

---

**华泰启泰金阊 FOF1 号集合资产管理  
计划资产管理合同**

合同编号：SZZQ2019002

管理人：华泰证券（上海）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苏州分行

二〇一九年四月

# 目 录

第 1 部分	前言.....	4
第 2 部分	释义.....	5
第 3 部分	合同当事人.....	9
第 4 部分	集合计划的基本情况.....	10
第 5 部分	集合计划的参与和退出.....	13
第 6 部分	管理人自有资金参与集合计划.....	18
第 7 部分	集合计划的分级.....	18
第 8 部分	集合计划客户资产的管理方式和管理权限.....	19
第 9 部分	集合计划的成立.....	19
第 10 部分	集合计划账户与资产.....	20
第 11 部分	集合计划资产托管.....	21
第 12 部分	集合计划的估值.....	21
第 13 部分	集合计划的费用、业绩报酬.....	24
第 14 部分	集合计划的收益分配.....	26
第 15 部分	投资理念与投资策略.....	27
第 16 部分	投资决策与风险控制.....	28
第 17 部分	投资限制及禁止行为.....	32
第 18 部分	集合计划的信息披露.....	34
第 19 部分	集合计划份额的转让、转换、非交易过户和冻结.....	36
第 20 部分	集合计划的展期.....	36
第 21 部分	集合计划终止和清算.....	37
第 22 部分	当事人的权利和义务.....	39
第 23 部分	违约责任.....	42
第 24 部分	适用法律和争议解决.....	43
第 25 部分	风险揭示.....	44
第 26 部分	合同的成立与生效.....	48
第 27 部分	合同的补充、修改与变更.....	48
第 28 部分	其他事项.....	49

---

特别约定：

本《华泰启泰金阆 FOF1 号集合资产管理计划资产管理合同》（以下简称“本合同”或“集合资产管理合同”）以电子方式签订。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；委托人（即华泰启泰金阆 FOF1 号集合资产管理计划的委托人）作为本合同一方，以电子签名方式签署本合同即表明委托人完全接受本合同项下的全部条款，同时本合同成立。

委托人、管理人、托管人同意遵守《电子签名法》、《证券公司资产管理电子签名合同操作指引》的有关规定，三方一致同意委托人自签署《电子签名约定书》之日起，委托人以电子签名方式接受电子签名合同、风险揭示书或其他文书的，视为签署《华泰启泰金阆 FOF1 号集合资产管理计划资产管理合同》、《华泰启泰金阆 FOF1 号集合资产管理计划说明书》、风险揭示书或其他文书，与在纸质合同、纸质风险揭示书或其他文书上手写签名或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。

特别提请委托人：

- （1）妥善保存电子签名约定书；
- （2）在签署电子签名合同前认真阅读合同、说明书及风险揭示书；
- （3）安全保护密码信息。
- （4）本合同若无明确约定，则管理人向委托人披露/公告的方式为通过管理人网站公告，敬请委托人经常关注管理人网站。管理人网站网址为：[htamc.htsc.com.cn](http://htamc.htsc.com.cn)。

## 第 1 部分 前言

为规范华泰启泰金阆 FOF1 号集合资产管理计划(以下简称“集合计划”或“计划”)运作,明确《华泰启泰金阆 FOF1 号集合资产管理计划集合资产管理合同》(以下简称“本合同”)当事人的权利与义务,依照《中华人民共和国合同法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》(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“运作管理规定”)等法律法规、中国证监会的有关规定,委托人、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《合同法》、《基金法》、《指导意见》、《管理办法》、《运作管理规定》、《华泰启泰金阆 FOF1 号集合资产管理计划产品说明书》(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。

委托人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、准确、完整,没有非法汇集他人资金或使用贷款、发行债券等筹集的非自有资金参与本集合计划,拥有适当和有效的签订并履行本协议所必需的授权,且不违反任何对委托人有法律约束力的协议或法规等文件,所披露或提供的信息和资料真实、完整、准确,并已阅知本合同和《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。委托人承诺其知悉《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》、《金融机构客户身份识别和客户身份资料及交易记录保存管理办法》、《金融机构大额交易和可疑交易报告管理办法》、《中国人民银行关于加强反洗钱客户身份识别有关工作的通知》等反洗钱相关法律法规的规定,将严格遵守上述规定,不会违反任何前述规定;承诺用于投资的资金来源不属于违法犯罪所得及其收益;承诺投资的资金来源和去向不涉及洗钱、恐怖融资和逃税等行为;承诺出示真实有效的身份证件或者其他身份证明文件,提供真实有效的业务性质与股权或者控制权结构、受益所有人信息等资料;承诺积极履行反洗钱职责,不借助本业务进行洗钱等违法犯罪活动。委托人承诺其不属于中国有权机关、联合国、欧盟或美国等制裁名单或禁止名单内的企业或个人,不位于被中国有权机关、联合国、欧盟或美国等主权国家或国际组织制裁的国家和地区。

委托人在此申明签署本集合计划管理合同即表明委托人承诺为已具备法律法规规定要求的合格投资者。

委托人声明若委托财产为本人/本机构通过设立的私募资产管理计划等募集所得,委托人保证资金来源和用途符合有关法律法规的规定,委托人将按管理人需要如实、及时提供最终投资人身份信息等材料,法律法规或监管机关另有规定的除外。

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。

本集合资产管理计划管理人按照法律法规的规定对本计划的设立、变更、展期、终止、清算等行为依法向中国证券投资基金业协会进行备案，并根据规定抄报中国证监会相关派出机构。中国证券投资基金业协会接受本计划的备案并不能免除本管理人按照规定真实、准确、完整、及时地披露本计划产品信息的法律责任，也不代表中国证券投资基金业协会对本计划的合规性、投资价值及投资风险做出保证和判断，也不表明投资于本计划没有风险。投资者应当自行识别本集合资产管理计划产品投资风险并承担投资行为可能出现的损失。

## 第 2 部分 释义

集合资产管理计划或本集合资产管理计划或本集合计划：	指华泰启泰金阆 FOF1 号集合资产管理计划
FOF	Fund of Fund，在本合同中指管理人通过自主管理及直接投资代表某类策略的金融产品的方式，对本集合计划进行资产配置的资产管理模式
《集合资产管理合同》：	指《华泰启泰金阆 FOF1 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
集合资产管理计划产品说明书或说明书：	指《华泰启泰金阆 FOF1 号集合资产管理计划产品说明书》及其的任何有效的修订和补充
托管协议	指《华泰启泰金阆 FOF1 号集合资产管理计划托管协议》及其的任何有效的修订和补充
风险揭示书	指《华泰启泰金阆 FOF1 号集合资产管理计划风险揭示书》
《合同法》	指 1999 年 3 月 15 日第九届全国人民代表大会第二次会议通过并于 1999 年 10 月 1 日起实施的《中华人民共和国合同法》

《基金法》	指2012年12月28日第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订通过，自2013年6月1日起施行的《中华人民共和国证券投资基金法》
《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、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施行的《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》
《运作管理规定》:	指2018年10月22日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》
中国:	指中华人民共和国(为本协议之目的，不包括香港特别行政区、澳门特别行政区及台湾地区)
法律法规:	指中国公布实施并现时有效的法律、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
元:	指人民币元
中国证监会、证监会:	指中国证券监督管理委员会
基金业协会	指中国证券投资基金业协会
集合资产管理计划管理人或管理人:	指华泰证券(上海)资产管理有限公司(简称“华泰资管”)
集合资产管理计划托管人或托管人:	上海浦东发展银行股份有限公司苏州分行
销售机构:	指华泰证券(上海)资产管理有限公司及与管理人签订本计划销售协议的其他销售机构
注册与过户登记机构:	指办理登记、存管、过户、清算和结算等注册登记业务的机构。本集合计划的注册登记机构为华泰证券(上海)资产管理有限公司
集合资产管理合同当事人:	指受《集合资产管理合同》约束，根据《集合资产管理合同》享受权利并承担义务的法律主体

个人委托人:	指依据中国有关法律法规及其他有关规定可以投资于集合资产管理计划的自然人合格投资者
机构委托人:	指依据中国有关法律法规及其他有关规定可以投资于集合资产管理计划的,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
合格投资者:	指具备相应风险识别能力和风险承担能力,投资于单只资产管理产品不低于一定金额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: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登记的私募基金管理人、商业银行、金融资产投资公司、信托公司、保险公司、保险资产管理机构、财务公司及中国证监会认定的其他机构;。4)接受国务院金融监督管理机构监管的机构发行的资产管理产品;5)基本养老金、社会保障基金、企业年金等养老基金,慈善基金等社会公益基金,合格境外机构投资者(QFII)、人民币合格境外机构投资者(RQFII);6)中国证监会视为合格投资者的其他情形。
委托人:	指上述委托人(个人委托人和机构委托人)的合称
业绩报酬:	指集合计划存续期内,当集合计划净值收益率超过一定水平时,管理人从委托人退出、分红(如有分红计提业绩报酬时)款项中收取的金额
工作日:	指上海证券交易所和深圳证券交易所等相关交易所的正常交易日
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工作日
T+n日:	指自T日起第n个工作日(不包含T日)

T-n 日:	指 T 日前第 n 个工作日 (不包含 T 日)
初始募集期	指自本集合计划启动推广之日起不超过 60 日的期间, 具体推广时间以本集合计划推广公告为准
存续期	指计划成立并存续的期间, 也称管理期限
开放期	指委托人可以办理集合计划参与或退出等业务的工作日
开放日	指开放期内的每个工作日
封闭期	本集合计划除开放期外的每一个工作日均为封闭期, 在此期间委托人不得参与、退出该集合计划
参与	指委托人按集合资产管理合同申请购买本集合计划份额的行为
首次参与	指委托人在参与之前未持有过本集合计划的情形
退出:	指委托人按集合资产管理合同规定的条件要求收回全部或部分委托资产的行为
集合资产管理计划收益:	指本集合计划投资所得红利、股息、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
集合资产管理计划资产总值:	指集合计划投资所形成的各类有价证券、银行存款本息及其他资产的价值总和
集合资产管理计划资产净值:	指集合资产管理计划资产总值扣除负债后的净资产值
集合资产管理计划份额净值:	指集合资产管理计划资产净值除以计划总份额
集合资产管理计划份额面值 (或“份额面值”):	指人民币 1.00 元

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，以确定集合资产管理计划资产净值的过程
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、突发停电或其他突发事件、注册与过户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
管理人指定网站、管理人网站	指 htamc.htsc.com.cn, 管理人指定网站变更时以管理人公告为准
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，包括到期日在十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）、停牌股票、流动受限的新股以及非公开发行股票、资产支持证券（票据）、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，以及中国证监会认定的其他资产
七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，七个工作日内到期或者可支取的逆回购、银行存款，七个工作日内能够确认收到的各类应收款项等

### 第 3 部分 合同当事人

#### 一、委托人

签署本合同且合同正式生效的委托人即为本合同的委托人。委托人的基本信息在签署电子签名合同时即以数据电文的形式录入系统。

#### 二、管理人

管理人名称：华泰证券（上海）资产管理有限公司

法定代表人：崔春

住所：中国（上海）自由贸易试验区东方路 18 号 21 层

联系地址：上海浦东新区东方路 18 号 15 层

联系电话：4008895597

邮政编码：210000

### 三、托管人

托管人名称：上海浦东发展银行股份有限公司苏州分行

负责人：詹定国

住所：苏州工业园区钟园路 718 号

联系电话：0512-67573263

传真号码：0512-62572053

邮政编码：215000

## 第 4 部分 集合计划的基本情况

一、名称：华泰启泰金阆 FOF1 号集合资产管理计划

二、类型：混合类(FOF)

三、目标规模

本集合计划初始募集期规模上限为 50 亿份（不包括委托人参与资金利息转增份额），存续期不设规模上限。

本集合计划委托人总人数不得超过 200 人。单个客户首次参与金额不低于 40.4 万元（具体最低参与金额以管理人公告为准）。

四、投资范围和投资比例

一、本集合计划的投资范围包括：

本集合计划主要投资于金融产品和现金类资产。

1、金融产品：本计划主要投资于管理人选定的证券公司、基金公司、期货公司发行的集合资产管理计划以及在中国证券投资基金业协会备案的私募基金管理人发行的私募证券投资基金（上述资产简称：私募基金）、公募证券投资基金、商业银行理财产品。本集合计划所投资的资产管理产品不会再投资公募证券投资基金以外的资产管理产品，所投资的底层资产不包含非标准化债权类资产、非标准化股权类资产、非标准化商品及金融衍生品类资产。

2、现金类资产：包括现金、存款、通知存款、同业存单、期限在 7 天以内（含 7 天）的债券逆回购、货币市场基金以及中国证监会认可的其他现金管理类工具。

如法律法规或监管机构以后允许投资其他品种，投资管理人在履行适当程序后，可以将

其纳入投资范围。

## 二、本集合计划的投资比例限制

1、金融产品：占集合计划资产总值的 80%-100%，金融产品包括证券公司、基金公司、期货公司发行的集合资产管理计划以及在中国证券投资基金业协会备案的私募基金管理人发行的私募证券投资基金（上述资产简称：私募基金）、公募证券投资基金、商业银行理财产品。本计划按照所投资资产管理产品披露组合投资的频率，根据穿透原则合并计算的投资于权益类、固定收益类、商品及金融衍生品类资产的总值均不得超过计划总资产的 80%。

