

第一创业天元重工员工参与北交所战略 配售集合资产管理计划资产管理合同

合同编号：JH-TYZGZP2026 第 1 号

管理人：第一创业证券股份有限公司
托管人：华福证券股份有限公司

二〇二六年【九】月

目 录

一、前言	4
二、释义	5
三、承诺与声明	8
四、当事人及权利义务	10
五、资产管理计划的基本情况	16
六、资产管理计划的募集	18
七、资产管理计划的成立与备案	20
八、资产管理计划的参与、退出与转让	21
九、份额持有人大会及日常机构	27
十、资产管理计划份额的登记	27
十一、资产管理计划的投资	27
十二、投资顾问	32
十三、分级安排	33
十四、利益冲突及关联交易	33
十五、投资经理的指定与变更	36
十六、资产管理计划的财产	36
十七、投资指令的发送、确认和执行	38
十八、交易及交收清算安排	40
十九、越权交易的界定	41
二十、资产管理计划财产的估值和会计核算	43
二十一、资产管理计划的费用与税收	46
二十二、资产管理计划的收益分配	49
二十三、信息披露与报告	50
二十四、风险揭示	52
二十五、资产管理合同的变更、终止与财产清算	62
二十六、违约责任	67
二十七、争议的处理	68
二十八、资产管理合同的效力	68
二十九、其他事项	69
附件一：投资运作监督事项表	72
附件二：投资指令（样本）	74
附件三：第一创业证券指令发送授权文件（样本）	75
附件五：专用清算账户及资金划拨专用账户	77

特别约定： 本《第一创业天元重工员工参与北交所战略配售集合资产管理计划资产管理合同》可以电子签名或者纸质合同手写签名、盖章方式签订，管理人、托管人作为本合同签署方，已接受本合同项下的全部条款；投资者（即第一创业天元重工员工参与北交所战略配售集合资产管理计划的投资者）作为本合同一方，以电子签名或纸质合同手写签名、盖章方式签署本合同即表明投资者完全接受本合同项下的全部条款，同时本合同成立。

投资者、管理人、托管人同意遵守《电子签名法》的有关规定，三方一致同意投资者自签署《电子签名约定书》之日起，投资者以电子签名方式接受电子签名合同（即本合同、集合计划说明书）、风险揭示书或其他文书的，视为签署本合同、集合计划说明书、风险揭示书或其他文书，与在纸质合同、纸质风险揭示书或其他文书上手写签名或者盖章具有同等法律效力，无须另行签署纸质合同、纸质风险揭示书或其他文书。投资者、管理人同意向托管人提供中国证券登记结算有限责任公司电子合同签署有关投资者信息，供托管人完成电子合同签署的相关流程。

一、前言

（一）订立本合同的目的、依据和原则

1、订立本《第一创业天元重工员工参与北交所战略配售集合资产管理计划资产管理合同》（以下简称“集合资产管理合同”、“资产管理合同”或“本合同”）的目的是为了明确投资者、管理人和托管人在集合资产管理业务过程中的权利、义务及职责，确保第一创业天元重工员工参与北交所战略配售集合资产管理计划（以下简称“集合资产管理计划”、“资产管理计划”、“集合计划”或“本计划”）财产的安全，保护当事人各方的合法权益，本合同是约定投资者、管理人和托管人基本权利义务的法律文件。其他与本计划相关的涉及本合同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。本合同的当事人包括投资者、资产管理人和资产托管人。投资者自签订本合同之时起即成为本合同的当事人，自其不再持有本计划份额之日起，投资者不再成为本计划的投资者和本合同的当事人。除资产管理合同另有约定外，每份计划份额具有同等的合法权益。

2、订立本合同的**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》”）、《中华人民共和国期货和衍生品法》（以下简称“《期货和衍生品法》”）、《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“《运作管理规定》”）、《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》”）、《集合资产管理计划资产管理合同内容与格式指引》（以下简称“《合同指引》”）等法律、行政法规以及中国人民银行、中国证监会和中国证券投资基金业协会（以下简称“基金业协会”）的有关规定。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，各方当事人应及时就本合同做出相应的变更和调整。

3、订立本合同的**原则**是平等自愿、公平、诚实信用，充分保护本合同各方当事人的合法权益。

（二）管理人将按照相关规定向基金业协会办理本计划的设立、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，具体以监管机构要求为准。

（三）基金业协会办理本计划备案不代表基金业协会对本计划的合规性、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，根据自身风险承受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。

二、释义

在本合同中，除非文义另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

1、集合资产管理计划、资产管理计划、集合计划、本计划：指第一创业天元重工员工参与北交所战略配售集合资产管理计划；

2、集合计划说明书、说明书：指《第一创业天元重工员工参与北交所战略配售集合资产管理计划说明书》及对说明书的任何有效的修订和补充；

3、集合资产管理合同、资产管理合同、本合同：指《第一创业天元重工员工参与北交所战略配售集合资产管理计划资产管理合同》及对该合同的任何有效的修订和补充；

4、风险揭示书：指《第一创业天元重工员工参与北交所战略配售集合资产管理计划风险揭示书》及对该风险揭示书的任何有效的修订和补充；

5、《管理办法》：指中国证监会发布并施行的《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》及其不时做出的修订和补充；

6、《运作管理规定》：指中国证监会发布并施行的《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》及其不时做出的修订和补充；

7、《指导意见》：指2018年4月27日中国人民银行、中国银行保险监督管理委员会、中国证券监督管理委员会、国家外汇管理局联合发布并施行的《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》及其不时做出的修订和补充；

8、中国证监会、证监会：指中国证券监督管理委员会；

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

10、集合计划管理人、管理人：指第一创业证券股份有限公司，也简称为“第一创业证券”、“第一创业”；

11、集合计划托管人、托管人：指华福证券股份有限公司，也简称为“华福证券”；

12、销售机构：指第一创业证券股份有限公司和/或其他符合相应资格条件的、经管理人委托的、代理推广本集合资产管理计划的机构；

13、注册登记机构：指办理登记、存管、过户、清算和结算等注册登记业务的机构。本集合计划的注册登记机构为第一创业证券股份有限公司；

14、集合计划投资者、投资者：指依据集合资产管理合同和集合计划说明书参与本计划并符合《运作管理规定》等监管规则要求的合格投资者；

15、合格投资者：指具备相应风险识别能力和风险承受能力，投资于单只资产管理产品不低于一定金额且符合下列条件的自然人、法人或者其他组织：

（一）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；

（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）基本养老保险、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。

上述家庭金融总资产，是指全体家庭成员共同共有的全部金融资产，包括银行存款、股票、债券、基金份额、资产管理计划、银行理财产品、信托计划、保险产品、期货和衍生产品等。家庭金融净资产是指家庭金融总资产减去全体家庭成员的全部负债；

16、份额持有人、持有人：指通过签订本合同而依法取得和持有本计划份额的投资者；

17、集合计划成立日：指本计划经过推广达到集合计划说明书和本合同约定的成立条件后，管理人公告本计划成立的日期；

18、初始募集期：指自本计划启动募集之日起不超过 60 日的期间，具体募集期间以本计划推广公告为准；

19、开放期：指投资者可以办理本计划参与和/或退出等业务的工作日；

20、封闭期：指本计划成立后的封闭时间段，封闭期内不办理参与、退出业务；

21、存续期：指自本计划成立并存续的期间，本计划的管理期限为 5 年，从本计划成立日起算。

22、工作日：指北京证券交易所、上海证券交易所和深圳证券交易所的正常交易日；

23、T 日：指办理本计划业务申请的工作日；

24、T+n 日（n 指任意正整数）：指 T 日后的第 n 个工作日；

- 25、天：指自然日；
- 26、分红权益登记日：指确认在注册登记机构登记在册的投资者享有某次分红收益分配的日期；
- 27、会计年度：指公历年度的1月1日至12月31日；
- 28、参与：指投资者申请购买本计划份额的行为；
- 29、首次参与：指投资者在当日参与之前未持有过本计划的参与情形；
- 30、追加参与：指除首次参与外的其他参与情形；
- 31、退出：指投资者按集合资产管理合同约定的条件要求收回全部或部分委托资产的行为；
- 32、集合计划收益：指本计划投资所得红利、股息、债券利息、基金红利、买卖证券价差、银行存款利息及其他合法收入；
- 33、集合计划份额、计划份额、份额：指集合计划的最小单位；
- 34、元：指人民币元；
- 35、计划单位面值、单位面值：人民币1.00元；
- 36、集合计划资产总值、计划资产总值：指本计划所投资的各类有价证券、银行存款本息、本计划各项应收款以及其他资产所形成的价值总和；
- 37、集合计划资产净值、计划资产净值：指集合计划资产总值减去负债后的净资产值；
- 38、集合计划单位净值、单位净值：指计算日集合计划资产净值除以计算日集合计划总份额的金额；
- 39、集合计划单位累计净值、累计净值：指集合计划单位净值与集合计划份额累计分红之和；
- 40、集合计划资产估值：指计算评估本计划资产和负债的价值，以确定本计划资产净值的过程；
- 41、不可抗力：不可抗力是指任何不能预见、不能避免、不能克服的客观事件或因素，包括但不限于：相关法律法规、监管政策、自律规则的变更；国际、国内金融市场风险事故的发生；战争或动乱、自然灾害、公众通讯设备故障、电力中断、互联网故障等；
- 42、关联方关系：集合资产管理合同和说明书所指关联方关系的含义与《企业会计准则第36号——关联方披露》中的关联方关系的含义相同；
- 43、管理人指定网站、管理人网站：指<http://www.firstcapital.com.cn>，管理人指定网站变更时以管理人公告为准；

44、信义义务：托管人信义义务是指托管人按恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则，根据相关法律法规规定和监管规定，在本合同约定范围内尽职尽责履行安全保管托管资产、办理清算交割、复核审查净值信息、开展投资监督、召集份额持有人大会等职责。法律法规另有规定的，从其规定。

45、标的股票：指德阳天元重工股份有限公司（以下简称“上市公司”或“发行人”）在北京证券交易所首次公开发行股票的战略配售股票。

46、锁定期：自标的股票上市之日起 12 个月，相关法律法规、公司股票上市地证券监管规则对股票锁定期另有规定的，从其规定。

47、减持期：自标的股票锁定期届满后为减持期。

三、承诺与声明

（一）管理人的承诺与声明

1、管理人是依法设立的证券公司，并经中国证监会批准，具有从事客户资产管理业务的资格。

2、管理人承诺已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；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；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。**

3、**管理人声明不接受投资者、交易对手方或其他第三方的口头承诺或与投资者、交易对手或其他第三方私下签订补充协议。**

（二）托管人的承诺与声明

1、托管人具有合法的从事基金托管业务的资格。

2、托管人承诺按照《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；根据法律法规、中国证监会及基金业协会的规定和本合同的约定，对管理人的投资或清算指令等进行监督。

3、托管人保证根据本合同所提供的资料和信息真实、准确、完整、合法，如该资料、报告是依据从管理人、投资者或第三方处获得的数据而编制的，则托管人保证编制过程的完整、真实、合法，没有任何重大遗漏或误导。

（三）投资者的承诺与声明

1、投资者声明出资资产为其拥有合法处分权的资产，保证出资资产的来源及用途符合国家有关规定，保证有完全及合法的授权管理人和托管人进行出资资产的投资管理和托管业务，保证没有任何其他限制性条件妨碍管理人和托管人对该出资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。投资者承诺未使用贷款、发行债券等筹集的非自有资金投资本计划。

2、投资者承诺遵守“经发行人董事会审议通过，发行人高级管理人员与核心员工可以通过专项资产管理计划参与战略配售，获配的股票数量不得超过本次公开发行股票数量的10%，且股票持有期限不得少于12个月”等相关政策要求。

3、投资者承诺签署和履行本合同系其真实意思表示，已经按照其章程或者其它内部管理文件的要求取得合法、有效的授权，且不会违反对其有约束力的任何合同和其他法律文件；投资者已经取得签订和履行本合同所需的一切有关批准、许可、备案或者登记，投资事项符合法律法规的规定及其业务决策程序的要求。

4、投资者承诺符合《运作管理规定》合格投资者的要求，向管理人或销售机构提供的有关投资目的、投资偏好、投资限制、财产收入情况和风险承受能力等基本情况真实、完整、准确、合法，不存在任何虚假陈述、重大遗漏或误导。前述信息资料如发生任何实质性变更，及时书面告知管理人或销售机构。

5、投资者承诺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的集合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做出任何承诺**，了解“卖者尽责、买者自负”的原则，投资于本计划将自行承担投资风险。投资者承认，管理人、托管人未对受托资产的本金不受损失以及收益状况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）、业绩比较基准（如有）不是管理人的保证。

6、投资者承诺知悉和了解《中华人民共和国反洗钱法》、《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》、等反洗钱相关法律法规的规定，将严格遵守上述规定；承诺其资金来源不属于违法犯罪所得及其收益；承诺其资金来源和去向不涉及洗钱、恐怖融资和逃税等行为；承诺出示真实有效的身份证件或者其他身份证明文件，提供真实有效的业务性质与股权或者控制权结构、受益所有人信息等资料；承诺积极履行反洗钱职责，不借助本计划进行洗钱等违法犯罪活动。

7、投资者不通过任何形式在本计划所投资的标的股票的锁定期内转让所持有的本计划份额。

9、投资者承诺其已充分理解《北京证券交易所证券发行与承销管理细则》等相关规定关于发行人高级管理人员、核心员工通过专项资管计划参与战略配售的相关要求，承诺其作为阳天元重工股份有限公司的高级管理人员或核心员工，其参与战略配售已经按照相关规定履行了决策程序及信息披露义务。

11、投资者确认，投资者于此作出的声明和承诺是真实、准确和完整的，不存在任何隐瞒、欺诈或重大遗漏，并应自行承担因违反本声明和承诺给本人的出资资产造成的损失，若给管理人或本计划财产造成损失的，还应向管理人和本计划财产承担全面、及时、恰当的赔偿责任。

（一）投资者

其他:

10

法定代表人：郭川

住所地：深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 20 楼

通讯地址：北京市西城区广宁伯街 2 号金泽大厦东楼 16 层

邮政编码：100037

联系人：史磊

联系电话：010-63197727

（三）托管人

机构名称：华福证券股份有限公司

法定代表人：黄德良

住所地：福州市鼓楼区鼓屏路 27 号 1#楼 3 层

通讯地址：福建省福州市台江区江滨中大道 380 号宝地广场 18 楼

联系人：陈孝可

联系电话：021-20655027

（四）本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。

（五）投资者的权利与义务

1、投资者的权利

- （1）分享本计划财产收益；
- （2）取得分配清算后的剩余本计划财产；
- （3）按照本合同的约定参与、退出和转让本计划份额；
- （4）按照法律法规及本合同约定的时间和方式获得本计划的信息披露资料；
- （5）监督管理人、托管人履行投资管理及托管义务的情况；
- （6）法律法规、中国证监会及基金业协会规定的和本合同约定的其他权利。

2、投资者的义务

- （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受能力问卷，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；
- （4）认真阅读并签署风险揭示书；

(5) 按照本合同约定支付本计划份额的参与款项, 承担本合同约定的管理费、业绩报酬(如有)、托管费、审计费、税费等合理费用及因本计划财产运作产生的其他费用;

(6) 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;

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

(8) 不得违反本合同的约定干涉管理人的投资行为, 并接受管理人的投资结果, 自行承担投资损益;

(9) 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;

(10) 保守商业秘密, 不得泄露本计划的投资计划、投资意向等; 不得利用本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) 不得违规转让其所持有的本计划份额;

(12) 投资者应当以自己的名义开立资金账户, 办理指定手续, 用于办理委托划款、红利款项、退出款项以及清算款项的收取, 在本合同有效期内, 不得撤销该账户, 并妥善保管账户资料;

(13) 投资者应自行关注和监控本计划所持有的股票是否存在减持限制等处置限制, 履行相应的信息披露义务并及时告知管理人; 如因上述限制或其他投资者自身原因导致管理人无法及时、足额处置标的股票的, 管理人不承担责任;

(14) 为本计划配售标的股票之目的, 按照管理人要求配合提供监管机构、交易所、证券业协会等自律组织、主承销商或其他机构要求提供的资料、承诺等;

(15) 投资者在提交本计划的参与申请时应如实向管理人披露投资者是否为德阳天元重工股份有限公司的高级管理人员、核心技术人员等核心人员, 并在上述情况发生变化时通过邮件等形式及时告知管理人;

