

# 第一创业智选 FOF1 号集合资产管理计划 资产管理合同

合同编号：(JH) YCZHIX-GTJA-HT2020 第 1 号

管理人：第一创业证券股份有限公司

托管人：国泰君安证券股份有限公司

二〇二二年七月

## 目 录

一、前言 .....	4
二、释义 .....	4
三、承诺与声明 .....	8
四、当事人及权利义务 .....	10
五、资产管理计划的基本情况 .....	15
六、资产管理计划的募集 .....	17
七、资产管理计划的成立与备案 .....	19
八、资产管理计划的参与、退出与转让 .....	20
九、份额持有人大会及日常机构 .....	26
十、资产管理计划份额的登记 .....	26
十一、资产管理计划的投资 .....	26
十二、投资顾问 .....	32
十三、分级安排 .....	33
十四、利益冲突及关联交易 .....	33
十五、投资经理的指定与变更 .....	34
十六、资产管理计划的财产 .....	35
十七、投资指令的发送、确认和执行 .....	36
十八、交易及交收清算安排 .....	39
十九、越权交易的界定 .....	40
二十、资产管理计划财产的估值和会计核算 .....	42
二十一、资产管理计划的费用与税收 .....	47
二十二、资产管理计划的收益分配 .....	49
二十三、信息披露与报告 .....	50
二十四、风险揭示 .....	53
二十五、资产管理合同的变更、终止与财产清算 .....	62
二十六、违约责任 .....	67
二十七、争议的处理 .....	69
二十八、资产管理合同的效力 .....	69
二十九、其他事项 .....	70

**特别约定：**本《第一创业智选 FOF1 号集合资产管理计划资产管理合同》可以电子签名或者纸质合同手写签名、盖章方式签订，管理人、托管人作为本合同签署方，已接受本合同项下的全部条款；委托人（即第一创业智选 FOF1 号集合资产管理计划的投资者）作为本合同一方，以电子签名或纸质合同手写签名、盖章方式签署本合同即表明委托人完全接受本合同项下的全部条款，同时本合同成立。

委托人、管理人、托管人同意遵守《电子签名法》的有关规定，三方一致同意委托人自签署《电子签名约定书》之日起，委托人以电子签名方式接受电子签名合同（即本合同、集合计划说明书）、风险揭示书或其他文书的，视为签署本合同、集合计划说明书、风险揭示书或其他文书，与在纸质合同、纸质风险揭示书或其他文书上手写签名或者盖章具有同等法律效力，无须另行签署纸质合同、纸质风险揭示书或其他文书。管理人同意向托管人提供中国证券登记结算有限责任公司电子合同签署有关委托人信息，供托管人完成电子合同签署的相关流程。

## 一、前言

### （一）订立本合同的目的、依据和原则

1、订立本《第一创业智选 FOF1 号集合资产管理计划资产管理合同》（以下简称“集合资产管理合同”、“资产管理合同”或“本合同”）的目的是为了明确委托人、管理人和托管人在集合资产管理业务过程中的权利、义务及职责，确保第一创业智选 FOF1 号集合资产管理计划（以下简称“集合资产管理计划”、“资产管理计划”、“集合计划”或“本计划”）财产的安全，保护当事人各方的合法权益，本合同是约定委托人、管理人和托管人基本权利义务的法律文件。

2、订立本合同的依据是《中华人民共和国合同法》（以下简称“《合同法》”）、《中华人民共和国证券法》（以下简称“《证券法》”）、《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》（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》”）、《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》”）、《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“《合同指引》”）等法律、行政法规以及中国人民银行、中国证监会和中国证券投资基金业协会（以下简称“基金业协会”）的有关规定。

3、订立本合同的原则是平等自愿、诚实信用、充分保护本合同各方当事人的合法权益。

（二）对于本计划的设立、变更、展期、终止、清算等安排，管理人将按照中国证监会和基金业协会的要求向基金业协会备案并抄报管理人住所地中国证监会派出机构。

（三）基金业协会接受本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，除非文义另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

1、集合资产管理计划、资产管理计划、集合计划、本计划：指第一创业智选 FOF1 号集合资产管理计划；

2、集合计划说明书、说明书：指《第一创业智选 FOF1 号集合资产管理计划说明书》及对说明书的任何有效的修订和补充；

3、集合资产管理合同、资产管理合同、本合同：指《第一创业智选 FOF1 号集合资产管



理计划资产管理合同》及对该合同的任何有效的修订和补充；

4、托管协议：指《第一创业证券-国泰君安证券关于指定集合资产管理计划之托管协议（托管人结算模式）》及对该协议的任何有效的修订和补充；

5、风险揭示书：指《第一创业智选 FOF1 号集合资产管理计划风险揭示书》及对该风险揭示书的任何有效的修订和补充；

6、《管理办法》：指 2018 年 10 月 22 日中国证监会发布并施行的《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》及其不时做出的修订和补充；

7、《运作管理规定》：指 2018 年 10 月 22 日中国证监会发布并施行的《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》及其不时做出的修订和补充；

8、《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并施行的《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》及其不时做出的修订和补充；

9、中国证监会、证监会：指中国证券监督管理委员会；

10、集合资产管理合同当事人：指受集合资产管理合同约束，根据集合资产管理合同享有权利并承担义务的集合计划管理人、托管人和委托人；

11、集合计划管理人、管理人：指第一创业证券股份有限公司，也简称为“第一创业证券”、“第一创业”；

12、集合计划托管人、托管人：指国泰君安证券股份有限公司，也简称为“国泰君安证券”；

13、销售机构：指第一创业证券股份有限公司，及其他符合相应资格条件的、经管理人委托的、代理推广本集合资产管理计划的机构；

14、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第一创业证券股份有限公司；

15、集合计划委托人、委托人：指依据集合资产管理合同和集合计划说明书参与本计划并符合《运作管理规定》等监管规则要求的合格投资者；

16、合格投资者：指具备相应风险识别能力和风险承担能力，投资于单只资产管理产品不低于一定金额且符合下列条件的自然人、法人或者其他组织：

（一）具有 2 年以上投资经历，且满足下列三项条件之一的自然人：家庭金融净资产不低于 300 万元，家庭金融资产不低于 500 万元，或者近 3 年本人年均收入不低于 40 万元；

（二）最近 1 年末净资产不低于 1000 万元的法人单位；

(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;

(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;

(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);

(六)中国证监会视为合格投资者的其他情形。

上述家庭金融总资产,是指全体家庭成员共同共有的全部金融资产,包括银行存款、股票、债券、基金份额、资产管理计划、银行理财产品、信托计划、保险产品、期货及其他衍生产品等。家庭金融净资产是指家庭金融总资产减去全体家庭成员的全部负债;

17、份额持有人、持有人:指通过签订本合同而依法取得和持有本计划份额的委托人;

18、集合计划成立日:指本计划经过推广达到集合计划说明书和本合同约定的成立条件后,管理人公告本计划成立的日期;

19、初始募集期:指自本计划启动募集之日起不超过60日的期间,具体募集期间以本计划推广公告为准;

20、开放期:指委托人可以办理本计划参与和/或退出等业务的工作日;

21、封闭期:指本计划成立后的封闭时间段,封闭期内不办理参与、退出业务;

22、存续期:指自本计划成立并存续的期间,本计划的管理期限为10年,从本计划成立日起算;

23、工作日、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;

24、T日:指办理本计划业务申请的工作日;

25、T+n日(n指任意正整数):指T日后的第n个工作日;

26、天:指自然日;

27、分红权益登记日:指确认在注册登记机构登记在册的委托人享有某次分红收益分配的日期;

28、会计年度:指公历年度的1月1日至12月31日;

29、参与:指投资者申请购买本计划份额的行为;

30、首次参与:指投资者在参与之前未持有过本计划的情形;

31、追加参与:指除首次参与外的其他参与情形;

32、退出：指委托人按集合资产管理合同约定的条件要求收回全部或部分委托资产的行为；

33、集合计划收益：指本计划投资所得红利、股息、债券利息、基金红利、买卖证券价差、银行存款利息及其他合法收入；

34、集合计划份额、计划份额、份额：指集合计划的最小单位；

35、元：指人民币元；

36、计划单位面值、单位面值：人民币 1.00 元；

37、集合计划资产总值、计划资产总值：指本计划所投资各类有价证券、银行存款本息、本计划各项应收款以及其他资产所形成的价值总和；

38、集合计划资产净值、计划资产净值：指集合计划资产总值减去负债后的净资产值；

39、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；

40、集合计划单位累计净值、累计净值：指集合计划单位净值与集合计划份额累计分红之和；

41、集合计划资产估值：指计算评估本计划资产和负债的价值，以确定本计划资产净值的过程；

42、不可抗力：不可抗力是指任何不能预见、不能避免、不能克服的客观事件或因素，包括但不限于：相关法律法规、监管政策、自律规则的变更；国际、国内金融市场风险事故的发生；战争或动乱、自然灾害、公众通讯设备故障、电力中断、互联网故障等；

43、关联方关系：集合资产管理合同和说明书所指关联方关系的含义与《企业会计准则第 36 号——关联方披露》中的关联方关系的含义相同；

44、管理人指定网站、管理人网站：指 <http://www.firstcapital.com.cn>，管理人指定网站变更时以管理人公告为准；

45、运营服务机构：接受管理人委托，根据与其签订的服务协议中约定的服务范围，为本计划提供估值核算等服务的机构，本计划的运营服务机构为国泰君安证券股份有限公司。运营服务机构已完成在中国基金业协会的备案，编号为 A00005；

46、流动性受限资产：指由于法律法规、监管、合同或者操作障碍等原因无法以合理价格予以变现的资产，包括到期日在 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）等资产。

47、资产管理产品：指《指导意见》规定的资产管理产品，包括但不限于人民币或外币



形式的银行非保本理财产品，资金信托，证券公司、证券公司子公司、基金管理公司、基金管理子公司、期货公司、期货公司子公司、保险资产管理机构、金融资产投资公司发行的资产管理产品等；

48、虚拟单位净值：指本计划所投资的资产管理计划、私募基金等场外资产管理产品类别的份额净值扣除估值当日预计内含的业绩报酬后的份额净值。

### 三、承诺与声明

#### （一）管理人的承诺与声明

1、管理人是依法设立的证券公司，并经中国证监会批准，具有从事客户资产管理业务的资格。

2、管理人承诺已在签订本合同前充分向委托人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；已经了解委托人的风险偏好、风险认知能力和承受能力，对委托人的财务状况进行了充分评估；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。

3、管理人保证根据本合同所提供的资料和信息真实、准确、完整、合法。如该资料、报告是依据从托管人、委托人或第三方处获得的数据而编制的，则管理人保证编制过程的完整、真实、合法，没有任何重大遗漏或误导。

4、管理人声明不接受委托人、交易对手方或其他第三方的口头承诺或与委托人、交易对手或其他第三方私下签订补充协议。

#### （二）托管人的承诺与声明

1、托管人具有合法的从事基金托管业务的资格。

2、托管人承诺按照《基金法》恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则安全保管委托财产，履行信义义务以及本合同约定的其他义务；根据法律法规、中国证监会及基金业协会的规定和本合同的约定，对管理人的投资或清算指令等进行监督；

3、托管人保证根据本合同所提供的资料和信息真实、准确、完整、合法，如该资料、报告是依据从管理人、委托人或第三方处获得的数据而编制的，则托管人保证编制过程的完整、真实、合法，没有任何重大遗漏或误导。

#### （三）委托人的承诺与声明

1、委托人声明委托资产为其拥有合法处分权的资产，保证委托资产的来源及用途符合

国家有关规定，保证有完全及合法的授权管理人和托管人进行委托资产的投资管理和托管业务，保证没有任何其他限制性条件妨碍管理人和托管人对该委托资产行使相关权利且该权利不会为任何其他第三方所质疑。

2、委托人承诺未使用贷款、发行债券等筹集的非自有资金投资本计划，委托人不是资产管理计划或者其他资产管理产品。

3、委托人承诺签署和履行本合同系其真实意思表示，已经按照其章程或者其它内部管理文件的要求取得合法、有效的授权，且不会违反对其有约束力的任何合同和其他法律文件；委托人已经取得签订和履行本合同所需的一切有关批准、许可、备案或者登记，投资事项符合法律法规的规定及其业务决策程序的要求。

4、委托人承诺符合《运作管理规定》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。

5、委托人承诺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的集合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本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。委托人承认，管理人、托管人未对委托财产的本金不受损失以及收益状况作出任何承诺或担保。

6、委托人承诺知悉和了解《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》、《金融机构反洗钱规定》等反洗钱相关法律法规的规定，将严格遵守上述规定；承诺其资金来源不属于违法犯罪所得及其收益；承诺其资金来源和去向不涉及洗钱、恐怖融资和逃税等行为；承诺出示真实有效的身份证件或者其他身份证明文件，提供真实有效的业务性质与股权或者控制权结构、受益所有人信息等资料；承诺积极履行反洗钱职责，不借助本计划进行洗钱等违法犯罪活动。

7、委托人确认，委托人于此作出的声明和承诺是真实、准确和完整的，不存在任何隐瞒、欺诈或重大遗漏，并应自行承担因违反本声明和承诺给本人的委托财产造成的损失，若给管理人或本计划财产造成损失的，还应向管理人和本计划财产承担全面、及时、恰当的赔偿责任。



#### 四、当事人及权利义务

##### (一) 委托人

个人填写：

姓名：                    证件类型：                    证件号码：

住所：

通讯地址：  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/负责人：

住所：

通讯地址：                    邮政编码：

代理人姓名：                    证件类型：                    证件号码：

联系电话：                    电子信箱：

其他：

##### (二) 管理人

机构名称：第一创业证券股份有限公司

法定代表人：刘学民

住所地：深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 20 楼

通讯地址：深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 3B 层

邮政编码：518046

联系人：邹乐凯

联系电话：0755-23838270

##### (三) 托管人

机构名称：国泰君安证券股份有限公司

法定代表人/负责人：贺青

住所地：中国（上海）自由贸易试验区商城路 618 号

通讯地址：上海市静安区新闻路 669 号 19 楼

邮政编码：

联系人：丛艳

联系电话：021-38677336

（四）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。

（五）委托人的权利与义务

#### 1、委托人的权利

- （1）分享本计划财产收益；
- （2）取得分配清算后的剩余本计划财产；
- （3）按照本合同的约定参与、退出和转让本计划份额；
- （4）按照法律法规及本合同约定的时间和方式获得本计划的信息披露资料；
- （5）监督管理人、托管人履行投资管理及托管义务的情况；
- （6）法律法规、中国证监会及基金业协会规定的和本合同约定的其他权利。

#### 2、委托人的义务

- （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；
- （2）接受合格投资者认定程序，如实填写风险识别能力和风险承受能力问卷，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本计划的，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本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、税费等合理费用及因本计划财产运作产生的其他费用；
- （6）在持有的本计划份额范围内，承担本计划亏损或者终止的有限责任；
- （7）向管理人或本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）不得违反本合同的约定干涉管理人的投资行为，并接受管理人的投资结果，自行承担投资损益；
- （9）不得从事任何有损本计划及其委托人、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，不得泄露本计划的投资计划、投资意向等；不得利用本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) 不得违规转让其所持有的本计划份额；

(12) 委托人应当以自己的名义开立资金账户，办理指定手续，用于办理委托划款、红利款项、退出款项以及清算款项的收取，在本合同有效期内，不得撤销该账户，并妥善保管账户资料；

(13) 除非在本合同约定的退出开放期或终止日，不得要求提前终止本资产管理关系；

(14) 本计划财产及委托人需承担管理人代表本计划及委托人处理本计划涉及诉讼、仲裁或争议解决的事项所产生的费用及支出，包括但不限于律师费、仲裁费、诉讼费等，以实际发生金额为准；

(15) 法律法规、中国证监会及基金业协会规定和本合同约定的其他义务。

#### (六) 管理人的权利与义务

##### 1、管理人的权利

(1) 按照本合同约定，独立管理和运用本计划财产；

(2) 按照本合同约定，及时、足额获得管理人管理费用及业绩报酬（如有）；

(3) 按照有关规定和本合同约定行使因本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，对于托管人违反本合同或有关法律法规规定、对本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，并报告管理人住所地中国证监会派出机构及基金业协会；

(5) 自行提供或者委托经中国证监会、基金业协会认定的服务机构为本计划提供募集、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，代表本计划行使投资过程中产生的权属登记等权利；