2、现金类资产：现金类资产包括现金、存款、通知存款、同业存单、期限在 7 天以内（含 7 天）的债券逆回购、货币市场基金以及中国证监会认可的其他现金管理类工具。

本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。

委托人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、托管人及与管理人、托管人有关联方关系的公司发行的或在承销期内承销的证券及管理人发行的公募基金，或者从事其他重大关联交易。交易完成后，管理人应及时通知托管人和委托人，采取切实有效措施，防范利益冲突，保护投资者合法权益并按相关规定报告或备案。

管理人将在本集合计划成立之日起 6 个月内使本集合计划的投资组合比例符合以上约定。非因管理人主观因素导致突破上述投资比例限制的，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 15 个工作日内调整至符合要求。确有特殊事由未能在规定时间内完成调整的，管理人应当及时向其住所地中国证监会相关派出机构和基金业协会报告。产品的实际投向不得违反合同约定，如有改变，应当先行取得委托人和托管人同意，并履行登记备案等法律法规以及中国证监会规定的程序。

如法律法规或监管部门或本合同修改或取消上述限制，履行适当程序后，本集合计划可相应调整投资组合限制的规定。

## 五、管理期限

本集合计划的存续期为 10 年。存续期满后，符合展期条件的，可以展期。

## 六、封闭期、开放期及流动性安排：

### 1、封闭期安排

本计划成立之日起 6 个月封闭运作。成立满 6 个月后，除开放期外的每一个工作日均为封闭期，封闭期内不办理参与、退出业务。

### 2、开放期安排

自本集合计划封闭期满 6 个月后的每年 2、5、8、11 月的第 1 个交易日开放参与和退出。

**预约退出方式：**委托人如需在该开放期退出，需在开放日前 25 个工作日（T-25 日）至 18 个工作日（T-18 日）通过信件、传真、电子邮件等方式在销售机构提出预约退出申请，

具体以管理人公告为准。在除管理人特别约定的情形外，若委托人未提交预约退出申请，则管理人有权拒绝该次退出申请。经委托人提交预约退出申请后，管理人在该退出开放期对提交预约退出申请的客户进行份额退出。

### 3、流动性安排

本集合计划开放期内，资产组合中七个工作日内可变现资产的价值不低于本计划资产净值的10%。

### 七、集合计划份额面值

人民币1.00元。

### 八、参与本集合计划的最低金额

首次参与的最低金额为人民币40.4万元（具体最低参与金额以管理人公告为准），追加参与的最低金额为人民币1万元。

### 九、本集合计划的风险收益特征及适合销售对象

本集合计划属于中风险产品，适合风险测评结果为稳健型、积极型、激进型的合格投资者。

### 十、本集合计划的销售

1、销售机构：华泰证券（上海）资产管理有限公司及与管理人签订本计划销售协议的其他销售机构。

#### 2、销售方式

管理人应将集合资产管理合同、集合资产管理计划产品说明书等正式销售文件，以纸质或电子文档方式置备于销售机构营业场所（仅向合格投资者推介）。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，推荐与客户风险承受能力相匹配的集合计划，引导客户审慎作出投资决定。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，但不得通过广播、电视、报刊及其他公共媒体销售本集合计划。

### 十一、本集合计划的各项费用

#### 1、参与费率：

参与金额 M	参与费率
$M < 100$ 万	1%
$100 \text{ 万} \leq M < 300$ 万	0.5%
$M \geq 300$ 万	0

2、退出费率：0%；

3、托管费：按照年费率 0.02%收取；

4、管理费：按照年费率 0.8%收取；

5、业绩报酬：本集合资产计划设有业绩报酬，委托人持有期间年化收益率超过 6%以上部分按照 8%的比例收取；

6、其他费用：其他费用及具体计算方法详见本合同“第 13 部分 集合计划的费用、业绩报酬”。

## 十二、预警线、平仓线

1、预警线：集合计划累计单位净值 0.92。存续期内，当任意交易日（T 日）集合计划累计单位净值等于或低于预警线，管理人必须在最近的底层金融产品开放日赎回产品份额，并在 T+15 日内变现资产，使得现金类资产占比不低于产品净值的 30%，直至集合计划累计单位净值高于预警线，如由于底层金融产品暂停赎回等原因无法变现的，持续变现直至满足上述比例。

2、平仓线：集合计划累计单位净值 0.88。存续期内，当任意交易日（T 日）集合计划累计单位净值等于或低于平仓线，集合计划进入终止清算程序，管理人必须在最近的底层金融产品开放日赎回产品份额，并在 T+15 日内将所有资产变现，如由于底层金融产品暂停赎回等原因无法变现的，管理人将持续变现或根据合同约定进入二次清算程序。

## 第 5 部分 集合计划的参与和退出

### 一、集合计划的参与

#### 1、参与的办理场所和时间

本集合计划参与将通过销售机构下属指定营业网点或销售机构指定网点办理集合计划的参与。委托人以电子签名合同的方式参与本计划。

##### （1）初始募集期参与

在初始募集期内，委托人在工作日内可以参与本集合计划。本集合计划的具体初始募集期以管理人的公告为准。管理人可根据集合计划销售情况在募集期限内适当延长或缩短集合计划的发售时间，并及时公告。

##### （2）存续期参与

投资者在集合计划开放期内的工作日可以办理参与本集合计划的业务。

本集合计划成立满 6 个月后的每年 2、5、8、11 月的第 1 个工作日 T 日开放。

#### 2、参与原则与参与价格

（1）初始募集期参与价格：在集合计划初始募集期内参与，每一份额的参与价格为人

人民币 1.00 元；

(2) 存续期参与价格：存续期参与集合计划时，每一份额的参与价格为参与开放日（T 日）当日的份额单位净值；

(3) 采用金额参与的方式，即以金额参与申请；

(4) 在初始募集期内，当集合计划募集规模接近或达到约定的规模上限时，管理人可暂停接受参与申请；

(5) 单个委托人参与金额不低于 40.4 万元（具体最低参与金额以管理人公告为准），追加参与的最低金额为人民币 1 万元；

(6) 以“金额优先+金额同等情况下时间优先”原则，对认购/申购金额有效性进行确认，未确认部分的参与款项退还给委托人。

### 3、参与的程序和确认

(1) 委托人在接受销售机构风险承受能力测评后，需签署电子签名约定书，同意以电子签名方式签署集合资产管理合同，签署完本集合计划电子合同后必须根据销售机构规定的手续，在指定参与时间内提出参与申请。委托人既可以到本集合计划销售机构指定营业网点的柜台申请参与集合计划，也可以登录销售机构指定网络系统以自主下单或自主预约的方式申请参与集合计划，具体参与方式以管理人公告为准。

(2) 委托人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；委托人指定资金账户作为办理参与款项、红利款项、退出款项以及清算款项的收款账户。委托人应承诺在本集合计划的资产管理合同有效期内，不得撤销该账户，并妥善保管账户资料。

(3) 委托人签署本合同后，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。委托人参与申请确认成功后，其参与申请和参与资金不得撤销；

(4) 初始募集期参与的委托人，可在集合计划正式成立后到原销售网点、销售机构指定网络系统、管理人网站查询最终的成交确认情况；存续期参与的委托人于 T 日提交参与申请后，可于 T+3 日后在办理参与的网点查询参与确认情况；

(5) 本计划具体的销售起始日和结束日届时以管理人公告为准。原则上销售起始日和结束日之间不超过 60 日；

(6) 管理人在 T+2 个工作日内对委托人参与的有效性进行确认；

(7) 初始募集期内，在每日办理认购的交易时间结束后，管理人统计认购规模，当委托人累计认购规模达到 50 亿元（不含初始募集期利息）时，管理人有权发出停止认购指令，并宣布超过预定规模的认购无效。

### 4、参与费及参与份额的计算

(1) 参与费率：

参与金额 M	参与费率
--------	------

M < 100 万	1%
100 万 ≤ M < 300 万	0.5%
M ≥ 300 万	0

(2) 参与份额的计算方法:

初始募集期参与份额的计算:

净参与金额 = 参与金额 / (1 + 参与费率)

参与费用 = 参与金额 - 净参与金额

参与份额 = (净参与金额 + 初始募集期利息) / 集合计划份额面值

参与份额保留小数点后两位, 小数点后第三位四舍五入, 由此产生的差额计入集合计划损益。

(3) 存续期参与份额的计算:

净参与金额 = 参与金额 / (1 + 参与费率)

参与费用 = 参与金额 - 净参与金额

参与份额 = 净参与金额 / 开放日集合计划单位份额净值

参与份额保留小数点后两位, 小数点后第三位四舍五入, 由此产生的差额计入集合计划损益。

5、参与资金利息的处理方式

委托人的参与资金在初始募集期产生的利息将折算为计划份额归委托人所有, 利息金额以集合计划注册登记机构的记录为准。

## 二、集合计划的退出

1、退出的办理场所和时间

本计划成立满 6 个月后的每年 2、5、8、11 月的第 1 个工作日开放退出。

本集合计划采用预约退出的方式实现委托人份额的退出。委托人如需在某一开放期退出, 需在该开放日前 25 个工作日 (T-25 日) 至 18 个工作日 (T-18 日) 通过信件、传真、电子邮件等方式在销售机构提出预约退出申请。在除管理人特别约定的情形外, 若委托人未提交预约退出申请, 则管理人有权拒绝该次退出申请。经委托人提交预约退出申请后, 管理人在该退出开放期对提交的预约退出申请进行确认并为委托人办理份额退出。

2、退出的原则

(1) “未知价”原则, 即退出集合计划的价格以退出开放日 (T 日) 集合计划份额的单位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、退出的程序和确认

(1) 退出申请的提出

本集合计划的委托人在预约退出申请期内向管理人提出份额预约退出申请。

委托人在提交预约退出申请时，其在销售机构必须有足够可用的集合计划份额余额，否则所提交的预约退出的申请无效而不予成交。

#### (2) 退出申请的确认

管理人在集合计划退出开放期根据委托人的预约退出申请为委托人办理集合计划份额的退出，正常情况下管理人在 T+2 日内对该申请的有效性进行确认。委托人在 T+3 日后可向集合计划销售机构查询退出的成交情况。

#### (3) 退出款项划付

若注册登记机构确认退出申请成功，退出款项于 T+10 日内从托管账户中划出至销售机构指定账户，或划出至登记结算机构清算汇总账户，再由登记结算机构将退出款项分别划至销售机构指定账户。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委托人账户。

### 4、退出费及退出份额的计算

#### (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×T 日集合计划份额单位净值（或退出价格）

退出金额结果按照四舍五入方法，保留小数点后两位。

#### (3) 退出价格

本集合计划份额的退出以份额申请，采用“未知价”原则，即退出集合计划份额的价格以退出开放日的单位净值为基准进行计算。

### 5、退出的限制

委托人单笔退出最低份额为 1000 份；若某笔退出导致该委托人在某销售机构持有的金额少于 40 万元，则余额部分必须一起退出。委托人在某一开放日的退出次数不受限制。若管理人为委托人持有份额统一办理强制退出亦按此限制办理。

### 6、单个委托人大额退出的认定、申请和处理方式

本集合计划不单独设置单个委托人大额退出安排，但因单个委托人大额退出导致出现巨额退出，则根据巨额退出的认定和处理方式办理。

### 7、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，委托人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、部分顺延退出或暂停退出：

全额退出：当管理人认为有条件支付委托人的退出申请时，按正常退出程序办理。

部分顺延退出：当管理人认为支付委托人的退出申请可能会对计划资产净值造成较大波动时，管理人在当日接受净退出比例不低于集合计划总份额 10%的前提下，对其余退出申请予以延期办理。对于当日的退出申请，将按单个账户退出申请量占退出申请总量的比例，确定当日受理的退出份额；未能受理的退出部分，委托人可选择延期办理或撤销退出申请。对于选择延期办理的退出申请，管理人将在下一个工作日内办理，并以退出当日管理人公布的计划单位净值为准计算退出金额，依此类推，直至全部办理完毕为止，转入下一个工作日的退出申请不享有优先权。

## (3) 连续巨额退出的顺序、价格确定和款项支付

本集合计划每个开放日仅为一天，不涉及连续巨额退出。

## (4) 告知客户的方式

发生巨额退出并延期支付时，管理人应在 3 个工作日内在管理人指定网站公告，并说明有关处理方法。

## 8、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退出申请：

- (1) 不可抗力的原因导致集合计划无法正常运作；
- (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委托人利益时；
- (4) 因市场剧烈波动等原因而出现巨额退出，或者其他原因，导致本集合计划的现金支付出现困难时，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说明书、资产管理合同中已载明的特殊情形。

发生《集合资产管理合同》、计划产品说明书中未予载明的事项，但集合计划管理人有正当理由认为需要暂停接受集合计划退出申请的，报经中国证监会批准后可以暂停接受委托人的退出申请。

如果发生暂停开放日退出的情况，管理人应在导致暂停退出事项消失后设定新的开放日，并应及时恢复退出业务的办理。

---

## 第6部分 管理人自有资金参与集合计划

管理人可以自有资金参与本集合计划。

管理人以自有资金参与本集合计划的：

1、自有资金参与的条件：管理人以自有资金参与本集合计划，应符合《指导意见》、《管理办法》、《运作管理规定》和中国证监会及中国证券投资基金业协会和本合同的相关规定。

2、自有资金的参与方式：管理人以自有资金参与本集合计划，将在本集合计划销售机构参与。

3、自有资金参与的金额和比例：管理人自有资金参与本计划的份额不得超过本计划总份额的20%。管理人及其附属机构以自有资金参与本集合资产管理计划的份额合计不得超过本计划总份额的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，管理人应在具备退出本计划条件时将自有资金比例降至适合比例，并在退出本计划前5个工作日以网站公告的形式告知托管人和集合计划持有人。

