

102

华金证券股份有限公司  
合同编号:2022-1062

# 华金证券久久盈集合资产管理计 划 资产管理合同

合同编号:【       】

集合计划管理人: 华金证券股份有限公司

集合计划托管人: 兴业银行股份有限公司

二〇二二年十一月



## 目 录

一、前言 .....	- 3 -
二、释义 .....	- 4 -
三、承诺与声明 .....	- 10 -
四、合同当事人及权利义务 .....	- 11 -
五、集合计划的基本情况 .....	- 19 -
六、集合计划的募集 .....	- 21 -
七、集合计划的成立与备案 .....	- 25 -
八、集合计划的参与、退出与转让 .....	- 26 -
九、份额持有人大会及日常机构 .....	- 32 -
十、集合计划份额的登记 .....	- 32 -
十一、集合计划的投资 .....	- 33 -
十二、投资顾问 .....	- 40 -
十三、分级安排 .....	- 40 -
十四、利益冲突及关联交易 .....	- 40 -
十五、投资经理的指定与变更 .....	- 41 -
十六、集合计划的财产 .....	- 42 -
十七、投资指令的发送、确认和执行 .....	- 46 -
十八、交易及清算交收安排 .....	- 50 -
十九、越权交易的界定 .....	- 55 -
二十、集合计划财产的估值和会计核算 .....	- 58 -
二十一、集合计划的费用与税收 .....	- 63 -
二十二、集合计划的收益分配 .....	- 68 -
二十三、信息披露与报告 .....	- 70 -
二十四、风险揭示 .....	- 73 -
二十五、集合计划的变更、终止与财产清算 .....	- 82 -
二十六、违约责任 .....	- 86 -
二十七、争议的处理 .....	- 88 -
二十八、集合计划合同的效力 .....	- 88 -
二十九、其他事项 .....	- 89 -
附件一 华金证券久久盈集合资产管理计划风险揭示书.....	91
附件二 华金证券久久盈集合资产管理计划说明书.....	102
附件三 划款指令模板 .....	118
附件四 划款指令授权书 .....	119

## 一、前言

为规范华金证券久久盈集合资产管理计划(以下简称“本集合计划”、“集合计划”或“计划”)运作,明确《华金证券久久盈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》”)、《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》(以下简称“《指导意见》”)、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》(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》”)等有关法律法规及《集合资产管理计划资产管理合同内容与格式指引(试行)》(以下简称“《指引》”)等自律性文件的规定,投资者、管理人、托管人在平等自愿、诚实信用、公平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》、本合同及其他有关规定享有权利、承担义务。

投资者承诺以真实身份参与集合计划,并符合《指导意见》、《管理办法》、《运作规定》及本合同中关于“合格投资者”的要求,保证委托资产的来源及用途合法,所披露或提供的信息和资料真实,并已阅知本合同和本集合资产管理计划说明书全文,了解相关权利、义务和风险,根据自身能力及情况审慎决策,自行、独立承担投资风险和损失。投资者保证,管理人和托管人不因签订本资产管理合同而与投资者的客户(如有)发生直接的法律关系,如管理人和托管人因此被投资者的客户(如有)投诉或采取任何法律行动,投资者应承担相应责任。

管理人承诺以诚实守信、审慎尽责的原则管理和运用本集合计划资产,但不保证投资者委托资产本金不受损失,也不保证最低收益。

托管人承诺以诚实守信、审慎尽责的原则履行托管职责,安全保管客户集合计划资产、办理资金收付事项、监督管理人投资行为,但不保证本集合计划资产投资不受损失,不保证最低收益。

管理人依照有关规定对集合计划的设立、变更、展期、终止、清算等行为向

中国证券投资基金业协会（以下简称“基金业协会”）进行备案，并抄报中国证监会相关派出机构（如需）。

基金业协会接受本集合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，也不代表基金业协会对本集合计划的合规性、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

在本合同中除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

集合资产管理计划、本集合计划、集合计划或计划	指华金证券久久盈集合资产管理计划，及对本计划的任何有效修订和补充。
集合资产管理计划合同、资产管理合同、集合资产管理合同或本合同	指《华金证券久久盈集合资产管理计划资产管理合同》及其的任何有效修订和补充。
集合资产管理计划说明书、计划说明书、本说明书或说明书	指《华金证券久久盈集合资产管理计划说明书》及其的任何有效修订和补充。
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。
《指导意见》	指2018年4月27日，中国人民银行、中国银行保险监督管理委员会、中国证券监督管理委员会、国家外汇管理局联合发布的《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》及其作出

	的修订和补充。
《管理办法》	指2018年10月22日中国证监会发布并实施的《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》及其作出的修订和补充。
《运作规定》	指2018年10月22日中国证监会发布并实施的《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》及其作出的修订和补充。
《指引》	指2019年3月29日基金业协会发布并于2019年5月1日起实施的《集合资产管理计划资产管理合同内容与格式指引（试行）》。
中国证监会	指中国证券监督管理委员会。
集合计划管理人 或管理人	指华金证券股份有限公司，简称为“华金证券”。
集合计划托管人 或托管人	指【兴业银行股份有限公司】，简称为“【兴业银行】”。
代销机构	指符合相应资格条件，经管理人委托，代为办理资产管理计划的认购、参与和退出、收益分配等业务的机构。
销售机构	指华金证券和代销机构。
注册登记机构	指办理登记、存管、过户、清算和结算等注册登记业务的机构。本集合计划的注册登记机构为【华金证券股份有限公司】。
当事人	指受集合资产管理计划合同约束，根据集合资产管理计划合同享受权利并承担义务的法律主体，包括管理人、托管人、投资者。

<p>投资者</p>	<p>指依据本合同合法取得本集合计划份额的投资者。</p>
<p>合格投资者</p>	<p>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。</p> <p>（一）具有2年以上投资经历，且满足以下条件之一：家庭金融资产净资产不低于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。</p> <p>（二）最近1年末净资产不低于1000万元的法人单位。</p> <p>（三）依法设立并接受国务院金融监督管理机构监管的机构，包括证券公司及其子公司、基金管理公司及其子公司、期货公司及其子公司、在中国证券投资基金业协会（以下简称证券投资基金业协会）登记的私募基金管理人、商业银行、金融资产投资公司、信托公司、保险公司、保险资产管理机构、财务公司及中国证监会认定的其他机构；</p> <p>（四）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；</p> <p>（五）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）；</p> <p>（六）中国证监会视为合格投资者的其他情形。</p> <p>已接受其他私募资产管理产品投资的私募资产管理产品不得投资于本产品；其他可能导致本产品不符合《指导意见》等法律法规要求的投资人不得投资于本产品。如监管规则对合格投资者认定标准发生变化，则按照最新标准执行。</p>
<p>集合计划成立日</p>	<p>指集合计划经过募集达到集合资产管理计划合同规定的成立条件后，管理人公告集合计划成立的日期。</p>

募集期	指本集合计划自开始募集到募集完成之间的时间段，具体时间见有关公告。募集期结束日与集合计划成立日之间可以有合理的用于办理确认、验资等手续的工作日。
集合计划管理期限或存续期	指集合计划成立并存续的时间。
T日	指参与、退出或办理集合计划业务的申请日。
T+n日	指T日后的第n个交易日（不包含T日），n为自然数。
开放期	指存续期内投资者可以办理集合计划参与或退出等业务的交易日。
开放日	指开放期内的每个交易日。
封闭期	指集合计划成立日后的一个或多个封闭区间，封闭期内不办理参与和退出业务。
天、日	指自然日。
交易日	指上海证券交易所和深圳证券交易所的正常交易日。
月、月度或自然月	指每月1日起至该月最后一日为止的期间。
年、年度、会计年度	指公历每年1月1日起至当年12月31日为止的期间。
认购	指投资者根据集合计划的规定，在募集期投资于集合计划份额的行为。
参与	指投资者根据集合计划的规定，在存续期内开放期投资于集合计划份额的行为。

退出（赎回）	指投资者根据集合计划规定，在开放日申请部分或全部退出集合计划份额的行为。
巨额退出	指本集合计划单个开放日净退出申请份额（退出申请总份额扣除参与申请总份额后的余额）超过上一个交易日计划总份额【20】%的情形。
强制退出	指由管理人发起退出持有人持有份额的行为。
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。
集合计划份额、计划份额、份额	指集合计划的最小单位。
元	指人民币元。
集合计划份额面值、单位面值	人民币1.00元。
集合计划资产总值、资产总值	指集合计划所拥有的各类有价证券、银行存款本息、集合计划各项应收款以及其他资产所形成的价值总和。
集合计划负债	指集合计划运作时所形成的负债，如应付管理费、应付托管费、应付收益等。
集合计划资产净值、资产净值	指集合计划资产总值减去集合计划负债后的净资产值。
集合计划单位净值、单位净值	指计算日集合计划资产净值除以计算日集合计划总份额的金额。
集合计划累计单位净值、累计单位净值	指计划单位净值与集合计划份额累计分红之和。



集合计划资产估值	指计算评估集合资产管理计划资产和负债的价值，以确定集合计划资产净值的过程。
集合计划收益	指本集合计划投资所得红利、债券利息、基金红利、买卖证券价差、银行存款利息及其他合法收入扣除相关费用后的余额。
收益分配权益登记日	指享有收益分配权益的计划份额的登记日期,只有在收益分配权益登记日（不包括登记日当日）前参与的计划份额，并在权益登记日当天登记在册的份额才有资格参与收益分配。
管理人业绩报酬（如有）	在本集合计划存续期间，管理人按照一定的原则对相关的集合计划份额提取的业绩报酬。
信义义务	托管人信义义务是指托管人按恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则，根据相关法律法规和监管规定，在本资产管理合同约定范围内尽职尽责履行安全保管托管资产等托管人职责。
7个工作日可变现资产	包括可在交易所、银行间市场正常交易的股票、债券、非金融企业债务融资工具、期货及期权合约以及同业存单，7个工作日内到期或者可支取的逆回购、银行存款，7个工作日内能够确认收到的各类应收款项等。
流动性受限资产	指由于法律法规、监管、合同或操作障碍等原因无法以合理价格予以变现的资产，包括但不限于到期日在10个交易日以上的逆回购与银行定期存款（含协议约定有条件提前支取的银行存款）、停牌股票、流通受限的新股及非公开发行股票、资产支持证券、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券等；中国证监会认可的特殊情形除外。

<p>不可抗力</p>	<p>指当事人不能预见、不能避免、不能克服的客观情况，包括但不限于洪水、地震及其他自然灾害、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、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（如临时停市）等，非因管理人或托管人自身原因导致的技术系统异常事故、政策法规的修改或监管要求调整等情形。因中国人民银行银行间结算系统出现故障导致银行间的结算无法进行的情形，因电信服务商原因导致托管人资金划付的网络中断、无法使用的情形，构成对托管人适用的不可抗力事件。</p>
<p>管理人指定网站、管理人网站</p>	<p>指<a href="http://www.huajinsec.com/">http://www.huajinsec.com/</a>，管理人指定网站变更时以管理人公告为准。</p>

### 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，办理资金收付事项、对管理人的投资或清算指令等进行监督。

3. 在管理人发生异常且无法履行管理职能时，依照法律法规及合同约定召集份额持有人大会（如有），维护投资者权益，份额持有人大会设立日常机构的除外。

### （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（依法设立的各类资产管理产品投资的除外）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. 所披露或提供的信息和资料真实、准确、完整，并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. 投资者投资本计划不构成违反监管要求的多层嵌套情形，不存在以投资本计划规避投资范围、杠杆约束等监管要求等违规行为。

5. 已知悉《中华人民共和国反洗钱法》、《金融机构客户身份识别和客户身份资料及交易记录保存管理办法》、《金融机构大额交易和可疑交易报告管理办法》、《中国人民银行关于加强反洗钱客户身份识别有关工作的通知》等反洗钱相关法律法规的规定，将严格遵守上述规定，不会违反任何前述规定；承诺用于投资的资金来源不属于违法犯罪所得及其收益；承诺投资的资金来源和去向不涉及洗钱、恐怖融资和逃税等行为；承诺出示真实有效的身份证件或者其他身份证明文件，提供真实有效的业务性质与股权或者控制股权结构、受益所有人信息等资料；承诺积极履行反洗钱职责，不借助本业务进行洗钱等违法犯罪活动。

## 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：

电子信箱：

其他：

**机构填写：**

机构名称：

法定代表人：

注册地址：

通信地址：

邮政编码：

代理人姓名：

代理人身份证号码：

联系电话：

传真：

其他：

**管理人**

机构名称：华金证券股份有限公司

法定代表人：燕文波

注册地址：上海市静安区天目西路128号19层1902室

通信地址：上海市浦东新区杨高南路759号30层

邮政编码：200120

联系人：侯艺欣

联系电话：010-85552539

**托管人**

机构名称：兴业银行股份有限公司

负责人：吕家进

注册地址：福建省福州市台江区江滨中大道 398 号兴业银行大厦

通信地址：上海市浦东新区银城路 167 号

邮政编码：200120

联系人：倪倩

联系电话：021-52629999

传真号码：021-62152155

（一）本计划设定为均等份额，除本合同另有约定外，每份份额具有同等的合法权益。

（二）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）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；

（5）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；

（6）监督管理人、托管人履行投资管理及托管义务的情况；

（7）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）认真阅读并遵守本合同，保证投资资金的来源及用途合法，不得以非法汇集他人的资金、恐怖融资的资金及其他非法资金参与本集合计划；不得使用贷款、发行债券等筹集的非自有资金（依法设立的各类资产管理产品投资的除外）参与本集合计划；

（2）以真实身份参与集合计划、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) 按照本合同约定支付资产管理计划份额的参与款项，承担本合同约定的管理费、业绩报酬（如有）、托管费、审计费、税费等合理费用；退还因管理人、托管人、销售机构过错导致投资者获得的不当得利；

(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本合同约定的其他义务。

### (三) 管理人的权利和义务

#### 1. 管理人的权利

(1) 根据本合同的约定，独立管理和运作集合计划的资产；

(2) 根据本合同的约定，及时、足额获得管理费、业绩报酬（如有）等费用；

(3) 按照有关规定和本合同约定行使因资产管理计划财产投资所产生的权利；

(4) 根据本合同及其他有关规定，监督托管人，对于托管人违反资产管理合同或有关法律法规规定、对资产管理计划财产及其他当事人的利益造成重大损

失的，应当及时采取措施制止，并报告中国证监会相关派出机构及证券投资基金业协会；

(5) 自行提供或者委托经中国证监会、证券投资基金业协会认定的服务机构为资产管理计划提供募集、份额登记、估值与核算、信息技术系统等服务，并对其行为进行必要的监督和检查；

(6) 以管理人的名义，代表资产管理计划行使投资过程中产生的权属登记等权利；

(7) 在不损害投资者实质利益的前提下，管理人有权根据管理运作实际情况对集合计划管理运作过程中的相关事项进行调整或补充说明，并及时予以公告；

(8) 根据本合同相关条款的约定，终止本集合计划的运作；

(9) 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) 依法募集资金，办理集合计划的销售、登记、备案事宜；

(2) 按照证券投资基金业协会要求报送资产管理计划产品运行信息；

(3) 按照诚实信用、勤勉尽责的原则履行受托人义务，管理和运用资产管理计划财产；

(4) 对投资者的风险识别能力和风险承受能力进行评估，向符合法律法规规定的合格投资者非公开募集资金；

(5) 制作风险揭示书，向投资者充分揭示相关风险；

(6) 配备足够的具有专业能力的人员进行投资分析、决策，以专业技能管理和运用集合计划的资产，为投资者的最大利益服务，依法保护投资者的财产权益；

(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、本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，不得从事任何有损本集合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) 召集资产管理计划份额持有人大会（如有），份额持有人大会设立日常机构（如有）的除外；

(15) 按照资产管理合同约定计算并向投资者报告资产管理计划单位净值；

(16) 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；

(17) 对非标准化资产（如有）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；

(18) 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；

(19) 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；

(20) 按照本合同的约定确定收益分配方案，及时向投资者分配收益；

(21) 按照资产管理合同约定计算并向投资者报告资产管理计划单位净值；根据法律法规、本合同的规定，编制向投资者披露的资产管理计划季度、年度等定期报告，向证券投资基金业协会备案，并抄报中国证监会相关派出机构；

(22) 办理与受托财产管理业务活动有关的信息披露事项；

(23) 建立并保存投资者名单；

(24) 组织并参加资产管理计划财产清算小组，参与本集合计划财产的保管、清理、估价、变现和分配；

(25) 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；



(26) 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，并按照有关监管要求妥善处理有关事宜；

(27) 按照我国有关反洗钱法律、行政法规，履行客户身份识别反洗钱义务，识别、核实投资者的身份及资产管理计划的受益所有人，并按监管规定保存相关身份信息、资料；在客户身份识别的基础上对客户进行洗钱风险等级划分，对高风险的客户采取适当的风控措施；在法律允许范围内，配合资产托管人开展客户身份识别特别是受益所有人的识别工作，并提供必要客户信息、资料等；履行大额交易和可疑交易报告义务，并对可疑客户采取必要的管控措施。根据反洗钱政策及法规，要求投资者积极配合完成（包括本合同签订前和履行过程中的）反洗钱调查等必要程序。

(28) 采取了适当的措施，确保资产管理计划的投资者、受益所有人等不得为我国公安部等有权部门发布的恐怖活动组织及恐怖活动人员名单，不得为联合国、美国、欧盟等及其他国家和国际组织（地区）发布且得到我国承认的反洗钱和反恐怖融资名单，或中国人民银行及其他监管机构要求执行的反洗钱和反恐怖融资名单。

(29) 资产管理计划的投资行为不得违反我国、联合国及其他国家（地区）发布且得到我国承认的有关经济制裁或反洗钱法律法规规定，或用于其他洗钱、恐怖融资、逃税、欺诈等非法用途。

(30) 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；

(31) 本合同中涉及报送中国证监会及其相关派出机构、证券投资基金业协会等监管部门的各项备案及报告等事项均以最新的监管要求为准。

(32) 除必要的信息披露及监管要求外，管理人不得以托管人的名义进行营销宣传。

#### (四) 托管人的权利与义务

##### 1. 托管人的权利

- (1) 依照法律规定、本合同的约定，依法保管本集合计划资产；
- (2) 按照本合同的约定及时、足额收取托管费；

(3) 法律法规、中国证监会及基金业协会规定的、本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、办理资金收付事项；

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

(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，不得从事任何有损本集合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) 建立与管理人的对账机制，复核管理人计算的集合计划的资产净值、单位净值和资产管理计划参与、退出价格；

(7) 办理与集合计划托管业务活动相关的信息披露事项；

(8) 根据相关法律法规和本合同约定，复核管理人编制的资产管理计划财产的定期报告（季度、年度管理报告等），并出具书面意见；

(9) 编制托管年度报告，并向基金业协会备案，抄报中国证监会相关派出机构；

(10) 按照法律法规要求和资产管理合同约定，根据管理人的投资指令，及时办理集合计划名下的清算、交割事宜；

(11) 管理人未按规定召集或者不能召集份额持有人大会（如有）的，由托管人召集份额持有人大会，份额持有人大会设立日常机构的除外；

(12) 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；

(13) 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；

(14) 监督管理人集合计划的投资运作，发现管理人的投资或清算指令违反法律法规、中国证监会的有关规定和本合同约定的，应当要求其改正；未能改正

的，应当拒绝执行，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和基金业协会；

(15) 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。

(16) 在解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产时，及时报告管理人；

(17) 因违反本合同导致集合计划财产损失或损害投资者合法权益时，应承担赔偿责任；

(18) 法律法规、监管机构及本合同约定的其他义务。

## 五、集合计划的基本情况

(一) 名称：华金证券久久盈集合资产管理计划

简称：华金证券久久盈

(二) 类别：【固定收益类】集合资产管理计划

本计划是否为基金中基金资产管理计划（FOF）：【否】

(三) 运作方式

开放式集合资产管理计划。

(四) 封闭期、开放期

### 1. 封闭期

本集合计划存续期内除开放期和临时开放期以外的每个交易日都是封闭期，封闭期内不办理参与、退出业务。

### 2. 开放期

本集合计划成立日起每周周二、周三开放参与（如遇非交易日则暂停）。本集合计划每笔参与份额持有期限满 9 个月后可在每月的 15 日开放退出（如遇非交易日顺延）。具体开放期安排以管理人公告为准。

### 3. 临时开放期

因本合同修改或法律法规和监管要求变化等原因需要变更合同，为不同意合同变更的投资者退出而设置的开放期，具体见管理人公告。

## （五）本计划的投资目标、投资范围、投资比例、产品风险等级

### 1. 投资目标

在有效控制投资风险的前提下，尽量追求委托资产的增值，力争为投资者谋求投资回报。

### 2. 投资范围

本集合计划投资于具有良好流动性的固定收益类金融工具，主要包括银行间市场和交易所市场上市交易的国债、政策性金融债券、地方政府债、央行票据、企业债、公司债、金融机构债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债（包括二级资本债）、债券型基金、资产支持证券优先级、可交换债券、可转换债券、现金、银行存款、同业存单、债券回购、货币市场基金及其他法律法规或政策许可投资的固定收益证券品种。

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

### 3. 投资比例

本集合计划投资于固定收益类的比例不低于集合计划资产总值的 80%。

投资者在此同意并授权管理人可以将本集合计划的资产投资于管理人、托管机构及其控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司发行或者承销的证券，或者从事其他重大关联交易。管理人将遵循客户利益优先原则，在发生上述所列投资证券事项时，管理人按照法律法规及中国证监会的有关规定，应当将交易结果告知托管人，通过资产管理季度报告向投资者披露，并根据监管要求进行报告。

本集合计划管理人将在集合计划成立之日起【6】个月内使集合计划的投资组合比例符合以上约定。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管理人之外的因素，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（如遇相关证券不能上市交易的，上述时间期限自动顺延）。确有特殊事由未能在上述时间内完成调整的，管理人应当及时向住所地中国证监会派出机构和证券投资基金业协会报告。

### 4. 产品风险等级

本集合计划属于 R2(中低风险)固定收益类资产管理产品，适合合格投资者中的 C2 级及其以上的普通投资者及专业投资者。

(六) 存续期限

自集合计划成立之日起算，本集合计划存续期为【5】年，依据本合同约定，满足一定条件下可提前终止或展期。

(七) 集合计划份额的初始募集面值

人民币 1.00 元。

(八) 本集合计划的最低初始募集规模

本集合计划初始募集规模不低于 1000 万元人民币。

(九) 本集合计划的分级安排

本集合计划不分级。

(十) 本集合资产管理计划未聘请份额登记、估值与核算、信息技术系统等第三方服务机构。

## 六、集合计划的募集

(一) 适合募集对象

本集合计划适合募集对象为销售机构的评定与产品风险等级相匹配且认同本集合计划投资理念的合格投资者。合格投资者是指符合《指导意见》、《管理办法》、《运作规定》等其他法律法规规定的，具备相应风险识别能力和承担所投资集合资产管理计划风险能力的自然人、法人或其他组织。法律法规、中国证监会等金融监管部门另有规定的，从其规定。

投资者在此申明签署本合同即表明投资者为已具备《证券期货投资者适当性管理办法》、《指导意见》、《管理办法》、《运作规定》等规定要求的合格投资者，投资者承诺使用真实身份和自有资金参与本集合计划，不得使用贷款、发行债券等筹集的非自有资金投资本集合计划。

(二) 销售机构

本集合计划的销售机构为华金证券及华金证券委托的代销机构。

管理人可根据有关法律法规的要求，选择其他符合要求的销售机构代理销售本集合计划，管理人新增或变更本集合计划的销售机构时，将提前在管理人指定

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意见或与投资者另行签订协议。

### （三）募集方式

本集合计划通过非公开方式募集。销售机构应将集合资产管理计划合同、集合资产管理计划说明书、风险揭示书等文件，以纸质资料或电子资料方式置备于营业场所。销售机构应当了解客户的投资需求和风险偏好，详细介绍产品特点并充分揭示风险，推荐与客户风险承受能力相匹配的集合计划，引导客户审慎做出投资决定。禁止通过签订保本保底补充协议等方式，或者采用虚假宣传、宣传预期收益和商业贿赂等不正当手段募集集合计划。

销售机构不得向合格投资者之外的单位和个人募集资金，不得通过报刊、电台、电视台、互联网等公众传播媒体或者讲座、报告会、分析会和布告、传单、手机短信、微信、博客和电子邮件、自媒体等方式向不特定对象宣传推介。

### （四）募集期限

本集合计划具体募集时间具体以管理人官网([www.huajinsc.cn](http://www.huajinsc.cn))公告为准。初始募集期自集合计划份额发售之日起不超过 60 天。

