

合同编号：（JH）东证融汇-合同 2021 汇鑫 12M1 号

东证融汇汇鑫 12M1 号集合资产管理计划

资产管理合同

（固定收益类集合资产管理计划）

管理人：东证融汇证券资产管理有限公司

托管人：宁波银行股份有限公司

二〇 年 月

目 录

一、前言	1
二、释义	2
三、承诺与声明	6
四、当事人的权利和义务	7
五、资产管理计划的基本情况	13
六、资产管理计划的募集	16
七、资产管理计划的成立与备案	18
八、资产管理计划的参与、退出与转让	19
九、资产管理计划份额持有人大会及日常机构	28
十、资产管理计划份额的登记	28
十一、资产管理计划的投资	29
十二、投资顾问	35
十三、分级安排	35
十四、利益冲突及关联交易	35
十五、投资经理的指定与变更	36
十六、资产管理计划的财产	37
十七、投资指令的发送、确认和执行	40
十八、越权交易	43
十九、资产管理计划财产的估值和会计核算	45
二十、资产管理计划的费用与税收	50
二十一、资产管理计划的收益分配	56
二十二、信息披露与报告	56
二十三、风险揭示	59
二十四、资产管理合同的变更、终止与财产清算	66
二十五、违约责任与争议处理	70
二十六、资产管理合同的效力	72
二十七、其他事项	72

一、前言

为规范东证融汇汇鑫 12M1 号集合资产管理计划(以下简称“集合计划”或“计划”)运作,明确《东证融汇汇鑫 12M1 号集合资产管理计划资产管理合同》(以下简称“本合同”)当事人的权利与义务,依照《中华人民共和国民法典》(以下简称“《民法典》”)、《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》(以下简称“《指导意见》”)、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》(以下简称“《管理办法》”)、《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》(以下简称“《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“《格式指引》”)等法律法规、中国证监会和中国证券投资基金业协会、中国证券业协会的有关规定,投资者、管理人、托管人在平等自愿、诚实信用原则的基础上订立本合同。本合同是规定当事人之间基本权利义务的法律文件,当事人按照《民法典》、《基金法》、《指导意见》、《管理办法》、《运作规定》、《格式指引》、《东证融汇汇鑫 12M1 号集合资产管理计划说明书》(以下简称“《说明书》”)、本合同及其他有关规定享有权利、承担义务。

投资者承诺以真实身份参与集合计划,保证委托资产的来源及用途合法,所披露或提供的信息和资料真实,并已阅知本合同和集合计划说明书全文,了解相关权利、义务和风险,自行承担投资风险和损失。投资者承诺符合法律法规规定和本合同揭示的合格投资者条件。

管理人承诺以诚实守信、审慎尽责的原则管理和运用本集合计划资产,但不保证本集合计划一定盈利,也不保证最低收益。

托管人承诺以诚实守信、审慎尽责的原则履行托管职责,安全保管客户集合计划资产、办理资金收付事项、监督管理人投资行为,但不保证本集合计划资产投资不受损失,不保证最低收益。

管理人依照有关规定对资产管理计划的设立、变更、展期、终止、清算等行为向中国证券投资基金业协会(以下简称“证券投资基金业协会”)进行备案,并抄报管理人住所地中国证监会派出机构。

证券投资基金业协会接受本资产管理计划备案不能免除管理人按照规定真实、准确、完整、及时地披露产品信息的法律责任，也不代表证券投资基金业协会对本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。

二、释义

在本合同中除非文意另有所指，下列词语具有如下含义：

计划、集合计划或本集合计划	指东证融汇汇鑫12M1号集合资产管理计划，及对本计划的任何有效的修订和补充
《集合资产管理合同》、《资产管理合同》	指《东证融汇汇鑫12M1号集合资产管理计划资产管理合同》及其的任何修订和补充
《集合计划说明书》或《说明书》	指《东证融汇汇鑫12M1号集合资产管理计划说明书》
《基金法》	指2015年4月24日全国人大常委会发布并实施的《中华人民共和国证券投资基金法》及其不时修订
《指导意见》	指2018年4月27日中国人民银行、中国银行保险监督管理委员会、中国证券监督管理委员会及国家外汇管理局联合发布的《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》
《管理办法》	指2018年10月22日中国证监会发布并实施的《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》
《运作规定》	指2018年10月22日中国证监会发布并实施的《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》
中国证监会	指中国证券监督管理委员会
集合计划管理人或管理人	指东证融汇证券资产管理有限公司，也简称为“东证融汇”

集合计划托管人或托管人	指宁波银行股份有限公司，也简称为“宁波银行”
销售机构	指东证融汇、与管理人签订代理销售协议的其他机构等
注册与过户登记人	指东证融汇
证券交易所	指上海证券交易所、深圳证券交易所
中国结算	指中国证券登记结算有限责任公司
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
当事人	指受《集合资产管理合同》及《说明书》约束，根据《集合资产管理合同》及《说明书》享受权利并承担义务的法律主体，包括管理人、托管人、投资者
个人投资者	指依据中华人民共和国有关法律法规及其他有关规定可以投资于集合计划的自然人
机构投资者	指在中国境内合法注册登记或经有权政府部门批准设立的企业法人、事业法人、社会团体或其它组织
投资者	指上述投资者(个人投资者和机构投资者)的合称，也称为“资产管理计划份额持有人”
集合计划成立日	指集合计划经过销售达到集合计划说明书和集合资产管理合同规定的成立条件后，管理人公告的集合计划成立的日期
初始募集期	指自本集合计划自资产管理计划份额发售之日起不超过60个工作日的期间，具体募集时间以本集合计划销售公告为准

集合计划管理期限、存续期	指集合计划成立并存续的时间。本集合计划管理期限为10年。本集合计划成立后，管理人有权视市场情况，决定是否提前终止。
工作日或交易日	指上海证券交易所和深圳证券交易所的正常交易日
T日	指日常参与、退出或办理集合计划业务的申请日
T+n日	指自T日起第n个工作日（不包含T日）
业绩报酬计提基准	每个封闭期开始之前，管理人公告本集合计划当期（含该封闭期和该封闭期结束后的开放期）的业绩报酬计提基准（年化）。本集合计划的业绩报酬计提基准仅作为管理人收取业绩报酬的基准，不作为实际收益分配的依据
年化收益率	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，初始募集期参与的，为产品成立日；申购参与的，为申购参与当日）到本次业绩报酬计提日的年化收益率
开放期	本集合计划自成立之日起每满1个月开放参与（参与开放期），开放期为1个工作日，具体开放期以每满1个月的对日为基准日，前后浮动不超过7个工作日，届时以管理人公告为准，管理人网站上发布公告即视为履行了告知义务。管理人可根据资产配置安排和集合计划已有投资者利益的考虑进行额度控制。 本集合计划投资者参与的份额自参与确认日（募集期认购的，为本集合计划成立之日）起进入封闭期，封闭运作12个月（前后浮动不超过7个工作日）当月的参与开放期为份额退出日（退出开放期），投资者可申请退出（遇非工作日顺延），若投资者在份额退出日（退出开放期）未退出，则投资者该份额自动

	进入下一个封闭期，在该封闭期内投资者不得退出该份额，须持有至下一个份额退出日（退出开放期），法律法规及本合同另有规定的除外。
临时退出开放期	若出现合同变更、监管规则修订、管理人自有资金参与比例被动超限等法定事由，管理人将公告临时退出开放期，投资者可在临时退出开放期退出本集合计划。临时退出开放期的具体安排以管理人公告为准，管理人网站上发布公告即视为履行了告知义务
封闭期	除开放期及临时退出开放期（如有）以外的期间，均为封闭期，封闭期内本集合计划封闭运作，不接受投资者参与和退出申请，对本集合计划的每一份额而言，其一个封闭期为 12 个月（前后浮动不超过 7 个工作日，具体以管理人公告为准），法律法规及本合同另有规定的除外。
年、年度、会计年度	指公历每年1月1日起至当年12月31日为止的期间
初始募集期参与	指在初始募集期内投资者申请购买本集合计划份额的行为
存续期参与	指在存续期内集合计划份额的开放期，投资者申请购买本集合计划份额的行为
退出	指在存续期内集合计划份额的开放期，投资者卖出集合计划份额的行为
集合计划收益	指本集合计划投资所得红利、债券利息、基金红利、买卖证券价差、银行存款利息及其他合法收入
集合计划份额、计划份额、份额	指集合计划的最小单位
元	指人民币元

集合计划份额面值、单位面值	人民币1.00元
集合计划资产总值	指集合计划所投资各类证券、银行存款本息、集合计划各项应收款以及其他资产所形成的价值总和
集合计划资产净值	指集合计划资产总值减去负债后的净资产值
集合计划单位净值、单位净值 集合计划份额净值、份额净值	指计算日集合计划资产净值除以计算日集合计划总份额的金额
集合计划累计单位净值、累计单位净值	指计划单位净值与集合计划份额累计分红之和
集合资产管理计划资产估值	指计算评估集合资产管理计划资产和负债的价值，以确定集合计划资产净值的过程
分红权益登记日（如有）	指享有分红权益的计划份额的登记日期，只有在分红权益登记日（不包括本登记日）前购入的计划份额，并在权益登记日当天登记在册的份额才有资格参加分红
不可抗力	指遭受不可抗力事件一方不能预见、不能避免、不能克服的客观情况，包括但不限于洪水、地震及其它自然灾害、战争、骚乱、火灾、突发性公共卫生事件、政府征用、没收、法律法规变化或其他突发事件、注册与过户登记人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等。管理人或托管人因不可抗力不能履行《集合资产管理合同》时，应及时通知其他各方并采取适当措施防止投资者损失的扩大
管理人指定网站、管理人网站	指www.nesc.cn，管理人指定网站变更时以管理人公告为准

三、承诺与声明

（一）管理人承诺

1、在签订本合同前充分向投资者说明了有关法律法规和相关投资工具的运作市场及方式，并充分揭示了相关风险。

2、已经了解投资者的风险偏好、风险认知能力和承受能力，对投资者的财务状况进行了充分评估。

3、按照《基金法》恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用委托财产，不保证委托财产一定盈利，也不保证最低收益或本金不受损失，以及限定投资损失金额或者比例。

（二）托管人承诺

1、按照《基金法》恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则安全保管委托财产，履行信义义务以及本合同约定的其他义务。

2、根据法律法规、中国证监会及证券投资基金业协会的规定和资产管理合同的约定，对管理人的投资或清算指令等进行监督。

（三）投资者声明

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

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

3、已充分理解本合同条款，了解相关权利义务，了解有关法律法规及所投资资产管理计划的风险收益特征，知晓管理人、托管人及相关机构不应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、当事人的权利和义务

（一）投资者

1、投资者的基本情况

个人填写：

姓名：证件类型：证件号码：__

通信地址：_____ 邮政编码：_____

联系电话：_____ 移动电话：_____ 电子信箱：_____

其他：_____

机构填写：

机构名称： 法定代表人：_____

通信地址：_____

邮政编码：_____

联系人：

联系电话：_____

2、投资者的权利

- (1) 分享资产管理计划财产收益；
- (2) 取得分配清算后的剩余资产管理计划财产；
- (3) 按照本合同的约定参与、退出和转让资产管理计划份额；
- (4) 根据本合同的约定，参加或申请召集资产管理计划份额持有人大会（如有），行使相关职权；
- (5) 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；
- (6) 监督管理人、托管人履行投资管理及托管义务的情况；
- (7) 法律法规、中国证监会及证券投资基金业协会规定的和资产管理合同约定的其他权利。

3、投资者的义务

- (1) 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；
- (2) 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；
- (3) 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；
- (4) 认真阅读并签署风险揭示书；
- (5) 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；

（6）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；

（7）向管理人或资产管理计划销售机构提供法律法规规定的信息资料及身份证明文件，配合管理人或其销售机构完成投资者适当性管理、非居民金融账户涉税信息尽职调查、反洗钱等监管规定的工作；

（8）不得违反资产管理合同的约定干涉管理人的投资行为；

（9）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；

（10）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；

（11）法律法规、中国证监会及证券投资基金业协会规定和资产管理合同约定的其他义务。

（二）管理人

1、管理人的基本情况

机构名称：东证融汇证券资产管理有限公司

法定代表人：李福春

住所：中国（上海）自由贸易试验区新金桥路 255 号 540 室

通信地址：上海市浦东新区杨高南路 729 号陆家嘴世纪金融广场 1 号楼 16

层

邮政编码：200135

联系人：郝笑寒

联系电话：021-20361175

2、管理人的权利

（1）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；

（2）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）；

（3）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；

(4) 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证券投资基金业协会；

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

(6) 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；

(7) 法律法规、中国证监会、证券投资基金业协会规定的及资产管理合同约定的其他权利。

3、管理人的义务

(1) 依法办理资产管理计划的销售、登记、备案事宜；

(2) 按照证券投资基金业协会要求报送资产管理计划产品运行信息；

(3) 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；

(4) 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；

(5) 制作风险揭示书，向投资者充分揭示相关风险；

(6) 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；

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

(8) 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；

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

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

(11) 除规定情形或符合规定条件外，不得为管理人、托管人及其关联方提供融资；

(12) 按照资产管理合同约定接受投资者和托管人的监督；

(13) 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；

(14) 召集资产管理计划份额持有人大会（如有），份额持有人大会设立日常机构的除外；

(15) 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；

(16) 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；

(17) 对非标准化资产（如有）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；

(18) 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；

(19) 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；

(20) 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；

(21) 根据法律法规与资产管理合同的规定，编制向投资者披露的资产管理计划季度、年度等定期报告，向证券投资基金业协会备案，并抄报中国证监会相关派出机构；

(22) 办理与受托财产管理业务活动有关的信息披露事项；

(23) 建立并保存投资者名单；

(24) 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；

(25) 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；

(26) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会相关派出机构、证券投资基金业协会并通知托管人和投资者；

(27) 法律法规、中国证监会及证券投资基金业协会规定的和资产管理合同约定的其他义务。

(三) 托管人

1、托管人的基本情况

机构名称： 宁波银行股份有限公司

住所： 宁波市鄞州区宁东路 345 号

法定代表人： 陆华裕

联系人： 王晓斐

联系电话： 025-51809809

2、托管人的权利

(1) 按照资产管理合同约定，依法保管资产管理计划财产；

(2) 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；

(3) 法律法规、中国证监会及证券投资基金业协会规定的和资产管理合同约定的其他权利。

3、托管人的义务

(1) 安全保管资产管理计划财产；

(2) 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；

(3) 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；

(4) 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；

(5) 按规定开立和注销资产管理计划的托管账户及其他投资所需账户；

(6) 复核资产管理计划资产净值和份额净值；

(7) 办理与资产管理计划托管业务有关的信息披露事项；

(8) 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；

(9) 编制托管年度报告，并向证券投资基金业协会备案，抄报中国证监会相关派出机构；

(10) 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；

(11) 管理人未按规定召集或者不能召集份额持有人大会（如有）的，由托管人召集份额持有人大会，份额持有人大会设立日常机构的除外；

(12) 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；

(13) 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；

(14) 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证券投资基金业协会；

(15) 投资于《管理办法》第三十七条第（五）项规定资产（如有）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；

(16) 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。

五、资产管理计划的基本情况

（一）资产管理计划的名称

东证融汇汇鑫 12M1 号集合资产管理计划

（二）资产管理计划的类型

固定收益类集合资产管理计划

（三）资产管理计划的运作方式

开放式

本集合计划自成立之日起每满 1 个月开放参与（参与开放期），开放期为 1 个工作日，具体开放期以每满 1 个月的对日为基准日，前后浮动不超过 7 个工作日，届时以管理人公告为准，管理人网站上发布公告即视为履行了告知义务。管

