

创盈大岩 aShares500 集合资产管理计划
集合资产管理合同

管理人：第一创业证券股份有限公司

托管人：交通银行股份有限公司深圳分行

2018年8月

目 录

一、前言	3
二、释义	4
三、本合同当事人	8
四、本计划的基本情况	9
五、本计划的参与和退出	15
六、管理人自有资金参与本计划	22
七、本计划的分级	24
八、本计划的管理方式和管理权限	24
九、本计划的成立	25
十、本计划账户与资产	26
十一、本计划资产托管	27
十二、本计划的估值	27
十三、本计划的费用、业绩报酬和税收	36
十四、本计划的收益分配	41
十五、投资理念与投资策略	41
十六、投资决策与风险控制	43
十七、投资限制及禁止行为	48
十八、本计划的信息披露	50
十九、本计划份额的转让、非交易过户和冻结	53
二十、本计划的展期	53
二十一、本计划终止和清算	55
二十二、当事人的权利和义务	58
二十三、违约责任与争议处理	63
二十四、风险揭示	65
二十五、本合同的成立与生效	71
二十六、合同的补充、修改与变更	72
二十七、或有事件	73

特别约定：本《创盈大岩 aShares500 集合资产管理计划集合资产管理合同》（以下简称“本合同”或“集合资产管理合同”）以电子签名或纸质合同手写签名、盖章方式签订，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(即创盈大岩 aShares500 集合资产管理计划的投资者)作为本合同一方，以电子签名或纸质合同手写签名、盖章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。

委托人、管理人、托管人同意遵守《电子签名法》、《证券公司资产管理电子签名合同操作指引》的有关规定，三方一致同意委托人自签署《电子签名约定书》之日起，委托人以电子签名方式接受电子签名合同（即本合同、集合计划说明书）、风险揭示书或其他文书的，视为签署本合同、集合计划说明书、风险揭示书或其他文书，与在纸质合同、纸质风险揭示书或其他文书上手写签名或者盖章具有同等的法律效力，无须另行签署纸质合同、纸质风险揭示书或其他文书。管理人同意向托管人提供中国证券登记结算公司电子合同签署有关委托人信息，供托管人完成电子合同签署的相关流程。

一、前言

为规范创盈大岩 aShares500 集合资产管理计划(以下简称“集合计划”或“本计划”)运作,明确《创盈大岩 aShares500 集合资产管理计划集合资产管理合同》(以下简称“本合同”)当事人的权利与义务,依照《中华人民共和国合同法》、《证券公司客户资产管理业务管理办法》、《证券公司集合资产管理业务实施细则》、《证券期货经营机构私募资产管理业务运作管理暂行规定》、《证券公司客户资产管理业务规范》、《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》等法律法规、中国证监会、中国证券业协会及中国证券投资基金业协会的有关规定,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,当事人按照上述相关法律法规、本合同、《创盈大岩 aShares500 集合资产管理计划说明书》(以下简称“本计划说明书”、“说明书”)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本计划,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,并已阅知本合同和本计划说明书全文,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计划资产,但不保证本计划一定盈利,不保证本集合计划资产投资不受损失,也不保证最低收益。

委托人和管理人承诺其知悉《中华人民共和国反洗钱法》、《金融机构报告涉嫌恐怖融资的可疑交易管理办法》、《金融机构客户身份识别和客户身份资料及交易记录保存管理办法》、《金融机构大额交易和可疑交易报告管理办法》等反洗钱相关法律法规的规定,将严格遵守上述规定,不会违反任何前述规定;承诺用于非证券投资的资金来源不属于违法犯罪所得及其收益;承诺非证券投资的资金来源和去向不涉及洗钱、恐怖

融资和逃税等行为；承诺出示真实有效的身份证件或者其他身份证明文件，提供真实有效的业务性质与股权或者控制权结构、收益所有人信息等资料；承诺积极履行反洗钱职责，不借助本业务进行洗钱等违法犯罪活动。

委托人和管理人承诺，其不属于中国有权机关、联合国、欧盟或美国制裁名单内的企业或个人，不位于被中国有权机关、联合国、欧盟或美国制裁的国家和地区。

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

二、释义

本合同中除非文义另有所指，下列简称或名词具有如下含义：

集合资产管理计划、本集合计划、集合计划、本计划：指创盈大岩 aShares500 集合资产管理计划；

集合计划说明书、本计划说明书、说明书：指《创盈大岩 aShares500 集合资产管理计划说明书》及对说明书的任何有效的修订和补充；

集合资产管理合同、资产管理合同、本合同：指《创盈大岩 aShares500 集合资产管理计划集合资产管理合同》及对该合同的任何有效的修订和补充；

托管协议：指《创盈大岩 aShares500 集合资产管理计划托管协议》及对该协议的任何有效的修订和补充；

风险揭示书：指《创盈大岩 aShares500 集合资产管理计划风险揭示书》；

《管理办法》：指 2013 年 6 月 26 日中国证监会发布并施行的《证券公司客户资产

管理业务管理办法》及其不时做出的修订和补充；

《实施细则》、《细则》：指 2013 年 6 月 26 日中国证监会发布并施行的《证券公司集合资产管理业务实施细则》及其不时做出的修订和补充；

《规范》：指 2012 年 10 月 19 日中国证券业协会发布并施行的《证券公司客户资产管理业务规范》及其不时做出的修订和补充；

《暂行规定》：指 2016 年 7 月 14 日中国证监会发布并于 2016 年 7 月 18 日施行的《证券期货经营机构私募资产管理业务运作管理暂行规定》及其不时做出的修订和补充；

《指导意见》：指 2018 年 4 月 27 日经国务院同意，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、国家外汇管理局联合印发的《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》及其不时做出的修订和补充；

中国证监会、证监会：指中国证券监督管理委员会；

集合资产管理合同当事人：指受集合资产管理合同约定，根据集合资产管理合同享有权利并承担义务的集合计划管理人、集合计划托管人和委托人；

集合计划管理人、管理人：指第一创业证券股份有限公司，也简称“第一创业证券”；

集合计划托管人、托管人：指交通银行股份有限公司深圳分行，也简称“交行深圳分行”；

推广机构：指第一创业证券股份有限公司，及其他符合相应资格条件的、经管理人委托的、代理推广被集合资产管理计划的机构；

注册登记机构：指办理登记、存管、过户、清算和结算等注册登记业务的机构。本集合计划的注册登记机构为第一创业证券股份有限公司；

委托人：指依据集合资产管理合同和集合计划说明书参与本集合计划并符合监管规

则要求的合格投资者，包括个人投资者和机构投资者；

个人投资者：指依据中华人民共和国有关法律法规、监管规定可以投资于本集合资产管理计划的自然人合格投资者；

机构投资者：指依法可以投资本集合资产管理计划，在中华人民共和国境内合法注册登记或经有关政府部门批准设立的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织（包括受国务院金融监督管理机构或其授权机构监管的机构依法设立并管理的投资计划）；

合格投资者：是指具备相应风险识别能力和承担所投资集合资产管理计划风险能力且符合《证券期货投资者适当性管理办法》、《证券公司资产管理业务管理办法》、《证券公司集合资产管理业务实施细则》等法律法规和监管规定要求的合格个人和机构投资者；

份额持有人、持有人：指通过签订集合资产管理合同取得和持有本集合计划份额的委托人；

集合计划成立日：指集合计划经过推广达到集合计划说明书和集合资产管理合同规定的成立条件后，管理人公告集合计划成立的日期；

推广期：指自集合计划推广募集的时间，具体推广时间以本集合计划推广公告为准；

开放期：指投资者可以办理本集合计划参与或退出等业务的工作日；

封闭期：指本集合计划成立后的封闭时间段，封闭期内不办理参与、退出业务；

存续期：指本集合计划成立并存续的时间，本集合计划的存续期指本集合计划的公告成立日至计划终止之日；

工作日：指上海证券交易所和深圳证券交易所等相关交易所的正常交易日；

T日：指办理本集合计划业务申请的工作日；

T+n 日（n 指任意正整数）：指 T 日后的第 n 个工作日；

天：指自然日；

会计年度：指公历每年 1 月 1 日至 12 月 31 日；

参与：指委托人申请购买本集合计划份额的行为；

首次参与：指委托人在参与之前未持有过本集合计划份额的情形；

退出：指委托人按集合计划合同约定的条件收回全部或部分委托资产的行为；

计划收益：指本集合计划投资所得的红利、股息、债券利息、买卖证券价差、银行存款利息及其他合法收入；

集合计划份额、计划份额、份额：指集合计划的最小单位；

元：指人民币元；

计划单位面值、单位面值：人民币 1.00 元；

集合计划资产总值、计划资产总值：指集合计划所投资各类有价证券、银行存款本息、集合计划各项应收款以及其他资产所形成的价值总和；

集合计划资产净值、计划资产净值：指集合计划资产总值减去负债后的净资产值；

计划单位净值、单位净值：指计算日集合计划资产净值除以计算日集合计划总份额的金额；

计划累计单位净值、累计净值：指集合计划单位净值与集合计划份额累计分红之和；

计划资产估值：指计算评估本集合计划资产和负债的价值，以确定本集合计划资产净值的过程；

不可抗力：不可抗力是指本合同当事人无法预见、无法克服、无法避免，且在本合同生效之后发生的，使本合同当事人无法全部或部分履行本合同的任何事件，包括但不

限于洪水、地震及其他自然灾害、战争、骚乱、火灾、政府征用、没收、法律法规及监管规则变化、证券交易场所非正常暂停或停止交易和其他突发事件等；

关联关系：本计划说明书和本合同所指关联方关系的含义与《企业会计准则第 36 号——关联方披露》中的关联方关系的含义相同；

管理人网站、管理人指定网站：指 www.firstcapital.com.cn，管理人指定网站变更时以管理人公告为准。

电子签名方式：指按照《证券公司资产管理电子签名合同操作指引》规定，证券公司集合资产管理计划的委托人、管理人和托管人之间通过电子信息网络以电子形式达成的资产管理合同。本计划资产管理合同的签署采用电子签名方式或纸质合同手写签名、盖章方式。

电子签名约定书：指中国证券业协会颁布的《证券公司资产管理电子签名合同操作指引》第八条所要求的文件。

三、本合同当事人

1、委托人

个人填写：

姓名： 证件类型： 证件号码：

通信地址： 邮政编码：

联系电话： 移动电话： 电子信箱：

其他：

机构填写：

机构名称： 法定代表人：

通信地址： 邮政编码：

代理人姓名： 身份证号码：

联系电话： 其他：

2、管理人

机构名称：第一创业证券股份有限公司

法定代表人：刘学民

住所地：深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 20 层

邮政编码：518048

联系电话：0755-23838362

3、托管人

机构名称：交通银行股份有限公司深圳分行

法定代表人：陈瑜

住所地：深圳市福田区深南中路 3018 号交通银行大厦 13F

邮政编码：518048

联系电话：0755-88020360

四、本计划的基本情况

(一) 名称：创盈大岩 aShares500 集合资产管理计划

(二) 产品类型：权益类集合资产管理计划

(三) 目标规模及人数限制

本集合计划推广期规模上限为 50 亿份，存续期不设目标规模上限。推广期规模上

限不含参与资金利息转增份额。

管理人有权根据实际情况调整推广期及存续期规模上限,并在管理人指定网站公告。

本集合计划的总参与人数为 2 人以上(含) 200 人以下。

(四) 投资范围和投资比例

1、投资范围

本集合计划可投资于法律法规及监管规则允许证券公司集合资产管理计划投资的权益类资产、固定收益类资产、现金类资产、金融衍生品及中国证监会认可的其他投资品种:

(1) 权益类资产: 国内依法发行并在证券交易所交易的股票(含主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的 A 股股票, 含且不限于二级市场股票、新股发行等)、沪港股票市场交易互联互通机制允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票(“沪港通标的股票”)、深港股票市场交易互联互通机制允许买卖的规定范围内的香港联合交易所市场的股票(“深港通标的股票”)、证券投资基金(含股票型基金、混合型基金, 运作方式包括但不限于契约型开放式、契约型封闭式、上市开放式、交易型开放式及分级基金等);

(2) 固定收益类资产: 在银行间市场和交易所交易的国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债、金融债、次级债、企业债、公司债、短期融资券、超短期融资券、中期票据、可转债、可交换债、非公开定向债务融资工具(PPN)、债券型基金;