4、自有资金的收益分配：管理人将与委托人按照持有本集合计划份额比例承担风险和享有收益。

5、自有资金责任承担方式：本集合计划管理人不承担补偿责任。

6、自有资金参与集合计划的持有期限不得少于6个月。在满足持有期不少于6个月等监管规定的前提下，管理人有权退出以自有资金参与的本集合计划的份额。管理人参与、退出时应当提前5个工作日以网站公告的形式告知托管人和集合计划持有人。

7、为应对集合资产管理计划巨额退出以解决流动性风险，或者中国证监会认可的其他情形，在不存在利益冲突并遵守合同约定的前提下，管理人及其附属机构以自有资金参与及其后续退出集合资产管理计划可不受上述限制，但事后及时告知委托人和托管人。

8、集合计划存续期内，当法律法规或有关自有资金参与集合计划的规定或政策发生变更，管理人经与托管人协商一致并告知委托人后，可直接对本部分内容进行修改和调整。委托人若同意修改或调整的内容需在修改或调整的内容生效前按照本合同规定向计划管理人发出书面同意意见。委托人未发表书面同意意见的，视为其不同意修改或调整的内容，计划管理人有权安排其退出集合计划。

## 第7部分 集合计划的分级

本集合计划不分级。

---

## 第 8 部分 集合计划客户资产的管理方式和管理权限

### 一、管理方式：

本集合计划由华泰证券（上海）资产管理有限公司担任管理人，并根据相关法律法规的规定对本资产集合计划进行管理。

### 二、管理权限：

管理人根据本合同约定的投资范围、委托期限以及投资限制进行投资管理。

## 第 9 部分 集合计划的成立

### 一、集合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 千万元（不含初始募集期利息）人民币且其不含管理人自有资金参与的委托人的人数为 2 人（含）以上，200 人以下，并经管理人聘请的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出具验资报告后，管理人公告本集合计划成立。

集合计划设立完成前，委托人的参与资金只能存入注册与过户登记机构指定的专门账户或资产托管机构的募集专户，不得动用。

### 二、集合计划设立失败

集合计划初始募集期结束，在集合计划规模低于人民币 1000 万元或者不含管理人自有资金参与的委托人人数低于 2 人条件下，集合计划设立失败，管理人承担集合计划全部推广费用，并将已认购资金及同期利息在初始募集期结束后 30 个工作日内退还集合计划委托人，各方互不承担其他责任。利息金额以本集合计划注册登记机构的记录为准。

### 三、本集合计划的备案

本集合资产管理计划的募集金额缴足之日起十个工作日内，本计划管理人应当委托具有证券相关业务资格的会计师事务所进行验资并出具验资报告。本计划管理人应当在集合资产管理计划取得验资报告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、验资报告等材料报基金业协会备案，并抄报中国证监会相关派出机构。

### 四、集合计划开始运作的条件和日期

#### 1、集合计划开始运作的条件：

当本集合计划满足成立条件，并在会计师事务所出具验资报告、管理人公告本集合计划成

立后，本集合计划即可开始运作。

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除外。

## 2、集合计划开始运作的日期：

本计划将在管理人公告产品成立之日起开始运作。本集合计划开始运作的日期为本集合计划的成立日。

## 第 10 部分 集合计划账户与资产

### 一、集合计划账户的开立

托管人应以本集合计划的名义为计划财产开立托管账户，以办理相关的资金汇划业务，集合计划的一切货币收支活动，包括但不限于投资、支付退出金额、支付计划收益、收取参与款，均需通过该账户进行。户名应为“华泰启泰金阆 FOF1 号集合资产管理计划”（以实际开立为准）。预留印鉴由托管人指定印章组成，印鉴卡原件由托管人保管。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。

托管人为本集合计划开立证券账户，证券账户名称为“管理人+华泰启泰金阆 FOF1 号集合资产管理计划托管人+集合计划名称” [备注：账户名称以实际开立账户名称为准]。托管人不垫付开户费用。

销售机构为集合计划的每一位委托人建立集合计划交易账户，记录委托人通过该销售机构买卖本集合计划份额的变动及结余情况。

注册登记机构为委托人开立集合计划账户，用于记录委托人持有的本集合资产管理计划份额。

### 二、集合计划资产的构成

本集合计划资产的构成主要有：

1、金融产品：本计划主要投资于管理人选定的证券公司、基金公司、期货公司发行的集合资产管理计划以及在中国证券投资基金业协会备案的私募基金管理人发行的私募证券投资基金（上述资产简称：私募基金）、公募证券投资基金、商业银行理财产品。本集合计划所投资的资产管理产品不会再投资公募证券投资基金以外的资产管理产品。

2、现金类资产：包括现金、存款、通知存款、同业存单、期限在 7 天以内(含 7 天)的债券逆回购、货币市场基金以及中国证监会认可的其他现金管理类工具。

### 三、集合计划资产的管理与处分

集合计划资产由托管人托管，并独立于管理人及托管人的自有资产及其管理、托管的其

他资产。管理人或托管人的债权人无权对集合计划资产行使冻结、扣押及其他权利。除依照相关法律法规和合同约定处分外，集合计划资产不得被处分。

## **第 11 部分 集合计划资产托管**

本集合计划资产交由上海浦东发展银行股份有限公司苏州分行负责托管，管理人已经与托管人签署了托管协议。托管人的托管职责以托管协议的约定为准。

托管方式为：托管人结算模式。

委托人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 12 部分 集合计划的估值**

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、资产总值**

集合计划的资产总值是指通过发行计划份额方式募集资金，并依法进行有价证券交易等投资所形成的各类资产的价值总和。

### **二、资产净值**

集合计划资产净值是指集合资产管理计划资产总值扣除负债后的净资产值。

### **三、单位净值**

集合计划份额净值是指集合计划资产净值除以计划总份额。

### **四、估值目的**

客观、准确地反映集合计划资产的价值。经集合计划资产估值后确定的集合计划单位净值，是进行信息披露、计算参与和退出集合计划的基础。

### **五、估值对象**

运用本集合计划资产所购买的一切有价证券、银行存款及其他资产。

### **六、估值日**

本集合计划成立后（含成立日），每个工作日对上一日的资产进行估值。

### **七、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、保护委托人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。

- 1、本计划持有的现金以成本列示。
- 2、本计划持有的银行存款以成本估值并按其商定利率在持有期内逐日计提应收利息。
- 3、本计划持有的同业存单采用中央国债登记结算有限责任公司提供的相应品种当日的估值价格估值。

4、逆回购交易以成本列示，按实际利率在实际持有期间内逐日计提利息。

#### 5、对金融产品的估值方法

(1) 持有的交易所上市基金（包括封闭式基金、上市开放式基金（LOF）、创新型分级基金等），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，或者类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值；

(2) 持有的场外开放式基金（包括托管在场外的上市开放式基金（LOF））按估值日的基金份额净值估值；估值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，按所投资基金前一估值日至估值日期间（含节假日）的万份收益计提估值日基金收益；

(4) 持有的基金处于封闭期的，按照估值日份额净值估值；没有公布份额净值的，按照成本估值；

(5) 持有的集合资产管理计划以及私募基金，按照管理人或管理人授权的第三方披露的估值日计划（基金）单位净值估值，估值日单位净值未披露的，以最近一次披露的计划（基金）单位净值估值。若其管理人收取业绩报酬，且披露的单位净值未反应业绩报酬影响，为消除集合资产管理计划以及私募基金计提业绩报酬对资产净值的影响，分以下情况处理：a) 在估值日，持仓份额发生实际业绩报酬计提，按照管理人或授权第三方披露的实际计提的业绩报酬调整持仓份额；b) 在估值日，持仓份额未发生实际业绩报酬计提，但管理人或其授权第三方披露扣除预估业绩报酬后的计划（基金）单位净值，采用扣除预估业绩报酬后的计划（基金）单位净值估值；c) 在估值日，持仓份额未发生实际业绩报酬计提，但管理人或其授权第三方披露估值日预估业绩报酬，根据披露的估值日预估业绩报酬对未扣减业绩报酬的计划（基金）单位净值进行调整，采用调整后的扣除预估业绩报酬的计划（基金）单位净值估值。调整后计划（基金）单位净值=（估值日持有份额数-估值日预估业绩报酬扣减份额数）\*未扣减业绩报酬计划（基金）单位净值/估值日持有份额数；d) 在估值日，持仓份额未发生实际业绩报酬计提，管理人也未披露扣除预估业绩报酬后的计划（基金）单位净值或预估业绩报酬，以最近一次扣除（预估）业绩报酬后的净值估值。如遇该估值日为集合计划开放日，为使申购、赎回价格公允合理，集合计划管理人可根据计划（基金）合同约定的业绩报酬计提方法预估业绩报酬并调整计划（基金）净值，在履行相应程序后按调整后的计划（基金）净值估值。为实现本款估值之目的，本计划管理人应及时告知托管人本计划持有的

集合资产管理计划以及私募基金的相关信息，包括但不限于：持有的计划（基金）之管理人是否收取业绩报酬、其披露的单位净值是否反应业绩报酬影响、在估值日持仓份额是否发生实际业绩报酬计提、是否披露扣除预估业绩报酬后的计划（基金）单位净值或预估业绩报酬、调整后的单位净值等，托管人据此估值。若本计划管理人未及时告知托管人的，托管人将以披露的单位净值估值。

6、如有充足证据表明按前述办法进行估值不能真实公允反映集合计划资产价值的，本集合计划的管理人根据具体情况，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的基础上，经与托管人商定之后，按最能反映公允价值的方法估值。

7、相关法律法规以及监管部门另有规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值；

如管理人或托管人发现集合估值违反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。

根据有关法律法规，资产净值计算和会计核算的义务由管理人承担。本集合的会计责任方由管理人担任，因此，就与本集合计划有关的会计问题，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，按照管理人对集合资产净值的计算结果对外予以公布。

8、暂停估值的情形：集合计划投资所涉及的证券交易所遇法定节假日或其它原因暂停营业时，或因其它任何不可抗力致使管理人或托管人无法准确评估集合计划资产价值时，可暂停估值。但估值条件恢复时，管理人或托管人必须及时完成估值工作。

## 八、估值程序

集合计划的日常估值由管理人进行，托管人复核。具体流程为管理人完成估值后，将估值结果按双方约定的方式报送托管人，托管人进行复核；托管人复核无误后以双方约定方式返回给管理人。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。

托管人对估值结果的复核包括但不限于集合计划总净值、集合计划单位净值等。托管人在进行估值结果核对之前，需在估值日完成当日交易结果和银行存款余额的复核。

## 九、估值错误与遗漏的处理方式

管理人和托管人应采取必要、适当、合理的措施确保资产估值的准确性和及时性。当份额计价出现错误时，管理人应当立即予以纠正，通报托管人，并采取合理的措施防止损失进一步扩大。估值错误偏差达到集合计划资产净值的0.5%时，集合计划管理人应当立即通报集合计划托管人，并向委托人披露。因集合计划份额资产净值计算错误给集合计划资产及委托人造成损失的，管理人应当承担赔偿责任。赔偿仅限于因差错而导致的委托人的直接损失。管理人在赔偿后，可以向其他有关差错责任方追偿。集合计划管理人具有向当事人追偿不当得利的权利。如法律法规或监管机关另有规定的，按其规定处理。

## 十、估值复核

集合计划总净值、集合计划单位净值、由管理人完成估值后，将估值结果以双方约定方

式报送托管人，托管人进行复核；托管人复核无误后以双方约定方式返回给管理人。如果托管人的复核结果与管理人的计算结果存在差异，且双方经协商未能达成一致，管理人有权按照其对集合计划净值的计算结果对外予以公布，托管人有权将相关情况报中国证监会指定机构备案。

## 第 13 部分 集合计划的费用、业绩报酬

### 一、集合计划费用支付标准、计算方法、支付方式和时间

#### 1、管理费：

管理人按集合计划资产前一日净值的 0.8% 年费率收取集合计划固定管理费。

$$K = E \times \text{固定管理年费率} \div \text{当年天数}$$

K 为每日集合计划应计提的固定管理费；

E 为前一日该集合计划资产净值。

固定管理费每日计提，按季支付，由托管人于每季结束后次月首日起 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支付。若集合计划现金资产不足以支付当期固定管理费，则可顺延至有足额现金资产后支付。延期支付固定管理费不计利息，仍按原价支付。

#### 2、业绩报酬

##### (1) 管理人收取业绩报酬的原则

(i) 管理人在本集合计划收益分配日、份额退出日、集合计划终止日收取业绩报酬；

(ii) 若业绩报酬计算期间的年化收益率  $r$  小于或等于业绩报酬计提基准  $R_0$ ，则管理人不提取业绩报酬；若持有期年化收益率  $r$  大于业绩报酬计提基准  $R_0$ ，则管理人提取持有期收益率超过  $R_0$  部分的 8% 作为业绩报酬；本集合计划业绩报酬计提基准  $R_0$  为 6%。

(iii) 在本集合计划收益分配日、份额退出日、集合计划终止日提取业绩报酬的，业绩报酬从分红资金或退出资金中扣除。业绩报酬提取频率每 6 个月最多一次，因委托人退出本集合计划，管理人按照本合同的约定提取业绩报酬的，不受前述提取频率的限制。