理人可根据资产配置安排和集合计划已有投资者利益的考虑进行额度控制。

本集合计划投资者参与的份额自参与确认日(募集期认购的,为本集合计划成立之日)起进入封闭运作期,封闭运作 12 个月(前后浮动不超过 7 个工作日)当月的参与开放期为份额退出日(退出开放期),投资者可申请退出(遇非工作日顺延),若投资者在份额退出日(退出开放期)未退出,则投资者该份额自动进入下一个封闭运作期,在该封闭运作期内投资者不得退出该份额,须持有至下一个份额退出日(退出开放期),法律法规及本合同另有规定的除外。

除合同变更、监管规则修订、管理人自有资金参与比例被动超限等法定事由外,本集合计划原则上不设定临时开放期。

(四) 资产管理计划的投资目标、主要投资方向、投资比例

1、投资目标

在充分考虑集合计划投资安全的基础上,以宏观经济和资产配置研究为导向,在有效控制风险的前提下,为集合计划份额持有人争取稳定的投资收益。

2、主要投资方向

本集合计划投资范围包括中国境内依法发行的国债、金融债、企业债、公司债、地方政府债、政策性金融债、可转债、可交换债、央行票据、短期融资券(含超短融)、中期票据、项目收益票据、非公开定向债务融资工具、次级债(含二级资本债)、国债期货、资产支持证券优先级、债券回购(含债券正回购和债券逆回购)、银行存款(包括银行定期存款、活期存款、协议存款、同业存款)、同业存单、大额可转让存单、货币市场基金、债券型基金。

3、投资比例

(1) 投资于债权类资产,包括国债、金融债、企业债、公司债、地方政府债、政策性金融债、可转债、可交换债、央行票据、短期融资券(含超短融)、中期票据、项目收益票据、非公开定向债务融资工具、次级债(含二级资本债)、资产支持证券优先级、同业存单、大额可转让存单、债券型基金、银行存款(包括银行定期存款、活期存款、协议存款、同业存款)、货币市场基金、债券逆回购占集合计划资产总值的比例为 80-100%;

(2) 国债期货当日保证金余额占比不超过资产管理计划资产净值的 4%;

(3) 本集合计划可以参与债券回购,本计划的总资产不得超过本计划净资

产的 200%。

(五) 资产管理计划的产品风险等级

从集合计划整体运作来看，本产品属于中低风险等级的品种。

(六) 资产管理计划的存续期限

自成立之日起，本集合计划管理期限为 10 年。本集合计划成立后，管理人有权视市场情况，决定是否提前终止。

(七) 资产管理计划份额的初始募集面值

人民币 1 元。

(八) 资产管理计划的最低初始募集规模

本集合计划的初始募集规模不得低于 1000 万元人民币，但法律法规、监管机构及自律组织另有规定的除外。

(九) 资产管理计划的分级安排

本集合计划无分级安排。

(十) 资产管理计划的份额登记、估值与核算、信息技术系统等服务机构

1、份额登记机构

东证融汇证券资产管理有限公司。

2、估值核算服务机构及信息技术系统服务机构

东证融汇为东北证券股份有限公司（以下简称“东北证券”）全资子公司，根据东证融汇与东北证券签署的《业务外包服务协议》以及《服务与支持备忘录》，东北证券为东证融汇管理的产品提供估值与核算、信息技术系统支持。

(十一) 折算

1、折算条件：任一开放日，如果集合计划单位净值不等于 1.0000 元，管理人有权对本集合计划进行份额折算。

2、折算频率：触发份额折算条件时。

3、折算原则：份额折算前后集合计划的资产净值不发生改变，份额折算后份额的单位净值为 1.0000 元。

4、折算方法： $F = NV / 1.0000$ 。

T 日为份额折算日，F 为 T 日份额折算后集合计划的份额数；NV 为 T 日集合计划资产净值。

5、折算前，以在管理人网站发布公告的方式通知全体投资者。

（十二）其他

本计划设定为均等份额。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。

六、资产管理计划的募集

（一）资产管理计划的募集

1、募集对象

本集合计划的适合募集对象为管理人和销售机构现有客户中具有匹配的风险承受能力，且认同集合计划投资理念的合格投资者，包括个人投资者和机构投资者（法律法规禁止投资集合资产管理计划的除外）。

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

（1）具有 2 年以上投资经历，且满足以下条件之一的自然人：家庭金融净资产不低于 300 万元，家庭金融资产不低于 500 万元，或者近 3 年本人年均收入不低于 40 万元；

（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、在中国证券投资基金业协会（以下简称证券投资基金业协会）登记的私募基金管理人、商业银行及其理财子公司、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。

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

2、募集方式

本计划通过管理人及管理人委托的销售机构进行募集。管理人应将集合资产管理合同、集合资产管理计划说明书等正式销售文件，置备于销售机构营业场所。销售机构应当坚持“了解产品”和“了解客户”的经营理念，了解客户的投资需求和风险偏好，加强投资者适当性管理，详细介绍产品特点并充分揭示风险，推荐与客户风险承受能力相匹配的集合计划，引导客户审慎做出投资决定。禁止通过签订保本保底补充协议等方式，或者采取虚假宣传、夸大收益和商业贿赂等不正当手段销售集合计划。

管理人及销售机构应当采取有效措施，并通过管理人、中国证券投资基金业协会、中国证监会电子化信息披露平台或者中国证监会认可的其他信息披露平台，客观准确披露集合计划备案信息、风险收益特征、投诉电话等，使客户详尽了解本集合计划的特性、风险等情况及客户的权利、义务，但不得向合格投资者之外的单位和个人募集资金，不得通过报刊、电台、电视台、互联网等公众传播媒体或者讲座、报告会、分析会、布告、传单、短信、微信、博客、电子邮件、自媒体等方式向不特定对象宣传推介。

3、募集期限

资产管理计划的募集期分为初始募集期和存续募集期。其中，初始募集期是指本集合计划自资产管理计划份额发售之日起不超过 60 个工作日的期间，具体募集时间以本集合计划销售公告为准；存续募集期以本集合计划公告为准。

（二）资产管理计划的认购

1、认购费用、认购份额的计算方式

本集合计划无认购费。

认购份额 = (参与金额 (不含认购费用) + 利息) / 计划单位面值

认购份额的计算结果以四舍五入的方法保留小数点后两位，由此产生的差额部分计入集合计划资产的损益。

2、认购申请的确认

初始募集期内，在每日 (T 日) 办理认购的交易时间结束后，管理人将对投资者认购规模实行汇总统计，当集合计划累计认购规模达到初始募集期销售公告确定规模或投资者数达到 200 人时，管理人将于次日起暂停接受参与申请。对 T 日提交的参与申请，管理人将按“时间优先”的原则，来确定参与成功的份额，

参与时间以注册登记系统的确认结果为准；当投资者参与集合计划时间相同时，按“规模优先”原则确定参与成功的份额，参与规模以集合计划管理人的确认结果为准。

3、初始认购资金的管理及利息处理方式

管理人应当将资产管理计划初始募集期间投资者的初始认购资金存入资产管理计划募集结算专用账户，在资产管理计划成立前，任何机构和个人不得动用。投资者的初始认购资金（不含认购费用）加计其在初始募集期产生的同期活期存款利息将折算为计划份额归投资者所有。利息转份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

投资者在初始募集期间的认购金额不得低于 30 万元人民币（不含认购费用）。认购资金应以货币方式支付。

（四）募集机构的募集结算专用账户和委托募集账户（如有）

1、管理人募集结算专用账户（直销）

户名：东证融汇证券资产管理有限公司直销专户

银行账号：310066580018800040554

开户行：交通银行上海市浦东分行

大额支付号：301290050844

2、代理销售机构委托募集账户（代销）

具体以管理人公告及销售机构披露为准。

七、资产管理计划的成立与备案

（一）资产管理计划成立的条件和日期

集合计划的参与资金总额不低于 1,000 万元人民币，其投资者的人数为 2 人（含）以上，且不超过 200 人，募集过程应符合法律、行政法规和中国证监会的规定。

管理人于募集金额缴足之日起 10 个工作日内聘请具有证券相关业务资格的会计师事务所对集合计划进行验资，并在取得验资报告后，公告本集合计划成立。

集合计划设立完成前，投资者的参与资金只能存入募集结算专用账户，任何机构和个人不得动用。本计划托管账户不做募集账户，管理人需在完成资金募集后，将募集资金一次性划入开立在托管人处的托管账户。

（二）资产管理计划募集失败的处理方式

集合计划初始募集期结束，在集合计划规模低于人民币 1,000 万元或投资者的人数少于 2 人条件下，集合计划设立失败，管理人以固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用，并将已认购资金及同期活期存款利息在初始募集期结束后 30 日内退还集合计划投资者。

（三）集合计划开始运作的条件和日期

1、条件：本集合计划公告成立且完成备案。

2、日期：本集合计划自成立且完成备案之日起开始运作。

管理人应当在集合计划成立之日起五个工作日内，将资产管理合同、投资者名单与认购金额、验资报告或者资产缴付证明等材料报证券投资基金业协会备案，并抄报中国证监会相关派出机构。

本集合计划完成备案前不得开展投资活动，以现金管理为目的，投资于银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券、货币市场基金等中国证监会认可的投资品种的除外。

八、资产管理计划的参与、退出与转让

（一）资产管理计划的参与

1、参与场所

本集合计划的参与将通过集合计划销售机构在销售机构指定的场所进行。

本集合计划的销售机构为东证融汇证券资产管理有限公司及其他符合条件的代销机构。

2、参与的办理时间

（1）初始募集期参与

初始募集期是指本集合计划自资产管理计划份额发售之日起不超过 60 个工作日的期间，具体募集时间以本集合计划销售公告为准。

（2）存续期参与

本集合计划自成立之日起每满一个月开放参与（参与开放期），开放期为 1 个工作日，具体开放期以每满 1 个月的对日为基准日，前后浮动不超过 7 个工作日，届时以管理人公告为准，管理人网站上发布公告即视为履行了公告义务。管

理人可根据资产配置安排和集合计划已有投资者利益的考虑进行额度控制。若出现其他特殊情况，管理人将视情况对前述开放日及时间进行相应的调整并公告。管理人网站上发布公告即视为履行了告知义务。

3、参与的原则

(1) 投资者参与本集合计划前，应当首先是管理人或销售机构的客户；

(2) 本集合计划采用纸质合同或电子签名合同。如采用电子签名合同，投资者在签署电子签名约定书，并以电子签名方式签署电子签名合同后方可参与本集合计划。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，管理人和其他销售机构应当按照有关规定对投资者提供的信息和资料进行审查并如实记录。投资者以电子签名方式接受电子签名合同（仅采用中国证券登记结算公司电子合同模式），电子合同包括本合同、集合计划说明书、风险揭示书或其他文书的，与在纸质合同、纸质风险揭示书或其他文书上手写签名或者盖章具有同等的法律效力，无须另行签署纸质合同、纸质风险揭示书或其他文书；托管人仅认可通过中国证券登记结算有限责任公司系统进行合同文本及电子数据相关传输保存。

(3) 认购“已知价”原则，即初始募集期参与价格，以集合计划认购面值1元为基准进行计算；

(4) 申购“未知价”原则，即存续期参与的价格，以受理申请当日集合计划每份额净值为基准进行计算；

(5) 采用金额参与的方式，即以参与金额申请；

(6) 初始募集期内，在每日（T日）办理认购的交易时间结束后，管理人将对投资者认购规模实行汇总统计，当集合计划累计认购规模达到1,000万份且投资者数量不低于2人时，管理人有权于次日起暂停接受参与申请；

(7) 初始募集期内，在每日（T日）办理认购的交易时间结束后，管理人将对投资者认购规模实行汇总统计，当集合计划累计认购规模达到初始募集期销售公告确定规模或投资者数达到200人时，管理人将于次日起暂停接受参与申请。对T日提交的参与申请，管理人将按“时间优先”（提交参与申请时间较早者优先确认）的原则，来确定参与成功的份额，参与时间以注册登记系统的确认结果为准；当投资者参与集合计划时间相同时，按“规模优先”（规模较大者优先确

认) 原则确定参与成功的份额, 参与规模以集合计划管理人的确认结果为准;

(8) 集合计划存续期内, 在每个开放日(T日)办理申购的交易时间结束后, 管理人将对投资者实行汇总统计, 当集合计划每次开放期累计申购规模达到每次开放公告确定的规模或投资者数达到200人时, 管理人将于次日起暂停接受参与申请。对T日提交的参与申请, 管理人将按“时间优先”(提交参与申请时间较早者优先确认)的原则, 来确定参与成功的份额, 参与时间以注册登记系统的确认结果为准; 当投资者参与集合计划时间相同时, 按“规模优先”(规模较大者优先确认)原则确定参与成功的份额, 参与规模以集合计划管理人的确认结果为准。

4、参与的程序和确认

(1) 投资者按销售机构指定营业网点的具体安排, 在规定的交易时间段内办理;

(2) 投资者应开设销售机构认可的交易账户, 并在交易账户备足认购/申购的货币资金; 若交易账户内参与资金不足, 销售机构不受理该笔参与申请;

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

(4) 投资者参与申请确认后, 其参与申请和参与资金不得撤销;

(5) 投资者于T日提交参与申请后, 可于T+2日后在办理参与的网点查询参与确认情况。

5、参与费及参与份额的计算

(1) 参与费率:

本集合计划免收参与费, 即参与费率为0。

(2) 参与份额的计算方法:

1) 初始募集期参与

参与份额 = (参与金额 (不含认购费用) + 利息) / 计划单位面值

2) 开放期参与

参与份额 = 参与金额 (不含参与费用) / 计划单位净值

投资者参与份额以四舍五入的方法保留小数点后两位, 由此产生的差额部分计入集合计划资产的损益。

6、参与资金利息的处理方式

投资者的参与资金（不含参与费用）在初始募集期产生的利息将折算为计划份额归投资者所有。

7、参与金额的限制

投资者在集合计划开放期购买资产管理计划份额的，投资者应符合合格投资者标准，且参与金额应满足资产管理计划最低参与金额限制（不含参与费用），已持有资产管理计划份额的投资者在存续期开放日追加购买资产管理计划份额的除外。

首次参与的最低金额为人民币 30 万元（不含参与费用），超过最低参与金额的部分不设金额级差；追加参与的最低金额为人民币 1 万元，超过部分不设金额级差。

投资者以货币方式支付参与金额。

8、拒绝或暂停参与的情形及处理

发生下列情形时，管理人可以拒绝或暂停受理投资者的参与申请：

- （1）因不可抗力导致集合计划无法正常运转；
- （2）发生本合同约定的暂停集合计划资产估值情况时，管理人可暂停接受投资者的参与申请；
- （3）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；
- （4）接受某笔或某些参与申请可能会影响或损害现有计划投资者利益时；
- （5）计划资产规模过大，使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，或其他损害现有计划投资者利益的情形；
- （6）管理人、托管人、销售机构或登记机构的异常情况导致销售系统、登记系统或会计系统无法正常运行；
- （7）法律、行政法规和中国证监会认定的其他情形或其他在本合同及说明书中载明的特殊情形。

发生上述情形之一的，管理人将在当日立即公告。

（二）资产管理计划的退出

1、退出场所

本集合计划在存续期间的退出将通过集合计划销售机构在销售机构指定的场所进行。

2、退出的办理时间

本集合计划投资者参与的份额自参与确认日(募集期认购的,为本集合计划成立之日)起进入封闭期,封闭运作12个月(前后浮动不超过7个工作日)当月的参与开放期为份额退出日(退出开放期),投资者可申请退出,若投资者在份额退出日(退出开放期)未退出,则投资者该份额自动进入下一个封闭期,在该封闭期内投资者不得退出该份额,须持有至下一个份额退出日(退出开放期),法律法规及本合同另有规定的除外。

