

国信证券鼎信睿元 1 号集合资产 管理计划托管协议



管理人：国信证券股份有限公司

托管人：中国工商银行股份有限公司深圳市分行

2019年5月9日

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、越权交易..... | 7 |
| 六、计划资产保管..... | 9 |
| 七、指令的发送、确认和执行..... | 12 |
| 八、交易安排..... | 15 |
| 九、计划开放期参与、退出的资金清算..... | 17 |
| 十、计划资产估值、净值计算和会计核算..... | 18 |
| 十一、计划收益分配..... | 20 |
| 十二、计划的费用、业绩报酬和税收..... | 21 |
| 十三、计划的信息披露..... | 21 |
| 十四、托管报告及有关文件档案的保存..... | 22 |
| 十五、计划委托人名册的登记和保管..... | 22 |
| 十六、禁止行为..... | 23 |
| 十七、违约责任..... | 23 |
| 十八、适用法律与争议解决..... | 25 |
| 十九、托管协议的效力和文本..... | 25 |
| 二十、托管协议的修改、终止和资产清算..... | 25 |
| 二十一、其他事项..... | 26 |
| 附件一：关联方名单..... | 28 |
| 附件二：证券交易参数表..... | 30 |
| 附件三：关于申购赎回相关业务说明..... | 32 |
| 附件四：授权委托书..... | 33 |
| 附件五：银行联系表..... | 34 |
| 附件六：管理人联系表..... | 35 |
| 附件七：划款指令（样本）..... | 36 |
| 附件八：投资交易监督事项表..... | 37 |
| 附件九：托管账户预留印鉴样本..... | 39 |

鉴于国信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，拟发起设立国信证券鼎信睿元 1 号集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”）；

鉴于中国工商银行股份有限公司系一家依照中国法律合法成立并有效存续的银行，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；

鉴于国信证券股份有限公司拟担任计划的管理人，中国工商银行股份有限公司深圳市分行拟担任计划的托管人。

鉴于计划的委托人指“国信证券鼎信睿元 1 号集合资产管理计划”的参与人，并与国信证券股份有限公司以及中国工商银行股份有限公司深圳市分行签订了《国信证券鼎信睿元 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：国信证券股份有限公司
注册地址：深圳市红岭中路 1012 号国信证券大厦
办公地址：深圳市红岭中路 1012 号国信证券大厦
法定代表人：何如
成立时间：1994 年 2 月 1 日
组织形式：股份有限公司
注册资本：70 亿元人民币
电话：(0755) 22940159
联系人：毕燃

（二）托管人

名称：中国工商银行股份有限公司深圳市分行
办公地址：深圳市深南东路金融中心大厦北座
负责人：徐守本
成立时间：1984 年 1 月 1 日
组织形式：股份有限公司
注册资本：人民币 349,018,545,827.00 元
电话：0755-25930416
联系人：祝武

二、订立托管协议的依据、目的、原则和解释

（一）依据

本托管协议依据依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《中华人民共和国合同法》、《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》）以及《国信证券鼎信睿元 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、转换子计划、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“国信证券鼎信睿元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推广期结束后，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且托管人收到计划资产之日，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的投资范围、投资比例、投资限制、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、合规性进行监督和核查。托管人仅在其托管资产的范围内承担监督义务，对于不属于本集合计划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。

其中，如投资的中小企业私募债有特定条件限制，特定条件由管理人自行判断，托管人仅对中小企业私募债的投资比例进行监督。

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，应及时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。

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，对于证券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。

（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投资指令、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、越权交易

（一）越权交易的界定

1、越权交易是指管理人违反有关法律法规的规定以及违反或超出本集合计划合同项下投资者的授权而进行的投资交易行为，包括：（1）违反有关法律法规和本集合计划合同投资范围的规定进行的投资交易行为；（2）法律法规禁止的超买、超卖行为。

2、管理人应在有关法律法规和本集合计划合同规定的权限内运用集合计划财产进行投资管理，不得违反有关法律法规和本集合计划合同的约定，超越权限管理集合计划财产。

（二）越权交易的处理程序

1、资产托管人对于承诺监督的越权交易中，发现资产管理人依据交易程序已

经生效的指令违反相关法律法规，或者违反本集合计划合同约定的，应当立即通知资产管理人并有权及时报告中国证监会。

2、管理人应向托管人主动报告越权交易，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越权事项未能在限期内纠正的，托管人应报告管理人住所地中国证监会派出机构。

3、超买、超卖行为：托管人在行使监督职能时，如果发现出现超买或超卖现象，应立即提醒管理人，由管理人负责解决，由此给集合计划资产及托管人托管的其它财产造成的损失由管理人承担。如果因管理人原因发生超买行为，管理人必须于 T+1 日上午 10:00 前准备好资金，用以完成清算交收。

4、越权交易所发生的损失及相关交易费用由管理人负担，所发生的收益归集合计划所有。

（三）托管人对管理人投资运作的监督

1、托管人对管理人的投资行为行使监督权：

（1）托管人的交易监督义务以《投资交易监督事项表》规定的事项为准。《投资交易监督事项表》变更时，合同各方协商一致并签署补充协议。资产管理人在新的《投资交易监督事项表》启用前 3 个工作日内向资产托管人提交《投资交易监督事项表》扫描件。

