酬计提方式：

在集合计划分红日计提业绩报酬的，业绩报酬从分红资金中扣除。

在集合计划份额退出和集合计划终止时计提业绩报酬的，业绩报酬从退出资金中扣除。委托人多次参与集合计划的，退出份额采取“后进先出”原则。

(4) 业绩报酬支付方式

业绩报酬在分红日计提的，由管理人计算并向托管人发送业绩报酬划付指令，托管人于收到指令后 5 个工作日内从集合计划资产中将计提的业绩报酬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。

业绩报酬在委托人持有份额退出或集合计划终止时计提的，由管理人计算并向托管人发送业绩报酬划付指令，托管人于5个工作日内将业绩报酬划拨给注册登记机构，由注册登记机构将业绩报酬支付给管理人。若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

4、上述（一）集合计划费用的种类中4至9项费用由托管人根据其他相关法规及相应协议的规定，按费用实际支出金额支付，列入当期集合计划费用。

（三）不列入集合计划费用的项目

集合计划成立前发生的费用，以及存续期间发生的与推广有关的费用，不得在集合计划资产中列支。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集合计划资产的损失以及处理与集合计划运作无关的事项发生的费用等不得列入集合计划费用。

（四）税收支出

本集合计划运作过程中涉及的各项纳税事项，依照国家法律法规的规定进行纳税。除法律法规另行规定外，管理人不对委托人承担的各类税负进行代扣代缴；

八、收益分配

（一）集合计划收益的构成

- 1、集合资产投资所得红利、股息、债券利息；
- 2、买卖证券价差；
- 3、银行存款利息；
- 4、法律法规及集合资产管理合同规定的其他收入。

因运用集合资产带来的成本或费用的节约计入收益。

（二）收益分配原则

收益分配需同时满足下列原则：

- 1、每份集合计划份额享有同等分配权。
- 2、集合计划资产收益分配基准日的单位净值减去单位份额分红金额后不能低于集合计划份额面值。
- 3、符合上述原则下，集合计划的净收益每年至少分红一次，最多分配四次，

每次分配比例不低于本集合计划当次可供分配利润的 70%。集合计划可供分配利润指截至收益分配基准日集合计划未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

4、收益分配基准日到红利发放日的时间不超过 15 个工作日。集合计划年度分配时间为集合计划每会计年度结束后 20 个工作日内。

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

（三）收益分配方案及披露

本集合计划收益分配方案由集合计划管理人拟定，由集合计划托管人复核计算无误后确定，在方案确定后 5 个工作日内管理人在其网站进行公告，并在方案实施后的 5 个工作日内将委托人实际获得的分红金额划往指定资金账户。

收益分配方案中应载明集合计划期末可供分配利润、收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。

（四）收益分配的方式

本计划的收益分配采用现金红利方式。

（五）收益分配中发生的费用

收益分配时发生的银行转账等手续费由委托人自行承担。

九、信息披露

（一）信息披露的形式

本集合计划的信息披露将严格按照《试行办法》、《实施细则》、集合资产管理合同及其他有关规定进行。本集合计划的定期公告与报告、临时公告与报告将通过管理人的网站——长江证券长网（www.95579.com）来进行信息的披露。对账单主要采取邮寄或电子邮件的形式进行寄送。

（二）信息披露的内容和时间

1、定期公告与报告

（1）单位净值

集合计划成立后，集合计划管理人应在每周第一个工作日公布前一工作日的集合计划单位净值、单位累计净值；在每一开放日的次工作日公布前一工作日集合计划单位净值、单位累计净值。

（2）季度报告

每季度结束之日起 15 个工作日内，集合计划管理人应向委托人提供准确、完整的资产管理报告，对报告期内集合计划资产的投资策略、资产组合、业绩表现、份额变动等情况做出详细的说明，并报管理人住所地中国证监会派出机构备案；托管人应向委托人提供准确、完整的资产托管报告，对报告期内管理人在投资运作、净值计算、费用开支等问题是否符合法律、法规、集合计划说明书及合同的规定做出详细的说明，并由管理人报其住所地中国证监会派出机构备案。

