

编号：SZ2019203003



安信证券策略优选 1 号集合资产管理计划
托管协议

(适用于托管行法人结算模式)



目 录

| | |
|-------------------------------|----|
| 一、托管协议的依据、目的、原则和解释 | 3 |
| 二、计划托管人和计划管理人之间的业务监督、核查 | 3 |
| 三、集合计划资产的保管 | 7 |
| 四、指令的发送、确认和执行 | 8 |
| 五、交易安排 | 11 |
| 六、集合计划参与、退出及分红的资金清算 | 14 |
| 七、集合计划资产估值、资产净值计算与复核 | 16 |
| 八、集合计划的收益分配、费用计算及支付 | 18 |
| 九、信息披露 | 19 |
| 十、集合计划有关文件和档案的保存 | 19 |
| 十一、集合计划托管报告 | 20 |
| 十二、禁止行为 | 20 |
| 十三、违约责任和责任划分 | 20 |
| 十四、适用法律与争议解决 | 21 |
| 十五、托管协议的效力和文本 | 21 |
| 十六、托管协议的修改、终止和资产清算 | 21 |
| 十七、其他事项 | 22 |
| 附件一：划款指令及相关业务授权书（格式） | 24 |
| 附件二：相关账户信息 | 25 |
| 附件三：管理人发送的划款指令（格式） | 26 |

集合资产管理计划托管协议 （适用于托管行法人结算模式）

计划管理人（以下简称“管理人”）：安信证券股份有限公司

住所：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元

通讯地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 A 座 27 层

法定代表人：王连志

联系人：应涵

联系电话：0755-82558218

传真：0755-82558219

电子邮件：yinghan@essence.com.cn

计划托管人（以下简称“托管人”）：上海浦东发展银行股份有限公司深圳分行

主要营业地址：深圳市福田区福华三路国际商会中心 1、2、3、25、26 楼

联系人：胡月琴

电话：0755-88691606

传真：——

电子邮件：huyq5@spdb.com.cn

一、托管协议的依据、目的、原则和解释

（一）依据

本协议依据《中华人民共和国合同法》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》（以下称“《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》（以下称“《运作管理规定》”）、《证券公司客户资产管理业务规范》（以下简称“《规范》”）、《安信证券策略优选 1 号集合资产管理计划资产管理合同》（以下简称“《资产管理合同》”）及其他有关法律、法规制订。

（二）目的

本协议的目的是明确计划托管人和计划管理人之间在开展的本集合计划相关业务（包括但不限于参与人名册的登记、集合计划资产的保管、集合计划资产的管理和运作、集合计划的参与、退出及相互监督等）过程中的有关权利、义务及职责，保护委托人的合法权益。

（三）原则

计划管理人对拟发起设立的本集合资产管理计划，委托计划托管人对集合计划资产进行托管。双方本着平等自愿、诚实信用的原则，经协商一致，签订本协议。

（四）解释

除非文义另有所指，本协议的所有术语与《资产管理合同》的相应术语具有相同含义。

二、计划托管人和计划管理人之间的业务监督、核查

（一）本计划的投资范围

（1）沪深交易所依法发行上市的股票（包括科创板、新股申购）、港股通标的股票；

（2）交易所、银行间债券市场公开发行的债券或非公开发行的债券，包括但不限于国债、地方政府债、金融债、央行票据、企业/公司债券、短期融资券、超短期融资券、中期票据、非公开定向债务融资工具、非公开发行私募债、资产支持证券、资产支持票据、同业存单、金融机构次级债、可转换公司债券、可交换债券、债券正逆回购、银行存款以及符合《指导意见》规定的其他标准化债权类资产；

（3）股指期货、国债期货、商品期货、交易所期权等标准化商品及金融衍生品；

（4）股票型公募基金证券投资基金（含 ETF 场外申赎及场内买卖、LOF）、债券型公募基金证券投资基金、货币型公募基金证券投资基金。

本集合计划可以开展融资融券业务。如法律法规或监管机构以后允许集合计划投资其他品种，管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

（二）计划托管人对计划管理人的业务监督、核查

1、计划托管人对计划管理人就以下事项进行监督：

本计划资产配置比例：

权益类资产占本计划总资产的比例为 60%-80%（不含）；固定收益类资产占本计划总资产的比例不超过 80%；商品及衍生品类持仓合约价值占本计划总资产的比例不超过 80%或衍生品账户权益不超过集合计划资产总资产的 20%。

管理人将在集合计划成立后的 6 个月建仓期内，逐步将资产配置比例满足上述比例限制要求。建仓期内的投资活动，应当符合本合同约定的投向和本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。建仓期结束后，资产管理计划的资产组合应当符合法律、行政法规、中国证监会规定和本合同约定的投向和比例。

委托人同意并授权管理人可以直接或间接将集合计划的资产投资于管理人、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发行的证券或者承销期内承销的证券。但应当建立健全管理人内部审批机制和评估机制，遵循委托人利益优先原则，并采取有效措施防范利益冲突。事后管理人将在交易发生后五个工作日内以公告的方式向托管人和委托人披露，并向中国证监会相关派出机构和证券投资基金业协会报告，投资于证券期货的关联交易还应当向证券期货交易所报告。

因证券期货市场波动、证券发行人合并、资产管理计划规模变动等管理人之外的因素导致资产管理计划投资不符合法律、行政法规和中国证监会规定的投资比例或者合同约定的投资比例的，管理人应当在流动性受限资产可出售、可转让或者恢复交易的 15 个交易日内调整至符合要求。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，除高风险类型的产品超出比例范围投资较低风险资产外，应当先行取得投资者书面同意，并履行合同变更、登记备案等法律法规以及金融监督管理部门规定的程序。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等适当程序后，可以将其纳入本计划的投资范围。