### （五）本集合计划的认购事项

#### 1. 资产管理计划认购费用

本集合计划认购费率为 0%。

#### 2. 认购申请的确认

（1）本集合计划的认购申请根据不同销售机构的程序，采用电子签名或纸质签名的方式提交。采用电子签名方式通过中国证券登记结算公司系统进行电子签署，投资者应当根据销售机构的要求签署纸质的《电子签名约定书》或如实提供与签署电子签名合同相关的信息和资料，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。投资者保证其所提供的信息及资料真实、准确、完整，否则应当承担由此造成的一切后果。采用纸质签名方式的投资者需签署纸质的风险揭示书、签订纸质的合同。投资者根据销售机构的程序，到销售机构指定网点或管理人直销柜台申请认购集合计划，或登录销售机构指定网络系统以自主下单方式申请认购集合计划。

（2）投资者按销售机构的具体安排，在规定的交易时间段内提交认购申请。

(3)通过管理人直销方式认购集合计划的,投资者开设管理人认可的集合资产管理计划账户,并在有效时间内将足额资金划入管理人指定的直销账户中,并保证汇款人名称与开立集合资产管理计划账户的持有人名称一致。投资者指定关联的银行卡作为办理红利款项、退出款项、清算款项的收款账户。投资者应承诺在本合同有效期内,不得撤销该账户,并妥善保管账户资料;由于投资者原因造成款项和收益不能及时划入指定账户及由此造成的损失由投资者承担,管理人和托管人不承担责任;通过其他销售机构认购集合计划的,投资者应按照销售机构的相关规定和程序提交认购申请。

(4)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;投资者认购申请确认后,其认购申请和认购资金不得撤销。

(5)投资者于初始募集期认购本计划的,可于计划成立后到办理认购的销售机构查询认购确认情况。确认无效的申请,销售机构将退还投资者已交付的认购款项本金。

### 3. 认购份额的计算方式

净认购金额=认购金额/(1+认购费率);

认购份额=(净认购金额+募集期内产生的利息)/计划单位面值。

### 4. 初始认购资金的管理

管理人应当将资产管理计划初始募集期投资者的认购资金存入资产管理计划募集结算专用账户或托管账户,在资产管理计划成立前,任何机构和个人不得动用。

### 5. 认购的办理时间

在初始募集期内,投资者在每个工作日内可以认购本集合计划。初始募集时间等安排由管理人公告确定。管理人可根据集合计划销售情况在募集期限内适当延长或缩短本集合计划的发售时间,并及时公告。

管理人有权根据集合计划资金募集情况,决定是否提前结束初始募集期,并采用“时间优先、规模优先”的原则避免出现募集份额超过集合计划目标规模上限或超出人数上限的情况。

管理人在 T+1 日对投资者认购申请的有效性进行确认,投资者可在集合计划

正式成立后到其办理认购的销售机构查询成交确认结果。

#### 6. 认购的原则

(1) 初始募集期内，本集合计划份额以面值认购，即人民币 1.00 元；

(2) “金额认购”原则，即以认购金额申请；

(3) 投资者可多次认购本集合计划，认购申请仅可以在当日业务办理时间内撤销；管理人可以对单个投资者认购上限进行规定；

(4) 在初始募集期内，当集合计划募集规模接近或达到约定的规模上限或人数上限或管理人认为有必要时，管理人有权提前终止募集期。

#### (六) 本集合计划的最低认购金额及支付方式

单个投资者首次参与本集合计划的最低认购金额为人民币【30】万元（不含认购费），追加认购的最低金额为人民币【1】万元。

首次参与指提出参与本集合计划申请的投资者在参与之前未持有本集合计划份额的情形。如监管规则发生变化，按照最新标准执行。认购资金应以现金形式交付。

#### (七) 募集结算账户的披露渠道和查询方式

本集合计划的募集结算账户为集合计划归集总账户：

账户名称：华金证券股份有限公司募集专户

账号：216200100101693864

开户行：兴业银行上海分行营业部

行号：309290000107

销售机构委托募集账户（如有）的披露渠道和查询方式：管理人及其委托的销售机构（如有）应当将初始募集期间募集的投资者资金存入募集结算资金专用账户（募集账户）。该账户为管理人委托集合计划份额登记机构开立的注册登记账户，用于本集合计划募集期间和存续期间认购、参与、退出、费用等资金的归集与支付，集合计划财产清算过程中剩余资产的归集与分配。管理人委托销售机构募集的，投资者可按照代销机构公布的渠道和方式查询接收认购资金的账户信息。

(八) 投资者的认购参与款项（不含参与费）加计其在初始销售期形成的利息将折算为资产管理计划份额归投资者所有。初始认购资金的利息以份额登记机



构的记录结果为准。

## 七、集合计划的成立与备案

### （一）集合计划成立的条件

1. 集合计划的初始募集规模不低于 1000 万元人民币；
2. 投资者的人数为 2 人（含）以上，且不超过 200 人；
3. 募集过程符合法律、行政法规和中国证监会的规定；
4. 符合中国证监会规定以及本资产管理合同约定的其他条件。

### （二）集合计划的成立与备案

本集合计划募集金额缴足之日起 10 个工作日内经管理人聘请的具有证券相关业务资格的会计师事务所对集合计划进行验资并出具验资报告后，管理人公告本集合计划成立。

集合计划成立后 5 个工作日内，管理人应当将发起设立情况报中国证券投资基金业协会备案，同时抄送管理人住所地的中国证监会派出机构，并提交监管要求的材料。管理人应向资产托管人提供向基金业协会备案的资产管理计划资产备案登记证明。

集合计划募集完成前，投资者的参与资金只能存入集合计划归集总账户，任何机构和个人不得动用投资者参与资金。

集合计划在成立后备案完成前，不得开展投资活动，以现金管理为目的，投资于银行活期存款、国债、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。

如上述监管规则发生变化，则按照最新标准执行。

### （三）集合计划不能满足成立条件的处理方式

集合计划募集期结束，不能满足集合计划成立条件的，管理人应当：

1. 以固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用；
2. 在募集期届满后三十日内返还投资者已缴纳的款项，并加计银行同期活期存款利息。

集合计划募集期内，发生影响或可能影响本集合计划募集或运作的情形（包括但不限于市场环境及法律法规变动、证监会或相关自律组织不时发布的监管意

见等)，管理人有权视情况决定停止本集合计划募集。

## 八、集合计划的参与、退出与转让

### （一）集合计划参与、退出场所

本集合计划将通过销售机构下属指定营业网点或销售机构指定网络系统办理集合计划的参与和退出。

### （二）集合计划参与、退出的办理时间

本集合计划成立日起每周周二、周三开放参与（如遇非交易日则暂停）。本集合计划每笔参与份额持有期限满 9 个月后可在每月的 15 日开放退出（如遇非交易日顺延）。具体开放期安排以管理人公告为准。

管理人有权根据集合计划资金募集情况，决定是否提前结束开放期，并采用“时间优先、规模优先”的原则避免出现募集份额超过集合计划目标规模上限或集合计划投资者数超过 200 人的情况。

本集合计划除开放期以外的日期均为封闭期，封闭期内不办理参与和退出业务。

### （三）临时开放期的触发条件、程序及披露等相关安排

在本集合计划存续期内，因本合同修改、或法律法规和监管要求变化等原因需要变更合同的，管理人有权设置临时期间为不同意合同变更的投资者办理集合计划份额的退出业务。具体安排见管理人公告。

### （四）参与、退出的方式、价格、程序与确认

1. “未知价”原则，即参与和退出的价格，以受理申请当日集合计划每单位净值为基准进行计算；

2. 本集合计划采用金额参与、份额退出的方式，即参与以金额申请，退出以份额申请。

3. 投资者办理参与、退出等业务时应提交的文件和办理手续、办理时间、处理规则等在遵守本合同约定的前提下，以各销售机构的具体规定为准。

4. 当日的参与和退出申请可以在当日开放时间结束前撤销，在当日的开放时间结束后不得撤销。

5. 参与和退出申请的确认。销售网点受理参与和退出申请并不表示对该申请

是否成功的确认，而仅代表销售网点确实收到了参与或退出申请。参与申请采取时间优先、金额优先原则进行确认，退出申请按先进先出的方式处理。申请是否有效应以注册登记机构的确认为准。注册登记机构应在 2 个工作日内对投资者参与、退出申请的有效性进行确认。

6. 参与和退出申请的款项支付。参与采用全额交款方式，若资金在规定时间内未全额到账则参与不成功，则为无效申请，已交付的委托款项将退回投资者指定资金账户。投资者退出申请确认后，资产管理人应按规定自确认之日起 7 个工作日内向投资者支付退出款项。在发生巨额退出时，退出款项的支付办法按本合同和有关法律法规规定处理。

7. 本集合计划采用纸质或电子合同，投资者在签署合同后方可参与本集合计划。参与申请经管理人确认有效后，构成《资产管理合同》的有效组成部分。

如投资者以管理人直销方式参与，应于本集合计划参与申请提交之日将参与资金划付至以下集合计划归集总账户：

账户名称：华金证券股份有限公司募集专户

账号：216200100101693864

开户行：兴业银行上海分行营业部

行号：309290000107

8. 资产管理人在不损害投资者权益的情况下可更改上述原则，但最迟应在新的原则实施前 3 个工作日告知投资者。资产管理人提前 3 个工作日在指定网站公告前述调整事项即视为履行了告知义务。

#### （五）参与和退出的金额限制

单个投资者首次参与本集合计划的最低认购金额为人民币【30】万元（不含认购费），追加认购的最低金额为人民币【1】万元。

投资者在集合计划存续期开放日参与集合计划份额的，投资者应符合合格投资者标准，且参与金额应满足集合计划最低参与金额限制【30】万元（不含参与费用），已持有集合计划份额的投资者在资产管理计划存续期开放日追加参与的除外。

投资者追加参与集合计划的，每次追加参与的金額应当不少于【1】万元（不含参与费用）。

投资者部分退出集合计划的,其退出后持有的集合计划资产净值应当不低于规定的合格投资者最低参与金额。

当投资者持有的集合计划资产净值低于最低参与金额时,则余额部分必须一起退出。当管理人发现投资者申请部分退出后将致使其持有的计划资产净值低于最低参与金额的,管理人有权将投资者的全部份额退出给投资者。

当单个投资者一次性申请退出份额 500 万份及以上时,属于单个投资者大额退出。单个投资者大额退出必须在开放期之前至少提前 3 个交易日通过销售机构向管理人提交书面预约,否则管理人有权拒绝接受其退出申请。管理人根据预约情况提前对资产配置进行调整。如构成巨额退出,应按巨额退出程序办理。

#### (六) 参与和退出的费用及计算方式

##### 1. 参与费用

(1) 参与费率:【0%】。

(2) 参与份额的计算方法:

参与费=参与资金÷(1+参与费率)×参与费率

净参与资金=参与资金-参与费

参与份额=净参与资金÷T日本集合计划单位净值

参与份额以四舍五入的方法保留小数点后两位,由此产生的差额部分计入集合计划资产损益。多笔参与时,按上述公式进行逐笔计算。管理人有权在合理范围内调整确定存续期参与份额的计算方法。

##### 2. 退出费用

(1) 退出费率:【0%】

(2) 退出金额的计算方法

本集合计划退出时以申请退出日的计划单位净值作为计价基准,按扣除退出费和业绩报酬(如有)后的实际金额支付。退出金额的计算公式如下:

退出总额=退出当日计划单位净值×退出份额

退出费=退出总额×退出费率

退出净额=退出总额-退出费-业绩报酬(若有)

上述计算结果均以四舍五入的方法保留小数点后两位,由此产生的差额部分计入集合计划资产损益。退出费由投资者承担,不列入集合计划资产。

## （七）巨额退出的认定及处理方式

### 1. 巨额退出的认定

单个开放日内，本集合计划净退出申请份额（退出申请总份额扣除参与申请总份额之余额）超过上一交易日计划份额总份数的【20】%，即认为是发生了巨额退出。

### 2. 巨额退出的处理方式

当出现巨额退出时，管理人有权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延期退出，并及时在指定网站上进行公告。

全额退出：当管理人认为有能力支付投资者的退出申请时，按正常退出程序办理。

部分延期退出：当管理人认为支付投资者的退出申请有困难或认为兑付投资者的退出申请可能对本集合计划的资产净值造成较大波动时，管理人在当日接受净退出计划份额不低于上一日计划总份额的【20】%的前提下，对其余退出申请延期办理，延期时间不得超过 20 个交易日。对于当日的退出申请，按单个账户退出申请量占退出申请总量的比例，确定当日受理的退出申请；未受理部分可延迟至下一个交易日办理。转入下一个交易日的退出申请不享有优先权并以该交易日的计划单位净值为依据计算退出金额，以此类推，直到全部退出为止。投资者在申请退出时可选择当日未受理部分予以撤销，未进行选择的默认顺延。

### 3. 告知客户的方式

发生巨额退出并延期支付时，管理人应在管理人网站公告，并说明有关处理方法。

### 4. 连续巨额退出的认定和处理方式

#### （1）连续巨额退出的认定

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

#### （2）连续巨额退出的处理方式

出现连续巨额退出时，管理人可采用全额退出或部分延期退出方式处理。当管理人认为有必要时，也可按暂停接受退出申请，但暂停期限不得超过 20 个交易日；已经接受的退出申请，可以延迟支付退出款项，但不得超过正常支付时间

20 个交易日，并在管理人指定网站上进行公告。

#### （八）延期支付及延期退出的情形和处理方式

发生下列情形时，管理人可延期支付退出款项或延期办理投资者退出申请：

1. 因不可抗力导致管理人不能支付赎回款项；
2. 发生本合同规定的暂停估值情况；
3. 证券交易所交易时间非正常停市，导致管理人无法计算当日计划资产净值；
4. 发生巨额退出的情况；
5. 发生继续接受退出申请将损害现有份额持有人利益的情形时；
6. 当前一估值日集合计划资产净值 50%以上的资产出现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时，经与托管人协商确认后，集合计划管理人应当延缓支付退出款项或暂停接受集合计划退出申请；
7. 法律、行政法规和中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一的，管理人将在网站进行公告。已接受的退出申请，若管理人有足额支付能力，则管理人将足额支付；如暂时不能足额支付的，将按每个退出申请人已被接受的退出申请量占已接受退出申请总量的比例分配给退出申请人，其余部分在后续交易日予以兑付。若出现上述第 4 项所述情形，按本合同的相关条款处理。在延期支付的情况消除时，管理人应及时恢复退出业务的办理。

#### （九）拒绝或暂停参与、退出的情形及处理

##### 1. 拒绝或暂停参与的情形及处理方式

在如下情况下，管理人可以拒绝或暂停接受投资者的参与申请：

- （1）战争、自然灾害等不可抗力的原因导致集合计划无法正常运转；
- （2）证券交易市场交易时间非正常停市，导致管理人无法计算当日单位净值；
- （3）管理人有适当理由认为市场缺乏合适的投资机会，继续接受参与可能对现有投资者利益产生损害；
- （4）管理人认为会有损于现有投资者利益的其他参与；
- （5）管理人、托管人、募集网点或注册登记人的技术保障或人员支持等不充分；
- （6）募集机构对投资者资金来源表示疑虑，投资者不能提供充分证明的；

(7) 法律、法规、规章规定的其他情形。

如果投资者的参与申请被拒绝，被拒绝的参与款项将退还给投资者，期间不计利息。

2. 发生下列情形时，管理人可以拒绝或暂停受理投资者的退出申请：

(1) 不可抗力的原因导致集合计划无法正常运转；

(2) 证券交易场所交易时间非正常停市，导致当日集合计划资产净值无法计算；

(3) 管理人认为接受某笔或某些退出申请可能会影响或损害现有投资者利益时；

(4) 因市场剧烈波动等原因而出现连续巨额退出，或者其他原因，导致本集合计划的现金出现困难时，管理人可以暂停接受集合计划的退出申请；

(5) 法律、行政法规和中国证监会认定的其他情形或其他在本合同及说明书中载明的特殊情形。

发生上述情形之一的，管理人将在网站进行公告。已接受的退出申请，若管理人有足额支付能力，则管理人将足额支付；如暂时不能足额支付的，将按每个退出申请人已被接受的退出申请量占已接受退出申请总量的比例分配给退出申请人，其余部分在后续交易日予以兑付。发生拒绝或暂停受理退出的情形时，管理人应将拒绝或暂停受理退出的原因和处理办法在管理人网站进行信息披露。在暂停退出的情况消除时，管理人应在及时恢复退出业务的办理。

#### (十) 集合计划份额的转让

集合计划存续期间，在管理人允许的情况下，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资产管理计划份额，份额转让应遵守交易场所相关规定及要求，并按规定办理份额变更登记手续。

管理人和托管人无需就本集合计划份额转让事宜与投资者另行签订补充协议。受让方首次参与集合计划，应满足合格投资者的条件，并先与管理人、托管人签订集合资产管理合同。转让后，持有资产管理计划份额的合格投资者合计不得超过二百人。

#### (十一) 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、以及其他符合规定的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。

#### （十二）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。当集合计划份额处于冻结状态时，集合计划注册登记机构或其他相关机构有权拒绝集合计划份额的退出、非交易过户等业务的申请。

（十三）管理人应定期将集合计划投资者变更情况报送证券投资基金业协会。

#### （十四）管理人自有资金参与本集合计划情况

管理人不以自有资金参与本集合计划。

## 九、份额持有人大会及日常机构

本集合计划全体投资者、管理人、托管人一致同意，本集合计划不设份额持有人大会及日常机构。

## 十、集合计划份额的登记

（一）本集合计划的注册登记业务指本集合计划的登记、存管、清算和结算业务，具体内容包括投资者资产管理计划账户建立和管理、资产管理计划份额的注册登记、资产管理计划销售业务的确认、清算和结算、收益分配、建立并保管投资者名册等。

（二）本计划的注册登记业务由管理人【华金证券股份有限公司】负责办理。

管理人如委托其他机构代为办理资产管理计划份额登记业务的，应当与有关机构签订委托代理协议，并列明代为办理资产管理计划份额登记机构的权限和职责。

1. 注册登记机构享有如下权利：

（1）建立和管理投资者的资产管理计划账户；



- (2) 取得注册登记费；
- (3) 保管投资者开户资料、交易资料、投资者名册等；
- (4) 在法律法规允许的范围内，制定和调整注册登记业务的相关规则并依法公告；
- (5) 法律法规规定的其他权利。

2. 计划份额登记机构应履行如下注册登记职责：

- (1) 配备足够的专业人员办理本集合计划的注册登记业务；
- (2) 严格按照法律法规和本合同约定办理本集合计划的注册登记业务；
- (3) 保存集合计划客户资料表及相关的参与和退出等业务记录 20 年以上；
- (4) 对投资者的账户信息负有保密义务，因违反该保密义务对投资者或集合计划带来的损失，须承担相应的赔偿责任，但法律法规或监管机构另有规定的除外；
- (5) 按照本合同为投资者办理非交易过户等业务，提供集合计划收益分配等其他必要的服务；
- (6) 法律法规规定的其他职责。

全体集合计划份额持有人同意，管理人、份额登记机构义务人可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、报送至基金业协会、中国证监会及其认定的机构。

## 十一、集合计划的投资

### (一) 投资目标

在有效控制投资风险的前提下，尽量追求委托资产的增值，力争为投资者谋求投资回报。

### (二) 投资范围及比例

#### 1. 本集合计划主要投资于：

本集合计划投资于具有良好流动性的固定收益类金融工具，主要包括银行间市场和交易所市场上市交易的国债、政策性金融债券、地方政府债、央行票据、企业债、公司债、金融机构债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债（包括二级资本债）、债券型基金、资产支持证券优先级、可交换债券、可转换

债券、现金、银行存款、同业存单、债券回购、货币市场基金及其他法律法规或政策许可投资的固定收益证券品种。

如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

本集合计划投资于固定收益类的比例不低于集合计划资产总值的 80%。

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管理人之外的因素，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（如遇相关证券不能上市交易的，上述时间期限自动顺延）。确有特殊事由未能在上述时间内完成调整的，管理人应当及时向住所地中国证监会派出机构和证券投资基金业协会报告。

### （三）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管理人之外的因素，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（如遇相关证券不能上市交易的，上述时间期限自动顺延）。

### （四）说明 FOF 产品（如是）所投资资产管理产品的选择标准

**【本集合计划不适用】。**

### （五）风险收益特征

本集合计划属于 R2(中低风险)固定收益类资产管理产品，适合合格投资者中的 C2 级及其以上的普通投资者及专业投资者。

### （六）业绩比较基准（如有）及确定依据

本计划不设置业绩比较基准。

### （七）投资策略

#### 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）《管理办法》等法律法规及本资产管理合同约定。
- （2）宏观经济发展态势、微观经济运行环境和证券市场走势，作为本计划投

资决策的基础。

(3) 投资对象收益和风险的配比关系。在充分权衡投资对象的收益和风险的前提下作出投资决策，是本集合计划维护投资者利益的重要保障。

## 2. 集合计划的投资决策程序

管理人资产管理业务投资决策体系由管理人资产管理产品及业务决策委员会、投资部门负责人或协管领导、投资经理三级体系组成。

管理人资产管理产品及业务决策委员会是管理人资产管理业务的决策机构，负责审议资管产品业务方案，任命及变更投资经理，评估产品重大投资风险等事项。

投资经理是资产管理业务具体项目的直接管理人，在管理人授权范围内进行投资管理。

## 3. 投资交易程序

管理人设置独立的交易岗，投资经理下达的投资指令通过交易岗实施。交易岗接到投资经理的投资指令后，根据有关规定对投资指令的合规性、合理性和有效性进行检查，确保投资指令在合法、合规的前提下得到高效的执行。

## 4. 投资管理的方法、标准、策略

### 4.1、资产配置策略

本集合计划在合同约定的范围内实施稳健的整体资产配置策略。管理人通过分析细类资产的收益率水平、风险来源、市场流动性等因素，结合对国内宏观经济运行态势、宏观经济政策变化、证券市场运行状况等因素的深入研究，采取积极的投资策略，对投资组合中各细类属资产进行动态优化配置，以寻求收益、风险、流动性之间的最佳平衡点。

### 4.2、固定收益类资产投资策略

#### (1) 普通债券投资策略

本集合计划在普通债券的投资中主要基于对国家财政政策、货币政策的深入分析以及对宏观经济的动态跟踪，采用久期控制下的主动性投资策略，主要包括：久期控制、期限结构配置、信用风险控制、跨市场套利和相对价值判断等管理手段，对债券市场、债券收益率曲线以及各种债券价格的变化进行预测，相机而动、积极调整。

①久期控制是根据对宏观经济发展状况、金融市场运行特点等因素的分析确定组合的整体久期，有效的控制整体资产风险。

②期限结构配置是在确定组合久期后，针对收益率曲线形态特征确定合理的组合期限结构，包括采用集中策略、两端策略和梯形策略等，在长期、中期和短期债券间进行动态调整，从长、中、短期债券的相对价格变化中获利。

③信用风险控制是管理人充分利用现有行业与公司研究力量，根据发债主体的经营状况和现金流等情况对其信用风险进行评估，以此作为品种选择的基本依据。

④跨市场套利根据不同债券市场间的运行规律和风险特性，构建和调整债券债组合，提高投资收益，实现跨市场套利。

⑤相对价值判断是根据对同类债券的相对价值判断，选择合适的交易时机，增持相对低估、价格将上升的债券，减持相对高估、价格将下降的债券。

## (2) 附权债券投资策略

附权债券指对债券发行体授予某种期权，或者赋予债券投资者某种期权，从而使债券发行体或投资者有了某种灵活的选择余地，从而增强该种金融工具对不同发行体融资的灵活性，也增强对各类投资者的吸引力。

### ①可转换债券投资策略

可转换债券不同于一般的企业(公司)债券，其投资人具有在一定条件下转股和回售的权利，因此其理论价值应当等于作为普通债券的基础价值加上可转换公司债内含期权价值，是一种既具有债性，又具有股性的混合债券产品，具有抵御价格下行风险，分享股票价格上涨收益的特点。

可转换债券最大的优点在于，可以用较小的本金损失，博取股票上涨时的巨大收益。可以充分运用可转换公司债券在风险和收益上的非对称性分布，买入低转换溢价率的债券，并持有的投资策略，只要在可转换公司债券的存续期内，发行转债的公司股票价格上升，则投资就可以获得超额收益。

### ②可交换债券投资策略

本集合计划将通过自下而上的标的正股分析和可交换债条款分析，寻找真正具有减持意愿的可交换债。同时，通过深入研究个券的投资价值，在获取可交换债较高票面利率收益基础上，寻找未来有较大转股概率的投资标的。具体而言，