（2）托管人对集合计划资产的投资限制的监督自集合计划成立日起开始。因证券期货市场波动、证券发行人合并、集合计划规模变动等管理人之外的因素导致集合计划投资不符合《投资监督事项表》约定内容的，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相关要求。如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。

（3）投资者确认，托管人投资监督的准确性和完整性受限于管理人及其他中介机构提供的数据信息，合规投资的最终责任在管理人。托管人对这些机构信息的准确性和完整性不做任何担保、暗示或表示，并且对由于上述机构提供的信息的真实性、准确性和完整性所引起的损失不承担任何责任。

2、托管人发现管理人的投资运作违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反本集合计划合同时，不予执行，应当通知管理人限期纠正，管理人收到通知后应及时核对，并以书面形式向托管人进行解释或举证，由此造成的损失由管理

人承担。托管人发现管理人违规情况时的通知方式为邮件、电话或书面通知。资产管理人联系人员及接收通知的邮件地址：杨辉，yanghui4@guosen.com.cn。

在限期内，托管人有权随时对通知事项进行复查，督促管理人改正。管理人对托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，托管人应通知投资者，并报告管理人住所地证监会派出机构。

六、计划资产保管

（一）计划资产保管的原则

1、对于移交托管人且由托管人实际保管控制的资产，托管人应承担保管责任。托管人将遵守法律法规规定、《集合资产管理合同》和本协议约定，为计划持有人的最大利益处理相关事务。托管人保证恪尽职守，依照诚实信用、勤勉尽责的原则，谨慎、有效的持有并保管计划资产。

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

3、托管人应当购置并保持对于计划资产的托管所必要的设备和设施（包括硬件和软件），并对设备和设施进行维修、维护和更换，以保持设备和设施的正常运行，以及与中国证券登记结算有限公司数据通讯线路的畅通。

4、除依据法律法规规定、《集合资产管理合同》和本协议约定外，托管人不得为自己及任何第三人谋取利益，如托管人违反此义务，利用计划资产为自己及任何第三方谋取利益，所得利益归于计划资产。

5、托管人必须将计划资产与自有财产严格分开，将本计划资产与其托管的其他计划资产严格分开；托管人应当对本计划与托管人的其他业务和其他计划的托管业务实行严格的分账管理，保证不同计划之间在名册登记、账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立。

6、除依据法律法规规定、《集合资产管理合同》和本协议约定外，托管人不得委托第三人托管计划资产。

7、托管人应安全、完整地保管计划资产；未经管理人的正当指令，不得自行运用、处分、分配计划的任何资产。

8、对于计划应收参与款，由管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知托

管人，在确定的计划资产没有到达托管人处的，托管人应及时通知管理人采取措施进行处理，由此给计划资产造成损失的，管理人应负责向有关当事人追偿。

（二）计划推广期间及募集资金的验资

1、集合计划设立推广期满，管理人应当聘请具有证券相关业务资格的会计师事务所对集合资产管理计划进行验资并出具验资报告。管理人应不迟于集合计划成立当日向托管人提供注册会计师事务所正式出具的验资报告及管理公司出具的加盖公章的成立公告。

2、集合计划成立，管理人应将全部推广期参与资金转入托管人指定的托管账户，并确保转入的资金与验资确认金额一致。在托管人确认本计划资产划入托管专户后，托管人正式承担托管职责。

3、如果在推广期满后，计划未达到成立条件，按《集合资产管理合同》规定办理退款事宜。

（三）银行托管账户的开立和管理

1、托管人在其营业机构为集合计划开立银行托管账户，账户名称应为国信证券股份有限公司-产品名称（具体名称以实际开立为准），托管账户可出款日期以开户行执行中国人民银行《人民币银行结算账户管理办法》的具体要求为准。该账户用于办理本集合计划参与及退出资金、收益分配等资金往来相关业务。托管账户与管理人、托管人和推广机构自有资金账户以及其他集合计划资金账户相互独立。集合计划资产的一切货币收支活动均通过本集合计划托管账户进行。管理人应配合托管人办理账户开立事宜并提供相关资料，并保证所提供账户开户材料的真实性和有效性，且在相关资料变更后及时将变更的资料提供给托管人。

2、银行托管账户印鉴的预留

管理人、托管人确认托管账户的预留印鉴由双方设置，由国信证券股份有限公司公章、国信证券股份有限公司法定代表人授权代表个人名章、托管授权人的个人名章（托管账户预留印鉴样本见附件九）组成，资产管理人印鉴由资产管理人保管，资产托管人印鉴由资产托管人保管。

3、集合计划银行托管账户的开立和使用，限于满足开展本集合计划业务的需要。托管人和管理人不得假借本集合计划的名义开立任何其他银行账户；亦不得使用本集合计划的任何账户进行本集合计划业务以外的活动。

4、集合计划银行托管账户的开立和管理应符合《人民币银行结算账户管理

办法》、《现金管理条例》、《中国人民银行利率管理的有关规定》、《关于大额现金支付管理的通知》、《支付结算办法》以及中国人民银行、中国银监会的其他规定。

（四）证券账户的开立和管理

1、托管人根据管理人委托按中国证券登记结算有限责任公司相关规定在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司、深圳分公司为本集合计划分别开立证券账户，用于本集合计划证券投资的清算和存管。托管人对账户业务发生情况进行如实记录。管理人应配合托管人办理账户开立事宜并提供相关资料，资金账户名称应当是“资产管理计划名称”，集合资产管理计划的证券账户、期货账户名称应当是“管理人名称—托管人名称—资产管理计划名称”。

