

甬证资管季季盈 1 号集合资产管理计划 资产管理合同

合同编号：YZZG-PFSF-JH-202101

管理人：上海甬兴证券资产管理有限公司

托管人：【上海浦东发展银行股份有限公司上海分行】

二零二一年【七】月

目 录

第一节 前言.....	1
第二节 释义.....	2
第三节 承诺与声明.....	6
第四节 当事人及权利与义务.....	8
第五节 资产管理计划的基本情况.....	14
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.....	36
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 划款指令的发送、确认和执行.....	39
第十八节 越权交易的界定.....	43
第十九节 交易及清算交收安排.....	44
第二十节 资产管理计划财产的估值和会计核算.....	46
第二十一节 资产管理计划的费用与税收.....	50
第二十二节 资产管理计划的收益分配.....	55
第二十三节 信息披露与报告.....	55
第二十四节 风险揭示.....	58
第二十五节 资产管理合同的变更、终止与财产清算.....	65
第二十六节 违约责任.....	70
第二十七节 争议的处理.....	72
第二十八节 资产管理合同的效力.....	72
第二十九节 保密事项.....	72
第三十节 通知与送达.....	73
第三十一节 其他事项.....	73

特别约定：《甬证资管季季盈 1 号集合资产管理计划资产管理合同》（以下简称“集合资产管理计划”、“资产管理计划”或“计划”）可以电子合同方式或者纸质合同手写签名、盖章方式签订，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；投资者作为本合同一方，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。

《电子签名约定书》用于约定：投资者通过身份验证登录管理人指定推广机构的网络系统，确认同意接受相关电子合同或文书的，视为签署合同，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或文书。

《电子签名约定书》自投资者签署之日起生效，若投资者因参与管理人管理的其他集合计划而曾签署过《电子签名约定书》，则无需重新签署。

第一节 前言

为规范甬证资管季季盈 1 号集合资产管理计划（以下简称“集合资产管理计划”、“资产管理计划”或“计划”）运作，明确《甬证资管季季盈 1 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，根据《中华人民共和国民法典》、《中华人民共和国证券法》、《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《指引》）、《证券期货投资者适当性管理办法》、《证券经营机构投资者适当性管理实施指引（试行）》、《基金募集机构投资者适当性管理实施指引（试行）》（以下统称《适当性管理相关规定》）等法律、行政法规和中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）、中国证券业协会、中国证券投资基金业协会（以下简称“证券投资基金业协会”）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《管理办法》、《运作规定》、《甬证资管季季盈 1 号集合资产管理计划说明书》（以下简称《说明书》）、本合同及其他有关规定享有权利、承担义务。

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

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

投资者保证委托财产的来源及用途合法，并在签订本合同前，已经签署了风险揭示书及客户风险承受能力调查表，投资者阅知本合同全文，了解相关权利、义务和风险，自行承担投资风险。投资者保证，管理人和托管人不因签订本资产管理合同而与投资者的客户（如有）发生直接的法律关系，如管理人和托管人因此被投资者的客户（如有）投诉或采取任何法律行动，投资者应承担相应责任。

投资者承诺其知悉《中华人民共和国反洗钱法》、《金融机构报告涉嫌恐怖融资的可疑交易管理办法》、《金融机构大额交易和可疑交易报告管理办法》、《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；承诺出示真实有效的身份证件或者其他身份证明文件，积极履行反洗钱职责，配合进行受益所有人识别、金融账户涉税信息调查，真实、准确、完整的提供上述识别与调查材料，不借助本业务进行洗钱等违法犯罪活动。

投资者承诺其不属于中国有权机关、联合国、欧盟或美国制裁名单内的企业或个人，不位于被中国有权机关、联合国、欧盟或美国制裁的国家和地区。

第二节 释义

1、法律法规：指中国现时有效并公布实施的法律、行政法规、行政规章及规范性文件、地方法规、地方规章及规范性文件。

2、《基金法》：指 2004 年 6 月 1 日经中国证监会发布并施行的《中华人民共和国证券投资基金法》。

3、《指导意见》：指 2018 年 4 月 27 日经中国人民银行、中国银行保险监督管理委员会、中国证监会、国家外汇管理局共同发布并施行的《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》。

4、《管理办法》：指 2018 年 10 月 22 日经中国证监会发布并施行的《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》。

5、《运作规定》：指 2018 年 10 月 22 日经中国证监会发布并施行的《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》。

6、《内容与格式指引》：指 2019 年 3 月 29 日经证券投资基金业协会发布并施行的《集合资产管理计划资产管理合同内容与格式指引（试行）》。

7、《适当性管理相关规定》：指经中国证券监督管理委员会发布并于 2017 年 7 月 1 日施行的《证券期货投资者适当性管理办法》、经中国证券业协会发布并于 2017 年 7 月 1 日施行的《证券经营机构投资者适当性管理实施指引（试行）》、经证券投资基金业协会发布并于 2017 年 7 月 1 日施行的《基金募集机构投资者适当性管理实施指引（试行）》，以及后续发布的适当性管理相关法规和规范。

8、集合资产管理合同、资产管理合同、本合同：指投资者、管理人和托管人签署的《甬证资管季季盈 1 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。

9、资产管理计划、本集合资产管理计划、本集合计划、本资产管理计划、本计划：指依据《甬证资管季季盈 1 号集合资产管理计划资产管理合同》和《甬证资管季季盈 1 号集合资产管理计划说明书》所设立的甬证资管季季盈 1 号集合资产管理计划。

10、中国证监会：指中国证券监督管理委员会。

11、合同当事人：指受集合资产管理合同约定，根据集合资产管理合同享有权利并承担义务的资产管理计划管理人、资产管理计划托管人和投资者。

12、管理人：指上海甬兴证券资产管理有限公司。

13、托管人：指【上海浦东发展银行股份有限公司上海分行】。

14、投资者：指依据集合资产管理合同和资产管理计划说明书参与本资产管理计划的投资者，包括个人投资者和机构投资者。

15、合格投资者：指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一定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，且满足下列三项条件之一的自然人：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、在证券投资基金业协会登记的私募基金管理人、商业银行、金融资产管理公司、信托公司、保险公司、保险资产管理机构、财务公司及中国证监会认定的其他机构；（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。如未来法律法规或监管机构对合格投资者有新的规定，本集合计划将按新的规定执行。合格投资者分为普通合格投资者和专业投资者。

16、专业投资者：符合下列条件之一的是专业投资者：（1）经有关金融监管部门批准设立的金融机构，包括证券公司、期货公司、基金管理公司及其子公司、商业银行、保险公司、信托公司、财务公司等；经行业协会备案或者登记的证券公司子公司、

期货公司子公司、私募基金管理人；(2) 上述机构面向投资者发行的理财产品，包括但不限于证券公司资产管理产品、基金管理公司及其子公司产品、期货公司资产管理产品、银行理财产品、保险产品、信托产品、经行业协会备案的私募基金；(3) 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）。(4) 同时符合下列条件的法人或者其他组织：①最近1年末净资产不低于2000万元；②最近1年末金融资产不低于1000万元；③具有2年以上证券、基金、期货、黄金、外汇等投资经历；(5) 同时符合下列条件的自然人：①金融资产不低于500万元，或者最近3年个人年均收入不低于50万元；②具有2年以上证券、基金、期货、黄金、外汇等投资经历，或者具有2年以上金融产品设计、投资、风险管理及相关工作经历，或者属于本条第(1)项规定的专业投资者的高级管理人员、获得职业资格认证的从事金融相关业务的注册会计师和律师。前款所称金融资产，是指银行存款、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。

17、普通合格投资者：专业投资者之外的合格投资者为普通合格投资者。

18、直销机构：指上海甬兴证券资产管理有限公司。

19、代销机构：指与管理人签订相关合同，为本资产管理计划代理销售的机构。

20、销售机构：指直销机构和代销机构。

21、注册登记机构：指办理登记、存管、过户、清算和结算等注册登记业务的机构。本资产管理计划的注册登记机构为【上海甬兴证券资产管理有限公司】。

22、成立日：指资产管理计划经过募集达到资产管理合同规定的成立条件后，管理人公告资产管理计划成立的日期。

23、推广期、募集期：指本资产管理计划开始接受投资者参与日至募集结束日，具体时间见有关公告，本资产管理计划初始募集期不超过60天。

24、开放期：指集合计划参与人在集合计划存续期内办理参与、退出集合计划手续的工作日。

25、临时开放日：在合同变更基于投资者利益考虑的情形下，管理人有权设置临时开放日，临时开放日内投资者可办理退出申请，临时开放日的具体安排以管理人公告为准；如因其他目前未可预见的监管变动或行业特殊情况须安排临时开放日时，管理人将按照监管要求或征询监管意见后安排执行。

- 26、封闭期：指投资者不得办理参与、退出等业务的期间；
- 27、存续期、管理期限：指资产管理计划成立至终止之间的期限。
- 28、工作日、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。
- 29、元：指中国法定货币人民币，单位“元”。
- 30、T 日：指日常参与、退出或办理其他集合资产管理计划业务的申请日。
- 31、T+N 日：指 T 日后（不含 T 日）的第 N 个工作日。
- 32、T-N 日：指 T 日前（不含 T 日）的第 N 个工作日。
- 33、参与：指投资者申请参与本资产管理计划份额的行为。
- 34、认购参与（或认购）：指在集合资产管理计划募集期内申请参与本资产管理计划份额的行为。
- 35、退出：指投资者按资产管理合同规定的条件申请退出本资产管理计划份额的行为。
- 36、资产管理计划份额、计划份额、份额：指资产管理计划的最小单位。
- 37、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。
- 38、资产管理计划资产总值：指资产管理计划的资金进行的各类投资、购买的各种有价证券、银行存款本息、资产管理计划应收款项及其他投资等所形成的价值总和。
- 39、资产管理计划资产净值：指资产管理计划资产总值扣除负债后的净资产值。
- 40、资产管理计划单位净值：指计算日资产管理计划资产净值除以计算日资产管理计划总份额。
- 41、资产管理计划收益：指资产管理计划利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入。
- 42、初始委托资产总额：指资产管理计划投资者在募集期内参与本资产管理计划金额的总额。
- 43、份额面值：指人民币 1.0000 元。
- 44、管理人指定网站、管理人网站：指 www.yxzqzg.com，管理人指定网站变更时以管理人公告为准。
- 45、关联方：本资产管理计划资产管理合同和《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。
- 46、不可抗力：指不能预见、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、火灾、突发性公共卫生事件、政府征用、没收、法律法规变化、突发停电或其他突发事件、注册登记机构非正常的暂停或终止业务、证券交易所非正常暂停或停止交易等。管理人或托管人因不可抗力不能履行本资产管理计划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。

47、信义义务：信义义务是指管理人和托管人按恪尽职守、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分别履行管理和运用资产管理计划财产等管理人职责和安全保管托管资产等托管人职责。

48、流动性受限资产：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。

49、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。

第三节 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。

3、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。

（三）投资者声明

1、符合《运作管理规定》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。承诺出示真实有效的身份证件或者其他身份证明文件，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。

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，投资于本资产管理计划将自行承担投资风险。

4、保证其签署并履行本合同均在其权力和营业范围之内，并已履行适当程序取得适当授权，且其从事本项委托资产管理不违反或者违法违规避对其有约束力或影响的法律法规、监管机构要求、合同的限制、机构投资者的内部制度；投资者保证其有权以本合同项下委托财产委托管理人运作并投资本合同项下投资工具。

5、投资者具有合法的参与集合资产管理业务的资格，不存在法律、行政法规和中国证监会有关规定禁止或限制参与集合资产管理业务的情形。

6、投资者声明已听取了管理人指定的专人对管理人业务资格的披露和对相关业务规则、合同的讲解，已充分理解本合同条款，了解相关权利义务；投资者已阅读并理解风险揭示书的相关内容，并签署风险揭示书，承诺自行承担风险和损失。知晓管理人、托管人及相关机构不对资产管理计划的收益状况或本金不受损失作出任何承诺。

7、投资者承诺对管理人根据合同约定从事的投资行为承担完全后果，根据相

关合同约定自行承担投资风险。

8、投资者承诺履行反洗钱义务，积极配合管理人开展反洗钱工作，管理人若发现委托资金涉嫌洗钱的，可根据反洗钱法律法规等规定履行反洗钱报告等义务。

9、投资者承诺其将配合管理人开展适当性管理工作。

10、投资者承诺及保证：符合法律法规、监管机构及自律组织对于本资产管理计划投资者的各项要求，包括但不限于：

（1）投资者具备相应风险识别能力和风险承受能力，为符合要求的合格投资者；

（2）投资者以其管理的资产管理产品投资于本资产管理计划的，应如实告知资产管理人，且保证该产品的所有投资者为符合法律法规规定的合格投资者且委托财产来源合法合规，且均非资产管理产品；投资者承诺投资本资产管理计划不存在违反监管要求的产品嵌套，以及以投资本资产管理计划规避投资范围、杠杆约束等监管要求等违法违规行为。若投资者以其管理的资产管理产品申请认购/参与本资产管理计划，资产管理人认为可能导致本资产管理计划违反监管要求的产品嵌套规定的，资产管理人有权拒绝其认购/参与申请。

第四节 当事人及权利与义务

（一）合同当事人

1、投资者

（1）个人填写：

姓名：

证件类型：

证件号码：

住所：

通信地址：

联系电话：

（2）机构填写：

机构名称：

法定代表人：

住所：

通信地址：

邮政编码：

联系人：

联系电话：

传真号码：

2、管理人

机构名称：上海甬兴证券资产管理有限公司

法定代表人：宫晓萱

住所：上海市黄浦区北京东路 666 号 H 区(东座)6 楼 H671

通信地址：上海市浦东新区南泉北路 429 号泰康保险大厦 31F

邮政编码：200120

联系人：吴雨竹

联系电话：021-20587591

3、托管人

机构名称：【上海浦东发展银行股份有限公司上海分行】

负责人：【汪素南】

住所：【上海市浦东新区浦东南路 588 号】

通信地址：【上海市浦东新区浦东南路 588 号】

邮政编码：【200120】

联系人：【倪宁】

联系电话：【021-61618469】

（二）权益约定

本资产管理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。

（三）投资者的权利和义务

1、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) 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；
- (5) 监督管理人、托管人履行投资管理及托管义务的情况；
- (6) 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。