##### (2) 业绩报酬 (R) 的计提方法

如果  $r \leq R_0$ ，则  $R=0$ ；

如果  $R_0 < r$ ，则  $R = C \times F \times (r - R_0) \times 8\% \times T / 365$

$$r = (C_T - C_0) / C / T * 365$$

$C_T$  = 业绩报酬计提日的份额累计单位净值

$C_0$  = 上一次业绩报酬计提日的份额累计单位净值；若该笔份额还未提取过业绩报酬，则为该笔份额对应的认购或申购时的份额累计单位净值

$C$  = 上一次业绩报酬计提日的份额净值

$F$  = 提取业绩报酬的集合计划份额

T= 上一次业绩报酬计提日至本次业绩报酬计提日的自然日天数

初始募集期参与的集合计划份额首次计提业绩报酬的上一次业绩报酬计提日指计划成立日；参与开放期参与的集合计划份额首次计提业绩报酬的上一次业绩报酬计提日指参与日。

(3) 业绩报酬支付：赎回业绩报酬从份额持有人退出资金中扣除；分红业绩报酬从份额持有人分红资金中扣除（如果份额持有人本次分红的金额小于应计提的业绩报酬时，不足部分可在份额持有人以后的分红金额或退出款项中扣除）；集合计划终止时业绩报酬从产品清算资金中扣除。管理人负责计算业绩报酬，托管人对于业绩报酬不予复核，托管人根据管理人的指令将业绩报酬支付给管理人。

### 3、托管费：

托管费按集合计划资产前一日的资产净值的 0.02% 的年费率计提。

$H = E \times \text{托管年费率} \div \text{当年天数}$

H 为每日集合计划应计提的托管费；

E 为前一日该集合计划资产净值。

托管费每日计提，按季支付，经管理人和托管人核对一致后，由托管人于每季结束后次月首日起 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支付。若集合计划现金资产不足以支付当期托管费，则可顺延至有足额现金资产后支付。延期支付托管费不计利息，仍按原价支付。托管费为包含增值税的含税价款。

### 4、管理费、业绩报酬和托管费的调整

管理人和托管人可协商调减管理费、业绩报酬和托管费，并在新的费率开始实施前 3 个工作日在管理人指定网站公告。经委托人同意，管理人和托管人可协商调高管理费、业绩报酬和托管费，并在新的费率开始实施前 3 个工作日在管理人指定网站公告。管理人可以根据集合计划现金头寸情况调整管理费、业绩报酬和托管费的划付时间。

### 5、证券交易费用：

集合计划投资运作期间发生的交易手续费、开放式基金的认（申）购和赎回费、印花税等有关税费，在收取时从集合计划中扣除。交易佣金的费率由集合计划管理人本着保护委托人利益的原则，按照法律法规的规定确定。

### 6、年度专项审计费用

本集合计划的年度专项审计费用，按与会计师事务所签定协议所规定的金额，在被审计会计期间，按直线法在每个自然日内平均摊销。

### 7、律师费和信息披露费用

集合计划成立后的律师费和信息披露费用，以及按照国家有关规定可以列入的其他费用，由集合计划管理人本着保护委托人利益的原则，按照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定，上述费用分别在发生时扣除。

计划初始募集期发生的会计师费、律师费和信息披露费等相关费用以及存续期间发生的

与推广有关的费用，不得列入计划费用。

8、银行结算费用、开户费等集合计划运营过程中发生的相关费用。

银行结算费用、开户费，分别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（实际发生的费用不影响集合计划估值日单位净值小数点后4位的），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（实际发生的费用影响集合计划估值日单位净值小数点后4位的），并且可以对应到相应会计期间，应该在该会计期间内按直线法摊销。

9、上述集合计划费用中第5项、第7项和第8项费用，以及按照国家有关规定可以列入的其他费用，由集合计划托管人根据有关法律法规及相应协议的规定，在协议规定的时间按费用实际支出金额划拨，列入集合计划费用。

## 二、不列入集合计划费用的项目

计划初始募集期发生的信息披露费、会计师费、律师费等相关费用以及存续期间发生的与推广有关的费用，不得列入计划费用。集合计划管理人和集合计划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。

## 三、集合计划的税收

本合同相关方一致同意，根据《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）等相关文件要求，就资管产品运营过程中发生的增值税，由本计划委托财产承担。

# 第14部分 集合计划的收益分配

## 一、利润的构成

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。

## 二、可供分配利润

本集合计划可供分配利润指截至收益分配基准日未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低者。

## 三、收益分配原则和方式

- 1、收益分配基准日的单位净值减去每单位份额收益分配金额后不能低于面值；
- 2、收益采用现金分配的方式，每位委托人获得的分红收益金额保留小数点后两位，第三位四舍五入；
- 3、在符合收益分配原则的前提下，本集合计划可根据情况选择在计划存续期进行收益

分配；

- 4、收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由委托人自行承担；
- 5、法律法规另有规定的从其规定。

管理人经与托管人协商一致，可在监管机构允许的范围内调整收益分配原则，并在管理人网站上公告。

#### 四、收益分配方案的确定和披露

收益分配方案由管理人根据本合同拟定，包括截止收益分配基准日的可供分配利润、分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容，经托管人复核，并至少在 R-2 个工作日（R 为权益登记日）之前将收益分配方案向委托人公告。

#### 五、收益分配方式

本集合计划的分红方式为现金分红。现金分红时，管理人将现金红利款划往销售机构账户，再由销售机构划入委托人账户，自红利发放之日起 7 个工作日内到达委托人账户。

## 第 15 部分 投资理念与投资策略

### 一、投资目标

在控制投资风险的前提下，实现组合资产长期稳定增值。

### 二、投资理念

本计划为进取型的主动管理类 FOF 产品，投资策略为筛选以量化对冲套利类策略为主，以股票多头、宏观对冲等策略为辅的优质基金。

### 三、投资策略

#### 1、金融产品投资策略

本计划为 FOF 产品，投资的金融产品策略涵盖股票多空、股票多头、量化多因子、股票统计套利、股票打新、保本策略、定增策略、可交债策略、利率债波段交易策略、信用债精选策略、管理期货策略、宏观对冲策略等。通过不同投资策略金融产品的配置，对本集合计划的整体风险起到了良好的分散作用。在建仓初期，本计划将以投资量化对冲套利类策略为主，以股票多头、宏观对冲等策略为辅，后期将择机加入其他策略。

本计划管理人对资产管理产品的选择主要基于对金融产品管理人投资能力评估和合规运营风险评估，采用定性分析为主，定量分析为辅的方法，将投资能力和合规运营风险各自分为 5 个等级，两方面必须同时达到 3 分以上方可聘用。具体的分析方法：（1）定量分析：通过获取拟投资资产管理产品的数据，辅以定量归因分析。（2）定性分析：对金融产品管理人的核心投研人员进行面对面访谈。对单个金融产品的选择上，更加注重投资逻辑的稳定性和预判性，而非仅仅基于历史收益风险比。在此基础上，选择其优势策略产品。

评分等级分类见下表：

投资能力等级	合规运营风险等级
5 杰出	5 健全
4 卓越	4 标准
3 优秀	3 建议改善
2 低于平均	2 不足
1 不足	1 无效

## 2、现金类资产投资策略

本计划以严谨的市场价值分析为基础，采用稳健的投资组合策略，通过对现金管理类金融品种的组合操作，在保持本金的安全性与资产流动性的同时，追求稳定的当期收益。通过合理有效分配本计划的现金流，保持投资组合的流动性，满足本计划投资运作的要求。

## 第 16 部分 投资决策与风险控制

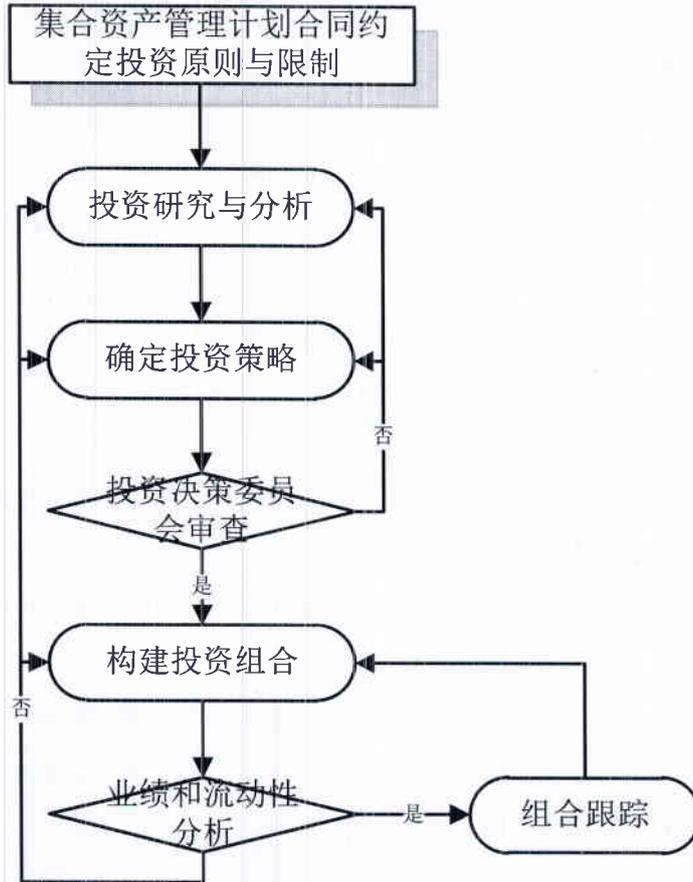
### 一、集合计划的决策依据

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，并以维护集合计划委托人利益作为最高准则。具体决策依据包括：

- 1、《指导意见》、《管理办法》、《运作管理规定》、《集合资产管理合同》、《说明书》等有关法律性文件；
- 2、国内外经济形势、利率变化趋势以及行业与上市公司基本面研究；
- 3、投资对象收益和风险的匹配关系，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。

### 二、集合计划的投资程序

投资管理程序分为投资研究、投资决策、投资执行、组合业绩和流动性分析、投资跟踪与反馈五个环节，具体流程图如下：



1、华泰资管研究人员通过自身研究及借助外部研究机构，形成宏观经济、金融市场、货币政策、行业发展、公司经营等方面的研究报告。华泰资管定期召开投资研究联席会议，投资人员与研究人员相互交流研究成果，为投资决策提供科学的依据。

2、投资经理在集合资产管理计划合同规定的投资策略指引下，按季度制作《投资策略报告》，对于超出投资经理投资权限的投资项目，投资经理按照集合计划投资授权方案的规定报上级审批。需由客户资产管理投资决策委员会审批的项目，投资经理需制订《重大投资项目建议书》，并附有关研究报告，提交客户资产管理投资决策委员会讨论。

3、客户资产管理投资决策委员会按约定方式召开投资策略和重大项目建议书审查会。客户资产管理投资决策委员会就投资策略报告是否符合集合计划合同约定的投资原则进行实质性审查，就具体的资产配置方案、投资品种选择等提出意见。客户资产管理投资决策委员会审查投资经理提交的《投资策略报告》、《重大投资项目建议书》，经客户资产管理投资决策委员会成员讨论修改并签字，形成投资决议。

4、投资交易指令由集中交易室统一执行，严格执行投资与交易分离制度。

5、公司风险管理委员会和合规风控部对投资决策和投资执行的过程进行合规性监督检查，防范投资管理过程中的违规风险。

### 三、风险控制

## 1、风险管理理念

本集合计划管理人——华泰资管始终秉承“高效、诚信、稳健、创新”的核心价值观和“追求风险可控的合理收益”的风险管理理念,将风险管理放在与业务发展同等重要的位置。在风险管理模式和手段上,逐步实现了由事后控制向事前审核、事中监控和事后评估的转变,全面实行了集中化风险管理模式,完善了定性判断和定量分析相结合的风险管理技术手段。

## 2、风险管理主要内容

- (1) 确立加强风险管理的指导思想,制定业务风险管理的目标和原则;
- (2) 建立层次分明、权责明确的业务风险管理机制;
- (3) 建立完善的业务风险控制流程;
- (4) 对业务面临的风险进行全面、系统的评估,制定详细、可行的风险管理方案;
- (5) 确定集合资产管理业务风险控制措施和报告制度;
- (6) 保障业务风险管理制度的持续性和有效性,制定可行的制度评价、检查机制。

## 3、风险管理体系

公司建立严密有效的多级风险防范体系,集合资产管理业务的风险管理工作纳入公司的风险管理体系。公司风险管理组织架构包括四个主要部分:董事会、总经理及风险管理委员会、首席风险官及合规风控部、各其他职能部门以及业务部门。

### (1) 一级风险防范

一级风险防范是指公司董事会对集合资产管理业务的风险进行管理和防范,其主要职责为:设定风险管理的总体目标、基本政策;决定风险管理的机构设置及职责。

### (2) 二级风险防范

二级风险防范是指公司总经理及风险管理委员会对集合资产管理业务实际运作风险的管理与防范。公司总经理是集合资产风险管理第一责任人,根据董事会的授权和批准,结合集合资产管理经营目标,具体负责实施风险管理工作。公司总经理对集合资产全面风险管理执行的有效性承担主要责任。公司总经理下设风险管理委员会,风险管理委员会为非常设机构,其主要职责为:制定公司风险管理政策,确定公司风险管理运行机制;分解董事会确定的风险管理额度;日常经营和重大投资业务的风险评估和决策。

### (3) 三级风险防范

三级风险防范是指首席风险官及合规风控部对集合资产管理业务各项风险的管理与防范。公司设首席风险官,负责全面风险管理工作,首席风险官由董事会提名、聘任。首席风险官为公司高级管理人员,并不得兼任或者分管与其职责相冲突的职务或部门。公司设立合规风控部履行风险管理职责,在首席风险官领导下推动全面风险管理工作,监测、评估、报告公司整体风险水平,并为业务决策提供风险管理建议;协助、指导和检查各部门风险管理工作;对创新业务和重大风险业务或项目进行独立风险审核及评估。

