

海通红利优选一年持有期混合型
集合资产管理计划
托管协议

管理人：上海海通证券资产管理有限公司

托管人：交通银行股份有限公司

二〇二一年七月

目录

一、托管协议当事人.....	3
二、托管协议的依据、目的和原则.....	4
三、托管人对管理人的业务监督和核查.....	4
四、管理人对托管人的业务核查.....	11
五、集合计划财产的保管.....	12
六、指令的发送、确认和执行.....	15
七、交易及清算交收安排.....	17
八、集合计划资产净值计算和会计核算.....	20
九、集合计划收益分配.....	26
十、集合计划信息披露.....	27
十一、集合计划费用.....	28
十二、集合计划份额持有人名册的保管.....	31
十三、集合计划有关文件档案的保存.....	32
十四、管理人和托管人的更换.....	32
十五、禁止行为.....	34
十六、托管协议的变更、终止与集合计划财产的清算.....	35
十七、违约责任.....	37
十八、争议解决方式.....	38
十九、托管协议的效力.....	38
二十、其他事项.....	39
二十一、托管协议的签订.....	39

鉴于上海海通证券资产管理有限公司系一家依照中国法律合法成立并有效存续的有限责任公司，按照相关法律法规的规定具备担任集合资产管理计划管理人（以下简称“管理人”）的资格和能力；

鉴于交通银行股份有限公司系一家依照中国法律合法成立并有效存续的银行，按照相关法律法规的规定具备担任集合资产管理计划托管人（以下简称“托管人”）的资格和能力；

鉴于上海海通证券资产管理有限公司拟担任海通红利优选一年持有期混合型集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”或“集合计划”）的管理人，交通银行股份有限公司拟担任海通红利优选一年持有期混合型集合资产管理计划的托管人；

为明确海通红利优选一年持有期混合型集合资产管理计划的管理人和托管人之间的权利义务关系，特制订本协议；

除非文义另有所指，本协议的所有术语与《海通红利优选一年持有期混合型集合资产管理计划资产管理合同》（以下简称“《资产管理合同》”或“资产管理合同”）中定义的相应术语具有相同的含义。若有抵触应以《资产管理合同》为准，并依其条款解释。

管理人承诺其知悉《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》（银发〔2017〕235号）、《中国人民银行关于进一步做好受益所有人身份识别工作有关问题的通知》（银发〔2018〕164号）等反洗钱相关法律法规、监管规定，将严格遵守上述规定，不会违反任何前述规定；审核用于投资的资金来源不属于违法犯罪所得及其收益；审核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。

管理人承诺管理人及其关联方均不属于联合国、欧盟或美国等制裁名单，及中国政府部门或有权机关发布的涉恐及反洗钱相关风险名单内的企业或个人；不位于被联合国、欧盟或美国等制裁的国家和地区。

一、托管协议当事人

（一）管理人

名称：上海海通证券资产管理有限公司

住所：上海市黄浦区广东路 689 号第 32 层 01-12 室单元

办公地址：上海市黄浦区广东路 689 号第 32 层 01-12 室单元

法定代表人：裴长江

成立时间：2012 年 6 月 26 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监许可[2012]418 号

经营范围：证券资产管理业务。

注册资本：22 亿元

组织形式：有限责任公司

存续期间：持续经营

（二）托管人

名称：交通银行股份有限公司（简称：交通银行）

住所：中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 号

办公地址：上海市长宁区仙霞路 18 号

法定代表人：任德奇

成立时间：1987 年 3 月 30 日

批准设立机关及批准设立文号：国务院国发(1986)字第 81 号文和中国人民银行银发[1987] 40 号文

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[1998] 25 号

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项业务；提供保管箱服务；经国务院银行业监督管理机构批准的其他业务；经营结汇、售汇业务。

注册资本：742.63 亿元人民币

组织形式：股份有限公司

存续期间：持续经营

二、托管协议的依据、目的和原则

本协议依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《基金法》）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称《销售办法》）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称《运作办法》）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称《信息披露办法》）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称《流动性风险管理规定》）、《海通红利优选一年持有期混合型集合资产管理计划资产管理合同》及其他有关规定订立。

本协议的目的是明确管理人和托管人之间在集合计划财产的保管、投资运作、净值计算、收益分配、信息披露及相互监督等有关事宜中的权利、义务及职责，以确保集合计划财产的安全，保护集合计划份额持有人的合法权益。

管理人和托管人遵循平等自愿、诚实信用、充分保护投资者合法利益的原则，经协商一致，签订本协议。

三、托管人对管理人的业务监督和核查

（一）托管人对管理人的投资行为行使监督权

1. 托管人根据有关法律法规的规定及《资产管理合同》和本协议的约定，对集合计划的投资范围、投资对象进行监督。

本集合计划的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括主板、创业板、存托凭证及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票（以下简称“港股通标的股票”）、债券（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债券、政府支持机构债券、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券等）、资产支持证券、银行存款、同业存单、货币市场工具、债券回购、股指期货、股票期权以及法律法规或中国证监会允许集合计划投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

本集合计划根据法律法规的规定参与融资业务。在法律法规允许的情况下并履行适当程序后，本集合计划可以参与融券业务和转融通证券出借业务。在法律法规允许的情况下，本集合计划可以投资各类期权品种。

如法律法规或监管机构以后允许集合计划投资其他品种,管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

本集合计划的投资组合比例为:股票(含存托凭证)资产占集合计划资产的60%-95%(投资于港股通标的股票的比例合计占股票资产的0%-50%),投资于本集合计划界定的红利优选相关证券的比例不低于非现金集合计划资产的80%;每个交易日日终在扣除股指期货合约、股票期权合约需缴纳的保证金后,现金或到期日在一年以内的政府债券不低于集合计划资产净值的5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本集合计划将港股通标的股票投资的比例下限设为零,本集合计划可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化,选择将部分集合计划资产投资于港股通标的股票或选择不将集合计划资产投资于港股通标的股票,集合计划资产并非必然投资港股通标的股票。

托管人对管理人业务进行监督和核查的义务自资产管理合同生效日起开始履行。

2.托管人根据有关法律法规的规定及《资产管理合同》和本协议的约定,对集合计划投资比例进行监督。

(1) 本集合计划投资于股票(含存托凭证)的比例占集合计划资产的60%-95%(投资于港股通标的股票的比例合计占股票资产的0%-50%),投资于本集合计划界定的红利优选相关证券的比例不低于非现金集合计划资产的80%;

(2) 每个交易日日终在扣除股指期货合约、股票期权合约需缴纳的交易保证金后,保持不低于集合计划资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券,其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等;

(3) 本集合计划持有一家公司发行的证券(同一家公司在内地和香港同时上市的A+H股合计计算),其市值不超过集合计划资产净值的10%;

(4) 本管理人管理的全部公开募集性质的集合计划持有一家公司发行的证券(同一家公司在内地和香港同时上市的A+H股合计计算),不超过该证券的10%,完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的集合计划品种可以不受此条款规定的比例限制;

(5) 本集合计划投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例,不得超过集合计划资产净值的10%;

(6) 本集合计划持有的全部资产支持证券，其市值不得超过集合计划资产净值的 20%；

(7) 本集合计划持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；

(8) 本管理人管理的全部公开募集性质的集合计划投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；

(9) 本集合计划应投资于信用级别评级为 BBB 以上（含 BBB）的资产支持证券。集合计划持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，在具备市场流动性的情况下，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；

(10) 集合计划财产参与股票发行申购，本集合计划所申报的金额不超过本集合计划的总资产，本集合计划所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

(11) 本集合计划进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过集合计划资产净值的 40%，进入全国银行间同业市场进行债券回购的最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；

(12) 本管理人管理的全部公开募集性质的开放式集合资产管理计划持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；本管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，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开放式集合计划以及中国证监会认定的特殊投资组合可不受前述比例限制；

