

协议编号：

申港证券巨杉 1 号 集合资产管理计划 托管协议

管理人：申港证券股份有限公司

托管人：招商证券股份有限公司

目 录

一、托管协议当事人.....	4
二、订立托管协议的依据、目的、原则和解释.....	4
三、托管事项.....	5
四、托管人和管理人之间的业务监督、核查.....	5
五、资产管理计划的财产.....	7
六、指令的发送、确认和执行.....	9
七、交易安排及清算交收安排.....	12
八、计划开放期参与、退出的资金清算.....	15
九、资产管理计划财产的估值和会计核算.....	16
十、计划收益分配.....	21
十一、计划的费用、业绩报酬和税收.....	22
十二、计划的信息披露.....	22
十三、托管报告及有关文件档案的保存.....	23
十四、计划委托人名册的登记和保管.....	23
十五、禁止行为.....	23
十六、违约责任.....	24
十七、适用法律与争议解决.....	25
十八、托管协议的效力和文本.....	25
十九、托管协议的修改、终止和资产清算.....	26
二十、其他事项.....	26
附件一：证券交易参数表.....	28
附件二：资产管理人授权通知书.....	30
附件三：预留印鉴.....	31
附件四：联系人名单.....	32
附件五：划款指令（样本）.....	33
附件六：托管资产相关银行账户.....	34
附件七：关于申购赎回相关业务说明.....	35
附件八：投资监督事项表.....	36
附件九：关联方名单.....	39

鉴于申港证券股份有限公司是一家依照中国法律合法成立并有效存续的股份有限公司，具有发行集合资产管理计划资格，拟发起设立申港证券巨杉 1 号集合资产管理计划（以下简称“本计划”、“计划”）；

鉴于招商证券股份有限公司是一家依照中国法律合法成立并有效存续的证券公司，已按照相关法律、法规的规定取得证券投资基金托管资格，具备履行本托管协议担任托管人的资格和能力；

鉴于申港证券股份有限公司拟担任计划的管理人，招商证券股份有限公司拟担任计划的托管人。

鉴于计划的委托人指“申港证券巨杉 1 号集合资产管理计划”的参与者，并与申港证券股份有限公司及招商证券股份有限公司签订了《申港证券巨杉 1 号集合资产管理计划资产管理合同》，合同当事人依照该合同享有权利、承担义务。

为明确管理人和托管人之间的权利义务关系，特制订本协议。

一、托管协议当事人

（一）管理人

名称：申港证券股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区世纪大道 1589 号长泰国际金融大厦 16/22/23 楼

办公地址：上海市浦东新区世纪大道 1589 号长泰国际金融大厦 16/22/23 楼

法定代表人：刘化军

电话：200122

联系人：李琳珊

（二）托管人

名称：招商证券股份有限公司

办公地址：深圳市福田区福田街道福华一路 111 号 29 层

法定代表人：霍达

注册资本：66.99 亿元

电话：0755-86157588

联系人：张战辉

二、订立托管协议的依据、目的、原则和解释

（一）依据

本托管协议依据中国证监会《证券期货经纪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“《运作规定》”）以及《申港证券巨杉 1 号集合资产管理计划资产管理合同》（以下简称“《集合资产管理合同》”）制定。

（二）目的

本协议的目的是明确托管人和管理人之间在计划资产保管、委托人档案资料保管、管理和运作、委托人参与或退出计划、计划资产清算及相互监督等相关事宜中的权利、义务及责任，以确保计划资产的安全，保护委托人的合法权益。

（三）原则

管理人和托管人本着平等自愿、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《集合资产管理合同》的相应术语具有相同含义。

三、托管事项

(一) 托管资产种类

本协议所称托管资产是指“申港证券巨杉1号集合资产管理计划”项下的一切资产。托管资产的初始形态为现金。

(二) 托管资产金额

初始托管资产金额为本计划成立之日，托管账户的实际到账金额，该金额应与会计师事务所验资报告一致。

(三) 托管时间

本计划资产托管时间始于计划成立之日，终止于计划终止且资产清算和分配完毕之日。

四、托管人和管理人之间的业务监督、核查

(一) 托管人对管理人的业务监督和核查

1、根据有关法律法规规定、《集合资产管理合同》或本协议约定，托管人应对涉及本集合计划资产投资监督事项表中的投资范围、投资比例、投资限制、关联交易进行监督，对本集合计划资产的核算、资产净值的计算、托管费和其他相关费用的计提和支付、计划收益分配及计划清算等事项的合法性、合规性进行复核。托管人对资产管理人投资运作的监督内容详见《投资监督事项表》，对于不属于本合同托管人托管下的财产，托管人不承担监督义务。托管人对于管理人是否使用集合计划资产进行不必要的交易，及是否存在内幕交易、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，均不承担监督义务。

2、托管人发现管理人上述行为违反有关法律法规规定、《集合资产管理合同》或本协议约定，有权以双方认可的形式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以书面或双方认可的其他方式向托管人发出回函。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，托管人有权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。

3、如托管人认为管理人的作为或不作为违反了有关法律法规、《集合资产管理合同》或本协议约定，托管人应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，并有权利行使法律法规、《集合资产管理合同》或本托

管协议规定的所有权利，以保护计划资产的安全和计划投资者的利益。

4、在本集合计划运行期间，除法律、行政法规和监管部门同时发送（含抄送）至管理人和托管人的部门规章、通知、决定、文件外，对于集合资产管理计划应遵守的监管部门仅发送至管理人的部门规章、通知、决定、文件等规定，管理人有义务及时向托管人书面提供，托管人收到后应书面回复并确定监督内容。如管理人没有及时提供监管部门仅发送至管理人的相关监管要求，托管人不对此承担监督的职责。

5、资产托管人仅对资产管理人提供的反映本计划投资用途的资料扫描件或传真件进行形式审查，不进行实质性审查，不承担扫描件或传真件与原件不符或用途资料虚假等原因而产生的任何责任。

（二）管理人对托管人的业务核查

1、根据有关法律法规规定、《集合资产管理合同》、本协议约定，管理人就托管人是否及时执行管理人合法合规的划款指令、妥善保管计划的全部资产、是否对计划资产实行分账管理、是否擅自动用计划资产、是否按时将分配给委托人的收益划入计划资金归集专户等事项，对托管人进行监督和核查。

2、管理人定期对托管人保管的计划资产进行核查。管理人发现托管人未对计划资产实行分账管理、擅自挪用计划资产、因托管人的过错导致计划资产灭失、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。

3、管理人发现托管人的行为违反有关法律法规规定、《集合资产管理合同》和本协议约定，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对管理人发出回函。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。

4、如管理人认为托管人的作为或不作为违反了有关法律法规、《集合资产管理合同》或本协议约定，管理人应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，并有权利并有义务行使有关法律法规、《集合资产管理合同》或本托管协议赋予、给予、规定的管理人的任何及所有权利和救济措施，以保护计划资产的安全和委托人的利益。

(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计划业务执行监督、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，情节严重或经监督方提出警告仍不改正的，监督方应报告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。

