

# 华鑫鑫国1号集合资产管理计划 资产管理合同

合同编号：HXXG-2019 第2号

二〇一九年十二月

管理人：华鑫证券有限责任公司

托管人：宁波银行股份有限公司

目 录

第一节	前 言	5
第二节	释 义	6
第三节	声明与承诺	11
第四节	当事人的权利与义务	13
第五节	资产管理计划的基本情况	20
第六节	资产管理计划的募集	21
第七节	集合计划的成立与备案	24
第八节	资产管理计划的参与、退出与转让	25
第九节	份额持有人大会及日常机构	32
第十节	资产管理计划份额的登记	33
第十一节	资产管理计划的投资	34
第十二节	投资顾问	41
第十三节	分级安排	42
第十四节	利益冲突及关联交易	43
第十五节	投资经理的指定与变更	44
第十六节	资产管理计划的财产	45
第十七节	投资指令的发送、确认和执行	47
第十八节	越权交易的界定	50
第十九节	资产管理计划财产的估值和会计核算	51
第二十节	集合计划的费用与税收	58
第二十一节	资产管理计划的收益与分配	63
第二十二节	信息披露与报告	64
第二十三节	风险揭示	67
第二十四节	资产管理合同的变更、终止与清算	73
第二十五节	违约责任	76
第二十六节	争议的处理	78
第二十七节	资产管理合同的效力	79
第二十八节	管理人自有资金参与集合计划	80
第二十九节	集合计划的展期	82

---

附件一专用清算账户及资金划拨专用账户 .....	84
附件二管理人关联方名单.....	85
附件三托管人关联方名单.....	88
附件四预留印鉴授权书.....	89
附件五：投资监督事项表.....	90

## 重要提示

特别约定：《华鑫鑫国 1 号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”）以中登电子签名方式签订，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（华鑫鑫国 1 号集合资产管理计划的投资者）作为本合同一方，以中登电子签名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《中华人民共和国电子签名法》、《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，委托人以中登电子签名方式接受电子签名合同（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。

本合同及管理人公告中的业绩报酬计提基准并不是管理人向客户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。在集合计划资产出现极端损失情况下，委托人可能面临无法取得收益乃至投资本金受损的风险。

## 第一节 前言

为规范华鑫鑫国1号集合资产管理计划的运作，明确《华鑫鑫国1号集合资产管理计划资产管理合同》（以下简称“本合同”/“资产管理合同”/“电子合同”）当事人的权利与义务，依照《中华人民共和国合同法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券公司客户资产管理业务规范》（以下简称《业务规范》）、《私募投资基金监督管理暂行办法》（以下简称《私募管理暂行办法》）、《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》）、《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《运作管理规定》）等法律法规、中国证监会、中国证券业协会和中国证券投资基金业协会的有关规定，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《管理办法》、《运作管理规定》、《华鑫鑫国1号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。

管理人对资产管理计划的设立、变更、展期、终止、清算等行为向证券投资基金业协会进行备案，并抄报中国证监会相关派出机构。

证券投资基金业协会接受资产管理计划备案不能免除管理人按照规定真实、准确、完整、及时地披露产品信息的法律责任，也不代表证券投资基金业协会对资产管理计划的合规性、投资价值及投资风险做出保证和判断。投资者应当自行识别产品投资风险并承担投资行为可能出现的损失。

## 第二节 释 义

本合同中除非文意另有所指，下列词语具有如下含义：

集合计划、本集合计划或本计划	指华鑫鑫国 1 号集合资产管理计划。
《集合计划说明书》或《说明书》	指《华鑫鑫国 1 号集合资产管理计划说明书》以及对其所有的有效修订和补充。
《资产管理合同》、本合同	指《华鑫鑫国 1 号集合资产管理计划资产管理合同》及对其的任何有效修订和补充。
《证券投资基金法》	指 2013 年 6 月 1 日起正式实施并经 2015 年 4 月 24 日第十二届全国人民代表大会常务委员会第十四次会议《全国人民代表大会常务委员会关于修改〈中华人民共和国港口法〉等七部法律的决定》修订的《中华人民共和国证券投资基金法》。
《规范》	指 2012 年 10 月 19 日中国证券业协会发布并施行的《证券公司客户资产管理业务规范》（中证协发[2012]206 号）。
《私募管理暂行办法》	指 2014 年 8 月 21 日中国证监会公布并于公布之日起施行的《私募投资基金监督管理暂行办法》。
《暂行规定》	指 2016 年 7 月 14 日中国证监会公布并于 2016 年 7 月 18 日起施行的《证券期货经营机构私募资产管理业务运作管理暂行规定》。
《证券期货投资者适当性管理办法》	指 2016 年 12 月 12 日中国证监会公布并于 2017 年 7 月 1 日起施行的《证券期货投资者适当性管理办法》。
《指导意见》	指 2018 年 4 月 27 日经国务院同意，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、国家外汇管理局日前联合印发的《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 日中国证监会公布并于公布之日起施行的《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》。
《运作管理规定》	指 2018 年 10 月 22 日中国证监会公布并于公布之日起施行的《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（此处不包括香港、澳门特别行政区和台湾地区）。

法律法规	指中国现时有效并公布实施的法律、行政法规、行政规章及规范性文件。
中国证监会	指中国证券监督管理委员会。
委托人或持有人	指签订本合同，委托投资本资产管理计划初始金额不低于【30】万元人民币，且能够识别、判断和承担相应投资风险的自然人、法人或其他组织。
管理人	指华鑫证券有限责任公司，在本合同中有时也简称“华鑫证券”。
托管人	指宁波银行股份有限公司，在本合同中有时也简称“宁波银行”。
投资顾问	指根据本资产管理合同及其他相关协议，为本资产管理计划提供涉及投资策略、投资决策、投资指令、交易安排等方面的建议或意见的机构。
投资者/合格投资者	<p>合格投资者是指具备相应风险识别能力和风险承担能力，符合下列条件的自然人和法人或者其他组织。</p> <p>（一）具有2年以上投资经历，且满足以下条件之一：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。</p> <p>（二）最近1年末净资产不低于1000万元的法人单位。</p> <p>（三）金融管理部门视为合格投资者的其他情形。</p> <p>依法设立并受监管的各类集合投资产品视为单一合格投资者。</p>
销售机构	<p>指华鑫证券有限责任公司及管理人认可并与签署相关协议的具有基金销售资格的其他销售机构。</p> <p>管理人可根据有关法律法规的要求，选择符合要求的销售机构销售本集合计划，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，管理人网站公告后即生效，管理人无需就增加或变更推广机构事宜征求委托人意见或与委托人另行签订协议。</p> <p>销售机构应当依法、合规销售活推介本集合资产管理计划。</p>
销售期	指本集合计划自开始销售到销售完成之间的时间段；管理人应当在推广之日起的60天内完成推广、设立活动，具体时间见有关管理人公告。

注册登记业务	指本集合计划的登记、存管、清算和交收业务，具体内容包括委托人集合计划账户管理、集合计划份额注册登记、清算及集合计划交易确认、建立并保管集合计划持有人名册等。
注册登记机构	指办理本集合计划注册登记业务的机构，本集合计划的注册登记机构为华鑫证券有限责任公司。
集合计划销售期间	指本集合计划开始接受委托人认购参与日至销售期结束日。
集合计划存续期、管理期限	集合计划从成立到集合计划终止的时期。本集合计划管理期限 3 年，集合计划份额管理期限请参见集合计划销售公告或开放公告。
成立日	指本集合计划达到《资产管理合同》约定的成立条件后，管理人确定的本集合计划成立的日期。本计划成立日以管理人公告上记载的具体日期为准。
T 日	指本集合计划的销售机构在规定时间受理委托人参与、退出等业务申请或管理人为集合计划份额办理参与、退出等业务的日期。
T+n 日	指自 T 日起第 n 个工作日（不包含 T 日），n 为自然数，当 n 为负数时表示 T 日前的第 n 个工作日。
股指期货交割日	指股指期货合约到期月份的第三个周五，遇国家法定假日顺延
工作日	指上海证券交易所和深圳证券交易所的正常交易日。
开放期	指管理人可为委托人办理本集合计划参与、退出业务的工作日。
封闭期	指集合计划成立后的封闭时间。封闭期内不办理参与、退出业务。
认购	指在资产管理计划初始销售期间，委托人按照本合同的约定购买本计划份额的行为；
参与	指在资产管理计划开放日，委托人按照本合同的约定参与本计划份额的行为。
退出	指在资产管理计划开放日，委托人按照本合同的约定退出本计划份额的行为。
元	指人民币元。



集合计划收益	指集合计划利息收入、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。
集合计划资产总值	指通过发行计划份额方式募集资金，并依法进行集合资产管理计划投资所形成的资产的价值总和。
集合计划资产净值	指集合计划资产总值减去负债后的净资产值。
单位份额净值	指集合计划资产净值除以总份额所得的每份集合计划资产的价值。
累计份额净值	指单位份额净值与集合计划成立以来单位份额累计分红之和。
集合计划资产估值	指计算评估集合计划资产和负债的价值，以确定集合计划资产净值和每份额净值的方法和过程。
可供分配利润	采用资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。
管理费	指管理人为集合计划提供投资管理服务而向集合计划收取的费用。
管理人业绩报酬	管理人按照资产管理合同规定的计算比例和方式收取的费用。
托管费	指托管人为集合计划提供托管服务而向集合计划收取的费用。
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、注册登记机构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、中国人民银行以及其他机构结算系统发生故障、非因管理人或托管人自身原因导致的技术系统异常事故以及政策、法律、法规、监督规则的修改或监管要求调整等（包括但不限于监管/主管部门或自律组织出台与本合同项下业务相关的任何书面或口头的规则、规范、政策、通知、指令、指引、备忘录、意见或问答等）。

<b>流动性受限资产</b>	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。
<b>家庭金融总资产</b>	指全体家庭成员共同共有的全部金融资产，包括银行存款、股票、债券、基金份额、资产管理计划、银行理财产品、信托计划、保险产品、期货及其他衍生产品等。家庭金融净资产是指家庭金融总资产减去全体家庭成员的全部负债。
<b>资产管理产品</b>	指《指导意见》规定的资产管理产品，包括但不限于人民币或外币形式的银行非保本理财产品，资金信托，证券公司、证券公司子公司、基金管理公司、基金管理子公司、期货公司、期货公司子公司、保险资产管理机构、金融资产投资公司发行的资产管理产品等。

### 第三节 声明与承诺

#### 委托人声明：

签署本集合计划管理合同即表明委托人承认已为满足《指导意见》规定的投资者风险匹配要求：

合格投资者是指具备相应风险识别能力和风险承担能力，符合下列条件的自然人和法人或者其他组织。

(一) 具有 2 年以上投资经历，且满足以下条件之一：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。

(二) 最近 1 年末净资产不低于 1000 万元的法人单位。

(三) 金融管理部门视为合格投资者的其他情形。

投资者不得使用贷款、发行债券等筹集的非自有资金投资资产管理产品。

依法设立并受监管的各类集合投资产品视为单一合格投资者，若本计划投资者为投资产品的，不得通过拆分转让资产管理计划份额或其收益权、为投资者直接或间接提供短期借贷等方式，变相突破合格投资者标准。

(四) 已完全知悉本计划投资顾问就本计划涉及投资策略、投资决策、投资指令、交易安排等方面向管理人提供投资建议及意见，在符合法律法规、监管规定和本合同约定的前提下，管理人参考投资顾问的投资建议及意见进行投资。委托人签署本合同投资本计划将视为认可并接受本计划的上述安排。

#### 委托人承诺：

1. 符合《运作规定》合格投资者的要求，向管理人或销售机构提供的有关投资目的、投资偏好、投资限制、财产收入情况和风险承受能力等基本情况真实、完整、准确、合法，不存在任何虚假陈述、重大遗漏或误导。前述信息资料如发生任何实质性变更，及时书面告知管理人或销售机构。

2. 财产的来源及用途符合国家有关规定，未使用贷款、发行债券等筹集的非自有资金投资资产管理计划，且投资事项符合法律法规的规定及业务决策程序的要求。

3. 已充分理解本合同条款，了解相关权利义务，了解有关法律法规及所投资资产管理计划的风险收益特征，知晓管理人、托管人及相关机构不应为资产管理计划的收益状况或本金不受损失做出任何承诺，了解“卖者尽责，买者自负”的原则，投资于本计划将自行承担投资风险。

4. 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》、《证券期货投资者适当性管理办法》、《非居民金融账户涉税信息尽职调查管理办法》等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明文件及相关账户信息，积极履行反洗钱职责，不借助本业务进行洗钱等违法犯罪活动，配合管理人开展非居民金融账户涉税信息尽职调查，提供因监管机构或国家有权机关调查所需客户账户相关信息。

**管理人承诺：**

1. 在签订本合同前充分向投资者说明了有关法律法规和相关投资工具的运作市场及方式，并充分揭示了相关风险。
2. 已经了解投资者的风险偏好、风险认知能力和承受能力，对投资者的财务状况进行了充分评估。
3. 按照《基金法》恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用委托财产，不保证委托财产一定盈利，也不保证最低收益或本金不受损失，以及限定投资损失金额或者比例。
4. 本合同及管理人公告中的业绩报酬计提基准并不是管理人向客户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。在集合计划资产出现极端损失情况下，委托人可能面临无法取得收益乃至投资本金受损的风险。
5. 管理人保证就委托人提供的客户资料信息保密，除监管机构和国家有权机关调查所用外，不对外使用或泄露。
6. 管理人承诺合法、合规运作资产管理计划，包括但不限于遵守关联关系禁止等法律法规的要求

**托管人承诺：**

1. 按照《基金法》恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则安全保管委托财产，履行信义义务以及本合同约定的其他义务。
2. 根据法律法规、中国证监会及证券投资基金业协会的规定和资产管理合同的约定，对管理人的投资或清算指令等进行监督。
3. 托管人具有中国证监会认可的从事资产托管业务的资格。
4. 根据托管协议的约定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。

#### 第四节 当事人的权利与义务

##### 一、投资者、管理人和托管人的基本情况

###### 投资者

个人填写：

姓名： 证件类型： 证件号码：  
通信地址： 邮政编码：  
联系电话： 移动电话： 电子邮箱：

机构填写：

机构名称： 法定代表人：  
通信地址： 邮政编码：  
代理人姓名： 身份证号码：

联系电话：

签订《华鑫鑫国 1 号集合资产管理计划资产管理合同》的投资者即为本合同的委托人。委托人作为本合同一方，以电子签名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）在电子签名合同数据电文中列示。

本资产管理计划份额均等，每份份额具有同等的合法权益。

###### 管理人

管理人名称：华鑫证券有限责任公司

法定代表人：俞洋

住所：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 28 层 A01、B01（b）单元

联系地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 28 层 A01、B01（b）单元

联系人：王毓霆

联系电话：021-54967779

传真：0755-83025029

###### 托管人

托管人名称：宁波银行股份有限公司

负责人：陆华裕

住所：浙江省宁波市鄞州区宁东路345号

联系地址：浙江省宁波市鄞州区宁东路345号

联系人：丁慧

联系电话：021-31158281

## 二、委托人的权利和义务

### （一）委托人的权利

- 1、分享资产管理计划财产收益。
- 2、按照法律法规及本合同约定的时间，通过管理人网站查询等方式知悉有关集合计划投资运作的信息，包括集合计划的资产配置、投资比例、损益状况等信息披露资料。
- 3、按照本合同及《说明书》的约定，参与、退出和转让资产管理计划份额。
- 4、按持有份额取得分配清算后的剩余资产管理计划财产。
- 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、监督管理人、托管人履行投资管理及托管义务的情况
- 7、根据本合同的规定，参加或申请召集资产管理计划份额持有人大会，行使相关职权，本计划不设置份额持有人大会的除外。
- 8、法律、行政法规、中国证监会的有关规定及本合同、《说明书》约定的其他权利。

### （二）委托人的义务

- 1、委托人应认真阅读本合同及《说明书》，并保证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》约定支付资产管理计划份额的参与款项，承担资产管理合同约定的管理费、业绩报酬、托管费、审计费、税费等合理费用。
- 3、按本合同及《说明书》约定承担集合计划的投资损失。
- 4、接受合格投资者认定程序，如实填写风险识别能力和风险承受能力问卷，如实提供资金来源、金融资产、收入及负债情况，并对其真实性、准确性和完整性负责，签署合格投资者相关文件。
- 5、除公募资产管理产品外，以合伙企业、契约等非法人形式直接或者间接投资于资产管理计

划的，应向管理人充分披露实际投资者和最终资金来源。

6、委托人应向管理人或资产管理计划销售机构提供法律法规规定的信息资料及身份证明文件，配合管理人或其销售机构完成投资者适当性管理、非居民金融账户涉税信息尽职调查、反洗钱等监管规定的工作。委托人为法人或者依法成立的其他组织并用筹集的资金参与资产管理计划的，应当提供合法筹集资金的证明文件，以协助销售机构开展反洗钱工作。

