

合同编号：【HT202605SE35】

华夏资本鲁班大师 1 号集合资产管理计划 资产管理合同

资产管理人：华夏资本管理有限公司

资产托管人：上海浦东发展银行股份有限公司宁波分行

华夏资本管理有限公司
2026-05-26
hezhangtianlang



目 录

一、前言.....	2
二、释义.....	3
三、承诺与声明.....	6
四、当事人及权利义务.....	8
五、资产管理计划的基本情况.....	13
六、资产管理计划的募集.....	15
七、资产管理计划的成立与备案.....	18
八、资产管理计划的参与、退出与转让.....	19
九、份额持有人大会及日常机构.....	26
十、资产管理计划份额的登记.....	27
十一、资产管理计划的投资.....	29
十二、服务机构及投资顾问.....	32
十三、分级安排.....	33
十四、利益冲突及关联交易.....	34
十五、投资经理的指定与变更.....	37
十六、资产管理计划的财产.....	38
十七、投资指令的发送、确认和执行.....	41
十八、越权交易.....	44
十九、交易及清算交收安排.....	47
二十、资产管理计划财产的估值和会计核算.....	49
二十一、资产管理计划的费用与税收.....	54
二十二、资产管理计划的收益分配.....	59
二十三、信息披露与报告.....	60
二十四、风险揭示.....	63
二十五、资产管理合同的变更、终止与财产清算.....	71
二十六、违约责任.....	75
二十七、争议的处理.....	77
二十八、资产管理合同的效力.....	78
二十九、反洗钱.....	79
三十、其他事项.....	80
附件一、 授权通知书（此为样本，具体以管理人出具格式为准）	84
附件二： 划款指令书（此为样本，具体以管理人出具格式为准）	85

一、前言

订立本合同的依据、目的和原则：

1、订立本资产管理合同的依据是《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法》（以下简称“《证券法》”）、《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》（以下简称“《指导意见》”）、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》（以下简称“《管理办法》”）、《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》（以下简称“《运作规定》”）、《集合资产管理计划资产管理合同内容与格式指引》、《证券期货投资者适当性管理办法》、《非居民金融账户涉税信息尽职调查管理办法》及其他有关法律法规。若因法律法规的制定或修改导致本合同的内容存在与届时有效的法律法规的规定不一致之处，应当以届时有效的法律法规的规定为准，各方当事人认可资产管理人根据届时有效的法律法规对本合同做出的相应变更和调整。

2、订立本资产管理合同（以下简称“本合同”）的目的是为了明确资产委托人、资产管理人和资产托管人在集合资产管理业务过程中的权利、义务及职责，确保受托资产的安全，保护当事人各方的合法权益。

3、订立本资产管理合同应当遵循平等自愿、诚实信用、公平原则，充分保护本合同各方当事人的合法权益，不得损害国家利益、社会公共利益和他人合法权益。

4、资产委托人自签订资产管理合同即成为资产管理合同的当事人。在本计划存续期间，资产委托人自全部退出资产管理计划之日起，该资产委托人不再是资产管理计划的投资人和资产管理合同的当事人。

资产管理人应当按照规定向中国证券投资基金业协会办理资产管理计划的设立、变更备案，并及时报送资产管理计划的运行情况、风险情况以及终止清算报告等信息。中国证券投资基金业协会办理资产管理计划备案不代表中国证券投资基金业协会对资产管理计划的合规性、投资价值及投资风险作出保证和判断，也不表明中国证券投资基金业协会对备案材料的真实性、准确性、完整性作出保证。投资者应当充分了解资产管理计划的投资范围、投资策略和风险收益等信息，根据自身风险承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。

特别约定：《华夏资本鲁班大师1号集合资产管理计划资产管理合同》（以下简称“本合同”或“集合资产管理合同”）以电子签名方式签订，管理人、托管人作为本合同签署方，已接受本合同项下的全部条款；委托人（华夏资本鲁班大师1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委托人完全接受本合同项下的全部条款，同时本合同成立。

二、释义

本合同中除非文意另有所指，下列词语具有如下含义（若释义与合同正文内容不一致，以合同正文内容为准）：

1、资产管理合同、本合同、合同：指资产委托人、资产管理人和资产托管人签署的《华夏资本鲁班大师1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

2、资产委托人、委托人、投资者：指签订本合同，具备相应风险识别能力和风险承担能力，投资于本资产管理计划不低于一定金额且符合《指导意见》、《运作规定》中关于合格投资者要求

3、资产管理人、管理人：指华夏资本管理有限公司

4、资产托管人、托管人：指上海浦东发展银行股份有限公司宁波分行

5、注册登记机构：指资产管理人或其委托的经中国证监会认定可办理开放式证券投资基金份额登记业务的其他机构

6、资产管理计划、本计划、计划：指按照本合同的约定设立，为资产委托人的利益，将多个资产委托人交付的资金进行集中管理、运用或处分，进行投资活动的集合资产管理安排，即华夏资本鲁班大师1号集合资产管理计划

7、计划说明书：指《华夏资本鲁班大师1号集合资产管理计划计划说明书》，内容包括资产管理计划名称和类型、资产管理人与资产托管人概况、资产管理计划的投资范围、投资策略和投资限制情况、投资风险揭示、中国证监会规定的其他事项等

8、工作日：同交易日

9、交易日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

10、开放日：指非计划初始募集期间，资产管理人办理计划参与、退出业务的工作日

11、证券账户：指根据中国证监会有关规定和中国证券登记结算有限责任公司等相关机构的有关业务规则，由资产托管人为资产管理计划财产在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司、深圳分公司开设的专用证券账户、在中央国债登记结算有限责任公司、银行间市场清算所股份有限公司开立的有关账户及其他证券类账户

12、资金账户、托管账户：指资产托管人根据有关规定为资产管理计划财产开立的专门用于清算交收的银行账户

13、资产管理计划财产、受托资产：指委托人在投资本计划前拥有合法所有权或处分权、本计划成立后为管理人管理并由资产托管人托管的作为本合同标的的财产

14、计划资产总值：指本资产管理计划拥有的各类有价证券、银行存款本息、应收款项及

其他资产的价值总和

15、计划资产净值：指本资产管理计划资产总值减去负债后的价值

16、计划份额净值：指计算日资产管理计划资产净值除以计算日资产管理计划份额总数所得的数值

17、资产管理计划资产估值：指计算、评估资产管理计划资产和负债的价值，以确定本资产管理计划资产净值和份额净值的过程

18、初始募集期间：指资产管理合同或计划说明书中载明的投资者初始认购的期间，自计划份额发售之日起最长不超过 60 天

19、存续期：指本计划成立至终止之间的期限

20、本合同生效日、资产管理计划成立日：指本计划的募集金额缴足之日起十个工作日内，由资产管理人公告资产管理计划成立

21、认购：指在资产管理计划初始募集期间，资产委托人按照本合同的约定购买本计划份额的行为

22、参与：指在资产管理计划开放日，资产委托人按照本合同的规定参与本计划份额的行为

23、退出：指在资产管理计划开放日，资产委托人按照本合同的规定退出本计划份额的行为

24、违约退出：指资产委托人在非合同约定的退出开放日退出资产管理计划的行为，本计划不接受违约退出

25、销售机构：指资产管理人或符合《管理办法》等法律法规和中国证监会规定的条件，取得基金销售资格，受管理人委托代理办理本计划认购、参与和退出等业务的机构

26、法律法规：指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、部门规章、规范性文件、监管政策、自律规则以及对该等法律法规不时的修订和补充

27、不可抗力：指不能预见、不能避免并不能克服的客观情况，包括但不限于地震、台风、水灾、火灾、战争、暴乱、流行病、政府行为、罢工、停工、停电、通讯失败等，非因资产管理人、资产托管人自身原因导致的技术系统异常事故、法律法规调整等情形。因交易所、银行、登记结算机构的交易、结算系统出现故障导致的交易、结算无法进行的情形，因电信服务商原因导致资金划付的网络中断、无法使用的情形，亦构成不可抗力事件

28、T 日：指在规定时间受理投资人相关业务申请的工作日

29、T+n 日：指自 T 日起第 n 个工作日（n 为自然数）

30、临时开放期：指资产管理合同发生变更或法律法规、监管规定及自律规则发生修订，或者存在其他监管或自律机构允许情形时，资产管理人为保障投资者选择退出资产管理计划的

权利，资产管理人有权视本计划实际运作情况设定临时办理本计划份额退出的期间，具体以管理人公告为准

31、首个运作期、第 1 个运作期：本计划自成立日（含）起至成立日所在月（不含）后第 6 个月的第四个星期三（不含）（如遇非交易日则顺延至下一个交易日）称为首个运作期，首个运作期届满后原则上以每【6】个月为一个运作期，对应称为第 i 个运作期（ $i=1,2,\dots$ ），具体以管理人公告为准

三、承诺与声明

（一）资产管理人承诺与声明

- 1、在签订本合同前充分向投资者说明了有关法律法规和相关投资工具的运作市场及方式，并充分揭示了相关风险。
- 2、已经了解投资者的风险偏好、风险认知能力和承受能力，对投资者的财务状况进行了充分评估。
- 3、按照《基金法》恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用受托资产，不保证受托资产一定盈利，也不保证最低收益或本金不受损失，以及限定投资损失金额或者比例。
- 4、管理人应对项目的合规性负责。

（二）资产托管人承诺与声明

- 1、按照《基金法》恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则安全保管受托资产，履行信义义务以及本合同约定的其他义务。托管人信义义务是指托管人按恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则，根据相关法律法规和监管规定，在本合同约定范围内尽职尽责履行安全保管受托资产等托管人职责。
- 2、根据法律、行政法规、中国证监会及中国证券投资基金业协会的规定和资产管理合同的约定，对管理人的投资或者清算指令等进行监督。
- 3、在资产管理人发生异常且无法履行管理职能时，依照法律、行政法规的规定、本合同的约定以及中国证监会、基金业协会的要求履行相关资产托管人职责，维护投资者权益。

（三）投资者承诺与声明

- 1、受托资产为其拥有合法所有权或处分权的资产，保证受托资产的来源以及用途符合国家有关规定，保证其参与投资本资产管理计划符合法律法规的规定以及业务决策程序的要求，保证没有任何其他限制性条件妨碍资产管理人和资产托管人对该受托资产行使相关权利且该权利不会为任何其他第三方所质疑。
- 2、资产委托人声明已充分理解本合同条款，了解相关权利、义务，了解有关法律法规及所投资资产管理计划的风险收益特征，知晓资产管理人、资产托管人以及相关机构不应对资产管理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，投资于本资产管理计划将自行承担投资风险。资产委托人承认，资产管理人、资产托管人未对受托资产的收益状况及本金安全作出任何承诺或担保。本合同约定的业绩报酬计提基准（如有）仅是费用计提标准而不是投资目标或投资保证。资产管理人、资产托管人不保证资产管理计划一定盈利，也不保证最低收益或受托资产本金不受损失。
- 3、符合《运作规定》合格投资者的要求，向资产管理人提供的（若通过销售机构认购本

计划的，则向销售机构提供）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、重大遗漏或误导。前述信息资料如发生任何实质性变更，应当及时书面告知资产管理人或者销售机构。

4、资产委托人确认在签署本合同前已签署相应的风险揭示书，委托人理解风险揭示书中所述内容，愿意承担本计划可能存在的风险与后果。资产委托人理解受托资产的投资、运作、托管面临本合同第二十四部分中列举的各类风险，资产管理人及资产托管人就受托资产面临的前述固有风险免于承担责任。

5、资产委托人承诺及保证：符合法律法规、监管机构及自律组织对于本计划投资者的各项要求，包括但不限于：

(1) 资产委托人具备相应风险识别能力和风险承担能力，为符合要求的合格投资者：1) 具有 2 年以上投资经历，且满足下列三项条件之一的自然人：家庭金融净资产不低于 300 万元，家庭金融资产不低于 500 万元，或者近 3 年本人年均收入不低于 40 万元；2) 最近 1 年末净资产不低于 1000 万元的法人单位；3) 依法设立并接受国务院金融监督管理机构监管的机构，包括证券公司及其子公司、基金管理公司及其子公司、期货公司及其子公司、在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；4) 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；5) 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）；6) 中国证监会视为合格投资者的其他情形。

6、资产委托人在此同意并授权：管理人为实现资产管理合同服务之目的或其他资金管理、经营管理的需求，或根据相关法律法规及监管要求，有权自主决定对委托人个人信息（范围包括但不限于个人的姓名、身份证号、认购信息、账户信息等合理范围内的信息）/机构信息（范围包括但不限于机构名称、证件号、认购信息、账户信息等合理范围内的信息）以及资产管理合同的相关信息进行合理范围内的收集、使用、处理，范围包括但不限于：（1）根据法律、法规、证券交易所规则、税务机关、政府机关、法院或仲裁机构要求披露；（2）为投资运营管理的必要需求，根据资产管理合同管理人、托管人、注册登记机构（如有）、投资顾问（如有）、销售机构（如有）、证券经纪服务机构（如有）等机构的要求向其披露；（3）为资产管理合同投资运营管理的必要需求，向律师事务所（如有）、会计师事务所（如有）、资产评估（如有）和（或）税务等其他专业顾问披露；（4）其他为实现合同目的而合理收集、使用、处理个人信息的情形。

四、当事人及权利义务

(一) 本资产管理计划设定为均等份额。除资产管理合同另有约定外，每份计划份额享有同等权益，承担同等风险。

(二) 资产委托人

1、资产委托人基本情况

签署本合同并足额交纳认购、参与资金，且合同正式生效的投资者即为本合同的资产委托人。资产委托人的详细情况在合同签署页列示。

2、资产委托人的权利

- (1) 分享资产管理计划财产收益；
- (2) 取得分配清算后的剩余资产管理计划财产；
- (3) 按照本合同约定的时间和方式获得资产管理计划的信息披露资料；
- (4) 监督资产管理人、资产托管人履行投资管理和托管义务的情况；
- (5) 资产管理计划设定为均等份额。除本合同另有约定外，每份份额具有同等的合法权益；
- (6) 按照本合同的约定认购、参与、退出资产管理计划份额；
- (7) 法律、行政法规、中国证监会及基金业协会规定和本合同约定的其他权利。

3、资产委托人的义务

- (1) 认真阅读并遵守本合同，保证投资资金的来源及用途合法；
- (2) 接受合格投资者认定程序，如实填写风险识别能力和风险承担能力问卷，如实提供资金来源、金融资产、收入及负债情况，并对其真实性、准确性和完整性负责，签署合格投资者相关文件；
- (3) 除公募资产管理产品外，以合伙企业、契约等非法人形式直接或者间接投资于资产管理计划的，应当向管理人和销售机构充分披露实际投资者和最终资金来源；
- (4) 认真阅读并签署风险揭示书；
- (5) 按照资产管理合同约定支付资产管理计划份额的参与款项，承担资产管理合同约定的管理费、业绩报酬（如有）、托管费、审计费、税费等合理费用；
- (6) 在持有的资产管理计划份额范围内，承担资产管理计划亏损或者终止的有限责任；
- (7) 按照规定向管理人或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；特别地，由于本产品可能投资场外期权或收益互换等衍生品类资产，监管机构要求资管计划进行此类投资时，需考察穿透后的委托人的相关金融资产量、收入情况和/或投

资经验情况,投资者在整个产品持有期间均有义务配合管理人或资产管理计划销售机构提供相应金融资产量证明、收入证明和/或投资经验证明材料;

(8) 不得违反资产管理合同的约定干涉资产管理人的投资行为;

(9) 不得从事任何有损资产管理计划及其投资者、资产管理人及资产管理人管理的其他资产、资产托管人以及资产托管人托管的其他资产合法权益的活动;

(10) 不得利用资产管理计划相关信息进行内幕交易或者其他不当、违法的证券期货业务活动;

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

(12) 在签署本合同前,向资产管理人书面告知资产委托人的关联方发行的证券名单或其他禁止交易的证券名单(如涉及),在上述证券名单发生变更时,及时书面通知资产管理人;资产管理人在获悉资产委托人关联方信息后应及时通知资产托管人;

(13) 在本计划存续期间及时关注资产管理人的短信、电话、邮件、传真以及其公司网站公告;

(14) 理解并同意承担受托资产的投资、运作、托管面临本合同之第二十四部分“风险揭示”以及风险揭示书中列举的各类风险;

(15) 法律、行政法规、中国证监会及基金业协会规定和本合同约定的其他义务。

(二) 资产管理人

1、资产管理人的基本情况

名称: 华夏资本管理有限公司

住所: 深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室(入驻深圳市前海商务秘书有限公司)

统一社会信用代码: 914403000602994389

法定代表人或授权代表: 李生平

联系人: 张天朗

通讯地址: 北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座8层

邮政编码: 100033

联系电话: 010-58225296

传真: 010-88066270

2、资产管理人的权利

(1) 按照本合同的约定,独立管理和运用资产管理计划财产;

(2) 依照本合同的约定,及时、足额获得资产管理人管理费用和业绩报酬(如有);

(3) 依照有关规定和本合同约定行使因资产管理计划财产投资所产生的权利；

(4) 根据本合同及其他有关规定，监督资产托管人；对于资产托管人违反本合同或有关法律、行政法规规定、对资产管理计划财产及其他当事人的利益造成重大损失的，应当及时采取措施制止，并报告中国证监会相关派出机构；

