

---

海通远见 1 号 FOF 集合资产管理计划  
资产托管协议  
(证券类投资)

合同编号: ■■■■■



管理人: 上海海通证券资产管理有限公司  
托管人: 中国民生银行股份有限公司



---

## 托管协议当事人

管理人：

名称：上海海通证券资产管理有限公司

注册地址：上海市黄浦区广东路 689 号第 32 层第 01-12 室单元

法定代表人：裴长江

邮政编码：200001

电 话：021-23219000

传 真：021-63410460

托管人：

名称：中国民生银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号

法定代表人：洪崎

邮政编码：100031

联系人：单新尧

电 话：010-58560666

传 真：010-58560794

2018-192393



---

## 目 录

第一条	托管协议的依据、目的和原则.....	4
第二条	托管人与管理人相互的业务监督、核查.....	11
第三条	集合计划资产的保管.....	13
第四条	指令的发送、确认和执行.....	17
第五条	交易单元.....	21
第六条	证券交易的资金清算与交割.....	22
第七条	集合计划资产的估值和会计核算.....	26
第八条	集合计划资产有关文件档案的保存.....	29
第九条	信息披露.....	30
第十条	集合计划的费用支出.....	33
第十一条	集合计划清算资产的分配.....	38
第十二条	管理人的权利与义务.....	40
第十三条	托管人的权利与义务.....	42
第十四条	禁止行为.....	44
第十五条	违约责任.....	45
第十六条	争议的处理.....	47
第十七条	托管协议的效力.....	48
第十八条	托管协议的修改和终止.....	49
附件：业务联系表.....		51
附件 2：投资监督事项表.....		54

## 第一条 托管协议的依据、目的和原则

### （一）订立托管协议的依据

本协议根据《中华人民共和国民法通则》、《中华人民共和国合同法》、《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券公司监督管理条例》、《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》（以下简称“《指导意见》”）、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》（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》（以下简称《管理规定》）、《证券期货经营机构私募资产管理业务运作管理暂行规定》（以下简称“《暂行规定》”）等法律法规和《海通远见 1 号 FOF 集合资产管理计划说明书》、《海通远见 1 号 FOF 集合资产管理计划集合资产管理合同》及其他有关规定制定。若因法律、法规的制定或不时地修改导致本协议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协议进行相应变更和调整。

### （二）订立托管协议的目的

订立本协议的目的是为了明确托管人和管理人之间在海通远见 1 号 FOF 集合资产管理计划资产（以下简称“集合计划资产”）持有人名册的登记与保管、集合计划资产的保管、管理和运作及相互监督等相关事宜中的权利、义务及职责，确保集合计划资产安全，保护委托人的合法权益。由于本集合资产管理计划的设计安排、管理、运作模式而产生的任何责任，托管人不予承担。


### （三）订立托管协议的原则

双方当事人本着诚实信用、平等自愿的原则，经协商一致，订立本托管协议。

### （四）释义

在本托管协议中除非文义另有所指，下列词语具有以下含义：

《集合资产管理合同》：	指《海通远见 1 号 FOF 集合资产管理计划集合资产管理合同》及其的任何修订和补充
《暂行规定》：	指 2016 年 7 月 18 经中国证监会公告（2016）13 号公布并施行的《证券期货经营机构私募资产管理业务运


	作管理暂行规定》
《指导意见》:	指 2018 年 4 月 27 日经中国人民银行、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发布并施行的《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》
《管理办法》:	指 2018 年 10 月 22 日经中国证监会令第 151 号公布的《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》
《管理规定》:	指 2018 年 10 月 22 日经中国证监会公告(2018)31 号公布的《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》
中国:	指中华人民共和国(就本集合计划的销售地域,不包括香港特别行政区、澳门特别行政区及台湾地区)
法律法规: 	指中国公布实施并现时有效的法律、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
元:	指中国法定货币人民币单位“元”
集合资产管理计划或本集合资产管理计划或本集合计划:	指依据《海通远见 1 号 FOF 集合资产管理合同》和《海通远见 1 号 FOF 集合资产管理计划说明书》所设立的海通远见 1 号 FOF 集合资产管理计划
子产品:	指本集合计划所投资的专项资产管理计划、各类证券投资基金、证券投资类资产管理计划、集合资金信托计划等金融监管部门批准或备案发行的金融产品
集合资产管理计划说明书或说明书:	指《海通远见 1 号 FOF 集合资产管理计划说明书》,供集合资产管理计划委托人选择并决定是否提出集合资

	产管理计划参与申请的要约邀请文件
中国证监会：	指中国证券监督管理委员会
集合资产管理计划管理人或管理人：	指上海海通证券资产管理有限公司（简称“海通资产管理”）
集合资产管理计划设立人或设立人：	指上海海通证券资产管理有限公司（简称“海通资产管理”）
集合资产管理计划托管人或托管人：	指中国民生银行股份有限公司（简称“民生银行”）
销售机构：	指海通证券、海通资产管理（直销）及其他符合相应资格条件的、经管理人委托的、销售本集合资产管理计划的机构
注册登记人、注册登记机构、注册与过户登记人	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海通资产管理；
集合资产管理合同当事人：	指受《集合资产管理合同》约束，根据《集合资产管理合同》享受权利并承担义务的法律主体
个人投资者：	指依据中国有关法律法规及其他有关规定可以投资于集合资产管理计划的自然人投资者
机构投资者：	指在中国境内合法注册登记或经有权政府部门批准设立的企业法人、事业法人、社会团体或其它组织，以及监管机构批准的其他合格机构
委托人：	指依据《集合资产管理计划合同》合法取得本集合计划份额的投资者，包括个人投资者和/或机构投资者

业绩报酬：	指集合计划存续期内，当集合计划净值收益率超过一定水平时，管理人从集合计划资产中计提的金额，该部分金额作为对管理人的业绩激励
工作日：	指上海证券交易所、深圳证券交易所和中国境内商业银行营业共同的正常交易日
T日：	指日常参与、退出或办理其他集合资产管理计划业务的申请日
T+n日：	指自T日起第n个工作日（不包含T日）
募集期：	指集合计划成立前，接受委托人认购参与至集合计划成立日之间的时期。集合计划的初始募集期自资产管理计划份额发售之日起不得超过60天
募集期参与、认购参与或认购：	指在募集期内本集合资产管理计划委托人购买本集合资产管理计划份额的行为
建仓期：	指自产品成立之日起的6个月
存续期参与或申购：	指在存续期内本集合资产管理计划委托人购买本集合资产管理计划份额的行为
退出、赎回：	指集合资产管理计划委托人根据集合资产管理计划销售网点规定的手续，申请卖出集合资产管理计划份额的行为。本集合资产管理计划的退出在开放期办理
集合资产管理计划收益：	指集合资产管理计划投资所得红利、股息、债券利息、基金红利、买卖证券价差、银行存款利息以及其他收益
集合资产管理计划资	指集合资产管理计划通过发行计划份额方式募集资

产总值:	金, 并依法进行有价证券交易等资本市场投资所形成的各类资产的价值总和
集合资产管理计划资产净值:	指集合资产管理计划资产总值扣除负债后的净资产值
集合资产管理计划份额净值、计划单位净值、单位净值:	指集合资产管理计划资产净值除以计划总份额
集合资产管理计划累计净值、计划累计净值、累计净值:	指集合计划资产净值与计划累计分红之和
集合资产管理计划份额面值(或“份额面值”):	指人民币 1.00 元
集合资产管理计划资产估值:	指计算评估集合资产管理计划资产和负债的价值, 以确定集合资产管理计划资产净值的过程
不可抗力:	指遭受不可抗力事件一方不能预见, 不能避免, 不能克服的客观情况, 包括但不限于洪水、地震及其它自然灾害、战争、骚乱、火灾、突发性公共卫生事件、政府征用、没收、法律法规变化、突发停电或其他突发事件、注册与过户登记人非正常的暂停或终止业务、证券交易所非正常暂停或停止交易等
投资者/合格投资者:	指具备相应风险识别能力和风险承担能力, 投资于单只资产管理计划不低于一定金额且符合下列条件的自然人和法人或者其他组织:



