

合同编号：zg202302001

**长江期货-长享顺添利 4 号债券  
集合资产管理计划  
资产管理合同**

资产管理人：长江期货股份有限公司

资产托管人：兴业银行股份有限公司武汉分行



## 长江期货-长享顺添利 4 号债券集合资产管理计划风险揭示书

尊敬的投资者：

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

根据有关法律法规，管理人长江期货股份有限公司及投资者分别作出如下承诺、风险揭示及声明：

### 一、管理人声明与承诺

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

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

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

（四）管理人应当承担的责任不因聘请第三方服务机构而免除，因聘请第三方服务机构而引发的相关纠纷，由管理人负责沟通处理。

### 二、风险揭示

#### （一）特殊风险揭示

[本公司郑重提醒投资者，本计划为固定收益类产品，主要投资于债权类、期货和衍生品类、现金类资产，其中，投资于债权类资产、现金类资产的比例不低于资产管理计划总资产 80%，应特别关注固定收益类产品的投资风险，包括但不限于：1) 利率风险，本计划所投资债券的价格因受经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素影响而引起的波动，导致利率水平变化，所持有的债券价格有可能下跌，从而产生投资亏损；2) 汇率风险，本计划所投资债券面临的汇率变化风险。汇率直接影响着固定收益类品种的价格和收益率，影响着企业的融资成本和利润，本计划所投资的债券，其收益水平会受到汇率变化的影响；3) 信用风险，本计划所投资的债券评级均在 AA 级以上，但仍有可能出现所投资债券发行人出现违约、拒绝支付到期本息，或由于债券发行人信用质量降低导致债券价

格下降，造成集合计划资产损失的风险；4) 可转债投资风险，包括可转债标的股票价格波动的风险、利息损失风险和可转债提前赎回的风险；5) 债券正回购交易风险，计划在进行正回购操作时，可能由于回购利率大于债券投资收益以及由于正回购操作导致投资总量放大，致使整个组合风险放大。此外，在进行正回购操作对组合收益进行放大的同时，也对组合的波动性进行了放大，致使组合的风险将会加大。正回购比例越高，风险暴露程度也就越高，对组合造成损失的可能性也就越大。6) 流动性风险，因市场交易量不足，导致债券不能迅速、低成本地转变为现金的风险。流动性风险还包括由于本集合计划在开放日出现投资者大额或巨额赎回，致使本集合计划没有足够的现金应付集合计划退出支付的要求所导致的风险。7) 估值风险，本计划在估值日无法及时获取估值日当日产品净值，而采取前一日产品净值进行估值，在计划开放日，可能出现因市场剧烈波动，部分投资者利用申购或赎回动作获取估值折价或溢价，而使集合计划净值产生额外波动的风险。本计划不设预警线、止损线，所造成的损失由资产委托人自行承担。]

本公司郑重提醒投资者本计划存在以下事项，可能会对本计划产生影响：

**1、资产管理计划委托募集所涉风险：**本计划通过直销机构（管理人）和管理人委托的代销机构进行销售。销售机构受理认购申请并不表示对参与申请成功的确认，而仅代表销售机构确实收到了参与申请，认购的确认以管理人的确认结果为准。可能存在未成功参与的风险。本计划的代销机构为长江证券股份有限公司，与本计划管理人存在关联方关系，请委托人知悉。

**2、资产管理计划外包事项所涉风险：**本计划的基金服务机构为长江证券股份有限公司，由于聘请外包机构可能因为技术系统的故障或者差错而影响估值核算或者导致委托人的利益受到影响，从而带来风险。

**3、资产管理计划份额转让所涉风险：**资产委托人可通过现时或将来法律、法规或监管机构允许的方式办理转让业务，资产管理计划份额转让后，如果份额持有人人数或者单个投资者持有的份额余额不再符合中国证监会或者资产管理计划的约定，从而产生风险。

**4、资产管理计划未设置份额持有人大会所涉风险：**本计划未设计划份额持有人大会日常机构，委托人面临不能通过份额持有人大会日常机构行使相关权利(包括但不限于表决权)的风险。

**5、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，导致资产管理计划无法投资运作，从而产生风险。**

6、本计划可能投资于管理人、托管人及其关联方或者与上述主体有其他重大利害关系

的主体直接或间接管理或代理销售的、或提供客户服务的、或者该等主体持有的符合本合同投资范围规定的投资产品。资产委托人签署本合同即表明其已经知晓并同意本计划将进行关联交易或重大关联交易。管理人将在关联交易完成后的五个工作日内按照本合同约定的方式向委托人和托管人进行披露。

#### 7、期货投资风险

本计划将投资于国内期货交易所上市的期货金融衍生品。无论管理人是否出于投机目的对金融衍生品进行投资，由于金融衍生品的高杠杆性等特征，对金融衍生品的投资无论在任何情况下均具有较高的风险。

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

#### 8、经纪服务商风险

证券及期货经纪服务商由管理人自行聘任，管理人委托其向托管人提供计划参与证券、期货交易的相关数据及凭证。若因管理人、经纪服务商或交易所、登记公司、股转系统等原因导致托管人未能及时、完整、准确获得交易数据或凭证，影响托管人履行投资监督、估值核算、账目核对等职责的，可能造成委托人财产损失。

#### (二) 一般风险揭示

##### 1、本金损失风险

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

本计划属于 R2（中低风险）风险投资品种，适合风险识别、评估、承受能力 C2（谨慎型）及以上的合格投资者。

##### 2、市场风险

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

### 3、管理风险

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

### 4、流动性风险

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

### 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（集合资产管理计划）

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：

（一）以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用；

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

7、投资标的的风险（适用于期货和衍生品、非标准化债权、未上市股权及收益权等，如有）

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、税收风险

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

### 9、其他风险

包括但不限于关联交易风险、技术风险和操作风险、发生不可抗力事件的风险等。技术风险，在计划的各种交易行为或者后台运作中，可能因为技术系统的故障或者差错而影响交易的正常进行或者导致资产委托人的利益受到影响。操作风险，相关当事人在业务各环节操作过程中，因内部控制存在缺陷或者人为因素造成操作失误或违反操作规程等引致的风险。

### 三、投资者声明

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

1、本人/机构已仔细阅读资产管理业务相关法律文件和其他文件，充分理解相关权利、义务、本计划运作方式及风险收益特征，愿意承担由上述风险引致的全部后果。【     】

2、本人/机构知晓，管理人、销售机构、托管人及相关机构不应当对资产管理计划财产的收益状况作出任何承诺或担保。【     】

3、本人/机构符合《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》有关合格投资者的要求，并已按照管理人或销售机构的要求提供相关证明文件。【     】

4、本人/机构已认真阅读并完全理解资产管理合同的所有内容，并愿意自行承担购买资产管理计划的法律责任。【     】

5、本人/机构已认真阅读并完全理解资产管理合同“当事人及权利义务”的所有内容，并愿意自行承担购买资产管理计划的法律责任。【     】

6、本人/机构已认真阅读并完全理解资产管理合同“资产管理计划的投资”的所有内容，并愿意自行承担购买资产管理计划的法律责任。【     】

7、本人/机构已认真阅读并完全理解资产管理合同“资产管理计划的费用与税收”中的所有内容。【     】

8、本人/机构已认真阅读并完全理解资产管理合同“法律适用和争议的处理”中的所有内容。【     】

9、本人/机构已经配合管理人或其销售机构提供了法律法规规定的信息资料及身份证明文件，以配合上述机构完成投资者适当性管理、非居民金融账户涉税信息尽职调查以及反洗钱等监管规定的工作。

本人/机构承诺上述信息资料及身份证明文件真实、准确、完整、有效。【     】

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

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

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

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

投资者（自然人签字或机构盖章）：

日期：



销售机构经办人（签字）：

日期：



## 资产合法性及投资者适当性承诺书

本人/本单位以真实身份委托长江期货股份有限公司(以下简称“长江期货”)运用委托资产进行投资。本人/本单位承诺委托资产来源及用途合法,不属于违反规定的公众集资,不存在使用贷款、发行债券等筹集的非自有资金投资本计划的情形,符合有关反洗钱法律法规的要求。长江期货有权要求本人/本单位提供资产来源及用途合法性证明,对资产来源及用途合法性进行调查,本人/本单位愿意配合。

本人/本单位符合期货公司资产管理业务合格投资者相关标准,合格投资者是指具备相应风险识别能力和风险承受能力,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:

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

(二) 最近 1 年末净资产不低于 1000 万元的法人单位;

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

(四) 接受国务院金融监督管理机构监管的机构发行的资产管理产品;

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

(六) 中国证监会视为合格投资者的其他情形。

本人/本单位符合中国证监会、中国期货业协会、期货交易所及长江期货关于投资者适当性管理的规定。长江期货根据法律法规、期货交易所业务规则、行业自律规则的各项要求对本人/本单位进行适当性评价。评价结果不构成对本人/本单位的投资建议,不构成对本人/本单位的获利保证。本人/本单位不得以不符合适当性标准为由拒绝承担计划投资费用或亏损。

本人/本单位未被法律、法规或监管机构限制参与期货资产管理业务。

本人/本单位将严格遵守以上承诺，否则长江期货有权解除资产管理合同，本人/本单位违反委托资产来源及用途合法性承诺的，长江期货还有权依法限制本人/本单位提取该委托资产。本人/本单位承担因此造成的全部损失和法律责任。

承诺人：（签字或盖章）

日期： 年 月 日

## 投资者告知书

### 尊敬的投资者：

本资产管理计划通过直销机构(管理人)和管理人委托的代销机构进行销售。投资者认购或参与本计划，以人民币货币资金形式交付，在直销机构认购或参与的投资者须将认购资金从在中国境内开立的自有银行账户划款至募集账户，在代销机构认购或参与的投资者按代销机构的规定缴付资金。

募集账户由管理人开立，该账户仅用于本计划募集期间和存续期间认购、参与和退出资金的归集与支付。募集账户是管理人为资产管理计划提供服务的专用账户，不表明管理人对本计划的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本计划没有风险。

募集账户信息如下：

账户名：长江期货股份有限公司资产管理计划销售结算专户

账号： 421860035018010042127

开户行：交通银行武汉天安支行

本人/机构已认真阅读《投资者告知书》，清楚认识并认可关于募集账户的上述告知内容，并愿意自行承担由此可能导致的一切风险和损失。

投资者：

(自然人签字或机构盖章)

法定代表人或授权代理人(机构签字或盖章)：

日期： 年 月 日

## 目录

长江期货-长享顺添利 4 号债券集合资产管理计划风险揭示书.....	1
一、前言.....	11
二、释义.....	12
三、声明与承诺.....	14
四、当事人及权利义务.....	16
五、资产管理计划基本情况.....	22
六、资产管理计划的募集.....	23
七、资产管理计划的成立与备案.....	25
八、资产管理计划的参与、退出与转让.....	26
九、份额持有人大会及日常机构.....	34
十、资产管理计划份额的登记.....	34
十一、资产管理计划的投资.....	35
十二、投资顾问.....	39
十三、分级安排.....	39
十四、利益冲突及关联交易.....	39
十五、投资经理的指定与变更.....	40
十六、资产管理计划的财产.....	41
十七、指令的发送、确认与执行.....	43
十八、越权交易.....	47
十九、资产管理计划财产的估值和会计核算.....	51
二十、资产管理计划的费用与税收.....	57
二十一、资产管理计划的收益分配.....	62
二十二、信息披露与报告.....	63
二十三、风险揭示.....	65
二十四、资产管理合同的变更、终止与财产清算.....	66
二十五、违约责任.....	71
二十六、法律适用和争议的处理.....	73
二十七、资产管理合同的效力.....	73
二十八、其他事项.....	74

## 一、前言

订立本合同的目的、依据和原则：

1、订立本合同的目的是明确本合同当事人的权利义务、规范本计划的运作、保护资产委托人的合法权益。

2、订立本合同的依据是《中华人民共和国民法典》、《中华人民共和国期货和衍生品法》、《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《基金法》）、《期货公司监督管理办法》、《证券期货经营机构私募资产管理业务运作管理暂行规定》、《基金募集机构投资者适当性管理实施指引（试行）》、《私募投资基金监督管理暂行办法》、《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》（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）》及其他法律法规的有关规定。

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

本合同是约定本合同当事人之间基本权利义务的法律文件，其他与本计划相关的涉及本合同当事人之间权利义务关系的任何文件或表述，均以本合同为准。本合同的当事人包括资产管理计划管理人、资产管理计划托管人和资产委托人。资产管理合同的当事人按照本合同及其他有关法律法规规定享有权利、承担义务。

本计划按照中国法律法规成立并运作，若本合同的内容与届时有效的法律法规的强制性规定不一致，应当以届时有效的法律法规的规定为准。

4、管理人应当对本计划的设立、变更、展期、终止、清算等行为报告证券投资基金业协会。

5、证券投资基金业协会接受资产管理计划报告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

在本合同中，除上下文另有规定外，下列用语应当具有如下含义：

1、本合同/资产管理合同：《长江期货-长享顺添利 4 号债券集合资产管理计划资产管理合同》及对本合同的任何有效修订和补充。

2、本计划、计划：长江期货-长享顺添利 4 号债券集合资产管理计划。

3、资产管理人、管理人：长江期货股份有限公司。

4、资产托管人、托管人：兴业银行股份有限公司武汉分行。

5、投资顾问：本计划未聘请投资顾问。

6、资产委托人、委托人：签署本合同，依法可以投资于期货公司资产管理计划的个人投资者、机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买期货公司资产管理计划的其他投资者的合称。委托人需是符合《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》及《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》的合格投资者。

7、基金服务机构、份额登记机构：接受管理人委托，根据与其签订的金融运营服务协议中约定的服务范围，为本计划提供份额注册登记业务、估值等服务的机构，本计划的基金服务机构为长江证券股份有限公司。**基金服务机构如果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计划服务业务的公司，经资产管理人同意，可由该新设立的资产管理计划服务业务公司作为本计划新的服务机构，本合同各方无须就服务机构主体变更事项重新签署资产管理计划合同，资产管理人将按照本合同约定的通知方式向资产委托人披露变更的具体内容。**

8、代销机构：指符合资产管理人关于资产管理计划销售机构的遴选机制，取得公开募集证券投资基金销售业务资格，代为办理资产管理计划的认购、参与和退出等业务的代理机构。

9、中国证券投资基金业协会（简称“基金业协会”或“证券投资基金业协会”）：基金行业相关机构自愿结成的全国性、行业性、非营利性社会组织。

10、工作日：上海期货交易所、大连商品交易所、郑州商品交易所、中国金融期货交易所、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。

11、开放日：管理人办理资产管理计划参与和/或退出业务的工作日。

12、T 日：本计划的开放日，包括特别开放期。

13、T+n 日：T 日后的第 n 个工作日，当 n 为负数时表示 T 日前的第 n 个工作日。

14、计划财产、计划资产、委托资产：资产委托人拥有合法处分权、资产管理人管理并由资产托管人托管的作为本合同标的的财产。

15、托管资金专门账户（简称“托管账户”）：资产托管人为计划财产在具有基金托管资格的商业银行开立的银行结算账户，用于计划财产中现金资产的归集、存放与支付，该账户不得存放其他性质资金。

16、证券账户：根据中国证监会有关规定和中国证券登记结算有限责任公司（下称“中登公司”）等相关机构的有关业务规则，由资产托管人（或资产管理人）为计划财产在中登公司上海分公司、深圳分公司开设的证券账户。

17、证券交易资金账户：资产管理人为计划财产在证券经纪机构下属的证券营业部开立的证券交易资金账户，用于计划财产证券交易结算资金的存管、记载交易结算资金的变动明细以及场内证券交易清算。证券交易资金账户按照“第三方存管”模式与托管账户建立一一对应关系，由资产托管人通过银证转账的方式完成资金划付。

18、期货账户：资产管理人为计划财产在期货公司开立的期货保证金账户，用于计划财产期货交易结算资金的存管、记载交易结算资金的变动明细以及期货交易清算。期货保证金账户应与托管账户建立一一对应关系，由资产托管人通过银期转账或手工出入金的方式办理期货交易的出入金。

19、募集账户：是由资产管理人开立，该账户用于本计划募集期间认购、存续期间参与和退出资金的归集与支付。募集账户是管理人为资产管理计划提供服务的专用账户，不表明管理人对本计划的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本计划没有风险。