7、认真阅读并签署风险揭示书。

8、在持有的资产管理计划份额范围内，承担资产管理计划亏损或者终止的有限责任。

9、不得违规转让其所拥有的计划份额。

10、不得违反本合同约定干涉管理人的投资行为和托管人的托管行为。

11、不得从事任何有损集合计划及其他委托人、管理人管理的其他资产及托管人托管的其他资产合法权益的活动。

12、保守商业秘密，不得泄露资产管理计划的投资计划、投资意向等；不得利用资产管理计划相关信息进行内幕交易或者其他不当、违法的证券期货业务活动。

13、委托人应当采取有效措施妥善保管与电子签名合同有关的信息和资料，防止他人以委托人名义实施电子签名行为。

14、接受合格投资者认定程序，如实填写风险识别能力和风险承担能力问卷，如实提供资金来源、金融资产、收入及负债情况，并对其真实性、准确性和完整性负责，签署合格投资者相关文件。

15、法律、行政法规、中国证监会的有关规定及本合同、《说明书》约定的其他义务。

### 三、管理人的权利和义务

#### （一）管理人的权利

1、根据本合同及《说明书》的约定，独立管理和运用资产管理计划财产。

2、根据本合同及《说明书》的约定，及时、足额获得管理人管理费用及业绩报酬。

3、按照本合同及《说明书》的约定，停止办理集合计划的参与，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、按照法律法规和本合同及《说明书》的约定，监督托管人，对于托管人违反资产管理合同或有关法律法规规定、对资产管理计划财产及其他当事人的利益造成重大损失的，应当及时采取措施制止，并报告中国证监会相关派出机构及证券投资基金业协会。

6、按照法律法规和本合同及《说明书》的约定，行使因资产管理计划财产投资所产生的权利。

7、自行提供或者委托经中国证监会、证券投资基金业协会认定的服务机构为资产管理计划提供募集、份额登记、估值与核算、信息技术系统等服务，并对其行为进行必要的监督和检查。

8、以管理人的名义，代表资产管理计划行使投资过程中产生的权属登记等权利。

9、集合计划资产受到损害时，向有关责任人追究法律责任。

10、有权获得投资顾问（如有）的投资建议服务，并对其提供的投资建议有审议、修改和最终的决策权。

11、法律、行政法规、中国证监会有关规定及本合同、《说明书》约定的其他权利。

## （二）管理人的义务

1、按照证券投资基金业协会要求报送资产管理计划产品运行信息。

2、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，配备足够的具有专业能力的人员进行投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作资产管理计划资产，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。

3、依法募集资金，自行或委托符合监管要求办理产品份额的发售和登记事宜。

4、办理资产管理计划的销售、登记备案或者注册手续。

5、对投资者的风险识别能力和风险承受能力进行评估，向符合法律法规规定的合格投资者非公开募集资金

6、制作风险揭示书，向投资者充分揭示相关风险。

7、建立健全的内部管理制度，保证本资产管理计划财产与其管理的其他资产管理计划财产、管理人的固有财产相互独立，对所管理的不同财产分别管理，分别记账，分别投资；聘请投资顾问的，应制定相应利益冲突防范机制。

8、除依据法律法规、本合同、《说明书》的约定及其他有关规定外，不得为管理人及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作资产管理计划财产。

9、保守商业秘密，不得泄露资产管理计划的投资计划、投资意向等，依法依规提供信息的除外。

10、公平对待所管理的不同财产，不得从事任何有损资产管理计划财产及其他当事人利益的活动。

11、除规定情形或符合规定条件外，不得为管理人、托管人及其关联方提供融资。

12、按照资产管理合同的约定确定收益分配方案，及时向委托人分配收益。

13、按照资产管理合同约定，进行资产估值等会计核算并编制产品财务会计报告。



- 14、聘请具有证券相关业务资格的会计师事务所对年度财务会计报告进行审计
- 15、依法计算并披露产品净值或者投资收益情况，确定参与、退出价格。
- 16、办理与资产管理计划业务有关的信息披露事项。
- 17、根据法律法规与资产管理合同的规定，编制向投资者披露的资产管理计划季度、年度等定期报告，向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。
- 18、以管理人名义，代表委托人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为。
- 19、在兑付受托资金及收益时，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。
- 20、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，接受投资者和托管人的监督。
- 21、不得以受托管理的资产管理计划份额进行质押融资，放大杠杆。
- 22、对非标准化资产和相关交易主体进行充分的尽职调查，形成书面工作底稿，并制作尽职调查报告
- 23、依法对托管人、销售机构的行为进行监督，如发现托管人、代理销售机构违反法律、行政法规和中国证监会的规定，或者违反托管协议、代理销售协议的，应当予以制止。
- 24、按规定出具资产管理报告，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。
- 25、按照法律法规、中国证监会的有关规定和《集合资产管理合同》及《说明书》的约定，及时向申请退出集合计划的委托人支付退出款项。
- 26、按照法律、行政法规和中国证监会的规定，保存资产管理计划的会计账册，妥善保存有关的合同、协议、销售文件、委托人资料、交易记录等文件、资料和数据，保存期限自资产管理计划终止之日起不得少于20年
- 27、在集合计划到期或其他原因解散时，组织并参加资产管理计划财产清算小组，与托管人一起妥善处理有关保管、清理、估价、变现、分配和委托人资金的返还事宜。
- 28、面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会相关派出机构、证券投资基金业协会并及时向委托人和托管人报告。
- 29、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。
- 30、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。

31、法律、行政法规、中国证监会的有关规定、本合同及托管协议约定的其他义务。

#### 四、托管人的权利和义务

##### (一) 托管人的权利

- 1、按照本合同和托管协议的约定依法托管集合计划的资产。
- 2、按照本合同和托管协议的约定按时、足额收取托管费。
- 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、托管协议约定的，有权要求其改正；未能改正的，应当拒绝执行。
- 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及本合同《托管协议》约定的其他权利。

##### (二) 托管人的义务

- 1、依本合同及托管协议的约定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、托管协议的约定，不得擅自用或处分集合计划资产，不得为托管人及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管资产管理计划财产。
- 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，对所托管的不同财产分别设置账户，确保资产管理计划财产的完整与独立，依法保护委托人的资产权益。
- 4、根据本合同及托管协议的约定，安全保管集合计划资产，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、根据本合同及托管协议的约定定期核对资产管理业务资产情况。
- 6、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及中国证券投资基金业协会。
- 7、根据本合同及托管协议的约定复核管理人计算的集合计划的资产净值。
- 8、保守集合计划的商业秘密，在集合计划有关信息对外披露前予以保密，不向他人泄露（法律法规、中国证监会另有规定或有权机关要求、向所聘请的审计、法律等外部专业顾问提供、资产管理合同及托管协议等另有约定的除外）。
- 9、按照本合同及托管协议的约定出具集合计划托管业务有关的信息披露事项。
- 10、根据相关法律法规和资产管理合同约定，复核管理人编制的资产管理计划财产的定期报告，并出具书面意见。
- 11、编制托管年度报告，并向证券投资基金业协会备案，抄报中国证监会相关派出机构
- 12、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 and

数据，保存期不少于二十年。

13、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。

14、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。

15、因托管人过错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。

17、投资于《管理办法》第三十七条第（五）项规定资产时，准确、合理界定安全保管资产管理计划财产、监督管理人投资运作等职责。

18、公平对待所托管的不同财产，不得从事任何有损资产管理计划财产及其他当事人利益的活动。

19、法律法规、中国证监会有关规定及本合同、《托管协议》约定的其他义务。

## 第五节 资产管理计划的基本情况

一、名称：华鑫鑫国 1 号集合资产管理计划。

二、类型：【开放式固定收益类】集合资产管理计划。

### 三、目标规模

本集合计划在销售期的募集资金（不含销售期利息）不低于 1,000 万元（含本数），募集规模上限以管理人公告为准；存续期规模上限为 10 亿元（含本数）；本集合计划委托人合计数为 2 人（含）以上 200 人（含）以下。

### 四、投资目标

在严格控制风险的前提下，通过科学合理的资产配置和投资管理，以稳健收益为目标，为资产委托人提供稳定的投资回报。

### 五、投资范围和投资组合设计

详见本合同第十一节。

### 六、管理期限

本集合计划管理期限自成立之日起【三年】，符合一定条件下可展期（具体参见第二十九节展期条款）。

管理人可根据本集合实际运作情况，经与托管人协商一致，可以提前终止本集合计划，提前终止的，管理人应在管理人网站公告。若本集合计划管理权限届满或终止时投资标的未全部变现的，集合计划自动延期至投资标的全部变现之日，具体以管理人公告为准。

### 七、集合计划份额面值

本集合计划份额的面值为人民币 1.0000 元。本计划设定为均等份额，每份计划份额具有同等的合法权益。

### 九、本集合计划的产品风险等级

本资产管理计划属于【中低风险 R2】风险投资品种，适合风险识别、评估、承受能力【普通投资者的 C2-C5 及专业投资者】的合格投资者

### 十、本集合计划的投资顾问

本计划无投资顾问。

### 十一、分级安排

本计划不分级。

## 第六节资产管理计划的募集

### 一、销售期、封闭期、开放期

(一) 销售期: 管理人可视情况决定本集合计划的销售开始和终止时间, 本集合计划销售期自销售启动之日起, 不超过【60】日, 具体时间安排详见管理人网站公告。管理人将提前公告集合计划份额的业绩报酬计提基准、起息日、到期日、开放期等要素。

(二) 开放期和封闭期:

#### 1、开放期

本集合计划原则上定期开放, 本计划成立之日起 6 个月为封闭期, 6 个月封闭期后的自然月的 10 日、11 日为首个开放参与期, 上一个产品周期的到期日(T 日)为开放日的第一日, 之后每满 6 个月开放一次, 开放期 2 个工作日(遇法定节假日顺延)。开放期可办理参与、退出业务, 办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所正常工作日的交易时间, 遇法定节假日顺延。具体开放期以管理人公告为准, 集合计划按规定限制或暂停退出的情况除外。

管理人有权根据实际情况将开放期顺延, 但管理人应提前 1 个工作日告知委托人和托管人具体的开放时间。业务办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常工作日的交易时间。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%, 且管理人应当确保集合资产管理计划开放退出期内, 资产组合中 7 个工作日内可变现资产的价值不低于本集合计划资产净值的 10%, 按规定限制或暂停退出的情况除外。

#### 2、封闭期

本集合计划除开放期和临时开放日以外的均为封闭期, 封闭期内不得办理参与、退出业务。

### 二、本集合计划的风险收益特征及适合销售对象

本资产管理计划属于【中低风险 R2】风险投资品种, 适合风险识别、评估、承受能力【普通投资者的 C2-C5 及专业投资者】的合格投资者。

**委托人在此声明: 签署本集合计划管理合同即表明委托人承认己为满足《指导意见》规定的投资者风险匹配要求:**

合格投资者是指具备相应风险识别能力和风险承担能力, 符合下列条件的自然人和法人或者其他组织。

(一) 具有 2 年以上投资经历, 且满足以下条件之一: 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。

(二) 最近 1 年末净资产不低于 1000 万元的法人单位。

(三) 金融管理部门视为合格投资者的其他情形。

投资者不得使用贷款、发行债券等筹集的非自有资金投资资产管理产品。

依法设立并受监管的各类集合投资产品视为单一合格投资者, 若本计划投资者为投资产品的,

不得通过拆分转让资产管理计划份额或其收益权、为投资者直接或间接提供短期借贷等方式，变相突破合格投资者标准。

### 三、参与本集合计划的最低金额

委托人首次参与的最低金额为人民币【30】万元，追加参与的最低金额为人民币【1】万元，具体参与最低金额以管理人公告为准。

本集合计划存续期间，若法律法规或监管机构下调合格投资者投资于单只混合类产品的金额下限，管理人有权根据监管要求对委托人首次参与本集合计划的最低金额进行变更。

### 四、本集合计划的销售

(一) 销售机构：华鑫证券有限责任公司以及管理人认可并与其签署相关协议的的其他销售机构。

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，管理人网站公告后即生效，管理人无需就增加或变更销售机构事宜征求委托人意见或与委托人另行签订协议。

#### (二) 销售方式

本集合计划将通过销售机构进行销售。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文件，置备于销售机构营业场所。本计划应当向合格投资者销售，合格投资者累计不得超过 200 人。销售机构应当了解客户的投资需求和风险偏好，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。禁止向投资者宣传资产管理计划预期收益率、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、中国证券投资基金业协会、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批准或者备案信息、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，但不得向合格投资者之外的单位和个人募集资金，不得通过广播、电视、报刊、互联网及其他公共传播媒体或者讲座、报告会、分析会等方式向不特定对象销售本集合计划。

### 五、本集合计划的各项费用

#### (一) 参与费率：

本集合计划不收取参与费，即参与费率为0。

#### (二) 管理费：

本集合计划的管理费率为【0.6】%/年，管理费由集合计划财产承担。集合计划管理费每日计

提，按自然季支付。经管理人与托管人双方核对无误后，由托管人根据管理人划款指令于次季度首日起5个工作日内从集合计划资产中一次性划款给管理人。具体计算公式详见本合同第二十章。

(三) 托管费率：

本集合计划的托管费率为【0.01】%/年，托管费由集合计划财产承担。

集合计划于托管费每日计提，按自然季支付。经管理人与托管人双方核对无误后，由托管人根据管理人划款指令于次季度首日起5个工作日内从集合计划资产中一次性划款给托管人。具体计算方式详见本合同第二十章。

(四) 投资顾问费：

详见本合同第二十章集合计划的费用与税收。

(五) 业绩报酬：

详见本合同第二十章集合计划的费用与税收。

(六) 退出费率：

本集合计划不收取退出费，即退出费率为0。

(七) 其他费用

其他费用及具体计算方法详见本合同第二十章集合计划的费用与税收。

## 六、募集结算专用账户披露渠道和查询方式

本计划募集结算专用账户将以账户信息告知书的方式向投资者进行披露，投资者可在管理人处查询；销售机构委托募集账户（如有）由销售机构向投资者进行披露，投资者可在销售机构处查询。

## 第七节 集合计划的成立与备案

### 一、集合计划成立的条件和日期

集合计划的参与资金总额不低于1,000万元人民币且其委托人的人数为2人（含）以上且不超过200人，并募集金额缴足之日起10个工作日内，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，管理人通过管理人网站宣布本集合计划成立。

管理人在本集合计划成立之日起5个工作日内，将资产管理合同、投资者名单与认购金额、验资报告或者资产缴付证明等材料报送证券投资基金业协会备案，并抄送中国证监会相关派出机构。

本集合计划完成备案前，委托人的参与资金不得开展投资活动，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。

### 二、集合计划设立失败

集合计划销售期结束，在集合计划规模低于人民币1,000万元或者委托人人数低于2人，则集合计划设立失败，管理人承担集合计划全部销售费用，并将已认购资金及按照银行同期活期利率计算的利息在销售期结束后30个工作日内退还集合计划委托人，各方互不承担其他责任。利息具体金额以注册登记机构确认结果为准。

### 三、集合计划开始运作的条件和日期

#### （一）条件

自本合同生效后且集合计划公告成立即开始运作。

#### （二）日期

本集合计划成立时间以成立公告为准。



## 第八节 资产管理计划的参与、退出与转让

### 一、集合计划的参与

#### (一) 参与的办理时间

##### 1、销售期参与

本集合计划销售期指集合计划接受委托人认购参与日至销售期结束日。销售期具体时间见管理人网站公告。

在销售期内，投资者在销售机构的工作日内可以参与本集合计划。

销售期内，管理人有权根据集合计划资金募集情况，决定是否提前结束销售期，并采用“时间优先，时间相同情况下金额优先”的原则避免出现募集份额超过集合计划目标规模上限或集合计划委托人数超过200人的情况。若管理人决定提前结束销售期，应提前1个工作日通知销售机构和注册登记机构。

管理人在【T+1】日对委托人参与申请的有效性进行确认，委托人可在集合计划正式成立后到原销售网点查询成交确认结果。

##### 2、开放期参与

本集合计划原则上定期开放，本计划成立之日起6个月为封闭期，6个月封闭期后的自然月的10日、11日为首个开放参与期，上一个产品周期的到期日（T日）为开放日的第一日，之后每满6个月开放一次，开放期2个工作日（遇法定节假日顺延）。开放期可办理参与、退出业务，办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所正常工作日的交易时间，遇法定节假日顺延。具体开放期以管理人公告为准，集合计划按规定限制或暂停退出的情况除外。

例如，本计划的成立日为2019年7月18日，则2020年1月10日为首个封闭期的到期日，封闭期为2019年7月18日至2020年1月9日。下个封闭期的开放日为2020年1月10日和2020年1月13日，下期封闭期的到期日为2020年7月10日，以此类推。

