

财通基金同富量化精选 1 号 (FOF) 集合资产管理计划 资产管理合同

合同编号: FFDPA00202211300460

资产管理人: 财通基金管理有限公司

资产托管人: 南京银行股份有限公司

目 录

一、前言	3
二、释义	3
三、承诺与声明	6
四、当事人及权利义务	7
五、资产管理计划的基本情况	13
六、资产管理计划的募集	15
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	24
十二、投资顾问 (如有)	28
十三、分级安排 (如有)	28
十四、利益冲突及关联交易	28
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、确认与执行	31
十八、越权交易的界定	34
十九、交易及清算交收安排	36
二十、资产管理计划财产的估值和会计核算	39
二十一、资产管理计划的费用与税收	43
二十二、资产管理计划的收益分配	46
二十三、资产管理计划的存续期资产分配	47
二十四、信息披露与报告	47
二十五、风险揭示	49
二十六、资产管理合同的变更、终止与财产清算	54
二十七、违约责任	59
二十八、争议的处理	60
二十九、资产管理合同的效力	60
三十、其他事项	61

一、前言

订立本合同的依据、目的和原则：

1、订立本资产管理合同的依据是《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》（以下简称“《基金法》”）、《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》（以下简称“《指导意见》”）、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》（以下简称“《管理办法》”）、《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》（以下简称“《运作规定》”）、《集合资产管理计划资产管理合同内容与格式指引（试行）》和其他可适用本资产管理计划的有关规定。

2、本合同应当适用上述第 1 款中所列示的相应法律法规之规定，若因法律法规的制定或修改或更新导致本合同的内容与届时有效法律法规的强制性规定不一致，应当以届时有效法律法规的强制性规定为准。

3、订立本资产管理合同的目的是为了明确资产委托人、资产管理人和资产托管人在集合资产管理业务过程中的权利、义务及职责，确保资产管理计划财产的安全，保护当事人各方的合法权益。

4、订立本资产管理合同应当遵循平等自愿、诚实信用、公平原则，充分保护本合同各方当事人的合法权益，不得损害国家利益、社会公共利益和他人合法权益。

5、资产委托人自签订资产管理合同即成为资产管理合同的当事人。在本计划存续期间，资产委托人自全部退出资产管理计划之日起，该资产委托人不再是资产管理计划的投资人和资产管理合同的当事人。

资产管理人应当对本资产管理计划的设立、变更、展期、终止、清算等行为向中国证券投资基金业协会（以下简称“基金业协会”）进行备案。基金业协会接受本资产管理计划的备案不能免除资产管理人按照规定真实、准确、完整、及时地披露产品信息的法律责任，也不代表基金业协会对本资产管理计划的合规性、投资价值及投资风险做出保证和判断。投资者应当自行识别产品投资风险并承担投资行为可能出现的损失。

二、释义

在本合同中，除上下文另有规定外，下列用语应当具有如下含义：

1、资产管理合同、本合同：指资产委托人、资产管理人和资产托管人签署的《财通基金同富量化精选 1 号 (FOF) 集合资产管理计划资产管理合同》及其附件，以及对该合同及附件做出的任何有效变更

2、资产委托人、委托人：指签订本合同，具备相应风险识别能力和风险承担能力，投资于本资产管理计划不低于一定金额且符合《指导意见》、《运作规定》关于合格投资者要求的投资者

3、资产管理人、管理人：指财通基金管理有限公司

4、资产托管人、托管人：指南京银行股份有限公司

5、投资顾问：指由资产管理人聘请为本计划的投资运作提供投资建议服务的第三方机构。

本计划未聘请投资顾问

6、注册登记机构：指资产管理人或其委托的经中国证监会认定可办理开放式证券投资基金份额登记业务的机构

7、资产管理计划、本计划、计划：指按照本合同的约定设立，为资产委托人的利益，将多个资产委托人交付的资金进行集中管理、运用或处分，进行投资活动的集合资产管理安排，即财通基金同富量化精选 1 号 (FOF) 集合资产管理计划

8、计划说明书：指《财通基金同富量化精选 1 号 (FOF) 集合资产管理计划计划说明书》，内容包括资产管理计划名称和类型、资产管理人与资产托管人概况、资产管理计划的投资范围、投资策略和投资限制情况、投资风险揭示、中国证监会规定的其他事项等

9、工作日：指资产管理人和资产托管人均办理相关业务的营业日

10、交易日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

11、开放日：指非计划初始募集期间，资产管理人办理计划参与、退出业务的工作日

12、证券账户：指根据中国证监会有关规定和中国证券登记结算有限责任公司等相关机构的有关业务规则，由资产托管人为资产管理计划财产在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司、深圳分公司开设的专用证券账户、在中央国债登记结算有限责任公司、银行间市场清算所股份有限公司开立的有关账户

13、资金账户、托管账户：指资产托管人根据有关规定为资产管理计划财产开立的专门用于清算交收的银行账户

14、期货账户（如有）：指根据中国证监会有关规定和中国金融期货交易所等相关期货交易所的有关业务规则，资产管理人为委托资产在资产管理人选定的期货公司处开立的用于存放委托资产期货保证金的账户，其用途包括出入金、支付期货交易结算款和相关费用等，期货账户对应唯一的期货结算账户，也即资金账户

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

16、计划资产总值：指本资产管理计划拥有的各类有价证券、银行存款本息及其他资产的价值总和

17、计划资产净值：指本资产管理计划资产总值减去负债后的价值

18、计划份额净值/单位净值：指计算日资产管理计划资产净值除以计算日资产管理计划份额总数所得的数值

19、资产管理计划资产估值：指计算、评估资产管理计划资产和负债的价值，以确定本资产管理计划资产净值和份额净值的过程

20、初始募集期间：指资产管理合同及计划说明书中载明，自计划份额发售之日起最长不超过 60 天

21、计划存续期、存续期：指本计划成立至计划终止之间的期限

22、本合同生效日、资产管理计划成立日：指本计划的募集金额缴足之日起十个工作日内，资产管理人应当委托具有证券相关业务资格的会计师事务所进行验资并出具验资报告。本计划在取得验资报告后，由资产管理人公告资产管理计划成立

23、认购：指在资产管理计划初始募集期间，资产委托人按照本合同的约定购买本计划份额的行为

24、参与：指在资产管理计划开放日，资产委托人按照本合同的规定参与本计划份额的行为

25、退出：指在资产管理计划开放日，资产委托人按照本合同的规定退出本计划份额的行为

26、违约退出：指资产委托人在非合同约定的退出开放日退出资产管理计划的行为，本计划不接受违约退出

27、代理销售机构、代销机构：指符合中国证监会规定的条件，取得基金销售资格并接受资产管理人委托，代为办理本计划认购、参与、退出等业务的机构

28、直销机构：指财通基金管理有限公司

29、销售机构：指代理销售机构和直销机构

30、法律法规：指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、部门规章、规范性文件、监管政策、自律规则以及对该等法律法规不时的修订和补充

31、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

32、不可抗力：指不能预见、不能避免并不能克服的客观情况，包括但不限于地震、台风、水灾、火灾、战争、暴乱、流行病、政府行为、罢工、停工、停电、通讯失败等，非因资产管理人、资产托管人自身原因导致的技术系统异常事故、法律法规调整等情形。因交易所、银行、登记结算机构的交易、结算系统出现故障导致的交易、结算无法进行的情形，因电信服务商原因导致资金划付的网络中断、无法使用的情形，亦构成不可抗力事件

三、承诺与声明

(一) 资产管理人承诺

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

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

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

(二) 资产托管人承诺

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

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

(三) 资产委托人声明

委托财产为其拥有合法所有权或处分权的资产，保证委托财产的来源及用途符合国家有关规定，保证其参与投资本资产管理计划符合法律法规的规定及业务决策程序的要求，保证有完全及合法的授权委托资产管理人和资产托管人进行委托财产的投资管理和托管业务，保证没有任何其他限制性条件妨碍资产管理人和资产托管人对该委托财产行使相关权利且该权利不会为任何其他第三方所质疑。

资产委托人声明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，投资于本资产管理计划将自行承担投资风险。资产委托人承认，资产管理人、资产托管人未对委托财产的收益状况及本金安全作出任何承诺或担保。

资产委托人承诺其向资产管理人提供的（若通过代理销售机构（如有）认购、参与本计划的，则向代理销售机构（如有）提供）有关投资目的、投资偏好、投资限制、财产收入情况和风险承受能力等基本情况真实、完整、准确、合法，不存在任何虚假陈述、重大遗漏或误导。前述信息资料如发生任何实质性变更，应当及时书面告知资产管理人或代理销售机构（如有）。

资产委托人确认在签署本合同前已签署相应的风险揭示书，委托人理解风险揭示书中所述内容，愿意承担本计划可能存在的风险与后果。资产委托人理解委托财产的投资、运作、托管面临本合同中列举的各类风险，资产管理人及资产托管人就委托财产面临的前述固有风险免于承担责任。

资产委托人承诺及保证：符合法律法规、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、资产委托人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：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；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、金融资产投资公司、信托公司、保险公司、保险资产管理机构、财务公司及中国证监会认定的其他机构；4) 接受国务院金融监督管理机构监管的机构发行的资产管理产品；5) 基本养老金、社会保障基金、企业年金等养老基金，慈善基金等社会公益基金，合格境外机构投资者 (QFII)、人民币合格境外机构投资者 (RQFII)；6) 中国证监会视为合格投资者的其他情形。

2、资产委托人的资金来源合法合规，不存在使用贷款、发行债券等筹集的非自有资金投资本资产管理计划的情形。

3、资产委托人以其管理的资产管理产品投资于本资产管理计划的，应如实告知资产管理人，且保证该产品的所有投资者委托财产来源合法合规，且均非资产管理产品，委托人为私募资产管理产品的，其所有投资者为符合法律法规规定的合格投资者；资产委托人承诺投资本计划不存在违反监管要求的产品嵌套，以及以投资本计划规避投资范围、杠杆约束等监管要求等违法违规行为。若资产委托人以其管理的资产管理产品申请认购/参与本计划，资产管理人认为可能导致本计划违反监管要求的产品嵌套规定的，资产管理人有权拒绝其认购/参与申请。

四、当事人及权利义务

(一) 资产委托人

1、资产委托人基本情况

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

2、资产委托人的权利

- (1) 分享资产管理计划财产收益；
- (2) 取得分配清算后的剩余资产管理计划财产；
- (3) 按照本合同的约定参与、退出和转让资产管理计划份额；
- (4) 按照法律法规及本合同约定的时间和方式获得资产管理计划的信息披露资料；
- (5) 监督资产管理人及资产托管人履行投资管理和托管义务的情况；

(6) 资产管理计划设定为均等份额。除本合同另有约定外, 每份份额具有同等的合法权益;

(7) 法律法规、中国证监会及基金业协会规定的及本合同约定的其他权利。

3、资产委托人的义务

(1) 认真阅读并遵守本合同, 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受能力问卷, 如实提供资金来源、金融资产、收入及负债情况, 并对其真实性、准确性和完整性负责, 签署合格投资者相关文件;

(3) 除公募资产管理产品外, 以合伙企业、契约等非法人形式直接或者间接投资于资产管理计划的, 应向管理人充分披露实际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、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) 向管理人或资产管理计划销售机构提供法律法规规定的信息资料及身份证明文件, 配合管理人或其销售机构完成投资者适当性管理、非居民金融账户涉税信息尽职调查、反洗钱等监管规定的工作; 及时、全面、准确地向资产托管人提供法律法规规定的身份证明文件及受益所有人信息资料, 配合资产托管人完成反洗钱等监管规定的合规工作;

(8) 不得违反资产管理合同的约定干涉资产管理人的投资管理行为;

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

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

(11) 在签署本合同前, 向资产管理人、资产托管人书面告知资产委托人的关联方发行的证券名单或其他禁止交易的证券名单, 在上述证券名单发生变更时, 及时书面通知资产管理人和资产托管人;

(12) 在本计划存续期间及时关注资产管理人的短信、电话、邮件、传真以及其公司网站公告;

(13) 理解并同意承担委托财产的投资、运作、托管面临本合同“风险揭示”章节以及风险揭示书中列举的各类风险;

(14) 资产委托人以其管理的资产管理产品投资于本资产管理计划的, 该产品的所有投资者为符合法律法规规定的合格投资者且委托财产来源合法合规, 且均非资产管理产品; 资产委

托人承诺投资本计划不存在违反监管要求的产品嵌套,以及以投资本计划规避投资范围、杠杆约束等监管要求等违法违规行为;

(15) 严格遵守其向资产管理人作出的相关承诺;

(16) 配合资产管理人在反洗钱方面对投资者的尽职调查、资金来源和用途合法性审查、可疑交易调查和报告;

(17) 法律法规、中国证监会及基金业协会规定和本合同约定的其他义务。

(二) 资产管理人

1、资产管理人的基本情况

名称: 财通基金管理有限公司

住所: 上海市虹口区吴淞路 619 号 505 室

法定代表人: 吴林惠

组织形式: 有限责任公司

存续期间: 持续经营

联系人: 陈飞君

联系电话: 021-20537803

网址: www.ctfund.com

通讯地址: 上海市银城中路 68 号时代金融中心 41、43 楼

2、资产管理人的权利

(1) 按照本合同的约定,独立管理和运用资产管理计划财产;

(2) 依照本合同的约定,及时、足额获得资产管理人管理费用和业绩报酬(如有);

(3) 依照有关规定和本合同约定行使因资产管理计划财产投资所产生的权利;

(4) 根据本合同及其他有关规定,监督资产托管人;对于资产托管人违反本合同或有关法律法规规定、对资产管理计划财产及其他当事人的利益造成重大损失的,应当及时采取措施制止,并报告中国证监会相关派出机构及基金业协会;

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

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

(7) 资产管理人有权根据市场情况对本资产管理计划的总规模、单个资产委托人首次参与金额、每次参与金额及持有的本计划总金额限制进行调整;

(8) 有权对资产委托人进行尽职调查,要求资产委托人提供相关证明文件、资料,并在上述文件和资料发生变更时,及时提交变更后的相关文件与资料;

(9) 若因资产委托人原因导致资产管理人受到监管部门的调查或采取其他措施的,资产

委托人应承担全部责任, 资产管理人有权向资产委托人追偿;

(10) 法律法规、中国证监会、基金业协会规定的及本合同约定的其他权利。

3、资产管理人的义务

(1) 依法办理资产管理计划的销售、登记、备案事宜;

(2) 按照基金业协会要求报送资产管理计划产品运行信息;

(3) 按照诚实信用、勤勉尽责的原则履行受托人义务, 管理和运用资产管理计划财产;

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

(5) 制作风险揭示书, 向投资者充分揭示相关风险; 妥善保管资产委托人的身份资料信息, 如托管人为落实反洗钱法律法规要求, 应监管机构或国家有权机关调查需要要求管理人提供资产委托人的身份资料信息的, 托管人提供相应监管或调查文件后, 管理人应积极予以提供或协助;

(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) 建立健全内部管理等制度, 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、资产管理人的固有财产相互独立, 对所管理的不同财产分别管理、分别记账, 分别投资; 聘请投资顾问的, 应制定相应利益冲突防范机制;

(8) 除依据法律法规、本合同及其他有关规定外, 不得为资产管理人及任何第三人谋取利益, 不得委托第三人运作资产管理计划财产;

(9) 保守商业秘密, 不得泄露资产管理计划的投资计划、投资意向等, 依法依规提供信息的除外;

(10) 公平对待所管理的不同财产, 不得从事任何有损资产管理计划财产及其他当事人利益的活动;

(11) 除规定情形或符合规定条件外, 不得为管理人、托管人及其关联方提供融资;

(12) 按照本合同的约定接受资产委托人和资产托管人的监督;

(13) 以资产管理人的名义, 代表资产委托人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为;

(14) 按照本合同约定计算并向资产委托人报告资产管理计划份额净值;

(15) 确定资产管理计划份额参与、退出价格, 采取适当、合理的措施确保份额交易价格的计算方法符合法律法规的规定和本合同的约定;

(16) 按照本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;

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

(18) 按照本合同约定确定收益分配方案, 及时向资产委托人分配收益;

(19) 根据法律法规与本合同的规定, 编制向投资者披露的资产管理计划季度、年度等定期报告;

