

信达证券信丰 1 号单一资产管理计划 资产管理合同

投资者：信达投资有限公司

管理人：信达证券股份有限公司

托管人：中国建设银行股份有限公司北京市分行

目录

一、前言	1
二、释义	1
三、承诺与声明	4
四、当事人及权利义务	5
五、资产管理计划的基本情况	11
六、资产管理计划的成立与备案	13
七、资产管理计划的参与和退出	14
八、资产管理计划的投资	19
九、服务机构及投资顾问	24
十、利益冲突及关联交易	24
十一、投资经理的指定与变更	27
十二、资产管理计划的财产	27
十三、投资指令的发送、确认和执行	29
十四、越权交易的界定	33
十五、资产管理计划财产的估值和会计核算	35
十六、资产管理计划的费用与税收	40
十七、交易及交收清算安排	42
十八、资产管理计划的收益分配	46
十九、信息披露与报告	48
二十、风险揭示	51
二十一、资产管理合同的变更、计划终止与财产清算	60
二十二、违约责任	64
二十三、争议的处理	66
二十四、资产管理合同的效力	66
二十五、其他事项	67
附件一：初始受托财产缴付通知书（样本）	72
附件二：受托财产到账通知书（样本）	73
附件三：资产管理计划成立通知书（样本）	74
附件四：受托财产追加通知书（样本）	75
附件五：受托财产运作确认书（样本）	76
附件六：受托资产提取通知书（样本）	77
附件七：收益分配通知函（样本）	78
附件八：授权通知书	80
附件九：划款指令（样本）	81
附件十：预留印鉴	82
附件十一：业务联系人名单	83
附件十二：专用清算账户及资金划拨专用账户	85
附件十三：关于受托资金来源的说明函	87
附件十四：风险揭示书	88

一、前言

订立本合同的依据、目的和原则：

1、订立本合同的依据是《中华人民共和国民法典》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《中华人民共和国证券法》、《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》）、《单一资产管理计划资产管理合同内容与格式指引》（以下简称《合同内容与格式指引》）等有关法律法规及中国证券投资基金业协会（以下简称“证券投资基金业协会”或“基金业协会”）等自律组织的自律性文件的规定。

2、订立本合同的目的是规范信达证券信丰1号单一资产管理计划(以下简称“单一计划”“本资产管理计划”或“计划”)运作，明确《信达证券信丰1号单一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，保护单一计划投资者的合法权益。

3、订立本合同的原则是平等自愿、诚实信用、充分保护单一计划投资者的合法权益。投资者、管理人、托管人在平等自愿、诚实信用、公平原则的基础上订立本合同。

本合同是规定当事人之间基本权利义务的法律文件，当事人按照《指导意见》、《管理办法》、《运作规定》、本合同及其他有关规定享有权利、承担义务。

资产管理人应当按照规定向基金业协会办理本资产管理计划的设立、变更备案，并及时报送本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。资产管理人履行本资产管理计划备案手续，应当真实、准确、完整、及时地报送备案信息、材料和运行信息，对备案信息、材料和运行信息的真实性、准确性、完整性、及时性和合规性负责。基金业协会办理本资产管理计划备案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作出保证和判断，也不表明基金业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本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本资产管理计划，自主判断投资价值，自行承担投资风险。

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：

(一) 投资者、投资人：信达投资有限公司。

(二) 资产管理人：指信达证券股份有限公司。

(三) 资产托管人：指中国建设银行股份有限公司北京市分行。

(四) 本合同、本单一资产管理计划合同：指投资者、资产管理人和资产托管人签署的《信达证券信丰 1 号单一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及补充。

(五) 本计划、单一资产管理计划、本资产管理计划：信达证券信丰 1 号单一资产管理计划。

(六) 受托财产：指投资者拥有合法处分权、委托资产管理人管理并由资产托管人托管的财产。管理人因受托财产的管理、运用、处分或者其他情形而取得的财产，也归入受托财产。

(七) 交易日：指上海证券交易所和深圳证券交易所的正常交易日。

(八) 工作日：同交易日。

(九) 资产委托起始日、运作起始日：指管理人确认初始受托资产到账后，向投资者和托管人发送《资产管理计划成立通知书》，由投资者及托管人双方确认签收。投资者和托管人双方确认签收《资产管理计划成立通知书》的当日（若非同日常收，则为最后一方签收日的当日）作为资产委托起始日。

(十) 风险揭示书：指《信达证券信丰 1 号单一资产管理计划风险揭示书》。

(十一) 《指导意见》：指 2018 年 4 月 27 日中国人民银行、中国银行保险监督管理委员会、中国证券监督管理委员会、国家外汇管理局发布的《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》。

(十二) 《管理办法》：指中国证监会于 2023 年 1 月 12 日发布并于 2023 年 3 月 1 日施行的《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》。

(十三) 《运作规定》：指中国证监会于 2023 年 1 月 12 日发布并于 2023 年 3 月 1 日施行的《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》。

(十四) 中国证监会、证监会：指中国证券监督管理委员会。

(十五) 投资收益: 受托管理期限内受托财产投资运作获得的各类收益, 包括但不限于: 投资所得红利、股息、买卖证券差价、银行存款利息以及其他收入。投资收益可以为负数, 即投资亏损。

(十六) 受托财产净值: 指受托财产总值减去负债后的价值。

(十七) 受托财产单位净值: 指受托财产净值与受托财产份额之比。

(十八) 财产清算: 指本合同终止后, 在清算期内对受托财产进行核算, 并按规定计算受托财产投资收益、相关费用, 并支付相关费用、返还投资者剩余受托财产的行为。

(十九) 清算日: 指本合同期限届满、依据合同条款提前到期或经合同当事人同意提前终止日。

(二十) 银行托管账户: 资产托管人根据有关规定为受托财产开立的专用存款账户。

(二十一) 其他专用账户: 指用于本合同项下单一资产管理计划投资于符合法律法规规定和本合同约定的其他投资品种时需要开立的账户。

(二十二) 不可抗力: 指不能预见、不能避免并不能克服的客观情况。

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

三、承诺与声明

（一）管理人承诺与声明

- 1、在签订本合同前充分地向投资者说明了有关法律法规和相关投资工具的运作市场及方式，并充分揭示了相关风险；
- 2、已经了解投资者的风险偏好、风险认知能力和承受能力，对投资者的财务状况进行了充分评估；
- 3、按照《基金法》恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用受托财产，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。

（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、根据法律法规、中国证监会及证券投资基金业协会的规定和资产管理合同的约定，对管理人的投资或清算指令等进行监督；
- 3、在管理人发生异常且无法履行管理职能时，依照法律法规及合同约定履行受托职责，即托管人履行安全保管托管资产的义务，维护投资者权益。

（三）投资者承诺与声明

- 1、符合《运作规定》合格投资者的要求，具有合法参与单一资产管理业务的资格，不存在通过拆分转让本计划收益权等方式变相突破合格投资者标准的情形，不存在法律、行政法规和中国证监会有关规定禁止或限制参与单一资产管理业务的情形且不是管理人的董事、监事、从业人员及其配偶。
- 2、向管理人提供的有关投资目的、投资偏好、投资限制、财产收入情况和风险承受能力等基本情况真实、完整、准确、合法，不存在任何虚假陈述、重大遗漏或误导。前述信息资料如发生任何实质性变更，及时书面告知管理人。
- 3、财产的来源及用途符合国家有关规定，未使用贷款等筹集的非自有资金投资资产管理计划，且投资事项符合法律法规的规定及业务决策程序的要求。
- 4、已充分理解本合同条款，了解相关权利义务，了解有关法律法规及所投资资产管理计划的风险收益特征，知晓管理人、托管人及相关机构不应对资产管理计划的收益状况或本金不受损失做出任何承诺，了解“卖者尽责，买者自负”的原则，投资于本计划将自行承担投资风险。

5、保证本委托事项已经取得法律法规所要求的其内部授权和批准，符合其业务决策程序的要求；签署和履行本合同系其真实意思表示，已经按照其章程或者其他内部管理文件的要求取得合法、有效的授权，且不会违反对其有约束力的任何合同和其他法律文件；已经或将会取得签订和履行本合同所需的一切有关批准、许可、备案或者登记。

6、投资者承诺受托财产只能从附件十二约定的投资者移交、缴付受托财产的账户转入托管人的托管账户。受托财产的分配、提取、清算只能转入附件十二约定的投资者接受受托资产分配的账户。

特殊情况导致与以上约定账户不一致时，投资者应出具符合相关法律法规规定的书面说明，变更为投资者的其他同名账户，否则管理人、托管人有权拒绝划转申请。

7、投资者保证没有非法汇集他人资金参与本计划，不得将自有资金和募集资金混同操作。

8、投资者声明已听取了管理人指定的专人对管理人业务资格的披露和对相关业务规则、合同的讲解，阅读并理解风险揭示书的相关内容，并签署风险揭示书，承诺以本计划为限自行承担风险和损失。

9、投资者承诺对管理人根据合同约定从事的投资行为承担完全后果，根据相关合同约定自行承担投资风险，并同意管理人以剩余资产为限向其进行分配。

10、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。投资者投资资产管理计划，承诺出示真实有效的身份证件或者其他身份证明文件，积极配合管理人履行反洗钱职责，不借助投资资产管理计划进行洗钱等违法犯罪活动。管理人若发现受托资产（资金）涉嫌洗钱的，可根据反洗钱法律法规等规定履行反洗钱报告等义务。

11、投资者承诺不利用本单一资产管理计划开展资金池业务。

12、投资者承诺其将配合管理人开展适当性管理工作，进行专业投资者或普通投资者认定，并按需进行风险承受能力测评。未达到专业投资者标准的普通投资者，应在签署本合同前配合管理人签署《投资者风险承受能力问卷》及《投资者风险承受能力评估结果告知书》。

13、投资者承诺其将配合管理人开展非居民金融账户涉税信息的尽职调查。

四、当事人及权利义务

（一）投资者

名称：信达投资有限公司

住所：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼

法定代表人：林华喆

联系人：王宏观

通讯地址：北京市海淀区中关村南大街18号北京国际大厦C座18楼

联系电话：010-62157317

（二）资产管理人

名称：信达证券股份有限公司

住所：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼

法定代表人：祝瑞敏

联系人：李敏

通讯地址：北京市西城区宣武门西大街甲127号金隅大厦B座

联系电话：010-83252709

（三）资产托管人

名称：中国建设银行股份有限公司北京市分行

法定代表人（负责人）：张连钢

住所：北京市西城区宣武门西大街28号楼大成广场4门8门

通信地址：北京市西城区复兴门南大街天银大厦A西座一层

联系人：王霄

联系电话：010-83326032

（四）投资者的权利与义务

1、投资者的权利

- （1）按照本合同的约定取得资产管理计划财产收益；
- （2）取得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、退出资产管理计划；
- （4）按照法律法规及本合同约定的时间和方式获得资产管理计划的信息披露资料；
- （5）监督管理人及托管人履行投资管理和托管义务的情况；
- （6）法律法规、中国证监会及证券投资基金业协会规定的和资产管理合同约定的其他

权利。

2、投资者的义务

(1) 认真阅读并遵守资产管理合同，保证投资资金的来源及用途合法，不得非法汇集他人资金参与本计划；

(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、金融财产、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；听取了管理人的适当性匹配意见，并对自身的风险承受能力、投资期限、投资品种等要素进行评估，独立、自主、审慎作出投资决策，自愿独立承担投资风险。投资者知悉并确认，管理人的信息告知、规则讲解、风险揭示、适当性匹配意见不会降低产品的固有风险，不表明管理人对产品的风险和收益作出实质性判断或保证；

(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) 向管理人提供法律法规规定的信息资料及身份证明文件，配合管理人完成投资者适当性管理、非居民金融账户涉税信息的尽职调查、反洗钱等监管规定的工作；

(5) 认真阅读并签署风险揭示书；

(6) 按照资产管理合同的约定，将参与资金缴付管理人和托管人分别进行投资管理和资产托管，以参与资金为限，承担资产管理计划亏损或者终止的有限责任；

(7) 按照资产管理合同的约定承担资产管理计划的管理费、业绩报酬（如有）、托管费及税费等合理费用；

(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、管理人管理的其他资产以及托管人（如有）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) 法律法规、中国证监会及证券投资基金业协会规定和资产管理合同约定的其他义务。

(五) 资产管理人的权利与义务

1、资产管理人的权利

根据《基金法》、《管理办法》、《运作规定》及其他有关规定订明管理人的权利，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及业绩报酬（如有）；
- (3) 按照有关规定和资产管理合同约定行使因资产管理计划财产投资所产生的权利；
- (4) 自行提供或者委托经中国证监会、证券投资基金业协会认定的服务机构为资产管理计划提供估值与核算、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) 按照有关规定，要求投资者提供公司证照、授权证明文件、证券投资经验、风险认知与承受能力和投资偏好等相关的信息和资料；
- (7) 签署与本产品相关的投资协议；
- (8) 经投资者书面同意，管理人可将受托资产向投资者现状返还；
- (9) 法律法规、中国证监会、证券投资基金业协会规定的及资产管理合同约定的其他权利。

2、资产管理人的义务

根据《基金法》、《管理办法》、《运作规定》及其他有关规定，管理人的义务包括但不限于：

- (1) 依法办理资产管理计划的备案事宜；
- (2) 按照证券投资基金业协会要求报送资产管理计划产品运行信息；
- (3) 对投资者的风险识别能力和风险承受能力进行评估；
- (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) 按照资产管理合同约定接受投资者和托管人的监督；

(9) 对非标准化财产和相关交易主体（如涉及）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；

(10) 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；

(11) 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；

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

(13) 办理与受托资产管理业务活动有关的信息披露事项；

(14) 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；

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

(16) 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；

(17) 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提供融资；

(18) 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；

(19) 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；

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

(21) 管理人应当建立健全反洗钱内部控制制度，设立反洗钱专门机构或者指定内设机构负责反洗钱工作，并按照反洗钱法律法规的要求和本条的有关规定，勤勉尽责，建立健全客户身份识别制度、客户身份资料和交易记录保存制度、大额交易和可疑交易报告制度及客户风险等级划分制度，严格履行反洗钱义务；

(22) 除必要的信息披露及监管要求外，管理人不得以托管人的名义进行营销宣传；

(23) 法律法规、中国证监会及证券投资基金业协会规定的和资产管理合同约定的其他义务。

(六) 资产托管人的权利与义务

1、资产托管人的权利

根据《基金法》、《管理办法》、《运作规定》及其他有关规定，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（如有）；

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

2、资产托管人的义务

根据《基金法》、《管理办法》、《运作规定》及其他有关规定，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) 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；

(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) 按照法律法规要求和资产管理合同约定，根据管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；

(5) 及时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承销期内承销的证券等信息；

(6) 投资于《管理办法》第三十八条第（五）项规定财产时，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；

(7) 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、中国证监会的规定及资产管理合同约定的，应当拒绝执行，立即通知管理人并有权及时报告中国证监会相关派出机构；

(8) 办理与资产管理计划托管业务有关的信息披露事项；

(9) 对资产管理计划财务会计报告、年度报告出具书面意见；

(10) 编制托管年度报告，并向中国证监会相关派出机构报送；

(11) 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；

(12) 不得为托管人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；

(13) 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；

(14) 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；

(15) 托管人保证所提供的资料和信息真实、准确、完整、合法。如该数据、报告是依据从管理人、投资者或第三方处获得的数据而编制的，则托管人保证编制过程的完整、真实、合法，没有任何重大遗漏或误导；

(16) 托管人应当保证受托财产与托管人的自有资产相互独立，不同客户的受托财产相互独立，并保证及时准确办理受托财产的清算交收；

(17) 国家有关法律法规、中国证监会、证券投资基金业协会及中国银行业协会发布的《商业银行资产托管业务指引》规定的及资产管理合同约定的其他义务。

五、资产管理计划的基本情况

(一) 资产管理计划的名称：信达证券信丰 1 号单一资产管理计划

(二) 资产管理计划的类别：本产品属于【权益类】单一资产管理计划。

(三) 资产管理计划的运作方式：

本计划开放式运作。本计划成立后每周开放一次，一次不超过三天。

(四) 资产管理计划的投资目标、主要投资方向、投资比例

1、投资目标

本计划主要投资于有发展前景的上市公司股票、有转股价值的上市公司可转换债券等，在有效控制投资风险的前提下，力争实现计划资产的稳定增值。

2、投资范围

(1) 国内依法发行上市的股票（包括主板、创业板、科创板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证）、港股通标的股票。

(2) 银行间市场和交易所市场上市交易的国债、政策性金融债、政府支持机构债、金融债（含混合资本债、次级债、二级资本债、永续债、次级永续债）、地方政府债、中央银行票据、企业债券（含永续债）、公司债券（含非公开发行公司债券、永续公司债）、中期票据（含永续中票等）、短期融资券、超短期融资券、非公开定向债务融资工具、可交换债券、可转换债券、资产证券化产品[资产支持证券 ABS、资产支持票据 ABN]等、现金、银行存款（包括定期存款、活期存款、协议存款、同业存款等）、同业存单、结构性存款、债券回购（包含正回购和逆回购），以及其他法律法规或政策许可投资的固定收益证券品种。

(3) 经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金份额[包括但不限于场内 ETF、LOF、QDII 基金、封闭式基金、上市定期开放式基金、香港互认基金、商品基金、公募 REITs]；证券公司及资管子公司、期货公司及期货公司子公司、基金公司及基金子公司、保险资管、信托公司、商业银行及理财子公司、在中国证券投资基金业协会备案的私募基金管理人发行的资产管理产品（含 QDII 产品）。

(4) 特别揭示：本计划可进行债券正回购、逆回购业务。

3、本计划的投资比例

权益类资产占总资产的比例不低于 80%；

法律法规或中国证监会允许单一计划投资其他品种的，资产管理人在履行本合同约定的程序后，可以将其纳入本计划的投资范围。在投资运作前，管理人应与托管人就新增投资品的清算交收、估值核算等达成书面一致同意。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本单一计划，管理人在履行适当程序后，则本单一计划投资不再受相关限制。

因证券期货市场波动、证券发行人合并、资产管理计划规模变动等证券期货经营机构之外的因素导致突破前述比例限制的，应当在流动性受限资产可出售、可转让或者恢复交易的 20 个交易日内调整至符合要求。未来监管机构对上述限制有新规定的，本计划在履行适当程序后，按照新规定执行。

(五) 产品风险等级

本计划风险等级为 R4(中高风险等级)，适合风险承受能力 C4 等级以上的普通投资者及专业投资者，包含法律法规及监管规定允许投资的个人投资者、机构投资者，及监管机构允许投资本单一计划的其他投资者，禁止低于本计划风险等级的投资者参与本计划。

