
海通远见 1 号 FOF 集合资产管理计划 集合资产管理合同

合同编号：



二〇一八年十二月



目 录

一、前言	2
二、释义	4
三、合同当事人	10
四、集合计划的基本情况	10
五、集合计划的参与和退出	15
六、管理人自有资金参与集合计划	23
七、集合计划的分级	25
八、集合计划客户资产的管理方式和管理权限	25
九、集合计划的成立	25
十、集合计划账户与资产	26
十一、集合计划资产托管	27
十二、集合计划的估值	28
十三、集合计划的费用、业绩报酬	33
十四、集合计划的收益分配	38
十五、投资理念与投资策略	39
十六、投资决策与风险控制	40
十七、投资限制及禁止行为	44
十八、集合计划的信息披露	46
十九、集合计划份额的转让、非交易过户、冻结	49
二十、集合计划的展期	49
二十一、集合计划终止和清算	50
二十二、当事人的权利和义务	52
二十三、违约责任与争议处理	56
二十四、适用法律和争议解决	58
二十五、风险揭示	58
二十六、合同的成立与生效	64
二十七、合同的补充、修改与变更	64
二十八、通知和送达	65
二十九、其他事项	66

2018-1492393



特别约定：《海通远见 1 号 FOF 集合资产管理计划资产管理合同》（以下简称“本合同”或“集合资产管理合同”）以电子合同方式签订，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（海通远见 1 号 FOF 集合资产管理计划的委托人）作为本合同一方，以电子合同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，委托人接受电子合同（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

为规范海通远见 1 号 FOF 集合资产管理计划(以下简称“集合计划”或“计划”)运作,明确《海通远见 1 号 FOF 集合资产管理计划资产管理合同》(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》、(或《中华人民共和国电子签名法》)、《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》”)、以及《证券公司资产管理电子签名合同操作指引》等法律法规、中国证监会和中国证券业协会的有关规定,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《指导意见》、《管理办法》、《管理规定》、《海通远见 1 号 FOF 集合资产管理计划说明书》(以下简称《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、准确、完整,没有非法汇集他人资金参与本集合计划,并已阅知本合同和《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。

委托人承诺其知悉《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》、《金融机构大额交易和可疑交易报告管理办法》、《中国人民银行关于加强反洗钱客户身份识别有关工作的通知》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;承诺用于投资的资金来源不属于违法犯罪所得及其收益;承诺出示真实有效的身份证件或者其他身份证明文件,积极履行反洗钱职责,配合进行受益所有人识别,不借助本业务进行洗钱等违法犯罪活动。委托人承诺,其不属于联合国、欧盟或美国制裁名单内的企业或个人,不位于被联合国、欧盟或美国制裁的国家和地区。

委托人承诺，其不属于联合国、欧盟或美国制裁名单内的企业或个人，不位于被联合国、欧盟或美国制裁的国家和地区。

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。



二、释义

《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日经中国证监会公告(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

2018-1492393

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

2018-1492393



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产	指集合资产管理计划通过发行计划份额方式募集资金, 并依

2018-1492393

总值:	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、法人或者其他组织: (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:家庭金融净资产不低于 300 万元,家庭金融资产不低于 500 万元,或者近 3 年本人年均收入不低于 40 万元;

2018-1492393

2018-1492393

	<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) 基本养老金、社会保障基金、企业年金等养老基金, 慈善基金等社会公益基金, 合格境外机构投资者 (QFII)、人民币合格境外机构投资者 (RQFII);</p> <p>(六) 中国证监会视为合格投资者的其他情形</p>
份额持有人、持有人:	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
集合计划成立日:	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
封闭期:	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
存续期:	本集合计划成立并存续的期间
开放日:	指委托人可以办理集合计划参与、退出或其他约定业务的工作日
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
可供分配收益:	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 www.htsamc.com , 管理人指定网站变更时以管理人公告为准



三、合同当事人

委托人

签订《海通远见 1 号 FOF 集合资产管理计划集合资产管理合同》的投资者即为本合同的委托人。委托人的详细情况（包括但不限于名称、通讯地址、联系电话等信息）在签署页（注：采用电子合同的，应在数据电文中列示）中列示。

管理人

机构名称： 上海海通证券资产管理有限公司
法定代表人： 裴长江
通信地址： 上海市黄浦区广东路 689 号第 32 层第 01-12 室单元
邮政编码： 200001
联系电话： 021-23219000

托管人

机构名称： 中国民生银行股份有限公司
法定代表人： 洪崎
通信地址： 北京市西城区复兴门内大街 2 号
联系人： 单新尧
联系电话： 010-58560666
传真： 010-58560794



四、集合计划的基本情况

- (一) 名称：海通远见 1 号 FOF 集合资产管理计划
- (二) 类型：权益类集合资产管理计划
- (三) 投资者人数：

本集合计划委托人数量（含管理人自有资金）不少于 2 人，不得超过 200 人（含）。

（四）投资范围和投资比例

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。

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。

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。

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。

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、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。

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。

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。



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。

（五）投资目标和业绩参考基准

投资目标：本集合计划在严格控制与目标指数偏离风险的前提下，力争获得超越指数的投资收益，追求长期资本增值。

业绩参考基准：业绩参考基准 = 中证 500 指数收益率

本计划的业绩参考基准不同于业绩报酬的计提基准，仅用于投资风险的监控与绩效评估，投资绩效评估系统或人员定期对计划资产的安全性、流动性进行分析，并对资产收益率、收益的潜在来源、投资的特征等进行分析计算，将计划资产实际投资业绩与业绩参考基准以及与同行业同类产品分别进行比较，对投资绩效予以评价并进行业绩归因。

（六）管理期限

本集合计划期限为十年，符合法律法规、监管规定及本合同约定条件后可以展期。经全体委托人、管理人和托管人协商一致，可提前终止本集合计划。

（七）募集期、封闭期、开放日及流动性安排：

1、募集期：

本集合计划的具体募集期以管理人的募集公告为准。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。

2、封闭期：本集合计划自成立日（T 日）起封闭 6 个月，之后除开放期外均为封闭期，封闭期内不办理参与、退出业务。

3、开放日：本集合计划第一个开放期为成立满 6 个月的次日及其后的连续 4 个工作日（含成立满 6 个月的次日，共 5 个工作日，非工作日则顺延至下一工作日），其中每个开放日办理参与业务，最后一个开放日办理退出业务；其后，每个自然季度的首月 15 日及其后的连续 4 个工作日为开放期（含每个自然季度的首月 15 日，共 5 个工作日，非工作日则顺延至下一工作日），其中每个开放日办理参与业务，最后一个开放日办理退出业务。

本集合资产管理计划开放退出期内，资产组合中 7 个工作日可变现资产的价值，不低于该计划资产净值的 10%。



管理人有权在法律法规、金融监管机构有关规则修订、集合计划合同变更、展期时设置临时开放期，为委托人办理退出或其他业务，除上述情形外不再设置临时开放期。具体以管理人公告为准。

（八）集合计划份额面值

人民币 1.00 元。

（九）参与本集合计划的最低金额

首次参与的最低金额为人民币 100 万元，追加参与的最低金额为人民币 10 万元。如法律法规或监管部门修改上述首次参与最低金额的要求，届时管理人可通过公告的形式对本集合计划的首次参与最低金额进行调整。

（十）本集合计划的风险收益特征及适合销售对象

本计划为权益类产品，整体风险等级为 R4。适合销售对象为管理人和销售机构的客户且风险承受能力等级与 R4 级相匹配的合格投资者。管理人不接受以金融监管部门批准或备案发行的金融产品作为本产品的合格投资者。以上风险评级为管理人评级，销售机构评级可能与此不同。

（十一）本集合计划的销售

1、销售机构：

（1）海通资管（直销）

同管理人。

（2）海通证券股份有限公司

法定代表人：周杰

住所：上海市广东路 689 号

管理人可根据有关法律法规的要求，选择其他符合要求的销售机构代理销售本集合计划，管理人新增或变更本集合计划的销售机构时，将提前在管理人指定网站上公告。

2、销售方式

管理人应将集合资产管理合同、集合资产管理计划说明书等正式销售材料，以纸质或电子方式置备于销售机构营业场所。销售机构应当严格履行适当性管理义务，充分了解客户的投资需求和风险偏好，对客户进行分类，对资产管理计划进行风险评级。销售机构应当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。禁止误导投资者购买与其风险承受能力不相符合的产品，禁止向风险识别能力和风险承受能力低于产品风险等级的投资者销售资产管理计划，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销售集合计划。

管理人及销售机构应当采取有效措施，并通过管理人、中国证券业协会、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，使客户详尽了解本集合计划的特性、风险等情况及客户的权利、义务，但不得通过报刊、电台、电视、互联网等传播媒体或者讲座、报告会、传单、布告、自媒体等方式向不特定对象宣传具体资产管理计划。

(十二) 本集合计划的各项费用

1、认购/申购费：0%。

2、退出费：委托人申请退出本集合计划时，须按退出份额的持有期限缴纳退出费并计入集合计划资产，具体退出费率如下：

持有期限 (T)	退出费率 (%)
$T \leq 365$ 天	0.3
$T > 365$ 天	0

3、管理费：0.7%/年。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。

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_1 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 $\frac{AN_1 - AN_0}{AN_0} < \frac{I_1 - I_0}{I_0}$ ，则本年度的管理费率为 0%；若上一自然

