

方正证券鑫悦一年持有期债券型集合资产管理计划 托管协议

集合计划管理人：方正证券股份有限公司

集合计划托管人：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、集合计划托管人对集合计划管理人的业务监督和核查.....	4
四、集合计划管理人对集合计划托管人的业务核查.....	10
五、集合计划财产的保管.....	11
六、指令的发送、确认和执行.....	13
七、交易及清算交收安排.....	15
八、集合计划资产净值计算和会计核算.....	18
九、集合计划收益分配.....	23
十、集合计划信息披露.....	23
十一、集合计划费用.....	25
十二、集合计划份额持有人名册的保管.....	27
十三、集合计划有关文件档案的保存.....	27
十四、集合计划管理人和集合计划托管人的更换.....	27
十五、禁止行为.....	29
十六、托管协议的变更、终止与集合计划财产的清算.....	30
十七、违约责任.....	32
十八、争议解决方式.....	33
十九、托管协议的效力.....	33
二十、其他事项.....	34
二十一、托管协议的签订.....	35

鉴于方正证券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股份有限公司，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“集合计划管理人”）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“集合计划托管人”）的资格和能力；

鉴于方正证券股份有限公司拟担任方正证券鑫悦一年持有期债券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方正证券鑫悦一年持有期债券型集合资产管理计划的托管人；

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；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；承诺向托管人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、提供产品受益所有人的信息和资料，并在产品受益所有人发生变化时，及时告知托管人并按托管人要求完成更新；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。

为明确方正证券鑫悦一年持有期债券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《方正证券鑫悦一年持有期债券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。

一、托管协议当事人

（一）集合计划管理人

名称：方正证券股份有限公司

住所：湖南省长沙市天心区湘江中路二段 36 号华远华中心 4，5 号楼 3701-3717

办公地址：北京市朝阳区朝阳门南大街 10 号兆泰国际中心 A 座 18 层

法定代表人：施华

成立时间：1994 年 10 月 26 日

批准设立机关及批准设立文号：浙江省人民政府办公厅浙政办发〔1990〕47 号文批准

批准证券资产管理业务资格批文及文号：证监许可〔2009〕304 号

经营范围：证券经纪；证券投资咨询；与证券交易、证券投资活动有关的财务顾问；证券自营；证券资产管理；融资融券；证券投资基金代销；为期货公司提供中间介绍业务；代销金融产品。（按经营证券期货业务许可证核定的期限和范围从事经营）（依法须经批准的项目，经相关部门批准后方可开展经营活动）

注册资本：82.32 亿

组织形式：股份有限公司

存续期间：持续经营

（二）集合计划托管人

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》”）、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》（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》”）、《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第7号〈托管协议的内容与格式〉》、《方正证券鑫悦一年持有期债券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集合计划管理人和集合计划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。

集合计划管理人和集合计划托管人遵循平等自愿、诚实信用、充分保护集合计划份额持有人合法利益的原则，经协商一致，签订本协议。

若本集合计划实施侧袋机制的，侧袋机制实施期间的相关安排见资产管理合同和招募说明书的规定。

三、集合计划托管人对集合计划管理人的业务监督和核查

（一）集合计划托管人对集合计划管理人的投资行为行使监督权

1.集合计划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主要为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行的股票（含创业板、存托凭证及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、港股通标的股票、债券（含国债、地方政府债、政府支持机构债、央行票据、金融债券（含次级债券）、政策性金融债券、企业债券、公司债券、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、证券公司发行的短期公司债券、非金融企业债务融资工具（含短期融资券、超短期融资券、中期票据）、银行存款（包括协议存款、通知存款、定期存款）、同业存单、债券回购、货币市场工具、资产

支持证券、国债期货以及法律法规或中国证监会允许投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。

如法律法规或监管机构以后允许投资其他品种,集合计划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:本集合计划投资于债券的比例不低于集合计划资产的 80%,其中投资于可转换债券、可交换债券的比例合计不超过集合计划资产的 20%;本集合计划股票投资占集合计划资产的 0-20%,其中投资于港股通标的股票比例占股票资产的 0-50%。每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后,持有的现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计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。

