

资产管理合同编号：CITICSF [2021] JHZG[056]号

27

中信期货睿意全天候 FOF1 号集合资产管理计划 资产管理合同

资产管理人：中信期货有限公司

资产托管人：兴业银行股份有限公司

资产管理计划风险类型揭示书

尊敬的委托人：

感谢您/贵单位认购、申购中信期货有限公司（以下简称“我司”）依法设立发行的“中信期货睿意全天候 FOF1 号集合资产管理计划”（以下简称“产品”或“计划”）。本产品风险等级为 高风险 中高风险 中风险 中低风险 低风险（注：请务必在选项前 内打 ，且只能选择其中一项），相应风险等级的评价说明详见下表：

| 风险等级 | 评价说明 |
|------------|--|
| R1 低风险 | 产品结构简单，过往业绩及净值的历史波动率低，投资标的流动性很好、不含衍生品，估值政策清晰，杠杆不超监管部门规定的标准 |
| R2 中低风险 | 产品结构简单，过往业绩及净值的历史波动率较低，投资标的流动性好、投资衍生品以套期保值为目的，估值政策清晰，杠杆不超监管部门规定的标准 |
| R3 中风险 | 产品结构较简单，过往业绩及净值的历史波动率较高，投资标的流动性较好、投资衍生品以对冲为目的，估值政策清晰，杠杆不超监管部门规定的标准 |
| R4 中高风险 | 产品结构较复杂，过往业绩及净值的历史波动率高，投资标的流动性较差，估值政策较清晰，一倍（不含）以上至三倍（不含）以下杠杆 |
| R5 高风险 | 产品结构复杂，过往业绩及净值的历史波动率很高，投资标的流动性差，估值政策不清晰，三倍（含）以上杠杆 |

为保障您/贵单位的合法权益，请认真阅读本产品风险类型揭示书、资产管理合同、计划说明书、风险揭示书等有关文书，根据自身的风险承受能力审慎选择与风险等级相匹配的产品，自行承担参与本产品的投资风险。我司将以诚实信用、勤勉尽责的态度和专业的技能竭力为您管理和运作委托财产，但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。

特别提示：委托人在本《资产管理计划风险类型揭示书》上签字、盖章，即表明委托人已阅读并完全理解以上内容，自愿参与并承担本计划投资的风险和损失。

委托人（自然人签字或机构盖章）：

法定代表人或授权代表（签字或盖章）：

日期： 年 月 日

目 录

| | |
|--------------------------------|----|
| 中信期货睿意全天候 FOF1 号集合资产管理计划资产管理合同 | 1 |
| 第一节 前言 | 4 |
| 第二节 释义 | 5 |
| 第三节 承诺与声明 | 8 |
| 第四节 当事人及权利义务 | 9 |
| 第五节 资产管理计划的基本情况 | 15 |
| 第六节 资产管理计划的募集 | 17 |
| 第七节 资产管理计划的成立与备案 | 20 |
| 第八节 资产管理计划的参与、退出与转让 | 21 |
| 第九节 份额持有人大会及日常机构 | 29 |
| 第十节 资产管理计划份额的登记 | 29 |
| 第十一节 资产管理计划的投资 | 30 |
| 第十二节 投资顾问 | 35 |
| 第十三节 分级安排 | 35 |
| 第十四节 利益冲突及关联交易 | 35 |
| 第十五节 投资经理的指定与变更 | 36 |
| 第十六节 资产管理计划的财产 | 37 |
| 第十七节 投资指令的发送、确认和执行 | 41 |
| 第十八节 越权交易处理 | 44 |
| 第十九节 交易及清算交收安排 | 46 |
| 第二十节 资产管理计划财产的估值和会计核算 | 48 |
| 第二十一节 资产管理计划的费用与税收 | 54 |
| 第二十二节 资产管理计划的收益分配 | 57 |
| 第二十三节 信息披露与报告 | 59 |
| 第二十四节 风险揭示 | 62 |
| 第二十五节 资产管理合同的变更、终止与财产清算 | 68 |
| 第二十六节 违约责任 | 72 |
| 第二十七节 争议的处理 | 73 |
| 第二十八节 资产管理合同的效力 | 73 |
| 第二十九节 其他事项 | 74 |
| 附件一：费用列表 | 79 |
| 附件二：资产到账确认书 | 80 |
| 附件三：授权文件 | 81 |
| 附件四：划款指令 | 82 |
| 附件五：资产管理计划成立通知书样本 | 83 |
| 附件六：各方业务联系人名单及预留印鉴 | 84 |

特别约定：

《中信期货睿意全天候 FOF1 号集合资产管理计划资产管理合同》以电子签名方式或手签、盖章纸质合同方式签订，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；投资者（中信期货睿意全天候 FOF1 号集合资产管理计划的委托人）作为本合同一方，以纸质或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。若采用电子签名方式签约，则投资者、管理人、托管人同意遵守《电子签名法》等法律法规的有关规定，三方一致同意投资者自签署《电子签名约定书》之日起，投资者以电子签名方式接受电子签名合同（即本合同）的，视为签署本合同，与在纸质合同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。

第一节 前言

第一条 为规范中信期货睿意全天候 FOF1 号集合资产管理计划（以下简称“本计划”）运作，明确本计划资产管理合同当事人的权利与义务，依据《中华人民共和国民法典》、《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《基金法》）、《中华人民共和国证券法》、《期货交易管理条例》、《期货公司监督管理办法》、《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》（银发〔2018〕106号，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》（证监会令第151号，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》（证监会公告〔2018〕31号，以下简称《运作规定》）、《集合资产管理计划资产管理合同内容与格式指引（试行）》（以下简称《合同指引》）等法律、行政法规、中国证监会和中国证券投资基金业协会（以下简称“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、公平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，当事人按照法律法规、本合同及本合同附件《中信期货睿意全天候 FOF1 号集合资产管理计划说明书》（以下简称“计划说明书”）、《中信期货睿意全天候 FOF1 号集合资产管理计划风险揭示书》（以下简称“风险揭示书”）和其他有关规定，享有权利，承担义务。

第二条 管理人应当对资产管理计划的设立、变更、展期、终止、清算等行为向

基金业协会进行备案，并抄报中国证监会相关派出机构。

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

第三条 在本合同及计划说明书中，除非文意另有所指，下列用语应当具有如下含义：

一、资产管理合同、本合同：指《中信期货睿意全天候 FOF1 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和补充。

二、资产管理计划、计划、集合计划、产品：指中信期货睿意全天候 FOF1 号集合资产管理计划。

三、风险揭示书：指中信期货睿意全天候 FOF1 号集合资产管理计划风险揭示书。

四、计划说明书：指管理人制定的《中信期货睿意全天候 FOF1 号集合资产管理计划说明书》及对说明书的任何有效修订和补充。

五、委托人、投资者：指签订本合同，委托投资本资产管理计划初始金额不低于【40】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。

六、资产管理人、管理人：指中信期货有限公司。

七、资产托管人、托管人：指。

八、中国证监会：指中国证券监督管理委员会及其派出机构。

九、基金业协会：指中国证券投资基金业协会。

十、证券交易所：指上海证券交易所、深圳证券交易所和全国中小企业股份转让系统有限责任公司。

十一、注册登记机构：指中信期货有限公司或其委托的经中国证监会认定的可办理资产管理计划份额登记业务的机构。

十二、销售机构：指管理人或接受管理人委托的办理集合计划的参与、退出等业务的机构。

十三、认购：指在资产管理计划初始销售期间，资产委托人按照本合同的约定购买本计划份额的行为。

十四、参与、申购：指在资产管理计划开放日，资产委托人按照本合同的约定参与本计划份额的行为。

十五、退出、赎回：指在资产管理计划开放日，资产委托人按照本合同的规定退出本计划份额的行为。

十六、交易日：指证券交易所的正常交易日。

十七、工作日：同交易日。

十八、T日：指销售机构在规定时间受理投资者认购、参与、退出等业务申请的日期。

十九、T+n日：指T日后（不包括T日）第n个工作日。

二十、T-n日：指T日前（不包括T日）第n个工作日。

二十一、开放日：指存续期间，管理人办理计划参与、退出业务的工作日。

二十二、初始销售期间：指资产管理合同或产品说明书中载明的计划初始销售期限。

二十三、存续期：指本资产管理计划成立之日起计算，至资产管理计划终止之日之间的期限。

二十四、估值日：指对委托财产进行估值的日期，为每个工作日或本合同约定以及中国证监会规定的其它日期。

二十五、计划财产估值：指计算评估计划资产和负债的价值，以确定计划财产净值的过程。

二十六、资产管理计划财产总值：指资产管理计划财产投资于各类证券、银行存款及其他投资品种形成的资产总和。

二十七、资产管理计划财产净值：指计划资产总值减去负债后的价值。

二十八、资产管理计划份额净值：指单位份额代表的计划财产净值。

二十九、托管账户：指托管人根据有关规定为资产管理计划财产开立的专门用于资金收付、清算交收的银行账户。

三十、 委托财产：指委托人拥有合法所有权或处分权、委托给管理人管理并由资产托管人托管的作为本合同标的的财产, 不包括认购费或申购费。

三十一、 关联方：本合同及计划说明书所指关联方关系的含义与《企业会计准则第 36 号—关联方披露》中的关联方关系的含义相同。

三十二、 《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》（证监会令第 151 号）。

三十三、 《运作规定》：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》（证监会公告[2018]31 号）。

三十四、 不可抗力：指本集合计划合同当事人不能预见、不能避免并不能克服的客观情况，包括但不限于：洪水、地震及其它自然灾害；战争、骚乱、突发性公共卫生事件、政府征用、没收；证券登记结算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、法律法规变化等。

三十五、 法律法规：指中国现时有效并公布实施的法律、行政法规、部门规章及规范性文件、地方性法规、地方政府规章及规范性文件，为本合同之目的，不包括香港、澳门特别行政区及台湾地区法律法规。

三十六、 管理人网站：指 www.citicsf.com。

三十七、 家庭金融总资产，是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。

三十八、 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。

三十九、 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。

四十、除特别说明外，货币均为人民币，单位为“元”。

四十一、**信义义务**：托管人信义义务是指托管人按恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则，根据相关法律法规和监管规定，在本资产管理合同约定范围内尽职尽责履行安全保管托管资产等托管人职责。

第三节 承诺与声明

第四条 管理人承诺与声明

一、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，充分揭示了相关风险。

二、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。

三、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。

第五条 托管人承诺与声明

一、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。

二、根据法律法规、中国证监会及基金业协会的规定和本合同的约定，对管理人的投资或清算指令等进行监督。

三、在管理人发生异常且无法履行管理职能时，依照法律法规及合同约定履行受托职责，维护投资者权益。

第六条 委托人承诺与声明

一、以真实身份参与集合资产管理计划，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。

二、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。

三、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。

四、已知悉《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》、《中国人民银行关于加强反洗钱客户身份识别有关工作的通知》等反洗钱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；承诺投资的资金来源和去向不涉及洗钱、恐怖融资和逃税等行为；承诺出示真实有效的身份证件或者其他身份证明文件，提供真实有效的业务性质与股权或者控制权结构、受益所有人信息等资料；承诺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。

五、不属于中国有权机关、联合国、欧盟或美国等制裁名单或禁止名单内的企业或个人，不位于被中国有权机关、联合国、欧盟或美国等主权国家或国际组织制裁的国家和地区。

第四节 当事人及权利义务

第七条 投资者基本情况

签订《中信期货睿意全天候 FOF1 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。以手写、盖章签署纸质合同的，委托人的详细情况在“本合同签署页之一：委托人基本信息”列示。签署电子合同的，委托人的详细情况在电子签名合同数据电文中列示。

第八条 管理人基本情况

名称：中信期货有限公司

住所：深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场(二期)北座 13 层 1301-1305、14 层

通信地址：上海市杨高南路 799 号陆家嘴世纪金融广场三号楼 2304 室

邮政编码：200127

法定代表人：张皓

联系人：傅姝婷

电话：18612838080

传真：021-60819988

邮箱：fushuting@citicsf.com

第九条 托管人基本情况

名称：兴业银行股份有限公司

住所：福建省福州市湖东路154号

通讯地址：上海市浦东新区银城路167号

法定代表人：陶以平（代为履行法定代表人职权）

联系人：张珏

联系电话：021-56629999

传真：021-62535823

邮箱：zhangjue@cib.com.cn

第十条 本集合计划设定为均等份额，不进行份额分级，除资产管理合同另有约定外，每份份额具有同等的合法权益。

第十一条 投资者的权利

- 一、分享本资产管理计划财产收益；
- 二、取得分配清算后的剩余资产管理计划财产；
- 三、按照本合同的约定参与、退出和转让资产管理计划份额；
- 四、按照法律法规及本合同约定的时间和方式获得资产管理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、中国证监会及基金业协会规定的和资产管理合同约定的其他权利。

第十二条 投资者的义务

- 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；

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；

四、认真阅读并签署风险揭示书；

五、按照资产管理合同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（如有）、托管费、审计费、税费等合理费用；

六、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；应当退还因管理人、托管人、代理销售机构过错导致投资者获得的不当利得；

七、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，不按照规定提供相关信息，提供信息不真实、不准确、不完整的，应当依法承担相应的法律责任，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；

八、不得违反资产管理合同的约定干涉管理人的投资行为；

九、不得从事任何有损资产管理计划及其投资者、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；

十一、投资者转让本合同中的权利义务和集合计划份额应事先取得管理人的同意，不得违规转让其所拥有的集合计划份额（法律法规另有规定的除外）；

十二、法律法规、中国证监会及基金业协会规定和资产管理合同约定的其他义务。

第十三条 管理人的权利

一、按照资产管理合同约定，独立管理和运用资产管理计划财产；

二、按照资产管理合同约定，及时、足额获得管理人管理费用及业绩报酬（如有）；

三、按照有关规定和资产管理合同约定行使因资产管理计划财产投资所产生的权利；

四、根据资产管理合同及其他有关规定，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基金业协会；

五、自行提供或者委托经中国证监会、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；

六、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；

七、按照本合同的约定，停止或暂停办理集合计划的参与，暂停办理集合计划的退出事宜，终止本集合计划的运作；

八、集合计划资产受到损害时，向有关责任人追究法律责任；发生差错时，向当事主体追偿不当得利；

九、在不损害投资者实质利益的前提下，管理人有权根据管理运作实际情况对集合计划管理运作过程中的相关事项进行调整或补充明确，并及时予以公告；

十、如果投资者违反适当性、资金来源或其他投资者承诺与声明的，或管理人发现投资者资产来源或身份信息存在可疑之处的，管理人有权强制退出其持有的份额，并解除资产管理合同。

十一、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、修改和最终决策权；

十二、法律法规、中国证监会、基金业协会规定的及资产管理合同约定的其他权利。

第十四条 管理人的义务

一、依法办理资产管理计划的销售、登记、备案事宜；

二、按照基金业协会要求报送资产管理计划产品运行信息；

三、按照诚实信用、勤勉尽责的原则履行受托人义务，管理和运用资产管理计划财产；

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资产管理计划财产；

七、 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；

八、 除依据法律法规、资产管理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资产管理计划财产；

九、 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；

十、 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；

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、 按照资产管理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、 按照资产管理合同约定计算并向投资者报告资产管理计划份额净值；

十五、 确定资产管理计划份额参与、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、 按照资产管理合同约定负责资产管理计划会计核算并编制财务会计报告；

十七、 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；

十八、 按照资产管理合同的约定确定收益分配方案，及时向投资者分配收益；

十九、 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，向基金业协会备案，并抄报中国证监会相关派出机构；

二十、 办理与受托财产管理业务活动有关的信息披露事项；

二十一、 建立并保存投资者名单；

二十二、 组织并参加资产管理计划财产清算小组，参与资产管理财产的保管、

清理、估价、变现和分配；

二十三、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、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；

