东亚前海证券泓海 1 号集合资产管理计划

资产管理合同

编号：【DYQH-JH-2024-0007】

管理人：东亚前海证券有限责任公司

托管人：兴业银行股份有限公司

目 录

第一章 前 言 1

第二章 释 义 1

第三章 承诺与声明 7

第四章 当事人及权利义务 9

第五章 资产管理计划的基本情况 15

第六章 资产管理计划的募集 19

第七章 资产管理计划的成立与备案 21

第八章 资产管理计划的参与、退出与转让 22

第九章 份额持有人大会及日常机构 32

第十章 资产管理计划份额的登记 32

第十一章 资产管理计划的投资 32

第十二章 服务机构与投资顾问 39

第十三章 分级安排 47

第十四章 利益冲突及关联交易 47

第十五章 投资经理的指定与变更 51

第十六章 资产管理计划的财产 51

第十七章 投资指令的发送、确认和执行 54

第十八章 越权交易 57

第十九章 交易及清算交收安排 60

第二十章 资产管理计划财产的估值和会计核算 65

第二十一章 资产管理计划的费用与税收 70

第二十二章 资产管理计划的收益分配 75

第二十三章 信息披露与报告 76

第二十四章 风险揭示 80

第二十五章 资产管理合同的变更、终止与财产清算 90

第二十六章 违约责任 95

第二十七章 争议的处理 97
第二十八章 资产管理合同的效力 97
第二十九章 其他事项 98
第三十章 反虚假宣传条款 99
附件一：风险揭示书 102
附件二：授权通知书样本 121
附件三：划款指令信息 122
附件四：专用清算账户及资金划拨专用账户 123

特别约定：《东亚前海证券泓海1号集合资产管理计划资产管理合同》（下简称“本合同”或“集合资产管理合同”）以书面形式或电子形式签订，管理人、托管人作为本合同签署方，已接受本合同项下的全部条款；委托人（参与东亚前海证券泓海1号集合资产管理计划的合格投资者）作为本合同一方，以书面形式或电子形式签署本合同即表明委托人完全接受本合同项下的全部条款，自委托人、管理人、托管人签署本合同时，本合同成立。

委托人、管理人、托管人同意遵守《中华人民共和国电子签名法》的有关规定，三方一致同意委托人以电子签名方式签署本合同、风险揭示书或其他文书的，与在纸质合同、纸质风险揭示书或其他文书上手写签名或者盖章具有同等的法律效力，无须另行签署纸质合同、纸质风险揭示书或其他文书。

第一章 前 言

为规范东亚前海证券泓海1号集合资产管理计划（以下简称“集合资产管理计划”、“本集合资产管理计划”、“本集合计划”、“集合计划”或“本计划”）运作，明确《东亚前海证券泓海1号集合资产管理计划资产管理合同》（以下简称“集合资产管理合同”、“资产管理合同”或“本合同”）当事人的权利与义务，依照《中华人民共和国民法典》、《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《基金法》）、《中华人民共和国期货和衍生品法》、《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》）及《集合资产管理计划资产管理合同内容与格式指引》等法律法规、中国证监会和中国证券投资基金业协会（以下简称“证券投资基金业协会”）的有关规定，委托人、管理人、托管人在平等自愿、公平、诚实信用原则的基础上订立本合同。本合同是规定当事人之间基本权利义务的法律文件，当事人依据《基金法》、《管理办法》、《运作规定》、《东亚前海证券泓海1号集合资产管理计划说明书》（以下简称“集合资产管理计划说明书”、“计划说明书”、“说明书”）、本合同及其他有关规定享有权利、承担义务。

管理人应当按照规定向证券投资基金业协会办理资产管理计划的设立、变更备案，并及时报送资产管理计划的运作情况、风险情况以及终止清算报告等信息。

证券投资基金业协会办理资产管理计划备案不代表证券投资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作出保证和判断，也不表明证券投资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资产管理计划的投资范围、投资策略和风险收益等信息，根据自身风险承受能力审慎选择资产管理计划，自主判断投资价值，自行承担投资风险。

第二章 释 义

在本合同及《集合计划说明书》中除非文义另有所指，下列词语具有以下含义：

资产管理计划、本资产管理计划、集合资	指依据《东亚前海证券泓海1号集合资产管理计划资产管理合同》和《东亚前海证券泓海1号集合资产管理计划

产管理计划、本集合资产管理计划、本集合计划、集合计划、本计划	说明书》所设立的东亚前海证券泓海1号集合资产管理计划。
集合资产管理计划说明书或计划说明书、说明书	指《东亚前海证券泓海1号集合资产管理计划说明书》及对其的任何有效修订和补充。
集合资产管理合同、资产管理合同、本合同	指《东亚前海证券泓海1号集合资产管理计划资产管理合同》及对其的任何有效修订和补充。
《管理办法》	指2023年1月12日经中国证监会令第203号修订后的《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》及其不时做出的修订和补充。
《运作规定》	指2023年1月12日经中国证监会公告〔2023〕2号文修订后的《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》及其不时做出的修订和补充。
中国	指中华人民共和国（为本合同之目的，不包括香港特别行政区、澳门特别行政区及台湾地区）。
法律法规	指中华人民共和国现行有效并公布实施的法律、行政法规、行政规章及规范性文件、地方法规、地方规章及规范性文件。
元	指中国法定货币人民币，单位“元”。
中国证监会	指中国证券监督管理委员会。
中登公司、中国结算公司	指中国证券登记结算有限责任公司。
集合资产管理计划管理人、集合计划管理人或管理人、资产	指东亚前海证券有限责任公司（简称“东亚前海证券”）。

管理人	
集合资产管理托管人、集合托管人或托管人、资产托管人	指兴业银行股份有限公司（简称“兴业银行”）。
推广机构	指管理人及接受管理人委托办理本集合计划的参与、退出等业务的机构。
注册登记人、注册登记机构、注册与过户登记人、份额登记人、份额登记机构	本集合计划的注册登记机构为东亚前海证券有限责任公司。
集合资产管理计划管理合同当事人	指受集合资产管理合同约束，根据集合资产管理合同享受权利并承担义务的法律主体。
委托人、投资者、份额持有人	指签订集合资产管理合同并合法取得集合计划份额的投资者，包括个人委托人、机构委托人以及中国证监会视为合格投资者的其他投资者。
个人委托人	指自然人委托人。
机构委托人	指机构委托人（包括受国务院金融监督管理机构或其授权机构监管的机构依法设立并管理的投资计划）。
合格投资者	合格投资者是指具备相应风险识别能力和风险承受能力，投资于单只资产管理计划不低于一定金额且符合下列条件的自然人、法人或者其他组织： （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：家庭金融净资产不低于300万元，家庭金融资产不低于500万元，或者近3年本人年均收入不低于40万元； （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、在中国证券投资基金业协会（以下简称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； （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）中国证监会视为合格投资者的其他情形。 合格投资者投资于单只固定收益类资产管理计划的金额不低于30万元，投资于单只混合类资产管理计划的金额不低于40万元，投资于单只权益类、期货和衍生品类资产管理计划的金额不低于100万元。资产管理计划投资于《管理办法》第三十八条第（五）项规定的非标准化资产的，接受单个合格投资者参与资金的金额不低于100万元。 法律法规、监管机构另有规定的按其规定执行。
集合资产管理计划成立日	指本集合计划达到集合资产管理合同约定的成立条件后，管理人公告本集合计划成立的日期。
推广期	指集合计划成立前，接受委托人认购参与至集合计划成立日之间的时期。
集合计划存续期	指集合计划自成立日起至终止的期间。
工作日、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。
T日	指日常参与、退出或办理其他集合资产管理计划业务的申请日，或其他集合资产管理计划相关的日期。
T+n日	指自T日起第n个工作日（不包含T日）。

参与	指投资者申请投资于本集合计划的行为，包括认购和申购。
推广期参与、认购参与或认购	指在推广期内投资者申请购买本集合资产管理计划份额的行为。
存续期参与、中间参与或申购	指在存续期内投资者申请购买本集合资产管理计划份额的行为。
退出、赎回	指集合资产管理计划委托人按照集合资产管理计划的约定，申请卖出集合资产管理计划份额的行为。
封闭期	本计划开放期以外的存续期间均为封闭期。
开放日	指集合计划成立后，为投资者办理参与、退出集合计划等业务的工作日，包括参与开放日和退出开放日。
年、年度、会计年度	指公历每年1月1日起至当年12月31日为止的期间。
计划年度	指本集合资产管理计划成立之日起每满一年为止的期间。
自有资金	指管理人参与本集合资产管理计划的本金。
集合资产管理计划收益	指集合计划利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额。
集合资产管理计划账户	指注册与过户登记人给委托人开立的用于记录委托人持有本集合资产管理计划份额情况的登记账户。
集合资产管理计划资产总值	指集合计划所拥有的各种有价证券、银行存款本息、集合计划应收款项及其他资产的价值总和。
集合计划负债	指集合计划运作时所形成的负债，如应付管理费、应付托管费、应付收益等。
集合资产管理计划资产净值	指集合资产管理计划资产总值扣除负债后的净资产值。
集合资产管理计划份额/单位净值	指集合资产管理计划资产净值除以集合计划总份额。

集合资产管理计划份额面值	指人民币1.00元。
集合资产管理计划资产估值	指计算评估集合资产管理计划资产和负债的价值，以确定集合资产管理计划资产净值的过程。
不可抗力	指当事人不能预见，不能避免，不能克服的客观情况，包括但不限于洪水、地震及其他自然灾害、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、其他突发事件、注册与过户登记人非正常的暂停或终止业务、证券交易所非正常暂停或停止交易等，非因管理人、托管人自身原因导致的技术系统异常事故、政策法规的修改或监管要求调整等情形。因交易所、银行、登记结算机构的交易、结算系统出现故障导致交易、结算无法进行的情形，因电信服务商原因导致托管人资金划付的网络中断、无法使用的情形，构成对托管人适用的不可抗力事件。
关联方关系	本合同和本计划说明书所指关联方关系的含义，符合《企业会计准则第36号-关联方披露》及中国证监会、证券交易所等监管机构颁布的相关法律法规中的关联方关系的含义相同。
流动性受限资产	指由于法律法规、监管、合同或者操作障碍等原因无法以合理价格予以变现的资产，包括到期日在10个交易日以上的逆回购与银行定期存款（含协议约定有条件提前支取的银行存款）、资产支持证券（票据）、流动受限的新股以及非公开发行股票、停牌股票、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券和非金融企业债务融资工具等资产。
管理人网站、管理人指定网站、管理人官	指https://www.easec.com.cn，管理人指定网站变更时以管理人公告为准。

网	
信义义务	托管人信义义务是指托管人按恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则，根据相关法律法规和监管规定，在本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。

第三章 承诺与声明

（一）管理人承诺与声明

管理人就本合同之目的，做出如下承诺与声明：

1、管理人是依法设立的证券经营机构，并经中国证监会批准，具有从事证券资产管理业务的资格；

2、管理人已经了解委托人的风险偏好、风险认知能力和承受能力，对委托人的财务状况进行了充分评估；

3、管理人保证所提供的资料和信息真实、准确、完整、合法；

4、管理人在签订资产管理合同前充分地向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；

5、管理人将按照《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资产，不保证受托资产一定盈利，也不保证最低收益或者本金不受损失，以及限定投资损失金额或者比例。

（二）托管人承诺与声明

托管人就本合同之目的，做出如下承诺与声明：

1、托管人具有合法的从事资产托管业务的资格；

2、托管人将按照《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，履行信义义务以及资产管理合同约定的其他义务；

3、托管人将根据法律法规、行政法规、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，对管理人的投资或者清算指令等进行监督；

4、在管理人发生异常且无法履行管理职能时，托管人将依照法律、行政法规以及合同约定召集份额持有人大会（如有），维护委托人权益，份额持有人大会设立日常机构的除外；

5、托管人保证所提供的资料和信息真实、准确、完整、合法。

（三）委托人承诺与声明

委托人就本合同之目的，做出如下承诺与声明：

1、委托人符合《运作规定》合格投资者的要求，向管理人或者销售机构提供的有关投资目的、投资偏好、投资限制、财产收入情况和风险承受能力等基本情况真实、完整、准确、合法，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。前述信息资料如发生任何实质性变更，委托人将及时书面告知管理人或者销售机构；

2、委托人财产的来源以及用途符合国家有关规定，未使用贷款、发行债券等筹集的非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以及业务决策程序的要求；

3、委托人已充分理解资产管理合同条款，了解相关权利义务，了解有关法律法规以及所投资资产管理计划的风险收益特征，知晓管理人、托管人以及相关机构不应对资产管理计划的收益状况或者本金不受损失作出任何承诺，了解“卖者尽责，买者自负”的原则，投资于本计划将自行承担投资风险；

4、委托人充分理解本合同约定的业绩比较基准（如有）仅是投资目标而不是管理人的保证或承诺；

5、委托人承诺其知悉并遵守《中华人民共和国反洗钱法》《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，委托人声明其已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，委托人声明其参与集合资产管理业务的资金来源不属于违法犯罪所得及其收益，投资资金来源和去向不涉及洗钱、恐怖融资和逃税等行为，委托人承诺积极配合管理人履行反洗钱职责，不借助本业务进行洗钱等违法犯罪活动；

6、委托人声明，其不属于中国有权机关发布的制裁名单内的企业或个人，以及其他国际组织、有关外国政府或监管机构发布的且得到我国承认的制裁名单内的企业或个人，不位于被中国有权机关制裁的国家和地区，以及其他国际组织、有关外国政府或监管机构制裁并经过我国承认制裁的国家和地区；

7、如委托人以其管理的私募资产管理产品（含在基金业协会登记、备案的私募证券投资基金）参与本集合计划，委托人声明，该产品的所有投资者为符合

法律法规规定的合格投资者且受托资产来源合法合规，投资本计划不存在违反监管要求的产品嵌套，以及以投资本计划规避投资范围、杠杆约束等监管要求等违法违规行为；委托人承诺积极配合管理人为识别结构化发债行为进行的相关排查工作，包括但不限于根据管理人要求向管理人提供底层机构投资者及其关联方名单，协助管理人研判（如需）本计划所投标的债券发行人是否与前述关联方存在高度关联关系等事项；

8、委托人声明，一旦签署本合同，即视为委托人知悉、授权管理人及托管人可为订立、履行本合同所需或为履行法定职责或法定义务所需而处理其个人信息。

第四章 当事人及权利义务

本资产管理计划为均等份额，除资产管理合同另有约定外，每份份额享有同等权益，承担同等风险。

（一）委托人的权利和义务

1、委托人的基本信息

个人填写：

姓名：　　证件类型：　　证件号码：

通信地址：

邮政编码：

联系电话：　　移动电话：　　电子信箱：

其他：

机构/产品填写：

机构/产品名称：

机构/管理人法定代表人：

通信地址：

邮政编码：

代理人姓名：　　身份证号码：

联系电话：　　其他：

2、委托人的权利

（1）分享资产管理计划财产收益；

（2）取得分配清算后的剩余资产管理计划财产；

（3）按照资产管理合同的约定参与、退出和转让资产管理计划份额；

（4）根据资产管理合同的约定，参加或者申请召集资产管理计划份额持有人大会（如有），行使相关职权；

（5）按照资产管理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；

（6）监督管理人、托管人履行投资管理和托管义务的情况；

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

3、委托人的义务

（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；

（2）接受合格投资者认定程序，如实填写风险识别能力和风险承担能力问卷，如实提供资金来源、金融资产、收入及负债情况，并对其真实性、准确性和完整性负责，签署合格投资者相关文件；

（3）除公募资产管理产品外，以合伙企业、契约等非法人形式直接或者间接投资于资产管理计划的，应当向管理人充分披露实际委托人和最终资金来源；

（4）按照规定向管理人或者资产管理计划销售机构提供信息资料以及身份证明文件，配合管理人或者其销售机构完成投资者适当性管理、非居民金融账户涉税信息尽职调查、反洗钱等监管规定的工作；

（5）认真阅读并签署风险揭示书；

（6）在持有的资产管理计划份额范围内，承担资产管理计划亏损或者终止的有限责任；

（7）按照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；

（8）不得违反资产管理合同的约定干涉管理人的投资行为；

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

（10）不得利用资产管理计划相关信息进行内幕交易或者其他不当、违法的

证券期货业务活动；

（11）保守商业秘密，不得泄露资产管理计划的投资计划、投资意向、投资信息等，依法依规提供的信息除外；

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

（二）管理人的权利和义务

1、管理人的基本信息

机构名称：东亚前海证券有限责任公司

住所：深圳市前海深港合作区南山街道前湾一路 399 号前海嘉里商务中心 T7 办公楼 801

通讯地址：深圳市前海深港合作区南山街道前湾一路 399 号前海嘉里商务中心 T7 办公楼 801

法定代表人：孙冬青

联系人：李军伟

联系电话：021-38175750

传真：0755-21376999

2、管理人的权利

（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和业绩报酬（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可的服务机构为资产管理计划提供募集、份额登记、估值与核算、信息技术系统等服务，并对其行为进行必要的监督和检查；

（5）以管理人的名义，代表资产管理计划行使投资过程中产生的权属登记等权利；

（6）根据《管理办法》、《运作规定》、《集合资产管理合同》及其他有关规定，管理人有权对托管人是否及时执行管理人合法合规的投资指令、妥善保

管集合计划的全部资产、是否按时将集合计划分红收益及清算资产分配给委托人、是否对集合计划资产实行分账管理、是否擅自动用集合计划资产等行为进行监督和核查；

（7）管理人有权定期对托管人保管的集合计划资产进行核查。管理人发现托管人未对集合计划资产实行分账管理、擅自挪用集合计划资产、因托管人的过错导致集合计划资产灭失、减损、或处于危险状态的，管理人应立即以书面的方式要求托管人予以纠正和采取必要的补救措施。管理人有权利要求托管人赔偿集合计划因上述原因所遭受的损失；

（8）管理人发现托管人的行为违反《管理办法》、《运作规定》、《集合资产管理合同》及其他有关规定的，有权及时制止并以书面形式通知托管人限期纠正。托管人收到通知后应及时核对并以书面形式给管理人发出回函，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在限期内，管理人有权随时对通知事项进行复查。托管人对管理人通知的违规事项未能在限期内纠正的，管理人应报告中国证券投资基金业协会并抄送管理人住所地中国证监会派出机构。

（9）法律、行政法规、中国证监会及证券投资基金业协会规定和资产管理合同约定的权利。

3、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）对委托人的风险识别能力和风险承担能力进行评估，向合格投资者非公开募集资金；

（4）制作风险揭示书，向委托人充分揭示相关风险；

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

（6）配备足够的具有专业能力的人员进行投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作资产管理计划财产；

（7）建立健全内部管理制度，保证本资产管理计划财产与其管理的其他资产管理计划财产、管理人的固有财产相互独立，对所管理的不同资产管理计划的受托财产分别管理，分别记账，进行投资；

（8）按照资产管理合同约定接受委托人和托管人的监督；

（9）召集资产管理计划份额持有人大会（如有），份额持有人大会设立日常机构的除外；

（10）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相关要求以及合同的约定；

（11）按照资产管理合同约定计算并向委托人报告资产管理计划份额净值；

（12）对《管理办法》第三十八条第（五）项规定的非标准化资产(如有)和相关交易主体进行充分的尽职调查，形成书面工作底稿，并制作尽职调查报告；

（13）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；

（14）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；

（15）按照资产管理合同的约定确定收益分配方案，及时向委托人分配收益；

（16）编制向委托人披露的资产管理计划季度、年度等定期报告；

（17）办理与受托财产管理业务活动有关的信息披露事项；

（18）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；

（19）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；

（20）对于托管人违反法律、行政法规规定或者资产管理合同，对资产管理计划财产以及其他当事人的利益造成重大损失的，应当及时采取措施制止，并报告中国证监会相关派出机构；

（21）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；

（22）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其他人进行交叉融资安排等方式，违规为本机构及其控股股东、实际控制人或者其他关联方提供融资；

（23）建立并保存投资者名单；

（24）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；

（25）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；

（26）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委托人；

（27）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；

（28）管理人应根据法律法规及监管规定履行反洗钱义务，并根据人民银行有关规定向托管人发送本计划“受益所有人”信息，配合托管人履行反洗钱义务；

（29）法律、行政法规、中国证监会、证券投资基金业协会规定和资产管理合同约定的其他义务。

（三）托管人的权利与义务

1、托管人的基本信息

机构名称：兴业银行股份有限公司

法定代表人：吕家进

住所：福建省福州市台江区江滨中大道 398 号兴业银行大厦

通信地址：上海市浦东新区银城路 167 号

联系人：魏骏丞

联系电话：021-52629999

2、托管人的权利

（1）按照资产管理合同约定，依法保管资产管理计划财产；

（2）按照合同的约定，及时、足额获得资产管理计划托管费用；

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

3、托管人的义务

（1）安全保管集合计划财产；

（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）复核资产管理计划资产净值和份额净值；

（6）向管理人披露托管人及其控股股东、实际控制人或者其他关联方，以及前述机构发行的证券或者承销期内承销的证券等信息；

（7）投资于《管理办法》第三十八条第（五）项规定的资产时，准确、合理界定安全保管资产管理计划财产，监督管理人投资运作等职责；

（8）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，立即通知管理人并及时报告中国证监会相关派出机构；

（9）办理与资产管理计划托管业务有关的信息披露事项；

（10）对资产管理计划财务会计报告、年度报告出具意见；

（11）编制托管年度报告，报送中国证监会相关派出机构；

（12）管理人未按规定召集或者不能召集份额持有人大会（如有）的，由托管人召集份额持有人大会，份额持有人大会设立日常机构的除外；

（13）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；

（14）不得为托管人以及任何第三人输送利益，不得委托第三人托管资产管理计划财产；

（15）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；

（16）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；

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

第五章 资产管理计划的基本情况

（一）资产管理计划的名称：东亚前海证券泓海 1 号集合资产管理计划。

（二）资产管理计划的类别：混合类集合资产管理计划。

（三）资产管理计划的运作方式：开放式。

（四）资产管理计划的投资目标、主要投资方向、投资比例及产品风险等级

1、投资目标：

本计划以大类资产配置策略为主，通过审慎、适时、灵活地运用金融衍生工具制定不同的策略组合，进行系统性风险的对冲操作以降低投资组合的波动性。同时，在深入研究的基础上构建核心投资组合，力争获取中长期稳定的收益。

上述投资目标不构成管理人保证委托人出资资产本金不受损失或取得投资收益的承诺。

2、主要投资方向：

（1）固定收益类资产包括：现金、定期存款、协议存款、同业存款、同业存单、结构性存款、通知存款、大额可转让存单、债券回购、国债、政策性金融债券、央行票据、金融债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、非公开定向债务融资工具、资产支持证券、资产支持票据、项目收益票据、次级债（含二级资本债）、永续债、可转换债券、可交换债券等在银行间市场、证券交易所市场等经国务院同意设立的交易市场交易标准化债权资产以及债券型基金、债券逆回购；

