

合同编号：DHZQ-ZXYH-JHHT-2023-HY3-3

# 东海证券海阳 3 号集合资产管理计划 资产管理合同(第三版)

管理人：东海证券股份有限公司

托管人：中信银行股份有限公司苏州分行

2023 年 2 月

# 目 录

一、前言.....	3
二、释义.....	4
三、承诺与声明.....	8
四、当事人及权利义务.....	9
五、集合资产管理计划的基本情况.....	15
六、集合资产管理计划的募集.....	17
七、集合计划的成立与备案.....	19
八、集合计划存续期的参与、退出和转让.....	20
九、份额持有人大会及日常机构.....	27
十、份额的登记.....	27
十一、集合计划的投资.....	28
十二、利益冲突及关联交易.....	36
十三、投资经理的指定与变更.....	37
十四、集合计划的财产.....	38
十五、指令的发送、确认和执行.....	39
十六、越权交易.....	42
十七、集合计划的估值和会计核算.....	43
十八、本集合计划的会计政策.....	48
十九、集合计划的费用与税收.....	49
二十、集合计划的收益分配.....	53
二十一、集合计划的信息披露.....	55
二十二、风险揭示.....	57
二十三、集合计划合同的变更、终止与财产清算.....	63
二十四、违约责任.....	68
二十五、争议的处理.....	70
二十六、合同的效力.....	70
二十七、其他事项.....	71

特别约定：当《东海证券海阳 3 号集合资产管理计划资产管理合同》（以下简称“本合同”或“集合资产管理合同”）以电子签名方式签订时，管理人、托管人作为本合同签署方，已接受本合同项下的全部条款；投资者（东海证券海阳 3 号集合资产管理计划的投资者）作为本合同一方，以电子签名方式签署本合同即表明投资者完全接受本合同项下的全部条款，同时本合同成立。

投资者、管理人、托管人同意遵守《电子签名法》、《证券公司资产管理电子签名合同操作指引》的有关规定，三方一致同意投资者自签署《电子签名约定书》之日起，投资者以电子签名方式接受电子签名合同（即本合同、集合计划说明书）、风险揭示书或其他文书的，视为签署本合同、集合计划说明书、风险揭示书或其他文书，与在纸质合同、纸质风险揭示书或其他文书上手写签名或者盖章具有同等的法律效力，无须另行签署纸质合同、纸质风险揭示书或其他文书。

## 一、前言

为规范东海证券海阳 3 号集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”或“本计划”或“集合计划”或“计划”）运作，明确《东海证券海阳 3 号集合资产管理计划资产管理合同》（以下简称“本合同”）当事人的权利与义务，依照《中华人民共和国民法典》（以下简称《民法典》）、《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》（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《运作规定》）、《集合资产管理计划资产管理合同内容与格式指引（试行）》等有关法律法规及中国证券投资基金业协会（以下简称“证券投资基金业协会”）等自律组织文件的规定，投资者、管理人、托管人在平等自愿、诚实信用原则的基础上订立本合同。本合同是规定当事人之间基本权利义务的法律文件，当事人按照《基金法》、《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。

管理人对本集合计划的设立、变更、展期、终止、清算等行为向证券投资基金业协会进行备案，并抄报中国证监会相关派出机构。

证券投资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，也不代表证券投资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，除非文义另有所指，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：指东海证券海阳 3 号集合资产管理计划；

集合计划说明书、说明书：指《东海证券海阳 3 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；

集合资产管理合同、资产管理合同、本合同：指《东海证券海阳 3 号集合资产管理计划资产管理合同》及对该合同的所有有效的修订和补充；

托管协议：指《东海证券海阳 3 号集合资产管理计划资产托管协议》及对该协议的任何有效修订和补充；

风险揭示书：指《东海证券海阳 3 号集合资产管理计划风险揭示书》及对其任何有效修订和补充；

《基金法》：指 2003 年 10 月 28 日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，2012 年 12 月 28 日经第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订，自 2013 年 6 月 1 日起实施，并经 2015 年 4 月 24 日第十二届全国人民代表大会常务委员会第十四次会议《全国人民代表大会常务委员会关于修改〈中华人民共和国港口法〉等七部法律的决定》修改的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订；

《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、国家外汇管理局发布的《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》；

《管理办法》：指 2023 年 1 月 13 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》（证监会令[第 203 号]）；

《运作规定》：指 2023 年 1 月 13 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》（证监会公告[2023]2 号）；

中国证监会、证监会：指中国证券监督管理委员会；

集合资产管理合同当事人：指受集合资产管理合同约定，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、集合计划托管人和投资者；

集合计划管理人、管理人：指东海证券股份有限公司，也简称为“东海证券”；

集合计划托管人、托管人：指中信银行股份有限公司苏州分行，也简称为“中信银行”；

销售机构：指东海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、代理销售本集合资产管理计划的机构；

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东海证券股份有限公司；

投资者：指依据集合资产管理合同和集合计划说明书参与本集合计划的投资者，包括个人投资者和机构投资者；

个人投资者：指依据中华人民共和国有关法律法规、监管规定可以投资于本集合资产管理计划的自然人投资者；

机构投资者：指依法可以投资本集合资产管理计划，在中华人民共和国境内合法注册登记或经有关政府部门批准设立的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织；

合格投资者：指具备相应风险识别能力和风险承担能力，投资于单只资产管理产品不低于一定金额且符合下列条件的自然人和法人或者其他组织：1) 具有 2 年以上投资经历，且满足下列三项条件之一的自然人：家庭金融资产不低于 300 万元，家庭金融资产不低于 500 万元，或者近 3 年本人年均收入不低于 40 万元；2) 最近 1 年末净资产不低于 1000 万元的法人单位；3) 依法设立并接受国务院金融监督管理机构监管的机构；4) 接受国务院金融监督管理机构监管的机构发行的资产管理产品；5) 基本养老金、社会保障基金、企业年金等养老金，慈善基金等社会公益基金，合格境外机构投资者（QFII）、人民币合格境外机构投资者（RQFII）；6) 中国证监会视为合格投资者的其他情形；

份额持有人、持有人：指通过签订集合资产管理合同而依法取得和持有本集合计划份额的投资者；

**集合计划成立日：**指集合计划经过推广达到集合资产管理合同规定的成立条件后，管理人通告集合计划成立的日期；

**募集期：**指自本集合计划启动推广之日起至结束日的期间；

**开放期：**指投资者可以办理集合计划参与或退出等业务的工作日；

**开放日：**指开放期内的每个工作日；

**封闭期：**特指成立日后的一个期间，在此期间投资者不得参与、退出本集合计划；

**锁定持有期：**指本集合计划对投资者份额设置锁定持有期，锁定持有期内投资者不能提出退出申请；锁定持有期满后，投资者可以于开放期申请退出。

**存续期、管理期限：**指计划成立并存续的期间；

**工作日：**指上海证券交易所和深圳证券交易所等相关交易所的正常交易日；

**T 日：**指办理本集合计划业务申请的工作日；

**T+n 日（n 指任意正整数）：**指 T 日后的第 n 个工作日；

**天：**指自然日；

**投资本金：**指投资者参与本集合计划的净参与金额，即参与金额扣除参与费用后的余额。对于投资者在本集合计划募集期参与的集合计划份额，其投资本金还包括参与金额在募集期产生的利息，即在本集合计划募集期参与的集合计划份额的投资本金为净参与金额与募集期产生的利息之和，也即募集期参与份额与计划单位面值之积；

**会计年度：**指公历每年 1 月 1 日至 12 月 31 日；

**参与：**指投资者申请购买本集合计划份额的行为；

**退出：**指投资者按集合资产管理合同规定的条件要求收回全部或部分委托资产的行为；

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

**集合计划份额、计划份额、份额：**指集合计划的最小单位；

**元：**指人民币元；

**计划单位面值、单位面值：**本集合计划的面值为人民币 1.00 元；

**集合计划资产总值、计划资产总值：**指集合计划所投资各类有价证券、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；

**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；

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

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

**权益登记日：**指登记享有收益分配权益的集合计划份额的日期，集合计划份额投资者在权益登记日持有的集合计划份额享有收益分配的权利；

**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）、流动受限的新股以及非公开发行股票、停牌股票、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券和非金融企业债务融资工具等资产；

**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；

**管理人指定网站、管理人网站：**指 <https://www.longone.com.cn>，管理人指定网站变更时以管理人公告为准。

**业绩报酬计提基准：**本合同“业绩报酬计提基准”是管理人计提业绩报酬的基准，也是管理人在运作期间投资管理努力的方向和目标。管理人主要依以下因素制定业绩报酬计提基准：（1）本集合计划的投资策略；（2）本集合计划拟投资或已投资的大类资产组合的比例；（3）各类资产目前收益水平及未来收益的可能变化趋势情况；**业绩报酬计提基准不是预期收益和保证收益率，不构成管理人对委托财产的任何承诺或担保，投资者仍可能面临实际收益达不到业绩报酬计提基准甚至本金受损的风险。**

### 三、承诺与声明

#### (一) 管理人承诺

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

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

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

#### (二) 托管人承诺

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

2、根据法律法规、中国证监会及证券投资基金业协会的规定和资产管理合同的约定，对管理人的投资或清算指令等进行监督。

3、在管理人发生异常且无法履行管理职能时，依照法律法规和合同第二十三条（二）的相关约定执行管理人变更，履行托管人义务范围内的受托职责，维护投资者权益。

管理人发生异常且无法履行管理职能的情况：

（1）管理人依法解散、被依法撤销或被依法宣告破产的，且份额持有人未就另行聘请管理人达成一致意见的；

（2）管理人被依法取消管理人相关资格，且未能依法律法规及本合同的规定选任新的管理人的；

（3）管理人违反法律法规或违反本协议约定给投资人造成重大损失的，且失联的。

#### (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。



住所：江苏省常州市延陵西路 23 号投资广场 18 层

通信地址：上海市浦东新区东方路 1928 号东海证券大厦

邮政编码：200125

联系电话：021-20333333

托管人

机构名称：中信银行股份有限公司苏州分行

负责人：赵元新

通信地址：苏州工业园区苏州大道东 266 号金融港商业中心西楼

邮政编码：215021

联系电话：0512-65190417

（二）本集合计划设定为均等份额。每份份额具有同等的合法权益。

（三）投资者的权利：

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

（四）投资者的义务：

- 1、认真阅读并遵守资产管理合同，保证投资资金的来源及用途合法；
- 2、接受合格投资者认定程序，如实填写风险识别能力和风险承担能力问卷，如实提供资金来源、金融资产、收入及负债情况，并对其真实性、准确性和完整性负责，签署合格投资者相关文件；
- 3、除公募资产管理产品外，以合伙企业、契约等非法人形式直接或者间接投资于本集合计划的，应向管理人充分披露实际投资者和最终资金来源；

- 4、认真阅读并签署风险揭示书；
- 5、按照资产管理合同约定支付本集合计划份额的参与款项，承担资产管理合同约定的管理费、业绩报酬、托管费、审计费、税费等合理费用；
- 6、在持有的本集合计划份额范围内，承担本集合计划亏损或者终止的有限责任；
- 7、向管理人或本集合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、不得从事任何有损本集合计划及其投资者、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，不得泄露本集合计划的投资计划、投资意向等；不得利用本集合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、在签署本合同前，向管理人、托管人书面告知投资人的关联方发行的证券名单或其他禁止交易的证券名单，在上述证券名单发生变更时，及时书面通知管理人和托管人；
- 12、在本计划存续期间及时关注管理人的短信、电话、邮件、传真以及其公司网站公告；
- 13、理解并同意承担委托财产的投资、运作、托管面临本合同之第二十二部分“风险揭示”以及风险揭示书中列举的各类风险；
- 14、投资人以其管理的资产管理产品投资于本集合计划的，该产品的所有投资者为符合法律法规规定的合格投资者且委托财产来源合法合规，且均非资产管理产品；投资者承诺投资本计划不存在违反监管要求的产品嵌套，以及以投资本计划规避投资范围、杠杆约束等监管要求等违法违规行为；
- 15、法律法规、中国证监会及证券投资基金业协会规定和资产管理合同约定的其他义务。

#### （五）管理人的权利

- 1、按照资产管理合同约定，独立管理和运用本集合计划财产；
- 2、按照资产管理合同约定，及时、足额获得管理人管理费用及业绩报酬；

3、按照有关规定和资产管理合同约定行使因本集合计划财产投资所产生的权利；

4、根据资产管理合同及其他有关规定，监督托管人，对于托管人违反资产管理合同或有关法律法规规定、对本集合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本集合计划提供募集、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，代表本集合计划行使投资过程中产生的权属登记等权利；

