

省心享-华泰量化多头单策略 FOF1 号集合资产  
管理计划  
资产管理合同

合同编号：LH2022-1

管理人：华泰证券（上海）资产管理有限公司

托管人：招商银行股份有限公司南京分行

二〇二二年三月

## 目录

一、前言.....	3
二、释义.....	4
三、承诺与声明.....	8
四、当事人及权利义务.....	10
五、资产管理计划的基本情况.....	17
六、资产管理计划的募集.....	21
七、资产管理计划的成立与备案.....	24
八、资产管理计划的参与、退出与转让.....	25
九、份额持有人大会及日常机构.....	33
十、资产管理计划份额的登记.....	34
十一、资产管理计划的投资.....	36
十二、投资顾问.....	41
十三、分级安排.....	42
十四、利益冲突及关联交易.....	43
十五、投资经理的指定与变更.....	44
十六、资产管理计划的财产.....	45
十七、投资指令的发送、确认和执行.....	47
十八、交易及交收清算安排.....	53
十九、越权交易的界定.....	56
二十、资产管理计划财产的估值和会计核算.....	60
二十一、资产管理计划的费用与税收.....	65
二十二、资产管理计划的收益分配.....	68
二十三、信息披露与报告.....	70
二十四、风险揭示.....	73
二十五、资产管理合同的变更、终止与财产清算.....	79
二十六、违约责任.....	85
二十七、争议的处理.....	87
二十八、合同的成立与生效.....	88

特别约定：《省心享-华泰量化多头单策略 FOF1 号集合资产管理计划资产管理合同》（以下简称“本合同”或“集合资产管理合同”）以电子签名方式签订，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；投资者（省心享-华泰量化多头单策略 FOF1 号集合资产管理计划的投资者）作为本合同一方，以电子签名方式签署本合同即表明投资者完全接受本合同项下的全部条款，同时本合同成立。

投资者、管理人、托管人同意遵守《电子签名法》、《证券公司资产管理电子签名合同操作指引》的有关规定，三方一致同意投资者自签署《电子签名约定书》之日起，投资者以电子签名方式接受电子签名合同（即本合同、集合计划说明书）、风险揭示书或其他文书的，视为签署本合同、集合计划说明书、风险揭示书或其他文书，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。

## 一、前言

为规范省心享-华泰量化多头单策略 FOF1 号集合资产管理计划(以下简称“集合计划”或“计划”)运作,明确《省心享-华泰量化多头单策略 FOF1 号集合资产管理计划资产管理合同》(以下简称“本合同”)当事人的权利与义务,依照《中华人民共和国证券法》(以下简称《证券法》)、《中华人民共和国民法典》(以下简称《民法典》)、《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称《基金法》)、《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》(以下简称《指导意见》)、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》(以下简称《管理办法》)、《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》(以下简称《运作规定》)以及《集合资产管理计划资产管理合同内容与格式指引(试行)》(以下简称《集合指引(试行)》)等法律法规、中国证监会和中国基金业协会的有关规定以及对上述法律法规的颁布机关对其不时做出的修订,投资者、管理人、托管人在平等自愿、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,当事人按照本合同、《省心享-华泰量化多头单策略 FOF1 号集合资产管理计划说明书》(以下简称《说明书》)及其他有关规定享有权利、承担义务。

本资产管理计划管理人按照法律法规的规定对本资产管理计划的设立、变更、展期、终止、清算等行为依法向中国证券投资基金业协会进行备案。中国证券投资基金业协会接受本集合资产管理计划的备案并不能免除本管理人按照规定真实、准确、完整、及时地披露本资产管理计划产品信息的法律责任,也不代表中国证券投资基金业协会对本资产管理计划的合规性、投资价值及投资风险做出保证和判断,也不表明投资于本资产管理计划没有风险。投资者应当自行识别本资产管理计划产品投资风险并承担投资行为可能出现的损失。

## 二、释义

在本合同中，除非文义另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

本集合资产管理计划、本集合计划、集合计划、资产管理计划、本计划、计划：指省心享-华泰量化多头单策略 FOF1 号集合资产管理计划；

集合计划说明书、说明书：指《省心享-华泰量化多头单策略 FOF1 号集合资产管理计划说明书》及对说明书的任何有效的修订和补充；

集合资产管理合同、资产管理合同、本合同：指《省心享-华泰量化多头单策略 FOF1 号集合资产管理计划资产管理合同》及对该合同的任何有效的修订和补充；

风险揭示书：指《省心享-华泰量化多头单策略 FOF1 号集合资产管理计划风险揭示书》；

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

《管理办法》：2018 年 10 月 22 日中国证券监督管理委员会发布的《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》；

《运作规定》：2018 年 10 月 22 日中国证券监督管理委员会发布的《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》；

中国证监会、证监会：指中国证券监督管理委员会；

基金业协会：指中国证券投资基金业协会；

集合资产管理合同当事人：指受集合资产管理合同约定，根据集合资产管理合同享有权利并承担义务的集合计划管理人、集合计划托管人和投资者；

集合计划管理人、资产管理人、管理人：指华泰证券（上海）资产管理有限公司，也简称为“华泰证券资产管理”；

集合计划托管人、资产托管人、托管人：招商银行股份有限公司南京分行；

销售机构：指华泰证券（上海）资产管理有限公司以及与管理人签订《省心享-华泰量化多头单策略 FOF1 号集合资产管理计划销售协议》的销售机构等；

注册登记机构：指办理登记、存管、过户、清算和结算等注册登记业务的机构。本集合计划的注册登记机构为华泰证券（上海）资产管理有限公司。

合格投资者：指符合《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》的规定，具备相应风险识别能力和风险承担能力，初始投资于本集合计划不低于法律法规要求的一定金额的自然人、法人或者其他组织。

投资者、委托人：指依据集合资产管理合同和集合计划说明书参与本集合计划的投资者，包括个人投资者和机构投资者；

个人投资者：指依据中华人民共和国有关法律法规、监管规定可以投资于本集合资产管理计划的自然人投资者；

机构投资者：指依法可以投资本集合资产管理计划，在中华人民共和国境内合法注册登记或经有关政府部门批准设立的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织；

份额持有人、持有人：指通过签订集合资产管理合同而依法取得和持有本集合计划份额的投资者；

集合计划成立日：指集合计划经过销售达到集合计划说明书和集合资产管理合同规定的成立条件，管理人通告集合计划成立的日期；

初始募集期：指自本集合计划启动初始募集之日起不超过 60 天的期间，具体初始募集时间以本集合计划公告为准；

封闭期：特指集合计划成立日后的一个期间，在此期间投资者不得参与、退出本集合计划，本集合计划除开放期外的每一个工作日均为封闭期，在此期间投资者不得参与、退出该集合计划；

开放期：指投资者可以办理集合计划参与或退出等业务的工作日；

开放日：指开放期内的每个工作日；

存续期、管理期限：指计划成立并存续的期间；

工作日：指上海证券交易所和深圳证券交易所等相关交易所的正常交易日；

T 日：指办理本集合计划业务申请的工作日；

T+n 日（n 指任意正整数）：指 T 日后的第 n 个工作日；

天：指自然日；

会计年度：指公历每年 1 月 1 日至 12 月 31 日；

认购：指投资者在初始募集期申请购买本集合计划份额的行为；

参与：指投资者按集合资产管理合同申请购买本集合计划份额的行为；

首次参与：指投资者在参与之前未持有本集合计划的情形；

退出：指投资者按集合资产管理合同规定的条件要求收回全部或部分委托资产的行为；

计划收益：指本集合计划投资所得基金红利、银行存款利息及其他合法收入；

集合计划份额、计划份额、份额：指集合计划的最小单位；

元：指人民币元；

计划单位面值、单位面值：人民币 1.00 元；

集合计划资产总值、计划资产总值：指集合计划投资所形成的各类有价证券、银行存款本息及其他资产的价值总和；

份额净值：指计算日计划资产净值除以计算日计划总份额；

累计净值、累计份额净值：指计划份额净值与计划份额累计分红之和；

计划资产估值：指计算评估本集合计划资产和负债的价值，以确定本集合计划资产净值的过程；

不可抗力：指本合同当事人无法预见、无法克服、无法避免，且在本合同签署之后发生的，使本合同当事人无法全部或部分履行本合同的任何事件；

管理人指定网站、管理人网站：指 [htamc.htsc.com.cn](http://htamc.htsc.com.cn)，管理人指定网站变更时以管理人公告为准；

流动性受限资产：是指由于法律法规、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，包括到期日在十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）、停牌股票、流动受限的新股以及非公开发行股票、资产支持证券（票据）、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，以及中国证监会认定的其他资产；

七个工作日可变现资产：包括可在交易所、银行间市场正常交易的股票、债券、非金融企业债务融资工具、期货及期权合约以及同业存单，七个工作日内到期或者可支取的逆回购、银行存款，七个工作日内能够确认收到的各类应收款项等；

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，在本资产管理合同约定范围内尽职尽责履

行安全保管委托资产等托管人职责。

合同签订地：本合同的签订地为江苏省南京市建邺区。

### 三、承诺与声明

#### (一) 管理人承诺

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

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

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

#### (二) 托管人承诺

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

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

#### (三) 投资者声明

投资者在此申明签署本集合计划管理合同即表明投资者承诺为符合《运作规定》等法律法规规定要求的合格投资者，同意其向管理人或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，及时书面告知管理人或销售机构。

投资者承诺以真实身份和合法合规的资金参与集合计划，保证委托资产的来源及用途合法，没有使用贷款、发行债券等筹集的非自有资金或其他非法筹集他人资金参与本集合计划，投资事项符合法律法规的规定及业务决策程序的要求，且不违反任何对投资者有法律约束力的协议或法规等文件。

投资者承诺其知悉《中华人民共和国反洗钱法》、《金融机构客户身份识别和客户身份资料及交易记录保存管理办法》、《金融机构大额交易和可疑交易报告管理办法》、《中国人民银行关于加强反洗钱客户身份识别有关工作的通知》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；承诺用于投资的资金来源不属于违法犯罪所得及其收益；承诺投资的资金来源和

去向不涉及洗钱、恐怖融资和逃税等行为；承诺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。投资者承诺其不属于中国有权机关、联合国、欧盟或美国等制裁名单或禁止名单内的企业或个人，不位于被中国有权机关、联合国、欧盟或美国等主权国家或国际组织制裁的国家和地区。

投资者声明若委托财产为本人/本机构通过设立的私募资产管理计划等募集所得，投资者保证资金来源和用途符合有关法律法规的规定，投资者将按管理人需要如实、及时提供最终投资人身份信息等材料，法律法规或监管机关另有规定的除外。

投资者声明已充分理解本合同条款，了解相关权利义务，了解有关法律法规及所投资资产管理计划的风险收益特征，知晓管理人、托管人及相关机构不对资产管理计划的收益状况或本金不受损失做出任何承诺，了解“卖者尽责，买者自负”的原则，投资于本计划将自行承担投资风险。

## 四、当事人及权利义务

### （一）当事人基本情况

#### 1、投资者

投资者身份资料以投资者与各销售机构签订的电子合同及电子签名约定书中所确定的内容为准。

#### 2、管理人

机构名称：华泰证券（上海）资产管理有限公司

法定代表人：崔春

住所：中国（上海）自由贸易试验区基隆路6号1222室

通信地址：上海市浦东新区东方路18号保利广场E座21楼

邮政编码：200120

联系电话：025-83387035

联系人：刘宇涛

#### 3、托管人

名称：招商银行股份有限公司南京分行

住所：江苏省南京市建邺区庐山路199号

邮政编码：210019

负责人：戴深宇

联系人：韩琨

联系电话：025-84797482

### （二）份额设置情况

本集合计划份额为均等份额，每份份额具有同等的合法权益。

### （三）投资者的权利和义务

#### 1、投资者的权利

（1）分享资产管理计划财产收益；

（2）取得分配清算后的剩余资产管理计划财产；

（3）按照本合同的约定参与、退出和转让资产管理计划份额；

（4）按照法律法规及本合同约定的时间和方式获得资产管理计划的信息披

露资料；

(5) 监督管理人、托管人履行投资管理及托管义务的情况；

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

## 2、投资者的义务

(1) 认真阅读并遵守资产管理合同，保证投资资金的来源及用途合法；

(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) 向管理人或资产管理计划销售机构提供法律法规规定的信息资料及身份证明文件，配合管理人或其销售机构完成投资者适当性管理、非居民金融账户涉税信息尽职调查、反洗钱等监管规定的工作；

(8) 投资者身份资料以及联络方式以投资者在各销售机构所留存的信息/签署电子合同时留存的信息为准。投资者承诺留存的联络方式真实、有效、畅通，否则将自行承担不利后果。投资者联络方式变更时，应及时以书面方式通知管理人或销售机构，管理人或销售机构收到投资者通知的时间视为送达时间。投资者未书面通知管理人或销售机构的，管理人或销售机构以投资者原留存的联络方式为准。

(9) 本集合计划采用电子签名合同，投资者应当如实提供与签署电子合同相关的信息和资料。投资者应当以自己的名义在参与网点开立指定资金账户，办理指定手续，用于办理委托划款、红利款项、退出款项以及清算款项的收取。并承诺在本合同有效期内，不得撤销该账户，并妥善保管账户资料；

(10) 不得违反资产管理合同的约定干涉管理人的投资行为；

(11) 不得从事任何有损资产管理计划及其投资者、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；

(12) 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；

(13) 法律法规、中国证监会及基金业协会规定和资产管理合同约定的其他义务。

#### (四) 管理人的权利和义务

##### 1、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及业绩报酬（如有）；

(3) 按照资产管理合同约定，停止或暂停办理集合计划份额的参与，暂停办理集合计划的退出事宜；

(4) 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；

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

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

(7) 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；

(8) 按照资产管理合同约定，终止本集合计划的运作；

(9) 集合计划资产受到损害时，向有关责任人追究法律责任；

(10) 更换公司相关业务主要负责人以及投资经理人员；

(11) 法律法规、中国证监会、基金业协会规定的及资产管理合同约定的其他权利。

## 2、管理人的义务

- (1) 依法办理资产管理计划的销售、登记、备案事宜；
- (2) 按照基金业协会要求报送资产管理计划产品运行信息；
- (3) 按照诚实信用、勤勉尽责的原则履行受托人义务，管理和运用资产管理计划财产；
- (4) 对投资者的风险识别能力和风险承受能力进行评估，向符合法律法规规定的合格投资者非公开募集资金；
- (5) 制作风险揭示书，向投资者充分揭示相关风险；
- (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) 建立健全的内部管理制度，保证本资产管理计划财产与其管理的其他资产管理计划财产、管理人的固有财产相互独立，对所管理的不同财产分别管理，分别记账，分别投资；聘请投资顾问的，应制定相应利益冲突防范机制；
- (8) 除依据法律法规、资产管理合同及其他有关规定外，不得为管理人及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作资产管理计划财产；
- (9) 保守商业秘密，不得泄露资产管理计划的投资计划、投资意向等，依法依规提供信息的除外；
- (10) 公平对待所管理的不同财产，不得从事任何有损资产管理计划财产及其他当事人利益的活动；
- (11) 除规定情形或符合规定条件外，不得为管理人、托管人及其关联方提供融资；
- (12) 按照资产管理合同约定接受投资者和托管人的监督；
- (13) 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；
- (14) 按照资产管理合同约定计算并向投资者报告资产管理计划份额净值；
- (15) 确定资产管理计划份额参与、退出价格，采取适当、合理的措施确保份额交易价格的计算方法符合法律法规的规定和合同的约定；
- (16) 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；

