



宁波银行  
BANK OF NINGBO

编号：S00070056

# 华林证券满堂红汇利 1 号 FOF 集合资产管理计划资产管理合同

合同编号：HL(2022)JH 字第 2 号

管理人：华林证券股份有限公司

托管人：宁波银行股份有限公司

# 目 录

一、前言.....	4
二、释义.....	4
三、承诺与声明.....	9
四、当事人及权利义务.....	10
五、集合资产管理计划的基本情况.....	16
六、集合计划的募集.....	18
七、集合计划的成立与备案.....	21
八、集合计划的参与、退出与转让.....	22
九、集合计划份额持有人大会及日常机构.....	30
十、集合计划份额的登记.....	31
十一、集合计划的投资.....	31
十二、投资顾问.....	36
十三、分级安排.....	36
十四、利益冲突及关联交易.....	36
十五、投资经理的指定与变更.....	38
十六、集合计划的财产.....	38
十七、集合计划投资指令的发送、确认和执行.....	40
十八、越权交易的界定.....	46

十九、集合计划财产的估值与会计核算.....	48
二十、集合计划的费用与税收.....	52
二十一、集合计划的收益分配.....	57
二十二、集合计划的信息披露与报告.....	58
二十三、风险揭示.....	61
二十四、资产管理合同的变更、终止及清算.....	70
二十五、违约责任.....	74
二十六、争议的处理.....	75
二十七、资产管理合同的效力.....	75
二十八、其他事项.....	76
附件一：募集结算专用账户信息.....	79
附件二：资产管理计划风险揭示书.....	80

## 重要提示

【仅适用于电子合同】本合同以电子签名方式签署，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；投资者作为本合同一方，以电子签名方式签署本合同即表明投资者完全接受本合同项下的全部条款，同时本合同成立。

投资者、管理人、托管人同意遵守《电子签名法》、《证券公司资产管理电子签名合同操作指引》的有关规定，三方一致同意投资者自签署《电子签名约定书》之日起，投资者以电子签名方式接受电子签名合同（即本合同、计划说明书）、风险揭示书或其他文书的，视为签署本合同、计划说明书、风险揭示书或其他文书，与在纸质合同、纸质风险揭示书或其他文书上手写签名或者盖章具有同等的法律效力，无须另行签署纸质合同、纸质风险揭示书或其他文书。

## 一、前言

为规范华林证券满堂红汇利 1 号 FOF 集合资产管理计划(以下简称“集合计划”或“计划”)运作,明确《华林证券满堂红汇利 1 号 FOF 集合资产管理计划资产管理合同》(以下简称“本合同”)当事人的权利与义务,依照《中华人民共和国民法典》、《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称《基金法》)、《中华人民共和国证券法》、《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(试行)》等法律法规及中国证监会、中国证券业协会、中国证券投资基金业协会的规定,投资者、管理人、托管人在平等自愿、诚实信用原则的基础上订立本合同。本合同是规定当事人之间基本权利义务的法律文件,当事人按照《管理办法》《运作规定》《华林证券满堂红汇利 1 号 FOF 集合资产管理计划说明书》(以下简称《说明书》)、本合同及其他有关规定享有权利、承担义务。

管理人对集合计划的设立、变更、展期、终止、清算等行为应当向证券投资基金业协会进行备案,并抄报中国证监会相关派出机构。证券投资基金业协会接受计划备案不能免除管理人按照规定真实、准确、完整、及时地披露产品信息的法律责任,也不代表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做出保证和判断。投资者应当自行识别产品投资风险并承担投资行为可能出现的损失。

## 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:

集合资产管理计划、资产管理计划、资管计划、集合计划、本计划:指华林证券满堂红汇利 1 号 FOF 集合资产管理计划;

集合计划说明书、说明书:指《华林证券满堂红汇利 1 号 FOF 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;

集合资产管理合同、资产管理合同、本合同：指《华林证券满堂红汇利1号FOF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；

托管协议：指《华林证券满堂红汇利1号FOF集合资产管理计划托管协议》及对该协议的任何有效修订和补充；

风险揭示书：指《华林证券满堂红汇利1号FOF集合资产管理计划风险揭示书》；

《指导意见》：指2018年4月27日中国人民银行、中国银保监会、中国证监会、外汇管理局发布并施行的《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》

《管理办法》：指2018年10月22日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》；

《运作规定》：指2018年10月22日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》；

《合同指引》：指2019年3月29日中国证券投资基金业协会发布并施行的《集合资产管理计划资产管理合同内容与格式指引（试行）》；

中国证监会、证监会：指中国证券监督管理委员会；

证券投资基金业协会、中国基金业协会、基金业协会：指中国证券投资基金业协会；

中国证券业协会、证券业协会：指中国证券业协会；

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

集合计划管理人、管理人：指华林证券股份有限公司；

集合计划托管人：指宁波银行股份有限公司；

销售机构：指管理人或与管理人签订《华林证券满堂红汇利1号FOF集合资产管理计划代理销售协议》（具体协议名称以实际签署为准）的符合相应资格条件的机构（若有），具体以管理人公告为准；

登记结算机构：指办理登记、存管、过户、清算和结算等登记结算业务的机构。本集合计划的登记结算机构为华林证券股份有限公司；

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集合计划的投资人，包括个人投资者和机构投资者；

个人投资者：指依据中华人民共和国有关法律法规、监管规定可以投资于本集合资产管理计划的自然人投资者；

机构投资者：指依据中华人民共和国有关法律法规、监管规定可以投资本集合资产管理计划，在中华人民共和国境内合法注册登记或经有关政府部门批准设立的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织；

合格投资者：指根据《指导意见》、《运作规定》的规定，且具备相应风险识别能力和风险承担能力，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和法人或者其他组织：

(1) 具有 2 年以上投资经历，且满足以下条件之一：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、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督的机构发行的资产管理产品；

(5) 基本养老金、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。

份额持有人、持有人：指通过签订集合资产管理合同而依法取得和持有本集合计划份额的投资者；

集合计划成立日：指集合计划经过初始募集达到集合计划说明书和集合资产管理合同规定的成立条件后，管理人公告集合计划成立的日期；

初始募集期：指自本集合计划启动销售之日起至本集合计划募集结束之日，具体时间见有关公告，最长不超过 60 天；

建仓期：特指集合计划成立日后的一段期间，在此期间的投资活动应当符合合同约定的投向和风险收益特征；

封闭期：本集合计划存续期内除开放期外为封闭期，封闭期内不办理集合计

划的参与和退出业务。

开放期：指投资者可以办理集合计划参与或退出等业务的期间；

开放日：指开放期内的每个工作日；

存续期间、运作期间：在本合同中又称为投资运作期间或存续期，指本集合计划成立后转入投资运作的时间段；

工作日：指上海证券交易所和深圳证券交易所等相关证券交易所的正常交易日；

T 日：指办理本集合计划业务申请的工作日；

T+n 日（n 指任意正整数）：指 T 日后的第 n 个工作日；

天：指自然日；

会计年度：指公历每年 1 月 1 日至 12 月 31 日；

参与：指投资者申请购买本集合计划份额的行为；

首次参与：指投资者在参与之前未持有过本集合计划份额的情形；

追加参与：指除首次参与外的其他参与情形；

柜台交易：本集合计划的柜台交易特指柜台协议交易，即客户通过协议形式实现本集合计划的份额转让；

退出：指投资者按集合资产管理合同规定的条件要求收回全部或部分委托资产的行为；

巨额退出：指本集合计划单个开放日累计净退出申请份额（退出申请总份额扣除参与总份额后的余额）超过上一日计划总份额 10% 的情形；

强制退出：指由管理人依据合同约定直接发起退出持有人持有份额的行为；

计划收益：指本集合计划投资所得红利、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；

集合计划份额、资产管理计划份额、计划份额、份额：指集合计划的最小单位；

元：指人民币元；

计划单位面值、单位面值：人民币 1.00 元；

集合计划资产总值、计划资产总值：指集合计划所投资的各类有价证券、银行存款本息、集合计划各项应收款以及其他资产所形成的价值总和；

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；

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；

计划单位累计净值、累计净值：指计划单位净值与集合计划份额累计分红之和；

计划资产估值：指计算评估本集合计划资产和负债的价值，以确定本集合计划资产净值的过程；

银行托管账户：资产托管人根据有关规定为委托资产开立的专用存款账户，并通过签署第三方存管三方协议，与证券资金账户建立第三方存管的对应关系；

证券交易结算资金账户（以下简称“证券资金账户”）：即资产管理人为委托资产在证券公司开立的唯一用于本委托资产进行证券交易的证券资金账户，该账户的资金划入、划出由资产托管人根据资产管理人指令通过银证转账进行；

流动性受限资产：流动性受限资产是指由于法律法规、监管、合同或者操作障碍等原因无法以合理价格予以变现的资产，包括到期日在 10 个交易日以上的逆回购与银行定期存款(含协议约定有条件提前支取的银行存款)、资产支持证券(票据)、流动受限的新股以及非公开发行股票、停牌股票、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券和非金融企业债务融资工具等资产；

7 个工作日可变现资产：7 个工作日可变现资产包括可在交易所、银行间市场正常交易的股票、债券、非金融企业债务融资工具、期货及期权合约以及同业存单，7 个工作日内到期或者可支取的逆回购、银行存款，7 个工作日内能够确认收到的各类应收款项等；

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、登记结算机构非正常的暂停或终止业务、证券交易所非正常暂停或停止交易等、证券交易所及登记结算公司发送的数据错误、互联网故障等，但一方收到监管部门业务连续性相关处罚的除外；

管理人指定网站、管理人网站：指 [www.chinalin.com](http://www.chinalin.com)，管理人指定网站变更时以管理人公告为准。

### 三、承诺与声明

#### (一) 管理人承诺

- 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委托财产，不保证委托财产一定盈利，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、为保护委托人的利益，管理人郑重提示委托人：在每次参与本集合计划（无论募集期参与还是存续期参与）时，委托人应及时通过原销售机构网点、原销售机构指定网络系统查询参与结果。
- 5、对于本集合计划的开放期安排、管理人自有资金参与退出、合同变更登记有关管理人向委托人披露的事项，管理人将通过管理人网站 [www.chinalin.com](http://www.chinalin.com) 发布，委托人应及时关注该网站内容。

#### (二) 托管人承诺

- 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委托财产，履行信义义务以及本合同约定的其他义务；
- 2、根据法律法规、中国证监会及证券投资基金业协会的规定和资产管理合同的约定，对管理人的投资或清算指令等进行监督；
- 3、在管理人发生异常且无法履行管理职能时，依照法律法规及合同约定采取措施，维护投资者权益。

#### (三) 投资者声明

- 1、符合《运作规定》合格投资者的要求，以真实身份参与集合计划，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；

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

3、已充分理解本合同条款，了解相关权利义务，了解有关法律法规及所投资资产管理计划的风险收益特征，知晓管理人、托管人及相关机构不应对资产管理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。

4、已知悉《中华人民共和国反洗钱法》、《金融机构客户身份识别和客户身份资料及交易记录保存管理办法》、《金融机构大额交易和可疑交易报告管理办法》、《中国人民银行关于加强反洗钱客户身份识别有关工作的通知》等反洗钱相关法律法规的规定，将严格遵守上述规定，不会违反任何前述规定；承诺用于投资的资金来源不属于违法犯罪所得及其收益；承诺投资的资金来源和去向不涉及反洗钱、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、收益所有人信息等资料；承诺积极履行反洗钱职责，不借助本业务进行洗钱等违法犯罪活动。

5、资产委托人承诺投资本计划不存在违反监管要求的产品嵌套或以投资本计划规避投资范围、杠杆约束等监管要求等违规行为。

#### 四、当事人及权利义务

##### (一) 投资者

个人投资者填写：

姓名：\_\_\_\_\_ 证件类型：\_\_\_\_\_ 证件号码：\_\_\_\_\_

住所：\_\_\_\_\_ 联系人：\_\_\_\_\_ 联系电话：\_\_\_\_\_

通讯地址：\_\_\_\_\_ 邮政编码：\_\_\_\_\_

电子信箱：\_\_\_\_\_

其他：\_\_\_\_\_

机构投资者填写：

机构名称：\_\_\_\_\_ 法定代表人：\_\_\_\_\_

通讯地址：\_\_\_\_\_ 邮政编码：\_\_\_\_\_

联系人姓名：\_\_\_\_\_身份证号码：\_\_\_\_\_

联系电话：\_\_\_\_\_其他：\_\_\_\_\_

## （二）投资者的权利

投资者的权利包括但不限于：

- 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、按照本合同的约定参与、退出和转让资产管理计划份额；
- 4、根据本合同的规定，参加或申请召集资产管理计划份额持有人大会，行使相关职权（如有）；

5、按照法律法规及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；

- 6、监督管理人、托管人履行投资管理及托管义务的情况；
- 7、法律法规、中国证监会及证券投资基金业协会规定的和资产管理合同约定的其他权利。

## （三）投资者的义务

投资者的义务包括但不限于：

- 1、认真阅读并遵守资产管理合同，保证委托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、在持有的集合计划份额范围内，承担资产管理计划亏损或者终止的有限责任；
- 7、向管理人或资产管理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、不得违反资产管理合同的约定干涉管理人的投资行为；

9、不得从事任何有损资产管理计划及其投资者、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，不得泄露资产管理计划的投资计划、投资意向等；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、投资者转让本合同中的权利义务和集合计划份额应事先取得管理人的同意，不得违规转让其所拥有的集合计划份额（法律法规另有规定的除外）；

12、法律法规、中国证监会及证券投资基金业协会规定和资产管理合同约定的其他义务。

#### （四）资产管理人

机构名称：华林证券股份有限公司

住址：拉萨市柳梧新区国际总部城 3 棚 1 单元 5-5

通讯地址：深圳市南山区粤海街道深南大道 9668 号华润置地大厦 C 座 32 层

法定代表人：林立

邮政编码：518000

联系电话：0755-80707888

#### （五）资产管理人的权利

资产管理人的权利包括但不限于：

1、按照资产管理合同约定，独立管理和运用资产管理计划财产；

2、按照资产管理合同约定，及时、足额获得管理人管理费用及业绩报酬（如有）；

3、按照有关规定和资产管理合同约定行使因资产管理计划财产投资所产生的权利；

4、根据资产管理合同及其他有关规定，监督托管人，对于托管人违反资产管理合同或有关法律规定、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及证券投资

基金业协会；

5、自行提供或者委托经中国证监会、证券投资基金业协会认定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、按照本合同的约定，停止或暂停办理集合计划的参与、暂停办理集合计划的退出事宜，终止本集合计划的运作；

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

9、在不损害投资者实质利益的前提下，管理人有权根据管理运作实际情况对集合计划管理运作过程中的相关事项进行调整或补充明确，并及时予以公告；

10、法律法规、中国证监会、证券投资基金业协会规定的及资产管理合同约定的其他权利。

## （六）资产管理人的义务

资产管理人的义务包括但不限于：

1、依法办理资产管理计划的销售、登记、备案事宜；

2、按照证券投资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资产管理计划财产；

7、建立健全的内部管理制度，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、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、资产管理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、按照资产管理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、召集资产管理计划份额持有人大会（如有），份额持有人大会设立日常机构的除外；

15、按照资产管理合同约定计算并向投资者报告资产管理计划份额净值；

16、确定资产管理计划份额参与、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合同的约定；

17、对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；

18、按照资产管理合同约定负责资产管理计划会计核算并编制财务会计报告；

19、聘请具有证券相关业务资格的会计师事务所对年度财务会计报告进行审计；

20、按照资产管理合同的约定确定收益分配方案，及时向投资者分配收益；

21、根据法律法规与资产管理合同的规定，编制向投资者披露的资产管理计划季度、年度等定期报告，向证券投资基金管理协会备案，并抄报中国证监会相关派出机构；

22、办理与受托财产管理业务活动有关的信息披露事项；

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、按照法律、行政法规和中国证监会的规定，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，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，及时报告中国证监会及相关派出机构、证券投资基金业协会并通知托管人和投资者；

