东北证券6号核心优势
集合资产管理计划管理合同
（第4次修订）

集合计划管理人：东证融汇证券资产管理有限公司

集合计划托管人：中国建设银行股份有限公司

目　录

第 1 部分　前言.....1
第 2 部分　合同当事人.....1
第 3 部分　集合计划的基本情况.....1
第 4 部分　集合计划的参与.....3
第 5 部分　管理人以自有资金参与本集合计划时的特别约定.....0
第 6 部分　集合计划账户管理.....1
第 7 部分　集合计划资产的托管.....1
第 8 部分　集合计划费用.....1
第 9 部分　投资收益与分配.....1
第 10 部分　集合计划的信息披露.....1
第 11 部分　投资者的权利与义务.....1
第 12 部分　管理人的权利与义务.....1
第 13 部分　托管人的权利与义务.....1
第 14 部分　集合计划存续期间投资者的退出.....1
第 15 部分　集合计划终止和清算.....1
第 16 部分　不可抗力.....1
第 17 部分　违约责任与争议处理.....1
第 18 部分　合同的签署和附件.....1
第 19 部分　合同的补充与修改.....1
第 20 部分　其他事项.....3

第 1 部分　前言

第一条　依照《中华人民共和国民法典》、（以下简称《民法典》）、《证券公司大集合资产管理业务适用<关于规范金融机构资产管理业务的指导意见>操作指引》（以下简称《操作指引》）等法律、行政法规和中国证监会的有关规定，管理人发起设立集合资产管理计划，委托托管人对集合计划资产进行托管。为规范“东北证券6号核心优势集合资产管理计划”（下称“集合计划”、“本集合计划”或“本计划”）运作，明确集合资产管理合同当事人的权利与义务，依照《民法典》、《操作指引》等法律、行政法规和中国证监会的有关规定，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《操作指引》、本合同及本合同附件《东北证券6号核心优势集合资产管理计划说明书》（下称《说明书》）及其他有关规定，享有权利，承担义务。

第二条　投资者承诺以真实身份参与集合资产管理计划（以下简称集合计划），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。

第三条　管理人承诺以诚实信用、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。

第四条　托管人承诺以诚实信用、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。

第五条　中国证监会对本集合计划出具了批准文件（证监许可【2011】1842号文《关于核准东北证券股份有限公司设立东北证券6号核心优势集合资产管理计划的批复》），但中国证监会对本集合计划做出的任何决定，均不表明中国证监会对本集合计划的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明参与本集合计划没有风险。

第 2 部分　合同当事人

第六条　投资者

投资者的详细情况在各投资者分别与管理人、托管人签署的《东北证券6号核心优势集合资产管理计划管理合同签署条款》（下称《签署条款》）中列示。

第七条　管理人

管理人名称：东证融汇证券资产管理有限公司（以下简称“东证融汇”）

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

联系地址：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16F

联系电话：021-20361060　传真：021-20361038

联系人：王茜

第八条　托管人

托管人名称：中国建设银行股份有限公司

法定代表人：田国立

住所：北京市西城区金融大街25号（邮编：100032）

联系地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼（邮编：100032）

联系电话：010-67595017　传真：010-66275830

联系人：文健

第 3 部分　集合计划的基本情况

第九条　名称与类型

1、名称：东北证券6号核心优势集合资产管理计划。

2、类型：债券型集合资产管理计划。

第十条　目标规模

本集合计划推广期内募集目标规模为30亿元，当认购金额达到30亿元时，将提前终止推广期。

本集合计划成立并在进入开放期后，不约定规模上限。

第十一条　投资范围和投资组合设计

1、投资范围

国内依法发行的固定收益品种，包括中国境内依法发行的债券、央行票据、短期融资券、资产支持证券、可转债、可交债、中期票据，银行存款、债券回购、场外货币市场基金以及中国证监会认可的其他投资品种。

2、投资组合比例

（1）投资于现金、银行存款（包括但不限于银行定期存款、协议存款、同业存款等各类存款）、货币市场基金、期限为7天内(含7天)的债券逆回购、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等现金类资产占集合计划资产总值的比例为0-100%;

（2）投资于固定收益类产品，包括国债、到期日在1年以上(不含1年)的地方政府债、到期日在1年以上(不含1年)的央行票据、金融债、企业债、公司债（含非公开发行公司债）、短期融资券、资产支持证券、中期票据、可转债、可交债、非公开定向债务融资工具等经银行间交易商协会批准发行的各类债务融资工具、期限在7天以上（不含7天）的债券逆回购等固定收益类金融产品的资产占集合计划资产总值的比例为0-100%;