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

3、集合计划证券账户的开立和证券账户卡的保管由托管人负责，管理和使用由管理人负责。

4、证券账户、专用交易单元管理人应当报证券交易所、证券登记结算机构以及证券公司住所地所在地中国证监会派出机构及中国证券投资基金业协会备案。

5、债券账户的开设和管理

合同生效后，托管人根据中国人民银行、中央国债登记结算有限责任公司（以下简称“中债登”）和银行间市场清算所股份有限公司（以下简称“上清所”）的有关规定，在中债登和上清所开立债券账户和债券资金结算账户，并代表集合计划进行银行间市场债券交易的结算。管理人应配合托管人办理账户开立事宜并提供相关资料。

（五）基金账户的开立和管理

基金账户由管理人根据投资需要按照相关规定开立，完成账户开立后，资产管理人应以书面形式将基金账户信息告知资产托管人。

（六）其他账户的开立和管理

因业务发展而需要开立的其他账户，可以根据法律法规和本集合计划合同的规定，经管理人与托管人进行协商后进行办理。新账户按照有关规则使用并管理。

（七）与计划资产有关的重大合同的保管

1、由管理人代表计划签署的与计划有关的重大合同的原件分别由托管人、管理人保管。除本协议另有规定外，管理人在代表计划签署与计划有关的重大合同时，应保证计划一方持有两份以上的正本，以便管理人和托管人至少各持有一份正本的原件。

2、合同的保管期限为自《集合资产管理合同》终止之日起 20 年。

3、与计划资产有关的重大合同，根据需要由托管人以计划的名义签署的，由管理人以传真方式下达签署指令（含有效授权内容），合同原件由托管人保管，但托管人应将该合同原件的复印件盖章（骑缝章）后，交管理人一份。如该合同需要加盖管理人公章，则管理人至少应保留一份合同原件。

4、因管理人将自己保管的本计划重大合同在未经托管人同意的情况下，用于抵（质）押、担保或债权转让或作其他权利处分而造成计划资产损失，由管理人负责赔偿。

5、因托管人将自己保管的本计划重大合同在未经管理人同意的情况下，用于抵（质）押、担保或债权转让或作其他权利处分而造成计划资产损失，由托管人负责赔偿。

（八）其他事项的约定

管理人应配合托管人办理集合计划运作前的相关准备工作，应不迟于资金托管账户开设前向托管人提供《证券交易参数表》、《关于申购赎回相关业务说明》。

七、指令的发送、确认和执行

（一）投资指令的授权

授权通知的内容：管理人应事先向托管人提供书面授权通知（以下称“授权通知”），指定投资指令的被授权人员及被授权印鉴，授权通知的内容包括被授权人的名单、签章样本、权限和预留印鉴样本。管理人撤换被授权人员、改变被授权人员的权限或更改被授权印鉴，须提前向托管人提供变更后的新的授权通知。授权通知应加盖管理人公司公章并由法定代表人或授权代表签署，若由授权代表签署，还应附上法定代表人的授权书，同时应写明生效时间。

授权通知的确认：集合计划成立时的授权通知，在管理人与托管人电话确认收妥原件后，于授权通知载明的生效时间生效。由于人员、权限或印鉴变更而提供的变更后的新的授权通知，管理人必须提前至少一个交易日，使用传真

方式或其他资产管理人和资产托管人书面认可的方式向托管人发送，同时电话通知托管人，变更后的新的授权通知经管理人与托管人电话确认收受后，于授权通知载明的生效时间生效，同时原授权通知失效，若托管人收到新的授权通知的时间晚于该授权通知载明的生效时间，则以托管人收到该授权通知的时间生效，同时原授权通知失效。

授权通知的保管：管理人在与托管人电话确认授权通知后的三个工作日内将授权通知的正本送交资产托管人。管理人应确保授权通知的正本与传真件一致。若变更后的新的授权通知正本内容与资产托管人收到的传真件不一致的，以托管人收到的已生效的传真件为准。管理人和托管人对授权通知负有保密义务，其内容不得向授权人、被授权人及相关操作人员以外的任何人泄露。

（二） 投资指令的内容

投资指令是在管理集合计划时，管理人向托管人发出的交易成交单、交易指令及资金划拨类指令（以下简称“指令”）。指令应加盖预留印鉴并由被授权人签章。管理人发给托管人的资金划拨类指令应写明款项事由、时间、大小写金额、出款和收款账户信息等。

（三） 指令的发送、确认和执行

指令的发送：管理人应按照相关法律法规以及本集合计划合同的规定，在其合法的经营权限和交易权限内依照授权通知的授权用传真方式或其他托管人和管理人书面认可的方式向托管人发送。管理人在发送指令时，应确保相关出款账户有足够的资金余额，并为托管人留出执行指令所必需的时间（至少 2 个工作小时）。