年度 $\frac{AN_1 - AN_0}{AN_0} \geq \frac{I_1 - I_0}{I_0}$ ，则本年度的管理费率为 0.7%/年。

4、托管费：0.05%/年；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。

5、业绩报酬：具体见本合同“十三、集合计划的费用、业绩报酬”的相关约定。

6、证券交易费用：

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），作为交易成本从集合计划资产中直接扣除，其费率由管理人根据相关法规政策确定。

7、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。

8、其他费用：除交易手续费、印花税、管理费、业绩报酬、托管费之外的集合计划费用，由管理人根据有关法律法规及相应的合同或协议的具体规定，按费用实际支出金额列入当期费用，从集合计划资产中支付。

五、集合计划的参与和退出

（一）集合计划的参与

1、参与的办理时间

（1）募集期参与

在募集期内，委托人在工作日内可以参与本集合计划。募集时间等募集安排由管理人公告确定。管理人有权根据实际募集情况，决定延长或提前结束募集期。

(2) 存续期参与

存续期内，投资者在开放日可以参与本集合计划。

2、参与方式

委托人同意以下列方式参与本集合计划(两种方式可选择其一或两种并行选择)：

(1) 委托人以募集期参与的方式购买集合计划份额，同意在提出募集期参与申请的同时支付参与金额；

(2) 委托人以存续期参与的方式购买集合计划份额，同意在提出存续期参与申请的同时支付参与金额。

3、参与价格与参与原则

(1) 在集合计划募集期内参与集合计划，每份额的价格均为每份额面值，即人民币壹元；

(2) 存续期参与的价格，以受理申请当日集合计划单位净值为基准进行计算；

(3) 采用金额参与的方式，即以参与金额申请；

(4) 在募集期内，当集合计划参与人数达到参与人数上限后，管理人不接受任何新投资者的参与申请而只接受本集合计划份额持有人的追加参与；

(5) 在募集期及存续期内，管理人使用“时间优先，金额优先”方法对集合计划募集的人数进行控制，即首先按照参与时间顺序，先参与先确认，对于同样参与时间的，金额高者先确认，超过上限后的所有参与无效；

(6) 管理人有权仅接受管理人指定投资者的参与申请。

4、参与的程序和确认

(1) 参与申请的提出

委托人必须根据本集合计划销售机构网点规定的手续，在开放日或销售机构确定的预约参与日的业务办理时间内向销售机构网点提出参与申请或预约参与申请。

若本集合计划销售机构安排预约申请参与期，则委托人可以在预约参与期预



约参与，若委托人预约参与的份额符合份额参与的条件，则管理人将在对应的开放日为委托人办理参与，参与价格按照指定的开放参与当日的份额单位净值进行计算。

销售机构规定需提前预约申请参与的，委托人必须根据本集合计划销售机构网点规定的手续预约参与，通过直销参与的委托人份额的预约申请参与期为开放参与日的前十个工作日，通过代销参与的委托人份额的预约申请参与期由代销机构安排并通知委托人。

(2) 投资者应开设销售机构认可的交易账户，并在交易账户备足认购/申购的货币资金；若交易账户内参与资金不足，销售机构不受理该笔参与申请。

(3) 委托人必须到销售机构营业网点或通过销售机构指定网络平台签署《电子签名约定书》，之后既可以到集合计划销售机构指定营业网点的柜台申请参与集合计划，也可以登录销售机构指定网络系统以自主下单的方式参与集合计划，参与申请经管理人确认有效后，构成《集合资产管理合同》的有效组成部分。仅在特殊情况下，经管理人允许，委托人可以以签署纸质合同的方式申请参与。

(4) 投资者参与申请确认成功后，其参与申请和参与资金不得撤销。

(5) 投资者募集期参与的，可于计划成立3个工作日后通过办理参与的营业网点或网上交易等周边系统查询参与确认情况；存续期参与的，可于开放日结束3个工作日后通过办理参与的营业网点查询或网上交易等周边系统查询参与确认情况。委托人认可管理人对其认购参与有效性的确认，除经管理人同意外，不再要求管理人提供任何有效性确认的资料。

5、参与费及参与份额的计算

(1) 参与费率：0%；

(2) 参与份额的计算方法：

①募集期参与

参与份额 = (参与金额 + 参与金额在募集期内认购参与所带来的利息) / 计划单位面值

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计划资产损益。

②存续期参与



委托人在开放日参与本计划的，管理人根据当日计划单位净值计算其参与份额。

参与份额=参与金额 / T 日计划单位净值

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计划资产损益。

管理人有权在合理范围内调整确定存续期参与份额的计算方法。

6、参与资金利息的处理方式

委托人的参与资金在募集期产生的利息将在募集期结束后折算为委托人份额，其中利息以注册登记机构的记录为准。

7、拒绝或暂停参与

(1) 出现下列情形，管理人可以拒绝或暂停接受委托人的参与申请：

①本集合计划委托人数接近或达到法律、行政法规和资产管理合同规定的上限；

②战争、自然灾害等不可抗力的原因导致集合计划无法正常运转；

③管理人认为接受某笔或某些参与申请可能会影响或损害现有委托人利益时；

④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而未提供管理人要求的合法筹集资金的证明文件；

⑤法律、行政法规规定或中国证监会认定的其他情形。

(2) 拒绝或暂停本集合计划的参与，管理人应提前在管理人指定网站公告。

(3) 委托人的参与申请被拒绝时，被拒绝的参与款项将无息退还给委托人，各方互不承担其他责任。

(4) 在暂停参与的情况消除后的 20 个工作日内，管理人将及时恢复参与业务的办理，并在管理人指定网站公告。

(二) 集合计划的退出

1、退出的办理时间

本集合计划第一个开放期为成立满 6 个月的次日及其后的连续 4 个工作日（含成立满 6 个月的次日，共 5 个工作日，非工作日则顺延至下一工作日），其中最后一个开放日办理退出业务；其后，每个自然季度的首月 15 日及其后的连



续 4 个工作日为开放期（含每个自然季度的首月 15 日，共 5 个工作日，非工作日则顺延至下一工作日），其中最后一个开放日办理退出业务。

本集合资产管理计划开放退出期内，资产组合中 7 个工作日可变现资产的价值，不低于该计划资产净值的 10%。

管理人有权在法律法规、金融监管机构有关规则修订、集合计划合同变更、展期时设置临时开放期，为委托人办理退出或其他业务，除上述情形外不再设置临时开放期。具体以管理人公告为准。

2、退出的原则

(1) 对于通过有预约功能的销售机构参与但未预约退出的委托人，管理人有权在开放日拒绝其退出申请。对于通过无预约功能的销售机构参与的委托人，管理人在开放日为提交退出申请的委托人，办理退出业务；

(2) “未知价”原则，即退出集合计划的价格以退出申请日（T 日）集合计划每份额单位净值为基准进行计算；

(3) 采用份额退出的方式，即退出以份额申请；

(4) “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；

(5) 退出申请仅可以在当日业务办理时间内撤销。

3、退出的程序和确认

(1) 退出申请的提出

委托人必须根据本集合计划销售机构网点规定的手续，在开放退出日或销售机构确定的预约退出日的业务办理时间内向销售机构网点提出退出申请或预约退出申请。退出申请数量超过委托人持有份额数量时，超出委托人持有份额的申请无效。

若管理人为计划份额统一办理强制退出则不需委托人另行提出退出申请。

若本集合计划销售机构安排预约申请退出期，则委托人可以在预约退出期预约退出，若委托人预约退出的份额符合份额退出的条件，则管理人将在对应的开放退出日为该部分份额办理退出，退出价格按照指定的开放退出当日的份额单位净值进行计算。若委托人预约退出的份额不符合份额退出的条件，则该预约退出申请失败，管理人不另行通知委托人。

2018-1492393



销售机构规定需提前预约申请退出的,委托人必须根据本集合计划销售机构网点规定的手续预约申请退出,通过直销参与的委托人份额的预约申请退出期为开放退出日的前十个工作日,通过代销参与的委托人份额的预约申请退出期由代销机构安排并通知委托人。

(2) 退出申请的确认

委托人可在 T+3 个工作日(包括该日)之后到销售机构网点取得 T 日退出申请成交确认单,若交易未成功或数据不符,委托人可与为其办理手续的销售机构网点人员联系并进行核实。

T 日指委托人提出申请日,如为管理人自动发起业务则指业务发起日。

直销的投资者可以在 T+2 个工作日后向管理人查询确认。

(3) 退出款项划付

若管理人确认委托人退出申请成功,本集合计划的开放退出为 T 日,相应退出款将于 T+7 个工作日内从托管账户划出,管理人与托管人协商后,可以将划拨日期相应顺延。在发生大额退出、巨额退出及连续巨额退出的情形时,款项的支付办法参照本合同的有关条款处理。

由于交易所或交易市场数据传输延迟、通讯系统故障、银行数据交换系统故障或其它非管理人及托管人所能控制的因素影响业务处理流程,则退出款顺延至管理人及托管人无法控制的因素消除后划往委托人账户。