(六) 资产管理计划的存续期限

本计划存续期限为自资产管理计划成立之日起【1】年，本合同提前终止时委托期限提前届满。

（七）资产管理计划的最低初始规模

本合同受托财产应以现金形式交付，初始受托财产不得低于 1000 万元人民币。

（八）本计划的费用

- 1、管理人的管理费：建仓期内不收取管理费，建仓期结束后固定管理费为 80 万元；
- 2、托管人的托管费：0.01%/年，累计不超过 20 万元（含）；
- 3、受托财产拨划支付的银行费用；
- 4、受托财产的证券账户的开户费用以及投资交易、清算、登记等实际发生的费用；
- 5、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、询证费等；
- 6、相关税费；
- 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）本计划的估值与核算、信息技术系统等服务机构

本计划的估值与核算、信息技术系统服务机构的服务机构为【信达证券股份有限公司】（基金业协会登记的会员编码为：PT0300000351）。

六、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、初始受托资产规模不低于 1000 万元，且全部划转至本计划托管账户及专用账户；
- 2、管理人确认初始受托资产到账后，向投资者和托管人发送《资产管理计划成立通知书》（见附件三），由投资者及托管人双方确认签收。投资者和托管人双方确认签收《资产管理计划成立通知书》的当日（若非同日报收，则为最后一方签收日的当日）为资产管理计划成立日。

（二）受托财产的移交

本计划受托财产应以现金形式交付，投资者初始受托资金不得低于 1000 万元人民币。投资者应及时将初始受托财产足额划拨至资产托管人为本受托财产开立的托管账户，并向管理人出具《初始受托财产缴付通知书》（见附件一）。资产托管人应于受托资产托管账户收到初始受托财产的当日传真《受托财产到账通知书》（见附件二）或邮件的形式发送。管理

人在收到《受托财产到账通知书》之后，向投资者和托管人发送《资产管理计划成立通知书》（见附件三）。

（三）资产管理计划的备案

管理人应在资产管理计划成立起 5 个工作日内报证券投资基金业协会备案。资产管理计划成立前，任何机构和个人不得动用投资者参与资金。资产管理计划在成立后备案完成前，不得开展投资活动，以现金管理为目的，投资于银行活期存款除外。

备案完成后，管理人应及时向托管人发送备案通过证明文件。

七、资产管理计划的参与和退出

（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营业场所。

（二）参与和退出时间

1、本计划的参与

本计划成立每周开放一次，一次不超过三天，如遇非工作日不开放、不顺延。投资者可在开放期内参与本计划。投资者参与本计划应至少于拟参与本计划之日前一个工作日向管理人提交缴付财产书面文件《受托财产追加通知书》（见附件四），并抄送托管人。资产托管人在参与本计划的财产到账当日向管理人传真《受托财产到账通知书》（见附件二）或邮件的形式发送扫描件至管理人处。管理人在收到《受托财产到账通知书》后，向投资者和托管人发送《受托财产运作确认书》（见附件五）。资产管理人和资产托管人在参与本计划资金到账当日将其确认为受托财产。管理人、托管人应按照本合同的约定分别管理和托管参与本计划的受托财产。

2、本计划的退出

本计划成立每周开放一次，一次不超过三天，如遇非工作日不开放、不顺延。投资者可在开放期内退出本计划。即当受托财产净值高于 100 万元人民币时，投资者可以提取部分托管账户项下受托资产，但提取后的受托财产净值不得低于 100 万元人民币。若投资者退出本计划后受托资产净值小于 100 万元的，管理人有权单方提前终止本合同，本产品进入终止清算程序。

投资者如需要退出本计划，应至少提前一个工作日向管理人提交《受托资产提取通知书》（见附件六）。托管账户内现金资产足额的，管理人应当在该通知载明的提取时间的基础上提前向托管人发送《划款指令》（见附件九），托管人审核无误后按照《划款指令》将相应

资产划往指定账户，托管人应于划款当日以电话通知管理人，并由管理人通知投资者。若本受托财产无法快速变现导致托管账户内现金资产不足额，管理人有权延期或拒绝办理投资者退出本计划。管理人和托管人不承担由于投资者通知不及时造成的资产变现损失。

若中国证监会有新的规定，或出现新的交易市场、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投资者。资产管理人以书面方式通知投资者即视为履行了告知义务。

（三）临时开放期

当法律法规发生修订导致本资产管理合同变更的，或者存在其他监管机构允许情形时，资产管理人为保障投资者选择退出本资产管理计划的权利，资产管理人有权视本计划实际运作情况设定临时开放期。此等情形下，该等临时开放期安排不受前述参与和退出安排的限制。临时开放期退出金额限制应符合本章节“（五）参与和退出的金额限制”的约定。

临时开放期的具体安排以资产管理人通知为准，届时资产管理人以书面方式通知投资者即视为履行了告知义务。

（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净值为基准进行计算。

2、资产管理计划采用金额参与、退出的方式，即参与、退出均以金额申请。

3、资产投资者办理参与、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约定的前提下，以资产管理人的具体规定为准。

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。资产管理人受理参与或退出申请并不表示对该申请是否成功的确认，而仅代表资产管理人确实收到了参与或退出申请。申请是否有效应以资产管理人的确认为准。资产管理人应在法律法规规定的时限内对资产投资者参与、退出申请的有效性进行确认。

资产投资者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退出资金先退出，确认日期在后的退出资金后退出，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,已交付的参与资金将无息退回资产投资者账户。投资者退出申请成交后,资产管理人应按规定向资产投资者支付退出款项,退出款项在自受理资产投资者有效退出申请之日起不超过1个工作日内划往资产投资者银行账户。在发生巨额退出时,退出款项的支付办法按本合同的约定和有关法律法规规定办理。

7、资产管理人在不损害资产投资者权益的情况下可更改上述原则,但最迟应在新的原则实施前1个工作日告知资产投资者。

(五) 参与和退出的金额限制

受托财产相关账户开立完毕后,投资者应通过投资者指定账户及时将参与资金足额划拨至资产托管人为资产管理计划财产开立的托管账户、证券账户或其他专用账户,资产托管人应于受托财产托管账户收到参与资金的当日向资产管理人发送受托财产到账的书面通知。

投资者在资产管理计划存续期开放日内参与的,每次参与金额应不低于1万元人民币。

当投资者持有的计划资产净值高于100万元人民币时,投资者可以选择全部或部分退出本计划;选择部分退出本计划的,投资者在退出后持有的计划资产净值应当不低于100万元人民币。当资产管理人发现投资者申请部分退出本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100万元人民币的,资产管理人有权适当减少投资者的退出金额,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100万元人民币。

当投资者持有的计划资产净值低于100万元人民币(含100万元人民币)时,需要退出计划的,经合同各方当事人协商一致可以提前终止本合同。

资产管理人可根据市场情况,依据法律法规规定合理调整对参与金额和退出的金额限制,资产管理人进行前述调整必须提前1个工作日告知投资者。

(六) 参与和退出的费用

1、参与费用与参与金额的计算方式

参与费率为0。

参与金额及参与费用的计算方法如下:

净参与金额=(参与金额+参与期间利息)/(1+参与费率)

参与费用=参与金额+参与期间利息-净参与金额

参与份额=净参与金额/参与申请当日的资产管理计划净值

其中,净参与金额及参与费用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。

2、退出费用与退出金额的计算方式

退出费率为0。

退出金额及退出费用的计算方法如下：

净退出金额=退出金额/（1+退出费率）

退出费用=退出金额-净退出金额

退出份额=净退出金额/退出申请当日的资产管理计划净值

其中，净退出金额及退出费用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、资产管理人可以在法律法规规定和本合同约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3个工作日书面告知资产投资者，并征得投资者同意。

（七）参与资金的利息处理方式（如有）

资产管理人应当将参与资金存入资产托管人为资产管理计划财产开立的托管账户、证券账户或其他专用账户，在确认参与有效前，任何机构和个人不得动用。投资者的参与资金（不含参与费用）在转出资产投资者指定账户后至资产管理人确认参与有效前发生的利息收入按银行活期存款利率（税后）计算。该利息收入在确认参与有效后归入受托财产。

（八）巨额退出的认定及处理方式

1、巨额退出的认定

单个工作日中，本资产管理计划需处理的净退出申请金额超过本资产管理计划上一工作日资产管理计划财产总值的20%时，即认为本资产管理计划发生了巨额退出。

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投资者的全部退出申请时，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。

（2）部分延期退出：当全额兑付资产投资者的退出申请有困难，或兑付资产投资者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，资产管理人可在该工作日接受部分退出申请，其余部分的退出申请在后续工作日予以受理。对于需要部分延期

办理的退出申请,除资产投资者在提交退出申请时明确做出不参加顺延下一个工作日退出的表示外,自动转为下一个工作日退出处理,以下一工作日资产管理计划财产总值作为退出价格确定依据,以此类推,直到全部退出为止,本计划进入终止清算程序。部分退出导致资产投资者持有的计划资产净值低于【100】万元人民币的,资产管理人可按全额退出处理,本计划进入终止清算程序。

(3) 巨额退出的通知:当发生巨额退出并部分延期退出时,资产管理人应当通知资产投资者,并说明有关处理方法;同时资产管理人应当按照法律法规的规定及时履行报告义务(如需)。

(4) 出现连续巨额退出时,即连续2个开放日以上(含本数)发生巨额退出,如资产管理人认为有必要,可暂停接受退出申请;已经接受的退出申请可以延缓支付退出款项。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,资产管理人应当通知资产投资者,并说明有关处理方法;同时资产管理人应当按照法律法规的规定及时履行报告义务(如需)。

(九) 拒绝或暂停参与、暂停退出的情形及处理

1、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) 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,从而损害资产管理计划资产投资者的利益的情形。

(2) 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)。

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

(4) 法律法规规定或经中国证监会认定或本合同约定的其他情形。

资产管理人决定拒绝接受资产投资者的参与申请时,参与款项将无息退回资产投资者账户。

2、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投资者的参与申请。

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

(3) 发生本资产管理计划合同约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或本合同约定的其他情形。

资产管理人决定暂停接受全部或部分参与申请时,应当告知资产投资者。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投资者。

3、在如下情况下，资产管理人可以暂停接受资产投资者的退出申请：

(1) 因不可抗力导致资产管理人无法支付退出款项。

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

(3) 发生本资产管理计划合同约定的暂停资产管理计划资产估值的情况；

(4) 发生连续巨额退出；

(5) 法律法规规定或经中国证监会认定或本合同约定的其他情形。

发生上述情形之一的，资产管理人应当及时告知资产投资者。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，其余部分在后续开放日予以支付。

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

4、暂停资产管理计划的参与、退出时，资产管理人应按规定告知资产投资者并履行相应报告程序（如需）。

5、暂停参与或退出期间结束，资产管理计划重新开放时，资产管理人应按规定告知资产投资者并履行相应报告程序（如需）。

(十) 其他事项

本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。

八、资产管理计划的投资

(一) 投资目标

本计划主要投资于有发展前景的上市公司股票、有转股价值的上市公司可转换债券等，在有效控制投资风险的前提下，力争实现计划资产的稳定增值。

(二) 投资范围及比例

1、投资范围

(1) 国内依法发行上市的股票（包括主板、创业板、科创板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证）、港股通标的股票。

(2) 银行间市场和交易所市场上市交易的国债、政策性金融债、政府支持机构债、金融债（含混合资本债、次级债、二级资本债、永续债、次级永续债）、地方政府债、中央银

行票据、企业债券（含永续债）、公司债券（含非公开发行公司债券、永续公司债）、中期票据（含永续中票等）、短期融资券、超短期融资券、非公开定向债务融资工具、可交换债券、可转换债券、资产证券化产品[资产支持证券 ABS、资产支持票据 ABN]等、现金、银行存款（包括定期存款、活期存款、协议存款、同业存款等）、同业存单、结构性存款、债券回购（包含正回购和逆回购），以及其他法律法规或政策许可投资的固定收益证券品种。

（3）经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金份额[包括但不限于场内 ETF、LOF、QDII 基金、封闭式基金、上市定期开放式基金、香港互认基金、商品基金、公募 REITs]；证券公司及资管子公司、期货公司及期货公司子公司、基金公司及基金子公司、保险资管、信托公司、商业银行及理财子公司、在中国证券投资基金业协会备案的私募基金管理人发行的资产管理产品（含 QDII 产品）。

（4）特别揭示：本计划可进行债券正回购、逆回购业务。

2、投资比例

权益类资产占总资产的比例不低于 80%；

法律法规或中国证监会允许单一计划投资其他品种的，资产管理人在履行本合同约定的程序后，可以将其纳入本计划的投资范围。在投资运作前，管理人应与托管人就新增投资品种的清算交收、估值核算等达成书面一致同意。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本单一计划，管理人在履行适当程序后，则本单一计划投资不再受相关限制。

（三）投资比例超限的处理方式及流程

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管理人之外的因素导致资产管理计划投资不符合法律、行政法规和中国证监会规定的投资比例或者合同约定的投资比例的，管理人应当在流动性受限财产可出售、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，管理人应当及时向中国证监会相关派出机构报告。

（四）风险收益特征

本产品风险等级为 R4(中高风险等级)，适合风险承受能力 C4 等级以上的普通投资者及专业投资者，包含法律法规及监管规定允许投资的个人投资者、机构投资者，及监管机构允许投资本单一计划的其他投资者，禁止低于本计划风险等级的投资者参与本计划。

（五）投资策略

1、决策依据

本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》等有关法律文件；

（2）宏观经济发展态势、微观经济运行环境和证券市场走势。这是本计划投资决策的基础；

（3）投资对象收益和风险的配比关系。在充分权衡投资对象的收益和风险的前提下做出投资决策，是本计划维护投资者利益的重要保障。针对产品的特点，在衡量投资收益与风险之间的配比关系时，力争保护投资者的本金安全，在此基础上为投资者争取较高的收益；

（4）管理人关于资产管理业务的内部各项制度性文件。

2、决策程序

（1）管理人研究开发中心公开发布的研究报告、外部研究机构及资产管理事业部投研人员提供宏观分析、市场分析等各类研究报告，为本计划的投资管理提供决策依据；

（2）资产管理事业部投研组根据上述研究报告，结合对证券市场和投资品种的分析判断，形成本计划的投资预案，包括策略制定及品种选择；

（3）资产管理业务投资决策委员会审议资产管理事业部投资预案，并对本计划的资产配置比例等提出指导性意见，投资经理在授权范围内做出投资决策；

（4）资产管理事业部投研组依据资产管理业务投资决策委员会决议，运用定量和定性方法进行研究，经过评级、估值和风险评判，形成投资组合配置比例及交易策略。投资经理在既定的资产配置比例和投资策略安排下，结合对证券市场的分析判断，具体构造投资组合并决定买卖时机，向交易室下达投资指令。交易员审核后具体品种的交易；

（5）资产管理事业部风险控制岗对投资计划的执行进行日常监督，并对重大事项提出风险控制意见上报资产管理业务投资决策委员会。

3、投资管理的方法和标准

（1）权益类投资策略

本计划主要投资于有发展前景的上市公司股票及可转债，在有效控制投资风险的前提下，力争实现计划资产的稳定增值。

管理人对上市公司进行充分尽调，并对公司所处行业进行研究，按照管理人内部决策流程进行了审批和授权。

（2）普通债券投资策略

本计划债券投资的目的是在保证本计划资产流动性的基础上，有效利用本计划资产，提高本计划资产的投资收益。

本计划管理人将基于对国内外宏观经济形势的深入分析、国内财政政策与货币市场政策等因素对各类债券的影响，进行合理的利率预期，判断市场的基本走势，制定久期控制下的资产类属配置策略。在债券投资组合构建和管理过程中，本计划管理人将重点关注非信用类混合类证券（国债、中央银行票据等），具体采用期限结构配置、市场转换、信用利差和相对价值判断、信用风险评估、现金管理等管理手段进行个券选择。

（3）可转换债券投资策略

本计划通过自下而上的标的正股分析和转股条款分析，寻找有转股价值的可转换债券，以转股为目的对可转债进行投资，投资后在达到转股条件后择机转股。

（4）现金类资产投资策略

本单一计划将在确定总体流动性要求的基础上，结合不同类型现金类资产的流动性和预期收益水平、银行存款的期限来确定资产的配置，并定期对以上资产组合平均剩余期限以及投资品种比例进行适当调整。

（六）投资限制

为切实维护投资者的合法权益，受托资产的投资遵循以下限制：

1、本计划参与债券、可转换公司债券等证券发行申购时，本计划所申报的金额原则上不得超过该资产管理计划的总资产，本计划所申报的数量原则上不得超过拟发行公司本次发行的总量；

2、不得将受托财产用于可能承担无限责任的投资；

3、不得进行利益输送或商业贿赂；

4、不得承销证券、向他人贷款或提供担保；

5、不得从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；

6、不得直接投资商业银行信贷财产；

7、不得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、不得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；

9、本计划所投资的其他资产管理产品不再投资于除货币市场基金以外的其他资产管理计划；

10、本单一计划总资产不超过净资产的 200%。本计划投资于同一发行人及其关联方发行的债券的比例超过其净资产 50%的，本计划的总资产不得超过本计划净资产的 120%。如法律法规或监管部门修改或取消上述限制，履行适当程序后，本计划可相应调整投资组合限制的规定；

11、法律法规、国家政策和本合同约定禁止从事的其他投资。

（七）资产管理计划的建仓期

建仓期自产品成立之日起不得超过 6 个月。除以现金管理为目的，投资于银行活期存款外，建仓期内的投资活动，应当符合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。建仓期结束，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。

（八）为规避特定风险投资超标

投资者同意并授权管理人：资产管理计划存续期间，为规避特定风险，经投资者同意后，本计划投资于权益类资产的比例可以低于计划总资产 80%，但不得持续 6 个月低于计划总资产 80%。**投资者签署本合同即视为同意前述条款。**特定风险包括但不限于以下风险：

1、特定市场风险。因管理人判断市场行情或近期走势不利于、不兼容、不适合本计划投资策略，若投资于权益类资产的比例超过总资产 80%将不利于本计划投资收益的稳定或可能造成本计划承受特定市场风险；

2、特定流动性风险。因管理人判断市场行情流动性不足，投资于权益类资产持仓比例超过 80%不利于本计划、可能使得本计划产生流动性的风险，或为应对本计划提取、收益分配、清算等需要，管理人有权进行减仓或者平仓操作。

（九）财产组合的流动性与本计划的参与、分配安排相匹配

在本合同有效期内，本计划在受托资产运作起始日当日，以书面形式通知投资者资产管理计划成立（见附件《资产管理计划成立通知书》），本计划存续期内每周开放一次，一次不超过三天，如遇节假日不开放、不顺延。具体时间以管理人和投资者书面确认的受托资产追加、提取通知书为准，投资者可以在开放日办理本计划的参与、退出。本计划的退出流程应符合本合同“七、资产管理计划的参与和退出”中“（四）参与和退出的方式、价格、程序及确认等”的相关约定，管理人和托管人不承担由于投资者通知不及时造成的资产变现损失。