1、对于新债申购等网下公开发行业务，管理人应于网下申购缴款日的 14:00 前将指令发送给托管人。

2、对于银行间业务，管理人应于交易日 17:00 前将银行间成交单及相关划款指令发送至托管人。管理人应与托管人确认资产托管人已完成证书和权限设置后方可进行集合计划的银行间交易。

3、对于指定时间出款的交易指令，管理人应提前 2 个工作小时将指令发送至托管人；对于管理人于 15:00 以后发送至托管人的指令，托管人应尽力配合出款，但如未能出款时资产托管人不承担责任。管理人首次进行场内交易前应 与托管人确认交易单元和股东代码设置无误后方可进行。

指令的确认：管理人义务在发送指令后与托管人以录音电话的方式进行确认。指令以获得托管人确认该指令已成功接收之时视为送达托管人。对于依照“授权通知”发出的指令，管理人不得否认其效力。

指令的执行：托管人确认收到管理人发送的指令后，应对指令进行形式审查，验证指令的要素是否齐全，传真指令还应审核印鉴和签章是否和预留印鉴和签章样本表面相符，指令复核无误后应在规定期限内及时执行，不得延误。若存在要素不符或其他异议，托管人应及时与管理人进行电话确认，暂停指令的执行并要求管理人重新发送指令。托管人有权要求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。托管人不负责审查管理人发送指令同时提交的其他文件资料的合法性、真实性、完整性和有效性，管理人应保证上述文件资料合法、真实、完整和有效。如因管理人提供的上述文件不合法、不真实、不完整或失去效力而影响托管人的审核或给任何第三人带来损失，托管人不承担任何形式的责任。托管人待收齐相关资料并判断指令有效后重新开始执行指令。管理人应在合理时间内补充相关资料，并给托管人预留必要的执行时间。在指令未执行的前提下，若管理人撤销指令，管理人应在原指令上注明“作废”并加盖预留印鉴及被授权人签章后传真给托管人，并电话通知托管人。

（四）托管人依照法律法规暂缓、拒绝执行指令的情形和处理程序

托管人发现资产管理人发送的指令有可能违反《基金法》、《管理办法》、《运作规定》、本集合计划合同或其他有关法律法规的规定时，应暂缓执行指令，并及时通知管理人，管理人收到通知后应及时核对并纠正；托管人发现管理人的投资或清算指令违反法律、行政法规、中国证监会的规定或者资产管理合同约定的，应当拒绝执行，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。

（五）管理人发送错误指令的情形和处理程序

管理人发送错误指令的情形包括指令发送人员无权或超越权限发送指令及交割信息错误，与预留印鉴不符，指令中重要信息错误、模糊不清或不全等。托管人在履行监督职能时，发现管理人的指令错误时，有权拒绝执行，并及时通知资产管理人纠正。

（六）指令的保管

指令若以传真形式发出，则正本由管理人保管，托管人保管指令传真件。当两者不一致时，以托管人收到的指令传真件为准。

（七）相关责任

对管理人在没有充足资金的情况下向托管人发出的指令致使资金未能及时清算所造成的损失由管理人承担。因管理人原因造成的传输不及时、未能留出足够执行时间、未能及时与托管人进行指令确认致使资金未能及时清算或交易失败所造成的损失由管理人承担，但如遇到不可抗力的情况除外。托管人正确执行管理人发送的有效指令，集合计划发生损失的，托管人不承担任何形式的责任。在正常业务受理渠道和指令规定的时间内，因托管人原因未能及时或正确执行合法合规的指令而导致集合计划受损的，托管人应承担相应的责任，但如遇到不可抗力的情况除外。

托管人根据本集合计划合同相关规定履行形式审核职责，如果管理人的指令存在事实上未经授权、欺诈、伪造或未能及时提供授权通知等情形，托管人不承担因执行有关指令或拒绝执行有关指令而给管理人或集合计划或任何第三方带来的损失，托管人不承担责任，但托管人未按合同约定尽形式审核义务执行指令而造成损失的情形除外。

八、交易安排

（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，并将用于计划交易的专用交易单元向证券交易所、证券登记结算机构、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。

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) 管理人应采取合理措施，确保在 T+1 日上午 12:00 前有足够的资金头寸用于托管人与中国证券登记结算公司上海分公司和深圳分公司的资金结算。

(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。在托管组合头寸足额情况下，若管理人无法及时出具划款指令且又临近资金交收时点时，托管人可先进行资金划付，避免因资金划付不及时导致交收失败及资金占用的风险，之后再由管理人补具指令。

(6) 集合计划参与股票质押式回购交易的责任认定及处理程序

① 集合计划参与股票质押式回购交易，发生回购首期、到期、回购利率变动、提前终止、期限延后、收益分配等业务时，集合计划管理人须在业务发生当日 15:00 前按照托管人要求提供业务信息包括但不限于业务合同、托管人要求格式的业务数据等，并对所提供业务信息的准确性负责。因集合计划管理人提供的业务信息不完整或有误给集合计划或托管人造成的损失由集合计划管理人承担。

② 股票质押式回购存续期间如发生回购利率变动，可在变动日开始按照新的利率计提收益，不得追溯调整已计提的收益。

③ 股票质押式回购采用 T+0 交易所非担保交收，须遵照本协议关于参与 T+0 交易所非担保交收交易的相关条款执行。

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投资基金业协会报告。

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 16:30 传真托管人。

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书后及时且不晚于当日 16:30 传真托管人。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。