2、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受能力问卷，如实提供资金来源、金融资产、收入及负债情况，并对其真实性、准确性和完整性负责，签署合格投资者相关文件；
- (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。

(四) 管理人的权利和义务

1、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。

2、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，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）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；

（15）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；

（16）对非标准化资产和相关交易主体进行充分的尽职调查，形成书面工作底稿，并制作尽职调查报告；

（17）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；

（18）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；

（19）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；

（20）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；

（21）办理与受托财产管理业务活动有关的信息披露事项；

（22）建立并保存投资者名单；

（23）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；

（24）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；

（25）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；

（26）本合同存续期内，管理人应依法履行相应反洗钱义务，并主动配合托管人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，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，或单方面终止本合同。

（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。

（五）托管人的权利与义务

1、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。

2、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，根据管理人的划款指令，及时办理清算、交割事宜；

(11) 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；

(12) 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；

(13) 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；

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

(15) 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。

(16) 托管人承担的托管职责仅限于法律法规规定和本合同、《托管协议》的约定，对实际管控的托管资金账户内资产承担保管职责。托管人的托管职责不包含以下内容，法律法规另有规定或托管合同、《托管协议》另有约定的除外。

- 1) 投资者的适当性管理；
- 2) 对托管产品本金及收益提供保证或承诺；
- 3) 对已划出托管账户以及处于资产托管人实际控制之外的资产的保管责任；
- 4) 主会计方未接受托管人的复核意见进行信息披露产生的相应责任；
- 5) 因不可抗力，以及由于第三方（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等）发送或提供的数据错误及合理信赖上述信息操作给托管资产造成的损失；
- 6) 提供保证或其他形式的担保；

第五节 资产管理计划的基本情况

（一）资产管理计划的名称：甬证资管季季盈 1 号集合资产管理计划

（二）资产管理计划的类别：固定收益类集合资产管理计划

（三）运作方式：开放式运作

（四）投资目标、主要投资方向、投资比例、风险等级

1、投资目标

在有效控制和分散投资风险的前提下，力争实现稳健的投资收益。

2、投资范围

（1）固定收益类资产：包括现金、国内依法发行上市的国债、地方政府债、央行票据、企业债、公司债（含非公开发行公司债）、超短期融资券、短期融资券、金融企业发行债券（含次级债、混合资本债）、中期票据、非公开定向融资工具（PPN）、资产支持证券（ABS）非次级份额、资产支持票据（ABN）非次级份额以及银行存款、银行同业存单、公募债券型基金、货币市场基金、债券正逆回购（含协议式回购）；

（2）如法律法规或监管机构规则变动允许本资产管理计划投资其他品种的，经管理人、托管人及全体投资者一致同意后，可以将其纳入投资范围。

3、投资比例

本集合计划投资于固定收益类资产的比例不低于计划总资产的 80%；

本集合计划的建仓期为自产品成立之日起【3】个月。建仓期的投资活动，应当符合本资产管理计划合同约定的投向和资产管理计划的风险收益特征（以现金管理为目的，投资于银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债、货币市场基金的除外）。建仓期不受资产配置比例约束，建仓期结束后，管理人应当使本资产管理计划的投资组合的投向和比例符合以上约定。

本资产管理计划存续期内，因证券期货市场波动、上市公司合并、资产管理计划规模变动等管理人之外的因素致使资产管理计划投资不符合约定投资比例的，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报告。

4、本资产管理计划风险等级为 R2（中低风险）。适合风险识别、评估、承受能力为 C2（相对保守型）及以上的合格投资者。本资产管理计划投资者的风险承受能力应当与本计划的风险等级相匹配。

（五）存续期限

本资产管理计划委托期限为【9】年，满足本合同规定的条件的，可以根据本合同约定进行展期或提前终止。

（六）最低初始募集规模

人民币 1,000 万元。

（七）集合计划份额初始募集面值

人民币 1.00 元。

（八）分级安排

本资产管理计划不进行分级设计。

（九）份额登记、估值与核算、信息技术系统等服务机构

本资产管理计划的注册登记机构为【上海甬兴证券资产管理有限公司】。

本资产管理计划由管理人或管理人委托的外包服务机构完成估值后，将估值结果以托管人认可的形式传送，托管人按本合同及托管协议规定的估值方法、时间、程序进行复核，复核无误后返回给管理人或管理人委托的外包服务机构。

本资产管理计划的信息技术服务机构为【上海甬兴证券资产管理有限公司】。

（十）封闭期、开放期安排

1、封闭期：本资产管理计划自成立之日起 3 个月及其他非开放期间为封闭期，封闭期内不办理参与、退出业务。

2、开放期：本资产管理计划首个开放期为封闭期满后次月的 12 日和 13 日，之后每满 3 个月当月的 12 日和 13 日为后续开放期，遇节假日及非交易日顺延。如有变动，管理人可视情况调整，以管理人公告为准。投资者可根据管理人届时公告在开放期进行参与或退出。

3、临时开放期：仅在合同变更、合同展期、因资产管理计划规模变动等客观因素导致管理人自有资金份额被动超过法律、法规及本合同规定比例上限的情形下，管理人才有权设置临时开放期，临时开放期内投资者仅可以办理退出业务，临时开放期的具体安排以管理人公告或管理人向投资者发出的通知为准。

如因其他目前未可预见的监管变动或行业特殊情况须安排临时开放期时，管理人将按照监管要求或征询监管意见后安排执行。

（十一）参与本集合计划的最低金额

单个投资者的最低认购金额为人民币 30 万元，追加参与不设最低金额限制，

超过最低参与金额的部分不设金额级差。

(十二) 本集合计划的各项费用

- 1、认购/申购费：无；
- 2、退出费：无；
- 3、管理费率：【0.3】%；
- 4、业绩报酬：参见合同资产管理计划的费用与税收部门；
- 5、托管费率：【0.02】%；
- 6、其他费用：参见合同资产管理计划的费用与税收部分。

第六节 资产管理计划的募集

(一) 资产管理计划的募集对象、募集方式、募集期限

1、募集对象

参与本资产管理计划的投资者应当是具备相应风险识别能力和承担所投资集合资产管理计划风险能力（本资产管理计划的募集对象为风险承受能力评估结果为 C2（相对保守型）、C3（稳健型）、C4（积极型）、C5（激进型））的普通合格投资者以及专业投资者，合格投资者累计不得超过 200 人。

2、募集方式

本资产管理计划将通过管理人的销售机构向特定客户进行销售。本资产管理计划的销售机构包括【上海甬兴证券资产管理有限公司】和【甬兴证券有限公司】，管理人有权以管理人网站公告方式增加其他销售机构。投资者认购本资产管理计划，必须与管理人和托管人签订资产管理合同，按销售机构规定的方式足额缴纳认购款项。投资者认购的具体金额和本资产管理计划份额以注册登记机构的确认结果为准。

销售机构应将本资产管理计划资产管理合同、计划说明书等正式推广文件，置备于销售机构。本资产管理计划应当面向合格投资者推广，客户风险承受能力应与本资产管理计划相匹配，销售机构应当了解客户的投资需求和风险偏好，详细介绍产品特点并充分揭示风险，引导客户审慎做出投资决定。禁止通过签订保本保底补充协议等方式，或者采用虚假宣传、夸大收益和商业贿赂等不正当手段推广本资产管理计划。

管理人及销售机构应当采取有效措施，通过管理人、中国证券业协会、中国证

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

3、募集期限

本资产管理计划初始募集期不超过 60 天，具体募集期以管理人的销售公告为准，管理人有权根据实际情况提前结束。在募集期内，投资者在工作日内交易时间可以认购本资产管理计划。如在募集期内本资产管理计划投资者人数达到 200 人，可提前终止募集期。如管理人决定提前结束募集期，应提前一个工作日通知销售机构和注册登记机构。

（二）资产管理计划的认购事项

1、认购费：本资产管理计划不收取认购费。

2、认购份额的确认

管理人在 T+1 个工作日（T 日为认购申请日）对投资者认购参与的有效性进行确认，投资者认可管理人对其认购参与有效性的确认，除经管理人同意外，不再要求管理人提供任何有效性确认的资料。募集期参与的投资者，可于本资产管理计划成立日后第 2 个工作日在办理参与的网点查询份额参与确认情况。

募集期投资者参与成功后，注册登记机构在募集期结束后统一为投资者登记权益并办理注册登记手续。

投资者同意管理人、份额登记机构或其他份额登记义务人将本资产管理计划投资者名称、身份信息以及本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。

管理人采用“金额优先+金额同等情况下时间优先”的原则对资产管理计划参与实行控制。

（1）募集期内认购申请人数不足 200 人（含 200 人）的情形：若募集期内认购申请全部确认后本资产管理计划参与的总人数不足 200 人（含 200 人），则所有的有效认购申请全部予以确认。

(2) 募集期内参与申请人数超过 200 人的情形：若募集期内认购申请全部确认后本资产管理计划参与人数超过 200 人，管理人将提前终止募集期。募集期人数上限日指在募集期资产管理计划认购申请人数超过人数上限的第一个交易日。在募集期人数上限日之前的有效认购申请全部予以确认；在募集期人数上限日的有效认购申请采用“金额优先+金额同等情况下时间优先”的原则给予部分确认，未确认部分的认购款项全部退还给投资者；在募集期人数上限日之一下个交易日，管理人通知各销售网点结束认购，同时公告募集期提前结束；在募集期人数上限日之后的认购申请全部予以拒绝。

在募集期人数上限日，管理人根据投资者申请参与金额进行从大到小排序，在申请金额同等的情况下则按时间优先原则排序，再对排序后的申请单进行逐笔确认，直到累计确认人数达到人数上限，并停止接受该资产管理计划认购申请。

3、认购份额的计算方式

认购份额=（认购金额+募集期内产生的利息）/ 资产管理计划份额面值

认购份数保留小数点后两位，小数点后第三位四舍五入。

4、初始认购资金的管理及利息处理方式

募集期内，有效认购资金应划入注册登记机构开立的结算账户，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。

投资者的认购资金（不包含认购费）在募集期产生的利息将折算为资产管理计划份额归投资者所有，利息金额以资产管理计划注册登记机构的记录为准。

（三）最低认购金额和支付方式

单个投资者的最低认购金额为人民币【30】万元，追加不设最低金额限制，超过最低参与金额的部分不设金额级差，最低认购金额不包含认购费。

（四）其他事项

1、管理人有权根据认购情况提前结束或延期结束募集期。

2、在资产管理计划募集期内，当资产管理计划募集规模接近或达到约定的规模上限（如有）时，管理人将自次日起暂停接受认购申请。

3、超额募集的控制措施

本资产管理计划在募集期内，管理人进行严格的规模限制，最大限度控制超额募集的风险。

若管理人或销售机构 T 日接受的认购申请数量过多,致使总额超出目标规模(如有),管理人或销售机构将于 T+1 日停止接受认购申请。管理人在 T+1 日对于 T 日提交的认购申请,在管理人和各销售机构所分配的限额内,按投资者认购时间从早到晚排序确认有效认购。若加上某一笔认购申请金额后,管理人或该销售机构的认购总份额超出了分配额度,则管理人对该认购申请及迟于该笔申请的认购申请予以全部拒绝,超出目标规模的部分由管理人或销售机构将认购资金无息退回投资者账户。

(五) 募集结算专用账户和销售机构委托募集账户(如有)

1、募集结算专用账户

募集结算专用账户仅用于本集合计划募集期间认购资金的归集与支付,账户信息如下:

账户名称:【上海甬兴证券资产管理有限公司】

账号:【70050122000427607】

开户行:【宁波银行股份有限公司上海闵行支行】

2、销售机构委托募集账户(如有)

管理人可根据有关法律法规的要求,选择其他符合要求的销售机构代理销售本集合计划。其他销售机构的募集账户信息以管理人公告为准,投资者可以通过管理人官方网站的公告进行查询。

(六) 募集期的利息

投资者的认购参与款项加计其在初始销售期形成的利息将折算为资产管理计划份额归投资者所有。

第七节 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

本资产管理计划的认购资金总额(不含认购费)不低于 1 千万元人民币,投资者的人数为 2 人(含)以上,且不超过 200 人,募集过程符合法律、行政法规和中国证监会的规定。

(二) 资产管理计划的募集金额缴足之日起 10 个工作日内,管理人应当委托具有证券相关业务资格的会计师事务所对资产管理计划进行验资并出具验资报告,

并在取得验资报告后公告宣布本资产管理计划成立。资产管理计划设立完成前，投资者的参与资金只能存入注册登记机构指定的募集账户，不得动用。

（三）资产管理计划设立失败

本资产管理计划募集期结束，如出现下列情形，资产管理计划设立失败，管理人承担资产管理计划的全部募集费用，并将已认购资金及利息在募集期结束后 30 个工作日内退还资产管理计划投资者已缴纳的款项，认购资金产生的利息，以注册登记机构记录为准：

- 1、本资产管理计划规模低于人民币 1 千万元；
- 2、投资者的人数少于 2 人。

（四）管理人应在资产管理计划成立起 5 个工作日内报中国证券投资基金业协会备案，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。

（五）资产管理计划在成立后备案完成前，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、货币市场基金等中国证监会认可的投资品种的除外。

（六）募集期届满，资产管理计划未达到成立条件的，管理人应当承担的责任包括但不限于：

- 1、以固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用；
- 2、在募集期届满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，具体以注册登记机构记录为准。

（七）集合计划募集期内，发生影响或可能影响本集合计划募集或运作的情形（包括但不限于市场环境及法律法规变动、证监会或相关自律组织不时发布的监管意见等），管理人有权视情况决定停止本集合计划募集。

第八节 资产管理计划的参与、退出与转让

（一）参与和退出场所

本资产管理计划参与和退出的场所为销售机构的营业场所，或按销售机构提供的其他方式办理参与和退出。

（二）参与和退出的开放日和时间

1、封闭期：本资产管理计划自成立之日起3个月及其他非开放期间为封闭期，封闭期内不办理参与、退出业务。

2、开放期：本资产管理计划首个开放期为封闭期满后次月的12日和13日，之后每满3个月当月的12日和13日为后续开放期，遇节假日及非交易日顺延。如有变动，管理人可视情况调整，以管理人公告为准。投资者可根据管理人届时公告在开放期进行参与或退出。

3、流动性安排：管理人将对资产管理计划的流动性进行安排，本集合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该计划资产净值的10%。