特别风险提示:在本集合计划份额封闭期内,投资者存在无法退出的流动性风险。对本集合计划的每一份额而言,其一个封闭期为12个月(前后浮动不超过7个工作日,具体以管理人公告为准),法律法规及本合同另有规定的除外。

若出现合同变更、监管规则修订、管理人自有资金参与比例被动超限等法定事由,管理人将公告临时退出开放期,投资者可在临时退出开放期退出本集合计划。临时退出开放期的具体安排以管理人公告为准。管理人网站上发布公告即视为履行了告知义务。

管理人在法律法规允许的情况下可以根据情况宣布提前结束或延期结束开放期。开放期的具体日期以管理人公告为准。若出现其他特殊情况,管理人将视情况对前述开放日及时间进行相应的调整并公告。管理人网站上发布公告即视为履行了告知义务。

3、退出的原则

(1) “未知价”原则,即退出集合计划的价格以退出申请日(T日)集合计划每份额净值为基准进行计算;

(2) 采用份额退出的方式,即退出以份额申请;

(3) 本计划份额退出的时候采用“先进先出”原则;

集合计划管理人可根据集合计划运作的实际情况并在不影响投资者实质利益的前提下调整上述原则。此集合计划退出原则更改将遵循合同变更的相关程序。

4、退出的程序和确认

(1) 退出申请的提出

投资者必须根据本集合计划销售机构网点规定的手续，在开放日的业务办理时间内向销售机构网点提出退出申请。申请退出份额数量超过投资者持有份额数量时，申请无效。

(2) 退出申请的确认

管理人以收到退出申请的当天作为退出申请日（T日），在T+1日内对该交易的有效性进行确认，确认有效后，投资者可在T+2日之后（包括该日）向原销售网点或销售机构指定的网络系统查询退出申请的成交情况，并在原销售网点打印成交确认单。在发生巨额退出及连续巨额退出时，参照本合同巨额退出以及连续巨额退出的处理办法。

(3) 退出款项划付

投资者退出申请确认后，管理人将指示托管人把退出款项从集合计划托管专户划往注册登记机构，再由注册登记机构划往各销售机构，并通过销售机构划往申请退出投资者的指定账户，退出款项将在T+2日内从托管账户划出。如集合计划出现暂停估值的情形时，管理人与托管人协商后，可以将划拨日期相应顺延。

由于交易所或交易市场数据传输延迟、通讯系统故障、银行数据交换系统故障或其它非管理人及托管人所能控制的因素影响业务处理流程，则退出款顺延至管理人及托管人无法控制的因素消除后划往投资者账户。

5、退出费及退出金额的计算

(1) 退出费用

本集合计划免收退出费，即退出费率为0。

(2) 退出金额的计算方法

退出金额=退出份额×单位净值-业绩报酬（如有）

退出金额计算结果保留到小数点后两位，第三位四舍五入。

6、退出金额的限制

投资者部分退出资产管理计划的，其退出后持有的资产管理计划份额净值应当不低于本合同规定的合格投资者最低参与金额。投资者持有的资产管理计划份额净值低于规定的最低投资金额时，需要退出资产管理计划的，应当一次性全部退出；投资者没有一次性申请全部退出的，管理人或注册登记机构有权对该投资者所持有的全部份额做退出处理。本集合计划不设退出次数限制。

7、单个投资者大额退出的认定、申请和处理方式

本集合计划不设大额退出限制条款。

8、巨额退出的认定和处理方式

(1) 巨额退出的认定

单个开放日，投资者当日累计净退出申请份额（退出申请总份额扣除参与申请总份额之后的余额）超过上一工作日计划总份额数的 10%时，即为巨额退出。

(2) 巨额退出的顺序、价格确定和款项支付

发生巨额退出时，管理人可以根据本集合计划当时的资产组合状况决定全额退出、部分延期退出或暂停退出。

1) 全额退出：当管理人认为有足够能力支付投资者的全额退出申请时，按正常退出程序办理。

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

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

(3) 告知客户的方式

当发生巨额退出并采用超额部分延期退出或者发生暂停退出情形时，管理人应及时通过管理人指定网站（www.nesc.cn）或代销机构网点刊登公告，或以电子邮件、书面邮寄、传真等方式通知投资者，说明有关处理方法。

9、连续巨额退出的认定和处理方式

(1) 连续巨额退出的认定

如果本集合计划连续 2 个开放日发生巨额退出,即认为发生了连续巨额退出。

(2) 连续巨额退出的顺序、价格确定和款项支付

本集合计划发生连续巨额退出,管理人可按说明书及资产管理合同载明的规定,暂停接受退出申请,但暂停期限不得超过 20 个工作日;已经接受的退出申请可以延缓支付退出款项,但不得超过正常支付时间 20 个工作日,并在管理人指定网站上进行公告。

(3) 告知客户的方式

当发生连续巨额退出并采用超额部分延期退出或者发生暂停退出情形时,管理人应及时通过管理人指定网站 (www.nesc.cn) 或代销机构网点刊登公告,或以电子邮件、书面邮寄、传真等方式通知投资者,说明有关处理方法。

10、拒绝或暂停退出的情形及处理

发生下列情形时,管理人可以拒绝或暂停受理投资者的退出申请:

(1) 不可抗力的原因导致集合计划无法正常运转;

(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) 管理人认为接受某笔或某些退出申请可能会影响或损害现有投资者利益时;

(4) 因市场剧烈波动等原因而出现连续巨额退出,或者其他原因,导致本集合计划的现金出现困难时,管理人可以暂停接受集合计划的退出申请;

(5) 法律、行政法规和中国证监会认定的其他情形或其他在本合同及说明书中载明的特殊情形。

发生上述情形之一的,管理人将在当日立即公告。已接受的退出申请,若管理人有足额支付能力,则管理人将足额支付;如暂时不能足额支付的,将按每个退出申请人已被接受的退出申请量占已接受退出申请总量的比例分配给退出申请人,其余部分在后续工作日予以兑付。发生拒绝或暂停受理退出的情形时,管理人应将拒绝或暂停受理退出的原因和处理办法在管理人网站进行信息披露。在暂停退出的情况消除时,管理人应在不超过正常支付时间 20 个工作日内及时恢复退出业务的办理。

(三) 资产管理计划的转让、非交易过户和冻结

1、资产管理计划份额的转让

集合计划存续期间,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,向合格投资者转让集合计划份额,份额转让应遵守交易场所相关规定及要求,并按规定办理份额变更登记手续。受让方首次参与集合计划,应先与管理人、托管人签订集合资产管理合同。转让后,持有资产管理计划份额的合格投资者合计不得超过二百人。

2、资产管理计划份额的非交易过户

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。集合计划注册登记机构只受理因继承、捐赠、司法强制执行、以及其他符合规定的情况下的计划份额非交易过户。对于符合条件的非交易过户申请按登记结算机构的有关规定办理。

3、资产管理计划份额的冻结

集合计划登记结算机构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。

(四) 管理人自有资金参与资产管理计划

1、管理人自有资金参与的条件、方式、金额和比例

在初始募集期和存续期,管理人可以以自有资金参与本集合计划。管理人自有资金参与本集合计划的份额,不超过本集合计划总份额的16%。

2、管理人自有资金退出的条件

管理人以自有资金参与本集合计划,承诺持有期限不少于6个月。管理人在参与和退出时,将提前5个工作日通过管理人网站告知客户和资产托管机构。

3、在存续期,为应对集合计划巨额赎回,解决流动性风险,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或退出集合计划可不受上述规定限制,事后管理人及时告知客户和资产托管机构,并向住所地中国证监会派出机构及中国证券投资基金业协会报告。

为应对集合计划巨额赎回,解决流动性风险,管理人有权设置特定开放期,自行安排自有资金参与或退出集合计划。

4、管理人自有资金参与部分的收益分配

管理人自有资金参与份额与投资者持有计划份额享有同等参与收益分配的权利，也有承担与计划份额相对应损失的责任。

5、管理人自有资金参与集合计划被动超限的处理原则

管理人自有资金参与本集合计划的份额，不得超过本集合计划总份额的 16%。因集合计划规模变动等客观因素导致自有资金参与集合计划被动超限的，管理人应当在 10 个工作日内设立临时开放期，退出被动超限部分，依法及时调整。

(五) 资产管理计划投资者变更情况报送

管理人应当根据《指导意见》、《管理办法》、《运作规定》等相关规定，定期将资产管理计划投资者变更情况报送证券投资基金业协会。

九、资产管理计划份额持有人大会及日常机构

集合计划投资者、管理人、托管人一致同意，本集合计划不设置份额持有人大会及日常机构，不召开份额持有人大会。

十、资产管理计划份额的登记

(一) 本集合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，具体内容包括投资者账户管理、份额注册登记、清算及交易确认、收益分配、建立并保管集合计划客户资料表、办理非交易过户等。

(二) 本集合计划份额的注册登记机构由东证融汇证券资产管理有限公司担任。

(三) 注册登记机构履行如下职责：

- 1、建立和保管投资者账户资料、交易资料、资产管理计划客户资料表等，并将客户资料表提供给管理人；
- 2、配备足够的专业人员办理本集合计划的注册登记业务；
- 3、严格按照法律法规和本合同规定的条件办理本集合计划的注册登记业务；
- 4、接受管理人的监督；
- 5、依法保存投资者名称、身份信息、份额明细、相关的参与和退出等业务记录和登记数据；
- 6、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集合计划带来的损失，须承担相应的赔偿责任，但法律法规或监管机构另有规定的除

外；

- 7、按本合同为投资者提供集合计划收益分配等其他必要的服务；
- 8、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；
- 9、法律法规规定的其他职责。

注册登记机构履行上述职责后，有权取得注册登记费。

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

十一、资产管理计划的投资

(一) 投资目标

在充分考虑集合计划投资安全的基础上，以宏观经济和资产配置研究为导向，在有效控制风险的前提下，为集合计划份额持有人争取稳定的投资收益。

(二) 投资范围及比例

1、投资范围

本集合计划投资范围包括中国境内依法发行的国债、金融债、企业债、公司债、地方政府债、政策性金融债、可转债、可交换债、央行票据、短期融资券（含超短融）、中期票据、项目收益票据、非公开定向债务融资工具、次级债（含二级资本债）、国债期货、资产支持证券优先级、债券回购（含债券正回购和债券逆回购）、银行存款（包括银行定期存款、活期存款、协议存款、同业存款）、同业存单、大额可转让存单、货币市场基金、债券型基金。

2、投资比例

(1) 投资于债权类资产，包括国债、金融债、企业债、公司债、地方政府债、政策性金融债、可转债、可交换债、央行票据、短期融资券（含超短融）、中期票据、项目收益票据、非公开定向债务融资工具、次级债（含二级资本债）、资产支持证券优先级、同业存单、大额可转让存单、债券型基金、银行存款（包括银行定期存款、活期存款、协议存款、同业存款）、货币市场基金、债券逆回购占集合计划资产总值的比例为 80-100%；

(2) 国债期货当日保证金余额占比不超过资产管理计划资产净值的 4%；

(3) 本集合计划可以参与债券回购，本计划的总资产不得超过本计划净资产的 200%。

上述投资比例符合《运作规定》组合投资的要求。

如因一级市场申购发生投资比例超标，应自申购证券可交易之日起 10 个交易日内将投资比例降至许可范围内；如因证券市场波动、证券发行人合并、资产管理计划规模变动等证券公司之外的因素，造成集合计划投资比例超标，管理人应在超标发生之日起在具备交易条件的 15 个交易日内将投资比例降至许可范围内。确有特殊事由未能在规定时间内完成调整的，管理人应当及时向其所在地中国证监会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集合计划投资其他品种的，资产管理人在与托管人协商一致并履行合同变更程序后，可以将其纳入本计划的投资范围。

(三) 风险收益特征

从集合计划整体运作来看，本产品属于中低风险等级的产品。

(四) 业绩比较基准

本集合计划不设置业绩比较基准。

(五) 投资策略

1、决策依据

集合计划以国家有关法律、法规和本合同的有关规定为决策依据，并以维护集合计划投资者利益作为最高准则。具体决策依据包括：

(1) 《指导意见》、《管理办法》、《运作规定》、《集合资产管理合同》、《说明书》等有关法律性文件。

(2) 宏观经济发展态势、微观经济运行环境和证券市场走势。

(3) 利率走势与通货膨胀预期。

(4) 地区及行业发展状况。

(5) 发债主体信用分析和上市公司价值发现。

(6) 投资对象收益和风险的配比关系。本计划将在充分权衡投资对象的风险和收益的前提下做出投资决策。

2、决策程序

本计划的投资程序具体为：管理人董事会下设的业务决策小组决定证券资产

管理业务阶段性投资策略和资产配置方案；投资部门负责组织落实具体产品的投资策略及资产配置方案；投资经理拟定投资策略进行战术性的投资操作；交易部门执行具体交易计划。

(1) 业务决策小组负责确定证券资产管理业务阶段性投资策略和资产配置方案。业务决策小组通过定期和不定期的会议，对宏观经济形势和证券市场走势等进行综合分析，确定证券资产管理业务阶段性投资策略和资产配置方案。

(2) 投资部门负责根据业务决策小组确定的投资策略及资产配置方案，组织落实具体产品的投资策略及资产配置方案。

(3) 投资经理负责根据业务决策小组及投资部门制订的投资策略，结合产品合同约定，在授权范围内，组织拟定投资组合方案，进行投资操作。

(4) 交易部门依据投资经理的投资指令在集合计划专用交易单元实施投资交易。交易部门收到交易指令并对其合规性和操作性进行检查后，如果符合要求立即执行交易指令。若发现有违反监管法规或公司制度的交易指令将拒绝执行并反馈。

3、投资管理方法和标准

委托资产的管理方式为投资者向管理人委托资金，由管理人按照本合同约定进行投资管理。委托资金的投资及核算与管理人自有资产及管理人管理的其他资产相互独立。

投资者授权管理人在本合同的约定的投资范围、委托期限以及投资限制内进行投资管理。管理人不对投资者的本金和收益做出任何承诺和保证。

4、投资策略

(1) 债券等固定收益类投资策略

集合计划的固定收益类投资品种主要有政府债券、企业债等中国证监会认可的金融工具。在适度保持本集合计划流动性的基础上争取稳定的收益。

管理人对宏观经济和未来市场利率水平的分析，动态调整投资组合的平均久期；在此基础上，通过对债券市场收益率期限结构进行分析，对不同期限的债券进行配置；对于不同期限不同类型的债券，将根据信用风险、税赋水平、市场流动性、市场风险等因素选择投资品种；在确定投资品种后，通过对债券市场收益率期限结构的分析，确定各债券品种的配置比例。

（2）可转换债券投资策略

先分别计算纯债部分理论价值与含权部分的理论价值，从而得到可转债的理论价值，然后结合正股基本面因素、市场可转债溢价率因素判断其价值。选择具有良好盈利能力和成长前景的上市公司的可转债，并进行重点投资。基于资金安全性的考虑，本集合计划也关注转债的纯债券价值和转股溢价的平衡，选择有一定债券价值支撑、转股溢价适中的品种。

（3）基金投资策略

本计划对各类证券投资基金进行精选，积极主动选取具有核心竞争优势的证券投资基金。

（4）现金类管理工具投资策略

本集合计划将投资于银行存款（包括银行定期存款、活期存款、协议存款、同业存款）、货币市场基金、债券逆回购、到期日在1年内（含1年）的政府债券、到期日在1年内（含1年）的央行票据等高流动性短期金融产品来保障资产的安全性和流动性。

（5）资产支持证券的投资策略

资产支持证券定价受多种因素影响，包括市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率等。本集合计划将深入分析上述基本面因素，并辅助数量化定价模型，评估其内在价值。