二十四、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、基金业协会并通知托管人和投资者；

二十五、按照我国有关反洗钱法律、行政法规及经济制裁政策，履行反洗钱义务；负责对委托财产来源的合法合规性进行审查，确保本计划成立及运作的合法合规性，确保本资产管理计划运作期间所投资项目的合法合规性；

二十六、法律法规、中国证监会及基金业协会规定的和资产管理合同约定的其他义务。

第十五条 托管人的权利

- 一、按照资产管理合同约定，依法保管资产管理计划财产；
- 二、按照资产管理合同约定，及时、足额获得资产管理计划托管费用；
- 三、法律法规、中国证监会及基金业协会规定的和资产管理合同约定的其他权利。

第十六条 托管人的义务

一、在集合计划托管业务中恪尽职守，履行诚实信用、谨慎勤勉的义务，安全保管本资产管理计划的财产；

二、除依据法律法规规定和资产管理合同的约定外，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资产管理计划财产；

三、按照规定开设资产管理计划的托管账户，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；

四、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；非依法律、行政法规和中国证监会有关规定或合同约定，不得擅自自动用或处分资产管理计划财产；

五、按规定开立和注销资产管理计划的托管账户及依据本合同约定开立和注销其他投资所需账户；

六、建立与管理人的对账机制，复核资产管理计划资产净值、份额净值和资产

管理计划参与、退出价格：

七、按照本合同的约定办理与资产管理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；

九、编制托管年度报告，并向基金业协会备案，抄报中国证监会相关派出机构；

十、按照法律法规要求和资产管理合同约定，根据管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；

十一、保守商业秘密，除法律法规、规章、审计或本合同另有要求的外，对资产管理计划投资信息和相关资料承担保密责任，不得向任何机构或者个人提供、泄露相关信息和资料，但托管人应在合法可行的前提下以最大努力尽早通知管理人；

十二、根据法律、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、交易记录等文件资料，保存期限自资产管理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、行政法规、中国证监会的规定或资产管理合同约定的，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基金业协会；

十四、赔偿因自身过错导致的集合计划资产的损失；

十五、因托管人无正当理由单方解除本合同给投资者、管理人造成损失的，对投资者、管理人予以赔偿；

十六、真实、准确、完整地向管理人提供其控股股东、实际控制人以及与其有其他重大利害关系的公司名单（见附件七）；

十七、国家有关法律法规、监管机构及资产管理合同规定的其他义务。

第五节 资产管理计划的基本情况

第十七条 资产管理计划的基本情况

一、名称：中信期货睿意全天候 FOF1 号集合资产管理计划。

二、类别：本计划为混合类基金中基金（FOF）集合资产管理计划。

三、资产管理计划的运作方式：**【开放式】**

四、资产管理计划的投资目标、主要投资方向、投资比例、产品风险等级

（一）投资目标

本计划的投资目标为：在严格控制风险的前提下，实现计划资产的增值。

（二）主要投资方向及投资比例

本计划主要投资于债券（不包括银行间债券）、货币市场基金、债券逆回购、证券公司资产管理计划、基金公司（含基金子公司）特定客户资产管理计划、期货公司资产管理计划、保险公司资产管理计划、在基金业协会登记的私募基金管理人发行并由具有相关资质机构托管的契约式私募证券投资基金、银行理财产品以及中国证监会认可的其他投资品种。

（三）产品风险等级

本合同当事人已知悉，管理人对本计划评定的产品风险等级为 **R3-中风险**，适合 **C5-积极型、C4-相对积极型、C3-平衡型** 的投资者。

五、资产管理计划的存续期限

本计划存续期限为 10 年。

出现资产管理合同约定的终止情形时，本计划终止并按照合同约定进行清算。

符合本合同约定的资产管理计划的展期条件的，本计划可延长存续期限。

六、资产管理计划份额的初始募集面值为 1 元。

七、资产管理计划的最低初始募集规模

单个资产委托人初始参与资产管理计划的财产不得低于【40】万元人民币，本计划最低初始募集规模不低于 2000 万元。

八、资产管理计划的分级安排

本计划不做分级安排。

九、资产管理计划的服务机构

为本集合计划提供份额登记、估值与核算、信息技术系统等服务的机构为中信期货有限公司。

十、人数限制

本集合计划投资者数量为 2 人以上（含）200 人以下（含）。

在集合计划人数达到上限时，管理人将有权拒绝接受初次参与申请，但继续接受本集合计划份额持有人的追加参与申请，并对当日已提交的初次参与申请，管理人将按照“时间优先、金额优先”的原则确认有效参与申请，并及时向投资者披露，

超出计划人数上限的参与申请为无效申请。

第六节 资产管理计划的募集

第十八条 资产管理计划募集有关事项

一、资产管理计划的募集对象、募集方式、初始销售期间

(一) 募集对象

本计划募集对象为：中华人民共和国境内的个人投资者、机构投资者（法律法规禁止的除外），法律法规或中国证监会允许参与本集合计划的其他投资者。

投资者应确保自身具备合格投资者条件。合格投资者系指符合中国证监会的相关规定，具备相应风险识别能力和风险承受能力，投资于单只资产管理计划不低于本合同约定的最低参与金额，且符合下列条件的自然人、法人或者其他组织：

1. 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 500 万元，或者近 3 年本人年均收入不低于 40 万元；
2. 最近 1 年末净资产不低于 1000 万元的法人单位；
3. 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、在基金业协会登记的私募基金管理人、商业银行、金融资产投资公司、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；
4. 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；
5. 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）；
6. 中国证监会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。如未来法律法规或监管机构对合格投资者有新规定的，本计划将按新规定执行。

投资者如为管理人的董事、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的，应在参与本计划时特别告知管理人，同意并授权管理人可以按照相关规定对其此次投资行为进行披露、监控以及向有权机构报告。

本计划面向特定的合格投资者募集，对于未经管理人认可的委托人，管理人

权拒绝其参与申请，已经参与的，管理人有权强制退出其持有的份额。

(二) 募集方式

本计划通过管理人或管理人委托的销售机构以非公开的方式向合格投资者募集。具体销售机构名单、联系方式以本资产管理计划相关文件为准。

销售机构应当依法、合规销售或者推荐本资产管理计划。

初始销售期间本计划初始销售期间自资产管理计划份额发售之日起不得超过60天，具体时间由管理人根据相关法律法规以及本合同约定确定，并在产品说明书中披露。在初始销售期间，资产管理人可与销售机构（如有）协商决定提前终止初始销售期间。

二、资产管理计划的认购事项

(一) 认购费用

本计划认购费率为0。

(二) 认购申请的确认

本计划的委托人不得少于2人，且不得超过200人。若法律法规或监管机构将来另有规定的，从其规定。当认购人数超过200人（不含）时，按照本合同的约定进行处理。

认购申请一经受理不得撤销，资产委托人在初始销售期内可以按本合同规定的条件多次追加委托投资金额。销售机构受理申请并不表示对该申请成功的确认，而仅代表销售机构确实收到了申请。认购申请是否有效以注册登记机构的确认并且资产管理合同生效为准，投资者应在本合同生效后到管理人或销售机构查询最终确认情况和有效认购份额。确认无效的申请，管理人将无息退还委托人已交付的认购款项。

(三) 认购份额的计算方式

认购份额=[净认购金额+认购期利息]/初始募集面值。

认购费用=认购金额*认购费率/(1+认购费率)。

净认购金额=认购金额/(1+认购费率)。

认购份额保留到小数点后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。

(四) 初始认购资金的管理及利息处理方式

管理人及销售机构应当将资产管理计划初始销售期间委托人的资金存入专门账户，在资产管理计划初始募集行为结束前，任何机构和个人不得动用。

初始销售期间产生的利息在资产管理合同生效后折算为资产管理计划份额归委托人所有。其中，利息从认购申请确认后的次工作日起计算，按管理人募集户开户银行同期活期存款利率计算，利息转份额的具体数额以注册登记机构的记录为准。

三、资产管理计划的最低认购金额、支付方式

本计划接受合格投资者以货币资金认购，最低认购金额为人民币【40】万元，且可追加认购，追加认购金额为【1】万元的整数倍。前述认购金额均不包含认购费。投资者将红利再投资不受前述限制。

如未来法律法规或监管机构对参与最低金额有新规定的需要调整的，**资产委托人同意**：除非本合同另有约定，资产管理人在其网站上公告前述调整事项即视为履行了告知义务。

第十九条 资产管理计划募集结算专用账户和销售机构委托募集账户

一、直销处理

资产委托人通过直销渠道认购（即通过管理人直接认购）的，在初始销售期的认购款项需在规定时间内划付至如下管理人募集结算专用账户：

户名：中信期货有限公司直销专户

账号：7600 2101 8770 0000 176

开户行：中信银行深圳软件基地支行

二、代销处理

资产委托人通过销售机构认购的，应将委托资产划入销售机构指定的销售机构委托募集账户，或由销售机构根据委托人的指令从委托人账户中进行扣划。销售机构委托募集账户（如有）以本合同约定、销售机构相关公告或管理人公告为准。

销售机构 1：【蚂蚁（杭州）基金销售有限公司】

本资产管理计划的销售机构委托募集账户信息：

户名：蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

开户行：上海浦东发展银行杭州分行

账号：95200157870000159

销售机构 2:【上海天天基金销售有限公司】

本资产管理计划的销售机构委托募集账户信息:

户名:上海天天基金销售有限公司私募基金销售监督专户

开户行:中国民生银行上海分行营业部

账号:630 637 510(资金交收账户)

联行号:3052 9000 2012

第七节 资产管理计划的成立与备案

第二十条 资产管理计划成立的有关事项

一、资产管理计划成立的条件

资产管理计划成立应当具备以下条件:

(一) 募集过程符合法律、行政法规和中国证监会的规定;

(二) 募集金额达到本合同约定的成立规模,且不违反中国证监会规定的最低成立规模;

(三) 投资者人数不少于二人,且不超过二百人;

(四) 符合中国证监会规定以及资产管理合同约定的其他条件。

资产管理计划满足上述成立条件,且募集金额缴足之日起十个工作日内,管理人应当将全部初始销售资金转入托管账户,托管人经管理人通知后查询委托财产到账情况,并在确认无误后出具《资产到账确认书》(详见附件二)或其他可替代性材料的传真件或电子扫描件给管理人。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。

二、资产管理计划的成立

管理人在取得验资报告后,公告资产管理计划成立,资产管理计划的成立日以管理人公告为准。

第二十一条 资产管理计划的备案

管理人应在资产管理计划成立之日起5个工作日内报基金业协会备案,抄报中国证监会相关派出机构。资产管理计划成立前,任何机构和个人不得动用投资者参

与资金。

若本资产管理计划未通过基金业协会的备案，则本计划提前终止，进入清算程序，具体终止时间以管理人的公告为准。对于未通过基金业协会的备案而提前终止的资产管理计划，管理人、托管人、销售机构、投资顾问（如有）一致认可，不收取认购费、管理费、托管费、投资顾问费（如有）、管理人业绩报酬及投资顾问业绩报酬（如有）。为免疑义，因本计划成立而产生的前述费用以外的债务和费用（包括但不限于相关税费、交易费等），应当由本计划财产承担。

第二十二条 备案前投资事项

资产管理计划在成立后备案完成前，不得开展投资活动。但在本计划公告成立日至备案完成前，管理人可以以现金管理为目的，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。无论本合同的投资范围中是否包括前述投资标的，管理人按照此条进行投资，均视为符合本计划的投资范围，不违反本合同的任何约定。

第二十三条 募集失败的处理

资产管理计划初始销售期间届满，不能满足本计划成立条件的，资产管理人应当：

1. 以其固有财产承担因销售行为而产生的债务和费用。

2. 在资产管理计划初始销售期限届满后 30 日内返还客户已缴纳的款项，并加计银行同期活期存款利息（按照募集账户开立的银行所公布的当期活期存款利率计算委托人认购资金所对应的利息）。利息金额以本计划注册与登记机构的记录为准。

第八节 资产管理计划的参与、退出与转让

第二十四条 参与和退出事项

一、参与和退出场所

本计划参与和退出场所为资产管理人和其委托的销售机构（如有）的营业场所，或按管理人和销售机构提供的其他方式办理参与和退出。

管理人可以根据需要增加、变更代理销售机构。具体销售机构名单、联系方式以资产管理人发布的销售公告/产品说明书、销售机构公告或本合同的约定为准。

二、参与和退出的开放日和时间

(一) 本资产管理计划不设封闭期。

(二) 本计划的开放日分为申购开放日和赎回开放日。本计划申购开放日为每月 15 日-17 日（如遇非交易日则顺延至下一交易日），接受计划份额的参与；赎回开放日为每年的 1 月和 7 月首个申购开放日的前一个交易日，接受计划份额的退出。举例：若本计划 2021 年 8 月 1 日成立，2021 年 8 月 16 日-8 月 18 日为申购开放日（遇非交易日则顺延至下一交易日），以此类推；2022 年 1 月 14 日为赎回开放日，以此类推。

(三) 申请参与的资产委托人应在开放日前 5 个工作日内至 1 个工作日，即 T-5 个工作日内至 T-1 个工作日（含）15:00 前向资产管理人提交参与申请，参与成功以委托人已签署合同并且参与资金到达募集账户为准。申请退出的资产委托人应在开放日前 15 个工作日内至 10 个工作日，即 T-15 个工作日内至 T-10 个工作日内（含）15:00 前向资产管理人提交退出申请。

(四) 未在前述期间提交参与或退出申请书的，管理人有权拒绝受理委托人的参与或退出申请。

(五) 存续期间，资产管理人有权调整开放日以及委托人必须提交申请的时间，并通知资产托管人。有权根据证券交易市场、证券交易所交易时间变更或其他特殊情况对开放日及开放时间作相应调整。

资产委托人签署本合同即表示同意：管理人提前 5 个工作日在资产管理人网站公告或通过委托人认可的其他形式告知前述调整事项即视为履行了告知义务。

(六) 委托人通过代理销售机构参与、退出本计划的，应根据代理销售机构制定的规则和流程办理参与、退出业务。

三、临时开放期的触发条件、程序及披露等相关安排

当触发本合同约定的因合同变更、法律法规变化的情形时，管理人可以安排临时开放日，临时开放日仅允许委托人退出，除前述情形外，本集合计划在存续期不设临时开放期。

四、参与和退出的方式、价格、程序及确认等

(一) “未知价”原则，即委托人按约提交参与申请或/且退出申请后，资产管理计划份额的参与和退出价格以开放期（即：T 日）当日的计划份额净值为基准进行计算。

(二) 资产管理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) 委托人办理参与、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,以管理人或销售机构的具体规定为准。

(四) 参与和退出申请的确认。销售机构受理参与和退出申请并不表示对该申请是否成功的确认,而仅代表销售机构确实收到了参与和退出申请。参与和退出申请的确认以份额登记机构的确认结果为准。

本计划的人数规模上限为 200 人。管理人按照“时间优先、金额优先”的原则确认有效参与申请。超出计划人数上限的参与申请为无效申请。

在正常情况下,份额登记机构在【T+3】日内对 T 日参与和退出申请的有效性进行确认。若参与不成功,管理人应在【T+3】日起三十日内无息返还委托人已缴纳的款项。

(五) 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无息退回委托人指定资金账户。参与资金在份额确认之前不计利息。委托人退出申请成交后,管理人应按规定向委托人支付退出款项,退出款项自开放日起 9 个工作日内划往委托人的退出账户或者销售机构指定的账户。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。

管理人在不损害委托人权益的情况下可更改上述原则,但最迟应在新的原则实施前 5 个工作日告知委托人。管理人通过公司网站公告或以委托人认可的其他形式告知即视为履行了告知义务。

五、参与和退出的金额限制

存续期开放日购买资产管理计划份额的,投资者应当符合合格投资者标准,参与金额应不低于【40】万元,已持有资产管理计划份额的投资者在资产管理计划存续期开放日追加购买资产管理计划份额的除外。投资者追加参与金额应为【1】万元的整数倍。前述金额均不包含参与费。