集合计划每个计息周期为：（1）集合计划成立日（含）至到期日（含）的期间；（2）集合计划每个开放日的次一个工作日（含）至集合计划下一个到期日（含）的期间，以此类推。

当发生本合同变更或因客观原因导致自有资金参与本集合计划被动超过法律法规和本合同约定的比例等或管理人认为必要时可提前1-5个工作日通过指定网站公告增加集合计划份额的临时开放日。

#### (二) 参与的原则

1、合格投资者资格要求请详见本合同第三节“承诺与说明”中的相关约定。

2、委托人采用电子签名方式的，需到集合计划销售机构指定营业网点或登陆销售机构指定网络系统签署电子合同。合同在管理人、托管人、委托人三方完成签署，且委托人按合同约定将

参与资金划入指定账户并经注册登记机构确认有效后生效。委托人应当如实提供与签署合同相关的信息和资料，管理人和其他销售机构应当按照有关规定对委托人提供的信息和资料进行审查并如实记录。委托人保证其所提供的信息及资料真实、准确、完整，否则应当承担由此造成的一切后果。

3、“金额参与”原则，即参与时以金额申请。本集合计划的单个委托人首次参与的最低金额为30万元，超过部分按1万及1万整数倍递增，追加参与的最低金额为1万元，超过部分按1万整数倍递增。首次参与指提出参与申请的投资者在参与之前未持有本计划份额的情形。

4、在销售期内，委托人以集合计划的面值（1.0000元/份额）参与；开放期内，委托人参与价格为开放期受理申请当日集合计划份额的单位净值。

5、委托人可以多次参与本集合计划，当日参与申请只能在当日交易时间结束之前撤销。

6、如本集合计划在销售期，销售机构当日的参与申请全部确认后使得本集合计划的募集规模超过募集上限或客户数达到200户以上，则对该日有效参与申请采用“时间优先，时间相同情况下金额优先”的原则给与部分确认，未确认部分的参与款项退还给委托人；如本集合计划在任一开放期，销售机构当日的参与申请全部确认后规模超过每次开放公告确定的规模上限或客户数达到200户以上，则对该日有效参与申请采用“时间优先，时间相同情况下金额优先”的原则给与部分确认，未确认部分的参与款项退还给委托人。

7、委托人的参与资金在集合计划成立之前所产生的利息折成集合计划份额，归委托人所有，具体份额以注册与过户登记人的记录为准。

### （三）参与的程序和确认

#### 1、参与程序和确认

（1）投资者按销售机构指定营业网点的具体安排，在交易时间段内办理。

（2）投资者应开设销售机构认可的交易账户，并在交易账户备足参与资金；若资金账户内参与资金不足，销售机构不受理该笔参与申请。

（3）投资者签署本合同后，方可申请参与集合计划。参与申请经管理人确认有效后，构成本合同的有效组成部分。

（4）投资者参与申请确认后，其参与申请和参与资金不得撤销。

（5）投资者销售期参与的，可于计划成立后2个工作日到办理参与的营业网点、原销售机构指定网络系统查询参与确认情况；投资者开放期参与的，可于申请日后2个工作日到办理参与的网点、原销售机构指定网络系统查询参与确认情况。确认无效的申请，销售机构将退还委托人已交付的参与款项本金（不包括利息）。

## 2、暂停参与的情形

如出现如下情形，集合计划管理人可以拒绝或暂停集合计划委托人的参与申请：

- (1) 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作。
- (2) 管理人认为本集合计划出现或可能出现超额募集情况。
- (3) 证券交易场所在交易时间非正常停市，导致无法计算当日的集合计划资产净值。
- (4) 管理人认为集合计划资产规模过大，可能对集合计划业绩产生负面影响，从而损害现有集合计划委托人的利益。
- (5) 集合计划管理人、集合计划托管人或注册登记机构的技术保障或人员支持等不充分。
- (6) 销售机构对委托人资金来源表示疑虑，委托人不能提供充分证明的。
- (7) 集合计划管理人认为会有损于现有集合计划委托人利益。
- (8) 其他管理人认为有必要拒绝或暂停参与申请的情形。
- (9) 法律法规规定或中国证监会认定的其它可暂停参与的情形。

发生上述(1)到(5)项、第(7)项暂停参与情形时，集合计划管理人应当通过管理人网站报告委托人。

### (四) 参与费及参与份额的计算

#### 1、参与费率：

本集合计划不收取参与费，即参与费率为0。

#### 2、参与份额的计算方法：

##### (1) 销售期参与份额的计算：

参与份额 = (参与金额 + 销售期利息) ÷ 集合计划份额面值

集合计划份额面值为1.0000元。委托人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集合计划资产的损益。

如本集合计划在销售期内参与的客户数达到200户，或达到规模上限的，可提前终止销售期。管理人提前结束销售的，应通知各销售网点结束产品认购，同时公告销售期提前结束。

本集合计划管理人在销售期内使用“时间优先，时间相同情况下金额优先”方法对集合计划参与总规模实行限量控制。

#### 具体计算参见例1。

例1：某委托人投资1,000,000元参与本集合计划，假设销售期产生利息50元，则该委托人最终可得到的集合计划份额计算如下：

参与份额 = (1,000,000 + 50) / 1.00 = 1,000,050 份

## (2) 开放期参与份额的计算

参与份额=参与金额÷受理申请当日(T日)集合计划份额单位净值

注：委托人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集合计划资产的损益；多笔参与时，按上述公式进行逐笔计算。本集合计划管理人在开放期内使用“时间优先，时间相同情况下金额优先”方法对集合计划参与总规模实行限量控制。

## 二、集合计划的退出

### (一) 退出的办理时间

本集合计划采用“预约退出”原则，委托人只有在退出预约日进行预约退出的份额才能在本周期的到期日(T日)自动退出

### (二) 退出的原则

1、本集合计划采用份额退出的方式，即退出以份额申请。

2、本集合计划采用“未知价”原则，即退出集合计划的价格以退出日(T日)集合计划份额单位净值为基准进行计算。

3、本集合计划采用“预约退出”原则，委托人只有在退出预约日进行预约退出的份额才能、在本周期的到期日(T日)自动退出。对于未做预约退出申请的份额，根据管理人公告自动默认继续参与本集合计划。

4、当日的预约退出申请可以且只能在当日交易时间结束之前撤销。

5、委托人部分退出集合计划份额时，如其该笔申请退出后在该销售机构剩余的集合计划金额低于 30 万元时，则管理人自动将该委托人在该销售机构的全部份额退出给委托人。当委托人持有的计划份额资产净值高于【30】万元时，委托人可以选择全部或部分退出资产管理计划份额，选择部分退出资产管理计划份额的，委托人退出后持有的计划资产不得低于【30】万元，低于【30】万元时，管理人应将该委托人所持份额做强制退出处理。

### (三) 退出的程序和确认

1、预约退出申请的提出：退出需要在各期产品到期日前预约申请，否则将根据管理人公告自动参与下期产品。每期产品的到期日(T日)之前第6个工作日和第5个工作日为预约退出日(即T-6日、T-5日)，对于已在退出预约日(即T-6日、T-5日)办理退出预约申请成功的份额，将自动办理退出业务，委托人无需在T日再次办理退出申请。如果委托人持有到期而未申请退出，且到期时没有滚动发行相同投资期限的下期产品，则管理人为委托人办理退出。

委托人必须根据集合计划销售机构规定的手续，向集合计划销售机构提出预约退出的申请。委托人在提交预约退出申请时，其在销售机构必须有足够可用的集合计划份额余额，否则所提交

的预约退出的申请无效而不予成交。

因销售机构系统原因无法实现预约退出的情况，则由委托人于到期日（T 日）申请退出。销售机构在 T 日规定时间受理委托人申请，管理人在 T+1 日内对该申请的有效性进行确认，委托人可在 T+2 日向原销售网点、原销售机构指定网络系统查询预约退出确认情况。因销售机构系统原因无法实现预约退出的，管理人有权拒绝“未通过预约赎回申请退出的份额”（即在 T 日才申请退出的份额）的申请。

2、预约退出申请的确认：销售机构在退出预约日（即 T-6 日、T-5 日）规定时间受理委托人申请，管理人在退出预约日后 1 日内对该申请的有效性进行确认，委托人可在退出预约日后第 2 日向原销售网点、原销售机构指定网络系统查询预约退出确认情况。

3、退出款项的划付：退出款项将在 T+4 日内从托管账户划出，经销售机构划往委托人指定资金账户，但发生巨额退出情形时，按巨额退出情形的相关规定处理。如集合计划出现本合同第十九节所述暂停估值的情形，管理人与托管人协商后，可以将划拨日期相应顺延。

#### （四）退出费及退出金额的计算

本集合计划不收取退出费，即退出费率为 0。

本集合计划退出时以退出日（T 日）计划份额单位净值作为计价基准，退出金额的计算公式如下：

退出总额=T 日集合计划份额单位净值\*退出份额

退出费=退出总额\*退出费率

退出金额=退出总额-退出费-业绩报酬（如有）

上述计算结果均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损益。

#### （五）单个委托人大额退出的认定及预约申请

本集合计划未设单个委托人大额退出的限制条件。

#### （六）巨额退出的认定和处理方式

##### 1、巨额退出的认定

本集合计划开放期的首个开放日，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后的余额）超过上一工作日计划总份额数的 10%时，即为巨额退出。

##### 2、巨额退出的顺序、价格确定和款项支付

发生巨额退出时，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、部分延期退出或暂停退出。

(1) 全额退出：当管理人认为有足够能力支付委托人的全额退出申请时，按正常退出程序办理。

(2) 超额部分延期退出：当管理人认为全额支付委托人退出申请有困难或认为全额支付委托人退出申请可能会对集合计划资产净值造成较大波动时，管理人在当日接受退出比例不低于上一日本集合计划总份额 10%的前提下，对其余退出申请可延期予以办理。管理人对单个委托人的退出申请，应当按照其退出申请份额占当日本集合计划退出申请总份额的比例，确定该委托人当日办理的退出申请份额。委托人在申请退出时，可以选择将当日未获办理的退出申请份额予以撤销。委托人选择延期退出的，管理人对当日未办理的退出申请份额，延迟至下一工作日办理，退出价格为下一工作日的集合计划单位净值。转入下一个工作日的退出申请不享有优先权，以此类推，直到全部退出为止。

(3) 暂停退出：连续两个或以上开放日发生巨额退出的，管理人可以暂停接受退出申请；已经接受的退出申请可以延缓支付退出款项。暂停和延缓期限不得超过 20 个工作日。

### 3、告知客户的方式

当发生巨额退出并采用超额部分延期退出或者发生暂停退出情形时，管理人应及时将有关情况向管理人住所地中国证监会派出机构报告，并通过管理人网站通告委托人，说明有关处理方法。

(七) 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作。
- 2、证券交易场所或银行间债券市场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、发生本合同规定的其他暂停估值情况。
- 4、退出开放期内发生连续巨额退出的情形。
- 5、法律法规规定、本合同规定或中国证监会认定的其它情形。

## 三、集合计划的转让

### (一) 集合计划份额的转让

本计划成立后，委托人可以按照规定申请份额转让事宜。

申请份额转让事宜之后，委托人、销售机构的客户之间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，并按规定办理份额变更登记手续。但转让后每个委托人持有集合计划金额不得少于30万元，委托人合计不超过200人。受让方应符合本合同约定的合格投资者

要求，受让方首次参与集合计划的，应先与管理人、托管人签订集合资产管理合同。

### （二）集合计划的非交易过户

非交易过户是指不采用参与、退出等集合计划交易方式，将一定数量的集合计划份额按照一定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。

注册登记机构只受理继承、捐赠、以及其他形式资产分割或转移等情况下的非交易过户。具体业务规则以注册登记机构业务规则为准。

委托人办理因上述原因引起的非交易过户须提供注册登记机构要求的相关证明文件等材料到注册登记机构处办理。对于符合条件的非交易过户申请自申请受理日起2个月内办理，并按注册登记机构规定的标准收费。

### （三）集合计划的冻结

集合计划份额冻结、解冻的业务，由注册登记机构办理。

集合计划注册登记机构只受理国家有关机关依法要求的集合计划份额的冻结与解冻以及注册登记机构认可的其他情况的集合计划份额的冻结与解冻。

当集合计划份额处于冻结状态时，集合计划注册登记机构或其他相关机构有权拒绝集合计划份额的退出、非交易过户等业务的申请。

## 四、管理人应定期将资产管理计划投资者变更情况报送证券投资基金业协会。

## 第九节 份额持有人大会及日常机构

一、所有当事人一致同意，本计划不设置份额持有人大会且不设置份额持有人大会日常机构，即当事人签署本集合计划则视为同意不设置份额持有人大会。



## 第十节 资产管理计划份额的登记

一、本资产管理计划份额的注册登记业务指本资产管理计划的登记、存管、清算和交收业务，具体内容包括委托人账户管理、份额注册登记、清算及交易确认、收益分配、建立并保管资产管理计划客户资料表等。

二、本资产管理计划的注册登记业务由华鑫证券有限责任公司办理。

### 三、注册登记机构的职责

(一) 建立和保管委托人账户资料、交易资料、资产管理计划客户资料表等；

(二) 配备足够的专业人员办理本资产管理计划的注册登记业务；

(三) 严格按照法律法规和本资产管理合同规定的条件办理本资产管理计划的注册登记业务；

(四) 严格按照法律法规和本资产管理合同规定计算业绩报酬；

(五) 保管资产管理计划客户资料表及相关的各类业务记录，保存期限自集合资产管理计划账户销户之日起 20 年以上；

(六) 对委托人的账户信息负有保密义务，因违反该保密义务对委托人、管理人、托管人或资产管理计划带来的损失，须承担相应的赔偿责任，但司法强制检查及按照法律法规的规定进行披露的情形除外；

(七) 按照本资产管理合同，为委托人办理非交易过户等业务，提供资产管理计划收益分配等其他必要的服务；

(八) 在法律法规允许的范围内，制定和调整注册登记业务的相关规则；

(九) 法律法规规定及本合同约定的其他职责。

四、全体资产管理计划份额持有人同意管理人、份额登记机构或其他份额登记义务人将集合资产管理计划投资者名称、身份信息以及集合资产管理计划份额明细等数据备份至中国证监会认定的机构。

## 第十一节 资产管理计划的投资

### 一、投资目标

在严格控制风险的前提下，通过科学合理的资产配置和投资管理，以稳健收益为目标，为资产委托人提供稳定的投资回报。上述投资目标仅供委托人参考，不构成管理人保证委托人委托资产本金不受损失或取得投资收益的承诺。

### 二、投资理念

本集合计划坚持以价值投资为基础，在管理项目风险的基础上寻求持续稳健的投资收益。

### 三、投资策略

#### 1、债券投资策略

本计划将在保持债券组合低波动性的前提下，综合运用多种策略参与市场所提供的投资机会，以期为委托人获取稳健的收益。

##### (1) 久期配置策略

本计划将在分析中长期经济变化趋势的基础上，预测未来一段时间内利率可能的走向，以此来决定组合久期的长短。预期利率下降时延长组合久期，以获得因债券价格上涨而带来的资本利得；预期利率上升时缩短组合久期，以降低或规避债券价格下跌所带来的风险。

##### (2) 收益率曲线策略

在确定组合久期后，采用收益率曲线分析模型对不同期限债券的风险收益特征进行评估，并根据对收益率曲线形状变化进行预测，采用子弹型策略、哑铃型策略或梯形策略，来决定本计划资产在长、中、短期债券间的配置比例。

##### (3) 债券类属配置策略

根据国债、金融债、企业债等不同债券间的相对投资价值分析，增持价值被相对低估的债券板块，借以取得较高收益。

##### (4) 骑乘策略

通过分析收益率曲线各期限段的利差情况，买入收益率曲线最陡峭处所对应的债券，随着本计划持有债券时间的延长，债券的剩余期限将缩短，到期收益率将下降，从而获得资本利得收入。

##### (5) 信用债投资策略

本计划根据对宏观经济运行周期的研究，综合分析公司债、企业债、短期融资券等发行人所处行业的发展前景和状况、发行人所处的市场地位、财务状况、管理水平等因素后，结合具体发行契约，获取利差的变动会带来趋势性的信用产品投资机会。

#### 2、现金管理投资策略

本计划以严谨的市场价值分析为基础，采用稳健的投资组合策略，通过对现金管理类金融品种的组合操作，在保持本金的安全性与资产流动性的同时，追求稳定的当期收益。通过合理有效分配本计划的现金流，保持投资组合的流动性，满足本计划投资运作的要求。