（6）国债期货投资策略

本集合计划投资国债期货仅限于对冲所投资的固定收益类资产现货价值，以套期保值为目的，以更好的实现本集合计划的投资目标。

（六）投资限制与禁止行为

1、投资限制

为维护投资者的合法权益，本集合计划的投资限制为：

（1）不得投资于债券主体评级及债项评级均在 AA（不含）以下的债券（注：依据的评级机构不包括中债资信，本条不适用于无主体评级或/且无债项评级的债券）；

（2）不得投资于交易所或银行间市场之外的资产支持证券；

（3）不得投资于底层资产包含资管产品或其收受益权的资产支持证券，不

得投资于资产支持证券的次级份额；

(4) 投资范围不得超出本合同的约定；

(5) 本计划的总资产不得超过本计划净资产的 200%；

(6) 投资于同一资产的资金，不得超过计划资产净值的 25%；管理人管理的全部私募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；

(7) 参与债券、可转换公司债券、可交换公司债券等证券发行申购时，所申报的金额不得超过计划的总资产，所申报的数量不得超过拟发行公司本次发行的总量；

(8) 不得从事证券法规规定和集合计划管理合同约定禁止从事的其他投资。如法律法规或监管部门修改或取消上述限制，经管理人、托管人书面协商一致，并履行公告程序后，本集合计划可相应调整投资组合限制的规定。

2、禁止行为

本集合计划的禁止行为包括：

(1) 违规将集合计划资产用于资金拆借、贷款、抵押融资或者对外担保等用途；

(2) 将集合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) 挪用集合计划资产；

(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) 使用集合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。

(七) 资产管理计划的建仓期

本集合计划管理人将在集合计划成立之日起 6 个月内使集合计划的投资组

合比例符合以上约定。建仓期的投资活动，应当符合本合同约定的投向和本集合计划的风险收益特征。以现金管理为目的，投资于银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券、货币市场基金等中国证监会认可的投资品种的除外。

（八）资产管理计划的特定风险

集合计划存续期间，为规避特定风险，经全体投资者同意后，投资于固定收益类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%。

“特定风险”主要指市场趋势性风险，例如，基于股市、债市、衍生品市场风险判断，调整资产配置比例。

（九）资产管理计划的流动性安排

本计划开放退出期内，其资产组合中7个工作日可变现资产的价值，不低于该计划资产净值的10%。主动投资于流动性受限资产的市值在开放退出期内合计不得超过该资产管理计划资产净值的20%。

（十）资金前端控制

证券交易所、中国结算在每个交易日实施资金前端控制。

管理人（作为“交易参与者”）向托管人（作为“结算参与者”）提供资金前端控制最高额度相关信息，由结算参与者向中国结算申报。中国结算接收结算参与人的申报信息，依据最高额度计算标准对最高额度进行有效性校验后发送证券交易所。管理人应当在最高额度以内向交易所申报资金前端控制自设额度。证券交易所根据管理人申报的符合要求的自设额度，对其相关交易单元实施资金前端控制。管理人可以对其资金前端控制的最高额度与自设额度等信息进行调整；经管理人授权，托管人可以对其资金前端控制的最高额度进行调整。

管理人、托管人应当按照证券交易所、中国结算的要求，及时申报有关信息，确保申报信息真实、完整、有效，切实履行资金前端控制各项职责。

证券交易所、中国结算依据业务规则的有关规定，根据管理人、托管人申报的额度信息实施资金前端控制，如交易参与者、结算参与者故意或重大过失造成本计划损失的，由管理人、托管人根据各自过错承担相应的损失。

（十一）期货投资保证金的流动性应急处理机制

1、应急触发条件

管理人收到追加保证金及/或强行平仓通知后, 管理人未有足够的现金资产及时追加保证金到位或预计难以按要求自行减仓时, 触发期货保证金的流动性应急处理机制。

2、保证金补充机制

如出现保证金不足的情况时, 管理人将首先运用计划资产从市场上拆借资金; 如仍不能满足保证金缺口的, 管理人将及时变现计划资产, 变现时应重点考虑变现资产的流动性, 以最大限度的降低损失。

3、损失责任承担

因管理人超限交易且未在规定时间内调整等违法违规行为而造成的计划资产损失, 管理人应赔偿, 但管理人不承担委托资产的变现损失及未及时追加保证金的损失(包括穿仓损失)。对于其他相关方的原因给投资者造成的损失, 由过错责任方承担赔偿责任, 但管理人应代表计划投资者的利益向过错方追偿。投资者同意并确认, 有关期货交易中各方的权利义务及违约赔偿等事项, 以管理人代表计划与各方签订的相关协议为准。

十二、投资顾问

本集合计划未聘请投资顾问

十三、分级安排

本集合计划非分级资产管理计划, 不设分级安排。

十四、利益冲突及关联交易

(一) 利益冲突

1、利益冲突的情形

(1) 全体投资者一致同意, 管理人可以将本计划的资产投资于管理人、托管人及其控股股东、实际控制人或者其他关联方发行的证券或承销期内承销的证券, 或者从事其他重大关联交易, 可能存在利益冲突的情况;

(2) 鉴于管理人目前开展资产证券化业务, 存在管理人管理的资产管理计划账户以及管理人作为投资顾问管理的资产管理计划账户(如有)投资于管理人

发行或即将发行的资产支持证券及其原始权益人发行的股票、债券等资产的情况；

(3) 鉴于管理人目前开展股票质押式回购业务，存在管理人管理的资产管理计划账户以及管理人作为投资顾问管理的资产管理计划账户（如有）投资于股票质押式回购业务标的股票涉及的上市公司股票、债券等资产的情况；

(4) 法律法规、中国证监会等监管机构规定的其他情形。

2、利益冲突的处理方式及披露

(1) 当管理人利益与投资者利益冲突时，以保护投资者利益为原则；

(2) 当投资者之间利益冲突时，以公平对待为原则；

(3) 如发生利益冲突情形，管理人认为确有必要的，应及时将利益冲突具体情形及处理方式向投资者进行公告。

(二) 关联交易

管理人、托管人应于合同生效前向对方提供关联方名单，并在合同期限内根据变化及时更新关联方名单。若管理人或托管人没有及时提供关联方信息，导致托管人或管理人无法及时对关联方证券进行监督，所产生的一切后果，由关联方信息提供方承担。

投资者在此同意并授权管理人可以将集合计划的资产投资于管理人、托管人及管理人、托管人的控股股东、实际控制人或者其他关联方发行的证券或承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易。管理人应当遵循客户利益优先原则，事后通过管理人的网站告知投资者和托管人，并向管理人所在地中国证监会派出机构和证券投资基金业协会报告，投资于证券期货（如涉及）的关联交易还应当向证券期货交易所报告。

十五、投资经理的指定与变更

(一) 投资经理的指定

1、投资经理的指定

集合计划投资经理由管理人负责指定。

2、本计划投资经理

本计划投资经理为余冠蓉、郭晓娜。

投资经理简历：

余冠蓉女士，兰州大学经济学学士，佩斯大学投资管理学硕士，2014年开始从事证券行业相关工作，有丰富的固收类投资组合管理经验，擅长深挖主体信用并有效搭配杠杆与久期，已取得基金从业资格并在中国证券投资基金业协会完成注册，无兼职工作。2014年6月至2015年6月，在财通证券资产管理有限公司固定收益部担任产品经理，2015年8月至2017年9月在财通证券资产管理有限公司担任投资经理助理，2017年10月至2019年3月在财通证券资产管理有限公司担任投资经理。2019年4月至2020年8月在红塔证券股份有限公司固定收益部担任投资经理。于2020年9月加入东证融汇证券资产管理有限公司，现任职东证融汇固定收益总部副总经理、投资经理（证书编号:F5620000000104），未曾被监管机构采取行政监管措施、行政处罚。

郭晓娜女士，河南大学计算机科学与技术学士，首都经济贸易大学金融学硕士，证券资产管理从业年限10年，2010年9月加入东北证券股份有限公司，历任东北证券股份有限公司上海分公司高级项目经理；2014年8月至2015年12月底，担任东北证券上海分公司投资主办人，管理定向产品的投资运作事宜；2016年1月至2019年3月，担任东证融汇证券资产管理有限公司交易部固定收益交易员；2019年4月至今，在固定收益总部从事投资研究、投资管理等相关工作（证书编号：Z0110116060041），且在债券、基金等固定收益投资相关领域具有较为丰富的投研经验，已取得基金从业资格并在中国证券投资基金业协会完成注册，无兼职工作，未曾被监管机构采取行政监管措施、行政处罚。

（二）投资经理的变更

管理人可根据业务需要变更投资经理，并在变更后五个工作日及时告知投资者。管理人在网站公告前述调整事项即视为履行了告知义务。

十六、资产管理计划的财产

（一）资产管理计划财产的保管与处分

1、资产管理计划财产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。

2、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。

3、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。

4、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。

5、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。

（二）资产管理计划财产相关账户的开立和管理

托管人按照规定开立资产管理计划财产的托管专户和证券账户，由管理人根据投资需要按照规定开立基金账户，资产投资者和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。托管专户名称为：“东证融汇汇鑫 12M1 号集合资产管理计划”，具体名称以实际开立为准。托管人根据有关规定以二级户的形式为委托资产开立专门用于保管货币形式存在的委托资金及清算交收的银行账户。二级户的预留印鉴以一级账户的预留印鉴为准。该账户应遵循托管人的《单位银行结算账户管理协议》规定。托管专户由托管人根据本合同规定进行保管和使用，托管专户的开立需遵循开户机构的相关规定。委托财产的一切货币收支活动均通过该资金账户进行，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。托管专户利息归托管的资产管理计划所有。证券账户名称应当是“东证融汇证券资管—宁波银行—东证融汇汇鑫 12M1 号集合资产管理计划”（账户名称以实际开立账户名称为准）。集合计划托管专户及证券账户，与集合计划管理人、集合计划托管人、集合计划销售机构和集合计划注册登记机构自有财产的账户以及其他集合计划和其他客户财产的账户相互独立。托管专户利息归托管的资产管理计划所有。托管账户内的银行存

款利率每半年或遇到重大市场调整时，如有需要，双方可对账户利率进行重新议价。

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

集合计划账户、专用交易单元应由集合计划管理人报证券交易所、证券登记结算机构备案。

银行存款（包括协议存款）账户其预留印鉴必须有一枚托管人指定印章，管理人与托管人就具体操作流程应协商一致方可办理存款协议，协议存款或定期存款协议中应明确注明存款到期本息应划回托管账户。委托资产投资银行存款，管理人应与存款机构签订银行存款协议，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账户（明确户名、开户行、账号等），不得划入其他任何账户”。并依据本协议交接原则对存单交接流程予以明确，如银行存款协议中未体现前述条款，托管人有权拒绝银行存款投资的划款指令。存款行或管理人应当于存单开立之日起 5 个工作日内将存款证实书原件交由托管人保管，除非存款协议中规定存款证实书由存款行保管或存款协议作为存款支取的依据，存单交接原则上采用存款行或管理人上门服务的方式。对于跨行存款，管理人需对跨行存款的利率政策风险、存款行的选择及存款协议承担责任，并应先行确认授权送、取存单人员的身份信息，并提前 3 个工作日与托管人就存单的交接进行沟通，管理人承诺对交接给托管人保管的存款证实书的真实性、完整性负责。

（三）资产管理计划资产的构成

集合计划的资产包括集合计划所拥有的各类有价证券、银行存款本息、其他应收的款项以及其他投资等的价值总和。

其主要构成是：银行存款及其应计利息；清算备付金及其应计利息；应收证券交易清算款；应收参与款；交易保证金及其应计利息；其他根据有关规定缴纳的保证金；债券、基金投资及其分红或应收利息、应收红利；其他资产等。

（四）交易及交收清算：

资产管理人和资产托管人在委托财产场内清算交收及相关风险控制方面的职责按照签署的《托管银行资金结算规定》的要求执行。

十七、投资指令的发送、确认和执行

（一） 资金划拨方式

托管人根据管理人指定的被授权人出具的投资指令通过传真、电子邮件发送扫描件（常规方式）或其它双方书面认可的方式划拨本托管账户项下的资金。

（二） 交易清算授权

管理人应提前三个工作日以书面形式通知托管人有权发送投资指令的人员（下称“指令发送人员”）名单，授权通知应注明相应的权限，授权生效时间、预留印鉴和授权人签章样本。授权通知书（以下简称“授权通知”）应由管理人加盖公章并由法定代表人或其授权签字人签署，若由授权签字人签署，还应附上法定代表人的授权书。管理人发出授权通知后向托管人电话确认。管理人、投资者和托管人对授权通知负有保密义务，其内容不得向授权人及相关操作人员以外的任何人泄露。

授权通知自其中注明的生效日期起开始生效。若托管人收到授权通知的日期晚于其中注明的生效日期，授权通知自托管人收到的日期起开始生效。授权通知应以原件形式送达托管人。

若管理人同时向托管人出具了资产管理业务统一交易清算授权书和单个资管计划交易清算授权书的，授权书以以下第（1）种方式为准：

（1） 统一授权书：

（2） 单个资管计划授权书。

（三） 投资指令的内容

投资指令是管理人在运用、分配委托资产时，向托管人发出的资金划拨及其他款项收付的指令（以下简称“指令”）。管理人发给托管人的指令应写明款项事由、支付时间、金额、账户等，加盖预留印鉴并有指令发送人员签章。有效指令是指指令要素（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的指令。

（四） 投资指令的发送、确认、执行与拒绝执行情形和处理程序

投资指令由授权通知确定的指令发送人员代表管理人用传真、电子邮件发送

扫描件的方式或其他托管人和管理人书面确认的方式向托管人发送。资产管理人发送指令的传真号码为：021-20361277；021-20361084；021-20361038，邮箱地址为：1013353815@qq.com；1400200827@qq.com；233113383@qq.com；1013353815@qq.com；1400200827@qq.com；233113383@qq.com；763431866@qq.com；236738480@qq.com；sunshuy@nesc.cn；gaosijia@nesc.cn；zhu_xf@nesc.cn；394872084@qq.com（或资产管理人以书面的形式另行提供）。

管理人有义务在发送指令后及时与托管人进行电话确认，并以电话确认结果作为指令送达结果，因管理人过失未能及时与托管人进行指令电话确认，致使资金未能及时到账所造成的损失由管理人承担。托管人根据授权通知，对指令的预留印鉴、签字章样本等进行审核，审核无误后方可执行指令。对于指令发送人员发出的指令，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指令，指令发送人员应按照其授权权限发送指令。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。管理人发送有效指令的截止时间为每一个交易日的 15:00。对于中国结算实行 T+0 非担保交收的业务，管理人应在交易日 14:00 前将划款指令发送至托管人。如管理人要求当天某一时点到账，则交易结算指令需提前 2 个工作小时发送（资产托管人工作时间为 8:30-11:30，13:30-17:00）。管理人在上述截止时间之后发送的指令，托管人尽力配合执行，但不保证划款成功。由管理人过失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。托管人对于管理人提供的相关合同、交易凭证或其他证明材料的投资方向、金额、入账账户等要素是否与划款指令记载相符进行审查，管理人应保证书面提供的资金用途说明、相关交易合同、投资凭证（加盖有效业务往来章）的真实性、有效性、完整性。

管理人发送投资指令时应同时向托管人发送必要的投资合同、费用发票（如有）等划款证明文件的复印件并对发送的上述文件资料的合法性、真实性、完整性和有效性负责。托管人确认收到管理人发送的指令后，应对指令进行审查，验证指令的要素是否齐全，并在其承诺监督范围内审查投资指令是否违反法律法规及本合同约定，传真指令还应审核印鉴和签章是否和预留印鉴和签章样本记载相

