

HG1)020-055

东莞证券旗峰月月盈 1 号
集合资产管理计划资产管理合同

(固定收益类)

管理人：东莞证券股份有限公司

托管人：宁波银行股份有限公司

二〇二〇年五月

目 录

一、前言.....	3
二、释义.....	4
三、承诺与声明.....	7
四、当事人及权利义务.....	8
五、资产管理计划的基本情况.....	15
六、资产管理计划的募集.....	16
七、资产管理计划的成立与备案.....	18
八、资产管理计划的参与、退出与转让.....	19
九、份额持有人大会及日常机构.....	25
十、资产管理计划份额的登记.....	25
十一、资产管理计划的投资.....	25
十二、投资顾问.....	29
十三、分级安排.....	30
十四、利益冲突及关联交易.....	30
十五、投资经理的指定与变更.....	31
十六、资产管理计划的财产.....	31
十七、指令的发送、确认和执行.....	33
十八、越权交易的界定.....	36
十九、资产管理计划财产的估值和会计核算.....	37
二十、资产管理计划的费用与税收.....	41
二十一、资产管理计划的收益分配.....	44
二十二、信息披露与报告.....	45
二十三、风险揭示.....	48
二十四、资产管理合同的变更、终止与财产清算.....	53
二十五、违约责任.....	57
二十六、争议的处理.....	59
二十七、资产管理合同的效力.....	59
二十八、其他.....	60

一、前言

为规范东莞证券旗峰月月盈1号集合资产管理计划(以下简称“集合计划”或“计划”)运作,明确《东莞证券旗峰月月盈1号集合资产管理计划资产管理合同》(以下简称“本合同”)当事人的权利与义务,依照《中华人民共和国合同法》、《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称《基金法》)、《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》(以下简称《指导意见》)、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》(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》)及《集合资产管理计划资产管理合同内容与格式指引(试行)》(以下简称《格式指引》)等法律法规、中国证监会、中国证券业协会及中国证券投资基金业协会的有关规定,委托人、管理人、托管人在平等自愿、诚实信用、公平原则的基础上订立本合同。本合同是规定当事人之间基本权利义务的法律文件,当事人按照《管理办法》、《运作规定》、《东莞证券旗峰月月盈1号集合资产管理计划说明书》(以下简称《说明书》)、本合同及其他有关规定享有权利、承担义务。

委托人承诺以真实身份参与集合计划,保证委托资产的来源及用途合法,所披露或提供的信息和资料真实、准确、完整,没有非法汇集他人资金参与本集合计划,并已阅知本合同和集合计划说明书全文,了解相关权利、义务和风险,自行承担投资风险和损失。委托人承诺管理人及其委托的第三方销售机构在向其销售集合计划时,已向其真实、准确、完整地披露了集合计划交易结构、集合计划当事各方权利义务、收益分配内容、委托第三方机构提供服务、关联交易情况等信息,委托人完全理解集合计划合同中“争议处理”、“集合计划费用”等所有内容。

管理人承诺以诚实守信、审慎尽责的原则管理和运用本集合计划资产,但不保证本集合计划一定盈利,也不保证最低收益。

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

委托人、管理人及托管人知悉并承诺,在开展业务中,严格遵守法律法规、

中国证监会的规定和行业自律规则，遵守社会公德、商业道德、职业道德和行为规范，公平竞争，合规经营，忠实勤勉，诚实守信，不直接或者间接向他人输送不正当利益或者谋取不正当利益，遵守廉洁从业规定。

管理人应当对资产管理计划的设立、变更、展期、终止、清算等行为向证券投资基金业协会进行备案，并抄送中国证监会相关派出机构。

证券投资基金业协会接受资产管理计划备案不能免除管理人按照规定真实、准确、完整、及时地披露产品信息的法律责任，也不代表证券投资基金业协会对资产管理计划的合规性、投资价值及投资风险做出保证和判断。投资者应当自行识别产品投资风险并承担投资行为可能出现的损失。

二、释义

除非文义另有所指，本合同中下列词语或简称具有如下含义：

计划、集合计划或本集合计划：指东莞证券旗峰月月盈 1 号集合资产管理计划。

集合计划说明书、本说明书、说明书：指本《东莞证券旗峰月月盈 1 号集合资产管理计划说明书》及对其的任何有效修订和补充。

集合资产管理计划管理合同、管理合同、资产管理合同、本合同：指《东莞证券旗峰月月盈 1 号集合资产管理计划资产管理合同》及对其的任何有效修订和补充。

托管协议：指《东莞证券旗峰月月盈 1 号集合资产管理计划托管协议》及对其的任何有效修订和补充。

风险揭示书：指《东莞证券旗峰月月盈 1 号集合资产管理计划风险揭示书》及对其的任何有效修订和补充。

《基金法》：指 2013 年 6 月 1 日起正式实施的《中华人民共和国证券投资基金法》。

《指导意见》：指经中国人民银行、中国银行保险监督管理委员会、中国证监会、国家外汇管理局批准发布并于 2018 年 4 月 27 日实施的《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》。

《管理办法》：指经中国证监会批准发布并于 2018 年 10 月 22 日实施的《证

券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》。

《运作规定》：指经中国证监会批准发布并于2018年10月22日实施的《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》。

元：指人民币元。

中国证监会、证监会：指中国证券监督管理委员会。

管理人：指东莞证券股份有限公司（简称“东莞证券”）。

托管人：指宁波银行股份有限公司（简称“宁波银行”）。

推广机构、销售机构：东莞证券股份有限公司（简称“东莞证券”）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计划的机构。

份额登记机构：指办理登记、存管、过户、清算和结算等份额登记业务的机构。本集合计划的份额登记机构为中国证券登记结算有限责任公司（简称“中登公司”）。

《管理合同》当事人：指受《管理合同》及说明书的约束，根据《管理合同》及说明书享受权利并承担义务的法律主体，包括管理人、托管人、委托人。

委托人：指根据《管理合同》及说明书合法取得集合计划份额的个人投资者或机构投资者。

个人投资者：指依法投资于集合资产管理计划的自然人。

机构投资者：指依法投资集合资产管理计划，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以及合格境外机构。

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委托人。

集合计划账户：指份额登记机构为委托人开立的、记录其持有的集合计划份额余额及其变动情况的账户。

集合计划成立日：指集合计划经过推广达到集合计划说明书和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。

工作日：指上海证券交易所和深圳证券交易所的正常交易日。

T日：指本集合计划约定的特定日。

T+n日：指本集合计划约定的特定日之后（不包括T日）第n个工作日，

如有特殊说明的除外。

初始募集期：指本集合计划自开始推广到推广完成之间的时间段，具体时间见管理人公告。

开放期：指初始募集期结束后，管理人为委托人办理计划参与和/或退出等业务的工作日。

封闭期：指产品成立后除开放期以外的每一工作日，在此期间委托人不得参与、退出本集合计划。

会计年度：指公历每年1月1日起至当年12月31日为止的期间。

集合计划份额：指委托人对集合计划享有资产所有权、收益分配权和其他相关权利，并承担相应义务的基本计量单位。

集合计划份额面值：人民币1.00元。

参与：指投资者申请购买本集合计划份额的行为。

首次参与：指投资者在参与之前未持有过本集合计划的情形。

追加参与：指除首次参与外的其他参与情形。

退出：指委托人在集合计划开放日部分或全部退出集合计划的行为，不包括委托人在本集合计划终止时收回资产的行为。

收益：指集合计划投资所得债券利息、买卖证券收益、银行存款利息以及其他收益，在扣除相关费用后的余额。

资产总值：指集合计划所购买的各类证券、银行存款本息及其他投资所形成的价值总和。

资产净值：指资产总值减去负债后的价值。

单位净值：指集合计划资产净值除以计划总份额。

资产估值：指计算评估集合计划资产的价值，以确定该资产净值和单位净值的过程。

法律法规：指中华人民共和国（不包括香港特别行政区、澳门特别行政区、台湾地区）现行有效的法律、行政法规、司法解释、部门规章以及其他对《管理合同》当事人有约束力的决定、决议、通知等。

不可抗力：指《管理合同》当事人无法预见、无法克服、无法避免且在《管理合同》生效之后发生的，使《管理合同》当事人无法全部或部分履行合同的任

何事件，包括但不限于洪水、地震及其他自然灾害、战争、政府征用、没收、法律变化等。

管理人指定网站、管理人网站：指 www.dgzq.com.cn，管理人指定网站变更时以管理人公告为准。

三、承诺与声明

（一）管理人承诺

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

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。

4、管理人应对项目的合规性负责。

（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，维护投资者权益。

（三）投资者声明

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

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

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

四、当事人及权利义务

(一) 投资者、管理人和托管人的基本情况

委托人

个人投资者填写：

姓名： 证件类型：

证件号码：

住所/通信地址：

邮政编码：

联系电话：

移动电话：

电子信箱：

其他：

机构投资者填写：

机构名称：

法定代表人：

住所/通信地址：

邮政编码：

代理人姓名：

身份证号码：

联系电话：

其他：

如采用电子签名方式的，委托人的详细情况在电子签名合同数据电文中列示。

管理人

机构名称：东莞证券股份有限公司

法定代表人：陈照星

住所/通信地址：广东省东莞市莞城区可园南路1号金源中心24楼

邮政编码：523000

联系电话：0769-22119271

托管人

机构名称：宁波银行股份有限公司

法定代表人：陆华裕

住所/通信地址：浙江省宁波市鄞州区宁东路 345 号宁波银行大厦

邮政编码：510620

联系电话：0755-22661805

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

(三) 委托人

1、委托人的权利

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

2、委托人的义务

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

(4) 委托人应认真阅读并签署风险揭示书；

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

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

(7) 委托人应向管理人或资产管理计划销售机构提供法律法规规定的信息及身份证明文件，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) 委托人不得违反资产管理合同的约定干涉管理人的投资行为；

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

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

(11) 本集合计划采用电子签名合同，委托人应当如实提供与签署电子签名合同相关的信息和资料。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，并承诺在本合同有效期内，不得撤销该账户，并妥善保管账户资料；

(12) 委托人承诺其知悉《中华人民共和国反洗钱法》、《金融机构大额交易和可疑交易报告管理办法》等反洗钱相关法律法规的规定，并承诺将严格遵守上述规定，不会实施任何违反前述规定的非法行为；积极配合管理人进行相应的客户身份识别及反洗钱客户风险等级划分、反洗钱可疑交易报送、涉嫌恐怖融资可疑交易报送等工作；

(13) 委托人保证提供给管理人进行身份信息识别的信息和资料均真实、准确、完整、合法。在其身份信息资料发生变更时，应当及时书面告知管理人；委托人预留的有效联系方式发生变更的，应及时通知管理人。如委托人预留联系方式变更未及时通知管理人导致管理人在其认为需要时无法及时联系到委托人的，因此而产生的责任和风险由委托人自行承担；

