

编号：

长信基金-众锐8号混合型集合资产管理计划  
资产管理合同

资产管理人：[长信基金管理有限责任公司]

资产托管人：[招商银行股份有限公司北京分行]

## 目 录

一、前言.....	2
二、释义.....	2
三、承诺与声明.....	4
四、当事人及权利义务.....	6
五、资产管理计划的基本情况.....	11
六、资产管理计划份额的预警线和止损线.....	13
七、资产管理计划的募集.....	13
八、资产管理计划的成立与备案.....	15
九、资产管理计划的参与、退出与转让.....	15
十、份额持有人大会及日常机构.....	21
十一、资产管理计划份额的登记.....	21
十二、资产管理计划的投资.....	22
十三、投资顾问（如有）.....	25
十四、分级安排（如有）.....	25
十五、利益冲突及关联交易.....	26
十六、投资经理的指定与变更.....	27
十七、资产管理计划的财产.....	28
十八、投资指令的发送、确认与执行.....	30
十九、交易及清算交收安排.....	33
二十、越权交易的界定.....	35
二十一、资产管理计划财产的估值和会计核算.....	38
二十二、资产管理计划的费用与税收.....	41
二十三、资产管理计划的收益分配.....	44
二十四、信息披露与报告.....	45
二十五、风险揭示.....	47
二十六、资产管理计划的变更、终止与财产清算.....	54
二十七、违约责任.....	58
二十八、法律适用和争议的处理.....	59
二十九、资产管理合同的效力.....	60
三十、其他事项.....	60
长信基金-众锐 8 号混合型集合资产管理计划风险提示函.....	65
衍生品投资风险揭示函.....	74
附件一：托管银行证券资金结算协议.....	76
附件二：授权通知书（样本）.....	86
附件三：划款指令书（格式）.....	87
附件四 共用交易单元说明函.....	88
附件五 电子指令启用函（样本）.....	89

## 一、前言

订立本合同的依据、目的和原则：

1、本资产管理合同依据相关法律法规及业务规则订立。

2、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。

3、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。

4、资产管理人应当对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。资产委托人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。

5、资产委托人自签订本资产管理合同即成为本资产管理合同的当事人。在本计划存续期间，资产委托人自委托财产全部退出资产管理计划之日起，该资产委托人不再是本资产管理计划的投资者和本资产管理合同的当事人。

## 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《长信基金-众锐8号混合型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或补充

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法律法规关于合格投资者要求的投资者。

3、**资产管理人/管理人**：长信基金管理有限责任公司

4、**资产托管人/托管人**：招商银行股份有限公司北京分行

5、**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。

6、**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。本资产管理计划全称为长信基金-众锐8号混合型集合资产管理计划。

7、**计划说明书**：指《长信基金-众锐8号混合型集合资产管理计划说明书》，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。

8、**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。

9、**交易日**：指上海证券交易所、深圳证券交易所等证券交易场所的正常交易日。

10、**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。

11、**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及其他证券类账户。

12、**银行托管专户**：指资产托管人根据有关规定为本资产管理计划财产开立的专用存款账户

13、**期货资金账户**（如有）：指资产管理人为本资产管理计划在期货公司开立的用于存放本资产管理计划期货保证金的账户。

14、**期货结算账户**（如有）：指资产托管人为本资产管理计划在具有保证金存管资格的商业银行开立的用于向本资产管理计划期货资金账户进行资金汇入、追加、提取和清退等划转的专用银行账户，该期货结算账户为本资产管理计划期货资金账户对应的唯一银行结算账户。期货结算账户与**银行托管专户**为同一账户。

15、**委托财产/委托资产/资产管理计划财产**：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、**资产管理计划财产总值**：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、**资产管理计划财产净值**：指本资产管理计划财产总值减去负债（包括但不限于管理费、托管费、业绩报酬（如有）、交易佣金）后的价值。

18、**资产管理计划份额净值**：指计算日本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、**资产管理计划财产估值**：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财产净值和份额净值的过程。

20、**初始募集期间**：指本资产管理合同及计划说明书中载明的，自计划份额发售之日起最长不超过[60]天的期间。

21、**存续期**：指本计划成立至终止之间的期限。

22、**本合同生效日/资产管理计划成立日**：指资产管理人在本计划的募集金额缴足之日起十个工作日内，由资产管理人公告资产管理计划成立之日。

23、**认购**：指在本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**：指在本资产管理计划开放日，资产委托人按照本合同的约定参与本计划份额的行为。

25、**退出**：指在本资产管理计划开放日，资产委托人按照本合同的约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本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**：本资产管理计划通过资产管理人或资产管理人委托的销售机构向客户进行募集。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》或资产管理人发布的相关公告为准。

28、**月度对日**：月度对日指本资产管理计划成立日之后月度的对应日，如2009年1月1日的月度对日之后各月度的对应日，即2009年2月1日、2009年3月1日等。如该对应日期为非工作日，则顺延至下一个工作日；若该日历年中不存在对应日期的，则月度对日为计划成立日所在月份对应的以后各月度月份下一个月份的第一个工作日（如2012年2月29日的年度对日为2012年3月1日）。

29、**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。

30、**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、政策变动、罢工、停工、停电、通讯失败等情形。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，以及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。

31、**信义义务**：一是忠实义务，资产托管人按照合同约定义务为委托人利益行事，不为自己或他人谋取私利，二是勤勉义务，资产托管人勤勉尽职、专业审慎履行本合同约定义务。

### 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资产委托人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、已经了解资产委托人的风险偏好、风险认知能力和承受能力，对资产委托人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，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）资产托管人承诺

1、按照相关法律法规的规定，恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉地安全保管委托财产，

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、在资产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，维护投资者权益。

4、履行本合同约定的其他义务。

### （三）资产委托人声明

1、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。

2、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就资产管理计划的收益状况或本金不受损失作出任何承诺，了解“卖者尽责，买者自负”的原则，投资于本计划将自行承担投资风险。资产委托人确认，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。

3、向资产管理人或代理销售机构提供的有关投资目的、投资偏好、投资限制、财产收入情况和风险承受能力等基本情况真实、完整、准确、合法，不存在任何虚假陈述、重大遗漏或误导。前述信息资料如发生任何实质性变更，及时书面告知资产管理人或代理销售机构。

4、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、托管面临本合同第二十五部分中列举的各类风险，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。

5、承诺其知悉《中华人民共和国反洗钱法》、《金融机构报告涉嫌恐怖融资的可疑交易管理办法》、《金融机构客户身份识别和客户身份资料及交易记录保存管理办法》、《金融机构大额交易和可疑交易报告管理办法》等反洗钱相关法律法规的规定，将严格遵守上述规定，不会违反任何前述规定；承诺其资金来源不属于违法犯罪所得及其收益；承诺出示真实有效的身份证件或者其他身份证明文件，提供真实有效的业务性质与股权或者控制权结构、受益所有人信息等资料；承诺积极履行反洗钱职责，不借助本业务进行洗钱等违法犯罪活动。

### （四）资产委托人承诺及保证

资产委托人承诺其符合法律法规、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、在中国证券投资基金业协会登记的私募基金管理人、商业银行、商业银行理财子公司、金融资产投资公司、信托公司、保险公司、保险资产管理机构、财务公司及中国证监会认定的其他机构；

(4) 接受国务院金融监督管理机构监管的机构发行的资产管理产品；

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

(6) 中国证监会视为合格投资者的其他情形。

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，投资于本计划的资产管理产品向上穿透后应确保本计划不构成《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》资产管理产品嵌套的情况，并且不得利用本资产管理计划作为其规避投资范围、杠杆约束等监管要求的通道。承诺作为本资产管理计划资产委托人期间不从事任何利益输送、内幕交易、操纵证券交易价格等违法违规行为。

#### 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，详细情况在合同签署页列示。

资产管理计划设定为均等份额，除资产管理合同另有约定外，资产委托人持有的每份计划份额具有同等的合法权益。

##### 2、资产委托人的权利

(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、中国证监会及基金业协会规定和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担能力问卷，如实提供资金来源、金融资产、收入及负债情况，并对其真实性、准确性和完整性负责，签署合格投资者相关文件；
- (3) 除公募资产管理产品外，以合伙企业、契约等非法人形式直接或者间接投资于资产管理计划的，应向管理人充分披露实际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) 如实向管理人或资产管理计划代理销售机构提供法律法规规定的信息资料及身份证明文件，配合管理人及/或代理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；
- (8) 不得违反本合同的约定干涉资产管理人的投资管理行为；
- (9) 不得从事任何有损本计划及其投资者、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；
- (12) 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：长信基金管理有限责任公司  
住所：中国（上海）自由贸易试验区银城中路 68 号 9 楼  
统一社会信用代码：913101157503035375  
法定代表人或授权代表：刘元瑞  
联系人：芦建祯  
通讯地址：中国（上海）自由贸易试验区银城中路 68 号 9 楼  
邮政编码：200120  
联系电话：021-61009999  
传真：021-61009800

##### 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（含业绩报酬（如有））；
- (3) 按照有关法律法规的规定和本合同约定，行使因资产管理计划财产投资所产生的权利；
- (4) 根据有关法律法规的规定和本合同约定，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行为，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本计划提供募集、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，代表本计划行使投资过程中产生的权属登记等权利；
- (7) 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) 选择、更换律师、会计师或其他为计划提供服务的外部机构；
- (9) 在符合法律法规规定的前提下，制订、修改有关资产管理计划认购、参与、退出、收益分配等方面的业务规则；
- (10) 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信息资料及身份证明文件，并在上述资料 and 文件发生变更时，及时提交变更后的相关资料和文件；
- (11) 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) 对资产委托人的风险识别能力和风险承担能力进行评估，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，向资产委托人充分揭示相关风险；
- (6) 配备足够的具有专业能力的人员进行投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作资产管理计划财产；
- (7) 建立健全内部管理等制度，保证所管理的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；
- (8) 除依据法律法规的规定及本合同约定外，不得为自身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，不得泄露本计划的投资计划、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) 按照本合同约定负责本计划会计核算并编制财务会计报告；

(15) 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；

(16) 根据法律法规的规定与本合同约定，编制向资产委托人披露的本计划季度、年度等定期报告；

(17) 办理与委托财产管理业务活动有关的信息披露事项；

(18) 按照法律法规的规定，保存本计划的会计账册、妥善保存有关的合同协议、交易记录等文件、资料和数据，保存期限自本计划终止之日起不少于 20 年；

(19) 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资产委托人；

(20) 按照我国有关反洗钱法律、行政法规，履行客户身份识别反洗钱义务，识别、核实资产委托人的身份及资产管理计划的受益所有人，并按监管规定保存相关身份信息、资料；在客户身份识别的基础上对客户进行洗钱风险等级划分，对高风险的客户采取适当的风控措施；在法律允许范围内，配合资产托管人开展客户身份识别特别是受益所有人的识别工作，并提供必要客户信息、资料等；履行可疑交易报告义务，并对可疑客户采取必要的管控措施。根据反洗钱政策及法规，要求资产委托人积极配合完成（包括本合同签订前和履行过程中的）反洗钱调查等必要程序；

根据《中国人民银行关于加强反洗钱客户身份识别有关工作的通知（银发【2017】235号）》（以下称“235号文”）、《中国人民银行关于进一步做好受益所有人身份识别工作有关问题的通知（银发【2018】164号）》（以下称“164号文”）的相关要求，单一资产管理计划、集合资产管理计划将直接持有或穿透后持有超过 25% 权益份额的自然人作为托管产品的受益所有人；不存在上述条件自然人的，将基金经理或者直接操作管理基金的自然人判定为托管产品受益所有人；不存在上述条件自然人的，将主要负责人、主要管理人或者主要发起人等作为托管产品的受益所有人；

(21) 采取了适当的措施，确保资产管理计划的委托人、受益所有人等不得被列入我国公安部等有权部门发布的恐怖活动组织及恐怖活动人员名单，不得被列入联合国及其他国家（地区）发布且得到我国承认的反洗钱和反恐怖融资名单，或中国人民银行及其他监管机构要求执行的反洗钱和反恐怖融资名单；

(22) 资产管理计划的投资行为不得违反我国、联合国及其他可适用的经济制裁或反洗钱法律法规，不得被用于其他洗钱、恐怖融资、逃税、欺诈等非法用途；

- (23) 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;
- (24) 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;
- (25) 聘请符合《证券法》规定的会计师事务所对年度财务会计报告进行审计;
- (26) 建立并保存投资者名单;
- (27) 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;
- (28) 向投资者支付的受托资金及收益返回其参与资产管理计划时使用的结算账户或其同名账户;
- (29) 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: 招商银行股份有限公司北京分行  
住所: 北京市西城区复兴门内大街 156 号  
统一社会信用代码: 91110102801105478Y

负责人或授权代表: 张诚

联系人: 吴姝靓

通讯地址: 北京市西城区月坛南街甲 1 号院 3 号楼

联系电话: 010-86493054

传真: 010-66428045

#### 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) 根据本合同及其他有关规定, 监督资产管理人对资产管理计划财产的投资运作;
- (3) 按照本合同的约定, 及时、足额获得资产托管费;
- (4) 相关法律法规、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财产;
- (2) 除依据法律法规规定和本合同的约定外, 不得为自身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) 为所托管的不同财产分别设置资金账户、证券账户等投资交易必须的相关账户, 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) 按规定开设和注销本计划的银行托管专户及其他投资所需账户;

- (6) 复核资产管理计划资产净值和份额净值；
- (7) 办理与资产管理计划托管业务活动有关的信息披露事项；
- (8) 根据相关法律法规和本合同约定，复核资产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；
- (10) 按照法律法规规定和本合同约定，根据资产管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；
- (11) 对投资信息和相关资料负保密义务，除法律法规、监管机构及审计要求外，不得向任何机构或者个人泄露相关信息和资料；
- (12) 按照法律法规的规定，保存本计划的会计账册，妥善保存有关的会计凭证、合同协议、交易记录等文件资料，保存期限自本计划终止之日起不少于 20 年；
- (13) 根据法律法规规定和合同约定的监督内容和监督方式，监督管理人的投资运作，发现资产管理人的投资或清算指令违反法律、行政法规、中国证监会的规定及资产管理合同约定的，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；
- (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) 国家有关法律法规、监管机构及本合同规定的其他义务。

## 五、资产管理计划的基本情况

### (一) 本计划名称：

长信基金-众锐8号混合型集合资产管理计划

### (二) 本计划类别：

- 固定收益类
- 权益类
- 期货和衍生品类
- 混合类

### (三) 本计划运作方式：

- 封闭式
- 开放式

开放期：定期开放式（每年开放一次）。

### (四) 本计划投资目标：

本计划追求在有效控制风险的前提下力争实现每年较高的回报。

### (五) 本计划主要投资方向：

本计划主要投资于股票、债券、经银行间市场交易商协会批准注册发行的各类债务融资

工具、公募基金、货币市场工具、银行存款（包括定期存款及协议存款）、同业存单、债券回购（不参与正回购）、股指期货以及法律、法规、监管规定允许范围内的其他金融工具，资产委托人同意委托资产可以投资于资产管理人管理的公开募集证券投资基金。

（六）本计划投资比例：

1) 权益类资产的投资市值占资产总值的 0-80%，具体包括：股票（包括主板、创业板、科创板、新股申购、定向增发等其他经中国证券监督管理委员会核准或注册上市的股票）、港股通标的股票（内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票）等；

2) 固定收益资产的投资市值占资产总值的 0-80%（不含 80%），具体包括：国债、地方政府债、金融债、央行票据、公司债、企业债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券、可交换债券等符合监管规定的固定收益类金融工具；

3) 期货和衍生品：股指期货。期货和衍生品投资应遵守持仓合约价值金额占资产总值的 0-80%（不含 80%）且保证金账户权益不得超过计划总资产的 20%。

证券投资基金投资（不包含货币市场基金）比例区分最终投向资产类别（根据披露的定期报告）穿透计算。如法律法规或监管机构以后允许投资其他品种，资产管理人与资产委托人协商一致，并征得资产托管人同意后，可以将其纳入投资范围。如因监管政策变化导致无法投资于上述投资品种的，管理人将按照监管要求进行妥善处理，并无需承担任何赔偿责任。

如法律法规或监管机构以后允许投资其他品种，资产管理人与全体资产委托人协商一致，并征得资产托管人同意后，可以将其纳入投资范围。如因监管政策变化导致无法投资于上述投资品种的，管理人将按照监管要求进行妥善处理，并无需承担任何赔偿责任。

（七）本计划风险等级：

R4，即较高风险。

（八）本计划存续期：

自资产管理计划成立之日起【3】年

（九）本计划最低初始规模：

本计划最低初始规模应不低于 1000（大写：壹仟）万元人民币。

（十）本计划份额的初始募集面值：

人民币 1.00 元。

（十一）本计划的分级安排（如有）

本计划无分级安排。

（十二）本计划的估值与核算、信息技术系统等服务机构（如有，请列明服务机构的名称和在基金业协会登记的业务登记编码）

本计划的估值与核算、信息技术系统由资产管理人担任。

资产管理人应切实履行职责，并对服务机构进行监督。资产管理人依法应当承担的责任

不因聘请服务机构而免除。

(十三) 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 (如系 FOF 或 MOM 产品, 请相应说明)