#### 四、建仓安排

本集合计划的建仓期自产品成立之日起不得超过6个月。

管理人在建仓期的投资活动，应当符合本集合计划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。

建仓期结束后，本集合计划的资产组合应当符合法律、行政法规、中国证监会规定和合同约定的投向和比例。

#### 五、投资范围和投资组合设计

##### （一）投资范围

固定收益类资产包括国债、央行票据、地方政府债、政策性金融债，政府支持机构债、非政策性金融债、公司债（含非公开发行的公司债）、企业债、项目收益债、可转换债、可分离交易可转债、可交换债、短期融资券、超短期融资券、中期票据、集合票据、次级债、证券公司次级债、中小企业私募债、混合资本债、资产支持证券、资产支持票据、非公开定向债务融资工具、永续中票、同业存单、大额可转让存单（CD）、债券型证券投资基金、债券逆回购、债券质押式回购等标准化债权类资产。以上债券的主体或债项评级在AA（含）以上（短期融资券、超短期融资券除外），若无债项评级，主体评级或担保机构评级需为AA（含）以上，且对中债资信评估有限公司评级信息不予参考。

现金类资产包括现金、银行存款（含活期存款、定期存款、通知存款、协议存款、同业存款等）、货币市场基金等。

以上投资范围中，由于投资主体（本集合计划）暂未获得相关资质或资格而无法投资的投资品种，在投资主体获得相关资质或资格后，可进行投资。法律法规或监管机构以后允许集合资产管理业务投资的其他品种，管理人和托管人协商一致后按本合同约定对合同进行变更或补充，并向委托人充分揭示相应风险且履行登记备案等法律法规以及金融监督管理部门规定的程序后，可以将其纳入投资范围。

##### （二）本计划的投资比例和投资限制

1、本集合计划投资组合在各类资产上的投资比例如下所列：

现金类资产市值占集合计划总资产的0-100%。

固定收益类资产市值占集合计划总资产的 80-100%。

债券正回购融入的资金余额占集合计划资产净值的 0-100%。

## 2、投资限制（占集合计划资产总值）

(1) 本计划不得投向未经具有证券投资基金托管资格的机构托管的私募基金；

(2) 本计划不得投资未在中国基金业协会备案的合伙企业份额；

(3) 本计划的计划资产总值占计划资产净值的比例不得超过 200%。计算单个资产管理计划的总资产按照穿透原则合并计算所投资资产管理产品的总资产。

(4) 本计划投资于固定收益类资产投资比例为资产管理计划财产总值的【80~100%】

(5) 本计划投资于同一资产的资金，不得超过计划资产净值的 25%；资产管理人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。

(6) 本计划不得投资于资产支持证券次级，仅限投资在交易所和银行间和机构间私募产品报价与服务系统（报价系统）挂牌交易的资产支持证券。投资标的遵循法律法规对产品嵌套的要求。

(7) 法律法规、中国证监会规定的其他投资限制。

## 3、投资禁止行为

本计划财产禁止从事下列行为：

- ① 不得承销证券；
- ② 不得将计划资产用于对外担保等用途；
- ③ 不得将计划资产用于可能承担无限责任的投资；
- ④ 不得从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- ⑤ 法律法规、中国证监会以及本合同规定的其他活动。

托管人对管理人投资行为监督的具体内容和标准按照本合同附件投资监督事项表（附件五）执行，若本合同第十一章第四点、第五点的内容与投资监督事项表（附件五）不一致的，以投资监督事项表（附件五）为准。

4、在本集合计划成立之日起六个月内，可不受上述比例限制，但应当符合本集合计划合同约定的投向和资产管理计划的风险收益特征。因证券市场波动、上市公司合并、资产管理计划规模变动等客观因素导致本计划投资比例超标的，管理人应自可交易之日起的 15 个交易日内调整完毕。法律法规另有规定的，从其规定。

5、【本计划存续期间，为规避特定风险并经全体投资者同意的，投资于对应类别资产的比例可以低于计划总资产 80%，但不得持续 6 个月低于计划总资产 80%，管理人应详细列明上述相关

### 特定风险。】

委托人在此同意授权管理人可以将集合计划的资产投资于管理人、托管人及前述机构的控股股东、实际控制人或者其他关联方发行的证券或承销期内承销的证券或者从事其他重大关联关系，将遵循客户利益优先原则，交易完成5个工作日内，管理人应当书面通知托管人，通过管理人的网站告知委托人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，并采取切实有效的措施，防范利益冲突，保护客户合法权益。管理人承诺不以本集合计划的资金，直接或通过投资其他资产管理计划等间接形式，为管理人、托管人及前述机构的控股股东、实际控制人或者其他关联方提供或者变相提供融资，或与关联方进行不正当交易、利益输送、内幕交易和操纵市场，包括但不限于投资于关联方虚假项目、与关联方共同收购上市公司、向本机构注资等。

在发生上述所列投资证券事项时，管理人按照法律法规及中国证监会的有关规定，应当将交易结果告知托管人，同时向证券交易所报告（如需），并通过本集合计划季报、年报等定期报告形式向委托人披露。

托管人仅依据法律法规或合同明确约定的投资范围、投资限制、投资禁止行为、管理人书面提供的关联方名单（若有）等内容进行投资监督，对投资策略及其他合规性问题不承担任何形式的责任。

## 六、集合计划的风险收益特征及适合销售对象

本计划属于[中低风险 R2]风险投资品种，适合风险识别、评估、承受能力[普通投资者的 C2-C5 及专业投资者]的合格投资者。本资产管理计划投资的资产组合的流动性与参与、退出安排相匹配。

## 七、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》、《业务规范》、《资产管理合同》、《说明书》等有关法律文件；
- 2、宏观经济发展态势、微观经济运行环境和证券市场走势，这是本集合计划投资决策的基础；
- 3、投资对象收益和风险的配比关系。在充分权衡投资对象的收益和风险的前提下作出投资决策，是本集合计划维护投资者利益的重要保障。

### （二）投资程序

## 1、投资决策程序

公司资产管理业务投资管理实行分级授权管理制度，每一层级的投资决策主体在各自的授权范围内行使相应的职权。具体投资决策程序如下：

1) 管理人资产管理业务委员会审定年度市场投资策略。

2) 资产管理投资决策小组根据资产管理业务委员会授权，不定期召开会议，审定资产管理业务阶段性市场投资策略。

3) 资产管理业务相关投资负责人组织各投资经理实施具体投资计划，投资经理定期将所管理产品的投资决策执行和投资运作情况报告投资决策小组。

## 2、投资交易程序

(1) 投资方式：委托财产的具体管理与运用由管理人、投资顾问、托管行共同完成，并由各方根据资管计划文件和相关合同的规定履行各自的职责。管理人根据投资顾问的投资建议，通过管理人审查后，进行本资管计划的投资运作，管理人执行投资顾问提供的投资建议，所形成的损失由委托资产承担。

(2) 具体的投资实施：管理人根据本合同中关于委托财产运用范围和投资比例的规定自行进行投资。

(3) 独立的执行：管理人设置独立的集中交易室，通过严格的交易制度和风险监控功能，保证投资主办人的投资指令在合法、合规的前提下得到高效地执行。

### (四) 风险控制

#### 1、风险控制目标

强化管理人的内部管理，保障集合计划的规范运作，控制集合计划的运作风险，维护集合计划委托人、管理人及托管人的合法权益。

#### 2、风险控制的原则

1) 及时有效原则：对所取得的监控信息和数据应及时进行处理、分析、查证和报告，并发出风险提示和监控意见，有效预警和控制风险。

2) 全面重点原则：在对系统各监控点进行日常监控的基础上，根据风险程度和工作需要，对有关监控点实施重点监控。

3) 持续同步原则：根据被监控对象的业务发展，不断完善监控系统的功能，以确保系统功能与业务发展同步，保证非现场监控工作的持续有效开展。

4) 授权责任原则：风险监控工作应遵循严格的授权制度，并建立明确的岗位责任制度。

#### 3、风险控制组织架构

1) 决策系统：风险控制委员会。公司风险管理的最高决策机构，负责制定公司总体风险管理政策。

2) 实施系统：风控部门。公司风险管理的专职日常工作机构，组织实施风险管理的具体工作内容与任务，通过公司风控平台，对集合资产管理业务的运作状况进行监控、分析和评估。

3) 监督系统：稽核部门和合规部门。稽核部门负责定期或不定期对集合资产管理业务的运作进行检查、评价。合规部门对集合资产管理业务和制度执行情况进行检查，发现违反法律、行政法规、中国证监会规定或者公司制度行为的，应当及时纠正处理，并向基金业协会及公司住所地证监会派出机构报告。

4) 支持系统：包括研究部门、财务管理部门、运营管理部门、信息技术管理部门、人力资源管理部门等，对风险监控提供宏观经济与行业分析、预警信息和风险监控技术、财务资金监管、人员等支持。

5) 公司实行公司风控部门和资产管理业务部门合规风控岗的二级风控体系，执行具体的风险管理制度，履行风险监控职能，包括风险监测和预警、提交风险报告和调整建议等。

#### 4、投资风险程序

##### 1) 建立风险控制构架，完善风险控制制度和体系

在制度管理方面，除了公司的基本制度和内控规范外，针对资产管理业务还系统地制定了产品设计、投资管理、交易、营销和集中清算等制度，对资产管理业务的投资决策体系、投资管理流程、权限管理、交易工作流程、可投资标的库的建立及维护程序、产品开发流程、客户服务机制等都做出了具体的规定。

在组织构架方面，在公司层面，风控部门动态监控资产管理业务的运作、稽核部门检查内控制度的执行情况及负责审计监督、合规部门审查业务的合规性、运营管理部门对资产管理业务实行集中清算。在资产管理业务部门内部将市场营销、投资管理、交易执行、风险管理等岗位分设，通过职能分离形成制衡。

##### 2) 风险识别

公司对各类风险及各个风险点进行全面有效识别。公司已按照资产管理业务流程，对本集合计划的设计开发、合同签订、委托人开户、投资决策、投资执行、交易、清算、资金管理、客户管理等各环节风险点进行全面梳理。本集合资产管理计划的主要风险为市场风险、流动性风险、信用风险、操作风险和管理风险等。

##### 3) 风险评估

公司风控部门定期或不定期评估集合资产管理业务的风险状况，范围包括所有可能对经营目

标产生负面影响的内部和外部因素，评估这些因素对集合计划总体目标产生影响的程度及可能性，并将评估报告报公司领导及相关部门。

#### 4) 风险报告

公司风控部门对风险事件进行分析，制作定期或不定期风险管理报告，及时报送公司领导及相关部门。

#### 5、外部风险监督

本集合计划在实行严格的内部风险控制的同时，也接受管理人以外的合作机构、监管机构以及委托人的监督。

##### 1) 托管人的监督

托管人监督管理人对集合计划的运作，发现管理人违反法律、法规和《集合资产管理合同》、托管协议的约定进行投资的，托管人有权对违反法律、法规和《集合资产管理合同》、托管协议的投资和资金清算指令不予执行，或采取有效措施防止损失扩大，并及时向委托人通报、向基金业协会及监管机构报告。托管人对本集合计划的清算估值进行复核、审查，按季编制集合计划托管报告，并报基金业协会备案，同时抄送管理人住所地中国证监会派出机构。

##### 2) 上级监管机构的监管

中国证监会等监管机构将对集合计划销售、交易、投资运作相关的业务活动和财务会计资料进行定期或不定期的现场检查、稽核，并要求管理人和托管人就集合计划运作中遇到的重大问题作专项报告。

##### 3) 委托人的监督

委托人有权查询或查阅集合计划的资产管理情况和持有集合计划份额的变动情况，以及审计机构、上级监管机构披露的各种审查报告。

#### (四) 预警、止损机制

本计划不设置【预警线、止损线】

#### 八、业绩比较基准

本集合计划无业绩比较基准。



## 第十二节 投资顾问

本集合计划不设投资顾问。

### 第十三节 分级安排

本集合计划不分级。

#### 第十四节 利益冲突及关联交易

本资产管理计划的资产可以投资于管理人、托管人及前述机构的控股股东、实际控制人或者其他关联方发行的证券或承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易。

委托人在此同意授权管理人可以将资产管理计划的资产投资于管理人、托管人及前述机构的控股股东、实际控制人或者其他关联方发行的证券或承销期内承销的证券，管理人应当遵循投资者利益优先原则，交易完成 5 个自然日内，管理人应书面通知托管人，并书面告知投资者关联交易的投资标的等相关内容，并根据法律、行政法规规定，向监管机构报告。除前款规定外，管理人不得将本资产管理计划资产，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、托管人及其控股股东、实际控制人或者其他关联方提供或者变相提供融资。

委托人在此同意授权管理人可以将资产管理计划的资产从事重大关联交易，管理人应当遵守法律、行政法规、中国证监会的规定和合同约定，遵循投资者利益优先原则，交易完成 5 个自然日内，管理人应书面通知托管人，并书面告知投资者关联交易的投资标的等相关内容，并向中国证监会相关派出机构和基金业协会报告，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。

托管人未提供控股股东、实际控制人或者其他关联方清单的，管理人实施相关关联交易直接或间接造成资产管理计划损失的，管理人不承担责任。

## 第十五节 投资经理的指定与变更

### 一、投资主办的指定

(一) 委托资产投资主办人由管理人负责指定。

(二) 集合资产管理业务的投资主办人不得兼任其它资产管理业务或自营业务的投资主办人。

投资主办人简历

#### 杨镭

投资经理，中国科学技术大学概率论与数理统计学学士、中山大学岭南学院管理学硕士，具有八年证券从业经验，曾先后就职于平安人寿保险、平安证券、华鑫证券等多家金融机构，长期从事量化研究、投资等相关工作，熟悉市场上各类投资品种，擅长 CTA、股指期货等衍生品的量化建模与投资。

#### 袁馨

投资经理，南京大学金融与保险学系学士、北京大学国家发展研究院金融学硕士，具有四年证券从业经验，曾先后就职于天风证券股份有限公司、东证融汇证券资产管理有限公司(原东北证券股份有限公司上海分公司)，历任自营交易、投资经理助理、投资主办人。

以上投资主办均取得基金从业资格，最近三年无被监管机构重大行政监管措施、无行政处罚。

### 二、投资主办与变更

集合计划存续期间，若负责集合资产管理业务的投资主办人员发生变更，管理人应当以管理人网站公告方式及时向客户披露，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。

## 第十六节 资产管理计划的财产

### 一、集合计划账户的开立

管理人或托管人按照规定开立集合计划的托管资金账户、证券账户和基金账户等投资所需账户。证券账户和基金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。开立的上述集合计划账户与集合计划管理人、集合计划托管人、集合计划募集机构和集合计划份额登记机构自有的财产账户以及其他财产账户相互独立。

托管人应为集合计划在其营业机构开立托管资金账户，资金账户名称为“资产管理计划名称”，具体账户名称以实际开立账户为准。托管人根据有关规定以二级户的形式为委托资产开立专门用于保管货币形式存在的委托资金及清算交收的银行账户，二级户的预留印鉴以一级账户的预留印鉴为准。该账户应遵循托管人的《单位银行结算账户管理协议》规定。集合资产管理合同签订后并以此名义在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司、深圳分公司开立集合计划专用证券账户，证券账户名称应当为“管理人名称-托管人名称-资产管理计划名称”，具体账户名称以实际开立账户为准。

集合计划专用证券账户的开立由托管人负责，账户资金的管理和运用由管理人负责。

托管人按照规定开立集合计划的托管账户等投资所需账户，管理人应给予必要的配合，并提供所需资料。本集合计划的一切货币收支活动，包括但不限于投资、支付退出金额、支付计划收益，均需通过托管账户进行。托管账户的开立和使用，仅限于满足本集合计划开展业务的需要。托管人和管理人不得假借本集合计划的名义开立其他任何银行账户，亦不得使用本集合计划的任何银行账户进行本集合计划业务以外的活动。

因业务发展而需要开立的其他账户，应由托管人或管理人根据有关法律法规的规定开立、管理和使用。如该账户是由管理人负责开立的，管理人应保证该账户专款专用。相应的投资回款及收益，也由管理人负责及时原路划回托管账户。管理人开立此类账户后需及时通知托管人。

集合计划账户、专用交易单元由管理人报证券交易所、证券登记结算机构以及证券公司住所所在地中国证监会派出机构及中国证券业协会指定的中证资本市场发展监测中心有限责任公司或其他机构备案。

委托资产投资银行存款，管理人应与存款机构签订定期存款协议，该协议作为划款指令附件，其预留印鉴至少有一枚托管人印章，该协议中必须有如下明确条款：“存款证实书、存单不得以任何方式被质押或以任何方式被抵押，并不得用于转让和背书；本息到期归还或提前支取的所有款项必须划至托管账户（明确户名、开户行、账号等），不得划入其他任何账户”。如定期存款协议中未体现前述条款，托管人有权拒绝定期存款投资的划款指令。在取得存款证实书、存单后，由