九、服务机构及投资顾问

本资产管理计划不聘请其他机构为资产管理计划提供估值、投资顾问等服务。本资产管理计划由管理人提供估值与核算、信息技术系统服务。管理人具体信息如下：

名称：信达证券股份有限公司

法定代表人：祝瑞敏

住所：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼

通讯地址：北京市西城区宣武门西大街甲127号金隅大厦B座

邮政编码：100031

客服电话：95321

基金业协会登记的会员编码为：PT0300000351

十、利益冲突及关联交易

（一）关联交易

1、关联交易的范围

关联交易是指管理人运用其管理的资产管理计划的资产投资于管理人、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（包括逆回购交易的质押券）、承销期内承销的证券，与前述关联方作为交易对手的交易，以及从事其他投资相关的关联交易。

关联方按照《企业会计准则》的规定确定，管理人的关联方名单以管理人公开披露的最新年报以及管理人公司网站公告（如有）为准。托管人关联方名单以中国建设银行股份有限公司公开披露的最新年报为准。

2、重大关联交易与一般关联交易

管理人将对本计划可能涉及的关联交易进行分层管理。具体而言，管理人根据交易的性

质和金额将关联交易区分为一般关联交易和重大关联交易。

（1）重大关联交易

满足以下任一条件的关联交易属于重大关联交易：

1）除高管战略配售资产管理计划、员工持股计划等特定目的资产管理计划外，买卖管理人、托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司发行的证券或承销期内承销的证券；

2）与管理人及其控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司开展逆回购交易，或回购交易中的质押券为相关关联方发行的证券。

其他重大利害关系的公司指管理人、托管人及其控股股东、实际控制人可以实际控制的企业。

（2）一般关联交易

满足以下任一条件的关联交易属于一般关联交易：

1）与管理人、托管人及其控股股东、实际控制人或者其他关联方开展的正回购交易；

2）高管战略配售资产管理计划、员工持股计划等特定目的资产管理计划，所投资的股票为管理人、托管人及其控股股东、实际控制人或者其他关联方承销期内承销的股票，或者该等股票的发行人为管理人、托管人及其控股股东、实际控制人或者其他关联方的，该等特定目的资产管理计划投资该上市公司股票的；

3）除第1条规定的重大关联交易以外的关联交易。

若后续法律法规或监管部门及有权机关关于一般关联交易及重大关联交易作出相关的认定标准，管理人在履行相关程序后，将以相关法律法规、监管部门及有权机关的最新规定为准。

3、管理人关于关联交易的内部管控机制

（1）管理人关联交易的审批和评估机制

管理人已经建立健全关联交易内部审批机制和评估机制：管理人按照实际投资需求，按照管理人、托管人及其关联方清单谨慎开展关联交易，按照公司制度规定的定价规则充分评估关联交易定价的公允性，并对包括但不限于定价结果、交易必要性等要素作出说明、提交审批。

在实际投资运作中，管理人应当遵循投资者利益优先原则，采取切实有效措施，防范利益冲突，保护投资者合法权益。拟开展一般关联交易时，投资经理发起申请，并对关联交易

要素作出说明，提交风控岗在投资交易系统完成临时风控参数设置操作（如需要）；拟开展重大关联交易时，投资经理将该议案提交资产管理业务投资决策委员会审议，并对交易要素作出说明，投资决策委员会审议通过后，风控岗在投资交易系统完成临时风控参数设置操作（如需要）。

除公司章程外，管理人专门制定了《关联交易管理制度》《关联交易管理工作指引》《资产管理业务关联交易管理工作指引》等规章制度，进一步明确公司相关部门职责分工、规范关联交易行为。管理人稽核审计部对关联交易事项及制度执行情况进行稽核检查。

（2）管理人运用本单一计划资产从事关联交易的，应当遵守法律、行政法规、中国证监会的规定和本合同约定，并有充分证据证明未损害投资者利益。

对于一般关联交易，投资者签订本合同即视为在此同意并授权管理人运用本计划资产从事一般关联交易，管理人无需另行取得投资者同意。

对于重大关联交易，管理人应逐笔提前以书面方式告知投资者，并取得投资者同意后，方可进行相应的投资，并在投资后及时将投资结果以书面方式告知投资者和托管人。

管理人重大关联交易的通知邮箱为：【csc@cindasc.com】，投资者重大关联交易接收邮箱为：【wanghongguan@cinda.com.cn】。

（二）利益冲突的情形

本计划在投资和运作过程中可能会存在一些利益冲突情形，包括但不限于：本计划可租用管理人关联方提供的证券交易单元；管理人、托管人开展不同业务类型可能产生的利益冲突；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；其他可能产生利益冲突的情况等。

此外，管理人可以在遵循法律法规和相关原则的前提下运用自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。

资产管理计划在投资运作过程中存在利益冲突情形的，资产管理人将从充分维护投资者利益角度积极处理该等利益冲突情形，防范利益输送等违法违规行为。在发生该等利益冲突时，资产管理人将视具体利益冲突情形和重要程度选择在向投资者提供的定期报告或临时报告中披露，具体披露内容包括利益冲突情形、处理方式、对投资者利益的影响等。

（三）如法律法规、监管要求对利益冲突事项或从事关联交易的条件和要求进行变更的，

在履行适当程序后，本单一计划将按照变更后的规定执行。

十一、投资经理的指定与变更

（一）本资产管理计划的投资经理由资产管理人负责指定。本资产管理计划的投资经理为【余婧】。

投资经理简介如下：余婧，复旦大学理学硕士，10年以上从业经验。2023年9月加入信达证券资产管理事业部，曾任职于中泰证券，山西证券等券商，具有丰富的权益类投研工作经验；策略类型包括量化选股、指数增强、量化中性以及各类套利策略等。擅长运用各类数据进行量化建模，并结合衍生品工具和风险模型有效控制组合波动。

（二）投资经理变更的条件和程序

资产管理人可根据业务需要变更投资经理，投资经理变更后，资产管理人应及时通知投资者及资产托管人。

资产管理人保证变更后的投资经理符合法律法规及本合同的规定。

十二、资产管理计划的财产

（一）资产管理计划财产的保管与处分

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

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

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

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

5、资产管理计划财产产生的债权不得与不属于资产管理计划财产本身的债务相互抵销。

非因资产管理计划财产本身承担的债务，管理人、托管人不得主张其债权人对受托财产强制执行。上述债权人对资产管理计划财产主张权利时，管理人、托管人应明确告知资产管理计划财产的独立性，采取合理措施并及时通知投资者。

6、证券类资产及证券交易资金的保管

资产管理计划投资形成的证券类资产，由相关法定登记或托管机构根据法律法规的规定实行第三方保管；证券交易结算资金由相关证券经纪商和存管银行保管。对于在未经托管人同意的情况下管理人自行变更证券经纪商或存管银行造成的损失，及因证券经纪商原因导致证券交易结算资金无法正常转账支取造成的损失，由过错方承担责任。

（二）资产管理计划财产相关账户的开立和管理

管理人或托管人按照规定为本计划开立托管资金账户、证券账户和期货账户等投资所需账户。证券账户和期货账户的持有人名称应当符合证券、期货登记结算机构的有关规定。开立的上述资产管理计划财产账户与管理人、托管人自有的财产账户以及其他计划财产账户相独立。对于托管人办理开户的，投资者和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。

1、资产管理计划财产托管资金账户的开立和管理

资产托管人按照有关规定开立资产管理计划的托管账户及其他投资所需账户，投资者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。

（1）账户的开设与管理由资产托管人根据管理人委托，按照相关法律法规规定和有关业务规则办理。产品管理人应依法履行产品投资人识别义务，在开立托管账户时按照开户银行要求，就相关信息的提供、核实等提供必要的协助，并确保所提供信息以及证明材料的真实性、准确性。托管资金账户名称应为本资产管理计划的名称，与托管资金账户有关的预留印鉴由资产托管人保管和使用。资产托管人应及时将有关托管资金账户的开通信息通知管理人。托管资金账户信息详见附件十二。

本资产管理计划的一切货币收支活动，包括但不限于投资、支付提取金额、支付计划收益、收取初始受托资金/参与本计划资金，均需通过该托管资金账户进行。

（2）托管资金账户的开立和使用，限于满足开展本资产管理计划业务的需要。托管人和管理人不得假借本资产管理计划的名义开立其他任何银行账户；亦不得使用本计划的任何

银行账户进行本资产管理计划业务以外的活动。

(3) 托管资金账户的管理应符合有关法律法规的规定。

2、证券账户的开立和管理

根据管理人的申请，管理人、托管人按照规定开立计划财产证券账户。管理人、托管人应当在开户过程中相互配合，并提供所需资料。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。

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

证券账户卡的保管由托管人负责，证券账户的管理和运用由管理人负责。

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。

十三、投资指令的发送、确认和执行

(一) 交易清算授权

1、授权通知的内容

资产管理人应事先向资产托管人提供书面《授权通知书》（见附件八，以下称“授权通知”）原件，指定划款指令的被授权人员及被授权印鉴，授权通知的内容包括被授权人的名单、签章样本、权限和预留印鉴。资产管理人撤换被授权人员、改变被授权人员的权限或更改被授权印鉴，须提供变更后的新的授权通知。授权通知应加盖资产管理人公司公章并由法定代表人或其授权代表签署，若由授权代表签署，还应附上法定代表人的授权书。

2、授权通知的确认

合同成立时的授权通知，在资产托管人收妥原件后于授权通知载明的生效时间生效。资产托管人收到的授权通知原件的日期晚于通知中载明的生效日期的，则以晚到的为准。

（二）投资指令的内容

划款指令是在管理受托财产时，资产管理人向资产托管人发出的交易成交单、交易指令及资金划拨类指令（以下简称“指令”，见附件九）。指令应加盖预留印鉴并由被授权人签章。资产管理人发给资产托管人的资金划拨类指令应写明日期、款项事由、大小写金额、出款和收款账户信息等。

（三）投资指令的发送、确认和执行

1、指令的发送

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依照授权通知的要求用邮件或传真方式或其他资产托管人和资产管理人书面认可的方式向资产托管人发送。对于采用电子直连方式发送指令的，管理人、托管人应签署《中国建设银行电子直连协议》（以实际签约名称为准），双方应遵守该协议关于电子直连方式的具体托管操作安排。管理人有权在发送指令后与托管人进行确认。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，由过错方承担责任。资产管理人在发送指令时，应确保相关出款账户有足够的资金余额，若因账户资金不足造成未能及时划款，托管人不承担任何形式责任。若对划款到账时间有时点要求，需为资产托管人留出执行指令所必需的时间(2 个工作小时)。

对于场内业务，首次进行场内交易前资产管理人应与资产托管人确认已完成交易单元和股东代码设置后方可进行。

对于银行间业务，资产管理人应于交易日 15:00 前将银行间成交单及相关划款指令发送至资产托管人。资产管理人应与资产托管人确认资产托管人已完成证书和权限设置后方可进行资产管理计划的银行间交易。

对于指定时间出款的交易指令，资产管理人应提前 2 个工作小时将指令发送至资产托管人；对于资产管理人于 15:00 以后发送至资产托管人的指令，资产托管人应尽力配合出款工作，但如未能出款时资产托管人不承担责任。

2、指令的确认

资产管理人有义务在发送指令后与资产托管人以电话的方式进行确认。指令以获得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。对于依照“授权通知”发出的指令，

资产管理人不得否认其效力。

3、指令的执行

资产托管人确认收到资产管理人发送的指令后，应对指令进行形式审查，验证指令的要素是否齐全，传真指令还应审核印鉴和签章和预留印鉴和签章样本的一致性，指令复核无误后应在规定期限内及时执行，不得延误。资产管理人发送划款指令时应根据托管人要求同时向托管人发送必要的投资合同、费用发票（如有）等划款证明文件的复印件。资产托管人需对资产管理人提交的划款指令按照本合同约定进行审查，资产管理人应保证上述文件资料合法、真实、完整和有效。如因资产管理人提供的上述文件不合法、不真实、不完整或失去效力而影响资产托管人的审核或给任何第三人带来损失，管理人应承担相应责任。若存在要素不符或其他异议，资产托管人应及时与资产管理人进行确认，暂停指令的执行并要求资产管理人重新发送指令。资产托管人可以要求资产管理人邮件、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。资产托管人待收齐相关资料并判断指令有效后重新开始执行指令。资产管理人应在合理时间内补充相关资料，并给资产托管人预留必要的执行时间。在指令未执行的前提下，若资产管理人撤销指令，资产管理人应在原指令上注明“作废”并加盖预留印鉴及被授权人签章后邮件、传真给资产托管人，并电话通知资产托管人。

（四）资产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

资产托管人发现资产管理人发送的指令有可能违反《基金法》、本合同或其他有关法律法规的规定时，应暂缓执行指令，并及时通知资产管理人，资产管理人收到通知后应及时核对并纠正。

资产管理人对在托管过程中提供给资产托管人的一切合同、文件、资料的真实性、准确性和完整性负责。

（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，与预留印鉴不符，指令中重要信息错误、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纠正。

（六）更换投资指令被授权人的程序

资产管理人若对授权通知的内容进行修改,应当提前至少一个工作日提供书面的变更授权通知文件,以邮件的形式送达资产托管人确认,并及时电话通知资产托管人。变更授权通知文件应加盖公章及法定代表人或授权代表签字或签章并写明生效时间,若由授权代表签署,还应附上法定代表人的授权书。变更后的新的授权通知经托管人确认后于授权通知载明的生效时间生效,如托管人收到授权通知的日期晚于授权通知载明的生效日期的,以托管人确认收到的日期作为授权通知生效的日期,同时原授权通知失效。变更授权通知文件在邮件发出后五个工作日内送达文件正本。新的授权通知生效之后,正本送达之前,托管人按照新的授权通知邮件内容执行有关业务,如果新的授权通知正本与邮件内容不同,以托管人收到的邮件为准。资产管理人和资产托管人对授权通知负有保密义务,其内容不得向授权人、被授权人及相关操作人员以外的任何人泄露。

(七) 指令的保管

指令若以传真、扫描形式发出,则正本由资产管理人保管,资产托管人保管指令传真件、扫描件。当两者不一致时,以资产托管人收到的指令传真件、扫描件为准。

(八) 相关责任

对资产管理人在资产管理计划托管账户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,资产托管人不承担因为不执行该指令而造成的损失。资产托管人正确执行资产管理人发送的指令,受托财产发生损失的,资产托管人不承担相应的责任。因资产管理人原因造成的传输不及时、未能留出足够执行时间、未能及时与资产托管人进行指令确认致使资金未能及时清算或交易失败所造成的损失由资产管理人承担。在正常业务受理渠道和指令规定的时间内,因资产托管人故意或重大过失未能及时或正确执行合法合规的有效指令而导致受托财产受损的,资产托管人应承担相应的责任,但因不可抗力原因的情况除外。

资产托管人根据本合同相关规定履行审核职责,如果资产管理人的指令存在事实上未经授权、欺诈、伪造或未能及时提供授权通知等情形,资产托管人不承担因执行有关指令或拒绝执行有关指令而给资产管理人或受托财产或任何第三方带来的损失,但资产托管人未按合同约定审核义务执行指令而造成损失的情形除外。

十四、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约定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

资产托管人对于约定监督的越权交易中，发现资产管理人的划款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，及时通知资产管理人并有权报告中国证监会相关派出机构。

资产托管人对于约定监督的越权交易中，发现资产管理人依据交易程序已经生效的划款指令违反法律、行政法规和其他规定，或者违反本合同约定的，应当及时通知资产管理人并有权报告中国证监会相关派出机构。

资产管理人应向投资者和资产托管人主动报告越权交易。在限期内，投资者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。资产管理人对投资者和资产托管人通知的越权事项未能在限期内纠正的，资产托管人有权报告中国证监会相关派出机构。

- 2、越权交易所发生的损失及相关交易费用由资产管理人负担，所发生的收益归本受托财产所有。

（三）资产托管人对资产管理人的投资监督

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的本小节约定及法律法规的规定进行监督，对本计划的投资范围、投资比例、投资限制、关联方交易进行严格监督，及时提示管理人：

（1）投资范围

（1）国内依法发行上市的股票（包括主板、创业板、科创板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证）、港股通标的股票。

（2）银行间市场和交易所市场上市交易的国债、政策性金融债、政府支持机构债、金融债（含混合资本债、次级债、二级资本债、永续债、次级永续债）、地方政府债、中央银行票据、企业债券（含永续债）、公司债券（含非公开发行公司债券、永续公司债）、中期票据（含永续中票等）、短期融资券、超短期融资券、非公开定向债务融资工具、可交换债券、可转换债券、资产证券化产品[资产支持证券 ABS、资产支持票据 ABN]等、现金、银行存款（包括定期存款、活期存款、协议存款、同业存款等）、同业存单、结构性存款、债券回购（包含正回购和逆回购），以及其他法律法规或政策许可投资的固定收益证券品种。

（3）经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金份额[包括但不限于场内 ETF、LOF、QDII 基金、封闭式基金、上市定期开放式基金、香港互认基金、商品基金、公募 REITs]；证券公司及资管子公司、期货公司及期货公司子公司、基金公司及基金子公司、保险资管、信托公司、商业银行及理财子公司、在中国证券投资基金业协会备案的私募基金管理人发行的资产管理产品（含 QDII 产品）。

（4）特别揭示：本计划可进行债券正回购、逆回购业务。

（2）投资比例

权益类资产占总资产的比例不低于 80%；

法律法规或中国证监会允许单一计划投资其他品种的，资产管理人在履行本合同约定的程序后，可以将其纳入本计划的投资范围。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本单一计划，管理人在履行适当程序后，则本单一计划投资不再受相关限制。如因投资需要或法律法规修改导致托管人监督事项发生变化的，需经投资者、管理人和托管人协商一致后履行必要的合同变更流程，还应为托管人调整监督事项留出必要的时间。

（3）投资限制

1）本计划所投资的其他资产管理产品不再投资于除货币市场基金以外的其他资产管理计划；

2）本单一计划总资产不超过净资产的 200%。本计划投资于同一发行人及其关联方发行的债券的比例超过其净资产 50%的，本计划的总资产不得超过本计划净资产的 120%。如

法律法规或监管部门修改或取消上述限制，履行适当程序后，本计划可相应调整投资组合限制的规定；

3) 法律法规、国家政策和本合同约定禁止从事的其他投资。

2、资产托管人对资产管理人的投资监督自本计划成立之日起开始。

3、资产托管人发现资产管理人的投资运作违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反本合同时，应当拒绝执行，应当及时通知资产管理人，并通知资产管理人限期纠正。