集合计划托管人对集合计划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.集合计划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)本集合计划投资于债券的比例不低于集合计划资产的 80%,其中投资于可转换债券、可交换债券的比例合计不超过集合计划资产的 20%;本集合计划股票投资占集合计划资产的 0-20%,其中投资于港股通标的股票比例占股票资产的 0-50%;

(2)每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后,本集合计划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、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 股合并计算,下同),其市值不超过集合计划资产净值的 10%;

(4)本集合计划管理人管理的全部大集合计划持有一家公司发行的证券,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大集合计划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) 本集合计划管理人管理的全部大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，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) 本集合计划管理人管理的全部开放式大集合计划（包含开放式大集合计划以及处于开放期的采取定期开放方式运作的大集合计划）持有一家上市公司发行的可流通股股票，不得超过该上市公司可流通股股票的 15%；本集合计划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股票，不得超过该上市公司可流通股股票的 30%；完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的大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；

(12) 本集合计划在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；

(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本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集合计划管理人之外的因素致使集合计划不符合该比例限制的，集合计划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) 本集合计划总资产不得超过集合计划净资产的 140%；

(16) 本集合计划投资于国债期货的投资限制如下：

1) 本集合计划在任何交易日日终，持有的买入国债期货合约价值，不得超过集合计划资产净值的 15%；

2) 本集合计划在任何交易日日终，持有的卖出国债期货合约价值不得超过集合计划持有的债券总市值的 30%；

3) 本集合计划所持有的债券（不含到期日在一年以内的政府债券）市值和买入、卖出国债期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合资产管理合同关于债券投资比例的有关约定；

4) 本集合计划在任何交易日内交易（不包括平仓）的国债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 30%；

(17) 本集合计划投资存托凭证的比例限制依照内地上市交易的股票执行，与境内上市交

易的股票合并计算；

(18) 法律法规及中国证监会规定的和《资产管理合同》约定的其他投资比例限制。

除上述第(2)、(9)、(13)、(14)项情形之外，因证券市场波动、证券发行人合并、集合计划规模变动等集合计划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，集合计划管理人应当在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。法律法规或监管部门另有规定时，从其规定。

集合计划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。集合计划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。

如果法律法规或监管部门对上述投资比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本集合计划，则本集合计划投资不再受相关限制。

集合计划托管人依照上述规定对本集合计划的投资组合限制及调整期限进行监督。

3.集合计划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) 买卖其他集合计划或基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；
- (5) 向其集合计划管理人、集合计划托管人出资；
- (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。

集合计划管理人运用集合计划财产买卖集合计划管理人、集合计划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的原则，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集合计划托管人的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交集合计划管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。集合计划管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

在资产管理合同生效后2个工作日内，集合计划管理人和集合计划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、行政法规或监管部门取消或变更上述禁止性规定，集合计划管理人在履行适当程序后，本集合计划可不受上述规定的限制或以变更后的规定为准。

4.集合计划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，对集合计划管理人参与银行间债券市场进行监督。

(1) 集合计划托管人依据有关法律法规的规定和《资产管理合同》的约定对于集合计划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。

(2) 集合计划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，集合计划管理人应当负责向相关责任人追偿。

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

(1) 集合计划管理人、集合计划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) 集合计划管理人与集合计划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) 集合计划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) 集合计划管理人与集合计划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.集合计划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) 集合计划管理人应在集合计划首次投资流通受限证券前，向集合计划托管人提供有

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，集合计划管理人还应提供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。集合计划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集合计划托管人，保证集合计划托管人有足够的时间进行审核。集合计划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，集合计划管理人应向集合计划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。集合计划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集合计划托管人，保证集合计划托管人有足够的时间进行审核。

(5) 集合计划托管人应对集合计划管理人提供的有关书面信息进行审核，集合计划托管人认为上述资料可能导致集合计划投资出现风险的，有权要求集合计划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，并保留查看集合计划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，集合计划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，集合计划托管人不承担任何责任，并有权报告中国证监会。