(3) 年度报告

每会计年度结束之日起 60 个工作日内，集合计划管理人应向委托人提供准确、完整的资产管理年度报告及集合计划审计报告，对报告期内集合计划资产的业绩表现、收益分配、投资策略、内部监察、投资组合、会计报表等情况做出详细的说明，并报管理人住所地中国证监会派出机构备案；托管人应向委托人提供准确、完整的资产托管年度报告，除对报告期内管理人在投资运作、净值计算、费用开支等问题是否符合法律、法规、集合计划说明书及合同的规定做出详细的说明外，还应复核检查资产管理年度报告中的财务指标、业绩表现、收益分配、会计报表、投资组合等内容是否真实、准确、完整，并由管理人报其住所地中国证监会派出机构备案。

年度报告及年度审计意见在集合计划管理人的指定网站披露。

2、临时公告与报告

本集合计划在运作过程中发生下列可能对投资者权益产生重大影响的事项之一时，管理人必须按照法律、法规及中国证监会的有关规定及时报告，并办理相关的审批或报备手续。

(1) 证券的发行公司出现重大事件，导致集合计划所持有的该公司发行的证券不能按正常估值方法进行估值，在管理人根据有关法律法规的规定进行调整后，调整金额影响到集合计划资产净值的情形；

(2) 涉及本集合计划的重大关联事项；

(3) 涉及本集合计划的重大诉讼、仲裁事项；

(4) 导致集合计划终止的情况发生；

(5) 集合计划管理人的董事长、总经理等高级管理人员、托管人托管部门负责人、投资主办人发生变动；

- (6) 变更投资策略或投资程序等；
- (7) 集合计划开始办理申购、退出业务；
- (8) 集合计划发生巨额退出并延期支付；
- (9) 暂停办理集合计划的申购、退出；
- (10) 暂停申购、退出后重新开放集合计划的申购、退出；
- (11) 管理费、托管费、业绩报酬等费用计提方式或费率发生变更；
- (12) 业绩报酬标准的调整；
- (13) 集合计划分红；
- (14) 其他可能影响委托人权益的重大事项。

在集合计划存续期间，管理人将根据法律、法规和中国证监会的有关规定，定期或不定期向中国证监会及其派出机构、中国证券业协会、沪深证券交易所报告本集合计划的运作情况。

3、对账单服务

本集合计划每季度向委托人寄送对账单，对账单的寄送形式为邮寄或电子邮件，委托人可以选择寄送方式，默认的寄送方式为邮寄。

对账单的内容包括计划的差异性、风险，委托人持有集合计划份额的数量和净值，期间参与和退出明细以及收益分配情况等。

(三) 信息披露文件的存放与查阅

本集合计划的定期公告与报告、临时公告与报告存放在管理人、托管人的办公场所，委托人可在办公时间查阅。委托人在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复印件，委托人还可以登陆管理人的网站或拨打咨询电话进行查询。

管理人和托管人保证文本的内容与所公告的内容完全一致。

管理人和托管人应当妥善保存客户开户资料、委托记录、交易记录和与内部管理、业务经营有关的各项资料，任何人不得隐匿、伪造、篡改或者毁损。上述资料的保存期限自集合资产管理合同终止之日起不得少于二十年。

十、委托人的权利与义务

（一）委托人的权利

- 1、分享集合计划收益；
- 2、依据本合同知悉有关集合计划投资运作的信息，包括集合计划的资产配置、投资比例、损益状况等；
- 3、按照本合同的约定，参与、退出集合计划；
- 4、参与分配集合计划清算后的剩余资产；
- 5、因管理人、托管人过错导致合法权益受到损害的，有权得到赔偿；
- 6、法律、行政法规、中国证监会的有关规定及本合同约定的其他权利。

（二）委托人的义务

- 1、承诺委托资金的来源及用途合法，向管理人或代理推广机构如实提供财务状况及投资意愿等基本情况；法人或者依法成立的其他组织，用筹集的资金参与集合计划的，应当向管理人或代理推广机构提供合法筹集资金的证明文件；
- 2、按照本合同约定，交付委托资金，承担相应税费，支付合同约定的管理费、托管费和其他费用；
- 3、按照合同约定，承担集合计划可能的投资损失；
- 4、不得转让集合计划份额（法律、行政法规另有规定的除外）；
- 5、法律、行政法规、中国证监会的有关规定及本合同约定的其他义务。

