

华安资管湘赢 36M036 号集合资产管理计划  
资产管理合同

合同编号：【HAZG-SZYH-36M036】

管理人：华安证券资产管理有限公司

托管人：苏州银行股份有限公司

## 目录

第一部分	前言	4
第二部分	释义	5
第三部分	承诺与声明	9
第四部分	当事人及权利义务	11
第五部分	本计划的基本情况	20
第六部分	本计划的募集	23
第七部分	本计划的成立与备案	27
第八部分	本计划的参与、退出与转让	28
第九部分	份额持有人大会及日常机构	38
第十部分	计划份额的登记	38
第十一部分	资产管理计划的投资	40
第十二部分	服务机构和投资顾问	51
第十三部分	分级安排	51
第十四部分	利益冲突及关联交易	51
第十五部分	投资经理的指定与变更	56
第十六部分	资产管理计划的财产	57
第十七部分	划款指令的发送、确认和执行	61
第十八部分	交易及交收清算安排	65
第十九部分	越权交易的界定	67
第二十部分	资产管理计划财产的估值和会计核算	69
第二十一部分	资产管理计划的费用与税收	76
第二十二部分	资产管理计划的收益分配	82
第二十三部分	信息披露与报告	84
第二十四部分	风险揭示	90
第二十五部分	资产管理合同的变更、终止与财产清算	101
第二十六部分	违约责任	107
第二十七部分	争议的处理	108
第二十八部分	资产管理合同的效力	109
第二十九部分	其他事项	110
附件一	《划款指令授权通知书》(样本)	113
附件二	资产管理业务划款指令	114
附件三	各方业务人员联系核实信息表	115

附件四：交易监控合规表 ..... 117

## 第一部分 前言

### 一、订立本资产管理合同的依据、目的和原则

(一) 订立本资产管理合同(以下简称“本合同”)的依据是《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》)《中华人民共和国证券法》(以下简称《证券法》)《中华人民共和国期货和衍生品法》《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》(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》)《集合资产管理计划资产管理合同内容与格式指引》《商业银行资产托管业务指引》及其他有关法律法规的规定。

若因法律法规的制定或修改导致本合同的内容与届时有效的法律法规存在冲突,应当以届时有效的法律法规的规定为准,各方当事人应及时对本合同进行相应变更和调整。

(二) 订立本合同的目的是在严格遵守国家有关法律法规的前提下,保护本合同各当事人合法权益,明确本合同各当事人之间权利和义务,保证本集合资产管理业务合法、合规及有效地进行。

(三) 订立本合同的原则是平等自愿、公平和诚实信用,充分保护本合同各当事人的合法权益,不得损害国家利益、社会公共利益和他人合法权益。

二、管理人应当按照规定向中国证券投资基金业协会(以下简称“协会”或“基金业协会”)办理资产管理计划的设立、变更备案,并及时报送资产管理计划的运行情况、风险情况以及终止清算报告等信息。

三、协会办理资产管理计划备案不代表协会对资产管理计划的合规性、投资价值及投资风险作出保证和判断,也不表明协会对备案材料的真实性、准确性、完整性作出保证。投资者应当充分了解资产管理计划的投资范围、投资策略和 risk 收益等信息,根据自身风险承担能力审慎选择资产管理计划,自主判断投资价

值，自行承担投资风险。

四、本合同是约定各当事人之间权利义务关系的基本法律文件，其他与本计划相关的涉及本合同各当事人之间权利义务关系的任何文件或表述，如与本合同不一致或有冲突，均以本合同为准。

五、当本合同以电子签名方式签订时，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（华安资管湘赢 36M036 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、管理人和托管人同意遵守《中华人民共和国民法典》《中华人民共和国电子签名法》《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以电子签名方式接受电子签名合同（即本合同、计划说明书、风险揭示书和其他文书）的，视为签署本合同、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盖章具有同等的法律效力，无须另行签署纸质合同、纸质风险揭示书或其他文书。以电子签名方式签署本合同的，投资者应当采取有效措施妥善保管与电子签名合同相关的信息和资料，防止他人以投资者名义实施电子签名行为。

## 第二部分 释义

在本合同中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

资产管理计划、计划、本计划、本集合计划、集合计划：指华安资管湘赢 36M036 号集合资产管理计划。

资产管理合同、本合同：指投资者、管理人及托管人三方签署的《华安资管湘赢 36M036 号集合资产管理计划资产管理合同》及其附件，以及对该合同及附件做出的任何有效变更及补充。

计划说明书：指《华安资管湘赢 36M036 号集合资产管理计划说明书》及其附件，以及对该计划说明书及附件做出的任何有效变更及补充。

风险揭示书：指《华安资管湘赢 36M036 号集合资产管理计划风险揭示书》及对该风险揭示书做出的任何有效修订和补充。

法律法规：指中国现时有效并公布实施的法律、行政法规、行政规章及规范性文件、地方法规、地方规章及规范性文件。

《民法典》：指《中华人民共和国民法典》。

《基金法》：指《中华人民共和国证券投资基金法》。

《证券法》：指《中华人民共和国证券法》。

《指导意见》：指中国人民银行、中国银行保险监督管理委员会、中国证券监督管理委员会、国家外汇管理局于 2018 年 4 月 27 日联合印发的《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》（银发〔2018〕106 号）。

《管理办法》：指中国证监会于 2018 年 10 月 22 日公布，2023 年 1 月 12 日修订的《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》（证监会令〔第 203 号〕）。

《运作规定》：指中国证监会于 2018 年 10 月 22 日公布，2023 年 1 月 12 日修订的《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》（证监会公告〔2023〕2 号）。

中国证监会：指中国证券监督管理委员会。

基金业协会、协会：指中国证券投资基金业协会。

投资者：指签订本合同且根据本合同及相关文件合法取得本计划份额的、符合《指导意见》和《运作规定》规定条件的合格投资者。

资产管理人、计划管理人、管理人：指华安证券资产管理有限公司。

资产托管人、托管人：指苏州银行股份有限公司。

注册登记机构、份额登记机构：指办理登记、存管、过户、清算和结算等注册登记业务的机构。本计划的注册登记机构为华安证券资产管理有限公司。

推广机构、募集机构、销售机构：指管理人和符合中国证监会规定的条件，具有公开募集证券投资基金（以下简称公募基金）销售资格并接受管理人委托，代为办理本计划销售或推介等业务的机构，具体以管理人公告为准。

募集期、初始募集期：指本计划启动发售之日起至初始募集结束日的期间，自发售之日起不超过 60 个自然日。

封闭期：特指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。

存续期：指本计划成立至终止之间的期限。

开放期：指在本计划存续期内，销售机构办理本计划参与、退出等业务的期间。

开放日：指开放期中的单个交易日。

计划成立日、成立日：指资产管理计划募集期结束，经资产管理人公告本计划成立之日。

工作日、交易日、估值日：均指上海证券交易所、深圳证券交易所、中国金融期货交易所等交易所的正常交易日。

认购：指在本计划募集期内，投资者参与本计划的行为。

参与、申购：指在本计划参与开放期内，投资者按照指定销售机构规定的手续，参与本计划的行为。

退出、赎回：指在本计划退出开放期内，投资者按照指定销售机构规定的手续，申请部分或全部退出本计划的行为。

元：指人民币元。

计划资产总值：指本计划财产拥有的各类有价证券、银行存款本息、证券投资基金份额及其他资产的价值总和。

计划资产净值：指计划资产总值减去计划负债后的价值。

计划财产估值：指计算评估资产管理计划资产和负债的价值，以确定计划资产净值和计划份额净值的过程。

计划份额净值、份额净值、单位净值：指计算日计划资产净值除以当日资产管理计划份额总数后得出的资产管理计划每份额资产净值。

计划份额累计净值、份额累计净值、单位累计净值：指计划份额净值与资产管理计划历来份额收益分配金额（分红收益金额）之和。

二次清算：指本计划终止时，集合计划因持有流通受限证券及其他投资品种等原因导致本计划财产无法及时变现的，当该等资产达到可变现状态时，管理人将其变现，并进行清算分配的过程。

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 10 个交易日以上的逆回购与银行定期存款（含协议约定有条件提前支取的银行存款）、资产支持证券（票据）、流动受限的新股以及非公开发行股票、停牌股票、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券和非金融企业债务融资工具等资产。

7 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，7 个工作日内到期或者可支取的逆回购、银行存款，7 个工作日内能够确认收到的各类应收款项等。

每年：指会计年度。

不可抗力：指任何不能预见、不能避免、不能克服的客观情况，且在本合同

由资产管理人、资产托管人签署之日后发生的，使本合同当事人无法全部或部分履行本合同的事件和因素。包括但不限于有关法律法规及重大政策调整；台风、洪水、地震及其他自然灾害；战争、骚乱、火灾、政府征用、戒严、没收、恐怖主义行为、电力故障、互联网故障、瘟疫、流行病等突发公共卫生事件或其他突发事件；证券交易场所非正常暂停或停止交易等事件。

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

### 第三部分 承诺与声明

#### 一、管理人承诺与声明

(一)在签订本合同前已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，充分揭示了相关风险；

(二)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。

(三)按照《基金法》恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用受托资产，不保证受托资产一定盈利，也不保证最低收益或者本金不受损失，以及限定投资损失金额或者比例。管理人按照法律法规要求，诚信、审慎、合规尽职管理资产管理计划。

资产管理人对本资产管理计划的合规性负责，由于资产管理计划本身的合规性问题给投资者、资产托管人造成损失的，资产管理人应承担相应的赔偿责任。作为本资产管理计划的资产管理人，将勤勉尽责履行资产管理人义务，按照合同约定管理资产管理计划的投资运作，遵循投资者利益优先原则，防范利益冲突，有效识别结构化发债，不得直接或者间接参与结构化发债，不得扰乱市场秩序、侵害投资者利益；确保本计划不存在结构化问题（包括发行和交易环节）、非法代持、利益输送等情况。资产管理人承诺其提供的电子签约平台满足《中华人民

共和国电子签名法》要求，获得中国金融认证中心（CFCA）权威证书，能够避免恶意篡改、伪造电子签章、确保签名数据安全有效。

对于本计划的业绩报酬计提基准及比例调整、合同变更、信息披露与报告等有关管理人向投资者披露的事项，管理人一般仅通过管理人网站发布，投资者应及时关注该网站内容。

## 二、托管人承诺与声明

（一）按照《基金法》恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则安全保管受托财产，履行信义义务以及资产管理合同约定的其他义务。

（二）根据法律、行政法规、中国证监会及协会的规定和资产管理合同的约定，对管理人的投资或者清算指令等进行监督。

（三）在管理人发生异常且无法履行职能时，依照法律、行政法规以及合同约定履行相关托管人职责，维护投资者权益。

## 三、投资者承诺与声明

（一）符合《运作规定》合格投资者的要求，承诺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，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。前述信息资料如发生任何实质性变更，及时书面告知管理人或销售机构。

（二）财产的来源及用途符合国家有关规定，未使用贷款、发行债券等筹集的非自有资金投资资产管理计划，且投资事项符合法律法规的规定及业务决策程序的要求。

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

(四) 知悉《中华人民共和国反洗钱法》《金融机构反洗钱规定》《金融机构反洗钱和反恐怖融资监督管理办法》《金融机构客户尽职调查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》《金融机构洗钱和恐怖融资风险评估及客户分类管理指引》及相关的法律法规、监管规定，将严格遵守上述规定，不违反任何前述规定，投资者承诺用于投资的资金来源不属于违法犯罪所得及其收益。投资者承诺且知悉管理人、销售机构向监管机构报送反洗钱相关信息不视为违反保密约定。

#### 第四部分 当事人及权利义务

##### 一、合同当事人

##### (一) 投资者

姓名/名称:

证件类型:

证件号码:

住所:

联系人:

通讯地址:

联系电话:

投资者的详细情况（包括但不限于姓名/名称、证件、住所、联系人、通讯地址、联系电话等信息）在电子签名合同数据电文中列示。

##### (二) 管理人

姓名/名称: 华安证券资产管理有限公司

住所：安徽省合肥市高新区创新大道 2800 号创新产业园二期 E1 栋基金大厦  
A 座 506 号

联系人：王凝墨

通讯地址：安徽省合肥市政务区天鹅湖路 198 号

联系电话：0551-65980148

### （三）托管人

姓名/名称：苏州银行股份有限公司

住所：中国（江苏）自由贸易试验区苏州片区苏州工业园区钟园路 728 号

联系人：朱洁

通讯地址：中国（江苏）自由贸易试验区苏州片区苏州工业园区钟园路 728  
号

联系电话：0512-69860270

二、本计划设定为均等份额，除本合同另有约定外，每份份额享有同等权益，  
承担同等风险。

三、投资者的权利包括但不限于：

（一）分享本计划财产收益；

（二）按持有份额取得分配清算后的剩余计划财产；

（三）按照本合同的约定参与、退出和转让本计划份额；

（四）按照本合同约定的时间和方式获得本计划的信息披露资料；

（五）监督管理人、托管人履行投资管理及托管义务的情况；

（六）法律、行政法规、中国证监会及协会规定和资产管理合同约定的其他  
权利。

#### 四、投资者的义务包括但不限于：

（一）认真阅读并遵守资产管理合同，保证参与资金的来源符合法律、行政法规的规定；

（二）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；

（三）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本计划的，应向管理人充分披露实际投资者和最终资金来源；

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

（五）认真阅读并签署风险揭示书；

（六）在持有的本计划份额范围内，承担本计划亏损或者终止的有限责任；

（七）按照资产管理合同约定支付本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；

（八）不得违反本合同的约定干涉管理人的投资行为；

（九）不得从事任何有损本计划及其投资者、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；

（十）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；

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

（十二）本集合计划如采用电子签名合同，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。投资者应当以自己的名义开立资金账户，办理指定手续，用于办理投资划款、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；

（十三）除非在本合同规定的退出开放期或终止日，不得要求提前终止受托资产管理关系；

（十四）在本计划存续期间及时关注管理人或销售机构的短信、电话、邮件及其公司网站公告；

（十五）法律、行政法规、中国证监会及协会规定和资产管理合同约定的其他义务。

五、管理人的权利包括但不限于：

（一）按照本合同约定，独立管理和运用本计划财产；

（二）按照本合同约定，及时、足额获得管理人管理费用及业绩报酬（如有）；

（三）按照有关规定和本合同约定行使因本计划财产投资所产生的权利；

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

（五）以管理人的名义，代表本计划行使投资过程中产生的权属登记等权利；

（六）按照规定要求投资者提供与其身份、财产与收入状况、投资经验、风险认知与承受能力和投资偏好等相关的信息和资料，要求投资者积极配合完成（包括本合同签订前和履行过程中的）反洗钱调查等必要程序，并在上述信息和资料发生变更时，及时提交变更后的相关信息与资料；

（七）本计划资产受到损害时，向有关责任人追究法律责任，发生差错时，向当事主体追偿不当得利；

(八)在不损害投资者实际利益的前提下,管理人有权根据管理运作实际情况对集合计划管理运作过程中的相关事项进行调整或补充明确,并及时予以公告,但应符合法律、行政法规、中国证监会及协会相关规定;

(九)如果投资者违反适当性、资金来源或其他投资者承诺与声明的,管理人有权强制退出其持有的份额。

(十)投资者同意,出于监管要求、内部管理等需要,管理人可能会将本合同及本计划相关数据及信息报送给管理人控股股东及实际控制人;管理人确保其承担与管理人相同的保密义务。

(十一)法律、行政法规、中国证监会及协会规定和资产管理合同约定的其他权利。

#### 六、管理人的义务包括但不限于:

(一)依法办理本计划的销售、登记、备案事宜;

(二)按照协会要求报送本计划运行信息;

(三)对投资者的风险识别能力和风险承受能力进行评估,向合格投资者非公开募集资金;

(四)制作风险揭示书,向投资者充分揭示相关风险;

(五)按照诚实信用、勤勉尽责的原则履行受托人义务,管理和运用本计划财产;

(六)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本计划财产;

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

(八) 按照资产管理合同约定接受投资者和托管人的监督；

(九) 确定本计划份额参与、退出价格，采取适当、合理的措施确保份额交易价格的计算方法符合相关要求以及合同的约定；

(十) 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；

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

(十二) 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；

(十三) 聘请符合《证券法》规定的会计师事务所对年度财务会计报告进行审计；

(十四) 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；

(十五) 编制向投资者披露的资产管理计划季度、年度等定期报告；

(十六) 办理与受托财产管理业务活动有关的信息披露事项；

(十七) 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；

(十八) 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；

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

(二十) 公平对待所管理的不同财产，不得从事任何有损资产管理计划财产

以及其他当事人利益的活动；不得向管理人以及任何第三人输送利益；不得委托第三人运作资产管理计划财产；

（二十一）不得利用资产管理计划，通过直接投资、投资其他资产管理产品或者与他人进行交叉融资安排等方式，违规为本机构及其控股股东、实际控制人或者其他关联方提供融资；

（二十二）建立并保存投资者名单；

（二十三）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；

（二十四）保守商业秘密，不得泄露资产管理计划的投资计划、投资意向、投资信息等，依法依规提供信息的除外；

（二十五）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、协会并通知托管人和投资者；

（二十六）按中国反洗钱与制裁合规法律法规相关要求履行各项反洗钱和反恐怖融资义务。在建立业务关系时，自行或委托代销机构采取符合要求的客户尽职调查措施，尽职调查内容包括但不限于获得投资者身份、财产与收入状况、投资经验、风险认知与承受能力和投资偏好等相关的信息和资料，识别并采取合理措施核实资产管理计划受益所有人。在业务关系存续期间，持续关注并评估资产管理计划整体状况和交易情况，了解洗钱风险状况，发现交易与其身份、风险状况等不符的，应当进一步核实相关情况；对存在洗钱高风险情形的，必要时可以采取必要的洗钱风险管理措施；在法律允许范围内，配合资产托管人开展尽职调查，提供相关客户身份信息和资料；妥善保管、更新客户及投资者身份资料及交易记录；根据反洗钱法律法规，要求投资者积极配合完成反洗钱调查等必要程序；与资产托管人在法律法规允许范围内积极开展反洗钱领域的信息支持与合作；落实反洗钱法律法规要求的其他反洗钱和反恐怖融资工作；

(二十七)自行或委托代销机构采取适当措施,确保资产管理计划的投资者、法定代表人、受益所有人不得为我国有关机关发布的反洗钱特别预防措施名单所列对象,不得为联合国和国际组织发布且得到我国承认的反洗钱、反恐怖融资、涉及定向金融制裁的名单所列对象,或中国人民银行及其他监管机构要求执行的反洗钱和反恐怖融资名单;

(二十八)资产管理计划的投资行为、资金交易不得违反我国以及得到我国承认的联合国和国际组织有关经济制裁或反洗钱法律法规,或用于其他洗钱、恐怖融资、逃税、欺诈等违法违规用途;

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

(三十)除必要的信息披露及监管要求外,管理人不得以托管人的名义进行营销宣传;

(三十一)保证向投资者支付的受托资金及收益返回其参与本计划时使用的结算账户或其同名账户;

(三十二)法律、行政法规、中国证监会及协会规定和本合同约定的其他义务。

七、托管人的权利包括但不限于:

- (一)按照本合同约定,依法保管本计划财产;
- (二)按照本合同约定,及时、足额获得本计划托管费用;
- (三)法律、行政法规、中国证监会及协会规定和本合同约定的其他权利。

八、托管人的义务包括但不限于:

- (一)安全保管本计划财产;