集合计划管理人将综合考虑可交换债的票面利率和其他附带条款如回售等，并对发行人和标的公司进行信用评估，对可交换债从纯债上做出价值衡量，在此基础上对标的正股所在行业和标的正股公司做深度分析，并结合可交换债的换股价格等情况，充分挖掘内含看涨期权价值高的可交换债，综合纯债价值和看涨期权价值两方面考量，本集合计划对综合价值高的精选个券做出重点配置。

### （3）资产证券化产品投资策略

证券化是将缺乏流动性但能够产生稳定现金流的资产，通过一定的结构化安排，对资产中的风险与收益进行分离组合，进而转换成可以出售、流通，并带有固定收入的证券的过程。

资产证券化产品的定价受市场利率、发行条款、标的资产的构成及质量、提前偿还率等多种因素影响。本集合计划将在基本面分析和债券市场宏观分析的基础上，对资产证券化产品的交易结构风险、信用风险、提前偿还风险和利率风险等进行分析，采取包括收益率曲线策略、信用利差曲线策略、预期利率波动率策略等积极主动的投资策略，投资于资产证券化产品。

### （4）回购套利策略

集合计划管理人在发现债券市场明显投资机会的情况下，或债券市场存在套利机会时，通过回购等融资融券手段，应用适量的杠杆获取超额收益。

### （5）银行存款、货币市场基金、债券逆回购等资产投资策略

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

## （八）投资限制及禁止行为

### 1. 投资限制

为维护投资者的合法权益，本集合计划的投资限制为：

（1）本集合计划的总资产不得超过净资产的 200%；

（2）本集合计划投资于同一资产的资金，不得超过本集合计划资产净值的 25%；管理人管理的全部集合资产管理计划投资于同一资产的资金，不得超过该资产的 25%。银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债

券等中国证监会认可的投资品种除外；

(3) 本计划参与债券正回购资金余额不得超过上一日净资产 100%；参与债券逆回购资金余额不得超过上一日净资产 100%；

(4) 本集合计划退出开放期内，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%；

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

(6) 本计划参与债券、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；

(7) 本集合计划投资于主体评级不低于 AA 的信用债（包括短期融资券、超短期融资券），投资可转债的主体评级不低于 A+；无主体评级的信用债，债项评级不得低于 AA，其中短期融资券债项评级不得低于 A-1；

(8) 本集合计划参与债券逆回购接受质押券的信用债主体评级不低于 AA（包括短期融资券、超短期融资券）；无主体评级的信用债，债项评级不得低于 AA，其中短期融资券债项评级不得低于 A-1；

(9) 本集合计划投资于可转债、可交债的资金合计不得超过本计划资产总值的 10%；

(10) 本集合计划不得违反《集合资产管理合同》中投资范围的规定；

(11) 法律法规、中国证监会以及本合同规定的其他投资限制。

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

## 2. 投资禁止

本集合计划的禁止行为包括：

(1) 管理人不得将本集合计划资产直接投资商业银行信贷资产；不得违规为地方政府及其部门提供融资，不得要求或者接受地方政府及其部门违规提供担保；不得直接或者间接投资法律、行政法规和国家政策禁止投资的行业或领域；

(2) 将集合计划资产用于可能承担无限责任的投资；

(3) 向客户做出保证其资产本金不受损失或者保证其取得最低收益的承诺；

- (4) 挪用集合计划资产；
- (5) 募集资金超过计划说明书约定的规模；
- (6) 接受单一客户参与资金低于中国证监会规定的最低限额；
- (7) 以获取佣金或者其他不当利益为目的，使用集合计划资产进行不必要的交易；
- (8) 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；
- (9) 法律、行政法规和中国证监会禁止的其他行为。

#### (九) 资产管理计划的建仓期

本集合计划的建仓期为【6】个月，本集合计划管理人将在集合计划成立之日起【6】个月内使集合计划的投资组合比例符合以上约定。建仓期的投资活动，应当符合资产管理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除外。

(十) 全体投资者不可撤销地同意并授权管理人在本集合计划存续期间，为规避特定风险，投资于【固定收益类】资产的比例可以低于计划总资产的 80%，但不得持续 6 个月低于计划总资产的 80%。上述特定风险包括但不限于因经济政策、交易制度、交易方式、市场环境等因素的变化可能对资产收益产生不利影响而产生的风险。

(十一) 管理人应做好本集合计划资产组合的流动性管理工作，同时有权在发生巨额退出等情形时启动本合同约定的相关条款，使得投资的资产组合的流动性与参与、退出安排相匹配。

1. 主动投资于流动性受限资产的市值在开放退出期内合计不得超过本集合计划资产净值的 20%；

2. 在集合计划开放退出期内保留 7 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%。

#### (十二) 本集合计划的特殊风险控制措施

本集合计划设置了预警线、平仓线作为特殊风险控制措施。

本集合计划的预警线为【0.9000】元，平仓线为【0.8000】元。

在本集合计划存续期内，当某一工作日（T日）估值结果显示T-1日集合计划单位净值触及预警线时，从T日起，本计划仅可进行卖出或赎回及相关的投资操作，不再进行买入或申（认）购及相关的投资操作。当本计划单位净值恢复到预警线以上的下一个交易日起，本计划可恢复进行买入或申（认）购及相关的投资操作。

在本集合计划存续期内，当连续3个工作日估值结果显示前一个工作日集合计划单位净值 $\leq$ 平仓线时，管理人需于第4个工作日对集合计划持有的全部非现金类资产进行不可逆变现操作，直至集合计划资产全部变现。若因客观因素导致当日无法平仓完毕，则顺延至下一工作日。管理人于第4个工作日起对本集合计划进行强制平仓并不表示管理人必须在当日内全部变现，若存在无法变现标的的，管理人将等到能够变现之时再变现。当本集合计划被强制平仓、非现金类资产全部变现后，本集合计划提前终止。

平仓线的操作由管理人自行监控，托管人仅配合进行账务处理。

## 十二、投资顾问

本集合计划未聘用投资顾问。

## 十三、分级安排

本集合计划不进行分级。

## 十四、利益冲突及关联交易

### （一）利益冲突情形

在不违反法律法规的强制性规定、不违反本合同约定的前提下，本计划可能投资于管理人、托管人及前述机构的控股股东、实际控制人或者其他关联方发行的证券或者承销期内承销的证券，或从事其他重大关联交易。

投资者在此不可撤销地同意并授权管理人可以将本集合计划的资产投资于管理人、托管机构及其控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司发行或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易。



## （二）利益冲突的处理方式、披露内容及频率

管理人在运用受托管理资产从事关联交易时，将按照法律法规及中国证监会的有关规定，遵循客户利益优先原则，事后以临时公告或定期报告的形式告知投资者、托管人，并根据监管要求进行报告。

若管理人董事、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管理人设立的资产管理计划，管理人应当向投资者进行披露，对该计划账户进行监控，并按监管要求进行报告。

除上述规定外，管理人不得将本资管计划的委托资产，直接或者通过投资其他资产管理计划等间接形式，为本机构、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，投资者为符合中国证监会规定的专业投资者且投资金额不低于 1000 万元，并且提前 2 个工作日向管理人出具书面同意投资的除外。

## 十五、投资经理的指定与变更

### （一）投资经理的指定

本集合计划的投资经理由管理人负责指定。

投资经理相关简介如下：

姓名：贾鹏

从业简历：华金证券资管总部投资经理。中国人民大学金融工程硕士，14 年证券从业经历，曾先后任职于中原证券固定收益投资总部、中原证券资产管理总部和华金证券资管总部。累计管理规模超过 200 亿元，对宏观经济运行、利率期限结构和信用评价分析有深刻的理解和认识，投资风格稳健，擅长在稳健基础上通过多元策略获取增厚收益。

学历：硕士研究生

兼职情况：无兼职

投资管理、投资研究、投资咨询等相关业务经验：有

是否取得基金从业资格：是

最近三年是否被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚：否

姓名：刘德杰

从业简历：华金证券资产管理总部高级投资经理。2012年-2015年，中国中纺集团公司期货部，从事期货策略研究、期货投资套利等工作；2015年-2020年，信达证券股份有限公司，投资助理及场外新股和可转债研究；2021年1月至今，任职于华金证券资产管理总部。

9年期货和证券公司从业经历，对外经济贸易大学金融工程学士。2012年起从事期货及期权套利策略构建和投资工作，2015年起于信达证券资产管理部协助投资经理进行投资研究与交易工作，包括且不限于减持策略研究、打新及可转债策略研究。擅长把握市场结构性机会，对公司基本面和行业逻辑具有较深理解。

学历：学士

兼职情况：无兼职

投资管理、投资研究、投资咨询等相关业务经验：有

是否取得基金从业资格：是

最近三年是否被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚：否

## （二）投资经理的变更

投资经理离职或因故不能履行其职责时，管理人可以根据需要变更投资经理，投资经理变更后，管理人应在【五】个工作日通过管理人官网向投资者披露，并向中国证券投资基金业协会报告。管理人在其网站就投资经理变更事宜进行相应公告，即视为已经履行了相应告知程序。

## 十六、集合计划的财产

### （一）集合计划财产的保管与处分

集合计划的财产包括集合计划所拥有的各类有价证券、银行存款本息、其他应收的款项以及其他投资等的价值总和。对因管理人投资产生的存放或存管在资产托管人以外机构的委托财产，由管理人负责清算交收。

1. 集合计划财产的债务由集合计划财产本身承担责任，投资者以其出资为限对资产管理计划财产的债务承担责任。

2. 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、托管人不得将资产管理计划财产归入其固有财产。因为资产管理人投资产生的存放或存管在资产托管人以外机构的委托财产，由相应的保管机构承担保管职责，管理人应审慎选择保管机构。

3. 管理人、托管人因资产管理计划财产的管理、运用或者其他情形而取得的财产和收益，归入集合计划财产。

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，其债权人不得对资产管理计划财产行使请求冻结、扣押和其他权利。管理人、托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，资产管理计划财产不属于其清算财产。

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

## （二）非现金类财产的保管

### 1. 证券类资产及证券交易资金的保管

本计划投资形成的证券类资产，由相关法定登记或托管机构根据法律法规的规定实行第三方保管；证券交易结算资金由相关证券经纪商和存管银行保管。对于在未经托管人同意的情况下管理人自行变更证券经纪商或存管银行造成的损失，及因证券经纪商原因导致证券交易结算资金无法正常转账支取造成的损失，由过错方承担相应责任。

对于因为管理计划投资产生的应收资产，应由管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知托管人，到账日托管账户未收到应收资产的，托管人应及时通知管理人采取措施进行催收，由此给计划造成损失的，管理人应负责向有关当事人追偿。

## （三）集合计划财产相关账户的开立和管理

### 1. 托管账户

（1）管理人、托管人为本资产管理计划单独开立托管资金账户。托管资金账户的名称应当包含本资产管理计划名称，具体名称以实际开立为准。本资产管

理计划的一切货币收支活动,包括但不限于投资、支付赎回金额、支付计划收益、收取认购/申购款,均需通过该托管资金账户进行。

(2) 托管资金账户的开立和使用,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。

(3) 托管资金账户的管理应符合有关法律法规的规定。

## 2. 证券账户的开立和管理

根据管理人的申请,管理人、托管人按照规定开立计划财产证券账户。管理人、托管人应当在开户过程中相互配合,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。

证券账户的开立和使用,限于满足开展本资产管理计划业务的需要。托管人和管理人不得出借和未经对方同意擅自转让本资产管理计划任何证券账户,亦不得使用本计划的任何证券账户进行本计划业务以外的活动。

证券账户卡的保管由托管人负责,证券账户的管理和运用由管理人负责。

## 3. 银行间债券市场的相关账户的开立和管理

管理人负责以本资产管理计划的名义申请并取得全国银行间同业拆借市场的交易资格,并代表本计划进行交易;托管人负责以计划资产的名义在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开设银行间债券市场债券托管账户,并代表本计划进行债券和资金的清算。管理人、托管人应互相配合并提供相关资料。

## 4. 开放式证券投资基金账户的开立和管理

(1) 管理人负责为本计划开立所需的基金账户。

(2) 管理人在开立计划账户时应将托管资金账户作为赎回款、红利分配款项指定收款账户。

(3) 管理人需及时将计划账户的开户资料(复印件)加盖经授权的管理人业务专用章后交付托管人。

(4) 在托管人收到开户资料前,管理人不得利用该账户进行投资活动。

(5) 托管人有权随时向基金注册登记人查询该账户资料。管理人应于每季度结束后十个工作日内将开放式基金对账单发送给托管人。

#### 5. 第三方销售平台基金账户的开立

第三方销售平台基金账户由资产管理人负责开立。账户开立前，资产管理人应确认拟合作的第三方销售平台已经取得基金销售业务资格且有效存续。账户开立后，资产管理人应向资产托管人书面提供基金账户的账户信息，包括基金账户的户名、账号、回款路径等；其中基金账户的名称应为产品名称，回款账户应为该产品的托管银行账户。如通过 FISP 平台划款，资产管理人需向中登发起接入 FISP 的申请，并将基金账户信息通过 FISP 平台关联至本产品，由 FISP 通知托管人。

#### 6. 定期存款账户

委托财产投资定期存款在存款机构开立的银行账户，包括实体或虚拟账户。定期存款账户户名应与托管账户保持一致，该账户预留印鉴由管理人负责预留。管理人应该在合理的时间内进行定期存款的投资和支取事宜。对于任何的定期存款投资，管理人都必须和存款机构签订定期存款协议，该协议作为划款指令附件，该协议中必须有如下明确条款：“存款证实书不得被质押或以任何方式被抵押，并不得用于转让和背书；本息到期归还或提前支取的所有款项必须划至托管专户（明确户名、开户行、账号等），不得划入其他任何账户”。如定期存款协议中未体现前述条款，托管人有权拒绝定期存款投资的划款指令。存款证实书原件由管理人负责办理、取得并保管。

#### 7. 其他账户（如有）

（1）因业务发展需要而开立的其他账户，可以根据法律法规和资产管理合同的规定，由托管人或管理人负责开立。新账户按有关规定使用并管理。

（2）法律法规等有关规定对相关账户的开立和管理另有规定的，从其规定办理。

本合同当事人应当在开户过程中给予开立账户方必要的配合，并提供所需资料。管理人保证所提供的账户开户材料的真实性和有效性，且在相关资料变更后及时将变更的资料提供给托管人。

与委托财产投资有关的其他账户，由管理人与托管人根据相关法律法规和本合同的规定协商一致后办理，新账户按有关规则使用并管理。

集合计划账户、专用交易单元应由集合计划管理人报证券交易所、证券登记

结算机构以及住所所在地中国证监会派出机构及中国证券投资基金业协会备案。

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

#### （四）集合计划账户的托管

本集合计划资产由兴业银行股份有限公司负责托管，托管人将严格遵照有关法律法规及双方达成的协议对集合资产进行托管。

为提高银行间交易的清算交收效率，管理人在此授权并同意托管人根据外汇交易中心发送的成交数据，对本集合计划涉及的相关交易在中债综合业务平台或上海清算所客户终端的现券及回购交易自行完成交易确认操作，管理人取消向托管人发送本集合计划银行间交易的纸质成交单。对于分销、回售、逾期返售，转托管等业务，管理人仍需向托管人发送交易指令及附件。如果银行间中债综合业务平台或上海清算所客户终端系统已经生成的交易需要暂停、取消或终止，管理人应在第一时间以电子邮件或固定电话方式通知托管人，并在后续出具暂停确认说明函加盖预留印鉴发送至托管人，对于需要取消但通知前已进行确认操作的以及不是托管人原因导致未接收到外汇交易中心数据而导致交易未及时确认的，由此带来的影响由管理人承担。为保证交易平稳运行，管理人应于集合计划首次进行银行间交易时电话或邮件提示托管人，托管资金账户与 DVP 资金账户之间的轧差指令将继续采用出具指令的形式，由托管人遵照指令执行；由于外汇交易中心暂未开通直连或系统问题等原因，导致托管人无法接收外汇交易中心成交数据或接收数据不完整时，管理人有义务根据托管人要求发送纸质成交单。

## 十七、投资指令的发送、确认和执行

### （一）管理人对发送业务指令人员的授权

#### 1、管理人应指定专人向托管人发送业务指令

2、管理人应当事先向托管人发出书面授权通知（已提供统一授权书的除外），向托管人提供有权签字人的签章样本和公司公章或业务章印章样本，并在授权通知上载明管理人有权发送指令的人员名单、联系方式和权限范围。管理人应指定至少两名以上的有权发送指令人员。

3、管理人向托管人发出的授权通知应加盖公章。托管人在收到授权通知的当日与管理人通过录音电话的方式确认。该授权通知自托管人确认收到授权书原件之日与其上载明的生效日期孰晚之日开始生效。

4、管理人和托管人对授权通知及其更改负有保密义务，其内容不得向有权发送指令人员及相关操作人员以外的任何人披露、泄露。

## （二）业务指令的内容

1、业务指令包括收款指令、付款指令（含退出付款指令、收益分配付款指令）等资金划付指令、银行间交易指令、场外交易指令、会计核算业务处理指令等。

2、管理人发送的业务指令应加盖在托管人处预留的印鉴并由被授权人签章。管理人发给托管人的有关资金划出的业务指令应写明收、付款人名称、用途、支付时间、金额、账户、开户行支付行号等。

## （三）业务指令发送、确认及执行的程序

### 1、业务指令的发送

（1）指令需有授权通知确定的预留印鉴和签章，并由有权发送指令人员在指令上签章后，代表管理人用传真或者邮件的方式向托管人发送。在特殊（应急）情况下，也可采用双方协商一致的其他方式。

（2）管理人应按照《管理办法》和有关法律、法规规定，在其合法的经营权限和交易权限内发送指令；被授权人应严格按照其授权权限发送指令。

（3）指令发出后，管理人应及时通知托管人。

（4）集合计划管理人在发送指令时，应于划款当日 15:00 前或提前 1 个工作日向计划托管人发送投资划款指令并确认，要求当日某一时点划款，应当提前 2 个工作小时向托管人发送划款指令并获托管人确认。对于当日 15:00 之后发送收到的指令，托管人应尽力在划款指定时间内完成资金划拨。计划管理人应为计划托管人执行划款指令留出必要时间，如计划管理人未在指令中列明划款时间的，则计划托管人以确认收到指令后 2 个工作小时内执行划款，但是托管账户余额不足或者如遇不可抗力的除外。

### 2、业务指令的确认

（1）托管人在接收指令时，应对指令是否由有权发送指令人员发送、指令的要素是否齐全、指令印鉴与签章是否与预留的授权文件内容相符进行审慎验证，

如发现问题，应及时通知管理人。经确认的指令，管理人不得否认其效力，但如果管理人已经撤销或更改对有权签署、发送指令人员的授权，并且已通知托管人确认，则对于此后该类相关人员无权发送的指令，或超权限发送的指令，管理人不承担责任。

(2) 托管人在确有必要的情况下可以要求管理人邮件提供相关交易凭证或单据、合同或其他有效会计资料，以确保托管人有足够的资料来判断指令的有效性。

### 3、业务指令的执行

(1) 托管人确认指令有效后，方可执行指令。

(2) 托管人在复核后应在规定期限内执行指令，不得延误。

(3) 若管理人的指令违反法律法规规定或者本合同约定的，托管人应当不予执行，并立即通知管理人要求其变更或撤销相关指令，若管理人在托管人发出上述通知后仍未变更或撤销相关指令，托管人有权拒绝执行，并有权向中国证券业协会报告并抄报管理人住所地中国证监会派出机构

(4) 集合计划托管专户发生的银行结算费用等银行费用，由托管人直接从资金户中扣划，无须管理人出具指令。

#### (四) 托管人依法暂缓、拒绝执行指令的情形和处理程序

托管人在依据本合同履行监督职能时，如发现集合计划管理人的指令或相关投资合同、协议等文件资料不完整的，应拒绝执行，并及时通知资产管理人补充或纠正。对有效投资指令资产托管人应在规定期限内及时执行，不得延误。

托管人发现集合计划管理人的指令违法、违规或违反本合同约定的，有权不予执行，并及时书面或电子邮件或双方认可的其他方式通知集合计划管理人。

#### (五) 资产管理人发送错误指令的情形和处理程序

资产管理人发送错误指令的情形包括指令发送人员无权或超越权限发送指令及交割信息错误，指令中重要信息模糊不清或不全等。

资产托管人发现资产管理人的指令错误时，有权拒绝执行，并及时通知资产管理人改正。

#### (六) 被授权人的更换

集合计划管理人若对授权通知的内容进行修改（包括但不限于指令发送人员



的名单的修改,或权限的修改),应当至少提前1个工作日通知集合计划托管人;修改授权通知的文件应由集合计划管理人加盖公章并注明生效日期。集合计划管理人对授权通知的修改应当以传真或电子邮件发送扫描件的形式发送给集合计划托管人,同时电话通知集合计划托管人,集合计划托管人收到变更通知后及时通过录音电话向集合计划管理人确认。集合计划管理人收到托管人的回复视为通知已送达托管人。管理人在与托管人电话确认授权通知后的三个工作日内将授权通知的正本送交托管人。管理人有义务确保授权通知的正本与传真件或电子扫描件一致。若授权通知正本内容与托管人收到的传真件或电子扫描件不一致的,以托管人收到的已生效的传真件或电子扫描件为准,由此造成的责任和损失由管理人自行承担。

托管人更换接收管理人指令的人员,应提前通知管理人。

#### (七) 指令的保管

指令正本由管理人保管,托管人保管指令传真件或电子扫描件。当两者不一致时,以托管人收到的业务指令传真件或电子扫描件为准。

#### (八) 其他事项

1、集合计划托管人在接收指令时,应对划款指令的印鉴和被授权人是否与预留的授权文内容相符做一致性审慎检查,如发现问题,应及时通知集合计划管理人。

2、集合计划托管人因正确执行集合计划管理人划款指令而产生的相关法律责任,由集合计划管理人承担。集合计划托管人因未正确执行集合计划管理人符合法律法规规定及本合同、本集合计划相关约定的划款指令而使集合计划的利益受到损害或产生的相关法律责任,由集合计划托管人承担,集合计划管理人不承担该责任,但是托管账户余额不足或者托管人如遇不可抗力的除外。

3、集合计划管理人向集合计划托管人下达指令时,集合计划管理人应确保集合计划银行托管账户有足够的资金余额,对超头寸的投资指令,集合计划托管人在履行及时通知义务但管理人未采取措施情况下有权拒绝执行,由此造成的损失,托管人不承担赔偿责任。因资产管理人原因造成的传输不及时、未能留出足够执行时间、未能及时与资产托管人进行指令确认致使资金未能及时清算或交易失败所造成的损失托管人不承担赔偿责任。

4、对于可能存在管理人由于管理原因、内部道德风险导致发出的指令，如托管人复核与授权文件内容一致，应由管理人承担全部责任，管理人不得以不知情、相关人员犯罪、不是真实意思表示为由，主张划款指令无效或者要求托管人承担赔偿责任。

5、资产托管人根据本合同相关规定履行印鉴和签名的表面一致性形式审核职责，如果资产管理人的指令存在事实上未经授权、欺诈、伪造或未能及时提供授权通知等情形，资产托管人不承担因执行有关指令或拒绝执行有关指令而给资产管理人或委托资产或任何第三方带来的损失，全部责任由过错方承担，但资产托管人未按合同约定尽形式审核义务执行指令而造成损失的情形除外。

## 十八、交易及清算交收安排

### 1、选择证券经纪机构的程序

(1) 资产管理人负责选择代理本资产管理计划财产证券买卖的证券经营机构，并与其签订证券交易单元使用协议。

(2) 资产管理人应及时将本资产管理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资产托管人。

(3) 资产管理人与资产托管人配合完成交易单元的合并清算事宜，资产管理人在交易前应确认相关合并清算事宜已办结。若资产管理人在合并清算办结前交易，则相关的交收责任由资产管理人承担。

### 2、投资证券后的清算交收安排

(1) 关于托管资产在证券交易所市场达成的符合中国结算公司多边净额结算要求的证券交易以及新股业务：

①资产托管人、资产管理人应共同遵守中登公司制定的相关业务规则 and 规定，该等规则 and 规定自动成为本款规定的内容。资产管理人在投资前，应充分知晓与理解中登公司针对各类交易品种制定结算业务规则 and 规定，并遵守资产托管人为履行特别结算参与人的义务所制定的业务规则与规定。

②资产托管人代理资产管理计划与中登公司完成证券交易及非交易涉及的证券资金结算业务，并承担由资产托管人原因造成的正常结算、交收业务无法完成的责任；若由于资产管理人原因造成资产托管人无法正常完成结算业务，资产

托管人发现后应立即通知资产管理人，由资产管理人负责解决，由此造成资产托管人无法按时向中国证券登记公司支付证券清算款的责任由资产管理人承担。

③ 资产托管人遵照中登公司上海分公司和中登公司深圳分公司备付金、保证金管理办法有关规定，确定和调整该委托财产最低结算备付金、证券结算保证金限额，资产管理人应存放于中登公司的最低备付金、结算保证金日末余额不得低于资产托管人根据中登公司上海和深圳分公司备付金、保证金管理办法规定的限额。资产托管人根据中登公司上海和深圳分公司规定向委托财产支付利息。