在严格控制风险的前提下，本集合计划可参与债券正回购，融入资金余额不超过集合计划资产净值的40%，中国证监会另有规定的除外。

投资者同意管理人将本集合计划资产投资于管理人及与管理人有关联方关系的公司发行的证券，但不得超过本集合计划资产净值的7%。

管理人应当在本计划成立之日起6个月内使本计划的投资组合比例符合以上约

定。因证券市场波动、投资对象合并、集合资产管理计划规模变动等外部因素致使集合资产管理计划的组合投资比例不符合集合资产管理合同约定的，管理人应当在10个工作日内进行调整。

第十二条　存续期限

本集合计划不设固定存续期。

第十三条　各方同意本集合计划份额的初始募集面值为人民币1元。

第十四条　单个投资者首次参与的最低金额为人民币50,000元（含参与费）。对于已经是本集合计划的持有人，其新增参与资金的最低金额是人民币1,000元；将红利再投资本集合计划的份额不受上述限制。

第十五条　集合计划开始运作的条件和日期

本集合计划将在中国证监会对本计划出具了批准文件之日起6个月内开始推广，在60个工作日内完成集合计划的推广、设立活动。在推广期终止时，若本集合计划符合下列条件：

（1）推广过程符合法律、行政法规和中国证监会的规定；

（2）募集金额不低于1亿元人民币；

（3）客户不少于2人；

（4）符合集合资产管理合同及计划说明书的约定；

（5）中国证监会规定的其他条件。

管理人聘请具有证券相关业务资格的会计师事务所，对集合计划募集的资金进行验资并出具验资报告后，即可宣布集合计划成立并开始运作。如果集合计划不能同时满足上述条件，或在推广期内发生使集合计划无法设立的战争、自然灾害等不可抗力事件，则不得成立。本集合计划成立的时间为计划管理人根据相关法规规定发布集合计划成立公告的日期。

第十六条　各方一致同意，集合计划推广期满时，如果出现下列情形之一，则本集合计划设立失败：

1、投资者的参与金额未达到1亿元；

2、投资者数量不到2人；

3、推广期内发生使计划无法设立的战争、自然灾害等不可抗力事件。

如果集合计划依据前款约定不能成立，管理人应将投资者的资金加计利息在推广期结束后30天内返还给投资者，各方互不承担其他责任。利息金额以本集合计划注册与过户登记人的记录为准。

第 4 部分　集合计划的参与

第十七条　参与时间

1、推广期参与

本集合计划将在中国证监会对本计划出具了批准文件之日起6个月内开始推广，在60个工作日内完成集合计划的推广、设立活动。具体推广时间由管理人公告确定。在推广期内，投资者在各销售机构的工作日内可以参与本集合计划。

推广期内，管理人将采用实时监控的方式控制募集规模。若募集规模已接近或达到目标上限，则管理人有权停止接受投资者的参与申请。管理人停止接受投资者的参与申请后，将即时在指定网站公告结束募集的信息，并于次日上报监管部门。本集合计划的推广期将会提前结束，并且经验资合格后本集合计划成立。

若管理人决定提前结束推广期，应提前一个工作日通知销售机构和注册与过户登记人。

2、存续期参与

本计划自本次合同变更生效之日起开放3个工作日（即首个开放期，含本次合同变更生效当日，下同），首个开放期接受投资者的参与和退出申请。首个开放期之后本计划每满28天开放一次，开放期为1个工作日，具体开放期以每满28天后对日为基准日，前后浮动不超过5个工作日，开放期内接受投资者参与和退出申请，管理人可根据相关监管要求、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。具体开放期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。

第十八条　参与价格

1、推广期参与价格

在集合计划推广期内参与，每份额的参与价格为人民币1元。

2、存续期参与价格

“未知价”原则，即存续期参与价格以参与申请日份额单位净值为基准进行计算。

第十九条 参与费率、净参与金额及参与份额计算

1、参与费（认购/申购费）率

（1）推广期参与费率：参与金额越大，费率越低

认购/申购金额（M）	适用费率

M＜100万	1.0%
100万≤M＜200万	0.8%
200万≤M＜500万	0.5%
500万≤M＜1000万	0.3%
M≥1000万	1000元/笔

（2）存续期参与费率：0

2、参与份额的计算

（1）推广期参与份额计算

推广期参与本集合计划采用前端收费模式，即在参与集合计划时缴纳参与费。投资者的参与金额包括参与费用和净参与金额。有效参与款项在推广期间形成的利息归投资者所有，具体份额以注册与过户登记人的记录为准，投资者参与份额的计算方式如下：