- (二) 按规定开立和注销本计划的托管账户及其他投资所需账户；
- (三) 对所托管的不同财产分别设置账户，确保本计划财产的完整与独立；
- (四) 按照资产管理合同约定，根据管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；
- (五) 复核本计划资产净值和份额净值；
- (六) 向管理人披露托管人及其控股股东、实际控制人或者其他关联方，以及前述机构发行的证券或者承销期内承销的证券等信息，具体以公开披露信息及证券市场信息为准；
- (七) 投资于《管理办法》第三十八条第（五）项规定资产时，准确、合理界定安全保管资产管理计划财产，监督管理人投资运作等职责；
- (八) 监督管理人的投资运作，发现管理人的投资或者清算指令违反法律、行政法规、中国证监会的规定或者资产管理合同约定的，应当拒绝执行，立即通知管理人并及时报告中国证监会相关派出机构；
- (九) 办理与资产管理计划托管业务有关的信息披露事项；
- (十) 对资产管理计划财务会计报告、年度报告出具意见；
- (十一) 编制托管年度报告，报送中国证监会相关派出机构；
- (十二) 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以及其他当事人利益的活动；
- (十三) 不得为托管人以及任何第三人输送利益，不得委托第三人托管资产管理计划财产；
- (十四) 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；
- (十五) 保守商业秘密，不得泄露资产管理计划的投资计划、投资意向、投

资信息等，依法依规提供信息的除外；

（十六）法律、行政法规、中国证监会及协会规定和资产管理合同约定的其他义务。

## 第五部分 本计划的基本情况

### 一、本计划的名称

华安资管湘赢 36M036 号集合资产管理计划

### 二、本计划的类别和特殊类别（如有）

固定收益类集合资产管理计划

### 三、本计划的运作方式

开放式运作

### 四、本计划的投资目标、主要投资方向、投资比例、产品风险等级

#### （一）投资目标

在严格控制风险的基础上，主要投资于债券等固定收益类资产，把握市场投资机会，追求本集合计划的稳健收益，同时辅之以少量权益资产配置，提升组合收益水平。

#### （二）投资范围

1.投资范围：（1）银行存款、国内依法发行的国债、中央银行票据、地方政府债、各类金融债（含次级债、混合资本债等）、企业债券、公司债券（含非公开发行公司债）、可转债、可交换债、永续债、同业存单、超短期融资券、短期融资券、中期票据、非公开定向债务融资工具、资产支持证券（票据）、货币市场基金、债券型公募基金及中国证监会允许本集合计划投资的其他固定收益类品种；（2）本计划可参与 A 股定向增发股票，可参与可转债与可交换债转股；

(3) 本集合计划可参与债券回购（包含正回购和逆回购）。

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，可以将其纳入本集合计划的投资范围。法律法规或中国证监会变更集合计划原有投资品种投资比例限制的，资产管理人在履行合同变更程序后，可以相应调整本集合计划的投资比例上限规定。

### （三）投资比例

本集合计划投资固定收益类资产比例为资产总值的 80-100%。

### （四）产品风险等级

本计划以固定收益类资产投资为主，根据《证券期货投资者适当性管理办法》及相关规定，经由管理人审慎评估，整体风险处于中低水平，风险评级为 R2 级，可面向 C2、C3、C4 和 C5 类投资者进行推广。投资者承诺并确认自身风险承受能力符合本计划的要求，自愿承担参与本计划投资所产生的全部风险。

以上风险等级由管理人确定，管理人选择的销售机构的风险评级可能与此不同，产品最终风险等级以各销售机构的评定结果为准。因法律法规或中国证监会、基金业协会的相关规定、管理人内部控制调整导致调高或降低本计划风险等级的，管理人可以调整产品风险等级，并及时以公司网站公告等方式告知投资者。

## 五、本计划的存续期限

本计划存续期限为【10】年，到期后可展期。

六、本计划的最低初始募集规模为【1000】万元人民币，本计划份额的初始募集面值为 1 元。

## 七、本计划的各项费用

1、认购/申购费率：0%

2、托管费率：0.01%/年

3、管理费率：0.8%/年

4、退出费率：0%

5、业绩报酬：

本计划对客户持有期内每笔参与份额对应的年化收益率超过业绩报酬计提基准的部分提取业绩报酬，业绩报酬从分红资金、退出资金或清算资金中提取，从分红资金中提取业绩报酬的频率不得超过每6个月一次。

本计划于初始募集期或开放期前公告下一个封闭期的业绩报酬计提基准等要素。若调高业绩报酬计提基准，管理人公告即生效；若调低业绩报酬计提基准，不同意业绩报酬计提基准的投资者可在开放期退出。

6、其他费用：

包括计划财产划拨支付的银行费用、计划财产的投资交易费用、本计划存续期内以及终止清算过程中与本计划有关的信息披露费用、会计师费(包含审计费)、律师费、诉讼费(如有)和违约处置费用(如有)以及按照法律法规及本合同约定可以在本计划财产中列支的其他费用。

八、本计划的分级安排

本计划不分级。

九、服务机构信息

管理人未委托外部服务机构为本计划提供相关服务。

十、本集合计划于初始募集期或开放期前公告后续运作期间的业绩报酬计提基准等要素，调整后计提基准等要素以管理人公告为准。

管理人通过深入分析国内外宏观经济走势、社会资金运动及各项宏观经济政策对金融市场特别是货币市场的影响，密切关注市场资金面松紧变化，把握市场利率走势，合理确定本计划未来业绩报酬计提基准的范围。管理人确定业绩报酬

计提基准主要基于本计划投资标的的收益情况估算,但并不是管理人向投资者保证其资产本金不受损失或者保证取得最低收益的承诺,投资风险由投资者自行承担。

本计划的业绩报酬计提基准仅为管理人提取业绩报酬的标准,并不是管理人向客户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。

十一、本集合计划无预警线、止损线

十二、其他需要订明的内容

无。

## 第六部分 本计划的募集

### 一、本计划的募集对象

本计划向合格投资者非公开募集,计划份额持有人不得超过 200 人。

合格投资者是指具备相应风险识别能力和风险承担能力,投资于本计划的金额不低于本合同约定的最低参与金额(不含参与费用)且符合下列条件的自然人、法人或者其他组织:

(一)具有 2 年以上投资经历,且满足以下条件之一的自然人:家庭金融资产不低于 300 万元,家庭金融资产不低于 500 万元,或者近 3 年本人年均收入不低于 40 万元;

(二)最近 1 年末净资产不低于 1000 万元的法人单位;

(三)依法设立并接受国务院金融监督管理机构监管的机构,包括证券公司及其子公司、基金管理公司及其子公司、期货公司及其子公司、在中国证券投资基金业协会登记的私募基金管理人、商业银行、商业银行理财子公司、金融资产投资公司、信托公司、保险公司、保险资产管理机构、财务公司及中国证监会认

定的其他机构；

（四）接受国务院金融监督管理机构监管的机构发行的资产管理产品；

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

（六）中国证监会视为合格投资者的其他情形。

合格投资者承诺使用真实身份参与本计划，财产的来源及用途符合国家有关规定，不得使用贷款、发行债券等筹集的非自有资金投资资产管理计划。法律法规、监管机构、自律组织对于合格投资者认定将来另有规定的，从其规定。

## 二、本计划的募集方式

本计划通过管理人及其指定的销售机构以非公开形式向特定客户进行销售，具体以推广机构确定的销售方式为准。投资者认购本计划，必须与管理人和托管人签订资产管理合同，按销售机构规定的方式足额缴纳认购款项。投资者认购的具体金额和本计划份额以注册登记机构的确认结果为准。

推广机构应将本计划资产管理合同、计划说明书等正式推广文件，置备于推广机构。本计划应当面向合格投资者推广，客户风险承受能力应与本计划相匹配，推广机构应当了解客户的投资需求和风险偏好，详细介绍产品特点并充分揭示风险，引导客户审慎做出投资决定。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、夸大收益和商业贿赂等不正当手段推广本计划。

管理人及推广机构应当采取有效措施，通过管理人、中国证券业协会、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，客观准确披露本计划备案信息、风险收益特征、投诉电话等，使投资者详尽了解本计划的特性、风险等情况及投资者的权利、义务，但不得向合格投资者之外的单位和个人募集资金，不得公开或变相公开募集资产管理计划，不得通过报刊、电台、电视、互联网等传播媒体或者讲座、报告会、传单、布告、自媒体等方式向不特定

对象推广本计划。

### 三、本计划的募集期限

本计划的募集期限由管理人根据相关法律法规以及本合同的规定确定,初始募集期自资产管理计划份额发售之日起不超过60个自然日。管理人有权根据本计划销售的实际情况按照相关程序延长或缩短初始募集期,此类变更适用于所有募集机构。延长或缩短募集期的相关信息将及时发布通知,即视为履行完毕延长或缩短募集期的程序。

### 四、募集账户信息

本计划销售募集账户由管理人和管理人委托的销售机构自行开立,销售募集账户的开户行、账户名称、账户号码等信息以管理人或销售机构届时公告为准。管理人和管理人委托的销售机构在其网站上发布公告即视为履行了向投资者告知的义务。

### 五、本计划认购费用

本计划的认购费率为【0】。

认购费用的计算方式:

认购费用=认购金额×认购费率

### 六、本计划认购申请的确认

(一)认购程序。投资者办理认购业务时应提交的文件和办理手续、办理时间、处理规则等在遵守本合同约定的前提下,以销售机构的具体规定为准。

(二)认购申请的确认。认购申请受理完成后,投资者不得撤销。销售网点受理认购申请并不表示对该申请是否成功的确认,而仅代表销售网点确实收到了认购申请,申请是否有效应以注册登记机构的确认并且本计划成立为准。管理人有权仅接受管理人指定投资者的认购申请。投资者应在本计划成立后到各销售网

点查询最终确认情况和有效认购份额。

(三)投资者签订本合同、其认购的本计划份额经注册登记机构确认后正式成为本计划投资者。

(四)注册登记机构可按照“时间优先,金额优先”的原则在募集期届满后对认购金额申请予以确认。在采用本原则进行确认时,认购时间在前者被优先确认,认购时间相同时认购金额高的投资者优先被确认。

当计划达到目标规模后,管理人有权暂停接受投资者的认购申请。如果当日认购申请的份额和名额加上已有的认购份额和名额已经超过目标规模或 200 人,则次日对认购申请的份额按照“时间优先,金额优先”原则进行确认,以保证集合计划份额或名额不超过目标规模或 200 人。对未被确认的投资人,管理人应在募集期届满后 30 日内向投资者的资金结算账户中返还该等投资者已缴纳的认购金额,并加计银行同期活期存款利息,利息金额以本计划注册登记机构的记录为准,投资者已缴纳款项未划转至达本计划销售募集账户的除外。

#### 七、认购份额的计算方式

认购份额的计算方法如下:

净认购金额=认购金额-认购费用

认购份额=(净认购金额+认购期间的利息)/资产管理计划份额初始募集面值,本计划份额的初始募集面值为 1 元。

认购份额的计算保留到小数点后 2 位,小数点后 2 位以后的部分舍去,舍去部分归入资产管理计划资产。

#### 八、初始认购资金的管理及利息处理方式

管理人应将本计划募集期间客户的资金存放于下列计划募集结算专用账户,在本计划初始募集行为结束前,任何个人和机构不得动用。募集结算专用账户通过管理人网站(<http://www.hazq.com>)披露和查询。

## 九、本计划的最低认购金额和支付方式

认购资金应以货币资金形式交付。投资者初始单笔认购金额不低于本合同约定的最低参与金额（不含认购费用）并可追加认购，单笔最低追加金额为 1000 元（不含认购费用）。管理人可以对每个账户的认购和持有计划份额进行限制，具体限制请参见计划说明书或相关公告。

十、认购资金在募集期间发生的利息收入按银行同期活期存款利率计算，利息金额以本计划注册登记机构的记录为准。投资者的认购参与款项（不含认购费用）加计其在初始募集期形成的利息将折算为资产管理计划份额归投资者所有，其中利息转份额的具体数额以注册登记机构的记录为准。利息的计算保留到小数点后 2 位，小数点后 2 位以后的部分舍去，舍去部分归入本计划财产。

## 第七部分 本计划的成立与备案

### 一、本计划成立的条件

- （一）本计划初始募集规模不低于 1000 万元；
- （二）投资者人数不少于 2 人，且不超过 200 人；
- （三）募集过程符合法律、行政法规和中国证监会的规定。

二、本计划在募集金额缴足之日起 10 个工作日内，由管理人公告本计划成立。本计划成立前，任何机构和个人不得动用投资者参与资金。

### 三、本计划募集失败的处理方式

募集期届满，本计划未达到本合同约定的成立条件的，本计划募集失败，则管理人应当承担下列责任：

- （一）以固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用；
- （二）在募集期届满后 30 日内退还投资者已缴纳的款项，并加计银行同期

活期存款利息，利息金额以本计划注册登记机构的记录为准，投资者已缴纳款项未划转至达本计划销售募集账户的除外。托管人仅依据管理人的划款指令办理有关集合计划设立失败后资金的退还有关事宜，因上述事宜产生的任何纠纷由管理人与投资者协商解决，托管人需提供必要的协助配合。

由于监管政策及指导意见的不时更新与变动，本计划可能存在无法成立或无法进行备案的风险，全体投资者确认，管理人及托管人对此不承担任何责任。

四、管理人应在本计划成立之日起5个工作日内报协会备案。本计划在成立后备案完成前，可以以现金管理为目的，投资于银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券、货币市场基金等中国证监会认可的投资品种。

五、资产管理计划无法完成备案的，应当及时告知投资者，并按照合同约定履行终止清算程序。

## 第八部分 本计划的参与、退出与转让

一、本计划运作期间的开放期内，投资者可办理参与和退出业务。

二、参与和退出场所

本计划运作期间的募集机构包括本计划管理人和计划管理人委托的销售机构。

投资者应当在募集机构办理计划销售业务的营业场所或按募集机构提供的其他方式办理计划份额的申购和赎回。管理人可根据情况变更或增减计划销售机构，并予以公告。

三、参与和退出的开放日和时间

本计划自成立之日起36个月为封闭期，首个开放期为2029年3月28日，之后每满36个月当月的28日为后续开放期，遇节假日及非交易日顺延。如有

变动，管理人在不影响开放期时间、次数和频率的前提下可视情况调整，以管理人公告为准。投资者可根据管理人届时的公告在开放期进行参与或退出。开放期开放时间后的申请均确认失败。

若中国证监会会有新的规定，或出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更或发生其他特殊情况，管理人将视情况对前述开放期及开放时间进行相应的调整并公告。

管理人在其网站上发布公告即视为履行了向投资者告知的义务。

当发生合同变更、合同展期、监管规则修订等需要临时开放的情况时，管理人可公告临时开放期，投资者可在临时开放期退出本计划，临时开放期具体安排以管理人公告为准。

#### 四、参与和退出的方式、价格、程序及确认

（一）“未知价”原则，即本计划的参与和退出价格以参与和退出申请提交日所在交易日收市后计算的计划份额净值为基准进行计算。

（二）本计划采用金额参与和份额退出的方式，即参与以金额申请，退出以份额申请。

（三）投资者办理参与、退出等业务时应提交的文件和办理手续、办理时间、处理规则等在遵守本合同约定的前提下，以销售机构的具体规定为准。

（四）当日的参与和退出申请可以在当日开放时间结束前撤销，在当日的开放时间结束后不得撤销。

（五）参与和退出申请的确认。销售机构受理参与和退出申请并不表示对该申请是否成功的确认，而仅代表销售机构确实收到了参与或退出申请。参与申请采取时间优先、金额优先原则进行确认，退出申请按时间优先、先进先出的方式处理，即管理人按时间优先的原则，对投资者账户中的计划份额进行处理，即先确认的份额先退出，后确认的份额后退出，分别计算、提取退出份额对应的业绩

报酬（如有）。管理人有权仅接受管理人指定投资者的参与申请。投资者参与和退出的申请是否有效应以注册登记机构的确认为准。注册登记机构应在法律法规规定的时限内对投资者参与、退出申请的有效性进行确认，注册登记机构确认参与申请有效的日期为申购确认日，注册登记机构确认退出申请有效的日期为退出确认日。投资者可在当个开放期结束后至各销售机构查询最终确认情况。

（六）参与和退出申请的款项支付。参与采用全额交款方式，若资金在规定时间内未全额到账则参与不成功，为无效申请，已交付的参与款项将退回投资者指定资金账户。投资者退出申请确认后，管理人应按规定向投资者支付退出款项，退出款项自退出确认日起7个工作日内支付退出款项。在发生巨额退出时，退出款项的支付办法按本合同和有关法律法规规定处理。

（七）管理人在不损害投资者权益的情况下，经与销售机构协商一致，可更改上述原则，但最迟应在新的原则实施前3个工作日告知投资者。管理人提前3个工作日在其网站发布公告即视为履行了向投资者告知的义务。

#### 五、参与和退出的金额限制

投资者在本计划存续期开放日参与本计划份额的，投资者应符合合格投资者标准，且参与金额应不低于【30】万元人民币（不含参与费用，“最低参与金额”），已持有本计划份额的投资者在本计划存续期开放日追加参与资产管理计划份额的除外。现有投资者在本计划存续期参与开放期追加本计划份额的，单笔追加金额应不低于1000元人民币（不含参与费用）。

当投资者在某一销售机构持有的计划份额所对应的资产净值高于【30】万元人民币时，投资者可以选择全部或部分退出本计划份额，每次退出的最低份额为1000份；选择部分退出本计划份额的，投资者在退出后持有的计划份额所对应的资产净值不得低于【30】万元。当管理人发现投资者申请部分退出本计划将致使其在部分退出申请确认后在该销售机构持有的计划份额所对应的资产净值低于【30】万元人民币的，管理人有权适当减少或增加该投资者的退出金额，以保

证部分退出申请确认后投资者持有的计划份额所对应的资产净值不低于【30】万元或全部退出。当投资者在某一销售机构持有的计划份额所对应的资产净值低于【30】万元人民币（含【30】万元人民币）时，需要退出本计划的，投资者必须选择一次性全部退出本计划。

管理人有权根据市场情况和本计划的总规模，合理调整对参与金额和退出份额的数量限制并告知投资者。管理人在其网站发布公告即视为履行了向投资者告知的义务。

#### 六、参与和退出的费用

本计划参与费率为【0】，退出费率为【0】。

参与费用=参与金额×参与费率

退出费用=退出份额×退出申请所在交易日的资产管理计划份额净值×费率

#### 七、参与份额和退出金额的计算方式

##### （一）本计划参与份额的计算方式

本计划参与份额的计算方式如下：

净参与金额=参与金额-参与费用

参与份额=净参与金额/参与申请所在交易日的资产管理计划份额净值

其中，参与份额的计算结果保留到小数点后2位，小数点2位以后的部分四舍五入，由此产生的误差产生的收益或损失由计划财产承担。

##### （二）本计划退出金额的计算方式

本计划退出金额的计算方式如下：退出总额=退出份额×退出申请所在交易日的资产管理计划份额净值

退出费用=退出总额×退出费率

退出金额=退出总额-退出费用-业绩报酬（如有）

其中，退出总额和退出金额的计算结果保留到小数点后2位，小数点2位以后的部分四舍五入，由此产生的误差产生的收益或损失由计划财产承担。

#### 八、参与资金的利息处理方式（如有）

存续期参与资金无相关利息，不进行利息转份额的处理。

#### 九、单个投资者大额退出的认定、申请和处理方式

##### （一）单个投资者大额退出的认定

在单个开放日，本集合计划单个投资者净退出申请份额（退出申请份额总数扣除参与申请份额总数后的余额）超过1000万份（包括1000万份）时，即认为发生了单个投资者大额退出。

##### （二）单个投资者大额退出的申请和处理方式

当投资者申请大额退出时，需提前3个工作日向管理人提出书面预约。投资者如未提前预约，管理人有权确认失败，投资者书面预约退出且确认成功的，如构成巨额退出，应按巨额退出程序办理。

#### 十、巨额退出和连续巨额退出

##### （一）认定标准

若本计划于某个退出开放期内的计划份额净退出申请超过前一交易日的计划总份额的【10%】，即认定为计划发生了巨额退出。同一退出开放期内连续2个开放日以上（含2个交易日）发生巨额退出，即认定为计划发生了连续巨额退出。

## （二）退出顺序、退出价格确定和退出款项支付

出现巨额退出时，管理人和销售机构协商一致，可以根据本计划当时的资产状况决定接受全额退出或部分退出。出现连续巨额退出时，如管理人认为有必要，可暂停接受计划份额退出申请；已经接受的退出申请可以延缓支付退出款项，但不得超过【20】个工作日，并应当及时告知投资者。