本集合计划的投资限制为：

（1）权益类资产占本计划总资产的比例为 60%-80%（不含）；固定收益类资产占本计划总资产的比例不超过 80%；商品及衍生品类持仓合约价值占本计划总资产的比例不超过 80%或衍生品账户权益不超过集合计划资产总资产的 20%。

(2) 本集合计划投资于同一资产的资金，不得超过本计划资产净值的 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。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%。

(3) 本集合计划的总资产不得超过该计划净资产的 200%；

(4) 本集合计划不得投资于本机构管理的其他资产管理计划；

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

(6) 本集合计划开放退出期内，其资产组合中 7 个工作日可变现资产的价值，不低于本计划资产净值的 10%。本集合计划主动投资于流动性受限资产的市值在开放退出期内合计不得超过该资产管理计划资产净值的 20%。流动性受限资产，是指由于法律法规、监管、合同或者操作障碍等原因无法以合理价格予以变现的资产，包括到期日在 10 个交易日以上的逆回购与银行定期存款（含协议约定有条件提前支取的银行存款）、资产支持证券（票据）、流动受限的新股以及非公开发行股票、停牌股票、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券和非金融企业债务融资工具等资产。

(7) 证券法规规定和集合计划管理合同约定禁止从事的其他投资。

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，造成集合计划投资比例超标，管理人应在超标发生之日起在具备交易条件的 15 个工作日内将投资比例降至许可范围内。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。

若法律法规、监管规定等有变化，管理人履行合同变更程序后，可以对上述投资限制进行调整，并在管理人网站公告告知委托人。

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) 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) 接受单一客户参与资金低于中国证监会规定的最低限额；
- (7) 使用集合计划资产进行不必要的交易；
- (8) 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；
- (9) 直接投资于商业银行信贷资产；
- (10) 违规为地方政府及其部门提供融资；
- (11) 要求或者接受地方政府及其部门违规提供担保；
- (12) 直接或者间接投资法律法规和国家政策禁止投资的行业和领域；
- (13) 直接或者间接投资于违反国家产业政策、环境保护政策的项目（证券市场投资除外），包括但不限于以下情形：
 - a) 投资项目被列入国家发展和改革委员会发布的淘汰类产业目录；
 - b) 投资项目违反国家环境保护政策要求；
 - c) 通过穿透核查，资产管理计划最终投向上述投资项目。
- (14) 法律、行政法规和中国证监会禁止的其他行为。

管理人、托管人应定期向对方提供各自控股股东、实际控制人或者其他关联方名单，共同构成本集合计划的关联方名单。托管人对管理人关联方交易的监督以上述关联方名单为准，管理人及托管人应定期更新该名单。

2、托管人发现管理人的划款指令违反法律、行政法规、中国证监会的规定或者资产管理合同及本协议约定的，应当以书面或录音电话形式通知并要求管理人改正；未能改正的，托管人有权并应拒绝执行，并向管理人住所地、资产管理分公司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。对于依据交易程序已经生效的交易，托管人应依据证券交收规则先办理证券清算交收，事后提示管理人限期改正，并有权向管理人住所地、资产管理分公司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。对于因管理人违规行为对计划资产造成的损失，托管人不承担任何责任。

（三）计划管理人对计划托管人的业务监督、核查

管理人发现计划托管人的行为违反法律法规、部门规章和资产管理合同的规定，应及时以书面形式通知托管人限期纠正。托管人收到通知后应及时核对并以书面形式给计划管理人发出回函，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。计划管理人有权随时

对通知事项进行复查，督促计划托管人改正。计划管理人发现计划托管人有重大违规行为，应立即报告计划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，同时通知计划托管人限期纠正，并将纠正结果报告计划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。

（四）计划托管人与计划管理人在业务监督、核查中的配合、协助

计划管理人和计划托管人有义务配合和协助对方依照本协议对集合计划业务执行监督、核查。计划管理人或计划托管人无正当理由，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，情节严重或经监督方提出警告仍不改正的，监督方应报告计划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。

三、集合计划资产的保管

（一）集合计划资产保管的原则

1、计划托管人按照规定代理开立集合计划财产的银行托管账户、证券账户、债券托管专户等各类账户，对所托管的不同集合计划财产分别设置账户。

计划托管人对在计划托管人之处开立的银行账户内的资金负有安全保管职责；对于计划投资银行存款的，计划托管人保管相应的存款凭证原件。计划托管人对在中国证券登记结算有限责任公司开立的证券账户和在中央国债登记结算有限责任公司、银行间市场清算所股份有限公司（上海清算所）开设的银行间债券市场债券托管账户中的证券不负保管职责。

实物证券的保管根据相关规定办理，如规定存放于中央国债登记结算有限公司、上海清算所或中国证券登记结算有限公司等其他机构的，按规定办理。如无规定的，由计划托管人负责存管。

2、计划托管人未经计划管理人的指令，不得自行运用、处分、分配集合计划的任何资产（不包含计划托管人依据中国结算公司结算数据完成场内交易交收、托管资产开户银行扣收汇划费、结算费和账户维护费等费用）。

3、对于因为集合计划投资产生的应收资产或计划应收代销参与款，应由计划管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知计划托管人，到账日集合计划资产没有到达计划托管人处的，计划托管人应及时通知计划管理人采取措施进行催收，由此给集合计划造成损失的，计划管理人应负责向有关当事人追偿集合计划的损失。