7、管理人有权根据市场情况对本集合计划的总规模、单个资产投资者首次参与金额、每次参与金额及持有的本计划总金额限制进行调整；

8、有权对投资者进行尽职调查，要求投资者提供相关证明文件、资料，并在上述文件和资料发生变更时，及时提交变更后的相关文件与资料；

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。

#### （六）管理人的义务

1、依法办理本集合计划的销售、登记、备案事宜；

2、按照证券投资基金业协会要求报送本集合计划运行信息；

3、按照诚实信用、勤勉尽责的原则履行受托人义务，管理和运用本集合计划财产；

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

5、制作风险揭示书，向投资者充分揭示相关风险；

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

7、建立健全的内部管理制度，保证本集合计划财产与其管理的其他集合计划财产、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；

8、除依据法律法规、资产管理合同及其他有关规定外，不得为管理人及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作本集合计划财产；

9、保守商业秘密，不得泄露本集合计划的投资计划、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、以管理人的名义，代表投资者利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；

14、按照合同约定计算并向投资者报告本集合计划份额净值；

15、确定本集合计划份额参与、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；

16、按照合同约定负责本集合计划会计核算并编制财务会计报告；

17、保证向投资者支付的受托资金及收益返回其参与资产管理计划时使用的结算账户或其同名账户；

18、聘请符合《证券法》规定的会计师事务所对年度财务会计报告进行审计；

19、按照合同的约定确定收益分配方案，及时向投资者分配收益；

20、根据法律法规与合同的规定，编制向投资者披露的本集合计划季度、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；

21、办理与受托财产管理业务活动有关的信息披露事项；

22、建立并保存投资者名单；

23、组织并参加本集合计划财产清算小组，参与资产管理财产的保管、清理、估价、变现和分配；

24、按照法律、行政法规和中国证监会的规定，保存本集合计划的会计账册，妥善保存有关的合同、协议、交易记录等文件、资料和数据，保存期限自本集合计划终止之日起不得少于20年；

25、面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会相关派出机构、证券投资基金业协会并通知托管人和投资者；

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

#### （七）托管人的权利

- 1、按照资产管理合同约定，依法保管本集合计划财产；
- 2、按照资产管理合同约定，及时、足额获得本集合计划托管费用；
- 3、法律法规、中国证监会及证券投资基金业协会规定的和资产管理合同约定的其他权利。

#### （八）托管人的义务

- 1、安全保管本集合计划财产；
- 2、除依据法律法规规定和资产管理合同的约定外，不得为托管人及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管本集合计划财产；
- 3、对所托管的不同财产分别设置账户，确保本集合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、按规定开立和注销本集合计划的托管账户及其他投资所需账户；
- 6、复核本集合计划资产净值和份额净值；
- 7、办理与本集合计划托管业务有关的信息披露事项；
- 8、根据相关法律法规和资产管理合同约定，复核管理人编制的本集合计划财产的定期报告，并出具书面意见；
- 9、编制托管年度报告，并向证券投资基金业协会备案，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，根据管理人的划款指令，及时办理清算、交割事宜；

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

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

13、监督管理人的投资运作，发现管理人的投资或清算指令违反法律、行政法规、中国证监会的规定或资产管理合同约定的，应当拒绝执行，立即通知管理人并及时报告中国证监会相关派出机构和证券投资基金业协会；

14、国家有关法律法规、监管机构及资产管理合同规定的其他义务。

## 五、集合资产管理计划的基本情况

(一) 集合计划的名称：东海证券海阳 3 号集合资产管理计划。

(二) 集合计划的类别：混合类集合资产管理计划。

(三) 集合计划的运作方式：开放式。

1、封闭期：开放期以外的期间，均为本集合计划的封闭期。封闭期内不办理参与、退出业务。

2、开放期：本集合计划自成立之日起每个自然月初的前 3 个工作日为开放期，开放期内可以办理参与、退出业务。若遇法定节假日、休息日等顺延，具体开放日期以管理人的公告为准。管理人有权提前结束或延长开放期，届时将在管理人网站上公告。

3、锁定持有期：投资者每笔份额的锁定持有期为 170 个自然日，投资者只能在锁定持有期满后的开放期申请退出，但本合同另有约定的除外。

4、临时开放期：若因本计划管理人决定展期或变更合同的，管理人将通过网站公告的形式征询投资者的意见。投资者不同意的，管理人将为不同意的投资者设置临时开放期，临时开放期内投资者仅可退出本计划，不可申购本计划份额。

(四) 集合资产管理计划目标规模

本集合计划销售期和存续期规模不设上限，单个客户首次参与金额不低于 40 万元（含参与费），追加参与的最低金额为 1000 元的整数倍。本集合计划投资者数量为 2 人以上(含)200 人以下(含)。本集合计划设定为均等份额。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。

管理人有权根据实际情况调整销售期的目标规模、首次参与起点金额，并由管理人在管理人指定网站公告。

#### （五）集合计划的投资目标、主要投资方向、投资比例

##### 1、投资目标

在控制和分散投资组合风险的前提下，追求较高的当期收益和投资回报。

##### 2、投资范围

本集合计划投资标的为符合法律法规及监管认定的金融工具，主要投资于国内依法发行的股票（包括二级市场买入及新股申购的主板、创业板、科创板、港股通及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、债券（含国债、政策性金融债、可交换债券、可转换债券等）、同业存单、公开募集证券投资基金、债券正回购、债券逆回购、银行存款以及中国证监会认可的其他投资品种。

如法律法规或监管机构以后允许资产管理计划投资其他品种，管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

##### 3、资产配置比例

（1）权益类资产，包括股票（包括二级市场买入及新股申购的主板、创业板、科创板、港股通及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、股票型和混合型证券投资基金等占集合计划资产总值的比例为：0-80%；

（2）固定收益类资产，包括债券（含国债、政策性金融债、可交换债券、可转换债券等）、同业存单、债券正回购、债券逆回购、银行存款（包括但不限于银行定期存款、协议存款、同业存款等各类存款）、债券型证券投资基金、货币市场基金等占集合计划资产总值的比例为：0-80%；

（3）现金类资产，包括现金、银行活期存款等占集合计划资产总值的比例为：0-100%。

因证券市场波动、证券发行人合并、集合计划规模变动等管理人之外的因素导致集合计划投资不符合法律、行政法规和中国证监会规定的投资比例或者合同约定的投资比例的，管理人应当在流动性受限资产可出售、可转让或者恢复交易的 20 个交易日内调整至符合相关要求。确有特殊事由未能在规定时间内完成调整的，管理人应当及时向中国证监会相关派出机构报告。每个开放期的前、后

20 个交易日以及开放期期间不受前述投资组合比例的限制。

#### （六）集合计划的风险等级

本计划的产品风险等级为 R3（中风险），本产品适合于专业投资者及普通投资者中风险承受能力等级为 C3 及高于 C3 的投资者。投资者承诺并确认自身风险承受能力符合本计划要求，自愿承担参与本计划投资所产生的全部风险。

管理人将定期或不定期对本计划的风险等级重新评估。经与托管人书面协商一致后，可根据重新评估的情况对风险等级进行调整。新的风险等级应在管理人网站公告，公告满 5 个工作日后生效。若调低风险等级，全体投资者同意管理人不再按照本合同“第二十三部分 集合计划合同的变更、终止与财产清算”的规定进行合同变更事宜。若调高风险等级，管理人应当按照本合同“第二十三部分 集合计划合同的变更、终止与财产清算”的规定进行合同变更事宜。

#### （七）集合计划的存续期限

本集合计划的存续期限为自集合计划成立之日起的 10 年，在合同约定的条件下可以展期、提前终止。

（八）集合计划份额的初始募集面值：人民币 1.00 元。

（九）集合计划的最低初始募集规模：人民币 1000 万元。管理人可以在符合监管要求的募集规模限额内进行初始募集规模的调整并进行公告，该规模调整不涉及合同变更流程。

（十）集合计划的初始募集规模上限：本集合计划不设置募集规模上限。

（十一）份额登记、估值与核算服务机构：本集合计划的份额登记机构、估值与核算机构、信息技术系统机构均为管理人，无相关服务机构。

## 六、集合资产管理计划的募集

（一）本集合计划的募集对象、募集方式、募集期限

### 1、募集对象

本集合计划适合向合格投资者中的专业投资者及风险承受能力为 C3、C4、C5 的普通投资者推广。本集合计划投资者的风险承受能力应当与集合计划的风险等级相匹配。本集合计划投资者人数累计不得超过二百人。

### 2、募集方式

本集合计划通过管理人和/或管理人委托的代销机构进行募集。本集合计划销售机构及其从业人员以非公开方式向投资者募集资金。

### 3、募集期限

本集合计划的募集期限由管理人在募集期开始前确定，在募集期结束前，管理人有权根据本集合计划的销售情况延长或缩短募集期。初始募集期自本集合计划份额发售之日起不超过 60 天。

#### (二) 集合计划的认购事项

##### 1、认购费用

投资者在初始募集期认购本集合计划，按照单笔认购金额的不同而收取相应的认购费用。

单笔认购金额（含认购费）M	认购费率
M < 100 万元	1.20%
100 万元 ≤ M < 500 万元	1.00%
M ≥ 500 万元	0.80%

##### 2、认购的程序

投资者在销售机构规定的交易时间段内办理认购申请。投资者应在销售机构开设其认可的交易账户，并在交易账户备足认购的货币资金，若交易账户内参与资金不足，销售机构不受理该笔参与申请。当日办理业务申请仅能在当日业务办理时间内撤销。

投资者通过纸质合同或电子合同的方式签署本合同后，方可申请认购集合计划。

##### 3、认购申请的确认

认购申请的确认以管理人的确认结果为准。投资者募集期认购的，可于集合计划成立后 2 个工作日内到办理认购的营业网点查询认购确认情况。

本集合计划募集人数上限为 200 人，且管理人可以设置募集规模上限。超额募集的控制措施具体见本合同第八条集合计划存续期的参与、退出和转让中“集合计划规模、人数超额募集的控制措施”。

##### 4、认购份额的计算方式

净认购金额 = 认购金额 / (1 + 认购费率)

认购费用=认购金额-净认购金额

认购份额=(净认购金额+利息)/面值

认购份额以四舍五入的方法保留小数点后两位,由此产生的差额部分计入集合计划资产的损益。

(三) 本集合计划的最低认购金额、支付方式

投资者首次参与集合计划的最低认购金额为人民币 40 万元(含认购费)。超过最低参与金额的部分按 1000 元的整数倍递增。管理人可以对集合计划最低认购金额进行调整(但需满足法律法规及监管规定)无需进行合同变更程序。

(四) 本集合计划募集结算专用账户和销售机构委托募集账户(如有)在管理人指定网站披露,投资者可以登录查询。

(五) 初始认购资金的管理及利息处理方式

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

投资者的认购参与款项(不含认购费用)加计其在初始销售期形成的利息将折算为本集合计划份额归投资者所有,利息金额以集合计划注册登记机构的记录为准。

## 七、集合计划的成立与备案

(一) 集合计划成立的有关事项

1、集合计划成立的条件

集合计划的初始募集规模不低于 1000 万元人民币,投资者人数不少于 2 人且不超过 200 人,募集过程符合法律、行政法规和中国证监会的规定。

2、集合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集合计划成立。

3、集合计划募集失败的处理方式

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,管理人承担集合计划的全部募集行为而产生的费用,并将已认购资金及同期利息在募集期结束后 30 日内退还集合计划

投资者。

(二) 集合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集合计划成立。管理人应在本集合计划成立之日起 5 个工作日内报证券投资基金业协会备案，抄报中国证监会相关派出机构。集合计划成立前，任何机构和个人不得动用投资者参与资金。

(三) 集合计划在成立后备案完成前的投资活动

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。

(四) 募集期届满，本集合计划未达到成立条件的，管理人应当承担的责任：

- 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。

## 八、集合计划存续期的参与、退出和转让

(一) 参与和退出场所

本集合计划的参与和退出将通过销售机构进行。具体的销售机构将由管理人在本合同或其他相关公告中列明。管理人可根据情况变更或增减销售机构，并予以公告。投资者应当在销售机构办理集合计划销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理集合计划份额的参与和退出。

(二) 参与和退出的开放日和时间

投资者按销售机构的具体安排，在开放日的交易时间段内办理参与和退出申请。当日的参与和退出申请可以在管理人规定的时间以内撤销。

本集合计划存续期内，本集合计划自成立之日起每个自然月初的前 3 个工作日为开放期，开放期内可以办理参与、退出业务。若遇法定节假日、休息日等顺延，具体开放日期以管理人的公告为准。管理人有权提前结束或延长开放期，届时将在管理人网站上公告。投资者每笔份额的锁定持有期为 170 个自然日，投资者只能在锁定持有期满后的开放期申请退出，但本合同另有约定的除外。