	<p>(一) 具有 2 年以上投资经历, 且满足下列三项条件之一的自然人: 家庭金融资产不低于 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;</p> <p>(二) 最近 1 年末净资产不低于 1000 万元的法人单位;</p> <p>(三) 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登记的私募基金管理人、商业银行、金融资产投资公司、信托公司、保险公司、保险资产管理公司、财务公司及中国证监会认定的其他机构;</p> <p>(四) 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;</p> <p>(五) 基本养老保险、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);</p> <p>(六) 中国证监会视为合格投资者的其他情形</p>
<p>份额持有人、持有人:</p>	<p>指通过签订资产管理合同而依法取得和持有本计划份额的委托人</p>
<p>集合计划成立日:</p>	<p>指集合计划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</p>
<p>封闭期:</p>	<p>特指成立后的一个或多个期间, 在此期间委托人不得参与、退出本集合计划</p>
<p>存续期:</p>	<p>本集合计划成立并存续的期间</p>
<p>开放日:</p>	<p>指委托人可以办理集合计划参与、退出或其他约定业</p>

	务的工作日
临时开放期、临时开放日：	在合同变更以及其他合同特别约定等基于委托人利益考虑的情形下，管理人临时设置的委托人可以办理参与或退出业务的日期，临时开放期、临时开放日的具体安排以管理人安排为准
天：	指自然日
会计年度：	指公历每年 1 月 1 日至 12 月 31 日
巨额退出：	指本集合计划单个开放日累计净退出申请份额（退出申请总份额扣除参与总份额后的余额）超过上一日计划总份额 20% 的情形
强制退出：	指由管理人发起退出持有人持有份额的行为
集合计划份额、计划份额、份额：	指集合计划的最小单位
可分配收益：	指截至收益分配基准日资产负债表中集合计划未分配收益与未分配收益中已实现收益的孰低数
书面通知：	包括以纸质方式邮寄/递送、传真、电子邮件等方式发送的通知
管理人指定网站：	指 <a href="http://www.htsamc.com">www.htsamc.com</a> ，管理人指定网站变更时以管理人公告为准

## 第二条 托管人与管理人相互的业务监督、核查

### （一）托管人对管理人的业务监督、核查

根据《指导意见》、《管理办法》、《管理规定》、《集合资产管理合同》和有关法律法规的规定，托管人应对管理人就集合计划资产的投资范围和对象、投资组合比例、集合计划资产的核算、资产净值计算、参与资金的到账和退出资金的划付、管理人管理费、收益分配、清算资产分配等行为的合法性、合规性分别进行监督和核查。

本产品投资范围详见《集合资产管理合同》第四条约定。

托管人发现管理人有违反《指导意见》、《管理办法》、《管理规定》、《集合资产管理合同》和有关法律、法规规定的行为，应及时通知管理人限期纠正，管理人收到通知后应及时核对确认并回复托管人。在限期内，托管人有权随时对通知事项进行复查，督促管理人改正。管理人对托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，托管人应报告相关监管机构。自本协议生效后，如本计划的投资范围和投资比例限制需要变更的，资产管理人应与本协议各方就调整事项进行协商，待协商一致后以书面盖章方式告知资产托管人，并为新品种或新标准的托管流程设计和系统开发上线留出足够准备时间。

如托管人认为管理人的作为或不作为违反了法律法规、《集合资产管理合同》或本托管协议，托管人有权利行使法律法规、《集合资产管理合同》或本托管协议赋予托管人的所有权利，以保护集合计划资产的安全和持有人的利益。

管理人应当根据本合同确定的投资范围进行合法、合规投资。自《集合资产管理合同》和本协议生效后，若需更改或增加新的投资品种、调整投资限制监督内容，管理人应在进行新品种投资和调整投资限制前与托管人商议，重新调整监督事项和修订本协议，并为新品种或新标准的托管流程设计和系统开发上线留出足够准备时间。

### （二）管理人对托管人的业务监督、核查

根据《指导意见》、《管理办法》、《管理规定》、《集合资产管理合同》和有关法律法规的规定，管理人就托管人是否及时执行管理人的指令、是否将集合计划资产

---

和自有资产分账管理、是否将不同集合计划资产分账管理、是否擅自动用集合计划资产、是否按时将分配给持有人的收益、退出款项和清算资产分配等资金划入持有人指定账户等事项，对托管人进行监督和核查。

1. 管理人发现托管人未对集合计划资产实行分账管理、擅自挪用集合计划资产、因托管人的过错导致集合计划资产灭失、减损、或处于危险状态的，管理人应立即以书面的方式要求托管人予以纠正和采取必要的补救措施。

2. 管理人发现托管人的行为违反《指导意见》、《管理办法》、《管理规定》、《集合资产管理合同》和有关法规的规定，应及时通知托管人限期纠正，托管人收到通知后应及时核对并回复管理人。在限期内，管理人有权随时对通知事项进行复查，督促托管人改正。托管人对管理人通知的违规事项未能在限期内纠正的，管理人应报告相关监管机构。

3. 如管理人认为托管人的作为或不作为违反了法律法规、《指导意见》、《管理办法》、《管理规定》、《集合资产管理合同》，管理人有权行使法律法规、《集合资产管理合同》或本托管协议赋予管理人的权利和补救措施，以保护集合计划资产的安全和持有人的利益。

#### （三）托管人与管理人在业务监督、核查中的配合、协助

管理人和托管人有义务配合和协助对方依照本协议对集合计划资产执行监督、核查。管理人或托管人无正当理由，拒绝、阻挠对方根据本协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督，监督方应报告相关监管机构。

#### （四）集合计划的关联交易

本协议所指关联方及关联交易，与国家有关法律法规、部门规章以及证监会监管要求的定义相同。

本集合计划的关联交易须严格遵守《指导意见》、《管理办法》、《管理规定》、《集合资产管理合同》等规定的要求。

### 第三条 集合计划资产的保管

#### (一) 集合计划资产保管的原则

托管人应安全、完整保管本集合计划的全部资产。

集合计划资产应独立于管理人、托管人、份额登记机构的自有资产。管理人、托管人、份额登记机构不得将集合计划资产归入其自有资产。托管人必须为集合计划资产设立独立的账户，必须将集合计划资产与托管人自身的资产及其他托管资产实行严格的分账管理。托管人未经管理人的授权，不得自行运用、处分、分配集合计划资产。

托管人应当设立专门的托管部门，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉集合资产管理计划托管业务的专职人员，负责集合计划资产托管事宜；建立健全内部风险监控制度，对负责集合计划资产托管的部门和人员的行为进行事先控制和事后监督，防范和减少风险。

除依据《指导意见》、《管理办法》、《管理规定》、《集合资产管理合同》及其他有关规定外，托管人不得委托第三人托管本集合计划资产。

#### (二) 集合计划的验资

集合计划募集活动结束后，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集合计划进行验资，并出具验资报告，验资报告需要2名以上（含2名）中国注册会计师签字方为有效。管理人依据验资报告，将募集的全部资金划入托管人以集合计划资产名义开立的银行账户，并在划款当日通知托管人一方，经托管人当天确认资金到账后，双方进行账务处理。

集合计划募集活动结束后，本集合计划若不成立，管理人承担全部募集费用，并委托由注册登记机构将已参与资金加计其产生的银行同期活期利息自募集期终止之日起三十日内退还委托人。

#### (三) 集合计划证券账户的开设和管理(如有)

1. 托管人按照《指导意见》、《管理办法》、《管理规定》的规定，为集合计划在证券登记结算机构（上海、深圳分公司）代理开立专门的证券账户，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”。

[备注：账户名称以实际开立账户为准]

证券账户的开立和使用，限于满足开展本集合计划业务的需要。托管人和管理人不得出借和擅自转让集合计划的任何证券账户；亦不得使用集合计划的任何账户进行本集合计划业务以外的活动。

2. 在本协议订立后，集合计划如被允许从事其他投资品种的投资业务的，涉及相关账户的开设，由托管人或管理人为集合计划代理开立相应专门账户。并应当比照并遵守上述关于账户开设、使用的规定。

3. 证券账户由管理人负责管理和运用。

#### （四）集合计划银行账户的开设和管理

1. 托管人负责集合计划的银行账户的开设和管理。

2. 托管人按照法律法规的规定在其营业机构开设托管专户，托管账户的名称应当是“海通远见 1 号 FOF 集合资产管理计划”[备注：账户名称以实际开立账户为准]，银行预留印鉴由托管人保管和使用。集合计划的一切货币收支活动，包括但不限于投资、支付费用、委托人退出金额、收益分配款、清算资产分配款等，均需通过该银行账户进行。托管人和管理人不得假借本集合计划的名义开立其他任何银行账户；亦不得使用集合计划的任何银行账户进行本集合计划业务以外的活动。

托管专户的管理应符合《银行账户管理办法》、《现金管理条例》、《中国人民银行利率管理的有关规定》、《关于大额现金支付管理的通知》、《支付结算办法》以及银行业监督管理机构的其他规定。