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

(18) 按照资产管理合同的约定确定收益分配方案，及时向投资者分配收益；

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

(20) 办理与受托财产管理业务活动有关的信息披露事项；

(21) 建立并保存投资者名单；

(22) 组织并参加资产管理计划财产清算小组，参与资产管理财产的保管、清理、估价、变现和分配；

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

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

(25) 履行（或承担）客户身份识别、客户身份以及交易记录保存等法定反洗钱义务；

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

#### （五）托管人的权利与义务

##### 1、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) 按照资产管理合同约定，及时、足额获得资产管理计划托管费用；

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

(4) 发现委托人、管理人有下列情形的，有权终止托管服务：

a. 违反资产管理目的，不当处分产品财产的；

b. 未能遵守或履行合同约定的有关承诺、义务、陈述或保证；

c. 被依法取消从事资产管理业务的相关资质或经营异常；

d. 被依法解散、被依法撤销、被依法宣告破产或失联。

e.法律法规明确规定和合同约定的其他情形

## 2、托管人的义务

(1) 安全保管资产管理计划财产，依法保护委托人的财产权益；

(2) 除依据法律法规规定和资产管理合同的约定外，不得为托管人及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管资产管理计划财产；

(3) 对所托管的不同财产分别设置账户，确保资产管理计划财产的完整与独立；

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

(5) 按规定开立和注销资产管理计划的托管账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有关的信息披露事项；

(8) 根据相关法律法规和资产管理合同约定，复核管理人编制的资产管理计划财产的定期报告，并出具书面意见；

(9) 编制托管年度报告，报中国证监会相关派出机构；

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

(11) 保守商业秘密，除法律法规、本合同及其他有关规定另有要求外，不得向他人泄露；

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

(13) 监督管理人的投资运作，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；托管人仅对投资的资产管理产品合同约定的投资范围进行审核。如其突破产品合同约定投资，实质违规的，托管人无法知悉、无法尽到提示、报告的义务，托管人对此免责

(14) 在集合计划终止时，与管理人一起妥善处理有关清算和委托人资产的返还事宜；

(15) 在解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产时，及时报告委托人和管理人；

(16) 因违反本合同导致集合计划资产损失或损害委托人合法权益时，应承担赔偿责任；

(17) 国家有关法律法规、监管机构及资产管理合同规定的其他义务。

## 五、资产管理计划的基本情况

(一) 名称：省心享-华泰量化多头单策略 FOF1 号集合资产管理计划

(二) 类型：权益类 (FOF)

(三) 运作方式：开放式

(四) 投资情况

### 1、投资目标

在控制投资风险的前提下，实现组合资产长期稳定增值。

### 2、投资范围

投资范围包含如下资产：

本集合计划主要投资于金融产品和现金类资产。

(1) 金融产品：本计划主要投资于管理人选定的证券公司、基金公司、期货公司发行的集合资产管理计划以及在中国证券投资基金业协会备案的私募基金管理人发行的私募证券投资基金（上述资产简称：私募基金）、公募证券投资基金、商业银行理财产品。本集合计划所投资的资产管理产品不会再投资公募证券投资基金以外的资产管理产品。

(2) 现金类资产：包括现金、存款、通知存款、同业存单、期限在 7 天以内(含 7 天)的债券逆回购、货币市场基金以及中国证监会认可的其他现金管理类工具。

如法律法规或监管机构以后允许本资产管理计划投资其他证券市场或者其他品种，资产管理计划资产管理人在征得合同各方书面同意并履行适当程序后，可以相应调整本资产管理计划的投资范围、投资比例规定，并应为资产管理人和资产托管人相关系统准备以及投资组合调整留出必要的时间。

### 3、投资比例

(1) 金融产品：占集合计划资产总值的 80%-100%，金融产品包括证券公司、基金公司、期货公司发行的集合资产管理计划以及在中国证券投资基金业协会备案的私募基金管理人发行的私募证券投资基金（上述资产简称：私募基金）、公募证券投资基金、商业银行理财产品。本计划按照所投资资产管理产品披露组合投资的频率，根据穿透原则合并计算的投资于权益类资产的总值不得低于计划总资产的 80%，投资于固定收益类、商品及金融衍生品类资产的总值均不得超过计

划总资产的 20%。

(2) 现金类资产：现金类资产包括现金、存款、通知存款、同业存单、期限在 7 天以内（含 7 天）的债券逆回购、货币市场基金以及中国证监会认可的其他现金管理类工具。

管理人应自起始运作日起 6 个月内使本计划符合该比例限制。

本计划完成备案前不得开展投资活动，以现金管理为目的，投资于银行活期存款、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。

本集合计划的建仓期为 6 个月，本集合计划管理人应当在产品成立之日起 6 个月内，使得本产品投资组合比例符合上述要求。

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管理人之外的因素导致资产管理计划投资不符合法律、行政法规和中国证监会规定的投资比例或者合同约定的投资比例的，管理人应当在流动性受限资产可出售、可转让或者恢复交易的十五个交易日内调整至符合相关要求。

法律法规或中国证监会允许集合计划投资其他品种的，资产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。

4、产品风险等级：本集合计划属中高风险产品，适合合格投资者中专业投资者和积极型及以上的普通投资者。

#### (五) 存续期限

本集合计划的存续期限为 10 年，从集合计划成立日起计算。

(六) 初始募集面值：人民币 1.00 元。

#### (七) 最低初始募集规模

本集合计划的最低初始募集规模为人民币 1000 万元。

(八) 分级安排：本集合计划不根据风险收益特征进行分级。

#### (九) 服务机构情况

本集合计划的份额登记、信息技术系统服务由华泰证券（上海）资产管理有限公司提供。

本集合计划的估值与核算服务由华泰证券股份有限公司提供，基金业协会业务登记编码为 A00004。

#### (十) 本集合计划的各项费用

##### 1、认购/参与费：

认购/参与金额 M	认购/参与费率
M<300 万	1%
300 万≤M<500 万	0.5%
M≥500 万	0

##### 2、退出费：0

##### 3、管理费：1%/年

4、业绩报酬：委托人持有期间年化收益率超过 8%以上部分按照 15%的比例收取；

##### 5、托管费：0.01%/年

6、其他费用（如有）：年度专项审计费用、律师费、信息披露费用、银行结算费用、开户费等集合计划运营过程中发生的相关费用。

#### (十一) 本集合计划的销售

1、销售机构：华泰证券（上海）资产管理有限公司以及与管理人华泰证券（上海）资产管理有限公司签订销售协议且符合法律法规要求的其他销售机构。

本集合计划管理人可根据有关法律、法规的要求，选择其他符合要求的销售机构销售本集合计划。

##### 2、销售方式

管理人应将集合资产管理合同、集合资产管理计划说明书等正式销售文件提供给销售机构。销售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，引导客户审慎作出投资决定。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、宣传预期收益和商业贿赂等不正当手段销售集合计划。

管理人及销售机构应当采取有效措施，并通过管理人、中国基金业协会、中国证监会电子化信息披露平台或者中国证监会认可的其他信息披露平台，客观准确披露集合计划备案信息、风险收益特征、投诉电话等，使客户详尽了解本集合计划的特性、风险等情况及客户的权利、义务，但不得通过报刊、电台、电视、互联网等公众传播媒体或者讲座、报告会、分析会和布告、传单、手机短信、微信、播客和电子邮件、自媒体等方式，向不特定对象宣传推介。

(十二) 预警线、平仓线 (托管人不予监控)

1、预警线：集合计划份额累计净值 0.70。存续期内，当任意交易日 (T 日) 集合计划份额累计净值等于或低于预警线，管理人必须在最近的底层金融产品开放日赎回产品份额，并在 T+15 日内变现资产，使得现金类资产占比不低于产品净值的 30%，直至集合计划份额累计净值高于预警线，如由于底层金融产品暂停赎回等原因无法变现的，持续变现直至满足上述比例。

2、平仓线：集合计划份额累计净值 0.50。存续期内，当任意交易日 (T 日) 集合计划份额累计净值等于或低于平仓线，集合计划进入终止清算程序，管理人必须在最近的底层金融产品开放日赎回产品份额，并在 T+15 日内将所有资产变现，如由于底层金融产品暂停赎回等原因无法变现的，管理人将持续变现或根据合同约定进入二次清算程序。

## 六、资产管理计划的募集

### (一) 资产管理计划募集的有关事项

#### 1、募集对象

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（不包括金融产品）：

(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：家庭金融资产净值不低于 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（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、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) 基本养老保险、社会保障基金、企业年金等养老基金，慈善基金等社会公益基金，合格境外机构投资者（QFII）、人民币合格境外机构投资者（RQFII）；

(5) 中国证监会视为合格投资者的其他情形。

#### 2、初始募集期认购

在初始募集期内，投资者在工作日内可以认购本集合计划。本集合计划初始募集期自计划份额发售之日起不超过 60 天。

#### 3、资产管理计划的认购事项

##### (1) 认购费率：

认购金额 M	认购费率
M < 300 万	1%
300 万 ≤ M < 500 万	0.5%
M ≥ 500 万	0

投资者如果有多笔认购，费率按单笔分别计算。

管理人有权调减认购费率，并在募集公告中明确揭示。

##### (2) 初始募集期认购费用以及份额的计算：

认购费用 = 认购金额 / (1 + 认购费率) × 认购费率

认购份额 = (认购金额 - 认购费用 + 初始募集期利息) / 集合计划初始募集面值

认购份数保留小数点后两位，小数点后第三位四舍五入。

(3) 认购资金利息的处理方式：投资者的认购资金在初始募集期产生的利息将折算为计划份额归投资者所有，参与资金的利息以注册登记机构的确认结果为准。

(4) 最低认购金额：投资者认购的最低金额为人民币 101 万元（含认购费），超过最低认购金额的部分不设金额级差。

(5) 在初始募集期内，当集合计划募集规模接近或达到约定的规模上限时，管理人可提前暂停接受认购申请，对有效认购申请采用“金额优先+金额同等情况下时间优先”的原则给与部分确认，未确认部分的认购款项退还给投资者。

(6) 集合计划设立完成前，投资者的认购资金只能存入注册登记机构指定的募集账户或为本集合计划开立的托管账户，不得动用。

#### (7) 认购的程序和确认

1) 投资者在接受销售机构风险承受能力测评后，需签署电子签名约定书，同意以电子签名方式签署集合资产管理合同，之后必须根据本集合计划销售机构规定的手续，在指定时间内提出认购申请。投资者既可以到本集合计划销售机构指定营业网点的柜台申请认购集合计划，也可以登录销售机构指定网络系统以自主下单的方式申请认购集合计划。当日认购申请可以且只能在当日交易时间内申请撤销。

2) 投资者需要事先开设销售机构认可的交易账户，并在账户内备足认购的货币资金；若账户内认购资金不足的，销售机构不受理该笔认购申请。投资者认购申请经确认成功后，其认购申请和认购资金不得撤销；投资者指定资金账户作为办理参与款项、红利款项、退出款项以及清算款项的收款账户。投资者应承诺在本集合计划的资产管理合同有效期内，不得撤销该账户，并妥善保管账户资料。在兑付受托资金及收益时，管理人应当保证受托资金及收益返回投资者的原账户、同名账户。

3) 投资者签署本合同后，方可申请认购集合计划。参与认购经管理人确认有效后，构成本合同的有效组成部分。

4) 投资者参与认购确认后, 其认购申请和认购资金不得撤销。

5) 投资者可在集合计划正式成立第 2 个工作日后到原销售场所或管理人网站查询最终的成交确认情况。

#### (二) 资产管理计划募集账户的披露渠道和查询方式

资产管理计划募集结算专用账户和销售机构委托募集账户(如有)将在管理人网站进行披露, 投资者可登陆进行查询。

## 七、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

集合计划的参与资金总额（不含参与费）不低于 1000 万元人民币且投资者人数为 2 人（含）以上 200 人以下，并经管理人聘请的具有证券相关业务资格的会计师事务所对集合计划进行验资并出具验资报告后，管理人公告本集合计划成立。

集合计划设立完成前，投资者的认购资金只能存入注册登记机构指定的募集账户或为本集合计划开立的托管账户，不得动用。

### （二）集合计划的验资和备案

本计划的募集金额缴足之日起 10 个工作日内，管理人应当委托具有证券相关业务资格的会计师事务所进行验资并出具验资报告，并在取得验资报告后公告资产管理计划成立。管理人应在资产管理计划成立起 5 个工作日内报基金业协会备案。资产管理计划成立前，任何机构和个人不得动用投资者参与资金。

本计划在成立后备案完成前，不得开展投资活动，以现金管理为目的，投资于银行活期存款、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。

### （三）集合计划设立失败的处理方式

集合计划初始募集期结束，在集合计划规模低于人民币 1000 万元或投资者的人数少于 2 人的条件下，集合计划设立失败，管理人以固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用，并在募集期届满后三十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。

### （四）集合计划存续期内的资产规模

本计划成立后，连续 60 个工作日出现集合计划资产净值低于 1000 万元情形的，管理人有权视计划运作情况终止本计划合同。

法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。

## 八、资产管理计划的参与、退出与转让

### (一) 集合计划的参与、退出

#### 1、参与和退出的办理场所

投资者既可以到本集合计划销售机构指定营业网点的柜台申请参与或退出集合计划,也可以登录销售机构指定网络系统以自主下单的方式申请参与或退出集合计划,具体参与和退出方式以管理人公告为准。

#### 2、参与和退出的开放日和时间

(1) 封闭期:本计划成立之日起1个月封闭运作。自本集合计划成立满1个月后的每周四、周五开放参与(如遇非交易日则当天不开放参与),自本集合计划成立满6个月后的每月的第1个交易日开放退出。除开放期外的每一个工作日均为封闭期,封闭期内不办理参与、退出业务。