### （三）临时开放期的触发条件、程序及披露

若因本计划管理人决定展期或变更合同的，管理人将通过网站公告的形式征询投资者的意见。投资者不同意的，管理人将为不同意的投资者设置临时开放期，临时开放期内投资者仅可退出本计划，不可申购本计划份额。

### （四）参与和退出的方式

1、“金额参与、份额退出”原则，即参与以金额申请的方式，退出以份额申请的方式。

2、退出“先进先出”原则，即按照投资者份额参与的先后次序进行顺序退出的方式确定退出份额。

### （五）参与和退出的价格

参与和退出采用“未知价”原则，即参与、退出集合计划的价格以申请日（T日）收市后计算的集合计划每份额净值为基准进行计算。

### （六）参与和退出的程序及确认

#### 1、参与的程序和确认

（1）投资者按销售机构的具体安排，在规定的交易时间段内办理；

（2）投资者应开设销售机构认可的交易账户，并在交易账户备足认购/申购的货币资金；若交易账户内参与资金不足，销售机构不受理该笔参与申请；

（3）投资者签署本合同后，方可申请参与集合计划。参与申请经管理人确认有效后，构成本合同的有效组成部分；

（4）管理人在 T+2 日对 T 日参与申请的有效性进行确认。投资者可于 T+3 日后在办理参与的网点查询参与确认情况。

#### 2、退出的程序和确认

##### （1）退出申请的提出

投资者必须根据本合同约定及本集合计划销售机构网点规定的手续，在开放日的业务办理时间内向销售机构网点提出退出申请。申请退出份额数量超过投资者持有份额数量时，申请无效。

##### （2）退出申请的确认

管理人在 T+2 日对 T 日退出申请的有效性进行确认。投资者可在 T+3 日后到销售机构网点取得退出申请成交确认单，若交易未成功或数据不符，投资者可与

为其办理手续的网点人员联系并进行核实。投资者的退出申请确认后，退出款项划拨自退出申请确认后 5 个工作日内完成。

#### （七）参与和退出的金额限制

投资者在集合计划存续期开放日购买集合计划份额的，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（40 万元，含参与费用），已持有集合计划份额的投资者在集合计划存续期开放日追加购买集合计划份额的除外。超过最低参与金额的部分按 1000 元的整数倍递增。管理人可以对集合计划参与的最低金额进行调整（但需满足法律法规及监管规定），无需进行合同变更程序。

投资者持有的集合计划份额资产净值高于 40 万元时，可以选择部分退出，但退出后持有的集合计划份额净值应当不低于 40 万元。投资者持有的集合计划份额净值低于 40 万元时，投资者需要退出的，应当一次性申请全部退出，没有一次性申请全部退出的，管理人将在退出申请确认日对该投资者所持的全部份额做退出确认。

#### （八）参与和退出的费用

##### 1、参与的费用

集合计划的参与费采用价外支付的方式进行扣除，按照单笔参与金额的不同而收取相应的参与费用。

单笔参与金额（含参与费）M	参与费率
M < 100 万元	1.20%
100 万元 ≤ M < 500 万元	1.00%
M ≥ 500 万元	0.80%

##### 2、退出的费用

本集合计划的具体赎回费率如下：

持有期限（N）	退出费率
N < 1 年	1.00%
N ≥ 1 年	0

#### （九）参与份额的计算方式

净参与金额 = 参与金额 / (1 + 参与费率)

参与份额=净参与金额/参与申请日集合计划单位净值

参与费用=参与金额-净参与金额

投资者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的损益。

#### （十）退出金额的计算方式

本集合计划份额退出时，以退出申请受理日（T 日）集合计划单位净值作为计价基准，按扣除退出费（若有）和业绩报酬后的实际金额支付。计算如下：

退出金额=（T 日集合计划单位净值×退出份额）×（1-退出费率）-业绩报酬（若有）

#### （十一）巨额退出的认定和处理方式

##### 1、巨额退出的认定

单个开放日，投资者当日累计净退出申请份额（退出申请总份额扣除参与申请总份额之后的余额）超过上一工作日计划总份额数的 20%时，即为巨额退出。

##### 2、巨额退出的顺序、价格确定和款项支付

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

（1）全额退出：当管理人认为有条件支付投资者的退出申请时，按正常退出程序办理。

（2）部分顺延退出：当管理人认为支付投资者的退出申请可能会对计划资产净值造成较大波动时，管理人在当日接受净退出比例不低于集合计划总份额 20%的前提下，对其余退出申请予以延期办理。对于当日的退出申请，将按单个账户退出申请量占退出申请总量的比例，确定当日受理的退出份额；未能受理的退出部分，投资者可选择延期办理或撤销退出申请。对于选择延期办理的退出申请，管理人将在下一个工作日内办理，并以该工作日的计划单位净值为准计算退出金额，依此类推，直至全部办理完毕为止，但不得超过正常支付时间 20 个工作日，转入下一个工作日的退出申请不享有优先权。

##### 3、告知投资者的方式

发生巨额退出并延期支付时，管理人应选择邮寄、传真、电话或网上公告等方式在开放日后 5 个工作日内通知申请退出的投资者，并说明有关处理方法。

## （十二）连续巨额退出的认定和处理方式

### 1、连续巨额退出的认定

如果本集合计划连续 2 个开放日发生巨额退出，即认为发生了连续巨额退出。

### 2、连续巨额退出的顺序、价格确定和款项支付

本集合计划发生连续巨额退出，管理人可按说明书及资产管理合同载明的规定，暂停接受退出申请，但暂停期限不得超过 20 个工作日；已经接受的退出申请可以延缓支付退出款项，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上进行公告。

## （十三）单个投资者大额退出的预约申请

单个投资者从本集合计划中一次退出份额达到或超过 1000 万份（含）时，认定为大额退出。投资者必须提前 10 个工作日直接或通过销售机构向管理人预约申请，未经预约，管理人有权拒绝其退出申请。

## （十四）拒绝或暂停参与的情况及处理方式

如出现如下情形，集合计划管理人可以拒绝或暂停集合计划投资者的参与申请：

- 1、不可抗力的原因导致集合计划无法正常运行；
- 2、本集合计划出现或可能出现超额募集情况；
- 3、集合计划管理人、集合计划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、销售机构对投资者资金来源表示疑虑，投资者不能提供充分证明的；
- 5、集合计划管理人认为会有损于现有集合计划投资者利益；
- 6、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。

## （十五）拒绝或暂停退出的情形及处理

发生下列情形时，管理人可以拒绝或暂停受理投资者的退出申请：

- 1、不可抗力的原因导致集合计划无法正常运行；
- 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说明书、资产管理合同中已载明且中国证监会无异议的特殊情形。

#### （十六）集合计划规模、人数超额募集的控制措施

本集合计划在募集期或存续期内，管理人可以设置参与规模上限，并对超额募集部分做控制。

若销售机构 T 日接受的参与申请数量过多，致使实际参与总人数超出参与人数上限，销售机构将于 T+1 日停止接受参与申请。管理人在 T+2 日对于 T 日提交的参与申请，在各销售机构所分配的人数上限内，按投资者参与申请单号从小到大排序确认有效参与。若加上某一投资者后，该销售机构的参与人数超出了分配参与人数上限，则管理人对该参与人及大于该申请单号的参与人予以全部拒绝，超出参与人数上限的投资者的参与金额由销售机构退回至投资者指定资金账户。

若销售机构 T 日接受的参与申请数量过多，致使募集总额超出目标规模，销售机构将于 T+1 日停止接受参与申请。管理人在 T+2 日对 T 日提交的参与申请，在各销售机构所分配的限额内，按投资者参与申请单号从小到大排序确认有效参与。若加上某一笔参与申请金额后，该销售机构的参与总份额超出了分配额度，则由管理人对该笔参与申请予以部分拒绝，对大于该申请单号的参与申请予以全部拒绝，超出目标规模的参与资金将退回投资者指定资金账户。

#### （十七）集合计划份额的转让

本集合计划暂时不支持份额的转让。但在条件允许的情况下，本集合计划份额方可转让。集合计划份额转让业务的开通和处理方式、份额转让的实际收费标准以管理人公告为准。在符合管理人公告的条件下，并经管理人同意后，投资者可以通过证券交易所以及中国证监会认可的其他方式，向合格投资者转让其持有的集合计划份额，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。受让方首次参与集合计划，应满足合格投资者的条件，并与管理人、托管人签订集合资产管理合同。

#### （十八）集合计划份额的非交易过户

1、管理人及注册登记机构只受理继承、捐赠、司法强制执行和经注册登记机构认可的其他情况下的非交易过户。其中：

“继承”是指投资者死亡，其持有的计划份额由其合法的继承人继承。

“捐赠”是指投资者将其持有的计划份额向公益机构转赠，或将其持有的计划份额产生的收益向公益机构转赠。

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

2、办理非交易过户业务必须提供注册登记机构规定的相关资料。符合条件的非交易过户申请自申请受理日起 2 个月内办理；申请人按注册登记机构规定的标准缴纳过户费用。

#### （十九）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。

#### （二十）集合计划份额的强制司法执行

投资者持有的集合计划份额被强制司法执行时，管理人将对该集合计划份额进行相应的控制（控制手段包括限制退出等）；管理人不允许该集合计划份额退出，并依法配合司法机关对该集合计划份额的强制执行。

#### （二十一）集合计划份额的转托管

本集合计划存续期间投资者不得将其所拥有的集合计划份额进行转托管；如本集合计划存续期间法律法规或管理人对转托管事宜有新的规定，则转托管的处理方式以管理人公告为准。

#### （二十二）管理人自有资金参与集合计划

管理人以自有资金参与本集合计划的：

##### 1、自有资金参与的金额和比例

在集合计划存续期内，管理人自有资金持有本集合计划份额不超过集合计划总份额的 16%。管理人及其子公司以自有资金参与本集合计划的份额合计不得超过集合计划总份额的 50%。

##### 2、自有资金的责任承担方式与收益分配

管理人自有资金所持的集合计划份额与投资者持有的集合计划份额享有同

等权益、承担同等风险。管理人自有资金不对投资者的本金和收益进行赔付。

### 3、自有资金的参与、退出

管理人自有资金参与集合计划的持有期限不得低于 6 个月,参与、退出时应当提前 5 个工作日以网站公告的形式告知全体投资者和托管人。投资者应在公告指定的日期内按指定的形式回复意见,逾期未做答复的,视为投资者同意自有资金参与、退出事项。投资者向管理人答复不同意自有资金参与、退出事项的,则管理人不得以自有资金参与、退出本集合计划。

集合计划存续期间,管理人有权部分或全部退出自有资金持有份额。

因集合计划规模变动等客观因素导致自有资金参与集合计划被动超过法律、法规规定比例的,管理人按照中国证监会规定及时安排自有资金的退出,可不受上述限制。

4、为应对巨额退出以解决流动性风险,或者中国证监会认可的其他情形,在不存在利益冲突并遵守本合同约定的前提下,管理人参与的自有资金参与、退出可不受本条第 1 款、第 3 款的限制,但需事后及时告知投资者和托管人,并向相关中国证监会派出机构报告。

5、集合计划存续期内,当法律法规或有关自有资金参与集合计划的规定或政策发生变更,管理人经与托管人协商一致并公告后,可直接对本部分内容进行修改和调整。

6、风险揭示:管理人自有资金退出,可能遭遇流动性风险,从而影响计划损益。管理人将认真履行管理人职责,关注计划规模变动情况,控制流动性风险。

(二十三)管理人应定期将本集合计划投资者变更情况报送证券投资基金业协会。

## 九、份额持有人大会及日常机构

全体投资者、管理人和托管人一致同意不设置份额持有人大会及日常机构。投资者有权监督管理人的投资运作、托管人的托管活动。

## 十、份额的登记

### (一) 份额登记机构

1、本集合计划的份额登记业务由管理人办理。

2、份额登记机构应履行如下份额登记权限和职责：

(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规定的条件办理本集合计划的注册登记业务；

(3) 按照法律法规的要求，保存投资者资料表、份额持有人名册及相关的认购、参与与退出等业务记录，自本集合计划终止日起不少于 20 年；

(4) 对份额持有人的集合计划账户信息负有保密义务，因违反该保密义务对份额持有人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) 在法律法规允许的范围内，制定和调整登记业务的相关规则；

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

(二) 本集合计划全体投资者在此同意管理人、份额登记机构或其他份额登记义务人将集合资产管理计划投资者名称、身份信息以及集合资产管理计划份额明细等数据备份至中国证监会认定的机构。