### (4) 四级风险防范

四级风险防范指各业务部门及职能部门负责各自条线的风险管理工作，主动执行公司各项风险管理制度。公司各部门负责人是风险管理的第一责任人，应当全面了解并在决策中充分考虑与业务相关的各类风险，及时识别、评估、应对、报告相关风险，并承担风险管理有效性的直接责任。公司集合资产管理相关部门对自身业务风险进行自我检查和控制，根据经营计划、业务规则及本部门具体情况制定本部门的工作流程及风险控制措施，达到：

a. 一线岗位双人双职双责，互相监督；直接与交易、资金、电脑系统、重要空白支票、业务用章接触的岗位，实行双人负责；属于单人、单岗处理的业务，强化后续的监督机制；

b. 公司内部相关部门、相关岗位之间相互监督制衡。部门之间和岗位之间建立重要业务凭据顺畅传递的渠道，各部门和岗位分别在授权范围内承担各自的职责，将风险控制在最小范围内。

#### 4、风险管理流程

##### (1) 建立控制环境

公司制定风险管理目标和风险管理制度，设立相应的风险管理部门。公司内部组织结构的设计方面，体现部门之间职责既有分工，又相互合作与制衡的原则。集合计划投资管理、运营、清算、财务等工作岗位有明确的授权分工，各岗位的操作相互独立，并且有独立的报告系统。各工作岗位之间相互核对、相互牵制，以减少舞弊或错误与遗漏发生的风险。

##### (2) 风险评估

风险评估包括风险识别和风险分析。风险识别是指对集合资产管理业务面临的各种风险因素进行甄别；风险分析是指对风险的重大程度、风险发生可能性进行分析预测，拟定风险应对措施等。

集合资产管理业务风险评估包括事前评估和事后评估。集合资产管理业务事前评估指在开展集合资产管理业务前，针对业务流程和特点，对业务开展过程中可能存在的风险进行评估。集合资产管理业务的事后评估指开展集合资产管理业务后对于风险进行的定期评估与不定期评估。

(3) 风险报告建立完善的风险报告制度。风险报告制度要求各部门之间以及部门内部的操作必须有书面文件予以记录，各个部门、各个岗位对风险管理情况和风险隐患按一定程序向部门领导及合规风控部作书面报告；合规风控部对于日常操作中发现的或认为具有潜在可能的问题应向总经理及首席风控官报告，并负责追踪整改情况。

#### 5、风险管理具体措施

##### (1) 市场风险管理

公司建立科学严谨的从客户资产投资决策会议到投资经理的多层次投资决策体系、完备的投资授权制度；组建覆盖权益投资、固定收益投资、衍生品、量化策略等各类型投资的投资研究队伍及专业化投资决策小组；通过运行投资例会制度、证券池制度、止盈止损制度等一系列投资管理控制制度，同时以投资交易管理系统作为辅助控制手段来达到控制市场风险

的目的。

#### (2) 合规性风险管理

公司风险管理委员会和合规风控部对集合资产管理业务的合法、合规性进行全面和重点的分析和检查，控制集合资产管理业务在合规性方面的风险。

#### (3) 信用风险管理

信用风险控制实行事前、事中、事后三个环节同时把控的原则；建立信用分析会议制度，综合考虑债券发行人所有制性质以及实际控制人情况、发债主体盈利与现金流、发债主体偿债能力与偿债意愿及担保情况对债券主体及债项进行评级；建立动态禁止投资黑名单制度。

#### (4) 流动性风险管理

公司将流动性风险管理工作纳入绩效考核，并建立问责制度；对流动性风险实施事前、事中、事后全方位管理；投资经理投资过程中对流动性以“宁多勿少”为原则，特别关注产品开放赎回期及季末、年末等特殊时期；公司通过建立流动性风险应急预案防止风险扩大化。

#### (5) 操作风险管理

通过建立健全各项操作制度、岗位职责，建立岗位复合制度，发现风险事件及时统计、定期归纳回顾，修订流程、制度，并辅以一定的奖惩措施的方法将操作风险降至最低。

#### (6) 法律风险管理

通过加强合规法务人员的配备，提高对公司资产管理各业务的覆盖，同时加强对员工法律意识及相关法律知识的培训来达到控制法律风险的目的。

#### (7) 信息技术风险管理

公司的信息技术服务由母公司提供外包服务，公司仍需将通过明确岗位职能、健全相关制度，以及通过各种方式如培训、讲座、邮件提醒等提高员工的信息技术风险防范意识的多种途径，防范和化解信息技术风险。

#### (8) 其他风险管理措施。

除了上述针对特定投资风险采取专门的管理措施之外，本集合计划还针对各个可能的风险点建立各种风险防范和控制措施，以及建立风险管理与控制相匹配的技术支持系统，实现对集合资产管理业务全流程、实时、动态的风险管理与控制。

## 第 17 部分 投资限制及禁止行为

### 一、投资限制

为维护委托人的合法权益，本集合计划的投资限制为：

- 1、本计划的总资产不得超过本计划净资产的 200%。

2、本计划投资于同一资产的资金不得超过计划资产净值的 25%；按照所投资资产管理产品披露组合投资的频率，根据穿透原则合并计算的管理人管理的全部集合资产管理计划投资于同一资产的资金，不得超过该资产的 25%；银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券等中国证监会认可的投资品种除外。

3、本计划投资于其他资产管理产品的，计算本计划的总资产时应当按照穿透原则合并计算所投资资产管理产品的总资产。本计划投资于其他私募资产管理产品的，该资产管理计划按照穿透原则合并计算的投资同一资产的比例以及投资同一或同类资产的金额，应当符合中国证监会的最新监管规定。资产管理计划应当按照所投资资产管理产品披露投资组合的频率，及时更新计算该资产管理计划所投资资产的金额或比例。

4、本计划不直接投资于证券二级市场，不投资于融资类项目；

5、本计划所投资的资产管理产品不再投资除公募基金以外的其他资产管理产品，所投资的底层资产不包含非标准化债权类资产、非标准化股权类资产、非标准化商品及金融衍生品类资产；

6、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%；

7、本计划所投资股票量化对冲、期货期权等套利策略不得低于本计划资产净值的 60%，股票多头策略、宏观对冲策略、商品 CTA 策略等不得高于本计划资产净值的 40%。

如法律法规或监管部门或本合同修改或取消上述限制，履行适当程序后，本集合计划可相应调整投资组合限制的规定。

## 二、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、募集资金超过计划产品说明书约定的规模；
- 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。

---

## 第 18 部分 集合计划的信息披露

### 1、定期报告

定期报告包括集合计划单位净值报告、季度报告、年度报告、年度审计报告和对账单。

#### (1) 集合计划单位净值报告

披露时间：封闭期内至少每周披露一次集合计划份额净值，即每周第二个工作日内披露上周最后一个工作日集合计划份额净值，开放期内 T+2 日内披露集合计划每个开放日的集合计划份额净值。

披露方式：本集合计划的信息披露事项主要在管理人网站上查询，网址：[htamc.htsc.com.cn](http://htamc.htsc.com.cn)。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) 季度报告

管理人每季度结束之日起一个月内编制完成经托管人复核的季度报告。对报告期内集合计划资产的配置状况、价值变动情况、重大关联交易做出说明，向委托人清晰披露产品的投资资产组合情况，并根据固定收益类、权益类、商品及金融衍生品类资产投资比例充分披露和提示相应的投资风险。上述报告应于每季度结束之日起 1 个月内通过管理人网站公告。本集合计划成立不足 3 个月或者存续期间不足 3 个月的，管理人可以不编制当期的季度报告。

#### (3) 年度报告

管理人每年度结束之日起四个月内编制完成经托管人复核的年度报告。对报告期内集合计划资产的配置状况、价值变动情况、重大关联交易做出说明，向委托人清晰披露产品的投资资产组合情况，并根据固定收益类、权益类、商品及金融衍生品类资产投资比例充分披露和提示相应的投资风险。上述报告应于每个会计年度结束之日起 4 个月内通过管理人网站公告。本集合计划成立不足 3 个月或者存续期间不足 3 个月的，管理人可以不编制当期的年度报告。

#### (4) 托管报告

管理人应当在每季度结束后 20 日内向托管人提供其编制的季度报告、当期财务会计报告（如有）供托管人复核，托管人复核管理人季度报告、当期财务会计报告中的财务数据后，于每季度结束之日起一个月内向管理人提供季度托管报告，报告内容包括托管人履职情况以及对当期财务会计报告（如有）、季度报告的复核意见等。

管理人应当在每年度结束后三个月内向托管人提供其编制的年度报告、当期财务会计报告供托管人复核，托管人复核管理人年度报告、当期财务会计报告中的财务数据后，于每年度结束之日起四个月内向管理人提供年度托管报告，报告内容包括托管人履职情况以及对当期财务会计报告、年度报告的复核意见等。

上述托管人报告由管理人向投资者披露。计划成立不足三个月或者存续期间不足三个月的，托管人可以不编制当期的季度报告和年度报告。

#### (5) 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集合计划的运营情况进行年度审计，并在每年度结束之日起4个月内将审计报告提供给托管人，通过管理人网站向委托人提供。

#### (6) 对账单

管理人应当每个季度通过网站或交易客户端等方式向委托人提供对账单，对账单内容应包括委托人持有计划份额的数量及净值，参与、退出明细，收益分配等情况。

### 2、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，管理人应当通过管理人网站公告的方式向客户披露。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高级管理人员或投资经理人员发生变更，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) 暂停受理或者重新开始受理参与或者退出申请；

(3) 集合计划终止和清算；

(4) 合同的补充、修改与变更；

(5) 与集合计划有关的重大诉讼、仲裁事项；

(6) 本集合计划的代理销售机构发生变更；

(7) 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；

(8) 管理人、托管人因解散、破产、撤销等原因不能履行相应职责。

(9) 其他管理人认为的重大事项。

### 3、委托人查询的方式和途径

#### (1) 管理人网站信息披露

本说明书、集合计划资产管理合同、其他备查文件、相关报告等有关集合计划的信息，将在集合计划管理人网站上披露，委托人可随时查阅。

管理人网址：[htamc.htsc.com.cn](http://htamc.htsc.com.cn)

#### (2) 管理人、其他销售机构指定营业网点查询

本说明书、集合计划资产管理合同、其他备查文件、相关报告等文本存放在集合计划管理人和集合计划其他销售机构的住所，委托人可在营业时间内免费查阅，也可按工本费购买复印件。对委托人按上述方式所获得的文件及其复印件，集合计划管理人保证其内容与所披露的内容完全一致。

#### (3) 华泰证券客服电话

本集合计划披露的有关集合计划的信息，委托人可以通过华泰证券客服电话

(4008895597) 查询。

## 第 19 部分 集合计划份额的转让、转换、非交易过户和冻结

### 一、集合计划份额的转让

在技术条件成熟的前提下，经管理人申请并开通份额转让事宜后，本集合计划份额可以转让。集合计划存续期间，客户可以通过证券交易所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。委托人在此授权，当集合计划获得份额转让资格后，管理人可根据份额转让交易平台的规则，为满足份额转让实现和符合合同规定，为委托人办理份额转托管等相关业务。

### 二、集合计划份额的转换

集合计划的转换指委托人按管理人规定的条件，将其持有的管理人管理的本集合计划的份额转换为同一管理人管理的另一只集合计划份额的行为。为方便集合计划份额持有人，未来在各项技术条件成熟的情况下，委托人可以依照管理人的有关规定选择在本集合计划和管理人管理的其他集合计划之间进行转换。转换的数额限制、转换费率等具体规定将由管理人届时另行规定并通告。

### 三、集合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委托人集合计划账户转移到另一委托人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、司法执行、以及其他形式财产分割或转移引起的计划份额非交易过户。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。

### 四、集合计划份额的冻结

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。

## 第 20 部分 集合计划的展期

本集合计划可以展期。

### 一、展期的条件

1、在存续期间，本集合计划运营规范，管理人、托管人未违反法律、行政法规、中国证监会规定和《集合资产管理合同》、《说明书》的约定；

2、展期没有损害委托人利益的情形；

- 3、托管人同意继续托管展期后的集合计划资产；
- 4、符合本集合计划的成立条件；
- 5、中国证监会规定的其他条件。

## 二、展期的安排

### 1、通知展期的时间

本集合计划应不晚于集合计划到期前 1 个月通知展期的时间。

### 2、通知展期的方式

经管理人、托管人协商一致，管理人应在合同约定的时间内，在管理人网站进行公告，公告内容包括但不限于展期时间、委托人回复方式以及对于不同意展期的客户进行相关退出安排等。

### 3、委托人回复的方式

委托人应当在管理人网站公告之日起 20 个工作日内以书面或以管理人约定的其他方式明确回复意见。

## 三、委托人不同意展期的处理办法

若委托人明确回复不同意展期，委托人有权在存续期届满日前（含届满日）按照管理人的公告到销售机构办理退出手续；若委托人未在存续期届满日前（含届满日）到销售机构办理集合计划份额退出手续，则管理人有权决定强制将其份额退出。若委托人未回复意见或回复意见不明确的，并未在上述期限内办理退出手续，视为不同意展期，管理人有权决定强制将其份额退出。

## 四、展期的实现

如果同意集合计划展期的委托人人数不少于 2 人，则集合计划存续期将依法展期；如果同意本集合计划展期的各委托人人数低于 2 人则集合计划到期终止，将按照《集合资产管理合同》等相关法律文件的规定办理计划到期终止和清算事宜。