(20) 办理与受托财产管理业务活动有关的信息披露事项;

(21) 建立并保存投资者名单;

(22) 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;

(23) 按照法律、行政法规和中国证监会的规定, 保存资产管理计划的会计账册、妥善保存有关的合同、协议、交易记录等文件、资料和数据, 保存期限自资产管理计划终止之日起不得少于 20 年;

(24) 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;

(25) 对本计划投资其他资管产品的底层资产进行穿透监督。对本计划所投资的资管产品的投资范围是否超过本计划的投资范围、所投资的资管产品是否再投资于除公募证券投资基金外的资管产品、以及本计划涉及所投资资管产品的资产的投资比例等进行监督;

(26) 按照《中华人民共和国反洗钱法》等有关反洗钱法律法规和监管要求履行反洗钱义务, 并向资产托管人提供法律法规规定的受益所有人信息资料, 配合资产托管人完成反洗钱等监管规定的合规工作;

(27) 法律法规、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。

(三) 资产托管人

1、资产托管人的基本情况

名称: 南京银行股份有限公司

住所: 南京市建邺区江山大街 88 号

法定代表人或授权代表: 胡升荣

通讯地址: 上海市黄浦区徐家汇路 518 号 310 室

联系人: 闫浪

联系电话: 021-66069163

传真: 021-54662130

2、资产托管人的权利

(1) 按照本合同的约定, 依法保管资产管理计划财产;

(2) 按照本合同的约定, 及时、足额获得资产管理计划托管费用;

(3) 法律法规、中国证监会及基金业协会规定的和本合同约定的其他权利。

3、资产托管人的义务

- (1) 安全保管资产管理计划现金财产;
- (2) 除依据法律法规规定和本合同的约定外,不得为资产托管人及任何第三人谋取利益,不得委托第三人托管资产管理计划财产;
- (3) 对所托管的不同财产分别设置账户,确保资产管理计划财产的完整与独立;
- (4) 公平对待所托管的不同财产,不得从事任何有损资产管理计划财产及其他当事人利益的活动;
- (5) 按规定开设和注销委托财产的托管账户及证券账户;
- (6) 复核资产管理计划资产净值和份额净值;
- (7) 办理与资产管理计划托管业务活动有关的信息披露事项;
- (8) 根据相关法律法规和资产管理合同约定,复核管理人编制的资产管理计划财产的定期报告,并出具书面意见;
- (9) 编制托管年度报告,并向基金业协会备案,抄报中国证监会相关派出机构;
- (10) 按照法律法规要求和本合同的约定,根据资产管理人的投资指令,及时办理清算、交割事宜;
- (11) 保守商业秘密,除法律法规、本合同及其他有关规定另有要求外,不得向他人泄露;
- (12) 根据法律、行政法规和中国证监会的规定保存资产管理计划的会计账册,妥善保存有关的合同、协议、交易记录等文件资料,保存期限自资产管理计划终止之日起不得少于 20 年;
- (13) 监督资产管理人的投资运作,发现资产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本合同约定的,应当拒绝执行,立即通知资产管理人并及时报告中国证监会相关派出机构和基金业协会;
- (14) 设立专门的资产托管部门,具有符合要求的营业场所,配备足够的、合格的熟悉资产托管业务的专职人员,负责财产托管事宜;
- (15) 及时向资产管理人报告其自身及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行或者承销的证券、设立的资产管理产品的明细信息;
- (16) 国家有关法律法规、监管机构及本合同规定的其他义务。

(四) 资产管理人、资产托管人的更换条件和程序

1、资产管理人职责终止的情形

有下列情形之一的,资产管理人职责终止:

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

2、资产托管人职责终止的情形

有下列情形之一的，资产托管人职责终止：

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

3、资产管理人和资产托管人的更换程序

资产管理人/资产托管人职责终止的，资产管理人/资产托管人应妥善保管资产管理/托管业务资料，及时向新任资产管理人/新任资产托管人办理资产管理业务/计划资产及托管业务的移交手续，新任资产管理人/新任资产托管人应及时接收。新任资产管理人/新任资产托管人应与资产托管人/资产管理人核对计划资产总值和净值。

4、新任资产管理人接收资产管理业务，或新资产托管人接收计划资产和资产托管业务前，原资产管理人或原资产托管人应继续履行相关职责，并保证不做出对资产委托人的利益造成损害的行为。原资产管理人或资产托管人在继续履行相关职责期间，仍有权按照资产管理合同的规定收取资产管理费或资产托管费。

五、资产管理计划的基本情况

(一) 资产管理计划的名称

财通基金同富量化精选 1 号 (FOF) 集合资产管理计划。

(二) 资产管理计划的类别

混合类集合资产管理计划。

(三) 资产管理计划的运作方式

定期开放式。本资产管理计划自成立之日起每 12 个月开放一次计划份额的参与和退出。开放期为本计划成立之日起每 12 个月对日 (T 日，若该日为非工作日，则为该日之后的第一个工作日，若 12 个月期满后不存在对应日期的，则顺延至该月最后一日的下一工作日)，开放计划份额的参与和退出，开放时间为 9:00 至 15:00。

资产管理人可根据实际情况延长开放时间，延长的开放日仅允许参与，不允许退出，但每次开放期总开放时间不超过 5 个工作日。具体开放安排以资产管理人公告为准，届时资产管理人网站上发布公告即视为履行了告知义务。本计划不接受违约退出。在法律法规、监管政策或本合同变更的情况下，资产管理人有权增加临时开放期，临时开放期仅允许计划份额的退出。具体开放期以资产管理人公告为准。法律法规、监管机构及自律组织另有规定的，从其规定。

(四) 资产管理计划的投资目标、主要投资方向、投资比例、产品风险等级

1、投资目标：在严格控制风险的基础上，力争实现计划资产的稳健增值。

2、主要投资方向：经中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金（含资产管理人管理的证券投资基金）、股票（包括主板、创业板、科创板以及其他经中国证监会核准或注册上市的首次公开发行股票及二级市场股票）及固定收益类品种（包括国内依法发行和上市交易的国债、政策性金融债、央行票据、地方政府债、债券逆回购、银行存款）。

3、本计划投资于公开募集证券投资基金的比例不低于本计划资产总值的 80%，穿透合并计算后，权益类资产的投资比例（按市值计）为本计划总资产的 0-80%，固定收益类资产（除银行活期存款）的投资比例（按市值计）为本计划总资产的 0-80%，商品及金融衍生品的投资比例（按市值计）为本计划总资产的 0-80%或衍生品账户权益不超过本计划总资产的 20%；计划资产总值占计划资产净值比例不超过 200%。

4、产品风险等级：R3（管理人会定期对产品进行风险评级，本产品届时重新评定的风险等级以管理人公告为准，代销机构（如有）对本产品风险等级的评定不低于管理人对本产品的风险等级评定的，以代销机构（如有）评定的风险等级为准）。

（五）资产管理计划的存续期限

本计划存续期限为 60 个月，自本计划成立之日起至届满 60 个月之月度对日的前一日止，如该日为非工作日，则顺延至下一工作日。出现资产管理合同约定的本计划提前终止或展期情形的，本计划相应提前终止或展期。

（六）资产管理计划的最低初始募集规模

本资产管理计划成立时资产管理计划财产的初始资产不得低于 1000 万元人民币，但法律法规、监管机构及自律组织另有规定的除外。

（七）资产管理计划份额的初始募集面值

人民币 1.00 元。

（八）资产管理计划的分级安排（如有）

本计划不存在分级安排。

（九）资产管理计划的份额登记、估值与核算、信息技术系统等服务机构

本计划份额登记、估值与核算服务机构为财通基金管理有限公司。

本计划的信息技术系统服务机构为财通基金管理有限公司。

（十）对基金中基金资产管理计划（FOF）或管理人中管理人资产管理计划（MOM）进行特别标识（如是）

本计划属于基金中基金资产管理计划（FOF）。

（十一）对于因资产管理合同的订立、内容、履行和解释或与资产管理合同有关的争议，合同当事人应尽量通过协商或调解途径解决。不愿或者不能通过协商或调解解决的，任何一方均有权将争议提交上海国际经济贸易仲裁委员会，按提交仲裁申请时该仲裁机构有效之仲裁规

则进行仲裁，仲裁地点为上海。

(十二) 其他

除本合同另有约定外，资产管理计划应当设定为均等份额，每份计划份额具有同等的合法权益。

六、资产管理计划的募集

(一) 资产管理计划的募集期限、募集方式、募集对象

1、募集期限

本资产管理计划的初始募集期自资产管理计划份额发售之日起最长不超过60日。具体时间由资产管理人根据相关法律法规以及本合同的规定确定，并在计划说明书中披露。

2、募集方式

本资产管理计划通过资产管理人的直销机构及其他代理销售机构进行募集。具体销售机构名单、联系方式以本资产管理计划的计划说明书为准。

3、募集对象

具备相应风险识别能力和风险承受能力，投资于本资产管理计划不低于本计划要求的最低认购金额且符合下列条件的自然人、法人或者其他组织：

(1) 具有2年以上投资经历，且满足下列三项条件之一的自然人：家庭金融净资产不低于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；

(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、金融资产投资公司、信托公司、保险公司、保险资产管理机构、财务公司及中国证监会认定的其他机构；

(4) 接受国务院金融监督管理机构监管的机构发行的资产管理产品；

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

(6) 中国证监会视为合格投资者的其他情形。

法律法规、监管机构、自律组织对于合格投资者认定将来另有规定的，从其规定。

(二) 资产管理计划的最低认购金额和支付方式

认购资金应以现金形式交付。

投资者在初始募集期间的净认购金额不得低于40万元人民币(不含认购费用)，并可多次认购。

(三) 资产管理计划份额的认购费用

本资产管理计划认购费率为：0%。

认购份额及认购费用的计算方法如下：

净认购金额=认购金额/（1+认购费率）

认购费用=认购金额-净认购金额

认购份额=（净认购金额+认购期利息）/1.00

认购份额及认购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，由此产生的误差计入资产管理计划财产。

（四）初始募集期的认购程序

1、资产管理人委托代理销售机构进行募集的，可以委托代理销售机构代为完成投资者尽职调查工作，并将相关资料提供给资产管理人。

2、认购程序。资产委托人办理认购业务时应提交的文件和办理手续、办理时间、处理规则等在遵守本合同规定的前提下，以各销售机构的具体规定为准。

3、认购申请的确认。

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认购申请。申请是否有效应以注册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。

认购申请一经受理，不得撤销。

（五）初始认购资金的管理及利息处理方式

资产管理人应当将资产管理计划初始募集期间客户的认购资金存入资产管理计划募集结算专用账户，在资产管理计划成立前，任何机构和个人不得动用。投资者的认购参与资金（不含认购费用）在初始募集期间发生的利息收入按银行活期存款利率（税后）计算。该利息收入在初始募集期结束后折合成计划份额，归资产委托人所有。利息转份额以注册登记机构的记录为准。

（六）本资产管理计划募集结算专用账户和销售机构委托募集账户等信息，具体以销售机构相关告知为准。

七、资产管理计划的成立与备案

（一）资产管理计划成立的条件

- 1、募集过程符合法律、行政法规和中国证监会的规定；
- 2、初始募集规模不低于 1000 万元；
- 3、投资者人数不少于 2 人，且不超过 200 人；
- 4、符合中国证监会规定以及资产管理合同约定的其他条件。

（二）资产管理计划的成立与备案

初始募集期限届满，符合资产管理计划成立条件的，资产管理人应当自募集金额缴足之日起 10 个工作日内聘请具有证券相关业务资格的会计师事务所进行验资，并出具验资报告。本资产管理计划在取得验资报告后，由资产管理人公告本资产管理计划成立，并书面通知资产托管人。资产管理人应当在本资产管理计划成立之日起五个工作日内，将资产管理合同、投资者名单与认购金额、验资报告或者资产缴付证明等材料报基金业协会备案。资产管理计划成立前，任何机构和个人不得动用投资者认购参与资金。

本资产管理计划完成备案前不得开展投资活动，但以现金管理为目的，可以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。资产管理人于资产管理计划获得基金业协会备案确认当日书面通知资产托管人。

(三)资产管理合同的生效

资产管理合同自本资产管理计划成立日生效。

(四)资产管理计划不能满足成立条件的处理方式

资产管理计划初始募集期限届满，不能满足资产管理计划成立条件的，资产管理人应当承担下列责任：

- 1、以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用；
- 2、在初始募集期限届满后 30 日内退还投资者已缴纳的款项，并加计银行同期活期存款利息。

八、资产管理计划的参与、退出与转让

(一)参与和退出场所

本资产管理计划参与和退出场所为资产管理人的直销机构及代理销售机构的营业场所，或按销售机构提供的其他方式办理参与和退出。具体销售机构名单、联系方式以本资产管理计划的计划说明书为准。

(二)参与和退出的开放日和时间

本资产管理计划自成立之日起每 12 个月开放一次计划份额的参与和退出。开放期为本计划成立之日起每 12 个月对日（T 日，若该日为非工作日，则为该日之后的第一个工作日，若 12 个月期满后不存在对应日期的，则顺延至该月最后一日的下一工作日），开放计划份额的参与和退出，开放时间为 9:00 至 15:00。

资产管理人可根据实际情况延长开放时间，延长的开放日仅允许参与，不允许退出，但每次开放期总开放时间不超过 5 个工作日。具体开放安排以资产管理人公告为准，届时资产管理人网站上发布公告即视为履行了告知义务。本计划不接受违约退出。注册登记机构于受理资产委托人参与、退出申请后在法律法规规定的时限内，对委托人参与、退出申请的有效性进行确认。

若中国证监会有新的规定,或出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更或其他特殊情况,资产管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整并告知资产委托人。资产管理人网站上发布公告即视为履行了告知义务。

(三) 临时开放期

在法律法规、监管政策或本合同变更的情况下,资产管理人可以设置临时开放期,临时开放期仅允许计划份额的退出、不开放参与。该等临时开放期安排不受前述参与和退出安排的限制。临时开放期仅限于本合同发生修改,为不同意修改的投资者提供退出机会的情形,其临时开放期的具体安排以资产管理人公告为准,届时资产管理人网站上发布公告即视为履行了告知义务。法律法规、监管机构及自律组织另有规定的,从其规定。

(四) 参与和退出的方式、价格、程序及确认等

1、“未知价”原则,即资产管理计划的参与和退出价格以受理申请当日收市后计算的资产管理计划份额净值为基准进行计算。

2、资产管理计划采用金额参与和份额退出的方式,即参与以金额申请,退出以份额申请。

3、资产委托人办理参与、退出等业务时应提交的文件和办理手续、办理时间、处理规则等在遵守本合同规定的前提下,以各销售机构的具体规定为准。

4、当日的参与与退出申请可以在当日开放时间结束前撤销,在当日的开放时间结束后不得撤销。

5、参与和退出申请的确认。销售机构受理参与或退出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参与或退出申请。申请是否有效应以注册登记机构的确认为准。注册登记机构应在法律法规规定的时限内对资产委托人参与、退出申请的有效性进行确认。

如将开放当日全部有效参与申请确认后,投资者总人数不超过 200 人,则注册登记机构对参与申请全部予以确认。如将开放当日全部有效参与申请确认后投资者总人数超过 200 人,则注册登记机构按照时间优先、金额优先的原则确认参与申请,确保本资产管理计划的委托人数不超过 200 人,对未予确认的参与资金无息予以返还。

资产委托人退出资产管理计划时,资产管理人按先进先出的原则,份额确认日期在前的计划份额先退出,确认日期在后的计划份额后退出,以确定所适用的退出费率(如有)及业绩报酬(如有)。

6、参与和退出申请的款项支付。参与采用全额交款方式,若资金在规定时间内未全额到账则参与不成功,已交付的委托款项将无息退回资产委托人账户。投资者退出申请成交后,资产管理人应按规定向资产委托人支付退出款项,退出款项在自受理资产委托人有效退出申请确认之日起不超过[15]个工作日内划往资产委托人银行账户。在发生巨额退出时,退出款项的支付办法按本合同和有关法律法规规定办理。