(3) 现金类资产: 包括现金、银行存款(包括银行活期存款、银行定期存款和银行协议存款等各类存款)、货币市场基金;

(4) 金融衍生品: 股指期货、国债期货;

(5) 本集合计划可参与债券回购（含正回购、逆回购）交易；

(6) 若后续相关法律法规或者监管规则允许集合资产管理计划投资于中国存托凭证（CDR）的，则本集合计划可以投资于中国存托凭证（CDR），且应当遵守相关的法律法规及监管规则对于中国存托凭证（CDR）的投资限制、投资比例和风控指标等具体要求，在投资前将跟托管方沟通确认估值相关事宜。

2、资产配置比例

(1) 权益类资产：占资产净值比例不低于 80%；

(2) 固定收益类（含现金类资产）资产：占资产净值比例不超过 20%；

(3) 参与证券回购融入资金余额不得超过集合计划资产净值的 40%，参与证券逆回购资金余额不得超过集合计划上一个工作日资产净值的 100%，中国证监会另有规定的除外。

(4) 金融衍生品：

I、在任一交易日日终， $[\text{股指期货空头合约价值} - \text{股指期货多头合约价值} - \text{权益类证券市值（股票、股票型基金等）}] / \text{资产净值}$ 的比例不得超出 20%；

II、在任一交易日日终， $(\text{股指期货多头合约价值} + \text{权益类资产市值}) / \text{资产净值}$ 的比例不得超出 130%；

III、在任一交易日日终，国债期货多头合约价值占资产净值比例不超过 30%，空头合约价值占资产净值比例不超过 30%。

上述 I、II、III 项由资产管理人自行监控。

本计划将在合同生效之日起六个月内使计划的投资组合比例符合合同的有关约定。如因证券市场波动、证券发行人合并、资产管理计划规模变动等证券公司之外的因素，

造成本计划投资比例超标，管理人应在超标发生之日起在具备交易条件的 10 个交易日内将投资比例降至许可范围内。如遇限售期等原因导致交易条件不具备，则上述期限自动顺延，具体顺延时间由管理人确定。

委托人在此同意授权管理人可以将本计划的资产投资于管理人及与管理人有关联关系的公司发行的证券或承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易。在发生上述所列投资证券事项时，管理人按照法律法规及中国证监会的有关规定，应当将交易结果告知托管人，同时向证券交易所报告，通过资产管理季度报告向委托人披露。

法律法规或中国证监会允许集合计划投资其他品种的，资产管理人在履行合同变更程序后，可以将其纳入本计划的投资范围。

（五）管理期限

本集合计划的存续期限为自成立之日起 8 年，在符合本集合计划合同约定的展期条件下可展期。但当本集合计划出现应当终止的情形时，本集合计划将终止并进行清算。

（六）封闭期、开放期及流动性安排

1、封闭期：指本集合计划成立日起不办理参与、退出的时间，本计划除约定的开放期外，均为封闭期。

2、开放期：本集合计划存续期内每年的 3 月、6 月、9 月、12 月的 20 日为开放日（如遇非工作日则自动顺延至下一工作日），委托人可在开放日内办理参与和/或退出业务。若自本集合计划自成立之日起至最近的开放日不满 90 天的，则以下一个开放日作为本集合计划的首个开放日。例如若本集合计划成立于 2018 年 7 月 19 日，距离成立日最近的开放日为 2018 年 9 月 20 日，不满 90 天，则以 2018 年 12 月 20 日作为本集合计划首个开放日。

管理人有权根据本集合计划运作的实际情况、净值表现及其他特殊需要设立临时开放期供委托人申购和/或赎回，管理人设立临时开放期的，应至少提前 1 个工作日以公告的方式告知委托人。

3、流动性安排：本计划在开放日将保留适当比例的现金类资产，包括到期日在一年以内（含一年期）的国债、期限在 7 天以内（含 7 天）的债券逆回购、货币市场基金、银行存款和现金（包括结算备付金）等，以应对委托人的退出需求。

（七）本计划份额面值

本计划份额的面值为人民币 1.00 元。

（八）参与本计划的最低金额

首次参与的最低金额为人民币 100 万元（含认购/申购费），追加参与的最低金额为人民币 1 万元（含认购/申购费），追加资金不设级差。管理人可以根据情况设置和调整最低参与金额（但不得低于人民币 100 万元）并提前披露。

（九）本计划的风险收益特征及适合推广对象

本计划属于【中高】风险等级产品，适合合格的专业投资者及风险承受能力为【C4（积极型）】及以上的合格投资者。

（十）本计划的推广

1、推广时间：本计划推广时间由管理人发布的推广公告约定。

2、推广机构：第一创业证券股份有限公司及其他符合相应资格条件的、经管理人委托的、代理推广本集合资产管理计划的机构。

管理人可根据有关法律法规的要求，选择其他符合要求的推广机构代理销售本计划。若管理人认为有必要变更推广机构的，委托人和托管人同意管理人在管理人网站公告后

即变更生效。

3、推广方式

管理人及推广机构应将本合同、本计划说明书等正式推广文件，以纸质或电子方式置备于推广机构营业场所。管理人及推广机构应当了解客户的投资需求和风险偏好，详细介绍产品特点并充分揭示风险，推荐与客户风险承受能力相匹配的集合计划，引导客户审慎作出投资决定。禁止通过签订保本保底补充协议等方式，或者采用虚假宣传、夸大预期收益和商业贿赂等不正当手段推广集合计划。

管理人及推广机构应当采取有效措施，并通过管理人、中国证券投资基金业协会、中国证监会电子化信息披露平台或者中国证监会认可的其他信息披露平台，客观准确披露集合计划备案信息、风险收益特征、投诉电话等，使客户详尽了解本计划的特性、风险等情况及客户的权利、义务，但不得通过广播、电视、报刊及其他公共媒体向不特定对象推广本计划。

（十一）本计划的各项费用

1、 认购/申购费：

认购/申购金额 (M)	M<300 万	M≥300 万
认购/申购费率	1%	0%

2、退出费：本计划不收取退出费；

3、管理费：【1.5】%/年；

4、托管费：【0.02】%/年；

5、业绩报酬：本集合计划在一定情况下收取业绩报酬，具体参见本计划资管合同“十三、本计划的费用、业绩报酬和税收”；

- 6、 证券交易费用；
- 7、 与本计划存续期相关的费用；
- 8、 其他费用（如有）。

上述费用详情请见本计划资管合同“五、本计划的参与和退出”和“十三、本计划的费用、业绩报酬和税收”。

五、本计划的参与和退出

（一）本计划的参与

1、参与的办理时间

认购在推广期内办理，申购在申购开放期办理。按推广机构指定营业网点或直销柜台的具体安排办理。

2、参与的原则

（1）投资者参与本计划必须是合格投资者，本集合计划可接受的投资者人数上限为 200 人；

（2）“金额参与，全额预缴”原则，即委托人以现金方式参与本集合计划，并缴足申请参与的现金金额。委托人交付款项，参与申请即为有效；

（3）认购价格为份额面值，申购价格为开放期内受理参与申请当日的集合计划单位净值；

（4）委托人首次参与集合计划的最低认购/申购金额（含认购/申购费）为 100 万元，委托人可以多次参与本计划，多次参与的最低金额为 1 万元（含认购/申购费）。计划的参与申请一经提交，当日参与申请可以（且只能）在申请当日内撤销。在推广期

或存续期内单个委托人的累计认购规模仅受本计划总目标规模的限制；

(5) 在推广期或存续期，当集合计划募集或参与规模接近或达到约定的规模上限时，管理人可自次日起暂停接受参与申请。

3、参与的程序和确认

(1) 投资者按推广机构指定营业网点的具体安排，在规定的交易时间段内办理；

(2) 投资者应开设推广机构认可的交易账户，并在交易账户备足参与的货币资金；若交易账户内参与资金不足，推广机构不受理该笔参与申请；

(3) 投资者同意以书面签名或电子签名方式签署本合同后，方可通过推广机构的交易系统申请参与集合计划。参与申请经管理人确认后，构成本合同的有效组成部分；

(4) 投资者参与申请经注册登记机构确认后，其参与申请和参与资金不得撤销；

(5) 投资者在推广期提交参与申请后，可于推广期结束后的 2 个工作日后在办理参与的网点查询参与确认情况。在开放期提交的参与申请，可于提交日后的 2 个工作日后在办理参与的网点查询参与确认情况。

(6) 在 T 日参与申请全额确认后规模超过集合计划规定的规模上限时，管理人可自次日 (T+1) 起暂停接受参与申请，对当日 (T 日) 已提交的参与申请，注册登记机构根据“时间优先、金额优先、申请单号优先”的先后原则逐笔确认，即相同时间金额大者优先确认；相同金额申请单号小者优先确认。未确认部分的参与资金、由销售机构退还到委托人账户中。以上处理规则适用于推广期超额募集与存续期超额申购。

(7) 投资者同意，参与申请的情况以管理人确认的结果为准。管理人有权根据对

客户风险承受能力、适当性的判断和本计划资金募集或投资的需要，拒绝某投资者的参与，管理人不承担因拒绝投资者参与本计划而导致的责任。

4、参与费及参与份额的计算

(1) 参与费

本集合计划的认购/申购费率如下：

认购/申购金额 (M)	M<300 万	M≥300 万
认购/申购费率	1%	0%

(2) 参与份额的计算方法

A: 认购份额的计算方法

净认购金额=认购金额÷(1+认购费率)

认购费用=认购金额-净认购金额

认购份额=(净认购金额+应计利息)÷推广期认购价格

B: 申购份额的计算方法

净申购金额=申购金额÷(1+申购费率)

申购费用=申购金额-净申购金额

申购份额=净申购金额÷开放日申购价格

注：投资者参与份额以四舍五入的方法保留小数点后两位，由此产生的差额部分计入本计划资产；多笔参与时，按上述公式逐笔计算。

5、参与资金利息的处理方式

投资者的参与资金在推广期产生的利息将折算成计划份额归委托人所有。参与资金利息以注册登记系统的确认结果为准。

6、拒绝或暂停参与的情况及处理方式

如出现如下情形，本计划管理人可以拒绝或暂停投资者的参与申请：

- (1) 不可抗力的原因导致本计划无法正常运作；
- (2) 本计划出现或可能出现超额募集情况；
- (3) 本计划管理人、本计划托管人或注册登记机构的技术保障或人员支持等不充分；
- (4) 推广机构对投资者资金来源表示疑虑，投资者不能提供充分证明的；
- (5) 本计划管理人认为会有损于现有本计划委托人利益；
- (6) 证券交易所在交易时间非正常停市；
- (7) 发生集合资产管理合同约定的暂停集合计划资产估值情况；
- (8) 本合同、法律法规或中国证监会认定的其它可拒绝或暂停参与的情形。

(二) 本计划的退出

1、退出的办理时间

委托人可通过原参与集合计划推广机构柜台系统或登录原推广机构的网络系统办理所持有份额的部分或全部退出手续。

退出在退出开放期办理。

2、退出的原则

- (1) “未知价”原则，退出份额以办理退出日（T 日）的退出价格作为计价基准进行退出金额计算；
- (2) “份额退出”原则，即退出以份额计算；
- (3) “先进先出”原则，即按照委托人份额参与的先后次序进行顺序退出的方式

确定退出份额；

(4) 委托人部分退出时，持有剩余份额不能低于 500,000 份；

(5) 委托人申请退出时，退出申请一经提交，可以（且只能）在当日交易时间内撤销。

管理人可根据集合资产管理计划运作的实际情况并不影响委托人实质利益的前提下调整上述原则。集合计划管理人必须在新规则开始实施前在管理人网站公告告知委托人。

3、退出的程序和确认

(1) 退出的确认

若根据管理人公告的退出安排，委托人申请退出的，则委托人必须根据本集合计划推广机构网点和直销柜台规定的手续，在开放期的业务办理时间内向推广机构网点或直销柜台提出退出申请。申请退出份额数量超过委托人持有份额数量时，申请无效。

管理人在退出日的下一工作日对退出交易的有效性进行确认。委托人可在 T+2 日（包括该日）之后到推广机构网点或直销柜台取得 T 日退出申请成交确认单，若交易不成功或数据不符，委托人可与为其办理手续的推广机构网点或直销柜台人员联系并进行核实。