## 第 21 部分 集合计划终止和清算

### 一、有下列情形之一的，集合计划应当终止：

- 1、集合计划存续期届满且不展期；
- 2、计划存续期间，持续五个工作日客户少于 2 人；
- 3、集合计划投资的基金资产全部终止的，管理人有权提前终止本集合计划；
- 4、管理人因重大违法违规，被中国证监会取消相关业务资格，或因停业、解散、破产、撤销等原因不能履行相应职责，且在六个月内没有新的管理人承接；
- 5、托管人因重大违法违规，被中国证监会取消相关业务资格，且无其他适当的托管人承接托管人原有的权利和义务；或托管人因停业、解散、破产、撤销等原因不能履行相应职

责，且在六个月内没有新的托管人承接；

6、战争、自然灾害等不可抗力发生导致本集合计划不能存续；

7、经全体委托人、管理人和托管人一致同意终止的；

8、发生经管理人认为影响本集合计划正常投资运作的情形，包括但不限于管理人未及时向金融监督管理部门产品备案通过等；

9、法律、法规及中国证监会规定的其他终止情形。

管理人应当自资产管理计划终止之日起五个工作日内报基金业协会备案，并抄报管理人住所地中国证监会相关派出机构。

## 二、集合计划的清算

### 1、集合计划的清算小组

(1) 自集合计划终止之日起五个工作日内成立清算小组；

(2) 集合计划清算小组负责本集合计划资产的保管、清理、估价、变现和分配。集合计划清算小组可以依法以集合计划的名义进行必要的民事活动。

### 2、集合计划清算程序

(1) 集合资产管理计划终止日后5个工作日内启动清算程序，并由集合计划清算小组将终止事项向委托人披露；

(2) 集合计划清算小组统一接管集合计划资产；

(3) 对集合计划财产和债权债务进行清理和确认；

(4) 对集合计划资产进行估值和变现；

(5) 制作集合计划清算报告

(6) 聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计

(7) 对计划剩余资产进行分配和办理相关账户注销事宜；

(8) 清算结束后5个工作日内，集合计划清算小组将清算结果报中国基金业协会备案，并抄报管理人住所地中国证监会相关派出机构。

### 3、清算费用

清算费用是指清算小组在进行集合计划清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由清算小组从集合计划资产中支付。

### 4、集合计划剩余资产的分配

依据集合计划财产清算的分配方案，将集合计划财产清算后的全部剩余资产扣除集合计划财产清算费用、税款及其他债务后，按份额持有人持有的份额比例进行分配。清算期间，管理人可以根据财产清算变现情况和投资者服务需要，对同一级别计划财产按份额持有人持有的份额比例进行分次清算。

若本计划在终止之日因委托财产流动性受限等原因需要延期清算的，管理人应及时向中国证监会相关派出机构和证券投资基金业协会报告，并通过管理人网站进行披露。

对于本计划在终止之日流动性受限的委托财产，管理人将在对应委托财产恢复流通或交易后及时进行变现，扣除相关费用后按份额持有人持有的份额比例进行分配，清算期间变现的委托财产不得再进行投资。

对于本计划因证券交易等原因按登记结算机构规定缴纳的保证金(包括但不限于最低结算备付金和交易单元保证金)、以及保证金和存款账户的未结利息等资产，需要在登记结算机构退回保证金及利息结息后才能收回。管理人可选择在上述资产收回后或以管理人财产先行垫资方式，将委托财产按份额持有人持有的份额比例进行分配。如以管理人财产先行垫资方式完成委托财产全部清算的，本计划清算结束至本计划银行账户销户期间产生的孳息归管理人所有。

本计划终止后，按照委托财产变现清算情况，管理人和托管人应按监管机构和登记结算金融服务机构规定及时完成相关证券交易账户(包括但不限于银行间市场账户、沪深市场股东账户、期货账户等)的销户，最后再完成银行存款账户的销户。

#### 5、集合计划清算的公告

集合计划清算程序终止后五个工作日内由集合计划清算小组在集合计划管理人公司网站上披露，并将清算结果向中国基金业协会备案，抄报管理人住所地中国证监会相关派出机构。

清算过程中的有关重大事项将及时披露。

## 第 22 部分 当事人的权利和义务

### 一、委托人的权利和义务

#### 1、委托人的权利

- (1) 取得集合计划收益；
- (2) 通过管理人网站查询等方式知悉有关集合计划运作的信息，包括资产配置、投资比例、损益状况等；
- (3) 按照本合同及《说明书》的约定，参与和退出集合计划；
- (4) 按持有份额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、《说明书》约定的其他权利。

#### 2、委托人的义务

- (1) 委托人应认真阅读本合同及《说明书》，并承诺委托资金的来源及用途合法，不得非法汇集他人资金或使用贷款、发行债券等筹集的非自有资金参与本集合计划；

(2) 按照本合同及《说明书》约定交付委托资金，承担本合同约定的管理费、托管费和其他费用；

(3) 按照本合同及《说明书》约定承担集合计划投资损失；

(4) 不得违规转让其所拥有的计划份额（法律、行政法规另有规定的除外）；

(5) 以自己的名义在参与网点开立资金账户，办理指定手续，用于办理委托划款、退出款项、红利款项、清算款项的收取。并承诺在本合同有效期内，不得撤销该账户，并妥善保管账户资料；

(6) 除非在本合同规定的开放日或终止日，不得要求提前终止委托资产管理关系；

(7) 及时登陆管理人网站、托管人网站查询关于本集合计划的所有信息披露和公告情况；

(8) 法律法规及本合同约定的其他义务。

## 二、管理人的权利和义务

### 1、管理人的权利

(1) 根据本合同及《说明书》的约定，独立运作集合计划的资产；

(2) 根据本合同及《说明书》的约定，收取管理费等相关费用；

(3) 按照本合同及《说明书》的约定，停止办理集合计划份额的参与，暂停办理集合计划的退出事宜；

(4) 根据本合同及《说明书》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委托人的利益；

(6) 行使集合计划资产投资形成的投资人权利；

(7) 集合计划资产受到损害时，向有关责任人追究法律责任，以管理人名义，代表投资者利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为（如涉及）；

(8) 更换本集合计划的分管公司领导、资产管理业务主要负责人、产品主要承办人员、投资经理人员；

(9) 代表集合计划行使集合计划资产投资形成的投资人权利；

(10) 管理人自行承担本集合计划的注册登记人，负责集合计划份额的注册登记等事宜；

(11) 法律、行政法规和中国证监会规定及本合同约定的其他权利。

### 2、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，以专业技能管理集合计划的资产，为委托人的最大利益服务，依法保护委托人的财产权益；

(2) 进行资产估值等会计核算并编制资产管理计划财务会计报告；

(3) 根据中国证监会有关规定、本合同、《说明书》和托管协议的约定，接受托管人的监督；

(4) 依法对托管人、代理销售机构的行为进行监督，如发现托管人、代理销售机构违

反法律、行政法规和中国证监会的规定，或者违反托管协议、销售协议的，应当予以制止；

(5) 按规定出具资产管理报告，保证委托人能够了解有关集合计划投资组合、资产净值、费用与收益等信息；

(6) 按照本合同及《说明书》约定向委托人分配集合计划的收益；

(7) 按照法律法规、中国证监会的有关规定和本合同及《说明书》的约定，及时向申请退出集合计划的委托人支付退出款项；

(8) 妥善保存与集合计划有关的合同、协议、推广文件、客户资料、交易记录、会计账册等文件、资料和数据；

(9) 在集合计划到期或其他原因解散时，与托管人一起妥善处理有关清算和委托人资金的返还事宜；

(10) 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，及时向委托人和托管人报告；

(11) 因管理人违反本合同导致集合计划财产损失或损害委托人合法权益时，应承担赔偿责任；

(12) 因托管人违反本合同导致集合计划财产损失或损害委托人合法权益时，代委托人向托管人追偿；

(13) 代表集合计划签署后续交易的相关协议文本，行使该等协议文本项下的义务。

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

### 三、托管人的权利与义务

#### 1、托管人的权利

(1) 依法对集合计划的资产进行托管；

(2) 按照本合同、《说明书》和托管协议的约定收取托管费；

(3) 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法规、中国证监会的有关规定或者本合同、《说明书》和托管协议约定的，要求其改正；未能改正的，应当拒绝执行；

(4) 查询集合计划的经营运作情况；

(5) 法律法规、中国证监会有关规定和本合同、《说明书》以及托管协议约定的其他权利。

#### 2、托管人的义务

(1) 依法为集合计划开立专门的资金账户和专门的证券账户等相关账户；

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

(3) 在集合计划托管活动中恪尽职守，履行诚实信用、谨慎勤勉的义务，保管集合计

划的资产，确保集合计划资产的独立和安全，依法保护委托人的财产权益；

(4) 安全保管集合计划资产，执行管理人的投资或者清算指令，负责办理集合计划名下的资金往来；但托管人对于已划转出托管账户的资产，以及处于托管人实际控制之外的资产不承担保管责任，托管人不负责委托资产的投资保管，对管理人的任何投资行为以及投资问题不承担任何形式的责任，不因提供监督服务而对管理人的违规投资承担责任；

(5) 定期核对资产管理业务资产情况，建立与管理人的对账机制、复核、审查管理人计算的资产管理计划资产净值和管理计划参与、退出价格；

(6) 根据本合同及托管协议的约定监督资产管理人的投资，发现管理人的投资或清算指令违反本合同及托管协议约定的，应当要求其改正；未能改正的，应当拒绝执行；

(7) 复核、审查管理人计算的集合计划的资产净值；

(8) 保守集合计划的商业秘密，在集合计划有关信息向委托人披露前予以保密，不向他人泄露（法律法规、中国证监会另有规定或有权机关要求的除外）；

(9) 按规定出具集合计划托管情况的报告，对资产管理计划财务会计报告、年度报告出具意见；

(10) 妥善保存与集合计划托管业务有关的合同、协议、交易记录、会计账册等文件、资料和数据，保存期不少于二十年；

(11) 在集合计划终止时，与管理人一起妥善处理有关清算和委托人资产的返还事宜；

(12) 在解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产时，及时报告委托人和管理人；

(13) 因违反本合同导致集合计划资产损失或损害委托人合法权益时，应承担赔偿责任；

## 第 23 部分 违约责任

1、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，给计划财产或者委托人造成损害的，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、注册与过户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。

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

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；

(4)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。

(5)本合同当事人应保证向本合同另一方提供的数据、信息真实完整，并承担相应的法律责任。如果该方提供的信息和数据不真实或不完整是由于另一方提供的数据或信息不真实、不完整等原因所致，由此造成的损失由初始过错方承担。

(6)管理人及托管人对由于第三方（包括但不限于交易所、注册与过户登记人等）发送的数据错误给集合计划资产造成的损失等。

2、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委托人损失，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。

7、委托人的债权人通过司法机关对集合计划资产采取强制措施，由此造成集合计划资产损失的，管理人和托管人不承担任何责任。

## 第 24 部分 适用法律和争议解决

本协议适用中国法律，并依此解释。

因履行本合同发生的争议，首先由协议签订各方友好协商解决，本合同当事人不愿通过

协商、调解解决或协商、调解不成的，则任何一方提交上海国际经济贸易仲裁委员会按照当时的仲裁规则进行仲裁解决，仲裁地点在上海。仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

争议处理期间，合同当事人仍应履行本合同规定的义务，维护资产委托人的合法权益。

除提交诉讼的争议之外，各方当事人仍应履行本协议的其他规定。争议处理期间，各方当事人应恪守计划管理人和计划托管人职责，各自继续忠实、勤勉、尽责地履行《集合资产管理合同》和托管协议规定的义务，维护计划持有人的合法权益。

## 第 25 部分 风险揭示

本集合计划面临包括但不限于以下风险：

### 一、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周期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，使集合计划资产管理业务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

委托人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，从而使委托人的实际收益下降。

#### 6、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收益率，从而对本计划产生再投资风险。

## 二、管理风险

在集合资产管理计划运作过程中，管理人的知识、经验、判断、决策、技能等，会影响其对信息的获取和对经济形势、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。

## 三、流动性风险

指集合计划资产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。

## 四、因管理人或托管人不能履行职责所导致的风险

管理人或托管人因停业、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时，可能导致委托资产的损失，从而带来风险。

## 五、信用风险

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

## 六、合规风险

指集合计划管理或运作过程中，违反国家法律、法规的规定，或者集合计划投资违反法规及《集合资产管理计划合同》有关规定的风险。

## 七、本集合计划特有风险

### 1、设立失败风险

初始募集期结束时，本集合计划受市场环境，或其他同业竞争的影响，募集规模可能未达到法律、法规规定或本合同约定的最低设立条件，导致本集合计划不能成立的风险。

### 2、集合计划提前终止的风险

集合计划运作期间，当集合计划委托人持续五个工作日少于 2 人或者本集合计划约定的其他提前终止情形出现时，导致集合计划提前终止的风险。

### 3、合同变更风险

管理人就合同变更征求委托人意见期间，在第 27 部分描述的几种不同情况下，未明确提出异议的委托人可能被视为同意修改或变更合同和说明书。部分委托人可能未能及时登录管理人官网获知合同变更事项，如果委托人因上述情况未能按时退出本计划，可能会被视为同意合同变更，从而存在风险。

### 4、委托人可能无法参与的风险

由于本集合计划设定了初始募集期及存续期的规模上限，管理人将根据合同的约定对每类份额的规模上限以及份额配比进行控制，因此委托人可能面临着因上述原因而无法参与本集合计划的风险。