4、资产托管人发现资产管理人可能存在违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反本合同约定，但难以明确界定时，应及时报告资产管理人。资产管理人应及时予以答复，资产管理人未及时予以答复的，资产托管人有权报告中国证监会相关派出机构。

5、在限期内，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。资产管理人对资产托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，资产托管人应通知资产管理人，并有权报告中国证监会相关派出机构。

6、管理人应于合同生效前提供关联方名单，并在合同期限内根据变化及时更新关联方名单。托管人仅根据管理人提供的名单，在托管人系统可识别监控范围之内对资产管理计划进行关联交易监督。若管理人没有及时提供关联方信息，导致托管人无法及时对关联方证券进行监督，由过错方承担相应的责任。

7、如因投资需要或法律法规修改导致托管人监督事项发生变化的，各方除履行必要的合同变更流程外，还应为托管人调整监督事项留出必要的时间。

十五、资产管理计划财产的估值和会计核算

(一) 估值目的

资产管理计划财产估值目的是准确、真实地反映资产相关金融财产和金融负债的公允价值及受托财产是否增值、保值。

(二) 估值时间

资产管理人与资产托管人每个交易日对资产管理计划进行估值，管理人每个工作日（T

日)对当日的受托财产进行核算与估值,并由托管人复核。

(三) 估值方法

资产管理人如采用本项规定的方法对受托财产进行估值,均应被认为采用了适当的估值方法。但是,如果资产管理人认为按本项规定的方法对受托财产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,并与资产托管人商定后,在符合最新法律法规要求情况下重新确定新的估值方法。具体投资品种估值方法:

1、证券交易所上市的有价证券的估值方法:

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(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、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市价(收盘价)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、权证,采用估值技术确定公允价值;

(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、协议转让方式取得的带有交易限制的股票等,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.债券的估值方法

(1)对于已上市交易或挂牌转让的不含权固定收益品种(本合同另有规定的除外),选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值全价进行估值;交易所公开发行上市交易的可转换债券除外。

(2)对于已上市或已挂牌转让的含权固定收益品种(本合同另有规定的除外),选取第三方估值基准服务机构提供的相应品种当日的唯一估值全价或推荐估值全价。对于含投资者回售权的固定收益品种,行使回售权的,在回售登记日至实际收款日期间选取第三方估值基准服务机构提供的相应品种的唯一估值全价或推荐估值全价,同时应充分考虑发行人的信

用风险变化对公允价值的影响。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。

（3）交易所市场上市交易的公开发行的可转换债券等有活跃市场的含转股权的债券，实行全价交易的债券选取估值日收盘价作为估值全价；实行净价交易的债券选取估值日收盘价并加计每百元税前应计利息作为估值全价。

（4）对于未上市或未挂牌转让且不存在活跃市场的固定收益品种，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定其公允价值。

（5）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。

4、银行定期存款或通知存款以成本列示，按协议或合同商定利率在实际持有期间内逐日计提利息，在利息到账日以实收利息入账，如有差额，不做追溯调整。

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

6、如有确凿证据表明按上述规定不能客观反映受托财产公允价值的，管理人和托管人可根据具体情况协商，按最能反映受托财产公允价值的方法估值。

7、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。

如资产管理人、托管人条件具备，并一致决定采用第三方估值机构提供的数据对以上某类交易品种进行估值更能科学地体现公允价值的，以届时签署的补充协议为准。

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。

（四）估值对象

估值对象为组合所持有的 A 股上市公司股票、可转债、基金和银行存款本息等财产及负债。

（五）估值程序

管理人每个工作日对当日的受托财产进行核算与估值，并由托管人完成复核。估值原则

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。如估值结果需要对外公布，管理人和托管人先通过电话形式核对一致后，管理人将加盖有效预留业务章或公章的财产净值表以传真或通过邮件发送扫描件方式发送给托管人，托管人对净值计算结果复核后以传真或邮件方式传送给管理人，由管理人对外公布。管理人经托管人催告仍不按约定与托管人对账，导致托管人无法及时履行投资监督职责的，由管理人承担相应的责任。

（六）估值错误的处理

如管理人或托管人发现财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投资者利益时，应立即通知对方，共同查明原因，协商解决。

根据有关法律法规，受托财产净值计算和会计核算的义务由管理人承担。本受托财产的会计责任方由管理人担任。因此，就与本财产有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致意见，以管理人的意见为准。

当受托财产估值出现错误时，管理人和托管人应该立即报告投资者，并举证证明已经在过程中采取必要、适当、合理的措施进行检查，在投资者同意后，立即更正。

对于因税收规定调整或其他原因导致计划实际缴纳税金与估值计提的应交税金有差异的，计划将在相关税金调整日或实际支付日进行相应的估值调整。相关估值调整不作为计划财产估值错误处理。

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，进而导致受托财产净值计算错误造成投资者的损失，以及由此造成以后交易日受托财产净值计算顺延错误而引起的投资者的损失，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登记结算公司及证券经营机构发送的数据错误，或由于其他不可抗力原因，资产管理人和资产托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误的，由此造成的受托财产估值错误，资产管理人和资产托管人免除赔偿责任。但资产管理人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。

（七）估值调整的情形与处理

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,根据法律法规和监管规定或第三方公允估值对持仓证券的估值进行重新调整,按最能反映公允价值的价格估值。

(八) 暂停估值的情形

- 1、受托财产投资所涉及的交易场所遇法定假日或因其他原因暂停营业时;
- 2、因其他任何不可抗力致使资产管理人、资产托管人无法准确评估受托财产价值时;
- 3、占受托财产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,决定延迟估值并征得资产托管人同意的;
- 4、中国证监会认定的其他情形。

(九) 资产管理计划财产净值的确认

受托财产指投资者拥有合法处分权、受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。

受托财产净值,是指受托财产总值减去负债后的价值。受托财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。受托财产份额净值的计算保留到小数点后4位,小数点后第5位四舍五入。

(十) 资产管理计划的会计政策

资产管理计划的会计政策比照现行政策或按照资产管理合同约定执行。

- 1、本受托财产的会计年度为公历年度的1月1日至12月31日。
- 2、受托财产核算以人民币为记账本位币,以人民币元为记账单位。
- 3、会计制度执行国家有关会计制度。
- 4、本受托财产单独建账、独立核算。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受托财产会计报表。
- 5、资产托管人应定期每月与管理人就上月最后一个自然日受托财产的估值表、资产负债表以及上月利润表进行核对。

十六、资产管理计划的费用与税收

(一) 根据有关法律法规及相应合同协议的规定, 可以按实际支出金额列入或摊入受托资产管理业务当期费用的种类:

- 1、管理人的管理费;
- 2、托管人的托管费;
- 3、受托财产的管理运用、处分而发生的银行手续费(如汇划邮电费、汇划中转费等)、账户开户费用、税费及交易费用;
- 4、受托财产的证券交易费用;
- 5、受托财产变现费用、受托财产运作及清算过程中涉及的政府规费、手续费用、向第三方追偿费用(包括但不限于诉讼费、仲裁费、律师费、公证费、评估费、鉴定费、查询费、财产保全费、执行费用、差旅费拍卖费及其他形式的财产处置费);
- 6、受托财产运作过程中涉及的聘请中介机构费用, 包括但不限于审计费、项目监管费、律师费、公证费、评估费、鉴定费等;
- 7、相关税费;
- 8、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。

(二) 费用计提方法、计提标准和支付方式

1、管理费的计算方式及支付方式

(1) 固定管理费的计算方式及支付方式

本计划建仓期内不收取管理费, 建仓期结束后, 本计划一次性支付管理费 80 万元。经资产管理人和资产托管人核对后, 由资产托管人按照约定的方式于管理费结算日后五个工作日之内从资产管理计划财产中一次性支付给资产管理人。若因法定节假日、休息日, 或战争、自然灾害等不可抗力致使无法按时支付的, 则在不可抗力情形消除后的首个工作日支付。

管理人指定的接收管理费的银行账户信息如下:

开户名称: 信达证券股份有限公司

开户银行: 中国建设银行北京前门支行

账号：11001005100053013161

大额支付行号：105100001028

（2）业绩报酬的计算方式及支付方式

本计划不收取业绩报酬。

2、托管费的计算方式及支付方式

本计划托管费按当日受托资产实收资本余额的 0.01% 年费率计提，具体计算方法如下：

$$H=E \times 0.01\% \div 360$$

托管人收取的托管费为包含增值税的含税价款 H 为每日应计提的托管费；

E 为本计划当日受托资产实收资本余额。

本计划的托管费累计总额最高不超过 20 万元（含），托管人的托管费按日累计，支付时间与管理人管理费支付时间一致。由管理人向托管人发送划付截至结算日已计提的托管费的指令，托管人复核无误后于结算日后的五个工作日内从托管专户资产中一次性扣除支付给托管人。

托管人指定的接收托管费的银行账户信息如下：

户 名：托管费收入暂收暂付户

开户行：建行北京分行营运管理部

账 号：1100019001563139990000000019

管理人和托管人与投资者协商一致后，可根据市场发展情况调整管理费和资产托管费率。上述费用若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

（三）不列入资产管理业务费用的项目

资产管理计划成立前发生的费用不得在计划财产中列支。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受托财产的损失，以及处理与本受托财产运作无关的事项或者不合理事项所发生的费用等不列入受托财产运作费用。

（四）管理人和托管人与投资者协商一致后，可根据市场发展情况调整资产管理费率和资产托管费率，并报中国证券投资基金业协会备案，同时抄送管理人住所地、资产管理分公司所在地中国证监会派出机构。

（五）税收

1、根据国家税收法律、法规相关要求，本计划运营过程中如发生增值税应税行为，形成的增值税及其附加税费等相关税负由本计划财产承担。相关税款由资产管理人计算后向资产托管人出具划款指令，由资产托管人划付至资产管理人账户并由资产管理人依据税务部门要求完成相关税款申报缴纳。

资产管理人账户信息如下：

管理人账户名称：信达证券股份有限公司

管理人账号：11001058900052504499

管理人开户银行名称：中国建设银行北京保利支行

2、本计划运作过程中涉及除增值税及其附加税费以外的各纳税主体、扣缴主体，其纳税义务、扣缴义务按国家税收法律、法规执行。

3、如本计划存续期内，本计划所适用的税收相关法律法规及具体执行方式因相关政策调整而发生变化，则资产管理人经与资产托管人协商一致并经由资产管理人提前公告后，可直接对本计划合同中涉及的相关税收内容进行修改和调整。

（六）如果投资者在本合同到期后要求延长管理期限，则延长期间的管理费、托管费及其他税费另行约定。

受托财产运作及清算过程中涉及的因受托财产与第三方产生的法律纠纷及/或由于第三方违约等原因需要向第三方追偿的情形，管理人通过诉讼或仲裁等方式追回损失，因此产生的全部费用（包括但不限于诉讼费、仲裁费、执行费用、律师费、公证费、差旅费等）由受托财产列支。

十七、交易及交收清算安排

本产品参与交易所场内证券投资，采取托管人结算模式，资产管理人与资产托管人应根据有关法律、行政法规及相关业务规则，签订《托管银行证券资金结算协议》用以具体明确资产管理人与资产托管人在证券交易资金结算（含港股通）业务中的程序与责任。协议签署前，资产管理人应按资产托管人要求配合提供相应准入材料。

资产管理人、资产托管人应遵守本合同下述（一）和（二）之约定。

（一）选择代理证券买卖的证券经营机构的程序

资产管理人负责选择代理本计划财产证券买卖的证券经营机构，并和被选中的证券经营机构签订委托协议，使用其交易单元作为资产管理计划财产的交易单元。资产管理人应提前十个工作日书面通知资产托管人，并依据资产托管人要求提供相关资料，以便资产托管人申请办理接收结算数据手续。

资产管理人应及时将资产管理计划财产交易单元专用号、佣金费率等基本信息以及变更情况以书面形式通知资产托管人。

（二）投资证券后的清算交收安排

1、结算备付金与保证金

中国结算分别于每月前6个交易日及每月前3个交易日内，对结算参与人最低备付金限额与结算保证金限额进行重新核算、调整。资产托管人应分别于每月前3个交易日内及结算保证金调整当日通过《资金账户报告》通知资产管理人本计划最低备付金调整金额以及调整后的结算保证金金额。资产管理人应预留最低备付金和结算保证金，并根据中国结算确定的实际最低备付金、结算保证金数据为依据安排资金运作，调整所需的现金头寸。如因调整最低备付金、结算保证金后造成透支，资产管理人应视资产托管人最低结算备付金比例计收方式分别于下列时点补足透支金额：

（1）固定备付金比例计收方式下，资产管理人应在调整最低备付金、结算保证金当日上午11:00之前补足金额。

（2）差异化备付金比例计收方式下，资产管理人应最晚于资金交收日8:30前补足金额。

2、清算交收

资产托管人负责资产管理计划财产买卖证券交易的清算交收。证券交易所场内资金结算由资产托管人根据中国结算结算数据办理；其他场外资金汇划由资产托管人根据资产管理人的资金划款指令具体办理。

如果因为资产托管人自身过错在清算上造成资产管理计划财产的直接损失，应由资产托管人负责赔偿，但因中国人民银行、中国结算和银行间市场登记结算机构资金结算系统以及其他机构的结算系统发生故障等非资产托管人的过错造成清算资金无法按时到账的情形，资产托管人免责；如果因为资产管理人未事先通知资产托管人增加交易单元等事宜，致使资产

托管人接收数据不完整,造成清算差错的责任由资产管理人承担;如果因为资产管理人未事先通知需要单独结算的交易,造成资产管理计划资产损失的由资产管理人承担;资产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T+1日中国结算的资金交收。如因资产管理人原因导致资金头寸不足,资产管理人应视资产托管人最低结算备付金比例计收方式分别于下列时点补足透支金额:

(1) 固定备付金比例计收方式下,资产管理人应最晚于资金交收当日上午 11:00 之前补足金额。

(2) 差异化备付金比例计收方式下,资产管理人应最晚于资金交收日 8:30 前补足金额。

如果资产管理人未遵循上述规定备足资金头寸,影响了计划资产自身的清算交收及资产托管人与中国结算之间的一级交收,由此给资产托管人、本资产管理计划财产及资产托管人托管的其他资产造成的损失由资产管理人负责。

如果由于资产管理人违反市场操作规则的规定进行超买、超卖及质押券欠库等原因造成资产管理计划财产投资清算困难和风险的,资产托管人在预清算结束后应通知资产管理人预透支和预欠库事项,资产管理人应保持联系方式畅通,后续补缴等事宜由资产管理人负责解决,由此给资产托管人、本资产管理计划财产和资产托管人托管的其他资产造成的损失由资产管理人承担。

根据中国结算结算规定,资产管理人在进行融资回购业务时,用于融资回购的债券将作为偿还融资回购到期购回款的质押券。如因资产管理人原因造成债券回购交收违约或因折算率变化造成质押欠库,导致中国结算欠库扣款或对质押券进行处置造成的投资风险和损失由资产管理人承担。

对于中国结算实行 T+0 非担保交收的业务,资产管理人应在交易日 14:00 前将划款指令发送至资产托管人。因资产管理人指令传输不及时,致使资金未能及时划入中国结算指定交收账户所造成的损失由资产管理人承担。包括赔偿在该市场引起其他托管客户交易失败、赔偿因占用结算参与人最低备付金带来的利息损失。

(三) 资金、证券和期货账目及交易记录的核对

资产管理人和资产托管人每月对资产管理计划财产的证券账目、实物券账目、交易记录进行核对。

(四) 资金余额的确认

资产托管人于 T+1 日上午 09:30 以前向资产管理人传真 T 日资产管理计划财产投资交易清算后的《资金账户报告》。每日日终,完成当日投资交易资金结算并核实账户资金余额后,传真《资金账户报告》进行资金余额的确认。

(五) 投资银行存款的特别约定

1、资产管理人和资产托管人的职责

资产管理人应当加强对本产品投资银行存款风险的评估与研究,建立健全银行存款投资的业务流程、岗位职责、风险控制措施和监察稽核制度,严格测算与控制投资银行存款的风险敞口,针对不同类型存款银行建立相关投资限制制度,切实防范有关风险。由于资产管理人提前支取或部分提前支取存款投资导致的息差(即本产品已计提的资金利息和提前支取时收到的资金利息差额),资产管理人负责解决。办理存款业务,管理人需委派双人负责办理且在存款行现场临柜办理开户等手续。

资产托管人负责依据资产管理人提供的银行存款投资合同/协议、投资指令、支取通知等有关文件办理资金的支付以及存款证实书的接收、保管与交付,切实履行托管职责。资产托管人负责依据本合同的约定对存款开户证实书进行保管,不负责对存款开户证实书真伪的辨别,存款开户证实书对应存款的本金及收益的安全由资产管理人负责。

2、相关协议的签署

资产管理人在投资银行存款之前,需与存款银行签订具体存款协议。具体存款协议应包括但不限于以下内容:

(1) 存款账户必须以本资产管理计划名义开立。

(2) 协议须约定存款类型、期限、利率、计息方式、金额、账号、起止时间,存款银行经办行名称、地址及进款账户。

(3) 协议须约定将资产托管人为本计划开立的托管银行账户指定为唯一回款账户,任何情况下,存款银行都不得将存款本息划往任何其他账户。

(4) 资金划转过程中存款银行需要使用过渡账户的,存款银行须保证资金在过渡账户中不出现滞留,不被挪用。

(5) 存款银行有义务保证本产品存款投资在存续期内的安全。

(6) 协议须约定存款银行不得接受资产管理人或资产托管人任何一方单方面提出的对该笔存款投资进行更名、转让、挂失、质押、担保、撤销变更印鉴及回款账户信息等任何可能导致财产转移的申请。

(7) 协议须明确, 存款银行对存款证实书的真实性负责, 并承担移交过程中由于存款证实书丢失、损毁、被人为调换等所引发的一切后果。正常情况下, 同城存款银行应在存款证实书开立后 2 个工作日内将原件移交托管行保管; 异地存款银行应在存款证实书开立后 5 个工作日内将原件移交资产托管人保管。

3、办理本资产管理计划财产投资银行存款的开户、全部提前支取、部分提前支取或到期支取, 可采取以下方式:

(1) 由资产管理人的授权代表持授权委托书全程办理, 资产管理人上述事项被授权人员与资产管理人负责洽谈存款事宜并签订存款协议的人员不能为同一人。

(2) 资产管理人与资产托管人双方协商一致的其他办理方式。

4、本产品投资银行存款或办理存款支取时, 资产管理人需提前发送银行存款投资合同/协议、投资指令、支取通知等有关文件到资产托管人处, 以便资产托管人有足够的时间履行相应的业务操作程序。