20、资产管理结算账户：资产委托人用于办理委托资产汇入、追加、提取和清退的银行账户，也即委托人认购、参与本计划的划出账户与退出本计划的划入账户。

21、投资指令：指管理人在运用资产管理计划财产时向托管人发送资金划拨及其他款项收付的指令。

22、计划资产总值：本计划拥有的各类有价证券、银行存款本息及其他资产的价值总和。

23、计划资产净值：本计划资产总值减去负债后的价值。

24、计划份额净值：计算日计划资产净值除以计算日计划份额总数所得的数值。

25、计划份额累计净值：指计划份额净值和计划历史上累计份额分红金额之和。

26、计划资产估值：计算、评估计划资产和负债的价值，以确定本计划资产净值和份额净值的过程。

27、募集期：指本计划的初始销售期限。

28、存续期：指本计划成立至终止之间的期限。

29、认购：指在募集期间，资产委托人按照本合同的约定购买本计划份额的行为。

30、参与：指在计划开放日，资产委托人按照本合同的约定购买本计划份额的行为。

31、退出：指在计划开放日，资产委托人按照本合同的约定将本计划份额兑换为现金的行为。

32、不可抗力：指本合同当事人不能预见、不能避免、不能克服的客观情况。

33、期货主力、次主力合约：某一期货品种前一交易日成交量最大及第二大的合约。

34、期货盘中市价：期货盘中市价是指某交易日某一期货合约交易期间的即时成交价格。

35、期货收盘价：收盘价是指某一期货合约当日交易的最后一笔成交价格，无成交合约当日收盘价为当日结算价。

36、期货结算价：商品期货结算价是指某一期货合约当日交易期间成交价格按成交量的加权平均价。无成交合约当日结算价按照各交易所相关规定确定，结算价是进行当日未平仓合约盈亏结算和确定下一交易日涨跌停板幅度的依据；金融期货结算价是指某一合约当日一定时间内成交价格按照成交量的加权平均价。

37、信义义务：托管人信义义务是指托管人按恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则，根据相关法律法规和监管规定，在本资产管理合同约定范围内尽职尽责履行安全保管托管资产等托管人职责。

### 三、声明与承诺

#### （一）委托人的声明与承诺

1、委托人具有合法的参与期货公司资产管理业务的资格，不存在法律、行政法规和中国证监会有关规定禁止或限制参与资产管理业务的情形。

2、委托人承诺以真实身份参与期货公司资产管理业务，且符合《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。

3、委托人保证委托资产的来源和用途合法，符合有关反洗钱法律法规及相关国家有关规定的要求，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，且委托资产中没有违反规定的公众集资，投资事项符合法律法规的规定及业务决策程序的要求。

4、委托人保证本委托事项已经取得法律法规所要求的其内部授权和批准，符合其业务



决策程序的要求。

5、委托人声明对市场及产品风险具有适当的认识，已了解资产管理方案和投资策略的风险收益特征，委托人接受期货公司的审慎评估并经自我评估认为具备参与资产管理业务的风险承受能力。

6、委托人声明已听取了期货公司对相关业务规则、合同条款、资产管理方案和交易策略的讲解，已经阅读并理解风险揭示书及本合同的相关内容，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，清楚认识委托投资存在的市场风险、管理风险、流动性风险和其他风险，并承诺投资于本计划将自行承担投资风险。

7、委托人承认，管理人未对委托资产的收益状况作出任何承诺或担保，本合同约定的业绩报酬计提基准仅作为管理人提取业绩报酬的基准，而不是管理人的收益保证。

8、委托人承诺由本人/本单位法定代表人或其授权代表人签署本合同。

## （二）管理人的声明与承诺

1、管理人是依法设立的期货经营机构，并经中国期货业协会备案通过，具有资产管理业务资格。

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

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

4、管理人声明已指定专人向委托人披露业务资格，讲解有关法律法规、合同内容和相关投资工具的运作市场及方式，提示委托人阅读风险揭示书，并充分揭示了相关风险，并已了解委托人的风险偏好、风险认知能力和承受能力，对委托人的财务状况进行了充分评估。

5、管理人保证所提供的资料和信息真实、准确、完整、合法。

6、管理人声明不以任何方式向委托人承诺或担保取得最低收益或分担损失。

7、管理人声明禁止本公司员工以个人名义接受委托人资产管理委托，或对委托人做出最低收益和分担损失的承诺。

## （三）托管人的声明与承诺

1、托管人具有中国证监会认可的从事资产托管业务的资格。

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

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

4、托管人承诺在管理人发生异常且无法履行管理职能时，依照法律法规及本合同约定履行托管职责，维护委托人权益。

5、托管人保证所提供的资料和信息真实、准确、完整、合法。

6、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）内容进行投资监督。

#### 四、当事人及权利义务

##### （一）资产委托人

##### 1、资产委托人概况

签署本合同且合同正式生效的投资者即为本合同的资产委托人。资产委托人的详细情况在合同签署页列示。

##### 2、资产委托人的权利

- （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）监督资产管理人及资产托管人履行投资管理和托管义务的情况；
- （5）按照法律法规及本合同约定的时间和方式获得资产管理计划的信息披露资料；
- （6）根据本合同的规定，参加或申请召集资产管理计划份额持有人大会，行使相关职权，集合计划未设置份额持有人大会的除外；
- （7）资产管理计划设定为均等份额，除资产管理合同另有约定外，资产委托人持有的每份计划份额具有同等的合法权益；

（8）国家有关法律法规、监管机构及本合同规定的其他权利。

##### 3、资产委托人的义务

- （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资产管理计划的，应向管理人充分披露实际委托人和最终资金来源；

(4) 认真阅读并签署风险揭示书；

(5) 了解本计划的风险收益特征，了解自身风险承受能力和风险识别能力，自主判断本计划的投资价值，自主做出投资决策，按照本合同约定承担本计划的投资损失；

(6) 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；

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

(8) 向管理人或资产管理计划销售机构提供法律法规规定的信息资料及身份证明文件，配合管理人或其销售机构完成投资者适当性管理、非居民金融账户涉税信息尽职调查、反洗钱等监管规定的工作；

(9) 不得违反资产管理合同的约定干涉管理人的投资行为；

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

(11) 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；

(12) 参与、退出、分配等资产管理计划交易过程中因任何原因获得不当得利的，应予返还；

(13) 保证其享有签署包括本合同在内的资产管理计划相关文件的权利，并就签署行为已履行必要的批准或授权手续，且履行上述文件不会违反任何对其有约束力的法律法规、公司章程、合同协议的约定；

(14) 协助管理人办理资产管理计划相关账户的开立、使用、转换、变更和注销等手续，并不得将相关账户以出租、出借、转让或者其他方式提供给他人使用；

(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。

(二) 资产管理人

1、资产管理人概况

名称：长江期货股份有限公司

住所：武汉市武昌区中北路 9 号长城汇 T2 号写字楼第 27、28 层

法定代表人：潘山

通讯地址：武汉市武昌区中北路 9 号长城汇 T2 号写字楼第 27、28 层

联系人：李子勇

联系电话：027-65261509

传真：027-85860103

网址：<http://www.cjfc.com.cn>

## 2、资产管理人的权利

(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，并报告中国证监会相关派出机构及证券投资基金业协会；

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

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

(7) 当委托人委托资产发生权属变更等可能影响管理人正常管理委托资产的重大变更时，管理人有权提前终止资产管理委托；

(8) 自行销售或者委托有销售资格的机构销售资产管理计划，制定和调整有关资产管理计划销售的业务规则，并对销售机构的销售行为进行必要的监督；

(9) 要求委托人提供与其身份、财产与收入状况、资金来源及用途、资产管理需求、风险认知与承受能力等相关的信息和资料，并对委托人适当性进行审慎评估；在上述文件和资料发生变更时，及时提交变更后的相关文件与资料；

(10) 资产管理人有权根据市场情况对本计划的总规模、单个计划委托人首次认购、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；

(11) 有权要求托管人提供其关联方名单，用于本计划关联交易内部审批、评估及对委托人的信息披露；

(12) 国家有关法律法规、监管机构及本合同规定的其他权利。

### 3、资产管理人的义务

- (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) 对委托人的风险识别能力和风险承受能力进行评估，向符合法律法规及监管规定的合格投资者非公开募集资金；
- (5) 制作风险揭示书，向委托人充分揭示相关风险；
- (6) 配备足够的具有专业能力的人员进行投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作资产管理计划财产；
- (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委托人和托管人的监督；
- (13) 以管理人的名义，代表委托人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
- (14) 按照资产管理合同约定计算并向委托人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) 按照资产管理合同的约定确定收益分配方案，及时向委托人分配收益；
- (20) 根据法律法规与资产管理合同的规定，编制向委托人披露的资产管理计划季度、

年度等定期报告；

(21) 办理与受托资产管理业务活动有关的信息披露事项；

(22) 建立并保存委托人名单；

(23) 组织并参加资产管理计划财产清算小组，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委托人；

(26) 按规定为本资产管理计划开立和注销资产管理业务相关账户；

(27) 办理或者委托其他资产管理计划份额登记机构代为办理资产管理计划份额的注册登记事宜；

(28) 根据相关法规及资产管理合同的约定，向资产托管人提供资产管理计划交易数据、投资文件及资产管理计划其他相关数据与文件，并确保提供材料的合法、真实、完整和有效；

(29) 发生变更投资经理等可能影响委托人利益的重大事项时，应在合理时间内告知委托人；

(30) 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；

(31) 在兑付受托资金及收益时，管理人应当保证受托资金及收益返回委托人的原账户、同名账户或者本合同约定的账户；

(32) 管理人不得对资产托管人所承担的责任进行虚假宣传，不得以资产托管人名义或利用资产托管人商誉进行非法募集资金、承诺投资收益等违规活动。

(33) 管理人应根据法律法规及监管规定履行反洗钱义务，并根据人民银行有关规定向托管人发送本计划“受益所有人”信息，配合托管人履行反洗钱义务。

(34) 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。

(三) 资产托管人

1、资产托管人概况

名称：兴业银行股份有限公司武汉分行

住址：湖北省武汉市武昌区中北路108号

法定代表人：刘秉文

联系人：周全

通讯地址：湖北省武汉市武昌区中北路108号

联系电话：027-87821830

传真：027-86798933

网址：<http://www.cib.com.cn>

## 2、资产托管人的权利

- (1) 按照资产管理合同约定，依法保管资产管理计划财产；
- (2) 按照资产管理合同约定，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。

## 3、资产托管人的义务

- (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) 编制托管年度报告，报送中国证监会相关派出机构；
- (10) 按照法律法规要求和资产管理合同约定，根据管理人的投资指令，及时办理清算、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；

(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、资产管理计划基本情况

(一) 资产管理计划的名称：长江期货-长享顺添利 4 号债券集合资产管理计划。

(二) 资产管理计划的类别：固定收益类集合资产管理计划。

(三) 资产管理计划的运作方式：开放式。

(四) 资产管理计划的投资目标：本资产管理计划将在严格控制风险的前提下，力争使本资产管理计划保值增值。

(五) 资产管理计划的存续期限：本资产管理计划自成立之日起计算的 6 年为固定存续期限，6 年后的对应月对应日的前一天即为到期日，如到期日为非工作日的，非工作日后的第 1 个工作日视为到期日。本资产管理计划在存续期届满前 1 个月内经当事人协商一致可以展期，展期应当符合本合同约定的条件。

(六) 投资范围及投资比例：

1、投资范围：

(1) 债权类资产：在交易所和银行间市场交易各类标准化债券（如国债、央行票据、中期票据、政策性银行债券、商业银行债券（含普通债、次级债、混合资本债）、资本工具（二级资本债、商业银行二级资本债）、证券公司短期融资券、保险公司债、证券公司债（含证券公司次级债、证券公司短期公司债）、其他金融机构债、企业债券、公司债券、非公开发行公司债券、短期融资券、超短期融资券（SCP）、非公开定向债务融资工具、政府支持机构债、可分离债券、可转换债券（含可分离交易可转债）、可交换债券（含私募可交换债券）（含一级申购）、货币市场基金、银行存款（包括银行活期存款、银行定期存款和银行协议存款）、债券型公募基金、**债券逆回购（包括银行间及交易所）**；

(2) 期货和衍生品类资产：境内交易所上市交易的国债期货；

(3) 现金类资产，包括现金；



**本集合计划可参与债券正回购业务（包括银行间及交易所）。**

如法律法规或中国证监会允许集合计划投资其他品种的，资产管理人在与资产委托人、资产托管人协商一致并履行适当程序后，可以将其纳入本计划的投资范围，并应为管理人和托管人相关系统准备以及投资组合调整留出必要的时间。

**2、投资比例：**

（1）投资于债权类资产、现金类资产的比例按市值计算不低于资产管理计划总资产 80%。

（2）投资于期货和衍生品的持仓合约价值的比例低于资产管理计划总资产 80%，或期货和衍生品账户权益不超过资产管理计划总资产的 20%。

非因本资产管理人主观因素导致突破前述比例限制的，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。

（七）资产管理计划份额的初始募集面值：人民币 1.00 元。

（八）产品类型：**本计划为固定收益类产品。**

（九）产品风险等级：R2（中低风险）等级产品。以上风险评级由管理人确定，销售机构的风险评级可能与此不同，但不得低于管理人的上述评级。

（十）最低初始募集规模：1000 万元。

（十一）基金服务机构：本计划委托长江证券股份有限公司作为基金服务机构，长江证券股份有限公司在中国基金业协会登记的外包业务登记编码为 A00022。

## **六、资产管理计划的募集**

**（一）计划的募集期限、方式及对象**

**1、募集期限**

募集期自计划份额发售之日起不超过 60 天，资产管理人可与销售机构协商后，在符合法规要求的前提下缩短募集期并在资产管理人网站专区进行公告。

本计划的募集期限由管理人根据相关法律法规以及本合同的规定确定。管理人有权根据本计划销售的实际情况按照相关程序延长或缩短募集期，此类变更适用于所有销售机构。延长或缩短募集期的相关信息将及时发布通知，具体见管理人公告。

**2、募集方式**

本计划通过直销机构（管理人）进行销售和/或管理人委托的代销机构进行销售。**本计划的代销机构为长江证券股份有限公司。**资产管理人可以根据情况增加或减少代销机构，

此时管理人应在公司官网公告代销机构相关信息。

资产委托人认购本计划，必须与资产管理人和资产托管人签订资产管理合同，按规定的方式足额缴纳认购款项。认购的具体金额和份额以注册登记机构的确认结果为准。

**资产管理人及其委托的代销机构不得向合格投资者之外的单位和个人募集资金，不得通过报刊、电台、电视、互联网等公众传播媒体或者讲座、报告会、分析会和布告、传单、手机短信、微信、博客和电子邮件等方式，向不特定对象宣传推介。**

### 3、募集对象

本计划仅向符合《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》、《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》的合格投资者发售。

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

### 4、募集账户信息

募集账户由管理人开立，该账户用于本计划募集期间和存续期间认购、参与和退出资金的归集与支付。募集账户是管理人为资产管理计划提供服务的专用账户，不表明管理人对本计划的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本计划没有风险。

本计划募集账户信息如下：

账户名：长江期货股份有限公司资产管理计划销售结算专户

账号：421860035018010042127

开户行：交通银行武汉天安支行

#### （二）计划份额的认购和持有限额

委托人认购本计划，以人民币货币资金形式交付。本计划不接受现金方式认购，在直销机构认购的委托人须将认购资金从在中国境内开立的自有银行账户划款至募集账户，在代销机构认购的委托人按代销机构的规定缴付资金。

委托人在募集期首次认购的金额不得低于 30 万元人民币（法律法规或部门规章对认购金额无最低要求的合格投资者不受此限），并可多次认购，每次追加认购金额应不低于 1 万元人民币。

#### （三）计划份额的认购费用

本计划不收取认购费用。

#### （四）认购申请的确认

认购申请受理完成后，不得撤销。销售机构受理认购申请并不表示对该申请成功的确认，

而仅代表销售机构确实收到了认购申请。认购的确认以管理人的确认结果为准。

本计划的人数规模上限为 200 人。管理人在募集期间每个工作日可接受的人数限制内，按照“时间优先、金额优先”的原则确认有效认购申请。超出人数规模上限的认购申请为无效申请。

#### （五）认购份额的计算方式

净认购金额=认购金额-认购费用

认购份额=（净认购金额+认购资金利息）÷面值

认购份额保留到小数点后 2 位，小数点后第 3 位四舍五入，由此产生的误差计入计划财产。

#### （六）募集期委托人资金的管理

销售机构应当将本计划募集期间投资者的认购资金存入募集结算专用账户，在计划认购结束前，任何机构和个人不得动用。资产管理计划成立前，委托人的认购参与款项（不含认购费用）加计其在募集期形成的利息（按银行同期活期存款利率计算）将折算为资产管理计划份额归委托人所有。

