

西南证券日新泽达 1 号  
集合资产管理计划  
资产管理合同（2024 年 4 月版）

（合同编号：XN-RXZD-01-1）

管理人：西南证券股份有限公司

托管人：招商银行股份有限公司重庆分行

## 目录

|                                  |    |
|----------------------------------|----|
| 一、前言                             | 1  |
| 二、释义                             | 1  |
| 三、承诺与声明                          | 5  |
| 四、当事人及权利义务                       | 7  |
| 五、资产管理计划的基本情况                    | 12 |
| 六、资产管理计划的募集                      | 13 |
| 七、资产管理计划的成立与备案                   | 16 |
| 八、资产管理计划的参与、退出与转让                | 17 |
| 九、份额持有人大会及日常机构                   | 23 |
| 十、资产管理计划份额的登记                    | 23 |
| 十一、资产管理计划的投资                     | 23 |
| 十二、服务机构及投资顾问（如有）                 | 27 |
| 十三、分级安排（如有）                      | 27 |
| 十四、利益冲突及关联交易                     | 27 |
| 十五、投资经理的指定与变更                    | 29 |
| 十六、资产管理计划的财产                     | 29 |
| 十七、投资指令的发送、确认和执行                 | 30 |
| 十八、越权交易的界定                       | 32 |
| 十九、资产管理计划财产的估值和会计核算              | 33 |
| 二十、资产管理计划的费用与税收                  | 38 |
| 二十一、资产管理计划的收益分配                  | 40 |
| 二十二、信息披露与报告                      | 41 |
| 二十三、风险揭示                         | 43 |
| 二十四、资产管理合同的变更、终止与财产清算            | 48 |
| 二十五、违约责任                         | 53 |
| 二十六、争议的处理                        | 54 |
| 二十七、资产管理合同的效力                    | 54 |
| 二十八、通知和送达                        | 55 |
| 二十九、或有事件                         | 56 |
| 附件 1：西南证券日新泽达 1 号集合资产管理计划交易监督事项表 | 60 |
| 附件 2 管理人和托管人关联方名单                | 61 |
| 附件 3 电子指令启用函（样本）                 | 65 |

## 一、前言

为规范西南证券日新泽达 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《西南证券日新泽达 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《中华人民共和国民法典》《中华人民共和国证券法》《中华人民共和国证券投资基金法》《中华人民共和国期货和衍生品法》《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》（以下简称《指导意见》）、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》（以下简称《管理办法》）、《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》（以下简称《运作规定》）、《集合资产管理计划资产管理合同内容与格式指引》等法律法规、中国证监会和中国证券业协会、中国证券投资基金业协会（以下简称“基金业协会”或“协会”）的有关规定，投资者、管理人、托管人在平等自愿、公平、诚实信用原则的基础上订立本合同。本合同是规定当事人之间基本权利义务的法律文件，当事人按照《管理办法》《运作规定》《指导意见》《西南证券日新泽达 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。

管理人应当按照规定向协会办理资产管理计划设立、变更备案，并及时报送资产管理计划的运行情况、风险情况以及终止清算报告等信息，如中国证监会、基金业协会更新了相关规则或制定了其他相关规则，则从其规则执行。

协会办理资产管理计划备案不代表协会对资产管理计划的合规性、投资价值及投资风险作出保证和判断，也不表明协会对备案材料的真实性、准确性、完整性作出保证。投资者应当充分了解资产管理计划的投资范围、投资策略和风险收益等信息，根据自身风险承受能力审慎选择资产管理计划，自主判断投资价值，自行承担投资风险。本合同中关于信息披露以及向证监会、基金业协会、证监会派出机构报备条款，如中国证监会、基金业协会更新了相关规则或制定了其他相关规则，则从其最新规则执行。

## 二、释义

本合同中除非文义另有所指，下列词语具有如下含义：

|                             |                                                                      |
|-----------------------------|----------------------------------------------------------------------|
| 《资产管理合同》或资产管理合同或管理合同或本合同或合同 | 指《西南证券日新泽达 1 号集合资产管理计划资产管理合同》及对其的任何修订和补充                             |
| 《管理办法》                      | 指中国证监会公布的 2023 年 3 月 1 日起施行的《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》（证监会令【第 203 号】）    |
| 《运作规定》                      | 指中国证监会公布的 2023 年 3 月 1 日起施行的《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》（证监会公告[2023]2 号） |

|                                   |                                                                                               |
|-----------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------|
| 《电子签名合同指引》                        | 指《证券公司集合资产管理电子签名合同操作指引》                                                                       |
| 《电子签名约定书》                         | 指根据《电子签名合同指引》制订的法律文件，明确投资者使用电子签名方式签署合同的相关事项。投资者在签署电子合同前，必须签署电子签名约定书                           |
| 中国                                | 指中华人民共和国                                                                                      |
| 法律法规                              | 指中国现时有效并公布实施的法律、行政法规、行政规章及规范性文件、地方法规、地方规章及规范性文件                                               |
| 元                                 | 指中国法定货币人民币，单位“元”                                                                              |
| 集合资产管理计划或资产管理计划或本集合计划或集合计划或本计划或计划 | 指依据《西南证券日新泽达 1 号集合资产管理计划资产管理合同》和《西南证券日新泽达 1 号集合资产管理计划说明书》所设立的西南证券日新泽达 1 号集合资产管理计划             |
| 集合资产管理计划说明书或说明书                   | 指《西南证券日新泽达 1 号集合资产管理计划说明书》                                                                    |
| 中国证监会                             | 指中国证券监督管理委员会                                                                                  |
| 集合资产管理计划管理人或管理人                   | 指西南证券股份有限公司（简称“西南证券”）                                                                         |
| 集合资产管理计划托管人或托管人                   | 指招商银行股份有限公司重庆分行（简称“招商银行重庆分行”）                                                                 |
| 销售机构                              | 指西南证券股份有限公司及与管理人签订代销协议的金融机构                                                                   |
| 份额登记机构或注册登记机构                     | 指办理登记、存管、过户、清算和结算等注册登记的机构。本集合计划的注册登记机构为西南证券股份有限公司（简称“西南证券”）                                   |
| 集合资产管理合同当事人                       | 指受《西南证券日新泽达 1 号集合资产管理计划资产管理合同》约束，根据《西南证券日新泽达 1 号集合资产管理计划资产管理合同》享受权利并承担义务的法律主体，包括管理人、托管人和份额持有人 |
| 份额持有人                             | 指依《资产管理合同》和《说明书》合法取得份额的投资者                                                                    |
| 个人投资者                             | 指依据中华人民共和国有关法律法规及其他有关规定可以投资于集合资产管理计划的自然人投资者                                                   |
| 机构投资者                             | 指依法可以投资本集合计划，在中国境内合法注册登记或经有权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                                      |
| 投资者或参与者                           | 指上述投资者（个人投资者和机构投资者）的合称                                                                        |
| 合格投资者                             | 指具备相应风险识别能力和风险承受能力，且符合                                                                        |

|           |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
|-----------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|           | <p>下列条件的自然人、法人或者其他组织，即：</p> <p>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：家庭金融净资产不低于300万元，家庭金融资产不低于500万元，或者近3年本人年均收入不低于40万元；</p> <p>2、最近1年末净资产不低于1000万元的法人单位；</p> <p>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、金融资产管理公司、信托公司、保险公司、保险资产管理机构、财务公司以及中国证监会认定的其他机构；</p> <p>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；</p> <p>5、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）；</p> <p>6、中国证监会视为合格投资者的其他情形。</p> |
| 初始募集期     | 指自本集合计划启动份额发售推广之日起不超过60天的期间，管理人有权根据募集情况调整提前终止或延长初始募集期                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
| 存续期或管理期限  | 本集合计划存续期为9年，到期可以展期。符合终止的条件，本集合计划可提前终止                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
| 工作日       | 指上海证券交易所、深圳证券交易所、北京交易所的正常交易且管理人和托管人均办理相关业务的日期                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
| 日、天       | 指自然日                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |
| T日        | 指日常参与、退出或办理其他集合资产管理计划业务的工作日                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |
| T+n日      | 指自T日起第n个工作日（不包含T日）                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
| 封闭期       | 指集合计划成立后的封闭运作时间段                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
| 开放日       | 指集合计划成立后，为投资者办理参与或退出集合计划业务的工作日                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
| 年、年度、会计年度 | 指公历每年1月1日起至当年12月31日为止的期间                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
| 参与        | 指在本集合资产管理计划投资者购买本集合资产管理计划份额的行为                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
| 认购        | 指在集合资产管理计划募集期内投资者申请参与集合资产管理计划的行为                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |

|                     |                                                                                                                                                                                          |
|---------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 退出                  | 指投资者按集合资产管理合同规定的条件要求收回全部或部分受托财产的行为                                                                                                                                                       |
| 巨额退出                | 单个开放日，投资者当日累计净退出申请份额（退出申请总份额扣除参与申请总份额之后的余额）超过上一工作日计划总份额数的 10% 时，即为巨额退出                                                                                                                   |
| 管理人自有资金或自有资金        | 指管理人参与本计划的本金                                                                                                                                                                             |
| 集合资产管理计划资产或委托投资资产   | 指依据有关法律法规和投资者的意愿，投资者参与的本集合资产管理计划净额                                                                                                                                                       |
| 集合资产管理计划收益          | 指集合计划利息收入、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                                                                                                                                                   |
| 集合资产管理计划资产总值        | 指集合资产管理计划通过发行计划份额方式募集资金，并依法进行有价证券交易等资本市场投资所形成的各类资产的价值总和                                                                                                                                  |
| 集合资产管理计划资产净值        | 指集合资产管理计划资产总值扣除负债后的净资产值                                                                                                                                                                  |
| 集合资产管理计划份额净值或单位净值   | 指集合资产管理计划资产净值除以计划总份额所得的每份集合计划资产的价值                                                                                                                                                       |
| 集合资产管理计划份额累计净值或累计净值 | 指集合资产管理计划份额净值与份额累计分红之和                                                                                                                                                                   |
| 集合资产管理计划份额面值        | 指人民币 1.00 元                                                                                                                                                                              |
| 集合资产管理计划资产估值        | 指计算评估集合资产管理计划资产和负债的价值，以确定集合资产管理计划资产净值的过程                                                                                                                                                 |
| 管理人指定网站或管理人网站       | 指 <a href="http://www.swsc.com.cn">www.swsc.com.cn</a>                                                                                                                                   |
| 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，包括但不限于政府干预，国家或者地方政策调整、社会安全事件、洪水、地震及其它自然灾害、战争、骚乱、火灾、突发性公共卫生事件、政府征用、没收、法律法规变化或其他突发事件、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 |
| 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，在本资产管理合同的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。                                                                                                                                               |
| 流动性受限资产    | 指由于法律法规、监管、合同或者操作障碍等原因无法以合理价格予以变现的资产，包括到期日在10个交易日以上的逆回购与银行定期存款（含协议约定有条件提前支取的银行存款）、资产支持证券（票据）、流动受限的新股以及非公开发行股票、停牌股票、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券和非金融企业债务融资工具等资产。 |
| 7个工作日可变现资产 | 包括可在交易所、银行间市场正常交易的股票、债券、非金融企业债务融资工具、期货及标准化期权合约以及同业存单，7个工作日内到期或者可支取的逆回购、银行存款，7个工作日内能够确认收到的各类应收款项等。                                                       |

### 三、承诺与声明

#### （一）管理人承诺与声明

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

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

3、按照《基金法》恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用受托财产，但不保证受托财产一定盈利，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。管理人承诺其提供的电子签约平台满足《中华人民共和国电子签名法》要求，获得中国金融认证中心（CFCA）权威证书，能够避免恶意篡改、伪造电子签章、确保签名数据安全有效。

根据《中华人民共和国反洗钱法》等反洗钱相关法律法规要求履行反洗钱义务，包括但不限于客户身份识别、客户身份资料和交易记录保存和可疑交易报告，并为资产托管人开展反洗钱工作提供充分的协助，法律法规另有规定的除外。

#### （二）托管人承诺与声明

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受托财产，履行信义义务以及本合同约定的其他义务。

2、根据法律、行政法规、中国证监会及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、资产托管人对受托财产的保管，并非对受托财产本金或收益的保证或承诺。

4、根据《中华人民共和国反洗钱法》等反洗钱相关法律法规要求履行反洗钱义务，并为资产管理人开展反洗钱工作提供充分的协助，法律法规另有规定的除外。

#### （三）投资者承诺与声明

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，不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。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投资者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作出任何承诺，了解“卖者尽责，买者自负”的原则，投资于本计划将自行承担投资风险。

4、投资者承诺遵守《中华人民共和国反洗钱法》等反洗钱相关法律法规，承诺参与集合资产管理业务的资金来源不属于违法犯罪所得及其收益。投资者开展本业务，承诺出示真实有效的身份证件或者其他身份证明文件，积极配合管理人及托管人履行反洗钱职责，不借助本业务进行洗钱等违法犯罪活动。

5、已知悉《中华人民共和国反洗钱法》《金融机构客户身份识别和客户身份资料及交易记录保存管理办法》《金融机构大额交易和可疑交易报告管理办法》《中国人民银行关于加强反洗钱客户身份识别有关工作的通知》等反洗钱相关法律法规的规定，并严格遵守上述规定，不会违反任何前述规定；承诺用于投资的资金来源不属于违法犯罪所得及其收益；承诺投资的资金来源和去向不涉及洗钱、恐怖融资和逃税等行为；承诺出示真实有效的身份证件或者其他身份证明文件，提供真实有效的业务性质与股权或者控制权结构、受益所有人信息等资料；承诺所提供的信息、资料发生任何变更或有效身份证明文件失效、过期的，应及时告知管理人，以管理人认可的方式进行修改，并承担因未能及时以管理人认可方式对信息、资料进行修改而导致的后果、风险和损失；承诺积极履行反洗钱职责，不借助本业务进行洗钱等违法犯罪活动。

6、投资者承诺及保证：符合《运作规定》等法律法规、监管机构及自律组织对于本计划投资者的各项要求，包括但不限于：

（1）投资者具备相应风险识别能力和风险承担能力，为符合要求的合格投资者；

（2）投资者以其管理的资产管理产品投资于本集合计划的，应如实告知管理人，保证该产品的所有投资者为符合法律法规规定的合格投资者且受托资金来源合法合规，且均非资产管理产品；投资者承诺投资本集合计划不存在违反监管要求的产品嵌套，以及以投资本集合计划规避投资范围、杠杆约束等监管要求的违法违规行为。若投资者以其管理的资产管理产品申请认购/参与本集合计划，管理人认为可能导致本集合计划违反监管要求的产品嵌套规定的，管理人有权拒绝其认购/参与申请。

#### 四、当事人及权利义务

##### 投资者

投资者基本情况在资产管理合同签署页列示。

集合计划将设定为均等份额，除资产管理合同另有约定外，每份份额享有同等权益，承担同等风险。

##### 管理人

机构名称：西南证券股份有限公司

法定代表人：吴坚

联系人：王寒

住所：重庆市江北区金沙门路32号

通讯地址：重庆市江北区金沙门路32号

邮政编码：400025

联系电话：023-67603514

邮箱：whan@swsc.com.cn

托管人：招商银行股份有限公司重庆分行

名称：重庆市北部新区星光大道88号

法定代表人/负责人：陈磊

联系人：金小圣

住所：重庆市北部新区星光大道88号

通讯地址：重庆市北部新区星光大道88号

联系电话：023-67031812

邮政编码：401121

##### （一）投资者的权利和义务

###### 1、投资者的权利，包括但不限于：

- （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、行政法规、中国证监会及基金业协会规定的和本合同约定的的其他权利。

###### 2、投资者的义务，包括但不限于：

- （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，应当向管理人充分披露实际投资者和最终资金来源；

（4）认真阅读并签署风险揭示书；

（5）按照资产管理合同约定支付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（含业绩报酬（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，承担资产管理计划亏损或者终止的有限责任；

（7）按照规定向管理人或者资产管理计划销售机构提供信息资料以及身份证明文件，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，并确保提供的信息是真实、有效和完整的。如上述资料、信息发生变更时，及时向管理人提供变更后的证明资料。对具备合理理由怀疑涉嫌洗钱、恐怖融资的投资者，接受管理人或托管人将按照反洗钱监管规定采取的必要管控措施或单方面终止合同；

（8）不得违反资产管理合同的约定干涉管理人的投资行为；

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

（10）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）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、投资信息等，依法依规提供信息的除外；

（12）不得违规转让其所拥有的集合计划份额；

（13）保证其所做出的全部声明、保证与承诺在投资本集合计划存续期间持续有效，如相关情况出现变化需及时告知管理人，管理人有权根据法律法规、监管规定、自律规则做出相关处理，投资者将予以配合并承担相关后果和损失；

（14）法律、行政法规、中国证监会及基金业协会规定的和本合同约定的其他义务。

## （二）管理人的权利和义务

### 1、管理人的权利，包括但不限于：

（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（含业绩报酬（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）自行提供或者委托经中国证监会、基金业协会认可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；

（5）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；

（6）如投资者先前提交的身份证件或者身份证明文件已过期，没有在合理期限内更新且没有提出合理理由的，管理人有权采取限制投资者办理认购、参与等新业务以及限制其资金转出等措施；