固定收益类资产中的现金类资产包括货币市场基金、银行活期存款、现金、到期日在1年内（含1年）的国债、到期日在1年内（含1年）的央行票据、到期日在1年内（含1年）的政府债券。

（2）权益类资产：国内依法发行上市的股票（包括新股申购所得股票、参与定向增发所得股票、创业板股票、科创板股票、北交所股票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、股票型基金、混合型基金等。

（3）期货和衍生品类：股指期货、国债期货、商品期货等金融衍生品。

本计划可参与债券正回购。本计划不投资于私募基金。

3、投资比例：

1）本计划投资于固定收益类资产的比例小于资产管理计划总资产80%；

2）本计划投资于权益类资产（不含融资融券合约负债）的比例小于资产管

理计划总资产 80%；

3）本计划投资于期货和衍生品的持仓合约价值的比例小于资产管理计划总资产 80%或本计划期货和衍生品账户权益比例小于资产管理计划总资产 20%。

以上投资比例符合混合类资产管理计划的监管规定。

资产管理计划投资于其他资产管理产品的，大类资产配置比例、总资产占净资产比例应当按照穿透原则合并计算；资产管理计划投资于其他私募资产管理产品的，应当按照穿透原则合并计算投资同一资产的比例以及投资同一或者同类资产的金额。

特别说明：本集合计划终止或提前终止进行资产变现时，管理人可不受投资比例限制的指标约束，管理人在此情形下的超限行为不认为管理人违约。

4、投资限制：

1）本集合计划的总资产不得超过本集合计划净资产的 200%；资产管理计划的嵌套层数不得超过两层。

2）本集合计划投资于同一资产的资金，不得超过集合计划资产净值的 25%；管理人管理的全部集合资产管理计划投资于同一资产的资金，不得超过该资产的 25%。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）本计划开放退出期内，其资产组合中 7 个工作日可变现资产的价值，不低于本计划资产净值的 10%。

4）任一交易日日终，持有的一家上市公司的股票数量不得超过该只股票流通股的 10%。

5）任一交易日日终，持有的一家上市公司的股票数量不得超过该只股票总股本的 5%。

6）任一交易日日终，持有的单一债券（国债除外）市值占本计划资产净值的比例不超过 10%。

7）任一交易日日终，持有的单一股票/存托凭证市值占本计划资产净值的比例不超过 10%。

8）本集合计划参与股票、债券、可转换公司债券、可交换公司债券等证券发行申购时，本集合计划所申报的金额不得超过该资产管理计划的总资产，本集

合计划所申报的数量不得超过拟发行公司本次发行的总量。

9）本集合计划投资的企业债、公司债、非公开定向债务融资工具、中期票据、资产支持证券、资产支持票据的债项评级为AA（含）以上，若无债项评级，则参考主体评级或担保人评级（孰高），短期融资券的债项评级为A-1级（含）以上，若无债项评级，则参考主体评级或担保人评级（孰高）；

10）债券正回购资金余额或逆回购资金余额均不得超过本计划上一日净资产的100%。

11）不得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），包括但不限于以下情形：投资项目被列入国家发展和改革委员会发布的淘汰类产业目录；投资项目违反国家环境保护政策要求；通过穿透核查，资产管理计划最终投向上述投资项目。

12）本集合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本计划净资产50%的，本集合计划的总资产不得超过其净资产的120%。本集合计划投资于国债、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。

13）本计划投资资产支持证券、资产支持票据的，其挂牌场所为证券交易所或银行间市场，仅限于投资资产支持证券、资产支持票据的优先级，且拟投资的资产支持证券基础资产不包含资产管理产品、信托计划、私募基金及其收/受益权等具有资产管理产品性质的资产，但包含仅作为特殊目的载体（SPV）存在的情况，并实行穿透式监控，严格遵守前述规定进行投资管理。

14）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（若有）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、公开募集证券投资基金，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。

15）法律法规及中国证监会规定的其他限制。

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

本集合计划属于混合类产品。本集合计划是产品风险评级为R4的投资品种，适合风险承受能力等级为C4及以上的合格投资者。

如本集合计划通过代销渠道代销的，产品风险等级及适当性匹配意见以代销机构结果为准，且代销机构所依据的产品风险等级评价结果不得低于管理人作出的风险等级评价结果。

（五）资产管理计划的存续期限

管理期限为自本计划成立之日起【10 年】，具体到期日以产品成立公告为准。如发生法律法规、监管要求或当本集合计划在存续期内出现应当终止或展期的情形时，本集合计划将终止并进行清算或展期。

（六）资产管理计划的最低初始募集规模：初始规模不低于人民币【1000】万元；资产管理计划份额的初始募集面值为 1 元。

（七）资产管理计划的费用：本计划费用具体参见本合同第二十一章“资产管理计划的费用与税收”。

（八）资产管理计划的分级安排：本集合计划不分级。

（九）资产管理计划的份额登记、估值与核算、信息技术系统等服务机构：本计划无委托相关服务机构，管理人自行提供份额登记、估值与核算、信息技术系统支持等。

（十）资产管理计划的投资顾问：上海泓湖私募基金管理有限公司，在证券投资基金业协会登记的会员编号为 GC1900000004。

（十一）其他

（1）预警线：本计划无预警线。

（2）止损线：本计划无止损线。

第六章 资产管理计划的募集

（一）资产管理计划的募集对象、募集方式、募集期限

1、募集对象：合格投资者。

2、募集方式

推广机构应将集合资产管理合同、集合资产管理计划说明书等正式推广文件，以书面方式或电子方式置备于推广机构营业场所。推广机构应当了解客户的投资需求和风险偏好，详细介绍产品特点并充分揭示风险，推荐与客户风险承受能力相匹配的集合计划。禁止通过签订保本保底补充协议等方式，或者采用虚假宣传、

夸大预期收益和商业贿赂等不正当手段推广集合计划。

管理人及推广机构不得通过广播、电视、报刊及其他公共媒体向不特定对象推广本集合计划。

3、募集期限：初始募集期自资产管理计划份额发售之日起不超过 60 个自然日，具体以推广机构官网公布为准。

4、推广机构：东亚前海证券有限责任公司及管理人委托的其他符合相应资格条件的代销机构。

（二）资产管理计划的认购事项

1、认购费用

本计划认购费率为【1%】。

2、认购申请的确认

委托人以推广期参与的方式购买集合计划份额，同意在推广期提出认购申请的同时支付认购资金。

在集合计划推广期参与集合计划，每份额的价格均为每份额面值，即人民币壹元。采用金额认购的方式，即以认购金额申请。

（1）委托人按推广机构的具体安排，在规定的交易时间段内办理；

（2）委托人必须到推广机构或以管理人认可的方式认购集合计划，认购申请经管理人确认有效后，构成本合同的有效组成部分。委托人应开设推广机构认可的交易账户，并在交易账户备足认购/申购的货币资金；若交易账户内参与资金不足，推广机构不受理该笔认购申请；

（3）委托人认购申请确认成功后，其认购申请和认购资金不得撤销；

（4）推广机构受理认购申请并不表示对该申请是否成功的确认。委托人推广期认购的，可于集合计划成立 2 个工作日后通过办理认购的推广机构查询认购确认情况。委托人认可管理人对其认购参与有效性的确认，除经管理人同意外，不再要求管理人提供任何有效性确认的资料。

（5）对于认购申请超 200 人等其他认购申请未确认成功情况的处理原则：按时间优先原则进行认购申请确认。对于认购失败的，管理人会在认购申请日当天做认购失败处理，委托人认购款项将于 2 个交易日内原路退还至其认购资产管理计划时使用的结算账户或者同名账户。

3、认购份额的计算方式

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+推广期利息）/ 计划单位发售面值

委托人认购份额以四舍五入的方法保留小数点后两位，小数点后第三位四舍五入，由此产生的差额部分计入集合计划资产的损益。

认购费用的用途、支付对象、方式、实际结算金额由本管理人确定，管理人及代销机构可以在不违背法律法规规定及本合同约定的情形下，对认购费率实行一定的优惠，费率优惠情况届时以管理人或代销机构发布的相关公告或通知为准。

4、初始认购资金的管理及利息处理方式

委托人的有效认购资金（不含认购费）在推广期内应存入集合计划份额登记机构指定的专门账户，在集合计划成立前，任何机构和个人不得动用，委托人的有效认购资金（不含认购费）在初始销售期产生的利息将折算为计划份额归委托人所有，其中利息转份额的具体数额以登记机构的记录为准。

（三）资产管理计划的最低认购金额、支付方式

1、最低认购金额

首次参与的最低金额（不含认购费）为人民币 40 万元，追加参与的最低金额（不含认购费）为人民币 1 万元，红利再投资除外。最低认购金额不包含认购费。

2、支付方式：以货币资金形式。

（四）募集结算专用账户（简称“募集专户”）

本计划通过管理人和代销机构进行销售。本计划的募集专户可通过管理人营业网点等方式查询具体信息。本集合计划代销机构的募集结算专用账户由管理人委托的代销机构自行开立并自行聘请监督机构对其进行监督，各代销机构的募集结算专用账户的具体信息由代销机构向委托人披露，具体以代销机构规定为准。

第七章 资产管理计划的成立与备案

（一）集合计划成立的条件和日期

1、初始募集规模不低于【1000】万元，委托人人数不少 2 人（含管理人），

且不超过 200 人，募集过程符合法律、行政法规和中国证监会的规定。

2、本资产管理计划的募集金额缴足之日起 10 个工作日内，由管理人公告资产管理计划成立。集合计划成立时间以管理人正式发出的成立公告为准。

3、本计划成立前，任何机构和个人不得动用委托人参与资金。

（二）集合计划设立失败

集合计划推广期结束，本计划未达到成立条件的，管理人应当承担下述责任：

1、以固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用；

2、在推广期届满后三十日内返还委托人已缴纳的款项，并加计银行同期活期存款利息。

（三）集合计划的备案

管理人应在资产管理计划成立之日起 5 个工作日内，向中国证券投资基金业协会履行备案手续。

本计划在成立后、完成备案前，可以以现金管理为目的，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。

管理人开展投资活动前，应及时向托管人发送成立公告。备案完成后，应及时向托管人发送备案通过的材料。

资产管理计划无法完成备案的，管理人应当及时告知委托人，并按照合同约定履行终止清算程序。

第八章 资产管理计划的参与、退出与转让

（一）参与和退出场所

本集合计划参与、退出将通过推广机构下属指定营业网点或推广机构指定网络系统办理集合计划的参与、退出。

本集合计划的推广期和存续期内，委托人可以在管理人公告的参与开放日内办理参与本集合计划的业务（管理人通告暂停参与时除外），在本集合计划退出开放日办理退出事项，具体业务办理时间以推广机构公布时间为准。

（二）参与和退出的开放日和时间

本计划开放期以外的存续期间均为封闭期。在封闭期间，原则上不办理退出

业务，若出现法律法规或中国证监会、证券投资基金业协会的相关规定变更的情况或资产管理合同发生变更的情况，管理人将视情况设置临时退出开放期，具体开放时间及相关情况由管理人提前在指定网站上公告。

本计划开放日为本计划成立之日次月起每月的20日、21日开放，若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法开放的，则顺延至下一个交易日开放，届时具体以管理人公告为准。开放期内委托人可办理参与和退出业务，但**份额持有人参与本计划自参与（包括推广期参与、存续期参与）申请确认成功之日起【3个月（不含）】内不得退出。**

（三）临时开放期的触发条件、程序及披露等相关安排

在合同变更、本计划展期以及法律法规、监管规则规定可设置临时开放期的其他情形下，管理人有权设置临时开放期，临时开放期仅开放退出，不开放参与。临时开放期的具体安排以管理人在指定网站上公告为准。

若在临时开放期发生大额或巨额退出，按照本章第（九）、（十）项条款处理。

（四）参与和退出的方式、价格、程序及确认

1、参与的方式、价格、程序及确认

(1)参与方式

委托人以存续期参与的方式购买集合计划份额，同意在提出存续期参与申请的同时支付参与金额。

(2）参与价格与参与原则

参与价格：每份额的价格均为参与当日的产品单位净值。

参与原则：

1）在集合计划存续期内参与集合计划，每份额的价格均为参与当日的产品单位净值；

2）采用金额参与的方式，即以参与金额申请。

(3)参与的程序及确认

1）委托人按推广机构的具体安排，在规定的交易时间段内办理；

2）委托人必须到推广机构或以管理人认可的方式参与集合计划，参与申请经管理人确认有效后，构成《集合资产管理合同》的有效组成部分。委托人应开

设推广机构认可的交易账户，并在交易账户备足申购的货币资金；若交易账户内参与资金不足，推广机构不受理该笔参与申请；

3）委托人参与申请确认成功后，其参与申请和参与资金不得撤销；

4）存续期参与的，可于开放日结束 2 个工作日后通过办理参与的推广机构查询参与确认情况。委托人认可管理人对其认购参与有效性的确认，除经管理人同意外，不再要求管理人提供任何有效性确认的资料。

2、退出的方式、价格、程序及确认

（1）退出的方式与原则

委托人以存续期退出的方式退出集合计划份额，同意在提出存续期退出申请的同时明确退出的份额。

（2）退出价格与退出原则

退出价格：为退出申请日（T 日）集合计划的产品单位净值。

退出原则：

1）“未知价”原则，即退出集合计划的价格以退出申请日（T 日）集合计划产品单位净值为基准进行计算（具体见“退出金额的计算方式”中的退出价格计算）；

2）采用份额退出的方式，即退出以份额申请；

3）“先进先出”原则，即按照委托人份额参与的先后次序进行顺序退出的方式确定退出份额。

（3）退出的程序及确认

1）退出申请的提出

份额委托人需提出退出申请，管理人根据委托人的退出申请对委托人份额办理退出事宜。

2）退出申请的确认

管理人在退出申请受理日的下一个工作日对该交易的有效性进行确认。

3）退出款项划付

委托人的退出申请确认后，退出款项将在 T+2 日内从托管账户划出。如集合计划出现暂停估值的情形时，管理人与托管人协商后，可以将划拨日期相应顺延。由于交易所或交易市场数据传输延迟、通讯系统故障、银行数据交换系统故障或

其它非管理人及托管人所能控制的因素影响业务处理流程，则退出款顺延至管理人及托管人无法控制的因素消除后从托管账户划出。

（五）参与和退出的金额限制

1、参与的金额限制

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，委托人应符合合格投资者标准，且参与金额应满足资产管理计划最低参与金额限制（不含参与费用），已持有资产管理计划份额的委托人在资产管理计划存续期开放日追加购买资产管理计划份额的除外。

参与本集合计划的最低金额（不含参与费）为人民币 40 万元，追加（包括存续期）参与的最低金额（不含参与费）为人民币 1 万元，红利再投资除外。

2、退出的金额限制与次数

每次退出的最低份额为 1 万份，委托人可将其部分或全部集合计划份额退出。委托人可以选择部分退出资产管理计划份额，但在退出后持有的资产净值不得低于监管要求的最低参与金额限制。委托人部分退出资产管理计划的，其退出后持有的资产管理计划份额净值应当不低于规定的合格投资者最低参与金额。委托人持有的资产管理计划份额净值低于本合同规定的首次参与最低投资金额时，需要退出资产管理计划的，应当一次性全部退出。委托人部分退出后持有的资产净值不得低于 40 万元。若委托人部分退出后当日剩余资产净值低于 40 万元的，剩余份额将被强制赎回退出。

本集合计划不设退出次数限制。

（六）参与和退出的费用

参与费率：1%。

退出费率：0%。

（七）参与份额的计算方法、退出金额的计算方式

1、参与份额的计算方法

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 / 参与申请日当日计划单位净值

委托人参与份额以四舍五入的方法保留小数点后两位，由此产生的差额部分

计入集合计划资产的损益。

参与费用的用途、支付对象、方式、实际结算金额由本管理人确定，管理人及代销机构可以在不违背法律法规规定及本合同约定的情形下，对参与费率实行一定的优惠，费率优惠情况届时以管理人或代销机构发布的相关公告或通知为准。

2、退出金额的计算方法

本集合计划退出时按份额申请退出，以退出申请日（T 日）计划单位净值作为计价基准计算退出总额，按扣除退出费后的实际金额支付。

退出费和退出金额的计算公式如下：

退出总额＝T 日计划单位净值×退出份额

退出费＝（退出总额－业绩报酬）×退出费率

退出金额＝退出总额－业绩报酬－退出费

退出金额保留到小数点后四位四舍五入计算，由此产生的差额部分计入集合计划资产的损益。

（八）参与资金的利息处理方式

存续期间参与金额在开放日无利息。

（九）巨额退出或连续巨额退出

1、巨额退出的认定和处理方式

（1）巨额退出的认定

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

（2）巨额退出的顺序、价格确定和款项支付

发生巨额退出时，管理人可以根据本集合计划当时的资产组合状况决定全额退出、部分顺延退出。

全额退出：当管理人认为有条件支付委托人的退出申请时，按正常退出程序办理。

部分顺延退出：当管理人认为支付委托人的退出申请可能会对计划资产净值造成较大波动时，管理人在当日接受净退出比例不低于集合计划总份额 10%的前提下，对其余退出申请予以延期办理。对于当日的退出申请，将按单个账户退出申请量占退出申请总量的比例，确定当日受理的退出份额；未能受理的退出部分，

委托人可选择延期办理或撤销退出申请。对于选择延期办理的退出申请，管理人将在下一个工作日内办理，并以该工作日的计划单位净值为准计算退出金额，依此类推，直至全部办理完毕为止，但不得超过正常支付时间 20 个工作日，转入下一个工作日的退出申请不享有优先权。

（3）告知客户的方式

发生巨额退出并部分顺延退出时，管理人应在 3 个工作日内在管理人指定网站公告，并说明有关处理方法。

2、连续巨额退出的认定和处理方式

（1）连续巨额退出的认定

如果本集合计划连续 2 个开放日发生巨额退出，即认为发生了连续巨额退出。

（2）连续巨额退出的顺序、价格确定和款项支付

本集合计划发生连续巨额退出，管理人可按说明书及资产管理合同载明的规定，暂停接受退出申请，但暂停期限不得超过 20 个工作日；已经接受的退出申请可以延缓支付退出款项，但不得超过正常支付时间 20 个工作日，并在管理人指定网站上进行公告。

（3）告知客户的方式

发生连续巨额退出并暂停接受退出申请时，或发生连续巨额退出并延缓支付退出款项时，管理人应在 3 个工作日内在管理人指定网站公告，并说明有关处理方法。

（十）单个委托人大额退出

1、单个委托人大额退出的认定

大额退出是指，单个委托人在本集合计划单个退出开放日一次退出份额达到或超过 500 万份（含）的情形。

2、单个委托人大额退出的申请和处理方式

发生大额退出的，委托人需在退出日的前 3 个工作日提出预约，否则管理人有权拒绝其退出申请。若大额退出构成巨额退出的，按巨额退出程序办理。

（十一）拒绝或暂停参与、暂停退出、延期支付及延期退出的情形及处理

发生下列情形时，管理人可以拒绝或暂停接受委托人的参与申请、暂停或延期接受委托人的退出申请、进行延期支付：

（1）不可抗力的原因导致集合计划无法正常运作；

（2）证券或期货交易场所交易时间非正常停市，导致当日集合计划资产净值无法计算；

（3）管理人认为接受某笔或某些退出申请可能会影响或损害现有委托人利益时；

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

（5）资产管理计划的人数达到法律法规规定上限；

（6）法律、行政法规和中国证监会认定的其他情形或其他在说明书、资产管理合同中已载明且中国证监会无异议的特殊情形。

拒绝或暂停参与、暂停退出、延期支付及延期退出的方式包括：

管理人将在当日立即公告。已接受的退出申请，若管理人有足额支付能力，则管理人将足额支付；如暂时不能足额支付的，将按每个退出申请人已被接受的退出申请量占已接受退出申请总量的比例分配给退出申请人，其余部分在后续开放日予以兑付。

暂停集合计划的参与、退出，管理人应及时披露。在暂停参与、退出的情况消除时，管理人应及时恢复参与、退出业务的办理。

发生本合同未予载明的事项，但集合计划管理人有正当理由认为需要暂停接受集合计划退出申请的，应向委托人披露。

委托人认可上述关于退出的原则及处理方法，接受管理人依据法律法规及本合同的约定所做出的延期支付及延期退出或暂停参与、退出的决定。

（十二）集合计划份额的转让

集合计划存续期间，在技术条件允许的情况下，管理人有权决定本集合计划份额在中国证监会认可的交易平台开展转让交易，份额转让应遵守交易场所相关规定及要求，并按规定办理份额变更登记手续。受让方应符合合格投资者资格，首次参与集合计划，应先与管理人、托管人签订集合资产管理合同。转让后，委托人持有集合计划份额净值不得低于本合同约定的最低投资金额，持有集合计划份额的合格投资者合计不得超过 200 人。份额转让的处理方式以管理人公告为准。

（十三）集合计划份额的非交易过户

本合同所称集合计划份额非交易过户是指不采用参与、退出等交易方式，将一定数量的集合计划份额按照一定的规则从某一委托人集合计划账户转移到另一委托人集合计划账户的行为。集合计划注册登记机构只受理因继承、捐赠、司法强制执行以及经注册登记机构认可的其他情况下的非交易过户。对于符合条件的非交易过户申请按登记结算机构的有关规定办理。

集合计划登记结算机构只受理国家有权机关依法要求的集合计划份额冻结与解冻事项。当集合计划份额处于冻结状态时，集合计划注册与登记机构或其他相关机构有权拒绝集合计划份额的退出申请、非交易过户。

（十四）管理人应监管机构的要求定期将资产管理计划委托人变更情况报送证券投资基金业协会。

（十五）管理人自有资金参与集合计划

管理人自有资金可以参与本集合计划。推广期和存续期，管理人以自有资金参与本集合计划的，具体按照《管理办法》、《运作规定》和《集合资产管理合同》以及相关法律法规的规定执行。

1、自有资金参与的条件

在推广期内，本计划托管人和参与本计划的全体投资者在此授权同意管理人在本计划成立时以自有资金参与本计划。

在存续期内，管理人以自有资金参与本集合计划的，应当按照法律法规相关规定及公司制度规定，提前 5 个工作日告知全体委托人及托管人，并取得其同意。管理人有权视情况采取以下任一方式获取委托人及托管人同意。

方式一：“提前公告”方式。管理人以【电子邮件】形式告知托管人，以【公告】形式告知委托人。托管人如不同意，应在指定时间内以【电子邮件】形式回复管理人，未在指定时间内回复不同意的，即视为同意。委托人如不同意，可根据管理人公告在指定开放期申请退出本集合计划，委托人未申请退出的，即视为同意。

方式二：“提前告知+回复同意”方式。管理人以【电子邮件】形式告知托管人，以【电子邮件】或【短信】形式告知委托人。托管人如不同意，应在指定时间内以【电子邮件】形式回复管理人，未在指定时间内回复不同意的，即视为