（三）临时开放期

仅在合同变更、合同展期、因资产管理计划规模变动等客观因素导致管理人自有资金份额被动超过法律、法规及本合同规定比例上限的情形下，管理人才有权设置临时开放期，临时开放期内投资者仅可以办理退出业务，临时开放期的具体安排以管理人公告或管理人向投资者发出的通知为准。

如因其他目前未可预见的监管变动或行业特殊情况须安排临时开放期时，管理人将按照监管要求或征询监管意见后安排执行。

（四）参与和退出的方式、价格、程序及确认等

1、参与的办理时间

本资产管理计划存续期的开放日内可办理投资者参与业务。

2、参与的原则

（1）投资者在资产管理计划存续期开放日购买资产管理计划份额的，投资者应符合合格投资者标准。

（2）采用金额参与的方式，即以参与金额申请。

（3）本资产管理计划可接受人数上限为200人。

（4）存续期参与采用“未知价”原则，即开放日参与价格以受理申请当日资产管理计划每份额净值为基准进行计算。

（5）本集合资管计划不设参与次数限制。

3、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，在开放日的交易时间段内

办理。

(2) 投资者应指定以本人名义开立的银行资金账户作为办理本集合资产管理合同项下, 支付参与资金及收取退出资金和收益等款项的账户(以下简称指定账户)。投资者申请参与时应在该指定账户备足参与的货币资金; 若指定账户内参与资金不足, 销售机构不受理该笔参与申请。

投资者承诺在本集合资产管理合同有效期内, 不得撤销指定账户, 并妥善保管账户资料, 由于投资者原因造成退出款项和收益不能及时划入指定账户及由此造成的损失, 由投资者承担, 管理人和托管人不承担责任。投资者办理参与业务时应提交的文件和办理手续、办理时间、处理规则等在遵守本合同规定的前提下, 以销售机构的具体规定为准。

(3) 投资者签署本合同后, 方可申请参与资产管理计划。投资者到资产管理计划销售机构指定营业网点的柜台申请参与资产管理计划。参与申请采取时间优先、金额优先原则进行。申请是否有效以管理人的确认为准。参与申请经确认有效后, 构成本合同的有效组成部分。

(4) 当日(T 日)在交易时间内提交的申请, 管理人或登记结算机构将在收到投资者参与申请的 T+1 日对该申请的有效性进行确认。投资者一般可于 T+2 日后在办理参与的网点查询参与确认情况。投资者应当及时查询和确认参与申请的相关信息。

确认无效的申请, 销售机构将退还投资者已交付的参与款项本金, 就该投资者而言, 集合资产管理合同自始无效。

(5) 投资者参与申请确认成功后, 其参与申请和参与资金不得撤销。

(6) 在本资产管理计划存续期内, 如开放日当日的参与申请全部确认后使得本资产管理计划的投资者人数达到 200 人以上的, 则对该开放日有效参与申请采用“金额优先+金额同等情况下时间优先”的原则给予部分确认, 未确认部分的参与款项退还给投资者。

4、退出的办理时间

投资者在开放日根据本合同约定的及管理人的公告条件退出本资产管理计划。在满足资产管理计划合同约定自有资金退出条件的情形下, 管理人可以自行安排自有资金的退出。业务办理时间以销售机构指定营业网点的规定为准。

5、退出的原则

(1) “未知价”原则，即以退出日（T 日）的资产管理计划单位净值为计价基准进行退出金额计算。

(2) 采用份额退出的方式，即退出以份额申请。

(3) “先进先出”原则，即对同一投资者在管理人或该销售机构参与的资产管理计划份额进行退出处理时，参与确认日在前的资产管理计划份额先退出，参与确认日期在后的资产管理计划份额后退出。

(4) 投资者可将其全部或部分资产管理计划份额退出。本资产管理计划按照份额进行退出，申请退出份额精确到小数点后两位。

6、退出的程序和确认

(1) 退出申请的提出

A. 投资者可按照销售机构规定的手续在原参与资产管理计划的销售机构营业网点或登录销售机构指定网络系统以自主下单的方式办理集合计划退出。

B. 投资者提交退出申请时，其在登记结算机构须有足够的集合计划份额。若投资者申请退出的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

当日（T 日）在交易时间内提交的申请，管理人或登记结算机构将在收到投资者退出申请的 T+1 日对该申请的有效性进行确认。投资者一般可于 T+2 日后在办理退出的网点查询退出确认情况。

(3) 退出款项划付

投资者的退出申请确认后，退出款项将在 T+3 日内从托管账户划出。

7、退出的限制与次数

本资产管理计划不设最低退出份额，无退出的次数限制。

8、若在资产管理计划运作期间出现需要控制规模的情形，管理人将结合资产管理计划参与、退出的情况，并参照超额募集的控制措施进行控制。

(五) 参与和退出的金额限制

投资者在资产管理计划存续期开放日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。

投资者部分退出集合计划的，其退出后持有的集合计划份额净值应当不低于规定的合格投资者最低参与金额(即 30 万元)，如完成该部分退出后该投资者剩余的集合计划份额净值低于 30 万元的，管理人自动将其剩余的集合计划份额一并退出给投资者。投资者持有的集合计划份额净值低于 30 万元时，需要退出本集合计划的，应当一次性全部退出，否则管理人将强制退出投资者持有的本计划全部份额。

(六) 参与和退出的费用

本资产管理计划无参与费和退出费。

(七) 参与份额的计算方式、退出金额的计算方式

1、参与份额的计算

参与份额=参与金额÷T 日单位净值；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。

2、退出金额的计算

本资产管理计划退出时以退出日（T 日）的资产管理计划单位净值为计价基准进行退出金额计算。

退出金额的计算公式如下：

退出金额=T 日资产管理计划单位净值×退出份额-业绩报酬（如有）

上述计算结果均以四舍五入的方法保留小数点后两位，由此产生的差额部分计入资产管理计划资产的损益。

(八) 拒绝或暂停参与、退出的情形及处理方式

1、如出现如下情形，资产管理计划管理人可以拒绝或暂停资产管理计划投资者的参与申请：

(1) 不可抗力的原因导致资产管理计划无法正常运转；

(2) 资产管理计划管理人、资产管理计划托管人或注册登记机构的技术保障或人员支持等不充分；

(3) 销售机构对投资者资金来源表示疑虑，投资者不能提供充分证明的；

(4) 资产管理计划管理人认为会有损现有资产管理计划投资者利益；

(5) 法律法规规定或中国证监会认定的其它可暂停参与的情形。

2、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资产管理计划无法正常工作；

(2) 证券交易场所交易时间非正常停市，导致当日资产管理计划资产净值无法计算；

(3) 若连续巨额退出，可以拒绝或暂停接受投资者的退出申请；

(4) 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；

(5) 法律、行政法规和中国证监会认定的其他情形或其他在说明书、资产管理合同中已载明且中国证监会无异议的特殊情形。

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，管理人应及时恢复退出业务的办理。

(九) 巨额退出或连续巨额退出

1、单个投资者大额退出的认定、申请和处理方式

(1) 单个投资者大额退出的认定

单个投资者单日退出份额超过上一日资产管理计划总份额 5%，即视为单个投资者大额退出。

(2) 单个投资者大额退出的申请和处理方式

投资者必须提前 10 个工作日直接或通过销售机构向管理人申请，否则管理人有权拒绝接受其退出申请。

(3) 巨额退出的认定和处理方式

2、巨额退出的认定

单个开放日内，本资产管理计划净退出申请份额（退出申请总份额扣除参与申请总份额之余额）超过上一日计划份额总份数的 10%，即认为是发生了巨额退出。

3、巨额退出的处理方式

当出现巨额退出时，管理人可以根据本资产管理计划当时的资产组合状况决定全额退出或部分退出。

(1) 全额退出：当管理人认为有能力支付投资者的退出申请时，按正常退出程序执行。

(2) 部分延期退出：当管理人认为支付投资者的退出申请有困难或认为兑付

投资者的退出申请可能对本资产管理计划的资产净值造成较大波动时，管理人在当日接受退出计划份额不低于上一日计划总份额的10%的前提下，对其余退出申请延期办理，延期时间不得超过10个工作日。对于当日的退出申请，按单个账户退出申请量占退出申请总量的比例，确定当日受理并接受的退出申请；未受理部分可延迟至下一个工作日办理。转入下一个工作日的退出申请不享有优先权并以该工作日的计划单位净值为依据计算退出金额，以此类推，直到全部退出为止。投资者在申请退出时可选择当日未受理部分予以撤销，未进行选择的默认顺延。

4、连续巨额退出

连续巨额退出的认定：集合计划连续两个开放日（含两日）以上发生巨额退出，即认为发生了连续巨额退出。

连续巨额退出的处理方式：出现连续巨额退出时，管理人可采用全额退出或部分延期退出方式处理，当管理人认为有必要时，也可拒绝或暂停接受退出申请，并对已经接受的退出申请，采用全额退出或部分延期退出方式处理。

（十）延期支付及延期退出的情形和处理方式

当管理人认为支付投资者的退出申请有困难或认为兑付投资者的退出申请可能对本资产管理计划的资产净值造成较大波动时，管理人在当日接受退出计划份额不低于上一日计划总份额的10%的前提下，对其余退出申请延期办理，延期时间不得超过10个工作日。对于当日的退出申请，按单个账户退出申请量占退出申请总量的比例，确定当日受理并接受的退出申请；未受理部分可延迟至下一个工作日办理。转入下一个工作日的退出申请不享有优先权并以该工作日的计划单位净值为依据计算退出金额，以此类推，直到全部退出为止。投资者在申请退出时可选择当日未受理部分予以撤销，未进行选择的默认顺延。

（十一）投资者在资产管理计划投资运作期间的份额转让事宜

集合资产管理计划存续期间，客户可以通过证券交易所、证券公司柜台交易市场等中国证监会认可的交易平台转让集合计划份额。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。资产管理计划份额转让的清算交收事宜，由资产管理计划份额登记机构根据其规则办理。受让方应当符合本合同所规定的合格投资者条件。

（十二）资产管理计划份额的非交易过户

本集合资产管理计划份额只受理继承、捐赠、司法强制执行以及其他符合规定的情况引起的计划份额非交易过户申请，对于符合条件的非交易过户的申请按登记结算机构的有关规定办理。

（十三）管理人自有资金认购/参与资产管理计划

1、自有资金认购/参与、退出的条件

本资产管理计划的管理人及其附属机构可以自有资金认购/参与本集合计划。管理人及其附属机构自有资金认购/参与、退出本集合计划时，应符合监管机构发布的相关规定的要求。

2、自有资金认购/参与方式和比例

管理人可以自有资金认购/参与本资产管理计划，管理人自有资金不超过资产管理计划规模（含自有资金部分）的【15%】。上述自有资金的份额占比如果出现不尽的情况，可由管理人按照实际计算情况进行调整，最终误差不得超过 0.1%。管理人及其附属机构以自有资金参与本集合计划时，参与份额合计不超过集合计划总份额的 50%。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，管理人可在 90 个工作日内按照本合同约定在临时开放期内申请退出所持有的份额，直至参与比例符合本合同约定。管理人自有资金参与应提前 5 个工作日告知投资者和托管人，告知方式为管理人指定披露网站公告。

3、自有资金的收益分配和责任承担方式

管理人及其附属机构自有资金参与本集合计划所形成的份额在本集合计划进行收益分配时，与其他投资者的份额享有同等权益。管理人及其附属机构自有资金参与本集合计划所形成的份额与其他投资者的份额享有同等权益、承担同等风险。

4、自有资金认购/参与、退出的约定

（1）自有资金认购/参与、退出的约束

管理人以自有资金参与集合计划的持有期限不得低于 6 个月。因本集合计划规模变动等客观因素导致管理人自有资金参与比例或管理人及其附属机构自有资金参与比例被动超标的，在遵守相关监管要求的前提下，管理人可根据自有资金参与退出的有关法规适时安排自有资金的退出，不受前述条款限制。

（2）自有资金认购/参与、退出的信息披露

管理人以自有资金参与、退出时，应当提前 5 个工作日在管理人网站上披露并

通知资产托管机构。

(3) 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，管理人及其附属机构以自有资金参与及其后续退出集合计划可不受上述参与比例和本款第(1)条、第(2)条限制，但管理人应通知托管人，通过管理人的网站告知投资者，并向中国证监会相关派出机构及证券投资基金业协会报告。

5、管理人特别提示

(1) 管理人及其附属机构有权以自有资金参与集合计划，不构成管理人及其附属机构一定会以自有资金参与集合计划以及具体参与时间的承诺。

(2) 管理人及其附属机构以自有资金参与集合计划，相关份额与投资者持有的同类份额享有同等参与收益分配的权利，不对投资者份额承担任何补偿责任。因此，管理人及其附属机构自有资金的参与不构成对投资者本金及收益的保证，也不能保证投资者份额本金不受损失。

(十四) 投资者信息报送

管理人应定期将资产管理计划投资者变更情况报送证券投资基金业协会。

第九节 份额持有人大会及日常机构

本资产管理计划不设份额持有人大会及日常机构。

第十节 资产管理计划份额的登记

(一) 本资产管理计划的份额注册登记机构为【上海甬兴证券资产管理有限公司】。注册登记机构为本资产管理计划的每一位投资者建立投资者账户，记录其全部持有的资产管理计划份额及其变动情况；为投资者办理集合计划份额的登记、管理、托管和转托管，资产管理计划份额持有人名册的管理，权益分配时红利的登记、派发，资产管理计划交易份额的清算、过户和资产管理计划交易资金的交收等业务。

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

第十一节 资产管理计划的投资

（一）投资目标

在有效控制投资风险的前提下，力争实现稳健的投资收益。

（二）投资范围及比例

1、投资范围

（1）固定收益类资产：包括现金、国内依法发行上市的国债、地方政府债、央行票据、企业债、公司债（含非公开发行公司债）、超短期融资券、短期融资券、金融企业发行债券（含次级债、混合资本债）、中期票据、非公开定向融资工具（PPN）、资产支持证券（ABS）非次级份额、资产支持票据（ABN）非次级份额以及银行存款、银行同业存单、公募债券型基金、货币市场基金、债券正逆回购（含协议式回购）；

（2）如法律法规或监管机构规则变动允许本资产管理计划投资其他品种的，经管理人、托管人及投资者一致同意后，可以将其纳入投资范围。

本资产管理计划成立后备案完成前，管理人可以现金管理为目的，投资于银行活期存款、国债、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。