本计划非 FOF 基金资产管理计划 (FOF) 或管理人中管理人资产管理计划 (MOM)。

(十四) 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、资产管理计划份额的预警线和止损线

(一) 预警线

资产管理计划运作期间, 任一交易日 (T 日) 收市后, 当本资产管理计划份额净值小于或等于本资产管理计划的预警线【0.7000 元】且高于本资产管理计划的止损线【0.6000 元】(不含) 时, 本计划应于下一交易日 (T+1 日) 起逐渐将计划资产变现, 使得本计划所持有的非现金类资产净值占本计划资产总值的比例小于等于 70%, 直至本计划份额净值恢复至 0.7000 元 (不含) 以上为止。

(二) 止损线

资产管理计划运作期间, 任一交易日 (T 日) 收市后, 当本资产管理计划份额净值小于或等于本资产管理计划的止损线【0.6000 元】时, 资产管理人应自下一交易日 (T+1 日) 起将计划资产变现, 直至计划资产全部变现为止, 本计划提前终止, 实际变现后的计划份额净值可能低于本计划止损线, 资产管理人按照实际变现所得的计划资产净值清算。若变现期间计划份额净值恢复至 0.6000 元 (不含) 以上, 则可停止止损变现, 并根据本合同约定继续运作。

预警线、止损线由资产管理人进行监控, 资产托管人负责按本合同约定复核本产品净值, 配合进行账务处理。

## 七、资产管理计划的募集

(一) 本计划的募集期限、募集渠道、募集对象

1、募集期限

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

资产管理人有权根据资产管理计划初始募集的实际情况按照相关程序提前终止初始募集, 此类变更适用于所有销售机构。相关公告在资产管理人指定的网站及时公告, 即视为履行完毕提前终止初始募集的程序。资产管理人发布公告提前结束初始募集的, 本资产管理计划自公告之时起不再接受认购申请。

## 2、募集渠道

本资产管理计划通过资产管理人的直销机构或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或资产管理人发布的相关公告为准。

## 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本合同第三部分（四）条件的资产委托人。

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）本计划的最低认购金额和支付方式

本计划认购资金应以现金形式交付。

资产委托人在初始募集期间的认购金额不低于40万（大写：肆拾万）元人民币（不含认购费用），并可多次认购，初始募集期间追加认购金额不低于1万（大写：壹万）元人民币。

### （三）本计划份额的认购费用

1、本资产管理计划认购费率为：[0]%。

2、本资产管理计划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）/计划份额初始销售面值

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，并要求代理销售机构将相关资料提供给资产管理人。

2、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约定的前提下，以各销售机构的具体规定为准。

3、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，仅代表销售机构确实收到了认购申请。认购申请一经受理，不得撤销。

认购申请采取时间优先、金额优先原则进行确认，即不同时间提交的申请，对申请时间在先的申请予以确认；相同时间提交的申请，对金额较大的申请予以确认。申请是否有效应以注册登记机构的确认并且资产管理计划成立为准。资产委托人届时应向各销售机构查询最终确认情况和有效认购份额。注册登记机构有权就该确认原则制定细则，投资者应予遵守，以确保本计划成立时本资产管理计划的有效认购人数不超过200人。

### （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）募集结算专用账户和销售机构委托募集账户（如有）、募集金额，具体以计划说明书或管理人公告登载为准。

## 八、资产管理计划的成立与备案

### （一）本计划成立的条件

- 1、募集过程符合法律法规的规定；
- 2、初始募集规模不低于 1000（大写：壹仟）万元人民币；
- 3、投资者人数不少于 2 人，且不超过 200 人；
- 4、符合中国证监会的规定及本合同约定的其他条件。

### （二）本计划的成立与备案

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十个工作日内，由资产管理人公告本资产管理计划成立。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，向资产托管人提供资产管理计划资产备案登记证明。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。

### （三）本合同的生效

本合同自本资产管理计划成立之日起生效。

### （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 日内返还投资者已缴纳的款项，并加计银行同期活期存款利息。

## 九、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或资产管理人发布的相关公告为准。

## （二）参与和退出的开放日和时间

除本资产管理合同另有约定外，本资产管理计划每年开放一次计划份额的参与和退出，资产委托人进行参与、退出申请仅可在本计划开放期内进行，在封闭期内无法进行参与和退出。本计划开放期原则上不超过10个工作日，即原则上不超过本计划成立日年度对日（T日）之日起10个工作日（T+9日），开放日每日接受资产委托人的参与和退出申请。具体开放时间以资产管理人公告为准。资产管理人应于本计划开放期前一个工作日在资产管理人网站（www.cxfund.com.cn）发布开放公告。资产管理人发布开放公告即视为履行告知全体委托人本计划开放的义务，资产管理人不再以其他方式另行通知本计划的委托人。

原则上开放时间为开放日的9:30-15:00。若出现本资产管理计划所投资的主要市场因节假日休市、暂停交易、或出现新的证券交易市场或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。资产管理人通过销售机构通知前述调整事项即视为履行了告知义务。

4、本计划不接受违约退出。

## （三）临时开放期

经全体资产委托人协商一致变更资产管理合同或本计划展期的，资产管理人将设置临时开放期，该临时开放期可为资产委托人办理退出手续。临时开放期的具体开放日及开放时间等以资产管理人届时发布的相关公告为准。

## （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

（1）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。资产委托人可在销售机构办理业务后的第[3]个工作日至各销售机构查询最终确认情况。

（2）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。

(3) 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之日起不超过[7]个工作日内划往资产委托人账户。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，但最迟应在新的原则实施前[3]个工作日告知资产委托人。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

资产委托人在资产管理计划存续期开放日购买资产管理计划份额的，如资产委托人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（不含认购费用），在开放日内追加参与的，每次参与的金額应不低于 1 万元人民币（不含参与费用）。

当投资者持有的**资产管理计划财产净值**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**资产管理计划财产净值**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**资产管理计划财产净值**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**资产管理计划财产净值**不低于 40 万元人民币。

当投资者持有的**资产管理计划财产净值**低于 40 万元人民币（含本数）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，资产管理人进行前述调整必须提前[3]个工作日告知资产委托人。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：

净参与金额 = 参与金额 / (1 + 参与费率)

参与费用=参与金额-净参与金额

参与份额=净参与金额÷T日资产管理计划份额净值

T日为管理人受理投资者有效申请的开放日。

参与份额计算结果按照舍去尾数法，保留到小数点后两位，因计算误差产生的损失由资产管理计划财产承担，产生的收益归资产管理计划财产所有。

## 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、收益或损失由资产管理计划财产承担。

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

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

(5) 法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

资产管理人决定拒绝接受全部或部分参与申请时，参与款项将无息退回资产委托人账户。

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的其他情形。

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

3、在如下情况下，资产管理人可以暂停接受资产委托人的退出申请：

(1) 因不可抗力导致资产管理人无法支付退出款项；  
(2) 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) 发生连续巨额赎回；

(5) 法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

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

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

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

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

#### (八) 大额退出的通知

任一委托人在开放日退出金额超过人民币500（大写：伍佰）万元的，应当提前[10]个工作日书面通知管理人。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

单个工作日中，本资产管理计划需处理的净退出申请总份额超过本资产管理计划上一工作日资产管理计划总份额的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[15]个工作日。

(2) 部分延期退出：当资产管理人认为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，资产管理人可在该期的开放日内接受部分退出申请，其余部分的退出申请在下一期的开放日予

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至下一期的开放日退出的表示外，自动转为下一期的开放日的退出处理，转入下一期的开放日的退出申请的退出价格为下一期的开放日的资产管理计划份额净值，以此类推，直到全部退出为止。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，资产管理人可按全额退出处理。发生部分延期退出时，资产管理人可以适当延长退出款项的支付时间，但最长不应超过[15]个工作日。

(3) 巨额退出的通知：当发生巨额退出并部分延期退出时，资产管理人应当在[3]个工作日内通知资产委托人，并说明有关处理方法；同时资产管理人应当按照法律法规的规定及时履行报告义务。

(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，资产管理人应当在[5]个工作日内通知资产委托人，并说明有关处理方法；同时资产管理人应当按照法律法规的规定及时履行报告义务。

#### (十) 份额转让

1、根据法律法规、监管机构、交易所的相关规定，资产委托人可以通过交易所交易平台以及中国证监会认可的其他方式向符合合格投资者条件的特定客户转让其持有的资产管理计划份额，并按规定办理份额变更登记手续。转让后，持有资产管理计划份额的合格投资者合计不得超过二百人。

2、资产委托人转让其持有的资产管理计划份额的业务规则，由资产管理人依据法律法规、监管机构、交易所的相关规定制定并不时修订。

3、资产委托人通过交易所交易平台转让资产管理计划份额的，转让人和受让人应当按照转让份额面值（即“转让的计划份额数\*1”元）的0.01%分别向资产管理人缴纳转让手续费，同时还需按照届时交易所的规定向交易所缴纳相关费用（由资产管理人代扣代缴）。

#### (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”是指司法机关依据生效司法文书将资产委托人持有的计划份额强制划转给其他自然人、法人、非法人组织的情形。

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。符合条件的非交易过户申请自申请受理日起[2]个月内办理；申请人按注册登记机构规定的标准缴纳过户费用。

(十二) 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。

(十三) 资产管理计划份额转让或非交易过户的后果

资产委托人将其所持资产管理计划份额全部进行转让或非交易过户的,自转让或非交易过户完成之日起,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,受让方自转让或非交易过户完成之日起持有所受让的资产管理计划份额,并根据资产管理计划文件规定享有相应的份额利益,受让方应遵守资产管理合同规定,按照资产管理计划文件行使相应权利、履行相关义务、承担投资风险。

## 十、份额持有人大会及日常机构

本资产管理计划不设置份额持有人大会及日常机构。

## 十一、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、严格按照法律法规规定和本资产管理合同约定的条件办理本资产管理计划的注册登记业务。

4、严格按照法律法规规定和本资产管理合同的约定计算业绩报酬(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、按照本资产管理计划合同的约定，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、注册登记机构或其他注册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。

## 十二、资产管理计划的投资

### (一) 本计划投资目标

本计划追求在有效控制风险的前提下力争实现获得每年较高的回报。

### (二) 本计划投资范围及比例

本计划主要投资于股票、债券、经银行间市场交易商协会批准注册发行的各类债务融资工具、公募基金、货币市场工具、银行存款（包括定期存款及协议存款）、同业存单、债券回购（不参与正回购）、股指期货以及法律、法规、监管规定允许范围内的其他金融工具，资产委托人同意委托资产可以投资于资产管理人管理的公开募集证券投资基金。

本计划投资比例：

1) 权益类资产的投资市值占资产总值的 0-80%，具体包括：股票（包括主板、创业板、科创板、新股申购、定向增发等其他经中国证券监督管理委员会核准或注册上市的股票）、港股通标的股票（内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票）等；

2) 固定收益资产的投资市值占资产总值的 0-80%（不含 80%），具体包括：国债、地方政府债、金融债、央行票据、公司债、企业债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券、可交换债券等符合监管规定的固定收益类金融工具；

3) 期货和衍生品：股指期货。期货和衍生品投资应遵守持仓合约价值金额占资产总值的 0-80%（不含 80%）且保证金账户权益不得超过计划总资产的 20%。

证券投资基金投资（不包含货币市场基金）比例区分最终投向资产类别（根据披露的定

期报告)穿透计算。如法律法规或监管机构以后允许投资其他品种,资产管理人与资产委托人协商一致,并征得资产托管人同意后,可以将其纳入投资范围。如因监管政策变化导致无法投资于上述投资品种的,管理人将按照监管要求进行妥善处理,并无需承担任何赔偿责任。

### (三) 投资比例超限的处理方式及流程

因证券期货市场波动、证券发行人合并、资产管理计划规模变动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规定的投资比例或者本合同约定的投资比例的,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,资产管理人应当及时向中国证监会相关派出机构报告。

### (四) 本计划投资策略

1、决策依据:根据相关法律、法规和本资产管理合同的有关规定。

#### 2、决策程序

相关研究部门通过对宏观经济、行业与公司、投资策略等方面的研究,为各投资组合的投资决策提供研究支持。

投资经理在投资决策委员会领导下,并在相关研究部门的研究支持下,对投资组合进行独立投资决策,根据资产管理合同要求以及资产管理人内部授权下对投资组合进行管理。

投资经理的投资决策经投资管理系统进行控制,独立的风险管理人员对投资组合进行事前、事中、事后风险管控,确保符合法律法规以及资产管理合同相关要求。

#### 3、投资管理的方法和标准

##### (1) 资产配置策略

本计划将通过跟踪考量通常的宏观经济变量(包括GDP增长率、CPI走势、M2的绝对水平和增长率、利率水平与走势等)以及各项国家政策(包括财政、税收、货币、汇率政策等),并结合美林时钟等科学严谨的资产配置模型,动态评估不同资产大类在不同时期的投资价值及其风险收益特征,追求股票、债券和货币等大类资产的灵活配置和稳健的绝对收益目标。

##### (2) 债券投资策略

本计划债券投资将采取久期策略、收益率曲线策略、骑乘策略、息差策略、个券选择策略、信用策略、中小企业私募债投资策略等积极投资策略,灵活地调整组合的券种搭配,精选安全边际较高的个券,力争实现组合的绝对收益。

##### (3) 股票投资策略

###### 1) 行业配置策略

在行业配置层面,本计划将运用“自上而下”的行业配置方法,通过对国内外宏观经济

走势、经济结构转型的方向、国家经济与产业政策导向和经济周期调整的深入研究，采用价值理念与成长理念相结合的方法来对行业进行筛选。

## 2) 个股投资策略

本计划将结合定性与定量分析，主要采取自下而上的选股策略。依据约定的投资范围，基于对上市公司的品质评估分析、风险因素分析和估值分析，筛选出基本面良好的股票进行投资，在有效控制风险前提下，争取实现计划资产的长期稳健增值。

## (4) 期货投资策略

本计划在进行期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，结合期货定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。资产管理人将充分考虑期货合约的收益性、流动性及风险性特征，运用期货合约对冲系统性风险；利用期货和衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。

## (五) 本计划投资限制

除遵守前述第（二）项规定的投资比例限制外，本计划还需遵循以下限制：

- 1、本计划的总资产不得超过该计划净资产的 200%；
- 2、本计划投资于同一资产的资金不得超过该计划资产净值的 25%；资产管理人管理的全体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%。银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券等中国证监会认可的投资品种除外；
- 3、资产管理人管理的全部资产管理计划及公开募集证券投资基金合计持有单一上市公司发行的股票不得超过该上市公司可流通股票的 30%；完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的资产管理计划、公募基金，以及中国证监会认定的其他投资组合可不受前述比例限制；
- 4、本计划参与股票、债券、可转换公司债券、可交换公司债券等证券发行申购时，单个资产管理计划所申购金额原则上不得超过该资产管理计划的总资产，单个资产管理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；
- 5、本计划投资于港股通标的股票的比例不高于股票资产的 50%。
- 6、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其净资产的 120%。投资于国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券等中国证监会认可的投资品种不受前述规定限制。
- 7、法律法规、中国证监会规定以及本合同约定的其他投资限制。

## (六) 本计划投资禁止

- 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）投资策略的变更

经全体资产委托人、资产托管人与资产管理人协商一致可对投资策略进行变更，变更投资策略应以书面形式作出。投资策略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。

#### （八）建仓期

本计划的建仓期为自本计划成立之日起 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，投资于银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券、货币市场基金等中国证监会认可的投资品种的除外。

建仓期结束后，资产管理计划的资产组合应当符合法律法规规定和合同约定的投向和比例。

#### （九）风险收益特征

本资产管理计划为【较高】风险收益。

#### （十）其他

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

### 十三、投资顾问（如有）

无。

### 十四、分级安排（如有）

本计划不设分级安排。

## 十五、利益冲突及关联交易

### （一）本计划存在或可能存在的关联交易的情形

在遵守相关法律法规及本合同约定，避免不公平交易、利益输送等违法违规行为的前提下，全体资产委托人知悉并同意资产管理人运用计划财产投资于资产管理人、托管人及其控股股东、实际控制人或者其他关联方发行或承销期内承销的证券品种、银行存款、金融产品，以及与前述机构以公平合理的价格进行交易，或者进行其他类型的关联交易，包括本计划与前述机构因管理、托管、销售或交易业务产生的佣金与费用等。

### （二）关联交易的处理和披露

关联交易应按照市场通行的方式和条件参与，公平对待委托财产，不得存在内幕交易、利用非公开信息交易、操纵市场、利益输送等任何违法违规行为。相关关联方名单可以参见资产管理人官网发布的公告。

（1）、重大关联交易：资产管理人运用计划财产投资于资产管理人、资产托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司发行或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易时，资产管理人应事先取得资产委托人的同意（包括但不限于纸质授权、电子邮件或录音电话），事后及时告知资产委托人、托管人，并向中国证监会相关派出机构报告。

（2）、一般关联交易：除前述重大关联交易之外的为一般关联交易，投资者签署本合同即视为已经充分理解并同意本计划从事一般关联交易，资产管理人无需就一般关联交易再行分别取得资产委托人的授权。各方在此同意资产管理人在定期报告中披露相关内容即视为履行事后告知义务，并按规定向中国证监会相关派出机构报告。资产委托人在此同意资产管理人在其官网发布相关公告即视为履行事后告知义务。

（3）、关联交易审批程序：资产管理人在公司内部建立了关联交易管理制度及关联交易审批流程，投资决策相关部门在实施投资决策时就旗下投资组合涉及关联方交易的投资应根据公司内部管理制度要求，提交公司经营管理层审批。对于重大关联交易，除依照前述审批程序外，还应在董事会与经营管理层的管理下执行，并及时对信息披露事项进行确认。