## 七、资产管理计划的成立与备案

### （一）资产管理计划的成立

本计划募集期内，当全部满足如下条件时，才能成立：

- 1、初始募集规模不低于 1000 万元；
- 2、投资者人数不少于 2 人，且不超过 200 人；
- 3、募集过程符合法律、行政法规和中国证监会的规定。

（二）本计划在募集金额缴足之日起十个工作日内，由管理人公告本计划成立。

### （三）募集失败的处理方式

募集期限届满，本计划未能成立的，管理人应当：

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

### （四）资产管理计划的备案

管理人应在资产管理计划成立起 5 个工作日内报证券投资基金业协会备案。资产管理计

划成立前，任何机构和个人不得动用委托人参与资金。

#### （五）资产管理计划备案失败的处理

本计划应当在基金业协会规定的期限内完成备案手续，不能满足资产管理计划备案条件或资产管理人放弃计划备案的，资产管理人应及时通知委托人和资产托管人。若资产管理人放弃本计划备案或本计划未能成功通过备案，且管理人决定终止时，本合同相应终止，具体终止流程参见本合同“资产管理合同的变更、终止与财产清算”章节。

**本计划如果在中国证券投资基金业协会备案未通过，则需要按照监管机构或基金业协会的要求修改本合同或提前终止本计划。本计划在前述情形下存在需修改合同或提前终止的风险。请委托人注意。**

## 八、资产管理计划的参与、退出与转让

本计划存续期间参与、退出与转让应符合《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》、《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》、《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》和监管机构的相关规定，管理人应定期将资产管理计划委托人变更情况报送证券投资基金业协会。

### （一）参与和退出的场所

本资产管理计划的销售机构包括直销机构(资产管理人)和资产管理人委托的代销机构。具体的销售机构将由管理人在本合同第六节或其他相关公告中列明。

资产委托人应当在销售机构办理资产管理计划销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理计划份额的参与和退出。管理人可根据情况变更或增减代销机构，并予以公告。

### （二）参与和退出的时间

委托人可在本计划开放日根据本合同相关约定参与和/或退出本资产管理计划，但管理人根据法律法规、中国证监会的要求或本合同的规定公告暂停参与和/或退出时除外。

#### 1、开放期

本资产管理计划成立后第一个开放期为2023年10月25日，之后每6个自然月的25日固定开放（如遇节假日则顺延至下一交易日。第一个开放期为2023年10月25日，第二个开放期为2024年4月25日，以此类推）。投资者可以在开放期申购参与本计划，也可以申请赎回本计划。管理人有权调整开放期时间长度，并提前通过管理人网站向委托人公告，

具体以管理人的公告为准。

本计划因合同变更、监管规则修订等情形可设置特别开放期，具体以管理人公告为准。管理人应在每个开放日前一交易日 17:00 前通知托管人及基金服务机构。特别开放期不允许委托人申购，且委托人申请赎回的，应当赎回全部份额。

## 2、流动性安排

为保障客户资金的流动性，管理人将在开放退出期内，保持资产组合中 7 个工作日可变现资产的价值，不低于本计划资产净值的 10%，且不得投资于流动性受限资产。

### （三）出资方式及参与期限

本计划的参与以人民币货币资金形式交付，不接受现金方式参与。

在直销机构参与本计划的委托人应在参与有效期内将参与资金从在中国境内开立的自有银行账户划款至募集账户，在代销机构参与的委托人可通过代销机构了解募集账户（如有）信息。

### （四）参与和退出的方式、价格及程序

1、委托人参与本计划时，按照参与申请所对应的开放日的计划份额净值为基准计算计划份额。资产委托人退出计划时，按照退出申请所对应的开放日的计划份额净值计算退出金额。

2、“未知价”原则，即计划的参与价格、退出价格以开放日当日收市后计算的计划份额净值为基准进行计算。

3、计划参与采用金额申请的方式，计划退出采用份额申请的方式。

4、资产委托人退出本计划时，管理人按先进先出的原则，按资产委托人认购、参与计划份额的先后次序进行顺序退出。

5、管理人将采用“时间优先”的原则避免出现规模超过集合计划目标规模和人数上限的情况。参与资金“时间优先”是指：当 T 日认购申请全部确认后规模超过集合计划规定的份额或者委托人数超过人数上限时，管理人可自次日（T+1 日）起暂停接受参与申请。对当日（T 日）已提交的参与申请即可采取按照注册登记系统的时间优先的方法逐笔确认。如果有多笔参与时间相同，且按照“时间优先”的原则排序后其前一时间点参与的总规模（或总人数）尚未达到上限，而在加上这多笔参与后总规模（或总人数）又超过上限，则此相同时间参与的金额全部确认失败，并及时向委托人披露。未确认的参与资金，由销售机构退还到委托人账户中。

### （五）参与和退出申请的确认及款项支付

销售机构对参与、退出的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到申请。参与、退出的确认以管理人的确认结果为准。

在正常情况下，管理人在 T+2 日内对 T 日参与和退出申请的有效性进行确认（如遇特殊情况且在管理人和托管人技术条件支持下，管理人有权对份额确认日进行调整，并通知资产委托人和托管人）。

参与采用全额交款方式，若参与不成功，则参与款项本金退还给委托人。委托人退出申请确认后，管理人将在 T+7 日内将退出款项从托管账户划出。若遇证券、期货交易所或交易市场数据传输延迟、通讯系统故障、银行数据交换系统故障或其他非管理人及托管人所能控制的因素影响业务处理流程时，退出款项顺延至上述情况消除后的下一个工作日划出。在发生巨额退出或本合同载明的其他暂停退出或延缓支付退出款项的情形时，款项的支付参照本合同有关条款处理。

#### （六）参与和退出的金额限制

委托人应满足合格投资者标准，首次参与金额应不低于 30 万元人民币（法律法规或部门规章对参与金额无最低要求的合格投资者不受此限），在开放日内追加参与的，追加金额应不低于 1 万元人民币。

委托人持有的计划资产净值高于 30 万元时，可以选择部分退出，单笔退出份额应不低于 1 万份，但退出后持有的计划资产净值不得低于 30 万元。如委托人退出部分计划份额后可能导致其在退出后持有的计划资产净值不足 30 万元的，必须选择一次性退出全部计划份额；当资产管理人发现委托人申请部分退出资产管理计划将致使其在部分退出申请确认后持有的计划资产净值低于 30 万元人民币的，资产管理人有权对该份额持有人基金账户持有的本计划份额做全部退出处理，退出费按照本合同的规定正常收取。

当委托人持有的计划资产低于 30 万元（含 30 万元）时，需要退出计划的，委托人必须选择一次性全部退出资产管理计划。

此外，管理人可根据市场情况，合理调整对参与金额和退出份额的数量限制，管理人进行前述调整必须提前 3 个工作日告知资产管理计划份额持有人。管理人在其网站公告前述调整事项，即视为履行了告知义务。

#### （七）参与和退出的费用

##### 1、参与费用

本计划无参与费用。

##### 2、退出费用

本计划无退出费用。

(八) 参与份额与退出金额的计算方式

1、参与份额计算

净参与金额=参与金额-参与费用（如有）

参与份额=净参与金额÷参与价格

参与价格为参与申请所对应的开放日计划份额净值。

参与份额保留到小数点后 2 位，小数点后第 3 位四舍五入，由此产生的误差计入计划财产。

2、退出金额计算

退出金额=退出份数×退出价格-业绩报酬（如有）

退出价格为退出申请所对应的开放日计划份额净值。

退出金额保留到小数点后 2 位，小数点后第 3 位四舍五入，由此产生的误差计入计划财产。

(九) 拒绝或暂停参与、暂停退出的情形及处理

1、在如下任一情况下，资产管理人可以拒绝接受委托人的参与申请：

(1) 如接受该申请，将导致本计划资产委托人超过 200 人。

(2) 根据市场情况，资产管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对资产管理计划业绩产生负面影响，从而损害现有资产管理计划资产委托人的利益的情形。

(3) 因资产管理计划收益分配、或资产管理计划内某个或某些证券进行权益分派等原因，使资产管理人认为短期内接受参与可能会影响或损害现有资产管理计划资产委托人利益的。

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

(5) 法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

资产管理人决定拒绝接受某些资产委托人的参与申请时，参与款项将退回资产委托人账户。

2、在如下任一情况下，资产管理人可以暂停委托人的参与：

(1) 因不可抗力导致无法受理资产委托人的参与申请；

(2) 交易场所交易时间临时停市，导致资产管理人无法计算当日资产管理计划财产净值；

(3) 本计划的证券/期货经纪商没有或未及时发送交易清算数据或对账数据、发送的交

易清算数据或对账数据不完整或有误，导致无法或未能及时计算当日计划资产净值的情形；

(4) 对于没有或未及时获取场外交易数据或场外行情数据、场外交易数据或场外行情数据不完整或有误，导致无法或未能及时计算当日计划资产净值的情形；

(5) 发生本资产管理合同规定的暂停资产管理计划资产估值情况；

(6) 法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

资产管理人决定暂停接受全部或部分参与申请时，应当告知资产委托人。在暂停参与的情形消除时，资产管理人应及时恢复参与业务的办理并告知资产委托人。

3、在如下任一情况下，资产管理人可以暂停接受资产委托人的退出申请：

(1) 因不可抗力导致资产管理人无法支付退出款项；

(2) 交易场所交易时间临时停市，导致资产管理人无法计算当日资产管理计划财产净值；

(3) 本计划的证券/期货经纪商没有或未及时发送交易清算数据或对账数据、发送的交易清算数据或对账数据不完整或有误，导致无法或未能及时计算当日计划资产净值的情形；

(4) 对于没有或未及时获取场外交易数据或场外行情数据、场外交易数据或场外行情数据不完整或有误，导致无法或未能及时计算当日计划资产净值的情形；

(5) 发生本资产管理合同规定的暂停资产管理计划资产估值的情况；

(6) 法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一的，资产管理人应当及时告知资产委托人。已接受的退出申请，资产管理人应当足额支付；如暂时不能足额支付，应当按单个退出申请人已被接受的退出申请量占已接受的退出申请总量的比例分配给退出申请人，其余部分在后续开放日予以支付。

在暂停退出的情况消除时，资产管理人应及时恢复退出业务的办理并及时告知资产委托人。

4、暂停资产管理计划的参与、退出时，资产管理人应按规定告知资产委托人。资产管理人在其公司网站公告或以资产委托人认可的其他方式告知即视为资产管理人履行了告知义务。

5、暂停参与或退出期间结束，资产管理计划重新开放时，资产管理人应按规定告知资产委托人。资产管理人在其公司网站公告或以资产委托人认可的其他方式告知即视为资产管理人履行了告知义务。

6、发生本合同、计划说明书中未予载明的事项，但管理人有正当理由认为需要暂停接受参与、退出申请的，在符合相关法律法规规定并履行相应程序后管理人可以暂停接受投资



者的参与、退出申请。

(十) 单个委托人大额退出及预约申请

对单个委托人单日退出份额超过集合计划总份额3%，即视为单个委托人大额退出。

委托人必须提前2个工作日直接或通过销售机构向管理人预约申请；大额退出未预约申请，管理人有权拒绝接受其退出申请。

(十一) 巨额退出的认定及处理方式

1、巨额退出的认定

单个开放日中，本计划需处理的计划净退出申请份额超过本计划上一工作日资管计划总份额的10%时，即认为本计划发生了巨额退出。

2、巨额退出的处理方式

(1) 一个开放期中开放日天数>1时

出现巨额退出时，资产管理计划管理人可以根据本资产管理计划当时的资产状况决定接受全额退出或部分退出。

1) 接受全额退出：当资产管理计划管理人认为有能力兑付资产管理计划份额持有人的全部退出申请时，按正常退出程序执行。对开放日提出的退出申请，如构成巨额退出的，应当按照本资产管理计划合同约定全额接受退出，但退出款项支付时间可适当延长，最长不应超过20个工作日。

2) 部分延期退出：当资产管理计划管理人认为全额兑付资产管理计划份额持有人的退出申请有困难，或兑付资产管理计划份额持有人的退出申请进行的资产变现可能使资产管理计划资产净值发生较大波动时，资产管理计划管理人可在该工作日接受部分退出申请，其余部分的退出申请在后续工作日予以受理。对于需要部分延期办理的退出申请，除资产管理计划份额持有人在提交退出申请时明确做出不参加顺延下一个工作日退出的表示外，自动转为下一个工作日退出处理，转入下一个工作日的退出申请的退出价格为下一个工作日的资产管理计划份额净值，以此类推，直到全部退出为止，但是若下一个工作日为非退出开放日，则资产管理计划份额持有人的退出申请在开放期最后一个工作日全部处理，退出价格为该日的资产管理计划份额净值。因延期退出而导致委托人的份额净值较申请退出日增加或减少的，管理人不享有权利或承担任何责任。转入下一个工作日的退出申请不享有优先权。发生部分延期退出时，资产管理计划管理人可以适当延长退出款项的支付时间，但最长不应超过20个工作日。

(2) 一个开放期中开放日天数=1时

出现巨额退出时,资产管理计划管理人可以根据本资产管理计划当时的资产状况决定接受全额退出或部分退出。

1) 接受全额退出:当资产管理计划管理人认为有能力兑付资产管理计划份额持有人的全部退出申请时,按正常退出程序执行。对开放日提出的退出申请,如构成巨额退出的,应当按照本资产管理计划合同约定全额接受退出,但退出款项支付时间可适当延长,最长不应超过20个工作日。

2) 接受部分退出:当资产管理计划管理人认为全额兑付资产管理计划份额持有人的退出申请有困难,或兑付资产管理计划份额持有人的退出申请进行的资产变现可能使资产管理计划资产净值发生较大波动时,资产管理计划管理人可在该工作日接受部分退出申请,未被接受的剩余部分退出申请转入下一交易日。

### 3、巨额退出的公告

当发生巨额退出并顺延赎回时,待资产管理人确认退出申请后,资产管理人可通过邮寄、传真、电话或网上公告等方式在3个工作日内通知申请赎回的资产委托人和资产托管人,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,管理人可按计划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。

连续巨额退出的价格由受理申请当日的计划单位净值决定。

#### (十三) 资产管理计划份额的转让

资产管理计划成立后,委托人可以按照规定申请份额转让事宜。

申请份额转让事宜之后,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转让资产管理计划份额。但转让后委托人持有资产管理计划份额不得少于 30 万份,委托人合计不超过 200 人。受让方首次参与资产管理计划,应满足合格委托人要求,应先与管理人、托管人签订资产管理合同。

委托人之间的份额转让,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。

#### （十四）资产管理计划份额的非交易过户

非交易过户是指不采用参与、退出等交易方式，将一定数量的资产管理计划份额按照一定的规则从某一委托人账户转移到另一委托人账户的行为。非交易过户包括继承、捐赠、司法执行以及计划份额登记机构认可、符合法律法规的其他类型。办理非交易过户必须提供计划份额登记机构要求提供的相关资料，接收划转的主体必须是依法可以持有本计划份额的委托人。

继承是指资产委托人死亡，其持有的计划份额由其合法的继承人继承；捐赠指资产委托人将其合法持有的计划份额捐赠给福利性质的基金会或社会团体；司法强制执行是指司法机关依据生效司法文书将资产委托人持有的计划份额强制划转给其他自然人、法人或其他组织。办理非交易过户必须提供计划份额登记机构要求提供的相关资料，对于符合条件的非交易过户申请按计划份额登记机构的规定办理，并按计划份额登记机构规定的标准收费。

#### （十五）管理人自有资金参与本计划

##### 1、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，应符合《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》、《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》、《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》和监管机构的相关规定。

##### 2、自有资金的参与与退出方式

管理人以自有资金参与集合计划份额的持有期限不得少于 6 个月。管理人以自有资金参与、退出本计划时，应当提前 5 个工作日以官网公告等方式告知全体委托人和托管人，并取得其同意。委托人不同意管理人自有资金参与、退出的，可在募集期结束前或最近一个固定开放日申请退出本资产管理计划，具体以管理人的公告为准。未退出本资产管理计划的，视为同意管理人自有资金参与、退出。