托管人保管证实书、存单正本。管理人应该在合理的时间内进行银行存款的投资和支取事宜。

## 二、集合计划资产的构成

本集合计划的资产是指运用集合计划资金进行投资所形成的各类资产，包括集合计划所拥有的权益类资产、固定收益类资产及其他投资等资产。

## 三、集合计划资产的管理与处分

(一) 集合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、托管人不得将集合计划财产归入其固有财产；

(二) 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，其债权人不得对集合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，集合计划财产不属于其清算财产；

(三) 集合计划财产产生的债权，不得与管理人、托管人固有财产的债务相互抵消。非因集合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集合计划财产强制执行。上述债权人对集合计划财产主张权利时，管理人、托管人应明确告知集合计划财产的独立性；

(四) 管理人、托管人不得违反法律法规的规定和集合计划合同约定擅自将集合计划资产用于抵押、质押、担保或设定任何形式的优先权或其他第三方权利；

(五) 除本合同另有约定外，管理人、托管人因集合计划财产的管理、运用或者其他情形而取得的财产和收益，归集合计划财产；

(六) 管理人、托管人对不同客户的集合计划独立建账、独立核算、分账管理。

(七) 本资产管理计划财产的债务由资产管理计划财产本身承担责任，投资者以其出资为限对资产管理计划财产的债务承担责任。

## 第十七节 投资指令的发送、确认和执行

### 一、交易清算授权

管理人应事先书面通知托管人有权发送指令的人员（下称“指令发送人员”）名单，授权通知应注明相应的权限，授权生效时间、预留印鉴和授权人签字样本。授权通知书（以下简称“授权通知”）应由管理人加盖公章并由法定代表人或其授权签字人签署，若由授权签字人签署，还应附上法定代表人的授权书。管理人发出授权通知后向托管人电话确认。授权通知自其中注明的生效日期起开始生效。若托管人收到授权通知的日期晚于其中注明的生效日期，授权通知自托管人收到的日期起开始生效。授权通知应以原件形式送达托管人。除本合同另有约定外，管理人、投资者和托管人对授权通知负有保密义务，其内容不得向授权人及相关操作人员以外的任何人泄露。

### 二、投资指令的内容

1、投资指令是管理人在运用委托财产时，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投资指令应写明款项事由、到账时间、金额、收款账户信息等，加盖预留印鉴并由指令发送人员签字/章。

2、本委托财产托管专户发生的银行结算费用等银行费用，托管人可直接从托管专户中扣划，无须管理人出具指令。

### 三、投资指令的发送、确认、执行的程序

投资指令由授权通知确定的指令发送人员代表管理人用传真、邮件的方式或托管人和管理人认可的其他方式向托管人发送（管理人的传真号码为 021-54967280，邮箱地址为 qiuwq@cfsc.com.cn、niqin@cfsc.com.cn、luowj@cfsc.com.cn、dusy@cfsc.com.cn、zangxy@cfsc.com.cn，托管人只接受此传真号码/邮箱的划款指令。若管理人传真号码/邮箱地址变更，应提前一个工作日以邮件或其他形式告知托管银行，并且获得托管行确认开始生效）。管理人有义务在发送指令后及时与托管人进行电话确认，托管人确认该投资指令已成功接收之时视为送达托管人。因管理人未能及时与托管人进行投资指令确认，致使资金未能及时到账所造成的损失，托管人不承担责任。托管人根据授权通知，对投资指令的预留印鉴、签字/章样本等表面真实性审核无误后，方可执行投资指令。

对于指令发送人员依照授权通知发出的投资指令，管理人不得否认其效力。管理人应按照国家法律、行政法规和本合同的约定，在其合法的经营权限和交易权限内发送投资指令，指令发送人员应按照其授权权限发送投资指令。管理人在发送指令时，应为托管人留出执行投资指令所必

需的时间。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，致使资金未能及时到账所造成的损失托管人不予承担。

管理人向托管人下达指令时，应确保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指令而造成损失的责任。

对于要求当天到账的投资指令，管理人发送投资指令的截止时间为 15:00；对于所有有明确到账时点的投资指令，管理人应在要求到账时点前 2 个工作小时发送(托管人工作时间是 8:30-11:30, 13:30-17:00)。

托管人收到管理人发送的投资指令后，应对传真投资指令进行表面形式审查，验证投资指令的书面要素是否齐全、审核印鉴和签名是否和预留印鉴和签名样本相符，复核无误后应在规定期限内及时执行，不得延误。

管理人发送划款指令时应同时向托管人发送必要的投资合同、费用发票(如有)等划款证明文件的复印件。但托管人仅对管理人提交的划款指令按照本合同约定进行表面一致性审查，托管人不负责审查管理人发送指令同时提交的其他文件资料的合法性、真实性、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。

#### 四、托管人依法暂缓、拒绝执行投资指令情形的处理程序

托管人发现管理人的指令违反法律、行政法规规定或《资产管理合同》约定的，应立即与管理人指定人员进行电话联系和沟通，暂停投资指令的执行并要求管理人重新发送修改后的投资指令。托管人可以要求管理人通过电子邮件或传真的方式提供相关交易凭证、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投资指令的有效性。托管人仅对管理人提交的投资指令按照本合同约定进行表面一致性审查，托管人不负责审查管理人发送指令同时提交的其他文件资料的合法性、真实性、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。

管理人若修改或要求停止执行已经发送的指令，应先与托管人电话联系，若托管人还未执行，管理人应重新发送修改指令或在原指令上注明“停止执行”字样并由指令发送人员签字/章。

#### 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，指



令中重要信息模糊不清或不全等。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，并及时通知管理人改正。

## 六、授权通知的变更

管理人若变更授权通知（包括但不限于变更指令发送人员、联系方式、预留印鉴、签字样本等），应当至少提前1个工作日通知托管人；变更授权通知的文件应由管理人加盖公章发送至托管人。管理人对授权通知的变更应当以原件送达托管人，同时电话通知托管人。授权通知自其中注明的生效日期起开始生效。若托管人收到授权通知的日期晚于其中注明的生效日期，授权通知自托管人收到的日期起开始生效。

## 七、投资指令的保管

投资指令以传真、电子邮件形式发送托管人，原件由管理人保管，托管人保管传真件/扫描件，若传真件/扫描件与原件不一致的，以托管人收到的传真件/扫描件为准。

## 八、其他事项

1、除因托管人主观恶意或重大过失致使委托财产受到损害而负赔偿责任外，托管人对执行管理人的合法指令造成的委托财产的损失不承担赔偿责任；对于执行指令过程中由于本合同当事人以外的第三方原因对委托财产造成的损失，托管人不承担赔偿责任。

2、资金未能及时到账或相关财产权利未能及时变更而导致委托财产损失的，由过错方承担责任。由于相关第三方原因，导致委托财产损失的，由投资者负责向第三方追偿，管理人、托管人予以必要的协助。

3、管理人未将拟投资产品的相关合同、协议等文件资料提供托管人的，托管人有权对管理人相关委托财产管理运用指令拒绝执行。

4、托管人应对指令依据本单一资产管理合同进行监督审核，对适当的指令应在规定期限内执行，不得延误。托管人在履行监督职能时，发现管理人的指令违背法律、行政法规、单一资产管理合同规定的，应当要求管理人改正或撤销，未能改正或撤销的，托管人应当拒绝执行，并向监管机构报告。

## 第十八节 越权交易的界定

### 一、越权交易的界定

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合同约定而进行的投资交易行为，包括：

- （一）违反有关法律法规和本合同规定进行的投资交易行为。
- （二）法律法规禁止的超买、超卖行为。

### 二、越权交易的处理程序

（一）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，托管人有权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。

（二）托管人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，并有权及时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。

（三）越权交易所发生的损失及相关交易费用由管理人负担，所发生的收益归本集合计划财产所有。

## 第十九节 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、资产总值

集合计划的资产总值是指集合计划投资所形成的各类有价证券、银行存款本息及其他资产的价值总和。

### 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净资产值。

### 三、单位净值

集合计划单位份额净值指估值日集合计划资产净值除以集合计划的份额总数所得的数值。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。集合计划资产净值由资产管理人T日负责计算，T+1日上午12点之前资产托管人复核完成。

### 四、估值目的

集合计划资产估值的目的是客观、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份额净值，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

本集合计划成立后，对资产进行估值之每个交易日。

### 七、估值方法

估值应符合本合同、《证券公司客户资产管理业务规范》中的估值原则、《证券公司客户资产管理业务估值方法指引》、《证券公司金融工具估值指引》、《企业会计准则》、《指导意见》以及中国证监会关于资产管理计划对金融工具进行核算与估值的规定、资产管理计划净值计价及风险控制要求，确认和计量资产管理计划净值。

如法律法规未做明确规定的，参照行业通行做法处理。管理人、托管人的估值数据应依据合法的数据来源独立取得。对于固定收益类投资品种的估值应依据中国证券业协会基金估值工作小组的指导意见及指导价格估值。

管理人应当定期对本集合计划的估值执行效果进行评估，必要时调整完善，保证公平、合理。

当有充分证据表明本集合计划相关资产的计量方法已不能真实公允反映其价值时，管理人应当与托管人进行协商，即使采用公允价值计量方法对资产管理计划净值进行调整。

(一) 股票估值方法

1、上市流通股票的估值

上市流通股票按估值日其所在证券交易场所的收盘价估值；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，以最近交易日的收盘价估值；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考监管机构或行业协会有关规定，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。

2、未上市股票的估值

(1) 首次发行未上市的股票，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，按成本价估值。

(2) 送股、转增股、配股和公开增发新股等发行未上市的股票，按估值日在证券交易场所上市的同一种股票的市价进行估值。

(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，按估值日在证券交易场所上市的同一种股票的市价进行估值。

(4) 非公开发行的且在发行时明确一定期限锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。本计划投资非公开发行股票按以下方法估值：

i. 估值日在证券交易场所上市交易的同一种股票的收盘价低于非公开发行股票初始取得成本时，采用在证券交易场所上市交易的同一种股票的收盘价作为估值日该非公开发行股票的价值；

ii. 在证券交易场所上市交易的同一种股票的收盘价高于非公开发行股票初始取得成本时，应按下列公式确定估值日该非公开发行股票的价值：

$$FV = C + (P - C) \times \frac{D_1 - D_r}{D_1}$$

其中：FV 为估值日该非公开发行股票的价值；C 为该非公开发行股票初始取得成本；P 为估值日在证券交易场所上市交易的同一种股票的收盘价；D<sub>1</sub> 为非公开发行股票锁定期所含的交易天数；D<sub>r</sub> 为估值日剩余锁定期，即估值日至锁定期结束所含的交易天数（不含估值日当天）。

(二) 债券估值方法

1、在证券交易场所市场挂牌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；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考监管机构或行业协会有关规定，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。

2、在证券交易所市场挂牌未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去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所含的债券应收利息得到的净价估值；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考监管机构或行业协会有关规定，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。

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、在对银行间市场的固定收益品种估值时，应主要依据中债估值为主，同时参考中证估值、CFETS估值和上清所估值等第三方估值机构公布的收益率曲线及估值价格。

5、在交易所挂牌转让的资产支持专项计划、资产支持证券，采用适当估值技术确定其公允价值进行估值。在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。管理人应持续评估上述估值方法的适当性，并在情况发生变化时进行适当的调整。

6、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。

7、商业银行理财计划、信托计划、保险公司及其子公司资产管理计划、期货公司及其子公司资产管理计划、私募基金等按照最近公布的份额净值估值；如未公布产品份额净值，管理人将按照成本价估值。

### （三）权证估值方法

1、从持有确认日起到卖出日或行权日止，上市交易的权证按估值日在证券交易所挂牌的该权证的收盘价估值；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，将参考监管机构或行业协会有关规定，调整最近交易日收盘价，确定公允价值。

2、首次发行未上市的权证，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、因持有股票而享有的配股权，以及停止交易、但未行权的权证，采用估值技术确定公允价值进行估值。配股权证，从配股除权日起到配股确认日止，按收盘价高于配股价的差额估值；如果收盘价低于配股价，则估值增值额为零。

### （四）证券投资基金估值方法

1、持有的交易所基金，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，以最近交易日的收盘价估值；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考监管机构或行业协会有关规定，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。

2、持有的场外基金，估值日证券投资基金管理人提供单位净值的，按证券投资基金管理人提供的估值日单位净值估值；估值日证券投资基金管理人未提供单位净值，且从最近净值提供日到估值日整体市场环境及投资标的未发生重大变化的，可参考最近可获取的单位净值确定公允价值。

3、持有的货币市场基金，每日按基金公司公布的当日的每万份收益逐日计提收益；估值日无公布的，按最近交易日公布的每万份收益逐日计提收益估值。

**（五）银行定期存款或通知存款估值方法**

银行定期存款或通知存款以本金列示，按协议或合同利率逐日计提利息。如提前支取或利率发生变化，将及时进行账务调整。

**（六）交易所交易衍生品的估值方法**

交易所交易的衍生品或具有衍生品性质的其他合约(如:股票期权、股指期货、国债期货、商品期货、贵金属现货延期交收合约等),按估值日交易所公布的当日结算价估值;估值日无交易,且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的,按最近交易日的结算价估值;如最近交易日后发生影响公允价值计量的重大事件的,应采取相应的衍生品估值模型,确定公允价值。

（七）逆回购以成本列示，按照预期收益率逐日计提利息。

（八）债券计提每日利息，股票红利按税后计算投资收益。

（九）如有新增事项或变更事项，按国家最新规定估值。

（十）如有确凿证据表明按上述规定不能客观反映集合计划资产公允价值的，管理人可根据具体情况，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，在与托管人商议后，按最能反映集合计划资产公允价值的方法估值。

（十一）当市场发生极端的流动性不足或者证券被停牌，合同终止无法变现的资产处理由合同各方根据相关法律法规，视具体情况就资产变现、估值等事宜协商解决。

（十二）如管理人或托管人发现计划估值违反资产管理合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护委托人利益时，应立即通知对方，共同查明原因，双方协商解决。

（十三）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。本集合计划的会计责任方由管理人担任。

**八、估值程序**

集合计划的日常估值由管理人进行，托管人复核。用于公开披露的集合计划单位净值由管理人以邮件或双方认可的方式发给托管人，托管人复核后以邮件或双方认可的方式回复管理人。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，由此给委托人和集合计划财产造成的损失，托管人不承担任

何责任。报告期末估值复核与集合资产管理计划会计账目的核对同时进行。

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。

### 九、估值错误与遗漏的处理

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。当估值计价出现错误时，管理人和托管人应当立即予以纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大。

前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，按其规定处理。

### 十、差错处理

#### （一）差错类型

本计划运作过程中，如果由于管理人、托管人、注册登记机构、或销售机构、或委托人自身的过错造成差错，导致其他当事人遭受损失的，过错的责任人应当对由于该差错遭受损失的当事人（“受损方”）按下述“差错处理原则”给予赔偿并承担赔偿责任。

上述差错的主要类型包括但不限于：资料备案差错、数据传输差错、数据计算差错、系统故障差错、下达指令差错等；对于系统故障差错、因技术原因引起的差错，若系同行业现有技术水平无法预见、无法避免、无法抗拒，则属不可抗力，按照下述规定执行。

由于不可抗力原因造成委托人的交易资料灭失或被错误处理或造成其他差错，因不可抗力原因出现差错的当事人不对其他当事人承担赔偿责任，但因该差错取得不当得利的当事人仍负有返还不当得利的义务。

#### （二）差错处理原则

1、差错已发生，但尚未给当事人造成损失时，差错责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正差错发生的费用由差错责任方承担；由于差错责任方未及时更正已产生的差错，给当事人造成损失的由差错责任方承担；若差错责任方已经积极协调，并且有协助义务的当事人有足够的时间进行更正而未更正，则有协助义务的当事人应当承担相应的责任，但不限于赔偿、责任声明等。差错责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认，确保差错已得到更正；

2、差错的责任方对可能导致有关当事人的直接经济损失负责，不对间接损失负责，并且仅对差错的有关直接当事人负责，不对第三方负责；

3、因差错而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但差错责任方仍应对差错负责，如果由于获得不当得利的当事人不返还或不全部返还不当得利造成其他当事人的利益损失，则差错责任方应赔偿受损方的损失，并在其支付的赔偿金额的范围内对获得不当得利的当事人享有要求返还不当得利的权利及要求获得不当得利的当事人承担因不返还或不全部返还不当得利造

成的损失；如果获得不当得利的当事人已经将此部分不当得利返还给受损方，则受损方应当将其已经获得的赔偿额加上已经获得的不当得利返还的总和超过其实际损失的差额部分支付给差错责任方；

4、差错调整采用尽量恢复至假设未发生差错的正确情形的方式；

5、差错责任方拒绝进行赔偿时，如果因管理人过错造成集合资产管理计划财产损失时，托管人应为集合资产管理计划的利益向管理人追偿，如果因托管人过错造成集合资产管理计划财产损失时，管理人应为集合资产管理计划的利益向托管人追偿。除管理人和托管人之外的第三方造成集合资产管理计划资产的损失，并拒绝进行赔偿时，由管理人负责向差错方追偿，托管人可以给予必要的配合和协助；