### （三）利益冲突

资产委托人知悉，尽管资产管理人承诺谨慎勤勉地管理委托财产、公平对待各投资组合，本计划在投资和运作过程中可能会存在一些利益冲突情形。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。资产管理人应当视具体利益冲突情形选择在向资产委托人提供的定期报告或临时报告中披露。

### （四）特殊风险揭示

提示投资者注意：本计划可能投资于资产管理人、托管人及其控股股东、实际控制人或者其他关联方发行或承销期内承销的证券品种、银行存款、金融产品，以及与前述机构以公平合理的价格进行交易，或者进行其他类型的关联交易，包括本计划与前述机构因管理、托管、销售或交易业务产生的佣金与费用等。虽然管理人积极遵循委托人利益优先的原则、遵守相关法律法规的规定操作、积极防范利益冲突，但依然不能避免未来可能发生的关联交易和利益冲突风险，可能因资产管理人运用计划财产从事关联交易被监管部门认为存在利益输送、内幕交易的风险，进而可能影响投资者的利益。该类投资标的价格可能会出现下跌，从而使本计划收益下降，甚至带来本金损失。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被限制相关权利的行使，进而可能影响计划财产的投资收益。

#### 一般关联交易风险

投资者签署本合同即视为已经充分理解并同意本计划从事一般关联交易，资产管理人无需就一般关联交易再行分别取得资产委托人的授权，资产管理人在定期报告中披露相关内容即视为履行事后告知义务，可能存在资产委托人因获取上述信息相对滞后而无法及时知悉本计划从事一般关联交易的风险。

#### 重大关联交易风险

资产管理人开展法律法规及本合同约定的重大关联交易的，将事前取得全体资产委托人同意，可能存在部分资产委托人未及时告知或明确拒绝资产管理人开展重大关联交易而导致丧失投资机会的风险。

中国证监会或中国基金业协会对关联交易及利益冲突的规定发生变化或另有规定的，资产委托人知悉并同意资产管理人将根据最新规定要求对关联交易等进行管控或履行信息披露义务。

本章所列的关联方交易范围、重大关联交易与一般关联交易的划分标准以及关联交易审批程序，除法律法规强制规定列为关联方、重大关联交易者或另有规定外，系资产管理人公司制度的规定。如该等制度发生修改或变更导致上述范围、标准或程序调整的，资产管理人无需另行取得资产委托人、资产托管人的事先同意，资产管理人将根据本合同约定向投资者披露。

## 十六、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。

本计划投资经理基本信息如下：

姓名：黄向南

从业简历：黄向南先生南京大学硕士毕业，具有基金从业资格。2016年6月加入长信基金管理有限责任公司，曾任研究员，负责行业、上市公司研究工作，现任专户投资经理。

【黄向南】具有基金从业资格，最近三年未被监管机构采取重大行政监管措施、行政处

罚。资产管理人可根据业务需要变更投资经理，并在变更后及时告知资产委托人。资产管理人在网站公告前述事项即视为履行了告知义务。

## 十七、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，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。

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管理的和资产托管人托管的其他财产。资产管理人、资产托管人不得将资产管理计划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、资产托管人以其固有财产承担法律责任，其债权人不得对资产管理计划财产行使请求冻结、扣押和其他权利。资产管理人、资产托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，资产管理计划财产不属于其清算财产。

5、资产管理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资产管理计划财产强制执行。上述债权人对资产管理计划财产主张权利时，资产管理人、资产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，法律法规另有约定的除外。

6、资产管理计划财产的保管：资产管理计划的现金资产保管在本计划开立在资产托管人的银行托管专户中；资产管理计划投资沪深交易所、银行间市场、证券期货交易所等国务院同意设立的交易场所品种形成的资产登记在本计划开立在中央存管机构的证券账户或账号中；资产管理计划投资公募基金形成的资产登记在本计划开立在此类产品指定的注册登记机构的基金账户中。资产托管人对因为资产管理人投资产生的存放或存管在资产托管人以外机构的委托财产不承担保管责任。由于该等机构或本合同当事人外第三方的欺诈、疏忽、过失或破产等原因给委托财产造成的损失等，以及资产托管人基于从第三方合法获得信息以及合理依赖上述信息而操作导致的委托财产的任何损失，资产托管人均免于承担责任。

### (二) 资产管理计划财产相关账户的开立和管理

资产托管人按照规定开立资产管理计划财产的资金账户、证券账户和期货账户（如有）等投资所需账户，资产管理人应给予必要的配合，并提供所需资料。证券账户和期货账户（如

有)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。资金账户名称应当是“资产管理计划名称”，具体以实际开立为准。

#### 1、银行托管专户

资产托管人按相关规定为本资产管理计划在资产托管人处开立专用存款账户作为本资产管理计划财产的银行托管专户。所留印鉴为托管人印鉴。银行托管专户的所有预留印章印鉴由资产托管人保管和使用。该账户不得透支、提现，保管期间资产委托人、资产管理人、资产托管人三方均不得采取任何使该账户无效的行为。

在保管期间，资产委托人授权资产托管人对银行托管专户全权控制和管理。未经资产托管人书面同意，资产管理人不得自行采取使得银行托管专户、该专户的预留印鉴、网银密钥等无效的行为，否则资产托管人有权拒绝执行相关指令。

除法律法规另有规定外，投资账户户名与本资产管理计划银行托管账户户名一致，投资本金及收益回款账户应指定为本资产管理计划的银行托管账户。

他行存款账户，存款证实书应由托管人保管，预留托管人预留印鉴，托管人保管存款证实书，存款证实书由存款机构上门办理、当面移交，到期后资金必须划回托管账户。存款证实书不得被质押或以任何方式被抵押、并不得用于背书转让。集合产品投资他行存款在存款机构开立的银行账户，包括实体或虚拟账户。存款账户户名应与托管账户保持一致，该账户预留印鉴为托管人指定印章。管理人应该在合理的时间内安排存款的投资和支取事宜。对于任何的存款投资，管理人都必须和存款机构签订存款协议，协议采用托管人模板，协议中涉及托管人相关职责的约定须由管理人和托管人双方协商一致后签署。该协议须由管理人和托管人双方协商一致，内容应至少包含起息日、到期日、存款金额、存款账户、存款利率、存款是否可以提前支取、到期支取账户、存款证实书如何交接以及存款证实书不得转让质押等条款。协议须约定资产托管人名称、地址和账户，并将本资产管理产品托管账户指定为唯一回款账户。存款银行根据其的对账频率，至少每季度向托管人邮寄对账单或回复托管人发送的查询查复。

#### 2、专用证券账户

(1) 根据相关规定，资产托管人为本计划在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司、深圳分公司开设证券账户，用于办理本计划财产在交易所市场进行证券投资时的证券登记和交割。资产管理人应及时向资产托管人提供开立上述证券账户所需资料。

(2) 专用证券账户仅供本计划使用，且只能由资产管理人使用，不得转托管或转指定，但中国证监会另有规定的除外，该账户未经资产委托人、资产管理人、资产托管人三方书面同意不得挪作他用。

计划成立前，资产管理人应向资产托管人提供《交易单元说明函》(附件三)和《产品参数说明函》(附件四)，明确席位信息、佣金费率、佣金计算方式等信息。当相关信息发生变更时，资产管理人应及时向资产托管人提供变更后的《交易单元说明函》和《产品参数说

明函》。

### 3、银行间账户

资产管理人负责以本资产管理计划的名义申请并取得进入全国银行间同业拆借市场的交易资格，并代表本计划进行交易；资产管理人授权资产托管人负责以本资产管理计划的名义在中央国债登记结算有限责任公司、上海清算所开设银行间债券市场债券托管账户，并代表本资产管理计划进行债券交割和资金结算。

### 4、开放式基金账户

若因本计划投资证券投资基金的需要，由资产管理人为本计划在指定的基金公司开立开放式基金账户，用于办理本计划投资于开放式基金时的基金份额登记和交割。

### 5、开户材料真实性

资产管理人承诺其提交给资产托管人的用于办理开户手续的证明文件的真实性，并保证证明文件复印件与原件一致。

### 6、未启用账户的销户

组合开立的以上账户在开立后6个月内未使用的，资产管理人应对以上账户做销户处理，资产托管人应给予必要的协助。

## （三）日常联系人制度

资产管理人、资产托管人应建立业务联系人制度，确定本计划存续期内双方业务联系人及岗位职责权限。首次确定应当按照本合同列明的联系人、邮箱地址进行，若上述信息发生变更，双方可依据已经建立的联系人制度通过其他书面形式通知。

## 十八、投资指令的发送、确认与执行

### （一）投资指令（也即划款指令）要素

资产管理人按与资产托管人约定的形式发送划款指令，资产管理人发送给资产托管人的传真指令必须包括但不限于以下基本要素：产品名称、划款日期、付款人/收款人账户户名、付款/收款账号、开户行、开户行大额支付行号、金额（大小写）、付款/收款事由、划款指令授权书中指定的预留印鉴印章或签字样本。在计划开始运作前，资产管理人应事先书面向资产托管人提供指令启用函（附件五）。指令启用函应明确资产管理人采取电子指令的业务类型、启用日期、紧急情况下发送和接收传真指令的号码、指令确认的电话号码等。启用函应加盖资产管理人业务专用章（预留印鉴）。

### （二）划款指令的授权及变更

#### 1、划款指令的授权

（1）本资产管理计划起始运作前，资产管理人应向资产托管人提供划款指令授权书，

其内容应包括：适用产品范围，被授权人名单、权限及签章样本，被授权业务签发预留印鉴样本，启用时间及有效期间约定。资产管理人出具的划款指令授权书落款应加盖管理人公章和法定代表人（或授权人）签字/签章（若由授权代表签署，还应附上法定代表人的授权书）。资产管理人和资产托管人对授权文件负有保密义务，其内容不得向被授权人及相关操作人员以外的任何人泄露。

（2）划款指令授权书可按照资产管理人旗下管理的、由资产托管人托管的所有产品合并出具，合并出具的情况下，应明确所适用的产品范围。如按照单个产品出具，则应在划款指令授权书中注明该产品名称。

（3）资产管理人应使用传真或其他与资产托管人协商一致的方式向资产托管人发出授权通知，同时电话通知托管人。授权通知经资产管理人与资产托管人以电话方式或其他资产管理人和资产托管人认可的方式确认后，于授权通知载明的生效时间生效，未注明生效时间的以授权通知的落款日期为生效日期。资产管理人在此后三个工作日内将授权通知的正本送交资产托管人。授权通知书正本内容与资产托管人收到的传真不一致的，以资产托管人收到的传真为准，因授权通知书与传真件不一致导致的任何损失，托管人不承担相关责任。

## 2、划款指令授权的变更

（1）资产管理人撤换被授权人员或改变被授权人员的权限，应该提前至少一个交易日，使用传真方式或其他资产管理人和资产托管人认可的方式向资产托管人发出加盖资产管理人公司公章的书面变更通知，同时电话通知资产托管人。被授权人变更通知，经资产管理人与资产托管人以电话方式或其他资产管理人和资产托管人认可的方式确认后，于授权通知载明的生效时间生效，同时原授权通知失效。资产管理人在此后三个工作日内将被授权人变更通知的正本送交资产托管人。变更通知书书面正本内容与资产托管人收到的传真不一致的，以资产托管人收到的传真为准，因变更通知书正本与传真件不一致导致的任何损失，托管人不承担相关责任。

（2）资产托管人更换接受资产管理人指令的人员，应提前通知资产管理人，并通过电话确认。

资产管理人知晓、同意并授权资产托管人收集和使用上述被授权人员的个人信息（包括但不限于姓名、证件号码、手机/电话号码、电子邮箱、地址等）。资产管理人确认并承诺，资产管理人已获得被授权人员同意向资产托管人提供和使用上述个人信息，且被授权人员已知晓和同意个人信息使用用途。资产管理人将对上述个人信息的提供承担全部责任，如违反此项承诺给资产托管人造成损失的，由资产管理人承担一切法律后果。上述个人信息将用于本合同下托管业务的需要。

## （三）划款指令的发送、确认及执行

1、资产管理人若采用传真方式向资产托管人发送指令，指令传送后，资产管理人应进行电话确认。传真以获得资产托管人确认该指令已成功接收之时视为送达。

2、资产管理人有义务在发送指令后及时与托管人进行确认，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，资产托管人不承担任何形式的责任。资产管理人应按照有关法律法规和本合同的规定，在其合法的经营权限和交易权限内发送划款指令。

3、资产托管人收到资产管理人发送的指令后，应对传真划款指令进行审查，验证指令的书面要素（金额、收款账号、收款户名、用途）是否齐全、审核指令加盖的印鉴或签名是否和划款指令授权书中预留的签名样本相符。资产管理人应保证上述文件资料合法、真实、完整、准确和有效。如因资产管理人提供的上述文件不合法、不真实、不完整、不准确或无效而影响资产托管人的审核或给任何第三人带来损失，由资产管理人承担责任。复核无误后应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。

4、资产管理人向资产托管人发送划款指令时，应遵守下述指令截止时间要求。

除网下新股申购、投资定期存款外，资产管理人应在清算市场关闭前或资产管理人指定的划款时间（不晚于清算市场关闭时间）前至少2个工作小时（资产托管人工作时间9点至11点30分，13点至17点）向资产托管人发送划款指令。网下新股申购的划款指令截止时间为划款日上午10:00；投资定期存款的划款指令截止时间为划款日15:00。如资产管理人发送划款指令时给予托管人的划拨执行时间小于2个工作小时或晚于前述指令截止时间的，资产托管人将尽力配合执行，但不承担指令执行失败的责任。由资产管理人原因造成的指令传输不及时、未能留出足够划款所需时间，致使资金未能及时到账所造成的损失由资产管理人承担。

5、资产管理人应向资产托管人提供划款指令相关的交易凭证、合同或其他有效会计资料，确保资产托管人能够据此判断指令的有效性。本委托财产参与银行间市场交易时，资产管理人应将银行间同业拆借中心成交通知单加盖预留印鉴后传真至资产托管人，资产管理人与资产托管人另有约定的除外。

6、在本委托财产申购/认购场外基金时，资产管理人应在向资产托管人提交划款指令的同时将经管理人签署的基金申购/认购申请书以传真形式送达资产托管人，资产托管人审核无误后，应及时将划款指令交付执行，并对划款指令执行情况进行查询，将执行结果通知资产管理人；资产管理人赎回开放式基金时，应在向基金管理公司或代销机构发出基金赎回申请书的同时，传真资产托管人，资产托管人应及时查询到账情况；资产管理人应及时将申购（认购）、赎回交易确认单、分红（红利转份额）确认单等相关业务单据传真至资产托管人。

#### （四）划款指令无法执行的情形与处理

1、资产管理人应确保在资产托管人执行指令时，划款指令所指定的划款金额及其汇划费用合计不超过银行托管专户的资金余额，如因余额不足导致指令无法执行，资产托管人不承担由此造成的资产计划受损的任何责任。

2、如资产管理人发送的划款指令经资产托管人审核后，存在印鉴与划款指令授权书不

符、或关键要素欠缺或模糊不清、或指令相关内容与对应凭据不符等情形，资产托管人有权拒绝执行，并及时通知资产管理人更正，如因资产管理人未及时更正导致指令最终无法执行，资产托管人不承担由此造成的任何损失。

#### （五）划款指令的保管

1、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。当两者不一致时，以资产托管人收到的指令传真件为准。

#### （六）相关责任

1、资产托管人正确执行资产管理人符合本合同规定、合法合规的有效划款指令，资产管理计划发生损失的，资产托管人不承担任何形式的责任。对于因银行托管账户没有充足资金致使资产管理人向资产托管人发出的指令未能及时清算所造成的损失，由资产管理人承担。因资产管理人原因造成的指令发送不及时、指令发送错误、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、未提供符合资产托管人要求的指令附件等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造成未能及时或正确执行合法合规的有效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，但如遇到不可抗力的情况除外。

2、资产托管人根据本合同相关规定履行印鉴和签名的一致性审核职责，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或任何第三人带来的损失。

3、资产托管人发现资产管理人发送的指令有可能违反本合同约定或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；如相关交易已生效，则应通知资产管理人在法规规定期限内及时纠正；对于此类资产托管人事前无法监督并拒绝执行的交易行为，托管人仅负责通知管理人。

## 十九、交易及清算交收安排

### （一）选择代理证券买卖的证券经营机构的程序

资产管理人负责选择代理本资产管理计划财产证券买卖的证券经营机构，并与其签订专用证券交易单元租用协议。资产管理人应及时将资产管理计划财产专用交易单元号、佣金费率等基本信息以及变更情况及时以书面形式通知资产托管人。

管理人最晚于初始委托资产起始运作日前一个工作日以书面形式告知托管人上交所和深交所的交易单元号、交易品种的费率、佣金收取标准和证券账户信息等。最晚于投资期货前一个工作日以书面形式告知托管人在期货公司的交易会员号、期货结算账户信息、交易编

