

合同编号：HRRD-000248-ZG

华融融达期货云湾 1 号多策略 FOF 集合 资产管理计划资产管理合同



管理人：华融融达期货股份有限公司

托管人：国信证券股份有限公司

目 录

资产合法性及投资者适当性承诺书	1
第一章 前言	3
第二章 释义	4
第三章 声明与承诺	7
第四章 当事人及权利义务	10
第五章 资产管理计划的基本情况	16
第六章 资产管理计划的募集	20
第七章 资产管理计划的成立与备案	23
第八章 资产管理计划的参与、退出与转让	24
第九章 份额持有人大会及日常机构	31
第十章 资产管理计划份额的登记	31
第十一章 资产管理计划的投资	32
第十二章 投资顾问	36
第十三章 分级安排	36
第十四章 利益冲突及关联交易	36
第十五章 投资经理的指定与变更	37
第十六章 资产管理计划的财产	38
第十七章 投资风险控制	40
第十八章 投资指令的发送、确认和执行	41
第十九章 交易及清算交收安排	44
第二十章 越权交易	44
第二十一章 资产管理计划资产的估值与会计核算	48
第二十二章 资产管理业务的费用与税收	55
第二十三章 资产管理计划的收益分配	61
第二十四章 信息披露与报告	62
第二十五章 风险揭示	64
第二十六章 资产管理合同的变更与终止	75
第二十七章 资产管理计划资产的清算	77
第二十八章 保密	80
第二十九章 违约责任	80
第三十章 争议的处理	82
第三十一章 通知和送达	82
第三十二章 资产管理合同的效力	83
第三十三章 其他事项	84
附件1 风险揭示书	88

资产合法性及投资者适当性承诺书

本人/本单位以真实身份委托华融融达期货股份有限公司运用计划资产进行投资。本人/本单位承诺计划资产来源及用途合法,不属于违反规定的公众集资,符合有关反洗钱法律法规的要求。华融融达期货股份有限公司有权要求本人/本单位提供资产来源及用途合法性证明,对资产来源及用途及合法性进行调查,本人/本单位愿意配合。

本人/本单位保证委托财产为其拥有合法所有权或处分权的资产,委托财产的来源及用途符合中华人民共和国法律法规的相关规定,保证有完全及合法的授权委托资产管理人和资产托管人进行委托财产的投资管理和托管业务。本人/本单位同时保证委托资产没有设置任何可能涉及第三方的权利主张,也没有任何其它限制性条件妨碍管理人对该计划资产行使投资管理权。

本单位以其管理的资产管理产品投资于本资产管理计划的,该产品的所有投资者为符合法律法规规定的合格投资者且委托财产来源合法合规,且均非资产管理产品;本单位承诺投资本计划不存在违反监管要求的产品嵌套,以及以投资本计划规避投资范围、杠杆约束等监管要求等违法违规行为。

本人/本单位符合华融融达期货股份有限公司资产管理业务合格投资者相关标准,合格投资者是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,且满足下列三项条件之一的自然人:家庭金融净资产不低于300万元,家庭金融资产不低于500万元,或者近3年本人年均收入不低于40万元;2)最近1年末净资产不低于1000万元的法人单位;3)依法设立并接受国务院金融监督管理机构监管的机构,包括证券公司及其子公司、基金管理公司及其子公司、期货公司及其子公司、在基金业协会登记的私募管理人、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。

本人/本单位以真实身份参与资产管理业务,保证其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等所有信息和资料真实、准确、完整、合法,不存在任何重大遗漏或误导。前述提供的信息资料如发生任何变

更，委托人应当及时书面告知管理人或销售机构。

本人/本单位承诺：以自己合法所有资金人民币，认购/申购本计划的份额，并未非法汇集他人资金参与本计划。本人/本单位的资金来源合法合规，不存在使用贷款、发行债券等筹集的非自有资金投资本资产管理计划的情形。

本人/本单位将严格遵守以上承诺，否则华融融达期货股份有限公司有权解除合同。本人/本单位承担因此造成的全部损失和法律责任。

承诺人：

(签字或盖章)

日期： 年 月 日

第一章 前言

(一)订立本资产管理合同的依据是《中华人民共和国民法典》(以下简称“《民法典》”)、《中华人民共和国证券法》(以下简称“《证券法》”)、《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《证券期货经营机构私募资产管理业务运作管理暂行规定》、《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计划运作管理规定》(以下简称“《运作规定》”)、《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》”)、《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、行政法规和中国证监会的有关规定。订立本资产管理合同的原则是平等自愿、诚实信用、充分保护本合同各方当事人的合法权益。订立本资产管理合同的目的是为了明确资产委托人、资产管理人和资产托管人在特定多个客户资产管理业务过程中的权利、义务及职责,确保资产管理计划财产的安全,保护当事人各方的合法权益。

(二)委托人保证委托资产的来源及用途合法,签订本合同之前已阅知本合同全文和《风险揭示书》,签订了《资产合法性与投资者适当性承诺书》,并已经了解所有相关权利、义务和风险,明确知悉应自行承担投资风险。

(三)资产委托人自签订资产管理合同即成为资产管理合同的当事人。在本计划存续期间,资产委托人自全部退出资产管理计划之日起,该资产委托人不再是资产管理计划的投资人和资产管理合同的当事人。本合同将在本资产管理计划成立后由管理人报中国证券投资基金业协会(以下简称“证券投资基金业协会”或“基金业协会”)备案并抄报中国证监会相关派出机构,但证券投资基金业协会接受本合同的备案并不表明其对本资产管理计划的价值和收益作出实质性判断或保证,也不表明投资于资产管理计划没有风险。

(四)管理人承诺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,并抄报中国证监会相关派出机构。法律法规、监管规则另有规定的,从其规定。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。

(五)托管人作为计划资产的托管机构承诺按照诚实信用、勤勉尽责的原则安全保管委托人的计划资产,并履行本合同约定的相关义务。

(六)本合同是规定各当事人之间权利义务关系的基本法律文件,其他与本计划相关的

涉及本合同各当事人之间权利义务关系的任何文件或表述,如与本合同不一致或有冲突,均以本合同为准。

第二章 释义

在本合同中,除上下文另有规定外,下列用语应当具有如下含义:

1. 资产管理计划、本计划、计划、集合资产管理计划、资管计划:指华融融达期货云湾1号多策略FOF集合资产管理计划。

2. 本合同、资产管理合同:委托人和管理人、托管人签署的《华融融达期货云湾1号多策略FOF集合资产管理计划资产管理合同》及其附件,以及对合同及附件做出的任何有效变更。

3. 资产委托人、委托人、投资者、投资人、客户:指具备相应风险识别能力和风险承受能力,投资于本资产管理计划不低于一定金额且符合《指导意见》、《运作规定》关于合格投资者要求的投资者。

4. 资产管理人、管理人:指华融融达期货股份有限公司。

5. 资产托管人、托管人:指国信证券股份有限公司。

6. 法律法规:指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、部门规章及规范性文件等、地方法规、地方规章及规范性文件。

7. 合同当事人、当事人:指受本合同约束,根据本合同享受权利并承担义务的法律主体,包括资产委托人、资产管理人和资产托管人。

8. 计划资产、委托资产:指委托人拥有所有权或合法处分权,委托管理人管理的并由资产托管人托管的作为本合同标的的财产。

9. 计划收益:资产管理计划投资所得,即存款利息、基金红利、其他资管产品收益、买卖证券价差以及其他合法收入扣除相关费用后的余额。

10. 代销机构:指符合中国证监会规定的条件,取得基金销售业务资格且受管理人委托代为办理本计划份额销售的机构。

11. 直销机构:指管理人。

12. 募集机构、销售机构:指管理人及代销机构的统称。

13. 资产管理计划资产总值:指资产管理计划拥有的各类有价证券、银行存款本息、应收认购款及其他资产的价值总和。

14. 资产管理计划资产净值:指资产管理计划资产总值减去资产管理计划负债后的价值。

15. 资产管理计划份额净值：指估值日资产管理计划资产净值除以估值日资产管理计划份额总数。

16. 资产管理计划份额累计净值：指资产管理计划份额净值和资产管理计划历史上累计份额派息金额之和。

17. 资产管理计划资产估值：指计算评估资产管理计划资产和负债的价值，以确定资产管理计划资产净值和资产管理计划份额净值的过程。

18. 工作日、交易日、估值日：均指上海证券交易所、深圳证券交易所等相关交易所的正常交易日。

19. 证券账户：指根据中国证券监督管理委员会有关规定和中国证券登记结算有限责任公司等相关机构的有关业务规则，为本资产管理计划开立的相关证券账户。

20. 托管账户：指资产托管人根据有关规定为本资产管理计划开立的专门用于清算交收的银行账户。

21. 期货账户：管理人为计划财产在期货经纪机构开立的期货保证金账户，用于计划财产期货交易结算资金的存管、记载交易结算资金的变动明细以及期货交易清算。

22. 期货交易所：指上海期货交易所、大连商品交易所、郑州商品交易所、上海国际能源交易中心、广州期货交易所和中国金融期货交易所等国务院同意设立的期货交易场所。

23. 初始募集期间：指本计划的初始募集期限自计划份额发售之日起最长不超过60天。管理人可根据计划份额的认购情况，决定延长或缩短初始募集期间，并在计划管理人网站公告。

24. 存续期：指资产管理合同生效至终止之间的期限。

25. 开放期：指销售机构办理本计划参与、退出等业务的期间。

26. 资产管理计划成立日：指资产管理计划达到本合同约定的成立条件后，初始募集期结束并完成验资，经资产管理人公告本计划成立之日。

27. 认购：指在资产管理计划初始募集期间，资产委托人按照本合同的规定购买本计划份额的行为。

28. 参与、申购：指在本计划开放期内，资产委托人按照本合同的规定参与本资产管理计划份额的行为。

29. 退出、赎回：指在本计划开放期内，委托人按照指定销售机构规定的手续，申请部分或全部退出本计划的行为。

30. 违约退出：指资产委托人在非合同约定的退出开放期主动退出资产管理计划的行为，

本计划不接受违约退出。

31. 不可抗力事件：指本合同当事人不能预见、不能避免、不能克服，且在本合同签署之后发生的，使本合同当事人无法全部履行或无法部分履行本合同的任何事件，包括但不限于洪水、地震及其他自然灾害、战争、骚乱、火灾、政府征用或没收、法律法规变化、相关交易所非正常暂停或停止交易以及非当事人所引起或能控制的计算机系统、通讯系统、网络系统、电力系统故障或其他突发事件等情形。

32. 年、年度、会计年度：指公历每年1月1日至12月31日。

33. 元：指人民币元。

34. 中国证监会：指中国证券监督管理委员会。

35. 证券投资基金业协会、基金业协会：指中国证券投资基金业协会。

36. 运营服务机构：指接受管理人委托，根据与其签订的运营外包服务协议中约定的服务范围，为本计划提供份额注册登记、计划估值等服务的机构，本计划的运营服务机构为国信证券股份有限公司

37. 注册登记机构、份额登记机构：指为本计划办理计划份额注册登记业务的机构。本计划的注册登记机构为国信证券股份有限公司。

38. 《基金法》：指《中华人民共和国证券投资基金法》。

39. 《暂行规定》：指《证券期货经营机构私募资产管理业务运作管理暂行规定》。

40. 《暂行办法》：指《私募投资基金监督管理暂行办法》。

41. 《指导意见》：指中国人民银行、中国银行保险监督管理委员会、中国证券监督管理委员会、国家外汇管理局于2018年4月27日联合印发的《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》（银发〔2018〕106号）。

42. 《管理办法》：指中国证监会于2018年10月22日发布并施行的《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》（证监会令〔第151号〕）。

43. 《运作规定》：指中国证监会于2018年10月22日发布并施行的《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》（证监会公告〔2018〕31号）。

44. 结算价：是指某一期货合约当日交易期间成交价格按成交量的加权平均价，当日无成交的，以上一交易日的结算价作为当日结算价。

45. 盘中市价：是指某交易日某一期货合约交易期间的即时成交价格。

46. 收盘价：是指某一期货合约当日交易的最后一笔成交价格。

47. 募集结算专用账户：指本计划募集期开始前为本计划资产在商业银行开立的专门

账户，用于接受资产委托人的委托资金，以及账户内资金与托管账户、委托人收益账户及管理人（或管理人指定的代理销售机构）账户的定向划转。

48. 计划说明书、《计划说明书》：指《华融融达期货云湾1号多策略FOF集合资产管理计划说明书》及其附件，以及对该计划说明书及附件做出的任何有效变更及补充。内容包括资产管理计划名称和类型、资产管理人与资产托管人概况、资产管理计划的投资范围、投资策略和投资限制情况、投资风险揭示、中国证监会规定的其他事项等。

49. 风险揭示书、《风险揭示书》：指《华融融达期货云湾1号多策略FOF集合资产管理计划风险揭示书》及对该风险揭示书做出的任何有效变更及补充。

第三章 声明与承诺

（一）委托人的声明与承诺

1. 委托人承诺其为符合《运作规定》及其他监管规定的合格投资者，具有合法参与资产管理业务的资格，不存在法律、行政法规和中国证监会有关规定禁止或限制参与资产管理业务的情形；资产委托人承诺及保证：符合法律法规、监管机构及自律组织对于本计划投资者的各项要求，包括但不限于：

资产委托人具备相应风险识别能力和风险承担能力，为符合要求的合格投资者：1) 具有2年以上投资经历，且满足下列三项条件之一的自然人：家庭金融资产不低于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、在基金业协会登记的私募管理人、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) 基本养老保险、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。

2. 委托人声明以真实身份参与资产管理业务，保证其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等所有信息和资料真实、准确、完整、合法，不存在任何虚假陈述、重大遗漏或误导。前述提供的信息资料如发生任何实质性变更，委托人应当及时书面告知管理人或销售机构。

3. 委托人声明已充分理解本合同全文，对市场及产品风险具有适当的认识，已了解资产

管理方案和投资策略的风险收益特征,委托人接受管理人的审慎评估并经自我评估认为具备参与资产管理业务的风险承受能力,本委托事项符合其业务决策程序的要求。

4. 委托人声明已听取了管理人对管理人业务资格的披露和对相关业务规则、合同条款、资产管理方案和交易策略的讲解,已阅读并理解《风险揭示书》的相关内容,签订了《资产合法性与投资者适当性承诺书》,并已经了解所有相关权利、义务和风险,清楚认识委托投资存在的市场风险、管理风险、流动性风险和其他风险,并承诺自行承担投资风险和损失。

5. 资产委托人声明委托财产为其拥有合法所有权或处分权的资产,保证委托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,保证有完全及合法的授权委托资产管理人和资产托管人进行委托财产的投资管理和托管业务。委托人保证其投资于计划的委托资产的来源及用途合法,符合有关反洗钱法律法规的要求,且委托资产中没有违反规定的公众集资。委托人同时保证委托资产没有设置任何可能涉及第三方的权利主张,也没有任何其它限制性条件妨碍管理人对该计划资产行使投资管理权,且投资事项符合法律法规的规定及业务决策程序的要求。

6. 本合同由委托人本人签署,如果委托人为机构的,委托人应保证其法定代表人、单位负责人或其授权代表有充分和完整的授权签署本合同,并在本合同上加盖委托人公章或者合同专用章。本合同经委托人正式签署后即构成对委托人合法、有效、可执行及有约束力的法律文件。

7. 委托人声明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。资产委托人承认,资产管理人、资产托管人未对委托财产的收益状况及本金安全作出任何承诺或担保。

8. 资产委托人以其管理的资产管理产品投资于本资产管理计划的,该产品的所有投资者为符合法律法规规定的合格投资者且委托财产来源合法合规,且均非资产管理产品;资产委托人承诺投资本计划不存在违反监管要求的产品嵌套,以及以投资本计划规避投资范围、杠杆约束等监管要求等违法违规行为。

(二) 管理人的声明与承诺

1. 管理人是依法设立的证券期货经营机构或其子公司,并具有从事特定客户资产管理业务资格;

2. 管理人承诺遵守法律、行政法规和中国证监会有关规定，诚实守信，审慎尽责，坚持公平交易，避免利益冲突，禁止利益输送，保护委托人合法权益；

3. 管理人声明已向委托人披露业务资格，讲解有关业务规则和合同内容，提示委托人阅读风险揭示书；

4. 管理人承诺在签订本合同前充分地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；

5. 管理人保证所提供的资料和信息真实、准确、完整、合法；

6. 管理人承诺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；

7. 管理人承诺按照《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；

8. 管理人声明不以任何方式向委托人承诺或担保取得最低收益或分担损失；管理人过往业绩和对计划资产未来的收益预测仅供委托人参考，不构成管理人保证计划资产不受损失或取得最低收益的承诺；

9. 管理人声明禁止管理员工以个人名义接受委托人资产管理委托或向委托人作出最低收益和分担损失的承诺。

（三）托管人的声明与承诺

1. 托管人具有中国证监会认可的从事资产托管业务的资格；

2. 托管人承诺按照《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；

3. 托管人承诺根据法律法规、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；不保证客户计划资产本金不受投资损失或取得最低收益；

4. 托管人保证所提供的资料和信息真实、准确、完整、合法；

（四）管理人、托管人、投资顾问（如有）及相关从业人员不得有下列行为：

1. 利用资产管理计划从事内幕交易、操纵市场或者其他不当、违法的证券期货业务活动；

2. 泄露因职务便利获取的未公开信息、利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关交易活动；

3. 为违法或者规避监管的证券期货业务活动提供交易便利；

4. 从事不公平交易、利益输送等损害投资者合法权益的行为；
5. 利用资产管理计划进行商业贿赂；
6. 侵占、挪用资产管理计划财产；
7. 利用资产管理计划或者职务便利为投资者以外的第三方谋取不正当利益；
8. 直接或者间接向投资者返还管理费；
9. 以获取佣金或者其他不当利益为目的，使用资产管理计划财产进行不必要的交易；
10. 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他行为。

第四章 当事人及权利义务

（一）资产委托人

1. 资产委托人概况

签署本合同且合同正式生效的特定客户即为本合同的资产委托人。资产委托人的详细情况在委托人信息填写页列示。

2. 资产委托人的权利

- （1）按照本合同约定分享资产管理计划财产收益。
- （2）按照本合同约定取得分配清算后的剩余资产管理计划财产。
- （3）监督资产管理人履行投资管理职责及资产托管人履行托管职责的情况。
- （4）按照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）委托人持有的同类资产管理计划份额设定为均等份额，除资产管理合同另有约定外，资产委托人持有的每份同类计划份额具有同等的合法权益。
- （6）按照本合同的约定参与、退出和转让资产管理计划份额。
- （7）根据本合同的规定，参加或申请召集资产管理计划份额持有人大会（如有），行使相关职权。

（8）法律法规、中国证监会及证券投资基金业协会规定的和本合同约定的其他权利。

3. 资产委托人的义务

- （1）认真阅读并遵守本合同，保证以真实身份参与资产管理计划。
- （2）保证委托资金来源及用途合法，按照本合同约定交纳购买资产管理计划份额的款项及规定的费用。
- （3）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。

(4) 承诺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，如实向管理人充分披露实际投资者和最终资金来源。

(5) 认真阅读并签署风险揭示书。

(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) 及时、全面、准确地向资产管理人告知其投资目的、投资偏好、投资限制和风险承受能力等基本情况。

(8) 向资产管理人或其代销机构提供法律法规规定的信息资料及身份证明文件，配合资产管理人或其销售机构履行投资者适当性管理、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；在向管理人或其代销机构提供的各种资料、信息、联系方式发生变更时，及时通知管理人。

(9) 不得违反本合同的规定干涉资产管理人的投资行为。

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

(11) 按照本合同的规定支付资产管理计划份额的参与款项，承担资产管理合同约定的管理费、业绩报酬（如有）、托管费、审计费、税费等合理费用以及因资产管理计划财产运作产生的其他费用。

(12) 保守商业秘密，不得泄露资产管理计划财产投资计划、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。

(13) 投资者联络方式变更的，应主动联系管理人或代销机构进行信息更新。

(14) 在本计划存续期间及时关注资产管理人的短信或邮件提醒或其公司网站公告。

(15) 理解并同意承担委托财产的投资、运作、托管面临本合同“风险揭示”章节以及风险揭示书中列举的各类风险。

(16) 法律法规、中国证监会及证券投资基金业协会规定和本合同约定的其他义务。

(二) 资产管理人

1. 资产管理人概况

名称：华融融达期货股份有限公司

住所：郑州市郑东新区商务内环路27号楼1单元3层01号、2单元3层02号

通讯地址：郑州市郑东新区商务内环路27号3层

邮政编码：450016

法定代表人：苏小勇

注册资本：183030.7304 万元

联系人：段云婷

联系电话：0371-69106189

网站：www.hrrdqh.com

2. 资产管理人的权利

(1) 要求委托人提供与其身份、财产与收入状况、资金来源及用途、资产管理需求、风险认知与承受能力等相关的信息和资料，对委托人适当性进行审慎评估。

(2) 按照本合同的约定，独立或参照投资顾问（如有）的建议管理和运用资产管理计划财产，不受资产委托人（不包括认购本计划份额的投资顾问，如有）的直接或间接（包括但不限于发出投资建议或投资指令等方式）影响。