#### （五）结算资金账户的开立和管理（如有）

1. 根据中国证券登记结算有限责任公司的规定，托管人以法人名义参与在中国证券登记结算有限责任公司证券资金结算业务。作为该公司的特别结算参与者，代表本集合计划完成与中国证券登记结算有限责任公司的一级证券交割与资金清算；本集合计划完成与托管人的二级证券资金的清算与交割。

2. 该账户按照中国证券登记结算有限责任公司有关账户管理与资金结算办法进行管理。管理人应配合托管人，按照中国证券登记结算有限责任公司业务管理的相关规章制度、业务规则等缴足各类结算保证金，按照有关规定交纳

相关业务费用。

(六) 银行间债券登记结算机构债券托管账户的开设和管理(如有)

本集合计划成立后, 托管人以本集合计划的名义在银行间债券登记结算机构开设债券托管账户, 债券账户名称应以债券登记结算机构的规定为准, 管理人应及时将银行间交易成交通知单和划款指令传真托管人, 托管人据此办理本集合计划银行间交易债券和资金的清算。在上述债券托管账户手续办理完毕后, 由托管人负责向相关监管部门进行报备。

(七) 证券投资基金账户开立和管理

因集合计划投资证券投资基金的需要, 管理人为本委托资产在指定的基金公司或第三方销售机构以本产品的名义开立证券投资基金账户, 用于办理本委托资产投资于开放式基金时的基金份额登记和交割, 并确保在产品存续期间托管账户为所投资的基金发生分红和赎回时的唯一资金回款账户, 管理人管理开立和使用上述账户, 账户开立后管理人需及时书面告知托管人该账户的相关信息。持有基金期间, 管理人需及时将基金确认、分红或赎回等业务单据的复印件发送给托管人。管理人应对第三方销售机构尽职调查后与其签订合同, 约定双方的权利和义务, 管理人负责解决因第三方销售机构不履行合同约定而给本委托资产造成的纠纷或损失。



定期存款账户开立和管理

集合计划投资定期存款在存款机构开立的银行账户, 包括实体或虚拟账户。定期存款账户户名应与托管专户保持一致, 该账户预留印鉴经与托管人商议后预留。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。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, 约定管理人和托管人双方的权利和义务。该协议须由管理人和托管人双方协商一致, 内容应至少包含起息日、到期日、存款金额、存款账户、存款利率、存款是否可以提前支取、定存到期支取账户、存款证实书如何交接以及存款证实书不得转让质押等条款。协议须约定资产托管人经办行名称、地址和账户, 并将本资产管理计划资金账户指定为唯一回款账户。

(九) 集合计划投资的有关实物证券的保管

---

实物证券由托管人负责保管，托管人可将其存放于托管人所在银行的保管库；也可存入中央国债登记结算有限公司或中国证券登记结算有限责任公司的代保管库。保管凭证原件由托管人持有。

实物证券的购买和转让，由托管人根据管理人的指令办理。托管人对托管人以外机构实际有效控制的证券不承担责任。保管费用按中国证监会及其它有权机关的规定执行。

#### （十）与集合计划资产相关合同的保管

1. 由管理人代表本集合计划签署与集合计划投资有关的合同，合同原件由管理人保管，但管理人应及时通知托管人并将该合同原件的复印件加盖公司公章后交托管人一份。保管期限按照国家有关规定执行。由于合同产生的问题，由合同签署方负责处理。

2. 根据集合计划运作管理的需要由托管人以集合计划的名义签署的合同，由管理人以传真方式下达签署指令，合同原件由托管人保管，但托管人应将合同原件的复印件交管理人一份。如该等合同需要加盖管理人公章，则管理人至少应保留一份合同原件。

3. 因管理人将自己保管的本集合计划相关合同项下的权利在未经托管人同意的情况下，用于担保或债权转让或作其他权利处分而造成集合计划资产损失，由管理人负责，托管人予以免责。

4. 因托管人将自己保管的本集合计划相关合同项下的权利在未经管理人同意的情况下，用于担保或债权转让或作其他权利处分而造成集合计划资产损失，由托管人负责，管理人予以免责。



#### 第四条 指令的发送、确认和执行

##### （一）管理人对发送指令人员的授权

管理人应向托管人提供预留印鉴和授权人签字样本，事先书面通知（以下称“授权通知”）托管人有权发送指令的人员名单，注明相应的交易权限，并规定管理人向托管人发送指令时托管人确认有权发送人员身份的方法。授权通知应由资产管理人法定代表人或授权签字人签字并加盖公章，若由授权签字人签署，还应附上法定代表人的授权书，授权通知应载明生效时间。管理人应以传真或其他双方认可的方式向托管人发送授权通知并及时与托管人进行电话确认。授权通知书载明的具体生效时间不得早于托管人电话确认时间，否则以托管人电话确认时间为授权通知的生效时间。管理人应确保原件与传真件/扫描件一致，若不一致则以生效的传真件/扫描件为准。管理人和托管人对授权文件负有保密义务，其内容不得向授权人及相关操作人员以外的任何人泄露。

##### （二）指令的内容

指令是管理人在运作集合计划资产时，向托管人发出的资金划拨及其他指令。包括付款指令（包括委托人退出金额支付、费用支付、收益分配款、清算资产分配款等）、以及其它资金划拨指令等。管理人发给托管人的指令应写明款项事由、支付时间、到账时间、划款金额、付款人账户信息、收款人账户信息等，加盖预留印鉴并有被授权人签字。

相关登记结算有限责任公司向托管人发送的资金结算通知或数据等视为管理人向托管人发出的有效指令。

##### （三）指令的发送、确认和执行

1. 指令由授权通知确定的指令发送人员代表管理人用传真或管理人和托管人双方确认的方式向托管人发送。管理人在发出划款指令后，需与托管人电话或其他双方认可的方式联系确认，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托管人不承担责任。

管理人应按照《指导意见》、《管理办法》、《管理规定》、《集合资产管理合同》和有关法律法规的规定，在其合法的经营权限和交易权限内发送指令；指令发送

---

人员应按照其授权权限发送指令。对于被授权的指令发送人员发出的指令，管理人不得否认其效力。但如果管理人已经撤销或更改对指令发送人员的授权，并且托管人已经确认的，则对于此后该指令发送人员无权发送的指令，或超权限发送的指令，管理人不承担责任，授权已更改但未通知托管人或托管人未确认的情况下，因前指令发送人员发送的指令造成的损失，托管人不负任何责任。

管理人向托管人发送指令时，应确保集合计划银行托管专户或结算备付金账户有足够的资金余额。对超头寸的指令，托管人可不予执行，但应立即通知管理人，并视托管专户资金余额充足时为指令送达时间，托管人不承担因未执行该指令造成损失的责任。划款指令执行日累计金额超过人民币 1 亿元，原则上管理人应提前一个工作日向托管人报备，如当日报备则需在上午 9:15 之前。

托管人对复核无误的指令应在规定期限内执行，不得延误。管理人在下达指令时还应考虑托管人执行指令所需的合理时间，一般为两个小时（如遇特殊情况晚于截止时间，资产托管人尽量完成，但不承担因延误发送指令造成的任何损失）。托管人办理资金 T+0 划转业务的受理时间截止到当天 15:00，否则由此导致业务指令无法执行或延误执行的，托管人不承担责任。如遇特殊情况，视业务情况双方当事人协商解决。

管理人应在交易结束后将银行间同业市场债券交易成交单加盖预留印鉴后及时传真给托管人，并电话确认。如果不传真，管理人应出具加盖预留印鉴的函件说明不再出具交易成交单并与托管人确认接收该函件后起执行。如果银行间簿记系统已经生成的交易需要取消或终止，管理人要书面通知托管人。（如有）

本计划财产资金账户发生的银行结算费用、银行账户维护费等银行费用，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划款指令。

管理人发送指令时应同时向托管人发送必要的投资合同、费用发票等划款证明文件的复印件（如有）。购买证券投资基金时，托管人依据管理人出具的划款指令进行资金支付，同时管理人应提供相关的交易凭证或单据。

2. 托管人在接收指令时，应根据《指导意见》、《管理办法》、《管理规定》、《集合资产管理合同》等有关规定对指令内容的合规性、指令要素的完整性、正确性进行检查，托管人可根据指令的内容要求管理人提供合同、协议等款项支付

的文件依据。托管人仅对管理人提交的指令按照本协议约定进行表面一致性审查，托管人不负责审查管理人发送指令同时提交的其他文件资料的合法性、真实性和有效性，管理人应当保证上述文件资料合法、真实和有效。如因管理人提供的上述文件不合法、不真实或失去效力而影响托管人的审核或给任何第三人带来损失，托管人不承担任何形式的责任。