本计划针对每一集合计划份额设有锁定期,锁定期为自该集合计划份额被确认之日起180天(约6个月),即委托人仅可在本集合计划开放退出日对其持有的已过锁定期的集合计划份额进行退出。认购的份额自集合计划成立之日起计算,申购的份额自申购确认之日起计算。

(2) 开放期:自本集合计划成立满1个月后的每周四、周五开放参与(如遇非交易日则当天不开放参与),自本集合计划成立满6个月后的每月的第1个交易日开放退出,本集合计划具体开放安排以管理人公告为准。中国证监会另有规定的除外。

预约退出方式:委托人如需在该开放期退出,需在本集合计划成立满6个月后的开放退出的每月第1个交易日(T日)前9个工作日(T-9日)至7个工作日(T-7日)通过信件、传真、电子邮件等方式在销售机构提出预约退出申请,具体以管理人公告为准。在除管理人特别约定的情形外,若委托人未提交预约退出申请,则管理人有权拒绝该次退出申请。经委托人提交预约退出申请后,管理人在该退出开放期对提交预约退出申请的客户进行份额退出。

#### 3、临时开放期

在不损害现有委托人利益的情况下或因法律法规及中国证监会规定导致委托人需退出本集合计划的,管理人有权在合同变更和法规调整的情况下设置临时开放期,供投资者退出,同时对投资者退出费进行减免,具体以管理人公告为准。

#### 4、参与和退出的方式、价格、程序及确认

##### (1) 参与的方式、价格和金额限制

1) 投资者在存续期开放日购买资产管理计划份额的，应符合合格投资者标准。

2) 参与以金额申请。本集合计划单个投资者参与最低金额为 101 万元人民币（含参与费），超过最低参与金额的部分不设金额级差，已持有资产管理计划份额的投资者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。

3) 初始募集期认购采用“已知价”原则，参与价格为份额面值 1.00 元人民币；存续期参与采用“未知价”原则，即参与集合计划份额的价格以参与申请日当日份额净值为基准进行计算。

4) 在存续期内，当集合计划募集规模接近或达到约定的规模上限时，管理人可提前暂停接受参与申请，对有效参与申请采用“金额优先+金额同等情况下时间优先”的原则给与部分确认，未确认部分的参与款项退还给投资者。

5) 本集合计划采用电子签名合同，投资者在签署电子签名合同后方可参与本集合计划。投资者应当如实提供与签署电子签名合同相关的信息和资料，管理人和销售机构应当按照有关规定对投资者提供的信息和资料进行审查并如实记录。

##### (2) 参与的程序和确认

1) 投资者在接受销售机构风险承受能力测评后，需签署电子签名约定书，同意以电子签名方式签署集合资产管理合同，之后必须根据本集合计划销售机构规定的手续，在指定参与时间内提出参与申请。投资者既可以到本集合计划销售机构指定营业网点的柜台申请参与集合计划，也可以登录销售机构指定网络系统以自主下单的方式申请参与集合计划。当日参与申请可以且只能在当日交易时间内申请撤销。

2) 投资者需要事先开设销售机构认可的交易账户，并在账户内备足参与的货币资金；若账户内参与资金不足的，销售机构不受理该笔参与申请。投资者参与申请经确认成功后，其参与申请和参与资金不得撤销；投资者指定资金账户作为办理参与款项、红利款项、退出款项以及清算款项的收款账户。投资者应承诺在本集合计划的资产管理合同有效期内，不得撤销该账户，并妥善保管账户资料。在兑付受托资金及收益时，管理人应当保证受托资金及收益返回投资者的原账户、

同名账户。

3) 投资者签署本合同后, 方可申请参与集合计划。参与申请经管理人确认后, 构成本合同的有效组成部分。

4) 注册登记机构在 T+2 日内为投资者参与的有效性进行确认, 投资者参与申请确认后, 其参与申请和参与资金不得撤销。

5) 开放期参与的, 投资者于 T 日提交参与申请后, 可于 T+3 日后在原销售场所或管理人网站查询参与确认情况。

### (3) 退出的方式、价格和金额限制

1) “未知价”原则, 即退出集合计划份额的价格以退出申请日当日份额净值为基准进行计算。

2) 采用份额退出的方式, 即退出以份额申请。

3) 单笔退出申请份额不低于 1000 份。投资者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。投资者持有的资产管理计划份额净值低于规定的最低投资金额时, 即 100 万, 需要退出资产管理计划的, 应当一次性全部退出。

### (4) 退出的程序和确认

#### 1) 退出申请的提出

投资者可在原参与网点, 在规定的开放期内办理退出申请, 或登录原参与销售机构指定的网络系统以自主下单的方式申请退出集合计划。

具体退出方式以管理人退出公告为准, 如公告中采用自动退出或按比例自动退出方式等则由管理人为客户按公告约定的退出规则为管理人办理退出。

#### 2) 退出申请的确认

销售机构指定营业网点受理申请后, 检查投资者持有的集合计划份额, 交注册登记机构确认; 注册登记机构在 T+2 日内为投资者扣除权益并办理相应的注册登记手续。当日 (T 日) 在交易时间内提交的申请, 投资者通常可在 T+3 日到网点查询退出的确认情况。

#### 3) 退出款项划付

退出款项将在 T+10 日内从托管账户划出, 经销售机构划往投资者资金账户。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划往委托人账户。

#### 5、参与和退出的费用

##### (1) 参与费率：

参与金额 M	参与费率
M<300 万	1%
300 万≤M<500 万	0.5%
M≥500 万	0

投资者如果有多笔参与，费率按单笔分别计算。

管理人有权调减参与费率，并在新的费率开始实施前 1 个工作日在管理人指定网站公告。

##### (2) 退出费率：0

#### 6、参与份额的计算方式、退出金额的计算方式

##### (1) 存续期参与份额的计算：

参与费=参与金额/(1+参与费率)×参与费率

参与份额=(参与金额-参与费)/集合计划参与日份额净值

参与份数保留小数点后两位，小数点后第三位四舍五入。

##### (2) 退出金额的计算：

委托人退出金额为退出总额扣减退出费用和管理人业绩报酬后的余额，计量单位为人民币元，退出金额保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分四舍五入，舍去部分所代表的资产归属集合计划资产。

退出总额=退出份额×集合计划份额净值-管理人业绩报酬（如有）

退出费用=退出总额×退出费率

退出金额=退出总额-退出费用

管理人业绩报酬计算方式详见“资产管理计划的费用与税收”章节。

#### 7、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，本集合计划持有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）超过上一工作日总份额数的 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、部分顺延退出或暂停退出；

全额退出：当管理人认为有条件支付投资者的退出申请时，按正常退出程序办理。

部分顺延退出：当管理人认为支付投资者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，投资者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份额净值为准计算退出金额，依此类推，直至全部办理完毕为止，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

发生巨额退出并延期办理时，管理人应在 5 个自然日内在管理人指定网站公告，并说明有关处理方法。

#### (4) 单客户大额退出的认定及处理

单个开放日，本集合计划单个持有人退出申请份额符合上述情形的，管理人有权对该单客户超出该比例的退出申请实施延期办理，对于该单客户的剩余退出申请管理人有权根据前文（2）中“全额退出”或“部分顺延退出”与其他集合计划份额持有人的退出申请一并办理。延期的退出申请与下一开放日退出申请一并处理，无优先权并以下一开放日的集合计划单位份额净值为基础计算退出金额，依此类推，直到全部退出为止。但是，对于未能退出部分，如该单客户在提交退出申请时选择取消退出，则其当日未获受理的部分退出申请将被撤销。

### 8、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，管理人可按本合同载明的规定，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 20 个工作日，并在管理人指定网站上进行公告。

#### 9、拒绝或暂停参与、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受理投资者的参与申请：

- (1) 本集合计划份额接近或达到规模上限；
- (2) 本集合计划委托人数接近或达到法律、行政法规和资产管理合同规定的上限；
- (3) 战争、自然灾害等不可抗力的原因导致集合计划无法正常运行；
- (4) 管理人认为接受某笔或某些参与申请可能影响或损害现有委托人利益时；
- (5) 法人或者依法成立的其他组织用筹集的资金参与集合计划而未提供管理人要求的合法筹集资金的证明文件；
- (6) 法律、行政法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生下列情形时，管理人可以拒绝或暂停受理投资者的退出申请：

- (1) 不可抗力的原因导致集合计划无法正常运行；
- (2) 证券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) 管理人认为退出申请可能会影响或损害现有投资者利益时；
- (4) 因非管理人原因，导致本集合计划的现金支付出现困难时；
- (5) 连续巨额退出；
- (6) 法律、行政法规和中国证监会认定的其他情形或其他在本合同及说明书中载明的特殊情形。

#### (二) 集合计划份额的转让

在技术条件成熟的前提下，经管理人申请并开通份额转让事宜后，本集合计划份额可以转让。集合计划存续期间，投资者可以通过证券交易所以及中国证监会认可的交易平台转让集合计划份额。受让方首次参与集合计划，应先与管理人、托管人签订集合资产管理合同。投资者在此授权，当集合计划获得份额转让资格后，管理人可根据份额转让交易平台的规则，为满足份额转让实现和符合合同规定，为投资者办理份额转托管等相关业务。

### （三）集合计划份额的非交易过户

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投资者集合计划账户转移到另一投资者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、司法执行、以及其他形式财产分割或转移引起的计划份额非交易过户。对于符合条件的非交易过户申请按注册登记机构的有关规定办理。

### （四）集合计划份额的冻结

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。

### （五）管理人自有资金参与集合计划

#### 1、自有资金参与的条件

管理人在初始募集期和存续期均可以自有资金参与本集合计划。管理人以自有资金参与本集合计划，应符合法律、行政法规、中国证监会、中国证券投资基金业协会和本合同的相关规定，并按照《公司法》和公司章程的规定获得相应授权程序的批准。

#### 2、自有资金参与的金额和比例

在集合计划存续期内，管理人自有资金参与本集合计划的份额不得超过本计划总份额的 20%。管理人及其附属机构以自有资金参与本集合资产管理计划的份额合计不得超过本计划总份额的 50%。因集合计划规模变动等客观因素导致自有资金参与集合计划被动超限的，管理人应在具备退出本计划条件时将自有资金比例降至适合比例，并在退出本计划前 5 个工作日以网站公告的形式告知托管人和集合计划持有人。

#### 3、自有资金的责任承担方式与收益分配

管理人自有资金参与集合计划，按照其参与份额比例分享同等收益、承担同等风险。

自有资金的参与和退出时应当符合法律、行政法规和中国证监会的规定。

4、管理人自有资金参与集合计划的持有期限不得低于 6 个月。在满足持有期不少于 6 个月等监管规定的前提下，管理人有权退出以自有资金参与的本集合计划的份额，管理人参与、退出时应当提前 5 个工作日以网站公告的形式告知托

管人和集合计划持有人。

为应对集合资产管理计划巨额退出以解决流动性风险,或者中国证监会认可的其他情形,在不存在利益冲突并遵守合同约定的前提下,管理人及其附属机构以自有资金参与及其后续退出集合资产管理计划可不受上述限制。

集合计划存续期内,当法律法规或有关自有资金参与集合计划的规定或政策发生变更,管理人经与托管人协商一致并公告后,可直接对本部分内容进行修改和调整。投资者对修改或调整的内容有异议,可在修改或调整的内容生效前按照本合同规定申请退出集合计划。投资者未退出的,视为同意修改或调整的内容。

(六) 管理人应定期将资产管理计划投资者变更情况报送基金业协会。

## 九、份额持有人大会及日常机构

本集合计划不设份额持有人大会及日常机构。

## 十、资产管理计划份额的登记

### （一）登记信息的备份

全体资产管理计划份额持有人在此同意管理人、份额登记机构或其他份额登记义务人将集合资产管理计划投资者名称、身份信息以及集合资产管理计划份额明细等数据备份至中国证监会认定的机构。

### （二）集合计划份额的登记业务

本集合计划的登记业务指本集合计划登记、存管、过户、清算和结算业务，具体内容包括投资人集合计划账户的建立和管理、集合计划份额登记、集合计划销售业务的确认、清算和结算、代理发放红利、建立并保管集合计划份额持有人名册和办理非交易过户等。

### （三）集合计划登记业务办理机构

本集合计划的登记业务由集合计划管理人或集合计划管理人委托的其他符合条件的机构办理。集合计划管理人委托其他机构办理本集合计划登记业务的，应与代理人签订委托代理协议，以明确集合计划管理人和代理机构在投资人集合计划账户管理、集合计划份额登记、清算及集合计划交易确认、发放红利、建立并保管集合计划份额持有人名册等事宜中的权利和义务，保护集合计划份额持有人的合法权益。本集合计划的注册登记机构为华泰证券（上海）资产管理有限公司。

### （四）集合计划登记机构的权利

集合计划登记机构享有以下权利：

- 1、取得登记费；
- 2、建立和管理投资人集合计划账户；
- 3、保管集合计划份额持有人开户资料、交易资料、集合计划份额持有人名册等；
- 4、在法律法规允许的范围内，对登记业务的办理时间进行调整，并依照有关规定于开始实施前在指定媒介上公告；
- 5、法律法规及中国证监会规定的和集合计划合同约定的其他权利。

### （五）集合计划登记机构的义务

集合计划登记机构承担以下义务：

- 1、配备足够的专业人员办理本集合计划份额的登记业务；
- 2、严格按照法律法规和集合计划合同规定的条件办理本集合计划份额的登记业务；
- 3、妥善保存登记数据，并将集合计划份额持有人名称、身份信息及集合计划份额明细等数据备份至中国证监会认定的机构。其保存期限自集合计划账户销户之日起不得少于 20 年；
- 4、对集合计划份额持有人的集合计划账户信息负有保密义务，因违反该保密义务对投资人或集合计划带来的损失，须承担相应的赔偿责任，但司法强制检查情形及法律法规及中国证监会规定的和集合计划合同约定的其他情形除外；
- 5、按集合计划合同及招募说明书规定为投资人办理非交易过户业务、提供其他必要的服务；
- 6、接受集合计划管理人的监督；
- 7、法律法规及中国证监会规定的和集合计划合同约定的其他义务。

## 十一、资产管理计划的投资

### (一) 投资目标

本集合计划主要投资于金融产品，管理人依据丰富的投资经验及专业的研究能力，严格控制业务风险，在争取本金安全的前提下追求稳定的收益。

### (二) 投资范围及比例

#### 投资范围：

1、金融产品：本计划主要投资于管理人选定的证券公司、基金公司、期货公司发行的集合资产管理计划以及在中国证券投资基金业协会备案的私募基金管理人发行的私募证券投资基金（上述资产简称：私募基金）、公募证券投资基金、商业银行理财产品。本集合计划所投资的资产管理产品不会再投资公募证券投资基金以外的资产管理产品。