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

(6) 以管理人的名义，代表资产管理计划行使投资过程中产生的权属登记等权利；

(7) 资产管理人有权根据市场情况对本资产管理计划的总规模、单个资产委托人首次认购金额、每次追加认购金额及持有的本计划总金额限制进行调整；

(8) 有权对资产委托人进行尽职调查，要求资产委托人提供相关证明文件、资料，并在上述文件和资料发生变更时，及时提交变更后的相关文件与资料；

(9) 自行销售或者委托有基金销售资格的机构销售本集合资产管理计划，制定和调整有关集合资产管理计划销售的业务规则，并依据法律法规对销售机构的销售行为进行必要的监督；

(10) 法律、行政法规、中国证监会、基金业协会规定的及本合同约定的其他权利。

3、资产管理人的义务

(1) 依法办理资产管理计划的销售、登记、备案事宜；

(2) 按照基金业协会要求报送资产管理计划产品运行信息；

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

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

(5) 制作风险揭示书，向投资者充分揭示相关风险；

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

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

(8) 不得向资产管理人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；

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

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

(11) 除规定情形或符合规定条件外，不得为管理人、托管人及其关联方提供融资；

(12) 按照本合同的约定接受投资者和资产托管人的监督；

(13) 以资产管理人的名义，代表资产委托人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；

(14) 按照本合同约定计算并向投资者报告资产管理计划份额净值；

(15) 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；

(16) 按照本合同约定负责资产管理计划会计核算并编制财务会计报告；

(17) 聘请符合《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；

(18) 按照本合同约定确定收益分配方案，及时向投资者分配收益（如有）；

(19) 编制向投资者披露的资产管理计划季度、年度等定期报告；

(20) 办理与受托财产管理业务活动有关的信息披露事项；

(21) 对于资产托管人违反法律、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。

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

(23) 建立并保存投资者名单；

(24) 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；

(25) 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；

(26) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告相关监管机构并通知托管人和投资者；

(27) 确定资产管理计划份额认购、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；

(28) 保证向投资者支付的受托资金及收益返回其参与资产管理计划时使用的结算账户或其同名账户。

(29) 法律、行政法规、中国证监会及基金业协会规定的和本合同约定的其他义务。

（三）资产托管人

1、资产托管人的基本情况

名称：上海浦东发展银行股份有限公司宁波分行

住址：浙江省宁波市海曙区江厦街 21 号

通讯地址：浙江省宁波市海曙区江厦街 21 号

法定代表人：张文钰

联系人：周超

联系电话：0574-81888081

2、资产托管人的权利

- (1) 按照本合同的约定，依法保管资产管理计划财产；
- (2) 按照本合同的约定，及时、足额获得资产管理计划托管费用；
- (3) 法律、行政法规、中国证监会及基金业协会规定的和本合同约定的其他权利。

3、资产托管人的义务

- (1) 安全保管资产管理计划财产；
- (2) 不得为资产托管人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；
- (3) 对所托管的不同财产分别设置账户，确保资产管理计划财产的完整与独立；
- (4) 公平对待所托管的不同财产，不得从事任何有损资产管理计划财产及其他当事人利益的活动；
- (5) 按规定开设和注销受托资产的托管账户及其他投资所需账户；
- (6) 复核资产管理计划资产净值和份额净值；
- (7) 办理与资产管理计划托管业务活动有关的信息披露事项；
- (8) 对资产管理计划财务会计报告、年度报告出具意见；
- (9) 编制托管年度报告，并报送相关监管机构；
- (10) 按照本合同约定，根据资产管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；
- (11) 保守商业秘密，不得泄露资产管理计划的投资计划、投资意向、投资信息等，但按照法律法规或有权机关要求或本合同允许提供信息的除外；
- (12) 保存资产管理计划的会计账册，妥善保存有关的合同、协议、交易记录等文件资料，保存期限自资产管理计划终止之日起不得少于 20 年；
- (13) 监督资产管理人的投资运作，投资监督内容包含根据法律法规或本合同明确约定的投资范围、投资比例、投资限制等内容，发现资产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本合同约定的，应当拒绝执行，立即通知资产管理人及时按监管要求报告相关机构；
- (14) 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，监督资产管理人投资运作等职责；
- (15) 设立专门的资产托管部门，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉资产托管业务的专职人员，负责财产托管事宜；
- (16) 向资产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（如有）或者承销期内承销的证券（如有）等信息，均以公开信披为准；
- (17) 法律、行政法规、中国证监会及基金业协会规定的和本合同约定的其他义务。

五、资产管理计划的基本情况

（一）资产管理计划的名称

华夏资本鲁班大师 1 号集合资产管理计划。

（二）资产管理计划的类别

混合类集合资产管理计划。

（三）资产管理计划的跟踪标的

本计划的跟踪标的为【中证 500】指数（代码：【000905.SH】）。后续运作期跟踪标的如有变化以管理人公告为准。

（四）资产管理计划的运作方式

开放式。

本计划自成立日起每 6 个月为一个运作期。每个运作期前 3 个月封闭运作，直至运作期首日所在月（不含）后的第 3、4、5 个月度的 15 号及第 6 个月的第四个星期三开放（如遇非交易日则顺延至下一个交易日），原则上每次至多开放 1 个交易日，其中第 3 个月、第 4 个月、第 5 个月每次开放只能退出，不能参与；第 6 个月开放退出及参与。投资者可在前述参与/退出开放期内进行具体参与/退出操作。具体开放安排和开放日以管理人公告为准。

若上述开放期安排有调整，管理人将至少提前 1 个工作日在管理人网站上公告相关调整安排，具体以管理人公告为准。资产管理人网站上发布公告即视为履行了告知义务。资产委托人参与签署本合同，即视为对前述运作方式已经进行了充分了解并予以充分认可。

（五）资产管理计划的投资目标、主要投资方向、投资比例、产品风险等级

本计划在充分控制风险的基础上，力争实现资产管理计划财产的增值。

主要投资范围包括：

1、在证券/期货交易所等国务院同意设立的交易场所集中交易清算的期货、期权等期货和衍生品类资产。

2、银行存款、现金、国债逆回购等。

3、公募证券投资基金（含 QDII、互认基金）等。

4、国内依法在上海证券交易所、深圳证券交易所、北京证券交易所发行上市的股票（包括主板、创业板、中小板、科创板、北交所及其他经中国证监会核准上市的股票）等。

投资比例：

1、本计划投资于期货和衍生品类资产的持仓合约价值的比例低于本计划总资产的 80%或衍生品账户权益不超过本计划总资产的 20%；

2、本计划投资于固定收益类资产的比例按市值计算低于本计划总资产的 80%；

3、本计划投资于权益类资产的比例低于本计划总资产的 80%。

非因资产管理人主观因素导致突破前述比例限制的,资产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 20 个交易日内调整至符合要求。

如法律法规或监管机构以后允许集合资产管理计划投资其他品种,资产管理人在征得全体资产委托人,资产托管人一致书面同意后,并且资产管理人履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

本产品风险等级为【R4-中高风险】。

(六) 资产管理计划的存续期限

除本合同另有约定外,本计划存续期限及资产管理合同有效期限为资产管理计划成立日起满 10 年对日(若当月无对日,则以当月最后一日作为对日;若对日非交易日,则顺延至下一交易日)终止。

(七) 资产管理计划的最低初始募集规模

本资产管理计划成立时资产管理计划财产的初始受托资产不得低于 1000 万元人民币,但法律法规、监管机构及自律组织另有规定的除外。

(八) 资产管理计划份额的初始募集面值

人民币 1.00 元。

(九) 资产管理计划的费用

本资产管理计划收取的费用主要包括固定管理费、托管费、管理人业绩报酬等。

(十) 资产管理计划的份额登记、估值与核算、信息技术系统等服务机构

华夏基金管理有限公司(证券投资基金业协会登记的外包业务登记编码:A00010)。

(十一) 其他

除本合同另有约定外,资产管理计划应当设定为均等份额,每份计划份额具有同等的合法权益。

六、资产管理计划的募集

(一) 资产管理计划的募集期限、募集方式、募集对象

1、募集期限

本资产管理计划的初始募集期自资产管理计划份额发售之日起最长不超过60日。具体时间由资产管理人根据相关法律法规以及本合同的规定确定，并在计划说明书中披露。

根据资产管理计划初始募集的实际情况，资产管理人可与销售机构协商决定提前终止初始募集。资产管理人与销售机构协商决定提前终止初始募集，并在资产管理人网站及时公告，即视为履行完毕提前终止初始募集的程序。资产管理人发布公告提前终止初始募集的，本计划自公告载明的截止认购之时起不再接受认购申请。

如原定初始募集期不能满足本计划成立条件的，经向投资者公告后可以适当延长募集期（但延长后的募集期自计划份额发售之日起不超过60日）。资产管理人与销售机构协商决定延长初始募集期，并在资产管理人网站及时公告，即视为履行完毕延长初始募集的投资者告知程序。

2、募集方式

本资产管理计划通过管理人或销售机构进行募集。

3、募集对象

具备相应风险识别能力和风险承受能力，投资于本资产管理计划不低于本计划要求的最低认购金额且符合下列条件的自然人、法人或者其他组织：

(1) 具有2年以上投资经历，且满足下列三项条件之一的自然人：家庭金融净资产不低于300万元，家庭金融资产不低于500万元，或者近3年本人年均收入不低于40万元；

(2) 最近1年末净资产不低于1000万元的法人单位；

(3) 依法设立并接受国务院金融监督管理机构监管的机构，包括证券公司及其子公司、基金管理公司及其子公司、期货公司及其子公司、在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；

(4) 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；

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

(6) 中国证监会视为合格投资者的其他情形。

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。

资产委托人不得使用贷款、发行债券等筹集的非自有资金投资本资产管理计划。

本计划的资产委托人不得少于 2 人且不得超过 200 人。法律法规将来另有规定的，从其规定。

（二）资产管理计划的最低认购金额和支付方式

认购资金应以现金形式交付。

投资者在初始募集期间的净认购金额不得低于【50】万元人民币（不含认购费用），并可多次认购，初始募集期间追加认购金额不低于【1】万元。单笔追加认购金额应为 1 万元的整数倍。

（三）资产管理计划份额的认购费用

1、认购费率：【0】

2、认购费用及认购份额的计算方法

净认购金额=认购金额/（1+认购费率）

认购费用=认购金额-净认购金额

认购份额=（净认购金额+认购金额在初始募集期内的利息）/1.00

投资者多笔认购时，按上述公式进行逐笔计算。认购份额及认购费用的计算结果保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此产生的差额部分计入资产管理计划财产。

（四）初始募集期的认购程序

1、资产管理人委托销售机构进行募集的，可以委托销售机构代为完成投资者适当性评估工作，销售机构可以将相关资料提供给资产管理人。

2、认购程序。资产委托人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规定的前提下，以各销售机构的具体规定为准。

3、认购申请的确认。

销售机构受理认购申请并不表示对该申请是否成功的确认，而仅代表销售机构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资产管理合同生效为准。

认购申请一经受理，不得撤销。

（五）初始认购资金的管理及利息处理方式

资产管理人应当将资产管理计划初始募集期间客户的认购资金存入资产管理计划募集结算专用账户，在资产管理计划成立前，任何机构和个人不得动用。投资者的认购资金在初始募集期间发生的利息收入在初始募集期结束后折合成计划份额，归资产委托人所有。利息转份额以注册登记机构的记录为准。

本计划的人数规模上限为 200 人。资产管理计划募集截止时，注册登记机构就投资者的有效认购申请按照“时间优先、金额优先”的原则进行确认，即不同时间提交的申请，对申请时间在先的申请予以确认；相同时间提交的申请，对金额较大的申请予以确认。资产管理人有权就

该确认原则制定细则，投资者应予遵守。

认购申请一经注册登记机构受理，原则上不得撤销。

投资者于 T 日提交认购申请后，一般可于 T+3 日向销售机构查询申请受理情况。投资者可在计划成立后通过销售机构查询最终的成交确认情况。

投资者应当及时查询和确认认购申请的相关信息。确认无效的申请，资产管理人将通过销售机构退还投资者已交付的认购款项本金。

（六）募集结算专用账户和销售机构委托募集账户（如有）的披露渠道和查询方式
管理人的募集结算专用账户为：

账户名称：华夏资本管理有限公司

账户号：11001046500053019722

开户行：建设银行北京复兴支行

大额系统支付号：105100008038

销售机构委托募集账户等信息如需披露由销售机构自行披露，销售机构联系方式以计划说明书或公告登载为准。

七、资产管理计划的成立与备案

(一) 资产管理计划成立的条件

- 1、募集过程符合法律、行政法规和中国证监会的规定；
- 2、初始募集规模不低于 1000 万元；
- 3、投资者人数不少于 2 人，且不超过 200 人，符合条件的员工持股计划不穿透计算员工人数；
- 4、符合中国证监会规定以及资产管理合同约定的其他条件。

(二) 资产管理计划的成立与备案

初始募集期限届满，符合资产管理计划成立条件的，资产管理人应当自募集金额缴足之日起 10 个工作日内，由资产管理人公告本资产管理计划成立。资产管理人应当在本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、资产缴付证明等材料报基金业协会备案。资产管理计划成立前，任何机构和个人不得动用投资者认购资金。

本资产管理计划完成备案前不得开展投资活动，但可以以现金管理为目的，投资于银行活期存款、货币市场基金等中国证监会认可的投资品种。法律、行政法规或监管部门取消或变更上述限制，以最新法律、行政法规或监管要求为准。

若本计划最终未完成备案，本计划终止，资产管理人、资产托管人应按照本合同的约定对计划受托资产进行清算。

(三) 资产管理合同的生效

资产管理合同自本资产管理计划成立日起生效。

(四) 资产管理计划不能满足成立条件的处理方式

资产管理计划初始募集期限届满，不能满足资产管理计划成立条件的，资产管理人应当承担下列责任：

- 1、以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用；
- 2、在初始募集期限届满后 30 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。

资产管理计划募集失败的，资产管理人、资产托管人及销售机构不得请求报酬。资产管理人、资产托管人和销售机构为计划募集支付的全部费用应由各方各自承担。

八、资产管理计划的参与、退出与转让

（一）参与和退出的场所

本计划参与与退出场所为销售机构的营业场所，或按销售机构提供的其他方式办理参与与退出。具体销售机构名单、联系方式以本资产管理计划的《计划说明书》或管理人公告为准。

（二）参与和退出的方式、开放日和时间

开放式。本计划自成立日起每6个月为一个运作期。每个运作期前3个月封闭运作，直至运作期首日所在月（不含）后的第3、4、5个月度的15号及第6个月的第四个星期三开放（如遇非交易日则顺延至下一个交易日），原则上每次至多开放1个交易日，其中第3个月、第4个月、第5个月每次开放只能退出，不能参与；第6个月开放退出及参与。投资者可在前述参与/退出开放期内进行具体参与/退出操作。具体开放安排和开放日以管理人公告为准。

若上述开放期安排有调整，管理人将至少提前1个工作日在管理人网站上公告相关调整安排，具体以管理人公告为准。资产管理人网站上发布公告即视为履行了告知义务。资产委托人参与签署本合同，即视为对前述运作方式已经进行了充分了解并予以充分认可。

本计划存续期间除开放期以外的其他时间封闭运作，不开放参与和退出。

开放日参与与退出业务的办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所、中国金融期货交易所同时开放交易的时间。投资者在开放日办理时间之外提出的参与与退出申请，视为下一工作日提交的申请；如该下一工作日不在开放期内，则该申请无效。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/期货交易所交易时间变更或其他资产管理人认为不利于本计划投资等特殊情况下，资产管理人将视情况对前述开放日及开放参与与退出安排进行相应的调整并告知资产委托人。资产管理人网站上发布公告即视为履行了告知义务。

资产委托人参与签署本合同，即视为对前述运作方式已经进行了充分了解并予以充分认可。管理人按照有关规定，定期将资产管理计划投资者变更情况报送证券投资基金业协会。

（三）临时开放期的触发条件、程序及披露等相关安排

1、临时开放期的触发条件

发生以下情形时，资产管理人有权设置临时开放期：

- （1）因法律法规规定或中国证监会相关规定发生变化导致需要对合同进行变更；
- （2）根据本合同约定变更资产管理合同；
- （3）法律法规及本合同约定的其他情形。

2、临时开放期的程序

发生符合临时开放期触发条件的情形时，资产管理人有权于该情形发生后设置临时开放期，保障投资者选择退出资产管理计划的权利，在临时开放期内，不允许参与，只允许退出。具体

安排以资产管理人公告为准。

3、临时开放期的披露安排

资产管理人在网站上 (<https://fund.chinaamc.com/capital>) 发布设置临时开放期的公告即视为履行了告知义务。

(四) 参与和退出的方式、价格及程序

1、委托人参与本计划时，按照参与申请所对应的开放日的计划份额净值为基准计算计划份额。资产委托人退出计划时，按照退出申请所对应的开放日的计划份额净值计算退出金额。

2、“未知价”原则，即计划的参与价格、退出价格以开放日当日收市后计算的计划份额净值为基准进行计算。

3、计划参与采用金额申请的方式，计划退出采用份额申请的方式。

4、资产委托人退出本计划时，资产管理人按先进先出的原则，按资产委托人认购、参与计划份额的先后次序进行顺序退出。

5、资产委托人办理参与、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规定的前提下，以各销售机构的具体规定为准。