（7）按照本合同的约定，拒绝或暂停办理集合计划的参与、退出事宜，终止本集合计划的运作；

（8）在不损害投资者实质利益的前提下，管理人有权根据管理运作实际情况对集合计划管理运作过程中的相关事项进行调整或补充明确，并按照资产管理合同约定进行信息披露；

（9）法律、行政法规、中国证监会、证券投资基金业及基金业协会规定的和本合同约定的其他权利。

2、管理人的义务，包括但不限于：

（1）依法办理资产管理计划销售、登记、备案事宜；

（2）按照基金业协会要求报送资产管理计划产品运行信息，中国证监会、基金业协会更新了相关规则或制定了其他相关规则，则从其最新规则执行；

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

（4）制作风险揭示书，向投资者充分揭示相关风险；

（5）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；

（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，对所管理的不同资产管理计划的受托财产分别管理，分别记账，进行投资；

（8）按照资产管理合同约定接受投资者和托管人的监督；

（9）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；

（10）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；

（11）对《管理办法》第三十八条第（五）项规定的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；

（12）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；

（13）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；

（14）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；

（15）编制向投资者披露的资产管理计划季度、年度等定期报告；

（16）办理与受托财产管理业务活动有关的信息披露事项；

（17）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；

（18）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；

（19）对于托管人违反法律、行政法规和规定或者资产管理合同，对资产管理计划财产以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，并报告中国证监会的规定，相关派出机构；

（20）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以及其他当事人利益的活动；不得向管理人以及任何第三人输送利益；不得委托第三人运作资产管理计划财产；

（21）不得利用资产管理计划，通过直接投资、投资其他资产管理产品或者与他人进行交叉融资安排等方式，违规为本机构及其控股股东、实际控制人或者其他关联方提供融资；

（22）建立并保存投资者名单；

（23）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；

（24）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、投资信息等，依法依规提供信息的除外；

（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、基金业协会并通知托管人和投资者；

（26）资产管理人应按照《中华人民共和国反洗钱法》等有关反洗钱的法律法规和监管要求履行反洗钱义务，并为资产托管人开展反洗钱工作提供充分的协助，在法律允许范围内，配合资产托管人开展客户身份识别特别是受益所有人的识别工作，并提供必要的客户信息、资料等。根据《中国人民银行关于加强反洗钱客户身份识别有关工作的通知（银发【2017】235号）》（以下称“235号文”）、《中国人民银行关于进一步做好受益所有人身份识别工作有关问题的通知（银发【2018】164号）》（以下称“164号文”）的相关要求，将本计划直接持有或穿透后持有超过25%权益份额的自然人作为托管产品的受益所有人；不存在上述条件自然人的，将本产品基金经理或者直接操作管理基金的自然人判定为托管产品受益所有人；

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

（28）除必要的披露及监管要求外，不得以资产托管人的名义做营销宣传；

（29）管理人应妥善保管销售机构提供的产品投资者的身份资料信息（如有），如托管银行应法律法规或监管要求需要，管理人应积极予以提供或协助；

（30）在从事关联交易时应按照市场公允价格进行交易，并对违反市场公允价格交易原则的交易行为给资管计划财产/份额持有人造成的损失承担赔偿责任；

（31）法律、行政法规、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。

（三）托管人的权利与义务

1、托管人的权利，包括但不限于：

（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、行政法规、中国证监会及基金业协会规定的和本合同约定的的其他权利；

2、托管人的义务，包括但不限于：

（1）安全保管资产管理计划财产；

（2）不得为托管人以及任何第三人输送利益，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）对资产管理计划财务会计报告、年度报告出具书面意见；

（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，不得泄露资产管理计划的投资计划、投资意向、投资信息等，依法依规提供信息的除外；

（12）向管理人披露托管人及其控股股东、实际控制人或者其他关联方，以及前述机构发行的证券或者承销期内承销的证券等信息。托管人及其控股股东、实际控制人或者其他关联方的名单详见附件，后续以托管人对外发布的半年报、年报信息为准。前述机构发行的证券或者承销期内承销的证券等信息具体以托管人公开市场披露的主体信息和证券信息为准。因托管人未及时履行前述义务，导致管理人信息披露不准确、不及时，管理人不承担责任。

（13）保存资产管理计划的会计账册，妥善保存有关的合同、协议、交易记录等文件资料，保存期限自资产管理计划终止之日起不得少于20年；

（14）监督管理人的投资运作，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；

（15）投资于《管理办法》第三十八条第（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；

（16）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：西南证券日新泽达 1 号集合资产管理计划

（二）类型：混合偏权益类集合资产管理计划

（三）运作方式：开放式集合资产管理计划

（四）投资目标、投资范围、投资比例、产品风险等级

### 1、投资目标

在严格控制风险的前提下，以成长投资策略为基本出发点，兼顾公司价值，通过发掘全市场具有独特竞争力成长型上市公司进行投资，选择具备高性价比投资标的构建组合，力争实现资产的长期稳健增值。

### 2、投资范围

交易所交易的股票（包括沪深交易所、北京交易所），公募基金，国债逆回购，银行活期存款。

### 3、投资比例

（1）权益类资产：依市值合计占集合计划当日资产总值的比例为 20%（含）-100%（不含）；

（2）固定收益类资产：依市值合计占集合计划当日资产总值的比例为 0-80%（不含）；

（3）集合计划总资产占净资产的比例不超过 140%；

（4）集合计划持有同一资产的比例不得超过当日集合计划资产净值的 25%；管理人管理的全部集合计划投资于同一资产的资金，不得超过该资产的 25%。银行活期存款除外。同一资产的认定及计算方式：各类股票、公募基金、国债逆回购【以市值】进行计算；

本计划投资于其他资产管理产品的，大类资产配置比例、总资产占净资产比例应当按照穿透原则合并计算，且应当符合监管规定和资产管理合同的约定。

### 4、产品风险等级

本集合计划属于 R4（中高风险）等级产品，适合风险承受能力为 C4 型（积极型）及以上等级的投资者。

### （五）存续期限

本集合计划存续期为 9 年，自计划成立日起算，到期可以展期，但需符合本合同约定的展期条件。符合终止条件的，本集合计划可提前终止。

### （六）集合计划份额面值

各方同意本集合计划份额的初始募集面值为人民币 1.00 元。

### （七）集合计划的最低初始募集规模

本集合计划的最低初始募集规模为 1000 万元。

### （八）资产管理计划的费用

本集合计划认购费率：【0】%；参与费率：【0】%；退出费率：【0】%。

从集合计划财产中支付的费用种类如下：

1、管理费（固定管理费和业绩报酬）

（1）固定管理费：固定管理费率为年费率【1】%。在通常情况下，固定管理费按前一自然日计划资产净值的年费率计提。

（2）管理人的业绩报酬

在分红权益登记日、投资者退出日或集合计划清算终止日，如集合计划年化收益率 R 超过【10】%/年的，管理人提取超额收益的 20%作为业绩报酬。

2、托管费：托管费率为年费率【0.03】%。在通常情况下，托管费按前一自然日计划资产净值的年费率计提。

3、集合计划财产开立账户需要支付的费用、资金结算汇划费（含赎回划款手续费）、账户管理与维护费、网银开户相关费用等；

4、集合计划财产的证券、期货（如有）等账户的开户费用以及证券、期货（如有）等投资交易费用（包括但不限于本集合计划所有金融工具的交易费、工商登记及变更费用（如有）、经手费、印花税、过户费、手续费、经纪商佣金等类似性质的费用）；

5、注册登记费；

6、本集合计划存续期间发生的信息披露费用、受托财产投资运作相关的或者为维护投资者利益支出的会计师费、审计费、律师费、仲裁费、诉讼费、保全费等合理费用；

7、按照法律法规及本合同的约定可以在受托财产中列支的其他费用。

（九）集合计划的分级安排（如有）

本集合计划无分级安排。

（十）集合计划的服务机构

本集合计划的份额登记机构、估值与核算、信息技术系统服务机构为西南证券股份有限公司。

## 六、资产管理计划的募集

（一）集合计划的募集对象

集合计划的投资者应当是具备相应风险识别能力和风险承受能力，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：家庭金融资产净值不低于 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、财务公司以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、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）；

6、中国证监会视为合格投资者的其他情形。

投资者参与本集合计划前，应当首先是销售机构的客户。

## （二）集合计划的募集方式

1、集合计划的销售机构

西南证券股份有限公司。

2、集合计划的募集方式

本集合计划将通过销售机构下属的营业网点面向合格投资者通过非公开方式进行募集。

销售机构应将资产管理合同、集合资产管理计划说明书等正式募集文件以纸质资料或电子资料方式置备于销售机构营业场所。本计划应当面向合格投资者进行募集，合格投资者累计不得超过 200 人。销售机构应当了解投资者的投资需求和风险偏好，详细介绍产品特点并充分揭示风险，推荐与投资者风险承受能力相匹配的集合计划，引导投资者审慎作出投资决定。禁止通过签订保本保底补充协议等方式，或者片面宣传资产管理计划管理人及其管理的产品、投资经理等的过往业绩和商业贿赂等不正当手段推广集合计划，禁止向风险识别能力和风险承受能力低于产品风险等级的投资者销售本集合计划。

管理人及销售机构应当采取有效措施，并通过管理人、基金业协会、中国证监会电子化信息披露平台或者中国证监会认可的其他信息披露平台，客观准确披露集合计划备案信息、风险收益特征、投诉电话等，使投资者详尽了解本集合计划的特性、风险等情况及投资者的权利、义务，但不得通过广播、电视、报刊及其他公共媒体推广本集合计划。

## （三）集合计划的募集期限

具体募集期间以管理人的募集公告为准，但募集期自本集合计划份额发售之日起最长不超过 60 个自然日。管理人有权根据本集合计划销售的实际情况提前结束或延长募集期，并通过管理人网站公告方式及时通知销售机构、托管人和投资者，集合计划自公告所载募集结束日期起不再接受认购申请。

## （四）集合计划募集账户信息

本集合计划销售募集账户由计划管理人自行开立，销售募集账户的开户行、账户名称、账户号码及监督机构等信息以计划管理人或销售机构届时公告为准。投资者可通过登录管理人网站进行查询。

## （五）集合计划的认购事项

1、认购费用及认购份额的计算方式

（1）认购费率 0%

（2）认购份额的计算方法

认购份额的计算公式

在募集期参与认购的：认购份额=（认购金额+认购资金在募集期内的利息）/1.00 元

认购份数保留小数点后两位，小数点后第三位四舍五入。

## 2、认购的程序和认购申请的确认

（1）投资者按销售机构指定营业网点的具体安排，在规定的交易时间段内办理认购；

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

（3）投资者通过纸质合同和/或电子合同的方式签署本合同后，方可申请认购集合计划。

（4）本集合计划的募集规模上限以管理人的募集公告为准，如募集期间，募集资金规模超过募集公告上限的，管理人将于超限日发布公告，并将按照管理人公告的方式进行资金规模控制。本集合计划人数规模上限为 200 人。认购申请采取“时间优先、时间相同情况下金额优先”原则进行。认购是否有效以份额登记机构的确认为准。

认购申请经管理人确认后有效，构成本合同的有效组成部分；

（5）投资者提交认购申请后，可于集合计划成立后到办理参与的营业网点或网上交易等周边系统查询参与确认情况。投资者认可管理人对其认购参与有效性的确认，除经管理人同意外，不再要求管理人提供任何有效性确认的资料。

（6）投资者认购申请确认后成功，其认购申请和认购资金不得撤销；

（7）销售机构受理认购申请并不表示对该申请是否成功的确认，而仅代表销售机构确实收到了该申请。申请是否有效应以份额登记机构的确认并且资产管理合同生效为准。投资者应在本合同生效后到各销售网点查询最终确认情况和有效认购份额。确认无效的认购申请，销售机构将退还投资者已交付的认购款项。无效申请退款不支付利息。

## 3、初始认购资金的管理及利息处理方式

管理人应当将集合计划募集期投资者的认购资金存入本集合计划的募集结算资金专用账户，在资产管理计划成立前，任何机构和个人不得动用。投资者的认购资金在募集结算资金专用账户中实际产生的利息按照银行同期活期存款利率计算，并将折算为计划份额归投资者所有。认购资金的利息以份额登记机构的记录结果为准。

### （六）集合计划的最低认购金额和支付方式

本集合计划单个投资者首次最低认购金额为人民币 100 万元（不包含认购费），本集合计划可多次认购，追加认购不低于 1 万元且应为 1 万元的整数倍。

投资者认购本集合计划，以人民币货币资金形式交付。本集合计划不接受非现金方式认购，在管理人直销渠道认购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管理人直销渠道募集结算专用账户，在销售机构认购的投资者按代销机构的规定缴付资金。

### （七）暂停或拒绝认购的情形及处理

出现以下情况之一时，管理人可暂停或拒绝接受投资者的认购申请：

- 1、本集合计划认购申请人数接近或达到200人；
- 2、当本集合计划规模接近、达到或超过约定的规模；
- 3、战争、自然灾害等不可抗力的原因导致集合计划无法正常运作；
- 4、证券交易所在交易时间非正常停市；
- 5、销售机构对投资者资金来源表示疑虑，投资者不能提供充分证明的；
- 6、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

如果投资者的认购申请被拒绝，被拒绝的参与款项（不计利息）将退还给投资者，其签署的资产管理合同自始无效。

### （八）集合计划募集账户信息

本集合计划销售募集账户由计划管理人和管理人委托的销售机构自行开立，销售募集账户的开户行、账户名称、账户号码等信息，以计划管理人或销售机构届时公告为准。投资者可通过登录管理人网站进行查询。

## 七、资产管理计划的成立与备案

### （一）集合计划成立的条件

1、集合计划的参与资金总额不低于1000万元人民币且其投资者的人数为2人（含）以上，200人（含）以下，募集过程符合法律、行政法规和中国证监会的规定；

2、管理人应当自集合计划的募集金额缴足之日起10个工作日内，公告本集合计划成立。

集合计划设立完成前，投资者的参与资金只能存入集合计划份额登记机构指定的专门账户，不得动用。

### （二）集合计划设立失败及管理人应承担的责任

集合计划募集期结束，在集合计划规模低于人民币1000万元或投资者的人数少于2人的情况下，集合计划设立失败，管理人以固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用，并将已认购资金及银行同期活期存款利息在募集期结束后30日内退还集合计划投资者，利息具体金额以登记结算机构确认结果为准。

### （三）集合计划开始运作的条件和日期

#### 1、条件：

资产管理计划公告成立。

#### 2、日期：

本集合计划成立的时间以计划管理人根据《管理办法》及相关法规规定发布的集合计划成立公告上载明的具体日期为准。

3、管理人将在集合计划成立起5个工作日内报基金业协会备案。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。

4、集合计划在成立后备案完成前可以以现金管理为目的，投资于银行活期

存款、货币市场基金等中国证监会认可的投资品种。

资产管理计划无法完成备案的，应当及时通过管理人网站公告方式告知投资者，并按照合同约定履行终止清算程序。管理人网站上发布公告即视为履行了告知义务。

## 八、资产管理计划的参与、退出与转让

### （一）参与和退出场所

本集合计划参与和退出场所为管理人的销售机构。投资者应当在销售机构办理集合计划销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理计划份额的参与和退出。管理人可根据情况变更或增减计划销售机构，并予以公告。

### （二）参与和退出的开放日和时间

1、封闭期：本集合计划存续期内，除开放期外，均为封闭期。除本合同另有约定外，投资者在封闭期不能办理参与、退出业务。

2、开放期：集合计划自成立日起，每月开放一次，开放日为每月的第一个工作日，如开放日为节假日前一个工作日或节假日前两个工作日，则顺延至节假日后的第一个工作日，具体开放期日期以管理人公告为准，管理人将提前在管理人网站上公告。

### （三）临时开放期的触发条件、程序及披露等相关安排

因法律法规和监管规则修订、监管要求、合同变更等事由，管理人有权设置临时开放期为投资者办理份额退出业务，临时开放期仅为投资者办理退出且不开放参与。管理人根据上述约定设置临时开放期的，应事先通知托管人、销售机构和份额登记机构，并应至少提前【1】个工作日通过管理人网站公告的方式通知全体投资者。管理人网站上发布公告即视为履行了告知义务。（四）集合计划的参与

集合计划存续期间，投资者可以在开放期内办理本集合计划的参与申请。

#### 1、参与的原则

（1）存续期采用“未知价”原则，即参与集合计划的单位价格以开放日的单位净值为基准进行计算；

（2）“金额参与”原则，即参与以金额申请；

（3）开放期内，当集合计划规模达到约定或公告的规模上限或投资者数量达到 200 人时，管理人对已提交的参与申请采取“时间优先、时间相同情况下金额优先”原则予以确认；

（4）投资者可多次参与本集合计划，参与申请一经确认不可更改或撤销；

（5）投资者存续期首次参与本集合计划的，应与管理人、托管人签署资产管理合同。投资者在集合计划存续期开放日首次参与集合计划的，投资者应符合合格投资者标准，首次参与的最低金额为人民币 100 万元（不含参与费用），追加认购不低于 1 万元且应为 1 万元的整数倍。