④ 根据中登公司托管行集中清算规则，如委托财产 T 日进行了中登公司深圳分公司 T+1DVP 卖出交易，资产管理人不能将该笔资金作为 T+1 日的可用头寸，即该笔资金在 T+1 日不可用也不可提，该笔资金在 T+2 日才能划拨至托管资金账户。

⑤ 根据中国证券登记结算有限责任公司的规定，结算备付金账户内的最低备付金、交易保证金账户内的资金按月调整按季结息，因此，资产管理合同终止时，资产管理计划可能有尚存放于结算公司的最低备付金、交易保证金以及结算公司尚未支付的利息等款项。对上述款项，资产托管人将于结算公司支付该等款项时扣除相应银行汇划费用后划付至资产管理计划清算报告中指定的收款账户。资产管理合同终止后，中登根据结算规则，调增计划的结算备付以及交易保证金，资产管理人应配合资产托管人，向资产托管人及时划付调增款项，以便资产托管人履行交收职责。

(2) 关于托管资产在证券交易所市场达成的符合中国结算公司 T+0 非担保结算要求的证券交易：

①对于在沪深交易所交易的采用 T+0 非担保交收的交易品种（如中小企业私募债、股票质押式回购、债券质押式协议回购、资产支持证券等，根据中登公司业务规则适时调整），资产管理人需在交易当日不晚于 14:00 向资产托管人发送交易应付资金划款指令，同时将相关交易证明文件传真至资产托管人，并与资产托管人进行电话确认，以保证当日交易资金交收的顺利进行，中登业务规则允许采用 RTGS 交收的，在计划非担保交收账户可用资金充足的情况下，托管人将进行勾单处理。对于资产管理人在 14:00 后出具的划款指令，特别是需要资产托管人进行“勾单”确认的交易，资产托管人本着勤勉尽责的原则积极处理，但不

保证支付/勾单成功。

② 资产管理人一旦出现交易后无法履约的情况，应在第一时间通知资产托管人。对于中国结算公司允许资产托管人指定不履约的交易品种，资产管理人应向资产托管人出具书面的取消交收指令，另，鉴于中登公司对取消交收（指定不履约）申报时间有限，资产托管人有权在电话通知资产管理人后，先行完成取消交收操作，资产管理人承诺日终前补出具书面的取消交收指令。

③ 若资产管理人未及时出具交易应付资金划款指令，或资产管理人在托管产品资金托管账户头寸不足的情况下交易，资产托管人有权在中登公司取消交收截止时点前半小时内主动对该笔交易进行取消交收申报，所有损失由资产管理人承担。

④ 对于根据结算规则不能取消交收的交易品种，如出现前述第 2、3 项所述情形的，资产管理人知悉并同意资产托管人有权（但并非确保）仅根据中国结算公司的清算交收数据，主动将托管产品资金托管账户中的资金划入中国结算公司用以完成当日 T+0 非担保交收交易品种的交收，资产管理人承诺在日终前向资产托管人补出具资金划款指令。

⑤ 发生以下因资产管理人原因所造成的情形，资产管理人应承担相应责任：

I、资产管理人所托管的产品资金不足导致其自身产品交收失败，由资产管理人承担交易失败的风险，资产托管人无义务为该产品垫付交收款项；

II、因资产管理人未在合同约定的时间前向资产托管人提交有效划款指令，导致资产托管人无法及时完成支付结算操作而使其自身产品交收失败的，由资产管理人自行承担交易失败的风险；

III、因资产管理人所托管的产品资金不足，且占用托管行最低备付金交收成功，造成托管行损失，则应承担赔偿责任，且资产托管人保留根据上海银行间市场同业拆借利率向资产管理人追索利息的权利；

IV、因资产管理人所托管的产品资金不足或资产管理人未在规定时间内向资产托管人提交划款指令，且有证据证明其直接造成资产托管人托管的其他产品交收失败和损失的，资产管理人应负赔偿责任。

⑥ 资产管理人已充分了解托管行结算模式下可能存在的交收风险。如资产托管人托管的其他产品资金不足或过错，进而导致资产管理人管理的产品交收失

败的，则资产托管人将配合资产管理人提供相关数据等信息向其他客户追偿。

⑦ 对于托管产品采用 T+0 非担保交收下实时结算 (RTGS) 方式完成实时交收的收款业务，管理人可根据需要在交易交收后，深圳 T+0 不晚于交收当日 14:00、上海 T+0 不晚于交收当日 15:00 向托管人发送交易应收资金收款指令，同时将相关交易证明文件传真至托管人，并与托管人进行电话确认，以便托管人将交收金额提回至托管产品资金托管账户。

(3) 关于托管资产在证券交易所市场达成的符合中国结算公司 T+N 非担保结算要求的证券交易

资产管理人知悉并同意资产托管人仅根据中国结算公司的清算交收数据主动完成托管产品资金清算交收。若资产管理人出现交易后无法履约的情况，并且中国结算公司的业务规则允许资产托管人对相关交易可以取消交收的，资产管理人应于交收日前一工作日向资产托管人出具书面的取消交收指令，并与资产托管人进行电话确认。

### 3、开放式基金投资的清算交收安排

(1) 开放式基金申购 (认购) 相应的资金划拨由托管人依据管理人的划款指令逐笔划付。管理人申购 (认购) 开放式基金时，应将划款指令连同基金申购 (认购) 申请单一并传真至托管人。托管人审核无误后，应及时将划款指令交付执行。管理人应实时调整当日可用资金余额。管理人在收到基金申购 (认购) 确认回单后，应立即传真至托管人。

(2) 管理人赎回开放式基金时，应在向基金管理公司或代销机构发出基金赎回申请书的同时将赎回申请书传真至托管人；管理人在收到赎回确认回单后，应及时传真至托管人。

(3) 为确保本计划财产会计核算及估值的及时处理，管理人应于开放式基金交易 (包括认购、申购、赎回、基金转换、红利再投资、现金分红等) 的确认日及时获取确认单等单据的传真件，要求并督促基金管理公司于当日传真给管理人，管理人收到后应立即传真至托管人。

### 4、银行间交易资金结算安排

(1) 管理人负责对交易对手的资信控制，按银行间债券市场的交易规则进行交易，并负责解决因交易对手不履行合同或不及时履行合同而发生的纠纷。

(2) 银行间交易结算方式采用券款对付的, 托管资金账户与本计划在登记结算机构开立的 DVP 资金账户之间的资金调拨, 除了登记结算机构系统自动将 DVP 资金账户资金退回至托管资金账户之外, 应当由管理人出具资金划款指令, 托管人审核无误后执行。由于管理人未及时出具指令导致本计划在托管资金账户的头寸不足或者 DVP 资金账户头寸不足导致的损失, 由过错方承担责任。

(3) 本合同履行过程中如涉及到期违约债券处置(‘到期违约’是指, 在发行文件中约定的到期兑付日, 债券本金或利息未能得到按时足额偿付, 或因发行人破产等法定或约定原因导致债券提前到期且债券本金或利息未能得到按时足额偿付的情形), 管理人应自行负责寻找交易对手方、交易价格商定、协议签署、债券过户等违约债券转让业务所涉环节, 托管人不参与上述业务, 仅根据本合同的约定履行托管人职责(包括根据管理人指令将资金调入产品托管账户或自托管账户划至 DVP 账户)。相关违约债券处置的全部责任或可能造成的损失均由管理人自行承担。

为维护投资者利益, 如须托管人配合管理人根据《全国银行间债券市场债券托管结算机构到期违约债券转让结算业务规则》向债券托管结算机构出具《到期违约债券转让结算业务承诺函》(以下简称“《承诺函》”)的, 各方一致确认, 虽然《承诺函》由管理人和托管人双方共同出具, 相关承诺事项视为全部由管理人单方作出, 因其违反/不符合《承诺函》导致的全部责任及后果由管理人自行承担。同时, 管理人确认并承诺: 如托管人因在《承诺函》所承诺事项而被债券托管结算机构或任何第三方追责, 导致托管人对外偿付及其他任何损失的, 将由管理人承担全部赔偿责任。

#### 5、投资银行存款的特别约定

(1) 本计划投资银行存款前, 应与存款银行签署投资银行定期存款协议。

(2) 本计划投资银行存款, 必须采用管理人和托管人认可的方式办理。

(3) 管理人投资银行存款或办理存款支取时, 应提前书面通知托管人, 以便托管人有足够的时间履行相应的业务操作程序。

(4) 定期存款账户, 到期后资金必须划回托管账户。存款证实书不得被质押或以任何方式被抵押、并不得用于背书转让。集合产品投资定期存款在存款机构开立的银行账户, 包括实体或虚拟账户。定期存款账户户名应与托管账户保持一

致, 该账户预留印鉴由管理人指定。管理人应该在合理的时间内安排定期存款的投资和支取事宜。对于任何的定期存款投资, 管理人都必须和存款机构签订定期存款协议, 该协议中必须有如下明确条款: “存款证实书不得被质押或以任何方式被抵押, 并不得用于转让和背书; 本息到期归还或提前支取的所有款项必须划至托管资金账户(明确户名、开户行、账号等), 不得划入其他任何账户, 并将本资产管理产品托管账户指定为唯一回款账户。”如定期存款协议中未体现前述条款, 托管人有权拒绝定期存款投资的划款指令。

#### 6、资金、证券账目及交易记录的核对

管理人和托管人应定期对账。

对计划财产的资金账目, 以管理人与托管人约定方式核对, 确保相关各方账账相符。

对计划财产的证券账目, 由相关各方根据外部第三方对账数据定期进行对账。

对计划财产的交易记录, 管理人与托管人核对估值结果之前, 应保证所有实际交易记录与会计账簿上的交易记录完全一致, 托管人应履行相应估值结果核对监督职责。如果实际交易记录与会计账簿记录不一致, 造成会计核算不完整或不真实, 由此导致的损失由过错方承担。

为确保本计划托管账户资金安全, 管理人、托管人应至少每季度一次就托管账户余额进行账务核对, 托管人通过托管网银的“托管账户银企对账”模块按月向管理人提供本计划托管账户余额对账服务。管理人应在每季度初 15 天内就上个季度托管账户余额进行对账反馈。管理人逾期未反馈的, 托管人视同管理人默认账务核对无误, 其后果由管理人自行承担。管理人应做好托管网银系统用户密码安全管理工作。对于管理人原因导致对账用户被非法使用、密码保管不当被泄露等情况造成的损失由管理人自行承担。管理人应对账务核对结果的真实性、准确性负责。账务核对不符的, 管理人可向托管人查询。

## 十九、越权交易的界定

### (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本合同的约定而进行的投资交易行为, 包括违反本合同约定的投资范围和投资比例限制等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，不得违反本合同关于投资范围和投资限制的约定，超越权限从事投资。

## （二）越权交易的处理程序

### 1. 违反本合同投资范围和投资比例限制规定进行的投资交易行为

托管人在行使监督职责时，发现管理人的投资指令违反本合同约定的，应当拒绝执行，立即通知管理人，并有权依据相关法律法规的要求报告中国证监会相关派出机构或基金业协会。

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本合同约定的，应立即通知管理人，并有权依据相关法律法规的要求报告中国证监会相关派出机构或基金业协会。

管理人应向托管人主动报告越权交易并限期改正。托管人有权督促管理人在限期内改正并在期限内对通知事项进行复查。管理人对托管人通知的越权事项未能在限期内纠正的，托管人有权依据相关法律法规的要求报告中国证监会或基金业协会。

2. 越权交易所发生的损失及相关交易费用由管理人负担，所发生的收益归本集合计划资产所有。

## （三）托管人对管理人投资运作的监督

1. 根据有关法律法规的规定及本合同的约定，对托管资产的投资运作情况进行监督。托管人监控条款如下：

### （1）投资范围及比例

本集合计划主要投资于：

本集合计划投资于具有良好流动性的固定收益类金融工具，主要包括银行间市场和交易所市场上市交易的国债、政策性金融债券、地方政府债、央行票据、企业债、公司债、金融机构债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债（包括二级资本债）、债券型基金、资产支持证券优先级、可交换债券、可转换债券、现金、银行存款、同业存单、债券回购、货币市场基金及其他法律法规或政策许可投资的固定收益证券品种。

如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。



## 投资比例

本集合计划投资于固定收益类的比例不低于集合计划资产总值的 80%。

### (2) 投资限制及禁止行为

#### 投资限制

为维护投资者的合法权益，本集合计划的投资限制为：

- 1) 本集合计划的总资产不得超过净资产的 200%；
  - 2) 本集合计划投资于同一资产的资金，不得超过本集合计划资产净值的 25%；管理人管理的全部集合资产管理计划投资于同一资产的资金，不得超过该资产的 25%。银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券等中国证监会认可的投资品种除外；
  - 3) 本计划参与债券正回购资金余额不得超过上一日净资产 100%；参与债券逆回购资金余额不得超过上一日净资产 100%；
  - 4) 本集合计划退出开放期内，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%；
  - 5) 本计划主动投资于流动性受限资产的市值在赎回开放期内合计不得超过该资产管理计划资产净值的 20%；
  - 6) 本计划参与债券、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；
  - 7) 本集合计划投资于主体评级不低于 AA 的信用债（包括短期融资券、超短期融资券），投资可转债的主体评级不低于 A+；无主体评级的信用债，债项评级不得低于 AA，其中短期融资券债项评级不得低于 A-1；
  - 8) 本集合计划投资于可转债、可交债的资金合计不得超过本计划资产总值的 10%；
  - 9) 本集合计划不得违反《集合资产管理合同》中投资范围的规定；
  - 10) 法律法规、中国证监会以及本合同规定的其他投资限制。
- 如法律法规或监管部门修改或取消上述限制，履行适当程序后，本集合计划可相应调整投资组合限制的规定。

2. 为保证托管人投资监督职责的有效履行，切实保障投资者合法权益，部分

投资监督事项需要管理人配合提供监督所必需的交易材料等信息，并确保所提供的业务材料及时、完整、准确、真实、有效。管理人经托管人催告仍不按约定与托管人对账，导致托管人无法及时履行投资监督职责的，由管理人承担相应的责任。

3. 托管人依照相关法律法规、托管合同约定履行了监督职责，管理人仍违反法律法规规定、托管合同约定的投资禁止行为，而造成托管财产损失的，由管理人承担责任。

4. 托管人对管理人进行本集合计划交易的监督和检查自本合同生效之日起开始。

5. 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数据信息，合规投资的最终责任在管理人。托管人对资产管理人及其他机构信息的准确性和完整性不做任何担保、暗示或表示。托管人对计划财产的投资监督和检查自本合同生效之日起开始执行。托管人在本合同约定范围内，对资产管理计划的直接投资履行监督职能。

6. 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，应当拒绝执行，立即通知资产管理人限期纠正；资产托管人发现资产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限期纠正，超过期限未纠正的，资产托管人有权报告中国证监会相关派出机构和证券投资基金业协会。资产管理人收到通知后应及时核对或纠正，并以书面形式向资产托管人进行解释或举证。

## 二十、集合计划财产的估值和会计核算

### （一）集合计划财产的估值

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

#### 1. 资产总值

集合计划资产总值是指集合计划所投资的各种有价证券、银行存款本息、集合计划各项应收款以及其他资产所形成的价值总和。

## 2. 资产净值

集合计划资产净值是指集合计划资产总值减去集合计划负债后的净资产值。

## 3. 单位净值

集合计划单位净值是指集合计划资产净值除以当日集合计划份额总数计算得到的每集合计划份额的价值。除资产管理合同另有约定外，每份份额具有同等的合法权益。

## 4. 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。

## 5. 估值时间

本计划的估值日（T日）为沪、深交易所的正常营业日及每个自然周、月、年的最后一个自然日，估值核对日（T日）为沪、深交易所的正常营业日。管理人在每个估值日对资产管理计划财产进行估值，于估值核对日由托管人进行复核。

## 6. 估值对象

集合计划项下所有的金融资产及负债。

## 7. 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。除投资管理人在资产购入时特别标注并给托管人正式书面通知及另有规定外，本计划购入的资产均默认按交易性金融资产核算与估值。如国内证券投资会计原则及方法发生变化，由管理人与托管人另行协商确定估值方法，并以签署补充协议的方式确定有关内容。

### 7.1、固定收益品种的估值方法

（1）同一债券同时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。

（2）交易所上市实行净价交易的债券，采用第三方估值机构（中证指数有限公司）提供的估值日当日估值价格确定公允价值，在第三方估值机构（中证指数有限公司）未提供估值价格的情况下，应采用估值技术确认公允价值。

(3) 交易所上市未实行净价交易的债券，采用第三方估值机构（中证指数有限公司）提供的估值日当日估值全价减去债券全价中所含的债券应计利息得到的净价进行估值。

(4) 交易所上市不存在活跃市场的资产支持证券、中小企业私募债、在上交所固定收益平台或者深交所综合协议平台交易的非公开发行公司债券等，采用估值日当日第三方估值机构（中证指数有限公司）提供的估值价格估值。在第三方估值机构（中证指数有限公司）未提供估值价格的情况下，应采用估值技术确认公允价值。

(5) 首次发行未上市债券，采用第三方估值机构（中证指数有限公司）提供的估值日当日估值价格确定公允价值，如第三方估值机构未提供估值价格，在发行利率与二级市场利率不存在明显差异、未上市或流通期间内市场利率没有发生重大变动以及发行人信用情况没有发生重大变动的情况下，可采用发行价格估值。

(6) 全国银行间债券市场交易的债券、非公开债务融资工具，短期融资券、超短期融资券、资产支持证券等固定收益品种，采用估值日当日第三方估值机构（中央国债登记结算公司）提供的估值价格确定公允价值，在第三方估值机构（中央国债登记结算公司）未提供估值价格的情况下，应采用估值技术确认公允价值。

## 7.2、证券投资基金的估值方法

(1) 在交易所交易的基金（包括封闭式基金、上市开放式基金（LOF）等），按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值，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的，可参考监管机构和行业协会估值意见，或者参考类似投资品种的现行市价等变化因素，确定公允价值进行估值。

(2) 未上市流通的其他开放式证券投资基金按估值日公布的上一工作日基金份额净值估值，当日未公布的，以估值当日能获取的最新基金份额净值为准。若有充足证据表明最近可获取的单位净值不能真实反映公允价值的，可采用估值技术确定公允价值。

(3) 持有的交易所上市的交易型货币市场基金，如所投资基金披露份额净值，则按所投资基金估值日的份额净值估值，并按照中国结算提供的数据处理现

金分红或红利再投。非交易所上市的交易型货币市场基金，按所投资基金前一估值日至估值日期间（含节假日）的万份收益计提估值日基金收益。以所投资基金的基金份额净值估值的，若所投资基金与本计划估值频率一致但未公布估值日基金份额净值，按其最近公布的基金份额净值为基础估值。

### 7.3、存款的估值方法

银行存款（活期、定期）及证券资金账户存款按照约定利率在持有期内逐日计提应收利息，在利息到账日以实收利息入账。

7.4、债券逆回购以本金列示，按约定利率逐日确认利息收入。

7.5、债券正回购以成本列示，按约定利率逐日确认利息支出。

7.6、如有确凿证据表明按上述规定不能客观反映集合计划资产公允价值的，管理人可根据具体情况，尽可能使用市场参与者在定价时考虑的所有市场参数，在与托管人商议后，按最能反映集合计划资产公允价值的方法估值。如有新增事项或国家有最新规定的，按国家最新规定估值。

7.7、本计划应当按照新金融工具准则规定进行资产分类及会计核算。

### 8. 估值程序

集合计划资产的日常估值由管理人进行，托管人于每日日终对当日的资产净值进行复核。用于披露的资产净值由管理人完成估值后，将估值结果报送托管人，托管人按照规定的估值方法、时间与程序进行复核，托管人复核无误后返回给管理人，由管理人负责在指定网站上进行披露。报告期末估值复核与集合资产管理计划会计账目的核对同时进行。

### 9. 估值错误与遗漏的处理方式

（1）计划份额资产净值的计算采用四舍五入的方法保留小数点后四位，法律另有规定的从其规定。当计划资产的估值导致计划份额资产净值小数点后四位以内（不含第四位）发生差错时，视为计划份额资产净值错误。

（2）管理人和托管人应采取必要、适当、合理的措施，确保计划资产净值的准确性和及时性。当管理人确认计划份额资产净值发生错误时，管理人立即予以纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大。

（3）因集合计划估值错误给投资者或集合计划资产造成损失的，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。在没有其他

责任人情况下，管理人计算的计划资产净值、计划单位净值已由托管人复核确认后公告的，由此造成的投资者或集合计划资产的损失，应先由管理人承担，后由管理人按照托管人的过错程度向托管人追偿。

(4) 针对净值处理错误，如法律法规或监管机构另有规定的，从其规定办理。如果行业有通行做法，双方当事人应本着平等和保护集合计划持有人利益的原则进行协商确定处理原则。

#### 10. 估值调整的情形与处理

如有确凿证据表明按上述规定不能客观反映集合计划资产公允价值或上述估值方法严重影响集合计划单位净值的，管理人可根据具体情况，在综合考虑市场成交价、市场报价、流动性、收益率曲线等多种因素基础上，在与托管人商议后，按最能反映集合计划资产公允价值的方法估值。

#### 11. 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) 占委托财产相当比例的投资品种的估值出现重大转变，而资产管理人为保障投资者的利益，决定延迟估值并征得资产托管人同意的；

(4) 中国证监会认可的其他情形。

#### 12. 集合计划单位净值的确认

用于集合计划信息披露的计划单位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计划单位净值并发送给托管人。托管人对单位净值计算结果复核确认后发送给管理人。集合计划单位净值由管理人负责对投资者公布。

根据相关法律，集合计划会计责任方由资产管理人担任。因此，就与本集合计划相关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，管理人有权按照其对集合计划资产净值的计算结果对外予以公布，并承

担因此而产生的责任。托管人有权将该情况报相关监管机构备案。

### 13. 特殊情形的处理

由于不可抗力原因，或由于证券交易所、登记结算公司等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，但仍未能发现错误的，由此造成的计划资产估值错误，本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。

## （二）集合计划的会计政策

1. 管理人为本集合计划的会计责任方，会计制度执行国家有关会计制度。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。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《资产管理合同》生效少于2个月，可以并入下一个会计年度。

2. 本集合资产管理计划独立建账、独立核算；管理人应保留完整的会计科目、凭证并进行日常的会计核算，编制会计报表；托管人应定期与管理人就资产管理计划的会计核算、报表编制等进行核对。

## 二十一、集合计划的费用与税收

### （一）集合计划费用的种类

1. 管理人的管理费；
2. 托管人的托管费；
3. 业绩报酬（如有）；
4. 证券交易费用；
5. 证券账户开户费；
6. 相关税费；
7. 银行间费用；
8. 与资产管理计划相关的会计师费、律师费、诉讼费、仲裁费、公证费、评估费、拍卖费、保全费及其他形式的资产处置费等其他费用。

### （二）集合计划费用支付标准、计算方法、支付方式和时间

#### 1. 管理费

本集合计划应给付管理人管理费，管理费按前一日的资产净值的年费率计提。

本集合计划的年管理费率为【0.60】%。计算方法如下：

$$H = E \times 【0.60】\% / 365$$

H 为每日应支付的管理费；

E 为前一日集合计划资产净值。

管理人的管理费每日计提，按自然季支付，托管人根据与管理人核对一致的财务数据，按照本协议约定的管理费计算方式计算并于每自然季度结束之日起第5个交易日自托管账户自动扣划管理费，管理人无需再出具资金划拨指令。如遇托管账户资金余额不足的，需由管理人向托管人出具指令进行划付。费用自动划扣后，管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系托管人协商解决。

管理人指定的接收管理费的银行账户信息：

账户名称（管理人统一收款账户）：华金证券股份有限公司

账 号：216200100100908100

开户行：兴业银行股份有限公司上海分行营业部

行号：309290000107

## 2. 托管费

本集合计划应给付托管人托管费，按前一日的资产净值的年费率计提。本集合计划的年托管费率为【0.02】%。计算方法如下：

$$H = E \times 【0.02】\% / 365$$

H 为每日应支付的托管费；

E 为前一日集合计划资产净值。

托管人的托管费每日计提，按自然季支付，托管人根据与管理人核对一致的财务数据，按照本合同约定的托管费计算方式计算并于每自然季度结束之日起第5个交易日自托管账户自动扣划托管费，管理人无需再出具资金划拨指令。如遇托管账户资金余额不足的，需由管理人向托管人出具指令进行划付。费用自动划扣后，管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系托管人协商解决。