4、计划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

控制制度，防范和减少风险。

5、除依据《资产管理合同》、《管理办法》、《运作管理规定》及其他有关规定外，计划托管人不得委托第三人托管集合计划资产。

6、计划托管人不对处于自身实际控制之外的账户及财产承担责任。

（二）集合计划的银行托管账户的开设和管理

1、计划托管人可以在集合计划成立日前以集合计划的名义在其营业机构代理开立集合计划的专用银行托管账户，并根据计划管理人合法合规的指令办理资金收付。计划管理人应根据法律法规及开户行的相关要求，为托管人开立银行托管账户提供必要协助。本集合计划的银行托管账户的预留印鉴的印章由计划托管人保管和使用。

2、集合计划银行账户的开立和使用，限于满足开展本集合计划业务的需要。计划托管人和计划管理人不得假借本集合计划的名义开立任何其他银行账户；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。

3、集合计划银行账户的开立和管理应符合银行业监督管理机构的有关规定。

4、在符合法律法规、部门规章规定的条件下，计划托管人可以通过集合计划银行托管账户办理集合计划资产的支付。

（三）其他各类账户的开设和管理

1、其他各类账户，诸如证券账户、债券托管专户等，由管理人或托管人代理本计划在相关开户机构开立，管理人和托管人均需为开户事宜提供必要协助。

2、上述所有账户的开立和使用，限于满足开展本集合计划业务的需要。计划托管人和计划管理人不得出借和未经另一方同意擅自转让本集合计划的任何账户；亦不得使用本集合计划的任何账户进行本集合计划业务以外的活动。

3、上述各类账户的原件均由计划托管人保管。

（四）与集合计划资产有关的重大合同的保管

与集合计划资产有关的重大合同的原件分别由计划托管人、计划管理人保管。重大合同包括资产管理合同、托管协议及其附件等。除本协议另有规定外，计划管理人在代表集合计划签署与集合计划有关的重大合同时，应保证集合计划一方持有两份以上的正本，以便计划管理人和计划托管人至少各持有一份正本的原件。

四、指令的发送、确认和执行

（一）计划管理人对发送指令人员的授权

1、计划管理人应指定专人向计划托管人以传真或邮件形式发送指令。

2、计划管理人应于集合计划成立日前向计划托管人提供书面授权文件，内容包括被授权人名单、预留印鉴及被授权人签字样本，授权文件应注明被授权人相应的权限。签署划款指令授权书的人员只限于管理人的法定代表人或其授权代表签署并加盖公章，若由授权代表签署，还应附上法定代表人的授权书。

3、计划托管人收到授权文件正本后，并经与计划管理人电话确认，授权文件即生效。

4、计划管理人和计划托管人对授权文件负有保密义务，其内容不得向被授权人及相关操作人员以外的任何人泄漏。

（二）指令的内容

1、指令包括付款指令以及其他资金划拨指令等。

2、计划管理人发给计划托管人的指令应写明产品名称、款项事由、支付时间、支付金额、收付款账户信息等，并加盖全部预留印鉴并由被授权人签字或盖章。

（三）指令的发送、确认和执行

1、指令的发送

（1）计划管理人应按照法律法规、部门规章和资产管理合同的规定，在其合法的经营权限和交易权限内发送指令；被授权人应严格按照其授权权限发送指令。对于被授权人依约定程序发出的指令，计划管理人不得否认其效力。但如果计划管理人已经撤销或更改对交易指令发送人员的授权，且该授权已依本条（一）-3 款生效后，则对于此后该交易指令发送人员无权发送的指令，或超权限发送的指令，计划管理人不承担责任。但授权已更改但未通知计划托管人并生效的除外。

指令发出后，计划管理人应及时以电话方式向计划托管人确认。资产托管人可以要求资产管理人传真提供相关交易凭证、合同或其他有效会计资料，以确保资产托管人有足够的资料来判断指令的有效性。在本委托财产申购/认购开放式基金时，资产管理人应在向资产托管人提交划款指令的同时将经有效签章的基金申购/认购申请书以传真形式送达资产托管人；本委托财产参与银行间市场交易时，资产管理人应将银行间同业拆借中心成交通知单加盖预留印鉴后传真给资产托管人，资产管理人与资产托管人另有约定的除外。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。

（2）托管人发现管理人的划款指令、其他划款证明文件违反法律、行政法规、中国证监会的规定或者资产管理合同及本协议约定的，应当以书面或录音电话形式通知并要求管理人改正；未能改正的，托管人有权并应拒绝执行，并向管理人住所地、资产管理分公司所在地

中国证监会派出机构及中国证券投资基金业协会报告。对于依据交易程序已经生效的交易，托管人应依据证券交收规则先办理证券清算交收，事后提示管理人限期改正，并有权向管理人住所地、资产管理分公司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。

（3）资产管理人向资产托管人发送划款指令时，应遵守下述指令截止时间要求。

除新股申购、定期存款、非担保业务外，资产管理人应在清算市场关闭前或资产管理人指定的划款时间（不晚于清算市场关闭时间）前至少 2 个工作小时（资产托管人工作时间 9 点至 11 点 30 分，13 点至 17 点）向资产托管人发送划款指令。网下新股申购的划款指令截止时间为划款日上午 10:00；投资定期存款、非担保交收品种的划款指令截止时间为划款日 14:00。如资产管理人发送划款指令时给予托管人的划拨执行时间小于 2 个工作小时或晚于前述指令截止时间的，资产托管人将尽力配合执行，但不承担指令执行失败的责任。