（6）本集合计划采用纸质或电子合同的方式签署，个人投资者通过销售机

构的各销售网点签署纸质合同，或通过网上交易系统签署电子合同，两种合同签署方式具有同等效力。对机构投资者仅提供通过销售机构的各销售网点签署纸质合同的合同签署方式。管理人、托管人作为本合同签署方，已接受本合同项下的全部条款；投资者作为本合同一方，签署本合同即表明投资者完全接受本合同项下的全部条款。合同在管理人、托管人、投资者三方完成签署，且投资者按合同约定将参与资金划入指定账户并经注册登记机构确认有效后生效。

投资者应当如实提供与签署合同相关的信息和资料，并保证其所提供的信息及资料真实、准确、完整，否则应当承担由此造成的一切后果。

本合同的签署采用纸质合同的方式进行的，管理人应妥善保管并按托管人要求及时向托管人移交投资者签署的合同原件；

本合同的签署采用电子签名的方式进行的，管理人应确保投资者使用管理人、代理销售机构或其委托的具备相应资质的第三方认证机构颁发的有效的数字证书，以符合《中华人民共和国电子签名法》《电子签名合同指引》等法律法规、监管规定的电子签名方式签订本合同。

## 2、参与的方式、程序及确认

（1）投资者按销售机构指定营业网点的具体安排，在规定的交易时间段内办理集合计划的参与申请；

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

（3）本合同通过纸质或电子签名的方式签署，投资者如采用电子签名方式，在签署本合同前，必须曾与销售机构签署过《电子签名约定书》。投资者签署本合同后，方可申请参与集合计划。参与申请经管理人确认有效后，构成本合同的有效组成部分；

（4）参与申请是否有效以份额登记机构的确认为准。参与申请经管理人确认有效后，构成本合同的有效组成部分；

（5）投资者于开放日（T日）提交参与申请后，可于T+3日后在办理参与的销售机构查询参与确认情况。

确认无效的申请，销售机构将无息退还投资者已交付的参与款项。

## （五）集合计划的退出

集合计划存续期间，投资者可以在开放期内办理本集合计划的退出申请。

### 1、退出的原则

（1）“未知价”原则，即退出份额的价格以开放日的集合计划份额单位净值为基准进行计算。

（2）“份额退出”原则，即退出以份额申请。

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

### 2、退出的程序和确认

（1）退出申请的提出：投资者按销售机构的具体安排或通过销售机构的指

定系统，在开放日规定的交易时间段内办理退出申请。

（2）退出申请的确认：投资者于开放日（T 日）提交的退出申请，可于 T+3 日后在销售机构查询退出确认情况。

（3）退出申请款项的支付：投资者退出申请确认有效后，管理人将指示托管人将退出款项在 T+5 日内从集合计划托管资金账户划出至管理人指定的在份额登记机构开立的集合计划清算备付金账户或清算户，再由份额登记机构划往各销售机构，销售机构收到退出款项后划往投资者指定资金账户。如集合计划出现《资产管理合同》所述暂停估值的情形时，管理人与托管人协商后，可以将划拨日期相应顺延。

#### （六）参与和退出的金额限制

投资者在本集合计划存续期开放日首次参与集合计划份额的，投资者应符合合格投资者标准，且参与应满足本集合计划最低参与金额限制即不低于 100 万元人民币（不含参与费），已持有本集合计划份额的投资者在本集合计划存续期开放日追加参与的除外。

当投资者持有的集合计划份额资产净值高于 100 万元时，投资者可以选择部分退出集合计划份额。投资者选择部分退出集合计划份额的，其退出后持有的集合计划份额资产净值不得低于 100 万元，否则管理人有权自动将该投资者的集合计划全部份额一次性退出给投资者。当投资者持有的集合计划份额资产净值低于 100 万元时，需要退出资产管理计划的，应当选择一次性退出全部集合计划份额，否则管理人有权自动将该投资者的集合计划全部份额一次性退出给投资者。

#### （七）参与和退出的费用

##### 1、参与费用及参与份额的计算

（1）参与费率：0%。

（2）参与份额的计算方法：

参与份额=参与金额/参与申请日集合计划单位净值。

投资者多笔参与时，按上述公式进行逐笔计算。参与份额及参与费用的计算结果保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此产生的差额部分计入集合计划资产损益。

##### 2、退出费用及退出份额的计算

（1）退出费率：0%

（2）退出金额的计算方法

退出以份额申请。

退出金额=退出份额×退出申请日集合计划份额单位净值-管理人业绩报酬（如有）

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

#### （八）参与资金的利息处理方式

投资者的参与款项（不含参与费用）在开放期实际产生的利息按照银行同期

活期存款利率计算（如有），并将折算为计划份额归投资者所有，参与资金的利息以注册登记机构的记录结果为准。

本集合计划开放期间参与资金不涉及利息。

#### （九）巨额退出的认定和处理方式

##### 1、巨额退出的认定

单个开放日，投资者当日累计净退出申请份额（退出申请总份额扣除参与申请总份额之后的余额）超过上一工作日计划总份额数的 10%时，即为巨额退出。

##### 2、巨额退出的顺序、价格确定和款项支付

发生巨额退出时，管理人可以根据本集合计划当时的资产组合状况决定全额退出、部分延期退出或暂停退出：

全额退出：当管理人认为有条件支付投资者的退出申请时，按正常退出程序办理。

部分延期退出：当管理人认为支付投资者的退出申请可能会对计划资产净值造成较大波动时，管理人在当日接受净退出比例不低于集合计划总份额 10%的前提下，对其余退出申请予以延期办理。对于当日的退出申请，将按单个账户退出申请量占退出申请总量的比例，确定当日受理的退出份额；未能受理的退出部分，投资者可选择延期办理或撤销退出申请。对于选择延期办理的退出申请，管理人将在下一个工作日内办理，并以该工作日的计划单位净值为准计算退出金额，以此类推，直至全部办理完毕为止，但不得超过正常支付时间 20 个工作日，转入下一个工作日的退出申请不享有优先权。

##### 3、告知投资者的方式

发生巨额退出并延期支付时，管理人应在 5 个工作日内在管理人指定网站公告，并说明有关处理方法。

#### （十）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，管理人可按本合同载明的规定，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。

##### 3、告知投资者的方式

当发生连续巨额退出并且管理人决定执行部分延期退出或暂停退出时，管理人应在 5 个工作日内在管理人指定网站公告，并说明有关处理方法。

#### （十一）单个投资者大额退出的认定、预约申请和处理方式

本集合计划不设单个投资者大额退出限制条款，但因单个投资者大额退出导致出现巨额退出，则根据巨额退出的认定和出资方式办理。

## （十二）延期支付及延期退出的情形和处理方式

- 1、因不可抗力导致管理人不能支付退出款项。
- 2、发生资产管理合同规定的暂停集合计划资产估值情况时，管理人可暂停接受投资人的退出申请或延缓支付退出款项。
- 3、证券交易所交易时间非正常停市，导致管理人无法计算当日集合计划资产净值。
- 4、连续两个或两个以上开放日发生巨额退出。
- 5、发生继续接受退出申请将损害现有集合计划份额持有人利益的情形时，管理人可暂停接受集合计划份额持有人的退出申请。
- 6、当前一估值日集合计划资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与托管人协商确认后，管理人应当延缓支付退出款项或暂停接受集合计划退出申请。
- 7、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一且管理人决定暂停退出或延缓支付退出款项时，管理人应在当日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备案，中国证监会、中国证券投资基金业协会更新了相关规则或制定了其他相关规则，则从其最新规则报送，已确认的退出申请，管理人应足额支付；如暂时不能足额支付，应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给退出申请人，未支付部分可延期支付。若出现上述第 4 项所述情形，按资产管理合同的相关条款处理。集合计划份额持有人在申请退出时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。在暂停退出的情况消除时，管理人应及时恢复退出业务的办理并公告。

## （十三）拒绝或暂停参与、退出的情形及处理

### 1、拒绝或暂停参与的情形及处理方式

- （1）战争、自然灾害等不可抗力的原因导致集合计划无法正常运转；
  - （2）管理人认为本集合计划出现或可能出现超额募集情况；
  - （3）证券交易场所在交易时间非正常停市，导致无法计算当日的集合计划资产净值；
  - （4）管理人认为集合计划资产规模过大，可能对集合计划业绩产生负面影响，从而损害现有集合计划投资者的利益；
  - （5）集合计划管理人、集合计划托管人或注册登记机构的技术保障或人员支持等不充分；
  - （6）集合计划管理人认为会有损于现有集合计划投资者利益；
  - （7）法律、行政法规规定或中国证监会认定的其它可暂停参与的情形。
- 发生上述（1）到（7）项情形时，集合计划管理人应当通过管理人网站报告投资者。

### 2、拒绝或暂停退出的情形及处理

发生下列情形时，管理人可以拒绝或暂停受理投资者的退出申请：

- （1）不可抗力的原因导致集合计划无法正常运转；

（2）证券交易场所交易时间非正常停市、份额登记机构或银行结算系统无法正常运作等，导致当日集合计划资产净值无法计算；

（3）管理人认为接受某笔或某些退出申请可能会影响或损害现有投资者利益时；

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

（5）法律、行政法规和中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一的，已接受的退出申请，集合计划管理人将足额支付；如暂时不能支付的，可支付部分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，未支付部分由集合计划管理人按照发生的情况制定相应的处理办法在后续工作日予以支付，但最长不超过正常支付时间20个工作日，并通过管理人网站报告给投资者。

发生《资产管理合同》、集合计划说明书中未予载明的事项，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，可以暂停接受投资者的参与、退出申请。

暂停集合计划退出，集合计划管理人应及时通过管理人网站报告投资者，并制定相应的补救措施。

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

资产管理计划向投资者支付的受托资金及收益应当返回其参与资产管理计划时使用的结算账户或者同名账户。

#### （十四）集合计划的份额转让、非交易过户和冻结

##### 1、集合计划份额的转让

集合计划存续期间在技术措施允许的条件下，本资产管理计划份额方可转让。集合计划份额转让业务的开通和处理方式、份额转让的实际收费标准以管理人公告为准。在符合管理人公告的条件下，并经管理人同意后，投资者可以通过证券交易所以及中国证监会认可的其他方式，向合格投资者转让其持有的集合资产管理计划份额，并按规定办理份额变更登记手续。转让后，持有资产管理计划份额的合格投资者合计不得超过二百人。受让方首次参与集合计划，应满足合格投资者的条件，并与管理人、托管人签订集合资产管理合同。

##### 2、集合计划份额的非交易过户

非交易过户是指不采用参与、退出等交易方式，将一定数量的集合计划份额按照一定的规则从某一投资者集合计划账户转移到另一投资者集合计划账户的行为。集合计划注册登记机构只受理因继承、捐赠、司法执行，以及其他形式财产分割或转移引起的计划份额非交易过户。对于符合条件的非交易过户申请按登记结算机构的有关规定办理。

##### 3、集合计划份额的冻结

集合计划登记结算机构只受理国家有权机关依法要求的集合计划份额冻结

与解冻事项。

（十五）证券期货经营机构及其子公司以自有资金参与集合计划

本集合计划不涉及证券期货经营机构及其子公司的自有资金参与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合同约定的前提下，证券期货经营机构及其子公司以自有资金参与、退出可不受《管理办法》《运作规定》相关规定的限制，但应当及时告知投资者和托管人，并向管理人住所地中国证监会派出机构报告。

（十六）管理人应定期将资产管理计划投资者变更情况报送基金业协会。

## 九、份额持有人大会及日常机构

本集合计划不设立份额持有人大会及日常机构。

## 十、资产管理计划份额的登记

（一）本集合计划的份额登记业务由集合计划管理人办理。份额登记机构应履行如下份额登记职责：

- 1、配备足够的专业人员办理本集合计划份额的登记业务；
- 2、严格按照本合同的约定办理本集合计划份额的登记业务；
- 3、保存集合计划份额持有人名册及相关的认购、申购与赎回等业务记录不少于 20 年；

4、对集合计划份额持有人的集合计划账户信息负有保密义务，因违反该保密义务对投资者或集合计划带来的损失，须承担相应的赔偿责任，但司法强制检查情形及法律法规及中国证监会规定的和本合同约定的其他情形除外；

5、法律法规及中国证监会规定的和本合同约定的其他义务。

（二）全体集合计划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

在严格控制风险的前提下，以成长投资策略为基本出发点，兼顾公司价值，通过发掘全市场具有独特竞争力成长型上市公司进行投资，选择具备高性价比投资标的构建组合，力争实现资产的长期稳健增值。

### （二）投资范围与投资比例

#### 1、投资范围

交易所交易的股票（包括沪深交易所、北京交易所），公募基金，国债逆回购，银行活期存款。

#### 2、投资比例

（1）权益类资产：依市值合计占集合计划当日资产总值的比例为 20%（含）-100%（不含）；

（2）固定收益类资产：依市值合计占集合计划当日资产总值的比例为 0-80%（不含）；

（3）集合计划总资产占净资产的比例不超过 140%；

（4）集合计划持有同一资产的比例不得超过当日集合计划资产净值的 25%；管理人管理的全部集合计划投资于同一资产的资金，不得超过该资产的 25%。银行活期存款除外。同一资产的认定及计算方式：各类股票、公募基金、国债逆回购【以市值】进行计算；

本计划投资于其他资产管理产品的，大类资产配置比例、总资产占净资产比例应当按照穿透原则合并计算，且应当符合监管规定和资产管理合同的约定。

本计划为混合偏权益类产品，主要投资于权益类资产，权益类资产投资比例为 20%-100%。根据宏观经济、政策形势和证券市场走势等，综合考量各类资产的市场流动性和风险收益特征等因素，以及根据对资本市场趋势的判断，管理人将在本合同约定的投资范围内对各类资产进行主动调整，合理确定固定收益类、权益类等资产的投资比例。当管理人判断权益市场具有较好投资性价比时，比如沪深 300 指数估值整体低于其历史 50% 百分位时等情形，权益类资产投资仓位可超过 80%。当管理人认为相关投资建仓、持仓不利于本计划收益最大化的，管理人可酌情降低仓位，比如整体市场出现高估，沪深 300 指数估值已经超过其历史估值的 80% 分位等情形；或整体市场出现流动性风险时，比如沪指连续两周累计跌幅超过 10% 时等情形，权益类资产投资仓位可低于 80%。

资产管理计划应当按照所投资资产管理产品披露投资组合的频率，及时更新计算所投资资产的金额或比例。

### （三）投资比例超限的处理方式及流程

如因证券市场波动、证券发行人合并、资产管理计划规模变动等证券公司之外的因素，造成集合计划投资不符合法律、行政法规和中国证监会规定的投资比例或者合同约定的投资比例的，管理人应在流动性受限资产可出售、可转让或者恢复交易的二十个交易日内调整至符合相关要求。确有特殊事由未能在规定时间内完成调整的，管理人及时向中国证监会相关派出机构报告。

### （四）风险收益特征

本集合计划属于 R4（中高风险）等级产品，适合风险承受能力为 C4 型（积极型）及以上等级的投资者。

### （五）投资策略

#### 1、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，并以维护集合计划投资者利益作为最高准则。具体决策依据包括：

（1）《管理办法》《运作规定》《指导意见》《资产管理合同》《说明书》等有关法律性文件。

(2) 宏观经济发展态势、微观经济运行环境和证券市场变化。

(3) 利率走势与通货膨胀预期，地区及行业基本面变化情况。

(4) 投资对象收益和风险的配比关系。本集合计划在衡量投资对象投资收益与风险之间的配比关系时，在尽量避免本金损失的前提下，力争为投资者获取较高的收益。

## 2、投资决策程序

(1) 管理人资产管理决策委员会确定集合计划的设立等重大决策。

(2) 投资经理负责集合计划的投资

投资经理参考研究员的研究，并依据宏观经济、政策走向等的分析，选择具体的投资标的构建投资组合，并根据基本面、市场等的变化，对组合进行调整和优化。

(3) 交易员根据投资经理的投资指令在集合计划专有席位实施投资交易，并根据有关规定对投资指令的合规性、合理性和有效性进行检查。

## 3、投资管理的方法与标准

(1) 资产配置策略

集合计划通过定性分析与定量分析，综合分析国内外政治经济环境、政策形势、金融市场走势、行业景气等因素，研判市场时机，结合货币市场、债券市场和股票市场估值等状况，进行资产配置及组合的构建，合理确定集合计划在股票、现金等资产类别上的投资比例。集合计划将主要投资于股票并保持较高仓位运作，但根据市场情况，也会适时动态调整，以降低仓位作为应对市场波动、控制风险的主要方式。

(2) 股票投资策略

集合计划坚持低估值中高速成长股投资策略，积极布局市场估值结构性分化带来的投资机会，对高估值、高风险资产保持谨慎。通过精选基本面低风险、盈利增长持续性强、估值便宜的成长股，构建高性价比的投资组合。同时加强风险管理，竭力使投资组合始终保持较高性价比，力争获得可持续的超额收益。

(3) 公募基金的投资策略

集合计划将在充分考虑公募基金的收益率、流动性、规模及风险的基础上，优先选择资产规模大、赎回到账速度快、收益率较高的产品。通过建立资管产品投资标的池，灵活调整投资组合中的投资品种及投资比例，在保证投资组合流动性的基础上，力争实现投资增值。