托管人指定的接收托管费的银行账户信息：

账户名称（接收托管费）：证券公司客户资产管理计划托管业务收入

账 号：356980191675000145

开户银行：兴业银行杭州分行营业部



大额支付系统行号：309331006988

### 3. 业绩报酬

#### (1) 计提原则

本集合计划的业绩报酬计提日为收益分配基准日、申请退出日和本集合计划终止日。在收益分配日提取业绩报酬的，业绩报酬从收益分配资金中扣除。在投资者退出和集合计划终止时提取业绩报酬的，业绩报酬从退出资金中扣除。

本集合计划的管理人在业绩报酬计提日按投资者每笔参与本金分别计算年化收益率并提取业绩报酬。管理人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，证券期货经营机构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) 计提方法

业绩报酬计算起始日：此份额上一次提取业绩报酬的日期。若此份额在产品成立后参与且未提取过业绩报酬，则为份额参与日。若此份额在产品成立前参与且未提取过业绩报酬，则为产品成立日。

在本集合计划的业绩报酬计提日，管理人视业绩报酬计算起始日至本次业绩报酬计提日期间的投资收益情况，收取一定的业绩报酬。若集合计划的期间份额年化收益率超过业绩报酬计提基准K，超过K的部分业绩报酬提取比例为【50】%。业绩报酬计提基准以管理人公告为准。

期间份额年化收益率计算公式：

$$R=(A-B)/B' \times 365/T \times 100\%$$

R 为期间份额年化收益率；

A 为业绩报酬计提日的单位累计净值；

B 为业绩报酬计算起始日的单位累计净值；

B' 为业绩报酬计算起始日的单位净值；

T 为业绩报酬计算起始日至本次业绩报酬计提日的间隔天数；

R 的计算在百分号内保留两位小数。

期间业绩报酬计提计算公式：

若  $R \leq K$ ， $Y=0$ ；

若  $R > K$ ，

$$Y = F \times B' \times (R - K) \times T / 365 \times 50\%$$

Y 为业绩报酬计提日的业绩报酬；

F 为业绩报酬计提日投资者单笔投资退出份额（适用退出时计提业绩报酬）或持有份额（适用收益分配和本集合计划终止时计提业绩报酬）；

B' 为业绩报酬计算起始日的单位净值；

K 为业绩报酬计提基准；

T 为业绩报酬计算起始日至本次业绩报酬计提日的间隔天数；

Y 的计算结果保留到小数点后两位，小数点后第三位四舍五入。

因涉及注册登记数据，业绩报酬由管理人计算并复核，托管人仅根据管理人提供数据和划款指令配合进行资金划付。

**管理人特别声明：业绩报酬计提基准不是预期收益和保证收益率。投资者承认，资产管理合同所提及的业绩报酬计提基准仅是管理人计提业绩报酬的标准，不构成管理人、托管人对委托财产收益状况的任何承诺或担保。在某些情况下，投资者仍可能面临投资收益甚至本金受损的风险。**

管理人指定的接收业绩报酬的银行账户信息：

账户名称（接收业绩报酬）：华金证券股份有限公司

账 号：216200100100908100

开户行：兴业银行股份有限公司上海分行营业部

行号：309290000107

管理人可以根据集合计划现金头寸情况调整管理费和托管费的划付时间。

#### 4. 证券账户开户费

证券账户开户费在产品成立后，经管理人与托管人核对无误，按照管理人指令，从委托资产中划出至托管人指定的证券账户开户费用账户；托管人不承担垫付开户费用义务。

#### 5. 相关税费

本集合计划的增值税每日计算，逐日计提，按自然月支付，托管人根据与管理人核对一致的财务数据，按照本合同约定的增值税计算方式计算并于每自然月度结束之日起第 6 个交易日自托管账户自动扣划增值税，管理人无需再出具资金划拨指令。如遇托管账户余额不足的，需由管理人向托管人出具指令进行划付。

费用自动划扣后，管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系托管人协商解决。

支付方式：

账户名称（接收增值税费）：华金证券股份有限公司

账 号：216200100100908100

开户行：兴业银行股份有限公司上海分行营业部

行号：309290000107

#### 6. 证券交易费

本集合计划投资运作期间所发生的交易手续费、印花税等有关税费，作为交易费用在交易过程中直接扣除。本计划向所租用交易单元的券商支付佣金（该佣金已扣除风险金），其费率由管理人根据有关政策法规确定。在每自然季度首日起 10 个交易日内支付给提供交易单元的券商。

#### 7. 银行间费用

本集合计划的银行间费用（包括中央国债登记结算有限责任公司、上海清算所）按自然季支付，托管人根据中央国债登记结算有限责任公司、上海清算所提供的相关缴费数据于每自然季度结束之日起第 10 个工作日自托管账户自动扣划费用，管理人无需再出具资金划拨指令。如遇托管账户资金余额不足的，需由管理人向托管人出具指令进行划付。费用自动划扣后，管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系托管人协商解决。管理人会跟进费用支付的进程，发现迟付或漏付的情况时，及时通知托管人处理。

#### 8. 其他费用

集合计划成立后的其他费用，包括但不限于本计划成立后的中债数据服务费、信息披露费用、会计师费和为保护和实现集合计划资产权利及解决因处理集合计划资产事务产生的纠纷而发生的费用（包括但不限于诉讼费、仲裁费、律师费、公证费、评估费、拍卖费、保全费、执行费及其他形式的资产处置费）以及按照国家有关规定可以列入的其他费用，由管理人本着保护投资者利益的原则，按照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定。并由托管人根据法律法规及相应协议的规定，按费用实际支出金额支出，列入当期集合计划费用。

#### （三）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，不在计划资产中列支。

管理人和托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出，以及处理与本集合计划运作无关的事项或不合理事项所发生的费用等不列入本集合计划费用。

其他不列入集合计划费用的具体项目依据中国证监会有关规定执行。

#### (四) 税收

本合同各方当事人应根据国家法律法规规定，履行纳税义务。投资者缴纳必须由其自行缴纳的税费，管理人不承担代扣代缴或纳税的义务。

依据相关法律法规或税务机关的规定，本计划投资及运营过程中发生增值税等应税行为，以管理人为纳税人或由管理人代扣代缴的，除本计划已列明的资产管理业务费用（如管理费、托管费、业绩报酬（如有）等）由各收费方自行缴纳外，管理人有权以计划资产予以缴纳或代扣代缴，且无需事先征得投资者的同意。

管理人在向投资者交付相关收益或资产后税务机关要求管理人就已交付收益或资产缴纳相关税费的，投资者必须按照管理人要求进行补缴（具体以管理人通知为准），管理人亦有权以计划剩余资产直接扣缴。

投资者不得要求管理人以任何方式向其返还或补偿管理人以计划资产缴纳或代扣代缴、投资者按照管理人要求补缴的税费。

如管理人因此垫付相应税费等款项的，管理人有权向投资者就垫付的税费进行追偿，投资者应按管理人通知向管理人指定账户返还垫付款项。

投资者已知悉并同意，计划资产承担上述税费可能导致资产变现损失或投资收益减损。

## 二十二、集合计划的收益分配

本集合计划收益分配方案依据现行法律法规以及合同约定执行。

### （一）收益的构成

本集合计划收益指集合计划利息收入、投资收益和其他收入扣除相关费用后的余额，集合计划已实现收益指集合计划利润减去公允价值变动收益后的余额。

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。

本集合计划可供分配利润为截至收益分配基准日资产管理计划未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

## （二）收益分配原则

1. 本集合计划每一份额享有同等分配权利。

2. 当期收益先弥补上一年度亏损后，方可进行当年收益分配；

3. 本集合计划收益分配后的计划单位净值不得低于计划单位面值，即收益分配基准日的计划单位净值减去每份集合计划收益分配金额后不能低于计划单位面值。

4. 本集合计划发生现金收益分配、本金归还等现金支付时，银行收取的与此有关的任何费用均由投资者承担。

5. 本集合计划进行收益分配、本金归还时所涉及的相关税负由投资者自行承担，管理人、托管人均不承担代扣代缴等纳税义务。

6. 若本集合计划在存续期间不进行收益分配，则本集合计划也可在终止清算后将货币资金分派给投资者，由此产生的相关的税负由投资者自行承担，管理人、托管人均不承担代扣代缴等纳税义务。

7. 法律、法规或监管机构另有规定的从其规定。

## （三）收益分配方案的确定与通知

1. 收益分配的时间与方案由管理人根据本集合计划收益情况拟定，经由托管人复核后确定，并在方案确定后的【10】个交易日内在管理人指定网站上披露。

2. 收益分配方案须载明集合计划收益范围、可供分配利润、分配对象、分配原则、收益分配基准日、收益分配权益登记日、除权日、红利下发日、分配时间、分配数额及比例、分配方式及有关手续费等内容。

## （四）收益分配执行方式

本集合计划的收益分配方式包括现金分红和红利转份额两种方式。投资者选择现金分红的，现金红利在收益分配权益登记日后【5】个交易日内返还至投资者的指定账户；投资者选择红利转份额的，现金红利按除权日的计划单位净值自动划转为计划份额进行再投资。若投资者不选择，本计划默认的收益分配方式是现金分红。

## 二十三、信息披露与报告

### （一）信息披露方式

本集合计划的信息披露将严格按照《管理办法》、本合同及其他有关规定进行。本集合计划的计划单位净值、计划累计单位净值等信息将在管理人指定网站上披露，投资者可随时查阅。若管理人指定网站变更，管理人将提前进行相关信息的详细披露。

### （二）信息披露的种类、内容、频率

#### 1. 定期报告

定期报告包括集合计划单位净值报告、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）集合计划单位净值报告

本集合计划开放期内每个开放日在管理人网站上公布前一个交易日集合计划单位净值，封闭期内管理人至少每周在其网站上公布一次集合计划单位净值。

##### （2）集合计划的资产管理季度报告

管理人在每季度向投资者提供一次准确、完整的管理季度报告，对报告期内集合计划资产的配置状况、价值变动情况、重大关联交易做出说明。

本集合计划资产管理季度报告将披露管理人履职报告、托管人履职报告、资产管理计划投资表现、资产管理计划投资组合报告、资产管理计划资产负债情况、资产管理计划运用杠杆情况（如有）、资产管理计划支付的费用、资产管理计划投资收益分配情况、资产管理计划投资收益分配情况、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以及中国证监会及基金业协会规定的其他事项。

季度报告应于每季度截止日后 1 个月内通过管理人网站公告，并按照监管要求报备。本计划成立不足三个月或者存续期间不足三个月的，可以不编制资产管理计划当期的季度报告。

管理人应当在每季度结束后 15 日内向托管人提供其编制的季度管理报告、当期财务会计报告（如有）供托管人复核，托管人复核管理人季度报告、当期财务会计报告（如有）中的财务数据后，于 5 个工作日内向管理人提供季度托管人

履职报告。

### (3) 集合计划的资产管理年度报告

管理人在每年度向投资者提供一次准确、完整的管理年度报告，对报告期内集合计划资产的配置状况、价值变动情况、重大关联交易做出说明。

本集合计划年度报告应包括但不限于管理人履职报告、托管人履职报告、资产管理计划投资表现、资产管理计划投资组合报告、资产管理计划运用杠杆情况（如有）、资产管理计划财务会计报告、资产管理计划支付的费用、资产管理计划投资收益分配情况、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以及中国证监会及基金业协会规定的其他事项。

年度报告应于每个会计年度截止日后 4 个月内通过管理人网站公告，并按照监管要求报备。本计划成立不足三个月或者存续期间不足三个月的，可以不编制资产管理计划当期的年度报告。

托管人履职报告作为管理人季度报告、年度报告内容的一部分，由托管人完成管理人季度报告、年度报告的复核工作后，确定托管人履职报告内容并向管理人反馈，由管理人根据本合同约定的方式向投资者披露。

### (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运营情况进行年度审计，将在资产管理计划年度报告中向投资者披露。

## 2. 临时报告

集合计划存续期间，发生对集合计划持续运营、客户利益、资产净值产生重大影响的事件，管理人应当以管理人指定网站、销售机构网站或网点、或其他途径和方式，在事项发生之日起五日内向客户披露。临时报告的情形包括但不限于：

(1) 集合计划运作过程中，负责集合资产管理业务的投资经理发生变更，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) 集合计划终止和清算；

(4) 集合计划存续期满并展期；

(5) 合同的补充、修改与变更；

- (6) 与集合计划有关的重大诉讼、仲裁事项；
- (7) 本集合计划的销售机构发生变更；
- (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) 集合计划分红或发生业绩报酬计提（如有）；
- (11) 资产计价出现错误（当资产估值导致本集合计划单位净值小数点后四位以内（不含第四位）发生差错时，视为本集合计划单位净值错误）；
- (12) 管理费、托管费等费用计提方式或费率发生变更；
- (13) 其他对集合计划持续运营、客户利益、资产净值产生重大影响的事件；
- (14) 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，管理人应向投资者披露；
- (15) 管理人认为重大的其他事项。

### （三）信息披露文件的存放与查阅

本资产管理计划合同和说明书存放在各募集场所，投资者可在营业时间免费查阅。投资者还可以登录管理人的网站或拨打咨询电话进行查询。对投资者按上述方式所获得的文件及其复印件，管理人保证与所报告的内容完全一致。集合资产管理定期报告、托管定期报告及其他临时公告等信息披露文件公布于管理人网站，供投资者查阅。

### （四）管理人、托管人向监管机构报告的种类、内容、时间和途径

本合同已列明管理人、托管人向监管机构报告的种类、内容、时间和途径等有关事项，具体事宜详见本合同相关章节。除本合同约定事项外，如监管机构对管理人、托管人向监管机构报告的种类、内容、时间和途径等另有规定的，从其规定。

### （五）托管人履职报告（以下称“托管报告”）

（1）托管人履职报告作为管理人季度报告、年度报告内容的一部分，由托管人完成管理人季度报告、年度报告的复核工作后，确定托管人履职报告内容并向管理人反馈，同时在管理人、托管人协商一致的季度报告、年度报告上盖



章确认，由管理人根据本合同约定的方式向投资者披露。托管人履职报告内容包括托管人履职情况、对管理人投资运作的监督情况及有关报告财务数据的复核意见等。

(2)管理人应当在每季度结束后 20 日内向托管人提供其编制的季度报告、当期财务会计报告（如有）供托管人复核，托管人复核管理人季度报告、当期财务会计报告中的财务数据后，于 10 日内向管理人反馈复核意见。

(3)管理人应当在每年度结束后两个月内向托管人提供其编制的年度报告、当期财务会计报告供托管人复核，托管人复核管理人年度报告、当期财务会计报告中的财务数据后，于一个月内向管理人反馈复核意见。

(4)因资产管理计划成立不足三个月或者存续期间不足三个月，管理人未编制资产管理计划当期的季度报告和年度报告的，托管人不编制当期托管人履职报告。

## 二十四、风险揭示

管理人在资产管理、运用或处分财产过程中，本集合计划面临包括但不限于以下风险：

### （一）一般风险揭示

#### 1、本金损失风险

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

本集合计划属于 R2(中低风险) 固定收益类资产管理产品，适合合格投资者中的 C2 级及其以上的普通投资者及专业投资者。

#### 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：

##### （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，使集合计划的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

固定收益品种获得的本息收入或者回购到期的资金，可能由于市场利率的下降面临资金再投资的收益率低于原来收益率，从而对本计划产生再投资风险。

## 3、管理风险

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集合计划财产所产生的风险，由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

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、通过第三方基金销售机构投资开放式基金的风险

本资产管理计划可通过第三方基金销售机构投资开放式基金，资产管理人负责选择销售机构，并确保在销售机构预留的备案回款账户为银行托管账户。资产托管人对于通过第三方基金销售机构投资开放式基金不承担任何风险。

由于通过第三方销售平台购买，可能会存在认（申）购、赎回（现金分红）

基金时资金被挪用的风险；第三方销售平台对基金账户管理不当造成投资人持有基金份额不准确的风险；认（申）购款未能用于购买指定基金的风险；以及第三方基金销售平台无基金销售资质的风险。

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

#### 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、其他风险

包括但不限于关联交易风险、技术风险和操作风险、发生不可抗力事件的风险等。

##### （1）关联交易风险

投资者同意并授权管理人可以将集合计划的资产投资于管理人、托管人及与管理人或托管人有关联方关系的公司发行的证券或承销期内承销的证券，或从事其他重大关联交易，存在关联交易风险。投资者不得基于任何原因，对于本将集合计划的资产投资于管理人、托管人及与管理人或托管人有关联方关系的公司发行的证券或承销期内承销的证券，或从事其他重大关联交易而造成的损失、收益未达预期或其他责任，向管理人主张任何权利。

##### （2）技术风险

在集合计划的日常交易中，可能因为技术系统的故障或者差错而影响交易的正常进行或者导致投资者的利益受到影响。这种技术风险可能来自管理人、估值服务机构、托管人、证券交易所、证券登记结算机构等。

##### （3）操作风险

管理人、估值服务机构、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。

(4) 上市公司经营风险

上市公司的经营状况受多种因素影响，如市场、技术、竞争、管理、财务因素等都会导致公司盈利发生变化，从而导致集合计划投资收益变化。

(5) 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。

(6) 合同变更风险

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

(7) 使用电子签名合同的风险

本集合计划资产管理合同采用电子签名方式签署，可能存在因网络中断或不运作、传送安全系统失灵、系统遭受非法攻击等各种因素造成数据的损失或丢失。

(8) 强制退出风险

若本集合计划投资者的某笔退出导致该投资者在注册登记机构处持有的份额净值低于【30】万，则管理人对该余额部分作强制退出处理。强制退出会导致投资者的计划份额减少至零。

(二) 特殊风险揭示

1、资产管理合同与基金业协会合同指引不一致所涉风险

基金业协会针对集合资产管理计划资产管理合同的内容及格式发布了合同指引。

本资产管理合同虽然已在能够满足本计划投资需要的前提下涵盖了合同指引明确要求的条款，但合同指引主要为概括性、原则性约定，因此本资产管理合同具体条款的约定不可避免的比合同指引更为复杂、更为具体，也不可避免地与合同指引不完全相同。

投资人应当认真阅读本资产管理合同，理解本资产管理合同的全部条款，独立做出是否签署本资产管理合同的决定。

2、资产管理计划外包事项所涉风险

本集合计划不涉及外包事项。

### 3、资产管理计划委托募集所涉风险

根据相关法律法规及自律监管规则规定，资产管理人可以委托具有基金销售资格的代理销售机构募集本资产管理计划财产。

虽然资产管理人能够确认在委托募集时该等代理销售机构具有基金销售资格，但无法保证其持续满足该等业务资格要求，且无法保证其将按照相关法律法规及自律监管规则的规定进行募集活动。若届时因代理销售机构不符合资质要求、或不具备提供相关服务的条件和技能、或因管理不善、操作失误等，可能给投资者带来一定的风险。而且，如果代理销售机构未按照相关法律法规及自律监管规则的规定进行募集活动，亦将直接影响投资者对本计划风险收益的判断，从而对本计划投资者的利益产生不利影响。

### 4、资产管理计划份额转让所涉风险

本合同依据相关法律法规约定，在集合计划存续期间，投资者可以通过证券交易所或柜台交易市场等中国证监会认可的交易平台转让集合计划份额，管理人有权决定是否开放计划份额的转让业务。在办理转让业务时可能出现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某些人为或客观原因出现故障，从而影响转让业务办理。

#### (2) 折溢价风险

在份额可以办理转让后，份额的交易价格与其计划份额单位净值之间可能发生偏离并出现折/溢价交易的风险。

对于投资者通过证券交易所办理转让业务时可能出现的风险包括但不限于：

(3) 证券交易所为资产管理计划份额转让提供服务，不代表对资产管理计划的投资风险或收益做出判断或保证。管理人在资产管理合同和说明书中对资产管理计划存在的风险已作揭示，投资者在参与资产管理计划份额转让业务前，应认真阅读资产管理合同和说明书，了解产品特性，关注产品风险。

(4) 资产管理计划份额在证券交易所进行转让，并非集中竞价交易，可能不具有一个活跃的转让市场。证券交易所可以根据需要暂停或终止转让服务。

(5) 资产管理计划份额在证券交易所进行转让实行非担保交收。申报转让

(受让)资产管理计划份额时,证券交易所对资产管理计划份额(资金)余额事先不实行检查、控制,相关份额登记结算机构也不实行担保交收,转让合同履行风险由转让方、受让方及管理人自行控制。

本风险揭示的揭示事项仅为列举性质,并未穷尽通过证券交易所办理资产管理计划份额转让业务所有风险因素。投资者参与资产管理计划份额转让业务前,对其他可能产生投资风险的相关因素也应详细了解、认真评估,避免因贸然从事此业务而遭受损失。

#### 5、资产管理计划设置份额持有人大会所涉风险

本集合计划不设份额持有人大会。投资者可能面临无法通过份额持有人大会或日常机构进行本集合计划运作期间相关事宜商讨和投票表决的风险。

#### 6、资产管理计划未在证券投资基金业协会完成备案手续或不予备案情形所涉风险

本计划成立后需在基金业协会进行备案。除非以现金管理为目的投资于银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券、货币市场基金等中国证监会认可的投资品种外,资产管理计划在完成基金业协会备案前不得开展投资活动。

因此,即使本计划成立,并不意味着本计划必然能获得基金业协会的备案。而该等备案过程可能会受到相应监管政策的影响,包括备案时间所需时间、能否通过备案都存在一定的不确定性。

如果在计划成立后不能及时完成备案,将可能导致本计划错过市场行情或投资机会;本计划如在中国证券投资基金业协会备案未通过,则需要按照监管机构的要求修改本合同或提前终止本计划,本计划在上述情形下存在需要修改合同或提前终止的风险。如备案未通过,管理人有权提前终止本计划,管理人退还投资者的资金总额为投资者投资本金加上期间活期存款利息。由此直接影响投资者参与本计划的投资目的,请投资者注意。

#### 7、无法提前退出的风险

本集合计划每笔参与份额持有期限满9个月后可在每月的15日开放退出(如遇非交易日顺延)。若持有期限未满9个月,投资者不得退出本集合计划,投资者面临无法提前退出的风险。

#### 8、集合计划份额延期的风险

当集合计划的管理期限届满时，如集合计划所投资的资产支持证券、资产支持票据等未全部变现，该期集合计划可能面临自动延期至投资标的全部变现之日，相应投资者可能面临份额延期的风险。

#### 9、业绩报酬计提基准调整的风险

管理人有权根据市场情况及集合计划运作情况，在每个退出开放期开始前对下一个封闭期的业绩报酬计提基准进行调整，投资者可能面临业绩报酬计提基准调整的风险。

本合同约定的业绩报酬计提基准仅作为管理人计提业绩报酬的标准，不作为管理人对委托资产未来收益的预测，亦不构成管理人保证委托资产本金不受损失或取得最低收益的承诺。

#### 10、投资国债、地方政府债、中央银行票据等利率债券的风险

A、利率风险。利率风险是指利率的变动导致债券价格与收益率发生变动的风险。债券是一种法定的契约，大多数债券的票面利率是固定不变的（浮动利率债券与保值债券例外），当市场利率上升时，债券价格下跌，使债券持有者的资本遭受损失。因此，投资者购买的债券离到期日越长，则利率变动的可能性越大，其利率风险也相对越大。

B、收回风险。一些债券在发行时规定了发行者可提前收回债券的条款，这就有可能发生债券在一个不利于债权人的时刻被债务人收回的风险。当市场利率一旦低于债券利率时，收回债券对发行公司有利，这种状况使债券持有人面临着不对称风险，即在债券价格下降时承担了利率升高的所有负担，但在利率降低，债券价格升高时却没能收到价格升高的好处。

C、突发事件风险。这是由于突发事件使发行债券的机构还本付息的能力发生了重大的事先没有料到的风险。这些突发事件包括突发的自然灾害和意外的事故等，例如，一场重大的事故会极大地损害有关公司还本付息的能力。

D、税收风险。表现为两种形式：一是投资免税的政府债券的投资者面临着权入税率下调的风险，税率越高，免税的价值就越大，如果税率下调，免税的实际价值就会相应减少，债券的价格就会下降；二是投资于免税债券的投资者面临着所购买的债券被有关税收征管当局取消免税优惠的风险。

E、政策风险。是指由于政策变化导致债券价格发生波动而产生的风险。

11、投资于金融债、企业债、公司债、短期融资券、超短期融资券、次级债（包括二级资本债）、资产支持证券优先级的风险

A、利率风险。利率风险是指利率的变动导致债券价格与收益率发生变动的风险。债券是一种法定的契约，大多数债券的票面利率是固定不变的（浮动利率债券与保值债券例外），当市场利率上升时，债券价格下跌，使债券持有者的资本遭受损失。因此，投资者购买的债券离到期日越长，则利率变动的可能性越大，其利率风险也相对越大。