十一、管理人的权利与义务

（一）管理人的权利

- 1、根据本合同的约定，独立运作集合计划的资产；
- 2、根据本合同的约定，收取管理费、业绩报酬等相关费用；
- 3、合理更换本集合计划的分管总裁、资产管理业务主要负责人、主要承办人员、投资主办人员；
- 4、集合计划资产受到损害时，向有关责任人追究法律责任；
- 5、按照本合同的约定，停止或暂停办理集合计划的参与，暂停办理集合计划的退出事宜；
- 6、根据本合同的约定，终止本集合计划的运作；
- 7、行使集合计划资产投资形成的投资人权利；
- 8、可将集合计划投资于与管理人、托管人及与管理人、托管人有关联方关

系的公司发行的证券，但投资的资金不超过本集合计划资产净值的3%；

9、法律、行政法规、中国证监会有关规定及本合同约定的其他权利。

（二）管理人的义务

1、在集合计划投资管理活动中以专业技能管理集合计划的资产，为委托人利益服务，依法保护委托人的财产权益；

2、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；

3、根据中国证监会有关规定、本合同和托管协议的约定，接受托管人的监督；

4、按规定出具资产管理报告，保证委托人能够及时了解有关集合计划资产投资组合、资产净值、费用与收益等信息；

5、保守集合计划的商业秘密，在集合计划有关信息向委托人披露前，不泄露集合计划的投资安排、投资意向等信息（法律、行政法规、中国证监会另有规定的除外）；

6、依法对托管人的行为进行监督，如发现托管人违反法律、行政法规和中国证监会的规定，或者违反托管协议的，应当予以制止，并及时报告住所地中国证监会派出机构；

7、按照合同约定向委托人分配集合计划的收益；

8、按照有关法律、行政法规、中国证监会有关规定及本合同的约定，办理集合计划的开户登记事务及其他手续；

9、及时向退出集合计划的委托人支付退出款项；

10、妥善保存与集合计划有关的合同、协议、推广文件、交易记录、会计账册等文件、资料，保存期自本合同终止之日起不少于二十年；

11、在集合计划终止或因其他原因解散时，与托管人一起妥善处理有关清算和委托人资产的返还事宜；

12、保证向委托人提供的集合资产管理合同文本内容与管理人、托管人共同书面确认的文本内容一致，并承担相应责任；

13、在解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产或因其他原因不能继续履行管理人职责时，及时向委托人和托管人报告；

14、因自身或其代理人的过错造成集合计划资产损失的，向委托人承担赔偿责任；

15、因托管人过错造成集合计划资产损失时，代委托人向托管人追偿；

16、因管理人单方面解除本合同给委托人、托管人造成经济损失时，对委托人、托管人予以赔偿；

17、聘请具有证券相关业务资格的会计师事务所，对每个集合计划的运营情况进行年度审计，并将集合计划审计报告在每年度结束之日起 60 日内，向委托人和托管人提供，并报管理人住所地中国证监会派出机构备案；

18、负责办理集合计划中需要中国证监会或其派出机构审批、备案的相关事宜和手续；

19、负责将电子合同文本通过公证机关公证，并委托登记公司存放以备查；

20、管理人自身对说明书、资产管理报告等所有向委托人披露的涉及本系列集合计划基本情况和信息的真实性、准确性、完整性负责；

21、法律、行政法规、中国证监会有关规定及本合同约定的其他义务。

十二、托管人的权利与义务

（一）托管人的权利

- 1、对集合计划资产进行托管；
- 2、按照本合同的约定收取托管费；
- 3、查询集合计划的经营运作情况；
- 4、法律、行政法规、中国证监会有关规定及本合同约定的其他权利。