当投资者持有的计划资产净值高于 40 万元人民币时,投资者可以选择全部或部分退出资产管理计划;选择部分退出资产管理计划的,投资者在退出后持有的计划资产净值不得低于 40 万元人民币。当资产管理人发现投资者申请部分退出资产管理

计划将致使其在部分退出申请确认后持有的计划资产净值低于 40 万元人民币，资产管理人按投资者赎回其全部份额处理。当投资者持有的计划资产净值低于 40 万元（含 40 万元）时，需要退出计划的，委托人应当一次性全部退出资产管理计划。

六、参与和退出的费用

（一）参与费用

本计划参与费率为 0。

（二）退出费用

资产委托人于其认购/申购后的 1 年（按 365 天计，下同）内于开放日申请退出的，需缴纳 2% 的退出费用。在其认购/申购后的 1 年（含）后于开放日申请退出的，不需要缴纳退出费用。退出费用（如有）由退出资产管理计划份额的委托人承担，在委托人退出资产管理计划份额时收取，其中 50% 归属委托资产，50% 归属资产管理人。归属资产管理人部分，资产管理人有权减免。

资产管理人可以在法律法规和本合同约定的范围内调整参与费率、退出费率或收费方式。费率或收费方式如发生变更，资产管理人应在调整实施前 3 个工作日告知资产委托人。资产委托人同意：除非本合同另有约定，资产管理人在其网站上公告前述调整事项即视为履行了告知义务。

七、参与份额、退出金额的计算方式

（一）参与份额的计算方式

本资产管理计划采用金额参与的方式。参与份额的计算方式如下：

参与份额=参与金额/(1+参与费率)/参与价格。

参与费用=参与金额*参与费率/(1+参与费率)。

净参与金额=参与金额/(1+参与费率)。

参与份额的计算保留到小数点后 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。

（二）本资产管理计划采用份额退出的方式。退出金额的计算方式如下：

如采用整体业绩报酬计提方式，则：

退出金额=退出份数×退出价格-退出费用。

退出费用=退出份数×退出价格×退出费率。

如采用单个委托人单笔业绩报酬计提方式，则：

退出金额=退出份数×退出价格-退出费用-应计提业绩报酬。

退出费用=退出份数×退出价格×退出费率。本条所述 T 日为开放期当日，参与价格和退出价格为 T 日份额净值。

退出金额和退出费用的计算保留到小数点后 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。

本计划计划份额的退出遵循“先进先出”原则，即按照委托人认购、参与和红利再投资所得份额的先后次序进行退出。

八、巨额退出或连续巨额退出

(一) 巨额退出的认定：在单个开放日，集合计划净退出申请份额(退出申请总数扣除参与申请总数后的余额)超过上一个工作日集合计划总份额的 20%时，即为巨额退出。

(二) 巨额退出的程序：巨额退出时，管理人可以根据发生巨额退出的集合计划当时的资产组合状况决定全额退出，或部分顺延退出。

1. 全额退出：当管理人认为有条件支付投资者的全部退出申请时，按正常退出程序办理。

2. 部分顺延退出：当资产管理人认为全额支付资产委托人的退出申请有困难或认为全额支付资产委托人的退出申请可能会对资产管理计划的资产净值造成较大波动时，资产管理人在当日接受退出比例不低于上一日资产管理计划总份额的 20%的前提下，对其余退出申请延期予以办理。对于单个资产管理计划资产委托人的退出申请，应当按照其申请退出份额占当日申请退出总份额的比例，确定该单个资产管理计划资产委托人当日办理的退出份额；资产委托人未能退出部分，除资产委托人在提交退出申请时选择将当日未获办理部分予以撤销外，延迟至下一个开放日办理，退出价格为下一个开放日的价格。依照上述规定转入下一个开放日的退出不享有退出优先权，并以此类推，直到全部退出为止。部分顺延退出不受单笔退出最低份额的限制。

3. 连续巨额退出：集合计划连续两个开放日以上(含两个开放日)发生巨额退出导致集合计划的现金支付出现困难的，即认为发生了连续巨额退出。连续巨额退出如管理人认为有必要，可暂停接受退出申请；已经接受的退出申请可以延缓支付退出款项，并应当管理人网站以公告的形式通知投资者。

(三) 巨额退出的影响

1. 巨额退出并不影响当期的参与；
2. 巨额退出期间，如果集合计划达到终止条件，则本集合计划将按规定终止；
3. 巨额退出结束，集合计划将恢复到正常的退出状态。

(四) 巨额退出的信息披露

1. 巨额退出通告

当发生巨额退出并采用部分顺延退出时，管理人应在 T+2 日内通过管理人网站以公告的形式通知委托人，并说明有关处理方法。

集合计划连续两个开放日以上（含两个开放日）发生巨额退出导致集合计划的现金支付出现困难的，如管理人认为有必要，可拒绝或暂停接受退出申请；管理人应当在 T+2 日内通过管理人网站及时以公告的形式通知投资者，并说明有关处理方法。

2. 重新开放退出的通告

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向投资者披露。

(五) 单个委托人大额退出的预约申请

本集合计划不设置单个委托人大额退出及预约申请安排。但在单个开放日，集合计划净退出申请份额（退出申请总数扣除参与申请总数后的余额）超过上一日集合计划总份额的 20% 时，将触发巨额退出机制。

九、延期支付及延期退出的情形和处理方式

集合计划连续两个开放日以上（含两个开放日）发生巨额退出导致集合计划的现金支付出现困难的，如管理人认为有必要，可暂停接受退出申请；已经接受的退出申请可以延缓支付退出款项，并应当通过管理人网站以公告的形式通知投资者。

十、拒绝或暂停参与、暂停退出的情形及处理方式

(一) 在如下情形下，管理人可以拒绝接受委托人的参与申请：

1. 本计划的委托人人数达到上限 200 人；
2. 根据市场情况，管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对计划业绩产生负面影响，从而损害现有委托人的利益的情形；
3. 因本计划持有的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委托人利益的情形；

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委托人利益的情形；

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，参与款项将无息退回投资者账户。

(二) 在如下情形下，管理人可以暂停接受委托人的参与申请：

1. 因不可抗力导致无法受理委托人的参与申请的情形；

2. 证券交易场所交易时间临时停市，导致管理人无法计算开放日当日计划资产净值的情形；

3. 发生本合同约定的暂停计划资产估值的情形；

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告知投资者。

(三) 全体投资者和托管人同意，出现下列情形时，管理人可以按照“时间优先、金额优先”的原则暂停接受全部或部分集合计划投资者的退出申请：

1. 不可抗力的原因导致集合计划无法正常运行；

2. 证券交易场所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. 因净退出申请份额超过集合计划可变现资产（集合计划可变现资产指集合计划净资产减去流通受限资产市值）或因市场剧烈波动或其它原因导致集合计划的现金支付出现困难；

4. 投资者未按照本合同约定的程序申请退出或管理人依据本合同约定拒绝其退出申请；

5. 本集合计划投资的标的无法及时变现或其他原因导致集合计划资产无法变现；

6. 资产管理合同约定、法律法规规定或中国证监会认定的其它情形。

暂停集合计划的退出，管理人应及时告知资产委托人。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，并应当及时告知资产委托人。

第二十五条 资产管理计划的份额转让

在技术条件成熟的条件下，经管理人同意并开通份额转让事宜之后，本计划份

额可以转让。转让后，持有本计划份额的合格投资者合计不得超过 200 人。本计划份额转让是指在资产管理计划存续期间，客户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资产管理计划份额，份额转让应遵守交易所相关规定及要求，并按规定办理份额变更登记手续。受让方应接受管理人的合规性审查并确保其自身满足本计划的合格投资者条件，首次参与的本计划的，应先与管理人、托管人签订资产管理合同。

本计划转让平台、转让时间、暂停转让的情形及处理方式等事宜以管理人公司网站公告为准。

第二十六条 非交易过户的认定及处理方式

非交易过户是指不采用参与、退出等交易方式，将一定数量的集合计划份额按照一定的规则从某一投资者集合计划账户转移到另一投资者集合计划账户的行为。本集合计划注册登记机构只受理因继承、捐赠、司法执行、以及其他形式财产分割或转移引起的计划份额非交易过户。接受划转的主体必须是依法可以持有本资产管理计划份额的投资人。其中：

“继承”是指资产委托人死亡，其持有的计划份额由其合法的继承人继承；

“捐赠”是指资产委托人将其合法持有的计划份额捐赠给福利性质的基金会或社会团体的情形；

“司法强制执行”是指司法机构依据生效司法文书将资产委托人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。

对于符合条件的非交易过户申请按注册登记机构的有关规定办理和支付费用。

管理人只受理国家有权机关依法要求的集合计划份额冻结与解冻事项。

第二十七条 管理人以自有资金参与资产管理计划的规定

一、管理人及其附属机构有权以自有资金参与本集合计划，与集合计划其他客户份额享有同等权益，承担同等风险；若管理人或管理人的附属机构以其自有资金参与的，则管理人以自有资金参与本集合计划的份额不得超过该计划总份额的 20%，管理人及其附属机构以自有资金参与本集合计划的份额不得超过该计划总份额的 50%；未来监管机构对自有资金参与有新规定的，本计划将按照新规定执行。因集合计划规模变动等客观因素导致前述比例被动超标的，不视为管理人违反此项约定，但在客观条件允许的情况下，管理人及其附属机构应当在超标情况发生后的 15 个交

易日内调整自有资金参与份额，并在调整后 5 个工作日内通过管理人网站公告告知投资者和托管机构，确保符合前述约定。

二、在资产管理计划存续期间，管理人以自有资金参与本计划的，持有期限不得少于 6 个月。参与、退出时，应当提前 5 个工作日通过管理人网站公告告知投资者。

三、为应对集合资产管理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，管理人及其附属机构以自有资金参与及其后续退出集合资产管理计划可不受本条第一点、第二点规定的限制，但应当及时通过管理人网站以公告的形式告知投资者和托管人，并向中国证监会相关派出机构及基金业协会报告。

第二十八条 委托人变更情况

管理人应定期将本计划委托人变更情况报送基金业协会。

第九节 份额持有人大会及日常机构

第二十九条 本计划不设置份额持有人大会机制。

第十节 资产管理计划份额的登记

第三十条 计划份额登记业务

本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，具体内容包括资产委托人账户管理、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资产委托人资料表等。

第三十一条 计划份额登记业务办理机构

本计划份额登记业务由管理人中信期货有限公司办理。

第三十二条 数据备份

全体资产管理计划份额持有人一致同意管理人、注册登记机构或其他份额登记义务人将本计划投资者姓名或名称、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。

第十一节 资产管理计划的投资

第三十三条 资产管理计划财产投资的有关事项

一、投资目标

本计划的投资目标为：在严格控制风险的前提下，实现计划资产的增值。

二、投资范围及比例

本计划投资运作应当符合《运作规定》组合投资的要求，具体投资范围及比例约定如下：

（一）投资范围

1. 本计划投资于：债券（不包括银行间债券）、货币市场基金、债券逆回购、证券公司资产管理计划、基金公司（含基金子公司）特定客户资产管理计划、期货公司资产管理计划、保险公司资产管理计划、在基金业协会登记的私募基金管理人发行并由具有相关资质机构托管的契约式私募证券投资基金、银行理财产品以及中国证监会认可的其他投资品种。

2. 法律法规或中国证监会允许集合计划投资其他品种的，管理人在履行合同变更程序后，可以将其纳入本计划的投资范围。在履行合同变更程序后，可以变更本合同约定的投资范围。

（二）投资比例

本计划作为混合类集合资产管理计划，投资组合比例应符合以下规定：

1. 投资于存款、债券等债权类资产的比例低于资产管理计划总资产 80%；
2. 投资于股票等权益类资产的比例低于资产管理计划总资产 80%；
3. 投资于商品及金融衍生品的持仓合约价值比例低于资产管理计划总资产 80%，或衍生品账户权益不超过资产管理计划总资产的 20%；
4. 本计划的总资产占净资产的比例不超过 200%；
5. 本计划投资于同一资产的资金不得超过本计划资产净值的 25%。管理人管理的全部集合资产管理计划投资于同一资产的资金，不得超过该资产的 25%。银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券等中国证监会认可的投资品种除外。
6. 本计划投资于接受国务院金融监督管理机构监管的机构发行的产品，按市值计算，不得低于本计划资产净值的 80%。

未来监管机构对上述限制有新规定的，本集合计划将按照新规定执行。在履行合同变更程序后，可以变更本合同约定的投资比例。

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非管理人主观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本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，管理人应当及时向中国证监会相关派出机构和基金业协会报告。

四、FOF 产品所投资资产管理产品的选择标准

资产管理产品的管理公司评价包括定量分析和定性分析。定量分析主要包括公司基本实力、投资管理能力、稳定性等。其中，公司基本实力主要考察发行资产管理产品公司的资产管理规模、客户数量、产品数量、产品完善程度等；投资管理能力主要考察旗下资产管理产品业绩和排名情况；稳定性主要考察投资经理稳定性、公司股权、高级管理人员和投资总监的稳定性。上述定量分析结果，加上根据公司调研以及其他形式的沟通得到的公司定性分析，发掘综合实力较强的公司重点跟踪，并剔除综合实力较弱或负面因素较多的公司，规避风险。

所投资资产管理产品的选择标准：资产管理产品评价与筛选由定量与定性研究两个方面构成，以定量筛选剔除不达基本标准的品种；而后以定性研究在符合基本标准的品种中选取可以投资的。公募基金方面，每个季度对全市场公募基金公司和公募基金产品进行定量筛选，主要考察多个维度的风险调整后指标进行综合评价，形成公募基金核心库，对核心库里的重点基金品种进行定性调研形成调研报告后方可投资。其他资产管理产品方面，先从朝阳永续、WIND 等数据库或其它第三方可靠数据源获得不少于 1 年的相关产品净值数据进行定量+定性研究，再发起投资评审会，需投资评审会审核通过方可投资，对于已投资产品将保持比较紧密的跟踪调研。管理人将按照本合同的约定定期披露资产管理计划发生的费用、投资管理人及管理人关联方所设立的资产管理产品的情况。

五、风险收益特征

管理人评定的具体本计划风险等级为 R3-中风险，适合 C5-积极型、C4-相对积极型、C3-平衡型的投资者。

六、业绩比较基准

本计划无业绩比较基准。

七、投资决策依据

1. 《指导意见》、《管理办法》、《运作规定》等有关法律法规以及集合资产管理合同和说明书；依法决策是本集合计划进行投资的前提。

2. 宏观经济发展态势、微观经济运行环境和政策环境；这是本集合计划投资决策的基础。

3. 利率变动和证券市场走势。

4. 基于对资本市场金融产品收益/风险的度量和控制。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。

八、投资决策程序

1. 管理人投资决策程序分为事前、事中和事后。事前投资决策程序主要包括大类资产配置研究、策略研发、策略评审、策略上线等，事中投资决策程序主要包括投资授权、投资指令、交易执行和监控等，事后投资决策程序主要包括投资总结、业绩评估等。

2. 管理人依托内外部研究资源，通过对宏观经济政策研究、行业研究以及数量模型分析等方式，把握宏观经济与市场波动的趋势，研制各类投资策略，经公司策略评审机构审慎评审后进行实盘操作。

3. 管理人建立投资决策授权机制，投资经理在既定的资产配置比例和投资策略安排下，借助管理人内外部研究资源，根据资产管理合同约定的投资范围和集合计划的收益-风险特征，在遵守风控要求的前提下，结合自身对市场的分析判断，在授权范围内进行投资。