## (六) 投资限制

为维护投资者的合法权益，本集合计划的投资限制为：

1、集合计划总资产占净资产的比例不超过 140%；

2、不得投资于“ST、\*ST 类股票”以及最近一期年报中审计意见为“保留意见”、“带强调事项段的无保留意见”、“无法表示意见”和“否定意见”股票；

3、集合计划开放退出期内，其主动投资于流动性受限资产的市值合计不得

超过该资产管理计划资产净值的 20%，资产组合中 7 个工作日可变现资产的价值不低于集合计划资产净值的 10%；

4、申购新股时，申购金额不得超过集合计划资产总额，申购数量不得超过上市公司本次发行总量。

5、法律、行政法规、中国证监会规定以及本合同约定的其他限制。

如法律法规或监管部门修改或取消上述限制，经与托管人协商一致且履行适当程序后，本集合计划可相应调整投资组合限制的规定。法律法规或中国证监会允许集合计划投资其他品种的，资产管理人在履行合同变更程序后，可以将其纳入本计划的投资范围。

#### （七）禁止行为

资产管理人不得运用本集合计划资产从事如下禁止行为：

- 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、向投资者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、接受单一投资者参与资金低于中国证监会规定的最低限额；
- 7、使用集合计划资产进行不必要的交易；
- 8、内幕交易、利益输送、操纵证券价格、不正当关联交易及其他违反公平交易规定的行为；
- 9、直接投资商业银行信贷资产；
- 10、直接或间接投资法律、行政法规和国家政策禁止投资的行业或领域；
- 11、违规为地方政府及其部门提供融资，或要求或者接受地方政府及其部门违规提供担保；开展明股实债投资；
- 12、法律、行政法规和中国证监会禁止的其他行为。

#### （八）业绩比较基准及确定依据

本集合计划不设置业绩比较基准。

#### （九）集合计划的建仓期

集合计划成立之日起 6 个月内为建仓期。

#### （十）集合计划止损机制

止损线：集合计划单位净值【0.7000】元（止损线的计算以资产管理人与资产托管人核对一致的日终净值为准，下同）

本集合计划存续期间内任何一個工作日（T 日），如果日终集合计划单位净值不高于止损线的，自 T+1 日起管理人有权对集合计划持有的非现金类资产进行不可逆变现，直至可变现计划资产全部变现为止，可变现计划资产全部变现后本集合计划终止。

本计划的止损线由管理人负责监控并执行。决定是否执行止损是管理人的

权利而非义务，管理人有权决定在日终集合计划单位净值不高于止损线时止损，也有权决定在上述情况下继续运作本集合计划

#### （十一）集合计划的流动性安排

集合计划开放退出期内，其主动投资于流动性受限资产的市值在开放退出期内合计不得超过资产管理计划资产净值的 20%，资产组合中 7 个工作日可变现资产的价值，不低于该计划资产净值的 10%。集合计划投资的资产组合的流动性与参与、退出安排相匹配。

#### 十二、服务机构及投资顾问（如有）

本集合计划的份额登记机构、估值与核算、信息技术系统服务机构均为西南证券股份有限公司。

本计划未聘请投资顾问。

#### 十三、分级安排（如有）

本集合计划无分级安排。

#### 十四、利益冲突及关联交易

##### （一）存在或可能存在利益冲突的情形

1、管理人运用计划财产从事一般关联交易或重大关联交易；

2、管理人管理的其他资管产品（包括本计划投资经理管理的其他资管产品）

基于各自投资策略需要可能与本计划存在相同、相似或相反的投资交易行为，或者在买卖同一只证券的时间上存在先后；

3、管理人在遵循法律法规和相关原则的前提下运用固有资金进行证券投资，该等投资也可能与本计划存在相同、相似或相反的投资交易行为，或者在买卖同一只证券的时间上存在先后，不排除可能影响或限制本计划的投资运作；

4、其他利益冲突的情形。

##### （二）资管计划关联方

本资管计划的关联方为本计划的管理人、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。

资管计划关联方名单详见附件，后续以管理人的定期公告为准。托管人关联方名单详见附件，后续以托管人对外发布的半年报、年报信息为准。因托管人未及时对外发布导致管理人信息披露不准确、不及时，管理人不承担责任。

##### （三）关联交易情形

1、本计划投资于资管计划关联方发行的证券或者承销期内承销的证券；

2、本计划接受资管计划关联方发行或承销期内承销的证券作为质押券与对

手开展逆回购交易；

3、本计划与资管计划关联方作为交易对手发生交易；

4、本计划涉及与资管计划关联方签订服务类协议或向其支付佣金、服务费等费用的行为；

5、本计划投资资管计划关联方所设立的资产管理产品。

其中第1项为重大关联交易，第2-5项为一般关联交易。

#### （四）利益冲突及关联交易内部控制机制

1、管理人建立健全内部控制机制，采取有效隔离措施，防范管理人与投资者之间、不同投资者之间的利益冲突。管理人将其证券经纪业务、证券承销业务、证券自营业务和证券资产管理业务分开办理，不得混合操作。

管理人资产管理业务建立健全内部控制制度，采取有效措施，将资产管理业务与其他业务分开管理，不同投资经理管理的资产管理计划的持仓和交易等重大非公开投资信息相隔离，控制敏感信息的不当流动和使用，防范内幕交易、利用未公开信息交易、利益冲突和利益输送。

当公司利益和投资者利益发生冲突时，应以投资者利益为重；当不同投资者利益发生冲突时，应公平地对待不同的投资者；严禁直接或者间接安排在不同投资组合之间进行利益输送。

2、管理人运用受托资产从事关联交易的，在遵循投资者利益优先原则和符合合同约定的投资目标及策略的前提下，管理人根据实际投资需要，按照资管计划关联方名单谨慎开展关联交易。

管理人建立关联交易管理制度，对关联交易操作、信息披露等环节进行有效管控。在投资方面，投资经理应对投资标的进行审慎评估，按照所投标的是否具备公允价值进行分类，分别提交资产管理决策机构或授权机构审批。

管理人运用受托管理资产从事关联交易的，应确认已按照本合同约定事先征得投资者的同意，事后须按照合同约定进行相关披露。

#### （五）存在利益冲突的处理方式、披露方式、内容及频率

投资者在此对上述列举的存在的或可能存在的利益冲突情形表示知悉，资产管理计划投资者不得因本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赔偿的要求。

1、管理人运用本计划资产进行前述关联交易，需要遵循投资者利益优先的原则、防范利益冲突。

资产管理计划投资者签署本合同即表明其已经充分理解并同意本计划从事前述的一般关联交易，管理人无需就具体的一般关联交易分别取得投资者的个别授权，但该种投资行为应按照市场通行的方式和条件参与。管理人运用受托资产从事一般关联交易的，应遵循投资者利益优先的原则，事后管理人应在定期报告中全面、客观地向投资者和托管人进行披露，并按要求及时向中国证监会相关派出机构报告。

管理人运用受托资产从事重大关联交易的，管理人应通过事先公告等方式

逐笔取得投资者同意。投资者如未在公告载明的回复截止日按指定的形式回复意见或回复意见不明确的，视为同意本计划从事上述重大关联交易。

投资者不同意管理人进行重大关联交易的，管理人保障其退出集合计划的权利。管理人应当于征求意见期满后安排最近一个开放期，供不同意的投资者退出本计划。对于明确答复不同意但逾期未退出本集合计划的投资者，管理人将统一在开放期次一工作日做强制退出处理（退出价格为退出当日的计划单位净值）。

重大关联交易发生之日起五日内，管理人通过临时报告形式向托管人和投资者进行告知，并及时向中国证监会相关派出机构报告。

2、投资者充分知悉并理解，尽管管理人承诺谨慎勤勉地管理受托财产、公平对待各投资组合，本计划在投资和运作过程中可能仍会存在一些利益冲突情形。投资者认可此等情形的存在并自愿承担相关投资风险。

3、若管理人涉及相关利益冲突情形的，管理人应严格遵守法律、行政法规和中国证监会的规定以及本合同的约定，并及时履行相应的信息披露义务。

## 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

集合计划投资经理由管理人负责指定。

#### 2、本集合计划投资经理

曾勇，硕士研究生，FRM。2012年11月加入西南证券股份有限公司，先后担任重庆大石坝营业部投资顾问，重庆北碚营业部投资顾问，风险控制部项目评估。2021年10月加入西南证券资管投资部，任投资经理。

投资经理已取得基金从业资格，最近三年无被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚事项。投资经理不存在兼职情况。

### （二）投资经理变更的条件和程序

管理人可根据业务需要变更投资经理，并于管理人网站发布公告告知投资者及托管人。

## 十六、资产管理计划的财产

### （一）集合计划财产的构成

本集合计划资产为信托财产，包括计划所拥有的各类有价证券、银行存款本息、其他应收的款项以及其他投资等的价值总和。其构成主要有：

#### 1、银行存款和应计利息；

2、清算备付金及其应计利息、应收证券交易清算款、应收参与款、交易保证金及其应计利息、其他根据有关规定缴纳的保证金、债券投资及其应计利息、基金投资及其分红或应收利息、其他资产等。

## （二）集合计划财产的保管与处分

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

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

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

4、管理人、托管人以其固有财产承担法律责任，其债权人不得对集合计划财产行使请求冻结、扣押和其他权利。管理人、托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，集合计划财产不属于其清算财产。

5、集合计划财产产生的债权不得与不属于集合计划财产本身的债务相互抵销。非因集合计划财产本身承担的债务，管理人、托管人不得主张其债权人对集合计划财产强制执行。上述债权人对集合计划财产主张权利时，管理人、托管人应明确告知集合计划财产的独立性，采取合理措施并及时通知投资者（如因托管人债权人对资产管理计划主张权利的，则由托管人告知管理人，并由管理人通知投资者）。

## （三）集合计划财产相关账户的开立和管理

1、集合计划管理人或托管人按照规定开立集合计划财产的托管资金账户、证券账户等投资所需账户。证券账户的持有人名称应当符合证券登记结算机构的有关规定。开立的上述集合计划财产账户与集合计划管理人、集合计划托管人、集合计划销售机构和集合计划份额登记机构自有的财产账户以及其他集合计划财产账户相独立。

2、集合计划托管人为本集合计划在商业银行开立集合计划的托管资金账户。本集合计划的一切货币收支活动，包括但不限于投资、支付赎回金额、支付集合计划收益，均需通过本集合计划的托管资金账户进行。本托管资金账户仅限于本集合计划使用，仅限于满足开展本集合计划业务的需要。

3、证券账户以及集合计划投资运作有关的其他账户由集合计划管理人与集合计划托管人协商后办理。集合计划管理人和集合计划托管人不得随意假借本集合计划的名义开立任何其他银行账户。如集合计划投资运作有关的其他账户是由集合计划管理人负责开立的，集合计划管理人应保证该账户专款专用，并聘请资金监管机构对该账户的资金划付进行监管。相应的投资回款及收益，也由集合计划管理人负责及时原路划回托管资金账户，已聘请资金监管机构的，集合计划管理人应配合资金监管机构完成投资回款的划付。集合计划管理人开立此类账户后需及时通知集合计划托管人。

## 十七、投资指令的发送、确认和执行

### （一）交易清算授权

1、管理人应当事先向托管人发出授权通知，向托管人提供指令的预留印鉴样本和被授权人签字样本，并在授权通知上载明管理人被授权人名单、交易权限、生效条件等。管理人应指定至少两名被授权人。

2、管理人向托管人发出授权通知应加盖公章并由法定代表人或授权代表签署，若由授权代表签署，还应附上法定代表人的授权书。资产管理人将授权通知通过传真或电子邮件发送扫描件方式发出后以电话形式向资产托管人确认，授权通知自资产托管人收到传真或扫描件并电话确认后，方视为通知送达。授权通知自通知送达时生效（如果授权通知载明的生效日期与该日期不一致时，以后到日期为生效日期）。资产管理人应在此后三个交易日内将授权通知的正本送交资产托管人并与其电话确认。传真件或扫描件如与正本不一致，资产托管人以传真件或扫描件为准并及时通知资产管理人。

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

## （二）投资指令的内容

1、投资指令包括管理人在运作计划资产时，向托管人发出的资金划拨电子或书面文书，包括付款指令（含退出、收益分配付款指令）及其他资金划拨指令等。

2、管理人发给托管人的投资指令应写明款项事由、支付时间、收付款人开户银行、金额、收付款人账户名称、账号等要素信息，加盖预留印鉴并由被授权人签字。

## （三）投资指令的发送、确认和执行

### 1、投资指令的发送

（1）投资指令需有投资指令授权书确定的预留印鉴和签字，并由有权发送指令人员代表管理人用深证通、邮件、传真或管理人与托管人协商一致的其他方式向托管人发送，并电话确认托管人收到指令。

（2）托管人应预先书面或以双方认可的方式通知管理人接收人名单和联系方式。

### 2、指令的接收及确认

（1）管理人有义务在发送指令后及时与托管人进行确认，因管理人未能及时与托管人进行指令确认，致使资金未能及时到账所造成的损失不由托管人承担。托管人在接收指令时，应对指令是否由有权发送指令人员发送、指令的要素是否齐全、指令印鉴与签字是否与预留的授权文件内容相符进行形式审核。对于显示为有权发送指令人员发出的指令，管理人不得否认其效力，但如果管理人已经撤销或更改对有权签署、发送指令人员的授权，并且授权变更通知已生效，则对于此后该类相关人员无权发送的指令，或超权限发送的指令，管理人不承担责任。

（2）托管人可以要求管理人传真或通过管理人与托管人协商一致的其他方式提供相关交易凭证、合同或其他有效会计资料，以确保托管人有足够的资料来判断指令的有效性。

### 3、指令的执行

（1）托管人确认指令有效后，方可执行指令。

（2）托管人在复核后应在规定期限内执行适当的指令，不得延误。指令执行完毕后，托管人应通知管理人。托管人发现管理人的指令违反法律法规、资产管理合同约定的，应当要求改正，未能改正的，应当拒绝执行，并有权向管理人住所地中国证监会派出机构及中国证券业协会报告。

（3）中国证券登记结算公司向托管人发送的结算通知视为管理人向托管人发出的有效指令，托管人应予以执行。

（四）托管人依法暂缓、拒绝执行指令的情形和处理程序

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

托管人在履行监督职能时，发现管理人的指令错误时，有权拒绝执行，并及时通知管理人改正。但托管人因执行管理人的合法指令而对管理计划财产造成损失的，托管人不承担赔偿责任。托管人对执行管理人的依据交易程序已经生效的指令对本计划资产造成的损失不承担赔偿责任。托管人因故意或过失错误执行指令或未及时执行指令，致使本计划资产的利益受到损害，应负赔偿责任。

（五）管理人发送错误指令的情形和处理程序

托管人发现管理人发送的指令违反《指导意见》、《管理办法》、《运作规定》、本合同或其他有关法律的规定，在指令依交易程序未生效的情况下，不予执行，并及时通知管理人纠正，管理人收到通知后应及时核对并更正，由此造成的损失由管理人承担。

（六）更换被授权人的程序

管理人撤换被授权人员或改变被授权人员的权限，必须提前至少一个交易日，向托管人邮件发送由管理人法定代表人或其授权的代理人签字且加盖公章的新授权书，如新授权书由授权代理人签字的，还应提供法定代表人的授权书及法定代表人身份证明书；管理人同时电话通知托管人，新授权书自托管人收到邮件并电话确认后，按照新授权书上约定生效时间开始生效。若电话确认时间晚于所载明生效时间，则生效时间应为电话确认时间。管理人在此后五个工作日内将新授权书的正本送交托管人。如果托管人收到的新授权书正本和邮件不一致，以邮件为准。管理人更换新授权书生效后，对于已被撤换的人员无权发送的指令，或被改变授权范围人员超权限发送的指令，托管人不予执行。

（七）指令的保管

管理人、托管人应根据法律法规，独立保管指令及相关附件。

## 十八、越权交易的界定

（一）越权交易的界定

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

- 1、违反有关法律法规和本合同规定进行的投资交易行为；
- 2、法律法规禁止的超买、超卖行为。

管理人应在有关法律法规和本合同规定的权限内运用受托财产进行投资管理，不得违反有关法律法规和本合同的约定，超越权限管理、从事证券投资。

#### （二）越权交易的处理程序

- 1、托管人发现管理人的投资指令超越本合同投资的，应当拒绝执行。
- 2、资产托管人在行使监督职能时，如果发现受托财产投资证券过程中出现超买或超卖现象，应及时提醒管理人，由管理人负责解决，由此给受托财产造成的损失由管理人承担。
- 3、托管人发现管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反本合同约定的，应当立即通知管理人并要求管理人改正；管理人不改正的，及时报告中国证监会相关派出机构。
- 4、越权交易所发生的损失及相关交易费用由管理人负担，所发生的收益归本受托财产所有。

#### （三）托管人对管理人的投资监督

- 1、托管人对管理人的投资行为行使监督权，托管人根据法律法规要求和本合同附件《西南证券日新泽达 1 号集合资产管理计划交易监督事项表》约定对资产管理人的相关投资行为进行监督。因证券市场波动、上市公司合并、资产管理计划规模变动等管理人之外的因素致使受托财产投资不符合资产管理合同约定的投资比例的，管理人应当按照资产管理合同的约定进行及时调整。
- 2、托管人对受托财产的监督和检查自本合同生效之日起开始。
- 3、托管人发现管理人的投资运作违反法律、行政法规和其他有关规定时，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；托管人发现管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规或其他有关规定约定的，应当立即通知管理人并及时报告中国证监会相关派出机构。