由资产管理人原因造成的指令传输不及时、未能留出足够划款所需时间，致使资金未能及时到账所造成的损失由资产管理人承担。

2、指令的确认

计划托管人应指定专人接收计划管理人的指令，并将指令接收人员的名单预先通知计划管理人。指令到达计划托管人后，计划托管人应指定专人立即对指令内容进行审查、并对预留印鉴进行核对，如有疑问及时通知计划管理人，并有权附注相应说明后立即将指令退还给管理人，要求其重新下达有效指令。

3、指令的执行

计划托管人对指令验证后，应及时办理。指令执行完毕后，计划托管人应及时以指令回传方式通知计划管理人。

划款指令及相关划款证明文件的正本由计划管理人保管，计划托管人保管传真件或邮件扫描件。当两者不一致时，以计划托管人收到的传真件或邮件扫描件为准。因此造成损失的，计划托管人不承担任何责任。

（四）被授权人的更换

计划管理人更换被授权人、更改或终止对被授权人的授权范围的，应提前 3 个工作日通知计划托管人，并于新授权书生效前将加盖计划管理人公章及法定代表人或其授权代表签字或盖章确认的书面文件送达计划托管人。被授权人变更通知，自通知载明的生效时间开始生效。若计划托管人收到通知的日期晚于通知载明的生效日期的，则该变更将在计划托管人收到正式书面通知原件并经与计划管理人电话确认后正式生效，同时原授权书作废。被授权人变更通知生效前，计划托管人仍应按原约定执行指令，计划管理人不得否认其效力。在特殊

情况下，可按双方商定的方式处理。如果计划管理人授权人员名单、权限有变化时，未能按本协议约定及时通知计划托管人并预留新的加盖计划管理人公章及法定代表人或其授权代表签字或盖章的印鉴和签字样本而导致计划资产受损的，计划托管人不承担任何形式的责任。

计划托管人更换接受计划管理人指令的人员，应提前通知计划管理人，并通过电话确认。因计划托管人未及时通知所造成的损失，由计划托管人承担。

（五）其它事项

1、计划托管人在接受指令时，应对指令的要素是否齐全、印鉴与被授权人预留的授权文件内容是否相符进行核对，如发现问题，应及时通知计划管理人。

2、计划托管人对其依据计划管理人按照正常交易程序已经生效的指令而执行的操作所导致的对集合计划资产的损失不承担赔偿责任。

3、资产管理人向资产托管人下达指令时，应确保本计划项下的托管专户有足够的资金余额，对托管专户没有充足资金的情况下向资产托管人发出的指令，资产托管人可不予执行，并通知资产管理人，资产托管人不承担因为不执行该指令而造成损失的责任。

4、如果计划管理人的划款指令、其他划款证明文件存在事实上未经授权、欺诈、伪造或未能按时提供划款指令人员的预留印鉴和签字样本等非计划托管人原因造成的情形，只要计划托管人根据本合同相关规定验证有关印鉴与签名无误，计划托管人不承担因正确执行有关指令而给计划管理人或资产管理计划或任何第三人带来的损失。

五、交易安排

（一）代理本集合计划证券买卖的证券经营机构的选择

计划管理人负责选择代理本集合计划证券买卖的证券经营机构。

计划管理人应及时以书面形式通知计划托管人集合计划专用交易单元、佣金费率等集合计划基本信息以及变更情况。计划管理人应当通过专用交易单元进行交易，该交易单元只对应托管人，同时，该交易单元下不能办理自营业务，并向证券交易所、证券登记机构备案。

（二）集合计划投资证券后的清算、交割及账目核对

1、清算与交割

（1）基本规定

集合计划投资于证券发生的所有场内、场外交易的资金清算交割，全部由计划托管人负责办理。

集合计划投资于场内交易的投资品种前，计划管理人和计划托管人应当另行签署托管银行证券资金结算协议。

(2) 投资于网下新股和非担保交收的投资品种

委托财产投资于网下新股和非担保交收的投资品种时，资产管理人应在约定时间内提交指令，且指令信息应符合如下要求。

委托财产投资网下新股指令收款账户及指令摘要信息如下：

上海市场网下新股申购收款账户信息：

户名：中国证券登记结算有限责任公司上海分公司（网下发行专户）

账号：97020153700000021

开户行：上海浦东发展银行上海分行营业部

划款摘要：申购证券账户账号及申购证券的代码，例如“B888888888*****”

深圳市场网下新股申购收款账户信息：

户名：中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司网下发行专户

账号：79170153700000013

开户行：上海浦东发展银行深圳分行

划款摘要：B001999906WAFX 及申购证券的代码，例如“B001999906WAFX*****”

采用实时逐笔全额（RTGS）、T+0 非担保结算方式的买入交易资金划出指令相关收款账户及指令摘要信息如下：

上海市场非担保交收收款账户信息：

户名：中国证券登记结算有限责任公司上海分公司（备付金）

账号：97020153500000011

开户行：上海浦东发展银行上海分行营业部

划款摘要：04000000000430982

指令备注：“成交号码”、“股东代码”、“证券代码”

深圳市场非担保交收收款账户信息：

户名：中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司（备付金）

账号：990002322003856

开户行：上海浦东发展银行深圳分行营业部

划款摘要：B009999715

指令备注：“委托序号”、“股东代码”、“证券代码”

（3）银行间债券券款对付结算

资产管理计划投资于银行间债券市场若采用券款对付结算模式，计划管理人和计划托管人应当另行签署券款对付结算业务服务标准协议。

（4）定期存款投资

投资管理人与存款行签订的存款协议条款格式应在定期存款起息日的前一个工作日发送给托管人，定期存款的划款指令及存款协议盖章版（传真件或扫描件）最迟不得晚于起息日 15:00（指令截至时间）提交托管人。