2、投资比例

本集合计划投资于固定收益类资产的比例不低于计划总资产的 80%；

本资产管理计划本集合计划的建仓期为自产品成立之日起【3】个月。建仓期的投资活动，应当符合本资产管理计划合同约定的投向和资产管理计划的风险收益特征（以现金管理为目的，投资于银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债、货币市场基金的除外）。建仓期不受资产配置比例约束。建仓期结束后，管理人应当使本资产管理计划的投资组合的投向和比例符合以上约定。

本资产管理计划存续期内，因证券期货市场波动、上市公司合并、资产管理计划规模变动等管理人之外的因素致使资产管理计划投资不符合约定投资比例的，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证券投资基金业协会报告。

（三）风险收益特征

本资产管理计划风险等级为【R2】（中低风险）。适合风险识别、评估、承受能力

为 C2（相对保守型）及以上的合格投资者。本资产管理计划投资者的风险承受能力应当与本计划的风险等级相匹配。

（四）业绩比较基准及确定依据

本资产管理计划为净值型产品，业绩表现将随市场波动，具有不确定性。本资产管理计划业绩比较基准为中国人民银行公布的 7 天通知存款利率。

业绩比较基准不代表本资产管理计划的未来表现和实际收益，或管理人对本资产管理计划进行的收益承诺。投资者不应将业绩比较基准作为持有本资产管理计划份额到期的综合投资收益参考值。本计划存续期间，管理人有权根据市场情况对业绩比较基准进行调整，并在调整之日起 5 个工作日内由管理人在网站上以公告方式进行信息披露。

（五）投资策略

1、决策依据

本资产管理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，并以维护本资产管理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》以及本合同等有关法律性文件。

（2）宏观经济发展态势、微观经济运行环境和证券市场走势。这是本资产管理计划投资决策的基础。

（3）投资对象收益和风险的配比关系。在充分权衡投资对象的收益和风险的前提下作出投资决策，是本资产管理计划维护投资者利益的重要保障。针对本资产管理计划的特点，在衡量投资收益与风险之间的配比关系时，以追求投资者的本金安全为第一要旨，在此基础上为投资者争取较高的收益。

2、决策程序

管理人资产管理业务投资决策体系由管理人资产管理投资决策委员会、分管领导、部门总经理、投资经理四级体系组成。

管理人资产管理投资决策委员会是管理人资产管理业务的最高决策机构，负责审批固定收益相关的业务规则、进行投资决策、审核和批准总体投资方案等固定收益投资决策重要事项。投资经理是资产管理业务具体项目的直接管理人，在管理人授权范围内进行投资管理。

3、投资策略

通过对宏观经济、利率走势、资金供求、信用风险状况、证券市场走势等方面的分析和预测，在严格的风险控制基础上，主动构建及调整投资组合，力求实现委托财产的稳健增值。

（1）资产配置策略

通过自上而下的宏观分析与自下而上的市场研判进行前瞻性的资产配置决策。在大类资产配置上，将通过对各种宏观经济变量（包括 GDP 增长率、CPI 走势、货币供应增长率、市场利率水平等）的分析和预测，研判宏观经济运行所处的经济周期及其演进趋势。同时，积极关注财政政策、货币政策、汇率政策、产业政策和证券市场政策等的变化，分析其对不同类别资产的市场影响方向与程度，通过考察证券市场的资金供求变化以及债券市场等的估值水平，并从投资者交易行为、企业盈利预期变化与市场交易特征等多个方面研判证券市场波动趋势，进而综合比较各类资产的风险与相对收益优势，结合不同市场环境下各类资产之间的相关性分析结果，对各类资产进行动态优化配置，以规避或分散市场风险，提高并稳定委托财产的收益水平。

（2）债券投资策略

通过对利率走势、资金供求、信用风险状况、证券市场走势等方面的分析和预测，综合运用久期选择、收益率曲线分析、债券类属选择、个券选择、信用风险分析、杠杆策略等，力求规避风险并实现委托财产的保值增值。

A. 久期选择

根据中长期的宏观经济走势和经济周期波动趋势，判断债券市场的未来走势，并形成对未来市场利率变动方向的预期，动态调整组合的久期。当预期收益率曲线下移时，适当提高组合久期，以分享债券市场上涨的收益；当预期收益率曲线上移时，适当降低组合久期，以规避债券市场下跌的风险。

B. 收益率曲线分析

除考虑系统性的利率风险对收益率曲线形状的影响之外，还将考虑债券市场微观因素对收益率曲线的影响，如历史期限结构、新债发行、回购及市场拆借利率等，形成一定阶段内的收益率曲线变动趋势的预期，并适时调整委托财产的债券投资组合。

C. 债券类属选择

根据对金融债、企业债（公司债）等债券品种与同期限国债之间利差变化分析与预测，确定不同类属债券的投资比例及其调整策略。

D. 个债选择

根据债券市场收益率数据，运用利率模型对单个债券进行估值分析，并结合债券的信用评级、流动性、息票率、税赋等因素，选择具有良好投资价值的债券品种进行投资。

E. 信用风险分析

通过对信用债券发行人基本面的深入调研分析，结合流动性、信用利差、信用评级、违约风险等的综合评估结果，选取具有价格优势和套利机会的优质信用债券产品进行投资。

F. 杠杆策略

组合将配置部分折算比例高的债券，在一定范围内进行杠杆操作，以获取超额收益。管理人在进行正回购投资时，将采取严格风控挑选信用风险低、流动性好、久期适中的债券进入质押池。

G. 公募基金投资策略

管理人在充分考虑货币市场基金、债券型基金收益率、流动性、规模及风险的基础上，优先选择资产规模大、赎回到账速度快、收益率较高的产品。通过建立产品备选池，灵活调整投资组合中的投资品种及投资比例，在保证投资组合流动性的基础上，力争实现投资增值。

（3）现金类资产投资策略

本集合计划将在确定总体流动性要求的基础上，结合不同类型货币市场工具的流动性和货币市场预期收益水平、银行存款的期限、债券逆回购的预期收益率来确定现金类资产的配置，并定期对现金类资产组合平均剩余期限以及投资品种比例进行适当调整。

投资者同意并授权管理人可以根据市场情况变化在投资范围内进行策略调整和更新，管理人在调整和更新投资策略时，应遵守法律法规及中国证监会的有关规定。

（六）投资限制及投资禁止

1、投资限制

为维护投资者的合法权益，本资产管理计划的投资限制为：

(1) 本集合计划投资于固定收益类资产的比例不低于计划总资产的 80%;

(2) 本集合计划投资于同一资产的资金不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金额不得超过该资产的 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) 本集合计划投资债券正回购资金余额或逆回购资金余额均不超过上一日净资产的 100%；

(4) 本集合计划开放退出期内，其资产组合中 7 个工作日可变现资产的价值，不低于本计划资产净值的 10%；

(5) 本集合计划的总资产不超过净资产的 200%。

(6) 本集合计划投资于商业性金融债、企业债、公司债（含非公开发行的公司债）、中期票据、非公开定向债务融资工具等，主体评级或债项评级不低于 AA；

(7) 本集合计划投资于短期融资券、超短期融资券，主体评级不低于 AA 或债项评级不低于 A-1；

(8) 本集合计划投资于资产支持证券及资产支持票据的债项评级不低于 AA；

(9) 本集合计划参与债券发行申购时，所申报的金额不超过本计划的总资产，所申报的数量不超过拟发行公司本次发行的总量；

(10) 不得投资于投资范围之外的投资品种；

(11) 法律法规或监管部门规定的其他投资限制。

2、本资产管理计划的禁止行为

(1) 违规将资产管理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) 将资产管理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) 挪用资产管理计划资产；

(5) 向管理人、托管人出资；

(6) 募集资金不入账或者其他任何形式的账外经营；

(7) 募集资金超过计划说明书约定的规模；

(8) 使用资产管理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。

上述禁止行为均是根据本资产管理计划设立时现行有效的《管理办法》及《运作规定》制定的，如未来监管机构取消或修改上述规定，履行本合同约定的适当程序后，本资产管理计划将按照最新规定取消或修改上述投资限制及禁止行为。

(七) 资产管理计划的建仓期

本集合资产管理计划的建仓期为自产品成立之日起【3】个月。建仓期的投资活动，应当符合本资产管理计划合同约定的投向和资产管理计划的风险收益特征。建仓期不受资产配置比例约束。建仓期结束后，管理人应当使本资产管理计划的投资组合的投向和比例符合以上约定。

(八) 特定风险

本资产管理计划为固定收益类资产管理计划，存续期间，为规避流动性等特定风险，投资者在此明确同意，投资于对应类别资产的比例可以低于计划总资产 80%，但不得持续 6 个月低于计划总资产 80%。如对应类别资产比例持续 6 个月低于计划总资产的 80%，则本资产管理计划提前结束。

特定风险还包括市场趋势性下跌风险、发生巨额或连续巨额退出、投资标的流动性风险等。

(九) 投资的资产组合的流动性与追加、退出安排相匹配。

本资产管理计划投资的资产组合的流动性应当与参与、退出安排相匹配。

第十二节 投资顾问

本资产管理计划未聘请投资顾问。

第十三节 分级安排

本资产管理计划不设分级安排。

第十四节 利益冲突及关联交易

1、存在的或可能存在利益冲突的情形

(1) 本资管计划投资于管理人及其控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司发行或者在承销期内承销的证券；

(2) 本资管计划投资于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或者在承销期内承销的证券；

(3) 从事其他重大关联交易；

2、投资者签署本合同即视为已充分理解并同意资产管理人从事前文已经明确列明的关联交易情形，资产管理人无需就前述具体关联交易分别取得投资者的授权及事前同意。管理人运用资产管理计划财产从事上述交易时，应当遵守相关法律、行政法规、中国证监会的规定和本合同的约定，遵循投资者利益优先原则，严格按照投资决策程序进行决策和审批，采取切实有效措施防范利益冲突和利益输送；

3、管理人运用资产管理计划财产从事除前述列明情形以外的其他关联交易的，应该在本集合计划利益冲突事项发生之日起 10 个工作日内，通过管理人的网站以公告的方式及时向投资者和托管人披露，披露应当是及时、全面、客观的，披露或通知内容包括但不限于交易的时间、标的名称、数量、金额等，并向中国证监会相关派出机构和证券投资基金业协会报告，投资于证券期货的关联交易还应当向证券期货交易所报告。若该等关联交易构成重大关联交易的，则应当事先取得投资者的同意，并应当提供充分证据证明未损害投资者利益；

4、托管人应配合向管理人提供关联方信息，不晚于本集合计划成立日将其、及其控股股东、实际控制人及其其他关联方名单提供给管理人，并负责及时更新该等名单及清单。

第十五节 投资经理的指定与变更

(一) 投资经理的指定

本资产管理计划投资经理由管理人负责指定，管理人指定本合同项下投资经理为：

朱凌燕女士，英国威尔士大学 MBA，具有 16 年证券基金行业从业经历，先后任职于国泰基金、东方财富证券和申港证券，长期从事固定收益投资研究及部门管理工

作，具备证券投资基金从业资格。

学历：硕士

兼职情况：无

投资管理、投资研究、投资咨询等相关业务经验：有

是否取得基金从业资格：是

最近三年是否被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚：否

（二）投资经理变更的条件和程序

1、管理人在以下情况需更换投资经理

（1）本资产管理计划投资经理因岗位变动或离职故无法履行其职能的，管理人可以变更投资经理；

（2）管理人根据资产管理业务实际需要和内部管理规定，认为有必要的，可以变更投资经理。

2、投资经理变更的程序

管理人应在投资经理变更后 5 个工作日内告知投资者及托管人，变更后的投资经理应当符合法律法规的要求及本合同的约定。

第十六节 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、托管人的固有财产，并由托管人保管，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、除本章节第 4 款约定的情形外，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。

6、管理人、托管人不得违反法律法规的规定和资产管理合同约定擅自将计划资产用于抵押、质押、担保或设定任何形式的优先权或其他第三方权利。

（二）资产管理计划财产相关账户的开立和管理

1、托管账户的开设和管理

（1）托管人按照规定在商业银行开立与本资产管理计划有关的资金账户，管理人应配合托管人办理账户开立事宜并提供相关资料。

（2）托管账户的开设和管理由托管人负责。本资产管理计划的一切货币收支活动，包括但不限于对外投资、支付退出金额、支付计划收益、收取申购款，均需通过该账户进行。

（3）托管账户的开立和使用，限于满足开展资产管理业务的需要。托管人和管理人不得假借本资产管理计划的名义开立其他任何银行账户；亦不得使用本资产管理计划的任何银行账户进行本资产管理业务以外的活动。

托管人以管理人、托管人和资产管理计划联名的方式在中国证券登记结算有限责任公司开立专门的证券账户，并以资产管理计划的名义在中央国债登记结算有限责任公司、上海清算所开立银行间债券市场债券托管账户。托管人根据管理人提交的开户申请开立相关账户。管理人和托管人对资产管理计划资产独立核算、分账管理，保证资产管理计划资产与其自有资产、资产管理计划资产与其他客户资产、不同资产管理计划的资产相互独立。

（4）托管账户的管理应符合《人民币银行结算账户管理办法》、《现金管理暂行条例》、《支付结算办法》和中国人民银行利率管理的有关规定以及其他有关规定。

（5）托管账户预留印鉴为托管人托管业务专用章 1 枚以及监管人名章 1 枚。托管账户的开立需遵循托管人《单位银行结算账户管理协议》的相关规定。

（6）委托资产投资定期存款，管理人应与存款机构签订定期存款协议，该协议作为划款指令附件，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”。委托财产投资定期存款，预留印鉴必须有一枚托管人监管印章。如定期存款协议中未体现前述条款，托管人有权拒绝定期存款投资的划款指令。在取得存款证实书后，由托管人保管证实书正本。管理人应该在合理的时间内进行银行存款的投资和支取事宜。

2、其他账户的开设和管理

因投资运作而需要开立的其他账户，由托管人或管理人根据有关法律法规的规定开立。如该等账户是由管理人负责开立的，管理人开立此类账户后需及时通知托管人，且应保证该账户专款专用。