### 十九、资产管理计划财产的估值和会计核算

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。

#### （一）估值目的

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

#### （二）估值时间

指本集合计划成立后的每 T+1 交易日对 T 日本集合计划进行估值，即上海证券交易所、深圳证券交易所、北京交易所的正常交易日。

#### （三）估值方法

##### 1、存款的估值

银行存款以成本列示，按照商定利率在实际持有期间内逐日计提利息。

## 2、回购的估值

回购交易以成本列示，按商定利率在实际持有期间内逐日计算利息。

## 3、公募基金的估值方法

（1）持有的交易所基金，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；如果估值日无交易，且最近交易日经济环境发生了重大变化的，将参考监管机构或行业协会有关规定，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。

（2）持有的场外基金（包括托管在场外的上市开放式基金（LOF）），按估值日基金净值估值，估值日开放式基金份额净值未公布的，以前最近一个交易日基金份额净值估值。

（3）持有的货币市场基金，按基金管理公司公布的估值日的每万份收益计提收益。

（4）持有的基金处于封闭期的，按照最新公布的份额净值估值。

## 4、股票估值方法

（1）上市流通股票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，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，以最近交易日的收盘价估值；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考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）在任何情况下，资产管理人如采用本项第（1）小项规定的方法对委托资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。

（3）国家有最新规定的，按其规定进行估值。

5、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。

6、其他标的，根据《企业会计准则》《指导意见》等关于金融工具核算与估值的相关规定进行估值。

7、如有新增事项或变更事项，按国家最新规定估值。

### （四）估值对象

运用本集合计划资产所购买的一切有价证券、银行存款及其他资产。

### （五）估值程序

集合计划资产的日常估值由管理人进行，托管人复核。用于公开披露的资产净值由管理人完成估值后，将估值结果以双方认可的形式报送托管人。托管人按照规定的估值方法、时间与程序进行复核；托管人进行复核无误后，签名、盖章并发回给管理人，由管理人在官网对外公布。月末、年中和年末估值复核与会计账目的核对同时进行。资产净值的计算保留到小数点后 2 位，小数点后第 3 位四舍五入。

#### （六）估值错误与遗漏的处理方式

本集合计划单位净值的计算精确到0.0001元，小数点后第五位四舍五入。当资产估值导致本集合计划单位净值小数点后四位以内发生差错时，视为本计划单位净值错误。管理人和托管人应采取必要、适当、合理的措施确保资产估值的准确性和及时性。当份额计价出现错误时，管理人应当立即予以纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大。

因份额净值错误给投资人造成损失的，管理人和托管人应当按照各自过错承担赔偿责任。当管理人计算的计划资产净值、计划单位净值已由托管人复核确认后公告的，由此造成的投资者或集合计划资产的损失，应由过错方对投资者或集合计划资产支付赔偿金。

前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，按其规定处理。

由于证券交易所、注册登记机构发送的数据错误或其他不可抗力造成估值错误的，管理人和托管人免于承担责任。

#### （七）估值调整的情况及处理

如因重大事件或极端情况，并有确凿证据表明集合计划估值不公允，或根据相关法律法规需要进行估值调整的，在与托管人商议一致后，按最能反映集合计划资产公允价值的方法估值，并于管理人网站发布公告。

#### （八）暂停估值的情形

- 1、与本计划投资有关的证券交易场所遇法定节假日或因其他原因停市时；
- 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集合资产管理计划资产价值时；
- 3、管理人和托管人估值需第三方机构提供数据的，第三方机构未能提供估值所需资料，导致管理人和托管人无法对资产进行正常估值时；
- 4、中国证监会认定的其他情形。

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。

#### （九）资产管理计划份额净值的确认

用于集合计划信息披露的集合计划资产净值和集合计划份额净值由管理人负责计算，托管人负责进行复核。管理人应于每个开放日交易结束后的1个工作日计算当日的集合计划资产净值和集合计划份额净值并发送给托管人。托管人对净值计算结果复核确认后当日发送给管理人，由管理人对集合计划净值予以公布。

#### （十）差错处理

##### 1、差错类型

本计划运作过程中，如果由于管理人、托管人、注册与过户登记人或代理销售机构或投资者自身的过错造成差错，导致其他当事人遭受损失的，过错的责任人应当对由于该差错遭受损失的当事人（“受损方”）按下述“差错处理原则”

给予赔偿并承担赔偿责任。

上述差错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；对于因技术原因引起的差错，若系同行业现有技术无法预见、无法避免、无法抗拒，则属不可抗力，按照下述规定执行。

由于不可抗力原因造成投资者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、差错处理原则

（1）差错已发生，但尚未给当事人造成损失时，差错责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正差错发生的费用由差错责任方承担；由于差错责任方未及时更正已产生的差错，给当事人造成损失的由差错责任方承担；若差错责任方已经积极协调，并且有协助义务的当事人有足够的时间进行更正而未更正，则有协助义务的当事人应当承担相应赔偿责任。差错责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认，确保差错已得到更正；

（2）差错的责任方对可能导致有关当事人的直接损失负责，不对间接损失负责，并且仅对差错的有关直接当事人负责，不对第三方负责；

（3）因差错而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但差错责任方仍应对差错负责，如果由于获得不当得利的当事人不返还或不全部返还不当得利造成其他当事人的利益损失，则差错责任方应赔偿受损方的损失，并在其支付的赔偿金额的范围内对获得不当得利的当事人享有要求交付不当得利的权利；如果获得不当得利的当事人已经将此部分不当得利返还给受损方，则受损方应当将其已经获得的赔偿额加上已经获得的不当得利返还的总和超过其实际损失的差额部分支付给差错责任方；

（4）差错调整采用尽量恢复至假设未发生差错的正确情形的方式；

（5）差错责任方拒绝进行赔偿时，如果因托管人过错造成集合资产管理计划资产损失时，管理人应为集合资产管理计划的利益向托管人追偿。除管理人和托管人之外的第三方造成集合资产管理计划资产的损失，并拒绝进行赔偿时，由管理人负责向差错方追偿；

（6）如果出现差错的当事人未按规定对受损方进行赔偿，并且依据法律法规、《资产管理合同》或其他规定，管理人自行或依据法院判决、仲裁裁决对受损方承担了赔偿责任，则管理人有权向出现过错的当事人进行追索，并有权要求其赔偿或补偿由此发生的费用和遭受的损失；

（7）按法律法规规定的其他原则处理差错。

## 3、差错处理程序

差错被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

（1）查明差错发生的原因，列明所有的当事人，并根据差错发生的原因确定差错的责任方；

(2) 根据差错处理原则或当事人协商的方法对因差错造成的损失进行评估；

(3) 根据差错处理原则或当事人协商的方法由差错的责任方进行更正和赔偿损失；

(4) 根据差错处理的方法，需要修改注册与过户登记人的交易数据的，由注册与过户登记人进行更正，并就差错的更正向有关当事人进行说明。

#### (十一) 特殊情形的处理

由于本计划所投资的各个市场及其登记结算机构发送的数据错误，或由于其他不可抗力原因，管理人和托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误的，由此造成的集合资产管理计划资产计价错误，管理人和托管人免除赔偿责任。但管理人和托管人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

由于注册与过户登记人发送的数据有误，处理方法等同于交易数据错误的处理方法。

由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误，有关会计制度变化、管理人或托管人托管业务系统出现重大故障或由于其他不可抗力原因，管理人和托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误而造成的份额净值计算错误，管理人、托管人免除赔偿责任。但管理人、托管人应积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

#### (十二) 集合计划会计制度

本集合计划的会计政策比照现行政策执行。本集合计划的会计年度指公历每年 1 月 1 日至 12 月 31 日；记账本位币为人民币，记账单位为元；本集合计划的会计核算按《证券公司客户资产管理业务估值方法指引》《证券投资基金会计核算业务指引》、企业会计准则及其他法律法规的规定执行。

#### (十三) 集合计划账册的建账和对账

1、资产管理计划应独立建账、独立核算；管理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；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。

2、管理人和托管人在本计划成立后，应按照双方约定的同一记账方法和会计处理原则，分别独立地设置、登录和保管本计划的全套账册，对双方各自的账册定期进行核对，互相监督，以保证计划资产的安全。若双方对会计处理方法存在分歧，应以管理人的处理方法为准。

3、双方应每日核对账目，如发现双方的账目存在不符的，管理人和托管人必须及时查明原因并纠正，保证双方平行登录的账册记录完全相符。

#### (十四) 集合计划财务报表的编制和复核

1、资产管理计划应独立建账、独立核算；管理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；集合计划财务报表（包括：资产负债表、利润表）由管理人编制，托管人复核。

2、托管人在复核过程中，发现双方的报表存在不符时，管理人和托管人应

共同查明原因，进行调整，调整以双方认可的账务处理方式为准；若双方无法达成一致，以管理人的账务处理为准。如果管理人与托管人不能于应当披露之日之前就相关报表达成一致，管理人有权按照其编制的报表对外披露，托管人有权就相关情况报基金业协会备案，同时抄送管理人住所地中国证监会派出机构。

## 二十、资产管理计划的费用与税收

### （一）集合计划费用支付标准、计算方法、支付方式和时间

#### 1、托管费：

本集合计划托管人托管费按前一自然日集合计划资产净值的【0.03】%年费率（含税）计提，计算方法如下：

$$H = E * 【0.03】\% / 365$$

H 为每日应计提的托管费；

E 为前一自然日集合计划资产净值。

集合计划托管费自计划成立日起于每个自然日计提，逐日累计至每季度末，按季支付。由管理人于本集合计划成立后的每自然季度的次季度首日起5个工作日内向托管人出具划款指令，托管人依据管理人划款指令从集合计划资产中扣划托管费一次性支付给托管人，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

托管人指定收取托管费的银行账户为：

户名：【其他应付款-托管费收入】

开户行：【招商银行重庆分行】

账号：【912357120620091010】

大额支付号：【308653018018】

#### 2、管理费：

本集合计划的管理费按前一自然日集合计划的资产净值计提，管理费的年费率为【1】%。计算方法如下：

$$H = E * 【1】\% / 365$$

H 为每日应计提的集合计划管理费

E 为前一自然日集合计划资产净值

集合计划管理费自计划成立日起于每个自然日计提，逐日累计至每季度末，按季支付。由管理人于本集合计划成立后的每自然季度的次季度首日起5个工作日内向托管人出具划款指令，托管人依据管理人划款指令从集合计划资产中扣划管理费一次性支付给管理人，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

资产管理人指定收取管理费的银行账户为：

户名：【西南证券股份有限公司】

开户行：【中国建设银行股份有限公司重庆市分行营业部】

账号：【50001333600050003872】

#### 3、证券交易费用

本集合计划证券交易费用包括集合计划运作期间投资所发生的交易手续费、

开放式基金的认（申）购和赎回费、印花税、证券投资类金融产品管理人提取的业绩报酬等有关税费，作为交易成本直接扣除。

4、以管理人的名义，需代表本资管计划及投资者向有关责任人追究法律责任（包括但不限于主动追索、诉讼、仲裁、财产保全、强制执行、向侦查机关报案等方式），所产生的费用及支出（包括但不限于律师费、诉讼费、仲裁费、执行费、保全费、公告费、拍卖费、评估费、鉴定费等）由受托财产承担；

集合计划在存续期间发生的信息披露费、注册登记机构收取的相关费用、会计师费、审计费、律师费等由受托财产承担；

集合计划存续期间开立投资账户发生的开户费、银行结算费、银行间市场账户维护费、集合计划因投资公募基金发生的基金申购费、基金赎回费、基金管理费、基金托管费等由受托财产承担。

#### 5、其他费用

其他费用由管理人本着保护投资者利益的原则，按照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定，由托管人根据管理人划款指令按费用实际支出金额支付，列入当期集合计划费用。

#### 6、管理费、托管费的调整

管理人（托管人）有权根据市场情况调低管理费率（托管费率），经管理人与托管人书面协商一致后，在管理人网站公告。如涉及费率的调高，则按照合同变更流程履行变更程序后实施。若根据本合同约定本合同提前终止的，则按资产管理计划存续实际天数计算管理费和资产托管费。

#### （二）不列入集合计划费用的项目

集合计划成立前发生的费用，以及存续期间发生的与募集有关的费用（如认购费、参与费、销售服务费、投资者维护费等），不得在集合计划资产中列支。管理人和托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或集合计划资产的损失以及处理与集合计划财产运作无关事项或不合理事项所发生的费用等不得列入集合计划费用。

#### （三）管理人的业绩报酬

##### 1、管理人收取业绩报酬的原则

（1）同一投资者不同时间多次参与本集合计划份额的，对投资者每次参与的份额分别计算应当计提的业绩报酬。

（2）业绩报酬提取频率为一年一次。在分红权益登记日、投资者退出日或集合计划清算终止时，管理人对符合业绩报酬提取条件的份额提取业绩报酬。

（3）在分红权益登记日提取业绩报酬的，业绩报酬从分红金额中扣除；在投资者退出或集合计划清算终止时提取业绩报酬的，业绩报酬从退出资金中扣除，不受前述提取频率的限制。

##### 2、业绩报酬的计提方法

在分红权益登记日、投资者退出日或集合计划清算终止日，如集合计划年化收益率  $R$  超过【10】%/年的，管理人提取超额收益的20%作为业绩报酬。

年化收益率 R 的计算公式为：

$$R = (A - B) / C / D \times 365 \times 100\%$$

R 保留至小数点后四位，小数点后第五位四舍五入。

管理人计提的业绩报酬 H 的计算公式为：

$$H = \text{MAX} [R - 10\%, 0] \times C \times D / 365 \times M \times 20\%$$

其中：

A 为业绩报酬提取日的累计单位净值；

B 为上一业绩报酬提取日（若无上一业绩报酬提取日的，则为集合计划成立日或投资者该笔份额申购日）的累计单位净值；

C 为上一业绩报酬提取日（若无上一业绩报酬提取日的，则为集合计划成立日或投资者该笔份额申购日）的单位净值；

D 为投资者所持有的每笔份额上一业绩报酬提取日（不含）（若无上一业绩报酬提取日的，则为集合计划成立日（含）或投资者该笔份额申购日（不含））到本次业绩报酬提取日（含）的实际天数；

M 为计提业绩报酬的份额数。

管理人对于业绩报酬计算结果四舍五入保留至小数点后两位，因四舍五入产生的差额由集合计划承担。

### 3、业绩报酬的支付

在业绩报酬计提后，托管人根据管理人的指令完成业绩报酬的划拨支付。若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。业绩报酬一经计提，不得转回。

业绩报酬的计算和复核工作由管理人完成。业绩报酬收取账户为本合同约定的资产管理人管理费收取账户。

4、业绩报酬计提基准不是管理人向全体投资者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，集合计划份额也可能出现本金或收益的损失。

#### （四）税收

根据财政部、国家税务总局发布的《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》（财税[2016]140号）、《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》（财税[2017]2号）、《关于资管产品增值税有关问题的通知》（财税[2017]56号）以及《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》（财税[2017]90号）等文件的相关规定：自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。前述税费由本计划受托财产承担，管理人将按相关法规和税务机关的规定计算和缴纳。投资者知悉因本计划所适用的税收征管法律法规及执行要求可能会因国家相关税收政策变化或管理人主管税务机关指导意见调整而发生改变。

## 二十一、资产管理计划的收益分配

### （一）可供分配利润的构成

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

（二）可供分配利润：指截至收益分配基准日集合计划未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

### （三）分配原则

- 1、每一集合计划份额享有同等收益分配权；
- 2、收益分配基准日的份额净值减去每单位集合计划份额收益分配金额后不能低于面值；
- 3、管理人可根据产品运作情况在产品开放日进行分红，具体分配时间见管理人公告；
- 4、收益分配时发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担；
- 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拟定，经托管人复核后确定。管理人应在分红后 5 个工作日内公告当次收益分配方案。

### （五）收益分配的执行方式

本集合计划采用现金分红方式，管理人自分红权益登记日起 5 个工作日内从托管户划出。

现金分红形成的集合计划份额计算保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此产生的差额计入集合计划资产的损益。

## 二十二、信息披露与报告

本集合计划的信息披露应符合《指导意见》《管理办法》《运作规定》及相关自律规则的规定。如中国证监会、中国证券投资基金业协会更新了相关信息披露规则或制定了其他相关规则，则从其规则执行。

### （一）定期报告

定期报告包括集合计划单位净值报告、集合计划的资产管理季度（年度）报告、托管季度（年度）报告、年度审计报告。

#### 1、集合计划单位净值报告

管理人每周一（若遇节假日，则顺延至下一个工作日）通过管理人网站（[www.swsc.com.cn](http://www.swsc.com.cn)）披露经过托管人复核的 T-2 个工作日的集合计划单位净值。

管理人披露的计划份额净值并不代表投资者所能够即时获得的现金等财产金额，也不代表将来在财产分配时所能获得的分配金额，份额净值的估值及披露受限于资产管理合同约定的假设、方法及时效，不构成管理人或托管人对受托财产本金、收益的任何保证或承诺。管理人披露资产管理计划净值应当经托管人复核。

