

东海证券海睿进取灵活配置混合型  
集合资产管理计划  
托管协议（第2版）

管理人：东海证券股份有限公司

托管人：交通银行股份有限公司

# 目 录

一、托管协议当事人 .....	3
二、托管协议的依据、目的和原则.....	5
三、托管人对管理人的业务监督和核查.....	5
四、管理人对托管人的业务核查.....	12
五、集合计划财产的保管.....	13
六、指令的发送、确认和执行.....	16
七、交易及清算交收安排.....	18
八、集合计划资产净值计算和会计核算.....	20
九、集合计划收益分配.....	27
十、集合计划信息披露.....	28
十一、集合计划费用.....	29
十二、集合计划份额持有人名册的保管.....	32
十三、集合计划有关文件档案的保存.....	33
十四、管理人和托管人的更换.....	33
十五、禁止行为.....	37
十六、托管协议的变更、终止与集合计划财产的清算.....	37
十七、违约责任.....	40
十八、争议解决方式.....	41
十九、托管协议的效力.....	41
二十、其他事项.....	42
二十一、托管协议的签订.....	42

鉴于东海证券股份有限公司系一家依照中国法律合法成立并有效存续的股份有限公司，拟管理东海证券海睿进取灵活配置混合型集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”或“集合计划”）；

鉴于交通银行股份有限公司系一家依照中国法律合法成立并有效存续的银行，按照相关法律法规的规定具备担任托管人的资格和能力；

鉴于东海证券股份有限公司拟担任东海证券海睿进取灵活配置混合型集合资产管理计划的管理人，交通银行股份有限公司拟担任东海证券海睿进取灵活配置混合型集合资产管理计划的托管人；

**反洗钱：**投资者承诺知悉反洗钱相关法律法规、监管规定，将严格遵守，不会违反任何相关规定。管理人承诺其知悉《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》（银发〔2017〕235号）、《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）等反洗钱相关法律法规、监管规定，将严格遵守上述规定，不会违反任何前述规定。投资者/管理人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；承诺向托管人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、提供产品受益所有人的信息和资料，并在产品受益所有人发生变化时，及时告知托管人并按托管人要求完成更新；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。

投资者/管理人承诺投资者/管理人及其关联方均不属于联合国、欧盟或美国等制裁名单，及中国政府部门或有权机关发布的涉恐及反洗钱相关风险名单内的企业或个人；不位于被联合国、欧盟或美国等制裁的国家和地区。

为明确东海证券海睿进取灵活配置混合型集合资产管理计划的管理人和托管人之间的权利义务关系，特制订本协议；

除非文义另有所指，本协议的所有术语与《东海证券海睿进取灵活配置混合型集合资产管理计划资产管理合同》（以下简称《集合计划合同》）中定义的相应术语具有相同的含义。若有抵触应以《集合计划合同》为准，并依其条款解释。

若本集合计划实施侧袋机制的，侧袋机制实施期间的相关安排见集合计划合同和招募说明书的规定。

## 一、托管协议当事人

### (一) 管理人

名称：东海证券股份有限公司（简称：东海证券）

住所：江苏省常州市延陵西路 23 号投资广场 18 层

办公地址：上海市浦东新区东方路 1928 号

法定代表人：王文卓

成立时间：1993 年 1 月 16 日

批准设立机关：中国人民银行

批准设立文号：银复〔1992〕362 号

经营范围：证券经纪；证券投资咨询；与证券交易、证券投资活动有关的财务顾问；证券承销与保荐；证券自营；证券资产管理；证券投资基金代销；为期货公司提供中间介绍业务；融资融券业务；代销金融产品业务。

注册资本：167000 万元整

组织形式：股份有限公司

存续期间：持续经营

### (二) 托管人

名称：交通银行股份有限公司（简称：交通银行）

住所：上海市浦东新区银城中路 188 号（邮政编码：200120）

办公地址：上海市长宁区仙霞路 18 号（邮政编码：200336）

法定代表人：任德奇

成立时间：1987 年 3 月 30 日

批准设立机关及批准设立文号：国务院国发(1986)字第 81 号文和中国人民银行银发〔1987〕40 号文

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字〔1998〕25 号

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项业务；提供保管箱服务；经国务院银行业监督管理机构批准的其他业务；经营结汇、售汇业务。

注册资本：742.63 亿元人民币

组织形式：股份有限公司

存续期间：持续经营

## 二、托管协议的依据、目的和原则

本协议依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《基金法》）、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》（以下简称《销售办法》）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称《运作办法》）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称《信息披露办法》）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》、《东海证券海睿进取灵活配置混合型集合资产管理计划资产管理合同》（以下简称《集合计划合同》）及其他有关规定订立。

本协议的目的是明确管理人和托管人之间在集合计划财产的保管、投资运作、净值计算、收益分配、信息披露及相互监督等有关事项中的权利、义务及职责，以确保集合计划财产的安全，保护集合计划份额持有人的合法权益。

管理人和托管人遵循平等自愿、诚实信用、充分保护投资者合法利益的原则，经协商一致，签订本协议。

## 三、托管人对管理人的业务监督和核查

### （一）托管人对管理人的投资行为行使监督权

1、托管人根据有关法律法规的规定及《集合计划合同》和本协议的约定，对集合计划的投资范围、投资对象进行监督。

本集合计划的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法公开发行的股票（包括主板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、债券（含公司债、企业债、国债、金融债、央行票据、短期融资券、可转换公司债券、分离交易可转债）、债券逆回购、资产支持证券等各类金融工具、银行存款及其他中国证监会允许投资的金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

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

集合计划的投资组合比例为：股票资产占集合计划资产的比例为0%-90%。本集合计划持有现金或到期日在1年以内的政府债券不低于集合计划资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

2、托管人根据有关法律法规的规定及《集合计划合同》和本协议的约定，对集合计划投资、融资比例进行监督。

根据《集合计划合同》的约定，本集合计划投资组合比例应符合以下规定：

- (1) 股票资产占集合计划资产的比例为0%-90%；
- (2) 本集合计划保持不低于集合计划资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；
- (3) 本集合计划持有一家公司发行的证券，其市值不超过集合计划资产净值的10%；
- (4) 本集合计划管理人管理的全部公开募集性质的集合资产管理计划持有一家公司发行的证券，不超过该证券的10%，完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的集合资产管理计划品种可以不受此条款规定的比例限制；
- (5) 本集合计划投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过集合计划资产净值的10%；
- (6) 本集合计划持有的全部资产支持证券，其市值不得超过集合计划资产净值的20%；
- (7) 本集合计划持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的10%；
- (8) 本集合计划管理人管理的全部公开募集性质的集合资产管理计划投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的10%；
- (9) 本集合计划应投资于信用级别评级为BBB以上(含BBB)的资产支持证券。集合计划持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起3个月内予以全部卖出；
- (10) 集合计划财产参与股票发行申购，本集合计划所申报的金额不超过本集合计划的总资产，本集合计划所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；



(11)本集合计划进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过集合计划资产净值的40%，进入全国银行间同业市场进行债券回购的最长期限为1年，债券回购到期后不得展期；

(12)本集合计划管理人管理的全部公开募集性质的开放式集合资产管理计划(包括开放式集合资产管理计划以及处于开放期的定期开放集合资产管理计划)持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的15%；本集合计划管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的30%，完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的开放式集合计划以及中国证监会认定的特殊投资组合可不受前述比例限制；(管理人自行监控)

(13)本集合计划主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过集合计划资产净值的15%；因证券市场波动、上市公司股票停牌、集合计划规模变动等管理人之外的因素致使集合计划不符合该比例限制的，管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

(14)本集合计划与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与集合计划合同约定的投资范围保持一致；