九、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；管理人将双方盖章确认的前一日集合计划净值通告在各销售网点、管理人的网站上告知投资者。

（二）T+1 日 15:00 前，注册登记机构根据 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）委托第三方作为产品注册登记机构，管理人负责以产品的名义在注册

登记机构开立备付金账户和费用账户；管理人作为注册登记机构的，管理人应指定专门账户，用于本集合计划参与、中间参与和退出环节的清算交收，上述账户简称集合计划清算账户。

（四）集合计划清算账户与集合计划托管账户之间的资金清算时间安排为：参与资金（不含参与费用）在 T+2 日清算，退出资金和退出费用在 T+2 日清算。

（五）集合计划“托管账户”与“集合计划清算账户”之间的资金清算，采取“净额清算、净额交收”的原则，即按照托管账户每日应收资金和应付资金的差额来确定托管账户每日的资金交收净额。

当托管账户存在净应收额（集合计划应收参与款大于应付退出款）时，管理人将净应收额从“集合计划清算账户”划至“集合计划托管账户”，在资金划出后管理人应立即通知托管人，在资金到账后托管人应立即通知管理人进行账务处理。当托管账户存在净应付额（集合计划应付退出款大于应收参与款）时，托管行按管理人的划款指令将托管账户净应付额从“集合计划托管账户”划至管理人指定的“集合计划清算账户”，托管人在资金划出后立即通知管理人，管理人确认资金到账后立即通知托管人进行账务处理。

十、计划资产估值、净值计算和会计核算

（一）计划资产估值

管理人及托管人应当按照《资产管理合同》的约定进行估值。

（二）计划资产净值的计算、复核与完成的时间及程序

1、计划资产净值是指计划资产总值减去负债后的价值。

计划份额资产净值是指计算日计划资产净值除以计算日计划份额总数后的价值。

2、复核程序

（1）用于计划信息披露的计划资产净值和计划份额资产净值由管理人负责计算，托管人复核。管理人应于（1）开放期的每个工作日；（2）封闭期的每周最后一个工作日结束后，计算得出当日的计划份额资产净值，以电子对账数据或盖章后传真的方式发送给托管人

（2）托管人应在收到上述电子对账数据或传真后对净值计算结果进行复核，复核无误的，以电子或盖章后以传真方式将复核结果传送给管理人。如果托管人的复核结果与管理人的计算结果存在差异，且双方经协商未能达成一致，管理人

有权按照其对计划净值的计算结果对外予以公布，托管人有权将相关情况报中国证券投资基金业协会备案，同时抄送管理人住所地中国证监会派出机构。由此给计划或管理人造成的损失由管理人承担赔偿责任，托管人不承担赔偿责任。

(3) 管理人和托管人应当按照《集合资产管理合同》规定的时间和方式，至少每周公布一次集合计划份额净值。

3、计划份额资产净值错误的处理

(1) 计划份额资产净值的计算采用四舍五入的方法保留小数点后四位，国家另有规定的从其规定。当计划资产的估值导致计划份额资产净值小数点后四位以内发生差错时，视为计划份额资产净值错误。

(2) 管理人和托管人应采取必要、适当、合理的措施，确保计划资产净值的准确性和及时性。

(3) 当管理人确认计划份额资产净值发生错误时，管理人立即予以纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大。错误偏差达到计划资产净值的 0.5% 时，管理人应当通报托管人并立即披露。

(4) 因计划份额资产净值发生估值差错造成计划资产及委托人损失的，由管理人负责先行赔偿，赔偿原则如下：赔偿仅限于因差错而导致的委托人的直接损失；管理人代表本计划保留要求相关当事人返还不当得利的权利；管理人在赔偿后，有权向有关责任方追偿；如果管理人计算的计划份额资产净值错误，且已由托管人复核确认后披露的，由此给计划或计划委托人造成的损失，就实际支付的赔偿金额，管理人和托管人按照各方的过错程度各自承担相应责任。

(5) 针对净值处理错误，如法律法规或监管机构另有规定的，从其规定办理。

4、特殊情形的处理

由于不可抗力原因，或由于证券交易所、登记结算公司等机构发送的数据错误等原因，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，但仍未能发现错误的，由此给计划资产造成损失的，本管理人和托管人可以免除赔偿责任。但本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。

(三) 计划会计制度

本计划的会计核算按《证券公司客户资产管理业务估值方法指引》、《证券投资基金会计核算业务指引》、企业会计准则及其他法律、法规的规定执行。

（四）计划账册的建账和对账

1、管理人和托管人在本计划成立后，应按照双方约定的同一记账方法和会计处理原则，分别独立地设置、登录和保管本计划的全套账册，对双方各自的账册定期进行核对，互相监督，以保证计划资产的安全。若双方对会计处理方法存在分歧，应以管理人的处理方法为准。