(7) 按照法律、行政法规和中国证监会的有关规定，要求委托人提供与其身份、财产与收入状况、证券投资经验、风险认知与承受能力和投资偏好等相关的信息和资料；

(8) 发现委托人或委托资产涉嫌洗钱的，有权按照《中华人民共和国反洗钱法》和相关规定履行报告义务；

(9) 按照本合同的约定，停止办理本计划份额的参与，暂停办理本计划的退出事宜；

(10) 按照本合同的约定，终止本计划的运作；

(11) 本计划财产受到损害时，代表本计划及委托人向有关责任人追究法律责任（包括但不限于主动追索、仲裁、诉讼、财产保全、强制执行、向侦查机关报案等方式），相应所产生的费用及支出由本计划财产及委托人承担，前述费用及支出包括但不限于律师费、仲裁费、诉讼费等，以实际发生金额为准；

(12) 本计划投资除公募证券投资基金以外的其他资产管理产品，委托人为资产管理产品的，或管理人合理理由认为委托人认购本计划将违反《管理办法》的，管理人有权拒绝该等委托人认购本计划，并有权对其认购申请做确认失败处理而无需承担任何责任；

(13) 法律法规、中国证监会、基金业协会规定的及本合同约定的其他权利。

## 2、管理人的义务

(1) 依法办理本计划的销售、登记、备案事宜；

(2) 按照中国人民银行、证监会、基金业协会等监管机构和自律组织的要求报送本计划产品运作信息；

(3) 按照诚实信用、勤勉尽责的原则履行受托人义务，管理和运用本计划财产；

(4) 对委托人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，向委托人充分揭示相关风险；

(6) 配备足够的具有专业能力的人员进行投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作本计划财产；

(7) 建立健全内部管理制度，保证本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本计划财产；

(9) 保守商业秘密，不得泄露本计划的投资计划、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) 按照本合同约定接受委托人和托管人的监督；

(13) 以管理人的名义，代表委托人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；

(14) 按照本合同约定计算并向委托人报告本计划份额净值；

(15) 确定本计划份额参与、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本合同的约定；

(16) 按照本合同约定负责本计划会计核算并编制财务会计报告；



- (17) 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；
- (18) 按照本合同的约定确定收益分配方案，及时向委托人分配收益；
- (19) 按照法律法规与本合同的约定，编制向委托人披露的本计划季度、年度等定期报告，向基金业协会备案，并抄报管理人住所地中国证监会派出机构；
- (20) 办理与受托资产管理业务活动有关的信息披露事项；
- (21) 建立并保存委托人名单；
- (22) 组织并参加本计划财产清算小组，参与本计划财产的保管、清理、估价、变现和分配；
- (23) 按照法律法规和中国证监会的规定，保存本计划的会计账册，妥善保存有关的合同、协议、交易记录等文件、资料和数据，保存期限自本计划终止之日起不得少于 20 年；
- (24) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告管理人住所地中国证监会派出机构、基金业协会并通知托管人和委托人；
- (25) 本计划投资除公募证券投资基金以外的其他资产管理产品的，管理人应审查该等资产管理产品不得再投资于《管理办法》第三十七条第（五）项规定资产；
- (26) 法律法规、中国证监会及基金业协会规定的和本合同约定的其他义务。

#### (七) 托管人的权利与义务

##### 1、托管人的权利

- (1) 按照本合同约定，依法保管本计划财产；
- (2) 按照本合同约定，及时、足额获得本计划托管费用；
- (3) 照相关法律法规的规定和本合同约定，根据《托管人投资监督事项表》行使投资监督权利。发现管理人的投资运作违反法律、行政法规规定或本合同《托管人投资监督事项表》的约定时，有权拒绝执行投资指令或进行事后提示并要求管理人改正；管理人未能改正或者造成委托财产损失的，有权报告监管机构；
- (4) 法律法规、中国证监会及基金业协会规定的和本合同约定的其他权利。

##### 2、托管人的义务

- (1) 按照资产管理合同约定安全保管本计划财产；
- (2) 除依据法律法规规定和本合同的约定外，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本计划财产；
- (3) 对所托管的不同财产分别设置账户，确保本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计划财产及其他当事人利益的



活动；

(5) 按规定开立和注销本计划的托管账户及其他投资所需账户；

(6) 复核本计划资产净值和份额净值；

(7) 办理与本计划托管业务有关的信息披露事项；

(8) 根据相关法律法规和本合同约定，复核管理人编制的本计划财产的定期报告中的财务数据，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，抄报管理人所在地中国证监会派出机构；

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

(11) 保守商业秘密，除法律法规、本合同及其他有关规定另有要求外，不得向他人泄露；

(12) 根据法律法规和中国证监会的规定保存本计划的会计账册，妥善保存有关的合同、协议、交易记录等文件资料，保存期限自本计划终止之日起不得少于 20 年；

(13) 监督管理人的投资运作，发现管理人的投资或清算指令违反法律、行政法规、中国证监会的规定或本合同《托管人投资监督事项表》约定的，应当拒绝执行，立即通知管理人并有权及时报告管理人住所地中国证监会派出机构和基金业协会；

(14) 国家有关法律法规、监管机构规定的和本合同约定的其他义务。

## 五、资产管理计划的基本情况

(一) 资产管理计划的名称

第一创业智选 FOF1 号集合资产管理计划。

(二) 资产管理计划的类别

混合类集合资产管理计划。

(三) 资产管理计划的运作方式

开放式。

(四) 本计划为基金中基金（FOF）型集合资产管理计划。

(五) 资产管理计划的投资目标、主要投资方向、投资比例

1、本计划的投资目标为：在有效控制投资风险的前提下，争取本计划财产的保值增值，为委托人谋求稳定的投资回报。

2、本计划的投资方向为：

(1) 金融品类资产：公募证券投资基金、证券公司集合资产管理计划、基金公司及基金公司子公司集合资产管理计划、期货公司及期货公司子公司集合资产管理计划和在基金业协会备案的私募基金管理人发行的私募证券投资基金、货币市场基金、银行非保本理财产品、及其他金融监管部门批准或备案发行的资产管理产品。

(2) 现金类资产：现金、各类银行存款（包括银行活期存款、银行同业存款、银行定期存款和银行协议存款等各类存款，不含结构性存款）、货币市场基金。

(3) 衍生品类资产：沪深交易所及期货交易所上市的期权及期货。

3、本计划的投资比例为：本计划为混合类产品，投资于金融品类资产的比例不低于80%；直接或通过投向金融品类资产进行以下比例的资产配置：

(1) 固定收益类资产与现金类资产的投资比例为资产总值的 0-80%；

(2) 权益类资产的投资比例为资产总值的 0-80%；

(3) 商品及金融衍生品类资产的持仓合约价值不超过资产总值的 80%或衍生品账户权益不超过资产总值的 20%。

(六) 资产管理计划的产品风险等级

资产管理计划的风险收益特征及适合推广对象：本计划属于中高(R4)风险等级的产品，适合且仅能向风险承受能力为C4（积极型）级及以上的合格投资者销售。

(七) 资产管理计划的存续期限

本计划的管理期限为 10 年，从本计划成立日起算。在符合本合同约定的展期条件下可展期，但按照本合同约定出现本计划应当终止的情形时，本计划将提前终止并进行清算。

(八) 资产管理计划份额的初始募集面值

人民币 1.00 元。

(九) 资产管理计划的最低初始募集规模

本计划成立时计划财产的初始资产净值不得低于人民币 1000 万元，本计划初始募集期及存续期不设规模上限。

管理人有权根据实际情况调整初始募集期及存续期规模上限，并在管理人指定网站公告。

(十) 资产管理计划的分级安排

本计划是否根据风险收益特征进行分级：否。

(十一) 资产管理计划的份额登记

第一创业证券股份有限公司。

## （十二）资产管理计划的运营服务机构

国泰君安证券股份有限公司

## （十三）预警止损机制

本计划以资产管理人与资产托管人核对一致的日终计划份额单位净值为基础设置预警线和止损线，管理人负责对本计划预警线和止损线进行监控和采取相关操作。当 R 日计划份额净值低于或等于预警线或止损线，资产托管人于 R 日日终计划份额单位净值核对一致后 2 个工作日（含）内以邮件或其他资产托管人与资产管理人共同认可的方式向资产管理人进行提示。具体安排如下：

1、本计划预警线为 0.8200 元。当本计划份额日终单位净值 $<0.8200$  元时（该交易日称为“R”日），则自 R+2 日起，管理人仅可卖出、赎回金融产品和进行现金类资产的投资，不得再进行买入或申（认）购的投资操作，直至本计划的份额单位净值恢复至 0.8200 元（含）及以上时，自下一个交易日起，方可恢复买入、申（认）购操作；

2、本计划止损线为 0.8000 元。本计划份额日终单位净值 $<0.8000$  元时（该交易日称为“R”），则自 R+2 日起，管理人应对本计划持有的全部非现金类资产进行不可逆的变现操作，直至计划资产全部变现为止。本计划资产全部变现的当日为本合同提前终止日。

## 六、资产管理计划的募集

### （一）资产管理计划的募集期限、募集对象、销售机构和募集方式

#### 1、募集期限

本计划的初始募集期为自本计划启动募集之日起不超过 60 日的期间，具体募集期间以本计划推广公告为准；管理人有权根据本计划销售的实际情况延长（但最长不得超过 60 日）或缩短募集期限，此变更适用于所有销售机构，管理人延长或缩短募集期限的，将在管理人指定网站公告。

#### 2、募集对象

本计划仅向符合《运作管理规定》规定的合格投资者销售。合格投资者人数累计不得超过 200 人。

委托人为金融产品的，或管理人有合理理由认为委托人认购本计划将违反《管理办法》的，管理人有权拒绝该等委托人认购本计划，并有权对其认购申请做确认失败处理而无需承担任何责任。



### 3、销售机构

第一创业证券股份有限公司及其他符合相应资格条件的、经管理人委托的、代理推广本计划的机构。

### 4、募集方式

销售机构应当根据了解的客户情况,推荐与客户风险承受能力相匹配的集合资产管理计划,引导客户审慎做出投资决定,不得误导投资者购买与其风险承受能力不相符合的产品,不得向风险识别能力和风险承受能力低于产品风险等级的投资者销售集合资产管理计划。

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、分析会等方式,布告、传单、短信、微信、博客和电子邮件等载体向不特定对象宣传推介,但管理人、销售机构通过设置特定对象确定程序的官网、客户端等互联网媒介向已注册特定对象进行宣传推介的除外,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、夸大预期收益和商业贿赂等不正当手段推广集合资产管理计划。

#### (二) 资产管理计划的认购事项

##### 1、认购费用及认购份额的计算

###### (1) 认购费率

本计划无认购费,即认购费率为0。

###### (2) 认购份额的计算方法

认购份额 = (认购金额 + 应计利息) ÷ 1

注:本计划份额计算时采用四舍五入,保留至0.01份,由此产生的误差计入本计划财产;多笔参与时,按上述公式进行逐笔计算。

##### 2、认购申请的确认

投资者按销售机构指定营业网点的具体安排,在规定的交易时间段内办理认购,投资者以书面签名或电子合同方式签署本合同后,方可通过销售机构的交易系统申请参与本计划。

销售机构受理认购申请并不代表投资者认购成功,而仅代表销售机构确实收到了认购申请,认购申请受理完成后,投资者不得撤销认购申请。认购申请采取“时间优先、金额优先、申请单号优先”原则进行确认,认购申请是否成功且有效应以注册登记机构的确认并且本计划成立为准。委托人可于本计划成立后2个工作日后到各销售机构查询认购确认情况。

##### 3、初始认购资金的管理及利息处理方式

销售机构应当将本计划初始募集期间投资者的资金存入募集账户,在本计划募集期限结

束前，任何机构和个人不得动用。本计划成立前，认购款在募集账户产生的利息将折算为本计划份额归委托人所有，其中利息金额以注册登记机构的记录为准。

### （三）资产管理计划的最低认购金额、支付方式

（1）投资者首次认购本计划的最低认购金额为人民币 400,000 元（不含认购费），超额部分不设金额级差，管理人可以根据法律法规的规定及本计划运作的实际情况设置和调整最低认购金额（但最低不得低于人民币 40 万元），并提前披露。投资者可以多次参与本计划，投资者多次参与本计划的每次最低参与金额为人民币 1 万元，超过部分不设金额级差。

（2）投资者应开设销售机构认可的交易账户，并在交易账户备足认购的货币资金；若交易账户内资金不足，销售机构将不受理该笔认购申请。

### （四）资产管理计划的募集账户

管理人应当将本计划募集期间投资者的资金存放在募集结算专用账户（募集账户），管理人将在本计划推广公告中披露本计划募集账户信息。

（五）委托人的认购参与资金（不含认购费用）加计其在初始募集期间产生的利息将折算为本计划份额归委托人所有，利息金额以本计划注册登记机构的记录为准。

## 七、资产管理计划的成立与备案

### （一）资产管理计划成立的条件和日期

初始募集期限届满时，本计划的初始募集规模不低于人民币 1000 万元且其委托人的人数为 2 人至 200 人（含管理人自有资金参与份额），募集过程符合法律法规和中国证监会的规定，并经管理人聘请的具有证券相关业务资格的会计师事务所对本计划进行验资并出具验资报告后，管理人公告本计划成立。

### （二）资产管理计划设立失败

初始募集期限届满，在本计划初始募集规模低于人民币 1000 万元或委托人的人数少于 2 人条件下，本计划设立失败。本计划设立失败的，按照下述“（五）资产管理计划未达成成立条件的处理方式”的约定处理。

### （三）资产管理计划的成立和备案

本计划的募集金额缴足之日起 10 个工作日内，管理人应当委托具有证券相关业务资格的会计师事务所进行验资并出具验资报告，并在取得验资报告后公告本计划成立。

管理人应当在本计划成立之日起 5 个工作日内将本合同、投资者名单与认购金额、验资报告等材料向基金业协会备案，同时抄报管理人住所地中国证监会派出机构。



本计划成立前，任何机构和个人不得动用投资者参与资金。

(四) 本计划在成立后备案完成前，不得开展投资活动，但管理人以现金管理为目的，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、货币市场基金除外。

(五) 资产管理计划未达成立条件的处理方式

本计划初始募集期限届满，未达成立条件的，管理人应当：

- 1、以其固有财产承担本计划因募集行为而产生的债务和费用；
- 2、在募集期届满后 30 日内返还投资者已缴纳的款项，并加计银行同期活期存款利息。

## 八、资产管理计划的参与、退出与转让

(一) 资产管理计划的参与、退出

### 1、参与和退出的场所

本计划的参与和退出场所为管理人及代理销售机构（如有）的营业场所或按照管理人及代理销售机构（如有）提供的其他方式办理参与和退出。

### 2、参与和退出的开放日和时间

本计划自成立之日起每年 3 月、6 月、9 月与 12 月第三个周五（如遇非交易日则提前至前一个交易日）开放申购，每年 1 月与 7 月第一个周五（如遇非交易日则提前至前一个交易日）开放赎回，具体开放时间以管理人公告为准。在开放期内的工作日，委托人可办理参与和/或退出业务。

本计划主动投资于流动性受限资产的市值在开放退出期内合计不得超过本计划资产净值的 20%。流动性受限资产是指由于法律法规、监管、合同或者操作障碍等原因无法以合理价格予以变现的资产，包括到期日在 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）、资产支持证券（票据）、流动性受限的新股以及非公开发行股票、停牌股票、因发行人违约无法进行转让或交易的债券和非金融企业债务融资工具等资产。

### 3、临时开放期

因法律、法规、规章、中国证监会、基金业协会的规定、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或因本计划运作的实际情况需要变更合同及在发生其他必要情况时，管理人有权设定临时开放期，为委托人办理退出业务，临时开放期的具体安排以管理人公告为准，管理人需提前通知托管人及运营服务机构。

#### 4、参与和退出的方式、价格、程序及确认等

(1) “未知价”原则，即参与价格为注册登记机构受理参与申请日（T日）本计划的单位净值，退出价格为注册登记机构受理退出申请当日本计划单位净值；

(2) 本计划采用金额参与和份额退出的方式，即参与以金额申请，退出以份额申请；

(3) 参与和退出申请的确认：投资者按销售机构指定营业网点的具体安排，在规定的交易时间段内办理参与或退出，投资者以书面签名或电子合同方式签署本合同后，方可通过销售机构的交易系统申请参与本计划。销售机构受理参与或退出申请并不表示对该申请是否成功的确认，而仅表示销售机构确实收到了参与或退出申请。申请是否有效应以注册登记机构的确认为准；

对于开放日当日（T日）交易时间结束前受理的有效申购和赎回申请，在正常情况下，本计划注册登记机构在 T+3 个工作日内对该申请的有效性进行确认。委托人可在申请日后第 4 个工作日内至各销售网点查询确认情况；