4、退出费及退出份额的计算

(1) 退出费:委托人申请退出本集合计划时,须按退出份额的持有期限缴纳退出费并计入集合计划资产,具体退出费率如下:

持有期限 (T)	退出费率 (%)
$T \leq 365$ 天	0.3
$T > 365$ 天	0

(2) 退出金额的计算方法

本集合计划退出时以受理申请日计划单位净值作为计价基准,按扣除退出费、业绩报酬(若有)后的实际金额支付。退出费和退出金额的计算公式如下:

退出金额=退出份额×T 日集合计划份额净值

退出费用=退出金额×退出费率



退出净额=退出金额-退出费用-业绩报酬

退出费用以人民币元为单位，计算结果按照四舍五入方法，保留小数点后两位；退出净额结果按照四舍五入方法，保留小数点后两位。由此产生的差额部分计入集合计划资产损益。

(3) 收取方式

本计划的退出费将在资金返还至委托人账户之前，从委托人退出金额中直接扣收。

5、退出的限制

委托人单笔退出最低份额为 20 万份；委托人在某一开放日的退出次数不受限制。当委托人在某一销售机构处持有的份额小于 20 万份时，该部分份额将被强制退出。

6、单个委托人大额退出的认定、申请和处理方式

本集合计划不设大额退出限制条款，但因单个委托人大额退出导致出现巨额退出，则根据巨额退出的认定和处理方式办理。

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，委托人当日累计净退出申请份额（退出申请总份额扣除参与申请总份额之余额）超过上一工作日集合计划总份额的 20% 时，即认为发生了巨额退出。

(2) 巨额退出的顺序、价格确定和款项支付

当出现巨额退出时，集合计划管理人可以根据本集合计划当时的资产组合状况决定全额退出、部分顺延退出或暂停退出。

1) 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。

2) 部分顺延退出：当集合计划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可能会对集合计划的资产净值造成较大波动时，集合计划管理人在当日接受退出比例不低于集合计划总份额的 30% 的前提下，对其余退出申请延期予以办理。对于当日的退出申请，应当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；委托人未能退出部分，除委托



人在提交退出申请时明确做出不参加顺延下一个工作日退出的表示外，自动转为下一个工作日退出处理，并以管理人公布的计划单位净值为准计算退出金额，以此类推，直到全部退出为止，转入下一个工作日的退出申请不享有优先权。

3) 暂停退出：本集合计划连续 2 个开放日发生巨额退出，如管理人认为有必要，可暂停接受退出申请，已经接受的退出申请可以延缓支付退出款项，并在销售机构网点公告。

(3) 告知客户的方式

当发生巨额退出并采用部分顺延退出时，集合计划管理人应在 3 个工作日内在管理人网站上公告，并说明有关处理方法。

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

本集合计划连续两个开放日发生巨额退出，就认定为连续巨额退出。

(2) 连续巨额退出的顺序、价格确定和款项支付

1) 当出现连续巨额退出时，如果集合计划管理人根据本集合计划当时的资产组合状况按照上述巨额退出的处理方式对委托人的退出申请，采取全额退出或部分顺延退出的方式逐日能够满足委托人的退出要求时，按巨额退出的处理方式办理。

2) 当集合计划管理人认为连续支付委托人的退出申请确有困难或认为连续支付委托人的退出申请对集合计划的资产净值造成很大波动时，管理人可以暂停接受退出申请，但暂停期限不得超过 20 个工作日。对已经接受的退出申请，可以延缓支付退出款项，但不得超过正常支付时间 20 个工作日，退出份额以后续开放日的集合资产管理计划份额净值为依据计算，并通过管理人网站向委托人公告。

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受理委托人的退出申请：

- (1) 不可抗力的原因导致集合计划无法正常运转；
- (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) 管理人认为接受某笔或某些退出申请可能会影响或损害现有委托人利



益时；

(4) 因市场剧烈波动等原因而出现连续巨额退出，或者其他原因，导致本集合计划的现金支付出现困难时，管理人可以暂停接受集合计划的退出申请；

(5) 法律、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的特殊情形。

已接受的退出申请，管理人应足额支付；如暂时不能足额支付的，可支付部分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，未支付部分由管理人按照发生的情况制定相应的处理办法在后续开放日予以支付。

发生集合计划说明书、《集合资产管理合同》中未予载明的事项，但管理人有正当理由认为需要暂停接受集合计划参与、退出申请的，可以暂停接受委托人的参与、退出申请，并向管理人住所地中国证监会派出机构及中国证券投资基金业协会报告。

暂停集合计划退出，集合计划管理人应及时通过管理人网站报告委托人，并制定相应的补救措施。

委托人认可上述关于退出原则及处理方法，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集合计划

管理人可以以自有资金参与本集合计划。

(一) 自有资金参与的条件

管理人以自有资金参与本集合计划，应符合《指导意见》、《管理办法》、《管理规定》和中国证监会及中国证券业协会的相关规定。

(二) 自有资金的参与方式、金额和比例

1、募集期间与存续期间，管理人可以参与集合计划份额。

2、存续期间，管理人可以通过证券交易所等中国证监会认可的交易平台以受让方式持有集合计划份额。

3、自有资金参与的金额和比例：

管理人以自有资金参与本集合计划，参与份额不超过本集合计划份额总数的

16%。管理人及其附属机构以自有资金参与本集合资产管理计划的份额合计不得超过本计划总份额的 50%。因集合资产管理计划规模变动等客观因素导致前述比例被动超限的，管理人应当依照中国证监会规定及资产管理合同的约定及时调整。

为应对集合资产管理计划巨额赎回以解决流动性风险，或者中国证监会认可的其他情形，在不存在利益冲突并遵守合同约定的前提下，可不受本条前述规定的限制，但应当及时告知委托人及托管人，并向相关派出机构及证券投资基金业协会报告。

（三）自有资金的收益分配和风险承担

1、管理人自有资金参与的份额按照本合同的规定享有收益分配，并承担相应责任。

2、自有资金责任承担方式

管理人以自有资金参与本集合计划持有的各分类集合计划份额与其他委托人持有的同类集合计划份额享有同等权利和义务。

管理人以自有资金参与份额的本金及收益不对委托人在本集合计划中投资的本金或收益承担任何补偿责任。

（四）自有资金的退出

1、退出的条件

（1）管理人自有资金参与本集合计划持有的份额在符合法律、行政法规等关于自有资金退出规定的情况下，可以与其他委托人同样办理退出业务；

（2）因集合计划规模变动等客观因素导致自有资金参与集合计划被动超过法律、法规规定比例；

（3）已经提前 5 个工作日告知委托人和托管人，告知方式包括在管理人指定网站公告或书面告知等方式。

管理人自有资金持有的集合计划份额均可以通过证券交易所等中国证监会认可的交易平台转让给其他投资者。

2、管理人自有资金参与集合计划的持有期限不得低于 6 个月，参与、退出时应当提前 5 个工作日通过管理人指定网站告知委托人和托管人；为应对集合资产管理计划巨额赎回以解决流动性风险，或者中国证监会认可的其他情形，在不



存在利益冲突并遵守合同约定的前提下，可不受本条前述规定的限制，但应当及时告知委托人及托管人，并向相关派出机构及证券投资基金业协会报告。

3、因集合计划规模变动等客观因素导致自有资金参与集合计划被动超过法律、法规规定的比例时的处理原则及处理措施：管理人可以临时开放本集合计划，退出超限部分的集合计划份额。同时，管理人应及时在管理人指定网站公告自有资金参与集合计划被动超限情况，包括超限比例、超限原因、处理方案等。

（五）风险揭示

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

（六）信息披露

管理人及时在管理人指定网站公告自有资金参与和退出情况。

七、集合计划的分级

本集合计划不分级。



八、集合计划客户资产的管理方式和管理权限

（一）管理方式：本集合计划由上海海通证券资产管理有限公司担任管理人，负责管理与运作。

（二）管理权限：管理人在本合同约定范围内行使管理人权限。

九、集合计划的成立

（一）集合计划成立的条件和日期

集合计划的参与资金总额（含参与费）不低于 1 千万元人民币且其委托人的人数为 2 人（含）以上，200 人以下。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集合计划进行验资并出具验资报告后，管理人宣布本集合计划成立。

集合计划设立完成前，委托人的参与资金只能存入证券登记结算机构指定的专门账户或资产托管机构的募集专户，不得动用。

（二）集合计划设立失败

集合计划募集期结束，在集合计划规模低于人民币 1 千万元或委托人的人数少于 2 人的，集合计划设立失败，管理人承担集合计划的全部募集费用，并将已认购资金及同期活期利息在募集期结束后 30 个工作日内退还集合计划委托人。

（三）集合计划开始运作的条件和日期

1、集合计划开始运作的条件：

本计划将在管理人宣布成立后开始运作。

2、集合计划开始运作的日期：

本计划将在管理人公告产品成立之日起开始运作。

管理人应在本集合资产管理计划成立起 5 个工作日内，应当将资产管理合同、委托人名单与认购金额、验资报告或者资产缴付证明等材料报中国证券投资基金业协会备案，同时抄送管理人住所地中国证监会派出机构。