(14) 委托人不得违规转让其所拥有的计划份额；

(15) 委托人承诺本次投资行为是为本人/本机构购买集合计划；

(16) 委托人承诺不以非法拆分转让为目的购买集合计划，不会突破合格投资者标准，将金融产品份额或其收益权进行非法拆分转让；

(17) 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。

(四) 管理人

1、管理人的权利

(1) 按照资产管理合同约定，独立管理和运用资产管理计划财产；

(2) 按照资产管理合同约定，及时、足额获得管理人管理费用及业绩报酬（如有）；

(3) 按照有关规定和资产管理合同约定行使因资产管理计划财产投资所产生的权利；

(4) 根据资产管理合同及其他有关规定，监督托管人，对于托管人违反资产管理合同或有关法律法规规定、对资产管理计划财产及其他当事人的利益造成重大损失的，应当及时采取措施制止，并报告中国证监会派出机构及证券投资基金业协会；

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

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

(7) 资产管理计划资产受到损害时，向有关责任人追究法律责任；

(8) 管理人如发现委托人资产来源或身份信息存在可疑之处的，可不与其签订资产管理合同或解除资产管理合同；

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

2、管理人的义务

(1) 依法办理资产管理计划的销售、登记、备案事宜；

- (2) 按照证券投资基金业协会要求报送资产管理计划产品运行信息；
- (3) 按照诚实信用、勤勉尽责的原则履行受托人义务，管理和运用资产管理计划财产；
- (4) 对投资者的风险识别能力和风险承担能力进行评估，向符合法律法规规定的合格投资者非公开募集资金；
- (5) 制作风险揭示书，向投资者充分揭示相关风险；
- (6) 配备足够的具有专业能力的人员进行投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作资产管理计划财产；
- (7) 建立健全的内部管理制度，保证本资产管理计划财产与其管理的其他资产管理计划财产、管理人的固有财产相互独立，对所管理的不同财产分别管理，分别记账，分别投资；聘请投资顾问的，应制定相应利益冲突防范机制；
- (8) 除依据法律法规、资产管理合同及其他有关规定外，不得为管理人及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作资产管理计划财产；
- (9) 保守商业秘密，不得泄露资产管理计划的投资计划、投资意向等，依法依规提供信息的除外；
- (10) 公平对待所管理的不同财产，不得从事任何有损资产管理计划财产及其他当事人利益的活动；
- (11) 除规定情形或符合规定条件外，不得为管理人、托管人及其关联方提供融资；
- (12) 按照资产管理合同约定接受投资者和托管人的监督；
- (13) 以管理人的名义，代表投资者利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
- (14) 按照资产管理合同约定计算并向投资者报告资产管理计划份额净值；
- (15) 确定资产管理计划份额参与、退出价格，采取适当、合理的措施确保份额交易价格的计算方法符合法律法规的规定和合同的约定；
- (16) 对非标准化资产和相关交易主体进行充分的尽职调查，形成书面工作底稿，并制作尽职调查报告；
- (17) 按照资产管理合同约定负责资产管理计划会计核算并编制财务会计报告；

(18) 聘请具有证券相关业务资格的会计师事务所对年度财务会计报告进行审计;

(19) 按照资产管理合同的约定确定收益分配方案, 及时向投资者分配收益;

(20) 根据法律法规与资产管理合同的规定, 编制向投资者披露的资产管理计划季度、年度等定期报告, 并向证券投资基金业协会备案, 抄报证监会相关派出机构;

(21) 办理与受托资产管理业务活动有关的信息披露事项;

(22) 建立并保存投资者名单;

(23) 组织并参加资产管理财产清算小组, 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, 保存资产管理计划的会计账册、妥善保存有关的合同、协议、交易记录等文件、资料和数据, 保存期限自资产管理计划终止之日起不得少于 20 年;

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

(26) 管理人在与委托人签订资产管理合同时, 应当按照《中华人民共和国反洗钱法》、《金融机构反洗钱规定》、《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》、《金融机构洗钱和恐怖融资风险评估及客户分类管理指引》以及其他相关法律法规的规定对委托人进行身份识别, 了解客户及其交易目的和交易性质的基础上, 进行反洗钱客户风险等级划分; 按照《金融机构大额交易和可疑交易报告管理办法》等配套制度的规定, 履行大额交易、可疑交易以及涉嫌恐怖融资可疑交易的报告义务;

(27) 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。

(五) 托管人

1、托管人的权利

(1) 按照资产管理合同约定, 依法保管资产管理计划财产;

(2) 按照合同的约定, 及时、足额获得资产管理计划托管费用;

(3) 法律法规、中国证监会及证券投资基金业协会规定的和资产管理合同

约定的其他权利。

2、托管人的义务

- (1) 安全保管资产管理计划财产；
- (2) 除依据法律法规规定和资产管理合同的约定外，不得为托管人及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管资产管理计划财产；
- (3) 对所托管的不同财产分别设置账户，确保资产管理计划财产的完整与独立；
- (4) 公平对待所托管的不同财产，不得从事任何有损资产管理计划财产及其他当事人利益的活动；
- (5) 按规定开立和注销资产管理计划的托管账户及其他投资所需账户；
- (6) 复核资产管理计划资产净值和份额净值；
- (7) 办理与资产管理计划托管业务有关的信息披露事项；
- (8) 根据相关法律法规和资产管理合同约定，复核管理人编制的资产管理计划财产的定期报告，并出具书面意见；
- (9) 编制资产管理计划的年度托管报告，并向证券投资基金业协会备案，抄报中国证监会相关派出机构；
- (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资产管理计划资产管理的会计账册，妥善保存有关的合同、协议、交易记录等文件资料，保存期限自资产管理计划终止之日起不得少于 20 年；
- (13) 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) 非依法律、行政法规和中国证监会有关规定或本合同、说明书及托管协议约定，不得擅自用或处分集合计划资产；
- (15) 因管理人过错造成集合计划资产损失的，协助委托人向管理人追偿；

(16) 投资于《管理办法》第三十七条第(五)项规定资产时, 准确、合理界定安全保管资产管理计划财产、监督管理人投资运作等职责, 并向投资者充分披露。托管人根据法律法规或协议明确约定的投资范围、投资限制、禁止行为、委托人或管理人书面提供的关联方名单(若有)等内容履行投资监督义务;

(17) 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、资产管理计划的基本情况

(一) 名称: 东莞证券旗峰月月盈 1 号集合资产管理计划

(二) 类别: 固定收益类集合资产管理计划

(三) 运作方式: 开放式

(四) 是否 FOF/MOM 产品: 否

(五) 投资目标、主要投资方向、投资比例、产品风险等级

1、投资目标: 在追求集合计划资产长期安全的基础上, 力争为集合计划份额持有人获取稳定的投资收益。

2、主要投资方向

本集合计划资产投资于国内依法发行的国债、金融债、中期票据、公司债、企业债、地方政府债券、可转债、分离交易可转债、可交换债、短期融资券、债券逆回购、非公开定向债务融资工具(PPN)、银行存款、同业存单、央行票据、债券型基金、货币市场基金。

本集合计划可投资于债券正回购。

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

3、投资比例

本集合计划资产的配置比例如下:

(1) 债券、银行存款、货币市场基金等债权类资产占资产总值的比例不低于 80%;

(2) 固定收益类资产中投资可转债、可交换债占资产总值的比例不高于 20%;

(3) 本集合计划投资同一资产的比例不超过计划资产净值的 25%; 投资银

行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券等中国证监会认可的投资品种除外；

(4) 管理人所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%。投资银行活期存款、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；

(5) 债券正回购：融入资金余额不超过集合计划净资产的 100%，中国证监会另有规定的除外。

4、产品风险等级：本集合计划属于中低风险收益品种，适销对象是具有中低风险、中等风险、中高风险和高风险承受能力的谨慎型、稳健型、积极型和激进型合格投资者。

以上风险等级仅供委托人参考，本集合计划风险等级将根据所投资标的不定期更新，具体以管理人公告为准。

(六) 存续期限

本集合计划存续期限为 10 年，可展期。

(七) 集合计划初始募集面值

每一份集合计划份额的初始募集面值均为人民币 1.00 元。

(八) 最低初始募集规模

本计划设立初始募集规模最低为人民币 1000 万元。

(九) 分级安排

本集合计划不分级。

(十) 服务机构

本集合计划的份额注册登记机构为中登公司。

六、资产管理计划的募集

(一) 集合计划的募集方式

1、募集对象

本集合计划面向合格投资者募集。

合格投资者是指具备相应风险识别能力和风险承受能力，投资于单只资产管理计划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：

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

(2) 最近 1 年末净资产不低于 1000 万元的法人单位；

(3) 依法设立并接受国务院金融监督管理机构监管的机构，包括证券公司及其子公司、基金管理公司及其子公司、期货公司及其子公司、在中国证券投资基金业协会登记的私募基金管理人、商业银行、金融资产投资公司、信托公司、保险公司、保险资产管理机构、财务公司及中国证监会认定的其他机构；

(4) 接受国务院金融监督管理机构监管的机构发行的资产管理产品；

(5) 基本养老金、社会保障基金、企业年金等养老基金，慈善基金等社会公益基金，合格境外机构投资者（QFII）、人民币合格境外机构投资者（RQFII）；

(6) 中国证监会视为合格投资者的其他情形。

投资者不得使用贷款、发行债券等筹集的非自有资金投资本集合计划。

2、募集方式

非公开募集。

3、募集期限

在初始募集期内，投资者在工作日内可以参与本集合计划。初始募集期为自本集合计划份额发售之日起不超过 60 天，具体时间以管理人公告为准。

（二）集合计划的认购事项

1、认购费用

本集合计划不收取认购费。

2、认购方式及认购申请的确认

(1) 投资者按推广机构的具体安排，在规定的交易时间段内办理；

(2) 投资者应开设推广机构认可的交易账户，并在交易账户备足认购的货币资金；若交易账户内认购资金不足，推广机构不受理该笔认购申请；

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

(4) 在本集合计划初始募集期内，每份额认购价格均为每份额的面值，集合计划的每份额面值均为 1.00 元人民币；

(5) 投资者认购申请确认成功后, 其认购申请和认购资金不得撤销; 当日办理业务申请仅能在当日业务办理时间内撤销;

(6) 在每日(T日)办理认购的交易时间结束后, 管理人将对委托人认购规模实行汇总统计, 以集合计划份额募集规模上限为依据, 按“时间优先”的原则, 来确定认购成功的份额, 认购时间以份额登记系统的确认结果为准; 当委托人认购集合计划时间相同时, 按“规模优先”原则确定认购成功的份额, 认购规模以集合计划管理人的确认结果为准;

