

# 华安证券季季赢 14 号集合资产管理计划

## 资产管理合同

合同编号：【HAZQ-ZSYH-JJY14】

托管合同编号：Z192C20210819D222

管理人：华安证券股份有限公司

托管人：浙商银行股份有限公司

## 目录

第一部分前言	3
第二部分释义	4
第三部分承诺与声明	6
第四部分当事人及权利义务	7
第五部分本计划的基本情况	13
第六部分本计划的募集	15
第七部分本计划的成立与备案	18
第八部分本计划的参与、退出与转让	19
第九部分份额持有人大会及日常机构	26
第十部分计划份额的登记	26
第十一部分资产管理计划的投资	27
第十二部分投资顾问	39
第十三部分分级安排	39
第十四部分利益冲突及关联交易	39
第十五部分投资经理的指定与变更	40
第十六部分资产管理计划的财产	41
第十七部分划款指令的发送、确认和执行	44
第十八部分越权交易的界定	47
第十九部分资产管理计划财产的估值和会计核算	48
第二十部分资产管理计划的费用与税收	54
第二十一部分资产管理计划的收益分配	57
第二十二部分信息披露与报告	58
第二十三部分风险提示	61
第二十四部分资产管理合同的变更、终止与财产清算	67
第二十五部分违约责任	71
第二十六部分争议的处理	72
第二十七部分资产管理合同的效力	72
第二十八部分其他事项	72

## 第一部分前言

### 一、订立本资产管理合同的依据、目的和原则

(一) 订立本资产管理合同(以下简称“本合同”)的依据是《中华人民共和国民法典》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》、《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》、《集合资产管理计划管理合同内容与格式指引(试行)》、《商业银行资产托管业务指引》及其他有关法律法规的规定。

若因法律法规的制定或修改导致本合同的内容与届时有效的法律法规存在冲突,应当以届时有效的法律法规的规定为准,各方当事人应及时对本合同进行相应变更和调整。

(二) 订立本合同的目的是在严格遵守国家有关法律法规的前提下,保护本合同各当事人合法权益,明确本合同各当事人之间权利和义务,保证本集合资产管理业务合法、合规及有效地进行。

(三) 订立本合同的原则是平等自愿、诚实信用和公平,充分保护本合同各当事人的合法权益。

二、管理人应当对本集合计划的设立、变更、展期、终止、清算等行为向证券投资基金业协会(以下简称“协会”)进行备案,并抄报中国证监会相关派出机构。

三、协会接受本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,也不代表协会对本计划的合规性、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。

四、本合同是规定各当事人之间权利义务关系的基本法律文件,其他与本计划相关的涉及本合同各当事人之间权利义务关系的任何文件或表述,如与本合同不一致或有冲突,均以本合同为准。

五、当本合同以电子签名方式签订时,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;投资者(华安证券季季赢 14 号集合资产管理计划的投资者)作为本合同一方,以电子签名方式签署本合同即表明投资者完全接受本合同项下的全部条款,同时本合同成立。

投资者、管理人和托管人同意遵守《电子签名法》、《证券公司资产管理电子

签名合同操作指引》的有关规定，投资者以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。

## 第二部分 释义

在本合同中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

资产管理计划、计划、本计划：指华安证券季季赢 14 号集合资产管理计划。

资产管理合同、本合同：指投资者、管理人及托管人三方签署的《华安证券季季赢 14 号集合资产管理计划资产管理合同》及其附件，以及对该合同及附件做出的任何有效变更及补充。

托管协议：指《华安证券季季赢 14 号集合资产管理计划托管协议》及对该协议的任何有效修订和补充。

计划说明书：指《华安证券季季赢 14 号集合资产管理计划计划说明书》及其附件，以及对该计划说明书及附件做出的任何有效变更及补充。

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、地方法规、地方规章及规范性文件。

《民法典》：指《中华人民共和国民法典》。

《基金法》：指《中华人民共和国证券投资基金法》。

《指导意见》：指中国人民银行、中国银行保险监督管理委员会、中国证券监督管理委员会、国家外汇管理局于 2018 年 4 月 27 日联合印发的《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》（银发〔2018〕106 号）。

《管理办法》：指中国证监会于 2018 年 10 月 22 日发布并施行的《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》（证监会令〔第 151 号〕）。

《运作规定》：指中国证监会于 2018 年 10 月 22 日发布并施行的《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》（证监会公告〔2018〕31 号）。

中国证监会：指中国证券监督管理委员会。

基金业协会、协会：指中国证券投资基金业协会。

资产委托人、投资者：指签订本合同且根据本合同及相关文件合法取得本计

划份额的、符合《指导意见》和《运作规定》规定条件的合格投资者。

资产管理人、管理人：指华安证券股份有限公司。

资产托管人、托管人：浙商银行股份有限公司。

注册登记机构：指办理登记、存管、过户、清算和结算等注册登记业务的机构。本计划的注册登记机构为华安证券股份有限公司。

推广机构：指管理人及其指定的销售机构。

募集期：指本计划启动推广之日起至结束日的期间，自发售之日起不超过 60 日。

封闭期：特指成立日后的一个期间，在此期间投资者不得参与、退出本集合计划。

存续期：指本计划成立至终止之间的期限。

开放期：指销售机构办理本计划参与、退出等业务的期间。

本资产管理计划成立日、成立日：指资产管理计划募集期结束并完成验资，经资产管理人公告本计划成立之日。

工作日、交易日、估值日：均指上海证券交易所、深圳证券交易所、中国金融期货交易所等期货交易所的正常交易日。

认购：指在本计划募集期内，投资者参与本计划的行为。

参与(申购)：指在本计划参与开放期内，投资者按照指定销售机构规定的手续，参与本计划的行为。

退出(赎回)：指在本计划退出开放期内，投资者按照指定销售机构规定的手续，申请部分或全部退出本计划的行为。

元：指人民币元。

计划资产总值：指本计划财产拥有的各类有价证券、银行存款本息、证券投资基金份额及其他资产的价值总和。

计划资产净值：指计划资产总值减去计划负债后的价值。

计划财产估值：指计算评估资产管理计划资产和负债的价值，以确定计划资产净值和计划份额净值的过程。

二次清算：指本计划终止时，集合计划中还有未能流通的证券处于合法冻结状态，当该证券达到可变现状态时，管理人将其变现，并进行清算分配的过程。

计划份额净值：指计算日计划资产净值除以当日资产管理计划份额余额总

数后得出的资产管理计划每份额资产净值。

**计划份额累计净值：**指计划份额净值与资产管理计划历来份额收益分配金额之和。

**流动性受限资产：**是指由于法律法规、监管、合同或者操作障碍等原因无法以合理价格予以变现的资产，包括到期日在 10 个交易日以上的逆回购与银行定期存款（含协议约定有条件提前支取的银行存款）、资产支持证券（票据）、流动受限的新股以及非公开发行股票、停牌股票、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券和非金融企业债务融资工具等资产。

**7 个工作日可变现资产：**包括可在交易所、银行间市场正常交易的股票、债券、非金融企业债务融资工具、期货及期权合约以及同业存单，7 个工作日内到期或者可支取的逆回购、银行存款，7 个工作日内能够确认收到的各类应收款项等。

**每年：**指会计年度。

**不可抗力：**指任何不能预见、不能避免、不能克服的客观情况，且在本合同由资产管理人、资产托管人签署之日后发生的，使本合同当事人无法全部或部分履行本合同的事件和因素。包括但不限于有关法律法规及重大政策调整、台风、洪水、地震、流行病及其他自然灾害，战争、骚乱、火灾、政府征用、戒严、没收、恐怖主义行为，电力故障或其他突发事件、证券交易所非正常暂停或停止交易等事件。

### 第三部分承诺与声明

一、管理人承诺在签订本合同前已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，充分揭示了相关风险，并已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。管理人承诺按照《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。

二、托管人承诺按照《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。托管人承诺根据法律法规、中国证监会及协会的规定和本合同约定，对管理人的投资或清算指令进行

监督。

三、投资者保证为符合《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，不存在任何虚假记载、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。投资者承诺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。投资者承诺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对本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。

#### 第四部分 当事人及权利义务

##### 一、合同当事人

###### (一) 投资者

姓名/名称：

证件类型：

证件号码：

住所：

联系人：

通讯地址：

联系电话：

###### (二) 管理人

姓名/名称：华安证券股份有限公司

住所：安徽省合肥市政务区天鹅湖路 198 号

联系人：袁方

通讯地址：安徽省合肥市政务区天鹅湖路 198 号

联系电话：0551-65161521

###### (三) 托管人

姓名/名称：浙商银行股份有限公司

住所：浙江省杭州市萧山区鸿宁路 1788 号

联系人：俞挺

通讯地址：浙江省杭州市延安路 368 号

联系电话：0571-88267931

二、本计划设定为均等份额，除本合同另有约定外，每份份额具有同等的合法权益。

三、本计划投资者的权利包括但不限于：

- （一）分享本计划财产收益；
- （二）取得分配清算后的剩余计划财产；
- （三）按照本合同的约定参与、退出和转让本计划份额；
- （四）按照法律法规及本合同约定的时间和方式获得本计划的信息披露资料；
- （五）监督管理人、托管人履行投资管理及托管义务的情况；
- （六）法律法规、监管规定和本合同约定的其他权利。

四、本计划投资者的义务包括但不限于：

- （一）认真阅读并遵守资产管理合同，保证投资资金的来源及用途合法；
- （二）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；
- （三）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本计划的，应向管理人充分披露实际投资者和最终资金来源；
- （四）认真阅读并签署风险揭示书；
- （五）按照本合同约定支付本计划份额的参与款项，承担本合同约定的管理费、业绩报酬、托管费、审计费、税费等合理费用；
- （六）在持有的本计划份额范围内，承担本计划亏损或者终止的有限责任；
- （七）向管理人或本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；投资者理解并同意管理人收集、使用、留存、及处理本计划涉及到的必要个人信息，包括但不限于投资者的姓名、证件号码、出生日期、住址、电话号码、电子邮箱等，并保证提供给管理人进行身份信息识别的信息和资料均真实、准确、完整、合法。在其身份信息资料发生变更

时，应当及时书面告知管理人；

(八) 不得违反本合同的约定干涉管理人的投资行为；

(九) 不得从事任何有损本计划及其投资者、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；

(十) 保守商业秘密，不得泄露本计划的投资计划、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；

(十一) 本集合计划如采用电子签名合同，投资者应当如实提供与签署电子签名合同相关的信息和资料。投资者应当以自己的名义开立资金账户，办理指定手续，用于办理委托划款、红利款项、退出款项以及清算款项的收取。并承诺在本合同有效期内，不得撤销该账户，并妥善保管账户资料；

(十二) 除非在本合同规定的退出开放期或终止日，不得要求提前终止委托资产管理关系；

(十三) 法律法规、监管规定和本合同约定的其他义务。

五、管理人的权利包括但不限于：

(一) 按照本合同约定，独立管理和运用本计划财产；

(二) 按照本合同约定，及时、足额获得管理人管理费用及业绩报酬；

(三) 按照有关规定和本合同约定行使因本计划财产投资所产生的权利；

(四) 根据本合同及其他有关规定，监督托管人，对于托管人违反本合同或有关法律法规规定、对本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，并报告证监会相关派出机构及协会；

(五) 自行提供或者委托经中国证监会、协会认定的服务机构为本计划提供募集、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；

(六) 以管理人的名义，代表本计划行使投资过程中产生的权属登记等权利；

(七) 按照有关规定，要求资产委托人提供与其身份、财产与收入状况、投资经验、风险认知与承受能力和投资偏好等相关的信息和资料，要求资产委托人积极配合完成（包括本合同签订前和履行过程中的）反洗钱调查等必要程序，并在上述文件和资料发生变更时，及时提交变更后的相关文件与资料；

(八) 法律法规、监管规定及本合同约定的其他权利。

六、管理人的义务包括但不限于：

- (一) 依法办理本计划的销售、登记、备案事宜；
- (二) 按照协会要求报送本计划运行信息；
- (三) 按照诚实信用、勤勉尽责的原则履行受托人义务，管理和运用本计划财产；
- (四) 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；
- (五) 制作风险揭示书，向投资者充分揭示相关风险；
- (六) 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本计划财产；
- (七) 建立健全的内部管理制度，保证本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；
- (八) 除依据法律法规、本合同及其他有关规定外，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本计划财产；
- (九) 保守商业秘密，不得泄露本计划的投资计划、投资意向等，依法依规提供信息的除外；
- (十) 公平对待所管理的不同财产，不得从事任何有损本计划财产及其他当事人利益的活动；
- (十一) 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；
- (十二) 按照本合同约定接受投资者和托管人的监督；
- (十三) 以管理人的名义，代表投资者利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
- (十四) 按照本合同约定计算并向投资者报告本计划份额净值；
- (十五) 确定本计划份额参与、退出价格，采取适当、合理的措施确保份额交易价格的计算方法符合法律法规的规定和合同的约定；
- (十六) 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；
- (十七) 按照本合同约定负责本计划会计核算并编制财务会计报告；
- (十八) 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；

(十九) 按照本合同的约定确定收益分配方案，及时向投资者分配收益；

(二十) 根据法律法规与本合同约定，编制向投资者披露的本计划季度、年度等定期报告，向协会备案，并抄报证监会相关派出机构；

(二十一) 办理与受托财产管理业务活动有关的信息披露事项；

(二十二) 建立并保存投资者名单；

(二十三) 组织并参加本计划财产清算小组，参与本计划财产的保管、清理、估价、变现和分配；

(二十四) 按照法律法规和中国证监会的规定，保存本计划的会计账册、妥善保存有关的合同、协议、交易记录等文件、资料和数据，保存期限自本计划终止之日起不得少于 20 年；

(二十五) 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、协会并通知托管人和投资者；

(二十六) 按照我国有关反洗钱法律、行政法规，履行客户身份识别反洗钱义务，识别、核实资产委托人的身份及资产管理计划的受益所有人，并按监管规定保存相关身份信息、资料；在客户身份识别的基础上对客户进行洗钱风险等级划分，对高风险的客户采取适当的风控措施；在法律允许范围内，配合资产托管人开展客户身份识别特别是受益所有人的识别工作，并提供必要客户信息、资料等；履行大额交易和可疑交易报告义务，并对可疑客户采取必要的管控措施。根据反洗钱政策及法规，要求资产委托人积极配合完成（包括本合同签订前和履行过程中的）反洗钱调查等必要程序；

(二十七) 采取了适当的措施，确保资产管理计划的委托人、受益所有人等不得为我国公安部等有权部门发布的恐怖活动组织及恐怖活动人员名单，不得为联合国、美国、欧盟等国家和国际组织发布的反洗钱和反恐怖融资名单，或中国人民银行及其他监管机构要求执行的反洗钱和反恐怖融资名单；

(二十八) 资产管理计划的投资行为不得违反我国、联合国、美国、欧盟等国家和国际组织有关经济制裁或反洗钱法律法规规定，或用于其他洗钱、恐怖融资、逃税、欺诈等非法用途；

(二十九) 管理人应根据法律法规及监管规定履行反洗钱义务，并根据人民银行有关规定向托管人发送本计划“受益所有人”信息，配合托管人履行反洗钱

义务；

(三十)除必要的信息披露及监管要求外，管理人不得以托管人的名义进行营销宣传；

(三十一)法律法规、监管规定和本合同约定的其他义务。

七、托管人的权利包括但不限于：

- (一)按照本合同约定，依法保管本计划财产；
- (二)按照本合同约定，及时、足额获得本计划托管费用；
- (三)法律法规、监管规定和本合同约定的其他权利。

八、托管人的义务包括但不限于：

- (一)安全保管本计划财产；
- (二)除依据法律法规规定和本合同约定外，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本计划财产；