(13) 本集合计划主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过该集合计划资产净值的 15%；因证券市场波动、上市公司股票停牌、集合计划规模变动等管理人之外的因素致使集合计划不符合该比例限制的，管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

(14) 本集合计划与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与资产管理合同约定的投资范围保持一致；

(15) 本集合计划资产总值不超过集合计划资产净值的 140%；

(16) 本集合计划在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过集合计划资产净值的 10%；在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过集合计划资产净值的 95%，其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；在任何交易日日终，持有的卖出股指期货合约价值不得超过集合计划持有的股票总市值的 20%；在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日集合计划资产净值的 20%；所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合资产管理合同关于股票投资比例的有关约定（即本集合计划股票（含存托凭证）资产占集合计划资产的 60%-95%）；

(17) 本集合计划投资于股票期权的投资限制如下：

1) 本集合计划因未平仓的期权合约支付和收取的权利金总额不得超过集合计划资产净值的 10%；

2) 本集合计划开仓卖出认购期权的，应持有足额标的证券；开仓卖出认沽期权的，应持有合约行权所需的全额现金或交易所规则认可的可冲抵期权保证金的现金等价物；

3) 本集合计划未平仓的期权合约面值不得超过集合计划资产净值的 20%。其中，合约面值按照行权价乘以合约乘数计算；

(18) 本集合计划仅在参与融资时遵守下列要求：本集合计划参与融资的每个交易日日终，本集合计划持有的融资买入股票与其他有价证券市值之和，不得超过集合资产管理计划资产净值的 95%；

(19) 本集合计划投资存托凭证的比例限制依照境内上市交易的股票执行；

(20) 法律法规及中国证监会规定的和《资产管理合同》约定的其他投资限制。

除上述第（2）、（9）、（13）、（14）项外，因证券/期货市场波动、上市公司合并、集合计划规模变动等管理人之外的因素致使集合计划投资比例不符合上述规定投资比例的，管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。

管理人应当自资产管理合同生效之日起 6 个月内使集合计划的投资组合比

例符合资产管理合同的有关约定。在上述期间内，本集合计划的投资范围、投资策略应当符合资产管理合同的约定。托管人对集合计划的投资的监督与检查自资产管理合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本集合计划，管理人在履行适当程序后，则本集合计划投资不再受相关限制。

3. 托管人根据有关法律法规的规定及资产管理合同和本协议的约定，对集合计划投资禁止行为进行监督。集合计划财产不得用于下列投资或者活动。

- (1) 承销证券；
- (2) 违反规定向他人贷款或者提供担保；
- (3) 从事承担无限责任的投资；
- (4) 买卖其他集合资产管理计划份额或基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；
- (5) 向其管理人、托管人出资；
- (6) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- (7) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

管理人运用集合计划财产买卖管理人、托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合集合计划的投资目标和投资策略，遵循集合计划份额持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到托管人的同意，并按法律法规予以披露。

在资产管理合同生效后 2 个工作日内，管理人和托管人应相互提供与本机构有控股关系的股东、实际控制人或者与本机构有其他重大利害关系的公司名单，以上名单发生变化的，应及时予以更新并通知对方。

如法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制。

4. 托管人根据有关法律法规的规定及资产管理合同和本协议的约定，对管理人参与银行间债券市场进行监督。

(1) 托管人依据有关法律法规的规定和《资产管理合同》的约定对于管理人参与银行间市场交易时面临的交易对手资信风险进行监督。

管理人向托管人提供符合法律法规及行业标准的银行间市场交易对手的名单。托管人在收到名单后 2 个工作日内电话或回函确认收到该名单。管理人应定期和不定期对银行间市场现券及回购交易对手的名单进行更新。托管人在收到名单后 2 个工作日内电话或书面回函确认，新名单自托管人确认当日生效。新名单生效前已与本次剔除的交易对手所进行但尚未结算的交易，仍应按照协议进行结算。

(2) 管理人参与银行间市场交易时，有责任控制交易对手的资信风险，由于交易对手资信风险引起的损失，管理人应当负责向相关责任人追偿。

5. 托管人根据有关法律法规、资产管理合同和本协议，对管理人投资银行存款业务约定如下：

(1) 管理人、托管人应当与存款银行建立定期对账机制，确保集合计划银行存款业务账目及核算的真实、准确。

(2) 管理人与托管人应根据相关规定，就本集合计划银行存款业务另行签订书面协议，明确双方在相关协议签署、账户开设与管理、投资指令传达与执行、资金划拨、账目核对、到期兑付、文件保管以及存款证实书的开立、传递、保管等流程中的权利、义务和职责，以确保集合计划财产的安全，保护集合计划份额持有人的合法权益。

(3) 托管人应加强对集合计划银行存款业务的监督与核查，严格审查、复核相关协议、账户资料、投资指令、存款证实书等有关文件，切实履行托管职责。

(4) 管理人与托管人在开展银行存款业务时，应严格遵守《基金法》、《运作办法》等有关法律法规，以及国家有关账户管理、利率管理、支付结算等的各项规定。

6. 托管人对集合计划投资流通受限证券的监督。

(1) 集合计划投资流通受限证券，应遵守《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》等有关法律法规规定。

(2) 流通受限证券，包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开

发行股票、公开发行业股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券，不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。

(3) 管理人应在集合计划首次投资流通受限证券前，向托管人提供经管理人董事会批准的有关集合计划投资流通受限证券的投资决策流程、风险控制制度。集合计划投资非公开发行股票，管理人还应提供管理人董事会批准的流动性风险处置预案。上述资料应包括但不限于集合计划投资流通受限证券的投资额度和投资比例控制情况。管理人应至少于首次执行投资指令之前两个工作日将上述资料书面发至托管人，保证托管人有足够的时间进行审核。托管人应在收到上述资料后两个工作日内，以书面或其他双方认可的方式确认收到上述资料。

(4) 集合计划投资流通受限证券前，管理人应向托管人提供符合法律法规要求的有关书面信息，包括但不限于拟发行证券主体的中国证监会批准文件、发行证券数量、发行价格、锁定期，集合计划拟认购的数量、价格、总成本、总成本占集合计划资产净值的比例、已持有流通受限证券市值占资产净值的比例、资金划付时间等。管理人应保证上述信息的真实、完整，并应至少于拟执行投资指令前两个工作日将上述信息书面发至托管人，保证托管人有足够的时间进行审核。

(5) 托管人应对管理人提供的有关书面信息进行审核，托管人认为上述资料可能导致集合计划投资出现风险的，有权要求管理人在投资流通受限证券前就该风险的消除或防范措施进行补充书面说明，并保留查看管理人风险管理部门就集合计划投资流通受限证券出具的风险评估报告等备查资料的权利。否则，托管人有权拒绝执行有关指令。因拒绝执行该指令造成集合计划财产损失的，托管人不承担任何责任，并有权报告中国证监会。

如管理人和托管人无法达成一致，应及时上报中国证监会请求解决。如果托管人切实履行监督职责，则不承担任何责任。

7. 托管人根据法律法规的规定及《资产管理合同》和本协议的约定，对集合计划投资其他方面进行监督。

(二) 托管人应根据有关法律法规的规定及资产管理合同的约定，对集合计划资产净值计算、各类集合计划份额净值计算、应收资金到账、集合计划费用开支及收入确认、集合计划收益分配、相关信息披露、宣传推介材料中登载集合计

划业绩表现数据等进行监督和核查。如果管理人未经托管人的审核擅自将不实的业绩表现数据印制在宣传推介材料上，则托管人对此不承担任何责任，并有权在发现后报告中国证监会。

（三）管理人应积极配合和协助托管人的监督和核查，在规定时间内答复并改正，就托管人的疑义进行解释或举证。对托管人按照法规要求需向中国证监会报送集合计划监督报告的，管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

托管人发现管理人的投资指令或实际投资运作违反《基金法》及其他有关法规、《资产管理合同》和本协议规定的行为，应及时以书面形式通知管理人限期纠正，管理人收到通知后应及时核对，并以电话或书面形式向托管人反馈，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，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，托管人有权报告中国证监会。