(3) 依照有关规定和本合同的约定，及时、足额获得资产管理费、业绩报酬（如有），按本合同约定以计划财产支付应由计划财产承担的交易费用、税费及其他费用。

(4) 依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。

(5) 根据本合同及其他有关规定，监督资产托管人，对于资产托管人违反本合同或有关法律法规规定的行为，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，应及时采取措施制止，并报告证监会派出机构及证券投资基金业协会。

(6) 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、投资顾问（如有）、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。

(7) 以资产管理人的名义，代表本资产管理计划行使投资过程中产生的权属登记等权利。

(8) 资产管理人有权根据市场情况对本资产管理计划的总规模、单个资产委托人首次参与金额、每次参与金额及持有的本计划总金额限制进行调整。

(9) 有权对资产委托人进行尽职调查，要求资产委托人提供相关证明文件、资料，并在上述文件和资料发生变更时，及时提交变更后的相关文件与资料。

(10) 法律法规、中国证监会、证券投资基金业协会规定的及本合同约定的其他权利。

3. 资产管理人的义务

(1) 具备开展资产管理业务所需的相关主体资格与内部授权，依法办理资产管理计划的销售、登记、备案事宜。

(2) 按照证券投资基金业协会要求报送资产管理计划产品运行信息。

(3) 制定和执行资产管理投资策略，以诚实信用、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) 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，不得从事有损委托人利益的行为。

(5) 建立健全的内部管理制度，保证所管理的资产管理计划财产与其管理的其他资产管理计划财产、资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（如有）的，应制定投资顾问管理制度，明确相应利益冲突防范机制。

(6) 除依据法律法规、本合同及其他有关规定外，不得为资产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。

(7) 制作调查问卷，对投资者的风险识别能力和风险承担能力进行评估，向符合法律法规规定的合格投资者非公开募集资金，并履行相关法律法规、监管规定要求的投资者适当性管理职责。

(8) 制作风险揭示书，向投资者充分揭示相关风险。

(9) 按照本合同的约定接受和配合资产委托人和资产托管人的监督。

(10) 以资产管理人的名义，代表资产委托人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为。

(11) 计算并按照本合同的约定向资产委托人报告资产管理计划份额净值；按照约定的风险提示机制，及时通知委托人委托资产亏损情况。

(12) 确定资产管理计划份额参与、退出价格，采取适当、合理的措施确保份额交易价格的计算方法符合法律法规的规定和合同的约定；

(13) 召集资产管理计划份额持有人大会（如有），本计划不设份额持有人大会或份额持有人大会设立日常机构的除外。

(14) 确定本计划份额参与、退出价格，采取适当、合理的措施确定份额交易价格的计算方法符合法律法规的规定和合同的约定。

(15) 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。

(16) 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。

(17) 聘请符合《证券法》规定的会计师事务所对年度财务会计报告进行审计。

(18) 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。

(19) 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，并向证券投资基金业协会备案，抄报证监会相关派出机构。

(20) 建立并保存投资者名单。

(21) 组织并参加资产管理财产清算小组，参与资产管理财产的保管、清理、估价、变现和分配。

(22) 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。

(23) 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。

(24) 公平对待所管理的不同资产管理计划财产，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。

(25) 保守商业秘密，不得向任何第三方泄露资产管理计划的投资计划、投资意向等，但法律法规、本合同及监管机构另有规定的除外。

(26) 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。

(27) 办理与受托财产管理业务活动有关的信息披露事项。

(28) 管理人应按照法律法规的要求，履行计算资管计划资产应纳税额并及时向税务机关申报并缴纳税务的义务。

(29) 管理人不得违反《暂行规定》，变相突破投资者人数限制。

(30) 在本合同终止时，按照约定向委托人分配剩余计划资产。

(31) 法律法规、中国证监会及证券投资基金业协会规定的和本合同约定的其他义务。

(三) 资产托管人

1. 资产托管人概况

名称：国信证券股份有限公司

住所：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层

办公地址：深圳市福田区福华一路125号国信金融大厦19楼

邮政编码：518000

存续期间：持续经营

法定代表人：张纳沙

电话：0755-61897778

2. 资产托管人的权利

(1) 依照本合同的规定，及时、足额获得资产管理计划托管费。

(2) 根据相关法律法规及本合同规定，监督及查询资产管理人对资产管理计划财产的投资运作，发现投资或清算指令违反法律、行政法规、中国证监会及证券投资基金业协会的规定或者本合同约定的，有权要求其改正或拒绝执行；对于违反本合同或有关法律法规规定的行为，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情形，有权报告中国证监会及证券投资基金业协会并采取必要措施。

(3) 根据本合同的规定，依法保管资产管理计划财产。

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

3. 资产托管人的义务

(1) 安全保管资产管理计划财产，不得擅自动用或处分托管资产。

(2) 设立专门的资产托管部门，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉资产托管业务的专职人员，负责财产托管事宜。

(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) 除依据法律法规、本合同及其他有关规定外，不得为资产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。

(5) 按规定开设和注销资产管理计划的托管账户及其他投资所需账户，管理人自行开立的账户除外。

(6) 复核资产管理计划资产净值和份额净值。

(7) 根据相关法律法规和资产管理合同约定，复核资产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。

(8) 编制资产管理计划的托管年度报告，并向证券投资基金业协会备案，抄报中国证监会相关派出机构。

(9) 按照法律法规要求和本合同的约定，根据资产管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜。

(10) 按照约定的方式、时间向资产管理人提供资产管理计划委托资产信息。

(11) 办理与本计划托管业务有关的信息披露事项。

(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资产管理的会计账册，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) 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。

(14) 保守商业秘密，不得向任何第三方泄露资产管理计划的投资计划、投资意向等，但法律法规、本合同及监管机构另有要求的除外。

(15) 按照法律法规及本合同规定监督资产管理人的投资运作，资产托管人发现投资或清算指令违反法律、行政法规和中国证监会的规定，或者违反本合同约定的，应当拒绝执行，通知资产管理人并及时报告中国证监会相关派出机构和证券投资基金业协会；资产托管人发现依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和中国证监会的规定，或者违反本合同约定的，有权通知资产管理人并及时报告中国证监会相关派出机构和证券投资基金业协会。

(16) 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；

(17) 国家有关法律法规、监管机构及本合同规定的其他义务。

第五章 资产管理计划的基本情况

(一) 资产管理计划的名称

华融融达期货云湾 1 号多策略 FOF 集合资产管理计划。

(二) 运作方式

定期开放式。

(三) 资产管理计划的类别

本计划的类型为混合类 FOF 集合资产管理计划。

(四) 资产管理计划的投资目标、主要投资方向、投资比例、产品风险等级

1. 本计划的投资目标为：

在控制风险的前提下，力争获取计划资产的长期稳定增值。

2. 本计划的主要投资方向为：

(1) 现金类资产，具体包括：现金、银行活期存款等；

(2) 固定收益资产，具体包括：银行存款（含银行定期存款、协议存款、同业存款等各类存款）、同业存单、货币市场基金、债券逆回购、国债、地方政府债、央行票据、公司债（含非公开发行公司债）、企业债、可转换债券、可交换债（含私募可交换债）、可分离

交易可转债、短期融资券、超短期融资券、中期票据、金融债、债券型公募基金、优先级资产支持证券、优先级资产支持票据、非公开定向债务融资工具、次级债，经银行间市场交易商协会批准注册发行的其他债务融资工具，以及中国证监会认可的比照公募基金管理的固定收益类资产管理产品等；

(3) 权益类资产，具体包括：股票（含证券交易所、全国中小企业股份转让系统上市 的股票及其他经中国证监会允许上市 的股票，以及新股申购所得股票）、港股通标的股票（含内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市 的股票）、股票型公募基金、混合型公募基金、公开募集基础设施证券投资基金（REITs），以及中国证监会认可的比照公募基金管理的权益类和混合类资产管理产品等；

(4) 衍生金融工具投资，具体包括：股指期货、国债期货、商品期货、场内期权等；

(5) 各类公募基金以及中国证监会认可的比照公募基金管理的资产管理产品；

(6) 资产管理计划可以参与证券逆回购，但参与逆回购资金余额均不得超过其上一日净资产的100%；

(7) 法律法规或中国证监会允许投资的其他投资品种。

(8) 各类金融产品（不含其劣后级份额）：银行或银行理财子公司发行的理财产品、证券公司及其子公司资产管理计划、期货公司及其子公司资产管理计划、保险公司资产管理计划、基金公司及其子公司资产管理计划、在基金业协会登记的私募基金管理人发行且有托管机构托管的私募基金。本计划所投资的资产管理产品不得再投资除公募基金以外的其他资产管理产品。

上述各类基金均包括 QDII 基金。

本资产管理计划在中国基金业协会完成备案，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。

本计划建仓期为自本计划成立之日起3个月。

其中，本计划穿透投资标的合并计算（包含公募证券投资基金）后投资固定收益资产的投资市值占资产总值的0-80%（不含80%），权益类资产的投资市值占资产总值的0-80%（不含80%），衍生金融工具持仓合约价值金额占资产总值的0-80%（不含80%）或衍生品账户权益占资产总值的0-20%（不含20%）。本计划投资于接受国务院金融监督管理机构监管的机构发行的资管产品资产的比例依市值计不低于总资产的80%。

管理人将所投资于基金的投资组合按托管人和管理人协商共同认可的方式和频率提供

给托管人,托管人依据管理人提供的数据进行监控。管理人应确保所提供数据的真实性,准确性以及完整性。全体确认,托管人投资监督的准确性和完整性受限于管理人提供的数据和信息,管理人按照诚实信用、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。因本计划所投资子基金管理人原因影响数据真实性,准确性以及完整性的,管理人不承担相关数据责任。

3. 本计划的投资限制为:

(1) 本计划总资产不得超过净资产的 200%; 计算单只产品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;

(2) 本计划参与股票、债券、可转换公司债券、可交换公司债券等证券发行申购时,所申报的金额不得超过该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;

(3) 本计划投资于同一资产的资金,不得超过该计划资产净值的 25%; 本管理人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;

(4) 本计划在其开放退出期内,其资产组合中 7 个工作日可变现资产的价值,不得低于该计划资产净值的 10%;

(5) 按市值计算,投资于一家上市公司所发行的股票,不得超过该上市公司总股本的 4.99%,同时不得超过该上市公司流通股本的 10%。本管理人全部资产管理产品及公募基金投资单一上市公司发行的股票不得超过该上市公司可流通股票的 30%。完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的资产管理计划、公募基金,以及中国证监会认定的其他投资组合可不受前述比例限制;

(6) 本计划主动投资于流动性受限资产的市值在退出开放期内合计不得超过该资产管理计划资产净值的 20%;

(7) 本计划单一信用债投资不超过资产净值的 10%,投资于单一信用主体合计投资比例不超过资产净值的 10%,且主动投资于信用债(不含可交换债券、可转换债券)的信用评级不低于 AA,其中,投资于信用评级为 AAA 及以上的信用债的比例不低于信用债资产的 50%;投资于信用评级为 AA+ 的信用债的比例不高于信用债资产的 50%;投资于信用评级为 AA 的信用债的比例不高于信用债资产的 20%。上述信用评级为债项评级,短期融资券、超短期融资券等短期信用债的信用评级依照评级机构出具的主体信用评级,本计划投资的信用债若无债项评级的,参照主体信用评级。本计划持有信用债期间,如果其信用评级下降不再符合前

述标准，应在评级报告发布之日起3个月内调整至符合约定。本计划对信用债评级的认定参照管理人选定的评级机构出具的债券信用评级；

(8) 本集合计划禁止投资于法律法规规定的非标准化资产，标准化票据在被法律法规或人民银行、证监会等监管机构明确认定为标准化债权类资产前不得投资；

(9) 按市值计算，本计划投资于上市公司所发行的单一股票的投资总额不得超过本计划项下资产净值的25%；

(10) 按市值计算，本计划对单只股票型封闭基金的投资额不能超过本计划资产净值的25%；

(11) 不得主动投资“S”、“ST”、“*ST”、“S*ST”及“SST”类股票；

(12) 法律法规、本合同约定的其他比例限制；

(13) 本计划不投资于非公开发行股票。

4. 本计划的风险等级为：

本资产管理人根据相关规则和本计划实际情况判定，本计划属于【R3】级投资品种，适合风险承受能力为【C3】型及以上的合格投资者。资产委托人应确认具备与本计划相匹配的风险识别能力和风险承担能力，愿意承担相应的投资风险。

(若代销机构根据其风险等级划分方法对本计划风险收益特征的评定与本合同约定不一致，投资者通过代销机构认购/参与本计划份额的，产品风险等级及投资者适当性匹配意见以代理销售机构为准，但代销机构的评级不应低于管理人的评级。)

(五) 存续期限

本资产管理计划的有效期限为自本计划成立公告日起满10年止(如到期日为非工作日，则顺延至最近一个工作日)。

(六) 初始募集面值

人民币1.0000元。

(七) 最低初始募集规模

本计划的初始募集成立规模不低于1000万元，但法律法规、监管机构及自律组织另有规定的除外。

(八) 投资顾问

本资产管理计划不聘请投资顾问。

(九) 托管机构

本计划的托管人为国信证券股份有限公司。

(十) 运营服务机构

本计划的运营服务机构为国信证券股份有限公司,运营服务机构已完成在中国证券投资基金业协会的备案,编号为A00003。

(十一) 份额分级/分类

本计划不分级。

本计划设为均等份额,每份份额享有同等的合法权益。

第六章 资产管理计划的募集

(一) 资产管理计划份额的初始募集期间

本计划初始募集期的具体时间由资产管理人根据相关法律法规以及本资产管理合同的规定确定,并在计划说明书中披露,并在资产管理人网站进行公告,或以本合同约定的其他信息披露形式通知委托人。资产管理计划的初始募集规模不得低于1000万元,初始募集期自资产管理计划份额发售之日起不得超过60天。

资产管理人可根据实际销售及认购人数等情况提前结束本计划份额的初始募集。

资产管理人决定提前终止初始募集,并在资产管理人网站及时公告,或以本合同约定的其他信息披露形式通知投资者,即视为履行完毕提前终止初始募集的程序。资产管理人发布公告提前结束初始募集的,本资产管理计划自公告之时起不再接受认购申请。

(二) 资产管理计划份额的募集方式

本资产管理计划由管理人自行或委托代销机构以非公开的方式进行募集。本计划的代销机构为上海云湾基金销售有限公司,管理人可根据情况变更或增减代销机构,并予以公告。

投资者认购本计划,应与管理人和托管人签订资产管理合同,按资产管理合同规定的方式足额缴纳认购款项。认购的具体金额和份额以管理人的确认结果为准。

(三) 资产管理计划份额的募集对象

本资产管理计划份额的销售对象为符合《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》第三条规定的合格投资者。

本资产管理计划的委托人不少于2名且不得超过200名。若法律法规将来另有规定的,从其规定。

(四) 资产管理计划份额的认购金额限制

委托人初始募集期间认购金额不低于人民币40万元(不含认购费)。委托人均可多次认购,初始募集期间追加委托投资金额应不低于【1】万元(含认购费)人民币。除非本合

同另有约定，认购一经受理不得撤销。

(五) 资产管理计划份额的认购费用

认购费率为 0.5%。认购费由募集机构收取，募集机构有权对个别投资者的认购费进行减免。

(六) 资产管理计划份额的认购事项

本计划认购采取全额缴款认购的方式，委托人在初始募集期内可多次认购，不设单个账户最高认购金额上限，除非本合同另有约定，认购一经受理不得撤销。

1. 认购份额的计算

净认购金额 = 认购金额 / (1 + 认购费率)

认购费用 = 净认购金额 × 认购费率

认购份额 = (净认购金额 + 认购期利息) ÷ 份额初始面值

认购份额计算结果采用四舍五入的方式保留到小数点后 2 位，舍弃部分归入本计划财产。

2. 认购申请确认

募集机构对认购申请的受理并不代表申请一定成功，而仅代表募集机构确实接收到委托人申请，申请是否有效应以管理人的确认并且资产管理合同生效为准。认购的确认以份额登记机构的确认结果为准。委托人应考虑到其申请被拒绝或被部分确认的可能性，并应在本合同生效后到各募集机构查询最终确认情况和有效认购份额。若认购失败，待计划成立后 10 个工作日内，认购本金及利息应返还委托人银行账户，利息金额按银行同期活期利率计算。

本计划的人数规模上限为 200 人。管理人在初始销售期间每个工作日可接受的人数限制内，按照“时间优先；时间相同，金额优先”的原则确认有效认购申请。超出本计划人数规模上限的认购申请为无效申请。无效申请退款不支付利息。

3. 认购缴纳款项及利息的处理方式

管理人应将初始募集期间投资者的认购资金存入募集结算资金专用账户。在本计划成立前，任何机构和个人不得动用。

认购资金在募集结算资金专用账户中实际产生的利息归入投资者认购金额中，并将按照份额面值折算为本计划份额计入份额持有人名下，折算的具体份额以注册登记机构记录的为准。利息的计算按照四舍五入方法，保留到小数点后 2 位，由此误差产生的损失由集合计划财产承担，产生的收益归集合计划财产所有。

4. 支付方式

本计划的投资者须从银行开设的自有银行账户划款进行认购，投资者的认购资金及认购

费不得由第三方账户支付。

(七) 拒绝或暂停认购

出现以下情形之一，管理人可以拒绝委托人的认购：

1. 本计划认购人数接近或达到上限 200 人；
2. 由于不可抗力的原因导致本计划无法正常运作；
3. 当投资者不符合《管理办法》、《运作规定》或其他法律法规及本合同、《计划说明书》关于合格投资者的规定，违反反洗钱、制裁及打击恐怖融资、反贪污贿赂及其他金融犯罪等相关法律法规，或管理人审核后认为不适合接受投资者认购申请的其他情形的；
4. 管理人、推广机构的技术故障等异常情况导致销售系统无法正常运行；
5. 投资者不符合与本计划投资标的有关的法律法规、监管规定、自律规则对于本计划投资者条件的规定的；
6. 拒绝认购申请有利于保护委托人的权益；
7. 法律、法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述第 1、2、4、7 项暂停参与情形之一且管理人决定暂停接受投资者认购申请时，管理人应通过管理人网站公告投资者。如果投资者的认购申请被拒绝，被拒绝的参与款项（不计利息）将退还给投资者，如该投资者为首次参与，就该投资者而言，其签署的《集合合同》自始无效。在暂停参与的情况消除后，管理人应及时恢复参与业务的办理，通过管理人网站公告、信函、传真、电子邮件、手机短信等本合同规定的方式之一告知投资者。

(八) 认购资金的交付

管理人应当将资产管理计划募集期委托人的资金存入专门账户，在资产管理计划募集行为结束前，任何机构和个人不得动用。在募集行为结束后，管理人应当及时将委托人的资金划转至本资产管理计划托管账户。

1、直销处理

资产委托人通过直销渠道认购的，应将委托财产划入如下募集结算专用账户：

本资产管理计划的募集结算专用账户信息：

账户名称： 华融融达期货云湾1号多策略FOF集合资产管理计划募集专户

账户账号： 443899991010004700

账户开户银行名称： 交通银行股份有限公司深圳燕南支行

账户大额支付号： 301584000145

在本计划募集行为结束之前，募集资金任何人不能动用。对募集结算专用账户的监督由

监督机构负责，本计划的监督机构为国信证券股份有限公司。

募集结算专用账户是运营服务机构接受资产管理人委托代为提供运营服务的专用账户，并不代表运营服务机构接受委托人的认购或参与资金，也不表明运营服务机构对本计划的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本计划没有风险。在募集结算专用账户的使用过程中，除非有足够的证据证明是因运营服务机构的原因造成的损失外，资产管理人应就其自身操作不当等原因所造成的损失承担相关责任。

委托人将委托资金划入本计划募集结算专用账户的汇出账户为委托人收益账户，资产管理人只能将募集结算专用账户中的资金定向划拨至该计划对应的托管账户（认购、参与时）、委托人收益账户（分红、退出、清算时）及资产管理人或资产管理人委托的代理销售机构的账户（划拨认购费、参与费、退出费等在本资管合同中列明的费用时）。

2、代销处理（如有）

资产委托人通过管理人委托的代理销售机构认购本计划的，应将委托财产划入代理销售机构指定的代销归集账户，代销机构将资金由代销归集账户划付至募集结算专用账户。

对于采取代销募集方式的募集资金，账户监督机构仅对代销归集账户划入募集账户后的资金承担监督职责，募集资金到达募集账户之前的资金监督，由管理人和代销机构根据法规和协议约定承担。对于通过代销募集方式的参与本计划的投资者份额，其所对应的分配收益、给付赎回款项以及分配计划清算后的剩余计划财产的业务款项，账户监督机构仅将相关款项划入代销归集账户，由管理人和代理销售机构完成对委托人的最终支付，账户监督机构不负责监督职责。