(15) 集合计划资产总值不得超过集合计划资产净值的140%；

(16) 法律法规及中国证监会规定的和《集合计划合同》约定的其他投资限制。

除上述(2)、(9)、(13)、(14)情形之外，因证券市场波动、证券发行人合并、集合计划规模变动等管理人之外的因素致使集合计划投资比例不符合上述规定投资比例的，管理人应当在10个交易日内进行调整。法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

管理人应当自集合计划合同生效之日起6个月内使集合计划的投资组合比例符合集合计划合同的有关约定。在上述期间内，本集合计划的投资范围、投资策略应当符合集合计划合同的约定。托管人对集合计划的投资的监督与检查自集合

计划合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门取消或变更上述限制，如适用于本集合计划，管理人在履行适当程序后，则本集合计划投资不再受相关限制或以变更后的规定为准，但须提前公告，不需要经集合计划份额持有人大会审议。

托管人依照上述规定对本集合计划的投资组合限制及调整期限进行监督。

3、托管人根据有关法律法规的规定及集合计划合同和本协议的约定，对集合计划投资禁止行为进行监督。集合计划财产不得用于下列投资或者活动。

- (1) 承销证券；
- (2) 违反规定向他人贷款或者提供担保；
- (3) 从事承担无限责任的投资；
- (4) 买卖其他集合计划份额或基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；
- (5) 向管理人、托管人出资；
- (6) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- (7) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

管理人运用集合计划财产买卖管理人、托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合集合计划的投资目标和投资策略，遵循集合计划份额持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到托管人的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

法律法规或监管部门取消上述组合限制、禁止行为规定或从事关联交易的条件和要求，本集合计划可不受相关限制。法律法规或监管部门对上述组合限制、禁止行为规定或从事关联交易的条件和要求进行变更的，本集合计划可以变更后的规定为准。经与托管人协商一致，管理人可依据法律法规或监管部门规定直接

对集合计划合同进行变更，该变更无须召开集合计划份额持有人大会审议。

在集合计划合同生效后2个工作日内，管理人和托管人应相互提供与本机构有控股关系的股东或者与本机构有其他重大利害关系的公司名单，以上名单发生变化的，应及时予以更新并通知对方。

如法律法规或监管部门变更或取消上述禁止性规定，管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制或以变更后的规定为准。

4、托管人根据有关法律法规的规定及集合计划合同和本协议的约定，对管理人参与银行间债券市场进行监督。

(1) 托管人依据有关法律法规的规定和《集合计划合同》的约定对于管理人参与银行间债券市场交易时面临的交易对手资信风险进行监督。

管理人向托管人提供符合法律法规及行业标准的银行间债券市场交易对手的名单。托管人在收到名单后2个工作日内电话或回函确认收到该名单。管理人应定期和不定期对银行间债券市场现券及回购交易对手的名单进行更新。托管人在收到名单后2个工作日内电话或书面回函确认，新名单自托管人确认当日生效。新名单生效前已与本次剔除的交易对手所进行但尚未结算的交易，仍应按照协议进行结算。

(2) 管理人参与银行间债券市场交易时，有责任控制交易对手的资信风险，由于交易对手资信风险引起的损失，管理人应当负责向相关责任人追偿。

5、托管人根据有关法律法规的规定及集合计划合同和本协议的约定，对管理人银行存款业务进行监督。

本集合计划投资银行存款应符合如下规定：

(1) 管理人、托管人应当与存款银行建立定期对账机制，确保集合计划银行存款业务账目及核算的真实、准确。

(2) 管理人与托管人应根据相关规定，就本集合计划银行存款业务另行签订书面协议，明确双方在相关协议签署、账户开设与管理、投资指令传达与执行、资金划拨、账目核对、到期兑付、文件保管以及存款证实书的开立、传递、保管

等流程中的权利、义务和职责,以确保集合计划财产的安全,保护集合计划份额持有人的合法权益。

(3) 托管人应加强对集合计划银行存款业务的监督与核查,严格审查、复核相关协议、账户资料、投资指令、存款证实书等有关文件,切实履行托管职责。

(4) 管理人与托管人在开展集合计划存款业务时,应严格遵守《基金法》、《运作办法》等有关法律法规,以及国家有关账户管理、利率管理、支付结算等的各项规定。

## 6、托管人对集合计划投资流通受限证券的监督

(1) 集合计划投资流通受限证券,应遵守《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》等有关法律法规规定。

(2) 流通受限证券,包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券,不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。

(3) 管理人应在集合计划首次投资流通受限证券前,向托管人提供经管理人董事会批准的有关集合计划投资流通受限证券的投资决策流程、风险控制制度。集合计划投资非公开发行股票,管理人还应提供管理人董事会批准的流动性风险处置预案。上述资料应包括但不限于集合计划投资流通受限证券的投资额度和投资比例控制情况。管理人应至少于首次执行投资指令之前两个工作日将上述资料书面发至托管人,保证托管人有足够的时间进行审核。托管人应在收到上述资料后两个工作日内,以书面或其他双方认可的方式确认收到上述资料。

(4) 集合计划投资流通受限证券前,管理人应向托管人提供符合法律法规要求的有关书面信息,包括但不限于拟发行证券主体的中国证监会批准文件、发行证券数量、发行价格、锁定期、集合计划拟认购的数量、价格、总成本、总成本占集合计划资产净值的比例、已持有流通受限证券市值占资产净值的比例、资金划付时间等。管理人应保证上述信息的真实、完整,并应至少于拟执行投资指令前两个工作日将上述信息书面发至托管人,保证托管人有足够的时间进行审核。

(5) 托管人应对管理人提供的有关书面信息进行审核, 托管人认为上述资料可能导致集合计划投资出现风险的, 有权要求管理人在投资流通受限证券前就该风险的消除或防范措施进行补充书面说明, 并保留查看管理人风险管理部门就集合计划投资流通受限证券出具的风险评估报告等备查资料的权利。否则, 托管人有权拒绝执行有关指令。因拒绝执行该指令造成集合计划财产损失的, 托管人不承担任何责任, 并有权报告中国证监会。

如管理人和托管人无法达成一致, 应及时上报中国证监会请求解决。如果托管人切实履行监督职责, 则不承担任何责任。

7、托管人根据法律法规的规定及《集合计划合同》和本协议的约定, 对集合计划投资其他方面进行监督。

(二) 托管人应根据有关法律法规的规定及集合计划合同的约定, 对集合计划资产净值计算、集合计划份额净值计算、应收资金到账、集合计划费用开支及收入确认、集合计划收益分配、相关信息披露、集合计划宣传推介材料中登载集合计划业绩表现数据等进行监督和核查。如果管理人未经托管人的审核擅自将不实的业绩表现数据印制在宣传推介材料上, 则托管人对此不承担任何责任, 并有权在发现后报告中国证监会。

(三) 管理人应积极配合和协助托管人的监督和核查, 在规定时间内答复并改正, 就托管人的疑义进行解释或举证。对托管人按照法规要求需向中国证监会报送集合计划监督报告的, 管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

托管人发现管理人的投资指令或实际投资运作违反《基金法》及其他有关法规、《集合计划合同》和本协议规定的行为, 应及时以书面形式通知管理人限期纠正, 管理人收到通知后应及时核对, 并以电话或书面形式向托管人反馈, 说明违规原因及纠正期限, 并保证在规定期限内及时改正。在限期内, 托管人有权随时对通知事项进行复查, 督促管理人改正。管理人对托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的, 托管人有权报告中国证监会。

托管人发现管理人有重大违规行为, 应立即报告中国证监会, 同时通知管理人在限期内纠正。

托管人发现管理人的指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反《集合计划合同》约定的，应当拒绝执行，立即通知管理人，并有权向中国证监会报告。

托管人发现管理人依据交易程序已经生效的指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反《集合计划合同》约定的，应当立即通知管理人，并有权向中国证监会报告。