存款银行无法在存入 17 点前向托管人送达存款证实书的，投资管理人应敦促存款银行将存款证实扫描件发送至托管人。存款证实书送达托管人后，托管人负责保管存款证实书原件。托管人仅对存款证实书进行形式审核，形式审核内容为账户名称、起息日、到期日、金额、利率。托管人不对存款证实书真实性承担审核职责。

投资管理人与存款银行签订的存款协议，应包括：

a) 存款银行为托管资产办理定期存款业务的存款账户开立、资金存入和支取提供必要的支持和高效的结算服务；

b) 存款银行为托管资产所投资的定期存款的存款证明文件提供上门服务，即：定期存款资金到账当日，存款银行派授权代理人将“存款证实书”（以下简称“证实书”）妥善送至托管人处。“证实书”移交给托管人之前，因“证实书”丢失、损毁而造成的一切损失由存款银行承担。

c) 定期存款到期日当日或提前支取日当日，存款银行应派授权代理人前往托管人处提取“证实书”。“证实书”移交给存款行授权代理人之后，因“证实书”丢失、损毁而造成的一切损失由存款银行承担。

存款银行应至少提前一个工作日向托管人提供对前述授权代理人办理相关事务的书面授权书。授权代理人提供上门服务时，应出示有效身份证或工作证原件及托管人要求提供的其他书面证明材料。

d) 存款银行应保证及时支付存款本金和利息，于支取当日将本息划付至托管人（上海浦东发展银行）处的托管账户，并列明账户的开户行、账号、户名、大额支付号。存款银行应确认，定期存款的本息只能划入开立在托管人的相应托管账户或经托管人确认的指定账户。上述指定收款账户信息如需变更，必须经托管人书面同意。

e) 存款银行应为定期存款业务提供定期对账服务。首次对账应不晚于存款资金存入后的一个自然月。除首次对账外，对账频率不少于每年一次。存款银行应配合托管人对“证实书”的书面征询。

f) 在存款存续期内，“证实书”的预留印鉴发生变更的，存款银行应配合办理变更手续。

(5) 开放式基金认购、申购、赎回的交易安排

计划管理人申购（认购）开放式基金时，应将划款指令连同有效签章的基金申购（认购）申请单传真至计划托管人。计划托管人审核无误后，应及时将划款指令交付执行，并对划款指令执行情况进行查询，将执行结果通知计划管理人。

计划管理人赎回开放式基金时，应在向基金管理公司或代销机构发出基金赎回申请书的同时，连同收款通知传真计划托管人。计划托管人应及时查询到账情况并反馈计划管理人。

计划管理人应及时将申购（认购）、赎回交易确认单、分红（红利转份额）确认单等相关业务单据传真至计划托管人。

2、资金和证券账目核对的时间和方式

(1) 资金账目的核对

资金账目包括集合计划的银行存款等会计资料。管理人和托管人对资金账目（每日）对账一次，按日核实，做到账账相符。

(2) 证券账目的核对

计划托管人在收到有关登记结算数据后，（每日）核对账面证券种类和余额与登记结算数据是否相符。管理人和托管人（每日）核对证券账目，做到账账相符。

六、集合计划参与、退出及分红的资金清算

本计划的参与、退出及分红的相关规则按集合计划资产管理合同约定。

(一) 募集期的基本规定

1、本计划募集结束后可，管理人应将全部参与资金从管理人在注册登记机构开立的集合资产管理计划募集账户转入托管人为本集合计划代理开立的银行托管账户。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资产管理计划进行验资并出具验资报告提供给托管人。管理人应确保银行托管账户实际到账款项与计划验资报告金额一致。如果发现不一致的情况，托管人应书面通知管理人，由管理人负责解决。

2、集合计划的销售机构不得在其销售材料中增加本协议所列资产托管人职责义务之外

其他涉及资产托管人的内容，不得包含可能影响资产托管人声誉风险的表述。

以上事项如中国证监会另有新规定，按新规定执行。

（二）存续期间参与和退出业务处理的基本规定

1、本集合计划存续期内集合计划参与和退出的确认、清算由计划管理人指定的注册登记机构负责办理。

2、计划管理人原则上每个工作日 17:00 前向计划托管人发送 T-2 日（T 为当日）与本集合计划注册登记有关的数据。

管理人应保证发送给托管人的数据的真实性、准确性和完整性，因管理人发送数据不真实、不准确、不完整而造成托管人对相应集合计划核算差错以及对相应集合计划造成相应影响或损失的，托管人不承担任何责任。

3、计划管理人通过与计划托管人建立的深证通系统发送有关数据，如因各种原因，该系统无法正常发送，双方可协商解决处理方式。计划管理人向计划托管人发送的数据，双方各自按有关规定保存。

4、关于集合计划清算账户的设立和管理

为满足存续期内退出及参与资金汇划的需要，注册登记机构的专用账户由份额登记机构管理。

5、对于本集合计划参与过程中产生的应收资产，应由计划管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知计划托管人，到账日相应的集合计划资产没有到达计划托管人处的，计划托管人应及时通知计划管理人采取措施进行催收，由此给相应的集合计划造成损失的，管理人应负责向有关当事人追偿相应集合计划的损失。

6、退出和分红资金划拨的规定

拨付退出款或进行集合计划分红时，如相应的集合计划银行托管账户有足够的资金，计划托管人应按照管理人的有效划款指令按时拨付；因相应的集合计划银行托管账户没有足够的资金，导致计划托管人不能按时拨付，计划托管人不承担垫款义务。