2、双方应每日核对账目，如发现双方的账目存在不符的，管理人和托管人必须及时查明原因并纠正，保证双方平行登录的账册记录完全相符。

（五）财务报表与报告的编制和复核

1、计划财务报表由管理人编制，托管人复核。季度报告应在每季度结束之日起1个月内编制完毕；年度报告在每年度结束之日起4个月内编制完毕。

2、管理人在季度报告完成当日，将有关报告提供给托管人复核，托管人应在收到后5个工作日内完成复核，并将复核结果书面通知管理人。管理人在年度报告完成当日，将有关报告提供托管人复核，托管人应在收到后20个工作日内完成复核，并将复核结果书面通知管理人。管理人和托管人之间的上述文件往来均以传真的方式或双方商定的其他方式进行。

3、托管人在复核过程中，发现双方的报表存在不符时，管理人和托管人应共同查明原因，进行调整，调整以双方认可的账务处理方式为准；若双方无法达成一致，以管理人的账务处理为准。核对无误后，托管人在管理人提供的报告上加盖托管业务部门公章或者出具加盖托管业务部门公章的复核意见书，双方各自留存一份。如果管理人与托管人不能于应当披露之日之前就相关报表达成一致，管理人有权按照其编制的报表对外披露，托管人有权就相关情况报中国证券投资基金业协会备案，同时抄送管理人住所地中国证监会派出机构。由此给计划或管理人造成的损失由管理人承担赔偿责任，托管人不承担赔偿责任。

十一、计划收益分配

（一）收益的构成

集合计划的收益包括集合计划投资所得分红、银行存款利息及其他合法收入。

集合计划的净收益为集合计划收益扣除按照国家有关规定可以在集合计划资产中扣除的费用后的余额。

（二）收益分配原则

1、所有集合计划份额享有同等收益分配权；

- 2、集合计划份额净值须高于面值时方可进行收益分配；
- 3、集合计划收益分配后，份额净值不得低于面值；
- 4、在符合分红条件的前提下，管理人可选择分红，并在管理人指定网站上披露；
- 5、管理人须于收益分配日后的 15 个工作日内完成集合计划红利发放；
- 6、在有利于投资者利益的前提下，管理人有权对收益分配原则进行调整，并在管理人网站上进行公告，无需履行合同变更程序；
- 7、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

（三）收益分配方案的确定与披露

收益分配方案中将载明收益的范围、收益分配对象、分配原则、收益分配日、分配数额及比例、分配方式等内容。

收益分配方案由管理人拟定，经托管人核实后确定，并在确定之日起 5 个工作日内由管理人在网站上以公告方式进行信息披露。

（四）收益分配方式

投资者可以选择现金分红或红利再投资的分红方式，集合计划默认分红方式为现金分红。

投资者选择红利再投资的方式时，分红资金在扣除管理人业绩报酬后（如有），按分红除权日的集合计划单位净值转成集合计划份额，无需缴纳参与费。份额的计算结果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集合计划资产的损益。

十二、计划的费用、业绩报酬和税收

集合计划费用按照《集合资产管理合同》的约定计提和支付。

十三、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、管理人和托管人均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，管理人和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。

3、本计划的信息披露的公告，必须符合《管理办法》、《管理规定》、《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、托管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、托管人应为文本存放、委托人查询有关文件提供必要的场所和其他便利。

管理人和托管人应保证文本的内容与所公告的内容完全一致。

十四、托管报告及有关文件档案的保存

(一) 托管人按照《管理办法》、《管理规定》、《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。

十五、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。

十六、禁止行为

(一) 管理人、托管人须遵守《管理办法》、《管理规定》的规定，不得从事《管理办法》、《管理规定》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。

十七、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。

十八、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深圳国际仲裁院并按其仲裁规则进行仲裁, 仲裁地点在深圳。

(三) 除提起诉讼的争议之外, 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。

十九、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。本协议的有效期限自生效日起至第十九条第(二)款所述之情形发生时止。

(二) 本协议壹式陆份, 协议双方各执贰份, 上报监管部门贰份, 每份具有同等法律效力。

二十、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、业绩报酬、托管费等费用后的余额，划付至计划资金归集专户，由管理人划付至委托人；

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。

二十一、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。

(此页无正文，为国信证券鼎信睿元1号集合资产管理计划托管协议签署页)

管理人(章)



国信证券股份有限公司

法定代表人或授权代理人(签字)



托管人(章)



中国工商银行股份有限公司深圳市分行

负责人或授权代理人(签字)

胡平安

签订地:

签订日: 2019年5月9日

附件一：关联方名单

托管人关联方名单：

工商银行关联方及关联方交易情况表

| 关联方类别 | 关联方 | 关联方交易情况 |
|----------------|--|---------|
| 前 10 名普通股股东 | 汇金公司 | |
| | 财政部 | |
| | 香港中央结算有限公司 | |
| | 中国证券金融股份有限公司 | |
| | 中国平安人寿保险股份有限公司 | |
| | 梧桐树投资平台有限责任公司 | |
| | 中央汇金资产管理有限责任公司 | |
| | 中国人寿保险股份有限公司 | |
| | 安邦财产保险股份有限公司 | |
| | 首都机场集团公司 | |
| H 股股东 | 全国社会保障基金理事会 | |
| | Temasek Holdings (Private) Limited | |
| | 平安资产管理有限责任公司 | |
| | BlackRock, Inc. | |
| 前 10 名境外优先股股东 | Cede & Co. | |
| | The Bank of New York Depository (Nominees) Limited | |
| 前 10 名境内优先股股东 | 中国移动通信集团公司 | |
| | 中国烟草总公司 | |
| | 中国人寿保险股份有限公司 | |
| | 中国平安人寿保险股份有限公司 | |
| | 建信信托有限责任公司 | |
| | 交银施罗德资产管理有限公司 | |
| | 华润深国投信托有限公司 | |
| | 中银国际证券有限责任公司 | |
| | 中国烟草总公司山东省公司 | |
| | 中国烟草总公司黑龙江省公司 | |
| 中国平安财产保险股份有限公司 | | |
| 境外控股子公司 | 中国工商银行（亚洲）有限公司 | |