#### 四、管理人对托管人的业务核查

根据《基金法》及其他有关法规、《集合计划合同》和本协议规定，管理人对托管人履行托管职责的情况进行核查，核查事项包括但不限于托管人是否安全保管集合计划财产、开立集合计划财产的资金账户和证券账户及债券托管账户等投资所需账户，是否及时、准确复核管理人计算的集合计划资产净值和集合计划份额净值，是否根据管理人指令办理清算交收，是否按照法规规定和《集合计划合同》规定进行相关信息披露和监督集合计划投资运作等行为。

管理人定期和不定期地对托管人保管的集合计划资产进行核查。托管人应积极配合管理人的核查行为，包括但不限于：提交相关资料以供管理人核查托管财产的完整性和真实性，在规定时间内答复并改正。

管理人发现托管人未对集合计划资产实行分账管理、擅自挪用集合计划资产、未执行或无故延迟执行管理人资金划拨指令、泄露集合计划投资信息等违反《基金法》、《集合计划合同》、本协议及其他有关规定的，应及时以书面形式通知托管人在限期内纠正，托管人收到通知后应及时核对并以书面形式对管理人发出回函。在限期内，管理人有权随时对通知事项进行复查，督促托管人改正。托管人对管理人通知的违规事项未能在限期内纠正的，管理人应报告中国证监会。对管理人按照法规要求需向中国证监会报送集合计划监督报告的，托管人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

管理人发现托管人有重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时通知托管人在限期内纠正。

## 五、集合计划财产的保管

### (一) 集合计划财产保管的原则

- 1、托管人应安全保管集合计划财产，未经管理人的指令，不得自行运用、处分、分配集合计划的任何资产。
- 2、集合计划财产应独立于管理人、托管人的固有财产。
- 3、托管人按照规定开立集合计划财产的资金账户、证券账户和债券托管账户等投资所需账户。
- 4、托管人对所托管的不同集合计划财产分别设置账户，确保集合计划财产的完整和独立。
- 5、对于因为集合计划投资产生的应收资产和集合计划申购过程中产生的应收资产，应由管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知托管人，到账日集合计划资产没有到达集合计划银行存款账户的，托管人应及时通知管理人采取措施进行催收。由此给集合计划造成损失的，管理人应负责向有关当事人追偿集合计划的损失。托管人对此不承担任何责任。

### (二) 集合计划的银行存款账户的开立和管理

- 1、托管人应负责本集合计划银行存款账户的开立和管理。
- 2、托管人以本集合计划的名义在其营业机构开立集合计划的银行存款账户，并根据管理人合法合规的指令办理资金收付。本集合计划的银行预留印鉴由托管人刻制、保管和使用。
- 3、本集合计划银行存款账户的开立和使用，限于满足开展本集合计划业务的需要。托管人和管理人不得假借本集合计划的名义开立其他任何银行存款账户；亦不得使用集合计划的任何银行存款账户进行本集合计划业务以外的活动。
- 4、托管人可以通过申请开通本集合计划银行账户的企业网上银行业务进行资金支付，并使用交通银行企业网上银行（简称“交通银行网银”）办理托管资产的资金结算汇划业务。

5、集合计划银行存款账户的管理应符合银行业监督管理机构的有关规定。

(三) 集合计划证券交收账户、资金交收账户的开立和管理

托管人以托管人和本集合计划联名的方式在中国证券登记结算有限责任公司开立证券账户。

集合计划证券账户的开立和使用,限于满足开展本集合计划业务的需要。托管人和管理人不得出借和未经对方同意擅自转让集合计划的任何证券账户;亦不得使用集合计划的任何账户进行本集合计划业务以外的活动。

管理人不得对集合计划证券交收账户、资金交收账户进行证券的超卖或超买。

托管人以托管人的名义在中国证券登记结算有限责任公司开立结算备付金账户即资金交收账户,用于证券交易资金的结算。托管人以本集合计划的名义在托管人处开立集合计划的证券交易资金结算的二级结算备付金账户。

(四) 债券托管账户的开立和管理

1、银行间债券市场债券托管专户开立前,管理人负责向相关监管部门进行报备,托管人给予必要的配合。托管人负责在中央国债登记结算有限责任公司及银行间市场清算所股份有限公司以本集合计划的名义开立债券托管账户,并由托管人负责集合计划的债券及资金的清算。管理人负责申请集合计划进入全国银行间同业拆借市场进行交易,由管理人在中国外汇交易中心开设同业拆借市场交易账户。

2、管理人和托管人共同代表集合计划签订全国银行间债券市场债券回购主协议等其他相关协议,协议正本由托管人保管。管理人代表集合计划与交易对手就每笔交易达成协议,银行间债券交易的资金清算和债券交割由托管人办理。管理人应及时将债券成交通知单及划拨指令传真给托管人,托管人据此办理资金收付和债券交割。

(五) 集合计划投资银行存款账户的开立和管理

存款账户必须以集合计划名义开立,账户名称为集合计划名称,存款账户开户文件上加盖预留印鉴(须包括托管人印章)及管理人公章。



本集合计划投资银行存款时,管理人应当与存款银行签订具体存款协议或存款确认单据,明确存款的类型、期限、利率、金额、账号、对账方式、支取方式等细则。

为防范特殊情况下的流动性风险,定期存款协议中应当约定提前支取条款。

#### (六) 其他账户的开立和管理

若中国证监会或其他监管机构在本托管协议订立日之后允许集合计划从事其他投资品种的投资业务,涉及相关账户的开立、使用的,由管理人协助托管人根据有关法律法规的规定和《集合计划合同》的约定,开立有关账户。该账户按有关规则使用并管理。

#### (七) 集合计划财产投资的有关实物证券、银行存款定期存单等有价凭证的保管

实物证券由托管人存放于托管人的保管库。实物证券的购买和转让,由托管人根据管理人的指令办理。托管人对由托管人以外机构实际有效控制的本集合计划资产不承担保管责任。

银行存款定期存单等有价凭证由托管人负责保管。

托管人只负责对存款证实书进行保管,不负责存款证实书真伪的辨别,不承担存款证实书对应存款的本金及收益的安全保管责任。

#### (八) 与集合计划财产有关的重大合同的保管

由管理人代表集合计划签署的与集合计划有关的重大合同的原件分别由托管人、管理人保管,相关业务程序另有限制除外。除本协议另有规定外,管理人在代集合计划签署与集合计划有关的重大合同时,应尽可能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授权业务章的合同传真件,未经双方协商或未在合同约定范围内,合同原件不得转移。

## 六、指令的发送、确认和执行

### (一) 管理人对发送指令人员的书面授权

管理人应事先书面通知(以下称“授权通知”)托管人有权发送指令的人员名单、签字样本、预留印鉴和启用日期,注明相应的权限,并规定管理人向托管人发送指令时托管人确认有权发送人员(以下简称“被授权人”)身份的方法。管理人向托管人发出的授权通知应加盖公章。管理人发出授权通知后,以电话形式向托管人确认,授权通知自其上面注明的启用日期开始生效,在此后三个工作日内管理人应将授权通知的正本送交托管人。

托管人收到授权通知后,将签字和印鉴与预留样本核对无误后,应在收到授权通知当日电话向管理人确认。

管理人和托管人对授权文件负有保密义务,其内容不得向授权人及相关操作人员以外的任何人泄露,但法律法规另有规定或有权机关另有要求的除外。

### (二) 指令的内容

指令是管理人在运用集合计划资产时,向托管人发出的资金划拨及其他款项收付的指令。指令应写明款项事由、支付时间、到账时间、金额、账户、大额支付号等执行支付所需内容,加盖预留印鉴。