27、法律法规、中国证监会及证券投资基金业协会规定的和资产管理合同约定的其他义务。

### **(七) 资产托管人**

机构名称：宁波银行股份有限公司

住址：浙江省宁波市鄞州区宁东路 345 号宁波银行大厦

通讯地址：浙江省宁波市鄞州区宁东路 345 号宁波银行大厦

法定代表人：陆华裕

邮政编码：315100

联系电话：0755-22661998

### **(八) 资产托管人的权利**

资产托管人的权利包括但不限于：

(1) 按照资产管理合同约定，依法保管资产管理计划财产；

(2) 按照资产管理合同约定，及时、足额获得资产管理计划托管费用；

(3) 法律法规、中国证监会及证券投资基金业协会规定的和资产管理合同约定的其他权利。

### **(九) 资产托管人的义务**

资产托管人的义务包括但不限于：

(1) 安全保管资产管理计划财产；

(2) 除依据法律法规规定和资产管理合同的约定外，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) 按规定开立和注销资产管理计划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有关的信息披露事项;
  - (8) 根据相关法律法规和资产管理合同约定，复核管理人编制的资产管理计划财产的定期报告，并出具书面意见；
  - (9) 编制托管季度及年度报告，并向证券投资基金业协会备案，抄报中国证监会相关派出机构；
  - (10) 按照法律法规要求和资产管理合同约定，根据管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；
  - (11) 管理人未按规定召集或者不能召集份额持有人大会的（如有），由托管人召集份额持有人大会，份额持有人大会设立日常机构的除外；
  - (12) 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；
  - (13) 根据法律、行政法规和中国证监会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，保存期限自资产管理计划终止之日起不得少于 20 年；
  - (14) 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资产管理合同约定的，应当拒绝执行，立即通知管理人并及时报告中国证监会相关派出机构和证券投资基金业协会；
  - (15) 投资于《管理办法》第三十七条第（五）项规定资产时，准确、合理界定安全保管资产管理计划财产、监督管理人投资运作等职责，并通过复核季报、年报的方式向投资者充分揭示；
  - (16) 根据《指导意见》的要求以书面告知方式向管理人披露托管人的控股股东、实际控制人或者与托管人有其他重大利害关系的公司名单并及时更新；
  - (17) 国家有关法律法规、监管机构及资产管理合同规定的其他义务。
- (十) 本集合计划设定为均等份额，除资产管理合同另有约定外，每份份额具有同等的合法权益。

## 五、集合资产管理计划的基本情况

- (一) 名称：华林证券满堂红汇利 1 号 FOF 集合资产管理计划

(二) 类别：混合类集合资产管理计划。本集合计划为基金中基金资产管理计划（FOF）。

(三) 运作方式：开放式  
本计划为开放式资产管理计划，投资者可在开放日参与或退出（合同另有约定的除外）。

(四) 投资目标

本集合计划以追求收益增值为目标，在有效控制投资组合风险的前提下，追求资产净值的长期增值。

(五) 主要投资方向

本集合计划通过下列金融产品或工具，最终投资于标准化资产：

(1) 资产管理产品：公开募集证券投资基金、受国务院金融监督管理机构监管的机构发行的其他资产管理产品（含私募证券投资基金），本集合计划所投资的资产管理产品不再投资除公募基金以外的其他资产管理产品。

(2) 货币市场工具：包括银行存款、货币市场基金、债券逆回购。

**特别提示：1、本集合计划可投资债券逆回购；2、本集合计划投资的资产管理产品可能存在委托私募证券投资机构担任投资顾问的情形。**

集合计划在成立后备案完成前，不得开展投资活动，以现金管理为目的，投资于银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券、货币市场基金等中国证监会认可的投资品种的除外。

(六) 投资比例

(1) 本计划为混合类基金中基金资产管理计划，投资于公开募集证券投资基金、受国务院金融监督管理机构监管的机构发行的其他资产管理产品（含私募证券投资基金）的比例（按市值计算）不低于计划总资产的80%。

(2) 固定收益类资产：市值占资产管理计划总资产的比例为0-80%（不含）。  
固定收益类资产包括银行存款、货币市场基金、债券逆回购及固定收益类资产管理产品等；

(3) 权益类资产：市值占资产管理计划总资产的比例为0-80%（不含）。  
权益类资产包括权益类资产管理产品等。

(4) 混合类资产管理产品：市值占资产管理计划总资产的比例为0-100%。

本计划运作期间投资于公募基金及私募基金的，根据其信息披露的程度与频率，按照穿透原则合并计算的投资同一类资产的比例，应符合上述投资比例要求。

上述投资比例符合《运作规定》组合投资的要求。

#### （七）产品风险等级

本产品属于中风险[R3]投资品种，适合专业投资者及风险识别、评估、承受能力为[C3（稳健型）、C4（积极型）、C5（激进型）]的合格投资者。

#### （八）管理期限/存续期限

本集合计划的管理期限即为本集合计划的存续期，本集合计划存续期限为自集合计划成立日开始至5年后对应的同月同日止（遇法定节假日、休息日自动顺延）。若无对应日期，则以对应的同月的最后一个自然日为准（遇法定节假日、休息日自动顺延）。

本集合计划出现集合资产管理合同约定的终止情形时终止清算。

（九）集合计划初始募集面值为1.00元。

（十）集合计划最低初始募集规模不低于人民币1000万元。

（十一）本资产管理计划无分级安排。

## 六、集合计划的募集

### （一）集合计划的募集对象

本集合计划面向符合《指导意见》《运作规定》的合格投资者销售，合格投资者的人数不少于2人且不超过200人。适合追求资产稳健增值、同时具有相应风险承受能力且法律法规允许的个人投资者和机构投资者。本集合计划适合向合格投资者中的专业投资者和风险承受能力为C3（稳健型）、C4（积极型）、C5（激进型）的普通投资者募集。

如未来法律法规或监管机构对合格投资者有新规定的，本集合计划将按新规定执行。

投资者不得使用贷款、发行债券等筹集的非自有资金投资资产管理计划。  
投资者经过管理人和销售机构认可后方可参与本集合计划。管理人和销售机构有权拒绝未经认可的投资者参与本集合计划。

依法设立并受监管的其他资产管理产品视为单一合格投资者，不合并计算其

他资产管理产品的投资者人数，但应当有效识别资产管理计划的实际投资者与最终资金来源。

本资产管理计划面向特定的投资者募集，未经过管理人认可的投资者，管理人有权拒绝其参与申请，已经参与的，管理人有权强制退出其持有的份额。

## （二）募集方式

本集合计划可以通过管理人或管理人委托的外部销售机构面向合格投资者以非公开的形式募集。

### 1、销售机构

（1）华林证券股份有限公司。

（2）与管理人签订《华林证券满堂红汇利 1 号 FOF 集合资产管理计划代理销售协议》（具体协议名称以实际签署为准）的其他符合条件的银行和证券公司等机构（若有）。

本资产管理计划的销售机构以管理人的销售公告为准，产品成立后，管理人有权变更或增加其他符合条件的机构为本资产管理计划的销售机构，并及时向投资者披露。

### 2、销售方式

投资者可通过管理人直接参与资产管理计划；如通过其他销售机构销售的，管理人应将集合资产管理合同、集合资产管理计划说明书等正式销售文件，以纸质或电子文档等方式提供给销售机构。销售机构应当了解客户的投资需求和风险偏好，详细介绍产品特点并充分揭示风险，向客户销售与其风险承受能力相匹配的集合计划，引导客户审慎作出投资决定。禁止通过签订保本保底补充协议等方式，或者采用虚假宣传、夸大预期收益和商业贿赂等不正当手段销售集合计划。

管理人及销售机构应当采取有效措施，并通过管理人、中国证券业协会、基金业协会、中国证监会电子化信息披露平台或者中国证监会认可的其他信息披露平台，客观准确披露集合计划备案信息、风险收益特征、投诉电话等，使客户详细了解本集合计划的特性、风险等情况及客户的权利、义务，但不得通过广播、电视、报刊、互联网及其他公共媒体销售本集合计划。

## （三）募集期限

本集合计划的具体募集期以管理人的募集公告为准。集合计划初始募集期自

启动销售之日起至本集合计划初始募集结束之日，最长不超过 60 天。

#### （四）集合计划的认购

1、认购费率：0.5%；管理人及销售机构可以在不违反法律法规且公平对待投资者的情况下对认购费进行调整。

#### 2、认购参与的原则

(1) 投资者参与本集合计划前，应当在管理人或销售机构处开立相关账户。

(2) “金额参与”原则，即参与以金额申请。本集合计划单个投资者首次参与的初始认购金额为【40】万元人民币。首次参与指提出参与申请的投资者在参与之前未曾持有过本集合计划份额的情形。

(3) 初始募集期内，在每日（T 日）办理认购的交易时间结束后，管理人将对投资者认购规模实行汇总统计，当投资者数达到 200 人时，T+1 日（含）起停止认购。T 日的参与申请将根据参与时间优先、时间相同情况下参与金额优先的原则（金额大者优先）进行确认，超过 200 人的认购无效，并通过管理人网站等方式对相关信息进行披露。

#### 3、认购参与的程序和确认

(1) 投资者按销售机构的销售公告，在销售公告规定的交易时间段内办理；

(2) 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；若交易账户内参与资金不足，销售机构不受理该笔参与申请；

投资者承诺在本集合资产管理合同有效期内，不得撤销指定账户，并妥善保管账户资料，由于投资者原因造成退出款项和收益不能及时划入指定账户及由此造成的损失，由投资者承担，管理人和托管人不承担责任。投资者办理参与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《集合资产管理合同》规定的前提下，以销售机构的销售公告为准；

(3) 投资者签署本合同后，方可申请参与集合计划。如认购人数超过 200 人（不含），参与申请采取“参与时间优先、时间相同情况下参与金额优先（金额大者优先）”原则进行。申请是否有效以登记结算机构出具成交确认单为准。参与申请确认有效后，构成本合同的有效组成部分；

(4) 投资者参与申请确认成功后，其参与申请和参与资金不得撤销；

(5) 投资者于 T 日提交参与申请后，本计划注册登记机构在 T+2 日内对交易

的有效性进行确认。T 日提交的有效申请，投资者可于 T+3 日后（包括该日）在办理参与的销售机构查询参与确认情况。销售机构对参与申请的受理并不代表申请一定生效，而仅代表销售机构确实接收到申请。参与确认以注册登记机构的确认结果为准。

确认无效的申请，销售机构将退还投资者已交付的参与款项。

#### 4、认购份额计算方式

$$\text{净认购金额} = \text{认购金额} / (1 + \text{认购费率})$$

$$\text{认购费用} = \text{认购金额} - \text{净认购金额}$$

$$\text{初始认购份额} = (\text{净认购金额} / \text{基金份额初始净值}) + \text{初始销售利息转份额}$$

#### 5、初始认购资金的管理及利息处理方式

投资者的参与资金在初始募集期产生的利息将折算为计划份额归投资者所有，参与资金的利息以登记结算机构的记录结果为准。

##### （五）资管计划最低认购金额及支付方式

最低认购金额：单个投资者首次参与本集合计划的初始认购金额为人民币【40】万元（不含认购费，下同）。超过最低认购金额的部分不设金额级差。

支付方式：投资者以货币方式通过银行转账支付参与金额，本计划不接受现金参与。

（六）资产管理计划募集结算专用账户和销售机构委托募集账户信息详见附件一。

## 七、集合计划的成立与备案

### （一）集合计划成立的有关事项

1、集合计划的初始募集规模不低于 1000 万元人民币，投资者的人数不少于 2 人且不超过 200 人，募集过程符合法律、行政法规和中国证监会的规定。

2、资产管理计划在取得验资报告后，管理人公告本集合计划成立。

### 3、集合计划募集失败的处理方式

集合计划初始募集期结束，在集合计划规模低于人民币 1000 万元或投资者的人数少于 2 人条件下，或初始募集期内发生使本集合计划无法设立的不可抗力，集合计划设立失败，管理人承担集合计划的全部销售费用，并将已认购资金

在初始募集期结束后 30 日内退还集合计划投资者，并加计银行同期活期存款利息（以登记结算机构的记录为准），退还完毕各方互不承担其他责任。

（二）集合计划的募集金额缴足之日起 10 个工作日内，管理人应当委托具有证券相关业务资格的会计师事务所进行验资并出具验资报告，并在取得验资报告后公告资产管理计划成立。管理人应在资产管理计划成立起 5 个工作日内报证券投资基金业协会备案，抄报中国证监会相关派出机构。集合计划成立前，投资者的参与资金只能存入登记结算机构指定的专门账户，任何机构和个人不得动用投资者参与资金。

（三）集合计划在成立后备案完成前，不得开展投资活动，以现金管理为目的，投资于银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券、货币市场基金等中国证监会认可的投资品种的除外。

## 八、集合计划的参与、退出与转让

### （一）集合计划的参与、退出场所：

（1）华林证券股份有限公司。

（2）与管理人签订《华林证券满堂红汇利 1 号 FOF 集合资产管理计划代理销售协议》（具体协议名称以实际签署为准）的其他符合条件的机构。

### （二）参与和退出的开放日和时间

1、封闭期：本集合计划存续期内除开放期外为封闭期，在每个封闭期内封闭运作，封闭期内原则上不办理集合计划的参与和退出业务（管理人公告临时开放的情况除外）。

开放期：本计划首个封闭期为产品成立之后的 60 日，本计划首个开放期为封闭期满后首个交易日，之后每周一为申购开放日和赎回开放日，委托人可参与或退出集合计划，遇节假日不开放。

因展期、合同的补充、修改或变更需要，管理人有权设置临时开放日并予以公告生效。

2、通知方式：本集合计划首个开放日以管理人公告为准，后续本计划存续期每周一正常开放的（遇节假日不开放），管理人不再另行公告。如遇临时开放的，开放期具体调整以管理人提前 1 个工作日在管理人指定网站出具的公告内容

为准。如在开放日内发生不可抗力或其他情形致使无法按时开放参与、退出业务的，开放日中止，顺延至下一正常开放日。

### （三）临时开放期

#### 1、触发条件

本集合计划，管理人可在出现以下情况时设置临时开放期：

(1) 经征询托管人意见后拟变更集合资产管理合同的，管理人进行合同变更公告或向投资者发送合同变更征询意见函后，可视情况增设临时开放日仅允许投资者退出集合计划；

(2) 在法律法规、监管政策等变化的情况下，依照法律法规、监管政策的要求，管理人可增设临时开放日仅允许投资者退出集合计划。

#### 2、临时开放程序及披露

(1) 管理人拟对本集合计划进行临时开放，应提前1个工作日在管理人指定网站上公告临时开放期具体事项，同时报送证券投资基金管理业协会。

(2) 临时开放期内投资者仅可退出本集合计划，具体退出程序按照本合同开放期内退出程序。

### （四）参与和退出的方式、价格、程序及确认

#### 1、参与的程序和确认

(1) 投资者按销售机构的具体安排，在规定的交易时间段内办理，具体以管理人指定网站发布的公告为准；

参与的程序和确认与第六章“3、认购参与的程序和确认”一致。

#### (2) 资管计划最低申购金额及支付方式

最低申购金额：单个投资者首次参与本集合计划的初始申购金额为人民币【40】万元（不含认购费，下同）。超过最低认购金额的部分不设金额级差。

支付方式：投资者以货币方式通过银行转账支付参与金额，本计划不接受现金参与。

#### 2、退出的原则

(1) “未知价”原则，即退出集合计划的价格以退出申请日(T日)集合计划单位净值为基准进行计算；巨额退出的情形另行约定。

(2) 采用份额退出的方式，即退出以份额申请；

(3) “先进先出”原则，即对该投资者在该销售机构参与的集合计划份额进行处理时，参与确认日期在前的集合计划份额先退出，参与确认日期在后的集合计划份额后退出。

(4) 投资者可以在销售机构规定的受理时间内撤销当日的退出申请；

(5) 若某笔退出导致该投资者的剩余持有份额对应的资产净值少于【40】万元，则余额部分必须一起退出。

### 3、退出的程序和确认

#### (1) 退出申请的提出

投资者必须根据本集合计划销售机构规定的手续，在开放日的业务办理时间内向销售机构提出退出申请。申请退出份额数量超过投资者持有份额数量时，申请无效。

#### (2) 退出申请的确认

T 日交易时间内提交的退出申请，集合计划注册登记机构在 T+2 日对该交易的有效性进行确认。T 日提交的有效申请，投资者可在 T+3 日后（包括该日）到销售机构查询退出申请的确认情况。销售机构对退出申请的受理并不代表申请一定生效，而仅代表销售机构确实收到申请。退出的确认以注册登记机构的确认结果为准。

巨额退出、连续巨额退出的情形另行约定。

#### (3) 退出款项划付

投资者的退出申请确认后，管理人将指示托管人把退出款项从集合计划托管专户划往登记结算机构，再由登记结算机构划往各销售机构，并通过销售机构划往申请退出投资者的指定账户，退出款项将在 5 个工作日内从托管账户划出。如集合计划出现集合资产管理合同所述暂停估值的情形时，管理人应当及时告知投资者。已接受的退出申请，管理人应当足额支付；如暂时不能足额支付，应当按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，其余部分在造成暂停估值的因素已消除，具备足额支付条件后的 2 个工作日内予以支付。