(7) 投资者于T日提交认购申请后, 可于T+2日后在办理认购的推广机构查询认购确认情况。

3、认购份额的计算

初始募集期认购份额 = (认购金额 + 利息) / 集合计划份额单位面值

委托人认购份额保留小数点后两位, 第三位四舍五入, 由此产生的差额部分记入集合计划资产损益。委托人多笔认购时, 按上述公式进行逐笔计算。

4、初始认购资金的管理及利息处理方式

集合计划募集期间, 销售机构应当在规定期限内, 将投资者参与资金存入集合计划份额登记机构指定的专门账户, 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。

委托人的认购资金在初始募集期产生的利息(若有)将折算为计划份额归委托人所有。

(三) 最低认购金额

本集合计划单个委托人首次认购最低金额为30万元人民币, 超过最低认购金额的部分不设金额级差。最低认购金额不包含认购费。

(四) 集合计划的募集结算专用账户和销售机构委托募集账户(如有)由管理人在管理人网站进行公告披露, 委托人可以在管理人网站查询。

(五) 投资者的认购参与款项(不含认购费用)加计其在初始募集期形成的利息将折算为资产管理计划份额归投资者所有。

七、资产管理计划的成立与备案

(一) 资产管理计划成立的有关事项

(1) 资产管理计划成立的条件为：初始募集规模不低于 1000 万元，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) 资产管理计划在取得验资报告后，公告资产管理计划成立；

(3) 资产管理计划募集失败的处理方式：

集合计划初始募集期结束，在集合计划规模低于人民币 1000 万元或委托人的数量少于 2 人条件下，或初始募集期内发生使本集合计划无法设立的不可抗力，集合计划设立失败，管理人承担集合计划的全部推广费用，并将已认购资金及同期活期存款利息在初始募集期结束（确认资产管理计划无法成立）后 30 日内退还集合计划委托人。

(二) 资产管理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资产管理计划成立。管理人应在资产管理计划成立后 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。资产管理计划成立前，任何机构和个人不得动用投资者参与资金。

(三) 资产管理计划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，资产管理计划未达到成立条件的，管理人应当承担以下责任：

(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（确认资产管理计划无法成立）后三十日内退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) 集合计划的参与和退出安排

1、参与和退出场所

投资者可以在本集合计划推广机构办理本集合计划的参与退出手续。

2、开放日安排

本集合计划的参与退出在开放期办理。本集合计划自成立之日起6个月内为封闭期,封闭期内不办理参与退出业务;封闭期结束后每月9号、10号为开放期(遇节假日顺延至下一个工作日),开放期内可办理参与、退出业务。在存续期内,管理人可视运作情况对开放期净参与规模上限及单个委托人参与金额上限进行限制,具体由管理人公告确定。

3、临时开放期安排

存续期内,管理人可设置临时开放期,该临时开放期仅适用于合同变更或监管规定需要时办理客户退出业务,不办理客户参与业务,具体安排以管理人公告为准。

4、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、退出以份额申请。

(2) “先进先出”原则,委托人在退出集合计划份额时,按先进先出的原则,即对该委托人在该销售机构参与的集合计划份额进行处理时,参与确认日期在前的集合计划份额先退出,参与确认日期在后的集合计划份额后退出。

5、参与和退出的价格

参与和退出采用“未知价”原则,即参与、退出份额的价格以开放日当日的集合计划份额单位净值为基准进行计算。

6、参与和退出的程序及确认

(1) 投资者按推广机构的具体安排,在规定的交易时间段内办理;

(2) 投资者应开设推广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,推广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后有效后,构成本合同的有效组成部分;

(4) T日在交易时间内提交的申请,管理人及份额登记机构在收到委托人申请的T+1日对该申请的有效性进行确认,委托人通常可在T+2日到网点查询申请的确认情况;

(5) 本集合计划存续期内发生参与申请的,在参与当日(T日)办理参与业务时间结束后,管理人将对参与规模和投资者人数进行汇总统计,当本集合计划

开放日累计参与规模达到集合公告的规模上限（如有）或投资者人数达到人数上限时，对 T 日提交的参与申请，管理人将按照“时间优先、金额优先”的原则确认申请通过的份额，即申请时间（以注册登记机构确认结果为准）在前的参与申请优先确认，时间相同的，申请参与金额更大的参与申请优先确认；

（6）退出申请款项的支付：委托人退出申请确认后，管理人将指示托管人把退出款项从集合计划托管专户划往份额登记机构，再由份额登记机构划往各推广机构，并通过推广机构划往申请退出委托人的指定账户，退出款项将在 T+3 日内从托管账户划出。

7、参与和退出的金额限制

本集合计划单个委托人首次参与最低金额为 30 万元人民币，超过最低参与金额的部分不设金额级差。投资者在资产管理计划存续期开放日购买资产管理计划份额的，投资者应符合合格投资者标准，且申购金额应满足资产管理计划最低参与金额限制（不含参与费用），已持有资产管理计划份额的投资者在资产管理计划存续期开放日追加购买资产管理计划份额的除外。委托人可选择部分退出资产管理计划份额，但其在退出后，当日持有的集合计划份额净值应当不低于 30 万元，若某笔退出申请会导致退出后委托人当日持有的份额净值低于 30 万元，则管理人将该委托人全部剩余份额强制退出。

8、参与和退出的费用

本集合计划免收参与、退出费。

9、参与份额、退出金额的计算

（1）参与份额的计算方法：

存续期参与份额=参与金额/参与当日集合计划份额单位净值

委托人参与份额保留小数点后两位，第三位四舍五入，由此产生的差额部分记入集合计划资产损益。委托人多笔参与时，按上述公式进行逐笔计算。

（2）退出金额的计算方法及退出方式

退出金额=退出份额×退出日集合计划份额单位净值-管理人业绩报酬

上述计算结果均保留小数点后两位，第三位四舍五入，由此产生的差额部分计入集合计划资产损益。

10、巨额退出的认定和处理方式

(1) 巨额退出、连续巨额退出的认定标准

集合计划单个开放日净退出申请份额（退出申请份额总数-参与申请份额总数）超过前一交易日集合计划总份额的10%时，即认为发生了巨额退出。

本集合计划在单个开放期内，连续两个工作日净退出申请份额均超过上一日集合计划总份额的10%时，即认为发生了连续巨额退出。

(2) 巨额退出的处理方式

当出现巨额退出的情况时，计划管理人可以根据集合计划当时的资产组合状况决定全额退出、部分顺延退出或暂停退出。

全额退出：当集合计划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：当集合计划管理人认为支付委托人的退出金额有困难或认为支付委托人的退出金额可能会引起集合计划的资产净值较大波动时，集合计划管理人在当日正常接受退出比例不低于前一交易日集合计划总份额的10%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集合计划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，并以该工作日的集合计划份额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。如顺延后仍发生巨额退出，且管理人未宣布暂停退出，仍继续按比例受理退出份额。

暂停退出：本集合计划发生连续巨额退出情形时可暂停接受退出申请；

管理人可以对已经接受的退出申请延缓支付退出款项，但不得超过正常支付时间二十个工作日。

(3) 告知客户的方式

当发生巨额退出或连续巨额退出并采用部分顺延退出或者发生暂停退出情形时，管理人应及时将有关情况通过管理人网站通告委托人，说明有关处理方法。

11、单个委托人大额退出的认定、申请和处理方式

本集合计划不设置单个委托人大额申请退出限制条款。

12、延期支付及延期退出的情形和处理方式

无。

13、拒绝或暂停参与、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委托人的参与、退出申请：

(1) 不可抗力的原因导致集合计划无法正常运作；

(2) 证券交易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) 法律、法规、规章规定的其他情形或其他在本合同及说明书中载明的特殊情形。

发生上述情形之一的，管理人通过管理人网站通告委托人。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。发生拒绝或暂停受理参与、退出的情形时，管理人应将拒绝或暂停受理参与、退出的原因和处理办法在管理人网站进行信息披露。在暂停参与、退出的情况消除时，管理人应在不超过正常支付时间 20 个工作日内及时恢复参与、退出业务的办理。

发生说明书、资产管理合同中未予载明的事项，但集合计划管理人有正当理由认为需要暂停接受集合计划参与、退出申请的，应与托管人协商一致，并向委托人披露。

(二) 份额转让

本集合计划份额暂不可转让，如满足相关条件可以进行转让后，按管理人公告的条件和方式进行。若本集合计划满足转让条件时，委托人可以通过证券交易所以及中国证监会认可的其他方式，向合格投资者转让其持有的资产管理计划份额，份额转让应遵守交易场所相关规定及要求，并按规定办理份额变更登记手续。具体方式以管理人公告为准。管理人应及时将经管理人确认同意的投资者份额转让信息以管理人、托管人双方认可的形式通知托管人，受让方首次参与集合计划，应先与管理人、托管人签订集合资产管理合同。

(三) 非交易过户

非交易过户是指不采用参与、退出等交易方式，将一定数量的集合计划份额按照一定的规则从某一委托人集合计划账户转移到另一委托人集合计划账户

的行为。集合计划份额登记机构只受理因继承、捐赠、司法执行、以及其他形式财产分割或转移引起的计划份额非交易过户（以份额登记机构规定为准）。对于符合条件的非交易过户申请按份额登记机构的有关规定办理。

（四）管理人自有资金参与

1、自有资金参与的条件

管理人可以自有资金参与本集合计划，应符合《管理办法》、《运作规定》和中国证监会及中国证券业协会的相关规定。

2、自有资金的参与方式

在初始募集期、每个开放日，管理人可以自有资金参与本集合计划。

3、自有资金参与的比例和限制

管理人以自有资金参与本集合计划的份额，不得超过本集合计划总份额的15%，管理人及其附属机构以自有资金参与本集合计划份额不得超过本集合计划总份额的50%，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限的，管理人应当及时公告退出安排，将部分自有资金参与份额退出，以符合法规要求。集合计划存续期间，管理人自有资金参与集合计划的持有期限不得少于6个月。管理人以自有资金参与、以参与本集合计划持有的份额退出时，应当提前5个工作日通过管理人网站公告，告知委托人和托管人。

为应对本集合计划巨额赎回以解决流动性风险，或者中国证监会认可的其他情形，在不存在利益冲突并遵守合同约定的前提下，管理人及其附属机构以自有资金参与及其后续退出可不受前款限制，但应及时告知委托人和托管人，并向相关派出机构及证券投资基金业协会报告。