托管人发现管理人有重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时通知管理人在限期内纠正。

托管人发现管理人的指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反《资产管理合同》约定的，应当拒绝执行，立即通知管理人，并有权向中国证监会报告。

托管人发现管理人依据交易程序已经生效的指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反《资产管理合同》约定的，应当立即通知管理人，并有权向中国证监会报告。

四、管理人对托管人的业务核查

根据《基金法》及其他有关法规、《资产管理合同》和本协议规定，管理人对托管人履行托管职责的情况进行核查，核查事项包括但不限于托管人是否安全保管集合计划财产、开立集合计划财产的资金账户、证券账户、期货账户及债券托管账户等投资所需账户，是否及时、准确复核管理人计算的集合计划资产净值和各类集合计划份额净值，是否根据管理人指令办理清算交收，是否按照法规规定和《资产管理合同》规定进行相关信息披露和监督集合计划投资运作等行为。

管理人定期和不定期地对托管人保管的集合计划资产进行核查。托管人应积

极配合管理人的核查行为，包括但不限于：提交相关资料以供管理人核查托管财产的完整性和真实性，在规定时间内答复并改正。

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、未执行或无故延迟执行管理人资金划拨指令、泄露集合计划投资信息等违反《基金法》、《资产管理合同》、本协议及其他有关规定的，应及时以书面形式通知托管人在限期内纠正，托管人收到通知后应及时核对并以书面形式对管理人发出回函。在限期内，管理人有权随时对通知事项进行复查，督促托管人改正。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监会。对管理人按照法规要求需向中国证监会报送集合计划监督报告的，托管人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

管理人发现托管人有重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时通知托管人在限期内纠正。

五、集合计划财产的保管

（一）集合计划财产保管的原则

1. 托管人应安全保管集合计划财产，未经管理人的指令，不得自行运用、处分、分配集合计划的任何资产。

2. 集合计划财产应独立于管理人、托管人的固有财产。

3. 托管人按照规定开立集合计划财产的资金账户、证券账户和债券托管账户等投资所需账户，管理人和托管人按照规定开立期货资金账户。

4. 托管人对所托管的不同集合计划财产分别设置账户，确保集合计划财产的完整和独立。

5. 对于因为集合计划投资产生的应收资产和集合计划申购过程中产生的应收资产，应由管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知托管人，到账日集合计划资产没有到达集合计划银行存款账户的，托管人应及时通知管理人采取措施进行催收。由此给集合计划造成损失的，管理人应负责向有关当事人追偿集合计划的损失。托管人对此不承担任何责任。

6、除依据法律法规和《资产管理合同》的规定外，托管人不得委托第三人托管集合计划财产。

（二）集合计划的银行存款账户的开立和管理

1. 托管人应负责本集合计划银行存款账户的开立和管理。
2. 托管人以本集合计划的名义在其营业机构开立集合计划的银行存款账户，并根据管理人合法合规的指令办理资金收付。本集合计划的银行预留印鉴由托管人保管和使用。
3. 本集合计划银行存款账户的开立和使用，限于满足开展本集合计划业务的需要。托管人和管理人不得假借本集合计划的名义开立其他任何银行存款账户；亦不得使用集合计划的任何银行存款账户进行本集合计划业务以外的活动。
4. 托管人可以通过申请开通本集合计划银行账户的企业网上银行业务进行资金支付，并使用交通银行企业网上银行（简称“交通银行网银”）办理托管资产的资金结算汇划业务。
5. 集合计划银行存款账户的管理应符合银行业监督管理机构的有关规定。

（三）集合计划证券交收账户、资金交收账户的开立和管理

托管人以托管人和本集合计划联名的方式在中国证券登记结算有限责任公司开立证券账户。

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

管理人不得对集合计划证券交收账户、资金交收账户进行证券的超卖或超买。

托管人以托管人的名义在中国证券登记结算有限责任公司开立结算备付金账户即资金交收账户，用于证券交易资金的结算。托管人以本集合计划的名义在托管人处开立集合计划的证券交易资金结算的二级结算备付金账户。

（四）债券托管账户的开立和管理

1. 资产管理合同生效后，管理人负责向人民银行进行报备，并在备案通过后由托管人在中央国债登记结算有限责任公司及银行间市场清算所股份有限公司以本集合计划的名义开立债券托管账户，并由托管人负责集合计划的债券及资金的清算。管理人负责申请集合计划进入全国银行间同业拆借市场进行交易，由管理人在中国外汇交易中心开设同业拆借市场交易账户。

2. 管理人代表集合计划签订全国银行间债券市场债券回购主协议，协议正本由管理人保存。

（五）股指期货的相关账户的开立和管理

管理人、托管人应当按照相关规定开立期货资金账户，在中国金融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。

托管人已取得期货保证金存管银行资格，管理人授权托管人办理相关银期转账业务。

（六）集合计划投资银行存款账户的开立和管理

存款账户必须以集合计划名义开立，账户名称为集合计划名称，存款账户开户文件上加盖预留印鉴（须包括托管人印章）及管理人公章。

本集合计划投资银行存款时，管理人应当与存款银行签订具体存款协议或存款确认单据，明确存款的类型、期限、利率、金额、账号、对账方式、支取方式等细则。

为防范特殊情况下的流动性风险，定期存款协议中应当约定提前支取条款。

（七）其他账户的开立和管理

若中国证监会或其他监管机构在本托管协议订立日之后允许集合计划从事其他投资品种的投资业务，涉及相关账户的开立、使用的，由管理人协助托管人根据有关法律法规的规定和《资产管理合同》的约定，开立有关账户。该账户按有关规则使用并管理。

（八）集合计划财产投资的有关实物证券、银行存款定期存单等有价凭证的保管

实物证券由托管人存放于托管人的保管库。实物证券的购买和转让，由托管人根据管理人的指令办理。托管人对由托管人以外机构实际有效控制的本集合计划资产不承担保管责任。

银行存款定期存单等有价凭证由托管人负责保管。托管人只负责对存款证实书进行保管，不负责核对存款证实书真伪的辨别，不承担存款证实书对应存款的本金及收益的安全保管责任。

（九）与集合计划财产有关的重大合同的保管

由管理人代表集合计划签署的与集合计划有关的重大合同的原件分别由托管人、管理人保管，相关业务程序另有限制除外。除本协议另有规定外，管理人在代集合计划签署与集合计划有关的重大合同时应尽可能保证持有二份以上的正本，以便管理人和托管人至少各持有一份正本的原件，管理人应及时将正本送达托管人处。合同的保管期限按照国家有关规定执行。

对于无法取得二份以上的正本的，管理人应向托管人提供加盖授权业务章的合同传真件，未经双方协商或未在合同约定范围内，合同原件不得转移。

六、指令的发送、确认和执行

（一）管理人对发送指令人员的书面授权

管理人应事先书面通知（以下称“授权通知”）托管人有权发送指令的人员名单、签字样本、预留印鉴和启用日期，注明相应的权限，并规定管理人向托管人发送指令时托管人确认有权发送人员（以下简称“被授权人”）身份的方法。管理人向托管人发出的授权通知应加盖公章。管理人发出授权通知后，以电话形式向托管人确认，授权通知自其上面注明的启用日期开始生效，在此后三个工作日内管理人应将授权通知的正本送交托管人。

托管人收到授权通知后，将签字和印鉴与预留样本核对无误后，应在收到授权通知当日电话向管理人确认。

管理人和托管人对授权文件负有保密义务，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，但法律法规另有规定或有权机关另有要求的除外。

（二）指令的内容

指令是管理人在运用集合计划资产时，向托管人发出的资金划拨及其他款项收付的指令。指令应写明款项事由、支付时间、到账时间、金额、账户、大额支付号等执行支付所需内容，加盖预留印鉴。