3、开立的上述资产管理计划财产账户与管理人、托管人、募集机构和注册登记机构自有的财产账户以及其他资产管理计划财产账户相独立。

4、对于非由托管人管理的账户，托管人不承担保管职责。

第十七节 划款指令的发送、确认和执行

（一）交易清算授权

管理人应向托管人提供预留印鉴和授权人签字/盖章样本，事先书面通知（以下称“授权通知”）托管人有权发送指令的人员名单，注明相应的交易权限，并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。授权通知应由管理人加盖公章并由其法定代表人签字或盖章。管理人向托管人发送授权通知原件，自其中载明的生效日期起开始生效。

托管人收到的授权通知原件的日期晚于通知中载明的生效日期，通知自托管人收到之日起生效。

若资产管理人同时向资产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。

（二）划款指令的内容

划款指令是在管理计划财产时，管理人向托管人发出的资金划拨及其他款项支付的指令。管理人发给托管人的指令应写明本资产管理计划全称、付款方账户信息、收款方账户信息、支付日期、付款金额、事由等，加盖管理人公章或按授权通知约定加

盖预留印鉴或被授权人签字或签章。采用电子划款指令的，管理人应与托管人就指令发送的签字、内容、方式、有效性等方面另行签订协议。

（三）指令的发送、确认和执行程序

指令由“授权通知”确定的有权发送人（下称“被授权人”）代表管理人用传真或邮件的方式（传真号：【 021-20587501 】，邮箱地址【 尾缀为@yongxingsec.com 】，托管人只接受此传真及邮箱的划款指令）或其他托管人和管理人书面约定方式向托管人发送。管理人未按照以上约定发送的指令，托管人有权拒绝执行。传真及邮件扫描件与原件不一致时，以托管人收到的指令传真及邮件扫描件为准。管理人有义务在发送指令后及时与托管人以电话方式进行确认。

托管人依照“授权通知”规定的方法确认指令有效并根据本合同约定进行审核后，方可执行指令。对于被授权人发出的指令，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，发送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，资产托管人的工作时间如下（08:30-11:30，13:30-17:00）。对于需要当日到账的交易所场外资金划转，管理人应于划款当日 15:00 前向托管人发送资金支付指令（如遇特殊情况晚于截止时间，资产托管人尽量完成），如有特殊情况，双方协商解决。对于在上交所和深交所交易的、实行“实时逐笔全额结算”和“T+0 逐笔全额非担保交收”的业务，指令发送截止时点另有要求，管理人应于 T+0 日 14:00 前出具有效划款指令，确保指令要素（包括但不限于交收金额、成交编号）与实际交收信息一致，并确保有足额头寸用于上述交易。

托管人收到管理人发送的指令后，应立即审查印鉴和签名与预留印鉴或签名的表面一致性，对指令是否违反法律法规及本合同进行形式审查，托管人可根据指令的内容要求管理人提供合同、协议等款项支付的文件依据，审查无误后应在规定期限内执行，不得延误。管理人应保证上述文件资料合法、真实、完整和有效。由管理人原因造成的指令传输不及时、未能留出足够划款所需时间，致使资金未能及时到账所造成的损失由管理人承担。

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。管理人向托管人下达指令

时，应确保银行托管账户有足够的资金余额，对管理人在银行托管账户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，并视银行托管账户资金余额足够时为指令送达时间。

管理人应在进行银行间同业市场交易后及时将交易成交单传真、邮件或以双方约定的方式发送给托管人，并电话确认。如果银行间簿记系统已经生成的交易需要取消或终止，管理人要书面通知托管人。

管理人在进行新债申购网下发行业务时，需自行或委托估值清算机构在网下申购缴款日(T 日)15:00 前将指令发送给资产托管人。

本资产管理计划财产在证券交易所场内交易的资金清算交割，由托管人通过中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司及清算代理银行办理。托管人视中国证券登记结算有限责任公司向其发送的清算数据为有效指令，无须管理人向托管人另行出具划款指令。

本资产管理计划财产资金账户发生的银行结算费用、银行账户维护费等银行费用，由托管人直接从资金账户中扣划，无须管理人出具划款指令，但如发生扣划需在扣划当日及时通知管理人。

管理人发送指令时应同时向托管人发送必要的投资合同、费用发票等划款证明文件的复印件（如有），资产管理人对该等资料真实性、有效性、完整性和合法合规性负责。购买证券投资基金时，托管人依据管理人出具的划款指令进行资金支付，同时管理人应提供相关的交易凭证或单据。

托管人在收到有效指令后，将对于同一批次的划款指令随机执行，如有特殊支付顺序，管理人应以书面形式提前告知。

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字/盖章，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。

划款指令执行日跨行累计金额超过人民币1亿元，原则上管理人应提前一个工作日告知托管人，如当日有相关资金安排，需及时与托管人沟通。

（四）托管人依照法律法规暂缓、拒绝执行指令的情形和处理程序

托管人发现管理人发送的指令违反相关法律法规或本合同的规定时，不予执行，

并及时以书面形式通知管理人纠正，管理人收到通知后应及时核对，并以书面形式对托管人发出回函确认，由此造成的损失由管理人承担。

（五）管理人发送错误指令的情形和处理程序

管理人发送错误指令的情形包括指令发送人员无权或超越权限发送指令及交割信息错误，指令中重要信息模糊不清或不全、划款指令项下投资超出本合同规定投资范围、违反本合同规定的投资限制等，未按照本合同约定的传真及邮箱地址或双方认可的其他形式发送划款指令等。

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。资产托管人按资产管理人最后确认的正确指令执行。但资产托管人因执行资产管理人的合法指令而对资产管理计划财产造成损失的，托管人不承担赔偿责任。资产托管人对执行资产管理人的依据交易程序已经生效的指令对本资产管理计划资产造成的损失不承担赔偿责任。如管理人根据托管人监督要求未及时改正，由此给投资者造成的损失管理人应当承担相应责任。因资产托管人执行资产管理人的指令而对委托财产造成的损失，由资产管理人对造成的委托财产损失承担赔偿责任。

（六）更换划款指令被授权人的程序

管理人更换被授权人员或改变被授权人员的权限(包括但不限于变更指令发送人员、联系方式、预留印鉴、签字/盖章样本等)，必须提前至少一个交易日，向托管人发送由管理人加盖公章并由其法定代表人签字或盖章的被授权人变更通知原件，并及时与托管人进行电话确认。托管人收到的授权变更通知原件的日期晚于通知中载明的生效日期，通知自托管人收到之日起生效。新的授权文件需载明具体生效时间，载明的具体生效时间不得早于电话确认时间，新的授权文件自载明日期生效，且原授权文件同时废止。管理人更换被授权人通知生效后，对于已被更换的人员无权发送的指令，或被改变授权范围人员超权限发送的指令，托管人不予执行。

（七）划款指令的保管

指令若以传真形式发出或以邮件方式发送，则正本由管理人保管，托管人保管指令传真件或邮件发送的签署版本扫描件。当两者不一致时，以托管人收到的指令传真件或签署版本扫描件为准。

（八）相关责任

在正常业务受理渠道和划款规定的时间内,因托管人故意或重大过失未能及时或正确执行符合本合同约定、合法合规的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直接经济损失,但托管人遇到不可抗力的情况除外。

如管理人的划款指令存在事实上未经授权、欺诈、伪造情形的,相关责任由过错方承担。

对于已被撤销授权的人员无权发送的指令,或被改变授权人员超权限发送的指令,因托管人原因导致执行上述指令导致委托财产损失的,应对由此造成的直接经济损失承担赔偿责任。

第十八节 越权交易的界定

(一) 本合同所指的越权交易是指法律法规禁止的买空卖空行为、投资比例超过本合同限制及其他违反本合同和相关法律法规的投资行为,不包括因证券市场波动导致的委托资产市值变化、投资组合规模变动等管理人之外的因素致使委托资产的投资比例不符合本合同限制或有关法律法规规定的情况,发生该等被动超标情况时,管理人应当在 10 个交易日内进行调整。未上市或锁定期证券应在该投资品种上市交易的 10 个工作日内将资产配置比例调整至规定的范围内。

(二) 管理人应在本合同规定的权限内运用委托资产进行投资管理,不得违反本合同的约定。

(三) 托管人对管理人的投资运作进行监督。托管人根据本合同有关资产管理计划财产的约定,对本计划的投资范围、投资比例、投资限制进行监督。托管人对管理人进行委托资产投资的监督和检查自本合同生效之日起开始。

(四) 处理方式和程序

1、场内交易:托管人根据管理人与托管人核对一致的估值表对管理人每个交易日的场内交易进行审核。如发现管理人的投资运作存在越权行为时,托管人通知管理人进行纠正;管理人收到通知后及时核查,并以电话或书面形式向投资者和托管人进行解释或举证。

2、场外交易:托管人根据对管理人发送给托管人的场外清算划款指令进行审核,如果符合要求,则立即执行;如果发现管理人的投资行为不符合规定,则在交易合同未生效的情况下提示管理人,并有权拒绝执行;如交易合同已生效,则托管

人依指令进行划款，通知管理人进行纠正。对于通过全国银行间同业拆借中心达成的债券交易（包括现券买卖、债券质押式回购、债券买断式回购、债券远期等），托管人收到场外清算划款指令，视同交易合同已生效，托管人应依指令进行划款，通知管理人进行纠正。

3、资产管理人应向投资者和资产托管人主动报告越权交易。在托管人要求管理人进行改正期间，托管人有权随时对通知事项进行复查，督促管理人改正。管理人对托管人通知的越权事项未能按托管人要求进行纠正的，托管人有权报告管理人住所地中国证监会派出机构及中国证券投资基金业协会或法律法规规定的其他相关机构。管理人应就因其越权投资管理而致使投资者及其委托资产遭受的损失承担赔偿责任。

（五）法律法规禁止的超买、超卖行为

托管人在行使监督职能时，如果发现委托资产投资证券过程中出现超买或超卖现象，应立即提醒管理人，由管理人负责解决，由此给委托资产、托管人及其托管的其他资产造成的损失由管理人承担。如果因管理人原因发生超买行为，必须于 T+1 日上午 10:00 前完成融资，用以完成清算交收。

（六）越权交易所发生的损失及相关交易费用由管理人负担，所发生的收益归本委托资产所有。

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（如有）

为本资产管理计划提供证券、期货、期权交易服务的经纪机构由管理人指定并经托管人同意。

资产管理人应在本资产管理计划开始场内交易前将本资产管理计划专用交易单元号、佣金费率等基本信息以及变更情况及时以书面形式通知托管人，并将被选中证券经营机构提供的《交易单元租用协议》及时送达托管人，确保托管人申请接收结算数据。

本资产管理计划投资证券、期货、期权（视属情况而定）前，管理人应与相应的经纪机构签订经纪合同，管理人、托管人和经纪机构可就本资产管理计划参与证券、期货、期权交易的具体事项另行签订协议。

（二）清算交收安排

1、本资产管理计划通过证券、期货、期权经纪机构进行的交易，由托管人、期货、期权经纪机构作为结算参与人代理本资产管理计划进行清算交收。本资产管理计划投资于证券发生的所有场内、场外交易的资金清算交割，全部由基金托管人负责办理。

本资产管理计划投资于场内交易的投资品种前，资产管理人和托管人应当另行签署托管银行证券资金结算协议。本资产管理计划投资于非担保交收的投资品种时，资产管理人应遵守托管人提前以告客户书形式提供的书面通知。

托管人对存放在证券、期货、期权经纪公司的资金不行使保管职责，管理人应在经纪协议或其他协议中约定由选定的证券、期货、期权经纪公司承担资金安全保管责任。

2、交易所证券、期货、期权资金结算

托管人、管理人应共同遵守所从事交易的交易所及登记结算机构（清算机构）制定的相关业务规则 and 规定，该等规则 and 规定自动成为本合同约定的内容。

管理人在投资前，应充分知晓与理解所从事交易的交易所及登记结算机构（清算机构）针对各类交易品种制定的业务规则 and 规定。

证券、期货、期权经纪机构代理本资产管理计划财产完成证券、期货、期权交易及非交易涉及的资金结算业务，并承担由经纪机构原因造成的结算交收业务无法完成的责任；若由于管理人原因造成的正常结算交收业务无法完成，责任由管理人承担。

本资产管理计划其他场内证券交易，参照上述交易所证券、期货、期权资金结算安排，由管理人、托管人协商处理。

3、场外交易资金结算

本资产管理计划场外投资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。管理人应将划款指令连同相关交易文件（包括但不限于场外投资产品的产品合同或类似法律文件）通过邮件或双方约定的其他方式发送至托管人。托管人审核无误后，应及时将划款指令交付执行。

场外投资产品的交易文件中约定的其他转让条件由管理人负责审核。管理人同时应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的收款账户必须指定为本资产管理计划的托管账户，不得划入其他账户。

4、银行间债券券款对付结算

管理人应及时将银行间上清所、中债登划款指令和成交通知单按相关规定提交基金托管人，资产管理人应为资产托管人留出执行指令所必需的时间。

管理人应根据中债登、上清所提供的查询功能，实时跟踪交易结算情况、证券与资金到账与余额变动情况，便于监控结算过程，做好资金与交易匹配的前端控制。

5、对于任何原因发生的证券资金交收违约事件，相关各方应当及时协商解决。

（三）资金、证券账目及交易记录的核对

管理人和托管人定期对资产的证券账目、实物券账目、交易记录进行核对。

第二十章 资产管理计划财产的估值和会计核算

管理人应当制订健全、有效的估值政策和程序，并定期对其执行效果进行评估，保证集合资产管理计划估值的公平、合理。

（一）估值目的：客观、准确地反映资产管理计划资产的价值。经资产管理计划资产估值后确定的资产管理计划单位净值，是进行信息披露、计算参与和退出资产管理计划的基础。

（二）估值时间：本资产管理计划成立后的每个工作日进行估值，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。估值原则应符合本资产管理合同、《证券投资基金会计核算方法》、《证券公司客户资产管理业务估值方法指引》及其他法律、法规的规定。

（三）估值方法

在不违反现行法律法规的前提下，管理人按照公平、公允、保护投资者利益的原则选择合适的估值方法，并应就此与托管人达成一致。

委托财产的估值对象为组合所拥有的各类证券、基金和银行存款本息、其他等资产及负债。

1、债券估值方法

（1）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；

(2) 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) 交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值；