码、交易目的、交易品种的费率、交易保证金率等，并确认已建立银期转账关系。

在合同有效期内若交易单元号、交易会员号、交易编码、或涉及的相关费率等变动，则管理人应在变动生效前一个工作日书面告知托管人。

## （二）投资证券后的清算交收安排

### 1、资产托管人在清算和交收中的责任

（1）本资产管理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，全部由资产托管人负责办理。本资产管理计划财产所有场内证券交易的清算交割由资产托管人作为结算参与人代理所托管资产管理计划财产与中登公司进行结算，场内证券投资的应付清算款由资产托管人根据中登公司的交收指令主动从银行托管专户中扣收。

本资产证券投资的清算交割，由资产托管人通过中登公司上海分公司/深圳分公司、清算代理银行及其他登记结算机构办理。

### （2）证券交易所证券资金结算

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

资产管理人在投资前，应充分知晓与理解中登公司针对各类交易品种制定结算业务规则 and 规定，并遵守资产托管人为履行结算参与人的义务所制定的业务规则 with 规定。

资产托管人代理资产管理计划财产与中登公司完成证券交易及非交易涉及的证券资金结算业务，并承担由资产托管人原因造成的正常结算、交收业务无法完成的责任；若由于资产管理人原因造成的正常结算业务无法完成，责任由资产管理人承担。

（3）对于任何原因发生的证券资金交收违约事件，相关各方应当及时协商解决。

（4）除本合同约定外，资产管理人和资产托管人在委托财产场内清算交收及相关风险控制方面的职责还应按照附件一《托管银行证券资金结算协议》的要求执行。

为有效控制交易结算风险，委托人及管理人知悉并授权托管人向中国证券登记结算有限责任公司报送融资主体相关信息及用于交易资金前端控制的相关数据信息。托管人依据与管理人核对一致的委托财产估值信息向中国证券登记结算有限责任公司报送上述数据信息。托管人按照规则报送了资金前端控制额度后，管理人因超额度导致的交易失败所造成的损失由管理人承担。

## （三）选择期货经纪机构及期货投资资金清算安排

1、本资产管理计划投资于期货前，资产管理人负责选择为本资产管理计划提供期货交易服务的期货经纪公司，并与其签订期货经纪合同。资产管理人、资产托管人和期货公司就资产管理计划参与股指期货交易的具体事项另行签订《期货投资托管操作协议》。

资产管理人应责成其选择的期货公司通过深证通向资产托管人及资产管理人发送以保证金监控中心格式显示本产品成交结果的交易结算报告及参照保证金监控中心格式制作的显示本产品期货保证金账户权益状况的交易结算报告。经资产托管人同意，可采用电子邮件

的传送方式作为应急备份方式传输当日交易结算数据。

本资产管理计划投资于期货发生的资金交割清算由资产管理人选定的期货经纪公司负责办理,资产托管人对由于期货交易所期货保证金制度和清算交割的需要而存放在期货经纪公司的资金不行使保管职责,资产管理人应在期货经纪协议或其他协议中约定由选定的期货经纪公司承担资金安全保管责任。

(四) 银行间债券券款对付结算安排 (如有)

本资产管理计划如涉及银行间市场交易 (中债登、上清所), 资产管理人和资产托管人应在相关账户开户前当另行签署《银行间债券市场券款对付结算业务服务标准协议》。

(五) 参与或退出的资金清算1、T日 (指资产管理计划开放日), 客户进行参与或退出申请, 资产管理人和资产托管人分别计算资产管理计划财产净值, 并进行核对; 资产管理人向资产委托人报告并向注册登记机构发送资产管理计划份额净值。

2、T+2日下午14:00前, 注册登记机构根据T日资产管理计划份额净值计算参与份额或退出金额等, 更新资产委托人数据库, 并将确认的参与或退出汇总数据向资产管理人传送; 资产管理人于T+2日下午15:30前将参与或退出汇总数据 (包括但不限于参与份额、退出金额及相应业绩报酬及相应业绩报酬等) 传送资产托管人。资产管理人、资产托管人根据确认数据进行账务处理。

3、资产管理人应要求注册登记机构开立并管理专门用于办理资产管理计划参与和退出款项清算的“清算账户”。

4、资产管理计划参与和退出款项最晚不迟于T+3日16:00前在注册登记机构的“清算账户”和银行托管专户之间交收。

5、对于应收账款, 资产托管人按照管理人通知要求应及时查收资金是否到账, 对于未准时到账的资金, 应及时通知资产管理人划付, 由此产生的责任应由资产管理人承担。对于应付款, 资产托管人应根据资产管理人的有效指令及时进行划付。

6、注册登记机构应将每个开放日的参与和退出汇总数据传送给资产管理人, 资产管理人将参与和退出汇总数据 (包括但不限于参与份额、退出金额及相应业绩报酬及相应业绩报酬等) 传送资产托管人。资产管理人及注册登记机构应对传递的数据真实性负责。资产托管人应及时查收参与资金的到账情况并根据资产管理人的有效指令及时划付退出款项。

## 二十、越权交易的界定

(一) 越权交易的界定

1、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。

2、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

资产托管人对于承诺监督的越权交易中，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，并立即通知资产管理人在指定的期限内予以纠正，并有权报告中国证监会相关派出机构。

资产托管人对于承诺监督的越权交易中，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要求其限期纠正，并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，应立即提示资产管理人，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。如果因资产管理人的原因发生超买行为，资产管理人必须于T+1日上午11:00前完成融资，确保完成清算交收。

3、越权交易所发生的损失及相关交易费用由资产管理人负担，资产管理人应按资产托管人、资产委托人发生的实际损失进行赔偿，因越权交易所发生的收益归资产管理计划所有。

## （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。资产托管人承诺，在实际可控制的能力范围内，对本计划下述投资事项进行监督：

### 1) 资产托管人根据本合同的约定，对本计划投资范围及比例进行监督。

#### 本计划投资范围及比例

本计划主要投资于股票、债券、经银行间市场交易商协会批准注册发行的各类债务融资工具、公募基金、货币市场工具、银行存款（包括定期存款及协议存款）、同业存单、债券回购（不参与正回购）、股指期货以及法律、法规、监管规定允许范围内的其他金融工具，资产委托人同意委托资产可以投资于资产管理人管理的公开募集证券投资基金。

#### 本计划投资比例：

1) 权益类资产的投资市值占资产总值的0-80%，具体包括：股票（包括主板、创业板、科创板、新股申购、定向增发等其他经中国证券监督管理委员会核准或注册上市的股票）、港股通标的股票（内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的规定范围内的香港联合

交易所上市的股票)等;

2) 固定收益资产的投资市值占资产总值的0-80% (不含80%), 具体包括: 国债、地方政府债、金融债、央行票据、公司债、企业债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券、可交换债券等符合监管规定的固定收益类金融工具;

3) 期货和衍生品: 股指期货。期货和衍生品投资应遵守持仓合约价值金额占资产总值的0-80% (不含80%) 且保证金账户权益不得超过计划总资产的20%。

如法律法规或监管机构以后允许投资其他品种, 资产管理人与全体资产委托人协商一致, 并征得资产托管人同意后, 可以将其纳入投资范围。如因监管政策变化导致无法投资于上述投资品种的, 管理人将按照监管要求进行妥善处理, 并无需承担任何赔偿责任。

2) 资产托管人根据本合同的约定, 对本计划投资限制进行监督。

本计划还需遵循以下限制:

1、本计划的总资产不得超过该计划净资产的200%;

2、本计划投资于同一资产的资金不得超过该计划资产净值的25%; 资产管理人管理的全体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%。银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券等中国证监会认可的投资品种除外; (管理人维度由管理人自行监控)

3、资产管理人管理的全部资产管理计划及公开募集证券投资基金合计持有单一上市公司发行的股票不得超过该上市公司可流通股票的30%; 完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的资产管理计划、公募基金, 以及中国证监会认定的其他投资组合可不受前述比例限制; (管理人维度由管理人自行监控)

4、本计划参与股票、债券、可转换公司债券、可交换公司债券等证券发行申购时, 单个资产管理计划所申购金额原则上不得超过该资产管理计划的总资产, 单个资产管理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; (管理人自行监控)

5、本计划投资于港股通标的股票的比例不高于股票资产的50%。

6、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其净资产的120%。投资于国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券等中国证监会认可的投资品种不受前述规定限制。(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%时, 由管理人告知托管人, 托管人对总资产不得超过其净资产的120%进行监控)

7、法律法规、中国证监会规定以及本合同约定的其他投资限制。

资产托管人对上述指标的监督义务, 仅限于监督由资产管理人管理且由资产托管人托管的所有组合是否符合上述比例限制。托管人对上述指标的监督, 不进行穿透监督, 也即仅监督本计划直接投资的金融产品的比例。

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以外的因

素导致资产管理计划投资不符合法律法规规定的投资比例或者本合同约定的投资比例的，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，资产管理人应当及时向中国证监会相关派出机构报告。

2、资产托管人对资产管理人的投资监督和检查自本计划成立之日起开始。

3、资产托管人投资监督的准确性和完整性受限于资产管理人及其他机构提供的信息，合规投资的最终责任在资产管理人。资产托管人对资产管理人及其他机构提供的信息的真实性、准确性、完整性和有效性不做任何担保、暗示或表示，并且对资产管理人及其他机构提供的信息的真实性、准确性、完整性和有效性所引起的损失不承担任何责任。

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，应立即通知资产管理人，通知管理人即视为托管人已经完全履行了监督和托管职责。

## 二十一、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、估值对象、目的

估值对象为本资产管理计划所持有的所有资产。

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

资产管理计划存续期间，资产管理人与资产托管人在估值核对日（T+[ 1 ]个交易日）完成对估值日T日（每日/每周五/每月末/每季度末）估值结果的核对。资产管理计划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。

管理人在估值核对日将估值表提交托管人进行复核，托管人于管理人提交当日内完成核对。资产托管人对上述核算估值结果进行复核后，以管理人和托管人认可的方式（如电子对账、录音电话或邮件等）告知管理人。

#### 3、估值方法

本计划核算与估值原则应符合本合同、相关法律、法规的规定，并参照《证券投资基金会计核算业务指引》等相关会计管理办法。若有未尽事项，由资产管理人负责在具体投资之前向资产托管人明确。

##### 1) 证券交易所上市的权益类证券的估值

交易所上市的有价证券（包括股票、权证等），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,且最近一个交易日后经济环境未发生重大变化,以最近一个交易日的市价(收盘价)估值;如最近一个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)处于未上市期间的权益类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,如果发行日后未发生影响公允价值计量的重大事件的,采用发行价作为公允价值的最佳估计,已发生影响公允价值计量重大事件的,采用估值技术确定公允价值;

(3)发行时明确一定期限限售期的股票(包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等,不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票),按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

3)固定收益品种的估值

(1)对于已上市交易或已挂牌转让的不含权固定收益品种(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。

(2)对于已上市交易或已挂牌转让的含权固定收益品种(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唯一估值全价或推荐估值全价进行估值;

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机构提供的相应品种的唯一估值全价或推荐估值全价进行估值,同时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)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,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公允价值。

4)同一证券同时在两个或两个以上市场交易的,按证券所处的市场分别估值。

5)基金估值

(1)上市流通的证券投资基金按估值日其所在证券交易所的收盘价估值;估值日无交易的,以最近交易日的收盘价估值。

(2)货币市场基金及短期理财基金按成本估值,按估值日当日的万份收益计提红利。

(3)其他开放式基金以估值日当日基金净值估值,该日无净值的,以最近一日基金净值计算。

6) 期货以估值日的结算价估值, 若估值当日无结算价的, 且最近交易日后经济环境未发生重大变化的, 采用最近交易日结算价估值。法律法规另有规定的, 从其规定。

7) 银行存款按照约定利率在持有期内逐日计提应收利息, 实际利息以银行实际兑付数据为准。

8) 估值计算中涉及港币对人民币汇率的, 将依据下列信息提供机构所提供的汇率为基准: 当日中国人民银行公布的人民币与港币的中间价。

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。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。

#### 4、估值结果认定与估值错误处理

根据有关法律法规的规定, 本资产管理计划的会计责任方为资产管理人, 资产托管人承担复核责任。资产管理人与资产托管人对核算估值结果遵循“谁错谁调整”的原则。如双方经平等协商, 仍无法对会计核算估值结果达成一致意见的情况下, 以资产管理人的意见为准。由此给资产委托人和本计划财产造成的损失, 由资产管理人负责全部赔付, 托管人不承担任何责任。

如资产管理人或资产托管人事后发现资产估值结果存在错误, 或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。必要时, 资产管理人应报告资产委托人, 说明情况及补救措施。

#### 5、暂停估值的情形

- 1) 与本资产管理计划投资有关的证券交易场所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时;
- 2) 因不可抗力或其他情形致使资产管理人无法准确评估资产管理计划资产价值时;
- 3) 中国证监会认定的其他情形。

#### 6、特殊情形的处理

1) 资产管理人按本合同约定的按公允价值进行估值时, 所造成的误差不作为计划份额净值错误处理。

2) 证券交易所及其登记结算公司发送的数据错误, 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, 由此造成的资产管理计划财产估值错误, 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、资产托管人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

### (二) 会计政策

资产管理计划的会计政策比照如下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、会计年度: 本项资产管理计划的会计年度为每年 1 月 1 日至 12 月 31 日。

3、记账本位币：人民币，记账单位为元。

4、会计核算制度：资产管理计划的会计核算应符合本合同、《证券投资基金会计核算业务指引》、《股指期货投资会计核算业务细则》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。

5、资产管理人、资产托管人应根据有关法律法规的规定，对资产管理计划独立建账、独立核算。

6、资产管理人应保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，编制会计报表。

7、资产托管人应定期(□每日/□每周五/√每月末/□每季度末)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。

## 二十二、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(含固定管理费及业绩报酬)

(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) 资产管理合同生效后与之相关的会计师费、审计费、律师费、仲裁费、诉讼费、保全费等

(5) 资产管理计划的注册登记费

(6) 资产管理计划的证券、期货(如有)等账户的开户费用以及资产管理计划的证券交易费用(包括但不限于本计划投资的所有金融工具的交易费、经手费、印花税、证管费、过户费、手续费、经纪商佣金、权证交易的结算费及其他类似性质的费用等)

(7) 资产管理计划财产的银行汇划费用账户费用等

(8) 资产管理计划成立后的资产管理计划信息披露费用

(9) 投资于公募基金需支付的公募基金认(申)购费、赎回费、管理费、托管费等

(10) 按照国家有关规定和本合同约定，可以在资产管理计划资产中列支的其他费用  
第(4)项到第(10)项费用由资产托管人根据其他有关法规及相应合同的规定，按费用支出金额支付，列入或摊入当期资产管理计划财产运作费用。

本资产管理计划银行托管专户上发生的银行结算费用等银行费用(包括手续费，邮电费，账户开户费等)，由资产托管人直接从计划银行托管专户中扣划，无须资产管理人出具划款指令。

### (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

(1) 固定管理费

在通常情况下，资产管理计划管理费按前一日资产管理计划财产净值的年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年实际天数}$ ，本资产管理计划年管理费率为 1 %

H 为每日应计提的资产管理计划管理费

E 为前一日资产管理计划财产净值（产品成立首日以当日实收资本为基数计算）

资产管理计划管理费自资产管理计划起始运作日起，每日计提，按季支付。由资产管理人于次季首日起 5 个工作日内向资产托管人发送资产管理计划管理费划付指令，经资产托管人复核后于次季首日起 10 个工作日内从资产管理计划中一次性支付给资产管理人。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。

## （2）资产管理人的业绩报酬

### 1) 业绩报酬的计提时点及原则

业绩报酬计入资产管理人管理费。

业绩报酬计提区间：本计划的封闭期即业绩报酬计提区间为自本合同生效日起至下一年度对日前一日的期间、每个开放期后第一日至下一个合同生效日年度对日前一日的期间、以及最后一个开放期后第一日至本合同终止日期间。

业绩报酬计提日：本计划的业绩报酬计提日为每个固定收益分配基准日、本计划终止日以及资产委托人退出确认日（若根据合同约定设置临时开放期），固定收益分配基准日为每个封闭期的最后一个工作日。

在业绩报酬计提日，资产管理人按资产委托人所持有份额在该业绩报酬计提日对应的封闭期间超额收益的一定比例收取业绩报酬。业绩报酬以计划资产的投资增值部分（包含净值增长部分）高于预先设定的业绩报酬计提基准 R 的部分为基础进行计算，具体计算方法如下：

（1）当封闭期内计划份额累计净值年化增长率  $\leq R$  时，资产管理人在该封闭期内不计提业绩报酬；

（2）当封闭期内计划份额累计净值年化增长率  $> R$  时

业绩报酬 =  $S_i \times NAV0^* \times [ (NAV1 - NAV0) / NAV0^* - R \times T / 365 ] \times B$ ;

其中：

R=6%，业绩报酬计提基准

（在本计划每个封闭期届满五个工作日前，资产管理人有权变更下一个封闭期内的业绩报酬计提基准 R，并在变更后及时告知资产委托人，资产管理人在网站公告前述事项即视为履行了告知义务）