(16) 投资者应当听取管理人或销售机构的适当性匹配意见并进行自主决策, 在购买本产品或接受相应服务时, 应当按照管理人和销售机构明示的要求提供管理人和销售机构履行适当性管理和开展反洗钱工作所需的真实信息。如投资者向管理人或销售机构提供虚假信息或证明材料, 管理人、销售机构据此作出销售产品或提供金融服务行为的, 由投资者自行承担不利后果及责任;

(17) 除非在本合同约定的退出开放期或终止日, 不得要求提前终止本资产管理关系;

(18) 本计划财产及投资者需承担管理人代表本计划及投资者处理本计划涉及诉讼、仲裁或争议解决的事项所产生的费用及支出，包括但不限于律师费、诉讼费、仲裁费，以实际发生金额为准；

(19) 法律法规、中国证监会及基金业协会规定和本合同约定的其他义务。

(六) 管理人的权利与义务

1、管理人的权利

(1) 按照本合同约定，独立管理和运用本计划财产；

(2) 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）；

(3) 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；

(4) 自行提供或者委托经中国证监会、基金业协会认定的服务机构为本计划提供募集、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；

(5) 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；

(6) 按照法律、行政法规和中国证监会的有关规定，要求投资者提供与其身份、财产与收入状况、证券投资经验、风险认知与承受能力和投资偏好等相关的信息和资料；

(7) 发现投资者或出资资产涉嫌洗钱的，有权按照《中华人民共和国反洗钱法》和相关规定履行报告义务；

(8) 按照本合同的约定，停止办理本计划份额的参与，暂停办理本计划的退出事宜；

(9) 按照本合同的约定，终止本计划的运作；

(10) 本计划财产受到损害时，代表本计划及投资者向有关责任人追究法律责任（包括但不限于主动追索、诉讼、仲裁、财产保全、强制执行、向侦查机关报案等方式），相应所产生的费用及支出由本计划财产及投资者承担，包括但不限于律师费、诉讼费、仲裁费，以实际发生金额为准；

(11) 法律法规、中国证监会、基金业协会规定的及本合同约定的其他权利。

2、管理人的义务

(1) 依法办理本计划的销售、登记、备案事宜；

(2) 按照中国人民银行、证监会、基金业协会等监管机构和自律组织的要求报送本计划产品运作信息；

(3) 按照诚实信用、勤勉尽责的原则履行受托人义务，管理和运用本计划财产；

(4) 对投资者的风险识别能力和风险承受能力进行评估，向符合法律法规规定的合格投资者非公开募集资金；

- (5) 制作风险揭示书，向投资者充分揭示相关风险；
- (6) 配备足够的具有专业能力的人员进行投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作本计划财产；
- (7) 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，对所管理的不同财产分别管理、分别记账，分别投资；聘请投资顾问的，应制定相应利益冲突防范机制；
- (8) 除依据法律法规、本合同及其他有关规定外，不得为管理人及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作本计划财产；
- (9) 保守商业秘密，不得泄露本计划的投资计划、投资意向等，依法依规提供信息的除外；
- (10) 公平对待所管理的不同财产，不得从事任何有损资产管理计划财产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；
- (11) 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；
- (12) 按照本合同约定接受投资者和托管人的监督；
- (13) 以管理人的名义，代表投资者利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
- (14) 根据本合同及其他有关规定，监督托管人，对于托管人违反本合同或有关法律法规规定、对本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，并报告管理人住所地中国证监会派出机构，具体以监管机构的要求为准；
- (15) 按照本合同约定计算并向投资者报告本计划份额净值；
- (16) 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法律法规的规定和本合同的约定；
- (17) 按照本合同约定负责本计划会计核算并编制财务会计报告；
- (18) 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；
- (19) 按照本合同的约定确定收益分配方案，及时向投资者分配收益；
- (20) 按照法律法规与本合同的约定，编制向投资者披露的本计划季度、年度等定期报告；
- (21) 办理与受托财产管理业务活动有关的信息披露事项；
- (22) 建立并保存投资者名单；

(23) 组织并参加本计划财产清算小组，参与本计划财产的保管、清理、估价、变现和分配；

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

(25) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告管理人住所地中国证监会派出机构、基金业协会并通知托管人和投资者，具体以监管机构要求为准；

(26) 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。

(27) 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。

(28) 召集本计划份额持有人大会，份额持有人大会设立日常机构的除外；

(29) 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；

(30) 法律法规、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。

(七) 托管人的权利与义务

1、托管人的权利

(1) 按照本合同约定，依法保管本计划财产；

(2) 按照本合同约定，及时、足额获得本计划托管费用；

(3) 法律法规、中国证监会及基金业协会规定的和本合同约定的其他权利。

2、托管人的义务

(1) 安全保管本计划财产；

(2) 除依据法律法规规定和本合同的约定外，不得为托管人及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管本计划财产；

(3) 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；

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

(5) 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；

(6) 复核本计划资产净值和份额净值；

(7) 办理与本计划托管业务有关的信息披露事项；

(8) 根据相关法律法规和本合同约定，复核管理人编制的本计划财产的定期报告，并出具书面意见；

(9) 编制托管年度报告，报送中国证监会派出机构，具体以监管机构要求为准；

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

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

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

(13) 监督管理人的投资运作，发现管理人的投资或清算指令违反法律、行政法规、中国证监会的规定或本合同约定的，应当拒绝执行，立即通知管理人并及时报告中国证监会派出机构，具体以监管机构要求为准；

(14) 应当向管理人提供其控股股东、实际控制人及其他关联方的名单，托管人应当保证该名单的真实性、准确性和完整性，若该名单发生变更时，托管人应及时书面通知管理人；

(15) 国家有关法律法规、监管机构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

第一创业天元重工员工参与北交所战略配售集合资产管理计划。

(二) 资产管理计划的类别

权益类集合资产管理计划。

(三) 资产管理计划的运作方式

开放式。

(四) 资产管理计划的投资目标、主要投资方向、投资比例

1、投资目标

本计划的投资者为德阳天元重工股份有限公司之高级管理人员、核心员工（根据相关法律法规及监管要求规定禁止认购的人士除外），本计划财产主要按照本合同约定的投资比例投资于德阳天元重工股份有限公司在北京证券交易所首次公开发行股票的战略配售股票，剩余资产进行现金管理。

本计划将在标的股票限售锁定期届满后，在遵守相关减持规则的前提下，择机变现本计划持有的部分或全部上述股票，力争获取投资收益，减持期内变现资金仅用于现金管理。

2、主要投资方向

本计划投资于法律法规及监管规则允许证券公司集合资产管理计划投资的以下资产：

(1) 权益类资产：德阳天元重工股份有限公司在北京证券交易所首次公开发行股票的战略配售股票；

(2) 现金类资产：包括现金、各类银行存款（包括银行活期存款、银行同业存款、银行定期存款和银行协议存款等各类存款，不含结构性存款）、货币市场基金；

3、投资比例

本计划财产投向权益类资产的投资比例为资产总值的 80%（含）-100%（含）；投向现金类资产的投资比例为资产总值的 0%（含）-20%（不含）。

（五）资产管理计划的产品风险等级

本计划属于中高（R4）风险等级的产品，适合且仅能向风险承受能力为 C4（积极型）级及以上或者符合专业投资者标准的合格投资者销售。

（六）资产管理计划的存续期限

本计划的管理期限为 5 年，从本计划成立日起算。在符合本合同约定的展期条件下可展期，但按照本合同约定出现本计划应当终止的情形时，本计划将提前终止并进行清算。

投资者同意并授权管理人可视情况提前结束本资产管理计划。管理人决定提前结束本资产管理计划的，将在计划终止日前三个工作日通过管理人指定网站公告。

（七）资产管理计划份额的初始募集面值

人民币 1.00 元。

（八）资产管理计划的最低初始募集规模

本计划成立时计划财产的初始资产净值不得低于人民币 1000 万元，本计划初始募集期及存续期不设规模上限。

管理人有权根据实际情况调整初始募集期及存续期规模上限，并在管理人指定网站公告。

（九）资产管理计划的费用

1、本计划销售相关费用

本计划参与及退出费率为 0；

2、本计划运作相关费用

以下费用将从本计划资产中扣除：

费用类型	费率	收费方式
------	----	------

费用类型	费率	收费方式
固定管理费	0.8%/年	季度支付
管理人业绩报酬	/	/
托管费	0.01%/年	季度支付
其他费用	证券交易费用、证券账户开户费、本计划成立后的信息披露费用、注册登记费用、审计费和汇划费，税费，以及按照法律法规及本合同的约定可以在本计划财产中列支的其他费用	按费用实际支出金额支出。

（十）资产管理计划的分级安排

本计划是否根据风险收益特征进行分级：否。

（十一）资产管理计划的份额登记、估值核算服务机构

第一创业证券股份有限公司。

（十二）预警与止损策略

本集合计划不设置预警线和止损线。

六、资产管理计划的募集

（一）资产管理计划的募集期限、募集对象、销售机构和募集方式

1、募集期限

本计划的初始募集期为自本计划启动募集之日起不超过 60 日的期间，具体募集期间以本计划推广公告为准；管理人有权根据本计划销售的实际情况延长（但最长不得超过 60 日）或缩短募集期限，此变更适用于所有销售机构，管理人延长或缩短募集期限的，将在管理人指定网站公告。

2、募集对象

本计划仅向符合《运作管理规定》规定的合格投资者销售。合格投资者人数累计不得超过 200 人。

根据本集合计划设立之目的，本集合计划的募集对象为拟在北京证券交易所上市的德阳天元重工股份有限公司之高级管理人员、核心员工。

本集合计划面向特定的投资者募集，对于不符合法律法规规定或本合同约定的投资者以

及未经管理人认可的投资者，管理人有权拒绝该等投资者认购本计划，并有权对其认购申请做确认失败处理而无需承担任何责任。

3、销售机构

第一创业证券股份有限公司和/或其他符合相应资格条件的、经管理人委托的、代理推广本计划的机构。

4、募集方式

销售机构应当根据了解的客户情况，推荐与客户风险承受能力相匹配的集合资产管理计划，引导客户审慎做出投资决定，不得误导投资者购买与其风险承受能力不相符合的产品，**不得向风险识别能力和风险承受能力低于产品风险等级的投资者销售集合资产管理计划**，不得向合格投资者之外的单位和个人募集资金，不得通过报刊、电台、电视台、互联网等公众传播媒体或者讲座、报告会、分析会等方式，布告、传单、短信、微信、博客和电子邮件等载体向不特定对象宣传推介，但管理人、销售机构通过设置特定对象确定程序的官网、客户端等互联网媒介向已注册特定对象进行宣传推介的除外，禁止通过签订保本保收益补充协议等方式，或者采用虚假宣传、夸大预期收益和商业贿赂等不正当手段推广集合资产管理计划。

（二）资产管理计划的认购事项

1、认购费用及认购份额的计算

（1）认购费率

本计划无认购费，即认购费率为0。

（2）认购份额的计算方法

认购份额 = (认购金额 + 应计利息) ÷ 1

注：本计划份额计算时采用四舍五入，保留至0.01份，由此产生的误差计入本计划财产；多笔参与时，按上述公式进行逐笔计算。

2、认购申请的确认

（1）投资者按销售机构指定营业网点的具体安排，在规定的交易时间段内办理认购。

（2）投资者以书面签名或电子合同方式签署本合同后，方可通过销售机构的交易系统申请参与本计划。具体的签署形式以销售机构指定营业网点的安排为准。

（3）销售机构受理认购申请并不代表投资者认购成功，而仅代表销售机构确实收到了认购申请。认购申请受理完成后，投资者不得撤销认购申请。

（4）认购申请采取“时间优先、金额优先、申请单号优先”原则进行确认，认购申请

是否成功且有效应以注册登记机构的确认并且本计划成立为准。投资者可于本计划成立后 2 个工作日后到各销售机构查询认购确认情况。

3、初始认购资金的管理及利息处理方式

销售机构应当将本计划初始募集期间投资者的资金存入募集账户，在本计划募集期限结束前，任何机构和个人不得动用。

本计划成立前，投资者的认购资金（不含认购费用）加计其在初始募集期间在募集账户产生的利息将折算为本计划份额归投资者所有，其中利息金额以注册登记机构的记录为准。未经注册登记机构确认的认购资金将退还给投资者（无利息）。

（三）资产管理计划的最低认购金额、支付方式

（1）投资者首次认购本计划的最低认购金额为人民币 1,000,000 元（不含认购费），超过部分不设金额级差，管理人可以根据法律法规的规定及本计划运作的实际情况设置和调整最低认购金额（但最低不得低于人民币 100 万元），并提前披露。投资者在募集期内可以多次认购本计划，其新增每次最低参与金额为人民币 10,000 元，超过部分不设金额级差。

（2）投资者应开设销售机构认可的交易账户，在交易账户备足认购的货币资金并按照销售机构的规定缴付资金；若交易账户内资金不足，销售机构将不受理该笔认购申请。其中，通过管理人直销柜台参与的，需按管理人要求提供交易账户开立及参与所需文件，缴款方式以该等文件载明信息为准。

（四）资产管理计划的募集账户

管理人应当将本计划募集期间投资者的资金存放在募集结算专用账户（募集账户），管理人将在本计划推广公告中披露本计划募集账户信息。

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和日期

初始募集期限届满时，本计划的初始募集规模不低于人民币 1000 万元且其投资者的人数为 2 人至 200 人，募集过程符合法律法规和中国证监会的规定，管理人公告本计划成立。

（二）资产管理计划设立失败

初始募集期限届满，在本计划初始募集规模低于人民币 1000 万元或投资者的人数少于 2 人条件下，或募集期内发生使本计划无法成立的不可抗力事件，则本计划设立失败。本计划设立失败的，按照下述“（五）资产管理计划未达成立条件的处理方式”的约定处理。

（三）资产管理计划的成立和备案

本计划的募集金额缴足之日起 10 个工作日内，管理人公告本计划成立。

管理人应当在本计划成立之日起 5 个工作日内将本合同、投资者名单与认购金额等材料向基金业协会备案，具体以监管机构的要求为准。

本计划成立前，任何机构和个人不得动用投资者参与资金。

（四）本计划成立后完成备案前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。

（五）资产管理计划未达成立条件的处理方式

本计划初始募集期限届满，未达成立条件的，管理人应当：

- 1、以其固有财产承担本计划因募集行为而产生的债务和费用；
- 2、在募集期届满后 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。

（六）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。

八、资产管理计划的参与、退出与转让

（一）资产管理计划的参与、退出

1、参与和退出的场所

本计划的参与和退出场所为管理人及代理销售机构（如有）的营业场所或按照管理人及代理销售机构（如有）提供的其他方式办理参与和退出。

2、参与和退出的开放日和时间

自本集合计划成立日次日起至本集合计划签署《德阳天元重工股份有限公司向不特定合格投资者公开发行股票并在北京证券交易所上市之战略配售协议》（协议名称以实际签署为准）前，管理人于每周二、三、四设置开放日（如遇节假日不开放且不顺延），投资者可办理参与、退出业务。

自本集合计划签署《德阳天元重工股份有限公司向不特定合格投资者公开发行股票并在北京证券交易所上市之战略配售协议》之日起，本集合计划封闭运作，不设置开放期，不得办理参与、退出业务，直至本计划资产全部变现，本计划可提前终止清算。

如发生不可抗力或其他情形致使本计划无法按时办理参与和退出业务，或依据本合同需暂停参与和退出业务的，开放日顺延至前述情形消除之日的下一个工作日，具体以管理人公告为准。

若出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更或其他特殊情况，集合计划管理人将视情况对前述开放日及具体业务办理时间进行相应的调整，并在实施日3个工作日前告知投资者。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。

3、临时开放期

因法律、法规、规章、中国证监会、基金业协会的规定、证券登记结算机构业务规则以及证券交易所等交易规则修订或因本计划运作的实际情况需要变更合同等情况时，管理人有权设定临时开放期，为投资者办理退出业务，临时开放期的具体安排以管理人公告为准。

4、参与和退出的方式、价格、程序及确认等

(1) “未知价”原则，即存续期参与价格为参与申请当日本计划的单位净值，退出价格为退出申请当日本计划的单位净值；

(2) 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；

(3) 参与申请和退出申请的确认：投资者按销售机构及\或其指定营业网点的具体安排，在规定的交易时间段内办理参与或退出。投资者以书面签名或电子合同方式签署本合同后，方可通过销售机构的交易系统申请参与本计划。销售机构受理参与或退出申请并不表示对该申请是否成功的确认，而仅表示销售机构确实收到了参与或退出申请，申请是否有效应以注册登记机构的确认为准。投资者在T日提交参与或退出申请后，注册登记机构在T+1日对申请的有效性进行确认，并为确认成功的申请办理增加或扣除权益的登记手续，投资者可在T+2日至各销售网点查询确认情况。未经确认的参与申请，参与资金（无利息）由销售机构退还至投资者账户。