本计划完成备案前不得开展投资活动，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。



十、集合计划账户与资产

（一）集合计划账户的开立

托管人为本集合计划开立证券账户、资金账户以及其他相关账户。资金账户名称应当是“海通远见 1 号 FOF 集合资产管理计划”，证券账户名称应当是“海通资产管理-民生银行-海通远见 1 号 FOF 集合资产管理计划”。以上账户以实际开立账户名称为准。

开立债券账户，以管理人备案户名为准开立债券账户。备案工作由管理人办理，托管人协助办理。开户工作由托管人办理，管理人协助办理。

证券账户由托管人开户的，管理人需协助提供证券开户费划款凭证截图和相关开户资料。销户时，由托管人办理证券账户销户的，管理人协助提供证券账户销户相关资料。

如开立定期存款账户，定期存单应由托管人保管，要留托管人预留印鉴，托管人保管定期存单，定期存单当面移交，到期后资金必须划回托管账户。存款证

实书不得被质押或以任何方式被抵押、并不得用于背书转让。

托管人对存放于资金账户的现金资产以及其他由托管人实际控制的财产进行保管。对于证券登记机构、期货经纪公司、基金公司、结算机构、票据保管机构、他行定期存款等非资产托管人保管的财产，托管人不承担保管责任。

销售机构为集合计划的每一位委托人建立集合计划交易账户，记录委托人通过该销售机构买卖本集合计划份额的变动及结余情况。

注册登记机构为上海海通证券资产管理有限公司。注册登记机构为委托人开立集合计划账户，用于记录委托人持有的本集合资产管理计划份额。

管理人应依法履行受益所有人识别义务，在开立托管账户时按照开户银行要求，就相关信息的提供、核实等提供必要的协助，并确保所提供信息以及证明材料的真实性、准确性。

（二）集合计划资产的构成

本集合计划的资产包括用集合计划资金购买的各种有价证券、银行存款本息及其他投资，其主要构成包括银行存款及其应计利息，清算备付金及其应计利息，根据有关规定缴纳的保证金，应收参与款，债券投资及其应计利息，股票、基金投资及其分红，其他资产等。

（三）集合计划资产的管理与处分

集合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集合计划资产行使冻结、扣押及其他权利。除依照《指导意见》、《管理办法》、《管理规定》、《集合资产管理合同》、《说明书》及其他有关规定处分外，集合计划资产不得被处分。



十一、集合计划资产托管

托管方式为：银行托管。

本集合计划资产交由中国民生银行负责托管，管理人已经与托管人签署了托管协议。

签订的托管协议已经明确了托管人和管理人之间在计划资产的保管、资金归集和划转、会计核算责任、清算交收流程、最终交收责任、集合计划档案资料保管及集合计划运作互相监督等活动中的权利、义务关系，以确保计划资产的安全，

保护委托人的合法权益。托管人的托管职责以托管协议的约定为准，如管理合同、说明书与托管协议不一致，相关约定以托管协议为准。

十二、集合计划的估值

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，保证集合资产管理计划估值的公平、合理。

（一）资产总值

集合计划的资产总值是指通过发行计划份额方式募集资金，并依法进行基金、股票、债券交易等资本市场投资所形成的各类资产的价值总和。

（二）资产净值

集合计划资产净值是指集合计划资产总值减去负债后的余额。

（三）单位净值

集合计划份额净值是指集合计划资产净值除以当日集合计划总份额数计算得到的每集合计划份额的价值。

（四）估值目的：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：估值日指本集合计划成立后的每个工作日。

（七）估值方法：

在不违反现行法律法规的前提下，管理人按照公平、公允、保护委托人利益的原则选择合适的估值方法，并应就此与托管人达成一致。

1、估值基本原则

（1）对存在活跃市场的投资品种，估值日有报价的，采用估值日的报价确定公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。

（2）存在活跃市场的投资品种，估值日无报价，且最近交易日后发生了影响公允价值计量的重大事件，使潜在估值调整对资产净值的影响较大的，可以参考类似投资品种的现行价格及重大变化因素，调整最近交易价格，确定公允价值。



2018-1492393

(3) 对不存在活跃市场的投资品种，其潜在估值调整对资产净值的影响较大的，可以采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定公允价值。

采用前述估值技术确定公允价值的，管理人应当尽可能使用市场参与者在定价时考虑的所有市场参数，并通过定期校验，确保估值技术的有效性。

管理人运用前述估值技术得出的结果，应当反映估值日在公平条件下进行正常商业交易所采用的交易价格。

(4) 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，管理人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，并向委托人披露。

2、具体投资品种估值方法

(1) 资产管理产品估值方法

投资的资产管理产品，按所投资资产管理产品估值日的份额净值估值。

(2) 货币基金估值方法

①投资的境内场外货币市场基金，按所投资基金前一估值日后至估值日期间（含节假日）的万份（百份）收益计提估值日基金收益。

②投资的境内上市交易型货币市场基金，如所投资基金披露份额净值，则按所投资基金估值日的份额净值估值；如所投资基金披露万份（百份）收益，则按所投资基金前一估值日后至估值日期间（含节假日）的万份（百份）收益计提估值日基金收益。

(3) 如遇所投资资产管理产品或者基金不公布产品份额净值、进行折算或拆分、估值日无交易等特殊情形，管理人根据以下原则进行估值：

①以所投资资管产品或基金的份额净值估值的，若所投资资管产品或者基金与本产品估值频率一致但未公布估值日份额净值，按其最近公布的份额净值为基础估值。

②以所投资基金的收盘价估值的，若估值日无交易，且最近交易日后市场环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后市场环境发生了重大变化的，可使用最新的基金份额净值为基础或参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素调整最近交易市价，确定公允价值。



③如果所投资资管产品或基金前一估值日至估值日期间发生分红除权、折算或拆分，根据份额净值或收盘价、单位基金份额分红金额、折算拆分比例、持仓份额等因素合理确定公允价值。

④当管理人认为按上述第①至第③条进行估值存在不公允时，应与托管人协商一致采用合理的估值技术或估值标准确定其公允价值。

(4) 银行存款以成本列示，按商定的存款利率以当日银行营业终了的存款余额为基数在实际持有期间内逐日计提应收利息。

(5) 债券的估值方法

①对在交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（另有规定的除外），选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值；

②对在交易所上市交易的含有转股权的债券，实行净价交易的，按估值日收盘价估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日收盘价进行估值。估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。实行全价交易的，按估值日收盘价减去所含债券应收利息后得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日收盘价减去可转换债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

③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；

④在交易所市场挂牌转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值；

⑤交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本进行后续计量。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，按估值技术估值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按照成本估值；

⑥在全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值，主要依据第三方估值机构公布的收益率曲线及估值价



格；

⑦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；

⑧在任何情况下，管理人如采用本项第①—⑦小项规定的方法对计划资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果管理人认为按本项第①—⑦小项规定的方法对计划资产进行估值不能客观反映其公允价值的，资产管理人在综合考虑市场成交价、市场报价、流动性、收益率曲线等多种因素基础上形成的债券估值，资产管理人可根据具体情况与资产托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

(6) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，管理人可根据具体情况与托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

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或指定推广网点通告委托人。

(7) 相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

管理人更改原则进行估值的，要及时书面通知托管人。托管人要认真核查管理人采用的估值政策和程序。当托管人对计划估值方法存有异议时，托管人有权要求管理人做出合理解释，通过积极商讨达成一致意见。

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。本资管计划的会计责任方由管理人担任，因此，就与本资管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，按照管理人对资产净值的计算结果对外予以公布。

(八) 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。

(九) 估值错误与遗漏的处理方式



1、本集合计划单位净值的计算精确到0.0001元，小数点后第五位四舍五入。当资产估值导致本集合计划单位净值小数点后四位以内(含第四位)发生差错时，视为本集合计划单位净值错误。

2、管理人和托管人应采取必要、适当、合理的措施确保资产估值的准确性和及时性。当估值出现错误时，管理人应当立即予以纠正，通报托管人，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。

3、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，应先由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。

4、由于证券交易所、注册登记机构发送的数据错误、遗漏或其他不可抗力造成估值错误的，管理人和托管人免于承担责任。

5、管理人按估值方法的第(6)项进行估值时，所造成的误差不作为计划单位净值错误处理。

6、前述内容如法律法规或监管机构另有规定的，按其规定处理。

(十) 暂停估值的情形

当出现下列情形致使集合计划管理人无法准确评估集合计划资产价值时，可暂停估值。但估值条件恢复时，集合计划管理人必须按规定完成估值工作。

(1) 集合计划投资所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集合计划管理人、托管人无法准确评估集合计划资产价值时。

(3) 金融监管部门认可的其他情形。

(十一) 特殊情形的处理



由于战争、自然灾害等不可抗力原因，或由于证券交易所及注册登记机构发送的数据错误、遗漏，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，但未能发现错误的，由此造成的资产估值错误，管理人和托管人免除赔偿责任。但管理人、托管人应当积极采取必要的措施消除或减轻由此造成的影响。