### 5、FOF 产品管理模式特有风险

各类不同资产及投资策略在不同的市场环境下表现不同，管理人根据资产配置模型进行大类资产配置，并筛选市场上各个策略的投资策略资产进行投资。各个策略资产的表现可能高于预期，也可能低于预期；可能由于管理人对策略资金分配不当，导致集合计划资产亏损。反之，也可能出现管理人资金分配合理，但由于具体策略的投资管理人投资管理能力不佳造成的资产亏损。

## 6、投资金融产品的风险

本集合计划部分资产将配置于金融监管部门批准或备案发行的金融产品（包括证券投资基金、基金管理公司特定多个客户资产管理计划、期货公司集合资产管理计划、基金管理公司子公司特定多个客户资产管理计划、经备案的投资于证券市场的契约型私募基金及法律法规允许的其他金融产品等），投资上述金融产品可能因下列特定风险因素给本计划造成不利影响，请委托人知悉。

### （1）金融产品管理人风险

金融产品管理人风险包括管理人经营风险和操作风险。经营风险是指因管理能力、财务状况、行业竞争、人员素质、内控等因素导致公司经营不善，极端情况下甚至破产倒闭，可能对其管理人的产品业绩造成不利影响。另外，对于约定了止损条款的金融产品，可能因管理人未及时操作导致产品损失扩大的风险。

### （2）金融产品投资风险

本集合计划所投资的金融产品可能由于其管理人对市场判断失误、买入标的市场表现不佳、风险控制失效等原因造成产品净值的下降，从而造成集合计划净值下降，最终导致集合计划委托人资产损失；

### （3）策略模型风险

在实际运作中，因金融产品的投资经理变更导致模型无法有效运作，开发的策略或模型不再有效或者在运作过程中与产品期初投资策略和投资风格发生偏离，进而影响产品投资业绩。

### （4）赎回金融产品面临的流动性风险

因本计划委托人赎回或资产配置调整需要，管理人赎回金融产品时，可能触发所投资的金融产品大额赎回或巨额赎回条款，或所投资的金融产品处在封闭期，导致赎回资金延迟到账的风险。

### （5）投资金融产品可能面临双层收费的风险

本集合计划委托人需要承担双层费用，即集合计划费用及集合计划所投资的金融产品自身需要承担费用。集合计划所投资的金融产品自身需要承担费用包括金融产品的管理费、托管费、业绩报酬（如有）、认购费（如有）、赎回费（如有）等，以上费用在计提时将会扣减金融产品的资产净值，从而造成集合计划净值下降。

### （6）投资金融产品的估值风险

本集合计划的投资多个底层金融产品，每个金融产品的估值时间可能不一致，且披露时间可能不一致，本集合计划按照金融产品估值日最近的单位净值进行估值。在存续期间，集合计划单位净值可能无法反映真实投资管理情况。

此外，为消除底层金融产品计提业绩报酬对本计划资产净值的影响，本计划在估值方法上已采取适当的措施与安排，但仍不排除在本计划的封闭期内，由于无法在每个估值日及时准确获取金融产品预估业绩报酬或扣除预估业绩报酬后的净值，导致封闭期披露的集合计划份额净值未充分体现底层金融产品计提业绩报酬的影响，当底层金融产品发生业绩报酬提取或在本计划开放日发生管理人根据金融产品约定的业绩报酬计提方法预估业绩报酬并调整本计划份额净值的情形时，可能造成集合计划份额净值波动的风险。

#### (7) 底层金融产品提取业绩报酬对产品净值造成下跌的风险

由于本计划投资多个金融产品，每个金融产品在业绩报酬计提方式、业绩报酬计提时间以及产品估值时间与本集合计划层面可能不一致，当底层金融产品提取业绩报酬后造成集合计划净值下降、委托人持有集合计划份额期间收益下降的风险。

#### 八、采用电子签名合同管理方式所带来的风险

本集合计划采用电子签名方式进行集合计划资产管理合同的签署、核对、收集、整理和保管，在运用电子签名方式进行集合计划合同管理过程中，由于系统故障、人员操作失误、相关机构之间衔接不畅等原因，可能导致委托人参与申请无法及时确认、委托人资料信息错误、委托人无法查询交易信息等情形，从而导致风险。

#### 九、未在基金业协会完成备案的风险

本集合计划备案过程中可能面临最新监管规定发布且本计划计划合同条款与最新监管规定不相符的情况，导致本集合计划未在基金业协会完成备案的风险。

#### 十、关联交易风险

本集合计划可能投资于管理人、托管人及与管理人、托管人有关联方关系的公司发行的或在承销期内承销的证券及管理人发行的公募基金，或者从事其他重大关联交易。上述情况的发生将构成关联交易，存在关联交易风险，若交易价格不公允则可能损害委托人利益。若本集合计划投资运作中发生此类关联交易，管理人将及时向投资者进行披露。

#### 十一、其他风险

1、技术风险。在集合计划的日常交易中，可能因为技术系统的故障或者差错而影响交易的正常进行或者导致委托人的利益受到影响。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。

2、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。

3、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。

---

## 第 26 部分 合同的成立与生效

### 一、合同的成立与生效

本合同经管理人、托管人法定代表人\负责人或授权签字人签署并加盖公章，委托人以电子签名方式签署后即告成立。

本合同成立后，同时满足以下条件时生效：

- (1) 委托人参与资金实际交付并确认；
- (2) 本集合计划成立。

本集合计划终止，本合同终止。但合同项下有关清算、违约责任、争议解决的条款仍然有效。

### 二、合同的组成

《华泰启泰金阆 FOF1 号集合资产管理计划产品说明书》、经管理人确认有效的委托人参与、退出本集合计划的申请材料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等为本合同的附件，是合同的组成部分，与合同具有同等法律效力。

但《华泰启泰金阆 FOF1 号集合资产管理计划产品说明书》与本合同正文不一致的，以本合同正文为准。

## 第 27 部分 合同的补充、修改与变更

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修订，自该修订生效之日起，本合同相关内容及条款按该修订办理并在管理人网站公告。委托人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。委托人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。

2、由于其他原因需要变更合同（不涉及产品产品类型、投资比例、具体投向变更）的，管理人须以管理人网站公告或其他方式向委托人发送合同变更征询意见，委托人应在征询意见函指定的日期内按指定的形式回复意见。委托人不同意变更的，有权在管理人公告规定的时间内提出退出本集合计划的申请；对于明确答复不同意合同变更但逾期未退出本集合计划的委托人，管理人将统一在合同变更生效日前一工作日做强制退出处理（退出价格为退出当

日的计划单位净值)。委托人未在前述时间回复意见的,视为委托人同意。变更事项自征询意见函指定的日期届满的次一工作日开始生效,对合同各方均具有法律效力。

3、管理人如需对本合同的产品类型、产品投向、投资比例做出变更的,需先行取得投资者书面同意,如委托人未在前述时间书面回复同意的,视为委托人不同意,委托人不同意变更的,有权在管理人公告规定的时间内提出退出本集合计划的申请;对于未在前述时间书面回复同意但逾期未退出本集合计划的委托人,管理人将统一在合同变更生效日前一工作日做强制退出处理(退出价格为退出当日的计划单位净值)。

4、合同变更后,委托人、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。

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

## 第 28 部分 其他事项

管理人因重大违法违规,被中国证监会取消相关业务资格,或因停业、解散、破产、撤销等原因不能履行相应职责的,本计划可以由其他符合条件的管理人承接;托管人因重大违法违规,被中国证监会取消相关业务资格,或托管人因停业、解散、破产、撤销等原因不能履行相应职责,本计划也可以由其他符合条件的托管人承接。

本合同如有未尽事宜,由各方按有关法律法规和规定协商解决。

本合同应由委托人本人签署,当委托人为机构时,应由法定代表人或其授权代表签署。

本合同一式叁份,委托人、管理人和托管人各执壹份,每份具有同等法律效力。本集合计划成立后,相关材料需报中国证监会指定机构备案,同时抄送管理人住所地中国证监会派出机构。

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

(以下无正文)

(本页无正文，为华泰启泰金阊 FOF1 号集合资产管理计划资产管理合同签署页)

管理人：华泰证券（上海）资产管理有限公司（公章）



法定代表人或其授权签字人签字：



签订日期： 年 月 日

托管人：上海浦东发展银行股份有限公司苏州分行（公章）



负责人或其授权签字人签字或盖章：



签订日期：2019年4月3日

# 关于华泰启泰金阆 FOF1 号集合资产管理计划

## 第一次合同变更的意见征询函

尊敬的上海浦东发展银行股份有限公司苏州分行：

根据《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》(《运作管理规定》),为更好地为投资者提供投资理财服务,我司拟对《华泰启泰金阆 FOF1 号集合资产管理计划资产管理合同》部分要素进行合同变更,并重新修订了合同如下:

1、修订《华泰启泰金阆 FOF1 号集合资产管理计划资产管理合同》第 4 部分第六条第 2 点。

原条款：“2、开放期安排

自本集合计划封闭期满 6 个月后的每年 2、5、8、11 月的第 1 个交易日开放参与和退出。

预约退出方式:委托人如需在该开放期退出,需在开放日前 25 个工作日(T-25 日)至 18 个工作日(T-18 日)通过信件、传真、电子邮件等方式在销售机构提出预约退出申请,具体以管理人公告为准。在除管理人特别约定的情形外,若委托人未提交预约退出申请,则管理人有权拒绝该次退出申请。经委托人提交预约退出申请后,管理人在该退出开放期对提交预约退出申请的客户进行份额退出。”

修改为：“2、开放期安排

自本集合计划成立满 6 个月后的每年 2、5、8、11 月的第 1-3 个交易日开放参与,自本集合计划成立满 6 个月后的每年 2、5、8、11 月的第 1 个交易日开放退出,如遇节假日则顺延,本集合计划具体开放安排以管理人公告为准。中国证监会另有规定的除外。

预约退出方式:委托人如需在该开放期退出,需在本集合计划成立满 6 个月后的每年 2、5、8、11 月的第 1 个交易日(T 日)前 9 个工作日(T-9 日)至 7 个工作日(T-7 日)通过信件、传真、电子邮件等方式在销售机构提出预约退出申请,具体以管理人公告为准。在除管理人特别约定的情形外,若委托人未提交



预约退出申请,则管理人有权拒绝该次退出申请。经委托人提交预约退出申请后,管理人在该退出开放期对提交预约退出申请的客户进行份额退出。”

2、修订《华泰启泰金阆 FOF1 号集合资产管理计划资产管理合同》第 5 部分第一条第 1 点第 (2) 项。

原条款：“(2) 存续期参与

投资者在集合计划开放期内的工作日可以办理参与本集合计划的业务。

本集合计划成立满 6 个月后的每年 2、5、8、11 月的第 1 个工作日 T 日开放。”

修改为：“(2) 存续期参与

投资者在集合计划开放期内的工作日可以办理参与本集合计划的业务。

本集合计划成立满 6 个月后的每年 2、5、8、11 月的第 1-3 个工作日开放参与。”

3、修订《华泰启泰金阆 FOF1 号集合资产管理计划资产管理合同》第 5 部分第二条第 1 点。

原条款：“1、退出的办理场所和时间

本计划成立满 6 个月后的每年 2、5、8、11 月的第 1 个工作日开放退出。

本集合计划采用预约退出的方式实现委托人份额的退出。委托人如需在某一开放期退出,需在该开放日前 25 个工作日 (T-25 日) 至 18 个工作日 (T-18 日) 通过信件、传真、电子邮件等方式在销售机构提出预约退出申请。在除管理人特别约定的情形外,若委托人未提交预约退出申请,则管理人有权拒绝该次退出申请。经委托人提交预约退出申请后,管理人在该退出开放期对提交的预约退出申请进行确认并为委托人办理份额退出。”

修改为：“1、退出的办理场所和时间

本计划成立满 6 个月后的每年 2、5、8、11 月的第 1 个工作日开放退出。

本集合计划采用预约退出的方式实现委托人份额的退出。委托人如需在该开放期退出,需在本集合计划成立满 6 个月后的每年 2、5、8、11 月的第 1 个交易日 (T 日) 前 9 个工作日 (T-9 日) 至 7 个工作日 (T-7 日) 通过信件、传真、电子邮件等方式在销售机构提出预约退出申请,具体以管理人公告为准。在除管理人特别约定的情形外,若委托人未提交预约退出申请,则管理人有权拒绝该次退出申请。经委托人提交预约退出申请后,管理人在该退出开放期对提交预约退出

申请的客户进行份额退出。”

我司特向贵司征询关于华泰启泰金闯 FOF1 号集合资产管理计划合同变更的意见。

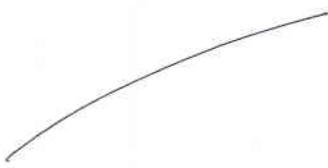
此致

华泰证券（上海）资产管理有限公司

二〇一九年九月一日



请托管人根据以上内容作出意见表示：若同意合同变更，请于“同意”栏盖章；若不同意合同变更，请于“不同意”栏盖章

华泰启泰金阆FOF1号集合资产管理计划合同变更意见征询的回函	
意见	托管人 盖章
同意合同变更	
不同意合同变更	
2019 年 9 月 10 日	

# 关于华泰启泰金阆 FOF1 号集合资产管理计划

## 第一次合同变更意见征询的公告

华泰启泰金阆 FOF1 号集合资产管理计划（以下简称“该集合计划”）已于 2019 年 4 月 16 日成立。根据《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》（《运作管理规定》），为更好地为投资者提供投资理财服务，经管理人与托管人协商一致，我司拟对《华泰启泰金阆 FOF1 号集合资产管理计划资产管理合同》部分要素进行合同变更，并参照《集合指引（试行）》重新修订了合同，修订条款为：