管理人应当按照有关法律法规、《集合资产管理合同》的规定对集合资产管理计划的运营情况单独进行年度审计，将审计意见提供给客户和托管人，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。

管理人应积极配合和协助托管人的监督和核查，包括但不限于在规定时间内答复并改正，对托管人按照法规要求需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送计划监控报告的，管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

五、资产管理计划的财产

(一) 资产管理计划财产的保管与处分

1. 资产管理计划财产独立于管理人、托管人的固有财产，并由托管人保管，管理人、托管人不得将资产管理计划财产归入其固有财产。

2. 除本章第（一）条第 3 款约定的情形外，管理人、托管人因资产管理计划财产的管理、运用或者其他情形而取得的财产和收益归入资产管理计划财产。

3. 管理人、托管人可以按本合同的约定收取管理费、托管费以及本合同约定的其他费用。管理人、托管人以其固有财产承担法律责任，其债权人不得对资产管理计划财产行使请求冻结、扣押和其他权利。管理人、托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，资产管理计划财产不属于其清算财产。

4. 资产管理计划财产产生的债权不得与不属于资产管理计划财产本身的债务相互抵销。非因资产管理计划财产本身承担的债务，管理人、托管人不得主张其债权人对资产管理计划财产强制执行。上述债权人对资产管理计划财产主张权利时，管理人、托管人应明确告知资产管理计划财产的独立性。

5. 管理人、托管人不得违反法律法规的规定和资产管理合同约定擅自将计划资产用于抵押、质押、担保或设定任何形式的优先权或其他第三方权利。

6. 托管人仅负责保管本计划项下托管账户内的现金资产。对于本计划项下未由其保管且未受其实际控制的其他资产（包括现金类资产与非现金类资产），托管人不承担保管职责，且对其安全性和完整性不承担任何责任。管理人负责保管本计划对外投资过程中形成的股权、债权、收益权等非现金资产及相关权利凭证，并应及时将相关权利凭证的复印件加盖公章或其他有效签章后交付托管人。管理人应对本计划项下非现金资产及其权利凭证的安全和完整负责。除资产管理合同另有约定外，管理人不得在该等非现金资产或其权利凭证之上设置抵押、质押或其他权利负担。

7. 本计划项下，管理人代表本计划与交易对手签订投资协议、开立相关账户及办理相关登记手续，并按照投资协议的约定行使相关权利和履行相关义务。托管人对于计划对外投资而产生的风险不承担任何责任。管理人未按投资协议约定行使相关权利、履行相关义务或处分资产管理计划财产不当而使资产管理计划财产遭受损失的，托管人亦不承担任何责任。

（二）资产管理计划财产相关账户的开立和管理

1. 托管账户的开设和管理

（1） 托管人按照规定在商业银行开立与本计划有关的资金账户，管理人应配合托管人办理账户开立事宜并提供相关资料。

（2） 托管账户的开设和管理由托管人负责。本计划的一切货币收支活动，包括但不限于对外投资、支付退出金额、支付计划收益、收取申购款，均需通过该账户进行。

（3） 托管账户的开立和使用，限于满足开展资产管理业务的需要。托管人和管理人不得假借本计划的名义开立其他任何银行账户；亦不得使用本计划的任何银行账户进行本资产管理业务以外的活动。

托管人以管理人、托管人和资产管理计划联名的方式在中国证券登记结算有限责任公司开立专门的证券账户，并以资产管理计划的名义在中央国债登记结算有限责任公司、上海清算所开立银行间债券市场债券托管账户。托管人根据管理人提交的开户申请开立相关账户。管理人和托管人对资产管理计划资产独立核算、分账管理，保证资产管理计划资产与其自有资产、资产管理计划资产与其他客户资产、不同资产管理计划的资产相互独立。

（4） 托管账户的管理应符合《人民币银行结算账户管理办法》、《现金管

理暂行条例》、《支付结算办法》和中国人民银行利率管理的有关规定以及其他有关规定。

2. 其他账户的开设和管理

因投资运作而需要开立的其他账户，由托管人或管理人根据有关法律法规的规定开立。如该等账户是由管理人负责开立的，管理人开立此类账户后需及时通知托管人，且应保证该账户专款专用。证券账户和期货账户的持有人名称应当符合证券、期货登记结算机构的有关规定。

3. 开立的上述资产管理计划财产账户与管理人、托管人、募集机构和注册登记机构自有的财产账户以及其他资产管理计划财产账户相独立。

4. 对于非由托管人管理的账户，托管人不承担保管职责。

六、指令的发送、确认和执行

（一）交易清算授权

管理人应事先向托管人发送书面授权通知（以下称“授权通知”），授权通知应包括预留印鉴，或被授权人的名单、签字签章样本。授权通知应加盖管理人公章并注明生效时间。

管理人可以以传真、电子邮件方式或双方另行约定的其他方式向托管人发送授权通知，托管人收到后，于授权通知载明的生效时间生效。但如托管人收到授权通知的日期晚于授权通知载明的生效时间，则授权通知自托管人收到该授权通知之日生效。

管理人应向托管人寄送书面授权通知的原件。托管人依据传真件或邮件或双方另行约定的其他方式发送的授权通知进行指令审核视为适当履行了托管人指令审核义务，管理人不得否认其效力；托管人收到的授权通知原件与传真件或邮件或双方另行约定的其他方式发送的授权通知不一致时，以托管人收到的传真件或电子邮件或双方另行约定的其他方式发送的指令为准；管理人未能按约定寄回原件的，不影响托管人的执行效力，但管理人因此免除寄送书面授权通知的义务。

（二）投资指令的内容

投资指令是在管理计划财产时，管理人向托管人发出的资金划拨及其他款项支付的指令。管理人发给托管人的指令应写明本资产管理计划全称、付款方账户信息、收款方账户信息、支付日期、付款金额、事由等，加盖管理人公章或按授

权通知约定加盖预留印鉴或被授权人签字或签章。采用电子投资指令的，管理人应与托管人就指令发送的签字、内容、方式、有效性等方面另行签订协议。

（三）投资指令的发送、确认和执行的程序和程序

投资指令由管理人用传真、电子邮件（为免歧义，本节所指“电子邮件方式”均指以电子邮件发送扫描件方式）或托管人和管理人另行约定的其他方式向托管人发送。指令以获得收件人（托管人）确认该指令已成功接收之时视为送达收件人（托管人）。管理人如发现托管人未确认成功接收指令，有义务与托管人以电话或邮件或其他管理人及托管人约定的方式进行确认，因管理人未能及时与托管人进行指令确认，致使资金未能及时清算所造成的损失，托管人不承担责任。