5、如发生逾期支取, 资产托管人不承担相应利息损失及逾期支取手续费。

6、本产品投资银行存款时, 应本着便于存款证实书安全保管和日常监督核查的原则, 尽可能选择托管账户开户行所在地的银行机构办理。

7、对于已移交资产托管人保管的存款开户证实书等实物凭证, 资产托管人应确保安全保管; 对未按约定将存款开户证实书等实物凭证移交资产托管人保管的, 资产托管人应向资产管理人进行必要的催缴和风险提示; 提示后仍不将相关实物凭证送达资产托管人保管的, 出于托管履职和尽责, 资产托管人可视情况采取必要的风险控制措施: (1) 建立风险预警机制, 对于实物凭证未送达集中度较高的存款银行, 主动发函资产管理人尽量避免在此类银行进行存款投资; (2) 在定期报告中, 对未按约定送达资产托管人保管的实物凭证信息进行规定范围信息披露; (3) 未送达实物凭证超过送单截止日后 30 个工作日, 且累计超过 3 笔(含)以上的, 部分或全部暂停配合资产管理人办理后续新增存款投资业务, 直至实物凭证送达托管人保管后解除。实物凭证未送达但存款本息已安全划回托管账户的, 以及因发生特殊情况由资产管理人提供相关书面说明并重新承诺送单截止时间的, 可剔除不计。

十八、资产管理计划的收益分配

(一) 收益的构成

收益包括单一计划投资所得利息、红利、股息、买卖证券价差、银行存款利息及其他合法收入。单一计划的净收益为单一计划收益扣除按照国家有关规定可以在单一计划收益中扣除相关费用后的余额。

（二）可供分配利润

指截至收益分配基准日资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

（三）收益分配原则

1、收益分配采用现金分配的方式。进行收益分配的条件是可供分配利润为正。

2、收益分配的金额计量单位为人民币元，按四舍五入法保留到小数点后两位，由此误差产生的损失由单一计划财产承担，产生的收益归单一计划财产所有。扣除根据本合同第十六条约定的所有费用后（含管理费、托管费、税费等相关费用），管理人将单一计划剩余财产于退出申请日（T日）后两个工作日向托管人出具划款指令，分配至投资者账户。

3、本计划存续期内，管理人根据本合同第十六条约定扣除所有费用后（含管理费、托管费、税费等相关费用），可以进行收益分配，收益分配日原则上为投资收益到账日起3个工作日内。

4、收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担，与收益分配的相关税费由投资者自行承担。

5、收益分配后产品单位净值不得低于面值。

6、法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

（四）收益分配方案的确定与通知

收益分配方案须载明收益的范围、可供分配利润、分配对象、分配原则、分配时间、分配金额及比例等内容。

收益分配方案由管理人根据上述分配原则拟定，由托管人复核。管理人若分配投资收益的，应向投资者发送书面文件《收益分配通知函》（见附件七）并抄送托管人。待收到投资者回执后，管理人向托管人发送划款指令，托管人根据管理人提供的《收益分配通知函》并收到投资者的回执后，根据管理人的指令及时将分配款划付给投资者。

通知托管人将分配款从托管账户划拨至投资者指定账户。如遇特殊情况，投资者与管理人、托管人协商一致，可另行处理，但不得违反法律、法规的相关规定。分配款以《收益分

配通知函》为准。

（五）收益分配的执行方式

本单一计划分红方式为现金分红方式。投资者同意遵守登记结算机构的业务规则（包括但不限于现有规则、对现有规则的修订、以及以后新制定的规则）。

现金分红形成的单一计划分红金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单一计划财产的损益。

十九、信息披露与报告

（一）净值披露

管理人通过电子邮件或书面等方式，向投资者提供资产净值的查询服务，净值至少每周向投资者披露一次。管理人应于每个开放日向投资者披露本计划的净值。

（二）定期报告

1、季度报告

管理人通过电子邮件或书面等方式在每季度向投资者提供一次准确、完整的管理季度报告。

季度报告包括但不限于下列信息：

（1）管理人履职报告；

（2）托管人履职报告（如有）；

（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）等费用的计提基准、计提方式和支付方式；

（7）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；

（8）中国证监会规定的其他事项。

管理人应当在每季度结束之日起一个月内编制资产管理季度报告,上述报告应于每季度结束之日起一个月内提供给投资者。本计划成立不足3个月或者存续期间不足3个月的,可以不编制当期的季度报告。产品终止当季,无需编制季度报告。

2、年度报告

管理人通过电子邮件或书面等方式在每年度向投资者提供一次准确、完整的管理年度报告。

年度报告包括但不限于下列信息:

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

管理人应当在每年度结束之日起四个月内编制资产管理年度报告,上述报告应于每年度结束之日起四个月内提供给投资者。本计划成立不足三个月或者存续期间不足三个月的,可以不编制当期的年度报告。产品终止当年,无需编制年度报告。

(三) 临时报告

计划存续期间,发生对计划持续运营、客户利益、财产净值产生重大影响的事件,管理人应当在事项发生之日起五日内告知投资者。

(四) 向监管机构提供的报告

1、管理人应当于每月十日前向证券投资基金业协会报送资产管理计划的持续参与情况、投资运作情况、资产最终投向等信息。

2、管理人应当在每季度结束之日起一个月内,编制私募资产管理业务管理季度报告,

并报中国证监会相关派出机构备案。管理人、托管人应当在每年度结束之日起四个月内，分别编制私募资产管理业务管理年度报告和托管年度报告，并报中国证监会相关派出机构备案。管理人在每年度结束之日起四个月内出具年度审计结果。

3、资产管理计划成立之日起五个工作日内，将资产管理合同、合规审查意见或者资产缴付证明等材料报证券投资基金业协会备案；自资产管理合同变更之日或资产管理计划终止之日起五个工作日内报证券投资基金业协会；资产管理计划清算结束后五个工作日内将清算报告报证券投资基金业协会备案。资产管理计划因受托财产流动性受限等原因延期清算的，及时向中国证监会相关派出机构报告。

4、出现以下情形时，管理人应及时向中国证监会相关派出机构报告：

（1）因证券期货市场波动、证券发行人合并、资产管理计划规模变动等证券期货经营机构之外的因素导致资产管理计划投资不符合法律、行政法规和中国证监会规定的投资比例或者合同约定的投资比例的，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，及时向中国证监会相关派出机构报告；

（2）从事关联交易；

（3）出现重大风险事件。

5、托管人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者资产管理合同约定的，应当拒绝执行，并向中国证监会相关派出机构报告。

若本合同中约定的管理人、托管人向监管机构报告/备案/抄报等的种类、内容、时间和途径等与法律法规、监管准则和要求不一致的，管理人、托管人应当按照届时有效的法律法规、监管准则和要求执行。各方一致同意不将上述不一致视为任意一方的违约行为。

（五）投资者向托管人查询信息的方式

1、投资者可通过电话、传真或电子邮件等联系方式，经由管理人向托管人查询有关信息披露资料。

2、对于管理人向投资者提供的文件材料中不在托管人复核职责范围内的信息，应由管

理人保证该等信息的真实性、有效性、合法性，托管人不承担任何审查和保证责任。

3、对于因管理人未提供或未及时提供应由托管人复核的相关信息披露文件等客观因素，导致托管人无法履行或无法按时履行相应复核职责的，托管人不承担相应责任。

（六）托管人履职报告（以下称“托管报告”）

1、托管人履职报告作为管理人季度报告、年度报告内容的一部分，由托管人完成管理人季度报告、年度报告的复核工作后，确定托管人履职报告内容并向管理人反馈，由管理人根据本合同约定的方式向投资者披露。托管人履职报告内容包括托管人履职情况、对管理人投资运作的监督情况及有关报告财务数据的复核意见等。

2、管理人应当在每季度结束后 20 日内向托管人提供其编制的季度报告、当期财务会计报告（如有）供托管人复核，托管人复核管理人季度报告、当期财务会计报告中的财务数据后，于 10 日内向管理人反馈复核意见。

3、管理人应当在每年度结束后三个月内向托管人提供其编制的年度报告、当期财务会计报告供托管人复核，托管人复核管理人年度报告、当期财务会计报告中的财务数据后，于一个月内向管理人反馈复核意见。

4、因资产管理计划成立不足三个月或者存续期间不足三个月，管理人未编制资产管理计划当期的季度报告和年度报告的，托管人不编制当期托管人履职报告。

二十、风险揭示

投资者投资于本计划可能面临以下风险，有可能因下述风险导致投资者本金或收益损失。管理人承诺以诚实信用，谨慎勤勉的原则管理和运用本计划资产，管理人制定并执行相应的内部控制制度和风险管理制度，以降低风险发生的概率。但这些制度和办法不能完全防止风险出现的可能，管理人不保证本计划本金不受损失，不保证本计划一定盈利，不保证最低收益，也不限定投资损失的金额或者比例。本计划面临的风险包括但不限于以下风险：

本计划风险等级为 R4(中高风险等级)，适合风险承受能力 C4 等级以上的普通投资者及专业投资者，包含法律法规及监管规定允许投资的个人投资者、机构投资者，及监管机构允许投资本单一计划的其他投资者，禁止低于本计划风险等级的投资者参与本计划。投资者在决定参与本计划之前，应该仔细阅读并签署《风险揭示书》，投资者签署了风险揭示

书，即表明已经理解并愿意自行承担参与本计划的风险。

本单一资产管理计划可能面临的风险，包括但不限于以下几项：

一、本计划特有风险

1、资产管理计划未在基金业协会完成备案手续或不予备案情形所涉风险

未在证券投资基金业协会完成备案的风险，导致本计划不能成立的风险。根据《合同指引》的规定及本合同约定，本计划募集完毕后，管理人应当向基金业协会办理备案手续。本计划在基金业协会完成备案后方可进行投资运作。因备案所需时间无法准确预估且投资者在此期间无法及时赎回其投资本金，本计划及投资者均存在备案期间错失投资机会的风险。

2、资产无法变现的风险

本资产管理计划投资的证券等如出现停牌等特殊事件导致管理人无法将资产变现，投资者将面临退出业务延迟办理、退出价格不确定或资产管理计划资产进行二次清算等风险。

3、权益类产品的风险

本计划属于权益类单一资产管理计划，主要将 80%以上资产投资于 A 股市场股票（含上市公司非公开发行的股份）及可转债，剩余资金可投资于现金管理类资产。投资股票及可转债的风险如下：

（1）国家货币政策、财政政策、产业政策等的变化对证券市场产生一定的影响，导致市场价格水平波动的风险。

（2）宏观经济运行周期性波动，对股票市场的收益水平产生影响的风险。

（3）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发生变化，从而导致股票价格变动的风险。

（4）投资标的过于集中的风险

本计划有可能集中投资于某一只或几只股票或可转债，本计划的收益及资金安全依赖于投资对象的经营状况，相关市场宏观调控政策、财政税收政策、产业政策、法律法规、经济周期的变化以及区域市场竞争格局的变化等都可能影响所投资企业经营状况，进而影响资产管理计划投资标的的价值。

（5）持股锁定期的风险

同时本计划投资的股票或可转债可能存在法定或承诺的锁定期，由于锁定期、休市、停牌等因素导致股票无法变现，投资者可能面临不能如期收回本金和收益的风险。

4、投资资产管理产品的风险

本计划可投资于金融监管部门批准或备案发行的资产管理产品（包括债券型基金、货币市场基金及中国证监会允许投资的其他资产管理产品），投资上述资产管理产品可能因下列特定风险因素给本计划造成不利影响。

（1）资产管理产品管理人风险

资产管理产品管理人风险包括管理人经营风险和操作风险。经营风险是指因管理能力、财务状况、行业竞争、人员素质、内控等因素导致公司经营不善，极端情况下甚至破产倒闭，可能对其管理人的产品业绩造成不利影响。另外，对于约定了止损条款的资产管理产品，可能因管理人未及时操作导致产品损失扩大的风险。

（2）赎回资产管理产品面临的流动性风险

因本计划投资者赎回或管理人进行资产配置调整需要，管理人赎回资产管理产品时，可能触发资产管理产品大额赎回或巨额赎回条款，导致赎回资金延迟到账的风险。

（3）投资资产管理产品的估值风险

本计划投向多个底层资产管理产品，每个资产管理产品的估值时间可能不一致，且披露时间可能不一致，本计划按照资产管理产品估值日最近的单位净值进行估值。在存续期间，资管计划单位净值可能无法反映真实投资管理情况。

5、投资债券的风险

本计划投资债券还将面临包括但不限于如下风险：

（1）流动性风险

受托资产不能迅速转变成现金，或者转变成现金会对资产价格造成重大不利影响的风险。流动性风险按照其来源可以分为两类：

1）市场整体流动性相对不足。证券市场的流动性受到市场行情、投资群体等诸多因素的影响，在某些时期成交活跃，流动性好；而在另一些时期，可能成交稀少，流动性差。在

市场流动性相对不足时，交易变现有可能增加变现成本，对受托资产造成不利影响。

2) 证券市场中流动性不均匀，存在个股和个券流动性风险。由于流动性存在差异，即使市场流动性比较好的情况下，一些个股和个券的流动性可能仍然比较差，从而在进行个股和个券操作时，可能难以买入和卖出预期的数量，或买入卖出行为对个股和个券价格产生比较大的影响，增加个股和个券的建仓成本或变现成本。

(2) 信用风险

信用风险是指发行人是否能够实现发行时的承诺，按时足额还本付息的风险，或者交易对手未能按时履约的风险。

1) 交易品种的信用风险：投资于公司债券等固定收益类产品，存在着发行人不能按时足额还本付息的风险；此外，当发行人信用评级降低时，本计划所投资的债券可能面临价格下跌风险。

2) 交易对手的信用风险：交易对手未能履行合约，或在交易期间未如约支付已借出证券产生的所有股息、利息和分红，将使本计划面临交易对手的信用风险。

6、参与债券回购的风险

(1) 参与债券正回购的风险

债券回购为提升本计划的组合收益提供了可能，但也存在风险。用于融资回购的债券将作为资产托管人相关结算备付金账户偿还融资回购到期购回款的质押券，若资产管理人债券回购交收违约，资产管理人和投资者面临结算公司依法对质押券进行处置的风险。

(2) 参与债券逆回购的风险

债券逆回购投资面临的主要风险是信用风险，即债券逆回购交易中交易对手在回购到期时违约，不能向本计划按期偿还全部价款，从而导致本计划净值损失的风险。

7、可交换债和可转债的相关风险

可交换债和可转债为含权债券，其市场风险不仅来自市场利率变化，其转股期权价值也随标的股票价格波动而波动，从而导致可交换债和可转债的二级市场价格等变现价值有出现较大的波动的可能性，且此等波动将远大于一般公司债券的波动，在债券发行时无法预测，

由此可能导致投资出现损失。

目前可交换债和可转债市场容量和投资者相对有限,特别是私募可交换债期限相对较长、流动性很差,可能面临在产品开放日无法变现等问题,给投资者带来损失。

可交换债发行人为上市公司股东,债务人信用资质可能较弱且信息披露不完善,可能因债务人自身信用状况恶化、标的股票贬值等出现无法按时足额履行可交换债所对应的还本、付息、回售、补充质押等相关义务,从而给受托资产带来损失。

8、投资 QDII 基金的风险(如有)

本计划拟投资 QDII 基金,汇率波动可能对本计划所投资的 QDII 基金的投资收益造成损失。此外,本计划拟投资的 QDII 基金将受到全球宏观经济和货币政策变动等因素所导致的系统性风险。

9、投资永续债、永续中票等的风险

投资永续债、永续中票除了面临上述投资债券的风险外,还面临着包括但不限于下述特有风险:

(1) 发行人不行使赎回权的风险

永续债、永续中票没有固定到期日,发行条款约定发行人在特定时点有权赎回,如果发行人在可行使赎回权时没有行权,会使本计划投资期限变长,由此可能给本计划带来一定的投资风险。

(2) 无法收回投资本金的风险

永续债、永续中票在发行人行使赎回权前长期存续,除非发生发行人赎回,发行人不需要兑付本金,本计划可能面临无法收回投资本金的风险。

(3) 利息递延支付风险

永续债、永续中票条款可能会约定,发行人有权递延支付利息,如果发行人决定利息递延支付,则会使本计划获取利息的时间推迟甚至中短期内无法获取利息,由此可能给本计划带来一定的投资风险。

10、投资结构性存款的风险

本计划拟投资结构性存款，不同于一般性存款，具有投资风险，包括但不限于结构性存款挂钩资产固有的投资风险、流动性风险、外汇利率风险、交易对手信用风险、无法提前赎回的风险、全球宏观经济和货币政策变动等因素所导致的系统性风险等。

二、本计划的一般风险

（一）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。

（二）市场风险

市场风险是指投资品种的价格因受经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素影响而引起的波动，导致收益水平变化，产生风险。市场风险主要包括：

1、政策风险

货币政策、财政政策、产业政策、监管政策等国家宏观经济政策的变化对资本市场产生一定的影响，导致市场价格波动，影响单一资产管理业务的收益而产生风险。特别提示投资者注意，由于单一资产管理业务为证券公司的创新业务，因此本单一资产管理计划可能面临因监管政策的突然变化而被监管机构强制终止而使投资者的投资收益无法如预期实现的风险。

2、经济周期风险

经济运行具有周期性的特点，受其影响，单一资产管理计划的收益水平也会随之发生变化，从而产生风险。

3、利率风险

金融市场利率的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，使单一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、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、财务等会导致公司盈利状况发生变化。如与单一资产管理业务相关的证券价格可能下跌，存在使单一资产管理业务收益水平下降的风险。

（三）管理风险

在单一资产管理计划运作过程中，管理人的知识、经验、判断、决策、技能等，会影响其对信息的获取和对经济形势、金融市场价格走势的判断，如管理人判断有误、获取信息不全、对投资工具使用不当等影响单一资产管理计划的收益水平。

（四）流动性风险

受托财产不能迅速转变成现金，或者转变成现金会对财产价格造成重大不利影响的危险。流动性风险按照其来源可以分为两类：

1、市场整体流动性相对不足。证券市场的流动性受到市场行情、投资群体等诸多因素的影响，在某些时期成交活跃，流动性好；而在另一些时期，可能成交稀少，流动性差。在市场流动性相对不足时，交易变现有可能增加变现成本，对受托财产造成不利影响。

2、证券市场中流动性不均匀，存在个券流动性风险。由于流动性存在差异，即使在市场流动性比较好的情况下，一些个券的流动性可能仍然比较差，从而在进行个券操作时，可能难以买入和卖出预期的数量，或买入卖出行为对个券价格产生比较大的影响，增加个券的建仓成本或变现成本。