对于投资者的参与申请，若参与申请全额确认后规模超过本计划规定的规模上限或超过本计划规定的人数上限时，管理人可自次日起暂停接受参与申请，对已提交的参与申请，注册登记系统根据“时间优先、金额优先、申请单号优先”的先后原则逐笔确认，即相同时间金额大者优先确认；相同金额申请单号小者优先确认。未确认部分的参与资金（无利息）由销售机构退还至投资者账户。

对于投资者的退出申请，管理人按照先进先出的原则予以确认，即按照投资者份额参与的先后次序进行顺序退出的方式确定退出份额并适用相应的退出费率。

若投资者在退出开放期间提出的退出申请，可能影响本计划参与战略配售或损害其他投资者利益的，则管理人有权对本次退出开放期投资者的退出申请进行拒绝。

(4) 参与和退出申请的款项支付：投资者应开设销售机构认可的交易账户，并在交易账户备足认购的货币资金；若交易账户内资金不足，销售机构将不受理该笔参与申请；其中，

通过管理人直销柜台参与的，需按管理人要求提供交易账户开立及参与所需文件，缴款方式以该等文件载明信息为准。

投资者退出申请确认成功后，管理人应按照本合同约定向投资者支付退出款项，退出款项于确认之日起7个工作日内从托管账户中划出。在发生巨额退出、暂停估值等本合同约定的情形时，款项的支付办法参照本合同的有关条款处理。投资者申请退出份额数量超过投资者持有份额数量时，申请无效。

(5) 管理人可根据本计划运作的实际情况并在不影响投资者实质利益的前提下调整上述原则。管理人必须在新规则开始实施前在管理人指定网站公告告知投资者。

(6) 管理人有合理理由认为投资者参与本计划将不符合本合同约定或监管规定的，管理人有权拒绝该等投资者参与本计划，有权对其参与申请做确认失败处理而无需承担任何责任。

5、参与和退出的金额限制

投资者在本计划存续期内的参与开放期参与本计划的，如投资者在提交参与申请时未持有本计划份额的，则参与金额应不低于人民币1,000,000元（不含参与费）；已持有本计划份额的投资者，在本计划存续期内的参与开放期追加参与本计划的，则每次追加参与金额应大于或等于人民币10,000元。

当投资者持有的本计划份额资产净值高于人民币1,000,000元时，投资者可以在本计划的退出开放期内选择全部或者部分退出本计划，选择部分退出的，投资者在退出后持有的本计划份额资产净值不得低于人民币1,000,000元。当管理人发现投资者申请部分退出本计划将导致其在部分退出申请确认后持有的本计划份额净值低于人民币1,000,000元的，管理人有权发起强制退出投资者持有的本计划全部份额。当投资者持有的本计划份额资产净值低于（含）人民币1,000,000元时，需要退出本计划的，投资者应当选择一次性全部退出本计划，否则管理人有权发起强制退出投资者持有的本计划全部份额。

如相关法律法规变更导致前述约定不再符合法律法规规定的，管理人有权根据变更后的法律法规要求，合理调整对参与金额和退出份额的数量限制，管理人必须在新规则开始实施前在管理人网站指定公告告知投资者。

6、参与和退出的费用

(1) 参与费用

本计划无参与费，即参与费率为0。

(2) 退出费用

本计划无退出费，即退出费率为0。

7、参与份额和退出金额的计算

（1）参与份额的计算

参与份额=参与金额÷注册登记机构受理申请当日本计划的单位净值

注：本计划份额计算时采用四舍五入，保留至0.01份，由此产生的误差计入本计划财产；多笔参与时，按上述公式进行逐笔计算。

（2）退出金额的计算

退出金额=退出总额-管理人业绩报酬（如有）

退出总额=退出份额×注册登记机构受理申请当日本计划的单位净值

注：退出金额结果按照四舍五入方法，保留小数点后两位，多笔退出时，按上述公式进行逐笔计算。

8、巨额退出的认定和处理方式

（1）巨额退出的认定

单个开放日中，本计划净退出申请的份额（退出总份额扣除参与总份额后的余额）超过本计划上一日总份额的10%时，即认为本计划发生了巨额退出。

（2）巨额退出的处理方式

当出现巨额退出时，管理人可以根据本计划当时的资产组合状况决定全额退出、部分顺延退出。

在发生巨额退出的情形下，为避免投资者利益因份额净值的小数点保留精度受到重大影响，管理人可以通过设立巨额退出情形下的净值精度应急调整机制从而提高份额净值的精度。届时，管理人在与托管人协商一致的情况下，发布关于净值精度调整的公告。

①全额退出：当管理人认为有能力支付投资者的退出申请时，按正常退出程序执行。

②部分顺延退出：当本计划支付投资者的退出申请可能会对本计划的资产净值造成较大波动或造成本计划存在流动性困难时，管理人在当日正常接受的退出份额不低于上一日本计划总份额的10%的前提下，对其余退出申请延期办理。对于当日的退出申请，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者取消退出。选择延期退出的，将自动转入下一个工作日继续退出，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工作日的退出申请一并处理，不享有优先权并以下一工作日的本计划单位资产净值为依据计算退出金额，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。部分顺延退出不受单笔退出最低份额的限制。

（3）告知客户的方式

当本计划出现巨额退出，并发生部分顺延退出或暂停接受退出申请的，管理人应及时在管理人网站上公告。

9、连续巨额退出的认定和处理方式

（1）连续巨额退出的认定

如果本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。

（2）连续巨额退出的处理方式

暂停退出：本计划发生连续巨额退出的，如本计划支付投资者的退出申请可能会对本计划的资产净值造成较大波动或造成本计划存在流动性困难的，管理人可以按本合同约定部分顺延退出或暂停接受退出申请；已经接受的退出申请可以延缓支付退出款项，但不得超过20个工作日。

（3）告知客户的方式

当本计划出现连续巨额退出，并发生部分顺延退出或暂停接受退出申请的，管理人应及时在管理人指定网站公告。

10、单个投资者大额退出

对单个投资者单日退出份额超过集合计划总份额10%，即视为单个投资者大额退出。大额退出的，投资者必须至少提前2个工作日直接或者通过代理销售机构向管理人提出书面退出预约申请，未提交书面退出预约申请的，管理人有权拒绝其退出申请，且不承担任何责任。

单个投资者大额退出触发本计划巨额退出的，按照本合同约定的“巨额退出的认定和方式”予以处理。

11、拒绝或暂停参与的情况及处理方式

如出现如下情形，管理人可以拒绝或暂停本计划的参与申请：

- （1）不可抗力的原因导致本计划无法正常运转；
- （2）本计划出现或可能出现超出募集规模上限（如有）或投资者超过200人；
- （3）管理人、托管人、销售机构或注册登记机构的技术保障或人员支持等不充分；
- （4）销售机构对投资者资金来源表示疑虑，投资者不能提供充分证明的；
- （5）管理人认为会有损于现有投资者利益；
- （6）证券交易所在交易时间非正常停市；

(7) 发生本合同规定的暂停本计划资产估值情况；

(8) 本集合计划成立日次日起至本集合计划签署《德阳天元重工股份有限公司向不特定合格投资者公开发行股票并在北京证券交易所上市之战略配售协议》（协议名称以实际签署为准）之前，投资者参与后导致集合计划的规模高于战略配售拟缴款金额的 125%的；

(9) 法律、行政法规和中国证监会认定的其他情形或其他在本合同中已载明的特殊情形。

拒绝或暂停受理参与的方式包括：

管理人决定拒绝某些投资者的参与申请时，参与款项（无利息）将退回至投资者账户。

12、拒绝或暂停退出的情况及处理方式

发生下列情形时，管理人可以拒绝或暂停受理本计划的退出申请：

(1) 不可抗力的原因导致本计划无法正常运行；

(2) 证券交易场所交易时间非正常停市，导致当日本计划资产净值无法计算；

(3) 管理人认为接受某笔或某些退出申请可能会影响或损害现有投资者利益时；

(4) 因市场剧烈波动、连续两个以上工作日（含本数）发生巨额退出，或者其他原因导致本计划的现金出现困难时，管理人可以暂停办理本计划的退出；

(5) 管理人、托管人、销售机构或注册登记机构的技术保障或人员支持等不充分；

(6) 发生本合同规定的暂停本计划资产估值情况；

(7) 本集合计划成立日次日起至本集合计划签署《德阳天元重工股份有限公司向不特定合格投资者公开发行股票并在北京证券交易所上市之战略配售协议》（协议名称以实际签署为准）之前，投资者退出后导致集合计划的规模低于战略配售拟缴款金额的 105%的；

(8) 法律、行政法规和中国证监会认定的其他情形或其他在本合同中已载明的特殊情形。

拒绝或暂停受理退出的方式包括：

管理人将在当日立即公告，并在重新开放退出时，提前在管理人指定网站公告。已接受的退出申请，若管理人有足额支付能力，则管理人将足额支付；如暂时不能足额支付的，将按每个退出申请人已被接受的退出申请量占已接受退出申请总量的比例分配给退出申请人，其余部分在后续工作日予以兑付。

发生本合同未予载明的事项，但管理人有正当理由认为需要暂停接受本计划参与、退出申请的，在履行相应程序后管理人可以暂停接受投资者的参与、退出申请。投资者认可上述关于参与、退出的原则及处理方法，接受管理人依据法律法规及本合同的约定所做出

的决定。

（二）资产管理计划的份额转让

投资者承诺不通过任何形式在本计划所投资的标的股票的锁定期内转让所持有的本计划份额。

（三）资产管理计划份额的非交易过户

非交易过户是指不采用参与、退出等交易方式，将一定数量的本计划份额按照一定的规则从某一投资者账户转移到另一投资者账户的行为。本计划注册登记机构只受理因继承、司法执行以及经注册登记机构认可的其他情况下的计划份额非交易过户。

办理非交易过户业务必须提供注册登记机构规定的资料，对于符合条件的非交易过户申请按注册登记机构的有关规定办理，申请人按照注册登记机构规定的标准缴纳过户费用。

（四）资产管理计划份额的冻结

本计划注册登记机构只受理国家有权机关依法要求的本计划份额冻结与解冻事项。

（五）管理人自有资金参与资产管理计划

管理人不得以自有资金参与本集合计划。

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及日常机构。

十、资产管理计划份额的登记

（一）资产管理计划的份额登记结算业务

本计划份额的登记结算业务指本计划的登记、存管、结算和交收业务，具体内容包括投资者账户管理、份额注册登记、结算及交易确认、资产分配、建立并保管本计划投资者资料表等。

（二）本计划的份额登记结算业务由管理人负责办理。

（三）本计划投资者同意管理人、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。

十一、资产管理计划的投资

（一）资产管理计划的投资目标

本计划的投资者为德阳天元重工股份有限公司之高级管理人员、核心员工（根据相关法

律法规及监管要求规定禁止认购的人士除外），本计划财产主要按照本合同约定的投资比例投资于德阳天元重工股份有限公司在北京证券交易所首次公开发行股票的战略配售股票，剩余资产进行现金管理。

本计划将在标的股票限售锁定期届满后，在遵守相关减持规则的前提下，择机变现本计划持有的部分或全部上述股票，力争获取投资收益，减持期内变现资金仅用于现金管理。

（二）资产管理计划的投资范围：

（1）权益类资产：德阳天元重工股份有限公司在北京证券交易所首次公开发行股票的战略配售股票；

（2）现金类资产：包括现金、各类银行存款（包括银行活期存款、银行同业存款、银行定期存款和银行协议存款等各类存款，不含结构性存款）、货币市场基金；

（三）资产管理计划的投资策略

1、管理人的决策依据

本计划以国家有关法律、法规和本合同的有关规定为决策依据，并以维护本计划投资者利益作为最高准则。具体决策依据包括：

（1）《管理办法》、《运作管理规定》等有关法律法规及《集合资产管理合同》等法律文件；

（2）宏观经济发展态势、微观经济运行环境和证券市场走势，为本计划投资决策的市场基础；

（3）投资对象收益和风险的配比关系。在充分权衡投资对象的收益和风险的前提下作出投资决策，是本计划维护投资者利益的重要保障。针对产品的特点，在衡量投资收益与风险之间的配比关系时，力争保护投资者的本金安全，在此基础上为投资者争取较高的收益。

2、管理人的决策程序

管理人资产管理业务投资决策体系由管理人资产管理业务委员会、资产管理业务部门、投资经理三级体系组成。

管理人资产管理业务委员会是管理人资产管理业务的最高决策机构，下设投资管理委员会负责确定以下事项：

（1）在资产管理业务委员会授权范围内，对资产管理业务部门的投资品种、投资规模等进行授权；

（2）审议资产管理业务部门超出授权限额但未超过监管规定限额的投资；

（3）核准资产管理业务部门投资经理的履职资格；

(4) 讨论与决定其他涉及客户资产管理投资业务的重大事宜。

资产管理业务部门的主要职责是：

(1) 确定客户资产管理业务投资、研究工作的政策，约束客户资产投资管理的整体过程；

(2) 讨论、提名投资经理人选，并报公司资产管理业务委员会下设的投资管理委员会审批；

(3) 对投资经理进行适当的定级和授权；

(4) 审批超过投资经理授权权限但未超过投资管理委员会授权权限的投资事宜；

(5) 制定客户资产管理相关的具体投资研究交易制度；

(6) 建立和维护投资品池；

(7) 讨论与决定其他涉及客户资产管理业务的具体事宜。

投资经理是资产管理业务具体产品的直接管理人，在管理人授权范围内进行投资管理。

3、管理人投资管理的方法和标准

本集合计划成立后按照合同约定比例将受托财产投资于德阳天元重工股份有限公司在北京证券交易所首次公开发行股票的战略配售股票，本计划存续期内不再买入上述股票；其余资产进行现金管理。管理人在本计划持有的股票锁定期结束后根据本集合计划的运作情况卖出标的股票。

(四) 投资比例

1、资产配置比例

本计划财产投向权益类资产的投资比例为资产总值的 80%（含）-100%（含）；投向现金类资产的投资比例为资产总值的 0%（含）-20%（不含）。

2、总资产占净资产的比例

本计划总资产不得超过本计划资产净值的 200%，计算总资产时，应当按照穿透原则合并计算所投资资产管理产品的总资产，中国证监会另有规定的除外；

3、组合投资要求比例

本计划投资于同一资产的资金，不得超过本计划资产净值的 25%；除以收购公司为目的设立的资产管理计划、专门投资于未上市企业股权的资产管理计划外，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%，单一融资主体及其关联方的非标准化资产，视为同一资产合并计算；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。如本计划根据《北京证券交易所证

券发行与承销管理细则》相关规定投资于德阳天元重工股份有限公司在北京证券交易所首次公开发行股票的战略配售股票，不受以上规定限制。

4、投资比例超限的处理方式和流程

如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主观因素之外的因素，造成本计划投资比例不符合法律、行政法规和中国证监会规定的投资比例或者本合同约定的投资比例的，管理人应在流动性受限资产可出售、恢复交易或者具备交易条件的20个工作日内将投资比例调整至符合相关要求的范围内。确有特殊事由未能在前述约定时间内完成调整的，管理人应当及时向管理人住所地中国证监会派出机构报告。