4、自有资金的收益分配

管理人以自有资金参与份额与其他份额投资者享有同等收益分配权利和义务。

5、自有资金责任承担方式和金额

管理人以自有资金参与份额与其他份额投资者享有同等权利和义务。

6、风险揭示和信息披露

集合计划管理人按上述约定以自有资金参与本集合计划份额，不构成对本集合计划份额本金及收益不受损失的保证。

管理人自有资金退出时应当提前 5 个工作日通过管理人网站公告,告知委托人和托管人。

(五)管理人应当定期将本集合计划投资者变更情况报送证券投资基金业协会。

九、份额持有人大会及日常机构

本集合计划不设份额持有人大会。

十、资产管理计划份额的登记

(一)管理人委托中登公司代为办理资产管理计划份额登记业务,管理人已与中登公司签订委托代理协议,中登公司担任受托注册登记人,通过其基金登记结算系统代为办理投资账户管理、持有人名册登记以及资管产品参与、退出、转托管、非交易过户、冻结解冻、权益分派等登记结算相关事宜。

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

十一、资产管理计划的投资

(一) 投资目标

在追求集合计划资产长期安全的基础上,力争为集合计划份额持有人获取稳定的投资收益。

(二) 投资范围及比例

1、投资范围

本集合计划资产投资于国内依法发行的国债、金融债、中期票据、公司债、企业债、地方政府债券、可转债、分离交易可转债、可交换债、短期融资券、债券逆回购、非公开定向债务融资工具(PPN)、银行存款、同业存单、央行票据、债券型基金、货币市场基金。

本集合计划可投资于债券正回购。

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

2、投资比例

本集合计划资产的配置比例如下：

(1) 债券、银行存款、货币市场基金等债权类资产占资产总值的比例不低于 80%；

(2) 固定收益类资产中投资可转债、可交换债占资产总值的比例不高于 20%；

(3) 本集合计划投资同一资产的比例不超过计划资产净值的 25%；投资银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券等中国证监会认可的投资品种除外；

(4) 管理人所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%。投资银行活期存款、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；

(5) 债券正回购：融入资金余额不超过集合计划净资产的 100%，中国证监会另有规定的除外。

(三) 投资比例超限的处理方式

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证券公司之外的因素导致资产管理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，证券公司应当在流动性受限资产可出售、可转让或者恢复交易的十五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，证券公司应当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。因一级市场申购而发生比例超标的情况时，应在该获配证券锁定期结束后 15 个交易日内将持仓比例降至许可范围内。

(四) 产品风险收益特征：本集合计划属于中低风险收益品种，适销对象是具有中低风险、中等风险、中高风险和高风险承受能力的谨慎型、稳健型、积极型和激进型合格投资者。

以上风险等级仅供委托人参考，本集合计划风险等级将根据所投资标的的不定期更新，具体以管理人公告为准。

（五）业绩比较基准

本集合计划不设业绩比较基准。

（六）投资策略

1、资产配置策略

通过深入分析国内外宏观经济指标、各项宏观经济政策及资金流动方向对金融市场特别是货币市场和债券市场的影响，充分利用固定收益类资产的特性，结合本计划的流动性需求，将计划资产在债券类资产及其他中短期固定收益类资产间进行合理配置。

2、固定收益资产投资策略

立足于对债券市场内在运行逻辑的深刻理解，把握收益率曲线运动和宏观经济走势的关系；综合使用定性和定量的方法分析不同债券投资品种的绝对价值和相对价值，捕捉潜在的趋势交易机会和套利交易机会；在此基础上，结合对个券风险收益特征的分析构建投资组合，实现投资收益最大化。

（1）久期选择

通过对宏观经济状况和货币政策的分析，根据中长期的宏观经济走势和经济周期性特征，对债券市场走势作出判断，并形成对未来市场利率变动方向的预期，动态调整组合的久期。

（2）期限结构配置

在确定组合久期后，根据对未来收益率曲线形态变化的预期以及本集合计划的现金流特征确定合理的久期期限结构，相应构建哑铃型、子弹型或阶梯型债券组合。

（3）动态增强型策略

积极发现市场失衡和定价错误，运用骑乘策略（根据债券收益曲线形状变动预期为依据来建立和调整组合头寸）、息差策略（利用回购利率低于债券收益率，通过正回购将所获资金投资于债券）、利差策略（对两个期限相近债券利差进行分析并对利差水平未来走势作出判断，从而进行相应债券置换）等主动捕捉潜在的趋势交易机会。

3、现金管理类资产投资策略

本计划以严谨的市场价值分析为基础，采用稳健的投资组合策略，通过对现金管理类金融品种的组合操作，在保持本金的安全性与资产流动性的同时，追求

稳定的当期收益。通过合理有效分配本计划的现金流，保持投资组合的流动性，满足本计划投资运作的要求。

4、投资决策依据

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，并以维护集合计划委托人利益作为最高准则。具体决策依据包括：

- (1) 《基金法》、《指导意见》、《管理办法》、《运作规定》、《格式指引》、《集合资产管理合同》、《说明书》等有关法律性文件；
- (2) 宏观经济情况、财政政策和货币政策的调整以及汇率、利率变化趋势；
- (3) 投资对象流动性、收益和风险的配比关系。

5、决策程序

(1) 管理人资产管理投资决策委员会是本集合计划管理人进行资产管理投资运作的最高决策机构，贯彻落实有关法律法规、管理人的公司制度，授权并监督管理人的资产管理业务部门的工作。

(2) 管理人资产管理部投资总监负责领导资产管理业务的投资团队管理所属各资产管理计划，监控投资决策和投资执行过程；在公司资产管理投资决策委员会授予的权限范围内，对产品重大资产投资项目进行审核。

(3) 管理人深圳分公司投资决策小组对本集合计划的投资决策等提出指导性意见，负责本集合计划的营运和管理；如遇重大事项按制度规定上报公司资产管理投资决策委员会批准。

(4) 管理人投资经理依据资产管理投资决策委员会及投资决策小组决议，制定交易策略，进行具体品种的交易。

(5) 管理人深圳分公司风控专员根据市场变化对投资计划提出风险防范措施，投资经理依据本集合计划参与退出的情况控制投资组合的流动性风险。

(6) 管理人在确保集合计划委托人利益的前提下有权根据环境变化和实际需要对上述投资程序做出调整，但应在调整之日起五个工作日内公告。

(七) 投资限制

为维护委托人的合法权益，本集合计划投资的投资限制为：

- 1、集合计划参与债券正回购融入资金余额不得超过集合计划资产净值的100%，中国证监会另有规定的除外；
- 2、除本合同另有约定外，集合计划投资于同一证券资产的资金比例，不得超

过集合计划资产净值的25%;

3、集合计划的总资产占净资产的比例不得超过 200%;

4、不得将委托资产投向高污染、高能耗行业等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）；

5、相关法律法规以及监管部门规定的其它投资限制。

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

（八）建仓期

自合同生效之日起，本集合计划存续满六个月内为本集合计划建仓期。建仓期内的投资活动，应当符合合同约定的投向和本集合计划的风险收益特征。以现金管理为目的，投资于活期存款、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，本集合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。

（九）特定风险情况

全体投资者签订本合同即同意本集合计划存续期间，为规避特定风险，投资于固定收益类资产的比例可以低于计划总资产 80%，但不得持续 6 个月低于计划总资产 80%。本集合计划的特定风险是指由于发生巨额赎回，或由于市场剧烈波动导致本集合计划净值受较大影响以及证券发行人、交易对方或者融资人发生风险事件，可能导致本计划损失的，管理人为应对计划流动性而需要进行的仓位调整。

（十）流动性安排

本集合计划开放期内，管理人将视本集合计划运营情况在开放期保持适当比例的现金，以保持本集合计划整体流动性充足。集合计划开放期内，其资产组合中 7 个工作日可变现资产的价值，不低于本集合计划资产净值的 10%。

十二、投资顾问

本集合计划不聘用投资顾问。

十三、分级安排

本集合计划不分级。

十四、利益冲突及关联交易

（一）关联交易及利益冲突情形

在不违反法律法规的强制性规定、不违反本合同约定并严格遵守管理人内部有关投资决策管理及关联交易管理等制度的前提下，本产品可能投资于管理人、托管人及其关联方所发行、管理、保荐、托管、销售或存在其他法律关系或利益联系的金融产品，或者与该等金融产品以公平合理的价格进行交易。

托管人应在本计划成立 5 个工作日内向管理人提供托管人关联方名单，以便履行关联方信息披露义务，如后续托管人关联方名单发生变动的，应在变动之日起 5 个工作日内书面通知管理人。

（二）本计划存在利益冲突的处理方式、披露方式、披露内容和披露频率

1、管理人将本计划资产投资于管理人、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者承销期内承销的证券，或进行其他关联交易（包括重大管理交易）的，管理人应当建立健全内部审批机制和评估机制，并应当遵循投资者利益优先原则，交易完成后，管理人应书面通知托管人，以公告的形式通知委托人。

2、委托人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委托人的授权，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。

3、本计划在投资运作过程中存在利益冲突情形的，管理人应当坚持委托人利益优先原则，从充分维护委托人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委托人提供的定期报告或临时报告中披露。

（三）管理人运用受托管理资产从事关联交易的，事后应及时、全面、客观

的以公告的方式向投资者披露，并书面通知托管人。

管理人运用受托管理资产从事重大关联交易的，应向中国证监会相关派出机构和证券投资基金业协会报告，投资于证券期货的关联交易还应当向证券期货交易所报告。

十五、投资经理的指定与变更

(一) 资产管理计划投资主办人由管理人负责指定。

管理人经研究决定指定赖春灵女士为本集合计划投资经理。

赖春灵，女，中南财经政法大学经济学学士，中山大学岭南学院金融硕士，2016年加入东莞证券，历任东莞证券深圳分公司债券交易员、信评，擅长宏观政策分析和信用研究，具有良好的诚信记录和职业操守，已取得基金从业资格，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) 管理人可以根据业务需要变更投资主办人，经管理人内部审批决议后进行变更。变更后，管理人应在5个工作日内通知委托人和托管人。

十六、资产管理计划的财产

(一) 集合计划财产的保管与处分

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

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

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

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

属于其清算财产。

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

（二）集合计划财产相关账户的开立和管理

托管人为本集合计划开立资金托管账户。资金托管账户名称应当是“东莞证券旗峰月月盈 1 号集合资产管理计划”，证券账户名称应当是“东莞证券—宁波银行—东莞证券旗峰月月盈 1 号集合资产管理计划”（账户名称以实际开立为准）。委托财产托管期间，托管人根据有关规定以二级户的形式为集合计划开立专门用于保管货币形式存在的委托资金及清算交收的银行账户，二级户的预留印鉴以一级户的预留印鉴为准。一级托管账户预留印鉴为托管人托管业务专用章及托管人监管名章各一枚。开立的托管账户应遵循《单位银行结算账户管理协议》规定。