### (三) 指令的发送、确认和执行的时间和程序

管理人应按照《基金法》及其他有关法规、《集合计划合同》和本协议的规定,在其合法的经营权限和交易权限内发送指令,被授权人应按照其授权权限发送指令。指令由“授权通知”确定的被授权人代表管理人用传真的方式向托管人发送。发送后管理人及时通过电话与托管人确认指令内容。管理人必须在15:00之前向托管人发送付款指令并确保集合计划银行账户有足够的资金余额,15:00之后发送付款指令或截止15:00时账户资金不足的,托管人不能保证在当日完成划付。对管理人在没有充足资金的情况下向托管人发出的指令,托管人可不予执行,并立即通知管理人,托管人不承担因为不执行该指令而造成损失的责任。如管理人要求当天某一时点到账,必须至少提前2个工作小时向托管人发送付款指

令并与托管人电话确认。管理人指令传输及确认不及时或账户资金不足，未能留出足够的执行时间，致使指令未能及时执行的，托管人不承担由此导致的损失。管理人应将银行间市场成交单加盖预留印鉴后传真给托管人。对于被授权人发出的指令，管理人不得否认其效力。托管人依照“授权通知”规定的方法确认指令的有效后，方可执行指令。指令执行完毕后，托管人将执行结果反馈给管理人。托管人仅根据管理人的授权文件对指令进行表面相符性的形式审查，对其真实性不承担责任。

#### （四）管理人发送错误指令的情形和处理程序

管理人发送错误指令的情形包括指令发送人员无权或超越权限发送指令及交割信息错误，指令中重要信息模糊不清或不全等。托管人在履行监督职能时，发现管理人的指令错误时，有权拒绝执行，并及时通知管理人改正。

#### （五）托管人依照法律法规暂缓、拒绝执行指令的情形和处理程序

托管人在对集合计划场外投资指令进行审核时，如发现管理人的投资指令违反有关集合计划的法律法规、《集合计划合同》、本协议的规定，如交易未生效，则不予执行并立即通知管理人；如交易已生效，则以书面形式通知管理人限期纠正。管理人收到通知后应及时核对，并以约定形式向托管人反馈，由此造成的损失由管理人承担。

托管人在对集合计划场外投资指令进行审核时，如发现投资指令有可能违反法律法规、《集合计划合同》、本协议的规定，应暂缓执行指令，通知管理人改正。如果管理人拒不改正，托管人有权向中国证监会报告。

#### （六）托管人未按照管理人指令执行的处理方法

托管人由于自身原因造成未按照管理人发送的正常指令执行，应在发现后及时采取措施予以弥补，给集合计划份额持有人造成损失的，对由此造成的直接经济损失负赔偿责任。

#### （七）被授权人员的更换

管理人撤换被授权人员或改变被授权人员的权限，必须提前至少三个工作日，

使用传真向托管人发出加盖公章的被授权人变更通知,注明启用日期,同时电话通知托管人。被授权人变更通知自其上面注明的启用日期起开始生效。管理人对授权通知的内容的修改自启用日期起生效。管理人在此后三个工作日内将被授权人变更通知的正本送交托管人。

如果管理人已经撤销或更改对指令发送人员的授权,并且书面通知托管人,则对于在变更通知的启用日期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。

## 七、交易及清算交收安排

### (一) 选择代理证券买卖的证券经营机构的标准和程序

管理人负责选择代理本集合计划证券买卖的证券经营机构。

管理人应代表集合计划与被选择的证券经营机构签订交易单元租用协议。管理人应及时将集合计划交易单元号、佣金费率等基本信息以及变更情况及时以书面形式通知托管人,并在法定信息披露公告中披露相关内容。

### (二) 集合计划投资证券后的清算交收安排

#### 1、资金划拨

对于管理人的资金划拨指令,托管人在复核无误后应在规定期限内执行,不得延误。管理人应保证托管人在执行管理人发送的资金划拨指令时,集合计划银行账户或资金交收账户上有充足的资金。集合计划的资金头寸不足时,托管人有权拒绝管理人发送的划款指令。管理人在发送划款指令时应充分考虑托管人的划款处理时间和在途时间。在集合计划资金头寸充足的情况下,托管人对管理人符合法律法规、《集合计划合同》、本协议的指令不得拖延或拒绝执行。对超头寸的划款指令,托管人有权止付但应及时电话通知管理人,由此造成的损失由管理人承担。

#### 2、结算方式

支付结算以转账形式进行。如中国人民银行有更快捷、安全、可行的结算方式,托管人可根据需要进行调整。

### 3、证券交易资金的清算

本集合计划投资于证券而发生的场内、场外交易的清算交割，由托管人负责办理。

本集合计划场外证券投资的清算交割，由托管人根据管理人的指令通过登记结算机构办理。本集合计划场内证券投资的清算交割，由托管人根据双方签订的《托管银行证券资金结算协议》约定，由托管人负责办理。但本集合计划场内证券投资涉及T+0日非担保、RTGS交收的业务，管理人应在T+0日15:00前书面通知托管人办理交收，否则托管人不能保证相关清算交割成功。如因托管人的自身原因在清算上造成集合计划资产的损失，应由托管人负责赔偿集合计划的损失；如果因为管理人投资运作而造成集合计划投资清算困难和风险的，托管人发现后应立即通知管理人，由管理人负责解决，托管人应给予必要的配合，由此给集合计划造成的损失由管理人承担。

托管人在完成相关登记结算公司通知的事项后应以书面形式通知管理人。

由于管理人的原因造成集合计划无法按时支付证券清算款，按照登记结算机构的有关规定办理。

#### （三）管理人与托管人进行资金、证券账目和交易记录的核对

对集合计划的交易记录，由管理人按日进行核对。每日对外披露集合计划份额净值之前，必须保证当天所有实际交易记录与集合计划会计账簿上的交易记录完全一致。如果交易记录与会计账簿记录不一致，造成集合计划会计核算不完整或不真实，由此导致的损失由集合计划的会计责任方承担。管理人每一交易日以双方认可的方式在当日全部交易结束后，将编制的集合计划资金、证券账目传送给托管人，托管人按日进行账目核对。

对实物券账目，相关各方定期进行账实核对。

托管人应定期核对证券账户中的证券数量和种类。

双方可协商采用电子对账方式进行账目核对。

#### （四）申购、赎回、转换开放式集合资产管理计划的资金清算和数据传递的

时间、程序及托管协议当事人的责任界定

1、集合计划份额申购、赎回的确认，清算由管理人指定的登记机构负责。

2、管理人应将每个开放日的申购、赎回、转换开放式集合资产管理计划的数据传送给托管人。管理人应对传递的申购、赎回、转换开放式集合资产管理计划的数据真实性、准确性、完整性负责。托管人应及时查收申购资金的到账情况并根据管理人指令及时划付赎回及转换款项。

3、管理人应在T+3日前将申购净额（不包含申购费）划至托管账户。如申购净额未能如期到账，托管人应及时通知管理人采取措施进行催收，由此给集合计划造成损失的，由责任方承担。管理人负责向责任方追偿集合计划的损失。

4、管理人应及时向托管人发送赎回及转换资金的划拨指令。托管人依据划款指令在T+3日（包含赎回产生的应付费用）划至管理人指定账户。管理人应及时通知托管人划付。若赎回金额未能如期划拨，由此造成的损失，由责任方承担。管理人负责向责任方追偿集合计划的损失。

#### （五）集合计划收益分配的清算交收安排

1、管理人决定收益分配方案并通知托管人，经托管人复核后公告。

2、托管人和管理人对集合计划收益分配进行账务处理并核对后，管理人应及时向托管人发送分发现金红利的划款指令，托管人依据划款指令在指定划付日及时将资金划至管理人指定账户。

3、管理人在下达分红款支付指令时，应给托管人留出必需的划款时间。

## 八、集合计划资产净值计算和会计核算

### （一）集合计划资产净值及集合计划份额净值的计算与复核

集合计划资产净值是指集合计划资产总值减去集合计划负债后的价值。

管理人应每工作日对集合计划资产估值。估值原则应符合《集合计划合同》、《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及其他法律、法规的规定。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，托管人复核。管理人