#### (4) 退出的限制与次数

投资者可将其部分或全部集合计划份额退出。当投资者某笔退出后导致其剩

余持有份额对应的资产净值少于【40】万元时，该部分份额将被强制退出。

本集合计划不设单个投资者退出次数限制。

### (五) 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购买资产管理计划份额的，投资者应符合合格投资者标准，且参与金额应满足资产管理计划最低参与金额限制（不含参与费用），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购买资产管理计划份额的除外。单个投资者首次参与的初始申购金额不低于为购买资产管理计划份额的除外。单个投资者首次参与的初始申购金额不低于为【40】万元人民币。投资者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对应的资产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对应的资产净值低于规定的最低参与份额时，应当一次性全部退出。

### (六) 参与和退出的费用

1、参与费率：0.5%。

管理人及销售机构可以在不违反法律法规且公平对待投资者的情况下对参与费进行调整。参与费用不列入集合计划财产。

2、退出费率：投资者申请退出本集合计划时，须按退出份额的持有期限缴纳退出费并计入集合计划资产，退出费率如下：

持有天数 N	退出费率
N<60 天	1.5%
360 天>N>=60 天	0.5%
N>=360 天	0%

管理人及销售机构可以在不违反法律法规且公平对待投资者的情况下对退出费进行调整。

### (七) 参与份额的计算方式、退出金额的计算方式

1、参与份额计算方式

$$\text{净参与金额} = \text{参与金额} / (1 + \text{参与费率})$$

$$\text{参与费用} = \text{参与金额} - \text{净参与金额}$$

$$\text{参与份额} = \text{净参与金额} / T \text{ 日计划单位净值}$$

投资者多笔参与时，按上述公式进行逐笔计算。投资者参与份额以四舍五入

的方法保留小数点后两位，由此产生的差额部分计入集合计划资产的损益。

## 2、退出金额的计算方式

本集合计划退出时以申请日计划单位净值作为计价基准，按扣除退出费、业绩报酬后的实际金额支付。退出费和退出金额的计算公式如下：

$$\text{退出金额} = (\text{T 日计划单位净值} \times \text{有效退出份额} - \text{业绩报酬}) * (1 - \text{退出费率})$$

上述计算结果均以四舍五入的方法保留小数点后两位，由此产生的差额部分计入集合计划资产的损益。退出费由投资者承担，不列入集合计划资产。

当投资者某笔退出后导致其剩余持有份额对应的资产净值少于【40】万时，该部分份额将被强制退出。

本集合计划不设单个投资者退出次数限制。

## （八）参与资金的利息处理方式

投资者的参与资金在初始募集期产生的利息将折算为计划份额归投资者所有，参与资金的利息以登记结算机构的记录结果为准。

## （九）巨额退出事项

### 1、认定标准

单个开放日，投资者当日累计净退出申请份额（退出申请总份额扣除参与申请总份额之后的余额）超过上一工作日计划总份额数的10%时，即为巨额退出。

### 2、巨额退出的顺序、价格确定和款项支付

发生巨额退出时，管理人可以根据本集合计划当时的资产组合状况决定全额退出、部分顺延退出；

全额退出：当管理人认为有条件支付投资者的退出申请时，按正常退出程序办理。

部分顺延退出及退出款项支付：当管理人认为支付投资者的退出申请可能会对计划资产净值造成较大波动时，管理人在当日接受净退出比例不低于上一日集合计划总份额10%的前提下，对其余退出申请予以延期办理。对于当日的退出申请，将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；未能受理的退出部分，投资者可选择延期办理或撤销退出申请，如投资者不进行选择则默认为投资者延期办理申请。对于选择延期办理的退出申请，管理人将在

下一个工作日内办理，并以该工作日的计划单位净值为准计算退出金额，依此类推，直至全部办理完毕为止，但不得超过正常支付时间 20 个工作日，转入下一个工作日的退出申请不享有优先权。

### 3、告知客户方式

发生巨额退出并延期支付时，管理人应在 3 个工作日内在管理人指定网站公告，并说明有关处理方法。

### 4、单个客户大额退出的认定、预约申请、处理方式

#### (1) 单个委托人大额退出的认定

单个开放日，单个委托人一次申请退出份额达到或超过 500 万份（含本数）即视为单个委托人大额退出。

#### (2) 单个委托人大额退出的申请和处理方式

发生大额退出的，委托人必须提前 2 个工作日提出退出申请，否则管理人有权拒绝接受其退出申请。

### (十) 巨额退出、延期支付及延期退出的情形和处理方式

#### 1、延期退出的情形

如果本集合计划连续 2 个开放日发生巨额退出，即认为发生了连续巨额退出，管理人可进行延期退出。

#### 2、延期退出的顺序、价格确定和款项支付

本集合计划发生连续巨额退出，管理人可按说明书及资产管理合同载明的规定，暂停接受退出申请，但暂停期限不得超过 20 个工作日；已经接受的退出申请可以延缓支付退出款项，但不得超过正常支付时间 20 个工作日，并在管理人指定网站上进行公告。

### (十一) 拒绝或暂停参与、暂停退出的情形及处理方式

#### 1、拒绝或暂停参与的情形及处理

管理人可拒绝或暂停接受投资者参与的情形，包括但不限于：

(1) 初始募集期和存续期内，参与本集合计划投资者接近或达到合同约定的人数上限；

(2) 战争、自然灾害等不可抗力的原因导致集合计划无法正常运作；

(3) 证券交易所在交易时间非正常停市；

(4) 发生集合资产管理合同规定的暂停集合计划资产估值情况；

(5) 管理人认为接受某笔或某些参与申请可能会影响或损害现有投资者利益时；

(6) 其他可能对本集合计划业绩产生负面影响，从而损害现有投资者利益的情形；

(7) 法律、法规规定或中国证监会认定的其他情形。

如果投资者的参与被拒绝，就该投资者而言，集合资产管理合同自始无效。

发生上述第(1)、(2)、(3)项拒绝或暂停接受投资者参与情形时，管理人应当及时将拒绝或暂停接受参与的原因和处理方法以至少指定一种方式向投资者披露。在暂停参与的情况消除时，管理人应及时恢复参与业务的办理并提前3个工作日向投资者披露。

2、发生下列情形时，管理人可以拒绝或暂停受理投资者的退出申请：

(1) 不可抗力的原因导致集合计划无法正常运作；

(2) 证券交易场所交易时间非正常停市，导致当日集合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) 因市场剧烈波动等原因而出现连续巨额退出，或者其他原因，导致本集合计划的现金支付出现困难时，管理人可以暂停接受集合计划的退出申请；

(5) 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及说明书中已载明的特殊情形。

发生上述情形之一的，管理人将在当日立即公告。已接受的退出申请，若管理人能足额支付退出申请，则管理人将足额支付退出申请；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退出。发生拒绝或暂停受理退出的情形时，管理人应将拒绝或暂停受理退出的原因和处理办法在管理人指定网站进行信息披露。在暂停退出的情况消除时，管理人应在不超过正常支付时间20个工作日内及时恢复退出业务的办理。

## (十二) 集合计划份额的转让

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。受让方首次参与本集合计划，应先签订集合资产管理合同。

#### (十三) 集合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，将一定数量的集合计划份额按照一定的规则从某一投资者集合计划账户转移到另一投资者集合计划账户的行为。集合计划登记结算机构只受理因继承、捐赠、司法强制执行以及其他形式行为引起或财产分割或转移引起的计划份额非交易过户。对于符合条件的非交易过户申请按登记结算机构的有关规定办理。

#### (十四) 集合计划份额的冻结

集合计划登记结算机构只受理国家有权机关依法要求的集合计划份额冻结与解冻事项。

#### (十五) 管理人自有资金参与集合计划

1、管理人可以以自有资金参与本集合计划：

在本集合计划初始募集期起始日至集合计划终止日内，管理人可以以自有资金参与本集合计划。

管理人以自有资金参与本集合计划，应符合《管理办法》、《运作规定》和监管机构的相关规定。

2、自有资金参与的金额和比例：

管理人自有资金参与本集合计划份额不超过本集合计划总份额的 16%。管理人及其附属机构以自有资金参与本集合计划的份额合计不得超过本集合计划总份额的 50%。因集合计划规模变动等客观因素导致管理人自有资金参与本集合计划份额被动超过集合计划总份额的 16%，或管理人及其附属机构以自有资金参与本集合计划的份额合计超过本集合计划总份额的 50%时，管理人有权为自有资金退出设置临时开放期，按照自有资金或其自有资金和附属机构自有资金份额的超额情况，退出或督促其附属机构退出超过上述限制部分的参与份额。

3、自有资金的收益分配及责任：

管理人持有计划份额与投资者持有计划份额享有同等参与收益分配的权利，

与投资者持有的计划份额同等承担风险和责任。

4、自有资金退出的条件：

管理人自有资金参与部分在出现以下情况之一时，可以退出本集合计划：

(1) 管理人自有资金参与份额，满足参与时间不少于6个月条件时，可与其他投资者同样办理退出业务。

(2) 管理人自有资金参与本集合计划的份额及对应的资产净值，均不得超过相关法律法规、监管机构规定的比例。因集合计划规模变动（含份额、净值变动）等客观因素导致自有资金参与集合计划的比例被动达到相关法律法规、监管机构规定的预警标准或者不符合规定标准的，管理人应当将部分自有资金参与份额在本集合计划开放期办理退出业务或非开放期间办理份额强制退出，以使自有资金比例在相关法律法规规定的时限内符合法规要求。法律法规另有规定时，从其规定。

(3) 法律法规或监管机构规定的允许自有资金退出的其他情况。

5、管理人自有资金参与集合计划的持有期限不得低于6个月，参与、退出时应当提前5个工作日告知投资者和托管人，法律法规或本合同另有规定的除外。

6、风险揭示：管理人自有资金退出，可能遭遇流动性风险，从而影响计划损益。管理人将认真履行管理人职责，关注计划规模变动情况，控制风险。管理人以自有资金参与本集合计划并不代表管理人对本集合计划的风险和收益水平作任何形式的判断，管理人自有资金参与份额与其他持有计划同类份额享有同等权利并承担相同责任。

7、信息披露：管理人及时在管理人指定网站公告自有资金参与及退出的相关情况。

8、在存续期，为应对集合计划巨额赎回，解决流动性风险，在不存在利益冲突并遵守合同约定的前提下，管理人以自有资金参与及后续退出集合计划可不受前述第2、4、5项的限制，管理人应及时告知投资者和托管人，并向住所地中国证监会派出机构及中国证券投资基金业协会报告。

## 九、集合计划份额持有人大会及日常机构

本计划不设立份额持有人大会及日常机构。

## 十、集合计划份额的登记

(一) 本集合计划份额登记机构：华林证券股份有限公司

(二) 本集合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（如有）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。

(三) 本集合计划资产交由【宁波银行股份有限公司】负责托管，并签署了托管协议，托管人的托管职责以托管协议的约定为准。

## 十一、集合计划的投资

### (一) 投资目标

在追求集合计划资产安全性和流动性的前提下，以研究分析为基础，以追求绝对回报为目标，为投资者获取投资收益。

### (二) 投资范围及比例

本集合计划投资范围和投资比例符合《运作规定》组合投资的要求：

#### 1、投资范围

本集合计划通过下列金融产品或工具，最终投资于标准化资产：

(1) 资产管理产品：公开募集证券投资基金、受国务院金融监督管理机构监管的机构发行的其他资产管理产品（含私募证券投资基金），本集合计划所投资的资产管理产品不再投资除公募基金以外的其他资产管理产品。

(2) 货币市场工具：包括银行存款、货币市场基金、债券逆回购。

集合计划在成立后备案完成前，不得开展投资活动，以现金管理为目的，投资于银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券、货币市场基金等中国证监会认可的投资品种的除外。

#### 2、资产配置比例

(1) 本计划为混合类基金中基金资产管理计划，投资于公开募集证券投资基金、受国务院金融监督管理机构监管的机构发行的其他资产管理产品（含私募证券投资基金）的比例（按市值计算）不低于计划总资产的80%。

(2) 固定收益类资产：市值占资产管理计划总资产的比例为0-80%（不含）。固定收益类资产包括银行存款、货币市场基金、债券逆回购及固定收益类资产管理产品等；

(3) 权益类资产：市值占资产管理计划总资产的比例为0-80%（不含）。权益类资产包括权益类资产管理产品等。

(4) 混合类资产管理产品：市值占资产管理计划总资产的比例为0-100%。本计划运作期间投资于公募基金及私募基金的，根据其信息披露的程度与频率，按照穿透原则合并计算的投资同一类资产的比例，应符合上述投资比例要求。

本计划建仓期为集合计划成立之日起不得超过6个月，管理人将在建仓期内，使集合计划的投资组合比例符合上述约定。因证券市场波动、投资对象合并、集合计划规模变动等外部因素，致使本集合计划的组合投资比例不符合上述约定的，管理人将在15个交易日内进行调整（如遇相关证券不能上市交易的，上述时间期限自动顺延）。

委托人在此同意并授权管理人可以将集合计划的资产投资于管理人及与管理人有关联方关系的公司、托管人及与托管人有关联方关系的公司发行或承销的证券。委托人同意管理人在进行上述各项关联交易前无需再征求委托人意见。交易完成5个工作日内，管理人应书面通知托管人，通过管理人网站告知委托人，并向证券交易所报告。

法律法规或中国证监会允许集合计划投资其他品种的，资产管理人在获得托管人、所有资产委托人一致同意后，可以将其纳入本计划的投资范围，具体投资比例由所有资产委托人协商一致确定。

### （三）投资比例超限的处理方式及流程

因证券期货市场波动、证券发行人合并、资产管理计划规模变动等管理人之外的因素导致资产管理计划投资不符合法律、行政法规和中国证监会规定的投资比例或者合同约定的投资比例的，管理人应当在流动性受限资产可出售、可转让或者恢复交易的十五个交易日内调整至符合相关要求。确有特殊事由未能在规定

时间内完成调整的，管理人应当及时向中国证监会相关派出机构和证券投资基金业协会报告。

#### （四）所投资资产管理产品的选择标准

管理人建立了一套科学完整的资产管理产品管理人筛选体系，资产管理产品的筛选流程包括量化初选池，尽调准入池和投资跟踪池，力争通过定量分析和定性评价结合的方式对资产管理人的投研能力、投资风格、业绩可持续性和管理团队进行细致分析，以筛选出符合FOF产品的优秀管理人，其中：定量方法主要通过业绩与风险指标在海量数据库中筛选可入池资产管理产品，包括收益指标、风险指标、风格指标等，对于每个指标在同类策略中横向打分，再加权各指标得分进行排名；定性方法主要用在对于资产管理产品管理人投研团队、投资理念、投资策略及风格、公司治理等综合方面的深入评价和分析。

#### （五）风险收益特征

本集合计划为固定收益类资产管理计划，主要投资于债券等固定收益类资产，属【R3】风险等级产品（中风险），该类产品流动性较高，存在一定风险，适合具有匹配的风险承受能力且认同集合计划投资理念的投资者，包括符合合格投资者条件的个人投资者和机构投资者（法律法规禁止投资集合资产管理计划的除外）。

#### （六）本集合计划不设业绩比较基准。

#### （七）投资策略与投资决策

##### 1、集合计划投资策略

###### （1）资产配置策略

本集合计划首先根据宏观环境分析、风险收益分析、资产相关性分析等多种因素对资产配置方案进行决策，用最优化方法形成目标资产配置。

###### （2）FOF投资管理策略

管理人可以在符合投资目标和投资理念的情况下，由投资经理进行投资管理，管理的方式包括：1) 在投资范围和投资限制约束下，主动对底层资产进行直接投资管理；2) 对代表某类资产和投资风格的资产管理产品进行直接投资，本集合计划主要投资于公募中长期纯债基金，短债基金，同业存单指数基金，公募REITs；投资以绝对收益为目标的量化对冲，宏观对冲，中性策略的公、私募

基金等资管产品。

本产品投资决策如下：

① 精选大类资产进行组合配置。根据目标客户对于产品的风险收益水平目标，按照各类资产的过去历史风险收益特征等指标，结合管理人的对于未来各大类资产展望，通过资产配置模型，确定各大类资产在投资组合中的初步配置比例，再通过不同资产及策略的配置比例精选代表某类策略与投资风格的资产管理产品进行投资；

② 组合优化配置。根据结合产品的承受的风险水平，在投资团队对未来各类资产收益和风险的预期基础上，微调各类资产在投资组合中的配置比例；

③ 组合配置调整。定期回顾和跟踪底层各大类资产和管理人业绩表现，调整组合的资产配置比例，实现组合风险与收益的动态平衡。

### （3）货币市场工具投资策略

本集合计划通过对货币市场工具的组合操作，在保持本金的安全性与资产流动性的同时，追求相对稳健的当期收益。通过合理有效分配本计划的现金流，保持投资组合的流动性，满足本计划投资运作的要求。