相关法律法规对信息披露有新规定的，本集合计划的信息披露也将按照新规

定执行。

## 2、集合计划的资产管理季度报告和托管季度报告

管理人在每季度向投资者提供一次准确、完整的资产管理计划季度报告，对报告期内集合计划资产的配置状况、价值变动情况、重大关联交易作出说明，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；
- （7）资产管理计划投资收益分配情况；
- （8）投资经理变更、关联交易等涉及投资者权益的重大事项；
- （9）中国证监会规定的其他事项。

上述报告应于每季度截止日后1个月内通过管理人网站公告。集合计划成立不足3个月或者存续期间不足3个月的，管理人可以不编制当期的季度报告。

## 3、集合计划的资产管理年度报告和托管年度报告

管理人在每年度分别向投资者提供一次准确、完整的资产管理计划年度报告，对报告期内集合计划资产的配置状况、价值变动情况、关联交易作出说明，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、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。

上述报告应于每个会计年度截止日后4个月内通过管理人网站公告。集合计划成立不足3个月或者存续期间不足3个月的，管理人可以不编制当期的年度报告。

## 4、年度审计报告

管理人应当聘请符合《证券法》规定的会计师事务所对本集合计划的运营情况进行年度审计，并在每年度结束之日起4个月内将审计报告提供给托管人，通

过管理人网站向投资者提供。

## （二）重大事项临时报告

集合计划存续期间，发生对集合计划持续运营、投资者利益、资产净值产生重大影响的事件，管理人应当以网站公告方式在事项发生之日起五日内向投资者披露。临时报告的情形包括但不限于：

- 1、发生巨额退出并延期支付；
- 2、集合计划因受托财产流动性受限等原因延期清算的；
- 3、与集合计划有关的重大诉讼、仲裁事项；
- 4、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；
- 5、管理人、托管人因解散、破产、撤销等原因不能履行相应职责；
- 6、资产计价出现错误（当资产估值导致本集合计划单位净值小数点后四位以内发生差错时，视为本集合计划单位净值错误）；
- 7、其他发生对集合计划持续运营、投资者利益、资产净值产生重大影响的事件。
- 8、其他管理人认为的重大事项。

## （三）其他事项

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。

## （四）向监管机构提供的报告

管理人、托管人应当根据法律法规、中国证监会和基金业协会的要求履行报告义务。

## 二十三、风险揭示

管理人在管理、运用或处分财产过程中，资产管理计划可能面临包括但不限于以下风险：

### （一）特殊风险揭示

#### 1、资产管理合同与合同指引不一致风险

《资产管理合同》是基于协会发布的《集合资产管理计划资产管理合同指引》而制定的，《资产管理合同》虽已在能够满足本计划投资需要的前提下涵盖了合同指引明确要求的条款，但合同指引主要为概括性、原则性约定，《资产管理合同》具体条款约定不可避免的比合同指引更为复杂具体，也不可避免与合同指引不完全相同。管理人对合同指引相关内容做出了合理的调整，导致资产管理合同与合同指引不完全一致的风险。

#### 2、集合计划委托募集风险

管理人可以委托具有公开募集证券投资基金销售资格的机构募集本计划，虽然管理人通过签署相关协议与销售机构进行权利义务的划分，但仍可能存在因销售机构自身违法违规行为、违反《资产管理合同》约定的操作、技术系统故障或操作差错等非管理人的原因而导致本计划投资者合法权益受损的风险。

### 3. 募集失败所涉风险

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

管理人的责任承担方式：

（1）以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用；

（2）在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交纳的款项，并加计银行同期活期存款利息。

### 4. 未在协会完成备案手续所涉风险

本计划成立后管理人应当根据有关规定及资产管理合同的约定向协会办理本计划备案手续，本计划在协会备案完成前无法进行投资操作，仅可进行现金管理。若因任何原因导致本计划无法完成备案的，管理人应当及时通过管理人网站公告方式告知投资者，并按照资产管理合同约定履行终止清算程序。本计划募集失败或提前终止情况下，投资者的投资目标无法实现。

备案中协会可能要求管理人对资产管理合同进行变更，管理人将按照资产管理合同约定的变更程序变更资产管理合同，资产管理合同变更履行相关程序需要一定时间，将影响本计划及时完成备案，进而影响本计划及时开展投资，如资产管理合同最终无法完成变更从而最终无法完成备案的，本计划提前终止。

### 5. 份额转让所涉风险

在监管法规及技术措施允许的情况下，本计划存续期间，投资者可以通过证券交易所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本计划份额。本计划份额转让可能不具有一个活跃的转让市场，且交易平台可能根据需要暂停或终止转让服务。投资者可能面临份额无法转让或转让失败的风险。

### 6. 利益冲突及关联交易的风险

投资者知悉，管理人可以根据资产管理合同约定的程序和方式运用资产管理计划资产从事一般关联交易、重大关联交易（以下统称关联交易），管理人承诺关联交易应按照市场通行的方式和条件进行。

投资者知悉，尽管管理人承诺谨慎勤勉地管理资产管理计划财产、公平对待各投资组合，本计划在投资和运作过程中可能还会存在一些其他的利益冲突情形，包括但不限于：管理人管理的其他资管产品（包括本计划投资经理管理的其他资管产品）基于各自投资策略需要可能与本计划存在相同、相似或相反的投资交易行为，或者在买卖同一只证券的时间上存在先后；管理人在遵循法律法规和相关原则的前提下运用固有资金进行证券投资，该等投资也可能与本计划存在相同、相似或相反的投资交易行为，或者在买卖同一只证券的时间上存在先后，不排除可能影响或限制本计划的投资运作等。该等利益冲突可能会不利于本计划，也可能使本计划在投资运作时暂时受限，进而可能会影响收益甚至发生损失等。投资者认可此等情形的存在并自愿承担

相关投资风险。

此外，管理人运用资产管理计划财产从事关联交易时可能依照相关法律法规、监管机构、自律组织的规定被限制相关权利的行使，进而可能影响资产管理计划财产的投资收益。管理人遵循投资者利益优先和审慎原则，根据资产管理合同的约定参与关联交易，尽管管理人确认将确保该等交易安排合法合规、不存在利益输送等违法违规行为，但该等交易仍构成关联交易，存在利益冲突风险。

除了上述风险以外，一般关联交易、重大关联交易还分别存在以下风险：

#### （1）一般关联交易风险

管理人根据实际投资需求，可能运用资产管理计划财产接受资管计划关联方发行或承销期内承销的证券作为质押券与交易对手开展逆回购交易；或者与资管计划关联方作为交易对手发生交易；或者涉及与资管计划关联方签订服务类协议或向其支付佣金、服务费等费用的行为；或者投资资管计划关联方成立的资产管理产品。对于资产管理计划涉及的一般关联交易事项，管理人可以根据资产管理合同的约定与投资者的授权以资产管理计划财产从事一般关联交易，管理人无需就前述具体一般关联交易再行分别取得投资者授权，因此投资者承担管理人未经投资者另行同意直接开展一般关联交易的风险。

#### （2）重大关联交易风险

管理人根据实际投资需求，可能运用资产管理计划财产投资于资管计划关联方发行的证券或者承销期内承销的证券。对于资产管理计划涉及的重大关联交易事项，为保护投资者权益，管理人应当根据资产管理合同的约定提前取得投资者同意，但投资者仍然面临关联交易可能造成的风险。

投资者应密切关注关联交易的信息披露，知悉了解相关的投资信息。

管理人承诺关联交易应按照市场通行的方式和条件进行，投资者认可此等关联交易情形的存在并自愿承担相关投资风险。

#### 7. 业绩报酬计提基准调整的风险（如有）

本计划的业绩报酬计提基准仅为管理人提取业绩报酬的标准，不构成管理人保证计划财产本金不受损失或取得最低收益的承诺。本计划业绩报酬计提基准发生变更时由管理人通过公告形式告知投资者及托管人。业绩报酬计提基准的变化，可能对投资者的利益产生不利影响。

#### （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。

##### 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、再投资风险等。

#### （1）政策风险

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

#### （2）经济周期风险

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

#### （3）利率风险

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

#### （4）购买力风险

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

#### （5）再投资风险

投资者将从本资产管理计划中获得的收益进行再次投资的情况，因上述风险的发生，而导致投资者再投资资产出现亏损的风险。

### 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。

### 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的风险。

### 5、信用风险

因债务人、交易对手或持仓金融头寸的发行人未能按时履约或者信用资质恶化，给资产管理计划带来损失的风险。

### 6、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。

### 7、技术风险

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

### 8、操作风险

管理人、托管人、证券交易所、证券登记结算机构等在业务操作过程中，因

操作失误或操作规程不完善而引起的风险。

#### 9、参与申请失败的风险

因本集合计划对参与人数进行控制，如果募集期或开放期内某日可能出现参与人数超过 200 人的情况，则管理人根据投资者申请单按时间优先原则进行排序，再对排序后的申请单进行逐笔金额确认，直到累计参与投资者数达到 200 人。超过目标规模上限的其他投资者委托将不被确认。如果确认某单笔委托将导致参与人数超限，则该单笔委托将全额不被确认。另外，由于投资者自身原因导致资金未到账或资金不到参与下限也将造成参与委托不被确认。投资者参与申请存在失败的风险。

10、管理人因停业、解散、撤销、破产，或者被中国证监会撤销相关业务许可等原因不能履行职责的风险

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

### （三）本集合计划的特有风险揭示

#### 1、电子签名合同风险

本集合计划可以采取电子签名的方式签署电子合同，可以通过网上交易系统认购，因此存在互联网安全、操作失误等风险。

#### 2、封闭期无法退出的风险

集合计划每月开放一次，允许投资者退出。除开放期外，均为封闭期。投资者存在封闭期内无法退出的风险。

3、本集合计划为混合偏权益类集合资产管理计划，主要投资于权益类资产。因此股市的变化将影响到产品业绩表现。本计划虽然按照风险收益配比原则，实行动态的资产配置，但并不能完全抵御市场整体下跌风险。本计划管理人将发挥专业研究优势，加强对市场、上市公司基本面的深入研究，持续优化组合配置，以控制特定风险。

4、本计划可投资于北交所股票。北交所上市企业为创新型中小企业，相对于沪深交易所上市企业，北交所上市企业的经营风险、盈利风险、技术风险、流动性风险、退市风险、股价大幅波动风险等整体上更为突出，且在北交所投资还存在市场制度、交易规则等差异可能带来的风险。

管理人将密切关注北交所股票的特殊风险，但并不能确定北交所特定风险的完全免除。

#### 5、止损线风控措施的风险

本计划止损线为 0.7000 元。本集合计划存续期间内任何一个工作日(T日)，如果日终集合计划单位净值不高于止损线的，自 T+1 日起对集合计划持有的非现金类资产进行不可逆变现，并在 T+2 日内发布公告告知客户产品止损事宜。将可变现资产进行全部变现后本集合计划终止。

决定是否执行止损是管理人的权利而非义务，管理人有权决定在日终集合计划单位净值 高于止损线时止损，也有权决定在上述情况下继续运作本集合

计划。

管理人根据上述情况进行止损操作，但止损操作的执行效果与所持有品种的流动性及止损时所处的市场环境等因素有关，即可能出现止损不能及时完成，本计划净值进一步下跌的可能，也可能出现因流动性等原因，止损价格不理想导致本集合计划财产损失（份额净值下跌）的可能性。

#### （四）不可抗力因素导致的风险

指遭受不能预见，不能避免，不能克服等不可抗力的客观情况所导致的风险，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，包括但不限于政府干预，国家或者地方政策调整、社会安全事件、洪水、地震及其它自然灾害、战争、骚乱、火灾、突发性公共卫生事件、政府征用、没收、法律法规变化或其他突发事件、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。

#### （五）其他风险

包括管理人、托管人被提起诉讼或业务活动违反法律或行政法规，可能承担行政责任或者赔偿责任，有可能导致委托资产损失的风险。

## 二十四、资产管理合同的变更、终止与财产清算

### （一）合同的变更

1、因法律、法规、规章、中国证监会的规定、基金业协会自律管理规则、证券登记结算机构业务规则以及证券交易所等交易规则颁布或修订，或相关监管机构或自律组织对本集合计划备案补正意见的要求涉及合同修改的。管理人经与托管人协商，可以对本集合计划合同及说明书与新的法律法规或有关政策不一致的内容进行更新或修改，或根据相关监管机构或自律组织备案补正意见的要求对本合同及说明书进行修改，更新或修改的内容不得违反法律法规和中国证监会的有关规定。更新或修改的内容在管理人网站公告满5个工作日后生效。投资者对更新或修改的内容有异议，可在更新或修改内容生效前向代理销售机构申请退出本集合计划，在管理人安排临时开放期申请退出集合计划。

2、由于其他原因需要变更合同的，管理人和托管人应书面达成一致意见后以管理人指定网站公告或其他适当方式向投资者发送合同变更征询意见。投资者不同意变更的，应在征询意见发出后的最近一个开放期或管理人设置的合同变更临时开放期内提出退出本集合计划的申请；投资者未在前述时间回复意见也未在开放期退出集合计划的，视为投资者同意合同变更。投资者不同意变更的，管理人对其采取如下权利保障措施及后续安排：

投资者不同意变更的，管理人保障其退出集合计划的权利；对于明确答复不同意合同变更但逾期未退出本集合计划的投资者，管理人将统一在合同变更生效日次一工作日做强制退出处理（退出价格为退出当日的计划单位净值）。合同变更于开放期结束后的第一个工作日起生效。

投资者同意，无论其是否提出退出申请，管理人经与托管人书面达成一致后

变更本合同的行为均不应被视为或裁定为管理人或托管人的违约行为。

本集合计划改变投向和比例的，应当事先取得投资者同意，并按上述规定履行合同变更程序。

此外，本集合计划也可通过全体投资者、资产管理人和资产托管人协商一致并签署补充协议的方式对资产管理合同进行变更。

### 3、特殊情形下的合同变更

#### （1）管理人的更换

1) 管理人因被依法撤销资产管理业务资格或者依法解散、被撤销、宣告破产等原因不能履行管理人职责，资产管理计划由其他管理人承接。发生此等情形时，原管理人应当向新的管理人交接本计划资产管理事务。

托管人决定更换管理人的，托管人向投资者征询更换管理人的意见，并告知投资者拟更换的新的管理人。投资者同意更换管理人的，投资者、原管理人、新管理人、托管人四方签署协议约定变更管理人事项。投资者不同意更换管理人的，投资者、原管理人、托管人协商一致终止本计划。

2) 管理人应按照监管机构的要求办理转让手续；

3) 管理人职责终止的，管理人应妥善保管资产管理业务资料，及时向新任管理人办理资产管理业务的移交手续，新任管理人应及时接收。新任管理人应与托管人核对本计划资产总值和净值；

4) 管理人职责终止的，应当按照法律法规规定聘请会计师事务所对计划财产进行审计，并将审计结果予以公告，同时报法律法规规定的监管机构、自律组织备案，审计费用从计划财产中列支；

5) 管理人更换后，如果原任或新任管理人要求，应按其要求替换或删除计划名称中与原管理人有关的名称字样；

6) 管理人变更程序的例外：管理人可能以独资或者控股方式成立具有独立法人资格的从事资产管理业务的公司。投资者在此同意，如果本事件发生，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前述的从事资产管理业务的公司，并无须就此项变更和投资者另行签订专项协议。但在转让前管理人应以信息披露的形式通告投资者。管理人保障投资者退出本计划的权利，并在届时的公告中对相关事项作出合理安排。管理人应当保证受让人具备开展此项业务的相关资格，并向托管人提供监管机构相关批复文件复印件。管理人应按照监管机构的要求办理转让手续。

#### （2）托管人的更换

1) 托管人因被依法撤销基金托管资格或者依法解散、被撤销、宣告破产等原因不能履行管理人职责，资产管理计划由其他托管人承接。发生此等情形时，原托管人应当向新的托管人交接本计划资产托管事务。

管理人决定更换托管人的，管理人向投资者征询更换托管人的意见，并告知投资者拟更换的新的托管人。投资者同意更换托管人的，投资者、管理人、新托管人、原托管人四方签署协议约定变更托管人事项。投资者不同意更换托管人的，

投资者、管理人、原托管人协商一致终止本计划。

2) 托管人应按照监管机构的要求办理转让手续；

3) 托管人职责终止的，托管人应妥善保管资产管理业务资料，及时向新任托管人办理资产管理业务的移交手续，新任托管人应及时接收。新任托管人应与管理人核对本计划资产总值和净值；

4) 托管人职责终止的，应当按照法律法规规定聘请会计师事务所对计划财产进行审计，并将审计结果予以公告，同时报法律法规规定的监管机构、自律组织备案，审计费用从计划财产中列支。

(3) 新任管理人接受资产管理或新任托管人接受计划财产和托管业务前，原管理人或托管人应依据法律法规和本合同的规定继续履行相关职责，并保证不对投资者的利益造成损害。原管理人或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管理费或托管费。

本部分关于管理人、托管人更换条件和程序的约定，凡是直接引用法律法规或监管规则的部分，如将来法律法规或监管规则修改导致相关内容被取消或变更的，管理人与托管人协商一致并提前公告后，可直接对相应内容进行修改和调整，无需经投资者同意。