(三)对所托管的不同财产分别设置账户，确保本计划财产的完整与独立；

(四)公平对待所托管的不同财产，不得从事任何有损本计划财产及其他当事人利益的活动；

(五)按规定开设和注销本计划的托管账户及其他投资所需账户；

(六)复核本计划资产净值和份额净值；

(七)办理与本计划托管业务有关的信息披露事项；

(八)根据相关法律法规和本合同约定，复核管理人编制的本计划财产的定期报告中的财务数据，并出具书面意见；

(九)编制私募资产管理业务托管年度报告，并向协会备案，抄报中国证监会相关派出机构；

(十)按照法律法规要求和本合同约定，根据管理人的划款指令，及时办理清算、交割事宜；

(十一)保守商业秘密，除法律法规、本合同及其他有关规定另有要求外，不得向他人泄露；

(一二)根据法律法规和中国证监会的规定保存本计划的会计账册，妥善保存有关的合同、协议、交易记录等文件资料，保存期限自本计划终止之日起不得少于20年；

(十三)监督管理人的投资运作，发现管理人的投资或清算指令违反法律法

规、中国证监会的规定及本合同约定的，应当拒绝执行，立即通知管理人并及时报告中国证监会相关派出机构和协会；

(十四) 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，并向投资者充分揭示；

(十五) 国家有关法律法规、监管规定及本合同约定的其他义务。

托管协议与本合同、说明书约定不一致的，托管人的托管职责以本合同的约定为准。

## 第五部分 本计划的基本情况

一、本计划的基本情况：

(一) 本计划的名称

华安证券季季赢 14 号集合资产管理计划

(二) 本计划的类别

固定收益类集合资产管理计划

(三) 本计划的运作方式

开放式运作

(四) 本计划的投资目标

在严格控制风险的基础上，主要投资于债券等固定收益类资产，把握市场投资机会，追求本集合计划的稳健收益。

(五) 本计划的投资范围

本集合计划投资于国内依法发行的国债、各类金融债(含次级债、混合资本债)、中央银行票据、企业债券、公司债券(含非公开发行公司债)、可转债、可交换债、债券型公募基金、资产支持证券(票据)、现金、债券正回购、债券逆回购、银行存款、同业存单、超短期融资券、短期融资券、中期票据、非公开定向债务融资工具、货币市场基金、定向增发(仅包括在主板、中小板、创业板上市的股票)及中国证监会允许本集合计划投资的其他固定收益类产品。

(六) 本计划的投资比例

本集合计划投资固定收益类资产比例为资产总值的 80-100%。

(七) 本计划的产品风险等级

本集合资产管理计划以固定收益类资产投资为主，根据《证券期货投资者适当性管理办法》及相关规定，经由管理人审慎评估，整体风险处于中低水平，风险评级为 R2 级，可面向 C2、C3、C4 和 C5 类投资者进行推广。投资者承诺并确认自身风险承受能力符合本集合计划的要求，自愿承担参与本集合计划投资所产生的全部风险。

(八) 本计划的存续期限

本计划存续期限为【10】年，到期后可展期。

(九) 本计划份额的初始募集面值为 1 元每份。

(十) 本计划的最低初始募集规模

本计划募集的资产合计不低于【1000】万元人民币。

(十一) 本计划的分级安排

本计划不分级

(十二) 服务机构信息

管理人未委托服务机构为本计划提供相关服务。

(十三) 业绩报酬：本计划对该产品年化收益率超过业绩报酬计提基准的部分提取业绩报酬，提取频率不超过每 6 个月一次。

(十四) 本集合计划于初始募集期或开放期前公告后续运作期间的业绩报酬计提基准等要素，若需调整业绩报酬计提基准，管理人需提前通知托管人，调整后计提基准以管理人公告为准。

管理人通过深入分析国内外宏观经济走势、社会资金运动及各项宏观经济政策对金融市场特别是货币市场的影响，密切关注市场资金面松紧变化，把握市场利率走势，合理确定集合计划的开放申购的时机、规模、投资标的以及业绩报酬计提基准的范围。管理人确定业绩报酬计提基准主要基于集合计划投资标的的收益情况估算，但并不是管理人向投资者保证其资产本金不受损失或者保证取得最低收益的承诺，投资风险为投资者自行承担。

本集合计划的业绩报酬计提基准仅为管理人提取业绩报酬的标准，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。

(十五) 本集合计划的各项费用

1. 认购/申购费率：0%

2. 托管费率：0.05%/年

3. 管理费率：0.8%/年

4. 退出费率：0%

5. 业绩报酬/其他费用：本计划对该产品年化收益率超过业绩报酬计提基准的部分提取业绩报酬，提取频率不超过每 6 个月一次。本计划于初始募集期或于放期前至少两个工作日公告下一个封闭期的业绩报酬计提基准等要素；其他费用包括计划财产划拨支付的银行费用、证券交易费用、本计划成立后的信息披露费用、本计划成立后与本计划有关的会计师费（包含审计费）和律师费以及按照法律法规及本合同约定可以在本计划财产中列支的其他费用。

（十六）其他需要订明的内容

无。

## 第六部分 本计划的募集

### 一、本计划的募集对象

本计划向合格投资者募集，计划份额持有人累计不得超过 200 人。

合格投资者是指具备相应风险识别能力和风险承受能力，投资于本计划的金額不低于【30】万元且符合下列条件的自然人、法人或者其他组织：

（一）具有 2 年以上投资经历，且满足以下条件之一的自然人：家庭金融资产不低于 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）依法设立并接受国务院金融监督管理机构监管的机构，包括证券公司及其子公司、基金管理公司及其子公司、期货公司及其子公司、在中国证券投资基金业协会登记的私募基金管理人、商业银行、金融资产管理公司、信托公司、保险公司、保险资产管理机构、财务公司及中国证监会认定的其他机构；

（四）接受国务院金融监督管理机构监管的机构发行的资产管理产品；

（五）基本养老金、社会保障基金、企业年金等养老基金，慈善基金等社会公益基金，合格境外机构投资者（QFII）、人民币合格境外机构投资者（RQFII）；

（六）中国证监会视为合格投资者的其他情形。

### 二、本计划的募集方式

本计划通过管理人及其指定的销售机构向特定客户进行销售，具体发售方式见《计划说明书》。投资者认购本计划，必须与管理人和托管人签订资产管理合同，按销售机构规定的方式足额缴纳认购款项。投资者认购的具体金额和本计划份额以注册登记机构的确认结果为准。

推广机构应将本计划资产管理合同、计划说明书等正式推广文件，置备于推广机构。本计划应当面向合格投资者推广，客户风险承受能力应与本计划相匹配，推广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，引导客户审慎做出投资决定。禁止通过签订保本保底补充协议等方式，或者采用虚假宣传、夸大收益和商业贿赂等不正当手段推广本计划。

管理人及推广机构应当采取有效措施，通过管理人、中国证券业协会、中国证监会电子化信息披露平台或者中国证监会认可的其他信息披露平台，客观准确披露本计划批准或者备案信息、风险收益特征、投诉电话等，使投资者详尽了解本计划的特性、风险等情况及投资者的权利、义务，但不得向合格投资者之外的单位和个人募集资金，不得公开或变相公开募集资产管理计划，不得通过报刊、电台、电视、互联网等传播媒体或者讲座、报告会、传单、布告、自媒体等方式向不特定对象推广本计划。

### 三、本计划的募集期限

本计划的募集期限由管理人根据相关法律法规以及本合同的规定确定，初始募集期自资产管理计划份额发售之日起不超过 60 天。管理人有权根据本计划销售的实际情形按照相关程序延长或缩短初始募集期，此类变更适用于所有募集机构。延长或缩短募集期的相关信息将及时发布通知，即视为履行完毕延长或缩短募集期的程序。

### 四、募集账户信息

本计划销售募集账户由计划管理人和管理人委托的销售机构自行开立，销售募集账户的开户行、账户名称、账户号码及监督机构等信息以计划管理人或销售机构届时公告为准。

### 五、本计划认购费用

本计划的认购费率为【0】。

认购费用的计算方式：认购费用=认购金额\*认购费率

### 六、本计划认购申请的确认

(一) 认购程序。投资者办理认购业务时应提交的文件和办理手续、办理时间、处理规则等在遵守本合同规定的前提下，以销售机构的具体规定为准。

(二) 认购申请的确认。认购申请受理完成后，投资者不得撤销。销售网点受理认购申请并不表示对该申请是否成功的确认，而仅代表销售网点确实收到了认购申请，申请是否有效应以注册登记机构的确认并且本计划成立为准。投资者应在本计划成立后到各销售网点查询最终确认情况和有效认购份额。

(三) 投资者签订本合同、其认购的本计划份额经注册登记机构确认后正式成为本计划投资者。

(四) 注册登记机构可按照“时间优先，金额优先”的原则在募集期届满后对认购金额申请予以确认。在采用本原则进行确认时，认购时间在前者被优先确认，认购时间相同时认购金额高的投资者优先被确认。

当计划达到目标规模后，管理人有权暂停接受投资者的认购申请。如果当日认购申请的份额加上已有的认购份额已经超过目标规模，则次日对认购申请的份额按照“时间优先，金额优先”原则进行确认，以保证集合计划份额不超过目标规模。

对未被确认的投资人，管理人应在募集期届满后 30 日内向投资者的资金结算账户中返还该等投资者已缴纳的认购金额，并加计银行同期活期存款利息。

#### 七、认购份额的计算方式

认购份额的计算方法如下：

认购份数 = (认购金额 + 认购期间的利息) / 资产管理计划份额初始销售面值

认购份额的计算保留到小数点后 2 位，小数点后 2 位以后的部分舍去，舍去部分归入资产管理计划资产。

#### 八、初始认购资金的管理及利息处理方式

管理人应将本计划募集期间客户的资金存放于下列计划募集结算专用账户，在本计划初始募集行为结束前，任何个人和机构不得动用。募集结算专用账户通过管理人网站 (<http://www.hazq.com>) 披露和查询。

#### 九、本计划的最低认购金额和支付方式

认购资金应以现金形式交付。投资者初始单笔认购金额不低于 30 万元人民币（最低认购金额不包含认购费）并可追加认购，单笔最低追加金额为 1000 元（不含认购费用）。管理人可以对每个账户的认购和持有计划份额进行限制，具

体限制请参见《计划说明书》或相关公告。

十、认购资金在募集期间发生的利息收入按银行同业活期存款利率计算。投资者的认购参与款项（不含认购费用）加计其在初始销售期形成的利息将折算为资产管理计划份额归投资者所有，其中利息转份额的具体数额以注册登记机构的记录为准。利息的计算保留到小数点后 2 位，小数点后 2 位以后的部分舍去，舍去部分归入本计划财产。

## 第七部分 本计划的成立与备案

### 一、本计划成立的条件

- （一）本计划初始募集规模不低于 1000 万元；
- （二）投资者人数不少于 2 人，且不超过 200 人；
- （三）募集过程符合法律、行政法规和中国证监会的规定。

二、本计划的募集金额缴足之日起 10 个工作日内，管理人应当委托具有证券相关业务资格的会计师事务所进行验资并出具验资报告，并在取得验资报告后公告本计划成立。管理人应在本计划成立起 5 个工作日内报协会备案，抄报中国证监会相关派出机构。本计划成立前，任何机构和个人不得动用投资者参与资金。

### 三、本计划募集失败的处理方式

募集期届满，本计划未达到本合同约定的成立条件的，本计划募集失败，则管理人应当承担下列责任：

- （一）以固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用；
- （二）在募集期届满后 30 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，利息金额以本计划注册登记机构的记录为准。托管人仅依据管理人的划款指令办理有关集合计划设立失败后资金的退还有关事宜，因上述事宜产生的任何纠纷由管理人与投资者协商解决，托管人需提供必要的协助配合。

由于监管政策及指导意见的不时更新与变动，本计划可能存在无法成立或无法进行备案的风险，全体投资者确认，管理人及托管人对此不承担任何责任。

四、本计划在成立后备案完成前，不得开展投资活动，符合本合同约定以现金管理为目的的投资行为除外。

## 第八部分 本计划的参与、退出与转让

一、本计划运作期间的开放期内，投资者可办理参与和退出业务。

### 二、参与和退出场所

本计划运作期间的募集机构包括本计划管理人和计划管理人委托的代销机构。

计划投资者应当在募集机构办理计划销售业务的营业场所或按募集机构提供的其他方式办理计划份额的申购和赎回。计划管理人可根据情况变更或增减计划代销机构，并予以通知。

### 三、参与和退出的开放日和开放时间

本计划自成立之日起3个月为封闭期，首个开放期为封闭期满后首个自然月的15日、16日，之后每满3个月当月的15日、16日为后续开放期，遇节假日及非交易日顺延。如有变动，管理人可视情况调整，以管理人公告为准。投资者可根据管理人届时的公告在开放期进行参与或退出。开放期开放时间后的申请均确认失败。

若中国证监会会有新的规定，或出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更或发生其他特殊情况，管理人将视情况对前述开放期及开放时间进行相应的调整并告知投资者。

管理人在其网站上发布公告即视为履行了向投资者告知的义务。

当发生合同变更、监管规则修订等需要临时开放的情况时，管理人可公告临时开放期，投资者可在临时开放期退出本计划，临时开放期具体安排以管理人公告为准。

### 四、参与和退出的方式、价格、程序及确认

(一)“未知价”原则，即本计划的参与和退出价格以参与和退出申请提交日所在交易日收市后计算的计划份额净值为基准进行计算。

(二)本计划采用金额参与和份额退出的方式，即参与以金额申请，退出以份额申请。

(三)投资者办理参与、退出等业务时应提交的文件和办理手续、办理时间、处理规则等在遵守本合同规定的前提下，以销售机构的具体规定为准。

(四)当日的参与和退出申请可以在当日开放时间结束前撤销，在当日的开放时间结束后不得撤销。

(五)参与和退出申请的确认。销售网点受理参与和退出申请并不表示对该申请是否成功的确认，而仅代表销售网点确实收到了参与或退出申请。参与申请采取时间优先、金额优先原则进行确认，退出申请按时间优先、先进先出的方式处理，即管理人按时间优先的原则，对投资者账户中的计划份额进行处理，即先确认的份额先退出，后确认的份额后退出。申请是否有效应以注册登记机构的确认为准。注册登记机构应在法律法规规定的时限内对投资者参与、退出申请的有效性进行确认。投资者可在当个开放期结束后至各销售网点查询最终确认情况。

(六)参与和退出申请的款项支付。参与采用全额交款方式，若资金在规定时间内未全额到账则参与不成功，为无效申请，已交付的委托款项将退回投资者指定资金账户。投资者退出申请确认后，管理人应按规定向投资者支付退出款项，退出款项自确认之日起7个工作日内支付退出款项。在发生巨额退出时，退出款项的支付办法按本合同和有关法律法规规定处理。

(七)管理人在不损害投资者权益的情况下，经与销售机构协商一致，可更改上述原则，但最迟应在新的原则实施前3个工作日告知投资者。管理人提前3个工作日在其网站集合理财相关区域上发布公告即视为履行了向投资者告知的义务。同时，管理人应提前书面告知销售机构。

#### 五、参与和退出的金额限制

投资者在本计划存续期开放日购买本计划份额的，投资者应符合合格投资者标准，且参与金额应不低于【30】万元人民币（不含参与费用），已持有本计划份额的投资者在本计划存续期开放日追加购买资产管理计划份额的除外。现有投资者在本计划存续期参与与开放期追加本计划份额的，单笔追加金额应不低于1000元人民币（不含参与费用）。