委托资产投资定期存款，存款账户预留的其中一枚印鉴应当为托管人的监管人名章，管理人应与存款机构签订定期存款协议，该协议作为划款指令附件，该协议中必须有如下明确条款：“存款证实书（或存单）不得以任何方式被质押或以任何方式被抵押，并不得用于转让和背书；本息到期归还或提前支取的所有款项必须划至托管账户（明确户名、开户行、账号等），不得划入其他任何账户”。如定期存款协议中未体现前述条款，托管人有权拒绝定期存款投资的划款指令。在取得存款证实书（或存单）等凭证后，存款证实书（或存单）等凭证正本需由托管人保管。本合同当事人应当在开户过程中给予开立账户方必要的配合，并提供所需资料。与委托资产投资有关的其他账户，由管理人与托管人根据相关法律法规和本合同的规定协商一致后办理，新账户按有关规则使用并管理。

集合计划账户的管理应符合国家法律法规及其他有关规定。

集合计划账户、专用交易单元应由集合计划管理人报证券交易所、证券登记结算机构以及相关监管部门备案。

十七、指令的发送、确认和执行

（一）交易清算授权

1、集合计划管理人应当事先向集合计划托管人发出书面通知（以下称“授权通知”），载明集合计划管理人有权发送指令的人员名单（以下称“指令发送人员”）及各个人员的权限范围、授权生效日期，并规定集合计划管理人向集合计划托管人发送指令时集合计划托管人确认有权发送指令的人员身份的方法。集合计划管理人应向集合计划托管人提供指令发送人员的人名印鉴的预留印鉴样本和签字或签章样本。授权发送指令人员及预留印鉴，继续沿用集合计划管理人已在集合计划托管人所托管集合计划产品签发的授权，如有变更则另行发出更新的“授权通知”。

2、集合计划管理人向集合计划托管人发出的授权通知应加盖公章。管理人发出授权通知后向托管人电话确认。授权通知自其中注明的生效日期起开始生效。若托管人收到授权通知原件的日期晚于其中注明的生效日期，授权通知自托管人收到原件的日期起开始生效。授权通知应以原件形式送达集合计划托管人。若集合计划管理人同时向集合计划托管人出具了资产管理业务统一授权书和单个集合计划授权书的，授权书以以下第（1）种方式为准：（1）统一授权书。（2）单个集合计划授权书。

3、集合计划管理人和集合计划托管人对授权通知及其更改负有保密义务，其内容不得向指令发送人员及相关操作人员以外的任何人披露、泄露。

（二）投资指令（划款指令）的内容

投资指令（即划款指令，以下亦可简称为“指令”）是集合计划管理人在运作集合计划资产时，向集合计划托管人发出的资金划拨及其他款项支付的指令。相关登记结算公司向集合计划托管人发送的结算通知视为集合计划管理人向集合计划托管人发出的指令。

（三）指令的发送、确认、执行和保管

1、指令由“授权通知”确定的指令发送人员代表集合计划管理人用传真、邮件、易托管或其它管理人和托管人双方确认的方式向集合计划托管人发送。集合计划管理人的传真号为（0769-22119425），除此之外的传真号发送的资料集合计划托管人有权拒绝执行。当指令原件与指令传真件、扫描件等非原件不一致

时，以资产托管人收到的业务指令传真件、扫描件等非原件形式为准。

集合计划托管人依照“授权通知”规定的方法确认指令有效后，方可执行指令。对于指令发送人员发出的指令，集合计划管理人不得否认其效力。但如果集合计划管理人已经撤销或更改对指令发送人员的授权，且管理人已经书面通知集合计划托管人并得到托管人的回函确认，则对于此后该指令发送人员无权发送的指令，或超权限发送的指令，集合计划管理人不承担责任。

2、集合计划管理人应按照《管理办法》和有关法律法规的规定，在其合法的经营权限和交易权限内，并依据相关业务规则发送指令。指令发出后，集合计划管理人应及时电话通知集合计划托管人。

管理人向托管人发送划款指令时应确保预留托管人至少2个工作小时的处理时间（托管人的工作时间 8:30-11:30,13:30-17:00），对于当日 15:00 之后收到的指令，托管人应尽力在指定时间内完成资金划拨，但不承担执行失败的责任。集合计划托管人发现集合计划管理人的指令违法、违规或违反本合同约定的，有权不予执行，并及时书面通知集合计划管理人。

集合计划管理人在发送划款指令时，应为集合计划托管人执行划款指令留出执行指令时所必需的时间。指令传输不及时未能留出足够的执行时间，致使指令未能及时执行所造成的损失由集合计划管理人承担。若托管人因投资监督需要要求管理人发送相关交易解释、说明等文件，则视托管人收到上述有效文件时间为收到划款指令时间。

资产管理人发送指令时应同时向资产托管人发送必要的投资合同、划款指令、费用发票（如有）等划款证明文件的复印件或扫描件。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，托管人不负责审查管理人发送指令同时提交的其他文件资料的合法性、真实性、完整性和有效性，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，托管人不承担任何形式的责任。

（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有可能违反《基金法》、《指导意见》、《运作规定》、本合同或其他有关法律法规的规定时，应暂缓或拒绝执行指令，并及

时通知管理人，管理人收到通知后应及时处理，由此造成的损失由管理人承担。

（五）管理人发生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，未按照本合同约定的传真号码、邮箱、易托管或双方认可的其他形式发送划款指令等。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。若托管人发现划款指令存在要素不符、资金去向异常或其他问题，应及时与管理人进行电话确认，并暂停指令的执行。托管人有权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判断指令的有效性。

（六）更换被授权人的程序

集合计划管理人若对授权通知的内容进行修改（包括但不限于指令发送人员的名单的修改，及/或权限的修改），应当至少提前1个工作日通知集合计划托管人；修改授权通知的文件应由集合计划管理人加盖公章并由法定代表人或其授权代表签署，若由授权代表签署，还应附上法定代表人的授权书。集合计划管理人对授权通知的修改应当以原件的形式发送给集合计划托管人，同时电话通知集合计划托管人。变更授权通知应注明生效时间，若集合计划托管人收到变更授权通知原件的日期晚于注明的生效日期，则以集合计划托管人收到变更授权通知原件的日期为准。集合计划管理人更换授权变更文件生效后，对于已被撤换的人员无权发送的指令，或被改变授权人员超权限发送的指令，集合计划管理人不承担责任。

（七）投资指令的保管

划款指令若以传真、扫描形式发出，则正本由资产管理人保管，资产托管人保管指令传真件、扫描件。

（八）其它事项

1、集合计划托管人在接收指令时，应对划款指令的印鉴和被授权人是否与预留的授权文件内容相符做表面一致性审慎检查，如发现问题，应及时通知集合计划管理人。

2、除因过失致使集合计划的利益受到损害而负赔偿责任外，集合计划托管人对执行集合计划管理人指令对集合计划财产造成的损失不承担赔偿责任。集合

计划托管人因正确执行集合计划管理人划款指令而产生的相关法律责任,由集合计划管理人承担,集合计划托管人不承担该责任。集合计划托管人因未正确执行集合计划管理人符合法律法规规定及本合同约定的指令而使集合计划的利益受到损害或产生的相关法律责任,由集合计划托管人承担,集合计划管理人不承担该责任。

3、集合计划管理人向集合计划托管人下达划款指令时,集合计划管理人应确保集合计划银行托管账户有足够的资金余额,对超头寸的划款指令,集合计划托管人在履行及时通知义务但管理人未采取措施情况下可不予执行,由此造成的损失,由集合计划管理人负责赔偿。

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

5、交易资金的清算

(1) 因本集合计划投资于证券发生的所有场内、场外交易的清算交割,全部由集合计划托管人负责办理。

(2) 本集合计划证券投资场内交易的清算交割,由集合计划托管人根据相关登记结算公司的结算规则办理。

(3) 本集合计划证券投资场外交易的清算交割,由集合计划托管人根据相关结算要求办理。

十八、越权交易的界定

(一) 越权交易的界定

本合同所指越权交易是指管理人在委托投资交易过程中发生的如下行为:

(1) 违反本合同投资范围规定的投资交易行为;(2) 进行法律法规禁止的超买、超卖行为。

(二) 越权交易的处理程序

1、违反本合同投资范围的规定进行的投资交易行为

对于越权交易买进或卖出的款、券,管理人应于交割清算完成之日起二个工

作日内进行相反的卖出或买进冲销处理并结算损益，若发生损失的，管理人应将
与越权交易而导致的损失及相关交易费用等额的资金补足拨入委托资金账户；冲
销处理后，若有盈余的，收益归委托财产所有。

2、法律法规禁止的超买、超卖行为。

管理人在委托财产投资证券过程中出现超买或超卖现象，由管理人负责解
决，由此给委托财产造成的损失及相关交易费用由管理人承担。如果因管理人原
因发生超买行为，必须于 T+1 日上午 10:00 前完成融资，用以完成清算交收。

管理人就越权交易部分未依本条规定办理，给委托财产造成损失的，由管理
人承担赔偿责任。

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
本委托财产所有。

(三) 托管人对管理人投资运作的监督

托管人自本资产管理合同成立之日起，于每一估值日后，对投资范围、投资
比例、投资禁止等进行监督，法律、行政法规对托管人监督职责另有规定的除外。

托管人发现证券公司的投资或清算指令违反法律、行政法规、中国证监会的
规定或者集合资产管理合同约定的，应当要求改正；未能改正的，有权拒绝执行，
并报告管理人住所地、资产管理分公司所在地中国证监会派出机构及中国证
券投资基金业协会。

十九、资产管理计划财产的估值和会计核算

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

(二) 估值时间：集合计划成立后，管理人与托管人每个工作日均对集合计划资
产进行估值。每个工作日对集合计划资产进行核对。

(三) 集合计划财产的估值方法：

1、固定收益品种的估值方法

(1) 在证券交易所市场流通的债券，按如下估值方式处理：

在证券交易所市场挂牌交易实行净价交易的债券按估值日收盘价估值；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，按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，可参考监管机构和行业协会估值意见，或者参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。

在证券交易所市场挂牌交易未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去所含的债券应收利息得到的净价进行估值；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，按最近交易日债券收盘价减去所含的债券应收利息得到的净价估值；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，可参考监管机构和行业协会估值意见，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) 首次发行未上市债券采用估值技术确定的公允价值进行估值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

(3) 全国银行间债券市场交易的债券等固定收益品种，采用中债登公布的收益率曲线及估值价格确定公允价值。

(4) 同一债券在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

2、银行存款以成本列示，按商定利率在实际持有期间内逐日计提利息。

3、持有的交易所上市基金，按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值；持有的场外基金，按估值日前一交易日的基金份额净值估值；估值日前一交易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；持有的货币市场基金，按基金管理公司公布的估值日前一交易日的每万份收益计提红利；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。