托管人在收到有效指令后，将对于同一批次的划款指令随机执行，如有特殊支付顺序，管理人应以书面形式提前告知，如未及时告知导致托管人未按管理人需要的顺序执行指令造成的资金及其他损失，托管人免责。

托管人在履行监督职能时，发现管理人的指令内容违法、违规的，有权不予执行，并通知管理人进行复查和改正。对管理人未能在限期内纠正的，托管人应及时报告相关监管机构。

托管人发现管理人发送指令要素错误、无相关合同或协议依据的费用支付指令、预留印鉴错误等情形，应及时告知管理人，由管理人改正后重新发送。对于要素错误的指令，托管人应不予执行。托管人对执行资产管理人的依据交易程序已经生效的指令对本计划财产造成的损失不承担赔偿责任。

管理人若修改或要求停止执行已经发送的指令，应先与托管人电话联系，若托管人还未执行，管理人应重新发送修改指令或在原指令上注明“停止执行”字样并由指令发送人员签字，托管人收到修改或停止执行的指令后，将按新指令执行；若托管人已执行原指令，则应与管理人电话说明。

#### （四）被授权人的更换

管理人若对授权通知的内容进行修改、变更（包括但不限于指令发送人员的名单、权限的修改），应当至少提前 1 个工作日通知托管人；修改授权通知的文件应由管理人加盖公章并由法定代表人或其授权代表签署，若由授权代表签署的，还应附上法定代表人的授权书。管理人对变更后的授权通知，应当以传真或双方认可的方式发送给托管人并及时与托管人进行电话确认。若授权书中载明具体生效时间，则该时间不得早于托管人电话确认时间，否则以托管人电话确认时间为生效时间，原授权文件同时废止。管理人应确保原件与传真件/扫描件一致，若不一致则以生效的传真件/扫描件为准。管理人更换被授权人通知生效后，对

---

于已被撤换的人员无权发送的指令，或被改变授权范围人员超权限发送的指令，托管人不予执行。

托管人更换接受管理人指令的人员，亦应提前电话通知管理人。

（五）其它事项

1. 除因故意或过失致使集合计划的利益受到损害而负赔偿责任外，托管人对执行管理人的合法指令或执行指令过程中由于本协议当事人以外的第三方过失对集合计划资产造成的损失不承担赔偿责任。

2. 托管人因过错致使本集合资产管理计划的利益受到损害，应对所造成的直接经济损失负赔偿责任。

3. 资金划款指令正本由管理人保管，托管人保管指令传真件。当两者不一致时，以托管人收到的业务指令传真件为准。



---

## 第五条 交易单元

本计划在进行证券交易所场内交易前，管理人应将集合计划在证券交易所的投资交易活动，集中在专用的交易单元上进行，并向证券交易所、证券登记结算机构以及其他相关监管机构备案。

该交易单元不得用于管理人的自营业务、经纪业务。



## 第六条 证券交易的资金清算与交割

### （一）资金清算与交割

集合计划的证券投资的清算交割，由托管人通过相关登记结算机构及清算代理银行办理。

#### 1. 资金划拨

管理人的资金划拨指令，托管人在复核无误后应在规定期限内执行，不得延误。如管理人的资金划拨指令有违法、违规或违反《集合资产管理合同》或本协议约定的，托管人不予执行并通知管理人进行复查和改正。

#### 2. 结算方式

支付结算方式应符合中国人民银行结算管理办法以及托管人资金结算管理规定。

#### 3. 资金的清算交收安排

本计划非证券交易所场内交易的资金清算交割由托管人根据管理人出具的指令进行办理。

本计划如涉及证券交易所场内交易时，场内交易的资金清算交割由托管人负责办理。其中场内交易的资金清算由托管人根据中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司的结算数据办理。本资产证券投资的清算交割，由托管人通过中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司及清算代理银行办理。

如果因为托管人自身过错在清算上造成集合计划财产的损失，应由托管人负责赔偿；如果因为管理人违反法律法规的规定进行证券投资而造成集合计划资产清算困难和风险的，托管人发现后应及时通知管理人，由管理人负责解决，由此给集合计划资产造成的损失和违约责任由管理人承担。

集合计划进行证券交易所场内交易后，托管人按照中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司的清算交收规则，于每月初第二个工作日调整本集合计划的最低备付金和证券结算保证金余额，资产管理人应提前一个交易日匡算最低备付金和证券结算保证金调整金额，留出足够资金头寸，以保证正常交收。如由于资产管理人的原因导致无法正常交收的，由此给托管人造成实际损失由资

产管理人承担。

集合计划参与 T+0 交易所非担保交收债券交易时，管理人应确保有足额头寸用于上述交易，并必须于 T+0 日 14:00 之前出具有效划款指令（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。如由非托管人的原因导致 T+0 非担保交收失败，给托管人造成损失的，管理人应承担赔偿责任。

## （二）期货交易及清算交收(如有)

管理人选择的期货公司负责办理集合计划的期货交易的清算交割；管理人应负责其选择的期货公司对发送的数据的准确性、完整性、真实性负责。管理人、托管人以及期货公司应另行签署《期货投资托管操作备忘录》，约定集合计划在期货投资运作中的职责及义务。

## （三）资金和证券账目对账的时间和方式

集合计划的证券、资金账目，管理人和托管人应每日核对。

资金账目的核对需要集合计划的管理人和托管人双方每个交易日进行。交易日终了时，首先由托管人负责与开户银行核对，确保账实相符；待当日账务处理完毕，管理人与托管人核对账务，确保双方账账相符。

2018-11-09 9:03  
证券账目的核对需要集合计划管理人和托管人双方每个交易日进行。交易日终了时，管理人将列明所持有证券种类、数量的估值表，用传真方式或约定的电子传送方式送托管人进行核对。核对中出现问题的，由管理人和托管人双方共同查找原因，进行调整。

对实物券账目，每月月末相关各方进行对账核实。

管理人应采取必要且合理措施，确保集合资产管理计划不发生透支。

发生证券超买时，管理人应以自有资金补足超买款（包括超买款项及相关费用）。超买证券平仓后，托管人将资金扣除相应损失、费用后退还管理人。管理人承担由此引起的一切法律责任。

## （四）集合计划参与、退出业务的处理

### 1. 参与、退出业务安排

本集合计划参与、退出业务根据集合计划合同及/或相关信息披露文件确定

---

时间开始办理，管理人应及时通知托管人上述业务的开办时间。

管理人和托管人应当按照合同的约定，在集合计划参与、退出的时间、场所、方式、程序、价格、费用、收款或付款等各方面相互配合，积极履行各自的义务，保证集合计划参与、退出工作能够顺利进行。

## 2. 参与、退出业务的资金清算、过户与登记方式的基本规定

集合计划的投资者可通过管理人的销售网点或代销网点进行参与和退出申请，由本集合计划的注册登记人办理份额的过户和登记，托管人负责接收并确认资金的到账情况，以及依照管理人的划款指令划付退出款项。

## 3. 集合计划清算专用账户

为满足认购、申购、退出及分红资金汇划的需要，由管理人开立资金清算的专用账户，该账户由注册登记机构管理。

## 4. 募集期参与业务清算（N 日为截止认购日）：

(1) N+2 日，注册登记机构反馈确认数据；生成净认购金额（份额）和费用数据。

(2) N+3 日，注册登记机构将认购资金扣除认购费用后，划到清算专用账户。对于通过直销参与的认购资金，可以在 N+2 日划款。

(3) 管理人当日根据注册登记机构确认的资金清算结果，向注册登记机构发出划款，将清算资金从清算专用账户划至本集合计划在托管人处开立的“托管专用账户”，完成与托管人的资金交收。会计师事务所在托管户验资，提供验资报告。

## 5. 参与、退出业务清算（T 为交易申请日）

(1) T+2 日 15:00 前，管理人或其委托的登记机构根据 T 日份额净值计算投资者申购、赎回的份额，并将清算确认的有效数据和资金数据汇总传输给托管人。管理人和托管人据此进行申购、赎回的会计处理。管理人和托管人协商一致后，可根据实际情况缩短产品份额净值计算的时间。

(2) 管理人应要求注册登记机构开立并管理专门用于办理产品申购赎回等款项清算的“清算账户”。托管账户与“清算账户”间的资金清算遵循“净额清算、净额交收”的原则，即按照托管账户应收资金与托管账户应付额的差额来确