应于每个工作日交易结束后计算当日的集合计划资产净值和集合计划份额净值，以约定方式发送给托管人。托管人对净值计算结果复核后，将复核结果反馈给管理人，由管理人按规定予以公布。

本集合计划按以下方法估值：

#### 1、证券交易所上市的有价证券的估值

(1) 交易所上市的有价证券（包括股票），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，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；

(2) 交易所上市交易或挂牌转让的不含权固定收益品种，选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值；

(3) 交易所上市交易或挂牌转让的含权固定收益品种，选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价进行估值；

(4) 交易所上市交易的可转换债券以每日收盘价作为估值全价；

(5) 交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。交易所市场挂牌转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值；

(6) 对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券，对存在活跃市场的情况下，应以活跃市场上未经调整的报价作为估值日的公允价值；对于活跃市场报价未能代表估值日公允价值的情况下，应对市场报价进行调整以确认估值日的公允价值；对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下，应采用估值技术确定其公允价值。

#### 2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

(1) 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估值方法估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值；

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

(3) 在发行时明确一定期限限售期的股票, 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, 按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

3、对全国银行间市场上不含权的固定收益品种, 按照第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值。对银行间市场上含权的固定收益品种, 按照第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价估值。对于含投资人回售权的固定收益品种, 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价格进行估值。对银行间市场未上市, 且第三方估值机构未提供估值价格的债券, 在发行利率与二级市场利率不存在明显差异, 未上市期间市场利率没有发生大的变动的情况下, 按成本估值。

4、同一债券或股票同时在两个或两个以上市场交易的, 按债券或股票所处的市场分别估值。

#### 5、存款的估值方法

持有的银行定期存款或通知存款以本金列示, 按协议或合同利率逐日确认利息收入。

#### 6、同业存单的估值方法

同业存单按估值日第三方估值机构提供的估值净价估值; 选定的第三方估值机构未提供估值价格的, 按成本估值。

7、如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的, 管理人可根据具体情况与托管人商定后, 按最能反映公允价值的价格估值。

8、当发生大额申购或赎回情形时, 管理人可以采用摆动定价机制, 以确保集合计划估值的公平性。

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。

如管理人、托管人发现集合计划估值违反集合计划合同订明的估值方法、程序以及相关法律法规的规定或者未能充分维护集合计划份额持有人利益时,发现方应立即通知对方,共同查明原因,双方协商解决。

根据有关法律法规,集合计划资产净值计算和集合计划会计核算的义务由管理人承担。本集合计划的集合计划会计责任方由管理人担任,因此,就与本集合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,管理人有权按照其对集合计划净值信息的计算结果对外予以公布,由此给集合计划持有人和集合计划造成的损失以及因该交易日集合计划资产净值计算顺延错误而引起的损失,由管理人负责赔付,托管人不负责赔付。

## (二) 净值差错处理

管理人和托管人将采取必要、适当、合理的措施确保集合计划资产估值的准确性、及时性。当集合计划份额净值小数点后4位以内(含第4位)发生估值错误时,视为集合计划份额净值错误。

集合计划合同的当事人应按照以下约定处理:

### 1、估值错误类型

本集合计划运作过程中,如果由于管理人或托管人、或登记机构、或销售机构、或投资人自身的过错造成估值错误,导致其他当事人遭受损失的,过错的责任人应当对由于该估值错误遭受损失当事人(“受损方”)的直接损失按下述“估值错误处理原则”给予赔偿,承担赔偿责任。

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。

### 2、估值错误处理原则

(1) 估值错误已发生,但尚未给当事人造成损失时,估值错误责任方应及时协调各方,及时进行更正,因更正估值错误发生的费用由估值错误责任方承担;由于估值错误责任方未及时更正已产生的估值错误,给当事人造成损失的,由估

值错误责任方对直接损失承担赔偿责任；若估值错误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，则其应当承担相应赔偿责任。估值错误责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认，确保估值错误已得到更正。

(2) 估值错误的责任方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。

(3) 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。但估值错误责任方仍应对估值错误负责。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(“受损方”)，则估值错误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估值错误责任方。

(4) 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。

### 3、估值错误处理程序

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：

(1) 查明估值错误发生的原因，列明所有的当事人，并根据估值错误发生的原因确定估值错误的责任方；

(2) 根据估值错误处理原则或当事人协商的方法对因估值错误造成的损失进行评估；

(3) 根据估值错误处理原则或当事人协商的方法由估值错误的责任方进行更正和赔偿损失；

(4) 根据估值错误处理的方法，需要修改集合计划登记机构交易数据的，由集合计划登记机构进行更正，并就估值错误的更正向有关当事人进行确认。

### 4、集合计划份额净值估值错误处理的方法如下：

(1) 集合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。

(2) 错误偏差达到或超过集合计划份额净值的0.25%时，管理人应当通报托管人并报中国证监会备案；错误偏差达到或超过集合计划份额净值的0.5%时，管理人应当公告，并报中国证监会备案。

(3) 当集合计划份额净值计算差错给集合计划和集合计划份额持有人造成损失需要进行赔偿时，管理人和托管人应根据实际情况界定双方承担的责任，经确认后按以下条款进行赔偿：

①本集合计划的会计责任方由管理人担任，与本集合计划有关的会计问题，如经双方在平等基础上充分讨论后，尚不能达成一致时，按管理人的建议执行，由此给集合计划份额持有人和集合计划财产造成的损失，由管理人负责赔付。

②若管理人计算的集合计划份额净值已由托管人复核确认后公告，由此给集合计划份额持有人造成损失的，应根据法律法规的规定对投资者或集合计划支付赔偿金，就实际向投资者或集合计划支付的赔偿金额，管理人与托管人按照管理费和托管费率的比例各自承担相应的责任。

③如管理人和托管人对集合计划份额净值的计算结果，虽然多次重新计算和核对或对管理人采用的估值方法，尚不能达成一致时，为避免不能按时公布集合计划份额净值的情形，以管理人的计算结果对外公布，由此给集合计划份额持有人和集合计划造成的损失，由管理人负责赔付。

④由于管理人提供的信息错误（包括但不限于集合计划申购或赎回金额等），进而导致集合计划份额净值计算错误而引起的集合计划份额持有人和集合计划财产的损失，由管理人负责赔付。

(4) 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。

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。

## 5、特殊情况的处理

(1) 管理人或托管人按集合计划合同约定的估值方法第7项进行估值时，所造成的误差不作为集合计划资产估值错误处理；

(2) 由于不可抗力原因、有关会计制度变化或由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误等,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,由此造成的集合计划资产估值错误,管理人和托管人免除赔偿责任。但管理人、托管人应当积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。

### (三) 集合计划会计制度

按国家有关部门制定的会计制度执行。

### (四) 集合计划账册的建立

管理人和托管人在《集合计划合同》生效后,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、登录和保管本集合计划的全套账册,对双方各自的账册定期进行核对,互相监督,以保证集合计划财产的安全。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。

### (五) 会计数据和财务指标的核对

双方应每个交易日核对账目,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,确保核对一致。若当日核对不符,暂时无法查找到错账的原因而影响到集合计划资产净值的计算和公告的,以管理人的账册为准。

### (六) 集合计划定期报告的编制和复核

集合计划财务报表由管理人和托管人每月分别独立编制。月度报表的编制,应于每月终了后5个工作日内完成。定期报告文件应按中国证监会的要求公告。季度报表的编制,应于季度终了后15个工作日内完成。《集合计划合同》生效后,招募说明书的信息发生重大变更的,管理人应当在三个工作日内,更新招募说明书并登载在规定网站上;招募说明书其他信息发生变更的,管理人至少每年更新一次。集合计划终止运作的,管理人不再更新招募说明书。中期报告在集合计划会计年度前6个月结束后的两个月内公告;年度报告在会计年度结束后三个月内公告。

