

合同编号：PAZQ-ZXLHZX[2022]001

平安证券尊享量化中性 1 号集合资产
管理计划资产管理合同

管理人：平安证券股份有限公司

托管人：平安银行股份有限公司深圳分行

二〇二二年四月

目 录

一、 前言	4
二、 释义	5
三、 承诺与声明	9
四、 合同当事人及权利义务	11
五、 集合资产管理计划的基本情况	19
六、 集合计划的募集	23
七、 集合计划的成立与备案	26
八、 集合计划的参与、退出与转让	27
九、 份额持有人大会及日常机构	37
十、 集合计划份额的登记	37
十一、 集合计划的投资	38
十二、 投资顾问	45
十三、 分级安排	46
十四、 利益冲突及关联交易	46
十五、 投资经理的指定与变更	47
十六、 集合计划的财产	48
十七、 投资指令的发送、确认和执行	50
十八、 越权交易	54
十九、 集合计划的估值和会计核算	57
二十、 集合计划的费用与税收	66
二十一、 集合计划的收益分配	71
二十二、 集合计划的信息披露与报告	73
二十三、 风险揭示	77
二十四、 资产管理合同的变更、终止和财产清算	88
二十五、 违约责任与争议处理	95
二十六、 资产管理合同的效力	97
二十七、 或有事件	99
二十八、 反虚假宣传条款	100

特别约定：《平安证券尊享量化中性 1 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”）以手写签名、盖章或电子签名的方式签订，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，以手写签名、盖章或电子签名的方式签署本合同即表明投资者完全接受本合同项下的全部条款，同时本合同成立。

若采用电子签名的方式，投资者、管理人、托管人同意遵守《电子签名法》、《电子签名合同操作指引》的有关规定，三方一致同意投资者自签署《电子签名约定书》之日起，投资者以电子签名方式接受电子签名合同（即本合同、集合计划说明书）、风险揭示书或其他文书的，视为签署本合同、集合计划说明书、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。

一、前言

为规范平安证券尊享量化中性1号集合资产管理计划(以下简称“集合计划”或“计划”)运作,明确《平安证券尊享量化中性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,依照《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国民法典》、《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》(银发〔2018〕106号,以下简称“《指导意见》”)、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》(证监会令【第151号】,以下简称“《管理办法》”)、《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》(证监会公告[2018]31号,以下简称“《运作规定》”)、《集合资产管理计划资产管理合同内容与格式指引(试行)》等法律法规、中国证监会、中国证券业协会和中国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《指导意见》、《管理办法》、《运作规定》、《平安证券尊享量化中性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。

管理人将对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。

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。

二、 释义

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。
元	指中国法定货币人民币，单位“元”。
中国证监会	指中国证券监督管理委员会。
证券投资基金业协会	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	指平安证券股份有限公司（简称“平安证券”）。
集合资产管理计划托管人或托管人	指平安银行股份有限公司深圳分行
销售机构	指平安证券股份有限公司以及依据代理推广协议接受管理人委托办理集合计划参与、退出等业务的机构。管理人新增或变更本集合计划的销售机构时，将提前在管理人网站上公告。
注册登记机构	指负责登记存管过户清算等注册登记业务的机构，本计划的注册

	登记机构为平安证券股份有限公司。
集合资产管理合同当事人	指受本《集合资产管理计划资产管理合同》约束, 根据《集合资产管理计划资产管理合同》享受权利并承担义务的法律主体, 包括投资者、管理人、托管人。
投资者	指依据集合资产管理合同和集合计划说明书参与本集合计划的投资者, 包括个人投资者和机构投资者
个人投资者	指依据中华人民共和国有关法律法规及其他有关规定可以投资于集合资产管理计划的个人投资者。
机构投资者	指依据中华人民共和国有关法律法规及其他有关规定可以投资于集合资产管理计划的机构投资者。
集合资产管理计划成立日	指集合资产管理计划规模超过人民币 1000 万元(含), 参与人数超过 2 人(含), 集合资产管理计划管理人可以依据《指导意见》、《管理办法》、《运作规定》和集合资产管理计划实际参与情况决定停止集合资产管理计划参与, 并在取得会计师事务所出具的验资报告后宣告集合资产管理计划成立的日期。
募集期	指自集合资产管理计划管理人开始销售集合资产管理计划到集合资产管理计划成立日之间的时间段。
集合计划存续期	指集合计划自成立起到终止清算的期间。
工作日	指上海证券交易所和深圳证券交易所的正常交易日。
T 日	指日常参与、退出或办理其他集合资产管理计划业务申请的工作

	日。
T+n 日	指自 T 日起第 n 个工作日（不包含 T 日）。
开放日	指管理人为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。
募集期参与	指在募集期内本集合资产管理计划投资者购买本集合资产管理计划份额的行为。
存续期参与	指在存续期内本集合资产管理计划投资者购买本集合资产管理计划份额的行为。
退出	指集合资产管理计划投资者根据集合资产管理合同规定的条件或集合资产管理计划销售网点规定的手续，向集合资产管理计划管理人卖出集合资产管理计划份额的行为。
集合资产管理计划资产或委托投资资产	指依据有关法律、法规和投资者的意愿，投资者参与的本集合资产管理计划净额。
集合资产管理计划收益	指集合资产管理计划投资所得红利、股息、债券利息、基金红利、买卖证券价差、银行存款利息以及其他收益。
集合资产管理计划账户	指注册与过户登记人给投资者开立的用于记录投资者持有本集合资产管理计划份额情况的登记账户。
集合资产管理计划资产总值	指集合资产管理计划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资本市场投资所形成的各类资产的价值总和。

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。
集合资产管理计划负债	指集合计划在存续期内已经计提,但尚未收取的管理费、托管费、交易佣金、业绩报酬以及集合计划可能发生的其他应付款。
集合资产管理计划单位净值/份额净值	指计算日集合资产管理计划资产净值除以计算日集合计划总份额。
集合资产管理计划单位累计净值	指集合计划单位净值与集合计划份额累计分红之和。
集合资产管理计划份额面值	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。
关联方	本计划及说明书所指关联方的含义与财政部《企业会计准则》所指关联方含义相同。
分红权益登记日	指享有分红权益的计划份额的登记日期,只有在分红权益登记日(不包括本登记日)前购入的计划份额,并在权益登记日当天登记在册的份额才有资格参加分红。
收益分配基准日	指本集合计划以该日的可供分配收益为准进行分红。
《管理办法》	指 2018 年 10 月 22 日经中国证券监督管理委员会发布并于公布

	之日起施行的《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》
《运作规定》	指 2018 年 10 月 22 日经中国证券监督管理委员会发布并于公布之日起施行的《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》
信义义务	指依照《基金法》及本合同之约定，托管人在履行托管职责时，应当恪尽职守，履行诚实信用、谨慎勤勉的义务。
管理人网站	指 https://stock.pingan.com/

三、 承诺与声明

（一）管理人承诺

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

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

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

（二）托管人承诺

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

2. 根据法律法规、中国证监会及证券投资基金业协会的规定和资

产管理合同的约定，对管理人的投资或清算指令等进行监督，但不保证本集合计划资产投资不受损失，不保证最低收益。

3、托管人保证其就托管本资产管理计划已取得内部授权，已经享有签署本资产管理合同的权利，并就签署行为已履行必要的批准授权手续。

（三）投资者声明

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

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

3. 已充分理解本合同条款，了解相关权利义务，了解有关法律法规及所投资资产管理计划的风险收益特征，知晓管理人、托管人及相关机构不应对资产管理计划的收益状况或本金不受损失做出任何承诺，了解“卖者尽责，买者自负”的原则，投资于本计划将自行承担投资风险。

4. 如投资者系以其管理的资产管理产品投资本单一资产管理计划，投资者保证投资本单一资产管理计划的其管理的资产管理产品的认购人不得为资产管理产品，且符合《关于规范金融机构资产管理业

务的指导意见》要求的合格投资者。

四、 合同当事人及权利义务

投资者

个人填写：

姓名：_____证件类型：_____证件号码：_____

通信地址：_____邮政编码：_____

联系电话：_____移动电话：_____

电子信箱：_____

其他：_____

（注：电子邮箱用于接受本集合计划的净值披露以及对 账单、年报等各种信息，请审慎填写）

机构填写：

机构名称：_____法定代表人：_____

通信地址：_____邮政编码：_____

代理人姓名：_____身份证号码：_____

联系电话：_____

电子信箱：_____

（注：电子邮箱用于接受本集合计划的净值披露以及对账单、年报等各种信息，请审慎填写）

管理人

管理人名称：平安证券股份有限公司

法定代表人：何之江

注册地址：深圳市福田区福田街道益田路 5023 号平安金融中心
B 座第 22-25 层

联系地址：深圳市福田区福田街道益田路 5023 号平安金融中心
B 座第 22-25 层

邮政编码：518038

联系电话：95511-8

托管人

机构名称：平安银行股份有限公司深圳分行

法定代表人：杨志群

注册地址：深圳市福田区深南中路 1099 号平安银行大厦

通信地址：深圳市福田区深南中路 1099 号平安银行大厦 13 楼

邮政编码：518031

联系电话：

联系人：李晶芳

本集合计划设定为均等份额，每份份额具有同等的合法权益。

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

(3) 除公募资产管理产品外，以合伙企业、契约等非法人形式直接或者间接投资于资产管理计划的，应向管理人充分披露实际投资者和最终资金来源；

(4) 认真阅读并签署风险揭示书；

(5) 按照资产管理合同约定支付资产管理计划份额的参与款项，承担资产管理合同约定的管理费、业绩报酬、托管费、审计费、税费等合理费用；

(6) 在持有的资产管理计划份额范围内，承担资产管理计划亏损或者终止的有限责任；

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

工作；

(8) 不得违反资产管理合同的约定干涉管理人的投资行为；

(9) 不得从事任何有损资产管理计划及其投资者、管理人管理的其他资产及托管人托管的其他资产合法权益的活动；

(10) 保守商业秘密，不得泄露资产管理计划的投资计划、投资意向等；不得利用资产管理计划相关信息进行内幕交易或者其他不当、违法的证券期货业务活动；

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

(二) 管理人的权利和义务

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；

(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；

(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通过官网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；

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

(三) 托管人的权利与义务

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；
- (10) 按照法律法规要求和资产管理合同约定，根据管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；
- (11) 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；

(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) 资产管理计划成立前向管理人提供托管人关联方信息并及时更新，以满足资管计划关联交易信息披露的要求；

(16) 国家有关法律法规、监管机构及资产管理合同规定的其他义务。

五、 集合资产管理计划的基本情况

(一) 名称：平安证券尊享量化中性 1 号集合资产管理计划

(二) 类别：本计划为混合类集合资产管理计划

(三) 运作方式：开放式

本计划为开放式集合资产管理计划，成立后每月 10 日开放（如遇节假日顺延至最近一个工作日）。具体开放安排请见本合同第八条集合计划的参与、退出和转让。

(四) 投资目标、主要投资方向、投资比例、产品风险等级

1、投资目标

本集合计划通过均衡的资产配置，在有效控制风险的前提下，力

争为投资者提供长期稳定的回报。

2、主要投资方向

本集合计划主要投向以下资产：

(1) 权益类资产：上海证券交易所、深圳证券交易所、北京证券交易所发行及上市交易的股票（含创业板、科创板及其他经中国证监会核准上市的股票，包括新股申购，不包括在全国中小企业股份转让系统挂牌的股票）等；

(2) 固定收益及现金类资产：银行活期存款、货币市场基金、债券逆回购。

(3) 金融衍生品：股指期货。

特别提示：本计划可以参与债券逆回购业务。

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

3、投资比例及限制

(1) 本资管计划的总资产不得超过净资产的 200%

(2) 本资管计划投资权益类资产的比例低于计划总资产的 80%；

(3) 本资管计划投资于金融衍生品的持仓合约比例低于计划总资产的 80%，或投资于衍生品权益账户的规模不高于计划总资产的 20%

(4) 商品及金融衍生品类资产投资限制：

$-10\% \leq (\text{股票多头} + \text{股指期货多头合约价值} - \text{股指期货空头合约价值}) / \text{总资产} \leq 10\%$