投资者在此同意在本计划存续期间，为规避流动性或市场风险，管理人投资于权益类资产的比例可以低于本计划总资产的80%，但不得持续6个月低于本计划总资产的80%。

（五）资产管理计划的投资限制及禁止行为

1、为维护投资者的合法权益，本计划的投资限制为：

（1）管理人管理的全部资产管理产品投资单一上市公司发行的股票不得超过该上市公司可流通股票的30%；

（2）本计划总资产不得超过本计划资产净值的200%，计算总资产时，应当按照穿透原则合并计算所投资资产管理产品的总资产，中国证监会另有规定的除外；

（3）本计划参与股票等证券发行申购时，本计划所申报的金额不得超过本资产管理计划的总资产，本计划所申报的数量不得超过拟发行公司本次发行的总量；

（4）本计划获配的德阳天元重工股份有限公司在北京证券交易所首次公开发行股票的证券数量不得超过德阳天元重工股份有限公司公开发行数量的10%；

（5）法律法规、中国证监会以及本合同规定的其他投资限制。

2、禁止行为

本计划的禁止行为包括：

（1）违规将本计划资产用于资金拆借、贷款、抵押融资或者对外担保等用途；

（2）将本计划资产用于可能承担无限责任的投资；

（3）向投资者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）侵占、挪用本计划资产；

（5）募集资金不入账或者其他任何形式的账外经营；

（6）接受单一客户参与资金低于中国证监会规定的最低限额；

（7）以获取佣金或者其他不当利益为目的，使用本计划资产进行不必要的交易；

(8) 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；

(9) 为违法或者规避监管的证券期货业务活动提供交易便利；

(10) 利用本计划进行商业贿赂；

(11) 利用本计划或者职务便利为投资者以外的第三方谋取不正当利益；

(12) 直接或者间接向投资者返还管理费；

(13) 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；

(14) 为本人或他人违规持有金融机构股权提供便利；

(15) 开展明股实债投资；

(16) 不得投资于不符合国家产业政策、环境保护政策的项目（证券市场投资除外），包括但不限于以下情形：

1) 投资项目被列入国家发展和改革委员会发布的淘汰类产业目录；

2) 投资项目违反国家环境保护政策要求；

3) 通过穿透核查，资产管理计划最终投向上述投资项目。

(17) 不得将本计划财产用于投资房地产价格上涨过快热点城市普通住宅地产项目或用于支付土地出让价款或补充流动资金；前述关于“房地产价格上涨过快热点城市”、“普通住宅地产项目”、“房地产开发企业”之认定，以基金业协会《证券期货经营机构私募资产管理计划备案管理规范第4号——私募资产管理计划投资房地产开发企业、项目》及其不时做出的修订和补充之规定为准；

(18) 本计划不得直接投资于商业银行信贷资产；

(19) 本计划不得违规为地方政府及其部门提供融资，不得要求或者接受地方政府及其部门违规提供担保；

(20) 本计划不得直接或者间接投资法律法规和国家政策禁止进行债权或股权投资的行业和领域；

(21) 法律法规和中国证监会禁止的其他行为。

(六) 资产管理计划的业绩比较基准及确定依据

本计划不设业绩比较基准。

(七) 资产管理计划的风险收益特征及适合推广对象：

本计划属于中高（R4）风险等级的产品，适合且仅能向风险承受能力为C4（积极型）级

及以上或符合专业投资者标准的合格投资者销售。

（八）资产管理计划的建仓期

管理人将在本计划成立之日起6个月内，使本计划的投资组合比例符合上述关于投资比例的约定。建仓期的投资活动，应当符合本合同约定的投向和本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。

（九）本计划投资的资产组合的流动性与本计划参与、退出的安排相匹配，具体为：

1、本计划签署《德阳天元重工股份有限公司向不特定合格投资者公开发行股票并在北京证券交易所上市之战略配售协议》前每周二、三、四定期开放，主要投资于现金类资产，在合同约定的开放退出期内具有较好的流动性及变现能力，可以满足本计划参与、退出安排。

2、本计划主动投资于流动性受限资产的市值在开放退出期内合计不得超过本计划资产净值的20%。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）、流动性受限的新股以及非公开发行股票、停牌股票等资产。

3、本计划开放退出期内资产组合中七个工作日可变现资产的价值，不低于本计划资产净值的10%。七个工作日可变现资产，包括可在交易所、银行间市场正常交易的股票、债券、非金融企业债务融资工具、期货及期权合约以及同业存单，七个工作日内到期或者可支取的逆回购、银行存款，七个工作日内能够确认收到的各类应收款项等。本集合计划投资的资产组合中七个工作日可变现资产，主要包括交易所市场正常交易的股票和七个工作日内到期或者可支取的银行存款。

4、本计划签署《德阳天元重工股份有限公司向不特定合格投资者公开发行股票并在北京证券交易所上市之战略配售协议》之日起封闭运作，均不接受投资者提出的参与、退出申请，直至本计划资产全部变现。

（十一）本计划所持股票表决权的行使

管理人将代表本集合计划按照法律规定行使本集合计划所持股票的表决权，全体份额持有人特此同意，除非法律法规要求管理人必须出席股东大会的情况外，管理人不出席股东大会；如果管理人按照法律法规要求出席股东大会，管理人将在行使表决权时投弃权票。

十二、投资顾问

本计划是否聘请投资顾问：否。

十三、分级安排

本计划是否根据风险收益特征进行分级：否。

十四、利益冲突及关联交易

（一）资产管理计划存在或可能存在利益冲突的情形

本计划存在或可能存在如下利益冲突的情形：

1、若发生管理人开展的不同业务之间的敏感信息不当流动和使用，导致管理人其他业务与管理人资产管理业务可能存在利益冲突；

2、若发生不同投资经理管理的资产管理计划的持仓、交易等重大非公开信息的不当流动和使用，导致管理人管理的不同资产管理计划之间可能存在利益冲突；

3、若发生管理人从业人员利用知悉的敏感信息参与资产管理计划且未按规定进行申报和披露的，导致管理人从业人员与资产管理计划及投资者之间可能存在利益冲突；

4、其他可能存在的管理人、管理人从业人员与资产管理计划及管理人管理的不同资产管理计划之间可能存在的利益冲突情形。

（二）资产管理计划存在利益冲突的处理方式及披露

1、利益冲突的处理方式

管理人制定了信息隔离墙管理办法及利益冲突管理办法，并在业务开展过程中严格执行业务隔离和利益冲突防范的机制，对利益冲突进行识别和管理，若发现存在利益冲突情形的，管理人将遵循如下原则及时予以处理，维护本计划及投资者的合法权益：

（1）在处理涉及到公司、从业人员与客户之间的利益冲突时，严格坚持客户利益至上的原则；

（2）在处理涉及到客户与客户之间的利益冲突时，严格坚持公平对待客户的原则。

2、利益冲突的披露

对于实际发生的利益冲突情形，管理人将自发现之日起5个工作日内通过管理人网站公告将利益冲突的具体情形及管理人的处理安排等告知投资者。

（三）资产管理计划的关联交易

管理人可运用本计划财产从事关联交易，关联交易包括一般关联交易和重大关联交易，管理人制定的划分标准、管控机制包括：

1、关联方范围

本计划所称关联方包括：

（1）本计划管理人、管理人的控股股东、实际控制人及其他关联方（含管理人公司的一级全资子公司及控股子公司）；

（2）本计划的托管人、托管人的控股股东、实际控制人及其他关联方；

（3）本计划的投资顾问（如有）、投资顾问的控股股东、实际控制人及其他关联方；

（4）与管理人、本计划的托管人、投资顾问（如有）有其他重大利害关系的机构。上述第（1）项为管理人全部资产管理计划的关联方；第（2）（3）项为本计划的关联方。

（5）监管机构、基金业协会、管理人内部管理制度另有要求的，管理人遵照执行。

2、关联交易范围

本计划涉及的关联交易的具体类型包括但不限于：

（1）本计划财产投资于管理人、管理人的控股股东、实际控制人及其他关联方（含管理人公司的一级全资子公司及控股子公司）发行或者承销期内承销的证券；

（2）本计划财产投资于本计划托管人、托管人的控股股东、实际控制人及其关联方发行的证券或者承销期内承销的证券；

（3）本计划财产投资于其投资顾问（如有）、投资顾问的控股股东、实际控制人及其他关联方发行的证券或者承销期内承销的证券；

（4）本计划财产投资于管理人、管理人的控股股东、实际控制人及其他关联方（含管理人的一级全资子公司及控股子公司）担任管理人的资产管理产品（含公募基金）；

（5）本计划财产投资于管理人对外作为投资顾问管理的资产管理产品；

（6）本计划财产投资于投资顾问（如有）担任管理人的资产管理产品（含公募基金）；

（7）本计划财产以本计划关联方或者以本条第（4）、（5）、（6）项规定的资产管理产品为交易对手，进行询价交易（包括但不限于银行间市场、交易所固收平台、大宗交易平台、场外基金申购、协议存款、逆回购交易等）；

（8）本计划财产以本计划关联方或者以本条第（4）、（5）、（6）项规定的资产管理产品为交易对手，进行《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》第三十八条第（五）项规定的非标准化资产交易；

（9）本计划财产开展逆回购交易，质押券为管理人、管理人的控股股东、实际控制人及其他关联方（含管理人的一级全资子公司及控股子公司）发行的证券；

（10）监管机构、基金业协会、管理人内部管理制度另有要求的，管理人遵照执行。

3、一般关联交易和重大关联交易

关联交易分为一般关联交易和重大关联交易，实行分类管理。重大关联交易是指投资于本计划关联方发行或承销期内承销的证券、投资于关联方产品的（本计划为 FOF 产品，或本计划投资于货币基金，或关联产品为公募基金、投资金额不超过该资管产品净值 10% 且不超过公募基金份额 10% 的除外）、与关联方及关联方产品为交易对手开展非标准化资产交易或金额及比例重大（固定收益类单笔交易金额超过资管产品净值 20% 或金额超过 2 亿元，权益类、衍生品及其他标准化资产单笔交易金额超过资管产品净值 10% 或金额超过 3000 万元）的询价交易、以管理人及其关联方发行证券作为质押券开展的金额及比例重大（固定收益类单笔交易金额超过资管产品净值 20% 或金额超过 2 亿元，权益类、衍生品及其他标准化资产单笔交易金额超过资管产品净值 10% 或金额超过 3000 万元）的逆回购交易等需强化审批、披露、报告的关联交易；一般关联交易是指除重大关联交易以外的其他关联交易。监管机构和基金业协会对于一般关联交易和重大关联交易的区分标准有明确规定的，以监管机构和基金业协会的相关要求为准。

投资者在此同意并授权管理人可以将本计划财产投资于一般关联交易。管理人将本计划财产投资于一般关联交易的，应在交易完成后，定期书面告知投资者和托管人并向管理人住所地中国证监会派出机构报告，具体以监管机构的要求为准。

管理人将本计划财产投资于重大关联交易的，应当遵守法律、行政法规、中国证监会的规定和本合同约定，逐笔通过公告或其他方式提前通知投资者，投资者约定时间内未提出异议的视为同意。投资者提出异议的处理方式，由管理人在通知中明确。同时，管理人应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，具体以监管机构的要求为准。

4、关联交易的内部控制机制

管理人应当遵循诚信、公平原则，以公平、合理的市场价格进行交易，防范利益冲突，禁止利益输送。管理人为此制定了相应的内控管理制度，明确了关联交易的范围及类型、审批程序、信息披露、关联数据库管理、稽核审计等内控机制并执行，参与关联交易管理的部门包括业务部门、内控部门等前中后台部门，管理人参与关联交易管理的部门按照内控机制的要求对关联交易进行审批。

5、产品关联方名单披露方式

本产品的关联方名单信息将通过公告的形式在管理人指定网站上披露或其他适当的方式通知投资者。若管理人指定网站变更，管理人将提前进行相关信息的详细披露。

6、其他

除将本计划财产投资于管理人、托管人及前述机构的控股股东、实际控制人或者其他关

关联方发行的证券或者承销期内承销的证券外，管理人不得将本计划财产直接或者通过投资其他资产管理计划等间接形式，或通过与他人进行交叉融资安排等方式，违规为管理人、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提供或者变相提供融资。全部投资者均为符合中国证监会规定的专业投资者（专业投资者为私募资产管理产品的，穿透认定该私募资产管理产品的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）且单个投资者投资金额不低于 1000 万元，并且事先取得投资者同意的除外。

（四）托管人的关联方名单以托管人官网-“公司简介”栏中披露信息为准，托管人及其关联方发行的证券或者承销期内承销的证券等信息以公开资讯为准，投资者可以通过托管人官网查询托管人关联方名单。

十五、投资经理的指定与变更

（一）投资经理的指定

1、本计划投资经理由管理人负责指定，投资经理不得同时办理客户资产管理业务和自营业务。

2、本计划投资经理

本计划投资经理是牛岩。

本计划投资经理简介：牛岩，武汉大学硕士，于 2016 年加入第一创业证券，拥有 10 年以上证券从业经验。现任资产管理部投资经理，熟悉国内资本市场，在公募 REITs、股票等领域具备丰富的投资研究经验，最近三年未被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚。

（二）投资经理的变更

管理人可根据业务实际需要或者人员调整的安排变更投资经理，并在变更后及时公告告知投资者和托管人。管理人应当确保变更后的投资经理符合法律法规的规定及本合同的约定。

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、本计划财产的债务由本计划财产本身承担责任，投资者以其出资为限对本计划财产的债务承担责任。

2、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。

3、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。

4、管理人、托管人可以按照本合同的约定收取管理费、托管费以及本合同约定的其他费用。管理人、托管人以其固有财产承担法律责任，其债权人不得对本计划财产行使请求冻结、扣押和其他权利。管理人、托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，本计划财产不属于其清算财产。

5、本计划财产产生的债权不得与不属于本计划财产本身的债务相互抵消。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本计划财产强制执行。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。

6、托管人应安全、完整地保管本计划财产，未经本合同约定或管理人的指令，托管人不得自行运用、处分、分配本计划财产；**管理人对本计划财产的管理和运用以及托管人对本计划财产的保管并非对投资者对本金或收益的保证或承诺。**

7、托管人仅负责保管本计划项下托管账户内的现金资产。对于本资产管理计划项下未由其保管且未受其实际控制的其他资产（包括现金类资产与非现金类资产），资产托管人不承担保管职责，且对其安全性和完整性不承担任何责任。资产管理人负责保管本资产管理计划对外投资过程中形成的股权等非现金资产及相关权利凭证。管理人应对本资产管理计划项下非现金资产及其权利凭证的安全和完整负责。除资产管理计划合同另有约定外，资产管理人不得在该等非现金资产或其权利凭证之上设置抵押、质押或其他权利负担。

（二）资产管理计划财产相关账户的开立和管理

托管人负责为本计划出资资产开立托管专户，保管本计划的银行存款。本计划的一切货币收支活动，包括但不限于投资、支付退出金额、支付计划收益、收取参与款，均需通过该账户进行。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计划的名义开立其他任何银行账户；亦不得使用计划的任何银行账户进行本资产管理计划业务以外的活动。管理人应当在开户过程中给予必要的配合，并提供所需资料。托管账户开立后，托管人应提供正式的开户通知函明确各项账户关键信息（含利率），如发生变动应及时以书面形式告知管理人。

管理人或托管人为本计划开立证券账户及投资所需的其他账户。证券账户名称及投资所需的其他账户名称应当符合证券、期货登记结算机构的有关规定。

本计划证券账户、专用交易单元及投资所需的其他账户应由管理人报证券交易所、证券登记结算机构以及管理人住所地中国证监会派出机构及基金业协会备案，具体以监管机构的

要求为准。

十七、投资指令的发送、确认和执行

（一）投资指令的授权

管理人应当事先向托管人提供书面指令发送授权文件（下称“授权文件”，附件三），指定有权向托管人发送投资指令的被授权人员（下称“被授权人”），包括被授权人的名单、权限、预留印鉴、签字样本或签章，并注明相应的交易权限及授权通知生效日期。

授权通知应当以传真或双方认可的其他方式送达托管人，并在送达之日起 10 个工作日内以原件形式送达托管人。授权通知应当载明生效日期，生效日期不早于托管人收到传真件或扫描件之日。托管人收到授权文件并完成确认的日期晚于载明的生效日期或授权通知未载明生效日期的，则自托管人收到授权文件并完成确认的日期生效。托管人收到的传真件或扫描件与原件所载不一致的，以传真件或扫描件为准。

（二）投资指令的内容

投资指令（格式见附件二）是管理人在管理本计划财产时，管理人向托管人发出的资金划拨及其他款项支付的指令。管理人发给托管人的指令应当写明款项事由、到账时间、金额、收款账户信息等，加盖预留印鉴并有被授权人签字或签章。

（三）投资指令的发送、确认及执行时间和程序

指令由被授权人代表管理人用传真方式或其他管理人与托管人一致认可的方式向托管人发送。管理人应当在发送指令后与托管人以录音电话、通过托管人提供的网上服务平台或者其他管理人与托管人一致认可的方式进行确认，因管理人未能及时与托管人进行指令确认，致使资金未能及时到账所造成的损失，由过错方承担责任。托管人确认指令有效后，方可执行指令。