4、合同变更后，投资者、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。

5、自合同变更之日起 5 个工作日，管理人应按照基金业协会要求及时向基金业协会备案。

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

管理人特别提示，合同变更可能涉及投资者的各项权益调整（包括但不限于权利义务的重大变动，管理费、托管费、业绩报酬（如有）的提高或降低等），投资者应实时关注管理人网站（[www.swsc.com.cn](http://www.swsc.com.cn)）公告；投资者同意，管理人通过网站公告的方式视为已合理征询投资者的意见。管理人在与托管人达成一致意见并通过管理人网站或其他适当方式向投资者发送合同变更征询意见后，按照上述程序变更本合同属于投资者认可的行为。

## **（二）集合计划的展期变更**

### **1、展期变更的条件**

(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、中国证监会规定和《资产管理合同》《说明书》的约定；

(2) 展期没有损害投资者利益的情形；

(3) 符合资产管理计划的成立条件。

(4) 中国证监会规定的其他条件。

### **2、展期的安排**

(1) 通知展期的时间

管理人拟展期的，管理人应当在收到托管人同意展期的书面文件后、集合计划存续期届满前，提前5个工作日内向投资者征询意见。

## （2）通知展期的方式

管理人应当通过管理人网站公告或邮件通知等方式向投资者发送集合计划展期的征询意见，投资者需在征询意见发出之日起5个工作日内通过销售机构向管理人做出是否同意回复。

## （3）投资者回复的方式

集合计划存续期届满后，投资者不同意展期的，应在征询意见发出之日起5个工作日内（含当日）向管理人提出退出本集合计划的申请；投资者未在前述时间回复意见或意思表示不明确或未在征询意见发出之日起5个工作日内提出退出计划申请的，视为投资者同意展期，管理人不再另行通知。

## 3、投资者不同意展期的处理办法

投资者在征询意见发出之日起5个工作日内（含当日）提出退出申请的，管理人保障其退出集合计划的权利。退出价格及退出方式按照本合同第八节集合计划退出条款执行。

管理人应对不同意展期的投资者退出事宜作出公平、合理安排。管理人应当在原存续期届满日对其持有的计划份额一次性统一办理退出手续。

## 4、展期的实现

如果同意集合计划展期的投资者人数不少于2人，且集合计划存续规模不低于1000万元，则集合计划将依法展期；如果同意本集合计划展期的各投资者人数低于2人或集合计划存续规模低于1000万元，则集合计划到期终止，将按照《资产管理合同》等相关法律文件的规定办理计划到期终止和清算事宜。

## （三）集合计划应当终止的情形

如出现下列情形之一，本集合计划应当终止并进入资产清算程序：

- 1、集合计划存续期届满且未展期；
  - 2、经全体投资者、管理人和托管人协商一致决定终止的；
  - 3、触发《资产管理合同》第十一部分止损条款；
  - 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、持续五个工作日投资者少于2人的；
  - 7、未在基金业协会完成备案的情形；
  - 8、管理人认为必要时可终止本集合计划；
  - 9、集合计划单位净值高于2.00元时，管理人有权单方面提前终止集合计划；
  - 10、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。
- 集合计划发生终止的，管理人应在管理人网站公告终止情况。

#### （四）集合计划的清算

##### 1、资产管理计划财产清算小组成员及职责

（1）集合计划清算小组成员由管理人和托管人组成，清算小组可以聘用必要的工作人员。

（2）集合计划财产清算小组负责资产管理计划财产的保管、清理、估价、变现和分配。清算小组可以依法进行必要的民事活动。

##### 2、资产管理计划财产清算的程序

（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投资者披露；

（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进行分配；

（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。

##### 3、清算费用的来源和支付方式

清算费用是指集合计划财产清算小组在进行清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由集合计划财产清算小组优先从集合计划财产中支付。清算费用包括但不限于：

（1）集合计划资产的保管、清理、估价、变现和分配产生的费用；

（2）信息披露所发生的费用；

（3）诉讼仲裁所发生的费用；

（4）其他与清算事项有关的费用。

除交易所、登记结算机构、开户银行等自动扣缴的费用外，所有清算费用由管理人向托管人出具指令，由托管人复核后办理支付。

##### 4、资产管理计划财产清算剩余资产的分配

依据集合计划财产清算的分配方案，将集合计划财产清算后的全部剩余资产扣除集合计划财产清算费用、缴纳所欠税款并清偿集合计划债务后，按集合计划份额持有人持有的集合计划份额比例进行分配。

##### 5、集合计划延期清算处理方式

若本集合计划因受托财产流动性受限等原因延期清算的，管理人应对集合计划财产进行清算并先行分配已变现部分。在上述流动性受限资产可以变现时，管理人及时完成剩余集合计划财产的变现操作，并将变现后的资产按照投资者拥有份额的比例或本合同的约定，以货币形式全部分配给投资者。本集合计划持有多个流通受限的证券的，管理人可进行多次变现及清算。在变现过程中，管理人和托管人不再计提管理费、托管费。

集合计划延期清算的，管理人应当及时向中国证监会相关派出机构报告。

## 6、资产管理计划财产清算报告的告知安排

清算过程中的有关重大事项须及时公告；管理人应在清算结束后 5 个工作日内在管理人网站公布清算结果并报基金业协会备案。

7、集合计划财产清算完毕后，集合计划托管人及集合计划管理人应按照交易所、银行的有关规定注销托管资金专门账户、证券账户等投资所需账户。托管人按照规定注销资产管理计划财产的托管账户等投资所需账户，管理人应给予必要的配合。

8、集合资产管理计划清算账册及有关文件由管理人和托管人按相关法律法规规定年限妥善保存，保存期不少于 20 年。

9、管理人应当自资产管理计划终止之日起 5 个工作日内报告基金业协会，并在资产管理计划清算结束后 5 个工作日内将清算报告报送基金业协会。

## 二十五、违约责任

资产管理合同当事人违反本合同，应当承担违约责任。

（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，给计划财产或者投资者造成损害的，应当分别对各自的行为依法承担赔偿责任，但不因各自职责以外的事由与其他当事人承担连带赔偿责任；因资产管理人、资产托管人共同行为给计划财产或者投资者造成损害的，应当按照过错原则承担赔偿责任。但是发生下列情况的，当事人可以免责：

### 1、不可抗力

不可抗力是指本合同当事人无法预见、无法克服、无法避免，且在本合同生效之后发生的，使本合同当事人无法全部或部分履行本合同的任何事件，包括但不限于政府干预，国家或者地方政策调整、社会安全事件、洪水、地震及其它自然灾害、战争、骚乱、火灾、突发性公共卫生事件、政府征用、没收、法律法规变化或其他突发事件、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、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。

5、在计划运作过程中，管理人及托管人按照法律、行政法规的规定以及本合同的约定履行了相关职责，但由于其控制能力之外的第三方原因或其他原因

而造成运作不畅、出现差错和损失的。

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

7、投资者未能事前就其关联交易或其他禁止交易证券明确告知管理人致使资产管理计划资产发生违规投资行为的，管理人与托管人均不承担责任；

8、法律法规规定及本合同约定的其他情况。

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

（三）本合同一方当事人造成违约后，其他当事人应当采取适当措施防止损失的扩大；没有采取适当措施致使损失扩大的，不得就扩大的损失要求赔偿。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投资者损失，管理人和托管人免除赔偿责任。但是管理人和托管人应积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

（五）一方当事人依据本合同向另一方当事人赔偿的损失，仅限于直接损失。

（六）管理人违反法律、行政法规的有关规定，被中国证监会依法撤销证券资产管理业务许可、责令停业整顿，或者因停业、解散、撤销、破产等原因不能履行职责的，应当按照有关监管要求妥善处理有关事宜。

## 二十六、争议的处理

计划管理人、托管人、投资者之间因本协议产生的或与本协议有关的争议可首先通过友好协商解决，本协议当事人不愿通过协商、调解解决或协商、调解不成的，则任何一方应将争议提交管理人住所地法院诉讼。

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、尽责地履行资产管理合同规定的义务，维护投资者的合法权益。

## 二十七、资产管理合同的效力

### （一）合同的签署方式

本合同是约定合同当事人之间权利义务关系的法律文件。本合同以纸质或电子签名的方式签署，管理人、托管人作为本合同签署方，已接受本合同项下的全部条款，投资者作为本合同一方，签署本合同即表明投资者完全接受本合同项下的全部条款，同时本合同成立。

1、本合同的签署采用纸质合同方式进行的：投资者为法人的，资产管理合同自投资者、管理人和托管人加盖公章/合同专用章以及各方法定代表人/负责人或授权代表签字或盖章之日起成立；投资者为自然人的，资产管理合同自投资者

本人签字、管理人和托管人加盖公章/合同专用章以及双方法定代表人/负责人或授权代表签字或盖章之日起成立。

2、本合同的签署采用电子签名方式进行的：资产管理人与资产托管人通过加盖公章/合同专用章以及各方法定代表人/负责人或授权代表签字或盖章签署纸质合同后，投资者以电子签名方式签署本合同后本合同即告成立。电子签名签署的电子合同与纸质合同上手写签名或盖章具有同等法律效力，投资者不得否认其效力。

## （二）合同生效

本合同成立后，同时满足以下条件时生效：

- 1、投资者参与资金实际交付并确认；
- 2、管理人公告本计划成立；

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。

资产管理合同成立后，对于初始募集期认购的投资者，本合同自本计划成立之日起生效，本计划成立日以管理人公告为准；对于存续期参与的投资者，本合同自投资者的参与资金实际交付、份额登记机构确认参与份额之日起生效。

对于已经签署了西南证券日新泽达1号集合资产管理计划资产管理合同（合同编号：XN-RXZD-01）（以下简称原合同）的投资者而言，投资者未在管理人公告的因合同变更而设置的指定开放期内申请退出的，视为同意本次合同变更，且自本次合同变更生效之日（以合同变更相关公告为准）起，视为有效签署本合同，本合同成立并生效，原合同作废。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。

本合同自生效之日起对投资者、管理人、托管人具有同等的法律约束力。

## （三）合同的有效期限

本合同期限自本合同生效之日起至本集合计划资产全部清算分配完毕之日终止。

投资者自签署合同起即成为本合同的当事人。在集合计划存续期间，投资者自全部退出集合计划之日起，不再是本合同的当事人。

## （四）合同的组成

《西南证券日新泽达1号集合资产管理计划说明书》、《西南证券日新泽达1号集合资产管理计划风险揭示书》经管理人确认有效的投资者参与、退出本集合计划的申请材料及各销售机构出具的集合计划参与、退出业务受理有关凭证等为本合同的附件，是本合同不可分割的一部分，与合同具有同等法律效力。

## 二十八、通知和送达

（一）任何一方发出的通知或其它联系应以中文书写。各方应按照下表中相关方的通讯方式，以专人送达、挂号信件、EMS特快专递、电子邮件、传真或以公认的快递服务或图文传真发送到另一方等有效方式进行通知和送达。

|      |                                                                                                                |
|------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资者  | 投资者信息以合同签署页为准                                                                                                  |
| 托管人： | 招商银行股份有限公司重庆分行<br>地址：重庆市北部新区星光大道88号<br>邮编：401121<br>业务联系人：金小圣<br>电话：023-67031812<br>邮箱：tuoguan_cq@cmbchina.com |
| 管理人： | 西南证券股份有限公司<br>地址：重庆市江北区金沙门路32号<br>邮编：400025<br>联系人：王寒<br>邮箱：whan@swsc.com.cn<br>电话：023-67603514                |

投资者信息以合同签署页为准。

本合同项下司法文书的送达地址亦为上述地址，该地址可以用于收取各类司法文书，按照上述地址送达的，视为签收，如受送达人拒收的，不影响送达的效力。

（二）通知在下列日期视为送达被通知方：

- 1、专人送达：专人递交的通知在专人交到之日视为送达；
- 2、挂号信件、特快专递形式或公认的快递服务：发出后第三日视为送达；
- 3、电子邮件：通知方成功发送至被通知方上述指定的邮箱之日；
- 4、图文传真发送的通知：以发件方发送后打印出的发送确认单所示时间视为送达；
- 5、传真：被通知方收到成功发送的传真并电话确认之日。

（三）一方通讯地址或联络方式发生变化，应提前5个工作日以书面形式通知其他各方。如果在合同终止前一个月内发生变化，应提前3个工作日以书面形式通知其他各方；

如果通讯地址或联络方式发生变化的一方（简称“变动一方”），未将有关变化及时通知其他各方，除非法律另有规定，变动一方应对由此而造成的影响和损失承担责任。

## 二十九、或有事件

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

投资者在此同意,如果或有事件发生,在管理人与托管人协商一致的基础上,管理人有权将本合同中由管理人享有的权利和由管理人承担的义务转让给上一条所述的从事资产管理业务的公司,并无须就此项变更和投资者另行签订专项协议。但在转让前管理人应以信息披露的形式通告投资者。管理人保障投资者退出本计划的权利,并在届时的通告中对相关事项作出合理安排。

管理人应当保证受让人具备开展此项业务的相关资格,并向托管人提供监管机构相关批复文件复印件。

管理人应按照监管机构的要求办理转让手续。

（以下无正文）

### 合同签章页

本页无正文，为投资者、管理人西南证券股份有限公司与托管人招商银行股份有限公司重庆分行关于《西南证券日新泽达 1 号集合资产管理计划资产管理合同》（2024 年 4 月版）（合同编号：XN-RXZD-01-1）的投资者签署页。

管理人、托管人确认，已向投资者明确说明集合计划的风险并就与投资者有重大利害关系的条款的概念、内容及其法律后果向投资者充分提示并作出解释说明，不保证投资者资产本金不受损失或取得最低收益；投资者确认，已充分理解本合同的内容及与投资者有重大利害关系的条款，并自行承担投资风险和损失。

### 投资者信息

个人填写：

姓名：

证件类型：

证件号码：

通信地址：

邮政编码：

联系电话：

移动电话：

电子信箱：

其他：

机构填写：

机构名称：

法定代表人：

通信地址：

邮政编码：

代理人姓名：

身份证号码：

联系电话：

其他：

投资者签字/盖章：

西南证券股份有限公司在此向您温馨提示：警惕洗钱陷阱，保护自身利益，请不要随意出借身份证件及个人账户供他人使用；请如实填写身份信息，配合金融机构工作人员开展客户尽职调查。

签订日期：            年    月    日

### 合同签章页

本页无正文，为投资者、管理人西南证券股份有限公司与托管人招商银行股份有限公司重庆分行关于《西南证券日新泽达1号集合资产管理计划资产管理合同》（2024年4月版）（合同编号：XN-RXZD-01-1）的管理人、托管人签署页。

管理人、托管人确认，已向投资者明确说明集合计划的风险并就与投资者有重大利害关系的条款的概念、内容及其法律后果向投资者充分提示并作出解释说明，不保证投资者资产本金不受损失或取得最低收益；投资者确认，已充分理解本合同的内容及与投资者有重大利害关系的条款，并自行承担投资风险和损失。

管理人：西南证券股份有限公司（盖章）



法定代表人或授权代表：

*[Handwritten signature]*

托管人：招商银行股份有限公司重庆分行（盖章）



法定代表人/负责人或授权代表：



签订日期：2024年4月24日

## 附件 1：西南证券日新泽达 1 号集合资产管理计划交易监督事项表

| 序号 | 监督内容                                                                                              |
|----|---------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 1  | 交易所交易的股票（包括沪深交易所、北京交易所），公募基金，国债逆回购，银行活期存款。                                                        |
| 2  | 集合计划持有权益类资产：依市值合计占集合资管计划当日资产总值的比例为 20%（含）-100%（不含）。                                               |
| 3  | 集合计划持有固定收益类资产：依市值合计占集合资管计划当日资产总值的比例为 0%-80%（不含）。                                                  |
| 4  | 集合计划持有同一资产的比例不得超过当日集合计划资产净值的 25%。                                                                 |
| 5  | 集合计划的总资产不得超过净资产的 140%。                                                                            |
| 6  | 集合计划不得投资于“ST、*ST 类股票”                                                                             |
| 7  | 集合计划开放退出期内，主动投资于流动性受限资产的市值不超过计划资产净值的 20%，资产组合中 7 个工作日可变现资产的价值不低于集合计划资产净值的 10%。                    |
| 8  | 申购新股时，申购金额不得超过集合计划资产总额，申购数量不得超过上市公司本次发行总量。（在管理人提供申购金额的前提下托管人予以监控）                                 |
| 9  | 因管理人之外的因素导致的集合计划投资不符合法律、行政法规和中国证监会规定的投资比例或者合同约定的投资比例的，管理人应在流动性受限资产可出售、可转让或者恢复交易的二十个交易日内调整至符合相关要求。 |