(2) 退出款项划付

若注册登记机构确认退出办理成功，退出款项于 T+2 日内从托管账户中划出。在发生大额退出或巨额退出的情形时，款项的支付方法按照本合同的有关条款处理。如集合计划出现暂停估值的情形时，管理人与托管人协商后，可以将划拨日期相应顺延。

4、退出费及退出金额的计算

(1) 本计划不收取退出费。

(2) 退出金额的计算公式

退出总额=退出份额×退出申请日（T日）计划单位份额净值

退出金额=退出总额-管理人业绩报酬

退出金额结果按照四舍五入方法，保留小数点后两位，多笔退出时，按上述公式进行逐笔计算。

5、退出的限制与次数

本集合计划无其他退出的限制与次数安排。

6、单个委托人大额退出的认定、申请和处理方式

本集合计划无大额退出安排。

7、巨额退出的认定和处理方式

(1) 巨额退出的认定

单个开放日中，计划净退出申请的份额（退出总份额扣除参与总份额后的余额）超过计划上一日总份额的 20%时，即认为本计划发生了巨额退出。

(2) 巨额退出的处理方式

当出现巨额退出时，计划管理人可以根据集合计划当时的资产组合状况决定全额退出、部分顺延退出。巨额退出的价格由受理申请当日的计划单位净值决定。

全额退出：当集合计划管理人认为有能力支付委托人的退出申请时，按正常退出程序执行。

部分顺延退出：当集合计划支付委托人的退出申请存在流动性困难或可能会对集合计划的资产净值造成较大波动时，管理人在当日正常接受的退出份额不低于上一日集合计划总份额的 20%的前提下，对其余退出申请延期办理。对于当日的退出申请，按单

个账户退出申请量占退出申请总量的比例，确定当日受理的退出份额；计划持有人可在申请退出时选择将当日未获受理部分予以撤销，如持有人不撤销未获处理部分，未受理部分自动延迟至下一个工作日办理。转入下一个工作日的退出申请不享有优先权，并以该工作日的集合计划单位资产净值为依据计算退出金额，以此类推，直到全部退出为止。

(3) 告知客户的方式

当集合计划出现巨额退出并发生部分顺延退出的，管理人应及时在管理人网站上公告。

8、连续巨额退出的认定和处理方式

(1) 连续巨额退出的认定

如果计划连续两个开放日以上发生巨额退出，即认为发生了连续巨额退出。

(2) 连续巨额退出的处理方式

暂停退出：集合计划发生连续巨额退出的，如集合计划支付委托人的退出申请存在流动性困难或可能会对集合计划的资产净值造成较大波动，管理人可以暂停接受退出申请；已经接受的退出申请可以延缓支付退出款项。暂停和延缓期限不得超过 20 个工作日。连续巨额退出的价格由受理申请当日的计划单位净值决定。

(3) 告知客户的方式

当集合计划出现连续巨额退出并发生暂停退出的，管理人应及时在管理人网站上公告。

9、拒绝或暂停退出的情形及处理

发生下列情形时，管理人可以拒绝或暂停委托人的退出：

(1) 不可抗力的原因导致集合计划无法正常运作；

(2) 证券交易场所交易时间非正常停市，导致当日集合计划资产净值无法计算；

(3) 管理人认为某笔或某些退出可能会影响或损害现有委托人利益时；

(4) 因市场剧烈波动或者其他原因导致本集合计划的现金出现困难无法全额满足委托人的退出申请时，管理人可以暂停办理本集合计划的退出；

(5) 法律、行政法规和中国证监会认定的其他情形或其他在说明书、资产管理合同中已载明且中国证监会无异议的特殊情形。

拒绝或暂停受理退出的方式包括：

管理人将在当日立即公告。已接受的退出申请，若管理人有足额支付能力，则管理人将足额支付；如暂时不能足额支付的，将以产品持有的现金资产量为限按每个退出申请人已被接受的退出申请量占已接受退出申请总量的比例分配给退出申请人，其余部分在后续工作日予以兑付。

如果发生暂停退出，在暂停结束重新开放退出时，管理人将提前在管理人网站对重新开放退出进行公告。

发生本合同未予载明的事项，但集合计划管理人有正当理由认为需要暂停接受集合计划退出申请的，应向委托人披露。

委托人认可上述关于退出的原则及处理方法，接受管理人依据法律法规及本合同的约定所做出的延期退出或暂停退出的决定。

六、管理人自有资金参与本计划

(一) 自有资金的参与时间与比例

管理人可在本计划推广期和存续期间以自有资金参与本计划，管理人自有资金持有

本计划份额不超过本计划总份额（含管理人自有资金参与部分）的 16%。

（二）自有资金的收益分配和责任承担方式

管理人持有计划份额与委托人持有计划份额享有同等参与收益分配的权利，也承担与计划份额相对应损失的责任。管理人投入自有资金参与集合计划份额不承担任何补偿责任。

（三）自有资金参与、退出的条件

在同时满足以下条件且符合本合同约定时，管理人自有资金可以参与、退出本计划：

- 1、管理人投入的自有资金参与份额持有期限满 6 个月后，可以退出本计划；
- 2、管理人自有资金参与、退出本计划时应当提前 5 日通过管理人网站公告的方式通知客户，并通知托管人。

但在发生以下特殊情形时，管理人自有资金参与、退出可以不受上述条件限制，但事后管理人应及时将自有资金参与、退出情况告知委托人和托管人，并向所在地中国证监会派出机构及中国证券投资基金业协会报告：

（1）因规模变动等客观因素导致管理人自有资金持有份额比例被动超限或可能被动超限（即超过本计划总份额 16%）。

管理人在发生上述超限情形之日起 5 个工作日内退出超限部分的参与份额，5 个工作日后仍超限的，管理人将在其后 5 个工作日处理。

（2）为解决流动性风险，在不存在利益冲突并遵守合同约定的前提下，管理人自有资金参与、退出本计划。

（四）风险揭示

（1）管理人以自有资金参与本集合计划的份额，享有与其他委托人份额相同的收

益分配权，且不对集合计划委托人承担任何补偿责任。请投资者注意投资风险。

(2) 管理人自有资金退出，可能遭遇流动性风险，从而影响本计划损益。管理人将认真履行管理人职责，关注本计划规模变动情况，控制流动性风险。

七、本计划的分级

本集合计划是否根据风险收益特征进行分级：否。

八、本计划的管理方式和管理权限

(一) 管理方式

管理人与不少于 2 个委托人统一签订资产管理合同，设立本集合计划，通过专门账户对客户资产进行集中运营管理。

(二) 管理权限

本计划的客户资产投资运作由第一创业证券股份有限公司担任管理人，管理人对本计划进行管理的权限来源为法律法规、本合同、本计划说明书。

(三) 聘用第三方机构提供专业服务的说明

本计划将聘用深圳嘉石大岩资本管理有限公司提供投资决策相关专业服务。

深圳嘉石大岩资本管理有限公司（以下称“大岩资本”或“公司”）于 2013 年 6 月成立。2014 年 4 月，公司在中国证券投资基金业协会登记为私募投资基金管理人。该公司注册地位于深圳，由汪义平博士为首的专业团队创建。大岩资本拥有经验丰富的投研团队，自创形成严密的科学投资体系，在国内外丰富的投资实践中广受市场认可。

深圳嘉石大岩资本管理有限公司作为本集合计划的投资顾问仅为本集合计划提供投资建议及研究服务，包括提供投资策略、研究报告、资产配置分析、投资组合业绩分析、投资建议等，不实施投资决策和委托交易，投资决策及委托交易等由管理人负责实施，且管理人承担聘用深圳嘉石大岩资本管理有限公司为本计划提供投资决策相关专业服务的最终管理责任。

九、本计划的成立

（一）本计划成立的条件和日期

本计划的募集金额（含所有参与资金利息转增份额）不低于 3 千万元人民币且其委托人的人数为 2 人（含）以上，并经管理人聘请的具有证券相关业务资格的会计师事务所对本计划进行验资并出具验资报告后，管理人宣布本计划成立。

本计划设立完成前，委托人的参与资金只能存入本计划份额登记机构集合计划设立完成前，委托人的参与资金只能存入注册登记机构指定的专门账户，不得动用。

（二）本计划设立失败

推广期结束，如本计划募集金额（含所有参与资金利息转增份额）低于人民币 3 千万元或委托人的人数少于 2 人条件，本计划设立失败，管理人承担本计划的全部推广费用，并将已认购资金及同期利息在推广期结束后 30 个工作日内退还本计划委托人，同期利息以本计划注册登记机构的记录为准。除此之外，各方互不承担其他责任。

（三）本计划开始运作的条件

- 1、条件：本集合计划公告成立。
- 2、日期：本集合计划自成立之日起开始运作。

管理人发起设立集合资产管理计划后 5 个工作日内，应当将发起设立情况报中国证券投资基金业协会备案，同时抄送管理人住所地中国证监会派出机构。

十、本计划账户与资产

（一）本计划账户的开立

托管人为本计划开立证券账户、托管账户以及其他相关账户。托管账户名称应当是“户名：创盈大岩 aShares500 集合资产管理计划交行托管专户”，证券账户名称应当是“管理人名称—托管机构名称—集合资产管理计划名称”。具体账户名称以实际开立为准。

（二）本计划资产的构成

本计划资产的构成主要有：

- 1、银行存款和应计利息；
- 2、根据有关规定缴纳的保证金；
- 3、应收证券交易清算款；
- 4、股票投资及其估值调整；
- 5、债券投资及其估值调整和应计利息；
- 6、其他投资及其估值调整；
- 7、其他资产。

（三）本计划资产的管理与处分

本计划资产由托管人托管，并独立于管理人及托管人的自有资产及其管理、托管的其他资产。管理人或托管人的债权人无权对本计划资产行使冻结、扣押及其他权利。除

依照《管理办法》、《实施细则》、本合同、本计划说明书及其他有关规定处分外，本计划资产不得被处分。

十一、本计划资产托管

托管方式为：由管理人指定的具有托管资格的金融机构作为托管人进行托管。

本计划资产由交通银行股份有限公司深圳分行负责托管，并签署了托管协议。托管人的托管职责以托管协议的约定为准，如管理合同、说明书与托管协议冲突，相关约定以托管协议为准。

十二、本计划的估值

管理人应当制订健全、有效的估值政策和程序，并定期对其执行效果进行评估，保证本计划估值的公平、合理。

（一）资产总值

集合计划资产总值是指集合计划投资所形成的各类有价证券、银行存款本息及其他资产的价值总和。

（二）资产净值

集合计划资产净值是指本集合计划资产总值减去负债后的净资产值。

（三）单位净值

集合计划单位净值指集合计划资产净值除以集合计划的份额总数所得的数值。

集合计划单位净值的计算精确到 0.001 元，小数点后第四位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

（四）估值目的

本集合计划资产估值的目的是客观、准确地反映集合计划资产的价值。经集合计划资产估值后确定的集合计划单位净值，是进行信息披露、计算参与和退出集合计划的基础。

（五）估值对象

运用集合计划资产所持有的一切金融资产和金融负债。

（六）估值日

本集合计划的估值日为相关证券交易场所的每个正常交易日。

（七）估值方法

1、股票的估值方法

（1）上市流通的股票，按估值日其所在证券交易场所的收盘价估值；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，且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件，以最近交易日的收盘价估值；估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化或者证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，使投资品种潜在估值调整对前一估值日的资产净值的影响在 0.5%以上的，可参考停牌股票的估值方法，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。

（2）首次发行未上市股票，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，按成本价估值。

（3）送股、转增股、配股和公开增发新股等发行未上市股票，按估值日在证券交易所上市同一股票的收盘价进行估值。

（4）首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按估值日在

证券交易所上市的同一股票的收盘价进行估值；在考虑投资策略的情况下，也可以参照(5)的方法估值。

(5) 通过非公开发行、大宗交易买卖等其他方式获取且有明确锁定期的股票，按以下方法估值：

1) 估值日在证券交易所上市交易的同一股票的收盘价低于非公开发行、大宗交易买卖等其他方式获取且有明确锁定期的股票的初始取得成本时，可采用在证券交易所上市交易的同一股票的收盘价作为估值日该非公开发行、大宗交易买卖等其他方式获取且有明确锁定期的股票的价值；