(5) 投资于单支股票的市值不超过资管计划资产净值的 5%

(6) 投资于单一股票持仓不超过该股票总股本的 2.5%、流通股本的 5%。

(7) 本资管计划不得投资于 ST、*ST、SST、S*ST 上市公司公开发行的股票。

(8) 本计划参与股票等证券发行申购时，所申报的金额不得超过本资产管理计划的总资产，所申报的数量不得超过拟发行公司本次发行的总量。

(9) 本资管计划不得直接或间接投资于违反国家产业政策、环境保护政策的项目（证券市场投资除外），包括但不限于以下情形：投资项目被列入国家发展改革委最新发布的淘汰类产业目录；投资项目违反国家环境保护政策要求；通过穿透核查，资产管理计划最终投向上述投资项目。

(10) 法律法规、中国证监会以及本合同规定的其他投资限制。法律法规或中国证监会允许集合计划投资其他品种的，资产管理人在履行合同变更程序后，可以将其纳入本计划的投资范围。

4、产品风险等级

本集合计划的风险等级为 R3(中风险)。

(五) 存续期限

本集合计划的存续期限为 5 年，可展期。

(六) 集合计划份额的初始募集面值为人民币 1.00 元。

(七) 最低初始募集规模

本集合计划最低初始募集规模为 1000 万元。

本集合计划不设存续期规模上限与募集期规模，投资者人数不超过 200 人。

(八) 分级安排

本集合计划无分级安排。

(九) 份额登记、估值与核算、信息技术系统等服务机构

本集合计划的管理人（证券投资基金业协会会员编码：PT0300011749），负责本集合计划的份额登记、估值与核算等工作，不再额外聘请份额登记、估值与核算、信息技术系统等服务机构。

(十) 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 万元（不含参与费），追加参与最低金额为人民币 1 万元（不含参与费）。

(十一) 预警与止损策略

本集合计划设置预警线、止损线来进行风险控制，预警线、止损线的计算基准为：资产管理计划单位净值。本资产管理计划预警线为 0.94 元，本资产管理计划止损线为 0.91 元。具体请见本合同第十一条“集合计划的投资”第（十）款“本集合计划风控措施”。

(十二) 本集合计划的销售

1、销售机构：平安证券股份有限公司

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销售本集合计划，管理人新增或变更本集合计划的销售机构时，将提前在管理人网站上公告。管理人网站公告后即生效，管理人无需就增加或变更销售机构事宜征求投资者、托管人意见或与投资者、托管

人另行签订协议。

2、销售方式

销售机构应当了解投资者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，推荐与投资者风险承受能力相匹配的集合计划，引导投资者审慎作出投资决定。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，使投资者详尽了解本集合计划的特性、风险等情况及投资者的权利、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。

六、集合计划的募集

（一）募集对象、募集方式、募集期限

1. 募集对象

本集合计划面向符合条件的合格投资者募集，适合合格投资者中的专业投资者和风险承受能力为 C3 及以上的普通投资者；本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，且人数累计不超过 200 人。

2. 募集方式

本集合计划通过管理人和/或管理人委托的销售机构进行募集，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销

售本集合计划，管理人新增或变更本集合计划的销售机构时，将提前在管理人网站上公告；管理人网站公告后即生效，管理人无需就增加或变更销售机构事宜征求投资者、托管人意见或与投资者、托管人另行签订协议。

本计划以非公开方式向投资者募集资金。

3. 募集期限

本集合计划的初始募集期自资产管理计划份额发售之日起不超过 60 个自然日。具体募集期限请见本集合计划的发行公告。

在募集期的工作日内，投资者可以参与本集合计划。根据募集情况，管理人有权决定提前结束募集期。

（二）本集合计划的认购事项

1. 本集合计划的认购费

本资产管理计划针对募集期参与的投资者收取认购费，认购费率为 1%

2. 认购申请的程序及确认

(1) 投资者可通过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认购；

(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认购申请；

(3) 投资者签署本合同后，方可申请认购集合计划。认购申请经管理人确认后，构成本合同的有效组成部分；

(4) 投资者认购申请确认成功后，其参与申请和参与资金不得撤销；

(5) 投资者提交认购申请后，可于募集期结束之日起的第 2 个工作日后在办理参与的网点查询参与确认情况。

(6) 本集合计划直销募集结算专用账户信息由管理人在直销业务单证内提供，投资者可联系管理人业务人员进行查询。

(7) 销售机构募集账户由销售机构负责安排及通知投资者，并可通过销售机构的客服热线或官方网站进行查询。

3、认购份额的计算方式

认购费用=认购金额×认购费率÷(1+认购费率)

净认购金额=认购金额-认购费用

认购费用采用价外法收取。

认购份额=净认购金额÷集合计划份额的初始募集面值

认购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。

4、初始认购资金的管理

销售机构应当将集合计划募集期间投资者的初始认购资金存入募集结算资金专用账户，在募集结束前，任何机构和个人不得动用。

5、认购资金利息的处理方式

投资者的认购资金(不含认购费用)在初始募集期产生的利息(按照银行同期活期存款利率加计)将折算为计划份额归投资者所有，利息金额以集合计划注册登记机构的记录为准。

（三）本集合计划的最低认购金额与支付方式

本集合计划的最低认购金额为 40 万元。支付方式请见本集合计划销售机构的具体公告。最低认购金额不包含认购费。

七、集合计划的成立与备案

（一）集合计划成立的条件

集合计划的参与资金总额不低于1000万元人民币，其投资者不少于2人，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。

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进行验资并出具验资报告，并在取得验资报告后公告资产管理计划成立。

在集合计划成立之日起5个工作日内，管理人应报证券投资基金业协会备案。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。

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

（二）集合计划募集失败

集合计划募集期届满，在集合计划规模低于人民币 1000 万元或投资者的人数少于 2 人条件下，集合计划设立失败，管理人以固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用，并在募集期届满后 30 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。

(三) 集合计划开始运作的条件和日期

1、条件：当本集合计划满足成立条件，取得验资报告、公告资产管理计划成立后，本集合计划即可开始运作。

2、日期：本集合计划自成立之日起开始运作。

八、集合计划的参与、退出与转让

(一) 参与和退出场所

本集合计划的参与和退出将通过销售机构进行。投资者应当在销售机构办理集合计划销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理集合计划份额的参与和退出。

(二) 参与和退出的开放日和时间

1、参与的办理时间

投资者在集合计划募集期或参与受理期内的工作日可以办理参与本集合计划的业务。

参与受理期：指开放日前的第 2 个工作日（含当日）至开放日（含当日）的期间。在参与受理期内，资产管理人接受委托人参与本计划的申请。

2、退出的办理时间

每份参与份额自募集结束日或份额申购当期开放日起锁定 6 个月，投资者在锁定期后的集合计划开放日办理退出集合计划的业务。

3、开放日安排及通知方式

开放日：本集合计划成立后每月 10 日开放（如遇节假日顺延至最近一个工作日）。

若出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更或其他特殊情况，集合计划管理人将视情况对前述开放安排进行相应的调整，并在实施前告知投资者。

(三) 临时开放日

当发生需要临时开放的情况时，管理人可公告设置临时开放日，投资者可在临时开放日退出集合计划。

临时开放日的触发条件：本集合计划发生合同变更、展期等情形或遇到监管规则修订等情况。

设置临时开放日的程序：本集合计划存续期内，发生以上需设置临时开放日的情形时，管理人应在临时开放日前3个工作日在管理人网站公告临时开放日安排。投资者可在指定的临时开放日内提出退出申请。

临时开放日的披露：管理人应在临时开放日前3个工作日在管理人网站公告临时开放日安排。

临时开放日具体安排以管理人公告为准。

(四) 参与和退出的方式

1、参与的原则

(1) 采用金额参与的方式，即参与以金额申请；

(2) 在参与受理期内的工作日投资者可申请参与本计划，投资者在某个参与受理期内参与集合计划，必须符合管理人在其网站上披露的该次参与受理期内的参与条件与参与安排，参与条件与参与安排包括但不限于产品情况、募集规模、份额代码、参与份额或参

与金额的上限与下限、业绩报酬计提基准等。

(3) 投资者在非参与受理期内的工作日提交的参与申请，管理人有权确认参与失败。投资者提交参与申请额度超出公告明确的参与额度上限(如有)，则管理人有权确认该参与申请失败或部分失败。

(4) 在募集期内，当集合计划募集规模接近或达到约定的规模上限时，管理人将自次日起暂停接受参与申请。

(5) 若销售机构在当期参与受理期内接受的参与申请（开放日为 T 日）数量过多，致使本集合计划投资者数超过 200 人，T+2 日管理人对参与受理期内提交的参与申请按照申请单号从小到大排序，在可接受规模和申请人数限制内，进行逐笔确认。超过投资者人数上限或超出资金规模上限的部分由销售机构将参与资金退回投资者的资金账户。

(6) 本集合计划采用纸质合同/电子签名合同，当使用电子签名合同时，投资者在签署电子签名约定书、并以电子签名方式签署电子签名合同后方可参与本集合计划。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。

2、退出的原则

(1) “未知价”原则，即退出集合计划的价格以开放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) 投资者申请退出时，管理人按“先进先出”的原则，即按照投资者份额参与的先后次序依次退出的方式确定退出份额；

(4) 每次退出不设最低份额，当投资者在某一销售机构处持有的份额小于 40 万份时，该部分份额将被强制退出。

(五) 参与和退出的价格

参与集合计划的价格以开放日（T 日）收市后的集合计划每份额净值为基准进行计算。

退出集合计划的价格以开放日（T 日）收市后的集合计划每份额净值为基准进行计算。

(六) 参与和退出的程序及确认

1、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参与；

(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，销售机构不予受理该笔参与申请；

(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后，构成本合同的有效组成部分；

(4) 投资者参与申请确认后，其参与申请和参与资金不得撤销；

(5) 投资者于参与受理期内提交参与申请后（开放日为 T 日），可于 T+ 3 工作日后在办理参与的网点查询参与确认情况。

2、退出的程序和确认

(1) 退出申请的提出

投资者在参与集合计划的销售机构营业网点或以销售机构提供的方式办理集合计划的退出业务。

(2) 退出申请的确认

投资者退出计划的申请确认成功后,注册登记机构在退出申请日起的第2个工作日为投资者扣除权益并办理相应的注册登记手续。

投资者可在退出申请日起的第3个工作日之后到销售机构网点取得退出申请成交确认单,若交易未成功或数据不符,投资者可与为其办理手续的网点人员联系并进行核实。

(3) 退出款项划付

投资者退出申请成功后,相应退出净额将于退出申请日起的4个工作日内划往退出投资者指定的账户。

(七) 参与和退出的金额限制

投资者在本集合计划存续期购买资产管理计划份额的,投资者应符合合格投资者标准,且参与金额应满足资产管理计划最低参与金额限制(不含参与费用),即40万元;已持有资产管理计划份额的投资者在资产管理计划存续期追加购买资产管理计划份额的除外。存续期追加购买的,每次追加参与金额应不低于1万元(不含参与费)。管理人可以对集合计划参与的最低金额进行调整(但需满足法律法规及监管规定),并在管理人网站公告告知投资者。

投资者部分退出资产管理计划的,其退出后持有的资产管理计划份额净值应当不低于规定的合格投资者最低参与金额。投资者持有的资产管理计划份额净值低于规定的最低投资金额时,需要退出资产管

理计划的,应当一次性全部退出;投资者没有一次性申请全部退出的,管理人将在退出申请确认日对该投资者所持有的全部份额做退出确认。

(八) 参与和退出的费用;

1. 参与费:

本资产管理计划参与费如下:

(1) 认购费(募集期参与)

本资产管理计划在针对募集期参与的投资者收取认购费,认购费为1%

(2) 申购费(存续期参与)

本资产管理计划在存续期收取的申购费为1%。

2. 退出费:

本资产管理计划退出费为0。

(九) 参与份额的计算方式

$$\text{参与费用} = \text{认购/申购金额} \times \text{参与费率} \div (1 + \text{参与费率})$$

$$\text{参与金额} = \text{认购/申购金额} - \text{参与费用}$$

参与费用采用价外法收取。

$$\text{参与份额} = \text{参与金额} \div \text{集合计划单位净值}$$

(十) 退出金额的计算方式;

退出金额的计算方法

$$\text{退出金额} = \text{退出份额} \times \text{集合计划单位净值}$$

$$\text{退出费用} = \text{退出金额} \times \text{退出费率}$$

退出净额 = 退出金额 - 退出费用 - 管理人业绩报酬（如有）

（十一）巨额退出与连续巨额退出

1、巨额退出的认定

本集合计划单个开放日，集合计划净退出申请份额超过上一日集合计划总份额的 10% 时，即认为发生了巨额退出。如果计划连续两个开放日以上发生巨额退出，即认为发生了连续巨额退出。