资产管理人应在公司官网披露销售机构代销归集账户（如有）信息。

（九）初始募集期间客户资金的管理

资产管理计划份额初始募集期间，资产管理人应当将初始募集期间客户的资金存入资产管理计划募集结算专用账户。在资产管理计划成立前，任何个人和机构不得动用。

第七章 资产管理计划的成立与备案

（一）资产管理计划的成立

本资产管理计划募集过程符合法律法规、监管机构及自律组织的规定，须由至少2名及2名以上委托人有效认购后方可成立，且不超过200人。本计划初始募集成立规模不得低于1000万元。本计划募集结束后，管理人应将所有净认购资金划转至托管账户，托管人核实到账情况后，并向管理人出具资金到账通知书。本计划募集结束后十个工作日内，管理人委

托符合《证券法》规定的会计师事务所进行验资并出具验资报告，在取得验资报告后，管理人通过网站或者邮件的形式公告本计划成立。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。托管人职责自计划成立日起生效。

（二）资产管理计划备案的条件

管理人应当自资产管理计划成立之日起5个工作日内到中国证券投资基金业协会办理相关备案手续，并抄报中国证监会相关派出机构。客户资料表应包括投资人名称、投资人身份证明文件号码、通讯地址、联系电话、参与计划的金额和其他信息。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。

（三）资产管理计划不能满足成立条件的处理

1. 初始募集期限届满，不符合计划成立条件的，资产管理人应当承担下列责任：

（1）以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用；

（2）在初始募集期间届满后30个工作日内退还投资者已缴纳的款项，并加计自交付之日（含该日）起至退还之日（不含该日）止的期间的银行同期活期存款利息。

2. 计划不能满足成立条件的，投资者应向管理人退还全部资管计划文件；管理人、托管人、募集机构不得向投资者收取任何费用或主张任何报酬。

第八章 资产管理计划的参与、退出与转让

（一）资产管理计划份额的开放期

本资产管理计划成立后每月10日、25日为固定参与开放日（如遇节假日，则顺延至下一个交易日），投资者可于固定参与开放日申请参与本计划。本基金成立后每一自然年度3月15日、6月15日、9月15日、12月15日为固定退出开放日（如遇节假日，则顺延至下一个交易日），投资者可于固定退出开放日申请退出本计划。当固定参与开放日与固定退出开放日重合时，投资者可以申请参与本计划，也可以申请退出本计划。份额持有不满180天的不得在固定开放日及临时开放日退出。红利再投份额在开放日退出不受份额锁定期限制。

在本计划存续期内，除开放日外的期间为封闭期，在此期间管理人不接受委托人的参与和退出申请。

管理人可根据合同约定及本计划运行情况设置临时开放日，临时开放日不允许参与，只允许退出。管理人应在临时开放日前【5】个工作日按照本合同约定的信息披露形式，将具体开放安排告知给委托人。

当出现以下情形时，管理人可设置临时开放日为委托人办理退出：

(1) 法律、法规、行业指引、自律规则发生变化，本资产管理计划相应内容需要进行变更，委托人拒绝签署补充协议的；

(2) 对本计划进行合同变更；

(3) 投资者不同意合同投资经理或投资顾问（如有）变更的。

因管理人未及时通知全体资管计划投资者临时开放日导致的损失，管理人承担责任。管理人应在临时开放日前按照本合同约定的信息披露形式，将具体开放安排告知给委托人。

(二) 参与和退出的场所

投资者应当在销售机构办理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计划份额的参与和退出。

(三) 临时开放期的触发条件、程序及披露等相关安排

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，并由管理人按照合同约定及时向投资者披露变更的具体内容。本计划于此类合同变更后10个交易日内设置临时开放期，保障合同变更后投资者选择退出资产管理计划的权利，具体的临时开放期安排、开放时间由管理人和投资者共同协商确定。在临时开放期内，不允许参与，只允许退出。其具体安排以资产管理人公告为准，届时资产管理人网站上发布公告即视为履行了告知义务。

(四) 资产管理计划份额的参与

1. 参与资格

合格投资者可按照本合同约定及募集机构的要求申请参与资产管理计划份额。

2. 参与价格

参与资产管理计划份额的，每份资产管理计划份额参与价格按可参与的开放日资产管理计划份额净值计算。

3. 金额要求

参照“资产管理计划份额的认购金额限制”执行。

4. 参与费率

参与费率为0.5%。参与费由募集机构收取，募集机构有权对个别投资者的参与费进行减免。

5. 参与资产管理计划份额的计算

净参与金额 = 参与金额 / (1 + 参与费率)

参与费用 = 净参与金额 × 参与费率

参与份额=净参与金额÷参与价格

在投资者参与本资产管理计划时，根据该公式计算的参与份额保留到小数点后两位，第三位四舍五入。

6. 资产管理计划份额的参与方式

拟参与资产管理计划份额的投资者应当于开放日前的第【5】个工作日至开放日前【2】个工作日期间（即【T-5~T-2】，T为当期开放日）向募集机构提交书面参与申请，并向募集账户交付参与资金。未在约定时间内申请的，募集机构有权拒绝该申请。

7. 参与申请的确认

管理人于开放日后3个工作日内对于截至T日的参与申请进行确认。截至开放确认日15:00仍未确认的参与申请，视为参与失败，募集机构应于开放日后5个工作日内将该投资者的全部参与款项无息退还投资者

8. 参与的金额限制

投资者在资产管理计划存续期开放日申请参与资产管理计划的，投资者应符合合格投资者标准，且首次投资金额应不低于40万元（不含参与费用），已持有资产管理计划份额的投资者在资产管理计划存续期开放日追加投资资产管理计划的除外。

（五）资产管理计划份额的退出

投资者可根据本合同约定及募集机构的要求申请退出资产管理计划份额。

1. 退出价格

退出价格以可退出的开放日资产管理计划份额净值计算。

2. 退出时间

拟在当期开放日退出资产管理计划份额的投资者应于开放日前的第【7】个工作日至开放日前【5】个工作日期间（即【T-7~T-5】，T为当期开放日）向募集机构提交书面退出申请，管理人于开放日当日正式受理退出申请。未在约定时间内申请的，募集机构有权拒绝该申请。

3. 退出金额限制

（1）当资产委托人持有的计划资产净值高于40万元时，资产委托人可以选择全部或部分退出资产管理计划份额；选择部分退出资产管理计划份额的，资产委托人在退出后持有的计划资产净值不得低于40万元。当资产管理人发现资产委托人申请部分退出资产管理计划将致使其在部分退出申请确认后持有的计划资产净值低于40万元的，资产管理人有权适当减少该资产委托人的退出份额，以保证部分退出申请确认后资产委托人持有的计划资产净值

不低于40万元。

当资产委托人持有的计划资产净值低于40万元(含40万元)时,需要退出计划份额的,资产委托人必须选择一次性全部退出资产管理计划,投资者未申请一次性全部退出持有份额的,管理人应将该资产管理计划资产委托人所持全部份额做强制退出处理。

(2) 资产管理计划资产委托人退出资产管理计划时,管理人按先进先出的原则,按投资者认购、参与资产管理计划份额的先后次序进行顺序退出。

4. 退出费率

本计划不收取退出费。

5. 退出金额的计算公式

退出金额=退出份数×退出价格-应支付业绩报酬(如有)

在投资者退出本资产管理计划时,根据该公式计算的参与份额保留到小数点后两位,第三位四舍五入。

6. 退出款项的支付

(1) 投资者退出申请经管理人确认后,管理人应在当期开放日后十个工作日内将退出款划入投资者指定的账户。

(2) 在退出款项划付完成当日,即视为就已退出的资产管理计划份额已经完成清算分配;若投资者对退出款有异议,应在退出款到账后三个工作日内向管理人提出书面意见,否则视为投资者完全认同退出款的计算及分配。在退出款划付完成当日,视为该投资者就该部分退出份额已与管理人、托管人解除合同关系,三方之间的就该部分退出份额相关权利与义务自行终止。投资者同意,管理人、托管人无需就当期退出事项另行出具清算报告或其他信息披露文件等。

(六) 拒绝或暂停参与、暂停退出的情形及处理

1. 在如下情形下,管理人可以拒绝接受投资者的参与申请:

(1) 根据市场情况,管理人无法找到合适的投资品种,或存在其他如接受参与申请可能对资产管理计划业绩产生负面影响的其他情形;

(2) 因资产管理计划持有的某个或某些证券进行权益分派等原因,使管理人认为短期内接受参与可能会影响或损害现有资产管理计划资产委托人利益的情形;

(3) 管理人认为接受某笔或某些参与申请可能会影响或损害其他资产管理计划资产委托人利益的其他情形;

(4) 法律法规规定、经监管部门认定的或本合同约定的管理人可拒绝接受参与的其他

情形。

管理人决定拒绝接受某些投资者的参与申请时，参与款项将退回投资者账户。

2. 在如下情形下，管理人可以暂停接受投资者的参与申请：

(1) 因不可抗力导致无法受理投资者的参与申请的情形；

(2) 相关交易场所交易时间临时停市，导致管理人无法计算当日资产管理计划资产净值的情形；

(3) 发生本合同规定的暂停资产管理计划资产估值的情形；

(4) 法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

管理人决定暂停接受全部或部分参与申请时，应当以公告的形式告知投资者。在暂停参与的情形消除时，管理人应及时恢复参与业务的办理并以公告的形式告知投资者。

3. 在如下情形下，管理人可以暂停接受或拒绝资产管理计划资产委托人根据本合同约定提起的退出申请：

(1) 因不可抗力导致管理人无法支付退出款项的情形；

(2) 相关交易场所交易时间临时停市，导致管理人无法计算当日资产管理计划资产净值的情形；

(3) 发生本合同规定的暂停资产管理计划资产估值的情形；

(4) 法律法规规定、经监管部门认定的或本合同约定的管理人可暂停或拒绝接受退出的其他情形。

发生上述情形之一且管理人决定暂停退出的，管理人应当以公告形式告知资产管理计划资产委托人。已接受的退出申请，管理人应当足额支付；如暂时不能足额支付，应当按单个退出申请人已被接受的退出金额占已接受的退出总金额的比例将可支付金额分配给退出申请人，其余部分在后续开放日予以支付。

在暂停退出的情况消除时，管理人应及时恢复退出业务的办理并以公告形式告知资产管理计划资产委托人。

(七) 巨额退出的认定和处理方式

(1) 巨额退出的认定

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

(2) 巨额退出的顺序、价格确定和款项支付

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

顺延退出：

全额退出：当管理人认为有条件支付投资者的退出申请时，按正常退出程序办理。

部分顺延退出：当管理人认为全额兑付资产委托人的退出申请有困难，或会对计划资产净值造成较大波动时，与托管人协商后，资产管理人可在该工作日接受部分退出申请，其余部分的退出申请在后续工作日予以受理。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，投资者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，并以该工作日的计划份额净值为准计算退出金额，依此类推，直至全部办理完毕为止，但不得超过正常支付时间20个工作日，转入下一个工作日的退出申请不享有优先权。本资产管理计划不就延期退出份额的相应款项计算利息。如投资人在提交退出申请时未作明确选择，投资人未能退出部分作自动延期退出处理。

（3）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。

（4）暂停退出

连续2个开放日以上（含本数）发生巨额退出，如资产管理人认为有必要，可暂停接受本计划的退出申请，但暂停期限不得超过20个工作日；已经接受的退出申请可以延缓支付退出款项。

（八）大额退出

单个投资者申请退出比例超过本计划上一个季度报告或年度报告公布的本计划份额的10%时，需提前五个工作日向管理人提交预约申请，否则管理人有权拒绝投资者退出申请。

（九）管理人自有资金参与

资产管理人以自有资金参与并持有的本计划份额，与资产委托人所持的份额享有同等权益、承担同等风险。

（1）如资产管理人以自有资金参与本计划的，资产管理人的自有资金参与本计划的份额不得超过计划总份额的20%。资产管理人及其附属机构以自有资金参与本计划的份额合计不得超过计划总份额的50%。因本计划规模变动等客观因素导致前述比例被动超限的，资产管理人应当依照中国证监会规定及本合同的约定及时调整。

（2）资产管理人以自有资金参与集合资产管理计划的持有期限不得少于6个月。参与、退出时，应当提前5个工作日告知投资者和托管人。

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,资产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本条第(1)款、第(2)款规定的限制,但应当及时告知投资者和托管人,并向相关派出机构及证券投资基金业协会报告。

(十) 资产管理计划份额的转让

1. 在本计划存续期间,份额持有人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,份额转让应遵守交易场所等相关规定及要求,并按规定办理份额变更登记手续。转让完成后份额持有人持有的计划资产净值不得低于40万元,法律法规另有规定的除外。

2. 计划份额的转让应符合国家有关法律法规、监管规则的要求,并按照管理人的要求提供相关资料并履行必要的手续。

3. 计划份额转让期间及转让完成后,持有本计划份额的份额持有人数量合计不得超过200人。

4. 办理份额转让的变更登记,管理人应向注册登记机构发送书面的计划份额转让指令及转让方与受让方已签署并由管理人确认的计划份额转让协议,管理人应确保其书面指令符合相关法律法规、监管规则以及本合同约定。

5. 计划份额的转让行为不影响收益计算的连续性。份额登记机构不收取份额转让过户费。

6. 管理人应当在集合资产管理计划份额转让前,对受让人的合格投资者身份和资产管理计划的投资者人数进行合规性审查。受让方首次参与集合资产管理计划的,应当先与资产管理人、托管人签订资产管理合同。管理人、交易场所不得通过办理集合资产管理计划的份额转让,公开或变相公开募集资产管理计划。

7. 资产管理人有权在法律法规的前提下,制定本资产管理计划的份额转让的相关操作规定,资产委托人应当按照该等操作规定进行份额转让。

(十一) 非交易过户

管理人及其委托的注册登记机构(如有)只受理继承、司法强制执行和经注册登记机构认可的其他情况下的非交易过户。其中:

“继承”是指投资者死亡,其持有的计划份额由其合法的继承人继承;

“司法强制执行”是指司法机关依据生效司法文书将投资者持有的计划份额强制划转给其他自然人、法人、社会团体或其他组织的情形。

投资者办理非交易过户业务时,必须提供注册登记机构规定的相关资料。符合条件的非

交易过户申请自申请受理日起 2 个月内办理。注册登记机构有权向申请人按规定的标准收取过户费用。

(十二) 计划份额转让或非交易过户的后果

投资者所持计划份额进行转让或非交易过户的，自转让完成之日起，该投资者不再是本合同的当事人，受让人自转让完成之日起持有所受让的计划份额，并根据本合同规定享有相应的份额利益，受让人应遵守本合同规定，按照本合同行使相应权利、履行相关义务、承担投资风险。

(十三) 管理人应定期将资产管理计划投资者变更情况报送证券投资基金业协会。

第九章 份额持有人大会及日常机构

本计划不设置份额持有人大会及日常机构。资产委托人签署本合同即表明其已经知晓并同意本计划不设置份额持有人大会，不设立日常机构。

第十章 资产管理计划份额的登记

(一) 资产管理计划份额的注册登记业务指本资产管理计划的登记、存管、清算和交收业务，具体内容包括资产委托人账户建立和管理、份额注册登记、资产管理计划销售业务的确认、清算和结算、代理发放红利、建立并保管资产委托人名册等。

(二) 本计划的注册登记机构为国信证券股份有限公司。

(三) 计划份额登记机构应履行如下注册登记职责和权限：

1. 配备足够的专业人员办理本计划份额的登记业务；
2. 严格按照法律法规和本合同规定的条件办理本计划份额的登记业务；
3. 严格按照法律法规和本合同规定计算业绩报酬，并提供交易信息和计算过程明细给资产管理人。
4. 根据法律法规、监管规则的要求保存资产委托人名册及相关的认购、申购与赎回等业务记录，并按管理人要求提供给资产管理人；
5. 对资产委托人的账户信息负有保密义务，因违反该保密义务对投资者或计划财产带来的损失，须承担相应的赔偿责任，但司法强制检查情形、法律法规、监管规则和本合同另有约定的其他情形除外；
6. 在法律法规允许的范围内，制定和调整登记业务的相关规则；
7. 份额登记机构应当妥善保存登记数据，并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。其保存期限自集合资产管理计划账户销户之日起不得少于20年。

8. 法律法规及中国证监会、基金业协会规定的和本合同及委托代理服务协议约定的其他义务。

(四) 全体资产委托人同意管理人、注册登记机构应当按照中国基金业协会的规定将资产管理计划投资者名称、身份信息以及集合资产管理计划份额明细等数据备份至中国证监会认定的机构。

第十一章 资产管理计划的投资

(一) 投资目标

在控制风险的前提下，力争获取计划资产的长期稳定增值。

(二) 投资范围及比例

本资产管理计划的投资范围为：

(1) 现金类资产，具体包括：现金、银行活期存款等；

(2) 固定收益资产，具体包括：银行存款（含银行定期存款、协议存款、同业存款等各类存款）、同业存单、货币市场基金、债券逆回购、国债、地方政府债、央行票据、公司债（含非公开发行公司债）、企业债、可转换债券、可交换债（含私募可交换债）、可分离交易可转债、短期融资券、超短期融资券、中期票据、金融债、债券型公募基金、优先级资产支持证券、优先级资产支持票据、非公开定向债务融资工具、次级债，经银行间市场交易商协会批准注册发行的其他债务融资工具，以及中国证监会认可的比照公募基金管理的固定收益类资产管理产品等；

(3) 权益类资产，具体包括：股票（含证券交易所、全国中小企业股份转让系统上市 的股票及其他经中国证监会允许上市 的股票，以及新股申购所得股票）、港股通标的股票（含内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市 的股票）、股票型公募基金、混合型公募基金、公开募集基础设施证券投资基金（REITs），以及中国证监会认可的比照公募基金管理的权益类和混合类资产管理产品等；

(4) 衍生金融工具投资，具体包括：股指期货、国债期货、商品期货、场内期权等；

(5) 各类公募基金以及中国证监会认可的比照公募基金管理的资产管理产品；

(6) 资产管理计划可以参与证券逆回购，但参与逆回购资金余额均不得超过其上一日净资产的100%；

(7) 法律法规或中国证监会允许投资的其他投资品种。

(8) 各类金融产品（不含其劣后级份额）：银行或银行理财子公司发行的理财产品、证券公司及其子公司资产管理计划、期货公司及其子公司资产管理计划、保险公司资产管理计划、基金公司及其子公司资产管理计划、在基金业协会登记的私募基金管理人发行且有托管机构托管的私募基金。本计划所投资的资产管理产品不得再投资除公募基金以外的其他资产管理产品。

上述各类基金均包括QDII基金。

本资产管理计划在中国基金业协会完成备案，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。

本计划建仓期为自本计划成立之日起3个月。

其中，本计划穿透投资标的合并计算（包含公募证券投资基金）后投资固定收益资产的投资市值占资产总值的0-80%（不含80%），权益类资产的投资市值占资产总值的0-80%（不含80%），衍生金融工具持仓合约价值金额占资产总值的0-80%（不含80%）或衍生品账户权益占资产总值的0-20%（不含20%）。本计划投资于接受国务院金融监督管理机构监管的机构发行的资管产品资产的比例依市值计不低于总资产的80%。

管理人将所投资子基金的投资组合按托管人和管理人协商共同认可的方式和频率提供给托管人，托管人依据管理人提供的数据进行监控。管理人应确保所提供数据的真实性、准确性以及完整性。全体确认，托管人投资监督的准确性和完整性受限于管理人提供的数据和信息，管理人按照诚实信用、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。因本计划所投资子基金管理人原因影响数据真实性、准确性以及完整性的，管理人不承担相关数据责任。

本资产管理计划的投资限制为：

(1) 本计划总资产不得超过净资产的200%；计算单只产品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；

(2) 本计划参与股票、债券、可转换公司债券、可交换公司债券等证券发行申购时，所申报的金额不得超过该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；

(3) 本计划投资于同一资产的资金，不得超过该计划资产净值的25%；本管理人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；

(4) 本计划在其开放退出期内，其资产组合中7个工作日可变现资产的价值，不得低于该计划资产净值的10%；

(5) 按市值计算，投资于一家上市公司所发行的股票，不得超过该上市公司总股本的4.99%，同时不得超过该上市公司流通股本的10%。本管理人全部资产管理产品及公募基金投资单一上市公司发行的股票不得超过该上市公司可流通股票的30%。完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的资产管理计划、公募基金，以及中国证监会认定的其他投资组合可不受前述比例限制；