十三、集合计划的费用、业绩报酬

(一) 集合计划费用支付标准、计算方法、支付方式和时间

1、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。

2、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。

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的中证 500 指数；

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）的中证 500 指数。

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。

3、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。

4、与本集合计划相关的审计费

在存续期间发生的集合计划审计费用，在合理期间内摊销计入集合计划。



2018-1492393

本集合计划的年度审计费，按与会计师事务所签订协议所约定的金额，在被审计的会计期间，按直线法在每个自然日内平均摊销。

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

本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。

（二）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。

（三）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。

(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

十四、集合计划的收益分配

（一）收益的构成

收益包括：投资所得红利、股息、债券利息和基金红利；买卖证券价差；银行存款利息；其它收入。

（二）可供分配利润

本集合计划可供分配利润指截止收益分配基准日未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低者。

（三）收益分配原则

1、每份集合计划单位享有同等分配权；

2、如果投资当期出现净亏损，则不进行收益分配；

3、收益分配基准日的份额净值减去每单位收益分配金额后不低于 1 元，收益分配基准日即可供分配利润截止日；

4、本集合计划发生现金收益分配、本金归还等现金支付时，银行收取的与此有关的任何费用均由委托人承担。

5、本集合计划进行收益分配、本金归还时所涉及的相关税负由委托人自行承担，管理人、托管人均不承担代扣代缴等纳税义务。

6、若本集合计划在存续期间不进行收益分配，则本集合计划将在终止日或终止清算后将货币资金分派给委托人，由此产生的相关的税负由委托人自行承担，管理人、托管人均不承担代扣代缴等纳税义务。

7、收益分配金额由管理人负责计算，托管人负责资金汇划。

8、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

（四）收益分配方案的确定与披露

1、管理人计算集合计划的可分配收益。

2、管理人确定分配红利的金额、时间。管理人考虑集合计划的投资策略、现金流量和客户需求，在满足本部分规定的条件下确定收益分配的具体金额和具体时间。收益分配仅在开放期内办理。开放期进行收益分配的，相应调整计划份额净值。

3、管理人制定收益分配方案。收益分配方案包括每一份集合计划可以分配的金额、分配的登记日和分红除权日、分配方式及其选择和修改、现金分红划款



2018-1492393

时间、红利转再投资的转换日等。收益分配方案制定后，提交托管人复核确认后
方可实施收益分配。

4、管理人通知委托人。管理人至少在 R-5 个工作日（R 为权益登记日）之
前将收益分配方案在管理人网站上公告。

5、实施分配方案。

（五）收益分配方式

本集合计划的收益分配包括现金分红和红利转份额两种方式。选择采取现金
分配的，在除息日后的 5 个工作日内，将现金红利划转到委托人的交易账户；选
择采取红利再投资方式的，分红资金按分红除息日的单位净值转成相应的集合计
划单位。委托人未作选择的，本集合计划默认的收益分配方式是红利转份额方式。

十五、投资理念与投资策略

（一）投资目标：在严格控制与目标指数偏离风险的前提下，力争获得超越
指数的投资收益，追求长期资本增值。

（二）投资理念：本集合计划秉承严格控制投资风险实现稳健增值的投资理
念，将深入的基本面研究与数量化投资分析相结合，在控制与目标指数偏离风险
的前提下实现超越业绩参考基准的收益。

（三）投资策略：

本集合计划以“中证 500 指数收益率”为业绩参考基准，通过运用深入的基
本面研究及数量化投资分析，控制与目标的偏离风险，追求超越业绩参考基准的
收益水平。

（四）子产品选择标准：

鉴于本集合计划为基金中基金产品，管理人在选择子产品时，遵循以下标准：

1、管理人制定了严格的子产品管理人选择标准，根据子产品管理人的公司
基本面情况、公司治理、过往业绩、投资策略等信息动态分析，选择业绩优良、
运作规范的子产品管理人所管理的产品作为本集合计划投资标的；

2、管理人在考虑本集合计划的目标风险的基础上，对本集合计划的配置策
略进行分析，模拟投资组合的风险收益特征；

3、管理人在对子产品管理人目标产品进行尽职调查的基础上，结合子产品



的过往投资业绩、同策略绩效对比、同行业绩横向对比、收益能力、风险控制等有关信息，综合评定该子产品管理人的投资策略，选择资质良好的子产品管理人的策略产品进行备投。

4、针对本集合计划，管理人所挑选的子产品应满足以下两个条件：

(1) 本集合计划的子产品仅投资于标准化股权类资产（上市公司股票、存托凭证，以及中国证监会认可的其他标准化股权类资产）、《指导意见》及《管理办法》规定的标准化债权类资产和标准化商品及金融衍生品类资产；

(2) 本集合计划将选择开放退出频率不低于本集合计划开放退出频率的子产品。

十六、投资决策与风险控制

（一）集合计划的决策依据

集合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，并以维护集合计划委托人利益作为最高准则。具体决策依据包括：

1、《指导意见》、《管理办法》、《管理规定》、《集合资产管理合同》、《说明书》等有关法律性文件；

2、其他：根据宏观、微观经济环境和有关经济政策以及证券市场趋势制定投资策略；根据所投资品种的收益和风险的匹配关系。本集合计划将在控制风险的前提下追求收益的最大化。

（二）集合计划的投资程序

管理人执行本集合计划的投资职能。管理人的投资业务流程简述如下：研发团队负责证券库构建及维护；投资团队负责品种选择及投资组合建立；集中交易室执行交易；合规与法务部和风控与稽核部负责投资组合绩效评估和风险评估；各条线专门的投资决策委员会负责审批产品投资策略和投资经理提交的资产配置、投资计划等投资策略，该委员会由总经理、分管投研副总经理、投资总监、权益投资总监、固定收益投资总监、投资主办人及其他相关人员组成，是公司投资决策的最高权力机构。

1、投资决策程序

（1）确定投资原则和投资限制



投资团队根据国家有关法律、行政法规的规定、资产管理合同、管理人的有关管理制度，拟定本集合计划投资的基本原则和投资限制。

(2) 进行投资分析与研究

研究团队从宏观、中观、微观多层面分析经济状态和资本市场等。根据分析、研究结果以及对流动性的预测，制定投资策略建议。

(3) 制定投资策略与资产配置比例

投资团队综合考虑政治、经济及资本市场状况等因素，根据投资目标、原则、限制和研究建议，拟定投资策略，包括整体资产配置策略(期限结构和资产结构)、存款资产配置方案、存款银行选择方案等，报各条线专门的投资决策委员会审批通过。

(4) 进行投资组合管理

投资主办人对组合进行密切的日间监控及流动性影响分析，提出流动性优化方案；在授权范围内，根据各投资品种的资产配置比例，确定具体的投资品种、数量、价位、策略等，构建、优化和调整投资组合，进行投资组合的日常管理以及完善和加强存款银行和交易对手管理。

2、投资交易程序

投资主办人根据投资组合管理需要，作出投资决定，通过电子系统向集中交易室发出交易指令。交易员根据投资限制和市场情况，向投资主办人确认后，按交易指令确定的种类、价格、数量、时间予以执行。如果市场和个别证券交易出现异常情况，及时提示投资主办人。

3、投资风险的监控与绩效评估

投资绩效评估系统或人员定期对计划资产的安全性、流动性进行分析，并对资产收益率、收益的潜在来源、投资的特征等进行分析计算，将计划资产实际投资业绩与业绩参考基准以及与同行业同类产品分别进行比较，对投资绩效予以评价并进行业绩归因。

(三) 风险控制

1、风险控制目标

保障本集合计划的规范运作，控制本集合计划的运作风险，维护计划份额持有人、托管人和管理人的合法权益。



2、风险控制的原则

本集合计划管理人对投资风险控制的主要原则是：全面性原则、预防性原则、独立性原则、及时性原则、定量与定性相结合的原则。

投资风险是指投资未能根据国内外政治经济环境、行业发展趋势、投资对象基本面的变化及时调整投资组合，或投资在决策、交易执行过程中存在纰漏，从而造成资产损失的风险。投资风险的具体内容包括市场风险、流动性风险、交易风险和其他风险，其中市场风险和流动性风险构成投资最主要的风险，也成为评估投资风险和进行风险管理的关键。

3、风险控制组织架构

管理人的风险管理架构分为四个层次：

- (1) 第一层次为董事会；
- (2) 第二层次为经营层下设的合规与风险控制委员会；
- (3) 第三层次为管理人内设的合规与法务部和风控与稽核部；
- (4) 第四层次为各业务部门和职能部门的一线风险管理。

董事会履行如下职责：推进风险文化建设；审议批准公司风险管理的总体目标、基本政策和制度；审议批准公司整体风险偏好和风险容忍度以及重大风险限额；审议和批准合规管理的基本制度；审议批准年度合规报告及定期风险评估报告；决定解聘对发生重大合规风险负有主要责任或者领导责任的高级管理人员；决定聘任、解聘、考核合规负责人、首席风险官，决定其薪酬待遇；建立与合规负责人、首席风险官的直接沟通机制；评估合规管理有效性，督促解决合规管理中存在的问题；公司章程规定的其他合规与风险管理职责。