2、巨额退出与连续巨额退出的处理方式

当出现巨额退出与连续巨额退出时，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。

（1）全额退出：当集合计划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）部分顺延退出：当集合计划管理人认为支付投资者的退出申请有困难或认为支付投资者的退出申请可能会对集合计划的资产净值造成较大波动时，集合计划管理人在当日接受退出比例不低于集合计划总份额的 10% 的前提下，对其余退出申请延期予以办理。对于当日的退出申请，应当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；投资者未能退出部分，除投资者在提交退出申请时明确做出不参加顺延下一个工作日退出的表示外，自动转为下一个工作日退出处理，并以此类推，直到全部退出为止。

（3）暂停退出：本集合计划连续 2 个开放日发生巨额退出，如管理人认为有必要，可暂停接受退出申请，已经接受的退出申请可以延缓支付退出款项，但不得超过正常支付时间 20 个工作日，并应在销

售机构网点公告。

3、巨额退出的影响

(1) 巨额退出并不影响当期的参与；

(2) 巨额退出期间，如果计划达到终止的条件，则集合计划将按规定终止；

(3) 巨额退出结束，计划将恢复到正常的状态。

4、巨额退出的报告

当发生巨额退出并采用部分顺延退出时，集合计划管理人应在 3 个工作日内报告投资者，并说明有关处理方法。发生巨额退出时，管理人暂停或暂缓办理退出业务的期限不得超过 20 个工作日。

5、单个投资者大额退出预审申请安排

本集合计划不设置单个委托人大额退出的预约申请安排。

(十二) 拒绝或暂停参与、暂停退出的情形及处理方式

1、拒绝或暂停参与的情形及处理

发生下列情形时，管理人可以拒绝或暂停受理投资者的参与申请：

(1) 已达到规模上限或投资者人数上限；

(2) 不可抗力的原因导致集合计划无法正常运行；

(3) 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；

(4) 法律法规规定、本集合计划合同约定或中国证监会认定的其他情形。

2、拒绝或暂停退出的情形及处理

发生下列情形时，管理人可以拒绝或暂停受理投资者的退出申请：

(1) 不可抗力的原因导致集合计划无法正常运作；

(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) 退出对集合计划投资的业绩影响较大，有可能损害其它投资者利益。

(4) 法律法规规定、本集合计划说明书规定或中国证监会认定的其他情形。

(十三) 集合计划份额的转让

集合计划存续期间，在管理人按照交易所的规定申请份额转让服务后，投资者可以通过证券交易所以及中国证监会认可的其他交易平台向合格投资者转让其持有的集合计划份额。份额转让应遵守交易所相关规定及要求，并按规定办理份额变更登记手续。受让方首次参与集合计划，应先与管理人、托管人签订集合资产管理合同，且受让方首次参与金额不得低于本集合计划的最低参与金额。

(十四) 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投资者集合计划账户转移到另一投资者集合计划账户的行为。集合计划注册登记机构只受理因继承、捐赠、司法执行、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。

（十五）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。

（十六）管理人自有资金参与集合计划

1、自有资金参与的条件、方式

管理人在募集期和存续期均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应符合《管理办法》、《运作规定》和中国证监会及中国证券业协会的相关规定。

2、自有资金参与的金额和比例

管理人如以自有资金参与本集合计划，自有资金参与本集合计划的比例不超过集合计划总份额（含管理人自有资金）的16%，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该计划总份额的50%。管理人将于自有资金参与前的5个工作日，在管理人官网上公告自有资金参与事宜。

3、自有资金的退出

管理人如以自有资金参与集合计划，自有资金持有期限不得少于6个月，在产品存续期内，当自有资金持有期限不低于6个月，管理人有权选择退出集合计划。管理人将于自有资金退出前的5个工作日，在管理人官网上公告自有资金退出事宜。

管理人自有资金参与份额视同普通份额，与其他投资者持有计划份额享有相同的分红和收益权，也有承担与计划份额相对应损失的责任。管理人自有资金不承担任何补偿责任。

因集合计划规模变动等客观因素导致自有资金参与比例不符合监管制度或合同约定，导致的自有资金被动退出，管理人可无需事前披露。

为应对集合资产管理计划巨额赎回以解决流动性风险，或者中国证监会认可的其他情形，在不存在利益冲突并遵守合同约定的前提下，管理人自有资金参与及其后续退出集合资产管理计划可不受第二款、第三款第一项投资比例、投资时间、公告时间的限制，但应当及时告知投资者和托管人，并向中国证监会相关派出机构报告。

4、管理人自有资金参与部分不构成对投资者本金及收益的保证，也不保证投资者份额本金不受损失。管理人自有资金退出时应当按照法律法规相关规定进行信息披露。

(十七) 管理人应定期将本集合计划投资者变更情况报送证券投资基金业协会。

九、 份额持有人大会及日常机构

本集合计划所有当事人一致同意，集合计划不设置份额持有人大会及日常机构。

十、 集合计划份额的登记

本集合计划份额登记业务的各项事宜均由管理人负责。

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

十一、集合计划的投资

(一) 投资目标

本集合计划通过均衡的资产配置，在有效控制风险的前提下，力争为投资者提供长期稳定的回报。

(二) 投资范围、比例及限制

1、投资范围

(1) 权益类资产：上海证券交易所、深圳证券交易所、北京证券交易所发行及上市交易的股票（含创业板、科创板及其他经中国证监会核准上市的股票，包括新股申购，不包括在全国中小企业股份转让系统挂牌的股票）等；

(2) 固定收益及现金类资产：银行活期存款、货币市场基金、债券逆回购。

(3) 金融衍生品：股指期货；

特别提示：本计划可以参与债券逆回购业务。

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

2、投资比例及限制

- (1) 本资管计划的总资产不得超过净资产的 200%
- (2) 本资管计划投资权益类资产的比例低于计划总资产的 80%；
- (3) 本资管计划投资于金融衍生品的持仓合约比例低于计划总资产的 80%，或投资于衍生品权益账户的规模不高于计划总资产的 20%

(4) 商品及金融衍生品类资产投资限制:

$-10\% \leq (\text{股票多头} + \text{股指期货多头合约价值} - \text{股指期货空头合约价值}) / \text{总资产} \leq 10\%$

(5) 投资于单支股票的市值不超过资管计划资产净值的 5%

(6) 投资于单一股票持仓不超过该股票总股本的 2.5%、流通股本的 5%。

(7) 本资管计划不得投资于 ST、*ST、SST、S*ST 上市公司公开发行的股票。

(8) 本计划参与股票等证券发行申购时, 所申报的金额不得超过本资产管理计划的总资产, 所申报的数量不得超过拟发行公司本次发行的总量。

(9) 本资管计划不得直接或间接投资于违反国家产业政策、环境保护政策的项目(证券市场投资除外), 包括但不限于以下情形: 投资项目被列入国家发展改革委最新发布的淘汰类产业目录; 投资项目违反国家环境保护政策要求; 通过穿透核查, 资产管理计划最终投向上述投资项目。

(10) 法律法规、中国证监会以及本合同规定的其他投资限制。

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

3、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) 向投资者做出保证其资产本金不受损失或者保证其取得最低收益的承诺；
- (4) 挪用集合计划资产；
- (5) 募集资金不入账或者其他任何形式的账外经营；
- (6) 募集资金超过计划说明书约定的规模；
- (7) 接受单一投资者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。

(三) 股指期货保证金管理的应急处理机制及参与股指期货的风险控制

鉴于股指期货的保证金交易特征，管理人针对股指期货保证金的流动性管理建立应急处理机制：

1) 应急触发条件

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

2) 保证金补充机制

如出现保证金不足的情况时，管理人将及时变现委托财产以最大限度降低损失。

3) 损失责任承担

管理人不承担委托财产的变现损失以及非管理人原因导致的未
及时追加保证金的损失（包括穿仓损失）。对于其他相关方的原因给
委托财产造成的损失，由过错方承担责任，管理人应代表投资者的利
益向过错方追偿。投资者同意并确认：有关股指期货交易中各方的权
利义务及违约赔偿事项，以管理人代表本计划与各方签署的相关协议
为准。

管理人依照法律法规、资产管理合同以及相关内部管理制度的约
定进行股指期货的投资交易，相关交易将通过系统控制或人工复核确
保符合持仓限额、风险敞口限额、止损限额、保证金限额等风险限额
指标及授权额度要求。

(四) 投资比例超限的处理方式及流程

如因证券市场波动、证券发行人合并、资产管理计划规模变动等
证券公司之外的因素，造成集合计划投资比例超标，管理人应在超标
发生之日起在具备交易条件的 15 个交易日内将投资比例降至许可范
围内。确有特殊事由未能在规定时间内完成调整的，证券期货经营机
构应当及时向中国证监会相关派出机构报告。特别的，如因前述原因
导致股指期货投资比例不符合规定的，需在 10 个交易日内调整完毕，
并按监管规则进行报告。

(五) 风险收益特征

本集合计划的风险等级为 R3（中风险）。

(六) 业绩比较基准

本集合计划不设置业绩比较基准。

(七) 本集合计划的建仓期

集合计划成立之日起的 6 个月为建仓期。

建仓期内的投资活动，应当符合本合同约定的投向和本计划的风险收益特征，以现金管理为目的，投资于银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券、货币市场基金等中国证监会认可的投资品种的除外。建仓期结束后，资产管理计划的资产组合应当符合法律、行政法规、中国证监会规定和合同约定的投向和比例。

(八) 投资策略

管理人优选量化选股策略，通过多因子量化模型对低高频价量、基本面、技术面、资金面、事件驱动、市场情绪等因子建模，优选股票，再根据产品属性使用股指期货对冲市场风险，追求稳定持续的股票超额收益和绝对收益。

(九) 投资决策

1、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，并以维护集合计划投资者利益作为最高准则。具体决策依据包括：

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

(2) 宏观经济发展态势、微观经济运行环境和证券市场走势；

(3) 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，是本集合计划维护投资者利益的重要保障。

2、集合计划的决策程序

(1) 管理人资产管理业务实行分级决策制度。公司下设资产管理投资决策委员会，资产管理业务投资决策委员会是资产管理业务的决策机构。资产管理事业部是公司资产管理的专设部门，资产管理事业部设投资负责人及投资经理。

(2) 资产管理业务投资决策委员会下设固定收益投资决策小组、权益投资决策小组和基金及量化投资决策小组。各投资决策小组在投资交易工作中的主要职责是：在公司授权范围内，负责资产管理业务标准化资产管理产品投资以及各类投资的重大投资事项决策。

(3) 投资经理在授权范围内负责具体实施资产管理产品阶段性资产配置与投资实施方案。

3、投资管理的管控

管理人在董事会层面、公司风险管理层面，以及资产管理业务的运作部门层面建立了一系列严格、规范的风险控制制度，为资产管理业务投资管理的执行提供了制度保障。主要体现在以下几项制度中：

(1) 投资决策制度。资产管理投资业务实行分级决策制度，各级决策机构有明确的决策权限，确保集合计划的规范运作，保障集合计划资产的安全和增值。

(2) 投资备选库管理制度。资产管理业务建立投资备选库，并对入库品种实行严格筛选。备选库以外的品种禁止投资，有效防范集合计划的投资风险。

(3) 交易集中管理制度。资产管理业务实行集中交易管理制度，

在资产管理事业部内设立独立的交易室，由专职交易员执行投资经理交易指令，将投资决策过程和交易执行过程分开，保证交易工作的安全性。

(4) 风险报告制度。风险管理部及时跟踪资产管理业务风险控制指标和业绩状况，对风险控制指标异常和收益大幅波动等情况，及时进行关注，必要时发送风险提示，进行风险报告。

(5) 隔离墙制度。公司建立严格的隔离墙制度，实现资产管理业务与管理人的其他业务（自营、投行、经纪）之间，以及各项集合资产管理业务之间的有效隔离，杜绝内幕交易，维护客户利益。

(十) 本集合计划风控措施

本集合计划设置预警线、止损线来进行风险控制，预警线、止损线的计算基准为：资产管理计划单位净值。

1. 本资产管理计划预警线为 0.94 元。

任何一个交易日（A日）收盘后，当本集合计划的单位净值低于或等于预警线，管理人不得主动新增投资（股指期货除外）；在本集合计划的单位净值大于预警线后，管理人可主动新增投资。