同意。委托人通过【本合同（含电子签约方式）预留电子邮箱】或【本合同（含电子签约方式）预留手机号发送短信】回复同意后即取得委托人同意；委托人如不同意，可根据管理人在【电子邮件】或【短信】中的通知在指定开放期申请退出本集合计划；委托人回复同意、未在指定时间内回复意见或者回复不同意但逾期未申请退出的，均视为委托人同意。

2、自有资金的参与方式

管理人以自有资金参与本集合计划，将在本集合计划推广机构参与。

3、自有资金参与的金额和比例

自有资金在推广期或者存续期内的开放期参与本集合计划时，参与时的份额不超过推广期或者当前开放期内本集合计划总份额（含管理人已参与的份额）的15%。具体参与份额以管理人公告为准。

管理人及其子公司以自有资金参与其自身或其子公司管理的单个集合资产管理计划的份额合计不得超过该资产管理计划总份额的50%。中国证监会对证券期货经营机构自有资金投资比例另有规定的，从其规定。因集合资产管理计划规模变动等客观因素导致前述比例被动超标的，证券期货经营机构应当依照中国证监会规定及资产管理合同的约定及时调整达标。

4、自有资金责任承担方式

管理人投入自有资金参与集合计划份额不对委托人负担任何补偿责任。管理人自有资金所持的集合资产管理计划份额，应当与委托人所持的同类份额享有同等权益、承担同等风险。

5、自有资金退出的条件

除非法律法规、中国证监会或证券投资基金业协会另有规定，在同时满足以下条件时，管理人自有资金可以退出本集合计划：

（1）管理人投入的自有资金参与份额持有期限满6个月后；

（2）管理人自有资金退出本集合计划时应当提前5个工作日告知全体委托人及托管人，并取得其同意。管理人有权视情况采取以下任一方式获取委托人及托管人同意。

方式一：“提前公告”方式。管理人以【电子邮件】形式告知托管人，以【公告】形式告知委托人。托管人如不同意，应在指定时间内以【电子邮件】形式回

复管理人，未在指定时间内回复不同意的，即视为同意。委托人如不同意，可根据管理人公告在指定开放期申请退出本集合计划，委托人未申请退出的，即视为同意。

方式二：“提前告知+回复同意”方式。管理人以【电子邮件】形式告知托管人，以【电子邮件】或【短信】形式告知委托人。托管人如不同意，应在指定时间内以【电子邮件】形式回复管理人，未在指定时间内回复不同意的，即视为同意。委托人通过【本合同（含电子签约方式）预留电子邮箱】或【本合同（含电子签约方式）预留手机号发送短信】回复同意后即取得委托人同意；委托人如不同意，可根据管理人在【电子邮件】或【短信】中的通知在指定开放期申请退出本集合计划；委托人回复同意、未在指定时间内回复意见或者回复不同意但逾期未申请退出的，均视为委托人同意。

6、特定条件下的参与及退出

在发生以下特殊情形时，管理人自有资金参与、退出可以不受上述条件限制，但管理人应当事后及时告知委托人和托管人：

A、因规模变动等客观因素导致管理人自有资金参与份额比例被动超限（即超过集合计划总份额 15%）。

B、法律法规、中国证监会及证券投资基金业协会规定的其他情况。

本集合计划终止时，管理人参与的自有资金（即自有资金份额资产）按本合同“资产管理合同的变更、终止与财产清算”章节处理。

7、信息披露：管理人以自有资金参与或退出本集合计划，应当按照法律法规相关规定及时进行信息披露。

（十六）投资者信息披露

管理人应按照监管规定定期将本计划投资者变更情况报送证券投资基金业协会。

（十七）其他

本集合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。

第九章 份额持有人大会及日常机构

委托人、管理人、托管人在此一致同意，本计划不设置份额持有人大会及日常机构。

第十章 资产管理计划份额的登记

本集合计划的份额登记机构为东亚前海证券有限责任公司。

（一）份额登记机构应履行如下注册登记职责

1、严格按照法律法规和本合同规定的条件办理本计划份额的登记业务；

2、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，其保存期限自集合资产管理计划账户销户之日起不得少于20年；

3、对份额持有人的账户信息负有保密义务，但法律法规、有权机关及中国证监会另有规定的和本合同约定的其他情形除外；

4、法律法规及中国证监会规定的和本合同约定的其他义务。

（二）份额登记机构应当按照中国证券投资基金业协会的规定办理份额登记数据的备份。全体资产管理计划份额持有人同意管理人、份额登记机构或其他份额登记义务人将集合资产管理计划委托人名称、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。

第十一章 资产管理计划的投资

（一）投资目标

本计划以大类资产配置策略为主，通过审慎、适时、灵活地运用金融衍生工具制定不同的策略组合，进行系统性风险的对冲操作以降低投资组合的波动性。同时，在深入研究的基础上构建核心投资组合，力争获取中长期稳定的收益。

上述投资目标不构成管理人保证委托人出资资产本金不受损失或取得投资收益的承诺。

（二）投资范围及比例

1、投资范围

（1）固定收益类资产包括：现金、定期存款、协议存款、同业存款、同业

存单、结构性存款、通知存款、大额可转让存单、债券回购、国债、政策性金融债券、央行票据、金融债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、非公开定向债务融资工具、资产支持证券、资产支持票据、项目收益票据、次级债（含二级资本债）、永续债、可转换债券、可交换债券等在银行间市场、证券交易所市场等经国务院同意设立的交易市场交易标准化债权资产以及债券型基金、债券逆回购；

固定收益类资产中的现金类资产包括货币市场基金、银行活期存款、现金、到期日在1年内（含1年）的国债、到期日在1年内（含1年）的央行票据、到期日在1年内（含1年）的政府债券。

（2）权益类资产：国内依法发行上市的股票（包括新股申购所得股票、参与定向增发所得股票、创业板股票、科创板股票、北交所股票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、股票型基金、混合型基金等。

（3）期货和衍生品类：股指期货、国债期货、商品期货等金融衍生品。

本计划可参与债券正回购。本计划不投资于私募基金。

本计划接受其他资产管理产品参与的，管理人应履行主动管理职责，不得进行转委托，不得再投资除公募基金以外的其他资产管理产品。

对于参与股指期货、国债期货投资的特别说明：本计划参与股指期货、国债期货投资的主要目的是进行资产配置和对冲风险。管理人根据市场情况设定期货账户风险度指标（期货投资的风险度=期货合约持仓占用保证金/当前期货账户权益*100%）监控，并于本计划投资运作管理之前，在交易系统中设置风控阈值。在任一时点，当期货账户资金风险度达到或超过管理人风控标准时，管理人应追加保证金直至资金风险度降到风控标准以下，若无法在当日收盘前补足保证金则应强制减仓直至资金风险度降到风控标准以下。如因期货账户内保证金不足、又未能在规定的时间内补足，期货头寸将面临强行平仓的风险，可能导致本计划资产遭受损失，该损失由本计划资产承担。

对于债券回购的特别说明：本计划参与债券正回购、债券逆回购，债券回购为提升整体投资组合收益提供了可能，其主要风险包括信用风险、投资风险及波动性加大的风险。其中，信用风险指回购交易中交易对手在回购到期时，不能偿还全部或部分证券或价款，造成资产净值损失的风险；投资风险是指在进行

回购操作时，回购利率大于债券投资收益而导致的风险以及由于回购操作导致投资总量放大，致使整个投资组合风险放大的风险；而波动性加大的风险是指在进行回购操作时，在对投资组合收益进行放大的同时，也对投资组合的波动性（标准差）进行了放大，即投资组合的风险将会加大。回购比例越高，风险暴露程度也就越高，对资产净值造成损失的可能性也就越大。

若法律法规或监管机构允许计划投资其他投资品种的，管理人在履行合同变更程序后，可以将其纳入本计划的投资范围。

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，并履行合同变更程序。

2、投资比例、投资限制

投资比例：

1）本计划投资于固定收益类资产的比例小于资产管理计划总资产 80%；

2）本计划投资于权益类资产（不含融资融券合约负债）的比例小于资产管理计划总资产 80%；

3）本计划投资于期货和衍生品的持仓合约价值的比例小于资产管理计划总资产 80%或本计划期货和衍生品账户权益比例小于资产管理计划总资产 20%。

以上投资比例符合混合类资产管理计划的监管规定。

资产管理计划投资于其他资产管理产品的，大类资产配置比例、总资产占净资产比例应当按照穿透原则合并计算；资产管理计划投资于其他私募资产管理产品的，应当按照穿透原则合并计算投资同一资产的比例以及投资同一或者同类资产的金额。

特别说明：本集合计划终止或提前终止进行资产变现时，管理人可不受投资比例限制的指标约束，管理人在此情形下的超限行为不认为管理人违约。

投资限制：

1）本集合计划的总资产不得超过本集合计划净资产的 200%；资产管理计划的嵌套层数不得超过两层。

2）本集合计划投资于同一资产的资金，不得超过集合计划资产净值的 25%；管理人管理的全部集合资产管理计划投资于同一资产的资金，不得超过该资产的 25%。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）本计划开放退出期内，其资产组合中 7 个工作日可变现资产的价值，不低于本计划资产净值的 10%。

4）任一交易日日终，持有的一家上市公司的股票数量不得超过该只股票流通股的 10%。

5）任一交易日日终，持有的一家上市公司的股票数量不得超过该只股票总股本的 5%。

6）任一交易日日终，持有的单一债券（国债除外）市值占资产净值的比例不超过 10%。

7）任一交易日日终，持有的单一股票/存托凭证市值占资产净值的比例不超过 10%。

8）本集合计划参与股票、债券、可转换公司债券、可交换公司债券等证券发行申购时，本集合计划所申报的金额不得超过该资产管理计划的总资产，本集合计划所申报的数量不得超过拟发行公司本次发行的总量。

9）本集合计划投资的企业债、公司债、非公开定向债务融资工具、中期票据、资产支持证券、资产支持票据的债项评级为 AA（含）以上，若无债项评级，则参考主体评级或担保人评级（孰高），短期融资券的债项评级为 A-1 级（含）以上，若无债项评级，则参考主体评级或担保人评级（孰高）；

10）债券正回购资金余额或逆回购资金余额均不得超过本计划上一日净资产的 100%。

11）不得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），包括但不限于以下情形：投资项目被列入国家发展和改革委员会发布的淘汰类产业目录；投资项目违反国家环境保护政策要求；通过穿透核查，资产管理计划最终投向上述投资项目。

12）本集合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本计划净资产 50%的，本集合计划的总资产不得超过其净资产的 120%。本集合计划投资于国债、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。

13）本计划投资资产支持证券、资产支持票据的，其挂牌场所为证券交易所

或银行间市场，仅限于投资资产支持证券、资产支持票据的优先级，且拟投资的资产支持证券基础资产不包含资产管理产品、信托计划、私募基金及其收/受益权等具有资产管理产品性质的资产，但包含仅作为特殊目的载体（SPV）存在的情况，并实行穿透式监控，严格遵守前述规定进行投资管理。

14）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（若有）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、公开募集证券投资基金，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。

15）法律法规及中国证监会规定的其他限制。

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

（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，管理人应当及时向中国证监会相关派出机构报告。

其中，因证券期货市场波动、资产管理计划规模变动等证券期货经营机构之外的原因致使股指期货、国债期货交易比例不符合规定的，证券期货经营机构应当在10个交易日内调整完毕，同时在该情形发生之日起2个工作日内向其住所地证监局报告。

（四）风险收益特征

本计划为混合类产品，本计划产品风险评级为R4，适合风险承受能力等级为C4及以上的合格投资者。但法律法规及推广机构另有规定的除外。

如本集合计划通过代销渠道代销的，产品风险等级及适当性匹配意见以代销机构结果为准，代销机构所依据的产品风险等级评价结果不得低于管理人作出的风险等级评价结果。

（五）业绩比较基准

本计划无业绩比较基准。

（六）投资策略

本计划主要投资策略为宏观策略，以宏观策略研究体系和量化择时模型所给出的配置建议为基础，通过对宏观经济周期、货币供应量、市场估值水平、宏观政策导向以及市场氛围等因素的综合研究，形成对大类资产收益率在不同市场周期的预测和判断，从而确定股票、存托凭证、货币市场工具、商品期货和其他金融工具的投资比例，力争从相对分散的大类资产配置中获得收益。

1、集合计划的决策依据

集合计划以国家有关法律、法规和本合同的有关规定为决策依据，并以维护集合计划委托人利益作为最高准则。具体决策依据包括：

1）《管理办法》、《运作规定》等监管规定和《集合资产管理合同》、《说明书》等有关法律文件；

2）其他：宏观经济发展态势、微观经济运行环境和证券市场走势；投资对象收益和风险的配比关系。

2、集合计划的投资程序

资产管理部投资决策程序包括资产配置、行业配置、投资标的选择三个层面。资产管理部投资决策委员会在听取投资研究人员分析报告的基础上，结合自身判断，审议投资经理提交的资产管理计划资产配置报告，确定资产管理计划的资产配置比例，并对资产管理计划资产配置报告的可行性进行详细的分析与论证，最终形成投资决议。资产管理计划的投资决策应于研究报告充分分析讨论之后进行；投资经理根据资产管理部投资决策委员会的投资决议，参考证券买卖名单，筛选出符合标准的个券构建资产管理计划投资组合。当投资项目的资金额超过投资经理的投资权限时，投资经理根据不同情况提交给资产管理部投资决策委员会或公司资产管理决策委员会审议，经批准后执行。

3、投资管理的方法和标准

大类资产配置策略：以宏观策略研究体系和量化择时模型所给出的配置建议为基础，通过对宏观经济周期、货币供应量、市场估值水平、宏观政策导向以及市场氛围等因素的综合研究，形成对大类资产收益率在不同市场周期的预测和判断，从而确定股票、存托凭证、货币市场工具、商品期货和其他金融工具的投资比例，力争从相对分散的大类资产配置中获得收益。

固定收益类资产投资管理：由研究员进行宏观经济研究、债券市场研究支持。宏观经济研究主要从宏观经济分析、货币政策分析和财政政策分析等对未来利率变化趋势进行预测；债券市场研究主要从债券市场交易情况分析、债券市场收益率曲线分析寻找投资机会，选择最佳的交易策略。资管固定收益部结合宏观经济、债券市场两方面研究结果确定固定收益产品投资策略。投资经理根据投资方案做出投资决定，通过债券投资交易系统向交易部发出投资交易指令。交易下单和交易执行实行严格分离。所管理的资产管理计划投资的固定收益债券必须来自于债券备选池。

股票类资产投资管理：投资经理在授权范围内，可以自主投资，并遵守资产管理计划合同规定。超越投资权限的投资，投资经理应履行相关审批手续。投资经理应主动控制投资过程中的风险，包括流动性风险、集中度风险等。投资经理应在研究员协助下跟踪所投资股票的基本面变化。

期货类资产投资管理：投资经理根据产品投资策略及资产配置方案，结合产品合同约定，在授权范围内，确定择时进场策略、合约选择原则、展期策略及平仓策略，制定具体的期货投资方案；实时对期货投资管理方案效果进行跟踪、评估并及时进行适当调整；定期及不定期向资产管理部投资决策委员会汇报期货投资方案执行情况。

其他类资产：投资经理在授权范围内，遵守资产管理计划合同约定，符合公司内部制度以及监管要求，可以自主投资。

4、投资策略的变更

管理人在履行合同变更程序后，本计划投资策略可变更。

（七） 投资禁止

本集合计划的投资禁止行为包括：

1、直接投资商业银行信贷资产；

2、违规为地方政府及其部门提供融资，要求或者接受地方政府及其部门违规提供担保；

3、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；

4、以获取佣金或者其他不当利益为目的，使用集合计划资产进行不必要的交易；

5、内幕交易、操纵市场或者其他不当、违法的证券期货业务活动；

6、由委托人或其指定第三方自行负责尽职调查或者投资运作；

7、由委托人或其指定第三方下达投资指令或者提供具体投资标的等实质性投资建议；

8、根据委托人或其指定第三方的意见行使资产管理计划所持证券的权利；

9、法律、行政法规和中国证监会禁止的其他行为。

（八）建仓期

本计划建仓期为6个月。

管理人将在集合计划成立之日起6个月内，使集合计划的投资组合比例符合上述约定。

建仓期的投资活动，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。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、行政法规、中国证监会规定和本合同约定的投向和比例。

（九）投资的资产组合的流动性与参与、退出安排相匹配。

管理人将对本计划的流动性进行安排，本计划在开放退出期间将保持适当的现金、活期存款或其他高流动性短期金融工具。开放退出期内，本计划资产组合中7个工作日可变现资产的价值不低于本计划资产净值的10%。

第十二章 服务机构与投资顾问

（一）本集合计划未委托其他相关服务机构提供估值服务，管理人自行提供份额登记、估值与核算、信息技术系统支持等。

（二）投资顾问

1、投资顾问选择标准

本集合计划管理人按以下要求选聘投资顾问：

管理人可以聘请符合中国证监会规定条件并接受国务院金融监督管理机构监管的机构为资产管理计划提供投资顾问服务，投资顾问应当为依法可以从事资产管理业务的证券期货经营机构、商业银行资产管理机构、保险资产管理机构以

及中国证监会认可的其他金融机构，或者同时符合以下条件的私募证券投资基金管理人：

（一）在中国证券投资基金业协会登记满 1 年，无重大违法违规记录的会员；

（二）具备 3 年以上连续可追溯证券、期货投资管理业绩且无不良从业记录的投资管理人员不少于 3 人；

（三）中国证监会规定的其他条件。

2、投资顾问的基本情况及资质

基于本集合计划的投资策略，本集合计划聘请上海泓湖私募基金管理有限公司（以下简称“泓湖基金”）作为投资顾问，并签订了《东亚前海证券有限责任公司聘请上海泓湖私募基金管理有限公司担任东亚前海证券泓海 1 号集合资产管理计划之投资顾问服务协议》（以下简称“《投资顾问协议》”）。

（1）投资顾问的基本情况

机构名称：上海泓湖私募基金管理有限公司

成立时间：2010 年 3 月 4 日

法定代表人：梁文涛

注册资本：2000.0000 万元

住所：上海市浦东新区海徐路 2577 号 5 幢 127 室

泓湖基金作为本集合计划的投资顾问，与管理人和托管人均不存在关联关系。

（2）投资顾问资质

泓湖基金于 2014 年 4 月 1 日在中国证券投资基金业协会登记备案，登记编号为 P1000395，为协会观察会员，会员编号为 GC1900000004，入会时间为 2013 年 6 月 28 日。根据泓湖基金披露的信息及公开渠道信息查询，其具备 3 年以上连续可追溯证券、期货投资管理业绩且无不良从业记录的投资管理人员人数不少于 3 人。

3、投资顾问的权利和义务

（1）投资顾问有权按照《投资顾问协议》约定的标准、方式和时间，取得相应的投资顾问费。

（2）若投资顾问对管理人综合评估后的投资顾问费有异议，且经双方协商无法达成一致，则投资顾问可单方提前终止《投资顾问协议》。

（3）在合法合规的前提下，投资顾问有权要求管理人及时、全面、准确地向其提供投资顾问服务所必需的文件和信息资料，包括有关的本产品项下的受托资产的法律文件、投资指引、投资组合、投资策略、投资范围、投资比例、投资限制及禁止行为以及受托资产的相关信息资料（包括实际投资交易清单、投资组合清单、持仓、估值、申赎状况等信息），以便其提供投资顾问服务。

（4）投资顾问有义务按照《投资顾问协议》约定、有关法律法规和管理人向其提供的本计划项下的受托资产的文件和信息资料，按照诚实信用、勤勉尽责的原则，向管理人提供投资顾问服务，为本计划提供投资建议。

（5）投资顾问有权给管理人以外的其他投资者提供投资顾问服务。

（6）投资顾问应配备合格的具备相应资质的专业人员负责投资顾问工作。应指定授权投资顾问负责按照资产管理合同及《投资顾问协议》约定的方式向管理人及时、准确传送投资建议、投资研究、投资策略等材料，确保信息及材料的及时送达。

（7）投资顾问有义务于本合同生效前向管理人提供其关联方、所管理的产品、提供投资顾问服务的资产管理产品/机构名单，且名单内容发生变动时，及时更新并提供至管理人。若投资顾问没有及时提供关联方信息，导致管理人无法及时对关联方证券进行监督，从而导致本集合计划与上述相关方发生交易情形的，则管理人有权单方面终止投资顾问的相关权限，并有权单方面提前终止《投资顾问协议》。投资顾问不得提供以下投资建议：利用本集合计划与上述相关方发生交易。

（8）投资顾问应建立健全业务隔离等内控制度，确保公平对待各类客户，防范利益输送行为。投资顾问应公平对待不同资产，严禁直接或者通过第三方的交易安排在不同资产之间进行利益输送。

（9）投资顾问应遵守《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》、《上海证券交易所交易规则》、《上海证券交易所证券异常交易实时监控细则》、《深圳证券交易所交易规则》、《上海证券交易所科创板股票异常交易实时监控细则》、《深圳证券交易所创业板股票异常交易实时监控细则》等相关法律法规、监管规定、资产管理合同和《投资顾问协议》中关于投资范围、投资比例、投资限制、禁止行为、

风险控制等的相关约定和管理人内部风控要求提出投资建议。若因投资顾问投资建议涉及违法违规行为，管理人有权单方面终止投资顾问的相关权限，并有权单方面提前终止《投资顾问协议》。

（10）投资顾问应确保出具的投资建议符合资产管理合同、《投资顾问协议》和法律法规的规定，以及监管的要求，且不得提供任何有损受托财产及其他当事人利益的投资建议，如投资顾问提供了违反前述约定的投资建议，管理人通过电话、电子邮件、通知函等一种或多种方式通知投资顾问后有权单方面提前终止《投资顾问协议》，并不再接收投资顾问的投资顾问服务。。

（11）管理人发现本集合计划涉及异常交易情况且与投资顾问提供的投资建议有关的，管理人有权以通知形式要求投资顾问提供加盖其公章的解释说明文件，投资顾问应当于通知送达之日的 3 个工作日向管理人提供，如监管有特殊时限要求的，提供时限以监管要求为准；投资顾问未按前述约定提供加盖公章的解释说明文件，管理人有权向投资顾问出具《警示函》；投资顾问于《警示函》送达之日的次工作日未向管理人提供加盖公章的解释说明文件，管理人可以提前终止《投资顾问协议》，并解聘投资顾问。