7、资金指令

除参与款项到达计划托管人处的集合计划银行托管账户需双方按约定方式对账外，全额划出、退出和分红资金划拨时，计划管理人需向计划托管人下达指令。指令的格式、内容、发送、接收和确认方式等的处理程序如本协议第四部分执行。

（三）存续期集合计划资金清算时间安排

1、存续期本集合计划资金清算时间安排为：参与资金在 T+3 日内清算，退出资金在 T+7

日内清算。

2、T+2 日 14:00 前，计划管理人将 T 日参与、退出确认的有效数据汇总传输给计划托管人。计划管理人和托管人据此进行参与、退出的本集合计划会计处理。

3、集合计划银行托管账户与管理人在注册登记机构开立的专用账户间的参与和退出资金结算采用非担保交收模式，实行逐笔全额结算：

当银行托管账户存在应收额时，资金交收日的 15:00 前管理人将本集合计划的应收额从资金清算的集合计划注册登记机构的清算资金账户划到该集合计划的托管账户，托管人每日向管理人提交当日可用头寸表。

当本集合计划的银行托管账户存在应付额时，资金交收日的当日上午 11:00 前管理人将划款指令传真给托管人，资金交收日 15:00 前托管人按管理人的划款指令将本集合计划的应付额划向资金清算的该集合计划注册登记机构的清算资金账户。托管人在资金划出后应通知管理人，并将有关书面凭证交给管理人进行账务管理。

4、出现特殊情况时，计划管理人和托管人双方可协商处理。

（四）集合计划现金分红

1、计划管理人将其决定的本集合计划的分红方案通知计划托管人，由计划托管人对托管人客观上能够复核的数据进行复核。

2、计划管理人对本集合计划分红进行账务处理并核对后，计划管理人向计划托管人发出现金分红的划款指令，计划托管人应及时将资金划入注册登记机构的清算资金账户。

3、计划管理人在下达指令时，应给计划托管人留出必需的划款时间。

七、集合计划资产估值、资产净值计算与复核

集合计划资产的估值，应当遵循稳健性、公允性和一致性原则。

（一）集合计划资产估值

1、估值方法

本集合计划的估值方法参照资产管理合同执行。

2、估值程序

日常估值由管理人进行。用于披露的资产净值由管理人完成估值后，将估值结果以书面形式报送托管人，托管人按照规定的估值方法、时间与程序进行复核；托管人复核无误签章后返回给管理人。本计划净值（每日）披露。

3、差错处理责任

(1) 当发生净值计算错误时,由管理人负责处理,由此给委托人和集合计划造成损失的,由管理人对委托人或者计划先行支付赔偿金。管理人和托管人应根据实际情况界定双方承担的责任,经确认后按以下条款进行赔偿;

a) 本集合计划的会计责任方由管理人担任。与计划有关的会计问题,如经管理人和托管人在平等基础上充分讨论后,尚不能达成一致时,按会计责任方的建议执行,由此给委托人和计划造成的损失,托管人不承担责任;

b) 如管理人净值计算出错,托管人在复核过程中没有发现,且造成委托人损失的,由双方各自承担相应的赔偿责任;

c) 如管理人和托管人对计划份额净值的计算结果,虽然多次重新计算和核对,尚不能达成一致时,为避免不能按时向委托人报告份额净值的情形,以管理人的计算结果对外公布,由此给委托人和计划造成的损失,托管人不承担责任;

d) 如管理人与托管人协商不一致,以管理人为准。如管理人和托管人协商一致,采用本协议规定的方法确定一个价格进行估值的情形下,若管理人净值计算出错,托管人在复核过程中没有发现,且造成计划或委托人损失的,由管理人和托管人各自承担相应的赔偿责任。

(2) 由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误,有关会计制度变化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而造成的份额净值计算错误,管理人、托管人可以免除赔偿责任。但管理人、托管人应积极采取必要的措施消除由此造成的影响;

(3) 法律法规、部门规章或者监管部门另有规定的,从其规定。如果行业有通行做法,管理人和托管人应本着平等和保护委托人利益的原则进行协商。

(二) 集合计划资产净值的计算、复核与完成的时间及程序

1、集合计划资产净值

集合计划份额净值是指本集合计划资产净值除以集合计划份额总数,集合计划份额净值的计算,精确到人民币 0.0001 元,小数点后第五位四舍五入,国家另有规定的,从其规定。

2、复核程序

计划管理人对本集合计划资产进行估值后,按净值披露的要求将资产净值结果发送给计划托管人,计划托管人按资产管理合同规定的方法、时间、程序进行复核;经计划托管人复核无误后,盖章并以传真方式传送给计划管理人,由计划管理人对外披露。

3、集合计划份额净值的确认及错误的处理方式

集合计划份额净值的计算采用四舍五入的方法保留小数点后 4 位。国家另有规定的,从

其规定。当集合计划份额净值小数点后 4 位以内（含第 4 位）发生差错时，视为集合计划份额净值错误。

份额净值差错处理的原则和方法如下：

（1）集合计划份额净值出现错误时，计划管理人应当立即予以纠正，通报计划托管人，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；

（2）错误偏差达到集合计划份额净值 0.5% 时，计划管理人应当通报计划托管人并报计划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备案；

（3）计划管理人与托管人应当根据有关规定进行账务处理，但计算过程有误导导致净值计算错误，从而给委托人造成直接经济损失的，管理人与托管人应按过错原则，根据各自的过错承担赔偿责任；