2. 本资产管理计划止损线为 0.91 元。

任何一个交易日（A日）收盘后，当本计划的单位净值低于或等于止损线，则不论此后计划单位净值是否恢复到止损线以上，资产管理人应自 A+1 日起，在 A+5 日内遵循在最短时间内将委托财产变现的原则对本计划持有的所有非现金类资产进行不可逆变现，直至计划资产全部变现为止，计划资产全部变现后本计划提前终止。如

果由于非管理人原因导致的委托财产无法变现的，不受前述 A+5 日的
的时间限制。发生上述提前终止情形的，资产管理人应于资产管理
合同终止之日（含提前终止日）通知资产托管人和资产投资者，并
按照本资产管理合同的约定进行清算。

3. 预警线、止损线的适用

自本集合计划成立之日起的 2 个月内，本集合计划不适用上述预
警线、止损线来进行风险控制，但本集合计划在此期间的投资活动，
应当符合资产管理合同、发行公告约定的投向和本期集合计划的风
险收益特征。

自本集合计划成立之日起的 2 个月后，本集合计划适用上述预警
线、止损线来进行风险控制。

(十一) 本集合计划的流动性安排

管理人将对本集合计划的流动性进行安排，确保本集合计划在开
放退出期内，资产组合中七个工作日可变现资产的价值，不低于本集
合计划资产净值的 10%。

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。

十二、投资顾问

本集合计划不聘请投资顾问。

十三、分级安排

本集合计划无分级安排。

本集合计划设定为均等份额，每份份额具有同等的合法权益。

十四、利益冲突及关联交易

管理人已建立严格的隔离墙制度，实现资产管理业务与管理人的其他业务（自营、投行、经纪）之间，以及各项集合资产管理业务之间的有效隔离，杜绝内幕交易，维护投资者利益。

投资者知悉虽然管理人遵守相关法律法规进行操作，但依然不能避免可能产生的利益冲突的情形，如管理人运用委托财产从事重大关联交易，管理人自有资金参与和退出本集合计划等情形。

管理人将遵循投资者利益优先原则，保护投资者利益，公平对待投资者，发生上述情形时，管理人按合同的约定的时限及内容进行披露。

本资产管理计划关联交易是指本资产管理计划与本资产管理计划关联方（包括资产管理计划管理人、资产管理计划托管人、前述机构的控股股东、实际控制人及其它关联方）之间发生转移资源或义务的事项，包括但不限于下列事项：

- （一）投资于本资产管理计划关联方发行的证券或关联方在承销期内承销的证券；
- （二）以本资产管理计划关联方为交易对手进行的交易；
- （三）向本资产管理计划关联方支付报酬；
- （四）根据实质重于形式原则认定的其他通过约定可能引致资源、

劳务或者义务转移的其他事项。

投资者在此同意并授权管理人可以将集合计划资产投资于管理人、托管人及与前述机构的控股股东、实际控制人或者其他关联方发行的证券或承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易。交易完成后，管理人应及时将交易结果书面通知托管人，通过管理人的网站告知投资者，并向中国证监会派出机构等机构报告。

以下交易属于禁止性关联交易，不得开展：

（一）利用本资产管理计划资产为公司、资产托管人及前述机构的控股股东、实际控制人或者其他关联方提供或者变相提供融资。全部投资者均为符合中国证监会规定的专业投资者且单个投资者投资金额不低于 1000 万元，并且事先取得投资者同意的资产管理计划除外；

（二）利用本资产管理计划与本资产管理计划管理人及管理人关联方所设立的资产管理计划进行不正当交易、利益输送、内幕交易和操纵市场；

（三）利用本资产管理计划资产从事法律法规、监管机构及产品合同禁止的其他关联交易。

十五、投资经理的指定与变更

（一）投资经理的指定

资产管理计划投资经理由管理人负责指定。

本集合计划投资经理为冯张鹏先生。

冯张鹏先生，现任平安证券股份有限公司资产管理事业部量化投

资团队执行副总经理，英国帝国理工大学工科博士，控制理论和优化方向；曾任国投安信期货公司资管部量化投资总监，资管业务决策委员会委员；招商证券资产管理(香港)有限公司资管部量化投资总监；光大证券资管部资深基金经理；泰信基金量化投资负责人；英国德意志银行量化分析师。2008年进入华尔街开始从事投资和研究工作，专注于股票量化对冲，指数增强等量化投资领域。已取得投资经理资格及基金从业资格，无兼职情形，最近三年未被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚。

(二) 投资经理变更的条件和程序

管理人可根据业务需要变更投资经理。管理人将按照内部管理制度执行投资经理变更流程，并在投资经理变更后5日内在管理人指定网站公告。

十六、集合计划的财产

(一) 集合计划财产的保管与处分

1、本集合计划财产的债务由本集合计划财产本身承担责任，投资者以其出资为限对本集合计划财产的债务承担责任。

2、本集合计划财产独立于管理人和托管人的固有财产，并独立于管理人管理的和托管人托管的其他财产。管理人、托管人不得将本集合计划财产归入其固有财产。

3、管理人、托管人因本集合计划财产的管理、运用或者其他情形而取得的财产和收益，归入本集合计划财产。

4、管理人、托管人可以按照本合同的约定收取管理费、托管费

以及本合同约定的其他费用。管理人、托管人以其固有财产承担法律责任，其债权人不得对本集合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，本集合计划财产不属于其清算财产。

5、本集合计划财产产生的债权不得与不属于本集合计划财产本身的债务相互抵销。非因本集合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本集合计划财产强制执行。上述债权人对本集合计划财产主张权利时，管理人、托管人应明确告知本集合计划财产的独立性，采取合理措施并及时通知投资者。

（二）本集合计划财产相关账户的开立和管理

本集合计划根据相关法律法规、规范性文件开立集合计划托管账户以及其他账户，与集合计划管理人、集合计划托管人、集合计划销售机构和集合计划注册登记机构自有财产的账户以及其他集合计划和其他投资者财产的账户相互独立。

资产托管人按照规定开立资产管理计划财产的资金账户和证券账户，由资产管理人根据投资需要按照规定开立基金账户。资产托管人应协助上门开立、销户、变更托管账户，资产投资者和资产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。证券账户的持有人名称应当符合证券登记结算机构的有关规定。资金托管账户名称为：“平安证券尊享量化中性1号集合资产管理计划”，资产管理人授权资产托管人办理本集合资产计划的开立、销户、变更工作，具体按照资产托管人要求办理。银行托管账户由资产托管人根据本合同规定

进行保管和使用。委托财产的一切货币收支活动均通过该资金账户进行，包括但不限于投资、支付退出金额、支付计划收益、收取参与款，均需通过该托管专户进行。

托管专户的开立和使用，限于满足开展本资产管理计划业务的需要。资产托管人和资产管理人不得假借计划的名义开立其他任何银行账户；亦不得使用计划的任何银行账户进行本资产管理计划业务以外的活动。托管专户的管理应符合有关法律法规的规定。

管理人和托管人对集合计划资产独立核算、分账管理，保证集合计划资产独立于管理人和托管人的自有资产、集合计划资产与其他投资者资产、不同集合计划的资产相互独立。管理人、托管人不得将集合计划资产归入其自有资产。

因业务发展而需要开立的其他账户，应根据法律法规的规定和《资产管理合同》的约定开立，并按有关规则管理并使用。

（三）集合计划资产的构成

集合计划资产是指运用集合计划资金进行投资所形成的各类资产，包括集合计划购买的各类有价证券、银行存款本息及其他资产。

十七、投资指令的发送、确认和执行

（一）交易清算授权

管理人应向托管人提供资金划拨指令的授权人及预留印鉴。预留印鉴包括但不限于管理人预留的印章样本、有权签字人签字或名章样本。管理人需在预留印鉴上加盖公章，对预留印鉴进行授权。同时，预留印鉴还需同时载明管理人投资监督联络人及联系方式，包括办公

电话、移动电话、邮箱、传真和邮寄地址。

托管人在收到预留印鉴并与管理人进行电话确认后，预留印鉴即生效。如果预留印鉴中载明具体生效时间的，该生效时间不得早于托管人收到预留印鉴的时点。如生效时间早于托管人实际收到预留印鉴的时点，则以托管人收到预留印鉴的时点为预留印鉴的生效时间。管理人应在提供给托管人预留印鉴扫描件后的 5 个工作日内将原件寄给托管人，由于管理人未将预留印鉴原件寄给托管人，或原件与扫描件存在差异而引起的风险和损失，管理人承担相应责任。若预留印鉴原件与托管人收到的扫描件不一致，以托管人收到的已生效的扫描件为准。

管理人和托管人对预留印鉴负有保密义务，其内容不得向相关人员以外的任何人泄露。

（二）投资指令的内容

投资指令是指在管理集合计划财产时，管理人向托管人发出的资金划拨及其他款项收付的指令。投资指令的内容包括投资指令出具日期、款项事由、指令的执行时间、支付金额、最迟到账时间、付款账户信息、收款账户信息（如有）等，并加盖预留印鉴。

（三）投资指令的发送、确认及执行时间与程序

1、投资指令的发送

投资指令由管理人通过电子邮件发送扫描件或其他管理人和托管人认可的方式向托管人发送。以电子邮件接收到的投资指令，托管人接收投资指令的指定邮箱接收到附有投资指令及有效附件的邮件

后，视为该投资指令成功送达。划款指令原件与托管人收到的邮件不一致时，以托管人收到的邮件为准。管理人有关义务在发送指令后与托管人以电话等双方认可的方式进行确认，因管理人未能及时与托管人进行指令确认，致使资金未能及时到账，所造成的损失，管理人承担责任。

管理人应依照相关法律法规以及本合同的规定，在其合法的经营权限和交易权限内发送投资指令，并保证投资指令及其附件的合法、真实、完整和有效。管理人在发送投资指令时，应为托管人留出划款执行指令所必需的时间。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。除需考虑资金在途时间外，管理人还需为托管人留有两个工作小时复核和审批时间。

2、投资指令的确认

管理人有关义务在发送投资指令后与托管人以电话等双方认可的方式进行确认。因管理人未能及时与托管人进行指令确认，致使资金未能及时到账，所造成的损失，管理人承担责任。

3、投资指令的执行时间与程序

托管人收到管理人发送的投资指令后需进行审核，验证投资指令的必要内容是否齐全、审核印鉴和签名是否和预留印鉴和签名样本相符，复核无误后依照本合同约定在规定期限内及时执行。托管人仅依据被授权人预留印鉴和签名进行表面相符性审查。

（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《基金法》、本合同的规定时，不予执行，并应及时通知管理人纠正，管理人收到通知后应及时处理，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、指令账户信息不全或有误、预留印鉴不全或不符、交割信息错误，指令中重要信息模糊不清或不全等。托管人在履行监督职能时，如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。

（六）更换投资指令被授权人的程序

管理人更换投资指令被授权人及预留印鉴，必须提前至少一个工作日，使用传真方式或其他管理人和托管人认可的方式向托管人发出由管理人加盖公章的预留印鉴扫描件和原件，同时电话通知托管人。

托管人在收到变更预留印鉴并与管理人进行电话确认后，预留印鉴即生效。如果变更预留印鉴中载明具体生效时间的，该生效时间不得早于托管人收到变更预留印鉴的时点。如生效时间早于托管人实际收到变更预留印鉴的时点，则以托管人收到变更预留印鉴的时点为变更预留印鉴的生效时间。管理人应在提供给托管人变更预留印鉴扫描件后的5个工作日内将原件寄给托管人，由于管理人未将变更预留印鉴原件寄给托管人，或原件与扫描件存在差异而引起的风险和损失，管理人承担相应责任。

（七）投资指令的保管

投资指令若以传真形式发出或以电子邮件方式发送，则正本由管理人保管，托管人保管指令传真件或电子邮件发送的签署版本扫描件。

（八）相关责任

在正常业务受理渠道和指令规定的时间内，因托管人原因未能及时或正确执行符合本合同规定、合法合规的投资指令而导致基金财产受损的，托管人应承担相应的责任，但托管资金账户余额不足或托管人如遇到不可抗力的情况除外。对管理人在没有充足资金的情况下向托管人发出的指令，托管人有权拒绝执行。