符，指令复核无误后应在规定期限内及时执行。

管理人向托管人下达指令时，应确保托管账户有足够的资金余额，对管理人在没有充足资金的情况下向托管人发出的指令，托管人可不予执行，并立即通知管理人。托管人在收到有效指令后，将对于同一批次的指令随机执行，如有特殊支付顺序，管理人应以书面、电话形式或其他双方认可的方式提前告知。

管理人若修改或要求停止执行已经发送的指令，应先与托管人电话联系，若托管人还未执行，管理人应重新发送修改指令或在原指令上注明“停止执行”字样并由指令发送人员签章后按照划款指令的一般程序向托管人发送该指令，托管人收到修改或停止执行的指令后，将按新指令执行；若托管人已执行原指令，则应与管理人电话说明。

在正常业务受理渠道和指令规定的时间内，因资产托管人原因未能及时或正确执行合法合规的指令而导致资产管理计划受损的，托管人应承担相应的责任，但如遇到不可抗力或本协议另有约定的情况除外。托管人在指令规定时间内正确执行管理人的合法指令造成的委托资产的损失，由其他过错责任方承担赔偿责任；对于执行指令过程中由于本协议当事人以外的第三方原因对委托资产造成的损失，由其他过错责任第三方承担赔偿责任。

管理人未将拟投资产品的相关合同、协议等文件资料提供托管人的，托管人有权拒绝执行管理人的相关指令。

（五） 管理人发送错误指令的情形和处理程序

管理人发送错误指令的情形包括指令发送人员无权或超越权限发送指令及交割信息错误，指令中重要信息模糊不清或不全，未按照本合同约定的传真号码、邮箱地址或双方认可的其他形式发送指令等。

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。托管人按资产管理人最后确认的正确指令执行。如因管理人未及时发出撤销指令或未及时与托管人进行确认导致托管人按照管理人原先发出的有效指令执行从而对本委托资产造成损失，由管理人承担相应赔偿责任。

（六） 更换投资指令被授权人的程序

管理人若变更授权通知(包括但不限于变更指令发送人员、权限、预留印鉴、

签章样本等)，应当至少提前 1 个工作日将变更授权通知原件送达托管人，并电话通知托管人；变更授权通知的文件应由管理人加盖公章并由法定代表人或其授权签字人签署，若由授权签字人签署，还应附上法定代表人的授权书。新授权通知自其中注明的生效日期起开始生效，原授权通知失效。若托管人收到新授权通知的日期晚于新授权通知中注明的生效日期，新授权通知自托管人收到的日期起开始生效，原授权通知相应失效。管理人、投资者和托管人对授权通知的变更负有保密义务，其内容不得向授权人及相关操作人员以外的任何人泄露。新授权通知应以原件形式送达托管人。

（七） 投资指令的保管

管理人发送划款指令时，无需同时提交银行柜台转账凭证原件，托管人审核划款指令及相关业务文件后办理划款。

托管人收到的传真件、扫描件或其它双方书面认可的方式效力等同于原件，如其与原件不一致，以传真件、扫描件或其它双方书面认可的方式为准。投资指令原件由管理人保管。

十八、越权交易

（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投资者的授权而进行的投资交易行为，包括：

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

管理人应在有关法律法规和本合同规定的权限内运用资产管理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、从事投资。

（二）越权交易的处理程序

- 1、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，发现管理人的投资指令违反法律法规的规定，或者违反本合同约定的，应当拒绝执行，立即通知管理人并有权报告中国证监会。

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投资指令违反法律、行政法规和其他规定，或者违反本合同约定的，应当立即通知

资产管理人并及时报告中国证监会。

管理人应向投资者和托管人主动报告越权交易。在限期内，投资者和托管人有权随时对通知事项进行复查，督促管理人改正。管理人对投资者和托管人通知的越权事项未能在限期内纠正的，托管人应报告中国证监会。

2、法律法规禁止的超买、超卖行为

托管人在行使监督职能时，如果发现资产管理计划财产投资证券过程中出现超买或超卖现象，应立即提醒资产管理人，由资产管理人负责解决，由此给资产托管人及资产管理计划财产造成的损失由资产管理人承担。如果因非托管人的原因发生超买行为，管理人必须于超买日次一交易日上午 10:00 前完成融资，确保完成清算交收。

投资者在此同意，若管理人资金交收违约，且管理人未在结算公司规定的时点前两个小时向资产托管人书面指定托管资产证券账户内相当于透支金额价值 120%的证券（按照前一交易日的收盘价计算）作为交收履约担保物的，资产托管人依法自行确定相关证券作为交收履约担保物，且资产托管人可向结算公司申请，由结算公司协助将相关交收履约担保物予以冻结。

3、越权交易所发生的损失及相关交易费用由资产管理人负担，所发生的收益归本资产管理计划财产所有。

（三）托管人对管理人的投资监督

1、资产托管人对资产管理人的投资行为行使监督权。资产托管人根据法律法规或本合同明确约定的投资范围及比例、管理人及托管人书面提供的关联方名单（若有）等以及以下投资限制、投资禁止内容履行投资监督义务。

托管人对本集合计划的以下投资限制进行监督：

（1）不得投资于债券主体评级及债项评级均在 AA(不含)以下的债券（注：依据的评级机构不包括中债资信，本条不适用于无主体评级或/且无债项评级的债券）；

（2）不得投资于交易所或银行间市场之外的资产支持证券；

（3）不得投资资产支持证券的次级份额

（4）投资范围不得超出本合同的约定；

（5）本计划的总资产不得超过本计划净资产的 200%；

(6) 投资于同一资产的资金，不得超过计划资产净值的 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；

(7) 参与债券、可转换公司债券、可交换公司债券等证券发行申购时，所申报的金额不得超过计划的总资产，所申报的数量不得超过拟发行公司本次发行的总量；

(8) 不得从事证券法规规定和本章节约定禁止从事的其他投资。

如法律法规或监管部门修改或取消上述限制，经管理人、托管人书面协商一致，并履行公告程序后，本集合计划可相应调整投资组合限制的规定。

托管人对本集合计划的以下禁止行为进行监督：

(1) 违规将集合计划资产用于资金拆借、贷款、抵押融资或者对外担保等用途；

(2) 将集合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) 挪用集合计划资产；

(5) 募集资金不入账或者其他任何形式的账外经营；

(6) 使用集合计划资产进行不必要的交易；

(7) 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；

(8) 法律、行政法规和中国证监会禁止的其他行为。

2、对投资禁止行为的监督

(1) 托管人发现管理人的投资运作不符合投资限制或投资禁止时，应当提示管理人及时纠正，管理人收到提示后应及时核对，并以书面形式向托管人进行解释或举证。

(2) 托管人对资产管理人的投资监督和检查自本合同生效之日起开始。

十九、资产管理计划财产的估值和会计核算

(一) 资产管理计划的估值

1、估值目的

集合计划财产估值目的是客观、准确地反映资产管理计划财产的价值。

2、估值时间

估值日指本集合计划成立后的每个工作日，即上海证券交易所和深圳证券交易所的正常交易日。

3、估值对象

集合计划所拥有的债券、基金和银行存款本息、其它投资等资产。

4、估值方法

除投资管理人在资产购入时特别标注并给托管人正式书面通知及另有规定外，本计划购入的资产均默认按交易性金融资产核算与估值。如国内证券投资会计原则及方法发生变化，由管理人与托管人另行协商确定估值方法，并以签署补充协议的方式确定有关内容。

(1) 债券估值方法

①在证券交易所市场挂牌交易实行净价交易的债券按估值日收盘价估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考监管机构或行业协会有关规定，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。

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

③首次发行未上市债券采用估值技术确定的公允价值进行估值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

④交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本进行后续计量。

⑤在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，采用第三方估值机构公布的价格估值。

⑥同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

(2) 证券投资基金估值方法

①持有的交易所基金(包括封闭式基金、上市开放式基金(LOF)等)，按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考监管机构或行业协会有关规定，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。

②持有的场外基金(包括托管在场外的上市开放式基金(LOF))，按估值日前一交易日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，按此前最近交易日的基金份额净值估值。

③持有的货币市场基金，按估值日前一交易日基金的每万份收益计算。

(3) 银行存款估值方法

银行存款以本金列示，按协议或合同利率逐日确认利息收入。如提前支取或利率发生变化，将及时进行账务调整。

(4) 国债期货估值方法

上市流通的国债期货按估值日其所在交易所的结算价估值；估值日无结算价的，以最近交易日的结算价估值。极端情况下无最近交易日结算价的，以所在交易所公告为准。

(5) 如有新增事项或变更事项，按国家最新规定估值。

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

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

5、估值程序

日常估值由管理人或服务机构进行。用于披露的资产净值由管理人或服务机构完成估值后，将估值结果通过深证通平台电子对账的方式或其他双方认可的方式发送给托管人，托管人按照规定的估值方法、时间与程序进行复核；托管人复核无误后返回给管理人或服务机构；报告期末估值复核与集合资产管理计划会计

账目的核对同时进行。

集合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。

6、估值错误的处理

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

(1) 估值错误的处理原则

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，及时进行更正，因更正差错发生的费用由差错责任方承担；由于差错责任方未及时更正已产生的差错，给当事人造成损失的，由差错责任方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，则其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本集合计划的会计责任方为资产管理人，与本集合计划有关的会计问题，如经双方在平等基础上充分讨论后，尚不能达成一致时，按管理人的建议执行，但托管人有权向监管部门报告，由此给投资者和资产管理计划财产造成的损失，由资产管理人负责赔付。

②管理人计算的净值已由托管人复核确认，但因资产估值错误给投资者造成损失的，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。

③如管理人和托管人对净值的计算结果，虽然多次重新计算和核对仍不能达成一致时，为避免不能按时披露净值的情形，以管理人的计算结果对外披露，由此给投资者和资产管理计划造成的损失，由管理人承担责任。

④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财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。

⑤由于证券交易所及证券登记结算公司发送的数据错误，或由于其他不可抗力原

因，管理人和托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误的，由此造成的估值错误，由第三方过错责任方承担赔偿责任。但管理人和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。

⑥管理人、托管人按本部分“7、估值调整的情形与处理”估值时，所造成的误差不作为估值错误处理。

⑦管理人和托管人由于各自技术系统设置而产生的净值计算尾差，以管理人计算结果为准。

⑧前述内容如法律、行政法规或监管机构另有规定的，按其规定处理。如果行业另有通行做法，双方当事人应本着平等和保护投资者利益的原则进行协商。

7、估值调整的情形与处理

在任何情况下，管理人如采用本部分“4、估值方法”规定的方法对委托财产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果管理人认为按本部分“4、估值方法”规定的方法对委托财产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，并与托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

8、暂停估值的情形

(1) 计划投资所涉及的证券交易场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) 占资产管理计划相当比例的投资品种的估值出现重大转变，而管理人为保障投资者的利益，决定延迟估值的情形；

(4) 相关金融监管部门规定或本合同及本资产管理计划相关协议约定的其他情形。

9、资产管理计划份额净值的确认

用于向投资者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，按照管理人对计划份额净值的计算结果为准，但托管人有权向监管部门报告。

集合计划资产总值指集合计划所投资各类证券、银行存款本息、集合计划各项应收款以及其他资产所形成的价值总和。

集合计划资产净值指集合计划资产总值减去负债后的净资产值。

集合计划份额净值指计算日集合计划资产净值除以计算日集合计划总份额的金额。计划资产份额净值的计算保留到小数点后4位，小数点后第5位四舍五入，由此产生的误差计入资产管理计划财产。

10、特殊情形的处理

由于本计划所投资的各个市场及其登记结算机构发送的数据错误，或由于其他不可抗力原因，管理人和托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误的，由此造成的集合资产管理计划资产计价错误，由第三方过错责任方承担责任。但管理人和托管人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

由于注册与过户登记人发送的数据有误，处理方法等同于本部分“6、估值错误的处理”第（2）项第⑤种交易数据错误的处理方法。

由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误，有关会计制度变化、管理人或托管人相关业务系统出现重大故障或由于其他不可抗力原因，管理人和托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误而造成的份额净值计算错误，由第三方过错责任方承担赔偿责任。但管理人、托管人应积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

（二）资产管理计划的会计核算

本集合计划的会计政策比照现行政策或按照资产管理合同约定执行。

1、本集合计划的会计年度为自然年度。

2、本集合计划的记账本位币为人民币。

3、管理人根据法律法规及业务的要求建立会计制度，并根据风险控制点建立严密的会计系统，对于不同集合计划独立建账，独立核算；管理人应保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，编制会计报表，同时还建立会计档案保管制度，确保档案真实完整。管理人应定期与托管人就资产管理计划的会计核算、报表编制等进行核对。

二十、资产管理计划的费用与税收

（一）与资产管理计划运作有关费用

- 1、集合计划的管理费；
- 2、集合计划的托管费；
- 3、证券交易费用；
- 4、集合计划注册登记费用（如有）；
- 5、按照法律、行政法规的规定及本合同的约定可以在本集合计划财产中列支的其他费用。

（二）资产管理计划费用费率、计提标准、计提方式与支付方式

1、管理费

本集合计划应给付管理人管理费，按前一日的资产净值的年费率计提。本集合计划的年管理费率为 0.7%。计算方法如下：

$$H = E \times 0.7\% / 365$$

H 为每日应支付的管理费；

E 为前一日集合计划资产净值。

管理人的管理费每日计提，逐日累计，每季度支付一次，由托管人于每季度初前 5 个工作日内或在本集合计划终止日后 5 个工作日内依据管理人的划款指令从本集合计划资产中一次性支付给管理人，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

管理费收入账户：

户名：东证融汇证券资产管理有限公司

账号：3105 0166 3600 0000 0224

开户银行：中国建设银行上海市第五支行

2、托管费

本集合计划应给付托管人托管费，按前一日的资产净值的年费率计提。本集合计划的年托管费率为 0.01%。计算方法如下：

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

H 为每日应支付的托管费；

E 为前一日集合计划资产净值。

托管人的托管费每日计提，逐日累计，本集合计划每季度支付一次，由托管人于每季度初前 5 个工作日内或在本集合计划终止日后 5 个工作日内依据管理人

的划款指令从本集合计划资产中一次性支付给托管人，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

托管费收入账户：

账户名称：资产托管费待划转

账号：11070126102000013

开户行：宁波银行股份有限公司

3、证券交易费用

本集合计划应按规定比例支付经手费、证管费、过户费、印花税、证券结算风险基金、佣金、结算费等费用。

本集合计划向所租用交易单元的券商支付佣金（该佣金已扣除风险金），其费率由管理人根据有关政策法规确定。在每季度首日起 10 个工作日内支付给提供交易单元的券商。

4、集合计划注册登记费用（如有）

注册与过户登记人收取的 TA 系统月度服务费、登记结算费相关费用在支付当期列支。

5、其他费用

与集合计划相关的审计费、银行结算费用、银行账户维护费、开户费等集合计划运营过程中发生的相关费用、在存续期间发生的信息披露费用、律师费以及如果国家有关规定调整可以列入的其他费用，在集合计划费用中按有关规定列支。

在存续期间发生的审计费用，在合理期间内按直线法在每个自然日内平均摊销；

在存续期间发生的集合计划信息披露费用、律师费在发生时一次计入集合计划费用。

管理人应根据银行间费用相关法律法规及本合同约定，将账户开户、结算管理等各项费用列入或摊入当期计划财产运作费用，经管理人和托管人核对无误后，由管理人授权后划付，管理人收到托管人通知后一个月内未授权划付的，由托管人从计划资产中扣划，无须管理人出具指令。投资者和管理人在此申明已了解计划资产投资会产生的银行间费用，如因托管账户中的资金不足以支付银行间费用影响到指令的执行，托管人不承担由此产生的损失和责任。如本计划未起始运作，