##### 3、自有资金参与的份额比例及金额

管理人及其子公司以自有资金参与本计划的份额合计不得超过本计划总份额的 50%。中国证监会对证券期货经营机构自有资金投资比例另有规定的，从其规定。因本计划规模变动等客观因素导致前述比例被动超标的，管理人应当依照中国证监会规定及本合同的约定及时调整达标，为调整持有比例管理人有权设置仅供管理人自有资金退出的特别开放期进行调整。

##### 4、自有资金的收益分配及责任承担

管理人自有资金参与的份额与其他委托人持有的同类份额享有同等权益，承担同等风险。

##### 5、自有资金退出的条件

当出现以下情况之一时，管理人自有资金参与份额可以退出本集合计划：

1) 因集合计划规模变动等客观因素导致自有资金参与比例超过法律法规规定或本合同约定比例时；

2) 集合计划开放且自有资金持有计划份额超过6个月、符合法律法规规定允许退出的；

3) 法律法规或监管机构准许管理人自有资金退出的其他情况。

6、其他规定

为应对集合资产管理计划巨额赎回以解决流动性风险，或者中国证监会认可的其他情形，在不存在利益冲突并遵守本合同约定的前提下，管理人及其子公司以自有资金参与及其后续退出本计划可不受本条第2款、第3款规定的限制，但应及时告知委托人和托管人，并向管理人所在地中国证监会派出机构报告。

### 九、份额持有人大会及日常机构

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

### 十、资产管理计划份额的登记

(一)本资产管理计划的注册登记业务由资产管理人或资产管理人委托可办理开放式证券投资基金份额登记业务的其他机构办理。委托基金服务机构代为办理本计划注册登记业务的，应当与基金服务机构签订相关协议，并列明代为办理基金份额登记机构的权限和职责。**本计划的基金服务机构为长江证券股份有限公司。**计划份额登记机构应履行如下注册登记职责：

1、配备足够的专业人员办理本资产管理计划的注册登记业务。

2、严格按照法律法规和本合同约定办理本资产管理计划的注册登记业务。

3、保存资产管理计划客户资料表及相关的参与和退出等业务记录20年以上。

4、对资产委托人的账户信息负有保密义务，因违反该保密义务对资产委托人或资产管理计划带来的损失，须承担相应的赔偿责任，但法律法规或监管机构另有规定的除外。

5、按照本合同为资产委托人办理非交易过户等业务，提供资产管理计划收益分配等其他必要的服务。

6、建立和保管资产委托人账户资料、交易资料、资产管理计划客户资料表等，并将客

户资料表提供给资产管理人。

7、法律法规规定的其他职责。

(二) 委托人签订本合同即表明同意管理人、份额登记机构将集合资产管理计划委托人名称、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。

(三) 管理人依法应承担的注册登记职责不因委托而免除。

## 十一、资产管理计划的投资

(一) 投资目标：本资产管理计划将在严格控制风险的前提下，力争使本资产管理计划保值增值。

(二) 投资范围及投资比例：

### 1、投资范围

(1) 债权类资产：在交易所和银行间市场交易各类标准化债券（如国债、央行票据、中期票据、政策性银行债券、商业银行债券（含普通债、次级债、混合资本债）、资本工具（二级资本债、商业银行二级资本债）、证券公司短期融资券、保险公司债、证券公司债（含证券公司次级债、证券公司短期公司债）、其他金融机构债、企业债券、公司债券、非公开发行公司债券、短期融资券、超短期融资券（SCP）、非公开定向债务融资工具、政府支持机构债、可分离债券、可转换债券（含可分离交易可转债）、可交换债券（含私募可交换债券）（含一级申购）、货币市场基金、银行存款（包括银行活期存款、银行定期存款和银行协议存款）、债券型公募证券投资基金、债券逆回购（包括银行间及交易所）；

(2) 期货和衍生品类资产：境内交易所上市交易的国债期货；

(3) 现金类资产，包括现金；

本集合计划可参与债券正回购业务（包括银行间及交易所）。

如法律法规或中国证监会允许集合计划投资其他品种的，资产管理人在与资产委托人、资产托管人协商一致并履行适当程序后，可以将其纳入本计划的投资范围，并应为管理人和托管人相关系统准备以及投资组合调整留出必要的时间。

2、投资比例：

(1) 投资于债权类资产、现金类资产的比例按市值计算不低于资产管理计划总资产 80%。

(2) 投资于期货和衍生品的持仓合约价值的比例低于资产管理计划总资产 80%，或期货和衍生品账户权益不超过资产管理计划总资产的 20%。

非因本资产管理人主观因素导致突破前述比例限制的，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。

### （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、资产管理计划规模变动、系统故障或其他非管理人主观因素，造成资产管理计划投资比例超标的，此种情况不视为违约，管理人应在超标发生之日起具备交易条件 20 个交易日内将投资比例降至许可范围内。如遇投资标的限制流通等客观原因，调整时间顺延。法律法规或中国证监会及相关自律组织对本计划投资比例另有规定的，从其规定。

### （四）风险收益特征

本计划属于 R2（中低风险）等级产品。以上风险评级由管理人（直销机构）确定，代销机构的风险评级可能与此不同，但不得低于管理人的上述评级。

### （五）投资策略：

#### 1、资产配置策略

本集合计划将结合宏观分析和微观分析制定投资策略，动态调整集合计划的资产配置力求在满足安全性、流动性需求的基础上实现更高的集合计划收益。

#### 2、债券投资策略

本计划将在保持债券组合低波动性的前提下，综合运用多种策略参与市场所提供的投资机会，以期为持有人获取更高的收益：

（1）久期配置策略：本计划将在分析中长期经济变化趋势的基础上，预测未来一段时间内利率可能的走向，以此来决定组合久期的长短。预期利率下降时延长组合久期，以获得因债券价格上涨而带来的资本利得；预期利率上升时缩短组合久期，以降低或规避债券价格下跌所带来的风险。

（2）收益率曲线策略：在确定组合久期后，采用收益率曲线分析模型对不同期限债券的风险收益特征进行评估，并根据对收益率曲线形状变化进行预测，采用子弹型策略、哑铃型策略或梯形策略，来决定本计划资产在长、中、短期债券间的配置比例。

（3）债券类属配置策略：根据国债、金融债（含政策性金融债）、公司债、企业债等不同债券间的相对投资价值分析，增持价值被相对低估的债券板块，借以取得较高收益。

（4）骑乘策略：通过分析收益率曲线各期限段的利差情况，买入收益率曲线最陡峭处所对应的债券，随着本计划持有债券时间的延长，债券的剩余期限将缩短，到期收益率将下降，从而获得资本利得收入。

### 3、基金投资策略

基金投资策略主要遵循定量分析和定性分析相结合的原则。在开放式基金投资方面，管理人在充分考虑基金公司的管理能力的基础上，综合考察基金的业绩成长性、波动性、流动性等市场表现等情况进行投资。在封闭式基金投资方面，管理人将结合基金的存续期、基金的风险收益表现及市场折（溢）价情况，选择市场表现良好、投资管理能力强的封闭式基金进行投资。管理人在定性分析的基础上，定量分析基金的净值增长率、波动率、基金的选股能力和择时能力等指标，通过自有的基金评价系统综合考察基金的市场表现和基金的管理水准。

### 4、现金管理

本集合计划的现金管理的目的在于提高资金的运用效率、对稳固计划收益起到补充作用。管理人通过投资于固定收益类资产和现金类资产，在投资中严格控制风险，使其成为组合收益的稳定来源。

#### （六）投资限制

（1）投资于信用债的，需满足债项评级在 AA 及以上级别（不包含中债资信评级），若债券无评级则要求债券发行人主体评级在 AA 及以上级别；

（2）投资于单只债券的比例按最新面值总额计不超过计划资产净值的 25%且不超过该债券发行规模的 25%；

（3）投资于一家基金公司管理的单只基金，按成本计算不得超过计划资产净值的 25%；

（4）投资于短期融资券、超短期融资券的，需满足债券主体评级在 AA 及以上级别；

（5）不得主动投资于股票等权益类资产，因投资可转换债券、可交换债券所转换或者交换的股票，应在 15 个工作日之内卖出；

（6）国债期货占用保证金比例不得超过计划资产净值的 1%；

（7）产品的组合久期不得超过 4 年（如有回售权，则按行权久期计算）；

（8）计划资产总值不超过计划资产净值的 190%，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，计划资产总值不超过计划资产净值的 120%；

（9）投资于单一资产的资金不得超过计划资产净值的 25%；除以收购公司为目的设立的资产管理计划、专门投资于未上市企业股权的资产管理计划外，管理人管理的全部集合资产管理计划投资于同一资产的资金不得超过该资产的 25%；

（10）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。

如因证券、期货市场剧烈波动、证券发行人合并、资产管理计划规模变动、系统故障或

其他不可抗力等原因导致上述投资比例短期内超出以上限制,此种情况不视为违约,管理人应在超标发生之日起具备交易条件 20 个工作日内将投资比例降至许可范围内。如遇投资标的限制流通等客观原因,调整时间顺延。

#### (七) 投资禁止行为

资产管理人不得利用计划财产从事下列行为或进行如下投资运作,若由此造成计划财产、合同当事人及第三方损失的,所有责任由资产管理人承担:

- 1、违规将集合计划资产用于资金拆借、贷款、抵押融资或者对外担保等用途;
- 2、将集合计划资产用于可能承担无限责任的投资;
- 3、向客户做出保证其资产本金不受损失或者保证其取得最低收益的承诺;
- 4、挪用集合计划资产;
- 5、募集资金不入账或者其他任何形式的账外经营;
- 6、募集资金超过计划说明书约定的规模;
- 7、接受单一客户参与资金低于中国证监会规定的最低限额;
- 8、使用集合计划资产进行不必要的交易;
- 9、内幕交易、利益输送、操纵证券价格、不正当关联交易及其他违反公平交易规定的行为;
- 10、法律、行政法规和中国证监会禁止的其他行为。

#### (八) 预警止损机制

本计划未设置预警线及止损线。

#### (九) 资产管理计划的建仓期

本计划的建仓期为自本计划成立后的 6 个月,管理人将在建仓期内逐步将本计划资产配置比例符合合同有关约定。在此期间,本计划的投资范围和投资策略应该符合资产管理合同的有关约定。以现金管理为目的,投资银行活期存款、国债、中央银行票据、货币市场基金等中国证监会认可的投资品种的除外。

**(十) 特别提醒委托人注意:** 本计划为固定收益类产品,存续期间为规避市场剧烈波动、系统故障或其他不可抗力等原因的特定风险,全体委托人签署合同即表示同意,投资于对应类别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%。在本计划到期日前 10 个工作日内,因计划财产变现需要,本计划财产的投资比例限制可以不符合上述计划配置比例规定。

#### (十一) 资产组合的流动性及期限匹配



本计划自成立之日起计算的 6 年为固定存续期限，投向二级市场，流动性较强，满足期限匹配要求，且与资产管理合同约定的参与、退出安排相匹配。

(十二) 其他

本计划投资非证券交易所或期货交易所发行、上市的投资标的（如有）时，资产委托人在此授权并同意：资产管理人有权代表本计划与相关方签署资产管理计划投资相关文件及协议，并以资产管理人的名义办理相关权属登记及变更手续。但资产管理人应确保向投资相对方说明真实的资金来源为本计划，并保证将投资本金及收益及时返回至本计划托管账户。

## 十二、投资顾问

本计划未聘请投资顾问。

## 十三、分级安排

本计划不分级。

## 十四、利益冲突及关联交易

(一) 本资产管理计划存在的或可能存在利益冲突的情形

1、本资产管理计划投资于管理人及其控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司发行或者在承销期内承销的证券；

2、本资产管理计划投资于托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司发行或者在承销期内承销的证券；

3、本资产管理计划投资于管理人、托管人及其关联方或者与上述主体有其他重大利害关系的主体直接或间接管理或代理销售的、或提供客户服务的、或者该等主体持有的符合本合同投资范围规定的投资产品；

4、从事其他重大关联交易。

(二) 本资产管理计划存在利益冲突的处理方式、披露方式、披露内容以及披露频率

1、处理方式

当本资产管理计划存在或可能存在利益冲突情形时，管理人需要建立健全内部审批机制

和评估机制，并遵循投资者利益优先的原则，并采取切实有效措施，防范利益冲突，保护投资者合法权益。

## 2、披露方式、披露内容以及披露频率

当本资产管理计划发生上述存在利益冲突的情形，应采取切实有效措施，防范利益冲突，保护投资者合法权益。管理人应当事先取得投资者的同意，事后告知投资者和托管人，并向中国证监会相关派出机构报告。

### （三）关联交易

管理人将资产管理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，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，事先取得投资者的同意，事后告知投资者和托管人，并采取切实有效措施，防范利益冲突，保护投资者合法权益。

管理人以资产管理计划资产从事关联交易的，应当遵守法律、行政法规、中国证监会的规定和合同约定，事先取得投资者的同意，事后及时告知投资者和托管人，并向中国证监会相关派出机构报告。

**投资者签署本合同即表明其已经知晓并同意本资产管理计划可进行上述关联交易。**

**本资产管理计划份额持有人不得因本资产管理计划投资收益劣于管理人及其关联方管理的其他类似投资产品，而向管理人或托管人提出任何损失或损害补偿的要求。**

## 十五、投资经理的指定与变更

### （一）投资经理的指定

#### 1、投资经理的指定

本计划投资经理由资产管理人负责指定。

#### 2、本计划投资经理

本计划的投资经理由管理人指定为【**金晓**】【**苏晶**】。

金晓：资管业务总部投资部总经理，武汉大学西方经济学硕士。

从业经历：曾任长江证券固定收益总部信用评估部信用研究员，债券投顾部投资经理，长江期货资管业务总部投资部总经理助理，2020年10月起担任长江期货股份有限公司资管

业务总部投资部总经理。

苏晶：资管业务总部投资部投资经理，武汉大学硕士。

从业经历：曾任长江证券固定收益总部资金交易员，债券投顾部投资经理，2019 年 10 月起担任长江期货资管业务总部投资部投资经理。

本计划投资经理符合法律法规规定的以下条件。

- (1) 已取得期货从业资格，并具备基金从业资格；
- (2) 具有 3 年以上投资管理、投资研究、投资咨询等相关业务经验；
- (3) 具有良好的诚信记录及职业操守，且最近 3 年未被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚；

管理人承诺该投资经理未同时办理资产管理业务和其他业务。

#### (二) 投资经理的变更

资产管理人可根据业务需要变更投资经理，并在变更后及时告知资产委托人和资产托管人。资产管理人在上述变更之日起 5 日内在资产管理人公司网站公告调整事项即视为履行了告知义务。委托人不同意投资经理变更的，可在资产管理人公司网站公告后的 5 日内反馈资产管理人，于变更生效后临时设置的特别开放期申请退出本资产管理计划。特别开放期的时间设置见管理人网站和销售机构网点及网站公告。未退出本资产管理计划的视为同意管理人对投资经理的变更。

## 十六、资产管理计划的财产

### (一) 资产管理计划财产的保管与处分

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

2、计划财产独立于资产管理人、资产托管人的固有财产，并独立于管理人管理的和托管人托管的其他财产。资产管理人、资产托管人不得将计划财产归入其固有财产。资产托管人对因为资产管理人投资产生的存放或存管在资产托管人以外机构的委托财产不承担保管责任。

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

4、资产管理人、资产托管人、基金服务机构可以按照本合同的约定收取管理费、托管

费、基金服务费以及本合同约定的其他费用。资产管理人、资产托管人以其固有财产承担法律责任，其债权人不得对资产管理计划财产行使请求冻结、扣押和其他权利。资产管理人、资产托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，资产管理计划财产不属于其清算财产。

5、资产管理人、资产托管人不得违反法律法规的规定和本合同约定擅自将计划财产用于抵押、质押、担保或设定任何形式的优先权或其他第三方权利。

6、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委托人。

## （二）资产管理计划财产相关账户的开立和管理

1、托管人按照规定开立计划财产的托管账户等本计划所需账户，管理人应给予必要的配合，并提供所需资料。期货账户等投资所需的账户由管理人负责开立和注销，账户名称应当符合《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》及证券登记结算机构等机构的有关规定。开立的上述计划财产账户与管理人、托管人、代销机构和计划份额登记机构自有的财产账户以及其他计划财产账户相独立。托管人为委托资产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，预留印鉴账户预留印鉴为“兴业银行股份有限公司武汉分行托管账户专用章 1-2”以及开户机构托管业务负责人名章。该账户应遵循托管人的《单位银行结算账户管理协议》规定。