如集合计划管理人和集合计划托管人无法达成一致，应及时上报中国证监会请求解决。如果集合计划托管人切实履行监督职责，则不承担任何责任。

7.集合计划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) 集合计划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、相关信息披露等进行监督和核查。如果集合计划管理人未经集合计划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，则集合计划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) 集合计划管理人应积极配合和协助集合计划托管人的监督和核查，在规定时间内答复并改正，就集合计划托管人的疑义进行解释或举证。对集合计划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，集合计划管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

集合计划托管人发现集合计划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集合计划管理人限期纠正,集合计划管理人收到通知后应及时核对,并以电话或书面形式向集合计划托管人反馈,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,集合计划托管人有权随时对通知事项进行复查,督促集合计划管理人改正。集合计划管理人对集合计划托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的,集合计划托管人有权报告中国证监会。

集合计划托管人发现集合计划管理人有重大违规行为,应立即报告中国证监会,同时通知集合计划管理人在限期内纠正。

集合计划托管人发现集合计划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和本协议约定的,应当拒绝执行,立即通知集合计划管理人,并有权向中国证监会报告。

集合计划托管人发现集合计划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,应当立即通知集合计划管理人,并有权向中国证监会报告。

四、集合计划管理人对集合计划托管人的业务核查

根据《基金法》及其他有关法规、资产管理合同和本协议规定,集合计划管理人对集合计划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集合计划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、准确复核集合计划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,是否根据集合计划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。

集合计划管理人定期和不定期地对集合计划托管人保管的集合计划资产进行核查。集合计划托管人应积极配合集合计划管理人的核查行为,包括但不限于:提交相关资料以供集合计划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。

集合计划管理人发现集合计划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集合计划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集合计划托管人在限期内纠正,集合计划托管人收到通知后应及时核对并以书面形式对集合计划管理人发出回函。在限期内,集合计划管理人有权随时对通知事项进行复查,督促集合计划托管人改正。集合计

划托管人对集合计划管理人通知的违规事项未能在限期内纠正的,集合计划管理人应报告中国证监会。对集合计划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,集合计划托管人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

集合计划管理人发现集合计划托管人有重大违规行为,应立即报告中国证监会,同时通知集合计划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. 集合计划托管人应安全保管集合计划财产,未经集合计划管理人的指令,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集合计划管理人、集合计划托管人的固有财产。
3. 集合计划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,集合计划管理人和集合计划托管人按照规定开立期货资金账户。
4. 集合计划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,应由集合计划管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知集合计划托管人,到账日集合计划资产没有到达集合计划银行存款账户的,集合计划托管人应及时通知集合计划管理人采取措施进行催收。由此给集合计划造成损失的,集合计划管理人应负责向有关当事人追偿集合计划的损失。集合计划托管人对此不承担任何责任。

(二) 集合计划的银行存款账户的开立和管理

1. 集合计划托管人应负责本集合计划银行存款账户的开立和管理。
2. 集合计划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,并根据集合计划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集合计划托管人保管和使用。本集合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、支付集合计划收益,均需通过本集合计划的银行存款账户进行。
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。集合计划托管人和集合计划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. 集合计划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

集合计划托管人以集合计划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。集合计划托管人和集合计划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。

集合计划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。集合计划证券账户资产的管理和运用由集合计划管理人负责。

集合计划托管人以集合计划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。集合计划托管人以本集合计划的名义在集合计划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，集合计划管理人负责向人民银行进行报备，并在备案通过后由集合计划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，并由集合计划托管人负责集合计划的债券及资金的清算。集合计划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，由集合计划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. 集合计划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，协议正本由集合计划管理人保存。

（五）国债期货的相关账户的开立和管理

集合计划管理人、集合计划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规定设立。

集合计划托管人已取得期货保证金存管银行资格，集合计划管理人授权集合计划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（须包括集合计划托管人印章）及集合计划管理人公章。

本集合投资银行存款时，集合计划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、存款到期指定收款账户等细则。

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，由集合计划管理人协助集合计划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

实物证券由集合计划托管人存放于集合计划托管人的保管库。实物证券的购买和转让，由集合计划托管人根据集合计划管理人的指令办理。集合计划托管人对由集合计划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集合计划托管人负责保管。集合计划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