当投资者持有的计划份额所对应的资产净值高于【30】万元人民币时，投资者可以选择全部或部分退出本计划份额；选择部分退出本计划份额的，投资者在退出后持有的计划份额所对应的资产净值不得低于【30】万元。当管理人发现投资者申请部分退出本计划将致使其在部分退出申请确认后持有的计划份额所对应的资产净值低于【30】万元人民币的，管理人有权适当减少或增加该投资者的退出金额，以保证部分退出申请确认后投资者持有的计划份额所对应的资产净值不低于【30】万元或全部退出。当投资者持有的计划份额所对应的资产净值低于【30】万元人民币（含【30】万元人民币）时，需要退出本计划的，投资者必须

选择一次性全部退出本计划。

在符合上述规定的前提下，管理人可根据市场情况，合理调整对参与金额和退出份额的数量限制并告知投资者。管理人在其网站集合理财相关区域上发布公告即视为履行了向投资者告知的义务。

#### 六、参与和退出的费用

本计划参与费率为【0】，退出费率为【0】。

参与费用=参与金额\*费率

退出费用=退出份额\*份额净值\*费率

#### 七、参与份额和退出金额的计算方式

(一) 本计划参与份额的计算方式

本计划参与份额的计算方式如下：

参与份额=参与金额(不含参与费用)/参与申请所在交易日的资产管理计划份额净值

其中，参与份额(不含参与费用)的计算结果保留到小数点后2位，小数点2位以后的部分四舍五入，由此产生的误差产生的收益或损失由计划财产承担。

(二) 本计划退出金额的计算方式

本计划退出金额的计算方式如下：

退出总额=退出份额×退出申请所在交易日的资产管理计划份额净值

退出金额=退出总额-退出费用-业绩报酬

其中，退出总额和退出金额的计算结果保留到小数点后2位，小数点2位以后的部分四舍五入，由此产生的误差产生的收益或损失由计划财产承担。

#### 八、参与资金的利息处理方式

投资者的参与资金在募集期产生的利息将折算为计划份额归投资者所有。

#### 九、单个委托人大额退出的认定、申请和处理方式

(一) 单个委托人大额退出的认定

在单个开放日，本集合计划净退出申请份额(退出申请份额总数扣除参与申请份额总数后的余额)超过1000万份(包括1000万份)时，即认为发生了大额退出。

(二) 单个委托人大额退出的申请和处理方式

当委托人申请大额退出时，需提前3个工作日向管理人提出书面预约。如构

成巨额退出，应按巨额退出程序办理。

## 十、巨额退出和连续巨额退出

### （一）认定标准

若本计划于某个退出开放期内的计划份额净退出申请超过前一交易日的计划总份额的【10%】，即认定为计划发生了巨额退出。同一退出开放期内连续2个开放日以上（含2个交易日）发生巨额退出，即认定为计划发生了连续巨额退出。

### （二）退出顺序、退出价格确定和退出款项支付

出现巨额退出时，管理人和销售机构协商一致，可以根据本计划当时的资产状况决定接受全额退出或部分退出。出现连续巨额退出时，如管理人认为有必要，可暂停接受计划份额退出申请；已经接受的退出申请可以延缓支付退出款项，但不得超过【20】个工作日，并应当及时告知投资者。

1、全额退出：当管理人和销售机构认为有能力兑付投资者的全部退出申请时，管理人接受全额退出，并按正常退出程序执行。

2、部分退出：当管理人认为支付投资者的退出申请有困难或认为因支付投资者的退出申请而进行的财产变现可能会对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交易日计划总份额的【10%】的前提下，可对其余退出申请延期办理。对于当日的退出申请，应当按单个账户退出申请量占退出申请总量的比例，确定当日受理的退出份额；对于未能退出部分，投资者在提交退出申请时可以选择延期退出或取消退出。选择延期退出的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部退出为止；选择取消退出的，当日未获受理的部分退出回申请将被撤销。延期的退出申请与下一开放日退出申请一并处理，无优先权并以下一开放日的各类计划份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部退出为止。如投资者在提交退出申请时未作明确选择，投资者未能退出部分作自动延期退出处理。

### （三）告知客户方式

当发生巨额退出、连续巨额退出时，管理人应当及时告知投资者。管理人在其网站集合理财相关区域上发布公告即视为履行了向投资者告知的义务。

## 十一、延期支付及延期退出的情形和处理方式

发生下列情形时，管理人可延期支付退出款项或延期办理投资者退出申请：

- (一) 因不可抗力导致管理人不能支付赎回款项。
- (二) 发生本合同规定的暂停基金资产估值情况。
- (三) 证券/期货交易所交易时间非正常停市, 导致管理人无法计算当日计划资产净值。
- (四) 同一退出开放期内连续两个或两个以上交易日发生巨额退出。
- (五) 发生继续接受退出申请将损害现有份额持有人利益的情形时。
- (六) 当前一估值日计划资产净值 50% 以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时, 经与托管人协商确认后, 管理人应当延期支付退出款项或延期办理退出申请。
- (七) 法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一且管理人决定延期支付或延期支付时, 已确认的退出申请, 管理人应足额支付; 如暂时不能足额支付, 应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给退出申请人, 未支付部分可延期支付。若出现上述第(四)款所述情形, 按本合同的相关条款处理。在延期退出的情况消除时, 管理人应及时恢复退出业务的办理并及时告知投资者。

## 十二、拒绝或暂停参与、暂停退出的情形及处理方式;

(一) 在如下情况下, 管理人可以拒绝接受投资者的参与申请:

1. 本计划份额持有人达到 200 户;
2. 根据市场情况, 管理人无法找到合适的投资品种, 或其他可能对本计划业绩产生负面影响, 从而损害现有投资者的利益的情形;
3. 因本计划所持某个或某些证券进行权益分派等原因, 使管理人认为短期内接受参与可能会影响或损害现有投资者利益的;
4. 管理人认为接受某笔或某些参与申请可能会影响或损害其他投资者利益的;
5. 法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

管理人决定拒绝接受某些投资者的参与申请时, 参与款项将退回投资者账户。

(二) 在如下情况下, 管理人可以暂停接受投资者的参与申请:

1. 因不可抗力导致无法受理投资者的参与申请;
2. 证券、期货交易场所交易时间临时停市, 导致管理人无法计算当日计划资产净值和计划份额净值;

3. 发生本合同规定的暂停计划资产估值情况；
4. 法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

管理人决定暂停接受全部或部分参与申请时，应当告知投资者。在暂停参与的情形消除时，管理人应及时恢复参与业务的办理并予以告知投资者。

(三) 在如下情况下，管理人可以暂停接受投资者的退出申请：

1. 因不可抗力导致管理人无法支付退出款项。
2. 证券交易所交易时间临时停市，导致管理人无法计算当日计划资产净值和计划份额净值。
3. 发生本合同规定的暂停本计划资产估值的情况。
4. 连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。
5. 法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一的，管理人应当及时告知投资者。在暂停退出的情况消除时，管理人应及时恢复退出业务的办理并及时告知投资者。管理人在其网站集合理财相关区域上发布公告即视为履行了向投资者告知的义务。

### 十三、本计划投资运作期间的份额转让

投资者可以通过证券交易所以及中国证监会认可的其他方式，向合格投资者转让其持有的本计划份额，并按规定办理份额变更登记手续。转让后，持有本计划份额的合格投资者合计不得超过 200 人。

管理人应当在本计划份额转让前，对受让人的合格投资者身份和本计划的投资者人数进行合规性审查。受让方首次参与本计划的，应当先与管理人、托管人签订资产管理合同。

### 十四、非交易过户的受理条件与流程

1. 管理人及注册登记机构只受理继承、捐赠、司法强制执行和经注册登记机构认可的其他情况下的非交易过户。其中：

“继承”是指投资者死亡，其持有的计划份额由其合法的继承人继承。

“捐赠”是指投资者将其持有的计划份额向公益机构转赠，或将其持有的计划份额产生的收益向公益机构转赠。

“司法强制执行”是指司法机构依据生效司法文书将投资者持有的计划份额强制划转给其他自然人、法人、社会团体或其他组织的情形。

2. 办理非交易过户业务必须提供注册登记机构规定的相关资料。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；申请人按注册登记机构规定的标准缴纳过户费用。

#### 十五、管理人以自有资金参与本计划

##### （一）自有资金参与的条件

管理人以自有资金参与本计划，应符合法律、行政法规和中国证监会的规定，并按《中华人民共和国公司法》和公司章程的规定，获得公司董事会、监事会或其他授权程序的批准。

##### （二）自有资金的参与方式

管理人在募集期和存续期内可以以自有资金参与本计划。

##### （三）自有资金参与的份额比例

自有资金参与的份额不得超过本计划总份额的 20%。管理人及其附属机构以自有资金参与本计划的份额合计不得超过计划总份额的 50%。因本计划规模变动等客观因素导致前述比例被动超标的，管理人应当依照中国证监会规定及本合同约定及时调整达标。

##### （四）自有资金的收益分配

管理人自有资金所持的集合资产管理计划份额，应当与投资者所持的同类份额享有同等权益、承担同等风险。

##### （五）自有资金的责任承担

管理人以自有资金所持的本计划份额，与其他份额持有人所持的同类计划份额享有同等权益、承担同等风险。

##### （六）自有资金的退出

管理人自有资金参与本计划的持有期限不得少于 6 个月。自有资金参与、退出时，应提前 5 个工作日告知投资者和托管人。

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，但应及时告知投资者和托管人，并向相关证监会派出机构及协会报告。

#### 十六、管理人应定期将本计划投资者变更情况报送协会。

## 第九部分 份额持有人大会及日常机构

本集合计划不设置份额持有人大会及日常机构。

## 第十部分 计划份额的登记

一、资产管理计划的注册登记业务指资产管理计划的登记、存管、清算和结算业务，具体内容包括投资者资产管理计划账户建立和管理、资产管理计划份额的注册登记、资产管理计划销售业务的确认、清算和结算、代理发放红利、建立并保管投资者名册等。

二、本计划的注册登记业务由【华安证券股份有限公司】负责办理。

三、资产管理人委托其他机构代为办理本计划份额登记业务的，应当与有关机构签订委托代理协议。本计划份额登记机构的权限和职责如下：

(一) 注册登记机构享有如下权利：

1. 建立和管理投资者的资产管理计划账户；
2. 取得注册登记费；
3. 保管投资者开户资料、交易资料、投资者名册等；
4. 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并依法公告；
5. 法律法规规定的其他权利。

(二) 注册登记机构承担如下义务：

1. 配备足够的专业人员办理资产管理计划的注册登记业务；
2. 严格按照法律法规和资产管理合同规定的条件办理资产管理计划的注册登记业务；
3. 妥善保存登记数据，并将集合资产管理计划投资者名称、身份信息以及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。其保存期限自资产管理计划账户销户之日起不得少于 20 年；
4. 对投资者的账户信息负有保密义务，因违反该保密义务对投资者或资产管理计划带来的损失，须承担相应的赔偿责任，但司法强制检查情形除外；
5. 按资产管理合同和计划说明书规定为投资者办理非交易过户等业务，并提供其他必要服务；
6. 法律法规规定的其他义务。

四、本计划全体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本计划投资者名称、身份信息以及本计划份额明细等数据备份至中国证监会认定的机构。

## 第十一部分 资产管理计划的投资

### 一、本资产管理计划的投资目标

在严格控制风险的基础上，主要投资于债券等固定收益类资产，把握市场投资机会，追求本集合计划的稳健收益。

### 二、本资产管理计划的投资范围及比例

#### (一) 投资范围

1、本集合计划投资于国内依法发行的国债，各类金融债（含次级债、混合资本债）、中央银行票据、企业债券、公司债券（含非公开发行公司债）、可转债、可交换债、债券型公募基金、资产支持证券（票据）、现金、债券正回购、债券逆回购、银行存款、同业存单、超短期融资券、短期融资券、中期票据、非公开定向债务融资工具、货币市场基金、定向增发（仅包括在主板、中小板、创业板上市的公司股票）及中国证监会允许本集合计划投资的其他固定收益类产品。投资信用类债券，主体评级（或债项）必须在AA（含）以上。

2、本集合计划所投资资产支持证券（票据）应满足如下要求：

本集合计划投资资产支持证券（票据），底层资产非产品，底层资产相对分散，现金流稳定，现金流归集路径清晰；本集合计划投资资产支持证券（票据），仅限于投资优先级，且投资评级为AA（含）以上的份额；本集合计划投资资产支持证券（票据），投资品种挂牌场所为银行间市场和交易所市场。

3、本集合计划可参与可转债与可交换债转股。

4、投资者在此同意并授权管理人可以将计划的资产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。交易完成5个工作日内，管理人应书面通知托管人，通过管理人的网站告知投资者，并向中国证监会相关派出机构、证券投资基金业协会和证券交易所报告。

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。法律法规或中国证监会变更集合计划原有投资品种投资比例限制的，资产管理人在履行合同变更程序后，

可以相应调整本集合计划的投资比例上限规定。

## （二）资产配置比例

1、本集合计划投资固定收益类资产比例为资产总值的 80-100%，参与债券正回购金额不得超过该计划资产净值的 100%，中国证监会另有规定的除外；

2、本集合计划投资于同一资产的资金，不超过该计划资产净值的 25%；管理人管理的全部集合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。

全部投资者均为符合中国证监会规定的专业投资者且单个投资者投资金额不低于 1000 万元的封闭式集合资产管理计划，以及完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的资产管理计划等中国证监会认可的其他集合资产管理计划，不受前款规定限制。

3、本集合计划投资可转债、可交换债等产品金额不超过资管计划资产净值的 40%；

4、本集合计划参与权益类资产不超过计划资产净值的 20%；

5、现金类资产

本集合计划现金类资产比例为资产总值的 0-100%。其中，现金类资产包括但不限于：现金、银行存款、同业存单、剩余期限在 7 天以内的债券逆回购、货币市场基金、期限在 1 年以内的国债、政策性金融债及央行票据等。

法律法规或中国证监会允许计划投资其他品种的，资产管理人应事先取得投资者同意，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。

本计划成立后备案完成前，管理人可以现金管理为目的，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。

## 三、投资比例超限的处理方式及流程

因证券期货市场波动、证券发行人合并、资产管理计划规模变动等管理人之外的因素导致资产管理计划投资不符合法律、行政法规和中国证监会规定的投资比例或者合同约定的投资比例的，管理人应当在流动性受限资产可出售、可转让或者恢复交易的十五个交易日内调整至符合相关要求。确有特殊事由未能在规定时间内完成调整的，管理人应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。

四、本资产管理计划的风险收益特征；

本计划以固定收益类资产投资为主，风险评级为 R2 级。

五、本资产管理计划的投资策略

(一) 资产配置策略

管理人通过将集合计划资产主要配置于国债、金融债、公司债等固定收益类资产，同时辅之以权益类资产配置，将组合整体投资风险控制在较低水平，逐步提升组合收益水平。

(二) 固定收益类资产投资策略

本集合计划将运用多种积极管理增值策略，重点投资于债券等固定收益类金融产品，在严格控制信用风险的前提下，追求较高的稳健收益。其投资策略主要有持有到期策略、利率预期策略、收益率曲线策略、类属替换策略、个券优选策略等。同时，管理人将坚持基本面分析，充分挖掘公司债等新型信用品种的投资机会。

主要投资策略有：

1、持有到期策略

在流动性许可的情况下，管理人对本集合计划部分固定收益类资产将采取持有到期策略，该部分债券的剩余期限与其买入时本集合计划的剩余期限相匹配，从而有效地降低再投资风险，做到收益性与流动性兼顾。