## 2、集合计划决策依据

集合计划以国家有关法律、法规和《集合资产管理合同》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》、《集合资产管理合同》、《说明书》等有关法律性文件；

（2）国内外经济形势、利率变化趋势以及行业与上市公司基本面研究；

（3）投资对象收益和风险的匹配关系，本集合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。

## 3、集合计划决策程序

严格的投资管理制度和程序可以保证投资理念的正确执行，避免重大风险的发生。投资经理将跟踪经济状况、证券期货市场和上市公司的发展变化，结合集合计划参与和退出的现金流量情况，以及组合风险与绩效评估的结果，对投资组合进行监控和调整，使之不断得到优化。

## 4、投资管理的方法和标准

### (1) 投资管理方式

委托资产的管理方式为投资者向管理人委托资金，由管理人按照本合同约定进行投资管理。委托资金的投资及核算与管理人自有资产及管理人管理的其他资产相互独立。

### (2) 投资管理标准

投资者授权管理人在本合同约定的投资范围、委托期限以及投资限制内进行投资管理。管理人不对投资者的本金和收益做出任何承诺和保证。

## (八) 投资限制及禁止行为

### 1、投资限制

为维护投资者的合法权益，本集合计划的投资限制为：

(1) 本集合计划投资于其他资产管理产品的，所投资的资产管理产品不再投资于除公募基金以外的其他资产管理产品。

(2) 本集合计划投资单只资产管理产品的投资比例：0%-25%。

(3) 本集合计划投资于其他私募资产管理产品的，按照穿透原则合并计算后，投资同一资产的比例不得超过本资产管理计划资产净值的25%；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%。

(4) 本集合计划投资于其他资产管理产品的，计算集合计划的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。本集合计划的总资产占净资产的比例不得超过200%

(5) 债券正回购余额不得超过本集合资产管理计划净资产的100%。

(6) 证券法规规定和集合计划管理合同约定禁止从事的其他投资。

若因为市场波动，导致集合计划出现超限的情况，管理人应于15个交易日内调整到本合同约定的限制之内。

如法律法规或监管部门修改或取消上述限制，履行适当程序后，本集合计划可相应调整投资组合限制的规定。

### 2、本集合计划的禁止行为包括：

(1) 违规将集合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) 将集合计划资产用于可能承担无限责任的投资；
- (3) 向客户做出保证其资产本金不受损失或者保证其取得最低收益的承诺；
- (4) 挪用集合计划资产；
- (5) 募集资金不入账或者其他任何形式的账外经营；
- (6) 募集资金超过计划说明书约定的规模；
- (7) 接受单一客户参与资金低于中国证监会规定的最低限额；
- (8) 使用集合计划资产进行不必要的交易；
- (9) 内幕交易、利益输送、操纵证券价格、不正当关联交易及其他违反公平交易规定的行为；
- (10) 法律、行政法规和中国证监会禁止的其他行为。

### **(九) 建仓期**

本集合资产管理计划的建仓期自产品成立之日起不得超过 6 个月。

建仓期的投资活动，应当符合资产管理合同约定的投向和资产管理计划的风险收益特征。以现金管理为目的，投资于银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券、货币市场基金等中国证监会认可的投资品种的除外。

(十) 管理人在开放退出期内，其资产组合中 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%。

### **(十一) 集合计划的预警线、止损线**

本集合计划不设置预警线、止损线。

## **十二、投资顾问**

本集合计划无投资顾问。

## 十三、分级安排

本集合计划不分级。

## 十四、利益冲突及关联交易

### (一) 利益冲突

1、本集合计划存在的或可能存在利益冲突的情形，包括但不限于：

(1) 管理人可能将本计划的资产投资于管理人、托管人及其控股股东、实际控制人或者其他关联方发行的证券或承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易，可能存在利益冲突的情况；

(2) FOF 产品投资于管理人及管理人关联方所设立的资产管理产品（如涉及）；

(3) 法律法规、中国证监会等监管机构规定的其他情形。

### 2、集合计划存在利益冲突的处理方式

当管理人利益与投资者利益冲突时，管理人需建立健全内部审批机制和评估机制，并遵循投资者利益优先的原则，采取切实有效措施，防范利益冲突，保护投资者合法权益；管理人应当事先取得投资者的同意，事后告知投资者和托管人。

### 3、集合计划存在利益冲突的披露事项

集合计划发生合同约定可能存在利益冲突情形的，管理人应在该事项发生之日起五个工作日内通过公司官网向投资者披露可能存在利益冲突的具体情形，同时应在该事项发生之日起五个工作日内报送中国证监会相关派出机构、证券投资基金管理协会。

### (二) 关联交易

管理人将其管理的客户资产投资于与管理人、托管人及与其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或承销期内承销的证券，或者从事其他关联交易的，均应事先取得投资者书面同意，并遵循计划份额持有人利益优先的原则、防范利益冲突，保护计划份额持有人合法权益。同时在投资完成之日起 5 个工作日内按要求并向中国证监会相关派出机构、证券投资基金管理协会及证券交易所报告，并采取切实有效措施，防范利益冲突，保护投

资者合法权益。

管理人运用受托管理资产从事重大关联交易的，应事先取得投资者书面同意，并有充分证据证明未损害投资者利益。

管理人应及时向托管人提供关联方名单，如因管理人未及时提供关联方名单导致托管人监控不及时的，托管人不承担责任。

## 十五、投资经理的指定与变更

委托资产投资经理由资产管理人负责指定。

### (一) 投资经理简介

1、本集合计划投资经理基本情况：

姓名：贾志

基金从业执业证书编号：A20211011002605。

从业简历：贾志先生于 2015 年到 2019 年，担任天相投资顾问有限公司证券投资分析师，投研总监；2020 年到 2022 年，担任平安证券研究所证券投资分析师，基金研究团队负责人，2022 年 4 月加入华林证券资管部落，担任 FOF 投资团队负责人职务，对 FOF 投资组合管理有深入研究。

投资经理资质及投资经验：本集合计划投资经理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) 投资经理变更的条件和程序

1、资产管理人因以下情况需更换投资经理：

- (1) 投资经理辞职/离职；
- (2) 投资经理内部调整；
- (3) 其他原因需要更换投资经理。

2、变更程序

投资经理的变更由管理人确定，通过管理人网站公告并做好相关安排，无需另行征询委托人的意见。在投资经理变更之日起 5 个工作日向中国证券投资基金业协会报告，同时抄送证监会相关派出机构。

投资经理的变更程序不适用本合同第二十四章中的有关合同变更的程序。

## 十六、集合计划的财产

### （一）集合计划的财产的保管与处分

1、集合计划财产的债务由计划财产本身承担责任，投资者以其出资为限对资产管理计划财产的债务承担责任。

2、集合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、托管人不得将资产管理计划财产归入其固有财产。

3、管理人、托管人因资产管理计划财产的管理、运用或者其他情形而取得的财产和收益，归入资产管理计划财产。

4、管理人、托管人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，其债权人不得对集合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，集合计划财产不属于其清算财产。

5、集合计划财产产生的债权不得与不属于集合计划财产本身的债务相互抵消。非因集合计划财产本身承担的债务，管理人、托管人不得主张其债权人对资产管理计划财产强制执行。上述债权人对集合计划财产主张权利时，管理人、托管人应明确告知计划财产的独立性，采取合理措施并及时通知投资者。

### （二）集合计划账户的开立

托管人为本集合计划开立银行托管账户，托管人以集合计划的名义在托管机构开设托管专用账户，保管集合计划的银行存款，该托管专户是指托管人在集中清算模式下，代表所托管的包括集合计划在内的托管资产与中国证券登记结算有限责任公司进行一级结算的专用账户。集合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。托管人可根据实际情况需要，为委托财产开立资金清算辅助账户，以办理相关的资金汇划业务。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。

该托管专用账户名称应遵守监管机构规定的命名方式要求，托管账户预留印

鉴为托管人根据有关规定以二级户的形式为委托资产开立专门用于保管货币形式存在的委托资金及清算交收的银行账户，二级户的预留印鉴以母账户的预留印鉴为准，开立的托管账户应遵循宁波银行《单位银行结算账户管理协议》规定。

托管人根据管理人委托按中国证券登记结算有限责任公司相关规定为委托资产开立专用证券账户及其他相关账户，专用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。

托管人根据管理人委托按银行间市场登记结算机构相关规定为委托资产开立银行间债券交易账户，银行间债券交易账户的持有人名称应当符合银行间市场登记结算机构的有关规定。

本合同当事人应当在开户过程中给予开立账户方必要的配合，并提供所需资料。

与委托资产投资有关的其他账户，由管理人与托管人根据相关法律法规和本合同的规定协商一致后办理，新账户按有关规则使用并管理。

集合计划专用证券账户、专用交易单元应由集合计划管理人报证券交易所等备案。

定期存款（包括协议存款）账户的预留印鉴至少包含一枚托管人监管名章，由托管人保管和使用。对于任何的定期存款投资，管理人都必须和存款机构签订定期存款协议，约定双方的权利和义务，该协议作为划款指令附件。该协议中必须有如下明确条款：‘存款证实书不得被质押或以任何方式被抵押，并不得用于转让和背书；本息到期归还或提前支取的所有款项必须划至托管账户（明确户名、开户行、账号等），不得划入其他任何账户’。如定期存款协议中未体现前述条款，托管人有权拒绝定期存款投资的划款指令。在取得存款证实书后，托管人保管证实书正本。

### （三）集合计划资产的管理与处分

集合计划资产由托管人托管，并独立于管理人及托管人的自有资产及其管理、托管的其他资产。管理人或托管人的债权人无权对集合计划资产行使冻结、扣押及其他权利。除依照《管理办法》、《运作规定》、《集合资产管理合同》、《说明书》及其他有关规定处分外，集合计划资产不得被处分。

## 十七、集合计划投资指令的发送、确认和执行

### (一) 交易清算授权

本合同签署后，资产管理人应向资产托管人提供预留印鉴和授权人签字/章样本（以下简称“授权文件”），内容包括被授权人名单、预留印鉴及被授权人签字/章样本，授权文件应注明被授权人相应的权限及有效时限。首次授权通知和授权变更通知须为原件。

授权文件记载的具体生效时间为授权文书正式生效时间。如果授权文件中载明具体生效时间的，该生效时间不得早于资产托管人收到授权文件的时点。如早于，则以资产托管人收到授权文件的时点为授权文件的生效时间。

资产管理人更换被授权人、更改或终止对被授权人的授权，应立即将新的授权文件以原件方式通知资产托管人。新的授权文件记载的具体生效时间为新的授权文书正式生效时间。如果新的授权文件中载明具体生效时间的，该生效时间不得早于资产托管人收到新的授权文件的时点。如早于，则以资产托管人收到新的授权文件的时点为新的授权文件的生效时间。

若资产管理人同时向资产托管人出具了业务统一交易授权通知书和单个产品的授权通知书的，授权书以下第(1)种方式为准：(1)统一授权通知书。(2)单个产品授权通知书。

资产管理人和资产托管人对授权文件负有保密义务，其内容不得向被授权人及必要操作人员以外的任何人泄露。但法律法规规定或有权机关要求的除外。

### (二) 划付指令的内容

划款指令是资产管理人在运用委托资产时，向资产托管人发出的资金划拨及其他款项支付的指令。资产管理人发给资产托管人的指令应写明款项事由、支付时间、到账时间、大小写金额、收付款账户信息（含大额支付行号）等，按授权文件加盖预留印鉴并由被授权人签字/章。

### (三) 划付指令的发送、确认和执行程序

划款指令由被授权人代表资产管理人用传真的方式或邮件的方式向资产托管人发送。管理人的传真号码为（0755-82707865）、邮箱为（以管理人信息备忘录为准），除此以外的传真和邮箱发送的指令资产托管人有权拒绝执行。资产

托管人依照授权文件规定的方法确认指令有效后，方可执行指令。对于被授权人发出的指令，资产管理人不得否认其效力。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划款指令，被授权人应按照其授权权限发送划款指令。

对于要求当天到账的指令，资产管理人应在当天 15:00 前向资产托管人发送划款指令，15:00 之后发送的，资产托管人尽力执行，但不能保证划账成功。如果要求当天某一时点到账的指令，则指令需要至少提前 2 个工作小时发送，资产托管人的工作时间为 08:30-11:30, 13:30-17:00。对于中证登记公司实行 T+0 非担保交收的业务，资产管理人应在交易日 15:00 前将划款指令发送至资产托管人。

资产管理人发送划款指令时应同时向资产托管人发送必要的投资合同、费用发票（如有）等划款证明文件的复印件。但资产托管人仅对资产管理人提交的划款指令按照本合同约定进行审查，资产托管人不负责审查管理人发送指令同时提交的其他文件资料的合法性、真实性、完整性和有效性，资产管理人应保证上述文件资料合法、真实、完整和有效。如因资产管理人提供的上述文件不合法、不真实、不完整或失去效力而影响资产托管人的审核或给任何第三人带来损失，资产托管人不承担任何形式的责任。资产托管人收到资产管理人发送的指令后，应立即审核有关内容、印鉴和签名的一致性，并在其承诺监督范围内审查投资指令是否违反法律法规及本合同约定，复核无误后应在规定期限内执行，不得延误。资产托管人对于管理人提供的相关合同、交易凭证或其他证明材料的投资方向、金额、入账账户等要素是否与划款指令记载字面表述相符进行审查。有效划款指令是指指令要素（包括付款人、付款账号、收款人、收款账号、金额（大、小写）、款项事由、支付时间）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划款指令。资产管理人应确保资产托管人在执行指令时，资金账户有足够的资金余额。

资产管理人向托管人下达指令时，应确保委托资产托管专户有足够的资金余额，对资产管理人在没有充足资金的情况下向资产托管人发出的付款指令，资产托管人可不予执行，并及时通知资产管理人，资产托管人不承担因为不执行该指令而造成损失的责任。

#### （四）托管人依法暂缓、拒绝执行指令的情形和处理程序

资产托管人发现管理人的投资或清算指令违反法律、行政法规、中国证监会的规定或者资产管理合同约定的，应当拒绝执行，并向中国证监会相关派出机构和证券投资基金管理协会报告。

#### （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，与预留印鉴不符，指令中重要信息错误、模糊不清或不全，未按照本合同约定的传真号码或邮箱或双方认可的其他形式发送指令等。

资产托管人在履行监督职能时，发现资产管理人的指令错误时，有权拒绝执行，并及时以传真方式通知资产管理人改正。资产管理人接到托管人要求改正指令后，可重新发送新指令并在原指令上注明“停止执行”字样并由加盖预留印鉴经被授权人签字后发送资产托管人，资产托管人收到新指令和停止执行的指令后，应停止执行原指令并按新指令执行；但若原指令在资产托管人收到资产管理人通知前已执行，则应向资产管理人电话说明，资产托管人不承担因为执行原指令而造成的损失或责任。

资产托管人因执行资产管理人的合法指令和依据交易程序已经生效的指令而对委托资产造成的损失不承担赔偿责任。资产托管人由于主观故意或过失造成未按照或者未及时按照资产管理人发送的正常划款指令执行，给投资者造成损失的，应负赔偿责任。

#### （六）本计划的场内证券交易及交收清算方式可以选择下述两种方式之一 (请勾选) 并遵循下述有关要求：

##### 证券公司结算模式下的交易途径及清算交收方式

1. 资产管理人负责选择代理本委托资产证券买卖的证券经营机构以及代理本委托资产期货交易的机构，并与其签订相关协议。
2. 管理人最晚于初始委托资产起始运作日前一个工作日以书面形式告知托管人上交所和深交所的交易单元号、交易品种的费率、佣金收取标准和证券账户信息等，并确认已建立第三方存管关系、开通银证转账功能。

最晚于投资期货前一个工作日以书面形式告知托管人在期货公司的交易会员号、期货结算账户信息、交易编码、交易目的、交易品种的费率、交易保证金

率等，并确认已建立银期转账关系。

3、在合同有效期间若交易单元号、交易会员号、交易编码、或涉及的相关费率等变动，则管理人应在变动生效前一个工作日书面告知托管人。

#### 4、沪、深交易所数据传输和接收

1) 管理人应责成其选择的证券经营机构通过深证通或指定邮箱向托管人传送中登的登记及结算数据、交易所的交易清算数据。管理人应责成其选择的证券经营机构保证提供给托管人的交易数据的准确性、完整性、真实性，如数据不准确、不完整或不真实，由管理人选择的证券经营机构承担全部责任，但因证券交易所、中登及证券经营机构无法控制的其他原因造成数据传输错误或不及时的，证券经营机构不承担任何责任。