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

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

(四) 估值对象：集合计划投资所形成的各类有价证券、银行存款本息、其他应收的款项及其他资产。

(五) 估值程序

管理人应每个工作日对集合计划资产估值。集合计划资产净值和集合计划份额单位资产净值由管理人负责计算，托管人对集合计划资产净值、集合计划份额单位资产净值进行复核，法律法规有明确规定的除外。管理人应于每个工作日结束后计算得出当日的集合计划资产净值、单位资产净值。托管人应在收到集合计划资产净值估值结果后对净值计算结果进行复核，并以双方约定的方式将复核结果传送给管理人；如果托管人的估值结果与管理人的估值结果存在差异，且双方经协商未能达成一致，管理人有权按照其对集合计划净值的计算结果对外予以公布，由此产生的估值错误，托管人不承担赔偿责任，托管人有权将相关情况报集合计划管理人住所地、资产管理分公司所在地中国证监会派出机构，及中国证券投资基金业协会备案。

如管理人或托管人发现集合估值违反合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护委托人利益的时候，应立即通知对方，共同查明原因，双方协商解决。

(六) 估值错误与遗漏的处理方式

1、本计划单位资产净值的计算精确到 0.0001 元，小数点后第五位四舍五入。当资产估值导致本计划单位资产净值小数点后四位以内(含第四位)发生差错时，视为本计划单位资产净值错误。

2、本计划管理人和本计划托管人应严格按本合同约定进行估值。当估值出现错误时，本计划管理人应当立即纠正，并及时采取合理的措施防止损失进一步扩大。

3、因发生估值差错导致本计划资产或本计划持有人损失的，由本计划管理人负责赔偿，本计划管理人在赔偿本计划资产或本计划持有人后，对不应由其承担的责任，有权根据过错责任原则，向存在过错的一方追偿。

4、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。

（七）估值调整的情形与处理

1、管理人应定期评估估值方法的合理性，并对估值价格进行检验，防范可能出现的估值偏差。当出现投资品估值偏差，估值机构发布的估值不能体现公允价值时，管理人应综合第三方估值机构估值结果，经与托管人协商，谨慎确定公允价值，并按相关法规的规定，发布相关公告，充分披露确定公允价值的方法、相关估值结果等信息。

2、如有确凿证据表明按本合同约定的估值方法进行估值不能客观反映本计划公允价值的，管理人可根据具体情况与托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

（八）暂停估值的情形

集合计划投资所涉及的证券交易所遇法定节假日或其它原因暂停营业时，或因其它任何不可抗力致使管理人或托管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，管理人或托管人必须及时完成估值工作。

（九）份额净值的确认

管理人应于每个工作日结束后计算得出当日的集合计划资产净值、单位资产净值。托管人应在收到集合计划资产净值估值结果后对净值计算结果进行复核，并以双方约定的方式将复核结果传送给管理人。

（十）资产管理计划财产的会计核算政策

本集合计划的会计政策比照现行政策或按照资产管理合同约定执行。

- 1、本项委托财产的会计年度为每年1月1日至12月31日。
- 2、记账本位币为人民币，记账单位为元。
- 3、委托财产的会计核算按照《证券投资基金会计核算业务指引》执行。

（十一）资产管理计划财产的会计核算方法

1、管理人、托管人应根据有关法律法规和委托人的相关规定，对委托财产单独建账、独立核算。

2、管理人、托管人应保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，编制会计报表。

3、托管人应定期与管理人就委托财产的会计核算、报表编制等进行核对。

二十、资产管理计划的费用与税收

(一) 集合计划费用的种类

1、集合计划管理人的管理费

本集合计划管理费按前一日集合计划资产净值的【0.5%】年费率计提，计算方法如下：

$$T = E \times 【0.5\%】 \div \text{当年实际天数}$$

T 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。

集合计划管理费每日计提，每季度支付一次。经管理人与托管人双方核对无误后，由托管人于每季度第一个月首日起3个工作日内将管理费用从集合计划资产中一次性支付给管理人。

2、集合计划托管人的托管费

本集合计划托管费按前一日集合计划资产净值的【0.02%】年费率计提，计算方法如下：

$$T = E \times 【0.02\%】 \div \text{当年实际天数}$$

T 为每日应计提的集合计划托管费；

E 为前一日集合计划资产净值。

集合计划托管费每日计提，每季度支付一次。经管理人与托管人双方核对无误后，由托管人于每季度第一个月首日起3个工作日内将托管费用从集合计划资产中一次性支付给托管人。

3、管理费和托管费的调整

委托人在此同意并授权管理人和托管人可协商调减管理费和托管费，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。委托人签署本合同即同意以上约定。

(二) 可列入集合计划费用的项目

1、证券交易费用

集合计划投资运作期间发生的交易手续费、开放式基金的认（申）购和赎回费、债券交易经纪费用、印花税等有关税费，在收取时从集合计划中扣除。委托人在此同意并授权管理人以管理人指定网站公告的方式披露交易手续费的种类及费率。

2、其他费用

除交易手续费、印花税、管理费、业绩报酬、托管费之外的集合计划费用，例如证券账户开户费用、审计费、律师费、集合计划信息披露费用、注册登记费用、电子合同费用等，由管理人根据有关法律法规及相应的合同或协议的具体规定，按费用实际支出金额列入当期费用，从集合计划资产中支付。

银行间费用（如有）：资产管理人应根据银行间费用相关法律法规及本合同约定，将账户开户、结算管理等各项费用列入或摊入当期委托财产运作费用，经管理人和托管人核对无误后，由托管人主动从委托资产中扣划，无须资产管理人出具指令。资产委托人和资产管理人在此申明已了解委托资产投资会产生银行费用，并确保账户中有足够资金用于银行费用的支付，如因托管账户中的资金不足以支付银行费用影响到指令的执行，资产托管人不承担由此产生的损失和责任。如委托资产未起始运作，由管理人在收到托管人的缴费通知后完成支付，托管人不承担垫付费用义务。

3、增值税等应纳税费

本集合计划运营过程中发生的增值税应税行为，以管理人为增值税纳税人，法律法规有其他规定的，从其规定；本集合计划运营过程中发生的增值税及附加税费在本集合计划委托资产中列支，集合计划应每月计征应交增值税及附加税费，由管理人、托管人根据规定在纳税申报期结束前将应交增值税及附加税费款项划至管理人指定的缴税账户，管理人按规定缴纳增值税及附加税费。法律、法规及其他规范性文件对资产管理计划运营过程中发生的应税行为另有规定的，管理人根据规定执行。

（三）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，及集合计划管理人和集合计划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资产的损失，以及处理与集合计划运作无关的事项或不合理事项所发生的费用等不列入集合计划费用。

（四）管理人业绩报酬

本集合计划在集合计划分红日、委托人份额退出或集合计划终止清算时，管理人根据实际年化收益率提取业绩报酬。原则上业绩报酬的提取频率不超过每6个月一次，因委托人退出本集合计划提取业绩报酬的，不受前述提取频率的限制。

对于集合计划实际年化收益率大于对应份额业绩报酬计提基准的部分，按照60%的比例计提业绩报酬。业绩报酬计提基准是管理人通过深入分析国内外宏观经济形势、社会资金及金融市场利率走势，依据所投资品种综合收益预测，并不是管理人向委托人承诺的预期收益或保证收益，委托人将自行承担投资风险。

随着宏观经济和利率水平变化，管理人有权按月调整或不调整本集合计划业绩报酬计提基准，具体安排在最近一个开放期前在管理人网站上进行公告。

1、管理人业绩报酬提取原则：

（1）在符合业绩报酬计提条件时，本集合计划在分红日、委托人退出和本集合计划终止时计提业绩报酬；

（2）分红时提取业绩报酬的，业绩报酬从分红资金中扣除；委托人退出时提取业绩报酬的，业绩报酬从退出资金中扣除；集合计划终止时提取业绩报酬的，业绩报酬从清算资产中扣除。

2、业绩报酬计算方法：

以上一个发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日（以下简称“上一个业绩报酬计提日”，如未发生业绩报酬计提，初始募集期内认购的，以本集合计划成立日为上一个业绩报酬计提日，存续期内认购的，以认购当日为上一个业绩报酬计提日，下同）到本次业绩报酬计提日为计提区间计算年化收益率R。

年化收益率计算公式如下：

$$R=100%*(P1-P0)/(P01*D)*(当年天数)$$

P1 为业绩报酬计提日的单位累计净值；

P0 为上一业绩报酬计提日的单位累计净值；

P01 为上一业绩报酬计提日的单位净值；

D 为计提区间存续天数；

R 为年化收益率；

业绩报酬的计算公式为：

$E=K*(R-R_0)*60\%*D/(\text{当年天数})$

E= 业绩报酬;

R_0 =业绩报酬计提基准;

K= 提取业绩报酬的份额×上一业绩报酬计提日单位资产净值。

3、当集合计划份额分红、退出或集合计划终止时,托管人根据管理人指令,将应付给管理人的业绩报酬从托管账户中划拨给管理人,托管人不承担复核职责。

(五) 集合计划的税收

本集合计划运作过程中涉及的各项纳税主体,其纳税义务按国家税收法律法规执行。

二十一、资产管理计划的收益分配

(一) 可供分配利润的构成

可供分配利润包括:集合计划投资所得债券利息、买卖证券收益、银行存款利息及其他合法收入。

(二) 可供分配利润: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收益的孰低数。

(三) 收益分配原则

集合计划收益分配应遵循下列原则:

- 1、每一份额享有同等的分配权;
- 2、集合计划投资当期出现净亏损,不进行收益分配;
- 3、集合计划当期收益应先弥补上期亏损后,才可进行当期收益分配;
- 4、集合计划每个自然年度最多分配2次,具体分配基准、金额、比例、时间等以管理人公告为准。
- 5、法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

(四) 收益分配方案的确定与通知

收益分配方案由管理人公布并实施,收益分配方案须载明集合计划收益分配对象、分配时间、分配方式等内容。

收益分配方案由管理人拟定并通知托管人,由管理人公告确定。收益分配时

发生的银行转账等手续费用由持有人自行承担。

（五）收益分配的执行方式

委托人可选择现金红利或将现金红利按除权日的份额净值自动转为计划份额进行再投资。本集合计划收益分配方式默认为现金红利，管理人将现金红利款划往推广机构账户，再由推广机构划入委托人账户，现金红利款自款项从集合计划托管账户划出之日起7个工作日内到达委托人账户。

（六）托管人对收益分配不承担复核职责，法律法规有明确规定的除外。

二十二、信息披露与报告

（一）管理人、托管人应按照《管理办法》和《运作规定》的规定和委托人的要求，向委托人全面披露委托资产的运作情况。管理人应向委托人提供下列信息披露文件：

- 1、资产管理合同、计划说明书和风险揭示书；
- 2、资产管理计划净值；
- 3、资产管理计划定期报告，至少包括季度报告和年度报告；
- 4、重大事项的临时报告；
- 5、资产管理计划清算报告；
- 6、中国证监会规定的其他事项。