2、利率预期策略

管理人通过对影响债券投资的宏观经济状况和货币政策等因素的分析判断，形成对未来市场利率变动方向的预期，主动地调整债券投资组合的久期，提高债券投资组合的收益水平。

首先，本集合计划主要依据如下因素预期利率变动趋势：

- (1) 财政、货币政策分析；
- (2) 增长率及其变化趋势；
- (3) 物价水平、货币供应量、债券供求分析等及其预期。

其次，管理人依据对利率的预期，决定债券投资组合的期限结构：

- (1) 如利率预期上升，降低债券组合久期，以规避债券价格下降的风险；
- (2) 如利率预期下降，提高债券组合久期，以较多地获得债券价格上升带来

的收益。

### 3、收益率曲线策略

管理人通过对债券市场微观因素的分析判断,形成对未来收益率曲线形状变化的预期,相应地选择子弹型、哑铃型或梯型的组合期限配置,获取收益率曲线形变带来的投资收益。主要考虑的债券市场微观因素包括:收益率曲线、历史期限结构、新债发行、回购及市场拆借利率等。

### 4、类属替换策略

管理人研究宏观、微观经济,观察公司债、金融债、企业债等信用债券品种与同期限国债之间收益率利差状况,对公司债、金融债、企业债等信用债券品种与同期限国债之间收益率利差的扩大或收窄趋势作出判断;在预期信用利差将收窄时,主动提高信用债券类属品种的投资比例,相应降低同期限国债的投资比例;在预期信用利差将扩大时,主动降低信用债券类属品种的投资比例,相应提高同期限国债的投资比例,从而获取不同债券类属之间利差变化所带来的投资收益。

### 5、个券优选策略

在以上债券资产久期、期限和类属配置的基础上,根据债券市场收益率数据,对单个债券进行估值分析,并结合债券的信用评级、流动性、息票率、税赋、提前偿还和赎回等因素,选择具有良好投资价值的债券品种进行投资。

### 6、公司债券投资策略

管理人采取自上而下与自下而上相结合的投资策略发掘、把握公司债券中蕴藏的投资机会。

管理人运用于公司债券的自上而下的投资策略为前述适用于各种信用债券的类属替换策略,即分析、研究公司债券与同期限国债之间的信用利差状况,在预期信用利差收窄时加大公司债券的配置比例,在预期信用利差扩大时降低公司债券的配置比例;同时,管理人对发债公司基本面和公司债券的具体条款进行深入的研究,通过信用评级建立公司债券备选池。

在既定的组合目标久期和公司债券配置比例下,管理人自下而上地从公司债券备选池中精选具有较高投资价值的个券完成整体组合中公司债券部分的配置。

### 7、含权债券投资策略

本集合计划投资的含权债券主要是含选择权债券。管理人将以期权调整后的收益率水平(OAS)为基础,对含权债券的纯债价值进行评估,同时辅以对标的证

券的研究，选择具体含权债券进行投资。

### （三）权益类资产投资策略

1、本资产管理计划主要采取自下而上的主动投资管理策略，对公司的历史沿革、财务状况、盈利能力及前景、资产及权益价值等进行全面深入的研究分析，自上而下判断公司所在行业在长周期所在的位置以评估公司的合理价值，注重安全边际，选择能为投资者持续创造价值的股票，提高选股的有效性。

#### 2、定增标的精选投资策略

本资产管理计划的股票定量分析方法将在市场现有定增项目中，分析各行业的估值指标（如PE、PB、PE/G、PS、股息率等）、成长性指标（主营业务收入增长率、净利润增长率、毛利率增长率、净利润现金保障倍数等）、现金流量指标和其他财务指标，从中筛选出价值相对低估、成长性确定、现金流状况好、盈利能力和偿债能力强的公司，作为本计划的备选定增股票池；再通过分析各选股票所代表的公司的资产收益率、资产周转率等变量的时间序列，以及通过对市场整体估值水平、行业估值水平、主要竞争对手估值水平的比较，并参考国际市场估值水平来评估其投资价值。

在定量分析的基础上，本计划的股票定性分析方法将采用深度价值挖掘和多层面多维度分析体系，从定增项目目的、定增对象结构、定增项目类别，并结合管理人的投研平台，多层面地分析备选定增项目所对应公司业务环节的竞争优势和劣势，分析定增项目对公司未来的影响，以及对所处行业与上下游产业的影响。管理人将通过调研深入了解发行人的行业背景、市场地位、产销规模、核心技术、股东和管理层情况、持续经营与盈利能力等各方面的信息，对定增价格的合理性做出判断，并结合市场情况、风险偏好和估值水平，在进行全面和深入研究基础上做出投资决定，在控制风险的基础上力求获取较高的定增投资收益。

## 六、投资决策与风险控制

### （一）决策依据

- 1、国家有关法律、法规和本集合计划合同的相关规定；
- 2、根据宏观经济发展态势、微观经济运行环境和有关经济政策以及证券市场趋势制定投资策略；
- 3、利率走势与通货膨胀预期；
- 4、发债主体信用分析和上市公司价值发现；

5、根据所投资品种的风险收益的匹配关系，本集合计划以力争集合计划的资产安全和流动性为重要衡量标准，在此基础上争取较高的收益。

## （二）投资程序

严格、明确的投资流程是本集合计划控制投资风险，进行组合投资的制度保障。本集合计划采取私募资产管理业务决策委员会、资产管理总部私募投资决策小组领导下的投资经理负责制。

### 1、决策机构

管理人资产管理业务投资决策机构分为三级：私募资产管理业务决策委员会、资产管理总部私募投资决策小组和投资经理。

#### （1）私募资产管理业务决策委员会

私募资产管理业务决策委员会是公司私募资产管理业务日常运作的最高决策机构，私募资产管理业务决策委员会根据分工对公司私募资产管理业务重要和重大事项进行决策。

私募资产管理业务决策委员会主要担负以下职能：根据市场状况、公司战略目标和监管要求，在公司经营管理层的授权范围内，确定私募资管业务发展方向，审核年度和季度投资计划，确定或调整投资风险限额；在股东大会和董事会的决策范围内，确定或调整公司私募资产管理业务的投资目标、投资方向、投资策略；确定私募资管业务的重要风险控制指标、实时监控以及稽查方案，并组织实施；审核主动投资类、融资类和银证合作等各类资产管理业务产品方案，确定和调整产品投资经理人选；在规定限额内，研究审批或调整投资方案；审议创新型业务或交易结构复杂的投资；根据需要，对资产管理总部私募投资决策小组以及投资人员投资授权权限进行调整；研究审议私募资产管理业务部门提请审议的与私募资产管理业务有关的其他事项。

#### （2）资产管理总部私募投资决策小组

管理人资产管理总部私募投资决策小组接受私募资产管理业务决策委员会监督，并根据本集合计划投资方案和投资范围进行业务运作，严禁突破计划和方案的范围越权经营。主要担负以下职能：具体确定资金运用范围和仓位比例；制定阶段性投资策略；对投资经理上报投资方案进行讨论，并确定最终投资方案；对投资经理行为进行监督和审核等。

#### （3）投资经理

投资经理人员在私募资产管理业务决策委员会、资产管理总部私募投资决策小组授权范围内，主要担负以下职能：负责投资方案的具体实施；投资组合的构建与日常管理；交易指令的下达；根据市场变化提请私募投资决策小组及时对投资策略组织讨论、调整等。

## 2、决策程序

本集合计划管理人对集合计划的投资职能由集合计划管理人资产管理总部执行。该部门的整个投资业务流程包括以下环节：确定投资目标和投资原则；开展投资分析与研究；制定投资策略与资产配置比例；进行投资组合管理；交易实施；风险管理与组合的调整。

### (1) 确定投资目标和投资原则

私募资产管理业务决策委员会根据国家有关法律法规的规定、本合同、公司资产管理业务有关管理制度，确定本集合计划投资目标、投资原则以及资产配置原则等。

### (2) 开展投资分析与研究

资产管理总部从宏观经济形势、行业发展趋势、市场趋势、投资标的的评价结果等多个角度综合分析，运用定性和定量方法进行研究，经过评级、估值和风险评判，通过严格的筛选程序，构建投资对象一级备选库，撰写研究报告和市场投资策略，并根据市场变化情况，适时做出调整。

### (3) 制定投资策略与资产配置比例

资产管理总部私募投资决策小组综合考虑政治、经济及资本市场状况等因素，根据投资目标、投资原则以及资产配置原则和研究建议，确定投资对象二级备选库，提出投资对象核心备选库名单及调整建议，确定投资策略和将总体资产分配到不同类型资产的比例，并报私募资产管理业务决策委员会审议。

### (4) 进行投资组合管理

投资经理在授权范围内，根据投资策略与资产配置比例，从投资对象备选库中选择合适的投资标的构建投资组合，并负责进行投资组合的日常管理。

### (5) 交易实施

投资经理根据投资组合管理需要，做出投资决定，通过电子或书面形式向资产管理总部下属集中交易室发出交易指令。交易室根据投资限制和市场情况对交易指令进行审查，确认无误后，交易员按交易指令确定的种类、价格、数量、时

间予以执行，将交易结果及时反馈投资经理。如果市场和个别证券交易出现异常情况，交易员应及时提示投资经理。

#### (6) 风险管理与组合的调整

在投资决策过程中，公司风险管理部负责对集合计划的投资限制、市场风险、流动性风险及信用风险等投资风险进行事前评估、事中监控以及事后跟踪分析，并在整个投资流程完成后，对投资风险及绩效做出评估，提供给私募资产管理业务决策委员会、公司相关分管领导、资产管理总部等相关人员，监督资产管理总部对投资组合进行实时调整。资产管理总部也设置专门的风控管理岗承担本部门风险管理二作。

公司合规管理部和风险管理部负责对本集合计划投资的合规性风险、操作风险、道德风险以及其他风险进行监督和检查，稽核部负责对本集合计划的运行开展常规稽核和专项稽核。

### (三) 风险控制

#### 1、风险控制原则

公司资产管理业务内部控制应当遵循以下原则：

(1) 合法合规原则。公司资产管理业务内部控制机制以及相关制度必须严格遵守国家法律、法规、规章和相关规定。

(2) 健全性原则。内部控制机制必须覆盖公司与资产管理业务相关的各个部门和各级岗位，并渗透到决策、执行、监督、反馈等各个环节。

(3) 全面性原则。资产管理业务内部控制制度必须涵盖公司资产管理业务的各个环节，并普遍适用于相关岗位的每一个员工，不留有制度上的空白或漏洞。

(4) 有效性原则。通过科学的内控手段和方法，建立合理、切实可行的内部控制程序，维护内部控制制度的有效执行。任何员工不得拥有超越制度约束的权力。

(5) 独立性原则。公司负责资产管理业务的部门和岗位应当保持一定的相对独立性，公司资产管理业务客户资产与公司自有资产、其他资产的运作必须分离。

(6) 相互制衡原则。公司资产管理业务的部门和岗位设置必须权责分明、相互制衡。

(7) 防火墙原则。公司负责资产管理业务的部门和人员与公司投资银行业

务、经纪业务、自营业务和固定收益等部门，必须在物理和制度上适当隔离。

(8) 审慎性原则。公司资产管理业务内部控制的核心是风险控制，内部控制机制的建立应以审慎经营、防范和化解风险为出发点。

(9) 适时性原则。公司资产管理业务内部控制制度的制定应当具有前瞻性，并且必须随着公司经营战略、经营方针、经营理念等内部环境的变化和国家法律法规、政策制度等外部环境的变化及时进行相应的修改或完善。

(10) 成本效益原则。公司资产管理业务通过科学的经营管理方法，降低运营成本，提高经济效益，以合理的控制成本，努力实现效益最佳的内部控制效果。

## 2、风险控制体系

公司集合资产管理业务内部控制体系包括内部控制体系主体和内部控制制度体系。

公司内部控制体系的主体包括董事会、董事会风险控制和投资决策委员会、经营管理层、私募资产管理业务决策委员会、合规管理部、风险管理部、稽核部、法律事务室、资产管理总部以及其他相关部门和岗位。公司根据自身经营的特点，设立顺序递进、权责统一、严密有效的四道内部控制防线。包括：

(1) 建立一线岗位自控与互控为基础的第一道内控防线。各岗位职责明确，有详细的岗位职责和业务流程，各岗位人员在授权范围内承担责任。直接与客户、技术系统、资金、有价证券、重要空白凭证、业务用章等接触的岗位，必须严格实行双人负责制度。属于单人单岗处理的业务，原则上由上一级主管履行监督职责。

(2) 建立部门与部门之间、各部门内设部门之间的自控和互控为基础的第二道内控防线。公司在相关部门之间建立合理的重要业务处理凭证传递机制和顺畅的信息传递制度，相关部门分别在授权范围内承担各自职责，并相互监督制衡。各部门在内部自行检查，发现和消除各类风险隐患，规范业务流程，完善内控管理。

(3) 建立合规管理部、风险管理部、稽核部和法律事务室对各部门、各岗位、各项业务全面实施监督反馈的第三道内控防线。合规管理部和风险管理部对业务运作中的风险进行识别、评估、监测、反馈、防范并提出改进建议，对业务风险进行事前审核、事中监测和事后检查，审核和管理合同文本。稽核部对业务经营活动开展常规稽核和非常规稽核，检查和评价公司内部制度的建设和执行情况。

况。法律事务室对重大投资和经营活动提供法律咨询和监督，处理仲裁、诉讼以及其他法律纠纷。

(4) 建立以董事会及董事会风险控制与投资决策委员会、经营管理层、私募资产管理业务决策委员会为主体的第四道内控防线。董事会及董事会风险控制与投资决策委员会代表董事会对公司集合资产管理业务风险进行总体控制，发现公司内部控制中出现的隐患并组织解决，对公司合规管理部、风险管理部、稽核部等部门的工作予以监督、指导。私募资产管理业务决策委员会负责贯彻和落实公司资产管理业务有关内控制度，研究确定客户资产投资策略和配置原则，审议投资对象和进行投资授权。

公司内部控制制度体系按照其所管理的层次，由三个层次的制度构成：第一层次是公司章程；第二层次是公司资产管理业务管理和内部控制制度；第三层次是公司资产管理总部及相关部门根据业务需要制定的实施细则及操作流程等。

### 3、风险管理程序

风险管理程序包括风险识别、风险测量、风险控制、风险评价和风险报告，以上环节构成了一套完整、紧密、有效的风险管理过程。

风险识别是对管理人所面临的，以及潜在的各种风险加以判断、归类和鉴定风险性质的过程。

风险测量是指估计和预测风险发生的概率和可能造成的损失，并根据这两个因素的结合来衡量风险大小的程度。

风险控制是指通过减少风险的手段和建立必要的内部管理制度，实现以合理的成本在最大限度内防范风险和减少损失。

风险评价是指分析风险识别、风险测量和风险控制执行情况 and 运行效果的过程。

风险报告是指将风险事件及处置、风险评价情况以一定程序进行报告的过程。

### 4、合规检查机制

管理人建立公司和部门合规检查分级管理制度。

公司合规管理部是对资产管理业务进行合规检查的职能部门，对资产管理业务相关部门开展合规检查，并向公司提交合规检查报告。

资产管理总部负责人作为第一责任人，对本部门业务风险控制要切实履行相应职责。部门设立合规监督员以独立身份对有关资产管理业务的内部运行定期或

不定期进行检查,并向公司风险管理部和资产管理总部提交资产管理合规检查内部报告。

## 七、投资限制和投资禁止

### (一) 投资限制

为维护投资者的合法权益,对本计划限制以下投资行为:

1、本集合计划投资固定收益类资产比例为资产总值的 80-100%,参与债券正回购金额不得超过该计划资产净值的 100%,中国证监会另有规定的除外。

2、本集合计划投资于同一资产的资金,不超过该计划资产净值的 25%;管理人管理的全部集合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。因集合计划资产净值变动导致投资比例不满足上述约定的,管理人应当在流动性受限资产可出售、可转让或者恢复交易的十五个交易日内调整至符合相关要求。

全部投资者均为符合中国证监会规定的专业投资者且单个投资者投资金额不低于 1000 万元的封闭式集合资产管理计划,以及完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的资产管理计划等中国证监会认可的其他集合资产管理计划,不受前款规定限制。