| | | |
|-----------|--------------------|--|
| | 工银国际控股有限公司 | |
| | 中国工商银行（澳门）股份有限公司 | |
| | 中国工商银行马来西亚有限公司 | |
| | 中国工商银行（印度尼西亚）有限公司 | |
| | 中国工商银行（泰国）股份有限公司 | |
| | 中国工商银行（阿拉木图）股份有限公司 | |
| | 中国工商银行新西兰有限公司 | |
| | 中国工商银行（伦敦）有限公司 | |
| | 中国工商银行（欧洲）有限公司 | |
| | 中国工商银行（莫斯科）股份公司 | |
| | 中国工商银行（美国） | |
| | 工银金融服务有限责任公司 | |
| | 中国工商银行（加拿大）有限公司 | |
| | 中国工商银行（阿根廷）股份有限公司 | |
| | 中国工商银行（巴西）有限公司 | |
| | 中国工商银行（秘鲁）有限公司 | |
| | 中国工商银行（墨西哥）有限公司 | |
| | 中国工商银行（土耳其）股份有限公司 | |
| | 工银标准银行公众有限公司 | |
| 境内主要控股子公司 | 工银瑞信基金管理有限公司 | |
| | 工银金融租赁有限公司 | |
| | 工银安盛人寿保险有限公司 | |
| | 工银金融资产投资有限公司 | |
| 主要参股公司 | 标准银行集团有限公司 | |

附件二：证券交易参数表

中国工商银行资产托管部深圳分部：

根据《国信证券鼎信睿元1号集合资产管理计划托管协议》，对国信证券鼎信睿元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。

国信证券股份有限公司（盖章）

二〇一 年 月 日

附件三：关于申购赎回相关业务说明

中国工商银行资产托管部深圳分部：

根据我司与贵部签订的《国信证券鼎信睿元 1 号集合资产管理计划托管协议》，为作好国信证券鼎信睿元 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部，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、集合计划清算账户信息

账户名称：

账 号：

开 户 行：

国信证券有限公司（盖章）

二〇 年 月 日

附件四、授权委托书

中国工商银行股份有限公司深圳市分行：

经双方友好协商，由贵行托管的我公司管理下的国信证券鼎信睿元 1 号集合资产管理计划产品，自项目成立起，授权委托贵部于每季度初第 3 个工作日按照双方核对无误的金额划付至以下指定账户，我司不再另行出具投资划款指令，并承诺在资金划拨日头寸充足，确保费用顺利支付。

如有其他费用类请相应增加

| | | |
|-------|-----|----------------|
| 管理费 | 账户名 | |
| | 账号 | |
| | 开户行 | |
| 托管费 | 账户名 | 证券公司资产管理计划托管收入 |
| | 账号 | |
| | 开户行 | 中国工商银行深圳市 支行 |
| 投资顾问费 | 账户名 | |
| | 账号 | |
| | 开户行 | |
| 销售服务费 | 账户名 | |
| | 账号 | |
| | 开户行 | |

国信证券股份有限公司

2019 年 月 日

附件五：银行联系表

业务联系部门：中国工商银行股份有限公司深圳市分行资产托管与养老金业务部

办公地址：深圳市罗湖区深南东路 5055 号

邮政编码：518001

| 邮件指令联系人名单 | | | | |
|------------|-----------------------|-------------------|--------|--------------------------------|
| 姓名 | 岗位说明 | 电话 1 | 电话 2 | 指令邮箱 |
| 许志宏 | 营运主管 | 0755- 25930689 | | xuzh@sz.icbc.com.cn |
| 卢璞 | 营运主管 | 0755- 25930689 | | lupu@sz.icbc.com.cn |
| 黄静 | 指令主管 | 0755- 25982139 | | huangjing@sz.icbc.com.cn |
| 孙琦 | 对账主管 | 0755- 25626942 | | sunqi@sz.icbc.com.cn |
| 数据 接收邮箱 | sztgsj@sz.icbc.com.cn | | 指令接收邮箱 | sztgzhiling@sz.icbc.com. cn |

附件六：管理人联系表

| 岗 位 | 姓 名 | 联系电话 | 传真电话 | 邮箱 |
|-------|-----|--------------|------|----------------------|
| 营运联系人 | 毕燃 | 075581981109 | | biran@ guosen.com.cn |