（4）前述内容如法律法规、部门规章或监管机关另有规定的，从其规定处理。

（三）集合计划账册的建立

计划管理人进行集合计划会计核算并编制集合计划财务会计报告。计划管理人独立地设置、记录和保管本集合计划的全套账册。

计划托管人办理集合计划的资金收付所获得的凭证，由计划托管人保管原件。

双方经对账发现账目存在不符的，计划管理人和计划托管人应及时查明原因并纠正。

八、集合计划的收益分配、费用计算及支付

集合计划的收益分配、相关费用的计算及支付等，参照资产管理合同执行。

托管费的计算和支付方式为：

本集合计划应给付托管人托管费，按前一日的资产净值的年费率计提。本集合计划的年托管费率为 0.03%。计算方法如下：

$$C = V \times 0.03\% \div \text{当年实际天数}$$

C 为每日应支付的托管费；

V 为前一日的集合计划资产净值。

托管人的托管费每日计算，逐日累计至每个季度底，按季度支付，由托管人于次季度首日起 5 个工作日内依据管理人的划款指令从本集合计划资产中一次性支付。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

户 名：证券公司客户资产托管业务收入

账 号：79010142110000076

开户银行：上海浦东发展银行深圳分行

九、信息披露

（一）保密义务

除非有权机关依法提出要求，计划托管人和计划管理人应按法律法规、部门规章、资产管理合同和中国证监会关于集合计划信息披露的有关规定进行信息披露，拟披露的信息在披露之前应予保密，不得向他人泄漏。除依前述规定应予披露的信息外，任何一方不得通过正式和非正式的途径向外披露任何其他信息，法律法规或司法/监管机构另有规定或要求的除外。

（二）信息披露的内容

集合计划的信息披露主要包括但不限于：资产管理报告、资产托管报告、资产净值公告及其他必要的披露文件。本协议项下的各集合计划的信息披露事项由管理人以通告的形式给委托人。集合资产管理季度报告和托管季度报告及其他临时通告放置于管理人网站，供委托人查阅。

本协议项下的各集合计划成立后，管理人应每个工作日公告一次经过托管人复核的集合计划份额净值。

对于本资产管理合同所规定的信息披露要求应严格遵守。按有关规定需经计划托管人复核的，须经计划托管人复核无误后方可披露。其他不需经计划托管人复核的信息披露内容，应及时告知计划托管人。

（三）计划管理人和计划托管人在信息披露中的职责和信息披露程序

1、计划管理人和托管人应根据相关法律法规、部门规章、《资产管理合同》的规定，各自指定专门的人员承担相应的集合计划信息披露职责。计划管理人和计划托管人负有积极配合、互相督促、彼此监督、保证其履行按照法定方式和时限披露的义务。

2、集合计划信息披露事项在以下指定网站上公告：

管理人网址：www.essence.com.cn

十、集合计划有关文件和档案的保存

（一）计划管理人按相关法律法规、部门规章妥善保存与集合计划有关的合同、协议、推广文件、交易记录、会计账册、报表等文件、资料，保存期限不少于二十年；计划托管人按相关法律法规、部门规章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、报表等文件、资料，保存期限不少于二十年。

（二）计划管理人应及时将与本集合计划账务处理、资金划拨等有关合同、协议传真计划托管人。

十一、集合计划托管报告

计划托管人应按《资产管理合同》、《管理办法》、《运作管理规定》和中国证监会的有关规定出具计划托管人报告。

十二、禁止行为

（一）除《管理办法》、《运作管理规定》其他法律法规、部门规章、《资产管理合同》及中国证监会另有规定，计划管理人、计划托管人不得为自身和任何第三人谋取利益。

（二）计划管理人与计划托管人对集合计划经营过程中任何尚未按有关法规规定的方式披露的信息，不得对他人泄露，法律法规、部门规章另有规定的除外。

（三）计划管理人不得在没有充足资金的情况下向计划托管人发出指令和退出、分红资金的划拨指令，也不得违规向计划托管人发出指令。同时，计划托管人对计划管理人的正常指令不得拖延和拒绝执行。

（四）除根据计划管理人指令或《资产管理合同》另有规定的，计划托管人不得动用或处分任何集合计划资产。

（五）计划托管人、计划管理人不得进行法律法规、部门规章、《资产管理合同》和本《托管协议》禁止的其他行为。

十三、违约责任和责任划分

（一）如果由于计划管理人或计划托管人的过错，造成本协议不能履行或者不能完全履行的，由有过错的一方承担相应违约责任；如果由于双方的过错，造成本协议不能履行或者不能完全履行的，根据实际情况，由双方分别承担各自应负的违约责任。管理人和托管人相互不承担连带责任。

（二）当事人违约，给另一方当事人造成损失的，应就直接损失进行赔偿；给集合计划资产造成损失的，应就直接损失进行赔偿，另一方当事人有权利及义务代表集合计划向违约方追偿，追偿费用由违约方承担。但是发生下列情况，当事人可以免责：

1、发生自然灾害、法律法规变化、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、证券交易所及登记结算公司发送的数据错误、电力故障、

通信故障等不可抗力情形；

2、计划管理人及计划托管人按照中国证监会的规定或当时有效的法律、法规或规章的作为或不作为而造成的损失等；

3、在没有欺诈或过失的情况下，计划管理人由于按照本《资产管理合同》规定的投资原则而行使或不行使其投资权而造成的损失等。

（三）当事人一方违约，另一方在职责范围内有义务及时采取必要的措施，尽力防止损失的扩大。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。

（四）违约行为虽已发生，但本托管协议能够继续履行的，在最大限度地保护集合计划参与人利益的前提下，计划管理人和计划托管人应当继续履行本协议。若计划管理人或计划托管人因履行本协议而被起诉，另一方应提供合理的必要支持。