由集合计划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集合计划托管人、集合计划管理人保管，相关业务程序另有限制除外。除本协议另有规定外，集合计划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，以便集合计划管理人和集合计划托管人至少各持有一份正本的原件，集合计划管理人应及时将正本送达集合计划托管人处。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，集合计划管理人应向集合计划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）集合计划管理人对发送指令人员的书面授权

集合计划管理人应事先书面通知（以下称“授权通知”）集合计划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，并规定集合计划管理人向集合计划托管人发送指令时集合计划托管人确认有权发送人员（以下简称“被授权人”）身份的方法。集合计划管理人向集合计划托管人发出的授权通知应加盖公章。集合计划管理人发出授权

通知后，以电话形式向集合计划托管人确认，授权通知自其上面注明的启用日期开始生效。

集合计划托管人收到授权通知原件扫描件后，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集合计划管理人确认。

集合计划管理人和集合计划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

指令是集合计划管理人在运用集合计划资产时，向集合计划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，可采用实物章或电子章方式用印。

（三）指令的发送、确认和执行的时间和程序

集合计划管理人应按照《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集合计划管理人用双方约定的方式向集合计划托管人发送。发送后集合计划管理人及时通过电话与集合计划托管人确认指令内容。集合计划管理人必须在15:00之前向集合计划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，集合计划托管人不能保证在当日完成划付。对集合计划管理人在没有充足资金的情况下向集合计划托管人发出的指令，集合计划托管人可不予执行，并立即通知集合计划管理人，集合计划托管人不承担因为不执行该指令而造成损失的责任。如集合计划管理人要求当天某一时点到账，必须至少提前2个工作小时向集合计划托管人发送付款指令并与集合计划托管人电话确认。集合计划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，集合计划托管人不承担由此导致的损失。集合计划管理人应将银行间市场成交单加盖预留印鉴后传真给集合计划托管人。对于被授权人发出的指令，集合计划管理人不得否认其效力。集合计划托管人依照“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，集合计划托管人将执行结果反馈给集合计划管理人。集合计划托管人仅根据集合计划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）集合计划管理人发送错误指令的情形和处理程序

集合计划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。集合计划托管人在履行监督职能时，发现集合计划管理人的指令错误时，有权拒绝执行，并及时通知集合计划管理人改正。

（五）集合计划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

集合计划托管人在对集合计划场外投资指令进行审核时，如发现集合计划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集合计划管理人；如交易已生效，则以书面形式通知集合计划管理人限期纠正。集合计划管理人收到通知后应及时核对，并以约定形式向集合计划托管人反馈，由此造成的损失由集合计划管理人承担。

集合计划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，通知集合计划管理人改正。如果集合计划管理人拒不改正，集合计划托管人有权向中国证监会报告。

（六）集合计划托管人未按照集合计划管理人指令执行的处理方法

集合计划托管人由于自身原因造成未按照集合计划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

集合计划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，使用双方约定方式向集合计划托管人发出加盖公章的被授权人变更通知原件扫描件，注明启用日期，同时电话通知集合计划托管人。被授权人变更通知自其上面注明的启用日期起开始生效。集合计划管理人对授权通知的内容的修改自启用日期起生效。

如果集合计划管理人已经撤销或更改对指令发送人员的授权，并且书面通知集合计划托管人，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，集合计划管理人不承担责任。

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

集合计划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。

集合计划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集合计划托管人，并在法定信息披露公告中披露相关内容。对于佣金计算方式、参数设置有特殊需求的，集合计划管理人需充分与集合计划托管人进行沟通，确保集合计划托管人可实现，如集合计划托管人不能实现，集合计划管理人需预留系统开发时间，在系统不支持的前提下，以集合计划管理人的数据为准。

集合计划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

对于集合计划管理人的资金划拨指令，集合计划托管人在复核无误后应在规定期限内执行，不得延误。集合计划管理人应保证集合计划托管人在执行集合计划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，集合计划托管人有权拒绝集合计划管理人发送的划款指令。集合计划管理人在发送划款指令时应充分考虑集合计划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，集合计划托管人对集合计划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，集合计划托管人有权止付但应及时电话通知集合计划管理人，由此造成的损失由集合计划管理人承担。

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，集合计划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，由集合计划托管人负责办理。