（二）托管人的义务

1、在集合计划托管活动中恪尽职守，履行诚实信用、谨慎勤勉的义务，保管集合计划的资产，确保集合计划资产的独立和安全，依法保护委托人的财产权益；托管人自集合计划验资成立后，集合计划资产划入指定的托管账户之日起开始履行托管人职责，承担托管人义务；托管人对集合计划的销售不承担责任；

2、依法为集合计划开立专门的资金账户和专门的证券账户；

3、安全保管集合计划资产、办理资金收付事项；非依法律、行政法规和中国证监会有关规定或合同约定，不得擅自动用或处分集合计划资产；

4、执行管理人的投资或者清算指令，负责办理集合计划名下的资金往来；

5、监督管理人集合计划的经营运作，发现管理人的投资或清算指令违反法律、行政法规、中国证监会的有关规定或者本合同约定的，应当要求其改正；管理人未能改正的，并且管理人的投资或清算指令尚未生效执行的应当拒绝执行，

并向管理人住所地中国证监会派出机构报告；

6、复核管理人计算的集合计划的资产净值；

7、保守集合计划的商业秘密，在集合计划有关信息向委托人披露前予以保密，不向他人泄露（法律、行政法规、中国证监会另有规定的除外）；

8、按规定出具集合计划托管报告；

9、妥善保存与集合计划托管业务有关的合同、协议、交易记录、会计账册等文件、资料，保存期自本合同终止之日起不少于二十年；

10、在集合计划终止或因其他原因解散时，与管理人一起妥善处理有关清算和委托人资产的返还事宜；

11、在解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产时，及时报告委托人和管理人；

12、因自身过错导致集合计划资产损失的，向委托人承担赔偿责任；

13、因管理人过错造成集合计划资产损失的，代委托人向管理人追偿；

14、因托管人单方解除本合同给委托人、管理人造成经济损失的，对委托人、管理人予以赔偿；

15、法律、行政法规、中国证监会有关规定及本合同约定的其他义务。

十三、集合计划存续期间委托人的参与和退出

（一）集合计划存续期间委托人的参与和退出的时间

存续期内，三个月封闭期满后的5个工作日为开放日，其后每三个自然月开放一次，开放时间为每三个自然月的最后10个工作日，委托人可在开放日向推广机构提出参与或退出本集合计划的申请。

委托人在非开放日提出的申请为无效申请，推广机构不予受理。

（二）集合计划存续期间委托人的参与和退出的原则

1、“未知价”原则。即集合计划存续期间委托人参与或退出本集合计划的价格是次工作日公布的参与或退出当天本集合计划单位净值。当发生巨额退出并延缓办理时，退出价格为延缓办理日集合计划的单位净值。

2、“金额参与、全额预缴”原则。即委托人以金额数目参与本集合计划，并缴足所申请参与的金額与参与费用。

3、份额退出的原则。即委托人以份额数目申请退出本集合计划。

4、“后进先出”的原则。即委托人申请退出的份额顺序依次为：后申购的份额，先申购的份额，认购份额。

(三) 集合计划存续期间委托人参与和退出的数额限制

1、委托人在推广期间和存续期间可以多次参与本集合计划。首次参与本集合计划的最低金额不得低于100,000元（不含参与费），再次参与本集合计划的最低金额为10,000元。

2、退出份额的约定。委托人可将其持有的部分或全部集合计划份额退出，每次申请退出的最低份额为1,000份。

3、在推广机构保留的集合计划份额数量限制。委托人在某一推广机构保留的集合计划份额最低余额为1,000份，若某笔退出导致在该推广机构账户余额中集合计划份额不足1,000份的，余额部分应一同退出。