管理人应按照相关法律法规以及本合同的规定，在其合法的经营权限和交易权限内发送投资指令，管理人应确保投资指令中的被授权人员、预留印鉴符合授权通知的约定。对于不符合本资产管理合同或授权通知约定的指令，托管人有权拒绝；对于符合授权通知的指令，管理人不得否认其效力。管理人在发送投资指令时，应为托管人留出执行投资指令所必需的时间。管理人发送银证、银期、银衍转账的有效投资指令的截止时间为每一个工作日的 13:30，发送银行转账的有效投资指令的截止时间为每一个工作日的 15:00；如管理人要求当天某一时点到账，则投资指令需提前 2 个工作小时发送；管理人和托管人可另行书面约定关于某一类投资指令的具体时限要求。管理人发送的投资指令不符合前述时限要求的，托管人尽力配合执行，但不保证划款成功。由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，致使资金未能及时清算所造成的损失由管理人承担。

托管人收到管理人发送的投资指令后，应对投资指令进行表面一致性审查，复核无误后应在规定期限内及时执行，不得延误。

上文所指的“表面一致性审查”系指：托管人仅对相关文件上的中加盖的印鉴、签字等通过肉眼辨识的方式与预留印鉴及签字样本进行比对，二者形式上不存在重大差异的（对于因传真、扫描等（如有）引起的印章、签字等变形、扭曲，托管人亦不承担审查义务），即视为通过表面审查。托管人不对任何文件承担实质性审查义务，包括不对任何需经特殊技术、特定设备才能作出鉴别的“伪造”、“变造”文件承担审查责任，只要该类文件上的印章/签字通过表面审查后与预留印鉴/签字样本无重大差异，托管人即对因依据相应文件作出的任何行为后果

免责。托管人对管理人出具的其他文件均仅进行表面一致性审查。

若存在异议或不符，托管人应与管理人进行电话、邮件或其它约定的方式联系和沟通，暂停投资指令的执行并要求管理人重新发送经修改的投资指令。托管人有权要求管理人以传真或电子邮件形式提供相关交易凭证、投资协议或其他有效会计资料（上述资料应加盖管理人公章或其他有效签章），待收齐相关资料并判断投资指令有效后重新开始执行投资指令。管理人应在合理时间内补充相关资料，并给托管人执行投资指令预留必要的执行时间。管理人应保证其提交的上述文件资料的真实、合法、完整和有效，托管人不负责审查该等文件资料的真实性、合法性、完整性和有效性。

管理人向托管人下达投资指令时，应确保本资产管理计划托管账户有足够的资金余额，对管理人在没有充足资金的情况下向托管人发出的投资指令，托管人可不予执行，并立即通知管理人，托管人不承担因为不执行该投资指令而造成损失的责任。

（四）托管人依照法律法规暂缓、拒绝执行投资指令的情形和处理程序

托管人发现管理人发送的投资指令违反《中华人民共和国证券投资基金法》、《暂行办法》、《暂行规定》、《管理办法》、《管理规定》、本合同或其他有关法律法规的规定时，不予执行，并应及时通知管理人纠正，管理人收到通知后应及时核对，及时确认处理方式，并以书面形式通知托管人，由此造成的损失由管理人承担。

（五）管理人发送错误投资指令的情形和处理程序

管理人发送错误投资指令的情形包括：

1. 指令日期不符；
2. 账户信息不符、不清晰、不完整；
3. 金额错误、大小写不一致、模糊不清等；
4. 权限不符；
5. 印鉴或被授权人的签字无法通过表面一致性审查的；

托管人在履行监督职能时，发现管理人的投资指令错误时，有权拒绝执行，并及时通知管理人改正。

（六）更换预留印鉴或被授权人的程序

管理人变更预留印鉴、或撤换被授权人员或改变被授权人员的权限，必须提

前至少一个工作日，使用传真、电子邮件或管理人和托管人认可的其他方式向托管人发出加盖管理人公章的书面变更通知（“变更通知”），同时通知托管人。变更通知须列明新授权的起始日期。变更通知的生效日期按照变更通知上列明的新授权的起始日期与托管人确认收到的日期孰晚原则确定。变更通知的原件发送参照授权通知的约定执行。

（七）投资指令的保管

投资指令若以传真或电子邮件形式发出，则正本由管理人保管，托管人保管指令传真件或电子邮件。当两者不一致时，以托管人收到的指令传真件或电子邮件为准。电子指令的保管以管理人和托管人的相关协议约定为准。

（八）相关责任

托管人正确执行管理人发出的符合本合同约定的投资指令，计划财产发生损失的，托管人不承担任何形式的责任。在正常业务受理渠道和投资指令规定的时间内，确因托管人存在过错而未能及时或正确执行符合本合同规定的投资指令而导致计划财产受损的，托管人应承担相应的责任，但托管人如遇到不可抗力的情况除外。

如果管理人的投资指令存在事实上未经授权、欺诈、伪造或未能按时提供投资指令人员的预留印鉴和签章样本或发送投资指令时提交的文件资料不真实、不合法、不完整或失去效力等非托管人原因造成的情形，只要托管人根据本合同相关规定履行形式审核职责，托管人不承担因执行有关投资指令或拒绝执行有关投资指令而给管理人或计划财产或任何第三人带来的损失，全部责任由管理人承担。

七、交易安排及清算交收安排

（一）交易单元安排

- 1、管理人负责安排专用交易单元用于本计划的投资运作。
- 2、计划在证券交易所的投资交易活动，应当集中在专用交易单元上进行。
- 3、管理人在集合计划业务开展十个工作日前，将专用单元信息书面告知托管人，并配合托管人办理交易单元合并清算和清算及交易数据接收手续。

（二）证券交易的资金清算与交割

1、证券交易资金的清算

- （1）托管人负责办理因本计划投资于证券发生的所有场内、场外交易的清

算交割。

(2) 本计划交易所证券投资的清算交割，由托管人根据相关登记结算公司的结算规则办理。

(3) 如果因为托管人自身原因在清算上造成计划资产的损失，应由托管人负责赔偿；如果因为管理人买空、卖空造成计划资产清算困难和风险的，托管人发现后应立即通知管理人，由管理人负责解决，由此给计划资产或托管人造成的损失由管理人承担。

(4) 资产托管人、资产管理人应共同遵守中国证券登记结算有限责任公司制定的相关业务规则 and 规定，该等规则 and 规定自动成为本条款约定的内容。

资产管理人在投资前，应充分知晓与理解中国证券登记结算有限责任公司（上海分公司、深圳分公司）针对各类交易品种制定结算业务规则 and 规定，并遵守资产托管人为履行特别结算参与人的义务所制定的业务规则与规定。

资产托管人代理资产管理计划财产与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交易及非交易涉及的证券资金结算业务，并承担由资产托管人原因造成的正常结算、交收业务无法完成的责任，若由于资产管理人原因造成的正常结算业务无法完成，责任由资产管理人承担。因中国人民银行、中国证券登记结算有限责任公司和债券结算登记机构资金结算系统以及其他机构的结算系统发生故障等非资产托管人的原因造成清算资金无法按时到账的情形，资产托管人可免责；如果因为资产管理人未事先通知资产托管人增加交易单元等事宜，致使资产托管人接收数据不完整，造成清算差错的责任由资产管理人承担；如果因为资产管理人未事先通知需要单独结算的交易，造成委托资产损失的由资产管理人承担；资产管理人应采取合理措施，确保在 T 日日终有足够的资金头寸用于 T+1 日中国证券登记结算有限责任公司上海分公司和深圳分公司的资金结算。如因资产管理人原因导致资金头寸不足，资产管理人应在 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，由此给本委托财产造成的损失由资产管理人承担。