---

定托管账户净应收额或净应付额，以此确定资金交收额。

(3) 当存在托管账户净应收额时，产品管理人负责将托管账户净应收额在当日 16:00 前从“清算账户”划到产品的托管账户；当存在托管账户净应付额时，托管行按管理人的划款指令将托管账户净应付额在当日 12:00 前划到“清算账户”。



## 第七条 集合计划资产的估值和会计核算

### （一）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。

### （二）估值日

参照《集合资产管理合同》约定

### （三）估值程序

集合计划资产的日常估值由管理人进行。管理人于每个工作日的下一工作日内完成估值后，将估值结果发送至托管人，托管人按法律法规、产品合同规定的估值方法、时间、程序进行复核无误后返回给管理人；月末、年中和年末估值复核与会计账目的核对同时进行，但管理人根据法律法规或本产品合同的规定暂停估值时除外。由管理人负责在指定媒体上进行披露。

### （四）估值方法

以《集合资产管理合同》约定为准。

### （五）单位净值确认及差错处理

本集合计划单位资产净值的计算精确到 0.0001 元，小数点后第 5 位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

管理人和托管人应采取必要、适当、合理的措施确保集合计划资产估值的准确性和及时性。当集合计划单位净值的计算出现错误时，管理人、托管人立即予以纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大。估值错误偏差达到集合计划资产净值的 0.5% 时，集合计划管理人应当立即通报集合计划托管人，并向委托人披露。

因集合计划份额资产净值计算错误给集合计划资产及委托人造成损失的，应先从管理人承担赔偿责任。管理人在赔偿后，对不应由其承担的责任，有权向其他有关差错责任方追偿。当管理人计算的计划资产净值、计划单位净值已由托管人复核确认后公告的，由此造成的委托人或集合计划资产的损失，应根据法律法规的规定对委托人或集合计划资产支付赔偿金，就实际向委托人或基金支付的赔偿金额，由管理人与托管人按照管理费率 and 托管费率的比例各自承担相应的责任。集合计划管理人具有向当事人追偿不当得利的权利。如法律法规或监管机关另有规定的，按其

规定处理。


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，进而导致集合计划资产净值计算错误造成委托人或集合计划资产的损失，以及由此造成以后交易日集合计划资产净值计算顺延错误而引起的委托人或集合计划资产的损失，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登记结算公司发送的数据错误，或由于其他不可抗力原因，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，由此造成的集合计划资产估值错误，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。

针对净值差错处理，如果法律法规或证监会有新的规定，则按法律法规或新的规定执行；如果没有，则以公平的原则重新协商后进行处理。

当管理人计算的集合计划资产净值与托管人的计算结果不一致时，相关各方应本着勤勉尽责的态度重新计算核对，如果最后仍无法达成一致，应以管理人的计算结果为准对外公布，由此造成的损失以及因该交易日集合计划资产净值计算顺延错误而引起的损失由管理人承担赔偿责任，托管人不负赔偿责任。

#### （六）暂停估值的情形

2018-1492393  
时： 1. 本集合计划投资涉及的证券交易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管理人、托管人无法准确评估集合计划资产价值时；

3. 中国证监会认可的其他情形。

若估值条件恢复时，管理人必须按规定完成估值工作。

#### （七）会计核算制度

管理人和托管人应按照《会计法》、《管理办法》、说明书及《集合资产管理合同》等约定的同一记账方法和会计处理原则，分别独立进行集合计划资产的会计核算，并定期核对，相互监督。若对账发现相关各方的账目存在不符的，管理人和托管人必须及时查明原因并纠正，保证相关各方平行登录的账册记录完全相符。若当日核对不符的，暂时无法找到错账的原因而影响到集合计划资产核算和

---

公告的，以管理人的账册为准，因此发生的一切责任由管理人承担。

集合计划会计核算责任人由管理人承担。

#### （八）财务报表的编制、复核、上报

集合计划财务报表由管理人编制，托管人复核。年度报表在会计年度结束后4个月内完成并上报。

管理人需按《管理办法》规定定期编制集合计划资产管理报告。管理人在年度报表完成当日，将有关报告提供托管人复核，托管人在收到后30个工作日内对其中财务数据进行复核，并将复核结果反馈管理人。托管人在复核过程中，发现相关各方的报表存在不符时，管理人和托管人应共同查明原因，进行调整，调整以相关各方认可的账务处理方式为准。核对无误后，托管人在管理人提供的报告上加盖业务章，相关各方各自留存一份。

托管人在对年度报表复核完毕后，需出具相应的复核确认书，以备有关机构对相关文件审核时查阅。



---

## 第八条 集合计划资产有关文件档案的保存

管理人和托管人应按各自职责完整保存托管资产账册、原始凭证、记账凭证、交易记录、公告、重要合同、持有人名册等文件档案及相应的电子文档，保存期自资产管理计划终止之日起不少于二十年。

托管人应至少保管有关集合计划资产的全部合同的一份正本。



## 第九条 信息披露

### （一）保密义务

除按照《指导意见》、《管理办法》、《管理规定》、《集合资产管理合同》、说明书及中国证监会关于信息披露的有关规定进行披露以外,管理人和托管人对集合计划的有关信息均应恪守保密的义务。管理人与托管人对集合计划的任何信息,不得在其公开披露之前,先行对相关各方以外的任何机构、组织和个人泄露。

### （二）定期报告

定期报告包括集合计划单位净值报告、集合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. 集合计划单位净值报告

披露时间:本集合计划的封闭期内,管理人应当至少每周披露一次集合计划单位净值。在本集合计划的开放期内,管理人应当在每个工作日披露上一个工作日的计划单位净值。

披露方式:本集合计划的信息披露事项主要在管理人网站上向委托人披露,网址:[www.htsamc.com](http://www.htsamc.com)。

#### 2. 集合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、完整的管理季度报告和托管季度报告,对报告期内集合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。上述报告应于每季度结束之日起1个月内由管理人通过管理人网站向委托人披露。本计划成立不足3个月或者存续期间不足3个月的,可不编制当期的季度报告。

#### 3. 集合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,对报告期内集合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。上述报告应于每个会计年度截止日后4个月内由管理人通过管理人网站通告。本计划成立不足3个月或者存续期间不足3个月的,可不编制当期的年度报告。

#### 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集合计划的运营情况进行年度审计,并在每年度结束之日起4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。

管理人应当在每年度结束之日起4个月内将审计结果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。

#### 5. 对账单

委托人可以以电子邮件或者账号登录的方式索取对账单,默认的寄送方式为电子邮件。对账单内容应包括委托人持有集合计划的风险和差异性、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正确、有效的电子邮箱地址。电子邮件对账单自管理人系统发出即视为送达。

#### (三) 临时报告

集合计划存续期间,发生对集合计划持续运营、委托人利益、资产净值产生重大影响的事件,管理人应当以管理人指定网站、销售机构网站或网点、或其他途径和方式及时向委托人披露。临时报告的情形包括但不限于:

(1) 集合计划运作过程中,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,或出现其他可能对集合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) 发生巨额退出并延期支付;

(4) 集合计划终止和清算;

(5) 集合计划存续期满并展期;

(6) 管理人以自有资金参与和退出;

(7) 合同的补充、修改与变更;

(8) 与集合计划有关的重大诉讼、仲裁事项;

(9) 负责本集合计划的代理销售机构发生变更;

(10) 集合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;

- 
- (11) 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；
  - (12) 管理人、托管人因解散、破产、撤销等原因不能履行相应职责；
  - (13) 管理人认为重大的其他事项。

(四) 信息披露文件的存放与查阅

集合计划说明书、《集合资产管理合同》存放在各销售场所，委托人可在营业时间内免费查阅。在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复印件。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。对委托人按上述方式所获得的文件及其复印件，管理人和托管人保证与所报告的内容完全一致。集合资产管理定期报告、托管定期报告及其他临时通告等信息披露文件公布于管理人网站，供委托人查阅。





## 第十条 集合计划的费用支出

### (一) 集合计划费用计提方法、标准和支付方式

#### 1. 管理人的管理费

本集合计划对计划财产中持有的本管理人自身管理的资管产品的部分不收取管理费。本集合计划的管理费按前一日资产净值扣除所持有的本管理人自身管理的资管产品份额所对应的资产净值后的余额（若为负数，则取0）的0.7%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.7\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的管理费；

E为前一日资产净值扣除所持有的本管理人自身管理的资管产品份额所对应的资产净值后的余额。

管理费每日计提，逐日累计至每月月底，按季支付，由管理人向托管人发送管理费划付指令，托管人复核后于次月首日起5个工作日内从集合计划资产中一次性扣除支付给管理人，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延至下一个工作日。