7、资产管理人在不损害资产委托人权益的情况下可更改上述原则，但资产管理人应及时告知资产委托人。资产管理人网站发布公告即视为履行了告知义务。

(五) 参与和退出的金额限制

投资者在资产管理计划存续期开放日购买资产管理计划份额的，如投资者在提交参与申请时未持有资产管理计划份额，则投资者应符合合格投资者标准且申购金额应不低于[40]万元人民币（不含参与费用），在开放日内追加参与的不受最低参与金额限制。

当投资者持有的计划份额资产净值高于[40]万元人民币时，投资者可以选择全部或部分退出资产管理计划份额；选择部分退出资产管理计划份额的，投资者在退出后持有的计划份额资产净值应当不低于[40]万元人民币。当资产管理人发现投资者申请部分退出资产管理计划将致使其在部分退出申请确认后持有的计划资产净值低于[40]万元人民币的，资产管理人有权适当减少该投资者的退出金额，以保证部分退出申请确认后投资者持有的计划资产净值不低于[40]万元人民币。

当投资者持有的计划资产净值低于[40]万元人民币（含[40]万元人民币）时，需要退出计划的，投资者应当一次性全部退出资产管理计划。

资产管理人可根据市场情况，合理调整对参与金额和退出份额的数量限制，资产管理人应及时将上述情况告知资产委托人。资产管理人和代理销售机构在网站公告前述调整事项即视为履行了告知义务。

(六) 参与和退出的费用

1、参与费用与参与份额的计算方式

参与费率为[0%]。

参与份额及参与费用的计算方法，参照前文关于认购份额及认购费用的计算方法。

2、退出费用与退出金额的计算方式

退出费率为[0%]。

本计划退出金额的计算方法如下：

退出总额=退出份额×受理申请当日收市后计算的资产管理计划份额净值

退出金额=退出总额-退出费用(如有)-业绩报酬（如有）

其中，退出总额和退出金额的计算结果保留到小数点后2位，小数点2位以后的部分四舍五入，由此产生的误差产生的收益或损失由计划财产承担。

3、参与资金的利息处理方式

参与资金的利息处理方式，参照前文关于认购资金的利息处理方式。

4、资产管理人可以在法律法规和本合同规定范围内调低参与费率、退出费率或调整收费方式。如降低费率或调整收费方式，资产管理人应在调整实施前及时告知资产委托人。资产管

理人和代理销售机构在网站公告前述调整事项即视为履行了告知义务。

(七) 拒绝或暂停参与、暂停退出的情形及处理

1、开放期内在如下情况下，资产管理人可以拒绝接受投资者的参与申请：

- (1) 如接受该申请，将导致本计划的资产委托人超过200人。
- (2) 根据市场情况，资产管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对资产管理计划业绩产生负面影响，从而损害现有资产管理计划资产委托人的利益的情形。
- (3) 如接受该申请，将导致本计划资产总规模超过本合同约定的上限（如有）。
- (4) 因资产管理计划收益分配、或资产管理计划内某个或某些证券进行权益分派等原因，使资产管理人认为短期内接受参与可能会影响或损害现有资产管理计划资产委托人利益的。
- (5) 资产管理人认为接受某笔或某些参与申请可能会影响或损害其他资产管理计划资产委托人利益的。
- (6) 如接受该申请，将导致资产管理计划违反法律法规、监管机构关于产品嵌套规定的。
- (7) 法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

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

2、开放期内在如下情况下，资产管理人可以暂停接受投资者的参与申请：

- (1) 因不可抗力导致无法受理资产委托人的参与申请。
- (2) 证券交易场所交易时间临时停市，导致资产管理人无法计算当日资产管理计划财产净值。
- (3) 发生本资产管理计划合同规定的暂停资产管理计划资产估值情况。
- (4) 法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

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

3、开放期内在如下情况下，资产管理人可以暂停/拒绝接受资产委托人的退出申请：

- (1) 因不可抗力导致资产管理人无法支付退出款项。
- (2) 证券交易场所交易时间临时停市，导致资产管理人无法计算当日资产管理计划财产净值。
- (3) 发生本资产管理计划合同规定的暂停资产管理计划资产估值的情况；
- (4) 发生连续巨额赎回；
- (5) 法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

开放期内发生上述情形之一的，资产管理人应当及时告知资产委托人。已接受的退出申请，资产管理人应当足额支付；如暂时不能足额支付，应当按单个退出申请人已被接受的退出

申请量占已接受的退出申请总量的比例分配给退出申请人,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。

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

4、开放期内暂停资产管理计划的参与、退出时,资产管理人应按规定告知资产委托人并履行相应报告程序。

5、开放期内暂停参与或退出期间结束,资产管理计划重新开放时,资产管理人应按规定告知资产委托人并履行相应报告程序。

(八) 大额退出的通知

开放期内,任一委托人在开放日退出金额超过人民币[500]万元的,应当提前[3]个工作日书面通知管理人或通过代销机构通知管理人。管理人未收到该等通知的,管理人有权拒绝该委托人的退出。

(九) 巨额退出的认定及处理方式

1、巨额退出的认定

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

2、巨额退出的处理方式

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

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

(2) 部分延期退出:当全额兑付资产委托人的退出申请有困难,或兑付资产委托人的退出申请进行的资产变现可能使资产管理计划资产净值发生较大波动时,资产管理人可在该开放日接受部分退出申请。对于单日的退出申请,应当按照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,其余部分的退出申请在后续开放日予以受理。对于需要部分延期办理的退出申请,除资产委托人在提交退出申请时明确做出不参加顺延下一个开放日退出的表示外,自动转为下一个开放日退出处理,转入下一个开放日的退出申请的退出价格为下一个开放日的资产管理计划份额净值,以此类推。部分退出导致资产委托人持有的计划份额资产净值低于[40]万元人民币的,资产管理人可视情况按全额退出或[40]万元以上部分金额做部分退出处理。若开放期最后一日仍有退出申请未获受理的,资产管理人有权拒绝该部分退出申请。
资产委托人知悉并同意:管理人仅以本计划现金金额为限支付资产委托人部分或全部退出计划

财产份额，现金不足的部分延期支付。

(3) 巨额退出的通知：当发生巨额退出并部分延期退出时，资产管理人应当及时通知资产委托人，并说明有关处理方法。

(4) 出现连续巨额退出时，即连续2个开放日以上(含本数)发生巨额赎回，如资产管理人认为有必要，可暂停接受或者拒绝退出申请；已经接受的退出申请可以延缓支付退出款项，但不得超过[20]个工作日。出现连续巨额退出并暂停接受退出申请或延缓支付退出款项时，资产管理人应当及时通知资产委托人，并说明有关处理方法；同时资产管理人应当按照法律法规、监管规则的规定及时履行报告义务。

(十) 份额转让

资产委托人可以通过证券交易所以及中国证监会认可的其他方式，向合格投资者转让其持有的本资产管理计划份额，份额转让应遵守交易场所相关规定及要求，并按规定办理份额变更登记手续。转让后，持有本资产管理计划份额的合格投资者合计不得超过200人。资产管理人应当在本资产管理计划份额转让前，对受让人的合格投资者身份和资产管理计划的投资人数进行合规性审查。受让方首次参与本资产管理计划的，应当先与资产管理人、资产托管人签订资产管理合同。

资产管理人有权在法律法规的前提下，制定本资产管理计划的份额转让的相关操作规定，资产委托人应当按照该等操作规定进行份额转让。

(十一) 非交易过户认定及处理方式

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

“继承”是指资产委托人死亡，其持有的计划份额由其合法的继承人继承。

“捐赠”是指资产委托人将其合法持有的计划份额捐赠给公益性质的基金会或社会团体。

“司法强制执行”是指司法机构依据生效司法文书将资产委托人持有的计划份额强制划转给其他自然人、法人、社会团体或其他组织的情形。

2、办理非交易过户业务必须提供注册登记机构规定的相关资料。申请人按注册登记机构规定的标准缴纳过户费用。

(十二) 资产管理人自有资金参与

资产管理人以自有资金投资所持的本计划份额，需满足相关法律法规及监管要求，与资产委托人所持的份额享有同等权益、承担同等风险。

(十三) 管理人应定期将资产管理计划资产委托人变更情况报送基金业协会。

九、份额持有人大会及日常机构

本计划不设置份额持有人大会机制。

十、资产管理计划份额的登记

(一) 本资产管理计划份额的注册登记业务指本资产管理计划的登记、存管、清算和交收业务，具体内容包括资产委托人账户管理、份额注册登记、清算及交易确认、收益分配、建立并保管资产管理计划客户资料表等。

(二) 本资产管理计划的注册登记业务由资产管理人或资产管理人委托经中国证监会认定的可办理开放式证券投资基金份额登记业务的其他机构办理。资产管理人委托经中国证监会认定可办理开放式证券投资基金份额登记业务的其他机构代为办理本资产管理计划注册登记业务的，应当与有关机构签订委托代理协议，并列明代为办理资产管理计划份额登记机构的权限和职责。

(三) 注册登记机构履行如下职责：

- 1、建立和保管资产委托人账户资料、交易资料、资产管理计划客户资料表等，并将客户资料表提供给资产管理人。
- 2、配备足够的专业人员办理本资产管理计划的注册登记业务。
- 3、严格按照法律法规和本资产管理合同规定的条件办理本资产管理计划的注册登记业务。
- 4、严格按照法律法规和本资产管理合同的规定计算业绩报酬（如有），并提供交易信息和计算过程明细给资产管理人。
- 5、接受资产管理人的监督。
- 6、妥善保存登记数据，并将资产管理计划投资者名称、身份信息以及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。其保存期限自资产管理计划账户销户之日起不得少于20年。
- 7、对资产委托人的账户信息负有保密义务，因违反该保密义务对资产委托人或资产管理计划带来的损失，须承担相应的赔偿责任，但法律法规或监管机构另有规定的除外。
- 8、按本资产管理计划合同，为资产委托人提供资产管理计划收益分配等其他必要的服务。
- 9、在法律法规允许的范围内，制定和调整注册登记业务的相关规则。
- 10、法律法规规定的其他职责。

(四) 注册登记机构履行上述职责后，有权取得注册登记费。

(五) 全体资产管理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

在严格控制风险的基础上, 力争实现计划资产的稳健增值。

(二) 投资范围及比例

本计划在成立后备案完成前, 资产管理人以现金管理为目的, 可以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。

本计划完成备案后, 投资于经中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金 (含资产管理人管理的证券投资基金)、股票 (包括主板、创业板、科创板以及其他经中国证监会核准或注册上市的首次公开发行股票及二级市场股票) 及固定收益类品种 (包括国内依法发行和上市交易的国债、政策性金融债、央行票据、地方政府债、债券逆回购、银行存款)。

本计划投资于公开募集证券投资基金的比例不低于本计划资产总值的 80%, 穿透合并计算后, 权益类资产的投资比例 (按市值计) 为本计划总资产的 0-80%, 固定收益类资产 (除银行活期存款) 的投资比例 (按市值计) 为本计划总资产的 0-80%, 商品及金融衍生品的投资比例 (按市值计) 为本计划总资产的 0-80% 或衍生品账户权益不超过本计划总资产的 20%; 计划资产总值占计划资产净值比例不超过 200%。

资产委托人知悉并同意, 本计划可投资于资产管理人、资产托管人及其控股股东、实际控制人或者其他关联方发行的证券或者承销期内承销的证券; 投资完成后, 资产管理人将于官方网站披露, 并及时通知资产托管人。资产委托人知悉并同意, 资产管理人通过官方网站披露后即视为履行完毕前述事项的告知义务。资产委托人知悉并同意, 本计划可投资于管理人发行的证券投资基金、托管人同业存单及银行存款等, 且不再另行公告。

(三) 投资策略

关于投资决策流程。公司设有投资决策委员会, 是公司基金和专户投资管理的最高决策机构, 投资经理在投资决策委员会的领导和授权下进行投资。

1、大类资产配置策略

在对宏观经济、政策环境、利率走势、资金供给以及证券市场的现状及发展趋势等因素进行深入分析研究的基础上, 动态配置权益类资产、固定收益类资产以及现金类资产等大类资产之间的比例。

本计划动态监测代表性强的宏观经济高频指标以及微观企业指标, 前瞻性地把握经济运行状况, 基于宏观经济发展趋势、政策导向、市场未来的发展趋势以及各大类资产未来的风险收益比等因素, 判断权益类资产和非权益类资产之间的相对吸引力, 在一定范围内调整大类资产配置的比例。

2、基金投资策略

本计划采用定量分析和定性分析相结合的方式,一方面通过严格的量化规则筛选有潜在投资价值的标的纳入研究范围,另一方面结合所选基金的基金管理人的基本情况和投研文化等定性因素进行二次研判,双重维度力求筛选出中长期业绩稳定的优秀基金。

具体操作方面,通过定量和定性相结合的方法筛选出各类资产类别中优秀的基金经理和基金品种进行投资。定性研究主要指根据与基金经理进行访谈和调研的方式对基金管理人的盈利模式、风格特点及投资理念研究,定量研究主要包括:业绩分析:主要包括相对收益、绝对收益、风险调整后收益等关注方向;归因分析:主要包括择时能力、行业配置能力、选股能力等;

本计划还将定期对投资组合进行回顾和动态调整,剔除不再符合筛选标准的标的基金,增加符合筛选标准的基金,以实现基金投资组合的优化。

3、股票投资策略

本计划注重控制股票市场下跌风险,力求分享股票市场成长收益。本计划的股票投资以价值选股、组合投资为原则,精选基本面良好、有长期投资价值的优质企业,并通过分散投资、组合投资,降低个股风险与集中性风险。

4、参与新股申购投资策略

本资产管理人将对首次公开发行股票的公司进行基本面分析,结合市场未来走势进行判断,从战略角度评估参与新股申购的预期中签率、中签至合理变现日的间隔以及预期收益,积极参与新股申购。在中签后,本管理人将根据对股票内在投资价值和成长性的判断,结合股票市场环境的分析,选择适当的时机卖出。

对于科创板首次公开发行股票的申购,本计划将结合市场未来走势进行判断、中签率的预计以及新股定价的分析,积极参与定价合理的新股申购。在中签后,本管理人将根据对股票内在投资价值和成长性的判断,结合股票市场环境的分析,选择适当的时机卖出。

5、债券等固定收益类品种的投资策略

本计划主要基于流动性管理需求投资于债券,将结合宏观经济环境变化趋势、货币政策及不同债券品种的收益率水平、流动性和信用风险等因素进行投资。

上述已列明的投资策略表示资产管理人在计划运作过程中可以实施相关投资策略,而非必须实施,资产管理人可以根据市场实际情况进行投资决策,确认实施或不实施相关投资策略。

(四) 业绩比较基准 (如有)

本计划不设业绩比较基准。

(五) 投资限制

除投资范围部分规定的投资比例限制外,本计划还需遵循以下限制:

- 1、本计划投资于公开募集证券投资基金的比例不低于本计划资产总值的 80%;
- 2、投资于同一资产的资金不得超过本计划资产净值的 25%; 资产管理人管理的全部集合

资产管理计划投资于同一资产的资金,不得超过该资产的 25%;法律法规另有规定的,从其规定;

3、穿透合并计算后,权益类资产的投资比例(按市值计)为本计划总资产的 0-80%,固定收益类资产(除银行活期存款)的投资比例(按市值计)为本计划总资产的 0-80%,商品及金融衍生品的投资比例(按市值计)为本计划总资产的 0-80%或衍生品账户权益不超过本计划总资产的 20%;

4、本计划资产总值占计划资产净值比例不超过 200%;

5、本计划开放退出期内,本计划资产组合中 7 个工作日可变现资产的价值(按市值计)不低于本计划资产净值的 10%;

6、本计划投资于其他资产管理产品的,所投资的资产管理产品不再投资除公募基金以外的其他资产管理产品;

7、法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的,从其规定。

因证券期货市场波动、证券发行人合并、资产管理计划规模变动等资产管理人之外的因素导致资产管理计划投资不符合法律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,资产管理人应在 15 个交易日内调整至符合要求;如持有流动性受限资产的,资产管理人应当在流动性受限资产可出售、可转让或者恢复交易的十五个交易日内调整至符合相关要求。确有特殊事由未能在规定时间内完成调整的,资产管理人应当及时向中国证监会相关派出机构报告。

(六) 投资禁止

本合同委托财产的投资禁止行为包括:

- 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、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;
- 5、直接投资于商业银行信贷资产;
- 6、违规为地方政府及其部门提供融资,不得要求或者接受地方政府及其部门违规提供担保;
- 7、直接或者间接投资法律、行政法规和国家政策禁止投资的行业或领域;
- 8、直接或者间接投资于违反国家产业政策、环境保护政策的项目(证券市场投资除外);
- 9、法律法规、监管机构、自律组织禁止的其他活动。

(七) 说明 FOF 产品所投资资产管理产品的选择标准;

根据年化收益率、年化波动率、最大回撤与夏普比率作为主要评价指标作为本计划投资资

产管理产品的选择标准。

(八) 投资政策的变更

投资政策的变更,需履行本合同约定的相应程序。投资政策变更应为调整投资组合及资产托管人做好营运准备留出必要、合理的时间。资产管理人应及时告知资产托管人该等变更。

(九) 建仓期

本计划的建仓期为自本计划成立之日起最长不超过[6]个月。

本计划建仓期的投资活动,应当符合本资产管理合同约定的投向和资产管理计划的风险收益特征。以现金管理为目的,可以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。

建仓期结束后,资产管理计划的资产组合应当符合法律、行政法规、中国证监会规定和合同约定的投向和比例。

(十) 风险收益特征

本计划属于混合类产品,其风险等级为 R3 等级(管理人会定期对产品进行风险评级,本产品届时重新评定的风险等级以管理人公告为准,代销机构对本产品风险等级的评定不低于管理人对本产品的风险等级评定的,以代销机构评定的风险等级为准)。

(十一) 资产组合流动性管理与追加、提取安排

- 1、本计划开放前,资产管理人将提前做好组合流动性管理,开放期内,将保持适当比例的高流动性金融资产以匹配投资者的参与、退出安排。
- 2、运用追加资金进行再投资的,所投标的若有明确锁定期或封闭期等流通限制条款的,应与本计划的剩余期限相匹配,不得投资于流通受限解除之日晚于本计划剩余期限的投资标的。

(十二) 委托人确认,本章约定的事项不代表资产托管人的投资监督职责,资产托管人的投资监督职责以本合同第十八章第(三)款“资产托管人对资产管理人的投资监督”约定为准。

(十三) 止损线

为保护资产委托人的利益,本资产管理计划设置止损线为本资产管理计划份额净值 0.90 元。

在本资产管理计划存续期内任何一个工作日(T 日)收盘后,经托管人复核后的份额净值不高于止损线的,管理人应于下一工作日(T+1 日)开始不得新增投资,并开始进行全部变现和赎回操作,操作完成后,本资产管理计划提前终止。

本计划一旦进入止损,变现和赎回操作不可逆。在变现和赎回过程中,受证券市场波动及冲击成本等资产管理人之外的因素影响,变现和赎回完成后,计划份额净值一般低于止损线,极端情况下,甚至严重低于止损线,由此发生的损失全部由计划资产承担。止损线仅为资产管理人启动止损的触发条件,不代表资产管理计划承受的最大损失,亦不意味着资产管理人就本计划最大损失做出任何承诺或保证。

十二、投资顾问 (如有)

本计划未聘请投资顾问。

十三、分级安排 (如有)

本计划不设分级安排。

十四、利益冲突及关联交易

(一) 关联交易及利益冲突情形

全体资产委托人知悉并同意, 本计划可投资于资产管理人、资产托管人及其控股股东、实际控制人或者其他关联方发行的证券或者承销期内承销的证券; 投资完成后, 资产管理人将于官方网站披露, 并通知资产托管人。资产委托人知悉并同意, 资产管理人通过官方网站披露后即视为履行完毕前述事项的告知义务。资产委托人知悉并同意, 资产管理人投资管理人发行的证券投资基金、托管行同业存单及银行存款等不再另行公告。

资产管理人将资产管理计划资产投资于资产管理人、资产托管人及其控股股东、实际控制人或者其他关联方发行的证券或者承销期内承销的证券, 应当建立健全内部相关机制, 遵循投资者利益优先原则, 并采取切实有效措施, 防范利益冲突, 保护投资者合法权益。资产管理人通过官方网站披露后即视为履行完毕前述事项的告知义务。

资产委托人及其关联方未能事前就其关联证券或其他禁止交易证券明确告知资产管理人, 或告知不完全致使委托财产发生违规投资行为的, 资产管理人不承担任何责任。

(二) 关联交易及利益冲突的应对及处理

资产委托人签署本合同即视为已经充分理解并同意资产管理人从事前文已经明确列明的关联交易情形, 资产管理人无需就前述具体关联交易再行分别取得资产委托人的授权及事前同意, 但该等关联交易投资应按照市场通行的方式和条件参与, 公平对待委托财产, 防止利益冲突, 不得损害投资者利益。对于资产管理计划在投资运作过程中从事除前述列明情形以外的其他关联交易的, 事后应当及时、全面、客观的向资产委托人和托管人进行披露; 若该等关联交易构成重大关联交易的, 则应当事先取得资产委托人的同意, 并应当提供充分证据证明未损害资产委托人利益。

资产管理计划在投资运作过程中存在利益冲突情形的, 资产管理人应当坚持资产委托人利益优先原则, 从充分维护资产委托人利益角度积极处理该等利益冲突情形, 防范利益输送等违法违规行为。

十五、投资经理的指定与变更

本计划投资经理由资产管理人负责指定。本资产管理计划投资经理为陈凡卿先生。

本计划投资经理基本信息如下：

陈凡卿先生，上海交通大学工商管理硕士。历任中国建设银行上海分行个人金融部产品经理。2016 年 10 月加入财通基金管理有限公司，曾任产品战略部产品经理、量化投资部研究员，现任量化投资部投资经理。

本计划投资经理已经依法取得基金从业资格，具有三年以上投资管理、投资研究、投资咨询等相关业务经验，具备良好的诚信记录和职业操守，且最近三年未被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚。

资产管理人可以根据需要变更投资经理，投资经理变更后，资产管理人应在 5 个工作日内通知资产委托人及资产托管人，并向资产托管人提供投资经理身份信息资料。资产管理人在其网站就投资经理变更事宜进行相应公告，即视为已经履行了相应告知程序。

十六、资产管理计划的财产

(一) 资产管理计划财产的保管与处分

1、资产管理计划财产的债务由资产管理计划财产本身承担责任，资产委托人以其出资为限对资产管理计划财产的债务承担责任。尽管存在前述约定，若本计划委托财产无法偿还本计划对外投资所产生债务时，资产管理人无需以其自有财产或其他资管计划财产对外承担赔偿责任，资产管理人有权要求资产委托人追加出资并偿还本计划届时对外所负债务。资产托管人对实际交付并控制下的计划财产承担保管职责，对于证券登记机构、期货经纪公司或结算机构等非资产托管人保管的财产以及对于本计划投资本合同约定的非标准化资产由保管责任人承担相关责任。

2、资产管理计划财产独立于资产管理人、资产托管人的固有财产，并独立于资产管理人和资产托管人托管的其他财产。资产管理人、资产托管人不得将委托财产归入其固有财产。

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

4、资产管理人、资产托管人可以按本合同的约定收取管理费、托管费、业绩报酬（如有）以及本合同约定的其他费用。资产管理人、资产托管人以其自有财产承担法律责任，其债权人不得对委托财产行使请求冻结、扣押和其他权利。资产管理人、资产托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，资产管理计划财产不属于其清算财产。

5、资产管理计划财产产生的债权不得与不属于资产管理计划财产本身的债务相互抵销。非因资产管理计划财产本身承担的债务，资产管理人、资产托管人不得主张其债权人对委托财产强制执行。上述债权人向资产管理人或资产托管人对资产管理计划财产主张权利时，资产管

理人或资产托管人应明确向上述债权人告知资产管理计划财产的独立性。

(二) 资产管理计划财产相关账户的开立和管理

1、资金账户、证券账户

资产托管人按照规定开立资产管理计划财产的资金账户、证券账户。资产委托人和资产管理人应当在开户过程中给予必要的配合,并提供所需资料。

资金账户、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,具体而言,资金账户的托管银行预留印鉴以实际预留为准。托管专户由托管人负责管理,委托资产托管期间的一切货币收支活动,包括但不限于投资、支付费用、资产划拨、追加资产和提取资产等,均需通过该账户进行。托管专户内的银行存款利息按托管人公布的人民币银行同业利率为准。账号户名以托管人实际开立为准。开立的托管账户,应遵循南京银行《单位银行结算账户管理协议》的规定。资产托管人对存放于资金账户的现金资产以及其他由资产托管人实际控制的财产进行保管。

证券账户由托管人开户的,管理人需协助提供证券开户费划款凭证截图和相关开户资料;销户时,由托管人办理证券账户销户的,管理人协助提供证券账户销户相关资料。

资产管理人和资产托管人有权为本合同目的使用该资金账户、证券账户等投资所需账户。

委托财产存放于资产托管人开立的托管账户中的存款利率适用资产托管人公布的人民币银行同业利率。在本合同存续期内,若中国人民银行调整基准利率或利率浮动区间,则本合同资产管理计划财产资金账户中的存款利率将依据资产托管人的业务规则作相应调整。

当本合同项下托管账户被有权机关查询、冻结或扣划款项时,资产托管人按照有权机关要求依法予以执行,因此影响托管账户资金划付的,资产托管人不负任何责任。相关手续办理完毕后,资产托管人可以根据业务需要通知资产管理人,但法律法规或监管要求另有规定的除外。

2、定期存款账户

本资产管理计划开立定期存款账户或协议存款账户的,户名应与托管账户户名一致,因存入行系统原因造成存款账户与托管账户户名不一致的情形除外。在资产托管人以外的其他银行开立的定期存款(包括协议存款)账户的预留印鉴应至少留一枚资产托管人指定人员名章,协议存款或定期存款协议中应明确注明存款到期本息应划回托管账户。委托财产投资定期存款,资产管理人应与存款机构签订定期存款协议,该协议作为划款指令附件,该协议中必须有如下明确条款:“存款证实书不得被质押或以任何方式被抵押,并不得用于转让和背书;本息到期归还或提前支取的所有款项必须划至托管资金账户(明确户名、开户行、账号等),不得划入其他任何账户”。如定期存款协议中未体现前述条款,资产托管人有权拒绝定期存款投资的划款指令。

存款行或资产管理人应当于存单开立之日起5个工作日内将存款证实书原件交资产托管

人保管,存单交接原则上采用存款行或资产管理人上门服务的方式。对于跨行存款,资产管理人应先行确认授权送、取存单人员的身份信息,并提前 3 个工作日与资产托管人就存单的交接进行沟通。在存款行或资产管理人将存款证实书原件交资产托管人保管之前,存款证实书发生丢失、毁损、被恶意挂失等情形的,资产托管人不承担任何责任,资产托管人仅在取得存款证实书原件后履行保管职责。资产托管人取得存款证实书原件后,仅负责对存款证实书原件进行保管。

3、其他账户的开立和管理

因计划投资需要开立的其他账户应根据有关法律法规的规定开立,新账户按有关规则管理并使用。

十七、投资指令的发送、确认与执行

(一) 交易清算授权

资产管理人应向资产托管人提供预留印鉴和有权人(“授权人”)签字或签章样本,事先书面通知(以下称“授权通知”)资产托管人有权发送划款指令的人员名单(“被授权人”)。授权通知中应包括被授权人的名单、权限、电话、传真、预留印鉴和签字或签章样本,并注明相应的交易权限;规定资产管理人向资产托管人发送指令时资产托管人确认有权发送人员身份的方法。授权通知由授权人签字或签章并加盖资产管理人公章。授权通知须载明授权生效日期。授权通知自通知载明的生效日期开始生效。资产托管人收到通知的日期晚于通知载明生效日期的,则通知自资产托管人收到该通知时生效。资产管理人和资产托管人对授权文件负有保密义务,其内容不得向相关人员以外的任何人泄露。授权通知应以原件形式送达托管人。如以传真或电子邮件方式向资产托管人发送授权通知书,资产管理人须在其后五日内将授权通知书原件发送给资产托管人。

(二) 划款指令的内容

划款指令是在管理资产管理计划财产时,资产管理人向资产托管人发出的资金划拨及其他款项支付的指令。资产管理人发给资产托管人的非直连指令应写明款项事由、支付时间、最迟支付时间、大小写划款金额、付款账户信息、收款账户信息等,加盖预留印鉴并由被授权人签字或签章。本资产管理计划财产进行的证券交易所内的证券投资不需要资产管理人发送划款指令,资产托管人以中登公司发送的交收指令进行处理。

(三) 划款指令的发送、确认及执行的时间和程序

指令由“授权通知”确定的有权发送人代表资产管理人向资产托管人发送,发送方式以双方约定的电子直连、网银、传真或者邮件等的方式进行。资产管理人有义务在发送指令后与托管人以电话等双方认可的方式进行确认。资产管理人应事先书面向资产托管人指定各业

务类型划款指令的发送主渠道。因资产管理人未能及时与资产托管人进行指令确认,致使资金未能及时到账所造成的损失,资产托管人不承担责任。传真以获得收件人(资产托管人)确认该指令已成功接收之时视为送达。资产托管人依照“授权通知”规定的方法确认指令有效后,方可执行指令。

对于被授权人依照“授权通知”发出的指令,资产管理人不得否认其效力。资产管理人应按照相关法律法规以及本合同的规定,在其合法的经营权限和交易权限内发送划款指令,发送人应按照其授权权限发送划款指令。资产管理人在发送指令时,应为资产托管人留出执行指令所必需的时间。管理人必须确保头寸充足,并提前两个工作小时向托管人发送划款指令,资产管理人发送有效指令(包括原指令被撤销、变更后再次发送的新指令)的截止时间为当天的15:00。对于头寸不足,以及小于两个工作小时划款时间的指令,托管人不保证当日完成在银行的划付流程。但托管人需及时将处理结果反馈给管理人,并尽合理的努力配合管理人采取其他补救措施。

资产管理人对投资指令真实性、合法性、准确性和完整性负责。资产托管人收到资产管理人发送的指令后,应对划款指令进行如下审查,验证指令的要素是否齐全、指令上的签字或签章是否和授权通知中预留的签字或签章样本相符,复核无误后依据本合同约定在规定期限内及时执行,不得延误。若存在异议或不符,资产托管人立即与资产管理人指定人员进行电话联系和沟通,并要求资产管理人重新发送经修改的指令。资产托管人可以要求资产管理人传真提供相关交易凭证、合同或其他有效会计资料,以确保资产托管人有足够的资料来判断指令的有效性。资产托管人对以上资料仅做书面审查,对其合法性、真实性、准确性和完整性不作实质性审查。如相关资料与原件不符,由此给本资产管理计划财产和资产托管人造成的损失由资产管理人承担。

资产管理人向资产托管人下达指令时,应确保本计划银行账户有足够的资金余额,对资产管理人在没有充足资金的情况下向资产托管人发出的指令,资产托管人有权拒绝执行,并立即通知资产管理人,资产托管人不承担因为不执行该指令而造成的损失。

资产管理人应将银行间同业拆借中心的成交通知单加盖印章后传真给资产托管人。在本资产管理计划财产申购/认购开放式基金时,资产管理人应在向资产托管人提交划款指令的同时将经有效签章的基金申购/认购申请书以传真形式送达资产托管人。

指令及相关资料若资产管理人以电子邮件发送扫描件或传真形式向资产托管人发出,则正本由资产管理人保管,资产托管人保管传真件、扫描件。当两者不一致时,以资产托管人收到的传真件、扫描件为准,由此给委托财产造成的损失由资产管理人承担。

(四) 资产托管人依法暂缓、拒绝执行指令的情形和处理程序

资产托管人发现资产管理人发送的指令违反《基金法》、本合同或其他有关法律法规的

规定时,不予执行,并应及时以书面形式通知资产管理人纠正,资产管理人收到通知后应及时核对,并以书面形式对资产托管人发出回函确认。

(五) 资产管理人发送错误指令的情形和处理程序

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

(六) 更换划款指令被授权人的程序

资产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,使用扫描件形式向资产托管人发出资产管理人加盖公章的被授权人变更通知,并提供新被授权人签字或签章样本,同时电话通知资产托管人并与资产托管人确认。被授权人变更通知须载明新授权生效日期。被授权人变更通知,自通知载明的生效时间开始生效。资产托管人收到通知的日期同于或晚于通知载明的生效日期的,则通知应当自资产托管人收到该通知的下一个交易日生效。如托管人收到的扫描件与原件不符,以托管人收到的扫描件为准。资产管理人在电话告知后三日内将被授权人变更通知的正本送交资产托管人。被授权人变更通知生效后,对于已被撤换的人员无权发送的指令,或新被授权人员超权限发送的指令,资产管理人不承担责任。