由管理人在收到托管人的缴费通知后完成支付，托管人不承担垫付费用义务。

与集合计划运营有关的其他费用，如果金额较小，或者无法对应到相应会计期间，可以一次进入集合计划费用；如果金额较大，并且可以对应到相应会计期间，必须在该会计期间内按直线法摊销。

6、费用调整

本集合计划各项费用调低，经管理人和托管人协商一致即可；若各项费用需调高，则应由管理人、托管人与全体投资者协商一致通过后由管理人向投资者发布公告后方可调整。

（三）不列入集合计划费用的项目

集合计划成立前发生的费用，以及存续期间发生的与募集有关的费用，不在计划资产中列支。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。

其他不列入集合计划费用的具体项目依据中国证监会有关规定执行。

（四）管理人的业绩报酬

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，在投资者退出日和计划终止日计提业绩报酬，上述时间节点记为业绩报酬计提日；

（3）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；

（4）在投资者退出和计划终止时，业绩报酬按投资者退出份额和计划终止时持有份额计算。如退出份额为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；

（5）管理人提取业绩报酬频率不超过每 6 个月一次，因投资者退出本集合计划，管理人按照本合同约定提取业绩报酬的，不受前述提取频率限制。

2、业绩报酬的计提方法

以上一个业绩报酬计提日（如上一个发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日不存在，初始募集期参与的，为产品成立日；申购参与的，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基准。年化收益率的计算公式如下：

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

业绩报酬计提日为投资者退出日或计划终止日；

A=业绩报酬计提日的累计单位净值；若本次业绩报酬计提日之前或当日发生了份额折算，则 A 为复权后的业绩报酬计提日的累计单位净值。

B=上一个业绩报酬计提日的累计单位净值；若上一个业绩报酬计提日之前或当日发生了份额折算，则 B 为复权后的上一个业绩报酬计提日的累计单位净值。

C=上一个业绩报酬计提日的单位净值；若上一个业绩报酬计提日之前或当日发生了份额折算，则 C 为复权后的单位净值。

D=上一个业绩报酬计提日到本次业绩报酬计提日的年限。

R=年化收益率，以四舍五入的方法保留至小数点后四位。

若投资者该笔份额参与期间的年化收益率（R）低于或等于该笔委托资产对应的加权业绩报酬计提基准（R*），则不计提业绩报酬。

若投资者该笔份额参与期间的年化收益率（R）高于该笔委托资产对应的加权业绩报酬计提基准（R*），则按超额收益的 60%计提比例计算业绩报酬。

此时业绩报酬计算公式：

$$E = (R - R^*) \times 60\% \times (F/365) \times P_2 \times M$$

注：E 表示每笔参与份额应计提的业绩报酬，M 表示投资者每笔参与在上一个业绩报酬计提日对应的集合计划份额，若上一个业绩报酬计提日之前或当日发生了折算，则 M 为复权后上一个业绩报酬计提日对应的集合计划份额。

P₂表示上一个业绩报酬计提日的单位净值，若上一个业绩报酬计提日之前或当日发生了折算，则 P₂为复权后的单位净值。

F 表示上一个业绩报酬计提日到本次业绩报酬计提日的持有天数。

期间加权平均业绩报酬计提基准（R*）指该笔份额上一个业绩报酬计提日到本次业绩报酬计提日期间的的时间加权平均业绩报酬计提基准。

$$R^* = \frac{\sum R_i D_i}{\sum D_i} (i=1, 2, 3 \dots)$$

R_i为该笔份额自上一个业绩报酬计提日起始的第 i 个封闭期的业绩报酬计提基准；

D_i 为该笔份额自上一个业绩报酬计提日起始的第 i 个封闭期起始日（含）至第 i 个封闭期到期后的开放日（含）的持有天数。

每个封闭期开始之前，管理人通过指定官网公告本集合计划该封闭期的起始日及当期（含该封闭期和该封闭期结束后的开放期）的业绩报酬计提基准（年化），当期封闭期及该封闭期结束后的开放期内业绩报酬计提基准保持不变，如该封闭期到期后的开放期投资者未选择退出，则视为投资者于该开放期当日重新参与，以该日参与对应的业绩报酬计提基准作为新的业绩报酬计提基准。

3、本集合计划的业绩报酬计提基准参照当期债券市场利率水平、货币市场基金平均收益率及集合计划费率确定

当期债券市场利率水平：根据集合计划投资范围、投资限制、投资策略及当期市场主要债券及其他固定收益品种的利率水平，通过研究分析确定。

货币市场基金平均收益率：根据集合计划开放当月主要货币市场基金平均七天年化收益率确定。

集合计划费率：根据集合计划托管费、管理费、审计费用等集合计划合同中约定的费用以及从集合计划资产中缴纳的税费估算。

该业绩报酬计提基准仅作为业绩报酬计算的基准，供投资者的参考，不作为实际收益分配的依据，管理人未对本集合计划的收益作出任何承诺或保证。

如果今后市场中有其他代表性更强的业绩报酬计提基准，或者有更科学客观的权重比例适用于本集合计划时，本集合计划管理人可以依据维护集合计划份额持有人合法权益的原则，根据实际情况对业绩报酬计提基准进行相应调整。

（五）资产管理计划的税收

本合同各方当事人应根据国家法律法规规定，履行纳税义务。

投资者缴纳必须由其自行缴纳的税费，管理人不承担代扣代缴或纳税的义务。

依据相关法律法规或税务机关的认定，本集合计划投资及运营过程中发生增值税（含附加税费）等应税行为，以管理人为纳税人或由管理人代扣代缴的，除本集合计划已列明的资产管理业务费用（如管理费、业绩报酬、托管费）由各收费方自行缴纳外，管理人有权在集合计划资产中计提并以集合计划资产予以缴纳或代扣代缴，且无需事先征得投资者的同意。从集合计划资产中扣缴税费可能导致集合计划税费支出增加、净值和实际收益降低，从而降低投资者的收益水平。

管理人在向投资者交付相关收益或资产后税务机关要求管理人就已交付收益或资产缴纳相关税费的，投资者必须按照管理人要求进行补缴。

投资者不得要求管理人以任何方式向其返还或补偿管理人以集合计划资产缴纳或代扣代缴、投资者按照管理人要求补缴的税费。

二十一、资产管理计划的收益分配

本集合计划存续期间不进行收益分配。

二十二、信息披露与报告

（一）不定期报告

不定期报告包括业绩报酬计提基准公告、集合计划开放期公告、临时退出开放期公告。

1、业绩报酬计提基准公告

每个封闭期开始之前，管理人公告本集合计划当期（含该封闭期和该封闭期结束后的开放期）的业绩报酬计提基准（年化）。本集合计划的业绩报酬计提基准仅作为管理人收取业绩报酬的基准，不作为实际收益分配的依据。

2、集合计划开放期公告

管理人在每个开放期之前通过网站公布开放期的具体日期。

3、临时退出开放期公告

若出现合同变更、监管规则修订、管理人自有资金参与比例被动超限等法定事由，管理人将公告临时退出开放期，投资者可在临时退出开放期退出本集合计划。

（二）定期报告

定期报告包括集合计划单位净值报告、集合计划的资产管理季度（年度）报告、托管季度（年度）报告、其他报告。

1、集合计划单位净值报告

披露时间：管理人至少每周在其网站上公布一次集合计划单位净值，开放期内每个工作日披露集合计划截至前一个工作日集合计划单位净值。

披露方式：本集合计划的信息披露将严格按照《管理办法》、《运作规定》、

本合同及其他有关规定进行。本集合计划的计划单位净值、计划累计单位净值等信息将在管理人指定网站上披露，投资者可随时查阅。若管理人指定网站变更，管理人将提前进行相关信息的详细披露。

2、集合计划的资产管理季度报告和托管季度报告

管理人、托管人在每季度分别向投资者提供一次准确、完整的资产管理计划季度报告和托管季度报告，资产管理计划季度报告披露报告期内资产管理计划运作情况，包括但不限于下列信息：管理人履职报告；托管人履职报告（如适用）；资产管理计划投资表现；资产管理计划投资组合报告；资产管理计划运用杠杆情况（如有）；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；资产管理计划投资收益分配情况；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；中国证监会规定的其他事项。本集合计划资产管理计划季度报告将披露集合计划参与国债期货的有关情况，包括投资目的、持仓情况、损益情况、投资国债期货对集合计划总体风险的影响以及是否符合既定的投资目的等。上述报告应于每季度结束之日起一个月内通过管理人网站通告。本集合计划成立不足三个月或者存续期间不足三个月的可以不编制当期的季度报告。

3、集合计划的资产管理年度报告和托管年度报告

管理人、托管人在每年度分别向投资者提供一次准确、完整的资产管理计划年度报告和托管年度报告，资产管理计划年度报告披露报告期内资产管理计划运作情况，包括但不限于下列信息：管理人履职报告；托管人履职报告（如适用）；资产管理计划投资表现；资产管理计划投资组合报告；资产管理计划运用杠杆情况（如有）；资产管理计划财务会计报告；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；资产管理计划投资收益分配情况；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；中国证监会规定的其他事项。本集合计划资产管理计划年度报告将披露集合计划参与国债期货的有关情况，包括投资目的、持仓情况、损益情况、投资国债期货对集合计划总体风险的影响以及是否符合既定的投资目的等。上述报告应于每个会计年度截止日后4个月内通过管理人网站通告。本集合计划成立不足三个月或者存续期间不足三个月时，可以不编制当期的年度报告。

4、其他报告

管理人、托管人应当根据法律法规和中国人民银行、中国证监会、证券投资基金业协会等有关监管部门的要求履行其他报告义务。

(三) 临时报告

集合计划存续期间，发生对集合计划持续运营、客户利益、资产净值产生重大影响的事件时，管理人应当按照监管规定在重大事项发生之日起五日内通过管理人网站等方式及时向客户披露。临时报告的情形包括但不限于：

- 1、集合计划运作过程中，负责集合资产管理业务的投资经理发生变更，或出现其他可能对集合计划的持续运作产生重大影响的事项；
- 2、发生巨额退出或连续巨额退出并延期支付；
- 3、暂停受理或重新开始受理参与或退出申请；
- 4、集合计划出现暂停估值情形的；
- 5、开通本集合计划份额转让业务；
- 6、集合计划终止和清算；
- 7、合同的补充、修改与变更；
- 8、与集合计划有关的重大诉讼、仲裁事项；
- 9、负责本集合计划的销售机构发生变更；
- 10、集合计划投资于管理人及与管理人有关联方关系的公司发行的证券；
- 11、管理人、托管人因重大违法违规，被中国证监会取消相关业务资格；
- 12、管理人、托管人因解散、破产、撤销等原因不能履行相应职责；
- 13、法律法规规定或其他管理人认为对投资者利益可能产生重大影响的事项。

(四) 管理人关联方参与本集合计划的信息披露

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。

(五) 信息披露方式

本集合计划的信息披露将严格按照《管理办法》、《运作规定》、本合同及其他有关规定进行。集合计划的信息披露事项将以下列方式进行披露。

1、管理人网站信息披露

本计划《说明书》、《集合资产管理合同》、其他备查文件、相关报告等有

关集合计划的信息，将在管理人指定网站（www.nesc.cn）上披露，投资者可随时查阅。

2、管理人、销售机构指定营业网点查询

本计划《说明书》、《集合资产管理合同》、其他备查文件、相关报告等资料放置于管理人和集合计划销售机构，供投资者查询。

3、管理人客服电话

本集合计划披露的有关集合计划的信息，投资者可以通过管理人客服电话（021-20361067）查询。

（六）信息披露文件的存放及查阅

本集合计划的定期公告与报告、临时公告与报告披露于管理人指定网站（www.nesc.cn），供投资者查阅。

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

二十三、风险揭示

本集合计划面临包括但不限于以下风险：

（一）一般风险

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计划财产，但不保证计划财产本金不受损失，也不保证一定盈利及最低收益。

本计划属于中低风险投资品种，适合风险识别、评估、承受能力为谨慎型及以上的合格投资者。

在发生揭示的风险及其他尚不能预知的风险而导致本计划项下计划财产重大损失的，投资者可能发生委托本金损失的风险。

2、市场风险

市场风险是指投资品种的价格因受经济因素、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，产生风险。市场风险主要包括：

（1）政策风险

货币政策、财政政策、产业政策和证券市场监管政策等国家政策的变化对证

券市场产生一定的影响，可能导致证券价格波动，从而影响收益。

(2) 经济周期风险

证券市场受宏观经济运行的影响，而经济运行具有周期性的特点，而周期性的经济运行表现将对证券市场的收益水平产生影响，从而对收益产生影响。

(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，使集合资产管理计划收益水平随之发生变化，从而产生风险。

(4) 上市公司经营风险

上市公司的经营状况受多种因素影响，如市场、技术、竞争、管理、财务因素等都会导致公司盈利发生变化，从而导致集合计划投资收益变化。

(5) 购买力风险

投资者的利润将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，从而使投资者的实际收益下降。

(6) 汇率风险

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

(7) 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，从而对集合计划产生再投资风险。

(8) 衍生品风险

金融衍生产品具有杠杆效应且价格波动剧烈，会放大收益或损失，在某些情况下甚至会导致投资亏损高于初始投资金额。

3、管理风险

在集合资产管理计划运作过程中，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。管理人的知识、经验、判断、决策、技能等，会影响其对信息的获取和对经济形势、金融市场价格走势的判断，如管理人判断有误、获取信息不全、或对投资工具使用不当等影响集合资产管理计划的收益水平，从而产生风险。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、连续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。当本计划出现巨额退出或连续巨额退出等本合同约定情形，资产管理人有权暂停退出、延期退出或延期支付退出款项，该等情形的发生将直接影响投资者投资变现。

5、信用风险

信用风险是指交易对手是否能够实现交易时的承诺，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。

(1) 交易品种的信用风险：投资于公司债券、可转换债券等固定收益类品种，存在着发行人不能按时足额还本付息的风险；此外，当发行人或交易品种信用评级降低时，集合资产管理计划所投资的债券可能面临价格下跌风险。

(2) 交易对手的信用风险：交易对手未能履行合约，或在交易期间未如约支付已借出证券产生的所有利息和分红，将使集合资产管理计划面临交易对手的信用风险。

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。

初始募集期限届满，若本计划不符合成立条件，则存在募集失败的风险，在资产管理计划募集期限届满后 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。

7、投资标的风险

本集合计划拟投资于国债期货，可能会面临如下相关风险：

(1) 强制平仓和强制减仓风险

国债期货实行当日无负债结算制度，对资金管理要求非常高。价格波动剧烈的时候可能面临追加保证金的问题，如果没有在规定的时间内补足保证金，按规定将被强制平仓，投资者可能会因此导致亏损。

强制减仓是当市场出现连续两个及两个以上交易日的同方向涨停(跌)等特

别重大的风险时，交易所为迅速、有效化解市场风险，防止会员大量违约而采取的措施，即：交易所将当日以涨跌停板价申报的未成交平仓报单，以当日涨跌停板价与该合约净持仓盈利投资者按持仓比例自动撮合成交。

强制平仓和强制减仓都有可能计划的多空头寸的市值不匹配，从而使计划面临债券市场的系统性风险暴露。

由上述强制平仓或强制减仓造成的经济损失由投资者承担。

（2）信用风险

对于国债期货交易而言，信用风险发生的概率极小，原因是在进行国债期货交易时，交易所有一套独特的交易体系，如设立一系列的保证金制度，最低资金要求，逐日盯市结算措施及强行平仓制度等，使整个市场的信用风险下降。但这种由结算公司充当所有投资者的交易对手，并承担履约责任，一旦结算公司出现风险暴露，由于其风险过度集中，在重大风险事件发生时，或风险监控制度不完善时也会发生信用风险。