（12）投资顾问有义务及时向管理人报告与本集合计划相关的重大事项。

（13）投资顾问有义务根据有关法律法规、《投资顾问协议》以及本集合计划合同约定，遵循诚实信用原则，勤勉、审慎地向管理人提供投顾服务。

（14）投资顾问有义务根据管理人提供的有关文件和资料，以及本集合计划的投资需求、风险等级，向管理人提供适当的投顾服务。

（15）投资顾问依据本公司或者其他证券公司、证券投资咨询机构的证券研究报告作出投资建议的，应当向管理人说明证券研究报告的发布人、发布日期。

（16）投资顾问有义务向管理人提示投资顾问服务存在的风险，揭示投资风险。

（17）投资顾问若发生解散、撤销、破产或其他不再符合担任本集合计划投资顾问的情况，应及时通过电子邮件、函件等方式及时告知管理人。

（18）投资顾问不得对其服务能力和过往业绩进行虚假、不实、误导性的营销宣传，亦不得以任何方式承诺或保证投资收益。

（19）因投资顾问故意或过失或违反相关协议约定导致资产管理计划委托财

产遭受损失的，投资顾问应承担相应的赔偿责任。

（20）投资顾问应承担保密义务，未经管理人许可，其不得向第三方提供、披露管理人提交其使用的材料与文件，但国家法律法规另有规定、监管机构另有要求及投资顾问审计需要向审计机构提供的除外。

（21）投资顾问及其员工不得直接或间接向对方及其员工输送、收受、索取、谋取不正当利益，包括但不限于以下方式：1）提供或接受礼金、礼品、房产、汽车、有价证券、股权、佣金返还等财物，或者为上述行为提供代持等便利；2）提供或接受旅游、宴请、娱乐健身、工作安排等利益；3）安排显著偏离公允价格的结构化、高收益、保本理财产品等交易；4）直接或者间接提供或接受内幕信息、未公开信息、商业秘密和客户信息，明示或者暗示从事相关交易活动；5）其他存在不正当利益的情形。

（22）法律法规、监管规定以及《投资顾问协议》相关协议规定的其他权利和义务。

4、投资顾问服务的内容和方式

（1）投资顾问服务的内容：

泓湖基金接受管理人聘请担任本集合计划投资顾问，按照《投资顾问协议》约定向管理人提供投顾服务，服务内容包括但不限于如下方面：

1)为管理人指定具有投资经理资格的专业人员，担任授权投资顾问，专门负责为管理人提供投资顾问服务；

2)根据管理人向投资顾问提供的文件和信息资料，包括有关的本产品项下的受托资产的法律文件、投资指引、投资组合、投资策略、投资范围、投资比例、投资限制及禁止行为、拟投资资产的性质及规模，定期或者不定期向管理人提供本产品涉及证券及证券相关产品的投资建议服务，包括投资的品种选择建议、投资组合建议以及投资规划建议等；

3)根据双方协商定期或不定期为管理人提供一份定制化投资顾问报告，内容可包括但不限于宏观经济分析、市场分析、本计划资金的运用建议、组合的构建建议、资产配置管理建议等内容；

4)应管理人要求以投资策略会、业务培训会等形式提供相应投资顾问服务。

管理人对投资顾问所提供投资顾问服务的内容和方式可提出合理改进意见，

投资顾问应在合法合规前提下及时进行调整，管理人应当对投资顾问的投资建议进行审查，自行决定是否采纳投资建议，承担主动管理职责。

（2）投资顾问服务的方式：

1）投资顾问以《授权投资顾问告知书》方式为管理人指定具有投资经理资格的专门人员担任授权投资顾问，负责为管理人出具投资建议。其更换授权投资顾问，应事先征询管理人意见，并须在更换之日前至少 3 个工作日以书面形式通知管理人。

2）《投资建议书》

A. 由投资顾问向管理人提供《投资建议书》；

B.《投资建议书》须符合相关法律法规、监管要求、本合同以及《投资顾问协议》约定的投资范围、投资限制、投资策略和投资禁止行为，且是可执行的。

5、投资顾问收费标准及支付方式

（1）投资顾问费标准

泓湖基金接受管理人聘请为本集合计划提供投顾服务，有权收取相应的投资顾问费。投资顾问费用由管理人统一收取，不得在集合计划资产中列支，管理人综合评估投资建议采纳情况及业绩贡献后向投资顾问支付。

管理人对投资顾问的综合评估包含如下维度：

A. 投资建议能力

1）本季投资建议采用数量/下达数量；

2）本季度产品收益表现；

3）投顾投资策略的一致性。

B. 服务能力

1）提供研究报告个数；

2）路演次数；

3）投顾沟通效率。

C. 合规性和诚信度

1）评价期内投顾协议履行情况；

2）评价期内投顾是否有违规行为或不良记录。

D. 风险管理

1）风险控制指标履行情况；

2）投资建议评价期内是否发生信用违约。

管理人按上述评估维度对投资顾问提供的投资建议及投资顾问服务进行综合评估，评估频率为每季度。

投资顾问费包括以下两部分：

1）管理人收取的本集合计划管理费的 0-50%；

2）管理人收取的本集合计划超额业绩报酬的 0-50%（如有）。

管理人按季度对投资顾问提供的投资建议及投资顾问服务进行综合评估后，根据评估结果确定投资顾问费的支付标准。

（2）投资顾问费的核算及支付

投资顾问费的核算：

1）来源于管理人收取的管理费的投资顾问费，按管理人的管理费收取频率核算支付，管理人收取管理费后 15 个工作日内核算完成投资顾问应收取的该部分投资顾问费；

2）来源于管理人收取的超额业绩报酬的投资顾问费，按管理人超额业绩报酬收取频率核算支付，管理人收取超额业绩报酬后 15 个工作日内核算完成投资顾问应收取的该部分投资顾问费；

上述投资顾问费由管理人核算完成后，以邮件形式发送至投资顾问授权人邮箱确认。如管理人投资顾问费计算有误的，则投资顾问应于 3 个工作日内书面提出异议并与管理人协商解决，投资顾问未在上述期限内提出异议的，视为认可管理人计算的投资顾问费。

投资顾问费核定后，管理人应于核定日后 15 个工作日内向投资顾问支付。

6 、利益冲突防范机制及要求

《投资顾问协议》明确约定：投资顾问有义务于本合同生效前向管理人提供其关联方、其所管理的产品、其提供投资顾问服务的资产管理产品/机构名单，本合同生效后投资顾问应于每季度定期更新提供，且于名单内容发生变动时，及时更新并提供至管理人。

投资顾问应确保其不会提供本集合计划与上述相关方发生交易的投资建议，确保不会利用本集合计划从事内幕交易、操纵市场等违法违规行为。管理人按照

投资顾问提供的名单进行审查，防范利益冲突。

7、更换、解聘投资顾问的条件和程序

在本集合计划存续，且《投资顾问协议》到期/提前终止（含协商一致及单方解除的情况），管理人认为有必要更换投资顾问的情况下，管理人可在对拟新聘投资顾问履行尽职调查程序，并按照本合同第二十五章（一）第2条约定履行合同变更程序，在充分保障投资者的知情权及退出选择权后，更换投资顾问。

投资顾问发生下列情形，管理人有权单方面决定解聘投资顾问，无需征得投资顾问同意，但应提前3个工作日向投资顾问发送书面提前终止《投资顾问协议》的通知。投资顾问发生或者知悉下列情形时，应当及时书面通知管理人。投资顾问被解聘的，《投资顾问协议》提前终止：

（1）资产管理计划运作过程中，管理人发现投资顾问提供的投资建议等服务违反法律法规及监管规定、资产管理合同及《投资顾问协议》的相关约定，或从事相关限制、禁止行为，或存在损害资产管理计划及其资产委托人、资产管理人、资产托管人权利的情况。

（2）投资顾问负责为本计划提供投资建议的部门或投资团队发生重大变化，经沟通管理人不同意更换，从而管理人认为影响本合同和《投资顾问协议》项下业务资质或义务履行的。

（3）投资顾问减少注册资本、被兼并、分立、解散、依法被撤销、决定申请破产或被申请破产，从而管理人认为影响本合同和《投资顾问协议》项下业务资质或义务履行的。

（4）投资顾问经营状况恶化，管理人认为对于履行投资顾问职责有重大不利影响的。

（5）监管部门认定投资顾问投顾相关业务有重大违法、违规行为，经管理人书面催告投资顾问进行整改后的20个工作日内，投资顾问未完成整改的，或虽已完成整改但管理人认为存在影响本合同和《投资顾问协议》项下义务履行的情形。

（6）投资顾问投顾相关业务受到司法部门、政府部门、相关监管机构或同业协会等机构关于违法违规的刑事处罚或重大行政处罚，经管理人书面催告投资顾问进行整改后的20个工作日内，投资顾问未完成整改的，或虽已完成整改但

管理人认为存在影响本合同和《投资顾问协议》项下义务履行的情形。

（7）根据相关法律法规、监管机构要求或《投资顾问协议》约定的其他情形解聘投资顾问。

管理人依照上述情形解聘投资顾问后，应按照本合同第二十五章（一）第2条约定履行合同变更程序，充分保障投资者的知情权及退出权利。

8、因管理人聘请投资顾问对合同各方当事人权利义务产生影响的情况以及相关纠纷解决机制

（1）因管理人聘请投资顾问对合同各方当事人权利义务产生影响的情况

管理人应当切实履行主动管理职责，依法应当承担的责任不因聘请投资顾问而免除。委托人应充分关注因本集合计划聘请投资顾问相关风险，具体请参见本集合计划风险揭示书。

（2）纠纷解决机制

本集合计划合同约定的纠纷解决机制具体参见本合同第二十七章。《投资顾问协议》约定的纠纷解决机制如下：双方应本着友好合作的原则，尽量通过协商解决；协商不成的，双方一致同意将争议提交深圳国际仲裁院并按其仲裁规则进行仲裁，仲裁地点在深圳。

9、管理人确认投资顾问提供的投资建议仅用于辅助管理人做出投资决策，任何投资决策均须管理人自行做出，禁止投资顾问及其指派的授权代表代管理人作出投资决策，管理人将切实履行主动管理职责，依法应当承担的责任不因聘请投资顾问而免除。

第十三章 分级安排

本集合计划不分级。

第十四章 利益冲突及关联交易

（一）资产管理计划存在的或可能存在利益冲突的情形

1、本计划的资产投资于管理人、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发行的证券或承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易。

2、管理人公司董事、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管理人设立的资产管理计划。

3、本计划因聘请投资顾问可能产生的利益冲突。

（二）资产管理计划存在利益冲突的处理方式、披露方式、披露内容以及披露频率

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

在发生利益冲突时，管理人应当视具体利益冲突情形，根据相关法律法规、监管规则的规定以及本合同约定进行披露。关联交易的披露频率及披露内容具体参见下述规定，发生前述其它利益冲突情形的，按照相关法律法规、监管规则及本合同约定的内容和频率完成信息披露。

（三）资产管理计划关联方交易的处理与信息披露

本计划从事关联交易投资应按照法律法规、监管规则规定和管理人制度规定的方式参与，公平对待各投资组合，防范利益冲突。对于本计划在投资运作过程中从事关联交易的，按照以下方式处理：

1、关联方范围

本计划的关联方主要包括：

（1）本计划管理人及其控股股东、实际控制人或其他关联方；

（2）本计划的托管人及其控股股东、实际控制人或者其他关联方；

（3）本计划管理人管理的其他资产管理产品；

（4）法律法规、监管规则规定的其他被视为关联方的主体。

2、关联交易的认定

关联交易包括但不限于：

（1）本计划投资于管理人、托管人及其关联方发行的证券或者承销期内承销的证券，或其他非标资产；

（2）本计划投资于管理人及其关联方管理的其他资产管理计划或与前述资产管理计划开展交易行为；

（3）本计划与关联方开展证券等交易，互为交易对手的交易行为；

（4）本计划以关联方发行的证券作为质押品的交易行为；

（5）其他关联交易行为。

3、关联交易的分类

根据重要性原则，管理人对关联交易进行分层管理，分为一般关联交易及重大关联交易。

（1）重大关联交易

重大关联交易是指本计划从事的资产投资符合以下条件之一的关联交易：

a. 投资于管理人、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发行的证券或承销期内承销的证券；

b. 与关联方之间发生的单笔投资交易金额超过本资产管理计划总资产的 25%；或者多笔投资同一标的的交易金额在三个月内超过本资产管理计划总资产的 25%；或者投资金额超过人民币 300 万元；

c. 与关联方互为交易对手及以关联方发行的证券作为质押品的交易行为，交易金额及比例参照前述第 b 项规定执行；

d. 法律法规、监管机构对资产管理计划规定的其他重大关联交易。

如果法律法规、监管机构对私募资产管理产品的重大关联交易另有规定的，将按照相关监管规定执行。

对于从事前述重大关联交易，管理人应当根据公司内部审批机制和评估机制，并遵循投资者利益优先的原则，事前采取如下逐笔征求意见方式取得投资者的同意，事后及时告知投资者和托管人，并向中国证监会相关派出机构报告：

逐笔征求意见方式：“提前告知+回复同意”方式。管理人以【电子邮件】或【短信】形式提前告知委托人拟开展的重大关联交易并征询其意见，全体委托人通过【本合同（含电子签约方式）预留电子邮箱】或【本合同（含电子签约方式）预留手机号发送短信】回复同意即取得委托人同意；如有任何委托人明确回复不同意或未在指定时间内回复意见的，则管理人均不能开展相关重大关联交易。

本计划从事重大关联交易，管理人应在 5 个工作日内按本合同约定的信息披露方式向委托人和托管人披露，并依照相关规定向中国证监会相关派出机构报告。

（2）一般关联交易

一般关联交易是指除本章规定的重大关联交易之外的其他关联交易。

委托人在此同意并授权管理人可以将本计划资产从事前述一般关联交易，委

托人签署本合同即视为事先同意本计划参与一般关联交易，管理人无需就该等具体关联交易逐笔取得投资者的授权。

本计划从事一般关联交易，事后应按照本合同约定及时告知委托人和托管人，管理人可视具体情况在定期报告或临时报告中披露，并依照相关规定向中国证监会相关派出机构报告。

4、关联交易的决策与定价机制

管理人运用受托财产进行关联交易的，应当符合本合同约定的投资目标及策略，严格遵循公平公允、诚实信用、持有人利益优先的原则进行决策，禁止不正当关联交易，保护资产管理计划和委托人的利益不受侵害。

关联交易定价应遵循公允定价原则，交易事项有可比的市场价格或收费标准的，优先参考该价格或标准确定交易价格；如交易事项无可比的市场价格或收费标准的，参考关联方与独立于关联方的第三方发生的非关联交易价格确定。

5、公司关联交易内控机制

管理人制定关联交易管理制度，对关联交易认定标准、交易定价方法、交易审批程序进行规范，不得以本计划的资产与关联方进行不正当交易、利益输送、内幕交易和操纵市场。

管理人将根据关联方名单对关联证券及关联交易对手入库进行事前识别，对拟开展的关联交易按照以下审批程序进行：

（1）一般关联交易：

a、资产管理部提供拟从事的关联交易方案，经部门负责人审批同意；

b、报相关内控部门审核。

（2）重大关联交易：

a、资产管理部提供拟从事的关联交易方案，经部门负责人审批同意后，报资产管理投资决策委员会审批；

b、报相关内控部门审核；

c、报资产管理部分管领导审批。

6、关联交易的披露

管理人按照相关法律法规、监管规定以及本资产管理合同约定对于关联交易进行披露。

7、托管人义务

托管人向管理人披露托管人及其控股股东、实际控制人或者其他关联方，以及前述机构发行的证券或者承销期内承销的证券等信息，具体以托管人面向公开市场披露的信息为准。

8、其他事项

本章有关关联方和关联交易的相关约定，如法律法规、监管规则另有规定或管理人公司制度发生变更的，管理人可以按照法律法规、监管要求和公司制度调整相关内容并按本合同约定及时告知委托人，无需履行合同变更程序。

第十五章 投资经理的指定与变更

资产管理计划投资经理由管理人负责指定。

本计划投资经理为董迪君女士。

董迪君，上海财经大学金融学硕士研究生，具有 13 年金融行业从业经验。曾就职于金石期货、平安基金任投资经理，现任东亚前海证券资产管理部投资经理，在资产管理业务领域拥有丰富的投资经验。投资经理无兼职情况。

由于公司业务结构调整、人员变动等原因，本计划需要更换或新增本计划投资经理的，管理人应将变更情况在管理人网站进行公告。

公告内容应包括投资经理的姓名、从业简历、学历和兼职情况等基本信息，以及投资经理的投资管理、投资研究、投资咨询等相关业务经验。

第十六章 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、本计划财产为信托财产，其债务由计划财产本身承担责任，投资者以其出资为限对本计划财产的债务承担责任。

2、本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、托管人不得将本计划财产归入其固有财产。

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

4、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，本计划财产不属于其清算财产。

5、管理人、托管人以其固有财产承担法律责任，其债权人不得对资产管理

计划财产行使请求冻结、扣押和其他权利。

6、本计划财产产生的债权不得与不属于计划财产本身的债务相互抵销。非因本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计划财产强制执行。上述债权人对本计划财产主张权利时，管理人、托管人应明确告知本计划财产的独立性，采取合理措施并及时通知投资者。

(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及本合同约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。相关方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

（1）托管人为本资产管理计划单独开立托管资金账户。托管资金账户的名称应当包含本资产管理计划名称，具体名称以实际开立为准。本资产管理计划的一切货币收支活动，包括但不限于投资、支付赎回金额、支付计划收益、收取认购/申购款，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。资产托管人和资产管理人不得假借计划的名义开立其他任何银行账户；亦不得使用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、资产管理计划证券账户、资产托管人证券交易资金结算备付金账户的开立和管理

（1）资产托管人按照规定开立资产管理计划财产的证券账户。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。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。

（2）证券账户的开立和使用，限于满足开展本资产管理计划业务的需要。资产托管人和资产管理人不得出借和未经对方同意擅自转让计划的任何证券账户，亦不得使用计划的任何证券账户进行本资产管理计划业务以外的活动。

证券账户的开立和证券账户卡的保管由资产托管人负责，管理和运用由资产管理人负责。

（3）资产托管人以资产托管人的名义在中国证券登记结算有限责任公司上

海分公司、深圳分公司开立证券交易资金结算备付金账户（即资金交收账户），用于办理资产托管人所托管的包括本计划财产在内的全部资产在证券交易所进行证券投资所涉及的资金结算业务。

3、银行间债券市场的相关账户的开立和管理

管理人负责以本资产管理计划的名义申请并取得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；托管人负责以计划资产的名义在中央国债登记结算有限责任公司和银行间市场清算所股份有限公司开设银行间债券市场债券托管账户，并代表本计划进行债券和资金的清算。管理人、托管人应互相配合并提供相关资料。

4、开放式证券投资基金账户的开立和管理

（1）管理人负责为本计划开立所需的基金账户。

（2）管理人在开立计划账户时应将托管资金账户作为赎回款、分红款指定收款账户。

（3）管理人需及时将计划账户的开户资料（复印件）加盖经授权的管理人业务专用章后交付托管人。

（4）在托管人收到开户资料前，管理人不得利用该账户进行投资活动。

（5）托管人有权随时向基金注册登记人查询该账户资料。管理人应于每季度结束后十个工作日内将开放式基金对账单发送给托管人。

5、投资定期存款的银行账户的开立和管理

计划财产投资定期存款在存款机构开立的银行账户，包括实体或虚拟账户，其预留印鉴应包含托管人指定印章。本着便于计划财产的安全保管和日常监督核查的原则，存款行应尽量选择托管人经办行所在地的分支机构。对于任何的定期存款投资，管理人都必须和存款机构签订定期存款协议，约定双方的权利和义务，该协议作为划款指令附件。该协议中必须有如下条款或意思表示：“存款证实书不得被质押或以任何方式被抵押，并不得用于转让和背书；本息到期归还或提前支取的所有款项必须划至托管资金账户（明确户名、开户行、账号等），不得划入其他任何账户。”如定期存款协议中未体现前述条款，托管人有权拒绝定期存款投资的划款指令。在取得存款证实书后，原则上由托管人保管证实书正本。管理人应该在合理的时间内进行定期存款的投资和支取事宜，若管理人提前支取或部分提前支取定期存款，若产生息差（即计划财产已计提的资金利息和提前支取

时收到的资金利息差额），该息差的处理方法由管理人和托管人双方协商解决。

6、期货投资账户的开立和管理

管理人、托管人应当按照相关规定开立期货资金账户，在期货交易所获取交易编码。期货资金账户名称及交易编码对应名称应按照有关规定设立。

7、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。

第十七章 投资指令的发送、确认和执行

本集合计划资产由兴业银行托管。托管人将严格遵照有关法律法规及本合同约定对集合资产进行托管。

托管人的托管职责以资产管理合同的约定为准。

（一）投资指令的授权

1、管理人应指定专人向托管人以传真或邮件等双方一致认可的形式发送指令。

2、管理人应于集合计划成立日前向托管人提供书面授权文件，内容包括被授权人名单、预留印鉴及被授权人签字样本，授权文件应注明被授权人相应的权限及生效条件，并加盖管理人公章。

3、被授权人名单的通知及更新

管理人更换被授权人、更改或终止对被授权人的授权范围的，应提前 1 个工作日通知托管人，并于新授权书生效前将加盖管理人公章确认的书面文件送达托管人。被授权人变更通知，自通知载明的生效时间开始生效。若托管人收到通知的日期晚于通知载明的生效日期的，则该变更将在托管人收到正式书面通知原件并经与管理人电话确认后正式生效，同时原授权书作废。被授权人变更通知生效前，托管人仍应按原约定执行指令，管理人不得否认其效力。在特殊情况下，可按双方商定的方式处理。如果管理人授权人员名单、权限有变化时，管理人应及时将变化后的授权人员名单、权限告知托管人。

托管人更换接受管理人指令的人员，应提前 3 个工作日书面通知管理人，并通过电话确认。

4、托管人收到授权文件正本后，并经与管理人电话确认，授权文件即生效。

授权文件需载明具体生效时间，载明的具体生效时间不得早于托管人收到原件时间，授权文件自载明日期生效。

5、管理人和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漏。

（二）投资指令的内容

1、指令包括付款指令以及其他资金划拨指令等。

2、管理人发给托管人的指令应写明产品名称、款项事由、支付时间、支付金额（大小写）、收付款账户信息等，并加盖全部预留印鉴并由被授权人签字或盖章。

（三）投资指令的发送、确认及执行等程序

1、指令的发送

（1）管理人应按照法律法规、部门规章和资产管理合同的规定，在其合法的经营权限和交易权限内发送指令；被授权人应严格按照其授权权限发送指令。对于被授权人依约定程序发出的指令，管理人不得否认其效力。但如果管理人已经撤销或更改对交易指令发送人员的授权，且该授权已依本章第（一）条第3款生效后，则对于此后该交易指令发送人员无权发送的指令，或超权限发送的指令，管理人不承担责任，托管人不应执行。

指令发出后，管理人应及时以电话方式向托管人确认。托管人可以要求管理人传真或邮件或双方一致认可的其他方式提供相关交易凭证、合同或其他有效会计资料，以确保托管人有足够的资料来判断指令的有效性。在本受托财产申购/认购开放式基金时，管理人应在向托管人提交划款指令的同时将经有效签章的基金申购/认购申请书以传真或邮件或双方一致认可的其他形式送达托管人；本受托财产参与银行间市场交易时，管理人应将银行间同业拆借中心成交通知单传真或邮件或双方一致认可的其他方式发送给托管人，管理人与托管人另有约定的除外。如果银行间簿记系统已经生成的交易需要取消或终止，管理人要书面通知托管人。