对于任何原因发生的证券资金交收违约事件，相关各方应当及时协商解决。

(5) 集合计划参与 T+0 交易所非担保交收交易的责任认定及处理程序
集合计划参与 T+0 交易所非担保交收交易的，集合计划管理人应确保托管组

合有足额头寸用于上述交易，并必须于 T+0 日 14 时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。如由于非托管人的原因导致 T+0 非担保交收失败，由此给资产托管人、资产托管人托管的其他资产组合造成的损失，由集合计划管理人承担。

如资产管理人在本计划托管账户头寸不足的情况下交易，并最终占用托管人所托管其他产品在中国结算公司的备付金而交收成功的，管理人应在日终前补足交收款项，并承担可能造成的损失；若是占用了资产托管人其他托管产品存放中国结算公司的备付金而导致托管人所托管的其他产品交收失败的，所有损失将由资产管理人承担。同时，资产托管人保留根据上海银行间市场同业拆借利率向管理人追索利息的权利。

本委托财产可开通中债登与上清所之间的资金互划，由资产管理人向资产托管人发送有效的划款指令，经资产托管人确认后执行。由于管理人指令要素不全导致资金未能及时成功划付所造成的损失，资产托管人不承担任何责任。

2、结算方式

支付结算按中国人民银行、中国银监会的有关规定办理。

3、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、违规的或超头寸，托管人应不予执行并立即书面通知管理人要求其变更或撤销相关指令，若管理人在托管人发出上述通知后仍未变更或撤销相关指令，托管人应不予执行，并应向管理人住所地中国证监会派出机构及中国证券业协会报告。

资金划拨指令的下达程序应当按照本协议第六条规定的程序办理。

4、开放式基金认购、申购、赎回的交易安排

管理人与托管人在办理开放式基金认购、申购、赎回中的权利、义务、职责遵照有关法律法规规定执行。

管理人申购（认购）开放式基金时，应将划款指令连同基金申购（认购）申请单传真或邮件至托管人。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，将执行结果通知管理人。管理人在收到基金公司发送的申购确认书后应及时且不晚于当日 16:00 传真或邮件至托管人。

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，连同收款通知传真或邮件至托管人，并于收到基金管理公司或代销机构发送的基金赎回确认后及时且不晚于当日 16:00 传真或邮件至托管人。托管人应及时查询到帐情况并反馈管理人。

（三）交易记录、资金和证券账目的对账

对计划的资金、证券账目，由双方每日对账一次，确保双方账账相符。

（四）集合计划投资定期存款的约定及处理程序

集合计划投资定期存款（含同业存款、协议存款等）时，集合计划管理人应确保托管组合有足额头寸用于上述交易，至少提前一个工作日将签署完成的定期存款协议交付托管人，且在当日 14 时之前出具有效划款指令，并确保定期存款的期限不低于一个月。

八、计划开放期参与、退出的资金清算

（一）T 日，投资者进行集合计划参与和退出，管理人计算集合计划资产净值，托管人进行复核。

（二）T+1 日 15:00 前，管理人根据 T 日集合计划单位净值计算参与份额、转换金额、退出金额，更新集合计划委托人数据库；并将确认的参与、退出数据向集合托管人传送。管理人、托管人根据确认数据进行账务处理。

（三）管理人应开立并管理专门用于办理资产管理计划参与和退出款项清算的“清算账户”。资产管理计划资金账户与清算账户间的资金清算遵循“全额清算、净额交收”的原则。

（四）资产管理计划参与和退出款项采用轧差交收的结算方式，净额在最晚不迟于 T+3 日 16:00 前在管理人开立的清算账户和资金账户之间交收。

（五）如果当日为净应收款，托管人应及时查收资金是否到账，对于未准时到账的资金，应及时通知管理人划付。对于未准时划付的资金，托管人应及时通知管理人划付，由此产生的责任应由管理人承担。如果当日为净应付款，托管人应根据管理人的指令及时进行划付。对于未准时划付的资金，管理人应及时通知托管人划付，由此产生的责任应由托管人承担。

（六）注册登记机构应将每个开放日的参与或退出汇总数据传送给托管人。管理人或注册登记机构应对传递的数据真实性负责。托管人应及时查收参与资金的到账情况并根据管理人指令及时划付退出款项。

九、资产管理计划财产的估值和会计核算

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）估值目的：客观、准确地反映资产管理计划资产的价值。经资产管理计划资产估值后确定的资产管理计划单位净值，是进行信息披露、计算参与和退出资产管理计划的基础。

（二）估值日：估值日指本资产管理计划成立后的每个工作日，即上海证券交易所和深圳证券交易所的正常交易日。估值原则应符合本资产管理合同、《证券投资基金会计核算方法》、《证券公司客户资产管理业务估值方法指引》及其他法律、法规的规定。

（三）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、保护投资者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。

委托财产的估值对象为组合所拥有的债券、基金和银行存款本息等资产及负债。

1、证券交易所上市的有价证券的估值

（1）交易所上市的有价证券（包括股票、权证、封闭式基金、上市开放式基金（LOF）等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，以最近交易日的市价（收盘价）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；

（2）交易所上市实行净价交易的债券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，按最近交易日的收盘价估值。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）交易所上市未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息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，按最近交易日债券收盘价减去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；

(4) 交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。交易所上市的资产支持证券，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。

2、全国银行间债券市场交易的债券等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值。

3、同一品种同时在两个或两个以上市场交易的，按该品种所处的市场分别估值。

4、银行存款

按照约定利率在持有期内逐日计提应收利息，在利息到账日以实收利息入账。

5、证券投资基金

A、开放式基金（包括托管在场外的上市开放式基金 LOF）以估值日前一交易日基金净值估值，估值日前一交易日开放式基金份额净值未公布的，以前最近一个交易日基金份额净值计算。

B、上市流通的证券投资基金按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，以最近一个交易日的收盘价估值；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。

C、货币基金以成本估值，每日按前一交易日的万份收益计提红利。

6、债券回购和具有固定回报的买入返售金融资产

以买入/外放成本列示，按约定收益率逐日计提收益/成本。

7、期货合约

以估值当日结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。

8、委托资产持有的期权

从持有确认日起到卖出日或行权日止，上市交易的期权按估值日在证券交易所挂牌的该期权的收盘价估值；估值日没有交易的，按最近交易日的收盘价估值；未上市交易的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，按成本计量。

9、未上市品种、停止流通的品种

A、首次发行未上市的债券、基金，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，按成本计量；

B、对交易所发行未上市的债券，按成本估值。

10、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

(1) 送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市价（收盘价）估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值；

(2) 首次公开发行未上市的股票、债券和权证，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；

(3) 首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的市价（收盘价）估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值；