## 十一、集合计划的投资

(一) 投资目标

在控制和分散投资组合风险的前提下，追求较高的当期收益和投资回报。

(二) 投资范围及比例

1、投资范围

本集合计划投资标的为符合法律法规及监管认定的金融工具，主要投资于国内依法发行的股票（包括二级市场买入及新股申购的主板、创业板、科创板、港股通及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、债券（含国债、政策性金融债、可交换债券、可转换债券等）、同业存单、公开募集证券投资基金、债券正回购、债券逆回购、银行存款以及中国证监会认可的其他投资品种。

如法律法规或监管机构以后允许资产管理计划投资其他品种，管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

## 2、资产配置比例

(1) 权益类资产，包括股票（包括二级市场买入及新股申购的主板、创业板、科创板、港股通及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、股票型和混合型证券投资基金等占集合计划资产总值的比例为：0-80%；

(2) 固定收益类资产，包括债券（含国债、政策性金融债、可交换债券、可转换债券等）、同业存单、债券正回购、债券逆回购、银行存款（包括但不限于银行定期存款、协议存款、同业存款等各类存款）、债券型证券投资基金、货币市场基金等占集合计划资产总值的比例为：0-80%；

(3) 现金类资产，包括现金、银行活期存款等占集合计划资产总值的比例为：0-100%。

(4) 集合计划的总资产不得超过该计划净资产的 200%；资产管理计划投资于同一发行人及其关联方发行的债券的比例超过其净资产 50%的，该计划的总资产不得超过其净资产的 120%。资产管理计划投资于国债、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不受前述规定限制。

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

(6) 本计划不得再投资公募证券投资基金以外的资产管理产品；

(7) 本集合计划参与股票等证券发行申购时，本集合计划所申报的金额不得超过集合计划的总资产，本集合计划所申报的数量不得超过拟发行公司本次发行的总量；

(8) 信用类债券的债项或发行人主体评级不得低于 AA；短期融资券债项评级不得低于 A-1 或发行人主体评级不得低于 AA（本条所述评级均不含中债资信评级）。

(9) 法律法规及中国证监会规定的和《集合计划合同》约定的其他投资限制。

本集合计划的建仓期自产品成立之日起不得超过 6 个月，集合计划在 6 个月内需符合上述投资比例要求。同时，在建仓期及集合计划开放期前、开放期间管

理人可以根据投资情况及产品流动性情况在账户上全部或部分持有现金以及中国证监会认可的其他现金管理类工具等现金类资产。

### （三）投资比例超限的处理方式及流程

因证券期货市场波动、证券发行人合并、本集合计划规模变动等管理人之外的因素导致本集合计划投资不符合法律、行政法规和中国证监会规定的投资比例或者合同约定的投资比例的，管理人应当在流动性受限资产可出售、可转让或者恢复交易的 20 个交易日内调整至符合要求。确有特殊事由未能在规定时间内完成调整的，管理人应当及时向中国证监会相关派出机构报告。产品的实际投向不得违反合同约定，如有改变，应当先行取得投资者书面同意并书面告知托管人，并履行登记备案等法律法规以及金融监督管理部门规定的程序。

### （四）风险收益特征

本计划的产品风险等级为 R3（中风险），本产品适合于专业投资者及普通投资者中风险承受能力等级为 C3 及高于 C3 的投资者。投资者承诺并确认自身风险承受能力符合本计划要求，自愿承担参与本计划投资所产生的全部风险。

### （五）投资策略

#### 1、资产配置策略

在具体的资产配置过程中，本集合计划根据宏观经济发展趋势、政策面因素、金融市场的利率变动和市场情绪，综合运用定性和定量的方法，对股票、债券和现金类资产的预期收益风险及相对投资价值进行评估，确定计划资产在股票、债券及现金类资产等资产类别的分配比例。在有效控制投资风险的前提下，形成大类资产的配置方案。

#### 2、股票投资策略

股票方面，主要根据宏观经济运行、上下游行业运行态势与利益分配的观察来确定优势或景气行业，以最低的组合风险筛选出备选股票池。并在此基础上通过定性和定量相结合的方法，主要通过对品质、成长性和估值三个方面进行评估，筛选出各个子行业中具有竞争优势的优质上市公司。同时，根据科创板和创业板独特性、成长性特点，更多的关注其在技术、商业模式、用户或产品创新方面的能力，以及上述能力所带来的市场空间和壁垒强度。在估值定价方面，除原有景气周期和 PE、PB 判断，也通过 PS、FCF 等估值方法寻找投资时机。

### 3、新股申购投资策略

本计划将积极关注科创板、创业板、主板等股票新股申购的投资机会。通过深入研究行业的竞争格局、发展潜力，分析公司主营业务/产品的核心技术、发展前景和空间，坚持“三好”标准，选择管理水平优良、核心优势突出、盈利确定性高的公司。

### 4、债券投资策略：

#### （1）债券类属配置策略

根据国债、企业债等不同债券板块之间的相对投资价值分析，增持价值被相对低估的债券板块，减持价值被相对高估的债券板块，借以取得较高收益。

#### （2）信用债投资策略

信用债券收益率是与其具有相同期限的无风险收益率和反映信用风险收益的信用利差之和。基准收益率主要受宏观经济环境的影响，信用利差收益率主要受对应的信用利差曲线以及该信用债券本身的信用变化的影响，因此本计划主要采用持有到期策略，并结合信用利差曲线变化的策略。

##### ① 持有到期策略

本计划主要配置期限在一年以内的短期融资券、公司债、企业债等品种，采用持有到期策略。

本计划在采用持有到期策略为主的前提下重点跟踪所持债券品种的信用状况，依靠内部信用评级系统持续跟踪研究发债主体的经营状况、财务指标等情况，对其信用风险进行评估并作出及时反应。

为了准确评估发债主体的信用风险，本计划设计了定性和定量相结合的内部信用评级体系。内部信用评级体系遵循从“行业风险”—“公司风险”（包括公司背景、公司行业地位、企业盈利模式、公司治理结构和信息披露状况及企业财务状况）—“外部支持”（外部流动性支持能力及债券担保增信）—“得到评分”的评级过程。其中，定量分析主要是指对企业财务数据的定量分析，主要包括四个方面：盈利能力分析、偿债能力分析、现金流获取能力分析、营运能力分析。定性分析包括所有非定量信息的分析和研究，它是对定量分析的重要补充，能够有效提高定量分析的准确性。本计划内部的信用评级体系定位为即期评级，侧重于评级的准确性，从而为信用产品的实时交易提供参考。本计划会对宏观、行业、

公司自身信用状况的变化和趋势进行跟踪，发掘相对价值被低估的债券，以便及时有效地抓住信用债券本身信用变化带来的市场交易机会。

本计划将根据信用债券市场的收益率水平，在综合考虑信用等级、期限、流动性、息票率、提前偿还和赎回等因素的基础上，建立收益率曲线预测模型和信用利差曲线预测模型，并通过这些模型进行估值，重点选择具备以下特征的信用债券：较高到期收益率、预期信用质量将改善以及价值尚未被市场充分发现的个券。

## ② 基于信用利差曲线变化的策略

本计划将从以下两方面分析信用利差的变化情况，并采取相应的投资策略：

宏观经济环境对信用利差的影响：当宏观经济向好时，信用利差可能由于发债主体盈利能力改善而收窄；反之，信用利差可能扩大。本计划将根据宏观经济的变化情况，加大对信用利差收窄的债券的投资比例。

市场供求关系对信用利差的影响：信用债券的发行利率、企业的融资需求等都将影响债券的供给，而政策的变化、其他类属资产的收益率等也将影响投资者对信用债券的需求，从而对信用利差产生影响。本计划将综合分析信用债券市场容量、市场形势预期、流动性等因素，在具有不同信用利差的品种间进行动态调整。

## （3）可转换债券投资策略

由于可转换债券兼具债性和股性，其投资风险和收益介于股票和债券之间，可转换债券通过分析不同市场环境下其股性和债性的相对价值，把握可转换债券的价值走向，选择相应券种，从而获取较高投资收益。本集合计划将选择公司基本面优良、具有较高上涨潜力的可转换债券进行投资，以合理价格买入并持有。

## 5、现金类资产投资策略

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。

上述投资策略为管理人主要运用的投资策略，本集合计划投资策略包括但不限于上述策略。投资经理可在本集合计划投资范围内，根据市场变动及自主判断

采用其他投资策略。

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

2、宏观经济发展趋势、微观经济运行环境和证券市场走势，以及投资品种发行主体的经营状况、信用状况和价值分析；

3、投资对象收益和风险的配比关系。本集合计划在衡量投资对象的收益与风险之间的配比关系时，以力争集合计划的资产安全为重要衡量标准，在此基础上争取较高的收益。

#### （七）投资程序

##### 1、投资决策机制

本集合计划采用投资决策委员会授权下的投资经理负责制。投资决策委员会的主要职责是确定集合计划的重大资产配置方案、重大投资计划、审批重大单项投资决定，审视投资组合风险情况等。

投资经理的主要职责是在投资决策委员会的授权范围内负责集合计划的日常投资管理，构建和调整投资组合，并向交易团队下达投资指令。

交易团队负责交易执行和一线监控。通过严格的交易制度和实时的一线监控功能，保证投资经理的投资指令在合法、合规的前提下得到高效的执行。

##### 2、投资决策程序

投资决策委员会是本集合计划的最高决策机构，投资决策委员会定期就投资管理业务的重大问题进行讨论。投资经理、分析师、交易员在各自职责内按照业务程序独立工作并合理地相互制衡。具体的投资管理程序如下：

（1）研究团队研究员完成相应的研究报告，为投资决策提供依据；

（2）投资决策委员会定期召开投资决策会议，对资产配置比例提出指导性意见，并讨论投资重点等；

（3）投资经理根据投资决策委员会决议，依据分析师的宏观经济分析和策略建议、行业分析和个券研究，结合本集合计划产品定位及风险控制的要求，在

权限范围内制定具体的投资组合方案；

(4) 投资经理根据集合计划投资组合方案，向集中交易室下达交易指令；

(5) 交易指令通过风控系统的自动合规核查后，由交易团队执行，交易团队对交易情况及时反馈；

(6) 投资经理对每日交易执行情况进行回顾，并审视集合计划投资组合的变动情况；

(7) 合规风控团队定期完成有关投资风险监控报告。

投资决策委员会有权根据市场变化和实际情况的需要，对上述投资管理程序作出调整。

(八) 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、参见本章（二）投资范围、投资比例及投资限制的约定；

2、证券法规规定和集合计划管理合同约定禁止从事的其他投资，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。

本集合计划的投资禁止行为包括：

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

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

3、为违法或者规避监管的证券期货业务活动提供交易便利；

4、从事非公平交易、利益输送等损害投资者合法权益的行为；

5、利用资产管理计划进行商业贿赂；

6、侵占、挪用资产管理计划财产；

7、利用资产管理计划或者职务便利为投资者以外的第三方谋取不正当利益；

8、直接或者间接向投资者返还管理费；

9、以获取佣金或者其他不当利益为目的，使用资产管理计划财产进行不必要的交易；

10、利用资产管理计划，通过直接投资、投资其他资产管理产品或者与他人

进行交叉融资安排等方式，违规为管理人及其控股股东、实际控制人或者其他关联方提供融资；

11、为管理人、托管人、投资顾问（如有）及相关从业人员或他人违规持有金融机构股权提供便利；

12、法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他行为。

#### （九）本集合计划的建仓期

管理人将在集合计划成立之日起的 6 个月为建仓期。建仓期内的投资活动，应当符合本合同约定的投向和本计划的风险收益特征，以现金管理为目的，投资于银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券、货币市场基金等中国证监会认可的投资品种的除外。建仓期结束后，资产管理计划的资产组合应当符合法律、行政法规、中国证监会规定和合同约定的投向和比例。

#### （十）投资的资产组合的流动性

管理人将对集合计划的流动性进行安排，集合计划在开放退出期内投资的 7 个工作日可变现资产的价值不低于集合计划资产净值的 10%。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、期货及标准化期权合约和同业存单，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。

集合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该本集合计划资产净值的 20%。

#### （十一）预警止损机制

1、本计划将计划份额净值 0.8800 元设置为预警线；将计划份额净值 0.8000 元设置为止损线（预警线、止损线的计算以资产管理人与资产托管人核对一致的日终净值为准，下同）。

2、当 T 日计划份额净值低于或等于预警线 0.8800 元时，管理人应于 T+5 日（含）内将权益类资产的比例降至集合计划资产总值的 30%（含）以内。

3、当 T 日计划份额净值低于或等于止损线 0.8000 元时，管理人应于 T+5 日（含）内对本计划持有的全部非现金资产进行变现操作，直至计划资产全部变现为止。计划资产全部变现后本计划提前终止日。