管理人管理费指定接收账户信息如下：

账户名称（接收管理费）：上海海通证券资产管理有限公司  
账号：076334-98490153850000012

开户银行：上海浦东发展银行长宁支行

自集合计划成立的下一个自然年度起，本集合计划每个自然年度的管理费率按照上一自然年度的计划投资运作情况确定，并在每个自然年度的首个工作日公告确定当年的管理费率调整情况（若本集合计划成立日在6月30日以后的，则集合计划成立的下一个自然年度的管理费率为0.7%/年）。

假设，

$AN_i$  为上一自然年度最后一个工作日的集合计划单位累计净值；

$AN_0$  为上一自然年度首个工作日（或首年成立日在6月30日前的，取成立日）的集合计划单位累计净值；

$I_i$  为上一自然年度最后一个工作日中证500指数的点位；

$I_0$  为上一自然年度首个工作日（或首年成立日在 6 月 30 日前的，取成立日）中证 500 指数的点位。

若上一自然年度  $\frac{AN_i - AN_0}{AN_0} < \frac{I_i - I_0}{I_0}$ ，则本年度的管理费率为 0%；若上一自然年度

$\frac{AN_i - AN_0}{AN_0} \geq \frac{I_i - I_0}{I_0}$ ，则本年度的管理费率为 0.7%/年。

## 2. 托管人的托管费

本集合计划对计划财产中持有的本托管人自身托管的资管产品的部分不收取托管费。本集合计划的托管费按前一日资产净值扣除所持有的本托管人自身托管的资管产品份额所对应的资产净值后的余额（若为负数，则取 0）的 0.05% 年费率计提。

托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.05\% \div \text{当年实际天数}$$

H 为每日应计提的托管费；

E 为前一日资产净值扣除所持有的本托管人自身托管的资管产品份额所对应的资产净值后的余额。

托管费每日计提，逐日累计至每月月底，按季支付，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 5 个工作日内从集合计划资产中一次性扣除支付给托管人，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延至下一个工作日。

托管人托管费指定接收账户信息如下：

账户名称（接收托管费）：**证券公司客户资产管理产品托管费**

账 号：**C110050**

开户银行：**中国民生银行**

## 3. 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在符合业绩报酬计提条件时，在本集合计划收益分配日、委托人退出日或计划终止日计提业绩报酬；本集合计划业绩报酬提取频率不得超过每 6 个月一次，因投资者退出资产管理计划，管理人按照本合同的约定提取业绩报酬的，不受该提取

频率的限制；

③在收益分配日或委托人退出日提取业绩报酬的，业绩报酬从分红或退出资金中扣除；

④在计划终止时提取业绩报酬的，业绩报酬从清算资金中扣除；

⑤委托人申请退出时，管理人按“先进先出”的原则，即按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：

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，则募集期参与的为注册登记机构份额注册登记日，存续期参与的为份额参与日，下同）到本次业绩报酬计提日的期间年化收益率，作为计提业绩报酬的基准。期间年化收益率的计算公式如下：

$$R = \frac{(P_1 - P_0)}{P_0} \div \frac{D}{365} \times 100\%$$

业绩报酬计提日为分红收益分配日、委托人退出日或计划终止日；

$P_1$  为业绩报酬计提日的集合计划单位累计净值；

$P_0$  为上一个发生业绩报酬计提日的集合计划单位累计净值；



$P_0^*$  为上一个发生业绩报酬计提日的集合计划单位净值；

$D$  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实际天数；

$R$  为年化收益率。

管理人对每笔参与份额的业绩报酬计提如下：

年化收益率 (R)	计提比例	业绩报酬 (Y) 的计提公式
$R < 10\%$	0	$Y = 0$
$R \geq 10\%$	10%	$Y = A \times (R - 10\%) \times 10\% \times (D/365)$

其中， $Y$ =业绩报酬； $A$ =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。

(3) 业绩报酬支付：管理人负责计算业绩报酬，托管人不承担复核的责任，管理人于每个业绩报酬提取日计提业绩报酬，由托管人于业绩报酬提取日后5个工作日内按照管理人指令从本集合计划资产中一次性支取，若遇法定节假日、休息日等，

支付日期顺延。

(4) 本集合计划在分红日计提业绩报酬的，业绩报酬金额上限为分红金额，即若按照上述公式计算的业绩报酬金额大于该次分红金额的，该次业绩报酬金额以分红金额为限，管理人对超出部分予以免收。

#### 4. 证券交易费用

本集合计划运作期间在所投资市场实际发生的证券交易、清算、登记等费用、购买或处置证券有关的任何税收和费用（包括但不限于印花税、交易及其他税收及预扣提税以及与前述各项有关的税收和费用任何利息、罚金及费用等），作为交易费用在交易过程中直接扣除，其费率由管理人根据相关法规政策确定。

本集合计划向所租用交易单元的券商支付佣金（该佣金已扣除风险金），其费率由管理人根据有关政策法规确定。在每季度首日起 10 个工作日内支付给提供交易单元的券商。

#### 5. 清算费用

本集合计划终止清算时所发生费用，按实际支出额从集合计划资产总值中扣除。

#### 6. 其他费用

集合计划成立后的信息披露费用、会计师费和律师费，以及按照国家有关规定可以列入的其他费用，由管理人本着保护委托人利益的原则，按照公允的市场价格确定。法律法规另有规定时从其规定。并由托管人根据法律法规及相应协议的规定，按费用实际支出金额支出，列入当期集合计划费用；

银行结算费用，一次计入集合计划费用；

银行间市场账户维护费，按银行间市场规定的金额，在相应的会计期间一次性计入费用；

开户费、银行账户维护费、银行间交易费、转托管费在发生时一次计入集合计划费用；

因本计划运作涉及诉讼、仲裁而发生的诉讼费、仲裁费、执行费、保全费、律师费、差旅费及其他必要费用；

与集合计划运营有关的其他费用，如果金额较小，或者无法对应到相应会计期间，可以一次进入集合计划费用；如果金额较大，并且可以对应到相应会计期间，

应在该会计期间内按直线法摊销。

### （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募集有关的费用，不得在集合计划资产中列支。本集合计划注册登记费用不列入集合计划费用项目。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，以及处理与本集合计划运作无关的事项发生的费用等不列入本集合计划费用。

其他不列入集合计划费用的具体项目依据中国证监会有关规定执行。

### （四）税收

委托资产运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。签约各方同意并确认本产品投资、管理和运作过程中涉及的增值税及与增值税相关的附加税费（包括但不限于，城建税、教育费附加及地方教育费附加等）等由委托财产及委托人承担，管理人可直接划付至资管产品管理人账户并由资管产品管理人依据税务部门要求完成相关纳税申报义务。委托人实际获得的产品收益金额将可能会因此减少。

资产管理人有义务与所在地税务机关保持联系和沟通，确认相关纳税品种和相关计算方式。产品成立后资产管理人须及时向托管人提供增值税相关税率方案和参数方案。

如本计划财产进行清算后，发生管理人被税务机关要求补缴应由本计划委托资产及委托人承担的增值税及与增值税相关的附加税费（包括但不限于，城建税、教育费附加及地方教育费附加等）的情况，委托人同意向管理人支付该等补缴的税费金额，管理人有权向委托人就补缴的税费金额进行追偿。

资管产品增值税缴纳账户如下：

户 名：上海海通证券资产管理有限公司

账 号：310066726018170176718

开户银行：交通银行上海分行第一支行

## 第十一条 集合计划清算资产的分配

(一) 本合同终止，资产委托人仍应向资产管理人与资产托管人支付已产生的管理费、托管费、业绩报酬、交易费用等各项费用。

(二) 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；

(三) 清算过程中的有关重大事项应当及时公布；

(四) 清算结束后7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（如有）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；

(五) 清算结束后5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，并将清算结果报送相关管理机构备案，同时抄送管理人住所地中国证监会派出机构。

(六) 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，通过管理人网站进行披露，并应及时向中国证监会相关派出机构和证券投资基金业协会报告。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。管理人应采取合理、必要措施，确保T日日终有足够的资金头寸完成T+1日的投资交易资金结算；如因管理人原因导致资金头寸不足，管理人应在T+1日上午10:00前补足透支款项，确保资金清算。如果未遵循上述规定备足资金头寸，影响集合计划资产的清算交收及托管人与中国证券登记结算有限公司之间的一级清算，由此给托管人、集合计划资产及托管人托管的其他资产造成的直接损失由管理人负责。