所提供的数据均需按中登和交易所发布的最新数据接口规范进行填写，以便托管人能够完成会计核算、清算、监督职能。

若数据传送不成功，管理人应责成证券经营机构重复或以其它应急方式传送，直到托管人成功接收，托管人对因证券经营机构提供的数据错误或不及时等过失造成的委托资产损失不承担责任。

2) 管理人应责成证券经营机构于 T 日 20:00 前将委托资产的当日场内交易数据发送至托管人(但因证券交易所或中登及管理人无法控制的其他原因而造成数据延迟发送的情况除外)，如遇到特殊情况出现数据发送延迟等情况应及时通知托管人。

3) 管理人应责成证券经营机构于 T+1 日上午 9: 00 前打印 T 日清算后的证券账户对账单盖章后传真给托管人，以便托管人进行对账。对账单内容包括委托资产 T 日的交易明细、证券余额、资金余额等内容。

4) 管理人应责成证券经营机构指定专人负责数据的传输和接收，确保数据的安全性和保密性。在数据传输人员发生变更时，须至少提前 1 个工作日以书面方式通知资产托管人，且在资产托管人确认之后变更正式生效。变更通知书中必须说明变更时间、人员、事项等。

#### 5、清算交收

管理人所选择的证券经营机构负责办理委托资产的所有场内交易(或代销的场外开放式基金)的清算交割；托管人负责办理委托资产的所有场外交易的清算

交割。

#### 托管人结算模式下的交易途径及清算交收方式

本产品通过交易单元进行证券交易所交易的，资产管理人负责办理交易单元联通手续，协助资产托管人在登记公司办理合并清算安排合法证券交易单元用于本委托资产的投资运作。

本委托资产在证券交易所的投资交易活动，应当集中在上述证券交易单元上进行。

资产管理人与资产托管人应根据有关法律法规及相关业务规则，办理证券交易资金结算业务。

##### 1、结算备付金

根据中证登记公司规定，在每月第2个工作日，中证登记公司对结算参与人的最低结算备付金、结算保证金限额进行重新核算、调整。资产托管人在中证登记公司调整最低结算备付金、结算保证金当日，在资金余额调节表中反映调整后的最低备付金和结算保证金。资产管理人应预留最低备付金和结算保证金，并根据中证登记公司确定的实际最低备付金、结算保证金数据为依据安排资金运作，调整所需的现金头寸。

##### 2、清算交收

资产托管人负责委托资产买卖证券交易的清算交收。证券交易所场内资金结算由资产托管人根据中证登记公司结算数据办理；其他场外资金汇划由资产托管人根据资产管理人的指令具体办理。

如果因为资产托管人主观故意或过失在清算上造成委托资产的直接损失，应由资产托管人负责赔偿，但因中国人民银行、中证登记公司和银行间市场登记结算机构资金结算系统以及其他机构的结算系统发生故障等非资产托管人的原因造成清算资金无法按时到账的情形，资产托管人可免责；如果因为资产管理人未事先通知资产托管人增加交易单元等事宜，致使资产托管人接收数据不完整，造成清算差错的责任由资产管理人承担；资产管理人应采取合理措施，确保在T日日终有足够的资金头寸用于T+1日中证登记公司的资金交收。如因资产管理人原因导致资金头寸不足，资产管理人应在T+1日上午10:00前补足头寸，确保资金交收。

如果由于资产管理人超越本合同的约定规定进行超买、超卖等原因造成委托资产投资清算困难和风险的，资产托管人发现后应立即通知资产管理人，由资产管理人负责解决。

实行场内 T+0 非担保交收的资金清算按照资产托管人的相关规定流程执行。

#### （七）资金、证券及交易记录的核对

资产管理人和资产托管人每日对委托资产的证券账目、实物券账目、交易记录进行核对。

（八）资产托管人于 T 日向资产管理人传真/邮件发送 T 日委托资产投资交易清算后的资金调节表。

#### （九）划款指令的保管

划款指令若以传真形式或邮件发送扫描件形式发出，则正本由资产管理人保管，资产托管人保管指令传真件或扫描件。当两者不一致时，以资产托管人收到的划款指令传真件为准。

#### （十）其他事项

本委托资产在证券交易所场内交易的资金清算交割，由资产托管人通过中证登记公司上海分公司/深圳分公司办理。资产托管人视中证登记公司向其发送的清算数据为有效指令，无须资产管理人向资产托管人另行出具划款指令。

资金账户发生的银行结算费、银行账户维护费等银行费用，由资产托管人直接从资金账户中扣划，无须资产管理人出具划款指令。

## 十八、越权交易的界定

### （一）越权交易的界定

越权交易是指资产管理人违反本合同约定的投资范围和投资比例限制进行的投资交易行为，不包括因证券市场波动导致的委托资产市值变化、投资组合规模变动（委托资产的参与或退出）等资产管理人之外的因素致使委托资产的投资比例不符合本合同限制或有关法律法规规定的情况。

资产管理人应在本合同规定的权限内运用委托资产进行投资管理，不得违反本合同的约定，超越权限从事证券投资。

### （二）越权交易的处理程序

资产托管人对于承诺监督的越权交易中，托管人发现管理人的投资或清算指令违反法律、行政法规、中国证监会的规定或者资产管理合同约定的，应当要求管理人限时改正，管理人应及时核对、改正并以书面形式向托管人进行解释或举证；管理人未能及时改正或者造成客户委托财产损失的，托管人应当及时通知委托人，并有权报告管理人住所地中国证监会派出机构。

托管人在行使监督职能时，如果发现委托财产投资证券过程中出现超买或超卖现象，应立即提示管理人，由管理人负责解决。

### （三）托管人对管理人投资运作的监督

1、资产托管人根据合同的约定，对本计划的投资范围进行监督。

2、资产托管人对本计划的委托资产投资比例监督要求如下：

（1）本集合计划投资于其他资产管理产品的，所投资的资产管理产品不再投资于除公募基金以外的其他资产管理产品。

（2）本集合计划投资单只资产管理产品的投资比例：0%-25%。

（3）本集合计划投资于其他私募资产管理产品的，按照穿透原则合并计算后，投资同一资产的比例不得超过本资产管理计划资产净值的25%；

（4）本集合计划投资于其他资产管理产品的，计算集合计划的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，本集合计划的总资产占净资产的比例不得超过200%。

（5）债券正回购余额不得超过本集合资产管理计划净资产的100%。

（6）证券法规规定和集合计划管理合同约定禁止从事的其他投资。

若因为市场波动，导致集合计划出现超限的情况，管理人应于15个交易日内调整到本合同约定的限制之内。

如法律法规或监管部门修改或取消上述限制，履行适当程序后，本集合计划可相应调整投资组合限制的规定。

3、资产托管人对本计划的委托资产投资限制进行监督。

4、越权交易的例外

非因资产管理人主动投资行为导致的下列不符合投资政策的情形不构成本章所述越权交易，应当属于被动超标：

（1）由于资产管理人之外的原因导致的投资比例出现不符合本合同约定的

投资政策的情形（包括但不限于证券市场波动、证券发行人合并、已投资持有的证券在持有期间信用评级下降、证券发行人受到监管机关处罚或谴责、证券发行人股票被特别处理、证券发行人年度财务审计报告未被出具标准无保留意见、本投资组合规模变动等，视投资政策中的具体约定而确定），为被动超标，不属于越权交易。发生被动超标时，资产管理人应在相应证券可交易之日起 15 个交易日内进行调整，确有特殊事由未能在规定时间内完成调整的，管理人应当及时向中国证监会相关派出机构和证券投资基金管理业协会报告。

（2）法律法规对被动超标另有规定的从其规定。

5、托管人仅依据法律法规及越权交易中的监督事项进行投资监督，由管理人根据所投资产管理产品披露投资组合的频率，及时通过邮件方式(以管理人信息备忘录为准)将本资产管理计划所投资其他资产管理产品的估值表、净值等数据发送给托管人(托管人的邮箱地址为 custody@nbcn.cn; custody\_fa@nbcn.cn; custody-audit@nbcn.cn)。托管人仅根据管理人提供的数据进行复核，并根据管理人提供的数据及时进行投资监督。管理人应保证数据的真实性和完整性，如因管理人提供的上述文件不真实、不完整而带来的损失，由管理人承担。如本资产管理计划所投资其他资产管理产品披露组合的频率发生变化的，由托管人及管理人协商一致后进行调整

6、资产托管人对委托资产投资范围、投资比例及限制的监督和检查自本合同生效之日起开始。在本合同到期日前一个月内，因委托资产变现需要，本委托资产的投资比例限制可以不符合上述规定。

7、投资比例限制如需变更，资产管理人应与资产托管人、投资者书面达成一致，并应为资产托管人调整监督事项留出必要的时间。

8、资产托管人投资监督的准确性和完整性受限于证券经纪商及其他中介机构提供的数据和信息。

## 十九、集合计划财产的估值与会计核算

管理人应当制订健全、有效的估值政策和程序，并定期对其执行效果进行评估，保证集合资产管理计划估值的公平、合理。

（一）资产总值：集合计划资产总值是指其所购买的各类证券、银行存款本

息以及其他资产的价值总和。

(二) 资产净值：集合计划资产净值是指集合计划资产总值减去负债后的余额。集合计划资产净值的计算精确到 0.01 元，小数点后第三位四舍五入。

(三) 单位净值：集合计划单位净值是指集合计划资产净值除以当日集合计划份额总数计算得到的每集合计划份额的价值。

(四) 估值目的：客观、准确地反映集合计划资产的价值。经集合计划资产估值后确定的集合计划单位净值，是进行信息披露、计算参与和退出集合计划的基础。

(五) 估值对象：集合计划所拥有的银行存款本息、债券等所有资产。

(六) 估值日：估值日指本集合计划成立后的每个交易日，即上海证券交易所和深圳证券交易所的正常交易日。

(七) 估值方法：

估值应符合本合同、《证券公司客户资产管理业务规范》中的估值原则、《证券公司客户资产管理业务估值方法指引》、及其他法律、法规、自律规则的规定，如法律法规未做明确规定，参照行业通行做法处理。资产管理人、资产托管人的估值数据应依据合法的数据来源独立取得。对于固定收益类投资品种的估值应依据中国基金业协会证券投资基金估值工作小组的指导意见及指导价格估值。

#### 1、投资资产管理产品及证券投资基金的估值方法

(1) 持有的交易所上市基金(包括封闭式基金、上市开放式基金(LOF)、创新型分级基金等)，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，以最近交易日的收盘价估值；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考监管机构或行业协会有关规定，或者类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值；

(2) 持有的场外基金及资产管理产品（包括托管在场外的上市开放式基金(LOF)），按场外投资标的管理人提供的最新份额净值估值；估值日计划份额净值无公布的，按此前最近交易日的计划份额净值估值；

(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交易日的每万份收益计提红利；

(4) 持有的基金及资产管理产品处于封闭期的，封闭期内如无重大变化的，

按照最新公布的单位净值估值；无单位净值的，参考近期投资价格进行估值。

(5) 如遇所投资资产管理产品或者基金不公布产品份额净值、进行折算或拆分、估值日无交易等特殊情况，管理人根据以下原则进行估值：

①以所投资资管产品或基金的份额净值估值的，若所投资资管产品或者基金与本产品估值频率一致但未公布估值日份额净值，按其最近公布的份额净值为基础估值

②以所投资基金的收盘价估值的，若估值日无交易，且最近交易日后市场环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后市场环境发生了重大变化的，可使用最新的基金份额净值为基础或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，确定公允价值。

③如果所投资资管产品或基金前一估值日至估值日期间发生分红除权、折算或拆分，根据份额净值或收盘价、单位基金份额分红金额、折算拆分比例、持仓份额等因素合理确定公允价值。

④管理人认为按上述第①至第③条进行估值存在不公允时，应与托管人协商一致采用合理的估值技术或估值标准确定其公允价值。

## 2、存款、回购、债券借贷等资产的估值方法

银行存款、回购、债券借贷和其他固定收益工具按照约定利率在持有期内逐日计提应收利息，在利息到账日以实际利息入账。

3、估值方法是指管理人和托管人协商一致的，被市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的确定公允价值的方法。如有确凿证据表明按上述规定不能客观反映集合计划资产公允价值的，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，按最能反映集合计划资产公允价值的方法估值。

4、相关法律法规、监管部门及自律组织等有强制规定的，从其规定。如有新增事项或更新规定，按国家最新规定估值。

## （八）估值程序

管理人和托管人在 T+1 日对集合计划 T 日的份额净值进行估值及核对。用于公开披露的集合计划单位净值由管理人完成估值后，将估值结果以传真或以其他双方认可的书面方式发送至托管人，集合计划托管人进行复核，托管人复核无误

后返回给管理人。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，为了避免不能按时公布计划净值的情况，以管理人的估值结果对外公布。

#### （九）单位净值错误与遗漏的处理方式

1、管理人和托管人应采取必要、适当、合理的措施确保本集合计划资产估值的准确性和及时性。当估值出现错误时，本集合计划管理人应当立即予以纠正，通知托管人并采取合理的措施防止损失进一步扩大。

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，如经双方在平等基础上充分讨论后，尚不能达成一致时，按管理人的建议执行；或者管理人和托管人对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；如因计算错误由此给投资者和集合计划财产造成的损失由管理人承担与托管人根据各自过错的承担责任。

#### （十）暂停估值的情形

当出现下列情形致使集合计划管理人无法准确评估集合计划资产价值时，可暂停估值。但估值条件恢复时，集合计划管理人必须按规定完成估值工作。

1、集合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集合计划管理人、托管人无法准确评估集合计划资产价值时。

#### （十一）资产管理计划份额净值的确认

资产管理计划财产及资产净值由管理人负责计算，托管人进行复核。如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照管理人对资产管理计划资产净值的计算结果为准。

#### （十二）特殊情形的处理

管理人按估值方法的第3项存款的估值方法进行估值时，所造成的误差不作为计划单位净值错误处理。

由于不可抗力原因，或由于证券交易所及登记结算机构非正常暂停或停止交易、发送的数据错误，管理人或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而造成的估值错误、集合计划资产净值计算错误，管理人、托管人应积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。

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集合计划持有人利益的原则进行协商确定处理原则。

### （十三）计划会计制度

按国家有关部门规定的会计制度执行。

### （十四）计划账册的建账和对账

#### 1、集合计划账册的建账

集合计划会计核算责任由管理人承担，托管人也应按国家有关规定，独立地设置、记录和保管本集合计划的全套账册。管理人和托管人在本合同生效后，应按照相关各方约定的同一记账方法和会计处理原则，分别独立的设置、登录和保管委托财产的全套账册，对相关各方各自的账册定期进行核对，互相监督，以保证委托财产的安全。若双方对会计处理方法存在分歧，应以资产管理人的处理方法为准。

#### 2、凭证保管及核对

证券交易凭证由托管人和管理人分别保管并据此建账。

管理人与托管人对集合计划账册每日核对一次。经对账发现双方的账目存在不符的，管理人和托管人应及时查明原因并纠正，保持双方的账册记录完全相符。

### （十五）集合计划财务报表与报告的编制和复核

#### 1、财务报表的编制

集合计划财务报表由管理人编制，托管人复核。

#### 2、报表复核

托管人在收到管理人编制的集合计划财务报表后，进行独立的复核。核对无误后，在核对过的集合计划财务报表上加盖托管人和管理人业务公章，各留存一份。核对不符时，应及时通知管理人共同查出原因，进行调整，调整以国家有关规定为准。

## 二十、集合计划的费用与税收

### （一）费用种类

- 1、管理人的管理费及业绩报酬；
- 2、托管人的托管费；
- 3、证券交易费用；
- 4、证券账户开户费；
- 5、本集合计划成立后的信息披露费用；
- 6、本集合计划成立后的会计师费、审计费和律师费；
- 7、因集合计划资金划付支付的银行汇划费；
- 8、集合计划运营过程中发生的增值税及附加与集合计划缴纳税收有关的手续费、汇款费等，除法律法规另行规定外，管理人和托管人不对投资者承担的各类税负进行代扣代缴；
- 9、清算费用；
- 10、按照国家有关规定可以列入的其他费用。

## (二) 集合计划费用支付标准、计算方法、支付方式和时间

### 1、管理费及业绩报酬

#### (1) 管理费

本集合计划的管理费按前一日集合计划的资产净值计提，管理费的年费率为【0.6%】。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的集合计划管理费