投资者可按照本合同约定的时间和方式查阅或者复制所披露的信息资料。

（二）集合计划单位净值报告

披露时间：集合计划存续期内至少每周披露一次集合计划的单位净值。开放期应每日披露上一工作日集合计划的单位净值。

披露方式：管理人指定网站披露。

（三）定期报告

1、集合计划的资产管理季度报告和托管季度报告

管理人应当在每季度结束之日起一个月内，编制完成产品季度报告并经托管人复核，向委托人披露投资状况、投资表现等信息。管理人在季度报告完成后，将有关报告提供托管人复核，托管人在收到后3个工作日内复核，并将复核结果书面通知管理人。委托财产运作不到3个月的，不提供季度报告。管理人应当在

每季度结束之日起一个月内，将完成的集合计划资产管理业务季度报告报中国证监会相关派出机构及中国证券投资基金业协会备案。

2、集合计划的资产管理年度报告和托管年度报告

管理人应当在每年度结束之日起四个月内，编制完成产品年度报告并经托管人复核，向委托人披露投资状况、投资表现等信息。管理人在年度报告完成后，将有关报告提供托管人复核，托管人在收到后15个工作日内复核，并将复核结果书面通知管理人。委托财产运作不到3个月的，不提供年度报告。管理人应当在每年度结束之日起四个月内，将完成的集合计划资产管理业务年度报告报中国证监会相关派出机构及中国证券投资基金业协会备案。

年度报告包括但不限于下列信息：

- (1) 管理人履职报告；
- (2) 托管人履职报告；
- (3) 资产管理计划投资表现；
- (4) 资产管理计划投资组合报告；
- (5) 资产管理计划运用杠杆情况（如有）；
- (6) 资产管理计划财务会计报告；
- (7) 资产管理计划支付的管理费、托管费、业绩报酬（如有）等费用，包括计提基准、计提方式和支付方式；
- (8) 资产管理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；
- (10) 中国证监会规定的其他事项。

资产管理计划季度报告应当披露前款除第（6）项之外的其他信息。

3、年度审计报告

管理人应当聘请具有证券相关业务资格的会计师事务所对本集合计划的运营情况进行年度审计，管理人应当在每年度结束之日起4个月内将审计结果报中国证券投资基金业协会备案，同时抄送证券公司住所地、资产管理分公司所在地中国证监会派出机构，并将审计报告提供给托管人，通过管理人网站向委托人提供。

4、对账单

管理人应当每个季度以电子邮件方式向委托人寄送对账单。对账单内容应包括委托人持有集合计划份额的数量及净值，认购、退出明细，以及收益分配等情况。如委托人提供的通讯地址或联系方式不正确等原因导致对账单未能成功送达时，委托人应当联系推广机构，更新通讯地址或联系方式，管理人不对此承担任何责任。委托人亦可以直接登录本集合计划管理人网站（www.dgzq.com.cn）进行查阅。

（四）临时报告

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

（1）集合计划运作过程中，负责集合资产管理业务的高级管理人员或投资主办人员发生变更，或出现其他可能对集合计划的持续运作产生重大影响的事项；

（2）暂停受理或者重新开始受理认购或者退出申请；

（3）集合计划终止和清算；

（4）管理费、托管费等费用计提方式或费率发生变更；

（5）合同的补充、修改与变更；

（6）与集合计划有关的重大诉讼、仲裁事项；

（7）负责本集合计划的代理推广机构发生变更；

（8）集合计划投资于管理人、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；

（9）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；

（10）管理人、托管人因解散、破产、撤销等原因不能履行相应职责；

（11）管理人、托管人托管业务部门与本合同项下资产管理计划财产相关的行为受到监管部门的调查；

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

（13）其他根据法律法规和中国证监会的有关规定应当披露的重大事项。

（五）管理人的董事、监事、从业人员及其配偶、控股股东、实际控制人或

者其他关联方参与资产管理计划，应向投资者充分披露。

(六) 管理人、托管人应按照监管要求的内容和方式及时向监管机构提供相应的报告。

二十三、风险揭示

本集合计划可能面临包括但不限于以下风险：

(一) 一般风险

1、本金损失风险

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

本集合计划属于中低风险收益品种，适销对象是具有中低风险、中等风险、中高风险和高风险承受能力的谨慎型、稳健型、积极型和激进型合格投资者。

2、市场风险

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

3、管理风险

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

4、流动性风险

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

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。

募集失败时管理人的责任承担方式：

(1) 以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用；

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

7、投资标的的风险

本计划投资标的的价值取决于投资对象的经营状况，原股东对所投资企业的管理和运营，相关市场宏观调控政策、财政税收政策、产业政策、法律法规、经济周期的变化以及区域市场竞争格局的变化等都可能影响所投资企业经营状况，进而影响资产管理计划投资标的的价值。

8、关联交易风险

关联交易主要是指关联方之间的转移资源劳务或者是义务的行为，可能会产生以下风险：

(1) 经营风险。企业在关联交易的控制过程当中，由于关联双方鉴定不准确、关联交易定价不合理、关联交易活动中断，或未经审核变更关联交易合同中涉及权利义务的条款等原因导致的各种风险。

(2) 财务风险。因为关联交易会计核算不规范给企业造成的风险。财务风险也包括了提前入账，或者没有及时入账导致的关联交易数据失真，或者因为关联方识别错误，导致少计或多计引发统计偏差，账务核算失真对外披露不准确等风险。

9、操作或技术风险

(1) 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。

(2) 技术风险：在集合资产管理计划的日常交易中，可能因为技术系统的故障或者差错而影响交易的正常进行或者导致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、证券交易所、证券登记结算机构等。

10、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。

（二）特殊风险揭示

1、资产管理计划未在证券投资基金业协会完成备案手续或不予备案情形所涉风险；

管理人发起设立集合资产管理计划后 5 个工作日内，应当将资产管理合同、投资者名单与认购金额、验资报告或者资产缴付证明等材料报中国证券投资基金业协会备案，并抄报中国证监会相关派出机构，监管部门将根据监管规定对集合计划发起设立情况进行审查，集合计划可能无法通过备案。若集合计划备案不成功，管理人将进行合同变更、终止集合计划或根据监管要求进行处理，由此给本集计划带来不确定性的风险。

2、资产管理计划委托募集所涉风险

委托人可通过代销机构认可的平台参与或退出本集合计划，受不可抗力、交易所或者交易市场数据传输延迟、通讯系统故障、交易平台系统故障、银行数据交换系统故障等其他因素的影响，委托人可能面临参与款或退出款项无法及时划付的风险或由此导致的其他损失。

3、债券投资风险

本集合计划主要投资于债券类交易品种，因此将面临债券市场的特殊风险。主要包括：

（1）债券投资的交易品种的信用风险

投资于债券类交易产品，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，资产管理计划所投资的债券可能面临价格下跌风险，进而影响资产管理计划的净值；

（2）债券投资的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，将从而对资产管理业务计划的资产净值造成不利影响的的风险；

（3）债券投资的流动性风险

债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，流动性好；而在另一些时期，可能成交稀少，流动性差。在市场流动

性相对不足时，投资品种交易变现有可能增加变现成本，对资产管理计划造成不利影响的分析：

（4）债券投资的市场风险

当债券市场收益率曲线出现向上移动的情形，资产管理计划所投资的债券可能出现价格下跌，进而影响资产管理计划的净值；

（4）债券投资的估值风险

本资产管理计划的净值是根据估值方法进行确定，由于债券市场流动性相对较弱，资产管理计划所投资的债券的估值价格与实际卖出的价格可能存在一定的差异，进而影响资产管理计划的净值；

（5）债券投资的正回购风险

本计划投资范围包括债券正回购，且根据合同约定，参与证券回购融入资金余额可能达到该计划资产净值的 2 倍（不得超过 2 倍）。从事债券正回购存在着包括但不限于以下风险：

①债券投资的价格风险：是指由于债券交易价格不设涨跌幅幅度限制，可能发生债券交易价格剧烈波动，存在亏损的可能，由于债券正回购增大了资管计划的杠杆，可能由此造成损失的放大；

②债券投资的套利风险：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债券投资的交收风险：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债券投资的质押风险：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债券投资的结算风险：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。

（三）其他风险

（1）提前终止的风险

存续期内，集合计划委托人少于 2 人或者其他本集合计划约定的提前终止情形出现时，导致本集合计划提前终止。

（2）电子签名风险

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

委托人签署电子签名合同进行交易的，应积极采取安全措施，加强账户、密码的保护。

委托人、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。

（3）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）管理人将按照本合同的约定进行信息披露，委托人/投资者应充分关注并及时主动查询管理人披露的本产品相关信息。委托人/投资者预留的有效联系方式发生变更的，亦应及时通知管理人。如委托人/投资者未及时查询相关信息，或预留联系方式变更未及时通知管理人导致管理人在其认为需要时无法及时联系到委托人/投资者的，因此而产生的责任和风险由委托人/投资者自行承担。

（5）管理人履行投资者适当性职责不能取代委托人的投资判断，不会降低金融产品或金融服务的固有风险，也不会影响委托人依法承担相应的投资风险、履约责任以及费用。管理人的适当性匹配意见不表明其对产品或者服务的风险和收益做出实质性判断或者保证，委托人应当在了解产品或者服务情况，听取管理人适当性意见的基础上，根据自身实际情况作出判断，审慎决策，独立承担投资风险。

（6）按照沪深交易所和中国结算的有关规定，交易参与者、结算参与者应该设置资金前端控制的额度并由交易所对额度进行控制，这有可能导致资金前端交易不成功的风险。

（四）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诉和声明。

二十四、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要求发行变化必须变更资产管理合同的，管理人可以与托管人协商后修改资产管理合同，并由管理人按照合同约定及时向投资者披露变更的具体内容。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3个工作日后生效。

2、由于其他原因需要变更合同的（除本合同另有约定外），管理人和托管人应书面达成一致并在管理人网站公告。管理人须在公告后5个工作日内通过管理人网站或其他适当方式向委托人发送合同变更征询意见。委托人应在征询意见发出后的5个工作日内给出书面或其他约定方式的答复。委托人未在前述时间回复意见的，视为委托人同意合同变更。

3、委托人对合同变更事项有异议的，管理人对其采取如下权利保障措施及后续安排：委托人可在管理人指定的临时开放期提出退出本集合计划的申请。

委托人同意，无论其是否同意合同变更或提出退出申请，管理人变更本合同的行为均不应被视为或裁定为管理人的违约行为。

4、合同变更生效日以管理人公告为准，管理人应当及时通知托管人合同变更生效日。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、资产管理合同发生变更的，管理人应按照证券投资基金业协会要求及时向证券投资基金业协会备案，并抄报中国证监会相关派出机构。