(七) 集合计划财产清算完毕后，资产托管人按照规定办理本计划相关账户的销户工作，资产管理人应给与必要的配合。

(八) 集合资产管理计划清算账册及有关文件由集合计划管人、托管人、代

---

理托管机构按相关法律、法规规定年限妥善保存，保存期自资产管理计划终止之日起不少于二十年。



## 第十二条 管理人的权利与义务

### （一）管理人的权利

1. 根据《集合资产管理合同》及《说明书》的约定，独立运作集合计划的资产；
2. 根据《集合资产管理合同》及《说明书》的约定，收取管理费等费用；
3. 按照《集合资产管理合同》及《说明书》的约定，停止办理集合计划份额的参与，暂停办理集合计划的退出事宜；
4. 根据《集合资产管理合同》及《说明书》的约定，终止本集合计划的运作；
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. 行使集合计划资产投资形成的委托人权利；
7. 集合计划资产受到损害时，向有关责任人追究法律责任；
8. 法律、行政法规、中国证监会的有关规定、《集合资产管理合同》及托管协议约定的其他权利。

### （二）管理人的义务

在集合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，以专业技能管理集合计划的资产，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；建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的委托财产与旗下其他财产和管理人的财产相互独立，对所管理的不同财产分别管理、分别记账，独立开展投资；
3. 依法募集资金，办理产品份额的发售和登记事宜；
4. 办理产品登记备案手续；
5. 根据中国证监会有关规定、《集合资产管理合同》、《说明书》和托管协议的约定，接受托管人的监督；
6. 依法对托管人、代理销售机构的行为进行监督，如发现托管人、代理销售机构违反法律、行政法规和中国证监会的规定，或者违反托管协议、代理销售协议的，应当予以制止；
7. 办理与受托财产管理业务活动有关的信息披露事项；按规定进行产品会



---

计核算并编制产品财务会计报告，并出具资产管理报告，保证委托人能够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；

8. 按照《集合资产管理合同》及《说明书》约定确定收益分配方案，及时向投资者分配收益；

9. 按照法律法规、中国证监会的有关规定和《集合资产管理合同》及《说明书》的约定，及时向申请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、销售文件、委托人资料、交易记录、会计账册等文件、资料和数据，保存期自资产管理计划终止之日起不少于二十年；

11. 在集合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；

12. 以管理人名义，代表投资者利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；

13. 在兑付受托资金及收益时，管理人应当保证受托资金及收益返回委托人的原账户、同名账户或者合同约定的受益人账户；

14. 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；

15. 因管理人违反本合同导致集合计划资产损失或损害委托人合法权益时，应承担赔偿责任；

16. 因托管人违反本合同导致集合计划资产损失或损害委托人合法权益时，代委托人向托管人追偿；

17. 应确保资金来源的合法合规性，并履行（或承担）客户身份识别、客户身份以及交易记录保存等法定反洗钱义务；

18. 法律、行政法规、金融监督管理部门的有关规定、《集合资产管理合同》及托管协议约定的其他义务。

### 第十三条 托管人的权利与义务

#### （一）托管人的权利

1. 依法对集合计划的资产进行托管；
2. 按照《集合资产管理合同》和本托管协议的约定收取托管费；
3. 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法规、中国证监会的有关规定或者《集合资产管理合同》和本托管协议约定的，有权要求其改正；未能改正的，有权拒绝执行，并向相关监管机构报告；
4. 查询集合计划的经营运作情况；
5. 法律法规、中国证监会有关规定和《集合资产管理合同》、《说明书》以及托管协议约定的其他权利。

#### （二）托管人的义务

1. 依法为集合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，不得擅自用或处分集合计划资产；
3. 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，确保集合计划托管专户内资产的独立和安全，依法保护委托人的财产权益；
4. 安全保管集合计划托管专户内的资产，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. 按照资产管理合同约定，根据管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；
6. 定期核对资产管理业务资产情况；
7. 监督管理人集合计划的投资运作，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《集合资产管理合同》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，并及时报告管理人住所地中国证监会派出机构和证券投资基金业协会；
8. 建立与管理人的对账机制，复核、审查管理人计算的集合计划的资产净值和资产管理计划参与、退出价格；
9. 保守集合计划的商业秘密，对资产管理计划投资信息和相关资料承担保

密责任，除法律、行政法规、规章规定或者审计要求、合同约定外，不得向任何机构或者个人提供相关信息和资料；

10. 办理与资产管理计划托管业务活动有关的信息披露事项；对资产管理计划财务会计报告、年度报告出具意见；

11. 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、资料和数据，保存期自资产管理计划终止之日起不少于二十年；

12. 在集合计划终止时，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；

13. 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；

14. 因违反本合同导致集合计划资产损失或损害委托人合法权益时，应承担赔偿责任；

15. 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；

16. 法律、行政法规、中国证监会的有关规定和《集合资产管理合同》以及托管协议约定的其他义务。



---

## 第十四条 禁止行为

1. 管理人、托管人不得进行《指导意见》、《管理办法》、《管理规定》、《集合资产管理合同》禁止的任一行为。
2. 除《指导意见》、《管理办法》、《管理规定》、《集合资产管理合同》、说明书及中国证监会另有规定，管理人、托管人不得为自身和任何第三人谋取利益。
3. 管理人与托管人对集合计划经营过程中任何尚未按有关法律、法规规定的方式公开披露的信息，不得对他人泄露。
4. 除根据管理人指令或《集合资产管理合同》另有规定的，托管人不得动用或处分集合计划资产。
5. 托管人、管理人应在行政上、财务上互相独立，其高级管理人员不得相互兼职。
6. 《集合资产管理合同》、说明书投资限制中禁止投资的行为。
7. 法律、法规、《集合资产管理合同》和本协议禁止的其他行为。



## 第十五条 违约责任

(一) 当事人一方因过错不履行本托管协议中约定的义务或者履行义务不符合本托管协议规定的, 该当事人应当赔偿由此给对方当事人造成的损失。

(二) 当事人双方因过错不履行本托管协议约定的义务或者履行义务不符合本托管协议规定的, 当事人双方分别承担与其过错相适应的违约责任。

(三) 因本协议的当事人违反本托管协议的约定给集合计划资产造成实际损害的, 应由违约方承担赔偿责任。

(四) 当事人一方违约, 另一方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。

违约行为虽已发生, 但本托管协议能够继续履行的, 在最大限度地保护持有人和委托人利益的前提下, 管理人和托管人应当继续履行本协议。

(五) 托管人在没有过错的情况下, 由于按照本托管协议的条款对集合计划资产进行托管而造成损失的, 托管人不承担赔偿责任。

(六) 管理人应根据国家法律法规及相关规定, 保证本管理计划资金投资运作的合法合规性。由于本管理计划的设计安排、管理、运作模式而产生的经济责任和法律责任, 托管人不予承担。

(七) 托管人仅承担本托管协议及资产管理合同约定的相关责任及义务, 管理人不得对托管人所承担的责任进行虚假宣传, 更不得以托管人名义或利用托管人商誉进行非法募集资金、承诺投资收益等违规活动。

(八) 在发生下列情况, 当事人可以免责:

1. 不可抗力;
2. 管理人和/或托管人按照当时有效的法律、法规或金融管理部门的规定作为或不作为而造成的损失等;
3. 管理人由于按照《集合资产管理合同》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. 在集合资产管理计划运作过程中, 管理人及托管人按照法律、行政法规的规定、《集合资产管理合同》以及本协议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. 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。

6. 托管人可采用第三方机构提供的数据和信息进行辅助以完成投资监督义务。托管人投资监督的准确性和完整性受限于管理人及其他中介机构提供的数据和信息，合规投资责任方为管理人。托管人对这些机构信息的准确性和完整性不作任何担保、暗示或表示，并对这些机构信息的准确性和完整性所引起的损失不负任何责任。

7. 托管人对交由证券公司、第三方基金销售机构等其他机构负责清算交收的委托资产及收益，因该等机构欺诈、疏忽、过失、破产等原因给委托资产造成的损失，由相关责任方承担，托管人不承担责任。

8. 法律、行政法规及中国证监会有关规定的其他情况。



---

## 第十六条 争议的处理

发生纠纷时，本托管协议当事人可以通过协商或者调解予以解决。

因履行本合同发生的争议，由协议签订各方协商解决，协商不成的，任何一方均有权将争议提交管理人住所地有管辖权法院进行诉讼。

纠纷处理期间，相关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《集合资产管理合同》、说明书和托管协议规定的义务，维护持有人和委托人的合法权益。