因持有流通受限证券超过本计划存续期等原因导致本计划资产无法及时变

现的，管理人应当于本计划终止后对计划资产进行清算并先行分配已变现部分。本计划持有流通受限证券的，自该等证券可上市流通首日起 5 个交易日内（本计划剩余期限大于等于 5 个交易日的情形）或在本计划终止日前（本计划剩余期限小于 5 个交易日的情形），管理人完成变现操作。因不可抗力或意外事件，导致相关操作无法完成的，操作期限相应顺延。本计划持有多个流通受限的证券及投资产品的，管理人按本款约定进行多次变现及清算。

**在止损卖出过程中，由于大量卖出导致市场价格大幅下跌或因证券跌停、停牌等事件导致证券不能及时卖出等因素，可能给本计划带来损失，导致止损后计划资产净值可能低于止损前计划资产净值。**

#### （十二）投资顾问

本计划未聘请投资顾问。

#### （十三）分级安排

本计划未进行分级安排。

## 十二、利益冲突及关联交易

### （一）利益冲突情形

集合计划存在的或可能存在利益冲突的情形，包括但不限于：

1、管理人将集合计划的资产投资于管理人、托管人及管理人、托管人的控股股东、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，或者从事其他关联交易；

2、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集合计划；

3、管理人自有资金参与和退出本计划；

4、法律、行政法规规定或中国证监会认定的其他情形。

### （二）利益冲突的处理

1、若管理人将集合计划的资产投资于管理人、托管人及管理人、托管人的控股股东、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，或者从事其他关联交易。管理人应在交易完成后 10 个工作日内告知投资者和托管人，并按照现行法律法规、自律规则向监管机构报告。

2、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，并按照现行法律法规、自律规则向监管机构报告。

投资者签署本合同即视为已经充分理解并同意管理人从事前文已经明确列明的关联交易情形，管理人无需就前述具体关联交易再行分别取得投资者的授权，但该等关联交易投资应按照市场通行的方式和条件参与，公平对待委托财产，防止利益冲突，不得损害投资者利益。对于集合计划在投资运作过程中从事除前述列明情形以外的其他关联交易的，则应当事先取得投资者的同意，并应当提供充分证据证明未损害投资者利益。

3、管理人以自有资金参与本集合计划。

管理人在募集期和存续期均可以以自有资金参与本集合计划。管理人以自有资金参与本集合计划，应符合法律法规、监管规定和本合同的相关规定。管理人不得将集合计划资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。

集合计划在投资运作过程中存在利益冲突情形的，管理人应当坚持投资者利益优先原则，从充分维护投资者利益角度积极处理该等利益冲突情形，防范利益输送等违法违规行为。在发生该等利益冲突时，管理人应当视具体利益冲突情形选择在向投资者提供的定期报告或临时报告中披露，具体披露内容包括利益冲突情形、处置方式、对投资者利益的影响等。

## 十三、投资经理的指定与变更

### （一）投资经理

本计划的投资经理由刘希辉先生担任。

投资经理简历：中国科学院微电子学博士，证券从业多年。现任东海证券资产管理部投资经理，曾任东海证券研究所研究员、原东海证券股份有限公司上海证券资产管理分公司研究员、投资经理、兴业经济研究咨询股份有限公司信用分析师。

本计划投资经理已具备证券从业与基金从业资格，近三年未有被监管机构采

取重大行政监管措施、行政处罚。

## （二）投资经理变更的条件和程序

管理人依照恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用本集合计划资产，投资者同意并授权管理人可以根据业务需要变更投资经理。管理人需进行投资经理变更时，将按照内部管理人制度执行投资经理变更流程，并在投资经理变更后五个工作日内在管理人指定网站公告。

## 十四、集合计划的财产

### （一）集合计划财产的保管与处分

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

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

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

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

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

### （二）本集合计划财产相关账户的开立和管理

（1）管理人应当以计划的名义选择代理买卖证券经营机构在中国证券登记结算有限责任公司开立、使用及管理专用证券账户及资金账户，用于本计划证券

投资的清算和存管、证券交易资金清算，证券账户名称应为“东海证券—中信银行—东海证券海阳 3 号集合资产管理计划”（具体以实际开立为准）。根据券商结算模式，与托管账户建立三方存管关联关系。

（2）本计划证券账户的开立和使用，限于满足开展本计划业务的需要。托管人和管理人不得出借和未经另一方同意擅自转让本计划的任何证券账户；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。

（3）银行结算账户、管理账户、证券资金台账一经开立，即应按“第三方存管”模式建立对应关系，对应关系一经确定，不得更改。

## 十五、指令的发送、确认和执行

### （一）交易清算授权

资产管理人应事先向资产托管人提供书面授权通知（以下称“授权通知”），指定有权向资产托管人发送投资指令的被授权人员，包括被授权人的名单、权限、电话、传真、电子邮箱、预留印鉴和签章样本，并注明相应的交易权限，规定管理人向托管人发送指令时托管人确认有权发送人员身份的方法。授权通知应加盖资产管理人公司公章并注明生效时间。授权通知自通知载明的生效日期开始生效。托管人收到通知的日期晚于通知载明生效日期的，则通知自托管人收到该通知时生效。资产管理人和资产托管人对授权通知负有保密义务，不得向被授权人及相关操作人员以外的任何人泄露。

### （二）投资指令的内容

投资指令是管理人在运用托管账户内资产时，向托管人发出的资金划拨及其他款项支付的指令。管理人发给托管人的指令应写明款项事由、支付时间、到账时间、金额、账户等，加盖预留印鉴并有指令发送人员签字。

### （三）投资指令的发送、确认及执行时间与程序

指令由授权通知确定的指令发送人员代表管理人用深证通或托管网银电子指令方式向资产托管人发送，传真为备份方式。管理人有义务在发送指令后及时与托管人进行电话确认，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，资产管理人承担相应责任。托管人根据授权通知，对指令的预留印鉴、签字样本等表面真实性审核无误后，方可执行指令。对于指令

发送人员发出的指令，管理人不得否认其效力。管理人应按照有关法律法规和本合同的规定，在其合法的经营权限和交易权限内发送划款指令，指令发送人员应按照其授权权限发送划款指令。管理人在发送指令时，应为托管人留出执行指令所必需的时间。由管理人原因造成的指令传输不及时、未能留出足够划款所需时间，致使资金未能及时到账所造成的损失由管理人承担。

资产托管人收到划款指令后，应根据本协议约定，审核资产管理人的划款指令。资产托管人对划款指令以及资产管理人提交的与划款指令相关的所有材料进行表面一致性审核。

资产托管人应对下列内容进行审核：

- 一是划款指令要素、印鉴和签名是否正确完整；
- 二是划款指令金额与指令附件投资协议等证明文件中约定的投资金额一致；
- 三是划款指令中的收款账户信息与指令附件投资协议等证明文件中约定的收款账户信息一致（若有）。若指令附件投资协议未约定收款账户信息的，划款指令中的收款户名应与本协议约定的投资方向一致。

管理人向托管人下达指令时，应确保托管账户有足够的资金余额，对管理人在没有充足资金的情况下向托管人发出的指令，托管人可不予执行，并立即通知管理人，资产托管人承担因为不执行该指令而造成的损失。

对于要求当天到账的第三方存管银证转账的划款指令，管理人向托管人发送划款指令的截止时间为 11:00；对于要求当天到账的其他的划款指令，管理人发送划款指令的截止时间为 15:00；对于所有有明确到账时点的划款指令，管理人应在要求到账时点前 2 个工作小时发送。

管理人若修改或要求停止执行已经发送的指令，应先与托管人电话联系，若托管人还未执行，管理人应重新发送修改指令或在原指令上注明“停止执行”字样并由指令发送人员签字。

管理人应保证以上所提供的划款指令、印鉴及证明材料的真实、有效、完整、准确、合法，没有任何重大遗漏或误导。因管理人未能执行上述规定，导致造成本计划财产损失的，由管理人承担相关责任。托管人对提供材料是否与合同约定的投资范围是否相符进行审核。

管理人发送划款指令时应同时向托管人发送必要的投资合同、费用发票（如

有)等划款证明文件的复印件。但托管人仅对管理人提交的划款指令按照本合同约定进行表面一致性审查。管理人应保证上述文件资料合法、真实、完整和有效。如因管理人提供的上述文件不合法、不真实、不完整或失去效力而影响托管人的审核或给任何第三人带来损失, 资产管理人承担相应的责任。

资产管理人向资产托管人下达指令时, 应确保本组合银行账户有足够的资金余额, 对资产管理人在没有充足资金的情况下向资产托管人发出的指令, 资产托管人可不予执行, 并立即通知资产管理人, 资产管理人承担因为不执行该指令而造成损失的责任。

#### (四) 托管人依照法律法规暂缓、拒绝执行指令的情形和处理程序

托管人发现管理人发送的指令违反《基金法》、《管理办法》、《运作规定》本合同或其他有关法律法规的规定时, 不予执行, 并及时以书面形式通知管理人纠正, 管理人收到通知后应及时核对, 并以书面形式对托管人发出回函确认, 由此造成的损失由管理人承担。

#### (五) 管理人发送错误指令的情形和处理程序

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

托管人在履行监督职能时, 发现管理人的指令错误时, 有权拒绝执行, 并及时通知管理人改正。

#### (六) 授权通知的变更

管理人若变更授权通知(包括但不限于变更指令发送人员、联系方式、预留印鉴、签字样本等), 应当至少提前 1 个工作日通知托管人; 变更授权通知的文件应由管理人加盖公章并由法定代表人或其授权签字人签署, 若由授权签字人签署, 还应附上法定代表人的授权书。管理人对授权通知的变更应当以传真或电子邮件的形式发送给托管人, 同时电话通知托管人。新授权通知自其中注明的生效日期起开始生效, 原授权通知失效。若托管人收到新授权通知的日期晚于新授权通知中注明的生效日期, 新授权通知自托管人收到的日期起开始生效, 原授权通知相应失效。管理人在此后 3 个工作日内将授权变更通知的正本送交托管人, 若正本与传真件或电子邮件不一致的, 以托管人收到的已生效的传真件或电子邮件为准。托管人收到该变更通知生效之前, 原指令发送人员及其签字继续有效

### （七）投资指令的保管

投资指令原件的保管由计划管理人负责，投资指令传真件或电子邮件的保管由计划托管人负责。

### （八）其他相关责任

托管人正确执行管理人符合本合同规定、合法合规的划款指令，资产管理计划财产发生损失的，托管人不承担任何形式的责任。在正常业务受理渠道和指令规定的时间内，因托管人原因未能及时或正确执行符合本合同规定、合法合规的划款指令而导致资产管理计划财产受损的，托管人应承担相应的责任，但银行托管专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规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，全部责任由管理人承担，但托管人未尽审核义务执行划款指令而造成损失的情况除外。

## 十六、越权交易

### （一）越权交易的界定

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

- 1、违反有关法律法规和本合同约定的投资范围和投资比例限制等进行的投资交易行为。
- 2、法律法规禁止的超买、超卖行为。

资产管理人应在有关法律法规和本合同规定的投资范围和投资限制权限内运用本集合计划财产进行投资管理，不得违反有关法律法规和本合同的约定，超越权限管理、从事证券投资。

### （二）越权交易的处理程序

- 1、违反有关法律法规和本合同规定进行的投资交易行为

资产托管人对于承诺监督的越权交易中，发现资产管理人的划款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，立即通知资产管理人并

有权及时报告中国证监会或证券投资基金业协会。

资产托管人对于承诺监督的越权交易中，发现资产管理人依据交易程序已经生效的划款指令违反法律、行政法规和其他规定，或者违反本合同约定的，应当立即通知资产管理人并有权及时报告中国证监会或证券投资基金业协会。

#### 2、法律法规禁止的超买、超卖行为

资产托管人在行使监督职能时，如果发现本集合计划财产投资证券过程中出现超买或超卖现象，应立即提醒资产管理人，由资产管理人负责解决，由此给资产托管人及本集合计划财产造成的损失由资产管理人承担。如果因非资产托管人的原因发生超买行为，资产管理人必须于 T+1 日上午 10:00 前完成融资，确保完成清算交收。

3、因证券期货市场波动、证券发行人合并、本集合计划规模变动等管理人之外的因素导致本集合计划投资不符合法律、行政法规和中国证监会规定的投资比例或者合同约定的投资比例的，管理人应当在流动性受限资产可出售、可转让或者恢复交易的 20 个交易日内调整至符合要求。确有特殊事由未能在规定时间内完成调整的，管理人应当及时向中国证监会相关派出机构报告。产品的实际投向不得违反合同约定，如有改变，除高风险类型的产品超出比例范围投资较低风险资产外，应当先行取得投资者书面同意，并履行登记备案等法律法规以及金融监督管理部门规定的程序。