B=18%，业绩报酬计提比例

$S_i$  为资产委托人在业绩报酬计提日所持有的份额数量

NAV0 为资产委托人在业绩报酬计提日所持有份额所对应的封闭期首日的前一工作日的

计划份额累计净值（首次计提业绩报酬则为该份额对应的认购时的初始面值）

NAV0\*为资产委托人在业绩报酬计提日所持有份额所对应的封闭期首日的前一工作日的计划份额单位净值（第一个封闭期则为该份额对应的认购时的初始面值）。

NAV1 为本次业绩报酬计提日在扣除本次业绩报酬和本次分配收益（如有）之前的计划份额累计净值

T 为业绩报酬计提日所在封闭期的实际天数（算头算尾）

若根据本合同约定，封闭期内设立临时开放期，则 T 为对应上一开放期后第一日（若本次为首次计提则为本计划成立日）至退出申请日之间的实际天数（算头算尾）。

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，资产管理人向资产托管人发送划款指令，由资产托管人从资产管理计划财产中一次性支付给资产管理人。业绩报酬提取频率不得超过每 6 个月一次，但因委托人退出资产管理计划或资产管理计划终止的，不受前述提取频率的限制。

## 2) 业绩报酬的支付

业绩报酬由资产管理人负责计算，业绩报酬在收益分配金额、退出金额以及清算金额中进行扣除，即实际收益分配金额、实际退出资金和实际清算金额扣除了资产管理人的业绩报酬，最终收益分配金额、退出金额以及清算金额以资产委托人实际收到的收益分配金额、退出金额与清算金额为准。在固定收益分配基准日，收益分配金额小于等于资产管理人的业绩报酬，则以收益分配金额为上限支付给资产管理人。业绩报酬的计提金额以管理人计算为准，托管人不承担复核责任。

## 2. 资产托管人的托管费

在通常情况下，资产管理计划托管费按前一日资产管理计划财产净值或按照委托财产本金的年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年实际天数}$ ，本资产管理计划年托管费率为 0.1 %

H 为每日应计提的资产管理计划托管费

E 为前一日资产管理计划财产净值（产品成立首日以当日实收资本为基数计算）

资产管理计划托管费自资产管理合同生效日起，每日计提，按季支付。由资产管理人于次季首日起 5 个工作日内向资产托管人发送资产管理计划托管费划付指令，经资产托管人复核后从资产管理计划财产中支付给资产托管人。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。

户名： 其他应付款-托管费收入

账号： 911059720620091010

开户行： 招商银行北京分行运营中心

### (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所发生的费用等不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

本计划运作过程中涉及各纳税主体,其纳税义务按其适用的税收法律法规执行。因境外投资收到的分红、利息、股息等相关收入以标的资产管理人或其境外行政管理人派发的金额为准,直接确认收益。资产委托人应缴纳的税收,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。

根据法律法规或财政、税务主管部门明确要求资产管理人代扣代缴或承担委托财产运营所产生的增值税或其他税费(如有)扣缴义务的,资产管理人有权根据实际情况遵照规则从本计划委托财产中提取并代扣代缴/缴纳。

若本计划存续期间进行收益分配或开放赎回后,因本计划委托财产运营所涉相关税费存在应缴但未缴情形的,或本计划终止后出现税务主管部门向资产管理人追缴本计划委托财产运营的相关税收的,资产管理人有权向资产委托人追偿。

本计划应承担的相关税收由本计划委托财产直接缴付,或划付至资产管理人账户并由资产管理人依据税务部门要求完成税款申报缴纳。

## 二十三、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合同的约定执行。

### (一)可供分配利润的构成

资产管理计划可供分配利润包括:资产管理计划投资所得红利、股息、债券利息、票据投资收益、买卖证券差价、银行存款利息以及其他收入。因运用资产管理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委托财产承担。

3、在符合有关计划收益分配条件的前提下，本计划收益可多次分配，包含固定收益分配与临时收益分配。

4、收益分配的基准日包含固定收益分配基准日与临时收益分配基准日，其中，固定收益分配基准日为每个封闭期的最后一个工作日，临时收益分配基准日以管理人确认为准。

5、计划收益分配基准日的计划份额净值减去每单位计划份额收益分配金额后不能低于面值。

6、对于固定收益分配，业绩报酬（如有）将在收益分配金额中进行扣除，即实际收益分配金额扣除了资产管理人的业绩报酬，最终收益分配金额以资产委托人收到的实际收益分配金额为准。

7、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，并告知资产委托人，资产管理人在网站发布公告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

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，包括但不限于资产管理人履职报告、资产托管人履职报告、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个月内完成复核，并将复核结果书面通知资产管理人，资产托管人仅复核资产管理计划投资组合报告和财务会计报告。因资产管理人未及时发送至托管人处，造成定期报告无法按照规定时间完成披露的情形，托管人不承担相关责任。

资产管理计划成立未满3个月或者存续期间不足3个月、以及本计划终止的当年度，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，应由资产管理人向投资者充分披露。

## 2、季度报告

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资产管理人履职报告、资产托管人履职报告、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结束之日起10个工作日内完成季度报告，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7个工作日内完成复核，并将复核结果书面通知资产管理人，资产托管人仅复核资产管理计划投资组合报告和财务会计报告。因资产管理人未及时发送至托管人处，造成定期报告无法按照规定时间完成披露的情形，托管人不承担相关责任。

资产管理计划成立未满3个月或者存续期间不足3个月、以及本计划终止的当季度，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，应由资产管理人向投资者充分披露。

## 3、净值报告

本计划成立后，资产管理人至少每周向资产委托人报告一次当期末经资产托管人复核的计划财产净值。本计划净值披露频率不低于本计划的开放频率。

## 4、临时报告

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之日起5日内及时通知资产委托人：

- (1) 涉及本合同项下计划财产的诉讼；
- (2) 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调查；
- (3) 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符合《证券法》规定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、资产托管人不承担管理人未接受托管人的复核意见进行信息披露产生的相应责任。

7、因资产管理人未及时告知或发送至托管人处，造成上述各报告无法按照规定时间完成披露的情形，托管人不承担相关责任。

8、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) 资产管理人向资产委托人提供报告及资产委托人信息查询的方式

资产管理人向资产委托人提供的报告，将严格按照有关规定通过以下至少一种方式进行。存在代理销售机构的，资产管理人将上述信息通知到代理销售机构，视为已通知到资产委托人。资产委托人有义务随时与代理销售机构保持联系，了解有关本计划的各项信息。

1、资产管理人网站

资产管理合同、计划说明书、定期报告、临时报告等有关本资产管理计划的信息将在资产管理人网站上披露，资产委托人可随时查阅。

资产管理人网站：[www.cxfund.com.cn]

2、邮寄服务

资产管理人或代理销售机构向资产委托人邮寄定期报告、临时报告等有关本计划的信息。资产委托人在合同签署页上填写的通信地址为送达地址。通信地址如有变更，资产委托人应当及时通知资产管理人。

3、传真或电子邮件

如资产委托人留有传真号、电子邮箱等联系方式的，资产管理人也可通过传真、电子邮件、电报等方式将报告信息通知资产委托人。

(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[较高]风险投资品种，适合风险识别、评估、承受能力[成长型、积极型]的合格投资者。

## 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。

### （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）发债公司经营风险

发债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债券因公司经营不善，其债券偿还能力可能受到影响，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。

### （6）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。

### （7）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。

#### (8) 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

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。

在资产委托人提出追加或减少资产管理计划财产时，可能存在现金不足的风险和现金过多带来的收益下降风险。

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。

如本计划存续期间采取封闭运作的，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。

#### 5、信用风险

信用风险是债务人的违约风险，主用体现在信用产品中。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

本计划可能投资于资产管理人、托管人及其控股股东、实际控制人或者其他关联方发行或承销期内承销的证券品种、银行存款、金融产品，以及与前述机构以公平合理的价格进行交易，或者进行其他类型的关联交易，包括本计划与前述机构因管理、托管、销售或交易业务产生的佣金与费用等。虽然管理人积极遵循委托人利益优先的原则、遵守相关法律法规的规定操作、积极防范利益冲突，但依然不能避免未来可能发生的关联交易和利益冲突风险，

可能因资产管理人运用计划财产从事关联交易被监管部门认为存在利益输送、内幕交易的风险，进而可能影响投资者的利益。该类投资标的价格可能会出现下跌，从而使本计划收益下降，甚至带来本金损失。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被限制相关权利的行使，进而可能影响计划财产的投资收益。

#### 一般关联交易风险

投资者签署本合同即视为已经充分理解并同意本计划从事一般关联交易，资产管理人无需就一般关联交易再行分别取得资产委托人的授权，资产管理人在定期报告中披露相关内容即视为履行事后告知义务，可能存在资产委托人因获取上述信息相对滞后而无法及时知悉本计划从事一般关联交易的风险。

#### 重大关联交易风险

资产管理人开展法律法规及本合同约定的重大关联交易的，将事前取得全体资产委托人同意，可能存在部分资产委托人未及时告知或明确拒绝资产管理人开展重大关联交易而导致丧失投资机会的风险。

#### 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、特定投资方法及本计划财产所投资的特定投资对象可能引起的特定风险

##### 1) 汇率风险

本计划将投资港股通标的股票，在交易时间内提交订单依据的港币买入参考汇率和卖出参考汇率，并不等于最终结算汇率。港股通交易日日终，中国证券登记结算有限责任公司进行净额换汇，将换汇成本按成交金额分摊至每笔交易，确定交易实际适用的结算汇率。故本计划投资面临汇率风险。

## 2) 股指期货投资风险

### (1) 流动性风险

本计划在股指期货市场成交不活跃时,可能在建仓和平仓股指期货时面临交易价格或者交易数量上的风险。

### (2) 基差风险

基差是指股票指数现货价格与股指期货价格之间的差额。若产品运作中出现基差波动不确定性加大、基差向不利方向变动等情况,则可能对本计划投资产生影响。

### (3) 合约展期风险

本计划所投资的期货合约主要包括股指期货当月和近月合约。当计划所持有的合约临近交割期限,即需要向较远月份的合约进行展期,展期过程中可能发生价差损失以及交易成本损失,将对投资收益产生影响。

### (4) 股指期货保证金不足风险

由于股指期货价格朝不利方向变动,导致期货账户的资金低于金融期货交易所或者期货经纪机构的最低保证金要求,如果不能及时补充保证金,股指期货头寸将被强行平仓,导致无法规避对冲系统性风险,直接影响本计划收益水平,从而产生风险。

### (5) 杠杆风险

股指期货作为期货和衍生品,其投资收益与风险具有杠杆效应。若行情向不利方向剧烈变动,本计划可能承受超出保证金甚至计划资产本金的损失。

3) 本计划投资港股通标的股票的,会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险:

### (1) 港股市场股价波动较大的风险

港股市场实行 T+0 回转交易,且对个股不设涨跌幅限制,因此每日涨跌幅空间相对较大,港股股价可能表现出比 A 股更为剧烈的股价波动,使本计划面临较大的投资风险。

### (2) 港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险

根据现行的港股通规则,本计划在参与港股通交易时,只有境内、香港两地均为交易日且能够满足结算安排的交易日才为港股通交易日。因此会存在港股通交易日不连贯的情形(如内地市场因放假等原因休市而香港市场照常交易但非港股通交易日时,香港出现台风、黑色暴雨或者香港联合交易所规定的其他情形导致停市时,出现交易异常情况交易所可能暂停提供部分或者全部港股通服务的情形时),从而可能导致本计划暂停参与、退出,并使得本计划所持有的港股在后续港股通交易日开市交易时有可能出现价格波动骤然增大,进而

导致本计划所持有的港股在资产估值上出现波动增大的风险,进而影响计划份额净值出现较大波动。

4)本计划收益分配方案根据本资产管理合同约定执行,在每个封闭期间在符合收益分配条件的前提下,本计划收益可多次分配,包含固定收益分配与临时收益分配。其中,固定收益分配基准日为每个封闭期的最后一个工作日,临时收益分配基准日以管理人确认为准。

对于固定收益分配,业绩报酬(如有)将在收益分配金额中进行扣除,即实际收益分配金额扣除了资产管理人的业绩报酬,最终收益分配金额以资产委托人收到的实际收益分配金额为准。收益分配方案由资产管理人拟定,具体的收益分配时间、收益分配比例与收益分配金额等由资产管理人进行确认。

收益分配方式为现金分红,每次收益分配后,本计划净值以及份额净值会相应下降。因分红导致本计划份额净值调整至初始面值或附近,在市场波动等因素的影响下,本计划投资仍可能出现亏损或本计划净值仍有可能低于初始面值。因分红导致本计划净值变化,不会改变本计划的风险收益特征,不会降低本计划投资风险或提高本计划投资收益。

5)本计划的业绩报酬计提日为每个收益分配基准日、本计划终止日以及资产委托人退出确认日(若根据合同约定设置临时开放期)。若计划资产的投资增值部分(包含净值增长部分)高于预先设定的业绩报酬计提基准 R 的部分为基础进行计算,资产管理人即可提取业绩报酬。本计划的投资增值部分以本计划累计净值年化增长率来计算,只要业绩报酬计提日本计划累计净值年化增长率高于业绩报酬计提基准 R,管理人即可根据本合同约定提取业绩报酬。在本计划每个封闭期届满五个工作日前,资产管理人有权变更下一个封闭期的业绩报酬计提基准 R,并在变更前及时告知资产委托人,资产管理人在网站公告前述事项即视为履行了告知义务。

业绩报酬在收益分配金额、退出金额以及清算金额中进行扣除,即实际收益分配金额、实际退出金额和实际清算金额扣除了资产管理人的业绩报酬,最终收益分配金额、退出金额以及清算金额以资产委托人实际收到的收益分配金额、退出金额与清算金额为准。若在收益分配基准日,收益分配金额小于等于资产管理人的业绩报酬,则以收益分配金额上限支付给资产管理人。

6)在非业绩报酬计提日,本计划资产净值与单位份额净值可能不能真实反应本计划业绩报酬的实际提取情况,本计划的实际业绩报酬计提仅反应在业绩报酬计提日当日计划资产净值,即每个收益分配基准日、本计划终止日,因此可能会发生由于进行业绩报酬计提而导致的当日净值波动情况。

7) 资产委托人进行参与、退出申请仅可在本计划开放期内进行, 在封闭期内无法进行参与和退出。(本计划开放期原则上不超过 10 个工作日, 即原则上不超过本计划成立日年度对日(T 日)之日起 10 个工作日(T+9 日), 开放日每日接受资产委托人的参与和退出申请。具体开放时间以资产管理人公告为准。)

#### 2、未在基金业协会完成备案的风险

本计划成立后需在基金业协会进行备案。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或不予备案, 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或不予备案的情形, 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。

#### 3、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。

#### 4、预警止损的风险

本计划存续期内计划份额净值小于或等于止损线的, 资产管理人将根据本合同规定平仓, 实际变现后的计划净值可能低于本计划止损线, 资产管理人按照实际变现所得的计划资产净值清算。

5、本计划属于【较高】风险等级的资产管理计划品种, 销售机构的适当性匹配意见不表明对本计划的风险和收益做出实质性判断或者保证。投资者应当在了解本计划情况, 在适当性意见的基础上, 根据自身能力审慎决策, 独立承担投资风险。

#### 6、投资申报总量额度管理的风险

证券交易所根据《上海证券交易所、深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司证券交易资金前端风险控制业务规则》(以下简称“《资金前端风险控制业务规则》”)的规定, 对资产管理计划相关交易单位的全天净买入申报金额总量实施额度管理, 并实施资金前端控制。

本资产管理人将代表本资产管理计划根据《资金前端风险控制业务规则》的规定向交易所申报额度信息, 交易所根据额度信息实施资金前端控制造成的后果或损失, 将由本计划财产承担; 因不可抗力、意外事件、技术故障、重大错误等原因导致资金前端控制出现异常的, 交易所、中国结算可以采取调整额度、暂停实施资金前端控制、限制交易单元交易权限等处置措施, 因此造成损失的, 交易所、中国结算不承担责任。

因此, 本资产管理计划在投资时将面临以下风险:

1) 本资产管理计划因资金前端控制而无法完全依据既定的投资策略进行投资而导致无法实现投资目标从而导致收益减少甚至产生损失的风险；

2) 本资产管理计划因资金前端异常情况被交易所、中国结算采取相应措施而导致计划财产损失的风险。

### (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、资产管理计划的变更、终止与财产清算

### (一) 资产管理合同的变更

1、全体资产委托人、资产管理人和资产托管人协商一致后，可对本合同内容进行变更，但本合同另有约定的，从其约定。

2、尽管存在前述第 1 项的约定，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) 投资经理的变更；
- (3) 资产管理计划认购、参与、退出的时间、业务规则等变更；
- (4) 其他对资产委托人利益无实质性不利影响情形的变更。

3、尽管存在前述第 1 项的约定，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后变更：

- (1) 调低资产托管人的报酬标准；

(2) 因法律法规或中国证监会、基金业协会的相关规定、要求发生变化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及时向资产委托人披露变更的具体内容；

(3) 不会对资产委托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。

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，经履行本合同约定程序，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。

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，经履行本合同约定程序，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。

5、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。

6、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。

(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、本计划在成立后，未在基金业协会完成备案或不予备案的；

7、资产管理计划运作期间，任一交易日（T日）收市后，当本资产管理计划份额净值小于或等于止损线时，资产管理人应自下一交易日（T+1日）起将计划资产变现，直至计划资产全部变现为止，本计划提前终止；

8、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6项约定的情形除外。

(三) 本计划的展期

资产管理计划存续期限届满且符合以下条件，本计划可展期一年，展期满后符合本合同约定条件的可继续展期：

1、资产管理计划运作规范，资产管理人、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、中国证监会规定的其他条件。