本集合计划场外证券投资的清算交割，由集合计划托管人根据集合计划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，由集合计划托管人根据双方签订的《托管银行证券资金结算协议》约定，由集合计划托管人负责办理。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，集合计划管理人应在 T+0 日 15:00 前书面通知集合计划托管人办理交收，否则集合计划托管人不能保证相关清算交割成功。如因集合计划托管人的自身原因在清算上造成集合计划资产的损失，应由集合计划托管人负责赔偿集合计划的损失；如果因为集合计划管理人投资运作而造成集合计划投资清算困难和风险的，集合计划托管人发现后应立即通知集合计划管理人，由集合计划管理人负责解决，集合计划托管人应给予必要的配合，由此给集合计划造成的损失由集合计划管理人承担。

由于集合计划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，集合计划管理人应事先书面通知集合计划托管人，明确交

易单元、佣金费率等相关信息，在集合计划托管人完成相关设置后方可开展交易。若涉及需集合计划管理人做出选择的港股通公司行为，集合计划托管人根据集合计划管理人提供的数据将集合计划管理人的选择结果提交给中国结算。

（三）集合计划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。

集合计划管理人、集合计划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。

集合计划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集合计划估值计算错误的，应由集合计划管理人负责向数据发送方追偿，集合计划托管人不承担责任。

（四）集合计划管理人与集合计划托管人进行资金、证券账目和交易记录的核对

对集合计划的交易记录，由集合计划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。集合计划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、证券账目传送给集合计划托管人，集合计划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。

集合计划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。

（五）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，清算由集合计划管理人指定的登记机构负责。

2. 集合计划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集合计划托管人。集合计划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。集合计划托管人应及时查收申购资金的到账情况并根据集合计划管理人指令及时划付赎回及转换款项。

3. 集合计划管理人应在 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，由此给集合计划造成损失的，由责任方承担。集合计划管理人负责向责任方追偿集合计划的损失。

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

（六）集合计划收益分配的清算交收安排

1. 集合计划管理人决定收益分配方案并通知集合计划托管人，由集合计划托管人在 2 日内复核并回复审核意见，经集合计划托管人复核后在 2 日内在规定媒介公告。

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

3. 集合计划管理人在下达分红款支付指令时，应给集合计划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集合计划负债后的价值。

1、估值日

本集合计划的估值日为本集合计划相关的证券交易场所的交易日以及国家法律法规规定需要对外披露集合计划净值的非交易日。

2、估值对象

集合计划所拥有的股票、国债期货合约、债券、资产支持证券、银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。

3、估值原则

集合计划管理人在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，应符合《企业会计准则》、监管部门有关规定。

4、估值方法

（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，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，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减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；

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，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) 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、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) 同一证券同时在两个或两个以上市场交易的，按证券所处的市场分别估值。

(5) 估值计算中涉及港币对人民币汇率的，应当以集合计划估值日中国人民银行或其授权机构公布的人民币汇率中间价为准。

(6) 本集合计划投资国债期货合约，一般以期货合约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) 本集合计划投资存托凭证的估值核算依照内地上市交易的股票执行。

(8) 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，集合计划管理人可根据具体情况与集合计划托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

(9) 当发生大额申购或赎回情形时，集合计划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。

(10) 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。

如集合计划管理人或集合计划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。

根据有关法律法规，集合计划资产净值计算和集合计划会计核算的义务由集合计划管理人承担。本集合计划的集合计划会计责任方由集合计划管理人担任，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，按照集合计划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资产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，由集合计划管理人负责赔付。

5、估值程序

(1) 各类集合计划份额净值是按照每个工作日闭市后，该类集合计划资产净值除以当日该类集合计划份额的余额数量计算，精确到 0.0001 元，小数点后第 5 位四舍五入。集合计划管理人可以设立大额赎回情形下的净值精度应急调整机制。国家另有规定的，从其规定。

集合计划管理人应每个工作日计算集合计划资产净值及集合计划份额净值，并按规定公告。

(2) 集合计划管理人应每个工作日对集合计划资产估值。但集合计划管理人根据法律法规或资产管理合同的规定暂停估值时除外。集合计划管理人与托管人通过电子对账的方式完成每个工作日对集合计划资产估值，份额净值结果以电子对账核对结果为准，由集合计划管理人