合规与风险控制委员会履行如下职责：制定委员会的议事规则；对公司业务各环节的风险进行检查、监控、评估及处置，定期审核合规与法务部和风控与稽核部提交的风险和投资绩效评估报告，提出相应的建议和风控措施，并监督落实；根据监管制度和相关业务规则的变化，提醒和审核业务制度和流程并及时进行调整和更新；监督合规与风险控制委员会决议的执行；对新业务、新产品进行风险评估；听取经营层对风险议题的专题报告；听取投资主办人对重大市场变化的风险分析报告和投资绩效报告；调查风险事件，对于重大风险事件，及时向董事长、总经理及合规总监报告。



合规总监负责公司合规及风险管理战略和政策的具体执行。合规总监对董事会负责并向监管部门报告；合规总监具有充分的知情权，能够对公司重大决策和主要业务活动的合规性进行监督；合规总监具有独立调查公司内部可能违反合规政策事件的权力，能够自行聘请外部机构或指定公司有关部门对公司的重大事项进行独立调查。

公司按照《证券公司全面风险管理规范》要求设首席风险官。公司合规与法务部和风控与稽核部履行风险管理职责，在首席风险官领导下推动全面风险管理工作，监测、评估、报告公司整体风险水平，并为业务决策提供风险管理建议，协助、指导和检查各部门、分支机构的风险管理工作。

合规与法务部和风控与稽核部为风险管理职能部门，配备了适当数量的具备合规与风险管理资质、经验、专业技能的管理人员，协助合规总监及首席风险官开展合规与风险管理工作，包括全面审核公司资产管理业务经营活动、业务流程的合规性；组织完善资产管理业务的风险评估体系，对公司业务及内部管理活动的关键风险指标和绩效进行衡量与评估；依托风险管理信息系统平台，对资产管理业务进行实时监控；组织、监督各项风险防范措施的落实，实施对风险的事前、事中、事后全程管理。

资产管理业务各相关部门在部门内部对风险进行一线监控。负责组织实施与本部门业务和管理职能相关的风险管理工作；各部门内各岗位是其职责对应的业务与管理相关风险的直接责任人，履行一线风险管理职责。后台清算部门、估值部门、信息技术部门都负有相应的风险管理职责，从不同角度对资产管理业务的资金、财务、信息技术等相关风险进行专业化控制。

4、投资风险管理程序

(1) 风险识别：对各个业务环节的割裂风险和风险点进行识别。

(2) 风险测量：运用定性、定量方法估计风险发生的概率和损失。

(3) 风险控制：通过各种减少风险的手段和建立必要的内部管理制度，实现以合理的成本在最大限度内防范风险和减少损失。

(4) 风险评价：对风险控制体系、风险识别、测量、控制等执行情况和效果进行分析和评价。

(5) 风险报告：将风险测量、评价情况以及风险事件处置情况以一定程序

2018-1492393



进行报告。

5、全程风险管理控制

为贯彻投资收益与投资风险相匹配原则，充分实现委托人的投资意愿，最大程度上保障委托人利益，海通资产管理在建立科学投资流程的基础上，通过定量与定性相结合、人机控制相结合等方式将风险控制落实在投资管理的全过程。

首先，从事前的证券选择与组合构建、事中的组合实施与监控、事后的组合风险评估与绩效分析等建立科学的收益与风险评估系统，确保集合计划的管理符合客户投资目标。

事前风险控制主要体现在研究环节和投资决策环节，包括证券库制度、投研会议制度等。

事中风险控制主要体现在投资决策和决策执行过程中，主要包括授权授信、风险监控。

事后风险控制主要为业绩评价和稽核、风险管理评价。

其次，全面评估投资过程中的各类风险，将其量化成风险控制指标嵌入技术系统，借助 IT 技术系统实现风险在事前、事中以及事后的强制性、适时性控制，以确保投资决策的有效贯彻和客户利益的充分保障。



2018-1492393

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，本集合计划的投资限制为：

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。

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%；管理人管理的全部集合资产管理计划投资于同一资产的资金，不得超过该资产的 25%。银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券等中国证监会认可的投资品种除外。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。

3、管理人管理的全部资产管理计划合计持有单一上市公司发行的股票不得

超过该上市公司可流通股票的 30%。中国证监会另有规定的除外。

4、本集合计划投资于其他资产管理产品时，所投资的资产管理产品不再投资除公募基金以外的其他资产管理产品。

本集合计划投资于其他资产管理产品时，计算本集合计划的总资产时按照穿透原则合并计算所投资资产管理产品的总资产。

本集合计划投资于其他私募资产管理产品时，本集合计划按照穿透原则合并计算的投资同一资产的比例以及投资同一或同类资产的金额，应当符合法律法规、监管规则的相关规定。

5、本集合资产管理计划开放退出期内，资产组合中 7 个工作日可变现资产的价值，不低于该计划资产净值的 10%。

6、法律法规及中国证监会限制的其他行为。

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。

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、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。

（二）禁止行为

本集合计划的禁止行为包括：

- 1、违规将集合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、将集合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、侵占、挪用集合计划资产；



-
- 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、以获取佣金或者其他不当利益为目的，使用集合计划资产进行不必要的交易；
 - 9、利用资产管理计划或者职务便利为投资者以外的第三方谋取不正当利益；
 - 10、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；
 - 11、利用资产管理计划进行商业贿赂；
 - 12、直接或者间接投资于不符合国家产业政策、环境保护政策的项目（证券市场投资除外），包括但不限于以下情形：
 - ①投资项目被列入国家发展改革委最新发布的淘汰类产业目录；
 - ②投资项目违反国家环境保护政策要求；
 - ③通过穿透核查，资产管理计划最终投向上述投资项目。
 - 13、管理人将其管理的资产管理计划资产，直接或者通过投资其他资产管理计划等间接形式，为管理人、托管人及管理人、托管人的控股股东、实际控制人或者其他关联方提供或者变相提供融资。全部投资者均为符合中国证监会规定的专业投资者且单个投资者金额不低于 1000 万元，并且事先取得投资者同意的资产管理计划除外。针对本集合计划，委托人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。
 - 14、法律、行政法规和中国证监会禁止的其他行为。

十八、集合计划的信息披露

（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集合计划单位净值。

披露方式：本集合计划的信息披露将严格按照《指导意见》、《管理办法》、《管理规定》、本合同及其他有关规定进行。本集合计划的计划份额单位净值等信息将在管理人指定网站上向委托人披露，本集合计划委托人可随时查阅。管理人指定网站网址：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。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向委托人披露，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。托管人在每季度向委托人提供一次季度托管报告。上述报告应于每季度结束之日起 1 个月内通过管理人网站向委托人披露。集合计划成立不足 3 个月或者存续期间不足 3 个月的，管理人/托管人可以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。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向委托人披露，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。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 4 个月内通过管理人网站公告。集合计划成立不足 3 个月或者存续期间不足 3 个月的，管理人/托管人可以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

2018-1492393



人，并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。

6. 若法律、法规、行政政策对管理人报备事宜有新规定的，按新规定执行。

（三）临时报告

集合计划存续期间，发生对集合计划持续运营、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指定网站、销售机构网站或网点、或其他途径和方式及时向客户披露。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）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）与集合计划有关的重大诉讼、仲裁事项；
- （8）负责本集合计划的代理销售机构发生变更；
- （9）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；
- （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）集合计划分红；
- （13）资产计价出现错误（当资产估值导致本集合计划份额的单位净值小数



点后四位以内（不含第四位）发生差错时，视为本集合计划单位净值错误）；

（14）管理费、托管费等费用计提方式或费率发生变更；

（15）其他对集合计划持续运营、客户利益、资产净值产生重大影响的事件。

（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。委托人还可以登录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。

十九、集合计划份额的转让、非交易过户、冻结

（一）集合计划份额的转让

集合计划存续期间，客户可以通过证券交易所等中国证监会认可的交易平台转让集合计划份额。受让方首次参与集合计划，应先与管理人、托管人签订集合资产管理合同。管理人有权决定是否开放计划份额的转让业务。

（二）集合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，将一定数量的集合计划份额按照一定的规则从某一委托人集合计划账户转移到另一委托人集合计划账户的行为。集合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）集合计划份额的冻结

集合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、集合计划的展期

本集合计划可以展期。

（一）展期的条件



1、在存续期间，本集合计划运营规范，管理人、托管人未违反法律、行政法规、中国证监会规定和本合同的约定；

2、展期没有损害委托人利益的情形；

3、托管人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。

本集合资产管理计划展期的，应当持续符合集合资产管理计划的成立条件。

（二）展期的安排

1、通知展期的时间

在集合计划到期前 3 个月且不超过 1 个月期间内。

2、通知展期的方式

管理人将通过管理人指定网站公告。

3、委托人回复的方式

委托人应当在管理人指定网站公告之日起 20 个工作日内以书面或管理人约定的其他方式明确回复意见。

（三）委托人不同意展期的处理办法

若委托人明确回复不同意展期，委托人有权在存续期届满日前（含届满日）到销售机构办理退出手续（管理人可以在公告中约定开放日，为委托人办理退出手续）；若委托人未在存续期届满日前（含届满日）到销售机构办理退出手续，则管理人有权决定强制将其份额退出。