(四) 集合计划存续期间委托人参与和退出的程序

1、集合计划存续期间委托人参与的程序

存续期内，委托人参与集合计划的程序同本合同五（五）。

2、集合计划存续期间委托人退出的程序

（1）委托人可在原参与网点，在规定的开放期内办理退出申请，或登录原参与推广机构指定的网络系统以自主下单的方式申请退出集合计划；

委托人提交退出申请时，其在推广机构（网点）必须有足够的集合计划份额余额。

（2）委托人提出的退出申请，经管理人确认后，可向推广机构所属网点查询退出的确认情况。

（3）委托人退出申请被确认后的5个工作日内，管理人通过托管人将退出款项从托管专户划出，并通过推广机构营业网点划至委托人指定资金账户。

(五) 集合计划存续期间委托人的参与费率和退出费率

1、参与费率

本集合计划存续期间委托人的参与按照申购金额规模收取参与费，该费用前端收取（即委托人在参与集合计划时缴纳参与费），具体费率如下：

| 参与金额 N 万（含参与费） | N<100 | 100≤N<500 | 500≤N<1000 | 1000≤N |
|----------------|-------|-----------|------------|----------|
| 申购费率 | 1% | 0.8% | 0.5% | 1000 元/笔 |

2、退出费率

本集合计划的退出费率为：

| 持有期限 | 退出费率 |
|--------------------|------|
| 持有期限<182 天 | 0.4% |
| 182 天≤持有期限 < 365 天 | 0.3% |
| 365 天≤持有期限 < 547 天 | 0.2% |
| 547 天≤持有期限 < 730 天 | 0.1% |
| 730 天≤持有期限 | 0 |

本集合计划采取后进先出的退出方式，委托人退出本集合计划时，应当按照以上费率向管理人支付退出费用，退出费的计算保留到小数点后两位，小数点两位以后部分四舍五入。

（六）集合计划存续期间委托人的参与份额和退出金额的计算

1、参与份额的计算

委托人在存续期的开放日申购本集合计划的资金按申购当天集合计划单位净值折算成集合计划份额。

$$\text{净申购金额} = \text{申购金额} \div (1 + \text{参与费率})$$

$$\text{申购费} = \text{申购金额} - \text{净申购金额}$$

$$\text{申购份额} = \text{净申购金额} \div \text{申购当天集合计划单位净值}$$

申购份额的计算保留到小数点后两位，小数点两位以后部分四舍五入，由此产生的误差归入集合计划财产。

例：某委托人在开放日申请参与本集合计划，申购金额为200,000元，假设申请当日集合计划单位净值为1.2000元。则：

$$\text{净申购金额} = 200,000 \div (1 + 1\%) = 198,019.80 \text{元};$$

$$\text{申购费} = 200,000 - 198,019.80 = 1,980.20 \text{元};$$

$$\text{申购份额} = 198019.80 \div 1.2000 = 165,016.50 \text{份}。$$

2、退出金额的计算

委托人在退出本集合计划时缴纳退出费，委托人的退出净额为退出金额扣减退出费用。其中：

$$\text{退出金额} = \text{退出份额} \times \text{T 日集合计划份额净值}$$

$$\text{退出费用} = (\text{退出金额} - \text{业绩报酬}) \times \text{退出费率}$$

$$\text{退出净额} = \text{退出金额} - \text{退出费用} - \text{业绩报酬}$$

退出金额的计算保留到小数点后两位，第二位以后部分四舍五入，由此产生的误差归入集合计划财产。

例：如某委托人在集合计划申请退出 100,000 份集合计划份额，该 100,000 份计划份额最近一次被计提业绩报酬并分红之后的单位净值为 1.2000 元，退出时的净值为 1.5000 元，期间单位份额累计分红为 0.06 元，期间业绩报酬标准分别为 3.5%、5%、4%，所历经的时间分别为 195 天、365 天、240 天。

由上所述，期间收益率：

$$R_i = \frac{A - P_i + D_i}{P_i} \times 100\% = \frac{1.5000 - 1.2000 + 0.06}{1.2000} \times 100\% = 30\% ;$$

单位份额业绩报酬为：

$$\begin{aligned} S_i &= 1.2000 \times \text{Max}\left\{ \left[30\% - \left(3.5\% \times \frac{195}{365} + 5\% \times \frac{365}{365} + 4\% \times \frac{240}{365} \right) \right] * 20\%, 0 \right\} \\ &= 1.2000 \times \text{Max}\{ [30\% - 9.500\%] * 20\%, 0 \} \\ &= 0.0492 \text{ 元} \end{aligned}$$