6、如果出现差错的当事人未按规定对受损方进行赔偿，并且依据法律法规、《管理合同》或其他规定，管理人自行或依据法院判决、仲裁裁决对受损方承担了赔偿责任，则管理人有权向出现过错的当事人进行追索，并有权要求其赔偿或补偿由此发生的费用和遭受的直接经济损失，托管人可以给予必要的配合和协助；

7、按法律法规规定的其他原则处理差错。

### （三）差错处理程序

差错被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

- 1、查明差错发生的原因，列明所有的当事人，并根据差错发生的原因确定差错的责任方；
- 2、根据差错处理原则或当事人协商的方法对因差错造成的损失进行评估；
- 3、根据差错处理原则或当事人协商的方法由差错的责任方进行更正和赔偿损失；
- 4、根据差错处理的方法，需要修改注册登记机构的交易数据的，由注册登记机构进行更正，

并就差错的更正向有关当事人进行说明。

## 十一、暂停披露净值的情形

（一）与本计划投资有关的证券交易场所遇法定节假日或因其他原因停市时；

（二）因不可抗力或其他情形致使管理人、托管人无法准确评估集合资产管理计划资产价值时。

## 十二、特殊情形的处理

由于本计划所投资的各个市场及其登记结算机构发送的数据错误、遗漏，有关会计制度变化、管理人或托管人托管业务系统出现重大故障或由于其他不可抗力原因，管理人和托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误的，由此造成的集合资产管理计划资产净值计算错误，管理人和托管人免除赔偿责任。但管理人和托管人应当积极采取必要的措施



消除或减少由此造成的影响。

由于注册登记机构发送的数据有误，处理方法等同于交易数据错误的处理方法。

### 十三、会计核算

#### (一) 会计政策

- 1、本项委托财产的会计年度为每年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、委托财产的会计核算按《证券投资基金会计核算业务指引》执行。

#### (二) 会计核算方法

- 1、管理人、托管人应根据有关法律、行政法规，对委托财产单独建账、独立核算。
- 2、管理人、托管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。
- 3、管理人应定期与托管人就委托财产的会计核算、报表编制等进行核对。

## 第二十章集合计划的费用与税收

### 一、集合计划费用计提方法、计提标准和支付方式

#### (一) 管理人的管理费

集合计划管理费按照集合计划资产净值的【0.6%】年费率计算，计算方法如下：

$$H = E \times 0.6\% / 365$$

H 为每日应支付的管理费

E 为前一日集合计划资产净值

本计划成立之日起，资产管理费每日计提，按【季】支付，由资产管理人于本计划成立之日的【次季度】起，每【季度】首日起【10】个工作日内向资产托管人发送资产管理计划管理费划付指令，经资产托管人复核后的次一个工作日内从资产管理计划资产中支付给资产管理人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延，若遇不可抗力或计划资产无法变现致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

资产管理人指定收取管理费的银行账户为：

账户名称（接收管理费）：华鑫证券有限责任公司

账号：0764152322000913

开户行：上海浦东发展银行徐汇支行

#### (二) 托管人的托管费

集合计划托管费按照集合计划资产净值的【0.01%】年费率计算，计算方法如下：

$$H = E \times 0.01\% / 365$$

H 为每日应支付的托管费

E 为前一日集合计划资产净值

本计划成立之日起，托管费每日计提，按【季】支付，由资产管理人于本计划成立之日的【次季度】起，【每季度】首日起【10】个工作日内向资产托管人发送资产管理计划托管费划付指令，经资产托管人复核后的次一个工作日内从资产管理计划资产中支付给资产托管人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延，若遇不可抗力或计划资产无法变现致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

资产托管人指定收取托管费的银行账户为：

户 名：资产托管费待划转

账 号：11070126102000013

开户银行：宁波银行股份有限公司

#### (三) 投资顾问的投资顾问费

本计划不收取投资顾问费。

(四) 为维护集合计划财产的权利而发生的解决纠纷费用, 包括但不限于诉讼费、律师费、仲裁费等。

(五) 证券交易费用、注册登记费用、审计费。

(六) 按照国家有关规定可以列入的其他费用。

(七) 银行结算费用、开户费、银行账户维护费、交易费、转托管费、注册登记机构收取的相关费用等集合计划运营过程中发生的相关费用。

银行结算费用(包括但不限于银行账户的资金结算汇划费、账户维护费、询证费等各类银行收取的费用等), 在发生时一次性计入集合计划费用。

开户费、银行账户维护费、交易费、转托管费在发生时一次计入集合计划费用。

与集合计划运营有关的其他费用, 在发生时一次进入集合计划费用。

银行间费用(如有): 资产管理人应根据银行间费用相关法律法规及本合同约定, 将账户开户、结算管理等各项费用列入或摊入当期委托财产运作费用, 经管理人和托管人核对无误后, 由管理人授权后划付, 管理人收到托管人通知后三个月内未授权划付的, 托管人有权从委托资产中扣划, 无须资产管理人出具指令。资产委托人和资产管理人在此申明已了解委托资产投资会产生的银行费用, 并确保账户中有足够资金用于银行费用的支付, 如因托管账户中的资金不足以支付银行费用影响到指令的执行, 资产托管人不承担由此产生的损失和责任。如委托资产未起始运作, 由管理人在收到托管人的缴费通知后完成支付, 托管人不承担垫付费用义务。

上述计划费用中第(四)至(七)项费用由管理人根据有关法律法规及相应协议的规定, 按费用实际支出金额支付。其中注册登记费用、诉讼费、律师费、仲裁费等由资产托管人收到资产管理人发送的指令和费用凭证后, 对传真划款指令进行表面相符性的形式审查, 对其真实性和合理性不承担复核责任。

## 二、业绩报酬

### 1、业绩报酬计提原则

若委托人多笔参与, 按委托人每笔参与份额分别计算年化收益率并计提业绩报酬, 提取频率不得超过每6个月一次。

管理人业绩报酬计提日为本集合计划退出日、收益分配日、本集合计划终止日。以上一个业绩报酬计提日下一个工作日(如上一个发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日不存在, 销售期参与的为本集合计划成立日, 开放期参与的为参与当日的下一个工作日)至本次业绩报酬计提日的年化收益率  $R$  超过业绩报酬计提基准部分的 60% 作为业绩报酬。年化收益率

$$R = \frac{A - B}{C} \times \frac{365}{t} \times 100\%$$

其中： $A$  为业绩报酬计提日单位累计净值

$B$  为上一个业绩报酬计提日单位累计净值

$C$  为上一个业绩报酬计提日的单位净值

$t$  为上一业绩报酬计提日与本次业绩报酬计提日间隔天数

业绩报酬计算方式：

年化收益率 (R)	计提比例	业绩报酬 (E) 的计算方法
$R \leq$ 业绩报酬计提基准%	0	$E=0$
$R >$ 业绩报酬计提基准%	60%	$E=F \times C \times [(R - \text{业绩报酬计提基准\%}) \times 60\%] \times t / 365$

本集合计划的业绩报酬计提基准为由管理人在封闭期前公告确定。

其中： $E$  为业绩报酬

$F$  为计提业绩报酬的份额

退出日或到期日 (T 日) 的计划单位净值在当天证券交易所收市后计算，遇特殊情况，经管理人和托管人一致同意，可以适当延迟计算。

业绩报酬的计算保留小数点后 2 位，小数点后第 3 位四舍五入，由此带来的收益和损失归入计划资产。

业绩报酬由管理人负责计算，由托管人复核并由管理人在委托人分红、委托人退出或清算款项 (以下简称“退出金额”) 中分别予以相应扣除，业绩报酬收取账户为本合同约定的管理人管理费收取账户。

## 2、业绩报酬计提说明

### (1) 退出提取

委托人在本集合计划开放期申请预约退出或本集合计划终止清算时，管理人根据年化收益提取业绩报酬，从委托人退出计划资金款项中予以扣除。

例 1：某委托人预约退出申请日持有份额 400,000 份，全部预约申请退出，退出日单位累计净值 1.15 元，上一业绩报酬计提日单位累计净值为 1.10 元，上一业绩报酬计提日的单位净值为 1.05 元，退出日至上一个业绩报酬计提日的间隔天数为 183 天，假设业绩报酬计提基准为 5.1%，则

$$\begin{aligned}
 R(\text{年化收益率}) &= (A-B) \div C \times (365 \div t) \times 100\% \\
 &= (1.15-1.10) \div 1.05 \times (365 \div 183) \times 100\%=9.50\%
 \end{aligned}$$

$$\begin{aligned}
 E(\text{业绩报酬}) &= F \times C \times [(R- 5.1\%) \times 60\%] \times t/365 \\
 &= 400,000 \times 1.05 \times [(9.50\%- 5.1\%) \times 60\%] \times 183/365=5559.19 \text{ 元。}
 \end{aligned}$$

例 2：委托人于上一业绩报酬提取日持有份额 1,000,000 份，上一业绩报酬提取日单位累计净值为 1.10 元，上一业绩报酬计提日单位净值为 1.05 元，后续委托人在本次预约退出申请日申请预约退出份额 200,000 份，本次退出日单位累计净值 1.15 元，退出日至上一业绩报酬计提日的间隔天数为 183 天，则

a) 针对退出份额 200,000 份，管理人计提业绩报酬，具体业绩报酬计算方法参照例 1。

b) 针对未退出份额 800,000 份，本次退出日，管理人不计提业绩报酬，未来分红或退出清算时，管理人再计提业绩报酬。退出清算时，具体业绩报酬计算方法参照例 1，分红提取时具体业绩报酬计算方法参考分红提取。

## (2) 分红提取

当管理人进行分红时，管理人将根据年化收益提取业绩报酬，业绩报酬提取方式与退出提取方式相同，从委托人分红款项中予以扣除。

例 3：某委托人分红日持有份额 400,000 份，分红日单位累计净值为 1.15 元，上一业绩报酬提取日单位累计净值为 1.10 元，上一业绩报酬计提日单位净值为 1.05 元，分红日至上一个业绩报酬计提日的间隔天数为 183 天，则

$$\begin{aligned}
 R(\text{年化收益率}) &= (A-B) \div C \times (365 \div t) \times 100\% \\
 &= (1.15-1.10) \div 1.05 \times (365 \div 183) \times 100\%=9.50\%
 \end{aligned}$$

$$\begin{aligned}
 E(\text{业绩报酬}) &= F \times C \times [(R- 5.1\%) \times 60\%] \times t/365 \\
 &= 400,000 \times 1.05 \times [(9.5\%- 5.1\%) \times 60\%] \times 183/365=5559.19 \text{ 元。}
 \end{aligned}$$

注：当分红时，不满足业绩报酬提取条件时，不计提业绩报酬。

业绩报酬采用按账户计提的方式，多次参与、退出的在计算份额持有天数时采用“先进先出”法，比如，某委托人在 2018 年产品募集期时参与了 40 万份，封闭期 6 个月和在 2019 年第一次开放时又参与 60 万份，2019 年第二次开放时又退出 50 万份，则认为这 50 万份中的 40 万份持有了 6 个月，另外的 10 万份持有了 3 个月，分别计算业绩报酬。

## 三、不列入集合计划费用的项目

集合计划成立前发生的费用以及存续期间发生的与销售有关的费用、集合计划销售期间的费

用，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。

#### 四、税收

本合同各方当事人应根据国家法律法规规定，履行纳税义务。委托人必须自行缴纳的税收由委托人负责，管理人不承担代扣代缴或纳税的义务。如依据相关法律法规或税务机关的规定，就本计划运营过程中发生的增值税应税行为等应税行为，管理人需要承担相应纳税义务的，除本计划已列明的资产管理业务费用产生的税费由各收款方自行缴纳外，管理人有权以计划财产予以缴纳，且无需事先征得委托人的同意；管理人在向委托人交付利益或资产后税务机关要求管理人缴纳相关税费的，委托人应按照管理人通知要求进行缴纳，管理人亦有权以计划剩余财产直接缴纳；委托人不得要求管理人以任何方式向其返还或补偿该等税费。

## 第二十一节 资产管理计划的收益与分配

### 一、收益的构成

集合计划收益由买卖证券价差、股息、基金红利、债券利息、银行存款利息、公允价值变动收益及其他合法收入构成。

### 二、可分配收益

集合计划的利润指集合计划投资所得买卖证券价差、股息、基金红利、债券利息、银行存款利息、公允价值变动收益及其他合法收入扣除相关费用后的余额；

集合计划已实现收益指集合计划利润减去公允价值变动损益后的余额；

集合计划可分配收益指截至收益分配基准日（即可分配收益计算截至日）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。

### 三、收益分配原则

（一）每份集合计划份额享有同等分配权。

（二）如果投资当期出现净亏损，则不进行收益分配。

（三）收益分配后份额净值不低于本计划初始面值，即收益分配基准日的集合计划份额净值减去每份集合计划的份额收益分配金额后不能低于本计划初始面值 1.0000。

（四）在符合有关集合计划分红条件的前提下，本集合计划每年收益分配次数由管理人决定，本计划收益分配方式为红利转投。

（五）对于在开放期申请退出并确认的客户，本集合计划在该期产品到期的最后一个工作日将退出份额的收益分配给客户，对于在开放期末申请退出的客户，本集合计划在该期产品到期的最后一个工作日进行红利转投。

（六）若集合计划可分配收益大于零，则管理人将剩余全部可分配收益进行红利转投。但若集合计划可分配收益小于零，则管理人不对集合计划进行收益分配。

（七）收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由委托人承担。

（八）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

各方一致同意本集合计划收益分配方案由管理人拟定，由托管人核实后确定，管理人至少在 R-1 个工作日（R 为权益登记日）之前将收益分配方案向委托人公告。

## 第二十二节 信息披露与报告

### 一、定期报告

定期报告包括集合计划单位份额净值和累计份额净值报告、集合计划的资产管理季度(年度)报告、资产托管季度(年度)报告和年度审计报告和对账单。

#### (一) 集合计划单位份额净值和累计份额净值报告。

管理人在集合计划成立后每周一(如遇法定节假日相应顺延)通过管理人网站披露上一个工作日集合计划的单位份额净值和累计份额净值。

#### (二) 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提供一次准确、完整的季度资产管理报告和季度资产托管报告,对报告期内集合计划资产的配置状况、价值变动情况、重大关联交易做出说明。上述报告应于每季度截止日后1个月内通过管理人网站通告,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。集合计划成立不足3个月或存续期间不足3个月的,管理人、托管人可以不编制当期的季度报告。

报告内容需披露信息:

- 1、管理人履职报告;
- 2、托管人履职报告;
- 3、资产管理计划投资表现;
- 4、资产管理计划投资组合报告;
- 5、资产管理计划运用杠杆情况;
- 6、资产管理计划支付的管理费、托管费、业绩报酬等费用的计提基准、计提方式和支付方式;
- 7、资产管理计划投资收益分配情况;
- 8、投资经理变更、重大关联交易等涉及投资者权益的重大事项;
- 9、中国证监会规定的其他事项。

#### (三) 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提供一次准确、完整的年度资产管理报告和年度资产托管报告,对报告期内集合计划资产的配置状况、价值变动情况、重大关联交易做出说明。上述报告应于每个会计年度截止日后4个月内通过管理人网站通告,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。集合计划成立不足3个月时,管理人、托管人可以不编制当期的年度报告。

报告内容需披露信息:



- 1、管理人履职报告；
- 2、托管人履职报告；
- 3、资产管理计划投资表现；
- 4、资产管理计划投资组合报告；
- 5、资产管理计划运用杠杆情况；
- 6、资产管理计划财务会计报告；
- 7、资产管理计划支付的管理费、托管费、业绩报酬等费用的计提基准、计提方式和支付方式；
- 8、资产管理计划投资收益分配情况；
- 9、投资经理变更、重大关联交易等涉及投资者权益的重大事项；
- 10、中国证监会规定的其他事项。

#### （四）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资产管理计划的运营情况进行年度审计，并在每年度结束之日起4个月内将审计报告提供给托管人，通过管理人网站向委托人披露，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。

#### （五）对账单

委托人可以通过销售机构柜台自行查询、交易系统自行查询对账单或交易流水；委托人需要邮寄对账单，需及时与管理人取得联系，由于委托人提供的邮寄地址、手机号码、电子邮箱不详或因邮局投递差错、通讯故障、延误等原因，造成对账单无法按时准确送达，请委托人及时到原销售机构网点办理相关信息变更，管理人不对此承担任何责任。对账单内容应包括委托人持有计划份额的数量，参与、退出明细，以及收益分配等情况。

## 二、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网站公告方式及时向客户披露，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。临时报告的情形包括但不限于：