本协议受中华人民共和国法律管辖。



---

## 第十七条 托管协议的效力

本托管协议经双方当事人盖章以及双方法定代表人或法定代表人授权的代理人签字或签章并加盖公章或合同专用章之日起成立，自计划成立之日生效。

本协议的有效期限自生效日起至下列第 18 条所列的协议终止事由发生时止。

本协议一式三份，管理人持两份，托管人持一份，每份具有同等法律效力。





## 第十八条 托管协议的修改和终止

(一) 本托管协议中未尽事宜，应由当事人依据《集合资产管理合同》和有关法律、法规的规定协商解决。

(二) 对本托管协议的任何修改或补充，须经本协议双方当事人一致书面同意。修改后的新协议，其内容不得与《集合资产管理合同》的规定有任何冲突，否则以《集合资产管理合同》为准。

(三) 除《集合资产管理合同》中约定的管理人变更及托管人变更的情形外，发生以下情形，本托管协议终止，并按说明书、《集合资产管理合同》等约定的方式进行资产清算：

1. 集合计划终止；
2. 托管人解散、撤销、破产，且没有产生新的托管人；
3. 管理人解散、撤销、破产，且没有产生新的管理人；
4. 发生《管理办法》或其他法律法规规定的终止事项。

(四) 发生以下情形，本托管协议终止，并签订新的托管协议：

1. 由其他托管人依法接管本集合计划的集合资产；
2. 由其他管理人依法接替担任本集合计划的集合资产管理人。



本页无正文，供《海通远见 1 号 FOF 集合资产管理计划资产托管协议》  
签章使用。

管理人：上海海通证券资产管理有限公司（公章/合同专用章）



法定代表人或授权代表：

裴岩江

（签字或签章）

签订时间：      年      月      日

托管人：中国民生银行股份有限公司（公章/合同专用章）



法定代表人或授权代表：

（签字或签章）

张庆印

签订时间： 2018 年      月      日

## 附件：业务联系表

上海海通证券资产管理有限公司（管理人）

总机：021-23219000

岗 位	姓 名	联系方式	邮箱
数据发送和接收人员	金海峰	021-23219398	jhf9428@htsec.com
	李杨华	021-23219015	lyh@htsec.com
交易清算员	傅华胤	021-23212003	fhy9812@htsec.com
	胡其平	021-23212153	hqp10590@htsec.com
划款指令人联系人	钱晨奕	021-23212094	qcy9269@htsec.com
	童 峰	021-23212051	tf0547@htsec.com
对账联系人	赵新豪	021-23212135	zxh10872@htsec.com
	刘 雯	021-23212002	lw11327@htsec.com
协调人	陈 颖	021-23219897	cy7700@htsec.com



中国民生银行股份有限公司总行资产托管部（托管人）

总机：010-58560666

业务处室：资产托管部运营中心

姓名	岗位分工	办公电话	手机
<b>账户业务</b>			
张璇	业务联系人	010-57092370	13811629395
侯羽思		010-57092371	13601219900
账户咨询办理电话	010-57092373、010-57092374、010-57092377		
账户咨询办理邮箱		tgzh1@cmbc.com.cn	
<b>清算业务</b>			
冯昕	业务总联系（紧急联系人）	010-58560666-8611	18600555897
<b>清算业务-指令管理组</b>			
王丹	小组联系人	010-58560666-8642	15811391210
刘雯		010-58560666-8923	18610091820
指令发送传真	010-56368300, 010-56368301, 010-56368302, 010-56368303, 010-56368304, 010-56368305, 010-56368305, 010-56368307, 010-56368308, 010-56368309, 010-56368310		
指令发送邮箱		mstgqingsuan@cmbc.com.cn	
指令附件发送邮箱		mstgqingsuan1@cmbc.com.cn	
指令确认		010-58560666-8394/8758	
产品成立资料提交		010-58560700	
年金缴费及待遇支付			
指令执行情况/账户流水/余额查询			
<b>清算业务-证券结算组</b>			
郭娟	小组联系人	010-58560666-8745	18211191750
史慧杰		010-58560785	18701382875
朱远遥、王照涵	银行间业务	010-58560757、010-52667880	
史慧杰、朱远遥	定期存款业务	010-58560785、010-58560757	
	资金支付业务		
<b>核算业务</b>			
<b>核算业务-产品上线/交易维护</b>			
殷哲	新产品上线联系人	010-58560666-9535	13811763670
田绪运	交易维护联系人	010-57093127	13581803264
交易数据接收	深证通		小站号 k0241
	邮箱（仅用于紧急情况）		custody@cmbc.com.cn
<b>核算业务-业务处理</b>			
马自立	估值对账联系人	010-57093107	15210893751
王婷婷		010-57093458	13681161013

对账单/核算报表 接收	传 真	010-56368340
	邮 箱	mstghesuan@cmbc.com.cn

注：1、所有数据请压缩成压缩包，文件命名格式为【产品名称 yyyyymmdd.rar/zip】，其中 yyyyymmdd 为 8 位数日期，数据表示交易日期。

2、对账单如选择邮箱发送邮件名称为【对账单-产品名称 yyyyymmdd】，其中 yyyyymmdd 为 8 位数日期，数据表示交易日期。

**业务处室：资产托管部科技团队**


姓 名	岗 位	办公电话	手 机	邮 箱
周昊哲	技术支持 联系人	010-57093478	18600160346	zhouhaozhe@cmbc.com.cn
任秀丽		010-57092379	18611808497	renxiuli@cmbc.com.cn


**业务处室：资产托管部风险中心**

姓 名	岗 位	办公电话	手 机	邮 箱
罗菲菲	投资监督 联系人	010-58560666-8128	13810914509	luofeifei2@cmbc.com.cn
		010-58560798		

## 附件 2：投资监督事项表

### 投资监督事项表

序号	监督事项	监督内容
 2018-1492393-1	投资范围	<p>本集合计划主要投资于专项资产管理计划、各类证券投资基金、证券投资类资产管理计划、集合资金信托计划等金融监管部门批准或备案发行的金融产品（以下统称“子产品”），其中，投资于上述子产品的比例为 80%-100%，且按照穿透原则合并计算，最终投资于上市公司股票、存托凭证等权益类资产的比例为本集合计划总资产的 80%-100%；剩余资金可投资于债权类资产及现金类资产。</p> <p>特别提示，本计划投资的专项资产管理计划、各类证券投资基金、证券投资类资产管理计划、集合资金信托计划等，可能存在委托私募证券投资机构担任投资顾问的情形。</p> <p>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管理人管理的其他资产管理计划或托管人托管的其他资产管理计划。</p> <p>本集合计划建仓期的投资活动，应当符合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、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券、货币市场基金等中国证监会认可的投资品种的除外。</p> <p>本集合计划建仓期结束后，本集合计划的投资组合比例应符合上述约定。因证券期货市场波动、</p>

 <p>2018-1492393</p>		<p>证券发行人合并、资产管理计划规模变动等管理人以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十五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证券投资基金业协会报告。</p> <p>产品的实际投向不得违反合同约定，如有改变，管理人应在与资产托管人协商一致、先行取得投资者书面同意后，履行合同变更程序，并应为管理人和托管人相关系统准备、投资组合调整、新增投资品种的估值核算等事项留出必要的时间。</p> <p>本集合计划存续期间，管理人应当严格按照法律、行政法规、中国证监会规定以及合同约定的比例进行资产管理计划的投资运作。若本集合计划拟改变比例的，管理人应事先取得投资者同意并履行合同变更程序。</p> <p>若未来监管部门相关法规对 FOF 产品的投资比例和投资限制予以明确、修改或取消，管理人履行本合同“二十七、合同的补充、修改与变更”第一条约定的合同变更程序后，将按照新的监管标准予以调整，无需征询委托人意见。</p>
2	投资组合比例	<p>本集合计划主要投资于专项资产管理计划、各类证券投资基金、证券投资类资产管理计划、集合资金信托计划等金融监管部门批准或备案发行的金融产品（以下统称“子产品”），其中，投资于上述子产品的比例为 80%-100%，且按照穿透原则合并计算，最终投资于上市公司股票、存托凭证等权益类</p>

		资产的比例为本集合计划总资产的 80%-100%；剩余资金可投资于债权类资产及现金类资产。
3	投资限制	<p>1、本集合计划的总资产不得超过计划净资产的 200%。计算本集合计划的总资产时应当按照穿透原则合并计算所投资资产管理产品的总资产。</p> <p>2、本集合计划投资单只专项资产管理计划、证券投资基金、证券投资类资产管理计划、集合资金信托计划等金融监管部门批准或备案发行的金融产品不超过本集合计划资产净值的 25%；管理人管理的全部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。单一融资主体及其关联方的非标准化资产，按照同一资产合并计算。</p>

备注：如果投资监督内容需要调整，必须经过本合同当事方协商一致并书面确认后生效。