对于被授权人依照授权通知发送的指令，管理人不得否认其效力。被授权人应按照有关法律法规规定和本合同的约定，在其交易权限内以传真或双方认可的其他方式向托管人发送指令，管理人在发送指令时，应当为托管人留出执行指令所必需的时间。除需考虑资金在途时间外，还需给托管人留有至少 2 个小时的复核和审批时间。管理人向托管人发送要求当日支付的场外投资指令的最晚时间为每个工作日的 15:30，对于超过 15:30 的指令，托管人尽力配合执行，但不保证当日完成在银行的划付流程。有效投资指令是指指令要素准确无误、预留印鉴相符、相关的指令附件齐全且头寸充足的投资指令。由管理人原因造成的指令传输不及时、发送指令错误、未能留出足够划款所需时间、资金账户中未有足额余额，致使资金

未能及时到账所造成的损失，由过错方承担责任。

托管人收到管理人发送的指令后，应当对指令是否由被授权人发送、指令的要素是否齐全、指令印鉴与签字是否与预留的授权文件内容相符进行书面审查，复核无误后应在规定期限内及时执行，不得延误。若存在管理人未按时提供被授权人的预留印鉴和签字样本、表面一致性不符或出现本条第（五）项约定的管理人发出错误指令的情形时，托管人有权拒绝执行，并应及时与管理人指定人员进行电话联系和沟通，并要求管理人重新发送经修改的指令。托管人可以要求管理人提供相关交易凭证、合同或其他有效会计资料，以确保托管人有足够的资料来判断投资指令的有效性。

管理人向托管人下达指令时，应确保本计划资金账户有足够的资金余额，对管理人在没有充足资金的情况下向托管人发送的指令，托管人可不予执行，并立即通知管理人，托管人不承担因为不执行该指令而造成损失的责任。管理人应按照本合同约定向托管人发送指令。

（四）托管人依法暂缓、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违反法律法规规定或本合同约定的，应当要求改正，未能改正的，应当拒绝执行，并应及时以书面形式通知管理人并向管理人住所地中国证监会派出机构报告。托管人发现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本合同约定的，应及时以书面形式通知管理人并向管理人住所地中国证监会派出机构报告。

（五）管理人发送错误指令的情形和处理程序

管理人发送错误指令的情形包括指令发送人员无权或超越权限发送指令及交割信息错误，指令中重要信息模糊不清或不全等。托管人发现管理人的指令错误时，应按照本条第（三）项规定的程序进行处理，由此造成的损失，由过错方承担责任。

（六）撤回指令的处理程序

管理人撤回已发送至托管人的有效指令，须向托管人传真加盖预留印鉴的书面通知或双方一致认可的方式通知并电话确认，托管人收到通知并得到确认后，将撤回指令作废；如托管人在收到通知并得到确认时该指令已执行，则该指令为已生效的指令，不得撤回。

（七）更换投资指令被授权人的程序

管理人撤换被授权人或改变被授权人的权限，必须至少提前一个工作日使用传真方式或管理人与托管人一致认可的其他方式向托管人以“授权文件”的格式发出由管理人加盖公章和被授权人签字的变更通知，同时电话或以其他管理人与托管人一致认可的方式通知托管人。被授权人变更的通知须列明新授权的起始日期，原授权通知同时失效。管理人更换被授权人的通知生效后，对于已被撤换人员无权发送的指令，或被改变授权人员超越权限发送的

指令，管理人不承担任何责任。如管理人没有按照上述约定方式执行变更通知程序或被授权人变更的通知因任何理由不生效而导致托管人对变更授权文件提出异议的，则该授权变更不生效。

授权变更文件的原件应于传真件或扫描件发送后的十个工作日内送达托管人，若托管人收到的授权变更原件与传真件或扫描件不一致的，以托管人收到的传真件或扫描件为准。

（八）投资指令的保管

投资指令若以传真或双方认可的其他形式发出，则正本由管理人保管，托管人保管指令传真件或扫描件，当二者不一致时，以托管人收到的投资指令传真件或扫描件为准。

（九）其他相关责任

托管人正确执行管理人符合法律法规规定、本合同约定的投资指令，本计划财产发生损失的，由过错方承担责任。在正常业务受理渠道和指令规定的时间内，因托管人过错未能及时或正确执行符合法律法规规定、本合同约定的投资指令而导致本计划财产损失的，托管人应当承担相应的赔偿责任，但托管资金专户余额不足或托管人遇到不可抗力的情况除外。

十八、交易及交收清算安排

本计划财产证券交易采用证券公司结算模式。管理人担任本计划财产证券买卖的证券经营机构，出资资产投资于证券交易所交易的资金清算交割，由管理人和托管人配合完成交易单元的合并清算事宜。

出资资产投资于银行间市场交易的清算交割，由托管人通过中央结算公司、上清所办理。

出资资产投资于其他交易场所交易的资金清算，由托管人依据投资指令和相关投资文件进行资金划拨。

（一）交易所市场资金清算

交易所市场交易的资金清算由管理人根据中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司的结算数据办理。本计划证券投资的清算交割，由管理人通过中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司及清算代理银行办理。

管理人代理本计划与中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司完成证券资金结算，并承担由管理人原因造成的正常结算、交收业务无法完成的责任。

管理人应加强内部控制，控制证券交易前端风险，避免出现透支买卖，同时防范操作风险，对于因任何原因导致的证券资金交收违约事件，相关各方应及时协商解决。

（二）银行间交易清算

托管人根据管理人投资指令进行银行间债券交易的资金结算。对于乙类账户，托管人根据投资指令和成交单完成证券交割和资金交收，并根据相关规定支付交易费用。

（三）其他场外交易资金清算

除银行划款手续费外，场外资金汇划由托管人根据管理人有效投资指令和相关投资合同（如有）进行资金划拨。

（四）其他资金清算

如资金清算为支付税费的，托管人审核付款用途符合法律、法规及本合同约定后，根据管理人投资指令和相关税费单据（如有）进行资金划拨。

（五）资金和证券账目的对账

管理人和托管人每日对本计划的资金账目和证券账目进行核对，做到账实相符、账账相符。管理人可以向托管人申请开通托管账户的网上银行查询功能，以便查询托管账户现金流情况。

十九、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有关法律法规的规定以及违反本合同约定而进行的投资交易行为，包括：

- 1、违反有关法律法规的规定和本合同约定进行的投资交易行为；
- 2、法律法规禁止的超买、超卖行为；
- 3、法律法规规定以及本合同约定的其他情形。

越权交易的例外情形：如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主观因素之外的因素，造成本计划投资比例不符合法律、行政法规和中国证监会规定的投资比例或者本合同约定的投资比例的，不视为越权交易，管理人应当按照本合同约定予以处理。

管理人应在有关法律法规规定和本合同约定的范围内运用本计划财产进行投资管理，不得违反有关法律法规的规定和本合同的约定进行越权交易。

（二）越权交易的处理程序

- 1、违反有关法律法规规定和本合同约定进行的投资交易行为

托管人对于越权交易，发现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，应当拒绝执行并立即要求管理人改正；未能改正或者造成本计划财产损失的，托管人

应当及时通知管理人并有权报告中国证监会派出机构，具体以监管机构的要求为准。

根据交易规则，托管人只能在事后发现的越权交易，托管人应当立即通知管理人，管理人在收到通知后应当及时核对或纠正。

管理人应向投资者和托管人主动报告越权交易，在限期内，托管人有权随时对通知事项进行复查，督促管理人改正。管理人对托管人通知的越权事项未能在限期内纠正的，托管人有权报告中国证监会派出机构，具体以监管机构的要求为准。

2、法律法规禁止的超买、超卖行为

托管人在行使监督职能时，如果发现本计划财产投资证券过程中出现超买或超卖现象，应立即提醒管理人，由管理人负责解决，由此给本计划财产造成的损失由管理人承担。如果因管理人原因发生超买行为，管理人必须于 T+1 日上午 12:00 前准备好资金，用以完成清算交收。

3、越权交易所发生的损失及相关交易费用由管理人负担，所发生的收益归本计划财产所有。

（三）托管人对管理人投资运作的监督

1、托管人根据《投资运作监督事项表》（见附件一）对本计划的投资范围及投资比例、投资限制等进行监督。

2、托管人对管理人运用本计划财产进行投资管理的监督和检查自本合同生效之日起开始。托管人在本合同约定范围内，对本计划的直接投资履行监督职能。

3、管理人应当及时、准确、完整地向托管人提供履行投资监督所需的数据和信息。托管人投资监督的真实性、准确性和完整性受限于管理人、证券经纪商及其他中介机构提供的数据和信息。

4、管理人经托管人催告仍不按约定与托管人对账，导致托管人无法及时履行投资监督职责的，由过错方承担相关责任。

5、如需托管人对本计划关联交易进行监督的，管理人应于合同生效前提供关联方名单，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，所产生的一切后果，由过错方承担责任。

6、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。

二十、资产管理计划财产的估值和会计核算

（一）资产管理计划财产的估值

1、估值目的

客观、准确地反映本计划财产的价值。经资产估值后确定的本计划单位净值，是进行信息披露、计算参与和退出本计划计价的基础。

2、估值时间

估值日指本计划成立后的每个工作日，即北京证券交易所、上海证券交易所和深圳证券交易所的正常交易日。

管理人、托管人应于估值日（T日），对估值日的计划份额净值进行核对。

3、估值方法

估值应符合《企业会计准则》、其他相关法律法规的规定和本合同的约定，如法律法规未做明确规定的，参照行业通行做法处理。管理人、托管人的估值数据应依据合法的数据来源独立取得。

（1）股票的估值方法

1) 上市流通的股票，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，且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件，以最近交易日的收盘价估值；估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化或者证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，使投资品种潜在估值调整对前一估值日的资产净值的影响在0.5%以上的，可参考停牌股票的估值方法，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。

2) 首次发行未上市的股票，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的前提下，按成本价估值。

3) 送股、转增股、配股和公开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。

4) 流通受限股票（包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等）按以下公式进行估值：

$$FV=S \times (1-LoMD)$$

其中：

FV：估值日该流通受限股票的价值

S：估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值

LoMD: 该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣, 该流动性折扣一般由第三方估值基准服务机构提供, 具体估值机构由管理人和托管人协商约定。

(2) 货币市场基金估值方法

持有的货币市场基金, 按基金管理公司公布的估值日前一交易日的每万份收益计提基金收益。

(3) 银行定期存款或协议存款估值方法

银行定期存款或协议存款以本金列示, 按合同利率或协议利率逐日确认利息收入, 同时使用第三方估值基准服务机构提供的减值计量结果计提预期信用损失, 具体机构由管理人和托管人协商约定。

(4) 托管账户存款和证券资金账户内的资金按约定利率在实际持有期间内逐日计提利息, 在利息到账日以实收利息入账, 并冲减已计提部分。

(5) 如存在上述估值约定未覆盖的投资品种, 管理人可根据具体情况制定估值方法, 并将估值方法提供给托管人进行估值。

(6) 如有新增事项或变更事项, 按法律法规、监管规定的有关最新规定估值。

4、估值对象

运用本计划所持有的一切金融资产和金融负债。

5、估值程序

本计划资产的日常估值由管理人和托管人共同进行。每个估值日交易结束后计算当日的总资产净值, 并以双方认可的方式与托管人核对。

当管理人与托管人的估值结果不一致时, 各方应本着勤勉尽责的态度重新计算核对。如果仍无法达成一致, 应以管理人的估值结果为准。

6、估值错误的处理

本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。国家另有规定的, 从其规定。当资产估值导致本计划单位净值小数点后四位以内发生差错时, 视为本计划单位净值错误。

(1) 估值错误的处理原则

1) 管理人和托管人应采取必要、适当、合理的措施确保本计划资产估值的准确性和及时性。当本计划单位净值的计算出现错误时, 管理人、托管人立即予以纠正, 并采取合理的措施防止损失进一步扩大。当本计划计价出现错误偏差达到资产净值的 0.5% 时, 管理人应当通报托管人。

2) 如管理人计算并经托管人复核确认后公告的计划单位净值出现错误, 且造成投资者或计划资产直接经济损失的, 由管理人、托管人根据各自过错程度承担相应的赔偿责任。

3) 由于管理人和托管人任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, 进而导致计划资产净值计算错误造成投资者或计划资产直接经济损失, 以及由此造成计划资产净值计算顺延错误而引起的投资者或计划资产直接经济损失, 由提供错误信息的当事人向投资者或计划资产赔偿。

(2) 本计划的会计责任方由管理人担任, 与本计划有关的会计问题, 如经管理人、托管人在平等基础上充分讨论后, 尚不能达成一致时, 按管理人的处理方法执行; 或者管理人和托管人对本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, 为避免不能按时公布计划净值的情形, 以管理人的计算结果对外公布; 由此给投资者和本计划财产造成的损失, 由管理人承担责任。

(3) 若被诉人为托管人, 管理人应当为托管人提供估值方法合理性的说明和支持。若托管人因此承担赔偿责任, 应由托管人先行对投资者或者本计划支付赔偿金, 在托管人赔偿后, 托管人有权按上述条款就管理人承担责任的部分向管理人追索; 若被诉人为管理人, 托管人应当为管理人提供必要的支持。若管理人因此承担赔偿责任, 管理人有权按上述条款就托管人承担责任的部分向托管人追索。

(4) 由于证券交易所及其登记结算公司发送的数据错误, 或由于其他不可抗力原因, 管理人和托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查, 但是未能发现该错误的, 由此造成的计划资产估值错误, 管理人和托管人可以免除赔偿责任。但管理人和托管人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

(5) 法律法规或者监管部门另有规定的, 从其规定。如果行业有通行做法, 双方当事人应本着平等和保护投资者利益的原则进行协商确定处理原则。

7、估值调整的情形与处理

如有确凿证据表明按本合同约定的估值方法不能客观反映本计划财产公允价值的, 管理人可根据具体情况, 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, 在与托管人商议后, 及时采用公允价值计量方法对本计划财产净值进行调整。对于本合同约定的估值方法未列明的新增投资品种, 由管理人与托管人协商一致后进行估值。

8、暂停估值的情形

当出现下列情形致使管理人无法准确评估本计划财产价值时, 可暂停估值。但估值条件恢复时, 管理人必须按规定完成估值工作。

- (1) 本计划投资所涉及的证券交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时;
- (2) 因不可抗力或其他情形致使管理人、托管人无法准确评估本计划财产价值时;
- (3) 中国证监会认可的其他情形。

9、资产管理计划份额净值的确认

管理人应于每个估值日计算当日本计划总的资产总值与份额净值,以传真或双方认可的其他方式发送给托管人。托管人进行复核无误后,签名、盖章并发回给管理人,由管理人负责通过指定方式进行披露。月末、年中和年末估值复核与会计账目的核对同时进行。

当管理人与托管人的估值结果不一致时,各方应本着勤勉尽责的态度重新计算核对。如果仍无法达成一致,应以管理人的估值结果为准。如因管理人估值错误,由此给本计划财产或投资者造成损失的,由管理人承担责任。

10、特殊情况的处理

(1) 管理人按法律法规规定和本合同约定的公允价值进行估值时,所造成的误差不作为本计划份额净值错误处理。

(2) 由于不可抗力的原因或由于证券交易场所或注册登记机构发送的数据错误等非管理人、托管人造成的意外事件,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,仍未能发现错误的,由此造成的本计划财产估值错误,管理人和托管人可以免除赔偿责任,但管理人和托管人应当积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。

(二) 资产管理计划的会计政策

本计划的会计政策按照《证券投资基金会计核算业务指引》及如下约定执行:

- 1、本计划的会计年度为公历年度的1月1日至12月31日。
- 2、本计划核算以人民币为记账本位币,以人民币元为记账单位。
- 3、本计划的会计核算应符合相关法律法规规定及本合同的约定,如法律法规未有明确规定的,参照行业通行做法处理。
- 4、本计划财产单独建账、独立核算。
- 5、管理人及托管人各自保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算,按照本合同约定编制会计报表。
- 6、托管人应当定期与管理人就本计划财产的会计核算、报表编制等进行核对及确认。

二十一、资产管理计划的费用与税收

(一) 资产管理计划费用种类

- 1、管理人的固定管理费及业绩报酬；
- 2、托管人的托管费；
- 3、证券交易费用；
- 4、证券账户开户费；
- 5、本计划成立后的信息披露费用、注册登记费用、审计费和汇划费；
- 6、按照法律法规及本合同的约定可以在本计划财产中列支的其他费用。