- （一）集合计划运作过程中，负责集合资产管理业务的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。
- （二）暂停受理或者重新开始受理参与或者退出时。
- （三）发生巨额退出并延期支付。
- （四）集合计划终止和清算。
- （五）管理人以自有资金参与和退出。

- (六) 合同的补充、修改与变更。
- (七) 与集合计划有关的重大诉讼、仲裁事项。
- (八) 负责本集合计划的销售机构发生变更。
- (九) 集合计划投资于管理人及与管理人有关联方关系的公司发行的证券。
- (十) 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。
- (十一) 管理人、托管人因解散、破产、撤销等原因不能履行相应职责。
- (十二) 管理人的董事、监事、从业人员及其配偶、控股股东、实际控制人或者其他关联方参与资产管理计划，应向投资者充分披露。
- (十三) 其他管理人认为的重大事项。

### 三、信息披露方式

本集合计划的信息披露将严格按照《指导意见》、《管理办法》、《运作管理规定》、《资产管理合同》及其他有关规定进行。集合计划的信息披露事项将以下列方式进行披露。

#### (一) 管理人网站信息披露

本计划《说明书》、《资产管理合同》、其他备查文件、相关报告等有关集合计划的信息，将在集合计划管理人网站上披露，委托人可随时查阅。

#### (二) 管理人、销售机构指定营业网点查询

本计划《说明书》、《资产管理合同》、其他备查文件、相关报告等文本存放在集合计划管理人和集合计划销售机构的住所，委托人可在营业时间内免费查阅，也可按工本费购买复印件。对委托人按上述方式所获得的文件及其复印件，集合计划管理人保证其提供的内容与所披露的内容完全一致。

#### (三) 管理人客服电话

本集合计划披露的有关集合计划的信息，委托人可以通过管理人客服电话（95323）查询。

### 四、信息披露文件的存放及查阅

本集合计划的定期公告与报告、临时公告与报告存放在管理人的办公场所，委托人可在办公时间查阅。

管理人应当妥善保存客户开户资料、委托记录、交易记录和与内部管理、业务经营有关的各项资料，任何人不得隐匿、伪造、篡改或者毁损。

## 第二十三节 风险揭示

委托人投资于本计划可能面临以下风险，有可能因下述风险导致委托人本金或收益损失。管理人承诺以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用集合计划资产，管理人制定并执行相应的内部控制制度和风险管理制度，以降低风险发生的概率。但这些制度和办法不能完全防止风险出现的可能，管理人不保证本计划一定盈利，也不保证最低收益。本集合计划面临的风险包括但不限于以下风险：

### 一、特殊风险

#### 1、无法提前退出的风险

本集合计划份额定期开放，委托人只能于本集合计划退出日办理份额退出，其他时间委托人面临无法提前退出的风险。

#### 2、业绩报酬计提基准不能达到的风险

本集合计划公布的业绩报酬计提基准仅为管理人提取业绩报酬的依据，不代表预期收益率，也不是管理人向委托人保证其资产本金不受损失或者保证取得最低收益的承诺，委托人的投资可能出现达不到业绩报酬计提基准或本金受损的风险。

#### 3、集合计划份额延期的风险

当集合计划的管理期限届满时，如集合计划所投资的资产未全部变现，集合计划可能面临延期至投资资产全部变现之日，相应委托人可能面临份额延期的风险。

#### 4、聘请投资顾问的风险（若有）

管理人参照投资顾问的“投资建议”进行投资交易，投资风险由委托人承担。投资顾问的投资服务能力、服务水平将直接影响本计划的收益水平。在本计划投资管理运作过程中，可能因投资顾问对经济形势和证券市场等判断有误、获取的信息不全等因素影响本计划的收益水平。

#### 5、资金前端控制产生的风险

根据《上海证券交易所、深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司证券交易资金前端风险控制业务规则》的要求，管理人应控制在交易所实施竞价交易且为净额担保结算的交易品种的全天净买入金额，在极端情况下，可能因相关交易单元买入申报金额不符合资金前端控制额度限制而导致买入申报被拒绝。

### 二、一般风险

委托人投资于本集合计划可能面临以下风险，有可能因下述风险导致委托人本金或收益损失。管理人承诺以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用集合计划资产，管理人制定并执行相应的内部控制制度和风险管理制度，以降低风险发生的概率。但这些制度和办法不能完全防止风险出现

的可能，管理人不保证本集合计划一定盈利，也不保证最低收益。

本集合计划的主要风险因素为本金损失风险、市场风险、流动性风险、管理风险、合规性风险、信用风险、操作风险、合同变更风险、电子合同签约风险、对账单风险、份额转让风险、募集失败风险、投资标的风险、税收风险、其它风险，本集合计划管理人提醒委托人注意本集合计划的相关风险并对风险采取了对应的防范措施。具体风险揭示如下：

#### 1、本金损失风险

管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用资产管理计划财产，但不保证资产管理计划财产中的认（申）购资金本金不受损失，也不保证一定盈利及最低收益。

本资产管理计划属于【中低风险 R2】风险投资品种，适合风险识别、评估、承受能力【普通投资者的 C2-C5 及专业投资者】的合格投资者

#### 2、市场风险

##### （一）法律及政策风险

国家货币政策、财政税收政策、房地产政策、产业政策、投资政策、金融业监管政策等宏观政策、相关法律法规的调整与变化及经济周期的变化等因素，都可能对本集合计划带来风险。

##### （二）经济周期风险

证券市场是国民经济的晴雨表，而经济运行具有周期性的特点。宏观经济运行状况将对证券市场的收益水平产生影响，从而产生风险。

##### （三）利率风险

金融市场利率波动会导致股票市场及债券市场的价格和收益率的变动，同时直接影响企业的融资成本和利润水平，使集合资产管理计划收益水平随之发生变化，从而产生风险。

##### （四）汇率风险

汇率风险是指因境外证券投资所产生的以非本币计价的各类资产受汇率波动影响而引起本币估值下的集合计划资产波动，使集合计划资产面临的风险。

##### （五）上市公司经营风险

上市公司的经营好坏受多种因素影响，如管理能力、财务状况、市场前景、行业竞争、人员素质等，这些都会导致企业的盈利发生变化。虽然委托资产可以通过投资多样化来分散这种非系统风险，但不能完全规避。

##### （六）购买力风险

本集合计划投资的目的是使集合计划资产保值增值，如果发生通货膨胀，集合计划投资于证券所获得的收益可能会被通货膨胀抵消，从而影响集合计划资产的保值增值。

#### （七）再投资风险

由于金融市场利率下降造成的无法通过再投资而实现收益的风险。

#### 3、流动性风险

由于投资选择偏好和市场的变化，在投资过程中可能发生投资组合的流动性不足、资产变现困难，对净值产生不利影响，使集合计划资产面临较大的流动性风险。

#### 4、管理风险

在集合计划管理运作过程中，集合计划管理人的知识、经验和管理技术、管理手段，其对信息的占有和分析能力，以及对宏观经济形势、行业发展趋势和证券市场走势的判断能力等，都会较大影响集合计划的收益水平。

#### 5、合规性风险

指集合计划管理或运作过程中，违反国家法律、法规的规定，或者集合计划投资违反法规及《管理合同》有关规定的风险。

#### 6、信用风险

信用风险是指发行人是否能够实现发行时的承诺，按时足额还本付息的风险，或者交易对手未能按时履约的风险。

#### 7、操作风险

指相关当事人在业务各环节操作过程中，因内部控制存在缺陷或者人为因素造成操作失误或违反操作规程等所引致的风险，例如，越权违规交易、会计部门欺诈、交易错误、IT系统故障等风险。

#### 8、合同变更风险

管理人经托管人同意后可以对本合同做出调整和补充。管理人将及时通过管理人网站或书面形式（由管理人决定）就合同变更内容向委托人征求意见。

本合同生效后，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进行变更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。委托人对更新或修改的内容有异议，可在本集合计划最近一个临时开放期预约申请退出本集合计划，未在上述期间预约申请退出本集合计划的，视为同意，管理人不再另行通知。

除上述所述情形外需要变更合同的，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个工作日内以邮件或者管理人网站公告方式（由管理人决定）向委托人发送合同变更征询意见函（或通知）。委托人应在征询意见函（或通知）指定的日期内（不得多于5个工作日）按指定形式回复意见。委托人不同意变更的，应在征询意见函（或通知）指定的日期内即临时开放期内提出退出本集合计划的申请；委托人未在指定日期内即临时开放期内回复意见或未在指定日期内提出退出本集合计划申请的，视为委托人同意合同变更。如委托人同意变更，则变更事项自征询意见函（或通知）指定的日期届满的下一工作日开始生效，对合同各方均具有法律效力。

#### 9、电子合同签约风险

本集合计划可采用经中国证监会认可的机构验证的电子合同签约方式，同所有网上交易一样存在操作的风险。

#### 10、对账单风险

管理人根据委托人要求可使用邮寄对账单等方式，可能由于委托人提供的联系信息不准确，或者快递途中丢失，导致无法正常获得对账单信息。采用邮寄方式的，对账单自邮局寄出即视为送达。

#### 11、份额转让风险

本计划成立后，委托人可以按照规定申请份额转让事宜。份额转让交易平台可以是证券交易所，也可以是中国证监会认可的其他交易平台。委托人通过交易平台转让份额需自行寻找受让方，份额转让价格由委托人与受让方协商确定，产生的转让费用由委托人自行承担，委托人份额转让价格与集合计划份额净值可能不一致。

#### 12、募集失败风险

本集合计划在销售期的募集资金（不含销售期利息）不低于1,000万元（含本数），上限以管理人公告为准；存续期规模上限为10亿元（含本数）；本集合计划委托人合计数为2人（含）以上200人（含）以下。根据上述规则，集合计划的委托人可能面临因集合计划规模、人数等方面的限制而无法参与集合计划的风险。本计划的成立需符合相关法律法规的规定，本计划可能存在不能满足成立条件从而无法成立的风险。

管理人的责任承担方式：

（一）以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用；

（二）在资产管理计划募集期限届满（确认资产管理计划无法成立）后三十日内退还投资者已缴纳的款项，并加计银行同期活期存款利息。

### 13、投资标的的风险

本计划投资标的的价值取决于投资对象的经营状况，原股东对所投资企业的管理和运营，相关市场宏观调控政策、财政税收政策、产业政策、法律法规、经济周期的变化以及区域市场竞争格局的变化等都可能影响所投资企业经营状况，进而影响资产管理计划投资标的的价值。

### 14、税收风险

契约式产品所适用的税收征管法律法规可能会由于国家相关税收政策调整而发生变化，投资者收益也可能因相关税收政策调整而受到影响。

### 15、关联交易风险

资产管理计划可能实施关联交易，管理人已建立防范利益输送和利益冲突的机制，确认该等交易安排合法合规、不存在利益输送等违法违规行为；但该等交易仍可能存在利益冲突风险。

### 16、其它风险

(一) 计划管理人、托管人因重大违法、违规行为，被中国证监会取消业务资格等而导致本集合计划终止的风险。

(二) 计划管理人、托管人因停业、解散、破产、撤销等原因不能履行相应职责导致本集合计划终止的风险。

(三) 突发偶然事件的风险：指超出集合计划管理人自身直接控制能力之外的风险，可能导致集合计划或集合计划委托人利益受损。

其中“突发偶然事件”指任何无法预见、不能避免、无法克服的事件或因素，包括但不限于以下情形：

- 1、相关法律法规的变更，直接影响集合计划运行。
- 2、无法预测或无法控制的系统故障、设备故障、通讯故障。
- 3、管理人操作或者技术风险、电力故障等都可能对本集合计划的资产净值造成不利影响。
- 4、因集合计划业务快速发展而在人员配备、内控机制建立等方面不完善而产生的风险。
- 5、因人为因素而产生的风险，如内幕交易、欺诈行为等产生的风险。
- 6、对主要业务人员如投资主办人的依赖而可能产生的风险。
- 7、因业务竞争压力而可能产生的风险。

8、金融市场危机、行业竞争、代理商违约、托管人违约等超出集合计划管理人自身直接控制能力外的风险可能导致集合计划或者集合计划委托人利益受损。

9、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，可能导致集合计划资产的损失。

(四) 委托人部分退出集合计划份额时，如其该笔申请退出后在该销售机构剩余的集合计划金额低于30万元时，则管理人自动将该委托人在该销售机构的全部分额退出给委托人。

### 三、风险承担及免责

管理人依据本合同规定管理集合计划资产所产生的风险，由集合计划资产承担。

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，也不保证委托资金不受损失。

本风险揭示部分的揭示事项仅为列举性质，未能详尽列明投资者参与集合资产管理计划所面临的全部风险和可能导致投资者资产损失的所有因素。



## 第二十四节 资产管理合同的变更、终止与清算

### 一、合同的补充、修改与变更

(一) 本合同生效后，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进行变更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。委托人对更新或修改的内容有异议，可在本集合计划最近一个临时开放期预约申请退出本集合计划，未在上述期间预约申请退出本集合计划的，视为同意，管理人不再另行通知。

(二) 除上述(一)所述情形外需要变更合同的，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个工作日内以邮件或者管理人网站公告方式(由管理人决定)向委托人发送合同变更征询意见函(或通知)。委托人应在征询意见函(或通知)指定的日期内(不得多于5个工作日)按指定形式回复意见。委托人不同意变更的，应在征询意见函(或通知)指定的日期内即临时开放期内提出退出本集合计划的申请；委托人未在指定日期内即临时开放期内回复意见或未在指定日期内提出退出本集合计划申请的，视为委托人同意合同变更。如委托人同意变更，则变更事项自征询意见函(或通知)指定的日期届满的下一工作日开始生效，对合同各方均具有法律效力。

(三) 全体委托人、管理人和托管人协商一致并签署补充协议后，也可对本合同内容进行变更。

(四) 合同变更后，委托人、管理人和托管人应当按照变更后的合同行使相关权利，履行相应义务。

(五) 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。

(六) 本合同对应的托管协议是指《华鑫鑫国1号集合资产管理计划托管协议》(以实际签署为准)。本计划托管人为宁波银行股份有限公司，托管人根据本合同和《托管协议》的约定履行托管职责。

### 二、有下列情形之一的，集合计划应当终止：

(一) 计划存续期间，持续5个工作日集合计划参与人少于2人。

(二) 管理人因重大违法、违规行为，被中国证监会取消业务资格的，且在六个月内没有新的管理人承接。

(三) 托管人因重大违法、违规行为，被监管机构取消业务资格而管理人未能在合理时间内与新的托管人签订托管协议的。

(四) 管理人因停业、解散、破产、撤销等原因不能履行相应职责的，且在六个月内没有新的管理人承接。

(五) 托管人因解散、破产、撤销等原因不能履行相应职责时，管理人未在 30 个工作日内与新的托管人签订托管协议的。

(六) 不可抗力导致本集合计划不能存续。

(七) 本计划投资品种的交易对手在管理、运用、处分相关财产的过程中，发生违约，担保人违约或投资品种所涉其他法律关系的当事人违约，管理人认为有必要提前终止的。

(八) 由于法律、法规、监管规定或相关政策变化等原因，本集合计划不能继续存续的，管理人有权提前终止。

(九) 计划存续期届满且不展期。

(十) 经全体委托人、管理人和托管人协商一致决定终止的。

(十一) 未在证券投资基金业协会完成备案或不予备案的情况。

(十二) 法律、法规规定或中国证监会规定及本合同约定的其他情况。

### 三、集合计划的清算

(一) 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，集合计划清算小组成员由集合计划管理人、集合计划托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师组成。清算小组可以聘请必要的工作人员。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。

集合计划清算小组负责本集合计划资产的保管、清理、估价、变现和分配。集合计划清算小组可以依法以集合计划的名义进行必要的民事活动。

(二) 清算过程中有关重大事项应当及时公布。

(三) 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、托管费等费用后，将集合计划资产按照委托人拥有份额的比例或者集合资产管理合同的约定，以货币资金的形式全部分派给委托人，并注销集合计划专用证券账户和资金账户。

(四) 清算结束后 15 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或书面通知委托人清算结果。管理人应当在清算结束后 15 日内将清算结果报监管机构备案。

(五) 若本集合计划在终止之日有未能流通变现的证券，管理人可针对该部分未能流通变现证券制定二次清算方案，该方案应经托管人认可，并通过管理人网站进行披露。

管理人应根据二次清算方案的规定，对该部分未能流通变现的证券在可流通变现后进行二次

清算，将变现后的资产扣除相关费用后按照委托人拥有份额的比例，以货币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。在进行二次清算的变现过程中，变现的资金以现金保存，不得再进行投资。未返还委托人的计划资产照常计提管理费及托管费。

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单元保证金，在注册登记机构对其进行调整交收日才能收回，届时，集合计划清算小组将及时按照委托人拥有份额的比例或者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。