2) 估值日在证券交易所上市交易的同一股票的收盘价高于非公开发行、大宗交易买卖等其他方式获取且有明确锁定期的股票的初始取得成本时，可按下列公式确定估值日该非公开发行、大宗交易买卖等其他方式获取且有明确锁定期的股票的价值：

$$FV = C + (P - C) \times \frac{D_l - D_r}{D_l}$$

其中：FV 为估值日该非公开发行、大宗交易买卖等其他方式获取且有明确锁定期的股票的价值；C 为该非公开发行、大宗交易买卖等其他方式获取且有明确锁定期的股票的初始取得成本；P 为估值日在证券交易所上市交易的同一股票的收盘价； D_l 为该非公开发行、大宗交易买卖等其他方式获取股票锁定期所含的交易天数； D_r 为估值日剩余锁定期，即估值日至锁定期结束所含的交易天数（不含估值日当天）。

3) 股票的首个估值日为上市公司公告的股份上市日所对应的日历日。

2、固定收益品种的估值方法

(1) 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。

(2) 在证券交易所市场挂牌交易实行净价交易的债券采用以下估值方法：

按估值日收盘价估值；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，按最近交易日的收盘价估值；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考监管机构和行业协会估值意见，或者参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。

(3) 在证券交易所市场挂牌交易未实行净价交易的债券采用以下估值方法：

按估值日收盘价减去所含的债券应收利息得到的净价进行估值；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，按最近交易日债券收盘价减去所含的债券应收利息得到的净价估值；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考监管机构和行业协会估值意见，或者类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。

(4) 首次发行未上市债券采用估值技术确定的公允价值进行估值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

(5) 对于只在上交所固定收益平台或者深交所综合协议平台交易的债券，按照成本估值。

(6) 在对银行间市场的固定收益品种估值时，应主要依据第三方估值机构公布的收益率曲线及估值价格。

3、证券投资基金的估值方法

(1) 持有的交易所基金(包括封闭式基金、上市开放式基金 (LOF) 等)，按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考监管机构或行业协会有关规定，或者类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，

确定公允价值进行估值；

(2) 持有的场外基金（包括托管在场外的上市开放式基金（LOF）），按估值日前一交易日的基金单位净值估值；估值日前一交易日基金单位净值无公布的，按此前最近交易日的基金单位净值估值；

(3) 持有的货币市场基金，按基金管理公司公布的估值日前一交易日的每万份收益计算；

(4) 场内申购获得的 ETF 基金按【转出股票价值+现金替代+现金差额-可收替代】确认成本，其中，转出股票价值按估值日各转出股票收盘价计算；基金公司未公布估值日现金替代的，按基金公司公布的估值日预估现金部分计算，并于估值日现金差额公布后调整 ETF 基金成本；可收替代款于收到退补数据后调整 ETF 基金成本；如果现金差额公布日或者退补数据公布日，已无 ETF 持仓，该部分差额直接计入产品收益。场内赎回 ETF 基金获得的成分股票按【当日收盘价，如果停牌取最近日收盘价】确认成本，管理人应按时向托管机构提供退补数据；持有的 ETF 基金，按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考监管机构或行业协会有关规定，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值；

(5) 场内持有的分级基金的母基金，按照取得成本确认成本。母基金能够在交易所交易的，按照第（1）条规定的方法估值；不能在交易所交易的，按照第（2）条规定的方法估值。

(6) 持有的基金处于封闭期的，按照最新公布的份额净值估值；没有公布份额净值的，按照成本估值。

4、证券衍生品的估值方法

股指期货、国债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，以最近一日的当日结算价计算。

5、存款的估值方法

持有的银行定期存款或通知存款以本金列示，按协议或合同利率逐日计提应收利息。如提前支取或利率发生变化，管理人及时进行账务调整。

6、管理人采用前述原则仍不能客观反映相关投资品种的公允价值的，应当根据具体情况与资产托管机构进行商定，按最能反映公允价值的价格估值，并向客户披露。

如有新增事项或变更事项，按国家有关最新规定估值。管理人应于新规定实施后及时在管理人网站和/或推广网点通告委托人。

根据有关法律法规，资产净值计算和会计核算的义务由管理人承担。本计划的会计责任方由管理人担任，因此，就与本计划有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照管理人对本计划资产净值的计算结果对外予以公布。由此导致委托人或委托财产遭受损失的，托管人予以免责。

7、暂停估值的情形：本计划投资所涉及的证券交易所遇法定节假日或因其它原因暂停营业时或因其它任何不可抗力致使管理人无法准确评估本计划资产价值时，可暂停估值。但估值条件恢复时，管理人必须按规定完成估值工作。

(八) 估值程序

本计划日常估值由管理人与托管人共同进行。每个工作日用于披露的资产净值由管理人完成估值后，将估值结果以传真或电子对账等双方约定的形式报给托管人，托管人按本合同和与管理人签订的托管协议所规定的估值方法、时间、程序进行复核，复核无

误后盖章返回给管理人。月末、年中和年末估值复核与集合计划会计账目的核对同时进行。

(九) 估值错误与遗漏的处理方式

管理人和托管人将采取必要、适当、合理的措施确保资产估值的准确性、及时性。当本计划单位净值小数点后第三位以内发生差错时，管理人和托管人应当予以纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；错误偏差达到计划资产净值的 0.5%时，管理人应当通报托管人。

当管理人与托管人计算的单位净值结果不一致时，各方应本着勤勉尽责的态度重新计算核对。

1、差错类型

本计划运作过程中，如果由于本计划管理人、托管人、代理销售机构、注册登记机构或委托人自身的过错造成差错，导致其他当事人遭受损失的，过错的责任人应当对由于该差错遭受损失的当事人(“受损方”)按下述“差错处理原则”给予赔偿并承担相关责任。

上述差错的主要类型包括但不限于：资料申报差错、数据传输差错、数据计算差错、系统故障差错、下达指令差错等；对于因技术原因引起的差错，若系同行业现有技术水平无法预见、无法避免、无法抗拒，则属不可抗力，按照下述规定执行。

由于不可抗力原因造成委托人的交易资料灭失或被错误处理或造成其他差错，因不可抗力原因出现差错的当事人不对其他当事人承担赔偿责任，但因该差错取得不当得利的当事人仍负有返还不当得利的义务。

2、差错处理原则

(1) 差错已发生，但尚未给当事人造成损失时，差错责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正差错发生的费用由差错责任方承担；由于差错责任方未及时更正已产生的差错，给当事人造成损失的由差错责任方承担；若差错责任方已经积极协调，并且有协助义务的当事人有足够的时间进行更正而未更正，则其应当承担相应赔偿责任。差错责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认，确保差错已得到更正。

(2) 差错的责任方仅对差错可能对有关当事人产生的直接损失负责，不对间接损失负责，并且仅对差错的有关直接当事人负责，不对第三方负责。

(3) 因差错而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但差错责任方仍应对差错负责，如果由于获得不当得利的当事人不返还或不全部返还不当得利造成其他当事人的利益损失(“受损方”)，则差错责任方应赔偿受损方的损失，并在其支付的赔偿金额的范围内对获得不当得利的当事人享有要求交付不当得利的权利；如果获得不当得利的当事人已经将此部分不当得利返还给受损方，则受损方应当将其已经获得的赔偿额加上已经获得的不当得利返还的总和超过其实际损失的差额部分支付给差错责任方。

(4) 差错调整采用尽量恢复至假设未发生差错的正确情形的方式。

(5) 差错责任方拒绝进行赔偿时，如果因管理人过错造成本计划财产损失，托管人应为本计划的利益向管理人追偿；如果因托管人过错造成本计划财产损失，管理人应为本计划的利益向托管人追偿。除管理人和托管人之外的第三方造成本计划资产的损失，并拒绝进行赔偿时，由管理人负责向差错方追偿。

(6) 如果出现差错的当事人未按规定对受损方进行赔偿，并且依据法律法规、本计划资产管理合同或其他规定，管理人自行或依据法院判决、仲裁裁决对受损方承担了

赔偿责任，则管理人有权向出现过错的当事人进行追索，并有权要求其赔偿或补偿由此发生的费用和遭受的损失。

(7) 由于交易所及登记结算公司发送的数据错误，管理人和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的，由此造成的本计划资产估值错误，管理人和托管人可以免除赔偿责任。但管理人和托管人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

(8) 针对净值差错处理，如果法律法规或证监会有新的规定，则按新的规定执行；如果行业有通行做法，在不违背法律法规且不损害委托人利益的前提下，相关各方当事人应本着平等互利的原则重新协商确定处理原则。

(9) 按法律法规规定的其他原则处理差错。

3、差错处理程序

差错被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

(1) 查明差错发生的原因，列明所有的当事人，并根据差错发生的原因确定差错的责任方；

(2) 根据差错处理原则或当事人协商的方法对因差错造成的损失进行评估；

(3) 根据差错处理原则或当事人协商的方法由差错的责任方进行更正和赔偿损失；

(4) 根据差错处理的方法，需要修改本计划注册与过户登记数据的，由管理人进行更正，并就差错的更正向有关当事人进行确认；

(5) 本计划资产净值计算错误偏差达到本计划资产净值 0.5% 时，管理人应当通报托管人。

(十) 估值复核

管理人完成资产净值的估值后，将估值结果以书面或传真等电子方式报给托管人，托管人按本合同和与托管人签订的托管协议所规定的估值方法、时间、程序进行复核，复核无误后盖章返回给管理人。

(十一) 暂停披露净值的情形

- 1、本计划暂停估值时；
- 2、中国证监会认定的其他情形。

十三、本计划的费用、业绩报酬和税收

(一) 费用种类

- 1、管理人的管理费；
- 2、托管人的托管费；
- 3、管理人的业绩报酬；
- 4、证券交易费用；
- 5、证券账户开户费；
- 6、本集合计划成立后的信息披露费用、注册登记费用、审计费和汇划费；
- 7、按照国家有关规定可以列入的其他费用。

(二) 本计划费用计提方法、计提标准和支付方式

1、管理费

本计划的管理费按前一日本计划资产净值【1.5%】的年费率计提。计算方法如下：

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

H 为每日应计提的本计划管理费

E 为前一日本计划资产净值

管理费每日计提，逐日累计至每季度末，按季度支付，由托管人根据管理人的指令于次季首日起 15 个工作日内从集合计划资产中一次性支付给管理人。

2、托管费

本计划的托管费按前一日本计划资产净值【0.02%】的年费率计提。计算方法如下：

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

H 为每日应计提的本计划托管费

E 为前一日本计划资产净值

托管费每日计提,逐日累计至每季度末，按季度支付，由托管人根据管理人的指令于次季首日起 15 个工作日内从集合计划资产中一次性支付。

3、证券交易费用

证券交易费用指本计划进行各类投资品种的投资交易而形成的费用，包括但不限于：印花税、交易所经手费、证管费、银行间交易手续费、场外基金办理要求的申购赎回费等费用、结算费、过户费、佣金等各项费用，证券交易费用在交易发生时直接计入当期费用；以上各项费用的费率标准按照相关法规政策执行，其中交易佣金的费率由管理人本着保护委托人利益的原则，按照法律法规的规定确定。

4、本计划注册登记费用

根据注册登记机构规定的注册登记费用（包括登记结算费及服务月费），按费用实际支出金额支付，列入当期计划费用。

5、其他费用

在存续期间发生的本计划审计费用，由本计划承担，在被审计的会计期间，按直线

法在每个自然日内平均摊销。

银行间市场账户维护费、开户费、证券账户开户费、存续期间信息披露费、电子合同服务费、银行账户管理费、汇划费等本计划运营过程中发生的相关费用，按费用实际支出金额列入或摊入当期费用。

（三）不列入本计划费用的项目

本计划成立前的推广费用、验资费、律师费、会计师费和信息披露费用等，本计划成立后的客户和渠道维护费用，管理人、托管人因未履行或未完全履行义务，从而导致费用支出或本计划资产的损失，以及处理与本计划运作无关的事项而发生的费用，均不列入本计划费用。

（四）管理人的业绩报酬

1、管理人收取业绩报酬的原则

（1）同一委托人不同时间多次参与本计划的，对委托人每笔参与份额分别计算年化收益率、计提业绩报酬；

（2）在委托人退出日、本计划约定的固定业绩报酬提取日及计划终止日，即业绩报酬提取日，对符合业绩报酬提取条件的份额计提业绩报酬；

（3）在本计划约定的固定业绩报酬提取日提取业绩报酬的，业绩报酬以**扣减计划份额持有人份额的方式提取**，在委托人退出日及计划终止日提取业绩报酬的，业绩报酬从退出资金中扣除；