十八、越权交易

（一）越权交易的界定

越权交易是指管理人违反有关法律法规的规定以及违反或超出本合同项下投资者的授权而进行的投资交易行为，包括：

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

因证券市场波动、上市公司合并、资产管理计划规模变动等管理人以外的因素致使资产管理计划投资不符合本合同所约定的投资范围和投资比例的情况除外。如发生上述因管理人以外的因素致使资产管理计划投资不符合本合同所约定的投资范围和投资比例的情况，托管人应在 3 个工作日内通知管理人，管理人应具备交易条件后 15 个交易日内进行调整，其中股指期货因前述原因超标的应在 10 个交易日内进行调整，使之符合法律法规或本合同的约定。

管理人应在有关法律法规和本合同规定的权限内运用委托资产

进行投资管理，不得违反有关法律法规和本合同的约定，超越权限管理、从事证券投资。

(二) 越权交易的处理程序

1. 托管人就本合同投资监督事项表的内容对产品投资运作进行监督。

投资监督事项表

监督项目	监督内容
投资范围	<p>(1) 权益类资产：上海证券交易所、深圳证券交易所、北京证券交易所发行及上市交易的股票（含创业板、科创板及其他经中国证监会核准上市的股票，包括新股申购，不包括在全国中小企业股份转让系统挂牌的股票）等；</p> <p>(2) 固定收益及现金类资产：银行活期存款、货币市场基金、债券逆回购。</p> <p>(3) 金融衍生品：股指期货；</p>
投资限制	<p>(1) 本资管计划的总资产不得超过净资产的 200%</p> <p>(2) 本资管计划投资权益类资产的比例低于计划总资产的 80%；</p> <p>(3) 本资管计划投资于金融衍生品的持仓合约比例低于计划总资产的 80%，或投资于衍生品权益账户的规模不高于计划总资产的 20%</p> <p>(4) 投资于单支股票的市值不超过资管计划资产净值的 5%</p> <p>(5) 投资于单一股票持仓不超过该股票总股本的 2.5%、流通股本的 5%。</p> <p>(6) 本资管计划不得投资于 ST、*ST、SST、S*ST 上市公司公开发行的股票。</p> <p>(7) 本计划参与股票等证券发行申购时，所申报的金额不得超过本资产管理计划的总资产，所申报的数量不得超过拟发行公司本次发行的总量。</p> <p>(8) 本资管计划不得直接或间接投资于违反国家产业政策、环境保护政策的项目（证券市场投资除外），包括但不限于以下情形：投资</p>

项目被列入国家发展改革委最新发布的淘汰类产业目录；投资项目违反国家环境保护政策要求；通过穿透核查，资产管理计划最终投向上述投资项目。
--

(9) 法律法规、中国证监会以及本合同规定的其他投资限制。

托管人发现管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他规定，或者违反本合同投资监督事项表约定的，应当立即通知管理人并有权及时报告中国证监会相关派出机构。

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

2、法律法规禁止的超买、超卖行为

托管人在行使监督职能时，如果发现资产管理计划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，由此给资产管理计划财产造成的损失由管理人承担。

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

(三) 托管人对管理人投资运作的监督

1、托管人对管理人的投资行为行使监督权。托管人根据本合同有关资产管理计划投资政策的约定，对本计划的投资范围、比例及限制、投资禁止行为进行监督。具体投资监督事项如本合同投资监督事项表相关条款所述。

2、托管人对资产管理计划的投资限制的监督和检查，自本合同生效之日起开始。

3、托管人发现管理人的投资运作违反法律、行政法规或其他有关规定，或者违反本合同约定时，应当拒绝执行，立即通知资产管理人，并及时报告中国证监会相关派出机构；托管人发现管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规或其他有关规定，或者违反本合同约定的，应当立即通知资产管理人并及时报告中国证监会相关派出机构。资产管理人收到通知后应及时核对或纠正，并向资产托管人进行解释或举证。

4、托管人发现管理人可能存在违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反本合同约定，但难以明确界定时，应立即报告管理人。资产管理人应在3个工作日内予以答复，资产管理人在3个工作日内未予以答复的，资产托管人有权及时报告中国证监会相关派出机构。

5、托管人有权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违规事项未能在限期内纠正的，托管人应报告中国证监会相关派出机构。

十九、集合计划的估值和会计核算

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) 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。

(二) 资产净值：指本集合计划资产总值减去负债后的净资产值。

(三)单位净值:指计算日集合计划资产净值除以计算日该集合计划总份额的金额。本集合计划单位净值的计算,精确到0.0001元(即小数点后四位),小数点后第五位四舍五入。

(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:集合计划所持有的一切金融资产和金融负债。

(六)估值时间:集合计划成立后,管理人与托管人每个交易日对前一个交易日的集合计划资产进行估值,估算单位资产净值。

(七)估值方法:

估值应符合本合同、《证券公司客户资产管理业务规范》中的估值原则、《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,如法律法规未做明确规定的,参照行业通行做法处理。资产管理人、资产托管人的估值数据应依据合法的数据来源独立取得。对于固定收益类投资品种的估值应依据中国证券业协会基金估值工作小组的指导意见及指导价格估值。

1. 股票估值

(1)上市流通股票按估值日其所在证券交易所的收盘价估值。

(2)上市流通股票估值日无交易的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化,且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件,以最近交易日的收盘价估值。

(3) 首次发行未上市的股票，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，按成本价估值。

(4) 送股、转增股、配股和公开增发新股等发行未上市的股票，按估值日在证券交易所上市的同一种股票的收盘价进行估值。

(5) 首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按估值日在证券交易所上市的同一种股票的收盘价进行估值。

(6) 流通受限股票的估值处理

流通受限股票，是指在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票。

a) 流通受限股票按以下公式确定估值日该流通受限股票的价值。

$$FV = S \times (1 - LoMD)$$

其中：

FV：估值日该流通受限股票的价值

S：估值日在证券交易所上市交易的同一种股票的公允价值

LoMD：该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣。

b) 引入看跌期权计算该流通受限股票对应的流动性折扣。

LoMD = P/S，P 是估值日看跌期权的价值。

c) 证券投资基金持有的流通受限股票在估值日按平均价格亚式期权模型（“AAP 模型”）确定估值日看跌期权的价值。

AAP 模型公式如下所示:

$$P = Se^{-qt} \left[N\left(\frac{v\sqrt{T}}{2}\right) - N\left(-\frac{v\sqrt{T}}{2}\right) \right]$$
$$v\sqrt{T} = \left\{ \sigma^2 T + \ln \left[2(e^{\sigma^2 T} - \sigma^2 T - 1) \right] - 2 \ln(e^{\sigma^2 T} - 1) \right\}^{\frac{1}{2}}$$

其中:

S: 估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值

T: 剩余限售期, 以年为单位表示

σ : 股票在剩余限售期内的股价的预期年化波动率

q: 股票预期年化股利收益率

N: 标准正态分布的累积分布函数

未尽事宜, 按照《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》执行。

2. 货币市场基金按最近公布的基金份额净值估值, 并按照该基金公布的每万份收益逐日计提收益。

3. 中国金融期货交易所上市的股指期货合约, 一般以估值当日结算价进行估值, 估值当日无结算价的, 且最近交易日后经济环境未发生重大变化的, 采用最近交易日结算价估值。

4. 持有的银行活期存款、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。

5. 其他资产按法律法规或监管机构有关规定进行估值。

如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价

值的，管理人可根据具体情况与托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

相关法律法规以及监管部门有规定的，从其规定；如有最新规定，按最新规定估值。

（八）估值程序

本集合计划资产由集合计划管理人完成估值后，将估值结果以电子邮件、传真或其他管理人和托管人双方认可的方式发送至本集合计划托管人，托管人按本合同规定的估值方法、时间、程序进行复核，复核无误后签章返回给管理人。

（九）估值错误与遗漏的处理方式

当集合计划资产估值出现错误时，集合计划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，并通过在管理人网站上公告的方式向投资者披露。

1、差错类型

本集合计划运作过程中，如果由于集合计划管理人、托管人、销售机构、注册登记机构或投资者自身的过错造成差错，导致其他当事人遭受损失的，过错的责任人应当对由于该差错遭受损失的当事人（“受损方”）按下述“差错处理原则”给予赔偿并承担相关责任。

上述差错的主要类型包括但不限于：资料申报差错、数据传输差错、数据计算差错、系统故障差错、下达指令差错等；对于因技术原因引起的差错，若系同行业现有技术水平无法预见、无法避免、无法

抗拒，则属不可抗力，按照下述规定执行。

由于不可抗力原因造成投资者的交易资料灭失或被错误处理或造成其他差错，因不可抗力原因出现差错的当事人不对其他当事人承担赔偿责任，但因该差错取得不当得利的当事人仍负有返还不当得利的义务。

2、差错处理原则

(1) 差错已发生，但尚未给当事人造成损失时，差错责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正差错发生的费用由差错责任方承担；由于差错责任方未及时更正已产生的差错，给当事人造成损失的由差错责任方承担；若差错责任方已经积极协调，并且有协助义务的当事人有足够的时间进行更正而未更正，则有协助义务的当事人应当承担相应赔偿责任。差错责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认，确保差错已得到更正。

(2) 差错的责任方仅对差错可能对有关当事人产生的直接损失负责，不对间接损失负责，并且仅对差错的有关直接当事人负责，不对第三方负责。

(3) 因差错而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但差错责任方仍应对差错负责，如果由于获得不当得利的当事人不返还或不全部返还不当得利造成其他当事人的利益损失（“受损方”），则差错责任方应赔偿受损方的损失，并在其支付的赔偿金额的范围内对获得不当得利的当事人享有要求交付不当得利的权利；如果获得不当得利的当事人已经将此部分不当得利返还给受损方，则受

损方应当将其已经获得的赔偿额加上已经获得的不当得利返还的总和超过其实际损失的差额部分支付给差错责任方。

(4) 差错调整采用尽量恢复至假设未发生差错的正确情形的方式。

(5) 差错责任方拒绝进行赔偿时，如果因集合计划管理人过错造成集合计划财产损失，集合计划托管人应为集合计划的利益向集合计划管理人追偿；如果因集合计划托管人过错造成集合计划财产损失，集合计划管理人应为集合计划的利益向集合计划托管人追偿。除集合计划管理人和托管人之外的第三方造成集合计划资产的损失，并拒绝进行赔偿时，由集合计划管理人负责向差错方追偿。

(6) 如果出现差错的当事人未按规定对受损方进行赔偿，并且依据法律法规、资产管理合同或其他规定，集合计划管理人自行或依据法院判决、仲裁裁决对受损方承担了赔偿责任，则集合计划管理人有权向出现过错的当事人进行追索，并有权要求其赔偿或补偿由此发生的费用和遭受的损失。

(7) 由于交易所及登记结算公司发送的数据错误，集合计划管理人和托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误的，由此造成的集合计划资产估值错误，集合计划管理人和托管人可以免除赔偿责任。但集合计划管理人和托管人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

(8) 按法律法规规定的其他原则处理差错。

3、差错处理程序

差错被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

(1) 查明差错发生的原因，列明所有的当事人，并根据差错发生的原因确定差错的责任方；

(2) 根据差错处理原则或当事人协商的方法对因差错造成的损失进行评估；

(3) 根据差错处理原则或当事人协商的方法由差错的责任方进行更正和赔偿损失；

(4) 根据差错处理的方法，需要修改集合计划注册与过户登记数据的，由集合计划管理人进行更正，并就差错的更正向有关当事人进行确认；

(5) 集合计划资产净值计算错误偏差达到集合计划资产净值0.5%时，集合计划管理人应当通报托管人，并向投资者披露。

(十) 估值复核

根据托管协议，托管人有义务对计划资产情况进行复核，包括复核资产管理计划份额净值；复核资产管理人编制的本计划的资产管理季度（年度）报告，并出具书面意见。

(十一) 估值调整的情形与处理

当发生需要估值调整的情形，例如估值日证券无交易，但最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件等管理人认为目前估值无法反映证券真实的价格时，管理人可以与托管人协商进行估值调整。如遇估值调整，管理人将在估

值调整后5个工作日内进行公告。

（十二）暂停估值的情形

当出现下列情形致使集合计划管理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，集合计划管理人必须按规定完成估值工作。

1、集合计划投资所涉及的证券交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

2、因不可抗力或其他情形致使集合计划管理人、托管人无法准确评估集合计划资产价值时；

3、中国证监会认可的其他可以暂停估值的情形。

由于不可抗力原因，或由于证券交易所及注册登记机构发送的数据错误，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，但未能发现错误的，由此造成的资产估值错误，管理人和托管人可以免除赔偿责任。但管理人、托管人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