(二) 因发生以下事项需变更合同的，管理人应在管理人网站公告，委托人不同意变更的，应当在管理人指定的临时开放日提出退出本集合计划的申请，合同当事人的变更不应影响其他合同当事人的权利及义务：

(1) 管理人被依法撤销资产管理业务资格或者依法解散、被撤销、宣告破产，资产管理计划由其他管理人承接；

(2) 托管人被依法撤销资产管理业务资格或者依法解散、被撤销、宣告破产，资产管理计划由其他托管人承接。

(三) 资产管理合同的展期

本集合计划存续期满，若符合展期的条件，则可以展期：

1、展期的条件

(1) 在存续期间，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、本合同、《说明书》的约定；

(2) 展期没有损害委托人利益的情形；

(3) 托管人同意继续托管展期后的集合计划资产；

(4) 展期后符合集合资产管理计划的成立条件；

(5) 中国证监会规定的其他条件。

2、展期的程序

(1) 展期的公告

集合计划符合展期条件拟展期时，管理人在集合计划存续期届满前 30 个工作日内在管理人指定网站上公告，管理人将同时公告集合计划的具体展期方案。

(2) 委托人答复

管理人应在上述公告后 5 个工作日内通过管理人指定网站或以书面或电子邮件等方式将展期相关事宜通知委托人，征求委托人意见，委托人应根据管理人指定网站公告要求在规定的期限内明确意见；未在规定时间内作出答复的，视为不同意本集合计划展期。

(3) 不同意展期的委托人所持有份额的处理办法

展期经管理人指定网站公告后，不同意展期的委托人，可以在征询意见发出后在管理人公告指定的临时开放期办理退出申请；委托人未办理退出申请的，管理人为保障委托人到期合法终止合同的权利，管理人将在本集合计划原存续期届满之日将该部分委托人份额全部退出，并分配收益。具体办理要求和相关事项以管理人公告为准。

(4) 展期的成立

存续期满，集合计划符合展期条件，并且本集合计划展期的委托人不少于 2 人，本集合计划在原存续期届满日的次日实现展期，否则本集合计划不能展期。

(5) 展期的失败

若集合计划展期失败，本集合计划将进入清算终止程序。

3、展期情况备案

本集合计划展期后 5 个工作日内，管理人将展期情况公告并报相关监管部门备案。

(四) 集合计划的终止

集合计划终止的情形包括下列事项：

- (1) 资产管理计划存续期届满且不展期；
- (2) 经全体投资者、管理人和托管人协商一致决定终止的；
- (3) 管理人被依法撤销资产管理业务资格或者依法解散、被撤销、宣告破产，且在六个月内没有新的管理人承接；
- (4) 托管人被依法撤销基金托管资格或者依法解散、被撤销、宣告破产，且在六个月内没有新的托管人承接；
- (5) 持续五个工作日投资者少于 2 人的；
- (6) 未在证券投资基金业协会完成备案或不予备案的情形；
- (7) 不可抗力的发生导致本集合计划不能存续；
- (8) 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。

管理人应当自资产管理计划终止之日起五个工作日内报证券投资基金业协会备案，并抄报中国证监会相关派出机构，前述第（6）项约定的情形除外。

(五) 集合计划的清算

1、集合计划的清算小组

- (1) 自集合计划终止之日起五个工作日内成立清算小组；
- (2) 集合计划清算小组成员由集合计划管理人、集合计划托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师组成。清算小组可以聘请必要的工作人员；
- (3) 集合计划清算小组负责本集合计划资产的保管、清理、估价、变现和分配。集合计划清算小组可以依法以集合计划的名义进行必要的民事活动。

2、集合计划清算程序

(1) 集合资产管理计划终止日后 5 个工作日内启动清算程序，并由集合计划清算小组将终止事项向委托人披露；

(2) 集合计划清算小组统一接管集合计划资产；

(3) 集合计划清算小组对集合计划资产进行清理和确认；

(4) 集合计划清算小组对集合计划资产进行估价；

(5) 集合计划清算小组对集合计划资产进行变现；

(6) 集合计划清算小组对集合计划剩余资产的分配；

(7) 集合计划清算小组出具集合计划清算报告；

(8) 集合计划清算小组披露集合计划清算报告；

(9) 集合计划清算小组注销集合计划相关账户。

3、清算费用

清算费用是指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，清算费用由清算小组从集合计划资产中支付。

4、集合计划剩余资产的分配

集合计划清算小组应当在扣除清算费用、管理费、托管费及管理人业绩报酬等费用后，将集合计划资产按照委托人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委托人。

5、延期清算处理方式

若本集合计划在终止之日有未能流通变现的资产，管理人可针对该部分未能流通变现资产制定二次清算方案，该方案应经托管人认可，并通过管理人网站进行披露。管理人应当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。

若本集合计划在终止之日有未能流通变现的资产，集合计划清算小组应根据二次清算方案的规定，对该部分未能流通变现的资产在可流通变现后进行二次清算，将变现后的资产扣除相关费用后按照委托人拥有份额的比例、管理合同的约定或管理人的公告，以货币形式全部分配给委托人。在进行二次清算的变现过程中，变现的资金以现金保存，不得再进行投资。

对于由计划交纳、中登公司收取的最低结算备付金和交易单元保证金，在中登公司对其进行调整交收日才能收回，届时，集合计划清算小组将及时按照委托

人拥有份额的比例或者管理合同的约定，以货币资金的形式全部分配给委托人。

6、集合计划清算的报告

集合计划清算程序终止后五个工作日内由集合计划清算小组出具清算报告并在集合计划管理人公司网站上披露，并且清算过程中的有关重大事项也将及时披露。管理人应在清算结束后五个工作日内，将清算结果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。

7、集合计划财产清算完毕后，管理人应当注销集合计划专用证券账户，托管人应当注销集合计划资金托管账户等投资所需账户，管理人应当给予必要的配合。

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

二十五、违约责任

(一) 管理人、托管人在履行各自职责的过程中，违反法律、行政法规的规定或者本合同约定，给计划财产或者委托人造成损害的，应当分别对各自的行为依法承担赔偿责任；因共同行为给计划财产或者委托人造成损害的，根据实际情况，由双方分别承担各自应负的违约责任。管理人或托管人任何一方不因另一方的失职行为而给集合计划财产或委托人造成的损失向委托人承担连带责任。但是发生下列情况的，当事人可以免责：

1、不可抗力

不可抗力是指本合同当事人无法预见、无法克服、无法避免，且在本合同生效之后发生的，使本合同当事人无法全部或部分履行本合同的任何事件，包括但不限于洪水、地震及其他自然灾害、战争、骚乱、火灾、政府征用、没收、法律变化、系统故障、突发停电或其他突发事件、注册与过户登记人非正常的暂停或终止业务、证券交易所非正常暂停或停止交易等。

一方因不可抗力不能履行本合同时，应及时通知另一方，并在合理期限内提供受到不可抗力影响的证明，同时采取适当措施防止集合计划财产损失扩大。任何一方当事人迟延履行合同义务后，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、管理人由于按照合同规定的投资原则行使或不行使其投资权而造成的损失等。

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

5、托管人对存放或存管在托管人以外的机构的集合计划资产或交由证券公司、期货公司等其他机构负责清算交收的集合计划资产（包括但不限于期货保证金、期货合约等）及其收益，因该等机构故意、欺诈、疏忽、过失、破产等原因给集合计划资产造成的损失，由相关责任方承担，托管人不承担责任。

6、本合同当事人应保证向本合同另一方提供的数据、信息真实完整，并承担相应的法律责任。如果该方提供的信息和数据不真实或不完整是由于另一方提供的数据或信息不真实、不完整等原因所致，由此造成的损失由初始过错方承担。

7、管理人及托管人对基于第三方（包括但不限于交易所、注册与过户登记人等）合法获得的信息及合理信赖上述信息而操作给集合计划资产造成的损失等。

（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。违约方因防止损失扩大而支出的合理费用由违约方承担。

（四）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委托人损失，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或减少由此造成的影响。

（五）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。

(六) 管理人被依法撤销资产管理业务资格或者依法解散、被撤销、宣告破产，资产管理计划由其他管理人承接；托管人被依法撤销基金托管资格或者依法解散、被撤销、宣告破产，资产管理计划由其他托管人承接，均应当按照有关监管要求妥善处理有关事宜。

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

二十六、争议的处理

因履行本合同发生的争议，由合同签订各方协商解决；两个工作日内协商不成的，各方一致同意提请广东证券期货业协会进行调解；协商或调解不成的，任何一方均有权将争议提交深圳国际仲裁院并按其仲裁规则进行仲裁，仲裁地点在深圳，仲裁裁决对各方具有终局约束力。

二十七、资产管理合同的效力

(一) 资产管理合同签署的方式

本集合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。投资者为法人的，本集合合同自投资者、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之日起成立；投资者为自然人的，本集合合同自投资者本人签字、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之日起成立。

(二) 合同的生效条件

本合同成立后，同时满足以下条件时生效：

- 1、委托人认购资金实际交付并确认；
- 2、本集合计划依法有效成立。

(三) 本集合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。

(四) 合同的有效期限

本集合计划合同有效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展期、提前终止。

(五) 投资者自签订本集合合同即成为本集合合同的当事人。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, 该投资者不再是本集合合同的当事人。

(六) 合同的组成

《东莞证券旗峰月月盈 1 号集合资产管理计划说明书》、经管理人确认有效的委托人参与、退出本集合计划的申请材料和各推广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, 与本合同具有同等法律效力。

二十八、其他

(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。

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协议, 但在转让前管理人应以信息披露的形式通告委托人。管理人保障委托人退出本集合计划的权利, 并在届时的通告中对相关事项作出合理安排, 因公告变更相关事宜造成与管理人有关纠纷的责任由管理人承担, 与托管人无涉。

管理人应当保证该从事资产管理业务的公司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) 管理人、托管人确认, 已向委托人明确说明集合计划的风险, 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。

(三) 本合同应由委托人本人签署, 当委托人为机构时, 应由法定代表人或其授权代表签署。

本合同一式肆份, 管理人、托管人各执壹份, 其余按照有关监管部门的要求备案, 每份均具有同等法律效力。委托人通过中登公司签署电子合同, 电子合

同与纸质合同具有同等法律效力。



(本页无正文, 为《东莞证券旗峰月月盈1号集合资产管理计划资产管理合同》合同签署页)

委托人签字/盖章:

法定代表人或授权代理人(签字/盖章):

签订日期: 年 月 日

管理人: 东莞证券股份有限公司(公章)

法定代表人或授权代理人(签字/盖章):

签订日期: 2010年05月11日



托管人: 宁波银行股份有限公司(公章)

负责人(签字/盖章):

签订日期: 2010年5月11日