管理人在月初3个工作日内完成上月度报表的编制,经盖章后,以约定方式

将有关报表提供托管人；托管人收到后在2个工作日内进行复核，并将复核结果及时书面通知管理人。对于季度报告、中期报告、年度报告等定期报告及更新招募说明书，管理人和托管人应在上述监管部门规定的时间内完成编制、复核及公告。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。如果管理人与托管人不能于应当发布公告之日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发布公告，托管人有权就相关情况报中国证监会备案。

托管人在对财务报表、季度报告、中期报告或年度报告复核完毕后，可以出具复核确认书（盖章）或以其他双方约定的方式确认，以备有权机构对相关文件审核检查。

#### （六）实施侧袋机制期间的集合计划资产估值

本集合计划实施侧袋机制的，应根据本部分的约定对主袋账户资产进行估值并披露主袋账户的集合计划净值信息，暂停披露侧袋账户份额净值。

## 九、集合计划收益分配

集合计划收益分配是指将本集合计划的可分配收益根据持有集合计划份额的数量按比例向集合计划份额持有人进行分配。

（一）集合计划收益分配应该符合集合计划合同中收益分配原则的规定，具体规定如下：

1、在符合有关集合计划分红条件的前提下，本集合计划可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准；

2、本集合计划收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的集合计划份额进行再投资；若投资者不选择，本集合计划默认的收益分配方式是现金分红；

3、集合计划收益分配后集合计划份额净值不能低于面值，即集合计划收益分配基准日的集合计划份额净值减去每单位集合计划份额收益分配金额后不能低于面值；

- 4、同一类别的每一集合计划份额享有同等分配权；
- 5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### (二) 集合计划收益分配方案的确定与公告

集合计划收益分配方案由管理人拟定，并由托管人核实后确定，管理人应及时在中国证监会规定媒介公告。管理人向托管人下达收益分配的付款指令，托管人按指令将收益分配的全部资金划入管理人的指定账户，并由管理人负责分配。集合计划收益分配方案须载明截止收益分配基准日的可供分配利润、收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。

#### (三) 实施侧袋机制期间的收益分配

本集合计划实施侧袋机制的，侧袋账户不进行收益分配，详见招募说明书的规定。

## 十、集合计划信息披露

### (一) 保密义务

除按照《基金法》、《集合计划合同》、《信息披露办法》及中国证监会关于集合计划信息披露的有关规定进行披露以外，管理人和托管人对公开披露前的集合计划信息、从对方获得的业务信息及其他不宜公开披露的集合计划信息应予保密，不得向任何第三方泄露。法律法规另有规定的以及审计需要的除外。

如下情况不应视为管理人或托管人违反保密义务：

- 1、非因管理人和托管人的原因导致保密信息被披露、泄露或公开；
- 2、管理人和托管人为遵守和服从法院判决、仲裁裁决或中国证监会等监管机构的命令决定所做出的信息披露或公开。

### (二) 管理人和托管人在集合计划信息披露中的职责和信息披露程序

管理人和托管人应根据相关法律法规、《集合计划合同》的规定各自承担相应的信息披露职责。管理人和托管人负有积极配合、互相督促、彼此监督，保证其履行按照法定方式和时限披露的义务。

本集合计划信息披露的文件，包括《集合计划合同》规定的定期报告、临时报告、集合计划净值信息公告及中国证监会规定的其他必要的公告文件，由管理人拟定并公布。

托管人应按本协议第八条第（六）款的规定对相关报告进行复核。集合计划年报中的财务会计报告经符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所审计后方可披露。

本集合计划的信息披露公告，必须在符合中国证监会规定条件的全国性报刊及《信息披露办法》规定的互联网网站等媒介发布。

本集合计划实施侧袋机制的，相关信息披露义务人应当根据法律法规、集合计划合同和招募说明的规定进行信息披露，详见招募说明书的规定。

### （三）暂停或延迟相关信息披露的情形

当出现下述情况时，管理人和托管人可暂停或延迟披露集合计划相关信息：

- 1、集合计划投资所涉及的证券交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；
- 2、因不可抗力或其他情形致使管理人、托管人无法准确评估集合计划资产价值时；
- 3、发生暂停集合计划估值的情形时；
- 4、法律法规规定、中国证监会或集合计划合同认定的其他情形。

### （四）托管人报告

托管人应按《基金法》和中国证监会的有关规定出具集合计划托管情况报告。托管人报告说明该半年度/年度托管人和管理人履行《集合计划合同》的情况，是集合计划中期报告和年度报告的组成部分。

## 十一、集合计划费用

### （一）管理人的管理费和业绩报酬

### (1) 管理人的管理费

本集合计划的管理费按前一日集合计划资产净值的 1.2%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 1.2\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的集合计划管理费

E 为前一日的集合计划资产净值

集合计划管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由托管人于次月前 5 个工作日内依管理人指令从集合计划财产中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。

### (2) 管理人的业绩报酬

集合计划 A 类份额计提业绩报酬，集合计划 B 类份额不计提业绩报酬。

#### 1) 提取业绩报酬原则

a) 管理人对 A 类份额持有人的每笔计划份额按申购时间的不同加以区分，并对每笔计划份额单独计算年化收益率并计提业绩报酬；

b) 符合业绩报酬计提条件时，在集合计划分红、A 类份额持有人赎回和集合计划终止时计提业绩报酬；

c) 集合计划分红时提取业绩报酬的，业绩报酬从分红资金中扣除；

d) A 类份额持有人赎回和集合计划终止时提取业绩报酬的，业绩报酬从赎回资金中扣除；

e) A 类份额持有人赎回或计划终止时，业绩报酬按 A 类份额持有人赎回份额或集合计划终止时持有份额计算。

#### 2) 业绩报酬的计提方法

A 类份额的业绩报酬以上一业绩报酬计提日(如上一业绩报酬计提日不存在，则推广期认购的为集合计划成立日，存续期申购的为申购日，下同)到本次业绩报酬计提日的年化收益率，作为计提业绩报酬的基准。其中业绩报酬计提日即为集合计划分红权益登记日、A 类份额持有人赎回日和集合计划最后运作日。年化收益率计算方法为：

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



R: 指上一业绩报酬计提日至本次业绩报酬计提日的年化收益率;

$S^*_T$ : 指本次业绩报酬计提日的累计份额净值;

$S^*_0$ : 指上一业绩报酬计提日的累计份额净值;

$S_0$ : 指上一业绩报酬计提日的份额净值;

T: 指集合计划上一业绩报酬计提日至本次业绩报酬计提日的自然天数。

A类份额的业绩报酬根据上一业绩报酬计提日至本次业绩报酬计提日期间的年化收益率计算,若年化收益率R小于或等于8%,管理人不提取业绩报酬;若年化收益率R大于8%,管理人对超过8%以上部分提取20%作为业绩报酬。具体计算方法如下:

年化收益率 (R)	计提比例	业绩报酬(H)
$R \leq 8\%$	0	$H=0$
$R > 8\%$	20%	$H=M \times S_0 \times (R-8\%) \times 20\% \times T/365$

M为应计提业绩报酬的集合计划份额

### 3) 业绩报酬支付

由管理人向托管人发送业绩报酬划付指令,托管人于5个工作日内将业绩报酬划拨给登记机构,由登记机构将业绩报酬支付给管理人。若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。

## (二) 托管人的托管费

本集合计划的托管费率为年费率0.20%。

本集合计划的托管费按前一日集合计划资产净值的0.20%的年费率计提。计算方法如下:

$$H=E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的集合计划托管费

E为前一日的集合计划资产净值

集合计划托管费每日计提,逐日累计至每月月末,按月支付,由托管人于次月前5个工作日内依管理人指令从集合计划财产中一次性支取。若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。