（2）托管人发现管理人的划款指令、其他划款证明文件违反法律、行政法规、中国证监会的规定或者资产管理合同约定的，应当以书面或录音电话形式通知并要求管理人改正；未能改正的，托管人有权并应拒绝执行，并向管理人住所

地中国证监会派出机构及中国证券投资基金业协会报告。对于依据交易程序已经生效的交易，托管人应依据证券交收规则先办理证券清算交收，事后提示管理人限期改正，并有权向中国证监会派出机构报告。

（3）管理人向托管人发送划款指令时，应遵守下述指令截止时间要求。

除新股申购、定期存款、非担保业务外，管理人应在清算市场关闭前或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 个工作小时向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、非担保交收品种的划款指令截止时间为划款日 15:00。如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，托管人将尽力配合执行，但不能保证划账成功。

2、指令的确认

托管人应指定专人接收管理人的指令，并将指令接收人员的名单预先通知管理人。指令到达托管人后，托管人应指定专人立即对指令内容进行表面一致性审查及要素齐备性审查，核对指令的要素是否齐全、印鉴与被授权人预留的授权文件内容是否相符等，如有疑问托管人应当以书面或录音电话形式及时通知管理人，并有权附注相应说明后立即将指令退还给管理人，要求其重新下达有效指令。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。

3、指令的执行时间与程序

托管人对指令进行形式验证后，应及时办理。指令执行完毕后，托管人应及时以指令回传方式通知管理人。

（四）托管人依法暂缓、拒绝执行指令的情形和处理程序

托管人发现管理人的划款指令违反法律、行政法规、中国证监会的规定或者资产管理合同及本协议约定的，应当以书面或录音电话形式通知并要求管理人改正；未能改正的，托管人有权并应拒绝执行，并向管理人住所地中国证监会派出机构及中国证券投资基金业协会报告。对于依据交易程序已经生效的交易，托管人应依据证券交收规则先办理证券清算交收，事后提示管理人限期改正，并有权向中国证监会派出机构报告。

（五）管理人发送错误指令的情形和处理程序

托管人应当以书面或录音电话形式通知并要求管理人改正；未能改正的，托管人有权并应拒绝执行。

（六）投资指令的保管

划款指令及相关划款证明文件的正本由管理人保管，托管人保管传真件或邮件扫描件。当两者不一致时，以托管人收到的传真件或邮件扫描件为准。

（七）其它事项

管理人向托管人下达指令时，应确保本计划项下的托管专户有足够的资金余额，对托管专户没有充足资金的情况下向托管人发出的指令，托管人可不予执行，并通知管理人。

第十八章 越权交易

（一） 越权交易的界定

越权交易是指管理人违反有关法律法规及本合同的约定而进行的投资交易行为，包括：

1、违反本合同约定的投资范围和投资比例限制等进行的投资交易行为（被动超标除外）；

2、法律法规禁止的超买、超卖行为；

3、其他法律法规、监管机构禁止的投资、运作管理行为。

管理人应在本合同规定的权限内运用资产管理计划资产进行投资管理，不得违反本合同的约定，超越权限从事投资。

（二） 越权交易的处理程序

1、违反本合同投资范围和投资比例限制规定进行的投资交易行为。

托管人在行使监督职责时，发现管理人的投资划款指令违反本合同约定的，应当拒绝执行，应当以书面或录音电话形式通知并要求管理人改正；未能改正的，托管人应拒绝执行，并依据相关法律法规的要求报告相关监管机构。

2、法律法规禁止的超买、超卖行为。

托管人在行使监督职能时，如果发现计划资产投资过程中出现超买或超卖现象，应立即提醒管理人，由此给资产造成的损失由管理人承担。如果因管理人原因发生交易所场内超买行为，应于下一交易日上午 10：00 点之前准备好资金，

保证完成清算交收。

3、越权交易所发生的损失及相关交易费用由管理人负担，所发生的收益归本计划资产所有。

（三）托管人对管理人投资运作的监督

托管人对管理人的投资行为行使监督权，托管人根据本合同约定，对投资范围、投资比例、投资限制等投资运作相关事项进行监督。具体监督内容如下：

1、对本合同约定的投资范围进行监督：

（1）固定收益类资产包括：现金、定期存款、协议存款、同业存款、同业存单、结构性存款、通知存款、大额可转让存单、债券回购、国债、政策性金融债券、央行票据、金融债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、非公开定向债务融资工具、资产支持证券、资产支持票据、项目收益票据、次级债（含二级资本债）、永续债、可转换债券、可交换债券等在银行间市场、证券交易所市场等经国务院同意设立的交易市场交易标准化债权资产以及债券型基金、债券逆回购；

固定收益类资产中的现金类资产包括货币市场基金、银行活期存款、现金、到期日在1年内（含1年）的国债、到期日在1年内（含1年）的央行票据、到期日在1年内（含1年）的政府债券。

（2）权益类资产：国内依法发行上市的股票（包括新股申购所得股票、参与定向增发所得股票、创业板股票、科创板股票、北交所股票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、股票型基金、混合型基金等。

（3）期货和衍生品类：股指期货、国债期货、商品期货等金融衍生品。

本计划可参与债券正回购。本计划不投资于私募基金。

2、对本计划以下投资比例进行监督：

1）本计划投资于固定收益类资产的比例小于资产管理计划总资产80%；

2）本计划投资于权益类资产（不含融资融券合约负债）的比例小于资产管理计划总资产80%；

3）本计划投资于期货和衍生品的持仓合约价值的比例小于资产管理计划总资产80%或本计划期货和衍生品账户权益比例小于资产管理计划总资产20%。

以上投资比例符合混合类资产管理计划的监管规定。

资产管理计划投资于其他资产管理产品的，大类资产配置比例、总资产占净资产比例应当按照穿透原则合并计算；资产管理计划投资于其他私募资产管理产品的，应当按照穿透原则合并计算投资同一资产的比例以及投资同一或者同类资产的金额。

3、对本计划以下投资限制进行监督：

1）本集合计划的总资产不得超过本集合计划净资产的 200%；。

2）本集合计划投资于同一资产的资金，不得超过集合计划资产净值的 25%；管理人管理的全部集合资产管理计划投资于同一资产的资金，不得超过该资产的 25%。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）本计划开放退出期内，其资产组合中 7 个工作日可变现资产的价值，不低于本计划资产净值的 10%。

4）任一交易日日终，持有的一家上市公司的股票数量不得超过该只股票流通股的 10%。

5）任一交易日日终，持有的一家上市公司的股票数量不得超过该只股票总股本的 5%。

6）任一交易日日终，持有的单一债券（国债除外）市值占资产净值的比例不超过 10%。

7）任一交易日日终，持有的单一股票/存托凭证市值占资产净值的比例不超过 10%。

8）本集合计划参与股票、债券、可转换公司债券、可交换公司债券等证券发行申购时，本集合计划所申报的金额不得超过该资产管理计划的总资产，本集合计划所申报的数量不得超过拟发行公司本次发行的总量。

9）本集合计划投资的企业债、公司债、非公开定向债务融资工具、中期票据、资产支持证券、资产支持票据的债项评级为 AA（含）以上，若无债项评级，则参考主体评级或担保人评级（孰高），短期融资券的债项评级为 A-1 级（含）以上，若无债项评级，则参考主体评级或担保人评级（孰高）；

10）债券正回购资金余额或逆回购资金余额均不得超过本计划上一日净资产的 100%。

11）本集合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本计划净资产 50%的，本集合计划的总资产不得超过其净资产的 120%。本集合计划投资于国债、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。

12）本计划投资资产支持证券、资产支持票据的，其挂牌场所为证券交易所或银行间市场，仅限于投资资产支持证券、资产支持票据的优先级。

13）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（若有）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、公开募集证券投资基金，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。

14）法律法规及中国证监会规定的其他限制。

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

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，由过错方承担相应的责任。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。

托管人对计划财产的投资监督和检查自本合同生效之日起开始执行。托管人在本合同约定范围内，对本计划的投资履行监督职能。

管理人应当及时、准确、完整地向托管人提供履行投资监督所需的数据和信息，托管人投资监督的真实性、准确性和完整性受限于管理人、证券经纪商及其他中介机构提供的数据和信息。基于交易程序限制，托管人根据管理人、证券经纪商及其他中介机构提供的交易数据对管理人的场内交易结果进行事后监督。

投资监督事项涉及穿透核查或穿透计算的，管理人应当定期向托管人提供穿透所需的相关材料、数据及计算底稿，托管人仅凭管理人提供的材料进行事后核查监督，托管人核查监督的及时性、准确性受限于管理人提供信息的频率和信息的完整性、准确性。

第十九章 交易及清算交收安排

（一）选择证券、期货经纪机构的程序

1、资产管理人应及时将本资产管理计划财产证券交易单元号、佣金费率等基本信息以及变更情况及时以书面形式通知资产托管人。

2、资产管理人与资产托管人配合完成交易单元的合并清算事宜，资产管理人在交易前应确认相关合并清算事宜已办结。若资产管理人在合并清算办结前交易，则相关的交收责任由资产管理人承担。

3、本资产管理计划由资产管理人作为交易参与人通过交易单元在证券交易所进行证券交易。

根据证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司有关规定，管理人作为交易参与人，应分别向证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司申报资金前端控制有关信息；交易参与人应定期对自设额度等进行评估、优化，对全天净买入申报金额及额度使用情况进行监测，出现接近自设额度情形的，交易参与人应及时进行核查，采取相关措施保障后续交易的正常进行；并及时申报其他有关信息，确保申报信息真实、完整、有效，切实履行资金前端控制各项职责。本资产管理计划可能因上述业务规则而无法完成某笔或某些交易，由此造成的损益由计划财产承担。

（二）投资证券后的清算交收安排

1、关于托管资产在证券交易所市场达成的符合中国结算公司多边净额结算要求的证券交易以及新股业务：

资产托管人、资产管理人应共同遵守双方签署的《托管银行证券资金结算协议》及对该协议不时的更新。

2、关于托管资产在证券交易所市场达成的符合中国结算公司 T+0 非担保结算要求的证券交易：

（1）对于在沪深交易所交易的采用 T+0 非担保交收的交易品种（如中小企业私募债、股票质押式回购、债券质押式协议回购、资产支持证券等，根据中登公司业务规则适时调整），资产管理人需在交易当日不晚于 14：00 向资产托管人发送交易应付资金划款指令，同时将相关交易证明文件传真至资产托管人，并与资产托管人进行电话确认，以保证当日交易资金交收的顺利进行，中登业务规则允许采用 RTGS 交收的，在计划非担保交收账户可用资金充足的情况下，托管人将进行勾单处理。对于资产管理人在 14：00 后出具的划款指令，特别是需要

资产托管人进行“勾单”确认的交易，资产托管人本着勤勉尽责的原则积极处理，但不保证支付/勾单成功。

（2）资产管理人一旦出现交易后无法履约的情况，应在第一时间通知资产托管人。对于中国结算公司允许资产托管人指定不履约的交易品种，资产管理人应向资产托管人出具书面的取消交收指令，另，鉴于中登公司对取消交收（指定不履约）申报时间有限，资产托管人有权在电话通知资产管理人后，先行完成取消交收操作，资产管理人承诺日终前补出具书面的取消交收指令。

（3）若资产管理人未及时出具交易应付资金划款指令，或资产管理人在托管产品资金托管账户头寸不足的情况下交易，资产托管人有权在中登公司取消交收截止时点前半小时内主动对该笔交易进行取消交收申报。

（4）对于根据结算规则不能取消交收的交易品种，如出现前述第 2、3 项所述情形的，资产管理人知悉并同意资产托管人有权（但并非确保）仅根据中国结算公司的清算交收数据，主动将托管产品资金托管账户中的资金划入中国结算公司用以完成当日 T+0 非担保交收交易品种的交收，资产管理人承诺在日终前向资产托管人补出具资金划款指令。

（5）发生以下因资产管理人原因所造成的情形，资产管理人应对由此造成的直接损失承担相应责任：

1）资产管理人所托管的产品资金不足导致其自身产品交收失败，由资产管理人承担交易失败的风险，资产托管人无义务为该产品垫付交收款项；

2）因资产管理人未在合同约定的时间前向资产托管人提交有效划款指令，导致资产托管人无法及时完成支付结算操作而使其自身产品交收失败的，由资产管理人自行承担交易失败的风险；

3）因资产管理人所托管的产品资金不足，且占用托管行最低备付金交收成功，造成托管行损失，则应对于直接损失承担赔偿责任，资产托管人保留向资产管理人追索利息的权利；

4）因资产管理人所托管的产品资金不足或资产管理人未在规定时间内向资产托管人提交划款指令，且有证据证明其直接造成资产托管人托管的其他产品交收失败和损失的，资产管理人应对于由此造成的直接损失负赔偿责任。

（6）资产管理人已充分了解托管行结算模式下可能存在的交收风险。如资

产托管人托管的其他产品资金不足或过错，进而导致资产管理人管理的产品交收失败的，则资产托管人将配合资产管理人提供相关数据等信息以便资产管理人进行追偿。

（7）对于托管产品采用 T+0 非担保交收下实时结算（RTGS）方式完成实时交收的收款业务，管理人可根据需要在交易交收后，深圳 T+0 不晚于交收当日 14：00、上海 T+0 不晚于交收当日 15：00 向托管人发送交易应收资金收款指令，同时将相关交易证明文件传真至托管人，并与托管人进行电话确认，以便托管人将交收金额提回至托管产品资金托管账户。

3、关于托管资产在证券交易所市场达成的符合中国结算公司 T+N 非担保结算要求的证券交易

资产管理人知悉并同意资产托管人仅根据中国结算公司的清算交收数据主动完成托管产品资金清算交收。若资产管理人出现交易后无法履约的情况，并且中国结算公司的业务规则允许资产托管人对相关交易可以取消交收的，资产管理人应于交收日前一工作日向资产托管人出具书面的取消交收指令，并与资产托管人进行电话确认。

（三）开放式基金投资的清算交收安排

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

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

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

（四）银行间交易资金结算安排

1、管理人负责对交易对手的资信控制，按银行间债券市场的交易规则进行交易，并负责解决因交易对手不履行合同或不及时履行合同而发生的纠纷。

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

3、银行间交易结算方式采用券款对付的，托管资金账户与本计划在登记结算机构开立的 DVP 资金账户之间的资金调拨，除了登记结算机构系统自动将 DVP 资金账户资金退回至托管资金账户之外，应当由管理人出具资金划款指令，托管人审核无误后执行。由于管理人未及时出具指令导致本计划在托管资金账户的头寸不足或者 DVP 资金账户头寸不足导致的损失，由过错方承担相应的责任。

（五）投资银行存款的特别约定

1、本计划投资银行存款前，应与存款银行签署投资银行定期存款协议。

2、本计划投资银行存款，必须采用管理人和托管人认可的方式办理。

3、管理人投资银行存款或办理存款支取时，应提前书面通知托管人，以便托管人有足够的时间履行相应的业务操作程序。

4、因投资需要在托管银行以外的其他银行开立活期账户进行投资的，管理人、托管人和存款行需在投资前另行签署三方协议。

（六）期货投资的清算交收安排

本计划相关期货投资的具体操作按照管理人、托管人及期货经纪机构签署的《期货投资操作备忘录》（以实际名称为准）的约定执行。

（七）其他场外交易资金结算

1、管理人负责场外交易的实施，托管人负责根据管理人划款指令和相关投资文件进行场外交易资金的划付。管理人应将划款指令连同相关交易文件一并传真至托管人，托管人根据本合同第十七部分约定审核后及时执行划款指令。

2、托管人负责审核交易文件和划款指令要素的一致性，相关交易文件中约定的其他转让或划款条件由管理人负责审核。管理人同时应以书面形式通知托管人相关收款账户名、账号、交易费率等。投资或收益分配资金必须回流到本计划托管资金账户内，不得划入其他账户。

(八)资金、证券账目及交易记录的核对

管理人和托管人应定期对账。

对计划财产的资金账目，以管理人与托管人约定方式核对，确保相关各方账账相符。

对计划财产的证券账目，由相关各方根据外部第三方对账数据定期进行对账。

对计划财产的交易记录，管理人与托管人核对估值结果之前，应保证所有实际交易记录与会计账簿上的交易记录完全一致。

第二十章 资产管理计划财产的估值和会计核算

管理人应当制订健全、有效的估值政策和程序，并定期对其执行效果进行评估，保证集合资产管理计划估值的公平、合理。

（一）资产总值：集合计划的资产总值是指通过发行计划份额方式募集资金，并依法进行基金、债券交易等资本市场投资所形成的各类资产的价值总和。

（二）资产净值：集合计划资产净值是指集合计划资产总值减去负债后的价值。

（三）单位净值：集合计划单位净值是指估值日集合计划资产净值除以计划总份额。

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

（五）估值对象：运用集合计划资产所持有的一切金融资产和金融负债。

（六）估值时间：估值日指本集合计划成立后的每个工作日。

（七）估值方法

1、投资固定收益品种的估值方法

对于已上市或已挂牌转让的不含权固定收益品种，选取第三方估值基准服务机构提供的相应品种当日的估值全价。

对于已上市或已挂牌转让的含权固定收益品种，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。

对于在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。

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。

2、投资证券投资基金的估值方法

持有的交易所基金(包括封闭式基金、上市开放式基金（LOF）等)，按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考监管机构或行业协会有关规定，或者类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。

持有的场外基金（包括托管在场外的上市开放式基金（LOF）），按估值日前一交易日的基金份额净值估值；估值日前一交易日基金份额净值无公布的，按此前最近交易日的基金份额净值估值。

持有的货币市场基金，按基金管理公司公布的估值日前一交易日的每万份收益计提红利。

3、存款的估值方法

持有的银行定期存款或通知存款以本金列示，按协议或合同利率逐日确认利息收入。如提前支取或利率发生变化，管理人及时进行账务调整。

结构性存款，采用估值技术确定公允价值。

4、回购的估值方法

债券质押式回购以本金列示，按回购利率逐日确认利息收入。

5、股票的估值方法

（1）上市流通股票按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件，以最近交易日的收盘价估值；如果估值日无交易，且最

近交易日后经济环境发生了重大变化的或者证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，将参考监管机构或行业协会有关规定，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。

（2）未上市股票的估值

1）首次发行的股票，采用估值技术确定公允价值进行估值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

2）在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，估值方法如下：

FV=S×（1-LoMD）

其中：FV为估值日该流通受限股票的价值；S为估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值；LoMD为该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣。。

3）送股、转增股、配股和公开增发新股等方式发行的股票，按估值日该上市公司在证券交易所挂牌的同一流通股票的以第（1）条确定的估值价格进行估值。

6、期货的估值方法

期货合约以估值日的结算价估值，若估值当日无结算价的，且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大变化的，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、估值技术是指管理人和托管人协商一致的，被市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的确定公允价值的方法。如有确凿证据表明按上述规定不能客观反映集合计划资产公允价值的，管理人可根据具体情况，在综合考虑市场成交价、市场报价、流动性、收益率曲线等多种因素基础上，在与托管人商议后，按最能反映集合计划资产公允价值的方法估值。管理人应在新的估值方法实施前3个工作日在管理人网站通告委托人。如存在上述条款未覆盖的投资品种，管理人可根据具体情况与托管人协商一致后，按具有可靠性的确定公允价值的价格进行估值。

如有新增事项或变更事项，按国家有关最新规定估值。管理人应于新规定实施后及时以官网公告形式告知委托人。

（八）估值程序

集合计划资产的日常估值由管理人进行。管理人应于估值日交易结束后计算当日的资产净值并以电子对账、邮件或双方认可的其他方式与托管人核对。用于披露的集合计划单位净值由管理人完成估值后，将估值结果以书面的方式或双方认可的方式报送托管人，托管人按照规定的估值方法、时间与程序进行复核；托管人进行复核无误后发回给管理人，由管理人负责根据本合同约定进行披露。月末、季末、半年末和年末估值复核与余额表、资产负债表、损益表、所有者权益变动表等报表的核对同时进行。

（九）估值错误的处理

1、计划份额资产净值的计算采用四舍五入的方法保留小数点后四位，国家另有规定的从其规定。当计划资产的估值导致计划份额资产净值小数点后四位以内发生差错时，视为计划份额资产净值错误。

2、管理人和托管人应采取必要、适当、合理的措施，确保计划资产净值的准确性和及时性。

3、当计划份额资产净值发生错误时，管理人及托管人应立即予以纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大。

4、估值错误的处理原则和方法

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

(2)估值错误的处理方法：

1)管理人计算的资产管理计划净值已由托管人复核确认，但因资产估值错误给委托人造成损失的，由管理人与托管人按照过错对委托人的直接损失各自承担相应的责任。因估值导致资产管理计划份额净值出现错误时，管理人及托管人应

当立即纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大。

2)如管理人和托管人对资产管理计划净值的计算结果，虽然多次重新计算和核对尚不能达成一致时，为避免不能按时披露资产管理计划净值的情形，以管理人的计算结果对外披露。

3)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，进而导致资产管理计划净值计算错误造成委托人的损失，以及由此造成以后交易日计划资产净值计算顺延错误而引起的委托人的损失，由提供错误信息的当事人一方负责赔偿委托人的直接损失。

4)由于交易所及其注册登记结算公司等第三方机构发送的数据错误，或国家会计政策变更、市场规则变更等，或由于其他不可抗力原因，管理人和托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误的，由此造成的资产管理计划估值错误，管理人和托管人可以免除赔偿责任。但管理人和托管人应当积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。

5、管理人、托管人按估值方法进行估值时，所造成的误差不作为估值错误处理。

6、针对净值处理错误，如法律法规或监管机构另有规定的，从其规定办理。

（十）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，按最能反映公允价值的价格估值。管理人、托管人按此进行估值调整，所造成的误差不作为集合计划单位资产净值错误处理。

（十一）暂停估值的情形

1）与集合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管理人无法准确评估集合资管计划资产价值时；

3）中国证监会认定的其他情形。

（十二）资产管理计划份额净值的确认

1、用于计划信息披露的计划资产净值和计划份额资产净值等财务数据由管

理人负责计算，托管人复核。

2、托管人应在收到上述传真后对净值计算结果进行复核，复核无误的，以传真或双方一致认可的方式将复核结果传送给管理人。如果托管人的复核结果与管理人的计算结果存在差异，且双方经协商未能达成一致，管理人有权按照其对计划净值的计算结果对外予以公布，托管人有权将相关情况报中国证监会及中国证券投资基金业协会备案。

（十三）特殊情形的处理

由于不可抗力原因，或由于证券交易所、登记结算公司等机构发送的数据错误，管理人和托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但仍未能发现错误的，由此造成的计划资产估值错误，本管理人和托管人可以免除赔偿责任。但本管理人和托管人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