4. 有效监控下的决策执行。通过严格的交易制度和实时的前、后台监控功能，保证投资指令在合法、合规的前提下得到高效地执行。

5. 绩效评估与动态调整。管理人风控团队根据本集合计划特征，设计科学合理的风险监控指标体系，定期评估风险，检验既定的投资策略。

九、投资策略

本计划基于宏观情况下的资产配置，在兼顾流动性的条件下，投资于各类资产管理产品及私募证券投资基金，追求绝对收益。通过定期评价各类资产表现，跟踪

子基金策略收益、子基金资产相关性与策略相关性，在遵守监管相关规定与合同约定的前提下，根据市场情况调整资产与策略的配置比例，以期获得较高的收益风险比。

本计划主要采用 FOF 策略。子基金的投资采用多策略组合、多交易品种分散投资；子基金综合考虑管理人的主体资格和单个策略的风险收益特征以及策略和策略之间的相关性特征等。通过精选管理人、分散策略、动态跟踪并及时进行调仓止损，实现投资品种以及策略的多元化，从而有效地分散风险，强化母基金整体收益的安全。

十、投资限制

为维护本计划投资者的合法权益，按照法律法规以及本合同的约定，集合计划投资将遵守下列限制性规定：

1、不得直接投资于股票、期货类等权益类资产；

2、投资于单一资产的比例不得超过计划资产总值的 25%（按市值法计算）。管理人管理的全部集合资产管理计划投资于同一资产的资金，不得超过该资产的 25%。银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券等中国证监会认可的投资品种除外。

3、本计划的总资产占净资产的比例不超过 200%；

4、本计划所投资的资管产品不再投资公募基金以外的其他产品。

5、本计划投资于接受国务院金融监督管理机构监管的机构发行的产品，按市值计算，不得低于本计划资产净值的 80%。

计划存续期间有新的政策法律对上述限制做出不同规定的，上述限制根据规定做相应调整。全体投资者同意并授权管理人可以将集合计划的资产投资于本机构、托管机构及其控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券。管理人应通过公司网站公告告知投资者和托管人，并按相关规定报告或备案。

十一、资产管理计划预警止损机制

本合同各方当事人同意，本计划设置预警线、平仓触发线。

(一) 预警线：本计划份额净值【0.85】元。

在本计划存续期任何一交易日(T 日) 收盘后，若经管理人估算的 T 日计划资产

参考份额净值低于或者触及预警线时，管理人风控人员及时向本计划投资经理提示风险，并于 T+3 日下午开盘时起开始对计划所持有的股票、基金、期货、契约型基金份额等非现金类资产进行平仓或赎回操作，直至计划所持有的现金和货币基金占计划资产净值的比例超过 50%。当计划份额净值恢复到预警线以上后，资产管理计划非现金和货币基金占计划资产净值的比例方可高于 50%。

(二) 平仓触发线：本计划份额净值【0.80】元。

在本计划存续期任何一交易日(T 日)收盘后，若经管理人估算的 T 日计划资产参考份额净值低于或者触及平仓触发线时，应于 T+3 日下午开盘时起有权对本计划持有的非现金类资产进行止损操作，同时对交易所上市的投资品种进行平仓操作，直至计划财产全部变现为止。同时本计划终止进入清算程序。委托人对管理人按照上述约定进行平仓处理的过程及结果予以认可，当管理人根据上述约定进行平仓处理时，若证券价格出现反弹，计划财产将失去弥补亏损的机会，由此可能导致计划财产遭受损失，管理人将不因此承担任何责任。

预警、平仓线由管理人进行监控；托管人负责按本合同约定复核份额净值，配合进行账务处理。

全体委托人知晓并确认：虽然本计划设计有预警平仓机制，但在极端情况下，在止损卖出过程中，由于大量卖出导致市场价格大幅下跌或因证券跌停、停牌等事件导致证券不能及时卖出等因素，计划终止时的计划份额净值仍有可能远低于本资产管理计划的平仓触发线，届时本计划委托财产面临全部或者部分损失的风险。

上述预警线、平仓触发线由管理人负责监督并执行本计划的预警止损机制。

十二、资产管理计划的建仓期

本计划的建仓期自资产管理计划成立之日起不超过 6 个月。建仓期的投资活动，应当符合本合同约定的投向和资产管理计划的风险收益特征。在本计划建仓期，管理人可以以现金管理为目的，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。

建仓期结束后，资产管理计划的投资资产组合应当符合法律、行政法规、中国证监会规定和本合同约定的投向和比例。

十三、资产组合流动性与参与、退出安排

本计划投资的资产组合的流动性应当与本计划的参与、退出安排相匹配。

(一) 本计划主要投资于标准化资产，投资的资产组合的流动性较好；

(二) 管理人应当确保资产管理计划开放退出期内，资产组合中7个工作日可变现资产的价值，不低于本计划资产净值的10%；管理人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本计划资产净值的20%。

第十二节 投资顾问

第三十四条 本计划不聘请投资顾问，无投资顾问相关安排。

第十三节 分级安排

第三十五条 本计划不设分级安排。

第十四节 利益冲突及关联交易

第三十六条 资产管理计划存在的或可能存在利益冲突的情形

本计划存在的或可能存在的利益冲突情形包括但不限于：

一、 管理人或将计划的资产投资于本机构、托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券；

二、 管理人或将计划的资产投资于管理人、管理人关联方所设立的资产管理产品；

三、 管理人及其附属机构有权以自有资金参与本计划；

四、 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均有权参与本计划；

五、 其他可能产生利益冲突的情形。

第三十七条 资产管理计划存在利益冲突的处理方式、披露方式、披露内容以及披露频率

管理人建立健全内部控制和风险合规管理制度，采取有效措施，做好充分的信息隔离和利益冲突管理，遵循投资者利益优先的原则，防范、管控可能的利益冲突。管理人运用资产管理计划财产从事关联交易的，事后及时、全面、客观的向投资者和托管人进行披露；运用资产管理计划财产从事重大关联交易的，事先取得投资者同意，并避免损害投资者利益。具体安排包括：

一、投资者签署本合同即视为其授权管理人可以从事本合同第三十六条第一款情形下的关联交易，管理人将严格遵守法律、行政法规和中国证监会的规定以及本合同的约定，在交易完成后及时书面通知托管人，通过管理人的网站告知投资者，并按相关规定报告或备案。

二、管理人不得将其管理的资产管理计划资产投资于管理人管理的其他资产管理计划，依法设立的基金中基金资产管理计划以及中国证监会另有规定的除外。其他涉及本合同第三十六条第二款利益冲突情形的，管理人将严格遵守法律、行政法规和中国证监会的规定以及本合同的约定，采取有效措施，做好各资产管理产品间充分的信息隔离和利益冲突管理，确保公平交易，并向投资者进行披露。

三、若涉及了本合同第三十六条第三款利益冲突情形的，管理人及其附属机构将确保严格遵守法律、行政法规和中国证监会的规定以及本合同的约定，与集合计划其他客户份额享有同等权益、承担同等风险。

计划存续期间，管理人自有资金参与计划的持有期限不得少于6个月，参与、退出时，提前5个工作日通过管理人网站公告告知投资者和资产托管机构。

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，管理人以自有资金参与及其后续退出本计划可不受前款限制，但将事后及时通过管理人网站公告告知投资者和托管人，并根据相关规定报告。

四、若涉及了本合同第三十六条第四款利益冲突情形的，管理人将严格遵守法律、行政法规和中国证监会的规定以及本合同的约定，该部分投资者与本计划其他客户份额享有同等权益、承担同等风险。管理人将及时通过管理人网站公告向投资者进行披露，并对该资产管理计划账户进行监控，以及根据相关规定及时进行报告。

五、若管理人涉及了其他利益冲突情形的，管理人将严格遵守法律、行政法规和中国证监会的规定以及本合同的约定，及时履行相应的信息披露义务。

第十五节 投资经理的指定与变更

第三十八条 资产管理计划的投资经理

一、本合同全体当事人一致同意，本计划投资经理由管理人负责指定。

二、 管理人指定本计划投资经理为徐卓，详细情况如下：

徐卓，CFA，上海交通大学安泰经济与管理学院 MBA，现任中信期货资产管理中心投资经理。具有丰富 A 股策略研究经验，熟悉大类资产配置，负责 FOF 组合投资管理及基金管理人的尽职调查。专职于中信期货有限公司，除在中信期货有限公司任职之外，不存在其他兼职情形。

本计划投资经理已经取得基金从业资格，最近三年未被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚。

第三十九条 投资经理变更的条件和程序

一、 **投资经理变更的条件，包括但不限于如下情形：**

- (一) 投资经理离职；
- (二) 管理人决定变更；
- (三) 法律法规规定的其他情形。

二、 **投资经理变更的程序**

投资经理的变更由管理人确定，通过管理人网站公告并做好相关安排，无需另行征询委托人的意见。

资产委托人同意：管理人通过公司网站公告即视为履行了告知义务。

第十六节 资产管理计划的财产

第四十条 资产管理计划财产

一、 **资产管理计划财产的保管与处分**

(一) 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。

(二) 资产管理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、托管人不得将资产管理计划财产归入其固有财产。

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

(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，其债权人不得对资产管理计划财产行使请求冻结、扣押和其他权利。管理人、托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，资产管理计划财产不属于其清算财产。

(五) 资产管理计划财产产生的债权不得与不属于资产管理计划财产本身的债务相互抵销。非因资产管理计划财产本身承担的债务，管理人、托管人不得主张其债权人对资产管理计划财产强制执行。上述债权人对资产管理计划财产主张权利时，管理人、托管人应明确告知资产管理计划财产的独立性，采取合理措施并及时通知投资者。

(六) 托管人应安全、完整地保管资产管理计划财产，不得违反法律法规及合同的规定擅自运用、处分、分配资产管理计划财产。

二、资产管理计划财产相关账户的开立和管理

(一) 资产管理计划托管账户的开立和管理

管理人、托管人为本资产管理计划单独开立托管资金账户。托管资金账户的名称应当包含本资产管理计划名称，具体名称以实际开立为准。账户预留印鉴为管理人公章 1 枚，管理人法定代表人名章 1 枚，以及托管人账户专用章 2 枚。公章及法定代表人名章由管理人自行保管，账户专用章由托管人自行保管。本资产管理计划的一切货币收支活动，包括但不限于投资、支付赎回金额、支付计划收益、收取认购/申购款，均需通过该托管资金账户进行。资产管理计划托管账户的开立和管理应符合相关法律法规的有关规定。

托管人按照规定开立委托财产的托管账户等投资所需账户，管理人应给予必要的配合。

资产管理计划托管账户的开立和使用，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假借本资产管理计划的名义开立任何其他银行存款账户；亦不得使用资产管理计划的任何账户进行本资产管理计划业务以外的活动。

(二) 资产管理计划普通证券账户的开立和管理

根据管理人的申请，管理人、托管人按照规定开立计划财产证券账户。管理人、托管人应当在开户过程中相互配合，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。

资产管理计划证券账户的开立和使用，仅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或转让资产管理计划证券账户，亦不得使用资产管理计划证券账户进行本资产管理计划业务以外的活动

资产管理计划证券账户卡的保管由资产托管人负责。账户资产的管理和运作由资产管理人负责。

（三）专用资金账户（专用资金台账账户）

专用资金账户是以资产管理计划名义在管理人选择的证券公司的下属营业机构开立，并与托管资金账户建立第三方存管关系的账户。管理人应与托管资金账户开户机构签署《客户交易结算资金银行存管协议书》。专用资金账户开立后，管理人将专用资金账户的开户资料（复印件）加盖业务专用章后交托管人留存。

在本合同有效期内，未经托管人同意，管理人不得注销该专用资金账户，也不得自行通过“第三方存管”平台从专用资金账户向银行结算账户（即托管资金账户）划款。

（四）开放式证券投资基金账户的开立和管理

1. 管理人负责为本计划开立所需的基金账户。
2. 管理人在开立计划账户时应将托管资金账户作为赎回款、分红款指定收款账户。
3. 管理人需及时将计划账户的开户资料（复印件）加盖经授权的管理人业务专用章后交付托管人。
4. 在托管人收到开户资料前，管理人不得利用该账户进行投资活动。
5. 托管人有权随时向基金注册登记人查询该账户资料。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托管人。

（五）通过代销方式投资开放式基金或私募资产管理产品的账户开立

管理人通过销售机构投资于开放式证券投资基金、私募资产管理产品、私募投资基金【在合同约定的投资范围内根据具体情况约定】。管理人应确保其选择的销售机构已在中国证监会注册取得基金销售业务资格并已成为中国证券投资基金业协会会员，符合开展前述各类产品销售业务的各项资质和要求。投资前管理人应负责在销售机构为本委托财产开立所需的基金账户，并将托管专户作为赎回款、分红款指定收款账户。管理人需及时将基金账户的开户资料（复印件）加盖经授权的管理人

业务专用章后交付托管人。在托管人收到开户资料前，管理人不得利用该账户进行投资活动。托管人有权随时向销售机构或基金注册登记人查询该账户资料。管理人应于每季度结束后十个工作日内将对账单发送给托管人

管理人指定、新增或变更销售机构，应另行书面按以下格式向托管人通知销售机构名称及银行监管账户，并加盖管理人预留印鉴。

销售机构名称：

销售机构银行监管账户如下：

开户行：

开户名：

账户号：

届时托管人将根据管理人的指令向销售机构的银行监管账户划付认购/申购款项。

（六）银行间债券市场的相关账户的开立和管理

管理人负责以本资产管理计划的名义申请并取得全国银行间同业拆借市场的交易资格，并代表本计划进行交易；托管人负责以计划资产的名义在中央国债登记结算有限责任公司和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。管理人、托管人应互相配合并提供相关资料。

（七）其他账户的开立和管理

本计划根据法律法规规定和本合同约定开展其他投资品种的投资业务时，如果涉及相关账户的开设和使用，由管理人或托管人根据有关法律法规的规定和本合同的约定进行开立，管理人与托管人应当互相给予必要的配合，该等账户按有关规则使用并管理。法律法规等有关规定对该等相关账户的开立和管理另有规定的，从其规定办理。

（八）管理人和托管人对集合计划资产独立核算、分账管理，保证集合计划资产与其自有资产、集合计划资产与其他客户资产、不同集合计划的资产相互独立。

三、与资产管理计划财产有关的重大合同的保管

（一）与资产管理计划财产有关的重大合同的签署，由资产管理人负责。由资产管理人代表资产管理计划签署的与资产管理计划有关的重大合同的原件由资产管理

人保管。如该合同需要加盖资产托管人印章，则资产托管人有权保留一份合同原件。重大合同包括资产管理计划合同、证券经纪服务协议、期货交易结算服务协议、资产管理计划行政服务外包协议（如有）等双方一致确认属于重大合同的法律文本。

（二）重大合同的保管期限为本合同终止之日起 20 年，法律法规另有规定的，从其规定。

（三）与资产管理计划资产有关的重大合同，根据需要由资产托管人以资产管理计划的名义签署的，由资产管理人以传真或其他方式下达签署指令（含有效授权内容），合同原件由资产托管人保管，但资产托管人应将该合同原件的复印件盖章（骑缝章）后，交资产管理人一份。如该合同需要加盖资产管理人公章，则资产管理人至少应保留一份合同原件。

第十七节 投资指令的发送、确认和执行

第四十一条 指令的发送、确认和执行

一、 交易清算授权

若采用传真或邮件方式发送指令，管理人应事先向托管人提供书面通知（以下简称“授权文件”，具体见附件三《授权文件》），指定有权向托管人发送指令的被授权人员，包括被授权人的名单、权限、电话、传真、预留印鉴和签字或签章样本，并注明相应的交易权限及有效时限，规定管理人向托管人发送指令时托管人确认有权发送人员身份的方法。授权通知应加盖管理人公章并由管理人法定代表人或其授权代理人签署。

若采用电子指令方式，资产管理人应事先书面向资产托管人提供指令启用函。指令启用函内容包括管理人采取电子指令的业务类型、发送和接收传真指令的号码、指令确认的指定电话号码等。