4、越权交易所发生的损失及相关交易费用由资产管理人负担，所发生的收益归本集合计划财产所有。

#### (三) 托管人对管理人越权交易的监督

托管人对管理人的越权交易行使监督权，具体投资监督事项包括监督投资范围、投资比例、关联交易及投资限制的监督。

## 十七、集合计划的估值和会计核算

### (一) 资产总值

集合计划资产总值是指集合计划所购买各类证券、银行存款本息、集合计划各项应收款以及其他资产的价值总和。

### (二) 资产净值

集合计划资产净值是指集合计划资产总值减去负债后的余额。

### （三）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。

### （四）估值目的

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

### （五）估值时间

本集合计划管理人与托管人于每个工作日对前一个工作日的集合计划财产进行估值并进行核对。

### （六）估值方法

本计划按以下方式进行估值：

#### （1）证券交易所上市的有价证券的估值

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

B、交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（合同另有约定的除外），选取估值日第三方估值机构提供的相应品种对应的估值净价估值。

C、交易所上市未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；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，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含截止最近交易日的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

D、交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。交易所上市的私募债等非公开发行债券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

(2) 处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

A、送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市价（收盘价）估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值。

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

C、首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的市价（收盘价）估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

(3) 全国银行间债券市场交易的债券等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值。

(4) 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。

(5) 证券投资基金的估值

A、上市证券投资基金的估值

(i) 非货币市场基金按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；

(ii) 无市价的场内货币市场基金按照实际增加的份额数量确认收益；有市价的场内货币市场基金按收盘价估值，并按照实际增加的份额数量确认收益；

(iii) 若估值日无交易，且最近交易日后市场环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后市场环境发生了重大变化的，可使用最新的基金份额净值为基础或参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素调整最近交易市价，确定公允价值。

B、非上市证券投资基金的估值

(i) 非交易所上市的开放式基金（包括场外登记的 LOF、ETF 等），以其[估值日前一交易日]基金份额净值估值；

(ii) 货币市场基金和货币型理财基金，按[估值日前一交易日]的每万份收益估值；

(iii) 估值日不公布开放式基金份额净值的，以前最近公布的基金份额净值估值；尚未公布过基金份额净值的，按成本估值。

### C、基金分红除权、拆分和折算等情况的估值

如果所投资基金前一估值日至估值日期间发生分红除权、拆分或折算，管理人根据基金份额净值或收盘价、单位基金份额分红金额、折算拆分比例、持仓份额等因素合理确定公允价值。

(6) 银行存款、回购等固定收益工具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) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，资产管理人可根据具体情况与资产托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

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

#### (七) 估值对象

集合计划所投资的股票、债券、基金、银行存款本息、应收款项、其它投资等资产。

#### (八) 估值程序

集合计划的日常估值由管理人进行，托管人复核。用于披露的集合计划单位净值由管理人完成估值后，将估值结果以双方认可的方式发送至托管人，托管人复核无误后以双方认可的方式反馈给管理人。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，但托管人有权向监管部门报告。托管人未能及时履行复核义务或拒绝履行复核义务，管理人应积极协调并要求托管人按照合同约定进行估值复核；如因估值错误给集合计划财产或投资者造成损失的，根据错误发生原因确认责任方。

由于证券交易所、注册登记机构发送的数据错误、第三方机构提供的交易流水拆分数据错误或其他不可抗力造成估值错误的，管理人和托管人免于承担责任。

#### (九) 估值错误的处理

1、本集合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。当资产估值导致本集合计划单位净值小数点后四位以内(含第四位)发生差错时，

视为本集合计划单位净值错误。管理人计算的集合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。由此给集合计划投资者和集合计划造成损失的，由管理人先行对投资者或者集合计划支付赔偿金。在管理人赔偿后，管理人和托管人应根据实际情况界定双方承担的责任。

2、管理人和托管人应采取必要、适当、合理的措施确保本集合计划资产估值的准确性和及时性。当估值出现错误时，本集合计划管理人应当立即予以纠正，通知托管人并采取合理的措施防止损失进一步扩大。

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，按管理人的建议执行；或者管理人和托管人对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；由此给投资者和集合计划财产造成的损失，根据实际差错原因及协调情况确认赔付责任。

4、因集合计划估值错误给投资者造成损失的应先由管理人承担，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。

5、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。若被诉人为管理人，托管人应当为管理人提供必要的支持。

6、由于证券交易所及注册登记机构发送的数据错误，或由于管理人或托管人不可控制的其他原因，管理人或托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误而造成的集合计划资产净值计算错误，管理人、托管人可以免除赔偿责任。但管理人、托管人应积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。

7、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集合计划持有人利益的原则进行协商确定处理原则。

#### （十）估值调整的情形与处理

当发生需要估值调整的情形，例如估值日证券无交易，但最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件等管理人认为目前估值无法反映证券真实的价格时，管理人可以与托管人协商进行估值调整。如遇估值调整，管理人将在估值调整后五个工作日内进行公告。

#### （十一）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。

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

#### （十二）集合计划份额净值的确认

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

#### （十三）特殊情况的处理

由于不可抗力、系统等原因，或由于证券交易所、登记结算公司或证券经纪商发送的数据错误，或国家会计政策变更、市场规则变更等，管理人和托管人虽然已经按照本合同约定的估值方法、程序进行检查，但未能发现错误的，由此造成的集合计划资产估值错误，管理人和托管人免除赔偿责任。但管理人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

## 十八、本集合计划的会计政策

（一）集合计划的会计年度为公历年度的1月1日至12月31日；集合计划首次募集的会计年度按如下原则：如果《集合计划合同》生效少于2个月，可以

并入下一个会计年度披露；

(二) 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；

(三) 集合计划会计核算制度执行国家有关会计制度；

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

## 十九、集合计划的费用与税收

(一) 从集合计划财产中支付的费用种类

- 1、管理人的管理费和业绩报酬；
- 2、托管人的托管费；
- 3、证券交易费用；
- 4、本集合计划成立后的信息披露费用、注册登记费用、询证费、会计师费和律师费；
- 5、证券账户开户费；
- 6、按照国家有关规定可以列入的其他费用。

(二) 集合计划费用费率、费率的调整、计提标准、计提方式与支付方式

### 1、管理费

本集合计划的管理费按前一日集合计划的资产净值计提，管理费的年费率为 1.00%。计算方法如下：

$$H = E \times 1.00\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的集合计划管理费

E 为前一日集合计划资产净值

本计划的管理费按前一日集合计划资产净值计算，按日计提，按自然季度支付。由集合计划管理人于集合计划合同生效之日的每个自然季度首日起 10 个工作日内向集合计划托管人发送集合计划管理费划付指令，经集合计划托管人复核后于 3 个工作日内从集合计划资产中支付给集合计划管理人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延，若遇不可抗力或计划资产无法变现致使无法按时支付的，

顺延至最近可支付日支付。本合同终止（包括提前或延期）后，依据清算程序支付管理人尚未支付的管理费。

管理费收入账户：

户名：东海证券股份有限公司

账号：32001628636050004370

开户银行：建行常州分行营业部

跨行支付系统行号：105304000449

## 2、托管费

本集合计划的托管费按前一日集合计划的资产净值计提，托管费的年费率为 0.03%。计算方法如下：

$$H = E \times 0.03\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的托管费；

E 为前一日集合计划资产净值；

本计划的托管费按前一日集合计划资产净值计算，按日计提，按季支付。由集合计划管理人于集合计划合同生效之日的每个自然季度首日起 10 个工作日内向集合计划托管人发送集合计划托管费划付指令，经集合计划托管人复核后于 3 个工作日内从集合计划资产中支付给集合计划托管人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延，若遇不可抗力或计划资产无法变现致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。本合同终止（包括提前或延期）后，依据清算程序支付托管人尚未支付的托管费。

托管费收入账户：

账户名称：待处理托管业务收益款项

账号：7441010127322000101

开户银行：中信银行股份有限公司深圳分行

大额支付号：302584043105

## 3、管理费和托管费的调整

管理人和托管人可协商调减管理费和托管费（无需履行合同变更程序），并在新的费率开始实施前 3 个工作日在管理人指定网站公告。投资者同意管理人、托管人采取该种方式变更费用，并承担相关变更后果。

4、证券交易费用：本集合计划证券交易费用包括集合计划运作期间投资所发生的交易手续费、开放式基金的认（申）购和赎回费、印花税等有关税费，作为交易成本直接扣除。

5、证券账户开户费用：证券账户开户费从委托资产中扣划；

6、其他费用：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，由托管人按费用实际支出金额支付，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，不得在集合计划资产中列支。管理人和托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或集合计划财产的损失，以及处理与集合计划财产运作无关事项或不合理事项所发生的费用等不得列入集合计划的费用。

### （四）管理人的业绩报酬

#### 1、管理人收取业绩报酬的原则：

（1）同一投资者不同时间多次参与的，对投资者每笔参与份额分别计算年化收益率并计提业绩报酬；

（2）符合业绩报酬计提条件时，在集合计划分红、投资者退出和集合计划终止时计提业绩报酬；

（3）集合计划分红时提取业绩报酬的，业绩报酬从分红资金中扣除；

（4）在投资者退出或计划终止时提取业绩报酬的，业绩报酬从退出资金中扣除；

（5）投资者退出或计划终止时，业绩报酬按投资者退出份额或集合计划终止时持有份额计算；

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

（7）业绩报酬的提取频率不超过每 6 个月一次。因投资者退出本集合计划，管理人按照本合同的约定在投资者退出时提取业绩报酬的，不受前述提取频率的限制。

## 2、业绩报酬的计提方法：

以上一业绩报酬计提日（如上一业绩报酬计提日不存在，则初始募集期参与的为集合计划成立日，存续期参与的为参与日，下同）到本次业绩报酬计提日的年化收益率，作为计提业绩报酬的基准。其中业绩报酬计提日即为集合计划分红权益登记日、投资者退出日和集合计划终止日。年化收益率计算方法为：

$$R = \frac{S_T^* - S_0^*}{S_0} \times \frac{365}{T} \times 100\%$$

R：指上一业绩报酬计提日至本次业绩报酬计提日的年化收益率；

$S_T^*$ ：指本次业绩报酬计提日的累计单位净值；

$S_0^*$ ：指上一业绩报酬计提日的累计单位净值；

$S_0$ ：指上一业绩报酬计提日的单位净值（如上一业绩报酬计提日不存在，则为投资者参与集合计划的参与价格）；

T：指集合计划上一业绩报酬计提日至本次业绩报酬计提日的自然天数。

管理人按如下标准和方法提取业绩报酬：

①当  $R \leq 6\%$  时，管理人不收取业绩报酬；

②当  $R > 6\%$  时，业绩报酬 =  $M \times S_0 \times (R - 6\%) \times 20\% \times T / 365$

M：应计提业绩报酬的集合计划份额。

### （3）业绩报酬的支付

因涉及注册登记数据，业绩报酬由管理人依据本合同计算并复核，托管人根据管理人发送的指令执行划款操作。业绩报酬在业绩报酬计提日提取，管理人在提取业绩报酬当日向托管人发送业绩报酬提取金额。托管人据此入账，并于 5 个工作日内依据管理人出具的业绩报酬划款指令从集合计划资产中将业绩报酬一次性支付给管理人。若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

业绩报酬收入账户：

户名：东海证券股份有限公司

账号：32001628636050004370

开户银行：建行常州分行营业部

跨行支付系统行号：105304000449

### （五）集合计划的税收

鉴于资产管理人为本计划的利益，投资、运用委托财产过程中，可能因法律法规、税收政策的要求而成为纳税义务人，就归属于计划的投资收益、投资回报和/或本金承担纳税义务。因此，本计划运营过程中由于上述原因发生的增值税及相关附加等税负，仍由本计划委托财产承担。资产管理人有义务与所在地税务机关保持联系和沟通，确认相关纳税品种和相关计算方式。产品成立后资产管理人须及时向托管人提供增值税相关税率方案和参数方案。资产管理人有权在本计划每次收益分配前或计划清算时从委托财产中先行提取一定金额作为税费备用资金，具体金额由资产管理人根据届时情况确定，提取总额不得超过本计划应缴税费金额。资产管理人可能通过本计划托管账户划付至资产管理人账户并由资产管理人依据税务部门要求完成税款申报缴纳。如果资产管理人以固有财产垫付本集合计划运营过程中产生的增值税或其他税费（如有）的，则资产管理人有权从委托财产中优先受偿。本计划清算后若资产管理人被税务机关要求补缴应由委托财产承担的上述税费的，则资产管理人有权向资产投资者就补缴金额进行追偿。