3、本集合计划投资可转债、可交换债等产品金额不超过资管计划资产净值的 40%;

4、本集合计划参与权益类资产不超过计划资产净值的 20%;

5、投资信用类债券,主体评级(或债项)必须在 AA(含)以上。

### 6、现金类资产

本集合计划现金类资产比例为资产总值的 0-100%。其中,现金类资产包括但不限于:现金、银行存款、同业存单、剩余期限在 7 天以内的债券逆回购、货币市场基金、期限在 1 年以内的国债、政策性金融债及央行票据等。

因证券期货市场波动、证券发行人合并、资产管理计划规模变动等管理人之外的因素导致资产管理计划投资不符合法律、行政法规和中国证监会规定的投资比例或者合同约定的投资比例的,管理人应当在流动性受限资产可出售、可转让或者恢复交易的十五个交易日内调整至符合相关要求。确有特殊事由未能在规定时间内完成调整的,管理人应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。

法律法规或中国证监会允许计划投资其他品种的，资产管理人应事先取得投资者同意，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。

## （二）投资禁止

本计划财产禁止从事下列行为：

1、违规将计划资产投资商业银行信贷资产，为地方政府及其部门提供融资，为地方政府及其部门违规提供担保，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；

2、将计划资产用于可能承担无限责任的投资；

3、向客户做出保证其资产本金不受损失或者保证其取得最低收益的承诺；

4、挪用计划资产；

5、募集资金不入账或者其他任何形式的账外经营；

6、募集资金超过计划说明书约定的规模；

7、接受单一客户参与资金低于中国证监会规定的最低限额；

8、使用计划资产进行不必要的交易；

9、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；

10、法律、行政法规和中国证监会禁止的其他行为。

八、本资产管理计划的建仓期为计划成立之日起【6个月】。建仓期的投资活动，应当符合本资产管理合同约定的投向和资产管理计划的风险收益特征。以现金管理为目的，投资于银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券、货币市场基金等中国证监会认可的投资品种的除外。建仓期结束后，本资产管理计划的资产组合应当符合法律、行政法规、中国证监会规定和合同约定的投向和比例。

九、本计划存续期间，为规避特定风险，全体投资者同意，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%，如遇此种情形，资产管理人应当向在相应类别资产的比例低于计划总资产80%的五个工作日内向资产托管人提供书面说明文件。

十、本计划投资的资产组合的流动性与参与、退出安排相匹配

为应对产品的流动性要求，退出开放期为，本计划资产组合中7个工作日内可

变现资产的价值，不低于该计划资产净值的10%。

7个工作日可变现资产，包括可在交易所、银行间市场正常交易的股票、债券、非金融企业债务融资工具、期货及期权合约及同业存单，7个工作日内到期或者可支取的逆回购、银行存款，7个工作日内能够确认收到的各类应收账款项等。

## 第十二部分 投资顾问

本计划不聘请投资顾问。

## 第十三部分 分级安排

本计划不分级。

## 第十四部分 利益冲突及关联交易

一、在不违反法律法规的强制性规定、不违反本合同约定并严格遵守管理人内部有关投资决策管理及关联交易管理等制度的前提下，本产品可能投资于投资者、管理人、托管人及其关联方所发行、管理、保荐、托管、销售或存在其他法律关系或利益联系的金融产品，或者与该等金融产品以公平合理的价格进行交易，但投资者或托管人各自就其自身或其关联方另有限制并书面通知管理人的除外。投资者知悉并同意本计划从事上述关联交易。

二、管理人将本计划资产投资于管理人、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者承销期内承销的证券，管理人应当建立健全内部审批机制和评估机制，并应当遵循投资者利益优先原则，事后告知投资者和托管人，并采取切实有效措施，防范利益冲突，保护投资者合法权益。管理人以本计划资产从事重大关联交易的，还应向中国证监会相关派出机构和证券投资基金业协会报告，投资于证券期货的关联交易还应当向证券期货交易所报告。在集中交易市场交易的，由管理人参考最近成交价格确定公允价格，在非集中交易市场交易的，由管理人与交易方在不违反公平交易、不进行利益输送等合法合规原则下，协商确定交易价格。如有第三方权威机构定价的，可参考第三方权威机构的定价。

三、本计划存在利益冲突的处理方式、披露方式、披露内容和披露频率

若管理人运用委托财产买卖管理人、托管人及其关联方或者与上述主体有其他重大利害关系的主体直接或间接管理或代理销售的、或提供客户服务的、或者该等主体参与投资的符合本合同投资范围规定的投资产品，但管理人需要遵循投资者利益优先的原则、防范利益冲突，符合监管机构的规定，并履行信息披露义务。投资者签署本合同即表明其已经知晓且认可本基金可能进行上述关联交易。

计划管理人应在集合计划季度报告与年度报告中披露重大关联交易和利益冲突情形。年度报告应于每个会计年度截止日后四个月内通过管理人网站通告。

四、管理人运用计划资产从事关联交易的，应事后及时、全面、客观的向投资者和托管人进行披露。管理人运用本计划从事重大关联交易的，应事先取得投资者同意，并有充分证据证明未损害投资者利益。

五、投资者应事前就其关联方、关联证券或其他禁止交易证券明确告知管理人。若投资者未能事前就其关联方、关联证券或其他禁止交易证券明确告知管理人致使本计划财产发生违规投资行为的，管理人与托管人均不承担任何责任。

## 第十五部分 投资经理的指定与变更

一、资产管理计划投资经理由资产管理人负责指定。

二、本计划的投资经理的资料如下：

由少伦，男，从事证券投资研究工作经历 20 年。2006 年毕业于同济大学经济管理学院，获硕士学位；先后在证券公司，保险公司，公募基金等机构从事固定收益的投资管理工作，现任华安证券资产管理总部高级投资经理，擅长大类资产配置，有较强的投资管理能力和风险控制意识，目前为恒赢 2 号、恒赢 3 号、恒赢 4 号、恒赢 5 号等产品的投资经理。已取得基金从业资格，最近三年未被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚。

刘珩，财务管理硕士，2014 年毕业于上海财经大学财务管理专业，CFA 持证人，先后就职于浦银安盛基金、太平人寿保险、华安证券资产管理部，熟悉市场各类资产交易。擅长短久期、高流动性固定收益产品管理。现任华安证券资产管理总部投资经理。已取得基金从业资格，最近三年未被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚。

三、管理人可根据投资经理的履职情况变更投资经理，并在管理人网站进行公告并按规定程序向中国证券投资基金业协会备案。

## 第十六部分 资产管理计划的财产

### 一、资产管理计划财产的保管与处分

(一) 本计划财产的债务由计划财产本身承担责任，投资者以其出资为限对本计划财产的债务承担责任。

(二) 本计划财产独立于管理人和托管人的固有财产，并独立于管理人管理的和托管人托管的其他财产。管理人、托管人不得将本计划财产归入其固有财产。

(三) 管理人、托管人因本计划财产的管理、运用或者其他情形而取得的财产和收益，归入本计划财产。

(四) 管理人、托管人可以按照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，其债权人不得对本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，本计划财产不属于其清算财产。

(五) 本计划财产产生的债权不得与不属于计划财产本身的债务相互抵销。非因本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计划财产强制执行。上述债权人对本计划财产主张权利时，管理人、托管人应明确告知本计划财产的独立性，采取合理措施并及时通知投资者。

### (六) 非标准化资产的保管

本计划投资于《管理办法》第三十七条第(五)项规定资产及其他非现金类财产(即《管理办法》第(一)至(三)项规定以外的非标准化债权类资产、股权类资产、商品及金融衍生品类资产等其他非现金类资产)时，管理人应于完成投资后及时办理计划资产的确权事宜，负责保管相关权利凭证(如有)及行权依据，并及时将相关权利凭证及行权依据的复印件交付托管人。

(七) 对于因为管理计划投资产生的应收资产，应由管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知托管人，到账日托管账户未收到应收资产的，托管人应及时通知管理人采取措施进行催收，由此给计划造成损失的，管理人应负责向有关当事人追偿。

### 二、资产管理计划财产相关账户的开立和管理

管理人或托管人按照规定为本计划开立托管资金账户、证券账户等投资所需账户。证券账户的持有人名称应当符合证券登记结算机构的有关规定。开立的上述资产管理计划财产账户与管理人、托管人、募集机构和计划份额登记机构自有

的财产账户以及其他计划财产账户相独立。

#### (一) 托管专户的开立和管理

1、本计划以“华安证券季季赢 14 号集合资产管理计划”的名义（以实际开立名称为准）在资产托管人处开设托管专户，保管资产管理计划的银行存款。该托管专户是指资产托管人在集中清算模式下，代表所托管的包括本资产管理计划财产在内的全部资产与中国证券登记结算有限责任公司进行一级结算的专用账户。该账户不得透支、不得提现、不得通兑、不得购买支付凭证。托管期间管理人、托管银行双方均不得采取任何使该账户无效的行为。在托管期间，托管银行对专项计划账户全权控制和管理。未经托管银行书面同意，管理人不得自行采取使得专项计划账户网银等无效的行为，否则托管银行有权拒绝执行相关划款指令。本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、收取参与款，均需通过该托管专户进行。资产管理人应当在开户（或变更或撤销）过程中给予必要的配合，并提供所需账户资料。资产管理人应保证所提供账户资料的真实性、准确性和有效性，并在账户资料发生变更后 5 个工作日内及时向资产托管人提供更新后的账户资料。由于未及时提供更新账户资料导致资金账户未能正常使用的，由资产管理人承担相应责任。资产管理人可以向资产托管人申请开通网上银行查询，查询托管账户的余额和现金流情况。但管理人不得自行开立网上银行转账支付功能。

2、托管专户的开立和使用，限于满足开展本资产管理计划业务的需要。资产托管人和资产管理人不得假借计划的名义开立其他任何银行账户；亦不得使用计划的任何银行账户进行本资产管理计划业务以外的活动。

3、托管专户的管理应符合有关法律法规的规定。

#### (二) 资产管理计划证券账户、资产托管人证券交易资金结算备付金账户的开立和管理

1、资产托管人按照规定开立资产管理计划财产的证券账户。资产管理人应当在开户过程中给予必要的配合，并提供所需资料。证券账户的持有人名称应当符合证券登记结算机构的有关规定。

2、证券账户的开立和使用，限于满足开展本资产管理计划业务的需要。资产托管人和资产管理人不得出借和未经对方同意擅自转让计划的任何证券账户，亦不得使用计划的任何证券账户进行本资产管理计划业务以外的活动。

证券账户的开立由资产托管人负责，管理和运用由资产管理人负责。

3、资产托管人以资产托管人的名义在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司、深圳分公司开立证券交易资金结算备付金账户（即资金交收账户），用于办理资产托管人所托管的包括本计划财产在内的全部资产在证券交易所进行证券投资所涉及的资金结算业务。

### （三）债券托管账户的开设和管理

本计划成立后，资产管理人负责以计划财产的名义申请并取得进入全国银行间同业拆借市场的交易资格及取得人行上海总部颁发的银行间债市准入备案通知书，并代表本计划进行交易；资产托管人负责以本计划财产的名义在中央国债登记结算有限责任公司、银行间市场清算所股份有限公司开设银行间债券市场债券托管账户，并代表本计划进行债券和资金的清算。资产管理人应当予以配合并提供相关资料。

### （四）开放式证券投资基金账户的开立和管理

1、资产管理人负责为本计划开立所需的基金账户。

2、资产管理人在开立基金账户时应将托管专户作为赎回款、分红款指定收款账户。

3、资产管理人需及时将基金账户的开户资料（复印件）加盖经授权的资产管理人业务专用章后交付资产托管人。

4、在资产托管人收到开户资料前，资产管理人不得利用该账户进行投资活动。

5、资产托管人有权随时向基金注册登记人查询该账户资料。资产管理人应于每季度结束后十个工作日内将开放式基金对账单发送给资产托管人。

### （五）投资定期存款的银行账户的开立和管理

委托财产投资定期存款在存款机构开立的银行账户，定期存款账户的户名应与托管账户户名一致。本着便于委托财产的安全保管和日常监督核查的原则，存款行应尽量选择托管人经办行所在地的分支机构。对于任何的定期存款投资，管理人都必须和存款机构签订定期存款协议，约定双方的权利和义务，该协议作为划款指令附件。该协议中必须有如下明确条款：‘存款证实书不得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专户（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。在取得存款证实书后，托管人保管证实书正本或者复印件。管理人应该在合理的时间内进行定期存款的投资和支取事宜，若管理人提前支取或部分提前支取定期存款，若产生息差（即本委托财产已计提的资金利息和提前支取时收到的资金利息差额），该息差的处理方法由管理人和托管人双方协商解决。

#### （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，应根据有关法律法规的规定开立。新账户按有关规则管理并使用。

### 第十七部分 划款指令的发送、确认和执行

#### 一、交易清算授权

（一）管理人应指定专人向托管人发送指令。

（二）管理人应向托管人提供书面授权文件（已出具统一授权书的除外），该文件应加盖公章。文件内容包括被授权人名单、预留印鉴及被授权人签字或签章样本，授权文件应注明被授权人相应的权限及有效时限。

（三）管理人在发送给托管人授权文件后需向托管人电话确认，授权文件经托管人电话确认后，授权文件即在电话确认的时点或授权文件载明的时点（两者以孰晚者为准）生效。管理人应在授权文件生效的5个工作日内将授权文件原件寄送托管人。原件与传真件/扫描件不符的，以托管人收到的传真件/扫描件为准。

（四）管理人和托管人对授权文件负有保密义务，其内容不得向被授权人及相关操作人员以外的任何人泄露；但法律法规规定或有权机关要求的除外。

#### 二、划款指令的内容

划款指令是在管理计划财产时，管理人向托管人发出的资金划拨及其他款项支付的指令。管理人发给托管人的指令应写明款项事由、金额、收、付款账户信息等，加盖预留印鉴并有被授权人签字或签章。

资产管理人同意资产托管人根据其收到的中国证券登记结算公司或深、沪证券交易所的交易数据与中国证券登记结算公司进行交收。委托财产投资发生的所有场内交易的清算交收，由资产托管人根据相关登记结算公司的结算规则办理，资产管理人不需要另行出具指令。

遵照中登上海预交收制度、中登深圳结算互保金制度、中登上海深圳各付金

管理办法等有关规定所做的结算备付金、保证金及最低结算备付金的调整也视为资产管理人向资产托管人发出的有效指令，无须资产管理人向资产托管人另行出具指令，资产托管人应予以执行。

本计划资金账户发生的银行结算费用等银行费用，由资产托管人直接从资金账户中扣划，无须资产管理人出具指令。

### 三、划款指令的发送、确认及执行时间与程序

指令由“授权通知”确定的被授权人代表管理人用传真或其他托管人和管理人认可的方式向托管人发送。管理人有义务在发送指令后与托管人以录音电话的方式进行确认。因管理人未能及时与托管人进行指令确认，致使资金未能及时到账所造成的损失，由过错方承担责任。

对于被授权人依照“授权通知”发出的指令，管理人不得否认其效力。管理人应按照相关法律法规以及本合同的规定，在其合法的经营权限和交易权限内发送划款指令，发送人应按照其授权权限发送划款指令。管理人向托管人发送有效划款指令时，应确保托管人有足够的处理时间，除需考虑资金在途时间外，还需给托管人留有2个工作小时的复核和审批时间。管理人在每个工作日的15:00以后发送的要求当日支付的划款指令，托管人不保证当天能够执行。有效划款指令是指指令要素（包括付款人、付款账号、收款人、收款账号、金额（大、小写）、款项事由、支付时间）准确无误、预留印鉴相符、相关的指令附件齐全且头寸充足的划款指令。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由管理人承担。