电子指令方式是指管理人通过托管人网上托管银行系统录入或电子直连对接方式等方式，向托管人发送电子划款指令或投资指令。

网上托管银行是指托管人基于 Internet 网络，向管理人提供的客户服务软件，实现管理人与托管人之间指令处理、数据传输、业务查询、资料传递和信息服务等直通式处理。

管理人和托管人另行签订《兴业银行电子直联补充协议》（以实际签约名称为准）。

管理人通过托管人网上托管银行系统或电子直连对接向托管人发送电子指令的同时，通过已预留的传真号码或指定邮箱方式向托管人提供与电子指令相关的合同、交易凭证或其他证明材料，管理人对该等资料真实性、有效性、完整性及合法合规性负责。

对于通过管理人预留传真号码发出的指令，管理人不得否认其效力。变更或新增接收电子指令的号码，管理人应事先向托管人更新上述书面授权文件。

为履行本合同相关规定，管理人、托管人应当指定业务联系人专项对接，并预留印鉴，业务联系人信息及印鉴样本详见附件六。预留印鉴对应印章由各方各自保管和使用。业务联系人及预留印鉴变更的，管理人、托管人应当提前书面通知对方。

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必要操作人员以外的任何人泄露，法律法规规定或有权机关要求的除外。

二、 指令的内容

指令是管理人在运用计划资产时，向托管人发出的资金划拨及其他款项支付的指令。管理人发送给托管人的划款指令应写明以下要素：账户信息、资金用途及情况说明、支付时间、金额等，若采用传真或邮件方式发送指令，需加盖预留印鉴并由被授权人签字或加盖名章。

三、 指令的发送、确认及执行时间与程序

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依照授权通知的授权以电子邮件、邮件或传真等其他资产托管人和资产管理人认可的方式向托管人发送相关指令。管理人有义务在发送指令后与托管人以电话方式进行确认，如有变更需提前通知托管人。托管人依照“授权通知”规定的方法确认指令有效后，方可执行指令。

对于通过网上托管银行方式发送的电子指令或被授权人在其授权范围内发出的指令，管理人不得否认其效力。管理人应按照有关法律法规和本合同的规定，在其合法的经营权限和交易权限内发送划款指令，被授权人应按照其授权权限发送划款指令。管理人在发送指令时，应为托管人留出执行指令所必需的时间。原则上，管理人应提前两个小时向资产托管人发送划款指令，对于需要当日到账的资金划转，管理人应于划款当日15:00前向托管人发送资金支付指令。如有特殊情况，双方应协商解决。对于资产管理人于15:00以后发送至资产托管人的指令，资产托管人应尽力

配合出款，如出款不成功，则顺延至下一工作日资产管理人重新出具划款指令并审核无误后出款。

资产托管人收到资产管理人发送的指令后，根据资产管理合同等产品文件的规定对指令进行审查，验证指令的要素是否齐全以及是否符合合同约定的投资监督等相关条款，传真指令/指令扫描件还应审核印鉴和签章是否和预留印鉴和签章样本形式相符（印鉴、签章和划款指令授权通知书中的预留印鉴不存在重大差异即视为审核无误，管理人应避免传真或扫描引起的印章、签字等变形、扭曲），划款金额与相关划款证明文件所记载的划款金额是否一致，以及合同约定的其他事项。复核无误后应在规定期限内执行，不得延误。若存在要素不符或者其他异议，托管人应当拒绝执行，并立即通知管理人进行核查。

托管人有权要求管理人提供相关交易凭证、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。托管人待收齐相关资料并判断指令有效后重新开始执行指令。管理人应在合理时间内补充相关资料，并给托管人预留必要的执行时间，对因此造成的延误管理人承担相关责任。管理人应保证上述文件资料合法、真实、完整和有效。

管理人向托管人下达指令时，应确保资产管理计划财产专用银行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，托管人可不予执行，并立即通知管理人，管理人承担因不执行该指令的相关责任。

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法律法规或者本合同约定的，有权要求其改正；未能改正的，有权拒绝执行，并应及时以录音电话或书面形式通知管理人纠正。对管理人更正并重新发送后的指令经托管人核对确认后方能执行。

五、管理人发送错误指令的情形和处理程序

（一）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，指令不能辨识或要素不全导致无法执行等情形。

（二）当托管人认为所接受指令为错误指令时，应及时与管理人进行电话确认，暂停指令的执行并要求管理人重新发送指令。

六、更换投资指令被授权人的程序

管理人撤换被授权人员或改变被授权人员的权限，必须提前至少一个交易日，使用传真方式或其他管理人和托管人认可的方式向托管人发出加盖管理人公司公章

的书面变更通知，同时电话通知托管人。被授权人变更通知，经管理人与托管人以电话方式或其他管理人和托管人认可的方式确认后，于授权通知载明的生效时间生效，同时原授权通知失效。若载明的生效时间早于管理人与托管人确认的时间，则以确认的时间为准。管理人在此后三个工作日内将被授权人变更通知的正本送交托管人。变更通知书书面正本内容与托管人收到的传真/扫描件不一致的，以托管人收到的传真/扫描件为准。

托管人更换接收管理人指令的人员，应提前通知管理人。

七、 投资指令的保管

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

管理人、托管人按规定完整保存集合计划业务活动的投资指令凭证、交易记录等，保存期限为20年以上。

八、 其他相关责任

对管理人在没有充足资金的情况下向托管人发出的指令致使资金未能及时清算所造成的损失由管理人承担。因管理人原因造成的传输不及时、未能留出足够执行时间、未能及时与托管人进行指令确认致使资金未能及时清算或交易失败所造成的损失由管理人承担。托管人正确执行管理人符合本合同规定、合法合规的投资指令，资产管理计划财产发生损失的，发生的损失由资产管理计划财产承担。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资产管理计划财产受损的，托管人应承担相应的责任。

如果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或签章样本等非托管人原因造成的情形，给资产管理计划财产或任何第三人带来损失的，由管理人或其他过错方承担相关责任。

第十八节 越权交易处理

第四十二条 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或本合同约定的投资范围和投资比例限制而进行的投资交易行为。

第四十三条 越权交易的处理程序

托管人发现资产管理人的投资或清算指令违反法律法规或者本合同约定的，应当拒绝执行，立即通知管理人并按相关规定报告。

托管人发现管理人作出的依据交易程序已经生效的投资指令违反法律法规，或者违反本合同约定的，应当立即通知管理人并有权按相关规定报告。托管人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纠正的，托管人应按相关规定报告。

第四十四条 托管人对管理人投资运作的监督

托管人按照法律法规以及本合同的约定，对管理人的投资运作行为进行监督，并按照前款约定履行相应的越权交易的处理程序。托管人对管理人的投资监督和检查自本集合资产管理计划成立之日起开始。

一、资产托管人对投资范围进行如下监督：

本计划投资于：债券（不包括银行间债券）、货币市场基金、债券逆回购、证券公司资产管理计划、基金公司（含基金子公司）特定客户资产管理计划、期货公司资产管理计划、保险公司资产管理计划、在基金业协会登记的私募基金管理人发行并由具有相关资质机构托管的契约式私募投资基金、银行理财产品以及中国证监会认可的其他投资品种。

二、资产托管人对投资比例进行如下监督：

1. 投资于存款、债券等债权类资产的比例低于资产管理计划总资产80%；
2. 投资于股票等权益类资产的比例低于资产管理计划总资产80%；
3. 本计划的总资产占净资产的比例不超过200%；
4. 本集合计划投资于同一资产的资金不得超过本集合计划资产净值的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。

三、资产托管人对投资限制进行如下监督：

1. 不得直接投资于股票、期货类等权益类资产；
2. 资产管理计划总资产占净资产的比例不得超过200%；
3. 本计划投资于同一资产的资金，按市值计算，不超过本计划资产净值的25%；
4. 本计划投资于接受国务院金融监督管理机构监管的机构发行的产品，按市值

计算，不得低于本计划资产净值的80%。

5. 法律法规、集合计划资产管理合同以及中国证监会规定的其他限制。

四、根据交易规则，资产托管人若只能事后发现资产管理人投资行为违反法律法规或本合同约定的，资产托管人在及时向管理人发送风险提示函后，即视为履行了对资产管理人的投资监督职责。

第十九节 交易及清算交收安排

一、选择证券、期货经纪机构的程序

计划份额持有人授权管理人、托管人与证券公司签订《资产管理合同之操作协议》（具体以实际签约名称为准），委托证券公司下属营业部作为经纪服务商为本计划项下的证券资产及资金提供证券经纪服务。本计划财产投资于证券发生的所有场内交易的清算交割由经纪服务商负责根据相关登记结算公司的结算规则办理。管理人应在证券经纪服务协议或其他协议中约定由选定的证券经纪服务商承担资金安全保管责任。

二、投资证券后的清算交收安排

（一）场内外证券资金结算处理程序

1. 场内证券资金结算

管理人向托管人发送银证转账指令，划拨场内投资资金。本着安全保管本计划财产的原则，在不影响本计划投资管理且和管理人协商一致的前提下，托管人可根据管理人的指令定期或不定期将证券资金账户余额划入托管资金账户。

本计划的银行管理账户与证券资金账户通过“第三方存管”平台同步，经纪服务商日终清算完成后将交易所格式数据以约定方式发送给管理人、托管人。管理人、托管人根据T日交易数据各自进行清算并与经纪服务商T+1日提供的证券资金账户对账单进行核对。

本计划场内证券投资的具体操作按照管理人、托管人及证券经纪机构签署的《资产管理合同之操作协议》（以实际名称为准）的约定执行。

2. 场外证券资金结算

管理人负责场外交易的实施，托管人负责根据管理人划款指令以及相关交易附件进行指令审核并完成场外交易资金的划付。

三、开放式基金投资的清算交收安排

(一) 开放式基金申购(认购)相应的资金划拨由托管人依据管理人的划款指令逐笔划付。管理人申购(认购)开放式基金时,应将划款指令连同基金申购(认购)申请单一并通过邮件发送至托管人。托管人审核无误后,应及时将划款指令交付执行。管理人应实时调整当日可用资金余额。管理人在收到基金申购(认购)确认回单后,应立即发送邮件至托管人。

(二) 管理人赎回开放式基金时,应在向基金管理公司或代销机构发出基金赎回申请书的同时将赎回申请书发邮件至托管人;管理人在收到赎回确认回单后,应及时发邮件至托管人。

(三) 为确保本计划财产会计核算及估值的及时处理,管理人应于开放式基金交易(包括认购、申购、赎回、基金转换、红利再投资、现金分红等)的确认日及时获取确认单等单据,要求并督促基金管理公司于当日邮件发送给管理人,管理人收到后应立即发邮件至托管人。

四、投资银行存款的特别约定

(一) 本计划投资银行存款前,应与存款银行签署投资银行定期存款协议。

(二) 本计划投资银行存款,必须采用管理人和托管人认可的方式办理。

(三) 管理人投资银行存款或办理存款支取时,应提前书面通知托管人,以便托管人有足够的时间履行相应的业务操作程序。

五、其他场外交易资金结算

(一) 管理人负责场外交易的实施,托管人负责根据管理人划款指令和相关投资文件进行场外交易资金的划付。管理人应将划款指令连同相关交易文件一并发邮件至托管人,托管人根据本合同第十七部分约定审核后及时执行划款指令。

(二) 托管人负责审核交易文件和划款指令要素的表面一致性,相关交易文件中约定的其他转让或划款条件由管理人负责审核。管理人同时应以书面形式通知托管人相关收款账户名、账号、交易费率等。投资或收益分配资金必须回流到本计划托管资金账户内,不得划入其他账户。

六、资金、证券账目及交易记录的核对

管理人和托管人应定期对账。

对计划财产的资金账目,以管理人与托管人约定方式核对,确保相关各方账账

相符。

对计划财产的证券账目，由相关各方根据外部第三方对账数据定期进行对账。

对计划财产的交易记录，管理人与托管人核对估值结果之前，应保证所有实际交易记录与会计账簿上的交易记录完全一致，如果实际交易记录与会计账簿记录不一致，造成会计核算不完整或不真实，由此导致的损失由管理人承担。

为确保本计划托管账户资金安全，管理人、托管人应至少每季度一次就托管账户余额进行账务核对，托管人通过托管网银的“托管账户银企对账”模块按月向管理人提供本计划托管账户余额对账服务。管理人应在每季度初15天内就上个季度托管账户余额进行对账反馈。管理人逾期未反馈的，托管人视同管理人默认账务核对无误，其后果由管理人自行承担。管理人应做好托管网银系统用户密码安全管理工作。对于管理人原因导致对账用户被非法使用、密码保管不当被泄露等情况造成的损失由管理人自行承担。管理人应对账务核对结果的真实性、准确性负责。账务核对不符的，管理人可向托管人查询。

第二十章 资产管理计划财产的估值和会计核算

第四十五条 资产管理计划的估值

一、估值目的

客观、准确地反映资产管理计划财产的价值，并为计划份额的参与和退出等提供计价依据。

二、估值时间

本计划的估值日为每个交易日。

三、估值程序

资产管理人与资产托管人在每个交易日后的第二个工作日对本交易日的资产管理计划财产进行估值。

估值核对日包括每周最后一个交易日、每月最后一个交易日、开放日、收益分配日、终止日以及其他资产管理人和资产托管人认为需要核对净值的日期。资产管理人和资产托管人对估值核对日的净值进行核对确认。资产管理人将估值核对日计划财产净值以电子邮件或其他资产管理人和资产托管人认可的方式发送给托管人。资产托管人复核后，将复核结果反馈给资产管理人。月末、季末、年中和年末估值复核与本集合计划会计账目的核对同时进行。

计划份额净值的计算精确到 0.0001 元，小数点后第五位四舍五入，相关法律法规另有规定的，从其规定。

四、资产管理计划份额净值的确认

用于向委托人报告的计划份额净值由管理人负责计算，托管人进行复核。如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照管理人对计划资产净值的计算结果为准。

五、估值方法

1. 证券交易所上市的有价证券的估值

(1) 交易所上市的有价证券（包括股票、权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

(2) 交易所上市实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

(3) 交易所上市未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

(4) 交易所上市不活跃市场的有价证券及交易所上市的资产支持证券，选取中央国债登记结算有限责任公司提供的第三方估值净价进行估值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

2. 处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

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

(2) 首次公开发行未上市的股票、债券和权证，采用估值技术确定公允价值，

在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值；

(3) 有明确锁定期或在发行时有明确限售期的股票（不包括全国中小企业股份转让系统的股票），包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、首次公开发行网下配售有限限售期的股票、大宗交易买入有限限售期的股票，按监管机构或行业协会的有关规定确定公允价值。对于基金业协会规定的流通受限股票估值取值中的“流通受限股票的流动性折扣”，当估值日【第三方估值机构】未提供该流动性折扣时，则优先采用距估值日最近交易日【第三方估值机构】提供的流动性折扣进行估值处理。若【第三方估值机构】从未提供该流通受限股票的流动性折扣，则按估值日该流通受限股票在证券交易所上市交易的同一股票的市价（收盘价）估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值。

3. 全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，选取中央国债登记结算有限责任公司提供的第三方估值净价进行估值。在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值，在持有期内逐日计提应收利息。

4. 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。

5. 银行账户存款和证券资金账户内资金按商定利率在实际持有期间内逐日计提利息，在利息到账日以实收利息入账。

6. 公募证券投资基金估值方法

(1) 上市流通的证券投资基金按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值；

(2) 未上市流通的其他开放式证券投资基金按估值日基金管理公司公布的基金份额净值估值，估值日前一交易日基金份额净值无公布的，按最近交易日公布的基金份额净值估值；

(3) 货币基金以成本列示，按估值日基金管理公司公布的万份收益计提收益。

7. 商业银行理财产品的估值办法：资产管理计划持有的非净值型商业银行理财计划以本金列示，按协定收益逐日确认利息收入。资产管理计划持有的净值型商业银行理财计划按银行最近公布的理财产品份额净值估值。