E 为前一日集合计划资产净值

集合计划管理费每日计提，按季支付。经管理人与托管人双方核对无误后，由托管人根据管理人出具的划款指令于次月首日起5个工作日内从集合计划资产中一次性支付给管理人。

#### (2) 业绩报酬

##### a、收取业绩报酬的原则：

集合计划存续期间，管理人不主动提取业绩报酬，本集合计划仅在投资者退出日和本集合计划终止日计提业绩报酬并于投资者退出日和本集合计划终止日后的5个工作日内支付业绩报酬。

##### b、业绩报酬的计提方法：

本计划每期资产的业绩报酬计提基准根据管理人开放公告确认。

管理人特别声明：此业绩报酬计提计提标准不是预期收益和保证收益率。

投资者承认，资产管理合同所提及的业绩报酬计提标准仅是管理人计提业绩报酬的标准，不构成管理人、托管人对委托财产收益状况的任何承诺或担保，投资者仍可能面临投资收益甚至本金受损的风险。

在本集合计划的投资者退出日和本集合计划终止日，R 为每笔份额上一个发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日(如上一个发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日不存在，初始募集期参与的为本集合计划成立日，存续期参与的为参与当日)至本次业绩报酬计提日期间的年化收益率，年化收益率在业绩报酬计提基准以上管理人则提取的业绩报酬。

按公式表示如下：

$$R = \frac{A - B}{C} \times \frac{365}{D} \times 100\%$$

A 为业绩报酬计提日的累计单位净值；

B 为上一个业绩报酬计提日的累计单位净值；

C 为上一个业绩报酬计提日的单位净值；

D 为上一业绩报酬计提日与本次业绩报酬计提日间隔天数；

年化收益率 (R)	计提比例	业绩报酬 (H) 计算方法
$R \leqslant 5\%$	0	$H = 0$
$R > 5\%$	<u>20%</u>	$H = (R - \text{业绩报酬计提基准}) \times \frac{20\%}{365} \times C$ $\times F \times D / 365$

注：F 为提取业绩报酬的份额。

具体业绩报酬计提金额以管理人公告为准。

### c、业绩报酬支付

由管理人向托管人发送业绩报酬划付指令，托管人复核后于 5 个工作日内将业绩报酬支付给管理人。若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

管理费及业绩报酬收入账户信息：

户 名：华林证券股份有限公司

账 号：41005200040004682

开户银行：中国农业银行股份有限公司深圳中航城支行

大额支付行号：103584000523

## 2、托管费

本集合计划的托管费按前一日集合计划的资产净值计提，托管费的年费率【0.01%】。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的集合计划托管费

E 为前一日集合计划资产净值

集合计划托管费每日计提，按季支付。经管理人与托管人双方核对无误后，由托管人根据管理人的划款指令于次月首日起 5 个工作日内从集合计划资产中一次性支付给托管人。

托管费收入账户信息：

户 名：资产托管费待划转

账 号：11070126102000013

开户银行：宁波银行股份有限公司

大额支付行号：313332082914

## （三）其他费用的计提原则和计算方法

### 1、证券交易费用

本集合计划投资运作期间所发生的经手费、证管费、过户费、印花税、交易单元费和证券结算风险基金等，直接计入投资成本或者作为当期费用，其费率由管理人根据有关政策法规确定。本集合计划向所租用交易单元的券商支付佣金（该佣金已经扣除风险金），并在发生投资交易时按每笔成交金额计提，在每季度首日起 10 个工作日内支付给提供交易单元的券商。

### 2、其他费用

（1）银行结算费用、银行账户维护费用，在发生时一次性计入本集合计划费用。

（2）银行间市场账户维护费，按银行间市场规定的金额，在相应的会计期间进行预提。资产管理人应根据银行间费用相关法律法规及本合同约定，将账户开户、结算管理等各项费用列入或摊入当期委托财产运作费用，经管理人和托管

人核对无误后，由管理人授权后划付，管理人收到托管人通知后一个月内未授权划付的，由托管人从委托资产中扣划，无须资产管理人出具指令。资产委托人和资产管理人在此申明已了解委托资产投资会产生的银行费用，并确保账户中有足够资金用于银行费用的支付，如因托管账户中的资金不足以支付银行费用影响到指令的执行，资产托管人不承担由此产生的损失和责任。如委托资产未起始运作，由管理人在收到托管人的缴费通知后完成支付，托管人不承担垫付费用义务。

(3) 开户费、银行间交易相关维护费用、转托管费用、注册登记相关费用（包括但不限于服务月费、登记结算费、年度电子合同服务费等）等集合计划运营过程中发生的相关费用，在发生时一次性计入本集合计划费用。

(4) 在本集合计划存续期间发生的、与集合计划相关的审计费（按与会计师事务所签定协议所规定的金额）、律师费（按与律师事务所签定协议所规定的金额，签订协议前需向投资者披露）、信息披露费以及按照国家有关规定可以列入的其他费用等，在相应的会计期间，按直线法在每个自然日内平均摊销。

(5) 在本集合计划清算过程中因处置未变现集合计划资产而产生的全部费用（包括但不限于诉讼费、仲裁费、律师费（按与律师事务所签定协议所规定的金额，签订协议前需向投资者披露）、公证费、拍卖费及其他形式的资产处置费等费用），在发生时可计入本集合计划费用。

(6) 其他费用由管理人本着保护投资者利益的原则，按照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定，由托管人按费用实际支出金额支付，列入当期集合计划费用。本合同项下的管理费、业绩报酬、托管费及其他管理人或托管人收取的各类费用均为包含增值税的含税价。

### 3、清算费用

本集合计划进入清算程序后，管理人和托管人应当在扣除清算费用（包括但不限于审计费、银行汇划费）、管理费、业绩报酬及托管费等费用后，将集合计划资产按照投资者拥有集合计划份额的比例或集合资产管理合同的约定以货币资金的形式全部派给投资者。

### (四) 不列入集合计划费用的项目

集合计划成立前发生的费用，以及存续期间发生的与销售有关的费用，不得在集合计划资产中列支。管理人和托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用

支出或集合计划资产的损失以及处理与集合计划运作无关的事项发生的费用等不得列入集合计划费用。

#### （五）税费缴纳

根据财政部和国家税务总局《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号文）、《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》（财税【2017】2号文）、《关于资管产品增值税有关问题的通知》（财税【2017】56号文）及其后续颁布的具体征收管理办法等相关文件（若有）中“资管产品运营过程中发生的增值税应税行为”需缴纳的增值税及附加相关规定，资管产品应缴纳的增值税及附加由委托资产承担，由此会导致委托资产投资收益减少。后续颁布的法律、法规、规章等如有新的规定，按新的规定执行。本章约定收取的管理费、托管费、业绩报酬（若有）均不含上述提到的“资管产品运营过程中发生的增值税应税行为”需缴纳的增值税及附加。如果管理人在向投资者交付相关收益或资产后税务机关要求管理人缴纳相关税费的，投资者应按照管理人通知要求进行缴纳；投资者不得要求管理人以任何方式向其返还或补偿该等税费。

### 二十一、集合计划的收益分配

#### （一）收益的构成

本集合计划收益指集合计划利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额，集合计划已实现收益指集合计划收益减去公允价值变动收益后的余额。

#### （二）收益分配原则

- 1、集合计划在分红、退出、终止时按本合同约定分配计划份额收益。
- 2、每份集合计划份额享有同等分配权（因管理人业绩报酬的存在，每份份额集合计划实际得到的分红金额可能有所不同）
- 3、本合同中关于“利益”、“收益”的表述，并不意味着管理人保证委托人取得相应数额的利益，不意味着管理人保证集合计划资金不受损失。

#### （三）收益分配方案的确定与披露：

在符合有关分红条件和收益分配原则的前提下，收益在计划存续期内每年最

多分配 2 次。

本集合计划收益分配方案由管理人拟定，包括集合计划收益的范围、集合计划净收益、分配对象、分配原则、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容，由托管人核实后确定，并在确定之日起 3 个工作日内由管理人以至少一种指定方式进行信息披露。

#### （四）收益分配方式

本集合计划的默认分红方式为现金分红，委托人可以选择现金分红或者红利再投资分红方式。委托人同意遵守登记结算机构的业务规则（包括但不限于现有规则、对现有规则的修订、以及以后新制定的规则）。管理人分红时以登记结算机构登记的分红方式为准。

委托人选择红利再投分红方式的，分红资金在扣减管理人业绩报酬（若有）后，按分红除权日的集合计划每份净值转成本集合计划份额，免收参与费（红利再投资不受本计划份额上限的限制）。集合计划份额计算保留到小数点后两位，以后的部分采用去尾法，由此产生差额计入集合计划资产的损益。

#### （五）收益分配的执行方式

在收益分配方案公布后，管理人依据具体方案的规定就支付的现金收益向托管人发送划款指令，托管人按照管理人的指令及时进行现金收益的划付。托管人仅依据合同约定及管理人指令，对收益分配方案中的收益范围、分配方式、分配金额等要素进行核对。我行对于收益分配方案的复核内容仅限于对收益分配的总金额进行复核，对于在不同投资者之间分配的金额、分配顺序不承担复核义务，托管人不对向受益人划转资金本息的及时性、准确性负责。收益分配时，如有银行转账或其他手续费的，由投资者自行承担。

### 二十二、集合计划的信息披露与报告

#### （一）集合计划单位净值报告

披露时间：本集合计划成立后，每日披露集合计划份额净值、累计净值，管理人在下一个工作日内向投资者报告前一交易日经托管人对财务数据复核的计划财产净值。

披露方式：本集合计划的信息披露将严格按照《管理办法》、《运作规定》、

本合同及其他有关规定进行。本集合计划的计划单位净值、计划累计单位净值等信息通过管理人指定网站公告形式向投资者披露，除法律法规另有强制性规定，通过上述形式之一进行披露即视为管理人向投资者送达了相关信息披露事项的通知并履行了对投资者的信息披露义务。投资者可向管理人查询参与和退出的成交确认结果、打印成交确认单。

## （二）集合计划定期报告

定期报告包括集合计划的资产管理季度（年度）报告、托管季度（年度）报告和年度财务会计报告。

### 1、集合计划的资产管理季度报告和托管季度报告

管理人每季度向投资者提供一次准确、完整的管理季度报告，资产管理季度报告由管理人根据监管要求编制，经托管人对财务数据复核后由管理人公告，并报相关监管机构或自律组织。托管人每季度向投资者提供一次季度托管报告。上述报告应由管理人于每季度截止日后1个月内通过管理人网站披露，同时报送中国证监会相关派出机构、证券投资基金业协会。集合计划成立不足3个月或者存续期间不足3个月时，可以不编制当期的季度报告。

集合计划的季度报告内容包括下列信息：

（1）管理人履职报告；

（2）托管人履职报告；

（3）资产管理计划投资表现；

（4）资产管理计划投资组合报告；

（5）资产管理计划运用杠杆情况（如有）；

（6）资产管理计划支付的管理费、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；

（7）资产管理计划投资收益分配情况；

（8）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；

（9）中国证监会规定的其他事项。

若中国证监会等监管机构对集合资产管理计划参与上述标的的信息披露另有规定的，从其规定。

### 2、集合计划的资产管理年度报告和托管年度报告

管理人每年度向投资者提供一次准确、完整的管理年度报告，资产管理年度报告由管理人根据监管要求编制，经托管人复核后由管理人公告，并报相关监管机构或自律组织等备案。托管人每年度向投资者提供一次托管报告。上述报告应由管理人于每年度截止日后4个月内通过管理人网站披露，同时报送中国证监会相关派出机构、证券投资基金业协会。集合计划成立不足3个月或者存续期间不足3个月时，可以不编制当期的年度报告。

集合计划的年度报告内容包括下列信息：

- (1) 管理人履职报告；
- (2) 托管人履职报告；
- (3) 资产管理计划投资表现；
- (4) 资产管理计划投资组合报告；
- (5) 资产管理计划运用杠杆情况（如有）；
- (6) 资产管理计划财务会计报告；
- (7) 资产管理计划支付的管理费、托管费、业绩报酬（如有）等费用的计提基准、计提方式和支付方式；
- (8) 资产管理计划投资收益分配情况；
- (9) 投资经理变更、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。

资产管理计划季度报告应当披露前款除（6）之外的其他信息，资产管理计划成立不足三个月或者存续期间不足三个月的，管理人可以不编制资产管理计划当期的季度报告和年度报告。

若中国证监会等监管机构对集合资产管理计划参与上述标的的信息披露另有规定的，从其规定。

### 3、年度财务会计报告

集合资产管理计划年度财务会计报告应当经具有证券相关业务资格的会计师事务所审计，审计机构应当对资产管理计划会计核算及净值计算等出具意见。

### （三）集合计划临时报告

集合计划存续期间，发生对集合计划持续运营、客户利益、资产净值产生重大影响的事项，管理人应当在事项发生之日起五个工作日内及时通过管理人网站

等方式及时向客户披露。临时报告的情形包括但不限于：

- (1) 集合计划运作过程中，投资经理发生变更，或出现其他可能对集合计划的持续运作产生重大影响的事项；
- (2) 暂停受理或者重新开始受理参与或者退出申请；
- (3) 发生巨额退出并延期支付；
- (4) 集合计划终止和清算；
- (5) 管理人以自有资金参与和退出；
- (6) 合同的补充、修改与变更；
- (7) 与集合计划有关的重大诉讼、仲裁事项；
- (8) 负责本集合计划的代理销售机构发生变更；
- (9) 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；
- (10) 管理人、托管人因解散、破产、撤销等原因不能履行相应职责；
- (11) 集合计划收益分配；
- (12) 管理费、托管费等费用计提方式或费率发生变更；
- (13) 其他发生对集合计划持续运营、客户利益、资产净值产生重大影响的事件，以及根据法律法规及本合同约定应当披露的情形。

以上事项应在发生之日起五个工作日内按监管要求向中国证监会相关派出机构、证券投资基金业协会报送。

(四) 资产管理人、资产托管人应当保证投资者能够按照资产管理合同约定的时间和方式查询委托资产的投资运作、托管等情况。

(五) 集合计划管理人的董事、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集合计划，应通过管理人指定网站向客户充分披露，同时报送中国证监会相关派出机构、证券投资基金业协会。

## 二十三、风险揭示

本集合计划面临包括但不限于以下风险：

### (一) 资产管理计划面临的特定风险

1、资产管理合同与证券投资基金业协会合同指引不一致所涉风险；

本资产管理合同依据中国基金业协会发布的《集合资产管理计划资产管理合

同内容与格式指引（试行）》（以下简称“《合同指引》”）、《资产管理计划风险揭示书内容与格式指引（试行）》及相关法律法规制定。《合同指引》规定，在不违反相关法律法规、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》、《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》、《合同指引》以及其他有关规定的前提下，资产管理合同当事人可以根据实际情况约定《合同指引》规定内容之外的事项。《合同指引》部分具体要求对当事人确不适用的，当事人可对相应内容做出合理调整和变动。本合同中对《合同指引》规定内容之外的部分事项进行约定，也可能存在个别内容与《合同指引》不一致，或不适用《合同指引》中个别规定的情形，可能对投资者合法权益造成影响。

## 2、合同变更的风险

在一般情况下，管理人与托管人对合同变更事宜达成一致后，管理人在管理人网站通告委托人并明确合同变更征询期，并有权设置特殊赎回开放日，不同意合同变更的委托人，应在该赎回开放日办理本集合计划的退出事宜，委托人未退出的视为同意合同变更。征询期满后管理人即可确定变更生效日期。合同变更的征询函、公告、通知等，管理人将仅通过管理人网站发布，而不会单独通知每个委托人，委托人应及时关注该网站内容。

## 3、资产管理计划份额转让所涉风险；

本计划成立后，管理人可以按照规定申请份额转让事宜。份额转让交易平台可以是证券交易所，也可以是中国证监会认可的其他交易平台。投资者通过交易平台转让份额需自行寻找受让方，份额转让价格由投资者与受让方协商确定，产生的转让费用由投资者自行承担，投资者份额转让价格与集合计划份额净值可能不一致。

## 4、资产管理计划未在证券投资基金管理业协会完成备案手续或不予备案情形所涉风险

资产管理计划成立日五个工作日内将进行中国证券投资基金管理业协会备案申请，可能存在管理人未履行备案手续或者资产管理计划不符合备案要求等原因致使资产管理计划备案失败，从而给资产管理计划财产带来损失的风险。

## （二）FOF 产品特有风险

### 1、FOF 产品管理模式特有风险

各类不同资产及投资策略在不同的市场环境下表现不同，管理人根据资产配置模型进行大类资产配置，并筛选市场上各个策略的投资策略资产进行投资。各个策略资产的表现可能高于预期，也可能低于预期；可能由于管理人对策略资金分配不当，导致集合计划资产亏损。反之，也可能出现管理人资金分配合理，但由于具体策略的投资管理人投资管理能力不佳造成的资产亏损。