（三）指令的发送、确认和执行的时间和程序

管理人应按照《基金法》及其他有关法规、《资产管理合同》和本协议的规

定，在其合法的经营权限和交易权限内发送指令，被授权人应按照其授权权限发送指令。指令由“授权通知”确定的被授权人代表管理人用传真的方式向托管人发送。发送后管理人及时通过电话与托管人确认指令内容。管理人必须在 15:00 之前向托管人发送付款指令并确保集合计划银行账户有足够的资金余额，15:00 之后发送付款指令或截止 15:00 时账户资金不足的，托管人不能保证在当日完成划付。对管理人在没有充足资金的情况下向托管人发出的指令，托管人可不予执行，并立即通知管理人，托管人不承担因为不执行该指令而造成损失的责任。如管理人要求当天某一时点到账，必须至少提前 2 个工作小时向托管人发送付款指令并与托管人电话确认。管理人指令传输及确认不及时或账户资金不足，未能留出足够的执行时间，致使指令未能及时执行的，托管人不承担由此导致的损失。管理人应将银行间市场成交单加盖预留印鉴后传真给托管人。对于被授权人发出的指令，管理人不得否认其效力。托管人依照“授权通知”规定的方法确认指令的有效后，方可执行指令。指令执行完毕后，托管人将执行结果反馈给管理人。托管人仅根据管理人的授权文件对指令进行表面相符性的形式审查，对其真实性不承担责任。

（四）管理人发送错误指令的情形和处理程序

管理人发送错误指令的情形包括指令发送人员无权或超越权限发送指令及交割信息错误，指令中重要信息模糊不清或不全等。托管人在履行监督职能时，发现管理人的指令错误时，有权拒绝执行，并及时通知管理人改正。

（五）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

托管人在对集合计划场外投资指令进行审核时，如发现管理人的投资指令违反有关集合计划的法律法规、《资产管理合同》、本协议的规定，如交易未生效，则不予执行并立即通知管理人；如交易已生效，则以书面形式通知管理人限期纠正。管理人收到通知后应及时核对，并以约定形式向托管人反馈，由此造成的损失由管理人承担。

托管人在对集合计划场外投资指令进行审核时，如发现投资指令有可能违反法律法规、《资产管理合同》、本协议的规定，应暂缓执行指令，通知管理人改正。如果管理人拒不改正，托管人有权向中国证监会报告。

（六）托管人未按照管理人指令执行的处理方法

托管人由于自身原因造成未按照管理人发送的正常指令执行，应在发现后及时采取措施予以弥补，给集合计划份额持有人造成损失的，对由此造成的直接经济损失负赔偿责任。

（七）被授权人员的更换

管理人撤换被授权人员或改变被授权人员的权限，必须提前至少三个工作日，使用传真向托管人发出加盖公章的被授权人变更通知，注明启用日期，同时电话通知托管人。被授权人变更通知自其上面注明的启用日期起开始生效。管理人对授权通知的内容的修改自启用日期起生效。管理人在此后三个工作日内将被授权人变更通知的正本送交托管人。

如果管理人已经撤销或更改对指令发送人员的授权，并且书面通知托管人，则对于在变更通知的启用日期后该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。

七、交易及清算交收安排

（一）选择代理证券、期货买卖的证券、期货经营机构的标准和程序

管理人负责选择代理本集合计划证券买卖的证券经营机构。

管理人应代表集合计划与被选择的证券经营机构签订交易单元租用协议。管理人应及时将集合计划交易单元号、佣金费率等基本信息以及变更情况及时以书面形式通知托管人，并在法定信息披露公告中披露相关内容。

管理人负责选择代理本集合计划期货交易的期货经纪机构，并与其签订期货经纪合同，其他事宜根据法律法规、资产管理合同的相关规定执行，若无明确规定的，可参照有关证券买卖、证券经纪机构选择的规则执行。

（二）集合计划投资证券后的清算交收安排

1. 资金划拨

对于管理人的资金划拨指令，托管人在复核无误后应在规定期限内执行，不得延误。管理人应保证托管人在执行管理人发送的资金划拨指令时，集合计划银行账户或资金交收账户上有充足的资金。集合计划的资金头寸不足时，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时间和在途时间。在集合计划资金头寸充足的情况下，托管人对管理人符合法律法规、《资产管理合同》、本协议的指令不得拖延或拒绝执行。对超头寸的划款指令，托管人有权止付但应及时电话通知管理人，由此造成的损失由管理人承担。

2. 结算方式

支付结算以转账形式进行。如中国人民银行有更快捷、安全、可行的结算方式，托管人可根据需要进行调整。

3. 证券交易资金的清算

本集合计划投资于证券而发生的场内、场外交易的清算交割，由托管人负责办理。

本集合计划场外证券投资的清算交割，由托管人根据管理人的指令通过登记结算机构办理。本集合计划场内证券投资的清算交割，由托管人根据双方签订的《托管银行证券资金结算协议》约定，由托管人负责办理。但本集合计划场内证券投资涉及 T+0 日非担保、RTGS 交收的业务，管理人应在 T+0 日 15:00 前书面通知托管人办理交收，否则托管人不能保证相关清算交割成功。如因托管人的自身原因在清算上造成集合计划资产的损失，应由托管人负责赔偿集合计划的损失；如果因为管理人投资运作而造成集合计划投资清算困难和风险的，托管人发现后应立即通知管理人，由管理人负责解决，托管人应给予必要的配合，由此给集合计划、托管人和托管人托管的其他资产造成的损失由管理人承担。

托管人在完成相关登记结算公司通知的事项后应以书面形式通知管理人。

由于管理人的原因造成集合计划无法按时支付证券清算款，按照登记结算机构的有关规定办理。

本集合计划参与港股通交易时，管理人应事先书面通知托管人，明确交易单元、佣金费率等相关信息，在托管人完成相关设置后方可开展交易。若涉及需管理人做出选择的港股通公司行为，托管人根据管理人提供的数据将管理人的选择结果提交给中国结算。

（三）投资期货后的清算交收安排

本集合计划通过期货经纪机构进行的交易由期货经纪机构作为结算参与人

代理本集合计划进行结算，并承担由期货经纪机构原因造成的正常结算、交收业务无法完成的责任。

管理人、托管人和期货经纪机构可就集合计划参与期货交易的具体事项另行签订协议，明确三方在本集合计划参与期货交易中的账户开立、资金划拨、期货交易、交易费用、数据传输，以及风控控制与监督等方面的职责和义务。

管理人应责成其选择的期货公司对发送的数据的准确性、完整性、真实性负责。由于交易结算报告的记载事项出现与实际交易结果和权益不符造成本产品估值计算错误的，应由管理人负责向数据发送方追偿，托管人不承担责任。

（三）管理人与托管人进行资金、证券账目和交易记录的核对

对集合计划的交易记录，由管理人按日进行核对。每日对外披露集合计划份额净值之前，必须保证当天所有实际交易记录与集合计划会计账簿上的交易记录完全一致。如果交易记录与会计账簿记录不一致，造成集合计划会计核算不完整或不真实，由此导致的损失由集合计划的会计责任方承担。管理人每一交易日以双方认可的方式在当日全部交易结束后，将编制的集合计划资金、证券账目传送给托管人，托管人按日进行账目核对。

对实物券账目，相关各方定期进行账实核对。

托管人应定期核对证券账户中的证券数量和种类。

双方可协商采用电子对账方式进行账目核对。

（四）申购、赎回、转换开放式集合计划的资金清算和数据传递的时间、程序及托管协议当事人的责任界定

1. 集合计划份额申购、赎回的确认，清算由管理人指定的登记机构负责。

2. 管理人应将每个开放日的申购、赎回、转换开放式集合计划的数据传送给托管人。管理人应对传递的申购、赎回、转换开放式集合计划的数据真实性、准确性、完整性负责。托管人应及时查收申购资金的到账情况并根据管理人指令及时划付赎回及转换款项。