(6) 本计划主动投资于流动性受限资产的市值在退出开放期内合计不得超过该资产管理计划资产净值的20%；

(7) 本计划单一信用债投资不超过资产净值的10%，投资于单一信用主体合计投资比例不超过资产净值的10%，且主动投资于信用债（不含可交换债券、可转换债券）的信用评级不低于AA，其中，投资于信用评级为AAA及以上的信用债的比例不低于信用债资产的50%；投资于信用评级为AA+的信用债的比例不高于信用债资产的50%；投资于信用评级为AA的信用债的比例不高于信用债资产的20%。上述信用评级为债项评级，短期融资券、超短期融资券等短期信用债的信用评级依照评级机构出具的主体信用评级，本计划投资的信用债若无债项评级的，参照主体信用评级。本计划持有信用债期间，如果其信用评级下降不再符合前述标准，应在评级报告发布之日起3个月内调整至符合约定。本计划对信用评级认定参照管理人选定的评级机构出具的债券信用评级；

(8) 本集合计划禁止投资于法律法规规定的非标准化资产，标准化票据在被法律法规或人民银行、证监会等监管机构明确认定为标准化债权类资产前不得投资；

(9) 按市值计算，本计划投资于上市公司所发行的单一股票的投资总额不得超过本计划项下资产净值的25%；

(10) 按市值计算，本计划对单只股票型封闭基金的投资额不能超过本计划资产净值的25%；

(11) 不得主动投资“S”、“ST”、“*ST”、“S*ST”及“SST”类股票；

(12) 法律法规、本合同约定的其他比例限制；

(13) 本计划不投资于非公开发行股票。

(三) 投资策略

本产品为多策略FOF，根据投资需要参与各种策略子基金。针对市场上成熟的公募、私

募机构的深入研究，通过定性和定量两个纬度，在深入调研的基础上确定备选资产池。之后以最优收益风险比作为遴选标准，选择投资标的。资产配置主要采用目标风险策略，考虑到力争绝对收益的特征，本产品将风险资产分成资产和策略两个纬度，根据宏观条件采用战略配置角度设定各个资产类别的Beta风险敞口，根据风险平价模型基于风险角度确定各策略的配置比例，并根据各个市场的流动性环境以及市场上相类似策略的运行情况进行动态调整。

本计划的投资策略不属于本计划的投资范围、投资风格、投资比例或投资限制事项，托管人对本计划的投资策略不承担监督职责。

(四) 投资范围、投资比例和投资策略的变更

按照本合同约定履行合同变更程序后，可对投资范围、投资比例和投资策略进行变更。

(五) 投资禁止行为

本计划财产禁止从事下列行为：

1. 承销证券；
2. 向他人贷款、抵押融资或提供担保；
3. 从事承担无限责任的投资；
4. 从事内幕交易，操纵证券、期货价格及其他不正当的交易活动；
5. 法律法规、中国证监会、交易所等机构以及本合同规定禁止从事的其他行为。

(六) 管理人对计划财产进行管理运作的原则及方法：

1. 不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司的经营管理；
2. 有利于计划财产的安全与增值。
3. 投资的资产组合的流动性与参与、退出安排相匹配。

管理人按照国家有关法律法规的规定代表计划独立行使股东权利，保护投资者的利益。

(七) 风险收益特征

本资产管理人根据相关规则和本计划实际情况判定，本计划属于【R3】级投资品种，适合风险承受能力为【C3】型及以上的合格投资者。

(八) 业绩比较基准

无。

(九) 建仓期

本计划的建仓期为自本计划成立之日起3个月。

本计划建仓期的投资活动，应当符合本资产管理合同约定的投向和资产管理计划的风险

收益特征。以现金管理为目的，投资于银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券、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。

（十）投资的资产组合的流动性管理

本计划主要投资标准化资产，具有较好的流动性，与本计划参与、退出安排相匹配，基本能够满足本计划流动性管理的需求。

（十一）其他

本计划进行投资时，管理人可以以管理人的名义代表本计划与交易对手方签订投资协议，管理人应在各类投资协议中明确是代表本计划投资，且应在各类投资协议中明确约定该项投资收益款项的回款账户为本计划托管账户；投资协议为格式文本无法修改的，管理人应与各交易相关方拟定补充协议或向其出具说明函，明确原投资协议与本计划的直接关系。管理人未提供符合以上约定的投资协议、补充协议或说明函的，托管人有权拒绝执行投资指令，由此造成的损失由管理人负责。

第十二章 投资顾问

本计划不聘请投资顾问。

第十三章 分级安排

本计划未进行分级安排。本计划设为均等份额，每份份额享有同等的合法权益。

第十四章 利益冲突及关联交易

（一）管理人应当建立健全关联交易管理制度，对关联交易认定标准、交易定价方法、交易审批程序进行规范，不得以资产管理计划的资产与关联方进行不正当交易、利益输送、内幕交易和操纵市场。

资产委托人知悉并同意，资产管理人可以在本计划投资范围内运用委托财产从事关联交易，包括投资于资产管理人、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发行的证券或者承销期内承销的证券，资产管理人及其下属机构管理的金融产品，租用资产管理人关联方提供的证券交易单元等关联交易情形，但资产管理人承诺关联交易应按照市场通行的方式和条件进行，公平对待委托财产。资产委托人认可此等关联交易情形的存在并自愿

承担相关投资风险。本计划投资于资产管理人、资产管理人关联方管理的一只或多只产品的比例最高可达委托财产总值的 100%。资产委托人应事前就其关联方、关联证券或其他禁止交易证券明确告知资产管理人。若资产委托人未能事前就其关联方、关联证券或其他禁止交易证券明确告知资产管理人致使资产管理计划财产发生违规投资行为的,资产管理人与资产托管人均不承担任何责任。

委托财产从事关联交易的,应事后及时、全面、客观的向资产委托人和托管人进行披露,资产管理人应于交易后的【10】个工作日内向资产委托人和托管人披露上述关联交易情况。运用受托管理资产从事重大关联交易的,应事先取得投资者同意,并有充分证据证明未损害投资者利益。

资产委托人知悉,尽管资产管理人承诺谨慎勤勉地管理委托财产、公平对待各投资组合,本计划在投资和运作过程中可能会存在一些利益冲突情形,包括但不限于:资产管理人、资产托管人开展不同业务类型可能产生的利益冲突;资产管理人管理的其他资管产品(包括本计划投资经理管理的其他资管产品)基于各自投资策略需要可能与本计划存在相同、相似或相反的投资交易行为,或者在买卖同一只证券的时间上存在先后;其他可能产生利益冲突的情况等。该等利益冲突可能会不利于本计划,也可能使本计划在投资运作时暂时受限,进而可能会影响收益甚至发生损失等。资产委托人认可此等情形的存在并自愿承担相关投资风险。此外,资产管理人可以在遵循法律法规和相关原则的前提下运用固有资金进行证券投资,该等投资也可能与本计划存在相同、相似或相反的投资交易行为,或者在买卖同一只证券的时间上存在先后,不排除可能影响或限制本计划的投资运作。资产委托人认可此等情形的存在并自愿承担相关投资风险。

(二) 管理人应遵守中华人民共和国反洗钱法律法规,不参与涉嫌洗钱、恐怖融资、扩散融资等违法犯罪活动;依法配合托管人开展客户及受益人身份识别与尽职调查,提供真实、准确、完整客户及受益人资料。对具备合理理由怀疑涉嫌洗钱、恐怖融资的客户,托管人有权按照中国人民银行反洗钱监管规定采取必要管控措施。

第十五章 投资经理的指定与变更

(一) 投资经理的指定

本资产管理计划投资经理由管理人负责指定。

本资产管理计划财产投资经理为【韩国庆、李文卿】。

投资经理简历:

韩国庆：数量经济学博士，曾就职于证券公司自营部门，主要负责套利软件的开发测试和量化投资，曾参与中金所股指期货和国债期货交易系统开发工作，擅长自下而上的量化投资。

李文卿：金融学本科、注册国际投资分析师CIIA。拥有12年证券、期货从业经验，曾就职于西部证券资产管理部，主要负责多策略FOF投资研究工作。

本计划投资经理未同时兼任交易执行、风险控制等岗位，已取得基金从业资格，具有3年以上投资管理、投资研究、投资咨询等相关业务经验；具有良好的诚信记录及职业操守，且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）投资经理的变更

资产管理人可根据业务需要变更投资经理，并在变更前5个工作日内告知资产委托人及资产托管人。资产管理人在变更投资经理时需及时告知资产委托人，资产管理人及时在资产管理人公司网站公告调整事项或按本合同约定的其他信息披露形式披露即视为履行了告知义务。

投资者不同意合同投资经理变更的，可在管理人公告明确的时间内退出本计划，投资者未在管理人公告明确的时间内申请退出的，视为同意合同变更，投资者退出本计划后，其对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视为或裁定为管理人的违约行为。

第十六章 资产管理计划的财产

（一）资产管理计划财产的保管与处分

1. 资产管理计划财产的债务由资产管理计划财产本身承担责任，资产委托人以其出资为限对资产管理计划财产的债务承担责任。

2. 资产管理计划财产独立于资产管理人、资产托管人的固有财产，并独立于管理人管理的和托管人托管的其他财产，由资产托管人保管。资产管理人、资产托管人不得将资产管理计划财产归入其固有财产。

3. 除本条第4款规定的情形外，资产管理人、资产托管人因资产管理计划财产的管理、运用或者其他情形而取得的财产和收益归入资产管理计划财产。

4. 资产管理人、资产托管人可以按本合同的约定收取管理费、托管费以及本合同约定的其他费用。资产管理人、资产托管人以其固有财产承担法律责任，其债权人不得对资产管理计划财产行使请求冻结、扣押和其他权利。资产管理人、资产托管人因依法解散、被依法撤

销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，资产管理计划财产不属于其清算财产。

5. 资产管理计划财产产生的债权不得与不属于资产管理计划财产本身的债务相互抵销。非因资产管理计划财产本身承担的债务，资产管理人、资产托管人不得主张其债权人对资产管理计划财产强制执行。上述债权人对资产管理计划财产主张权利时，资产管理人、资产托管人应明确告知资产管理计划财产的独立性，采取合理措施并及时通知投资者。

6. 托管人负责保管本资产管理计划项下托管账户内的现金资产。管理人负责保管本资产管理计划对外投资过程中形成非现金资产及相关权利凭证，并应及时将相关权利凭证的复印件加盖公章或者其他有效签章后交付托管人。管理人应对本资产管理计划项下非现金资产及其权利凭证的安全和完整负责。除资产管理合同另有约定外，管理人不得在该等非现金资产或其权利凭证之上设置抵押、质押或其他权利负担。

7. 本资产管理计划项下，管理人代表本资产管理计划与交易对手签订投资协议、开立相关账户及办理相关登记手续，并按照投资协议的约定行使相关权利和履行相关义务。管理人未按投资协议约定行使相关权利、履行相关义务或处分计划财产不当而使计划财产遭受损失的，由过错方承担责任。

8. 资产管理计划财产的债务由资产管理计划财产本身承担，投资者以其出资为限对资产管理计划财产的债务承担责任。但资产管理合同依照《证券投资基金法》另有约定的，从其约定。

(二) 计划财产相关账户的开立和管理

1. 托管账户的开设和管理

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

(2) 托管账户的开设和管理由托管人负责。本计划的一切货币收支活动，包括但不限于对外投资、支付退出金额、支付计划收益、收取申购款，均需通过该账户进行。托管账户内资金余额按照开户机构活期存款挂牌利率计息。

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

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

2. 其他账户的开设和管理

因投资运作而需要开立的其他账户，由托管人或管理人根据有关法律法规的规定开立。如该等账户是由管理人负责开立的，管理人开立此类账户后需及时通知托管人，且应保证该账户专款专用。证券账户和期货账户的持有人名称应当符合证券、期货登记结算机构的有关规定。证券账户、期货账户名称应当是“证券期货经营机构名称—托管人名称—资产管理计划名称”。

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

第十七章 投资风险控制

本产品设置预警线及止损线。

1. 预警线

本计划的预警线为 0.9300 元。当管理人与托管人核对一致的计划份额净值小于或等于 0.9300 元时，本计划触及预警线。自该核对一致之日的下一交易日起的三个交易日内，管理人以录音电话、电子邮件或其他约定的方式向计划份额持有人提示投资风险。

2. 止损线

本计划的止损线为 0.9000 元。当管理人与托管人核对一致的计划份额净值小于或等于 0.9000 元时，本计划触及平仓线。在本计划存续期内，任何一个工作日（T 日）计划份额净值低于 0.9000（含）时，资产管理人自 T+1 日起的三个交易日内，以录音电话、电子邮件或其他约定的方式向计划份额持有人提示投资风险。自 T+1 日起，管理人应对本计划持有的全部资产进行不可逆的变现，直至将可变现的非现金资产全部变现，本计划终止。如遇因持有流通受限证券、资产被司法查封扣押冻结及其他原因，本计划资产未及时变现的，本计划应以 T+5 为终止日，剩余资产变现时间顺延，待资产可变现时，进行二次清算。为避免疑义，本计划根据本条款提前终止无需份额持有人大会（如有）决定。

3. 计划份额持有人对管理人按照上述约定进行平仓处理的过程及结果予以认可，当资产管理人根据上述约定进行平仓处理时，若非现金类资产价格出现反弹，计划将失去弥补亏损的机会，由此可能导致计划财产遭受损失，管理人将不因此承担任何责任。计划的预警和止损由资产管理人负责执行。

4. 管理人应当按照本合同的约定进行预警止损操作，若管理人未按照本合同的约定进行预警止损操作，给计划财产或委托人造成损失的，管理人应当自行承担相关责任。

5. 管理人特别提示：本资管计划设置止损线，并不代表管理人完成止损后计划份额净值

等于止损线，根据管理人变现操作的交易执行情况，本资管计划终止日计划份额净值可能低于止损线。

第十八章 投资指令的发送、确认和执行

（一）交易清算授权

管理人应就其出具划款指令事先向托管人发送书面授权通知（以下称“授权通知”），授权通知应包括管理人预留印鉴（预留印鉴应为管理人公章或管理人授权业务章）、被授权人员名单及其签字或签章样本。授权通知应加盖管理人公章并注明生效时间。

管理人可以以传真、电子邮件方式或双方另行约定的其他方式向托管人发送授权通知，托管人收到后，于授权通知载明的生效时间生效。但如托管人收到授权通知的日期晚于授权通知载明的生效时间，则授权通知自托管人收到该授权通知之日生效。

管理人应及时向托管人寄送书面授权通知的原件。因管理人未将书面授权通知原件寄给托管人，或原件与扫描件存在差异性而引起的风险和损失，由管理人承担相应责任。托管人依据管理人发送的授权通知对于管理人发送的指令进行审核视为适当履行了托管人指令审核义务，管理人不得否认其效力；托管人收到的授权通知原件与传真件或邮件或双方另行约定的其他方式发送的授权通知不一致时，以托管人收到的传真件或电子邮件或双方另行约定的其他方式发送的授权通知为准；管理人未能按约定寄回原件的，不影响托管人的执行效力，但管理人不因此免除寄送书面授权通知的义务。

（二）划款指令的内容

划款指令是在管理计划财产时，管理人向托管人发出的资金划拨及其他款项支付的指令。管理人发给托管人的指令应写明本计划全称、付款方账户信息、收款方账户信息、支付日期、付款金额、事由等，加盖管理人公章或按授权通知约定加盖预留印鉴或被授权人签字或签章。采用电子划款指令的，管理人应与托管人就指令发送的签字、内容、方式、有效性等方面另行签订协议。

托管人有权要求管理人提供相关交易凭证、投资协议或其他有效会计资料的扫描件或复印件作为划款指令的佐证，管理人应按照托管人要求提供相应材料。如管理人无法根据托管人要求提供相关交易文件的，托管人有权拒绝执行投资划款指令，由此造成的损失由管理人承担。

管理人应确保其提供的划款指令及相关交易凭证、投资协议等文件真实、合法、完整、有效且符合本合同及授权通知的约定。

(三) 划款指令的发送、确认和执行的程序和程序

划款指令由管理人用传真、电子邮件（为免歧义，本节所指“电子邮件方式”均指以电子邮件发送扫描件方式）或托管人和管理人另行约定的其他方式向托管人发送。指令以获得收件人（托管人）确认该指令已成功接收之时视为送达收件人（托管人）。管理人如发现托管人未确认成功接收指令，有义务与托管人以电话或邮件或其他管理人及托管人约定的方式进行确认，因管理人未能及时与托管人进行指令确认，致使资金未能及时清算所造成的损失，管理人承担责任。

管理人在发送划款指令时，应为托管人留出执行划款指令所必需的时间。管理人发送银证、银期、银行转账的有效划款指令的截止时间为每一个工作日的13:30，发送银行转账的有效划款指令的截止时间为每一个工作日的15:00；如管理人要求当天某一时点到账，则划款指令需提前1个工作小时发送；管理人和托管人可另行书面约定关于某一类划款指令的具体时限要求。管理人发送的划款指令不符合前述时限要求的，托管人尽力配合执行，但不保证划款成功。由于管理人发送指令不及时、未能留出足够划款所需时间致使资金未能及时清算所造成的损失由管理人承担，与托管人无关。

托管人收到管理人发送的划款指令后，应对划款指令进行审查，即：如为电子指令，应审查电子指令要素是否齐备；如为划款指令扫描件，应审查指令的要素是否齐全、印鉴和签名是否和预留印鉴和签名样本表面相符，复核无误后应在规定期限内及时执行，不得延误。

管理人应保证上述文件资料合法、真实、完整和有效。如因管理人提供的上述文件不合法、不真实、不完整或失去效力而影响托管人的审核或给计划份额持有人造成损失，管理人承担任何形式的责任。

若托管人对划款指令存在异议，应与管理人进行电话、邮件或其它约定的方式联系和沟通，暂停划款指令的执行并要求管理人重新发送经修改的划款指令或/并发送补充佐证材料。管理人应在合理时间内重新发送经修改的划款指令或/并补充相关资料，并给托管人执行划款指令预留必要的执行时间。

管理人向托管人下达划款指令时，应确保本计划托管账户有足够的资金余额，对管理人在没有充足资金的情况下向托管人发出的划款指令，托管人可不予执行，并立即通知管理人，管理人承担因为不执行该划款指令而造成损失的责任。

托管人按划款指令将资金从托管资金账户划出后，视为划款指令已执行，具体到账情况以收款方开户银行系统反馈信息为准。

(四) 托管人依照法律法规暂缓、拒绝执行划款指令的情形和处理程序

托管人发现管理人发送的划款指令违反有关法律法规的规定或本合同约定时,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核对,及时确认处理方式,并以书面形式通知托管人,由此造成的损失由管理人承担。

托管人发现管理人发送的划款指令存在以下错误情形的,有权暂缓或拒绝执行,并及时通知管理人,由此造成的损失由管理人承担:

1. 指令存在明显错误;
2. 账户信息不清晰、不完整或存在明显不一致的;
3. 指令事实上无法执行或执行后资金无法成功划付的。

(五) 更换预留印鉴或被授权人的程序

管理人变更预留印鉴,撤换被授权人员或改变被授权人员的权限,或变更授权通知的其他内容,必须提前至少一个工作日,使用传真、电子邮件或管理人和托管人认可的其他方式向托管人发出加盖管理人公章的书面变更通知(“变更通知”),同时通知托管人。变更通知须列明新授权生效的起始日期。变更通知的生效日期按照变更通知上列明的新授权生效的起始日期与托管人确认收到的日期孰晚原则确定。变更通知的原件发送程序及要求按照授权通知的约定执行。

(六) 划款指令的保管

划款指令若以传真或电子邮件形式发出,则正本由管理人保管,托管人保管指令传真件或电子邮件。当两者不一致时,以托管人收到的指令传真件或电子邮件为准。电子指令的保管以管理人和托管人的相关协议约定为准。

(七) 相关责任

托管人按照本合同约定执行管理人发出的划款指令,计划财产发生损失的,管理人承担任何形式的责任。在正常业务受理渠道和划款指令规定的时间内,确因托管人存在过错而未能及时或正确执行符合本合同规定的划款指令而导致计划财产受损的,托管人应承担相应的责任,但托管人如遇到不可抗力的情况除外。

如果管理人的划款指令存在事实上未经授权、欺诈、伪造或未能按时提供划款指令人员的预留印鉴和签章样本或发送划款指令时提交的文件资料不真实、不合法、不完整或失去效力等非托管人原因造成的情形,只要托管人根据本合同相关规定履行对划款指令审查的职责,因执行有关划款指令或拒绝执行有关划款指令而给管理人或计划财产或任何第三人带来的损失,全部责任由管理人承担。

第十九章 交易及清算交收安排

(一) 选择证券经纪机构及证券投资资金清算安排

1. 选择代理证券买卖的证券经营机构的程序

(1) 管理人负责选择代理本计划财产证券买卖的证券经营机构，并与其签订证券交易委托代理协议。管理人、托管人和证券经营机构可就计划参与证券买卖的具体事项另行签订协议。