则 100,000 份集合计划应计提的业绩报酬为：

$$S = 100,000 \times 0.0492 = 4,920 \text{ 元。}$$

份额持有期限为 195+365+240=800 日，大于 730 日，本次份额的退出费率为 0%：

退出金额=100,000×1.5000=150,000 元；

退出费=（150,000－4920）×0%=0 元；

退出净额=150,000－0－4,920=145,080 元。

（七）拒绝或暂停接受参与的情况及处理方式

在如下情况下，管理人可以拒绝或暂停接受委托人的参与申请：

- 1、推广期内已达到、接近或超过目标规模；
- 2、不可抗力的原因导致集合计划无法正常运行；
- 3、证券交易市场交易时间非正常停市，导致管理人无法计算当日单位净值；
- 4、管理人有适当理由认为继续接受参与可能对现有委托人利益产生损害，以及管理人认为会有损于委托人利益的其他参与；
- 5、管理人、托管人、推广网点或注册登记机构的系统出现故障；
- 6、法律、法规、规章规定的其他情形或其他在资产管理合同已经载明且中国证监会无异议的特殊情形。

如果委托人参与申请被拒绝，被拒绝的参与款项在 3 个工作日内退还委托人，期间不计利息。

（八）巨额退出的认定及处理方法

1、巨额退出的认定

存续期的开放日（T 日），本集合计划净退出申请份额超过上一日集合计划总份额的 10%时，即认为发生了巨额退出。

2、巨额退出的处理方式

出现巨额退出时，管理人可以根据本集合计划当时的资产组合状况决定接受全额退出、部分延期退出或暂停退出。

（1）接受全额退出：当管理人认为有能力支付委托人的全部退出申请时，按正常退出程序执行。

（2）部分顺延退出：当管理人认为支付委托人的退出申请有困难，或认为支付委托人的退出申请进行的资产变现可能使集合计划资产净值发生较大波动时，管理人在当日接受退出比例不低于前一日集合计划总份额10%的前提下，对其余退出申请延期办理。对于当日的退出申请，应当按单个账户退出申请份额占当期全部退出申请份额总量的比例，确定当日办理的退出份额。委托人未能退出部分，除委托人在提交退出申请时明确作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。延缓办理退出部分按照延缓办理日单位净值，逐日支付退出款项，但暂缓期限不得超过正常支付时间20个工作日，并在管理人网站公告。

（3）暂停退出：本集合计划连续两个或以上开放日发生巨额退出时，管理人可以按照说明书和资产管理合同的规定，暂停接受退出申请，但是暂停期限不得超过20个工作日。

（4）巨额退出的公告

当发生巨额退出并采用部分延期退出时，管理人应在T+1日内通过管理人网站通告委托人，并说明有关处理方法。

集合计划连续两个开放日以上（含两个开放日）发生巨额退出导致集合计划的现金支付出现困难，管理人决定暂停接受退出申请的，管理人应当在T+2日内通过管理人网站通告委托人。