（十四）资产计划的会计政策

1、本项委托资产的会计年度为每年 1 月 1 日至 12 月 31 日；

2、 记账本位币为人民币，计账单位为元；

3、 会计核算制度：委托资产的会计核算参照《证券投资基金会计核算业务指引》执行。

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。本计划应当单独建账、单独核算；管理人应保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，编制会计报表；托管人应定期与管理人就本计划的会计核算、报表编制等进行核对。

第二十一章 资产管理计划的费用与税收

（一）集合计划费用支付标准、计算方法、支付方式和时间

1、托管费

托管人的托管费按前一日集合计划资产净值的【0.02%】年费率计提。计算方法如下：

H＝E×【0.02%】÷当年天数

H 为每日应计提的托管费；

E 为前一日集合计划资产净值。

集合计划托管费每日计提，按季支付。由托管人根据与管理人核对一致的

估值数据以及按照上述公式进行计算的结果，自动在自然季后首月的第 3 个工作日按照指定的账户路径进行资金支付，管理人无需再出具划款指令。费用自动扣划后，托管人应配合管理人进行查询、核对，如发现数据不符，及时联系托管人协商解决。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的首个工作日支付。

托管人指定的接收托管费的银行账户信息：

账户名称（接收托管费）：证券公司客户资产管理计划托管业务收入

账　号：401010191675000106

开户行：兴业银行南京分行

2、管理人的管理费

（1）管理人的固定管理费

管理人的管理费，按前一日集合计划资产净值的【1.75%】年费率计提，计算方法如下：

H=E×【1.75%】÷当年天数

H 为每日应计提的管理费；

E 为前一日集合计划资产净值。

集合计划管理费每日计提，按季支付。由托管人根据与管理人核对一致的估值数据以及按照上述公式进行计算的结果，自动在自然季后首月的第 3 个工作日按照指定的账户路径进行资金支付，管理人无需再出具划款指令。费用自动扣划后，托管人应配合管理人进行查询、核对，如发现数据不符，及时联系托管人协商解决。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：

账户名称：东亚前海证券有限责任公司

银行账号：755935096210401

开户银行：招商银行股份有限公司深圳时代广场支行

（2）管理人的业绩报酬

1）业绩报酬的计提原则

a、业绩报酬应当从分红资金、退出资金或者清算资金中提取。

b、对委托人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。

c、本集合计划业绩报酬计提日为本集合计划收益分配登记日、委托人份额退出日或本集合计划终止清算分配日。在收益分配登记日和本集合计划终止清算分配日，对集合计划中符合业绩报酬计提条件的全部份额计提业绩报酬；在委托人份额退出日，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。

d、集合计划收益分配登记日和集合计划终止清算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，业绩报酬应当从分红资金、清算资金中提取。在委托人份额退出日符合业绩报酬计提条件的，业绩报酬应当从退出资金中提取，管理人应先将委托人申请退出的份额所对应的业绩报酬从退出金额中扣除后，再向委托人分配退出款。

2）业绩报酬的提取频率

本集合计划业绩报酬计提日为本集合计划收益分配登记日、委托人份额退出日或本集合计划终止清算分配日。本集合计划从收益分配资金中提取业绩报酬的频率不得超过每 6 个月一次。

3）业绩报酬的计提方法以及计提比例

管理人于业绩报酬计提日，将按份额认(申)购时间的不同，针对委托人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委托人所持有的每笔份额，自上一个业绩报酬计提日（如上一个业绩报酬计提日不存在，则为本集合计划成立日或委托人该笔份额申购确认日）至本次业绩报酬计提日期间。业绩报酬的提取比例不得超过计提基准以上投资收益的 60%。

管理人根据当前业绩报酬核算期的委托人每笔份额实际年化收益率（R）情况，分段计提业绩报酬（H），委托人所持份额以认(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≤S1	0	H=0，管理人不提取业绩报酬。
R>S1	S	H= (R-S1)×S×C×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集合计划单位累计净值；

P_0为上一个业绩报酬计提日（若该笔份额无上一个业绩报酬计提日的，则为集合计划成立日或委托人该笔份额申购日）集合计划的单位累计净值；

P 为上一个业绩报酬计提日（若该笔份额无上一个业绩报酬计提日的，则为集合计划成立日或委托人该笔份额申购日）集合计划的单位净值；

N 为该笔份额当前业绩报酬核算期的天数；

C 为委托人该笔份额上一业绩报酬计提日的净值= P*上一个业绩报酬计提日的投资者每笔份额数量。

特别说明：若收益分配登记日管理人提取业绩报酬 H=0，该日亦为业绩报酬计提日。

S1 为本集合计划的业绩报酬计提基准，具体见管理人推广公告，S 为业绩计提比例，S=20%。**在本集合计划存续期内，管理人有权根据集合计划运作情况对集合计划业绩报酬计提基准予以调整，调整结果以届时管理人网站公告为准。**

本集合计划的业绩报酬计提基准，仅作为管理人提取业绩报酬的依据，并非管理人向委托人做出保本保收益的承诺，委托人的实际年化收益率有可能低于业绩报酬计提基准。在本集合计划资产出现极端损失的情况下，委托人可能面临无法取得收益乃至投资本金受损的风险。

业绩报酬计提日为收益分配登记日和本集合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；业绩报酬计提日为委托人份额退出日的，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。由于涉及份额注册登记，管理人负责计算业绩报酬，托管人不复核，仅负责按照管理人出具的划款指令进行赎回费划款并配合进行账务处理。业绩报酬计提结束后，由管理人向托管人发送业绩报酬划付指令，托管人于 5 个工作日内划付至管理人账户。

3、证券交易费用

本集合计划的证券交易费用包括但不限于经手费、证管费、过户费、印花税、结算费、证券结算风险基金、券商佣金、银行间市场收取的相关交易费用、银行汇划费及其他类似性质的费用。本集合计划向所租用交易单元的券商支付佣金（该佣金已扣除经手费、证管费），其费率由管理人根据有关政策法规确

定，在次季度首日起5个工作日内支付给提供交易单元的券商。

4、清算费用

本集合计划终止清算所发生费用，实际支出额由本集合计划承担。

5、其他费用

在存续期间发生的集合计划审计费用，由集合计划承担，在被审计的会计期间，按直线法在每个自然日内平均预提。

集合计划成立后的信息披露费用和律师费、开/销户费、银行结算费用、银行划款费用、银行账户维护费、转托管费、询证费、银行间市场收取的相关费用（包括账户维护费、查询服务费等）、注册登记机构收取的相关费用（包括：TA 服务费、服务月费、电子合同费等）等集合计划运营过程中发生的相关费用，由管理人本着保护委托人利益的原则，按照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定。并由托管人根据法律法规及相应协议的规定，按费用实际支出金额支出，列入或摊入当期集合计划费用。

银行间市场账户维护费及查询服务费，按银行间市场规定的金额，在所属会计期间的每个自然日进行预提。

与本资产管理计划运作直接相关应税项目或应税行为产生的增值税及附加税费由集合计划承担。

（二）不列入集合计划费用的项目

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。

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资产管理计划财产的损失，以及处理与资产管理计划财产运作无关事项或不合理事项所发生的费用等不得列入资产管理计划的费用。

（三）费用调整

管理人、托管人经协商一致，并按照本合同“资产管理合同的变更、终止与财产清算”约定履行合同变更手续，可根据市场发展情况调整费用。若调低费用的，委托人在此同意，管理人与托管人协商一致即可调整。

（四）税收

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。委托人缴纳必须由其自行缴纳的税费，管理人不承担代扣代缴或纳税的义务。

依据相关法律法规或税务机关的认定，本集合计划投资及运营过程中发生增值税等应税行为，以管理人为纳税人或由管理人代扣代缴的，除本集合计划已列明的资产管理业务费用（如管理费、托管费等）的增值税由各收费方自行缴纳外，管理人有权以集合计划资产予以缴纳或代扣代缴，且无需事先征得委托人的同意。

管理人在向委托人交付相关收益或资产后税务机关要求管理人就已交付收益或资产缴纳相关税费的，委托人必须按照管理人要求进行补缴。

委托人不得要求管理人以任何方式向其返还或补偿管理人以集合计划资产缴纳或代扣代缴、委托人按照管理人要求补缴的税费。

第二十二章 资产管理计划的收益分配

（一）收益的构成

本集合计划收益指集合计划利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额，集合计划已实现收益指集合计划利润减去公允价值变动收益后的余额。

（二）可供分配利润的构成

可供分配利润指截至收益分配基准日（即可供分配利润计算截至日）资产负债表中集合计划未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

（三）收益分配原则

1、收益分配的方式：现金分红。

2、收益分配的基准：集合计划当期收益先弥补该期上一年度亏损后，方可进行该期集合计划当年收益分配。收益分配基准日的集合计划单位净值减去该期每单位集合计划份额收益分配金额后不能低于面值。

3、收益分配次数：具体的分配次数取决于集合计划的投资策略、收益情况以及管理人的决策，具体以管理人公告为准。

4、收益分配比例：集合计划的收益分配比例根据集合计划的收益情况确定，具体以管理人公告为准。

5、收益分配时间：具体以管理人公告为准。

6、同类集合计划份额享有同等分配权。

7、法律法规或中国证监会另有规定的从其规定。

（四）收益分配方案的确定、通知和实施

集合计划收益分配方案由管理人拟定，具体方式以管理人公告为准。包括集合计划收益的范围、集合计划可供分配利润、分配对象、分配原则、分配时间、分配数额及比例、分配方式、收益分配的基准等内容，托管人仅复核分配总额。

本集合计划的分红方式为现金分红。托管人根据指令将现金红利款项划往份额登记机构，份额登记机构将现金红利款项划往相应的推广机构，由推广机构划入委托人的指定资金账户。现金红利款在R+7日内（R为分红权益登记日）划转到委托人账户。

第二十三章 信息披露与报告

本集合计划的信息披露将严格按照法律法规、《集合资产管理合同》及其他有关规定进行。委托人可通过本合同约定的信息披露方式查询信息披露内容。资产管理计划应当向委托人提供资产管理合同、计划说明书、风险揭示书、资产管理计划净值、资产管理计划参与及退出价格、定期报告、重大事项的临时报告、清算报告等信息披露文件。管理人披露资产管理计划净值、资产管理计划参与及退出价格应当经托管人复核。

（一）资产管理计划参与及退出价格

资产管理计划参与价格按照参与当日净值确认，退出价格按照份额退出申请日的净值确认。

（二）定期报告

定期报告包括集合计划单位净值报告、集合计划的资产管理季度（年度）报告、托管年度报告、年度财务会计报告。

1、集合计划单位净值报告

披露时间：在本计划的存续期内，管理人应在 T+1 日通过官网披露 T 日的集合计划份额净值、份额累计净值，披露频率不低于每周一次。

披露方式：本集合计划的信息披露将严格按照《管理办法》、《运作规定》、本合同及其他有关规定进行。本集合计划的计划单位净值、计划累计单位净值等信息经托管人复核后，将在管理人指定网站上披露，投资者可随时查阅。若管理

人指定网站变更，管理人将提前进行相关信息的详细披露。

2、集合计划的季度报告和年度报告

管理人在每季度结束之日起一个月内向投资者披露本集合计划季度报告，每年度结束之日起四个月内向投资者披露年度报告，并按照监管规定报备。在前述时间内，管理季度、年度报告由管理人通过指定网站公告，供投资者可随时查阅。若管理人指定网站变更，管理人将提前进行相关信息的详细披露。

管理人应当按照本合同的约定向投资者提供资产管理计划季度、年度报告，披露报告期内资产管理计划运作情况。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）等费用的计提基准、计提方式和支付方式；

（8）资产管理计划投资收益分配情况；

（9）投资经理变更、重大关联交易等涉及投资者权益的重大事项；

（10）集合资产管理计划参与股指期货、国债期货交易的有关情况，包括交易目的、持仓情况、损益情况等，并充分说明交易股指期货、国债期货对集合资产管理计划总体风险的影响以及是否符合既定的交易目的；

（11）中国证监会规定的其他事项。

资产管理计划季度报告应当披露前款除第（6）项之外的其他信息。托管人履职报告由托管人提供。

资产管理计划成立不足 3 个月或者存续期间不足 3 个月的，管理人可以不编制资产管理计划当期的季度报告和年度报告。

3、托管人履职报告

(1)托管人履职报告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单独出具。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两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3个月或者存续期间不足3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。

4、年度财务会计报告

管理人应当聘请符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所对本集合计划的运营情况进行年度审计，会计师事务所应当对资产管理计划会计核算及净值计算等出具意见。

（三）重大事项的临时报告

集合计划存续期间，发生以下可能影响投资者利益的重大事项时，管理人应当以管理人指定网站、推广机构网站或管理人安排的其他信披方式向投资者披露：

1、以资产管理计划资产从事重大关联交易的；

2、本集合计划涉及重大诉讼、仲裁、财产纠纷的；

3、资产管理计划因受托资产流动性受限等原因延长清算时间的；

4、管理人认为按照合同约定兑付投资者的赎回申请有困难，对部分或全部赎回申请延期办理的；

5、管理人、托管人因重大违法违规，被中国证监会取消与本集合计划投资运作相关的业务资格的；

6、管理人、托管人因解散、破产、撤销等原因不能履行相应职责的；

7、发生其他可能影响投资者利益的重大事项。

发生上述约定或可能影响投资者利益的重大事项时，管理人应在事项发生之日起5日内向投资者披露。

（四）清算报告

资产管理计划在发生终止情形之日起5个工作日内，管理人开始组织清算资产管理计划资产，编制清算报告，并在管理人官网披露，同时在清算结束后5个工作日内报送证券投资基金业协会。

（五）投资者信息披露

管理人应按照监管规定定期将本计划委托人变更情况报送证券投资基金业协会。集合计划委托人在此同意管理人、托管人按照法律法规及监管机构的要求报送委托人相关信息，包括但不限于委托人名称、身份信息、集合计划份额明细等数据。

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

（六）信息披露文件的存放与查阅

集合计划说明书、《集合资产管理合同》存放在推广场所，投资者可在营业时间免费查阅。在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复印件。投资者还可以登陆管理人的网站或拨打咨询电话进行查询。对投资者按上述方式所获得的文件及其复印件，管理人保证与所报告的内容完全一致。集合资产管理定期报告及其他临时通告等信息披露文件公布于管理人网站，供投资者查阅。

（七）监管报告

管理人、托管人应当根据法律法规、中国证监会和证券投资基金业协会的要求履行向监管机构报告的义务。

如果法律法规、监管机构对私募资产管理产品的信息披露和报告的规定有修订的，本章信息披露和报告将按照最新的监管规定执行。

（八）其他

委托人在此同意管理人、托管人的信息报送，包括涉及的投资者名称、身份信息、资产参与、退出明细等数据。本集合计划存续期内，管理人和托管人须按照监管部门要求取消或新增报告事项。

尽管本合同对于备案、报告事项有所约定，但法律、行政法规、中国证监会、行业自律组织及相关监管机构对于备案、报告事项、报送信息等另有规定或要求的，管理人、托管人应从其规定，该种变化不应被视本合同项下的违约行为。

第二十四章 风险揭示

本集合计划面临包括但不限于以下风险：

（一）特殊风险揭示

1、本集合计划聘请投资顾问所涉风险

1）管理人在聘用第三方机构为集合资产管理计划提供投资决策相关专业服务时，必须确保第三方机构具有合法资质。管理人可能存在相关制度不健全，遴选规程不完善的情况从而给集合计划带来损失的风险。

2）管理人在聘用投资顾问时，可能存在双方的权利、义务、责任约定不明确，导致可能发生与集合计划相关的争议纠纷的风险。

3）管理人或投资顾问可能存在利益冲突防范机制不健全的情况，导致集合计划与投资顾问及其管理的其他产品之间发生利益输送等违法违规行为。

4）投资顾问的投资建议能力及风险管理水平可能对本集合计划的业绩表现造成实质性影响，本集合计划存在因管理人采纳投资顾问的投资建议从而导致投资损失或信用风险增加的风险。

5）发生可解聘投资顾问的情形或其他提前终止《投资顾问协议》的情形时，委托人面临因投资顾问服务终止而使得集合计划业绩受到不利影响，甚至集合计划提前终止的风险。

2、无法按意愿退出的风险

1）本集合计划份额锁定期设置相关风险

份额持有人参与本计划自参与（包括推广期参与、存续期参与）申请确认成功之日起【3个月（不含）】内不得退出。委托人面临在份额锁定期内无法退出的风险。

2）巨额退出风险

根据资产管理计划合同约定，单个开放日，委托人当日累计净退出申请份额（退出申请总份额扣除参与申请总份额之后的余额）超过上一工作日计划总份额数10%时，即为巨额退出。如发生巨额退出时，管理人可以根据本集合计划当时的资产组合状况决定全额退出、部分顺延退出，委托人面临无法按意愿退出的风险。

3）大额退出风险

根据资产管理计划合同约定，单个委托人在本集合计划单个退出开放日一次退出份额达到或超过 500 万份（含）则构成大额退出，发生大额退出的，委托人应在退出日的前 3 个工作日提出预约，否则管理人有权拒绝其退出申请，委托人如构成大额退出且未按约定在退出日的前 3 个工作日提出预约，则面临无法按意愿退出的风险。

3、本集合计划合同与证券投资基金业协会发布的合同指引（下称“《合同指引》”）不一致所涉风险

本集合计划合同依据《合同指引》及相关法律法规制定，根据管理人自身实际情况对相关内容做出了适当的调整。本集合计划合同中对《合同指引》规定内容之外的部分事项进行约定，也可能存在个别内容与《合同指引》不完全一致，或不适用《合同指引》中个别规定的情形，从而可能面临本合同被中国基金业协会要求管理人重新修订完善的风险。管理人将及时根据中国基金业协会的要求提交说明材料，如涉及委托人相关权利义务的，管理人及时在指定网站进行信息披露，相关内容以披露的信息为准。

4、资产管理计划委托募集所涉风险

本计划通过推广机构（管理人和管理人委托的其他符合相应资格条件的代销机构）进行募集，管理人可以根据情况增加或减少代销机构。

若代销机构不具备提供相关服务的条件和技能、或发生管理不善、操作失误等，或存在违法违规地公开宣传、虚假宣传、以保本保收益引诱投资者购买、未能履行投资者适当性审查工作、挪用侵占产品财产等行为，将导致委托人合法权益受损的风险。

5、募集失败所涉风险

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

管理人的责任承担方式：

1）以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用；

2）在资产管理计划募集期限届满（确认资产管理计划无法成立）后三十日内返还投资者已交纳的款项，并加计银行同期活期存款利息。

6、未在协会完成备案手续所涉风险

本计划在证券投资基金业协会备案完成前无法进行投资操作（法律法规允许的现金管理除外），因备案所需时间无法准确预估且委托人在此期间无法及时退出其投资本金，本计划及委托人均存在备案期间错失投资机会的风险。

本计划存在管理人未在合同约定期限内到中国证券投资基金业协会办理相关备案手续或未能成功通过备案导致计划提前终止的风险。

若管理人放弃本计划备案或本计划未能成功通过备案，且管理人决定终止时，本计划相应终止，具体终止流程参见资产管理合同终止清算相关章节。

7、未设置份额持有人大会所涉风险

本集合计划不设置份额持有人大会及日常机构，委托人面临无法参与份额持有人大会的风险。本计划不设置份额持有人大会可能存在以下风险：

1）投资者权益保障不足：份额持有人大会是投资者行使权利、参与决策的重要机制。不设置份额持有人大会，投资者的意见和诉求可能无法得到充分表达和考虑，从而导致投资者权益受损。

2）决策过程可能缺乏透明度：在不设置份额持有人大会的情况下，集合资产管理计划的重大决策可能只能由管理人单方面做出。这可能导致决策过程缺乏透明度，甚至可能引发投资者对管理人的不信任。

3）投资者沟通不畅：份额持有人大会为投资者提供了一个与管理人和其他投资者沟通的平台。不设置份额持有人大会，投资者之间的沟通可能变得不畅，不利于信息的传递和共享。

8、从事重大关联交易、一般关联交易所涉风险

1）对于重大关联交易的特别风险提示：虽然管理人积极遵循投资者利益优先的原则，对该等交易安排根据公司内部审批机制和评估机制进行事前内部审查，并事前采取逐笔征求意见或公告确认的等方式取得投资者的同意，但仍可能存在因管理人关联交易定价、关联交易审批程序而引起的风险，在此提示投资者特别注意。

2）对于一般关联交易的特别风险提示：虽然管理人设置了重大关联交易与一般关联交易的划分标准，并根据重要性原则采取分层管理，但仍可能因管理人针对一般关联交易在本合同采用事先统一授权同意模式、存在投资者未被逐

笔征询意见并在发生一般关联交易时无法及时退出本计划而引起的风险，在此提示投资者特别注意。

委托人同意并授权管理人可以将本计划资产从事一般关联交易，但管理人应当遵守法律、行政法规、中国证监会的规定和合同约定，并遵守管理人内部制度审批流程的规定。管理人根据监管规则的规定和本计划合同的约定履行一般关联交易的信息披露及报告的义务，同时事先向委托人充分披露了关联方范围、一般关联人和重大关联交易的区分标准、关联交易审批等内部管控机制等内容。虽然管理人履行了前述义务，但关联交易有可能因为交易对手方、交易价格、交易资产等问题，而发生交易风险；管理人运用计划财产从事关联交易时可能依照相关法律法规、监管机构、自律组织的规定被限制相关权利的行使，也可能影响受托资产的投资收益。

9、投资标的风险

1）期货投资风险

a、流动性风险：本计划所投资产管理产品在期货市场成交不活跃时，可能在建仓和平仓期货时面临交易价格或者交易数量上的风险。

b、基差风险：基差是指现货价格与期货价格之间的差额。若本计划所投资产管理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，则可能对本计划所投资产管理产品的投资产生影响，从而可能对本计划产生影响。

c、合约展期风险：本计划所投资产管理产品所投资的期货合约主要包括期货当月和近月合约。当本计划所投资产管理产品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。

d、期货保证金不足风险：由于期货价格朝不利方向变动，导致期货账户的资金低于期货交易所或者期货经纪商的最低保证金要求，如果不能及时补充保证金，期货头寸将被强行平仓，导致无法规避对冲系统性风险，直接影响本计划所投资产管理产品收益水平，从而产生风险。

e、杠杆风险：期货作为金融衍生品，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，本计划所投资产管理产品可能承受超出保证金甚至计划资产本金损失的风险，从而可能对本计划产生影响。

f. 市场风险：期货合约的价格受多种因素影响，如供需关系、宏观经济状况、政治事件、自然因素等，这些因素可能导致价格剧烈波动，从而可能对本计划产生影响。

2）债券投资特定风险

债券等固定收益类品种除存在上述市场风险、信用风险和流动性风险等外，还存在其自身的特定风险，包括：

a、再投资风险：债券偿付本息后以及回购到期后可能由于市场利率的下降面临资金再投资的收益率低于原来利率。

b、债券回购风险：债券回购为提升整体投资组合收益提供了可能，其主要风险包括信用风险、投资风险及波动性加大的风险，其中，信用风险指回购交易中交易对手在回购到期时，不能偿还全部或部分证券或价款，造成资产净值损失的风险；投资风险是指在进行回购操作时，回购利率大于债券投资收益而导致的风险以及由于回购操作导致投资总量放大，致使整个投资组合风险放大的风险；而波动性加大的风险是指在进行回购操作时，在对投资组合收益进行放大的同时，也对投资组合的波动性（标准差）进行了放大，即投资组合的风险将会加大。回购比例越高，风险暴露程度也就越高，对资产净值造成损失的可能性也就越大。

c、发行主体的风险：集合计划在交易过程中可能发生交收违约或者所投资债券的发行人倒闭、信用评级被降低、违约、拒绝支付到期本息的情况，从而导致集合计划财产损失。

3）资产支持证券、资产支持票据、项目收益票据投资的风险

资产支持证券、资产支持票据、项目收益票据中的基础资产信用风险主要来自于基础资产质量上。主要体现为原始权益人不能按时或不能对基础资产进行清偿，使得委托人可能无法获得约定的投资收益。