(七) 划款指令的保管

划款指令若以传真形式发出,则正本由资产管理人保管,资产托管人保管指令传真件。划款指令原件与托管人收到的传真件不一致时,以资产托管人收到的划款指令传真件为准,因此给资产管理计划财产造成的损失由资产管理人承担。

(八) 其他相关责任

资产托管人已依据本合同的约定履行审核义务,并正确执行资产管理人符合本合同规定、合法合规的划款指令,资产管理计划财产发生损失的,资产托管人不承担任何形式的责任。在正常业务受理渠道和指令规定的时间内,因资产托管人过错未能及时或正确执行符合本合同规定、合法合规的划款指令而导致资产管理计划财产受损的,资产托管人应承担相应的责任,但银行托管账户余额不足、不可抗力或其他非因资产托管人原因除外。

如果资产管理人的划款指令存在事实上未经授权、欺诈、伪造或未能按时提供划款指令人员的预留印鉴和签字样本等非资产托管人原因造成的情形,只要资产托管人根据本合同相关规定验证有关印鉴与签名无误,资产托管人不承担因正确执行有关指令而给资产管理人或资产管理计划财产或任何第三人带来的损失,全部责任由资产管理人承担,但资产托管人未尽审核义务执行划款指令而造成损失的情况除外。

十八、越权交易的界定

(一) 越权交易的界定

越权交易是指资产管理人违反有关法律法规的规定以及违反或超出本合同项下资产委托人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。

资产管理人应在有关法律法规和本合同规定的权限内运用资产管理计划财产进行投资管理，不得违反有关法律法规和本合同的约定，超越权限管理、从事投资。

(二) 越权交易的处理程序

- 1、违反有关法律法规和本合同规定进行的投资交易行为

资产托管人在本章第 (三) 款约定的投资监督事项范围内，发现资产管理人的投资指令违反法律法规的规定，或者违反本合同约定的，应当拒绝执行，立即通知资产管理人并有权及时报告中国证监会相关派出机构。

资产托管人在本章第 (三) 款约定的投资监督事项范围内，发现资产管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律法规的规定，或者违反本合同约定的，应当立即通知资产管理人并有权及时报告中国证监会相关派出机构。

资产管理人应向资产委托人和资产托管人主动报告越权交易。在限期内，资产委托人和资产托管人有权随时对通知事项进行复查，督促资产管理人改正。资产管理人对资产委托人和资产托管人通知的越权事项未能在限期内纠正的，资产托管人应报告中国证监会相关派出机构。

- 2、法律法规禁止的超买、超卖行为

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

3、由于包括但不限于证券期货市场波动、证券发行人合并、资产管理计划规模变动等资产管理人之外的因素导致资产管理计划的投资比例、投资范围等不符合本合同约定的投资政策，或者合规持有的证券在持有期间，非因资产管理人原因导致继续持有该证券不符合投资政策的，为被动超标，不构成越权交易。发生上述情形时，资产管理人应在发生被动超标之日或所涉流动性受限资产可出售、可转让或者恢复交易之日起 15 个交易日内进行调整，以满足法律法规及投资政策的要求。确有特殊事由未能在规定时间内完成调整的，资产管理人应当及时向中国证监会相关派出机构和基金业协会报告。法律法规另有规定的，从其规定。

- 4、本计划终止前，资产管理人有权对资产管理计划财产所投资证券进行变现，具体开始

变现时间由资产管理人届时根据市场情况确定，由此造成投资比例、投资范围等不符合投资政策规定的，视为被动超标，不构成越权交易，不属于资产管理人违反本合同的情形。

5、因被动超标导致本资产管理计划财产损失的，由本资产管理计划财产承担。

6、越权交易所发生的直接经济损失及相关交易费用由资产管理人负担，所发生的收益归本资产管理计划财产所有。

(三) 资产托管人对资产管理人的投资监督

资产托管人根据以下约定对资产管理人的投资行为进行监督，如本合同其他章节的约定与本款约定不一致的，资产托管人对资产管理人投资行为的监督内容与标准均以本第十八章第

(三) 款约定为准：

1、资产托管人对资产管理人的投资行为行使监督权。资产托管人根据本合同有关资产管理计划财产投资政策的约定，承诺对本计划项下投资监督事项如下：

本计划完成备案后，投资于经中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金（含资产管理人管理的证券投资基金）、股票（包括主板、创业板、科创板以及其他经中国证监会核准或注册上市的首次公开发行股票及二级市场股票）及固定收益类品种（包括国内依法发行和上市交易的国债、政策性金融债、央行票据、地方政府债、债券逆回购、银行存款）。

1) 本计划投资于公开募集证券投资基金的比例不低于本计划资产总值的 80%；

2) 投资于同一资产的资金不得超过本计划资产净值的 25%；法律法规另有规定的，从其规定；

3) 穿透合并计算后，权益类资产的投资比例（按市值计）为本计划总资产的 0-80%，固定收益类资产（除银行活期存款）的投资比例（按市值计）为本计划总资产的 0-80%，商品及金融衍生品的投资比例（按市值计）为本计划总资产的 0-80%或衍生品账户权益不超过本计划总资产的 20%；

4) 本计划资产总值占计划资产净值比例不超过 200%；

5) 本计划开放退出期内，本计划资产组合中 7 个工作日可变现资产的价值（按市值计）不低于本计划资产净值的 10%；

2、资产托管人对资产管理人的投资监督和检查自本合同生效之日起开始。

3、资产托管人履行投资监督义务受限于资产管理人、证券经纪机构、期货经纪机构及其他中介机构提供的数据和信息。

4、资产管理人对本计划投资其他资管产品的底层资产进行穿透监督，对本计划所投资的资管产品的投资范围是否超过本计划的投资范围、所投资的资管产品是否再投资于除公募证券投资基金外的资管产品、以及本计划涉及所投资资管产品的资产的投资比例等进行监督。

(四) 如因投资政策变更需调整上述监督职责的，资产管理人应提前以书面形式与资产托

管人协商一致，本合同另有约定的从其约定。

十九、交易及清算交收安排

(一) 本计划场内证券交易及清算交收

本集合资产管理计划场内证券交易资金结算方式为：托管行结算模式

(1) 选择代理证券买卖的证券经营机构的程序

管理人负责选择代理本委托财产证券买卖的证券经营机构，并与其签订证券交易单元使用协议。管理人应提前书面通知托管人，并依据托管人要求提供相关资料，以便托管人申请办理接收结算数据手续。如果因管理人未事先通知托管人增加交易单元等事宜，致使托管人接收数据不完整，造成清算差错的责任由管理人承担。

管理人应及时将委托财产的证券交易单元号、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。

(2) 投资证券后的清算交收安排

本计划财产投资于证券发生的所有场内、场外交易的资金清算交割，全部由托管人负责办理。

本委托财产证券投资的清算交割，由托管人通过中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司及清算代理银行办理。

(3) 最低备付金

根据《中国证券登记结算有限责任公司结算备付金管理办法》，在每月前 2 个工作日内，中国证券登记结算公司对结算参与人的最低结算备付金限额进行重新核算、调整。托管人在中国证券登记结算公司调整最低结算备付金当日，在资金调节表中反映调整后的最低备付金。管理人应预留最低备付金，并根据中国证券登记结算公司确定的实际最低备付金数据为依据安排资金运作，调整所需的现金头寸。

(4) 证券交易资金清算

托管人负责计划买卖证券的清算交收。场内资金结算由托管人根据中国证券登记结算有限责任公司结算数据办理；中小企业私募债等实行场内 T+0 非担保交收的资金清算根据管理人的交易划款指令具体办理。

如果因为托管人过错在清算上造成计划资产的损失，应由托管人负责赔偿直接损失；但对于因人民银行、中国证券登记结算机构资金结算系统以及其它机构的结算系统发生故障等非托管人的原因造成清算资金无法按时到账的情形，托管人免责；如果因为管理人未事先通知托管人增加交易单元等事宜，致使托管人接收数据不完整，造成清算差错的责任由管理人承担；如果因为管理人未事先通知需要单独结算的交易，造成计划资产损失的由管理人承担；因为管理人违反法律法规、部门规章的规定进行买空或卖空或者其他违规操作原因，造成计划投资清算

困难和风险的,应由管理人负责解决,由此给计划造成损失的,由管理人承担。如托管人发现管理人违反法律法规、部门规章的规定进行买空、卖空或其他违规操作造成计划投资清算困难和风险的,托管人应立即通知管理人。

管理人应采取合理措施,确保在 T 日日终有足够的资金头寸用于中国证券登记结算公司的资金结算。如果 T+1 日 11:00 前计划头寸不足,影响了计划资产自身的清算交收及托管人与中国证券登记结算有限公司之间的一级清算,由此给托管人、计划资产及托管人托管的其他资产造成的损失由管理人负责。

(5) 无法按时支付证券清算款的责任认定及处理程序

管理人应确保托管人在执行管理人发送的指令时,有足够的头寸进行交收。计划财产的资金头寸不足时,资产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所需的合理时间。如由于管理人的原因导致无法按时支付证券清算款,由此造成的直接损失由管理人承担。

在资金头寸充足的情况下,托管人对管理人符合法律法规、本合同的指令无合理理由不得拖延或拒绝执行。如由于托管人的过错导致计划财产无法按时支付证券清算款,由此造成的直接损失由托管人承担。

对于在上交所固定收益平台和在深交所综合协议交易平台交易的、实行“实时逐笔全额结算”和“T+0 逐笔全额非担保交收的业务,管理人应在交易日 15:00 将划款指令发送至托管人。

因管理人指令传输不及时,致使资金未能及时划入中登公司所造成的损失由管理人承担,包括赔偿引起其他托管客户交易失败、赔偿因占用中登公司最低备付金带来的利息损失。

(二) 开放式基金投资的清算交收安排

1. 开放式基金申购(认购)相应的资金划拨由托管人依据管理人的投资指令逐笔划付。管理人申购(认购)开放式基金时,应将划款指令连同基金申购(认购)申请单一并传真至托管人。托管人审核无误后,应及时将投资指令交付执行。管理人应实时调整当日可用资金余额。管理人在收到基金申购(认购)确认回单后,应立即传真至托管人。

2. 管理人赎回开放式基金时,应在向基金管理公司发出基金赎回申请书的同时将赎回申请书传真至托管人;管理人在收到赎回确认回单后,应及时传真至托管人。

3. 为确保本委托财产会计核算及估值的及时处理,管理人应于开放式基金交易(包括认购、申购、赎回、基金转换、红利再投资、现金分红等)的确认日及时获取确认单等单据的传真件,要求并督促基金管理公司于当日传真给管理人,管理人收到后应立即传真至托管人。

(三) 银行间交易资金结算安排

1. 管理人负责对交易对手的资信控制,按银行间债券市场的交易规则进行交易,并负责解

决因交易对手不履行合同或不及时履行合同而造成的纠纷及损失, 托管人不承担由此造成的任何法律责任及损失。

2. 管理人应在交易结束后将银行间同业市场债券交易成交单加盖预留印鉴后及时传真给托管人, 并电话确认。如果银行间中债综合业务平台或上海清算所客户终端系统已经生成的交易需要取消或终止, 管理人要书面通知托管人。

3. 管理人发送有效指令 (包括原指令被撤销、变更后再次发送的新指令) 的截止时间为当天的 15: 00。如管理人要求当天某一时点到账, 则交易结算指令需提前 2 个工作小时发送, 并进行电话确认。指令、成交单传输不及时、未能留出足够的操作时间, 致使资金未能及时到账、债券未能及时交割所造成的损失由管理人承担。在以电话方式对合同约定事项进行通知或者确认时, 应采用录音电话, 以备事后查证。

4. 管理人向托管人下达指令时, 应确保委托托管账户有足够的资金余额, 对管理人在没有充足资金的情况下向托管人发出的指令, 托管人可不予执行, 并立即通知管理人, 托管人不承担因为不执行该指令而造成损失的责任。管理人确认该指令不予取消的, 资金备足并通知托管人的时间视为指令收到时间。

5. 银行间交易结算方式采用券款对付的, 托管账户与该产品在登记结算机构开立的 DVP 资金账户之间的资金调拨, 除了交易日终, 中债登公司和上清所系统自动将 DVP 资金账户资金退回至托管账户的之外, 应当由管理人出具资金投资指令, 托管人审核无误后执行。由于管理人未及时出具指令导致该产品在托管账户的头寸不足或者 DVP 资金账户头寸不足导致的损失, 托管人不承担责任。

(四) 其他场外交易资金结算

1. 委托财产其他场外投资相应的资金划拨由托管人依据管理人的投资指令逐笔划付。管理人应将投资指令连同相关投资证明文件一并传真至托管人。托管人审核无误后, 应及时将投资指令交付执行。

2. 管理人应确保托管人在执行管理人发送的指令时, 有足够的头寸进行交收。委托财产的资金头寸不足时, 托管人有权拒绝管理人发送的投资指令。管理人在发送投资指令时应充分考虑托管人的划款处理所需的合理时间。如由于管理人的原因导致无法按时支付证券清算款, 由此造成的损失由管理人承担。

3. 在资金头寸充足的情况下, 在正常业务受理渠道和时间内, 托管人对管理人符合法律法规、本合同规定的指令不得拖延或拒绝执行, 如由于托管人的过错导致委托财产无法按时支付证券清算款, 由此造成的损失由托管人承担, 但银行托管专户余额不足或托管人遇不可抗力的情况除外。

(五) 资金、证券账目及交易记录的核对

1. 管理人定期进行交易记录的核对。在与托管人核对估值结果之前, 必须保证所有实际交易记录与会计账簿上的交易记录完全一致。如果实际交易记录与会计账簿记录不一致, 造成会计核算不完整或不真实, 由此导致的损失由管理人承担。

2. 对委托财产的资金账目, 以管理人与托管人约定方式核对, 确保相关各方账账相符。

3. 对委托财产的证券账目, 由相关各方根据外部第三方对账数据定期进行对账。

(六) 可用资金余额的确认

管理人可向托管人申请开通“鑫托管”业务系统查询权限, 自行查询托管账户资金余额。

二十、资产管理计划财产的估值和会计核算

(一) 资产管理计划财产的估值

1、估值目的

资产管理计划财产估值目的是客观、准确地反映资产管理计划财产的价值, 并为计划份额的参与和退出等提供计价依据。

2、估值时间及估值程序

资产管理人与资产托管人在每个工作日 T 日 (估值日) 对 T-1 日资产管理计划财产进行估值并完成核对。资产管理人优先使用电子直连方式与资产托管人进行计划财产估值核对。

3、估值依据

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

4、估值对象

资产管理计划所拥有的金融资产及负债。

5、估值方法

本计划按以下方式进行估值:

(1) 证券交易所上市的有价证券的估值

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

B、交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种 (合同另有约定的除外), 选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值进行估值。

C、交易所上市的资产支持证券, 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, 以第三方估值机构提供的价值数据估值。

(2) 处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理:

A、送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市价估值；该日无交易的，以最近一交易日的市价估值。

B、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，以第三方估值机构提供的价值数据估值。

C、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，估值方法如下：

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

其中：FV 为估值日该非公开发行有明确锁定期的股票的价值；S 为估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值；LoMD 为该非公开发行有明确锁定期的股票剩余限售期对应的流动性折扣。

(3) 全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，选取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。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，采用协商估值。

(4) 同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

(5) 银行存款、回购按照约定利率在持有期内逐日计提应收利息，在利息到账日以实收利息入账。

(6) 证券投资基金的估值

1) 本计划投资于境内非上市的非货币市场基金，按所投资基金估值日的份额净值进行估值；

2) 本计划投资于境内非上市的货币市场基金，如所投资基金披露万份（百份）收益，则按所投资基金前一估值日后至估值日期间（含节假日）的万份（百份）收益计提估值日基金收益；如所投资基金披露份额净值，则按所投资基金估值日的份额净值估值；