2、现金类资产：包括现金、存款、通知存款、同业存单、期限在7天以内(含7天)的债券逆回购、货币市场基金以及中国证监会认可的其他现金管理类工具。

#### 投资比例

1、金融产品：占集合计划资产总值的80%-100%，金融产品包括证券公司、基金公司、期货公司发行的集合资产管理计划以及在中国证券投资基金业协会备案的私募基金管理人发行的私募证券投资基金（上述资产简称：私募基金）、公募证券投资基金、商业银行理财产品。本计划按照所投资资产管理产品披露组合投资的频率，根据穿透原则合并计算的投资于权益类资产的总值不得低于计划总资产的80%，投资于固定收益类、商品及金融衍生品类资产的总值均不得超过计划总资产的20%。

2、现金类资产：现金类资产包括现金、存款、通知存款、同业存单、期限在7天以内(含7天)的债券逆回购、货币市场基金以及中国证监会认可的其他现金管理类工具。

管理人应自起始运作日起6个月内使本计划符合该比例限制。

本计划完成备案前不得开展投资活动，以现金管理为目的，投资于银行活期存款、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。

法律法规或中国证监会允许集合计划投资其他品种的，资产管理人在履行合

同变更程序后，可以将其纳入本计划的投资范围。

### （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管理人之外的因素导致资产管理计划投资不符合法律、行政法规和中国证监会规定的投资比例或者合同约定的投资比例的，管理人应当在流动性受限资产可出售、可转让或者恢复交易的十五个交易日内调整至符合相关要求。

### （四）风险收益等级

本集合计划属中高风险产品，适合专业投资者和合格投资者中积极型及以上的普通投资者。

### （五）业绩比较基准（如有）及确定依据

本集合计划不设业绩比较基准。

### （六）投资理念和投资策略

本计划为主动管理类 FOF 产品，投资策略为筛选涵盖量化多头策略的优质基金。

#### 1、金融产品投资策略

本计划管理人对资产管理产品的选择主要基于对金融产品管理人投资能力评估和合规运营风险评估，采用定性分析为主，定量分析为辅的方法，将投资能力和合规运营风险各自分为 5 个等级，两方面必须同时达到 3 分以上方可聘用。具体的分析方法：（1）定量分析：通过获取拟投资资产管理产品的数据，辅以定量归因分析。（2）定性分析：对金融产品管理人的核心投研人员进行面对面访谈。对单个金融产品的选择上，更加注重投资逻辑的稳定性和预判性，而非仅仅基于历史收益风险比。在此基础上，选择其优势策略产品。

评分等级分类见下表：

投资能力等级	合规运营风险等级
5 杰出	5 健全
4 卓越	4 标准
3 优秀	3 建议改善
2 低于平均	2 不足
1 不足	1 无效

## 2、现金类资产投资策略

本计划以严谨的市场价值分析为基础，采用稳健的投资组合策略，通过对现金管理类金融品种的组合操作，在保持本金的安全性与资产流动性的同时，追求稳定的当期收益。通过合理有效分配本计划的现金流，保持投资组合的流动性，满足本计划投资运作的要求。

### （七）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，并以维护集合计划投资者利益作为最高准则。具体决策依据包括：

- 1、《指导意见》、《管理办法》、《运作管理规定》、《集合资产管理合同》、《说明书》等有关法律性文件；
- 2、国内外经济形势、利率变化趋势以及行业与上市公司基本面研究；
- 3、投资对象收益和风险的匹配关系，本计划将在充分权衡投资对象的风险和收益的前提下做出投资决策。

### （八）集合计划的投资程序

#### 1、投资决策程序

投资决策委员会为最高投资决策机构，负责对相关品类投资中的重大问题进行决策，并在符合相关法规以及公司制度的要求下对投资部门负责人以及投资经理进行投资授权。

投资经理根据投资决策委员会授权，在研究支持下，根据市场情况进行投资组合的构建或调整。在组合构建和调整的过程中，投资经理必须严格遵守有关法律法规、本计划的投资范围、投资比例、投资限制及其他要求。

#### 2、投资交易程序

投资经理下达投资指令由交易员完成。通过严格的交易制度和独立的交易岗位、风险控制岗位，可实行实时监控，并通过集中清算加强监管，保证投资指令在合法、合规的前提下得到高效地执行。

#### 3、风险管理程序

风险管理部门按照有关法律法规、公司制度和本合同相关要求，对本计划的投资行为和投资组合进行持续监控，并进行风险预警，确保本计划承担的风险在

适当范围内。投资经理根据风险管理和业绩分析的情况及相关建议，对投资组合进行调整，以确保遵守各项合规控制和风险管理要求。

#### （九）投资限制

本集合计划的投资限制包括：

- 1、本计划的总资产不得超过本计划净资产的 200%；
- 2、本计划投资于同一资产的资金不得超过计划资产净值的 25%；按照所投资资产管理产品披露组合投资的频率，管理人管理的全部集合资产管理计划根据穿透原则合并计算的底层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、本计划投资于其他资产管理产品的，计算本计划的总资产时应当按照穿透原则合并计算所投资资产管理产品的总资产。本计划投资于其他私募资产管理产品的，该资产管理计划按照穿透原则合并计算的投资同一资产的比例以及投资同一或同类资产的金额，应当符合中国证监会的最新监管规定。资产管理计划应当按照所投资资产管理产品披露投资组合的频率，及时更新计算该资产管理计划所投资资产的金额或比例；
- 4、本计划不直接投资于证券二级市场，不投资于融资类项目；
- 5、本计划所投资的资产管理产品不再投资除公募基金以外的其他资产管理产品；
- 6、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，不低于该计划资产净值的 10%；
- 7、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本计划资产净值的 20%。

#### （十）投资禁止行为

本集合计划的禁止行为包括：

- 1、违规将集合计划资产用于资金拆借、贷款、抵押融资或者对外担保等用途；
- 2、将集合计划资产用于可能承担无限责任的投资；
- 3、向客户做出保证其资产本金不受损失或者保证其取得最低收益的承诺；

- 4、挪用集合计划资产；
- 5、募集资金不入账或者其他任何形式的账外经营；
- 6、募集资金超过计划说明书约定的规模；
- 7、接受单一客户参与资金低于中国证监会规定的最低限额；
- 8、使用集合计划资产进行不必要的交易；
- 9、内幕交易、利益输送、操纵证券价格、不正当关联交易及其他违反公平交易规定的行为；
- 10、不得直接投资商业银行信贷资产；
- 11、不得违规为地方政府及其部门提供融资，不得要求或者接受地方政府及其部门违规提供担保；
- 12、不得直接或者间接投资法律行政法规和国家政策禁止投资的行业或领域；
- 13、法律、行政法规和中国证监会禁止的其他行为。

#### （十一）建仓期

本集合计划的建仓期为 6 个月，本集合计划管理人应当在产品成立之日起 6 个月内，使得本产品投资组合比例符合投资比例的要求。

#### （十二）流动性安排

在开放退出期内，本集合计划资产组合中七个工作日可变现资产的价值不低于该计划资产净值的 10%。

## 十二、投资顾问

本集合计划是否聘请投资顾问：否

### 十三、分级安排

本集合计划是否根据风险收益特征进行分级：否

## 十四、利益冲突及关联交易

(一) 本集合计划可能存在以下利益冲突情形：

本集合计划可投资于管理人及管理人关联方所设立的金融产品。

(二) 利益冲突的处理方式、披露方式、披露内容以及披露频率

### 1、处理方式

对交易进行披露。

### 2、披露方式

管理人在官方网站进行公告。

### 3、披露内容

关联交易对手方、交易品种名称和交易金额。

### 4、披露频率

关联交易发生后的5个工作日内完成披露。

(三) 关联交易

投资者在此同意并认可管理人可以将集合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或承销期内承销的证券及管理人和管理人关联方发行的金融产品，或者从事其他类型的关联交易。交易完成5个工作日内，管理人应通过管理人的网站告知投资者，并书面通知托管人。涉及重大关联交易的，应当遵守法律、行政法规、中国证监会的规定和合同约定，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，投资于证券期货的关联交易还应当向证券期货交易所报告。

## 十五、投资经理的指定与变更

本集合计划投资经理由管理人负责指定。

本集合计划投资经理为彭菁菁、方宇翔。

彭菁菁，上海交通大学 FMBA，具有 6 年以上证券投资、研究、交易或类似从业经历，具备良好的诚信记录及职业操守，且最近三年内没有被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚，具备基金从业资格。

方宇翔，上海交通大学金融学硕士，具有 4 年以上证券投资、研究、交易或类似从业经历，具备良好的诚信记录及职业操守，且最近三年内没有被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚，具备基金从业资格。

集合计划存续期间，如管理人决定变更投资经理的，应当于变更决定日（含）起的 5 日内以管理人网站通告等方式及时向客户披露。

## 十六、资产管理计划的财产

### （一）集合计划资产的保管与处分

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

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

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

（4）管理人、托管人可以按照本合同的约定收取管理费、托管费以及本合同约定的其他费用。管理人、托管人以其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。管理人、托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，资产管理计划财产不属于其清算财产。

（5）资产管理计划财产产生的债权不得与不属于资产管理计划财产本身的债务相互抵销。非因资产管理计划财产本身承担的债务，管理人、托管人不得主张其债权人对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，管理人、托管人应明确告知资产管理计划财产的独立性，采取合理措施并及时通知投资者。

### （二）集合计划账户的开立

托管人为本集合计划开立托管账户、证券账户以及其他相关账户。托管账户名称为“省心享-华泰量化多头单策略 FOF1 号集合资产管理计划”，以实际开立为准。证券账户名称为“华泰证券资管—招商银行—省心享-华泰量化多头单策略 FOF1 号集合资产管理计划”，以实际开立为准。管理人应依法履行受益所有人识别义务，在开立托管账户时按照开户银行要求，就相关信息的提供、核实提供必要的协助，并确保所提供信息以及证明材料的真实性、准确性。

本资产管理计划开立定期存款账户或协议存款账户的，户名应与托管账户户名一致，因存入行系统原因造成存款账户与托管账户户名不一致的情形除外。在除托管人以外的其他银行开立定期存款或协议存款账户的预留印鉴应至少预留

一枚托管人指定人员名章。管理人应与存款银行签订存款协议，约定双方的权利和义务。该协议中必须有如下明确意思表示：“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账户（明确户名、开户行、账号等），不得划入其他任何账户”。

存款行或管理人应当于存单开立之日起5个工作日内将存款证实书原件交托管人保管，存单交接原则上采用存款行或管理人上门服务的方式。对于跨行存款，管理人应先行确认授权送、取存单人员的身份信息，并提前3个工作日与托管人就存单的交接进行沟通。在存款行或管理人将存款证实书原件交托管人保管之前，存款证实书发生丢失、毁损、被恶意挂失等情形的，责任由过错方承担，托管人仅在取得存款证实书原件后保管存款证实书原件。

## 十七、投资指令的发送、确认和执行

资产管理人在运用委托财产时向资产托管人发送资金划拨及其他款项付款指令，资产托管人执行资产管理人的指令、办理资产管理计划名下的资金往来等有关事项。

资产管理人发送的指令包括电子指令和纸质指令。

电子指令包括资产管理人发送的电子指令（采用电子报文传送的电子指令、招商银行托管+综合服务平台录入的电子指令）、自动产生的电子指令（网上托管银行托管人端根据管理人同意设定的业务规则自动产生的电子指令）。纸质指令包括资产管理人给资产托管人传真指令或原件指令。

### （一）资产管理人对发送指令人员的书面授权

资产管理人应事先向资产托管人提供书面授权通知书（下称“授权通知书”），指定指令的被授权人员及被授权印鉴，授权通知书的内容包括被授权人员名单、联系方式、签字/印章样本、权限和预留印鉴等。授权通知书应加盖资产管理人公司公章和法定代表人（或授权人）签字/签章，若由授权代表签署，还用附上法定代表人的授权书，并写明生效时间，未写明生效时间的以本合同签署日期或授权通知书的落款日期为生效时间。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书，同时电话通知资产托管人。授权通知书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，于授权通知书载明的生效时间或授权通知书的落款时间生效。资产管理人在此后三个工作日内将授权通知书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。

资产管理人和资产托管人对授权通知书负有保密义务，其内容不得向授权人、被授权人及相关操作人员以外的任何人泄露，但法律法规规定或有权机关另有要求的除外。

### （二）指令的内容

指令是在管理本资产管理计划时，资产管理人向资产托管人发出的交易成交单、交易指令及资金划拨类指令（下称“指令”）。指令应加盖预留印鉴并由被授权人印章/签字。资产管理人发给资产托管人的资金划拨类指令应写明款项事由、时间、金额、出款和收款账户信息等。

### (三) 指令的发送、确认及执行的时间和程序

#### 1. 指令发送的方式

资产管理人选择以下(2)的方式向资产托管人发送指令：

(1) 资产管理人通过招商银行托管+综合服务平台录入方式，向资产托管人发送电子划款指令或投资指令。

招商银行托管+综合服务平台是指资产托管人基于 Internet 网络，向资产管理人提供的客户服务软件，实现资产管理人与资产托管人之间指令处理、数据传输、业务查询、资料传递和信息服务等直通式处理。

资产管理人和资产托管人另行签订《招商银行“托管+”综合服务平台服务协议》，具体事宜以《招商银行“托管+”综合服务平台服务协议》的约定为准。

(2) 资产管理人通过深证通电子直连对接方式，向资产托管人发送电子划款指令或投资指令。

资产管理人通过深证通电子直连对接方式发送电子指令的，资产管理人应至少在产品成立日前一日，通过预留邮箱或加盖预留印鉴的函件告知资产托管人本产品的资产代码。

对于资产管理人通过上述(1)、(2)方式发送的指令，资产管理人不得否认其效力。

对于资产管理人通过上述(1)、(2)方式发送指令的，在应急情况下，资产管理人可以通过传真发送划款指令或者快递、现场交互原件指令。具体操作方式分别按照以下第(3)、(4)款指令发送方式执行。

#### (3) 资产管理人选择以传真方式发送指令

对于资产管理人通过预留传真号码发出的指令，资产管理人不得否认其效力。

特殊情况下，资产管理人无法使用预留传真号码发送指令时，可通过非预留传真号码应急发送传真指令，资产管理人须通过授权的电话号码通知资产托管人接收传真指令。如因资产管理人未通知资产托管人接收传真指令造成的损失，资产托管人不承担责任。上述特殊情况解决后，资产管理人应向资产托管人出具预留传真号码更新通知，并加盖资产管理人在授权通知书中的预留印鉴。