(4) 流通受限股票，按以下方法估值：

流通受限股票，是指明确带有一定限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票。

$$FV = S \times (1 - LoMD)$$

其中：FV 为估值日该流通受限股票的价值；S 为估值日在证券交易所上市交易的同一股票的收盘价；LoMD 为该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣，该流动性折扣一般由中证指数有限公司发布提供。

(5) 处于未上市期间的权证，以成本估值。处于未上市期间的由于购买可分离债券获得的权证按中国证券业协会公布的公允价值估值，对应的可分离债券按中国证券业协会公布的公允价值估值。

11、因持有股票而享有的配股权证，从配股除权日起到配股确认日止，如果收盘价高于配股价，按收盘价高于配股价的差额估值。收盘价等于或低于配股价，则估值为零。

12、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，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。

13、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。

（四）估值对象

资产管理计划所拥有的各种有价证券、银行存款本息、资产管理计划应收款项、其它投资等资产。

（五）估值程序

资产管理计划资产的日常估值由管理人进行。资产管理人应于估值日交易结束后计算当日的资产净值并以电话、邮件、电子对账系统等方式与资产托管人核对。管理人于每个开放期及每周最后一个工作日将资产管理计划当天的单位净值及累计单位净值以电子邮件的方式发送给托管人进行复核，托管人复核无误后，签章并发回给管理人，由管理人负责在其网站上进行披露。月末、年中和年末估值复核与会计账目的核对同时进行。

当管理人与托管人的估值结果不一致时，各方应本着勤勉尽责的态度重新计算核对。如果仍无法达成一致，应以管理人的估值结果为准。如因管理人估值错误，由此给资产管理计划财产或委托人造成损失的，由管理人承担责任，托管人不承担责任。

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

（六）估值错误与遗漏的处理方式

资产管理计划份额净值的计算，四舍五入精确到小数点后四位。国家另有规定的从其规定。当资产管理计划资产的估值导致资产管理计划份额净值小数点后四位内发生错误时，视为资产估值错误。

管理人和托管人应当采取必要、适当、合理的措施确保资产估值的准确性、及时性、当资产管理计划份额净值出现错误时，管理人应当立即披露、予以纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大。

如法律法规或监管机关另有规定的，按其规定处理。

（七）估值调整的情形与处理

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，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。

（八）暂停估值的情形

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

1、资产管理计划投资所涉及的证券交易所遇到法定节假日或其他原因暂停营业时；

2、因不可抗力或其他原因致使管理人、托管人无法准确评估资产管理计划资产价值时；

3、中国证监会认定的其他情形。

（九）资产管理计划份额净值的确认

1、资产总值：资产管理计划资产总值是指用资产管理计划的资金进行的各种投资、购买的各种有价证券、银行存款本息、资产管理计划应收款项及其他投资等所形成的价值总和。

2、资产净值：资产管理计划资产净值是指资产管理计划资产总值减去负债后的价值。

3、单位净值：资产管理计划的单位净值是指计算日集合资产管理计划资产净值除以计算日集合资产管理计划总份额。

T日资产管理计划单位净值 $V = T$ 日闭市后的资产管理计划资产净值 / T日资产管理计划份额的数量

本资产管理计划单位净值的计算，保留到小数点后4位，小数点后第5位四舍五入，由此产生的误差计入资产管理计划损益。

本资产管理计划累计单位净值指本资产管理计划单位净值加上单位累计分红。

管理人对资产管理计划单位净值、资产管理计划累计单位净值估值后，由托管人复核。

（十）特殊情况的处理

由于证券交易所或者注册登记机构发送错误数据，或其他不可抗力的原因，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，但仍未能正确进行估值，由此造成的资产估值错误，管理人和托管人不承担责任，但管理人和托管人应当采取积极措施减轻或消除由此造成的影响。

估值条件恢复时，管理人必须按规定完成估值工作。

(十一) 资产管理计划的会计政策

- 1、本资产管理计划的会计年度为每年 1 月 1 日至 12 月 31 日。
- 2、记账本位币为人民币，记账单位为元。
- 3、资产管理计划财产的会计核算按《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证券业协会《证券公司客户资产管理业务估值方法指引》执行。
- 4、资产管理计划应独立建账、独立核算；管理人应保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，编制会计报表；托管人应定期与管理人就资产管理计划的会计核算、报表编制等进行核对。

十、计划收益分配

(一) 收益的构成

本资产管理计划收益指资产管理计划利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额。

(二) 可供分配利润

指截至收益分配基准日资产负债表中“未分配收益”与“未分配收益中已实现”的孰低数。

(三) 收益分配原则

- 1、在符合有关分红条件和收益分配原则的前提下，本计划每半年最多进行 1 次收益分配；
- 2、本计划由管理人决定收益分配基准日及收益分配发放日；
- 3、同一类份额享有同等分配权；
- 4、本计划收益分配方式为现金分红；
- 5、收益分配基准日计划的份额净值减去每份额收益分配金额后不能低于 1.000 元；
- 6、收益分配比例由管理人根据计划运作情况决定；
- 7、收益分配时发生的银行转账或其他手续费用由资产管理计划财产承担；
- 8、法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。在法律法规和监管机构允许的范围内，经全体投资者、管理人、托管人书面协商一致，可以对上述收益分配条件和时间进行调整，并在管理人网站上公告。

(四) 收益分配方案的确定与通知

收益分配方案经管理人、托管人协商一致，在管理人网站上公告。

（五）收益分配的执行方式

在符合有关分红条件和收益分配原则的前提下，管理人有权进行收益分配。

分红权益登记日即收益分配基准日，收益分配基准日的资产管理计划份额净值减去每份资产管理计划的份额收益分配金额后不能低于面值。

十一、计划的费用、业绩报酬和税收

集合计划费用按照《资产管理合同》的约定计提和支付。

十二、计划的信息披露

（一）保密义务

1、除按照法律法规规定和《集合资产管理合同》约定进行信息披露以外，管理人和托管人对计划的有关信息均应恪守保密的义务。管理人与托管人对计划的任何信息，不得在其公开披露之前，先行对双方以外的任何机构、组织和个人泄露。法律法规另有规定或有权机关要求披露的除外。

2、管理人和托管人除为合法履行法律法规、《集合资产管理合同》及本协议规定的义务所必要之外，不得为其他目的使用、利用其所知悉的计划的保密信息，并且应当将保密信息限制在为履行前述义务而需要了解该保密信息的职员范围之内。但是，如下情况不应视为管理人或托管人违反保密义务：