（十三）集合计划份额净值的确认

集合计划份额净值由管理人负责计算，托管人负责进行复核。管理人应于每个估值核对日计算估值日的份额净值并发送给托管人。托管人对份额净值计算结果复核确认后发送给管理人。

（十四）特殊情况的处理

由于不可抗力、系统等原因，或由于证券交易所、登记结算公司或证券经纪商发送的数据错误，或国家会计政策变更、市场规则变更

等，管理人和托管人虽然已经按照本合同约定的估值方法、程序进行检查，但未能发现错误的，由此造成的集合计划资产估值错误，管理人和托管人免除赔偿责任。但管理人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

（十五）集合计划的会计核算

1、集合计划的会计年度为公历年度的1月1日至12月31日；集合计划首次募集的会计年度按如下原则：如果《集合计划合同》生效少于2个月，可以并入下一个会计年度披露；

2、集合计划核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位；

3、集合计划会计核算制度执行国家有关会计制度；

4、本集合计划独立建账、独立核算；管理人及托管人各自保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关规定编制集合计划会计报表；托管人每月与管理人就集合计划的会计核算、报表编制等进行核对并以书面或双方认可的其他方式确认。

二十、集合计划的费用与税收

（一）集合计划费用

1、托管费：

本集合计划托管费按前一日集合计划资产净值的0.03%的年费率进行计提，计算方法如下：

$$T = A \times 0.03\% \div 365$$

T 为每日应计提的集合计划托管费

A 为前一日集合计划资产净值

集合计划成立后，托管费每日计提，按季度支付。在下季初五个工作日内，管理人向托管人出具资金划拨指令，托管人复核后无误后从集合计划中支付给托管人。合同存续期间的最后一天以前一日资产管理计划财产净值和当日资产管理计划财产净值为基数分别计提托管费。

2、管理费

本集合计划管理费按前一日集合计划资产净值的1.8%的年费率进行计提，计算方法如下：

$$M = A \times 1.8\% \div 365$$

M 为每日应计提的集合计划管理费

A 为前一日集合计划资产净值

集合计划成立后，管理费每日计提，按季度支付。在下季初五个工作日内，管理人向托管人出具资金划拨指令，托管人复核后无误后从集合计划中支付给管理人。合同存续期间的最后一天以前一日资产管理计划财产净值和当日资产管理计划财产净值为基数分别计提管理费。

3、证券账户开户及证券交易费用

本集合计划证券账户开户费由本集合计划承担，并应按规定比例在发生投资交易时计提并支付经手费、证管费、过户费、印花税、证券结算风险基金、佣金、代理结算费等。

4、集合计划注册登记费用：

集合计划注册与过户登记人收取的相关费用，如果金额较小，或者无法对应到相应会计期间，可以一次性计入集合计划费用；如果金额较大，并且可以对应到相应会计期间，应在该会计期间内按直线法摊销。

5、税收

本计划投资、管理和运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务应按国家税收法律、法规执行。根据增值税相关法律法规、税收政策等要求，管理人为本计划在投资、管理和运作过程中发生的增值税应税行为的增值税纳税人，承担纳税义务。签约各方同意并确认本计划在投资、管理和运作过程中涉及的增值税及与增值税相关的附加税费（如，但不限于，城建税、教育费附加及地方教育费附加等）等仍由委托财产承担，届时管理人可通过本计划托管账户直接缴付，或划付至管理人账户并由管理人依据税务部门要求完成相关纳税申报义务。

本计划清算后，若管理人被税务机关要求补缴应由委托财产承担的任何税费，管理人有权向投资者追索实际补缴的税费。

6、其他费用：

银行结算费用、开户费、银行间账户维护费、银行间交易费、转托管费、年度专项审计费用等集合计划运营、交易过程中发生的相关费用。

银行结算费用、开户费、银行间账户维护费在每个费用支付日一次计入集合计划费用。

本集合计划的年度审计费，在被审计的会计期间，于支付时一次

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，可以一次性计入集合计划费用；如果金额较大，并且可以对应到相应会计期间，应在该会计期间内按直线法摊销。

（二）不列入集合计划费用的项目

集合计划成立前发生的费用，以及存续期间发生的与募集有关的费用，不得在集合计划资产中列支。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财产的损失，以及处理与集合计划财产运作无关事项或不合理事项所发生的费用等不得列入集合计划的费用。

（三）管理人的业绩报酬

1、管理人收取业绩报酬的原则：

（1）在收益分配基准日、投资者退出日和计划终止日对符合业绩报酬提取条件的份额计提业绩报酬；

（2）在收益分配基准日提取业绩报酬的，业绩报酬从分红中扣除；

（3）在投资者退出或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）投资者申请退出时，管理人按“先进先出”的原则，即按照投资者份额参与的先后次序进行顺序退出的方式确定退出份额，计算、提取退出份额对应的业绩报酬。

（5）业绩报酬提取频率不得超过每6个月一次。因投资者退出

资产管理计划，管理人按照资产管理合同的约定提取业绩报酬的，不受前述提取频率的限制。

2、业绩报酬的计提方法：每笔参与份额以上一个发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日（如该笔参与份额不存在上一个发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日，则募集期参与的为注册登记机构份额注册登记日，存续期参与的为份额参与日，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：

$$R = \frac{(P_1 - P_0)}{P_0^*} \div D \times 100\%$$

业绩报酬计提日为收益分配基准日、投资者参与份额退出日或计划终止日；

P_1 为业绩报酬计提日的计划单位累计净值；

P_0 为上一个发生业绩报酬计提日的计划单位累计净值；

P_0^* 为上一个发生业绩报酬计提日的计划单位净值；

D 表示上一个发生业绩报酬计提日到本次业绩报酬计提日的年限（1年按365天计算）；

R 为年化收益率。

管理人业绩报酬计提公式如下：

$$Y = A \times (R - a) \times b \times D$$

Y = 业绩报酬；

A = 每笔参与份额在上一个发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日的资产净值总额；

R = 年化收益率；

a=业绩报酬计提基准（0%）；

b=业绩报酬计提比例（20%）。

3、业绩报酬支付：当发生收益分配、集合计划份额退出或集合计划终止时，托管人根据管理人的指令将退出净值总额（含业绩报酬和退出费用）或分红金额（含业绩报酬）划拨给注册登记机构，由注册登记机构将业绩报酬和退出费用支付给管理人，并将扣除业绩报酬和退出费用的退出款项转入销售机构在注册登记机构的资金账户。托管人对业绩报酬的计算不承担复核义务和责任。

二十一、集合计划的收益分配

（一）收益的构成

收益包括：集合计划投资所得债券利息、红利、股息、买卖证券价差、银行存款利息及其他合法收入。集合计划的净收益为集合计划收益扣除按照国家有关规定可以在集合计划收益中扣除的费用后的余额。

（二）可供分配利润：指截至收益分配基准日资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

（三）收益分配原则

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、在符合分红条件和收益分配原则的前提下，管理人可选择收益分配的比例及时间；

3、现金红利款自款项从集合计划托管账户划出之日起 7 个工作

日内划转到投资者账户；

4、收益分配时发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担；

5、集合计划成立不满 6 个月可不进行收益分配；

6、收益分配频率不超过每 6 个月一次；

7、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

（四）收益分配方案的确定与通知

本集合计划收益分配方案由集合计划管理人拟定，至少在 T-3 日通知托管人，至少在 T-2 日（T 为权益登记日）之前将收益分配方案以至少一种指定方式进行信息披露。

（五）收益分配的执行方式

本集合计划的默认分红方式为现金分红，投资者可以选择现金分红或者红利再投资分红方式。投资者选择红利再投资分红方式的，分红资金按分红除权日当日的单位净值自动转为本集合计划的份额，免收参与费（红利再投资不受本计划份额上限的限制）；投资者选择现金分红方式的，管理人将现金红利款划往销售机构账户，再由销售机构划入投资者账户，现金红利款自款项从集合计划托管账户划出之日起 7 个工作日内到达投资者账户。

红利再投资形成的集合计划份额计算保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分采用去尾法，由此产生的差额部分计入集合计划资产。

二十二、集合计划的信息披露与报告

(一) 定期报告

定期报告包括集合计划净值报告、集合计划的资产管理季度（年度）报告、托管季度（年度）报告、年度审计报告。

1、集合计划净值报告

集合计划成立后每个交易日计算和确认集合计划净值，并于每周在官网披露经托管人复核的资产管理计划份额净值。

2、集合计划的资产管理季度报告和托管季度报告

每季度由管理人统一向投资者提供一次准确、完整的资产管理计划季度报告和托管季度报告，上述报告应于每季度结束之日起一个月内通过管理人网站公告。本集合计划成立不足3个月或存续期间不足3个月时，可以不编制当期的季度报告。

3、集合计划的资产管理年度报告和托管年度报告

每年度由管理人统一向投资者提供一次准确、完整的资产管理计划年度报告和托管年度报告，上述报告应于每个会计年度截止之日起四个月内挂网公告。本集合计划成立不足3个月或者存续期不足3个月时，可以不编制当期的年度报告。年度报告包括但不限于下列信息：

- (1) 管理人履职报告；
- (2) 托管人履职报告；
- (3) 本集合计划投资表现；
- (4) 本集合计划投资组合报告；
- (5) 本集合计划运用杠杆情况（如有）；

(6) 本集合计划参与股指期货交易的有关情况,包括投资目的、持仓情况、损益情况、投资股指期货对集合计划总体风险的影响以及是否符合既定的投资目的等;

(7) 本集合计划财务会计报告;

(8) 本集合计划支付的管理费、托管费、业绩报酬(如有)等费用的计提基准、计提方式和支付方式;

(9) 本集合计划投资收益分配情况;

(10) 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;

(11) 中国证监会规定的其他事项。

本集合计划季度报告应当披露前款除第 7 项之外的其他信息。

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集合计划的年度财务会计报告进行审计,审计机构应当对资产管理计划会计核算及净值计算等出具意见,在每年度结束之日起 4 个月内将审计报告提供给托管人,并通过管理人网站公告。

(二) 临时报告

集合计划存续期间,发生对集合计划持续运营、投资者利益、资产净值产生重大影响的事件,除监管规则或合同另有规定的,管理人应当在事项发生之日起 5 日内以挂网公告的方式及时向投资者披露。

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、资产管理计划因委托财产流动性受限等原因延长清算的；
- 4、集合计划涉及重大诉讼、仲裁、财产纠纷的；
- 5、集合计划出现延期兑付、负面舆论、群体性事件等重大风险事件的；
- 6、负责本集合计划的销售机构发生变更；
- 7、集合计划投资于管理人、托管人及与前述机构的控股股东、实际控制人或者其他关联方发行的证券或承销期内承销的证券；
- 8、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；
- 9、管理人、托管人因解散、破产、撤销等原因不能履行相应职责；
- 10、管理人以自有资金参与和退出的情形；
- 11、以集合计划资产从事重大关联交易；
- 12、其他对集合计划持续运营、投资者利益、资产净值产生重大影响的事件。

（三）管理人的董事、监事、从业人员及其配偶、控股股东、实际控制人或者其他关联方参与本集合计划，应向投资者充分披露。

（四）管理人、托管人将根据《指导意见》、《管理办法》、《运作规定》等监管要求，通过邮件、监管指定系统等认可的形式向中国证

监会相关派出机构、证券投资基金业协会等监管机构报送集合计划定期报告、重大事项临时报告及其它监管要求的信息。报告包括但不限于：

1、管理人应当于每月十日前向证券投资基金业协会报送资产管理计划的持续募集情况、投资运作情况、资产最终投向等信息。

2、管理人应当在每季度结束之日起一个月内，编制资产管理业务管理季度报告，并报中国证监会相关派出机构备案。管理人、托管人应当在每年度结束之日起四个月内，分别编制资产管理业务管理年度报告和托管年度报告，并报中国证监会相关派出机构备案。管理人应当在在私募资产管理业务管理季度报告和管理年度报告中就风险管理与内部控制制度在报告期内的执行情况等进行分析。

3、管理人进行年度审计，应当同时对资产管理业务的内部控制情况进行审计，并在每年度结束之日起四个月内将前述审计结果报送中国证监会相关派出机构等监管机构。

4、资产管理计划发生重大影响事项时应及时向中国证监会相关派出机构提交重大事项的临时报告。

监管要求变动的，管理人、托管人向监管机构报告的事项、内容等同步调整。

平安证券股份有限公司将通过指定网站进行集合资产管理计划的信息披露，包括但不限于产品单位净值/累计净值、定期报告（季度、年度）、临时报告、产品公告、公司公告等信息。指定网站：<https://stock.pingan.com/>。