B、收回风险。一些债券在发行时规定了发行者可提前收回债券的条款，这就有可能发生债券在一个不利于债权人的时刻被债务人收回的风险。当市场利率一旦低于债券利率时，收回债券对发行公司有利，这种状况使债券持有人面临着不对称风险，即在债券价格下降时承担了利率升高的所有负担，但在利率降低，债券价格升高时却没能收到价格升高的好处。

C、信用风险。资产管理计划投资的债券存在着发行人不能按时足额还本付息的风险；当发行人信用评级降低时，资管计划所投资的债券可能面临价格下跌风险。

D、税收风险。表现为两种形式：一是投资免税的政府债券的投资者面临着权入税率下调的风险，税率越高，免税的价值就越大，如果税率下调，免税的实际价值就会相应减少，债券的价格就会下降；二是投资于免税债券的投资者面临着所购买的债券被有关税收征管当局取消免税优惠的风险。

E、政策风险。是指由于政策变化导致债券价格发生波动而产生的风险。

12、可交债和可转债的投资风险

可交债和可转债为含权债券，其市场风险不仅来自于市场利率变化，其转股期权价值也随标的股票价格波动而波动，从而导致可交债和可转债的二级市场价格等变现价值有出现较大的波动的可能性，且此等波动将远大于一般公司债券的波动，在债券发行时无法预测，由此可能导致投资出现损失。

13、投资现金、银行存款、同业存单、债券回购、货币市场基金等标准资产等的风险。

A、法律与政策风险



因国家政策及相关法律、法规的调整与变化，导致投资无法按时收回或无法按时足额收回的风险。

#### B、信用风险

因融资人未按同业存款合同的约定履行还款义务而导致的风险。

#### C、市场风险

因宏观政策、经济周期、市场价格等因素的变化，导致投资无法按时收回或无法按时足额收回的风险。

#### D、操作风险

在同业存款的发放与管理过程中，非因管理人原因（不可抗力除外）产生的不完善或有问题的程序和不适当的管理措施，导致投资无法按时收回或无法按时足额收回的风险。

#### E、承担相关法律费用的风险

根据同业存款合同约定采取诉讼或仲裁等相应措施收回本息时，如需委托他人代为诉讼或仲裁，投资者可能将承担相应实现存单收益的费用，包括但不限于诉讼（仲裁）费、律师费、差旅费、执行费、保全费及其他实现存单收益的必要费用，从而带来风险。

#### 14、参与证券回购的风险

证券回购是一方以一定规模证券向另一方作抵押融入资金，并承诺在日后再从另一方购回所抵押证券的交易行为。抵押证券所获得的资金可以再行投资或抵押，相当于放大原始资金的倍数，具有一定投资风险。

#### 15、参与场外证券交易的风险

债券交易分为交易所市场和场外交易市场，且以场外交易市场为主。本产品拟投资的部分固定收益类资产如银行间发行债券、非公开发行债券以及资产支持证券等主要通过场外证券交易完成。相较场内证券交易而言，场外市场参与主体分散，没有固定的交易场所，交易价格通过买卖双方议价过程确定。

#### 16、参与场外证券交易的风险

债券交易分为交易所市场和场外交易市场，且以场外交易市场为主。本产品拟投资的部分固定收益类资产如银行间发行债券、非公开发行债券以及资产支持证券等主要通过场外证券交易完成。相较场内证券交易而言，场外市场参与主体

分散，没有固定的交易场所，交易价格通过买卖双方议价过程确定。

#### 17、资产管理计划止损平仓风险

当本计划单位净值触及或低于平仓线时，即使管理人作出相应措施，投资者最终分配的清算金额仍可能存在低于平仓线净值的风险。如发生极端情况，管理人无法按预先设定的平仓线完成平仓操作，可能导致投资者承受较大的损失。

## 二十五、集合计划的变更、终止与财产清算

### （一）集合计划的变更

除本合同另有约定外，本合同生效后，因法律、法规、规章、中国证监会、证券投资基金业协会的相关规定、证券登记结算机构业务规则以及证券交易所等交易规则变化或修订，自该变化或修订生效之日起，本合同相关内容及条款按该变化或修订进行变更并在管理人网站公告。投资者特此授权管理人经与托管人协商，可以对本集合计划合同及说明书与新的法律法规或有关政策不一致的内容进行更新或修改，更新或修改的内容不得违反国家法律法规和中国证监会的有关规定，更新或修改的内容在管理人网站公告满 5 个工作日后生效。

由于其他原因（包括但不限于改变投向和比例）需要变更合同的，管理人和托管人应书面达成一致，并通过在管理人网站公告的形式向投资者征求意见（本合同另有约定的除外）。

投资者不同意变更的，管理人保障其退出集合计划的权利，管理人可在临时开放期为投资者办理退出集合计划的业务；对于明确答复不同意合同变更但逾期未退出本集合计划的投资者，管理人有权在公告中说明的回复期限届满后，将其份额强制退出集合计划，由此发生的相关税费或或有损失由投资者自行承担。投资者未在管理人指定期限内回复意见的，视为投资者同意。

合同变更生效日以管理人公告为准。集合计划份额的退出价格为退出当日集合计划单位净值。

投资者同意，无论其是否提出退出申请，管理人变更本合同的行为均不应被视为或认定为管理人的违约行为。

自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。管理人应当自资产管理合同变更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。

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、宣告破产时，资产管理计划由其他管理人承接，承接后合同当事人权利义务不变，仍按照本合同履行各自权利义务。管理人将在上述事项发生之日起五日内通过管理人网站向投资者披露。

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，承接后合同当事人权利义务不变，仍按照本合同履行各自权利义务。管理人将在上述事项发生之日起五日内通过管理人网站向投资者披露。

## （二）集合计划的展期

### 1. 展期的条件

（1）本集合计划运营规范，管理人、托管人未违反法律、行政法规、中国证监会规定和本合同的约定；

（2）展期没有损害投资者利益的情形；

（3）中国证监会规定的其他条件。

集合计划展期的，应当符合集合计划的成立条件。

### 2. 展期的安排

（1）通知展期的时间

在集合计划到期前【3】个月内。

（2）通知展期的方式

管理人将通过管理人指定网站通知投资者。

（3）投资者回复的方式

投资者应当按照公告要求或管理人约定的其他方式明确回复意见。

### 3. 投资者不同意展期的处理办法

若投资者明确回复不同意展期，投资者有权在存续期届满日前（含届满日）到销售机构办理退出手续（管理人可以在公告中约定退出开放日，为投资者办理退出手续）；若投资者未在存续期届满日前（含届满日）到销售机构办理退出手续，则管理人有权决定强制将其份额退出或视为投资者同意管理人的展期安排。

若投资者未回复意见或回复意见不明确的，视为同意展期，管理人不再另行通知确认。

#### 4. 展期的实现

如果同意本集合计划展期的投资者人数不少于2人且符合其他展期条件的，则集合计划存续期将依法展期；

如果同意本集合计划展期的投资者人数低于2人或不符合其他展期条件的，则集合计划到期终止，将按照本合同等相关法律文件的规定办理计划到期终止和清算事宜。

集合计划展期成立后5个工作日内，管理人应当将展期情况报中国证券投资基金业协会备案，并同时抄送管理人住所地中国证监会派出机构。

#### （三）集合计划的终止

有下列情形之一的，集合计划应当终止：

1. 资产管理计划存续期届满且不展期；
2. 经全体投资者、管理人和托管人协商一致决定终止的；
3. 管理人被依法撤销资产管理业务资格或者依法解散、被撤销、宣告破产，且在六个月内没有新的管理人承接；
4. 托管人被依法撤销基金托管资格或者依法解散、被撤销、宣告破产，且在六个月内没有新的托管人承接；
5. 持续五个工作日投资者少于2人的；
6. 未在证券投资基金业协会完成备案或不予备案的情形；
7. 法律、行政法规、中国证监会规定及资产管理合同约定的其他情形。

管理人应当自集合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7项约定的情形除外。

#### （四）集合计划的清算

1. 自集合计划终止之日起5个交易日内，管理人可以组织成立集合计划清算小组按照监管机构的相关规定开始清算计划资产。集合计划财产清算小组成员由管理人和托管人组成，清算小组可以聘用必要的工作人员；

2. 集合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。集合计划财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。

3. 清算过程中的有关重大事项应当及时公布；

4. 清算后的剩余财产，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占总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，中国证监会另有规定的除外。对于由计划交纳、中国登记结算有限公司收取的最低结算备付金和交易席位保证金，在中国登记结算有限公司对其进行调整交收日才能收回，结算备付金及交易保证金账户利息于实际结息时才能收回，届时，管理人将及时按照集合资产管理合同的约定，以货币资金的形式全部分配给投资者，并注销集合计划专用证券账户和资金账户。托管人按照规定注销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。清算结束后确认的费用均由管理人承担，清算结束后产生的利息归管理人所有；

5. 清算结束后5个交易日内由管理人在管理人网站公布清算结果并向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；

6. 若本集合计划在终止之日有未能流通变现的证券或出现其他因委托财产流动性受限等原因延期清算的，管理人应当及时向中国证监会相关派出机构和基金业协会报告。管理人可对此制定二次清算方案，该方案应经托管人认可，并通过管理人网站进行披露。管理人应根据二次清算方案的规定，对前述未能流通变现的证券在可流通变现后进行二次清算，并将变现后的资产按照投资者拥有份额的比例或本合同的约定或其他合理方式，以货币形式全部分配给投资者。

7. 如本计划终止时有未能流通变现的证券，资产管理人与资产托管人继续按规定计提管理费、托管费等费用，其估值方法继续按《资产管理合同》的规定计算。清算小组在该证券可流通变现时应及时变现，在支付相关费用后按资产管理计划的投资者持有的计划份额比例进行再次分配并履行相应的告知义务，直至所有未能流通变现的证券全部清算完毕；

8. 投资者自行承担收益的缴税事项；

9. 集合计划财产清算账册及文件由管理人保存20年以上；

10. 集合计划的清算安排应当符合相关法律、法规、政策的规定。

## 二十六、违约责任

### （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，应当按照各自过错程度承担相应赔偿责任。但是发生下列情况的，当事人可以免责：

#### （1）不可抗力

指当事人不能预见、不能避免、不能克服的客观情况，包括但不限于洪水、地震及其他自然灾害、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、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（如临时停市）等，非因管理人、托管人自身原因导致的技术系统异常事故、政策法规的修改或监管要求调整等情形。

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）管理人和/或托管人按照当时有效的法律法规或中国证监会的规定作为或不作为而造成的损失等；

（3）在没有欺诈、故意或重大过失的情况下，管理人由于按照合同规定的投资原则行使或不行使其投资权而造成的损失等；

（4）在没有过错或重大过失的情况下，托管人执行管理人的生效指令对集合计划资产造成的损失；

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

（6）相关法律、行政法规和规定的变更。

2. 通过第三方销售平台购买开放式基金，资产托管人需根据划款指令将认（申）购资金划入第三方销售平台设立的收款账户，如第三方销售平台未将认（申）

购资金及时或全额划付至基金管理公司销售账户、未用于购买资产管理人指定投资的基金，由此产生的全部责任及损失由过错方承担。

3. 通过第三方销售平台提交基金赎回（现金分红）回款银行账户信息，如第三方销售平台擅自变更回款银行账户信息，导致赎回（分红）资金未能及时全额划付至托管账户，由此产生的全部责任及损失由过错方承担。

4. 通过第三方销售平台购买开放式基金，存在第三方销售平台对基金账户管理不当造成投资人持有基金份额不准确的风险。同时，实际认（申）购成功的基金份额受限于第三方销售平台提供的数据，资产管理人与资产托管人对委托财产进行估值时无法保证准确性，由此产生的全部责任及损失由过错方承担。

5. 如认（申）购基金的委托财产未能用于购买指定基金，可能出现委托财产投向违反有关法律法规和本合同约定的投资范围及投资限制的情形。因资产托管人投资监督的准确性及完整性受限于资产管理人及第三方销售平台提供的数据，由此产生的全部责任及损失由过错方承担。

6. 通过第三方销售平台购买开放式基金，资产托管人仅根据资产管理人指令将资金从托管户划往该第三方销售平台账户。

7. 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。

8. 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。

9. 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，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。

10. 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。

11. 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。

12. 投资者的债权人通过司法机关对集合计划资产采取强制措施，由此造成

集合计划资产损失的，管理人和托管人不承担任何责任。

## 二十七、争议的处理

本合同受中国（在此不包括香港、澳门特别行政区及台湾地区）法律管辖。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，任何一方均有权向管理人所在地人民法院提起诉讼。争议处理期间，合同当事人应恪守各自的职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行本资产管理合同规定的义务，维护投资者的合法权益。

## 二十八、集合计划合同的效力

本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，自该合同生效之日起对投资者、管理人和托管人具有同等的法律约束力。

### （一）合同的成立与生效

本合同经管理人、托管人的法定代表人/负责人或授权代理人签字（或盖章）并加盖公章（或合同专用章）和投资者的法定代表人或授权代理人签字（或盖章）并加盖公章（投资者为自然人的，应由投资者本人签字）后成立。如采用电子方式签署合同的，应该满足相关电子合同签约成立的条件。

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确认；
2. 本集合计划成立。

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。

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

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。

### （二）合同的组成

本集合计划说明书是管理人对于本集合计划重要事项的说明，是本合同的重



要附件，与本合同具有同等的法律效力。

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或数据电文和销售机构出具的集合计划参与、退出业务受理有关凭证等为本合同的附件，是本合同不可分割的一部分，与合同具有同等法律效力。

## 二十九、其他事项

### （一）管理人/托管人的变更

投资者在此同意，在管理人、托管人与受让人协商一致的基础上，若发生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；或（及）托管人被依法撤销基金托管资格或者依法解散、被撤销、被宣告破产或法规规定的变更管理人或托管人事件，管理人、托管人有权将本合同中由管理人、托管人享有的权利和由管理人、托管人承担的义务转让给具备从事资产管理业务、托管业务的公司，并且需按照监管机构的相关规定履行相应的变更及转让程序。

如果上述变更事件发生，在六个月内没有受让人承接的，本集合计划应当终止。

### （二）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协议。但在转让前管理人应以信息披露的形式公告投资者。管理人保障投资者退出本集合计划的权利，并在届时的公告中对相关事项做出合理安排。

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。

*（以下无正文）*

(本页为签署页, 无正文)

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。

本合同应由投资者本人签署, 当投资者为机构时, 应由法定代表人或其授权代表签署并加盖其公章。

本合同一式肆份, 管理人、投资者各执壹份、托管人执俩份, 每份具有同等法律效力。

投资者: (签字/公章)

签署日期: 年 月 日

(注: 自然人客户, 请签字; 机构客户, 请由法定代表人或其授权代理人签字并加盖机构公章)

管理人(盖章): 华金证券股份有限公司(公章/合同专用章)

法定代表人(或授权代理人)签字或盖章:

签署日期: 2022年 11月 16日



托管人(盖章): 兴业银行股份有限公司(公章/合同专用章)

负责人(或授权代理人)签字或盖章:

签署日期: 2022年 11月 17日



签署地点:

## 附件一 华金证券久久盈集合资产管理计划风险揭示书

尊敬的投资者：

投资有风险。当您/贵机构参与资产管理计划时，可能获得投资收益，但同时也面临着投资亏损的风险。您/贵机构在作出投资决策之前，请仔细阅读本风险揭示书和资产管理合同，充分认识本计划的风险收益特征和产品特性，认真考虑资产管理计划存在的各项风险因素，并充分考虑自身的风险承受能力，理性判断并谨慎作出投资决策。

根据有关法律法规，管理人华金证券股份有限公司及投资者分别作出如下承诺、风险揭示及声明：

### 一、管理人声明与承诺

（一）管理人向投资者声明，中国证券投资基金业协会（以下简称“证券投资基金业协会”）为资产管理计划办理备案不构成对管理人投资能力、持续合规情况的认可；不作为对资产管理计划财产安全的保证。

（二）管理人保证在投资者签署资产管理合同前已（或已委托销售机构）向投资者揭示了相关风险；已经了解投资者的风险偏好、风险认知能力和承受能力。

（三）管理人承诺按照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理运用资产管理计划财产，不保证资产管理计划财产一定盈利，也不保证最低收益。

### 二、风险揭示

#### （一）特殊风险揭示

##### 1、资产管理合同与基金业协会合同指引不一致所涉风险

基金业协会针对集合资产管理计划资产管理合同的内容及格式发布了合同指引。

本资产管理合同虽然已在能够满足本计划投资需要的前提下涵盖了合同指引明确要求的条款，但合同指引主要为概括性、原则性约定，因此本资产管理合同具体条款的约定不可避免的比合同指引更为复杂、更为具体，也不可避免地与合同指引不完全相同。

投资人应当认真阅读本资产管理合同，理解本资产管理合同的全部条款，独立做出是否签署本资产管理合同的决定。

##### 2、资产管理计划外包事项所涉风险

本集合计划不涉及外包事项。

### 3、资产管理计划委托募集所涉风险

根据相关法律法规及自律监管规则规定，资产管理人可以委托具有基金销售资格的代理销售机构募集本资产管理计划财产。

虽然资产管理人能够确认在委托募集时该等代理销售机构具有基金销售资格，但无法保证其持续满足该等业务资格要求，且无法保证其将按照相关法律法规及自律监管规则的规定进行募集活动。若届时因代理销售机构不符合资质要求、或不具备提供相关服务的条件和技能、或因管理不善、操作失误等，可能给投资者带来一定的风险。而且，如果代理销售机构未按照相关法律法规及自律监管规则的规定进行募集活动，亦将直接影响投资者对本计划风险收益的判断，从而对本计划投资者的利益产生不利影响。

### 4、资产管理计划份额转让所涉风险

本合同依据相关法律法规约定，在集合计划存续期间，投资者可以通过证券交易所或柜台交易市场等中国证监会认可的交易平台转让集合计划份额，管理人有权决定是否开放计划份额的转让业务。在办理转让业务时可能出现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某些人为或客观原因出现故障，从而影响转让业务办理。

#### (2) 折溢价风险

在份额可以办理转让后，份额的交易价格与其计划份额单位净值之间可能发生偏离并出现折/溢价交易的风险。

对于投资者通过证券交易所办理转让业务时可能出现的风险包括但不限于：

(3) 证券交易所为资产管理计划份额转让提供服务，不代表对资产管理计划的投资风险或收益做出判断或保证。管理人在资产管理合同和说明书中对资产管理计划存在的风险已作揭示，投资者在参与资产管理计划份额转让业务前，应认真阅读资产管理合同和说明书，了解产品特性，关注产品风险。

(4) 资产管理计划份额在证券交易所进行转让，并非集中竞价交易，可能不具有一个活跃的转让市场。证券交易所可以根据需要暂停或终止转让服务。

(5) 资产管理计划份额在证券交易所进行转让实行非担保交收。申报转让（受让）资产管理计划份额时，证券交易所对资产管理计划份额（资金）余额事先不实行检查、控制，相关份额登记结算机构也不实行担保交收，转让合同履行风险由转让方、受让方及管理人自行控制。

本风险揭示的揭示事项仅为列举性质，并未穷尽通过证券交易所办理资产管理计划份额转让业务所有风险因素。投资者参与资产管理计划份额转让业务前，对其他可能产生投资风险的相关因素也应详细了解、认真评估，以免因贸然从事此业务而遭受损失。

#### 5、资产管理计划设置份额持有人大会所涉风险

本集合计划不设份额持有人大会。投资者可能面临无法通过份额持有人大会或日常机构进行本集合计划运作期间相关事宜商讨和投票表决的风险。

#### 6、资产管理计划未在证券投资基金业协会完成备案手续或不予备案情形所涉风险

本计划成立后需在基金业协会进行备案。除非以现金管理为目的投资于银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券、货币市场基金等中国证监会认可的投资品种外，资产管理计划在完成基金业协会备案前不得开展投资活动。

因此，即使本计划成立，并不意味着本计划必然能获得基金业协会的备案。而该等备案过程可能会受到相应监管政策的影响，包括备案时间所需时间、能否通过备案都存在一定的不确定性。

如果在计划成立后不能及时完成备案，将可能导致本计划错过市场行情或投资机会；本计划如在中国证券投资基金业协会备案未通过，则需要按照监管机构的要求修改本合同或提前终止本计划，本计划在上述情形下存在需要修改合同或提前终止的风险。如备案未通过，管理人有权提前终止本计划，管理人退还投资者的资金总额为投资者投资本金加上期间活期存款利息。由此直接影响投资者参与本计划的投资目的，请投资者注意。

#### 7、无法提前退出的风险

本集合计划每笔参与份额持有期限满 9 个月后可在每月的 15 号开放退出（如遇非交易日顺延）。若持有期限未满 9 个月，投资者不得退出本集合计划，

投资者面临无法提前退出的风险。

#### 8、集合计划份额延期的风险

当集合计划的管理期限届满时，如集合计划所投资的资产支持证券、资产支持票据等未全部变现，该期集合计划可能面临自动延期至投资标的全部变现之日，相应投资者可能面临份额延期的风险。

#### 9、业绩报酬计提基准调整的风险

管理人有权根据市场情况及集合计划运作情况，在每个退出开放期开始前对下一个封闭期的业绩报酬计提基准进行调整，投资者可能面临业绩报酬计提基准调整的风险。

本合同约定的业绩报酬计提基准仅作为管理人计提业绩报酬的标准，不作为管理人对委托资产未来收益的预测，亦不构成管理人保证委托资产本金不受损失或取得最低收益的承诺。

#### 10、投资国债、地方政府债、中央银行票据等利率债券的风险

A、利率风险。利率风险是指利率的变动导致债券价格与收益率发生变动的风险。债券是一种法定的契约，大多数债券的票面利率是固定不变的（浮动利率债券与保值债券例外），当市场利率上升时，债券价格下跌，使债券持有者的资本遭受损失。因此，投资者购买的债券离到期日越长，则利率变动的可能性越大，其利率风险也相对越大。

B、收回风险。一些债券在发行时规定了发行者可提前收回债券的条款，这就有可能发生债券在一个不利于债权人的时刻被债务人收回的风险。当市场利率一旦低于债券利率时，收回债券对发行公司有利，这种状况使债券持有人面临着不对称风险，即在债券价格下降时承担了利率升高的所有负担，但在利率降低，债券价格升高时却没能收到价格升高的好处。

C、突发事件风险。这是由于突发事件使发行债券的机构还本付息的能力发生了重大的事先没有料到的风险。这些突发事件包括突发的自然灾害和意外事故等，例如，一场重大的事故会极大地损害有关公司还本付息的能力。

D、税收风险。表现为两种形式：一是投资免税的政府债券的投资者面临着权入税率下调的风险，税率越高，免税的价值就越大，如果税率下调，免税的实际价值就会相应减少，债券的价格就会下降；二是投资于免税债券的投资者面临

着所购买的债券被有关税收征管当局取消免税优惠的风险。

E、政策风险。是指由于政策变化导致债券价格发生波动而产生的风险。

11、投资于金融债、企业债、公司债、短期融资券、超短期融资券、次级债（包括二级资本债）、资产支持证券优先级的风险

A、利率风险。利率风险是指利率的变动导致债券价格与收益率发生变动的风险。债券是一种法定的契约，大多数债券的票面利率是固定不变的（浮动利率债券与保值债券例外），当市场利率上升时，债券价格下跌，使债券持有者的资本遭受损失。因此，投资者购买的债券离到期日越长，则利率变动的可能性越大，其利率风险也相对越大。

B、收回风险。一些债券在发行时规定了发行者可提前收回债券的条款，这就有可能发生债券在一个不利于债权人的时刻被债务人收回的风险。当市场利率一旦低于债券利率时，收回债券对发行公司有利，这种状况使债券持有人面临着不对称风险，即在债券价格下降时承担了利率升高的所有负担，但在利率降低，债券价格升高时却没能收到价格升高的好处。

C、信用风险。资产管理计划投资的债券存在着发行人不能按时足额还本付息的风险；当发行人信用评级降低时，资管计划所投资的债券可能面临价格下跌风险。

D、税收风险。表现为两种形式：一是投资免税的政府债券的投资者面临着权入税率下调的风险，税率越高，免税的价值就越大，如果税率下调，免税的实际价值就会相应减少，债券的价格就会下降；二是投资于免税债券的投资者面临着所购买的债券被有关税收征管当局取消免税优惠的风险。

E、政策风险。是指由于政策变化导致债券价格发生波动而产生的风险。

12、可交债和可转债的投资风险

可交债和可转债为含权债券，其市场风险不仅来自于市场利率变化，其转股期权价值也随标的股票价格波动而波动，从而导致可交债和可转债的二级市场价格等变现价值有出现较大的波动的可能性，且此等波动将远大于一般公司债券的波动，在债券发行时无法预测，由此可能导致投资出现损失。