依据资产管理合同和相关法律法规的规定对外公布。

（二）净值差错处理

集合计划管理人和集合计划托管人将采取必要、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按照以下约定处理：

1、估值错误类型

本集合计划运作过程中，如果由于集合计划管理人或集合计划托管人、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。

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。

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，集合计划管理人应当立即予以纠正，通报集合计划托管人，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；

(2) 错误偏差达到该类集合计划份额净值的0.25%时，集合计划管理人应当通报集合计划托管人并报中国证监会备案；错误偏差达到该类集合计划份额净值的0.5%时，集合计划管理人应当在报中国证监会备案的同时并及时进行公告；

(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

集合计划管理人和集合计划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，应以集合计划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，集合计划管理人和集合计划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集合计划资产净值的计算和公告的，以集合计划管理人的账册为准，由此给计划份额持有人和计划造成的损失以及因该交易日集合计划净值信息计算顺延错误而引起的损失，由集合计划管理人承担。

(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集合计划管理人和集合计划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，集合计划管理人应当在三个工作日内，更新招募说明书并登载在规定网站上；招募说明书其他信息发生变更的，集合计划管理人至少每年更新一次。集合计划终止运作的，集合计划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。

集合计划管理人在月初 3 个工作日内完成上月度报表的编制，以约定方式将有关报表提供集合计划托管人；集合计划托管人收到后在 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集合计划管理人。对于季度报告、中期报告、年度报告、更新招募说明书等报告，集合计划管理人和集合计划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。集合计划托管人在复核过程中，发现双方的报表存在不符时，集合计划管理人和集合计划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。如果集合计划管理人与集合计划托管人不能于应当发布公告之日前就相关报表达成一致，集合计划管理人有权按照其编制的报表对外发布公告，集合计划托管人有权就相关情况报中国证监会备案。

集合计划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，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

（一）集合计划利润的构成

集合计划利润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损益后的余额。

（二）集合计划可供分配利润

集合计划可供分配利润指截至收益分配基准日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、在符合有关集合计划分红条件的前提下，本集合计划每年可根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，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，集合计划份额持有人可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别集合计划份额进行再投资；若集合计划份额持有人不选择，本集合计划默认的收益分配方式是现金分红。

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 类计划份额不收取销售服务费，而 C 类计划份额收取销售服务费，各集合计划份额类别对应的可供分配收益将有所不同。本集合计划同一类别的每一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。

在不影响集合计划份额持有人利益的情况下，集合计划管理人可在法律法规允许的前提下酌情调整以上集合计划收益分配原则，此项调整不需要召开集合计划份额持有人大会，但应于变更实施日前在规定媒介和集合计划管理人网站公告。

（四）收益分配方案

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。

（五）收益分配方案的确定、公告与实施

本集合计划收益分配方案由集合计划管理人拟定，并由集合计划托管人复核，在 2 日内在规定媒介公告。

（六）集合计划收益分配中发生的费用

集合计划收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由集合计划份额持有人自行承担。当集合计划份额持有人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，集合计划登记机构可将集合计划份额持有人的现金红利自动转为相应类别集合计划份额。红利再投资的计算方法，依照《业务规则》执行。

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，集合计划管理人和集合计划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。

如下情况不应视为集合计划管理人或集合计划托管人违反保密义务：

1. 非因集合计划管理人和集合计划托管人的原因导致保密信息被披露、泄露或公开；
2. 集合计划管理人和集合计划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）集合计划管理人和集合计划托管人在集合计划信息披露中的职责和信息披露程序

集合计划管理人和集合计划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。集合计划管理人和集合计划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、集合计划净值信息公告及中国证监会规定的其他必要的公告文件，由集合计划管理人拟定并公布。

集合计划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符合《中华人民共和国证券法》规定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）暂停或延迟集合计划净值信息披露的情形

- 1、集合计划投资所涉及的证券/期货市场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集合计划管理人、集合计划托管人无法准确评估集合计划资产价值时；
- 3、法律法规、中国证监会或《资产管理合同》认定的其他情形。