（五）信用风险

信用风险是指融入方是否能够实现承诺，按时足额还本付息的风险，或者交易对手未能按时履约的风险。

交易对手的信用风险：交易对手未能履行合约，或在交易期间未如约支付已借出证券产生的所有股息、利息和分红，将使单一资产管理业务面临交易对手的信用风险。

（六）资产管理合同与基金业协会合同指引不一致所涉风险

基金业协会针对单一资产管理计划资产管理合同的内容及格式发布了《单一资产管理计划资产管理合同内容与格式指引》（以下简称“合同指引”）。

本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，因此本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本资产管理合同，理解本资产管理合同的全部条款，独立做出是否

签署本资产管理合同的决定。

（七）关联交易风险

1、一般关联交易的风险

管理人对与托管人有关的关联交易的监控受限于托管人提供关联方名单及关联证券名单的真实性、准确性、全面性和及时性，如托管人未能有效提供关联方名单及关联证券名单的，管理人将无法监控与托管人有关的关联交易，无法向投资者、托管人进行披露。

管理人根据资产管理合同约定从事关联交易的，虽然管理人积极遵循投资者利益优先的原则、遵守相关法律法规的规定进行操作、积极防范利益冲突，但仍可能因管理人运用本计划资产从事关联交易被监管部门认为存在重大风险，且管理人无法确保选择进行关联交易的实际交易结果（就投资结束后的实际损益情况而言）比进行类似的非关联交易的实际交易结果更优，进而可能影响本计划投资者的利益。此外，管理人运用本计划资产从事关联交易时可能依照相关法律法规、其他规范性文件被限制相关权利的行使，进而可能影响本计划投资者的利益。

2、重大关联交易的特定风险

对于重大关联交易，除面临上述关联交易的一般风险外，管理人从事重大关联交易，需逐笔提前征询投资者同意，若投资者不同意的，管理人不得从事该笔重大关联交易。若将来法律、行政法规及中国证监会的规定对于单一计划的关联交易做出新的监管要求的，本计划将按照届时最新的监管要求进行调整，该等调整可能会对单一计划的投资收益造成影响。

（八）操作或技术风险

操作或技术风险是指因人为因素、系统缺陷、流程不当或外部事件造成损失的可能性。

（九）税收风险

本合同各方当事人应根据国家法律法规规定，履行纳税义务。投资者必须自行缴纳的税收由投资者负责，管理人不承担代扣代缴或纳税的义务。如依据相关法律法规或税务机关的认定，就本计划运营过程中发生的增值税等应税行为，管理人需要承担相应纳税义务的，除本计划已列明的资产管理业务费用产生的管理费、托管费等税费由各收款方自行缴纳外，管理人有权以计划财产予以缴纳，且无需事先征得投资者的同意；管理人在向投资者交付相关收益或财产后税务机关要求管理人缴纳相关税费的，投资者应按照管理人通知要求进行缴纳；投资者不得要求管理人以任何方式向其返还或补偿该等税费。本计划清算后若资产管理人被税务机关要求补缴应由受托财产承担的上述税费的，则资产管理人有权向投资者就补缴金额

进行追偿。

三、其他风险

1、技术风险。在资产管理计划的日常交易中，可能因为技术系统的故障或者差错而影响交易的正常进行或者导致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。

2、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，因操作失误或违反操作规程而引起的风险。

3、资产管理计划管理或运作过程中，违反国家法律、法规的规定，或者违反单一资产管理合同有关规定的风险。

4、资产管理计划管理人、托管人因重大违法、违规行为，被中国证监会取消业务资格等，或因资产管理计划管理人解散、破产、撤销等原因，不能履行相应职责而导致资产管理计划亏损或终止的风险。

5、本资产管理计划存续期内存在因投资经理变更导致投资风格发生改变，从而影响投资者收益的风险。

6、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。

7、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，因以上所述风险的发生，而导致投资者再投资资产出现亏损的风险。

8、政策、法律、法规变化及/或监管部门要求，可能导致受托资产的收益变化或出现损失，从而带来的风险。

9、由于资产管理计划出现投资者大额或巨额退出，致使资产管理计划变现资产影响投资收益或没有足够的现金应付退出支付要求所导致的风险。

10、当出现不能预见，不能避免，不能克服的客观情况，包括但不限于自然灾害、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、注册登记机构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，可能导致资产管理计划资产的损失。

11、在合同存续期内，在符合本合同分配的前提下，管理人可以向投资者分配受托资产，但分配后的受托资产净值不低于100万元人民币；当受托资产净值不高于100万元人民币时，管理人不能继续分配，但经合同各方当事人协商一致可以提前终止合同。投资者面临不能完

全接受受托资产分配或者不能及时与各方当事人协商一致提前终止合同的风险。

12、其他不可预知、不可防范的风险。

二十一、资产管理合同的变更、计划终止与财产清算

（一）合同的变更

1、合同内容变更

因法律法规或中国证监会、证券投资基金业协会的相关规定、要求发生变化必须变更资产管理合同的，管理人可以与托管人协商后修改资产管理合同，并由管理人按照合同约定及时向投资者披露变更的具体内容。

因其他原因需要变更资产管理合同的，投资者、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，资产管理合同另有约定的除外。经投资者、管理人和托管人加盖公章或合同专用章以及执行事务合伙人委派代表/法定代表人/负责人或授权代表签字或盖章后生效。若由授权代表签字或盖章，还应附上法定代表人的授权书。

资产管理计划改变投向和比例的，应当事先取得投资者书面同意。

资产管理合同发生变更的，管理人应按照证券投资基金业协会要求在合同变更之日起五个工作日内向证券投资基金业协会备案。

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。

2、合同相关当事人发生变更

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，经全体投资者和托管人协商一致后，资产管理计划由其他管理人承接；

托管人被依法撤销基金托管资格或者依法解散、被撤销、宣告破产，经全体投资者和管理人协商一致后，资产管理计划由其他托管人承接。

（二）合同的展期

本合同的有效期限为自资产管理计划成立日起【1】年。存续期届满符合以下条件：

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

2、资产管理计划展期没有损害投资者利益的情形；

3、符合资产管理计划的成立条件，即受托财产不低于 1000 万元人民币；

4、中国证监会规定的其他条件。

经管理人、投资者及托管人协商一致，并签署相关补充协议后本计划可展期。

（三）资产管理计划的终止

本计划终止的情形包括下列事项：

1、资产管理计划存续期限届满且不展期；

2、经合同各方当事人协商一致决定终止的；

3、管理人被依法撤销资产管理业务资格或者依法解散、被撤销、宣告破产，且在六个月内没有新的管理人承接；

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

5、自投资者首期缴付出资后【5】日内，未在证券投资基金业协会完成备案或不予备案的，投资者有权单方解除本合同，提前终止资产管理计划，此时管理人应当向投资者返还其已经缴付的出资；

6、未经资产管理人书面同意，投资者擅自转让资产管理计划份额或资产管理计划收益权的；

7、投资者被监管机构接管的或因投资与本单一资产管理相似底层资产而受到监管处罚的；

8、资产管理计划投资的底层资产出现重大风险的，投资者在取得管理人和托管人的同意后，有权提前终止本协议；

9、单一计划备案通过后被监管机构等要求整改的；

10、当资产管理人认为因市场环境的变化等原因或根据法律法规、监管要求不适合本计划继续运行或再进行投资的，管理人认为有必要提前终止本单一计划的或本计划投资目的无法实现时，管理人有权提前单方终止本单一计划而免除违约责任；

11、本计划已完成所投资证券的减持退出且所有投资资产均已完成变现时，管理人有权提前终止本计划；

12、法律、行政法规、中国证监会规定及资产管理合同约定的其他情形。

管理人应当自资产管理计划终止之日起五个工作日内报送证券投资基金业协会备案,前述第5项约定的情形除外。

(四) 资产管理计划的清算

1、确认进入清算环节的财产状况

资产管理计划在发生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。

2、财产的变现

资产管理计划终止后,受托财产不应仍持有可流通非现金财产,如遇特殊情况,受托财产仍持有可流通非现金财产的,资产管理人有权将受托资产进行原状分配;受托财产持有的流通受限证券,如未到期回购、未上市新股或休市、停牌、暂停交易的证券等,自限制条件解除日起及时完成变现。投资者应接受上述由于财产变现产生的收益或损失。本资产管理计划终止后,受托财产归属于投资者。

非货币资金形式的受托财产,包括债权、和其他相关权益,以及本计划各交易文件项下资产管理人尚未履行完毕的权利义务等(如有),管理人有权将其随受托财产一并原状分配,自资产管理人书面通知投资者受托财产现状分配之日,即视为全部移交至投资者。

资产管理人应对有关交易文件的相关当事人进行通知或协助签署相关权利义务转让协议(如需要)、办理权属或担保变更登记手续(如需要),管理人应积极配合投资者行使债权追索权,管理人在提供相关手续上予以配合。

如根据相关法律法规,或经有权的司法机关裁判,上述现状分配无法实际执行的,投资者应于15个工作日内向管理人发出经管理人认可的、处理受托财产的书面意见,由管理人继续代为管理受托财产,管理人因执行投资者书面意见而支出的任何费用、款项,均由投资者另行支付。投资者对管理人执行该项书面意见的法律后果自行承担责任和风险,管理人和托管人不因该项书面意见的执行承担本合同约定之外的任何义务或责任。

本合同终止时,托管专户内货币形式的受托财产不足以支付应由受托财产承担的相应费用、税费及各项债务(如有)时,或者在向投资者以现状形式分配受托财产时,直接将该项债务分配给投资者。资产管理人和资产托管人不承担为投资者垫付相应费用、税费及各项债务(如有)的义务。

3、出具清算报告

资产管理人应于资产管理计划终止日后的 5 个工作日内开始组织清算资产管理计划的财产，并于清算完成后出具清算报告，资产托管人完成复核，由资产管理人向投资者提交。资产管理计划清算结束后五个工作日内将清算报告报送证券投资基金业协会备案。资产管理人向投资者提交清算报告并通过录音电话或邮件通知投资者后 3 个工作日内投资者未提出书面异议的，表示投资者接受此报告，资产管理人、资产托管人将照此执行。

清算报告包括下列事项：

（1）受托财产权、债务

受托财产权主要包括银行存款利息、备付金利息、保证金利息等，银行存款利息于托管账户注销时结清，备付金利息、保证金利息于季度结息日由中登公司支付。

受托财产债务主要包括应付管理费、托管费券商佣金、债券账户维护费（如有）、结算费用、外汇中心交易费用（如有）、银行费用等。清算过程产生的费用由受托财产承担。除交易所、登记结算机构、开户银行等自动扣缴的费用外，所有债务清偿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。原则上受托财产债务清偿应于合同终止后 3 个工作日内完成。

（2）合同终止日下一个月备付金调整数视合同终止日当月的交易量而定，交易保证金在合同终止且无证券持仓次月调整为零，调整数以中登公司数据为准。

4、受托财产支付

（1）受托财产首期清算款

投资者、资产管理人、资产托管人对清算报告无异议后，资产管理人匡算合同终止日的下一个月最低备付金及保证金，并预提足够的清算备用资金后向投资者支付首期清算款。资产管理人向资产托管人出具划款指令，资产托管人复核无误后，向投资者支付首期清算款。

若受托财产后续清算，出现账面剩余财产不足以支付相关负债的，投资者有义务于收到资产管理人、资产托管人联合发出的收款通知后当日将款项补足。

（2）支付剩余受托财产

受托财产权、债务结清后，资产管理人向资产托管人出具划款指令，资产托管人复核无误后，向投资者支付所有剩余财产，并配合管理人办理注销该受托资产托管账户。

5、受托财产相关账户销户

资产管理人应于本计划到期后及时完成收益兑付及其他应收应付款项资金划转,确保后续不再发生款项进出后 10 个工作日内向资产托管人发出销户申请。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。

(五) 清算费用

清算小组在进行本计划清算过程中发生的所有合理费用,由清算小组从资产管理计划财产中支付。

(六) 延期清算

资产管理计划因受托财产流动性受限等原因延期清算的,管理人可对此制定二次清算方案,该方案应经托管人认可,并由管理人向投资者进行披露。管理人应根据二次清算方案的规定,对前述未能流通变现的证券在可流通变现后进行二次清算,并将变现后的财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。因受托财产流动性受限等原因延期清算的,管理人应当及时向中国证监会相关派出机构报告。延期清算期间,继续按照本合同约定的费率计提管理费和托管费。

(七) 资产管理计划财产清算账册及文件的保存,资产管理计划财产清算账册及文件由管理人保存 20 年以上。

二十二、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;且管理人、托管人不因履行各自职责以外的事由与其他当事人承担连带赔偿责任;因共同行为给计划财产或者投资者造成损害的,应当按照各自过错承担相应赔偿责任。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,包括但不限于相关法律法规的

变更；国际、国内金融市场风险事故的发生；战争或动乱、自然灾害、公众通讯设备故障、电力中断、互联网故障等。

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单一计划财产损失扩大。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、在没有欺诈、故意或重大过失的情况下，管理人由于按照合同规定的投资原则行使或不行使其投资权而造成的损失等。

4、在没有过错或重大过失的情况下，托管人执行管理人的生效指令对单一计划财产造成的损失。

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、因司法、行政等有权机关对单一计划财产采取冻结、扣划等非托管人原因造成损失，托管人不承担相应责任。

7、相关法律、行政法规和规定的变更。

（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。守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。

(七) 托管人对于没有保管在托管人处的有价证券及其他单一计划财产不负有保管责任, 由于非托管人的过错致使其保管的财产发生毁损或灭失的, 托管人不承担赔偿责任。

投资者的债权人通过司法机关对单一计划财产采取强制措施, 由此造成单一计划财产损失的, 管理人和托管人不承担任何责任。

二十三、争议的处理

(一) 因本合同产生或与之相关的争议, 各方当事人应通过协商、调解解决, 当事人不愿通过协商、调解解决或协商、调解不能解决的, 任意一方有权将争议提交本合同签署地(北京市西城区)有管辖权的人民法院诉讼解决。除提交诉讼的争议之外, 各方当事人仍应履行本协议的其他规定。

(二) 各方同意, 对因诉讼而提交或通过诉讼程序而交换的所有证据、文件、资料、陈述、中间裁决和最终判决(以及该等判决中所认定的事实), 在诉讼期间和其后均承担保密义务。

(三) 争议处理期间, 合同当事人仍应履行本合同规定的义务, 维护各方合法权益。

二十四、资产管理合同的效力

(一) 合同的成立

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。本合同自投资者、管理人和托管人加盖公章或合同专用章以及执行事务合伙人委派代表/法定代表人/负责人或授权代表签字或盖章之日起成立。投资者自签订本合同即成为资产管理合同的当事人。

(二) 合同的生效

本合同成立后，满足以下条件时生效：管理人确认初始受托资产到账后，向投资者和托管人发送《资产管理计划成立通知书》，由投资者及托管人双方确认签收。投资者和托管人双方确认签收《资产管理计划成立通知书》的当日（若非同日常收，则为最后一方签收日的当日）为合同生效日。

资产管理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。

本单一计划终止，本合同终止。但本合同项下的清算条款、违约责任条款、争议解决条款仍然有效。

若合同变更通过重新签订合同的方式进行的，新签署合同的生效日期以管理人、投资者、托管人最后一方签章时间为准，同时在该生效日之前签订的合同同时废止。

（三）合同的组成

资产管理计划说明书及本合同的附件，是本合同不可分割的一部分，与本合同具有同等法律效力，如与本合同约定不一致的，以本合同约定为准。

（四）合同的期限

本计划存续期限为自资产管理计划成立之日起【1】年，如出现约定的终止情形时，终止清算，期满可展期。

投资者自签订资产管理合同即成为资产管理合同的当事人。在资产管理计划存续期间，投资者自全部退出资产管理计划之日起，该投资者不再是资产管理合同的当事人。

二十五、其他事项

（一）本合同如有未尽事宜，由本合同当事人各方按有关法律法规和规定协商解决。

（二）本合同签署后，若有关法律、法规、规章、自律规则、登记结算机构业务规则以及证券交易所交易规则修订或颁布，本合同相关条款与其中强制性规定发生冲突的，按新修订或颁布的法律、法规、规章、自律规则、业务规则及交易规则办理，但本合同其他内容及条款继续有效。

（三）保密

1、管理人、托管人应就受托财产及相关信息承担保密责任。除法律、法规的规定和本合同另有约定或有权机构另有要求外，未经投资者事先书面同意，不得以任何方式披露或利用该信息。

2、任何一方对于在本合同履行过程中获知的对方的数据和信息，未经该方事先书面同意，不得用于本合同外的目的，不得告知非本合同当事方或与允许非本合同当事方使用，法律法规另有规定、监管及审计要求或本合同另有约定的除外。

3、如经他方事先书面同意而将有关信息告知非本合同当事方或允许非本合同当事方使用，应当与该方签订保密合同。

4、本保密义务不因本合同的终止而终止。本保密义务持续至本合同终止之日起【2】年。

（四）个人信息保护

合同其他方签署本合同即视为知悉/授权托管人可为订立、履行个人作为一方当事人的合同所必需或为履行法定职责或者法定义务所必需而处理个人信息；托管人承诺对上述个人信息的处理合法合规，个人亦已知悉其享有《个人信息保护法》项下所有相关权利。如果个人信息系由一方向另一方提供的，提供方承诺已告知并获得相关个人同意向接收方提供个人信息，且个人已知晓个人信息的使用用途。

（五）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，并无需就此项变更取得投资者同意，也无需和投资者另行签订协议。但在转让前管理人应以信息披露的形式通告投资者。

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。

（六）本合同一式陆份，投资者执贰份，管理人执贰份，托管人执贰份，每份均具有同等法律效力。

二十六、反洗钱

双方（资产管理人和资产托管人）应按照所在国家 / 地区反洗钱和反恐怖融资方面的法律法规和监管要求，建立健全洗钱和恐怖融资风险管理体系，建立并有效执行反洗钱和反恐怖融资内部控制制度，设立反洗钱和反恐怖融资专门机构或者指定内设机构负责反洗钱和反恐怖融资工作，建立健全和执行客户身份识别、客户身份资料和交易记录保存制度、大额交易和可疑交易监控和报告制度、洗钱和恐怖融资风险自评估制度、反恐怖融资管理机制、制裁筛查机制等相关制度，依法执行联合国安理会制裁决议、中国制裁和反制措施以及国际金融制裁相关要求，开展反洗钱和反恐怖融资内部审计，做好境外洗钱和恐怖融资风险管控和合规经营工作，做好跨境业务的洗钱风险、制裁风险和恐怖融资风险防控，制定反洗钱和反恐怖融资培训制度，开展反洗钱和反恐怖融资宣传，并对可疑客户及可疑交易及时采取有效的风险管控措施。