托管人收到管理人发送的指令后，应对划款指令进行形式审查，验证指令的要素是否齐全、对纸质传真指令审核印鉴和签名是否和预留印鉴和签名样本相符，复核无误后依据本合同约定在规定期限内及时执行，不得延误。若存在异议或不符，托管人立即与管理人指定人员进行电话联系和沟通，并要求管理人重新发送经修改的指令。托管人可以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，以确保托管人有足够的资料来判断指令的有效性。管理人应保证上述资料合法、真实、完整和有效。

管理人向托管人下达指令时，应确保本计划托管账户有足够的资金余额，对管理人在没有充足资金的情况下向托管人发出的指令，托管人有权拒绝执行，并立即通知管理人，由此造成的损失由管理人承担。

#### 四、托管人依法暂缓、拒绝执行指令的情形和处理程序

托管人发现管理人发送的指令违反《基金法》、本合同或其他有关法律法规的规定时，不予执行，并应及时以电话或者书面形式通知管理人纠正，管理人收到通知后应及时核对，并以电话或者书面形式对托管人发出回函确认，由此造成的损失由管理人承担。

#### 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指令要素不全等。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、撤回指令的处理程序

管理人撤回已发送至托管人的有效指令，须向托管人传真加盖预留印鉴的书面通知并电话确认，托管人收到书面通知并得到确认后，将撤回指令作废；如果托管人在收到书面通知并得到确认时该指令已执行，则该指令为已生效指令，不得撤回，由此造成的损失由管理人承担。

#### 七、更换划款指令被授权人的程序

管理人更换被授权人、更改或终止对被授权人的授权，应当至少提前一个工作日通知托管人，同时管理人向托管人提供新的被授权人的姓名、权限、预留印鉴和签字样本。托管人在收到授权变更通知并电话确认后，授权文件即在电话确认的时点或授权文件载明的时点（两者以孰晚者为准）生效。管理人应在指令授权变更生效的5个工作日内将指令授权书原件寄送托管人。被授权人变更通知生效前，托管人仍应按原约定执行指令，管理人不得否认其效力。

#### 八、划款指令的保管

划款指令以传真形式发出，原件由管理人保管，托管人保管指令传真件。当两者不一致时，以托管人收到的划款指令传真件为准。

#### 九、其他相关责任

托管人正确执行管理人符合本合同规定、合法合规的划款指令，非托管人原因，计划财产发生损失的，由相关责任方承担责任。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符合本合同规定、合法合规的划款指令而导致计划财产受损的，托管人应承担相应的责任，但托管资金专户余额不足或托管人遇到不可抗力的情况除外。

如管理人的划款指令存在事实上未经授权、欺诈、伪造或未能按时提供划款指令人员的预留印鉴和签字样本等非托管人原因造成的情形,只要托管人根据本合同相关规定对有关印鉴与签名审核无误,托管人不承担因正确执行有关指令而给管理人或计划财产或任何第三人带来的损失,全部责任由管理人承担,但托管人未尽审核义务执行划款指令而造成损失的情况除外。

## 第十八部分 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项下计划份额持有人的授权而进行的投资交易行为。

管理人应在有关法律法规和本合同规定的权限内运用计划财产进行投资管理,不得违反有关法律法规和本合同的约定,超越权限管理、从事证券投资。

### 二、越权交易的处理程序

#### (一) 违反有关法律法规和本合同规定进行的投资交易行为

托管人对于承诺监督的越权交易中,发现管理人依据交易程序已经生效的划款指令违反法律、行政法规,或者违反托管协议附件《交易监控合规表》约定的,应当立即通知管理人并有权报告监管机构。

管理人应向计划份额持有人和托管人主动报告越权交易。在限期内,计划份额持有人和托管人有权随时对通知事项进行复查,督促管理人改正。管理人对计划份额持有人和托管人通知的越权事项未能在限期内纠正的,托管人应报告监管机构。

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

### 三、托管人对管理人投资运作的监督

#### (一) 托管人对下列资产管理计划的投资事项及管理人投资行为进行监督:

1. 对托管协议附件《交易监控合规表》约定的投资范围进行监督;
2. 对托管协议附件《交易监控合规表》投资限制进行监督;

#### (二) 投资于《管理办法》第三十七条第(五)项规定资产时的监督职责

本计划投资于《管理办法》第(一)至(三)项规定以外的非标准化债权类资产、股权类资产、商品及金融衍生品类资产时,托管人根据本合同第十七部分

及其他相关内容的约定,以审核管理人划款指令及交易附件的方式监督管理人投资运作。

(三) 托管人对计划财产的投资监督和检查自建账估值之日起开始执行。托管人在托管协议附件《交易监控合规表》约定范围内,对本计划的直接投资履行监督职能。

(四) 托管人投资监督的真实性、准确性和完整性受限于管理人、证券经纪商及其他中介机构提供的数据和信息,托管人对上述数据信息的真实性、准确性和完整性不作任何担保、暗示或表示。

(五) 如需托管人对本计划关联交易进行监督的,管理人应于本计划成立前提供关联方名单,并在合同期限内根据变化及时更新关联方名单。若管理人没有及时提供关联方信息,导致托管人无法及时对关联方证券进行监督,相关责任由管理人承担。

(六) 如因投资需要或法律法规修改导致托管人监督事项发生变化的,各方除履行必要的合同变更流程外,还应为托管人调整监督事项留出必要的时间。

## 第十九部分 资产管理计划财产的估值和会计核算

### 一、估值目的

资产管理计划财产估值的目的是客观、准确地反映计划资产的价值,依据经计划财产估值后确定的计划资产净值计算资产管理计划份额净值,是计算计划参与和退出价格的基础。

### 二、估值时间

资产管理人在每个交易日对计划财产进行估值。

### 三、估值方法

#### (一) 债券估值方法

1、交易所上市交易或挂牌转让的不含权固定收益品种,按估值日交易所收盘价估值;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,将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易日收盘价,选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值;

2、交易所上市交易或挂牌转让的含权固定收益品种,按估值日交易所收盘

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，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价进行估值；

3、交易所上市以全价交易的可转债、可交换债，选取每日收盘价减去所含的债券应收利息得到的净价作为估值净价进行估值，交易所上市以净价交易的可交换债，选取每日收盘价作为估值净价进行估值；

4、交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。交易所市场挂牌转让的资产支持证券（票据）和私募债，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值；

5、对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券，对存在活跃市场的情况下，应以活跃市场上未经调整的报价作为估值日的公允价值；对于活跃市场报价未能代表估值日公允价值的情况下，应对市场报价进行调整以确认估值日的公允价值；对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下，应采用估值技术确定其公允价值。

6、对全国银行间市场上不含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值。对银行间市场上含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价估值。对于含投资人回售权的固定收益品种，回售登记期截止日（含当日）后未行使回售权的按照延长待偿期所对应的价格进行估值。对银行间市场未上市，且第三方估值机构未提供估值价格的债券，在发行利率与二级市场利率不存在明显差异，未上市期间市场利率没有发生大的变动的情况下，按成本估值。

7、在任何情况下，计划管理人如采用本项第1—6小项规定的方法对计划资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果计划管理人认为按本项第1—6小项规定的方法对计划资产进行估值不能客观反映其公允价值的，计划管理人在综合考虑市场成交价、市场报价、流动性、收益率曲线等多种因素基础上形成的债券估值，计划管理人可根据具体情况与计划托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

## （二）股票估值方法

1、上市流通股股票按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，以最近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，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，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) 在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行、首次公开发行时股票公司股东公开发售以及通过大宗交易取得的有明确限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值；

(3) 送股、转增股、配股和增发新股等发行未上市的股票，按估值日在证券交易所上市的同一股票的收盘价进行估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值。

## (三) 基金估值方法

1、在证券交易所挂牌交易的封闭式基金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重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值；封转开期间的封闭式基金按估值日基金份额净值估值。

2、在证券交易所挂牌交易的 ETF 基金、LOF 基金场内部分按估值日收盘价估值；估值日没有交易的，以最近交易日的收盘价估值。

3、在场外交易的开放式基金（含 LOF 基金场外部分）按估值日前一交易日基金份额净值估值；估值日前一交易日没有基金份额净值的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近公告的基金份额净值估值；如果估值日前一交易日无基金份额净值，且最近交易日后经济环境发生重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日基金份额净值，确定公允价值进行估值。

4、处于封闭期的开放式基金，以此前最近公布的基金份额净值估值；如果

估值日前无基金份额净值，按成本进行估值。

5、货币市场基金的收益以基金公布的前一日收益计提。

(四) 货币资金按照约定利率在持有期内逐日计提应收利息，在利息到账日以实收利息入账。

(五) 其他资产的估值方法

按成本估值，在投资收益到账日以实际收益入账。

(六) 如资产管理人或资产托管人发现资产估值违反本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投资者利益时，应立即通知对方，共同查明原因，双方协商解决。

四、估值对象

本计划财产项下所有的股票、债券、基金、期货和银行存款本息、应收款项、其他投资等资产及负债。

五、估值程序

(一) 本计划单位净值=集合计划资产净值/集合计划总份额。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。集合计划资产净值是指本集合计划资产总值减去负债后的净资产值。集合计划资产净值的计算精确到 0.01 元，小数点后第三位四舍五入。

(二) 管理人在每个交易日对计划财产进行估值，估值原则应符合本合同及其他法律、法规的规定。管理人完成估值后，将估值结果发送托管人，由托管人进行复核。

(三) 本计划财产净值计算和会计核算的义务由管理人承担。因此，就与本计划财产有关的会计问题，会计责任方是管理人。如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致意见，以管理人对本计划财产净值的计算结果为准。

六、估值错误的处理

(一) 管理人和托管人将采取必要、适当、合理的措施确保本计划财产估值的准确性、及时性。当资产管理计划份额净值小数点后 4 位以内(含第 4 位)发生差错时，视为资产管理计划份额净值错误。

(二) 估值错误的处理原则和方法

1. 估值错误处理原则

估值错误已发生，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，由差错责任方对直接损失承担赔偿责任；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，则后者应当承担相应赔偿责任。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. 估值错误的处理方法

(1) 管理人计算的资产管理计划净值已由托管人复核确认，但因资产估值错误给计划份额持有人造成损失的，由管理人与托管人按照过错各自承担相应的责任。因估值导致资产管理计划份额净值出现错误时，管理人应当立即纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大。

(2) 如管理人和托管人对资产管理计划净值的计算结果，虽然多次重新计算和核对尚不能达成一致时，为避免不能按时披露资产管理计划净值的情形，以管理人的计算结果对外披露。

(3) 由于一方当事人提供的信息错误，另一方当事人在采取了必要合理的措施后仍不能发现该错误，进而导致资产管理计划净值计算错误造成投资者的损失，以及由此造成以后交易日计划资产净值计算顺延错误而引起的投资者的损失，由提供错误信息的当事人一方负责赔偿。

(4) 管理人按本合同约定的按公允价值进行估值时，所造成的误差不作为计划资产估值错误处理。

## 七、估值调整的情形与处理

(一) 管理人作为估值的第一责任人，应定期评估第三方估值机构的估值质量，并对估值价格进行检验，防范可能出现的估值偏差。当出现投资品估值偏差，估值机构发布的估值不能体现公允价值时，管理人应综合第三方估值机构估值结果，经与托管人协商，谨慎确定公允价值，并按相关法规的规定，发布相关公告，充分披露确定公允价值的方法、相关估值结果等信息。

(二) 如有确凿证据表明按本合同约定的估值方法进行估值不能客观反映本计划公允价值的，管理人可根据具体情况与托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

## 八、暂停估值的情形

(一)与本资产管理计划投资有关的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时;

(二)因不可抗力或其它情形致使管理人、托管人无法准确评估计划财产价值时;

(三)如出现管理人认为属于紧急事故的任何情况,会导致管理人不能出售或评估计划财产的;

(四)中国证监会和本合同认定的其它情形。

#### 九、资产管理计划份额净值的确认

计划财产净值和计划份额净值由管理人负责计算,管理人和托管人于每个交易日按照双方约定的方式进行核对确认。

#### 十、特殊情况的处理

(一)管理人或托管人按上述估值方法进行估值时,所造成的误差不作为计划财产估值错误处理。

(二)由于不可抗力原因,或由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误,或国家会计政策变更、市场规则变更等,管理人和托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查,但未能发现该错误的,由此造成的计划财产估值错误,管理人和托管人可以免除赔偿责任。但管理人、托管人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

#### 十一、资产管理计划的会计政策

本计划的会计政策比照现行政策并按照本资产管理合同约定执行:

(一)资产管理人为计划财产的会计责任方;

(二)计划财产的会计年度为公历年的1月1日至12月31日;

(三)计划财产的会计核算以人民币为记账本位币,以人民币元为记账单位;

(四)会计制度执行国家有关的会计制度;

(五)本计划财产独立建帐、独立核算;

(六)资产管理人应保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算,按照有关规定编制计划财产会计报表;

(七)托管人应定期与管理人就资产管理计划的会计核算、报表编制等进行核对。

## 第二十个部分 资产管理计划的费用与税收

### 一、资产管理计划的费用种类

- (一) 资产管理人的管理费；
- (二) 资产托管人的托管费；
- (三) 资产管理人依据本合同收取的业绩报酬；
- (四) 计划财产划拨支付的银行费用；
- (五) 计划财产的证券交易费用；
- (六) 本计划成立后的信息披露费用；
- (七) 本计划成立后与本计划有关的会计师费（包含审计费）和律师费；
- (八) 按照法律法规及本合同约定可以在本计划财产中列支的其他费用。

### 二、资产管理计划费用的计提标准、计提方式与支付方式

#### (一) 资产管理人的管理费

在通常情况下，资产管理计划管理费按前一日资产管理计划资产净值的

**【0.8】%**年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$ ，本资产管理计划年管理费率为**【0.8】%**

H为每日应计提的资产管理计划管理费

E为前一日资产管理计划资产净值

资产管理计划管理费自计划成立日起，管理人的管理费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付，由托管人根据管理人的指令于次月前5个工作日内从集合计划资产中一次性支付。

管理人可根据市场行情及本集合计划运作情况，经与托管人协商一致后，调整管理费率，以管理人网站公告为准。若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

#### (二) 资产托管人的托管费

在通常情况下，资产管理计划托管费按前一日资产管理计划资产净值的

**【0.05】%**年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$ ，本资产管理计划年托管费率为**【0.05】%**

H为每日应计提的资产管理计划托管费

E为前一日资产管理计划资产净值

**【指令扣划方式】**资产管理计划托管费自计划成立日起，托管人的托管费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付，由托管人根据管理人的指令于次月前5

个工作日内从集合计划资产中一次性支付。

托管人可根据市场行情及本集合计划运作情况，经与管理人协商一致后，调整托管费率，以管理人网站公告为准。若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。管理人在约定的托管费支付日未向托管人发送托管费划付指令的，托管人有权在托管费支付日当日或后续任一工作日自行扣收全部或部分应行未付托管费。费用自动划扣后，托管人应向管理人告知托管费支付金额及计算方式，管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系托管人协商解决。

### （三）业绩报酬

#### 1、管理人收取业绩报酬的原则：

（1）按投资者每笔参与份额分别计算年化收益率并计提业绩报酬；

（2）在符合业绩报酬计提条件时，在计划分红日（具体以届时的分红公告为准，下同）、投资者退出日和计划终止日计提业绩报酬，提取频率不超过每 6 个月一次；

（3）在计划分红日提取业绩报酬的，业绩报酬从分红资金中扣除；

（4）在投资者退出和计划终止时提取业绩报酬的，业绩报酬从退出资金中扣除；

（5）在投资者退出或计划终止时，业绩报酬按投资者退出份额或计划终止时持有份额计算。如退出份额包括一笔参与份额的一部分，则将该部分参与份额视为一笔参与份额进行核算。