13、投资现金、银行存款、同业存单、债券回购、货币市场基金等标准资产等的风险。

#### A、法律与政策风险

因国家政策及相关法律、法规的调整与变化，导致投资无法按时收回或无法按时足额收回的风险。

#### B、信用风险

因融资人未按同业存款合同的约定履行还款义务而导致的风险。

#### C、市场风险

因宏观政策、经济周期、市场价格等因素的变化，导致投资无法按时收回或无法按时足额收回的风险。

#### D、操作风险

在同业存款的发放与管理过程中，非因管理人原因（不可抗力除外）产生的不完善或有问题的程序和不适当的管理措施，导致投资无法按时收回或无法按时足额收回的风险。

#### E、承担相关法律费用的风险

根据同业存款合同约定采取诉讼或仲裁等相应措施收回本息时，如需委托他人代为诉讼或仲裁，投资者可能将承担相应实现存单收益的费用，包括但不限于诉讼（仲裁）费、律师费、差旅费、执行费、保全费及其他实现存单收益的必要费用，从而带来风险。

#### 14、参与证券回购的风险

证券回购是一方以一定规模证券向另一方作抵押融入资金，并承诺在日后再从另一方购回所抵押证券的交易行为。抵押证券所获得的资金可以再行投资或抵押，相当于放大原始资金的倍数，具有一定投资风险。

#### 15、参与场外证券交易的风险

债券交易分为交易所市场和场外交易市场，且以场外交易市场为主。本产品拟投资的部分固定收益类资产如银行间发行债券、非公开发行债券以及资产支持证券等主要通过场外证券交易完成。相较场内证券交易而言，场外市场参与主体分散，没有固定的交易场所，交易价格通过买卖双方议价过程确定。

#### 16、参与场外证券交易的风险

债券交易分为交易所市场和场外交易市场，且以场外交易市场为主。本产品拟投资的部分固定收益类资产如银行间发行债券、非公开发行债券以及资产支持



证券等主要通过场外证券交易完成。相较场内证券交易而言，场外市场参与主体分散，没有固定的交易场所，交易价格通过买卖双方议价过程确定。

#### 17、资产管理计划止损平仓风险

当本计划单位净值触及或低于平仓线时，即使管理人作出相应措施，投资者最终分配的清算金额仍可能存在低于平仓线净值的风险。如发生极端情况，管理人无法按预先设定的平仓线完成平仓操作，可能导致投资者承受较大的损失。

### (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。

本集合计划属于 R2(中低风险) 固定收益类资产管理产品，适合合格投资者中的 C2 级及其以上的普通投资者及专业投资者。

#### 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：

##### (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，使集合计划的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

固定收益品种获得的本息收入或者回购到期的资金，可能由于市场利率的下降面临资金再投资的收益率低于原来收益率，从而对本计划产生再投资风险。

### 3、管理风险

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集合计划财产所产生的风险，由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

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、通过第三方基金销售机构投资开放式基金的风险

本资产管理计划可通过第三方基金销售机构投资开放式基金，资产管理人负责选择销售机构，并确保在销售机构预留的备案回款账户为银行托管账户。资产托管人对于通过第三方基金销售机构投资开放式基金不承担任何风险。

由于通过第三方销售平台购买，可能会存在认（申）购、赎回（现金分红）基金时资金被挪用的风险；第三方销售平台对基金账户管理不当造成投资人持有基金份额不准确的风险；认（申）购款未能用于购买指定基金的风险；以及第三方基金销售平台无基金销售资质的风险。

### 7、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) 在集合计划募集期限届满（确认资产管理计划无法成立）后三十日内返

还投资者已缴纳的款项，并加计银行同期活期存款利息。

#### 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、其他风险

包括但不限于关联交易风险、技术风险和操作风险、发生不可抗力事件的风险等。

##### (1) 关联交易风险

投资者同意并授权管理人可以将集合计划的资产投资于管理人、托管人及与管理人或托管人有关联方关系的公司发行的证券或承销期内承销的证券，或从事其他重大关联交易，存在关联交易风险。投资者不得基于任何原因，对于本将集合计划的资产投资于管理人、托管人及与管理人或托管人有关联方关系的公司发行的证券或承销期内承销的证券，或从事其他重大关联交易而造成的损失、收益未达预期或其他责任，向管理人主张任何权利。

##### (2) 技术风险

在集合计划的日常交易中，可能因为技术系统的故障或者差错而影响交易的正常进行或者导致投资者的利益受到影响。这种技术风险可能来自管理人、估值服务机构、托管人、证券交易所、证券登记结算机构等。

##### (3) 操作风险

管理人、估值服务机构、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。

##### (4) 上市公司经营风险

上市公司的经营状况受多种因素影响，如市场、技术、竞争、管理、财务因素等都会导致公司盈利发生变化，从而导致集合计划投资收益变化。

##### (5) 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。

##### (6) 合同变更风险

投资者可能面临由于法律、法规、规章、中国证监会的规定、证券登记结算

机构业务规则以及证券交易所等交易规则修订导致合同变更的风险。

(7) 使用电子签名合同的风险

本集合计划资产管理合同采用电子签名方式签署，可能存在因网络中断或不运作、传送安全系统失灵、系统遭受非法攻击等各种因素造成数据的损失或丢失。

(8) 强制退出风险

若本集合计划投资者的某笔退出导致该投资者在注册登记机构处持有的份额净值低于【30】万，则管理人对该余额部分作强制退出处理。强制退出会导致投资者的计划份额减少至零。

### 三、投资者声明

作为本计划的投资者，本人/机构已充分了解并谨慎评估自身风险承受能力，自愿自行承担投资该计划所面临的风险。本人/机构作出以下陈述和声明，并确认（自然人投资者在每段段尾“【 】”内签名，机构投资者在本页、尾页盖章，加盖骑缝章）其内容的真实和正确：

- 1、本人/机构已仔细阅读资产管理业务相关法律文件和其他文件，充分理解相关权利、义务、本计划运作方式及风险收益特征，愿意承担由上述风险引致的全部后果。【 】
- 2、本人/机构知晓，管理人、销售机构、托管人及相关机构不应当对资产管理计划财产的收益状况作出任何承诺或担保。【 】
- 3、本人/机构符合《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》有关合格投资者的要求，并已按照管理人或销售机构的要求提供相关证明文件。【 】
- 4、本人/机构已认真阅读并完全理解资产管理合同的所有内容，并愿意自行承担购买资产管理计划的法律责任。【 】
- 5、本人/机构已认真阅读并完全理解资产管理合同第四部分“合同当事人及权利与义务”的所有内容，并愿意自行承担购买资产管理计划的法律责任。【 】
- 6、本人/机构已认真阅读并完全理解资产管理合同第十一部分“集合计划的投资”的所有内容，并愿意自行承担购买资产管理计划的法律责任。【 】
- 7、本人/机构已认真阅读并完全理解资产管理合同第二十一部分“集合计划的费用与税收”中的所有内容。【 】
- 8、本人/机构已认真阅读并完全理解资产管理合同第二十七部分“争议的处理”

中的所有内容。【  】

9、本人/机构已经配合管理人或其销售机构提供了法律法规规定的信息资料及身份证明文件，以配合上述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以及反洗钱等监管规定的工作。

本人/机构承诺上述信息资料及身份证明文件真实、准确、完整、有效。【  】

10、本人/机构知晓，证券投资基金业协会为资产管理计划办理备案不构成对管理人投资能力、持续合规情况的认可；不作为对资产管理计划财产安全的保证。

【  】

11、本人/机构承诺本次投资行为是为本人/机构购买(参与)资产管理计划。【  】

12、本人/机构承诺不以非法拆分转让为目的购买资产管理计划，不会突破合格投资者标准，将资产管理计划份额或其收益权进行非法拆分转让。【  】

13、本人/机构知悉本风险揭示书的揭示事项仅为列举性质，未能详尽列明投资者参与资产管理计划所面临的全部风险和可能导致投资者资产损失的所有因素。

【  】

投资者（自然人签字或机构盖章）：

日期：



销售机构经办人（签字）[集合资产管理计划适用]：

日期：

## 附件二 华金证券久久盈集合资产管理计划说明书

<b>特别提示：</b>		
<p>本说明书根据《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》（以下简称《管理办法》）、《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》（以下简称《运作管理规定》）、《华金证券久久盈集合资产管理计划资产管理合同》（以下简称《资产管理合同》）以及其他有关规定制作，管理人保证本说明书内容真实、准确、完整，不存在任何虚假记载、误导性陈述和重大遗漏。</p> <p>投资者承诺以真实身份参与集合计划，保证委托资产的来源及用途合法，并已阅知本说明书和《资产管理合同》全文，了解相关权利、义务和风险，自行承担投资风险和损失。管理人承诺以诚实守信、审慎尽责的原则管理和运用集合计划资产，但不保证集合计划一定盈利，也不保证最低收益。投资者签订《资产管理合同》且合同生效后，投资者即为《资产管理合同》的投资者，其认购或申购集合计划份额的行为本身即表明其对《管理合同》及本说明书的承认和接受。管理人和托管人将按照《管理办法》、《运作管理规定》、《资产管理合同》、本说明书及有关规定享有权利、承担义务。</p>		
集合计划基本信息	名称	华金证券久久盈集合资产管理计划
	简称	华金证券久久盈
	类型	<input type="checkbox"/> 权益类 <input checked="" type="checkbox"/> 固定收益类 <input type="checkbox"/> 混合类 <input type="checkbox"/> 商品及金融衍生品类
	目标规模	本集合计划初始募集规模不低于 1000 万元人民币。
	管理期限	自集合计划成立之日起算，本集合计划存续期为 5 年，可展期或提前结束。
	募集期	本集合计划具体募集时间具体以管理人官网(www.huajinsec.com)公告为准。初始募集期自集合计划份额发售之日起不超过 60 天。
	封闭期	本集合计划除开放期以外的日期均为封闭期，封闭期内不办理参与和退出业务。
	开放期	本集合计划成立日起每周周二、周三开放参与（如遇非交易日则暂停）。本集合计划每笔参与份额持有期限满 9 个月后可在每月的 15 日开放退出（如遇非交易日顺延）。具体开放期安排以管理人公告为准。
份额面值	每份集合计划的面值为人民币 1.00 元。	
最低金额	<p>投资者参与金额应满足集合计划最低参与金额限制【30】万元（不含参与费用），已持有集合计划份额的投资者在资产管理计划存续期开放日追加参与的除外。</p> <p>投资者追加参与集合计划的，每次追加参与的金額应当不少于【1】万元（不含参与费用）。</p>	
份额分级	不分级	
相关费率	<p>参与费率：【0】%；</p> <p>退出费率：【0】%</p> <p>管理费率：【0.60】%/年；</p> <p>托管费率：【0.02】%/年。</p>	

	<p><b>投资范围</b></p>	<p>本集合计划投资于具有良好流动性的固定收益类金融工具，主要包括银行间市场和交易所市场上市交易的国债、政策性金融债券、地方政府债、央行票据、企业债、公司债、金融机构债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债（包括二级资本债）、债券型基金、资产支持证券优先级、可交换债券、可转换债券、现金、银行存款、同业存单、债券回购、货币市场基金及其他法律法规或政策许可投资的固定收益证券品种。</p> <p>如法律法规或中国证监会允许集合计划投资其他品种，管理人在履行合同约定变更程序后，可以将其纳入本集合计划的投资范围。</p>
	<p><b>资产配置比例</b></p>	<p>本集合计划投资于固定收益类的比例不低于集合计划资产总值的 80%。</p>
	<p><b>风险收益特征及适合募集对象</b></p>	<p>本集合计划属于 R2(中低风险)固定收益类资产管理产品，适合合格投资者中的 C2 级及其以上的普通投资者及专业投资者。</p>
	<p><b>投资策略</b></p>	<p><b>1、资产配置策略</b></p> <p>本集合计划在合同约定的范围内实施稳健的整体资产配置。管理人通过分析细类资产的收益率水平、风险来源、市场流动性等因素，结合对国内宏观经济运行态势、宏观经济政策变化、证券市场运行状况等因素的深入研究，采取积极的投资策略，对投资组合中各细类属资产进行动态优化配置，以寻求收益、风险、流动性之间的最佳平衡点。</p> <p><b>2、固定收益类资产投资策略</b></p> <p><b>(1) 普通债券投资策略</b></p> <p>本集合计划在普通债券的投资中主要基于对国家财政政策、货币政策的深入分析以及对宏观经济的动态跟踪，采用久期控制下的主动性投资策略，主要包括：久期控制、期限结构配置、信用风险控制、跨市场套利和相对价值判断等管理手段，对债券市场、债券收益率曲线以及各种债券价格的变化进行预测，相机而动、积极调整。</p> <p>①久期控制是根据对宏观经济发展状况、金融市场运行特点等因素的分析确定组合的整体久期，有效的控制整体资产风险。</p> <p>②期限结构配置是在确定组合久期后，针对收益率曲线形态特征确定合理的组合期限结构，包括采用集中策略、两端策略和梯形策略等，在长期、中期和短期债券间进行动态调整，从长、中、短期债券的相对价格变化中获利。</p> <p>③信用风险控制是管理人充分利用现有行业与公司研究力量，根据发债主体的经营状况和现金流等情况对其信用风险进行评估，以此作为品种选择的基本依据。</p> <p>④跨市场套利根据不同债券市场间的运行规律和风险特性，构建和调整债券组合，提高投资收益，实现跨市场套利。</p> <p>⑤相对价值判断是根据对同类债券的相对价值判断，选择合适的交易时机，增持相对低估、价格将上升的债券，减持相对高估、价格将下降的债券。</p> <p><b>(2) 附权债券投资策略</b></p> <p>附权债券指对债券发行体授予某种期权，或者赋予债券投资者某种</p>

	<p>期权，从而使债券发行体或投资者有了某种灵活的选择余地，从而增强该种金融工具对不同发行体融资的灵活性，也增强对各类投资者的吸引力。</p> <p>①可转换债券投资策略</p> <p>可转换债券不同于一般的企业(公司)债券，其投资人具有在一定条件下转股和回售的权利，因此其理论价值应当等于作为普通债券的基础价值加上可转换公司债内含期权价值，是一种既具有债性，又具有股性的混合债券产品，具有抵御价格下行风险，分享股票价格上涨收益的特点。</p> <p>可转换债券最大的优点在于，可以用较小的本金损失，博取股票上涨时的巨大收益。可以充分运用可转换公司债券在风险和收益上的非对称性分布，买入低转换溢价率的债券，并持有的投资策略，只要在可转换公司债券的存续期内，发行转债的公司股票价格上升，则投资就可以获得超额收益。</p> <p>②可交换债券投资策略</p> <p>本集合计划将通过自下而上的标的正股分析和可交换债条款分析，寻找真正具有减持意愿的可交换债。同时，通过深入研究个券的投资价值，在获取可交换债较高票面利率收益基础上，寻找未来有较大转股概率的投资标的。具体而言，集合计划管理人将综合考虑可交换债的票面利率和其他附带条款如回售等，并对发行人和标的公司进行信用评估，对可交换债从纯债上做出价值衡量，在此基础上对标的正股所在行业和标的正股公司做深度分析，并结合可交换债的换股价格等情况，充分挖掘内含看涨期权价值高的可交换债，综合纯债价值和看涨期权价值两方面考量，本集合计划对综合价值高的精选个券做出重点配置。</p> <p>(3) 资产证券化产品投资策略</p> <p>证券化是将缺乏流动性但能够产生稳定现金流的资产，通过一定的结构化安排，对资产中的风险与收益进行分离组合，进而转换成可以出售、流通，并带有固定收入的证券的过程。</p> <p>资产证券化产品的定价受市场利率、发行条款、标的资产的构成及质量、提前偿还率等多种因素影响。本集合计划将在基本面分析和债券市场宏观分析的基础上，对资产证券化产品的交易结构风险、信用风险、提前偿还风险和利率风险等进行分析，采取包括收益率曲线策略、信用利差曲线策略、预期利率波动率策略等积极主动的投资策略，投资于资产证券化产品。</p> <p>(4) 回购套利策略</p> <p>集合计划管理人在发现债券市场明显投资机会的情况下，或债券市场存在套利机会时，通过回购等融资融券手段，应用适量的杠杆获取超额收益。</p> <p>(5) 银行存款、货币市场基金、债券逆回购等资产投资策略</p> <p>本集合计划将在确定总体流动性要求的基础上，结合不同类型货币市场工具的流动性和货币市场预期收益水平、银行存款的期限、债券逆回购的预期收益率来确定资产的配置，并定期对以上资产组合平均剩余期限以及投资品种比例进行适当调整。</p>
--	---



	<p><b>投资限制</b></p>	<p>(1) 本集合计划的总资产不得超过净资产的 200%；</p> <p>(2) 本集合计划投资于同一资产的资金，不得超过本集合计划资产净值的 25%；管理人管理的全部集合资产管理计划投资于同一资产的资金，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；</p> <p>(3) 本计划参与债券正回购资金余额不得超过上一日净资产 100%；参与债券逆回购资金余额不得超过上一日净资产 100%；</p> <p>(4) 集合计划退出开放期内，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%；</p> <p>(5) 本计划主动投资于流动性受限资产的市值在赎回开放期内合计不得超过该资产管理计划资产净值的 20%；</p> <p>(6) 本计划参与债券、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>(7) 本集合计划投资于主体评级不低于 AA 的信用债（包括短期融资券、超短期融资券），投资可转债的主体评级不低于 A+；无主体评级的信用债，债项评级不得低于 AA，其中短期融资券债项评级不得低于 A-1；</p> <p>(8) 本集合计划参与债券逆回购接受质押券的信用债主体评级不低于 AA（包括短期融资券、超短期融资券）；无主体评级的信用债，债项评级不得低于 AA，其中短期融资券债项评级不得低于 A-1；</p> <p>(9) 本集合计划投资于可转债、可交债的资金合计不得超过本计划资产总值的 10%；</p> <p>(10) 本集合计划不得违反《集合资产管理合同》中投资范围的规定；</p> <p>(11) 法律法规、中国证监会以及本合同规定的其他投资限制。</p>
--	--------------------	--

<p><b>投资者的重要权利和义务</b></p>	<p>1. 投资者的权利</p> <p>(1) 分享资产管理计划财产收益；</p> <p>(2) 取得分配清算后的剩余资产管理计划财产；</p> <p>(3) 按照本合同的约定参与、退出和转让资产管理计划份额；</p> <p>(4) 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；</p> <p>(5) 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；</p> <p>(6) 监督管理人、托管人履行投资管理及托管义务的情况；</p> <p>(7) 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。</p> <p>2. 投资者的义务</p> <p>(1) 认真阅读并遵守本合同，保证投资资金的来源及用途合法，不得以非法汇集他人的资金、恐怖融资的资金及其他非法资金参与本集合计划；不得使用贷款、发行债券等筹集的非自有资金（依法设立的各类资产管理产品投资的除外）参与本集合计划；</p> <p>(2) 以真实身份参与集合计划、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；</p> <p>(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；</p> <p>(4) 认真阅读并签署风险揭示书；</p> <p>(5) 按照本合同约定支付资产管理计划份额的参与款项，承担本合同约定的管理费、业绩报酬（如有）、托管费、审计费、税费等合理费用；退还因管理人、托管人、销售机构过错导致投资者获得的不当得利；</p> <p>(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；</p> <p>(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；</p> <p>(8) 不得违反资产管理合同的约定干涉管理人的投资行为；</p> <p>(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；</p> <p>(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；</p> <p>(11) 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。</p>
<p><b>信息披露的内容、方式和频率</b></p>	<p>(一) 信息披露方式</p> <p>本集合计划的信息披露将严格按照《管理办法》、本合同及其他有关规定进行。本集合计划的计划单位净值、计划累计单位净值等信息将在管理人指定网站上披露，投资者可随时查阅。若管理人指定网站变更，</p>

	<p>管理人将提前进行相关信息的详细披露。</p> <p>(二) 信息披露的种类、内容、频率</p> <p>1. 定期报告</p> <p>定期报告包括集合计划单位净值报告、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。</p> <p>(1) 集合计划单位净值报告</p> <p>本集合计划开放期内每个开放日在管理人网站上公布前一个交易日集合计划单位净值, 封闭期内管理人至少每周在其网站上公布一次集合计划单位净值。</p> <p>(2) 集合计划的资产管理季度报告</p> <p>管理人在每季度向投资者提供一次准确、完整的管理季度报告, 对报告期内集合计划资产的配置状况、价值变动情况、重大关联交易做出说明。</p> <p>本集合计划资产管理季度报告将披露管理人履职报告、托管人履职报告、资产管理计划投资表现、资产管理计划投资组合报告、资产管理计划资产负债情况、资产管理计划运用杠杆情况(如有)、资产管理计划支付的费用、资产管理计划投资收益分配情况、资产管理计划投资收益分配情况、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以及中国证监会及基金业协会规定的其他事项。</p> <p>季度报告应于每季度截止日后 1 个月内通过管理人网站公告, 并按照监管要求报备。本计划成立不足三个月或者存续期间不足三个月的, 可以不编制资产管理计划当期的季度报告。</p> <p>管理人应当在每季度结束后 15 日内向托管人提供其编制的季度管理报告、当期财务会计报告(如有)供托管人复核, 托管人复核管理人季度报告、当期财务会计报告(如有)中的财务数据后, 于 5 个工作日内向管理人提供季度托管人履职报告。</p> <p>(3) 集合计划的资产管理年度报告</p> <p>管理人在每年度向投资者提供一次准确、完整的管理年度报告, 对报告期内集合计划资产的配置状况、价值变动情况、重大关联交易做出说明。</p> <p>本集合计划年度报告应包括但不限于管理人履职报告、托管人履职报告、资产管理计划投资表现、资产管理计划投资组合报告、资产管理计划运用杠杆情况(如有)、资产管理计划财务会计报告、资产管理计划支付的费用、资产管理计划投资收益分配情况、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以及中国证监会及基金业协会规定的其他事项。</p> <p>年度报告应于每个会计年度截止日后 4 个月内通过管理人网站公告, 并按照监管要求报备。本计划成立不足三个月或者存续期间不足三个月的, 可以不编制资产管理计划当期的年度报告。</p> <p>托管人履职报告作为管理人季度报告、年度报告内容的一部分, 由托管人完成管理人季度报告、年度报告的复核工作后, 确定托管人履职报告内容并向管理人反馈, 由管理人根据本合同约定的方式向投资者披露。</p> <p>(4) 年度审计报告</p>
--	--

		<p>管理人应当聘请具有证券相关业务资格的会计师事务所对本集合计划的运营情况进行年度审计，将在资产管理计划年度报告中向投资者披露。</p> <p>2. 临时报告</p> <p>集合计划存续期间，发生对集合计划持续运营、客户利益、资产净值产生重大影响的事件，管理人应当以管理人指定网站、销售机构网站或网点、或其他途径和方式，在事项发生之日起五日内向客户披露。临时报告的情形包括但不限于：</p> <p>(1) 集合计划运作过程中，负责集合资产管理业务的投资经理发生变更，或出现其他可能对集合计划的持续运作产生重大影响的事项；</p> <p>(2) 暂停受理或者重新开始受理参与或者退出申请；</p> <p>(3) 集合计划终止和清算；</p> <p>(4) 集合计划存续期满并展期；</p> <p>(5) 合同的补充、修改与变更；</p> <p>(6) 与集合计划有关的重大诉讼、仲裁事项；</p> <p>(7) 本集合计划的销售机构发生变更；</p> <p>(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；</p> <p>(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；</p> <p>(10) 集合计划分红或发生业绩报酬计提（如有）；</p> <p>(11) 资产计价出现错误（当资产估值导致本集合计划单位净值小数点后四位以内（不含第四位）发生差错时，视为本集合计划单位净值错误）；</p> <p>(12) 管理费、托管费等费用计提方式或费率发生变更；</p> <p>(13) 其他对集合计划持续运营、客户利益、资产净值产生重大影响的事件；</p> <p>(14) 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，管理人应向投资者披露；</p> <p>(15) 管理人认为重大的其他事项。</p>
	<p><b>利益冲突的情况</b></p>	<p>(一) 利益冲突情形</p> <p>在不违反法律法规的强制性规定、不违反本合同约定的前提下，本计划可能投资于管理人、托管人及前述机构的控股股东、实际控制人或者其他关联方发行的证券或者承销期内承销的证券，或从事其他重大关联交易。</p> <p>投资者在此不可撤销地同意并授权管理人可以将本集合计划的资产投资于管理人、托管机构及其控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司发行或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易。</p> <p>(二) 利益冲突的处理方式、披露内容及频率</p> <p>管理人在运用受托管理资产从事关联交易时，将按照法律法规及中国证监会的有关规定，遵循客户利益优先原则，事后以临时公告或定期报告的形式告知投资者、托管人，并根据监管要求进行报告。</p> <p>若管理人董事、监事、从业人员及其配偶、控股股东、实际控制人</p>