由于基础资产债务人有提前偿还债务的权利，一旦提前还款，也会对委托人的收益产生较大的影响。此外，由于其本身具有复杂性和创新性，同时各类

资产的特性、信用增级方式、市场利率变化等因素，可能造成兑付、逾期等投资风险。

4）可转换债券、可交换债券投资的风险

可转换债券、可交换债券的投资存在波动性风险，具体表现为可转换债券、可交换债券的价格受到其相对应股票价格波动的影响，同时可转换债券、可交换债券还有信用风险和转股风险。转股风险指相对应股票价格跌破转股价，不能获得转股收益，从而无法弥补当初付出的转股期权价值。

5）股票投资风险

a、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，导致证券市场价格水平波动的风险。

b、宏观经济运行周期性波动，对证券市场的收益水平产生影响的风险。

c、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。

d、本产品股票投资范围包括新股申购，存在新股上市后股价跌破发行价而导致产品亏损的风险。同时若新股申购过程中出现实际中获配数量超过本计划可支付头寸的情况时，根据本合同约定委托人存在必须及时追加委托财产的流动性风险。

6）证券投资基金风险

本计划可投资于经中国证监会依法核准或注册的公开募集的证券投资基金，存在大类资产配置风险，有可能受到经济周期、市场环境或管理人对市场所处的经济周期和产业周期的判断不足等因素的影响，导致本计划的大类资产配置比例偏离最优化水平，给本计划的绩效带来风险。本计划对被投资基金的评估具有一定的主观性，将在基金投资决策中给本计划带来一定的不确定性的风险。被投资基金的波动会受到宏观经济环境、行业周期、基金经理管理能力和基金管理人自身经营状况等因素的影响。本计划坚持价值和长期投资理念，重视基金投资风险的防范，但是基于投资范围的规定，本计划无法完全规避基金市场、股票市场和债券市场的下跌风险。

11、其他特殊风险

（1）设立失败风险

推广期结束时，本集合计划受市场环境，或其他同业竞争的影响，募集规模可能未达到法律、法规规定或本合同约定的最低设立条件，导致本集合计划不能成立的风险。

（2）集合计划提前终止的风险

集合计划运作期间，当集合计划出现合同约定的情形或《投资顾问协议》提前终止或解聘、更换投资顾问的情形，导致委托人少于 2 人，或者其他本集合计划约定的提前终止情形出现时，导致集合计划提前终止的风险。。

（3）合同变更风险

管理人就合同变更征求委托人意见期间，未明确提出异议的委托人、不同意合同变更但逾期未提出退出申请的委托人均视为同意修改或变更合同和说明书。部分委托人可能因为未能提供有效的联系方法或者未能将变动后的联系方式及时通知管理人，而无法及时获知合同变更事项，如果委托人因上述情况未能按时退出本计划，可能会被视为同意合同变更，从而存在风险。

（4）使用电子签名合同的风险

本集合计划资产管理合同采用电子签名方式签署，所以在参与集合计划的过程当中，可能存在以下风险：

1）由于互联网和移动通讯网络数据传输等原因，交易指令可能会出现中断、停顿、延迟、数据错误等情况；

2）委托人账号及密码信息泄露或客户身份可能被仿冒；

3）由于互联网和移动通讯网络上存在黑客恶意攻击的可能性，网络服务器可能会出现故障及其他不可预测的因素，交易信息可能会出现错误或延迟；

4）委托人的网络终端设备及软件系统可能会受到非法攻击或病毒感染，导致电子签名合同数据无法传输或传输失败。

（5）管理人自有资金参与风险

管理人在本集合计划推广期间或存续期间以自有资金参与本集合计划。管理人持有计划份额与委托人持有计划份额享有同等参与收益分配的权利，也承担与委托人持有计划份额相对应损失的责任。管理人投入自有资金参与集合计划份额不承担任何补偿责任。

（6）可能无法通过份额转让退出的风险

资产管理计划合同并未强制要求管理人提供份额转让服务，管理人可能基于技术或其他原因不支持份额转让，委托人面临无法通过份额转让退出的风险。如果管理人决定本集合计划份额在中国证监会认可的交易平台开展转让交易，可能不具有一个活跃的转让市场，投资者面临无法通过转让退出或因流动性不足而折价卖出从而遭受损失的风险。

（7）延期清算的风险

若本集合计划在终止之日有未能流通变现的证券或其他资产，管理人可延期清算，如涉及投资的目标主体违约的，管理人需通过司法途径或其他方式向目标主体主张权利，可能导致延期清算时间较长，无法收回价款，投资者可能面临本集合计划资产长时间无法变现并分配、或最终无法变现并获得资金分配的风险。

（8）管理人调整集合计划业绩报酬计提基准的风险：在本集合计划存续期内，管理人有权根据集合计划运作情况对集合计划业绩报酬计提基准予以调整，调整结果将由管理人通过网站进行公告，管理人对集合计划业绩报酬计提基准的调整，可能会对投资者收益产生不利影响。

（二）一般风险揭示

1、本金损失风险

管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用资产管理计划财产，但不保证资产管理计划财产中的认（申）购资金本金不受损失，也不保证一定盈利以及最低收益。

2、市场风险

资产管理计划的投资品种价格因受经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素影响而引起的波动，导致收益水平变化产生的风险。主要包括：政策风险、经济周期风险、利率风险、购买力风险、再投资风险等。

（1）政策风险

货币政策、财政政策、产业政策等国家宏观经济政策或与业务相关的法律法规的变化对资本市场可能产生一定的影响，可能导致市场价格波动或交易、担保物处置受限等，从而使资产管理计划的委托资产及其收益面临收益下降或本金损失的风险。

（2）经济周期风险

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

（3）利率风险

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

（4）购买力风险

委托人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，从而使委托人的实际收益下降。

（5）再投资风险

集合计划存续期间，集合计划资金需进行再投资的，存在因管理人交易额度不足等原因，导致集合计划未能及时完成新的投资项目再投资的风险，进而导致集合计划收益下降、委托人需提前赎回份额等风险。

3、管理风险

资产管理计划运作过程中，管理人依据资产管理合同约定管理和运用资产管理计划财产所产生的风险，由资产管理计划财产以及投资者承担。

4、流动性风险

资产管理计划因市场整体或投资品种流动性不足、应付可能出现的投资者巨额退出或者大额退出等原因，不能迅速转变成现金，或者转变成现金会对资产价格造成重大不利影响的风险。

5、信用风险

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

6、税收风险

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。

7、其他风险

包括但不限于技术风险和操作风险、发生不可抗力事件的风险等。

（1）技术风险：可能由于技术系统的故障影响交易的正常进行，从而导致委托人的利益受影响。

（2）操作风险：操作风险是指那些由于不合理的内部程序，人为造成的或者是系统性的，由外部事件引发损失的风险。

（3）资金前端控制风险

本计划按证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的要求，将对资金前端控制的额度进行设置，买入申报金额不符合资金前端控制相关额度限制的，证券交易所可能拒绝接受买入申报，造成交易失败，从而导致本计划资产受损的风险；或因资金前端控制异常情况及证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司采取的相关应措施也可能造成本计划资产损失。

（4）发生不可抗力事件的风险：包括但不限于洪水、地震及其他自然灾害、战争、骚乱、火灾、政府征用、没收、法律法规变化、突发停电或其他突发事件、证券交易所或登记结算机构非正常暂停或停止交易、银行发生信用危机或破产倒闭等不可抗力因素的出现，将严重影响金融市场的正常运行，可能影响本集合计划的申购，赎回、投资等的正常进行，可能导致本集合计划收益降低，极端情况下甚至本金损失。对于由不可抗力风险所导致的任何损失，由投资者自行承担，管理人对此不承担任何责任。

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

（6）委托人可能无法参与的风险：由于本集合计划设定了推广期及存续期的人数上限，因此委托人可能面临着因上述原因而无法参与本集合计划的风险。

（7）信息传递风险：管理人按照管理合同有关“信息披露”的约定，进行本集合计划的信息披露。委托人应根据“信息披露”的约定及时进行查询。如委托人未及时查询，或由于通讯故障、系统故障以及其他不可抗力等因素的影响使委托人无法及时了解集合计划信息，并影响委托人的投资决策（包括但不限于申购、赎回本集合计划等），因而产生的责任和风险由委托人自行承担。委托人预留在管理人的联系方式应真实有效，有效联系方式变更的，应及时通

知管理人，如委托人未及时告知管理人联系方式变更的，管理人将可能在需要联系委托人时无法及时联系上，并可能会由此影响委托人的投资决策，由此而产生的责任和风险由委托人自行承担。

（8）其他不可预知、不可防范的风险。

第二十五章 资产管理合同的变更、终止与财产清算

（一）资产管理合同的变更

1、因监管规则变化需要变更资产管理合同的，经管理人与托管人协商一致，可以对资产管理合同内容进行变更，并由管理人以管理人网站公告形式及时向委托人披露变更的具体内容。具体变更的内容在管理人网站公告满 3 个工作日后生效。委托人对变更的内容有异议，可在变更内容生效前按照本合同的约定申请退出本集合计划。

2、全体投资者、管理人和托管人协商一致后，可以对资产管理合同内容进行变更，资产管理合同另有约定的除外。除监管规则变化以外的原因需要变更合同的，管理人和托管人应书面达成一致，并在管理人网站公告合同变更，通过管理人网站公告或者电子邮件等其他适当方式向委托人发送合同变更征询意见。委托人不同意变更的，应在征询意见指定的日期内提出退出本集合计划的申请；委托人未在前述时间回复意见的或者回复不同意合同变更但逾期未退出的，均视为委托人同意合同变更。资产管理计划改变投向和比例的，应当事先取得委托人同意。

3、资产管理合同变更生效日期以管理人公告为准，对本合同各方均具有法律效力。本合同变更生效之日起，变更后的内容即成为本合同组成部分。委托人退出本集合计划后，其对本合同补充或修改的异议将不影响本合同的变更。委托人同意，无论其是否提出退出申请，管理人变更本合同的行为均不应被视为或裁定为管理人的违约行为。

资产管理计划改变投向和比例的，应当事先取得委托人同意。委托人在此同意并授权管理人可以变更资产管理计划投向和比例，具体遵照本款前述合同变更流程执行。虽有上述约定，如监管机构对改变投向和比例事项另有规定或指导意见的，管理人将依据监管机构要求执行。

合同变更后，委托人、管理人和托管人应当按照变更后的合同行使相关权利，履行相应义务。

4、管理人、托管人及委托人也可通过签署补充协议的方式变更本合同。

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

6、管理人或托管人变更情况

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，资产管理计划由其他管理人承接的，经原管理人、新管理人、托管人、委托人协商一致后通过签署协议形式变更合同，并以管理人官网公告形式告知委托人。管理人变更后，委托人、新管理人和托管人应当按照变更后的合同行使相关权利，履行相应义务。

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，资产管理计划由其他托管人承接的，经原托管人、新托管人、管理人协商一致后通过签署协议形式变更托管人，并以管理人官网公告形式告知委托人。托管人变更后，委托人、新托管人和管理人应当按照变更后的合同行使相关权利，履行相应义务。

7、资产管理合同发生变更的，管理人应当自资产管理合同变更之日起 5 个工作日内报证券投资基金业协会备案。

（二）资管计划的展期

1、资产管理计划展期应符合以下条件：

（1）在存续期间，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委托人利益的情形；

（3）符合资产管理计划的成立条件；

（4）中国证监会规定的其他条件。

2、展期的程序与期限

展期的程序：本集合计划原存续期届满前，管理人可以决定到期清算终止或展期继续管理本集合计划。本集合计划拟展期的，管理人应当在计划存续期届满前 1 个月征询托管人是否同意继续托管展期后的集合计划资产。在获得托

管人同意后，管理人可开展本集合计划展期准备事宜，通过公告等形式通知委托人展期安排，并按照资产管理合同的约定进行展期。

展期的期限：管理人可以决定展期的期限，并以公告形式通知委托人，具体期限以管理人公告为准。

3、展期的安排

（1）通知展期的时间

管理人在获得托管人同意继续托管展期后的集合计划资产的意见后的 5 个工作日内在管理人网站进行公告，对集合计划展期事宜进行说明。

（2）通知展期的方式

管理人决定展期的，将在管理人网站进行公告，管理人须在公告后十五个工作日内以书面或电子方式向委托人发送展期征询意见。

（3）委托人反馈意见的方式

不同意展期的委托人，应在原存续期届满前通过推广机构办理退出手续；未在原存续期届满前办理退出手续的，视为同意展期。

4、委托人不同意展期的处理办法

管理人应对不同意展期的委托人退出事宜作出公平、合理安排。

具体措施包括：

不同意展期的委托人，可以在原存续期届满前通过推广机构办理退出手续。未在原存续期届满前办理退出手续的，视为同意展期，具体办理要求和相关事项以管理人公告为准。

5、展期的实现

同意本集合计划展期的委托人的人数不少于 2 人，且原存续期届满日符合展期条件的，本集合计划在原存续期届满日的次日实现展期，否则本集合计划不能展期；若本集合计划在原存续期届满日有未能流通变现的证券，同意展期的委托人需同意继续持有该未能流通变现的证券，且同意展期的委托人持有的集合计划资产净值不低于本集合计划未能流通变现证券资产规模，且原存续期届满日符合展期条件的，本集合计划在原存续期届满日的次日实现展期，否则本集合计划不能展期；本集合计划可以连续展期，且展期次数不限。

管理人应在展期后 5 个工作日内将展期情况报中国证券投资基金业协会备

案。

（三）资产管理计划的终止

1、本集合计划终止（含提前终止）的情形包括下列事项：

（1）资产管理计划存续期届满且不展期；

（2）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6个月内没有新的管理人承接；

（3）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6个月内没有新的托管人承接；

（4）经全体投资者、管理人和托管人协商一致决定终止；

（5）持续5个工作日投资者少于2人；

（6）份额持有人大会（如有）决定提前终止；

（7）未在证券投资基金业协会完成备案的情形；

（8）不可抗力的发生导致本集合计划不能存续；

（9）存续期间，本计划资产总规模低于本计划成立规模的，管理人有权决定提前终止本计划；

（10)委托人提出退出申请且一旦退出申请确认将使集合计划委托人少于2人时，管理人有权拒绝该等退出申请并提前终止集合计划；

（11）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5个工作日内报证券投资基金业协会备案，前述第（7）项约定的情形除外。

若管理人解聘投资顾问或《投资顾问协议》提前终止，管理人将继续主动管理本计划，并保留投资者选择退出的权利。

2、集合计划的清算

资产管理计划在发生终止情形之日起5个工作日内，管理人开始组织清算资产管理计划财产。

（1）财产清算组的成员及职责

资产管理计划财产清算小组（下称“清算小组”）成员由管理人和托管人组成。清算小组可以聘用必要的工作人员。清算小组按照监管机构的相关规定进行集合计划清算。

清算小组负责资产管理计划财产的保管、清理、估价、变现和分配。清算小组可以依法进行必要的民事活动。清算过程中的有关重大事项应当及时公布。

（2）财产清算的程序：

A、本合同约定终止情形出现时，由清算小组统一接管计划；

B、对计划财产和债权债务进行清理和确认；

C、对计划财产进行估值和变现；

D、制作清算报告；

E、聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计（如需要）；

F、将清算报告报相关监管部门备案并公告；

G、对计划剩余财产进行分配。

（3）清算费用的内容及支付方式

清算费用是指清算小组在进行资产管理计划清算过程中发生的合理费用，清算费用由清算小组优先从集合计划财产中支付，清算费用包括但不限于：

A、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；

B、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；

C、信息披露所发生的费用；

D、诉讼、仲裁、保全等维护计划委托财产利益所发生的费用；

E、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）财产清算剩余资产的分配

清算结束后 15 个工作日内，清算小组应当将计划财产清算后的全部剩余资产在扣除集合计划财产清算费用及各项负债后，将集合计划剩余资产按照委托人拥有集合计划份额的比例或集合资产管理合同的约定以货币资金的形式或中国证监会允许的其他方式全部分派给委托人。管理人应当在本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。清算结束后 15 个工作日内由清算小组在管理人网站或按照本合同约定的其他信息披露方式向委托人披露财产清算报告。委托人在此同意，除非法律法规或监管部门另有要求，清算报告不再另行审计。

（5）延期清算的处理方式

若本集合计划在终止之日有未能流通变现的财产，管理人可延期清算，并

对此制定二次清算或多次清算方案，该方案应经托管人认可，并通过管理人网站或按照本合同约定的其他信息披露方式进行披露。管理人应根据二次清算或多次清算方案的规定，对前述未能流通变现的财产在可流通变现后进行清算变现，并将变现后的资产按照本合同约定分配给委托人。发生延期清算的，管理人有权视情况对已变现资产做多次分配。

资产管理计划因受托资产流动性受限等原因延期清算的，管理人应当及时向管理人住所地中国证监会相关派出机构报告。

（6）财产清算报告的告知安排

财产清算报告在管理人官网披露，同时在清算结束后 5 个工作日内报送证券投资基金业协会。

（7）资产管理计划财产清算完毕后，管理人注销集合计划专用证券账户和资金账户等相关账户；托管人按照规定注销资产管理计划财产的托管账户等投资所需账户，管理人应当给予必要的配合。

（8）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。

第二十六章 违约责任

1、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。管理人或托管人任一方不因另一方的行为而给集合计划财产或委托人造成的损失向委托人承担连带责任。发生下列情况的，当事人可以免责：

（1）不可抗力

一方因不可抗力不能履行本合同时，应及时通知另一方，并在合理期限内提供受到不可抗力影响的证明，同时采取适当措施防止集合计划资产损失扩大。任何一方当事人延迟履行合同义务后，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）计算机系统故障、网络故障、通讯故障、电力故障、计算机病毒攻击及其它非资产管理人、资产托管人故意造成的意外事故。

（3）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。

（4）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。

（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）因证券市场波动、上市公司合并、集合计划财产规模变动等管理人之外的因素致使集合计划财产投资不符合本合同项下约定的投资策略、比例的，将不视为管理人的违约行为。

（7）管理人、托管人因所引用的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所引起的损失。

（8）投资者的债权人通过司法机关对集合计划财产采取强制措施，由此造成集合计划财产损失的，管理人和托管人免责。

2、资产管理合同当事人违反本合同，应当承担违约责任；给合同其他当事人造成损失的，应当承担赔偿责任。本合同能够继续履行的应当继续履行。

3、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。

4、**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委托人损失，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。

5、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。

6、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。

第二十七章 争议的处理

因履行本合同发生的争议，由协议签订各方协商解决，协商不成的，本合同各方一致同意将争议提交深圳国际仲裁院并按其仲裁规则进行仲裁，仲裁地点在深圳。除提交仲裁的争议之外，各方当事人仍应履行本协议的其他规定。本合同的订立、效力、解释、履行、争议的解决均适用于中华人民共和国法律。

争议处理期间，管理人和托管人应各自继续忠实、勤勉、尽责地履行相应义务，不得以争议为由损害委托人的合法权益。

第二十八章 资产管理合同的效力

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。

（一）资产管理合同签署的方式：电子合同和纸质合同

委托人为法人的，资产管理合同自委托人、管理人和托管人加盖公章或合同专用章以及各方法定代表人或授权代表/负责人签字或盖章之日起成立；委托人为自然人的，资产管理合同自委托人本人签字、管理人和托管人加盖公章或合同专用章以及双方法定代表人或授权代表/负责人签字或盖章之日起成立。

（二）资产管理合同的生效条件

本合同成立后，同时满足以下条件时生效：

1、委托人参与资金实际交付并确认；

2、本集合计划公告成立。

资产管理合同自生效之日起对委托人、管理人、托管人具有同等的法律约束力。本集合计划终止，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。

（三）投资者成为资产管理合同当事人的条件

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。

（四）合同的组成

《东亚前海证券泓海 1 号集合资产管理计划说明书》、《东亚前海证券泓海 1 号集合资产管理计划风险揭示书》、经管理人确认有效的委托人参与、退出本

集合计划的申请材料和推广机构出具的集合计划参与、退出业务受理有关凭证等为本合同的附件，是本合同不可分割的一部分，与本合同具有同等法律效力。

第二十九章 其他事项

（一）反商业贿赂及廉洁从业

根据《证券期货经营机构及其工作人员廉洁从业规定》《证券经营机构及其工作人员廉洁从业实施细则》《关于加强注册制下中介机构廉洁从业监管的意见》等监管规定，本合同各方当事人应当遵守廉洁从业规定，不得输送或谋取不正当利益，并遵守以下反商业贿赂及廉洁从业的约定：

1、本合同各方当事人在开展业务和履行职务过程中，均应严格遵守所适用的税收、反商业贿赂、反洗钱、廉洁从业方面的法律规定以及行业普遍遵守的职业道德和行为准则。

2、本合同各方当事人及其工作人员（如有）均不得利用职务便利向其他方及其工作人员索要、收受、提供、给予本合同约定以外的任何利益，既包括金钱利益和实物利益，也包括可以用金钱衡量的财产性利益。

如本合同一方违反上述约定，守约方有权要求违约方承担相应的违约责任，违约方应赔偿守约方因此遭受的损失。

若委托人、托管人发现东亚前海证券有限责任公司员工有违反廉洁从业规定的情形，请及时向东亚前海证券有限责任公司反映，监督电话：4008-158-158，举报邮箱：jubao@easec.com.cn。

（二）本合同所称的其他事件是指，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。

委托人在此同意，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本条上一款所述的从事资产管理业务的公司，并无须就此项变更和委托人、托管人另行签订专项协议。但在转让前管理人应通知委托人及托管人，并在届时的通知中对相关事项作出合理安排。

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

管理人应按照监管机构的要求办理转让手续。

（三）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；管理人、托管人承诺对上述个人信息的处理合法合规，其他方亦已知悉其享有《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，该方承诺已告知并获得相关个人同意向另一方提供个人信息，且个人已知晓个人信息的使用用途。