（4）委托人申请退出时，管理人按“先进先出”的原则，即按照委托人份额参与的先后次序进行顺序退出的方式确定退出份额，计算、提取退出份额对应的业绩报酬。

2、业绩报酬的计提方法

固定计提日：本计划存续期间，在每个自然年度 12 月 20 日（若非工作日则顺延到下一工作日）计提业绩报酬。委托人份额持有期限不满 180 天时，在前述固定时点不计提业绩报酬。

每笔参与份额以上一个发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日[如该笔参与份额不存在上一个发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日，则推广期参与的为本计划证券账户在上海证券交易所和深圳证券交易所均完成备案日（若非同一日完成备案的，则以孰晚日为准）后的第 2 个工作日，存续期参与的为份额参与日，下同]到本次业绩报酬计提日对应同期的中证 500 指数（指数代码 000905.SH）的年化收益率，作为计提业绩报酬的基准。

本计划年化收益率的计算公式如下：

$$R = \frac{(P_1 - P_0)}{P_0^*} \div D \times 100\%$$

P_1 为业绩报酬计提日的计划累计单位净值；

P_0 为上一个发生业绩报酬计提日的计划累计单位净值；

P_0^* 为上一个发生业绩报酬计提日的计划单位净值；

D 表示上一个发生业绩报酬计提日到本次业绩报酬计提日的年限（1 年按 365 天计算）；

R 为本计划年化收益率。

管理人业绩报酬计提公式如下：

年化收益率 (R)	计提比例	业绩报酬 (Y) 的计提公式
$R > R_{500}$ 且 $R > 0\%$	20%	$Y = A \times [(R - \max(R_{500}, 0))] \times 20\% \times D$
$R \leq R_{500}$ 或 $R \leq 0\%$	0%	$Y = 0$

Y = 某笔份额对应的业绩报酬；

R_{500} 为该笔份额上一个业绩报酬计提日到本次业绩报酬计提日期间的中证 500 指数年化收益率，计算公式为：

$$R_{500} = (H_1 - H_0) \div H_0 \div D \times 100\%$$

H_1 为业绩报酬计提日的中证 500 指数收市价格；

H_0 为上一个发生业绩报酬计提日的中证 500 指数收市价格；

D 表示上一个发生业绩报酬计提日到本次业绩报酬计提日的年限（1 年按 365 天计算）；

A = 每笔参与在上一个发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日的资产净值总额。

特别说明：当委托人参与的某笔份额在业绩报酬计提日同期中证 500 收益率 $R_{500} < 0$ 时，管理人将只对本计划收益率 0% 以上部分计提业绩报酬。

举例如下：

年化收益率 (R)	中证 500 同期年化收益率	业绩报酬 (Y)
6%	3%	$Y = A \times [(6\% - \max(3\%, 0))] \times 20\% \times D$ $= A \times 0.6\% \times D$
-3%	-6%	$Y = 0$
23%	3%	$Y = A \times [(23\% - \max(3\%, 0))] \times 20\% \times D$ $= A \times 4\% \times D$
10%	-3%	$Y = A \times [(10\% - \max(-3\%, 0))] \times 20\% \times D$ $= A \times 2\% \times D$
3%	6%	$Y = 0$

3、业绩报酬支付：

本计划在业绩报酬固定提取时点提取业绩报酬的，业绩报酬以扣减计划份额持有人

份额的方式提取;在退出日和计划终止日提取业绩报酬的,业绩报酬从赎回资金中扣除。

管理人的业绩报酬的计算和复核工作由管理人完成,由管理人向托管人发送划付指令,托管人于收到指令后5个工作日内从集合计划资产中一次性支付给管理人。

(五) 税收

委托人知悉并同意:就本计划投资运营过程中发生的增值税应税行为,无论是否以管理人作为纳税主体,该等增值税及附加税费均由计划财产承担,管理人有权以计划财产予以缴纳,如管理人垫付了相应税费等款项的,管理人有权向委托人追索垫付的税费和孳息款项,委托人应按管理人通知向管理人指定账户返还垫付款。委托人已知悉并同意,计划财产承担上述税费可能导致资产变现损失或投资收益减损。

除前述约定外,本资管计划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执行。委托人缴纳必须由其自行缴纳的税费,管理人不承担代扣代缴或纳税的义务。

(六) 费率调整

经计划管理人和计划托管人协商一致,可以调减管理费率或托管费率,并公告告知委托人。

十四、本计划的收益分配

本计划存续期不进行收益分配。

十五、投资理念与投资策略

(一) 投资目标

本计划力争在较长投资期限内，追求实现最大化风险调整后的超额收益。

（二）投资理念

本计划选取中证 500 指数收益率为业绩比较基准，以最大化风险调整后超额收益为目标，通过精选个股策略及其它投资标的资产的组合构建，进行投资。

（三）投资策略

1、资产配置策略

本计划采取灵活的资产配置体系，通过对宏观经济环境、经济增长前景、通货膨胀水平、各类别资产的风险收益特征水平进行综合分析，并结合市场趋势、投资期限、预期收益目标，灵活动态地调整权益类资产和其它类资产的比例，结合股指期货等衍生工具，从而实现本计划的投资目标。

2、股票投资策略

利用多策略构建股票组合，期望该股票组合能够获得较好的投资表现。

3、股指期货投资策略

为了规避股市的系统性风险，在一定条件下可灵活使用股指期货规避股票投资组合的系统性风险，以降低产品收益的波动性。本计划亦可进行股指期货多头买入的投资，以力争使本计划与业绩比较基准具有较高的相关性和类似的风险收益特征。

4、基金投资策略

本计划管理人从基金历史业绩、基金经理历史业绩及管理人综合能力等多角度对基金进行评价，优选出适合本计划的基金进行投资。适当选择杠杆型分级基金的子份额进行持有或套利等投资。

5、融资融券与港股通投资策略

本计划可以投资融资融券与港股通交易，本计划管理人通过对于市场的判断，通过融资融券与港股通灵活做多或者多空，力争使本计划获得较好的投资表现。

上述策略为本资产管理计划的主要投资策略，涉及的策略并非为投资策略的全部，仅为投资策略中的部分可选策略。

（四）业绩比较基准

本计划业绩比较基准为中证 500 指数收益率。

十六、投资决策与风险控制

（一）本计划的决策依据

本计划以国家有关法律、法规和本合同的有关规定为决策依据，并以维护委托人利益作为最高准则。具体决策依据包括：

1、《管理办法》、《实施细则》、《规范》、本合同、本计划说明书等有关法律性文件；

2、宏观经济发展态势、微观经济运行环境和证券市场走势。本计划将在对宏观经济和证券市场进行深入研究的基础上进行投资；

3、投资对象的预期收益和预期风险的匹配关系。本计划将在承受适度风险的范围内，选择预期收益大于预期风险的品种进行投资。

（二）本计划的投资程序

1、投资决策程序

管理人资产管理业务投资决策体系由管理人投资决策执行委员会、管理人客户资产管理投资委员会、投资主办人三级体系组成。

管理人投资决策执行委员会是管理人资产管理业务的最高决策机构，负责确定以下事项：

- (1) 讨论与决定客户资产管理业务投资的大类资产配置策略、投资策略；
- (2) 讨论与审批资产管理部证券投资相关制度；
- (3) 讨论与任命资产管理部提名的投资经理；
- (4) 讨论与决定其他涉及客户资产管理投资业务的重大事宜；
- (5) 投资决策执行委员会授权成立客户资产管理投资委员会，专职负责客户资产管理业务的投资管理。

客户资产管理投资委员会的主要职责是：

- (1) 确定客户资产管理业务投资、研究工作的整体战略，约束客户资产投资管理的整体过程；
- (2) 对投资建议进行认真审查，讨论、提名投资主办人，并报公司投资决策执行委员会审批；
- (3) 对研究员、投资主办人进行适当的定级和授权；
- (4) 审批超过投资主办人授权权限的投资事宜；
- (5) 定期讨论客户资产的大类资产配置战略；
- (6) 制定客户资产管理相关的投资研究交易制度；
- (7) 讨论与决定其他涉及客户资产管理业务的事宜。

投资主办人是资产管理业务具体项目的直接管理人，在管理人授权范围内进行投资管理。

2、投资交易程序

管理人设置独立的交易室，投资指令通过交易室实施。交易室接到投资指令后，根据管理人相关内部制度有关规定确保投资指令高效的执行。

（三）风险控制

1、风险控制原则

（1）合规性原则：计划的投资范围和比例严格遵守国家相关法律法规、行业规章和有关监管规定。

（2）全面性原则：风险管理应是全方位、全过程的，覆盖计划的资金运用的决策、执行、监督、反馈等各项业务和各个投资操作环节。

（3）独立性原则：公司稽核部、风险管理部、法律合规部应保持高度的独立性和权威性，其工作不受任何外界因素干扰。

（4）相互制约原则：计划的组织模式应遵循“共生共存、互为制约”的原则，建立不同部门和岗位之间的制衡机制，消除风险管理的盲点。

（5）审慎性原则：风险管理的核心是有效防范各种风险，所以内部各项管理制度和投资指引的制订都以防范和化解风险、审慎管理为出发点。

（6）有效性原则：公司所有员工都应在相关国家法律法规、监管部门规章和公司制度的范围内进行投资运作，任何管理人员和员工都不拥有超越制度或违反规章的权力。

（7）适时性原则：风险管理应根据国家法律、法规、政策、公司制度、投资策略的改变而及时进行更新、补充和调整，使其适应市场的发展趋势和最新的法律法规要求。

（8）隔离墙原则：计划与公司其他资产管理业务、自营业务、证券承销业务、经纪业务及其他证券业务在空间上和制度上适当分离，以达到风险防范的目的。因业务需要知悉内幕信息的人员，与公司签订保密协议。

(9) 定性与定量相结合原则：在风险的识别、计量和控制过程中采用定性与定量分析相结合的办法，界定风险的性质、范围、标准，测算风险的概率、损失率、权重，以建立完备的风险管理体系，使各项风险管理手段具科学性、客观性、操作性。

2、风险控制体系

管理人建立了由公司风险控制执行委员会、稽核部、风险管理部、法律合规部、资产管理总部风控合规专员以及外部独立审计机构组成的风险控制体系。各风险控制部门在合理分工的基础上履行风险控制职责。

(1) 公司风险控制执行委员会负责资产管理业务日常风险的控制、管理、评估和监督，主要负责审议业务风险监测指标体系和风险控制预警机制；评估新业务、新产品的风险；定期检查监督资产管理业务内部控制制度的执行情况；对重大突发风险事项提出处理意见等工作。

(2) 公司风险管理部负责协助识别、评估和防范资产管理业务的风险，对各理财计划的风险指标进行持续监控，督促各项风险控制措施的有效执行；稽核部负责检查资产管理业务内部控制制度的执行情况，对资产管理业务涉嫌违法违规的行为进行稽核检查并提出处理意见。

(3) 法律合规部负责对资产管理业务制度、法律文件、宣传资料等内容进行合规审核，提供合规咨询，对业务过程进行合规检查，对资产管理业务人员进行法律、合规宣传及培训，向公司内部及监管机构履行定期合规报告义务，负责协助资产管理总部做好客户资产管理业务中的合规风险处置及投诉举报工作。

(4) 资产管理部根据监管法规和公司有关制度，构建对本部门经营管理活动中的风险进行识别、衡量和控制的内部控制制度。资产管理总部部门负责人同时是本部门风

险管理的第一责任人，资产管理总部风控合规专员履行本部门风险管理职责。

(5) 外部独立审计。资产管理业务定期接受外部独立审计机构的常规审计，同时对本计划出具单独审计意见。

3、风险控制制度

管理人在公司风险管理层面以及资产管理业务的运作部门层面建立了一系列严格、规范的风险控制制度，为资产管理业务风险控制的执行提供了制度保障。本计划风险控制制度主要体现在以下几项制度中：

(1) 投资备选库管理制度。资产管理业务建立投资备选库，并对入库品种实行严格筛选。备选库以外的品种禁止投资，有效防范集合计划的投资风险。

(2) 交易集中管理制度。资产管理业务实行场内集中交易管理制度，在独立的交易室由专职交易员执行投资主办的场内交易指令，将投资决策过程和交易执行过程分开，保证交易工作的安全性。