3) 本计划投资的 ETF 基金，按所投资 ETF 基金估值日的公允价值进行估值；

4) 本计划投资的境内上市开放式基金（LOF），按所投资基金估值日的份额净值估值；

5) 本计划投资的境内上市定期开放式基金、封闭式基金，按所投资基金估值日的公允价值估值；

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

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

以所投资基金的基金份额净值估值的,若所投资基金与基金中基金估值频率一致但未公布估值日基金份额净值,以其最近公布的基金份额净值估值。以所投资基金的公允价值估值的,若估值日无交易,且最近交易日后市场环境未发生重大变化,以最近交易日的公允价值估值;如最近交易日后市场环境发生了重大变化的,可使用最新的基金份额净值为基础或参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素调整最近交易市价,确定公允价值。如果所投资基金前一估值日至估值日期间发生分红除权、折算或拆分,基金管理人应根据基金份额净值或收盘价、单位基金份额分红金额、折算拆分比例、持仓份额等因素合理确定公允价值。

(7) 计划资产外币资产价值计算中,所涉及人民币对美元、港币、英镑、欧元、日元的汇率应当以计划资产估值日中国人民银行或其授权机构公布的人民币汇率中间价为准。涉及到其它币种与人民币之间的汇率,参照数据服务商提供的当日各种货币兑美元折算率采用套算的方法进行折算。

(8) 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,按协商估值。

(9) 持有的回购以成本列示,按商定利率在实际持有期间内逐日计提利息。

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

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

6、估值错误的处理

如资产管理人或资产托管人发现计划资产估值违反本合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护资产委托人利益时,应立即通知对方,共同查明原因,协商解决。

当计划资产估值错误偏差达到计划财产净值的 0.5% 时,资产管理人和资产托管人应该立即更正并在定期报告中报告资产委托人。资产管理人计算的计划财产净值已由资产托管人复核确认、但因资产估值错误给资产委托人造成损失的,由资产管理人与资产托管人按照过错比例各自承担相应的责任。

由于一方当事人提供的信息错误,另一方当事人在采取了必要合理的措施后仍不能发现该错误,进而导致计划财产净值计算错误造成资产委托人的损失,以及由此造成以后交易日计划财产净值计算顺延错误而引起的资产委托人的损失,由提供错误信息的当事人一方负责赔偿。

由于证券交易所及其注册登记公司发送的数据错误,或由于其他不可抗力原因造成的计划资产估值错误,资产管理人和资产托管人可以免除赔偿责任。但资产管理人和资产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。

7、估值调整的情形与处理

如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件等情况, 经与资产托管人协商一致, 按最能反映公允价值的价格进行估值调整。

8、暂停估值的情形

- (1) 计划投资所涉及的证券交易场所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时;
- (2) 因不可抗力或其他情形致使资产管理人、资产托管人无法准确评估资产管理计划财产价值时;
- (3) 占资产管理计划相当比例的投资品种的估值出现重大转变, 而资产管理人为保障投资者的利益, 决定延迟估值的情形;
- (4) 中国证监会认定的其他情形。

9、资产管理计划份额净值的确认

用于向资产委托人报告的计划份额净值由资产管理人负责计算, 资产托管人进行复核。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, 可按照资产管理人对计划财产净值的计算结果披露, 但资产托管人保留保持估值结果不一致的权利。

资产管理计划财产净值即计划财产净值, 是指计划资产总值减去负债后的价值。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。计划资产份额净值的计算保留到小数点后 3 位, 小数点后第 4 位四舍五入。

10、特殊情况的处理

(1) 资产管理人或资产托管人按上述“5、估值方法”的第(10)项进行估值时, 所造成的误差不作为估值错误处理。

(2) 由于证券交易所及注册登记结算机构发送的数据错误或者由于其他不可抗力等, 造成的估值错误, 资产管理人和资产托管人免除赔偿责任。但资产管理人、资产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。

(二) 资产管理计划的会计政策

资产管理计划的会计政策比照证券投资基金现行政策执行:

- 1、资产管理人为本计划的主要会计责任方。
- 2、本计划的会计年度为公历年度的 1 月 1 日至 12 月 31 日。
- 3、计划核算以人民币为记账本位币, 以人民币元为记账单位。
- 4、会计制度执行国家有关会计制度。
- 5、本计划独立建账、独立核算。
- 6、资产管理人及资产托管人各自保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算, 按照本合同约定编制会计报表。

7、资产托管人定期与资产管理人就资产管理计划的会计核算、报表编制等进行核对并以书面方式确认。

二十一、资产管理计划的费用与税收

(一)资产管理业务费用的种类

- 1、资产管理人的管理费；
- 2、资产托管人的托管费；
- 3、资产管理人依据本合同收取的业绩报酬（如有）；
- 4、委托财产拨划支付的银行费用；
- 5、委托财产的证券、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；
- 6、资产管理计划成立后的资产管理计划信息披露费用；
- 7、资产管理计划成立后与资产管理计划有关的会计师费、审计费、律师费、仲裁费、诉讼费、保全费等；
- 8、按照法律法规及本合同的约定可以在委托财产中列支的其他费用。

(二)费用计提方法、计提标准和支付方式

1.资产管理人的管理费

本委托财产的年管理费率为 0.4%。但本计划投资于本计划管理人所管理的证券投资基金的部分不收取管理费。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的委托财产管理费

E 为前一日委托财产净值（扣除投资于本计划管理人所管理的证券投资基金的部分，计划成立日为初始委托财产规模），若为负数，则 E 取 0

委托财产管理费自计划成立日起，每日计提，按自然季度支付。由托管人根据与管理人核对一致的估值数据以及按照上述公式进行计算的结果，自动在每个自然季初的第 3 个交易日按照管理人指定的管理费账户路径进行资金支付，管理人无需再出具资金划拨指令。费用自动扣划后，管理人可进行核对，如发现数据不符，及时联系托管人协商解决。若因不可抗力或持有的委托财产无法及时变现致使无法按时支付的，则在不可抗力或无法变现的情形消除后的首个工作日由管理人出具指令、托管人复核后进行支付。本计划终止（包括提前或延期）后，依据清算程序支付管理人尚未支付的管理费。

资产管理人管理费收费账户信息如下：

户 名：财通基金管理有限公司

账 号: 1001156709300057557

开户银行: 工行上海市老西门支行

支付行号: 102290015678

上述资产管理人的账户信息或费用支付方式如有变更, 资产管理人可单独决定而无须变更本合同, 但须在账户信息或费用支付方式变更生效前至少三个工作日书面通知资产托管人。

2. 资产托管人的托管费

本委托财产年托管费率为 0.03%。但本计划投资于本计划托管人所托管的证券投资基金的部分不收取托管费。计算方法如下:

$$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的委托财产托管费

E 为前一日委托财产净值 (扣除投资于本计划托管人所托管的证券投资基金的部分, 计划成立日为初始委托财产规模), 若为负数, 则 E 取 0

委托财产托管费自计划成立日起, 每日计提, 按自然季度支付。由托管人根据与管理人核对一致的估值数据以及按照上述公式进行计算的结果, 自动在每个自然季初的第 3 个交易日按照托管人指定的托管费账户路径进行资金支付, 管理人无需再出具资金划拨指令。费用自动扣划后, 管理人可进行核对, 如发现数据不符, 及时联系托管人协商解决。若因不可抗力或持有的委托财产无法及时变现致使无法按时支付的, 则在不可抗力或无法变现情形消除后的首个工作日由管理人出具指令、托管人复核后进行支付。本计划终止 (包括提前或延期) 后, 依据清算程序支付托管人尚未支付的托管费。

托管费收费账户信息如下:

账户名称: 境内外资产托管费收入

账号: NJ120100

开户机构: 南京银行

上述资产托管人的账户信息如有变更, 资产托管人可单独决定而无须变更本合同, 但须在账户信息变更生效前至少三个工作日通知资产管理人。

3. 资产管理人的业绩报酬

在资产委托人全部或部分退出资产管理计划或计划财产分红时或资产管理计划财产清算完毕时, 资产管理人按资产委托人每笔退出份额或计划财产分红时或计划财产清算完毕时计划份额在该期间投资收益 (包含收益分配部分和净值增长部分) 超过计提基准 5.5% (年化) 的部分计提 15% 作为业绩报酬 (若分红金额小于业绩报酬, 则以分红款为限扣减客户分红金额), 具体计算方法如下:

$$\text{业绩报酬} = S \times \text{NAV}_0 \times [(\text{NAV}_T - \text{NAV}_1) / \text{NAV}_0 - B \times T / 365] \times 15\%$$

其中：

S 为业绩报酬计提日的计划份额数，提取赎回业绩报酬时为份额持有人赎回本计划的份额；提取分红业绩报酬时为委托人参与分红的计划份额；本计划终止时的业绩报酬为本计划终止时的全部份额。

NAV_0 为该笔份额上一个实际发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日的单位净值，如无则为该份额认购或参与时适用的单位净值。

NAV_1 为该笔份额上一个实际发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日的累计单位净值，如无则为该份额认购或参与时适用的累计单位净值。

NAV_T 为本次业绩报酬计提日的累计单位净值。

B 为业绩报酬计提基准，本计划为【5.5%】（年化），该业绩报酬计提基准仅作为费用计提标准，不对产品收益作出任何保证。

T 为该笔份额上一个实际发生业绩报酬计提的业绩报酬计提确认日与本次业绩报酬计提日的间隔天数。如资产委托人多次认购/参与的，每笔认购份额的业绩报酬分别计算，且退出的份额按照“先认购/参与的，先退出”的原则确定持有天数。

业绩报酬由注册登记机构负责计算，资产托管人不承担复核义务，业绩报酬在全部或部分退出资产管理计划或计划财产分红时和本计划终止日提取。由资产管理人向资产托管人发送业绩报酬划付指令，资产托管人依据指令将业绩报酬划出。

4、上述(一)中其他项费用由资产托管人根据其他有关法规及相应协议的规定，按费用支出金额支付，列入或摊入当期委托财产运作费用。

(三)不列入资产管理业务费用的项目

1、资产管理人和资产托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或委托财产的损失，以及处理与本资产管理计划财产运作无关的事项或不合理事项所发生的费用等不得列入资产管理计划的费用。

2、资产管理计划成立前发生的费用，以及存续期间发生的与募集有关的费用，不得在计划资产中列支。

3、其他根据相关法律法规及中国证监会、基金业协会的有关规定不得列入计划费用的项目。

(四)资产管理人和资产托管人与资产委托人协商一致后，可根据市场发展情况调整资产管理费率、资产托管费率及业绩报酬计提水平并履行相应备案报告义务。本合同另有约定的，从其约定。

(五)税收

资产管理计划运作中产生的纳税义务，由计划财产承担。根据国家税收法律、法规及相关

政策, 计划财产运作过程中的应税收入需要缴纳增值税等, 资产管理人将按照有关规定进行缴纳并以委托财产支付相关税款。

管理人在向委托人交付相关收益或资产后税务机关要求管理人就已交付收益或资产缴纳相关税款的, 委托人必须按照管理人要求进行补缴。由此导致委托人收益减少的, 委托人不得要求管理人以任何方式向其返还或补偿。

资产委托人必须自行缴纳的税收, 由资产委托人负责, 资产管理人不承担代扣代缴或纳税的义务。

二十二、资产管理计划的收益分配

本资产管理计划收益分配方案依据现行法律法规以及本资产管理的合同约定执行。

(一) 可供分配利润的构成

本资产管理计划可供分配利润为截至收益分配基准日计划未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

资产管理计划收益包括: 计划投资所得红利、股息、债券利息、证券投资收益、证券持有期间的公允价值变动、银行存款利息以及其他收入。因运用计划财产带来的成本或费用的节约计入收益。

(二) 收益分配原则

- 1、每一计划份额享有同等分配权。
- 2、本资产管理计划收益分配方式为现金分红。收益分配时发生的银行转账等手续费用由资产委托人自行承担。
- 3、在符合有关计划收益分配条件的前提下, 资产管理人有权进行收益分配。
- 4、法律法规或监管机构另有规定的, 从其规定。

(三) 收益分配方案的确定与通知

收益分配方案中应载明截至收益分配基准日的可供分配利润、计划收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。

收益分配方案由资产管理人拟定, 并由资产托管人复核后告知资产委托人。具体收益分配方案以资产管理人公告为准, 届时资产管理人网站上发布披露信息即视为履行了告知义务。

(四) 收益分配的执行方式

在收益分配方案公布后, 资产管理人依据具体方案的规定就支付的现金收益向资产托管人发送划款指令, 资产托管人按照资产管理人的指令及时进行现金收益的划付。

二十三、资产管理计划的存续期资产分配

(一) 可供分配资产的构成

资产管理人有权视情况,将本资产管理计划项下所持全部或部分现金类资产向资产委托人进行存续期分配。

为免歧义,该等可分配资产范围不限于本资产管理计划届时所得投资收益,资产管理人有权将本资产管理计划项下届时委托财产本金向资产委托人进行分配。

(二) 资产分配方案的确定与通知

存续期内资产分配方案由资产管理人拟定,并由资产托管人复核后由资产管理人告知资产委托人。具体资产分配方案以资产管理人披露信息为准,届时资产管理人网站上发布披露信息即视为履行了告知义务。

(三) 资产分配的执行方式

存续期资产分配方案公布后,资产管理人将依据具体方案的规定就应当支付的分配资产向资产托管人发送划款指令,资产托管人按照资产管理人的指令及时进行资产的划付。

二十四、信息披露与报告

(一) 向资产委托人提供的报告

1、年度报告

计划投资运作期间,资产管理人应当在每年结束之日起 4 个月内,编制完成计划年度报告并经资产托管人复核。年度报告应当披露报告期内本资产管理计划运作情况,包括但不限于管理人履职报告、托管人履职报告、资产管理计划投资表现、资产管理计划投资组合报告、资产管理计划运用杠杆情况(如有)、资产管理计划财务会计报告、资产管理计划支付的管理费、托管费、业绩报酬(如有)等费用的计提基准、计提方式和支付方式、资产管理计划投资收益分配情况、投资经理变更、重大关联交易等涉及投资者权益的重大事项以及中国证监会及基金业协会规定的其他事项。资产管理人应于每年结束之日起 3 个月内完成年度报告,并将年度报告发送至资产托管人复核,资产托管人在收到后 1 个月内复核年度报告中的财务数据内容,并将复核结果书面通知资产管理人。资产管理计划成立未满 3 个月或者存续期间不足 3 个月的,不编制当期的年度报告。

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

2、季度报告

计划投资运作期间,资产管理人应当在每季度结束之日起 1 个月内,编制完成计划季度报告。季度报告应当包括但不限于管理人履职报告、托管人履职报告、资产管理计划投资表现、

资产管理计划投资组合报告、资产管理计划运用杠杆情况 (如有)、资产管理计划支付的管理费、托管费、业绩报酬 (如有) 等费用的计提基准、计提方式和支付方式; 资产管理计划投资收益分配情况、投资经理变更、重大关联交易等涉及投资者权益的重大事项以及中国证监会及基金业协会规定的其他事项。资产管理人应于每季度结束之日起 20 日内完成季度报告, 并将季度报告发送至资产托管人复核, 资产托管人在收到后 10 日内复核季度报告中的财务数据内容, 并将复核结果书面通知资产管理人。资产管理计划成立未满 3 个月或者存续期间不足 3 个月的, 不编制当期的季度报告。

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

3、净值报告

计划投资运作期间, 本计划成立后, 资产管理人每周/每季度向资产委托人报告一次当期未经资产托管人复核的计划财产净值。

4、临时报告

计划投资运作期间, 发生本合同约定的、可能影响资产委托人利益的重大事项时, 资产管理人应当在事件发生后及时向资产委托人披露:

- (1) 投资经理发生变动;
- (2) 投资顾问发生变动 (如有);
- (3) 涉及资产管理人资产管理业务、计划财产、资产托管业务的, 并可能影响资产委托人利益的重大诉讼;
- (4) 资产管理人、资产托管人托管业务部门与本合同项下资产管理计划财产相关的行为受到监管部门的严重行政处罚;
- (5) 资产管理人及其总经理及其他高级管理人员、投资经理受到严重行政处罚, 资产托管人的托管业务或托管业务部门负责人受到严重行政处罚;
- (6) 法律法规、监管机构、自律组织的其他事项。