(五) 参与和退出申请的确认

1、开放期截止时，如将全部有效参与申请确认后，如资产委托人人数不超过200人(含)，则对有效的参与申请全部予以确认。

2、开放期截止时，如将全部有效参与申请确认后，如资产委托人人数超过200人(不含)，则按照“时间优先、金额优先”的原则进行确认。“时间优先、金额优先”原则首先按照客户提交申请时间判断，先到先得；在时间相同情况下，则金额优先，即金额大的优先确认成功，确保在开放期后本资产管理计划的资产委托人人数不超过200人。按照以上顺序，对于排序在前200(含200)位资产委托人的有效参与申请全额予以确认，其余资产委托人的参与资金予以返还(无息)。

3、资产委托人退出资产管理计划时，资产管理人按先进先出的原则，份额确认日期在前的计划份额先退出，确认日期在后的计划份额后退出。

4、销售机构对参与、退出的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到申请。参与、退出的确认以注册登记机构的确认结果为准。

(六) 参与和退出的金额限制

投资者在资产管理计划存续期开放日参与资产管理计划的，投资者应当符合合格投资者标准，且参与金额不低于50万元人民币(不含参与费用)，单笔追加金额应为1万元的整数倍。已持有资产管理计划份额的投资者在资产管理计划存续期开放日追加参与资产管理计划的除外。资产委托人部分退出资产管理计划的，其退出后持有的资产管理计划份额净值应当不低于

规定的合格投资者最低参与金额。投资者持有的资产管理计划份额净值低于规定的最低投资金额时，需要退出资产管理计划的，应当一次性全部退出。

在本计划存续期内，当受托资产资产净值高于50万元（大写：伍拾万元整）人民币时，资产委托人有权在开放期通过销售机构通知管理人退出部分受托资产，但退出后的受托资产资产净值不得低于50万元（大写：伍拾万元整）人民币；当受托资产资产净值少于50万元（大写：伍拾万元整）人民币时，资产委托人不得提前退出，但经本合同各方当事人协商一致或资产委托人一次性全部赎回可以提前终止本合同。

资产管理人可根据市场情况及计划投资运作情况，合理调整对参与、退出份额的数量限制，资产管理人进行调整前将以公告形式告知资产委托人。资产管理人在网站公告前述调整事项即视为履行了告知和信息披露义务。

（七）参与和退出的费用

1、参与费用：本计划的参与费由资产委托人承担，在资产委托人参与本计划时由销售机构收取，不属于本计划资产，本计划参与费率为【0%】。

2、退出费用：本计划不收取退出费用。

3、资产管理人可以在法律法规和本合同规定范围内调低参与费率、退出费率或调整收费方式。资产管理人在网站公告前述调整事项即视为履行了告知义务。

（八）参与份额与退出金额的计算方式

1、参与份额的计算

净参与金额=参与金额/(1+参与费率)

参与费=参与金额-净参与金额

参与份额=净参与金额/开放日当天的资产管理计划份额净值

T日，为投资人提出有效申请的开放日。

参与份额计算结果按照四舍五入，保留到小数点后两位，因计算误差产生的损失由资产管理计划财产承担，产生的收益归资产管理计划财产所有。

2、退出金额的计算

退出金额=退出份额×T日资产管理计划份额净值-业绩报酬（如有）

T日，为投资人提出有效申请的开放日。

退出金额计算结果以人民币元为单位，按照四舍五入，保留到小数点后两位，因计算误差产生的损失由资产管理计划财产承担，产生的收益归资产管理计划财产所有。

（九）巨额退出或连续巨额退出

1、巨额退出的认定

单个开放日中，资产管理计划的净份额退出申请超过上一日资产管理计划总份额的10%，

为巨额退出。巨额退出的价格由受理申请当日的计划单位净值决定。

2、巨额退出的顺序、价格确定、款项支付及通知

出现巨额退出时,资产管理人可以根据本资产管理计划当时的资产状况决定接受全额退出或部分延期退出。

(1) 接受全额退出:当资产管理人认为有能力兑付资产委托人的全部退出申请时,按正常退出程序执行。对开放日提出的退出申请,如构成巨额退出的,应当按照本资产管理合同约定全额接受退出,但退出款项支付时间可适当延长,最长不应超过【15】个工作日。

(2) 部分延期退出:当全额兑付资产委托人的全部退出申请有困难,或兑付资产委托人的全部退出申请进行的资产变现可能使资产管理计划资产净值发生较大波动时,资产管理人可在该开放日接受部分退出申请,其余部分的退出申请延期予以受理(若多个资产委托人巨额退出,按照申请退出的份额比例接受部分退出申请,其余部分的退出申请延期)。对于需要部分延期办理的退出申请,除资产委托人在提交退出申请时选择将当日未获办理部分予以撤销外,延迟至下一个开放日办理,退出价格为下一个开放日的计划份额净值。依照上述规定转入下一个开放日的退出不享有退出优先权,并以此类推,直到全部退出为止。部分顺延退出不受单笔退出最低金额的限制。发生部分延期退出时,资产管理人可以适当延长退出款项的支付时间,但最长不应超过【15】个工作日。

(3) 巨额退出的通知:当发生巨额退出并部分延期退出时,资产管理人应当在开放日后【3】个工作日内通过在资产管理人公司网站公告等方式通知资产委托人,并说明有关处理方法,即视为履行了告知义务。

3、任一委托人在开放日退出金额超过人民币【500】万元的,应当在开放日前【2】个工作日进行预约退出申请。销售机构和管理人未收到该等申请的,销售机构和管理人有权拒绝该委托人的退出。

4.连续巨额退出的认定

如果本计划连续两个开放日以上发生巨额退出,即认为发生了连续巨额退出。

5.连续巨额退出的顺序、价格确定、款项支付及通知

(1) 本计划发生连续巨额退出的,如本计划支付委托人的退出申请可能会对本计划的资产净值造成较大波动,管理人可以暂停接受退出申请;已经接受的退出申请可以延缓支付退出款项。暂停和延缓期限不得超过【30】个工作日。

(2) 连续巨额退出的价格由受理申请当日的计划单位净值决定。除本合同另有约定外,连续巨额退出参照巨额退出的约定进行。

(3) 连续巨额退出的通知:当发生连续巨额退出并部分延期退出时,资产管理人应当以邮件或公告方式在【3】个工作日内通知资产委托人。

(十) 延期支付及延期退出的情形和处理方式

管理人经与托管人协商,在确保投资者得到公平对待的前提下,可以依照法律、行政法规、中国证监会规定以及本合同约定,延期办理巨额退出申请、暂停接受退出申请、延缓支付退出款项,或者采取中国证监会认可的其他流动性管理措施。

(十一) 拒绝或暂停参与、暂停退出的情形及处理

1、在如下情况下,资产管理人可以拒绝接受投资者的参与申请:

(1) 如接受该申请,将导致本计划资产委托人超过200人。

(2) 根据市场情况,资产管理人无法找到合适的投资品种,或其他可能对资产管理计划业绩产生负面影响,从而损害现有资产管理计划资产委托人的利益的情形。

(3) 因资产管理计划收益分配、或资产管理计划内某个或某些证券进行权益分派等原因,使资产管理人认为短期内接受参与可能会影响或损害现有资产管理计划资产委托人利益的。

(4) 资产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资产管理计划资产委托人利益的。

(5) 法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

资产管理人决定拒绝接受某些资产委托人的参与申请时,参与款项(无息)将退回资产委托人账户。

2、在如下情况下,资产管理人可以暂停投资者的参与:

(1) 因不可抗力导致无法受理资产委托人的参与申请。

(2) 证券交易场所交易时间临时停市,导致资产管理人无法计算当日资产管理计划财产净值。

(3) 本计划的证券/期货经纪商没有或未及时发送交易清算数据或对账数据、发送的交易清算数据或对账数据不完整或有误,导致无法或未能及时计算当日计划资产净值的情形;

(4) 对于没有或未及时获取场外交易数据或场外行情数据、场外交易数据或场外行情数据不完整或有误,导致无法或未能及时计算当日计划资产净值的情形;

(5) 发生本资产管理合同规定的暂停资产管理计划资产估值情况。

(6) 法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

资产管理人决定暂停接受全部或部分参与申请时,应当告知资产委托人。在暂停参与的情形消除时,资产管理人应及时恢复参与业务的办理并告知资产委托人。

3、在如下情况下,资产管理人可以暂停接受资产委托人的退出申请:

(1) 因不可抗力导致资产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,导致资产管理人无法计算当日资产管理计划财产净值。

(3) 本计划的证券/期货经纪商没有或未及时发送交易清算数据或对账数据、发送的交易清算数据或对账数据不完整或有误，导致无法或未能及时计算当日计划资产净值的情形；

(4) 对于没有或未及时获取场外交易数据或场外行情数据、场外交易数据或场外行情数据不完整或有误，导致无法或未能及时计算当日计划资产净值的情形；

(5) 发生本资产管理合同规定的暂停资产管理计划资产估值的情况。

(6) 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，资产管理人应当及时告知资产委托人。已接受的退出申请，资产管理人应当足额支付；如暂时不能足额支付，应当按单个退出申请人已被接受的退出申请量占已接受的退出申请总量的比例分配给退出申请人，其余部分在后续开放日予以支付。

在暂停退出的情况消除时，资产管理人应及时恢复退出业务的办理并及时告知资产委托人。

4、暂停资产管理计划的参与、退出时，资产管理人应按规定告知资产委托人。

5、暂停参与或退出期间结束，资产管理计划重新开放时，资产管理人应按规定告知资产委托人。

(十二) 非交易过户的认定及处理方式

1、资产管理人及注册登记机构只受理继承、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”是指资产委托人死亡，其持有的计划份额由其合法的继承人继承。

“司法强制执行”是指司法机构依据生效司法文书将资产委托人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。

3、资产管理人应定期将资产管理计划投资者变更情况报送证券投资基金业协会。

(十三) 证券期货经营机构及其子公司自有资金参与、退出安排

1、证券期货经营机构及其子公司（如涉及）有权以自有资金参与本集合计划，与投资者所持的同类份额享有同等权益，承担同等风险。若证券期货经营机构及其子公司以其自有资金参与的，则证券期货经营机构及其子公司（如涉及）以自有资金参与本资产管理计划的份额合计不得超过该资产管理计划总份额的50%。中国证监会对证券期货经营机构自有资金投资比例另有规定的，从其规定。因集合资产管理计划规模变动等客观因素导致前述比例被动超标的，证券期货经营机构应当依照中国证监会规定及资产管理合同的约定及时调整达标。

2、在资产管理计划存续期间，证券期货经营机构以自有资金参与本计划的，持有期限不得少于6个月。证券期货经营机构及其子公司可以以自有资金参与、退出本计划。证券期货经营机构以自有资金参与、退出本计划的，应当提前5个工作日告知全体投资者和托管人指定邮

箱【tgzl6@spdb.com.cn】，并取得其同意。管理人可以提前5个工作日发布相关公告，并根据本合同约定设置临时开放日，若委托人不同意证券期货经营机构或其子公司自有资金参与、退出事项的，有权在最近一个开放日选择退出，若委托人未在最近一个开放日退出，则视为同意。

3、为应对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资产管理计划可不受本条第一点、第二点规定的限制，但应当及时通过管理人网站以公告的形式告知投资者和托管人，并向中国证监会相关派出机构报告。

4、投资者及托管人知悉并认可，本计划成立时可能涉及自有资金认购。

（十四）资产管理计划份额转让

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资产管理计划份额，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。

九、份额持有人大会及日常机构

本计划不设置份额持有人大会机制。

十、资产管理计划份额的登记

(一) 本资产管理计划份额的注册登记业务指本资产管理计划的登记、存管、清算和交收业务,具体内容包括资产委托人账户管理、份额注册登记、清算及交易确认、收益分配(如有)、建立并保管资产管理计划客户资料表等。

(二) 本资产管理计划的注册登记业务由资产管理人或资产管理人委托经中国证监会认定的可办理开放式证券投资基金份额登记业务的其他机构办理。资产管理人委托经中国证监会认定可办理开放式证券投资基金份额登记业务的其他机构代为办理本资产管理计划注册登记业务的,应当与有关机构签订委托代理协议,并列明代为办理资产管理计划份额登记机构的权限和职责。资产委托人同意:资产管理人有权聘请管理人的关联方华夏基金管理有限公司作为本计划的注册登记机构。

(三) 注册登记机构履行如下职责:

1、建立和保管资产委托人账户资料、交易资料、资产管理计划客户资料表等,并将客户资料表提供给资产管理人。

2、配备足够的专业人员办理本资产管理计划的注册登记业务。

3、严格按照法律法规和本资产管理合同规定的条件办理本资产管理计划的注册登记业务。

4、严格按照法律法规和本资产管理合同的规定计算业绩报酬(如有),并提供交易信息和计算过程明细给资产管理人。

5、接受资产管理人的监督。

6、妥善保存登记数据,并将资产管理计划投资者名称、身份信息以及资产管理计划份额明细等数据备份至中国证监会认定的机构。其保存期限自资产管理计划账户销户之日起不得少于20年。

7、对资产委托人的账户信息负有保密义务,因违反该保密义务对资产委托人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的除外。

8、按本资产管理计划合同,为资产委托人提供资产管理计划收益分配(如有)等其他必要的服务。

9、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。

10、法律法规规定的其他职责。

(四) 注册登记机构履行上述职责后,有权取得注册登记费。

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

(六) 本计划的注册登记和会计核算等相关事项均外包给华夏基金管理有限公司, 如在计划存续期间外包机构无法继续从事注册登记等行政服务外包业务, 可能会对计划产生不利影响。资产管理人将根据相关委托代理协议的纠纷解决机制进行处理, 维护资产委托人的合法利益。

十一、资产管理计划的投资

（一）投资目标

本计划在充分控制风险的基础上，力争实现资产管理计划财产的增值。

（二）投资范围及比例

投资范围：

1、在证券/期货交易所等国务院同意设立的交易场所集中交易清算的期货、期权等期货和衍生品类资产。

2、银行存款、现金、国债逆回购等。

3、公募证券投资基金（含 QDII、互认基金）等。

4、国内依法在上海证券交易所、深圳证券交易所、北京证券交易所发行上市的股票（包括主板、创业板、中小板、科创板、北交所及其他经中国证监会核准上市的股票）等。

本计划的跟踪标的为【中证 500】指数（代码：【000905.SH】）。后续运作期跟踪标的如有变化以管理人公告为准。

投资比例：

1、本计划投资于期货和衍生品类资产的持仓合约价值的比例低于本计划总资产的 80%或衍生品账户权益不超过本计划总资产的 20%；

2、本计划投资于固定收益类资产的比例按市值计算低于本计划总资产的 80%；

3、本计划投资于权益类资产的比例低于本计划总资产的 80%。

非因资产管理人主观因素导致突破前述比例限制的，资产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 20 个交易日内调整至符合要求。

如法律法规或监管机构以后允许集合资产管理计划投资其他品种，资产管理人在征得全体资产委托人，资产托管人一致书面同意后，并且资产管理人履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

（三）投资策略

1、投资策略

本产品将主要通过精选场内期货、场内期权合约、公募基金等投资标的的基础上，根据运作安排采用基差增强策略、场内指增策略等，力争实现产品保值增值。

若本计划存续期内因监管机构对资产管理计划的投资比例限制等变更等原因导致本合同约定的投资策略无法继续适用，管理人有权根据届时法律法规及监管要求对投资策略做出调整或者提前终止本计划。

2、投资决策依据、决策程序、投资管理的方法和标准等

(1) 投资决策依据

本计划以法律法规规定及本合同约定的有关规定为决策依据,并以维护集合计划投资者利益作为最高准则。具体决策依据包括:

- 1) 《指导意见》、《管理办法》、《运作规定》等法律法规的规定以及集合资产管理合同、说明书的约定;
- 2) 国内外经济形势及变化趋势等;
- 3) 投资对象收益和风险的匹配关系,本计划将在充分权衡投资对象的风险和收益的前提下做出投资决策。

(2) 投资决策程序

投资程序分为投资决策、投资执行、投资跟踪与反馈、投资核对与监督、合规与风险控制等环节。

(3) 投资管理的方法和标准

- 1) 具备明确的投资目标,包括产品的投资规模、投资方向、投资结构、投资的成本与收益等;
- 2) 准备投资备选的可行方案,审慎选择;
- 3) 充分考虑实践运作中可能产生的风险,通过制定场外衍生品业务准入名单,控制并降低风险;
- 4) 充分考虑公司自身的投资能力范畴,包括公司的风险承受能力、现金流缺口状况等。

(四) 业绩比较基准

本计划无业绩比较基准。

(五) 投资限制

除投资范围部分规定的投资比例限制外,本计划还需遵循以下限制:

- 1、本计划总资产不得超过净资产的 200%;
- 2、投资于同一资产的资金不得超过本计划资产净值的 25%;资产管理人管理的全部集合资产管理计划投资于同一资产的资金,不得超过该资产的 25%;银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券等中国证监会认可的投资品种除外;
- 3、开放退出期内,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%,主动投资于流动性受限资产的市值在开放退出期内合计不得超过该资产管理计划资产净值的 20%。
- 4、法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的,从其规定。

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资产管理人之外的因素导致资产管理计划投资不符合法律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

例和投资限制的，资产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，资产管理人应当及时向中国证监会相关派出机构报告。

（六）投资禁止

本合同受托资产的投资禁止行为包括：

- 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、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；
- 5、直接投资于商业银行信贷资产；
- 6、违规为地方政府及其部门提供融资，要求或者接受地方政府及其部门违规提供担保；
- 7、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；
- 8、直接或者间接投资于违反国家产业政策、环境保护政策的项目（证券市场投资除外）；
- 9、法律法规、监管机构、自律组织禁止的其他活动。