附件七：划款指令（样本）

划款指令（样本）

专用表

| | | | | |
|------------------------|---|-----------|------------------|--------|
| 编号:xxxxx | | 201 年 月 日 | | |
| 管 理 人 填 写: | *请于 201 年 月 日 | | 时前支付下列款项: | |
| | *金额大写: | | | |
| | *金额小写: | | | |
| | 付 方 信 息 | *账户名: | 收 方 信 息 | *账户名: |
| | | *账户号: | | *账户号: |
| | | *开户银行: | | *开户银行: |
| | | 大额支付号: | | 大额支付号: |
| | *资金用途 | | | |
| | 备注: *附件共 页 | | 请将划款凭证复印件传真至: | |
| | *管理人在托管人处预留印鉴: | | *经办: | *审批 |
| | | *复核: | | |
| 托 管 人 填 写: | *托管人签收回执（本回执表示托管人已经收到本传真，但并不表示托管人对传真内容明示或默示的认可或处理。） | | | |
| | *签收人: | | *签收时间 | |
| | | | *产品在银行处预留印鉴 | |
| | | | 鉴 | |
| 银 行 填 写: | *处理意见或结果（*附凭证共 页）: | | | |
| | （盖银行业务印鉴） | | | |
| | | | | |

附件八：投资交易监督事项表

| | |
|------|---|
| 投资范围 | <p>本集合计划主要投资于沪深交易所上市股票（含科创板），公募股票型基金等权益类资产；股指期货等商品及金融衍生品类资产；债券、在证券交易所和银行间市场上市的资产支持证券（票据）优先级、债券逆回购、银行存款、公募债券型基金、公募货币市场基金、固定收益类公募商业银行理财产品等固定收益类资产；公募混合型基金等混合类资产。本集合计划可以参与债券正回购交易。</p> <p>债券包括但不限于国债、地方政府债、央行票据、政府支持机构债券、金融债（含次级债、混合资本债、二级资本工具）、公司债（含非公开发行）、企业债、可转换债券（含可分离交易债）、中期票据、短期融资券、超短期融资券、非公开定向债务融资工具、项目收益票据、中小企业集合票据、同业存单等在证券交易所和银行间市场上市交易的标准化债权资产。</p> <p>法律法规或中国证监会允许集合计划投资其他品种的，资产管理人在履行合同变更程序后，可以将其纳入本集合计划的投资范围。</p> |
| 投资限制 | <p>（1）本集合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；</p> <p>（2）本集合计划不得超越资产管理合同约定的投资范围，严禁直接投资商业银行信贷资产；严禁违规为地方政府及其部门提供融资，严禁要求或者接受地方政府及其部门违规提供担保；严禁直接或者间接投资法律、行政法规和国家政策禁止投资的行业或领域（证券市场投资除外）；</p> <p>（3）本集合计划投资于权益类资产、商品及金融衍生品持仓合约价值、固定收益类资产的金额占集合计划总资产的比例均低于 80%；</p> <p>（4）本集合计划的总资产不得超过净资产的 200%；</p> <p>（5）本集合计划投资于同一资产的金额不超过本集合计划资产净值的 25%；</p> <p>（6）本集合计划投资于同一主体发行的信用债的成本合计不超过本集合计划资产总值的 25%；</p> <p>（7）本集合计划投资于资产支持证券（票据）的成本合计不超过本集合计划资产总值的 30%；</p> |

| | |
|--|--|
| | <p>(8) 本集合计划投资于科创板股票的市值不超过集合计划资产净值的 10%;</p> <p>(9) 权益类资产和股指期货净多头持仓合约价值的绝对值(同一交易品种不同月份合约多空轧差, 不同交易品种不得轧差) 合计不超过本集合计划资产净值的 20%;</p> <p>(10) 本集合计划不得投资可交换债券;</p> <p>(11) 资产支持证券(票据)的主体或债项评级不得低于 AA+;</p> <p>(12) 信用债的主体评级、债项评级和担保方评级至少有一项在 AA 以上(含);</p> <p>(13) 本集合计划参与股票、债券、可转换公司债券等证券发行申购时, 所申报的金额不得超过本集合计划的总资产, 且不得超过拟发行公司本次发行的总量;</p> <p>(14) 开放退出期内: 本集合计划资产组合中主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过本集合计划资产净值的 20%; 本集合计划资产组合中 7 个工作日可变现资产的价值不低于本集合计划资产净值的 10%;</p> <p>(15) 法律、行政法规、中国证监会及《集合资产管理合同》规定的其他限制;</p> <p>(16) 本集合计划自成立之日起 6 个月为建仓期, 管理人在建仓期内的投资应当符合本集合计划合同约定的投资范围和本集合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、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, 本集合计划的投资组合比例应符合上述资产配置比例的要求。</p> <p>托管人不对本投资限制第(2)项、第(5)项、第(14)项、第(12)项中担保方评级进行监控。</p> |
|--|--|

附件九：托管账户预留印鉴样本

资产管理人预留印鉴样本：

根据《国信证券鼎信睿元 1 号集合资产管理计划资产管理合同》，我司指定本资产管理计划托管账户我司对应的预留印鉴为我司公章、我司法人授权人个人名章，预留样式为：

单位公章：_____

有权人个人名章：_____



授权单位：（公章）

法定代表人或授权人：（签名或盖章）



日期：_____年 月 日

资产托管人预留印鉴样本：

根据《国信证券鼎信睿元 1 号集合资产管理计划资产管理合同》，我行指定本资产管理计划托管账户我行对应的预留印鉴为托管有权人个人名章，预留样式为：

有权人个人名章：_____



授权单位：（公章）

日期：_____年 月 日