#### (4) 资产管理人快递寄送或现场交互指令原件的形式传递指令

如需变更指令发送形式，资产管理人须提前向资产托管人提供变更指令发送形式的指令发送方式变更通知书。

## 2.指令附件的发送方式

资产管理人向资产托管人发送指令的同时，通过招商银行托管+综合服务平台、预留传真号码或预留指令附件发送电子邮箱提供相关合同、交易凭证或其他证明材料。资产管理人对该等资料的真实性、有效性、完整性和合法合规性负责。

对于通过招商银行托管+综合服务平台、预留传真号码或预留电子邮箱发出的指令附件，资产管理人不得否认其效力。

## 3.指令发送的时间

对于新股、新债申购等网下公开发行业务，资产管理人应于网下申购缴款日的 14:00 前将指令发送给资产托管人。

对于期货出入金业务，资产管理人应于交易日期货出入金截止时间前 2 小时将期货出入金指令发送至资产托管人。正常情况下由资产托管人依据资产管理人发出的出入金指令，通过期货结算银行银期转账系统进行出入金操作。当结算银行银期转账系统出现故障等其他紧急情况时，资产管理人可以使用非银期转账手工出入金。

非银期转账手工出入金，入金由资产托管人依据资产管理人提供的划款指令通过结算银行的网银系统划往期货公司指定账户后，由资产管理人通知期货公司进行入金操作，出金由资产管理人通知期货公司出金后，再发送指令给资产托管人，由资产托管人依据资产管理人提供的划款指令通过结算银行的网银系统划往本资产管理计划 托管账户。

执行完期货出金或入金的操作后，资产管理人应通过其交易系统或终端系统查询出金划出情况和入金到账情况。

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

对于银行间业务，资产管理人应于交易日 15:00 前将银行间成交单及相关划款指令发送至资产托管人。资产管理人应与资产托管人确认资产托管人已完成证书和权限设置后方可进行本资产管理计划的银行间交易。对于向资产托管人出具无需银行间成交单授权书的，资产管理人应在首笔银行间交易时通过预留电话

通知资产托管人，如资产管理人未通知资产托管人，导致指令未执行或执行失败的，资产托管人不承担责任。

对上海证券交易所认购权证行权交易，资产管理人应于行权日 15:00 前将需要交付的行权金额及费用金额书面通知资产托管人，资产托管人在 16:00 前支付至中国证券登记结算有限责任公司指定账户。

对于指定时间出款的交易指令，资产管理人应提前 2 小时将指令发送至资产托管人；对于资产管理人于 15:00 以后发送至资产托管人的指令，资产托管人不保证当日出款，如出款不成功，资产托管人不承担责任。

#### 4.指令的确认

资产管理人有义务在发送指令后使用预留电话与资产托管人进行确认，如因资产管理人未通知资产托管人接收传真指令造成的损失，资产托管人不承担责任。对于依照授权通知书发出的指令，资产管理人不得否认其效力。

#### 5.指令的执行

资产管理人在发送指令时，应确保出款账户有足够的资金余额、文件资料齐全，并为资产托管人留出执行指令所必需的时间，因资产管理人未给予合理必需的时间导致资产托管人操作不成功的，资产托管人不承担责任。

资产托管人确认收到资产管理人发送的指令后，应对指令进行形式审查，验证指令的要素（金额、收款账号、收款户名、用途）是否齐全；传真指令还应审核印鉴和印章/签字是否和预留印鉴和签字样本表面一致性相符，传真指令加盖的印鉴和预留印鉴形式上不存在重大差异即视为表面一致性审查通过，对于因传真或扫描引起的印章、签字等变形、扭曲，资产托管人不承担审查义务。资产托管人仅对资产管理人提交的指令按照本合同约定进行表面一致性审查，不负责审查资产管理人发送指令同时提交的其他文件资料的合法性、真实性、完整性和有效性，资产管理人应保证上述文件资料合法、真实、完整和有效。如因资产管理人提供的上述文件不合法、不真实、不完整或失去效力而影响资产托管人的审核或给任何第三人带来损失，由资产管理人承担责任。

资产托管人审核指令无误后应在规定期限内及时执行。

#### 6.指令的撤销

在指令未执行的前提下,若撤销传真指令,资产管理人应在原指令上注明“作废”“废”、“取消”等字样并加盖预留印鉴及被授权人印章/签字后传真给资产托管人,并电话通知资产托管人。若撤销电子指令,资产管理人应通过相关系统撤销,系统功能不支持撤销的,应参照撤销传真指令方式撤销电子指令。

#### (四) 资产管理人发送错误指令的情形和处理程序

1.资产管理人发送错误指令的情形包括指令发送人员无权或超越权限发送指令,指令不能辨识或要素不全导致无法执行等情形。

2.当资产托管人认为所接受指令为错误指令时,应及时与资产管理人进行电话确认,并暂停指令的执行,由资产管理人撤销指令或撤销后再重新发送指令。

#### (五) 资产托管人依照法律法规暂缓、拒绝执行指令的情形和处理程序

资产托管人发现资产管理人发送的指令有可能违反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;对于此类托管人事前无法监督并拒绝执行的交易行为,托管人在履行了对管理人的通知义务后,即视为完全履行了其投资监督职责。对于管理人此类违反《基金法》、《管理办法》、《运作规定》、本合同或其他有关法律法规行为造成委托财产或委托人损失的,由管理人承担全部责任,托管人免于承担责任。

#### (六) 资产托管人未按照资产管理人指令执行的处理方法

对于资产管理人的有效指令和通知,除非违反本合同约定或有关法律法规的规定或具有第(四)项所述错误,资产托管人不得无故拒绝或拖延执行。除因故意或重大过失致使本资产管理计划、资产管理人的利益受到损害而负赔偿责任外,资产托管人对执行资产管理人的合法指令对委托财产造成的损失不承担赔偿责任。

#### (七) 更换被授权人员等的程序

资产管理人撤换被授权人员、改变被授权人员的权限、变更或新增接收传真指令的号码、预留电话号码、预留邮箱,必须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重新向资产托管人发出加盖资产管理人公司公章的授权通知书,同时电话通知资产托管人。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，授权通知书于其载明的生效时间生效，同时原授权通知书失效。资产管理人在此后三个工作日内将重新出具的授权通知书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。资产托管人更换接收资产管理人指令的人员，应提前通知资产管理人。

#### （八）指令的保管

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。

#### （九）相关责任

对于因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传输不及时、未能留出足够执行时间、未能及时与资产托管人进行指令确认致使资金未能及时清算或交易失败所造成的损失由资产管理人承担。资产托管人正确执行资产管理人发送的有效指令，委托财产发生损失的，资产托管人不承担任何形式的责任。在正常业务受理渠道和指令规定的时间内，因资产托管人过错造成未能及时或正确执行合法合规的指令而导致委托财产受损的，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。

资产托管人根据本协议相关规定履行印鉴和签名的表面一致性形式审核职责，如果资产管理人的指令存在事实上未经授权、欺诈、伪造或未能及时提供授权通知书等情形，资产托管人不承担因执行有关指令或拒绝执行有关指令而给资产管理人或基金资产或任何第三方带来的损失，全部责任由资产管理人承担，但资产托管人未按合同约定尽形式审核义务执行指令而造成损失的情形除外。

## 十八、交易及交收清算安排

### （一）资金清算与交割

#### 1. 资金划拨

本委托财产非证券交易所场内交易的资金清算交割由托管人根据管理人出具的指令进行办理。在资金头寸充足的情况下，托管人对管理人符合法律法规、本合同的指令不得拖延或拒绝执行。

#### 2. 结算方式

本产品涉及证券交易所场内交易时，管理人通过其在中国证券登记结算有限责任公司（“中登公司”或“中登”）开立的客户结算备付金账户完成包括本合同项下资产管理业务在内的全部交易所证券交易资金结算

#### 3. 资金的清算交收安排

关于计划证券资金账户与银行托管专户之间的资金收付约定如下：

##### （1）资金清付（“银转证”）

管理人原则上应在T日15:00前向托管人发送资金划款指令，托管人在收到管理人的指令后，应对指令的一致性和交易内容进行审核，审核无误的有效指令，应该立即按指令内容将资金由“银行托管专户”最终划至“计划证券资金账户”。

在网络正常情况下，管理人与托管人双方配合在2个工作日内完成资金由“银行转证券”。非正常情况下，管理人与托管人双方配合，采用柜台转账方式完成资金划转。

##### （2）资金清收（“证转银”）

管理人与托管人约定采取以下方式二进行证转银操作：

方式一：

管理人若需将资金从“计划证券资金账户”划至“银行托管专户”，原则上应在T日15:00前向托管人发送资金汇入通知。管理人主动发出资金划款指令，并将处理结果及时通知托管人，托管人及时确认来账信息，完成资金核对。

在网络正常情况下，管理人在1个工作日内完成资金由“证券转银行”，非正常情况下，管理人与托管人双方应采取积极有效的手段完成资金划转。

方式二：

管理人原则上应在 T 日 15:00 前向托管人发送资金划款指令, 托管人在收到管理人的指令后, 应对指令的一致性和交易内容进行审核, 审核无误的有效指令, 应该立即按指令内容将资金由“计划证券资金账户”最终划至“银行托管专户”。

在网络正常情况下, 管理人和托管人双方配合, 在 2 个工作日内完成资金由“证券转银行”。非正常情况下, 管理人与托管人双方配合, 采用柜台转账方式完成资金划转。

(3) 如遇法定节假日, 资金划拨顺延至法定节假日后第一个证券交易所交易日。

#### 4、无法按时支付证券清算款的责任认定及处理程序

管理人应确保托管人在执行管理人发送的指令时, 有足够的头寸进行交收。委托财产的资金头寸不足时, 托管人有权拒绝管理人发送的划款指令。管理人在发送划款指令时应充分考虑托管人的划款处理所需的合理时间, 一般为 2 个工作日。如由于管理人的原因导致无法按时支付证券清算款, 由此造成的损失由管理人承担。

#### (二) 交易所证券交易数据的传输与送达

管理人选择的证券公司负责办理集合计划的证券交易的清算交割; 管理人应责成其选择的证券公司对其发送的数据的准确性、完整性、真实性负责。管理人、托管人以及证券公司应另行签署操作备忘录, 约定集合计划在证券投资运作中的职责及义务。

#### (三) 期货交易及清算交收

管理人选择的期货公司负责办理集合计划的期货交易的清算交割; 管理人应责成其选择的期货公司对其发送的数据的准确性、完整性、真实性负责。管理人、托管人以及期货公司应另行签署《期货投资托管操作备忘录》, 约定集合计划在期货投资运作中的职责及义务。

#### (四) 资金和证券账目对账的时间和方式

集合计划的证券、资金账目, 管理人和托管人应每日核对。

资金账目的核对需要集合计划的管理人和托管人双方每个交易日进行。待当日账务处理完毕, 管理人与托管人核对账务, 确保双方账账相符。

证券账目的核对需要集合计划管理人和托管人双方每个交易日进行。交易日终了时，管理人将列明所持有证券种类、数量的估值表，用传真方式或约定的电子传送方式送托管人进行核对。核对中出现问题的，由管理人和托管人双方共同查找原因，进行调整。

对实物券账目，每月月末相关各方进行对账核实。

管理人应采取必要且合理措施，确保集合资产管理计划不发生透支。

发生证券超买时，管理人应以自有资金补足超买款（包括超买款项及相关费用）。超买证券平仓后，托管人将资金扣除相应损失、费用后退还管理人。管理人承担由此引起的一切法律责任。

## 十九、越权交易的界定

### (一) 越权交易的界定

本合同所指越权交易是指管理人在委托投资交易过程中发生的如下行为：

- 1、违反本合同第十一章资产管理计划的投资中的规定的投资交易行为。
- 2、进行法律法规禁止的超买、超卖行为。

### (二) 对越权交易的处理

#### 1、违反本合同资产管理计划的投资章节中的规定进行的投资交易行为

托管人发现管理人的投资运作违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反本合同约定时，应当及时要求管理人在托管人指定的限期内纠正，管理人收到通知后应及时核对，并以书面形式向托管人进行解释或举证；如未能改正或造成委托人、委托资产损失的，托管人应当及时通知委托人，并向管理人住所地中国证监会派出机构报告。

在托管人指定的限期内，托管人有权随时对通知事项进行复查，督促管理人改正。管理人对托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，托管人应通知委托人，并报告管理人住所地中国证监会派出机构。

托管人保留就管理人违反法律、行政法规、中国证监会的规定或者本合同约定的任何违规行为向管理人住所地中国证监会派出机构报告的权利。

#### 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，如果发现委托资产投资证券过程中出现超买或超卖现象，应立即提示管理人，由管理人负责解决，如未能改正的，应当拒绝执行，并向管理人住所地中国证监会派出机构报告，由此给委托资产造成的损失由管理人承担。如果因管理人原因发生超买行为，管理人必须于 T+1 日上午 10:00 前保证所需资金到位,用以完成清算交收。

越权交易所发生的损失及相关交易费用由管理人负担，管理人应按托管人、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委托资产所有。

#### 3、反向交易行为

本计划不得在同一交易日内进行反向交易及其他可能导致不公平交易和利益输送的交易行为。确因投资策略或流动性等需要发生同日反向交易的，应要求投资经理提供决策依据，并留存书面记录备查。

### （三）托管人对管理人投资运作的监督

1.资产托管人对资产管理人的投资行为行使监督权。资产托管人根据本合同有关资产管理计划财产投资策略的约定，自本计划成立之日开始对本计划的以下投资范围、投资比例、投资限制、投资禁止行为进行监督和检查。

#### 投资范围：

（1）金融产品：本计划主要投资于管理人选定的证券公司、基金公司、期货公司发行的集合资产管理计划以及在中国证券投资基金业协会备案的私募基金管理人发行的私募证券投资基金（上述资产简称：私募基金）、公募证券投资基金、商业银行理财产品。本集合计划所投资的资产管理产品不会再投资公募证券投资基金以外的资产管理产品。

（2）现金类资产：包括现金、存款、通知存款、同业存单、期限在7天以内(含7天)的债券逆回购、货币市场基金以及中国证监会认可的其他现金管理类工具。

#### 投资比例：

（1）金融产品：占集合计划资产总值的80%-100%（按市值计），金融产品包括证券公司、基金公司、期货公司发行的集合资产管理计划以及在中国证券投资基金业协会备案的私募基金管理人发行的私募证券投资基金（上述资产简称：私募基金）、公募证券投资基金、商业银行理财产品。本计划按照管理人定期提供的所投资资产管理产品披露的组合投资，根据穿透原则合并计算的投资于权益类资产的总值不得低于计划总资产的80%，投资于固定收益类、商品及金融衍生品类资产的总值均不得超过计划总资产的20%。