1、全额退出：当管理人和销售机构认为有能力兑付投资者的全部退出申请时，管理人接受全额退出，并按正常退出程序执行。

2、部分退出：当管理人认为支付投资者的退出申请有困难或认为因支付投资者的退出申请而进行的财产变现可能会对计划资产净值造成较大波动时，管理人在当日接受退出比例不低于上一交易日计划总份额的【10%】的前提下，可对其余退出申请延期办理。对于当日的退出申请，应当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；对于未能退出部分，投资者在提交退出申请时可以选择延期退出或取消退出。选择延期退出的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部退出为止；选择取消退出的，当日未获受理的部分退出申请将被撤销。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各类计划份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部退出为止。如投资者在提交退出申请时未作明确选择，投资者未能退出部分作自动延期退出处理。

## （三）告知投资者方式

当发生巨额退出、连续巨额退出时，管理人应当及时告知投资者。管理人在其网站发布公告即视为履行了向投资者告知的义务。

## 十一、延期支付及延期退出的情形和处理方式

发生下列情形时，管理人可延期支付退出款项或延期办理投资者退出申请：

（一）因不可抗力导致管理人不能支付赎回款项。

(二) 发生本合同约定的暂停基金资产估值情况。

(三) 证券/期货交易所交易时间非正常停市，导致管理人无法计算当日计划资产净值。

(四) 同一退出开放期内连续两个或两个以上交易日发生巨额退出。

(五) 发生继续接受退出申请将损害现有份额持有人利益的情形时。

(六) 当前一估值日计划资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与托管人协商确认后，管理人应当延期支付退出款项或延期办理退出申请。

(七) 法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一且管理人决定延期支付或延期支付时，已确认的退出申请，管理人应足额支付；如暂时不能足额支付，应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给退出申请人，未支付部分可延期支付。若出现上述第(四)款所述情形，按本合同的相关条款处理。在延期退出的情况消除时，管理人应及时恢复退出业务的办理并及时告知投资者。

## 十二、拒绝或暂停参与、暂停退出的情形及处理方式；

(一) 在如下情况下，管理人可以拒绝接受投资者的参与申请：

1、本计划份额持有人接近或达到 200 人；

2、根据市场情况，管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对本计划业绩产生负面影响，从而损害现有投资者的利益的情形；

3、因本计划所持某个或某些证券进行权益分派等原因，使管理人认为短期内接受参与可能会影响或损害现有投资者利益的；

4、管理人认为接受某笔或某些参与申请可能会影响或损害其他投资者利益的；

5、法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

管理人决定拒绝接受某些投资者的参与申请时，参与款项将退回投资者账户。

(二) 在如下情况下，管理人可以暂停接受投资者的参与申请：

1、因不可抗力导致无法受理投资者的参与申请；

2、证券、期货交易场所交易时间临时停市，导致管理人无法计算当日计划资产净值和计划份额净值；

3、发生本合同约定的暂停计划资产估值情况；

4、法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

管理人决定暂停接受全部或部分参与申请时，应当告知投资者。在暂停参与的情形消除时，管理人应及时恢复参与业务的办理并予以告知投资者。

(三) 在如下情况下，管理人可以暂停接受投资者的退出申请：

1、因不可抗力导致管理人无法支付退出款项；

2、证券交易场所交易时间临时停市，导致管理人无法计算当日计划资产净值和计划份额净值；

3、发生本合同约定的暂停本计划资产估值的情况；

4、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回；

5、法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一的，管理人应当及时告知投资者。在暂停退出的情况消除时，管理人应及时恢复退出业务的办理并及时告知投资者。管理人在其网站发布公告即视为履行了向投资者告知的义务。

十三、资产管理计划向投资者支付的受托资金及收益应当返回其参与资产管理计划时使用的结算账户或者同名账户。

#### 十四、本计划投资运作期间的份额转让

投资者可以通过证券交易所以及中国证监会认可的其他方式,向合格投资者转让其持有的本计划份额,份额转让应遵守交易场所相关规定及要求,并按规定办理份额变更登记手续。转让后,持有本计划份额的合格投资者合计不得超过200人。

管理人应当在本计划份额转让前,对受让人的合格投资者身份和本计划的投资者人数进行合规性审查。受让方首次参与本计划的,应当先与管理人、托管人签订资产管理合同。

#### 十五、非交易过户的受理条件与流程

1. 管理人及注册登记机构只受理继承、捐赠、司法强制执行和经注册登记机构认可的其他情况下的非交易过户。其中:

“继承”是指投资者死亡,其持有的计划份额由其合法的继承人继承。

“捐赠”是指投资者将其持有的计划份额向公益机构转赠,或将其持有的计划份额产生的收益向公益机构转赠。

“司法强制执行”是指司法机构依据生效司法文书将投资者持有的计划份额强制划转给其他自然人、法人、社会团体或其他组织的情形。

2. 办理非交易过户业务必须提供注册登记机构规定的相关资料。符合条件的非交易过户申请自申请受理日起2个月内办理;申请人按注册登记机构规定的标准缴纳过户费用。

#### 十六、证券期货经营机构及其子公司以自有资金参与本计划

##### (一) 自有资金参与的条件

证券期货经营机构及其子公司以自有资金参与本计划,应符合法律、行政法规和中国证监会的规定,并按《中华人民共和国公司法》和公司章程的规定,获

得股东会、董事会或其他授权程序的批准。

## （二）自有资金的参与方式

证券期货经营机构及其子公司在募集期和存续期内可以以自有资金参与本计划，证券期货经营机构及其子公司自有资金参与本计划的持有期限不得少于6个月。

## （三）自有资金参与的份额比例

证券期货经营机构及其子公司以自有资金参与本计划的份额合计不得超过本计划总份额的50%。中国证监会对自有资金投资比例另有规定的，从其规定。因本计划规模变动等客观因素导致前述比例被动预警或者超标的，证券期货经营机构及其子公司应当依照中国证监会规定及本合同约定及时调整达标。

## （四）自有资金的收益分配及责任承担

证券期货经营机构及其子公司以自有资金所持的本计划份额，与其他份额持有人所持的同类计划份额享有同等权益、承担同等风险。

## （五）自有资金参与和退出的告知义务

托管人和投资者签署本合同即视为同意证券期货经营机构及其子公司以自有资金在募集期参与本计划。

证券期货经营机构及其子公司在存续期以自有资金参与、退出本计划，应当提前5个工作日告知全体投资者和托管人，管理人提前5个工作日在其网站发布公告即视为履行告知义务。管理人公告后，投资者不同意的，可以在开放期选择退出本计划，如投资者未在开放期选择退出本计划即视为已经充分理解并同意证券期货经营机构及其子公司的自有资金参与、退出事项，管理人无需就前述自有资金参与、退出事项再取得投资者同意；托管人不同意的应当以书面形式告知管理人，托管人未以书面形式告知管理人的即视为已经充分理解并同意证券期货经营机构及其子公司的自有资金参与、退出事项，管理人无需就前述自有资金参与、

退出事项再取得托管人同意。

除前款事项外，证券期货经营机构及其子公司在募集期自有资金参与的以及存续期因本计划规模变动等因素导致自有资金被动预警或者超标需退出的，无需提前5个工作日告知全体投资者和托管人并取得其同意，但需事后及时告知。监管另有规定的，从其规定。法律法规规定应当披露的，管理人应及时、全面、客观地向投资者和托管人进行披露。

为应对本计划巨额赎回以解决流动性风险，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，证券期货经营机构及其子公司以自有资金的参与、退出本计划可不受前述比例和持有期限限制，但应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。

十七、管理人应定期将本计划投资者变更情况报送协会。

### 第九部分 份额持有人大会及日常机构

本计划所有当事人一致同意，本集合计划不设置份额持有人大会及日常机构。

### 第十部分 计划份额的登记

一、资产管理计划的注册登记业务指资产管理计划的登记、存管、清算和结算业务，具体内容包括投资者资产管理计划账户建立和管理、资产管理计划份额的注册登记、资产管理计划销售业务的确认、清算和结算、代理发放红利、建立并保管投资者名册等。

二、本计划的注册登记业务由【华安证券资产管理有限公司】负责办理。

三、资产管理人委托其他机构代为办理本计划份额登记业务的，应当与有关机构签订委托代理协议。本计划份额登记机构的权限和职责如下：

（一）注册登记机构享有如下权利：

- 1、建立和管理投资者的资产管理计划账户；
- 2、履行相应职责后取得注册登记费（如有）；
- 3、保管投资者开户资料、交易资料、投资者名册等；
- 4、在法律法规允许的范围内，制定和调整注册登记业务的相关规则并依法公告；
- 5、法律法规规定的其他权利。

（二）注册登记机构承担如下义务：

- 1、配备足够的专业人员办理资产管理计划的注册登记业务；
- 2、严格按照法律法规和资产管理合同规定的条件办理资产管理计划的注册登记业务；
- 3、妥善保存登记数据，并将集合资产管理计划投资者名称、身份信息以及资产管理计划份额明细等数据备份至中国证监会认定的机构。其保存期限自资产管理计划账户销户之日起不得少于 20 年；
- 4、对投资者的账户信息负有保密义务，因违反该保密义务对投资者或资产管理计划带来的损失，须承担相应的赔偿责任，但法律法规或监管机构另有规定或司法强制检查情形除外；
- 5、按资产管理合同和计划说明书约定为投资者办理非交易过户等业务，并提供其他必要服务；
- 6、法律法规规定的其他义务。

四、本计划全体份额持有人同意管理人、份额登记机构或其他份额登记义务人将本计划投资者名称、身份信息以及本计划份额明细等数据备份至中国证监会认定的机构。

## 第十一部分 资产管理计划的投资

### 一、本资产管理计划的投资目标

在严格控制风险的基础上，主要投资于债券等固定收益类资产，把握市场投资机会，追求本集合计划的稳健收益，同时辅之以少量权益资产配置，提升组合收益水平。

### 二、本资产管理计划的投资范围

(1) 银行存款、国内依法发行的国债、中央银行票据、地方政府债、各类金融债(含次级债、混合资本债等)、企业债券、公司债券(含非公开发行公司债券)、可转债、可交换债、永续债、同业存单、超短期融资券、短期融资券、中期票据、非公开定向债务融资工具、资产支持证券(票据)、货币市场基金、债券型公募基金及中国证监会允许本集合计划投资的其他固定收益类品种；(2) 本计划可参与 A 股定向增发股票，可参与可转债与可交换债转股；(3) 本集合计划可参与债券回购(包含正回购和逆回购)。

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，可以将其纳入本集合计划的投资范围。法律法规或中国证监会变更集合计划原有投资品种投资比例限制的，资产管理人在履行合同变更程序后，可以相应调整本集合计划的投资比例上限规定。

### 三、本资产管理计划的投资策略

#### (一) 运作资产管理计划财产的决策依据

- 1、国家有关法律、法规和本集合计划合同的相关规定；
- 2、根据宏观经济发展态势、微观经济运行环境和有关经济政策以及证券市场趋势制定投资策略；
- 3、利率走势与通货膨胀预期；
- 4、发债主体信用分析和上市公司价值发现；

5、根据所投资品种的风险收益的匹配关系，本集合计划以力争集合计划的资产安全和流动性为重要衡量标准，在此基础上争取较高的收益。

## （二）运作资产管理计划财产的决策程序

管理人资产管理业务投资决策机构分为三级：私募资产管理业务决策委员会、私募投资决策小组和投资经理。本计划采取私募资产管理业务决策委员会、私募投资决策小组领导下的投资经理负责制。

私募资产管理业务决策委员会是管理人私募资产管理业务日常经营的重大事项决策机构，在董事会授权范围内，负责确定私募资产管理业务配置策略、投资事项和投资品种等投资运作管理事宜。私募投资决策小组根据投资目标、投资政策和资产配置原则，提出投资方案，并报私募资产管理业务决策委员会审议。投资经理根据已经批准的投资方案，按照计划合同和计划说明书要求，结合相关调研结果，制定定期投资计划，并经私募投资决策小组审议通过后，按照相关授权进行交易决策。

管理人投资决策具体程序如下：

### 1、确定投资目标和投资原则

私募资产管理业务决策委员会根据国家有关法律法规的规定、本合同、公司资产管理业务有关管理制度，确定本集合计划投资目标、投资原则以及资产配置原则等。

### 2、开展投资分析与研究

投研人员从宏观经济形势、行业发展趋势、市场趋势、投资标的评价结果等多个角度综合分析，运用定性和定量方法进行研究，经过评级、估值和风险评判，通过严格的筛选程序，构建投资标的池，并根据公司内部制度要求经审批后分别进入一级备选库、二级备选库及核心备选库。投研人员对入库标的开展定期、不定期跟踪管理，并根据市场变化情况，适时做出调整。

### 3、制定投资策略与资产配置比例

私募投资决策小组综合考虑政治、经济及资本市场状况等因素，根据投资目标、投资原则以及资产配置原则和研究建议，确定本计划投资策略和将总体资产分配到不同类型资产的比例，并报私募资产管理业务决策委员会审议。

### 4、进行投资组合管理

投资经理负责进行投资组合的日常管理，在授权范围内，根据投资策略与资产配置比例，从投资对象备选库中选择合适的投资标的构建投资组合。

### 5、交易实施

投资经理根据投资组合管理需要，做出投资决定，通过电子或书面形式向下属集中交易室发出交易指令。交易室根据投资限制和市场情况对交易指令进行审查，确认无误后，交易员按交易指令确定的种类、价格、数量、时间予以执行，将交易结果及时反馈投资经理。如果市场和个别证券交易出现异常情况，交易员应及时提示投资经理。

### 6、风险管理与组合的调整

在投资决策过程中，风控合规部负责对集合计划的投资限制、市场风险、流动性风险及信用风险等投资风险进行事前评估、事中监控以及事后跟踪分析，并在整个投资流程完成后，对投资风险及绩效做出评估。

公司风控合规部负责对本集合计划投资的合规性风险、操作风险、道德风险以及其他风险进行监督和检查，风控合规部设置专门的稽核审计岗负责对本集合计划的运行开展专项稽核。

### （三）资产配置策略

管理人通过将集合计划资产主要配置于国债、金融债、公司债等固定收益类资产，同时辅之以权益类（如有）资产配置，将组合整体投资风险控制在较低水平，逐步提升组合收益水平。

#### （四）固定收益类资产投资策略

本集合计划将运用多种积极管理增值策略，重点投资于债券等固定收益类金融资产，在严格控制信用风险的前提下，追求较高的稳健收益。其投资策略主要有持有到期策略、利率预期策略、收益率曲线策略、类属替换策略、个券优选策略等。同时，管理人将坚持基本面分析，充分挖掘公司债等新型信用品种的投资机会。

主要投资策略有：

##### 1、持有到期策略

在流动性许可的情况下，管理人对本集合计划部分固定收益类资产将采取持有到期策略，该部分债券的剩余期限与其买入时本集合计划的剩余期限相匹配，从而有效地降低再投资风险，做到收益性与流动性兼顾。

##### 2、利率预期策略

管理人通过对影响债券投资的宏观经济状况和货币政策等因素的分析判断，形成对未来市场利率变动方向的预期，主动地调整债券投资组合的久期，提高债券投资组合的收益水平。

首先，本集合计划主要依据如下因素预期利率变动趋势：

（1）财政、货币政策分析；

（2）增长率及其变化趋势；

（3）物价水平、货币供应量、债券供求分析等及其预期。

其次，管理人依据对利率的预期，决定债券投资组合的期限结构：

（1）如利率预期上升，降低债券组合久期，以规避债券价格下降的风险；

（2）如利率预期下降，提高债券组合久期，以较多地获得债券价格上升带来的收益。

### 3、收益率曲线策略

管理人通过对债券市场微观因素的分析判断,形成对未来收益率曲线形状变化的预期,相应地选择子弹型、哑铃型或梯型的组合期限配置,获取收益率曲线形变带来的投资收益。主要考虑的债券市场微观因素包括:收益率曲线、历史期限结构、新债发行、回购及市场拆借利率等。

### 4、类属替换策略

管理人研究宏观、微观经济,观察公司债、金融债、企业债等信用债券品种与同期限国债之间收益率利差状况,对公司债、金融债、企业债等信用债券品种与同期限国债之间收益率利差的扩大或收窄趋势作出判断;在预期信用利差将收窄时,主动提高信用债券类属品种的投资比例,相应降低同期限国债的投资比例;在预期信用利差将扩大时,主动降低信用债券类属品种的投资比例,相应提高同期限国债的投资比例,从而获取不同债券类属之间利差变化所带来的投资收益。

### 5、个券优选策略

在以上债券资产久期、期限和类属配置的基础上,根据债券市场收益率数据,对单个债券进行估值分析,并结合债券的信用评级、流动性、息票率、税赋、提前偿还和赎回等因素,选择具有良好投资价值的债券品种进行投资。

### 6、公司债券投资策略

管理人采取自上而下与自下而上相结合的投资策略发掘、把握公司债券中蕴藏的投资机会。

管理人运用于公司债券的自上而下的投资策略为前述适用于各种信用债券的类属替换策略,即分析、研究公司债券与同期限国债之间的信用利差状况,在预期信用利差收窄时加大公司债券的配置比例,在预期信用利差扩大时降低公司债券的配置比例;同时,管理人对发债公司基本面和公司债券的具体条款进行深入的研究,通过信用评级建立公司债券备选池。

在既定的组合目标久期和公司债券配置比例下,管理人自下而上地从公司债券备选池中精选具有较高投资价值的个券完成整体组合中公司债券部分的配置。

#### 7、含权债券投资策略

本集合计划投资的含权债券主要是含选择权债券。管理人将以期权调整后的收益率水平(OAS)为基础,对含权债券的纯债价值进行评估,同时辅以对标的证券的研究,选择具体含权债券进行投资。

#### 8、回购策略

在有效控制风险情况下,通过合理质押组合中持仓的债券进行正回购,用融回的资金做加杠杆操作,提高组合收益。为提高资金使用效率,在适当时点和相关规定的范围内进行债券回购,以增加组合收益率。

#### (五) 权益类资产投资策略(如有)

1、本资产管理计划主要采取自下而上的主动投资管理策略,对公司的历史沿革、财务状况、盈利能力及前景、资产及权益价值等进行全面深入的研究分析,自上而下判断公司所在行业在长周期所在的位置以评估公司的合理价值,注重安全边际,选择能为投资者持续创造价值的股票,提高选股的有效性。

#### 2、定增标的精选投资策略

本资产管理计划的股票定量分析方法将在市场现有定增项目中,分析各行业公司的估值指标(如PE、PB、PE/G、PS、股息率等)、成长性指标(主营业务收入增长率、净利润增长率、毛利率增长率、净利润现金保障倍数等)、现金流量指标和其他财务指标,从中筛选出价值相对低估、成长性确定、现金流状况好、盈利能力和偿债能力强的公司,作为本计划的备选定增股票池;再通过分析备选股票所代表的公司的资产收益率、资产周转率等变量的时间序列,以及通过对市场整体估值水平、行业估值水平、主要竞争对手估值水平的比较,并参考国际市场估值水平来评估其投资价值。

在定量分析的基础上,本计划的股票定性分析方法将采用深度价值挖掘和多层多维度分析体系,从定增项目目的、定增对象结构、定增项目类别,并结合管理人的投研平台,多层次地分析备选定增项目所对应公司业务环节的竞争优势和劣势,分析定增项目对公司未来的影响,以及对所处行业与上下游产业的影响。管理人将通过调研深入了解发行人的行业背景、市场地位、产销规模、核心技术、股东和管理层情况、持续经营与盈利能力等各方面的信息,对定增价格的合理性做出判断,并结合市场情况、风险偏好和估值水平,在进行全面和深入研究基础上做出投资决定,在控制风险的基础上力求获取较高的定增投资收益。

#### (六) 可转换、可交换债券投资策略(如有)

可转换、可交换债券兼具固定收益类资产和权益类资产的特性,具有抵御下行风险,分享股票价格上涨收益的特点。本计划结合债性和股性特征,在对公司基本面和转债条款深入研究的基础上进行估值分析,投资于公司基本面优良,且有较高安全边际和良好流动性的可转换、可交换债券,获取稳健的投资回报。