(3) 风险预警制度。资产管理业务实行严格的风险预警制度，专人实时监控投资风险，对监控中发现的风险及时预警、合理控制。

(4) 隔离墙制度。公司建立严格的隔离墙制度，实现资产管理业务与管理人的其他业务（自营、投行、经纪）之间，以及各项集合资产管理业务之间的有效隔离，杜绝内幕交易，维护客户利益。

4、风险控制流程

(1) 建立风险控制环境：具体包括制定风险控制战略、目标，设置相应的组织机构，并配备相应的人力资源与技术系统，设定风险控制的时间范围与空间范围等内容。

(2) 风险识别：针对计划的各类风险及各个风险点进行全面有效识别，并对风险

存在的原因进行分析说明。

(3) 风险分析：检查现有的控制措施，分析风险发生的可能性及其引起的后果。

(4) 风险计量：综合运用定性和定量的分析方法，对计划存在的各个风险点进行量化。定性的度量是把风险水平划分为若干级别，每一种风险按其发生的可能性与后果的严重程度分别进入相应的级别。定量的方法则是设计与运用风险指标与模型，计算风险值。

(5) 风险处理：区别重大风险事件和日常风险事项，采取不同的风险控制策略，基本策略有：拒绝风险、转移风险、降低风险、接受风险。

(6) 风险检查与监控：通过现有的风险管理系统和专项检查对风险进行持续、动态的跟踪与监视。

(7) 风险报告与总结：建立风险控制的报告机制，定期评估和总结风险控制工作效果，使公司董事会、高级管理人员了解风险控制状况，指导业务发展。

十七、投资限制及禁止行为

(一) 投资限制

为维护委托人的合法权益，本计划的投资限制将严格按照相关法律法规的要求执行。

本计划的投资限制为：

1、本计划申购新股，申报的金额不得超过本计划的现金总额，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；

2、本计划参与证券回购融入资金余额不得超过本计划资产净值的 40%，中国证监会另有规定的除外；

3、本计划投资于一家上市公司所发行的股票,不得超过该上市公司总股本的 4.99%,不得超过该上市公司流通股本的 10%;

4、按照成本计算,投资于单一债券或单一债券型基金的投资额占本计划资产净值比例不得超过 10% (货币市场基金、ETF 指数基金不受此限),

5、信用债 (除短期融资券、超短期融资券之外) 的主体评级和债项评级须在 AA 及以上,对于无债项评级的长期债券以最近一期的跟踪主体评级或担保方主体评级为准;短期融资券主体评级须在 AA 及以上,债项评级要求为 A-1;超短期融资债主体评级须在 AA 及以上。同业存单不受评级限制。以上认可的评级机构包括联合资信评估有限公司、中诚信国际信用评级有限责任公司、中诚信证券评估有限公司、上海新世纪资信评估投资服务有限公司、大公国际资信评估有限公司、东方金诚国际信用评估有限公司、鹏元资信评估有限公司,只要认可的任一评级公司出具的评级意见符合上述评级要求即可投资;

6、法律、行政法规、证监会限制及禁止的其他行为。

7、本合同约定的其他投资限制行为。

如法律法规或监管部门修改或取消上述限制,履行适当程序后,本计划可相应调整投资组合限制的规定,届时本计划不受上述限制。

(二) 禁止行为

本计划的禁止行为包括:

- 1、违规将本计划资产用于资金拆借、贷款、抵押融资或者对外担保等用途;
- 2、将本计划资产用于可能承担无限责任的投资;
- 3、向客户做出保证其资产本金不受损失或者保证其取得最低收益的承诺;

- 4、挪用本计划资产；
- 5、募集资金不入账或者其他任何形式的账外经营；
- 6、募集资金超过本计划说明书约定的规模；
- 7、接受单一客户参与资金低于中国证监会规定的最低限额；
- 8、使用本计划资产进行不必要的交易；
- 9、内幕交易、利益输送、操纵证券价格、不正当关联交易及其他违反公平交易规定的行为；
- 10、本计划不得直接或者间接投资法律法规和国家政策禁止进行债权或股权投资的行业和领域；
- 11、法律、行政法规和中国证监会禁止的其他行为。

十八、本计划的信息披露

（一）定期报告

定期报告包括本计划单位净值报告、本计划的资产管理季度（年度）报告、托管季度（年度）报告、年度审计报告和对账单。

1、本计划单位净值报告

披露时间：本计划存续期内每周第一个工作日披露上周最后一个工作日的计划单位净值。

披露方式：通过管理人网站披露。

2、本计划的资产管理季度报告和托管季度报告

管理人、托管人在每季度分别向委托人提供一次准确、完整的资产管理季度报告和

托管季度报告，对报告期内本计划资产的配置状况、价值变动情况、重大关联交易做出说明。资产管理季度报告由管理人编制，经托管人复核后由管理人公告，并报中国证券投资基金业协会备案，同时抄送管理人住所地中国证监会派出机构。上述报告应于每季度截止日后 15 个工作日内通过管理人网站通告。本集合计划成立不满二个月的，可以不编制当期的季度报告，产品终止当季，无需编制当季报告。

3、本计划的资产管理年度报告和托管年度报告

管理人、托管人在每年度分别向委托人提供一次准确、完整的管理年度报告和托管年度报告，对报告期内本计划资产的配置状况、价值变动情况、重大关联交易做出说明。资产管理年度报告由管理人编制，经托管人复核后由管理人公告，并报中国证券投资基金业协会备案，同时抄送证券公司住所地中国证监会派出机构。托管人在每年度向委托人提供一次托管报告。上述报告应于每个会计年度截止日后 3 个月内通过管理人网站通告。本集合计划成立不足 3 个月时，可以不编制当期的年度报告。产品终止当年，无需编制年度报告。

4、年度审计报告

管理人应当聘请具有证券相关业务资格的会计师事务所对本计划的运营情况进行年度审计，并在每年度结束之日起 3 个月内将审计报告提供给托管人，通过管理人网站向委托人提供。本集合计划成立不足 3 个月时，可以不编制当期的年度报告。产品终止当年，无需出具年度审计报告。

5、对账单

管理人应当每个季度以邮寄或邮件方式向委托人提供纸质或者电子对账单，对账单内容应包括委托人持有计划份额的数量及净值，参与、退出明细，以及收益分配等情况。

委托人应向管理人提供邮寄地址、对账单接收邮箱等资料，因委托人未正常提供以上信息、邮寄或邮件运营商系统平台故障及内部操作等原因导致委托人未能获得对账单的，管理人不承担任何责任。

（二）临时报告

本计划存续期间，发生对本计划持续运营、客户利益、资产净值产生重大影响的事件，管理人应当以管理人网站方式及时向客户披露。临时报告的情形包括但不限于：

- 1、本计划运作过程中，负责集合资产管理业务的高级管理人员或投资主办人员发生变更，或出现其他可能对本计划的持续运作产生重大影响的事项；
- 2、暂停受理或者重新开始受理参与或者退出申请；
- 3、本计划终止和清算；
- 4、本计划存续期满并展期；
- 5、管理人以自有资金参与和退出；
- 6、合同的补充、修改与变更；
- 7、与本计划有关的重大诉讼、仲裁事项；
- 8、负责本计划的代理推广机构发生变更；
- 9、本计划投资于管理人及与管理人有关关联方关系的公司发行的证券；
- 10、管理人、托管人因重大违法违规，被中国证监会取消相关业务资格；
- 11、管理人、托管人因解散、破产、撤销等原因不能履行相应职责；
- 12、其他根据法律法规和中国证监会的有关规定应当披露的重大事项。

十九、本计划份额的转让、非交易过户和冻结

（一）本计划份额的转让

本计划存续期间，在各项条件均满足的情况下，委托人可以通过证券交易所等中国证监会认可的交易平台转让本计划份额。管理人和托管人无需就本计划份额转让事宜与委托人另行签订协议。但委托人与受让人应签署转让协议，并将该转让协议发送给管理人、托管人书面确认，托管人在管理人已书面同意的情况下予以确认。受让方首次参与本计划，应先与管理人、托管人签订资产管理合同，份额转让事宜以管理人公告为准。。

（二）本计划份额的非交易过户

非交易过户是指不采用参与、退出等交易方式，将一定数量的本计划份额按照一定的规则从某一委托人本计划账户转移到另一委托人本计划账户的行为。本计划注册登记机构只受理因继承、捐赠、司法执行、以及其他形式财产分割或转移引起的计划份额非交易过户。对于符合条件的非交易过户申请按登记结算机构的有关规定办理。

（三）本计划份额的冻结

本计划登记结算机构只受理国家有权机关依法要求的集合计划份额冻结与解冻事项。

二十、本计划的展期

（一）本计划存续期届满时，管理人可以决定到期清算终止，或根据本合同约定进行集合计划展期。

（二）展期的条件

下列条件全部满足后，本计划可以展期：

1、集合计划运营规范，证券公司、资产托管机构未违反集合资产管理合同、计划说明书的约定；

2、集合计划展期没有损害客户利益的情形；

3、资产托管机构同意继续托管展期后的集合计划资产；

4、中国证监会规定的其他条件。

（三）委托人参与展期的方式

管理人拟展期时，应当至少在届满前 1 个月的期间内以短信或其他方式通知委托人，并在管理人网站进行公告。委托人不同意本计划展期的，可在公告发布之日起至计划存续期届满前的开放日提出退出申请，如在公告发布之日起至存续期届满前无开放日，本计划将在计划存续期届满前 20 个工作日内公告特别开放日。未在存续期届满前提出退出申请的，视同委托人已经同意计划展期。

（四）展期的成立

1、同意本集合计划展期的委托人的人数(含管理人)不少于 2 人，且原存续期届满日符合展期条件的，本集合计划在原存续期届满日的次日实现展期，否则本集合计划不能展期。

2、若本集合计划在原存续期届满日有未能流通变现的证券，同意展期的委托人需同意继续持有该未能流通变现的证券，且同意展期的委托人持有的集合计划资产净值不低于本集合计划未能流通变现证券资产规模，且原存续期届满日符合展期条件的，本集合计划在原存续期届满日的次日实现展期，否则本集合计划不能展期。

3、本集合计划可以连续展期，且展期次数不限。

4、管理人应在展期后 5 个工作日内将展期情况报中国证券投资基金业协会或监管

机构指定的其他机构备案，同时抄送管理人住所地中国证监会派出机构。

（五）展期的失败

若集合计划不符合展期条件，或者存续期届满，本计划不符合展期成立的条件，集合计划展期失败，集合计划在本合同约定的终止情形发生后进入清算程序。

二十一、本计划终止和清算

（一）有下列情形之一的，本计划应当终止：

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，不能继续担任本计划托管人的职务，而无其它托管机构承受其原有权利及义务；

3、计划存续期间，委托人少于 2 人；

4、管理人根据本产品运作的实际情况，为委托人利益考虑认为需要终止的则有权提前终止本计划。

5、因监管政策或监管规则的变化导致本产品违反相关监管政策或监管规则要求的，或监管机构通知（无论是口头或书面形式的通知）管理人停止开展此类资产管理产品的，则管理人有权提前终止本集合计划；

6、本集合计划成立后，未通过中国证券投资基金业协会的产品备案的或未取得产品的备案确认函的，则管理人有权终止本集合计划，且不承担任何责任；

7、本集合计划项下投资全部变现或投资目的已经实现，管理人有权终止本集合计划，但应提前以告知委托人；

- 8、不可抗力的发生导致本计划不能存续；
- 9、本计划期满且不展期；
- 10、法律、行政法规及中国证监会规定的其他终止情形。

（二）本计划的清算

1、集合计划达到终止条件管理人应通知托管人准备进入清算程序。自集合计划终止之日起 5 个工作日内成立集合计划清算小组，集合计划清算小组按照监管机构的相关规定进行集合计划清算；

2、清算过程中的有关重大事项应当及时公布；

3、清算结束后 15 个工作日内，管理人和托管人应当在扣除清算费用、管理费、业绩报酬及托管费等费用后，将集合计划资产按照委托人拥有集合计划份额的比例或集合资产管理合同的约定以货币资金的形式全部分派给委托人，并注销集合计划专用证券账户和资金账户；

4、清算结束后 15 个工作日内由集合计划清算小组在管理人网站公布清算结果；

5、委托财产支付

（1）委托财产首期清算款

资产委托人、资产管理人、资产托管人对清算报告无异议后，资产管理人匡算合同终止日的下一个月最低备付金及保证金，并预提足够的清算备用资金后向资产委托人支付首期清算款。资产管理人向资产托管人出具划款指令，资产托管人复核无误后，向资产委托人支付首期清算款。