(4) 首次公开发行未上市的债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，按成本估值；

(5) 全国银行间债券市场交易的债券等固定收益品种，应主要依据第三方估值机构公布的收益率曲线及估值价格，一般采用中债价格进行估值；

(6) 同一债券、开放式基金同时在两个或两个以上市场交易的，按债券或开放式基金所处的市场分别估值。

2、债券逆（正）回购按首期实付金额作为成本列示，按合同利率扣除（增加）费用后在实际持有期间内逐日确定利息收入（利息支出）。

3、银行存款、同业存单以成本列示，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，在知悉当日进行账务调整，不做追溯调整。

4、开放式基金（包括保管在场外的上市开放式基金（LOF））以估值日前一工作日基金净值估值（持有的货币市场基金，按估值日的前一工作日基金管理公司公布的每万份收益计提每日货币基金收益），估值日前一工作日开放式基金单位净值未公布的，以前最近一个工作日基金净值计算。尚未公布过基金份额净值的，应以账面价值估值。如果前一开放日至估值日该基金分红除权，则按前一开放日基金份额净值减单位份额分红额后的差额估值。

5、银行定期存款或通知存款估值方法，银行定期存款或通知存款以本金列示，按协议或合同利率逐日确认利息收入。如提前支取或利率发生变化，将及时进行账务调整。

6、如有确凿证据表明按上述规定不能客观反映本资产管理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，按最能反映本资产管理计划资产公允价值的方法估值。如：银行间债券估值如遇特殊情况，由管理人和托管人综合考虑

成本价、收益率曲线等因素确定的反映公允价值的价格估值。

7、如有新增事项或变更事项，按国家最新规定估值，管理人应于新规定实施后及时在管理人指定网站进行公告。

8、相关法律法规以及监管部门另有新规定的，从其规定。

（四）估值对象

资产管理计划所拥有的各种有价证券、银行存款本息、资产管理计划应收款项、其它投资等资产。

（五）估值程序

1、资产管理计划资产的日常估值由管理人进行，托管人于每日日终对当日的资产净值进行复核。资产管理人应于估值日交易结束后计算当日的资产净值并以电话、邮件、电子对账系统等双方认可的其它方式与资产托管人核对，托管人复核无误后返回给管理人，由管理人负责在指定网站上进行披露。月末、年中和年末估值复核与会计账目的核对同时进行。

2、当管理人与托管人的估值结果不一致时，各方应本着勤勉尽责的态度重新计算核对。如果仍无法达成一致，应以管理人的估值结果为准。如因管理人估值错误，由此给资产管理计划财产或投资者造成损失的，由管理人承担责任。

3、由于证券交易所、注册登记机构发送的数据错误或其他不可抗力等原因造成估值错误的，管理人和托管人免于承担责任。

（六）估值错误与遗漏的处理方式

1、资产管理计划份额净值的计算，四舍五入精确到小数点后四位。国家另有规定的从其规定。当资产管理计划资产的估值导致资产管理计划份额净值小数点后四位内发生错误时，视为资产估值错误。

2、管理人和托管人应当采取必要、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出现错误时，管理人应当立即披露、予以纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大。

3、如法律法规或监管机关另有规定的，按其规定处理。

（七）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，资产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估值。

（八）暂停估值的情形

当出现下列情形致使资产管理计划管理人无法准确评估资产管理计划资产价值时，可暂停估值。但估值条件恢复时，资产管理计划管理人必须按规定完成估值工作：

- 1、资产管理计划投资所涉及的证券交易所遇到法定节假日或其他原因暂停营业时；
- 2、因不可抗力或其他原因致使管理人、托管人无法准确评估资产管理计划资产价值时；
- 3、中国证监会认定的其他情形。

（九）资产管理计划份额净值的确认

1、T 日资产管理计划单位净值 $V = T$ 日闭市后的资产管理计划资产净值 / T 日资产管理计划份额的数量。

2、本资产管理计划单位净值的计算，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损益。

3、本资产管理计划累计单位净值指本资产管理计划单位净值加上单位累计分红。

4、管理人对资产管理计划单位净值、资产管理计划累计单位净值估值后，由托管人复核。

（十）特殊情况的处理

1、由于证券交易所或者注册登记机构发送错误数据，或其他不可抗力的原因，管理人和托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但仍未能正确进行估值，由此造成的资产估值错误，管理人和托管人不承担责任，但管理人和托管人应当采取积极措施减轻或消除由此造成的影响。

2、估值条件恢复时，管理人必须按规定完成估值工作。

（十一）资产管理计划的会计政策

1、本资产管理计划的会计年度为每年 1 月 1 日至 12 月 31 日。

2、记账本位币为人民币，记账单位为元。

3、资产管理计划财产的会计核算按《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证券业协会《证券公司客户资产管理业务估值方法指引》执行。

4、资产管理计划应独立建账、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；托管人应定期与管理人就资产管理计划的会计核算、报表编制等进行核对。

第二十一节 资产管理计划的费用与税收

（一）本资产管理业务费用的种类

- 1、管理费；
- 2、托管费；
- 3、业绩报酬；
- 4、资产管理计划财产开立账户需要支付的费用；
- 5、资产管理计划资金汇划发生的银行汇划费用（资金结算汇划费、账户维护费）；
- 6、委托财产的交易费用，包括证券、基金交易费用、交易佣金费用等；
- 7、按照法律法规及本合同的约定可以在委托资产中列支的其他费用，包括但不限于会计师事务所的审计费用，如涉及诉讼、仲裁，还有案件受理费、律师代理、申请执行或公证等相关费用；
- 8、相关税费；
- 9、资产管理计划清算费用；
- 10、按照法律法规及本合同约定可以在计划资产中列支的其他费用。

（二）管理费、托管费等费用的计算方法及支付方式

1、管理费

本资产管理计划的管理费按前一自然日集合计划资产净值的【0.3%】的年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 【0.3\%】 \div 365$$

H 为每日应计提的管理费

E 为前一自然日集合计划资产净值

本资产管理计划的管理费自计划成立日的下一个自然日起，每日计提，按自然季支付。在下个自然季度初的第三个工作日，管理人向托管人出具资金划款指令，按照指定的账户路径支付上个季度的管理费。如遇托管账户资金余额不足的，托管

人可待托管账户有资金时再划扣。费用划扣后，托管人应向管理人告知管理费支付金额及计算方式，管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系托管人协商解决。若因战争、自然灾害等不可抗力致使无法按时支付的，则在不可抗力情形消除后的首个工作日支付。产品终止后，依据清算程序支付本资产计划尚未支付的管理费。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

管理人指定的接收管理费的银行账户信息：

账户名称（接收管理费）：上海甬兴证券资产管理有限公司

账号：97990078801700001818

开户行：上海浦东发展银行第一营业部

行号：310290098012

2、托管费

本资产管理计划的托管费按前一自然日集合计划资产净值的【0.02%】的年费率计提。托管费的计算公式如下：

$$H=E \times 【0.02\%】 \div 365$$

H 为每日应计提的托管费

E 为前一自然日集合计划资产净值

本资产管理计划的托管费自计划成立日的下一个自然日起，每日计提，按自然季支付。在下个自然季度初的第三个工作日，管理人向托管人出具资金划款指令，按照指定的账户路径支付上个季度的托管费。如遇托管账户资金余额不足的，托管人可待托管账户有资金时再划扣。费用自动扣划后，管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系托管人协商解决。若因战争、自然灾害等不可抗力致使无法按时支付的，则在不可抗力情形消除后的首个工作日支付。资产托管人指定的接收托管费的银行账户信息：

账户名称（接收托管费）：【证券公司客户资产托管业务收入】

账号：【97990142110000075】

开户银行：【上海浦东发展银行第一营业部】

大额支付系统行号：【310290098012】

3、证券交易费用

本资产管理计划投资运作期间所发生的交易手续费、印花税等有关税费，作为交

易费用在交易过程中直接扣除。

4、增值税费

本资产管理计划运作期间的增值税费，在每月月初的第五个交易日至第八个交易日，经管理人与托管人核对无误，从委托资产中划出至管理人指定的缴税账户。

支付方式：

账户名称（接收增值税费）：上海甬兴证券资产管理有限公司

账号：97990078801700001818

开户行：上海浦东发展银行第一营业部

行号：310290098012

（三）其他费用

1、账户开户费

因银行存款账户、证券账户开立所产生的费用，应于合同生效日后 5 个工作日缴纳，由资产管理人出具划付指令从资产管理计划财产中进行支付，如合同未在规定时间内生效的，由资产管理人先行垫付。资产管理人垫付的证券账户在线开立费，由资产管理人直接出具划付指令从资产管理计划财产中进行支付，不再另外出具证券账户费用发票，但需提供包含收付款账户信息及费用金额的资金往来流水或者资产管理人的情况说明作为划付指令的附件（加盖预留业务章）。

2、证券资产非交易过户相关费用、银行汇划费用、交易费用等产品运营过程中发生的相关费用及如果国家有关规定调整可以列入的其他费用，托管人可以直接从托管账户中扣划，无需管理人出具划款指令；在存续期间发生的会计师费，为保护和实现委托资产权利及解决因处理委托资产事务产生的纠纷而发生的费用，包括但不限于律师费、诉讼费、仲裁费、公证费、评估费、拍卖费、保全费及其他形式的资产处置费，该部分费用将从本产品资产中列支，需管理人出具划款指令，托管人再从托管账户中扣划，不足部分由投资者另行偿付。

3、银行间费用

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委托财产运作费用。投资者和管理人在此申明已了解委托资产投资会产生的银行间费用，并确保账户中有足够资金用于银行费用的支付，如因托管账户中的资金不足以支付银行间费用影响到指令的执行，管理人承担由此产生的损失

和责任；如委托资产未起始运作，由管理人在收到托管人的缴费通知后完成支付，托管人不承担垫付费用义务。

（四）不得列入委托资产费用的项目

管理人、托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或委托资产的损失，资产管理计划成立前发生的费用以及处理与委托资产无关的事项发生的费用等不得列入委托资产费用。

（五）业绩报酬

1、业绩报酬计提原则

（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，在本集合计划投资者退出日和本集合计划终止日计提业绩报酬；

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

（5）本集合计划业绩报酬提取频率不得超过每6个月一次，因投资者退出本集合计划，管理人按照约定提取业绩报酬的，不受提取频率的限制。

2、业绩报酬计提办法

本集合计划年化收益率的计算公式如下：

$$R = \frac{P_1 - P_0}{P_0^*} * \frac{365}{N} * 100\%$$

R 为该笔集合计划份额的年化收益率；

P_1 为业绩报酬计提日的该笔集合计划份额的单位累计净值；

P_0 为该笔集合计划份额参与时的单位累计净值；

P_0^* 为该笔集合计划份额参与时的单位净值；

N 为该笔集合计划份额的期间经历天数（参与确认日（含）至本次业绩报酬计提日（不含））；

管理人以超额比例的方式提取业绩报酬，具体计算方法如下：

年化收益率（ R ）	计提比例	业绩报酬总额（ Y ）的计提公式
--------------	------	--------------------

$R \leq \text{【3.8\%】}$	0	$Y=0$
$R > \text{【3.8\%】}$	$\text{【50\%】}$	$Y=A \times (R - \text{【3.8\%】}) \times \text{【50\%】} \times N/365$

注：Y 为投资者每笔认购或参与应提的业绩报酬，A 为投资者每笔认购或参与时的资产净值总额，N 为该笔集合计划份额的期间经历天数（参与确认日（含）至本次业绩报酬计提日（不含））。

管理人在此郑重提示投资者：业绩报酬计提基准仅为管理人根据市场利率等因素设定的提取业绩报酬的基准，仅供投资者参考，不构成管理人对投资者的收益承诺，管理人不保证投资者投资收益达到业绩报酬计提基准，也不保证投资者资产本金不受损失。

3、业绩报酬支付方式

业绩报酬在业绩报酬计提日（如有）计提，由管理人在计提次日向托管人发送业绩报酬划付指令，托管人复核无误后，根据管理人的划付指令从集合计划资产中将计提的业绩报酬划付给管理人。业绩报酬计入管理费，须与产品对应并逐个结算，管理人管理的不同产品之间不得相互串用。如托管人与管理人对业绩报酬金额无法达成一致意见的，以管理人数据为准。若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

（六）税收

为免歧义，各方特别约定并优先使用如下条款：本合同各方特别约定，如依据相关法律法规或财政税务主管部门的规定，就本资产管理计划投资运营过程中发生的增值税应税行为及其他应税行为，由管理人作为纳税主体缴纳的，该税费由计划财产承担，管理人有权以计划财产予以缴纳，且无需事先征得投资者的同意（除本约定外，本资产管理计划已列明的资产管理业务费用产生的税费由各收款方自行缴纳的，相关方应自行缴纳）。管理人在向投资者交付利益或资产后税务机关要求管理人缴纳相关税费的，投资者应按照管理人通知要求缴纳相应税费（具体以管理人通知为准），管理人亦有权以计划剩余财产直接缴纳；投资者不得要求管理人以任何方式向其返还或补偿该等税费。如管理人因此垫付相应税费等款项的，管理人有权向投资者追索垫付的税费和孳息款项，投资者应按管理人通知向管理人指定账户返还垫付款。投资者已知悉并同意，计划资产承担上述税费可能导致资产变现损失或投资收益减损。

第二十二节 资产管理计划的收益分配

本资产管理计划不进行收益分配。

第二十三节 信息披露与报告

（一）定期报告

定期报告包括资产管理计划单位净值报告、资产管理计划的资产管理季度（年度）报告、托管季度（年度）报告、年度审计报告和对账单。

1、资产管理计划单位净值报告

（1）披露时间：每个工作日披露上一工作日经托管人复核的资产管理计划单位净值。

（2）披露方式：管理人通过管理人网站（www.yxzqzg.com）披露资产管理计划单位净值。

2、资产管理计划的资产管理季度报告和托管季度报告

（1）管理人每季度向投资者提供一次准确、完整的资产管理季度报告，对报告期内资产管理计划资产的配置状况、价值变动情况、重大关联交易等做出说明。资产管理季度报告由管理人编制，资产托管人仅对其中的投资组合报告、财务数据表等中的财务数据进行复核。托管人每季度出具托管报告。上述报告应由管理人于每季度截止日后一个月内通过管理人网站公告，并报中国证券投资基金业协会、证券公司（管理人）住所地中国证监会派出机构。