8. 债券逆回购等固定收益工具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。

9. 对于基金管理公司及其子公司的特定资产管理计划、证券公司集合资产管理

计划、保险资产管理计划、期货资产管理计划、信托计划、私募证券投资基金，估值方式具体如下：

(1)如管理人在标的产品权益确认日当天提供收到了标的产品权益确认原始凭证的，则托管人在标的产品权益确认日当天以权益确认原始凭证为依据入账；如管理人无法在权益确认日当天提供收到标的产品的权益确认原始凭证的，则托管人在管理人提供收到标的产品权益确认原始凭证的提供日当天进行入账，且不对历史账务进行追溯调整；

(2)按份额净值计价的投资标的，按照投资标的的管理人、管理人委托的基金服务机构或托管人提供的最新份额净值估值，未提供最新份额净值的，以最近一次得到的标的产品份额净值进行估值；

(3)如标的产品披露虚拟份额净值的（即份额净值扣除预估业绩报酬后得到的份额净值），为了估值的公允性，管理人须选择使用标的产品的虚拟份额净值对本基金进行估值。采用虚拟份额净值对本基金进行估值的，管理人须按标的产品份额净值的披露频率，向托管人及行政服务机构提供标的产品的最新虚拟份额净值。若无法在当天提供虚拟份额净值的，则在收到虚拟份额净值日当天进行入账，且不对历史账务进行追溯调整。不能提供虚拟份额净值的，则以份额净值进行估值。(4)按面值及每万份收益计价的投资标的，以成本列示，按投资标的的管理人、管理人委托的基金服务机构或托管人每日公布的最新每万份收益计提收益。

(5)如不属于上述情况的，则管理人应向托管人提供标的产品的估值方法和估值数据，并确保提供数据的真实、完整和有效，托管人按管理人提供的数据进行估值。

(6)托管人需提供固定的净值接收邮箱接收份额净值或者虚拟净值，估值时按照管理人或第三方提供的估值数据，数据提供方应对数据的真实性、完整性和准确性负责。

10. 估值技术是指管理人和托管人协商一致的，被市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的确定公允价值的方法。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。

如有新增事项或变更事项，按国家有关最新规定估值。管理人应于新规定实施后及时在管理人网站向投资者公告。

六、估值对象

资产管理计划所拥有的股票、债券、期货合约、证券投资基金、银行存款本息、其他投资等各类资产及负债。

七、估值错误的处理

如资产管理人或资产托管人发现计划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资产委托人利益时，应立即通知对方，共同查明原因，协商解决。

当计划资产估值错误偏差达到当日计划财产净值的 0.25%时，资产管理人和资产托管人应该立即更正并在定期报告中报告资产委托人。资产管理人计算的计划财产净值已由资产托管人复核确认，但因资产估值错误给资产委托人造成损失的，由资产管理人与资产托管人各自承担相应的责任。

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，进而导致本计划财产净值计算错误造成资产委托人的损失，以及由此造成以后交易日计划财产净值计算顺延错误而引起的资产委托人的损失，由提供错误信息的当事人一方负责赔偿。

由于第三方（包括但不限于证券交易所、期货交易所、中国证券登记结算公司、中国期货市场监控中心、投资标的的管理人、管理人委托的基金服务机构或托管人等）发送或提供的数据错误给委托资产造成的损失，管理人、托管人予以免责。

管理人和托管人对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，为避免不能按时公布计划净值的情形，以管理人的计算结果对外公布；因集合计划估值错误给投资者和集合计划财产造成的损失，由管理人和托管人根据过错情况承担赔偿责任，管理人和托管人没有过错的不负赔偿责任。

法律法规或者监管部门另有规定的，从其规定。如果行业有通行做法，双方当事人应本着平等和保护集合计划持有人利益的原则进行协商确定处理原则。

八、估值调整的情形与处理

如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，管理人可根据具体情况与资产托管人商定后，按最能反映公允价值的价格进行估值调整。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，按国家最新规定调整估值。

九、暂停估值的情形

1. 计划投资所涉及的证券交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；
2. 因不可抗力或其他情形致使资产管理人、资产托管人无法准确评估资产管理计划财产价值时；
3. 法律法规及中国证监会规定的其他情形。

出现以上情形，可以暂停估值，但估值条件恢复时，管理人、托管人应按规定完成估值工作。

十、特殊情况的处理

管理人、托管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份额净值错误处理。

由于不可抗力原因，或由于证券交易所及登记结算公司、期货交易所发送的数据错误，或国家会计政策变更、市场规则变更等，资产管理人和资产托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误或虽发现错误但因前述原因无法更正的，由此造成的计划资产估值错误，资产管理人和资产托管人免除赔偿责任。但资产管理人和资产托管人应当积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。

第四十六条 资产管理计划的会计政策

资产管理计划的会计政策按照本合同约定执行：

- 一、资产管理人为本计划的主要会计责任方。
- 二、本计划的会计年度为公历年度的1月1日至12月31日。
- 三、计划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会计制度。
- 五、本计划单独建账、独立核算。
- 六、资产管理人及资产托管人各自保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照本合同约定编制会计报表。
- 七、资产托管人定期与资产管理人就资产管理计划的会计核算、报表编制等进行核对并以书面方式确认。

第二十一节 资产管理计划的费用与税收

第四十七条 资产管理计划的费用

一、资产管理计划承担的费用种类

本合同各方当事人知悉并确认，以下费用由资产管理计划财产承担：

- (一) 管理人的管理费；
- (二) 托管人的托管费；
- (三) 管理人的业绩报酬；
- (四) 资产管理计划财产开立账户需要支付的费用；
- (五) 银行账户的资金结算汇划费、账户维护费；
- (六) 资产管理计划在发生投资交易时按规定比例支付的经手费、证管费、过户费、印花税、佣金等，直接计入当期费用；
- (七) 份额登记机构等资产管理计划的行政服务机构的服务费（如有）；
- (八) 资产管理计划成立以后与计划资产运作相关的会计师费、律师费等中介服务费用，资产管理计划合同生效后与之相关的信息披露费用；
- (九) 与资产管理计划运作直接相关应税项目或应税行为产生的增值税及附加税费；
- (十) 按照法律法规规定及本合同约定的应当由资产管理计划承担的其他费用。

二、费用计提标准、计提方式、支付方式及费率调整

(一) 管理人的管理费

管理费按前一日计划资产净值的【1.0】%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 【1.0】\% \div 365$$

H 为每日应计提的管理费

E 为前一日的资产管理计划资产净值（成立当日以初始委托计划份额总数计提）。

本计划的管理费每日计提，逐日累计至每季度季末最后一个自然日，按季支付，由管理人与托管人双方核对无误后，管理人有权于次季度后的 15 个工作日之内向托管

人发送管理费划款指令，托管人收到划款指令后从资产管理计划财产中将应付未付的管理费一次性支付给管理人。

管理人管理费收入账户信息如下：

账户名称：中信期货有限公司

开户银行：交通银行深圳红荔支行

银行账号：443066041018010049787

（二） 托管人的托管费

托管费按前一日计划资产净值的【0.05】%年费率计提，计算方法如下：

$$H2 = E2 \times 【0.05】\% \div 365$$

H2 为每日应计提的托管费

E2 为前一日的资产管理计划资产净值（成立当日以初始委托计划份额总数计提）。本计划的托管费每日计提，逐日累计至每季度季末最后一个自然日，按季支付，由资产管理人与资产托管人双方核对无误后，管理人有权于次季度后的 15 个工作日内向资产托管人发送托管费划款指令，资产托管人收到划款指令后从资产管理计划财产中将应付未付的托管费一次性支付给资产托管人。

托管人托管费收入账户信息如下：

户名：其他资产托管业务收入

账号：129900191679000125

开户行：兴业银行厦门分行

（三） 管理人业绩报酬

本计划于资产委托人退出时、分红时、计划终止清算时采用单人单笔高水位净值法计提业绩报酬。

于退出时计提业绩报酬，退出确认日为计提日，退出日为基准日，业绩报酬从投资者的退出资金中扣除。

于分红时计提业绩报酬，分红登记日为计提日，登记日前两个工作日为基准日，业绩报酬从投资者的可分红资金中扣除且不超过可分红资金。

于终止清算时计提业绩报酬，业绩报酬从投资者的清算资金中扣除。

资产管理人将根据投资者每笔投资的年化收益率，对年化收益率超过 7% 以上部分按 10% 比例收取业绩报酬。

计算公式如下：

$$R_{i,j} = \frac{NAV_{i,j}^k - NAV_{i,j}^h}{NAV_{i,j}^i} \times 365 \div T$$

| 年化收益率 | 计提公式 |
|--------------------|--|
| $R_{i,j} < 7\%$ | $E=0$ |
| $R_{i,j} \geq 7\%$ | $E = \sum_{i=1}^n \sum_{j=1}^m [S_{i,j} \times NAV_{i,j}^i \times (R_{i,j} - 7\%) \times 10\% \times T + 365]$ |

其中， $R_{i,j}$ 为第 i 个投资者持有的第 j 笔份额的年化收益率；

$NAV_{i,j}^k$ 为本次业绩报酬计提基准日第 i 个投资者持有的第 j 笔份额的份额累计净值；

$NAV_{i,j}^h$ 为前一次业绩报酬计提基准日第 i 个投资者持有的第 j 笔份额的份额累计净值（首次计提时，则为初始面值或参与时份额累计净值）；

$NAV_{i,j}^i$ 为前一次业绩报酬计提基准日第 i 个投资者持有的第 j 笔份额的份额净值（首次计提时，则为初始面值或参与时份额净值）；

T 为前一次业绩报酬计提日（含）到本次业绩报酬计提日（不含）的天数；

E 为此次应计提的业绩报酬；

$S_{i,j}$ 为此次业绩报酬计提时第 i 个投资者持有的第 j 笔计划份额；

n 为此次业绩报酬计提时涉及的投资者数量；

m 为此次业绩报酬计提时涉及的每个投资者涉及的持有份额笔数。

本计划成立后，资产管理人业绩报酬于计提日计提，因涉及注册登记数据，业绩报酬的计算和复核由资产管理人负责计算，相关责任由管理人承担，托管人根据管理人的划款指令进行划款。由资产管理人于计提日后 15 个工作日内向资产托管人发送资产管理人业绩报酬划付指令，资产托管人根据管理人指令从计划财产中支付给资产管理人。若遇不可抗力或委托财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。

管理人业绩报酬收取账户与管理费收款账户相同。

（四）本条第一款第 4-10 项规定的费用根据法律法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入或摊入资产管理计划当期费用，由托管人从本集合计划财产中支

付。

本合同各方当事人一致同意，如交易所或第三方金融机构调整相关费率的，则管理人根据有关法律法规及相应协议的要求，于费用发生时，直接在资产管理计划财产中列支。

(五) 费用调整

1. 管理人有权根据市场情况调低管理费率和支付频率，并在管理人网站公告。管理人须提前将相关情况书面告知托管人。

2. 经托管人同意，管理人有权根据市场情况调低托管费率和支付频率，并在管理人网站公告。

3. 除前款规定外，管理人和托管人与资产管理计划委托人协商一致，可根据市场发展情况调整管理费率和托管费率，并修改本合同。

第四十八条 以下事项不得列入资产管理计划业务费用的项目

一、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。

二、管理人和托管人处理与计划运作无关事项或不合理事项所发生的费用等。

三、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。

四、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入计划费用的项目。

第四十九条 资产管理业务的税收

本计划运作过程中涉及的各纳税主体，依照国家法律法规的规定履行纳税义务。各方一致同意，根据国家法律法规、部门规章和其他规范性文件，如果本集合计划的运营过程中产生增值税等应税行为，需要缴纳增值税等税费的，管理人有权从集合计划资产中提取与应承担税费等额的费用。具体提取时间及提取金额参考相关税费征缴情况由管理人确定，由托管人根据管理人划款指令从集合计划资产中支付给管理人。

第二十二节 资产管理计划的收益分配

第五十条 本计划收益分配政策依据现行法律法规以及本合同约定执行。

一、可供分配收益的构成

本计划可供分配收益包括：计划投资所得红利、股息、债券利息、证券投资收益、证券持有期间的公允价值变动、银行存款利息以及其他收入等。因运用计划财产带来的成本或费用的节约计入收益。

二、收益分配原则

本合同各方当事人一致同意，本计划收益分配遵循以下原则：

(一) 每份计划份额享有同等分配权（因管理人业绩报酬的存在，每份额计划实际得到的分红金额可能有所不同）；

(二) 基本分红条件为：计划收益分配基准日的计划份额净值减去计划份额收益分配的金额后不能低于 1.00 元/份，但资产管理计划终止日进行分配的除外；

(三) 在满足基本分红条件前提下，本计划每年收益分配次数最多为 2 次，两次收益分配的间隔时间不得低于 6 个月，若资产管理计划成立不满 3 个月可不进行收益分配。

(四) 在满足基本分红条件前提下，本计划可以进行收益分配。本计划的分红权益登记日和收益分配基准日由管理人确定。本计划红利发放日距离收益分配基准日（可供分配利润计算截止日）的时间不得超过 15 个工作日；

(五) 法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

在法律法规和监管机构允许的范围内，管理人、托管人协商一致，可以对上述收益分配条件和时间进行调整，并在管理人网站上公告。

三、本计划收益分配方式

(一) 本计划默认分红方式为现金分红，投资者可以选择现金分红或红利再投资分红方式。委托人同意遵守注册登记机构的业务规则（包括但不限于现有规则、对现有规则的修订、以及以后新制定的规则）。

(二) 委托人可以选择将所获红利再投资于本计划，选择采取红利再投资形式的，分红资金在扣除管理人业绩报酬（如有）后，按分红除权日的集合计划每份额净值转成集合计划份额。集合计划份额计算要保留到小数点后两位数，小数点后第三位四舍五入，由此产生的差额部分计入集合计划资产的损益。

四、收益分配方案的确定与通知

本计划收益分配方案由管理人拟定，包括集合计划收益的范围、集合计划可供分配利润、分配对象、分配原则、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容，并由资产托管人复核后确定，管理人通过官方网站公告的方式告知资产委托人。

五、收益分配的执行方式

在收益分配方案公布后，管理人依据具体方案的规定就支付的现金收益向托管人发送划款指令，托管人按照管理人的指令及时进行现金收益的划付。

收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由委托财产承担。

第二十三章 信息披露与报告

第五十一条 披露信息的种类、内容、频率和方式

管理人、托管人、销售机构和其他信息披露义务人应当依法披露资产管理计划信息，保证所披露信息的真实性、准确性、完整性、及时性，确保投资者能够按照本合同约定的时间和方式查阅或者复制所披露的信息资料。

一、披露信息种类及内容

资产管理计划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，包括季度报告和年度报告；

管理人应当向委托人提供资产管理计划季度报告和年度报告，披露报告期内资产管理计划运作情况，年度报告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。

资产管理计划季度报告应当披露前款除第（6）项之外的其他信息。资产管理计划成立不足三个月或者存续期间不足三个月的，管理人可以不编制资产管理计划当期的季度报告和年度报告，当期财务会计报告不再另行审计。资产管理计划当季度/年度终止的，管理人可以不编制本季度、本年度报告，资产管理计划终止当年的财务会计报告不再另行审计。

（四）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，同时在管理人、托管人协商一致的季度报告、年度报告上盖章确认，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三个月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。