3. 管理人应在 T+2 日 15:00 前将申购净额(不包含申购费)划至托管账户。如申购净额未能如期到账，托管人应及时通知管理人采取措施进行催收，由此给集合计划造成损失的，由责任方承担。管理人负责向责任方追偿集合计划的损失。

4. 管理人应及时向托管人发送赎回及转换资金的划拨指令。托管人依据划款指令在 T+3 日（包含赎回产生的应付费用）划至管理人指定账户。管理人应及时通知托管人划付。若赎回金额未能如期划拨，由此造成的损失，由责任方承担。管理人负责向责任方追偿集合计划的损失。

（五）集合计划收益分配的清算交收安排

1. 管理人决定收益分配方案并通知托管人，经托管人复核后在 2 日内在规定媒介公告。

2. 托管人和管理人对集合计划收益分配进行账务处理并核对后，管理人应及时向托管人发送分发现金红利的划款指令，托管人依据划款指令在指定划付日及时将资金划至管理人指定账户。

3. 管理人在下达分红款支付指令时，应给托管人留出必需的划款时间。

八、集合计划资产净值计算和会计核算

（一）集合计划资产净值及集合计划份额净值的计算与复核

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。

管理人应每个工作日对集合计划资产估值。估值原则应符合《资产管理合同》、《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及其他法律、法规的规定。集合计划资产净值和集合计划份额净值由管理人负责计算，托管人复核。管理人应于每个工作日交易结束后计算当日的集合计划资产净值和各类集合计划份额净值，以约定方式发送给托管人。托管人对净值计算结果复核后，将复核结果反馈给管理人，由管理人予以公布。

本集合计划按以下方法估值：

1、证券交易所上市的有价证券的估值

（1）交易所上市的有价证券（包括股票等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

(2) 交易所上市交易或挂牌转让的不含权固定收益品种（本合同另有规定的除外），选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值；

(3) 交易所上市交易或挂牌转让的含权固定收益品种（本合同另有规定的除外），选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价进行估值；

(4) 交易所上市交易的可转换债券，以每日收盘价作为估值全价；

(5) 交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。交易所市场挂牌转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值；

(6) 对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券，对存在活跃市场的情况下，应以活跃市场上未经调整的报价作为估值日的公允价值；对于活跃市场报价未能代表估值日公允价值的情况下，应对市场报价进行调整以确认估值日的公允价值；对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下，应采用估值技术确定其公允价值。

2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

(1) 送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的估值方法估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值；

(2) 首次公开发行未上市的股票和债券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值；

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

3、对全国银行间市场上不含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值。对银行间市场上含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价估值。对于含投资人回售权的固定收益品种，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。对银行间市场未上市，且第三方估值机构未提供估值价格的债券，在发行利率与二级市场利率不存在明显差异，未上市期

间市场利率没有发生大的变动的情况下，按成本估值。

4、同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

5、同业存单按估值日第三方估值机构提供的估值净价估值；选定的第三方估值机构未提供估值价格的，按成本估值。

6、股指期货合约，一般以股指期货当日结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。

7、股票期权合约，一般以估值当日结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。

8、本集合计划投资存托凭证的估值核算，依照境内上市交易的股票执行。

9、估值计算中涉及港币或其他外币币种对人民币汇率的，将依据下列信息提供机构所提供的汇率为基准：估值当日中国人民银行或其授权机构公布的人民币汇率的中间价进行估值。

10、当本集合计划发生大额申购或赎回情形时，管理人可以采用摆动定价机制，以确保集合计划估值的公平性，具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律规则的规定。

11、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，管理人可根据具体情况与托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

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

如管理人或托管人发现集合计划估值违反资产管理合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护集合计划份额持有人利益时，应立即通知对方，共同查明原因，双方协商解决。

根据《基金法》，管理人计算集合计划资产净值，托管人复核、审查管理人计算的集合计划资产净值。集合计划净值信息计算和集合计划会计核算的义务由管理人承担。本集合计划的会计责任方由管理人担任，因此，就与本集合计划有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照管理人对集合计划净值信息的计算结果对外予以公布。由此给集合计划持有人和集合计划造成的损失以及因该交易日集合计划资产净值计算顺延错误而引

起的损失，由管理人负责赔付。

（二）净值差错处理

管理人和托管人将采取必要、适当、合理的措施确保集合计划资产估值的准确性、及时性。当任一类别集合计划份额净值小数点后4位以内(含第4位)发生估值错误时，视为集合计划份额净值错误。

资产管理合同的当事人应以下约定处理：

1、估值错误类型

本集合计划运作过程中，如果由于管理人或托管人、或登记机构、或销售机构、或投资人自身的过错造成估值错误，导致其他当事人遭受损失的，过错的责任人应当对由于该估值错误遭受损失当事人（“受损方”）的直接损失按下述“估值错误处理原则”给予赔偿，承担赔偿责任。

上述估值错误的主要类型包括但不限于：资料申报差错、数据传输差错、数据计算差错、系统故障差错、下达指令差错等。

对于因技术原因引起的差错，若系同行业现有技术水平无法预见、无法避免、无法抗拒，则属不可抗力，按照下述规定执行：

由于不可抗力原因造成投资人的交易资料灭失或被错误处理或造成其他错误等，因不可抗力原因出现估值错误的当事人不对其他当事人承担赔偿责任，但因该估值错误取得不当得利的当事人仍应负有返还不当得利的义务。

2、估值错误处理原则

（1）估值错误已发生，但尚未给当事人造成损失时，估值错误责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正估值错误发生的费用由估值错误责任方承担；由于估值错误责任方未及时更正已产生的估值错误，给当事人造成损失的，由估值错误责任方对直接损失承担赔偿责任；若估值错误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，则其应当承担相应赔偿责任。估值错误责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认，确保估值错误已得到更正；

（2）估值错误的责任方对有关当事人的直接损失负责，不对间接损失负责，并且仅对估值错误的有关直接当事人负责，不对第三方负责；

（3）因估值错误而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。

但估值错误责任方仍应对估值错误负责。如果由于获得不当得利的当事人不返还或不全部返还不当得利造成其他当事人的利益损失（“受损方”），则估值错误责任方应赔偿受损方的损失，并在其支付的赔偿金额的范围内对获得不当得利的当事人享有要求交付不当得利的权利；如果获得不当得利的当事人已经将此部分不当得利返还给受损方，则受损方应当将其已经获得的赔偿额加上已经获得的不当得利返还的总和超过其实际损失的差额部分支付给估值错误责任方；

（4）估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式；

（5）按法律法规规定的其他原则处理估值错误。

3、估值错误处理程序

估值错误被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

（1）查明估值错误发生的原因，列明所有的当事人，并根据估值错误发生的原因确定估值错误的责任方；

（2）根据估值错误处理原则或当事人协商的方法对因估值错误造成的损失进行评估；

（3）根据估值错误处理原则或当事人协商的方法由估值错误的责任方进行更正和赔偿损失；

（4）根据估值错误处理的方法，需要修改集合计划登记机构交易数据的，由集合计划登记机构进行更正，并就估值错误的更正向有关当事人进行确认。

4、集合计划份额净值估值错误处理的方法如下：

（1）集合计划份额净值计算出现错误时，管理人应当立即予以纠正，通报托管人，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；

（2）错误偏差达到集合计划份额净值的0.25%时，管理人应当通报托管人并报中国证监会备案；错误偏差达到集合计划份额净值的0.5%时，管理人应当公告，并报中国证监会备案；

（3）前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。

（三）集合计划会计制度

按国家有关部门制定的会计制度执行。

（四）集合计划账册的建立

管理人和托管人在《资产管理合同》生效后，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，以保证集合计划财产的安全。若双方对会计处理方法存在分歧，应以管理人的处理方法为准。

（五）会计数据和财务指标的核对

双方应每个交易日核对账目，如发现双方的账目存在不符的，管理人和托管人必须及时查明原因并纠正，确保核对一致。若当日核对不符，暂时无法查找到错账的原因而影响到集合计划资产净值的计算和公告的，以管理人的账册为准。