第三十章 反虚假宣传条款

各方当事人均清楚并愿意严格遵守中华人民共和国《著作权法》、《商标法》、《专利法》、《反不正当竞争法》等知识产权类、合同法及广告法等相关法律的规定，各方当事人均有权就本合同所约定事项以约定方式在约定范围内进行真实、合理的使用或宣传，但不得涉及合同所约定的保密内容。

为避免商标侵权及不当宣传等风险的发生，各方当事人均同意，在使用对方的商标、品牌、企业名称等进行宣传前，均须获得对方事先的书面认可，否则，不得进行此类使用或宣传。

各方当事人在此承诺，会积极响应对方提出的就合作事项的合理使用或宣传申请。

各方当事人均承认，未经对方事先书面同意而利用其商标、品牌及企业名称等进行商业宣传；虚构合作事项；夸大合作范围、内容、效果、规模、程度等，均属对本合同的违反，并可能因虚假宣传构成不正当竞争，守约方或被侵权人将保留追究相应法律责任的权利。

管理人确认，已向委托人明确说明集合计划的风险，不保证委托人资产本金不受损失或取得最低收益；委托人确认，已充分理解本合同的内容，自行承担投资风险和损失。

本合同应由委托人本人签署，当委托人为机构时，应由法定代表人或其授权代表签署并加盖公章或合同专用章。

本合同一式肆份，当事人各执壹份，剩余壹份用于管理人按照监管要求报备相关机构，每份均具有同等法律效力。

（以下无正文）

（本页为《东亚前海证券泓海1号集合资产管理计划资产管理合同》签署页）

委托人：　　（公章/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

管理人（盖章）：东亚前海证券有限责任公司（公章/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：2024 年 12 月 16 日

托管人（盖章）：兴业银行股份有限公司（公章/合同专用章）

法定代表人/负责人（或授权代表）签字或盖章：

签署日期：2024 -12- 16

附件一：风险揭示书

东亚前海证券泓海 1 号集合资产管理计划
风险揭示书

管理人：东亚前海证券有限责任公司

托管人：兴业银行股份有限公司

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等文件，充分认识本资产管理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。

本计划属于[R4]风险投资品种，适合风险识别、评估、承受能力[相应评级水平]的合格投资者。根据有关法律法规，管理人[东亚前海证券有限责任公司]及投资者分别作出如下承诺、风险揭示及声明：

一、资产管理人声明与承诺

（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“协会”）办理资产管理计划备案不作为对资产管理计划财产安全和投资者收益的保证，也不表明协会对备案材料的真实性、准确性、完整性作出保证。

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

（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

集合计划可能面临的风险包括但不限于以下风险：

（一）特殊风险揭示

1、本集合计划聘请投资顾问所涉风险

1）管理人在聘用第三方机构为集合资产管理计划提供投资决策相关专业服务时，必须确保第三方机构具有合法资质。管理人可能存在相关制度不健全，遴选规程不完善的情况从而给集合计划带来损失的风险。

2）管理人在聘用投资顾问时，可能存在双方的权利、义务、责任约定不明确，导致可能发生与集合计划相关的争议纠纷的风险。

3）管理人或投资顾问可能存在利益冲突防范机制不健全的情况，导致集合计划与投资顾问及其管理的其他产品之间发生利益输送等违法违规行为。

4）投资顾问的投资建议能力及风险管理水平可能对本集合计划的业绩表现造成实质性影响，本集合计划存在因管理人采纳投资顾问的投资建议从而导致投资损失或信用风险增加的风险。

5）发生可解聘投资顾问的情形或其他提前终止《投资顾问协议》的情形时，委托人面临因投资顾问服务终止而使得集合计划业绩受到不利影响，甚至集合计划提前终止的风险。

2、无法按意愿退出的风险

1）本集合计划份额锁定期设置相关风险

份额持有人参与本计划自参与（包括推广期参与、存续期参与）申请确认成功之日起【3 个月（不含）】内不得退出。委托人面临在份额锁定期内无法退出的风险。

2）巨额退出风险

根据资产管理计划合同约定，单个开放日，委托人当日累计净退出申请份额（退出申请总份额扣除参与申请总份额之后的余额）超过上一工作日计划总份额数 10%时，即为巨额退出。如发生巨额退出时，管理人可以根据本集合计划当时的资产组合状况决定全额退出、部分顺延退出，委托人面临无法按意愿退出的风险。

3）大额退出风险

根据资产管理计划合同约定，单个委托人在本集合计划单个退出开放日一次退出份额达到或超过 500 万份（含）则构成大额退出，发生大额退出的，委托人应在退出日的前 3 个工作日提出预约，否则管理人有权拒绝其退出申请，委托人如构成大额退出且未按约定在退出日的前 3 个工作日提出预约，则面临无法按意愿退出的风险。

3、本集合计划合同与证券投资基金业协会发布的合同指引（下称“《合同指引》”）不一致所涉风险

本集合计划合同依据《合同指引》及相关法律法规制定，根据管理人自身实际情况对相关内容做出了适当的调整。本集合计划合同中对《合同指引》规定内容之外的部分事项进行约定，也可能存在个别内容与《合同指引》不完全一致，或不适用《合同指引》中个别规定的情形，从而可能面临本合同被中国基金业协会要求管理人重新修订完善的风险。管理人将及时根据中国基金业协会的要求提交说明材料，如涉及委托人相关权利义务的，管理人及时在指定网站进行信息披露，相关内容以披露的信息为准。

4、资产管理计划委托募集所涉风险

本计划通过推广机构（管理人和管理人委托的其他符合相应资格条件的代销机构）进行募集，管理人可以根据情况增加或减少代销机构。

若代销机构不具备提供相关服务的条件和技能、或发生管理不善、操作失误等，或存在违法违规地公开宣传、虚假宣传、以保本保收益引诱投资者购买、未能履行投资者适当性审查工作、挪用侵占产品财产等行为，将导致委托人合法权益受损的风险。

5、募集失败所涉风险

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

管理人的责任承担方式：

1）以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用；

2）在资产管理计划募集期限届满（确认资产管理计划无法成立）后三十日内返还投资者已交纳的款项，并加计银行同期活期存款利息。

6、未在协会完成备案手续所涉风险

本计划在证券投资基金业协会备案完成前无法进行投资操作（法律法规允许的现金管理除外），因备案所需时间无法准确预估且委托人在此期间无法及时退出其投资本金，本计划及委托人均存在备案期间错失投资机会的风险。

本计划存在管理人未在合同约定期限内到中国证券投资基金业协会办理相关备案手续或未能成功通过备案导致计划提前终止的风险。

若管理人放弃本计划备案或本计划未能成功通过备案，且管理人决定终止时，本计划相应终止，具体终止流程参见资产管理合同终止清算相关章节。

7、未设置份额持有人大会所涉风险

本集合计划不设置份额持有人大会及日常机构，委托人面临无法参与份额持有人大会的风险。本计划不设置份额持有人大会可能存在以下风险：

1）投资者权益保障不足：份额持有人大会是投资者行使权利、参与决策的重要机制。不设置份额持有人大会，投资者的意见和诉求可能无法得到充分表达和考虑，从而导致投资者权益受损。

2）决策过程可能缺乏透明度：在不设置份额持有人大会的情况下，集合资产管理计划的重大决策可能只能由管理人单方面做出。这可能导致决策过程缺乏透明度，甚至可能引发投资者对管理人的不信任。

3）投资者沟通不畅：份额持有人大会为投资者提供了一个与管理人和其他投资者沟通的平台。不设置份额持有人大会，投资者之间的沟通可能变得不畅，不利于信息的传递和共享。

8、从事重大关联交易、一般关联交易所涉风险

1）对于重大关联交易的特别风险提示：虽然管理人积极遵循投资者利益优先的原则，对该等交易安排根据公司内部审批机制和评估机制进行事前内部审查，并事前采取逐笔征求意见或公告确认的等方式取得投资者的同意，但仍可能存在因管理人关联交易定价、关联交易审批程序而引起的风险，在此提示投资者特别注意。

2）对于一般关联交易的特别风险提示：虽然管理人设置了重大关联交易与一般关联交易的划分标准，并根据重要性原则采取分层管理，但仍可能因管理人针对一般关联交易在本合同采用事先统一授权同意模式、存在投资者未被逐笔征询意见并在发生一般关联交易时无法及时退出本计划而引起的风险，在此提示投资者特别注意。

委托人同意并授权管理人可以将本计划资产从事一般关联交易，但管理人应当遵守法律、行政法规、中国证监会的规定和合同约定，并遵守管理人内部制度审批流程的规定。管理人根据监管规则的规定和本计划合同的约定履行一般关联交易的信息披露及报告的义务，同时事先向委托人充分披露了关联方范围、一般关联人和重大关联交易的区分标准、关联交易审批等内部管控机制等内容。虽然管理人履行了前述义务，但关联交易有可能因为交易对手方、交易价格、交易资产等问题，而发生交易风险；管理人运用计划财产从事关联交易时可能依照相关法律法规、监管机构、自律组织的规定被限制相关权利的行使，也可能影响受托资产的投资收益。

9、投资标的风险

1）期货投资风险

a、流动性风险：本计划所投资产管理产品在期货市场成交不活跃时，可能在建仓和平仓期货时面临交易价格或者交易数量上的风险。

b、基差风险：基差是指现货价格与期货价格之间的差额。若本计划所投资产管理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，则可能对本计划所投资产管理产品的投资产生影响，从而可能对本计划产生影响。

c、合约展期风险：本计划所投资产管理产品所投资的期货合约主要包括期货当月和近月合约。当本计划所投资产管理产品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。

d、期货保证金不足风险：由于期货价格朝不利方向变动，导致期货账户的资金低于期货交易所或者期货经纪商的最低保证金要求，如果不能及时补充保证金，期货头寸将被强行平仓，导致无法规避对冲系统性风险，直接影响本计划所投资产管理产品收益水平，从而产生风险。

e、杠杆风险：期货作为金融衍生品，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，本计划所投资产管理产品可能承受超出保证金甚至计划资产本金损失的风险，从而可能对本计划产生影响。

f.市场风险：期货合约的价格受多种因素影响，如供需关系、宏观经济状况、政治事件、自然因素等，这些因素可能导致价格剧烈波动，从而可能对本计划产生影响。

2）债券投资特定风险

债券等固定收益类品种除存在上述市场风险、信用风险和流动性风险等外，还存在其自身的特定风险，包括：

a、再投资风险：债券偿付本息后以及回购到期后可能由于市场利率的下降面临资金再投资的收益率低于原来利率。

b、债券回购风险：债券回购为提升整体投资组合收益提供了可能，其主要风险包括信用风险、投资风险及波动性加大的风险，其中，信用风险指回购交易中交易对手在回购到期时，不能偿还全部或部分证券或价款，

造成资产净值损失的风险；投资风险是指在进行回购操作时，回购利率大于债券投资收益而导致的风险以及由于回购操作导致投资总量放大，致使整个投资组合风险放大的风险；而波动性加大的风险是指在进行回购操作时，在对投资组合收益进行放大的同时，也对投资组合的波动性（标准差）进行了放大，即投资组合的风险将会加大。回购比例越高，风险暴露程度也就越高，对资产净值造成损失的可能性也就越大。

c、发行主体的风险：集合计划在交易过程中可能发生交收违约或者所投资债券的发行人倒闭、信用评级被降低、违约、拒绝支付到期本息的情况，从而导致集合计划财产损失。

3）资产支持证券、资产支持票据、项目收益票据投资的风险

资产支持证券、资产支持票据、项目收益票据中的基础资产信用风险主要来自于基础资产质量上。主要体现为原始权益人不能按时或不能对基础资产进行清偿，使得委托人可能无法获得约定的投资收益。

由于基础资产债务人有提前偿还债务的权利，一旦提前还款，也会对委托人的收益产生较大的影响。此外，由于其本身具有复杂性和创新性，同时各类资产的特性、信用增级方式、市场利率变化等因素，可能造成兑付、逾期等投资风险。

4）可转换债券、可交换债券投资的风险

可转换债券、可交换债券的投资存在波动性风险，具体表现为可转换债券、可交换债券的价格受到其相对应股票价格波动的影响，同时可转换债券、可交换债券还有信用风险和转股风险。转股风险指相对应股票价格跌破转股价，不能获得转股收益，从而无法弥补当初付出的转股期权价值。

5）股票投资风险

a、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，导致证券市场价格水平波动的风险。

b、宏观经济运行周期性波动，对证券市场的收益水平产生影响的风险。

c、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。

d、本产品股票投资范围包括新股申购，存在新股上市后股价跌破发行价而导致产品亏损的风险。同时若新股申购过程中出现实际中获配数量超过本计划可支付头寸的情况时，根据本合同约定委托人存在必须及时追加委托财产的流动性风险。

6）证券投资基金风险

本计划可投资于经中国证监会依法核准或注册的公开募集的证券投资基金，存在大类资产配置风险，有可能受到经济周期、市场环境或管理人对市场所处的经济周期和产业周期的判断不足等因素的影响，导致本计划的大类资产配置比例偏离最优化水平，给本计划的绩效带来风险。本计划对被投资基金的评估具有一定的主观性，将在基金投资决策中给本计划带来一定的不确定性的风险。被投资基金的波动会受到宏观经济环境、行业周期、基金经理管理能力和基金管理人自身经营状况等因素的影响。本计划坚持价值和长期投资理念，重视基金投资风险的防范，但是基于投资范围的规定，本计划无法完全规避基金市场、股票市场和债券市场的下跌风险。

10、其他特殊风险

（1）设立失败风险

推广期结束时，本集合计划受市场环境，或其他同业竞争的影响，募集规模可能未达到法律、法规规定或本合同约定的最低设立条件，导致本集合计划不能成立的风险。

（2）集合计划提前终止的风险

集合计划运作期间，当集合计划出现合同约定的情形或《投资顾问协议》提前终止或解聘、更换投资顾问的情形，导致委托人少于 2 人，或者其他本集合计划约定的提前终止情形出现时，导致集合计划提前终止的风险。

（3）合同变更风险

管理人就合同变更征求委托人意见期间，未明确提出异议的委托人、不同意合同变更但逾期未提出退出申请的委托人均视为同意修改或变更合同和说明书。部分委托人可能因为未能提供有效的联系方法或者未能将变动后的联系方式及时通知管理人，而无法及时获知合同变更事项，如果委托人因上述情况未能按时退出本计划，可能会被视为同意合同变更，从而存在风险。

（4）使用电子签名合同的风险

本集合计划资产管理合同采用电子签名方式签署，所以在参与集合计划的过程当中，可能存在以下风险：

1）由于互联网和移动通讯网络数据传输等原因，交易指令可能会出现中断、停顿、延迟、数据错误等情况；

2）委托人账号及密码信息泄露或客户身份可能被仿冒；

3）由于互联网和移动通讯网络上存在黑客恶意攻击的可能性，网络服务器可能会出现故障及其他不可预测的因素，交易信息可能会出现错误或延迟；

4）委托人的网络终端设备及软件系统可能会受到非法攻击或病毒感染，导致电子签名合同数据无法传输或传输失败。

（5）管理人自有资金参与风险

管理人在本集合计划推广期间或存续期间以自有资金参与本集合计划。管理人持有计划份额与委托人持有计划份额享有同等参与收益分配的权利，也承担与委托人持有计划份额相对应损失的责任。管理人投入自有资金参与集合计划份额不承担任何补偿责任。

（6）可能无法通过份额转让退出的风险

资产管理计划合同并未强制要求管理人提供份额转让服务，管理人可能基于技术或其他原因不支持份额转让，委托人面临无法通过份额转让退出的风险。如果管理人决定本集合计划份额在中国证监会认可的交易平台开展转让交易，可能不具有一个活跃的转让市场，投资者面临无法通过转让退出或因流动性不足而折价卖出从而遭受损失的风险。

（7）延期清算的风险

若本集合计划在终止之日有未能流通变现的证券或其他资产，管理人可延期清算，如涉及投资的目标主体违约的，管理人需通过司法途径或其他方式向目标主体主张权利，可能导致延期清算时间较长，无法收回价款，投资者可能面临本集合计划资产长时间无法变现并分配、或最终无法变现并获得资金分配的风险。

（8）管理人调整集合计划业绩报酬计提基准的风险：在本集合计划存续期内，管理人有权根据集合计划运作情况对集合计划业绩报酬计提基准予以调整，调整结果将由管理人通过网站进行公告。管理人对集合计划业绩报酬计提基准的调整，可能会对投资者收益产生不利影响。

（二）一般风险揭示

1、本金损失风险

管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用资产管理计划财产，但不保证资产管理计划财产中的认（申）购资金本金不受损失，也不保证一定盈利以及最低收益。

2、市场风险

资产管理计划的投资品种价格因受经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素影响而引起的波动，导致收益水平变化产生的风险。主要包括：政策风险、经济周期风险、利率风险、购买力风险、再投资风险等。

（1）政策风险

货币政策、财政政策、产业政策等国家宏观经济政策或与业务相关的法律法规的变化对资本市场可能产生一定的影响，可能导致市场价格波动或交易、担保物处置受限等，从而使资产管理计划的委托资产及其收益面临收益下降或本金损失的风险。

（2）经济周期风险

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

（3）利率风险

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

（4）购买力风险

委托人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，从而使委托人的实际收益下降。

（5）再投资风险

集合计划存续期间，集合计划资金需进行再投资的，存在因管理人交易额度不足等原因，导致集合计划未能及时完成新的投资项目再投资的风险，进而导致集合计划收益下降、委托人需提前赎回份额等风险。

3、管理风险

资产管理计划运作过程中，管理人依据资产管理合同约定管理和运用资产管理计划财产所产生的风险，由资产管理计划财产以及投资者承担。

4、流动性风险

资产管理计划因市场整体或投资品种流动性不足、应付可能出现的投资者巨额退出或者大额退出等原因，不能迅速转变成现金，或者转变成现金会对资产价格造成重大不利影响的风险。

5、信用风险

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

6、税收风险

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。

7、其他风险

包括但不限于技术风险和操作风险、发生不可抗力事件的风险等。

（1）技术风险：可能由于技术系统的故障影响交易的正常进行，从而导致委托人的利益受影响。

（2）操作风险：操作风险是指那些由于不合理的内部程序，人为造成的或者是系统性的，由外部事件引发损失的风险。

（3）资金前端控制风险

本计划按证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的要求，将对资金前端控制的额度进行设置，买入申报金额不符合资金前端控制相关额度限制的，证券交易所可能拒绝接受买入申报，造成交易失败，从而导致本计划资产受损的风险；或因资金前端控制异常情况及证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司采取的相关应措施也可能造成本计划资产损失。

（4）发生不可抗力事件的风险：包括但不限于洪水、地震及其他自然灾害、战争、骚乱、火灾、政府征用、没收、法律法规变化、突发停电或其他突发事件、证券交易所或登记结算机构非正常暂停或停止交易、银行发生信用危机或破产倒闭等不可抗力因素的出现，将严重影响金融市场的

正常运行，可能影响本集合计划的申购，赎回、投资等的正常进行，可能导致本集合计划收益降低，极端情况下甚至本金损失。对于由不可抗力风险所导致的任何损失，由投资者自行承担，管理人对此不承担任何责任。

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

（6）委托人可能无法参与的风险：由于本集合计划设定了推广期及存续期的人数上限，因此委托人可能面临着因上述原因而无法参与本集合计划的风险。

（7）信息传递风险：管理人按照管理合同有关“信息披露”的约定，进行本集合计划的信息披露。委托人应根据“信息披露”的约定及时进行查询。如委托人未及时查询，或由于通讯故障、系统故障以及其他不可抗力等因素的影响使委托人无法及时了解集合计划信息，并影响委托人的投资决策（包括但不限于申购、赎回本集合计划等），因而产生的责任和风险由委托人自行承担。委托人预留在管理人的联系方式应真实有效，有效联系方式变更的，应及时通知管理人，如委托人未及时告知管理人联系方式变更的，管理人将可能在需要联系委托人时无法及时联系上，并可能会由此影响委托人的投资决策，由此而产生的责任和风险由委托人自行承担。

（8）其他不可预知、不可防范的风险。

三、投资者声明与承诺

作为资产管理计划的投资者，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。如本人/机构为非产品投资者，承诺投资资金为自有资金，资金来源合法，不存在非法汇集他人资金等情况。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）其内容的真实和准确：

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有关“当事人及权利义务”章节中的所有内容，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有关“资产管理计划的投资”章节中的所有内容，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有关“服务机构与投资顾问”章节中的所有内容及风险揭示书中有关投资顾问的特殊风险揭示，并愿意自行承担购买资产管理计划的法律责任。【____】

8.本人/机构已认真阅读并完全理解资产管理合同有关“资产管理计划的费用与税收” 章节中的所有内容。【____】

9.本人/机构已认真阅读并完全理解资产管理合同有关 “争议的处理“章节中的所有内容。【____】

10.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。【____】

11.本人/机构知晓，中国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。【____】

12.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。【____】

13.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。【____】

14.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：2024.12.16

销售机构经办人（签字）[集合资产管理计划适用]：

日期：

附件二：授权通知书样本

授权通知书样本

兴业银行资产托管部：

我公司将于_____年____月___ 日正式启用此份运营授权书，该授权书适用于我公司管理的由贵行托管的【　　】集合资产管理计划，签字及印章样本如下：

文件类型	审核签发人员	预留业务公章
付款指令/收款通知	（A）签字或样章	
	（B）签字或样章	
核算估值结果/会计处理事项/其他事项	（A）签字或样章	
	（B）签字或样章	
密押公式（可选）		

贵行凭此签字及印章审核我公司的划款指令及托管运营相关的其他业务文书的有效性。如有更改，我公司将另行通知。

【　　】公司

年　月　日

附件三：划款指令信息

划款指令信息

东亚前海证券有限责任公司泓海 1 号集合资产管理计划划款指令__专用表

申请时间： 年 月 日　　编号： 年第 号

产品名称： 泓海 1 号集合资产管理计划

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。	
到账时间： 年 月 日	
付款户名：	收款户名：
付款账号：	收款账号：
开户行：	开户行：
大额支付行号：	大额支付行号：
划款金额（小写）：￥ 元	划款金额（大写）：人民币：
资金用途：	
备注：	
管理人经办人： 管理人复核人： 管理人签发人： 管理人预留印鉴盖章处：	托管人经办人： 托管人复核人： 托管人审批人： 托管人签章处：

重要提示：接此指令后，经审核无误按照指令条款进行划款。

附件四：专用清算账户及资金划拨专用账户

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。

托管资金账户

户名：

账号：

开户银行：

管理费收款账户

户名：东亚前海证券有限责任公司

账号：755935096210401

开户银行：招商银行股份有限公司深圳时代广场支行

托管费收款账户

户名：证券公司客户资产管理计划托管业务收入

账号：401010191675000106

开户行：兴业银行南京分行