(2) 管理人应及时将本计划财产证券交易单元号、佣金费率等基本信息以及变更情况及时以书面形式通知托管人。

2. 证券交易数据发送和接收

本计划的证券交易数据传输具体操作及时间要求按照管理人、托管人及证券经纪商签订的相关协议或操作备忘录的约定执行。

3. 证券交易的资金清算与交割

(1) 证券交易资金的清算

管理人的投资指令执行后，因本计划投资于证券发生的所有二级市场交易的清算交割，由管理人选择的证券经纪商负责办理。

(2) 资金结算

托管人、管理人应共同遵守按中国人民银行、中国银保监会、中国证券登记结算有限公司、交易所的有关规定办理，该等规则 and 规定自动成为本条款约定的内容。

管理人在投资之前，应充分知晓与理解各类交易品种的结算业务规则 and 规定。

证券经纪机构代理本计划财产与中国证券登记结算有限公司完成证券交易及非交易涉及的证券资金结算业务，并承担由证券经纪机构原因造成的正常结算、交收业务无法完成的责任；若由于管理人原因造成的正常结算业务无法完成，责任由管理人承担。

(3) 对于任何原因发生的证券交收违约事件，相关各方应该及时协商解决。

4. 清算交割处理

资金划转的方式在符合银行资金结算的有关规定的情况下可由托管人和管理人共同商定。

(二) 选择场内期权经纪机构及场内期权投资资金清算安排

一般情况下，管理人应选择其聘请的证券经纪机构作为其场内期权经纪商；在此情形下，场内期权交易数据发送和接收、资金清算与交割按照本章节第（一）条相关约定进行处理。

若管理人聘请其证券经纪机构以外的机构作为其场内期权经纪商的,应就场内期权交易数据发送和接收、资金清算与交割事宜与场内期权经纪商、托管人另行签署书面协议。

(三) 选择期货经纪机构及期货投资资金清算安排

本计划投资于期货前,管理人负责选择为本计划提供期货交易服务的期货经纪公司,并与其签订期货经纪合同。管理人、托管人和期货公司可就计划参与期货交易的具体事项另行签订协议。本计划的交易数据传输具体操作及时间要求按照管理人、托管人及期货经纪商签订的相关协议或操作备忘录的约定执行。

本计划投资于期货发生的资金交割清算由管理人选定的期货经纪公司负责办理,托管人对由于期货交易所期货保证金制度和清算交割的需要而存放在期货经纪公司的资金不行使保管职责,管理人应在期货经纪协议或其他协议中约定由选定的期货经纪公司承担资金安全保管责任。

(四) 资金、证券账目及交易记录的核对

管理人和托管人定期对资产的资金账目、证券账目、交易记录进行核对。

(五) 申购或赎回的资金清算

1. 基金份额申购、赎回的确认及清算由管理人负责。管理人和托管人根据确认数据进行账务处理。

2. 管理人或其委托的份额登记机构应将每个开放日的申购、赎回数据传送给托管人。管理人应对传递的申购、赎回数据的真实性、准确性、完整性负责。托管人根据管理人指令及时划付款项。

3. 管理人应在赎回确认日后在本合同约定的赎回款项支付时效内向托管人发送赎回的划款指令并保证托管资金账户预留足额资金,托管人依据划款指令划至管理人指定账户。

(六) 其他

因投资运作需要由管理人自行为本产品开立交易账户的,管理人须于该账户进行交易前以邮件或其他双方认可的方式告知托管人,并确保相关交易数据及时、准确的发送给托管人,因管理人未及时告知或未交由托管人保管的交易数据未及时提供所造成的影响,托管人不承担任何责任。

第二十章 越权交易

(一) 越权交易的界定

本合同约定的越权交易是指管理人违反法律法规规定或本合同约定而进行的投资交易

行为。

管理人应在本合同规定的投资范围和投资限制权限内运用计划财产进行投资管理,不得违反本合同约定超越权限从事投资。

(二) 越权交易的处理程序

托管人在行使监督职责时,发现管理人发出但未执行的投资指令违反法律法规规定或者违反本合同约定的,有权拒绝执行、通知管理人并依据相关规定向监管机构报告。

托管人在行使监督职责时,发现管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律法规规定或者本合同约定的,应通知管理人并有权依据相关规定向监管机构报告。因执行该指令造成的损失由管理人承担。

管理人应向份额持有人和托管人主动报告越权交易。管理人收到托管人关于越权交易的通知后应及时核查并纠正。

(三) 越权交易的责任承担

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

(四) 资产托管人对资产管理人的投资监督

1. 托管人按照本节约定对管理人的投资行为行使监督权,托管人自本计划成立日起开始履行监督职责。

(1) 受监督手段所限,托管人对合同投资范围列明的比例限制及场内品种仅进行盘后监督,而非事前审核或实时监督。就场内品种,对于管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反本合同约定的,托管人仅负有事后提示义务。场内品种是指在证券交易所、期货交易所等国家法律认可的股票、期货、现货交易所交易的品种。

(2) 托管资金账户向证券交易资金账户、期货账户、银行间DVP账户等各类资金账户进行的转账活动,不属于计划的投资活动,不属于托管人的监督范围。

(3) 托管人在投资监督职责范围内,发现产品运作中有不符合合同约定或者达到合同约定的条件时,托管人拟定《业务提示函》通过电子邮件或其他约定的方式通知管理人。

(4) 管理人应定期提供投资监督所需的所有信息,并对所提供的信息的准确性、完整性和及时性负责,托管人按照管理人提供的信息履行了相应义务即完成了本合同项下的监督义务。

2. 本合同“投资风险控制”章约定的风险控制机制的执行情况由管理人负责。

3. 托管人负责保管本计划项下托管账户内的现金资产,对于本计划项下未由其保管且未受其实际控制的其他资产(包括现金类资产与非现金类资产),由实际控制方承担保管职

责。

4. 对于需要外部市场公共数据支持才可以实现的投资监督，托管人不保证外部数据的真实、完整、准确，因外部数据提供商提供数据存在瑕疵导致计划财产的损失，由过错方承担责任。

6. 全体投资人确认，托管人的投资监督职责以本节约定为限，且托管人投资监督的准确性和完整性受限于证券经纪商及其他中介机构提供的数据和信息。

托管人对管理人投资运作的监督，以投资政策及经管理人与托管人核对确认的核算估值结果为根据。

(二) 委托人确认，托管人投资监督的准确性和完整性受限于管理人及其他机构等提供的的数据信息，合规投资的最终责任在管理人。托管人对这些机构信息的准确性和完整性不做任何担保、暗示或表示，并且对上述机构提供的信息的真实性、准确性和完整性所引起的损失不承担任何责任。

资产托管人发现资产管理人的投资运作违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反本合同时，不予执行，应当通知资产管理人限期纠正，资产管理人收到通知后应及时核对，并以书面形式向资产托管人进行解释或举证，由此造成的损失由资产管理人承担。管理人对托管人通知的违规事项未能在限期内纠正或者造成委托资产损失的，托管人有权向中国证监会相关派出机构和证券投资基金业协会报告。

管理人违反法律、行政法规、监管规定及本合同约定而给委托人委托财产造成损失的，管理人应当承担所有赔偿责任。

(四) 越权交易的例外

非因资产管理人主动投资行为导致的下列不符合投资政策的情形不构成本章所述越权交易，应当属于被动超标，因被动超标而对资产管理计划财产造成的损失由资产管理计划财产承担：

1. 由于资产管理人之外的原因导致的投资比例（如有）出现不符合法律、行政法规和中国证监会规定的或者本合同约定的投资政策的情形为被动超标，不属于越权交易，包括但不限于证券/期货市场波动、上市公司合并、已投资持有的证券在持有期间信用评级下降、上市公司受到金融监管部门处罚或谴责、上市公司股票被特别处理、上市公司年度财务审计报告未被出具标准无保留意见等，视投资政策中的具体约定而确定。发生被动超标时，管理人应在流动性受限资产可出售、可转让或者恢复交易的15个交易日内进行调整，以达到投资政策的要求。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

中国证监会相关派出机构和证券投资基金业协会报告。

2. 本合同终止前十个交易日内, 资产管理人有权对资产管理计划财产所投资证券进行变现, 由此造成投资比例(如有)、投资范围不符合投资政策规定的, 视为被动超标, 不属于越权交易。

3. 法律法规对被动超标另有规定的从其规定。

第二十一章 资产管理计划资产的估值与会计核算

(一) 估值

1. 估值日

本计划的估值日为本计划相关的证券交易所、期货交易所等相关交易场所的正常交易日。管理人应于每个估值日交易结束后次工作日计算本计划资产净值, 并与托管人进行核对。

2. 估值对象

资产管理计划所拥有的资产及负债。

3. 估值目的

计划财产估值目的是客观、准确地反映计划财产的价值, 并为计划份额的预警、止损、认购、申购、赎回等提供计算依据。

4. 资产管理计划份额净值的确认

(1) 计划资产总值

计划资产总值指其所购买各类证券、银行存款及利息、计划各项应收款以及其他资产的价值总和。

(2) 计划资产净值

计划资产净值是指计划资产总值减去负债后的净额。本计划资产净值保留到小数点后 2 位, 小数点后第 3 位四舍五入。

(3) 计划份额净值

计划份额净值是指计划资产净值除以计划份额后的价值。本计划的份额净值保留到小数点后 4 位, 小数点后第 5 位四舍五入。

5. 估值方法

(1) 银行存款每日计提应收利息, 按本金加应收利息计入资产。

(2) 期货合约以估值日期货交易所的当日结算价估值, 该日无交易的, 以最近一日的当日结算价估值。

(3) 证券交易所上市的有价证券的估值

A. 交易所上市的有价证券（包括股票、权证、存托凭证等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；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，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可调整最近交易市价，确定公允价格，若决定调整，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素。

B. 证券交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（包括但不限于债券、资产支持证券等投资品种，但可转换债券除外），选取中证指数有限公司提供的相应品种当日的估值净价进行估值。

C. 对在证券交易所市场上市交易的可转换债券，选取每日收盘价作为估值全价，减去其中所含当日的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，以最近交易日债券收盘价作为全价，减去其中所含截止最近交易日的债券应收利息得到的净价进行估值。

D. 交易所上市不存在活跃市场的其他有价证券，采用估值技术确定公允价值。

(4) 处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

A. 送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的估值方法估值；

B. 首次公开发行未上市的股票、存托凭证和权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

C. 首次公开发行未上市的固定收益品种（包括但不限于债券、资产支持证券等投资品种，但可转换债券除外），选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值。

(5) 流通受限股票，按以下方法估值：

流通受限股票，是指明确带有一定限售期的股票，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。

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

其中：FV为估值日该流通受限股票的价值；S为估值日在证券交易所上市交易的同一股票的收盘价；LoMD为该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣，该流动性折扣一般由中债金融估值中心有限公司发布提供。

当估值日中债金融估值中心未提供该流动性折扣时，则优先采用距估值日最近交易日中债金融估值中心提供的流动性折扣进行估值处理。若中债金融估值中心从未提供该流通受限

股票的流动性折扣，则按估值日该流通受限股票在证券交易所上市交易的同一股票的市价（收盘价）估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值。

管理人应当及时通知托管人上述股票的锁定/限售情况，如管理人未及时告知托管人锁定/限售情况的，则按照无流通受限股票的方法估值。由此造成的后果由管理人承担。

(6) 证券投资基金估值方法：

A. 上市流通的证券投资基金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，以最近一个交易日的收盘价估值；

B. 场外认购或申购的开放式基金（包括托管在场外的上市开放式基金（LOF））以估值日前一交易日基金份额净值进行估值，估值日前一交易日基金份额净值未公布的，以前最近公布的基金净值计算。货币基金以成本估值，每日按前一工作日的万份收益计提红利。

(7) 因融资融券业务而持有或者融入的证券，应参照上述“证券交易所上市的有价证券”估值方法进行估值，计入资产或者负债，并每日计提融资融券息费。

(8) 全国银行间债券的估值采用中债金融估值中心有限公司或银行间市场清算所股份有限公司当日公布的估值价确定公允价值，当日未提供的，使用最近一日的债券估值价进行估值。

(9) 同一债券在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

(10) 持有回购以成本列示，按商定利率在回购期间内逐日计提应收利息。

(11) 上海黄金交易所挂盘的贵金属现货延期交收合约，以其估值日在上海黄金交易所挂盘的结算价估值。估值当日无结算价，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。

(12) 交易所期权合约以估值日交易所公布的当日结算价估值，该日无交易的，以最近一日的结算价估值。

(13) 场外衍生品估值：

A. 持有的场外期权根据第三方或交易对手提供的期权合约盈亏估值结果或估值报告进行估值。

B. 持有的权益类收益互换、跨境收益互换根据第三方或交易对手提供的估值报告进行估值。

C. 持有的利率互换根据清算机构或者（代理清算机构）提供的结算单据或者结算数据进行估值。

如果不属于上述情况的，则管理人应向托管人提供标的产品的估值方法和估值数据，并

确保提供数据的真实、完整和有效。

托管人不负责对管理人或第三方提供的场外衍生品合约价值、估值报告的真实性和准确性进行复核。若因为管理人或第三方机构发送的估值结果、估值报告等场外衍生品估值数据不真实、不及时、不完整、不准确给财产造成损失的，由过错方承担责任。

(14) 全国中小企业股份转让系统挂牌的股票，以其估值日在全国中小企业股份转让系统挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易、且最近工作日后经济环境未发生重大变化，以最近工作日的市价（收盘价）估值；如最近工作日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。若监管机构或行业协会等出台有关全国中小企业股份转让系统挂牌的股票的估值方法，则以该估值方法进行估值。

(15) 证券交易所、全国中小企业股份转让系统退市/摘牌的股票，以退市/摘牌前该股票的最新估值价格进行估值。

(16) 对于投资的基金管理公司及其子公司资产管理产品、证券公司及其子公司资产管理产品、期货公司及其子公司资产管理计划、保险公司及其子公司发行的资产管理产品、私募投资基金、信托产品等场外产品（以下简称“标的金融产品”），按如下方式进行估值：

①如管理人在上述标的金融产品权益确认日提供了权益确认原始凭证，则在确认日当天以原始凭证为依据入账；如管理人未在权益确认日提供上述产品的权益确认原始凭证，可在原始凭证提供日与管理人确认后，不对以往账务进行追溯调整；

②如果上述产品有份额净值的，以管理人按照净值提供频率提供的标的金融产品最新份额净值或虚拟份额净值（即预计计提业绩报酬后的份额净值）进行估值，如果管理人没有按照净值提供频率提供最新份额净值或虚拟份额净值的，则按最近一次提供的份额净值或虚拟份额净值估值；如果上述产品有预期收益率且不公布份额净值，则管理人提供成本和预期收益率，以成本列示并每日加计应收利息（或应计收益）的方法进行估值；

③如果不属于上述情况的，则管理人应向托管人提供标的金融产品的估值方法和估值数据，并确保提供数据的真实、完整和有效。

由于上述标的金融产品份额净值或虚拟份额净值的真实性、准确性、完整性取决于该等金融产品的相关基础数据的真实性、准确性、完整性、及时性等因素，受限于交互因素，托管人仅根据收到的份额净值或虚拟份额净值对计划进行估值，不就标的金融产品的份额净值或虚拟份额净值的真实性、准确性、及时性承担任何复核义务和责任。本计划投资于上述标的金融产品时，管理人应按照标的金融产品的合同等相关协议约定的确权时效内或本计划

开放日前提供完整、准确及有效的估值数据作为托管人确认该笔投资权益的依据；管理人应敦促标的金融产品的管理人或其委托的基金服务机构（如有）及时、准确、完整地向本计划托管人提供标的金融产品的份额数量、净值及其他权益变动等估值信息。

（17）如存在上述估值约定未覆盖的投资品种，管理人可根据具体情况制定估值方法，并将估值方法提供给托管人进行估值。如管理人认为上述估值方法不合适或不能客观反映其公允价值的，可就相关估值方法进行修改，并将修改后的方法提前通知托管人进行估值。

（18）相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

因核算估值需要的相关信息，若托管人无法公开取得，应由管理人负责向托管人提供。管理人应确保数据真实、准确、完整和及时。

本计划的会计责任方由管理人担任，与本计划有关的会计问题和估值方法，如经双方在平等基础上充分讨论后，尚不能达成一致时，按管理人的建议执行，由此给计划份额持有人和财产造成的损失，由管理人负责赔付。

6. 侧袋机制：

（1）侧袋机制是指将特定资产从原有账户分离至一个专门账户进行处置清算，属于流动性风险管理工具。启用侧袋机制后，计划原有账户为主袋账户，包含特定资产的专门账户为侧袋账户。

前款所称特定资产包括：**a.** 无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性的资产；**b.** 按摊余成本计量且计提资产减值准备仍导致资产价值存在重大不确定性的资产；**c.** 其他资产价值存在重大不确定性的资产。

（2）启用情形：当计划持有前述特定资产时，管理人认为计划面临的潜在赎回压力较大且潜在赎回申请可能影响份额持有人利益时，可以启用侧袋机制。

启用侧袋机制前，管理人应当取得托管人同意。管理人应当负责以保护份额持有人利益为原则，制定完整、全面、合理的实施方案，公平对待各类投资者，充分考虑侧袋机制对于计划运作产生的各方面影响，不得当用而未用或者滥用侧袋机制。如因启用、实施侧袋机制相关事宜造成投资者任何损失的，应由管理人独立承担赔偿责任。

（3）处置方式：管理人以侧袋启用日的净资产为基数对主袋账户和侧袋账户的资产进行分割，主袋账户、侧袋账户实收计划份额与原有账户实收计划份额保持一致。计划实施侧袋机制期间，管理人对侧袋账户单独设置账套，实行独立核算。主袋账户和侧袋账户分别计算份额净值。主袋账户份额满足合同分红条款的可进行收益分配，计划合同分红条款不适用

于侧袋账户份额。侧袋账户的持续估值结果不作为侧袋账户资产最终变现价格的承诺。

特别地，如本计划启用侧袋机制，实施侧袋机制期间，本节约定的投资运作指标（包括但不限于投资限制、预警止损机制等）均仅以主袋账户资产为基准。

(4) 费用收取标准：管理人收取侧袋账户的管理费及业绩报酬，待侧袋账户变现后可将处置侧袋账户资产相关的费用从侧袋账户中列支。主袋账户可按照计划合同约定的方式计提管理费及业绩报酬（如有）。

(5) 参与退出政策：侧袋机制实施期间，管理人不得办理侧袋账户参与退出，侧袋账户资产恢复流动性后，管理人应按照计划资产利益最大化原则处置变现侧袋账户资产，并及时向侧袋账户计划份额持有人支付已变现部分对应的款项。

(6) 信息披露：启用侧袋机制的，管理人应当负责将侧袋机制实施方案及时通知全体份额持有人、托管人，并向全体份额持有人说明侧袋机制的影响、揭示相应风险。侧袋机制的具体实施规则，应以管理人公告为准。

(7) 法律法规、监管机构另有规定的，从其规定。

7. 汇率

若港股通（如有）估值计算中涉及港币的，将以中国证券登记结算有限责任公司或交易所提供的汇率进行估值。涉及其他货币的，如中国证券登记结算有限责任公司或交易所估值日提供了该币种兑人民币的汇率，则取该汇率，如未有提供，则使用外汇交易中心公布的汇率。

8. 估值程序

管理人应及时提供估值所需的交易数据、对账单、确认单等文件，若管理人未及时发送该等数据导致托管人估值不及时、不准确的，托管人不承担任何责任。

本计划日常估值由管理人负责。管理人应于每个估值日、月末及年末最后一个自然日的次工作日计算计划资产净值、计划份额净值并按照约定的方式发送至托管人。托管人对净值计算结果进行复核，并按照约定的方式反馈复核结果。如管理人对复核结果存在异议的，应当及时联系托管人共同查明原因。

在法律法规和相关监管机构允许的情况下，管理人与托管人可以各自委托第三方机构进行计划资产估值，但不改变管理人与托管人对计划资产估值各自应承担的责任。

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

9. 估值计算错误的处理

(1) 估值错误类型

因管理人或托管人未严格按照本合同约定的估值方法进行估值或在估值过程中存在操作性错误,导致本计划净值出现偏差,且计划资产估值错误偏离达到计划份额净值的0.25%时,视为估值错误。

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应负有返还不当得利的义务。

(2) 估值错误处理原则

由于管理人、托管人、证券/期货经纪机构、证券交易所、份额登记机构、募集机构或投资者自身的过错造成估值错误,导致其他当事人遭受损失的,遵循如下估值错误处理原则:

A. 如管理人或托管人发现计划资产估值违反本合同订明的估值程序及相关法律法规的规定,应共同查明原因,协商解决。

当计划资产估值出现错误时,管理人应当立即予以纠正,通知托管人,并采取合理的措施防止损失进一步扩大。

B. 因估值错误给投资者造成损失的应先由计划管理人承担,管理人对不应由其承担的责任,有权向过错人追偿。

C. 因估值错误而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。

D. 除不可抗力情形外,由于一方当事人提供的信息错误,进而导致计划资产净值计算错误造成投资者的损失,以及由此造成以后估值日计划资产净值计算顺延错误而引起的投资者的损失,由提供错误信息的当事人一方负责赔偿。

E. 前述内容如法律法规或者监管部门另有规定的,从其规定。如果行业另有通行做法,双方当事人应本着平等和保护份额持有人利益的原则进行协商。

10. 暂停估值的情形

(1) 计划投资所涉及的证券交易场所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时;

(2) 因不可抗力或其他情形致使管理人、托管人无法准确评估计划财产价值时;

(3) 占计划相当比例的投资品种的估值出现重大转变,而管理人为保障份额持有人的利益,决定延迟估值时;

(4) 没有或未及时获取交易数据或行情数据、交易数据或行情数据不完整或有误时;

(5) 中国证监会认定的其他情形。

如发生上述暂停估值的情形,托管人暂停对本计划的投资监督、定期报告的财务数据复核,自本计划恢复估值之日起,托管人恢复对本计划的投资监督和财务数据复核。

11. 特殊情况的处理

(1) 管理人、托管人按本合同约定的估值方法进行估值所造成的误差不作为估值错误处理。

(2) 由于不可抗力原因，或由于证券交易所、登记结算机构等第三方机构发送的数据错误，或国家会计政策变更、市场规则变更等非因管理人与托管人原因，管理人和托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，由此造成的计划财产估值错误，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减轻或消除由此造成的影响。

(二) 资产管理计划的会计政策

资产管理计划的会计政策比照证券投资基金现行政策执行：

1. 资产管理人为本计划的主要会计责任方。
2. 本计划的会计年度为公历年度的1月1日至12月31日。
3. 本计划的记账本位币为人民币，以人民币元为记账单位。
4. 会计核算制度执行国家有关会计制度。
5. 本计划单独建账、独立核算。
6. 资产管理人及资产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，按照本合同约定编制会计报表。
7. 资产托管人定期与资产管理人就资产管理计划的会计核算、报表编制等进行核对。

第二十二章 资产管理业务的费用与税收

(一) 资产管理业务费用的种类

1. 除非份额持有人另行支付或本合同另有约定，本计划运作过程中发生的下列费用（“计划费用”）由计划财产承担：

- (1) 管理人的管理费。
- (2) 托管人的托管费。
- (3) 运营服务机构的服务费
- (4) 管理人的业绩报酬（如有）。
- (5) 投资顾问的投资顾问费及业绩报酬（如有）。
- (6) 本计划的证券交易费用（包括但不限于经手费、印花税、证管费、过户费、手续费、券商佣金、权证交易的结算费及其他类似性质的费用等）。
- (7) 资产管理计划成立后与计划相关的资产评估师费、会计师费、律师费、审计费、

仲裁费、诉讼费及其他费用。

- (8) 银行账户的资金结算汇划费、账户维护费。
- (9) 计划财产开立资金、证券、期货等账户需要支付的费用。
- (10) 资产管理计划运营过程中发生的增值税及附加税（如有）。
- (11) 资产管理计划财产管理、运用及处分过程中发生的其他税费（如有）。
- (12) 资产管理计划成立后的资产管理计划信息披露费用。
- (13) 按照国家有关规定和本合同约定，可以在计划资产中列支的其他费用。

2. 管理人负责上述各项费用的核算工作，并应妥善保管上述费用的相关单据、凭证。除非特别说明，上述费用均在发生时或根据相关的合同约定由管理人指令托管人从托管账户中支付，并按实际支出金额列入当期费用。管理人或托管人如以固有财产先行垫付计划费用的，有权根据实际发生额（以实际支付凭证为准）从计划财产中优先获得补偿；尽管有本条款约定，托管人不承担垫付任何计划费用的义务。

3. 本条第1款所述之“银行账户的资金结算汇划费、账户维护费”由开户银行自动扣划，无需管理人向托管人出具投资指令。

4. 本产品如有参与银行间市场交易的，对于中央国债登记结算有限责任公司和银行间市场清算所股份有限公司的账户维护费、结算费等相关费用，托管人根据中央国债登记结算有限责任公司、银行间市场清算所股份有限公司费用数据文件中的费用信息，从产品托管账户中自动扣划。管理人在执行交易决策时，需考虑费用支付对可用交易金额的影响。

5. 本条第1款所规定的税费，如由计划资产直接缴纳的，需管理人向托管人出具划款指令；如由管理人代扣代缴的，需管理人向托管人出具划款指令，将相应税费划往管理人指定账户，由管理人向相关机构缴纳。管理人应在税费缴纳完成之后，保管相关缴纳流水、完成凭证，托管人可要求管理人提供复印件，并有权对管理人的保管情况进行检查。

6. 计划采用侧袋估值的，费用收取详见“资产管理计划资产的估值与会计核算”章节中“侧袋机制”的约定。

计划终止后不再计提管理费、托管费。

(二) 费用计提方法、计提标准和支付方式

1. 管理人的管理费

本计划的管理费按前一日计划财产净值的1.5%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times R \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的管理费

E为前一日的计划财产净值

R为本计划的年管理费率

本计划的管理费自本资产管理计划成立之日起，每日计提，按季（为免歧义，本合同中所提及的“季/季度”均指“自然季度”）支付。管理费经管理人与托管人核对一致后，托管人于次季五个工作日内从托管账户中将该季度的管理费划至管理人指定账户。管理人应保证支付日在托管账户中预留足额资金。以上由托管人执行的费用支付行为，无需管理人出具投资指令。若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延，若遇不可抗力或计划资产无法变现导致无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。管理人在执行交易决策时，需考虑费用支付对可用交易金额的影响。

管理人收款账户信息：

户名：华融融达期货股份有限公司

账号：7608 0153 8500 0006 9

开户银行：上海浦东发展银行郑州分行金水支行

以上收款账户如有变更的，管理人需至少提前两个工作日以告知函的形式通知托管人，账户变更生效日为托管人收到告知函之日。

2. 托管人的托管费

本计划的托管费按前一日计划财产净值的0.025%年费率计提。托管费的计算方法如下：

$H = E \times R \div \text{当年天数}$

H为每日应计提的托管费

E为前一日的计划财产净值

R为本计划的年托管费率

本计划的托管费自本资产管理计划成立之日起，每日计提，按季支付。托管费经管理人与托管人核对一致后，托管人于次季五个工作日内从托管账户中划至托管人指定账户。管理人应保证支付日在托管账户中预留足额资金。以上由托管人执行的费用支付行为，无需管理人出具投资指令。若遇法定节假日、休息日，支付日顺延，若遇不可抗力或计划资产无法变现导致无法支付的，顺延至最近可支付日支付。管理人在执行交易决策时，需考虑费用支付对可用交易金额的影响。

收款账户信息如下：

账户名称：国信证券股份有限公司

银行账号：7442710187000001914

开户银行：中信银行香蜜湖支行

3. 运营服务机构的服务费

本计划的服务费按前一日计划资产净值的0.025%年费率计提。服务费的计算方法如下：

$$H=E \times R \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的服务费

E为前一日的基金资产净值

R为本基金的年服务费率

本计划的服务费自本资产管理计划成立日起，每日计提，按季支付。服务费经管理人与托管人核对一致后，托管人于次季五个工作日内从托管账户中划至运营服务机构指定账户。管理人应保证在托管账户中预留足额资金。以上由托管人执行的费用支付行为，无需管理人出具划款指令。若遇法定节假日、休息日，支付日顺延，若遇不可抗力或计划资产无法变现导致无法支付的，顺延至最近可支付日支付。管理人在执行交易决策时，需考虑费用支付对可用交易金额的影响。

收款账户信息如下：

账户名称：国信证券股份有限公司

银行账号：7442710187000001914

开户银行：中信银行香蜜湖支行

4. 管理人的业绩报酬

管理人将根据如下约定计提业绩报酬。

(1) 收取业绩报酬的原则

同一投资者不同时间多次参与本计划的，对投资者每笔参与份额分别计算年化收益率计提业绩报酬。业绩报酬计提日为收益分配基准日、赎回日和计划终止日。

当收益分配基准日进行业绩报酬计提时，对于单个投资者，如收益分配金额不足以覆盖业绩报酬时，业绩报酬的计提金额以本次收益分配金额为限进行计提，后期不进行补提。

计划连续两次计提业绩报酬的间隔期不应短于6个月。投资者赎回份额时或在计划清算时计提业绩报酬的，可不受上述间隔期的限制。

在计划收益分配基准日提取业绩报酬的，业绩报酬计提确认日为收益分配权益登记日，业绩报酬将从收益分配资金中支付；在份额赎回时提取业绩报酬的，业绩报酬计提确认日为赎回确认日，业绩报酬从投资者赎回资金中支付；计划终止时提取业绩报酬的，业绩报酬计提确认日为清算日，业绩报酬从清算财产中支付。

(2) 业绩报酬的计提方法

在收益分配基准日、赎回日及计划终止日，若持有期年化收益率小于等于【6.5】%，则不计提业绩报酬；若持有期年化收益率大于【6.5】%，则管理人对超出部分按一定的比例累进提取业绩报酬。年化收益率R的计算公式如下：

$$R = \frac{P1 - P0}{P*} \times \frac{365}{T} \times 100\%$$

其中：

P1 为业绩报酬计提日的计划份额累计净值

P0 为上一个发生业绩报酬计提日的计划份额累计净值，初始认购份额首次计提业绩报酬时的“上一个发生业绩报酬计提日”是指计划成立日，存续期申购份额首次计提业绩报酬时的“上一个发生业绩报酬计提日”是指申购该笔份额的开放日；

P*为上一个发生业绩报酬计提日的计划份额净值，初始认购份额首次计提业绩报酬时的“上一个发生业绩报酬计提日”是指计划成立日，存续期申购份额首次计提业绩报酬时的“上一个发生业绩报酬计提日”是指申购该笔份额的开放日；

T表示上一个发生业绩报酬计提确认日到本次业绩报酬计提确认日的天数，每笔份额首次计提业绩报酬时的“上一个发生业绩报酬计提确认日”是指份额登记机构确认该笔份额之日；

管理人业绩报酬计提如下：

年化收益率 (R)	计提比例	收取业绩报酬总额 (Y) 的计提公式
$R \leq \text{【6.5】}\%$	0%	$Y=0$
$\text{【6.5】}\% < R$	$\text{【20】}\%$	$Y1(R) = A \times (R - \text{【6.5】}\%) \times \text{【20】}\% \times T / 365$

A = 参与份额在上一个发生业绩报酬计提日的资产净值总额。

(3) 业绩报酬支付

业绩报酬的计算由运营服务机构负责，复核工作由管理人完成。托管人不承担复核业绩报酬的责任。由管理人向托管人发送划付指令，托管人于收到指令后5个工作日内从计划资产中一次性支付给管理人。

注：单个委托人单笔投资资产管理人的业绩报酬保留到小数点后2位，小数点后3位四舍五入。

管理人收取业绩报酬账户信息：

户名：华融融达期货股份有限公司

账号： 7608 0153 8500 0006 9

开户行：上海浦东发展银行郑州分行金水支行

(三) 不列入计划业务费用的项目

1. 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计划财产的损失。
2. 管理人和托管人处理与计划运作无关的事项或不合理事项所发生的费用。
3. 资产管理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，不得在计划资产中列支。
4. 其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入计划费用的项目。

(四) 计划管理业务的税收

1. 管理人和托管人根据国家法律法规规定，履行纳税义务。
2. 份额持有人从资管计划财产中获得的各项收益，由份额持有人根据国家法律法规的规定，自行办理纳税申报并履行纳税义务。管理人不得扣代缴企业所得税和个人所得税（法律另有规定的除外）。

3. 本计划运营过程中发生的增值税应税行为须按相关规定缴纳增值税及附加税费的，该税款由管理人从本计划委托资产中列支承担。如法律法规对上述事项另有具体规定的，从其规定。

4. 托管人按照管理人确认的增值税税收规则进行税费的计算，计算结果由管理人最终确认，确认后，托管人按照管理人的指令，将应缴纳的税款从计划资产划付至管理人指定的纳税账户，由管理人向税务机关缴纳，管理人需将纳税账户信息或其变更情况提前以书面形式通知托管人，并承诺纳税账户信息的真实、准确与完整。如出现管理人未及时确认税收规则，或管理人未及时出具划款指令，或纳税账户信息错误或未及时通知托管人，或税款到达指定账户未及时、足额缴纳，或管理人在实际缴纳过程中出错等情形，导致缴税行为出现异常的，由管理人承担。

管理人向托管人出具的划款指令，应给托管人预留充足的划款时间，原则上不晚于缴纳截止日的前两个工作日。

管理人缴税账户信息如下：

户名：华融融达期货股份有限公司

账号： 76080 1538 5000 0069

开户行：上海浦东发展银行郑州分行金水支行

第二十三章 资产管理计划的收益分配

（一）可供分配收益构成

本资产管理计划可供分配利润指计划利息收入、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。

（二）收益分配原则

1. 本计划每一份额享有同等的分配权；
2. 本计划存续期内是否分配收益、收益分配比例和分配金额由管理人确定；收益分配基准日间隔不短于6个月。
3. 收益分配基准日计划的份额净值减去每份额收益分配金额不能低于1.0000元；
4. 收益分配比例由管理人根据计划运作情况决定；
5. 法律、法规或监管部门另有规定的从其规定。

（三）收益分配方式

本计划的收益分配方式分为现金分红及红利再投资，如果投资者不选择，系统默认为现金分红，具体以管理人的分配方案为准。红利转份额的，份额持有期按转份额日开始起算。每位投资者获得的分红收益金额保留小数点后2位，第3位四舍五入，由此产生的差额部分计入计划资产的损益。

（四）收益分配方案的确定与公告

存续期内，进行收益分配的，管理人应计算可供分配利润，并拟定计划收益分配方案，收益分配方案须载明可供分配利润、分配对象、收益分配基准日、收益分配发放日、分配数额、分配方式等内容。管理人应将分配方案发送给托管人，托管人在收到之日起5个工作日内完成复核，由管理人及时向投资人披露经复核的收益分配方案，并按法律法规及中国证监会或基金业协会的规定履行相应程序。

托管人仅对收益分配的总金额进行复核，对于在不同投资者之间分配的金额和顺序是否符合合同约定由管理人负责。

（五）收益分配方案的执行

在收益分配方案通知份额持有人后，如涉及现金分红的方式，管理人依据收益分配方案的规定向托管人发送划款指令进行划付，并最终由募集机构或其委托的账户监督机构向投资者划付具体分配款项；如涉及红利转份额的方式，份额持有人所转换的份额将以收益分配基准日份额净值为计算基准确定再投资份额，红利转份额所转换的份额将直接记入其计划账户。

第二十四章 信息披露与报告

（一）信息披露的形式

本计划的信息披露可选择下列任何一种方式进行，并自披露之日起五个工作日届满之日视为送达投资人：

1. 寄送给投资人；
2. 包括但不限于在管理人、基金业协会网站等公布；
3. 如委托人办理资产管理计划认购、参与或退出等业务时留有传真号、电子邮箱、手机号码及电话号码等联系方式的，资产管理人也可通过传真、电子邮件、手机短信、电话、电报等方式将报告信息通知资产委托人。资产委托人上述联系方式若发生变更应当及时通知资产管理人；

4. 双方认可的其他方式。

（二）信息披露的内容及时间

1. 自计划成立之日起，管理人于每个会计季度截止日后 1 个月内向投资人出具季度报告，每个会计年度截止日后 4 个月内向投资人出具年度管理报告。成立不满三个月的，无需出具年度管理报告。

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）资产管理计划投资表现；
- （4）资产管理计划投资组合报告；
- （5）资产管理计划资产负债情况；
- （6）资产管理计划运用杠杆情况（如有）；
- （7）资产管理计划财务会计报告；
- （8）资产管理计划支付的管理费、托管费、业绩报酬（如有）等费用，包括计提基准、计提方式和支付方式；
- （9）资产管理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。

资产管理计划季度报告应当披露前款除第（7）项之外的其他信息。

2. 计划终止, 管理人应于计划终止后十个工作日内做出处理资产管理计划事务的清算报告, 并送达投资人。

3. 管理人在计划成立后, 应至少每周向投资人披露计划份额净值。

4. 发生资产管理合同约定的或者可能影响投资者利益的重大事项时, 在事项发生之日起五日内向投资者披露。

(1) 投资经理发生变动;

(2) 投资顾问(如有)发生变动;

(3) 涉及资产管理人、计划财产、资产托管业务的诉讼;

(4) 资产管理人、资产托管人托管业务部门与本合同项下资产管理计划财产相关的行为受到监管部门的严重行政处罚;

(5) 资产管理人及其董事、总经理及其他高级管理人员、投资经理受到严重行政处罚, 资产托管人的托管业务或托管业务部门负责人受到严重行政处罚;

(6) 法律法规、监管机构、自律组织的其他事项。

5. 本计划的信息披露, 管理人可选择下列任何一种或多种方式进行:

(1) 管理人网站

通过管理人网站向份额持有人提供定期报告、临时报告等有关本计划信息的查询。

(2) 邮寄服务

管理人向份额持有人邮寄定期报告、临时报告等有关本计划的信息。份额持有人在本合同签署页填写的通信地址或在募集机构留存的通信地址为送达地址。通信地址如有变更, 份额持有人应当及时通知管理人。

(3) 传真、电子邮件、短信、微信

如份额持有人留有传真号、电子邮箱、手机号、微信号等联系方式的, 管理人可通过传真、电子邮件、电话等方式将报告信息通知份额持有人。

(4) 其他各方约定或中国证监会以及基金业协会明确规定的信息披露途径或方式。

6. 本计划成立不足三个月或者存续期间不足三个月的, 管理人可以不编制资产管理计划当期的季度报告和年度报告。

7. 管理人的董事、监事、从业人员及其配偶、控股股东、实际控制人或者其他关联方参与资产管理计划, 应向投资者充分披露。

8. 资产管理计划年度财务会计报告应当经符合《证券法》规定的会计师事务所审计, 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。

9. 为免疑义，资产管理人向资产委托人提供的上述报告，不包括反映本计划交易过程的交易明细及交易凭证等信息。

10. 本计划的具体开放时间，由管理人根据产品运作情况通过合同约定的方式提前告知相关合同当事人。

(三) 除上述条款规定的信息披露内容，管理人应承担相关法律法规、监管规则、自律规则要求的其他信息披露义务。

(四) 管理人应编制资产管理业务及资产管理计划净值、季报、年报、清算报告、重大事项的临时报告，并向中国证监会相关派出机构报送，抄报证券投资基金业协会。

(五) 托管人应编制资产管理计划的年度托管报告，并向证券投资基金业协会备案，抄报中国证监会相关派出机构。

第二十五章 风险揭示

本计划在投资管理过程中面临的各项风险包括但不限于：

(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

本资产管理合同关于份额持有人大会的相关规定与《集合资产管理计划资产管理合同内容与格式指引》（以下简称“《格式指引》”）中相应条款不完全一致，另有一些具体细节要求对合同当事人确不适用，故管理人对相应内容做出了合理调整和变动，导致合同与中国基金业协会合同指引不一致的风险。请投资者在签署合同前仔细阅读合同条款。

2. 计划委托募集（如有）所涉风险

本计划委托代销机构募集资金的，代销机构应当恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉地履行说明义务、反洗钱义务、承担特定对象确定、投资者适当性审查、推介及合格投资者确认等相关责任以及销售协议中约定的其他义务。如销售机构未能完全履行该等义务，将影响募集环节的合规有序开展，从而可能会导致本计划以及投资者受到一定损失。若销售机构的销售系统出现故障或销售人员存在操作失误，也可能对本计划以及计划投资者造成不利影响。

3. 资产管理计划外包事项所涉风险

(1) 如运营服务机构未按照法律法规规定或运营服务协议约定履行职责，可能导致本计划财产遭受损失。

(2) 由同一机构提供基金服务和托管服务的风险

本计划由国信证券股份有限公司担任托管人，同时管理人聘请国信证券股份有限公司为

其就本计划提供募集账户监督、份额注册登记、估值核算相关基金服务。国信证券股份有限公司在同时提供上述服务的情况下，存在一定的利益冲突风险。

4. 资产管理计划份额转让所涉风险

委托人可通过现时或将来法律、法规或监管机构允许的方式办理资管计划的份额转让业务，其转让地点、时间、规则、费用等按照办理机构的规则执行。如果份额转让因不符合法律法规或办理机构的规则未办理成功的，委托人需要自行承担相应风险和损失。