### 四、本资产管理计划的投资比例

#### (一) 资产配置比例

(1) 本集合计划投资固定收益类资产比例为资产总值的 80-100%,总资产占净资产的比例不超过 200%,参与债券正回购资金余额或债券逆回购资金余额不得超过本计划上一日净资产的 100%,中国证监会另有规定的除外;

(2) 本集合计划投资于同一资产的资金,不超过该计划资产净值的 25%;管理人管理的全部集合计划投资于同一资产的资金,不得超过该资产的 25%;银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券等中国证监会认可的投资品种除外。

全部投资者均为符合中国证监会规定的专业投资者且单个投资者投资金额不低于 1000 万元的封闭式集合资产管理计划,以及完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的资产管理计划等中国证监会认可的其他集合资产管理计划,不

受前款规定的投资比例限制；

(3) 本集合计划投资可转债、可交换债等资产金额不超过计划资产净值的20%；

(4) 本集合计划参与权益类资产不超过计划资产净值的20%；

(5) 本集合计划投资于同一发行人及其关联方发行的债券的比例超过其净资产50%的，该资产管理计划的总资产不得超过其净资产的120%。本集合计划投资于国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券等中国证监会认可的投资品种不受前述规定限制。

法律法规或中国证监会允许计划投资其他品种的，资产管理人应事先取得投资者同意，在履行合同变更程序后，可以将其纳入本集合计划的投资范围。

本计划成立后备案完成前，管理人可以现金管理为目的，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。

## (二) 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二十个交易日内调整至符合相关要求。确有特殊事由未能在规定时间内完成调整的，管理人应及时向中国证监会相关派出机构报告。

(三) 本计划存续期间，为规避特定风险，全体投资者同意投资于对应类别资产的比例可以低于计划总资产80%，但不得持续6个月低于计划总资产80%，如遇此种情形，资产管理人应当向在相应类别资产的比例低于计划总资产80%的五个工作日内向资产托管人提供书面说明文件。相关特定风险包括但不限于：证券市场短期内发生急剧波动，管理人基于专业判断认为相关投资行为不利于资本

产管理计划收益最大化的。

## 五、投资限制和投资禁止

### （一）投资限制

为维护投资者的合法权益，对本计划限制以下投资行为：

1.本集合计划投资固定收益类资产比例为资产总值的 80-100%，总资产占净资产的比例不超过 200%，参与债券正回购资金余额或债券逆回购资金余额不得超过本计划上一日净资产的 100%，中国证监会另有规定的除外。

2.本集合计划投资于同一资产的资金，不超过该计划资产净值的 25%；管理人管理的全部集合计划投资于同一资产的资金，不得超过该资产的 25%；银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券等中国证监会认可的投资品种除外。因集合计划资产净值变动导致投资比例不满足上述约定的，管理人应当在流动性受限资产可出售、可转让或者恢复交易的二十个交易日内调整至符合相关要求。

全部投资者均为符合中国证监会规定的专业投资者且单个投资者投资金额不低于 1000 万元的封闭式集合资产管理计划，以及完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的资产管理计划等中国证监会认可的其他集合资产管理计划，不受前款规定限制。

3、本集合计划所投资资产支持证券（票据）应满足如下要求：

本集合计划投资资产支持证券（票据），底层资产非资产管理产品或其受（收）益权，底层资产相对分散，现金流稳定，现金流归集路径清晰；本集合计划投资资产支持证券（票据），仅限于投资优先级，且投资评级为 AA（含）以上的份额；本集合计划投资资产支持证券（票据），投资品种挂牌场所为银行间市场和交易所市场。

4.本集合计划投资可转债、可交换债等资产金额不超过资管计划资产净值的

20%;

5.本集合计划参与权益类资产不超过计划资产净值的 20%;

6.投资信用类债券,主体评级(或债项)必须在 AA(含)以上,超短期、短期融资券债项(如有)评级不低于 A-1,主体评级(如有)在 AA(含)以上;若持有期间,主体评级(或债项)发生调整导致不符合本集合计划投资限制的,应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出。

7.当本集合计划投资于同一发行人及其关联方发行的债券的比例超过其净资产 50%时,该资产管理计划的总资产不得超过其净资产的 120%。本集合计划投资于国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券等中国证监会认可的投资品种不受前述规定限制。

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二十个交易日内调整至符合相关要求。确有特殊事由未能在规定时间内完成调整的,管理人应及时向中国证监会相关派出机构报告。

法律法规或中国证监会允许计划投资其他品种的,资产管理人应事先取得投资者同意,在履行合同变更程序后,可以将其纳入本集合计划的投资范围。

## (二)投资禁止

本计划财产禁止从事下列行为:

1、违规将计划资产投资商业银行信贷资产,为地方政府及其部门提供融资,为地方政府及其部门违规提供担保,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;

2、将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、利用资产管理计划，通过直接投资、投资其他资产管理产品或者与他人进行交叉融资安排等方式，违规为本机构及其控股股东、实际控制人或者其他关联方提供融资；

11、为本人或他人违规持有金融机构股权提供便利；

12、法律、行政法规和中国证监会禁止的其他行为。

六、本资产管理计划的风险收益特征；

本计划以固定收益类资产投资为主，风险评级为 R2 级。因法律法规或中国证监会、基金业协会的相关规定、管理人内部控制调整导致调高或降低本计划风险等级的，管理人可以调整产品风险等级，并及时以公司网站公告等方式告知投资者。

七、本计划的建仓期

本资产管理计划的建仓期为计划成立之日起【6 个月】。建仓期的投资活动，应当符合本资产管理合同约定的投向和资产管理计划的风险收益特征。以现金管理为目的，投资于银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券、货币市场基金等中国证监会认可的投资品种的除外。建仓期结束后，本资产管理计划的资产组合应当符合法律、行政法规、中国证监会规定和合同约定

的投向和比例。

#### 八、本计划投资的资产组合的流动性安排

本集合计划主要投资于标准化资产,结合不同类型货币市场工具的流动性和收益水平以及债券逆回购的收益水平来确定现金或者其他高流动性金融资产的配置,确保资产组合的流动性与本集合计划的开放期安排相匹配,同时管理人在开放期根据组合的具体情况安排适当比例的现金类资产,并确保在退出开放期内,本计划资产组合中7个工作日可变现资产的价值,不低于该计划资产净值的10%。

十、资产托管人对因为资产管理人投资产生的存放或存管在资产托管人以外机构的资产管理计划财产以及不属于托管人控制范围内的财产不承担保管职责。由于该等机构或本合同当事人外第三方的欺诈、疏忽、过失或破产等原因给资产管理计划财产造成的损失等,以及资产托管人基于从第三方合法获得信息以及合理依赖上述信息而操作导致的资产管理计划财产的任何损失,资产托管人均免于承担责任。

### 第十二部分 服务机构和投资顾问

本计划未聘请服务机构和投资顾问。

### 第十三部分 分级安排

本计划不分级。

### 第十四部分 利益冲突及关联交易

一、本计划存在的或者可能存在利益冲突的情形

(一)从事关联交易,包括重大关联交易和一般关联交易。

(二)证券期货经营机构及其子公司有权以自有资金参与、退出本计划。

(三) 管理人的董事、监事、从业人员及其配偶、控股股东、实际控制人或者其他关联方均有权参与本计划。

(四) 其他可能会存在利益冲突的情形,包括但不限于:本计划的部分销售机构可能为管理人的关联方;本计划可能投资控股股东或者其他关联方代销的金融产品;本计划可租用管理人关联方提供的证券交易单元;管理人、托管人开展不同业务类型可能产生的利益冲突;管理人管理的其他资管产品(包括本计划投资经理管理的其他资管产品)基于各自投资策略需要可能与本计划存在相同、相似或相反的投资交易行为,或者在买卖同一只证券的时间上存在先后;其他可能产生利益冲突的情况等。

## 二、本计划存在利益冲突的处理方式、披露方式、披露内容以及披露频率

管理人遵循投资者利益优先原则,建立健全内部控制和风险合规管理制度,做好充分的信息隔离,积极管控本计划在投资运作过程中可能存在的利益冲突,防范利益输送等违法违规行为。具体安排包括:

### (一) 对关联交易的处理和披露

管理人严格按照法律法规、监管规定、管理人关联交易制度以及本合同约定处理关联交易。在投资决策时,投资经理确定好拟投资的具体品种、规模和时机后,管理人将通过系统或人工的方式判断其是否属于关联交易并履行对应的审批程序。

1. 管理人以本计划资产从事本合同约定的重大关联交易的,在开展重大关联交易前,管理人将选择通过管理人网站公告或其他适当方式逐笔向投资者征询意见。投资者不同意该笔重大关联交易的,应当按照公告要求的方式并在公告要求的期限内向管理人明确反馈不同意的意见,投资者不同意该笔重大关联交易的,可以按照公告要求的方式提出退出本集合计划的申请,投资者未在公告要求的时间内提出退出申请的,视为同意进行该笔重大关联交易投资。如果投资者未按照管理人公告要求的方式进行反馈、或未在管理人公告要求的期限内及时反馈、

或在反馈中意见表示不明确的，则均视为投资者同意进行该笔重大关联交易。在获得全体投资者同意后，管理人可以从事该笔重大关联交易，管理人应严格遵守法律、行政法规和中国证监会的规定以及本合同的约定，在交易完成后，管理人将及时通知托管人、通过管理人网站告知投资者，并向中国证监会相关派出机构报告。

2.管理人以本计划资产从事一般关联交易的，投资者签署本合同即视为已经充分理解并同意管理人可以以本计划资产从事一般关联交易，管理人在本计划运作过程中从事一般关联交易时，视作已事先统一取得投资者同意。管理人严格遵守法律、行政法规和中国证监会的规定以及本合同的约定，及时书面通知托管人、通过管理人网站告知投资者，并向中国证监会相关派出机构报告。

（二）证券期货经营机构及其子公司以自有资金参与、退出本计划的，证券期货经营机构及其子公司将严格遵守法律、行政法规和中国证监会的规定以及本合同的约定，履行意见征询、信息披露和监管报告等程序。该部分投资者与本计划其他投资者份额享有同等权益、承担同等风险，并严格遵守相关持有期限、投资比例等要求。

（三）管理人的董事、监事、从业人员及其配偶、控股股东、实际控制人或者其他关联方参与本计划的，管理人应严格遵守法律、行政法规和中国证监会的规定以及本合同的约定，该部分投资者与本计划其他投资者份额享有同等权益、承担同等风险。管理人将对该部分投资者账户进行监控，并按照有关规定进行披露或和报告。

（四）本计划在投资运作过程中存在利益冲突情形的，管理人将从充分维护投资者利益角度积极处理该等利益冲突情形，防范利益输送等违法违规行为，在发生该等利益冲突时，资产管理人将视具体利益冲突情形和重要程度选择在向投资者提供的定期报告或临时报告中披露，具体披露内容包括利益冲突情形、处理方式、对投资者利益的影响等。

### 三、本计划从事关联交易的情形

#### （一）关联方范围和关联交易范围

管理人关联方和关联交易标准以管理人官网披露的为准。

托管人关联方名单及更新以托管人年报或官网披露的最新版年报为准，若因托管人关联方信息未及时披露或更新造成的后果，管理人不承担责任。管理人依据年报生成的托管人关联方清单与托管人监督口径不一致的，管理人不承担责任。

关联交易是指本计划与关联方之间进行的各类投资交易。具体包括投资于管理人、托管人及前述机构的控股股东、实际控制人或者其他关联方发行的证券或者承销期内承销的证券、本机构及其关联方管理的产品等情形。

#### （二）重大关联交易

重大关联交易是指管理人将资产管理计划资产投资于本机构及本机构股东、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且达到一定金额、本计划投资顾问及其关联方（如有）发行的或承销期内承销的证券等情形。

根据《华安证券资产管理有限公司私募资产管理业务关联交易管理实施细则》第十五条，满足以下情形之一的，构成重大关联交易标准：

（1）公司所管理的私募资产管理计划投资于公司及其关联方发行的或承销期内承销的证券，且单笔或累计交易金额超过该私募资管计划资产净值的 10% 或 3000 万元；

（2）公司所管理的私募资产管理计划投资于该计划投资顾问及其关联方发行的或承销期内承销的证券；

（3）法律法规和公司制度规定的其他重大关联交易。

管理人以本计划资产从事重大关联交易的，应当遵守法律、行政法规、中国证监会的规定和合同约定，按照管理人内部审批机制和评估机制逐笔进行事前审

批，并事先逐笔以公告形式取得投资者同意，事后及时告知投资者和托管人，并向中国证监会相关派出机构报告。

### （三）一般关联交易

一般关联交易是指除前述重大关联交易外的关联交易。管理人以本计划资产从事一般关联交易的，投资者签署本合同即视为已经充分理解并同意管理人可以以本计划资产从事一般关联交易，管理人在本计划运作过程中从事一般关联交易时，视作已事先统一取得投资者同意。

管理人以本计划资产从事一般关联交易的，应当遵循投资者利益优先原则，并采取切实有效措施，防范利益冲突，保护投资者合法权益，按照管理人内部审批机制和评估机制进行事前审批，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。

### （四）关联交易管控机制

管理人坚持公平和诚信原则，按照市场公平合理价格执行关联交易。禁止任何利益输送、内幕交易、不公平交易等，保护投资者合法权益。管理人已建立健全私募资管业务关联交易制度，对关联交易的界定、关联交易的审批、责任划分、信息披露等进行了规范；管理人已建立健全内部审批机制和评估机制，关联交易由投资经理发起，风险与合规管理人员审核，其中一般关联交易由公司私募投资决策小组进行审批，重大关联交易由公司私募资产管理业务决策委员会进行审批。审批内容包括依据法规、内部制度、产品合同审核关联交易的合法性、合规性、定价公允性等。

利益冲突和关联交易如法律法规或监管部门另有规定的，按其规定处理，管理人通过管理人网站等方式告知投资者和托管人相关事宜，无需另行履行合同变更程序。

## 第十五部分 投资经理的指定与变更

一、资产管理计划投资经理由资产管理人负责指定。

二、本计划的投资经理的资料如下：

曲少伦，任华安证券资产管理部高级投资经理，主要负责固定收益类产品的管理。同济大学工商管理硕士，证券从业经历 20 多年，历任中信证券山东管理总部资产管理投资经理、生命人寿保险股份有限公司债券研究员、投资经理、天治基金管理有限公司债券基金经理、浦银安盛基金管理有限公司固定收益基金经理、国开证券资产管理部高级投资经理、华安证券资产管理部高级投资经理。熟悉股票、债券市场，擅长大类资产配置，过往业绩优良(在公募基金管理的产品业绩在任职期间均排在同类产品前 1/3 的位置，个别产品排在前 1/8 的位置)，具有大资金管理经验。

樊艳，1999 年加入华安证券，曾任证券投资部研究员、投资经理，现任华安资管投资经理。2020 年-2025 年 11 月，担任参公运作大集合产品华安证券汇赢增利一年持有期灵活配置混合型集合资产管理计划、华安证券聚赢一年持有期债券型集合资产管理计划、华安证券合赢六个月持有期债券型集合资产管理计划、华安证券合赢三个月持有期债券型集合资产管理计划、华安证券月月红现金管理型集合资产管理计划投资经理。

以上投资经理无其他兼职，已取得基金从业资格，最近三年未被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚。

三、管理人可根据需要变更投资经理，并在管理人网站进行公告并按规定程序向中国证券投资基金业协会备案。投资经理变更后，管理人应及时通知投资者及托管人。管理人在其网站就投资经理变更事宜进行相应公告，即视为已经履行了相应告知程序。

## 第十六部分 资产管理计划的财产

### 一、资产管理计划财产的保管与处分

(一) 本计划的财产为信托财产，其债务由资产管理计划财产本身承担，投资者以其出资为限对本计划财产的债务承担责任。

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

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

(四) 管理人、托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，本计划财产不属于其清算财产。

(五) 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。

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

#### (七) 非标准化资产的保管

若本计划投资于《管理办法》第三十八条第(五)项规定资产及其他非现金类财产(即《管理办法》第三十八条第(一)至(三)项规定以外的非标准化债权类资产、股权类资产、期货和衍生品类资产等其他非现金类资产)时，管理人应于完成投资后及时办理计划资产的确权事宜，负责保管相关权利凭证(如有)及行权依据，并及时将相关权利凭证及行权依据的复印件交付托管人。

(八) 对于因为管理计划投资产生的应收资产，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，到账日托管账户未收到应收资产的，托管人应及

时通知管理人，由此给计划造成损失的，管理人应负责向有关当事人追偿。

(九)资产托管人对因为资产管理人投资产生的存放或存管在资产托管人以外机构的委托财产以及不属于托管人控制范围内的财产不承担保管职责。

## 二、资产管理计划财产相关账户的开立和管理

管理人或托管人按照规定为本计划开立托管账户、证券账户等投资所需账户。证券账户的持有人名称应当符合证券登记结算机构的有关规定。开立的上述资产管理计划财产账户与管理人、托管人、募集机构和计划份额登记机构自有的财产账户以及其他计划财产账户相独立。

### (一)受托资产的保管与处分

1、本资产管理计划财产为信托财产，其债务由本资产管理计划财产本身承担责任，投资者以其出资为限对本资产管理计划财产的债务承担责任，本合同另有约定的除外。

2、资产管理计划财产独立于管理人、托管人的固有资产，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资产。

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资产。

5、管理人、托管人（如有）以其固有财产承担法律责任，其债权人不得对资产管理计划财产行使请求冻结、扣押和其他权利。

6、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消。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、托管人应当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。

7、投资者的债权人通过司法机关对资产管理计划财产采取强制措施的，由此造成资产管理计划财产损失由投资者承担。

## （二）本资产管理计划财产相关账户的开立和管理

### 1、银行托管账户的开立和管理

（1）管理人应在托管人营业机构为本资产管理计划开立银行托管账户，账号、户名以托管人营业机构实际开立为准。本资产管理计划在托管期间的一切货币收支活动，包括不限于投资交易、支付费用、分配收益，均须通过银行托管账户进行。

（2）托管人按照《人民币银行结算账户管理办法》、《现金管理暂行条例》、《人民币利率管理规定》、《支付结算办法》以及其他相关规定开立银行托管账户，管理人应当在开户过程中给予必要的配合。管理人保证所提供的银行托管账户开户材料的真实、准确、完整和有效，且在相关资料变更后及时将变更的资料提供给托管人。

（3）银行托管账户作为本资产管理计划受托资产保管、管理和运用的专用账户，在本资产管理计划存续期内不可撤销。

### 2、银行间债券结算账户的开立与管理

管理人负责以本资产管理计划的名义申请并取得进入全国银行间同业拆借市场的交易资格，并代表本资产管理计划进行交易。托管人负责以本资产管理计划受托资产的名义在银行间市场登记结算机构开设债券结算账户，并代表本资产管理计划进行银行间市场债券交易的结算；管理人应当予以配合并提供相关资料，并确保所提供资料真实、准确、完整及有效。

### 3、证券账户的开立和管理

(1) 管理人委托托管人按照法律法规和开户机构相关业务规则，以本资产管理计划的名义在中国结算上海分公司、深圳分公司各开立证券账户用于证券交易所交易品种的交易，管理人应当予以配合并提供相关资料。

(2) 管理人应在证券账户开立前将证券账户开户费用汇至中国结算指定收费账户，并将汇款凭证及开户材料发送给托管人。托管人在收妥相关材料后应及时办理开户手续，并将开户回单发送给管理人。

(3) 证券账户仅限于满足开展本资产管理计划业务的需要，管理人、托管人双方不得出借或转让证券账户，亦不得使用证券账户进行本资产管理计划业务以外的活动。

#### 4、证券资金账户的开立与管理

(1) 管理人应以本资产管理计划的名义在证券经纪机构开立证券资金账户，用于证券交易结算资金的存管、记载交易结算资金的变动明细以及场内证券交易清算，并与托管人指定的第三方存管银行建立三方存管关系。