（3）结算风险

国债期货投资者的结算及其期货资产账户项下的资产保管由期货经纪公司负责。如果选择了不具有合法证券经纪业务资格的证券及期货经纪公司从事证券交易，计划作为国债期货投资者的权益将无法得到法律保护；或者所选择的证券及期货经纪公司在交易过程中存在违法违规经营行为或破产清算，也可能给投资者带来损失。

对从事国债期货的投资者来说，为投资者进行结算的结算会员或同一结算会员下的其他投资者出现保证金不足、又未能在规定的时间内补足，或因其他原因导致期货交易所对该结算会员下的经纪账户强行平仓时，投资者的资产可能因被连带强行平仓而遭受损失。

（4）合约展期风险

本计划所投资的国债期货合约临近交割期限，合约需要进行展期时，展期过程中可能发生价差损失以及交易成本损失，将对投资收益产生影响。

8、关联交易风险

虽然管理人积极遵循投资者利益优先的原则、遵守相关法律法规的规定进行操作、积极防范利益冲突，但仍可能因管理人运用委托财产从事关联交易被监管

部门认为存在利益输送、内幕交易的风险，进而可能影响资产投资者的利益。该类证券价格可能会出现下跌，从而使本计划收益下降，甚至带来本金损失。

此外，资产管理人运用计划财产从事关联交易时可能依照相关法律法规、监管机构、自律组织的规定被限制相关权利的行使，进而可能影响委托财产的投资收益。

9、操作或技术风险

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违反操作规程等引致的风险，例如，越权违规交易、会计部门欺诈、交易错误、信息技术系统故障等风险。

在计划的各种交易行为或者后台运作中，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的利益受到影响。这种技术风险可能来自基金管理公司、注册登记机构、销售机构、证券交易所、证券注册登记机构等。

10、税收风险

资产管理计划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。

根据本合同第二十部分“（五）资产管理计划的税收”的约定，从集合计划资产中扣缴税费可能导致集合计划税费支出增加、净值和实际收益降低，从而降低投资者的收益水平。

（二）特定风险

1、本集合计划投资于债权类资产的风险

本集合计划投资于银行存款、债券等债权类资产，如果债券市场出现下跌，债权类资产价格波动，本集合计划的净值表现将受到影响。

2、本集合计划的业绩报酬计提基准（年化）仅作为业绩报酬计算的基准，供投资者参考，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。本集合计划份额可能出现净值损失，投资风险由投资者自行承担。

3、资产管理计划委托募集所涉风险

管理人委托第三方代销机构代理销售本集合计划，因第三方代销机构不符合金融监管部门规定的资质要求、不具备提供相关服务的条件和技能、不尽职

履行客户服务、信息披露、资金交收、投资者适当性管理、反洗钱等各项职责等，可能给投资者带来一定的风险。

4、资产管理计划外包事项所涉风险

资产管理人将应属本机构负责的事项以服务外包等方式交由外包服务机构（如有）办理，因外包服务机构不符合金融监管部门规定的资质要求、或不具备提供相关服务的条件和技能、或因管理不善、操作失误等，可能给投资者带来一定的风险。

5、不能完成备案的风险

本计划成立后需在证券投资基金业协会进行备案。除非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外，资产管理计划在完成基金业协会备案前不得开展投资活动。

因此，即使本计划成立，并不意味着本计划必然能通过证券投资基金业协会的备案。而该等备案过程可能会受到相应监管政策的影响，包括备案时间所需时间、能否通过备案都存在一定的不确定性。

如果在计划成立后不能及时完成备案，将可能导致本计划错过市场行情或投资机会；如果本计划在成立后无法获得证券投资基金业协会的备案，则将直接影响本计划设立目的的实现。当出现无法通过基金业协会备案的情形，本计划提前终止，由此直接影响投资者参与本计划的投资目的。

6、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

本合同是基于中国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）》而制定，管理人根据自身实际情况对合同指引相关内容做出了合理调整，可能导致本合同被中国证券投资基金业协会认定为与合同指引不完全一致，从而要求管理人重新修订完善的风险。管理人将及时根据中国证券投资基金业协会的要求提交说明材料，如涉及投资者相关权利义务的，管理人及时在官方网站进行信息披露，具体以管理人披露信息为准。

7、无法退出风险

本集合计划投资者参与的份额自参与确认日（募集期认购的，为本集合计划成立之日）起进入封闭期，封闭运作 12 个月（前后浮动不超过 7 个工作日）当

月的参与开放期为份额退出日（退出开放期），投资者可申请退出，若投资者在份额退出日（退出开放期）未退出，则投资者该份额自动进入下一个封闭期，在该封闭期内投资者不得退出该份额，须持有至下一个份额退出日（退出开放期），法律法规及本合同另有规定的除外。投资者需注意在封闭运作周期面临无法退出的风险。

8、强制退出风险

投资者部分退出资产管理计划的，其退出后持有的资产管理计划份额净值应当不低于本合同规定的合格投资者最低参与金额。投资者持有的资产管理计划份额净值低于规定的最低投资金额时，需要退出资产管理计划的，应当一次性全部退出；投资者没有一次性申请全部退出的，管理人或注册登记机构有权对该投资者所持有的全部份额做退出处理。投资者需注意持有资产管理计划份额净值低于规定的最低投资金额时，需要退出资产管理计划的，存在全部份额被强制退出的风险。

9、提前终止的风险

本集合计划存续期间，当计划的投资者持续五个工作日少于 2 人或出现本合同约定的其他终止情形时，集合计划将终止。投资者可能面临集合计划因上述原因终止而停止投资的风险。

10、份额折算的风险

根据本集合计划的合同约定，在本集合计划的开放日（T 日），若 T 日集合计划单位净值不等于 1.0000 元，管理人有权对本集合计划进行份额折算，使得 T 日单位净值为 1.0000 元，份额折算将使得计划单位净值增加或减少，同时，投资者持有计划份额减少或增加。

11、电子签名的风险

本集合计划合同及风险揭示书以电子签名方式签订的，投资者签订《电子签名约定书》，即表明投资者同意在销售机构参与集合资产管理计划过程中使用电子合同、电子签名。投资者通过身份验证登录销售机构指定的网络系统，确认同意接受相关电子签名合同、风险揭示书或其他文书的，视为签署合同、签署风险揭示书或其他文书，与在纸质合同、纸质风险揭示书或其他文书上手写签名或者盖章具有同等的法律效力，无须另行签署纸质合同、纸质风险揭示

书或其他文书。投资者应妥善保管密码，经投资者密码等有效身份验证登录投资者账户后的所有操作视同投资者本人行为，投资者承担由此产生的一切民事责任和法律后果。

12、份额转让风险

本集合计划成立后，管理人可以按照规定申请份额转让事宜。份额转让交易平台可以是证券交易所，也可以是中国证监会认可的其他交易平台。投资者通过交易平台转让份额的价格与集合计划份额净值可能不一致。

（三）其他风险

1、证券交易所资金前端风险控制相关风险

根据《上海证券交易所、深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司证券交易资金前端风险控制业务规则》等有关规定，证券交易所、中国结算对管理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，并通过证券交易所对本计划实施资金前端控制。本计划可能因上述业务规则而无法完成某笔或某些交易，可能造成损失。

2、不可抗力的风险

战争、自然灾害等不可抗力因素的出现，将会严重影响证券市场的运行，可能导致委托资产的损失，从而带来风险。

二十四、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

1、本合同签署后，因法律、法规、规章、中国证监会的规定、证券登记结算机构业务规则以及证券交易所等交易规则、证券投资基金业协会相关规定修订，自该修订生效之日起，要求发生变化必须变更资产管理合同的，投资者特此授权管理人经与托管人协商，可以对本集合计划合同及说明书与新的法律法规或有关政策不一致的内容进行更新或修改，更新或修改的内容不得违反法律法规和中国证监会的有关规定，更新或修改的内容在管理人网站公告满 5 个工作日后生效。投资者对更新或修改的内容有异议，可在更新或修改内容生效前按照本合同的规定申请退出本集合计划。未在上述期间申请退出本集合计划的，视为同意，管理人不再另行通知。

2、由于其他原因需要变更合同的，管理人和托管人应书面达成一致并在管理人网站公告。管理人须在公告后5个工作日内以书面或者管理人网站公告方式（由管理人确定）向投资者发送合同变更征询意见。投资者不同意变更的，应在征询意见发出后的5个工作日或最近一个开放期内提出退出本集合计划的申请；投资者未在前述时间回复意见的，视为投资者同意本合同变更。意见答复不同意变更且逾期未退出的，管理人有权在期限届满后将相关份额强制退出计划；投资者回复意见不明确的，视为该投资者不同意变更，按照上述相应程序处理。自合同变更生效之日起，公告内容即成为本合同组成部分。

如果资产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，经履行本合同约定程序，可选择符合条件的其他资产管理人承接本资产管理计划项下资产管理人相关权利义务。发生此等情形时，原资产管理人应当向新的资产管理人交接本资产管理计划资产管理事务。

如果资产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，经履行本合同约定程序，可选择符合条件的其他资产托管人承接本资产管理计划项下资产托管人相关权利义务。发生此等情形时，原资产托管人应当向新的资产托管人交接本资产管理计划资产托管事务。

3、合同变更后，投资者、管理人和托管人应当按照变更后的合同行使相关权利，履行相应义务。

4、投资者、管理人、托管人不得通过签订补充协议、修改合同等任何方式，约定保证集合计划资产投资收益、承担投资损失，或排除投资者自行承担投资风险和损失。

5、管理人应当自资产管理合同变更之日起五个工作日内报中国证券投资基金业协会备案，并抄报管理人所在地中国证监会派出机构。

6、本集合计划改变投向和比例的应当事先取得投资者的同意，并按照本条第2款约定的程序进行合同变更。

（二）资产管理计划的展期

1、通知展期的时间

管理人拟展期的，管理人应当在收到托管人同意展期的书面文件后5个工作日内通过管理人指定网站公告方式向投资者披露。

2、通知展期的方式

展期公告在管理人指定网站进行披露。

3、投资者回复的方式

回复同意本集合计划展期的投资者，集合计划存续期届满后，继续持有本集合计划；回复不同意展期的投资者，管理人将按照《集合资产管理合同》的约定，在原存续期届满日对其持有的计划份额一次性统一办理退出手续。没有回复意见的，视为同意展期。

4、投资者不同意展期的处理办法

管理人应对不同意展期的投资者退出事宜作出公平、合理安排。管理人应当在原存续期届满日对其持有的计划份额一次性统一办理退出手续。若集合计划展期失败，本集合计划将进入清算终止程序。

5、展期的实现

在原存续期届满日后第1个工作日，本集合计划符合以下条件时，则本集合计划将于原存续期届满后第1个工作日确认展期：

(1) 经管理人和托管人协商一致同意。

(2) 同意本集合计划展期的投资者的人数不少于2人。

(3) 在原存续期届满日后第1个工作日，本集合计划参与资金总额不低于1000万元人民币。

(4) 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、中国证监会规定和资产管理合同的约定。

(5) 资产管理计划展期没有损害投资者利益的情形。

(三) 资产管理计划的终止

本集合计划的终止情形包括但不限于以下事项：

1、资产管理计划存续期届满且不展期；

2、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、被宣告破产，且在六个月内没有新的管理人承接；

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

4、经全体投资者、管理人和托管人协商一致决定终止的；

- 5、发生本合同约定的终止情形的；
- 6、集合资产管理计划存续期间，持续五个工作日投资者少于二人；
- 7、存续期内，当本集合计划资产净值低于 500 万元时，管理人有权与托管人协商一致，提前终止本集合计划；
- 8、本计划在成立后，未在基金业协会完成备案或不予备案的；
- 9、持有人大会（如有）决议提前终止资产管理合同；
- 10、法律、行政法规及中国证监会规定的其他情形。

管理人应当自资产管理计划终止之日起五个工作日内报中国证券投资基金业协会备案，并抄报管理人所在地中国证监会派出机构，前述第 8 项约定的情形除外。

（四）资产管理计划的财产清算

1、资产管理计划财产清算小组

自集合计划终止之日起 5 个工作日内由管理人发起成立集合计划财产清算小组，集合计划财产清算小组按照监管机构、行业自律组织的相关规定进行集合计划清算。集合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、集合计划财产清算小组职责

集合计划财产清算小组负责集合计划财产的保管、清理、估价、变现和分配。集合计划财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。

清算过程中的有关重大事项应当及时公布。

3、集合计划财产清算的程序

（1）清算结束后 20 个工作日内，管理人和托管人应当按照以下列示顺序，在优先扣除清算费用、缴纳集合计划所欠税款、支付管理费、业绩报酬及托管费等费用等本计划所欠债务后，将集合计划资产按照投资者拥有集合计划份额的比例或集合资产管理合同的约定以货币资金的形式全部分派给投资者；

（2）若本集合计划在终止之日有未能流通变现的证券，管理人可对此制定二次清算方案，该方案应经托管人认可，并通过管理人网站进行披露。管理人应根据二次清算方案的规定，对前述未能流通变现的证券在可流通变现后进行二次清算，并将变现后的资产按照投资者拥有份额的比例或本合同的约定，以货币形

式全部分配给投资者。

4、集合计划财产清算费用及剩余资产的分配

如本计划终止时有未能流通变现的证券，资产管理人与资产托管人继续按规定计提管理费、托管费等费用，其估值方法继续按本合同第十九条的规定计算。清算小组在该证券可流通变现时应及时变现，在支付相关费用后按资产管理计划的投资者持有的计划份额比例进行再次分配并履行相应的告知义务，直至所有未能流通变现的证券全部清算完毕。

5、计划财产清算报告的告知安排

清算结束后 5 个工作日内由集合计划清算小组在管理人网站公布清算结果；清算结束后 5 个工作日内，管理人将清算结果报中国证券投资基金业协会备案并抄报管理人所在地中国证监会派出机构。

6、集合计划财产清算完毕后，当事人在资产管理计划财产相关账户注销中的职责及相应的办理程序。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，管理人应给予必要的配合。

7、本集合计划因委托财产流动性受限等原因延期清算的，管理人应当及时向管理人所在地中国证监会派出机构和证券投资基金业协会报告。

8、集合计划财产清算账册及文件由管理人保存 20 年以上。

二十五、违约责任与争议处理

（一）违约责任

1、管理人、托管人在履行各自职责的过程中，基于主观恶意或重大过失违反法律、行政法规的规定或者本合同约定，给计划财产或者投资者造成损害的，应当分别对各自的行为依法承担赔偿责任；但是发生下列情况的，当事人可以免责：

（1）不可抗力

不可抗力是指本合同当事人无法预见、无法克服、无法避免，使本合同当事人无法全部或部分履行本合同的任何事件，包括但不限于洪水、地震及其它自然灾害、战争、骚乱、火灾、突发性公共卫生事件、政府征用、没收、法律法规变化或其他突发事件、注册与过户登记人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等。

一方因不可抗力不能履行本合同时，应及时通知另一方，并在合理期限内提供受到不可抗力影响的证明，同时采取适当措施防止集合计划资产损失扩大。任何一方当事人延迟履行合同义务后，发生了上述不可抗力事件致使合同当事人无法全部或部分履行本合同，该方不能减轻或免除相应责任。

(2) 管理人和/或托管人按照当时有效的法律法规或中国证监会的规定作为或不作为而造成的损失等。

(3) 管理人由于按照合同规定的投资原则行使或不行使其投资权而造成的损失等；托管人由于按照本合同规定行使托管职责而造成的损失等。

(4) 非因管理人、托管人故意或重大过失造成的损失等。

2、本合同所指损失仅指直接损失。合同当事人违反本合同，给其他当事人造成直接经济损失的，应当承担赔偿责任。在发生一方或多方当事人违约的情况下，合同能继续履行的，应当继续履行。

3、本合同一方当事人造成违约后，其他当事人应当采取适当措施防止损失的扩大；没有采取适当措施致使损失扩大的，不得就扩大的损失要求赔偿。守约方因防止损失扩大而支出的合理费用由违约方承担。