若委托人未回复意见或回复意见不明确的，视为同意展期，管理人不再另行通知确认。

（四）展期的实现

如果同意集合计划展期的委托人人数不少于 2 人，则集合计划存续期将依法展期；

如果同意本集合计划展期的委托人人数低于 2 人则集合计划到期终止，将按照本合同等相关法律文件的规定办理计划到期终止和清算事宜。

二十一、集合计划终止和清算

（一）有下列情形之一的，集合计划应当终止：



- 1、计划存续期间，持续五个工作日投资者少于 2 人；
- 2、集合计划存续期届满且不展期；
- 3、管理人被依法撤销资产管理业务资格或者依法解散、被撤销、被宣告破产，且在六个月内没有新的管理人承接；
- 4、托管人被依法撤销基金托管资格或者依法解散、被撤销、被宣告破产，且在六个月内没有新的托管人承接；
- 5、经全体投资者、管理人和托管人协商一致决定终止的；
- 6、管理人认为必要的情况下办理提前终止；
- 7、因战争、自然灾害等不可抗力发生导致本集合计划不能存续；
- 8、法律、行政法规及中国证监会规定的其他终止情形。

管理人应当自资产管理计划终止之日起 5 个工作日内报证券投资基金业协会备案，并抄报中国证监会相关派出机构。

（二）集合计划的清算

1、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 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，对于由计划交纳、注册登记机构收取的最低结算备付金和交易席位保证金，在注册登记机构对其进行调整交收日才能收回，结算备付金及交易保证金账户利息于实际结息时才能收回，届时，管理人将及时按照集合资产管理合同的约定，以货币资金的形式全部分配给委托人，并注销集合计划专用证券账户和资金账户；

4、清算结束后 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，并将清算结果报中国证券投资基金业协会备案，同时抄送住所地中国证监会派出机构；

5、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；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；

6、本集合计划在清算结束后5个工作日内，将清算结果报中国证券投资基金业协会备案，同时抄送住所地、资产管理分公司所在地中国证监会派出机构；

7、委托人自行承担收益的缴税事项；

8、集合计划的清算安排应当符合相关法律、法规、政策的规定。

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）取得集合计划收益；

（2）通过管理人网站查询等方式知悉有关集合计划运作的信息，包括资产配置、投资比例、损益状况等；

（3）按照本合同及《说明书》的约定，参与和退出集合计划；

（4）按持有份额取得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）集合计划存续期间，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集合计划份额；

（7）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。

2、委托人的义务

（1）委托人应认真阅读本合同及《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集合计划；

（2）按照本合同及《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《说明书》约定承担集合计划可能的投资损失；

（4）不得违规转让其所拥有的计划份额（法律、行政法规另有规定的除外）；

（5）其他义务：委托人承诺其知悉《中华人民共和国反洗钱法》《金融机构



2018-1492393

报告涉嫌恐怖融资的可疑交易管理办法》《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，不会实施任何违反前述规定的非法行为，不借助本业务进行洗钱等违法犯罪活动；

(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《说明书》的约定，独立运作集合计划的资产；

(2) 根据本合同及《说明书》的约定，收取管理费等相关费用；

(3) 按照本合同及《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) 根据本合同及《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投资人权利；

(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、中国证监会有关规定及本合同约定的其他权利。

2、管理人的义务

(1) 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、本合同、《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、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) 按照本合同及《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本合同及《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、客户资料、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、金融监督管理部门有关规定和本合同约定的其他义务。

(三) 托管人的权利与义务

1、托管人的权利

(1) 依法对集合计划的资产进行托管；



(2) 按照本合同和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本合同和托管协议约定的，要求其改正；未能改正的，有权拒绝执行；

(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本合同以及托管协议约定的其他权利。

2、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，不得擅自自动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，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) 因违反本合同项下托管人义务导致集合计划财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财产损失的，代委托人向管理人追偿；

(16) 法律、行政法规、中国证监会有关规定和本合同约定的其他义务。

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实际损害的，应当分别对各自的行为依法承担赔偿责任；因共同行为给计划财产或者委托人造成实际损害的，应当承担连带赔偿责任。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、证券交易所及登记结算公司发送的数据错误、互联网故障等。

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集合计划财产损失扩大。任何一方当事人延迟履行合同义务后，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金融管理部门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) 托管人由于执行管理人的符合托管协议约定的有效指令对集合计划资产造成的损失等；

(6) 托管人对存放或存管在托管人以外的机构的集合计划资产或交由证券公司、期货公司、第三方基金销售机构等其他机构负责清算交收的集合计划资产（包括但不限于期货保证金、期货合约等）及其收益，因该等机构故意、欺诈、疏忽、过失、破产等原因给集合计划资产造成的损失，由相关责任方承担，托管人不承担责任；

(7) 本合同当事人应保证向本合同另一方提供的数据、信息真实完整，并承担相应的法律责任。如果该方提供的信息和数据不真实或不完整是由于另一方提供的数据或信息不真实、不完整等原因所致，由此造成的损失由初始过错方承担；

(8) 管理人及托管人对由于第三方（包括但不限于交易所、注册与过户登记人、期货公司、第三方基金销售机构等）发送的数据错误、遗漏给集合计划资产造成的损失等；

(9) 相关法律、行政法规和规定的变更。

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。

7、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资产或委托人造成的损失向委托人承担连带责任。

8、委托人、管理人认可托管人投资监督的真实性、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，合规投资责任在管理人。托管人对这些机构的数据和信息真实性、准确性和完整性不作任何担保、暗示或表示，并对上述机构提供的数据和信息错误或遗漏所引起的损失不承担任何责任。

9、托管人无投资责任，对任何集合计划的投资行为（包括不限于其投资策略及决定）或其投资回报不承担任何责任。托管人不会因为提供投资监督报告而承担任何因管理人违规投资所产生的有关责任，也没有义务去采取任何手段回应任何与投资监督报告有关的信息和报道。但如收到管理人的书面指示，托管人将对投资监督报告所述的违规行为提供有关资料。

2018-1492933



二十四、适用法律和争议解决

本协议适用中国法律，并依此解释。

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。

争议处理期间，合同当事人仍应履行本合同规定的义务，维护资产委托人的合法权益。

二十五、风险揭示

本集合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，使集合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，从而导致集合计划投资收益变化。

5、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

在集合资产管理计划运作过程中，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集合资产管理计划的收益水平，从而产生风险。

（三）流动性风险

集合计划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的风险。流动性风险按照其来源可分为：

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，流动性好；而在另一些时期，可能成



交稀少，流动性差。在市场流动性相对不足时，投资品种交易变现有可能增加变现成本，对集合计划造成不利影响。

证券市场中流动性不均匀，存在单一证券流动性风险。由于流动性存在差异，即使是在市场流动性比较好的情况下，一些证券的流动性可能仍然比较差，从而使集合计划在进行上述证券操作时，可能难以按计划买入或卖出相应的数量，或买入卖出行为对上述证券价格产生比较大的影响，增加上述证券的建仓成本或变现成本。

2、集合计划中的资产不能应付可能出现的投资者大额或巨额赎回的风险。在集合计划开放期间，可能会发生巨额或大额退出的情况，可能致使本集合计划没有足够的现金应付集合计划退出支付的要求所导致的流动性风险，甚至影响本集合计划份额净值。

（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）信用风险

集合计划在交易过程中发生交收违约，或者集合计划所投资债券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，或由于债券发行人信用质量降低导致债券价格下降，造成集合计划资产损失的风险。

（六）其他风险

1、操作风险，指那些由于不合理的内部程序，人为造成的或者是系统性的，由外部事件引发损失的风险。

2、战争、自然灾害等不可抗力因素的出现，将会严重影响证券市场的运行，可能导致委托资产的损失，从而带来风险。

（七）税收风险

本计划项下的计划财产应按有关法律法规规定承担相应的税费，如财税【2017】56号文项下的增值税等，且随着国家财税政策的变化，应当由计划财产承担的税费可能发生变化，从而导致委托人实际获得的产品收益金额将可能会因此减少。如果国家相关税务政策出台或发生变化，本计划项下投资需要依法履



行纳税义务的，资产委托人实际获得的产品收益金额将可能会因此减少，亦可能由资产委托人向本计划或资产管理人另行支付相关税费。

（八）本集合计划特有风险

1、本集合计划如果在中国证券投资基金业协会备案未通过，则需要按照监管机构或自律协会的要求修改本合同或提前终止本计划。本计划在前述情形下存在需修改合同或提前终止的风险。请投资者注意。

2、本集合计划的投资风险由委托人自行承担。当计划结束时如果存在无法变现的资产可能面临二次清算的风险，需要延长时间对资产进行变现，变现后的资产可能无法保证委托人的本金和收益，从而造成影响委托人的资金安排，和影响委托人本金安全、收益实现等风险。

3、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。上述产品属于较高风险类型。上述产品管理人依据相关法律法规的规定及相关协议的约定管理和运用委托财产，但上述产品管理人并不保证委托财产本金不受损失，也不保证一定盈利及最低收益。上述产品管理人依据产品合同约定管理和运用委托财产所产生的风险，由委托财产及上述产品投资者承担。

除此之外，还有以下几方面的风险：

（1）政策风险

因国家宏观政策（如货币政策、财政政策、行业政策等）发生变化而产生的风险；

（2）管理风险

在上述产品财产管理运作过程中，产品管理人的知识、技能、经验、判断等主观因素或管理人的投资管理能力不足，会影响其对相关信息和经济形势、证券价格走势的判断，从而影响委托财产的收益水平；