（1）非因管理人和托管人的原因导致保密信息被披露、泄露或公开；

（2）管理人和托管人根据法律法规或中国证监会等监管机构的命令、决定所作出的信息披露或公开。

（二）管理人和托管人在信息披露中的职责和信息披露程序

1、管理人是本计划信息披露义务人。

2、对于法律、法规和中国证监会规定的、本计划需披露的信息，管理人保证其履行按照法定方式和时限披露的义务。

3、本计划的信息披露的公告，必须符合《管理办法》、《运作规定》、《集合资产管理合同》、本协议及其它有关规定。

（三）信息披露文本的存放

予以信息披露的文本存放在管理人的办公场所和营业场所，并接受委托人的查询和复制要求。管理人应为文本存放、委托人查询有关文件提供必要的场所和其他便利。

管理人应保证文本的内容与所公告的内容完全一致。

十三、托管报告及有关文件档案的保存

(一) 托管人按照《管理办法》、《运作规定》、《集合资产管理合同》和本协议有关规定出具计划托管情况报告。

(二) 管理人和托管人应完整保存各自的记录计划业务活动的计划委托人名册、原始凭证、记账凭证、计划账册、交易记录和重要合同等，保存期限为自《集合资产管理合同》终止之日起 20 年。

(三) 有关计划的全部合同的正本，应由托管人负责保管，保存期限为自《集合资产管理合同》终止之日起 20 年，管理人有权保留其作为合同签署方而应持有的合同正本。

十四、计划委托人名册的登记和保管

(一) 注册登记机构负责编制计划委托人名册，管理人负责保管计划委托人名册。

(二) 委托人名册的内容包括但不限于委托人姓名、证件类型和号码、持有计划的份额、联系地址和联系方式。

(三) 管理人负责向注册登记机构索取计划成立日、每季度末最后一个交易日的委托人名册，并妥善保管。为托管人履行有关法律法规、《集合资产管理合同》、本协议规定的职责之目的，管理人应当提供任何必要的协助。

十五、禁止行为

(一) 管理人、托管人须遵守《管理办法》、《运作规定》的规定，不得从事《管理办法》、《运作规定》禁止的任一行为。

(二) 除法律法规、《集合资产管理合同》和本协议另有规定，管理人、托管人不得为自身和任何第三人谋取利益。

(三) 管理人与托管人对计划运作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，法律法规另有规定的除外。

(四) 托管人对管理人的正当指令不得拖延和拒绝执行，管理人不得向托管人发送违规的、超头寸的交易指令。

(五) 除根据管理人指令或《集合资产管理合同》、本协议或法律法规另有规定以外，托管人不得动用或处分计划资产。

(六) 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。

(七)《集合资产管理合同》中规定的禁止投资的行为。

(八)法律法规、《集合资产管理合同》和本《托管协议》禁止的其他行为。

十六、违约责任

(一)如果由于管理人或托管人违反本协议，造成本协议不能履行或者不能完全履行的，由违约方承担违约责任；如果由于双方原因，造成本协议不能履行或者不能完全履行的，根据实际情况，由双方当事人分别按过错程度承担各自应负的违约责任。

(二)本协议任何一方当事人的违约行为给计划资产或委托人造成实际损害的，违约方应就直接损失承担赔偿责任，另一方有权利并且有义务代表计划对违约方进行追偿。但是发生下列情况，当事人可以免责：

1、管理人及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；

2、在没有欺诈或过失的情况下，管理人由于按照《集合资产管理合同》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。

3、托管人执行管理人依据交易程序已经成立的投资指令对集合计划资产造成的损失，托管人不承担责任；

4、管理人未能事前就其关联方名单明确告知托管人致使本集合计划发生违规投资行为的，托管人不承担任何责任。

5、计算机系统故障、网络故障、通讯故障、电力故障、计算机病毒攻击及其它非资产托管人故意造成的意外事故。

6、管理人违反本协议第四条第（一）款第4项约定的义务，未及时向托管人提供相关监管要求的，托管人不承担因此产生的责任。

7、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，因该等机构欺诈、疏忽、过失、破产等原因给集合计划资产造成的损失等。

(三)如果由于本协议一方当事人（“违约方”）的违约行为，给另一方当事人（“守约方”）造成任何损失，违约方应赔偿守约方由此遭受的直接损失。

(四)如果由于本协议一方当事人（“违约方”）的违约行为给计划资产或委托人造成损失，而另一方当事人（“守约方”）赔偿了计划资产或委托人的损失，

则守约方有权向违约方追索，违约方应赔偿和补偿守约方由此遭受的直接损失。

（五）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。如当事人一方明知对方的违约行为，有能力而不采取必要的措施，导致计划资产的损失进一步扩大的，不履行监督、补救职责的一方对损失的扩大部分负有对计划的连带赔偿责任。

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

（七）由于不可抗力原因或公众通讯设备故障、互联网故障、注册与过户登记机构非正常暂停或终止业务、证券交易所非正常暂停或停止交易等非管理人或托管人造成的意外事件，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，由此造成计划资产或委托人损失，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。

十七、适用法律与争议解决

（一）本协议适用中华人民共和国法律并从其解释。

（二）管理人、托管人之间因本协议产生的或与本协议有关的争议可首先通过友好协商解决，托管协议当事人不愿通过协商、调解解决或协商、调解不成的，任何一方均有权将争议提交上海仲裁委员会提起仲裁。

（三）除提起仲裁的争议之外，各方当事人仍应履行本协议的其他规定。争议处理期间，双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》和托管协议规定的义务，维护计划持有人的合法权益。

十八、托管协议的效力和文本

（一）本协议经双方当事人盖章以及双方法定代表人/负责人或授权代表签字，自计划成立之日起生效。管理人在发起设立计划后5日内，将发起设立情况向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。本协议的有效期自生效日起至第十九条第（二）款所述之情形发生时止。

（二）本协议壹式肆份，协议双方各执壹份，上报监管部门贰份，每份具有同等法律效力。

十九、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,可以对协议进行修改。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。

(二) 发生以下情况,本托管协议终止:

- 1、计划或《集合资产管理合同》终止;
- 2、托管人解散、依法被撤销、破产或由其他托管人接管计划资产;
- 3、管理人解散、依法被撤销、破产,被依法取消资产管理业务资格或由其他管理人接管计划资产管理权;
- 4、法律法规规定的其他终止事项。

(三) 计划终止后的资产清算

1、拟终止计划的,管理人应当在发生终止情形之日起 5 日内开始清算集合计划资产,并组织成立由管理人、托管人、相关专业人士组成的计划资产清算小组进行计划资产的清算;

2、托管人应当根据管理人的指令,将计划资产扣除清算费用、托管费和管理费等费用后的余额,划付至计划资金归集专户,由管理人划付至委托人;根据中国证券登记结算有限责任公司的规定,清算备付金账户内的资金按市场规则每月调整,交易保证金账户内的资金按市场规则每月调整,因此清算备付金账户内的资金、利息以及交易保证金账户内的资金及利息需等中国证券登记结算有限责任公司退款后方可清算。该笔清算资金在扣除相关费用后划往指定账户。

3、计划终止,托管人应当办理注销计划证券账户和资金账户等账户的相关手续,管理人应配合托管人办理账户注销事宜并提供相关资料;