资产投资者从委托财产中获得的各项收益产生的税费（包括但不限于委托财产产生的增值税及相关附加等），由资产投资者根据国家法律法规的规定自行承担。根据法律法规或主管税务机关规定，资产管理人应当就资产投资者获得收益所产生的税费履行代扣代缴义务的，则资产管理人有权根据届时有效的规定对资产投资者代扣代缴相关税费。资产管理人、资产托管人就其取得的本集合计划管理费、托管费，依据法律法规规定履行各自的纳税义务。

## 二十、集合计划的收益分配

### （一）收益的构成

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

### （二）可供分配利润

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

### （三）收益分配原则

- 1、每一集合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集合计划份额收益分配金额后不能低于面值；
- 4、红利发放日距离权益登记日的时间不得超过 15 个工作日；
- 5、收益分配时发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担，与收益分配、退出集合计划的相关税负由投资者自行承担；
- 6、本计划存续期间内，在满足本合同约定的收益分配条件前提下，每个自然年度管理人将对计划份额进行收益分配 1 次；具体时间以及分配方案由管理人根据本集合计划收益情况拟定，并在管理人指定网站上披露；如遇特殊情况，管理人有权对收益分配方式和时间进行调整，详见管理人公告。投资者实际分配收益以注册登记机构或管理人计算为准；
- 7、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

### （四）收益分配方案的确定与披露

收益分配方案须载明收益范围、分配对象、分配原则、分配时间、分配方式等内容。

本集合计划收益分配方案由集合计划管理人拟定，由管理人通知投资者。

### （五）收益分配方式

本集合计划的分红方式分为两种：现金分红与红利再投资。若投资者不选择收益分配方式，本计划默认为现金分红方式。投资者选择现金分红方式的，管理人将现金红利款划往销售机构账户，再由销售机构划入投资者账户，现金红利款自款项从集合计划资金账户划出之日起 7 个工作日内到达投资者账户。投资者选择采取红利再投资收益分配方式的，分红资金将按分红权益登记日的集合计划单位净值转成相应的集合计划份额，且红利再投资增加的集合计划份额计入集合计划份额规模。

投资者获得的现金分红或红利再投资份额保留小数点后两位，第三位四舍五入。

除分红权益登记日外，投资者可在计划存续期内选择变更收益分配的方式。

投资者在不同募集机构参与的计划份额可以申请采取不同的收益分配方式，但投资者在某一募集机构参与的计划份额只能选择一种分红方式，且在某一募集机构申请变更收益分配方式的计划份额只能是在该募集机构参与的计划份额。

## 二十一、集合计划的信息披露

### （一）定期报告

管理人将定期在管理人指定网站披露集合计划单位净值和累计单位净值、季度报告、年度报告、年度审计报告。计划终止当季，无需出具季度管理人报告；计划终止当年，无需出具年度管理人报告、托管人报告。

### （二）集合计划单位净值报告

披露时间：集合计划存续期内，管理人每个工作日（若遇节假日，则顺延至下一个工作日）披露经托管人复核的单位净值和累计单位净值，本合同约定的暂停估值的情形除外。管理人可以根据集合计划的情况适当增加单位净值和累计单位净值的披露频率。

披露方式：本集合计划的信息披露将严格按照法律法规、本合同及其他有关规定进行。本集合计划的单位净值和累计净值将在管理人指定网站上披露。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。

（三）管理人应当向投资者提供本集合计划季度报告和年度报告，披露报告期内本集合计划运作情况，年度报告包括但不限于下列信息：

- 1、管理人履职报告；
- 2、托管人履职报告；
- 3、本集合计划投资表现；
- 4、本集合计划投资组合报告；
- 5、本集合计划运用杠杆情况（如有）；
- 6、本集合计划财务会计报告；
- 7、本集合计划支付的管理费、托管费、业绩报酬（如有）等费用的计提基准、计提方式和支付方式；
- 8、本集合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投资者权益的重大事项；

本集合计划季度报告应当披露前款除第 6 项之外的其他信息。

本集合计划成立不足三个月或者存续期间不足三个月的, 管理人可以不编制本集合计划当期的季度报告和年度报告。

#### (四) 重大事项临时报告

集合计划存续期间, 发生对集合计划持续运营、投资者利益、资产净值产生重大影响的事件, 管理人应当在事项发生之日起五日内通过管理人指定网站向投资者披露。临时报告的情形包括但不限于:

1、集合计划运作过程中, 负责集合资产管理业务的高级管理人员或本集合计划投资经理发生变更, 或出现其他可能对本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认购或者退出申请;

3、发生巨额退出并延期支付;

4、本集合计划终止和清算;

5、本集合计划存续期满并展期;

6、调整本集合计划的风险等级;

7、合同的补充、修改与变更;

8、管理人设立开放期和临时开放期;

9、以本集合计划资产从事关联交易;

10、本集合计划涉及仲裁、诉讼、财产纠纷的;

11、本集合计划发生延期兑付、巨额亏损或兑付困难的;

14、管理人认为按照合同约定兑付投资者的赎回申请有困难, 对部分或全部赎回申请延期办理的;

15、因委托财产流动性受限等原因延期清算;

16、管理人、托管人等资产管理业务参与人经营情况发生重大变化或涉及法律纠纷, 可能影响资产管理计划按时分配收益的;

17、其他对产品持续运行、投资者利益、资产净值产生重大影响事件或管理人认为需要报告的其他情况。

#### (五) 对账单

管理人至少每个季度以邮寄或电子邮件方式向投资者寄送对账单, 投资者可

以选择寄送方式，默认的寄送方式为电子邮件。对账单内容应包括投资者持有集合计划的风险和差异性、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。

投资者可以选择对账单寄送方式，本计划默认的寄送方式为电子邮件。投资者应向管理人提供电子邮件等资料，以便管理人能正常发送电子对账单。管理人根据投资者提供的上述信息资料提供电子对账单的，电子对账单从管理人系统处发出即视为送达，因投资者未正常提供以上信息、销售机构未向管理人提供投资者的电子邮箱、电子邮件运营商系统平台故障等原因导致其未能获得电子对账单的，管理人不承担任何责任。投资者选择邮寄方式寄送对账单的，投资者应向管理人提供邮寄地址等资料，因投资者未正常提供以上信息、销售机构未向管理人提供投资者的邮寄地址、邮寄运营商系统平台故障及内部操作等原因导致投资者未能获得邮寄对账单的，管理人不承担任何责任。

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

（七）管理人、托管人将根据《指导意见》、《管理办法》、《运作规定》等监管要求，向中国证监会及相关派出机构、证券投资基金业协会等监管机构报送集合计划定期报告、重大事项临时报告。

## 二十二、风险揭示

### （一）特殊风险揭示

#### 1、资产管理合同与证券投资基金业协会合同指引不一致所涉风险

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

#### 2、合同变更的风险

管理人就合同变更征求投资者意见期间，未明确提出异议的投资者、不同意

合同变更但逾期未提出退出申请的投资者均视为同意修改或变更合同和说明书。部分投资者可能因为未能提供有效的联系方式或者未能将变动后的联系方式及时通知管理人，而无法及时获知合同变更事项，如果投资者因上述情况未能按时退出本计划，可能会被视为同意合同变更，从而存在风险。

### 3、锁定持有期无法退出的风险

本集合计划自成立之日起每个自然月初的前 3 个工作日为开放期，开放期内可以办理参与、退出业务。若遇法定节假日、休息日等顺延，具体开放日期以管理人的公告为准。管理人有权提前结束或延长开放期，届时将在管理人网站上公告。投资者每笔份额的锁定持有期为 170 个自然日，投资者只能在锁定持有期满后开放期申请退出，但本合同另有约定的除外。因此存在锁定持有期无法退出的风险。

### 4、本集合计划委托募集所涉风险

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

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

### 6、投资“港股通”股票的特定风险

香港证券市场与内地证券市场存在诸多差异，集合计划参与港股通交易需遵守内地与香港相关法律、行政法规、部门规章、规范性文件和业务规则；通过港股通参与香港证券市场交易与通过其他方式香港证券交易，也存在一定的差异。因此，港股通投资存在港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括但不限于海外市场风险、股价波动较大的风险、汇率风险、港股通额度限制、港股通可投资标的范围调整带来的风险、港股通交易日设定的风险、交收制度带来的流动性风险、港股通标的权益分派及转换的处理规则的风险、香港联合交易所停牌及退市制度差异带来的风险、港股通规则变动带来的风险等。

## 7、参与网下新股申购的风险

网下新股申购是指网下投资者通过交易所网下发行电子平台及中国结算公司登记结算平台，申购首次公开发行的股票（即“新股”）。

管理人作为网下投资者，本计划是其直接管理的配售对象，管理人的网下投资者资格直接影响本计划能否参与网下新股申购，如管理人不具备网下投资者资格，本计划相应不能参与新股网下申购。

新股网下申购不保证能够参与及获配，本资管计划需承担由于本计划未满足交易所或承销商的相关要求、未通过承销商的资料核查、新股报价无效、新股申购阶段被剔除、缴款不成功等风险；新股网下申购不保证收益，本资管计划需承担市场波动的风险。

## 8、因触及止损线而导致产品提前终止的风险

当T日计划份额净值低于或等于止损线0.8000元时，管理人应于T+5日(含)内对本计划持有的全部非现金资产进行变现操作，直至计划资产全部变现为止。计划资产全部变现后本计划提前终止日。**在止损卖出过程中，由于大量卖出导致市场价格大幅下跌或因证券跌停、停牌等事件导致证券不能及时卖出等因素，可能给本计划带来损失，导致止损后计划资产净值可能低于止损前计划资产净值。**

## 9、争议解决方式的风险

采用仲裁方式解决争议，具有自愿、专业、灵活和保密等特点，但仲裁活动所依据的法律与诉讼法律活动相比，客观存在着局限性；受限于客观条件，仲裁过程依赖于特定程序和实体认定，可能无法完全符合客观真实；经仲裁正当程序调查出的结果，由仲裁员作居中裁决者的制度设置也可能导致裁决结果的不确定性。此外，与诉讼法律活动相比，仲裁过程还具有复杂性和变异性等特点。根据我国法律规定，当事人约定仲裁方式进行争议解决的，不得就该争议向人民法院提起诉讼，仲裁结果可能是终局的，上述安排均可能影响当事各方的权益，各方当事人均已知悉并自愿选择仲裁方式进行争议解决。

### （二）一般风险揭示

#### 1、本金损失风险

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

本计划属于 R3 风险投资品种，适合风险识别、评估、承受能力 C3（平衡型）、C4（增长型）、C5（进取型）的合格投资者。本集合计划适合向合格投资者中的专业投资者及风险承受能力为 C3（平衡型）、C4（增长型）、C5（进取型）的普通投资者推广。本集合计划投资者的风险承受能力应当与集合计划的风险等级相匹配。

## 2、市场风险

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

### （1）政策风险

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

### （2）经济周期风险

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

### （3）利率风险

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

### （4）购买力风险

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

### （5）再投资风险

再投资风险反映了利率下降对固定收益证券利息收入再投资收益的影响，这与利率上升所带来的利率风险互为消长。具体为当利率下降时，集合计划从投资的固定收益证券所得的利息收入进行再投资时，将获得比之前较少的收益率。

### 3、管理风险

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

### 4、流动性风险

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

### 5、信用风险

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

### 6、募集失败风险

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

管理人的责任承担方式：

- (1) 以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用；
- (2) 在本集合计划募集期限届满（确认本集合计划无法成立）后三十日内返还投资者已缴纳的款项，并加计银行同期活期存款利息。

### 7、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。

### 8、业绩报酬提取风险

在满足本集合计划提取业绩报酬的前提下，管理人可以提取业绩报酬，但在业绩报酬提取后若集合计划单位净值下降，已提取的业绩报酬不予返还。

### 9、其他风险

#### (1) 关联交易的风险

管理人可以将集合计划的资产投资于管理人、托管人及与管理人、托管人的控股股东、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，或者从事其他关联交易；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可以参与管理人设立的集合计划。事后管理人将及时以公告的方式向托管人和投资者披露，涉及关联交易的需向中国证监会相关派出机构报告。

#### (2) 操作风险

操作风险是指那些由于不合理的内部程序，人为造成的或者是系统性的，由外部事件引发损失的风险。

#### (3) 不可抗力风险

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。

#### (4) 对账单寄送风险

管理人至少每个季度以邮寄或电子邮件方式向投资者寄送对账单，投资者可以选择寄送方式，默认的寄送方式为电子邮件。对账单内容应包括投资者持有集合计划的风险和差异性、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。

投资者可以选择对账单寄送方式，本计划默认的寄送方式为电子邮件。投资者应向管理人提供电子邮件等资料，以便管理人能正常发送电子对账单。管理人根据投资者提供的上述信息资料提供电子对账单的，电子对账单从管理人系统处发出即视为送达，因投资者未正常提供以上信息、电子邮件运营商系统平台故障等原因导致其未能获得电子对账单的，管理人不承担任何责任。投资者选择邮寄方式寄送对账单的，投资者应向管理人提供邮寄地址等资料，因投资者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原因导致投资者未能获得邮寄对账单的，管理人不承担任何责任。