（五）重大事项的临时报告；

（六）资产管理计划清算报告；

（七）法律法规规定的应向投资者披露的其他事项。

二、披露信息的频率与方式

（一）在资产管理计划运作期间，管理人应当按照以下要求向委托人提供相关信息：

1. 投资标准化资产的资产管理计划至少每周披露一次经托管人复核后的份额净值；

2. 经托管人复核后的开放式资产管理计划净值的披露频率不得低于资产管理计划的开放频率，分级资产管理计划（如本计划属于分级产品）应当披露各类别份额净值；

3. 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；

4. 发生本合同约定的或者可能影响委托人利益的重大事项时，在事项发生之日起五日内向委托人披露；

5. 中国证监会规定的其他要求。

（二）披露方式

本合同全体当事人一致同意，除特别明确约定外，本合同中约定的管理人向投资者进行的通知、通告、告知等都通过管理人网站（<https://www.citicsf.com>）向投资者披露，不另行单独通知投资者。管理人通过网站披露法律法规及本合同约定的信息，视为管理人已履行披露、通知义务。销售机构另有规定的，从其规定。

第五十二条 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本计划的，管理人应当向委托人进行披露，对该资产管理计划账户进行监控，并及时向中国证监会相关派出机构和基金业协会报告。

第五十三条 管理人、托管人向监管机构报告的种类、内容、时间和途径等有关事项

管理人应当于每月十日前向中国证监会及相关派出机构、证券投资基金业协会报送资产管理计划的持续募集情况、投资运作情况、资产最终投向等信息。

管理人应当在每季度结束之日起一个月内，编制私募资产管理业务管理季度报告，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。

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。

管理人进行年度审计，应当同时对私募资产管理业务的内部控制情况进行审计。管理人应当在每年度结束之日起四个月内将前述审计结果报送中国证监会及相关派出机构、证券投资基金业协会。

其他需向监管机构报告的事项，管理人、托管人将根据《指导意见》、《管理办

法》、《运作规定》及其他法律、行政法规、监管规定及要求及时进行及时报告。上述报告事项均依据现行有效的法律法规列举，未来监管机构对向其报告的种类、内容、时间和途径等有新规定或新要求的，本集合计划将按照新规定、新要求执行，无需另行履行合同变更程序。

第二十四节 风险揭示

第五十四条管理人在管理、运用或处分本计划财产过程中，资产管理计划可能面临的风险，包括但不限于：

一、特殊风险揭示

1. 资产管理合同与证券投资基金业协会合同指引不一致所涉风险

资产管理合同依据证券投资基金业协会发布的《集合资产管理计划资产管理合同内容与格式指引（试行）》及《资产管理计划风险揭示书内容与格式指引（试行）》（以下简称“《合同指引》”）及相关法律法规制定。《合同指引》规定，在不违反相关法律法规、《管理办法》、《运作规定》、《合同指引》以及其他有关规定的前提下，资产管理合同当事人可以根据实际情况约定《合同指引》规定内容之外的事项。《合同指引》中某些具体要求对当事人确不适用的，当事人可对相应内容做出合理调整和变动。资产管理合同中对《合同指引》规定内容之外的部分事项进行约定，也可能存在个别内容与《合同指引》不一致，或不适用《合同指引》中个别规定的情形，可能对投资者合法权益造成影响。投资人应当认真阅读本合同，理解本合同的全部条款，独立做出是否签署本合同的决定。

2. 资产管理计划委托募集所涉风险

管理人可委托销售机构销售资产管理计划，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资产管理计划募集风险：

（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）销售机构违反中国证监会及其他监管机构的规定，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基金销售业务资格或未成为证券

投资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合法有效授权即从事资产管理计划募集活动；

(5) 销售机构可能存在将资管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、侵占资管计划财产和客户资金等违法活动。

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

资产管理计划的管理人将按照相关法律法规的要求向证券投资基金业协会申请办理计划备案手续，但不能保证一定能办理成功。如本计划最终未能在证券投资基金业协会完成备案手续或被不予备案的，本资产管理计划将按照资产管理合同的约定提前终止并进入清算程序，管理人将按照资产管理合同约定向投资者返还本计划的清算财产，前述情形将导致投资者投资资产管理计划以获得投资收益的目的落空。

4. 资产管理计划份额转让所涉风险

投资者可通过现时或将来法律、法规或监管机构允许的方式办理本计划的份额转让业务，其转让地点、时间、规则、费用等按照办理机构的规则执行。如果份额转让因不符合法律法规或办理机构的规则未办理成功的，委托人需要自行承担相应风险和损失。

二、一般风险揭示

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。

本计划属于【R3-中风险】风险投资品种，适合风险识别、评估、承受能力【C5-积极型、C4-相对积极型、C3-平衡型】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：

(1) **政策风险：**货币政策、财政政策、产业政策等国家宏观经济政策的变化对资本市场产生一定的影响，导致市场价格波动，影响本资产管理计划的收益而产生风险。

(2) **经济周期风险：**经济运行具有周期性的特点，受其影响，本资产管理计

划投资的收益水平也会随之发生变化，从而产生风险。

(3) 利率风险:利率风险是指由于利率变动而导致的资产价格和资产利息的损益。利率波动会直接影响企业的融资成本和利润水平，导致证券市场的价格和收益率的变动，使本资产管理计划投资的收益水平随之发生变化，从而产生风险。

(4) 购买力风险:本资产管理计划投资的收益主要通过现金形式来分配，而现金可能因为通货膨胀的影响而导致购买力下降，从而使本资产管理计划投资的实际收益下降。

(5) 再投资风险:固定收益品种获得的本息收入或者回购到期的资金，可能由于市场利率的下降面临资金再投资的收益率低于原来利率，从而对本资产管理计划产生再投资风险。

3. 管理风险

资产管理计划运作过程中，管理人的知识、经验、判断、决策、技能等，会影响其对信息的占有和对经济形势、金融市场价格走势的判断，如变更投资经理、管理人判断有误、获取信息不全、或对投资工具使用不当等影响资产管理计划的收益水平，从而产生风险。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

交易对手方未能实现交易时的承诺，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。

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。

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) 在资产管理计划初始销售期间期限届满（确认资产管理计划无法成立）后

三十日内返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

7.1 参与债券逆回购的风险

债券回购为提升本计划的组合收益提供了可能，但也存在风险。用于融资回购的债券将作为资产托管人相关结算备付金账户偿还融资回购到期购回款的质押券，若资产管理人债券回购交收违约，资产管理人和委托人面临结算公司依法对质押券进行处置的风险。如果其他投资收益率更高，则债券逆回购存在机会成本损失；经济萧条时，包括债券逆回购在内的所有投资产品收益下降；回购义务人不履约造成的风险。

7.2 净值波动风险

本计划可能投资于公开募集基金、证券公司及其子公司集合资产管理计划、保险公司及其子公司集合资产管理计划、期货公司及其子公司集合资产管理计划、基金公司及其子公司“一对多”特定客户资产管理计划、于中国证券投资基金业协会官方网站公示已登记的管理人发行的私募基金等产品，投资上述产品出现如下情形之一时，将可能导致本计划出现净值波动风险：

- (1) 估值日无法及时获取上述投资品种的最新估值价格；
- (2) 投资上述品种后无法及时确认，上述投资品种在投资确认前估值价格波动；
- (3) 估值日取得的上述投资品种的最新估值价格没有或无法排除影响估值价格的因素（例如在估值日无法排除业绩报酬对估值价格的影响）。

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. 关联交易风险

管理人可能将资产管理计划的资产投资于本机构、托管机构及其控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司发行或者承销的证券，或者从事其他重大关联交易。相关投资存在一定风险，提请委托人知悉、充分关注，投资者签订资产管理合同即代表委托人认可同意上述关联交易并自愿承担相关风险。

10. 技术风险

在本计划的日常交易中，可能因为技术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利益受到影响。这种技术风险可能来自管理人、托管人、证券

交易所、证券登记结算机构等。

11. 操作风险

管理人、托管人、证券交易所、证券登记结算机构等在业务操作过程中，因操作失误或违反操作规程而引起的风险。

12. 不可抗力风险

战争、自然灾害等不可抗力因素的出现，将会严重影响证券期货市场的运行，可能导致资产管理计划资产的损失；金融市场危机、行业竞争、代理机构违约等超出管理人自身直接控制能力之外的风险，可能导致委托人利益受损；其他不可预知、不可防范的风险。

13. 合同变更风险

1. 在一般情形下，管理人与托管人对合同变更事宜达成一致后，管理人在管理人网站公告通知投资者并明确合同变更征询期，并有权设置特殊赎回开放日，不同意合同变更的投资者，应在该赎回开放日办理资产管理计划的退出事宜，委托人未退出的视为同意合同变更。征询期满后管理人即可确定变更生效日期。

2. 在因法律法规或有关政策变更而需要变更合同的情形下，管理人与托管人对合同变更事宜达成一致后即可对合同进行变更，无需征询委托人意见，合同变更生效日以管理人在公司网站公告所载日期为准。

3. 在各种合同变更的情形下，变更生效后，委托人未退出的视为同意合同变更，若不同意合同变更，只能按照合同约定申请退出。

4. 合同变更的征询函、公告、通知等，管理人将仅通过管理人网站（www.citicsf.com）发布，而不会单独通知每个投资者，投资者应及时关注管理人网站内容。

14. 电子合同风险

资产管理合同采用电子签名合同方式签订的，在合同签订过程中可能存在无法预测或无法控制的系统故障、设备故障、通讯故障，从而导致电子合同无法及时签订，从而影响委托人的投资收益。电子合同签订后，委托人凭密码进行交易，委托人通过密码登陆后所有操作均将视同本人行为，如委托人设置密码过于简单或不慎泄露，可能导致他人在未经授权的情况下操作委托人账户，给委托人造成潜在损失。

15. 管理人、托管人风险

担任资产管理计划的管理人、托管机构，因停业整顿、解散、撤销、破产，或

者被中国证监会撤销相关业务许可等原因不能履行职责，可能给投资者带来一定的风险。

16. 特殊估值方法风险

本计划资产出现无法评估公允价值的情况时，可能采取侧袋估值方法，在侧袋估值期间，本计划暂停计划份额的参与。退出计划份额时，该部分资产由于无法变现将延迟支付对应退出款直至该部分资产完全变现后另行支付。

17. 提前终止风险

发生合同规定的情形或其他法定情形时，管理人将按照法律法规、资管合同以及其他规定提前终止本计划，可能造成计划份额持有人不能足额取得计划收益。前述提前终止本计划的安排可能会对投资者的预期收益产生一定的影响。

18. 延期风险

本计划存续期限届满时，因持有流通受限证券、投资的产品封闭期（含限售期、锁定期）超过计划存续期等原因导致本计划财产无法及时变现的导致计划财产无法及时变现的，本计划将延期至计划财产全部变现为止，可能造成计划份额持有人不能足额取得或不能及时取得计划收益。

19. 二次清算风险

根据资产管理合同约定本计划在终止清算之日或委托人退出时有未能流通变现的投资品种，管理人可针对该部分未能流通变现的投资品种制定二次清算方案，并对未变现投资品种进行二次清算。由此可能导致委托人无法说到计划收益的剩余可分配财产。

三、其他不可预知、不可防范的风险。

关于本计划详细的风险揭示内容请委托人阅读并签署管理人单独编制的《风险揭示书》（本合同附件之一）。

此外，即使管理人已对可能存在的风险进行了揭示，但本计划仍可能存在未能揭示的风险，本计划本金仍存在部分亏损甚至全部亏损的可能。同时本计划项下管理人等相关机构和人员的过往业绩不代表该计划未来运作的实际效果，委托人应充分认识参与本计划的投资风险，管理人不保证最低收益或本计划本金不受损失，以及限定投资损失金额或者比例。

第五十五条 特别提示：委托人签署本合同及《风险揭示书》即表明已充分了解

本计划风险并已谨慎评估自身风险承受能力，理解并愿意自行承担参与本资产管理计划投资的风险和损失。

第二十五节 资产管理合同的变更、终止与财产清算

第五十六条 资产管理合同的变更

一、一般情形下合同变更的方式及程序

(一) 管理人应将拟进行合同变更的内容书面通知托管人，托管人应于收到通知后 3 个工作日内书面回复。经托管人同意后的合同拟变更内容应及时以管理人网站公告通告委托人，同时约定合同变更征询期。资产管理计划改变投资范围和投资比例的，应当事先按照本合同约定变更合同。

(二) 管理人有权在合同变更征询期对本计划设置特殊赎回开放日，不同意合同变更的委托人，应在该赎回开放日办理本计划的退出事宜，委托人未退出的视为同意合同变更。**特殊赎回开放日仅接受委托人退出，不接受委托人参与。**本合同变更生效后，委托人有权在任何开放日按照本合同相关约定申请退出。

(三) 管理人应最迟在变更后的合同生效之日通过管理人网站公告告知委托人。

(四) 本计划的合同变更等有关事项，管理人将仅通过管理人网站 www.citicsf.com 发布，委托人应及时关注管理人网站内容。

二、特殊情形下的合同变更方式及程序

尽管本合同有其他约定，但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本合同的，管理人可以与托管人协商一致后修改本资产管理合同（包括但不限于投资范围、投资比例及限制、自有资金参与、备案程序等相关内容）。变更后的内容不得违反法律法规和中国证监会的规定，管理人应将变更的合同内容根据相关规定备案。变更后的合同生效日期以公告为准。

三、因发生以下事项需要变更合同的，按照下列方式予以处理：

(一) 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，应当及时通知托管人及委托人，并由托管人与委托人协商一致选任承接的管理人，原管理人应善意配合该等管理人变更事宜。

(二) 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，应当及时通知管理人及委托人，并由管理人与委托人协商一致选任承接的托管人，原托

管人应善意配合该等托管人变更事宜。

投资者在此同意，如果上述事件发生，在管理人与托管人协商一致的基础上，管理人有权将本合同中由管理人享有的权利和由管理人承担的义务转让给其他从事资产管理业务的公司或从事托管业务的公司，并无须就此项变更和投资者另行签订专项协议。但在转让前管理人应以信息披露的形式通告投资者。管理人保障投资者退出本集合计划的权利，并在届时的通告中对相关事项作出合理安排。

四、合同变更生效后，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，履行相关义务。管理人应当按照相关规定进行备案。。

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，约定保证本计划资产投资收益、承担投资损失，或排除委托人自行承担投资风险和损失。

六、投资者同意，无论其是否同意合同变更或提出退出申请，管理人变更本合同的行为均不应被视为或裁定为管理人的违约行为。经全体投资者、管理人、托管人同意，也可通过签署补充协议的方式进行合同变更，采用该等方式变更合同的，可不受上述合同变更程序限制。

七、尽管有上述约定，若本合同约定内容与有关法律法规冲突，应以法律法规规定为准，直接按照相关法律法规执行，不再执行合同中与法律法规相冲突的条款，可不再按照本条上述约定变更合同。

第五十七条 资产管理计划的展期

本计划固定存续期 10 年，存续期届满，本计划可展期；出现本合同约定的终止情形时，终止清算。

一、展期的条件

(一) 资产管理计划运作规范，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；

(二) 资产管理计划展期没有损害投资者利益的情形；

(三) 中国证监会规定的其他条件。

本计划展期的，应当符合本合同规定的资产管理计划成立条件。

二、展期的程序与期限

展期的程序：本资产管理计划拟展期的，管理人可参照合同变更的方式履行展

期程序，具体参见本合同关于“资产管理合同变更的条件与程序”的规定。展期通知委托人的时间、方式以及委托人答复方式以届时管理人网站公告为准。

存续期届满，本计划符合展期条件的，管理人将在存续期满之日的下一个工作日公告本集合计划展期成立。

展期的期限：管理人应在公告具体展期方案时确定展期的具体期限，开放期和封闭期安排以展期公告为准。

第五十八条 资产管理计划终止的情形

本合同各方当事人一致同意，出现下列情形之一时，本计划应当终止：

- 一、存续期届满且不展期；
- 二、经全体委托人、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、计划存续期，本计划的投资者少于2人，且管理人决定终止的；但若发生持续五个工作日投资者少于2人的，则本计划自动终止；