二十三、风险揭示

本集合计划的风险等级为R3(中风险),面临包括但不限于以下风险:

(一) 特殊风险揭示

1、资产管理合同与证券投资基金业协会合同指引不一致所涉风险

本合同是基于中国基金业协会发布的《集合资产管理计划资产管理合同内容与格式指引(试行)》而制定的,管理人根据自身实际情况对合同指引相关内容做出了合理的调整,可能导致本合同被中国基金业协会认定为与合同指引不完全一致,从而要求管理人重新修订完善的风险。管理人将及时根据中国基金业协会的要求提交说明材料,如涉及投资者相关权利义务的,管理人及时在指定网站进行信息披露,相关内容以披露的信息为准。

2、特定投资方法及集合计划所投资的特定投资对象可能引起的特定风险

(1) 本计划投资公募基金产品的风险

A. 本计划开放日与所投资公募基金产品的开放日可能存在不一致的情形,因此投资者在本计划开放日申请退出委托资产时,本计划所投资的产品可能无法及时变现,存在本计划在开放日现金资产不足以支付退出款项的风险。

B. 本计划可能投资于公募基金,并将按照所投资基金合同及管理人公告的规定,承担公募基金的管理费、托管费和其他费用。公募基

金的管理费与本计划管理费分别核算与支付。

C. 估值时间不一致的风险。本计划投资的公募基金产品，可能存在估值时间不一致、披露时间不一致的情况，本计划按照所投产品的最近的单位净值或本合同约定的其他方法进行估值。在本计划存续期间，本计划的估值可能无法反映真实投资管理情况。

D. 净值波动或不准确风险

按照本合同第十九条的估值方法，当本计划投资于公募基金时，有如下情形之一时，可能导致本计划的净值波动：

- 1) 估值日无法及时获取上述投资品种的最新估值价格；
- 2) 估值日取得的上述投资品种的最新估值价格没有或无法排除影响估值价格的因素（例如在估值日无法排除业绩报酬（如有）对估值价格的影响）；
- 3) 按照基准收益率（或类似安排）反应的估值价格与实际兑付的收益产生差异。
- 4) 托管人以管理人或者其他第三方提供上述产品的资产净值为估值依据，若管理人或者其他第三方提供的资产净值数据错误将导致本计划的估值数据未能准确反映本计划的实际资产净值情况，可能导致本计划财产出现损失的风险。

（2）投资金融衍生品的风险

A. 流动性风险

本集合计划在金融衍生品市场成交不活跃时，可能在产生较高的冲击成本（不利交易价格）和时间价值（交易延迟风险）。

B. 保证金不足风险

由于金融衍生品价格朝不利方向变动，导致保证金低于金融期货交易所或者期货经纪商的最低保证金要求，如果不能及时补充保证金，金融衍生品头寸将被强制平仓，直接影响本集合计划收益水平，从而产生风险。

C. 衍生品杠杆风险

金融衍生品的投资收益与风险与保证金相比具有杠杆效应。若行情向不利方向剧烈变动，本集合计划可能承受超出保证金甚至计划资产本金的损失。

(3) 投资于科创板股票和新股申购的投资风险

本集合计划可投资于科创板股票，此类投资除股票投资的共有风险外，还可能因为以下因素导致其投资风险高于其他沪深证券交易所上市交易的股票。

A. 公司风险：科创板的上市条件更加灵活，同时退市的标准、程序、执行更加严格，科创板企业具有业务模式新、不确定性大等特点，企业的经营风险较大。

B. 流动性风险：科创板上市公司数量相对较少，市场的整体流动性可能不如沪深证券交易所其他板块市场。

C. 交易风险：科创板交易机制相较于沪深证券交易所其他板块不同，如科创板放宽了涨跌幅限制，因此其股票市值的波动性可能较大，从而产生风险。

D. 交易机制变化的风险：科创板作为我国新设立的交易板块，其

相关的上市、交易、退市等制度可能会有调整，从而带来投资的不确定性，产生相关风险。

E. 新股申购的风险是指获配新股上市后其二级市场交易价格下跌至申购价以下的风险。

(4) 投资债券逆回购的特有风险

信用风险：逆回购交易中交易对手在回购到期时，不能偿还全部或部分证券或价款，造成计划净值损失的风险；

(5) 投资于北交所股票和新股申购的投资风险

1) 北交所主要服务创新型中小企业，企业多处于成长期，规模可能偏小往往具有依赖核心技术人员和供应商、客户集中度高、应对外部冲击能力较弱等特点，企业上市后的持续创新能力、收入及盈利水平等仍具有较大不确定性。

2) 北交所设置四套上市标准，其中允许未盈利企业上市。因此可能存在企业向不特定合格投资者公开发行股票并在北交所上市时尚未盈利、有累计未弥补亏损等情形，以及在上市后仍无法盈利、持续亏损、无法进行利润分配等情况。

3) 因北交所上市企业多聚焦行业细分领域，业绩受外部环境影响受外部环境影响大，可比公司较少，传统估值方法可能不适用，上市后可能存在股价波动的风险。

4) 发行人发行承销过程中，出现预计发行后总市值无法满足招股文件所选上市标准的，将按规定中止发行。

5) 公开发行股票并上市时，发行人和主承销商可以采用超额配

售选择权，即存在超额配售选择权实施结束后，发行人增发股票的可能性。

6) 北交所股票可能因触及退市情形被终止上市。因触及交易类情形被终止上市的北交所股票，不进入退市整理期；因触及财务类、规范类及重大违法类情形被终止上市的，进入退市整理期交易 15 个交易日，且首个交易日不设价格涨跌幅限制。投资者应当充分了解北交所退市制度及相关规定，密切关注北交所股票退市相关风险。

7) 北交所股票上市首日不设涨跌幅限制，其后涨跌幅限制为 30%，投资者应当关注可能产生的股价波动风险。

8) 北交所股票交易具有盘中临时停牌情形，设有异常波动股票核查制度，投资者应当关注与此相关的风险。

9) 北交所证券相关法律、行政法规、部门规章、规范性文件（以下简称法律法规）和交易所业务规则，可能根据公开征求意见结果和市场情况进行修改，或者由相关部门制定新的法律法规和业务规则，投资者应当及时予以关注和了解。

3、本集合计划委托募集所涉风险

管理人可以委托在中国证监会注册取得基金销售业务资格并已成为中国基金业协会会员的机构销售本集合计划，销售机构可能存在违法违规地公开宣传、虚假宣传、以保本保收益引诱投资者购买、未能履行投资者适当性审查工作等行为导致基金投资者合法权益受损的风险。

4、本集合计划份额转让所涉风险

集合计划存续期间，当集合计划份额转让业务开通后，投资者可以通过证券交易所以及中国证监会认可的其他方式，向合格投资者转让其持有的集合资产管理计划份额，并按规定办理份额变更登记手续。所涉及的风险包括但不限于：

(1) 操作系统风险。办理转让操作的系统可能因为人为或客观原因出现故障，影响转让业务办理。

(2) 折溢价风险。办理份额转让时，份额的交易价格可能与份额单位净值发生偏离的风险。

5、合同变更的风险

管理人就合同变更征求投资者意见期间，未明确提出异议的投资者、不同意合同变更但逾期未提出退出申请的投资者均视为同意修改或变更合同和说明书。部分投资者可能因为未能提供有效的联系方式或者未能将变动后的联系方式及时通知管理人，而无法及时获知合同变更事项，如果投资者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。

6、未通过监管备案的风险

本集合计划存在募集完成后未在证券投资基金业协会完成备案或证券投资基金业协会不予备案的情形，导致集合计划财产不能进行投资运作，甚至终止清算的风险。

7、参与受限的风险

本集合计划投资者数量不得超过 200 人，投资者可能面临因集合计划参与人数达到上限而无法参与集合计划的风险。

8、集合计划提前终止的风险

集合计划存续期间，当满足本合同约定的集合计划终止情形，集合计划将终止，进入清算程序，投资者可能面临集合计划因上述原因终止而停止投资的风险。

9、投资者部分退出资产管理计划的，其退出后持有的资产管理计划份额净值低于最低参与金额且投资者没有一次性申请全部退出的，管理人在退出申请确认日对该投资者所持有的全部份额做退出确认的风险。

10、本计划主要采用量化投资策略，因模型不能完全、有效的刻画市场运行中的真实情况，在测算、评估时可能存在误差（历史表现不保证未来表现），如模型中的参数估计存在误差，或者市场条件忽然发生变化等原因，模型的可靠性或对产品净值产生影响。此外，如策略交易频率较高，可能导致投资交易的手续费等相关税费支出较高，影响产品收益。

（二）一般风险揭示

1、本金损失风险

管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用本集合计划财产，但不保证本集合计划财产中的认（申）购资金本金不受损失，也不保证一定盈利及最低收益。

本计划属于 R3 风险投资品种，适合风险识别、评估、承受能力 C3 及以上的合格投资者。

2、市场风险

市场风险是指投资品种的价格因受经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素影响而引起的波动，导致收益水平变化，产生风险。市场风险主要包括：

（1）政策风险

货币政策、财政政策、产业政策和证券市场监管政策等国家政策的变化对证券市场产生一定的影响，可能导致证券价格波动，从而影响收益。

（2）经济周期风险

证券市场受宏观经济运行的影响，而经济运行具有周期性的特点，而周期性的经济运行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）购买力风险

投资者的利润将主要通过现金形式来分配，而现金可能因为通货膨胀的影响而导致购买力下降，从而使投资者的实际收益下降。

（5）再投资风险

再投资风险反映了利率下降对固定收益证券利息收入再投资收益的影响，这与利率上升所带来的利率风险互为消长。具体为当利率

下降时，集合计划从投资的固定收益证券所得的利息收入进行再投资时，将获得比之前较少的收益率。

(6) 衍生品风险

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

3、管理风险

本集合计划运作过程中，管理人依据资产管理合同约定管理和运用本集合计划财产所产生的风险，由本集合计划财产及投资者承担。投资者应充分知晓投资运营的相关风险，其风险应由投资者自担。

4、流动性风险

本集合计划因市场整体或投资品种流动性不足、应付可能出现的投资者巨额退出或大额退出等原因，不能迅速转变成现金，或者转变成现金会对资产价格造成重大不利影响的风险。

5、信用风险

交易对手方未能实现交易时的承诺，按时足额还本付息的风险，或者交易对手未能按时履约的风险。

6、募集失败风险

本计划的成立需符合相关法律法规的规定，本计划可能存在不能满足成立条件从而无法成立的风险。

管理人的责任承担方式：

- (1) 以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用；
- (2) 在本集合计划募集期限届满（确认本集合计划无法成立）

后三十日内返还投资者已缴纳的款项，并加计银行同期活期存款利息。

7、投资标的的风险

本集合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、税收风险

契约式产品所适用的税收征管法律法规可能会由于国家相关税收政策调整而发生变化，投资者收益也可能因相关税收政策调整而受到影响。

9、网上交易及电子签名可能存在的风险

(1) 由于互联网是开放性的公众网络，网上申购或交易具有诸多风险；

(2) 由于互联网数据传输等原因，网上申购或交易可能会出现中断、停顿、延迟、数据错误、传输不及时等情况；

(3) 投资者密码泄露或身份可能被仿冒；

(4) 互联网上存在黑客恶意攻击的可能性，存在病毒入侵的可能性，互联网服务器可能会出现故障及其他不可预见的因素；

(5) 网上申购及电子签名可能存在的不可预见的其他风险。

上述风险可能会导致投资者发生损失。

风险防范措施：管理人及销售机构已对网上“操作平台”采取了

有效措施来保护网上申购或交易的安全，但上述风险依然存在。投资者采用网上“操作平台”申购、交易和使用电子签名，需要注意以下几点，以便防范风险：

(1) 投资者网上“操作平台”使用的电脑，须安装正版的病毒防火墙和网络防火墙软件，并确认其均工作正常；

(2) 投资者须定期修改电子签名的登录密码，密码不要过于简单或者易于猜测，如果将密码泄露，须及时修改密码；

(3) 投资者的网上申购或交易行为，不应在社会性网吧中办理；

(4) 投资者在网上申购或交易过程中如碰到异常或者疑问，可先查阅相关的“帮助”，不能解决的，可向管理人、销售机构进行咨询。

10、关联交易风险

为保障投资者利益最大化，管理人在根据本合同规定管理、运用委托财产时，可以公平的市场价格进行关联交易（如将集合计划资产投资于管理人、托管人及与前述机构的控股股东、实际控制人或者其他关联方发行的证券或承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易）。本资产管理计划的托管银行为平安银行股份有限公司【深圳】分行，投资者在此同意并接受开展该等关联交易。