本计划进行展期的，应当符合本计划的成立条件。

计划存续期满，不符合资产管理计划展期条件的，则展期失败，资产管理计划依据本合同的约定终止并进入清算程序。

资产管理计划展期的，资产管理人应当通知资产委托人，并对不同意展期的资产委托人的退出事宜作出公平、合理的安排。资产管理人在网站公告即视为履行了通知义务。

#### （四）资产管理计划变更、展期后的临时开放期

经全体资产委托人协商一致变更资产管理合同或本计划展期的，资产管理人或代理销售机构将设置临时开放期。该临时开放期可为资产委托人办理退出手续。委托人可向销售机构提出退出申请。

临时开放期的具体开放日及开放时间等以资产管理人届时发布的相关公告为准。

#### （五）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：资产管理人负责资产管理计划财产的清理、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。资产托管人负责资产管理计划财产的保管，执行管理人分配指令划付资金。

##### 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资产管理计划；
- （2）对资产管理计划财产和债权债务进行清理和确认；
- （3）对资产管理计划财产进行估值和变现；
- （4）制作清算报告；
- （5）聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- （6）清算结束后五个工作日内将清算结果报基金业协会备案，将清算报告报告知资产委托人；

- （7）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、清算剩余财产的安排和延期清算安排

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。

合同终止日前，资产管理人必须将投资组合内所有证券变现，合同终止时，有计划财产参加新股申购或者持有股市休市、停牌等不能流通变现情况的，则在锁定期结束新股上市或该持有股票恢复上市后进行资产清算。在进行延期清算的变现过程中，变现的资金以现金保存，不得再进行投资。

资产管理计划终止时因投资品违约导致无法及时变现或无法及时资金收回，资产管理人仍将恪尽职守，以资产管理人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，继续履行应收资产的清收义务，直至债权债务关系解除，不因本资产管理计划终止而解除前述职责。

在委托财产移交前，由资产托管人负责按照本合同“第十七条（一）6项”规定的原则进行保管。保管期间，任何当事人均不得运用该委托财产。保管期间产生的收益归委托财产所有，保管期间发生的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。

对于部分暂时不能变现的资产，资产管理人在其清算期间内，不再计提管理费和业绩报酬；资产托管人在其清算期间内，继续按照本合同“第二十二条（二）2项”规定的方式方法计收托管费。

资产管理计划因委托财产流动性受限等原因延期清算的，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。

#### 5、账户注销

资产管理计划财产清算完毕后，管理人应及时协助托管人办理银行托管专户、证券账户、

债券账户及DVP账户等账户的销户，以及交易单元挂接取消（若需）等工作，如有涉及并非托管人开立的账户，则由管理人负责或协调办理销户工作。组合到期清算时，为支付最低备付金，资产管理人应预留相应金额，若预留金额不足以支付实际需缴存的备付金金额的，差额部分由管理人通知资产委托人补足。

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。

#### 6、账册及文件的保存

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。

“不可抗力”指同时符合以下条件的任何事件：

- A. 超出受影响一方之控制；
- B. 不可预见，或者虽可预见但不可避免并不能克服的；
- C. 发生在本协议生效日之后；
- D. 妨碍该方履行全部或部分本协议项下的义务。

E. 不可抗力事件包括但不限于自然灾害、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、联网系统故障或失灵、系统故障、设备故障、人民银行结算系统故障、证券交易所及登记结算公司发送的数据错误、证券交易场所非正常暂停或停止交易等。

如果本合同任何相关方因“不可抗力”事件无法履行其义务，则在“不可抗力”事件影响履行义务期间，依情况可以解除合同或者免除部分或全部责任。声称遭受“不可抗力”事件影响的一方应在该不可抗力事件发生之日起七（7）日内告知其他方。声称遭受“不可抗力”事件影响的一方应运用一切合理努力消除、减轻该等“不可抗力”事件的影响。若任何一种“不可抗力”事件发生，各方应立即开始协商以解决“不可抗力”事件对本合同的影响，但遭遇“不可抗力”一方无需承担违约责任。若该等“不可抗力”事件的影响持续且对本合同之履行产生重大不利影响，合同各方通过协商不能达成一致意见的，合同各方均有权通知对方终止本合同。不可抗力；

### 2、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作为或不作为

而造成的损失；

3、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；

4、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；

5、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；

6、资产委托人理解资产管理计划财产的投资、运作、保管面临本合同第二十四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；

7、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，管理人和托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误的。

（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，但不因各自职责以外的事由与其他当事人承担连带赔偿责任；因共同行为对委托财产或者资产委托人造成损害的，应当按照各自过错承担相应赔偿责任。

（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、法律适用和争议的处理

（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解决。如协商不成的，任何一方均有权按以下第（2）种方式解决争议。

（1）依法向托管人所在地人民法院提起诉讼；

（2）提交上海国际经济贸易仲裁委员会，按其届时有效的仲裁规则进行仲裁，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；

（3）其他：\_\_\_\_\_无\_\_\_\_\_。

争议处理期间，合同各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。

（二）本合同适用中华人民共和国法律并依据其解释（为本合同之目的，在此不包括香

港特别行政区、澳门特别行政区及台湾地区的法律法规)。

## 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理人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、资产管理人及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理人签字或盖章之日起成立。资产托管人还可由其负责人签字或盖章。

(二) 本合同自本计划成立之日起生效。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。

(三) 本计划的存续期为[3]年。本合同另有约定的, 从其约定。

(四) 本合同至本计划全部资产清算分配完毕之日终止。

(五) 资产委托人自签订本资产管理合同时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者和资产管理合同的当事人。

## 三十、其他事项

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, 资产委托人、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。

本合同一式三份, 资产委托人及资产管理人各执一份, 资产托管人执一份。

**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

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: \_\_\_\_\_

联系人: \_\_\_\_\_

邮政编码: \_\_\_\_\_

联系电话: \_\_\_\_\_

传真: \_\_\_\_\_

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: \_\_\_\_\_

联系人: \_\_\_\_\_

邮政编码: \_\_\_\_\_

联系电话: \_\_\_\_\_

传真: \_\_\_\_\_

(二) 资产委托人认购金额

人民币 \_\_\_\_\_ 元整 (¥ \_\_\_\_\_)

(三) 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[长信基金-众锐 8 号混合型]集合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(公章或合同专用章):

\_\_\_\_\_  
法定代表人或授权代理人(签字或盖章):

签署日期: \_\_\_\_\_ 年 \_\_\_\_\_ 月 \_\_\_\_\_ 日

资产管理人(公章或合同专用章):

法定代表人或授权代理人(签字或盖章):

签署日期: \_\_\_\_\_ 年 \_\_\_\_\_ 月 \_\_\_\_\_ 日

资产托管人(公章或合同专用章):

负责人或授权代理人(签字或盖章):

签署日期: \_\_\_\_\_ 年 \_\_\_\_\_ 月 \_\_\_\_\_ 日

2023年 7月 06日

## 承诺函

本人/本机构声明委托财产为本人/本机构合法所有或拥有合法、合规、正当管理权限或拥有合法、合规、正当的占有、使用、处分和收益权限的资产，且该等资金的任何部分均不存在非法吸收公众存款、集资诈骗、不具有或超越管理权限或资产委托人对投资的资金享有的权利不完整、不适合、不恰当等违法、违规或任何其它可能会被认定为不适合、不恰当等情况，不存在任何可能被追索的情形。如委托财产为资产委托人募集的资产，资产委托人保证已向该等资产的提供方如实披露各类信息并充分揭示投资风险；保证该等资产的提供方不会被误导（包括但不限于误认为资产管理人为该等资产的募集方、资产管理人需要向该等资产的提供方承担任何责任等）；保证自行解决与该等资产的提供方之间的纠纷；保证委托财产的来源及用途符合国家有关规定，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。

本人/本机构声明已充分理解本合同全文，了解相关权利、义务及所委托财产的风险收益特征，愿意承担相应的投资风险，本委托事项符合本人/本机构业务决策程序的要求；本人/本机构承诺向资产管理人提供的有关投资目的、投资偏好、投资限制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、重大遗漏或误导。前述信息资料如发生任何实质性变更，本人/本机构应当及时书面告知资产管理人或销售机构。

本人/本机构承认，资产管理人、资产托管人未对委托财产的收益状况作出任何承诺或担保，资产管理合同约定的业绩报酬计提基准（若有）仅是投资目标而不是资产管理人的保证。本合同已经向中国证券投资基金业协会（以下简称“基金业协会”）备案，但基金业协会的备案并不表明其对资产管理计划的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于资产管理计划没有风险。

本人/本机构承诺自身或依据《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》要求需穿透核查的主体均符合监管机关规定的合格投资者条件，即（一）具有 2 年以上投资经历，且满足下列三项条件之一的自然人：家庭金融资产不低于 300 万元，家庭金融资产不低于 500 万元，或者近 3 年本人年均收入不低于 40 万元；（二）最近 1 年末净资产不低于 1000 万元的法人单位；（三）依法设立并接受国务院金融监督管理机构监管的机构，包括证券公司及其子公司、基金管理公司及其子公司、期货公司及其子公司、在基金业协会登记的私募基金管理人、商业银行、商业银行理财子公司、金融资产投资公司、信托公司、保险公

司、保险资产管理机构、财务公司及中国证监会认定的其他机构；（四）接受国务院金融监督管理机构监管的机构发行的资产管理产品；（五）基本养老金、社会保障基金、年金基金等养老基金，慈善基金等社会公益基金，合格境外机构投资者（QFII）、人民币合格境外机构投资者（RQFII）；（六）金融管理部门视为合格投资者的其他情形。如为本机构管理的资产计划的，本机构承诺该资产管理计划的结构、杠杆、嵌套、合格投资者等均符合《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》、《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》等法律法规规定的穿透识别的要求，并承诺已按法律法规要求履行了客户身份识别与反洗钱相关职责，委托财产最终资金来源涉及资产管理人的董事、监事、从业人员及其配偶的，本人/本机构应及时告知资产管理人。

本人/本机构不存在法律、法规、规章和交易所规则禁止或限制进入证券市场的情形，不存在通过资产管理人的投资运作以实现规避投资范围、杠杆约束等违反监管要求的情形，承诺不从事任何利益输送、内幕交易、操纵证券交易价格等违法违规行为。

本人/本机构确认，资产管理人、资产托管人未对委托资产的收益状况作出任何承诺或担保，资产管理人不保证资产委托人一定盈利，不保证最低收益，也不保证能取得市场平均业绩水平，资产管理人过往的投资业绩不构成对资产管理计划未来业绩的保证。

本人/本机构确认已认真阅读长信基金-众锐8号混合型集合资产管理计划资产管理合同、风险提示函，充分知晓投资长信基金-众锐8号混合型集合资产管理计划的风险，并自愿认购本资产管理计划，自行承担投资风险和损失。

资产委托人(自然人签字或机构盖章):

法定代表人或授权代理人(签字或盖章):

日期: 年 月 日

## 长信基金-众锐 8 号混合型集合资产管理计划风险提示函

尊敬的投资者：

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

根据有关法律法规，管理人长信基金管理有限责任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

#### （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[较高]风险投资品种，适合风险识别、评估、承受能力[成长型、积极型]的合格投资者。

##### 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。

（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）发债公司经营风险

发债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债券因公司经营不善，其债券偿还能力可能受到影响，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。

（6）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。

（7）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。

（8）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

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。

在资产委托人提出追加或减少资产管理计划财产时，可能存在现金不足的风险和现金过多带来的收益下降风险。

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。

如本计划存续期间采取封闭运作的，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。

#### 5、信用风险

信用风险是债务人的违约风险，主用体现在信用产品中。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 日内返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

本计划可能投资于资产管理人、托管人及其控股股东、实际控制人或者其他关联方发行或承销期内承销的证券品种、银行存款、金融产品，以及与前述机构以公平合理的价格进行交易，或者进行其他类型的关联交易，包括本计划与前述机构因管理、托管、销售或交易业务产生的佣金与费用等。虽然管理人积极遵循委托人利益优先的原则、遵守相关法律法规的规定操作、积极防范利益冲突，但依然不能避免未来可能发生的关联交易和利益冲突风险，可能因资产管理人运用计划财产从事关联交易被监管部门认为存在利益输送、内幕交易的风险，进而可能影响投资者的利益。该类投资标的价格可能会出现下跌，从而使本计划收益下降，甚至带来本金损失。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被限制相关权利的行使，进而可能影响计划财产的投资收益。

##### 一般关联交易风险

投资者签署本合同即视为已经充分理解并同意本计划从事一般关联交易，资产管理人无需就一般关联交易再行分别取得资产委托人的授权，资产管理人在定期报告中披露相关内容即视为履行事后告知义务，可能存在资产委托人因获取上述信息相对滞后而无法及时知悉本

计划从事一般关联交易的风险。

#### 重大关联交易风险

资产管理人开展法律法规及本合同约定的重大关联交易的,将事前取得全体资产委托人同意,可能存在部分资产委托人未及时告知或明确拒绝资产管理人开展重大关联交易而导致丧失投资机会的风险。

#### 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、特定投资方法及本计划财产所投资的特定投资对象可能引起的特定风险

##### 1) 汇率风险

本计划将投资港股通标的股票,在交易时间内提交订单依据的港币买入参考汇率和卖出参考汇率,并不等于最终结算汇率。港股通交易日日终,中国证券登记结算有限责任公司进行净额换汇,将换汇成本按成交金额分摊至每笔交易,确定交易实际适用的结算汇率。故本计划投资面临汇率风险。

##### 2) 股指期货投资风险

###### (1) 流动性风险

本计划在股指期货市场成交不活跃时,可能在建仓和平仓股指期货时面临交易价格或者交易数量上的风险。

###### (2) 基差风险

基差是指股票指数现货价格与股指期货价格之间的差额。若产品运作中出现基差波动不确定性加大、基差向不利方向变动等情况,则可能对本计划投资产生影响。

(3) 合约展期风险

本计划所投资的期货合约主要包括股指期货当月和近月合约。当计划所持有的合约临近交割期限,即需要向较远月份的合约进行展期,展期过程中可能发生价差损失以及交易成本损失,将对投资收益产生影响。

(4) 股指期货保证金不足风险

由于股指期货价格朝不利方向变动,导致期货账户的资金低于金融期货交易所或者期货经纪机构的最低保证金要求,如果不能及时补充保证金,股指期货头寸将被强行平仓,导致无法规避对冲系统性风险,直接影响本计划收益水平,从而产生风险。

(5) 杠杆风险

股指期货作为期货和衍生品,其投资收益与风险具有杠杆效应。若行情向不利方向剧烈变动,本计划可能承受超出保证金甚至计划资产本金的损失。

3) 本计划投资港股通标的股票的,会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险:

(1) 港股市场股价波动较大的风险

港股市场实行 T+0 回转交易,且对个股不设涨跌幅限制,因此每日涨跌幅空间相对较大,港股股价可能表现出比 A 股更为剧烈的股价波动,使本计划面临较大的投资风险。

(2) 港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险

根据现行的港股通规则,本计划在参与港股通交易时,只有境内、香港两地均为交易日且能够满足结算安排的交易日才为港股通交易日。因此会存在港股通交易日不连贯的情形(如内地市场因放假等原因休市而香港市场照常交易但非港股通交易日时,香港出现台风、黑色暴雨或者香港联合交易所规定的其他情形导致停市时,出现交易异常情况交易所可能暂停提供部分或者全部港股通服务的情形时),从而可能导致本计划暂停参与、退出,并使得本计划所持有的港股在后续港股通交易日开市交易时有可能出现价格波动骤然增大,进而导致本计划所持有的港股在资产估值上出现波动增大的风险,进而影响计划份额净值出现较大波动。

4) 本计划收益分配方案根据本资产管理合同约定执行,在每个封闭期间在符合收益分配条件的前提下,本计划收益可多次分配,包含固定收益分配与临时收益分配。其中,固定收益分配基准日为每个封闭期的最后一个工作日,临时收益分配基准日以管理人确认为准。

对于固定收益分配,业绩报酬(如有)将在收益分配金额中进行扣除,即实际收益分配金额扣除了资产管理人的业绩报酬,最终收益分配金额以资产委托人收到的实际收益分配金

额为准。收益分配方案由资产管理人拟定，具体的收益分配时间、收益分配比例与收益分配金额等由资产管理人进行确认。

收益分配方式为现金分红，每次收益分配后，本计划净值以及份额净值会相应下降。因分红导致本计划份额净值调整至初始面值或附近，在市场波动等因素的影响下，本计划投资仍可能出现亏损或本计划净值仍有可能低于初始面值。因分红导致本计划净值变化，不会改变本计划的风险收益特征，不会降低本计划投资风险或提高本计划投资收益。

5) 本计划的业绩报酬计提日为每个收益分配基准日、本计划终止日以及资产委托人退出确认日（若根据合同约定设置临时开放期）。若计划资产的投资增值部分（包含净值增长部分）高于预先设定的业绩报酬计提基准 R 的部分为基础进行计算，资产管理人即可提取业绩报酬。本计划的投资增值部分以本计划累计净值年化增长率来计算，只要业绩报酬计提日本计划累计净值年化增长率高于业绩报酬计提基准 R，管理人即可根据本合同约定提取业绩报酬。在本计划每个封闭期届满五个工作日前，资产管理人有权变更下一个封闭期的业绩报酬计提基准 R，并在变更前及时告知资产委托人，资产管理人在网站公告前述事项即视为履行了告知义务。