#### 2、业绩报酬的计提方法：

（1）当计划分红日、投资者退出日或计划终止日时，若持有期年化收益率  $R$  小于或等于业绩报酬计提基准，管理人不提取业绩报酬。

（2）当计划分红日、投资者退出日或计划终止日时，若持有期年化收益率  $R$  大于业绩报酬计提基准，管理人提取超出部分的一定比例作为业绩报酬，具体计算方法见下文“（4）管理人以超额比例的方式提取业绩报酬”。

（3）以上一个发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日（如上一个发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日不存在，募集期参与的为计划成立日，存续期参与的为申购参与当日，下同）到本次业绩报酬计提日的年化收益率，作为计提业绩报酬的年化收益率。年化收益率的计算公式如下：

$$R = \frac{P_1 - P_0}{P} \times \frac{365}{N} \times 100\%$$

业绩报酬计提日为计划分红日、投资者退出日或计划终止日；

R 为年化收益率

P1 为业绩报酬计提日的份额累计净值；

P0 为上一个发生业绩报酬计提日的份额累计净值；

P 为上一个发生业绩报酬计提日的份额净值；

N 表示上一个发生业绩报酬计提日到本次业绩报酬计提日的天数。

#### (4) 管理人以超额比例的方式提取业绩报酬

具体计算方法如下：

年化收益率(R)	提取比例	业绩报酬(F)
$R \leq r$	0	0
$r < R$	60%	$F = A \times (R - r) \times 60\% \times N / 365$

注：①F 为投资者每笔参与应提取的业绩报酬；

②R 为年化收益率，r 为业绩报酬计提基准；

③A 为投资者每笔参与在上一个发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日的资产净值总额。

④业绩报酬计提基准仅作为管理人提取业绩报酬的计算标准，不代表对资产管理计划未来收益的承诺或保证。管理人不保证资产管理计划一定盈利，也不保证最低收益。

#### (5) 业绩报酬的支付

提取业绩报酬时，由管理人向托管人发送业绩报酬划款指令，托管人收到指令后从本集合计划资产中以现金的方式一次性支付给管理人。若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。管理人的业绩报酬由管理人负责计算，托管人不承担复核义务。

#### (6) 业绩报酬的计算与复核

业绩报酬的计算和复核工作由管理人完成。

#### (四) 其他费用的支付

资产管理计划银行资金账户发生的银行结算费用等银行费用，由托管人直接从资金账户中扣划，无须管理人出具指令。

资产管理计划运作期间投资所发生的交易手续费、印花税等有关证券交易税费，作为交易成本直接扣除。

资产管理计划存续期间发生的信息披露费、与资产管理计划相关的律师费和会计师费、以及按照国家有关规定可以列入的其他费用等，由托管人根据有关法规及相应协议的规定，根据管理人的指令，按费用实际支出金额从资产管理计划资产中支付，列入资产管理计划费用。

#### （五）不得列入资产管理计划财产费用的项目

资产管理计划成立前发生的费用，以及存续期间发生的与募集有关的费用，不得在计划资产中列支。

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资产管理计划财产的损失，以及处理与资产管理计划财产运作无关事项或不合理事项所发生的费用等不得列入资产管理计划的费用。

#### （六）费率的调整

管理人和托管人与投资者协商一致后，可根据市场发展情况调整资产管理费率和资产托管费率，修改本合同并报中国证券投资基金业协会备案。

### 三、资产管理计划缴税安排

合同各方当事人根据国家法律法规的规定，履行纳税义务。

鉴于资产管理人在为本计划的利益投资、运用委托财产过程中，会因法律法规、税收政策的要求而成为纳税义务人，就归属于本计划的投资收益承担纳税义务。本计划运作过程中由于上述原因发生的增值税等税负，仍由本计划委托财产承担，届时由资产管理人向资产托管人发送划款指令，通过本计划托管账户直接缴付，或划付至资产管理人账户并由资产管理人依据税务部门要求完成税款申报缴纳。

## 第二十一部分 资产管理计划的收益分配

一、资产管理计划收益分配方案依据现行法律法规以及合同约定执行。

二、可供分配利润的构成

本集合计划收益包括集合计划利息收入、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。本集合计划净收益为集合计划收益扣除按照有关规定可以在集合计划收益中扣除的费用后的余额。

资产管理计划可供分配收益：截至收益分配基准日资产管理计划未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

### 三、收益分配原则

(一) 本计划存续期内，本计划份额净值大于 1.00 元时，管理人可根据投资运作情况决定是否向投资者分配收益，且分配后净值不得低于 1.00 元，每一计划份额享有同等分配权。具体分配方案、分配比例及收益分配时间以管理人公告为准。

(二) 本计划收益分配方式为现金分红，具体以管理人公告为准。

(三) 管理人在每个收益分配基准日确定收益分配方案后，在【3】个工作日内进行收益分配。

(四) 收益分配时，如果符合本合同约定的管理人业绩报酬计提条件的，将在收益分配的同时计提或提取管理人业绩报酬。

(五) 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通知

(一) 计划收益分配方案中应载明截止收益分配基准日的可供分配利润、计划收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。

(二) 计划收益分配方案由管理人拟订，由托管人复核，由管理人通知投资者。

### 五、收益分配的执行方式

收益分配方案确定后，管理人依据具体方案的规定进行收益分配，托管人依据收益分配方案配合执行管理人收益分配划款指令。

计划收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，计划登记机构可将计划份额持有人的现金红利自动转为计划份额。

## 第二十二部分 信息披露与报告

一、管理人应向投资者提供下列信息披露文件：

- (一) 资产管理合同，计划说明书和风险揭示书；
- (二) 资产管理计划净值，资产管理计划参与、退出价格；
- (三) 资产管理计划定期报告，至少包括季度报告和年度报告；

- (四) 重大事项的临时报告;
- (五) 资产管理计划清算报告;
- (六) 中国证监会规定的其他事项。

二、资产管理计划运作期间,管理人应向投资者披露以下信息:

#### (一) 净值报告

披露时间:至少每周披露一次计划份额净值,开放期内每个工作日披露计划前1个工作日的份额净值。

披露方式:通过管理人网站通告计划单位净值。

#### (二) 季度报告和年度报告

1. 管理人应于每季度结束之日起一个月内披露季度报告,每年度结束之日起四个月内披露年度报告,披露报告期内资产管理计划运作情况。本计划成立不足三个月或者存续期间不足三个月的,管理人可以不编制当期的季度报告和年度报告。上述报告应通过管理人网站通告。

2. 年度报告内容应包括但不限于下列信息:

- (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(如有);
- (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(如有)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。

3. 季度报告应当披露前款除第(6)项之外的其他信息。

4. 资产管理计划年度财务会计报告应当经具有证券相关业务资格的会计师事务所审计,审计机构应当对资产管理计划会计核算及净值计算等出具意见。

#### (三) 托管人履职报告

1. 托管人履职报告作为管理人季度报告、年度报告内容的一部分,由托管

人完成管理人季度报告、年度报告的复核工作后，确定托管人履职报告内容并向管理人反馈，由管理人根据本合同约定的方式向投资者披露。托管人履职报告内容包括托管人履职情况、对管理人投资运作的监督情况及有关报告财务数据的复核意见等。

2. 管理人应当在每季度结束后 20 日内向托管人提供其编制的季度报告、当期财务会计报告（如有）供托管人复核，托管人复核管理人季度报告、当期财务会计报告中的财务数据后，于 10 日内向管理人反馈复核意见。

3. 管理人应当在每年度结束后两个月内向托管人提供其编制的年度报告、当期财务会计报告供托管人复核，托管人复核管理人年度报告、当期财务会计报告中的财务数据后，于一个月内向管理人反馈复核意见。

4. 因资产管理计划成立不足三个月或者存续期间不足三个月，管理人未编制资产管理计划当期的季度报告和年度报告的，托管人不编制当期托管人履职报告。

### 三、临时报告

发生资产管理合同约定或可能影响投资者利益的重大事项时，在事项发生之日起五日内向投资者披露。

### 四、向投资者提供报告及投资者信息查询的具体方式

#### （一）投资者信息查询范围

投资者可根据本合同约定的时间和方式查阅或复制计划所披露的信息资料。

#### （二）投资者向管理人查询信息的方式

管理人通过以下至少一种方式进行披露信息即视为履行了告知义务，投资者可通过以下方式向管理人查阅本合同约定披露的信息资料：

#### 1. 资产管理人网站

定期报告、份额净值报告、临时报告等本合同约定披露的信息资料将在管理人网站上披露，投资者可随时查阅。

#### 2. 邮寄服务

管理人或代销机构向投资者邮寄定期报告等本合同约定披露的信息资料。投资者在管理人或代销机构留存的通信地址为送达地址。通信地址如有变更，投资者应当及时以书面方式或以管理人规定的其他方式通知管理人。

#### 3. 传真或电子邮件

如投资者留有传真号、电子邮箱等联系方式的，管理人也可通过传真、电子邮件、电报等方式将本合同约定披露的信息资料告知投资者。

### （三）投资者向托管人查询信息的方式

1. 投资者可通过电话、传真或电子邮件等联系方式，经由管理人向托管人查询有关信息披露资料。

2. 对于管理人向投资者提供的文件材料中不在托管人复核职责范围内的信息，应由管理人保证该等信息的真实性、有效性、合法性。

3. 对于因管理人未提供或未及时提供应由托管人复核的相关信息披露文件等客观因素，导致托管人无法履行或无法按时履行相应复核职责的，由过错方承担相应责任。

五、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。

### 六、管理人、托管人向监管机构的报告

管理人、托管人应当在每年度结束之日起四个月内，分别编制私募资产管理业务管理年度报告和私募资产管理业务托管年度报告，并报中国证监会相关派出机构和证券投资基金业协会备案。

## 第二十三部分 风险揭示

一、资产管理计划投资将可能面临下列各项风险，包括但不限于：

### （一）特殊风险揭示

若存在以下事项，应特别揭示风险：

#### 1. 资产管理计划委托募集所涉风险

本计划管理人可委托销售机构销售本计划，受托销售机构销售本计划时，可能存在包括但不限于如下违法违规行为而令投资者面临计划募集风险：

（1）销售机构采用公开宣传或变相公开宣传的方式销售本资产管理计划。

（2）销售机构进行虚假宣传，或通过任何方式以保本保收益误导投资者，或推介材料存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

（3）销售机构违反《私募办法》的有关规定，未审查投资者是否满足合格投资者相关条件，未对投资者的风险识别能力和风险承受能力进行鉴别，未履行投资者适当性审查义务。

(4) 销售机构可能因未在中国证监会注册取得资产管理计划销售业务资格或未成为中国基金业协会会员而不具备受托募集资产管理计划的资格。

(5) 销售机构从业人员可能未经正式授权即从事资产管理计划募集活动。

(6) 销售机构可能存在将资产管理计划募集结算资金归入其自有财产、挪用资产管理计划募集结算资金、侵占计划财产和客户资金等违法活动。

## 2. 资产管理计划份额转让所涉风险

依据相关法律法规约定，在集合计划存续期间，投资者可以通过柜台交易市场等中国证监会认可的交易平台转让集合计划和份额。在办理转让业务时可能出现的风险包括但不限于：

### (1) 操作系统风险

办理转让操作的系统可能因某些人为或客观原因出现故障，从而影响转让业务办理。

### (2) 折溢价风险

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

## 3. 资产管理计划未在证券投资基金业协会完成备案手续或不予备案情形所涉风险

本计划未在证券投资基金业协会完成备案手续或不予备案情形可能导致管理人无法按原计划建仓和投资，管理人应将投资者前期已存入托管账户中资金原路返回，在此期间暂不计息。

## 4. 资产管理计划投资于债券回购等投资杠杆业务所涉风险

债券回购存续期间，债券处于质押状态，正回购方无法卖出或另做他用，且在结算过程中，登记结算公司有可能依照有关业务规则或约定处置质押券，可能间接造成损失的风险以及杠杆业务带来放大投资或损失的风险。

## 5. 业绩报酬计提基准未能达到及可能变化的风险

本合同“业绩报酬计提基准”仅是管理人提取业绩报酬的基准，也是管理人在运作期内投资管理努力的方向和目标，业绩报酬计提基准不是预期收益和保证收益率，不构成管理人对委托财产的任何承诺或担保，投资者仍可能面临实际收益率达不到业绩报酬计提基准甚至本金受损的风险。同时业绩报酬计提基准由管理人根据投资策略和资产组合及市场变化趋势等确定，可能发生变化，最终以管

理人披露为准。

#### 6. 部分退出本计划所涉风险

当管理人发现投资者申请部分退出本计划将致使其在部分退出申请确认后持有的计划份额所对应的资产净值低于 30 万元人民币的，管理人可能采取强制赎回或赎回部分确认失败导致客户退出金额与申请份额对应的资金不一致所涉及的风险。

#### 7. 本计划的风险收益特征表述和销售机构风险评级可能不一致所涉风险

销售机构对于本计划风险收益特征的评估与表述可以与管理人不同，可能存在本计划资管管理人合同、风险揭示书或计划说明书中的风险收益特征表述与销售机构对本计划风险评级结果不一致的风险。投资者在投资本计划前，必须按照销售机构的标准和要求完成其对于投资者于本计划的客户适当性匹配检验及其他适当性义务。

### (二) 一般风险揭示

#### 1. 本金损失风险

资产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。

本计划属于 R2 风险投资品种，适合风险识别、评估、承受能力 C2、C3、C4 和 C5 的合格投资者。

#### 2. 市场风险

资产管理计划的投资品种价格因受经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素影响而引起的波动，导致收益水平变化产生的风险。主要包括：政策风险、经济周期风险、利率风险、购买力风险、再投资风险、衍生品风险等。

#### 3. 管理风险

资产管理计划运作过程中，资产管理人依据资产管理合同约定管理和运用资产管理计划财产所产生的风险，由资产管理计划财产及投资者承担。投资者应充分知晓投资运营的相关风险，其风险应由投资者自担。

#### 4. 流动性风险

资产管理计划因市场整体或投资品种流动性不足、应付可能出现的投资者巨额退出或大额退出等原因，不能迅速转变成现金，或者转变成现金会对资产价格

造成重大不利影响的风险。

#### 5. 信用风险

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

#### 6. 募集失败风险

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。

资产管理人的责任承担方式：

(1) 以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用；

(2) 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。

#### 7. 投资标的风险

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。

#### 8. 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。

#### 9. 业绩报酬提取风险

在满足本集合计划提取业绩报酬的前提下，管理人可以对集合计划账户提取业绩报酬，但在业绩报酬提取后若账户单位净值下降，已提取的业绩报酬不予返还。

#### 10. 通过第三方销售平台投放开放式基金的风险

本集合计划通过第三方销售平台投资开放式基金，相关数据的取得均依赖于第三方销售平台，可能存在如下风险：委托资产被挪用的风险、开放式基金认（申）购份额难以核对的风险、计划财产超出委托财产投资范围及投资限制的风险、第三方基金销售平台无基金销售资质等风险。

#### 11. 合同变更风险

管理人就合同变更征求投资者意见期间，未明确提出异议的投资者、不同意合同变更但逾期未提出退出申请的投资者均视为同意修改或变更合同和说明书。部分投资者可能因为未能提供有效的联系方式或者未能将变动后的联系方式及时通知管理人，而无法及时获知合同变更事项，如果投资者因上述情况未能按时退出本计划，可能会被视为同意合同变更，从而存在风险。

#### 12. 参与股票投资的风险

本集合计划投资于国内依法发行的股票，会面临因投资标的、市场制度及交易规则等带来的特有风险。

#### 13. 参与定向增发股票风险

本集合计划参与定向增发后获配股票有一定的锁定期，锁定期内股票无法变现，同时锁定期内股票价格受市场因素、宏观因素等影响，股票价格有可能下跌至增发价格以下，且因股票流动受限管理人无法进行止损操作，本集合计划存在承担大幅亏损的风险。