11、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。

12、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。

13、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。

二十四、资产管理合同的变更、终止和财产清算

（一）资产管理合同的变更

1、本合同签署后，因法律法规或中国证监会、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。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通告投资者满5个工作日后生效。投资者对更新或修改的内容有异议，可在更新或修改内容生效前的临时开放日内申请退出本集合计划。

2、如管理人或托管人决定调低本资产管理计划相关费用（包括但不限于参与费、退出费、管理费、托管费、业绩报酬收取比例），经管理人与托管人协商一致，可在调整实施的3个工作日前，于管理人官方网站告知投资者，无需征求投资者意见。管理人在其网站公告前述调整事项即视为履行了告知义务。

3、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通告投资者。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。管理人须在公告后 15 个工作日内，以管理人指定的网站公告向投资者征询合同变更意见，并采取如下权利保障措施及安排：

(1) 投资者应在公告指定的日期内按指定的形式回复意见，逾期未做答复的，视为投资者同意全部变更事项；

(2) 投资者向管理人答复不同意合同变更事项的，则应当在管理人发出的公告中确定的临时开放日内提出退出申请，逾期未提出退出申请的，则投资者其已以行为表明其对合同变更的最终确定的意思表示应为同意公告中载明的全部变更事项。

变更事项自公告指定的临时开放日届满的次工作日开始生效，对合同各方均具有法律效力。本合同变更生效之日起，变更后的内容即成为本合同组成部分。

投资者退出本集合计划后对资产管理合同补充或修改的异议将不影响合同的变更。投资者同意，无论其是否提出退出申请，管理人变更合同的行为均不应被归为或裁定为管理人的违约行为。

4、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。

5、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。

6、管理人应当自资产管理合同变更之日起 5 个工作日内报证券

投资基金业协会备案。

（二）管理人、托管人的变更

1、有下列情形之一的，管理人职责终止：

- （1）被依法取消资产管理业务资格；
- （2）依法解散、被依法撤销或被依法宣告破产；
- （3）法律法规及中国证监会规定的和合同约定的其他情形。

2、管理人的更换程序

（1）新任管理人由托管人提名，并征询投资者意见，经三分之二以上（含三分之二）投资者同意后通过。若投资者不同意，投资者有权办理退出手续。

（2）管理人更换后，由托管人公告。

（3）管理人职责终止的，管理人应妥善保管业务资料，及时向临时管理人或新任管理人办理业务移交手续。临时管理人或新任管理人应与托管人核对资产总值和净值。

3、有下列情形之一的，托管人职责终止：

- （1）被依法取消基金托管资格；
- （2）依法解散、被依法撤销或被依法宣告破产；
- （3）法律法规及中国证监会规定的和合同约定的其他情形。

4、托管人的更换程序

（1）新任托管人由管理人提名，并征询投资者意见，经三分之二以上（含三分之二）投资者同意后通过，若投资者不同意，投资者有权办理退出手续。

(2) 托管人更换后，由管理人公告。

(3) 托管人职责终止的，托管人应妥善保管业务资料，及时向临时托管人或新任托管人办理业务移交手续。临时托管人或新任托管人应与管理人核对资产总值和净值。

5、若将来法律法规或监管规则修改，管理人与托管人协商一致，并履行适当程序和提前公告后，可对本部分相应内容进行修改和调整。

(三) 集合计划的展期

1、本集合计划展期应符合以下条件：

(1) 本集合计划运作规范，管理人、托管人未违反法律、行政法规、中国证监会规定和资产管理合同的约定；

(2) 本集合计划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；

本集合计划展期的，应当符合本集合计划的成立条件。

2、本集合计划展期的情形：

集合计划有下列情形之一的，集合计划应当展期：

(1) 集合计划存续届满但本集合计划财产尚未全部变现，且管理人决定展期的；

(2) 经全体投资者、管理人和托管人协商一致决定合同展期的；

(3) 委托财产涉及诉讼（或仲裁），且诉讼（或仲裁）及执行程序尚未终结的；

(4) 管理人认为有必要展期的其他情形；

(5) 法律规定的及本合同约定的其他情形。

3、展期的程序：

(1) 集合计划展期，管理人在取得托管人同意后，管理人将按照本合同约定通知投资者，征求投资者意见并取得投资者回复意见，若同意本集合计划展期的投资者的人数不少于 2 人且参与资金总额不低于 1000 万元，则展期得以实现，管理人将在集合计划展期后【5】日内，将展期情况报中国证券投资基金业协会备案。

(2) 展期的期限：展期的期限以展期后资产管理合同的约定为准。

4、展期的安排

(1) 通知展期的时间及方式

集合计划展期，管理人应当及时通过管理人网站或其他方式书面形式通知投资者，征求投资者意见，投资者应当在【5】个工作日内明确意见。

(2) 投资者回复的方式

投资者不同意集合计划展期的，有权在管理人公告规定的 5 个工作日异议期限内提出退出申请；投资者未在 5 个工作日异议期限内提出退出申请的，视为同意集合计划展期。

5、展期的实现

同意本集合计划展期的投资者的人数不少于 2 人且参与资金总额不低于 1000 万元时，本集合计划即实现展期。

6、展期情况备案

本集合计划展期后 5 日内，管理人将展期情况公告并报中国证券

投资基金业协会备案。

（四）集合计划终止的情形

有下列情形之一的，集合计划应当终止：

- 1、本集合计划存续期届满且不展期；
- 2、当本集合计划规模小于【1000万】导致无法有效地进行投资，管理人可以与托管人协商一致提前终止本集合计划；其他情形下，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、为维护投资者利益，经管理人审慎考虑，认为有必要终止运作的；
- 8、管理人未按本合同约定进行投资运作，经全体委托人一致同意提前终止运作的；
- 9、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。

管理人应当自本集合计划终止之日起5个工作日内报证券投资基金业协会备案，前述第6项约定的情形除外。

（五）集合计划的财产清算

本集合计划在发生终止情形之日起 5 个工作日内开始组织清算本集合计划资产，以及财产清算的有关事项：

1、本集合计划财产清算小组

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

2、清算的程序

(1) 本合同约定的终止情形出现时，由集合计划财产清算小组统一接管集合计划财产；

(2) 对集合计划财产和债权债务进行清理和确认；

(3) 对集合计划财产进行估值和变现；

(4) 制作清算报告；

(5) 聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计；

(6) 将清算报告报证券投资基金业协会备案；

(7) 对集合计划剩余财产进行分配。

3、清算费用

清算费用是指集合计划财产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，清算费用优先从集合计划财产中支付。

4、本集合计划财产清算及剩余资产的分配

清算结束后 20 个工作日内，管理人和托管人应当在扣除清算费用、管理费、业绩报酬及托管费等费用后，将集合计划资产按照投资

者拥有集合计划份额的比例或集合资产管理合同的约定以货币资金的形式全部分派给投资者。

5、延期清算

若本集合计划在终止之日有因流动性受限等原因导致证券或资产管理产品等资产未能流通变现，管理人延期清算的，管理人应对此制定延期清算方案并通过管理人网站进行披露。管理人应当及时向中国证监会相关派出机构报告。

6、财产清算报告

清算结束后 5 个工作日内将清算结果报证券投资基金业协会备案。清算结束后 20 个工作日内由集合计划清算小组在管理人网站公布清算报告。

7、账户的注销

本集合计划财产清算完毕后，管理人按照规定注销证券交易账户等各种投资账户。托管人按照规定注销本集合计划财产的托管账户等投资所需账户，管理人应给予必要的配合。

8、本集合计划财产清算账册及文件由管理人保存 20 年以上。

二十五、违约责任与争议处理

(一) 违约责任

1、管理人、托管人在履行各自职责的过程中，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；因共同行为给计划财产或者投资者造成损害的，应当承担连带赔偿责任。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、注册与过户登记人非正常的暂停或终止业务、证券交易所非正常暂停或停止交易等。

一方因不可抗力不能履行本合同时，应及时通知另一方，并在合理期限内提供受到不可抗力影响的证明，同时采取适当措施防止集合计划财产损失扩大。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。

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。

（二）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，任何一方均有权将争议提交深圳国际仲裁院并按其仲裁规则进行仲裁。

二十六、资产管理合同的效力

（一）合同签署的方式

1、资产管理合同是约定资产管理合同当事人之间权利义务关系的法律文件。本合同的签署应当采用纸质合同或电子合同的方式进行，由管理人、托管人、投资者共同签署。

签署纸质合同时，应签署一式三份。投资者为法人的，投资者、管理人和托管人加盖公章以及各方法定代表人或授权代表签字或盖章。投资者为自然人的，资产管理合同由投资者本人签字、管理人和托管人加盖公章以及各方法定代表人或授权代表签字或盖章。

通过电子合同方式签署本合同，管理人、托管人及投资者认可电子合同的法律效力。

2、投资者在签署合同后方可进行认购、参与。

(二) 合同的成立与生效

1、合同的成立

本合同经管理人、托管人和投资者共同签署后合同即告成立。

2、本合同成立后，同时满足以下条件时生效：

(1) 投资者参与资金实际交付并经管理人确认成功；

(2) 本集合计划成立。

资产管理合同自生效之日起对投资者、管理人、托管人具有同等的法律约束力。

(三) 合同的有效期限

本集合计划终止，本合同终止。但本合同项下的清算条款、违约责任条款、争议解决条款仍然有效。

(四) 合同的组成

《平安证券尊享量化中性 1 号集合资产管理计划说明书》、《平安证券尊享量化中性 1 号集合资产管理计划风险揭示书》、经管理人确认有效的投资者参与、退出本集合计划的申请材料和各销售机构出具的集合计划参与、退出业务受理有关凭证、投资者通过电子签名方式产生的数据电文等为本合同的附件，是本合同不可分割的一部分，与合同具有同等法律效力。

(五) 投资者自签订资产管理合同即成为资产管理合同的当事人。

在本集合计划存续期间，投资者自全部退出本集合计划之日起，该投资者不再是资产管理合同的当事人。

二十七、或有事件

本合同所称的或有事件是指，根据相关法律法规的规定，管理人可能以独资或者控股方式成立具有独立法人资格的从事资产管理业务的公司。

投资者在此同意，如果或有事件发生，在管理人与托管人协商一致的基础上，管理人有权将本合同中由管理人享有的权利和由管理人承担的义务转让给上一条所述的从事资产管理业务的公司，并无须就此项变更和投资者另行签订专项协议。但在转让前管理人应以信息披露的形式通告投资者。管理人保障投资者退出本专项计划的权利，并在届时的通告中对相关事项作出合理安排。

管理人应当保证受让人具备开展此项业务的相关资格，并向托管人提供监管机构相关批复文件复印件。

管理人应按照监管机构的要求办理转让手续。

二十八、反虚假宣传条款

投资者、管理人、托管人均清楚并愿意严格遵守中华人民共和国《著作权法》、《商标法》、《专利法》、《反不正当竞争法》等知识产权类、民法典及广告法等相关法律的规定，合同当事人均有权就本合同所约定事项以约定方式在约定范围内进行真实、合理的使用或宣传，但不得涉及合同所约定的保密内容。为避免商标侵权及不当宣传等风险的发生，合同当事人均同意，在使用对方的商标、品牌、企业名称等进行宣传前，均须获得对方事先的书面认可，否则，不得进行此类使用或宣传。合同当事人在此承诺，会积极响应对方提出的就合作事项的合理使用或宣传申请。合同当事人均承认，未经对方事先书面同意而利用其商标、品牌及企业名称等进行商业宣传；虚构合作事项；夸大合作范围、内容、效果、规模、程度等，均属对本合同的违反，并可能因虚假宣传构成不正当竞争，守约方或被侵权人将保留追究相应法律责任的权利。

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

（以下无正文）

(本页无正文,为《平安证券尊享量化中性1号集合资产管理计划资产管理合同》签字页)

投资者: (自然人签字/法人盖章)

法定代表人或授权代表(签字或盖章)

管理人: 平安证券股份有限公司 (盖章)

法定代表人或授权代表(签字或盖章)



何明

托管人: 平安银行股份有限公司深圳分行 (盖章)

法定代表人或授权代表(签字或盖章)



签订日期: 2022年4月14日