（九）大额退出

大额退出需委托人向推广机构提出预约申请，即单个委托人从本集合计划中

一次退出份额达到或超过500万份（含500万份），需在退出日的前5个工作日提出申请，否则管理人和推广机构有权拒绝其退出申请。

十四、集合计划的终止和清算

（一）集合计划应当终止的情形

出现下列情形之一时，本集合计划将终止：

1、管理人因违反法律、行政法规的有关规定，被中国证监会依法撤销证券资产管理业务许可、责令停业整顿，或者因停业、解散、撤销、破产等原因不能履行职责；

2、托管人因解散、破产、撤销、丧失集合资产管理计划托管机构资格、停止营业等事由，不能继续担任集合计划托管人的职务，而无其它托管机构承受其原有权利及义务；

3、集合计划存续期间，委托人人数低于2人（不含管理人）；

4、法律、行政法规、集合资产管理合同及中国证监会规定的其他情形。

（二）资产清算主体

管理人负责在集合计划终止后5个工作日内开始本集合资产管理计划的资产清算，托管人应协同管理人进行必要的清算活动。

（三）清算程序

管理人应按以下程序进行清算：

1、本集合资产管理计划终止后，由管理人对集合计划资产进行清理和确认；

2、对集合计划资产进行评估和变现；

3、聘请具有证券从业资格的会计师事务所进行审计；

4、将清算结果报往中国证监会派出机构备案；

5、将清算结果报告给委托人；

6、对集合计划资产进行分配。按照本部分“（六）资产返还”的规定分配和返还资产。

（四）清算费用

清算费用由管理人优先从清算资产中支付。

（五）终止与清算的报告

集合计划终止的，管理人应当在发生终止情形之日起 5 日内开始清算集合计划资产。清算后的剩余资产，应当按照客户持有计划份额占计划总份额的比例，以货币资金的形式全部分配给客户。

管理人应当在清算结束后 15 日内，将清算结果报住所地中国证监会派出机构备案。

（六）资产返还

在合同有效期内，如本计划终止，集合计划在终止之日起 15 个工作日内，管理人和托管人按照说明书和资产管理合同，在扣除管理费、托管费、业绩报酬、清算费等费用后，把集合计划资产按照委托人持有份额的比例，以货币形式分派给委托人。如因集合计划所持有证券因证券停牌、处于限售状态等原因无法及时变现而导致集合计划资产无法一次性返还给委托人，管理人在集合计划终止后先对已变现资产进行清算，并在集合计划终止之日起 15 个工作日内将已变现资产按照委托人持有份额的比例，以货币形式分派给委托人。管理人在尚未变现的证券能够变现之日起的 20 个工作日内将所持有的该证券变现，当集合计划所有资产全部变现后，再进行二次清算并将剩余资产在集合计划所有资产全部变现后 15 个工作日内按照委托人持有份额的比例，以货币形式分派给委托人。

（七）清算账册及文件的保存

集合资产管理计划清算账册及有关文件由托管人按相关法律法规规定年限妥善保存。

十五、风险揭示及相应风险防范措施

本集合计划面临的风险主要有：市场风险、管理风险、流动性风险及其他风险等。相关风险揭示及防范措施详见本计划说明书“风险揭示及相应风险防范措施”部分。

十六、不可抗力

在本合同履行中因不可抗力导致本合同目的无法实现时，当事人均可依法免除相应责任。不可抗力指任何无法预见、无法避免并无法克服的客观情况，包括

但不限于地震、台风、火灾、水灾等自然灾害，以及罢工、政治动乱、战争、法律法规变化、突发停电或其他突发事件导致证券交易所非正常暂停或停止交易等事件。

十七、违约责任与争议处理

（一）违约责任

由于合同当事人过错，造成本合同不能履行或者不能完全履行的，由有过错的一方承担违约责任；如当事人均有过错的，各自承担应负的责任。

（二）争议的处理

因履行本合同发生的争议，由当事人协商解决，协商不成的，提交武汉市有管辖权的法院管辖。

（三）在发生以下情况时，管理人和托管人可以免责

1、管理人按照本合同约定的投资方向和内容如实履行投资运作职责但本集合计划资产却未能实现盈利的；

2、托管人按照本合同和托管协议约定履行了托管职责，对于由此导致的集合计划资产损失不承担责任；

3、发生本合同规定的不可抗力事项的；

4、按照本集合计划估值方法得出的估值与其他估值方法得出的估值有偏差的（具体关于估值的规定详见本计划说明书“集合计划的资产估值”）；

5、涉及集合计划及投资者自身的税务事项及其潜在风险的；

6、管理人或托管人任一方不因另一方的失职行为而给集合计划财产或委托人造成的损失向委托人承担连带责任。

十八、合同的成立与生效

本合同已加盖管理人、托管人公章，经委托人以电子合同、电子签名方式签署后即告成立。本合同同时满足以下二个条件时生效：

1、委托人首次将参与资金划入管理人指定账户并经管理人确认；

2、本集合计划成立。

集合计划终止时，合同终止。但本合同项下的清算条款、违约责任条款、争

议解决条款仍然有效。

本合同文本已由管理人在公证机关办理公证，作为证明本合同内容的唯一依据。集合计划说明书是本合同的组成部分。与合同具有同等法律效力。本合同签署地为管理人注册地。

本合同生效后，任何一方都不得单方解除本合同。

未经其他两方同意，任何一方不得擅自变更、篡改本合同内容。经三方一致同意修改或增补本合同的，仍可采用电子合同、电子签名的方式签订相关修改文本。修改内容如须中国证监会批准，则修改文件于批准后生效。