(二) 资产管理计划费用支付标准、计算方法、支付方式和时间

1、管理费：

(1) 本计划管理人固定管理费按本计划当日受托资产本金（含损益平准金）的 0.8% 年费率计提，计算方法如下：

$$H=E \times 0.8\% \div 360$$

H 为每日应计提的固定管理费；

E 为本计划当日受托资产本金（含损益平准金）。

本计划固定管理费每日计提，按季支付。管理人于每季度首月前 5 个工作日内向托管人出具管理费投资指令，经托管人核对无误后从本计划财产中一次性支付给管理人。

(2) 管理人的业绩报酬（浮动管理费）

管理人不收取业绩报酬。

2、托管费：

本计划托管人托管费按本计划当日受托资产本金（含损益平准金）的【0.01】%年费率计提，计算方法如下：

$$H=E \times 【0.01】\% \div 360$$

H 为每日应计提的托管费；

E 为本计划当日受托资产本金（含损益平准金）。

本计划托管费每日计提，按季支付。管理人于每季度首月前 5 个工作日内向托管人出具托管费投资指令，经托管人核对无误后从本计划资产中一次性支付给托管人。

托管人收取托管费的银行账户为：

户名：华福证券股份有限公司

账号：118330100100588888

开户银行：兴业银行福州东街支行

大额支付号：309391008337

若本计划现金资产不足以支付管理费和托管费的，则相应顺延至本计划现金资产足以支付之日支付。

管理人和托管人协商一致可以调低管理费率或者托管费率，并通过管理人网站公告告知投资者。

3、证券交易费用

证券交易费用指本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费等费用、结算费、过户费、佣金等各项费用，证券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，其中交易佣金的费率由管理人本着保护本计划及投资者利益的原则，按照法律法规的规定确定。

4、其他费用

在存续期间发生的本计划审计费用，由本计划承担，在被审计的会计期间，按直线法在每个自然日内平均摊销。

银行间市场账户开户费及维护费、证券账户开户费、存续期间信息披露费、电子合同服务费、注册登记费、银行汇划手续费、账户管理费、会计师费及律师费等本计划运营过程中发生按照国家有关规定可以列入的其他相关费用，按费用实际支出金额支出，列入或摊入当期本计划费用。

（三）不列入资产管理计划费用的项目

本计划成立前发生的费用（包括但不限于计划初始募集期发生的信息披露费、会计师费、律师费等相关费用），以及存续期间发生的与推广有关的费用，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本计划资产的损失以及处理与本计划运作无关的事项发生的费用等不得列入本计划费用。

（四）税收

各方一致同意：就本计划投资运营过程中发生的增值税应税行为，无论是否以管理人作为纳税主体，该等增值税及附加税费均由本计划财产承担，管理人有权以本计划财产予以缴纳，如管理人垫付了相应税费等款项的，管理人有权向投资者追索垫付的税费和孳息款项，投资者应按管理人通知向管理人指定账户返还垫付款。投资者已知悉并同意，本计划资产承担上述税费可能导致资产变现损失或投资收益减损。

除前述约定外，本计划已列明的资产管理业务费用产生的税费应当由各收款方自行缴纳。

二十二、资产管理计划的收益分配

本计划的收益分配方案依据法律法规的规定及本合同的约定执行：

（一）收益的构成

收益包括：本计划投资所得收益、利息、红利、银行存款利息及其他合法收入。

本计划的净收益为本计划收益扣除按照国家有关规定可以在本计划收益中扣除的费用后的余额。

（二）可供分配利润：指截至收益分配基准日资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数，实际分配利润的比例由管理人根据本计划运作的实际情况确定。

（三）收益分配原则

- 1、每一计划份额享有同等分配权；
- 2、收益分配基准日的份额净值减去每单位计划份额收益分配金额后不能低于面值；
- 3、收益分配时发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担；
- 4、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

（四）收益分配对象

分红权益登记日所有持有本计划的投资者。

（五）收益分配时间

本计划存续期间，管理人根据具体情况进行收益分配，具体分配时间以管理人公告为准。

（六）收益分配方案的内容

收益分配方案须载明收益的范围、净收益、分配对象、分配原则、分配时间、分配金额及比例、分配方式等内容。

（七）收益分配方案的确定与披露

本计划收益分配方案由管理人拟定，经托管人复核总金额后由管理人向投资者公告，但托管人不负责复核分配明细。

（八）收益分配中发生的费用

收益分配时发生的银行转账等手续费用由本计划投资者自行承担，分红款项将于本次分红权益登记日起3个工作日内从托管户划出。

（九）收益分配方式

本计划仅以现金红利方式向投资者分配收益。

二十三、信息披露与报告

本计划的信息披露和报告将严格按照《管理办法》、《运作管理规定》及其他法律法规的规定和本合同的约定进行。

（一）定期报告

定期报告包括本计划单位净值报告、本计划的资产管理季度及年度报告、托管年度报告、年度审计报告和对账单。

1、本计划单位净值报告

披露时间：本计划存续期内每周最后一个工作日及每个开放日（如遇节假日，则以节假日前最近一个工作日为估值日）的计划单位净值及计划累计单位净值将于 T+1 个工作日在管理人网站上公布。

披露方式：本计划的单位净值、累计单位净值等信息将在管理人指定网站上披露，投资者可随时查阅。若管理人指定网站变更，管理人将提前进行相关信息的详细披露。

2、本计划的季度报告和年度报告

（1）本计划的资产管理季度报告

管理人每季度结束之日起一个月内向投资者提供一次准确、完整的管理季度报告，对报告期内本计划的运作情况做出说明。资产管理季度报告由管理人编制，经托管人复核后由管理人通过管理人网站公告。

本计划成立不足 3 个月或存续期间不足 3 个月的，可以不编制当期的季度报告。

（2）本计划的资产管理年度报告和托管年度报告

管理人每年度结束之日起四个月内向投资者提供一次准确、完整的管理年度报告，对报告期内本计划的运作情况做出说明。资产管理年度报告由管理人编制，经托管人复核后由管理人通过管理人网站公告。托管人在每年度结束之日起四个月内向投资者提供一次年度托管报告，年度托管报告由管理人通过管理人网站公告。

本计划成立不足 3 个月或存续期间不足 3 个月的，可以不编制当期的年度报告。

（3）资产管理年度报告包括但不限于下列信息：

- 1) 管理人履职报告；
- 2) 托管人履职报告；
- 3) 本计划投资表现；
- 4) 本计划投资组合报告；
- 5) 本计划运用杠杆情况（如有）；

6) 本计划财务会计报告;

7) 本计划支付的管理费、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) 本计划投资收益分配情况;

9) 投资经理变更、重大关联交易等涉及投资者权益的重大事项;

10) 中国证监会规定的其他事项。

资产管理季度报告应当披露前述除第 6) 项之外的其他信息。

3、年度审计报告

管理人应当进行年度审计,应当同时对客户资产管理业务的运营情况进行审计,并要求符合《证券法》规定的具有证券相关业务资格的会计师事务所就本计划出具单项审计意见。

管理人应当将本计划的单项审计意见通过管理人网站公告。本计划成立不足 3 个月或存续期间不足 3 个月时,可以不编制当期的年度审计报告,产品终止当年,无需出具年度审计报告,具体以监管机构的要求为准。

4、对账单

管理人至少每个季度以邮寄或电子邮件方式向投资者寄送对账单。对账单内容应包括投资者持有计划份额的数量及净值,参与、退出明细,以及收益分配等情况。

投资者可以选择对账单寄送方式,本计划默认的寄送方式为电子邮件。投资者选择电子邮件方式寄送对账单的,投资者应向管理人提供电子邮件等资料,以便管理人能正常发送电子对账单。管理人根据投资者提供的上述信息资料提供电子对账单的,电子对账单从管理人系统处发出即视为送达,因投资者未正常提供以上信息、电子邮件运营商系统平台故障等原因导致其未能获得电子对账单的,管理人不承担任何责任。投资者选择邮寄方式寄送对账单的,投资者应向管理人提供邮寄地址等资料,因投资者未正常提供以上信息、邮寄运营商系统平台故障及内部操作等原因导致投资者未能获得邮寄对账单的,管理人不承担任何责任。

(二) 临时报告

本计划存续期间,发生对本计划持续运营、投资者利益、资产净值产生重大影响的事件,管理人应当在事项发生之日起 5 日内以管理人指定网站公告或其他途径和方式及时向投资者披露,并及时报送管理人住所地中国证监会相关派出机构,具体以监管机构的要求为准。临时报告的情形包括但不限于:

1、管理人或托管人变更;

2、本计划运作过程中,负责本计划的投资经理发生变更,或出现其他可能对本计划的

持续运作产生重大影响的事项：

- 3、暂停受理或者重新开始受理参与或者退出申请；
- 4、本计划终止和清算；
- 5、本合同的补充、修改与变更；
- 6、与本计划有关的重大诉讼、仲裁事项；
- 7、负责本计划的代理销售机构发生变更；
- 8、管理人、托管人因重大违法违规，被中国证监会取消相关业务资格；
- 9、管理人、托管人因解散、破产、撤销等原因不能履行相应职责；
- 10、资产计价出现错误（当资产估值导致本计划单位净值小数点后四位以内发生差错时，

视为本集合计划单位净值错误）；

- 11、管理费、托管费等费用计提方式或费率发生变更；
- 12、其他发生对本计划持续运营、投资者利益、资产净值产生重大影响的事件。

（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，管理人应当按照相关法律法规的规定和本合同的约定通过管理人网站或其他途径和方式向投资者披露，并向管理人住所地中国证监会派出机构，具体以监管机构要求为准。

（四）向监管机构的报告

管理人、托管人应当按照《指导意见》、《管理办法》、《运作管理规定》及其他相关法律法规的规定和本合同的约定，履行向中国人民银行、中国证监会、基金业协会等监管机构和自律组织的报告义务。

二十四、风险揭示

本计划面临包括但不限于以下风险：

（一）特殊风险揭示

1、本合同部分内容与基金业协会合同指引不一致所涉风险

本合同是基于基金业协会发布的《集合资产管理计划资产管理合同内容与格式指引》而制定的，管理人对合同指引相关内容做出了合理的调整以及增加了其他内容，导致本合同与基金业协会合同指引不一致的风险。

2、本计划委托募集所涉风险

管理人可以委托取得基金销售业务资格的代理销售机构推广销售本计划，代理销售机构

可能存在违法违规地公开宣传本计划、虚假宣传本计划、以保本保收益引诱投资者购买本计划、未能履行投资者适当性审查工作等行为导致投资者合法权益受损的风险。

3、本计划份额转让所涉风险

管理人若开放本计划份额转让的，则本计划份额在相应的交易场所转让，并非集中竞价交易，可能不具有一个活跃的转让市场，且相应的交易场所可能会根据需要暂停或终止转让服务，存在流动性风险；本计划份额转让实行非担保交收，申报转让（受让）本计划份额时，相应的交易场所对本计划份额（资金）余额事先不实行检查、控制，本计划份额登记机构也不实行担保交收，份额转让风险由转让方、受让方自行控制和承担。

4、本计划未在基金业协会完成备案手续或不予备案情形所涉风险

管理人在本计划成立后5个工作日内向基金业协会办理备案手续。本计划面临因未能在基金业协会履行备案手续或基金业协会不予备案导致本计划财产不能进行投资运作的风险。

5、其他特殊风险

（1）证券市场流动性风险

本计划面临的证券市场流动性风险主要表现在几个方面：计划财产不能迅速变现，或变现成本很高，难以应对可能出现的投资者大额退出的风险；证券投资中个券和个股的流动性风险等。这些风险的主要形成原因是：

市场整体流动性相对不足。证券市场的流动性受到市场行情、投资群体等诸多因素的影响，在某些时期成交活跃，流动性非常好，而在另一些时期，则可能成交稀少，流动性差。在市场流动性相对不足时，交易变现都有可能因流动性问题而增加变现成本，对本计划的资产净值造成不利影响。这种风险在发生大额退出时表现尤为突出：

证券市场中流动性不均匀，存在个股和个券流动性风险。由于流动性存在差异，即使市场流动性比较好的情况下，一些个股的流动性可能仍然比较差，这种情况的存在使得本计划在进行个股和个券操作时，可能难以按计划买入或卖出相应的数量，或买入卖出行为对个股和个券价格产生比较大的影响，增加个股和个券的建仓成本或变现成本。这种风险在出现个股和个券停牌和涨跌停板等情况时表现得尤为突出。

（2）投资北京证券交易所股票的特定风险

本计划的投资范围包含北京证券交易所股票，北京证券交易所股票发行采用注册制，在上市门槛、公司盈利能力、发行价格、减持制度、交易机制、涨跌幅限制以及退市制度等方面与沪深证券交易所各板块股票不同，可能导致本计划净值波动更大。包括：

1) 北京证券交易所新股发行价格、规模、节奏等坚持市场化导向，询价、定价、配售

等环节由机构投资者主导。北京证券交易所新股发行可能采用直接定价和询价定价方式，询价对象面向在中国证券业协会注册、符合中国证券业协会规定条件并已开通本所交易权限的网下投资者。同时，因北京证券交易所企业普遍具有技术新、前景不确定、业绩波动大、风险高等特征，市场可比公司较少，传统估值方法可能不适用，发行定价难度较大，北京证券交易所股票上市后可能存在股价波动的风险，获配新股上市后其二级市场交易价格可能下跌至申购价以下。

2) 北京证券交易所股票竞价交易设置较宽的涨跌幅限制，首次公开发行上市的股票，上市后的首个交易日不设涨跌幅限制，其后涨跌幅限制为 30%，可能产生股价波动的风险。

3) 北京证券交易所股票相关法律、行政法规、部门规章、规范性文件（以下简称法律法规）和交易所业务规则，可能根据市场情况进行修改，或者制定新的法律法规和业务规则，存在法律政策变动风险。

4) 退市风险方面，北京证券交易所可能存在因上市公司经营财务问题、重大违法违规情形等导致股票退市的风险。北京证券交易所的退市标准比 A 股其他板块更为严格，违反相关规定的北京证券交易所上市公司将直接退市，其面临退市风险更大，会给本计划资产净值带来不利影响。

5) 新股申购相关风险包括但不限于，获配新股上市后其二级市场交易价格可能下跌至申购价以下的风险，如通过战略配售参与获配新股有一定的锁定期，锁定期股票价格受各种市场因素、宏观政策因素等的影响，股票价格有可能下跌到申购价以下。

根据北交所战略配售股票发行规则，可能存在战略配售股票发行不成功，导致本计划无法参与战略配售；或战略配售股票发行成功，但本计划未成功获配售或未获预期配售比例；或因政策变化等情况，导致本计划不具备参与北交所战略配售的资格等情形，上述情形可能导致本计划投资策略、投资收益受到影响。

若本计划参与北交所新股申购，投资者可能需按照管理人通知要求对其是否存在不符合北京证券交易所证券发行相关规定进行核查，并及时、真实、准确、完整地回复核查结果，投资者未作出回复、投资者及管理人存在不符合北京证券交易所证券发行相关规定情形的，管理人不得进行该标的的证券申购。如因投资者未作出回复、投资者及管理人存在不符合北京证券交易所证券发行相关规定的情形导致未成功参与北交所新股申购的，相关风险将由本计划承担，管理人对此无需承担任何责任。

在北交所新股申购过程中，管理人进行投资管理时均会基于过往的知识、经验报价，若报价没有被接受，则可能导致北交所新股申购失败。北交所申购标的在投资前均经管理人细

致研究，但不排除投资期间因标的上市公司所处的宏观经济环境、国内外相关行业市场和资本市场状况等不可控因素以及标的上市公司自身风险因素发生变化，将可能导致标的上市公司股票价格大幅下跌，从而导致损失。

6) 流动性风险，北京证券交易所上市公司数量相对较少，市场的整体流动性可能不如沪深证券交易所。

7) 本计划拟参与北交所战略配售，投资者可能需按照管理人及承销机构通知，按照北京证券交易所证券发行相关规定进行核查配合，及时、真实、准确、完整地提供核查信息。投资者未及时作出回复或投资者存在不符合北京证券交易所证券发行相关规定的情形的，可能影响本计划参与标的证券的战略配售。如因投资者未作出回复、投资者存在不符合北京证券交易所证券发行相关规定的情形导致本计划未成功参与北交所战略配售的，相关风险将由本计划投资者承担。若标的股票由于战略配售股票减持相关法律法规、监管政策的约束，导致本计划不能卖出标的股票，投资者将面临不能完全及时退出的风险。如果投资者的参与人员属于受减持规则限制的特殊身份人员，投资者的出资资产提取申请如不符合法律法规、监管机构、交易所有关北京证券交易所股票减持规则的规定，投资者将无法按照预期退出。如果投资者不属于受减持规则限制的特殊身份人员，但本计划的减持整体受减持规则限制，则投资者的出资资产提取申请也可能不能按照预期实现，特殊身份的投资者也可能受此影响。若标的股票在开放期内停牌、涨跌停导致完全无法卖出，投资者将面临不能退出的风险。