本计划如开立各类存款账户，相应的存款证实书（或存单）正本须保管在托管行，存款账户的预留印鉴需包含资产托管人监管印鉴一枚。资产管理人必须和存款机构签订相应的存款协议，约定双方的权利和义务，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，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”，如相关存款协议中未体现上述条款，资产托管人有权拒绝相关存款投资的指令。

2、托管人在商业银行开立本计划的托管账户，并根据中国人民银行规定，按照托管人执行的利率标准计息。托管账户的银行预留印鉴由托管人制作、保管和使用。本计划的一切货币收支活动，包括但不限于投资、支付退出金额、支付计划收益，均需通过本计划的托管账户进行。本托管账户仅限于本计划使用，仅限于满足开展本计划业务的需要。

3、证券账户和证券资金账户的开设和管理（如有）

(1) 资产托管人应当在中国证券登记结算有限责任公司开设证券账户，用于本计划证券投资的清算和存管。资产管理人应配合资产托管人办理开立账户事宜并提供相关资料。

(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。资产托管人和资产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) 本计划证券账户的开立和证券账户卡的保管由资产托管人负责，相关账户的管理和使用由管理人负责。

(4) 资产托管人协助资产管理人以计划名义在营业网点开立证券资金账户，并按照资产管理人营业网点开户的流程和要求，签订相关的协议，并办理三方存管，银证转账的密码交由资产托管人保管，资产托管人应根据资产管理人的指令，进行银证转账的操作。

#### 4、其他账户的开立和管理

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

(2) 法律法规等有关规定对相关账户的开立和管理另有规定的，从其规定办理。

#### (三) 与资产管理计划财产有关的重大合同的保管

由管理人代表本计划签署的与本计划有关的重大合同的原件分别由管理人、托管人保管，相关业务程序另有限制除外。除本协议另有规定外，管理人在代计划签署与计划有关的重大合同时应当保证持有二份以上的正本，以便管理人和托管人至少各持有一份正本的原件，管理人应及时将正本送达托管人处。合同的保管期限按照国家有关规定执行。

对于无法取得二份以上的正本的，管理人应向托管人提供加盖管理人公章(或合同专用章)的合同传真件或扫描件，并注明内容与原件相符，未经双方协商或未在合同约定范围内，合同原件不得转移。

## 十七、指令的发送、确认与执行

### (一) 管理人对发送指令人员的授权

1. 管理人应当事先向托管人寄送书面通知原件(以下称“授权通知”附件二)，载明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。管理人应向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样本，并在寄送后向托管人电话确认，授权通知自其中注明的生效日期起生效，若资产托管人确认

收到授权通知的日期晚于其中注明的生效日期,授权通知自资产托管人确认收到的日期起开始生效。

若资产管理人同时向资产托管人出具了资产管理业务统一交易清算授权书和单个资管计划交易清算授权书的,授权书以以下第(2)种方式为准:

(1)统一授权书 (2)单个资管计划授权书

2. 管理人向托管人发出的授权通知应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,授权通知应以原件形式送达托管人。

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

## (二) 指令的内容

指令是管理人在运作计划资产时,向托管人发出的资金划拨及其他指令。包括付款指令(包括委托人退出金额支付、费用支付、收益分配款、清算资产分配款等)、以及其它资金划拨指令等。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、划款金额、收款人账户等,加盖预留印鉴并有被授权人签字。相关登记结算有限责任公司向托管人发送的资金结算通知或数据等视为管理人向托管人发出的有效指令。

## (三) 指令的发送、确认和执行

1. 指令由授权通知确定的指令发送人员代表管理人用邮件、传真(管理人的邮箱为zcglxzg@cjsc.com,管理人的传真为027-85860103,托管人只接受此邮箱/传真的投资指令)或甲乙双方确认的方式向托管人发送。管理人在发出投资指令(附件三)后,需与托管人电话联系确认。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不由托管人承担。

管理人应按照《资产管理合同》、说明书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发送指令;指令发送人员应按照其授权权限发送指令。对于被授权的指令发送人员发出的指令,管理人不得否认其效力。但如果管理人已经撤销或更改对指令发送人员的授权,并且托管人已经确认的,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,管理人不承担责任,授权已更改但未通知托管人或托管人未确认的情况下,因前指令发送人员发送的指令造成的损失,托管人不承担任何责任。

管理人向托管人发送指令时,应确保本计划银行托管专户或专用募集账户有足够的资金余额。对超头寸的指令,托管人可不予执行,但应立即通知管理人,并视托管专户资金余额充足时为指令送达时间,托管人不承担因未执行该指令造成损失的责任。

托管人对复核无误的指令应在规定期限内执行，不得延误。管理人在下达指令时还应考虑托管人执行指令所需的合理时间，一般为两个小时（工作时间范围：8:30-11:30, 13:30-17:00）。对于管理人于15:00以后发送至托管人的指令，托管人应尽力配合，但如未能出款时托管人不承担责任。如遇特殊情况，视业务情况双方当事人协商解决。

2. 托管人在接收指令时，应根据《资产管理合同》等有关规定对指令进行一致性检查，托管人可根据指令的内容要求管理人提供合同、协议等款项支付的文件依据。**托管人仅对管理人提交的指令按照本协议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、真实性和有效性，管理人应当保证上述文件资料合法、真实和有效。**如因管理人提供的上述文件不合法、不真实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。

托管人在收到有效指令后，将对于同一批次的投资指令随机执行，如有特殊支付顺序，管理人应以书面形式提前告知。

托管人在履行监督职能时，发现管理人的指令内容违法、违规的，有权不予执行，并通知管理人进行复查和改正。管理人收到托管人通知后及时进行核对，并以书面形式对托管人发出回函确认，因管理人回函确认不及时造成的损失不由托管人承担。对管理人未在限期内纠正的，托管人应及时报告监管机构。

托管人发现管理人发送指令要素错误、无相关合同或协议依据的费用支付指令、预留印鉴错误等情形，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表面一致性，应及时告知管理人，由管理人改正后重新发送。对于要素错误的指令，托管人应不予执行。要素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、邮箱地址或双方认可的其他形式发送投资指令等。

#### （四）被授权人的更换

管理人若对授权通知的内容进行修改、变更（包括但不限于指令发送人员的名单、权限的修改），应当至少提前1个工作日通知托管人；修改授权通知的文件（附件五）应由管理人加盖公章并由法定代表人或其授权代表签署，若由授权代表签署的，还应附上法定代表人的授权书。管理人对变更后的授权通知，应当以原件的方式发送给托管人，同时电话通知托管人；新的授权通知自其中注明的生效日期起生效，若资产托管人确认收到新的授权通知的日期晚于其中注明的生效日期，新的授权通知自资产托管人确认收到的日期起开始生效，原授权文件同时废止。被授权人变更通知生效前，托管人仍应按原约定执行指令，管理人不得

否认其效力。

托管人更换接受管理人指令途径（包括但不限于传真号和邮箱地址），亦应提前书面通知管理人。

#### （五）其它事项

1. 除因故意或重大过失致使计划的合法利益受到损害而负赔偿责任外，托管人对执行管理人的合法指令或执行指令过程中由于本协议当事人以外的第三方过失对计划资产造成的损失不承担赔偿责任。

2. 托管人因主观恶意或重大过失致使本资产管理计划的合法利益受到损害，应对所造成的直接经济损失负赔偿责任。

3. 资金投资指令正本由管理人保管，托管人保管指令传真件或扫描件。当两者不一致时，以托管人收到的业务指令传真件或扫描件为准。

#### （六）交易及清算交收安排

##### 1、选择证券经纪机构的程序

管理人负责选择代理本计划财产证券买卖的证券经纪机构，并与其签订证券经纪合同，管理人、托管人和证券经纪机构可就本计划参与证券交易的具体事项另行签订协议。

##### 2、投资证券后的清算交收安排

（1）本计划通过证券经纪机构进行的交易由证券经纪机构作为结算参与者代理本计划进行结算；本计划其他证券交易由托管人或相关机构负责结算。

##### （2）证券交易所证券资金结算

托管人、管理人应共同遵守中登公司制定的相关业务规则 and 规定，该等规则 and 规定自动成为本条款约定的内容。

管理人在投资前，应充分知晓与理解中登公司针对各类交易品种制定结算业务规则 and 规定。

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

（3）对于任何原因发生的证券资金交收违约事件，相关各方应当及时协商解决。若因此导致本计划的利益受到损害的，由过错方承担相应责任。

##### 3、资金、证券账目及交易记录的核对

管理人和托管人定期对资产的资金、证券账目、实物券账目、交易记录进行核对。



#### 4、参与或退出的资金清算

(1) T日, 客户进行参与或退出申请。

(2) 在正常情况下, 资产管理人或资产管理人委托的运营服务机构在T+2日内对T日的参与、退出申请进行确认(如遇特殊情况且在管理人和托管人技术条件支持下, 管理人有权对份额确认日进行调整, 并通知资产委托人和托管人); 并将确认的参与、退出等数据向资产托管人传送。资产管理人或资产管理人委托的运营服务机构、资产托管人根据确认数据进行账务处理。

(3) 资产委托人退出申请确认后, 资产管理人将在 T+5 日(包括T+5日)内支付退出款项。在发生巨额退出时, 款项的支付办法参照本合同有关条款处理。

(4) 资产管理人应对份额登记数据的准确性负责。资产托管人应及时查收参与资金的到账情况, 并根据资产管理人指令及时划付退出款项。

#### 5、非证券交易所交易资金交收

(1) 对于本计划的投资及所投资的资产变现时, 资产管理人应向资产托管人提交相关交易合同或协议、成交确认文件的复印件(加盖资产管理人有效印章), 并通知资产托管人相关资金的到账时间。资产管理人保证以上所提供的文件资料的真实性和有效性。

(2) 资产管理人应指定本计划的托管账户为本计划投资所产生的本金、利息、投资收益以及其他收益的唯一收款账户。

(3) 计划托管账户当日若有应收款, 在约定时间内未入账的, 由资产管理人负责向相关当事人进行催收。

## 十八、越权交易

### (一) 越权交易的界定

本合同约定的越权交易是指管理人违反本合同的约定而进行的投资交易行为, 包括: (1) 违反本合同约定的投资范围和投资比例限制等进行的投资交易行为; (2) 法律法规禁止的超买、超卖行为。

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

### (二) 对越权交易的处理程序

#### 1、违反本合同投资范围和投资比例限制规定进行的投资交易行为

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

托管人在行使监督职责时，发现管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反本合同约定的，应立即通知管理人，并有权依据相关法律法规的要求报告中国证监会或基金业协会。因执行该指令造成的损失托管人不承担任何责任。

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

## 2、法律法规禁止的超买、超卖行为。

托管人在行使监督职能时，如果发现计划资产投资过程中出现超买或超卖现象，应立即提醒管理人，由此给计划资产造成的损失由管理人承担，托管人不承担任何责任。如果因管理人原因发生交易所场内超买行为，管理人必须于发生超买行为的下一个工作日上午 10:00 点之前完成融资，保证完成清算交收。

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

### （三）托管人对管理人越权交易的监督

1、托管人对管理人的越权交易行使监督权，具体投资监督事项如下：

（1）本计划的投资范围及投资比例。

投资范围：

A. 债权类资产：在交易所和银行间市场交易各类标准化债券（如国债、央行票据、中期票据、政策性银行债券、商业银行债券（含普通债、次级债、混合资本债）、资本工具（二级资本债、商业银行二级资本债）、证券公司短期融资券、保险公司债、证券公司债（含证券公司次级债、证券公司短期公司债）、其他金融机构债、企业债券、公司债券、非公开发行公司债券、短期融资券、超短期融资券（SCP）、非公开定向债务融资工具、政府支持机构债、可分离债券、可转换债券（含可分离交易可转债）、可交换债券（含私募可交换债券）（含一级申购）、货币市场基金、银行存款（包括银行活期存款、银行定期存款和银行协议存款）、债券型公募基金、债券逆回购（包括银行间及交易所）；

B. 期货和衍生品类资产：境内交易所上市交易的国债期货；

C. 现金类资产，包括现金；

本集合计划可参与债券正回购业务（包括银行间及交易所）。

如法律法规或中国证监会允许集合计划投资其他品种的，资产管理人在与资产委托人、资产托管人协商一致并履行适当程序后，可以将其纳入本计划的投资范围，并应为管理人和托管人相关系统准备以及投资组合调整留出必要的时间。

投资比例：

- A. 投资于债权类资产、现金类资产的比例按市值计算不低于资产管理计划总资产 80%。
- B. 投资于期货和衍生品的持仓合约价值的比例低于资产管理计划总资产 80%，或期货和衍生品账户权益不超过资产管理计划总资产的 20%。

非因本资产管理人主观因素导致突破前述比例限制的，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 个工作日内调整至符合要求。

(2) 本计划的投资限制：

A. 投资于信用债的，需满足债项评级在 AA 及以上级别（不包含中债资信评级），若债券无评级则要求债券发行人主体评级在 AA 及以上级别；

B. 投资于单只债券的比例按最新面值总额计不超过计划资产净值的 25%且不超过该债券发行规模的 25%；

C. 投资于一家基金公司管理的单只基金，按成本计算不得超过计划资产净值的 25%；

D. 投资于短期融资券、超短期融资券的，需满足债券主体评级在 AA 及以上级别；

E. 不得主动投资于股票等权益类资产，因投资可转换债券、可交换债券所转换或者交换的股票，应在 15 个工作日之内卖出；

F. 国债期货占用保证金比例不得超过计划资产净值的 1%；

G. 产品的组合久期不得超过 4 年（如有回售权，则按行权久期计算）；

H. 计划资产总值不超过计划资产净值的 190%，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，计划资产总值不超过计划资产净值的 120%；

I. 投资于单一资产的资金不得超过计划资产净值的 25%；除以收购公司为目的设立的资产管理计划、专门投资于未上市企业股权的资产管理计划外，管理人管理的全部集合资产管理计划投资于同一资产的资金不得超过该资产的 25%；

J. 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。

如因证券市场剧烈波动、证券发行人合并、资产管理计划规模变动、系统故障或其他不可抗力等原因导致上述投资比例短期内超出以上限制，此种情况不视为违约，管理人应在超标发生之日起具备交易条件的 20 个工作日内将投资比例降至许可范围内。如遇投资标的限制流通等客观原因，调整时间顺延。

资产管理人自本合同生效之日起 6 个月内使本计划的投资组合比例符合本合同的有关约定,在此期间,本计划的投资范围和投资策略应该符合资产管理合同的有关约定。以现金管理为目的,投资中国证监会认可的投资品种的除外。由于包括但不限于证券、期货市场波动、证券发行人合并、本计划规模变动等资产管理人之外的因素导致本计划不符合本合同约定的投资比例、投资限制或投资禁止政策,为被动超标。资产管理人应在发生不符合法律法规或投资政策之日起的 20 个交易日内调整完毕。如发生证券、期货合约停牌或其他非资产管理人可以控制的原因导致资产管理人不能履行调整义务的,则调整期限相应顺延。资产管理人应当自证券、期货合约恢复交易之日起的 20 个交易日内调整完毕,法律、行政法规、金融监管部门另有规定的,从其规定。

**本计划为固定收益类产品,存续期间为规避市场剧烈波动、系统故障或其他不可抗力等原因的特定风险,经全体委托人同意后,投资于对应类别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%。在本计划到期日前 10 个交易日内,因计划财产变现需要,本计划财产的投资比例限制可以不符合上述计划配置比例规定。**

(3) 法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的,从其规定。若法律法规或监管部门取消上述限制,本计划投资可不受上述规定限制。

因证券市场波动、上市公司合并、计划规模变动等管理人之外的因素致使本计划不符合本合同约定的投资比例的,管理人应当在合理期限内调整完毕。

托管人以(1) — (3)项为限对本计划的直接投资承担投资监督职责。

托管人对管理人进行本计划越权交易的监督和检查自本合同生效之日起开始。

2、投资范围或投资限制变更,资产管理人应以书面形式通知资产委托人、资产托管人,并应与资产托管人重新协商调整投资监督事项,应为托管人调整监督事项留出必要的时间。

**3、资产托管人越权交易监督的真实性、准确性、及时性和完整性受限于管理人、证券经纪商、期货经纪商及其他中介机构提供的数据和信息,资产托管人对上述机构提供信息的真实性、准确性、及时性和完整性不作任何担保、暗示或表示,并对上述机构提供信息的错误、遗漏或延迟所引起的损失不承担任何责任。**