（2）季度报告包括但不限于下列信息：

- A. 管理人履职报告；
- B. 托管人履职报告；
- C. 资产管理计划投资表现；
- D. 资产管理计划投资组合报告；
- E. 资产管理计划运用杠杆情况（如有）；
- F. 资产管理计划财务会计报告；
- G. 资产管理计划投资收益分配情况；
- H. 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；
- I. 中国证监会规定的其他事项。

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。

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集合计划，管理人应通过季度报告或其他方式向投资者进行披露，并向中国证监会相关派出机构和证券投资基金业协会报告。

3、资产管理计划的资产管理年度报告和托管年度报告

(1) 管理人每年度向投资者提供一次准确、完整的资产管理年度报告，对报告期内资产管理计划资产的配置状况、价值变动情况、重大关联交易等做出说明。资产管理年度报告由管理人编制，资产托管人仅对其中的投资组合报告、财务报表等中的财务数据进行复核。托管人在每年度出具托管报告。上述报告应由管理人于每年度截止日后 4 个月内通过管理人网站公告，并报中国证券投资基金业协会、证券公司（管理人）住所地中国证监会派出机构。

2、年度报告包括但不限于下列信息：

- A. 管理人履职报告；
- B. 托管人履职报告；
- C. 资产管理计划投资表现；
- D. 资产管理计划投资组合报告；
- E. 资产管理计划运用杠杆情况（如有）；
- F. 资产管理计划财务会计报告；
- G. 资产管理计划支付的管理费、托管费、业绩报酬（如有）等费用，包括计提基准、计提方式和支付方式；
- H. 资产管理计划投资收益分配情况；
- I. 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；
- J. 中国证监会规定的其他事项。

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年度报告。

4、年度审计报告

管理人应当聘请具有证券相关业务资格的会计师事务所对本资产管理计划的运营情况进行年度审计，并在每会计年度结束之日起 4 个月内将审计报告提供给托

管人，通过管理人网站向投资者提供，并报告中国证券投资基金业协会、管理人住所地中国证监会派出机构。

5、对账单

(1) 管理人根据投资者的申请要求，向投资者提供季度对账单。对账单内容应包括投资者持有计划份额的数量及净值，参与、退出明细，以及收益分配等情况。

(2) 投资者应向管理人提供邮寄地址、电子邮箱等信息，因投资者未正常提供以上信息、邮寄、邮箱运营商系统平台故障及内部操作等原因导致投资者未能获得对账单的，管理人不承担任何责任。

(二) 临时报告

本资产管理计划存续期间，发生对本资产管理计划持续运营、客户利益、资产净值产生重大影响的事件，管理人应当在事项发生之日起五个工作日内在管理人网站公告的方式及时向客户披露。临时报告的情形包括但不限于：

- 1、资产管理计划运作过程中，负责集合资产管理业务的投资经理发生变更，或出现其他可能对资产管理计划的持续运作产生重大影响的事项；
- 2、发生巨额退出并延期支付；
- 3、资产管理计划终止和清算；
- 4、资产管理计划存续期满并展期；
- 5、管理人以自有资金参与和退出；
- 6、合同的补充、修改与变更；
- 7、资产管理计划有关的重大诉讼、仲裁事项；
- 8、负责本资产管理计划的代理销售机构发生变更；
- 9、资产管理计划投资于管理人及与管理人有关联关系的公司发行的证券或承销期内承销的证券；
- 10、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；
- 11、管理人、托管人因解散、破产、撤销等原因不能履行相应职责；
- 12、管理人或托管人变更；
- 13、资产计价出现错误（当资产估值导致本资产管理计划单位净值小数点后四位以内发生差错时，视为本资产管理计划单位净值错误）；
- 14、管理费、托管费等费用计提方式或费率发生变更；

15、其他发生对资产管理计划持续运营、客户利益、资产净值产生重大影响的事件；

16、管理人认为重大的其他事项。

（三）管理人、托管人应当按照以下要求向监管机构进行报告：

1、每季度结束之日起一个月内，管理人应当向监管机构报送季度报告；每年度结束之日起四个月内，管理人应当向监管机构报送年度报告；

2、发生资产管理合同约定的或者可能影响投资者利益的重大事项时，管理人应当在事项发生之日起五日内向监管机构报告；

3、本合同约定以及中国证监会规定的其他报告。

第二十四节 风险揭示

本资产管理计划面临包括但不限于以下风险：

（一）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资金本金不受损失，也不保证一定盈利及最低收益。

本资产管理计划属于中低风险收益（R2）风险投资品种，适合风险承受能力为相对保守型（C2）及以上的合格投资者。

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。

市场风险主要包括但不限于：

（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，影响集合资产管理业务的收益而产生风险。

（2）经济周期风险。经济运行具有周期性的特点，受其影响，集合资产管理业务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，使集合资产管理业务收益水平随之发生变化，从而产生风险。

（4）购买力风险。集合资产管理业务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，从而使集合资产管理业务的实际收益下降。

（5）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、财务等都会导致公司盈利状况发生变化。如集合资产管理业务所投资的上市公司经营不善，与其相关的证券价格可能下跌，或者能够用于分配的利润减少，从而使集合资产管理业务投资收益下降。

（6）再投资风险。投资者为了实现购买债券时所确定的收益相等的收益，这些临时的现金流就必须按照等于买入债券时确定的收益率进行再投资。如果这些临时性的现金流不得不以较低的利率进行再投资，这种风险就称为再投资风险。如果投资者只购买了短期债券，而没有购买长期债券，就会有再投资风险。再投资风险还是一个利率风险问题。

3、管理风险

在集合资产管理业务运作过程中，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业务的收益水平，从而产生风险。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

集合资产管理业务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的风险。流动性风险按照其来源可以分为两类：

（1）外生流动性风险

外生流动性风险指的是由于来自资产管理人外部冲击造成证券流动性的下降，这样的外部冲击可能是影响所有证券的事件，也可能只是影响个别证券的事件，但是其结果都是使得所有证券、某类证券或者单只证券的流动性发生一定程度的降低，造成证券持有者可能增加变现损失或者交易成本。

（2）内生流动性风险

所谓内生流动性风险是指由于本集合资产管理计划组合的资产需要及时调整仓位而面临的不能按照事前期望价格成交的风险，该风险可以以本集合资产管理计划资产变现（或购买证券）时成交价格小于（或大于）事前期望价格所产生的最大成本来度量。内生流动性风险在一定程度上是可控的，但其可控程度取决于流动性风险的来源及外部冲击。

5、信用风险

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

6、募集失败风险

本集合计划的成立需符合相关法律法规的规定，本集合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）在集合计划募集期限届满（确认集合计划无法成立）后三十日内退还投资者已缴纳的款项，并加计银行同期活期存款利息。

7、投资标的的风险

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

8、关联交易风险

投资者事先同意管理人可以将本资产管理计划的资产投资于管理人、托管人及前述机构的控股股东、实际控制人或者其它关联方发行的证券或承销期内承销的证券，或从事其他重大关联交易，从而可能存在关联交易风险，资产管理人将在投资完毕后履行相应的信息披露义务。投资者知悉并同意，资产管理人以现金管理为目的，可投资托管人同业存单及银行存款等，且不再另行公告。

9、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。

10、技术风险

在集合资产管理业务的日常交易中，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客户的利益受到影响。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、税收风险

（1）集合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，则投资者收益也会因相关税收政策调整而受到影响。若由于法律法规变化等原因导致集合资产管理计划需要缴纳的税收增加，则投资者的实际可获得的收益在扣除税收后将会减少的风险。

（2）增值税应税风险。根据财政部和国家税务总局《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》（财税【2016】140 号文）、《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》（财税【2017】2 号文）、《关于资管产品增值税有关问题的通知》（财税【2017】56 号文），2018 年 1 月 1 日（含）以后，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，应缴纳增值税。根据资管合同，该增值税由本资产管理计划财产承担，管理人有权从资管计划财产计提和扣收增值税。在该种情况下，资管计划的可分配收益可能受到影响，由此会产生投资者收益的减少的风险。

（二）特定风险揭示

1、本资产管理计划所投标的的特定风险

（1）投资于债券的风险，包括但不限于：

A. 市场平均利率水平变化导致债券价格变化的风险；
B. 债券市场不同期限、不同类属债券之间的利差变动导致相应期限和类属债券价格变化的风险；

C. 债券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，或由于债券发行人信用质量降低导致债券价格下降的风险。

（2）投资于公募基金的风险，包括但不限于：

A. 公募基金的流动性风险

流动性风险是指在开放式基金运作过程中，可能会发生基金管理人未能以合理

价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项或对价的风险。

B. 暂停接受赎回申请的风险

在特定情形下，本资产管理计划部分或全部赎回申请可能被拒绝，同时本资产管理计划完成基金赎回时的基金份额净值可能与本资产管理计划提交赎回申请时的基金份额净值不同。

C. 延缓支付赎回款项的风险

在特定情形下，本资产管理计划接受赎回款项的时间将可能比一般正常情形下有所延迟，可能对投资者的资金安排带来不利影响。

D. 收取短期赎回费的风险

各公募基金对持续持有期少于其规定期限的投资者可能会收取赎回费，并将上述赎回费全额计入基金财产。短期赎回费的收取将使得本资产管理计划在持续持有期限少于投资的公募基金规定的期限时会承担较高的赎回费。

E. 公募基金暂停基金估值的风险

在特定情形下，本资产管理计划一方面没有可供参考的基金份额净值；另一方面投资的公募基金将暂停接受基金申购赎回申请，暂停接受基金申购赎回申请将导致本资产管理计划投资者无法申购或赎回本资产管理计划的可能。

(3) 正回购的风险

正回购即融资回购，是一方以一定规模债券向另一方作抵押融入资金，并承诺在日后再从另一方购回所抵押债券的交易行为。抵押债券所获得的资金可以再行投资或抵押，相当于放大原始资金的倍数，具有投资风险。

(4) 投资于资产证券化的风险，包括但不限于：

资产支持证券信用增级措施相关风险、资产支持证券的利率风险、资产支持证券的流动性风险、评级风险、原始权益人破产风险、现金流预测风险及其他与基础资产相关的风险。

(5) 投资于非公开发行公司债（含中小企业私募债）的风险，包括但不限于：

由于该类债券采取非公开方式发行和交易，并不公开各类材料（包括招募说明书、审计报告等），外部评级机构一般不对这类债券进行外部评级，可能会降低市场对这类债券的认可度，从而影响这类债券的市场流动性。另一方面，由于中小企业私募债的债券发行主体资产规模较小、经营的波动性较大，且各类材料不公开发

布，也大大提高了分析并跟踪发债主体信用基本面的难度。由此可能给计划净值带来不利影响或损失。

2、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

基金业协会针对集合合同条款内容发布了《集合资产管理计划资产管理合同指引（试行）》，本合同虽已在能够满足本资产管理计划投资需要的前提下涵盖了合同指引明确要求的条款，但合同指引主要为概括性、原则性约定，本合同具体条款约定不可避免的比合同指引更为复杂具体，也不可避免与合同指引不完全相同。投资者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。

3、资产管理计划未在证券投资基金业协会完成备案手续或不予备案情形所涉风险

本资产管理计划成立后需在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，即使本资产管理计划成立，并不意味着本资产管理计划必然能获得基金业协会的备案。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，将可能导致本资产管理计划错过市场行情或投资机会；本资产管理计划如在中国证券投资基金业协会备案未通过，则需要按照监管机构的要求修改本合同或提前终止本资产管理计划，本资产管理计划在上述情形下存在需要修改合同或提前终止的风险。如备案未通过，管理人有权提前终止本资产管理计划，管理人退还投资者的资金总额为投资者投资本金加上期间活期存款利息。由此直接影响投资者参与本资产管理计划的投资目的，请投资者注意。

4、计划存续期间，为规避流动性等特定风险，投资于对应类别资产的比例可以低于计划总资产 80%，但不得持续 6 个月低于计划总资产 80%。如对应类别资产比例持续 6 个月低于计划总资产的 80%，则本资产管理计划提前结束。

5、电子合同签署风险

本集合计划投资者采用电子签名的方式签署相关合同，在电子合同签署的过程中，由于投资者向销售机构提供的个人（或机构）信息不全或有误被管理人、托

管人或注册登记机构确认需补正的，投资者面临补正上述信息后重新签署电子合同的风险；管理人、销售机构或注册登记机构电子合同相关系统出现故障或人为操作因素，导致投资者电子签名合同数据没有被系统接收，投资者面临重新签署电子合同的风险。

6、资产管理计划委托募集所涉风险

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

（1）销售机构采用公开宣传或变相公开宣传的方式销售本资产管理计划。

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

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

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

（5）销售机构从业人员可能未经正式授权即从事资产管理计划募集活动。

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

7、关联关系风险

本资产管理计划的代销机构【甬兴证券有限公司】与资产管理人存在关联关系。代销机构应当对本计划资产管理人履行严格的利益冲突评估机制。

8、外包服务风险

本资产管理计划的管理人可能将本计划的估值核算等运营服务事项外包给【甬兴证券有限公司】办理，因外包机构经营风险、技术系统故障、操作失误等，可能使得外包事项发生差错，给本计划运营带来风险。

9、其他特殊风险

本资产管理计划可能存在的其他特殊风险。

（三）其他风险

1、发生不可抗力事件的风险。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；

2、管理人、托管人因停业、解散、撤销、破产，或者被中国证监会撤销相关业务许可、责令停业整顿等原因不能履行职责所导致的风险；

3、资产管理计划管理人向投资者提供对账单（管理人将根据实际情况选择使用电子邮件、快递寄送等方式），投资者应向管理人提供正确、有效的电子邮件、寄送地址等资料。可能存在由于投资者提供的联系信息不准确、系统故障等原因，而不能有效接收对账单的风险；

4、合同变更风险。投资者可能面临由于法律、法规、规章、中国证监会的规定、证券登记结算机构业务规则以及证券交易所等交易规则修订导致合同变更的风险；

5、其他不可预知、不可防范的风险。

第二十五节 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、以下情况可由管理人和托管人协商后修改：

（1）调低管理费、托管费等费用；

（2）法律法规要求增加的资管计划费用的收取；

（3）因相应的法律法规或中国证监会、证券投资基金业协会的相关规定、要求发生变化必须变更资产管理合同的，管理人可以与托管人协商后修改资产管理合同，并由管理人按照合同约定及时向投资者披露变更的具体内容；