参与费用＝参与金额×参与费率

净参与金额=参与金额－参与费用

参与份额＝（净参与金额＋推广期利息）/集合计划份额面值

参与份数保留小数点后两位，小数点后第三位四舍五入。

（2）存续期参与份额计算

存续期参与本集合计划份额的计算方式如下：

参与费用=0

参与份额=参与金额/参与申请日份额单位净值

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。

第二十条　参与原则

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、“未知价”原则，即存续期参与价格以参与申请日份额单位净值为基准进行计算。

3、本集合计划采用电子签名合同，投资者在签署书面电子签名约定书，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。

4、“金额参与”原则，即参与以金额申请。本集合计划单个投资者首次参与最

低金额为5万元人民币，超过最低参与金额的部分不设金额级差。首次参与指提出参与申请的投资者在参与之前未曾持有过本集合计划份额的情形。如果投资者曾经持有本集合计划份额，追加参与每笔申请不得低于1,000元人民币，超过部分不设金额级差。

5、推广期内，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，管理人以最高募集规模为上限，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。

6、本集合计划在存续期参与开放期内，管理人可根据相关监管要求、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。管理人对全部有效申购申请按“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。

第二十一条　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）投资者必须根据集合计划推广网点规定的手续，在指定参与时间内到集合计划推广网点提出参与申请。申请方式为书面申请或集合计划推广网点规定的其他方式。当日参与申请可以（且只能）在当日交易时间内申请撤销；

（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。

第二十二条　参与的注册登记

投资者参与成功后，注册与过户登记人在T＋1日为投资者登记权益并办理注册登记手续，可于T+2日后在办理参与的网点查询参与确认情况。

第二十三条　暂停和拒绝参与的情形

如出现《说明书》中关于推广期投资者参与集合计划的规定的情形，集合计划管理人可以拒绝或暂停集合计划投资者的参与申请。

第 5 部分　管理人以自有资金参与本集合计划时的特别约定

第二十四条　管理人可以以自有资金参与本集合计划。

（一）管理人自有资金参与比例

在推广期和存续期，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%。

（二）管理人承诺事项

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个工作日告知客户和资产托管机构。

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，并按法律法规、监管规定向有关监管机构报告。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。

（三）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。

（四）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。

第 6 部分　集合计划账户管理

第二十五条　本集合计划以“东北证券6号核心优势集合资产管理计划”的名义开立集合计划专用银行存款账户，以管理人、托管人和集合资产管理计划联名开立“东北证券—中国建设银行—东北证券6号核心优势集合资产管理计划”证券账户，与管理人、托管人和销售机构自有的资产账户以及其他集合计划资产账户相独立。[备注：账户名称以实际开立账户名称为准]

销售机构为集合计划的每一位投资者建立集合计划交易账户，记录投资者通过该销售机构买卖本集合计划份额的变动及结余情况。

计划管理人委托中国证券登记结算有限责任公司（简称“中登公司”）或其它符合条件的机构担任本计划的注册与过户登记人，并承担相应委托责任。注册与过户登记人为投资者开立集合计划账户，用于记录投资者持有的本集合资产管理计划份额。

第 7 部分　集合计划资产的托管

第二十六条　集合计划资产由计划管理人委托中国建设银行股份有限公司托管，管理人已经与托管银行签订了托管协议。托管人将严格遵照有关法律法规及双方达成的托管协议对集合资产进行托管。

本合同前言中“保护集合计划资产的安全”及第四十八条中“安全保管集合计划的资产”是指托管人在现行证券交易、登记结算制度赋予的权限下，在本合同及托管协议约定的托管职责范围内，实现此项义务。

投资者签署本合同的行为本身即表明对现行证券交易、登记结算制度下托管人托管职能有充分的了解，并接受本合同约定的托管职责和范围。

第 8 部分　集合计划费用

第二十七条　投资交易费用

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、佣金和证券结算风险基金、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，在每季首日起10个工作日内支付给提供交易单元的券商。

第二十八条　托管费

各方同意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0.08%。计算方法如下：

H=E×0.08% ÷365

H为每日应支付的托管费；

E为前一日的集合计划资产净值。

托管人的托管费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付，由托管人于次月首日起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。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延，闰年2月29日不计算。

第二十九条　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0.3%。计算方法如下：

H ＝ E ×0.3%÷ 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算，逐日累计至每月月底，按月支付，由托管人于次月首日起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，闰年2月29日不计算。