（七）建仓期

本计划的建仓期为自本计划成立之日起【3】个月。

本计划建仓期的投资活动，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、货币市场基金等中国证监会认可的投资品种的除外。

建仓期结束后，资产管理计划的资产组合应当符合法律、行政法规、中国证监会规定和合同约定的投向和比例。

（八）风险收益特征

本计划属于【R4（中高风险）】投资品种，适合合格投资者中的专业投资者及风险识别、评估、承受能力【C4】及以上的普通投资者认购。资产管理人承诺依照恪尽职守、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一定盈利，也不保证最低收益或受托资产本金不受损失。

投资者应根据其投资经验及风险适应能力选择匹配的投资标的进行投资，请投资者仔细阅读本合同所作的风险揭示并谨慎做出投资决定。

（九）管理人将按照法律法规及本合同约定确保本计划所投资的资产组合流动性与本计划开放期安排相匹配。

十二、服务机构及投资顾问

（一）服务机构

本计划的注册登记和会计核算等相关事项均外包给华夏基金管理有限公司,已签订相关委托代理协议,如在计划存续期间外包机构无法继续从事注册登记等行政服务外包业务,可能会对计划产生不利影响。资产管理人将根据相关委托代理协议的纠纷解决机制进行处理,维护资产委托人的合法利益。

（二）本计划投资顾问情况

本计划不聘请投资顾问。

十三、分级安排

本计划不进行分级。

十四、利益冲突及关联交易

（一）关联交易及利益冲突情形

1、关联方范围

本资产管理计划的关联方包括：

- （1）资产管理人；
- （2）资产托管人；
- （3）资产管理人的控股股东、实际控制人；
- （4）资产托管人的控股股东、实际控制人；
- （5）与资产管理人有重大利害关系的公司；
- （6）与资产托管人有重大利害关系的公司；

（7）法律法规、监管规定、自律规则认定的其他关联方。本资产管理计划与关联方进行的交易属于关联交易，具体可分为重大关联交易和一般关联交易。资产管理人的关联方名单通过资产管理计划年度报告披露，资产托管人的关联方名单通过资产托管人网站或资产托管人提供的其他方式披露。

2、重大关联交易和一般关联交易的区分标准

（1）重大关联交易

私募资产管理计划的重大关联交易包括但不限于：

- 1) 一级市场申购管理人、托管人及其关联方发行或承销的股票、可转换债券（含可交换债券）；
- 2) 二级市场交易管理人、托管人及其关联方发行的股票、可转换债券，当日单券交易金额合计超过前一估值日组合净资产 1%且在 500 万元以上的；
- 3) 一级市场申购管理人、托管人及其关联方发行或承销的债券（不含可转换债券）、资产证券化产品，当日单券申购金额合计超过前一估值日组合净资产 5%且在 1000 万元以上的；
- 4) 二级市场交易管理人、托管人及其关联方发行的债券（不含可转换债券）、资产证券化产品，当日单券交易金额（以面值计算）合计超过前一估值日组合净资产 5%且在 1000 万元以上的；
- 5) 其他法律法规、监管规定、自律规则规定的重大关联交易。

（2）一般关联交易

私募资产管理计划的其他关联交易包括但不限于：

- 1) 投资管理人、托管人及其关联方发行或承销的老股东配售（配股配债等公司行为）；
- 2) 二级市场交易管理人、托管人及其关联方发行的股票、可转换债券，当日单券交易金

额合计占前一估值日组合净资产 1%以内或不超过 500 万元（含）的；

3) 一级市场申购管理人、托管人及其关联方发行或承销的债券（不含可转换债券）、资产证券化产品，当日单券申购金额合计占前一估值日组合净资产 5%以内或不超过 1000 万元（含）的；

4) 二级市场交易管理人、托管人及其关联方发行的债券（不含可转换债券）、资产证券化产品，当日单券交易金额（以面值计算）合计占前一估值日组合净资产 5%以内或不超过 1000 万元（含）的；

5) 与管理人及其关联方、托管人进行股票大宗交易、固定收益类投资标的二级市场现券询价交易、逆回购交易；

6) 逆回购质押券为管理人及其关联方、托管人发行的证券；

7) 开立管理人及其关联方、托管人的交易席位、期货账户、海外交易账户；

8) 投资管理人及其关联方、托管人发行的公募基金、私募资产管理计划；

9) 投资管理人及其关联方、托管人发行的收益凭证；

10) 场外交易对手为管理人及其关联方、托管人；

11) 其他法律法规、监管规定、自律规则规定的关联交易。

3、关联交易的交易决策、对价确定机制及审批程序

本计划参与关联交易的，关联交易应当符合合同约定的投资目标、投资策略，且关联交易价格应当公允。资产管理人将按照公司内部要求履行关联交易内部审批程序。资产管理人通过系统控制及人工审查等方式对关联交易进行管理，主要由风控合规部负责审核，其中，一般关联交易主要关注交易价格是否公允等，若存在价格偏离情形需根据公司制度要求进行特殊审批，一般关联交易无需另行取得资产委托人的个别授权和同意，但需履行信息披露义务；重大关联交易主要关注交易合理性，是否通过市场通行的方式和条件参与，是否存在利益输送行为等，经审批通过后且征求委托人同意后方可开展。

4、可能存在的利益冲突情形

本计划资产托管人为上海浦东发展银行股份有限公司宁波分行，本计划的行政服务机构/注册登记机构为管理人的关联方华夏基金管理有限公司。

资产管理人按照合同约定的投资范围和投资策略选择投资标的，有可能涉及资产托管人、资产管理人或其关联方发行、管理、保荐、托管、销售或存在其他法律关系的金融产品，资产管理人和资产托管人将按照合同约定履行职责，但仍不能完全避免发生关联交易或利益冲突的可能，存在关联交易的风险。

5、关联交易特别风险提示

提示资产委托人注意：重大关联交易主要包括使用资产管理计划财产投资资产管理人、资

产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等情形，虽然资产管理人积极遵循资产委托人利益优先的原则、遵守相关法律法规的规定进行操作，但仍可能影响资产委托人的利益。同时，一般关联交易由资产管理人按照市场通行的方式和条件参与，但关联交易涉及的证券价格仍可能会出现下跌，从而使本计划收益下降，甚至带来本金损失，且一般关联交易无需另行取得资产委托人的个别授权和同意，投资人主要通过信息披露文件事后了解相关信息，存在无法及时知悉相关交易，进而影响委托人投资决策的风险。此外，资产管理人运用计划财产从事关联交易时可能依照相关法律法规、监管机构、自律组织的规定被限制相关权利的行使，进而可能影响受托资产的投资收益。

（二）关联交易及利益冲突的应对及处理

1、资产委托人知悉并同意，资产委托人签署本合同即视为同意本资产管理计划从事前述一般关联交易，资产管理人无需就具体一般关联交易另行取得资产委托人的个别授权和同意，但该等一般关联交易投资应按照市场通行的方式和条件参与，公平对待受托资产，并依据相关要求履行信息披露义务。

2、本资产管理计划参与重大关联交易的，应当取得资产委托人同意，并依据相关要求履行信息披露义务。

资产管理人通过发布公告或发送征询意见函等方式就具体重大关联交易向资产委托人征询意见。资产委托人应及时关注资产管理人网站公告情况。资产委托人应在公告或征询意见函指定的日期内按指定的形式回复书面意见，资产委托人在公告或征询意见函规定期限内未回复意见的，视同该资产委托人同意，资产管理人不再另行通知，具体以管理人公告为准。

资产委托人对上述重大关联交易的反馈意见应向资产管理人指定邮箱或通过公告中约定的形式反馈，通过上述方式反馈的内容和信息等均视为资产委托人自身真实意思表示，资产委托人不得否认其效力。

3、资产管理计划在投资运作过程中存在利益冲突情形的，资产管理人应当坚持投资者利益优先原则，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，资产管理人应当视具体利益冲突情形选择在向投资者提供的定期报告或临时报告中披露。

（三）关于本章节约定的关联方范围、重大关联交易和一般关联交易的划分标准等，如法律法规另有规定或监管机构另有要求或资产管理人公司制度发生变更的，资产管理人可以按照法律法规、监管要求和公司制度调整相关内容并按本合同约定告知资产委托人和资产托管人，无需履行合同变更程序，资产管理人在其网站发布公告或发送通知函即视为履行告知义务。

十五、投资经理的指定与变更

本计划投资经理由资产管理人负责指定。

本计划投资经理基本信息如下：

姓名：温祺。

投资经理简历：

温祺先生：清华大学工学学士，管理科学与工程博士，8年投研经验，包括衍生品对冲交易、权益量化策略、大类资产配置策略和指数化投资策略的研究和投资管理。曾就职于申万宏源证券和工银瑞信基金管理有限公司，担任研究员和投资经理，现任华夏资本管理有限公司投资经理。

本计划投资经理已经依法取得基金从业资格，具有三年以上投资管理、投资研究、投资咨询等相关业务经验，具备良好的诚信记录和职业操守，且最近三年未被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚、无兼职。

资产管理人可以根据需要变更投资经理，投资经理变更后，资产管理人应及时通知资产委托人及资产托管人。资产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。投资经理发生变更时，原任投资经理应当妥善保管投资业务资料，及时办理投资经理业务的移交手续，新任投资经理应当及时接受。

十六、资产管理计划的财产

（一）资产管理计划财产的保管与处分

1、资产管理计划财产为信托财产，其债务由资产管理计划财产本身承担责任，资产委托人以其出资为限对资产管理计划财产的债务承担责任。

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

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

5、资产管理计划财产产生的债权不得与不属于资产管理计划财产本身的债务相互抵销。非因资产管理计划财产本身承担的债务，资产管理人、资产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，资产管理人、资产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资产委托人。

6、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的保管

资产管理计划投资于《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、商品及金融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，托管人不对资产管理计划投资的《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、商品及金融衍生品类资产等其他非现金类资产，及其权利凭证（如有）及行权依据承担保管责任。

对于上述实质上由管理人保管的计划财产，管理人不得违反合同约定将其进行抵押或转让。

（二）资产管理计划相关账户的开立和管理

资产托管人按照规定开立计划的托管账户以及其他投资所需账户，资产管理人应给予必要的配合。

1、资产管理计划募集期间的账户开立及管理

（1）资产管理计划初始销售期间募集的资金应存于“资产管理计划初始销售专户”。该账户由资产管理人开立并管理。

(2) 资产管理计划初始销售期间募集的资金入账后，资产管理人将属于资产管理计划财产的全部资金划入资产托管人开立的资产管理计划托管账户。

(3) 若资产管理计划初始销售期限届满，未能达到资产管理合同生效的条件，由资产管理人按规定办理退款等事宜。

2、资产管理计划托管账户的开立和管理

(1) 资产托管人按照相关规定以本产品名义在资产托管人指定的营业机构开立托管财产的托管账户（名称应当为本资产管理计划名称，具体名称以实际开立为准），账户名称、账户预留印鉴以为资产托管人托管业务专用章及托管业务负责人名章，资产托管人负责账户预留印鉴的保管和使用。托管账户信息以资产管理人和资产托管人双方认可的形式，由资产托管人向资产管理人进行反馈。资产管理人应依法履行受益所有人识别义务，在开立托管账户时按照开户银行要求，就相关信息的提供、核实等提供必要的协助，并确保所提供信息以及证明材料的真实性、准确性。

(2) 资产管理计划托管账户的开立和使用，限于满足开展本资产管理计划业务的需要。资产托管人和资产管理人不得假借本资产管理计划的名义开立任何其他资金账户；亦不得使用资产管理计划的任何账户进行本资产管理计划业务以外的活动。

3、资产管理计划证券账户和结算备付金账户的开立和管理

(1) 资产托管人在中国证券登记结算有限责任公司为资产管理计划开立证券账户，开户资料及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。证券账户资产的管理和运作由资产管理人负责。

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

(3) 本资产管理计划采用证券公司结算模式存管证券交易结算资金，资产管理人负责在证券公司开设资产管理计划专用资金账户，并与开立的资产管理计划托管账户建立第三方存管签约关系，在资产管理计划运作期间，不得变更资产管理计划专用资金账户与托管账户之间的第三方存管签约关系。

本资产管理计划由证券经纪商完成资产管理计划的日常证券交易的资金结算工作，相关结算规则依据沪深证券交易所等市场的规定执行，交易佣金参照资产管理人与证券经纪商约定的费率实施。

4、专用债券账户的开设和管理

资产管理合同生效后，资产管理人和资产托管人相互配合，根据中国人民银行、中央国债登记结算有限责任公司以及银行间清算所股份有限公司的有关规定，在债券登记结算机构开立

的专用债券账户，并代表资产管理计划进行银行间市场债券的结算。

5、定期存款账户开立和管理

投资定期存款管理人需在存款机构开立银行账户，定期存款账户户名应与托管账户保持一致，该账户预留印鉴经与资产托管人商议后预留。资产管理人与存款机构签订定期存款协议，协议中涉及资产托管人相关职责的约定须由资产管理人和资产托管人双方协商一致后签署。该协议内容应至少包含起息日、到期日、存款金额、存款账户、存款利率、存款是否可以提前支取、定存到期支取账户、存款证实书如何交接以及存款证实书不得转让质押等条款，同时需约定资产托管人经办行名称、地址和账户，并将本资产管理计划托管账户指定为唯一回款账户。

6、证券投资基金账户的开立和管理

资产委托人授权资产管理人为本委托资产在指定的基金公司或第三方销售机构及相关服务平台以本产品的名义开立证券投资基金账户，用于办理本委托资产投资于开放式基金时的基金份额登记和交割，并确保在产品存续期间托管账户为所投资的基金发生分红和赎回时的唯一资金回款账户。资产委托人在此授权资产管理人管理开立和使用上述账户，资产管理人需及时书面告知资产托管人该账户的相关信息，及时发送基金确认、分红或赎回等业务单据的复印件。

7、其他账户的开立和管理

(1) 因业务发展需要而开立的其他账户，可以根据法律法规和资产管理合同的规定，由资产管理人或资产托管人负责开立。新账户按有关规定使用并管理。

(2) 法律法规等有关规定对相关账户的开立和管理另有规定的，从其规定办理。

十七、投资指令的发送、确认和执行

（一）交易清算授权

1、资产管理人应事先书面通知（以下称“授权通知”）资产托管人有权发送指令的人员名单（以下称“指令发送人员”），授权通知应注明相应的交易权限、授权生效时间、预留印鉴和被授权人签字样本。授权通知书加盖公章。资产管理人应保证其提供的授权通知中授权人个人信息已获得授权人的同意。资产托管人在收到授权通知当日向资产管理人电话确认。授权通知经电话确认后于授权通知载明的生效日期和资产托管人向资产管理人电话确认后中较晚的时间生效。资产管理人和资产托管人对授权通知负有保密义务，不得向被授权人及相关操作人员以外的任何人泄露。

（二）投资指令的内容

投资指令是资产管理人在运用资产管理计划财产时，向资产托管人发出的资金划拨及其他款项支付的投资指令。资产管理人发给资产托管人的投资指令应写明款项事由、支付时间、到账时间、金额、收付款账户信息等，按授权文件加盖预留印鉴及被授权人签字或签章。

（三）投资指令的发送、确认及执行的时间和程序

资产管理人应按照有关法律法规和本合同的规定，在其合法的经营权限和交易权限内发送投资指令。被授权人应按照其授权权限发送投资指令，对于被授权人发出的投资指令，资产管理人不得否认其效力。

投资指令由被授权人以电子指令、传真、电子邮件或其他双方认可的方式向资产托管人发送，并及时与资产托管人进行电话确认。资产管理人发送投资指令的指定邮箱为：

【caobz@chinaamc.com、lih@chinaamc.com、yucy@chinaamc.com、vnts@chinaamc.com】。对于因资产管理人未能及时与资产托管人进行投资指令确认，致使资金未能及时划拨所造成的损失由资产管理人承担。

资产管理人发送投资指令后应该给资产托管人预留足够的执行时间。资产管理人要求当天某一时点到账，投资指令需提前2个工作小时发送。场外及限时发送投资指令的截止时间为当天的15:00。如遇特殊情况晚于截止时间，资产托管人尽量完成，但不承担因延误发送投资指令造成的任何损失。对于新股申购网下公开发行业务，资产管理人应在网下申购缴款日（T日）的前一日下班前将新股申购投资指令发送给资产托管人，投资指令发送时间最迟不应晚于T日上午10:00时。

资产管理人应保证资产托管人在执行投资指令时，托管账户上有充足的资金。资金头寸不足时，资产托管人有权拒绝执行投资指令，并视托管账户资金充足时为投资指令送达时间。

资产托管人收到投资指令后，应及时复核印鉴和签名与授权文件的预留印鉴和签名的表面

一致性，按本合同约定对投资指令进行复核。资产管理人发送投资指令时应向资产托管人发送必要的合同、交易凭证、费用发票等划款证明文件，同时资产托管人有权根据投资指令的内容要求资产管理人提供划款证明文件。资产管理人对提供文件资料的合法、合规、真实、完整和有效负责，并承担由于上述文件不合法、不真实、不完整或失去效力而造成的任何损失。

资产管理人应在进行银行间同业市场交易后将交易成交单加盖预留印鉴，及时以传真、电子邮件或其他双方认可的方式发送给资产托管人并电话确认，或者资产管理人出具加盖预留印鉴的书面文件，说明不再出具交易成交单，并与资产托管人确认接收后生效。如果银行间簿记系统已经生成的交易需要取消或终止，资产管理人要书面通知资产托管人。