（六）管理人需向托管人提供清算分配所需资料，托管人据此复核。若提供数据不准确导致分配数据有误，托管人不承担责任。

（七）清算小组在进行集合计划清算过程中发生的所有合理费用，由清算小组从集合计划资产中支付。

资产管理计划财产清算账册及文件由管理人保存20年以上。

## 第二十五节 违约责任

### 违约责任

(一) 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, 给本计划资产或者委托人造成损害的, 应当分别对各自的行为依法承担赔偿责任; 因共同行为给本计划资产或者委托人造成损害的, 根据实际情况, 由双方分别承担各自应负的违约赔偿责任。但是发生下列情况的, 当事人可以免责:

#### 1、不可抗力

一方因不可抗力不能履行本合同时, 应及时书面通知另一方, 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资产损失扩大。任何一方当事人迟延履行合同义务后, 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中国证监会的规定作为或不作为而造成的损失等。

3、在没有欺诈、故意或重大过失的情况下, 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、在本计划运作过程中, 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。

6、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。

7、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、期货公司等)发送的数据错误给集合计划资产造成的损失等。

8、在没有欺诈、故意或重大过失的情况下, 托管人执行管理人的生效指令对集合计划资产造成的损失

(二) 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。

(三) 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。

（四）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，由此造成计划资产或委托人损失，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或减少由此造成的影响。

（五）一方当事人依据本合同向另一方当事人赔偿的损失，仅限于直接经济损失。

（六）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。

（七）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，合规投资责任在集合计划管理人。托管人对这些机构的信息真实性、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信息错误或遗漏所引起的损失不承担任何责任。

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。

## 第二十六节 争议的处理

### 争议的处理

因履行本合同发生的争议，由协议签订各方协商、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本协议签署地（上海市徐汇区宛平南路）有管辖权的人民法院进行诉讼。

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。

诉讼费用由败诉方承担。

## 第二十七节 资产管理合同的效力

### 一、合同的成立与生效

本合同经管理人、托管人的法定代表人/负责人或授权代表签字（或盖章）并加盖公章（或合同专用章）和委托人的法定代表人或授权代表签字（或盖章）并加盖公章（委托人为自然人的，应由委托人本人签署）后成立。

本合同成立后，满足以下条件时生效：

- （一）委托人参与资金实际交付并确认。
- （二）管理人公告本集合计划成立。

本合同采用电子签名方式签署的，委托人、管理人、托管人在此确认，托管人的“宁波银行股份有限公司托管业务合同专用章”及“授权人名章”仅适用于本合同的签订。管理人应确保电子签名合同标准文本与管理人、托管人在线下签署的版本一致，若合同版本不一致的，托管人不承担责任。因管理人故意或重大过失导致资产管理电子合同及托管人印章电子版本管理不善给托管人造成损失的，由管理人承担相应责任，赔偿仅以直接经济损失为限。

本合同采用电子签名方式签署的，由中国证券登记结算有限责任公司对电子签名合同数据进行管理，管理人、代理推广机构应当及时向中国证券登记结算有限责任公司传输委托人已签署的电子签名合同数据。

### 二、合同的组成

《说明书》和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等本合同的附件，是本合同不可分割的一部分，与本合同具有同等法律效力。委托人在签署《管理合同》时应详阅上述文件。附件内容与本合同相关内容有冲突的，以本合同的表述为准。

## 第二十八节 管理人自有资金参与集合计划

管理人可以使用自有资金参与本集合计划。

### 一、 自有资金的参与

(一) 参与条件：管理人以自有资金参与本集合计划，应符合中国证监会及中国证券业协会的相关规定。

#### (二) 参与方式

1、销售期间与开放期间，管理人可以参与集合计划份额，参与时，管理人应当提前5个工作日通过管理人指定网站进行公告。

2、开放期间，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。

#### (三) 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%。

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限的，管理人应当在10个工作日内办理超出份额的退出手续。

为应对巨额退出，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，管理人参与的自有资金参与可不受上述限制，但管理人应通过管理人网站通告委托人和托管人，说明有关处理方法，并向相关派出机构及证券投资基金业协会报告。

### 二、 自有资金的收益分配和风险承担

1、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。

2、管理人以自有资金参与份额的本金及收益不对其他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。

### 三、 自有资金的退出

#### (一) 自有资金退出的情况和方式

1、管理人自有资金持有的本集合计划份额在符合法律、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、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场所等中国证监会认可的交易平台转让给其他投资者。

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。



(二) 自有资金退出要求

- 1、管理人自有资金参与集合计划的持有期限不得低于 12 个月。
- 2、退出时应当提前 5 个工作日通过管理人指定网站进行公告。

为应对本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，管理人自有资金的参与、退出可不受前述比例和持有期限限制，但应及时告知委托人和托管人，并向相关证监会派出机构及协会报告。

**四、 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。

**五、 信息披露**

管理人及时在指定网站公告自有资金参与和退出情况。管理人自有资金参与、退出时应当提前 5 个工作日通过管理人指定网站进行公告。

## 第二十九节 集合计划的展期

本集合计划期满后，若符合展期的条件，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、《说明书》的约定。

2、展期没有损害委托人利益的情形。

3、委托人人数不少于2人。

4、托管人同意继续托管展期后的集合计划资产。

5、中国证监会规定的其他条件。

6、资产管理计划展期的，应当符合资产管理计划的成立条件。

### 二、展期的程序

本集合计划存续期届满且符合展期条件拟展期时，管理人与托管人需就展期事宜达成一致，并应当在届满前至少5个工作日在管理人网站公告。

若管理人进行拟展期的，管理人应当通过指定网站公告，并以电子邮件等合适的方式通知委托人，委托人应当在公告期间表明意见。若委托人未明确对展期进行回复的，视为不同意展期。委托人不同意展期的，应办理集合计划份额的退出，委托人未主动办理集合计划预约退出，管理人有权为不同意展期的委托人办理强制退出，具体事宜以公告为准。

原存续期届满，符合展期条件进行展期的，本集合计划在原存续期届满之日实现展期。管理人应在原存续期届满之日起的10个工作日内将展期情况公告。

（以下无正文）

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者取得最低收益；委托人确认，已充分理解本合同的内容，自行承担风险和损失。

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/负责人或者其授权代表签署。

本合同一式肆份，管理人、托管人各执壹份，其余按照有关监管部门的要求备案，每份均有同等法律效力。委托人签署电子合同，电子合同与纸质合同具有同等法律效力。

委托人（签字）/（盖章）：

法定代表人或授权代表：

签订日期： 年 月 日

管理人：华鑫证券有限责任公司（盖章）

法定代表人或授权代表：

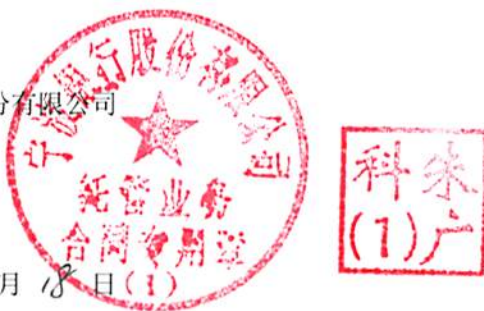
签订日期：2019年12月18日



托管人：宁波银行股份有限公司

负责人或授权代表：

签订日期：2019年12月18日(1)



附件一专用清算账户及资金划拨专用账户

注意：账户如有变更，请及时通知相关各方。

托管账户

户名：

账号：

开户银行：

管理费收款账户

户 名：华鑫证券有限责任公司

账 号：0764152322000913

开户银行：上海浦发银行徐汇支行

大额支付号：310290000177

托管费收款账户

户 名：资产托管费待划转

账 号：11070126102000013

开户银行：宁波银行股份有限公司



## 附件二 管理人关联方名单

华鑫证券有限责任公司关联方信息表	
序号*	名称
1	上海华鑫股份有限公司
2	上海金欣联合发展有限公司
3	上海金陵投资有限公司
4	上海择励实业有限公司
5	上海普林电路板有限公司
6	上海普林电子有限公司
7	上海鑫敦实业有限公司
8	力敦行房地产经纪有限公司
9	华鑫期货有限公司
10	华鑫证券投资有限公司
11	华鑫宽众投资有限公司
12	摩根士丹利华鑫证券有限责任公司
13	摩根士丹利华鑫基金管理有限公司
14	上海仪电（集团）有限公司
15	上海洪华投资发展有限公司
16	华鑫置业（集团）有限公司
17	上海华鑫置业集团工程咨询有限公司
18	上海华鑫物业管理顾问有限公司
19	上海华萃置业有限公司
20	上海华田置业有限公司
21	上海华维投资管理有限公司
22	上海华鑫资产管理有限公司
23	上海广业陕新投资管理有限公司
24	上海怡朋物业管理有限公司
25	上海华祈资产管理有限公司
26	上海云赛创鑫企业管理有限公司
27	上海电动工具研究所（集团）有限公司
28	上海电工技术交流中心
29	上海宝庆通用电工有限公司

30	上海电气器具检验测试所
31	上海松宝科技发展有限公司
32	中认尚动（上海）检测技术有限公司
33	上海电动所工具研究所集团嘉善有限公司
34	上海怡汇投资管理有限公司
35	云赛信息（集团）有限公司
36	上海广甸物业发展有限公司
37	上海华欧投资管理有限公司
38	上海云仪电子贸易有限公司
39	上海仪夏电子有限公司
40	上海仪电智能电子有限公司
41	华仪电子有限公司（香港）
42	上海飞乐音响股份有限公司
43	上海联威电子有限公司
44	云智视像科技（上海）有限公司
45	上海仪电汽车电子系统有限公司
46	日本信息系统株式会社
47	南非SVA电子公司
48	上海仪电分析仪器有限公司
49	云赛智联股份有限公司
50	上海亿人通信终端有限公司
51	上海仪电电子印刷科技有限公司
52	上海仪电显示材料有限公司
53	苏州飞乐电子元件股份有限公司
54	香港文康电子有限公司
55	上海圣阡实业有限公司
56	深圳金陵通讯技术有限公司
57	上海仪电物联技术股份有限公司
58	上海华冠电子设备有限责任公司
59	上海仪电数字技术有限公司
60	上海仪电楼宇科技有限公司
61	上海颐东网络信息有限公司
62	上海融天投资顾问有限公司

63	仪电思佰益融资租赁（上海）有限公司
64	上海华鑫智城科技有限公司
65	上海择鑫置业有限公司
66	苏州工业园区青剑湖置业有限公司
67	上海奥仑实业有限公司
68	上海华勃企业发展有限公司
69	上海金陵置业有限公司
70	上海始安房产管理有限公司
71	上海仪电资产经营管理（集团）有限公司
72	上海国盛集团资产有限公司
73	上海仪电电子股份有限公司

附件三托管人关联方名单

名称	关联关系
新加坡华侨银行有限公司	主要股东
宁波开发投资集团有限公司	主要股东
雅戈尔集团股份有限公司	主要股东
华茂集团股份有限公司	主要股东
宁波杉杉股份有限公司	主要股东
宁波富邦控股集团有限公司	主要股东
中央汇金资产管理有限公司	主要股东
宁兴(宁波)资产管理有限公司	主要股东
永赢基金管理有限公司	子公司
永赢金融租赁有限公司	子公司



附件四预留印鉴授权书

华鑫证券有限责任公司（作为管理人）、宁波银行股份有限公司（作为托管人）已签署编号为 HXXG-2019 第 2 号的《华鑫鑫国 1 号集合资产管理计划资产管理合同》。以下为管理人的预留印鉴，该印鉴用于集合资产管理业务运作过程中用于业务往来确认所盖印章的预留印鉴。



上述预留印鉴如需更换，应提供加盖管理人公章的新的预留印鉴样本。新的预留印鉴样本相应替代原有预留印鉴样本。未提供加盖公章的新预留印鉴样本的，预留印鉴不得更换。

管理人：华鑫证券有限责任公司（公章）



附件五：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>固定收益类资产包括国债、央行票据、地方政府债、政策性金融债，政府支持机构债、非政策性金融债、公司债（含非公开发行的公司债）、企业债、项目收益债、可转换债、可分离交易可转债、可交换债、短期融资券、超短期融资券、中期票据、集合票据、次级债、证券公司次级债、中小企业私募债、混合资本债、资产支持证券、资产支持票据、非公开定向债务融资工具、永续中票、同业存单、大额可转让存单（CD）、债券型证券投资基金、债券逆回购、债券质押式回购等标准化债权类资产</p> <p>以上债券的主体或债项评级在AA（含）以上（短期融资券、超短期融资券除外），若无债项评级，主体评级或担保机构评级需为AA（含）以上，且对中债资信评估有限公司评级信息不予参考。</p> <p>现金类资产包括现金、银行存款（含活期存款、定期存款、通知存款、协议存款、同业存款等）、货币市场基金等。</p> <p>以上投资范围中，由于投资主体（本集合计划）暂未获得相关资质或资格而无法投资的投资品种，在投资主体获得相关资质或资格后，可进行投资。</p> <p>法律法规或监管机构以后允许集合资产管理业务投资的其他品种，管理人和托管人协商一致后按本合同约定对合同进行变更或补充，并向委托人充分揭示相应风险且履行登记备案等法律法规以及金融监督管理部门规定的程序后，可以将其纳入投资范围。</p>

<p>二 投资比例及投资限制</p>	<p>1、本集合计划投资组合在各类资产上的投资比例如下所列：          现金类资产市值占集合计划总资产的 0-100%。          固定收益类资产市值占集合计划总资产的 80-100%。          债券正回购融入的资金余额占集合计划资产净值的 0-100%。</p> <p>2、投资限制（占集合计划资产总值）</p> <p>（1）本计划不得投向未经具有证券投资基金托管资格的机构托管的私募基金：</p> <p>（2）本计划不得投资未在中国基金业协会备案的合伙企业份额；</p> <p>（3）本计划的计划资产总值占计划资产净值的比例不得超过 200%。<u>计算单个资产管理计划的总资产按照穿透原则合并计算所投资资产管理产品的总资产。</u></p> <p>（4）本计划投资于固定收益类资产投资比例为资产管理计划财产总值的【80~100%】</p> <p>（5）本计划投资于同一资产的资金，不得超过计划资产净值的 25%，<u>资产管理人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%。</u>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。</p> <p>（6）本计划不得投资于资产支持证券次级，仅限投资在交易所和银行间和机构间私募产品报价与服务系统（报价系统）挂牌交易的资产支持证券。投资标的遵循法律法规对产品嵌套的要求。</p> <p>（7）法律法规、中国证监会以规定的其他投资限制。</p> <p>4、在本集合计划成立之日起六个月内，可不受上述比例限制，但应当符合本集合计划合同约定的投向和资产管理计划的风险收益特征。因证券市场波动、上市公司合并、资产管理计划规模变动等客观因素导致本计划投资比例超标的，管理人应自可交易之日起的 15 个工作日内调整完毕。法律法规另有规定的，从其规定。</p> <p>5、【本计划存续期间，为规避特定风险并经全体投资者同意的，投资于对应类别资产的比例可以低于计划总资产 80%，但不得持续 6 个月低于计划总资产 80%，管理人应详细列明上述相关特定风险。】</p> <p>委托人在此同意授权管理人可以将集合计划的资产投资于管理人、托管人及前述机构的控股股东、实际控制人或者其他关联方发行的证券或承销期内承销的</p>
--------------------	--

		<p>证券或者从事其他重大关联关系，将遵循客户利益优先原则，交易完成5个工作日内，管理人应当书面通知托管人，通过管理人的网站告知委托人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，并采取切实有效的措施，防范利益冲突，保护客户合法权益。管理人承诺不以本集合计划的资金，直接或通过投资其他资产管理计划等间接形式，为管理人、托管人及前述机构的控股股东、实际控制人或者其他关联方提供或者变相提供融资，或与关联方进行不正当交易、利益输送、内幕交易和操纵市场，包括但不限于投资于关联方虚假项目、与关联方共同收购上市公司、向本机构注资等。</p> <p>在发生上述所列投资证券事项时，管理人按照法律法规及中国证监会的有关规定，应当将交易结果告知托管人，同时向证券交易所报告（如需），并通过本集合计划季报、年报等定期报告形式向委托人披露。</p> <p>托管人仅依据法律法规或合同明确约定的投资范围、投资限制、投资禁止行为、管理人书面提供的关联方名单（若有）等内容进行投资监督，对投资策略及其他合规性问题不承担任何形式的责任。</p>
三	投资禁止	<p>本计划财产禁止从事下列行为：</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>① 不得承销证券；</li> <li>② 不得将计划资产用于对外担保等用途；</li> <li>③ 不得将计划资产用于可能承担无限责任的投资；</li> <li>④ 不得从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；</li> <li>⑤ 法律法规、中国证监会以及本合同规定的其他活动。</li> </ol>

注：如果投资范围、投资禁止和投资限制需要调整，必须经过委托人、管理人和托管人确认一致方可执行。