（2）现金类资产：现金类资产包括现金、存款、通知存款、同业存单、期限在7天以内（含7天）的债券逆回购、货币市场基金以及中国证监会认可的其他现金管理类工具。

#### 投资限制：

（1）本计划的总资产不得超过本计划净资产的200%（按市值计）；

（2）本计划投资于同一资产的资金不得超过计划资产净值的25%（按市值计）；按照所投资资产管理产品披露组合投资的频率，管理人管理的全部集合资产管理计划根据穿透原则合并计算的底层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) 本计划投资于其他资产管理产品的，计算本计划的总资产时应当按照穿透原则合并计算所投资资产管理产品的总资产。本计划投资于其他私募资产管理产品的，该资产管理计划按照穿透原则合并计算的投资同一资产的比例以及投资同一或同类资产的金额，应当符合中国证监会的最新监管规定。资产管理计划应当按照所投资资产管理产品披露投资组合的频率，及时更新计算该资产管理计划所投资资产的金额或比例；

(4) 本计划不直接投资于证券二级市场，不投资于融资类项目；

(5) 本计划所投资的资产管理产品不再投资除公募基金以外的其他资产管理产品；

(6) 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，不低于该计划资产净值的 10%；

(7) 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本计划资产净值的 20%。

托管人对上述投资比例中第 1 款、投资限制中第 (2)、(3)、(5) 款中根据穿透原则以及投资的资产管理产品投向进行的投资监督，均以管理人定期提供的数据为基准。

投资禁止行为：

(1) 挪用集合计划资产。

(2) 不得直接投资商业银行信贷资产。

2. 资产托管人发现资产管理人的投资运作、划款指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反本合同时，应当拒绝执行，立即通知资产管理人限期纠正，并及时报告中国证监会；资产托管人发现资产管理人依据交易程序已经生效的划款指令违反法律、行政法规或其他有关规定，或者违反本合同约定的，应当立即通知资产管理人限期纠正，超过期限未纠正的，有权及时报告中国证监会。资产管理人收到通知后应及时核对或纠正，并向资产托管人进行解释或举证。

3. 在限期纠正的期限内，资产托管人有权对通知事项进行复查，督促资产管理人改正。资产管理人对资产托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，资产

托管人应报告中国证监会。

4. 投资者确认，托管人的投资监督职责以本合同约定为限，且托管人投资监督的准确性和完整性受限于证券经纪商及其他中介机构提供的数据和信息。

托管人对管理人投资运作的监督，以投资政策及经管理人与托管人核对确认的核算估值结果为根据。

## 二十、资产管理计划财产的估值和会计核算

### (一) 集合计划的估值

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。

#### 1、资产总值

集合计划资产总值是指集合计划投资所形成的各类有价证券、银行存款本息及其他资产的价值总和。

#### 2、资产净值

集合计划资产净值是指本集合计划资产总值减去负债后的净资产值。

#### 3、份额净值

集合计划份额净值是指本集合计划资产净值除以计划份额。

#### 4、估值目的

本集合计划资产估值的目的是客观、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份额净值，是进行信息披露、计算参与和退出集合计划的基础。

#### 5、估值对象

本集合计划依法拥有的银行存款本息、有价证券、应收款项、其他投资等资产。

#### 6、估值时间

集合计划成立后（含成立日）的每个工作日均是计划的估值日，管理人与托管人在每个估值日的下一个工作日对估值日的集合计划资产进行估值处理并核对。

#### 7、估值方法

估值应符合《企业会计准则》、《指导意见》、《管理办法》、《运作规定》及其他法律、法规的规定，其中固定收益品种的估值参照基金业协会《估值小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》执行，如法律法规未做明确规定的，参照行业通行做法处理。资产管理人、资产托管人的估值数据应依据合法的数据来源独立取得。

##### (1) 金融产品的估值

1) 持有的交易所上市基金（包括封闭式基金、上市开放式基金（LOF）、创新型分级基金等），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。

2) 持有的场外开放式基金（包括托管在场外的上市开放式基金（LOF））按估值日的基金份额净值估值；估值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。

3) 持有的货币市场基金，按所投资基金前一估值日后至估值日期间（含节假日）的万份收益计提估值日基金收益。

4) 持有的基金处于封闭期的，按照估值日份额净值估值；没有公布份额净值的，按照成本估值。

5) 持有的集合资产管理计划以及私募基金，按照管理人或管理人授权的第三方披露的估值日计划（基金）份额净值估值，估值日份额净值未披露的，以最近一次披露的计划（基金）份额净值估值，托管人接受净值的邮箱为 [ss0819@cmbchina.com](mailto:ss0819@cmbchina.com) 和 [njzctgzy@cmbchina.com](mailto:njzctgzy@cmbchina.com)，最新净值数据以邮件接收为准。若其管理人收取业绩报酬，且披露的份额净值未反应业绩报酬影响，为消除集合资产管理计划以及私募基金计提业绩报酬对资产净值的影响，分以下情况处理：a) 在估值日，持仓份额发生实际业绩报酬计提，按照管理人或授权第三方披露的实际计提的业绩报酬调整持仓份额；b) 在估值日，持仓份额未发生实际业绩报酬计提，但管理人或其授权第三方披露扣除预估业绩报酬后的计划（基金）份额净值，采用扣除预估业绩报酬后的计划（基金）份额净值估值；c) 在估值日，持仓份额未发生实际业绩报酬计提，但管理人或其授权第三方披露估值日预估业绩报酬，根据披露的估值日预估业绩报酬对未扣减业绩报酬的计划（基金）份额净值进行调整，采用调整后的扣除预估业绩报酬的计划（基金）份额净值估值。调整后计划（基金）份额净值=（估值日持有份额数-估值日预估业绩报酬扣减份额数）\*未扣减业绩报酬计划（基金）份额净值/估值日持有份额数；d) 在估值日，持仓份额未发生实际业绩报酬计提，管理人也未披露扣除预估业绩报酬后的计划（基金）份额净值或预估业绩报酬，以最近一次扣除（预估）业绩报酬

后的净值估值。如遇该估值日为集合计划开放日，为使申购、赎回价格公允合理，集合计划管理人可根据计划（基金）合同约定的业绩报酬计提方法预估业绩报酬并调整计划（基金）净值，在履行相应程序后按调整后的计划（基金）净值估值。为实现本款估值之目的，本计划管理人应及时告知托管人本计划持有的集合资产管理计划以及私募基金的相关信息，包括但不限于：持有的计划（基金）之管理人是否收取业绩报酬、其披露的份额净值是否反应业绩报酬影响、在估值日持仓份额是否发生实际业绩报酬计提、是否披露扣除预估业绩报酬后的计划（基金）份额净值或预估业绩报酬等。若本计划管理人未及时告知托管人的，托管人将以披露的份额净值估值。

6) 计划发生的金融产品申购赎回交易，在取得申购赎回交易确认信息后，根据未知价原则将该交易确认在申请日后的最近一个估值日。

#### (2) 银行存款的估值

银行存款以成本列示，按商定的存款利率在实际持有期间内逐日计提应收利息。

#### (3) 逆回购的估值

逆回购交易以成本列示，按实际利率在实际持有期间内逐日计提利息。

(4) 本计划持有的同业存单采用中央国债登记结算有限责任公司提供的相应品种当日的估值价格估值，选定的第三方机构未提供价格的，按成本估值。

(5) 如有充足证据表明按前述方法进行估值不能真实公允客观反映其价值的，资产管理人根据具体情况，经与资产托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值。

(6) 如资产管理人或资产托管人发现对资产管理计划财产的估值违反本合同项下订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护资产投资者利益时，应立即通知对方，共同查明原因，双方协商解决。

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

### 8、估值程序

(1) 管理人应每工作日对集合计划资产估值。集合计划资产净值和份额净值由管理人负责计算，托管人复核。具体流程为：在估值日交易结束后，管理人

与托管人通过电话、电子邮件、深证通或其他双方约定的方式核对当日的交易结果与银行存款余额。在估值日的下一工作日管理人完成估值日的估值处理后，将估值结果以电话或电子邮件、深证通以及其他双方认可的方式发送给托管人，托管人进行复核，并以电话或电子邮件、深证通以及其他双方认可的方式将复核结果传送给管理人。如果托管人的估值结果与管理人的估值结果存在差异，且双方经协商未能达成一致，管理人有权按照其对集合计划净值的计算结果对外予以公布，由此产生的估值错误，由过错方承担相应赔偿责任，托管人有权将相关情况报集合计划管理人住所地中国证监会派出机构。

管理人委托华泰证券股份有限公司为本计划提供估值与核算服务。

## (2) 集合计划账册的对账

1) 管理人和托管人在本集合计划成立后，应按照双方约定的同一记账方法和会计处理原则，分别独立地设置、登录和保管本集合计划的全套账册，对双方各自的账册定期进行核对，互相监督，以保证集合计划资产的安全。

2) 管理人按日编制集合计划估值表，与托管人核对账目。

## 9、估值错误与遗漏的处理方式

(1) 本计划份额净值的计算精确到 0.0001 元，小数点后第五位四舍五入。当资产估值导致本计划份额净值小数点后四位以内（含第四位）发生差错时，视为本计划份额净值错误。

(2) 本计划管理人和本计划托管人应采取必要、适当、合理的措施确保本计划资产估值的准确性和及时性。当估值出现错误时，本计划管理人应当立即予以纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大。

(3) 因发生估值差错导致本计划资产或本计划持有人损失的，由本计划管理人负责赔偿，本计划管理人在赔偿本计划资产或本计划持有人后，对不应由其承担的责任，有权根据过错责任原则，向存在过错的一方追偿。

## 10、暂停估值的情形

集合计划投资所涉及的证券交易所遇法定节假日或因其它原因暂停营业时或因其它任何不可抗力致使管理人无法准确评估集合计划资产价值时，可暂停估值。但估值条件恢复时，管理人必须按规定完成估值工作。

## 11、特殊情况的处理

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

误等原因，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，但仍未能发现错误的，由此给计划资产造成损失的，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。

## （二）会计政策

1、管理人为本计划会计核算的责任主体，本计划的会计核算按国家有关会计制度执行。

2、本计划会计年度指公历每年1月1日至12月31日，计划成立当年的会计年度按如下原则：如果本计划成立不足3个月，可以并入下一个会计年度；

3、本计划核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位。

4、本计划独立建账、独立核算；

5、管理人及托管人各自保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关规定编制会计报表；

6、管理人应定期每月与托管人就资产管理计划的会计核算、报表编制等进行核对并以书面方式确认。

## 二十一、资产管理计划的费用与税收

### (一) 集合计划费用的种类

- 1、管理人的管理费；
- 2、管理人的业绩报酬；
- 3、托管人的托管费；
- 4、计划成立后与计划相关的会计师费；
- 5、计划成立后与计划相关的信息披露费用、律师费、诉讼费和仲裁费等费用；
- 6、计划的证券、期货、基金等交易相关费用；
- 7、计划的开户费用、账户维护费用、银行汇划费用；
- 8、按照国家有关规定和《集合计划合同》约定，可以在计划财产中列支的其他费用。

### (二) 费用计提方法、计提标准和支付方式

#### 1、集合计划管理人的管理费

本集合计划的管理费按前一日集合计划资产净值的 1% 年费率计提，计算方法如下：

$$T = E \times 1\% \div \text{当年天数}$$

T 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，按自然季度支付。经管理人与托管人双方核对无误后，管理人向托管人出具划款指令于每季度前 5 个工作日内将上季度计提的管理费从集合计划资产中一次性支付给管理人。

管理人有权根据情况下调管理费率，并于费率下调日前至少 1 个工作日公告。自下调日起，管理费按照新费率执行。

#### 2、集合计划管理人的业绩报酬

##### (1) 业绩报酬的计提原则：

投资者在不同时间多次参与本计划的，管理人对投资者按每笔参与份额分别考核，对超过业绩报酬计提基准的超额收益部分按约定的业绩报酬计提比例计提。

在本计划成立后每个收益分配、份额退出、计划终止时，管理人根据本计划合同约定的提取条件和方法计提业绩报酬。其中：

- 1) 收益分配时计提业绩报酬的，管理人将从分红金额中收取
- 2) 份额退出时计提业绩报酬的，管理人将从退出金额中收取；
- 3) 计划终止时计提业绩报酬的，管理人将从清算财产中收取。

(2) 业绩报酬 (R) 的计算方法

$$R = F \times NAV'_0 \times \left[ \frac{NAV_t - NAV_0}{NAV'_0} - B \times T / 365 \right] \times P\%$$

其中：

F 为提取业绩报酬的份额；

NAV'\_0 为上一个业绩报酬计提日的计划份额净值（如为首次计提业绩报酬，认购参与的为本计划初始发售面值，申购参与的为申购参与的份额净值）；

NAV\_t 为本次业绩报酬计提日的计划累计份额净值；

NAV\_0 为上一个业绩报酬计提日的计划累计份额净值；

B 为业绩报酬计提基准（年化）；

P% 为业绩报酬计提比例；

T 为上一个业绩报酬计提日（如为首次计提业绩报酬，认购参与的为本计划成立日，申购参与的为申购参与当日）到本次业绩报酬计提日的自然日天数；

(3) 业绩报酬计提基准和计提比例

业绩报酬计提基准：本集合计划业绩报酬计提基准（年化）为 8%。

业绩报酬计提比例 15%。

(4) 业绩报酬的计算和支付

本集合计划的业绩报酬由注册登记机构根据本合同约定的方法计算，并通过注册登记数据文件发送。

托管人根据管理人的指令将业绩报酬划拨给注册登记机构，由注册登记机构将业绩报酬支付给管理人。

### 3、集合计划托管人的托管费

本集合计划托管费按前一日集合计划资产净值的 0.01% 年费率计提，计算方法如下：

$$T = E \times 0.01\% \div \text{当年天数}$$

T 为每日应计提的集合计划托管费

E 为前一日集合计划资产净值

集合计划托管费每日计提，按自然季度支付。于每季度前5个工作日内经管理人与托管人双方核对无误后，管理人向托管人出具划款指令将上季度计提的托管费从集合计划资产中一次性支付给托管人。

托管费收入账户：

户名：其他应付款 - 托管费收入

账号：912550120620091010

开户银行：招商银行南京分行运营管理部

#### 4、计划成立后与计划相关的会计师费

本集合计划的年度财务会计报告审计费，按与会计师事务所签定协议所规定的金额，在被审计会计期间，按直线法在每个自然日内平均摊销。

5、上述“一、集合计划费用的种类”中的第5-8项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额通过一次计入或摊销方式列入当期费用。