### (三) 不列入集合计划费用的项目

从集合计划资产中列支管理人的管理费、托管人的托管费之外的其他集合计划费用，应当依据有关法律法规、《集合计划合同》的规定；管理人和托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或集合计划财产的损失，以及处理与集合计划运作无关的事项发生的费用等不列入集合计划费用。集合计划合同生效之前的律师费、会计师费和信息披露费用等不得从集合计划财产中列支；托管人对不符合《基金法》、《运作办法》等有关规定以及《集合计划合同》的其他费用有权拒绝执行。如果托管人发现管理人违反有关法律法规的有关规定和《集合计划合同》、本协议的约定，从集合计划财产中列支费用，有权要求管理人做出书面解释，如果托管人认为管理人无正当或合理的理由，可以拒绝支付。

### (四) 实施侧袋机制期间的集合计划费用

本集合计划实施侧袋机制的，与侧袋账户有关的费用可以从侧袋账户中列支，但应待侧袋账户资产变现后方可列支，有关费用可酌情收取或减免，但不得收取管理费和业绩报酬（如有），详见招募说明书的规定。

## 十二、集合计划份额持有人名册的保管

管理人可委托集合计划登记机构登记和保管集合计划份额持有人名册。集合计划份额持有人名册的内容包括但不限于集合计划份额持有人的名称和持有的集合计划份额。

集合计划份额持有人名册，包括集合计划募集期结束时的集合计划份额持有人名册、集合计划权益登记日的集合计划份额持有人名册、集合计划份额持有人大会权益登记日的集合计划份额持有人名册、每年最后一个交易日的集合计划份额持有人名册，由集合计划登记机构负责编制和保管，并对集合计划份额持有人名册的真实性、完整性和准确性负责。

管理人应根据托管人的要求定期和不定期向托管人提供集合计划份额持有人名册。

(一) 管理人于《集合计划合同》生效日及《集合计划合同》终止日后10个工作日内向托管人提供由登记机构编制的集合计划份额持有人名册；

(二) 管理人于集合计划份额持有人大会权益登记日后5个工作日内向托管人提供由登记机构编制的集合计划份额持有人名册;

(三) 管理人于每年最后一个交易日后10个工作日内向托管人提供由登记机构编制的集合计划份额持有人名册;

(四) 除上述约定时间外, 如果确因业务需要, 托管人与管理人商议一致后, 由管理人向托管人提供由登记机构编制的集合计划份额持有人名册。

托管人以电子版形式妥善保管集合计划份额持有人名册, 并定期刻成光盘备份, 保存期限为20年。托管人不得将所保管的集合计划份额持有人名册用于集合计划托管业务以外的其他用途, 并应遵守保密义务。若管理人或托管人由于自身原因无法妥善保管集合计划份额持有人名册, 应按有关法规规定各自承担相应的责任。

### 十三、集合计划有关文件档案的保存

管理人应保存集合计划财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料, 托管人应保存集合计划托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料。

管理人和托管人应按各自职责完整保存原始凭证、记账凭证、集合计划账册、会计报告、交易记录和重要合同等, 保存期限不少于20年。

管理人签署重大合同文本后, 应及时将合同文本正本送达托管人处。管理人应及时将与本集合计划账务处理、资金划拨等有关的合同、协议传真给托管人。

管理人或托管人变更后, 未变更的一方有义务协助接任人接收集合计划的有关文件。

### 十四、管理人和托管人的更换

#### (一) 管理人的更换

##### 1、管理人职责终止的条件

有下列情形之一的, 管理人职责终止:

- (1) 被依法取消集合计划管理资格；
- (2) 被集合计划份额持有人大会解任；
- (3) 依法解散、被依法撤销或被依法宣告破产；
- (4) 管理人将集合计划合同项下权利义务转让给其以独资或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；
- (5) 法律法规及中国证监会规定的和《集合计划合同》约定的其他情形。

## 2、管理人的更换程序

(1) 提名：新任管理人由托管人或由单独或合计持有10%以上（含10%）集合计划份额的集合计划份额持有人提名；

(2) 决议：集合计划份额持有人大会在管理人职责终止后6个月内对被提名的管理人形成决议，该决议需经参加大会的集合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，决议自表决通过之日起生效；

(3) 临时管理人：新任管理人产生之前，由中国证监会指定临时管理人；

(4) 备案：集合计划份额持有人大会更换管理人的决议须报中国证监会备案；

(5) 公告：管理人更换后，由托管人在更换管理人的集合计划份额持有人大会决议生效后2日内在规定媒介公告；

(6) 交接：管理人职责终止的，管理人应妥善保管集合计划管理业务资料，及时向临时管理人或新任管理人办理集合计划管理业务的移交手续，临时管理人或新任管理人应及时接收。新任管理人或临时管理人应与托管人核对集合计划资产总值和净值；

(7) 审计：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集合计划财产进行审计，并将审计结果予以公告，同时报中国证监会备案，审计费用从集合计划财产中列支；

(8) 集合计划名称变更：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集合计划名称中与原任管理人有关的名称字样。

### 3、管理人更换的特殊程序

当管理人根据相关法律法规的规定,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时,在管理人和托管人协商一致的基础上,管理人有权将集合计划合同中管理人的全部权利和义务转让给前述从事资产管理业务的公司,本集合计划的管理人变更为前述从事资产管理业务的公司,前述变更事项无需召开集合计划份额持有人大会审议,但管理人应当保证受让人具备管理本集合计划的相关资格,按照法律法规和中国证监会的要求履行相关程序,并按照《信息披露办法》的规定在规定媒介公告。

#### (二) 托管人的更换

##### 1、托管人职责终止的条件

有下列情形之一的,托管人职责终止:

- (1) 被依法取消基金托管资格;
- (2) 被集合计划份额持有人大会解任;
- (3) 依法解散、被依法撤销或被依法宣告破产;
- (4) 法律法规及中国证监会规定的和《集合计划合同》约定的其他情形。

##### 2、托管人的更换程序

(1) 提名: 新任托管人由管理人或由单独或合计持有10%以上(含10%)集合计划份额的集合计划份额持有人提名;

(2) 决议: 集合计划份额持有人大会在托管人职责终止后6个月内对被提名的托管人形成决议,该决议需经参加大会的集合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,决议自表决通过之日起生效;

(3) 临时托管人: 新任托管人产生之前,由中国证监会指定临时托管人;

(4) 备案: 集合计划份额持有人大会更换托管人的决议须报中国证监会备案;

(5) 公告：托管人更换后，由管理人在更换托管人的集合计划份额持有人大会决议生效后2日内在规定媒介公告；

(6) 交接：托管人职责终止的，应当妥善保管集合计划财产和集合计划托管业务资料，及时办理集合计划财产和集合计划托管业务的移交手续，新任托管人或者临时托管人应当及时接收。新任托管人或临时托管人应与管理人核对集合计划资产总值和净值；

(7) 审计：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集合计划财产进行审计，并将审计结果予以公告，同时报中国证监会备案，审计费用从集合计划财产中列支。

### (三) 管理人与托管人同时更换

1、提名：如果管理人和托管人同时更换，由单独或合计持有集合计划总份额10%以上（含10%）的集合计划份额持有人提名新的管理人和托管人；

2、管理人和托管人的更换分别按上述程序进行；

3、公告：新任管理人和新任托管人应在更换管理人和托管人的集合计划份额持有人大会决议生效后2日内在规定媒介上联合公告。

(四) 新任或临时管理人接收集合计划管理业务前或新任或临时托管人接收集合计划财产和集合计划托管业务前，原任管理人或原任托管人应依据法律法规和《集合计划合同》的规定继续履行相关职责，并保证不对集合计划份额持有人的利益造成损害。原任管理人或原任托管人在继续履行相关职责期间，仍有权按照集合计划合同的规定收取集合计划管理费、业绩报酬（如有）或集合计划托管费。