（六）集合计划招募说明书、定期报告的编制和复核

集合计划财务报表由管理人和托管人每月分别独立编制。月度报表的编制，应于每月终了后 5 个工作日内完成。定期报告文件应按中国证监会的要求公告。季度报表的编制，应于季度终了后 15 个工作日内完成；招募说明书的信息发生重大变更的，管理人应当在三个工作日内，更新招募说明书并登载在指定网站上；招募说明书其他信息发生变更的，管理人至少每年更新一次。集合计划终止运作的，管理人不再更新招募说明书。中期报告在集合计划会计年度前 6 个月结束后的两个月内公告；年度报告在会计年度结束后三个月内公告。

管理人在月初 3 个工作日内完成上年度报表的编制，经盖章后，以约定方式将有关报表提供托管人；托管人收到后在 2 个工作日内进行复核，并将复核结果及时书面或双方约定的其他方式通知管理人。对于季度报告、中期报告、年度报告、更新招募说明书等报告，管理人和托管人应在上述监管部门规定的时间内完成编制、复核及公告。托管人在复核过程中，发现双方的报表存在不符时，管理人和托管人应共同查明原因，进行调整，调整以双方认可的账务处理方式为准。如果管理人与托管人不能于应当发布公告之日前就相关报表达成一致，管理人有权按照其编制的报表对外发布公告，托管人有权就相关情况报中国证监会备案。

托管人在对财务报表、季度报告、中期报告或年度报告复核完毕后，可以出具复核确认书（盖章）或以其他双方约定的方式确认，以备有权机构对相关文件审核检查。

九、集合计划收益分配

集合计划收益分配是指将本集合计划的可分配收益根据持有集合计划份额的数量按比例向集合计划份额持有人进行分配。

(一) 集合计划收益分配应该符合资产管理合同中收益分配原则的规定，具体规定如下：

1、在符合有关集合计划收益分配条件的前提下，本集合计划每年收益分配次数最多为 12 次，每份集合计划份额每次集合计划收益分配比例不得低于集合计划收益分配基准日每份集合计划份额可供分配利润的 10%，若《资产管理合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

2、本集合计划收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为该类集合计划份额进行再投资；若投资者不选择，本集合计划默认的收益分配方式是现金分红；因红利再投资转换的份额类别，与集合计划份额持有人在收益分配基准日持有的份额同属一个类别；如集合计划份额持有人持有多个类别份额的，则根据不同类别收益分配方案分别计算该类别红利再投资份额；如投资者选择将现金红利自动转为相应类别的集合计划份额进行再投资，再投资集合计划份额的持有期限与原持有集合计划份额相同（红利再投资取得的 A 类份额和 C 类份额，其最短持有期限的起算日与原持有集合计划份额相同）；

3、集合计划收益分配后各类集合计划份额净值不能低于面值；即集合计划收益分配基准日的各类集合计划份额净值减去每单位该类集合计划份额收益分配金额后不能低于面值；

4、由于本集合计划 A 类份额、B 类份额不收取销售服务费，C 类份额收取销售服务费，各类别集合计划份额对应的可分配收益将有所不同。本集合计划同一类别的每一份集合计划份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

(二) 集合计划收益分配方案的确定与公告

本集合计划收益分配方案由管理人拟定，并由托管人复核，在 2 日内在规定媒介公告。集合计划收益分配方案中应载明截止收益分配基准日的可供分配利润、

集合计划收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。

十、集合计划信息披露

（一）保密义务

除按照《基金法》、《资产管理合同》、《信息披露办法》及中国证监会关于集合计划信息披露的有关规定进行披露以外，管理人和托管人对公开披露前的集合计划信息、从对方获得的业务信息及其他不宜公开披露的集合计划信息应予保密，不得向任何第三方泄露。法律法规另有规定的以及审计需要的除外。

如下情况不应视为管理人或托管人违反保密义务：

1. 非因管理人和托管人的原因导致保密信息被披露、泄露或公开；
2. 管理人和托管人为遵守和服从法院判决、仲裁裁决或中国证监会等监管机构的命令决定所做出的信息披露或公开。

（二）管理人和托管人在集合计划信息披露中的职责和信息披露程序

管理人和托管人应根据相关法律法规、《资产管理合同》的规定各自承担相应的信息披露职责。管理人和托管人负有积极配合、互相督促、彼此监督，保证其履行按照法定方式和时限披露的义务。

本集合计划信息披露的文件，包括《资产管理合同》规定的定期报告、临时报告、集合计划资产净值公告及中国证监会规定的其他必要的公告文件，由管理人拟定并公布。

托管人应按本协议第八条第（六）款的规定对相关报告进行复核。集合计划年报的财务会计报告经有从事证券相关业务资格的会计师事务所审计后方可披露。

本集合计划的信息披露公告，必须在中国证监会规定媒介发布。

（三）暂停或延迟信息披露的情形

- 1、不可抗力；
- 2、集合计划投资所涉及的证券/期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；
- 3、法律法规、《资产管理合同》或中国证监会规定的其他情况。

（四）托管人报告

托管人应按《基金法》和中国证监会的有关规定出具集合计划托管情况报告。托管人报告说明该半年度/年度托管人和管理人履行《资产管理合同》的情况，是集合计划中期报告和年度报告的组成部分。

十一、集合计划费用

（一）管理人的管理费和业绩报酬

（1）管理人的固定管理费

本集合计划的固定管理费按前一日集合计划资产净值的 0.8%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E\times 0.8\%\div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的集合计划固定管理费

E 为前一日的集合计划资产净值

集合计划固定管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。经管理人与托管人核对一致后，由托管人于次月前 5 个工作日内从集合计划财产中一次性支付给管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

（2）管理人的业绩报酬

在本集合计划投资者赎回日和集合计划终止日，管理人将根据投资者的期间年化收益率（R），对 B 类计划份额期间年化收益率超过 5%以上部分按照 18%的比例收取管理人业绩报酬（以下简称“业绩报酬”）；对 A 类或 C 类计划份额期间年化收益率超过 8%以上部分按照 20%的比例收取业绩报酬。

1) 业绩报酬计提原则：

- A. 同一投资者不同时间多次申购集合计划份额的，对投资者每笔参与份额（或红利再投份额）分别计算年化收益率、计提业绩报酬；
- B. 在投资者赎回日和集合计划终止日对符合业绩报酬提取条件的份额提取业绩报酬；
- C. 在投资者赎回或集合计划终止时提取业绩报酬的，业绩报酬从赎回资金中扣除；
- D. 投资者申请赎回时，管理人按“先进先出”的原则，即按照投资者份额参

与的先后次序进行顺序赎回的方式确定赎回份额，计算、提取赎回份额对应的业绩报酬。

2) 业绩报酬计提办法：

业绩报酬计提日为本集合计划赎回申请日和集合计划终止日。每笔参与份额以上一个发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日（以下简称“上一个业绩报酬计提日”，如该笔参与份额未发生业绩报酬计提，存续期内申购的，以申购当日为上一个业绩报酬计提日，下同）到本次业绩报酬计提日的年化收益率，作为计提业绩报酬的基准。年化收益率的计算公式如下：

$$R = \frac{(P_1 - P_0)}{P_0} \div D \times 100\%$$

P_1 为投资者本次业绩报酬计提日的单位累计净值；

P_0 为投资者上一个业绩报酬计提日的单位累计净值；

P_0^* 为投资者上一个业绩报酬计提日的单位净值；

D 为投资者上一个业绩报酬计提日（含）到本次业绩报酬计提日（不含）的年限（1 年按 365 天计算）；

R 为期间年化收益率

管理人业绩报酬计提如下：

A 类或 C 类计划份额 期间年收益率（R）	计提比例	业绩报酬（Y）的计提公式
$R < 8\%$	0	$Y = 0$
$R \geq 8\%$	20%	$Y = A \times (R - 8\%) \times 20\% \times D$
B 类计划份额期间 年收益率（R）	计提比例	业绩报酬（Y）的计提公式
$R < 5\%$	0	$Y = 0$
$R \geq 5\%$	18%	$Y = A \times (R - 5\%) \times 18\% \times D$