第三十条　与本集合计划相关的审计费

在存续期间发生的集合计划审计费用，在合理期间内摊销计入集合计划。

本集合计划的年度审计费，按与会计师事务所签定协议所规定的金额，在被审计

的会计期间，按直线法在每个自然日内平均摊销。

第三十一条　其他费用

其他费用是指银行结算费用、银行账户维护费、银行间市场账户维护费、开户费、银行间交易相关维护费、转托管费等集合计划运营过程中发生的相关费用。

银行结算费用、银行账户维护费，在每个费用支付日一次计入集合计划费用；

银行间市场账户维护费，按银行间市场规定的金额，一次性计入费用；

开户费、银行间交易相关维护费、转托管费在发生时一次计入集合计划费用；

与集合计划运营有关的其他费用，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。

第三十二条　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，在计划分红日、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；如不符合业绩报酬计提条件，计划分红日仍记为业绩报酬计提日，管理人计提的业绩报酬为零；

（3）在计划分红日提取业绩报酬的，业绩报酬从分红资金中扣除；

（4）在投资者退出和计划终止时提取业绩报酬的，业绩报酬从退出资金中扣除；

（5）在投资者退出和计划终止时，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。

2、业绩报酬的计提方法

以上一个业绩报酬计提日（本次合同变更生效前参与份额的业绩报酬计提日，为本次合同变更生效当日；如上一个业绩报酬计提日不存在，本次合同变更生效后申购参与份额的业绩报酬计提日为申购参与当日；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：

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

业绩报酬计提日为计划分红日、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业绩报酬计提基准（K）（年化），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业绩报酬计提基准（K）（年化），则按超额收益的60%计提比例计算业绩报酬。

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（K）（年化）。

此时业绩报酬计算公式：

E=(R-K)×60%×（F/365）×P2×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。

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。**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。

4、业绩报酬的计算和复核工作由管理人完成，相关信息以注册登记计算结果为准，托管人根据管理人提供的数据进行账务处理。

5、集合计划在本次合同变更生效前计提的风险准备金，管理人将在本集合计划下一次合同变更生效前提取，在特殊情况下，管理人有权放弃提取。

第三十三条 管理费和托管费的费用调整

集合计划管理人和托管人按照合同补充与修改程序的相关规定，并履行相关程序后，可调整集合计划管理费和托管费。

第三十四条 不计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推广有关的费用，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集合计划资产的损失以及处理与集合计划运作无关的事项发生的费用等不列入集合计划费用。

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。

第三十五条 集合计划的税收

本集合计划运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律法规执行。

第 9 部分　投资收益与分配

第三十六条　利润的构成

本集合计划利润指集合计划利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额，集合计划已实现收益指集合计划利润减去公允价值变动收益后的余额。可供分配利润指截至收益分配基准日（即可供分配利润计算截至日）资产负债表中集合计划未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

第三十七条　收益分配原则和方式

各方一致同意实施收益分配时应遵循以下原则：

1、收益分配基准日的份额净值减去每单位集合计划份额收益分配金额后不能低于面值；

2、集合计划存续期间，符合分红条件的前提下，集合计划可进行分配，收益分配以现金分红方式进行。具体收益分配方案以管理人公告为准；

3、每一份份额享有同等的分配权，收益分配方式为现金分红；

4、法律、法规或监管机构另有规定的从其规定。

第三十八条　收益分配方案

各方一致同意本集合计划收益分配方案由管理人拟定并直接报告投资者，托管人无需复核，包括集合计划收益的范围、集合计划可分配收益、分配对象、分配原则、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容，管理人于收益分配方案确定之日起2个工作日内在公司网站上公告。

第 10 部分 集合计划的信息披露

第三十九条 定期报告

包括集合计划净值通告、资产管理报告、资产托管报告和年度审计报告。

1、集合计划净值通告。本集合计划成立后，封闭期内，每周第一个工作日披露上周最后一个工作日的单位净值、累计净值。开放期内，每个工作日（T 日）的单位净值、累计净值在 T+1 日披露。

2、管理人、托管人在每季度结束之日起 1 个月内向投资者提供一次准确、完整的季度资产管理报告和季度资产托管报告，并由管理人报中国证券投资基金业协会及住所地中国证监会派出机构备案，集合计划成立不足 2 个月时，管理人、托管人可以不编制当期的季度报告。

3、管理人、托管人在每年度结束之日起 4 个月内向投资者提供一次准确、完整的年度资产管理报告和年度资产托管报告，对报告期内集合计划资产的配置状况、价值变动情况做出说明，并由管理人报中国证券投资基金业协会及住所地中国证监会派出机构备案，集合计划成立不足 3 个月时，管理人、托管人可以不编制当期的年度报告。