8) 本计划为主动管理的产品，管理人有权自主决定本计划持有的战略配售股票的卖出时间、价格、数量等，管理人的投资水平和管理能力将影响具体投资标的及本计划的投资收益。

北京证券交易所股票投资还存在以下风险：

1) 初步询价结束后，北京证券交易所发行人预计发行后总市值不满足其在招股说明书中明确选择的市值与财务指标上市标准的，将按规定中止发行。

2) 北京证券交易所股票网上发行比例、网下向网上回拨比例、申购单位、投资风险特别公告发布等与目前沪深交易所主板股票发行规则存在差异。

3) 首次公开发行股票时，发行人和主承销商可以采用超额配售选择权，不受首次公开发行股票数量条件的限制，即存在超额配售选择权实施结束后，发行人增发股票的可能性。

4) 北京证券交易所退市制度较主板更为严格，退市时间更短，退市速度更快；退市情形更多，新增市值低于规定标准，上市公司信息披露或者规范运作存在重大缺陷导致退市的情形；执行标准更严，明显丧失持续经营能力，仅依赖与主业无关的贸易或者不具备商业实

质的关联交易维持收入的上市公司可能会被退市。

5) 北京证券交易所制度允许上市公司设置表决权差异安排。上市公司可能根据此项安排,存在控制权相对集中,以及因每一特别表决权股份拥有的表决权数量大于每一普通股份拥有的表决权数量等情形,可能使本资管计划作为普通投资者的表决权利及对公司日常经营等事务的影响力受到限制。

6) 出现《北京证券交易所股票上市规则》以及上市公司章程规定的情形时,特别表决权股份将按 1:1 的比例转换为普通股份。股份转换自相关情形发生时即生效,并可能与相关股份转换登记时点存在差异。

7) 相对于主板上市公司,北京证券交易所上市公司的股权激励制度更为灵活,包括股权激励计划所涉及的股票比例上限和对象有所扩大、价格条款更为灵活、实施方式更为便利。实施该等股权激励制度安排可能导致公司实际上市交易的股票数量超过首次公开发行时的数量。

8) 北京证券交易所在条件成熟时将引入做市商机制,投资者应当及时关注相关事项。

9) 北京证券交易所股票交易的单笔申报数量、最小价格变动单位、有效申报价格范围等与沪深交易所主板市场股票交易存在差异。

10) 北京证券交易所股票交易方式包括竞价交易、盘后固定价格交易及大宗交易,不同交易方式的交易时间、申报要求、成交原则等存在差异。

11) 北京证券交易所股票上市首日即可作为融资融券标的,与沪深交易所主板市场存在差异。

12) 北京证券交易所股票交易盘中临时停牌情形和严重异常波动股票核查制度与沪深交易所主板市场规定不同。

13) 符合相关规定的红筹企业可以在北京证券交易所上市。红筹企业在境外注册,可能采用协议控制架构,在信息披露、分红派息等方面可能与境内上市公司存在差异。红筹公司注册地、境外上市地等地法律法规对当地投资者提供的保护,可能与境内法律为境内投资者提供的保护存在差异。

14) 上市公司经营风险

上市公司的经营受多种因素影响。如果所投资的上市公司经营不善,其股票价格可能下跌,或者能够用于分配的利润减少,使投资收益下降。

上述的揭示事项仅为列举性质,未能详尽列明北交所交易的所有风险,投资者在参与本计划前,应当认真阅读有关法律法规和交易所业务规则等相关规定,对其他可能存在的风险

因素也应当有所了解和掌握，并确信自己已做好足够的风险评估与财务安排。

（3）无法预警止损的风险

本计划未设置预警线和平仓线，由于投资品种价格可能持续向不利方向变动、投资品种市场剧烈波动等原因，出资资产存在全部亏损的风险。

（4）投资公开募集证券投资基金的估值风险

本计划投向公开募集证券投资基金，如所投公开募集证券投资基金的净值披露日期晚于本资管计划的估值核对日，在存续期间，资管计划单位净值可能无法反映真实投资管理情况。

（二）一般风险揭示

1、本金损失风险

管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用本计划财产，但不保证本计划财产中的认（申）购资金本金不受损失，也不保证一定盈利及最低收益。

本计划属于中高（R4）风险投资品种，适合风险识别、评估、承受能力 C4（积极型）及以上或符合专业投资者标准的合格投资者。

2、市场风险

市场风险是指投资品种的价格因受经济因素、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。市场风险主要包括：

（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

利率风险是指由于利率变动而导致的资产价格和资产利息的损益。利率波动会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，使集合计划资产管理业务收益水平随之发生变化，从而产生风险。

（4）购买力风险

投资者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，从而使投资者的实际收益下降。

（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利息收入再投资收益的影响。当利率下降时，资产管理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，收益率将比此前下降。

3、管理风险

在本计划运作过程中，管理人的知识、经验、判断、决策、技能等，会影响其对信息的获取和对经济形势、金融市场价格走势的判断，管理人精选出的投资品种业绩表现不一定持续优于其他投资品种，如管理人判断有误、获取信息不全、或对投资工具使用不当等影响本计划的收益水平，从而产生风险，该风险由本计划财产及投资者承担。投资者应充分知晓并自担管理人投资运营的相关风险。

4、流动性风险

流动性风险是指金融资产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。流动性风险将主要表现在以下几个方面：本计划的资产不能迅速转变成现金，或变现成本很高；不能应对可能出现的投资者赎回的风险等。这些风险的主要形成原因是：

（1）市场整体流动性相对不足。证券市场的流动性受到市场行情、投资群体等诸多因素的影响，在某些时期成交活跃，流动性较好；而在另一些时期，则可能成交稀少，流动性较差。在市场流动性相对不足时，交易变现有可能增加变现成本，对本计划的资产净值造成不利影响。这种风险在投资者提前赎回时表现尤为突出。

（2）证券市场中流动性不均匀，存在个股和个券流动性风险。由于流动性存在差异，即使市场流动性比较好的情况下，一些个股和个券的流动性可能仍然比较差，这种情况的存在使得管理人在进行个股和个券操作时，可能难以按计划买入或卖出预期的数量，或买入、卖出行为对个股和个券价格产生比较大的影响，增加个股和个券的建仓成本或变现成本。这种风险在出现个股和个券停牌或涨跌停板等情况时表现得尤为突出。

（3）若本计划投资于债券回购，可能因政策或交易所规则发生变化而出现质押债券折算率下调、债券暂停上市、债券延迟兑付或不兑付等情况，可能继而导致本计划出现资金流动性不足，需要投资者及时足额追加委托资金以避免出现欠库或透支的情况，也可能增加本计划资产净值的波动性。

（4）本计划财产不能应付可能出现的投资者大量赎回的风险。在本计划运作期间，可能会发生投资者大量赎回的情形，可能会产生仓位调整的困难，导致流动性风险，甚至影响

收益水平。

(5) 管理人因停业、解散、撤销、破产，或者被中国证监会撤销相关业务许可等原因不能履行职责的风险。管理人因停业、解散、撤销、破产，或者被中国证监会撤销相关业务许可等原因不能履行职责，可能导致委托资产的损失，从而带来风险。

5、信用风险

信用风险是指信用证券发行人是否能够实现发行时的承诺，按时足额还本付息的风险，或者交易对手未能按时履约的风险。

(1) 交易品种的信用风险：投资于公司债券等固定收益类产品，存在着发行人不能按时足额还本付息的风险；此外，当发行人信用评级降低时，本计划所投资的债券可能面临价格下跌风险。

(2) 交易对手的信用风险：交易对手未能履行合约，或在交易期间未如约支付已借出证券产生的所有股息、利息和分红，从而对本计划的资产净值造成不利影响的风险。

6、募集失败的风险

本计划的成立需符合相关法律法规的规定，本计划可能存在不能满足成立条件从而无法成立的风险。

管理人的责任承担方式：

(1) 以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用；

(2) 在本计划募集期限届满（确认本计划无法成立）后三十日内退还投资人已缴纳的款项，并加计银行同期存款利息。

7、证券交易资金前端控制的风险

根据上海证券交易所、深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司于2017年12月1日联合发布的《上海证券交易所 深圳证券交易所 中国证券登记结算有限责任公司证券交易资金前端风险控制业务规则》的要求，沪深交易所及中国结算自2018年6月1日起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，本计划管理人作为交易参与人需通过结算参与人向中国结算报告资金前端控制最高额度信息，且交易参与人需在最高额度内向交易所申报资金前端控制的自设额度，由交易所根据该额度实施资金前端控制。基于上述资金前端控制的机制，则存在买入申报金额不符合前端控制自设额度限制时，被交易所拒绝接受买入申报从而交易失败的风险，以及出现前端控制异常情况，导致无法买入申报从而交易失败的风险。

8、税收风险

本计划作为契约型产品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。

9、本计划提前终止的风险

本计划运作期间，当本计划投资者少于2人或者其他本计划约定的提前终止情形出现时，导致本计划提前终止的风险。

10、合同变更风险

管理人就合同变更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和说明书。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，从而存在风险。

11、投资者可能无法参与的风险

由于本计划仅向特定投资者募集，且可能设定规模上限或其他不适合进行投资者参与的情形，管理人将根据合同的约定对规模上限、特定投资者范围、拒绝或暂停投资者参与的情形进行控制，因此投资者可能面临着因上述原因而无法参与本计划的风险。

12、投资者部分退出的风险

投资者部分退出本计划份额时，如其该笔退出受理后投资者持有的剩余计划份额净值低于人民币1,000,000元，投资者面临剩余份额强制退出的风险。

13、投资者可能无法退出的风险

自本集合计划签署《德阳天元重工股份有限公司向不特定合格投资者公开发行股票并在北京证券交易所上市之战略配售协议》之日起，本集合计划封闭运作，不接受投资者提出的参与、退出申请，封闭期内投资者无法进行份额退出。此外，本计划还约定了特定情况下拒绝或暂停投资者退出的情形，投资者可能面临在本合同约定的情形下无法及时退出本计划的风险。

14、巨额赎回情形下净值精度应急调整机制的风险

当本计划发生巨额赎回情形且管理人决定采取净值精度应急调整机制，届时赎回净值可能发生变动，投资者退出金额可能会由于净值精度提高而产生差异，将直接影响到投资者的投资收益。举例如下：

假设本计划退出申请日单位净值为A（净值精度调整前），投资者退出份额为X，则退出申请日单位净值精度误差最高为 ± 0.00005 元（即四舍五入小数点后第5位最大误差），

由此计算的单位净值 A 调整精度后对投资者退出总金额的最大影响为 $\pm X \times 0.00005$ 元。

15、其他风险

(1) 关联交易的风险：

按照资产管理合同约定，管理人在本计划存续期内可运用本计划财产从事关联交易，关联交易包括一般关联交易和重大关联交易。

管理人制定了关联交易内控管理制度，明确了关联交易的类型和范围、审批程序、信息披露、关联数据库管理、稽核审计等内控机制并严格执行，但按照上述标准及机制进行关联交易管理时，需按照各方提供的关联方名单进行关联交易的审查，存在无法监控全部关联交易类型的风险；同时，本计划进行关联交易时虽然积极遵循投资者利益优先的原则、遵守相关法律法规的规定进行操作、防范利益输送，但仍可能存在一定的利益冲突风险，由此造成的损失由本计划财产承担。此外，资产管理人运用计划财产从事关联交易时，管理人无法确保选择进行交易的实际交易结果（就投资完成后的实际损益情况而言）比进行类似的非关联交易的实际交易结果更优，或者关联交易行为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，从而可能影响受托资产的投资收益，投资者应密切关注关联交易的信息披露，知悉了解相关的投资信息。

管理人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从事一般关联交易。该等事先约定同意、事后统一披露的方式可能造成投资者无法及时知悉本计划从事一般关联交易并采取措施，投资者愿承担由此造成的参与财产损失。

管理人从事重大关联交易的，可能因为重大关联交易金额或比例较高对本计划的投资运作产生较大影响。此外，对于重大关联交易，管理人将事先取得投资者同意，若投资者未及时更新有效联系方式，可能影响管理人征求意见的效率，进而可能影响本计划的投资策略实施。

(2) 操作与技术风险：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导致的风险，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。

在本计划的各种交易行为或者后台运作中，可能因为 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，这种技术风险可能来自管理人、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。

(3) 发生不可抗力事件的风险：战争、自然灾害等不可抗力因素的出现，将会严重影响证券市场的运行，可能导致本计划资产的损失。金融市场危机、行业竞争、代理机构违约

等超出管理人自身直接控制能力之外的风险，可能导致投资者利益受损。

对上述风险的具体描述请见《第一创业天元重工员工参与北交所战略配售集合资产管理计划风险揭示书》。

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、本合同签署后，因法律、法规、规章、中国证监会、基金业协会的规定、证券登记结算机构业务规则以及证券交易所等交易规则修订，自该修订生效之日起，本合同相关内容及条款按该修订办理并在管理人网站公告投资者。投资者特此授权管理人经与托管人协商，可以对本合同及说明书与新的法律法规或有关政策不一致的内容进行更新或修改，更新或修改的内容不得违反法律法规和中国证监会的有关规定，更新或修改的内容在管理人网站公告满5个工作日后生效。投资者对更新或修改的内容有异议，可在更新或修改内容生效前申请退出本计划。

2、由于其他原因需要变更合同的，管理人和托管人应书面达成一致后，以短信或其他方式通知投资者，并在管理人网站公告。投资者不同意变更的，应在公告发布之日起至合同变更生效日内的开放日提出退出申请，如在公告发布之日起至合同变更生效日内无开放日，则管理人将在公告中公布合同变更成立日前设定的临时开放日。未提出退出申请的，视同投资者已经同意合同变更。管理人应在公告中披露临时开放日、合同变更生效日。

3、若本计划的投资者人数较少的，则经投资者、管理人和托管人协商一致，可以签署书面补充协议的方式完成合同变更，该合同变更方式不受上述变更流程的限制。

4、合同变更后，投资者、管理人和托管人的应当按照变更后的合同行使相关权利，履行相应义务。

5、投资者、管理人、托管人不得通过签订补充协议、修改合同等任何方式，约定保证集合计划资产投资收益、承担投资损失，或排除投资者自行承担投资风险和损失。

6、本合同发生变更的，管理人应当按照基金业协会要求及时向基金业协会备案，具体以监管机构的要求为准。

（二）管理人或托管人的变更

1、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、宣告破产导致本计划由其他管理人承接时：

原管理人应当就变更管理人的事项与新任管理人和托管人达成书面一致后，以短信或其

他方式通知投资者，并在管理人网站公告。投资者不同意变更管理人的，应在公告发布之日起至管理人变更生效日内的开放日提出退出申请，如在公告发布之日起至管理人变更生效日内无开放日，则管理人将在公告中公布管理人变更生效日前设定的临时开放日。未提出退出申请的，视同投资者已经同意管理人变更。

2、发生托管人被依法撤销基金托管资格或者依法解散、被撤销、宣告破产导致本计划由其他托管人承接时：

原管理人应当就变更托管人的事项与原托管人和新任托管人达成书面一致后，以短信或其他方式通知投资者，并在管理人网站公告。投资者不同意变更托管人的，应在公告发布之日起至托管人变更生效日内的开放日提出退出申请，如在公告发布之日起至托管人变更生效日内无开放日，则管理人将在公告中公布托管人变更生效日前设定的临时开放日。未提出退出申请的，视同投资者已经同意托管人变更。

3、新任管理人或新任托管人自变更生效日起接任本计划的管理人或托管人，应当按照本合同关于管理人和托管人权利义务和职责的约定履行管理人和托管人职责。新任管理人或新任托管人接任之前，原管理人或原托管人应依据法律法规和本合同的约定继续履行相关职责。原管理人或原托管人在继续履行相关职责期间，仍有权按照本合同的约定收取管理费、业绩报酬（如有）或托管费。

（三）资产管理计划的展期

1、本计划存续期届满时，管理人可以决定到期清算终止，或根据本合同约定进行展期。

2、展期的条件

下列条件全部满足后，本计划可以展期：

（1）本计划运作规范，管理人、托管人未违反法律法规、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）资产托管机构同意继续托管展期后的本计划财产；