(五) 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，无需召开集合计划份额持有人大会审议。

## 十五、禁止行为

本协议项下的管理人和托管人禁止行为如下：

(一)《基金法》第二十条、第三十八条禁止的行为。

(二)除非法律法规及中国证监会另有规定，托管协议当事人不得利用集合计划财产从事《基金法》第七十三条禁止的投资或活动。

(三)除《基金法》及其他有关法规、《集合计划合同》及中国证监会另有规定，管理人、托管人不得利用集合计划财产为自身和任何第三人谋取利益。

(四)管理人与托管人对集合计划运作过程中任何尚未按有关法规规定的方式公开披露的信息，不得对他人泄露。

(五)管理人不得在资金头寸不足的情况下，向托管人发送划款指令。

(六)在资金头寸充足且为托管人执行指令留出足够时间的情况下，托管人对管理人符合法律法规、《集合计划合同》、本协议的指令不得拖延或拒绝执行。

(七)除根据管理人指令或《集合计划合同》另有规定的，托管人不得动用或处分集合计划财产。

(八)管理人与托管人不得为同一机构，不得相互出资或者持有股份。托管人、管理人应在行政上、财务上互相独立，其高级管理人员或其他从业人员不得相互兼职。

(九)《集合计划合同》投资限制中禁止投资的行为。

(十)法律法规、《集合计划合同》和本协议禁止的其他行为。

法律法规和监管部门取消上述禁止性规定的，则本集合计划不受上述相关限制。

## 十六、托管协议的变更、终止与集合计划财产的清算

(一) 托管协议的变更

本协议双方当事人经协商一致，可以对协议进行修改。修改后的新协议，其

内容不得与《集合计划合同》的规定有任何冲突。修改后的新协议，应报中国证监会备案。

## （二）托管协议的终止

### 1、《集合计划合同》终止；

2、托管人解散、依法被撤销、破产，被依法取消集合计划托管资格或因其他事由造成其他托管人接管集合计划财产；

3、管理人解散、依法被撤销、破产，被依法取消集合计划管理资格或因其他事由造成其他管理人接管集合计划管理权。

4、发生《基金法》、《销售办法》、《运作办法》或其他法律法规规定的终止事项。

## （三）集合计划财产的清算

### 1、集合计划财产清算小组

在集合计划财产清算小组接管集合计划财产之前，管理人和托管人应按照《集合计划合同》和本协议的规定继续履行保护集合计划资产安全的职责。

（1）集合计划财产清算小组：自出现《集合计划合同》终止事由之日起30个工作日内成立清算小组，管理人组织集合计划财产清算小组并在中国证监会的监督下进行集合计划清算。

（2）集合计划财产清算小组组成：集合计划财产清算小组成员由管理人、托管人、符合《中华人民共和国证券法》规定的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。集合计划财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

（3）集合计划财产清算小组职责：集合计划财产清算小组负责集合计划财产的保管、清理、估价、变现和分配。集合计划财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。

### 2、集合计划财产清算程序

（1）《集合计划合同》终止情形出现时，由集合计划财产清算小组统一接管



集合计划；

- (2) 对集合计划财产和债权债务进行清理和确认；
- (3) 对集合计划财产进行估值和变现；
- (4) 制作清算报告；
- (5) 聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- (6) 将清算报告报中国证监会备案并公告；
- (7) 对集合计划剩余财产进行分配。

集合计划财产清算的期限为6个月，但因本集合计划所持证券的流动性受到限制而不能及时变现的，清算期限可相应顺延。

### 3、清算费用

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

### 4、集合计划财产清算剩余财产的分配

集合计划财产按如下顺序进行清偿

- (1) 支付集合计划财产清算费用；
- (2) 交纳集合计划所欠税款；
- (3) 清偿集合计划债务；
- (4) 清算后如有余额，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、集合计划财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告。集合计划财产清算报告经符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所审计、律师事务所出具法律意见书后，报中国证监会备案并公告。集合计划财产清算公告于集合计划财产清算报告报中

国证监会备案后5个工作日内由集合计划财产清算小组进行公告，集合计划财产清算小组应当将清算报告登载在规定网站上，并将清算报告提示性公告登载在规定报刊上。

#### 6、集合计划财产清算账册及文件的保存

集合计划财产清算账册及有关文件由托管人保存期限不少于20年。

## 十七、违约责任

(一) 管理人或托管人不履行本协议或履行本协议不符合约定的，应当承担违约责任。

(二) 管理人、托管人在履行各自职责的过程中，违反《基金法》规定或者本托管协议约定，给集合计划财产或者集合计划份额持有人造成损害的，应当分别对各自的行为依法承担赔偿责任；因共同行为给集合计划财产或者集合计划份额持有人造成损害的，应当承担连带赔偿责任，对损失的赔偿，仅限于直接损失。但是发生下列情况，当事人免责：

1、管理人和/或托管人按照中国证监会的规定或当时有效的法律、法规或规章、市场交易规则的作为或不作为而造成的损失等；

2、在没有故意或过失的情况下，管理人由于按照《集合计划合同》规定的投资原则而投资或不投资而造成的损失等；

3、托管人对存放或存管在托管人以外机构的集合计划资产，或交由证券公司等其他机构负责清算交收的集合计划资产及其收益，由于该机构欺诈、疏忽、过失或破产等原因给本集合计划资产造成的损失等；

4、不可抗力；

如果由于本协议一方当事人（“违约方”）的违约行为给集合计划资产或集合计划投资者造成损失，而另一方当事人（“守约方”）赔偿了集合计划资产或集合计划投资者的损失，则守约方有权向违约方追索由此遭受的所有直接损失。

当事人一方违约，另一方在职责范围内有义务及时采取必要的措施，尽力防

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。

由于不可抗力原因，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，由此造成集合计划资产或集合计划投资者损失，管理人和托管人可以免除赔偿责任。但管理人和托管人应当积极采取必要的措施消除或降低由此造成的影响。

(三) 托管协议当事人违反托管协议，给另一方当事人造成损失的，应承担赔偿责任。

(四) 违约行为虽已发生，但本托管协议能够继续履行的，在最大限度地保护集合计划份额持有人利益的前提下，管理人和托管人应当继续履行本协议。

(五) 本协议所指损失均为直接损失。

## 十八、争议解决方式

双方当事人同意，因本协议而产生的或与本协议有关的一切争议，应通过友好协商或者调解解决。托管协议当事人不愿通过协商、调解解决或者协商、调解不成的，任何一方当事人均有权将争议提交上海国际经济贸易仲裁委员会（上海国际仲裁中心），根据该会届时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁的地点在上海市，仲裁裁决是终局的，并对双方当事人均有约束力。仲裁费用由败诉方承担。

争议处理期间，双方当事人应恪守管理人和托管人职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行《集合计划合同》和本协议规定的义务，维护集合计划份额持有人的合法权益。

本协议受中华人民共和国法律管辖。

## 十九、托管协议的效力

(一) 管理人在向中国证监会提交变更《东风5号集合资产管理计划托管协议》的申请时提交的托管协议草案应经托管协议当事人双方盖章以及双方法定代表人或授权代表签字或盖章，协议当事人双方根据中国证监会的意见修改托管协

议草案。托管协议以中国证监会批准的文本为正式文本。

(二) 托管协议自《集合计划合同》成立之日起成立, 自《集合计划合同》生效之日起生效。托管协议的有效期自其生效之日起至集合计划财产清算结果报中国证监会备案并公告之日止。

(三) 托管协议自生效之日起对托管协议当事人具有同等的法律约束力。

(四) 托管协议一式陆份, 除上报中国证监会和中国银行保险监督管理委员会各壹份外, 管理人和托管人分别持有贰份, 每份具有同等的法律效力。

## 二十、其他事项

本协议未尽事宜, 当事人依据集合计划合同、有关法律法规等规定协商办理。

## 二十一、托管协议的签订

(本页无正文)

管理人：东海证券股份有限公司（盖章）

法定代表人或授权代表（签章）：

签订地点：

签订日期：       年   月   日

托管人：交通银行股份有限公司（盖章）

法定代表人或授权代表（签章）：

签订地点：

签订日期：       年   月   日