Y = 业绩报酬； A = 每笔参与份额在上一个业绩报酬计提日的资产净值总额。

3) 业绩报酬支付：

业绩报酬由登记机构负责计算，托管人根据管理人发送的划付指令，从集合

计划财产中支付。

（二）托管人的托管费

本集合计划的托管费按前一日集合计划资产净值的 0.12% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.12\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的集合计划托管费

E 为前一日的集合计划资产净值

集合计划托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。经管理人与托管人核对一致后，由托管人于次月前 5 个工作日内从集合计划财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

（三）销售服务费

本集合计划 A 类份额、B 类份额不收取销售服务费，C 类份额的销售服务费年费率为 0.5%。

C 类份额的销售服务费按前一日 C 类份额资产净值的 0.5% 年费率计提，计算方法如下：

$$H=E \times \text{年销售服务费率} \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类份额前一日集合计划资产净值

销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由托管人根据与管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内从计划资产划出，管理人无需再出具资金划拨指令。销售服务费由管理人代收，管理人收到后按相关合同规定支付给销售机构。

销售服务费主要用于支付销售机构佣金、以及管理人的集合计划行销广告费、促销活动费、集合计划份额持有人服务等。

（四）从集合计划资产中列支管理人的管理费和业绩报酬、托管人的托管费、销售服务费之外的其他集合计划费用，应当依据有关法律法规、《资产管理合同》的规定；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集合计划财产的损失，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。资产管理合同生效之前的律师费、会计师费和信息披露费用等不得从集合计划财产中列支；托管人对不符合《基金法》、《运作办法》等有关规定以及《资产管理合同》的其他费用有权拒绝执行。如果托管人发现管理人违反有关法律法规的有关规定和《资产管理合同》、本协议的约定，从集合计划财产中列支费用，有权要求管理人做出书面解释，如果托管人认为管理人无正当或合理的理由，可以拒绝支付。

十二、集合计划份额持有人名册的保管

管理人可委托登记机构登记和保管集合计划份额持有人名册。集合计划份额持有人名册的内容包括但不限于集合计划份额持有人的名称和持有的集合计划份额。

集合计划份额持有人名册，包括集合计划募集期结束时的集合计划份额持有人名册、集合计划权益登记日的集合计划份额持有人名册、集合计划份额持有人大会权益登记日的集合计划份额持有人名册、每年最后一个交易日的集合计划份额持有人名册，由登记机构负责编制和保管，并对集合计划份额持有人名册的真实性、完整性和准确性负责。

管理人应根据托管人的要求定期和不定期向托管人提供集合计划份额持有人名册。

（一）管理人于《资产管理合同》生效日及《资产管理合同》终止日后 10 个工作日内向托管人提供由登记机构编制的集合计划份额持有人名册；

（二）管理人于集合计划份额持有人大会权益登记日后 5 个工作日内向托管人提供由登记机构编制的集合计划份额持有人名册；

（三）管理人于每年最后一个交易日后 10 个工作日内向托管人提供由登记机构编制的集合计划份额持有人名册；

（四）除上述约定时间外，如果确因业务需要，托管人与管理人商议一致后，由管理人向托管人提供由登记机构编制的集合计划份额持有人名册。

托管人以电子版形式妥善保管集合计划份额持有人名册，并定期刻成光盘备份，保存期限不低于法律法规规定的最低期限。托管人不得将所保管的集合计划份额持有人名册用于集合计划托管业务以外的其他用途，并应遵守保密义务。若管理人或托管人由于自身原因无法妥善保管集合计划份额持有人名册，应按有关

法规规定各自承担相应的责任。

十三、集合计划有关文件档案的保存

管理人应保存集合计划财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料，托管人应保存集合计划托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料。

管理人和托管人应按各自职责完整保存原始凭证、记账凭证、集合计划账册、会计报告、交易记录和重要合同等，保存期限法律法规规定的最低期限。

管理人签署重大合同文本后，应及时将合同文本正本送达托管人处。管理人应及时将与本集合计划账务处理、资金划拨等有关的合同、协议传真给托管人。

管理人或托管人变更后，未变更的一方有义务协助接任人接收集合计划的有关文件。

十四、管理人和托管人的更换

（一）管理人的更换

1. 管理人职责终止的条件

有下列情形之一的，管理人职责终止：

- （1）被依法取消管理人资格；
- （2）被集合计划份额持有人大会解任；
- （3）依法解散、被依法撤销或被依法宣告破产；
- （4）法律法规及中国证监会规定的和《资产管理合同》约定的其他情形

2. 管理人的更换程序

（1）提名：新任管理人由托管人或由单独或合计持有 10%以上（含 10%）集合计划份额的集合计划份额持有人提名；

（2）决议：集合计划份额持有人大会在管理人职责终止后 6 个月内对被提名的管理人形成决议，该决议需经参加大会的集合计划份额持有人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）表决通过，决议自表决通过之日起生效；

（3）临时管理人：新任管理人产生之前，由中国证监会指定临时管理人；

（4）备案：集合计划份额持有人大会选任管理人的决议须报中国证监会备案；

（5）公告：管理人更换后，由托管人在更换管理人的集合计划份额持有人

大会决议生效后 2 日内在规定媒介公告。

(6) 交接：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。临时管理人或新任管理人应与托管人核对集合计划资产总值和净值；

(7) 审计：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财产进行审计，并将审计结果予以公告，同时报中国证监会备案，审计费用从集合计划财产中列支；

(8) 集合计划名称变更：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管理人有关的名称字样。

(二) 托管人的更换

1. 托管人职责终止的条件

有下列情形之一的，托管人职责终止：

- (1) 被依法取消集合计划托管资格；
- (2) 被集合计划份额持有人大会解任；
- (3) 依法解散、被依法撤销或被依法宣告破产；
- (4) 法律法规及中国证监会规定的和《资产管理合同》约定的其他情形

2. 托管人的更换程序

(1) 提名：新任托管人由管理人或由单独或合计持有 10%以上（含 10%）集合计划份额的持有人提名；

(2) 决议：集合计划份额持有人大会在托管人职责终止后 6 个月内对被提名的托管人形成决议，该决议需经参加大会的集合计划份额持有人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）表决通过，决议自表决通过之日起生效；

(3) 临时托管人：新任托管人产生之前，由中国证监会指定临时托管人；

(4) 备案：集合计划份额持有人大会更换托管人的决议须报中国证监会备案；

(5) 公告：托管人更换后，由管理人在更换托管人的集合计划份额持有人大会决议生效后 2 日内在规定媒介公告。

(6) 交接：托管人职责终止的，应当妥善保管集合计划财产和集合计划托

管业务资料，及时办理集合计划财产和集合计划托管业务的移交手续，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；

（7）审计：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财产进行审计，并将审计结果予以公告，同时报中国证监会备案，审计费用从集合计划财产中列支。