（4）管理人应当合理保障合同变更后投资者选择退出资产管理计划的权利；

（5）投资者不同意变更的，应在公告后的 2 个工作日内以书面方式告知管理人。投资者未在前述时间回复意见的视为投资者同意合同变更。投资者不同意变更的，管理人应对不同意变更的投资者退出事宜作出公平、合理安排；

（6）以上合同变更公告满 5 个工作日后生效。投资者同意，无论其是否提出退出申请，管理人经与托管人书面达成一致并公告期满后变更本合同的行为均不应被视为或裁定为管理人或托管人的违约行为。

2、因其他原因需要变更资产管理合同的，可通过签署补充协议等方式进行合同变更。投资者不同意变更的，管理人应对不同意变更的投资者退出事宜作出公平、

合理安排。资产管理计划改变投向和比例的，应当事先取得投资者同意。资产管理合同发生变更的，管理人应按照证券投资基金业协会要求及时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。

3、管理人应当合理保障合同变更后投资者选择退出资产管理计划的权利。在合同变更基于投资者利益考虑的情形，设置临时开放日，临时开放日投资者只能申请退出，不能参与，临时开放日的具体安排以管理人公告为准。

4、当发生“①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，资产管理计划由其他管理人承接；②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，资产管理计划由其他托管人承接”情形时，管理人和托管人的更换程序如下：

（1）管理人的更换程序

A. 公告：管理人更换后，由托管人在中国证监会批准后 5 个工作日内公告。如果托管人和管理人同时更换，中国证监会不指定且没有中国证监会认可的机构进行公告时，由拟担任新任管理人的机构办理公告。

B. 交接：原管理人应作出处理资管计划事务的报告，并向新任管理人办理资管计划事务的移交手续；新任管理人应与托管人核对资管计划资产总值和净值。

C. 资管计划名称变更及合同修改：管理人更换后，应按其要求替换或删除资管计划名称中原公司的字样，并对合同进行变更。

（2）托管人的更换程序

A. 公告：托管人更换后，由管理人在中国证监会和中国人民银行批准后 5 个工作日内公告。如果托管人和管理人同时更换，中国证监会不指定，且没有中国证监会认可的机构进行公告时，由拟担任新任管理人的机构办理公告。

B. 交接：原托管人应作出处理资管计划事务的报告，并与新任托管人进行资管计划资产移交手续；新任托管人与资管计划管理人核对资管计划资产总值和净值。

5、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。

6、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，约定保证资产管理计划资产投资收益、承担投资损失，或排除投资者自行承担投资风险和损失。

（二）资产管理计划的展期

本资产管理计划管理期限为【9】年，到期可展期。

1、展期的条件

（1）在存续期间，本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、本合同、《说明书》的约定；

（2）展期没有损害投资者利益的情形；

（3）中国证监会规定的其他条件。

本集合资产管理计划展期的，还应当符合本集合资产管理计划的成立条件。

2、展期的程序与期限

（1）展期的程序：本资产管理计划拟展期的，管理人应当在指定网站上公告，并同时公告资产管理计划的具体展期方案。

（2）展期的期限：管理人可以决定展期的期限，并以公告形式通知投资者。

3、展期的安排

（1）通知展期的时间及方式

管理人与托管人协商一致后在管理人网站进行公告，对资产管理计划展期事宜进行说明。

（2）投资者参与展期

管理人将通过公告对投资者回复的方式做出安排，并通知投资者如不同意参与资产管理计划展期，应在公告规定期限内按照管理人公告规定的形式作出答复；未在规定时间内作出答复的，视为同意本资产管理计划展期。

4、投资者不同意展期的处理办法

不同意展期的投资者，可以在原存续期届满前的开放日或资产管理人设定的展期临时开放日内通过销售机构办理退出手续，具体办理要求和相关事项以管理人公告为准。未在原存续期届满前的开放日或资产管理人设定的展期临时开放日内办理退出手续的，视为同意展期。

5、展期的实现

（1）如果展期后的集合资产管理合同、计划说明书与原集合资产管理合同、计划说明书有变更之处，管理人将在其指定网站上对新的集合资产管理合同、计划说明书进行公告，并在 5 个工作日内将变更情况报中国证券投资基金业协会或其他

机构备案，同时抄送管理人住所地中国证监会派出机构。

(2) 若同意本资产管理计划展期的投资者的人数不少于 2 人，且原存续期届满日符合展期条件的，本资产管理计划在原存续期届满日的次日实现展期，否则本资产管理计划不能展期。

(3) 若本资产管理计划在原存续期届满日有未能流通变现的资产，同意展期的投资者需同意继续持有该未能流通变现的资产，且同意展期的投资者持有的资产管理计划资产净值不得低于本资产管理计划未能流通变现资产规模，否则本资产管理计划不能展期。

(4) 本资产管理计划可以连续展期，且展期次数不限。

(5) 管理人应在展期后 5 个工作日内将展期情况报中国证券投资基金业协会或其他机构备案，同时抄送管理人住所地中国证监会派出机构。

(三) 资产管理计划的终止

资产管理计划终止的情形，包括但不限于下列事项：

- 1、资产管理计划存续期届满且不展期；
- 2、经全体投资者、管理人和托管人协商一致决定终止的；
- 3、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；
- 4、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；
- 5、持续 5 个工作日投资者少于 2 人的；
- 6、未在证券投资基金业协会完成备案或不予备案的情形；
- 7、法律、行政法规、中国证监会规定及资产管理合同约定的其他情形。

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，并抄报中国证监会相关派出机构，前述第（六）项约定的情形除外。

(四) 资产管理计划的清算

资产管理计划在发生终止情形之日起五个工作日内开始由管理人组织清算资产管理计划资产，以及财产清算的有关事项：

1、资产管理计划财产清算小组

(1) 资产管理计划财产清算小组成员由管理人和托管人组成。清算小组可以

聘用必要的工作人员。

(2) 资产管理计划财产清算小组负责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。

2、资产管理计划财产清算的程序

(1) 资产管理计划达到终止条件管理人应通知托管人准备进入清算程序。自资产管理计划终止之日起 5 个工作日内成立资产管理计划清算小组，资产管理计划清算小组按照监管机构的相关规定进行资产管理计划清算；

(2) 清算过程中的有关重大事项应当及时公布；

(3) 清算结束后 5 个工作日内，管理人和托管人应当在按照本合同规定扣除清算费用、管理费、托管费等费用后，将资产管理计划资产按照投资者拥有资产管理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，并注销资产管理计划专用证券账户、资金账户等；

(4) 对于由计划交纳、注册登记机构收取的最低结算备付金和交易单元保证金，在注册登记机构对其进行调整交收日才能收回，届时，资产管理计划清算小组将及时按照投资者拥有份额的比例或者集合资产管理合同的约定，以货币资金的形式全部分配给投资者，并注销资产管理计划专用证券账户和资金账户。

(5) 清算结束后 5 个工作日内，管理人应当按照本合同约定的清偿顺序分配资产管理计划剩余财产。

3、清算费用由计划财产承担，支付方式以管理人公告为准。

4、资产管理计划财产清算及剩余资产的分配

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) 清偿计划债务；

(4) 按照合同约定支付管理费、托管费；

(5) 将资产管理计划资产按投资者持有资产管理计划份额的比例和合同约定分配给投资者。

5、资产管理计划延期清算处理方式

若本资产管理计划在终止之日有未能流通变现的证券，管理人可对此制定多次

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。管理人应根据多次清算方案的规定，对前述未能流通变现的证券在可流通变现后进行多次清算，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，以货币资金的形式全部分配给投资者。

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中国证券投资基金业协会报告。

6、资产管理计划财产清算报告的告知安排

清算结束后 5 个工作日内由资产管理计划清算小组在管理人网站公布清算结果，并且在清算结束后 5 日内，将清算结果报中国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。

7、资产管理计划财产清算完毕后，托管人按照规定注销资产管理计划财产的托管账户、证券账户和期货账户等投资所需账户，管理人应给予必要的配合。

8、资产管理计划财产清算账册及文件由管理人保存 20 年以上。

第二十六节 违约责任

（一）管理人、托管人在履行各自职责的过程中，违反法律、行政法规的规定或者本合同约定，给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，且在本合同生效之后发生的，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、突发停电或其他突发事件、注册登记机构非正常的暂停或终止业务、证券交易所非正常暂停或停止交易或不可预测或无法控制的系统故障、设备故障、通讯故障等，此外，同行业现有技术水平无法预见或无法避免或无法抗拒的技术原因亦属于不可抗力等。

一方因不可抗力不能履行本合同时，应及时通知其他方，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资产管理计划资产及其他当事人损失扩大。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；

4、在没有主观恶意或重大过失的情况下，托管人执行管理人的生效指令对资产管理计划资产造成的损失；托管人对于存放在托管人之外的委托财产的任何损失，及基于从第三方机构（包括但不限于证券交易所、期货交易所等）合法获得的信息及合理信赖上述信息而操作导致委托财产的任何损失等都应是免责的。

5、在计划运作过程中，管理人及托管人按照法律、行政法规的规定以及本合同的约定履行了相关职责，但由于其控制能力之外的第三方原因或其他原因而造成运作不畅、出现差错和损失的。

6、管理人或托管人任一方不因另一方的失职行为而给资产管理计划财产或投资者造成的损失向投资者承担连带责任；

7、相关法律、行政法规和规定的变更。

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

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

（四）由于不可抗力原因或注册登机构非正常暂停或终止业务、证券交易所非正常暂停或停止交易、证券交易所、注册登记机构等发送的数据错误等非管理人、托管人的原因，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。但是未能发现错误的，由此造成计划资产或投资者损失，管理人和托管人免除赔偿责任。但是管理人和托管人应积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。

（五）一方当事人依据本合同向另一方当事人赔偿的损失，仅限于直接损失。

（六）管理人违反法律、行政法规的有关规定，被中国证监会依法撤销证券资产管理业务许可、责令停业整顿，或者因停业、解散、撤销、破产等原因不能履行

职责的，应当按照有关监管要求妥善处理有关事宜。

（七）投资者的债权人通过司法机关对资产管理计划资产采取强制措施，由此造成资产管理计划资产损失的，管理人和托管人不承担任何责任。在投资者的资产管理计划资产被司法机关或其他政府机构扣押和查封的情况下，管理人和托管人没有义务代表投资者就针对资产管理计划资产所提起的司法或行政程序进行答辩，但是可以提供必要的协助。

第二十七节 争议的处理

因履行本合同发生的争议，由协议签订各方协商解决，协商不成的，任何一方均可将争议提交至上海仲裁委员会，根据该会届时有效的仲裁规则在上海进行仲裁。争议处理期间，合同当事人仍应履行本合同规定的义务，维护资产投资者的合法权益。

第二十八节 资产管理合同的效力

（一）合同的生效

本合同是约定资产管理合同当事人之间权利义务关系的法律文件，投资者为法人的，本合同自投资者、管理人和托管人加盖公章或合同专用章以及各方法定代表人/负责人或授权代理人签字或盖章之日起成立（投资者为自然人的由其签字或盖章）并自委托资产到账之日起生效。

（二）本合同自生效之日起对投资者、管理人、托管人具有同等的法律约束力。

（三）本合同的有效期限

本合同的有效期为自本合同生效之日起至本合同约定的资产管理计划终止情形发生日止。

（四）本合同一式陆份，投资者执贰份，管理人执贰份，托管人执贰份，每份具有同等法律效力。

第二十九节 保密事项

合同各方对委托资产以及相关资料和信息负有保密义务。合同各方在此承诺：

对于依据本合同所获得的所有关于任何一方未对外公布的资产状况、经营状况及委托资产运作情况，管理人投资管理的方法、策略及管理人投资管理人员、以及委托资产的投资计划、投资意向、运作明细等，未经各方书面事先同意，任何一方不得向任何第三方披露，并责成全体雇员以及任何有可能接触到上述机密的人员保守秘密。但法律法规、监管机关另有规定、当事人另有约定的情形除外。本合同各方当事人均应持续履行保密义务。本保密义务不因合同终止而终止，持续有效。

第三十节 通知与送达

任何与本合同有关的通知应以书面形式作出，由本合同一方以专人递送给其他当事人，或以传真、邮递、电子邮件方式发出。该等通知以专人递送，于递交对方时视为送达；以传真方式发出，于发件人传真机显示传真业已发出时视为送达；以邮递方式发出，于邮件寄出后的第3个工作日视为送达；以电子邮件方式发出，于邮件发出后第2个工作日视为送达。任何通知一经送达即行生效，本合同另有约定除外。

合同签署主体各方确认，在本合同中约定的送达方式为各方有效的送达方式，诉讼过程中（含保全、执行阶段）对其发出的传票、通知等司法文书只要发送到本合同中约定的通讯地址即为送达。如通讯地址或通讯方式发生变化，各方应在24小时之内书面通知对方，否则对方按原通讯地址所作出的送达仍视为有效送达。

第三十一节 其他事项

（一）本合同项下的所有通知，均应以本合同规定的书面形式传真、递送或邮寄等方式送达，任何通知一经送达即发生效力。

（二）合同终止，不影响管理费、托管费等费用结算条款、清算条款、争议处理条款、保守商业秘密条款、账册及文本保存条款的效力。

（三）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，约定保证委托资产投资收益、承担投资损失，或排除投资者自行承担投资风险和损失。

（四）本合同如有未尽事宜或需调整的事项，由合同当事人各方按有关法律法规和规定协商一致另行签订补充协议，并作为本合同附件与资产管理合同一起报证

券投资基金业协会备案。

本合同附件构成对本合同的有效补充，并具有同等法律效力。

管理人、托管人确认已向投资者说明集合资产管理业务的风险，不以任何方式对投资者资产本金不受损失或者取得最低收益作出承诺；投资者确认，已充分理解本合同内容，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加盖公章，由法定代表人/负责人或其授权代理人签署。

（以下无正文）

(本页无正文,为《甬证资管季季盈 1 号集合资产管理计划资产管理合同》签署页):

投资者(盖章;自然人签字或盖章):(公章/合同专用章)

法定代表人(或授权代理人)签字或盖章:

签署日期: 年 月 日

管理人(盖章):(公章/合同专用章)



法定代表人(或授权代理人)签字或盖章:

签署日期: 2021 年 7 月 1 日



托管人(盖章):(公章/合同专用章)



负责人(或授权代理人)签字或盖章:

签署日期: 2021 年 6 月 25 日