六、全体委托人赎回全部委托财产；

七、未在基金业协会完成备案或不予备案的情形；

八、全体委托人一致申请终止本计划的；

九、本合同生效后法律法规、监管政策发生变化，导致资产管理人开展本合同项下资产管理业务受到限制的，资产管理人有权决定提前终止本合同；

十、法律、行政法规、中国证监会规定及本合同约定的其他情形。

管理人应当自资产管理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（七）项约定的情形除外。

第五十九条 资产管理计划终止的清算

在资产管理计划发生终止情形之日起五个工作日内，管理人应成立清算组进行清算。

一、资产管理计划财产清算小组

资产管理计划财产清算小组成员由管理人及托管人组成。清算小组可以聘请必

要的工作人员。资产管理计划财产清算小组负责资产管理计划财产的保管、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、清算程序

1. 资产管理计划财产清算小组负责资产管理计划财产的保管、清理、估价、变现和分配。

2. 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，由资产管理人或销售机构按照资产委托人提供的联系方式或由资产管理人通过其公司网站告知资产委托人。资产委托人在此同意，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。

3. 管理人应当在清算结束后 5 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，并通知资产委托人完成清算财产的分配，本计划清算办理完毕。本资产管理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。

4. 除合同当事人三方另有约定外，计划财产期末移交采取现金方式，在计划终止日前，资产管理人必须将投资组合内所有证券变现。计划终止时，若计划财产仍持有暂时无法流通变现的证券，如未到期回购、未上市新股、在证券锁定期内等，对该类证券在其限制条件解除后进行资产清算。对上述暂时不能变现的资产，资产管理人、资产托管人、投资顾问（如有）在其清算期间内，不再计提管理费、托管费、投资顾问费（如有）和业绩报酬。

5. 本计划清算完毕，本资产管理合同终止。

三、清算费用

清算费用是指资产管理计划财产清算小组在进行计划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资产管理计划财产中支付。

四、资产管理计划财产按下列顺序清偿：

1. 支付清算费用；
2. 交纳所欠税款；
3. 清偿资产管理计划债务；
4. 按资产委托人持有的计划份额比例进行分配。

资产管理计划财产未按前款 1—3 项规定清偿前，不分配给资产委托人。

五、二次清算

因持有流通受限证券、投资的产品封闭期（含限售期、锁定期）超过计划存续期等原因导致本计划财产无法及时变现的，资产管理人应当于本计划终止后对计划财产进行清算并先行分配已变现部分。待上述资产可以变现时，资产管理人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，并将该部分财产另行分配给全体计划份额持有人。本计划持有多个流通受限的证券及投资产品的，资产管理人可以按本款约定进行多次变现及清算。二次清算期间（即自本计划首次清算完毕之日（不含）起至本计划第二次清算完毕之日止），资产管理人、资产托管人不计提管理费、托管费、投资顾问费（如有）及业绩报酬（如有）。二次清算流程同一次清算。

资产管理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证券投资基金业协会报告。

六、计划财产清算报告的告知安排

清算小组做出的清算报告，报监管机构备案并由管理人通过公告的方式告知计划委托人。自清算报告公布 20 个工作日内，资产管理人按照清偿顺序确定分配给委托人的金额后，向委托人支付其实际应得的资金。

七、资产管理计划财产相关账户的注销

资产管理计划财产清算完毕后，资产托管人按照规定注销资产管理计划财产的托管账户等投资所需账户，资产管理人应给予必要的配合。资产管理计划财产清算账册及文件由资产管理人保存至少 20 年。

第二十六节 违约责任

第六十条 各方当事人在实现各自权利、履行各自义务的过程中，违反法律法规规定或者本合同约定，应当各自承担相应的责任；给计划财产或者本合同其他当事人造成的损失，应当分别对各自的行为所造成的损失依法承担赔偿责任。一方违约承担的责任，限于直接损失。

第六十一条 各方当事人一致同意发生下列情况对本计划资产造成损失时，当事人可以免责：

一、管理人及/或托管人按照中国证监会的规定或当时有效的法律法规的作

为或不作为而造成的损失等；

二、管理人由于按照本合同规定的投资原则而行使或不行使其投资权利而造成的损失等；

三、因不可抗力不能履行本协议的，根据不可抗力的影响，违约方部分或全部免除责任，但法律法规另有规定的除外。当事人迟延履行后发生不可抗力的，不能免除责任。

四、托管人基于从第三方合法获得的信息及合理信赖上述信息而操作导致委托资产的任何损失。

五、管理人、托管人对因所引用其他中介机构（如有）提供的信息的真实性、准确性和完整性存在瑕疵所引起的损失不承担任何责任。

六、托管人对于本合同中明确约定应由管理人履行的义务不承担任何责任。

第六十二条 在发生一方或多方违约的情况下，在最大限度地保护委托人利益的前提下，本合同能够继续履行的应当继续履行。各方当事人在职责范围内有义务及时采取必要的措施，防止损失的扩大。没有采取适当措施致使损失进一步扩大的，不得就扩大的损失要求赔偿。其他当事方因防止损失扩大而支出的合理费用由违约方承担。

第二十七节 争议的处理

第六十三条 本合同受中国法律管辖，并从其解释。凡因本合同发生的及与本合同有关的任何争议，各方当事人应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，合同签订各方一致同意将争议向管理人所在地有管辖权的法院提起诉讼解决。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、尽责地履行资产管理合同规定的义务，维护资产委托人及合同各方的合法权益。

第二十八节 资产管理合同的效力

第六十四条 本资产管理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。委托人为法人的，本合同经委托人、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签章之日起成立；委托人为自然人的，本合同经资产委托人本人签字、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签章之日起成立。

资产管理合同成立后，自本计划成立之日首次生效，具体以管理人公告为准。对于存续期参与的资产委托人，本合同自合同成立且委托人的参与资金实际交付、注册登记机构确认参与份额之日起生效。

资产管理合同的有效期为合同生效之日起至本计划全部资产清算分配完毕之日终止。资产管理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。本合同由当事人各执壹份，每份具有同等的法律效力。

资产管理计划终止，但合同项下的清算条款、违约责任条款、争议解决条款仍然有效。

第六十五条 投资者自签订本合同即成为本资产管理合同的当事人。在本计划存续期间，投资者自全部退出资产管理计划之日起，该投资者不再是资产管理合同的当事人。

第六十六条 《中信期货睿意全天候 FOF1 号集合资产管理计划说明书》、《中信期货睿意全天候 FOF1 号集合资产管理计划风险揭示书》、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、管理人通过其公司网站发布的销售公告或其他公告、委托人签署的其他法律文书等为本合同附件，是本合同的有效组成部分，与本合同具有同等法律效力，本合同附件的约定与本合同有任何冲突之处，冲突之处以本合同的约定为准。本合同有约定的，若与计划说明书内容不尽一致的，以本合同约定为准；本合同未作约定的，以计划说明书内容为准。

第二十九节 其他事项

第六十七条 本合同未尽事宜，当事人依据有关法律法规和本计划说明书的规定办理。如本合同约定与法律法规有任何冲突之处，冲突之处按照法律法规规定执行。

本或计划存续期内，管理人应依据法律法规履行相应反洗钱义务，并主动配合托管账户开立结算银行根据监管部门有关反洗钱要求开展客户身份识别工作，提供真实、准确、完整的客户资料；根据人民银行有关规定向托管人发送本基金（或计划）

“受益所有人”信息，遵守各方反洗钱与反恐怖融资相关管理规定。对具备合理理由怀疑涉嫌洗钱、恐怖融资的客户，任何一方有权按照中国人民银行反洗钱监管规定采取必要管控措施，或单方面终止本合作。

一、本计划全体当事人一致同意，在不损害委托人实质利益的前提下，且在不违反相关法律法规、《管理办法》、《运作规定》、《合同指引》及其他有关规定的前提下，管理人有权根据资产管理计划运作实际情况对本集合计划管理运作过程中的相关事项进行调整或补充明确，并通过管理人网站及时予以公告。

二、合同终止，不影响管理费、业绩报酬（如有）、托管费等费用结算条款的效力。

三、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，约定保证委托资产投资收益、承担投资损失，或排除委托人自行承担投资风险和损失。

四、本合同项下的任何一项通知、通告的送达：为任何一方按照本合同第一节“当事人及权利义务”各方基本信息中的邮箱、地址、传真、电话等方式中的任何一种方式发送给接收方，即视为送达。任何一方变更信息的，应当书面通知其他方，否则自行承担无法送达的风险和责任。

五、委托人、管理人、托管人三方对相关资料和信息进行保密，除法律法规另有规定外，未经其余各方书面同意，不得向其他方透露本合同内容、履行情况、资产管理计划投资管理情况及其他商业秘密。

（以下无正文）

本合同签署页之一：委托人基本信息

(请资产委托人务必确保填写的资料真实、准确、完整，如因填写错误或填写信息不完整导致的任何损失，资产管理人和资产托管人不承担任何责任)

资产委托人请填写：

(一) 资产委托人

1、自然人

姓名：

证件名称：身份证 军官证 护照 其他：_____

证件号码：

联系地址：

邮编：

电子邮箱：

联系电话：

2、法人或其他组织

名称：

营业执照号码或统一社会信用代码：

法定代表人或负责人：

住所：

通讯地址：

邮编：

电子邮箱：

联系电话：

联系人：

预留印鉴：

(二) 资产委托人认购金额

人民币_____元整(¥_____)

(三) 资产委托人账户

资产委托人指定账户即为计划合同中约定的“委托人收益账户”。委托人认购计划的划出账户与清算退出计划的划入账户，必须为以委托人名义开立的同一个账户。特殊情况导致认购和清算退出计划的账户信息不一致，委托人申请变更账户信息的，应出具符合相关法律法规规定的书面说明。管理人仅对委托人提供的前述材料进行形式审查，因变更委托人账户信息所导致的责任由委托人自行承担，但管理人存在过错的除外。

投资者为其他资产管理产品的，需将其他产品的托管资金账户或专门的财产资金账户作为认购、参与计划的划出账户与清算退出计划的划入账户，在赎回本计划或者本计划清算分配全部完成之前，不得注销托管资金账户或专门的财产资金账户。

账户信息如下：

户名：

账号：

开户行：

本合同签署页之二：本页为资产委托人、中信期货有限公司、关于《中信期货睿意全天候 FOF1 号集合资产管理计划资产管理合同》签字/盖章页。

资产委托人：

自然人（签字）：_____

（或）法人或其他组织（公章或合同专用章）：

法定代表人或授权代表：

签署日期：_____年____月____日

资产管理人（公章或合同专用章）：中信期货有限公司



法定代表人或授权代表：

签署日期：2021年7月15日

资产托管人（公章或合同专用章）：兴业银行股份有限公司



法定代表人/负责人或授权代表：



签署日期：2021年7月____日

附件一：费用列表

费用列表(样本)

| 费用项目 | 计费方式 |
|---|---|
| 管理人每日收取的管理费和业绩报酬 | 1. 前一日计划资产净值×【 1.0 】%÷365，按日计提，按季支付。 2. 管理人的业绩报酬，具体计算约定见合同。 |
| 托管人每日收取的托管费 | 前一日计划资产净值×【 0.05 】%÷365，按日计提，按季支付。 |
| 资产管理计划财产开立账户需要支付的费用 | 根据有关法律法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入或摊入当期费用，由托管人从资产管理计划财产中支付。如交易所或第三方金融机构调整相关费率的，则管理人根据有关法律法规及相应协议的要求，于费用发生时，在资产管理计划财产中列支。 |
| 银行账户的资金结算汇划费、账户维护费 | |
| 资产管理计划在发生投资交易时按规定比例支付的经手费、证管费、过户费、印花税、佣金等 | |
| 份额登记机构等资产管理计划的行政服务机构的服务费（如有） | |
| 资产管理计划成立以后与计划资产运作相关的会计师费和律师费等中介服务费，资产管理计划合同生效后与之相关的信息披露费用 | |
| 与本资产管理计划运作直接相关应税项目或应税行为产生的增值税及附加税费 | |
| 其他根据法律法规或资产管理合同规定由资产管理计划承担的费用 | |

委托人确认：（签名/盖章）：

日期： 年 月 日

附件二：资产到账确认书

资产到账确认书（样本）

【管理人名称】：

【资产管理合同全称】（编号：【 】）项下托管账户：

户名：

账号：

开户银行：

于【】年【】月【】日收到现金资产【大写】元整，即¥【小写】元（以大写金额为准）。

【●】

（托管业务结算专用章）

【】年【】月【】日

，
：
✓

附件三：授权文件

授权文件(样本)

:

根据中信期货睿意全天候 FOF1 号集合资产管理计划资产管理合同，我公司授权以下人员代表公司向贵司发送划款指令，具体指令发送用章样本及有关人员的具体权限及签字或名章样本详见下表，请在实际业务开展过程中严格核验。上述被授权人在授权范围内向贵司发送指令的真实性、准确性及合法性由我公司负全部责任。

| 姓名 | 权限 | 签字样本 | 名章样本 |
|--|--------|------|------|
| | 经办 A | | |
| | 经办 B | | |
| | 复核 A | | |
| | 复核 B | | |
| 指令 发送 用章 | (预留印鉴) | | |
| 备注：1. 指令发送用章须与个人签字或人名章同时出具，方为有效； 2. 权限类型：经办、复核； 3. 本授权自【】年【】月【】日之当日生效； | | | |

资产管理人：(公章)

法定代表人(或授权代表)签字(或盖章)：

【】年【】月【】日

附件四：划款指令

划款指令（样本）

第 号

致【托管行名称】：

鉴于贵我双方签署的《中信期货【●】集合资产管理计划资产管理合同》之约定，特向贵司申请如下划款：

申请时间： 年 月 日

单位：人民币元

| | |
|--|---|
| 付款户名： | 收款户名： |
| 付款账号： | 收款账号： |
| 开户行： | 开户行： |
| 金额小写： | 金额大写： |
| 划款时间： 年 月 日 | |
| 资金用途及情况说明： 如有附件请在此列明附件名称，如有需要可以另附页。 | 管理人经办人： 管理人复核人： 管理人预留印鉴章： |

重要提示：接此指令后，经审核无误按照指令条款进行划款。

附件五：资产管理计划成立通知书样本

资产管理计划成立通知书（样本）

【托管行名称】：

我司作为管理人发起设立的【●】资产管理计划于【●】年【●】月【●】日成立。本计划每份额面值为【●】元。本计划初始销售期间所募集资金合计人民币¥【●（小写）】【●（大写）】元，折合产品份额【●】份。

销售期间产生利息【●（小写）】【●（大写）】元，折合份额【●】份。

以上实收资金及初始销售期期间利息共计人民币¥【●（小写）】【●（大写）】，共计折合份额【●】份。

（以上金额以大写为准）

特此通知。

资产管理人：【】

（资产管理业务专用章）

【】年【】月【】日

附件六：各方业务联系人名单及预留印鉴

管理人：中信期货有限公司业务联系表及预留印鉴

| | | | | |
|------|--|--------------|-------------|-------------------------|
| 总协调人 | 傅姝婷 | 010-60834786 | 18612838080 | fushuting@citicsf.com |
| 估值 | 许婕 | 021-60812956 | 18217298631 | xujie@citicsf.com |
| 划款 | 高丹丹 | 021-80365235 | 18721492967 | gaodandan@citicsf.com |
| 数据 | 李永强 | 021-60812950 | 18512105883 | liyongqiang@citicsf.com |
| 风控 | 巩国樑 | 021-60812969 | 13601708528 | fxjk@citicsf.com |
| 预留印鉴 | 印鉴样本  | | | |

托管人：业务联系表及预留印鉴

| 岗 位 | 姓 名 | 分 机 | 指定传真电话 | 手 机 |
|---------|--|--------|--------------|-------------|
| 业务联系协调人 | 张珏 | 213711 | 021-62535823 | 15021820853 |
| 托管人预留印鉴 | (印鉴样本) (总行运营产品以“兴业银行总行托管产品运营预留印鉴”材料为准，不再另行用印) | | | |