对于委托人的参与申请，若参与申请全额确认后规模超过本计划规定的规模上限或超过本计划规定的人数上限时，管理人可暂停接受参与申请，对当日（T日）已提交的参与申请，注册登记系统根据“时间优先、金额优先、申请单号优先”的先后原则逐笔确认，即相同时间金额大者优先确认；相同金额申请单号小者优先确认。未确认部分的参与资金，由销售机构退还到委托人账户中。以上处理规则亦适用于初始募集期间超额募集的情况；

对于委托人的退出申请，管理人按照先进先出的原则予以确认，也即是按照委托人份额参与的先后次序进行顺序退出的方式确定退出份额并适用相应的退出费率；

(4) 参与和退出申请的款项支付：投资者应开设销售机构认可的交易账户，并在交易账户备足认购的货币资金；若交易账户内资金不足，销售机构将不受理该笔参与申请；

委托人退出申请确认成功后，管理人应按照本合同约定向委托人支付退出款项，退出款项于确认之日起 7 个工作日内从托管账户中划出。在发生巨额退出的情形时，款项的支付办法参照本合同的有关条款处理。如本计划出现暂停估值的情形时，管理人与托管人协商后，可以将划拨日期相应顺延。委托人申请退出份额数量超过委托人持有份额数量时，申请无效。

(5) 管理人可根据本计划运作的实际情况并不影响委托人实质利益的前提下调整上述原则。管理人必须在新规则开始实施前在管理人指定网站公告告知委托人。

#### 5、参与和退出的金额限制

投资者在本计划存续期内的参与开放期参与本计划的，如投资者在提交参与申请时未持有本计划份额的，则首次参与金额应不低于人民币 400,000 元（不含参与费），已持有本计

划份额的委托人在本计划存续期内的参与开放期追加参与本计划份的除外。投资者可以多次参与本计划，投资者多次参与本计划的每次最低参与金额为人民币 1 万元，超过部分不设金额级差。

当委托人持有的本计划份额资产净值高于人民币 400,000 元时，委托人可以在本计划的退出开放期内选择全部或者部分退出本计划，选择部分退出的，委托人在退出后持有的本计划份额资产净值不得低于人民币 400,000 元。当管理人发现委托人申请部分退出本计划将导致其在部分退出申请确认后持有的本计划份额净值低于人民币 400,000 元的，管理人有权适当减少该委托人的退出份额，以保证部分退出申请确认后该委托人持有的本计划份额资产净值不低于人民币 400,000 元。当委托人持有的本计划份额资产净值低于(含)人民币 400,000 元时，需要退出本计划的，委托人应当选择一次性全部退出本计划，否则管理人有权发起强制退出委托人持有的本计划全部份额。

如相关法律法规变更导致前述约定不再符合法律法规规定的，管理人有权根据变更后的法律法规要求，合理调整对参与金额和退出份额的数量限制，管理人必须在新规则开始实施前在管理人网站指定公告告知委托人。

## 6、参与和退出的费用

### (1) 参与费用

本计划无参与费，即参与费率为 0。

### (2) 退出费用

本计划退出费率如下：

	持有期 $\geq$ 365 天	持有期 $<$ 365 天
退出费率	0	1%

## 7、参与份额和退出金额的计算

### (1) 参与份额的计算

参与份额=参与金额 $\div$ 注册登记机构受理申请当日本计划的单位净值

注：本计划份额计算时采用四舍五入，保留至 0.01 份，由此产生的误差计入本计划财产；多笔参与时，按上述公式进行逐笔计算。

### (2) 退出金额的计算

退出金额=退出总额-实际退出费-管理人业绩报酬（如有）

退出总额=退出份额 $\times$ 注册登记机构受理申请当日本计划的单位净值



实际退出费=原始退出费-返回退出费

返回退出费=原始退出费×（管理人业绩报酬（如有）/单位净值）/确认份额

原始退出费=退出总额×退出费率

注：退出金额结果按照四舍五入方法，保留小数点后两位，多笔退出时，按上述公式进行逐笔计算。

#### 8、退出预约申请的提出

委托人在提交退出申请前，需提前 10 个工作日向管理人提出书面退出预约申请，未提交退出预约申请的，管理人有权拒绝其退出申请。

#### 9、巨额退出的认定和处理方式

##### （1）巨额退出的认定

单个开放日中，本计划净退出申请的份额（退出总份额扣除参与总份额后的余额）超过本计划上一日总份额的 20% 时，即认为本计划发生了巨额退出。

##### （2）巨额退出的处理方式

当出现巨额退出时，管理人可以根据本计划当时的资产组合状况决定全额退出、部分顺延退出。巨额退出的价格以注册登记机构受理退出申请当日的本计划单位净值为准。

本计划单位净值的计算精确到 0.0001 元，但在发生巨额退出的情形下，为避免委托人利益因份额净值的小数点保留精度受到重大影响，管理人可以通过设立巨额退出情形下的净值精度应急调整机制从而提高份额净值的精度。届时，管理人在与托管人协商一致的情况下，发布关于净值精度调整的公告。

全额退出：当管理人认为有能力支付委托人的退出申请时，按正常退出程序执行。

部分顺延退出：当本计划支付委托人的退出申请可能会对本计划的资产净值造成较大波动或造成本计划存在流动性困难时，管理人在当日正常接受的退出份额不低于上一日本计划总份额的 20% 的前提下，对其余退出申请延期办理。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份额；委托人可在申请退出时选择将当日未获受理部分予以撤销，如委托人不撤销未获处理部分，未受理部分自动延迟至下一个工作日办理。转入下一个工作日的退出申请不享有优先权，并以该工作日的本计划单位资产净值为依据计算退出金额，以此类推，直到全部退出为止。

##### （3）告知客户的方式

当本计划出现巨额退出并发生部分顺延退出的，管理人应及时在管理人网站上公告。

#### 10、连续巨额退出的认定和处理方式

### （1）连续巨额退出的认定

如果本计划连续两个开放日以上发生巨额退出，即认为发生了连续巨额退出。

### （2）连续巨额退出的处理方式

暂停退出：本计划发生连续巨额退出的，如本计划支付委托人的退出申请可能会对本计划的资产净值造成较大波动或造成本计划存在流动性困难的，管理人可以暂停接受退出申请；已经接受的退出申请可以延缓支付退出款项。暂停和延缓期限不得超过 20 个工作日。连续巨额退出的价格由注册登记机构受理申请当日的本计划单位净值决定。

### （3）告知客户的方式

当本计划出现连续巨额退出并发生暂停退出的，管理人应及时在管理人指定网站公告。

#### 11、单个委托人大额退出

本计划无单个委托人大额退出的设置。

#### 12、拒绝或暂停参与的情况及处理方式

如出现如下情形，管理人可以拒绝或暂停本计划的参与申请而无需承担任何责任：

- （1）不可抗力的原因导致本计划无法正常工作；
- （2）本计划出现或可能出现超额募集情况；
- （3）管理人、托管人或注册登记机构的技术保障或人员支持等不充分；
- （4）销售机构对委托人资金来源表示疑虑，委托人不能提供充分证明的；
- （5）管理人认为会有损于现有委托人利益；
- （6）证券交易所在交易时间非正常停市；
- （7）发生本合同规定的暂停本计划资产估值情况；
- （8）委托人为金融产品的，或管理人有合理理由认为委托人认购本计划将违反《管理办法》的；
- （9）法律法规规定或中国证监会认定的其它可暂停参与的情形。

#### 12、拒绝或暂停退出的情况及处理方式

发生下列情形时，管理人可以拒绝或暂停受理本计划的退出申请：

- （1）不可抗力的原因导致本计划无法正常工作；
- （2）发生本合同规定的暂停本计划资产估值情况；
- （3）管理人认为接受某笔或某些退出申请可能会影响或损害现有委托人利益时；
- （4）因市场剧烈波动或者其他原因导致本计划的现金出现困难时，管理人可以暂停办

理本计划的退出；



(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中已载明且中国证监会无异议的特殊情形。

拒绝或暂停受理退出的方式包括：

管理人将在当日立即公告。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，其余部分在后续工作日予以兑付。同时，在出现上述连续巨额退出的情形时，对已接受的退出申请可延期支付退出款项，但不得超过正常支付时间 20 个工作日，并在管理人指定网站进行公告。

如果发生暂停退出，在暂停结束重新开放退出时，管理人将提前在管理人指定网站对重新开放退出进行公告。

发生本合同未予载明的事项，但管理人有正当理由认为需要暂停接受本计划退出申请的，应向委托人披露。

委托人认可上述关于退出的原则及处理方法，接受管理人依据法律法规及本合同的约定所做出的延期退出或暂停退出的决定。

## (二) 资产管理计划的份额转让

本计划存续期间，在各项条件均满足的情况下，委托人可以通过证券交易所等中国证监会认可的交易平台转让本计划份额，受让方必须是符合《运作管理规定》规定和本合同约定的合格投资者，份额转让应遵守相应的交易场所的相关规定及要求并按规定办理份额变更登记手续。

委托人与受让人应签署转让协议，并将该转让协议发送给管理人书面确认。受让方首次参与本计划，应先与管理人、托管人签订资产管理合同。

管理人可以视情况开放本计划的份额转让，管理人应在本计划开放份额转让前 5 个工作日通过网站公告，份额转让事宜以管理人公告为准。

## (三) 资产管理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，将一定数量的本计划份额按照一定的规则从某一委托人账户转移到另一委托人账户的行为。本计划注册登记机构只受理因继承、捐赠、司法执行、以及经注册登记机构认可的其他形式财产分割或转移引起的计划份额非交易过户。

办理非交易过户业务必须提供注册登记机构规定的资料，对于符合条件的非交易过户申请按注册登记机构的有关规定办理，申请人按照注册登记机构规定的标准缴纳过户费用。

#### （四）资产管理计划份额的冻结

本计划注册登记机构只受理国家有权机关依法要求的本计划份额冻结与解冻事项。

#### （五）管理人自有资金参与资产管理计划

管理人不得以自有资金参与本计划。

（六）管理人将按照法律法规及基金业协会的要求，定期将本计划投资者变更情况报送基金业协会。

### 九、份额持有人大会及日常机构

本计划不设置份额持有人大会及日常机构。

### 十、资产管理计划份额的登记

#### （一）资产管理计划的份额登记结算业务

本计划份额的登记结算业务指本计划的登记、存管、结算和交收业务，具体内容包括委托人账户管理、份额注册登记、结算及交易确认、资产分配、建立并保管本计划委托人资料表等。

（二）本计划的份额登记结算业务由管理人负责办理。

（三）本计划委托人同意管理人、份额登记机构或其他份额登记义务人将本计划委托人名称、身份信息以及本计划份额明细等数据备份至中国证监会认定的机构。

### 十一、资产管理计划的投资

#### （一）资产管理计划的投资目标

在有效控制和分散投资风险的前提下，争取本计划财产的保值增值，为委托人谋求稳定的投资回报。

#### （二）资产管理计划的投资范围及投资比例

##### 1、投资范围

（1）金融产品类资产：公募证券投资基金、证券公司集合资产管理计划、基金公司及其基金公司子公司集合资产管理计划、期货公司及期货公司子公司集合资产管理计划和在基金业协会备案的私募基金管理人发行的私募证券投资基金、货币市场基金、银行非保本理财产品及其他金融监管部门批准或备案发行的资产管理产品；

（2）现金类资产：现金、各类银行存款（包括银行活期存款、银行同业存款、银行定

期存款和银行协议存款等各类存款，不含结构性存款）、货币市场基金。

(3) 衍生品类资产：沪深交易所及期货交易所上市的期权及期货。

## 2、资产配置比例

本计划为混合类产品，投资于金融产品类资产的比例不低于 80%，直接或通过投向金融产品类资产进行以下比例的资产配置：

(1) 固定收益类资产与现金类资产的投资比例为资产总值的 0-80%；

(2) 权益类资产的投资比例为资产总值的 0-80%；

(3) 商品及金融衍生品类资产的持仓合约价值不超过资产总值的 80%或衍生品账户权益不超过资产总值的 20%。

本计划投资于上述资产管理产品的，计算本计划总资产时按照穿透原则合并计算所投资资产管理产品的总资产，且按照穿透原则合并计算的投资同一资产的比例以及投资同一或同类资产的金额需符合本计划资产配置比例的要求。本计划按照所投资资产管理产品披露投资组合的频率，并按照所投资资产管理产品的披露频率更新计算计划所投资资产的金额或比例。

(三) 如因证券期货市场波动、证券发行人合并、资产管理计划规模变动等管理人主观因素之外的因素，造成本计划投资比例不符合法律、行政法规和中国证监会规定的投资比例或者本合同约定的投资比例的，管理人应在流动性受限资产可出售、恢复交易或者具备交易条件的 15 个工作日内将投资比例调整至符合相关要求的范围内。确有特殊事由未能在前述约定时间内完成调整的，管理人应当及时向管理人住所地中国证监会派出机构和基金业协会报告。

### (四) FOF 产品所投资金融产品的选择标准

本集合计划根据宏观经济运行情况及投资风格表现制定资产配置策略，对全市场的子基金管理人进行深入的分析研究，将市场上投资管理能力强、投资风格清晰、投资收益稳定的子基金管理人作为标准，筛选并对子基金管理人实地尽调、业绩归因分析等多种方式评估及管理，本集合计划投资于上述子基金管理人成立的金融产品，其中选择投资的金融产品主要策略标准为股票多头策略、股票中性策略、CTA 策略、现金及准现金类资产投资策略。

(五) 资产管理计划的风险收益特征及适合推广对象：本计划属于中高（R4）风险等级的产品，适合且仅能向风险承受能力为 C4（积极型）级及以上的合格投资者销售。

### (六) 资产管理计划的业绩比较基准及确定依据

本计划无业绩比较基准。

### (七) 资产管理计划的投资策略



## 1、管理人的决策依据

本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，并以维护本计划委托人利益作为最高准则。具体决策依据包括：

(1) 《管理办法》、《运作管理规定》等有关法律法规及《集合资产管理合同》等法律文件；

(2) 宏观经济发展态势、微观经济运行环境和证券市场走势，为本计划投资决策的市场基础；

(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，是本计划维护委托人利益的重要保障。针对产品的特点，在衡量投资收益与风险之间的配比关系时，力争保护投资者的本金安全，在此基础上为投资者争取较高的收益。

## 2、管理人的决策程序

管理人资产管理业务投资决策体系由管理人资产管理业务委员会、资产管理业务部门、投资经理三级体系组成。

管理人资产管理业务委员会是管理人资产管理业务的最高决策机构，下设投资管理委员会负责确定以下事项：

(1) 在资产管理业务委员会授权范围内，对资产管理业务部门的投资品种、投资规模等进行授权；

(2) 审议资产管理业务部门超出授权限额但未超过监管规定限额的投资；

(3) 核准资产管理业务部门投资经理的履职资格；

(4) 讨论与决定其他涉及客户资产管理投资业务的重大事宜。

资产管理业务部门的主要职责是：

(1) 确定客户资产管理业务投资、研究工作的政策，约束客户资产投资管理的整体过程；

(2) 讨论、提名投资经理人选，并报公司资产管理业务委员会下设的投资管理委员会审批；

(3) 对投资经理进行适当的定级和授权；

(4) 审批超过投资经理授权权限但未超过投资管理委员会授权权限的投资事宜；

(5) 制定客户资产管理相关的具体投资研究交易制度；

(6) 建立和维护投资品池；

(7) 讨论与决定其他涉及客户资产管理业务的具体事宜。

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

### 3、管理人投资管理的方法和标准

#### 1、资产配置策略

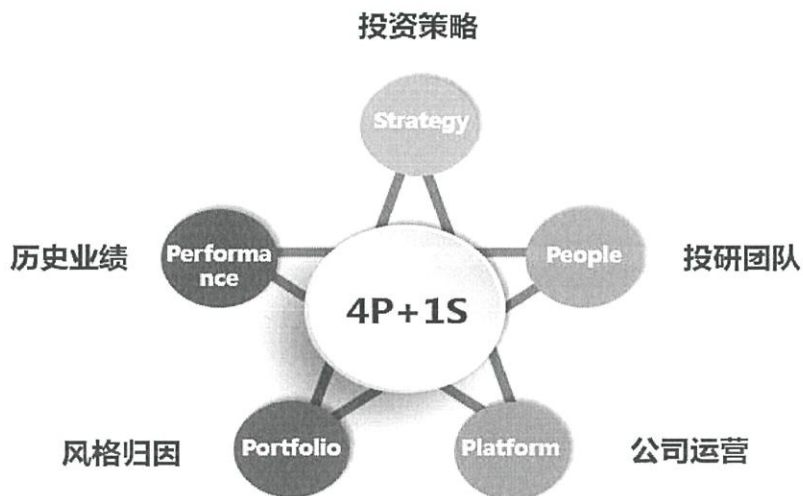
本集合计划在严格控制风险的基础上，通过对全球经济形势、中国经济发展（包括宏观经济运行周期、财政及货币政策、资金供需情况）、证券市场估值水平等的研判，动态调整计划大类资产的投资比例，力争为本计划资产获取稳健回报。