双方（资产管理人和资产托管人）应在符合相关法律法规和监管要求的前提下，共同推进反洗钱和反恐怖融资的合作，为调查涉嫌洗钱、恐怖融资或其他违法犯罪活动提供必要协助。双方（资产管理人和资产托管人）应为其自对方获得的与反洗钱和反恐怖融资相关的信息严格保密。一方或其所属的国家或地区在协议期间被列入国际组织、当地监管或有关外国政府的制裁名单或制裁范围（外国对中国公民或组织的歧视性限制措施除外），或一方被中国列入反制清单或采取反制措施，或一方被中国列入反制清单或采取反制措施，或一方客户及业务涉嫌洗钱和恐怖融资、核武器扩散、国内/国际制裁、违反国内反制措施的违规或其他违法犯罪活动，或一方为另一方拒绝接受的客户提供服务，另一方有权中止或拒绝办理相关业务。如遇上述情况，一方应提前 30 个工作日书面通知另一方。

(此页无正文，为信达证券信丰 1 号单一资产管理计划资产管理合同之签署页)

管理人确认已向投资者说明单一资产管理计划单一资产管理业务的风险，不以任何方式对投资者财产本金不受损失或者取得最低收益做出承诺；投资者确认，已充分理解本合同内容，自行承担投资风险和损失。

投资者：信达投资有限公司（公章）

法定代表人/授权代表（签章）：

林东皓

管理人：信达证券股份有限公司（公章）

法定代表人/授权代表（签章）：

托管人：中国建设银行股份有限公司北京市分行（盖章）

负责人/授权代表（签章）

签订日期：2025 年 04 月 27 日

签署地：北京市西城区

附件一：初始受托财产缴付通知书（样本）

初始受托财产缴付通知书

信达证券股份有限公司：

根据合同编号：_____的《信达证券信丰 1 号单一资产管理计划资产管理合同》，本计划投资者决定于【____】年【____】月【____】日缴付初始受托财产人民币：_____（小写：_____元）。

特此通知。

投资者（预留印鉴）

____年 ____月 ____日

附件二：受托财产到账通知书（样本）

受托财产到账通知书

信达证券股份有限公司并投资者：

贵公司管理的信达证券信丰 1 号单一资产管理计划资金于 年 月 日划入
该产品在我行开立的托管账户：

户名：信达证券信丰 1 号单一资产管理计划

账号：【】

开户行：【】

大额支付行号：【】

实际到账资金：人民币（大写）： （小写： 元）

托管人（预留印鉴）

年 月 日

附件三：资产管理计划成立通知书（样本）

资产管理计划成立通知书

尊敬的投资者信达投资有限公司并托管人中国建设银行股份有限公司北京市分行：

根据三方共同签署的“信达证券信丰 1 号单一资产管理计划资产管理合同”（合同编号：_____），中国建设银行股份有限公司北京市分行担任托管人，我司担任本受托财产的管理人。【_____】年【_____】月【_____】日，投资者已将初始受托财产人民币_____元（大写人民币：_____）转入受托财产专用账户，本资产管理计划于【_____】年【_____】月【_____】日成立。本受托财产已经具备正式投资运作的条件。

特此通知。

信达证券股份有限公司（预留印鉴）

_____年 _____月 _____日

（填写说明：本附件正本一式两份，一份由投资者留存，另一份由管理人归档。）

附件四：受托财产追加通知书（样本）

受托财产追加通知书

尊敬的管理人信达证券股份有限公司及托管人中国建设银行股份有限公司北京市分行：

根据三方共同签署的《信达证券信丰 1 号单一资产管理计划资产管理合同》，信达投资有限公司为信达证券信丰 1 号单一资产管理计划（以下简称“本计划”）的投资者，信达证券股份有限公司担任本计划的管理人，中国建设银行股份有限公司北京市分行担任本计划的托管人。

根据合同约定，本投资者将于【 】年【 】月【 】日参与本计划的现金资产价值人民币元【】（大写人民币）【】元，并转入本资产管理计划财产的托管专户。

投资者：（预留印鉴）

年 月 日

附件五：受托财产运作确认书（样本）

受托财产运作确认书

尊敬的投资者信达投资有限公司并托管人中国建设银行股份有限公司北京市分行：

根据三方共同签署的“信达证券信丰 1 号单一资产管理计划资产管理合同”（合同编号：_____），中国建设银行股份有限公司北京市分行担任托管人，我司担任管理人。【 】年【 】月【 】日，托管专户收到缴付的现金形式财产人民币（小写）： 元（大写人民币： 元）。

本管理人在上述资金到账当日将其确认为受托财产。

信达证券股份有限公司（预留印鉴）

年 月 日

附件六：受托资产提取通知书（样本）

受托资产提取通知书

信达证券股份有限公司：

根据三方共同签署的《信达证券信丰 1 号单一资产管理计划资产管理合同》（合同编号：_____），本投资者决定于【 】年【 】月【 】日提取受托资产人民币【 】元，请将提取的受托资产划入本投资者指定账户：

账号：

户名：信达投资有限公司

开户行银行：

请予以操作。

投资者：

（预留印鉴）

年 月 日

附件七：收益分配通知函（样本）

收益分配通知函

尊敬的投资者信达投资有限公司并托管人中国建设银行股份有限公司北京市分行：

根据与贵公司及托管人签署的《信达证券信丰 1 号单一资产管理计划资产管理合同》
(合同编号：)，本公司作为管理人，对下述业务予以通知：

管理人决定于 年 月 日分配收益：小写：¥ 元(大写：)，
请托管人将分配的收益划入投资者指定账户：

户名：信达投资有限公司

账号：

开户银行：

请予以操作。

信达证券股份有限公司

(预留印鉴)

年 月 日

回 执

尊敬的管理人：

投资者确认已收悉管理人于 年 月 日向我方发送的《收益分配通知函》
(第 号)，对通知书中所列受托财产的分配无异议。

投资者（预留印鉴）

年 月 日

林燕

林燕

林燕

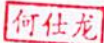


附件八：授权通知书

授权通知书

托管人中国建设银行股份有限公司北京市分行：

根据《信达证券信丰 1 号单一资产管理计划资产管理合同》，我单位授权以下人员向你行发送资管合同项下相关业务通知和指令。现将指令发送用章样本及有关人员签样本及相应权限留给你行，请在使用时核验。上述被授权人在授权范围内向你行发送指令的真实性、准确性及合法性由我单位负全部责任。

姓名	权限	签字样本	印章样本
何仕龙	经办		
原林	复核		
崔玉红	审核签发		
指令发送用章	 (用章样本)		
指令发送 指定传真号码	010-83252894		

备注： 1、指令发送用章须与个人签字或个人印章同时出具，方为有效。
2、权限类型：经办、复核、审核签发。
3、管理人指定传真号码变更，需提前通知托管人。



(公章)

法定代表人（或授权代表）



日

附件九：划款指令（样本）

划款指令

编号： 年第 号

指令日期： 年 月 日

托管人中国建设银行股份有限公司北京市分行：

敬请贵行根据以下提供的收款人名称、开户行、账号、到账日期和划款金额划款。

到账日期：

付款人：

开户行：

账 号：

收款人：

开户行：

账 号：

大额支付行号：

划款金额（小写）：

划款金额（大写）：

划款用途：

备注：

资产管理人签章：

资产托管人签章：

审批人：

审批人：

复核人：

复核人：

经办人：

经办人：

附件十：预留印鉴

投资者



资产管理人



托管人

备注：投资者、资产管理人、托管人确认，本预留印鉴样本中各方的预留印鉴适用于本计划项下日常往来文件的签署。

附件十一：业务联系人名单

投资者：

投资者：信达投资有限公司				
邮寄地址：			邮政编码：	
岗位	姓名	分机	EMAIL	传真

管理人：信达证券股份有限公司				
邮寄地址：北京市西城区宣武门西大街甲 127 号金隅大厦 B 座			邮政编码：100031	
岗位	姓名	分机	EMAIL	传真
业务联系协调人	李敏	010-83252709	limin@cindasc.com	/

中国建设银行股份有限公司北京市分行托管中心相关联系人				
邮寄地址：北京市西城区复兴门南大街甲 2 号楼天银大厦 A 西座				
邮政编码：100032				
岗位		联系人	电话	邮箱
总协调		王霄	010-83326032	wangxiao.bj@ccb.com
托管户		王玮	010-66425336	wangwei28.bj@ccb.com
		赵罡	010-66422668	zhaogeng3.bj@ccb.com
证券户		郭贝贝	010-66416368	guobeibei.bj@ccb.com
指令接收		指令接收（传真）021-38130168		
		指令接收（邮箱）tgzl.zh@vip.ccb.com		
		指令确认	0551-62890746	
		指令确认	0551-62890756	
核算估值	保险	杨月鑫	010-66536667	yangyuexin.bj@ccb.com
		付超	010-66536665	fuchao.bj@ccb.com
	其他	孙玥	010-63949276	Sunyue6.bj@ccb.com
		吴迪	010-66416968	wudi6.bj@ccb.com
实物凭证保管		陈旻	010-66411453	chenmin.bj@ccb.com
监督		许祺	010-66425205	xuqi.bj@ccb.com
		宫亭	010-63602825	gongting.bj@ccb.com

资金清算	申月	010-66414803	
	韩婧瑶	010-66416813	
数据接收	深证通方式：小站号 K0252		
	邮件方式：保险类【bj_tgyyljzx_bxywk.bj@ccb.com】； 其他类【bj_tgzxtgyyk.bj@ccb.com】		
注：请将指令授权书原件邮寄给李翼超（电话：021-60637143）公司名称：建行上海备份中心 地址： 上海浦东新区银城路 99 号 2 层 邮箱 tgshcs.zh@ccb.com 和 tgshzh.zh@ccb.com			

附件十二：专用清算账户及资金划拨专用账户

注意：账户如有变更，请及时通知相关各方。

(1) 托管专户

户名：信达证券信丰 1 号单一资产管理计划

账号：【】

开户银行：【】

大额支付行号：【】

(2) 托管费收入账户

户名：托管费收入暂收暂付户

账号：1100019001563139990000000019

开户银行：建行北京分行营运管理部

(3) 管理人费用收入账户

户名：信达证券股份有限公司

账号：11001005100053013161

开户银行：中国建设银行北京前门支行

大额支付行号：105100001028

(4) 增值税专用缴纳账户

户名：信达证券股份有限公司

账号：11001058900052504499

开户银行：中国建设银行北京保利支行

(5) 投资者移交、缴付受托财产的账户

户名：

账号：

开户银行：

(6) 投资者接收受托资产分配的账户

户名：信达投资有限公司

账号：

开户银行：

附件十三：关于受托资金来源的说明函

关于受托资金来源的说明函

信达证券股份有限公司：

我司作为《信达证券信丰1号单一资产管理计划》的投资者，自 年 月 日起，将受托资金委托给贵公司提供单一资产管理服务。受托资金来源于我司自有资金。

特此证明。

投资者：

年 月 日

附件十四：风险揭示书

信达证券信丰1号单一资产管理计划风险揭示书

尊敬的资产管理计划投资者：

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

根据有关法律法规，信达证券股份有限公司及投资者分别作出如下承诺、风险揭示及声明：

一、管理人声明与承诺

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

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

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

二、风险揭示

本单一资产管理计划可能面临的风险，包括但不限于以下几项：

（一）本计划特有风险

1、资产管理计划未在基金业协会完成备案手续或不予备案情形所涉风险

未在证券投资基金业协会完成备案的风险，导致本计划不能成立的风险。根据《合同指引》的规定及本合同约定，本计划募集完毕后，管理人应当向基金业协会办理备案手续。本

计划在基金业协会完成备案后方可进行投资运作。因备案所需时间无法准确预估且投资者在此期间无法及时赎回其投资本金，本计划及投资者均存在备案期间错失投资机会的风险。

2、资产无法变现的风险

本资产管理计划投资的证券等如出现停牌等特殊事件导致管理人无法将资产变现，投资者将面临退出业务延迟办理、退出价格不确定或资产管理计划资产进行二次清算等风险。

3、权益类产品的风险

本计划属于权益类单一资产管理计划，主要将 80%以上资产投资于 A 股市场股票（含上市公司非公开发行的股份），剩余资金可投资于现金管理类资产。投资股票的风险如下：

（1）国家货币政策、财政政策、产业政策等的变化对证券市场产生一定的影响，导致市场价格水平波动的风险。

（2）宏观经济运行周期性波动，对股票市场的收益水平产生影响的风险。

（3）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发生变化，从而导致股票价格变动的风险。

（4）投资标的过于集中的风险

本计划有可能集中投资于某一只或几只股票，本计划的收益及资金安全依赖于投资对象的经营状况，相关市场宏观调控政策、财政税收政策、产业政策、法律法规、经济周期的变化以及区域市场竞争格局的变化等都可能影响所投资企业经营状况，进而影响资产管理计划投资标的的价值。

（5）持股锁定期的风险

同时本计划投资的股票可能存在法定或承诺的锁定期，由于锁定期、休市、停牌等因素导致股票无法变现，投资者可能面临不能如期收回本金和收益的风险。

4、投资资产管理产品的风险

本计划可投资于金融监管部门批准或备案发行的资产管理产品（包括债券型基金、货币市场基金及中国证监会允许投资的其他资产管理产品），投资上述资产管理产品可能因下列特定风险因素给本计划造成不利影响。

（1）资产管理产品管理人风险

资产管理产品管理人风险包括管理人经营风险和操作风险。经营风险是指因管理能力、财务状况、行业竞争、人员素质、内控等因素导致公司经营不善，极端情况下甚至破产倒闭，可能对其管理人的产品业绩造成不利影响。另外，对于约定了止损条款的资产管理产品，可能因管理人未及时操作导致产品损失扩大的风险。

（2）赎回资产管理产品面临的流动性风险

因本计划投资者赎回或管理人进行资产配置调整需要，管理人赎回资产管理产品时，可能触发资产管理产品大额赎回或巨额赎回条款，导致赎回资金延迟到账的风险。

（3）投资资产管理产品的估值风险

本计划投向多个底层资产管理产品，每个资产管理产品的估值时间可能不一致，且披露时间可能不一致，本计划按照资产管理产品估值日最近的单位净值进行估值。在存续期间，资管计划单位净值可能无法反映真实投资管理情况。

5、投资债券的风险

本计划投资债券还将面临包括但不限于如下风险：

（1）流动性风险

受托资产不能迅速转变成现金，或者转变成现金会对资产价格造成重大不利影响的风险。流动性风险按照其来源可以分为两类：

1）市场整体流动性相对不足。证券市场的流动性受到市场行情、投资群体等诸多因素的影响，在某些时期成交活跃，流动性好；而在另一些时期，可能成交稀少，流动性差。在市场流动性相对不足时，交易变现有可能增加变现成本，对受托资产造成不利影响。

2）证券市场中流动性不均匀，存在个股和个券流动性风险。由于流动性存在差异，即使市场流动性比较好的情况下，一些个股和个券的流动性可能仍然比较差，从而在进行个股和个券操作时，可能难以买入和卖出预期的数量，或买入卖出行为对个股和个券价格产生比较大的影响，增加个股和个券的建仓成本或变现成本。

（2）信用风险

信用风险是指发行人是否能够实现发行时的承诺，按时足额还本付息的风险，或者交易对手未能按时履约的风险。

1) 交易品种的信用风险：投资于公司债券等固定收益类产品，存在着发行人不能按时足额还本付息的风险；此外，当发行人信用评级降低时，本计划所投资的债券可能面临价格下跌风险。

2) 交易对手的信用风险：交易对手未能履行合约，或在交易期间未如约支付已借出证券产生的所有股息、利息和分红，将使本计划面临交易对手的信用风险。

6、参与债券回购的风险

(1) 参与债券正回购的风险

债券回购为提升本计划的组合收益提供了可能，但也存在风险。用于融资回购的债券将作为资产托管人相关结算备付金账户偿还融资回购到期购回款的质押券，若资产管理人债券回购交收违约，资产管理人和投资者面临结算公司依法对质押券进行处置的风险。

(2) 参与债券逆回购的风险

债券逆回购投资面临的主要风险是信用风险，即债券逆回购交易中交易对手在回购到期时违约，不能向本计划按期偿还全部价款，从而导致本计划净值损失的风险。

7、可交换债和可转债的相关风险

可交换债和可转债为含权债券，其市场风险不仅来自市场利率变化，其转股权价值也随标的股票价格波动而波动，从而导致可交换债和可转债的二级市场价格等变现价值有出现较大的波动的可能性，且此等波动将远大于一般公司债券的波动，在债券发行时无法预测，由此可能导致投资出现损失。

目前可交换债和可转债市场容量和投资者相对有限，特别是私募可交换债期限相对较长、流动性很差，可能面临在产品开放日无法变现等问题，给投资者带来损失。

可交换债发行人为上市公司股东，债务人信用资质可能较弱且信息披露不完善，可能因债务人自身信用状况恶化、标的股票贬值等出现无法按时足额履行可交换债所对应的还本、付息、回售、补充质押等相关义务，从而给受托资产带来损失。

8、投资 QDII 基金的风险（如有）

本计划拟投资 QDII 基金，汇率波动可能对本计划所投资的 QDII 基金的投资收益造成损失。此外，本计划拟投资的 QDII 基金将受到全球宏观经济和货币政策变动等因素所导致的系统性风险。

9、投资永续债、永续中票等的风险

投资永续债、永续中票除了面临上述投资债券的风险外，还面临着包括但不限于下述特有风险：

（1）发行人不行使赎回权的风险

永续债、永续中票没有固定到期日，发行条款约定发行人在特定时点有权赎回，如果发行人在可行使赎回权时没有行权，会使本计划投资期限变长，由此可能给本计划带来一定的投资风险。

（2）无法收回投资本金的风险

永续债、永续中票在发行人行使赎回权前长期存续，除非发生发行人赎回，发行人不需要兑付本金，本计划可能面临无法收回投资本金的风险。

（3）利息递延支付风险

永续债、永续中票条款可能会约定，发行人有权递延支付利息，如果发行人决定利息递延支付，则会使本计划获取利息的时间推迟甚至中短期内无法获取利息，由此可能给本计划带来一定的投资风险。

10、投资结构性存款的风险

本计划拟投资结构性存款，不同于一般性存款，具有投资风险，包括但不限于结构性存款挂钩资产固有的投资风险、流动性风险、外汇利率风险、交易对手信用风险、无法提前赎回的风险、全球宏观经济和货币政策变动等因素所导致的系统性风险等。

（二）本计划一般风险

1、本金损失风险

管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用资产管理计划财产，但不

保证资产管理计划财产中的认（申）购资金本金不受损失，也不保证一定盈利及最低收益。

2、市场风险

市场风险是指投资品种的价格因受经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素影响而引起的波动，导致收益水平变化，产生风险。市场风险主要包括：