#### （三）不列入集合计划费用的项目

计划成立前以及初始募集期发生的信息披露费、会计师费、律师费等相关费用以及存续期间发生的与销售有关的费用，不得列入计划费用。

集合计划管理人和集合计划托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或集合计划资产的损失，以及处理与集合计划运作无关的事项发生的费用等不列入集合计划费用。

#### （四）集合计划的税收

本集合计划运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律法规执行。本集合计划运作过程中应当依法承担包括增值税在内的纳税义务。各方一致同意，根据国家法律法规、部门规章和其他规范性文件，如果本集合计划的运营过程中产生增值税等应税行为，需要缴纳增值税等税费的，管理人有权从集合计划资产中提取与应承担税费等额的费用。具体提取时间及提取金额参考相关税费征缴情况由管理人确定，由托管人根据管理人划款指令从集合计划资产中支付给管理人。管理人有义务与所在地方税务机关保持联系和沟通，确认相关纳税品种和相关计算方式。产品成立后管理人须及时向托管人提供增值税相关税率方案和参数方案。

## 二十二、资产管理计划的收益分配

本集合计划是否进行收益分配：是。

### （一）计划利润的构成

计划利润指计划利息收入、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，计划已实现收益指计划利润减去公允价值变动收益后的余额。

### （二）计划可供分配利润

计划可供分配利润指截至收益分配基准日计划未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数；

### （三）计划收益分配原则

1、在符合收益分配原则的前提下，计划管理人每年最多进行2次收益的分配；

2、计划收益分配基准日的份额净值减去每单位份额收益分配金额后不能低于面值；

3、每一计划份额享有同等分配权；

4、每次收益分配不得低于基准日可供分配收益的20%；

5、法律法规另有规定的从其规定。

在符合法律法规和计划合同约定，并对计划份额持有人利益无实质不利影响的前提下，管理人在与委托人协商一致后可对收益分配原则进行调整，并在管理人网站上公告。

### （四）收益分配方案的确定与通知

收益分配方案应载明截止收益分配基准日的可供分配利润、分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。

收益分配方案由管理人拟定，并通知托管人，在R-2日（R为权益登记日）前公告。

计划红利发放日距离收益分配基准日（即可供分配利润计算截止日）的时间原则上不得超过15个工作日。

### （五）收益分配的执行方式

本集合计划的分红方式为现金分红。现金分红时，管理人将现金红利款划往销售机构账户，再由销售机构划入委托人账户，自红利发放之日起7个工作日内

到达委托人账户。

计划收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，计划登记机构可将计划份额持有人的现金红利自动转为计划份额。

## 二十三、信息披露与报告

(一) 本计划的信息披露应符合《指导意见》、《管理办法》、《运作规定》、计划合同及其他有关规定。相关法律法规关于信息披露的规定发生变化时,本计划从其最新规定。

### (二) 管理人披露信息

#### 1、计划份额净值

计划成立后,在封闭期内,计划管理人应当至少每周披露一次计划份额净值;计划成立后的每个开放期内,计划管理人在每个开放日后两个工作日内披露开放日的计划份额净值。

计划份额净值信息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,管理人将提前在原网站进行公告。

#### 2、计划定期报告,包括年度报告、季度报告

管理人应当在每年结束之日起4个月内,编制完成经托管人复核的计划年度报告,并将年度报告在管理人指定网站上披露,管理人应当聘请具有证券相关业务资格的会计师事务所对本计划的年度报告进行审计。

管理人应当在每个季度结束之日起一个月内,编制完成经托管人复核的计划季度报告,并将季度报告在管理人指定网站上披露。

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

年度报告包括但不限于下列信息:

- (1) 管理人履职报告;
- (2) 托管人履职报告;
- (3) 资产管理计划投资表现;
- (4) 资产管理计划投资组合报告;
- (5) 资产管理计划运用杠杆情况(如有);
- (6) 资产管理计划财务会计报告;
- (7) 资产管理计划支付的管理费、托管费、业绩报酬(如有)等费用的计提基准、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) 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。

### 3、临时报告

集合计划存续期间，发生对集合计划持续运营、投资者利益、资产净值产生重大影响的事件，管理人应当于5日内以管理人网站通告等方式及时向客户披露。临时报告的情形包括但不限于：

1) 集合计划运作过程中，负责集合资产管理业务的高级管理人员或投资经理人员发生变更，或出现其他可能对集合计划的持续运作产生重大影响的事项；

2) 暂停受理或者重新开始受理参与或者退出申请；

3) 发生巨额退出并延期办理；

4) 集合计划终止和清算；

5) 集合计划存续期满并展期；

6) 管理人以自有资金参与和退出；

7) 合同的补充、修改与变更；

8) 与集合计划有关的重大诉讼、仲裁事项；

9) 集合计划投资于管理人及与管理人有关关联方关系的公司发行的证券；

10) 管理人、托管人因重大违法违规，被中国证监会取消相关业务资格；

11) 管理人、托管人因解散、破产、撤销等原因不能履行相应职责；

12) 其他可能影响投资者权益的重大事项。

13) 其他依据法律法规需要披露的情形。

### (三) 管理人提供的其他服务

#### 1、对账单

管理人每个季度通过网站或交易客户端等方式向投资者提供对账单，对账单内容应包括投资者持有计划份额的数量及净值，参与、退出明细，以及收益分配等情况。

### (四) 投资者查询的方式和途径

#### 1、管理人网站信息披露

本计划说明书、资产管理合同、其他备查文件、相关报告、相关公告等有关

集合计划的信息，将在集合计划管理人网站上披露，投资者可随时查阅。

管理人网址：[htamc.htsc.com.cn](http://htamc.htsc.com.cn)

## 2、管理人、其他销售机构指定营业网点查询

本计划说明书、资产管理合同、其他备查文件、相关报告等文本存放在集合计划管理人和集合计划其他销售机构的住所，投资者可在营业时间内免费查阅，也可按工本费购买复印件。对投资者按上述方式所获得的文件及其复印件，集合计划管理人和集合计划托管人保证其内容与所披露的内容完全一致。

## 3、华泰证券资产管理客服电话

本集合计划披露的有关集合计划的信息，投资者可以通过华泰证券资产管理客服电话（4008895597）查询。

## 二十四、风险揭示

本集合计划面临包括但不限于以下风险：

### （一）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、衍生品风险等。

#### 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及投资者承担。投资者应充分知晓投资运营的相关风险，其风险应由投资者自担。

#### 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

交易对手方未能实现交易时的承诺，按时足额还本付息的风险，或者交易对手未能按时履约的风险。

#### 6、募集失败风险

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缴纳的款项，并加计银行同期活期存款利息。

## 7、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，将由委托财产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。

## 8、合规风险

在资产管理计划管理或运作过程中，违反国家法律、法规的规定，或者资产管理计划投资范围、投资比例等违反法规及集合资产管理合同有关规定的风险。管理人可能因此被监管机构采取监管措施或被责令调整资产管理计划投资范围及比例，从而影响资产管理计划的具体运作和投资收益。

## 9、无法履约风险

管理人因停业、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。

## 10、关联交易风险

根据本合同的约定，本计划管理人可以将本计划资产投资于管理人、托管人及其控股股东、实际控制人或者其他关联方发行的证券或者承销期内承销的证券，或从事其他类型的关联交易，可能存在一定的风险。

## 11、适当性相关风险

(1) 委托人有义务保证其提供的相关信息及材料真实、准确、完整。管理人及销售机构（如有）评定委托人的风险承受能力、作出适当性匹配意见系基于委托人提供的相关信息及证明材料真实、准确、完整的前提下作出；如委托人提供的信息及材料不真实、不准确或不完整，存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，可能会导致委托人的风险承受能力评定、适当性匹配意见存在偏差、与实际不符的风险，管理人及销售机构（如有）有权拒绝为委托人提供服务或拒绝接受委托人的交易申请、业务申请，相关风险、责任、损失由委托人自行承担。

管理人及销售机构（如有）禁止其工作人员为影响评估结果在投资者填写基本信息表、风险承受能力评估问卷时进行提示、暗示、诱导。委托人知晓管理人及销售机构（如有）工作人员存在前述行为，仍遵照配合致使所提供的信息及材

料不真实、不准确、不完整，或存在虚假记载、误导性陈述、重大遗漏等情形的，视为委托人违反其应履行的适当性义务，委托人应承担由此产生的后果、损失、责任。

(2) 委托人在其信息发生重要变化、可能影响管理人及销售机构（如有）对其作出的投资者类别划分、风险承受能力认定时，应主动告知管理人及销售机构（如有），以便管理人及销售机构（如有）作出调整。若委托人未能及时有效告知管理人及销售机构（如有），则存在适当性匹配意见与实际不符的风险，进而可能产生应由委托人自行承担的相应风险、责任、损失。

(3) 委托人或产品的信息发生变化时，管理人及销售机构（如有）有权主动调整委托人的投资者分类、产品的风险等级以及适当性匹配意见。管理人及销售机构（如有）作出主动调整的，委托人的交易或者购买产品的资格可能受到影响，进而产生相应的风险。

## 12、其他风险

包括但不限于：

(1) 技术风险。在本集合计划的日常交易中，可能因为技术系统的故障或者差错而影响交易的正常进行或者导致投资者的利益受到影响。这种技术风险可能来自本集合计划管理人、托管人、证券交易所以及证券注册登记机构等。

(2) 操作风险。本集合计划管理人、托管人、证券交易所以及证券注册登记机构等在业务操作过程中，因操作失误或违反操作规程而引起的风险。

(3) 因制度建设、人员配备以及内控制度建立等方面不完善而产生的风险。

(4) 因人为因素而产生的风险、如内幕交易以及欺诈行为等产生的风险。

(5) 对主要业务人员如投资经理的依赖而可能产生的风险。

(6) 因业务竞争压力可能产生的风险。

(7) 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，可能导致委托资产的损失，从而带来风险。

(8) 其他意外导致的风险。

## (二) 特殊风险揭示

### 1、资产管理合同与证券投资基金业协会合同指引不一致所涉风险

本资产管理计划因投资或其他特殊需要，证券投资基金业协会发布的《集

合资产管理计划资产管理合同内容与格式指引（试行）》（以下简称《集合指引（试行）》）部分具体要求对本资产管理计划投资者不适用，可能存在资产管理合同部分条款与《集合指引（试行）》不一致的情况。

#### 2、资产管理计划份额转让所涉风险；

本资产管理计划份额允许通过证券交易所以及中国证监会认可的交易平台依法转让，存在因转让场所规则限制、投资者持有份额被司法冻结、投资者未满足资产管理合同最低参与金额要求或其他不可抗力的因素等造成的转让失败风险。

#### 3、资产管理计划未在证券投资基金业协会完成备案手续或不予备案情形所涉风险；

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

因此，即使本资管计划成立，并不意味着本计划必然能获得基金业协会的备案。而该等备案过程可能会受到相应监管政策的影响，包括备案时间所需时间、能否通过备案都存在一定的不确定性。如果在计划成立后不能及时完成备案，将可能导致本计划错过市场行情或投资机会；如果本计划在成立后无法获得基金业协会的备案，则将直接影响本计划设立目的的实现。当出现无法通过基金业协会备案的情形，资产管理人将有权决定提前终止本计划，由此直接影响委托人参与本计划的投资目的。

#### 4、采用电子签名合同管理方式所带来的风险

本集合计划采用电子签名方式进行集合计划资产管理合同的签署、核对、收集、整理和保管，在运用电子签名方式进行集合计划合同管理过程中，由于系统故障、人员操作失误、相关机构之间衔接不畅等原因，可能导致投资者参与申请无法及时确认、投资者资料信息错误、投资者无法查询交易信息等情形，从而导致风险。

#### 5、自有资金参与退出风险

鉴于本集合计划管理人在存续期自有资金的参与可能造成投资者收益稀释

或者由于自有资金退出致使管理人被动变现集合计划资产导致集合计划净值受损，从而产生自有资金参与退出风险。为此，管理人提请投资者注意该风险。

## 6、其他特殊风险。

### (1) FOF 产品管理模式特有风险

各类不同资产及投资策略在不同的市场环境下表现不同，管理人根据资产配置模型进行大类资产配置，并筛选市场上各个策略的投资策略资产进行投资。各个策略资产的表现可能高于预期，也可能低于预期；可能由于管理人对策略资金分配不当，导致集合计划资产亏损。反之，也可能出现管理人资金分配合理，但由于具体策略的投资管理人投资管理能力不佳造成的资产亏损。

### (2) 投资金融产品的风险

本集合计划部分资产将配置于金融监管部门批准或备案发行的金融产品（包括证券投资基金、基金管理公司特定多个客户资产管理计划、期货公司集合资产管理计划、基金管理公司子公司特定多个客户资产管理计划、经备案的投资于证券市场的契约型私募基金及法律法规允许的其他金融产品等），投资上述金融产品可能因下列特定风险因素给本计划造成不利影响，请委托人知悉。

#### 1) 金融产品管理人风险

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

#### 2) 金融产品投资风险

本集合计划所投资的金融产品可能由于其管理人对市场判断失误、买入标的市场表现不佳、风险控制失效等原因造成产品净值的下降，从而造成集合计划净值下降，最终导致集合计划委托人资产损失；

#### 3) 策略模型风险

在实际运作中，因金融产品的投资经理变更导致模型无法有效运作，开发的策略或模型不再有效或者在运作过程中与产品期初投资策略和投资风格发生偏离，进而影响产品投资业绩。

#### 4) 赎回金融产品面临的流动性风险

因本计划委托人赎回或资产配置调整需要，管理人赎回金融产品时，可能触发所投资的金融产品大额赎回或巨额赎回条款，或所投资的金融产品处在封闭期，导致赎回资金延迟到账的风险。

#### 5) 投资金融产品可能面临双层收费的风险

本集合计划委托人需要承担双层费用，即集合计划费用及集合计划所投资的金融产品自身需要承担费用。集合计划所投资的金融产品自身需要承担费用包括金融产品的管理费、托管费、业绩报酬（如有）、认购费（如有）、赎回费（如有）等，以上费用在计提时将会扣减金融产品的资产净值，从而造成集合计划净值下降。

#### 6) 投资金融产品的估值风险

本集合计划的投资多个底层金融产品，每个金融产品的估值时间可能不一致，且披露时间可能不一致，本集合计划按照金融产品估值日最近的份额净值进行估值。在存续期间，集合计划份额净值可能无法反映真实投资管理情况。

此外，为消除底层金融产品计提业绩报酬对本计划资产净值的影响，本计划在估值方法上已采取适当的措施与安排，但仍不排除在本计划的封闭期内，由于无法在每个估值日及时准确获取金融产品预估业绩报酬或扣除预估业绩报酬后的净值，导致封闭期披露的集合计划份额净值未充分体现底层金融产品计提业绩报酬的影响，当底层金融产品发生业绩报酬提取或在本计划开放日发生管理人根据金融产品约定的业绩报酬计提方法预估业绩报酬并调整本计划份额净值的情形时，可能造成集合计划份额净值波动的风险。