#### 2、FOF 投资管理策略

在 FOF 的投资管理模式下，第一创业证券作为管理人，负责根据宏观经济运行情况及投资风格表现制定资产配置策略，选聘市场上投资管理能力强、投资风格清晰、投资收益稳定的私募基金管理人，投资于上述私募基金管理人成立的私募证券投资基金，并对私募基金管理人的投资业绩进行评估及管理。

##### （1）子基金管理人筛选

对全市场的私募管理人进行分析研究，采用漏斗式，逐层深入的方式进行筛选，并创立了 4P+1S 管理人评级体系，通过多数据库、多资产类别、多策略覆盖方式对私募管理人进行全市场覆盖；通过多维度数量模型建立投顾基础池；通过实地尽调、业绩归因分析、策略甄别建立重点池；通过独特的 Alpha 因子、业绩可持续性分析、稳定架构等建立的核心池。



##### （2）子基金策略介绍

#### 1) 股票多头策略

通过挑选优秀的个股，以战胜市场指数为目标。

#### 2) 股票中性策略

股票中性策略采用股指期货空头、融券、期权等手段，与股票多头进行对冲，其目的是

获取与市场走势不相关的选股收益。股票中性策略运作会受股指期货的升贴水幅度、股票市场的波动率、股票市场的成交量等因素影响。

### 3) CTA 策略

CTA 策略是商品期货策略，主要包括商品趋势策略和商品套利策略，其中商品套利策略又分为跨期套利和跨品种套利。CTA 策略由于投资于商品市场，其收益走势主要受商品期货涨跌影响，与股票市场相关性较低，可以与股票投资形成较好的风险分散。

### 3、现金及准现金类资产投资策略

现金及准现金类资产包含银行存款、货币市场基金、现金（包括结算备付金）等。

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、银行存款的期限来确定现金类资产的配置，并定期对现金类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）资产管理计划的投资限制及禁止行为

##### 1、为维护委托人的合法权益，本计划的投资限制为：

（1）本计划投资于同一资产的资金，不得超过本计划资产净值的 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%，单一融资主体及其关联方的非标准化资产，视为同一资产合并计算。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。本计划属于基金中基金资产管理计划（FOF），基金中基金资产管理计划投资“定制”的子基金，并持有有一个或多个子基金产品的全部份额的，可豁免单只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%的组合投资要求；

（2）本计划总资产不得超过本计划资产净值的 200%，计算总资产时，应当按照穿透原则合并计算所投资资产管理产品的总资产，中国证监会另有规定的除外；

（3）本计划投资除公募证券投资基金以外的其他资产管理产品的，该等资产管理产品不得再投资除公募证券投资基金以外的其他资产管理产品，金融监管机构另有规定的除外；

（4）现行有关法律法规修订变化后，若上述投资限制与之产生抵触，应以有关法律法规规定为准，同时管理人应通过合同变更的形式明确相应修订内容；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，本计划可相应调整投资组合限制的规定。

##### 2、禁止行为

本计划的禁止行为包括：

（1）违规将本计划资产用于资金拆借、贷款、抵押融资或者对外担保等用途；



(2) 将本计划资产用于可能承担无限责任的投资；

(3) 向委托人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) 侵占、挪用本计划资产；

(5) 募集资金不入账或者其他任何形式的账外经营；

(6) 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，使用本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) 为违法或者规避监管的证券期货业务活动提供交易便利；

(10) 利用本计划进行商业贿赂；

(11) 利用本计划或者职务便利为委托人以外的第三方谋取不正当利益；

(12) 直接或者间接向委托人返还管理费；

(13) 不得投资于不符合国家产业政策、环境保护政策的项目（证券市场投资除外），

包括但不限于以下情形：

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

(14) 不得将本计划财产用于投资房地产价格上涨过快热点城市普通住宅地产项目或用于支付土地出让价款或补充流动资金；前述关于“房地产价格上涨过快热点城市”、“普通住宅地产项目”、“房地产开发企业”之认定，以基金业协会《证券期货经营机构私募资产管理计划备案管理规范第4号——私募资产管理计划投资房地产开发企业、项目》及其不时做出的修订和补充之规定为准。

(15) 本计划不得直接投资于商业银行信贷资产；

(16) 本计划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；

(17) 本计划不得直接或者间接投资法律法规和国家政策禁止进行债权或股权投资的行业和领域；

(18) 法律法规和中国证监会禁止的其他行为。

上述禁止行为由管理人监控。

(九) 资产管理计划的建仓期

管理人将在本计划成立之日起 6 个月内,使本计划的投资组合比例符合上述关于投资比例的约定。建仓期的投资活动,应当符合本合同约定的投向和本计划的风险收益特征。以现金管理为目的,投资于银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券、货币市场基金的除外。

(十)本计划投资的资产组合的流动性与本计划参与、退出的安排相匹配,具体为:本计划拟投资的私募证券投资基金均投资于资本市场,有较好流动性,私募基金设有提前预约赎回安排,在特殊或紧急情况下,私募基金支持临开放退出,确保本计划在开放退出期内可以满足以下投资安排:

1、本计划开放退出期内,其资产组合中 7 个工作日可变现资产的价值,不低于该计划资产净值的 10%,以满足开放退出期间的流动性要求。7 个工作日可变现资产,包括 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。

2、同时,本计划开放退出期内,管理人主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过本计划资产净值的 20%。

#### (十一) 预警止损机制

本计划以资产管理人与资产托管人核对一致的日终计划份额单位净值为基础设置预警线和止损线,管理人负责对本计划预警线和止损线进行监控和采取相关操作。当 R 日计划份额净值低于或等于预警线或止损线,资产托管人于 R 日日终计划份额单位净值核对一致后 2 个工作日(含)内以邮件或其他资产托管人与资产管理人共同认可的方式向资产管理人进行提示。具体安排如下:

1、本计划预警线为 0.8200 元。当本计划份额日终单位净值 $<0.8200$  元时(该交易日称为“R”日),则自 R+2 日起,管理人仅可卖出、赎回金融产品和进行现金类资产的投资,不得再进行买入或申(认)购的投资操作,直至本计划的份额单位净值恢复至 0.8200 元(含)及以上时,自下一个交易日起,方可恢复买入、申(认)购操作;

2、本计划止损线为 0.8000 元。本计划份额日终单位净值 $<0.8000$  元时(该交易日称为“R”),则自 R+2 日起,管理人应对本计划持有的全部非现金类资产进行不可逆的变现操作,直至计划资产全部变现为止。本计划资产全部变现的当日为本合同提前终止日。

## 十二、投资顾问

本计划是否聘请投资顾问:否。

### 十三、分级安排

本计划是否根据风险收益特征进行分级：否。

### 十四、利益冲突及关联交易

#### （一）资产管理计划存在或可能存在利益冲突的情形

本计划存在或可能存在如下利益冲突的情形：

1、若发生管理人开展的不同业务之间的敏感信息不当流动和使用，导致管理人其他业务与管理人资产管理业务可能存在利益冲突；

2、若发生不同投资经理管理的资产管理计划的持仓、交易等重大非公开信息的不当流动和使用，导致管理人管理的不同资产管理计划之间可能存在利益冲突；

3、若发生管理人从业人员利用知悉的敏感信息参与资产管理计划且未按规定进行申报和披露的，导致管理人从业人员与资产管理计划及委托人之间可能存在利益冲突；

4、其他可能存在的管理人、管理人从业人员与资产管理计划及管理人管理的不同资产管理计划之间可能存在的利益冲突情形。

#### （二）资产管理计划存在利益冲突的处理方式及披露

##### 1、利益冲突的处理方式

管理人制定了信息隔离墙管理办法及利益冲突管理办法，并在业务开展过程中严格执行业务隔离和利益冲突防范的机制，对利益冲突进行识别和管理，若发现存在利益冲突情形的，管理人将遵循如下原则及时予以处理，维护本计划及委托人的合法权益：

（1）在处理涉及到公司、从业人员与客户之间的利益冲突时，严格坚持客户利益至上的原则；

（2）在处理涉及到客户与客户之间的利益冲突时，严格坚持公平对待客户的原则。

##### 2、利益冲突的披露

对于实际发生的利益冲突情形，管理人将自发现之日起5个工作日内通过管理人网站公告将利益冲突的具体情形及管理人的处理安排等告知委托人。

#### （三）本计划投资管理人及管理人关联方所设立的资产管理产品的情况

本计划不投资管理人及管理人关联方所设立的资产管理产品。

#### （四）资产管理计划的关联交易

委托人在此同意并授权管理人可以将本计划财产投资于管理人、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承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易。

管理人应当遵循诚信、公平原则，以公平、合理的市场价格进行交易，防范利益冲突，禁止利益输送。管理人将本计划财产投资于管理人、托管人及前述机构的控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司发行的证券或承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应在交易完成后，书面告知委托人和托管人并向管理人住所地中国证监会派出机构和基金业协会报告。投资于证券期货的关联交易还应当及时向证券期货交易所报告。

除将本计划财产投资于管理人、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外，管理人不得将本计划财产直接或者通过投资其他资产管理计划等间接形式，为管理人、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提供或者变相提供融资。全部委托人均符合中国证监会规定的专业投资者（专业投资者不包含募集两个以上投资者资金设立的私募资产管理产品）且单个委托人投资金额不低于 1000 万元，并且事先取得委托人同意的除外。

## 十五、投资经理的指定与变更

### （一）投资经理的指定

1、本计划投资经理由管理人负责指定，投资经理不得同时办理客户资产管理业务和自营业务。

#### 2、本计划投资经理

本计划投资经理是景殿英。

本计划投资经理简介：景殿英，复旦大学理学博士，于 2010 年加入第一创业证券，现任资产管理部 FOF/MOM 投研部负责人，历任第一创业证券研究所研究组长、衍生产品部代理负责人等职，已取得证券投资基金从业资格。景殿英具有丰富的 FOF 投资研究经验，对资产与策略配置以及市场上的主流投资策略具有深入的研究和理解，涵盖股票主观、股票量化、CTA、债券、宏观对冲、套利、另类等多个领域。景殿英最近三年未被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚。

### （二）投资经理的变更

管理人可根据业务实际需要或者人员调整的安排变更投资经理，并在变更后及时公告告知委托人和托管人。管理人应当确保变更后的投资经理符合法律法规的规定及本合同的约定。

## 十六、资产管理计划的财产

### (一) 资产管理计划财产的保管与处分

1、本计划财产的债务由本计划财产本身承担责任，委托人以其出资为限对本计划财产的债务承担责任。

2、本计划财产独立于管理人和托管人的固有财产，并独立于管理人管理的和托管人托管的其他财产。管理人、托管人不得将本计划财产归入其固有财产。托管人仅对实际交付并控制下的计划资产承担保管职责。

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

4、管理人、托管人可以按照本合同的约定收取管理费、托管费以及本合同约定的其他费用。管理人、托管人以其固有财产承担法律责任，其债权人不得对本计划财产行使请求冻结、扣押和其他权利。管理人、托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，本计划财产不属于其清算财产。

5、本计划财产产生的债权不得与不属于本计划财产本身的债务相互抵消。非因本计划财产本身承担的债务，管理人、托管人不得主张其债权人对本计划财产强制执行。上述债权人对本计划财产主张权利时，管理人、托管人应明确告知本计划财产的独立性，采取合理措施并由管理人及时通知委托人。

6、托管人应安全、完整地保管本计划财产，未经本合同约定或管理人的指令，托管人不得自行运用、处分、分配本计划财产；管理人对本计划财产的管理和运用以及托管人对本计划财产的保管并非对委托人对本金或收益的保证或承诺。

7、管理人、托管人不得违反法律法规的规定和委托财产合同约定擅自将委托财产资产用于抵押、质押、担保或设定任何形式的优先权或其他第三方权利。

8、本计划存续期内，如相关监管机构或法规对委托财产的保管事宜另有规定的，从其规定。

9、对于委托财产的投资事宜，根据相关法律规定，可能出现管理人代表委托财产签订相关协议、开立相关账户及办理相关手续等情况，托管人对于因此而产生的风险不承担责任。

10、除本合同另有约定外，管理人、托管人因委托财产的管理、运用或者其他情形而取得的财产和收益，归委托财产。管理人保证投资本金及收益的回款账户为托管账户。

11、管理人、托管人对不同客户的委托财产独立建账、独立核算、分账管理。

12、对于因为委托财产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书面通知托管人，到账日委托财产资产没有到达托管账户的，由此给委托财产造成损失的，管理人应负责向有关当事人追偿委托财产的损失。

13、如发生有权机关对委托财产强制执行的情形，管理人应及时通知投资者。

#### （二）资产管理计划财产相关账户的开立和管理

托管人负责为本计划财产开立托管专户，保管本计划的银行存款。本计划的一切货币收支活动，包括但不限于投资、支付退出金额、支付计划收益、收取参与款，均需通过该账户进行。托管人可根据实际情况需要，为本计划财产开立资金清算辅助账户，以办理相关的资金汇划业务。管理人应当在开户过程中给予必要的配合，并提供所需资料。

托管人为本计划开立证券账户及投资所需的其他账户。证券账户名称及投资所需的其他账户名称应当符合证券、期货登记结算机构的有关规定，管理人应当在开户过程中给予必要的配合，并提供所需材料。

本计划证券账户、专用交易单元及投资所需的其他账户应由管理人报证券交易所、证券登记结算机构以及管理人住所地中国证监会派出机构及基金业协会备案。

### 十七、投资指令的发送、确认和执行

#### （一）交易清算授权

管理人应当事先向托管人提供加盖管理人公章和法定代表人（或授权代表）名章的书面授权通知书（下称“授权通知”），指定有权向托管人发送投资指令的被授权人员（下称“被授权人”），包括被授权人的名单、权限、预留印鉴、签字样本或签章，并注明相应的交易权限及授权通知生效日期。

授权通知应当以传真或双方认可的其他方式送达托管人，并在送达之日起 10 个工作日内以原件形式送达托管人。授权通知应当载明生效日期，生效日期不早于托管人收到传真件或扫描件之日。托管人收到的传真件或扫描件与原件所载不一致的，以传真件或扫描件为准，因托管人未收到上述传真件或扫描件或授权通知载明的生效日期早于托管人收到上述传真件或扫描件之日而造成的损失，托管人不承担责任。

#### （二）投资指令的内容

投资指令是管理人在管理本计划财产时，管理人向托管人发出的资金划拨及其他款项支付的指令。管理人发给托管人的指令应当写明款项事由、到账时间、金额、收款账户信息等，加盖预留印鉴并有被授权人签字或签章。

管理人通过托管人的电子指令平台提交场外投资指令的，应将填写完整的电子指令打印成纸质指令并加盖划款经办、复核、审核（如有）签章和预留印鉴，并扫描上传为电子指令的附件。管理人应确保电子指令与签章纸质指令扫描件的一致性，如不一致，托管人有权拒



绝执行或以电子指令为准执行。

当本计划进行场外投资，管理人要求托管人从托管资金账户向指定的收款账户划款时，管理人应向托管人提供以下资料：

- (1) 投资交易相关文件（当事人签署版）；
- (2) 收款账户证明文件；
- (3) 托管人认为必要的投资划款相关支持性文件。

管理人应确保所提供的上述文件合法、真实、完整和有效。交易文件应载明真实的资金来源为本计划，并明确上述投资到期或产品赎回后本金及收益将返回至本计划托管资金账户，如确有真实原因致使交易文件不能载明上述内容的，管理人应在上述投资到期或产品赎回/终止后将本金及收益返回至本计划托管资金账户。如果管理人无法提供上述交易文件的，托管人有权拒绝执行投资划款指令。管理人应确保上述交易文件的始终有效性、真实性、完整性、准确性。本计划投资的产品的管理人或投资顾问为管理人的，管理人承诺不进行任何利益输送的行为；在持有上述投资标的或产品期间，上述投资标的或产品的交易文件有任何变更的，管理人应负责审查同意该变更的行为不得损害本计划投资者实际利益；在持有上述投资标的或产品期间，管理人对上述投资标的或产品不得进行抵押、质押、非交易过户或其他任何有损本计划投资者利益的行为。