若委托资产后续清算，出现账面剩余资产不足以支付相关负债的，资产委托人有义务于收到资产管理人、资产托管人联合发出的收款通知后当日将款项补足。

(2) 二次清算

若本集合计划在终止之日有未能流通变现的证券，管理人可对此制定二次清算方案，该方案应经托管人认可，并通过管理人网站进行披露。管理人应根据二次清算方案的规定，对前述未能流通变现的证券在可流通变现后进行二次清算，并将变现后的资产按照委托人拥有份额的比例或本合同的约定，以货币形式全部分配给委托人。

委托资产债权、债务结清后，资产管理人向资产托管人出具划款指令，资产托管人复核无误后，向资产委托人支付所有剩余财产，并注销该委托财产托管账户。

6、委托财产相关账户销户

(1) 证券类账户销户

委托财产证券类资产完成变现、结清相关权益、缴清相关费用后，资产托管人负责证券类账户的销户工作，资产管理人负责基金账户销户，销户过程中其他各方应给以必要的配合。

在证券资产变现完毕、相关权益结清后 5 个工作日内，资产管理人将委托财产托管人注销证券账户的通知书及其他销户资料寄送资产托管人，资产托管人原则上应于收到资产管理人、资产委托人提供资料后的 10 个工作日内完成。

资产管理人在开放式基金变现完毕、相关权益结清后 15 个工作日内完成场外开放式基金账户注销，并向资产托管人出具销户确认通知书。

(2) 银行托管账户销户

委托资产债权、债务结清后，资产管理人向资产托管人出具划款指令，资产托管人复核无误后，向资产委托人支付所有剩余财产，并于当日注销该委托财产托管账户。剩余财产支付过程中发生的银行费用，由资产委托人负担。向资产委托人支付的托管账户

利息，以销户时银行实际支付为准。

与资产管理计划财产有关的其他账户的销户，由资产管理人与资产托管人协商一致后办理。

二十二、当事人的权利和义务

（一）委托人的权利和义务

1、委托人的权利

- （1）取得本计划收益；
- （2）通过查询已披露信息等方式知悉有关本计划运作的信息，包括资产配置、投资比例、损益状况等；
- （3）按照本合同及本计划说明书的约定，参与和退出本计划；
- （4）按持有份额取得本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）因资产管理人违反法律法规的规定及合同约定的投资范围、投资比例、投资限制及现金管理的要求，委托人可临时终止资产管理合同。
- （7）法律法规、中国证监会的有关规定和本合同及本计划说明书约定的其他权利。

2、委托人的义务

- （1）委托人应认真阅读本合同及本计划说明书，并承诺委托资金的来源及用途合法，不得非法汇集他人资金参与本计划；委托人应当以真实身份参与集合计划；自然人不得用筹集的他人资金参与集合计划，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，应当向管理人或其他推广机构提供合法筹集资金的证明文件；自然人以

及不具备合法募集资金资质的机构不得使用贷款、发行债券等筹集的非自有资金参与本集合计划；

(2) 按照本合同及本计划说明书约定交付委托资金，承担本合同约定的管理费、托管费和其他费用；

(3) 按照本合同及本计划说明书约定承担本计划的投资损失；

(4) 不得违规转让其所拥有的计划份额；

(5) 遵守《中华人民共和国反洗钱法》等反洗钱相关法律、法规，履行反洗钱义务，积极配合管理人开展反洗钱工作，管理人若发现委托资产（资金）涉嫌洗钱的，可根据反洗钱法律法规等规定履行反洗钱报告等义务；

(6) 委托资产及委托人需承担管理人代表委托人处理本产品涉及诉讼、仲裁或争议解决的事项所产生的费用及支出（包括但不限于律师费、诉讼费、仲裁费、执行费、评估费、鉴定费、差旅费等）；

(7) 法律法规、中国证监会的有关规定和本合同及本计划说明书约定的其他义务。

（二）管理人的权利和义务

1、管理人的权利

(1) 根据本合同及本计划说明书的约定，独立运作本计划的资产；

(2) 根据本合同及本计划说明书的约定，收取管理费等费用；

(3) 按照本合同及本计划说明书的约定，停止办理本计划份额的参与，暂停办理本计划的退出事宜；

(4) 根据本合同及本计划说明书的约定，终止本计划的运作；

(5) 监督托管人，并针对托管人的违约行为采取必要措施保护委托人的利益；

(6) 行使本计划资产投资形成的投资人权利；

(7) 本计划资产受到损害时，向有关责任人追究法律责任，相应支出的成本或费用由委托资产承担；

(8) 法律法规、中国证监会的有关规定和本合同及本计划说明书约定的其他权利。

2、管理人的义务

(1) 在本计划投资管理活动中恪尽职守，履行诚实信用、谨慎勤勉的义务，以专业技能管理本计划的资产，为委托人的最大利益服务，依法保护委托人的财产权益；

(2) 进行资产估值等会计核算；

(3) 根据中国证监会有关规定、本合同、本计划说明书和托管协议的约定，接受托管人的监督；

(4) 依法对托管人、代理推广机构的行为进行监督，如发现托管人、代理推广机构违反法律、行政法规和中国证监会的规定，或者违反托管协议、代理推广协议的，应当予以制止；

(5) 按规定出具资产管理报告，保证委托人能够了解有关本计划资产投资组合、资产净值、费用与收益等信息；

(6) 按照本合同及本计划说明书约定向委托人分配本计划的收益；

(7) 按照法律法规、中国证监会的有关规定和本合同及本计划说明书的约定，及时向申请退出本计划的委托人支付退出款项；

(8) 妥善保存与本计划有关的合同、协议、推广文件、客户资料、交易记录、会计账册等文件、资料和数据；

(9) 在本计划到期或其他原因解散时，与托管人一起妥善处理有关清算和委托人

资金的返还事宜；

(10) 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；

(11) 因管理人违反本合同导致本计划财产损失或损害委托人合法权益时，应承担赔偿责任；

(12) 因托管人违反本合同导致本计划财产损失或损害委托人合法权益时，代委托人向托管人追偿；

(13) 合同到期后资产管理人应使资产管理计划所持有非现金资产全部变现，因证券公司、交易所等原因或非现金资产停牌等原因无法变现的，应在能够变现之日起及时变现。

(14) 集合计划资产受到损害时，代表本集合计划及委托人积极向有关责任人追究法律责任（包括但不限于主动追索、诉讼、仲裁、财产保全、强制执行、向侦查机关报案等方式），相应所产生的费用及支出（包括但不限于律师费、诉讼费、仲裁费、执行费、评估费、鉴定费、差旅费等）由委托财产及委托人承担；

(15) 法律法规、中国证监会有关规定和本合同及本计划说明书约定的其他义务。

（三）托管人的权利与义务

1、托管人的权利

(1) 依法对本计划的资产进行托管；

(2) 按照本合同、本计划说明书和托管协议的约定收取托管费；

(3) 监督管理人本计划的经营运作，发现管理人的投资或清算指令违反法律法规、中国证监会的有关规定或者本合同、本计划说明书和托管协议约定的，要求其改正；未

能改正的，应当拒绝执行；

(4) 查询本计划的经营运作情况；

(5) 法律法规、中国证监会有关规定和本合同、本计划说明书以及托管协议约定的其他权利。

2、托管人的义务

(1) 依法为本计划开立专门的资金账户和专门的证券账户等相关账户；

(2) 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本计划资产；

(3) 在本计划托管活动中恪尽职守，履行诚实信用、谨慎勤勉的义务，保管本计划的资产，确保本计划资产的独立和安全，依法保护委托人的财产权益；

(4) 安全保管本计划资产，执行管理人的投资或者清算指令，负责办理本计划名下的资金往来；

(5) 定期核对资产管理业务资产情况；

(6) 监督管理人本计划的经营运作，发现管理人的投资或清算指令违反法律法规、中国证监会的有关规定和本合同、以及托管协议约定的，应当要求其改正；未能改正的，应当拒绝执行；

(7) 复核、审查管理人计算的本计划的资产净值；

(8) 保守本计划的商业秘密，在本计划有关信息向委托人披露前予以保密，不向他人泄露（法律法规、中国证监会另有规定或有权机关要求的除外）；

(9) 按规定出具本计划托管情况的报告；

(10) 妥善保存与本计划托管业务有关的合同、协议、交易记录、会计账册等文件、

资料和数据，保存期不少于二十年；

(11) 在本计划终止时，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；

(12) 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；

(13) 因违反本合同导致本计划资产损失或损害委托人合法权益时，应承担赔偿责任；

(14) 因管理人过错造成本计划资产损失的，代委托人向管理人追偿；

(15) 法律法规、中国证监会的有关规定和本合同、本计划说明书以及托管协议约定的其他义务。

二十三、违约责任与争议处理

(一) 违约责任

1、管理人、托管人在履行各自职责的过程中，违反法律、行政法规的规定或者本合同约定，给计划财产或者委托人造成损害的，应当分别对各自的行为依法承担赔偿责任。但是发生下列情况的，当事人可以免责：

(1) 不可抗力

不可抗力是指本合同当事人无法预见、无法克服、无法避免，且在本合同生效之后发生的，使本合同当事人无法全部或部分履行本合同的任何事件，包括但不限于洪水、地震及其他自然灾害、战争、骚乱、火灾、政府征用、没收、法律变化、证券交易场所非正常暂停或停止交易和其他突发事件等。

一方因不可抗力不能履行本合同时，应及时通知另一方，并在合理期限内提供受到

不可抗力影响的证明，同时采取适当措施防止本计划财产损失扩大。任何一方当事人迟延履行合同义务后，发生了上述不可抗力事件致使合同当事人无法全部或部分履行本合同，该方不能减轻或免除相应责任。

(2) 管理人和/或托管人按照当时有效的法律法规或中国证监会的规定作为或不作为而造成的损失等；

(3) 管理人由于按照合同规定的投资原则行使或不行使其投资权而造成的损失等；

(4) 在计划运作过程中，管理人及托管人按照法律、行政法规的规定以及本合同的约定履行了相关职责，但由于其控制能力之外的第三方原因或其他原因而造成运作不畅、出现差错和损失的。

(5) 托管人对存放在托管人以外机构的资产，因该等机构欺诈、疏忽、过失、破产等原因给委托资产带来的损失不承担责任；

(6) 托管人对基于从第三方（证券交易所、期货保证金监控中心等）合法获得的信息及合理信赖上述信息而操作导致委托财产的任何损失。

2、合同当事人违反本合同，给其他当事人造成直接经济损失的，应当承担赔偿责任。在发生一方或多方当事人违约的情况下，合同能继续履行的，应当继续履行。

3、本合同一方当事人造成违约后，其他当事人应当采取适当措施防止损失的扩大；没有采取适当措施致使损失扩大的，不得就扩大的损失要求赔偿。守约方因防止损失扩大而支出的合理费用由违约方承担。

4、由于管理人、托管人不可控制的因素导致业务出现差错，管理人和托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现错误的，由此造成计划财产或委托人损失，管理人和托管人免除赔偿责任。但是管理人和托管人应积极采取必要的

措施消除由此造成的影响。

5、一方当事人依据本合同向另一方当事人赔偿的损失，仅限于直接经济损失。

6、管理人违反法律、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的，应当按照有关监管要求妥善处理有关事宜。

（二）争议的处理

发生纠纷时，本合同当事人可以通过协商或者调解予以解决。当事人不愿通过协商、调解解决或者协商、调解不成的，应提交华南国际经济贸易仲裁委员会并按其仲裁规则进行仲裁，仲裁地点在深圳。仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力。仲裁费由败诉方承担。

争议处理期间，各方当事人应恪守管理人和托管人职责，各自继续忠实、勤勉、尽责地履行《资产管理合同》和《托管协议》规定的义务，维护集合计划持有人的合法权益。

本合同受中华人民共和国法律管辖。

二十四、风险揭示

本计划面临包括但不限于以下风险：

（一）市场风险

市场风险是指投资品种的价格因受经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素影响而引起的波动，导致收益水平变化，产生风险。市场风险主要包括：