#### 14. 投资者风险承受能力与本集合计划风险等级不匹配的风险

投资者应按照管理人或者销售机构的要求，真实、准确、完整的提供信息、资料，包括但不限于投资者身份、财产与收入状况、证券投资经验、风险承受能力、诚信记录和投资偏好等信息，若投资者提供的信息、资料存在虚假、不完整、不准确情形或者上述信息发生变化定期更新不及时，可能导致投资者风险承受能力等级与本集合计划不匹配，最终投资者可能遭受超出其承受能力的风险。

#### 15. 反洗钱报送安排相关风险

根据《中华人民共和国反洗钱法》、《金融机构反洗钱规定》、《金融机构反洗钱监督管理办法（试行）》、《金融机构客户身份识别和客户身份资料及交易记录保存管理办法》、《金融机构大额交易和可疑交易报告管理办法》、《金融机构洗钱和恐怖融资风险评估及客户分类管理指引》及相关的法律法规、监管规定，管理人、销售机构将向监管机构报送反洗钱信息，且前述报送安排及报送内容属管理人、销售机构保密信息，投资者无权知悉，投资者签署本协议，则视为知悉并同意前述安排。

#### 16. 交易所资金前端控制带来的风险

本资产管理计划由管理人作为交易参与者通过交易单元在上海和深圳证券交易所进行证券交易。根据《证券交易资金前端风险控制业务规则》等有关规定，

证券交易所、证券登记机构对交易参与人相关交易单元的全天净买入申报金额总量实施额度管理,并通过交易所对交易参与人实施前端控制。可能存在如下风险:

(1) 管理人操作失误,合计资产总额发生变动导致最高额度未能及时变更等,存在影响产品正常交易、无法有效进行风险控制等风险。

(2) 因不可抗力、意外事件、技术故障或者重大差错等原因导致资金前端控制出现异常,中国结算及沪、深交易所采取最高额度调整、暂停资金前端控制、限制交易单元接入等处置措施,产生业务风险。

本资产管理计划可能因上述业务规则而无法完成某笔或某些交易,由此造成的损益由计划财产承担。

## 17. 其他风险

包括但不限于关联交易风险、技术风险和操作风险,发生不可抗力事件的风险等。

### (1) 关联交易的风险

管理人可以将集合计划的资产投资于管理人、托管人及与管理人、托管人的控股股东、实际控制人或者其他管理人发行的证券或者承销期内承销的证券,事后管理人将及时以公告的方式向托管人和投资者披露,并向中国证监会相关派出机构和证券投资基金业协会报告,投资于证券期货的关联交易还应当向证券期货交易所报告。

管理人可以将集合计划的资产投资于管理人及管理人关联方设立的资产管理产品,事后管理人将以临时公告的方式进行披露。

### (2) 技术风险

在本计划的各种交易行为或者后台运作中,可能因为管理人、托管人、注册登记机构、销售机构、证券交易所、证券登记结算机构等 IT 系统的故障或者差错而影响交易的正常进行或者导致投资者的利益受到影响。

### (3) 操作风险

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者违反操作规程等导致的风险。

### (4) 不可抗力风险

战争、自然灾害、金融市场危机等不可抗力因素的出现,将会严重影响证券市场的运行,从而带来的风险。

二、管理人应当单独编制风险揭示书作为合同附件。投资者应充分了解并谨慎评估自身风险承受能力，并做出自愿承担风险的陈述和声明。

## 第二十四部分 资产管理合同的变更、终止与财产清算

### 一、资产管理合同的变更

(一) 因法律法规或中国证监会、基金业协会的相关规定，要求发生变化必须变更资产管理合同的，管理人可以与托管人协商后更新或修改资产管理合同，更新或修改的内容在管理人网站公告满1个工作日后生效。

(二) 因其他原因需要变更资产管理合同的，管理人和托管人应书面达成一致并在管理人网站公告，公告内容应包含但不限于以下内容：合同变更的内容、不同意变更的投资者的退出安排。管理人须在公告后5个工作日内以通过管理人网站或其他适当方式向投资者发送合同变更征询意见。投资者不同意变更的，应在公告发布之日起至公告规定的退出申请截止日前，按公告规定的方式提出退出本集合计划的申请。投资者未在规定时间内提出退出申请的，视为同意合同变更。但本合同约定资产管理人有权与资产托管人协商一致后变更合同内容的情形除外，包括：

1. 投资经理的变更。
2. 资产管理计划认购或参与、非交易过户的原则、时间、业务规则等变更。
3. 调低资产管理计划相关费用或比例。
4. 对资产管理合同的变更不涉及合同当事人权利义务关系发生重大变化，且对投资者利益无实质性不利影响。

本计划改变投向和比例的，应当事先取得投资者同意。

(三) 管理人应当合理保障合同变更后投资者选择退出本计划的权利。

合同变更后管理人可以采取临时开放等方式合理保障投资者选择退出资产管理计划的权利。

管理人特别提示，合同变更可能涉及投资者的各项权益调整（包括但不限于权利义务的重大变动，管理费、托管费、业绩报酬的提高或降低等），投资者应实时关注管理人网站（<http://www.hazq.com>）公告；投资者同意，管理人通过网站公告的方式视为已合理征询投资者的意见，无论其是否同意合同变更或提出退出申请；投资者同意，无论其是否同意合同变更或提出退出申请，管理人在

与托管人达成一致意见并通过管理人网站或其他适当方式向投资者发送合同变更征询意见后，按照上述程序变更本合同属于投资者认可的行为。

二、本合同发生变更的，管理人应按照基金业协会要求及时向基金业协会备案，并抄报中国证监会相关派出机构。

### 三、资产管理计划的展期

(一) 资产管理计划展期应符合以下条件：

1. 本计划运作规范，管理人、托管人未违反法律、行政法规、中国证监会规定和本合同的约定；

2. 本计划展期没有损害投资者利益的情形；

3. 中国证监会规定的其他条件；

(二) 本计划展期的，应当符合本计划的成立条件。

(三) 展期的安排

1. 通知展期的时间

存续期届满前3个月且不超过1个月。

2. 通知展期的方式

管理人将通过短信、电子邮件或信函方式向投资者发送展期征询意见。

3. 投资者回复的方式

投资者应当在管理人网站公告之日起10个工作日内以书面或管理人约定的其他方式明确回复意见。在征询意见发出后的10个工作日内提出退出本计划的申请；投资者未在前述时间回复意见的，视为投资者同意展期。

4. 投资者不同意展期的处理办法

若投资者明确回复不同意展期，投资者有权按照管理人公告内容在存续期届满日前（含届满日）到推广机构办理退出手续或按本合同规定办理集合计划份额转让手续；若投资者未在存续期届满日前（含届满日）到推广机构办理本计划份额退出、转让手续，则由管理人决定对上述份额于存续期届满之日做自动退出处理。若投资者未回复意见或回复意见不明确的，并未在上述期限内办理转让或退出手续，视为不同意展期，管理人不再另行通知确认。

5. 展期的实现

如果同意计划展期的投资者人数不少于2人，展期的投资者持有份额规模不少于1000万元，则本计划存续期将依法展期；如果同意计划展期的各投资者人

数低于 2 人，或展期的投资者持有份额规模不少于 1000 万元，则本计划到期终止，管理人将按照本合同约定办理计划到期终止和清算事宜。

四、资产管理计划终止的情形，包括但不限于下列事项：

(一) 资产管理计划存续期届满且不展期；

(二) 经全体投资者、管理人和托管人协商一致决定终止的；

(三) 管理人被依法撤销资产管理业务资格或者依法解散、被撤销、宣告破产，且在六个月内没有新的管理人承接；

(四) 托管人被依法撤销基金托管资格或者依法解散、被撤销、宣告破产，且在六个月内没有新的托管人承接；

(五) 持续五个工作日投资者少于 2 人的；

(六) 未在基金业协会完成备案或不予备案的情形；

(七) 法律、行政法规、中国证监会规定及资产管理合同约定的其他情形。

发生管理人被依法撤销资产管理业务资格或者依法解散、被撤销、宣告破产情形时，托管人有权立即对托管账户采取止付措施。

管理人应当自本计划终止之日起五个工作日内报基金业协会备案，并抄报中国证监会相关派出机构，前述第（六）项约定的情形除外。

五、资产管理计划的清算

管理人应在本计划发生终止情形之日起五个工作日内开始组织清算。

(一) 资产管理计划财产清算小组

1. 资产管理计划财产清算小组成员由管理人和托管人组成。清算小组可以聘用必要的工作人员。

2. 资产管理计划财产清算小组负责计划财产的保管、清理、估价、变现和分配。资产管理计划财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。

(二) 资产管理计划财产清算的程序

1. 本合同终止时，由资产管理计划财产清算小组统一接管财产；

2. 对本计划财产进行清理和确认；

3. 对本计划财产进行估价和变现；

4. 制作清算报告；

5. 对本计划剩余财产进行分配。

(三) 清算费用的来源和支付方式

清算费用是指资产管理计划财产清算小组在进行计划财产清算过程中发生的所有合理费用,清算费用由资产管理计划财产清算小组优先从计划财产中支付。

#### (四) 资产管理计划财产清算及剩余资产的分配

1. 本计划终止时已计提但尚未支付的管理费、托管费等,经清算小组复核后从清算财产中支付。

2. 依据资产管理计划财产清算的分配方案,将计划财产清算后的全部剩余资产扣除清算费用后,按本计划投资者持有的计划份额比例以现金形式进行分配,本合同另有约定的除外。

3. 因持有流通受限证券及其他投资品种等原因导致本计划财产无法及时变现的,管理人应将已变现部分先行分配,并于本计划终止后对计划财产进行二次清算。清算期间继续根据本合同约定提取管理费、托管费等相关费用及业绩报酬。待上述资产可以变现时,管理人应及时完成剩余可变现计划资产的变现操作后进行二次清算,并在扣除相关费用和业绩报酬后将该剩余财产分配给全体投资者。本计划持有多个流通受限证券及其他投资产品的,管理人按本款约定进行多次变现及清算。管理人应在剩余计划财产变现并完成清算后3个工作日内向托管人发送指令,托管人按指令将剩余计划财产划至指定账户。

4. 在计划财产移交前,由托管人负责保管。清算期间,任何当事人均不得运用该财产。清算期间的收益归属于计划财产,发生的保管费用由被保管的计划财产承担。因投资者原因导致计划财产无法转移的,托管人和管理人可以在协商一致后按照有关法律法规进行处理。

(五) 本计划因委托财产流动性受限等原因延期清算的,管理人应当及时向中国证监会相关派出机构和基金业协会报告。

#### (六) 资产管理计划财产清算报告的告知安排

清算小组在本计划终止后20个工作日内编制计划财产清算报告,由管理人或销售机构按照投资者提供的联系方式或由管理人通过其公司网站告知投资者。投资者在此同意,上述报告不再另行审计,除非法律法规或监管部门要求必须进行审计的。

管理人应当在计划清算结束后五个工作日内将清算结果报基金业协会备案,并抄报中国证监会相关派出机构

#### (七) 资产管理计划财产相关账户的注销

计划财产清算完毕后,托管人按照规定注销本计划托管账户及本计划投资所需账户,管理人应给予必要的配合。

#### (八) 资产管理计划财产清算账册及文件的保存

本计划财产清算账册及文件由管理人保存 20 年以上。

### 第二十五部分 违约责任

一、本合同当事人违反合同,应当承担违约责任。给其他当事人造成经济损失的,应当承担赔偿责任。在发生一方或多方违约的情况下,本合同能继续履行的,应当继续履行。

二、管理人、托管人及其他第三方机构在履行各自职责的过程中,因违反法律法规或者本合同约定,给计划财产或者投资者造成损害的,应按过错原则分别对各自的行为承担赔偿责任。

发生下列情况的,当事人可以免责:

(一) 不可抗力;

(二) 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;

(三) 管理人由于按照本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。

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。违约方因防止损失扩大而支出的合理费用由违约方承担。

四、因一方当事人违约而导致其他当事人损失的,投资者应先于其他受损方获得赔偿。

五、由于管理人、托管人不可控制的因素导致业务出现差错,管理人和托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查,但是未能发现错误的,由此造成计划财产或投资者损失,管理人和托管人可以免除赔偿责任。但是管理人和托管人应积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

六、本合同一方当事人依据本合同向另一方当事人赔偿的损失,仅限于直接损失。

## 第二十六部分 争议的处理

一、对于因本合同的订立、内容、履行和解释或与本合同有关的争议，合同当事人可以通过协商或者调解予以解决。当事人不愿通过协商、调解解决或者协商、调解不成的，采取以下第（一）种方式解决：

（一）因履行本合同发生的争议，由协议签订各方协商解决，协商不成的，任何一方均有权将争议提交托管人所在地法院解决。

（二）向被告所在地有管辖权的人民法院提起诉讼。

二、争议处理期间，合同当事人应恪守各自的职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行本合同规定的义务，维护投资者的合法权益。

三、本合同受中华人民共和国法律管辖。

## 第二十七部分 资产管理合同的效力

一、本合同是约定资产管理合同当事人之间权利义务关系的法律文件。投资者为法人的，本合同自投资者、管理人和托管人加盖公章或合同专用章以及各方法定代表人/负责人或授权代表签字或盖章之日起成立；投资者为自然人的，本合同自投资者本人签字、管理人和托管人加盖公章或合同专用章以及双方法定代表人/负责人或授权代表签字或盖章之日起成立（如采用电子方式签署合同的，应该满足相关电子合同签约成立的条件）。本合同自本计划成立之日起生效。

二、本合同自生效之日起对投资者、管理人、托管人具有同等的法律约束力。

三、本合同的有效期限为【10】年。

四、投资者自签订本合同即成为本合同的当事人。在本计划存续期间，投资者自全部退出计划之日起不再是本合同的当事人。

## 第二十八部分 其他事项

一、本合同各方当事人应对签署和履行本合同过程中所接触和获取的其他方当事人的数据、信息和其它涉密信息承担保密义务，非经其他方当事人同意，不得以任何方式向第三人泄露或用于非本合同之目的（法律法规或司法监管部门要求的除外）。本保密义务不因合同终止而终止。

二、如将来监管部门对本合同的内容与格式有其他要求的，投资者、管理人和托管人应立即展开协商，根据监管相关要求修改本合同的内容和格式。

三、除本合同另有约定外，管理人的通讯地址、托管人的通讯地址以及投资者在管理人或代销机构留存的通信地址适用于本合同相关的各类通知、协议、文书的送达，包括但不限于合同履行期间各类通知、协议等文件的送达，以及合同发生纠纷时相关文件和法律文书的送达，同时包括争议进入仲裁、民事诉讼程序后一审、二审、再审和执行程序及其他程序中相关文件的送达。本合同一方以专人递送给其他当事人，或以传真、邮递方式发出。该等通知以专人递送，于递交时视为送达；以传真方式发出，于收件人传真机显示收到时视为送达；以邮递方式发出，收件人签收之日视为送达。

四、本合同一式【肆】份，管理人执【贰】份，托管人执【壹】份，报基金业协会备案【壹】份，每份具有同等的法律效力。

(以下无正文)



本页无正文，为《华安证券季季赢 14 号集合资产管理计划资产管理合同》  
签署页

投资者： (壹)

法定代表人/负责人或授权代表：

签署日期： 年 月 日

资产管理人：华安证券股份有限公司 (壹)



法定代表人/负责人或授权代表：

签署日期：2021 年 4 月 28 日

资产托管人：浙商银行股份有限公司



法定代表人/负责人或授权人：



签署日期：2021 年 4 月 29 日