(5) 因法律、法规、规章、中国证监会的规定、证券登记结算机构业务规则以及证券交易所等交易规则修订时，或对集合计划的资产运作有重大影响的事件发生或可能发生时，为保护集合计划投资者的利益，管理人在不修改合同的情况下有权采取应对措施，可能导致投资者权利受到限制或委托资产遭受损失，从而带来风险。

(6) 在托管人履行投资监督义务过程中，因为交易习惯或者现有的技术等条件所限，托管人事实上可能难以及时、有效履行合同约定的投资监督义务。投资者在签订本合同时以充分知悉该风险，并完全理解和接受可能由此风险导致出

现的经济损失。

(三) 管理人单独编制了《风险揭示书》作为合同附件。投资者应充分了解并谨慎评估自身风险承受能力, 并做出自愿承担风险的陈述和声明。

## 二十三、集合计划合同的变更、终止与财产清算

### (一) 合同的变更

1、本合同签署后, 因法律、法规、规章、中国证监会的规定、证券投资基金业协会、证券业协会的规则、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。投资者特此授权管理人经与托管人协商, 可以对本集合计划合同及说明书与新的法律法规或有关政策不一致的内容进行更新或修改, 更新或修改的内容不得违反法律法规和中国证监会的有关规定, 更新或修改的内容在管理人网站公告满 5 个工作日后生效。投资者对更新或修改的内容有异议, 可在更新或修改内容生效前按照本合同的规定申请退出本集合计划。

因法律、法规、规章、中国证监会的规定、证券登记结算机构业务规则以及证券交易所等交易规则修订时, 或对集合计划的资产运作有重大影响的事件发生或可能发生时, 为保护集合计划投资者的利益, 管理人在无法及时与投资者协商修订合同时, 有权在不修改合同的情况下采取应对措施, 管理人采取应对措施时需进行公告, 同时以书面或者电子邮件、电话、传真方式通知投资者。

2、除调低管理费率、托管费率, 以及调低风险等级事宜外, 由于其他原因需要变更合同的, 管理人和托管人应书面达成一致并在管理人网站通告投资者。管理人须在公告后五个工作日内, 以管理人指定的网站公告的指定方式向投资者征询合同变更意见, 并采取如下权利保障措施及安排:

(1) 投资者应在公告指定的日期内按指定的形式回复意见, 逾期未做答复的, 视为投资者同意全部变更事项。如有改变集合计划的投资范围, 除高风险类型的产品超出比例范围投资较低风险资产外, 应当先行取得投资者书面同意; 若投资者未回复意见且逾期未退出的, 视同投资者不同意本合同变更, 则管理人有权在征询意见函或公告中说明的意见回复期限届满后将相关份额强制退出计划 (退出价格为退出申请当日集合计划当日净值);

(2) 投资者向管理人答复不同意合同变更事项的，则应当在管理人发出的公告中确定的开放日内提出退出申请；逾期未提出退出申请的，则管理人有权在征询意见函或公告中说明的意见回复期限届满后将相关份额强制退出计划（退出价格为退出申请当日集合计划当日净值），由此发生的相关税费及或有损失由投资者自行承担。

变更事项自公告指定的日期届满的次工作日开始生效，对合同各方均具有法律效力。本合同变更生效之日起，变更公告的内容即成为本合同组成部分。

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

3、合同变更后，投资者、管理人和托管人都应当按照变更后的合同行使相关权利，履行相应义务。

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

5、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。

## (二) 管理人、托管人的变更

1、有下列情形之一的，管理人职责终止：

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

2、管理人的更换程序

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

(2) 管理人更换后，由托管人公告。

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

3、有下列情形之一的，托管人职责终止：

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

4、托管人的更换程序

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

(2) 托管人更换后，由管理人公告。

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

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

(三) 集合计划的展期

1、本集合计划展期应符合以下条件：

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

(2) 本集合计划展期没有损害投资者利益的情形；

(3) 中国证监会规定的其他条件。

本集合计划展期的，应当符合本集合计划的成立条件。

2、展期的程序与期限

(1) 展期的程序：

①公告

管理人在获得托管人同意继续托管展期后的集合计划资产的意见后的 5 个工作日内在指定网站上公告集合计划的具体展期方案。

②投资者答复

管理人在指定网站公告集合计划的具体展期方案的同时，通过管理人指定的网站或电子邮件或短信等形式通知投资者，征求投资者意见，投资者应当在 10 个工作日内明确意见。若投资者不同意展期，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。投资者未在前述时间回复意见或意思表示不明确的,视为投资者同意展期。

截至到期日,如果同意集合计划展期的投资者人数不少于2人,并且符合集合计划的成立条件,则集合计划展期生效,自展期公告生效之日起,公告内容即成为本合同组成部分;如果同意本集合计划展期的各投资者人数低于2人,则集合计划到期终止,将按照《集合资产管理计划管理合同》等相关法律文件的规定办理计划到期终止和清算事宜。

(2) 展期的期限:

管理人应在指定网站公告的具体展期方案中明确展期的具体期限。

3、展期的管理人自有资金安排

本集合计划展期成立的,管理人承诺展期期间不收回参与的自有资金份额,但因集合计划规模变动等客观因素导致自有资金参与集合计划被动超过法律、法规及本合同规定比例的情形除外。

4、展期情况备案

本集合计划展期后5日内,管理人将展期情况公告并报证券投资基金业协会备案,同时抄送中国证监会派出机构。

(四) 本集合计划终止的情形,包括但不限于下列事项:

1、本集合计划存续期届满且不展期;

2、当本集合计划规模太小导致无法有效地进行投资,或者本集合计划的投资策略已不适当时的市场环境时,管理人有权提前终止本集合计划;其他情形下,经全体投资者、管理人和托管人协商一致决定终止的;

3、管理人被依法撤销资产管理业务资格或者依法解散、被撤销、宣告破产,且在六个月内没有新的管理人承接;

4、托管人被依法撤销基金托管资格或者依法解散、被撤销、宣告破产,且在六个月内没有新的托管人承接;

5、持续五个工作日投资者少于2人的;

6、当客户退出申请触发巨额退出且一旦退出申请确认将使集合计划持有份额人数少于2人时,管理人有权拒绝该退出申请并将产品提前终止;

7、未在证券投资基金业协会完成备案或不予备案的情形;

8、集合计划份额净值触及止损线的情形；

9、法律、行政法规、中国证监会规定及资产管理合同约定的其他情形。

管理人应当自本集合计划终止之日起5个工作日内报证券投资基金业协会备案，前述第7项约定的情形除外。

(五)本集合计划在发生终止情形之日起五个工作日内开始组织清算本集合计划资产，以及财产清算的有关事项：

#### 1、本集合计划财产清算小组

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

#### 2、清算的程序

(1)《集合计划合同》终止情形出现时，由集合计划财产清算小组统一接管集合计划财产；

(2)对集合计划财产和债权债务进行清理和确认；

(3)对集合计划财产进行估值和变现；

(4)制作清算报告；

(5)对集合计划剩余财产进行分配；

(6)聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计；

(7)将清算报告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，并公告。

#### 3、清算费用

清算费用是指集合计划财产清算小组在进行集合计划清算过程中发生的所有合理费用，清算费用优先从集合计划财产中支付。

#### 4、本集合计划财产清算及剩余资产的分配

清算结束后5个工作日内，管理人和托管人应当在扣除清算费用、管理费、业绩报酬及托管费等费用后，将集合计划资产按照投资者拥有集合计划份额的比例或集合资产管理合同的约定以货币资金的形式全部分派给投资者。管理人可能根据集合计划财产变现情况进行多次清算及分配，以提示二次及多次清算流程安排。

## 5、延期清算

若本集合计划在终止之日有未能流通变现的证券，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，及时向中国证监会相关派出机构和证券投资基金业协会报告。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，以货币形式全部分配给投资者。

## 6、清算的报告

管理人在资产管理计划清算结束后五个工作日内将清算报告报证券投资基金业协会。清算结束后 15 个工作日内由集合计划清算小组在管理人网站公布清算结果。

## 7、账户的注销

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

8、本集合计划财产清算账册及文件的保存，说明本集合计划财产清算账册及文件由管理人保存 20 年以上。

## 二十四、违约责任

1、由于合同当事人过错，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。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资产及其他当事人

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)管理人或托管人任一方不因另一方的失职行为而给集合计划财产或投资者造成的损失向投资者承担连带责任；

(7)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；

(8)相关法律、行政法规和规定的变更。

2、合同当事人违反本合同，给其他当事人造成直接经济损失的，应当承担赔偿责任。在发生一方或多方当事人违约的情况下，合同能继续履行的，应当继续履行。

3、本合同一方当事人造成违约后，其他当事人应当采取适当措施防止损失的扩大；没有采取适当措施致使损失扩大的，不得就扩大的损失要求赔偿。守约方因防止损失扩大而支出的合理费用由违约方承担。

4、由于管理人、托管人不可控制的因素导致业务出现差错，管理人和托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现错误的，由此造成计划财产或投资者损失，管理人和托管人免除赔偿责任。但是管理人和托管人应积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

5、一方当事人依据本合同向另一方当事人赔偿的损失，仅限于直接经济损失。

6、管理人违反法律、行政法规的有关规定，被中国证监会依法撤销证券资

产管理业务许可、责令停业整顿，或者因停业、解散、撤销、破产等原因不能履行职责的，应当按照有关监管要求妥善处理有关事宜。

## 二十五、争议的处理

一、对于因本合同的订立、内容、履行和解释或与本合同有关的争议，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，采取以下第（一）种方式解决：

（一）向**上海仲裁委员会**申请仲裁，以该会当时有效的仲裁规则为准，仲裁裁决是终局性的，并对各方当事人具有约束力，仲裁费由败诉方承担；

（二）向被告所在地有管辖权的人民法院提起诉讼。

二、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、尽责地履行本合同规定的义务，维护投资者的合法权益。

三、本合同受中华人民共和国法律管辖。

## 二十六、合同的效力

（一）合同签署的方式

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

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

通过电子合同方式签署本合同，管理人、托管人及投资者认可电子合同的法律效力。

2、投资者在签署合同后方可进行认购、参与。

（二）合同的成立与生效

1、合同的成立

本合同经管理人、托管人和投资者共同签署后合同即告成立。

2、本合同成立后，同时满足以下条件时生效：

(1) 投资者参与资金实际交付并经管理人确认成功；

(2) 本集合计划成立。

资产管理合同自生效之日起对投资者、管理人、托管人具有同等的法律约束力。

(三) 合同的有效期限

本集合计划的存续期限为自集合计划成立之日起的 10 年，在合同约定的条件下可以展期、提前终止。本集合计划终止，本合同终止。但本合同项下的清算条款、违约责任条款、争议解决条款仍然有效。

(四) 合同的组成

《东海证券海阳 3 号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，是本合同重要附件，与合同具有同等法律效力。

《东海证券海阳 3 号集合资产管理计划风险揭示书》是管理人对于本集合计划风险的揭示文件，是本合同重要附件，与合同具有同等法律效力。

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

(五) 投资者自签订资产管理合同即成为资产管理合同的当事人。在本集合计划存续期间，投资者自全部退出本集合计划之日起，该投资者不再是资产管理合同的当事人。

## 二十七、其他事项

(一) 或有事件

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

投资者在此同意，如果或有事件发生，在管理人与托管人协商一致的基础上，管理人有权将本合同中由管理人享有的权利和由管理人承担的义务转让给上一条所述的从事资产管理业务的公司，并无须就此项变更和投资者另行签订专项协

议。但在转让前管理人应以信息披露的形式通告投资者。管理人保障投资者退出本集合计划的权利，并在届时的通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。

(二) 如将来法律法规、中国证监会、证券投资基金业协会或其他有权机构对资产管理合同的内容与格式有其他要求的，投资者、管理人和托管人应立即展开协商，根据法律法规、中国证监会、证券投资基金业协会或其他有权机构的相关要求修改本合同的内容和格式。

(三) 本合同如有未尽事宜，由合同当事人各方按有关法律法规和规定协商解决。

(四) 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。

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。

本合同一式三份，管理人执两份、托管人执一份，每份均具有同等法律效力。

(以下无正文)

本页无正文，为《东海证券海阳 3 号集合资产管理计划资产管理合同》签字页。

投资者签字/盖章：

管理人：东海证券股份有限公司（盖章）

法定代表人或授权代理人（签字或盖章）：

托管人：中信银行股份有限公司苏州分行（盖章）

法定代表人或授权代理人（签字或盖章）：

签订日期：        年        月        日