本合同委托人可登陆推广机构指定网站查阅。

本合同壹式陆份，管理人、托管人各执贰份，其余按照有关监管部门的要求备案，每份均具有同等法律效力。

十九、合同的补充与修改

（一）合同修改的原则

1、委托人、管理人、托管人不得通过签订补充协议、修改合同等方式，约定保证集合计划资产投资收益、承担投资损失，或排除委托人自行承担投资风险和损失。

2、任何对本合同及说明书相关内容的修改及其变更方案，除非本合同有明确约定，均需先征得管理人、托管人、委托人一致书面同意，并报管理人住所地中国证监会派出机构备案，如果修改或变更内容涉及以下内容时，需报送中国证监会批准同意：

- （1）集合计划投资范围、投资比例；
- （2）管理人、托管人的报酬标准；
- （3）管理人、托管人；
- （4）中国证监会规定的其他事项。

（二）合同修改的前提

1、若修改或变更内容需要报送证监会批准同意，管理人须事先征求证监会批准同意。

2、集合计划符合合同规定的成立条件。

3、修改或变更合同及说明书须征得所有委托人的一致书面或电子方式同意。

4、法律法规规定的其他条件。

（三）合同修改的程序

1、管理人将修改或变更的内容在其指定的网站公告，并通过电子邮件、电话、手机短信平台等方式通知委托人，征求委托人对修改或变更合同及说明书的意见。以自通知之日起的三十个工作日内作为意见征求期间。

2、意见征求期间，集合计划照常运行。委托人可以在合同规定的开放日申请参与或退出本集合计划。申请参与的委托人在参与时需签署原合同（再次参与的不用另行签署）并书面或电子方式同意修改或变更合同及说明书。

3、当持有本集合计划份额的全体委托人均表示同意修改或变更合同及说明书时，并且集合计划符合存续条件（委托人人数不少于2人（不含管理人）），管理人方可修改或变更合同及说明书的内容。管理人于意见征求期间结束后五个工作日内在其指定的网站上公告并生效，同时将经修改或变更的本合同及说明书文本公布于公司网站供委托人查阅。

（四）集合计划存续期内当法律法规或有关政策发生变化时，管理人有权对本集合计划合同及说明书与新的法律法规或有关政策不一致的内容进行更新或修改，更新或修改的内容不得违反法律法规和中国证监会的有关规定，管理人应将更新或修改内容按照有关规定报中国证监会批准（或备案）。

更新或修改的内容在指定网站公告后5个工作日生效。如果委托人不同意对本合同进行修改或变更的，有权在管理人对修改或变更的内容进行公告后的任一开放日内按照合同规定的退出程序申请退出集合计划。

由于管理人单方变更合同引发的纠纷由管理人负责解决并承担法律责任，托管人应提供必要的协助。

二十、委托人、管理人、托管人签章及时间

委托人知晓并确认：管理人、托管人已向委托人明确说明集合计划的风险，不保证委托人资产本金不受损失或者取得最低收益；集合计划说明书是合同的组成部分，与合同具有同等法律效力；委托人确认，已经认真阅读了本合同和说明书的全部条款，充分理解了全部内容，并自行承担风险和损失。

本页无正文，为《资产管理合同》签字页。

委托人确认，已经认真阅读了资产管理合同和说明书的全部条款以及风险揭示书，充分理解了全部内容，并自行承担投资风险。委托人承诺，向集合计划推广机构提供的信息和资料均属真实。

委托人（签字）：

（盖章）：

管理人：长江证券股份有限公司（公章）

法定代表人或授权代表：（签字）

托管人：招商银行股份有限公司（公章）

法定代表人或授权代表：（签字）

签订日：二〇〇九年 月 日