### （三）投资指令的发送、确认及执行时间和程序

指令由被授权人代表管理人用传真方式或其他管理人与托管人一致认可的方式向托管人发送。管理人应当在发送指令后与托管人以录音电话、通过托管人提供的网上服务平台或者其他管理人与托管人一致认可的方式进行确认，因管理人未能及时与托管人进行指令确认，致使资金未能及时到账所造成的损失，托管人不承担责任。托管人确认指令有效后，方可执行指令。

对于被授权人依照授权通知发送的指令，管理人不得否认其效力。被授权人应按照有关法律法規规定和本合同的约定，在其交易权限内以传真或双方认可的其他方式向托管人发送指令，管理人在发送指令时，应当为托管人留出执行指令所必需的时间。除需考虑资金在途时间外，还需给托管人留有至少 2 个工作小时的复核和审批时间。管理人向托管人发送要求当日支付的场外投资指令的最晚时间为每个工作日的 15:30，对于超过 15:30 的指令，托管人尽力配合执行，但不保证当日完成在银行的划付流程。有效投资指令是指指令要素准确无误、预留印鉴相符、相关的指令附件齐全且头寸充足的投资指令。由管理人原因造成的指令传输不及时、发送指令错误，未能留出足够划款所需时间、资金账户中未有足额余额，致使

资金未能及时到账所造成的损失，托管人不承担责任。

托管人收到管理人发送的指令后，应当对指令是否由被授权人发送、指令的要素是否齐全、指令印鉴与签字是否与预留的授权文件内容表面相符进行审慎验证，复核无误后应在规定期限内及时执行，不得延误。若存在管理人未按时提供被授权人的预留印鉴和签字样本、表面一致性不符或出现本条第（五）项约定的管理人发出错误指令的情形时，托管人有权拒绝执行，并应及时与管理人指定人员进行电话联系和沟通，并要求管理人重新发送经修改的指令。托管人可以要求管理人提供相关交易凭证、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投资指令的有效性。

管理人向托管人下达指令时，应确保本计划资金账户有足够的资金余额，对管理人在没有充足资金的情况下向托管人发送的指令，托管人可不予执行，并立即通知管理人，托管人不承担因为不执行该指令而造成损失的责任。管理人应按照本合同约定向托管人发送指令。

#### （四）托管人依法暂缓、拒绝执行指令的情形和处理程序

托管人发现管理人发送的指令违反法律法规规定或本合同约定的，应当要求改正，未能改正的，应当拒绝执行，并应及时以书面形式通知管理人并有权向管理人住所地中国证监会派出机构及基金业协会报告。托管人发现管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律法规的规定或本合同约定的，应及时以书面形式通知管理人并有权向管理人住所地中国证监会派出机构及基金业协会报告。

#### （五）管理人发送错误指令的情形和处理程序

管理人发送错误指令的情形包括指令发送人员无权或超越权限发送指令及交割信息错误，指令中重要信息模糊不清或不全等。托管人发现管理人的指令错误时，应按照本条第（三）项规定的程序进行处理，由此造成的损失，托管人不承担责任。

#### （六）更换投资指令被授权人的程序

管理人撤换被授权人或改变被授权人的权限，必须至少提前一个工作日使用传真方式或管理人与托管人一致认可的其他方式向托管人以“授权通知”的格式发出由管理人加盖公章和被授权人签字的变更通知，同时电话或以其他管理人与托管人一致认可的方式通知托管人。被授权人变更的通知须列明新授权的起始日期，原授权通知同时失效。管理人更换被授权人的通知生效后，对于已被撤换人员无权发送的指令，或被改变授权人员超越权限发送的指令，管理人不承担任何责任。如管理人没有按照上述约定方式执行变更通知程序或被授权人变更的通知因任何理由不生效而导致托管人对变更授权文件提出异议的，则该授权变更不生效。

授权变更通知的原件应于传真件或扫描件发送后的十个工作日内送达托管人，若托管人



收到的授权变更原件与传真件或扫描件不一致的，以托管人收到的传真件或扫描件为准。

#### （七）投资指令的保管

投资指令若以传真或双方认可的其他形式发出，则正本由管理人保管，托管人保管指令传真件或扫描件，当二者不一致时，以托管人收到的投资指令传真件或扫描件为准。

#### （八）其他相关责任

托管人正确执行管理人符合法律法规规定、本合同约定的投资指令，本计划财产发生损失的，托管人不承担责任。在遵循本合同约定的业务受理渠道及在指令预留处理的时间内，因托管人过错未能及时或正确执行符合法律法规规定、本合同约定的投资指令而导致本计划财产损失的，托管人应当承担相应的赔偿责任，但托管账户及其他账户余额不足或托管人如遇到不可抗力的情况除外。

如果管理人的划款指令存在事实上未经授权、欺诈、伪造或未能按时提供划款指令人员的预留印鉴和签字样本等非托管人原因造成的情形，只要托管人根据本合同相关约定验证有关印鉴与签名无误，托管人不承担因正确执行有关指令而给管理人或资产管理计划财产或任何第三人带来的损失。

### 十八、交易及交收清算安排

本计划投资于证券发生的所有场内、场外交易（除场内期权交易外）的资金清算交割，全部由托管人负责办理；本计划投资于证券发生的场内期权交易的资金清算交割，由管理人负责办理。资金清算为场外投资的，托管人凭投资指令和相关投资文件进行资金划拨。本计划证券投资的清算交割（除场内期权交易外），由托管人通过中央结算公司、上交所、中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司及清算代理银行办理。

#### （一）交易所市场资金清算

1、交易所市场交易的资金清算交割（除场内期权交易外）由托管人根据中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司的结算数据办理。本计划证券投资的清算交割，由托管人通过中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司及清算代理银行办理。本计划投资于证券发生的场内期权交易的资金清算交割，由管理人负责办理。

2、托管人代理本计划与中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司完成证券资金结算，并承担由托管人原因造成的正常结算、交收业务无法完成的责任，若由于管理人原因造成托管人无法正常完成结算业务，责任由管理人承担。

3、管理人应加强内部控制，控制证券交易前端风险，避免出现透支买卖，同时防范操



作风险，以确保发送给托管人的投资指令有足够的头寸用于交收。

4、对于因任何原因导致的证券资金交收违约事件，相关各方应及时协商解决。

#### （二）银行间交易清算

托管人根据管理人投资指令进行银行间债券交易的资金结算。

对于乙类账户托管人根据投资指令和成交单完成证券交割和资金交收，并根据相关规定支付交易费用。

#### （三）其他场外交易资金清算

其他场外投资资金清算由托管人凭投资指令和相关投资文件进行资金划拨。

#### （四）其他资金清算

资金清算为支付税费的，托管人审核付款用途符合本合同约定后，凭投资指令和相关单据（若有）进行资金划拨。

（五）管理人应确保托管人在执行管理人发送的指令时，有足够的头寸进行交收，本计划的资金头寸不足时，托管人有权拒绝管理人发送的投资指令。管理人在发送投资指令时应充分考虑托管人的划款处理所需的合理时间，如因管理人原因导致无法按时支付证券清算款，由此造成的损失由管理人承担。

在资金头寸充足的情况下，托管人对管理人符合法律法规、本合同的指令不得拖延或拒绝执行。如由于托管人的原因导致本计划无法按时支付证券清算款，由此造成的损失由托管人承担。

#### （六）资金和证券账目的对账

管理人和托管人每日对本计划的资金账目和证券账目进行核对，做到账实相符、账账相符。

#### （七）可用资金余额的确认

管理人可以向托管人申请开通托管账户的网上银行查询功能，以便查询托管账户现金流情况。

### 十九、越权交易的界定

#### （一）越权交易的界定

越权交易是指管理人违反有关法律法规的规定以及违反本合同约定而进行的投资交易行为，包括：

1、违反有关法律法规的规定和本合同约定进行的投资交易行为；

- 2、法律法规禁止的超买、超卖行为；
- 3、法律法规规定以及本合同约定的其他情形。

越权交易的例外情形：如因证券期货市场波动、证券发行人合并、资产管理计划规模变动等管理人主观因素之外的因素，造成本计划投资比例不符合法律、行政法规和中国证监会规定的投资比例或者本合同约定的投资比例的，不视为越权交易，管理人应当按照本合同约定予以处理。

管理人应在有关法律法规规定和本合同约定的范围内运用本计划财产进行投资管理，不得违反有关法律法规的规定和本合同的约定进行越权交易。

托管人对管理人的投资行为行使监督权。托管人根据《托管人投资监督事项表》（附件一）的约定，对本计划的投资进行监督。托管人对管理人进行计划资产投资的监督和检查自本计划成立之日起开始，至本计划终止日起结束。资产管理合同当事人协商一致可对《托管人投资监督事项表》（附件一）进行变更。委托人、管理人应考虑托管人系统首次上线和后续修改所必需的开发、测试时间。

## （二）越权交易的处理程序

### 1、违反有关法律法规规定和本合同约定进行的投资交易行为

托管人对于越权交易，发现管理人的投资指令违反法律法规的规定，或者违反本合同约定的，应当拒绝执行并立即要求管理人改正；未能改正或者造成本计划财产损失的，托管人应当及时通知管理人并有权报告管理人住所地中国证监会派出机构及基金业协会。

根据交易规则，托管人只能在事后发现的越权交易，托管人应当立即通知管理人，管理人在收到通知后应当及时核对或纠正。

管理人应向托管人主动报告越权交易，在限期内，托管人有权随时对通知事项进行复查，督促管理人改正。管理人对托管人通知的越权事项未能在限期内纠正的，托管人应报告管理人住所地中国证监会派出机构及基金业协会。

### 2、法律法规禁止的超买、超卖行为

托管人在行使监督职能时，如果发现本计划财产投资证券过程中出现超买或超卖现象，应立即提醒管理人，由管理人负责解决，由此给本计划财产造成的损失由管理人承担。如果因管理人原因发生超买行为，管理人必须于 T+1 日上午 10:00 前准备好资金，用以完成清算交收。

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

### （三）托管人对管理人投资运作的监督

1、托管人根据本合同《托管人投资监督事项表》（附件一）进行监督。

2、托管人对管理人运用本计划财产进行投资管理的监督和检查自本合同生效之日起开始。

3、经委托人、管理人确认同意，托管人投资监督的及时性、准确性和完整性受限于管理人、证券经纪商（如有）以及其他中介机构提供的数据和信息，合规投资的责任在管理人，托管人对这些机构信息的及时性、准确性和完整性不作任何担保、暗示或表示。如因上述机构提供信息的真实性、准确性和完整性存在瑕疵而所引发的损失，由过错方承担。

## 二十、资产管理计划财产的估值和会计核算

### （一）资产管理计划财产的估值

#### 1、估值目的

客观、准确地反映本计划财产的价值。经本计划估值后确定的本计划单位净值，是进行信息披露、计算参与和退出本计划计价的基础。

#### 2、估值时间

估值日指本计划成立后的每个工作日，即上海证券交易所和深圳证券交易所的正常交易日。

一般情况下，管理人（或运营服务机构）、托管人应于估值日（T日）后第一个工作日对估值日的计划份额净值进行核对；如本计划开放期间，因下层投资标的估值信息未能收集齐备，为确保申购赎回份额确认时使用的净值准确，管理人（或运营服务机构）、托管人可延后至第二个工作日核对T日计划份额净值。对于非托管人原因造成的估值核对时效延误，由相关方承担责任。

#### 3、估值方法

估值应符合《企业会计准则》、《指导意见》、本合同及其他相关法律法规的规定，如法律法规未做明确规定的，参照行业通行做法处理。管理人、托管人的估值数据应依据合法的数据来源独立取得。

##### （1） 公募证券投资基金估值方法

1) 持有的交易所基金(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；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考监管机构或行业协会有关规定，或



者类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。

2) 持有的场外基金（包括托管在场外的上市开放式基金（LOF）），按估值日的基金份额净值估值；估值日基金份额净值无公布的，按此前最近交易日的基金份额净值估值。

3) 持有的货币市场基金，按成本估值，按估值日基金管理公司的每万份收益计算。

4) 持有的分级基金的母基金，按照取得成本确认成本。母基金能够在交易所交易的，按照前述第1)项约定的交易所基金的估值方法估值；不能在交易所交易的，按照前述本款第2)项约定的场外基金的估值方法估值。

5) 持有的基金处于封闭期的，按照最新公布的份额净值估值；没有公布份额净值的，按照成本估值。

#### (2) 银行定期存款或通知存款估值方法

银行定期存款或通知存款以本金列示，按协议或合同利率逐日确认利息收入。如提前支取或利率发生变化，将及时进行账务调整。

(3) 持有的金融产品（证券公司集合资产管理计划、信托公司集合资金信托计划、基金公司及其子公司集合资产管理计划、期货公司及期货公司子公司集合资产管理计划和在基金业协会备案的私募基金管理人发行的私募证券投资基金），该金融产品的管理人或其委托的估值核算机构定期公布份额净值的，按照最新公布的份额净值估值（若该金融产品的管理人或其委托的估值核算机构公布净值的同时，也提供扣除掉业绩报酬后的虚拟净值，优先选择按虚拟净值估值）；不公布份额净值的，按照成本估值。如所投金融产品公布的净值错误等管理人和托管人之外的原因，导致本计划估值错误的，本计划管理人和托管人予以免责。

按份额净值计价的前述投资标的，如需启用虚拟计提业绩报酬进行估值的，作为本计划的主会计方，管理人应当对该等资产管理产品采用虚拟净值估值的准确性、公允性以及可能发生的相关操作性风险、法律风险等风险进行审慎评估。

委托人签署本合同，即表明其已经知晓并认可本计划可采用上述虚拟净值的估值方式。委托人不得因本计划采用虚拟估值方式引起产品净值差异情况，而向管理人或托管人提出任何损失或损害补偿的要求。

管理人经评估后拟采取虚拟净值作为估值依据的，可以决定采用：(i) 场外投资标的的托管人或其运营服务机构或管理人最近一次提供的场外标的虚拟单位净值；或者(ii) 由本计划之管理人最近一次自行计算的场外标的虚拟单位净值，作为本计划之估值依据。管理人应

及时向托管人提供前述虚拟单位净值；如从未获得前述场外投资标的虚拟单位净值的，按场外投资标的最新的份额净值估值，如从未获得过前述场外投资标的的份额净值的，按成本估值。

由于场外资产管理产品虚拟净值的真实性、准确性、完整性取决于该等资产管理产品的相关基础数据的真实性、准确性、完整性、及时性等因素，受限于交互因素，托管人仅根据收到的虚拟净值对本计划进行估值，不就虚拟净值承担任何复核义务和责任。

#### （4）金融衍生品的估值方法

交易所交易的金融衍生品（具体为以下品种：股票期权、股指期货、国债期货、商品期货）按估值日交易所公布的当日结算价估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的结算价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考监管机构或行业协会有关规定，或者类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

（5）如有新增事项或变更事项，按法律法规、监管规定有关最新规定估值。

#### 4、估值对象

运用本计划所持有的一切金融资产和金融负债。

#### 5、估值程序

本计划单位净值的计算精确到 0.0001 元，小数点后第五位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

本计划资产的日常估值由管理人（或运营服务机构）进行。一般情况下，管理人（或运营服务机构）、托管人应于估值日（T 日）后第一个工作日对估值日的计划份额净值进行核对；如本计划开放期间，因下层投资标的估值信息未能收集齐备，为确保申购赎回份额确认时使用的净值准确，管理人（或运营服务机构）、托管人可延后至第二个工作日核对 T 日计划份额净值。

当管理人与托管人的估值结果不一致时，各方应本着勤勉尽责的态度重新计算核对。如果仍无法达成一致，应以管理人的估值结果为准。如因管理人估值错误，由此给本计划财产或委托人造成损失的，由管理人承担责任。

#### 6、估值错误的处理

（1）当资产估值导致本计划单位净值小数点后四位以内发生差错时，视为本计划单位净值错误。管理人计算的本计划单位资产净值由托管人复核确认后公告。当发生净值计算错误时，由管理人负责处理。



(2) 管理人和托管人应采取必要、适当、合理的措施确保本计划资产估值的准确性和及时性。当本计划单位净值的计算出现错误时，管理人、托管人立即予以纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大。当本计划计价出现错误偏差达到资产净值的 0.5%时，管理人应当通报托管人。

当管理人计算的本计划资产净值已由托管人复核确认后公告的，由此造成的委托人或本计划财产的损失，应根据法律法规的规定对委托人或本计划支付赔偿金，就实际向委托人或本计划支付的赔偿金额，由管理人和托管人根据过错各自承担相应的责任。