1、政策风险

货币政策、财政政策、产业政策和证券市场监管政策等国家政策的变化对证券市场产生一定的影响，可能导致证券价格波动，从而影响收益。

2、经济周期风险

证券市场受宏观经济运行的影响，而经济运行具有周期性的特点，而周期性的经济运行周期表现将对证券市场的收益水平产生影响，从而对收益产生影响。

3、利率风险

利率风险是指由于利率变动而导致的资产价格和资产利息的损益。利率波动会直接影响企业的融资成本和利润水平，导致证券市场的价格和收益率的变动，使本计划资产管理业务收益水平随之发生变化，从而产生风险。

4、上市公司经营风险

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、财务因素等都会导致公司盈利发生变化，从而导致本计划投资收益变化。

5、衍生品风险

金融衍生产品具有杠杆效应且价格波动剧烈，会放大收益或损失，在某些情况下甚至会导致投资亏损高于初始投资金额。

6、购买力风险

投资者的利润将主要通过现金形式来分配，而现金可能因为通货膨胀的影响而导致购买力下降，从而使投资者的实际收益下降。

（二）管理风险

在本计划运作过程中，管理人的知识、经验、判断、决策、技能等，会影响其对信息的获取和对经济形势、金融市场价格走势的判断，如管理人判断有误、获取信息不全、

或对投资工具使用不当等影响本计划的收益水平，从而产生风险。

（三）流动性风险

流动性风险是指金融资产不能迅速转变成现金，或者转变成现金会对资产价格造成重大不利影响的风险。流动性风险将主要表现在以下几个方面：集合计划的资产不能迅速转变成现金，或变现成本很高；不能应付可能出现的委托人赎回的风险等。这些风险的主要形成原因是：

1、市场整体流动性相对不足。证券市场的流动性受到市场行情、投资群体等诸多因素的影响，在某些时期成交活跃，流动性较好；而在另一些时期，则可能成交稀少，流动性较差。在市场流动性相对不足时，交易变现有可能增加变现成本，对本集合资产管理计划的资产净值造成不利影响。这种风险在委托人提前赎回时表现尤为突出。

2、证券市场中流动性不均匀，存在个股和个券流动性风险。由于流动性存在差异，即使在市场流动性比较好的情况下，一些个股和个券的流动性可能仍然比较差，这种情况的存在使得本集合资产管理计划的管理人在进行个股和个券操作时，可能难以按计划买入或卖出预期的数量，或买入、卖出行为对个股和个券价格产生比较大的影响，增加个股和个券的建仓成本或变现成本。这种风险在出现个股和个券停牌或涨跌停板等情况时表现得尤为突出。

3、若集合计划投资于债券回购，可能因政策或交易所规则发生变化而出现质押债券折算率下调、债券暂停上市、债券延迟兑付或不兑付等情况，可能继而导致本集合计划出现资金流动性不足，需要委托人及时足额追加委托资金以避免出现欠库或透支的情况，也可能增加集合资产管理计划资产净值的波动性。

4、集合资产管理业务中的资产不能应付可能出现的客户大额提取委托资产的风险。

在集合资产管理业务运作期间，可能会发生客户大额提取委托资产的情形，可能会产生仓位调整的困难，导致流动性风险，甚至影响收益水平。

（四）管理人因停业、解散、撤销、破产，或者被中国证监会撤销相关业务许可等原因不能履行职责的风险

管理人因停业、解散、撤销、破产，或者被中国证监会撤销相关业务许可等原因不能履行职责，可能导致委托资产的损失，从而带来风险。

（五）本计划特有风险

1、无预警平仓机制及设置临时开放日的风险

本计划不设置预警和平仓线，在极端情况下，可能出现由于市场波动投资标的价格持续下跌，导致本计划资产净值持续下跌，投资者面临本金全部亏损的风险。

在本计划存续期内管理人有权设置临时开放期。这个临时开放安排，是按照本计划运作的实际情况进行判定，而不是委托人具体持有的参与份额表现进行判定，不一定符合所有委托人的利益。因委托人持有份额在不同时点参与而与本计划实际净值表现存在一定差异，存在委托人忽略这种差异而进行错误决策的风险。

2、计划表现不及预期的风险

本计划的业绩比较基准为中证 500 指数（指数代码：000905.SH）。由于本计划的实际投资范围并不限于中证 500 指数成分股，可能导致本计划业绩表现与中证 500 指数有较大差异。投资者面临投资业绩不及预期，甚至投资业绩大幅低于同期中证 500 指数表现的风险。

3、业绩报酬特殊计提方式（份额缩减法）的风险

本计划在业绩报酬固定提取时点提取业绩报酬的，业绩报酬以扣减计划份额持有人

份额的方式提取；赎回和合同终止时提取业绩报酬的，业绩报酬从赎回资金中扣除。

委托人将面临在固定时点被计提业绩报酬后，虽然份额净值没有扣减，但是持有份额减少的情形。

4、股指期货投资风险

(1) 强制平仓和强制减仓风险

股指期货实行当日无负债结算制度，对资金管理要求非常高。价格波动剧烈的时候可能面临追加保证金的问题，如果没有在规定的时间内补足保证金，按规定将被强制平仓，本计划可能会因此导致亏损。

强制减仓是当市场出现连续两个及两个以上交易日的同方向涨停(跌)等特别重大的风险时，中金所为迅速、有效化解市场风险，防止会员大量违约而采取的措施，即中金所将当日以涨跌停板价申报的未成交平仓报单，以当日涨跌停板价与该合约净持仓盈利投资者按持仓比例自动撮合成交。由上述减仓造成的经济损失由本计划承担。

强制平仓和强制减仓都有可能导导致本计划的多空头寸的市值不匹配，从而使本计划面临股票市场的系统性风险暴露。

(2) 结算风险

金融期货投资的结算及金融期货资产账户项下的资产保管由期货经纪公司负责。如果所选择的证券及期货经纪公司在交易过程中存在违法违规经营行为或破产清算，可能给本计划带来损失。

为投资者进行结算的结算会员或同一结算会员下的其他投资者出现保证金不足、又未能在规定的时间内补足，或因其他原因导致中国金融期货交易所对该结算会员下的经纪账户强行平仓时，本计划的金融期货资产可能因被连带强行平仓而遭受损失。

(3) 数据风险

在现行股指期货交易结算模式下,本计划资产进行股指期货投资相关交易及结算数据由期货公司负责发送,管理人及托管人据以履行股指期货相关会计核算、估值等职责。若因期货公司、中金所或其他原因造成期货公司向管理人、托管人传送的本计划在中金所的交易及结算数据不准确、不完整或不真实,将为本计划资产带来风险。

5、无法实现收益甚至本金损失的风险

虽然本计划的全部资产净值扣除费用后将用于委托人本金和收益的分配,但管理人不能向客户保证其本金不受损失或者保证其取得最低收益。若本计划资产净值大幅下跌,且按照本合同进行各项清算后的剩余资产净值仍使委托人的本金出现亏损,委托人不得向本计划的管理人进行追偿。

6、聘用第三方机构提供相关专业服务的风险

管理人聘用第三方机构为本集合计划提供投资建议、资产配置、投资策略和研究咨询等专业服务。第三方机构可能由于本身差错、疏忽、未履行职责或自身能力等原因提供了不适当的研究建议,而导致集合资产亏损。

(六) 其他风险

- 1、因技术因素而产生的风险,如电脑系统不可靠产生的风险;
- 2、因制度建设、人员配备、内控制度建立等方面不完善而产生的风险;
- 3、因人为因素而产生的风险、如内幕交易、欺诈行为等产生的风险;
- 4、对主要业务人员如投资主办人员的依赖而可能产生的风险;
- 5、对主要研究人员如投资顾问的依赖而可能产生的风险;
- 6、因业务竞争压力可能产生的风险;

7、战争、自然灾害、金融市场危机等不可抗力因素的出现，将会严重影响证券市场的运行，可能导致集合计划资产的损失，从而带来风险；

8、金融市场危机、行业竞争、代理商违约等超出资产管理人和资产托管人自身直接控制能力之外的风险，也可能导致资产委托人利益受损；

9、计划清算时因存在不能变现资产而面临的不能及时回收全部资产的风险；

10、由于本计划在推广期设有募集资金规模上限，可能发生总规模超额募集的情况，委托人存在委托申请不成功的风险；

11、委托人部分退出集合计划份额时，如其该笔退出受理后委托人持有的剩余集合计划份额低于 500,000 份时，委托人面临剩余份额强制退出的风险；

12、当集合计划合同发生变更时，对于未在规定时间内申请退出的计划份额，将视为同意合同的修改，若委托人不接受集合计划合同变更条款，但又未能在规定的时间内办理退出申请，则委托人会面临被视为同意对合同的修改的风险；

13、其他意外导致的风险。

对风险的具体描述具体见《创盈大岩 aShares500 集合资产管理计划风险揭示书》。

二十五、本合同的成立与生效

（一）本合同的成立与生效

本合同经管理人、托管人和委托人签署后成立。本计划资产管理合同的签署应当采用书面方式进行。合同签署方式（包括但不限于书面、电子等）可能由于法律法规、监管要求、系统技术等等发生改变，各方同意管理人基于投资者的利益有权按规定采用新的签署方式，并及时进行信息披露。

本合同成立后，满足以下条件时生效：

- (1) 委托人参与资金实际交付并确认；
- (2) 本集合计划成立。

本集合计划终止，本合同终止。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。

(二) 本合同的组成

本计划说明书、经管理人确认有效的委托人参与、退出本计划的申请材料和各推广机构出具的本计划参与、退出业务受理有关凭证等为本合同的附件，是本合同不可分割的一部分，与合同具有同等法律效力。

二十六、合同的补充、修改与变更

1、本合同签署后，因法律、法规、规章、中国证监会的规定、证券登记结算机构业务规则以及证券交易所等交易规则修订，自该修订生效之日起，本合同相关内容及条款按该修订办理并在管理人网站公告。委托人特此授权管理人经与托管人协商，可以对本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，更新或修改的内容在管理人网站公告满3个工作日后生效。委托人对更新或修改的内容有异议，可在更新或修改内容生效前申请退出本计划，具体退出安排将在管理人网站公告。

2、由于其他原因需要变更合同的，应报中国证券业协会备案，同时抄送管理人住所地中国证监会派出机构。管理人和托管人应书面达成一致后，以短信或其他方式通知委托人，并在管理人网站公告。委托人不同意变更的，可在管理人公告的特别开放日申

请退出本计划，具体退出安排将在管理人网站公告。未提出退出申请的，视同委托人已经同意合同变更。

3、若本集合计划的委托人人数较少的，则经委托人、管理人和托管人协商一致，可以签署书面补充协议的方式完成合同变更，该合同变更方式不受上述变更流程的限制。

4、合同变更后，委托人、管理人和托管人的应当按照变更后的合同行使相关权利，履行相应义务。

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

二十七、或有事件

本合同所称的或有事件是指，根据相关法律法规的规定，管理人可能以独资或者控股方式成立具有独立法人资格的从事资产管理业务的公司。

委托人在此同意，如果或有事件发生，在管理人与托管人协商一致的基础上，管理人有权将本合同中由管理人享有的权利和由管理人承担的义务转让给上一条所述的从事资产管理业务的公司，关于管理人变更转让事宜，应由原管理人与新管理人签署转让协议，并将转让事宜以信息披露(管理人网站公告)的形式通告委托人和书面通知托管人。管理人保障委托人退出本集合计划的权利，并在届时的通告中对相关事项作出合理安排。公告变更相关事宜造成任何纠纷的责任由管理人承担，与托管人无关。

管理人应当保证受让人具备开展此项业务的相关资格，并向托管人提供监管机构相关批复文件复印件。

管理人应按照监管机构的要求办理转让手续。

管理人、托管人确认，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取得最低收益；委托人确认，已充分理解本合同的内容，自行承担投资风险和损失。

本合同应由委托人本人签署，当委托人为机构时，应由法定代表人或其授权代表签署并加盖其公章。

本合同一式肆份，管理人执贰份，委托人、托管人各执一份，管理人需按照监管要求报备相关机构的份数另计，每份均具有同等法律效力。

（本页以下无正文）

(本页无正文, 为《创盈大岩 aShares500 集合资产管理计划集合资产管理合同》签字页)

(适用于个人) 委托人签字:

(适用于机构) (盖章)

委法定代表人或授权代理人 (签字或签章)

管理人: 第一创业证券股份有限公司 (盖章)

法定代表人或授权代理人 (签字或签章)

托管人: 交通银行股份有限公司深圳分行 (盖章)

法定代表人或授权代理人 (签字或签章)

签订日期: 年 月 日