5、资产管理计划年度财务会计报告应当经具有证券相关业务资格的会计师事务所审计, 审计机构应当对资产管理计划会计核算及净值计算等出具意见。

6、为免疑义, 资产管理人向资产委托人提供的上述报告, 不包括反映本计划交易过程的交易明细及交易凭证等信息。

(二) 向资产委托人提供报告及资产委托人信息查询的方式

资产委托人签署本合同, 成为本计划的投资人为视为同意资产管理人以短信、微信、邮件、公告或其它适当方式向其发送有关本计划以及资产管理人业务的相关服务信息。资产委托人可自助登陆资产管理人官方网站或咨询资产管理人相关服务人员查询本计划运作相关信息。资产

管理人可通过资产管理人的官方网站向资产委托人提供报告及相关服务信息,资产委托人可自助登录资产管理人官方网站或咨询资产管理人相关服务人员查询本计划运作相关信息;本资产管理计划通过资产管理人的官方网站进行信息披露后,视为已履行完毕告知义务。

资产委托人可登陆资产管理人官网 www.ctfund.com, 点击“我要登入”查询信息披露相关信息,使用开户证件号码或基金账号登录,初始密码为开户证件号码后六位,字母用0代替。登录后请及时更改密码以保障账户安全。如有疑问可拨打资产管理人客户电话 400-820-9888 进行垂询。

在存有代销机构(如有)的情况下,资产管理人将上述信息通知到代销机构(如有),视为已通知到资产委托人。资产委托人有义务随时与代销机构(如有)保持联系,了解有关本计划的各项信息。

(三) 向监管机构提供的报告

资产管理人、资产托管人应当根据法律法规和监管机构及自律组织的要求履行报告义务。

(四) 信息保密义务

资产委托人根据上述资产管理合同的约定从资产管理人处获取的相关数据,仅供用于资产委托人了解本资产管理计划委托资产的相关投资状况,不得擅自以任何形式对外泄露、报导、转送,资产委托人不利用获取的相关数据进行内幕交易、不公平交易或者操作市场等其他违反证券法等法律法规的规定,不得向除资产委托人所指定数据接收人之外的其他方披露该等数据,法律法规另有规定或监管机关另有要求的除外。

资产委托人须采取必要的措施,将相关数据的知情者控制在最小范围内,不得在公司内部非业务相关部门或个人之间以任何形式传播,保证相关信息不被内部工作人员及外部相关人员利用获取的相关数据进行违法违规的交易。如违反前述义务,资产委托人应赔偿管理人因此造成的所有损失。

二十五、风险揭示

计划投资可能面临下列各项风险,包括但不限于:

(一) 资产管理计划面临的一般风险

1、本金损失风险

管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用计划财产,但不保证计划财产本金不受损失,也不保证一定盈利及最低收益。

在发生揭示的风险及其他尚不能预知的风险而导致本计划项下计划财产重大损失的,委托人可能发生委托本金损失的风险。

本计划属于 R3 风险投资品种,适合风险识别、评估、承受能力 C3、C4 及 C5 的合格投资者。(管理人会定期对产品进行风险评级,本产品届时重新评定的风险等级以管理人公告为准,

代销机构对本产品风险等级的评定不低于管理人对本产品的风险等级评定的,以代销机构评定的风险等级为准)

2、市场风险

证券、期货市场价格受到经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素的影响,导致委托财产收益水平变化,产生风险,主要包括:

(1) 政策风险

因国家宏观政策(如货币政策、财政政策、行业政策、地区发展政策等)发生变化,导致市场价格波动而产生风险。

资产管理人作为国家有权机关监管下的金融机构,监管机构对监管政策/规定的出台和变化,可能会对本计划的投资、运作、减持、变现将产生重大影响;本计划资产委托人同意,因资产管理人执行监管政策/规定导致资产管理合同项下全部或部分目的无法实现的,不视为违反资产管理合同的约定。

(2) 经济周期风险

随经济运行的周期性变化,证券、期货市场的收益水平也呈周期性变化。委托财产投资于债券与上市公司的股票,收益水平也会随之变化,从而产生风险。

(3) 利率风险

金融市场利率的波动会导致证券市场价格和收益率的变动。利率直接影响着债券的价格和收益率,影响着企业的融资成本和利润。委托财产投资于债券和股票,其收益水平会受到利率变化的影响。

(4) 上市公司经营风险

上市公司的经营好坏受多种因素影响,如管理能力、财务状况、市场前景、行业竞争、人员素质等,这些都会导致企业的盈利发生变化。如果委托财产所投资的上市公司经营不善,其股票价格可能下跌,或者能够用于分配的利润减少,使委托财产投资收益下降。虽然委托财产可以通过投资多样化来分散这种非系统风险,但不能完全规避。

(5) 购买力风险

委托财产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,从而使委托财产的实际收益下降。

(6) 债券收益率曲线风险

债券收益率曲线风险是指与收益率曲线非平行移动有关的风险,单一的久期指标并不能充分反映这一风险的存在。

(7) 再投资风险

再投资风险反映了利率下降对固定收益证券本息收入再投资收益的影响,这与利率上升

所带来的价格风险（即前面所提到的利率风险）互为消长。具体为当利率下降时，委托财产从投资的固定收益证券所得的本息收入进行再投资时，将获得比之前较少的收益率。

3、管理风险

在委托财产管理运作过程中，资产管理人的研究水平、投资管理水平直接影响委托财产收益水平，如果资产管理人对经济形势和证券、期货市场判断不准确、获取的信息不全、投资操作出现失误，都会影响委托财产的收益水平。

4、流动性风险

本计划非开放日，不接受资产委托人的退出申请，从而导致资产委托人的投资无法及时变现，有一定的流动性风险。当本计划出现巨额退出或连续巨额退出等本合同约定情形，资产管理人有权暂停退出、延期退出或延期支付退出款项，该等情形的发生将直接影响资产委托人投资变现。

在市场或个股流动性不足的情况下，资产管理人可能无法迅速、低成本地调整投资计划，从而对计划收益造成不利影响。

5、信用风险

信用风险是债务人的违约风险，主要体现在信用产品中。在委托资产投资运作中，如果资产管理人的信用研究水平不足，对信用产品的判断不准确，可能使委托资产承受信用风险所带来的损失。

本计划交易对手方发生交易违约或者计划持仓债券的发行人拒绝支付债券本息，导致资产管理计划财产损失。

6、募集失败风险

初始募集期限届满，若本计划不符合成立条件，则存在募集失败的风险，在资产管理计划募集期限届满后30日内退还客户已缴纳的款项，并加计银行同期活期存款利息。

7、关联交易风险

本计划可投资于资产管理人、资产托管人及其控股股东、实际控制人或者其他关联方发行的证券或者承销期内承销的证券涉及关联交易，可能因关联而影响资产管理计划利益的实现，资产管理人将在投资完毕后履行相应的信息披露义务。资产委托人知悉并同意，资产管理人投资资产管理人发行的证券投资基金、托管行同业存单及银行存款等不再另行公告。

资产委托人签署本合同即视为已经充分理解并同意资产管理人从事前文已经明确列明的关联交易情形，资产管理人无需就前述具体关联交易再行分别取得资产委托人的授权或事先同意，但该等关联交易投资应按照市场通行的方式和条件参与，公平对待委托财产，防止利益冲突，不得损害投资者利益。

此外，资产管理人运用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,进而可能影响委托财产的投资收益。

8、操作或技术风险

相关当事人在业务各环节操作过程中,因内部控制存在缺陷或者人为因素造成操作失误或违反操作规程等引致的风险,例如,越权违规交易、会计部门欺诈、交易错误、IT 系统故障等风险。

在计划的各种交易行为或者后台运作中,可能因为技术系统的故障或者差错而影响交易的正常进行或者导致投资者的利益受到影响。这种技术风险可能来自基金管理公司、注册登记机构、销售机构、证券交易所、证券注册登记机构等。

9、税收风险

资产管理计划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。

资产管理计划运营过程中需要缴纳增值税应税的,将由委托人承担并从委托资产中支付,按照税务机关的规定以资产管理人为增值税纳税人履行纳税义务,因此可能增加资产委托人的投资税费成本。

(二) 资产管理计划面临的特定风险

1、特定的投资方法及资产管理计划财产所投资的特定投资对象可能引起的特定风险

(1) 投资股票的风险

1) 上市公司经营风险:上市公司的经营状况受多种因素影响,如市场、技术、竞争、管理、财务等都会导致公司盈利状况发生变化。如产品所投资的上市公司经营不善,与其相关的证券价格可能下跌,或者能够用于分配的利润减少,从而使产品投资的收益下降。

2) 流动性风险:证券市场受到市场行情、投资情绪等诸多因素的影响,某些实际成交活跃、流动性好的股票在另一些时期可能成交稀少、流动性差。在市场流动性相对不足时,交易变现有可能增加变现成本或出现变现困难,对产品投资造成不利影响。

(2) 投资科创板的风险

本计划可投资于科创板,或面临 1) 流动性风险:科创板股票交易实施更加严格的投资者适当性管理制度,投资者门槛高;随着后期上市企业的增加,部分股票可能面临交易不活跃、流动性差等风险;且投资者可能在特定阶段对科创板个股形成一致性预期,存在本计划持有股票无法成交的风险。2) 退市风险:科创板退市制度较主板更为严格,退市时间短、退市速度快、退市情形多,且不再设置暂停上市、恢复上市和重新上市环节,上市公司退市风险更大,可能给计划资产净值带来不利影响。3) 集中投资风险:因科创板上市企业均为科技创新成长型企业,其商业模式、盈利风险、业绩波动等特征较为相似,基金难以通过分散投资降低投资风险,若股票价格同向波动,将引起计划资产净值波动。

2、募集失败的风险

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。资产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）后三十日返还投资者已缴纳的款项，并加计银行同期活期存款利息。

3、不能完成备案的风险

本计划成立后需在基金业协会进行备案。除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外，资产管理计划在完成基金业协会备案前不得开展投资活动。

因此，即使本计划成立，并不意味着本计划必然能获得基金业协会的备案。而该等备案过程可能会受到相应监管政策的影响，包括备案时间所需时间、能否通过备案都存在一定的不确定性。

如果在计划成立后不能及时完成备案，将可能导致本计划错过市场行情或投资机会；如果本计划在成立后无法获得基金业协会的备案，则将直接影响本计划设立目的的实现。当出现无法通过基金业协会备案的情形，本计划提前终止，由此直接影响资产委托人参与本计划的投资目的。

4、本计划展期或提前终止的风险

若发生本计划约定展期或提前终止情形时，将可能导致资产委托人无法按照预期安排委托财产投资或无法按时收回委托财产或委托财产收回金额不及预期等风险。

5、资产管理计划份额转让所涉风险

本计划成立后，投资者可以按照法律法规及资产管理合同的规定进行份额转让。资产管理计划份额转让的交易平台可以是证券交易所，也可以是中国证监会认可的其他交易平台。

受限于份额受让方须满足合格投资者要求、投资者合计不得超过 200 人以及届时计划份额流动性不足等相关限制因素的影响，都可能导致投资者届时可能无法顺利及时转让其所持有的计划份额。而且，计划份额转让须遵守交易场所的相关规定及要求，并按资产管理人的规定办理份额变更登记手续。由此，在办理该等份额转让过程中，投资者须履行相关程序性要求并不排除需要支付相关份额转让费用。

6、资产管理合同与基金业协会合同指引不一致所涉风险

基金业协会针对集合资产管理计划资产管理合同的内容及格式发布了《集合资产管理计划资产管理合同内容与格式指引（试行）》（以下简称“合同指引”）。

资产管理合同虽然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,因此资产管理合同具体条款的约定不可避免的比合同指引更为复杂、更为具体,也不可避免地与合同指引不完全相同。

投资人应当认真阅读资产管理合同,理解资产管理合同的全部条款,独立做出是否签署资产管理合同的决定。

7、资产管理计划的风险收益特征表述与销售机构风险评级可能不一致的风险

销售机构对于本计划风险收益特征的评估与表述标准可以与资产管理人不同,可能存在本计划资产管理合同、风险揭示书或计划说明书中的风险收益特征表述与销售机构对本计划风险评级结果不一致的风险。投资者在投资本计划前,必须按照销售机构的标准和要求完成其对于投资者与本计划的销售适当性匹配检验及其他销售适当性义务。

(三) 其它风险

1、战争、自然灾害等不可抗力因素的出现,将会严重影响证券市场的运行,可能导致委托财产的损失;

2、金融市场危机、行业竞争、代理商违约等超出资产管理人自身直接控制能力之外的风险,也可能导致资产委托人利益受损。

二十六、资产管理合同的变更、终止与财产清算

(一)全体资产委托人、资产管理人和资产托管人协商一致后,可对本合同内容进行变更,但本合同另有约定的情形除外。

1、各方一致同意,以下事项可由资产管理人自行决定变更:

(1) 调低资产管理人的报酬标准;

(2) 调低参与费、退出费的费率;

(3) 投资经理的变更;

(4) 对本资产管理计划的认购、参与、退出、资产管理计划份额转让的业务规则(包括但不限于总规模、单个投资者首次认购、参与金额及持有的本资产管理计划总金额限制等)进行调整;

(5) 法律法规规定或本资产管理合同约定的其他情形。

2、各方一致同意,以下事项可由资产管理人和资产托管人协商一致后变更:

(1) 调低资产托管人或投资顾问(如有)的报酬标准;

(2) 因法律法规、监管政策、自律政策、中国证监会/证券投资基金业协会的规定、要求发生变化,或证券登记结算机构业务规则、证券交易所等交易规则修订需要变更本资产管理合同,资产管理人可以与资产托管人协商后修改本资产管理合同,并由资产管理人按照本资产管理合同约定的方式及时向投资者披露变更的具体内容;

(3) 不会对资产管理计划份额持有人权利义务产生重大实质不利影响的资产管理合同相关

事项变更,但资产管理人有权自行决定变更的事项除外;

(4) 法律法规规定或本资产管理合同约定的其他情形。

3、除前文第 1 项、第 2 项所述之外的其余事项如需发生变更,资产管理人应事先取得资产托管人的同意。在取得资产托管人同意的情况下,在资产管理人网站进行公告。资产管理人应当于公告日之后设置临时开放期。资产委托人不同意资产管理合同的修订的,可于开放期内选择退出资产管理计划。资产委托人在开放期内未选择退出的,视为资产委托人同意本次资产管理合同的修订。

在临时开放期结束后第 1 个工作日,变更后的资产管理合同生效。

4、如果资产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,经全体资产委托人协商一致,可选择符合条件的其他资产管理人承接本资产管理计划项下资产管理人相关权利义务。发生此等情形时,原资产管理人应当向新的资产管理人交接本资产管理计划资产管理事务。

5、如果资产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,经全体资产委托人及资产管理人协商一致,可选择符合条件的其他资产托管人承接本资产管理计划项下资产托管人相关权利义务。发生此等情形时,原资产托管人应当向新的资产托管人交接本资产管理计划资产托管事务。

6、如司法机关或其他监管机构有确切证据表明资产管理人出现重大风险事件并可能将风险渗透至资产托管人,资产托管人可选择退出本资产管理计划,经资产管理人认可后可选择符合条件的其他资产托管人承接本资产管理计划项下资产托管人相关权利义务。发生此等情形时,原资产托管人应当向新的资产托管人交接本资产管理计划资产托管事务。

7、资产管理人应当合理保障合同变更后投资者选择退出资产管理计划的权利,具体以资产管理人届时安排并以公告为准。

8、资产管理人应当自资产管理合同变更之日起五个工作日内报基金业协会备案。

(二) 本计划终止(含提前终止)的情形包括下列事项:

1、资管计划存续期届满而不展期的;

2、资产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、被宣告破产,且在六个月内没有新的资产管理人承接;

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

4、经资产委托人、资产管理人和托管人协商一致决定终止的;

5、本计划存续期间内,持续五个工作日投资者少于二人;