## 附件2 管理人和托管人关联方名单

## 管理人关联方名单

|    |                       |     |                          |
|----|-----------------------|-----|--------------------------|
| 1  | 安诚财产保险股份有限公司          | 118 | 重庆高速公路集团有限公司             |
| 2  | 中新互联互通投资基金管理有限公司      | 119 | 重庆市城市建设投资(集团)有限公司        |
| 3  | 中交地产股份有限公司            | 120 | 重庆市江北嘴中央商务区投资集团有限公司      |
| 4  | 重庆机电股份有限公司            | 121 | 银华基金管理股份有限公司             |
| 5  | 重庆川仪自动化股份有限公司         | 122 | 重庆城投基础设施建设有限公司           |
| 6  | 长安汽车金融有限公司            | 123 | 重庆城投城市更新建设发展有限公司         |
| 7  | 三峡人寿保险股份有限公司          | 124 | 重庆颐天康养产业发展有限公司           |
| 8  | 重庆商社(集团)有限公司          | 125 | 重庆市城投路桥管理有限公司            |
| 9  | 重庆商社商业管理有限公司          | 126 | 重庆恒诚投资有限公司               |
| 10 | 西部绿色能源科技(重庆)有限公司      | 127 | 重庆市城投公租房建设有限公司           |
| 11 | 重庆华龙网集团股份有限公司         | 128 | 重庆市城市建设土地发展有限责任公司        |
| 12 | 长江经济联合发展(集团)股份有限公司    | 129 | 重庆城投集团开州建设有限公司           |
| 13 | 重庆华贸国有资产经营有限公司        | 130 | 重庆九锅箐农林综合开发有限责任公司        |
| 14 | 重庆渝富投资有限公司            | 131 | 重庆渝开发股份有限公司              |
| 15 | 重庆渝资光电产业投资有限公司        | 132 | 重庆城投建信基础设施建设股权投资基金管理有限公司 |
| 16 | 重庆银海融资租赁有限公司          | 133 | 重庆市城投金卡信息产业(集团)股份有限公司    |
| 17 | 重庆渝富兴欣土地开发有限公司        | 134 | 重庆国调企业管理有限公司             |
| 18 | 重庆进出口融资担保有限公司         | 135 | 重庆城投医疗健康产业发展有限公司         |
| 19 | 北京两江科技有限公司            | 136 | 重庆城投朝天门项目管理有限公司          |
| 20 | 重庆信惠投资有限公司            | 137 | 重庆市嘉郡房地产开发有限公司           |
| 21 | 深圳诚本财富管理有限公司          | 138 | 重庆骏励房地产开发有限公司            |
| 22 | 信惠商业保理有限公司            | 139 | 重庆渝开发新干线置业有限公司           |
| 23 | 重庆兴农融资担保集团有限公司        | 140 | 重庆渝开发物业管理有限公司            |
| 24 | 重庆市交通融资担保有限公司         | 141 | 重庆道金投资有限公司               |
| 25 | 重庆兴农资产价格评估房地产土地估价有限公司 | 142 | 重庆渝开发资产经营管理有限公司          |
| 26 | 重庆兴农智能科技有限公司          | 143 | 重庆国际会议展览中心经营管理有限公司       |
| 27 | 重庆兴农资产经营管理有限公司        | 144 | 重庆朗福置业有限公司               |
| 28 | 重庆三峡融资担保集团股份有限公司      | 145 | 重庆捷兴置业有限公司               |
| 29 | 深圳渝信资产管理有限公司          | 146 | 重庆市城投标信科技有限责任公司          |
| 30 | 重庆瑜信企业管理有限公司          | 147 | 重庆城投金卡好运通有限公司            |
| 31 | 重庆金宝保信息技术服务有限公司       | 148 | 重庆康居西城城投商街资产管理有限公司       |
| 32 | 深圳市前海普华汇信金融服务有限公司     | 149 | 重庆颐天展宸置业有限公司             |
| 33 | 重庆斐耐科技有限公司            | 150 | 云南颐天展宸置业发展有限公司           |
| 34 | 重庆两江新区长江三峡小额贷款有限公司    | 151 | 重庆城投江长建设有限公司             |
| 35 | 重庆市教育融资担保有限公司         | 152 | 重庆市万州机场有限责任公司            |
| 36 | 重庆渝台融资担保有限公司          | 153 | 重庆市万州江南新区开发建设有限公司        |
| 37 | 重庆金融后援服务有限公司          | 154 | 重庆中油诚源发展有限公司             |
| 38 | 重庆国资大数据智能科技有限公司       | 155 | 重庆渝泊停车场建设管理有限公司          |

|    |                      |     |                             |
|----|----------------------|-----|-----------------------------|
| 39 | 中国四联仪器仪表集团有限公司       | 156 | 重庆会展中心置业有限公司                |
| 40 | 巫溪县兼善光伏发电有限公司        | 157 | 中交航空港有限公司                   |
| 41 | 重庆川仪微电路有限责任公司        | 158 | 重庆药品交易所股份有限公司               |
| 42 | 绵阳四联电子科技有限公司         | 159 | 国家电投集团远达环保股份有限公司            |
| 43 | 重庆四联电子器件有限公司         | 160 | 重药控股股份有限公司                  |
| 44 | 江西川仪三川智慧水务科技有限公司     | 161 | 重钢西昌矿业有限公司                  |
| 45 | 绵阳川仪大泰环保有限责任公司       | 162 | 重庆征信有限责任公司                  |
| 46 | 上海宝川自控成套设备有限公司       | 163 | 重庆西证渝富股权投资基金管理有限公司          |
| 47 | 上海川仪工程技术有限公司         | 164 | 嘉兴恒渝股权投资合伙企业（有限合伙）          |
| 48 | 重庆川仪分析仪器有限公司         | 165 | 重庆金卡联智数字技术有限公司              |
| 49 | 重庆川仪工程技术有限公司         | 166 | 重庆龙湖颐天展图置业有限公司              |
| 50 | 重庆川仪环境科技有限公司         | 167 | 重庆龙湖颐天展晟置业有限公司              |
| 51 | 重庆川仪科学仪器有限公司         | 168 | 重庆龙湖颐天鼎圣房地产开发有限公司           |
| 52 | 重庆川仪控制系统有限公司         | 169 | 重庆颐天展驰置业有限公司                |
| 53 | 重庆川仪软件有限公司           | 170 | 重庆城投瑞安养老服务有限公司              |
| 54 | 重庆川仪十七厂有限公司          | 171 | 重庆市嘉星半岛城市建设发展有限公司           |
| 55 | 重庆川仪速达机电有限公司         | 172 | 重庆机场集团有限公司                  |
| 56 | 重庆川仪特种阀门修造有限公司       | 173 | 重庆旅游投资集团有限公司                |
| 57 | 重庆川仪调节阀有限公司          | 174 | 重庆燃气集团股份有限公司                |
| 58 | 重庆川仪物流有限公司           | 175 | 重庆农畜产品交易所股份有限公司             |
| 59 | 重庆川仪自动化工程检修服务有限公司    | 176 | 重庆千信集团有限公司                  |
| 60 | 重庆四联测控技术有限公司         | 177 | 重庆市江北嘴置业有限公司                |
| 61 | 重庆四联技术进出口有限公司        | 178 | 重庆市江北嘴水源空调有限公司              |
| 62 | 香港联和经贸有限公司           | 179 | 重庆市江北嘴股权投资基金管理有限公司          |
| 63 | 重庆鲲鹏测量设备有限公司         | 180 | 重庆渝海控股（集团）有限责任公司            |
| 64 | 重庆两江新区信联产融小额贷款有限公司   | 181 | 重庆市江北嘴聚鑫投资有限公司              |
| 65 | 重庆四联光电科技有限公司         | 182 | 重庆市两江金融发展有限公司               |
| 66 | 加拿大四联蓝宝石有限公司         | 183 | 重庆两江新区战新服务业股权投资基金合伙企业（有限合伙） |
| 67 | 兰州四联光电科技有限公司         | 184 | 重庆两江新区建设有限公司                |
| 68 | 重庆四联光电半导体材料有限公司      | 185 | 重庆寸滩国际邮轮母港发展有限公司            |
| 69 | 重庆四联智慧科技有限公司         | 186 | 重庆壹号企业管理咨询合伙企业（有限合伙）        |
| 70 | 重庆四联元润科技有限公司         | 187 | 重庆市首发企业管理咨询有限责任公司           |
| 71 | 重庆四联特种装备材料有限公司       | 188 | 重庆江北嘴国际投融资路演中心有限公司          |
| 72 | 重庆四联投资管理有限公司         | 189 | 重庆两江新区融资担保有限公司              |
| 73 | 重庆四联榆凯企业管理合伙企业（有限合伙） | 190 | 重庆两江博瑞德小额贷款有限公司             |
| 74 | 重庆四联微电子有限公司          | 191 | 重庆两江新区凌励资本管理中心（有限合伙）        |
| 75 | 重庆四联新能源有限公司          | 192 | 重庆两江智慧城市投资发展有限公司            |
| 76 | 四联新能源江苏有限公司          | 193 | 重庆市江北嘴物业服务服务有限公司            |
| 77 | 重庆四联光伏工程技术有限公司       | 194 | 重庆君恒建设有限公司                  |
| 78 | 重庆长辉节能减排工程技术有限公司     | 195 | 重庆渝海物业管理有限责任公司              |
| 79 | 重庆渝富控股集团有限公司         | 196 | 重庆绿满川农业发展有限公司               |
| 80 | 重庆渝富资本运营集团有限公司       | 197 | 海南渝海实业开发总公司                 |
| 81 | 重庆渝富（香港）有限公司         | 198 | 重庆市渝海实业总公司                  |

|     |                      |     |                                 |
|-----|----------------------|-----|---------------------------------|
| 82  | 重庆渝欣创商业管理有限公司        | 199 | 重庆卓杰商务发展有限公司                    |
| 83  | 重庆渝富资本股权投资基金管理有限公司   | 200 | 重庆华兴工程咨询有限公司                    |
| 84  | 重庆兴九企业管理有限公司         | 201 | 重庆两江新区金智股权投资基金合伙企业（有限合伙）        |
| 85  | 重庆银行股份有限公司           | 202 | 舞钢市两江智慧市政建设有限公司                 |
| 86  | 重庆农村商业银行股份有限公司       | 203 | 重庆渝海地王广场商业有限责任公司                |
| 87  | 重庆渝富土地开发经营有限公司       | 204 | 重庆城市广场有限公司                      |
| 88  | 重庆股权服务集团有限责任公司       | 205 | 重庆成功物业发展有限责任公司                  |
| 89  | 重庆股份转让中心有限责任公司       | 206 | 渝农商金融租赁有限责任公司                   |
| 90  | 重庆榆钱儿股权投资基金管理有限公司    | 207 | 重庆物流金融服务（集团）股份有限公司              |
| 91  | 重庆榆钱儿金融科技有限责任公司      | 208 | 重庆联顺合气创业投资基金合伙企业（有限合伙）          |
| 92  | 重庆钢铁集团矿业有限公司         | 209 | 重庆两江新区博科股权投资基金合伙企业（有限合伙）        |
| 93  | 重庆渝富产城运营建设发展有限公司     | 210 | 重庆两江中新嘉量金融科技人民币股权投资基金合伙企业（有限合伙） |
| 94  | 重庆澜天城市建设有限公司         | 211 | 重庆渝海建设监理有限公司                    |
| 95  | 重庆渝富兴都城市建设发展有限公司     | 212 | 重庆建工集团股份有限公司                    |
| 96  | 重庆渝富兴南城市建设发展有限公司     | 213 | 京东方科技集团股份有限公司                   |
| 97  | 重庆中新航旅实业有限公司         | 214 | 重庆市江北区国咨小额贷款有限公司                |
| 98  | 国家集成电路产业投资基金二期股份有限公司 | 215 | 重庆两江新区战略性新兴产业股权投资基金合伙企业（有限合伙）   |
| 99  | 重庆汇智丰国联房地产顾问有限公司     | 216 | 重庆战略性新兴产业股权投资基金合伙企业（有限合伙）       |
| 100 | 重庆汇丰智力企业管理咨询集团有限公司   | 217 | 重庆富城资产管理有限公司                    |
| 101 | 重庆汇丰房地产土地资产评估有限责任公司  | 218 | 中保保险资产登记交易系统有限公司                |
| 102 | 重庆元丰聚兴科技发展有限公司（有限合伙） | 219 | 重庆两江新区承为股权投资基金合伙企业（有限合伙）        |
| 103 | 重庆汇丰国鸿工程咨询有限公司       | 220 | 重庆国家金融科技认证中心有限责任公司              |
| 104 | 重庆汇集源科技有限公司          | 221 | 重庆市津信股权投资基金合伙企业（有限合伙）           |
| 105 | 中联资产评估集团重庆汇智丰有限公司    | 222 | 重庆市麻柳股权投资基金合伙企业（有限合伙）           |
| 106 | 重庆汇城大数据科技有限责任公司      | 223 | 重庆万州经开区股权投资基金合伙企业（有限合伙）         |
| 107 | 重庆元丰工程造价咨询有限公司       | 224 | 重庆巫溪双创股权投资基金合伙企业（有限合伙）          |
| 108 | 重庆汇晟数据科技有限公司         | 225 | 重庆两江新区市政景观建设有限公司                |
| 109 | 天津公评网汇聚鑫网络科技有限公司     | 226 | 重庆天脉实业有限公司                      |
| 110 | 北京市汉坤律师事务所           | 227 | 重庆百年上邦实业（集团）有限公司                |
| 111 | 重庆产业引导股权投资基金有限责任公司   | 228 | 西证股权投资有限公司                      |
| 112 | 重庆理工大科技发展有限责任公司      | 229 | 西证重庆股权投资基金管理有限公司                |
| 113 | 重庆天健财经顾问有限公司         | 230 | 西证创新投资有限公司                      |
| 114 | 重庆天健投资有限公司           | 231 | 西南期货有限公司                        |
| 115 | 重庆天健厚成投资有限公司         | 232 | 重庆鼎富瑞泽风险管理有限公司                  |
| 116 | 成都天健光华投资有限公司         | 233 | 西证国际投资有限公司                      |
| 117 | 重庆天健企业管理咨询有限公司       | 234 | 西证国际证券股份有限公司                    |

## 托管人关联方名单

|    |                                             |    |                             |
|----|---------------------------------------------|----|-----------------------------|
| 1  | 招银金融租赁有限公司（托管机构的控股机构、重大利害关系）                | 17 | 大家人寿保险股份有限公司（主要股东、重大利害关系）   |
| 2  | 招银国际金融控股有限公司（托管机构的控股机构、重大利害关系）              | 18 | 中国交通建设股份有限公司（主要股东、重大利害关系）   |
| 3  | Best Winner Investment Limited（主要股东、重大利害关系） | 19 | 深圳市晏清投资发展有限公司（主要股东、重大利害关系）  |
| 4  | 招商局实业发展(深圳)有限公司（主要股东、重大利害关系）                | 20 | 深圳市楚源投资发展有限公司（主要股东、重大利害关系）  |
| 5  | 招商局联合发展有限公司（主要股东、重大利害关系）                    | 21 | 中远海运投资控股有限公司（主要股东、重大利害关系）   |
| 6  | 招商局轮船有限公司（主要股东、重大利害关系）                      | 22 | 上海汽车工业（集团）有限公司（主要股东、重大利害关系） |
| 7  | 招商局集团有限公司（主要股东、重大利害关系）                      | 23 | 中国交通建设集团有限公司（主要股东、重大利害关系）   |
| 8  | 招商永隆银行有限公司（托管机构的控股机构、重大利害关系）                | 24 | 招商信诺人寿保险有限公司（重大利害关系）        |
| 9  | 招商局金融控股有限公司（主要股东、重大利害关系）                    | 25 | 中国远洋海运集团有限公司（主要股东、重大利害关系）   |
| 10 | 招商银行股份有限公司（托管机构）                            | 26 | 上海汽车集团股份有限公司（主要股东、重大利害关系）   |
| 11 | 招银理财有限责任公司（托管机构的控股机构、重大利害关系）                | 27 | 广州海宁海务技术咨询有限公司（主要股东、重大利害关系） |
| 12 | 招商银行（欧洲）有限公司（托管机构的控股机构、重大利害关系）              | 28 | 广州市三鼎油品运输有限公司（主要股东、重大利害关系）  |
| 13 | 招商信诺资产管理有限公司（托管机构的控股机构、重大利害关系）              | 29 | 中远海运(上海)有限公司（主要股东、重大利害关系）   |
| 14 | 招商基金管理有限公司（托管机构的控股机构、重大利害关系）                | 30 | 中远海运(广州)有限公司（主要股东、重大利害关系）   |
| 15 | 招联消费金融股份有限公司（重大利害关系）                        | 31 | 中国远洋运输有限公司（主要股东、重大利害关系）     |
| 16 | 中国保险保障基金有限责任公司（主要股东、重大利害关系）                 |    |                             |

## 附件 3 电子指令启用函（样本）

## 电子指令启用函（样本）

招商银行股份有限公司重庆分行：

对于我司管理，你行托管的“西南证券日新泽达 1 号集合资产管理计划”产品，采用你行网上托管银行（客户端）/电子直连，指令范围包括不限于投资、费用支付、其他划款等类型。

启用网上托管银行（客户端）/电子直连指令的产品名称、产品代码信息如下：

| 序号 | 启用电子指令产品名称           | 启用电子指令的产品代码 |
|----|----------------------|-------------|
| 1  | 西南证券日新泽达 1 号集合资产管理计划 |             |

启用日期：年 月 日

对于因网上托管银行（客户端）/电子直连指令异常导致电子指令无法发送的，我司采取传真方式发送指令，传真指令加盖书面授权通知中的预留印鉴生效。

我司发送及接收传真的传真号码：

我司发送指令附件的电子邮箱：

我司指令确认人员及指令确认电话号码：

西南证券股份有限公司（公章）