4、本计划合规投资的责任在资产管理人,对于资产管理人的投资策略、投资决定或由于资产管理计划产品设计缺陷或越权交易造成的任何损失,资产托管人不承担任何责任。资产托管人按照本合同约定履行了上述越权交易监督义务的,即代表托管人对计划投资运作进行了监督。

## 十九、资产管理计划财产的估值和会计核算

### （一）计划财产的估值

#### 1、计划资产总值

计划资产总值是指其所购买的各项期货、证券、银行存款及利息、计划各项应收款以及其他资产的价值总和。

#### 2、计划资产净值

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

#### 3、计划份额净值

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

#### 4、估值目的

计划财产估值目的是客观、准确地反映计划财产的价值，并为计划份额退出提供计价依据。

#### 5、估值时间

资产管理人与资产托管人对每个交易日的计划财产进行估值，并对每个交易日的估值进行核对。另外，管理人向托管人协商后，可要求对其他交易日的估值结果进行核对。

#### 6、估值依据

估值应符合本合同、《证券投资基金会计核算业务指引》及其他法律、法规的规定，如法律法规未做明确规定的，参照证券投资基金的行业通行做法处理。

#### 7、估值对象

本计划所拥有的期货、股票、债券、基金、其他衍生工具和银行存款本息、应收款项、其他投资等资产及负债。

#### 8、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、交易所上市的股票以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大变化的，以最近交易日的市价（收盘价）估值；估值日无报价且最近交易日后发生了影响公允价值计量的重大变化的，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、交易所上市的公开发行的实行全价交易的可转换债券按估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）作为估值全价进行估值；交易所上市的公开发行的实行净价交易的可转换债券按估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）并加计每百元税前应计利息作为估值全价进行估值。

估值日没有报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大变化的，交易所上市的公开发行的实行全价交易的可转换债券按最近交易日的市价（收盘价）作为估值全价进行估值；交易所上市的公开发行的实行净价交易的可转换债券按最近交易日债券市价（收盘价）并加计每百元税前应计利息作为估值全价进行估值。

如最近交易日后发生了影响公允价值计量的重大变化的，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。

C、交易所上市的可交换债券采用第三方估值基准服务机构（此处指中证指数有限公司）提供的相应品种当日的唯一估值全价或推荐估值全价进行估值。

D、交易所上市或挂牌转让的债券、私募债、资产支持证券等不含权固定收益品种，采用第三方估值基准服务机构（此处指中央国债登记结算有限责任公司）提供的相应品种当日的估值全价进行估值。

交易所上市或挂牌转让的债券、私募债、资产支持证券等含权固定收益品种，采用第三方估值基准服务机构（此处指中央国债登记结算有限责任公司）提供的相应品种当日的唯一估值全价或推荐估值全价进行估值。

交易所上市或挂牌转让的债券、私募债、资产支持证券等含投资者回售权的固定收益品种，行使回售权的，在回售登记日至实际收款日期间采用第三方估值基准服务机构（此处指中央国债登记结算有限责任公司）提供的相应品种的唯一估值全价或推荐估值全价进行估值；回售登记期截止日（含当日）后未行使回售权的，按照长待偿期所对应的估值全价进行估值。

（2）处于特定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收盘价估值；该日无报价的，以最近一日的收盘价估值。

B、首次公开发行未上市的股票和债券，应采用当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定其公允价值。

C、流通受限股票，按以下方法估值：

流通受限股票，是指明确带有一定限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次

公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票。

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

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

(3) 全国银行间债券市场交易的债券、私募债、资产支持证券等不含权固定收益品种，采用第三方估值基准服务机构（此处指中央国债登记结算有限责任公司）提供的相应品种当日的估值全价进行估值。

全国银行间债券市场交易的债券、私募债、资产支持证券等含权固定收益品种，采用第三方估值基准服务机构（此处指中央国债登记结算有限责任公司）提供的相应品种当日的唯一估值全价或推荐估值全价估值进行估值。

全国银行间债券市场交易的债券、私募债、资产支持证券等含投资者回售权的固定收益品种，行使回售权的，在回售登记日至实际收款日期间采用第三方估值基准服务机构（此处指中央国债登记结算有限责任公司）提供的相应品种的唯一估值全价或推荐估值全价进行估值；回售登记期截止日（含当日）后未行使回售权的，按照长待偿期所对应的估值全价进行估值。

(4) 回购等计息资产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。

(5) 银行存款、证券资金按照约定利率在持有期内逐日计提应收利息，以实际结息数为准；期货资金账户内资金不计提利息，以实际结息数为准；本计划终止清算时应收未收利息计入计划终止清算净值。

(6) 计划持有的公募证券投资基金按以下方法估值：

A、上市流通的证券投资基金按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无报价的，以最近交易日的收盘价估值。

B、上市开放式基金 (LOF)，按所投资基金估值日的份额净值估值。

C、上市交易型货币市场基金，如所投资基金披露份额净值，则按所投资基金估值日的份额净值估值；如所投资基金披露万份（百份）收益，则按所投资基金前一估值日后至估值日期间（含节假日）的万份（百份）收益计提估值日基金收益。

D、未在交易所上市交易的非货币市场基金，按所投资基金估值日的份额净值估值。

E、未在交易所上市交易的货币市场基金，按所投资基金前一估值日后至估值日期间（含节假日）的万份收益计提估值日基金收益。

如遇所投资基金不公布基金份额净值、进行折算或拆分、估值日无交易等特殊情况，基金管理人根据以下原则进行估值：

1) 以所投资基金的基金份额净值估值的，若所投资基金与本资管计划估值频率一致但未公布估值日基金份额净值，按其最近公布的基金份额净值为基础估值。

2) 以所投资基金的收盘价估值的，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。

3) 如果所投资基金前一估值日至估值日期间发生分红除权、折算或拆分，基金管理人应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。

(7) 期货合约以估值日的结算价估值，若估值当日无结算价的，且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大变化的，采用最近交易日结算价估值。法律法规另有规定的，从其规定。

(8) 上述估值约定采用第三方估值基准服务机构的估值全价进行估值的，第三方估值基准服务机构的估值全价保留至小数点后 4 位；在交易所市场实行净价交易按估值日在证券交易所挂牌的市价并加计每百元税前应计利息作为估值全价进行估值的，每百元税前应计利息保留至小数点后 8 位。

(9) 如存在上述估值约定未覆盖的固定收益品种，采用中央国债登记结算有限责任公司提供的相应品种当日的估值全价进行估值，中央国债登记结算有限责任公司未提供相应品种估值的，使用中证指数有限公司提供的相应品种当日的估值全价进行估值。以上第三方估值基准服务机构均未提供估值的，由管理人根据具体情况与基金托管人商定后，确定其公允价值。

(10) 如存在上述估值约定未覆盖的投资品种，资产管理人可根据具体情况制定估值方法，并将估值方法提供给托管人进行估值。如管理人认为上述估值方法不合适，可就相关估值方法进行修改，并将修改后的方法提前通知托管人进行估值。

(11) 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。



(12) 当有充足证据表明资产管理计划相关资产的估值方法已不能真实公允反映其价值时, 管理人应当与托管人进行协商, 及时采用公允价值计量方法对资产管理计划资产净值进行调整。

#### 9、汇率 (如有)

若港股通估值计算中涉及港币的, 将以中国证券登记结算有限责任公司或交易所提供的汇率进行估值。涉及其他货币的, 如中国证券登记结算有限责任公司或交易所估值日提供了该币种兑人民币的汇率, 则取该汇率, 如未有提供, 以双方协商一致的原则确定汇率。

#### 10、税收

对于因税收规定调整或其他原因导致计划实际缴纳税金与估算的应交税金有差异的, 计划将在相关税金调整日或实际支付日进行相应的估值调整。

#### 11、估值程序

计划日常估值由管理人进行, 根据相关法律法规, 管理人可以委托第三方外包机构办理资产管理计划的估值。管理人或其委托的第三方完成估值后, 将估值结果以书面形式或者双方认可的其他形式送至托管人, 托管人按法律法规、本合同规定的估值方法、时间、程序进行复核, 复核无误后在管理人发送的书面估值结果上加盖业务章或者双方认可的其他形式返回给管理人或其委托的第三方; 月末、年中和年末估值复核与资产管理计划会计账目的核对同时进行。

在法律法规和中国证监会允许的情况下, 管理人与托管人可以各自委托第三方机构进行计划资产估值, 但不改变管理人与托管人对计划资产估值各自承担的责任。

#### 12、估值错误的处理

当计划净值发生计算错误超过计划净值 0.5% 时, 视为估值错误。

本合同的当事人应按照以下约定处理:

##### (1) 估值错误类型

本计划运作过程中, 如果由于管理人、托管人、交易所、计划份额登记机构、销售机构或计划委托人自身的过错造成估值错误, 导致其他当事人遭受损失的, 按如下估值错误处理原则和处理程序执行。

上述估值错误的主要类型包括但不限于: 资料申报差错、数据传输差错、数据计算差错、系统故障差错、下达指令差错等。

自然灾害、突发事件、以及因技术原因引起的差错, 若系同行业现有技术水平不能预见、不能避免、不能克服, 则属不可抗力, 由于不可抗力造成资产委托人的交易资料灭失或被错

误处理或造成其他差错，因不可抗力原因出现差错的当事人不对其他当事人承担赔偿责任，但因该差错取得不当得利的当事人仍应负有返还不当得利的义务。

(2) 估值错误处理及估值调整原则

A、如管理人或托管人发现计划资产估值违反本合同订明的估值方法、程序的规定，导致计划净值发生计算错误超过计划净值的0.5%时，应立即通知双方，共同查明原因，协商解决；

B、估值错误的责任人应当对由于该估值错误遭受损失的直接当事人的直接损失承担赔偿责任；估值错误的责任人对有关当事人的直接损失负责，不对间接损失负责，并且仅对估值错误的有关直接当事人负责，不对第三方负责；

C、因估值错误而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务；

D、估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式；

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

F、管理人按本合同约定的估值方法进行估值时，所造成的误差不作为计划资产估值错误处理；

G、按法律法规规定的其他原则处理估值错误。

(3) 估值错误处理及估值调整程序

估值错误被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

A、计划份额净值计算出现错误时，管理人应当立即予以纠正，通报托管人，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；

B、当计划净值发生计算错误超过计划净值的0.5%时，查明估值错误发生的原因，根据当事人协商的方法对因估值错误造成的损失进行评估；

C、根据估值错误处理原则或当事人协商的方法，对估值错误进行处理；

D、前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。

13、暂停估值的情形

(1) 计划投资所涉及的交易场所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

(2) 因不可抗力或其他情形致使管理人、托管人无法准确评估计划财产价值时；

(3) 占计划相当比例的投资品种的估值出现重大转变，而管理人为保障计划委托人的利益，决定延迟估值的情形；

(4) 法律、法规、中国证监会认定的其他情形。

#### 14、计划份额净值的确认

用于计划信息披露的计划份额净值由资产管理人负责计算，资产托管人负责进行复核。资产管理人应于每个估值核对日计算估值日的计划份额净值并发送给资产托管人。资产托管人对份额净值计算结果复核确认后发送给资产管理人。计划份额净值由资产管理人负责对委托人公布。

根据相关法规，计划会计责任方由资产管理人担任。因此，就与本计划有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，资产管理人有权按照其对计划资产净值的计算结果对外予以公布，并承担由此而产生的责任。资产托管人有权将该等情况报相关监管机构备案。

#### 15、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，资产管理人和资产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，由此造成的计划资产估值错误，资产管理人和资产托管人免除赔偿责任。但资产管理人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

#### （二）计划的会计政策

资产管理计划的会计政策按照本合同约定执行，如本合同没有约定的，比照现行政策执行。

- 1、管理人为本计划的会计责任方；
- 2、计划的会计年度为公历年度的 1 月 1 日至 12 月 31 日；
- 3、计划核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位；
- 4、会计制度执行国家有关会计制度；
- 5、本计划独立建账、独立核算；

6、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，按照有关规定编制计划会计报表。托管人应定期与管理人就资产管理计划的会计核算、报表编制等进行核对。

## 二十、资产管理计划的费用与税收

#### （一）资产管理计划费用的种类

1、管理费；

(1) 固定管理费

(2) 管理人的业绩报酬

2、托管费；

3、基金服务费；

4、本计划的证券、期货交易费用及开户费用；

5、本计划成立后与之相关的会计师费、审计费和律师费；

6、本计划成立后的银行汇划费用；

7、按照国家有关规定和本合同约定，可以在计划资产中列支的其他费用。

(二) 费用计提方法、计提标准和支付方式

1、管理费

(1) 固定管理费

本计划的年固定管理费率为 0.6%。计算方法如下：

$$H=E \times 0.6\% \div N$$

H：每日应计提的管理费

E：前一日的计划资产净值

N：365 天

本计划的固定管理费自计划成立日起，每日计提，按季支付给管理人。管理人根据与托管人核对一致的财务数据，管理人于次季度首月前十五个工作日内向托管人发送管理费划付指令，由托管人根据划付指令从计划财产中支付给管理人。

(2) 管理人的业绩报酬

管理人可于本集合计划分红、份额退出和计划终止时计提管理人的业绩报酬。本集合计划的业绩报酬计提基准为 K%，若该笔基金份额的年化收益率超过业绩报酬计提基准，则管理人对该笔份额期间份额年化收益率超过业绩报酬计提基准的部分从分红资金、退出资金或清算资金中提取 60% 作为管理人的业绩报酬，从分红资金中提取业绩报酬的频率不得超过每 6 个月一次。本计划初始成立时确定的业绩报酬计提基准将在本计划募集前通过管理人公告的形式予以确定。本计划存续期间管理人有权在开放日根据相关监管规定和投资策略，综合调整业绩报酬计提基准，具体以管理人公告为准。

1) 期间年化收益率计算方式

$$R=(A-Y) / P / T \times 365 \times 100\%$$

2) 期间业绩报酬的计算方法

年化收益率	提取比例	业绩报酬计算公式
$R < K$	0	0
$R \geq K$	60%	$Z = Q \times P \times (R - K) \times 60\% \times T / 365$

其中：

R：该笔份额期间年化收益率

K：该期间的业绩报酬计提基准

Z：管理人的业绩报酬

A：集合计划分红时或计划份额退出日集合计划的份额累计净值

Y：该笔计划份额认购/参与日的份额累计净值或上一次计提业绩报酬时的份额累计净值

P：该笔计划份额认购/参与日的份额单位净值或上一次计提业绩报酬时的份额单位净值

Q：拟提取业绩报酬的该笔计划份额数

T：该笔计划份额上一业绩报酬提取日或该笔计划份额认购/参与日至本次业绩报酬提取日的自然天数 Z 的计算结果保留到小数点后两位，小数点后第三位四舍五入。

管理人应根据每笔计划份额的持有期限分别计算业绩报酬。

**为免歧义，特别说明：本集合计划约定的业绩报酬计提基准，仅是管理人计提业绩报酬的基准，并非管理人向委托人作出的预期收益，更非管理人向委托人做出保本保收益的承诺。管理人不得以任何方式向委托人作保本或保收益的承诺。**

### 3) 业绩报酬计提方式

在计划分红日计提业绩报酬的，业绩报酬从分红资金中扣除。在计划份额退出和计划终止时计提业绩报酬的，业绩报酬从退出资金、清算资金中扣除。委托人多次参与计划的，退出份额采取“先进先出”原则。委托人强制退出的份额和正常退出的份额一样收取退出费和业绩报酬。

#### (3) 管理人的业绩报酬的支付

由管理人向托管人发送划付指令和与托管人核对一致的注册登记系统确认结果，托管人于收到指令后 5 个工作日内从计划资产中一次性支付给管理人。若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

资产管理人费用收入银行账户信息如下（账户信息如有变更，管理人须及时通知相关各方）：

户名：长江期货股份有限公司

账号：4218 6003 5018 0018 43401

开户银行：交行武汉天安支行

## 2、托管费

本计划的年托管费率为 0.02%。计算方法如下：

$$H=E \times 0.02\% \div N$$

H：每日应计提的托管费

E：前一日的计划资产净值

N：365 天

本计划的托管费自计划成立日起，每日计提，按季支付给托管人。管理人根据与托管人核对一致的财务数据，管理人于次季度首月前十五个工作日内向托管人发送托管费划付指令，由托管人根据划付指令从计划财产中支付给托管人。