（四）集合计划托管人报告

集合计划托管人应按《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。集合计划托管人报告说明该半年度/年度集合计划托管人和集合计划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）集合计划管理人的管理费

（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 0.6%的年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.6\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的集合计划管理费

E 为前一日的集合计划资产净值集合计划管理费每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付，由集合计划托管人根据集合计划管理人的指令于次月前 5 个工作日内从集合计划资产中一次性支付。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休

息日结束之日起 2 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 2 个工作日内支付。

（二）集合计划托管人的托管费

本集合计划的托管费按前一日集合计划资产净值的 0.2%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

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，逐日累计至每月月底，按月支付，由集合计划托管人根据集合计划管理人的指令于次月前 5 个工作日内从集合计划资产中一次性支付。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 2 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 2 个工作日内支付。

（三）销售服务费

销售服务费用于支付销售机构佣金、营销费用以及集合计划份额持有人服务等。本集合计划 A 类计划份额不收取销售服务费，C 类计划份额的销售服务费年费率为 0.4%。C 类计划份额的销售服务费按前一日 C 类计划份额的集合计划资产净值的 0.4%年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.4\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类计划份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类计划份额前一日的集合计划资产净值

销售服务费每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付，由集合计划管理人向集合计划托管人发送销售服务费划款指令，集合计划托管人复核后于次月前 5 个工作日内从集合计划资产中一次性支付。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 2 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 2 个工作日内支付。

（四）从集合计划资产中列支集合计划管理人的管理费、集合计划托管人的托管费、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；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。资产管理合同生效前的相关费用，根据原《方正金泉友 2 号集合资产管理计划集合资产管理合同》的约定执行；集合计划托管人对不符合《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。如果集合计划托管人发现集合计划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，有权要求集合计划管理人做出书面解释，如果集合计划托管人认为集合计划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

集合计划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，包括资产管理合同生效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。

集合计划管理人定期和不定期向集合计划托管人提供集合计划份额持有人名册。

集合计划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。集合计划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。若集合计划管理人或集合计划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

集合计划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，集合计划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。

集合计划管理人和集合计划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，保存期限不低于法律法规规定的最低期限。

集合计划管理人签署重大合同文本后，应及时将合同文本正本或原件扫描件以双方约定的方式送达集合计划托管人处。集合计划管理人应及时将与本集合计划账务处理、资金划拨等有关合同、协议以双方约定的方式给集合计划托管人。

集合计划管理人或集合计划托管人变更后，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、集合计划管理人和集合计划托管人的更换

(一) 集合计划管理人的更换

1、提名：新任集合计划管理人由集合计划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集合计划管理人职责终止后 6 个月内对被提名的集合计划管理人形成决议，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；集合计划管理人更换为本集合计划管理人独资或控股设立的子公司，无需召开集合计划份额持有人大会审议；

3、临时集合计划管理人：新任集合计划管理人产生之前，由中国证监会指定临时集合计划管理人；

4、备案：集合计划份额持有人大会更换集合计划管理人的决议须报中国证监会备案；

5、公告：集合计划管理人更换后，由集合计划托管人在更换集合计划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：集合计划管理人职责终止的，集合计划管理人应妥善保管集合计划管理业务资料，及时向临时集合计划管理人或新任集合计划管理人办理集合计划管理业务的移交手续，临时集合计划管理人或新任集合计划管理人应及时接收。临时集合计划管理人或新任集合计划管理人应与集合计划托管人核对集合计划资产总值和净值；

7、审计：集合计划管理人职责终止的，应当按照法律法规规定聘请符合《中华人民共和国证券法》规定的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，审计费用在集合计划财产中列支；

8、集合计划名称变更：集合计划管理人更换后，如果原任或新任集合计划管理人要求，应按其要求替换或删除集合计划名称中与原集合计划管理人有关的名称字样。

（二）集合计划托管人的更换

1、提名：新任集合计划托管人由集合计划管理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集合计划托管人职责终止后 6 个月内对被提名的集合计划托管人形成决议，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、临时集合计划托管人：新任集合计划托管人产生之前，由中国证监会指定临时集合计划托管人；