由于管理人和托管人任何一方当事人提供的信息错误，另一方当事人在采取了必要合理的措施后仍不能发现该错误，进而导致集合计划资产净值计算错误造成委托人或集合计划资产的损失，以及由此造成以后交易日集合计划资产净值计算顺延错误而引起的委托人或集合计划资产的损失，由提供错误信息的当事人一方负责赔偿。

(3) 本计划的会计责任方由管理人担任，与本计划有关的会计问题，如经双方在平等基础上充分讨论后，尚不能达成一致时，按管理人的处理方法执行；或者管理人和托管人对本计划净值的计算结果，虽然多次重新计算和核对，尚不能达成一致时，为避免不能按时公布计划净值的情形，以管理人的计算结果对外公布；由此给委托人和本计划财产造成的损失，由管理人承担责任。

(4) 若被诉人为托管人，管理人应当为托管人提供估值方法合理性的说明和支持。若托管人因此承担赔偿责任，应由托管人先行对委托人或者本计划支付赔偿金，在托管人赔偿后，托管人有权按上述条款就管理人承担责任的部分向管理人追索；若被诉人为管理人，托管人应当为管理人提供必要的支持。若管理人因此承担赔偿责任，管理人有权按上述条款就托管人承担责任的部分向托管人追索。

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

(6) 法律法规或者监管部门另有规定的，从其规定。如果行业有通行做法，双方当事人应本着平等和保护委托人利益的原则进行协商确定处理原则。

#### 7、估值调整的情形与处理

如有确凿证据表明按本合同约定的估值方法不能客观反映本计划财产公允价值的，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



基础上，在与托管人商议后，及时采用公允价值计量方法对本计划财产净值进行调整。对于本合同约定的估值方法未列明的新增投资品种，由管理人与托管人协商一致后进行估值。

#### 8、暂停估值的情形

当出现下列情形致使管理人无法准确评估本计划财产价值时，可暂停估值。但估值条件恢复时，管理人必须按规定完成估值工作。

- (1) 本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管理人、托管人无法准确评估本计划财产价值时；
- (3) 中国证监会认可的其他情形。

估值条件恢复时，管理人必须按规定完成估值工作。

#### 9、资产管理计划份额净值的确认

一般情况下，管理人（或运营服务机构）、托管人应于估值日（T日）后第一个工作日对估值日的计划份额净值进行核对；如本计划开放期间，因下层投资标的估值信息未能收集齐备，为确保申购赎回份额确认时使用的净值准确，管理人（或运营服务机构）、托管人可延后至第二个工作日核对T日计划份额净值。托管人进行复核无误后，签名、盖章并发回给管理人，由管理人负责通过指定方式进行披露。月末、年中和年末估值复核与会计账目的核对同时进行。

当管理人与托管人的估值结果不一致时，各方应本着勤勉尽责的态度重新计算核对。如果仍无法达成一致，应以管理人的估值结果为准。如因管理人估值错误，由此给本计划财产或委托人造成损失的，由管理人承担责任。

#### 10、特殊情况的处理

(1) 管理人按法律法规规定和本合同约定的公允价值进行估值时，所造成的误差不作为本计划份额净值错误处理。

(2) 由于不可抗力的原因或由于证券交易场所或注册登记机构发送的数据错误，管理人和托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，仍未能发现错误的，由此造成的本计划财产估值错误，管理人和托管人可以免除赔偿责任，但管理人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) 资产管理计划的会计政策

本计划的会计政策按照《证券投资基金会计核算业务指引》及如下约定执行：

- 1、本计划的会计年度为公历年度的1月1日至12月31日。
- 2、本计划核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位。

3、本计划的会计核算应符合相关法律法规规定及本合同的约定，如法律法规未有明确规定的，参照行业通行做法处理。

4、本计划财产单独建账、独立核算。

5、管理人及托管人各自保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照本合同约定编制会计报表。

6、托管人应当定期与管理人就本计划财产的会计核算、报表编制等进行核对及确认。

7、管理人为本合同的主要会计责任方。

## 二十一、资产管理计划的费用与税收

### （一）资产管理计划费用种类

1、管理人的管理费；

2、托管人的托管费；

3、运营服务机构的运营服务费

4、证券交易费用；

5、证券账户开户费；

6、本计划成立后的信息披露费用、注册登记费用、审计费和汇划费；

7、按照法律法规及本合同的约定可以在本计划财产中列支的其他费用。

### （二）资产管理计划费用支付标准、计算方法、支付方式和时间

1、管理费：

本计划管理人管理费按本计划前一自然日净值的1%年费率计提，计算方法如下：

$$H=E \times 1\% \div 360$$

H为每日应计提的管理费；

E为本计划前一自然日资产净值。

本计划管理费每日计提，按季支付。管理人于每季度首月前5个工作日内向托管人出具管理费划款指令，经托管人核对无误后从本计划财产中一次性支付给管理人。

管理费及第一创业证券交易佣金收入账户

户名：第一创业证券股份有限公司

账号：4000023319200099986

开户银行：工行深圳分行福田支行

2、托管费：

本计划托管人托管费按本计划前一自然日净值的 0.025% 年费率计提，计算方法如下：

$$H=E \times 0.025\% \div 360$$

H 为每日应计提的托管费；

E 为本计划前一自然日资产净值。

本计划托管费每日计提，按季支付。管理人于每季度首月前 5 个工作日内向托管人出具托管费划款指令，经托管人核对无误后从本计划资产中一次性支付给托管人。

托管费收入账户

户名：国泰君安证券股份有限公司

开户行：招商银行股份有限公司上海张江支行

账号：415900000010916

大额支付号：308290003492

### 3、运营服务费：

本计划运营服务机构的运营服务费按本计划前一自然日净值的 0.025% 年费率计提，计算方法如下：

$$H=E \times 0.025\% \div 360$$

H 为每日应计提的运营服务费；

E 为本计划前一自然日资产净值。

本计划运营服务费每日计提，按季支付。管理人于每季度首月前 5 个工作日内向托管人出具运营服务费划款指令，经托管人核对无误后从本计划资产中一次性支付给运营服务机构。

运营服务费收入账户

户名：国泰君安证券股份有限公司

开户行：招商银行股份有限公司上海张江支行

账号：415900000010916

大额支付号：308290003492

若本计划现金资产不足以支付管理费、托管费和运营服务费的，则相应顺延至本计划现金资产足以支付之日支付。

管理人和托管人协商一致可以调低管理费率或者托管费率或者运营服务费费率，并通过管理人网站公告告知委托人。

### 4、证券交易费用

证券交易费用指本计划进行各类投资品种的投资交易而形成的费用，包括但不限于：印



花税、交易所经手费、证管费、银行间交易手续费、场外基金办理要求的申购赎回费等费用、结算费、过户费、佣金等各项费用，证券交易费用在交易发生时直接计入当期费用；以上各项费用的费率标准按照相关法规政策执行，其中交易佣金的费率由管理人本着保护本计划及委托人利益的原则，按照法律法规的规定确定。

#### 5、其他费用

在存续期间发生的本计划审计费用，由本计划承担，在被审计的会计期间，按直线法在每个自然日内平均摊销。

银行间市场账户开户费及维护费、证券账户开户费、存续期间信息披露费、电子合同服务费、注册登记费、银行汇划手续费、账户管理费、会计师费及律师费等本计划运营过程中发生按照国家有关规定可以列入的其他相关费用，按费用实际支出金额支出，列入或摊入当期本计划费用。

#### （三）不列入资产管理计划费用的项目

本计划成立前发生的费用(包括但不限于计划初始募集期发生的信息披露费、会计师费、律师费等相关费用)，以及存续期间发生的与推广有关的费用，管理人和托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或本计划资产的损失以及处理与本计划运作无关的事项发生的费用等不得列入本计划费用。

#### （四）管理人的业绩报酬

本计划管理人不收取业绩报酬。

#### （五）税收

各方一致同意：就本计划投资运营过程中发生的增值税应税行为，无论是否以管理人作为纳税主体，该等增值税及附加税费均由本计划财产承担，管理人有权以本计划财产予以缴纳，如管理人垫付了相应税费等款项的，管理人有权向委托人追索垫付的税费和孳息款项，委托人应按管理人通知向管理人指定账户返还垫付款。委托人已知悉并同意，本计划财产承担上述税费可能导致资产变现损失或投资收益减损。

除前述约定外，本计划已列明的资产管理业务费用产生的税费应当由各收款方自行缴纳。

## 二十二、资产管理计划的收益分配

本计划的收益分配方案依据法律法规的规定及本合同的约定执行：

### （一）收益的构成

收益包括：本计划投资所得收益、利息、红利、银行存款利息及其他合法收入。

本计划的净收益为本计划收益扣除按照国家有关规定可以在本计划收益中扣除的费用后的余额。

(二)可供分配利润：指截至收益分配基准日资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数，实际分配利润的比例由管理人根据本计划运作的实际情况确定。

#### (三) 收益分配原则

- 1、每一计划份额享有同等分配权；
- 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、收益分配基准日的份额净值减去每单位计划份额收益分配金额后不能低于面值；
- 4、收益分配时发生的银行转账或其他手续费用由委托人自行承担；
- 5、集合计划成立不满 6 个月可不进行收益分配；
- 6、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### (四) 收益分配对象

分红权益登记日所有持有本计划的委托人。

#### (五) 收益分配时间

本计划存续期间，管理人根据具体情况进行收益分配，具体分配时间以管理人公告为准，但收益分配的间隔期间不得短于 6 个月。

#### (六) 收益分配方案的内容

收益分配方案须载明收益的范围、净收益、分配对象、分配原则、分配时间、分配金额及比例、分配方式等内容。

#### (七) 收益分配方案的确定与披露

本计划收益分配方案由管理人拟定，经托管人复核总金额后由管理人向委托人公告，但托管人不负责复核分配明细。

#### (八) 收益分配中发生的费用

收益分配时发生的银行转账等手续费用由本计划委托人自行承担，分红款项将于本次分红权益登记日起 T+3 个工作日内从托管户划出。

#### (九) 收益分配方式

本计划仅以现金红利方式向投资者分配收益。

### 二十三、信息披露与报告

本计划的信息披露和报告将严格按照《管理办法》、《运作管理规定》及其他法律法规的

规定和本合同的约定进行。

#### （一）定期报告

定期报告包括本计划单位净值报告、本计划的资产管理季度及年度报告、托管年度报告、年度审计报告和对账单。

##### 1、本计划单位净值报告

披露时间：本计划存续期内管理人应每周公告一次计划单位净值及计划累计单位净值。本计划每个开放日（T日）的计划单位净值及计划累计单位净值将于 T+3 个工作日内在管理人网站上公布。

披露方式：本计划的单位净值、累计单位净值等信息将在管理人指定网站上披露，委托人可随时查阅。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。

##### 2、本计划的季度报告和年度报告

###### （1）本计划的资产管理季度报告

管理人每季度结束之日起一个月内向委托人提供一次准确、完整的管理季度报告，对报告期内本计划的运作情况做出说明。资产管理季度报告由管理人编制，经托管人复核财务数据后由管理人通过管理人网站公告，并报基金业协会备案，同时抄送管理人住所地中国证监会派出机构。

本计划成立不足 3 个月或存续期间不足 3 个月的，可以不编制当期的季度报告。

###### （2）本计划的资产管理年度报告和托管年度报告

管理人每年度结束之日起四个月内向委托人提供一次准确、完整的管理年度报告，对报告期内本计划的运作情况做出说明。资产管理年度报告由管理人编制，经托管人复核财务数据后由管理人通过管理人网站公告，并报基金业协会备案，同时抄报管理人住所地中国证监会派出机构。托管人在每年度结束之日起四个月内向委托人提供一次年度托管报告，年度托管报告由管理人通过管理人网站公告。

本计划成立不足 3 个月或存续期间不足 3 个月的，可以不编制当期的年度报告。

###### （3）资产管理年度报告包括但不限于下列信息：

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



6) 本计划财务会计报告;

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

8) 本计划投资收益分配情况;

9) 投资经理变更、重大关联交易等涉及委托人权益的重大事项;

10) 中国证监会规定的其他事项。

资产管理季度报告应当披露前述除第6)项之外的其他信息。

### 3、年度审计报告

管理人应当进行年度审计,应当同时对客户资产管理业务的运营情况进行审计,并要求具有证券相关业务资格的会计师事务所就本计划出具单项审计意见。

管理人应当将审计结果报基金业协会备案,同时抄送管理人住所地中国证监会派出机构,并将本计划的单项审计意见通过管理人网站公告。本计划成立不足3个月或存续期间不足3个月时,可以不编制当期的年度审计报告,产品终止当年,无需出具年度审计报告。

### 4、对账单

管理人至少每个季度以邮寄向委托人寄送对账单。对账单内容应包括委托人持有计划份额的数量及净值,参与、退出明细,以及收益分配等情况。

委托人应向管理人提供邮寄地址等资料,因委托人未正常提供以上信息、邮寄运营商系统平台故障及内部操作等非管理人原因导致委托人未能获得邮寄对账单的,管理人不承担任何责任。

## (二) 临时报告

本计划存续期间,发生对本计划持续运营、委托人利益、资产净值产生重大影响的事件,管理人应当在事项发生之日起5日内以管理人指定网站或其他途径和方式及时向委托人披露。临时报告的情形包括但不限于:

1、管理人或托管人变更;

2、本计划运作过程中,负责本计划的投资经理发生变更,或出现其他可能对本计划的持续运作产生重大影响的事项;

3、暂停受理或者重新开始受理参与或者退出申请;

4、本计划终止和清算;

5、本合同的补充、修改与变更;

6、与本计划有关的重大诉讼、仲裁事项;

- 7、负责本计划的代理销售机构发生变更；
- 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、资产计价出现错误(当资产估值导致本计划单位净值小数点后四位以内发生差错时，视为本集合计划单位净值错误)；
- 11、管理费、托管费等费用计提方式或费率发生变更；
- 12、其他发生对本计划持续运营、委托人利益、资产净值产生重大影响的事件。

(三) 管理人的董事、监事、从业人员及其配偶、控股股东、实际控制人或者其他关联方参与本计划的，管理人应当按照相关法律法规的规定和本合同的约定通过管理人网站或其他途径和方式向委托人披露，并向管理人住所地中国证监会派出机构和基金业协会报告。

#### (四) 向监管机构的报告

管理人、托管人应当按照《指导意见》、《管理办法》、《运作管理规定》及其他相关法律法规的规定和本合同的约定，履行向中国人民银行、中国证监会、基金业协会等监管机构和自律组织的报告义务。

## 二十四、风险揭示

本计划面临包括但不限于以下风险：

### (一) 特殊风险揭示

#### 1、本合同部分内容与基金业协会合同指引不一致所涉风险

本合同是基于基金业协会发布的《集合资产管理计划资产管理合同内容与格式指引（试行）》而制定的，管理人对合同指引相关内容做出了合理的调整以及增加了其他内容，导致本合同与基金业协会合同指引不一致的风险。

#### 2、本计划委托募集所涉风险

管理人可以委托取得基金销售业务资格的代理销售机构推广销售本计划，代理销售机构可能存在违法违规地公开宣传本计划、虚假宣传本计划、以保本保收益引诱投资者购买本计划、未能履行投资者适当性审查工作等行为导致投资者合法权益受损的风险。

#### 3、本计划份额转让所涉风险

管理人若开放本计划份额转让的，则本计划份额在相应的交易场所转让，并非集中竞价交易，可能不具有一个活跃的转让市场，且相应的交易场所可能会根据需要暂停或终止转让服务，存在流动性风险；本计划份额转让实行非担保交收，申报转让（受让）本计划份额时，

相应的交易场所对本计划份额（资金）余额事先不实行检查、控制，本计划份额登记机构也不实行担保交收，份额转让风险由转让方、受让方自行控制和承担。

#### 4、本计划未在基金业协会完成备案手续或不予备案情形所涉风险

管理人在本计划成立后 5 个工作日内向基金业协会办理备案手续。本计划面临因未能在基金业协会履行备案手续或基金业协会不予备案导致本计划财产不能进行投资运作的风险。

#### 5、使用虚拟净值进行估值的风险（如有）

当本计划投资场外资产管理产品时，由于场外资产管理产品的份额净值中包含了应当计提但是未支付的业绩报酬，采用份额净值对本计划资产进行估值可能无法准确地反映本基金的真实资产价值，因此，管理人可视产品实际运作情况，使用虚拟单位净值对该等场外资产管理产品进行估值。

由于虚拟单位净值的真实性、准确性、完整性依赖于场外资产管理产品的相关基础数据的真实性、准确性、完整性，若场外资产管理产品之托管人、运营服务机构、管理人以及本基金之管理人未及时提供真实、准确、完整的虚拟单位净值或估值材料，可能发生该等虚拟单位净值存在错误或延迟，从而影响本基金的单位净值。