本计划财产托管账户发生的银行结算费用、银行账户维护费等银行费用，由资产托管人直接从托管账户中扣划，无须资产管理人另行出具投资指令。

资产托管人在收到有效投资指令后，对于同一批次的投资指令随机执行，如有特殊支付顺序，资产管理人应提前告知。如因资产管理人未及时告知，导致资产托管人未按资产管理人需要的顺序执行投资指令造成的资金及其他损失由资产管理人承担。

（四）资产托管人依法暂缓、拒绝执行指令的情形和处理程序

资产托管人在履行监督职能时，发现资产管理人的投资指令违反法律法规，或者违反本合同约定的，有权拒绝执行，并及时通知资产管理人。

（五）资产管理人发送错误指令的情形和处理程序

资产管理人发送错误投资指令的情形包括违反法律法规和资产管理合同，投资指令发送人员无权或超越权限发送投资指令，投资指令中重要信息模糊不清或不全等。

资产管理人如需修改、撤销或停止执行已经发送的投资指令，应先与资产托管人电话联系。若资产托管人还未执行，资产管理人应重新发送修改投资指令或在原投资指令上注明“作废”字样并由投资指令发送人员签字，资产托管人收到修改或停止执行的投资指令后，将按新投资指令执行；若资产托管人已执行原投资指令，则应与资产管理人电话说明。

资产管理人的投资指令存在事实上未经授权、欺诈、伪造或未能及时提供授权通知等情形，资产托管人执行有关指令或拒绝执行有关指令而给资产管理人或受托资产或任何第三方带来的损失由资产管理人承担。

（六）更换投资指令被授权人的程序

（1）资产管理人更换被授权人、更改或终止对被授权人的授权范围的，应至少提前3个工作日通知资产托管人，并于新授权书生效前将加盖资产管理人公章的新授权书书面文件送达资产托管人。该变更将在资产托管人收到正式书面通知原件并电话确认后正式生效，同时原授权书作废。被授权人变更通知生效前，资产托管人仍应按原约定执行指令，资产管理人不得否认其效力。在特殊情况下，可按双方商定的方式处理。如果资产管理人授权人员名单、权限有

变化时,未能按本合同约定及时通知资产托管人并预留新的印鉴和签字样本而导致计划资产受损的,资产托管人不承担任何形式的责任。

(2) 资产托管人更换接受资产管理人指令的人员,应提前通知资产管理人,并通过电话确认。

(七) 撤回指令的处理程序

管理人撤回已发送至托管人的指令,须向托管人传真或通过电子邮件发送加盖预留印鉴的作废指令并电话确认,托管人收到作废指令并得到确认后,将该指令作废;如果托管人在收到作废指令并得到确认时该指令已执行,则该指令无法撤回。

(八) 投资指令的保管

投资指令及相关附件原件由资产管理人保管,资产托管人保管资产托管人收到的投资指令及相关附件文件扫描件或传真件。当两者不一致时,以资产托管人收到的业务投资指令及相关附件文件扫描件或传真件为准。

(九) 其他相关责任

在正常业务受理渠道和指令规定的时间内,因资产托管人原因未能及时或正确执行符合本合同规定、合法合规的投资指令而导致资产管理计划财产受损的,资产托管人应承担相应的责任,但银行托管专户余额不足或资产托管人如遇到不可抗力的情况除外。

十八、越权交易

（一）越权交易的界定

越权交易是指资产管理人违反有关法律法规的规定以及违反或超出本合同项下资产委托人的授权而进行的投资交易行为，包括：

- 1、违反有关法律法规和本合同规定进行的投资交易行为。
- 2、法律法规禁止的超买、超卖行为。

资产管理人应在有关法律法规和本合同规定的权限内运用资产管理计划财产进行投资管理，不得违反有关法律法规和本合同的约定，超越权限管理、从事投资。

（二）越权交易的处理程序

- 1、违反有关法律法规和本合同规定进行的投资交易行为

资产托管人在本节第（三）条约定监督范围内，发现资产管理人的投资指令违反法律法规的规定，或者违反本合同约定的，应当拒绝执行，立即通知资产管理人并有权按监管要求报告相关机构。

资产托管人在本节第（三）条约定监督范围内，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法规的规定，或者违反本合同约定的，应当立即通知资产管理人并有权按监管要求报告相关机构。

资产管理人应向资产委托人和资产托管人主动报告越权交易。在限期内，资产委托人和资产托管人有权随时对通知事项进行复查，督促资产管理人改正。资产管理人对资产委托人和资产托管人通知的越权事项未能在限期内纠正的，资产托管人应按监管要求报告相关机构。

- 2、法律法规禁止的超买、超卖行为

资产托管人在行使监督职能时，如果发现资产管理计划财产投资证券过程中出现超买或超卖现象，应立即提醒资产管理人，由资产管理人负责解决。

3、非因资产管理人主观因素导致本计划投资突破法律法规或本合同约定的情形，资产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 20 个交易日内调整完毕。法律法规、中国证监会等监管部门另有规定的从其规定。

4、因资产管理人过错导致的越权交易所发生的直接经济损失及相关交易费用由资产管理人负担，所发生的收益归本资产管理计划财产所有。

（三）资产托管人对资产管理人投资运作的监督

1、资产托管人对资产管理人的投资行为行使监督权。资产托管人根据法律法规或本合同明确约定的投资范围、投资比例、投资限制等内容进行投资监督。

- 1) 投资范围及比例

投资范围：

1、在证券/期货交易所等国务院同意设立的交易场所集中交易清算的期货、期权等期货和衍生品类资产。

2、银行存款、现金、国债逆回购等。

3、公募证券投资基金（含 QDII、互认基金）等。

4、国内依法在上海证券交易所、深圳证券交易所、北京证券交易所发行上市的股票（包括主板、创业板、中小板、科创板、北交所及其他经中国证监会核准上市的股票）等。

投资比例：

1、本计划投资于期货和衍生品类资产的持仓合约价值的比例低于本计划总资产的 80%或衍生品账户权益不超过本计划总资产的 20%；

2、本计划投资于固定收益类资产的比例按市值计算低于本计划总资产的 80%；

3、本计划投资于权益类资产的比例低于本计划总资产的 80%。

非因资产管理人主观因素导致突破前述比例限制的，资产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 20 个工作日内调整至符合要求。

如法律法规或监管机构以后允许集合资产管理计划投资其他品种，资产管理人在征得全体资产委托人，资产托管人一致书面同意后，并且资产管理人履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

2) 投资限制

除投资范围部分规定的投资比例限制外，本计划还需遵循以下限制：

a、本计划总资产不得超过净资产的 200%；

b、投资于同一资产的资金不得超过本计划资产净值的 25%；资产管理人管理的全部集合资产管理计划投资于同一资产的资金，不得超过该资产的 25%；银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券等中国证监会认可的投资品种除外；（针对本条，托管人在资产管理人托管在托管人处的产品范围内进行监督）

c、开放退出期内，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%，主动投资于流动性受限资产的市值在开放退出期内合计不得超过该资产管理计划资产净值的 20%。

d、法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的，从其规定。

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资产管理人之外的因素导致资产管理计划投资不符合法律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，资产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工作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，资产管理人应当及时向中国证

监会相关派出机构报告。

2、资产托管人对资产管理人的投资行为行使监督权，根据本合同相关约定对本计划投资范围、投资比例、投资限制进行监督。托管人投资监督的准确性、完整性和及时性受限于管理人及其他中介机构提供的数据信息。因管理人及其他中介机构提供的信息的真实性、准确性、完整性和及时性所引起的损失，由信息提供方承担相应的责任。

投资于《管理办法》第三十八条第（五）项规定资产时，资产托管人根据本合同“十七、投资指令的发送、确认和执行”中约定的投资指令审核要点进行审查，同时根据法律法规或本合同明确约定的投资范围、投资比例、投资限制等内容进行投资监督。

3、资产托管人对资产管理人的投资监督和检查自本合同生效之日起开始。

（四）如因法律法规或本合同变更需调整上述监督职责的，资产管理人应提前以书面形式通知资产托管人。

十九、交易及清算交收安排

（一）选择代理证券买卖的证券经营机构的程序（如涉及）

资产管理人负责选择代理本资产管理计划财产证券买卖的证券经营机构，并与其签订专用证券交易单元租用协议。资产管理人应及时将资产管理计划财产专用交易单元号、佣金费率等基本信息以及变更情况及时以书面形式通知资产托管人。本资产管理计划证券交易数据传输及清算交收相关约定，资产管理人、资产托管人将与证券经纪商另行签署《证券经纪服务协议》。

（二）投资证券后的清算交收安排

1、场内外证券资金结算处理程序

（1）场内证券资金结算

资产管理人向资产托管人发送银证转账指令，划拨场内投资资金。本着安全保管计划财产的原则，在不影响本计划投资管理且和资产管理人协商一致的前提下，可定期或不定期将证券资金账户余额划入托管账户。

本计划的托管账户与证券资金账户通过“第三方存管”平台同步，证券经纪服务商日终清算完成后将交易所格式数据以约定方式发送给资产管理人、资产托管人。资产管理人、资产托管人根据 T 日交易数据各自进行清算并与证券经纪服务商提供的证券资金账户对账单进行核对。资产管理人、资产托管人双方核对 T 日交易清算金额如果发现差异时按以下情况分别处理：

a. 当日证券清算差异小于 1.00 元的，不查差异原因，以证券经纪服务商提供的对账单为准；

b. 当日证券清算差异大于（含等于）1.00 元的，资产管理人发现问题后即刻通知资产托管人，并同时与证券经纪服务商立即逐笔核对 T 日交易明细并查明差异原因，如是资产托管人差错，则资产托管人自行调整，并将结果通知资产管理人；如是资产管理人差错，则由资产管理人自行调整，并将结果通知资产托管人；如是证券经纪服务商差错，则证券经纪服务商将调整后的相关数据和资料重新发送资产管理人及资产托管人。

（2）场外证券资金结算

资产管理人负责场外交易的实施，资产托管人负责根据资产管理人划款指令进行场外交易资金的划付。

2、无法按时支付证券清算款的责任认定及处理程序

资产管理人应确保资产托管人在执行资产管理人发送的指令时，有足够的头寸进行交收。对于场外证券交易，资产管理计划财产的资金头寸不足时，资产托管人有权拒绝资产管理人发送的划款指令。如由于非资产托管人的原因导致无法按时支付证券清算款，给资产管理计划财产造成损失的，资产托管人不承担责任。

在资金头寸充足的情况下，资产托管人对资产管理人在正常业务受理渠道和指令规定的时

间内发送的符合法律法规、本合同的指令不得拖延或拒绝执行。如由于资产托管人的原因导致资产管理计划财产无法按时支付证券清算款，由此造成的损失由资产托管人承担，但资产托管人如遇到不可抗力的情况除外。

(三) 资金、证券账目及交易记录的核对

资产管理人和资产托管人定期对资产的证券账目、实物券账目、交易记录进行核对。

二十、资产管理计划财产的估值和会计核算

（一）估值目的

资产管理计划估值目的是为了准确、真实地反映资产管理计划相关金融资产和金融负债的公允价值，并为资产管理计划份额的参与和退出等提供计价依据。

（二）估值时间

资产管理人每交易日对资产管理计划财产进行估值。

（三）估值程序

资产管理人应于估值日交易结束后计算当日的资产管理计划资产净值并与资产托管人核对。

（四）估值依据

估值应符合本合同、《企业会计准则》、《资产管理产品相关会计处理规定》、《证券投资基金会计核算业务指引》及其他法律法规的规定，如法律法规未做明确规定的，参照证券投资基金估值、核算相关的法律法规及行业通行做法处理。

（五）估值方法

1、本计划按以下方式进行估值：

（1）投资期货和衍生品类品种的估值方法

期货合约按照期货交易所估值日的结算价估值，若估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。法律法规另有规定的，从其规定。

（2）银行存款以余额列示，按商定的存款利率以当日银行营业终了的存款余额为基数在实际持有期间内逐日计提应计利息。

（3）持有的货币市场基金，按基金管理公司公布的估值日前一工作日的每万份收益计提收益。

（4）上市流通的证券投资基金、公募 REITs 基金按估值日其所在证券交易所的收盘价估值，特别的，QDII 公募基金以最近一个工作日公布的收盘价为准；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值；

（5）在场外交易的开放式基金（包括托管在场外的上市开放式基金（LOF））以估值日前一工作日的基金份额净值估值，特别的，QDII 公募基金以最近一个工作日公布的基金份额净值为准。估值日开放式基金份额净值未公布的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日公告的基金份额净值计算。如果估值日无基金份额净值，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。

(6) 场内期权合约，按估值日的结算价估值，若估值当日无结算价的，且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大变化的，采用最近交易日结算价估值。

(7) 债券、回购等计息资产按照约定利率在持有期内逐日计提利息，在利息到账日以实收利息入账。

(8) 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、权证等），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) 同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

a.交易所上市交易或挂牌转让的不含权固定收益品种（合同另有约定的除外），选取估值日第三方估值机构（中证）提供的相应品种对应的估值净价估值。

b.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（中证）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；交易所上市交易的可转换债券以每日收盘价作为估值全价；交易所市场挂牌转让的资产支持证券、私募债券，第三方估值机构（中证）公布净价的按照第三方净值估值，如无第三方净价则采用估值技术确定公允价值。

c.对在交易所市场未上市或未挂牌转让的债券，应以活跃市场上未经调整的报价作为计量日的公允价值；对于活跃市场报价未能代表计量日公允价值的情况下，应对市场报价进行调整以确认计量日的公允价值；对于不存在市场活动或者市场活动很少的情况下，则采用估值技术确定公允价值。

d. 全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券、资产支持票据等固定收益品种，采用第三方估值机构（中债）提供的估值日的估值净价进行估值或采用估值技术确定公允价值。

e. 对于含投资者回售权的固定收益品种，行使回售权的，在回售登记日至实际收款日期间选取第三方估值基准服务机构提供的相应品种的唯一估值净价或推荐估值净价，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，在回售登记截止日（含当日）至回售兑付除权日（不含当日）选取第三方估值基准服务机构提供的长待偿期对应的净价进行估值。

(9) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，资产管理人可根据具体情况与资产托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

(10) 可以从第三方渠道获取可靠数据的，应当主要使用第三方数据进行会计核算。若有充足证据表明第三方提供的数据不能真实反映公允价值的，经管理人与托管人双方协商一致

后，可采用估值技术确定公允价值。

使用模型估值的，应当审慎确定模型参数，不得随意调整。

对于仅依赖管理人所提供数据（包括但不限于管理人自建模型定价）且无法从其他渠道获取可靠数据进行会计核算的投资品种，管理人应对该估值数据的真实性、准确性、完整性、合规性负责，因上述估值数据错误导致估值结果的不真实、不准确、不完整、不合规，托管人不承担任何责任。

（11）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。

2、如使用侧袋估值等特殊估值方法的，应进行明确约定，并在风险揭示书中进行特别揭示。

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

（六）估值对象

资产管理计划财产项下所有的期货和衍生品类资产、固定收益类资产、权益类资产、应收款项、其他投资等资产及负债。

（七）估值错误的处理

1、资产管理人和资产托管人将采取必要、适当、合理的措施确保资产管理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2位以内(含第2位)发生差错时，视为资产管理计划份额净值错误。

2、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，则有协助义务的当事人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)当发生资产管理计划份额净值计算错误时，由资产管理人、资产托管人协商处理，由此给资产管理计划财产造成损失的，由差错方根据过错程度承担相应赔偿责任。

2)当资产管理计划份额净值计算差错给资产管理计划财产或投资者造成损失需要进行赔偿时，资产管理人和资产托管人应根据实际情况界定双方承担的责任，经确认后按以下条款进

行赔偿：

①本资产管理计划的主会计责任方由资产管理人担任，与本资产管理计划有关的会计问题，如经双方在平等基础上充分讨论后，尚不能达成一致时，按资产管理人的建议执行，由此给资产管理计划财产或投资者造成的损失，由资产管理人负责赔付；

②若资产管理人计算的资产管理计划份额净值已由资产托管人复核确认后公告，而且资产托管人未对计算过程提出疑义或要求资产管理人书面说明，资产管理计划份额净值出错且造成投资者损失的，应根据法律法规的规定向投资者支付赔偿金，就实际向投资者支付的赔偿金额，资产管理人与资产托管人按照各自过错比例各自承担相应的责任。

3、资产管理人、资产托管人按本估值方法规定的公允价值进行估值时，所造成的误差不作为估值错误处理。

4、由于不可抗力原因，或由于证券交易所、中国结算及银行间市场登记结算机构发送的数据错误，会计政策变更等，资产管理人和资产托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，由此造成的资产管理计划财产估值错误，资产管理人和资产托管人免除赔偿责任。但资产管理人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

5、前述内容如法律法规或监管机构另有规定的，按其规定处理。

（八）估值调整的情形与处理

如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，资产管理人可根据具体情况与资产托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

相关法律法规以及监管部门有强制规定的，上述估值方法需依据规定进行调整的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

（九）暂停估值的情形

- 1、资产管理计划投资所涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；
- 2、因不可抗力或其它情形致使资产管理人、资产托管人无法准确评估本计划资产价值时；
- 3、占资产管理计划相当比例的投资品种的估值出现重大转变，而资产管理人为保障投资者的利益，已决定延迟估值；
- 4、中国证监会和本合同认定的其它情形。