4、备案：集合计划份额持有人大会更换集合计划托管人的决议须报中国证监会备案；

5、公告：集合计划托管人更换后，由集合计划管理人在更换集合计划托管人的集合计划

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：集合计划托管人职责终止的，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，新任集合计划托管人或者临时集合计划托管人应当及时接收。新任集合计划托管人或者临时集合计划托管人与集合计划管理人核对集合计划资产总值和净值；

7、审计：集合计划托管人职责终止的，应当按照法律法规规定聘请符合《中华人民共和国证券法》规定的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，审计费用在集合计划财产中列支。

（三）集合计划管理人与集合计划托管人同时更换

1、提名：如果集合计划管理人和集合计划托管人同时更换，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集合计划管理人和集合计划托管人；

2、集合计划管理人和集合计划托管人的更换分别按上述程序进行；

3、公告：新任集合计划管理人和新任集合计划托管人应在更换集合计划管理人和集合计划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。

（四）集合计划管理人更换的特殊程序

当集合计划管理人根据相关法律法规的规定，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时，在集合计划管理人和集合计划托管人协商一致的基础上，集合计划管理人有权将合同中集合计划管理人的全部权利和义务转让给前述从事资产管理业务的公司，本集合计划的集合计划管理人变更为前述从事资产管理业务的公司。前述变更事项无需召开集合计划份额持有人大会审议。

十五、禁止行为

本协议项下的集合计划管理人和集合计划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，集合计划管理人、集合计划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）集合计划管理人与集合计划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）集合计划管理人不得在资金头寸不足的情况下，向集合计划托管人发送划款指令。

（六）在资金头寸充足且为集合计划托管人执行指令留出足够时间的情况下，集合计划托管人对集合计划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）除根据集合计划管理人指令或资产管理合同另有规定的，集合计划托管人不得动用或处分集合计划财产。

（八）集合计划管理人与集合计划托管人不得为同一机构，不得相互出资或者持有股份。集合计划托管人、集合计划管理人应在行政上、财务上互相独立，其高级集合计划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）双方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。

此外，管理员工还不得以以下方式谋取不正当利益，包括：1、以诱导客户从事不必要交易、使用客户受托资产进行不必要交易等方式谋取利益；2、违规从事营利性经营活动，违规兼任可能影响其独立性的职务或者从事与所在机构或者投资者合法利益相冲突的活动；3、违规利用职权为近亲属或者其他利益关系人从事营利性经营活动提供便利条件；4、其他谋取不正当利益的情形。

（十一）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. 集合计划托管人解散、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集合计划托管人接管集合计划财产；

3. 集合计划管理人解散、依法被撤销、破产，被依法取消集合计划管理人资格或因其他事由造成其他集合计划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：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，集合计划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集合计划管理人、集合计划托管人、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。

4. 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。

5. 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，清算期限相应顺延。

6. 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。

7. 集合计划财产清算剩余资产的分配

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、交纳所欠税款并清偿集合计划债务后，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。

8. 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。

9. 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集合计划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份额持有人造成损失，而另一方当事人（“守约方”）赔偿了集合计划资产或集合计划份额持有人的损失，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份额持有人损失，管理人和托管人免除赔偿责任。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

双方当事人同意，因本协议而产生的或与本协议有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，仲裁地点为北京市，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力。除非仲裁裁决另有规定，仲裁费用由败诉方承担。

争议处理期间，双方当事人应恪守各自的职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行资产管理合同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。

本协议受中国法律（为本协议之目的，不包括香港、澳门和台湾法律）管辖。

十九、托管协议的效力

（一）托管协议草案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，协议当事人双方根据中国证监会的意见修改托管协议草案。托管协议以报送中国证监会的文本为正式文本。

（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 3 份，除上报监管机构外，集合计划管理人和集合计划托管人分别持有 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

本协议双方加盖公章或合同专用章及双方法定代表人或授权代表签章、签订地、签订日。

（本页无正文，为《方正证券鑫悦一年持有期债券型集合资产管理计划托管协议》签字页）

集合计划管理人：方正证券股份有限公司（盖章）

法定代表人或授权代表（签字或盖章）：

签订地点：北京市

签订日期：2021年7月9日

集合计划托管人：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：上海市

签订日期：2021年7月22日