## 2、投资资产管理产品的风险

本集合计划部分资产将配置于公开募集证券投资基金、受国务院金融监督管理机构监管的机构发行的其他资产管理产品（含私募证券投资基金），投资上述资产管理产品可能因下列特定风险因素给本计划造成不利影响，请投资者知悉。

### （1）资产管理产品管理人风险

资产管理产品管理人风险包括管理人经营风险和操作风险。经营风险是指因管理能力、财务状况、行业竞争、人员素质、内控等因素导致公司经营不善，极端情况下甚至破产倒闭，可能对其管理人的产品业绩造成不利影响。本集合计划主要投资于公募中长期纯债基金，短债基金，同业存单指数基金，公募REITs；投资以绝对收益为目标的量化对冲，宏观对冲，中性策略的公、私募基金等产品。对于约定了止损条款的资产管理产品，可能因管理人未及时操作导致产品损失扩大的风险。

### （2）资产管理产品投资风险

本集合计划所投资的资产管理产品可能由于其管理人对市场判断失误、买入标的市场表现不佳、风险控制失效等原因造成产品净值的下降，从而造成集合计划净值下降，最终导致集合计划投资者资产损失。

### （3）策略模型风险

在实际运作中，因资产管理产品的基金经理变更导致模型无法有效运作，开发的策略或模型不再有效或者在运作过程中与产品期初投资策略和投资风格发生偏离，进而影响产品投资业绩。

### （4）集合计划所投资的资产管理产品因流动性问题导致赎回资金延到账风险

因本集合计划投资者退出或资产配置调整需要，管理人赎回所投资的资产管理产品时，可能面临资产管理产品不在开放期，也可能面临资产管理产品触发大

额赎回或巨额赎回条款，从而导致赎回资金延迟到账的风险。

#### （5）投资资产管理产品可能面临双层收费的风险

本集合计划投资者需要承担双层费用，即集合计划费用及集合计划所投资的资产管理产品自身需要承担费用。集合计划所投资的资产管理产品自身需要承担费用包括资产管理产品的管理费、托管费、业绩报酬（如有）、认购费或参与费（如有）、赎回费（如有）等，以上费用在计提时将会扣减资产管理产品的资产净值，从而造成集合计划净值下降。

#### （6）投资的多个资产管理产品估值时间不一致导致集合计划单位净值可能无法反映真实投资管理情况的风险

本集合计划投资多个资产管理产品，每个资产管理产品的估值时间可能不一致，且披露时间可能不一致。在存续期间，集合计划单位净值可能无法反映真实投资管理情况。

#### （7）底层资产管理产品提取业绩报酬对集合计划净值造成下跌的风险

### （三）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。

#### 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。主要包括但不限于：

##### （1）政策风险

货币政策、财政政策、产业政策等国家宏观经济政策的变化对资本市场产生一定的影响，导致市场价格波动，影响资产管理计划的收益而产生风险。

##### （2）经济周期风险

经济运行具有周期性的特点，受其影响，资产管理计划的收益水平也会随之发生变化，从而产生风险。

### (3) 利率、汇率风险

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，使资产管理计划的收益水平随之发生变化，从而产生风险。汇率波动范围将影响国内资产价格的重估，从而影响委托资产的净值。

### (4) 购买力风险

资产管理计划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，从而使资产管理计划的实际收益下降。

### (5) 再投资风险

投资者为了实现购买债券时所确定的收益相等的收益，这些临时的现金流就必须按照等于买入债券时确定的收益率进行再投资。如果这些临时性的现金流不得不以较低的利率进行再投资，这种风险就称为再投资风险。如果投资者只购买了短期债券，而没有购买长期债券，就会有再投资风险。再投资风险还是一个利率风险问题。

## 3、管理风险

资产管理计划运作过程中，管理人依据资产管理合同约定管理和运用资产管理计划财产所产生的风险，由资产管理计划财产及投资者承担。投资者应充分知晓投资运营的相关风险，其风险应由投资者自担。

## 4、流动性风险

资产管理计划因市场整体或投资品种流动性不足、应付可能出现的投资者巨额退出或大额退出等原因，不能迅速转变成现金，或者转变成现金会对资产价格造成重大不利影响的风险。流动性风险按照其来源可以分为两类：

(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，流动性好；而在另一些时期，可能成交稀少，流动性差。在市场流动性相对不足时，交易变现有可能增加变现成本，对集合资产管理计划造成不利影响。

(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，即使在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，从而使得集合资产管理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。

## 5、信用风险

信用风险是指交易对手方未能实现交易时的承诺，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、可转换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，集合资产管理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，将使集合资产管理计划面临交易对手的信用风险。

## 6、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。

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交纳的款项，并加计银行同期活期存款利息。

## 7、投资债券等标准化固定收益类品种特定风险

债券等固定收益类品种除存在上述市场风险、信用风险和流动性风险等外，还存在其自身的特定风险，包括：

(1) 再投资风险：债券偿付本息后以及回购到期后可能由于市场利率的下降面临资金再投资的收益率低于原来利率。

(2) 债券回购风险：债券回购为提升整体投资组合收益提供了可能，但也存在一定的风险。债券回购的主要风险包括信用风险、投资风险及波动性加大的风险，其中，信用风险指回购交易中交易对手在回购到期时，不能偿还全部或部分证券或价款，造成计划损失的风险；投资风险是指在进行回购操作时，回购利率大于债券投资收益而导致的风险以及由于回购操作导致投资总量放大，致使整个投资组合风险放大的风险；而波动性加大的风险是指在进行回购操作时，在对

投资组合收益进行放大的同时，也对投资组合的波动性（标准差）进行了放大，即投资组合的风险将会加大。回购比例越高，风险暴露程度也就越高，对计划造成损失的可能性也就越大。

### 8、业绩报酬提取风险

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

### 9、税收风险

契约式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。

### 10、资金前端控制风险

根据证券交易资金前端风险控制要求，需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行额度限制。当某笔竞价交易申报导致关联交易单元全天净买入申报金额达到或者超过其自设额度限制的，交易所技术系统拒绝接受该关联交易单元后续竞价交易买入申报。在发生未能及时撤销竞价交易买入申报（债券质押式回购卖出申报）或竞价交易卖出成交（债券质押式回购买入成交）以达到全天净买入金额低于其自设额度以及向交易所申请临时调整额度来不及时，本资管计划将面临不能及时进行交易所竞价交易买入的风险。

### 11、其他风险

(1) 关联交易风险。管理人可以将集合计划的资产投资于管理人及与管理人有关联方关系的公司、托管人及与托管人有关联方关系的公司发行或承销的证券。关联交易可能造成投资者误解，产生法律纠纷。

(2) 技术风险。在集合资产管理计划的日常交易中，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、证券交易所、证券登记结算机构等。

(3) 操作风险，操作风险是指那些由于不合理的内部程序，人为造成的或者是系统性的，由外部事件引发损失的风险。

(4) 不可抗力。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，可能导致委托资产的损失，从而带来风险。

(5) 管理人、托管人因停业、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。

(6) 金融市场危机、行业竞争、托管行违约等超出管理人自身直接控制能力之外的风险，也可能导致投资者利益受损。

(7) 其他不可预知、不可防范的风险。

#### (四) 本集合计划特有风险

1、集合计划达到一定规模或一定人数时，管理人有权停止认/申购。投资者可能面临因上述原因而无法参与本集合计划的风险。

2、本集合计划存续期间，当计划的投资者少于 2 人，集合计划将终止。投资者可能面临集合计划因上述原因终止而停止投资的风险。

3、当投资者某笔退出导致其剩余持有份额对应的资产净值小于【40】万元时，该部分份额将被强制退出。强制退出会导致投资者的计划份额减少至零。

4、本合同签署后，因法律、法规、规章、中国证监会的规定、中国证券业协会、基金业协会自律管理规则、证券登记结算机构业务规则以及证券交易所交易规则颁布或修订，管理人和托管人协商一致后，可对本合同与上述法律法规和相关政策不一致的地方进行更新或修改并及时在管理人网站公告修改内容。更新或修改的内容在管理人网站公告满五个个工作日后生效。投资者可能面临由于上述原因发生合同变更的风险。

5、除因法律、法规、规章、中国证监会的规定、中国证券业协会、基金业协会自律管理规则、证券登记结算机构业务规则以及证券交易所交易规则颁布或修订以外的合同变更时，管理人将向投资者发送合同变更征询意见函，投资者可选择在开放期退出或继续参与本集合计划。部分投资者可能因为未能提供有效的联系方法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。另外，合同中约定：

(1) “投资者不同意变更的，应在征询意见发出后的最近一个开放期或临时开放期内（以下统称“指定开放期”）提出退出本集合计划的申请；投资者未在前述时间回复意见的也未在指定开放期退出计划的，视为投资者同意合同变更”，在此情况下，投资者对默认情况的忽略或误解，可能存在潜在风险。

(2) “对于明确答复不同意合同变更但逾期未退出本集合计划的投资者，管理人将统一在合同变更生效日次一工作日做强制退出处理(退出价格为退出当日的计划单位净值)”，在此情况下，会导致投资者的计划份额减少至零。

#### 6、税收政策相关风险

本合同第二十章约定收取的管理费、托管费、业绩报酬（若有）均不含“资管产品运营过程中发生的增值税应税行为”需缴纳的增值税及附加。本计划在运营过程中发生的增值税等应税行为需缴纳的增值税及相关附加，由委托资产承担，将导致集合计划收益减少，净值下降，从而带来风险。

7、本集合计划成立后，相关材料需要报相关监管机构或自律组织等备案。管理人按照监管机构或自律组织等的要求补正可能涉及到本合同的修改，管理人届时与托管人达成一致后公告补正后的合同，各方按补正后的合同享有权利、履行义务。上述合同的修改会给投资者带来一定的风险。

8、金融产品的投资风险：金融产品的投资风险包括发行人的信用风险和管理能力风险。发行人的信用风险指金融产品发行人在产品运行过程中违反相关合同约定的风向；发行人的管理能力风险是指在市场波动情况下，金融产品发行人选择具体投资标的时体现出的风险，

9、净值波动风险：本产品不设预期收益率，投资者将面临产品净值波动的风险。

以上所述因素可能会给本集合计划投资带来特殊风险。

#### （五）特别提示

本集合计划依法设立，投资者在申请参与本集合计划之前应认真阅读集合资产管理合同及说明书等集合计划文件，并确保理解相关条款和业务规则，包括但不限于：

##### 1、提前终止条款

存续期内，本集合计划投资者不足2人时，本集合计划提前终止。

##### 2、强制退出条款

单个投资者退出后其持有的份额对应的资产净值最低为【40】万元。若某笔退出导致该投资者剩余持有的份额对应的资产净值低于【40】万元，则管理人对该余额部分作强制退出处理。强制退出会导致投资者的计划份额减少至零。

### 3、巨额退出事件风险

在集合计划存续期间可能发生投资者大量甚至巨额退出集合计划的情形，若出现合同约定的巨额退出，将可能导致集合计划面临流动性风险，增加集合计划所持有证券的变现成本，造成计划资产损失。对于投资者而言，在发生巨额退出时可能面临所持有集合计划份额被部分顺延退出或暂停退出的风险。

## 二十四、资产管理合同的变更、终止及清算

### （一）资产管理合同变更的条件、程序

1、本合同签署后，因法律、法规、规章、中国证监会的规定、证券业协会及中国基金业协会自律管理规则、证券登记结算机构业务规则以及证券交易所等交易规则颁布或修订，自相关规定颁布或修订生效之日起，本合同相关内容及条款按该颁布或修订的规定变更并在管理人网站公告。管理人可与托管人协商，可以对本集合计划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，更新或修改的内容通过管理人指定网站公告形式向投资者披露。投资者对更新或修改的内容有异议，可在更新或修改内容披露后五个工作日内按照本合同的规定申请退出本集合计划，更新或修改内容披露满五个工作日后生效。

本集合计划成立后，相关材料需要报相关监管机构或自律组织等备案。管理人按照监管机构或自律组织等的要求补正备案材料涉及到本合同修改的，管理人经与托管人协商一致后由管理人公告补正合同，补正的内容通过管理人指定网站公告的形式向投资者披露，投资者有权选择是否在补正公告披露后五个工作日内按照本合同的规定申请退出本集合计划，补正公告披露满五个工作日后生效。

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并在管理人指定网站公告。管理人须在公告后二个工作日内以管理人指定网站公告方式向投资者发布合同变更征询意见函。投资者不同意变更的，应在投资者收到合同变更征询意见函的五个工作日内（以下统称“指定开放期”）提出退出本集合计划的申请；投资者未在前述时间回复意见也未在指定开放期退出计划的，视为投资者同意合同变更。投资者不同意变更的，管理人对其采取如下权利保障措施及后续安排：

投资者不同意变更的，管理人保障其退出集合计划的权利；对于明确答复不同意合同变更但逾期未退出本集合计划的投资者，管理人将统一在合同变更生效日次一工作日做强制退出处理（退出价格为退出当日的计划单位净值）。

合同变更于指定开放期结束后的第一个工作日起生效，公告内容即成为本合同组成部分。

3、资产管理合同发生变更的，管理人应当自资产管理合同变更之日起五个工作日内报证券投资基金业协会备案，并抄报中国证监会相关派出机构。

## （二）特殊变更事项的处理

1、管理人发生被依法撤销资产管理业务资格或者依法解散、被撤销、宣告破产等情形，资产管理计划由其他管理人承接的，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。

2、托管人发生被依法撤销基金托管资格或者依法解散、被撤销、宣告破产等情形，资产管理计划由其他托管人承接的，管理人应在征求全体投资者意见后，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。

## （三）集合计划的展期

### 1、展期的条件

(1) 在存续期间，本集合计划运营规范，管理人、托管人未违反法律、行政法规、中国证监会规定及资产管理合同的约定；

(2) 展期没有损害投资者利益的情形；

(3) 中国证监会规定的其他条件。

### 2、展期的程序和安排

#### (1) 展期的公告

集合计划符合展期条件拟展期时，管理人应当在计划存续期届满前1个月征询托管人是否同意继续托管展期后的集合计划资产。在获得托管人同意后，管理人在管理人指定网站（www.chinalin.com）上公告，并将同时公告集合计划的具体展期方案。

## (2) 投资者答复

管理人应在上述公告后 10 个工作日内通过管理人指定网站公告，征求投资者意见，投资者应根据管理人指定网站公告要求在规定的期限内明确意见。若投资者同意本集合计划展期，则投资者应根据管理人指定网站公告要求在规定的期限内向管理人出具书面同意意见。截至存续期届满日，投资者未给出明确答复的，视为不同意展期。

## (3) 不同意展期的投资者所持有份额的处理办法

展期经管理人指定网站公告后，管理人将在本集合计划原存续期届满之日起按照本合同约定将不同意展期的投资者份额全部退出。

## (4) 展期的成立

存续期满，集合计划符合展期条件，并且同意本集合计划展期的投资者不少于 2 人，存续委托资产不低于人民币 1000 万元，本集合计划在原存续期届满日的次日实现展期，否则本集合计划不能展期。

## (5) 展期的失败

集合计划展期的，应当符合集合计划的成立条件；若未满足成立条件，本集合计划展期失败。集合计划展期失败，本集合计划将进入清算终止程序。

### 3、展期的期限

管理人应在公告具体展期方案时确定展期的具体期限，每次展期期限不超过三年。

4、资产管理计划展期的，管理人应当自资产管理合同展期之日起五个工作日内报证券投资基金业协会备案，并抄报中国证监会相关派出机构。

### (四) 有下列情形之一的，集合计划应当终止：

- 1、资产管理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、持有人大会决议提前终止资产管理合同（如有）；
- 4、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；
- 5、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；

- 6、持续五个工作日投资者少于2人的；
- 7、未在证券投资基金业协会完成备案或不予备案的情形；
- 8、法律、行政法规、本合同及中国证监会规定的其他终止情形。

管理人应当自资产管理计划终止之日起五个工作日内报证券投资基金业协会备案，并抄报中国证监会相关派出机构，前述第7项约定的情形除外。

#### （五）集合计划的清算

1、自集合计划终止之日起5个工作日内管理人根据监管要求开始组织清算资产管理计划资产，资产管理计划财产清算小组成员由管理人和托管人组成，清算小组可以聘用必要的工作人员。资产管理计划财产清算小组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、集合计划财产清算的程序：

- (1) 集合计划终止后，由财产清算小组对集合计划资产进行清理和确认；
- (2) 对集合计划财产和债券债务进行清理和确认；
- (3) 对集合计划财产进行估值和变现；
- (4) 制作清算报告，将清算报告按监管要求报相关自律组织及监管机构和投资者；
- (5) 对集合计划财产进行分配和返还。