（3）项目风险

上述产品所投资项目无法及时按期兑付本息，导致本集合计划投资损失的风险；

（4）信息披露相关风险

由于上述产品的信息披露透明度可能偏低，一般不公开其投资组合情况，本



集合计划作为投资者，可能无法及时、准确了解其资金运作情况和风险状况。

由于多种原因，集合计划投资的金融品种的基础投资标的可能到期无法变现，使得上述投资无法实现预期收益，从而带来风险。

3、本集合计划存续期内设封闭期，集合计划委托人将面临封闭期内无法退出的风险，由于投向的基金专项资产管理计划可能提前终止或延迟而造成集合计划封闭期的提前结束或延长进而影响委托人的资金安排和收益等风险。

4、电子信息保护

本计划资产管理合同采用电子合同方式签署，可能存在因网络中断或不运作、传送安全系统失灵、系统遭受非法攻击等多种因素造成数据的损坏或丢失。委托人签署电子合同进行交易的，应积极采取安全措施，加强账户、密码的保护。

5、合同变更风险

(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，更新或修改的内容在管理人网站公告满5个工作日后生效。管理人无需征求委托人的意见。委托人对更新或修改的内容有异议，可以在管理人安排的临时开放日申请退出集合计划。

(2) 由于其他原因需要变更合同的，管理人和托管人应书面达成一致并在管理人网站公告。管理人须在公告后5个工作日内以电子邮件方式向委托人发送合同变更征询意见。委托人未在前述时间回复意见的，视为委托人同意合同变更。委托人不同意变更的，管理人通过后续安排保障其退出集合计划的权利。

(九) 资产管理计划份额转让的风险

本合同依据相关法律法规约定，在集合计划存续期间，委托人可以通过证券交易所、柜台交易市场等中国证监会认可的交易平台转让集合计划份额。管理人有权决定是否开放计划份额的转让业务。在办理转让业务时可能出现的风险包括但不限于：

1、操作系统风险



办理转让操作的系统可能因某些原因出现故障，从而影响转让业务办理。

2、折溢价风险

在集合计划份额可以办理转让后，份额的交易价格与其单位净值之间可能发生偏离并出现折/溢价交易的风险。

对于委托人通过证券交易所办理转让业务时可能出现的风险包括但不限于：

3、证券交易所为资产管理计划份额转让提供服务，不代表对资产管理计划的投资风险或收益做出判断或保证。管理人在资产管理合同和说明书中对资产管理计划存在的风险已作揭示，投资者在参与资产管理计划份额转让业务前，应认真阅读资产管理合同和说明书，了解产品特性，关注产品风险。

4、资产管理计划份额在证券交易所进行转让，并非集中竞价交易，可能不具有一个活跃的转让市场。证券交易所可以根据需要暂停或终止转让服务。

5、资产管理计划份额在证券交易所进行转让实行非担保交收。申报转让（受让）资产管理计划份额时，证券交易所对资产管理计划份额（资金）余额事先不实行检查、控制，相关份额登记结算机构也不实行担保交收，转让合同履行风险由转让方、受让方及管理人自行控制。

本风险揭示的揭示事项仅为列举性质，并未穷尽通过证券交易所办理资产管理计划份额转让业务所有风险因素。投资者参与资产管理计划份额转让业务前，对其他可能产生投资风险的相关因素也应详细了解、认真评估，避免因贸然从事此业务而遭受损失。

（十）特别风险提示

（1）管理人不保证委托人资产本金不受损失或取得最低收益，本集合计划可能出现净值损失；

（2）本集合计划第一个开放期为成立满 6 个月的次日及其后的连续 4 个工作日（含成立满 6 个月的次日，共 5 个工作日，非工作日则顺延至下一工作日），其中最后一个开放日办理退出业务；其后，每个自然季度的首月 15 日及其后的连续 4 个工作日为开放期（含每个自然季度的首月 15 日，共 5 个工作日，非工作日则顺延至下一工作日），其中最后一个开放日办理退出业务，存在一定的流动性风险。



二十六、合同的成立与生效

（一）合同的成立与生效

本合同以电子合同或纸质合同方式签署，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；委托人作为本合同一方，以电子合同或纸质合同方式签署本合同，即表明委托人完全接受本合同项下的全部条款。本合同经管理人、托管人和委托人签署后成立。

本合同成立后，同时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。

本合同满足生效条件当日，管理人应书面通知托管人。

本集合计划终止，本合同终止。但合同项下有关清算、违约责任、争议解决的条款仍然有效。

（二）合同的组成

《海通远见 1 号 FOF 集合资产管理计划说明书》、经管理人确认有效的委托人参与、退出本集合计划的申请材料或数据电文和各销售机构出具的集合计划参与、退出业务受理有关凭证或委托人通过电子合同方式产生的数据电文等等为本合同的附件，是合同的组成部分，与合同具有同等法律效力。

但若说明书中的内容与本合同中的相关内容不一致的，以本合同中的表述为准。

二十七、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，可以对本集合计划合同及说明书与新的法律法规或有关规定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十五个工作日后生效。特别的，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，管理人履行前述合同变更程序后将按照新的监管标准予以调整。



2018-1492393

委托人对更新或修改的内容有异议，应在更新或修改内容于管理人指定网站公告之日起 10 个工作日内按照本合同的规定申请退出本集合计划，未申请退出的，视为无异议。

2、由于其他原因需要变更合同的，管理人和托管人应书面达成一致并在管理人网站公告。管理人须在公告后五个工作日内以管理人指定网站公告或书面通知等方式向委托人发送合同变更征询意见。

委托人不同意变更的，应在征询意见发出后的 10 个工作日（以下统称“指定期”）内提出退出本集合计划的申请或明确答复不同意合同变更；委托人未在前述时间回复意见的、也未在指定期退出计划或答复意见不明确的，视为委托人同意合同变更。

委托人不同意变更的，管理人对其采取如下权利保障措施及后续安排：委托人不同意变更的，管理人保障其退出集合计划的权利，管理人可在指定期内设置临时开放日为委托人办理退出集合计划的业务；对于明确答复不同意合同变更但逾期未退出本集合计划的委托人，管理人将统一在合同变更生效日次一工作日做强制退出处理。合同变更生效日以管理人公告为准。计划份额的退出价格为退出当日的计划单位净值。

委托人同意，无论其是否同意合同变更或提出退出申请，管理人变更本合同的行为均不应被视为或裁定为管理人的违约行为。

3、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。

4、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。

二十八、通知和送达

各方应按照第三条所列各方联系人的通讯方式，以专人送达、快递、传真、电子邮件等有效方式进行通知和送达。

通知在下列日期视为送达被通知方：

1、专人送达：在专人递送之交付日为有效送达；

2018-1492393



2、快递：以特快专递（付清邮资）发出的通知，在寄出（以邮戳为凭）后的第3日为有效送达；

3、传真：发送成功当日即为有效送达；


4、电子邮件：由电子邮件送达，以发送方服务器显示的发送成功时间为送达时间。通讯地址或联络方式发生变化的一方（简称“变动方”），应提前5个工作日以书面形式通知其他各方。如果变动方，未将有关变化及时通知其他各方，变动方应对由此而造成的影响和损失承担责任。

二十九、其他事项

本合同如有未尽事宜，由各方按有关法律法规和规定协商解决。

本合同一式陆份，当事人各执二份，报管理人住所地中国证监会派出机构备案二份，每份具有同等法律效力。

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。

2018-1492393  本合同如采用套印形式进行印刷，资产管理人作为印刷管理人，须与印刷厂签署保密协议，规定样版使用、印刷成品管理等具体措施，并要求印刷厂严格按照经资产管理人和资产托管人最终签署的资产管理合同样版进行批量印刷，记录印刷合同数量。按合同样版的内容及印模印刷的合同视为经资产管理人和资产托管人有效签署的合同。如正式印刷的合同与样版不一致，资产管理人将承担因此所产生的全部责任，并赔偿因此给资产托管人所造成的损失。资产管理计划成立后，资产管理人将未经资产委托人签订的印刷合同全部回收，核对数量无误后妥善处理好保管、登记和销毁事宜。资产托管人有权对上述事项随时抽查，资产管理人应予以配合。因合同丢失、损毁、未妥善保管等造成的任何损失，由资产管理人采取补救措施，资产托管人不承担责任。资产委托人特此声明：其认可资产管理人和资产托管人以套印方式加盖公章或合同章具有法律效力。

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签字人签署。

(以下无正文)



(本页无正文，为海通远见 1 号 FOF 集合资产管理计划合同签署页)

如委托人为自然人：

姓名：_____

住所地：_____

证件类型：_____ 证件号码：_____

联系地址：_____

邮政编码：_____ 联系电话：_____ 电子邮件：_____

如委托人为机构客户：

名称：

法定代表人/授权签字人姓名：

营业执照号码：

住所地：

邮政编码：_____ 联系电话：_____ 电子邮件：_____

管理人：_____公司（公章或合同专用章）



非云江

法定代表人（或授权代理人）签字或盖章：

托管人：_____（公章或合同专用章）



签订日期：2018 年 ■ 月 ■ 日