(2) 本资产管理计划运作期间，管理人进行的所有交易所场内投资，均需通过证券资金账户进行资金的交收。未经托管人同意，第三方存管对应关系一经确定，不得更改，管理人不得注销该证券资金账户，也不得自行通过其他途径从该证券资金账户进行资金转出。

(3) 证券资金账户开立完毕后，未经托管人同意，管理人不得自行开立其他的证券资金账户；管理人、托管人双方不得出借或转让证券资金账户，亦不得使用证券资金账户进行本资产管理计划投资运作以外的活动。

#### 5、其他账户

在符合法律法规及本资产管理计划投资运作需要的前提下，经管理人、托管人双方协商一致后，可按照法律法规和开户机构的规定开立其他账户。在上述账户的开立过程中，托管人不承担任何因管理人未给予托管人必要的配合可能造成

的损失。

## 第十七部分 划款指令的发送、确认和执行

(一)管理人在运用本资产管理计划受托资产时向托管人发送资金划拨及其他款项付款指令,托管人负责执行管理人的指令、办理本资产管理计划名下的资金往来等有关事项。

(二)管理人可向托管人发送的指令包括电子指令和纸质指令。

电子指令包括管理人发送的电子指令(含采用电子报文传送的电子指令、通过苏州银行资产托管服务平台录入的电子指令)、自动产生的电子指令(托管人根据管理人免指令授权函自动产生的电子指令)。纸质指令包括管理人通过授权邮箱或双方约定的其他方式发送的指令。

(三)管理人对发送指令人员的书面授权及授权通知书信息变更的程序

管理人应事先在本资产管理计划成立前向托管人提供书面划款指令授权通知书(附件一)(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、签章样本、权限和预留印鉴,以及授权的邮箱、电话号码等。授权通知书应加盖管理人公章和法定代表人(或被授权人)签章;若由授权代表签署,还应附上法定代表人的授权书。

授权通知书经管理人、托管人双方以电话方式或其他管理人、托管人双方认可的方式确认后,由管理人使用授权邮箱将授权通知书原件扫描件发送至托管人,并以授权通知书载明的生效时间与托管人收到时间两者较晚时间生效。管理人保管授权通知书的原件正本,托管人保管授权通知书原件扫描件,授权通知书原件正本内容与托管人收到的原件扫描件不一致的,以托管人收到的原件扫描件为准。

管理人撤换被授权人员或变更被授权人员权限等信息应提前至少1个工作日,使用授权邮箱重新向托管人发出加盖管理人公章和法定代表人(或被授权人)的授权通知书,同时电话通知托管人。经管理人与托管人以电话方式或其他管理人、托管人双方认可的方式确认后,被授权人变更通知,自授权通知书载明的生

效时间与托管人收到时间两者较晚时间生效。管理人保管变更授权通知书的原件正本，托管人保管变更授权通知书原件扫描件。变更授权通知书原件正本内容与托管人收到的原件扫描件不一致的，以托管人收到的原件扫描件为准。

#### （四）指令的内容

指令是在管理本资产管理计划时，管理人向托管人发出的交易成交单、交易指令及资金划拨类指令。纸质指令应加盖预留印鉴并由被授权人签章，并至少包含以下要素：支付日期、付款方户名、付款方账号、付款方开户行、收款方户名、收款方账号、收款方开户行、金额（大小写）、划款摘要等。

#### （五）指令的发送、确认及执行等程序

##### 1、指令发送的方式

托管人支持管理人通过以下任一方式发送指令：

（1）管理人通过深证通电子直连对接方式，向托管人发送电子划款指令。

管理人通过深证通电子直连对接方式发送电子指令的，管理人应在启用该方式前一工作日，通过管理人、托管人双方认可的方式告知托管人本资产管理计划的资产代码等信息。

（2）管理人通过苏州银行资产托管服务平台录入方式，向托管人发送电子划款指令。

苏州银行资产托管服务平台是指托管人向管理人提供的托管客户软件终端，实现管理人与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。在启用该方式前，管理人、托管人双方须另行签订服务协议，具体事宜以《苏州银行资产托管服务平台系统服务协议》的约定为准。

对于管理人通过上述电子方式发送指令的，在应急情况下，管理人可通过授权邮箱或双方约定的其他方式发送划款指令。

### (3) 管理人通过邮箱或双方约定的其他方式发送纸质指令

纸质划款指令须经管理人指定的授权邮箱或双方约定的其他方式发出方为有效。当出现特殊情况，管理人无法使用授权邮箱发送指令时，管理人可通过其他邮箱应急发送指令，并通过授权电话通知托管人，托管人不承担因管理人未及时通知托管人接收邮箱指令造成的损失。

#### 2、指令附件的发送

管理人向托管人发送指令的同时，应及时提供相关合同、交易凭证或其他证明材料（如需）。管理人对该等资料真实性、有效性、完整性和合法合规性负责。如管理人未及时提供符合托管人要求的指令附件，托管人有权暂不执行该指令直至管理人提交符合托管人要求的指令附件。

#### 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，管理人应于网下申购缴款日的10:00前将指令发送给托管人。

对于银证转账、银期转账业务，管理人应于交易所交易截止时间前2小时将指令发送至托管人，由托管人依据管理人发出的划款指令进行出入金操作。首次进行场内交易前，管理人应与托管人确认已完成交易单元和股东代码设置后方可进行。当第三方存管系统出现故障等其他紧急情况时，管理人可以使用非银期转账进行手工出入金。

对于银行间市场债券业务，管理人应与托管人确认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。管理人应最晚于交易日16:30前将银行间成交单及相关划款指令发送至托管人，并给托管人预留充足且合理的操作时间。

对于除上述业务以外的其他划款指令及附件，管理人应提前2小时向托管人发送，且不晚于工作日托管人接收指令截止时间（17:15前）。如管理人需托管人

配合执行工作日 17:15 后发送的划款指令，管理人应至少于工作日 17:15 前通过授权电话或其他双方认可的方式告知托管人。管理人未通过电话或其他双方认可的方式告知托管人的，托管人不承担划款指令当日未执行而造成的损失。

#### 4、指令的确认

管理人有义务在发送指令后使用授权电话与托管人进行确认，如因管理人未及时通知托管人接收邮箱指令造成的损失，托管人不承担责任。对于依照授权通知书发出的指令，管理人不得否认其效力。

#### 5、指令的执行

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，并为托管人留出执行指令所必需的时间，因管理人未给予合理必需的时间导致托管人操作不成功的，托管人不承担责任。

托管人确认收到管理人发送的指令后，仅对管理人提交的指令按照本合同约定进行表面一致性审查，管理人应保证上述文件资料合法、真实、完整和有效。对于因扫描引起的印章、签字等变形、扭曲，托管人不承担审查义务。托管人不承担因管理人提供的上述文件不真实或失去效力而造成的损失。

#### 6、指令的撤销

在指令未执行的前提下，若撤销邮件指令，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签章后通过授权邮箱发送给托管人，并通过授权电话及时通知托管人。若撤销电子指令，管理人应通过相关系统撤销，系统功能不支持撤销的，应参照撤销邮件指令方式撤销电子指令。

#### （六）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、重复发送指令，指令不能辨识或要素不全导致无法执行等情形。

当托管人认为所接收指令为错误指令时，应及时与管理人进行电话确认，并

暂停指令的执行，由管理人撤销指令或撤销后再重新发送指令。

#### （七）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

托管人发现管理人发送的指令有可能违反有关法律法规的规定、本合同约定，应暂缓执行指令，并及时通知管理人，管理人收到通知后应及时核对并纠正；如相关交易已生效，则应通知管理人在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。对于管理人违反有关法律法规的规定、本合同约定造成本资产管理计划受托资产损失的，由管理人承担全部责任，托管人免于承担责任。

#### （八）托管人未按照管理人指令执行的处理方法

除因托管人过错致使本资产管理计划受托资产受到损害而负赔偿责任外，托管人对执行管理人的合法有效指令对本资产管理计划受托资产造成的损失不承担赔偿责任。

#### （九）指令及指令附件的保管

纸质指令及指令附件由管理人保管原件正本，托管人保管其扫描件。当两者不一致时，以托管人收到扫描件为准。

### 第十八部分 交易及交收清算安排

#### （一）选择证券经纪机构的程序（如需）

管理人负责选择代理本资产管理计划委托财产进行证券买卖的证券经纪机构。管理人、托管人和证券经纪机构可另行签订证券经纪服务协议，载明本资产管理计划在证券交易所交易的交易席位号、佣金费率，交易数据、结算数据、对账单的传送，以及差错处理和违约责任等具体事项的安排。如证券经纪服务协议有效期内，交易席位号、佣金费率等信息发生变动，应于生效前一个交易日书面告知托管人。

管理人负责选择代理本资产管理计划委托财产进行期货交易的期货经纪机构。管理人、托管人和期货经纪机构可另行签订期货操作备忘录，载明本资产管理计划在期货交易所交易的期货交易编码、期货保证金账号、期货保证金比例、佣金费率，交易数据、结算数据、对账单的传送，以及差错处理和违约责任等具体事项的安排。在期货操作备忘录有效期内，佣金费率等信息发生变动的，应于生效前一个交易日书面告知托管人。

## （二）本资产管理计划投资证券、期货的清算交收（如需）

本产品为券商结算模式。

管理人向托管人发送有效划款指令时，应确保托管人有足够的处理时间。托管人收到指令后应及时处理完毕。

管理人通过证券经纪机构、期货经纪机构进行本资产管理计划的证券、期货交易的，由证券经纪机构、期货经纪机构作为结算参与人代理本资产管理计划进行结算，并负责证券资金账户、期货保证金账户项下的财产保管。本资产管理计划其它证券交易由托管人或相关机构负责结算。

本资产管理计划进行证券买卖、期货交易的资金交收违约事件，由相关各方及时协商解决。相关过错方在清算上造成本资产管理计划委托财产的损失，由过错方承担。

对证券资金账户、期货保证金账户，资金、证券、期货账目，由管理人、托管人双方定期与证券经纪机构、期货经纪机构进行对账，确保管理人、托管人双方账实相符。

## （三）本资产管理计划投资银行间债券的清算交收（如需）

管理人负责对交易对手方的资信控制，按银行间债券市场的交易规则进行交易，并负责解决因交易对手不履行合同或未及时履行合同而造成的纠纷及损失，托管人不承担由此造成的任何法律责任及损失，由责任方承担。

银行间债券交易资金的结算由托管人根据管理人出具划款指令执行，托管人

不承担因本资产管理计划银行托管账户、银行间债券结算账户头寸不足而导致的损失，由责任方承担。

#### （四）本资产管理计划其他场外交易资金结算

当本资产管理计划投资于其他场外交易时，应及时提前向托管人提供相关交易材料（包括但不限于投资合同、交易申请表、通过第三方机构交易的资格证明文件等），由托管人审核无误后进行资金划拨，托管人或委托的相关登记结算机构进行结算，托管人不承担因管理人未及时提供相关交易材料造成的损失。

### 第十九部分 越权交易的界定

#### （一）越权交易的界定

越权交易是指管理人违反法律法规规定或超出本合同项下投资者的授权而进行的投资交易行为。

管理人应在法律法规规定和本合同约定的权限内运用受托资产进行投资管理，不得违反有关法律法规规定和本合同的约定，超越权限管理、从事投资。

#### （二）越权交易的处理程序

托管人发现管理人的划款指令违反法律法规规定或本合同约定的，应当拒绝执行并立即通知管理人改正。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。管理人收到通知后应及时核对并在下一工作日前及时确认并以书面形式回复托管人，就托管人的疑义进行解释或举证，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越权事项未能在限期内改正或者造成受托资产损失的，托管人有权报告管理人住所地中国证监会派出机构及协会。

越权交易所发生的损失及相关交易费用由管理人负担，所发生的收益归受托资产所有。

#### 三、托管人对管理人投资运作的监督

(一) 托管人对下列资产管理计划的投资事项及管理人投资行为进行监督:

1. 对附件《交易监控合规表》约定的投资范围进行监督;
2. 对附件《交易监控合规表》投资限制进行监督;

(二) 托管人对计划财产的投资监督和检查自建账估值之日起开始执行。托管人在附件《交易监控合规表》约定范围内,对本计划的直接投资履行监督职能。

(三) 资产托管人投资监督的准确性和完整性受限于资产管理人及其他机构提供的数据信息,合规投资的最终责任在资产管理人。资产托管人对资产管理人及其他机构提供的信息的真实性、准确性、完整性和有效性不做任何担保、暗示或表示。

(四) 资产托管人发现资产管理人的投资运作违反法律、行政法规和其他有关规定,或者违反本合同时,应当拒绝执行,立即通知资产管理人限期纠正;资产托管人发现资产管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、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,资产托管人有权报告中国证监会相关派出机构。资产管理人收到通知后应及时核对或纠正,由此造成的损失由资产管理人承担。

(五) 资产托管人发现资产管理人可能存在违反法律、行政法规和其他有关规定,或者违反本合同约定,但难以明确界定时,应立即通知资产管理人,通知管理人即视为托管人履行了监督和托管职责。

(六) 托管人应对本计划关联交易进行监督,具体以本合同第十四部分“利益冲突及关联交易”约定的“关联交易范围”为准。管理人应于本计划成立前提供关联方名单,并在合同期限内根据变化及时更新关联方名单。若管理人没有及时提供关联方信息,导致托管人无法及时对关联方证券进行监督,相关责任由管理人承担。

(七) 如因投资需要或法律法规修改导致托管人监督事项发生变化的,各方

除履行必要的合同变更流程外，还应为托管人调整监督事项留出必要的时间。

## 第二十部分 资产管理计划财产的估值和会计核算

### 一、估值目的

资产管理计划财产估值的目的是客观、准确地反映计划资产的价值，依据经计划资产估值后确定的计划资产净值计算资产管理计划份额净值，是计算计划参与和退出价格的基础。

### 二、估值时间

资产管理人在每个交易日对计划财产进行估值。

### 三、估值对象

本计划财产项下所有的债券、基金、以及银行存款本息、应收款项、其他投资等资产及负债。

### 四、估值方法及其调整

#### （一）股票估值方法

1、上市流通股票按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，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、未上市股票的估值

（1）首次发行未上市的股票，采用估值技术确定公允价值；

（2）在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行、首次公开发行时股票公司股东公开发售以及通过大宗交易取得的有明确限售期的

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) 送股、转增股、配股和增发新股等发行未上市的股票，按估值日在证券交易所上市的同一股票的收盘价进行估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值。

## (二) 债券估值方法

1、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全价进行估值。

2、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全价或推荐估值全价进行估值。对于含投资者回售权的固定收益品种，行使回售权的，在回售登记日至实际收款日期间建议选取第三方估值基准服务机构提供的相应品种的唯一估值全价或推荐估值全价，同时充分考虑发行人的信用风险变化对公允价值的影响。回售登记期截止日（含当日）后未行使回售权的，按照长待偿期所对应的价格进行估值。

3、对于在交易所市场上市交易的公开发行的可转换债券等有活跃市场的含转股权的债券，实行全价交易的债券选取估值日收盘价作为估值全价；实行净价交易的债券选取估值日收盘价并加计每百元税前应计利息作为估值全价。

4、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（票据）和私募债，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全价或推荐估值全价进行估值。

5、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，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定其公允价值。

6、对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全价估值。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全价或推荐估值全价估值。对于含投资人回售权的固定收益品种，行使回售权的，在回售登记日至实际收款日期间，选取第三方估值机构提供的相应品种的唯一估值全价或推荐估值全价估值，同时充分考虑发行人的信用风险变化对公允价值的影响。回售登记期截止日（含当日）后未行使回售权的，按照延长待偿期所对应的价格进行估值。

7、在任何情况下，管理人如采用本项第1-6小项规定的方法对计划资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果管理人认为按本项第1-6小项规定的方法对计划资产进行估值不能客观反映其公允价值的，计划管理人在综合考虑市场成交价、市场报价、流动性、收益率曲线等多种因素基础上形成的债券估值，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。

### （三）基金估值方法

1、在证券交易所挂牌交易的封闭式基金按估值日收盘价估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按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重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值；封转开期间的封闭式基金按估值日基金份额净值估值，估值日基金净值未公布的，按此前最近公布的基金净值估值。

2、在证券交易所挂牌交易的ETF基金、LOF基金场内部分按估值日收盘价估值；估值日没有交易的，以最近交易日的收盘价估值。

3、在场外交易的开放式基金（含LOF基金场外部分）按估值日前一交易日基金份额净值估值；估值日前一交易日没有基金份额净值的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近公告的基金份额净值估值；如果估值日前一交易

日无基金份额净值，且最近交易日后经济环境发生重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日基金份额净值，确定公允价值进行估值。

4、处于封闭期的开放式基金，以最近公布的基金份额净值估值；如果估值日前无基金份额净值，按成本进行估值。

5、货币市场基金的收益以基金公布的前一日万份收益计提。

如遇到基金拆分、到期、转型等情况，管理人根据基金公告与托管人共同协商确定估值方法。

公开募集基础设施证券投资基金按照法律法规规定确定其公允价值。

其他资产管理产品（含固定收益类公募银行理财、私募证券投资基金、信托计划等），按最近公布的产品净值估值。

（四）货币资金按照约定利率在持有期内逐日计提应收利息，在利息到账日以实收利息入账。

#### （五）其他资产的估值方法

以合理评估能够反映公允价值的第三方定期提供的净值估值，如无能反映公允价值的第三方估值，采用估值技术确定公允价值。

（六）如资产管理人或资产托管人发现资产估值违反本合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护投资者利益时，应立即通知对方，共同查明原因，双方协商解决。

### 五、估值程序

（一）本计划单位净值=集合计划资产净值/集合计划总份额。集合计划单位净值的计算精确到0.0001元，小数点后第五位四舍五入。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。集合计划资产净值的计算精确到

0.01 元，小数点后第三位四舍五入。

(二) 管理人在每个交易日(T日)对当日(T日)的计划财产进行估值,估值原则应符合本合同及其他法律、法规的规定。管理人完成估值后,于当日以双方认可的方式将估值结果发送托管人,由托管人进行复核。

(三) 本计划财产净值计算和会计核算的义务由管理人承担。因此,就与本计划财产有关的会计问题,会计责任方是管理人。如经相关各方在平等基础上充分讨论后,仍无法达成一致意见,以管理人对本计划财产净值的计算结果为准,由此给投资者或资产管理计划造成损失的由资产管理人承担责任。

## 六、估值错误的处理

(一) 管理人和托管人将采取必要、适当、合理的措施确保本计划财产估值的准确性、及时性。当资产管理计划份额净值小数点后4位以内(含第4位)发生差错时,视为资产管理计划份额净值错误。

### (二) 估值错误的处理原则和方法

#### 1、估值错误处理原则

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

#### 2、估值错误的处理方法

(1) 管理人计算的资产管理计划净值已由托管人复核确认,但因资产估值错误给计划份额持有人造成损失的,由管理人与托管人按照过错各自承担相应的责任。因估值导致资产管理计划份额净值出现错误时,管理人应当立即纠正,并

采取合理的措施防止损失进一步扩大。

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

(3) 由于一方当事人提供的信息错误, 另一方当事人在采取了必要合理的措施后仍不能发现该错误, 进而导致资产管理计划净值计算错误造成投资者的损失, 以及由此造成以后交易日计划资产净值计算顺延错误而引起的投资者的损失, 由提供错误信息的当事人一方负责赔偿。

(4) 管理人按本合同约定的按公允价值进行估值时, 所造成的误差不作为计划资产估值错误处理。

## 七、估值调整的情形与处理

(一) 管理人作为估值的第一责任人, 应定期评估第三方估值机构的估值质量, 并对估值价格进行检验, 防范可能出现的估值偏差。当出现投资品估值偏差, 估值机构发布的估值不能体现公允价值时, 管理人应综合第三方估值机构估值结果, 经与托管人协商, 谨慎确定公允价值, 并按相关法规的规定, 发布相关公告, 充分披露确定公允价值的方法、相关估值结果等信息。