		<p>或者其他关联方参与管理人设立的资产管理计划，管理人应当向投资者进行披露，对该计划账户进行监控，并按监管要求进行报告。</p> <p>除上述规定外，管理人不得将本资管计划的委托资产，直接或者通过投资其他资产管理计划等间接形式，为本机构、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，投资者为符合中国证监会规定的专业投资者且投资金额不低于 1000 万元，并且提前 2 个工作日向管理人出具书面同意投资的除外。</p>
当事人	管理人	华金证券股份有限公司
	托管人	兴业银行股份有限公司
	销售机构	<p>本集合计划的销售机构为华金证券及华金证券委托的代销机构。</p> <p>管理人可根据有关法律法规的要求，选择其他符合要求的销售机构代理销售本集合计划，管理人新增或变更本集合计划的销售机构时，将提前在管理人指定网站上公告。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意见或与投资者另行签订协议。</p>
	风险承担	<p>合格投资者是指具备相应风险识别能力和风险承受能力，投资于单只资产管理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。</p> <p>(一) 具有 2 年以上投资经历，且满足以下条件之一：家庭金融净资产不低于 300 万元，家庭金融资产不低于 500 万元，或者近 3 年本人年均收入不低于 40 万元。</p> <p>(二) 最近 1 年末净资产不低于 1000 万元的法人单位。</p> <p>(三) 依法设立并接受国务院金融监督管理机构监管的机构，包括证券公司及其子公司、基金管理公司及其子公司、期货公司及其子公司、在中国证券投资基金业协会（以下简称证券投资基金业协会）登记的私募基金管理人、商业银行、金融资产投资公司、信托公司、保险公司、保险资产管理机构、财务公司及中国证监会认定的其他机构；</p> <p>(四) 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；</p> <p>(五) 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）；</p> <p>(六) 中国证监会视为合格投资者的其他情形。</p> <p>已接受其他私募资产管理产品投资的私募资产管理产品不得投资于本产品；其他可能导致本产品不符合《指导意见》等法律法规要求的投资人不得投资于本产品。如监管规则对合格投资者认定标准发生变化，则按照最新标准执行。</p>
集合计划的参与	办理时间	<p>本集合计划成立日起每周周二、周三开放参与（如遇非交易日则暂停）。本集合计划每笔参与份额持有期限满 9 个月后可在每月的 15 日开放退出（如遇非交易日顺延）。具体开放期安排以管理人公告为准。</p> <p>管理人有权根据集合计划资金募集情况，决定是否提前结束开放期，并采用“时间优先、规模优先”的原则避免出现募集份额超过集合计划目标规模上限或集合计划投资者数超过 200 人的情况。</p> <p>本集合计划除开放期以外的日期均为封闭期，封闭期内不办理参与和退出业务。</p>
	办理场所	本集合计划将通过销售机构下属指定营业网点或销售机构指定网

		络系统办理集合计划的参与。
	<b>办理方式、程序</b>	<p>1. 本集合计划采用金额参与的方式，即参与以金额申请。</p> <p>2. 投资者办理参与业务时应提交的文件和办理手续、办理时间、处理规则等在遵守本合同约定的前提下，以各销售机构的具体规定为准。</p> <p>3. 当日的参与申请可以在当日开放时间结束前撤销，在当日的开放时间结束后不得撤销。</p> <p>4. 参与申请的确认。销售网点受理参与申请并不表示对该申请是否成功的确认，而仅代表销售网点确实收到了参与申请。参与申请采取时间优先、金额优先原则进行确认。申请是否有效应以注册登记机构的确认为准。注册登记机构应在 2 个工作日内对投资者参与申请的有效性进行确认。</p> <p>5. 参与申请的款项支付。参与采用全额交款方式，若资金在规定时间内未全额到账则参与不成功，则为无效申请，已交付的委托款项将退回投资者指定资金账户。</p> <p>6. 本集合计划采用纸质或电子合同，投资者在签署合同后方可参与本集合计划。参与申请经管理人确认后，构成《资产管理合同》的有效组成部分。</p> <p>如投资者以管理人直销方式参与，应于本集合计划参与申请提交之日将参与资金划付至集合计划归集总账户。</p> <p>7. 资产管理人在不损害投资者权益的情况下可更改上述原则，但最迟应在新的原则实施前 3 个工作日告知投资者。资产管理人提前 3 个工作日在指定网站公告前述调整事项即视为履行了告知义务。</p>
	<b>参与费</b>	<b>【0%】</b>
	<b>认购资金利息</b>	投资者的认购参与款项（不含参与费）加计其在初始销售期形成的利息将折算为资产管理计划份额归投资者所有。初始认购资金的利息以份额登记机构的记录结果为准。
<b>集合计划的退出</b>	<b>办理时间</b>	<p>本集合计划成立日起每周周二、周三开放参与（如遇非交易日则暂停）。本集合计划每笔参与份额持有期限满 9 个月后可在每月的 15 日开放退出（如遇非交易日顺延）。具体开放期安排以管理人公告为准。</p> <p>管理人有权根据集合计划资金募集情况，决定是否提前结束开放期，并采用“时间优先、规模优先”的原则避免出现募集份额超过集合计划目标规模上限或集合计划投资者数超过 200 人的情况。</p> <p>本集合计划除开放期以外的日期均为封闭期，封闭期内不办理参与和退出业务。</p>
	<b>办理场所</b>	本集合计划参与将通过推广机构下属指定营业网点或推广机构指定网络系统办理集合计划的退出。
	<b>办理方式、程序</b>	<p>1. 本集合计划采用份额退出的方式，即退出以份额申请。</p> <p>2. 投资者办理退出等业务时应提交的文件和办理手续、办理时间、处理规则等在遵守本合同约定的前提下，以各销售机构的具体规定为准。</p> <p>3. 当日的退出申请可以在当日开放时间结束前撤销，在当日的开放时间结束后不得撤销。</p> <p>4. 退出申请的确认。销售网点受理退出申请并不表示对该申请是否成功的确认，而仅代表销售网点确实收到了退出申请。退出申请按先进</p>

	<p>先出的方式处理。申请是否有效应以注册登记机构的确认为准。注册登记机构应在 2 个工作日内对投资者退出申请的有效性进行确认。</p> <p>5. 退出申请的款项支付。投资者退出申请确认后，资产管理人应按规定自确认之日起 7 个工作日内向投资者支付退出款项。在发生巨额退出时，退出款项的支付办法按本合同和有关法律法规规定处理。</p> <p>6. 资产管理人在不损害投资者权益的情况下可更改上述原则，但最迟应在新的原则实施前 3 个工作日告知投资者。资产管理人提前 3 个工作日在指定网站公告前述调整事项即视为履行了告知义务。</p>
退出费与退出金额	退出费率：0%
退出的限制与次数	<p>投资者部分退出集合计划的，其退出后持有的集合计划资产净值应当不低于规定的合格投资者最低参与金额。</p> <p>当投资者持有的集合计划资产净值低于最低参与金额时，则余额部分必须一起退出。当管理人发现投资者申请部分退出后将致使其持有的计划资产净值低于最低参与金额的，管理人有权将投资者的全部份额退出给投资者。</p>
单个投资者大额退出的预约申请	<p>当单个投资者一次性申请退出份额 500 万份及以上时，属于单个投资者大额退出。单个投资者大额退出必须在开放期之前至少提前 3 个交易日通过销售机构向管理人提交书面预约，否则管理人有权拒绝接受其退出申请。管理人根据预约情况提前对资产配置进行调整。如构成巨额退出，应按巨额退出程序办理。</p>
巨额退出	<p>1. 巨额退出的认定</p> <p>单个开放日内，本集合计划净退出申请份额（退出申请总份额扣除参与申请总份额之余额）超过上一交易日计划份额总份数的【20】%，即认为是发生了巨额退出。</p> <p>2. 巨额退出的处理方式</p> <p>当出现巨额退出时，管理人有权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延期退出，并及时在指定网站上进行公告。</p> <p>全额退出：当管理人认为有能力支付投资者的退出申请时，按正常退出程序办理。</p> <p>部分延期退出：当管理人认为支付投资者的退出申请有困难或认为兑付投资者的退出申请可能对本集合计划的资产净值造成较大波动时，管理人在当日接受净退出计划份额不低于上一日计划总份额的【20】%的前提下，对其余退出申请延期办理，延期时间不得超过 20 个交易日。对于当日的退出申请，按单个账户退出申请量占退出申请总量的比例，确定当日受理的退出申请；未受理部分可延迟至下一个交易日办理。转入下一个交易日的退出申请不享有优先权并以该交易日的计划单位净值为依据计算退出金额，以此类推，直到全部退出为止。投资者在申请退出时可选择当日未受理部分予以撤销，未进行选择的默认顺延。</p>

	<p><b>连续巨额退出</b></p>	<p>(1) 连续巨额退出的认定 集合计划连续两个开放日（含两日）以上发生巨额退出，即认为发生了连续巨额退出。</p> <p>(2) 连续巨额退出的处理方式 出现连续巨额退出时，管理人可采用全额退出或部分延期退出方式处理。当管理人认为有必要时，也可按暂停接受退出申请，但暂停期限不得超过 20 个交易日；已经接受的退出申请，可以延迟支付退出款项，但不得超过正常支付时间 20 个交易日，并在管理人指定网站上进行公告。</p>
	<p><b>告知方式</b></p>	<p>发生巨额退出并延期支付时，管理人应在管理人网站公告，并说明有关处理方法。</p>
<p><b>管理人自有资金参与情况</b></p>	<p>管理人不以自有资金参与本集合计划。</p>	
<p><b>集合计划成立的条件、时间</b></p>	<p>集合计划的初始募集规模不低于 1000 万元人民币且其投资者的人数为 2 人（含）以上，且不超过 200 人，募集过程符合法律、行政法规和中国证监会的规定。本集合计划募集金额缴足之日起 10 个工作日内经管理人聘请的具有证券相关业务资格的会计师事务所对集合计划进行验资并出具验资报告后，管理人公告本集合计划成立，并将公告通过电子邮件的方式发送给托管人。</p> <p>集合计划成立后 5 个工作日内，管理人应当将发起设立情况报中国证券投资基金业协会备案，同时抄送住所地的中国证监会派出机构，并提交监管要求的材料。</p> <p>集合计划募集完成前，投资者的参与资金只能存入集合计划归集总账户，任何机构和个人不得动用投资者参与资金。</p> <p>集合计划在成立后备案完成前，不得开展投资活动，以现金管理为目的，投资于银行活期存款、国债、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。</p> <p>如上述监管规则发生变化，则按照最新标准执行。</p>	
<p><b>本集合计划不能成立及其有关事项的处理方法</b></p>	<p>集合计划募集期结束，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。</p> <p>集合计划设立失败的，管理人应当承担的责任，包括但不限于：</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1. 以固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用；</li> <li>2. 在募集期届满后三十日内返还投资者已缴纳的款项，并加计银行同期活期存款利息。</li> </ol> <p>集合计划募集期内，发生影响或可能影响本集合计划募集或运作的情形（包括但不限于市场环境及法律法规变动、证监会或相关自律组织不时发布的监管意见等），管理人有权视情况决定停止本集合计划募集。</p>	
<p><b>集合计划份额转让</b></p>	<p>集合计划存续期间，在管理人允许的情况下，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资产管理计划份额，份额转让应遵守交易场所相关规定及要求，并按规定办理份额变更登记手续。</p> <p>管理人和托管人无需就本集合计划份额转让事宜与投资者另行签订补充协议。受让方首次参与集合计划，应满足合格投资者的条件，并先与管理人、托管人签订集合资产管理合同。转让后，持有资产管理计</p>	



		划份额的合格投资者合计不得超过二百人。
收益分配	收益构成	<p>本集合计划收益指集合计划利息收入、投资收益和其他收入扣除相关费用后的余额，集合计划已实现收益指集合计划利润减去公允价值变动收益后的余额。</p> <p>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。</p> <p>本集合计划可供分配利润为截至收益分配基准日资产管理计划未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。</p>
	分配原则	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. 本集合计划每一份额享有同等分配权利。</li> <li>2. 当期收益先弥补上一年度亏损后，方可进行当年收益分配；</li> <li>3. 本集合计划收益分配后的计划单位净值不得低于计划单位面值，即收益分配基准日的计划单位净值减去每份集合计划收益分配金额后不能低于计划单位面值。</li> <li>4. 本集合计划发生现金收益分配、本金归还等现金支付时，银行收取的与此有关的任何费用均由投资者承担。</li> <li>5. 本集合计划进行收益分配、本金归还时所涉及的相关税负由投资者自行承担，管理人、托管人均不承担代扣代缴等纳税义务。</li> <li>6. 若本集合计划在存续期间不进行收益分配，则本集合计划也可在终止清算后将货币资金分派给投资者，由此产生的相关的税负由投资者自行承担，管理人、托管人均不承担代扣代缴等纳税义务。</li> <li>7. 法律、法规或监管机构另有规定的从其规定。</li> </ol>
	分配方式	<p>本集合计划的收益分配方式包括现金分红和红利转份额两种方式。投资者选择现金分红的，现金红利在收益分配权益登记日后【5】个工作日内返还至投资者的指定账户；投资者选择红利转份额的，现金红利按除权日的计划单位净值自动划转为计划份额进行再投资。若投资者不选择，本计划默认的收益分配方式是现金分红。</p>
	分配方案	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. 收益分配的时间与方案由管理人根据本集合计划收益情况拟定，经由托管人复核后确定，并在方案确定后的【10】个工作日内在管理人指定网站上披露。</li> <li>2. 收益分配方案须载明集合计划收益范围、可供分配利润、分配对象、分配原则、收益分配基准日、收益分配权益登记日、除权日、红利下发日、分配时间、分配数额及比例、分配方式及有关手续费等内容。</li> </ol>
费用报酬	费用种类	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. 管理人的管理费；</li> <li>2. 托管人的托管费；</li> <li>3. 业绩报酬（如有）；</li> <li>4. 证券交易费用；</li> <li>5. 证券账户开户费；</li> <li>6. 相关税费；</li> <li>7. 银行间费用；</li> <li>8. 与资产管理计划相关的会计师费、律师费、诉讼费、仲裁费、公证费、评估费、拍卖费、保全费及其他形式的资产处置费等其他费用。</li> </ol>

<p>不由集合计划承担的费用</p>	<p>集合计划成立前发生的费用，以及存续期间发生的与推广有关的费用，不在计划资产中列支。管理人和托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出，以及处理与本集合计划运作无关的事项发生的费用等不列入本集合计划费用。</p> <p>其他不列入集合计划费用的具体项目依据中国证监会有关规定执行。</p>
<p>业绩报酬的提取</p>	<p>(1) 计提原则</p> <p>本集合计划的业绩报酬计提日为收益分配基准日、申请退出日和本集合计划终止日。在收益分配日提取业绩报酬的，业绩报酬从收益分配资金中扣除。在投资者退出和集合计划终止时提取业绩报酬的，业绩报酬从退出资金中扣除。</p> <p>本集合计划的管理人在业绩报酬计提日按投资者每笔参与本金分别计算年化收益率并提取业绩报酬。管理人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，证券期货经营机构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。</p> <p>(2) 计提方法</p> <p>业绩报酬计算起始日：此份额上一次提取业绩报酬的日期。若此份额在产品成立后参与且未提取过业绩报酬，则为份额参与日。若此份额在产品成立前参与且未提取过业绩报酬，则为产品成立日。</p> <p>在本集合计划的业绩报酬计提日，管理人视业绩报酬计算起始日至本次业绩报酬计提日期间的投资收益情况，收取一定的业绩报酬。若集合计划的期间份额年化收益率超过业绩报酬计提基准K，超过K的部分业绩报酬提取比例为【50】%。业绩报酬计提基准以管理人公告为准。</p> <p>期间份额年化收益率计算公式：</p> $R = (A - B) / B' \times 365 / T \times 100\%$ <p>R 为期间份额年化收益率；  A 为业绩报酬计提日的单位累计净值；  B 为业绩报酬计算起始日的单位累计净值；  B' 为业绩报酬计算起始日的单位净值；  T 为业绩报酬计算起始日至本次业绩报酬计提日的间隔天数；  R 的计算在百分号内保留两位小数。</p> <p>期间业绩报酬计提计算公式：</p> <p>若 <math>R \leq K</math>，<math>Y = 0</math>；  若 <math>R &gt; K</math>，  <math>Y = F \times B' \times (R - K) \times T / 365 \times 50\%</math></p> <p>Y 为业绩报酬计提日的业绩报酬；  F 为业绩报酬计提日投资者单笔投资退出份额（适用退出时计提业绩报酬）或持有份额（适用收益分配和本集合计划终止时计提业绩报酬）；  B' 为业绩报酬计算起始日的单位净值；  K 为业绩报酬计提基准；  T 为业绩报酬计算起始日至本次业绩报酬计提日的间隔天数；  Y 的计算结果保留到小数点后两位，小数点后第三位四舍五入。</p> <p>因涉及注册登记数据，业绩报酬由管理人计算并复核，托管人仅根</p>

	<p>据管理人提供数据和划款指令配合进行资金划付。</p>
<p>集合计划展期</p>	<p>1. 展期的条件                  (1) 本集合计划运营规范, 管理人、托管人未违反法律、行政法规、中国证监会规定和本合同的约定;                  (2) 展期没有损害投资者利益的情形;                  (3) 中国证监会规定的其他条件。                  集合计划展期的, 应当符合集合计划的成立条件。</p> <p>2. 展期的安排                  (1) 通知展期的时间                  在集合计划到期前【3】个月内。                  (2) 通知展期的方式                  管理人将通过管理人指定网站通知投资者。                  (3) 投资者回复的方式                  投资者应当按照公告要求或管理人约定的其他方式明确回复意见。</p> <p>3. 投资者不同意展期的处理办法                  若投资者明确回复不同意展期, 投资者有权在存续期届满日前(含届满日)到销售机构办理退出手续(管理人可以在公告中约定退出开放日, 为投资者办理退出手续); 若投资者未在存续期届满日前(含届满日)到销售机构办理退出手续, 则管理人有权决定强制将其份额退出或视为投资者同意管理人的展期安排。                  若投资者未回复意见或回复意见不明确的, 视为同意展期, 管理人不再另行通知确认。</p> <p>4. 展期的实现                  如果同意本集合计划展期的投资者人数不少于 2 人且符合其他展期条件的, 则集合计划存续期将依法展期;                  如果同意本集合计划展期的投资者人数低于 2 人或不符合其他展期条件的, 则集合计划到期终止, 将按照本合同等相关法律文件的规定办理计划到期终止和清算事宜。                  集合计划展期成立后 5 个工作日内, 管理人应当将展期情况报中国证券投资基金业协会备案, 并同时抄送管理人住所地中国证监会派出机构。</p>
<p>集合计划的终止和清算</p>	<p>(一) 集合计划的终止                  有下列情形之一的, 集合计划应当终止:</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1. 资产管理计划存续期届满且不展期;</li> <li>2. 经全体投资者、管理人和托管人协商一致决定终止的;</li> <li>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;</li> <li>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;</li> <li>5. 持续五个工作日投资者少于 2 人的;</li> <li>6. 未在证券投资基金业协会完成备案或不予备案的情形;</li> <li>7. 法律、行政法规、中国证监会规定及资产管理合同约定的其他情形。</li> </ol> <p>管理人应当自集合计划终止之日起五个工作日内报证券投资基金</p>

	<p>业协会备案，并抄报中国证监会相关派出机构，前述第 7 项约定的情形除外。</p> <p>(二) 集合计划的清算</p> <p>1. 自集合计划终止之日起 5 个工作日内，管理人可以组织成立集合计划清算小组按照监管机构的相关规定开始清算计划资产。集合计划财产清算小组成员由管理人和托管人组成，清算小组可以聘用必要的工作人员；</p> <p>2. 集合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。集合计划财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。</p> <p>3. 清算过程中的有关重大事项应当及时公布；</p> <p>4. 清算后的剩余财产，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占总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，中国证监会另有规定的除外。对于由计划交纳、中国登记结算有限公司收取的最低结算备付金和交易席位保证金，在中国登记结算有限公司对其进行调整交收日才能收回，结算备付金及交易保证金账户利息于实际结息时才能收回，届时，管理人将及时按照集合资产管理合同的约定，以货币资金的形式全部分配给投资者，并注销集合计划专用证券账户和资金账户。托管人按照规定注销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。清算结束后确认的费用均由管理人承担，清算结束后产生的利息归管理人所有；</p> <p>5. 清算结束后 5 个工作日内由管理人在管理人网站公布清算结果并向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；</p> <p>6. 若本集合计划在终止之日有未能流通变现的证券或出现其他因委托财产流动性受限等原因延期清算的，管理人应当及时向中国证监会相关派出机构和基金业协会报告。管理人可对此制定二次清算方案，该方案应经托管人认可，并通过管理人网站进行披露。管理人应根据二次清算方案的规定，对前述未能流通变现的证券在可流通变现后进行二次清算，并将变现后的资产按照投资者拥有份额的比例或本合同的约定或其他合理方式，以货币形式全部分配给投资者。</p> <p>7. 如本计划终止时有未能流通变现的证券，资产管理人与资产托管人继续按规定计提管理费、托管费等费用，其估值方法继续按《资产管理合同》的规定计算。清算小组在该证券可流通变现时应及时变现，在支付相关费用后按资产管理计划的投资者持有的计划份额比例进行再次分配并履行相应的告知义务，直至所有未能流通变现的证券全部清算完毕；</p> <p>8. 投资者自行承担收益的缴税事项；</p> <p>9. 集合计划财产清算账册及文件由管理人保存 20 年以上；</p> <p>10. 集合计划的清算安排应当符合相关法律、法规、政策的规定。</p>
<p>特别说明</p>	<p>《华金证券久盈集合资产管理计划说明书》是管理人对于本集合计划重要事项的说明，是本合同的重要附件，与本合同具有同等的法律效力。</p> <p>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或数据电文和销售机构出具的集合计划参与、退出业务受理有关凭证等为本合同</p>

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。

投资者（签字/盖章）：

签署日期： 年 月 日

（注：自然人客户，请签字；机构客户，请由法定代表人或其授权代理人签字并加盖机构公章）

管理人（盖章）：

签署日期： 2024年11月16日



## 附件三 划款指令模板

### 划款指令报表

华金证券股份有限公司\_\_\_\_专用表

编号:	
指令日期:	
资产托管部:	
敬请贵部根据以下提供的收款人名称、开户行、账号、到账日期和划款金额划款。	
到账日期:	
付款人:	
开户行:	
账号:	
收款人:	
开户行:	
账号:	
划款金额(小写):	
划款金额(大写):	
划款用途:	
备注:	
管理人签章:	托管人签章:
审批人:	审批人:
复核人:	复核人:
经办人:	经办人:

制表:

复核:

审核:

打印:

打印日期:

## 附件四 划款指令授权书

### 划款指令授权书

兴业银行股份有限公司：

根据业务需要，我公司决定授权李青为华金证券股份有限公司划款业务审批人，袁洁静、凌慧慧、程晓玲、葛雅丽、徐梦涵、吴善莲、郭瑞、刘旭为划款业务复核人及经办人，且经办人、复核人和审批人不为同一人。该授权适用于我公司托管在贵司的所有资管产品，自2022年 11 月 16 日起生效。核算业务专用章预留印鉴印模详见附件。

相关人员联系方式如下：

职责	姓名	座机	传真	邮箱
划款业务审批人	李青	021-20655701	021-20655704	liqing@huajinsc.cn
划款业务经办及复核	袁洁静	021-20655711		yuanjiejing@huajinsc.cn
划款业务经办及复核	凌慧慧	021-20655706		linghuihui@huajinsc.cn
划款业务经办及复核	程晓玲	021-20655760		chengxiaoling@huajinsc.cn
划款业务经办及复核	葛雅丽	021-20655719		geyali@huajinsc.cn
划款业务经办及复核	徐梦涵	021-20655705		xumenghan@huajinsc.cn
划款业务经办及复核	吴善莲	021-20655741		wushanlian@huajinsc.cn
划款业务经办及复核	郭瑞	021-20655541		guoruil@huajinsc.cn
划款业务经办及复核	刘旭	021-20377021		liuxu1@huajinsc.cn










2022



华金证券股份有限公司往来专用章印鉴

启用日期：2022年11月16日

核算业务专用章	预留印鉴
	

职责	姓名	预留印鉴
业务审批人	李青	
经办及复核	袁洁静	
	凌慧慧	
	程晓玲	
	葛雅丽	
	徐梦涵	
	吴善莲	
	郭瑞	
	刘旭	

华金证券股份有限公司（公章）