业绩报酬在收益分配金额、退出金额以及清算金额中进行扣除，即实际收益分配金额、实际退出金额和实际清算金额扣除了资产管理人的业绩报酬，最终收益分配金额、退出金额以及清算金额以资产委托人实际收到的收益分配金额、退出金额与清算金额为准。若在收益分配基准日，收益分配金额小于等于资产管理人的业绩报酬，则以收益分配金额上限支付给资产管理人。

6) 在非业绩报酬计提日，本计划资产净值与单位份额净值可能不能真实反应本计划业绩报酬的实际提取情况，本计划的实际业绩报酬计提仅反应在业绩报酬计提日当日计划资产净值，即每个收益分配基准日、本计划终止日，因此可能会发生由于进行业绩报酬计提而导致的当日净值波动情况。

7) 资产委托人进行参与、退出申请仅可在本计划开放期内进行，在封闭期内无法进行参与和退出。（本计划开放期原则上不超过 10 个工作日，即原则上不超过本计划成立日年度对日（T 日）之日起 10 个工作日（T+9 日），开放日每日接受资产委托人的参与和退出申请。具体开放时间以资产管理人公告为准。）

## 2、未在基金业协会完成备案的风险

本计划成立后需在基金业协会进行备案。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或不予备案，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或不予备案的情形，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。

### 3、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。

### 4、预警止损的风险

本计划存续期内计划份额净值小于或等于止损线的，资产管理人将根据本合同规定平仓，实际变现后的计划净值可能低于本计划止损线，资产管理人按照实际变现所得的计划资产净值清算。

5、本计划属于【较高】风险等级的资产管理计划品种，销售机构的适当性匹配意见不表明对本计划的风险和收益做出实质性判断或者保证。投资者应当在了解本计划情况，在适当性意见的基础上，根据自身能力审慎决策，独立承担投资风险。

### 6、投资申报总量额度管理的风险

证券交易所根据《上海证券交易所、深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司证券交易资金前端风险控制业务规则》（以下简称“《资金前端风险控制业务规则》”）的规定，对资产管理计划相关交易单位的全天净买入申报金额总量实施额度管理，并实施资金前端控制。

本资产管理人将代表本资产管理计划根据《资金前端风险控制业务规则》的规定向交易所申报额度信息，交易所根据额度信息实施资金前端控制造成的后果或损失，将由本计划财产承担；因不可抗力、意外事件、技术故障、重大错误等原因导致资金前端控制出现异常的，交易所、中国结算可以采取调整额度、暂停实施资金前端控制、限制交易单元交易权限等处置措施，因此造成损失的，交易所、中国结算不承担责任。

因此，本资产管理计划在投资时将面临以下风险：

1) 本资产管理计划因资金前端控制而无法完全依据既定的投资策略进行投资而导致无法实现投资目标从而导致收益减少甚至产生损失的风险；

2) 本资产管理计划因资金前端异常情况被交易所、中国结算采取相应措施而导致计划财产损失的风险。

### （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。

### 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“当事人及权利义务”的所有内容，并愿意自行承担购买资产管理计划的法律责任。【     】

6、本人/机构已认真阅读并完全理解资产管理合同第十二章“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二十二章“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二十八章“法律适用和争议的处理”中的所有内容，知悉合同相关争议应提交上海国际经济贸易仲裁委员会在上海进行仲裁。  
【     】

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资产损失的所有因素。【     】

投资者（自然人签字或机构盖章）：

日期：

管理人（盖章）：

日期：

销售机构经办人（签字）[集合资产管理计划适用]：

日期：

## 衍生品投资风险揭示函

尊敬的委托人：

长信基金-众锐 8 号混合型集合资产管理计划（以下简称“本资产管理计划”或“本计划”）拟投资于期货等衍生品，根据中国证监会的规定，现向您提供本《衍生品投资风险揭示函》。本资产管理计划拟投资于期货等衍生品，投资于期货等衍生品会致使委托资产承受以下风险：

1、杠杆风险。期货等衍生品交易采用保证金交易方式，由于高杠杆特征，潜在损失可能成倍放大。

2、到期日风险。期货等衍生品合约到期时，交易所将按照交割结算价将资产委托人的合约进行现金交割，届时投资者将无法继续持有到期合约。另外，期货等衍生品交割日可能会出现合约与现货指数不完全收敛，或基差向不利方向变动，影响套利收益。

3、保证金追加风险。在套利过程中，期货等衍生品市场的变动可能会造成保证金不足，引发期货等衍生品和现货的强行平仓，由于强行平仓价格的不确定性，会可能造成收益率的减小甚至本金的损失。在极端情况下，由于市场向不利方向运行，或保证金比例临时大幅提高，导致出现保证金不足、又未能在规定的时间内补足，或因其他原因导致期货交易所对结算会员（也即期货公司）下的经纪账户强行平仓时，组合资产可能因被连带强行平仓而遭受损失。

4、套期保值策略的风险。首先，套期保值交易效果常常受衍生品组合变动的影响；其次，如果要保值的资产与套期工具的市场不一致，则存在交叉保值风险。股票组合的市场风险度量的是组合的系统风险，可以进行对冲，而非系统风险则不能对冲。股票组合的非系统风险，并不随交割期临近而趋向最低，如果股票组合相对值过高或过低、以及交易市场的时变性，本身就存在一定程度的交叉套期保值风险。最后，期货等衍生品交易实行保证金交易和逐日结算制度，因此一旦出现不利变动，公司可能被要求将保证金补足到规定的水平。如果资金周转不足，可能无法及时补足保证金而被强行平仓，套期保值策略由此落空。

5、强制平仓的风险。如果市场走势对委托财产不利导致账户保证金不足时，期货公司会按照期货经纪合同约定的时间和方式通知追加保证金，以使委托资产能继续持有未平仓合约。如未于规定时间内存入所需保证金，委托资产持有的未平仓合约将可能在亏损的情况下被强行平仓，导致套利策略失败，委托资产必须承担由此导致的一切损失。

6、无法平仓的风险。假如市场剧烈变化的情况下，资产管理人可能难以或无法将持有的未平仓合约平仓，例如市场达到涨跌停板或现货组合因停牌等情况无法卖出。这类情况将导致保证金有可能无法弥补全部损失，委托财产必须承担由此导致的全部损失。

7、强行减仓的风险。在极端情况下，委托财产持有的期货等衍生品合约可能被期货交易所强行减仓，从而使得委托财产无法继续持有期货合约，从而导致套利失败。

8、政策变化的风险。由于国家法律、法规、政策的变化、期货交易所交易规则的修改、紧急措施的出台等原因导致未平仓合约可能无法继续持有从而导致损失。

9、客户资产保全的风险。由于期货经纪公司内部控制不当，期货经纪公司本身可能面临巨大的风险，导致客户资产无法保全。本计划由资产委托人指定期货经纪公司，如因期货公司的原因导致客户资产无法保全，资产管理人、资产托管人不承担任何责任。

10、与交易相关的风险。本计划由资产委托人指定期货经纪公司，期货经纪公司的交易佣金比例、系统执行效率等都可能影响委托财产的收益率，资产管理人、资产托管人不承担任何责任。

11、交易系统的风险。由于无法控制和不可预测的系统故障、设备故障、通讯故障、电力故障、网络故障及其它因素，可能导致交易系统非正常运行甚至瘫痪，使得交易指令出现延迟、中断、数据错误等情况；由于网上交易系统存在被网络黑客和计算机病毒攻击的可能性，由此可能导致交易系统故障，使交易无法进行及行情信息出现错误或延迟；互联网上的数据传输可能因通信繁忙等原因出现延迟、中断、数据错误或不完整，从而使网上交易出现延迟、中断。上述风险均可能导致委托财产发生损失。

12、非可控因素导致的风险，例如：地震、水灾、火灾等不可抗力因素或者通讯系统故障等，可能造成指令无法成交或者无法全部成交从而导致损失。

（以下无正文）

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业务所面临的全部风险和可能导致投资者资产损失的所有因素。

资产委托人(自然人签字或机构盖章):

法定代表人或授权代理人(签字或盖章):

附件一：托管银行证券资金结算协议

甲方（资产托管人）：

法定代表人：

注册地址：

联系人：                    联系电话：

乙方（资产管理人）：

法定代表人：

注册地址：

联系人：                    联系电话：

为确保证券交易资金结算业务安全、高效运行，有效防范结算风险，规范结算行为，进一步明确资产托管人与其代理结算客户在证券交易资金结算业务中的责任，根据《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》《证券登记结算管理办法》《中国证券登记结算有限责任公司结算规则》《中国证券登记结算有限责任公司结算备付金管理办法》《债券质押式回购交易结算风险控制指引》等有关规定，以及证券交易所或其他全国性证券交易场所及证券登记结算机构相关业务规则，甲、乙双方就参与中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中国结算”）多边净额结算业务相关事宜约定如下：

**第一条** 甲方作为资产管理产品的托管人，系经中国银保监会、中国证监会及其他有关金融监管部门核准具备证券投资基金、保险资产、企业年金基金、资产管理计划，以及其他与中国结算办理结算业务相关的托管业务资格的商业银行；乙方作为资产管理产品的管理人，系经中国银保监会、中国证监会及其他有关金融监管部门批准设立的证券期货经营机构、保险公司、保险资产管理公司等投资管理机构。

**第二条** 乙方管理并由甲方托管的资产在证券交易所或其他全国性证券交易场所达成的符合多边净额结算要求的证券及回购交易，采取托管人结算模式的（包括证券投资基金、资产管理计划、企业年金等），应由甲方与中国结算办理证券资金结算业务；甲方负责作为

结算参与人参与中国结算多边净额结算业务，乙方应当按照甲方提供的清算结果，按时履行交收义务，并承担对甲方的最终交收责任，不得以资产委托人/受托人违约为由而拒绝承担交收责任。

**第三条** 乙方同意遵守中国结算制定的业务规则，知悉并配合落实中国结算制定的各项业务规则。在不违反中国结算业务规则的前提下，以本协议约定为准。

**第四条** 多边净额结算方式下，证券和资金结算实行分级结算原则。甲方负责办理与中国结算之间证券和资金的一级清算交收；同时负责办理与乙方管理资产之间证券和资金的二级清算交收。甲方与乙方管理资产之间的证券划付，委托中国结算代为办理。

**第五条** 甲方依据交易清算日（T日）清算结果，按照中国结算相关业务规则，与中国结算完成最终不可撤销的证券和资金交收处理；同时在规定时限内，与乙方管理资产完成不可撤销的证券和资金交收处理。

**第六条** 乙方管理资产交收违约应遵循谁过错谁赔偿的原则。

（一）因乙方原因导致的交收违约实际损失，由乙方承担。

（二）因甲方原因导致的交收违约实际损失，由甲方承担。

（三）由第三方过错导致的交收违约损失，按照最大程度保护乙方管理资产持有人合法权益的原则，由双方协商处理，由乙方承担最终交收责任，并负责向第三方追偿，甲方应提供协助。

**第七条** 甲方按照中国结算的规定，以甲方自身名义向中国结算申请开立相关结算备付金账户、证券交收账户，以及按照中国结算相关业务规定应开立的其他结算账户，用于办理甲方所托管乙方管理资产在证券交易所或其他全国性证券交易场所的证券交易及非交易涉及的资金和证券交收业务。

**第八条** 根据中国结算业务规则，甲方依法向乙方管理资产收取存入中国结算的最低结算备付金及结算保证金等担保资金，该类资金的收取金额及其额度调整按照中国结算业务规则，以及甲方和乙方的其他书面协议或约定（如有）执行，于中国结算规定的调整日进行调整。甲方有权根据中国结算规则选择最低结算备付金比例计收方式（固定备付金比例/差异化备付金比例）。甲方变更最低结算备付金比例计收方式的，应于变更前及时通知乙方，无须征得乙方书面同意。

如采用差异化备付金比例计收方式，甲方应于每月第三个交易日前将乙方管理资产适用的最低结算备付金调整比例通知乙方，无须征得乙方书面同意。

若乙方管理资产结算备付金账户余额低于调整后预计算的其最低结算备付金限额的，乙

方应于最近调整日按照本协议第十四条约定时点补足款项。未按第十四条约定补足的，甲方有权将其视为乙方的业务不良记录登记在案并向中国结算报送，监管部门另有要求的除外，并按照本协议第十八条资金交收违约相关条款进行处置。

**第九条** 甲方收到中国结算按照与结算银行商定利率计付的结算备付金（含最低备付金）、结算保证金等资金利息后，于收息当日或其他约定日期（含孳息）将属于乙方的部分向乙方管理资产支付。

**第十条** 甲方于交易清算日（T 日），根据中国结算按照证券交易成交结果计算的资金清算数据和证券清算数据以及非交易清算数据，分别用以计算乙方管理资产资金和证券的应收或应付净额，形成乙方管理资产当日交易清算结果。

**第十一条** 甲方完成托管资产交易预清算后，对于交收日乙方管理资产可能发生透支的情况，应及时与乙方沟通或以约定方式告知乙方。甲方于交收日（T+1 日）根据证券交易所或中国结算数据计算的乙方 T 日交易清算结果，完成乙方管理资产资金和证券的交收。

**第十二条** 乙方对甲方提供的清算数据存有异议，应及时与甲方沟通，但乙方不得因此拒绝履行或延迟履行交收义务。经双方核实，确属甲方清算差错的，甲方应予以更正并承担乙方管理资产的实际损失；若经核实，确属中国结算清算差错的，乙方应配合甲方与中国结算沟通；若因乙方在托管交易单元上进行非托管资产交易、指定交易单元错误等原因，致使甲方接收清算数据不完整不正确，造成清算差错的，乙方应优先完成资金交收，并由乙方承担托管资产、甲方实际损失。

**第十三条** 为确保甲方与中国结算的正常交收，不影响甲方所有托管资产的正常运作，交易日（T 日）日终乙方应保证其管理的各托管资产资金账户有足够的资金可按时完成 T+1 日的资金交收。

**第十四条** 若因乙方管理资产资金账户 T 日无法满足 T+1 日交收要求时，乙方应按照《托管协议》或《备忘录》中约定的时点补足金额，未有约定的或晚于如下时点的，应按如下时点分别补足相应市场应付金额：对于甲方采用固定比例最低备付金计收方式的，乙方应于 T+1 日 11:00 前补足金额。对于甲方采用差异化最低备付金比例计收方式的，乙方应最晚于 T+1 日 8:30 前补足金额，确保甲方及时完成清算交收。乙方未按约定时限补足透支金额，导致采用差异化最低结算备付金比例计收方式的甲方的最低结算备付金比例增加的，甲方有权依据影响大小调整相关乙方管理资产的最低结算备付金，并于变更前及时通知乙方并无需征得乙方的同意。

**第十五条** 乙方可通过“托管+”系统查询托管资产“可售交收锁定”打标情况、担保品

提交结果、“可售交收锁定”证券转为“待处置交收锁定”证券结果等信息。甲方可依据乙方申请为乙方向中国结算申请证券加设标识信息的相关明细数据。

**第十六条** 乙方应充分知晓以下结算规则，并认可由此可能对乙方管理资产产生的影响：

（一）根据中国结算业务规则，当T日日终甲方作为资金净应付结算参与人发生应付资金核验不足额情形时，甲方可以向中国结算申报乙方应收证券作为中国结算加设“可售交收锁定”标识的证券，T+1日甲方可以向中国结算申报乙方的已加设“可售交收锁定”标识证券转为“待处置交收锁定”证券，具体流程见本协议第十八条第（二）款；

甲方有权在考虑资金金额、账户可用余额、资金核验情况等多方面因素后，决定向中国结算申报优先或免除标识指令。

（二）乙方已知的T+1日无力补足超买资金时，应及时通知甲方。乙方确有需要开展可能T+1日日间需使用无标识证券的业务（如T日买入的证券计划用于T+1日开展采用实时逐笔全额非担保结算方式即RTGS的交易），可于T日15:00前向甲方发送免除标识指令，并按照免除标识指令证券上一日收盘价的120%提交现金担保至甲方指定账户（该账户原则上为备付金账户），甲方应在现金担保额度范围内于中国结算规定的截止时点前向中国结算申报免除标识指令。若乙方申报免除标识指令后，T+1日该证券并未实际开展RTGS等T+1日日间需使用无标识证券业务，甲方后续有权拒绝向中国结算申报乙方的免除标识指令。甲方不向乙方承诺优先标识或免除标识指令申报结果有效。

（三）甲方作为结算参与人对中国结算发生资金交收违约的，乙方管理资产的相关证券账户所涉“可售交收锁定”证券可能被按照市值由大到小顺序选择证券账户，所选证券账户内的全部“可售交收锁定”证券将被转为“待处置交收锁定”证券，直至足以弥补甲方对中国结算的交收违约金额；中国结算有权处置已加设“待处置交收锁定”标识的证券并优先受偿。

**第十七条** 乙方某管理资产发生证券交收违约的，甲方有权暂不交付该管理资产违约交收证券对应的价款。中国结算通过冲抵、卖空扣款、延迟交付、强制补购、临时借券或现金结算等机制进行违约处置时，乙方应予以配合。甲方按中国结算有关违约金的标准向乙方收取违约金及资金成本利息。乙方须T+1日内补足违约交收的相关证券及其权益，乙方未能补足的所产生的全部损失由乙方承担，收益归托管资产所有。