托管费收款账户：

户名：证券公司客户资产管理计划托管业务收入

账号：411010191675000122

开户银行：兴业银行股份有限公司武汉分行（作业中心）

## 3、基金服务费

本计划份额注册登记、估值核算等基金服务费用，年费率为 0.025%。

计算方法如下：

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

H：每日应计提的基金服务费

E：前一日计划资产净值

N：365 天

本计划的基金服务费自计划成立日起，每日计提，按季支付给基金服务机构。管理人根据与托管人核对一致的财务数据，管理人于次季度首月前十五个工作日内向托管人发送基金服务费划付指令，由托管人根据划付指令从计划财产中支付给基金服务机构。

基金服务费收款账户：

户名：长江证券股份有限公司私募基金费用结算专户

账号：416010100101263295

开户银行：兴业银行武汉分行营业部

## 4、其他费用的计提方法：

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，由管理人授权后划付，管理人收到托管人通知后一个月内未授权划付的，由托管人从委托资产中扣划，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的银行费用，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。

资产管理计划存续期间发生的信息披露费、与资产管理计划相关的律师费和会计师费、审计费以及按照国家有关规定可以列入的其他费用等，由托管人根据有关法规及相应协议的规定，按照管理人的指令，按费用实际支出金额从资产管理计划资产中支付，列入资产管理计划费用。

上述（一）中所列其他费用根据有关法规及相关协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由托管人从计划财产中支付。其中，证券账户开户费若由管理人在开户时先行垫付，自证券账户开户一个月内由托管人自动从计划资产中扣划，若因证券账户内资金不足导致扣款不成功，托管人不承担任何责任，托管人也无需垫付任何资金。管理人无需再出具资金划拨指令。费用自动扣划后，管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系托管人协商解决。

### （三）不列入计划业务费用的项目

1、资产管理计划成立前发生的费用，以及存续期间发生的与募集有关的费用（如合同文件制作、印刷费用），不得在计划资产中列支。

2、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资产管理计划财产的损失，以及处理与资产管理计划财产运作无关事项或不合理事项所发生的费用。

3、管理人和托管人处理与计划运作无关的事项发生的费用。

4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入计划费用的项目。

### （四）费用调整

资产管理人与资产托管人或基金服务机构协商一致，可下调托管费率和基金服务费率。

对上述费率的调整生效后，资产管理人按照本合同的约定向资产委托人披露变更的具体内容。

如遇交易所或第三方金融机构调整相关费率时，各方应根据相关机构的调整通知对相关费率标准进行相应调整。

### （五）资产管理计划的税收

本计划运作过程中涉及的各纳税主体及扣缴主体，其纳税义务及扣缴义务按国家税收法律、法规，由其各自承担、缴纳或扣缴。

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。资产管理人有权在本计划每次收益分配前或计划清算时从计划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直接缴付税费，或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。如果本计划托管账户受现金流动性限制无法足额现金缴纳上述税款，在征得资产委托人同意的前提下，资产管理人有权要求资产委托人向计划托管账户提供流动性支持，以按期足额缴付/划付相关税款。如果资产管理人以固有财产垫付资产管理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委托人就补缴金额进行追偿。

资产委托人从委托财产中获得的各项收益产生的税费，由资产委托人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委托人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委托人代扣代缴相关税费。资产管理人、资产托管人就其取得的计划管理费、托管费，依据法律法规规定履行各自的纳税义务。若届时国家税收相关法律法规发生调整变化，则依据其规定执行。

## 二十一、资产管理计划的收益分配

### 一、收益的构成

资产管理计划收益指资产管理计划利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额，资产管理计划已实现收益指资产管理计划收益减去公允价值变动收益后的余额。

### 二、可供分配收益



可供分配收益指截至收益分配基准日（即可供分配收益计算截至日）本计划未分配收益与未分配收益中已实现收益的孰低数。

### 三、收益分配原则

1、每份计划份额享有同等分配权；

2、资产管理计划收益分配后单位净值不能低于单位份额面值；

3、资产管理计划权益登记日原则上为本计划开放日，分配基准日为权益登记日的前三个工作日，权益登记日当日为收益分配日，如遇法定节假日、休息日，上述日期相应顺延，具体日期以管理人的公告为准；

4、收益分配方式：

本计划默认的收益分配方式为现金红利。委托人可选择红利再投资的分红方式。红利再投资不收参与费，且无需满足最低追加参与的金额要求。

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

### 四、收益分配方案披露

本资产管理计划收益分配方案由资产管理计划管理人拟定，由资产管理计划托管人核实后确定，管理人在方案确定后 5 个工作日内在指定网站进行公告。

## 二十二、信息披露与报告

### （一）运作期报告

1、管理人向资产委托人提供的报告种类、内容和提供时间

#### （1）净值报告

管理人每周将经托管人复核的上周最后一个交易日的计划份额净值以各方认可的形式提交资产委托人。

#### （2）年度报告

管理人应当在每年度结束之日起四个月内，编制完成计划年度报告并经托管人复核。年度报告包括但不限于下列信息：

（一）管理人履职报告；

（二）托管人履职报告；

（三）资产管理计划投资表现；

（四）资产管理计划投资组合报告；

- (五) 资产管理计划运用杠杆情况（如有）；
- (六) 资产管理计划财务会计报告；
- (七) 资产管理计划投资收益分配情况；
- (八) 投资经理变更、重大关联交易等涉及委托人权益的重大事项；
- (九) 资产管理计划支付的管理费、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；
- (十) 中国证监会规定的其他事项。

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

### (3) 季度报告

资产管理人应当在每季度结束之日起一个月内，编制完成计划季度报告并经资产托管人复核后向资产委托人披露。季度报告应当披露第（2）款“年度报告”除第（六）项之外的其他信息。

资产管理人应于每季度结束之日起一个月内完成季度报告若资产管理计划成立不足三个月或者存续期间不足三个月的，资产管理人可以不编制当期季度报告。

### (4) 临时报告

发生本合同约定的、可能影响委托人利益的重大事项时，资产管理人应及时履行报告义务，在事项发生之日起五日内，通过管理人网站公告等形式向委托人披露。涉及托管人的，托管人应及时向资产管理人告知相关事项。

### (5) 清算报告

清算小组在本计划终止后 30 个工作日内编制计划财产清算报告，由资产管理人或销售机构按照资产委托人提供的联系方式或由资产管理人通过其公司网站告知资产委托人。

## 2、向资产委托人提供报告及资产委托人信息查询的方式

管理人有权采用下列一种或多种方式向资产委托人提供报告或进行相关通知。

### (1) 传真、电子邮件或短信

如资产委托人留有传真号、电子邮箱或手机号等联系方式，管理人可通过传真、电子邮件或短信等方式将报告信息告知资产委托人。

### (2) 邮寄服务

管理人可向资产委托人邮寄年度报告等有关本计划的信息。资产委托人在销售机构留存的通信地址为送达地址。通信地址如有变更，资产委托人应当及时以书面方式或以管理人

规定的其他方式通知管理人。

### (3) 管理人网站

管理人通过管理人网站向资产委托人提供报告和信息查询，内容包括净值报告等。

如委托人办理资产管理计划认购、参与或退出等业务时留有传真号、电子邮箱、手机及电话号码等联系方式的，资产管理人也可通过传真、电子邮件、手机短信、电话、电报等方式将报告信息通知资产委托人。资产委托人上述联系方式若发生变更应当及时通知资产管理人。

委托人同意，上述信息披露方式一经发出即视为有效，且管理人以上述任意一种方式进行信息披露，即视同资产管理人履行了约定的通知与报告义务。

### (二) 向监管部门、自律组织提供的报告

管理人按照相关法律法规、中国证监会的规定、自律规则或相关监管机构的要求定期或不定期出具资产管理业务月报、季报、年报、重大事项报告、清算报告等，具体以法律法规、自律管理机构及监管机构规定的要求为准。

托管人向监管机构报告的种类、内容、时间和途径以监管机构对托管人的要求为准。

委托人可以在中国期货业协会网站(www.cfachina.org)查询有关期货公司资产管理业务资格、从业人员、主要投资策略、方向及风险等基本特征情况。

### (三) 其他

管理人的董事、监事、从业人员及其配偶、控股股东、实际控制人或者其他关联方参与本计划的，管理人将通过本合同约定的方式向委托人披露。

## 二十三、风险揭示

资产管理人在管理、运用或处分计划财产过程中，可能面临各项风险。资产委托人在签署本合同前，应当仔细阅读本合同全文及《风险揭示书》，知悉并理解其中列示的本计划可能面临的各项风险。《风险揭示书》的揭示事项仅为列举性质，未能详尽列明委托人参与本资管计划投资所面临的全部风险和可能导致委托人财产损失的所有因素。资产委托人在参与本计划投资并签署本合同前，应认真阅读并理解相关业务规则、资管合同及风险揭示书的全部内容，并确保自身已做好足够的风险评估与财务安排，避免因参与资管计划投资而遭受超过自身风险承受能力的损失。

其中《风险揭示书》中的其他风险包括但不限于关联交易风险、技术风险和操作风险、发生不可抗力事件的风险等操作或技术风险。

### 1、关联交易风险

资产管理人可将委托财产投资于资产托管人及其控股股东、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（如有），或上述主体直接或间接管理或代理销售的、或提供客户服务的、或者该等主体持有的符合本资产管理合同投资范围规定的投资产品，委托人签署本资产管理合同即表明其已经知晓并同意本计划可能进行上述关联交易。

虽然资产管理人积极遵循委托人利益优先的原则、遵守相关法律法规的规定进行操作、积极防范利益冲突，但仍可能存在因资产管理人运用委托财产从事关联交易被监管部门认为存在利益输送、内幕交易的风险，进而可能影响资产委托人的利益。此外，资产管理人从事关联交易时可能依照相关法律法规被限制相关权利的行使，进而可能影响资产委托人的收益。

### 2、技术风险

在计划的各种交易行为或者后台运作中，可能因为技术系统的故障或者差错而影响交易的正常进行或者导致资产委托人的利益受到影响。

### 3、操作风险

相关当事人在业务各环节操作过程中，因内部控制存在缺陷或者人为因素造成操作失误或违反操作规程等引致的风险。

4、请投资者知悉，本计划初始成立时确定的业绩报酬计提基准将在本计划募集前通过管理人公告的形式予以确定。本计划存续期间管理人有权在开放日根据相关监管规定和投资策略，综合调整业绩报酬计提基准，具体以管理人公告为准。

**特别提示：资产委托人签署本合同及《风险揭示书》即表明已充分了解并谨慎评估自身风险承受能力，理解并愿意自行承担参与资管计划投资的风险和损失。**

## 二十四、资产管理合同的变更、终止与财产清算

（一）因法律法规或中国证监会、基金业协会、期货业协会等相关监管规定、自律规则发生变化或有权机构对法律法规的解释导致本合同与之存在冲突或不一致需变更产品合同的，管理人经与托管人协商一致，可以对本合同与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，并由管理人于合同变更后通过管理人网站及时向投资者披露变更的具体内容。变更生效后，管理人应在变更之日起五个工作日内将更新或修改内容报相关监管机构备案。

（二）非因法律、法规及有关政策发生变化的原因而导致合同变更时，可分别采用以下

方式进行合同变更。

(1) 全体资产委托人、资产管理人和资产托管人协商一致后，可对本合同内容进行变更。

(2) 因本计划认购、申购、赎回的受理时间、资金划拨指令有关事宜、清算交收等业务规则、估值方法及核对的时间和程序、调低从本计划资产列支由托管人、行政服务机构(如有)收取的费用的标准等相关内容的变更,由资产管理人与资产托管人协商一致后对本合同相关内容进行变更,在征得托管人的书面同意后,在管理人网站向委托人公告,并以电子或者网站公告方式向委托人发送合同变更征询意见函。委托人不同意合同变更的,可在管理人公告明确的特别开放期内退出本计划,委托人未在管理人公告特别开放期内申请退出本计划的,视为同意合同变更(特别开放期内不允许委托人部分赎回)。合同变更于特别开放期结束后的第一个工作日开始生效,公告内容即成为本合同组成部分。

(3) 如合同变更对投资者利益无实质不利影响的,包括但不限于资产管理人或托管人信息(如法定代表人、地址、联系方式等)发生变化等情况,管理人可与托管人协商后修改本合同,并由管理人于合同变更后通过管理人网站及时向投资者披露变更的具体内容。

(4) 在与上述第(2)款项下约定不冲突的前提下,有下列情形之一的,资产管理人有权单方面变更合同的相关内容,若资产管理人进行任何单方面变更,应及时将变更内容加盖公章书面告知资产托管人,资产托管人收到该等书面告知后,资产管理人作出的变更始对资产托管人发生效力,并在变更生效之日起的五日内以本合同约定的方式对委托人披露:

- ①调低从本计划资产列支由资产管理人收取的费用标准;
- ②按照法律法规的规定或本合同的约定,资产管理人有权单方面变更本合同的其他情形。

(三) 若发生以下事项而导致合同变更时,可采用更换管理人或托管人的方式进行合同变更。

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。

(四) 计划管理人和计划托管人的更换程序:

1、计划管理人的更换程序

(1) 提名: 新任计划管理人由计划托管人或由单独或合计持有 10%以上(含 10%)基金份额的计划份额持有人提名;

(2) 决议：计划份额持有人大会在计划管理人职责终止后 6 个月内对被提名的计划管理人形成决议，该决议需经参加大会的计划份额持有人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）表决通过；

(3) 公告：计划管理人更换后，由计划原管理人在更换计划管理人的计划份额持有人大会决议生效后 2 日内在管理人官网公告；

(4) 交接：计划管理人职责终止的，计划管理人应妥善保管计划管理业务资料，及时向新任计划管理人办理计划管理业务的移交手续，新任计划管理人应及时接收。新任计划管理人应与计划托管人核对计划资产总值和净值；

(5) 计划名称变更：计划管理人更换后，如果原任或新任计划管理人要求，应按其要求替换或删除计划名称中与原计划管理人有关名称字样。

(6) 其他更换程序按照监管机构规定履行。

## 2、计划托管人的更换程序

(1) 提名：新任计划托管人由计划管理人或由单独或合计持有 10%以上（含 10%）计划份额的计划份额持有人提名；

(2) 决议：计划份额持有人大会在计划托管人职责终止后 6 个月内对被提名的计划托管人形成决议，该决议需经参加大会的计划份额持有人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）表决通过；

(3) 公告：计划托管人更换后，由计划管理人在更换计划托管人的计划份额持有人大会决议生效后 2 日内在管理人官网公告；

(4) 交接：计划托管人职责终止的，应当妥善保管计划财产和计划托管业务资料，及时办理计划财产和计划托管业务的移交手续，新任计划托管人应当及时接收。新任计划托管人应与计划管理人核对计划资产总值和净值；

(5) 其他更换程序按照监管机构规定履行。

## 3、计划管理人与计划托管人同时更换的条件和程序：

(1) 提名：如果计划管理人和计划托管人同时更换，由单独或合计持有计划总份额 10%以上（含 10%）的计划份额持有人提名新的计划管理人和计划托管人；

(2) 计划管理人和计划托管人的更换分别按上述程序进行；

(3) 公告：新任计划管理人和新任计划托管人应在更换计划管理人和计划托管人的计划份额持有人大会决议生效后 2 日内在管理人官网（或新任管理人官网）联合公告。

新任或临时计划管理人接受管理业务或新任或临时计划托管人接受计划财产和计划托

管业务前,原计划管理人或计划托管人应依据法律法规和资产管理计划合同的规定继续履行相关职责,并保证不对计划份额持有人的利益造成损害。原计划管理人或计划托管人在继续履行相关职责期间,仍有权按照本合同的规定收取计划管理费或计划托管费。

若本计划未设立计划份额持有人大会,计划管理人与计划托管人依法撤销资产管理业务资格与基金托管资格或者依法解散、被撤销、宣告破产,则本计划终止,计划管理人与计划托管人协商一致并提前公告。

4、若发生需采用更换管理人或托管人的方式进行合同变更的事项,因本计划未设立份额持有人大会导致无法进行合同变更的,则本计划终止。

(五)合同变更后,委托人、管理人和托管人应当按照变更后的合同行使相关权利,履行相应义务。管理人应当及时将产品合同变更的具体内容和生效时间告知资产委托人,并根据基金业协会的要求就产品合同重大事项变更向基金业协会备案。资产管理人通过本合同约定的方式之一通知资产委托人,即视为履行了告知义务。

(六)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,约定管理人保证资产管理计划资产投资收益、承担投资损失,或排除委托人自行承担投资风险和损失。

(七)资产管理计划展期的需满足下列事项:

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

2、资产管理计划展期没有损害委托人利益的情形;

3、中国证监会规定的其他条件。

资产管理计划展期的,应当符合资产管理计划的成立条件。

(八)资产管理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、经全体委托人、管理人和托管人协商一致决定终止的;