(二) 如有确凿证据表明按本合同约定的估值方法进行估值不能客观反映本计划公允价值的, 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。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。

## 八、暂停估值的情形

(一) 与本资产管理计划投资有关的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时;

(二) 因不可抗力或其它情形致使管理人、托管人无法准确评估计划财产价

值时；

(三)如出现管理人认为属于紧急事故的任何情况，会导致管理人不能出售或评估计划财产的；

(四)中国证监会和本合同认定的其它情形。

#### 九、资产管理计划份额净值的确认

计划财产净值和计划份额净值由管理人负责计算，管理人和托管人于每个交易日按照双方约定的方式进行核对确认。

#### 十、特殊情况的处理

(一)管理人或托管人按上述估值方法进行估值时，所造成的误差不作为计划财产估值错误处理。

(二)由于不可抗力原因，或由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误，或国家会计政策变更、市场规则变更等，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，但未能发现该错误的，由此造成的计划财产估值错误，管理人和托管人可以免除赔偿责任。但管理人、托管人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

#### 十一、资产管理计划的会计政策

本计划的会计政策比照现行政策并按照本合同约定执行：

(一)资产管理人为计划财产的会计责任方；

(二)计划财产的会计年度为公历年的1月1日至12月31日；

(三)计划财产的会计核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位；

(四)会计制度执行国家有关的会计制度；

(五)本计划财产单独建账、单独核算；

(六) 资产管理人应保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关规定编制计划财产会计报表；

(七) 托管人应定期与管理人就资产管理计划的会计核算、报表编制等进行核对。

## 第二十一部分 资产管理计划的费用与税收

### 一、资产管理计划的费用种类

(一) 资产管理人的管理费；

(二) 资产托管人的托管费；

(三) 资产管理人依据本合同约定收取的业绩报酬；

(四) 计划财产划拨支付的银行费用；

(五) 计划财产的投资交易费用；

(六) 本计划存续期内以及终止清算过程中与本计划有关的信息披露费用、会计师费（包含审计费）、律师费、诉讼费（如有）和违约处置费用（如有）；

(七) 按照法律法规及本合同约定可以在本计划财产中列支的其他费用。

### 二、资产管理计划费用的费率、计提标准、计提方式与支付方式

(一) 资产管理人的管理费

在通常情况下，资产管理计划管理费按前一日资产管理计划资产净值的【0.8】%年费率计提（为免疑义，本款按固定费率计提的管理费与下文约定的业绩报酬共同构成管理人收取的管理费）。计算方法如下：

$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$ ，本资产管理计划年管理费率为【0.8】%

H为每日应计提的资产管理计划管理费

E 为前一日资产管理计划资产净值

自本计划成立日起,管理人的管理费每日计算,逐日累计至每月月底,按月支付,由托管人根据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。

管理人可根据市场行情及本集合计划运作情况,经与托管人协商一致后,调低管理费率,以管理人网站公告为准。若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。

## (二) 资产托管人的托管费

在通常情况下,资产管理计划托管费按前一日资产管理计划资产净值的【0.01】%年费率计提。计算方法如下:

$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$ , 本资产管理计划年托管费率为【0.01】%

H 为每日应计提的资产管理计划托管费

E 为前一日资产管理计划资产净值

自本计划成立日起,托管人的托管费每日计算,逐日累计至每月月底,按月支付,由托管人根据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。

托管人可根据市场行情及本集合计划运作情况,经与管理人协商一致后,调低托管费率,以管理人网站公告为准。若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。管理人在约定的托管费支付日未向托管人发送托管费划付指令的,托管人有权在托管费支付日当日或后续任一日自行扣收全部或部分应付未付托管费。费用自动划扣后,托管人应向管理人告知托管费支付金额及计算方式,管理人应进行核对,如发现数据不符,及时联系托管人协商解决。

托管人指定托管费收费账户信息如下:

开户名称: 资产托管部其他应付托管收入

开户行：苏州银行股份有限公司

账号：70666050015622411206000001

### 三、业绩报酬（如有）的计提原则、计算方法、计提比例和提取频率

#### 1. 管理人收取业绩报酬的原则：

（1）按投资者每笔参与份额分别计算年化收益率并计提业绩报酬，如期间业绩报酬计提基准、计提比例出现调整，每笔参与份额分段计算年化收益率并在业绩报酬计提日分段计算业绩报酬；

（2）在符合业绩报酬计提条件时，在计划分红登记日（具体以届时的分红公告为准，下同）、投资者退出日和计划终止日（合称“业绩报酬计提日”）计提业绩报酬，业绩报酬应当从分红资金、退出资金或清算资金中提取，从分红资金中提取业绩报酬的频率不得超过每6个月一次；

（3）业绩报酬从分红资金、退出资金或清算资金中扣除；

（4）在计划分红登记日，管理人对全部存续份额计提业绩报酬；在投资者退出或计划终止时，业绩报酬按投资者退出份额或计划终止时持有份额计算。如退出份额包括一笔参与份额的一部分，则将该部分参与份额视为一笔参与份额进行核算，剩余未退出的份额不受影响。

#### 2. 业绩报酬的计提方法：

（1）于业绩报酬计提日，若持有期年化收益率  $R$  小于业绩报酬计提基准  $b$ ，管理人不提取业绩报酬。

（2）于业绩报酬计提日，若持有期年化收益率  $R$  大于或等于业绩报酬计提基准  $b$ ，管理人提取超出部分的一定比例作为业绩报酬，具体计算方法见下文“（4）管理人以超额比例的方式提取业绩报酬”。

（3）“持有期年化收益率”系指上一个发生业绩报酬计提的业绩报酬计提

日（如上一个发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日不存在，募集期参与的为计划成立日，存续期参与的为申购参与申请当日，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年化收益率。持有期年化收益率的计算公式如下：

$$R = \frac{P_1 - P_0}{P} \times \frac{365}{N} \times 100\%$$

R 为各段持有期年化收益率

P1 为业绩报酬计提日的本计划单位累计净值；

P0 为上一个发生业绩报酬计提日的本计划单位累计净值；

P 为上一个发生业绩报酬计提日的本计划单位净值；

N 表示上一个发生业绩报酬计提日到本次业绩报酬计提日的天数。

#### （4）管理人以超额比例的方式提取业绩报酬

本集合计划设置区间式业绩报酬计提基准，业绩报酬计提基准区间为[b,a]，其中 a>b。管理人对年化收益率超过业绩报酬计提基准的收益部分进行分阶计提，当业绩报酬计提基准 b≤R<业绩报酬计提基准 a 时，管理人收取超过 b 以上部分收益的 40%作为业绩报酬；当 R≥业绩报酬计提基准 a 时，管理人收取超过 a 以上部分收益的 60%以及 a-b 部分收益的 40%作为业绩报酬。

年化收益率 (R)	计提比例	业绩报酬计提方法 (F)
R ≥ 业绩报酬计提基准 a	60%	F=[R-业绩报酬计提基准 a] × 60% × A × N/365+[业绩报酬计提基准 a-业绩报酬计提基准 b] × 40% × A × N/365
业绩报酬计提基准 b ≤ R < 业绩报酬计提基准 a	40%	F=[R-业绩报酬计提基准 b] × 40% × A × N/365
R < 业绩报酬计提基准 b	0	F=0

其中：

F：为管理人对投资者每笔参与（于在计划分红登记日与计划终止日，指投

资人持有的每一笔存续份额；于投资者退出申请日，指投资者退出的每一笔份额；下同）应提取的业绩报酬；

R：为各段持有期年化收益率；

A：为投资者每笔参与在上一个发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日的资产净值总额；

N：表示上一个发生业绩报酬计提日到本次业绩报酬计提日的天数。

业绩报酬计提基准区间为 $[b, a]$ ，其中  $a > b$

管理人将在产品成立前公布该产品的业绩报酬计提基准，若业绩报酬计提基准发生变化，以管理人公告为准。

管理人业绩报酬提取频率不得超过每6个月一次，但因投资者退出集合计划提取业绩报酬的，不受前述提取频率的限制。

于业绩报酬计提日，管理人有权收取的业绩报酬总额，为所有投资者参与笔数对应的管理人业绩报酬的总和。业绩报酬计提基准仅作为管理人提取业绩报酬的计算标准，不代表对资产管理计划未来收益的承诺或保证。管理人不保证资产管理计划一定盈利，也不保证最低收益。

#### （5）业绩报酬的支付

提取业绩报酬时，由管理人向托管人发送业绩报酬划款指令，托管人收到指令后从本集合计划资产中以现金的方式一次性支付给管理人。若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。管理人的业绩报酬由管理人负责计算，托管人不承担复核义务。

#### （6）业绩报酬的计算与复核

因涉及注册登记数据，业绩报酬的计算和复核工作由管理人完成。

### 四、本集合计划其他费用的支付

本集合计划托管账户划拨支付发生的银行结算费用等银行费用,由托管人直接从资金账户中扣划,无须管理人出具指令。本集合计划银行结算费用、银行间市场账户维护费、开户费、转托管、询证费、注册登记机构收取的相关费用等在发生时一次性计入集合计划费用。

计划财产投资交易费用指本集合计划进行各类投资品种的投资交易而形成的费用,包括但不限于:印花税、交易所经手费、证管费、银行间交易手续费、场外基金办理要求的申购赎回等费用、结算费、交易手续费、过户费、佣金、印花税、证券结算风险基金等各项费用,投资交易费用在交易发生时直接计入当期费用;以上各项费用的费率标准按照相关法规政策执行,其中本集合计划支付的佣金费率,由管理人根据有关政策法规确定。

本集合计划存续期内以及终止清算过程中与本计划有关的信息披露费用、会计师费(包含审计费)、律师费、诉讼费(如有)和违约处置费用(如有)以及按照国家有关规定可以列入的其他费用等,由托管人根据有关法规及相应协议的约定,根据管理人的指令,按费用实际支出金额从资产管理计划资产中支付,列入资产管理计划费用。

#### 五、不得列入资产管理计划财产费用的项目

资产管理计划成立前发生的费用,以及存续期间发生的与募集有关的费用,不得在计划资产中列支,专门投资于未上市企业股权的资产管理计划聘请专业服务机构等事项所支出的合理费用除外。

管理人和托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或资产管理计划财产的损失,以及处理与资产管理计划财产运作无关事项或不合理事项所发生的费用等不得列入资产管理计划的费用。

#### 六、费率的调整

投资者在此同意并授权管理人调低本计划相关费用或比例,在新费率实施前在管理人指定网站公告;管理人和托管人与投资者协商一致后,可根据市场发展

情况调高资产管理费率和资产托管费率,修改本合同并报中国证券投资基金业协会备案。

## 七、资产管理计划缴税安排

合同各方当事人根据国家法律法规的规定,履行纳税义务。投资者应缴纳的税收,由投资者负责,管理人不承担代扣代缴或纳税义务。

鉴于资产管理人在为本计划的利益投资、运用计划财产过程中,会因法律法规、税收政策的要求而成为纳税义务人,就归属于本计划的投资收益承担纳税义务。本计划运作过程中由于上述原因发生的增值税及增值税相关的附加税费(包括但不限于城建税、教育费附加及地方教育费附加)等税负,仍由本计划财产承担,届时由资产管理人向资产托管人发送划款指令,通过本计划托管账户直接缴付,或划付至资产管理人账户并由资产管理人依据税务部门要求完成税款申报缴纳。

如本计划财产进行清算后,发生管理人被税务机关要求补缴应由本计划资产及投资者承担的增值税及与增值税相关的附加税费的情况,投资者同意向管理人支付该补缴的税费,管理人有权向投资者就补缴的税费进行追偿。

## 第二十二部分 资产管理计划的收益分配

### 一、可供分配利润的构成

本集合计划收益包括集合计划利息收入、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。本集合计划净收益为集合计划收益扣除按照有关规定可以在集合计划收益中扣除的费用后的余额。

资产管理计划可供分配收益:截至收益分配基准日资产管理计划未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

### 二、收益分配原则和方式

(一) 本计划收益分配原则如下:

1、本计划存续期内,本计划份额净值大于1.00元时,管理人可根据投资运作情况决定是否向投资者分配收益,且分配后净值不得低于1.00元,每一计划份额享有同等分配权。具体分配方案、分配比例及收益分配时间以管理人公告为准。

2、本计划红利发放日原则上不超过收益分配基准日15个工作日,具体以管理人公告为准。

3、收益分配时,如果符合本合同约定的管理人业绩报酬计提条件的,将在收益分配的同时计提或提取管理人业绩报酬。

4、法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

(二) 本计划收益分配方式如下:

本计划默认分红方式为现金分红,投资者可以选择现金分红或红利再投资分红方式,具体以管理人公告为准。

投资者可以选择将所获红利再投资于本计划,选择采取红利再投资形式的,分红资金在扣除管理人业绩报酬(如有)后,按计划分红登记日的本计划每份额净值转成计划份额,免收参与费(红利再投资不受本合同约定的最低参与金额的限制)。每位投资者获得的分红收益金额或再投资份额保留小数点后2位,小数点2位以后的部分四舍五入,由此产生的误差产生的收益或损失由计划财产承担。

三、收益分配方案的确定、通知和实施

(一) 计划收益分配方案中应载明截至收益分配基准日计划收益分配对象、分配时间、分配数额、分配方式等内容。

(二) 计划收益分配方案由管理人拟订,由托管人复核,由管理人通知投资者。

(三) 收益分配方案确定后, 管理人依据具体方案的约定进行收益分配, 托管人依据收益分配方案配合执行管理人收益分配划款指令。

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, 不足于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。

本集合计划进行收益分配、本金归还时所涉及的相关税负由投资者自行承担, 管理人不承担代扣代缴等纳税义务。

## 第二十三部分 信息披露与报告

一、管理人应向投资者提供下列信息披露文件:

- (一) 资产管理合同、计划说明书和风险揭示书;
- (二) 资产管理计划净值, 资产管理计划参与、退出价格;
- (三) 资产管理计划定期报告, 至少包括季度报告和年度报告;
- (四) 重大事项的临时报告;
- (五) 资产管理计划清算报告;
- (六) 中国证监会规定的其他事项。

前款第(二)(三)项信息披露文件, 管理人披露时应当经托管人复核。

前款第(四)项、第(六)项信息披露文件, 管理人应当及时报送中国证监会相关派出机构。

二、资产管理计划运作期间, 管理人应向投资者披露以下信息:

(一) 净值报告

披露时间: 至少每周披露一次计划份额净值, 开放期内每个工作日披露计划

前1个工作日份额净值。

披露方式:通过管理人网站通告计划单位净值。

## (二) 季度报告和年度报告

1、管理人应于每季度结束之日起一个月内披露季度报告，每年度结束之日起四个月内披露年度报告，披露报告期内资产管理计划运作情况。本计划成立不足三个月或者存续期间不足三个月的，管理人可以不编制当期的季度报告和年度报告。上述报告应通过管理人网站通告。

2、年度报告内容应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、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。

3、季度报告应当披露前款除第（6）项之外的其他信息。

4、资产管理计划年度财务会计报告应当经符合《证券法》规定的会计师事务所审计，审计机构应当对资产管理计划会计核算及净值计算等出具意见。

### （三）托管人履职报告

1、托管人履职报告作为管理人季度报告、年度报告内容的一部分，由托管人完成管理人季度报告、年度报告的复核工作后，确定托管人履职报告内容并向管理人反馈，由管理人根据本合同约定的方式向投资者披露。托管人履职报告内容包括托管人履职情况、对管理人投资运作的监督情况及有关报告财务数据的复核意见等。

2、管理人应当在每季度结束后 20 日内向托管人提供其编制的季度报告、当期财务会计报告（如有）供托管人复核，托管人复核管理人季度报告、当期财务会计报告中的财务数据后，于 10 日内向管理人反馈复核意见。

3、管理人应当在每年度结束后两个月内向托管人提供其编制的年度报告、当期财务会计报告供托管人复核，托管人复核管理人年度报告、当期财务会计报告中的财务数据后，于一个月内向管理人反馈复核意见。

4、因资产管理计划成立不足三个月或者存续期间不足三个月，管理人未编制资产管理计划当期的季度报告和年度报告的，托管人不编制当期托管人履职报告。

### 三、临时报告

发生资产管理合同约定或可能影响投资者利益的重大事项时，在事项发生之日起五日内向投资者披露。临时报告的情形包括但不限于：

- 1、集合计划运作过程中，投资经理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放受理参与或者退出申请；
- 3、发生巨额退出并延期支付；
- 4、集合计划终止和清算；

- 5、集合计划存续期满并展期；
- 6、合同的补充、修改和变更；
- 7、证券期货经营机构及其子公司以自有资金参与和退出；
- 8、与集合计划有关的重大诉讼、仲裁事项；
- 9、负责本计划的推广机构发生变更；
- 10、集合计划投资于管理人及与管理人有关联方关系的公司发行的证券；
- 11、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管；
- 12、管理人、托管人因解散、破产、撤销等原因不能履行相应职责；
- 13、集合计划分红；
- 14、其他管理人认为的重大事项。

#### 四、向投资者提供报告及投资者信息查询的具体方式

##### （一）投资者信息查询范围

投资者可根据本合同约定的时间和方式查阅或复制计划所披露的信息资料。

##### （二）投资者向管理人查询信息的方式

管理人通过以下至少一种方式进行披露信息即视为履行了告知义务，投资者可通过以下方式向管理人查阅本合同约定披露的信息资料：

##### 1、资产管理人网站

定期报告、份额净值报告、临时报告等本合同约定披露的信息资料将在管理人网站上（<http://www.hazq.com>）披露，投资者可随时查阅。

##### 2、传真或电子邮件

如投资者留有传真号、电子邮箱等联系方式的，管理人也可通过传真、电子

邮件等方式将本合同约定披露的信息资料告知投资者。

### （三）投资者向托管人查询信息的方式

1、投资者可通过电话、传真或电子邮件等联系方式，经由管理人向托管人查询有关信息披露资料。

2、对于管理人向投资者提供的文件材料中不在托管人复核职责范围内的信息，应由管理人保证该等信息的真实性、有效性、合法性。

3、对于因管理人未提供或未及时提供应由托管人复核的相关信息披露文件等客观因素，导致托管人无法履行或无法按时履行相应复核职责的，由过错方承担相应责任。

### （四）投资者向受托销售机构查询信息的方式（如有）

若本计划管理人委托销售机构销售本计划的，投资者可通过委托销售机构网站及指定的交易软件查阅本合同约定披露的信息资料。

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

### 六、管理人、托管人向监管机构报告的种类、内容、时间等相关事项

1、管理人应当于每月十日前向相关监管机构报送本计划的持续募集情况、投资运作情况、资产最终投向等信息。

2、管理人应当在每季度结束之日起一个月内，编制私募资产管理业务管理季度报告，并报送相关监管机构。管理人、托管人应当在每年度结束之日起四个月内，分别编制私募资产管理业务管理年度报告和托管年度报告，并报送相关监管机构。

3、资产管理计划成立之日起五个工作日内，将资产管理合同、投资者名单与认购金额或者资产缴付证明等材料报协会备案；自资产管理合同变更之日或资

产管理计划终止之日起五个工作日内报协会备案,资产管理计划清算结束后五个工作日内将清算报告报协会备案。资产管理计划因受托财产流动性受限等原因延期清算的,及时向中国证监会相关派出机构报告。

4、出现以下情形时,管理人应及时向中国证监会相关派出机构和协会报告:

(1)为应对集合资产管理计划巨额赎回以解决流动性风险,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,证券期货经营机构及其子公司以自有资金参与及其后续退出集合资产管理计划突破关于以自有资金投资集合计划的限制规定。

(2)公司董事、监事、从业人员及其配偶、控股股东、实际控制人或者其他关联方参与本公司设立的资产管理计划。

(3)因证券期货市场波动、证券发行人合并、资产管理计划规模变动等证券期货经营机构之外的因素导致资产管理计划投资不符合法律、行政法规和中国证监会规定的投资比例或者合同约定的投资比例的,管理人应当在流动性受限资产可出售、可转让或者恢复交易的二十个交易日内调整至符合相关要求。确有特殊事由未能在规定时间内完成调整的,及时向中国证监会相关派出机构报告。