#### 7) 底层金融产品提取业绩报酬对产品净值造成下跌的风险

由于本计划投资多个金融产品，每个金融产品在业绩报酬计提方式、业绩报酬计提时间以及产品估值时间与本集合计划层面可能不一致，当底层金融产品提取业绩报酬后造成集合计划净值下降、委托人持有集合计划份额期间收益下降的风险。

## 二十五、资产管理合同的变更、终止与财产清算

### (一) 合同变更的方式、条件和程序

1、本合同签署后，因法律、法规、规章、中国证监会的规定、基金业协会的相关规定、证券登记结算机构业务规则以及证券交易所等交易规则修订，自该修订生效之日起，本合同相关内容及条款按该修订办理并在管理人网站公告。投资者特此同意并认可管理人经与托管人协商，可以对本集合计划合同及说明书与新的法律法规或有关政策不一致的内容进行更新或修改，更新或修改的内容不得违反法律法规和中国证监会的有关规定，更新或修改的内容在管理人网站公告满五个工作日后生效。投资者对更新或修改的内容有异议，可在更新或修改内容生效前按照本合同的规定申请退出本集合计划。

2、由于其他原因需要变更合同（不涉及产品类型、投资比例、具体投向变更）的，管理人须以管理人网站公告或其他方式向投资者发送合同变更征询意见，投资者应在征询意见函指定的日期内按指定的形式回复意见。投资者不同意变更的，有权在管理人公告规定的时间内提出退出本集合计划的申请；对于明确答复不同意合同变更但逾期未退出本集合计划的投资者，管理人将统一在合同变更生效日前一工作日做强制退出处理（退出价格为退出当日的计划份额净值）。投资者未在前述时间回复意见的，视为投资者同意。变更事项自征询意见函指定的日期届满的次一工作日开始生效，对合同各方均具有法律效力。

3、管理人如需对本合同的产品类型、产品投向、投资比例做出变更的，需先行取得投资者书面同意，如投资者未在前述时间书面回复同意的，视为投资者不同意，投资者不同意变更的，有权在管理人公告规定的时间内提出退出本集合计划的申请；对于在前述时间书面回复不同意但逾期未退出本集合计划的投资者，管理人将统一在合同变更生效日前一工作日做强制退出处理（退出价格为退出当日的计划份额净值）。

4、合同变更后，投资者、管理人和托管人的应当按照变更后的合同行使相关权利，履行相应义务，同时管理人应当自合同变更之日起五个工作日内报证券投资基金业协会备案。

5、投资者、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，或排除投资者自行承担投资风

险和损失。

6、全体委托人和托管人一致同意，以下事项可由管理人和托管人协商后变更并经公告生效：根据市场情况（1）调低管理费、托管费的费率（2）调低管理费、托管费的支付频率（3）调低业绩报酬计提比例（4）调高业绩报酬计提基准，不需要征求委托人的意见。

## （二）管理人和托管人职责终止的情形和处理方式

### 1、管理人和托管人职责终止的情形：

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；

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。

### 2、管理人和托管人的变更程序

#### （1）管理人的变更程序

1) 新任管理人由托管人和全体委托人一致同意并共同选定。托管人和全体委托人应当于上述管理人职责终止事项发生后【20】个工作日内发起新任管理人的选定程序。管理人职责终止事项发生后6个月内未选定新任管理人的，本集合计划终止。

2) 新任管理人产生之前，由中国证监会或其他有权机构指定临时管理人。

3) 新任管理人的选任结果应向相关监管机构备案，备案完成后变更管理人生效。

4) 管理人应于变更管理人生效后的【5】个工作日内在管理人网站公告。

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

6) 管理人职责终止的，应当按照法律法规规定聘请会计师事务所对集合计划资产进行审计，并将审计结果予以公告，同时向相关监管机构备案，审计费用在集合计划资产中列支。

7) 管理人更换后，如果原任或新任管理人要求，应按其要求替换或删除集合

计划名称中与原任管理人有关的名称字样。

## (2) 托管人的变更程序

1) 新任托管人由管理人和全体委托人一致同意并共同选定。管理人和全体委托人应当于上述托管人职责终止事项发生后【20】个工作日内发起新任托管人的选任程序。托管人职责终止事项发生后6个月内未选定新人任托管人的，本集合计划终止。

2) 新任托管人产生之前，由中国证监会或其他有权机构指定临时托管人。

3) 新任托管人的选任结果应向相关监管机构备案，备案完成后变更托管人生效。

4) 管理人应于变更托管人生效后的【5】个工作日内在管理人网站公告。

5) 托管人职责终止的，托管人应当妥善保管集合计划资产和集合计划托管业务资料，及时向临时托管人或新任托管人办理移交手续，新任托管人或者临时托管人应当及时接收。新任托管人或临时托管人应与管理人核对集合计划资产总值和净值。

6) 托管人职责终止的，应当按照法律法规规定聘请会计师事务所对集合计划资产进行审计，并将审计结果予以公告，同时向相关监管机构报备；审计费用在集合计划资产中列支。

(3) 本部分关于管理人、托管人变更条件和程序的约定，凡是直接引用法律法规的部分，如将来法律法规修改导致相关内容被取消或变更的，管理人与托管人协商一致并提前公告后，可直接对相应内容进行修改和调整，无需事先征得委托人同意。

## (三) 资产管理计划的展期

本集合计划可以展期。

### 1、展期的条件

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

(2) 资产管理计划展期没有损害投资者利益的情形；

(3) 中国证监会规定的其他条件；

资产管理计划展期的，应当符合资产管理计划的成立条件。

## 2、展期的安排

### (1) 通知展期的时间

在集合计划到期前3个月且不超过1个月期间内。

### (2) 展期的方式

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个月或者管理人认为合理的期限内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投资者展期安排，并征询意见，并按照资产管理合同的约定进行展期。

### (3) 投资者回复的方式

投资者应当在管理人指定网站公告之日起20个工作日内以书面或管理人约定的其他方式明确回复意见。

## 3、投资者不同意展期的处理办法

若投资者明确回复不同意展期，投资者有权在存续期届满日前（含届满日）到销售机构办理退出手续（管理人可以在公告中约定开放日，为投资者办理退出手续）；若投资者未在存续期届满日前（含届满日）到销售机构办理退出手续，则管理人有权决定强制将其份额退出。

若投资者未回复意见或回复意见不明确的，视为不同意展期，管理人有权决定强制将其份额退出。

## 4、展期的实现

如果展期征求意见后本计划满足展期条件的，则根据法律法规和本合同的约定履行相应程序后集合计划存续期将依法展期；

如果同意本集合计划展期的投资者人数低于2人或者其他不满足展期条件要求的，将按照本合同等相关法律文件的规定办理计划到期终止和清算事宜。

### (四) 有下列情形之一的，集合计划应当终止：

1、资产管理计划存续期届满且不展期；

2、经全体投资者、管理人和托管人协商一致决定终止的；

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

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

5、持续五个工作日投资者少于2人的；

6、未在证券投资基金业协会完成备案或不予备案的情形；

7、战争、自然灾害等不可抗力发生导致本集合计划不能存续；

8、法律、行政法规、中国证监会规定及资产管理合同约定的其他情形。

管理人应当自资产管理计划终止之日起五个工作日内报证券投资基金业协会备案，前述第6项约定的情形除外。

### （五）集合计划的清算

#### 1、集合计划的清算小组

（1）自集合计划终止之日起五个工作日内成立清算小组，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。

（2）集合计划清算小组负责本集合计划资产的保管、清理、估价、变现和分配。集合计划清算小组可以依法以集合计划的名义进行必要的民事活动。

#### 2、集合计划清算程序

（1）集合资产管理计划终止日后五个工作日管理人开始组织清算本集合计划财产；

（2）集合计划清算小组统一接管集合计划；

（3）对集合计划财产和债权债务进行清理和确认；

（4）对集合计划财产进行估值和变现；

（5）制作清算报告；

（6）聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计；

（7）对计划剩余财产进行分配和办理相关账户注销事宜；

（8）清算程序结束后五个工作日内，清算结果报证券投资基金业协会备案。

#### 3、清算费用

清算费用是指清算小组在进行集合计划清算过程中发生的所有合理费用（包括但不限于审计费、诉讼费、仲裁费、律师费、财产保全费、公证费、拍卖费及其他形式的资产处置费等费用），清算费用由清算小组从集合计划财产中优先支付。

#### 4、集合计划财产清算及剩余资产的分配

依据集合计划财产清算的分配方案，将集合计划财产清算后的全部剩余资产扣除集合计划财产清算费用、税款及其他债务后，按份额持有人持有的份额比例进行分配。清算期间，管理人可以根据委托财产清算安排和投资者服务需要，对同一级别计划财产按份额持有人持有的份额比例进行分次做清算分配。

对于本计划因证券交易等原因按登记结算机构规定缴纳的保证金（包括但不限于最低结算备付金和交易单元保证金）、以及保证金和存款账户的未结利息等资产，需要在登记结算机构退回保证金及利息结束后才能收回。管理人可选择在上述资产收回后或以管理人财产先行垫资方式，将剩余委托财产分配给投资者。本计划归属投资者所有的权益全部清算分配后，本计划自投资者款项划出日起至托管账户销户完成期间产生的孳息损益归属管理人享有承担。

若本计划在终止之日因委托财产流动性受限等原因需要延期清算的，管理人应及时向证券投资基金业协会报告，并通过管理人网站进行披露。

对于本计划在终止之日流动性受限的委托财产，管理人将在对应委托财产恢复流通或交易后及时进行变现，扣除相关费用后按份额持有人持有的份额比例进行分配，清算期间变现的委托财产不得再进行投资。

#### 5、集合计划清算的公告

管理人应当在集合计划清算程序终止后五个工作日内将清算结果报证券投资基金业协会备案。

管理人应将清算结果及清算过程中的有关重大事项及时在管理人网站披露。

#### 6、销户

本计划终止后，按照委托财产变现清算情况，管理人和托管人应按监管要求和相关机构规定及时注销各类证券投资交易账户（如有，包括但不限于银行间市场交易账户、沪深市场股东账户、期货账户等），最后注销托管账户。

#### 7、集合计划财产清算账册及文件的保存

集合计划财产清算账册及文件由管理人保存 20 年以上。

## 二十六、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，给计划财产或者投资者造成损害的，应当分别对各自的行为依法承担赔偿责任；因共同行为给计划财产或者投资者造成损害的，根据实际情况，由双方分别承担各自应负的违约责任。但是发生下列情况的，当事人可以免责：

### (1) 不可抗力

不可抗力是指本合同当事人无法预见、无法克服、无法避免，且在本合同生效之后发生的，使本合同当事人无法全部或部分履行本合同的任何事件，包括但不限于洪水、地震及其它自然灾害、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。

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财产损失扩大。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) 管理人和/或托管人按照当时有效的法律法规或中国证监会的规定作为或不作为而造成的损失等；

(3) 管理人由于按照合同规定的投资原则行使或不行使其投资权而造成的损失等；

(4) 在计划运作过程中，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。

(5) 本合同当事人应保证向本合同另一方提供的数据、信息真实完整，并承担相应的法律责任。如果该方提供的信息和数据不真实或不完整是由于另一方提供的数据或信息不真实、不完整等原因所致，由此造成的损失由初始过错方承担。

(6) 管理人及托管人对由于第三方（包括但不限于交易所、注册与过户登记人等）发送的数据错误给集合计划资产造成的损失等。

2、合同当事人违反本合同，给其他当事人造成直接经济损失的，应当承担赔偿责任。在发生一方或多方当事人违约的情况下，合同能继续履行的，应当继

续履行。

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（包括但不限于律师费、差旅费、鉴定费、勘验费、财产保全费、财产保全担保费、公证费等费用）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投资者损失，管理人和托管人免除赔偿责任。但是管理人和托管人应积极采取必要的措施消除或减轻由此造成的影响。

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。

7、投资者的债权人通过司法机关对集合计划资产采取强制措施，由此造成集合计划资产损失的，由相关责任方承担责任。

8、对交由证券公司、第三方基金销售机构等其他机构负责清算交收的委托资产及收益，因该等机构欺诈、疏忽、过失、破产等原因给委托资产造成的损失，由相关责任方承担。

## 二十七、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，任何一方均有权将争议提交合同签订地管辖法院诉讼处理，诉讼费用由败诉方承担。争议处理期间，合同当事人应恪守各自的职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行本合同规定的义务，维护投资者的合法权益。

## 二十八、合同的成立与生效

### （一）合同的成立与生效

本合同是约定合同当事人之间权利义务关系的法律文件，合同已加盖管理人和托管人的公章或合同专用章以及双方法定代表人或授权代表签字或签章，投资者以电子签名方式签署后即告成立。本合同成立后，同时满足以下条件时生效：

- 1、投资者参与资金实际交付并确认有效；
- 2、本集合计划成立。

本集合计划合同自生效之日起对投资者、管理人、托管人具有同等的法律约束力。

本集合计划终止，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。

### （二）合同的组成

《省心享-华泰量化多头单策略 FOF1 号集合资产管理计划说明书》、《省心享-华泰量化多头单策略 FOF1 号集合资产管理计划风险揭示书》经管理人确认有效的投资者参与、退出本集合计划的申请材料和各销售机构出具的集合计划参与、退出业务受理有关凭证、投资者通过电子签名方式产生的数据电文等为本合同的附件，是本合同不可分割的一部分，与合同具有同等法律效力。

但《省心享-华泰量化多头单策略 FOF1 号集合资产管理计划说明书》、《省心享-华泰量化多头单策略 FOF1 号集合资产管理计划风险揭示书》与本合同正文不一致的，以本合同正文为准。

### （三）合同的有效期限

本合同的有效期限自合同生效日起至本集合计划终止日。

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。

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

本合同应由投资者本人签署，当投资者为机构时，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等有效印章。

本合同正本壹式肆份，管理人、托管人各执壹份，其余按照有关监管部门的要求备案，经签署每份均具有同等法律效力。

(本页无正文,为《省心享-华泰量化多头单策略 FOF1 号集合资产管理计划  
资产管理合同》合同签署页)

投资者签字/盖章:

签订日期: \_\_\_\_\_ 年 \_\_\_\_\_ 月 \_\_\_\_\_ 日

管理人: 华泰证券(上海)资产管理有限公司(盖章)

法定代表人或其授权代表:

签订日期: 2022 年 3 月 8 日



托管人: 招商银行股份有限公司南京分行(盖章)

法定代表人或其授权代表:

签订日期: 2022 年 3 月 11 日