5. 资产管理计划不设置份额持有人大会所涉风险

本计划不设立持有人大会。管理人将根据资产管理合同的约定对本计划运作进行管理，本计划的展期、变更、更换管理人\托管人、调整管理人\托管人报酬标准等对投资者权利义务产生重大影响的事项均将根据资产管理合同的约定进行。在发生上述事项时，管理人将按照合同约定的方式进行充分的信息披露，并尽力提供多种渠道方便投资者查询相关信息。

6. 未在证券投资基金业协会完成备案的风险

资产管理人应当在本计划募集完毕后向中国基金业协会办理基金备案手续。因系统障碍、与法规或监管规定不符或者其他原因，本计划存在未能在法规要求的时限内完成备案或者证券投资基金业协会拒绝本计划备案的情形。若本计划无法在证券投资基金业协会备案，届时可能会终止，由此导致的全部损失与风险由委托人承担。

7. 风险收益特征的风险揭示

本合同有关风险收益特征的表述是基于本计划成立时的投资范围、投资策略、投资比例、证券市场普遍规律等因素做出的概述性描述，仅代表了一般市场情况下本计划的长期风险收益特征。如后续本计划相关投资安排或产品信息发生变化，或者证券市场发生变动等原因，销售机构可能会依据其风险等级评价参考标准，重新评估和调整本计划的风险等级。资产委托人应随时关注本计划风险等级的更新情况，谨慎作出投资决策。

若代销机构根据其产品风险等级划分规则对本计划风险收益特征的评定与本合同约定不一致，投资者通过代销机构认购/申购本计划份额的，产品风险等级及投资者适当性匹配意见以代销机构为准。募集机构对本计划的风险评级及对投资者的风险评级的方法和方式可能影响测评结果的客观性和准确性。

8. 预警止损机制的风险

资产管理计划虽然约定了预警止损机制，但由于持仓品种价格可能持续向不利方向变动、持仓品种因流动性不足导致不能平仓等原因，本计划可能不能及时止损，本计划终止时的计划份额净值有可能远低于止损线。

9. 退出受限的风险

本计划份额仅可在满足合同约定的份额持有期（如有），并在约定的申请时间和可赎回的开放日赎回，若投资者未按约定提交赎回申请，投资者将面临无法及时退出的风险。

10. 大额赎回和巨额赎回的风险

本计划在非可赎回的开放日不接受投资者的退出申请，在触发合同约定的大额退出情形时管理人或代销机构可能拒绝投资者的赎回申请，在触发合同约定的巨额退出情形时管理人或代销机构可能部分顺延投资者的赎回申请，投资者面临在投资期内无法按意愿退出的风险。

11. 侧袋机制的风险

在特定情况下，管理人可能启动侧袋机制，在侧袋机制下投资者面临以下风险：

- （1）投资者将无法赎回侧袋基金份额，仅可获得主袋计划份额对应的计划资产；
- （2）本计划的投资限制、风控机制可能存在失效的风险；
- （3）侧袋账户资产净值可能无法准确地反映其真实价值。

12. 合同变更风险

管理人有可能按照本合同约定的程序和方式变更本合同条款，该等变更不一定与投资者意愿一致，投资者可能面临本合同条款变更的风险。

13. 采用“变更征询意见函”形式变更合同条款的风险

管理人就合同变更获得托管人的书面同意后，可通过变更征询意见函的方式变更合同条款，变更过程中可能存在以下风险：

- （1）投资者未能及时收到、查阅管理人按照本合同约定方式发送的变更征询意见函，从而未能及时获知合同拟变更内容的风险。
- （2）投资者不同意变更内容但未能在变更征询意见函指定的开放日内全部赎回所有份额，从而被动接受合同变更后内容的风险。
- （3）投资者不同意变更内容，导致的非主观意愿提前赎回份额的风险。

14. 管理人有权自行变更投资经理的风险

管理人有权按照本合同约定的程序和方式自行变更投资经理，如管理人变更投资经理，有可能导致投资风格的改变，从而影响本计划的投资收益，投资人可能面临着权益受到损害的风险。

15. 管理人股权变更的风险

在本计划存续期间，管理人的股权结构、关键控制人可能发生变更。相关变更可能导致

管理人组织架构、投研流程、投资风格的变更，从而影响本计划的投资收益，投资人可能面临着权益受到损害的风险。

16. 关联交易风险

管理人以资产管理计划资产从事关联交易的，应当遵守法律、行政法规、中国证监会的规定和合同约定，事先取得投资者的同意，事后及时告知投资者和托管人，并向中国证监会相关派出机构和证券投资基金业协会报告，投资于证券期货的关联交易还应当向证券期货交易所报告。管理人确认其已建立防范利益输送和利益冲突的机制，确认该等交易安排合法合规、不存在利益输送等违法违规行为。但该等交易仍构成管理人与本资产管理的关联交易，存在利益冲突风险。

17. 单人单笔法计提业绩报酬的风险

本计划采用“单人单笔法”计算向管理人支付业绩报酬，业绩报酬的计算由运营服务机构负责，复核工作由管理人完成。托管人不承担复核业绩报酬的责任。业绩报酬计算的准确性会对投资者的收益产生影响。

在业绩报酬计提日为收益分配基准日时，对于单个投资者，可能存在业绩报酬金额大于或者等于收益分配金额的情况，投资者面临在该收益分配基准日无法实际获得收益分配的风险。

18. 未约定收益分配比例的风险

本计划每次进行收益分配占可供分配利润的比例由管理人决定，如管理人决定进行的收益分配比例占可供分配利润的比例较低，可能发生一次收益分配的金额主要用于支付业绩报酬，实际上投资者无法获得收益分配款项或获得分配的收益分配金额较低，而损害投资者利益。

19. 存续期内不进行收益分配的风险

本计划存续期内由管理人决定是否进行收益分配，如管理人决定不进行收益分配，投资者只能在退出计划份额时或计划合同终止时取得投资收益，面临一定的流动性风险；且若存续期内净值发生波动或出现亏损，投资者在计划终止时可能面临净值回撤甚至无法获得投资收益的风险。

(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资产管理计划财产，但不保证资产管理计划财产中的认（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】级风险投资品种，适合风险识别、评估、承受能力【G3】型及以上的合格投资者。

2. 市场风险

资产管理计划的投资品种价格因受经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素影响而引起的波动，导致收益水平变化产生的风险。主要包括：政策风险、经济周期风险、利率风险、购买力风险、再投资风险、衍生品风险等。

3. 管理风险

资产管理计划运作过程中，管理人依据资产管理合同约定管理和运用资产管理计划财产所产生的风险，由资产管理计划财产及投资者承担。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

资产管理计划因市场整体或投资品种流动性不足、应付可能出现的投资者巨额退出或大额退出等原因，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危险。

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，可能导致本计划财产遭受损失。管理人和托管人并不保证交易对手方能够完全履行相关协议或遵守相关法规，也不保证委托人将不因任一方之违约而减少收益。

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) 在资产管理计划募集期限届满（确认资产管理计划无法成立）后三十日内返还投资者已交纳的款项，并加计银行同期活期存款利息。

7. 提前终止风险

如发生本合同约定的情形，本计划存续期限将相应提前终止，委托人将面临无法按预期获得收益或无法按意愿退出投资的风险。

8. 投资标的的风险

(1) 投资于股票的风险包括但不限于：

1) 国家货币政策、财政政策、产业政策等的变化对证券市场产生一定的影响，导致市

场价格水平波动的风险；

2) 宏观经济运行周期性波动，对股票市场的收益水平产生影响的风险；

3) 上市公司的经营状况受多种因素影响，如市场、技术、竞争、管理、财务等都会导致公司盈利发生变化，从而导致股票价格变动的风险。

4) 法规政策对股票发行条件、交易、涨跌幅限制、退市等变化。

(2) 投资于科创板股票的特殊风险

1) 科创板企业所处行业和业务往往具有研发投入规模大、盈利周期长、技术迭代快、风险高以及严重依赖核心项目、核心技术人员、少数供应商等特点，企业上市后的持续创新能力、主营业务发展的可持续性、公司收入及盈利水平等仍具有较大不确定性，进而会影响到股票价格，给本计划的净值带来波动。

2) 科创板企业可能存在首次公开发行前最近3个会计年度未能连续盈利、公开发行并上市时尚未盈利、有累计未弥补亏损等情形，可能存在上市后仍无法盈利、持续亏损、无法进行利润分配等情形，从而导致本计划所持股票价格可能下跌，或者能够用于分配的利润减少，从而使产品投资的收益下降。

3) 科创板退市制度较主板更为严格，退市时间更短，退市速度更快；退市情形更多，新增了市值低于规定标准、上市公司信息披露或者规范运作存在重大缺陷导致退市的情形；执行标准更严，明显丧失持续经营能力，仅依赖与主业无关的贸易或者不具备商业实质的关联交易维持收入的上市公司可能会被退市。因此，本计划可能存在因所持个股遭遇非预期性的退市而给计划财产带来损失的风险。

4) 科创板股票竞价交易设置较宽的涨跌幅限制，首次公开发行上市的股票，上市后的前5个交易日不设涨跌幅限制，其后涨跌幅限制为20%，因此股价波动风险更大，从而导致本计划净值的波动。

(3) 投资于全国中小企业股份转让系统股票的风险包括但不限于：

1) 全国中小企业股份转让系统挂牌企业的规模普遍较小，对单一技术、核心技术人员、大客户等经营要素依赖程度较高，其主营业务收入、营业利润、每股净收益等财务指标远低于上市公司，抵抗市场风险和行业风险的能力较弱，公司业绩和股票价格的波动较大；

2) 全国中小企业股份转让系统市场目前存在投资门槛较高、参与者不足等问题，市场交易不活跃，市场整体流动性低于沪深证券交易所，因此本私募基金面临较高的流动性风险；

3) 全国中小企业股份转让系统股票的价格波动较大，交易量较小，本私募基金所持有的全国中小企业股份转让系统股票的最终退出价格往往与某个估值日的股票价格偏离较大，

进而导致本私募基金在存续期内的估值未必能客观、准确地反映本私募基金资产的价值，估值的不准确性直接影响投资者的申购赎回价格；且由于市场交易不活跃，市场整体流动性低于沪深证券交易所，受流动性影响基金资产可能最终无法实现全部变现。

4) 全国中小企业股份转让系统市场上挂牌公司的信息披露标准低于上市公司，投资者基于披露的信息对挂牌公司了解有限。

(4) 投资于债券的风险包括但不限于：

1) 市场平均利率水平变化导致债券价格变化的风险；

2) 债券市场不同期限、不同类属债券之间的利差变动导致相应期限和类属债券价格变化的风险；

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

(5) 投资于港股通交易的风险

因沪、深、港股票市场在投资环境、投资者结构以及交易标的等方面都存在一定差异，参与港股通交易可能面临如下风险：

1) 市场联动风险：与内地A股市场相比，由于在港股市场上外汇资金自由流动，海外资金的流动与港股价格之间表现出高度相关性，因此，投资者在参与港股市场交易时受到全球宏观经济和货币政策变动导致的系统风险相对更大。

2) 股价波动风险：由于港股市场实行T+0交易机制，而且不设涨跌幅限制，加之香港市场结构性产品和衍生品种类相对丰富，因此，港股通个股的股价受到意外事件驱动的影响而表现出股价波动的幅度相对A股更为剧烈，投资者持仓的风险相对较大。

3) 汇率风险：本计划在交易时间内提交订单依据的港币买入参考汇率和卖出参考汇率，并不等于最终结算汇率。港股通交易日日终，中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中国结算”）进行净额换汇，将换汇成本按成交金额分摊至每笔交易，确定交易实际适用的结算汇率，可能存在港币汇率兑人民币波动的风险。

4) 个股流动性风险：本计划可以通过港股通买卖的股票存在一定的范围限制，且港股通股票名单会动态调整。对于被调出的港股通股票，自调整之日起，本计划将不得再行买入。

且不同于在内地市场中小市值股票的成交较为活跃，在香港市场，部分中小市值港股成交量则相对较少，流动较为缺乏。因此，若重仓持有此类股票，则可能因缺乏交易对手，进而面临小量抛盘即导致股价大幅下降的风险。

5) 额度限制风险：港股通业务试点期间存在每日额度和总额度限制。总额度余额少于

一个每日额度的，上交所证券交易服务公司自下一港股通交易日起停止接受买入申报，本计划将面临不能通过港股通进行买入交易的风险；在香港联合交易所有限公司（以下简称“联交所”）开市前阶段，当日额度使用完毕的，新增的买单申报将面临失败的风险；在联交所持续交易时段，当日额度使用完毕的，当日本计划将面临不能通过港股通进行买入交易的风险。

6) 交易成本风险：参与港股投资，除因股票交易而发生的佣金、交易征费、交易费、交易系统费、印花税、过户费等税费，在不进行交易时也可能要继续缴纳证券组合费等项费用，从而导致交易成本上升。

(6) 投资于期货的风险包括但不限于：

1) 期货交易所实行保证金制度、当日无负债结算制度、涨跌停板制度、持仓限额和大户持仓报告制度、风险准备金制度以及国务院期货监督管理机构规定的其他风险管理制度。本计划可能因保证金不足而被采取限制开仓、强制平仓，进而可能给本计划造成重大损失；本计划所委托的交易所会员除接受本计划委托外，还可能同时接受其他主体的委托，本计划所委托的交易所会员发生保证金不足时将被采取限制开仓、强制平仓等措施，而这种不足不一定是本计划的保证金不足造成的，还可能是上述交易所会员进行其他主体的委托操作所造成的，但即便如此本计划也可能因此受到重大损失；为及时缴纳保证金，本计划可能紧急变现部分计划财产，在上述情况下，该部分计划财产的变现可能并非以最优价格进行，从而造成本计划的损失。本计划及本计划所委托的交易所会员可能被实行强制结算，一旦本计划或本计划所委托的交易所会员被强制结算、可能给本计划财产造成损失；

2) 期货具有高杠杆性的特征，当出现不利行情时，本计划所投资期货合约品种微小的变动就可能使本计划遭受较大损失；

3) 在市场剧烈变化的情况下，管理人可能难以或无法将持有的未平仓合约平仓。这类情况将导致保证金有可能无法弥补全部损失，本计划必须承担由此导致的全部损失。同时本计划将面临期货合约无法当天平仓而价格变动的风险；

4) 相关交易所可能对交易品种的套期保值或套利实行额度管理，本计划如拟进行某交易品种的套期保值或套利交易的，可能因无法申请额度或无法及时获得额度而不能开展相关交易；

5) 相比于其他交易品种，期货的投资交易可能更加频繁，频繁操作将可能增加管理人、期货经纪人等相关方操作失误的可能性，存在操作风险。

(7) 投资于股指期货的特别风险包括但不限于：

作为股指期货合约标的的股票指数受股票交易市场价格波动的影响,从而给股指期货的投资带来风险。

(8) 投资于国债期货的特别风险包括但不限于:

1) 为进行国债期货的交割,投资者需要提供符合交易所要求的可交割国债,如管理人未能在国债期货合约到期前进行平仓,则需要购入/接受相关的可交割国债以满足交割的需求,或者需要以差额补偿的方式了结未平仓合约,甚至有可能因持仓不满足交割要求而需要支付额外的违约金/补偿金等;

2) 国债期货的合约标的为国债,与以较综合性的股票指数为标的物的股指期货相比,以国债合约作为合约标的的国债期货的价格更容易受市场部分投资者或某一市场消息的影响而发生价格或持续或较大幅度的波动,从而给国债期货的投资带来风险。

(9) 投资于期权的特别风险包括但不限于:

1) 期权属于高风险高收益的金融衍生品,由于高杠杆特征,当出现不利行情时,所投资期权合约品种微小的变动就可能会使本计划遭受较大损失;

2) 如本计划作为期权合约的买方,当出现不利行情时,如本计划选择不执行期权则本计划可能损失权利金/期权费及相应的时间成本,如本计划选择执行期权则可能因为不利行情因素导致本计划投资遭受损失;如本计划作为期权合约的卖方,当出现不利行情时,期权合约买方往往选择执行期权,本计划可能由于所持期权价格受不利行情影响而产生较大的损失。

3) 持有的期权合约存在可能难以或无法平仓的风险,当市场交易量不足或者连续出现单边涨跌停价格时,期权合约持有者可能无法在市场上找到平仓机会。

(10) 投资于QDII等产品从而间接投资于境外市场的风险包括但不限于:

1) 投资于海外证券的风险:投资于海外证券市场时,因各国或地区处于不同产业景气循环周期阶段,将对投资收益产生影响,海外证券市场可能由于对于负面的特定事件、该国或地区特有的政治因素、法律法规、市场状况、经济发展趋势的反映较境内证券市场有诸多不同,并且投资市场如香港和新加坡等证券交易市场对每日证券交易价格并无涨跌幅上下限的规定,因此这些国家或地区证券的每日涨跌幅空间相对较大,以上所述因素可能会带来市场的急剧下跌,从而带来投资风险的增加;

2) 汇率风险:指经济主体持有或运用外汇的经济活动中,因汇率变动而蒙受损失的可能性,QDII等产品投资于海外市场,可能涉及到多种外币币种的投资,外汇与人民币汇率波动、外汇之间交叉汇率的波动都有可能对QDII等产品以计价币种公布的净值造成不利或

有利的影响。

(11) 投资于资产管理产品的风险包括但不限于：

本计划作为 FOF 型产品，投资于接受国务院金融监督管理机构监管的机构发行的资管产品的比例依市值计不低于总资产的 80%，可能出现如下风险：

1) 该等金融产品的管理人在进行投资时，如出现判断有误、获取信息不全、或对投资工具使用不当，或未勤勉尽责进行投资管理等情形，将对本计划的收益甚至本金安全造成不利影响。

2) 本计划投资于该等金融产品时，仅能于投资时判断该标的金融相关产品要素是否符合本合同的约定，若该标的金融产品变更其产品要素（可能无需经本计划管理人同意），均可能给本计划造成不利影响。

3) 该等金融产品的管理人投资管理能力及其聘请的投资顾问（如有）的投资建议水平，均会对该等金融产品的收益水平产生重大影响，进而影响本计划的收益水平。

4) 该等金融产品可能并非随时开放申购、赎回，其申购、赎回的限制可能给本计划的流动性造成影响，也可能造成本计划不能及时执行预警止损机制（如有）。

5) 该等金融产品本身将会收取一定的费用，虽然该等费用可能并非直接在本计划项下列支，但相比较于份额持有人直接对该等金融产品进行投资的情况，份额持有人通过投资于本计划间接投资于该等金融产品，实质上同时承担了本计划、该等金融产品项下的费用。

6) 底层净值提供不及时、不准确对产品净值影响风险

本计划所投资的金融产品，如管理人或其指定机构就该等金融产品所提供的净值不及时、不准确，或估值日取得的金融产品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对估值价格的影响），可能会对本计划净值的准确性产生影响。

(12) 投资于可转债的风险

1) 股价波动风险

一旦持有者错误判断股市的后续发展或者正股未来的走势，转股后将面临股价波动带来的损失。

2) 提前赎回风险

可转债的发行者可以在发行一段时间之后，以某一价格提前赎回债券，这个机制在某种程度上限制了持有人获得更高收益的权利。

3) 机会成本

由于可转债兼具债性和股性，因此其利率一般低于普通债券利率。当选择了把债券转换

成股票的权力，就须放弃单纯持有普通债券的利息收益。因此当股价低于转换价格时，持有者为避免转股后股价继续下跌，不得不持有债券时，收益将低于持有普通债券。

(13) 投资于资产支持证券的风险

1) 评级风险

评级机构对资产支持证券的评级不是购买、出售或持有资产支持证券的建议，而是对资产支持证券预期收益和/或本金偿付的可能性作出判断，不能保证资产支持证券的评级或降低资产支持证券的评级。评级机构撤销或降低资产支持证券的评级可能对资产支持证券的价值带来负面影响

2) 市场风险

市场利率将随宏观经济环境的变化而波动，利率波动可能会影响资产支持证券投资者收益。

3) 资产支持证券流动性风险

在交易对手有限的情况下，资产支持证券投资者将面临无法在合理的时间内以公允价格出售资产支持证券而遭受损失的风险。

14. 托管风险

如托管人未按照法律法规规定或资产管理合同约定履行托管职责，可能导致本计划财产遭受损失。

托管人仅按照本合同约定的标准及范围履行投资监督职责，并不能确保管理人完全按照相关法律法规及本合同约定进行投资运作。

15. 操作或技术风险

相关当事人在业务各环节操作过程中，因内部控制存在缺陷或者人为因素造成操作失误或违反操作规程等引致的风险，例如，越权违规交易、会计部门欺诈、交易错误等风险。

在本计划的各种交易行为或者后台运作中，可能因为技术系统的故障或者差错而影响交易的正常进行或者导致资产委托人的利益受到影响，例如IT系统故障等风险。这种技术风险可能来自管理人、注册登记机构、募集机构、托管人等。