(4)从事关联交易。

(5)出现重大风险事件。

5、托管人监督管理人的投资运作,发现管理人的投资或清算指令违反法律、行政法规、中国证监会的规定或者资产管理合同约定的,应当拒绝执行,并向中国证监会相关派出机构报告。

6、其他需要向监管机构报告的事项,管理人、托管人将根据《指导意见》《管理办法》《运作规定》及其他法律法规、监管规定及要求及时进行及时报告。

7、中国证监会及相关派出机构、协会对管理人、托管人上述向其备案和报告事项要求有调整的,按中国证监会及相关派出机构、协会最新要求执行。

## 第二十四部分 风险揭示

一、资产管理计划投资将可能面临下列各项风险，包括但不限于：

### （一）特殊风险揭示

若存在以下事项，应特别揭示风险：

#### 1、资产管理合同与中国证券投资基金业协会合同指引不一致所涉风险

本计划合同条款不可避免的和 2023 年 12 月 15 日中国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》不完全相同，更为复杂、更为具体，因此带来的风险由本计划财产和投资者承担。

#### 2、资产管理计划委托募集所涉风险

本计划管理人可委托销售机构销售本计划，受托销售机构销售本计划时，可能存在包括但不限于如下违法违规行而令投资者面临计划募集风险：

（1）销售机构采用公开宣传或变相公开宣传的方式销售本资产管理计划。

（2）销售机构进行虚假宣传，或通过任何方式以保本保收益误导投资者，或推介材料存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

（3）销售机构违反《管理办法》和《运作规定》的有关规定，未审查投资者是否满足合格投资者相关条件，未对投资者的风险识别能力和风险承受能力进行鉴别，未履行投资者适当性审查义务。

（4）销售机构对于本计划风险收益特征的评估与表述可以和管理人不同，可能存在本计划资产管理合同、风险揭示书或计划说明书中的风险收益特征表述与销售机构对本计划风险评级结果不一致的风险。投资者在投资本计划前，必须按照销售机构的标准和要求完成其对于投资者于本计划的客户适当性匹配检验及其他适当性义务。

(5) 销售机构可能因未在中国证监会注册取得资产管理计划销售业务资格或未成为中国证券投资基金业协会会员而不具备受托募集资产管理计划的资格。

(6) 销售机构从业人员可能未经正式授权即从事资产管理计划募集活动。

(7) 销售机构可能存在将资产管理计划募集结算资金归入其自有财产、挪用资产管理计划募集结算资金、侵占计划财产和客户资金等违法活动。

(8) 销售机构可能与管理人之间存在关联关系，可能存在未向投资者充分披露与管理人之间的关联关系，未针对代销关联方产品建立专门的利益冲突识别、评估和防范机制，未做到有效防范利益冲突，并因此导致投资者利益受到损害。

### 3、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。

资产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，利息金额以本计划注册登记机构的记录为准，投资者已缴纳款项未划转至达本计划销售募集账户的除外。

### 4、资产管理计划未在中国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

本计划未在中国证券投资基金业协会完成备案手续或不予备案情形可能导致管理人无法按原计划建仓和投资，管理人应将投资者前期已存入托管账户中资金原路返回，在此期间暂不计息。

### 5、资产管理计划份额转让所涉风险

依据相关法律法规约定，在集合计划存续期间，投资者可以通过柜台交易市场等中国证监会认可的交易平台转让集合计划份额。在办理转让业务时可能出现的风险包括但不限于：

#### （1）操作系统风险

办理转让操作的系统可能因某些人为或客观原因出现故障，从而影响转让业务办理。

#### （2）折溢价风险

份额可以办理转让后，份额的交易价格与其计划份额单位净值之间可能发生偏离并出现折/溢价交易的风险。

6、本计划未设置份额持有人大会，不存在所涉风险。

7、本计划未聘请外包服务机构，不存在所涉风险。

8、投资股权类资产所涉风险（如有）

本计划投资标的的价值取决于投资对象的经营状况，原股东对所投资企业的管理和运营，相关市场宏观调控政策、财政税收政策、产业政策、法律法规、经济周期的变化以及区域市场竞争格局的变化等都可能影响所投资企业经营状况，进而影响资产管理计划投资标的的价值。

#### （1）参与股票投资的风险（如有）

本集合计划投资于国内依法发行的股票，会面临因投资标的、市场制度及交易规则等带来的特有风险。

#### （2）新股申购风险（如有）

新股申购风险是指获配新股上市后其二级市场交易价格下跌至申购价格以下的风险。

#### （3）投资流通受限股票的风险（如有）

本集合计划投资范围包括定向增发（如有），定向增发后获配股票有一定的锁定期，锁定期股票无法变现，同时锁定期股票价格受市场因素、宏观因素等影响，股票价格有可能下跌至增发价格以下，且因股票流通受限管理人无法进行止损操作，本集合计划存在承担大幅亏损的风险。

#### （4）科创板投资风险（如有）

科创板企业所处行业和业务往往具有研发投入规模大、盈利周期长、技术迭代快、风险高以及严重依赖核心项目、核心技术人员、少数供应商等特点，企业上市后的持续创新能力、主营业务发展的可持续性、公司收入及盈利水平等仍具有较大不确定性，由此带来股价波动的投资风险。

#### （5）参与新三板的投资风险（如有）

挂牌公司的状况受多种因素影响，如市场、技术、竞争、管理、财务等都会导致公司盈利能力发生变化，从而导致本集合计划投资收益波动的风险。

### 9、从事关联交易的风险

管理人可能运用本计划从事关联交易，相关投资存在一定风险，提请投资者知悉、充分关注。投资者可能面临本计划关联方名单获取、界定、识别不准确、不完整、不及时导致管理人无法及时准确识别相关关联交易以至于本计划从事关联交易未能事后及时向投资者披露，或者从事前述重大关联交易未事先征询投资者意见以及其他可能的相关风险，以及投资者认知的本计划关联方、一般和重大关联交易的区分标准和管理人采用的名单和标准不完全一致的风险。

重大关联交易发生前，管理人将通过官网公告或其他指定的形式向投资者征询意见，投资者的反馈方式和时限均由管理人确定，可能存在投资者在管理人或销售机构留存的联系信息不准确、未更新而无法及时接到通知，或未及时查阅相关通知，最终导致未及时反馈意见的风险；或投资者未按要求明确回复意见，或明确回复不同意后未及时提出退出申请，从而导致进行该笔重大关联交易与投资者主观意愿不相符的风险。

投资者签署本合同即视为已经充分理解并同意管理人可以以本计划资产从事一般关联交易，存在投资者无法事前知悉每一笔一般关联交易的风险。

#### 10、债券回购风险

债券回购为提升整体组合收益提供了可能，但也存在一定的风险。债券回购的主要风险包括信用风险、投资风险及杠杆的风险。其中，信用风险指回购交易中交易对手在回购到期时，不能偿还全部或部分证券或价款，造成净值损失的风险；投资风险是指在进行回购操作时，回购利率大于债券投资收益而导致的风险以及由于回购操作导致投资总量放大，致使整个组合风险放大的风险；而杠杆的风险是指在进行回购操作时，在对组合收益进行放大的同时，也对组合的波动性（标准差）进行了放大，即组合的风险将会加大。回购比例越高，风险暴露程度也就越高，对净值造成损失的可能性也就越大。

#### 11、本计划提前终止的风险

若发生本计划约定的提前终止情形，管理人有权在履行合同约定的信息披露义务后进行本计划的提前终止。由此将可能导致投资者无法按照设想妥善安排其投资计划，或无法按照本合同约定的时间收回其持有份额所对应的资产管理计划财产以及收回金额不及预期等风险。

#### 12、投资公开募集证券投资基金的风险

本计划所投资的公开募集证券投资基金可能由于其基金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基金净值的下降，从而造成集合计划净值下降，最终导致集合计划投资者资产损失。此外，如公募基金管理人延期兑付产品的本金或收益，则对投资者的流动性需求有所影响。

### （二）一般风险揭示

#### 1、本金损失风险

资产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。

本计划属于R2风险投资品种，适合风险识别、评估、承受能力C2、C3、C4和C5的合格投资者。

## 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：

### （1）政策风险

货币政策、财政政策、产业政策和证券市场监管政策等国家政策的变化对证券市场产生一定的影响，可能导致证券价格波动，从而影响收益。

### （2）经济周期风险

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

### （3）利率风险

金融市场利率波动会导致资产价格和资产利息的损益，同时直接影响企业的融资成本和利润水平，导致证券市场的价格和收益率的变动，使集合计划的收益水平产品随之发生变化，从而产生风险。

### （4）购买力风险

投资者的利润主要通过现金形式来分配，而现金可能因为通货膨胀的影响而导致购买力下降，从而使投资者的实际收益下降。

### （5）再投资风险

由于金融市场利率下降造成的无法通过再投资而实现收益的风险。

## (6) 上市公司经营风险

上市公司的经营状况受多种因素影响，如市场、技术、竞争、管理、财务等都会导致公司盈利发生变化，从而导致集合计划投资收益变化。

## (7) 衍生品风险

金融衍生品具有杠杠效应且价格波动剧烈，会放大收益或损失。

## 3、管理风险

资产管理计划运作过程中，资产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

集合计划在交易过程中发生交收违约，或者集合计划所投资债券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，或由于债券发行人信用质量降低导致债券价格下降，造成集合计划资产损失的风险。

## 6、税收风险

本计划所适用的税收征管法律法规可能会由于国家相关税收政策调整而发生变化，投资者收益也可能因相关税收政策调整而受到影响。

## 7、通过第三方销售平台投资开放式基金的风险

本资产管理计划可通过第三方基金销售机构投资开放式基金，资产管理人负责选择销售机构，并应确保在销售机构预留的备案回款账户为银行托管账户。资

产托管人对于通过第三方基金销售机构投资开放式基金不承担任何风险。

由于通过第三方销售平台购买，可能会存在认（申）购、赎回（现金分红）基金时资金被挪用的风险；第三方销售平台对基金账户管理不当造成投资人持有基金份额不准确的风险；认（申）购款未能用于购买指定基金的风险；以及第三方基金销售平台无基金销售资质的风险。

#### 8、投资者参与、退出集合计划风险

(1) 本计划投资者人数上限为 200 人。本计划投资者达到一定人数时，管理人有权停止认/申购。投资者可能面临因上述原因而无法参与本计划的风险。

(2) 当管理人发现投资者申请部分退出本计划将致使其在部分退出申请确认后持有的计划份额所对应的资产净值低于本合同约定的最低参与金额（不含参与费用）的，管理人可能采取强制赎回或赎回部分确认失败导致客户退出金额与申请份额对应的资金不一致所涉及的风险。

#### 9、投资者风险承受能力与本集合计划风险等级不匹配的风险

投资者应按照管理人或者销售机构的要求，真实、准确、完整的提供信息、资料，包括但不限于投资者身份、财产与收入状况、证券投资经验、风险承受能力、诚信记录和投资偏好等信息，若投资者提供的信息、资料存在虚假、不完整、不准确情形或者上述信息发生变化定期更新不及时，可能导致投资者风险承受能力等级与本集合计划不匹配，最终投资者可能遭受超出其承受能力的风险。

#### 10、业绩报酬计提基准未能达到及可能变化的风险

本合同“业绩报酬计提基准”仅是管理人提取业绩报酬的基准，也是管理人在运作期内投资管理努力的方向和目标，业绩报酬计提基准不是预期收益和保证收益率，不构成管理人对受托财产的任何承诺或担保，投资者仍可能面临实际收益达不到业绩报酬计提基准甚至本金受损的风险。同时业绩报酬计提基准由管理人根据投资策略和资产组合及市场变化趋势等确定，可能发生变化，最终以管

理人披露为准。

#### 11、业绩报酬提取风险

在满足本集合计划提取业绩报酬的前提下,管理人可以对集合计划账户提取业绩报酬,但在业绩报酬提取后若账户单位净值下降,已提取的业绩报酬不予返还。

#### 12、净值披露信息与投资者实际收益不一致的风险

管理人按照合同约定对本计划投资的资产进行估值,可能因费用计提、业绩报酬计提、底层资产的管理人/受托人(如有)提供的资产价值不准确或未及时更新等因素,致使本计划披露的净值可能与投资者实际收益不一致。投资者的实际收益以管理人最终分配的实际收益为准。

#### 13、反洗钱报送安排相关风险

根据《中华人民共和国反洗钱法》《金融机构反洗钱规定》《金融机构反洗钱和反恐怖融资监督管理办法》《金融机构客户尽职调查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》《金融机构洗钱和恐怖融资风险评估及客户分类管理指引》及相关的法律法规、监管规定,管理人、销售机构将向监管机构报送反洗钱信息,且前述报送安排及报送内容属管理人、销售机构保密信息,投资者无权知悉,投资者签署本合同,则视为知悉并同意前述安排。

#### 14、交易所资金前端控制带来的风险

本资产管理计划由管理人作为交易参与人通过关联交易单元在上海和深圳证券交易所进行证券交易。根据《证券交易资金前端风险控制业务规则》等有关规定,证券交易所、证券登记机构对交易参与人相关交易单元的全天净买入申报金额总量实施额度管理,并通过交易所对交易参与人实施前端控制。可能存在如下风险:

(1) 管理人操作失误，合计资产总额发生变动导致最高额度未能及时变更等，存在影响产品正常交易、无法有效进行风险控制等风险。

(2) 因不可抗力、意外事件、技术故障或者重大差错等原因导致资金前端控制出现异常，中国结算及沪、深交易所采取最高额度调整、暂停资金前端控制、限制交易单元接入等处置措施，产生业务风险。

本资产管理计划可能因上述业务规则而无法完成某笔或某些交易，由此造成的损益由计划财产承担。

#### 15、使用电子签名合同的风险

本计划可以采用电子签名方式签署，可能存在因网络中断或不运作、传送安全系统失灵、系统遭受非法攻击等多种因素造成数据的损坏或丢失。电子签名合同签订后，投资者凭密码进行交易，投资者通过密码登录后所有操作均将视同本人行为，如投资者设置密码泄露，可能导致他人在未经授权的情况下操作份额持有人指定资金账户，给投资者造成潜在损失。

#### 16、合同变更和合同展期风险

管理人就合同变更和合同展期征求投资者意见期间，未明确提出异议的投资者、不同意合同变更但逾期未提出退出申请的投资者均视为同意修改或变更合同、合同展期和计划说明书。部分投资者可能因为未能提供有效的联系方式或者未能将变动后的联系方式及时通知管理人，而无法及时获知合同变更事项，如果投资者因上述情况未能按时退出本计划，可能会被视为同意合同变更和合同展期，从而存在风险。

#### 17、其他风险

包括但不限于证券期货经营机构自有资金参与和退出的风险、技术风险和操作风险、发生不可抗力事件的风险等。

##### (1) 证券期货经营机构自有资金参与和退出的风险

投资者签署本合同即视为同意证券期货经营机构及其子公司以自有资金在募集期参与本计划。证券期货经营机构及其子公司在存续期以自有资金参与、退出本计划，应当提前5个工作日告知全体投资者和托管人，管理人提前5个工作日在其网站发布公告即视为履行了告知义务。证券期货经营机构及其子公司在募集期自有资金参与的以及存续期因本计划规模变动等因素导致自有资金参与比例被动预警或者超标需退出的，无需事前公告。

证券期货经营机构及其子公司自有资金参与、退出事项公告后，如投资者未在开放期选择退出本计划即视为已经充分理解并同意管理人已公告的自有资金参与、退出事项。证券期货经营机构及其子公司自有资金参与和退出行为可能使本计划面临再投资风险或流动性风险，从而影响计划损益，管理人将认真履行相关职责，关注计划规模变动情况。

#### (2) 技术风险

在本计划的各种交易行为或者后台运作中，可能因为管理人、托管人、注册登记机构、销售机构、证券交易所、证券登记结算机构等IT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。

#### (3) 操作风险

相关当事人在业务各环节操作过程中，因内部控制存在缺陷或者人为因素造成操作失误或者违反操作规程等导致的风险。

#### (4) 不可抗力风险

战争、自然灾害、金融市场危机等不可抗力因素的出现，将会严重影响证券市场的运行，从而带来的风险。

二、管理人应当单独编制风险揭示书作为合同附件。投资者应充分了解并谨慎评估自身风险承受能力，并做出自愿承担风险的陈述和声明。

## 第二十五部分 资产管理合同的变更、终止与财产清算

### 一、资产管理合同的变更

(一)一般情形下的合同变更,管理人和托管人应事先书面达成一致,经托管人同意后的合同拟变更内容应当及时在管理人网站公告,公告内容应包含但不限于以下内容:合同变更的内容、不同意变更的投资者的退出安排。管理人须在公告后5个工作日内以通过管理人网站或其他适当方式向投资者发送合同变更征询意见。投资者不同意变更的,应在公告发布之日起至公告规定的退出申请截止日前,按公告规定的方式提出退出本集合计划的申请,投资者未在规定时间内提出退出申请的,视为同意合同变更。对于合同变更期间本计划产品风险等级发生变化且投资者风险承受能力不再匹配产品风险等级的,管理人有权做强制退出处理(退出价格为退出当日的计划份额净值)。但本合同约定资产管理人有权与资产托管人协商一致后变更合同内容的情形除外,包括:

1. 投资经理的变更。

2. 资产管理计划认购或参与、退出,份额转让,非交易过户的原则、时间、业务规则等变更。

3. 调低资产管理计划相关费用或业绩报酬计提比例。

4. 对资产管理合同的变更不涉及合同当事人权利义务关系发生重大变化,且对投资者利益无实质性不利影响。

本计划改变投资范围和投资比例的,应当事先取得投资者同意。

本计划变更生效后,投资者有权在本计划任意开放日按本合同的约定申请退出。

(二)因监管规则变化,需要变更资产管理合同的,管理人可以与托管人协商后更新或修改资产管理合同,并由管理人向投资者披露变更内容,更新或修改的内容在管理人网站公告满1个工作日后生效。

(三) 管理人应当保障投资者选择退出资产管理计划的权利, 公平、合理安排相关后续事项, 具体以管理人公告为准。

(四) 本计划需要变更管理人或者托管人的, 不包含本款第(五)项的情形, 参照本款第(一)项履行合同变更程序。

(五) 因发生下列事项需要变更合同的:

1、管理人因被依法撤销资产管理业务资格或者依法解散、被撤销、宣告破产等原因不能履行管理人职责, 资产管理计划由其他管理人承接;

2、托管人因被依法撤销基金托管资格或者依法解散、被撤销、宣告破产等原因不能履行托管人职责, 资产管理计划由其他托管人承接。

投资者在此同意, 如果上述事件发生, 在管理人/托管人和受让人协商一致的基础上, 管理人有权将本合同中由管理人享有的权利和管理人承担的义务转让给其他从事资产管理业务的公司、将本合同中由托管人享有的权利和托管人承担的义务转让给其他从事托管业务的公司, 并均无须就此项变更与投资者另行签署专项协议。但在转让前管理人应以信息披露的形式通告投资者, 管理人保障投资者退出本计划的权利, 并在相关通告中对退出事项做出合理安排。

管理人特别提示, 合同变更可能涉及投资者的各项权益调整(包括但不限于权利义务的重大变动, 管理费、托管费、业绩报酬计提基准及比例的提高或降低等), 投资者应实时关注管理人网站(<http://www.hazq.com>)公告; 投资者同意, 无论其是否同意合同变更或提出退出申请, 管理人通过网站公告的方式视为已合理征询投资者的意见; 投资者同意, 无论其是否同意合同变更或提出退出申请, 管理人在与托管人达成一致意见并通过管理人网站或其他适当方式向投资者发送合同变更征询意见后, 按照上述程序变更本合同属于投资者认可的行为。