由于虚拟单位净值需要将场外资产管理产品份额净值扣除估值当日预计内含的业绩报酬（如有），因此采用虚拟单位净值估值后的单位净值将低于之前按照基金份额净值估值的单位净值。

#### 6、估值与核算外包事项所涉风险

本计划委托运营服务机构对本计划进行估值核算等服务，因运营服务机构经营风险、技术系统故障、操作失误等，可能使本计划估值核算发生差错，给本计划运营带来风险。

#### 7、其他特殊风险

##### （1）正回购风险（如有）

本计划投资范围包括债券正回购，且根据相关法律法规的规定，参与证券回购融入资金余额可能达到本计划资产净值的 100%（不得超过 100%）。从事债券正回购存在着包括但不限于以下风险：

1) 价格风险：是指由于债券交易价格不设涨跌停幅度限制，可能发生债券交易价格剧烈波动，存在亏损的可能，可能由此造成损失；

2) 套利风险：是指由于债券价格偏离预期，债券正回购和现券交易的组合套利过程中存在亏损的可能，可能由此造成损失；

3) 交收风险：是指债券正回购交易到期后存在无法完全履行交收责任的可能性，可能



由此造成损失；

4) 质押风险：是指由于交易所、登记公司债券质押式回购交易标准券折算比例的调整，可能导致债券欠库，可能由此造成损失；

5) 结算风险：根据证券登记结算公司的业务规则以及关于结算风险管理的相关规定，在债券正回购的结算过程中，证券登记结算公司有可能依照有关业务规则或约定处置质押券，可能由此造成损失。

6) 投资风险：在进行债券正回购交易时，可能出现回购利率大于债券投资收益率，从而导致本计划净值下降的可能性。

7) 资产净值波动加大的风险：通过债券正回购交易可放大交易杠杆，增加持仓证券总量，放大投资组合风险敞口，同时也增加了投资收益的不确定性，从而导致本计划资产净值波动加大。

## (2) 逆回购风险

本计划投资于债券逆回购，存在交易对手的信用风险，交易对手未能履行合约，或在交易期间未如约支付已借出证券产生的所有利息和分红，从而对本计划的资产净值造成不利影响的风险。

## (3) 投资金融产品的风险

本集合计划部分资产将配置于以量化套利、量化对冲、CTA、量化多空等量化策略为主的金融监管部门批准或备案发行的金融产品（包括公募证券投资基金、证券公司及子公司集合资产管理计划、期货公司及期货子公司集合资产管理计划以及在基金业协会备案的私募证券投资基金管理人发行的私募证券投资基金），投资上述金融产品可能因下列特定风险因素给本计划造成不利影响，请委托人知悉。

### 1) 金融产品管理人风险

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

### 2) 量化策略模型失效风险

本计划拟配置的量化套利、量化对冲、CTA、量化多空等量化策略主要依赖于量化模型，因为模型不能有效的、完全的刻画市场运行中的真实状况，模型在测算、评估时存在误差（历史表现不保证未来表现），模型中的参数估计存在误差，或者市场条件突然发生改变等因素，

量化模型的可靠性将对本资产管理计划的收益产生影响，可能最终导致模型失效的风险。

### 3) 量化策略模型风格偏离风险

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

### 4) 赎回金融产品面临的流动性风险

因本计划委托人赎回或管理人进行资产配置调整需要，管理人赎回金融产品时，可能触发金融产品大额赎回或巨额赎回条款，导致赎回资金延迟到账的风险。

### 5) 止损线监控风险

所投资的金融产品净值提供可能存在滞后性，与本计划估值频率不一致，从而导致本计划基金份额净值更新不及时，未及时监控、触及本计划止损线的情形。

## (4) 投资金融衍生品的风险

### 1) 期货投资风险（如有）

#### ① 流动性风险

本基金在期货市场成交不活跃时，可能在建仓和平仓期货时面临交易价格或者交易数量上的风险。

#### ② 基差风险

基差是指现货价格与期货价格之间的差额。若产品运作中出现基差波动不确定性加大、基差向不利方向变动等情况，则可能对本基金投资产生影响。

#### ③ 合约展期风险

本基金所投资的期货合约主要包括期货当月和近月合约。当基金所持有的合约临近交割期限，即需要向较远月份的合约进行展期，展期过程中可能发生价差损失以及交易成本损失，将对投资收益产生影响。

#### ④ 期货保证金不足风险

由于期货价格朝不利方向变动，导致期货账户的资金低于期货交易所或者期货经纪商的最低保证金要求，如果不能及时补充保证金，期货头寸将被强行平仓，导致无法规避对冲系统性风险，直接影响本基金收益水平，从而产生风险。

#### ⑤ 杠杆风险

期货作为金融衍生品，其投资收益与风险具有杠杆效应。若行情向不利方向剧烈变动，本基金可能承受超出保证金甚至基金资产本金的损失。

### 2) 场外衍生品风险（如有）

### ① 政策风险

场外衍生品（包括互换、场外期权）属于创新业务，监管部门可视业务的开展情况对相关政策和规定进行调整，引起场外衍生品（包括互换、场外期权）业务相关规定、运作方式变化或者证券市场波动，从而给投资者带来损失的风险。

### ② 市场风险

市场风险是指由于场外衍生品（包括互换、场外期权）中挂钩标的的市场价格、市场利率、波动率或相关性等因素的变化，导致投资者收益不确定的风险。

### ③ 交易对手不能履约的风险

交易对手因停业、解散、撤销、破产，或者被有权机构撤销相关业务许可、责令停业整顿等原因不能履行场外衍生品（包括互换、场外期权）中约定的义务，可能给投资者带来损失的风险。

## 3) 期权的投资风险（如有）

### ① 期权买方风险

由于期权标的价格波动导致期权不具行权价值，期权买方将损失付出的所有权利金。

### ② 期权卖方风险

卖出期权交易的风险一般高于买入期权交易的风险，卖出期权虽然能获得权利金，但也因承担行权履约义务而面临由于合约标的价格波动，而承受远高于该笔权利金的损失的风险。

### ③ 流动性风险

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

## (5) 净值波动风险（如有）

本计划可能投资于公募证券投资基金、证券公司及子公司集合资产管理计划、期货公司及期货子公司集合资产管理计划以及在基金业协会备案的私募证券投资基金管理人发行的私募证券投资基金等金融产品类资产，投资上述产品出现如下情形之一时，将可能导致本计划出现净值波动风险：

1) 估值日后的第一个交易日仍无法及时获取上述投资品种的最新估值价格；

2) 投资上述品种后无法及时确认，上述投资品种在投资确认前估值价格波动；

3) 估值日后的第一个交易日取得的上述投资品种的最新估值价格仍没有或无法排除影响估值价格的因素（例如在估值日无法排除业绩报酬对估值价格的影响）；

## (6) 本计划单位净值低于止损线的风险



当本计划份额单位净值在 R 日日终低于 0.8000 时,管理人自 R+2 日起将进行强制止损,对本计划持有的全部非现金类资产进行不可逆的变现操作,本计划终止并根据本合同的约定进入清算流程。因触发止损线到产品实际变现完毕之间存在时间差,产品净值存在进一步下滑的风险,投资者实际取得的净值收益可能低于本计划止损线。

## (二) 一般风险揭示

### 1、本金损失风险

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

本计划属于中高(R4)风险投资品种,适合风险识别、评估、承受能力 C4(积极型)及以上的合格投资者。

### 2、市场风险

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

#### (1) 政策风险

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

#### (2) 经济周期风险

证券市场受宏观经济运行的影响,而经济运行具有周期性的特点,而周期性的经济运行周期表现将对证券市场的收益水平产生影响,从而对收益产生影响。

#### (3) 利率风险

利率风险是指由于利率变动而导致的资产价格和资产利息的损益。利率波动会直接影响企业的融资成本和利润水平,导致证券市场的价格和收益率的变动,使集合计划资产管理业务收益水平随之发生变化,从而产生风险。

#### (4) 购买力风险

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

#### (5) 衍生品风险

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

#### (6) 再投资风险

再投资风险反映了利率下降对固定收益证券利息收入再投资收益的影响。当利率下降时，资产管理计划财产从投资的固定收益证券所得的利息收入进行再投资时，收益率将比此前下降。

### 3、管理风险

在本计划运作过程中，管理人的知识、经验、判断、决策、技能等，会影响其对信息的获取和对经济形势、金融市场价格走势的判断，管理人精选出的投资品种业绩表现不一定持续优裕其他投资品种，如管理人判断有误、获取信息不全、或对投资工具使用不当等影响本计划的收益水平，从而产生风险，该风险由本计划财产及委托人承担。投资者应充分知晓投资运营的相关风险，其风险应由委托人自担。

### 4、流动性风险

流动性风险是指金融资产不能迅速转变成现金，或者转变成现金会对资产价格造成重大不利影响的风险。流动性风险将主要表现在以下几个方面：本计划的资产不能迅速转变成现金，或变现成本很高；不能应付可能出现的委托人赎回的风险等。这些风险的主要形成原因是：

（1）市场整体流动性相对不足。证券市场的流动性受到市场行情、投资群体等诸多因素的影响，在某些时期成交活跃，流动性较好；而在另一些时期，则可能成交稀少，流动性较差。在市场流动性相对不足时，交易变现有可能增加变现成本，对本计划的资产净值造成不利影响。这种风险在委托人提前赎回时表现尤为突出。

（2）证券市场中流动性不均匀，存在个股和个券流动性风险。由于流动性存在差异，即使市场流动性比较好的情况下，一些个股和个券的流动性可能仍然比较差，这种情况的存在使得管理人在进行个股和个券操作时，可能难以按计划买入或卖出预期的数量，或买入、卖出行为对个股和个券价格产生比较大的影响，增加个股和个券的建仓成本或变现成本。这种风险在出现个股和个券停牌或涨跌停板等情况时表现得尤为突出。

（3）若本计划投资于债券回购，可能因政策或交易所规则发生变化而出现质押债券折算率下调、债券暂停上市、债券延迟兑付或不兑付等情况，可能继而导致本计划出现资金流动性不足，需要委托人及时足额追加委托资金以避免出现欠库或透支的情况，也可能增加本计划资产净值的波动性。

（4）本计划财产不能应付可能出现的委托人大额赎回的风险。在本计划运作期间，可能会发生委托人大额赎回的情形，可能会产生仓位调整的困难，导致流动性风险，甚至影响收益水平。

(5) 管理人因停业、解散、撤销、破产，或者被中国证监会撤销相关业务许可等原因不能履行职责的风险。管理人因停业、解散、撤销、破产，或者被中国证监会撤销相关业务许可等原因不能履行职责，可能导致委托资产的损失，从而带来风险。

#### 5、信用风险

信用风险是指信用证券发行人是否能够实现发行时的承诺，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。

(1) 交易品种的信用风险：投资于公司债券等固定收益类产品，存在着发行人不能按时足额还本付息的风险；此外，当发行人信用评级降低时，本计划所投资的债券可能面临价格下跌风险。

(2) 交易对手的信用风险：交易对手未能履行合约，或在交易期间未如约支付已借出证券产生的所有股息、利息和分红，从而对本计划的资产净值造成不利影响的风险。

#### 6、募集失败的风险

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

管理人的责任承担方式：

(1) 以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用；

(2) 在本计划募集期限届满（确认本计划无法成立）后三十日内返还投资人已缴纳的款项，并加计银行同期存款利息。

#### 7、证券交易资金前端控制的风险

根据上海证券交易所、深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司于 2017 年 12 月 1 日联合发布的《上海证券交易所 深圳证券交易所 中国证券登记结算有限责任公司证券交易资金前端风险控制业务规则》的要求，沪深交易所及中国结算自 2018 年 6 月 1 日起对交易参与者相关交易单元的全天净买入申报金额总量实施额度管理，并通过交易所对交易参与者实施前端控制，本计划管理人作为交易参与者需通过结算参与者（也即是本计划托管人）向中国结算报告资金前端控制最高额度信息，且交易参与者需在最高额度内向交易所申报资金前端控制的自设额度，由交易所根据该额度实施资金前端控制。基于上述资金前端控制的机制，则存在买入申报金额不符合前端控制自设额度限制时，被交易所拒绝接受买入申报从而交易失败的风险，以及出现前端控制异常情况，导致无法买入申报从而交易失败的风险。

#### 8、投资金融衍生品的风险（如有）

(1) 市场风险



由于保证金交易具有杠杆性，当出现不利情形时，标的证券微小的变动就可能会使委托人权益遭受较大损失；场内期权实行当日无负债结算制度，对资金管理要求非常高。价格波动剧烈的时候可能面临追加保证金的问题，如果没有在规定时间内补足保证金，按规定将面临平仓的风险。

#### （2）信用风险

对于衍生品交易而言，信用风险发生的概率极小，原因是在进行衍生产品交易时，交易所有一套独特的交易体系，如设立一系列的保证金制度，最低资金要求，逐日盯市结算措施及强行平仓制度等，使整个市场的信用风险下降。但这种由结算公司充当所有投资者的交易对手，并承担履约责任，一旦结算公司出现风险暴露，由于其风险过度集中，在重大风险事件发生时，或风险监控制度不完善时也会发生信用风险。

#### （3）杠杆风险

金融衍生品投资收益与风险具有杠杆效应。若行情向不利方向剧烈变动，本计划可能承受超出保证金甚至本计划财产本金的损失。

#### 9、税收风险

本计划作为契约型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，委托人收益也可能因相关税收政策调整而受到影响。

#### 10、本计划提前终止的风险

本计划运作期间，当本计划委托人少于 2 人或者其他本计划约定的提前终止情形出现时，导致集合计划提前终止的风险。

#### 11、合同变更风险

管理人就合同变更征求委托人意见期间，未明确提出异议的委托人、不同意合同变更但逾期未提出退出申请的委托人均视为同意修改或变更合同和说明书。部分委托人可能因为未能提供有效的联系方式或者未能将变动后的联系方式及时通知管理人，而无法及时获知合同变更事项，如果委托人因上述情况未能按时退出本计划，可能会被视为同意合同变更，从而存在风险。

#### 12、委托人可能无法参与的风险

由于本计划可能设定规模上限，管理人将根据合同的约定对规模上限进行控制，因此委托人可能面临着因上述原因而无法参与本计划的风险。

#### 13、委托人部分退出的风险

委托人部分退出本计划份额时，如其该笔退出受理后委托人持有的剩余集合计划份额净

值低于人民币 400,000 元，委托人面临剩余份额强制退出的风险。

#### 14、巨额赎回情形下净值精度应急调整机制的风险

当本计划发生巨额赎回情形且管理人决定采取净值精度应急调整机制，届时赎回净值可能发生变动，委托人退出金额可能会由于净值精度提高而产生差异，将直接影响到委托人的投资收益。举例如下：

假设本计划退出申请日单位净值为 A（净值精度调整前），委托人退出份额为 X，则退出申请日单位净值精度误差最高为  $\pm 0.00005$  元（即四舍五入小数点后第 5 位最大误差），由此计算的单位净值 A 调整精度后对委托人退出总金额的最大影响为  $\pm X \times 0.00005$  元。

#### 15、其他风险

（1）关联交易的风险：管理人可以将本计划的资产投资于管理人、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承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易，管理人按照各方提供的关联方名单进行关联交易的审查，存在无法监控全部关联交易类型的风险，同时，本计划进行关联交易时可能存在一定的利益冲突风险，由此造成的损失由本计划财产承担。

（2）操作与技术风险：相关当事人在业务各环节操作过程中，因内部控制存在缺陷或者人为因素造成操作失误或违反操作规程等导致的风险，例如，越权违规交易、会计部门欺诈、交易错误、IT 系统故障等风险。

在本计划的各种交易行为或者后台运作中，可能因为 IT 系统的故障或者差错而影响交易的正常进行或者导致委托人的利益受到影响，这种技术风险可能来自管理人、托管人、注册登记机构、销售机构、证券交易所、证券登记结算机构等。

（3）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，可能导致本计划资产的损失。金融市场危机、行业竞争、代理机构违约等超出管理人自身直接控制能力之外的风险，可能导致委托人利益受损。

对上述风险的具体描述请见《第一创业智选 FOF1 号集合资产管理计划风险揭示书》。

### 二十五、资产管理合同的变更、终止与财产清算

#### （一）资产管理合同的变更

1、本合同签署后，因法律、法规、规章、中国证监会、基金业协会的规定、证券登记结算机构业务规则以及证券交易所等交易规则修订，自该修订生效之日起，本合同相关内容及条款按该修订办理并在管理人网站公告委托人。委托人特此授权管理人经与托管人协商一