6、本计划开放期内任一个工作日接受委托人退出申请后导致投资者人数少于一人的,管

理人有权提前终止；

7、本计划在成立后，未在基金业协会完成备案或不予备案的；

8、同时满足下述两条件的，资产管理人有权提前终止本计划：

(1) 本计划所持有的流通受限证券锁定期全部解除；

(2) 本计划除因停牌、不可抗力或据相关法规等减持限制因素无法通过集中竞价交易方式全部减持的部份外，已全部减持，且本计划不进行展期的；

9、本计划所持资产全部为现金资产时，资产管理人有权提前终止；

10、资产委托人知悉并同意，资产管理人受到国家有权机关的监管，因有权机关发布的法律法规、监管政策、自律规则（下称“监管文件”）导致本合同不能继续履行，或继续履行将违反前述监管文件的，资产管理人有权终止本合同；

11、资产管理人有权根据资产管理计划运作情况提前终止；

12、法律、行政法规及中国证监会规定及本合同约定的其他情形。

资产管理人决定提前终止本计划的，应提前告知资产托管人及委托人。资产管理人网站上发布公告即视为履行了告知义务。

资产管理人应当自资产管理计划终止之日起五个工作日内报基金业协会备案，前述第 7 项约定的情形除外。

（三）本计划的展期

1、本计划展期的，应满足下列条件：

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

(2) 资产管理计划展期没有损害投资者利益的情形；

(3) 中国证监会规定的其他条件。

资产管理计划展期的，还应当符合集合资产管理计划的成立条件。

2、展期的程序与期限

计划存续期届满拟展期的，资产管理人与资产托管人协商一致后，在资产管理人网站进行公告。资产管理人应当于原存续期届满日之前（包括该日）设置临时开放期。资产委托人不同意本次资产管理合同展期的，可于开放期内选择退出资产管理计划。资产委托人未在开放期内选择退出的，视为资产委托人同意资产管理计划展期。

在原存续期届满日后第1个工作日，本计划符合上述展期条件的，则本计划将于原存续期届满后第1个工作日确认展期。

3、资产管理人应当自资产管理计划展期之日起五个工作日内报证券投资基金业协会备案。资产管理计划展期的，资产管理人将及时通过官方网站公告，并通过邮件方式通知资产托管人。

(四) 财产清算

1、清算小组

本资产管理计划终止 (含提前终止) 的, 资产管理人应当在发生终止 (含提前终止) 情形之日起五个工作日内开始组织清算资产管理计划财产, 具体可由清算小组具体处理。

清算小组成员由资产管理人、资产托管人组成。清算小组可以聘用必要的工作人员。

清算小组职责: 负责资产管理计划财产的保管、清理、估价、变现和分配。资产管理计划财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。清算小组中, 资产管理人、资产托管人双方具体职责如下:

(1) 资产管理人

- 1) 资产变现;
- 2) 除交易所、银行等自动扣收的费用外, 对清算期间资金支付出具划款指令;
- 3) 出具会计报表;
- 4) 清算期间的会计核算;
- 5) 编制清算报告并签章;
- 6) 配合资产托管人办理账户注销工作;
- 7) 代表计划财产清算小组聘请会计师事务所、律师事务所等服务机构 (如需要);
- 8) 向资产委托人发布清算通知、清算报告;
- 9) 将计划财产清算报告报中国证监会、基金业协会备案,
- 10) 履行与资产管理人义务相关的其他职责。

(2) 资产托管人

- 1) 清算期间的财产保管;
- 2) 复核资产管理人划款指令, 进行资金划付;
- 3) 根据资产管理人申请办理托管账户、证券账户的注销;
- 4) 复核资产管理人出具的会计报表;
- 5) 复核资产管理人出具的清算报告中的财务数据 (本合同约定的资产托管人无复核义务的数据除外);
- 6) 履行与资产托管人义务相关的其他职责。

2、清算程序

本资产管理计划终止 (含提前终止), 应当按法律法规和资产管理合同的有关规定对资产管理计划财产进行清算。资产管理计划财产清算程序主要包括:

- (1) 资产管理计划终止时, 由资产管理计划财产清算小组统一接管财产;
- (2) 对资产管理计划财产进行清理和确认;

- (3) 对资产管理计划财产进行估价和变现;
- (4) 制作清算报告;
- (5) 对资产管理计划剩余财产进行分配。

3、清算费用的来源和支付方式

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

- (1) 聘请会计师（如需）、律师（如需），以及其他工作人员所发生的报酬；
- (2) 资产管理计划资产的保管、清理、估价、变现和分配产生的费用；
- (3) 信息披露所发生的费用；
- (4) 诉讼、仲裁、保全等维护计划委托财产利益所发生的费用；
- (5) 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，所有清算费用由资产管理人向资产托管人出具指令，由资产托管人复核后办理支付。

4、清算剩余财产的支付

依据资产管理计划财产清算的分配方案，将资产管理计划财产清算后的全部剩余资产扣除资产管理计划财产清算费用及各项负债后，向资产委托人进行分配。计划财产按下列顺序清偿：

- (1) 支付清算费用；
- (2) 交纳所欠税款；
- (3) 清偿计划债务（包括但不限于管理费、托管费、业绩报酬（如有）等）；
- (4) 向资产委托人进行分配。

计划财产未按前款（1）、（2）、（3）项约定清偿前，不分配给计划份额持有人。在完成前款（1）、（2）、（3）项程序后的剩余财产，资产管理人将按照资产委托人所持份额占本计划总份额的比例，以现金形式向资产委托人进行分配。

本计划终止日后，计划财产不应仍持有可流通非现金资产，如遇特殊情况，计划财产仍持有可流通非现金资产的，资产管理人有权及时进行强制变现处理，仍持有未能流通变现的证券（包括但不限于因流动性差无法变现、流动性受限资产以及据其他法律法规无法通过集中竞价交易方式全部减持的股票或其他证券资产），本计划可在首次清算后进行多次清算，自上述限制条件解除日起的合理期限内完成变现。并将变现后的资产按照资产委托人持有份额的比例，以现金形式全部分配给资产委托人。**尽管有前述约定，在此清算期间，资产管理人可投资于货币市场基金（包括资产管理人管理的货币市场基金）和银行存款等流动性管理**

工具。资产委托人应接受上述由于资产变现或清算期间进行投资所产生的收益或损失。资产管理人、资产托管人继续按合同约定的费率收取多次清算期间的管理费和托管费。

在委托财产移交前，由资产托管人负责保管。保管期间产生的收益归委托财产所有，发生的保管费用由委托财产承担。因资产委托人原因导致委托财产无法转移的，资产托管人和资产管理人可以在协商一致后按照有关法律法规进行处理。

委托财产清算工作结束，并全部划入指定账户后，资产托管人应在资产委托人和资产管理人的配合下，尽快完成本合同项下相关账户的销户工作，并将销户结果通知资产委托人和资产管理人。如因本合同相关当事人故意拖延等行为造成销户不及时而出现直接损失或造成相关费用，应当对各自行为承担赔偿责任。

资产管理计划因委托财产流动性受限等原因导致可能多次清算的，资产管理人应当及时向中国证监会相关派出机构报告。

资产管理人应当在资产管理计划清算结束后五个工作日内将清算结果报基金业协会备案。资产委托人在此同意，上述清算报告不再另行审计，亦不需要律师出具法律意见，除非法律法规或监管部门要求必须进行审计或律师出具法律意见的。

资产管理人、资产托管人等机构应当按照法律法规、监管机构及自律组织的规定保存资产管理计划的会计账册，妥善保存有关的合同、协议、交易记录等文件、资料和数据，任何人不得隐匿、伪造、篡改或者销毁。保存期限自资产管理计划终止之日起不少于二十年。

二十七、违约责任

(一)因本合同当事人的违约行为造成本合同不能履行或者不能完全履行的，由违约的一方承担违约责任；如属当事人双方或多方当事人的违约，根据实际情况，由违约方分别承担各自应负的违约责任。但是发生下列情况，当事人应当免责：

- 1、不可抗力；
- 2、计算机系统故障、网络故障、通讯故障、电力故障、计算机病毒攻击及其它非资产管理人、资产托管人故意造成的意外事故；
- 3、资产管理人及/或资产托管人按照有效的法律法规或中国证监会的规定（包括但不限于监管机构新发布的与合同部分约定不符的规定或者要求）作为或不作为而造成的损失；
- 4、资产管理人按照本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；
- 5、资产委托人未能事前向资产管理人及资产托管人履行信息披露义务（如告知关联证券或其他禁止交易证券等），致使发生违规投资行为的，资产管理人与资产托管人均不承担任何责任，资产委托人需就资产管理人与资产托管人由此遭受的损失承担赔偿责任；
- 6、因证券市场波动、上市公司合并、计划财产规模变动等资产管理人之外的因素致使计划财产投资不符合本合同项下约定的投资策略的，将不视为资产管理人的违约行为；

7、资产委托人理解资产管理计划财产的投资、运作、保管面临本合同第二十五节中列举的各类风险,资产管理人及资产托管人就资产管理计划财产面临的上述固有风险免于承担责任;

8、资产管理人及资产托管人对因所引用的投资对象、证券经纪商及其他中介机构提供的信息的真实性、准确性和完整性存在瑕疵。

9、法律法规以及本合同规定或约定的其他情形。

(二) 资产管理人、资产托管人在履行各自职责的过程中,违反法律法规的规定或者本合同约定,给委托财产或者资产委托人造成损害的,应当分别对各自的行为依法承担赔偿责任;资产管理人或资产托管人任一方不因另一方的失职行为而给计划财产或资产委托人造成的损失向资产委托人承担连带责任。

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

(四) 一方依据本合同向另一方赔偿的损失,仅限于直接经济损失。

二十八、争议的处理

(一) 对于因本合同的订立、内容、履行和解释或与本合同有关的争议,合同当事人应尽量通过协商或调解途径解决。不愿或者不能通过协商或调解解决的,任何一方均有权将争议提交上海国际经济贸易仲裁委员会,按提交仲裁申请时该会有效之仲裁规则进行仲裁,仲裁地点为上海。仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力,仲裁费用由败诉方承担。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,维护资产委托人的合法权益。仲裁实行一裁终局的制度。仲裁裁决作出后,当事人不得就同一纠纷再申请仲裁或者向人民法院起诉,法律另有规定的除外。

(二) 本合同适用中华人民共和国法律并依据其解释。

二十九、资产管理合同的效力

(一) 资产管理合同是约定资产管理合同当事人之间权利义务关系的法律文件。资产委托人为法人的,本合同自资产委托人、资产管理人、资产托管人加盖公章或合同专用章以及各方法定代表人或授权代表签字或盖章之日起成立;资产委托人为自然人的,本合同自资产委托人本人签字、资产管理人、资产托管人加盖公章或合同专用章并由双方法定代表人或授权代表签字或盖章之日起成立。

(二) 合同的套印

本资产管理计划由资产托管人授权资产管理人对资产托管人的“南京银行股份有限公司/南京银行股份有限公司资产托管业务合同专用章”及“法人名章/授权人名章”进行套印,套印

总份数不超过【六百】份，资产管理人对套印的协议进行编号管理，实际使用之后剩余的套印合同由资产管理人进行销毁。资产管理人需在计划成立后的 3 个工作日内书面（邮件或传真）告知资产托管人实际套印合同的总份数、实际使用份数、销毁份数，并提供销毁协议的编号，便于资产托管人核对。因资产管理人对空白协议管理不善给资产托管人造成损失的，由资产管理人承担相应责任。

（三）本资产管理计划的募集金额缴足之日起十个工作日内，资产管理人应当委托具有证券相关业务资格的会计师事务所进行验资并出具验资报告。本资产管理计划在取得验资报告后，由资产管理人公告资产管理计划成立。资产管理人应当在资产管理计划成立之日起五个工作日内，将资产管理合同、投资者名单与认购金额、验资报告或者资产缴付证明等材料报基金业协会备案。

（四）本合同自本计划成立之日起生效。

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

（六）本计划的存续期为 60 个月，本合同有效期至本计划清算完毕之日止。本合同另有约定的，从其约定。

（七）资产委托人自签订资产管理合同即成为资产管理合同的当事人。在本计划存续期间，资产委托人自全部退出资产管理计划之日起，该资产委托人不再是资产管理计划的投资人和资产管理合同的当事人。

三十、其他事项

（一）如将来法律法规、中国证监会、基金业协会或其他有权机构对资产管理合同的内容与格式有其他要求的，资产管理人和资产托管人应立即展开协商，根据法律法规、中国证监会、基金业协会或其他有权机构的相关要求修改本合同的内容和格式。本合同另有约定的，从其约定。

（二）本合同如有未尽事宜，由合同当事人各方按有关法律法规和规定协商解决。

（三）本合同一式三份，资产委托人、资产托管人及资产管理人各执一份。

（四）反虚假宣传条款：资产委托人、资产管理人、资产托管人三方均清楚并愿意严格遵守中华人民共和国《著作权法》、《商标法》、《专利法》、《反不正当竞争法》等知识产权类、合同法及广告法等相关法律的规定，三方均有权就本合同所约定事项以约定方式在约定范围内进行真实、合理的使用或宣传，但不得涉及合同所约定的保密内容。为避免商标侵权及不当宣传等风险的发生，三方均同意，在使用对方的商标、品牌、企业名称等进行宣传前，均须获得对方事先的书面认可，否则，不得进行此类使用或宣传。三方在此承诺，会积极响应对方提出的就合作事项的合理使用或宣传申请。三方均承认，未经对方事先书面同意而利用其商标、

品牌及企业名称等进行商业宣传；虚构合作事项；夸大合作范围、内容、效果、规模、程度等，均属对本合同的违反，并可能因虚假宣传构成不正当竞争，守约方或被侵权人将保留追究相应法律责任的权利。

(五) 反商业贿赂：反商业贿赂条款是本合同之必备条款，与本合同具有同等法律效力，请签署合同之当事人认真阅读本条款，同意签订并遵守如下反商业贿赂条款：

1、资产管理人、资产托管人双方都清楚并愿意严格遵守中华人民共和国反商业贿赂的法律规定，双方都清楚任何形式的贿赂和贪渎行为都将触犯法律，并将受到法律的严惩。

2、双方均不得向对方或对方经办人或其他相关人员索要、收受、提供、给予本协议约定外的任何利益，包括但不限于明扣、暗扣、现金、购物卡、实物、有价证券、旅游或其他非物质性利益等，但如该等利益属于行业惯例或通常做法，则须在本协议中明示。

3、双方严格禁止双方经办人员的任何商业贿赂行为。双方经办人发生上述第 2 条所列示的任何一种行为，都是违反双方公司制度的，都将受到双方公司制度和国家法律的惩处。

4、双方郑重提示：双方反对本协议其他交易对手或本协议其他交易对手经办人员为了本协议之目的与本协议以外的任何第三方发生上述第 2 条所列示的任何一种行为，该等行为都是违反国家法律的行为，并将受到国家法律的惩处。

5、如因一方或一方经办人违反上述第 2 条、第 3 条、第 4 条之约定，给对方造成损失的，应承担损害赔偿责任。

6、本条所称“其他相关人员”是指本协议各方经办人以外的与本协议有直接或间接利益关系的人员，包括但不限于本协议经办人的亲友。

(以下无正文)

委托人请填写 (务必确保填写的资料正确有效, 如因填写错误导致的任何损失, 资产管理人和资产托管人不承担任何责任) :

(一) 资产委托人

1、自然人

姓名:

证件名称: 身份证 ☐、军官证 ☐、护照 ☐

证件号码:

住所:

通讯地址:

联系电话:

2、法人或其他组织

名称:

统一社会信用代码:

法定代表人或授权代表:

住所:

通讯地址:

联系电话:

(二) 资产委托人账户

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

账户名称:

账号:

开户银行名称:

(本页无正文,为《财通基金同富量化精选 1 号 (FOF) 集合资产管理计划资产管理合同》签署页。)

资产委托人:

自然人(签字):

或 法人或其他组织(盖章):

签署日期: 年 月 日

资产管理人: 财通基金管理有限公司 (盖章):

法定代表人或授权代表:

签署日期: 2023 年 1 月 30 日

资产托管人: 南京银行股份有限公司 (盖章):

法定代表人或授权代表:

签署日期: 2023 年 1 月 31 日