4、管理人应当在清算结束后 15 日内,将清算结果报中国证券投资基金业协会备案,同时抄送住所地中国证监会派出机构。

二十、其他事项

本协议未尽事宜,当事人应当依据《集合资产管理合同》、有关法律、法规和相关规定协商办理。

如本协议与《申港证券巨杉 1 号集合资产管理计划资产管理合同》的内容存在冲突的,以《申港证券巨杉 1 号集合资产管理计划资产管理合同》的约定为准。

(此页无正文, 为编号【 】《申港证券巨杉 1 号集合资产管理计划托管协议》之签署页)

管理人(章)



法定代表人或授权代理人(签字)



托管人(章)

招商证券股份有限公司

负责人或授权代理人(签字)



秦湘

签订地:

签订日: 2017 年 3 月 15 日

附件一：证券交易参数表

招商证券股份有限公司：

根据《申港证券巨杉 1 号集合资产管理计划托管协议》，对申港证券巨杉 1 号集合资产管理计划投资运作中涉及的交易参数约定如下：

(1) 组合信息：

	交易席位	清算编号	股东代码
上海			
深圳		——	

(2) 证券交易费用参照表

		佣金		备注
		费率‰	最小值(元)	
上海	股票		无	
	债券		无	如区分债券类型请注明
	普通基金		无	
	权证		无	
	ETF		无	
		无	
深圳	股票		无	
	债券		无	如区分债券类型请注明
	普通基金		无	
	权证		无	
	ETF		无	
		无	

品种		上海		深圳
		标准佣金‰	最小值(元)	标准佣金‰
回购	GC003			
	GC007			
	GC014			
	GC028			
	GC091			
	GC182			
	GC001			
	GC002			

	GC004			
			

注：本表未包括品种或代码，请自行补充。

(3) 组合佣金汇总计算方式：

- ①上海： 完全汇总 分笔汇总 按合同号汇总
 ②深圳： 完全汇总 分笔汇总 按合同号汇总

(4) 佣金扣费方式：

- ①上海： 原始费率不含费 原始费率含经手费证管费
 原始费率含经手费证管费结算费
 原始费率含经手费证管费结算费过户费
 ②深圳： 原始费率不含费 原始费率含经手费证管费
 原始费率含经手费证管费结算费
 原始费率含经手费证管费结算费过户费

(5) 组合佣金计算的中间精度为：

- 2 位 4 位
 其他 _____

注：如上海、深圳不同，请特别说明。

(5) 组合持有债券税费信息

- 扣税 不扣税
 部分债种扣税，包括： _____

(6) 银行存款、备付金等计息方式：

- 以前一日余额计息 以当日余额计息

特此告知，请作好组合运营前的准备工作。

申港证券股份有限公司（盖章）

年 月 日

附件二：资产管理人授权通知书

招商证券股份有限公司：

我公司作为资产管理人，特授权以下人员向贵方发送所有贵行托管产品的资金划拨指令以及估值数据、财务报表等其他相关通知。现将指令发送用章样本及有关人员签字样本、印章样本及相应权限留给贵方，请在使用时核验。上述被授权人在授权范围内向贵方发送指令的真实性、准确性及合法性由我单位负责。

姓名	权限	印章样本
	经办	
	经办	
	审核	
	审核	
划款指令、估值数据、财务报表等其他相关通知的业务发送用章		(用章样本)
备注：1、划款指令中业务发送用章须与个人签字或印章同时出具，方为有效。 2、上述授权人员任一划款指令中的经办人和复核人均不得重复。		

授权生效时间： 年 月 日

申港证券股份有限公司

年 月 日

附件四：联系人名单

申港证券股份有限公司					
邮寄地址：上海市世纪大道 1589 号 16 楼					
姓名	电话	传真	手机	电子邮件	
何晶晶	021-20639602	021-20639571	13818057926	hejingjing@shgsec.com	
李俊斌	021-20639615	021-20639571	15921138565	lijunbin@shgsec.com	
胡菡	021-20639561			huhan@shgsec.com	
谢菲	021-20639350			xiefei@shgsec.com	
申港证券股份有限公司					
邮寄地址：					
岗 位	姓 名	电 话	传 真	手 机	电 子 邮 件
业务联系 协调人					
数据接收 员					
估值核算 人员					
清算人员					

附件五：划款指令（样本）

申港证券巨杉1号集合资产管理计划

划款指令

付款户名：	收款户名：
付款账号：	收款账号：
开户行：	开户行：
付款金额（小写）¥	
付款金额（大写）：	
付款日期：	人行大额支付号：
划款用途（事由）	
发出人预留签章（印章）：	托管人预留签章（印章）：
发出人预留签字：	托管人预留签字：
签发人：	签发人：
复核人：	复核人：
经办人：	经办人：
托管人反馈信息栏： 1、该指令已执行 2、该指令未执行，原因如下： 托管业务专用章	开户行反馈信息栏： 1、该指令已执行 2、该指令未执行，原因如下： 核押：复核：经办： 支行签章（印章）

附件六：托管资产相关银行账户

托管专户

户名：申港证券巨杉1号集合资产管理计划

账号：

开户行：

大额支付号：

管理费及管理人业绩报酬收款账户

户名：申港证券股份有限公司

账号：1001309919024211005

开户行：中国工商银行股份有限公司上海自贸试验区分行

托管费收款账户

户名：招商证券股份有限公司

账号：4420 1501 1000 5259 3402

开户行：中国建设银行深圳分行营业部

投资顾问费及投资顾问业绩报酬收款账户

户名：巨杉（上海）资产管理有限公司账号：121913343510606

开户银行：招商银行上海分行民生支行

注意：账户如有变更，请及时通知相关各方。

管理人：申港证券股份有限公司（公章）

托管人：（公章）

附件七：关于申购赎回相关业务说明

招商证券股份有限公司：

根据我司与贵司签订的《申港证券巨杉 1 号集合资产管理计划托管协议》，为作好申港证券巨杉 1 号集合资产管理计划的运营工作，现就该产品申购赎回业务相关情况通知贵司，请作好相关准备工作。