1、修订《华泰启泰金阆 FOF1 号集合资产管理计划资产管理合同》第 4 部分第六条第 2 点。

原条款：“2、开放期安排

自本集合计划封闭期满 6 个月后的每年 2、5、8、11 月的第 1 个交易日开放参与和退出。

预约退出方式：委托人如需在该开放期退出，需在开放日前 25 个工作日（T-25 日）至 18 个工作日（T-18 日）通过信件、传真、电子邮件等方式在销售机构提出预约退出申请，具体以管理人公告为准。在除管理人特别约定的情形外，若委托人未提交预约退出申请，则管理人有权拒绝该次退出申请。经委托人提交预约退出申请后，管理人在该退出开放期对提交预约退出申请的客户进行份额退出。”



修改为：“2、开放期安排

自本集合计划成立满6个月后的每年2、5、8、11月的第1-3个交易日开放参与，自本集合计划成立满6个月后的每年2、5、8、11月的第1个交易日开放退出，如遇节假日则顺延，本集合计划具体开放安排以管理人公告为准。中国证监会另有规定的除外。

预约退出方式：委托人如需在该开放期退出，需在本集合计划成立满6个月后的每年2、5、8、11月的第1个交易日（T日）前9个工作日（T-9日）至7个工作日（T-7日）通过信件、传真、电子邮件等方式在销售机构提出预约退出申请，具体以管理人公告为准。在除管理人特别约定的情形外，若委托人未提交预约退出申请，则管理人有权拒绝该次退出申请。经委托人提交预约退出申请后，管理人在该退出开放期对提交预约退出申请的客户进行份额退出。”

2、修订《华泰启泰金阆 FOF1 号集合资产管理计划资产管理合同》第5部分第一条第1点第（2）项。

原条款：“（2）存续期参与

投资者在集合计划开放期内的工作日可以办理参与本集合计划的业务。

本集合计划成立满6个月后的每年2、5、8、11月的第1个工作日T日开放。”

修改为：“（2）存续期参与

投资者在集合计划开放期内的工作日可以办理参与本集合计划的业务。

本集合计划成立满6个月后的每年2、5、8、11月的第1-3个工作日开放参与。”

3、修订《华泰启泰金阆 FOF1 号集合资产管理计划资产管理合同》第5部分第二条第1点。

原条款：“1、退出的办理场所和时间

本计划成立满6个月后的每年2、5、8、11月的第1个工作日开放退出。

本集合计划采用预约退出的方式实现委托人份额的退出。委托人如需在某一开放期退出，需在该开放日前25个工作日（T-25日）至18个工作日（T-18日）通过信件、传真、电子邮件等方式在销售机构提出预约退出申请。在除管理人特别约定的情形外，若委托人未提交预约退出申请，则管理人有权拒绝该次退出申请。经委托人提交预约退出申请后，管理人在该退出开放期对提交的预约退出申请进行确认并为委托人办理份额退出。”

修改为：“1、退出的办理场所和时间

本计划成立满6个月后的每年2、5、8、11月的第1个工作日开放退出。

本集合计划采用预约退出的方式实现委托人份额的退出。委托人如需在该开放期退出，需在本集合计划成立满6个月后的每年2、5、8、11月的第1个交易日（T日）前9个工作日（T-9日）至7个工作日（T-7日）通过信件、传真、电子邮件等方式在销售机构提出预约退出申请，具体以管理人公告为准。在除管理人特别约定的情形外，



若委托人未提交预约退出申请，则管理人有权拒绝该次退出申请。经委托人提交预约退出申请后，管理人在该退出开放期对提交预约退出申请的客户进行份额退出。”

本次合同变更不涉及产品类型、投资比例、具体投向变更，变更征询意见期间为 2019 年 9 月 12 日至 2019 年 9 月 18 日，如委托人未在前述时间书面回复《关于华泰启泰金阆 FOF1 号集合资产管理计划合同变更意见征询的回函》（详见附件）并提出退出本集合计划的申请的，视为委托人同意。委托人不同意变更的，管理人将在 2019 年 9 月 19 日为不同意合同变更的委托人办理退出，合同变更自 2019 年 9 月 20 日生效。

特此公告。

华泰证券（上海）资产管理有限公司

二零一九年九月十二日



-----  
附件:

华泰启泰金阆FOF1号集合资产管理计划合同及说明书变更意见征询的回函	
意见	委托人 签字/盖章
同意合同变更	
不同意合同变更	
201 年 月 日	

产品持有人姓名\_\_\_\_\_身份证号码\_\_\_\_\_

联系电话\_\_\_\_\_客户所在销售机构\_\_\_\_\_

# 关于华泰启泰金阆 FOF1 号集合资产管理计划第一次合同变更

## 生效的公告

根据 2019 年 9 月 12 日公告，管理人在第一次合同变更意见征询期间已完成对华泰启泰金阆 FOF1 号集合资产管理计划委托人的意见征询，变更后的合同于 2019 年 9 月 20 日生效。

变更内容详见《关于华泰启泰金阆 FOF1 号集合资产管理计划第一次合同变更意见征询的公告》。

特此公告。

华泰证券(上海)资产管理有限公司

2019 年 9 月 20 日



# 关于华泰启泰金阆 FOF1 号集合资产管理计划

## 第二次合同变更的意见征询函

尊敬的上海浦东发展银行股份有限公司苏州分行：

根据《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》(《运作管理规定》),为更好地为投资者提供投资理财服务,我司拟对《华泰启泰金阆 FOF1 号集合资产管理计划资产管理合同》部分要素进行合同变更,并重新修订了合同如下:

1、修订《华泰启泰金阆 FOF1 号集合资产管理计划资产管理合同》第 4 部分第六条第 2 点。

原条款：“2、开放期安排

自本集合计划成立满 6 个月后的每年 2、5、8、11 月的第 1-3 个交易日开放参与,自本集合计划成立满 6 个月后的每年 2、5、8、11 月的第 1 个交易日开放退出,如遇节假日则顺延,本集合计划具体开放安排以管理人公告为准。中国证监会另有规定的除外。

预约退出方式:委托人如需在该开放期退出,需在本集合计划成立满 6 个月后的每年 2、5、8、11 月的第 1 个交易日(T 日)前 9 个工作日(T-9 日)至 7 个工作日(T-7 日)通过信件、传真、电子邮件等方式在销售机构提出预约退出申请,具体以管理人公告为准。在除管理人特别约定的情形外,若委托人未提交预约退出申请,则管理人有权拒绝该次退出申请。经委托人提交预约退出申请后,管理人在该退出开放期对提交预约退出申请的客户进行份额退出。”

修改为：“2、开放期安排

自本集合计划成立满 6 个月后的每月第 7-11 个交易日开放参与,自本集合计划成立满 6 个月后的每年 2、5、8、11 月的第 1 个交易日开放退出,如遇节假日则顺延,本集合计划具体开放安排以管理人公告为准。中国证监会另有规定的除外。

预约退出方式:委托人如需在该开放期退出,需在本集合计划成立满 6 个月



后的每年 2、5、8、11 月的第 1 个交易日 (T 日) 前 9 个工作日 (T-9 日) 至 7 个工作日 (T-7 日) 通过信件、传真、电子邮件等方式在销售机构提出预约退出申请, 具体以管理人公告为准。在除管理人特别约定的情形外, 若委托人未提交预约退出申请, 则管理人有权拒绝该次退出申请。经委托人提交预约退出申请后, 管理人在该退出开放期对提交预约退出申请的客户进行份额退出。”

2、修订《华泰启泰金阆 FOF1 号集合资产管理计划资产管理合同》第 5 部分第一条第 1 点第 (2) 项。

原条款:“(2) 存续期参与

投资者在集合计划开放期内的工作日可以办理参与本集合计划的业务。

本集合计划成立满 6 个月后的每年 2、5、8、11 月的第 1-3 个工作日开放参与。”

修改为:“(2) 存续期参与

投资者在集合计划开放期内的工作日可以办理参与本集合计划的业务。

本集合计划成立满 6 个月后的每月第 7-11 个交易日开放参与。”

3、增加《华泰启泰金阆 FOF1 号集合资产管理计划资产管理合同》第 17 部分第一条第 8 点:

“8、本计划主动投资于流动性受限资产的市值在开放退出期内合计不得超过本计划资产净值的 20%;”

我司特向贵司征询关于华泰启泰金阆 FOF1 号集合资产管理计划合同变更的意见。

此致

华泰证券(上海)资产管理有限公司



2020年3月10日

-----  
请托管人根据以上内容作出意见表示：若同意合同变更，请于“同意”栏盖章；若不同意合同变更，请于“不同意”栏盖章

华泰启泰金阆FOF1号集合资产管理计划第二次合同变更意见征询的回函	
意见	托管人 盖章
同意合同变更	
不同意合同变更	
2020年 3月17日	

公司苏州分行

管理有限公司  
章

## 关于华泰启泰金阆 FOF1 号集合资产管理计划

### 第二次合同变更意见征询的公告

华泰启泰金阆 FOF1 号集合资产管理计划（以下简称“该集合计划”）已于 2019 年 4 月 16 日成立。根据《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》、《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》，为更好地为投资者提供投资理财服务，经管理人与托管人协商一致，我司拟对《华泰启泰金阆 FOF1 号集合资产管理计划资产管理合同》部分要素进行合同变更，重新修订了合同，修订条款为：

1、修订《华泰启泰金阆 FOF1 号集合资产管理计划资产管理合同》第 4 部分第六条第 2 点。

原条款：“2、开放期安排

自本集合计划成立满 6 个月后的每年 2、5、8、11 月的第 1-3 个交易日开放参与，自本集合计划成立满 6 个月后的每年 2、5、8、11 月的第 1 个交易日开放退出，如遇节假日则顺延，本集合计划具体开放安排以管理人公告为准。中国证监会另有规定的除外。

预约退出方式：委托人如需在该开放期退出，需在本集合计划成立满 6 个月后的每年 2、5、8、11 月的第 1 个交易日（T 日）前 9 个工作日（T-9 日）至 7 个工作日（T-7 日）通过信件、传真、电子邮件等方式在销售机构提出预约退出申请，具体以管理人公告为准。在除管理人特别约定的情形外，若委托人未提交预约退出申请，则管理

人有权拒绝该次退出申请。经委托人提交预约退出申请后，管理人在该退出开放期对提交预约退出申请的客户进行份额退出。”

修改为：“2、开放期安排

自本集合计划成立满6个月后的每月第7-11个交易日开放参与，自本集合计划成立满6个月后的每年2、5、8、11月的第1个交易日开放退出，如遇节假日则顺延，本集合计划具体开放安排以管理人公告为准。中国证监会另有规定的除外。

预约退出方式：委托人如需在该开放期退出，需在本集合计划成立满6个月后的每年2、5、8、11月的第1个交易日（T日）前9个工作日（T-9日）至7个工作日（T-7日）通过信件、传真、电子邮件等方式在销售机构提出预约退出申请，具体以管理人公告为准。在除管理人特别约定的情形外，若委托人未提交预约退出申请，则管理人有权拒绝该次退出申请。经委托人提交预约退出申请后，管理人在该退出开放期对提交预约退出申请的客户进行份额退出。”

2、修订《华泰启泰金阆 FOF1 号集合资产管理计划资产管理合同》第5部分第一条第1点第（2）项。

原条款：“（2）存续期参与

投资者在集合计划开放期内的工作日可以办理参与本集合计划的业务。

本集合计划成立满6个月后的每年2、5、8、11月的第1-3个工作日开放参与。”

修改为：“（2）存续期参与

投资者在集合计划开放期内的工作日可以办理参与本集合计划的业务。

本集合计划成立满6个月后的每月第7-11个交易日开放参与。”

3、增加《华泰启泰金阆 FOF1 号集合资产管理计划资产管理合同》第17部分第一条第8点：

“8、本计划主动投资于流动性受限资产的市值在开放退出期内合计不得超过本计划资产净值的20%；”

本次合同变更不涉及产品类型、投资比例、具体投向变更，变更征询意见期间为2020年3月20日至2020年3月26日，如委托人未在前述时间书面回复《关于华泰启泰金阆 FOF1 号集合资产管理计划合同变更意见征询的回函》（详见附件）并提出退出本集合计划的申请的，视为委托人同意。委托人不同意变更的，管理人将在2020年3月27日为不同意合同变更的委托人办理退出，合同变更自2020年3月30日生效。

特此公告。

华泰证券（上海）资产管理有限公司

2020年3月17日



附件：

华泰启泰金阆FOF1号集合资产管理计划合同变更意见征询的 回函	
意见	委托人 签字/盖章
同意合同变更	
不同意合同变更	
年 月 日	

产品持有人姓名\_\_\_\_\_身份证号码\_\_\_\_\_

联系电话\_\_\_\_\_客户所在销售机构\_\_\_\_\_



## 关于华泰启泰金阆 FOF1 号集合资产管理计划第二次合同变更生效的公告

根据 2020 年 3 月 17 日公告，管理人在第二次合同变更意见征询期间已完成对华泰启泰金阆 FOF1 号集合资产管理计划委托人的意见征询，变更后的合同于 2020 年 3 月 30 日生效。

变更内容详见《关于华泰启泰金阆 FOF1 号集合资产管理计划第二次合同变更意见征询的公告》。

特此公告。

华泰证券（上海）资产管理有限公司

2020 年 3 月 30 日