致后，可以对本合同及说明书与新的法律法规或有关政策不一致的内容进行更新或修改，更新或修改的内容不得违反法律法规和中国证监会的有关规定，更新或修改的内容在管理人网站公告满5个工作日后生效。委托人对更新或修改的内容有异议，可在更新或修改内容生效前申请退出本计划。

2、由于其他原因需要变更合同的，管理人和托管人应书面达成一致后，以短信或其他方式通知委托人，并在管理人网站公告。委托人不同意变更的，应在公告发布之日起至合同变更生效日内的开放日提出退出申请，如在公告发布之日起至合同变更生效日内无开放日，则管理人将在公告中公布合同变更成立日前设定的临时开放日。未提出退出申请的，视同委托人已经同意合同变更。管理人应在公告中披露临时开放日、合同变更生效日。

3、本计划也可以经全体委托人、管理人和托管人协商一致，签署书面补充协议的方式完成合同变更，该合同变更方式不受上述变更流程的限制。

4、合同变更后，委托人、管理人和托管人的应当按照变更后的合同行使相关权利，履行相应义务。

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

6、本合同发生变更的，管理人应当按照基金业协会要求及时向基金业协会备案并抄报管理人住所地中国证监会派出机构。

## （二）管理人或托管人的变更

1、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、宣告破产导致本计划由其他管理人承接时：

原管理人应当就变更管理人的事项与新任管理人和托管人达成书面一致后，以短信或其他方式通知委托人，并在管理人网站公告。委托人不同意变更管理人的，应在公告发布之日起至管理人变更生效日内的开放日提出退出申请，如在公告发布之日起至管理人变更生效日内无开放日，则管理人将在公告中公布管理人变更生效日前设定的临时开放日。未提出退出申请的，视同委托人已经同意管理人变更。

2、发生托管人被依法撤销基金托管资格或者依法解散、被撤销、宣告破产导致本计划由其他托管人承接时：

原管理人应当就变更托管人的事项与原托管人和新任托管人达成书面一致后，以短信或其他方式通知委托人，并在管理人网站公告。委托人不同意变更托管人的，应在公告发布之日起至托管人变更生效日内的开放日提出退出申请，如在公告发布之日起至托管人变更生效



日内无开放日，则管理人将在公告中公布托管人变更生效日前设定的临时开放日。未提出退出申请的，视同委托人已经同意托管人变更。

### （三）资产管理计划的展期

1、本计划存续期届满时，管理人可以决定到期清算终止，或根据本合同约定进行展期。

#### 2、展期的条件

下列条件全部满足后，本计划可以展期：

（1）本计划运作规范，管理人、托管人未违反法律法规、中国证监会规定和本合同的约定；

（2）本计划展期没有损害委托人利益的情形；

（3）资产托管机构同意继续托管展期后的本计划财产；

（4）中国证监会规定的其他条件。

本计划展期的，还应当符合本计划的成立条件。

#### 3、委托人参与展期的方式

管理人拟展期时，应当至少在届满前 1 个月的期间内以短信或其他方式通知委托人，并在管理人网站进行公告。委托人不同意本计划展期的，可在公告发布之日起至本计划存续期届满前的开放日提出退出申请，如在公告发布之日起至存续期届满前无开放日，本计划将在计划存续期届满前 20 个工作日内公告临时开放期。未在存续期届满前提出退出申请的，视同委托人已经同意本计划展期。

#### 4、展期的实现

（1）同意本计划展期的委托人的人数(含管理人)不少于 2 人，且原存续期届满日符合展期条件的，本计划在原存续期届满日的次日实现展期，否则本计划不能展期。

（2）若本计划在原存续期届满日有未能流通变现的证券或其他资产，同意展期的委托人需同意继续持有该未能流通变现的证券或其他资产，且同意展期的委托人持有的本计划资产净值不低于本计划未能流通变现证券或其他资产规模，且原存续期届满日符合展期条件的，本计划在原存续期届满日的次日实现展期，否则本计划不能展期。

（3）本计划可以连续展期，且展期次数不限。

（4）管理人应在展期后 5 个工作日内将展期情况报基金业协会备案，同时抄报管理人住所地中国证监会派出机构。

#### 5、展期的失败

若本计划不符合展期条件，或者存续期届满，本计划不符合展期成立的条件，本计划展

期失败，本计划在本合同约定的终止情形发生后进入清算程序。

#### （四）资产管理计划的终止

有下列情形之一的，本计划应当终止：

1、本计划存续期届满且不展期；

2、经全体委托人、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、本计划存续期间，持续 5 个工作日委托人少于 2 人；

6、本计划成立后，未在基金业协会完成备案或未通过基金业协会的产品备案或未取得产品的备案确认函的，则管理人有权终止本计划，且不承担任何责任；

7、不可抗力的发生导致本计划不能存续；

8、因监管政策或监管规则的变化导致本产品违反相关监管政策或监管规则要求的，或监管机构通知（无论是口头或书面形式的通知）管理人停止开展此类资产管理产品的，则管理人有权停止开放本计划份额的参与并终止本计划，且不承担任何责任；

9、本计划净值低于或等于止损线且资产管理人完成平仓操作，将可变现的非现金资产全部变现的；

10、法律、行政法规、本合同及中国证监会规定的其他终止情形。

管理人应当自本计划终止之日起 5 个工作日内报基金业协会备案并抄报管理人住所地中国证监会派出机构，前述第 6 项约定的情形除外。

#### （五）资产管理计划的清算

##### 1、本计划财产清算小组

本计划在发生终止情形起 5 个工作日内，由管理人组织成立本计划财产清算小组，在本计划财产清算小组接管本计划财产之前，管理人和托管人应按照本合同的约定继续履行保护本计划财产安全的职责。

本计划财产清算小组成员由管理人、托管人组成，清算小组可以聘用必要的工作人员，本计划财产清算小组负责本计划财产的保管、清理、估价、变现和分配，本计划财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。

##### 2、本计划清算程序

- (1) 本计划终止情形发生后，由本计划财产清算小组负责统一接管本计划财产；
- (2) 本计划财产清算小组根据情况确定具体的清算期限；
- (3) 本计划财产清算小组对本计划财产进行清理和确认；
- (4) 对本计划财产进行评估和变现；
- (5) 制作清算报告；
- (6) 将清算报告报基金业协会、管理人住所地中国证监会派出机构并告知委托人；
- (7) 对本计划财产进行分配。

### 3、本计划清算费用

清算费用是指本计划财产清算小组在进行本计划财产清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由本计划财产清算小组优先从本计划财产中支付。

### 4、本计划财产清算及剩余资产的分配

依据本计划财产清算的分配方案，将本计划财产清算后的全部剩余资产扣除清算费用后，按本计划委托人持有的计划份额比例进行分配，本合同另有约定的除外，本计划财产按照以下顺序进行分配：

- (1) 支付清算费用；
- (2) 缴纳所欠税款；

(3) 清偿本计划债务：本计划债务主要包括应付管理费、托管费、银行间账户维护费、交易佣金、证券交易费用、银行汇划费用、销户费、管理人代表本计划及委托人处理本计划涉及诉讼、仲裁或争议解决的事项所产生的费用及支出等，除交易所、证券登记结算机构等自动扣缴的费用外，其他费用的清偿由管理人、托管人核对无误后，由管理人向托管人出具投资指令，由托管人复核后支付。

- (4) 按本计划委托人所持计划份额比例进行分配；

本计划财产未按前述第(1)、(2)、(3)项约定进行清偿前，不得分配给本计划委托人。

### 5、本计划二次清算

若本计划在终止之日有未能流通变现的证券或金融产品，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或金融产品可在可流通变现后进行二次清算，并将变现后的资产按照委托人拥有份额的比例或本合同的约定，以货币形式分配给委托人，二次清算期间，管理人、托管人继续按照本合同约定计提管理费、托管费及其他费用。发生二次清算情形的，管理人应当及时向管理人住所地中国证监会派出机构和基金业协会报告。



## 6、本计划清算报告的告知安排

清算结果由本计划财产清算小组结束后通过管理人网站向委托人进行披露。并报告管理人住所地中国证监会派出机构和基金业协会报告。

## 7、本计划相关账户销户

### (1) 证券类账户销户

本计划证券类资产完成变现、结清相关权益、缴清相关费用后，托管人负责证券类账户的销户工作，管理人负责基金账户销户，销户过程中其他各方应给以必要的配合。

在证券资产变现完毕、相关权益结清后 5 个工作日内，管理人将托管人注销证券账户的通知书及其他销户资料寄送托管人，托管人原则上应于收到管理人提供资料后的 10 个工作日内完成。

管理人在开放式基金变现完毕、相关权益结清后 15 个工作日内完成场外开放式基金账户注销，并向托管人出具销户确认通知书。

### (2) 银行托管账户销户

本计划财产清算完毕后管理人应向托管人申请注销本计划财产托管账户，托管人应予以配合。

与本计划财产有关的其他账户的销户，由管理人与托管人协商一致后办理。

8、本计划存续及清算期间，为支付本计划财产承担的各项税费，管理人有权预留相应金额，若预留金额不足以支付实际需缴存的税费的，差额部分由管理人通知委托人补足，管理人不承担垫付责任，委托人应当及时追加资金，不得以任何理由拒绝补足义务。

本计划清算期间，为支付最低备付金、结算保证金，管理人有权预留相应金额，若预留金额不足以支付实际需缴存的备付金、保证金金额的，差额部分由管理人通知委托人补足，管理人不承担垫付责任，委托人应当及时追加资金，不得以任何理由拒绝补足义务。

9、本计划清算账册及文件应当由管理人自清算完毕之日起保存 20 年以上。

## 二十六、违约责任

(一) 由于本合同当事人过错，造成本合同不能履行或者不能完全履行的，由有过错的一方承担违约责任；如当事人均有过错的，各自承担应负的责任。本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。但是发生下列情况的，当事人可以免责：

### 1、不可抗力

不可抗力是指本合同当事人无法预见、无法克服、无法避免，且在本合同签署之后发生的，使本合同当事人无法全部或部分履行本合同的任何事件，包括但不限于相关法律法规及监管规则的变更；国际、国内金融市场风险事故的发生；战争或动乱、自然灾害、公众通讯设备故障、电力中断、互联网故障等。

一方因不可抗力不能履行本合同时，应及时通知其他方，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本计划财产及其他当事人损失扩大。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、在没有欺诈、故意或重大过失的情况下，托管人执行管理人的生效指令对本计划财产造成的损失；

5、在本计划运作过程中，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、管理人或托管人任一方不因另一方的失职行为而给本计划财产或委托人造成的损失向委托人承担连带责任；

7、投资者未能事前就其关联交易或其他禁止交易证券等投资者自身违法违规原因明确告知管理人致使资产管理计划资产发生违规投资行为的，管理人与托管人均不承担任何责任；

8、资产管理人、资产托管人对由于第三方（包括但不限于交易所、中国结算等）发送或提供的数据错误及合理信赖上述信息而操作给本计划资产造成的损失等；

9、法律法规规定及本合同约定的其他情况。

（二）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。

（三）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。

(四) 由于不可抗力原因或注册登记机构非正常暂停或终止业务、证券交易所非正常暂停或停止交易、证券交易所、登记结算公司等机构发送的数据错误等非管理人或托管人的原因，管理人和托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误的，由此造成计划资产或委托人损失，管理人和托管人可以免除赔偿责任。但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。

(五) 一方当事人依据本合同向其他方当事人赔偿的损失，仅限于直接损失。

(六) 托管人对于没有保管在托管人处的有价证券及其他本计划财产不负有保管责任，由于非托管人的过错致使其保管的资产发生毁损或灭失的，托管人不承担赔偿责任。

(七) 委托人的债权人通过司法机关对本计划财产采取强制措施，由此造成本计划财产损失的，管理人和托管人不承担任何责任。

## 二十七、争议的处理

(一) 发生纠纷时，本合同当事人可以通过协商或者调解予以解决。当事人不愿通过协商、调解解决或者协商、调解不成的，应提交深圳国际仲裁院并按其仲裁规则进行仲裁，仲裁地点在深圳。仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力。仲裁费由败诉方承担。

(二) 纠纷处理期间，相关各方当事人应恪守职责，各自继续忠实、勤勉、尽责地履行本合同约定的义务，维护本计划及委托人的合法权益。

(三) 本合同适用并按照中华人民共和国法律（不包括香港、澳门特别行政区及台湾地区的法律）解释。

## 二十八、资产管理合同的效力

### (一) 合同的成立

本合同是约定委托人、管理人和托管人之间权利义务关系的法律文件。本合同经管理人、托管人和委托人签署后成立，委托人为机构的，本合同自委托人、管理人和托管人加盖公章或合同专用章以及各方法定代表人、执行事务合伙人或授权代表签字或签章之日起成立，委托人为自然人的，本合同自委托人本人签字、管理人和托管人加盖公章或合同专用章以及各方法定代表人或授权代表签字或签章之日起成立。

合同签署方式（包括但不限于书面、电子等）可能由于法律法规、监管要求、系统技术等等发生改变，各方同意管理人基于委托人的利益有权按规定采用新的签署方式，并及时进行信息披露。



## （二）合同的生效

本合同成立后，同时满足以下条件时生效：

- （1）委托人参与资金实际交付并确认；
- （2）本计划成立。

本合同自生效之日起对委托人、管理人、托管人具有同等的法律约束力。本计划终止，本合同终止，但本合同项下的财产清算条款、违约责任条款、争议解决条款等仍然有效。

## （三）合同的组成

《第一创业智选 FOF1 号集合资产管理计划说明书》是管理人对于本计划重要事项的说明，是本合同重要附件，与本合同具有同等法律效力。

经管理人确认有效的委托人参与、退出本计划的申请材料和各销售机构出具的本计划参与、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。

## （四）本合同的有效期限

本合同的有效期限为 10 年，从本计划成立日起算。在符合本合同约定的展期条件下可展期，但按照本合同约定出现本计划应当终止的情形时，本计划将提前终止并进行清算。

（五）委托人自签署本合同即成为本合同的当事人，在本计划存续期间，委托人自全部退出本计划之日起，该委托人不再是本合同的当事人。

## 二十九、其他事项

（一）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。

（二）委托人在此同意，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本条上一款所述的从事资产管理业务的公司，并无须就此项变更和委托人另行签订专项协议。但在转让前管理人应以在管理人网站公告委托人。管理人保障委托人退出本计划的权利，并在届时的公告中对相关事项作出合理安排。

（三）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。

（四）管理人应按照监管机构的要求办理转让手续。

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

本合同一式肆份，管理人执贰份，委托人、托管人各执一份，管理人需按照监管要求报备相关机构的份数另计，每份均具有同等法律效力。

（本页以下无正文）





## 附件一：托管人投资监督事项表

托管人据此表对委托财产的投资进行监督，但托管人无投资责任。

### 1、投资范围

(1) 金融产品类资产：公募证券投资基金、证券公司集合资产管理计划、基金公司及基金公司子公司集合资产管理计划、期货公司及期货公司子公司集合资产管理计划和在基金业协会备案的私募基金管理人发行的私募证券投资基金、货币市场基金、银行非保本理财产品及其他金融监管部门批准或备案发行的资产管理产品；

(2) 现金类资产：现金、各类银行存款（包括银行活期存款、银行同业存款、银行定期存款和银行协议存款等各类存款，不含结构性存款）、货币市场基金。

(3) 衍生品类资产：沪深交易所及期货交易所上市的期权及期货。

### 2、预警止损机制

管理人负责对本计划预警线和止损线进行监控和采取相关操作。当 R 日计划份额净值低于或等于预警线或止损线，资产托管人于 R 日日终计划份额单位净值核对一致后 2 个工作日（含）内以邮件或其他资产托管人与资产管理人共同认可的方式向资产管理人进行提示。

### 3、投资比例

本计划为混合类产品，投资于金融产品类资产的比例不低于 80%。

该产品为 FOF 产品，由于本计划托管人并不是本计划投向的私募证券投资基金的托管人，无法独立获取前述基金的估值数据，穿透核查投资比例将根据管理人定期提供的底层私募数据进行监督。

如因证券期货市场波动、证券发行人合并、资产管理计划规模变动等管理人主观因素之外的因素，造成本计划投资比例不符合法律、行政法规和中国证监会规定的投资比例或者本合同约定的投资比例的，管理人应在流动性受限资产可出售、恢复交易或者具备交易条件的 15 个工作日内将投资比例调整至符合相关要求的范围内。确有特殊事由未能在前述约定时间内完成调整的，管理人应当及时向管理人住所地中国证监会派出机构和基金业协会报告。