（十）资产管理计划份额净值的确认

资产管理计划资产净值是指资产管理计划资产总值减去负债后的价值。资产管理计划资产净值的计算保留到小数点后2位，小数点后第3位四舍五入。资产管理计划份额净值的计算保留到小数点后4位，小数点后第5位四舍五入。

如资产管理人和资产托管人对资产管理计划份额净值的计算结果，虽然多次重新计算和核对，尚不能达成一致时，为避免不能按时公布资产管理计划份额净值的情形，管理人向托管人

出具盖章的书面说明后，以资产管理人的计算结果对外公布，并对估值不一致事项进行说明。管理人发布未经托管人复核或托管人复核不一致的估值结果造成的损失，由管理人承担赔偿责任，托管人不负赔偿责任。

（十一）资产管理计划财产的会计核算

资产管理计划的会计政策比照现行政策或按照资产管理合同约定执行。

1、会计年度、记账本位币和会计核算制度

（1）本计划财产的会计年度为每年1月1日至12月31日。

（2）记账本位币为人民币，记账单位为元。

（3）资产管理计划财产的会计核算按《证券投资基金会计核算业务指引》或者按照资产管理合同约定执行。

2、会计核算方法

（1）资产管理人、资产托管人应根据有关法律法规和投资者的相关规定，对资产管理计划财产单独建账、单独核算。

（2）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，编制会计报表。

（3）资产托管人应定期与资产管理人就资产管理计划财产的会计核算、报表编制等进行核对。

（4）实收计划财产采用份额法进行核算。

二十一、资产管理计划的费用与税收

(一)资产管理业务费用的种类

- 1、资产管理人的固定管理费；
- 2、资产管理人的业绩报酬；
- 3、资产托管人的托管费；
- 4、受托资产拨划支付的银行费用；
- 5、受托资产的证券等账户的开户费用以及投资交易费用；
- 6、资产管理计划成立后的资产管理计划信息披露费用；
- 7、资产管理计划成立后与资产管理计划有关的会计师费、审计费、律师费、仲裁费、诉讼费、保全费等；
- 8、按照法律法规及本合同的约定可以在受托资产中列支的其他费用。

(二)费用计提方法、计提标准和支付方式

1、资产管理人的固定管理费

本计划成立后每个运作期一次性收取固定管理费，

第*i*个运作期的固定管理费=第*i*个运作期的计费基准×一次性固定管理费率【1.2】%（非年化）。

其中：

第1个运作期的计费基准为本计划初始募集规模，后续运作期的计费基准为当个运作期第二个工作日的资产管理计划资产净值；

上述一次性收取的固定管理费自本计划每个运作期起始日起【五】个工作日内经资产管理人与资产托管人核对一致后，由资产托管人依据管理人的相关指令从受托资产中一次性支付给资产管理人，并自支付之日（含）起至当个运作期第三个月对应的开放日（不含）逐日摊销。如资产管理计划在运作期内提前终止，已收取的上述固定管理费不予退还，未摊销的上述固定管理费在资产管理计划终止日一次摊销完毕。

2、资产管理人的业绩报酬

本计划业绩报酬计提日为除息日（若有）、赎回申请日和计划终止日。业绩报酬计提确认日为收益分配确认日（若有）、赎回确认日和计划终止确认日（原则上为业绩报酬计提日下一交易日）。若某次分红（若有）对应的除息日与本计划上一次发生业绩报酬计提对应的除息日期间隔期短于【6】个月时，则该次分红的除息日及其对应的收益分配确认日（若有）不计提业绩报酬。

(1) 业绩报酬计提原则

①委托人每笔参与份额分别计算期间年化收益率并计提业绩报酬。在符合业绩报酬计提条件时，在本计划赎回确认日、收益分配确认日（若有）和计划终止确认日计提业绩报酬。

②计划收益分配确认日（若有）提取业绩报酬的，业绩报酬从收益分配资金中扣除且不超过收益分配资金。在赎回确认日和计划终止确认日提取业绩报酬的，业绩报酬从赎回资金或清算资金中扣除。

③在赎回确认日和计划终止确认日，业绩报酬按委托人赎回份额或计划终止时持有份额计算。如赎回份额为一笔认购/申购份额的一部分，则将该赎回份额单独核算业绩报酬，而该笔认购/申购份额的剩余部分不受影响。

（2）业绩报酬计提方法

业绩报酬的计提，以该笔份额上一个发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日（简称“上一个业绩报酬计提日”）至本次业绩报酬计提日的期间为基准。如委托人第 j 笔份额未发生业绩报酬计提，认购所得的份额，以本计划成立日作为上一个业绩报酬计提日；申购所得的份额，以申购申请对应的开放日作为上一个业绩报酬计提日；收益分配所得的份额（若有），以红利再投资对应的除息日为准。

委托人赎回计划份额时，按照“先进先出”法依次逐笔计算计划份额所属认购/申购记录的业绩报酬。

① 期间年化收益率的计算公式

$$R_j = \frac{NAV_j^k - NAV_j^h}{NAV_j^l} \times 365 \div T$$

其中：

其中， R_j 为投资者持有的第 j 笔份额的年化收益率；

NAV_j^k 为本次业绩报酬计提日投资者持有的第 j 笔份额的份额累计净值；

NAV_j^h 为上一个业绩报酬计提日投资者持有的第 j 笔份额的份额累计净值（首次计提时，则为初始面值或参与时份额累计净值）；

NAV_j^l 为上一个业绩报酬计提日投资者持有的第 j 笔份额的份额净值（首次计提时，则为初始面值或参与时份额净值）；

T 为前一次业绩报酬计提确认日（含）到本次业绩报酬计提确认日（不含）的天数；

② 管理人以超额比例的方式提取业绩报酬，业绩报酬计提基准 R_{zs} （年化）具体计算公式如下， R_{zs} 为该笔份额上一个业绩报酬计提日到本次业绩报酬计提日期间的跟踪标的年化收益率，计算公式为：

$$R_{zs} = [(H1 - H0) \div H0] \times (365 \div T) \times 100\%$$

$H0$ 为上一个业绩报酬计提日的跟踪标的收市价格，若委托人第 j 笔份额未发生业绩报酬

计提，则为计划成立日的跟踪标的收市价格（适用于认购份额），或第j笔份额申购申请对应开放日的跟踪标的收市价格（适用于申购份额），或第j笔分红所得的份额在红利再投资对应的除息日的跟踪标的收市价格（适用于收益分配所得的份额，若有）；

H1 为该笔份额本次业绩报酬计提日的跟踪标的收市价格；

T 为前一次业绩报酬计提确认日（含）到本次业绩报酬计提确认日（不含）的天数；

跟踪标的收盘价以交易所和/或挂钩标的发布机构发布的挂钩标的收盘价格为准，且四舍五入精确到小数点后2位。若因不可抗力该收盘价未能公布，由管理人按照相关规则及协议约定处理。

期间年化收益率		收取比例	业绩报酬计算公式
Rzs ≤ 0% 时	$R_j \leq Rzs * 80\%$	0	E = 0
	$0\% \geq R_j > Rzs * 80\%$		
	$R_j > 0\%$	30%	$E = \sum_{j=1}^m [S_j \times NAV_j^t \times (R_j - 0\%) \times 30\% \times T \div 365]$
Rzs > 0% 时	$R_j \leq Rzs * 120\%$	0	E = 0
	$R_j > Rzs * 120\%$	30%	$E = \sum_{j=1}^m [S_j \times NAV_j^t \times (R_j - Rzs * 120\%) \times 30\% \times T \div 365]$

其中：

E 为此次应计提的业绩报酬；

S_j 为：a、退出时为此次业绩报酬计提时投资者退出的第j笔计划份额；

b、收益分配时为此次业绩报酬计提时投资者持有的第j笔计划份额；

c、终止清算时为此次业绩报酬计提时投资者持有的第j笔计划份额；

m 为此次业绩报酬计提时投资者涉及的持有份额笔数。

业绩报酬在资产管理计划业绩报酬计提日计算，由资产管理人负责计算，托管人不负责复核。由资产管理人于资产管理计划业绩报酬计提日后三个工作日内向托管人发送业绩报酬划付指令，由资产托管人根据资产管理人的付费指令从资产管理计划资产中一次性支付给管理人。

根据《基金管理公司特定客户资产管理子公司风险控制指标管理暂行规定》等相关规定，资产管理人管理费收入均应计提风险准备金。资产管理人的管理费和风险准备金收费账户如下：

资产管理人指定的接收固定管理费/业绩报酬的银行账户信息：

账户名称：华夏资本管理有限公司

账号：44201501100052551736

开户行：中国建设银行深圳市分行营业部

风险准备金收款账户：

账户名称：华夏资本管理有限公司

账号：11050137510000001547

开户行：中国建设银行股份有限公司北京复兴支行

3、资产托管人的托管费

本计划的托管费按计划资产净值的 0.01% 年费率计提。托管费的计算方法如下：

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

H 为每日应计提的托管费

E 为前一自然日的计划资产净值（首日以产品成立的初始规模）

本计划的托管费自计划成立日起，每日计提，定期支付，经资产管理人和资产托管人核对后，托管人于下自然季度初五个工作日之内依据管理人划款指令将上一季度计提的托管费从本集合计划中一次性支付给托管人。若因不可抗力或持有的受托资产无法及时变现致使无法按时支付的，则在不可抗力或无法变现的情形消除后的首个工作日支付。本计划终止（包括提前或延期）后，依据清算程序支付尚未支付的托管费。

资产托管人指定的接收托管费的银行账户信息如下：

账户名称：基金公司特定客户资产托管业务收入

账号：94010142110000104

开户行：上海浦东发展银行宁波分行

4、上述(一)中其他项费用由资产托管人根据其他有关法规及相应协议的规定，按费用支出金额支付，列入或摊入当期受托资产运作费用。

(三)不列入资产管理业务费用的项目

1、资产管理人和资产托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或受托资产的损失，以及处理与本资产管理计划财产运作无关的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。

2、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。

3、其他根据相关法律法规及中国证监会、基金业协会的有关规定不得列入计划费用的项目。

(四)资产管理人和资产托管人与资产委托人协商一致后，可根据市场发展情况调高资产管理费率、资产托管费率并履行相应备案报告义务。本合同另有约定的，从其约定。各方当事人一致同意：资产管理人有权单方调低管理费率、调低业绩报酬计提比例或调高管理人业绩报酬

计提基准,或者与资产托管人协商一致后调低托管费率,此等变更由资产管理人通过公告告知资产委托人即视为履行了信息披露义务,并另行书面通知资产托管人。

(五)缴税安排本计划运作过程中涉及的各项纳税主体,其纳税义务按其适用的税收法律法规执行。资产委托人应缴纳的税收,由资产委托人负责,资产管理人不承担代扣代缴或纳税的义务。

根据法律法规或财政、税务主管部门明确要求资产管理人代扣代缴或承担受托资产运营所产生的增值税或其他税费(如有)扣缴义务的,资产管理人有权根据实际情况遵照规则从本计划受托资产中提取并代扣代缴/缴纳。

若本计划存续期间进行收益分配(如有)后,因本计划受托资产运营所涉相关税费存在应缴但未缴情形的,或本计划终止后出现税务主管部门向资产管理人追缴本计划受托资产运营的相关税收的,资产管理人有权向资产委托人追偿。

本计划应承担的相关税收由本计划受托资产直接缴付,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。

二十二、资产管理计划的收益分配

（一）资产管理计划利润的构成

资产管理计划利润指利息收入、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；资产管理计划已实现收益指资产管理计划利润减去公允价值变动收益后的余额。

（二）资产管理计划可供分配利润

资产管理计划可供分配利润指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。

（三）收益分配原则

本资产管理计划收益分配应遵循下列原则：

- 1、本计划的每份资产管理计划同级份额享有同等分配权；
- 2、收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，资产管理计划注册登记机构可将投资者的现金红利按除权后的计划份额净值自动转为资产管理计划份额；
- 3、在符合有关资产管理计划分红条件的前提下，本计划每年最多分配4次；
- 4、若资产管理计划生效不满3个月则可不进行收益分配；
- 5、本计划收益分配方式分为两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利按除权后的计划份额净值自动转为资产管理计划份额进行再投资；若投资者不选择，本计划默认的收益分配方式是现金分红；
- 6、资产管理计划收益分配后每份资产管理计划份额净值不能低于面值，即资产管理计划收益分配基准日的资产管理计划份额净值减去每单位资产管理计划份额收益分配金额后不能低于面值；
- 7、法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

（四）收益分配方案

资产管理计划收益分配方案中应载明收益分配基准日以及该日的可供分配利润、资产管理计划收益分配对象、分配原则、分配时间、分配数额、分配方式等内容。

（五）收益分配的确定与通知

资产管理计划收益分配方案由资产管理人拟订，由资产托管人根据可掌握数据对分配总额进行复核，由资产管理人通知投资者。

（六）收益分配的执行方式

在收益分配方案确定后，资产管理人依据具体方案的规定就支付的现金红利向资产托管人发送划款指令，资产托管人按照资产管理人的指令及时进行分红资金的划付。

二十三、信息披露与报告

(一) 向资产委托人提供的报告

1、年度报告

资产管理人应当在每年结束之日起 4 个月内，编制完成计划年度报告并经资产托管人复核。年度报告应当披露报告期内本资产管理计划运作情况，包括但不限于管理人履职报告、托管人履职报告、资产管理计划投资表现、资产管理计划投资组合报告、资产管理计划运用杠杆情况（如有）、资产管理计划财务会计报告、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、资产管理计划投资收益分配情况（如有）、投资经理变更、重大关联交易等涉及投资者权益的重大事项以及中国证监会及基金业协会规定的其他事项。资产管理计划成立未满 3 个月或者存续期间不足 3 个月的，不编制当期的年度报告。

资产管理人每年度结束后三个月内向托管人提供其编制的年度报告供托管人复核，资产托管人在收到后 1 个月内复核其中的财务数据，并将复核结果书面通知资产管理人。

2、季度报告

资产管理人应当在每季度结束之日起 1 个月内，编制完成计划季度报告并经资产托管人复核。季度报告应当包括但不限于管理人履职报告、托管人履职报告、资产管理计划投资表现、资产管理计划投资组合报告、资产管理计划运用杠杆情况（如有）、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、资产管理计划投资收益分配情况（如有）、投资经理变更、重大关联交易等涉及投资者权益的重大事项以及中国证监会及基金业协会规定的其他事项。资产管理计划成立未满 3 个月或者存续期间不足 3 个月的，不编制当期的季度报告。

资产管理人在每季度结束后 20 日内向托管人提供其编制的季度报告供托管人复核，资产托管人在收到后 10 日内复核其中的财务数据，并将复核结果书面通知资产管理人。

3、净值报告

资产管理合同生效后，资产管理人按本合同约定的方式披露每周最后一个交易日、开放日当日份额净值。

4、临时报告

发生本合同约定的、可能影响资产委托人利益的重大事项时，资产管理人应当在事件发生之日起 5 日内及时通知资产委托人：

- (1) 投资经理发生变动；
- (2) 涉及资产管理人、计划财产、对本计划托管业务产生重大不利影响的诉讼；

(3) 资产管理人、资产托管人托管业务部门与本合同项下资产管理计划财产相关的行为受到监管部门的严重行政处罚；

(4) 资产管理人及其董事、总经理及其他高级管理人员、投资经理受到严重行政处罚，资产托管人的托管业务或托管业务部门负责人受到严重行政处罚；

(5) 法律法规、监管机构、自律组织的其他事项。

5、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，应向投资者充分披露。

6、清算报告

本计划清算完成后，清算报告报中国证券投资基金业协会后的 5 个工作日内，以合同约定的方式告知委托人。

7、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。

8、资产托管人出具托管人履职报告，并对上述信息披露事项中的资产管理计划净值，以及定期报告和清算报告中的财务数据进行复核，即视为资产托管人已完全履行了托管人的信息披露义务。

9、为免疑义，资产管理人向资产委托人提供的上述报告，不包括反映本计划交易过程的交易明细及交易凭证等信息。

(二) 向资产委托人提供报告及资产委托人信息查询的方式

资产管理人向资产委托人提供的报告，将严格按照以下至少一种方式进行，其中第二十三条第（一）款已列明的报告类型应至少通过管理人网站披露。在存有代销机构的情况下，资产管理人将上述信息通知到代销机构，视为已通知到资产委托人。资产委托人有义务随时与代销机构保持联系，了解有关本计划的各项信息。

1、资产管理人网站

在资产管理人网站披露有关本资产管理计划的信息。

资产管理人网站：<https://fund.chinaamc.com/capital>

2、邮寄服务

资产管理人或销售机构向资产委托人邮寄定期报告、临时报告等有关本计划的信息。资产委托人在合同签署页上填写的通信地址或在销售机构处预留的通信地址为送达地址。通信地址如有变更，资产委托人应当及时通知资产管理人和销售机构。

3、传真、电话、短信或电子邮件

如资产委托人留有传真号、电话号码、手机号码、电子邮箱等联系方式的，资产管理人和销售机构也可通过传真、电话、短信、电报等方式将报告信息通知资产委托人。

(三) 向监管机构提供的报告

资产管理人、资产托管人应当根据法律法规和监管机构的要求履行报告义务，包括但不限于资产管理人于每年结束 4 个月内通过系统等方式向监管机构报送产品年度报告，于每自然季度结束之日起 1 个月内通过系统等方式向监管机构报送产品季度报告，以监管机构最新要求为准。