二、本合同发生变更的, 管理人应当自资产管理合同变更之日起5个工作日内报协会备案。

### 三、资产管理计划的展期

本计划可以展期。

(一) 资产管理计划展期应同时符合以下条件：

1、本计划运作规范，管理人、托管人未违反法律、行政法规、中国证监会规定和本合同的约定；

2、本计划展期没有损害投资者利益的情形；

3、符合资产管理计划的成立条件；

4、中国证监会规定的其他条件。

(二) 展期的安排

1、通知展期的时间

本集合计划原存续期届满前，管理人可以决定到期清算终止或展期继续管理本集合计划。本集合计划拟展期的，管理人应当在计划存续期届满前 1 个月征询托管人是否同意继续托管展期后的集合计划资产。在获得托管人同意后，管理人可开展本集合计划展期准备事宜，通过公告等形式通知投资者展期安排，并按照合同变更的一般情形进行展期。

2、展期的期限

管理人可以决定展期的期限，并以公告形式通知投资者，具体期限以管理人公告为准。

3、投资者回复的方式

投资者如同意参与集合计划展期，应在公告规定期限内按照管理人公告规定的形式作出答复；未在规定时间内作出答复的，视为同意本集合计划展期。

4、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,投资者有权按照管理人公告内容在存续期届满日前(含届满日)到推广机构办理退出手续或按本合同规定办理集合计划份额转让手续;若投资者未在存续期届满日前(含届满日)到推广机构办理本计划份额退出、转让手续,则由管理人决定对上述份额于存续期届满之日做自动退出处理。若投资者未回复意见或回复意见不明确的,并未在上述期限内办理转让或退出手续,视为同意展期,管理人不再另行通知确认。

#### 5、展期的实现

如果同意计划展期的投资者人数不少于2人,展期的投资者持有份额规模不少于1000万元,则本计划存续期将依法展期;如果同意计划展期的各投资者人数低于2人,或展期的投资者持有份额规模少于1000万元,则本计划到期终止,管理人将按照本合同约定办理计划到期终止和清算事宜。

#### 四、资产管理计划终止的情形,包括但不限于下列事项:

(一)资产管理计划存续期届满且不展期;

(二)管理人被依法撤销资产管理业务资格或者依法解散、被撤销、宣告破产,且在6个月内没有新的管理人承接;

(三)托管人被依法撤销基金托管资格或者依法解散、被撤销、宣告破产,且在6个月内没有新的托管人承接;

(四)经全体投资者、管理人和托管人协商一致决定终止;

(五)持续5个工作日投资者少于2人;

(六)未在协会完成备案的情形;

(七)管理人提前终止本计划的情形;

若因监管政策变化导致本计划无法存续的,以及为了维护投资者利益的其他原因将本计划项下资产已全部变现的(如因本计划规模或投资策略无法适应当下

市场环境），管理人有权提前结束本计划，无需经投资者及资产托管人同意。提前终止时，终止日以管理人在其网站公告为准，管理人应及时通知投资者及托管人。

（八）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。

发生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、宣告破产情形时，托管人有权立即对托管账户采取止付措施。

管理人应当自本计划终止之日起五个工作日内报告基金业协会，前述第（六）项约定的情形除外。

#### 五、资产管理计划的清算（含提前终止的情形）

管理人应在本计划发生终止情形之日起五个工作日内开始组织清算。

##### （一）财产清算组的成员及职责

1、资产管理计划财产清算小组成员由管理人和托管人组成。2、资产管理人负责资产管理计划财产的清算、估价、变现和分配，可以依法进行必要的民事活动，聘用必要的工作人员。资产托管人负责资产管理计划财产的保管，执行管理人分配指令划付资金。

##### （二）财产清算的程序

- 1、本合同终止时，由资产管理计划财产清算小组统一接管财产；
- 2、对本计划财产进行清理和确认；
- 3、对本计划财产进行估价和变现；
- 4、制作清算报告；
- 5、对本计划剩余财产进行分配。

##### （三）清算费用的内容和支付方式

清算费用是指资产管理计划财产清算小组在进行计划财产清算过程中发生的所有合理费用、清算费用由资产管理计划财产清算小组优先从计划财产中支付。

#### （四）财产清算剩余资产的分配

1、本计划终止时已计提但尚未支付的管理费、托管费等，经清算小组复核后从清算财产中支付。

2、依据资产管理计划财产清算的分配方案，将计划财产清算后的全部剩余资产扣除清算费用后，按本计划投资者持有的计划份额比例原则上以货币资金形式分配，原则上以货币资金形式分配给投资者；资产管理合同另有约定的，从其约定；但不得违反中国证监会规定。

3、因持有流通受限证券及其他投资品种等原因导致本计划财产无法及时变现的，管理人应将已变现部分先行分配，并于本计划终止后对计划财产进行二次清算。清算期间继续根据本合同约定提取管理费、托管费等相关费用及业绩报酬。待上述资产可以变现时，管理人应及时完成剩余可变现计划资产的变现操作后进行二次清算，并在扣除相关费用和业绩报酬后将该剩余财产分配给全体投资者。本计划持有多只流通受限的证券及其他投资产品的，管理人按本款约定进行多次变现及清算。管理人应在剩余计划财产变现并完成清算后3个工作日内向托管人发送指令，托管人按指令将剩余计划财产划至指定账户。

4、在计划财产移交前，由托管人负责保管。清算期间，任何当事人均不得运用该财产。清算期间的收益归属于计划财产，发生的保管费用由被保管的计划财产承担。因投资者原因导致计划财产无法转移的，托管人和管理人可以在协商一致后按照有关法律法规进行处理。

（五）本计划因受托财产流动性受限等原因延期清算的，管理人应当及时向中国证监会相关派出机构报告。

#### （六）财产清算报告的告知安排

清算小组在本计划终止后 20 个工作日内编制计划财产清算报告，由管理人或销售机构按照投资者提供的联系方式或由管理人通过其公司网站告知投资者。投资者在此同意，上述报告不再另行审计，除非法律法规或监管部门要求必须进行审计的。

管理人应当在计划清算结束后五个工作日内将清算报告报基金业协会。

#### （七）资产管理计划财产相关账户的注销

计划财产清算完毕后，托管人按照规定注销本计划托管账户及本计划投资所需账户，管理人应给予必要的配合。

#### （八）资产管理计划财产清算账册及文件的保存

本计划财产清算账册及文件由管理人保存 20 年以上。

### 第二十六部分 违约责任

一、本合同当事人违反合同，应当承担违约责任。给其他当事人造成经济损失的，应当承担赔偿责任。在发生一方或多方违约的情况下，本合同能继续履行的，应当继续履行。

二、因本合同当事人的违约行为造成本合同不能履行或者不能完全履行的，由违约的一方承担违约责任；如属本合同当事人双方或多方当事人的违约，根据实际情况，由违约方分别承担各自应负的违约责任。

发生下列情况的，当事人可以免责：

（一）不可抗力；

（二）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；

（三）管理人由于按照本合同约定的投资原则行使或不行使其投资权而造成

的损失等。

三、本合同一方当事人造成违约后，其他当事人应当采取适当措施防止损失的扩大；没有采取适当措施致使损失扩大的，不得就扩大的损失要求赔偿。守约方因防止损失扩大而支出的合理费用由违约方承担。

资产管理人、资产托管人在履行各自职责的过程中，违反法律法规的规定或者本合同约定，给资产管理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，但不因各自职责以外的事由与其他当事人承担连带赔偿责任；资产管理人、资产托管人因共同行为给资产管理计划财产或投资者造成损害的，应当根据各自的过错程度承担相应的赔偿责任。资产管理人和资产托管人不构成共同受托人，资产托管人不对资产管理人的责任承担连带赔偿责任。

四、因一方当事人违约而导致其他当事人损失的，投资者应先于其他受损方获得赔偿。

五、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，管理人和托管人可以免除赔偿责任。但是管理人和托管人应积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

六、本合同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。

## 第二十七部分 争议的处理

一、对于因本合同的订立、内容、履行和解释或与本合同有关的争议，合同当事人可以通过协商或者调解予以解决。当事人不愿通过协商、调解解决或者协商、调解不成的，采取以下第（一）种方式解决：

（一）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，任何一方均应当将争议提交管理人所在地有管辖权的法院解决。

(二) 向被告所在地有管辖权的人民法院提起诉讼。

二、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、尽责地履行本合同约定的义务，维护投资者的合法权益。

三、本合同受中华人民共和国法律管辖。

## 第二十八部分 资产管理合同的效力

一、本合同是约定资产管理合同当事人之间权利义务关系的法律文件。

二、本合同可采用电子签名方式或书面方式进行签署，合同自三方签署后成立。以电子签名方式签署本合同的，投资者、管理人、托管人同意遵守《中华人民共和国电子签名法》《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、计划说明书、风险揭示书或其他文书的，视为签署本合同、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，无须另行签署纸质合同、纸质风险揭示书或其他文书。

三、本合同采用书面签署方式时，投资者为法人的，本合同自投资者、管理人和托管人加盖公章或合同专用章以及各方法定代表人/负责人或授权代表签字或盖章之日起成立；投资者为自然人的，合同自投资者本人签字、管理人和托管人加盖公章或合同专用章以及双方法定代表人/负责人或授权代表签字或盖章之日起成立(如采用电子方式签署合同的，应该满足相关电子合同签约成立的条件)。

四、本合同自本计划成立之日起生效。

五、投资者自签订本合同即成为本合同的当事人。在本计划存续期间，投资者自全部退出计划之日起不再是本合同的当事人。再次参与不用另行签署本合同(期间合同发生变更的除外)，参与申请被管理人确认后，即视为投资者重新成

为本合同的当事人，本合同对投资者具有法律约束力。本集合计划终止，本合同终止。但合同项下的费用及税收条款、清算条款、违约责任条款、争议解决条款、保密条款仍然有效。

## 第二十九部分 其他事项

一、本合同各方当事人应对签署和履行本合同过程中所接触和获取的其他方当事人的数据、信息和其它涉密信息承担保密义务，非经其他方当事人同意，不得以任何方式向第三人泄露或用于非本合同之目的（法律法规或司法监管部门要求的除外）。本保密义务不因合同终止而终止。

二、如将来监管部门对本合同的内容与格式有其他要求的，投资者、管理人和托管人应立即展开协商，根据监管相关要求修改本合同的内容和格式。

三、除本合同另有约定外，管理人的通讯地址、托管人的通讯地址以及投资者在管理人或销售机构留存的通信地址适用于本合同相关的各类通知、协议、文书的送达，包括但不限于合同履行期间各类通知、协议等文件的送达，以及合同发生纠纷时相关文件和法律文书的送达，同时包括争议进入仲裁、民事诉讼程序后一审、二审、再审和执行程序及其他程序中相关文件的送达。本合同一方以专人递送给其他当事人，或以邮递方式发出。该等通知以专人递送，于递交时视为送达；以邮递方式发出，收件人签收之日视为送达。

四、计划说明书、风险揭示书、经注册登记机构确认有效的投资者认购、参与、退出本计划的申请材料或数据电文和投资者通过电子签名方式产生的数据电文、管理人通过其公司网站发布的销售公告及其他公告等为本合同的附件，是本合同不可分割的一部分，与合同具有同等法律效力。计划说明书如与本合同有不一致的，以本合同为准。

五、本合同未尽事宜，当事人依据有关法律法规和集合计划说明书的规定办理。如集合资产管理合同、说明书中的约定存在冲突的，相关约定以集合资产管

理合同的约定为准。如本合同约定与法律法规有任何冲突之处，冲突之处按法律法规规定执行。

六、本合同一式【贰】份，管理人执【壹】份，托管人执【壹】份，每份具有同等的法律效力。



本页无正文，为《华安资管湘赢 36M036 号集合资产管理计划资产管理合同》

签署页

投资者： (章)

法定代表人/负责人或授权代表：

签署日期： 年 月 日

资产管理人：华安证券资产管理有限公司 (章)



法定代表人/负责人或授权代表：



签署日期：2026年3月20日

资产托管人：苏州银行股份有限公司



法定代表人或授权代表：



签署日期：2026年3月23日

附件一：《划款指令授权通知书》（样本）

### 划款指令授权通知书

苏州银行股份有限公司：

根据《华安资管湘赢 36M036 号集合资产管理计划资产管理合同》（编号：HAZG-SZYH-36M036），我司已向你行交付了本资产管理计划委托财产，我司现授权下列人员代表我司向你行发送本合同项下资金划拨指令以及其他相关通知，从 2026 年 3 月 20 日生效。被授权人在授权范围内向你行发送指令的真实性、准确性及合法性由我司负全部责任。

姓名	权限	签字样本	印章样本
	经办	韩朝青	
	经办		
	复核	胡乐	
	复核		
指令发送用章	(用章样本)		
<p>备注：1、指令发送用章须与个人签字或个人印章同时出具，方为有效。</p> <p>2、权限类型：经办、复核。</p> <p>3、同一类型权限应至少列明 2 名人员签字、印章样本，且其中任何一人签字或印章均有效。</p>			


  
 管理人（公章）  
 法定代表人或被授权人（签章）


  
 唐泳  
 3401310424614

附件二：资产管理业务划款指令

指令编号：

苏州银行股份有限公司：

根据我司与贵行签署的《华安资管湘赢 36M036 号集合资产管理计划资产管理合同》（协议编号：【 HAZG-SZYH-36M036 】）的约定，现向贵行申请如下划款：

指令日期：\_\_\_\_年\_\_\_\_月\_\_\_\_日

单位：元

付款户名：	收款户名：
付款账号：	收款账号：
开户行： 	开户行：
大写金额： 	小写金额：
划款方式：人行大额支付系统（ ）	
用途及备注：	
管理公司 经办人： 复核人：	管理人预留印鉴盖章处： 



附件三：各方业务人员联系核实信息表

投资 管理 人	公司	业务人员及其工作职责	办公电话	手机	
		袁方/产品部负责人	0551-65161521	18956518911	
		郭建业/运营支持部负责人	0551-65161559	13865516719	
		胡乐/估值	0551-65161571	huyue1921@163.com	
		杜里根/风控	0551-65980131	duligen@hazq.com	
		指定邮寄地址及邮编		指定传真	
		安徽合肥政务区天鹅湖路 198 号财智中心 B1 座 6 楼		0551-65161861	
		/		/	

托管人联系表

苏州 银行	业务人员	工作职责	办公电话	邮箱
	朱洁	产品经理	0512-69868888-91016	zhujie002@suzhoubank.com
	曹靓靓	账户管理	0512-69868888-91030	custodyaccount@suzhoubank.com
	李海龙	估值核算	0512-69868888-91017	CustodyAcc@suzhoubank.com
	曹静	清算划款	0512-69868888-91028	CustodyPay@suzhoubank.com
	李明旭	投资监督	0512-69868888-91034	custodyaud@suzhoubank.com
	/			
	/			
	/			
	/			
指定邮寄地址及邮编	中国（江苏）自由贸易试验区苏州片区苏州工业园区钟园路 728 号； 215028			

指定传真	/
------	---

附件四：交易监控合规表

1	监控范围	<p>投资范围：</p> <p>(1) 银行存款、国内依法发行的国债、中央银行票据、地方政府债、各类金融债（含次级债、混合资本债等）、企业债券、公司债券（含非公开发行公司债）、可转债、可交换债、永续债、同业存单、超短期融资券、短期融资券、中期票据、非公开定向债务融资工具、资产支持证券（票据）、货币市场基金、债券型公募基金及中国证监会允许本集合计划投资的其他固定收益类品种；(2) 本计划可参与 A 股定向增发股票，可参与可转债与可交换债转股；(3) 本集合计划可参与债券回购（包含正回购和逆回购）。</p> <p>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，可以将其纳入本集合计划的投资范围。法律法规或中国证监会变更集合计划原有投资品种投资比例限制的，资产管理人在履行合同变更程序后，可以相应调整本集合计划的投资比例上限规定。</p>
2	监控比例及限制	<p>投资比例及限制：</p> <p>资产配置比例：(1) 本集合计划投资固定收益类资产比例为资产总值的 80-100%，总资产占净资产的比例不超过 200%，参与债券正回购资金余额或债券逆回购资金余额不得超过本计划上一日净资产的 100%，中国证监会另有规定的除外；(2) 本集合计划投资于同一资产的资金，不超过该计划资产净值的 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；全部投资者均为符合中国证监会规定的专业投资者且单个投资者投资金额不低于 1000 万元的封闭式集合资产管理计划，以及完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的资产管理计划等中国证监会认可的其他集合资产管理计划，不受前款规定的投资比例限制；(3) 本集合计划投资可转债、可交换债等资产金额不超过计划资产净值的 20%；(4) 本集合计划参与权益类资产不超过计划资产净值的 20%；(5) 本集合计划投资于同一发行人及其关联方发行的债券的比例超过其净资产 50% 的，该资产管理计划的总资产不得超过其净资产的 120%。本集合计划投资于国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券等中国证监会认可的投资品种不受前述规定限制。法律法规或中国证监会允许计划投资其他品种的，资产管理人应事先取得投资者同意，在履行合同变更程序后，可以将其纳入本集合计划的投资范围。本计划成立后备案完成前，管理人可以现金管理为目的，投</p>

	<p>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。</p> <p><b>投资限制</b></p> <p>1.本集合计划投资固定收益类资产比例为资产总值的 80-100%，总资产占净资产的比例不超过 200%，参与债券正回购资金余额或债券逆回购资金余额不得超过本计划上一日净资产的 100%，中国证监会另有规定的除外。</p> <p>2.本集合计划投资于同一资产的资金,不超过该计划资产净值的 25%；管理人管理的全部集合计划投资于同一资产的资金，不得超过该资产的 25%，本条中资产管理人管理的全部集合资产管理计划，托管人仅根据管理人托管在托管人处的集合资产管理计划数据进行监控计算，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。因集合计划资产净值变动导致投资比例不满足上述约定的，管理人应当在流动性受限资产可出售、可转让或者恢复交易的二十个交易日内调整至符合相关要求。</p> <p>全部投资者均为符合中国证监会规定的专业投资者且单个投资者投资金额不低于 1000 万元的封闭式集合资产管理计划，以及完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的资产管理计划等中国证监会认可的其他集合资产管理计划，不受前款规定限制。</p> <p>3、本集合计划所投资资产支持证券（票据）应满足如下要求：</p> <p>本集合计划投资资产支持证券（票据），仅限于投资优先级，且投资评级为 AA（含）以上的份额；本集合计划投资资产支持证券（票据），投资品种挂牌场所为银行间市场和交易所市场。</p> <p>4.本集合计划投资可转债、可交换债等资产金额不超过资管计划资产净值的 20%；</p> <p>5.本集合计划参与权益类资产不超过计划资产净值的 20%；</p> <p>6.投资信用类债券，主体评级（或债项）必须在 AA（含）以上，超短期、短期融资券债项（如有）评级不低于 A-1，主体评级（如有）在 AA（含）以上；若持有期间，主体评级（或债项）发生调整导致不符合本集合计划投资限制的，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出。</p> <p>7.当本集合计划投资于同一发行人及其关联方发行的债券的比例超过其净资产 50%时，该资产管理计划的总资产不得超过其净资产的 120%。本集合计划投资于国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券等中国证监会认可的投资品种不受前述规定限制。因证券期</p>
--	---

	<p>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二十个交易日内调整至符合相关要求。确有特殊事由未能在规定时间内完成调整的，管理人应及时向中国证监会相关派出机构报告。</p>
--	---

备注：

1、 托管人只负责债券买入日终，债项信用等级或主体信用等级的控制，其它时点的债项或主体的信用等级由管理人负责。

2、 信用评级机构仅限于大公国际资信评估有限公司、中诚信国际信用评级有限责任公司、中诚信证券评估有限公司、联合资信评估有限公司、联合信用评级有限公司、上海新世纪资信评估投资服务有限公司、东方金诚国际信用评级有限公司及鹏元资信评估有限公司。（资产托管人对评级机构不予监控）

3、 需要按照穿透原则计算的指标或者需要按照穿透原则监督的指标需要由管理人在获取相关数据后的三个工作日内以电子邮件的形式向托管人邮箱发送邮件提供被投资产品数据，若未及时提供相应数据，托管人仅能按照本资管计划本层计算相应指标以及进行监控，不承担未穿透计算的相应责任；同时对于所投资的资产管理产品的投资行为托管人无法进行事前监督，仅能在管理人提供相应数据后进行事后监督。