（4）中国证监会规定的其他条件。

本计划展期的，还应当符合本计划的成立条件。

3、展期的程序

（1）在本计划存续期届满前，管理人可对本计划进行展期，展期的程序与因其他原因需要变更合同的程序保持一致，管理人将以短信或其他方式通知投资者，并在管理人网站公告展期的期限，展期变更生效日等。投资者不同意展期的，应在公告发布之日起至合同变更

生效日内的开放日提出退出申请，如在公告发布之日起至合同变更生效日内无开放日，则管理人将在公告中公布合同变更生效日前设定的临时开放日。未提出退出申请的，视同投资者已经同意合同展期。

(2) 若展期成立，管理人应在本计划展期后 5 个工作日内，将展期情况报中国证券投资基金业协会备案，具体以监管机构的要求为准。

(3) 本计划可以连续展期，且展期次数不限。

4、展期的实现

(1) 同意本计划展期的投资者人数（含管理人）不少于 2 人，且展期变更生效日符合展期条件的，本计划在展期变更生效日实现展期，否则本计划不能展期。

(2) 同意展期的投资者需同意继续持有本计划未能流通变现的证券和资产，且同意展期的投资者持有的本计划资产净值不低于本计划未能流通变现证券和资产的规模，否则本计划不能展期。

5、展期的失败

若本计划展期失败，本计划在本合同约定的终止情形发生后进入清算程序。

(四) 资产管理计划的终止

有下列情形之一的，本计划应当终止：

1、本计划存续期届满且不展期；

2、经全体投资者、管理人和托管人协商一致决定终止的；

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

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

5、本计划存续期间，持续 5 个工作日投资者少于 2 人；

6、本计划成立后，未在基金业协会完成备案或未通过基金业协会的产品备案或未取得产品的备案确认函的，则管理人有权终止本计划，且不承担任何责任；

7、不可抗力的发生导致本计划不能存续；

8、因监管政策或监管规则的变化导致本产品违反相关监管政策或监管规则要求的，或监管机构通知（无论是口头或书面形式的通知）管理人停止开展此类资产管理产品的，则管理人有权停止开放本计划份额的参与并终止本计划，且不承担任何责任；

9、管理人有权根据产品的运作情况决定提前终止本计划；

10、法律、行政法规、本合同及中国证监会规定的其他终止情形。

管理人应当自本计划终止之日起5个工作日内报基金业协会备案，前述第6项约定的情形除外。

（五）资产管理计划的清算

1、本计划财产清算小组

本计划在发生终止情形起5个工作日内，由管理人和托管人组织成立本计划财产清算小组，在本计划财产清算小组接管本计划财产之前，管理人和托管人应按照本合同的约定继续履行保护本计划财产安全的职责。

本计划财产清算小组成员由管理人、托管人组成，清算小组可以聘用必要的工作人员，本计划财产清算小组负责本计划财产的保管、清理、估价、变现和分配，本计划财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。

2、本计划清算程序

- （1）本计划终止情形发生后，由本计划财产清算小组负责统一接管本计划财产；
- （2）本计划财产清算小组根据情况确定具体的清算期限；
- （3）本计划财产清算小组对本计划财产进行清理和确认；
- （4）对本计划财产进行评估和变现；
- （5）制作清算报告；
- （6）将清算报告报基金业协会并告知投资者，具体以监管机构的要求为准；
- （7）对本计划财产进行分配。

3、本计划清算费用

清算费用是指本计划财产清算小组在进行本计划财产清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由本计划财产清算小组优先从本计划财产中支付。

4、本计划财产清算及剩余资产的分配

依据本计划财产清算的分配方案，将本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进行分配，本合同另有约定的除外，本计划财产按照以下顺序进行分配：

- （1）支付清算费用；
- （2）缴纳所欠税款；

（3）清偿本计划债务：本计划债务主要包括应付管理费、托管费、银行间账户维护费、交易佣金、证券交易费用、银行汇划费用、销户费、管理人代表本计划及投资者处理本计划

涉及诉讼、仲裁或争议解决的事项所产生的费用及支出等，除交易所、证券登记结算机构等自动扣缴的费用外，其他费用的清偿由管理人、托管人核对无误后，由管理人向托管人出具投资指令，由托管人复核后支付；

(4) 按本计划投资者所持计划份额比例进行分配；

本计划财产未按前述第(1)、(2)、(3)项约定进行清偿前，不得分配给本计划投资者。

(5) 清算后的剩余财产，原则上以货币资金形式进行分配；本合同另有约定的，从其约定；但不得违反中国证监会规定。

5、本计划二次清算

若本计划在终止之日有未能流通变现的证券或金融产品，管理人可对此制定二次清算方案，该方案应经托管人认可，并通过管理人网站进行披露。管理人应根据二次清算方案的规定，对前述未能流通变现的证券或金融产品可在流通变现后进行二次清算，并将变现后的资产按照投资者拥有份额的比例或本合同的约定，以货币形式分配给投资者，二次清算期间，管理人、托管人继续按照本合同约定计提管理费、托管费及其他费用。发生二次清算情形的，管理人应当及时向管理人住所地中国证监会派出机构报告，具体以监管机构的要求为准。

6、本计划清算报告的告知安排

清算结果由本计划财产清算小组结束后通过管理人网站向投资者进行披露，并报告基金业协会，具体以监管机构的要求为准。

7、本计划相关账户销户

(1) 证券类账户销户

本计划证券类资产完成变现、结清相关权益、缴清相关费用后，管理人或托管人负责证券类账户的销户工作，销户过程中其他各方应给以必要的配合。

(2) 银行托管账户销户

本计划财产清算完毕后，管理人应向托管人申请注销本计划银行托管账户，托管人应予以配合。

与本计划财产有关的其他账户的销户，由管理人与托管人协商一致后办理。

8、本计划存续及清算期间，为支付本计划财产承担的各项税费，管理人有权预留相应金额，若预留金额不足以支付实际需缴存的税费的，差额部分由管理人通知投资者补足，管理人不承担垫付责任，投资者应当及时追加资金，不得以任何理由拒绝补足义务。

本计划清算期间，为支付最低备付金、结算保证金，管理人有权预留相应金额，若预留

金额不足以支付实际需缴存的备付金、保证金金额的，差额部分由管理人通知投资者补足，管理人不承担垫付责任，投资者应当及时追加资金，不得以任何理由拒绝补足义务。

9、本计划清算账册及文件应当由管理人自清算完毕之日起保存 20 年以上。

二十六、违约责任

（一）由于本合同当事人过错，造成本合同不能履行或者不能完全履行的，由有过错的一方承担违约责任；如当事人均有过错的，各自承担应负的责任。本合同当事人违反本合同，给其他当事人造成直接经济损失的，应当承担赔偿责任。但是发生下列情况的，当事人可以免责：

1、不可抗力

不可抗力是指本合同当事人无法预见、无法克服、无法避免，且在本合同签署之后发生的，使本合同当事人无法全部或部分履行本合同的任何事件，包括但不限于相关法律法规及监管规则的变更；国际、国内金融市场风险事故的发生；战争或动乱、自然灾害、公众通讯设备故障、电力中断、互联网故障等。

一方因不可抗力不能履行本合同时，应及时通知其他方，并在合理期限内提供受到不可抗力影响的证明，同时采取适当措施防止本计划财产及其他当事人损失扩大。任何一方当事人延迟履行合同义务后，发生了上述不可抗力事件致使合同当事人无法全部或部分履行本合同，该方不能减轻或免除相应责任；

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

3、在没有欺诈、故意或重大过失的情况下，管理人由于按照合同规定的投资原则行使或不行使其投资权而造成的损失等；

4、在没有欺诈、故意或重大过失的情况下，托管人执行管理人的生效指令对本计划财产造成的损失；

5、在本计划运作过程中，管理人及托管人按照法律、行政法规的规定以及本合同的约定履行了相关职责，但由于其控制能力之外的第三方原因或其他原因而造成运作不畅、出现差错和损失的；

6、管理人或托管人任一方不因另一方的失职行为而给本计划财产或投资者造成的损失向投资者承担连带责任；

7、投资者理解出资资产的投资、运作、托管面临本合同、风险揭示书中列举的各类风

险，管理人及托管人就出资资产面临的上述固有风险免于承担责任。

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

（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。

（四）由于不可抗力原因或注册登记机构非正常暂停或终止业务、证券交易所非正常暂停或停止交易、证券交易所、登记结算公司等机构发送的数据错误等非管理人或托管人的原因，管理人和托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误的，由此造成计划资产或投资者损失，管理人和托管人可以免除赔偿责任。但管理人和托管人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

（五）一方当事人依据本合同向其他方当事人赔偿的损失，仅限于直接损失。

（六）托管人对于没有保管在托管人处的有价证券及其他本计划财产不负有保管责任，由于非托管人的过错致使其保管的资产发生毁损或灭失的，托管人不承担赔偿责任。

（七）投资者的债权人通过司法机关对本计划财产采取强制措施，由此造成本计划财产损失的，管理人和托管人不承担任何责任，但管理人和托管人应及时将前述强制措施情况告知投资者。

二十七、争议的处理

（一）发生纠纷时，本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，应提交深圳国际仲裁院并按其仲裁规则进行仲裁，仲裁地点在深圳。仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力。仲裁费由败诉方承担。

（二）纠纷处理期间，相关各方当事人应恪守职责，各自继续忠实、勤勉、尽责地履行本合同约定的义务，维护本计划及投资者的合法权益。

（三）本合同适用并按照中华人民共和国法律（不包括香港、澳门特别行政区及台湾地区的法律）解释。

二十八、资产管理合同的效力

（一）合同的成立

本合同是约定投资者、管理人和托管人之间权利义务关系的法律文件。本合同经管理人、

托管人和投资者签署后成立，投资者为机构的，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、执行事务合伙人或授权代表签字或签章之日起成立，投资者为自然人的，本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签章之日起成立。

合同签署方式（包括但不限于书面、电子等）可能由于法律法规、监管要求、系统技术等等发生改变，各方同意管理人基于投资者的利益有权按规定采用新的签署方式，并及时进行信息披露。

（二）合同的生效

本合同成立后，同时满足以下条件时生效：

- （1）投资者参与资金实际交付并确认；
- （2）本计划成立。

本合同自生效之日起对投资者、管理人、托管人具有同等的法律约束力。本计划终止，本合同终止，但本合同项下的财产清算条款、违约责任条款、争议解决条款等仍然有效。

（三）合同的组成

《第一创业天元重工员工参与北交所战略配售集合资产管理计划说明书》是管理人对于本计划重要事项的说明，是本合同重要附件，与本合同具有同等法律效力。

经管理人确认有效的投资者参与、退出本计划的申请材料和各销售机构出具的本计划参与、退出业务受理有关凭证等为本合同的附件，是本合同不可分割的一部分，与合同具有同等法律效力。

（四）本合同的有效期限

本合同的有效期限为5年，从本计划成立日起算。在符合本合同约定的展期条件下可展期，但按照本合同约定出现本计划应当终止的情形时，本计划将提前终止并进行清算。

（五）投资者自签署本合同即成为本合同的当事人，在本计划存续期间，投资者自全部退出本计划之日起，该投资者不再是本合同的当事人。

二十九、其他事项

（一）本合同所称的或有事件是指，根据相关法律法规的规定，管理人可能以独资或者控股方式成立具有独立法人资格的从事资产管理业务的公司。

（二）投资者在此同意，如果或有事件发生，在管理人与托管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由管理人承担的义务转让给本条上一款所述的

从事资产管理业务的公司，并无须就此项变更和投资者另行签订专项协议。但在转让前管理人应以在管理人网站公告投资者。管理人保障投资者退出本计划的权利，并在届时的公告中对相关事项作出合理安排。

（三）管理人应当保证受让人具备开展此项业务的相关资格，并向托管人提供监管机构相关批复文件复印件。

（四）管理人应按照监管机构的要求办理转让手续。

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

本合同一式肆份，管理人执贰份，投资者、托管人各执一份，管理人需按照监管要求报备相关机构的份数另计，每份均具有同等法律效力。

（本页以下无正文）

(适用于个人)投资者: 【 】

(适用于机构)投资者: 【 】(盖章)

签订日期: 20【 】年【 】月【 】日

签订日期: 2011 年 9 月

负责人或授权代理人 ☒ 签字或签章

签订日期：20【16】年【9】月【22】日

附件一：投资运作监督事项表

投资运作监督事项表

序号	监督项目	监督内容
一	投资范围及投资比例	1、投资范围 本计划投资于法律法规及监管规则允许证券公司集合资产管理计划投资的以下资产： （1）权益类资产：德阳天元重工股份有限公司在北京证券交易所首次公开发行股票的战略配售股票； （2）现金类资产：包括现金、各类银行存款（包括银行活期存款、银行同业存款、银行定期存款和银行协议存款等各类存款，不含结构性存款）、货币市场基金； 2、投资比例 （1）资产配置比例 本计划财产投向权益类资产的投资比例为资产总值的 80%（含）-100%（含）；投向现金类资产的投资比例为资产总值的 0%（含）-20%（不含）。 （2）总资产占净资产的比例 本计划总资产不得超过本计划资产净值的 200%，计算总资产时，应当按照穿透原则合并计算所投资资产管理产品的总资产，中国证监会另有规定的除外； （3）组合投资要求比例 本计划投资于同一资产的资金，不得超过本计划资产净值的 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。如本计划根据《北京证券交易所证券发行与承销管理细则》相关规定投资于德阳天元重工股份有限公司在北京证券交易所首次公开发行股票的战略配售股票，不受以上规定限制。
二	投资限制	为维护投资者的合法权益，本计划的投资限制为： （1）本计划总资产不得超过本计划资产净值的 200%； （2）本计划参与股票等证券发行申购时，本计划所申报的金额不得

		超过本资产管理计划的总资产，本计划所申报的数量不得超过拟发行公司本次发行的总量； （3）本计划获配的德阳天元重工股份有限公司在北京证券交易所首次公开发行股票的证券数量不得超过德阳天元重工股份有限公司公开发行数量的 10%； （4）法律法规、中国证监会以及本合同规定的其他投资限制。
三	关联交易	按照“十四、利益冲突及关联交易”章节的约定的关联交易进行监督。

附件二：投资指令（样本）

划款指令授权通知书

第一创业证券股份有限公司____专用表

第一创业-集合资产管理业务	
编号：202* 年第 * 号	
指令日期：202* 年 ** 月 **日	
**资产托管部： 敬请贵部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。	
资金划出账户：	
账号：	
开户行：	
到账时间：	
收款人：	
开户行：	
账号：	
划款金额（小写）：	
划款金额（大写）：	
资金用途：	
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：

附件三：第一创业证券指令发送授权文件（样本）

尊敬的托管人：

根据三方资产管理计划合同（或托管协议）的相关约定，我公司授予雷岩等同志负责托管在贵司的所有资产管理产品的运营管理工作。本授权书变更或终止时我公司另行通知。我公司有效授权人员，指定如下：

授权范围	授权人员	签字样本
指令经办	雷岩	
	杨晓文	
指令复核	周南鸿	
	黄小芳	
指令审批	孙蕤	
	黄焕元	

划款指令签发业务章（预留印鉴章）：

划款指令由上述对应授权范围内任一签字样本签署，并加盖预留印鉴方可生效。

以上授权及约定生效日期为 年 月 日

第一创业证券股份有限公司

年 月 日

附件四：联系人名单（样本）

第一创业证券股份有限公司			传真电话：0755-23838999-8593
邮寄地址：深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 19 楼			邮政编码：518048
岗 位	姓 名	联系电话	EMAIL
估值对账	张彩云	0755-23838099	zhangcaiyun@fcsc.com
投资指令	雷 岩	0755-23838065	leiyan@fcsc.com
投资指令	黄小芳	0755-23838082	huangxiaofang@fcsc.com

附件五：专用清算账户及资金划拨专用账户

专用清算账户及资金划拨专用账户

注意：账户如有变更，请及时通知相关各方。

托管资金账户

以开户通知书的账户信息为准

管理费收款账户

户名：第一创业证券股份有限公司

账号：4000023319200099986

开户银行：中国工商银行深圳福田支行

大额支付行号：102584002338

托管费收款账户

户名：华福证券股份有限公司

账号：118330100100588888

开户银行：兴业银行福州东街支行

大额支付号：309391008337

增值税收款账户

户名：第一创业证券股份有限公司

账号：4000023319200114668

开户银行：中国工商银行深圳福田支行

大额支付行号：102584002338