管理人按照《管理办法》的规定聘请会计师事务所对集合资产管理计划的运营情况单独进行年度审计，将审计报告在每年度结束之日起 60 个工作日内，提供给投资者和托管人，并由管理人报中国证券投资基金业协会及住所地中国证监会派出机构备案。

第四十条 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。

第四十一条　重大事项披露和披露方式

本集合计划在运作过程中发生下列可能对投资者权益产生重大影响的事项之一时，管理人必须按照法律法规及中国证监会的有关规定及时通过各推广网点向投资者向投资者披露，并在管理人网站公布；

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。**第四十二条　信息披露文件的存放与查阅**

集合资产管理定期报告、托管定期报告及其他临时通告等信息披露文件放置于管理人网站，供投资者查阅。

第 11 部分 投资者的权利与义务

第四十三条 投资者的权利

1、取得集合计划收益；

2、依据本合同知悉有关集合计划投资运作的信息，包括集合计划的资产配置、投资比例、损益状况等；

3、按照本合同的约定，参与、退出集合计划；

4、取得集合计划清算后的剩余资产；

5、因管理人、托管人过错导致合法权益受到损害的，有权得到赔偿；

6、法律、行政法规、中国证监会的有关规定及本合同约定的其他权利。

第四十四条 投资者的义务

1、保证以真实身份参与集合计划，并承诺委托资金的来源及用途合法，向管理人或代理销售机构如实提供财务状况及投资意愿等基本情况；法人或者依法成立的其他组织，用筹集的资金参与集合计划的，应当向管理人或代理销售机构提供合法筹集资金的证明文件；

2、按照本合同约定划付委托资金，承担相应费用；

3、按本合同约定承担集合计划的投资风险和损失；

4、不得转让本合同；

5、法律、行政法规、中国证监会的有关规定及本合同约定的其他义务。

第 12 部分 管理人的权利与义务

第四十五条 管理人的权利

1、根据本合同的约定，独立运作集合计划的资产；

2、根据本合同的约定，收取管理费、参与费、退出费和业绩报酬；

3、按照本合同的约定，停止或暂停办理集合计划的参与，暂停办理集合计划的退出事宜；

4、根据本合同的约定，终止本集合计划的运作；

5、监督托管人，并针对托管人的违约行为采取必要措施保护投资者的利益；

6、选择、更换律师、审计师、证券及期货经纪商或其他为集合计划提供服务的外部机构；

7、行使集合计划资产投资形成的投资人权利；

8、集合计划资产受到损害时，向有关责任人追究法律责任；

9、法律、行政法规、中国证监会有关规定及本合同约定的其他权利。

第四十六条 管理人的义务

1、在集合计划投资管理活动中恪尽职守，履行诚实信用、谨慎勤勉的义务，为投资者服务，以专业技能管理集合计划的资产，依法保护投资者的财产权益；

2、建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度；

3、根据中国证监会有关规定、本合同和托管协议的约定，接受托管人的监督；

4、管理人负责集合资产管理计划资产净值估值等会计核算业务，编制集合资产管理计划财务报告，并接受托管人的复核；

5、按规定出具资产管理报告，保证投资者能够及时了解有关集合计划资产投资组合、资产净值、费用与收益等信息；

6、保守集合计划的商业秘密，在集合计划有关信息向投资者披露前，不泄露集合计划的投资安排、投资意向等信息（法律、行政法规、中国证监会另有规定或相关司法部门、监管机构另有要求的除外）；

7、按照本合同约定向投资者分配集合计划的收益；

8、依法对托管人的行为进行监督，如发现托管人违反法律、行政法规和中国证监会的规定，或者违反托管协议的，应当予以制止，并及时报告住所地中国证监会派

出机构；

9、按照有关法律、行政法规、中国证监会有关规定及《说明书》的约定，指定注册与过户登记人办理集合计划的开户登记事务及其他与注册登记相关的手续；

10、按照法律、行政法规、中国证监会有关规定和本合同的约定，及时向申请退出集合计划的投资者支付退出款项；

11、按相关法律法规妥善保存与集合计划有关的合同、协议、推广文件、交易记录、会计账册等文件、资料，保存期不少于二十年；

12、在集合计划到期或因其他原因终止时，妥善处理有关清算和投资者资产的返还事宜；

13、在解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产或因其他原因不能继续履行管理人职责时，及时向投资者、托管人和中国证监会报告；

14、因自身过错造成集合计划资产损失的，就直接损失向投资者承担赔偿责任；

15、因托管人过错造成集合计划资产损失时，代投资者向托管人追偿；

16、因管理人单方面解除本合同给投资者、托管人造成经济损失时，就直接损失对投资者、托管人予以赔偿；

17、聘请具有证券相关业务资格的会计师事务所对本集合计划的运营情况进行专项审计，集合计划审计报告应当在每年度结束之日起60个工作日内，报送管理人住所地中国证监会派出机构备案，报送托管人，同时向投资者披露；