16. 管理人/托管人不能继续履行职责的风险

如在本计划存续期间管理人/托管人因停业、解散、撤销、破产，或者被监管部门撤销相关业务许可而不能继续履行资管合同项下的职责，可能会对本计划产生不利影响。

17. 计划投资类型变动风险

金融机构在发行资产管理产品时，应当向投资者明示资产管理产品的类型，并按照确定

的产品性质进行投资。产品投资债权类资产、权益类资产和商品及金融衍生品类资产的比例范围应当在发行产品时予以确定并向投资者明示，在产品成立后至到期日前不得擅自改变。产品的实际投向不得违反合同约定，如有改变，应当先行取得投资者书面同意，并履行登记备案等法律法规以及金融监督管理部门规定的程序。

非因金融机构主观因素导致突破前述比例限制的，金融机构应当在流动性受限资产可出售、可转让或者恢复交易的15个交易日内调整至符合要求。在调整期间，委托人权益有可能受到影响。

18. 税收风险

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

19. 其他风险

战争、自然灾害等不可抗力因素的出现，将可能导致计划资产遭受损失。金融市场危机、行业竞争等超出管理人自身直接控制能力之外的风险，可能导致份额持有人利益受损。

第二十六章 资产管理合同的变更与终止

（一）资管计划合同的变更

1. 以下合同变更事项可由管理人自行决定：

（1）调低管理人的管理费、业绩报酬（如有）、参与费、退出费、投资顾问（如有）的投资顾问费及业绩报酬的费率及比例；

（2）投资经理的变更和更换投资顾问（如有）；

（3）资管计划份额认购/申购的原则、时间、业务规则等设置（不包括上调认购费、申购费率、开放日的变更等涉及投资者权利、义务的条款）；

（4）法律法规、中国证监会、基金业协会规定及本合同约定的可以由管理人自行决定的其他事项。

管理人应该按照合同约定向资管资产委托人披露变更的具体内容。

2. 以下合同变更事项可由管理人和托管人协商一致后决定：

（1）调低托管人及服务机构（如有）的费用报酬标准；

（2）因法律法规、中国证监会、基金业协会对合同内容及格式要求发生变动而应对对资管计划合同进行变更；

（3）对本合同的修改，对资管资产委托人利益无实质性不利影响或不会导致本合同当

事人权利义务关系发生变化；

(4) 法律法规、中国证监会、基金业协会规定及本合同约定的可由管理人和托管人协商决定的其他事项。

管理人应该按照合同约定向资管资产委托人披露变更的具体内容。

3. 除上述第1项、第2项约定以及根据本合同约定需要召开份额持有人大会(如有)决定的情形外, 应通过如下任一方式变更资产管理合同:

(1) 资产管理合同的变更获得管理人、托管人及所有委托人一致书面同意;

为免疑义, 根据本合同约定需要召开份额持有人大会(如有)决定的事项, 可通过本第(1)项约定方式变更合同, 全体份额持有人签署的补充协议应视为全体份额持有人以书面形式一致表示同意的文件。

(2) 管理人就合同变更获得托管人的书面同意后, 就本合同变更事项以约定的方式向份额持有人发布合同变更征询意见函(或通知), 合同变更征询意见函(或通知)中应明确规定开放日设置安排。份额持有人不同意合同变更的, 应在管理人安排的开放日内申请赎回; 份额持有人未在管理人安排的开放日申请赎回的, 视为同意合同变更, 份额持有人退出本计划后, 其对合同补充或修改的异议将不影响合同的变更。份额持有人同意, 无论其是否提出赎回申请, 管理人变更合同的行为均不应被视为或裁定为管理人的违约行为。

管理人因合同条款变更设置开放日的, 不受本合同开放日及份额持有期限条款约定的限制。

因法律、法规或监管规定发生变化需要对本合同进行变更的, 管理人可与托管人协商后修改本合同。在此种情况下, 本合同的变更无需全体份额持有人书面同意, 但管理人应按照本合同的约定向份额持有人披露变更的具体内容。

管理人应按照证券投资基金业协会要求及时向证券投资基金业协会备案, 并抄报中国证监会相关派出机构。

(二) 资管计划的展期

经全体投资者、管理人和托管人协商一致, 资产管理计划可以展期, 但应签署书面协议。计划展期应符合以下条件:

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

2. 资产管理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;

4. 资产管理计划展期的，应当符合资产管理计划的成立条件。

(三) 资管计划的终止

发生下列任一情形的，本计划终止：

1. 资产管理计划存续期届满且不展期；
2. 管理人被依法撤销资产管理业务资格或者依法解散、被撤销、被宣告破产，且在六个月内没有新的管理人承接；
3. 托管人被依法撤销基金托管资格或者依法解散、被撤销、被宣告破产，且在六个月内没有新的托管人承接；
4. 经全体投资者、管理人和托管人协商一致决定终止的；
5. 持有人大会决议提前终止资产管理合同；
6. 发生资产管理合同约定的应当终止的情形；
7. 集合资产管理计划存续期间，持续五个工作日投资者少于二人；
8. 本计划在成立后，未在证券投资基金业协会完成备案或不予备案的；
9. 法律、行政法规及中国证监会规定的其他情形。

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

(四) 管理人被依法撤销资产管理业务资格或者依法解散、被撤销、宣告破产，资产管理计划由其他管理人承接，份额持有人可召开份额持有人大会（如有），按照份额持有人大会（如有）的议事规则和程序完成管理人更换。

(五) 托管人被依法撤销基金托管资格或者依法解散、被撤销、宣告破产，资产管理计划由其他托管人承接，管理人应召开份额持有人大会（如有），按照份额持有人大会（如有）的议事规则和程序完成托管人更换。

第二十七章 资产管理计划资产的清算

(一) 资产管理计划财产的清算

本计划终止后，应当按法律法规和本合同的有关规定对计划财产进行清算。管理人应在发生终止情形之日起五个工作日内开始组织清算资产管理计划资产。

(二) 资产管理计划财产清算小组

1. 计划财产清算小组成员由资产管理人、资产托管人组成。清算小组可以聘用必要的工作人员。

2. 计划财产清算小组负责资产管理计划财产的保管、清理、估价、变现和分配。计划财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。

3. 清算小组各成员的具体职责以本章约定为准，本节未约定的，清算小组成员可以书面形式进行补充约定。

（三）清算程序

1. 本合同终止情形发生后，由计划财产清算小组统一接管计划财产。
2. 对计划财产进行清理和确认。
3. 对计划财产进行评估和变现。
4. 制作清算报告。
5. 将清算报告告知资产委托人。
6. 对计划财产进行分配。

（四）清算报告的告知安排

管理人应于本计划终止日后十个工作日内向份额持有人披露经托管人复核无误的清算报告。

（五）清算费用

清算费用是指计划财产清算小组在进行计划清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由计划财产清算小组优先从计划财产中支付。清算费用包括但不限于：

1. 聘请会计师、律师，以及其他工作人员所发生的报酬；
2. 计划财产的保管、清理、估价、变现和分配产生的费用；
3. 信息披露所发生的费用；
4. 诉讼仲裁所发生的费用；
5. 其他与清算事项相关的费用。

（六）计划剩余财产的分配

依据资产管理计划财产清算的分配方案，将资产管理计划财产清算后的全部剩余资产扣除资产管理计划财产清算费用、应由资产管理计划财产承担的税款、资产管理计划其他费用及债务后，按照本合同约定进行分配。分配顺序如下：

1. 支付清算费用；
2. 缴纳所欠税款；
3. 支付托管费、服务费（如有）、管理费等计划相关费用以及清偿计划其他债务；
4. 按各份额持有人持有比例进行分配并分别扣除应计提业绩报酬（如有）

特别地，如分配时托管账户中的现金不足以按照上述顺序进行分配时，优先用于支付顺序在前的分配项目。

除交易所、登记结算机构、开户银行等自动扣缴的费用外，计划财产的分配由管理人向托管人出具划款指令，由托管人复核后办理支付。为免疑义，托管人仅按照管理人的指令及时将可供向全体份额持有人分配的款项划付至募集账户，最终由募集机构或其委托的账户监督机构向各个份额持有人进行具体分配。

自计划终止日至计划财产向份额持有人实际分配之日的期间，计划财产产生且未被列入计划清算财产的存款利息，用于支付计划财产清算、分配期间产生的银行手续费等，若有结余，归份额持有人所有；若不足，由管理人支付。

（七）二次清算

若本计划的部分投资标的不能在本章第四条约定的期限内变现完毕的，管理人将本计划届时已完成变现的部分资产按照本合同的约定进行清算。对于其余未能变现的资产，管理人有义务继续变现，变现完成后，管理人进行二次清算并分配。管理人应制定二次清算方案，该方案应经托管人认可，并按照清算报告的披露程序向资产委托人进行披露并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。

本计划持有多个未能按期变现投资标的的，管理人可按本条款约定进行多次变现及清算。

（八）清算报告及账册的备案及保存

计划财产清算小组做出的清算报告，管理人应当在资产管理计划清算结束后五个工作日内报中国证券投资基金业协会备案，并抄报中国证监会相关派出机构，并告知资产委托人。

计划财产清算账册及有关文件应由管理人按照法律法规、相关监管规则的要求保存。

（九）资产管理计划财产相关账户的注销

计划财产清算完毕后，托管人、管理人应按照规定注销资产管理计划财产的托管账户及其他投资所需账户。

（十）关于清算事项的特殊约定

尽管有上述约定，如发生管理人客观上丧失继续管理本计划能力的情况时，可由份额持有人根据本合同约定召集持有人大会、推选份额持有人代表，由托管人、份额持有人代表共同组建清算小组。清算小组可通过清算小组书面决议的形式对本章节的相关规定进行修改、补充，相关清算规则应以份额持有人大会（如有）决议及清算小组的决议内容为准。

第二十八章 保密

(一) 本合同各方应就计划资产以及相关信息承担保密责任。除法律、法规的规定和司法机关、监管部门或有权部门要求外, 未经对方书面同意, 任何一方不得以任何方式披露或利用该信息。

(二) 本合同任何一方未经对方事先书面同意, 不得使用对方的商标、标识、商业信息等知识产权, 否则守约方有权解除本合同并向违约方追究责任。

(三) 在本合同终止后, 各方当事人均应持续履行保密义务, 保密义务不因本合同的解除、终止而终止。

第二十九章 违约责任

(一) 违约责任

当事人违反本合同, 应当承担违约责任, 给合同其他当事人造成损失的, 应当承担赔偿责任。管理人、托管人在履行各自职责的过程中, 违反法律法规规定或本合同约定, 给计划财产或资产委托人造成损失的, 应当分别对各自的行为依法承担赔偿责任, 但不因各自职责以外的事由与其他当事人承担连带赔偿责任。本合同能够继续履行的应当继续履行。

(二) 免责条款

发生下列情况, 当事人可以免责:

1. 管理人及/或托管人按照中国证监会、基金业协会的规定或当时有效的法律法规作为或不作为而造成的损失等;

2. 在没有故意或重大过失的情况下, 管理人由于按照本合同规定的投资原则而行使或不行使其投资权而造成的损失等, 以及托管人由于执行管理人符合本合同规定的指令而造成的损失等。

3. 托管人对依据法律法规、合同约定、交易惯例等合理原因存放或存管在托管人以外机构的计划财产, 以及交由其他机构负责清算交收的计划财产(包括但不限于保证金账户内的资金、期货合约等)及其收益, 因该机构或其成员/会员单位欺诈、疏忽、过失、破产等原因给委托财产造成的损失等。

4. 管理人对因计划财产对外投资产生的存放或存管在托管人以外机构的计划资产, 在谨慎挑选并要求保证计划财产安全的前提下, 就该机构对计划财产的安全保管义务及该机构或该机构会员单位等本合同当事人外第三方的欺诈、疏忽、过失或破产等原因给计划财产

造成的损失等；

5. 托管人对托管账户之外的资产不行使保管职责，包括但不限于：计划初始募集期间存放于募集账户的资金；由于计划收益分配及清算而已经从托管账户划拨出的资金；由于投资从托管账户划拨出的资金及所购买的资产等。

6. 由于管理人及/或托管人不可控制的因素导致业务出现差错，管理人及/或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，由此给计划财产造成的损失等。

7. 对于不可抗力导致合同当事人方无法全部履行或部分履行本合同的，任何一方当事人不承担违约责任。但各方当事人应当在合理范围内勤勉尽责，防止计划财产损失扩大或对其他当事人的影响扩大。且一方当事人因不可抗力不能履行或完全履行本合同时，应及时通知其他合同当事人，其他当事人可以要求在合理期限内提供不可抗力影响的证明。

8. 一方当事人未能履行法律法规、监管规定及本合同约定的信息告知义务（包括但不限于关联方、禁止投资证券等信息），未能保证该信息的真实性、准确性、完整性和有效性，致使计划财产发生违规投资行为或者其他当事人无法履行合同职责的，其他当事人不承担任何责任。

9. 资产委托人理解计划财产的投资、运作、托管面临本合同《风险揭示书》中列举的各类风险，管理人及托管人就委托财产面临的上述固有风险免于承担责任。

10. 因证券/期货市场波动、上市公司合并、计划财产规模变动等资产管理人之外的因素致使计划财产投资不符合本合同项下约定的投资策略的，将不视为资产管理人的违约行为；

11. 资产管理人及资产托管人对因所引用的投资对象、证券经纪商及其他中介机构提供的信息的真实性、准确性和完整性存在瑕疵，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。

12. 法律法规规定及本合同约定的其他情况。

（三）在发生一方或多方违约的情况下，在最大限度地保护计划资产委托人利益的前提下，本合同能够继续履行的应当继续履行。非违约方当事人有义务及时采取必要的措施，防止损失的扩大。没有采取适当措施致使损失进一步扩大的，不得就扩大的损失要求赔偿。非违约方因防止损失扩大而支出的合理费用由违约方承担。

（四）一方依据本合同向另一方赔偿的损失，仅限于直接损失。

（五）本合同任何一方未经其他方事先书面同意，不得使用其他方的商标、标识、商业信息等知识产权，否则守约方有权解除本合同并向违约方追究责任。

(六) 托管人仅承担法律法规规定以及本合同约定的相关责任及义务。如管理人对托管人所承担的责任进行虚假宣传,或以托管人名义或利用托管人商誉进行非法募集资金、承诺投资收益等违规活动,托管人有权向管理人追究违约责任和侵权责任。

第三十章 争议的处理

(一) 本合同适用于中华人民共和国法律,并在中华人民共和国境内(不包含港澳台地区)接受管辖。

(二) 因本合同产生或与之相关的争议,各方当事人应通过协商解决,协商不能解决的,可以选择下列第1种争议解决方式:

1. 任何一方均有权向深圳国际仲裁院(深圳仲裁委员会)申请仲裁,仲裁地点为深圳,以该会当时有效的仲裁规则为准,仲裁裁决是终局性的,并对各方当事人具有约束力,因仲裁产生的一切费用均由败诉方承担。

2. 任何一方均有权就争议向有管辖权的人民法院提起诉讼,因诉讼产生的一切费用均由败诉方承担。

(三) 争议处理期间,除争议部分外合同当事人应本着恪守各自的职责,继续忠实、勤勉、尽责地履行本合同其余无争议部分,维护双方的合法权益。

第三十一章 通知和送达

(一) 合同各方应按照本合同中约定的各自的通讯方式,以专人、特快专递、传真、电子邮件等方式进行本合同项下相关事宜的通知和相关文件的送达,本合同有特殊约定的除外。

(二) 通知在下列日期视为送达被通知方:

1. 专人送达:被通知方在签收单或回执单上签收所示日;

2. 邮寄送达:被通知方在签收单上或回执单签收所示日,若通知方自成功寄出之日起5个工作日内未收到被通知方回执或异议的视为已经送达;

3. 传真:传真发送当日(通知方应电话确认传真发送成功);

4. 采用电子邮件送达的,以发出方电子系统显示成功发送之日视为送达之日。

(三) 一方通讯地址或联络方式发生变化,变化方应提前5个工作日以书面形式通知其他合同方;如果在合同终止前1个月内发生变化,变化方应提前3个工作日以书面形式通知其他合同方。

(四) 如果通讯地址或联络方式发生变化的一方, 未将有关变化及时通知对方, 除非法律另有规定, 未通知方应对由此而造成的影响和损失承担责任。

第三十二章 资产管理合同的效力

(一) 资管计划合同的成立与生效

1. 资管计划合同的成立

本合同自管理人、托管人、投资者通过纸质合同方式签署或以电子签名方式签署后即告成立。管理人应负责与投资者签署合同, 托管人不参与投资者签署合同流程。

采用纸质版合同签约的, 如签约方为法人, 应加盖签约方公章或合同专用章并由其法定代表人或其他授权代表签字或签章; 签约方为自然人的, 应由本人或授权的代理人签字。

采用电子签约方式签署合同的, 管理人应确保投资者签订本合同所使用的电子签名符合《中华人民共和国电子签名法》等法律法规、监管规定的要求。

投资者同意在认购/申购本计划过程中使用电子合同、电子签名, 投资者通过有效身份验证措施登录相关网络系统后, 确认同意接受相关计划合同等文件的, 视为签署合同及相关文件, 与在纸质合同及相关文件上手写签名或者盖章具有同等法律效力, 无需另行签署纸质合同等文件。投资者一经确认电子合同文本, 不得以任何理由主张电子合同文本或电子签名或电子签约方式无效。

投资者应当妥善保管与身份认证有关的设备、资料以及登录密码、交易密码等相关信息。通过有效身份验证措施登录相关网络系统后的所有操作均视同投资者本人行为, 投资者应当承担由此产生的一切民事责任和法律后果。

2. 资管计划合同的生效

本计划合同生效应当同时满足以下条件:

- (1) 本合同经投资者、管理人与托管人合法签署;
- (2) 投资者认购或者申购资金实际交付并经管理人确认成功, 投资者获得资管计划份额;
- (3) 本计划依法有效成立。

3. 资管计划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, 任何一方都不得单方解除。

4. 管理人应负责向托管人交付一份投资者、管理人及托管人签署的资管计划合同原件, 并确保交付至托管人的资管计划合同原件真实、有效、完整, 由于管理人未履行本条款规定

义务造成的所有损失、责任及不利后果均由管理人承担。

(二) 资管计划合同的有效期限

资管计划合同的存续期限与本计划的存续期限一致，自生效之日起算；但本计划合同生效期届满后计划财产的清算、违约责任、争议的处理等条款继续有效。

投资者自签订资产管理合同即成为资产管理合同的当事人。在资产管理计划存续期间，投资者自全部退出资产管理计划之日起，该投资者不再是资产管理合同的当事人。

(三) 本资产管理合同一式叁份，委托人、托管人、管理人各执壹份。

第三十三章 其他事项

(一) 本合同履行中，如果相关法律法规、规范性文件发生变化，直接适用修订后的相关法律法规、政策、交易所规则等；同时根据修订后的法律法规、政策、交易所规则等重新修订本合同相应内容。

(二) 本合同如有未尽事宜，由合同当事人按照有关法律法规、规范性文件及交易惯例等要求处理。

(三) 《风险揭示书》、《资产合法性及投资者适当性承诺书》以及合同附件是本合同的组成部分，与合同正文具有相同的效力。

(四) 管理人确认已向委托人说明资产管理业务的风险，不以任何方式对委托人资产本金不受损失或者取得最低收益做出承诺；委托人确认，已充分理解本合同内容，自行承担风险和损失。

(以下无正文)

(本页为委托人信息填写页, 委托人务必确保填写的资料正确有效, 如因填写错误导致的任何损失, 管理人和托管人不承担任何责任)

(一) 投资者信息

1. 自然人

姓名:

证件名称: 身份证军官证护照永久居住证

证件号码:

通讯地址:

联系方式(手机):

联系方式(固话)(选填):

电子邮箱:

2. 法人或其他组织

名称:

统一社会信用代码或营业执照号码:

法定代表人:

住所:

联系人:

联系方式(手机):

联系方式(固话)(选填):

电子邮箱:

委托人授权之代理人:

证件名称: 身份证军官证护照永久居住证

证件号码:

通讯地址:

联系方式(手机):

联系方式(固话)(选填):

电子邮箱:

(二) 投资者账户

委托人认购计划的划出账户与退出计划的划入账户，必须为以委托人名义开立的同一个账户。特殊情况导致认购和退出计划的账户信息不一致时，委托人应出具符合相关法律法规规定的书面材料，以证明原账户与变更后账户属于同一委托人。

账户信息如下：

账户名称：

账号：

开户银行名称：

(三) 认购/参与金额

认购/参与金额： 元（人民币大写： 元）

(本页为《华融融达期货云湾1号多策略FOF集合资产管理计划资产管理合同》的签署页，
无正文内容。)

委托人(签字/盖章):

法定代表人/单位负责人或其授权代表:

日期: 年 月 日

管理人(盖章): 华融融达期货股份有限公司
法定代表人/单位负责人或其授权代表:



日期: 2022年10月13日

托管人(盖章): 国信证券股份有限公司

法定代表人/单位负责人或其授权代表:

日期: 2022年10月12日