十四、适用法律与争议解决

（一）本协议适用中华人民共和国法律（为本协议之目的，在此不包括香港、澳门特别行政区和台湾地区法律），并从其解释。

（二）因本协议产生或与之相关的争议，双方当事人应通过协商、调解解决，协商、调解不能解决的，则任何一方有权将争议提交计划管理人所在地法院诉讼。争议处理期间，双方当事人应恪守计划管理人和计划托管人职责，各自继续忠实、勤勉、尽责地履行资产管理合同和本托管协议规定的义务，维护集合计划委托人的合法权益。

十五、托管协议的效力和文本

（一）本协议经计划管理人、计划托管人加盖公章（或合同专用章）以及双方法定代表人/负责人或授权代理人签字（或盖章）后于签署之日起生效。本协议的有效期自生效日起至本协议规定其效力终止之情形发生时止。

（二）本协议一式陆份，协议双方各执贰份，上报中国证监会贰份，每份具有同等法律效力。

十六、托管协议的修改、终止和资产清算

（一）本协议双方当事人经协商一致，可以对本协议进行修改。修改后的新协议，经计划管理人、计划托管人加盖公章（或合同专用章）以及双方法定代表人/负责人或授权代理人签字（或盖章）后生效。

（二）发生以下情况，本托管协议终止：

1、 双方以协议形式约定，经计划管理人、计划托管人加盖公章（或合同专用章）以及双方法定代表人/负责人或授权代理人签字或盖章后，本协议终止。

2、 发生《管理办法》、《运作管理规定》、《资产管理合同》或其他法律法规、部门规章规定的终止事项。

（三）计划终止及终止清算

在相应集合资产管理计划资产管理合同中规定的计划应当终止的情形发生时，计划终止。

管理人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。清算过程中有关重大事项应当及时公布。清算结束后 5 个工作日内，管理人和托管人应当在扣除清算费用、管理费、托管费等其他费用后，将集合计划资产按照委托人拥有的份额或者资产管理合同的约定，以现金形式全部分配给委托人，注销集合计划专用证券账户、资金账户、债券托管账户及集合计划开立的其他账户，挂接取消交易单元（若需）。清算结束后 5 个工作日内由集合计划清算小组将清算结果报证券投资基金业协会备案，并抄报中国证监会相关派出机构。

本集合资产管理计划清算账册及有关文件由托管人按相关法律法规规定年限妥善保存，保存期不少于二十年。

十七、其他事项

（一）双方在此确认，双方均已充分了解和知悉各方反对其员工利用职务之便谋取任何形式利益之立场，并承诺将本着廉洁公平原则避免此类情形，不向对方的员工私自提供任何形式的回扣、礼金、有价证券、贵重物品、各种奖励、私人费用补偿、私人旅游、高消费娱乐等不当利益。

（二）本协议未尽事宜，当事人依据相关《资产管理合同》和《资产管理计划托管协议之补充协议》（若有签署）、以及有关法律、法规和规定协商办理。

（以下无正文）

（本页为签署页，无正文）

本协议由下述双方于 2019 年 3 月 15 日签署。双方确认，在签署本协议时，双方已就全部条款进行了详细地说明和讨论，双方对协议的全部条款均无疑义，并对本协议中当事人有关权利义务和责任限制或免除条款的法律含义有准确无误的理解。

计划管理人（公章或合同专用章）

计划托管人（公章或合同专用章）

法定代表人或授权代理人

法定代表人/负责人或授权代理人

（签字或盖章）

（签字或盖章）



附件一：划款指令及相关业务授权书（格式）

致：上海浦东发展银行股份有限公司深圳分行

敬启者：

兹就贵行与我司于 年 月 日签署的编号为【 】的《安信证券策略优选 1 号集合资产管理计划资产管理合同》以及编号为【SZ2019203003】的《集合资产管理计划托管协议》（以下简称“该协议”）出具本函。该合同中所定义的词语在本函中应具有相同的含义。

在该协议有限期间，我司特对下述人员及印章的授权事宜说明如下：

1、我司特此授权下列人员于 年 月 日至 年 月 日期间，代表我司签发该协议项下的有关划款指令或通知：

授权签发人（预留签字或名章）：

划款指令签发业务章（预留印鉴章）：

请贵司以加盖上述授权签发人（全部或部分（两选一））及划款指令签发业务章的划款指令为有效的划款指令。

2、我司特授权以下“业务专用章”为日常与贵司业务往来时出具的函件、通知等使用的有效盖章。

业务专用章（预留印鉴章）：

安信证券股份有限公司（公章）：

法定代表人（签字）：

日期： 年 月 日

附件二：相关账户信息

1、管理人指定的接收管理费或业绩报酬的银行账户信息：

账户名称：安信证券股份有限公司

银行账号：7441010187000001190

开户银行：中信银行深圳分行营业部

2、托管人指定的接收托管费的银行账户信息：

户 名： 证券公司客户资产托管业务收入

账 号： 79010142110000076

开户银行： 上海浦东发展银行深圳分行

大额支付号： 310584000006

附件三：管理人发送的划款指令（格式）

划款日期： 年/月/日

指令编号：第 X 号

| | |
|------------------------------|--------|
| 组合名称 | |
| 付款方 | 户名： |
| | 账号： |
| | 开户行： |
| 收款方 | 户名： |
| | 账号： |
| | 开户行 |
| | 大额支付号： |
| 金额 | 小写： |
| (单位：元) | 大写： |
| 划款用途及 备注： | |
| 管理人授权签发人： 管理人授权签发业务章： | |
| 托管人确认处： | |