3、持有人大会决议(如有)提前终止资产管理合同;

4、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;

5、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;

6、持续五个工作日委托人少于 2 人的;

**7、当本计划规模连续 10 个工作日低于 1000 万元,且管理人要求终止的;**

8、未在证券投资基金业协会完成备案或不予备案的情形；

9、全体委托人提出退出申请，申请赎回本计划全部份额的；

10、因相关法律法规或监管规定发生变化，导致本计划或本计划的约定不符合上述法律法规及监管规定的，资产管理人与资产委托人无法达成一致的，本计划自动失效并终止。

11、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告证券投资基金业协会，前述第 8 项约定的情形除外。

### （九）财产清算

#### 1、清算小组

（1）管理人应当在发生终止情形之日起五个工作日内成立清算小组，并在清算小组成立后 30 个工作日内完成清算程序。

（2）清算小组成员由管理人、托管人等相关人员组成。清算小组可以聘用必要的工作人员。

（3）清算小组负责计划清算资产的保管、清理、估价、变现和分配。清算小组可以依法以计划的名义进行必要的民事活动。

#### 2、清算程序

（1）资产管理计划财产清算小组负责资产管理计划财产的保管、清理、估价、变现和分配。

（2）清算小组在本计划终止后 30 个工作日内编制计划财产清算报告，由资产管理人或销售机构按照资产委托人提供的联系方式或由资产管理人通过其公司网站告知资产委托人。资产委托人在此同意，上述报告不再另行审计，除非法律法规或监管部门要求必须进行审计的。

（3）清算小组根据计划财产清算报告完成清算财产的分配，本计划清算办理完毕。

（4）除合同当事人三方另有约定外，计划财产期末移交采取货币方式，在计划终止日前，资产管理人必须将投资组合内所有证券期货变现。合同终止后，资产管理计划仍持有可流通非货币资产的，在 5 个交易日内（含合同终止日当日）由资产管理人进行强制变现处理；对前述未能流通变现的证券期货在可流通变现后进行二次清算，并将变现后的资产按照资产委托人拥有份额的比例或本合同的约定，以货币形式全部分配给资产委托人。

#### 3、清算费用

清算费用是指清算小组在进行资产管理计划财产清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由清算小组优先从资产管理计划资产中支付。



#### 4、计划财产清算过程中剩余资产的分配

计划财产清算后的剩余资产按如下顺序进行分配，其中，在计划清算时免收资产委托人的退出费用（若有）：

- （1）支付计划财产清算费用；
- （2）缴纳计划所欠税款；
- （3）清偿计划债务；
- （4）清算后如有余额，按本计划收益分配的原则与顺序分配。

资产管理计划因受托财产流动性受限等原因延期清算的，管理人应当及时向中国证监会相关派出机构报告。本计划终止时有未能流通变现的证券，变现期间，继续计提管理费、托管费等费用，其估值方法继续按本合同第十八章的规定计算。**清算小组在该证券可流通变现后的五个工作日内强制变现**，在支付相关费用后仍按前述分配顺序进行再次分配并履行相应的告知义务，直至所有未能流通变现的证券全部清算完毕。

#### 5、清算未尽事宜

本合同中关于资产管理计划清算的未尽事宜以清算报告或资产管理人的通知为准。

#### 6、计划财产清算报告

本计划完成清算后，计划财产清算小组应编制计划财产清算报告，加盖资产管理人和资产托管人公章或业务章后以约定的方式通知资产委托人。

管理人应当在本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。

#### 7、相关账户的注销

（1）资产管理计划财产清算完成后，管理人负责注销本计划证券账户、期货账户等相关交易账户。

（2）资产管理计划财产清算完成后，托管人负责注销本计划托管账户，管理人应给予必要配合。

#### 8、资产管理计划财产清算账册及文件的保存

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）当事人违反本合同，应当承担违约责任，给合同其他当事人造成损失的，应当承担赔偿责任；如属本合同当事人双方或多方当事人的违约，根据实际情况，由违约方分别承

担各自应负的违约责任，若一方先行承担了应由另一方根据其过错应承担的责任，该方有权向另一方追偿。本合同能够履行的继续履行。但是发生下列情况，当事人应当免责或不承担责任：

1、管理人及和/或托管人按照中国证监会的规定或当时有效的法律法规的作为或不作为而造成的损失等。

2、管理人由于按照本合同规定的投资原则而行使或不行使其投资权而造成的损失等。

3、托管人由于按照管理人符合本合同约定的有效指令执行而造成的损失等。

4、在没有主观恶意或重大过失的情况下，资产托管人由于按照本合同规定行使托管职责而造成的损失等。

5、托管人对存放或存管在托管人以外机构的计划财产，或交由商业银行、期货公司、证券公司等其他机构负责清算交收的委托财产（包括但不限于保证金账户内的资金、期货合约等）及其收益，因该等机构包括但不限于欺诈、疏忽、过失、破产等原因给委托财产带来的损失等。

6、本协议各方对由于第三方（包括但不限于交易所、中登公司等）发送或提供的数据错误给本计划资产造成的损失等。

7、托管人对于存放在托管人之外的委托财产的任何损失，及基于从第三方机构（包括但不限于证券交易所、期货交所等）合法获得的信息及合理信赖上述信息而操作导致委托财产的任何损失。

8、不可抗力。

（二）资产管理人、资产托管人的任何一方如遇到不可抗力因素影响，应免去该方的部分或全部责任。不可抗力是指协议各方不能预见、不能避免、不能克服的客观情况，且在本协议生效之后发生的，使本备忘录当事人无法全部或部分履行的客观事件，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、法律变化或其他突发事件、交易所非正常暂停或停止交易及通讯故障、电力故障、系统故障、网络故障等不可控制的意外事件等。任何一方因不可抗力不能履行本协议时，应及时通知协议其他方，在合理期限内提供受到不可抗力影响的证明，并采取适当措施防止协议各方损失的进一步扩大。

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

(四) 由于资产管理人、资产托管人不可控制的因素导致业务出现差错, 资产管理人和资产托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查, 但是仍未发现错误的, 由此造成计划财产或委托人损失, 资产管理人和资产托管人免除赔偿责任。

(五) 一方依据本合同向另一方赔偿的损失, 仅限于直接损失。

## 二十六、法律适用和争议的处理

有关本合同的签署和履行而产生的任何争议及对本合同项下条款的解释, 均适用中华人民共和国法律法规(为本合同之目的, 在此不包括香港、澳门特别行政区及台湾地区法律法规), 并按其解释。

各方当事人同意, 因本合同而产生的或与本合同有关的一切争议, 合同当事人应尽量通过协商、调解途径解决。经友好协商未能解决的, 应向原告所在地有管辖权的人民法院提起诉讼。

争议处理期间, 合同当事人应恪守各自的职责, 继续忠实、勤勉、尽责地履行本合同规定的义务, 维护资产委托人的合法权益。

## 二十七、资产管理合同的效力

(一) 本合同是约定计划合同当事人之间权利义务关系的法律文件。资产委托人为法人的, 本合同自资产委托人、资产管理人和资产托管人加盖公章(或合同专用章)以及三方法定代表人/负责人或授权代表签字或盖章之日起成立; 资产委托人为自然人的, 本合同自资产委托人本人签名或盖章或授权的代理人签名或盖章、资产管理人和资产托管人加盖公章(或合同专用章)以及双方法定代表人/负责人或授权代表签章之日起成立。

(二) 资产管理合同的成立、生效及签署

### 1、合同的成立、生效

(1) 合同成立

本合同文本由资产管理人、资产托管人、资产委托人共同签署后合同即告成立。

(2) 合同生效

本合同生效应当同时满足如下条件:

a. 本合同经资产委托人、资产管理人与资产托管人合法签署;

b. 资产委托人认购或参与资金实际交付托管账户并经资产管理人和资产托管人确认成功，资产委托人获得资产管理计划份额；

c. 本资产管理计划依法有效成立；

本合同生效后，对本合同各方具有同等法律效力，除合同另有约定外，任何一方都不得单方解除。

## 2、合同的签署

(1) 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，由资产管理人、资产托管人、资产委托人共同签署。

如资产管理人、资产托管人及资产委托人签署纸质合同时，应签署一式肆份。资产管理人应在计划募集期或计划开放期完成后，将资产委托人签署的其中贰份纸质合同寄送给资产托管人，资产托管人在收到资产管理人寄送的本合同的前提下，尽合理努力保管资产委托人签署的纸质合同。因资产托管人收集资产委托人签署的纸质合同存在客观局限性，保管资产委托人签署的纸质合同不构成资产托管人的义务。

如资产管理人、资产托管人及资产委托人通过电子合同方式签署本合同，资产管理人、资产托管人及资产委托人认可电子合同的法律效力。若本计划使用的电子合同平台完成资产管理计划电子合同签署的，并不代表电子合同平台提供方承担资产管理计划销售、募集以及合同的订立、效力、履行等相关职责。

(2) 资产委托人在签署合同后方可进行认购、参与。

3、经资产管理人确认有效的资产委托人认购、参与、退出本资产管理计划的申请材料及销售机构出具的本资产管理计划认购、参与、退出业务受理有关凭证等为本合同的附件，是本合同的有效组成部分，与本合同具有同等的法律效力。

(三) 本合同自生效之日起对资产委托人、资产管理人、资产托管人具有同等的法律约束力。

(四) 委托人自签订本合同即成为本合同当事人。在本计划存续期，资产委托人自全部退出其持有计划份额之日起，不再是本资产管理计划的委托人和本合同的当事人。

(五) 本合同有效期为本合同生效日至本合同终止日。

## 二十八、其他事项

本合同项下的所有文件、文本，如开展业务时仅发送传真件或扫描件的，管理人应定期

将相关原件寄送给托管人，并确保原件与传真件或扫描件保持一致。在原件未寄达托管人之前，传真件或扫描件效力等同于原件，如其与原件不一致，以传真件或扫描件为准。

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监管规定协商解决。

（以下无正文）

(请资产委托人务必确保填写的资料正确有效,如资料信息发生变更的,需及时通知管理人更新。如因资产委托人填写错误或未及时更新导致的任何损失,资产管理人和资产托管人不承担任何责任)

**委托人请填写:**

(一) 委托人

1、自然人

姓名:

证件名称: 身份证、军官证、护照、其他

证件号码:

通讯地址:

邮编:

联系电话:

电子邮箱:

2、法人或其他组织

名称:

营业执照号码/统一社会信用代码:

组织机构代码证号码:

法定代表人或负责人:

通讯地址:

邮编:

联系电话:

电子邮箱:

(二) 资产管理结算账户

委托人认购、参与本计划的划出账户与退出本计划的划入账户,必须为以委托人名义开立的同一个账户。特殊情况导致认购、参与和退出本计划的账户名称不一致时,委托人应出具符合相关法律法规规定的书面说明并提供相关证明。账户信息如下:

账户名称:

账号:

开户银行名称:

(三) 认购\参与金额

签署本合同之委托人确认认购\参与如下金额:人民币\_\_\_\_\_元(大写人民币\_\_\_\_\_元,不含认/申购费)。

(以下无正文)



**附件一：**

**专用清算账户及资金划拨专用账户**

注意：账户如有变更，请及时通知相关各方。

**托管专户**

户 名：长江期货-长享顺添利4号债券集合资产管理计划

账 号：

开户银行：

**管理人管理费收款账户**

户 名：长江期货股份有限公司

账 号：421860035018001843401

开户银行：交行武汉天安支行

**管理人税费收款账户：**

户 名：长江期货股份有限公司

账 号：421860035018001843401

开户银行：交行武汉天安支行

**托管人托管费收款账户**

账户名：证券公司客户资产管理计划托管业务收入

账号：411010191675000122

开户行：兴业银行股份有限公司武汉分行（作业中心）

大额支付行号：309521016003



## 附件二：授权通知书

## 授权通知书

兴业银行股份有限公司武汉分行：

根据贵行与我公司于【】年【】月【】日签署的编号为【】的《长江期货-长享顺添利4号债券集合资产管理计划》，我公司授权以下人员（以下简称“被授权人”）代表我公司向贵行发送托管账户项下资金投资指令以及其他相关通知。现将投资指令发送用章样本及有关人员签字样本及相应权限留存贵行，请在使用时核验。上述被授权人在授权范围内向你行发送投资指令的真实性、准确性及合法性由我公司负全部责任。本授权从【】年【】月【】日起生效，授权期限同上述合同有效期，如有变更将另行通知。

姓名	权限	签字样本	印章样本
	经办		
	复核		
	审批		
指令发送用章	(用章样本)		
备注：1、指令发送用章须与被授权人个人签字或个人印章同时出具，方为有效。 2、权限类型：经办、复核、审批。			

管理人：（公章）

法定代表人（或授权代理人）：

【】年【】月【】日

附件三：投资指令（格式）

长江期货-长享顺添利 4 号债券集合资产管理计划投资指令

加急年月日第号投资指令（长江期货内部编号）

付款户名：	收款户名：
付款账号：	收款账号：
开户行：	开户行：
大额系统支付行号：	大额系统支付行号：
付款金额（小写）	
付款金额（大写）	
付款日期：年 月 日	到帐日期：年 月 日 时
划款用途（事由）：	
管理人预留指令发送章：	托管人预留签章（印章）
管理人预留签发人印章：	托管人预留签字：
经办人：	签发人：
复核人：	复核人：
审批人：	经办人：
	密押（托管分部填写）：
	提示支行信息：
	（1）请将事由内容作为发报摘要
	（2） <input type="checkbox"/> 加急 <input type="checkbox"/> 交换 <input type="checkbox"/> 其他_____
托管人反馈信息栏： 1、该指令已执行 2、该指令未执行，原因如下：	开户行反馈信息栏： 1、该指令已执行 2、该指令未执行，原因如下：  核押：                复核：                经办： 支 行签章（印章）

附件四：托管业务联系人名单

长江期货股份有限公司联系人

姓名	联系电话	手机号码	传真	邮箱	岗位
邓达	027-65261309	13476023399	027-85860103	dengda1@cjsc.com.cn	估值审核岗
王文静	027-65261583	15827463195	027-85860103	wangwj3@cjsc.com.cn	投资监督
张伟伟	027-65261536	15271864546	027-85860103	zhangww5@cjsc.com.cn	清算核算
唐雪丽	027-65261587	17607194260	027-85860103	tangxl2@cjsc.com.cn	业务协调人
授权印鉴	印章样本				

注：甲方指定第一联络人为估值审核岗。

授权印鉴供除投资指令外的业务往来使用。



### 兴业银行股份有限公司武汉分行联系人

岗位	姓名	分机	邮箱	传真电话
交易	聂磊	027-86798895	nielei@cib.com.cn	027-86798933
	王帅军	027-86657632	wangshuaijun@cib.com.cn	027-86798933
清算核算	张璐茜	027-86657632	zhanglucyhh@cib.com.cn	027-86798933
	王帅军	027-86657632	wangshuaijun@cib.com.cn	027-86798933
	高一	027-87821331	yolanda0213@cib.com.cn	027-86798933
	高琪媛	027-86657632	gaoqiyuan@cib.com.cn	027-86798933
投资监督	周全	027-87821830	zhouquan13@cib.com.cn	027-86798933
交易数据发送邮箱	深证通小站：k0222（首选）、cibac@cib.com.cn			
指令接收邮箱	wuhantgy@cib.com.cn、wangshuaijun@cib.com.cn、nielei@cib.com.cn、 yolanda0213@cib.com.cn、zhanglucyhh@cib.com.cn、 gaoqiyuan@cib.com.cn、husiyun@cib.com.cn			
对账单接收邮箱	wangshuaijun@cib.com.cn、nielei@cib.com.cn、 yolanda0213@cib.com.cn、zhanglucyhh@cib.com.cn			
合同协议资料寄送地址	武汉市武昌区中北路 108 号兴业银行大厦 19 楼资产托管部			

兴业银行股份有限公司武汉分行

年 月 日

附件五：

编号：

业务人员变更通知单

：

因业务开展需要，我方（岗位）原联系人将于\_\_\_\_年\_\_\_\_月\_\_\_\_日终止原有业务授权，该岗位由我方\_\_\_\_\_担任，该人员已获得我方业务负责人的相关授权，授权包括\_\_\_\_\_。同时变更业务联系电话为：\_\_\_\_，传真为：\_\_\_\_；预留印鉴为：

（预留印鉴样本）

特此通知！

长江期货股份有限公司

年 月 日

（加盖公章）