1) 政策风险

货币政策、财政政策、产业政策、监管政策等国家宏观经济政策的变化对资本市场产生一定的影响，导致市场价格波动，影响单一资产管理业务的收益而产生风险。特别提示投资者注意，由于单一资产管理业务为证券公司的创新业务，因此本单一资产管理计划可能面临因监管政策的突然变化而被监管机构强制终止而使投资者的投资收益无法如预期实现的风险。

2) 经济周期风险

经济运行具有周期性的特点，受其影响，单一资产管理计划的收益水平也会随之发生变化，从而产生风险。

3) 利率风险

金融市场利率的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，使单一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) 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、财务等会导致公司盈利状况发生变化。如与单一资产管理业务相关的证券价格可能下跌，存在使单一资产管理业务收益水平下降的风险。

3、管理风险

在单一资产管理计划运作过程中，管理人的知识、经验、判断、决策、技能等，会影响

其对信息的获取和对经济形势、金融市场价格走势的判断，如管理人判断有误、获取信息不全、对投资工具使用不当等影响单一资产管理计划的收益水平。

4、流动性风险

受托财产不能迅速转变成现金，或者转变成现金会对财产价格造成重大不利影响的风险。

流动性风险按照其来源可以分为两类：

1、市场整体流动性相对不足。证券市场的流动性受到市场行情、投资群体等诸多因素的影响，在某些时期成交活跃，流动性好；而在另一些时期，可能成交稀少，流动性差。在市场流动性相对不足时，交易变现有可能增加变现成本，对受托财产造成不利影响。

2、证券市场中流动性不均匀，存在个券流动性风险。由于流动性存在差异，即使在市场流动性比较好的情况下，一些个券的流动性可能仍然比较差，从而在进行个券操作时，可能难以买入和卖出预期的数量，或买入卖出行为对个券价格产生比较大的影响，增加个券的建仓成本或变现成本。

5、信用风险

信用风险是指融入方是否能够实现承诺，按时足额还本付息的风险，或者交易对手未能按时履约的风险。

交易对手的信用风险：交易对手未能履行合约，或在交易期间未如约支付已借出证券产生的所有股息、利息和分红，将使单一资产管理业务面临交易对手的信用风险。

6、资产管理合同与基金业协会合同指引不一致所涉风险

基金业协会针对单一资产管理计划资产管理合同的内容及格式发布了《单一资产管理计划资产管理合同内容与格式指引》（以下简称“合同指引”）。

本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，因此本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本资产管理合同，理解本资产管理合同的全部条款，独立做出是否签署本资产管理合同的决定。

7、关联交易风险

1) 一般关联交易的风险

管理人对与托管人有关的关联交易的监控受限于托管人提供关联方名单及关联证券名单的真实性、准确性、全面性和及时性,如托管人未能有效提供关联方名单及关联证券名单的,管理人将无法监控与托管人有关的关联交易,无法向投资者、托管人进行披露。

管理人根据资产管理合同约定从事关联交易的,虽然管理人积极遵循投资者利益优先的原则、遵守相关法律法规的规定进行操作、积极防范利益冲突,但仍可能因管理人运用本计划资产从事关联交易被监管部门认为存在重大风险,且管理人无法确保选择进行关联交易的实际交易结果(就投资结束后的实际损益情况而言)比进行类似的非关联交易的实际交易结果更优,进而可能影响本计划投资者的利益。此外,管理人运用本计划资产从事关联交易时可能依照相关法律法规、其他规范性文件被限制相关权利的行使,进而可能影响本计划投资者的利益。

2) 重大关联交易的特定风险

对于重大关联交易,除面临上述关联交易的一般风险外,管理人从事重大关联交易,需逐笔提前征询投资者同意,若投资者不同意的,管理人不得从事该笔重大关联交易。若将来法律、行政法规及中国证监会的规定对于单一计划的关联交易做出新的监管要求的,本计划将按照届时最新的监管要求进行调整,该等调整可能会对单一计划的投资收益造成影响。

7、操作或技术风险

操作或技术风险是指因人为因素、系统缺陷、流程不当或外部事件造成损失的可能性。

8、税收风险

本合同各方当事人应根据国家法律法规规定,履行纳税义务。投资者必须自行缴纳的税收由投资者负责,管理人不承担代扣代缴或纳税的义务。如依据相关法律法规或税务机关的认定,就本计划运营过程中发生的增值税等应税行为,管理人需要承担相应纳税义务的,除本计划已列明的资产管理业务费用产生的管理费、托管费等税费由各收款方自行缴纳外,管理人有权以计划财产予以缴纳,且无需事先征得投资者的同意;管理人在向投资者交付相关收益或财产后税务机关要求管理人缴纳相关税费的,投资者应按照管理人通知要求进行缴纳;

投资者不得要求管理人以任何方式向其返还或补偿该等税费。本计划清算后若资产管理人被税务机关要求补缴应由受托财产承担的上述税费的，则资产管理人有权向投资者就补缴金额进行追偿。

（三） 其他风险

1、技术风险。在资产管理计划的日常交易中，可能因为技术系统的故障或者差错而影响交易的正常进行或者导致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。

2、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，因操作失误或违反操作规程而引起的风险。

3、资产管理计划管理或运作过程中，违反国家法律、法规的规定，或者违反单一资产管理合同有关规定的风险。

4、资产管理计划管理人、托管人因重大违法、违规行为，被中国证监会取消业务资格等，或因资产管理计划管理人解散、破产、撤销等原因，不能履行相应职责而导致资产管理计划亏损或终止的风险。

5、本资产管理计划存续期内存在因投资经理变更导致投资风格发生改变，从而影响投资者收益的风险。

6、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。

7、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，因以上所述风险的发生，而导致投资者再投资资产出现亏损的风险。

8、政策、法律、法规变化及/或监管部门要求，可能导致受托资产的收益变化或出现损失，从而带来的风险。

9、由于资产管理计划出现投资者大额或巨额退出，致使资产管理计划变现资产影响投资收益或没有足够的现金应付退出支付要求所导致的风险。

10、当出现不能预见，不能避免，不能克服的客观情况，包括但不限于自然灾害、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

登记机构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，可能导致资产管理计划资产的损失。

11、在合同存续期内，在符合本合同分配的前提下，管理人可以向投资者分配受托资产，但分配后的受托资产净值不低于100万元人民币；当受托资产净值不高于100万元人民币时，管理人不能继续分配，但经合同各方当事人协商一致可以提前终止合同。投资者面临不能完全接收受托资产分配或者不能及时与各方当事人协商一致提前终止合同的风险。

12、其他不可预知、不可防范的风险。

三、投资者声明

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

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

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

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

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

5、本人/机构已认真阅读并完全理解资产管理合同第四章“当事人的权利与义务”的所有内容，并愿意自行承担购买资产管理计划的法律责任。【 】

6、本人/机构已认真阅读并完全理解资产管理合同第八章“资产管理计划的投资”的所有内容，并愿意自行承担购买资产管理计划的法律责任。【 】

7、本人/机构已认真阅读并完全理解资产管理合同第十四章“资产管理计划的费用与税收”中的所有内容。【 】

8、本人/机构已认真阅读并完全理解资产管理合同第二十三章“争议的处理”中的所有内容。【 】

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

本人/机构承诺上述信息资料及身份证明文件真实、准确、完整、有效。【 】

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

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

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

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

投资者（自然人签字或机构盖章）：

日期：



信达证券信丰1号单一资产管理计划
资产管理合同之补充协议

投资者：信达投资有限公司

管理人：信达证券股份有限公司

托管人：中国建设银行股份有限公司北京市分行

鉴于投资者、管理人和托管人已签署《信达证券信丰1号单一资产管理计划资产管理合同》（合同编号：【CSCA08-2025-298】号；下称“《原合同》”），现投资者、管理人和托管人三方友好协商，就《原合同》修改事项签订补充协议（以下简称“本补充协议”）。自本补充协议生效之日起，《原合同》中有关条款适用经本补充协议调整后的条款。具体变更内容如下：

一、 变更《原合同》第五节第（八）条：

原为：

（八）本计划的费用

1. 管理人的管理费：建仓期内不收取管理费，建仓期结束后固定管理费为80万元；
2. 托管人的托管费：0.01%/年，累计不超过20万元（含）；
3. 受托财产划拨支付的银行费用；
4. 受托财产的证券账户的开户费用以及投资交易、清算、登记等实际发生的费用；
5. 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、询证费等；
6. 相关税费；
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。

变更为如下内容：

（八）本计划的费用

1. 管理人的管理费：0.3%/年；
2. 托管人的托管费：0.01%/年，累计不超过20万元（含）；

3. 业绩报酬：业绩报酬提取日，管理人对份额年化收益率（R）超过业绩报酬计提基准（Rb）的部分，提取 10% 作为管理人业绩报酬。

4. 受托财产拨划支付的银行费用；

5. 受托财产的证券账户的开户费用以及投资交易、清算、登记等实际发生的费用；

6. 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、询证费等；

7. 相关税费；

8. 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。

二、 变更《原合同》第十六节第（二）1 条：

原为：

（二）费用计提方法、计提标准和支付方式

1、管理费的计算方式及支付方式

（1）固定管理费的计算方式及支付方式

本计划建仓期内不收取管理费，建仓期结束后，本计划一次性支付管理费 80 万元。经资产管理人和资产托管人核对后，由资产托管人按照约定的方式于管理费结算日后五个工作日之内从资产管理计划财产中一次性支付给资产管理人。若因法定节假日、休息日，或战争、自然灾害等不可抗力致使无法按时支付的，则在不可抗力情形消除后的首个工作日支付。

管理人指定的接收管理费的银行账户信息如下：

开户名称：信达证券股份有限公司

开户银行：中国建设银行北京前门支行

账号：11001005100053013161

大额支付行号：105100001028

（2）业绩报酬的计算方式及支付方式

本计划不收取业绩报酬。

变更为如下内容：

(二) 费用计提方法、计提标准和支付方式

1、管理费的计算方式及支付方式

(1) 固定管理费的计算方式及支付方式

本计划自成立日次日起计提管理费。管理费按照资管计划前一日资产净值的 0.3% 的费率计提。具体计算方法如下：

$$G=E \times 【0.3】 \% \div 360 ;$$

G 为每日应计提的管理费；

E 为本计划前一日资产净值。

管理费自本计划成立日的次日起，每日计提，按季度支付。经管理人与托管人双方核对后，由管理人于每个自然季度初 5 个工作日内向托管人发送投资指令，从资产管理计划资产中一次性支付给管理人。若因战争、自然灾害等不可抗力致使无法按时支付的，则在不可抗力情形消除后支付。

上述价格包括管理人本身应缴相关税费（包括但不限于增值税、城市维护建设税和教育附加税等）。

管理人指定的接收管理费的银行账户信息如下：

开户名称：信达证券股份有限公司

开户银行：中国建设银行北京前门支行

账号：11001005100053013161

大额支付行号：105100001028

(2) 业绩报酬的计算方式及支付方式

1、管理人计提业绩报酬的原则

1) 对投资者持有份额及退出份额（包括由于合同变更导致的份额退出）按份额认（申）购时间的不同分别计算的每笔份额的实际年化收益率（R）计提业绩报酬。

2) 本计划业绩报酬计提日为本计划收益分配日、投资者份额退出日或本计划终止清算日。在收益分配日和本计划终止日，对计划中符合业绩报酬计提条件的全部份额计提业绩报酬；在投资者份额退出日，仅对退出份额中符合业绩报酬计提条件的全部份额计提业绩报酬。

3) 投资者申请退出时，管理人按“先进先出”的原则，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，计算、提取退出份额对应的业绩报酬。

4) 计划收益分配日符合业绩报酬计提条件的，管理人先计提业绩报酬，再分配收益或剩余资金。计划终止清算日符合业绩报酬计提条件的，管理人先计提业绩报酬，再分配收益或剩余资金。在投资者份额退出日符合业绩报酬计提条件的，管理人应先将投资者申请退出的份额所对应的业绩报酬从退出金额中扣除后，再向投资者分配退出款。

业绩报酬应当从分红资金、退出资金或清算资金中提取，从分红资金中提取业绩报酬的频率不得超过每6个月一次。业绩报酬的提取比例不得超过投资收益的10%。

2、业绩报酬的计提方法

管理人于业绩报酬计提日，将按份额认（申）购时间的不同，针对投资者每笔份额分别核算其业绩报酬核算期。业绩报酬核算期是指针对投资者所持有的每笔份额，上一个管理人实际计提了业绩报酬的业绩报酬计提日（以下简称：上一业绩报酬计提日；如上一业绩报酬计提日不存在，则为本计划成立日或投资者该笔份额申购确认日）至本次业绩报酬计提日期间。

管理人根据当个业绩报酬核算期的投资者每笔份额实际年化收益率（R）情况计提业绩报酬（H），投资者所持份额以认（申）购时间的不同分别进行业绩报酬的核算和计提，具体计提规则如下：

实际年化收益率（R）	计提比例	业绩报酬（H）计提规则
$R \leq R_b$	0	$H=0$
$R > R_b$	10%	$H = (R - R_b) \times 10\% \times C \times N / 365$

其中：

$$R = \frac{P_1 - P_0}{P} \times \frac{365}{N} \times 100\%$$

P_1 为业绩报酬计提日的本计划单位累计净值；

P_0 为上一业绩报酬计提日（若该笔份额无上一业绩报酬计提日的，则为本计划认购日或投资者该笔份额申购日）本计划的单位累计净值；

P 为上一业绩报酬计提日（若该笔份额无上一业绩报酬计提日的，则为本计划认购日或投资者该笔份额申购日）本计划的单位净值；

N 为该笔份额当个业绩报酬核算期的天数；

C 为投资者该笔份额的成本= $P \times$ 认（申）购份额；

R_b 为业绩报酬计提基准， $R_b=6.0\%$ 。

业绩报酬计提日为收益分配日和本计划终止清算分配日的，管理人的业绩报酬为符合业绩报酬计提条件的全部份额根据上述约定计算的业绩报酬之和；业绩报酬计提日为投资者份额退出日的，管理人的业绩报酬为符合业绩报酬计提条件的全部退出份额根据上述约定计算的业绩报酬之和。

资产管理人特别声明：业绩报酬计提基准不是保证收益率。投资者确认并充分了解，本计划的相关业绩报酬计提基准仅供管理人计算提取业绩报酬使用，不构成管理人、托管人对受托资产本金及收益状况的任何预测、承诺或担保。投资有风险，投资者面临无法取得相应收益甚至损失本金的风险。

三、 变更《原合同》第十一节第（一）条：

原为：

（一）本资产管理计划的投资经理由资产管理人负责指定。本资产管理计划的投资经理为【余婧】。

投资经理简介如下：余婧，复旦大学理学硕士，10 年以上从业经验。2023 年 9 月加入信达证券资产管理事业部，曾任职于中泰证券，山西证券等券商，具有丰富的权益类投研工作经验；策略类型包括量化选股、指数增强、量化中性以及各类套利策略等。擅长运用各类数据进行量化建模，并结合衍生品工具和风险模型有效控制组合波动。

变更为如下内容：

（一）本资产管理计划的投资经理由资产管理人负责指定。本资产管理计划的投资经理为【余婧】、【李志强】。

投资经理简介如下：

余婧，复旦大学理学硕士，10 年以上从业经验。2023 年 9 月加入信达证券资产管理事业部，

曾任职于中泰证券，山西证券等券商，具有丰富的权益类投研工作经验；策略类型包括量化选股、指数增强、量化中性以及各类套利策略等。擅长运用各类数据进行量化建模，并结合衍生品工具和风险模型有效控制组合波动。

李志强，中央财经大学金融学硕士，CFA 持证人，5 年证券从业经验。2017 年加入信达证券股份有限公司资产管理事业部，先后担任股票研究员、投资顾问等职务，在宏观策略、资产配置、周期行业研究及市值管理方面具有丰富的投资研究经验。

四、《原合同》其他条款不变。本补充协议为《原合同》的组成部分，本补充协议与《原合同》内容不一致之处，以本补充协议的约定为准，本补充协议未尽事宜，以《原合同》约定的为准。由管理人负责向全体委托人披露本补充协议相应条款的修订事宜。

五、本补充协议自各方法定代表人（负责人）或授权代表签署并盖公章或合同专用章之日生效。本补充协议一式陆份，投资者、管理人、托管人各执贰份，每份具有同等法律效力。

（以下无正文）

(本页无正文，为《信达证券信丰1号单一资产管理计划资产管理合同之补充协议》签署页)

投资者：信达投资有限公司 (盖章)

法定代表人或授权代表 (签章):

林弟站

签署日期: 2025 年 6 月 10 日

管理人: 信达证券股份有限公司 (盖章)

法定代表人或授权代表 (签章):

1100000262339

签署日期: 2025 年 6 月 13 日

托管人: 中国建设银行股份有限公司北京市分行 (盖章)

负责人或授权代表 (签章):

司楠

签署日期: 2025 年 6 月 16 日

格米格

关于参与“信达证券信丰1号单一资管计划”投资事项的补充协议

甲方：信达投资有限公司（以下简称“投资者”）

乙方：信达证券股份有限公司（以下简称“管理人”）

丙方：中国建设银行股份有限公司北京市分行（以下简称“托管人”）

鉴于投资者、管理人和托管人已签署《信达证券信丰1号单一资产管理计划资产管理合同》（合同编号：【CSCA08-2025-298】号，下称“《资管合同》”），现经投资者、管理人和托管人三方友好协商，就三方参与的“信达证券信丰1号单一资管计划”投资事项签订本补充协议（以下简称“本协议”），以兹共同遵守。

本协议具体内容如下：

一、投资者参与信达证券信丰1号单一资产管理计划的总规模不超过200亿元；

二、本协议的生效条件为：（1）本协议各方法定代表人（负责人）或授权代表签署并加盖公章或合同专用章；（2）投资者已按照其适用的境内外法律、法规和规则（包括但不限于《香港联合交易所有限公司证券上市规则》）等的要求履行相应的公司治理程序和披露程序。

三、本协议一式陆份，投资者、管理人、托管人各执贰份，每份具有同等法律效力。

（以下无正文）



(本页无正文，为《关于参与“信达证券信丰1号单一资管计划”投资事项的
合作协议》签署页)

甲方：信达投资有限公司 (盖章):

法定代表人或授权代表 (签章):

签署日期: 2025 年 6 月 26 日

乙方：信达证券股份有限公司 (盖章)

法定代表人或授权代表 (签章):

签署日期: 2025 年 6 月 26 日

丙方：中国建设银行股份有限公司北京市分行 (盖章)

负责人或授权代表 (签章):

签署日期: 2025 年 6 月 26 日