(四) 信息保密义务

资产委托人根据上述资产管理合同的约定从资产管理人处获取的相关数据，仅供用于资产委托人了解本资产管理计划受托资产的相关投资状况，不得擅自以任何形式对外泄露、报导、转送，资产委托人不利用获取的相关数据进行内幕交易、不公平交易或者操作市场等其他违反证券法等法律法规的规定，不得向除资产委托人所指定数据接收人之外的其他方披露该等数据，法律法规另有规定或监管机关另有要求的除外。

资产委托人须采取必要的措施，将相关数据的知情者控制在最小范围内，不得在公司内部非业务相关部门或个人之间以任何形式传播，保证相关信息不被内部工作人员及外部相关人员利用获取的相关数据进行违法违规的交易。如违反前述义务，资产委托人应赔偿管理人因此造成的所有损失。

二十四、风险揭示

本计划投资可能面临下列各项风险，包括但不限于：

（一）资产管理计划面临的一般风险

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，在极端情况下委托人可能损失全部本金。资产管理人、资产托管人未对受托资产的收益状况作出任何承诺或担保。资产委托人充分理解投资本资产管理计划存在本金损失风险。

本计划属于【R4-中高风险】投资品种，适合合格投资者中的专业投资者及风险识别、评估、承受能力【C4】及以上的普通投资者认购。

2、市场风险

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

（1）政策风险

因国家宏观政策（如货币政策、财政政策、行业政策、地区发展政策等）发生变化，导致市场价格波动而产生风险。

（2）经济周期风险

随经济运行的周期性变化，各个行业和证券市场的收益水平也呈周期性变化。受托资产收益水平也会随之变化而导致风险。同时，经济周期影响资金市场的走势，可能导致委托人遭受损失。

（3）利率风险

金融市场利率的波动会导致证券市场价格和收益率的变动，及影响企业的融资成本和利润。受托资产收益水平会受到利率变化的影响。

（4）购买力风险

受托资产的利润将主要通过现金形式来分配，而现金可能因为通货膨胀的影响而导致购买力下降，从而使受托资产的实际收益下降，可能导致委托人遭受损失。

（5）再投资风险

再投资风险反映了利率下降对固定收益证券本息收入再投资收益的影响，这与利率上升所带来的利率风险互为消长。具体为当利率下降时，本计划财产从投资的固定收益证券所得的利息收入进行再投资时，将获得比之前较少的收益率。

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资产委托人承担。资产委托人应充分知晓投资运营的相关风险,其风险应由资产委托人自担。

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者大额退出等原因,不能迅速转变成现金,或者转变成现金会对资产价格造成重大不利影响的风险。另外,资产管理合同有效期内,除开放日外资产委托人不能退出本集合资产管理计划,本计划也不接受违约退出,对资产委托人存在流动性风险。本资产管理计划可能提前结束或延期结束,可能导致委托资金不能按期退出,对资产委托人存在流动性风险。

5、信用风险

因债务人、交易对手或持仓金融头寸的发行人未能按时履约或者信用资质恶化,给资产管理计划带来损失的风险。资产委托人应充分知晓相关信用风险,其风险应由资产委托人自担

6、投资标的风险

(1) 本计划资产可能投资于银行存款,银行存款的收益情况将影响本计划委托人的投资收益情况。如果交易对手延期支付银行存款本金或收益,则本计划的终止清算也将进行顺延,会对投资者的流动性需求有所影响。如果存款发生违约,无法全额支付银行存款本金或收益,则委托人将可能面临较大的损失。

(2) 本产品可能投资于场内期货、场内期权等期货和衍生品类资产,无论资产管理人是否出于投机目的对衍生品进行投资,由于衍生品的高杠杆性等特征,衍生品投资无论在任何情况下均具有较高的风险。场内衍生品投资风险包括但不限于:

1) 基差风险

在使用场内衍生品合约对冲市场风险的过程中,资产管理计划财产可能因为场内衍生品合约与标的物价格波动不一致而遭受基差风险。形成基差风险的潜在原因包括:

A.需要对冲的风险资产与场内衍生品标的物风险收益特征存在明显差异;

B.因未知因素导致场内衍生品到期时基差严重偏离正常水平;

C.因存在基差风险,在进行场内衍生品展期的过程中,受托资产可能会承受场内衍生品之间的价差向不利方向变动而导致的展期风险。

2) 杠杆风险

金融衍生品具有高杠杆性的特征,当出现不利行情时,本计划所投资期货合约品种微小的变动就可能使本计划遭受较大损失。

3) 到期日风险

场内衍生品到期时，资产管理计划财产如持有未平仓合约，交易所将按照交割结算价将受托资产持有的合约进行现金或实物交割，受托资产将无法继续持有到期合约，具有到期日风险。

4) 对手方风险

资产管理人运用受托资产投资于场内衍生品时，会尽力选择资信状况优良、风险控制能力强的期货或证券公司作为经纪商，但不能杜绝所选择的期货或证券公司在交易过程中存在违法、违规经营行为或破产清算导致受托资产遭受损失。

5) 盯市结算风险

场内衍生品采取保证金交易，保证金账户实行当日无负债结算制度，对资金管理要求较高。假如市场走势对受托资产不利，期货经纪公司或证券公司会按照合同约定的时间和方式通知资产管理人追加保证金，以使受托资产能继续持有未平仓合约。如出现极端行情，市场持续向不利方向波动导致保证金不足，又未能在规定时间内补足，按规定保证金账户将被强制平仓，甚至已缴付的所有保证金都不能弥补损失，从而导致超出预期的损失。

6) 平仓风险

衍生品投资实行保证金制度、当日无负债结算制度、涨跌停板制度、持仓限额和大户持仓报告制度、风险准备金制度以及国务院期货监督管理机构规定的其他风险管理制度。本计划可能因保证金不足而被采取限制开仓、强制平仓，进而可能给本计划造成重大损失；本计划所委托的交易所会员除接受本计划委托外，还可能同时接受其他主体的委托，本计划所委托的交易所会员发生保证金不足时将被采取限制开仓、强制平仓等措施，而这种不足不一定是本计划的保证金不足造成的，还可能是上述交易所会员进行其他主体的委托操作所造成的，但即便如此本计划也可能因此受到重大损失；为及时缴纳保证金，本计划可能紧急变现部分资产财产，在上述情况下，该部分资产财产的变现可能并非以最优价格进行，从而造成本计划的损失；本计划及本计划所委托的交易所会员可能被实行强制结算，一旦本计划或本计划所委托的交易所会员被强制结算、可能给本计划财产造成损失。在某些市场情况下，受托资产可能会难以或无法将持有的未平仓合约平仓，例如，这种情况可能在市场达到涨跌停板时出现。出现这类情况，受托资产缴付的所有保证金有可能无法弥补全部损失，委托人还必须承担由此导致的全部损失。

期货经纪公司或证券公司或其客户保证金不足，又未能在规定的时间内补足，或因其他原因导致交易所对期货经纪公司或证券公司的经纪账户强行平仓，受托资产可能因被连带强行平仓而遭受损失。

本计划参与场内衍生品交易，因市场变化导致保证金不足时，期货经纪场内衍生品将按合同约定的时间、方式通知管理人以计划资产追加保证金。当市场价格发生巨大波动时，管理人将可能被通知以计划资产大量追加保证金。若计划资产中的现金不足，无法在规定时间内、按

规定方式存入所需的追加保证金，本计划所持有的未平仓合约将可能被强行平仓，导致本计划资产损失；若因场内衍生品市场流动性差造成未平仓合约平仓困难或无法平仓，可能导致本计划资产损失，甚至可能出现计划权益为负（即“爆仓”或“穿仓”）的情形。管理人将针对上述可能的情形及时做出专业判断并最大程度避免其发生，但并不能保证上述风险不发生。

7) 投资于场内期权的特别风险包括但不限于：

除上述提示的投资于场内金融衍生品的风险外，投资于场内期权，还存在以下特别风险：

如本计划作为期权合约的买方，当出现不利行情时，如本计划选择不执行期权则本计划可能损失权利金/期权费及相应的时间成本，如本计划选择执行期权则可能因为不利行情因素导致本计划投资遭受损失；如本计划作为期权合约的卖方，出现不利行情时，期权合约买方往往选择执行期权，本计划可能因所持期权价格受不利行情影响而产生较大的损失。

8) 跟踪标的风险：

本计划跟踪标的的价格可能受到政治因素、经济因素、上市公司经营状况、投资者心理和交易制度等各种因素的影响而波动，导致跟踪标的的波动，直接影响跟踪标的的表现。

(3) 投资于公开募集证券投资基金的风险包括但不限于：

1) 公开募集证券投资基金的基金管理人在进行投资时，如出现判断有误、获取信息不全、或对投资工具使用不当，或未勤勉尽责进行投资管理等情形，将对本计划的收益甚至本金安全造成不利影响；

2) 本计划投资于公开募集证券投资基金时，仅能于投资时对公开募集证券投资基金的产品合同约定的投资范围是否符合本计划合同约定进行判断，若公开募集证券投资基金实际投资范围超出约定范围，或公开募集证券投资基金变更其投资范围（可能无需经资产管理人同意），均可能给本计划造成不利影响；

3) 本计划投资于公开募集证券投资基金时，管理人投资管理能力及其聘请的投资顾问的投资建议水平，均会对公开募集证券投资基金的收益水平产生重大影响，进而影响本计划的收益水平；

4) 公开募集证券投资基金可能并非随时开放申购、赎回，其申购、赎回的限制可能给本计划的流动性造成影响，也可能造成本计划不能及时执行预警止损机制（如有）；

5) 公开募集证券投资基金本身将会收取一定的费用，虽然该等费用可能并非直接在本计划项下列支，但相比较于份额持有人直接对公开募集证券投资基金进行投资的情况，份额持有人通过投资于本计划间接投资于公开募集证券投资基金，实质上同时承担了本计划、公开募集证券投资基金项下的费用。

(4) 投资于债券逆回购的风险包括不限于：一般情况下，债券逆回购是一种风险较低、流动性较强的品种，但极端情况下也存在以下风险：1) 机会成本风险，如果其他投资收益率

更高，则债券回购存在机会成本损失；2) 系统性风险，经济萧条时，所有投资产品收益下降，债券回购也不例外。

7、税收风险

资产管理计划所适用的税收征管法律法规可能会由于国家相关税收政策调整而发生变化，资产委托人收益也可能因相关税收政策调整而受到影响。

根据财政部和国税总局《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》（财税〔2016〕36号）、《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》（财税〔2016〕140号）、《关于资管产品增值税有关问题的通知》（财税〔2017〕56号）等系列法规要求及其后续可能颁布的具体征收管理办法等相关文件（若有），自2018年1月1日（含）以后资管产品运营过程中发生增值税应税行为的应当缴纳增值税及附加，上述税收由受托资产承担，资产管理人有权从受托资产中直接扣除。税收政策的调整可能对资产管理计划的净值产生影响。

8、资产管理计划提前终止风险

发生本合同约定的终止情形或投资标的发生终止事件时，本资产管理计划将可能提前终止。资产委托人知悉并同意承担资产管理计划提前终止的风险及可能产生的损失。

9、操作或技术风险

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违反操作规程等引致的风险，例如，越权违规交易、会计部门欺诈、交易错误、IT系统故障等风险。

在受托资产的各种交易行为或者后台运作中，可能因为技术系统的故障或者差错而影响交易的正常进行或者导致资产委托人的利益受到影响。这种技术风险可能来自基金管理公司、证券公司、期货公司子公司、证券交易所、证券登记结算机构等。

在托管人履行投资监督义务过程中，因为交易习惯或者现有的技术等条件所限，托管人事实上可能难以及时、有效履行合同约定的投资监督义务。委托人在签订本合同时已充分知悉该风险，并完全理解和接受可能由该风险导致出现的经济损失。

10、关联交易风险

本计划资产托管人为【上海浦东发展银行股份有限公司宁波分行】，本计划的注册登记机构/外包服务机构为管理人的关联方华夏基金管理有限公司。资产管理人按照合同约定的投资范围和投资策略选择投资标的，有可能涉及资产管理人、资产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，或资产管理人及其关联方、资产托管人及其关联方管理的公募基金，租用资产管理人及其关联方、资产托管人及其关联方的交易席位，与资产管理人及其关联方、资产托管人及其关联方作为交易对手以及法律法规规定和资产管理人认定的关联交易，资产管理人和资产托管人将按照合同约定履行职责，但仍不

能完全避免发生关联交易或利益冲突的可能，存在关联交易的风险。资产委托人知悉并同意管理人依据法律法规及本合同的约定进行前述关联交易（含重大关联交易），并自愿承担相关风险。

11、投资者适当性风险

由于合格投资者投资目标和风险收益要求变化或者产品风险等级调整，在重新进行投资者适当性匹配评估并采取调整措施之前，存在产品风险等级高于投资者风险承受能力的可能。

12、道德风险

道德风险主要指投资业务人员缺乏职业道德，不遵守公司有关规章制度，在投资过程中可能存在对投资项目把关不严、故意隐瞒投资项目存在的风险因素、人为抬高投资价格和通过项目投资进行利益输送等不当交易行为，从而导致资产管理计划蒙受损失的风险。

13、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。

14、不设置份额持有人大会及日常机构的风险

考虑到本计划运作特点，本计划不设置份额持有人大会及日常机构。对于延长资产管理合同期限、修改资产管理合同的重要内容或提前终止资产管理合同、更换管理人或托管人、调整管理人和托管人的报酬标准或其他可能对份额持有人权利义务产生重大影响的事宜将按照资产管理合同相关章节相应条款处理。

(二) 资产管理计划面临的特殊风险

1、资产管理计划外包事项所涉风险

根据法律法规规定，从事注册登记等行政服务外包业务的机构须获得中国证监会的认可。虽然外包机构相信其本身将按照相关法律法规的规定进行营运及管理，但无法保证其本身可以永久维持符合监管部门的法律法规要求。本计划的注册登记和会计核算相关事项均外包给华夏基金管理有限公司，如在计划存续期间外包机构无法继续从事注册登记等行政服务外包业务，可能会对计划产生不利影响。

2、资产管理计划未在证券投资基金业协会完成备案手续所涉风险

根据法律法规的规定，本资产管理计划成立之日起五个工作日内应当提交基金业协会备案。如本资产管理计划未通过备案，本合同将面临无法投资运作的风险。投资者对此充分知悉，并自愿承担由此导致的一切风险和损失。

3、资产管理合同与证券投资基金业协会合同指引不一致的风险

根据本计划具体情况，本资产管理合同与证券投资基金业协会合同指引不完全一致，资产委托人已认真阅读资产管理合同及本风险揭示书，并自愿承担由此导致的一切风险和损失。

4、资产管理计划委托募集所涉风险

根据相关法律法规及自律监管规则规定，资产管理人可以委托具有公开募集证券投资基金（以下简称公募基金）销售资格的销售机构募集本资产管理计划财产。

虽然资产管理人能够确认在委托募集时该等销售机构具有基金销售资格，但无法保证其持续满足该等业务资格要求，且无法保证其将按照相关法律法规及自律监管规则的规定进行募集活动。若届时因销售机构不符合资质要求、或不具备提供相关服务的条件和技能、或因管理不善、操作失误等，可能给投资者带来一定的风险。而且，如果销售机构未按照相关法律法规及自律监管规则的规定进行募集活动，亦将直接影响投资者对本计划风险收益的判断，从而对本计划投资者的利益产生不利影响。

5、本计划展期或提前终止的风险

若发生本计划约定展期或提前终止情形时，将可能导致资产委托人无法按照预期安排受托资产投资或无法按时收回受托资产或受托资产收回金额不及预期等风险。

6、签署电子合同所涉的风险提示及防范

以电子合同、电子签名方式签署合同或文书除具有以纸质方式签署合同或文书的所有风险外，还具有以下风险：

(1) 资产委托人密码泄露或资产委托人身份可能被仿冒；

(2) 由于互联网上存在黑客恶意攻击的可能性，互联网服务器可能会出现故障及其他不可预测的因素，合同或文书签署信息可能会出现错误或延迟；

(3) 资产委托人的上网设备及软件系统与所提供的网上交易系统不相匹配，导致无法签署合同或文书或签署失败；

(4) 如资产委托人不具备一定网上交易经验，可能因操作不当造成无法签署或签署失败；

(5) 资产委托人电脑系统感染电脑病毒或被非法入侵；

(6) 经资产委托人密码登陆资产委托人账户后下达的网络指令，一经发出即生效，且不得变更或撤销；

(7) 其他可能存在的签署风险。

(三) 其他风险

1、火灾、地震等自然灾害、非因管理人、托管人自身原因导致的技术系统异常事故、政策法规的修改等等不可抗力因素的出现，将会严重影响证券市场的运行，可能导致资产委托人利益受损；

2、金融市场危机、行业竞争、代理商（如有）违约等超出资产管理人自身直接控制能力之外的风险，也可能导致资产委托人利益受损。

（四）特别说明

资产委托人应充分认识到资产管理人不存在刚性兑付的意愿，更不具备刚性兑付的能力。本风险揭示并不能揭示投资本资产管理计划的全部风险。资产委托人在投资本资产管理计划之前应认真阅读本资产管理计划的资产管理合同，全面认识本资产管理计划的风险收益特征和产品特性，并充分考虑自身的风险承受能力及个人资产规模，理性判断市场，谨慎做出投资决策。