18、在与关联方发生交易行为时，保证对关联方及非关联方公平对待；

19、法律、行政法规、中国证监会有关规定及本合同约定的其他义务。

第 13 部分 托管人的权利与义务

第四十七条 托管人的权利

1、依法托管集合计划的资产；

2、按照本合同的约定收取托管费；

3、依据《管理办法》、《通知》、《托管协议》及本合同的规定监督集合计划的经营运作，发现管理人的投资或清算指令违反法律、行政法规、中国证监会的有关规定或者本合同约定的，要求其改正，或拒绝执行；

4、查询集合计划的经营运作情况；

5、法律、行政法规、中国证监会有关规定及本合同、《托管协议》约定的其他权利。

第四十八条 托管人的义务

1、按照本合同及托管协议安全保管集合计划的资产；

2、复核、审查管理人计算的集合计划的资产净值；

3、负责集合计划资产投资活动的清算交割，执行管理人的指令，负责办理集合计划名下的资金往来；

4、依法为每个集合计划开立专门的资金账户和专门的证券账户；

5、监督管理人集合计划的经营运作，发现管理人的投资或清算指令违反法律、行政法规、中国证监会的有关规定或者本合同约定的，应当要求其改正；未能改正的，应当拒绝执行(依据交易程序已经生效的指令除外)，并向中国证监会报告；

6、保守集合计划的商业秘密，在集合计划有关信息向投资者披露前予以保密，不向他人泄露（法律、行政法规、中国证监会另有规定或有权机关另有要求的除外）；

7、按规定出具集合计划托管情况的报告；

8、按相关法律法规妥善保存与集合计划有关的合同、协议、交易记录、会计账册等文件、资料，保存期不少于二十年；

9、在集合计划到期或因其他原因终止时，协同管理人进行必要的清算活动；

10、在解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产时，及时报告投资者和管理人；

11、因过错导致集合计划资产损失的，就直接损失向投资者承担赔偿责任；

12、因托管人单方解除本合同给投资者、管理人造成经济损失的，就直接损失对投资者、管理人予以赔偿；

13、非依法律、行政法规和中国证监会有关规定或合同约定，不得擅自动用或处分集合计划资产；

14、法律、行政法规、中国证监会有关规定和本合同、《托管协议》约定的其他义务。

第 14 部分 集合计划存续期间投资者的退出

第四十九条 退出办理的场所

本集合计划在存续期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。

第五十条 退出办理的开放日及时间

本计划自本次合同变更生效之日起开放3个工作日（即首个开放期，含本次合同变更生效当日，下同），首个开放期接受投资者的参与和退出申请。首个开放期之后本计划每满28天开放一次，开放期为1个工作日，具体开放期以每满28天后对日为基准日，前后浮动不超过5个工作日，开放期内接受投资者参与和退出申请，管理人可根据相关监管要求、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。具体开放期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。

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。

对于本次合同变更生效前持有本集合计划份额的投资者，管理人有权保留其在上述开放期以外时间退出本计划的权利。

第五十一条 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。

第五十二条 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，超出部分的申请无效。

（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账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。

第五十三条　退出的价格、费用、金额及退出的限制与次数

1、退出价格

“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、本集合计划退出费

本集合计划不收取退出费用。

3、退出金额的计算方法

退出金额=退出份额×退出申请日份额单位净值

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计划资产损益。

4、退出的限制与次数

投资者部分退出集合计划份额时，每次退出份额应大于或等于1000份，如其该笔退出完成后剩余的集合计划份额低于1000份时，则余额部分必须一起退出。本集合计划不设退出次数限制。

第五十四条　拒绝或暂停退出的情况及处理方式

如出现《说明书》存续期间的参与与退出部分规定的情形，集合计划管理人可以拒绝接受或暂停集合计划投资者的退出申请。

第五十五条　巨额退出的认定及处理方式

当出现巨额退出时，集合计划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或部分顺延退出。具体的认定及处理方式请参见《说明书》存续期间的参与和退出部分。

第 15 部分 集合计划终止和清算

第五十六条 集合计划的终止

集合计划的终止是指由于法定和约定情形的出现，管理人清算集合计划资产并将集合计划剩余资产按一定标准返还给投资者，同时注销该集合计划的行为。

本集合计划终止时，管理人和托管人应该遵照中国证监会相关规定或指示，采取必要和适当的措施，在扣除管理费、托管费等费用后，将集合计划资产按照投资者持有集合计划份额的比例，以货币的形式分派给投资者或者投资者以书面形式指定的其他人。