4、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，由第三方过错责任方承担赔偿责任。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。

5、一方当事人依据本合同向另一方当事人赔偿的损失，仅限于直接经济损失。

6、管理人违反法律、行政法规的有关规定，被中国证监会依法撤销证券资产管理业务许可、责令停业整顿，或者因停业、解散、撤销、破产等原因不能履行职责的，应当按照有关监管要求妥善处理有关事宜。

(二) 争议的处理

因履行本合同发生的争议，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，任何一方均有权将争议向管理人住所地有管辖权的法院提起诉讼。

二十六、资产管理合同的效力

（一）资产管理合同签署的方式

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。投资者为法人的，资产管理合同自投资者、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或授权代表签字或盖章之日起成立；投资者为自然人的，资产管理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或授权代表签字或盖章之日起成立。

（二）合同的成立与生效

本合同经管理人、托管人和投资者签署后成立。

本合同成立后，同时满足以下条件时生效：

- 1、投资者参与资金实际交付并确认；
- 2、本集合计划成立；
- 3、委托财产到达托管账户。

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效力。

投资者自签订资产管理合同即成为资产管理合同的当事人。在资产管理计划存续期间，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。

（三）合同的有效期限

本合同期限自本合同生效之日起至本集合计划资产全部清算完毕之日止。

（四）合同的组成

《东证融汇汇鑫 12M1 号集合资产管理计划说明书》、经管理人确认有效的投资者参与、退出本集合计划的申请材料或数据电文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、投资者通过电子签名方式产生的数据电文等是本合同不可分割的一部分，与合同具有同等法律效力。

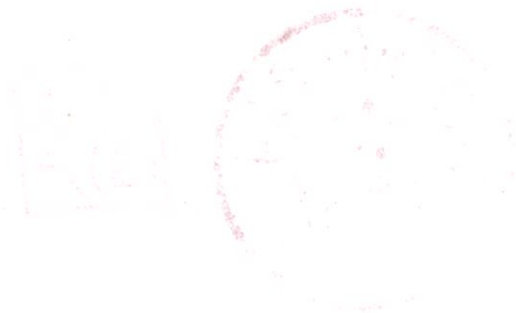
本合同正本一式肆份，管理人、托管人各持有贰份，每份具有同等的法律效力。

二十七、其他事项

若管理人或托管人被依法取消资产管理资格或基金托管资格；或者依法解散、

被依法撤销或被依法宣告破产；或者法律法规和本合同规定的其他情形，管理人将通过管理人网站公告，通知投资者更换管理人或托管人的相关具体程序。

（以下无正文）



管理人、托管人确认，已向投资者明确说明集合计划的风险，不保证投资者资产本金不受损失或取得最低收益；投资者确认，已充分理解本合同的内容，自行承担投资风险和损失。

本合同应由投资者本人签署，当投资者为机构时，应由法定代表人或其授权代表签署。

投资者签字/盖章：

法定代表人或授权代表：

管理人：东证融汇证券资产管理有限公司（盖章）

法定代表人或授权代表：



托管人：宁波银行股份有限公司（盖章）

法定代表人或授权代表：



签订日期：2021年6月30日

20210630 00000586 朱科

附件一：管理人关联方名单

东证融汇证券资产管理有限公司关联法人名单	
一、公司控股股东（唯一股东）	
法人工商登记名称	营业执照注册号
东北证券股份有限公司	91220000664275090B
二、公司控股股东（东北证券）控制的其他子公司	
法人工商登记名称	营业执照注册号
东方基金管理有限责任公司	911100007635106822
渤海期货有限公司	91310000MA1FL1T12Q
东证融通投资管理有限公司	9111010256579440XR
东证融达投资有限公司	91310115078128151J
三、公司控股股东（东北证券）关联方法人	
法人工商登记名称	营业执照注册号
吉林亚泰（集团）股份有限公司	91220000123961012F
吉林省信托有限责任公司	91220000123916641Y
银华基金管理股份有限公司	914403007109283569
长春市人民政府国有资产监督管理委员会	112201007561979154
吉林亚泰集团物资贸易有限公司	91220000682632311L
亚泰电子商务有限公司	912201015894779784
亚泰建材集团有限公司	91220000668781556N
吉林亚泰鼎鹿水泥有限公司	91220000244857326L
吉林亚泰集团水泥销售有限公司	91220000724886759C
亚泰集团长春建材有限公司	91220101726741502G
吉林亚泰龙潭水泥有限公司	91220201124501245D
吉林亚泰明城水泥有限公司	91220284732559053E
吉林亚泰水泥有限公司	912201122438443980
亚泰集团通化水泥股份有限公司	912205017493185043
通化市威龙新型建筑材料有限公司	9122050173702711X5
亚泰集团伊通水泥有限公司	9122032376899476X2
亚泰集团哈尔滨水泥有限公司	91230104127043796F
亚泰集团安达水泥有限公司	912312816848573702
亚泰集团哈尔滨水泥（阿城）有限公司	91230112686039785G
亚泰集团哈尔滨建材有限公司	91230100696802510Y
亚泰集团哈尔滨现代建筑工业有限公司	91230112571935168K
亚泰集团调兵山水泥有限公司	912112815709343310
亚泰集团铁岭水泥有限公司	91211200747116773W
亚泰集团沈阳建材有限公司	912101136919949126
亚泰（大连）预制建筑制品有限公司	912102825549690249
亚泰集团沈阳预拌混凝土有限公司	912101135694095727
铁岭县新东山碎石有限公司	91211221564605507W
抚顺市顺城区马前石材有限公司	912104115613929997
亚泰集团铁岭石料有限公司	91211221577239577J

亚泰集团沈阳现代建筑工业有限公司	91210100788739897J
亚泰集团图们水泥有限公司	912224006826449107
吉林亚泰集团(辽宁)建材有限公司	91210113683305718R
吉林亚泰集团辽阳水泥有限公司	91211022692665010K
辽宁富山水泥有限公司	91211022797683282P
辽宁交通水泥有限责任公司	9121050079155085X7
丹东交通水泥有限公司	91210600676867704M
亚泰集团沈阳矿业有限公司	9121011366253145X3
吉林亚泰集团沈阳建材技术研发有限公司	91210113079102228J
吉林亚泰建材电子商务有限公司	912200003400122785
吉林亚泰房地产开发有限公司	912200001239628919
吉林亚泰莲花山投资管理有限公司	91220101550470226G
长春市政建设(集团)房地产开发有限公司	912201011240470548
长春亚泰金安房地产开发有限公司	91220101050542481K
南京南汽同泰房地产有限公司	9132011479372127X8
南京金安房地产开发有限公司	913201165850835923
南京金泰房地产开发有限公司	91320191302410865J
沈阳亚泰金安房地产开发有限公司	9121011369653371XD
沈阳亚泰吉盛房地产开发有限公司	912101136965337368
松原亚泰房地产开发有限公司	91220700682633605C
天津亚泰吉盛投资有限公司	911201166940890375
吉林亚泰建筑工程有限公司	912201011239628832
沈阳吉泰建筑工程有限公司	912101045734640721
松原亚泰建筑工程有限公司	912207005894740729
吉林市亚泰金安建筑工程有限公司	91220201072299742T
吉林亚泰物业管理有限公司	912201051239722215
吉林亚泰环境工程有限公司	91220105729568100W
吉林亚泰恒大装饰工程有限公司	912201016051198726
吉林市中圣房地产开发有限公司	91220201578923725G
海南亚泰兰海投资集团有限公司	91460200665132737R
三亚六道湾发展有限公司	914602007477903389
海南五指山旅业控股有限公司	91469001780738443C
五指山亚泰雨林酒店有限公司	91469001552771057Y
蓬莱亚泰兰海投资置业有限公司	91370684558902441H
蓬莱亚泰兰海城市建设有限公司	913706845652372839
天津亚泰兰海投资有限公司	91120222556533451R
天津亚泰兰海现代科技农业开发有限公司	911202225661234569
长春兰海投资置业有限责任公司	91220103697759841A
三亚兰海亚龙北部湾区开发有限公司	914602006811623036
兰海泉洲水城(天津)发展有限公司	911202225503948330
亚泰能源集团有限公司	91220000594469673R
鸡西亚泰选煤有限公司	912303005561067249
双鸭山亚泰煤业有限公司	912305007660186426

亚泰医药集团有限公司	912200000597822974
亚泰长白山医药保健科技开发有限公司	91222400307891290A
吉林亚泰康派保健品有限公司	91220106068646190U
吉林亚泰永安堂药业有限公司	91220101702404245Y
吉林亚泰制药股份有限公司	91220000715393231E
吉林大药房药业股份有限公司	91220000702571318A
吉林大药房吉林市药业有限责任公司	912202016601367479
通化市吉林大药房药业有限责任公司	91220502691024289Q
吉林大药房白城市药业有限责任公司	9122080005408094XL
吉林省亚泰大健康电子商务有限公司	91220101339888416K
吉林省亚泰永安堂健康调理有限公司	912201013166954193
吉林亚泰健康医药有限责任公司	91220101316676082M
吉林亚泰生物药业股份有限公司	912200007307650053
吉林龙鑫药业有限公司	91222406732580610D
吉林省东北亚药业股份有限公司	912224037022515174
亚泰商业集团有限公司	91220000059783337T
北京亚泰饭店有限公司	91110108741575792K
长春龙达宾馆有限公司	912201017868161668
吉林亚泰超市有限公司	9122010112397223X3
吉林亚泰富苑购物中心有限公司	91220101749321412Q
吉林亚泰饭店有限公司	91220101702340800W
海南亚泰温泉酒店有限公司	91469027754388574W
吉林亚泰国际旅行社有限公司	91220105MA0Y3C6JOR
吉林亚泰润德建设有限公司	91220101MA14WQN8XM
吉林大药房(延边)药业有限责任公司	91222406MA14D3YR9B
北京亚泰永安堂医药股份有限公司	911101011012705954
北京永安堂医药连锁有限责任公司	91110101700156794K
吉林亚泰中科医疗器械工程技术研究院股份有限公司	91220101MA141WCU78
大连水产药业有限公司	91210231118429240M
长春奇朔红酒坊有限公司	91220105081828757X
奇朔药业有限公司	91220101059796592X
JintaVineyards&Winery, LLC (金塔葡萄酒庄有限责任公司)	-
QuixoteInc (美国奇朔公司)	-
QuixoteWinery, LLC (奇朔酒庄有限责任公司)	-
吉林亚泰大健康交易中心有限公司	91220101MA155CTX8T
凤城亚泰隆鑫贸易有限公司	91210682MA0UX7CE4P
吉林亚泰莲花山房地产开发有限公司	91220101MA150AJ60P
河北亚泰永安堂药业有限公司	91130104MA0CP0X98G
天津亚纳仪器有限公司	91120222MA06FR139Q
吉林亚泰隆华贸易有限公司	91220105MA170G4E9N

吉林亚泰智能科技有限公司	91220105MA170HEK4C
吉林省亚泰医药物流有限责任公司	91220107MA170KPK2L
亚泰房地产开发有限公司	91220000MA180H520G
吉林亚泰职业培训学校有限公司	91220105MA150BMT0E
深圳科谷金泰投资发展有限公司	91440300MA5FW2CQ97
南京吉盛房地产开发有限公司	91320116MA202CC94T
吉林省白求恩重离子医院有限公司	91220000MA17AQXD77
吉林亚泰中医药创新研究(院)有限公司	91220107MA177WF142
吉林亚泰跨境电子商务有限公司	91220107MA179MUQ87
吉林亚泰矿产资源综合利用有限公司	91220112MA17EM1M8E
中韩(长春)国际合作示范区北药交易中心 有限公司	91220100MA17JDCP5E
吉林亚泰北药投资控股集团有限公司	91220000MA17NWL7UC
长春净月高新技术产业开发区启航体育文 化投资有限公司	91220100MA17WBOBX7
吉林亚泰新动力购物中心有限公司	91220105MA17YY4P3T
铁岭县新岗采石有限责任公司	91211221768301759E
北京预制建筑工程研究院有限公司	9111010658257779XG
吉林银行股份有限公司	9122010170255776XN
辽宁矿渣微粉有限责任公司	91210500683749474J
黑龙江北疆公司克山县永鑫水泥有限公司	91230229592723973B
靖宇亚泰泉润建材有限公司	91220622MA0Y34FC96
海林亚泰三艺新型建材有限公司	91231083352161211H
齐齐哈尔鸿谊建材有限公司	91230200MA18WGHD9U
大庆聚谊建材有限公司	91230603MA18WL2HXM
辽宁云鼎水泥集团股份有限公司	91210100MA0UEACB4K
吉林亚泰体育文化发展股份有限公司	91220105MA0Y3NU16A
吉林省互联网传媒股份有限公司	91220101MA0Y3NXH6C
吉林亚泰跨境电子商务股份有限公司	91220108MA1726XG3N
江苏威凯尔医药科技有限公司	91220000759345557W
长春市轨道交通预制构件有限责任公司	9122000055979020X1
吉林金塔投资股份有限公司	91460200MA5T87KNOR
吉林宝鼎投资股份有限公司	91110111MA00F56K4Y
龙创控股有限公司	(荷兰注册)
北京金塔股权投资有限公司	912106007683156598
CRH 中国东北水泥投资有限公司	91220105MA14CERG9N
丹东万通城市燃气有限公司	912112818238194716
长春禹隆能源有限公司	91210900MA0YA6QD0J
铁法煤业(集团)有限责任公司煤炭销售分 公司	91320206562937567U
阜新矿业集团恒大煤炭销售有限公司	91211103MA0QF8W404
无锡启润钢铁贸易有限公司	91230112MA19LUR64X
辽宁恒鑫供应链管理有限公司	1230103MA19GGBR92

黑龙江建龙冶金机械制造有限公司	91320111558880182E
哈尔滨隆合建材有限公司	91220101310073475A
吉林省财政厅	11220000013544533P
天治基金管理有限公司	913101157465202565
天治北部资产管理有限公司	911101020766484796
天富期货有限公司	91220000100023170N
吉林省汇通典当有限责任公司	912201026826175254
吉林省汇富投资管理有限公司	9122010157894880XW
中融人寿保险股份有限公司	91110102552917941U
吉林九台农村商业银行股份有限公司	912200001243547911
吉林舒兰农村商业银行股份有限公司	91220201578916955W
长春农村商业银行股份有限公司	91220101691456671J
吉林银行股份有限公司	9122010170255776XN
吉林电力股份有限公司	91220000123962584G
吉林德惠农村商业银行股份有限公司	91220183081827316P
吉林春城农村商业银行股份有限公司	91220000MA0Y31314N
吉林公主岭农村商业银行股份有限公司	91220000MA0Y31330C
贵州航天电器股份有限公司	91520000730980020A
鹏华基金管理有限公司	91440300708470788Q
中国北京同仁堂（集团）有限责任公司	91110000101461180X
广东领益智造股份有限公司	91440700193957385W
晋能控股山西煤业股份有限公司	91140000729670025D
北京等嫣雨科技有限公司	91110108MA01L48T10

附件二：托管人关联方名单

名称	关联关系
宁波开发投资集团有限公司	主要股东
新加坡华侨银行有限公司	主要股东
雅戈尔集团股份有限公司	主要股东
华茂集团股份有限公司	主要股东
香港中央结算有限公司	主要股东
宁波富邦控股集团有限公司	主要股东
新加坡华侨银行有限公司（QFII）	主要股东
宁兴（宁波）资产管理有限公司	主要股东
宁波市轨道交通集团有限公司	主要股东
中央汇金资产管理有限责任公司	主要股东
永赢基金管理有限公司	子公司
永赢金融租赁有限公司	子公司
宁银理财有限责任公司	子公司