二十五、资产管理合同的变更、终止与财产清算

(一) 资产管理合同的变更

1、各方一致同意，以下事项可由资产管理人自行决定变更：

(1)调低资产管理人的报酬标准；

(2)投资经理的变更；

(3)对本资产管理计划的认购、参与、退出等运作安排进行调整；

(4)不会对资产管理计划份额持有人权利义务产生重大实质不利影响的资产管理合同相关事项变更；

(5)法律法规规定或本资产管理合同约定的其他情形。

2、各方一致同意，以下事项可由资产管理人和资产托管人协商后变更：

(1) 调低资产托管人的报酬标准；

(2) 法律法规规定或本资产管理合同约定的其他情形。

3、因监管规则变化或监管机构要求，需要变更资产管理合同的，经资产管理人与资产托管人协商一致，可以对资产管理合同内容进行变更，并由资产管理人按照合同约定及时向资产委托人披露变更的具体内容，并应保障委托人选择退出资产管理计划的权利(不会对资产管理计划份额持有人权利义务产生重大实质不利影响的变更事项除外)。

4、资产管理计划改变投向和比例的，应事先取得委托人的同意。

非因法律法规发生变化的原因而导致合同变更时，除本合同另有约定外，管理人有权选择以下两种方式中的任何一种进行本计划合同的变更。

(1) 全体投资者、资产管理人和托管人通过签署补充协议方式进行变更。

(2) 资产管理人、资产托管人可首先就本合同拟变更事项达成一致，由资产管理人就变更事项向投资者发布合同变更征询意见函（或公告）并设置合同变更征询期，且资产管理人应安排退出开放日。投资者不同意变更的，应在征询意见函（或公告）指定的日期内退出本计划；投资者未在征询意见函（或公告）指定的日期内退出本计划的，均视为投资者同意本次变更。

资产管理人应于征询意见函（或通知）指定日期届满之后以公告形式向投资者通知合同变更生效事宜，并以书面形式告知资产托管人。自合同变更生效之日起，对合同各方均具有法律效力。

5、如果资产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，经资产委托人及资产托管人协商一致，可选择符合条件的其他资产管理人承接本资产管理计划项下资产管理人相关权利义务。发生此等情形时，原资产管理人应当向新的资产管理人交接本资产管理计划资产管理事务，并以公告形式向资产委托人披露，保

障委托人选择退出资产管理计划的权利。

如果资产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，经资产委托人及资产管理人协商一致，可选择符合条件的其他资产托管人承接本资产管理计划项下资产托管人相关权利义务。发生此等情形时，原资产托管人应当向新的资产托管人交接本资产管理计划资产托管事务，资产管理人以公告形式向资产委托人披露，保障委托人选择退出资产管理计划的权利。

6、资产管理人应当合理保障合同变更后投资者选择退出资产管理计划的权利，具体以资产管理人届时安排并以公告为准。

7、资产管理人应当自资产管理合同变更之日起五个工作日内报基金业协会备案。

(二) 本计划终止（含提前终止）的情形包括下列事项：

- 1、资产管理计划存续期届满且不展期；
- 2、经全体投资者、资产管理人和资产托管人协商一致决定终止的；
- 3、资产管理人被依法撤销资产管理业务资格或者依法解散、被撤销、宣告破产，且在六个月内没有新的资产管理人承接；

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

5、投资者少于2人的；

6、未在证券投资基金业协会完成备案的情形；

7、存续期内资产管理合同项下的受托资产全部变现，且资产管理人宣布资产管理计划终止的，无需征求托管人和委托人同意，托管人和委托人对此不持任何异议。

8、资产管理计划净值低于【500】万元时，如资产管理人认为资产管理计划规模过小而不再适宜继续运作的，则资产管理人有权提前终止本计划，并提前通知资产委托人和资产托管人；

9、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。

资产管理人应当自资产管理计划终止之日起5个工作日报告基金业协会。

(三) 本计划的展期

在取得资产托管人同意的情况下，资产管理人届时将以本合同约定的方式向资产委托人发出本计划展期的征询意见函（或通知）。

资产委托人不同意展期的，应在征询意见函（或通知）指定期限内退出本计划，如未在指定期限内退出，视为资产委托人同意本计划展期。资产管理人有权设置临时开放期为前述投资者办理退出，具体开放期以管理人公告为准。

如果本计划届时符合如下条件，则视为本计划展期成功。

- 1、资产管理计划运作规范，资产管理人、托管人未违反法律、行政法规、中国证监会规

定和资产管理合同的约定；

- 2、资产管理计划展期没有损害投资者利益的情形；
- 3、符合本合同第七章第（一）条所约定的本计划成立条件；
- 4、中国证监会规定的其他条件。

（四）财产清算

1、清算组的成员及职责

本资产管理计划终止（含提前终止）的，资产管理人应当在发生终止（含提前终止）情形之日起五个工作日内开始组织清算资产管理计划财产，具体可由清算小组具体处理。

清算小组成员由资产管理人、资产托管人组成。清算小组可以聘用必要的工作人员。

清算小组职责：负责资产管理计划财产的保管、清理、估价、变现和分配。资产管理计划财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。

2、财产清算的程序

本资产管理计划终止（含提前终止），应当按法律法规和资产管理合同的有关规定对资产管理计划财产进行清算。资产管理计划财产清算程序主要包括：

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

3、清算费用内容及支付方式

清算费用是指清算小组在进行资产管理计划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资产管理计划财产中支付。清算费用包括但不限于：

- （1）聘请会计师（如需）、律师（如需），以及其他工作人员所发生的报酬；
- （2）资产管理计划资产的保管、清理、估价、变现和分配产生的费用；
- （3）信息披露所发生的费用；
- （4）诉讼、仲裁、保全等维护计划受托资产利益所发生的费用；
- （5）其他与清算事项有关的费用。

除交易所、登记结算机构、开户银行等自动扣缴的费用外，所有清算费用由资产管理人向资产托管人出具指令，由资产托管人复核后办理支付。

4、资产管理计划财产清算剩余财产的分配依据资产管理计划财产清算的分配方案，将资产管理计划财产清算后的全部剩余资产扣除资产管理计划财产清算费用及各项负债后，向资

产委托人进行分配。计划财产按下列顺序清偿：

- (1) 支付清算费用；
- (2) 交纳所欠税款；
- (3) 清偿计划债务（包括但不限于管理费、托管费、业绩报酬（如有）等）；
- (4) 向资产委托人进行分配。

计划财产未按前款（1）、（2）、（3）项约定清偿前，不分配给计划份额持有人。在完成前款（1）、（2）、（3）项程序后的剩余财产，资产管理人将按照资产委托人所持份额占本计划总份额的比例，以现金形式向资产委托人进行分配。

（五）延期清算的处理方式

若受托资产未全部变现的，资产管理人将首先以计划现金资产支付截至本计划到期时的应付未付费用。在非现金类资产可交易后的5个交易日内，资产管理人须将这部分资产变现，直至本计划所有财产变现完成后，资产管理人进行延期清算。

在受托资产移交前，由资产托管人负责保管实际交付给资产托管人并由资产托管人实际控制的资产。保管期间，任何当事人均不得运用该受托资产。保管期间产生的收益归受托资产所有，发生的保管费用由受托资产承担。因资产委托人原因导致受托资产无法转移的，资产托管人和资产管理人可以在协商一致后按照有关法律法规进行处理。

受托资产清算工作结束，并全部划入指定账户后，资产托管人应在资产委托人和资产管理人的配合下，尽快完成本合同项下相关账户的销户工作，并将销户结果通知资产委托人和资产管理人。如因本合同相关当事人故意拖延等行为造成销户不及时而出现直接损失或造成相关费用，应当对各自行为承担赔偿责任。

资产管理计划因受托资产流动性受限等原因延期清算的，资产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

资产管理人应当在资产管理计划清算结束后五个工作日内将清算报告报基金业协会。清算报告报中国证券投资基金业协会后的5个工作日内，以合同约定的方式告知委托人。

（七）资产管理人、资产托管人等机构应当按照法律法规、监管机构及自律组织的规定保存资产管理计划的会计账册，妥善保存有关的合同、协议、交易记录等文件、资料和数据，任何人不得隐匿、伪造、篡改或者销毁。保存期限自资产管理计划终止之日起不少于二十年。

二十六、违约责任

(一)资产管理人、资产托管人、资产委托人违反法律法规规定或者本合同约定，应当承担违约责任；给受托资产或资产管理合同其他当事人造成的直接损失，应当分别对各自的行为依法承担赔偿责任。本合同能够继续履行的应当继续履行。但是发生下列情况，且当事人无过错的，应当免责：

1、不可抗力；

2、计算机系统故障、网络故障、通讯故障、电力故障、计算机病毒攻击及其它非资产管理人、资产托管人故意或过失造成的意外事故；

3、资产管理人及/或资产托管人按照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；

4、资产管理人按照本合同规定的投资原则行使或不行使其投资权而造成的损失；

5、资产委托人未能事前向资产管理人及资产托管人履行信息披露义务（如告知关联证券或其他禁止交易证券等），致使发生违规投资行为的，资产管理人与资产托管人均不承担任何责任，资产委托人需就资产管理人与资产托管人由此遭受的损失承担赔偿责任；

6、因证券市场波动、上市公司合并、计划财产规模变动、计划不能通过对底层标的投资适当性审查要求等资产管理人之外的因素致使计划财产投资不符合本合同项下约定的投资策略的，将不视为资产管理人的违约行为；

7、资产委托人理解资产管理计划财产的投资、运作、保管面临本合同第二十四节中列举的各类风险，资产管理人及资产托管人就资产管理计划财产面临的上述固有风险免于承担责任；

8、资产管理人及资产托管人对因所引用的投资对象、证券经纪商及其他中介机构提供的信息的真实性、准确性和完整性存在瑕疵，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。

9、托管人对于存放在托管人之外的受托资产的任何损失、及基于从第三方机构（包括但不限于证券交易所、期货交易所等）合法获得的信息及合理信赖上述信息而操作导致受托资产的任何损失等都应是免责的。

(二)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，给受托资产或者资产委托人造成损害的，应当分别对各自的行为依法承担赔偿责任；因共同行为受托资产或者资产委托人造成损害的，应当按照各自过错承担相应赔偿责任。

(三) 在发生一方或多方违约的情况下，在最大限度地保护资产委托人利益的前提下，

本合同能够继续履行的应当继续履行。非违约方当事人在职责范围内有义务及时采取必要的措施，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。

(四) 一方依据本合同向另一方赔偿的损失，仅限于直接经济损失。

二十七、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，合同当事人应尽量通过协商或调解途径解决。不愿或者不能通过协商或调解解决的，任何一方均有权将争议提交北京仲裁委员会，按提交仲裁申请时该会有效之仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为北京。仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力，仲裁费用由败诉方承担。争议处理期间，合同当事人应恪守各自的职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行资产管理合同规定的义务，维护资产委托人的合法权益。

(二) 本合同适用中华人民共和国法律并依据其解释。

二十八、资产管理合同的效力

(一) 资产管理合同是约定资产管理合同当事人之间权利义务关系的法律文件。资产委托人为法人的，本合同自资产委托人、资产管理人、资产托管人加盖公章或合同专用章以及各方法定代表人或授权代表签字或盖章之日起成立；资产委托人为自然人的，本合同自资产委托人本人签字、资产管理人和资产托管人加盖公章或合同专用章并由双方法定代表人或授权代表签字或盖章之日起成立。

本合同采用电子签名方式签署的，管理人应确保电子签名合同标准文本与管理人、托管人在线下签署的版本一致。

资产管理人需确保资产委托人签署的电子合同的内容与资产管理人与资产托管人通过加盖公章以及各方法定代表人/负责人或授权代表签字或盖章签署纸质合同的内容一致，并妥善保存合同、数据等信息资料，资产托管人不对因合同内容有误而产生的任何风险和损失承担责任。

(二) 本资产管理计划的募集金额缴足之日起十个工作日内，由资产管理人公告资产管理计划成立。资产管理人应当在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、资产缴付证明等材料报基金业协会备案。

(三) 本合同自本计划成立之日起生效。

(四) 本合同自生效之日起对资产委托人、资产管理人、资产托管人具有同等的法律约束力。

(五) 资产管理合同的有效期限为资产管理计划成立日起满 10 年对日（若当月无对日，则以当月最后一日作为对日；若对日非交易日，则顺延至下一交易日）终止。本合同另有约定的，从其约定。

(六) 资产委托人自签订资产管理合同即成为资产管理合同的当事人。在本计划存续期间，资产委托人自全部退出资产管理计划之日起，该资产委托人不再是资产管理计划的投资人和资产管理合同的当事人。

二十九、反洗钱

(一) 资产管理人、资产托管人有权根据适用的反洗钱法律法规规定对本合同任意一方及本合同项下合作所涉及的交易等进行洗钱风险评估,若本合同任意一方违反银行反洗钱管理规定,或资产管理人、资产托管人具备合理理由怀疑本合同任意一方/或本合同项下业务涉嫌参与联合国安理会、反洗钱金融行动特别工作组、本业务涉及的司法管辖区认定的洗钱、制裁、恐怖融资或大规模杀伤性武器扩散融资活动、出口管制、或逃税等违法违规行为的,资产管理人、资产托管人将按照中国人民银行反洗钱监管规定采取必要管控措施,或在三方协商一致后终止合同。

三十、其他事项

(一) 如将来法律法规、中国证监会、基金业协会或其他有权机构对资产管理合同的内容与格式有其他要求的,资产委托人、资产管理人和资产托管人应立即展开协商,根据法律法规、中国证监会、基金业协会或其他有权机构的相关要求修改本合同的内容和格式。

(二) 或有事件:资产托管人获得监管机构批复或核准可以独资或者控股的具有独立法人资格的子公司(“托管子公司”)从事托管业务。

资产管理人、投资者皆同意,如果或有事件发生,资产托管人有权单方在资产托管人网站以公告通知的方式将本合同中应由资产托管人享有的权利和承担的义务概括转让给托管子公司。自该等公告通知载明的指定时间(含)起,上述概括转让被视为自动完成,本合同项下托管人变更为托管子公司,各方无须就此另行签订协议。

资产托管人保证托管子公司具备开展此项业务的相关资格和能力。

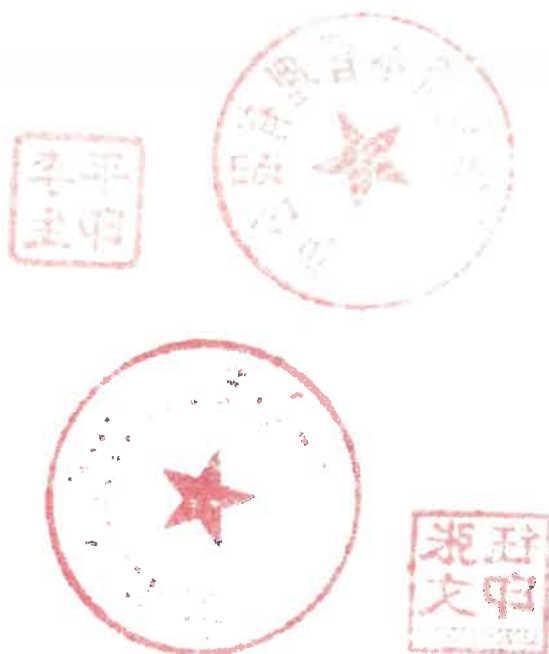
(三) 本合同如有未尽事宜,由合同当事人各方按有关法律法规和规定协商解决。

(四) 本合同一式叁份,资产管理人执两份,资产托管人执一份。

(以下无正文)

账号:

开户银行名称:



(本页无正文，系华夏资本鲁班大师1号集合资产管理计划资产管理合同签署页。)

资产委托人：

自然人（签字）：或 法人或其他组织（盖章）：

法定代表人或授权代表（签字或盖章）：

签署日期： 年 月 日

资产管理人：华夏资本管理有限公司（盖章）：

法定代表人或授权代表：

签署日期： 2026 年 5 月 13 日



资产托管人：上海浦东发展银行股份有限公司宁波分行（盖章）：

法定代表人/负责人或授权代表：

签署日期：2026 年 5 月 15 日



附件一、 授权通知书（此为样本，具体以管理人出具格式为准）

关于投资指令授权名单的函

上海浦东发展银行股份有限公司：

本公司决定授权以下人员负责向贵行发送本公司在贵行托管的所有投资组合的投资指令。

投资指令授权的相关情况如下：

注：以上任意两人分别为制单、复核即可。

人员	授权范围	签字样本	签章样本
/	制单、复核	/	/
/	制单、复核	/	/
/	制单、复核	/	/

人员	授权范围	签章样本	管理人签章
/	审批	/	/

注：以上制单、复核、审批的签章（签字）与管理人签章须同时使用，投资指令方为有效。

自即日起，请贵行以此份投资指令授权函为准，按以上人员发出的投资指令办理有关业务。

如有人员变更，请以本公司更新授权名单为准。

华夏资本管理有限公司

2026 年 / 月 / 日

附件二： 划款指令书（此为样本，具体以管理人出具格式为准）

划款指令书（***）

付款日 *年*月*日

上海浦东发展银行股份有限公司：			
敬请根据以下提供的收款人名称、开户行、账号、到账日期和划款金额划款。			
到账日期：	/		
收款方户名：	/		
开户行：	/		
账 号：	/		
大额支付号：	/	联行行	/
划款金额(小写)：	/		
划款金额(大写)：	/		
业务类型：	/		
交易日期：	/		
付 款	付款方户	/	
	开户行：	/	
	账 号：	/	
	大额支付	/	联行行 /
划款用途： /			
备注： /			
管理人签章： /		托管人签章： /	
审批人： /		审批人： /	
复核人： /		复核人： /	
经办人： /		经办人： /	

制作日