投资者或管理人有权在有关司法等有权部门或证券监管机关指示的情况下终止本计划而不承担任何责任。

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。

如果因任何原因托管人退出本计划或不能履行有关义务，管理人应立即寻找其他有资格的托管人进行替代，管理人应在尽可能短的时间内与新的托管人签署托管协议，并完成有关法律手续以确保新的托管人承担本计划项下的有关托管义务。投资者和管理人在此期间应继续履行《集合资产管理合同》项下的有关义务。

按照证监会的要求，如出现下列情形之一，本集合计划应当终止：

1、管理人因重大违法、违规行为，被中国证监会取消业务资格的；

2、托管人因重大违法、违规行为，被监管机构取消业务资格而管理人未在30个工作日内与新的托管人签订托管协议的；

3、管理人因停业、解散、破产、撤销等原因不能履行相应职责的；

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

5、存续期内，任一开放日集合计划投资者少于2人时；

6、战争、自然灾害等不可抗力的发生导致本集合计划不能存续；

7、法律、法规规定或中国证监会规定的其他情况。

第五十七条 集合计划的清算

1、资产清算主体

计划终止后，由管理人负责本集合资产管理计划的资产清算，托管人应协同管理人进行必要的清算活动。

2、清算程序

管理人应按以下程序进行：

（1）计划终止后，由管理人组织清算小组对计划资产进行清理和确认；

（2）对资产进行评估和变现；

（3）聘请具有证券从业资格的会计师事务所进行审计；

（4）将清算结果报告中国证券投资基金业协会；

（5）将清算结果报告给投资者；

（6）对资产进行分配。按照本部分“剩余资产分配”的规定分配和返还资产。

3、清算费用

清算费用是指管理人在进行资产清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由管理人优先从清算资产中支付。

4、清算公告

本集合计划终止后5个工作日内由管理人将终止情况向中国证券投资基金业协会及投资者报告，并同时开始清算程序；清算过程中的有关重大事项须及时报告投资者；清算结果由管理人清算结束后5个工作日内报告投资者。

5、集合计划剩余资产的分配

（1）集合计划期满结束时，则自结束之日起30个工作日内管理人和托管人在扣除管理费、托管费等费用后，将集合计划资产按照投资者持有集合计划份额的比例，以货币的形式分派给投资者。

（2）在合同有效期内，如本计划因故终止，则自终止之日起30个工作日内，管理人和托管人应当在扣除管理费、托管费等费用后，将集合计划资产按照投资者持有集合计划份额的比例，以货币的形式分派给投资者。

6、清算账册及文件的保存

计划清算账册及有关文件由托管人按相关法律法规妥善保存，保存期不少于20年。

第 16 部分 不可抗力

第五十八条 本合同中的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本合同时，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。

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、管理人或托管人托管业务系统出现重大故障或由于其他不可抗力原因，管理人和托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误而造成的份额净值计算错误，管理人、托管人免除赔偿责任。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。

第 17 部分 违约责任与争议处理

第五十九条 违约责任

1、由于本合同一方当事人的过错，造成本合同不能履行或者不能完全履行的，由有过错的一方承担违约责任；如属本合同多方当事人的过错，根据实际情况，由多方当事人分别承担各自应负的违约责任，各方互不承担连带责任。

2、各方同意发生下列情况对集合计划资产造成损失时，当事人免责：

（1）战争、自然灾害等不可抗力的发生；

（2） 管理人、托管人按照当时有效的法律、法规、规章或中国证监会的规定作为或不作为而造成的损失；

（3） 在没有过失的情况下，管理人对按照本合同规定的投资原则行使或不行使其投资权而造成的损失。

3、本合同当事人违反合同规定，给其他当事人造成损失的，应对直接损失进行赔偿。

4、因当事人之一违约而导致其他当事人损失的，投资者应先于其他受损方获得赔偿。

5、在投资者的集合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集合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。

6、投资者同意，本集合计划可以投资于以下存在关联关系的股票：

（1） 管理人将集合计划资产用于申购（包括网下申购和网上申购）本公司担任保荐人、主承销商的新股或其他首次发行证券。

（2） 本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。

在发生该等事项时，管理人按照法律法规及中国证监会的有关规定，在首次交易完成之日起2个工作日内向证券交易所报告并向投资者披露。托管人不承担责任。

第六十条 责任划分

1、如果管理人和托管人其中一方违约，给集合计划资产造成损失的，应由违约方就直接损失进行赔偿，另一方可接受计划参与人委托向违约方追偿；如果管理人和托管人两方都违反合同，给集合计划资产造成损失的，应根据实际情况，由双方分别