**第十八条** 乙方应积极采取各项措施履行资金交收义务，包括并不限于采用自有或其他合法合规来源资金及时补足待交收金额。如因乙方原因造成乙方管理资产、甲方实际损失，

由乙方承担。乙方未及时补足资金的，甲方有权直接扣划违约资金账户的资金，以及按照本协议第二十三条相关条款对乙方实施风险管理措施。乙方未按约定时点补足透支金额，构成资金交收违约，甲方依法按以下方式处理，且乙方应予以配合：

（一）未造成甲方对中国结算违约的：

乙方知晓并同意，甲方有权向中国结算申报将乙方管理资产对应证券账户内相当于透支金额价值（按照前一交易日的收盘价计算或双方认可的第三方估值基准服务机构提供的估值价格孰高计算）120%的净买入证券或已提交至中国结算质押品保管库的回购质押券划转至甲方的证券处置账户，并可以依据有关规定进行处置，申报划转的证券品种、数量可以由甲方确定。中国结算根据甲方申报的证券品种、数量办理划转。乙方亦可按上述规则向甲方指定交收担保物，甲方可以考虑乙方意见后进行申报。甲方过错导致乙方管理资产合法权益受到损害的，乙方可以向甲方主张权利，并由甲方承担对乙方管理资产造成的实际损失。

乙方应向甲方出具其同意中国结算协助甲方划转其证券账户内相应证券的书面文件。乙方出具上述书面文件的，视为已取得资产委托人的同意。如乙方不配合出具上述同意或确认的书面文件的，甲方仍有权按本条的约定办理。

乙方应于 T+2 日前向托管账户补足相应资金，包括交收违约金额和利息、违约金（若有）及相关费用。甲方确认乙方按时足额补足全部应付资金后，应及时向中国结算申请将交收担保物划回乙方证券账户。若乙方未能于 T+2 日补足相应资金，T+3 日起乙方应配合甲方对划转证券予以处置。如乙方不配合，甲方可依法自行对划转证券进行处置，但须及时通知乙方，甲方该等处置对乙方托管资产和乙方造成损失的，由乙方承担全部责任，甲方不承担任何责任。处置所得在扣除处置费用后，应首先用于完成交收及清偿乙方的违约责任，有剩余的，将由甲方返还乙方。如上述资金仍不足以完成交收时，甲方有权对乙方继续追偿。乙方或其管理的资产出资人不得以甲方处置该资产时未能做出最佳选择为理由向甲方主张权益，亦不得以甲方处置该资产时未经乙方同意为理由拒绝承担交易结果或向甲方主张权益。

（二）造成甲方对中国结算违约的：

乙方 T+1 日无法足额履行资金交收时，应于 T+1 日下午 14:00 之前向甲方书面申报可足额弥补 T+1 日日终资金交收违约金额的待处置证券，甲方应及时向中国结算完成申报。

如乙方管理资产当日不涉及可售交收锁定证券的，应按前述（一）条款指定交收担保物。若乙方未按时申报待处置证券和交收担保物，甲方有权在乙方该违约资产证券范围内自行确定和申报待处置证券及交收担保物，并通知乙方。若因乙方无法提交足额的待处置证券和交收担保物、未按时申报或申报错误而造成甲方对中国结算发生资金交收违约，进而导致中国

结算采取交收违约处理措施而产生的甲方全部实际损失，由乙方承担。

乙方于 T+2 日向甲方补足相应资金的，包括交收违约金额和利息、违约金（若有）及相关费用，甲方在中国结算规定时间前向中国结算补足上述资金，中国结算将相应证券账户中证券的“待处置交收锁定”标识解除。

T+3 日起，如甲方作为结算参与者仍未能向中国结算补足相应资金的，中国结算将处置待处置证券及其权益，乙方应知晓并配合。中国结算处置后，资金仍有不足导致中国结算向甲方追索的，甲方有权要求乙方立即支付交收违约金额和利息、违约金（若有）及相关费用等。若乙方未支付导致甲方垫付的，甲方将继续向乙方追索，并要求乙方进一步承担赔偿责任。

**第十九条** 乙方应根据《债券质押式回购交易结算风险控制指引》内容建立健全内部风险控制机制，并结合自身风险承受能力，对融资回购规模、融资回购规模增长率、回购融资负债率、标准券使用率、低信用等级质押券入库占比、单一发行人质押券入库集中度、流动性情况、欠库次数等风险因素进行检测并控制，并建立压力测试机制。乙方及其管理资产不得直接或通过其他利益相关方，为发行人使用自己发行的信用类债券开展融资回购交易提供便利；同时应密切关注中国结算和证券交易所或其他全国性证券交易场所发布的相关信息，及时做好应对安排，严格防范融资回购交易发生欠库和资金交收违约风险。

**第二十条** 乙方应积极配合甲方完成《债券质押式回购交易结算风险控制指引》项下要求甲方对乙方进行的定期综合评估及采取的其他风险控制措施要求；积极配合甲方履行法律法规、监管机构、登记结算机构等有权机构对甲方的履职要求，如因乙方未予以配合的，应承担由此给甲方造成的全部实际损失。甲乙双方应建立日常沟通机制，甲方向乙方发送违规提示或转发中国结算违规提示时，乙方应第一时间配合甲方对违规情况进行处理，并向甲方反馈违规处理报告。

**第二十一条** 为防范乙方管理资产参与交易所质押式回购类业务带来的资金交收风险，甲乙双方应遵守以下约定：

（一）乙方应主动加强质押券管理，对于可能发生欠库的产品应及时主动进行补券或提交现金担保品。甲方发现乙方有可能发生欠库的，甲方应通知乙方补券；若乙方无法进行补券，需要提交现金担保品的，应当在 T+1 日 11 点前，按照甲方要求发送现金担保品划款指令。乙方有义务配合补券、提交现金担保品并根据通知要求反馈甲方相关信息。

（二）若乙方未按要求完成补券，造成欠库的，乙方应及时弥补回购欠库扣款金额，并补充提交质押券或压缩融资规模，若出现连续欠库，乙方应根据《中国证券登记结算有限责

任公司上海/深圳分公司结算账户管理及资金结算业务指南》相关规定，交付回购欠库扣款金额和欠库违约金，履行资金交收义务。

**第二十二条** 乙方应积极采取各项措施履行回购交易资金交收义务，包括并不限于：采用自有或其他资金及时补足待交收金额。若因乙方原因发生资金交收违约，甲方有权对违约资金账户及乙方的其他资金结算账户（托管户除外）实施见款即扣等方式，以及按照本协议第二十三条相关条款对乙方实施风险管理措施。乙方知晓并确认，乙方管理资产中提交入库的债券将作为甲方相关结算备付金账户偿还融资回购到期购回款的质押券，若乙方债券回购交收违约，甲方有权依照中国结算相关规则进行处理。具体处理方式如下：

（一）如发生资金交收违约风险，乙方认可并同意以下事项：

乙方或其管理的资产应在融资回购业务应付资金交收违约后的第一个交易日 12:00 前，支付融资回购业务应付资金及违约金。乙方未支付融资回购业务应付资金及违约金的，乙方应向甲方具体指定违约资产证券账户中足额可供处置的质押券明细（质押券种类、数量和处置顺序）；甲方有权按照中国证监会、交易所、中国结算等机构制定的有关规定，要求乙方处置该违约资产。若乙方未及时处置该违约资产，甲方有权向中国结算申请将乙方违约资产证券账户中的资产划转至甲方专用证券清偿账户。乙方或其管理的资产出资人不得以甲方处置该资产时未能做出最佳选择为理由向甲方主张权益，亦不得以甲方处置该资产时未经乙方同意为理由拒绝承担交易结果或向甲方主张权益。

（二）乙方管理的违约资产中，可供处分的质押券处分所得不足以弥补其相关未支付融资回购业务应付资金、利息、违约金及处分质押券产生的全部费用等款项时，甲方有权对该资产证券账户内的其他证券采取冻结或划转等措施继续追索。在冻结或划转证券后的两个交易日内，如果乙方或其管理的违约资产补足上述不足款项，甲方将返还冻结或扣取的证券，否则，从第三个交易日起，甲方有权变卖冻结或扣取的证券，以抵补前款所述款项。由此造成的实际损失由乙方承担。

**第二十三条** 甲方根据自身的风险控制管理要求，有权基于乙方以下风险特征对乙方采取差异化的风险管理措施：

（一）连续 5 个交易日出现融资负债率超 80%（利率类债券入库占比超过 80%的，该比例可放宽至 90%）；

（二）连续 5 个交易日出现 AA+级、AA 级信用债入库集中度占比超过 10%；

（三）连续 5 个交易日出现单一发行人信用类债券入库担保集中度超标，即：对于上月日均回购未到期规模小于 2 亿元的，单一发行人信用类债券入库担保集中度高于 50%；

对于上月日均回购未到期规模大于2亿元（含2亿元）的，单一发行人信用类债券入库担保集中度高于30%；

- （四）一个自然月内出现1次及以上资金交收违约；
- （五）一个自然月内累计出现2日（含2日）以上发生回购欠库的情形；
- （六）甲方认定的其他高风险情形。

甲方采取的风控措施包括并不限于：

- （一）要求其降低回购规模或将交易所债券质押式回购调整为协议式正回购；
- （二）要求其降低某只或某些债券的入库占比或置换交易所质押券；
- （三）对托管资产征收额外结算保证金、最低备付金；
- （四）提请中国结算、证券交易所或其他全国性证券交易场所对托管资产采取相关自律监管措施，或者限制其融资回购交易；
- （五）按照中国结算标准计收违约资金的利息和违约金；
- （六）调高乙方管理的托管资产的最低备付金比例；
- （七）向中国证监会各派出机构或行业协会报告；
- （八）暂停为其提供相关结算业务及相关证券交易服务或将结算模式变更为券商结算模式；
- （九）记录诚信档案，并向中国结算提交；
- （十）甲方认为必要的其他措施。

上述风险管理措施待引发该措施的特征修正后，根据监管部门或相关行业协会意见（如有），经双方商定后终止。

**第二十四条** 乙方应遵守有关法律法规及监管部门、自律机构的要求，以及本协议约定，在发生融资回购交易时，发生超出法律法规或监管规定的指标要求的（发生日为T日），乙方须在发生之日起5个交易日内对其管理的资产回购未到期余额、质押券、托管债券及信用债等标的及业务要素及时进行调整，直至符合上述限制。

**第二十五条** 根据《中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司港股通存管结算业务指南》和《中国证券登记结算有限责任公司上海分公司港股通存管结算业务指南》的要求，开展港股通公司行为处理业务（以下简称“港股通公司行动”），甲方和乙方应遵守以下约定：

（一）乙方如果无法接收中国结算发送的港股通公司行动信息文件，应及时向甲方申请转发获取，并提供两个以上联系人及邮箱或乙方的深证通小站号；甲方向乙方预留联系人邮箱或双方认可的其他方式转发中国结算港股通公司行动信息文件，不对港股通公司行动信息

文件进行解析、修改等处理，涉及文件业务种类、内容、格式以中国结算发送为准；

(二) 乙方应及时关注港股通公司行动信息文件，如有港股通公司行动按照中国结算规定需甲方协助申报的业务需求，应按照中国结算规定的申报文件格式、内容填写要求，不晚于申报截止日 14:00 前发送甲方并进行电话确认，甲方不承担对申报文件内容审核及修改责任，甲方完成申报后将中国结算反馈的受理状态以邮件或者双方约定的方式通知乙方，乙方根据中国结算反馈的受理状态查看申报是否被中国结算受理。

(三) 若乙方修改申报内容，应在申报截止日 14:00 前重新填写申报文件并发送甲方进行申报。若乙方未在本协议约定时间内提交修改后的申报内容，而甲方已经向中国结算报送并被受理的，由此产生的一切后果由乙方自行承担，甲方对此不承担任何责任。

**第二十六条** 根据《内地与香港股票市场交易互联互通机制登记、存管、结算业务实施细则》和《中国证券登记结算有限责任公司上海/深圳分公司港股通存管结算业务指南》要求，乙方管理资产投资参与港股通交易的，乙方应保证在 T+1 日 9:30 之前有足够的头寸用于港股通 T+1 日公司行动、证券组合费和风控资金的交收，在 T+1 日 14:00 之前有足够的头寸用于港股通 T+2 日交易资金的交收。

乙方应知晓港股通交易日历优化实施后的交收规则，理解相关结算风险。对于两地市场非对称假期前（内地节假日但香港非节假日）的共同交易日，乙方应在 T 日 16:3000 之前向甲方发送资金划转指令，并同时保证有足够的头寸用于港股通 T 日交易资金的交收，履行资金提前到账义务。

如由于乙方原因导致的港股通交收失败，由此造成的甲方实际损失，由乙方承担。

**第二十七条** 因乙方原因导致甲方在新增港股通交易日（T 日）未能按中国结算相关业务规则完成资金提前到账，且于下一港股通交易日（T+1 日）16:00 终前仍未补足的，甲方将向中国结算申报乙方相关证券账户，中国结算将通知上交所和深交所暂停接受 T+2 日所申报证券账户的港股通买入申报。甲方承诺对申报行为和内容的真实、准确、完整、及时负责。

**第二十八条** 如果因不可抗力不能履行本协议时，可根据不可抗力的影响部分或全部免除责任。不可抗力是指甲方或乙方不能预见、不可避免、不能克服的客观情况，包括但不限于地震、台风、洪水、火灾、疫情、瘟疫、战争、政变、恐怖主义行动、骚乱、罢工、大面积停电、人民银行中央支付清算系统故障以及新法律或国家政策的颁布或对原法律或国家政策的修改等。任何一方因不可抗力不能履行本协议时，应及时通知对方并在合理期限内提供受到不可抗力影响的证明，并采取适当措施防止损失的扩大。发生临时停市时，乙方应密切关注证券交易所或其他全国性证券交易场所、中国结算发布的临时停市、恢复交易、登记结

算应对安排等公告，做好相关流动性风险管理等工作。

**第二十九条** 本协议有效期内，若因法律法规、中国结算业务规则发生变化导致本协议的内容与届时有效的法律法规、业务规则的规定不一致的，应当以届时有效的法律法规、业务规则的规定为准，协议双方应根据最新的法律法规、业务规则对本协议进行相应的修改和补充。

**第三十条** 双方一致认可本协议已经双方充分协商，并非格式合同。本协议未尽事宜，可由甲乙双方协商解决并另行签署补充协议。本协议之补充协议为本协议不可分割的组成部分，与本协议具有同等法律效力。

**第三十一条** 本协议作为托管合同或资产管理合同的附件和组成部分，与其同等法律效力，在托管合同或资产管理合同生效时生效。

附件二：授权通知书（样本）

授权通知书（样本）

招商银行股份有限公司：

我单位授权以下人员向你行发送相关业务通知和指令。现将发送用章样本、有关人员签字（章）样本及相应权限、授权传真号码、授权电子邮箱、指令确认人员及联系方式等通知你行，请在使用时核验。被授权人在授权范围内向你行发送业务通知和指令的真实性、准确性、完整性及合法性由我单位负全部责任，你行执行被授权人发送的业务通知和指令的全部法律后果由我单位承担。

此外，我单位知晓、同意并授权你行收集和使用以下被授权人员的个人信息。我单位确认并承诺，我单位已获得被授权人员同意向你行提供个人信息，且被授权人员已知晓个人信息使用用途。我单位将对上述个人信息的提供承担全部责任，如违反此项承诺给你行造成损失的，由我单位承担一切法律后果。

姓名	电话号码	权限	签字样本	印章样本
业务通知及指令发送用章	(用章样本)			
授权传真号码				
授权电子邮箱				
其他指令确认人员及联系方式				

备注：1、指令发送用章须与被授权人签字/章（如有）同时出具，指令方为有效。业务通知用章可单独使用。

2、权限类型：经办、复核；经办、复核、审批。

3、上述信息变更，我单位负责提前通知你行。

资产管理人（公章）：

法定代表人（或授权人）签字（章）：

年 月 日

附件三：划款指令书（格式）

### 划款指令信息

XXXXXX资产管理计划\_\_专用表

编号： 年 号 指令日期： 年 月 日	
XXX资产托管部： 敬请贵部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：	年 月 日
付款人：	
开户行：	
付款账号：	
收款人：	
开户行：	
收款账号：	
划款金额(小写)：	
划款金额(大写)：	
划款用途：	
备注：	
管理人签章：	托管人签章：
审批人：	审批人：
复核人：	复核人：
经办人：	经办人：

附件四 共用交易单元说明函

共用交易单元说明函

招商银行股份有限公司北京分行：

我公司托管在贵行的“xx”和“xx”与已托管在贵行的“xx”共用现有交易单元。具体信息如下：

上海	交易单元号\券商	清算编号
	\	
深圳	交易单元号\券商	主交易单元号
	\	

请协助办理。

XX 公司  
年月日

附件五 电子指令启用函（样本）

电子指令启用函（样本）

招商银行股份有限公司北京分行：

对于我司管理，你行托管的长信基金-众锐 8 号混合型集合资产管理计划产品，采用你行深证通电子直连对接方式，指令范围包括不限于投资、费用支付、其他划款等类型。凡我司通过深证通电子直连对接方式向贵行发送的指令均视为我司真实意思表示，我司愿意承担贵行执行指令所产生的法律后果。

对于因深证通电子直连异常导致电子指令无法发送的，我司采取传真方式发送指令，传真指令加盖书面授权通知中的预留印鉴生效。

我司发送指令附件的电子邮箱为\*\*\*\*@cxfund.com.cn。我司发送指令附件的电子邮箱：

长信基金管理有限责任公司公司

年 月 日