（三）管理人与托管人同时更换

1、提名：如果管理人和托管人同时更换，由单独或合计持有集合计划总份额 10%以上（含 10%）的集合计划份额持有人提名新的管理人和托管人；

2、管理人和托管人的更换分别按上述程序进行；

3、公告：新任管理人和新任托管人应在更换管理人和托管人的集合计划份额持有人大会决议生效后 2 日内在规定媒介上联合公告。

十五、禁止行为

本协议项下的管理人和托管人禁止行为如下：

（一）《基金法》第二十条、第三十八条禁止的行为。

（二）除非法律法规及中国证监会另有规定，托管协议当事人不得利用集合计划财产从事《基金法》第七十三条禁止的投资或活动。

（三）除《基金法》及其他有关法规、《资产管理合同》及中国证监会另有规定，管理人、托管人不得利用集合计划财产为自身和任何第三人谋取利益。

（四）管理人与托管人对集合计划运作过程中任何尚未按有关法规规定的方式公开披露的信息，不得对他人泄露。

（五）管理人不得在资金头寸不足的情况下，向托管人发送划款指令。

（六）在资金头寸充足且为托管人执行指令留出足够时间的情况下，托管人对管理人符合法律法规、《资产管理合同》、本协议的指令不得拖延或拒绝执行。

（七）除根据管理人指令或《资产管理合同》另有规定的，托管人不得动用或处分集合计划财产。

（八）管理人与托管人不得为同一机构，不得相互出资或者持有股份。托管人、管理人应在行政上、财务上互相独立，其高级管理人员或其他从业人员不得

相互兼职。

（九）《资产管理合同》投资限制中禁止投资的行为。

（十）法律法规、《资产管理合同》和本协议禁止的其他行为。

法律法规和监管部门取消上述禁止性规定的，则本集合计划不受上述相关限制。

十六、托管协议的变更、终止与集合计划财产的清算

（一）托管协议的变更

本协议双方当事人经协商一致，可以对本协议进行修改。修改后的新协议，其内容不得与《资产管理合同》的规定有任何冲突。修改后的新协议，应报中国证监会备案。

（二）托管协议的终止

1. 《资产管理合同》终止；
2. 托管人解散、依法被撤销、破产，被依法取消集合计划托管资格或因其他事由造成其他托管人接管集合计划财产；
3. 管理人解散、依法被撤销、破产，被依法取消管理人资格或因其他事由造成其他管理人接管集合计划管理权。
4. 发生《基金法》、《销售办法》、《运作办法》或其他法律法规规定的终止事项。

（三）集合计划财产的清算

1. 集合计划财产清算小组

（1）集合计划财产清算小组：自出现《资产管理合同》终止事由之日起 30 个工作日内成立清算小组，管理人组织集合计划财产清算小组并在中国证监会的监督下进行集合计划清算。

（2）集合计划财产清算小组组成：集合计划财产清算小组成员由管理人、托管人、符合《中华人民共和国证券法》规定的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。集合计划财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

（3）集合计划财产清算小组职责：集合计划财产清算小组负责集合计划财

产的保管、清理、估价、变现和分配。集合计划财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。

2.集合计划财产清算程序

(1)《资产管理合同》终止情形出现时,由集合计划财产清算小组统一接管集合计划;

(2)对集合计划财产和债权债务进行清理和确认;

(3)对集合计划财产进行估值和变现;

(4)制作清算报告;

(5)聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计,聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书;

(6)将清算报告报中国证监会备案并公告;

(7)对集合计划剩余财产进行分配。

3、集合计划财产清算的期限为6个月,但因本集合计划所持证券的流动性受到限制而不能及时变现的,管理人可针对该部分未能变现证券制定二次清算方案,该方案应经托管人认可,并通过管理人网站进行披露。管理人应根据二次清算方案的规定,对该部分流通受限证券在可流通变现后进行二次或多次清算,并将变现后的资产按合同约定以货币形式全部分配给份额持有人。

4.清算费用

清算费用是指集合计划财产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,清算费用由集合计划财产清算小组优先从集合计划财产中支付。

5.集合计划剩余财产的分配

集合计划财产按如下顺序进行清偿:

(1)支付集合计划财产清算费用;

(2)缴纳集合计划所欠税款;

(3)清偿集合计划债务;

(4)清算后如有余额,按集合计划份额持有人持有的集合计划份额比例进行分配。

6.集合计划财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告;集合计划财产清算报告经过符合

《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。集合计划财产清算公告于集合计划财产清算报告报中国证监会备案后5个工作日内由集合计划财产清算小组进行公告，集合计划财产清算小组应当将清算报告登载在规定网站上，并将清算报告提示性公告登载在规定报刊上。

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有关文件由托管人保存不低于法律法规规定的最低期限。

十七、违约责任

（一）管理人或托管人不履行本协议或履行本协议不符合约定的，应当承担违约责任。

（二）管理人、托管人在履行各自职责的过程中，违反《基金法》规定或者本托管协议约定，给集合计划财产或者集合计划份额持有人造成损害的，应当分别对各自的行为依法承担赔偿责任；因共同行为给集合计划财产或者集合计划份额持有人造成损害的，应当承担连带赔偿责任，对损失的赔偿，仅限于直接损失，一方承担连带责任后有权根据另一方过错程度向另一方追偿。但是发生下列情况，当事人免责：

1. 管理人及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；

2. 管理人由于按照《资产管理合同》规定的投资原则投资或不投资造成的直接损失或潜在损失等；

3. 托管人对存放或存管在托管人以外机构的集合计划资产，或交由证券公司等其他机构负责清算交收的集合计划资产及其收益，由于该机构欺诈、疏忽、过失或破产等原因给本集合计划资产造成的损失等；

4. 当事人不能预见、不能避免、不能克服，且在本协议由集合计划份额持有人、管理人、托管人签署之日后发生的，使本协议当事人无法全部履行或无法部分履行本协议的任何事件和因素，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、恐怖袭击、传染病传播、法律法规变化、系

统故障、突发停电或其他突发事件、证券交易所或证券登记结算机构非正常暂停或停止交易或发送数据存在延误、错漏。

如果由于本协议一方当事人（“违约方”）的违约行为给集合计划资产或集合计划投资者造成损失，而另一方当事人（“守约方”）赔偿了集合计划资产或集合计划投资者的损失，则守约方有权向违约方追索由此遭受的所有直接损失。

当事人一方违约，另一方在职责范围内有义务及时采取必要的措施，尽力防止损失的扩大。没有采取适当措施致使损失进一步扩大的，不得就扩大的损失要求赔偿。非违约方因防止损失扩大而支出的合理费用由违约方承担。

由于不可抗力原因，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，由此造成集合计划资产或集合计划投资者损失，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消除或降低由此造成的影响。

（三）托管协议当事人违反托管协议，给另一方当事人造成损失的，应承担赔偿责任。

（四）违约行为虽已发生，但本托管协议能够继续履行的，在最大限度地保护集合计划份额持有人利益的前提下，管理人和托管人应当继续履行本协议。

（五）本协议所指损失均为直接损失。

十八、争议解决方式

相关各方当事人同意，因本协议而产生的或与本协议有关的一切争议，应通过友好协商或者调解解决。托管协议当事人不愿通过协商、调解解决或者协商、调解不成的，应提交托管人所在地有管辖权的人民法院起诉。

争议处理期间，相关各方当事人应恪守管理人和托管人职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行《资产管理合同》和本协议规定的义务，维护集合计划份额持有人的合法权益。

本协议受中华人民共和国法律管辖。

十九、托管协议的效力

（一）托管协议应经托管协议当事人双方加盖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盖章。

（二）托管协议自《资产管理合同》成立之日起成立，自《资产管理合同》生效之日起生效。托管协议的有效期自其生效之日起至集合计划财产清算结果报中国证监会备案并公告之日止。

（三）托管协议自生效之日起对托管协议当事人具有同等的法律约束力。

（四）托管协议一式 5 份，除上报监管机构外，管理人持有 2 份，托管人持有 1 份，每份具有同等的法律效力。

二十、其他事项

本协议未尽事宜，当事人按资产管理合同、有关法律法规等规定协商办理。

二十一、托管协议的签订

本协议双方法定代表人或授权代表人签章、签订地、签订日。

（本页无正文，为《海通红利优选一年持有期混合型集合资产管理计划托管协议》签字页）

管理人：上海海通证券资产管理有限公司（盖章）

法定代表人或授权代表（签字或盖章）：

签订地点：上海

签订日期： 年 月 日

托管人：交通银行股份有限公司（盖章）

法定代表人或授权代表（签字或盖章）：

签订地点：上海

签订日期： 年 月 日