一、开放期申购赎回资金清算日期及现金分红到账日期

开放期申购资金清算日为：T+___

开放期赎回资金清算日为：T+___

现金分红到账日为：D+___

注：T 日为申请日，D 日为除权除息日。

二、TA 数据核算方式（请选择）

合并代销商 分代销商

三、集合计划 TA 备付金账户信息

1. 中登深圳分公司 TA 备付金账户

账户名称：

账 号：

开 户 行：

结算备付金账户账号：_____

2. 中登上海分公司 TA 备付金账户

账户名称：

账 号：

开 户 行：

结算备付金账户账号：_____

申港证券股份有限公司（盖章）

年 月 日

附件八：投资监督事项表

投资监督事项表

序号	监督项目	监督内容
一	投资范围	<p>(1) 权益类：沪深证券交易所上市的 A 股股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、沪港通中港股通标的范围内的股票、深港通中港股通标的范围内的股票、股票型和混合型公开募集证券投资基金；</p> <p>(2) 固定收益类：债券逆回购（小于或等于 14 天）、沪深交易所上市的可转换债券、沪深交易所上市的可交换债券、债券型和货币市场型公开募集证券投资基金、债券正回购（小于或等于 14 天）、银行存款；银行间市场及交易所挂牌交易的债券；</p> <p>(3) 衍生品：中国金融期货交易所上市的股指期货，沪深交易所上市的股票期权。</p>
二	投资比例	<p>(1) 权益类资产占计划总值的比例：0-80%（不含 80%）</p> <p>(2) 固定收益类资产占计划总值的比例：0-80%（不含 80%）</p> <p>(3) 衍生品类资产占计划总值的比例：0-80%（不含 80%）</p> <p>权益类、固定收益类按照该资产的市值占整个资产管理计划总值的比例来计算，衍生品类按照合约价值（非轧差）占整个资产管理计划总值的比例来计算。</p>
三	投资限制	<p>(1) 按成本计，本计划持有一家上市公司所发行的单一股票数量不得达到或超过其总股本的 5%；本计划持有一家上市公司所发行的单一股票数量不得超过其流通股本（即上市公司股本—限售股本，除上下文义推测有其他含义外，本计划的计划文件中所称“流通股本”均以此定义为准）的 10%；</p> <p>(2) 按成本计，投资于单只主板、中小板股票的比例不超过计划资产净值的 25%，投资于单只创业板股票的比例不得超过计划资产净值的 15%；投资全部创业板股票的金额合计不超过计划资产净值的 40%。</p> <p>(3) 按成本计，本计划投资于单只公募基金的市值不得超过本计划资产总值的 25%（即：单一基金的市值 ÷ 本计划资产总值 ≤ 25%），</p>

		<p>且本计划持有单只基金的市值不得超过该基金最新公开对外披露份额的 5%；所投公募基金的基金最新公开对外披露市值规模不得低于 10 亿元；</p> <p>(4) 按成本计，投资于同一发行人发行的债券的市值不得超过计划资产总值的 25%（即：同一发行人发行的债券市值合计÷计划资产总值≤25%），且本计划持有单只债券的市值不得超过该债券总发行规模的 5%；</p> <p>(5) 本计划投资的债券的主体信用评级不得低于 AA，且债项信用评级不得低于 AA；本计划投资的短期融资券的主体信用评级不得低于 AA，且债项信用评级不得低于 A-1。</p> <p>(6) 本计划届满前 3 个月内，不得认购新发行的开放日在计划到期日之后的开放式基金；</p> <p>(7) 期货账户全部权益（含保证金占用及可用资金）不得超过计划资产净值的 50%；</p> <p>(8) 期货的风险度不得超过 90%，期货风险度=期货保证金占用/期货账户全部权益（含保证金占用及可用资金）；</p> <p>(9) 本计划预警线（含）以上净敞口比例不得超过【-20%，100%】，预警线以下净敞口比例不得超过【-20%，50%】，净敞口比例=【（所有权益类资产多头价值+所有期货多头合约价值+所有期权多头合约价值）-（所有权益类资产空头价值+所有期货空头合约价值+所有期权空头合约价值）】/集合资产管理计划净值；</p> <p>(10) 期权账户保证金不得超过计划资产净值的 15%</p> <p>(11) 不得主动投资于已公告退市或已进退市整理期的股票、S、ST、*ST、SST、S*ST 类的股票；</p> <p>(12) 本计划不得投资于分级基金；不得投资于权证；不得投资于银行理财产品；</p> <p>(13) 本计划申购新股时，申报的数量不得超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；</p> <p>(14) 不得投资于投资范围之外的投资品种；</p>
--	--	--

		<p>(15) 本计划总资产占净资产的比例不得超过 200%;</p> <p>(16) 禁止投资于限售期超过本计划到期日的股票。</p> <p>(17) 法律法规或监管部门规定的其他投资限制。</p>
--	--	--

备注:

1. 经委托人、管理人确认同意, 托管人投资监督的及时性、准确性和完整性受限于管理人、证券经纪商(如有)以及其他中介机构提供的数据和信息, 合规投资的最终责任在管理人, 托管人对这些机构信息的及时性、准确性和完整性不作任何担保、暗示或表示。如因上述机构提供信息的真实性、准确性和完整性存在瑕疵而所引发的损失, 托管人不承担任何责任。
2. 托管人不对管理人的任何投资行为承担责任。托管人不因提供投资监督提示函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提示函有关的信息和报道。但如收到管理人的书面指示, 托管人将就投资监督提示函所述的违规行为提供有关资料。
3. 托管人仅对《投资监督事项表》列明的投资范围、投资比例、投资限制进行监督, 对于《投资监督事项表》未列名的投资限制等, 托管人不承担监督责任。

附件九：关联方名单

管理人关联方名单：

1	茂宸集团控股有限公司
2	民众证券有限公司
3	赛领国际投资基金（上海）有限公司
4	上海长甲投资有限公司
5	中诚信投资有限公司
6	北京国泽资本管理有限公司
7	张家港鸿运投资有限公司
8	嘉泰新兴资本管理有限公司
9	中邦置业集团有限公司
10	广东潮弘投资有限公司
11	上海慧玉投资中心（有限合伙）
12	武汉易鹏达投资有限公司
13	上海煌富贸易有限公司
14	北京志诚泰和电子技术有限公司

托管人关联方名单：

序号	公司名称
1	深圳市招融投资控股有限公司
2	招商局集团有限公司
3	博时基金管理有限公司
4	招商基金管理有限公司
5	招商证券国际有限公司
6	招商证券(香港)有限公司
7	招商期货(香港)有限公司
8	招商代理人(香港)有限公司
9	CMS Nominees (BVI) Limited
10	招商证券投资(香港)有限公司
11	招商资本(香港)有限公司
12	招商证券资产管理(香港)有限公司
13	招商期货有限公司
14	招商致远资本投资有限公司
15	深圳招商致远咨询服务有限公司

16	CMS Capital Fund Management Co. Ltd.
17	CMS Agri-Consumer Fund, L.P.
18	深圳市远盛投资管理有限公司
19	北京致远励新投资管理有限公司
20	深圳市招商致远股权投资基金管理有限公司
21	赣州招商致远壹号股权投资管理有限公司
22	江西致远发展投资管理有限公司
23	赣州招远投资管理有限公司
24	安徽招商致远创新投资管理有限公司
25	深圳市致远创业投资基金管理有限公司
26	青岛国信招商创业投资管理有限公司
27	深圳市招商创远投资有限公司
28	沈阳招商创业发展投资管理有限公司
29	合肥中安致远投资管理有限公司
30	池州中安招商股权投资管理有限公司
31	招商证券投资有限公司
32	招商证券资产管理有限公司
33	China Merchants Securities (UK) Co., Limited
34	China Merchants Securities (Singapore) Pte. Ltd
35	青岛招商致远投资管理有限公司
36	安徽致远智慧城市基金管理有限公司
37	深圳市招商致远文化投资管理有限公司
38	招证资本投资有限公司
39	招商证券(香港)融资有限公司
40	China Merchants Securities (Korea) Co., Ltd
41	安徽交控招商基金管理有限公司