承担各自应负的违约责任，双方互不承担连带赔偿责任。

2、在本合同履行过程中，除托管人因侵占、挪用或有其他重大过失而造成集合计划资产损失外，托管人对全体投资者及集合计划承担的赔偿责任最高限额为托管人就履行本合同已经获取的收入总额。

第六十一条 在发生违约的情况下，本合同能继续履行的，应当继续履行。

第六十二条 争议的处理

因本合同引起的或与本合同有关的任何争议，由合同签订各方协商解决，协商不成的，合同签订各方一致同意将争议提交位于北京的中国国际经济贸易仲裁委员会并按其仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对仲裁各方当事人均具有约束力。

第 18 部分 合同的签署和附件

第六十三条 投资者、管理人及托管人签署《签署条款》或电子合同即视为同意并接受本合同的条款。本合同于管理人、托管人、投资者三方完成签署，且投资者按合同约定将参与资金划入指定账户并经注册与过户登记人确认有效后，对各当事人产生效力。

第六十四条 合同的期限为本集合计划的存续期限。合同一式三份，投资者、管理人、托管人三方各持有一份，具有同等法律效力。

第六十五条 本合同的附件《说明书》和《合同签署条款》是本合同不可分割的一部分，与合同具有同等法律效力。

第六十六条 计划管理人负责本集合计划的代理推广工作，将投资者和管理人已经签署的合同提交托管人签署。托管人在签署合同时，仅对合同要素的完整性进行形式审核，即核对合同名称是否准确、个人投资者的名称和身份证明信息是否均填写、公司或机构投资者的名称是否填写、计划管理人是否已办理核对确认手续；托管人套印合同印章时，仅负责回收管理人提交的、另外两方已经签署的合同文本。

第 19 部分 合同的补充与修改

第六十七条 合同补充、修改的程序

1、本合同签署后，因法律、法规、规章、中国证监会的规定、中国证券业协会自律管理规则、证券登记结算机构业务规则以及证券交易所等交易规则颁布或修订，自相关规定颁布或修订生效之日起，本合同相关内容及条款按该颁布或修订的规定变更并在管理人网站公告。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五个工作日后生效。

本集合计划成立后，相关材料需要报中国证券投资基金业协会备案，同时抄送管理人所在地中国证监会派出机构。管理人按照协会的要求补正备案材料涉及到本合同修改的，投资者特此授权管理人经与托管人协商一致后，由管理人公告补正后的合同，补正的内容在管理人网站公告满五个工作日后生效。

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。管理人须在公告后两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，投资者应在征询意见函发出后管理人公告的临时开放期内提出退出申请，未提出退出申请的，视同投资者已经同意合同变更，合同变更于临时开放期结束后的下一个工作日生效，公告内容即成为本合同组成部分。管理人应在合同变更完成后5个工作日内根据法律法规、监管规定要求将相关情况报相关监管机构。

3、各方当事人同意，自修改后的新合同生效之日起，修改前的原管理合同（于2016年11月4日生效的《东北证券6号核心优势集合资产管理计划管理合同》）自动失效。

第六十八条 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。

第六十九条 合同变更后，投资者、管理人和托管人的应当按照变更后的合同行使相关权利，履行相应义务。

第七十条 投资者明确表示不同意管理人对合同做出的补充或修改内容的，有权

在征询意见函发出后管理人公告的临时开放期内提出退出申请。未提出退出申请的，视同投资者已经同意合同变更。管理人和托管人应当在扣除管理费、托管费等相关费用后，将退出款项划往退出投资者指定的银行账户。投资者同意，无论其是否提出退出申请，管理人变更本合同的行为均不应被视为或裁定为管理人的违约行为。

第 20 部分 其他事项

第七十一条 本合同未尽事宜，当事人依据有关法律、法规、规章和《说明书》的规定办理。

第七十二条 定义

除本合同另有定义之外，词语在本合同中使用时具有与在《说明书》中使用时相同的含义。

第七十三条 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者取得最低收益；投资者确认，已充分理解本合同的内容，并自行承担投资风险和损失。

（本签字页仅供《东北证券6号核心优势集合资产管理计划管理合同》各方签字或盖章使用，本页无正文）

管理人（东证融汇证券资产管理有限公司）

公 章：

法定代表人或授权代表人（签字或盖章）：

托管人（中国建设银行股份有限公司）

公 章 / 合同专用章：

法定代表人或授权代表人（签字或盖章）：

2021年　月　日于北京