3、集合计划清算费用包括聘请会计师事务所清算审计费用（如有）及其他清算活动过程中可能产生的费用。以上清算费用由集合计划承担，由管理人向托管人发出划款指令，将清算费用划至指定账号；

4、管理人和托管人应当在扣除清算费用、管理费、业绩报酬及托管费等费用后，将集合计划资产按照投资者拥有集合计划份额的比例或集合资产管理合同的约定以货币资金的形式全部分派给投资者，若本集合计划未持有流通受限的证券，则本集合计划清算结束，注销集合计划证券账户和托管账户；

管理费、托管费计提规则是以当日资产净值为基数在下一日计提，对于合同最后一日管理费、托管费则以当日资产净值为基数在当日计提；

管理人应匡算合同终止日下一个季度的最低备付金及交易保证金，并保证有足够的资金进行场内清算；

5、集合计划因委托财产流动性受限等原因延期清算的，管理人应当及时向中国证监会相关派出机构和证券投资基金业协会报告；

6、若本集合计划在终止之日有未能流通变现的证券，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在可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，以货币形式全部分配给投资者，并注销集合计划证券账户和托管账户；

7、集合计划清算过程中的有关重大事项应当及时公布；

8、集合计划清算结束后5个工作日内，由管理人通过管理人指定网站向投资者公布清算结果，并向中国证监会相关派出机构和证券投资基金业协会备案；

9、集合计划财产清算完毕后，托管人按照监管要求注销集合计划财产的专用证券账户、银行间债券交易账户、托管账户等投资所需账户，管理人应给予必要的配合；

10、集合计划财产清算账册及文件由管理人保存20年以上。

## 二十五、违约责任

(一) 资产管理合同当事人违反本合同的约定，应当承担违约责任；给合同其他当事人造成损失的，应当承担赔偿责任。本合同能够继续履行的应当继续履行。

(二) 但是发生下列情况的，当事人可以免责：

1、不可抗力。一方因不可抗力不能履行本合同时，应及时通知另一方，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集合计划资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等监管机构的规定作为或不作为而造成的损失等；

3、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、托管人执行管理人的生效指令对集合计划资产造成的损失；
- 5、相关法律、行政法规和规定的变更。

(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)由于管理人、托管人不可抗力的因素导致业务出现差错，管理人和托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现错误的，由此造成计划财产或投资者损失，管理人和托管人免除赔偿责任。但是管理人和托管人应积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

(五)一方当事人依据本合同向另一方当事人赔偿的损失，仅限于直接损失。

(六)管理人违反法律、行政法规的有关规定，被中国证监会依法撤销证券资产管理业务许可、责令停业整顿，或者因停业、解散、撤销、破产等原因不能履行职责的，应当按照有关监管要求妥善处理有关事宜。

(七)托管人对于没有保管在托管人处的有价证券及其他集合计划资产不负有保管责任，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。

(八)投资者的债权人通过司法机关对集合计划资产采取强制措施，由此造成集合计划资产损失的，管理人和托管人不承担任何责任。

(九)在投资者的集合计划资产被司法机关或其他政府机构扣押和查封的情况下，管理人和托管人没有义务代表投资者就针对集合计划资产所提起的司法或行政程序进行答辩，但是可以提供必要的协助。

## 二十六、争议的处理

- (一)本合同适用中华人民共和国（不含港澳台地区）法律，并从其解释。
- (二)因履行本合同发生的争议，由协议签订各方协商解决，协商不成的，任何一方均有权将争议提交【深圳仲裁委员会】进行仲裁，按照仲裁时届时有效的仲裁规则进仲裁，仲裁地点在深圳，仲裁是终局的，对各方都有约束力。

## 二十七、资产管理合同的效力

### (一) 合同的成立

本合同通过书面方式签署。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。投资者为法人的，资产管理合同自投资者、管理人和托管人加盖公章或合同专用章以及各方法定代表人/负责人或授权代表签字或盖章之日起成立；投资者为自然人的，资产管理合同自投资者本人签字、管理人和托管人加盖公章或合同专用章以及双方法定代表人/负责人或授权代表签字或盖章之日起成立。

### (二) 合同的生效

1、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) 管理人公告本集合计划成立。

2、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。

### (三) 本合同的有效期限

本合同有效期限【5年】。本合同到期终止后，本合同项下的清算条款、违约责任条款、争议解决条款仍然有效。

(四) 投资者自签订资产管理合同即成为本合同的当事人。在本集合计划存续期间，投资者自全部退出集合计划之日起，该投资者不再是本合同的当事人。

### (五) 合同的组成

1、《华林证券满堂红汇利1号FOF集合资产管理计划说明书》、《华林证券满堂红汇利1号FOF集合资产管理计划风险揭示书》是管理人对于本集合计划重要事项的说明，是本合同重要附件，与合同具有同等法律效力。

2、经管理人确认有效的投资者参与、退出本集合计划的申请材料和各销售机构出具的集合计划参与、退出业务受理有关凭证、投资者通过电子签名方式产生的数据电文等为本合同的附件，是本合同不可分割的一部分，与合同具有同等法律效力。

## 二十八、其他事项

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

管理人承诺按照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理运用资产管理计划财产，不保证资产管理计划财产一定盈利，也不保证最低收益。业绩报酬（若有）比较基准用于计算业绩报酬，不构成管理人、托管人、销售机构保证委托财产本金不受损失或取得最低收益的承诺。

本合同应由投资者本人签署，当投资者为机构时，应由法定代表人或其授权代表签署并加盖其公章。

本合同一式五份，管理人、托管人、投资者各执一份，其余二份按照有关监管部门的要求备案，每份均具有同等法律效力。

本页无正文，为合同编号为 HL(2022)JH 字第 2 号《华林证券满堂红汇利 1 号 FOF 集合资产管理计划资产管理合同》签字页。

委托人：

个人（签字）：

机构（盖章）：

证件类型及号码：

法定代表人或授权代理人：

签署日期：



## 附件一：募集结算专用账户信息

华林证券满堂红汇利1号FOF集合资产管理计划募集结算专用账户信息如下：

户名：华林证券股份有限公司（清算专户）

账号：443899991010006834543

开户银行：交通银行深圳华融支行

大额支付行号：301584000475

销售机构委托募集账户信息如下：

账户：

账号：

开户银行：

大额支付行号：

## 附件二：资产管理计划风险揭示书

# 资产管理计划风险揭示书

尊敬的投资者：

投资有风险。当您/贵机构参与资产管理计划时，可能获得投资收益，但同时也面临着投资亏损的风险。您/贵机构在作出投资决策之前，请仔细阅读本风险揭示书和资产管理合同，充分认识本计划的风险收益特征和产品特性，认真考虑资产管理计划存在的各项风险因素，并充分考虑自身的风险承受能力，理性判断并谨慎作出投资决策。

根据有关法律法规，管理人华林证券股份有限公司及投资者分别作出如下承诺、风险揭示及声明：

### 一、管理人声明与承诺

(一) 管理人向投资者声明，中国证券投资基金业协会（以下简称“证券投资基金业协会”）为资产管理计划办理备案不构成对管理人投资能力、持续合规情况的认可；不作为对资产管理计划财产安全的保证。

(二) 管理人保证在投资者签署资产管理合同前已（或已委托销售机构）向投资者揭示了相关风险；已经了解投资者的风险偏好、风险认知能力和承受能力。

(三) 管理人承诺按照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理运用资产管理计划财产，不保证资产管理计划财产一定盈利，也不保证最低收益。

### 二、风险揭示

#### (一) 特殊风险揭示

1、资产管理合同与证券投资基金业协会合同指引不一致所涉风险：

本资产管理合同依据中国基金业协会发布的《集合资产管理计划资产管理合同内容与格式指引（试行）》（以下简称“《指引》”）、《资产管理计划风险揭示书内容与格式指引（试行）》及相关法律法规制定。《指引》规定，在不违反相关法律法规、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》、《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》、《指引》以及其他有关规定的前提下，资产管理合同当事人可以根据实际情况约定本指引规定内容之外的事项。《指引》部分具体要求对当事人确不适用的，当事人可对相应内容做出合理调整和变动。本合同中对《指引》规定内容之外的部分事项进行约定，也可能存在个别内容与《指引》不一致，或不适用《指引》中个别规定的情形，可能对投资者合法权益造成影响。

#### 2、合同变更的风险

在一般情况下，管理人与托管人对合同变更事宜达成一致后，管理人在管理人网站通告委托人并明确合同变更征询期，并有权设置特殊赎回开放日，不同意合同变更的委托人，应在该赎回开放日办理本集合计划的退出事宜，委托人未退出的视为同意合同变更。征询期满后管理人即可确定变更生效日期。合同变更的征询函、公告、通知等，管理人将仅通过管理人网站发布，而不会单独通知每个

委托人，委托人应及时关注该网站内容。

### 3、资产管理计划份额转让所涉风险：

本计划成立后，管理人可以按照规定申请份额转让事宜。份额转让交易平台可以是证券交易所，也可以是中国证监会认可的其他交易平台。投资者通过交易平台转让份额需自行寻找受让方，份额转让价格由投资者与受让方协商确定，产生的转让费用由投资者自行承担，投资者份额转让价格与集合计划份额净值可能不一致。

### 4、资产管理计划未在证券投资基金管理协会完成备案手续或不予备案情形所涉风险

资产管理计划成立日五个工作日内将进行中国证券投资基金管理协会备案申请，可能存在管理人未履行备案手续或者资产管理计划不符合备案要求等原因致使资产管理计划备案失败，从而给资产管理计划财产带来损失的风险。

## （二）FOF 产品特有风险

### 1、FOF 产品管理模式特有风险

各类不同资产及投资策略在不同的市场环境下表现不同，管理人根据资产配置模型进行大类资产配置，并筛选市场上各个策略的投资策略资产进行投资。各个策略资产的表现可能高于预期，也可能低于预期；可能由于管理人对策略资金分配不当，导致集合计划资产亏损。反之，也可能出现管理人资金分配合理，但由于具体策略的投资管理人投资管理能力不佳造成的资产亏损。

### 2、投资资产管理产品的风险

本集合计划部分资产将配置于公开募集证券投资基金、受国务院金融监督管理机构监管的机构发行的其他资产管理产品（含私募证券投资基金），投资上述资产管理产品可能因下列特定风险因素给本计划造成不利影响，请投资者知悉。

#### （1）资产管理产品管理人风险

资产管理产品管理人风险包括管理人经营风险和操作风险。经营风险是指因管理能力、财务状况、行业竞争、人员素质、内控等因素导致公司经营不善，极端情况下甚至破产倒闭，可能对其管理人的产品业绩造成不利影响。本集合计划主要投资于公募中长期纯债基金，短债基金，同业存单指数基金，公募 REITs；投资以绝对收益为目标的量化对冲，宏观对冲，中性策略的私募基金等产品。对于约定了止损条款的资产管理产品，可能因管理人未及时操作导致产品损失扩大的风险。

#### （2）资产管理产品投资风险

本集合计划所投资的资产管理产品可能由于其管理人对市场判断失误、买入标的市场表现不佳、风险控制失效等原因造成产品净值的下降，从而造成集合计划净值下降，最终导致集合计划投资者资产损失。

#### （3）策略模型风险

在实际运作中，因资产管理产品的基金经理变更导致模型无法有效运作，开发的策略或模型不再有效或者在运作过程中与产品期初投资策略和投资风格发生偏离，进而影响产品投资业绩。

#### （4）集合计划所投资的资产管理产品因流动性问题导致赎回资金延迟到账风险

因本集合计划投资者退出或资产配置调整需要，管理人赎回所投资的资产管理产品时，可能面临资产管理产品不在开放期，也可能面临资产管理产品触发大额赎回或巨额赎回条款，从而导致赎回资金延迟到账的风险。

### (5) 投资资产管理产品可能面临双层收费的风险

本集合计划投资者需要承担双层费用，即集合计划费用及集合计划所投资的资产管理产品自身需要承担费用。集合计划所投资的资产管理产品自身需要承担费用包括资产管理产品的管理费、托管费、业绩报酬（如有）、认购费或参与费（如有）、赎回费（如有）等，以上费用在计提时将会扣减资产管理产品的资产净值，从而造成集合计划净值下降。

### (6) 投资的多个资产管理产品估值时间不一致导致集合计划单位净值可能无法反映真实投资管理情况的风险

本集合计划投资多个资产管理产品，每个资产管理产品的估值时间可能不一致，且披露时间可能不一致，在存续期间，集合计划单位净值可能无法反映真实投资管理情况。

### (7) 底层资产管理产品提取业绩报酬对集合计划净值造成下跌的风险

本集合计划按照资产管理产品虚拟计提业绩报酬后的单位净值进行估值，若投资的资产管理产品未能提供的，可按产品的单位净值进行估值。本集合计划投资多个资产管理产品，每个资产管理产品在业绩报酬计提方式、业绩报酬计提时间以及产品估值时间与本集合计划层面可能不一致。对于按照底层资产管理产品的单位净值进行估值的，当底层资产管理产品提取业绩报酬后造成集合计划净值下降、投资者持有集合计划份额期间收益下降的风险。

## （三）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资产管理计划财产，但不保证资产管理计划财产中的认（申）购资金本金不受损失，也不保证一定盈利及最低收益。

本计划为「混合类基金中基金」集合资产管理计划（FOF），属于[R3]风险投资品种，适合专业投资者及风险识别、评估、承受能力为「C3（稳健型）、C4（积极型）、C5（激进型）」的合格投资者。

### 2、市场风险

资产管理计划的投资品种价格因受经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素影响而引起的波动，导致收益水平变化产生的风险。主要包括但不限于：

#### ① 政策风险

货币政策、财政政策、产业政策等国家宏观经济政策的变化对资本市场产生一定的影响，导致市场价格波动，影响资产管理计划的收益而产生风险。

#### ② 经济周期风险

经济运行具有周期性的特点，受其影响，资产管理计划的收益水平也会随之发生变化，从而产生风险。

#### ③ 利率、汇率风险

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，使资产管理计划的收益水平随之发生变化，从而产生风险。汇率波动范围将影响国内资产价格的重估，从而影响委托资产的净值。

#### ④ 购买力风险

资产管理计划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，从而使资产管理计划的实际收益下降。

### ⑤ 再投资风险

投资者为了实现购买债券时所确定的收益相等的收益，这些临时的现金流就必须按照等于买入债券时确定的收益率进行再投资。如果这些临时性的现金流不得不以较低的利率进行再投资，这种风险就称为再投资风险。如果投资者只购买了短期债券，而没有购买长期债券，就会有再投资风险。再投资风险还是一个利率风险问题。

### 3、管理风险

资产管理计划运作过程中，管理人依据资产管理合同约定管理和运用资产管理计划财产所产生的风险，由资产管理计划财产及投资者承担。投资者应充分知晓投资运营的相关风险，其风险应由投资者自担。

### 4、流动性风险

资产管理计划因市场整体或投资品种流动性不足、应付可能出现的投资者巨额退出或大额退出等原因，不能迅速转变成现金，或者转变成现金会对资产价格造成重大不利影响的风险。流动性风险按照其来源可以分为两类：

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，流动性好；而在另一些时期，可能成交稀少，流动性差。在市场流动性相对不足时，交易变现有可能增加变现成本，对集合资产管理计划造成不利影响。

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，即使在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较差，从而使得集合资产管理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。

### 5、信用风险

信用风险是指交易对手方未能实现交易时的承诺，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、可转换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，集合资产管理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，将使集合资产管理计划面临交易对手的信用风险。

### 6、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。

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交纳的款项，并加计银行同期活期存款利息。

### 7、投资债券等标准化固定收益类品种特定风险

债券等固定收益类品种除存在上述市场风险、信用风险和流动性风险等外，还存在其自身的特定风险，包括：

① 再投资风险：债券偿付本息后以及回购到期后可能由于市场利率的下降面临资金再投资的收益率低于原来利率。

② 债券回购风险：债券回购为提升整体投资组合收益提供了可能，但也存在一定的风险。债券回购的主要风险包括信用风险、投资风险及波动性加大的风险，其中，信用风险指回购交易中交易对手在回购到期时，不能偿还全部或部分证券或价款，造成计划损失的风险；投资风险是指在进行回购操作时，回购利率大于债券投资收益而导致的风险以及由于回购操作导致投资总量放大，致使整个投资组合风险放大的风险；而波动性加大的风险是指在进行回购操作时，在对投资组合收益进行放大的同时，也对投资组合的波动性（标准差）进行了放大，即投资组合的风险将会加大。回购比例越高，风险暴露程度也就越高，对计划造成损失的可能性也就越大。

## 8、业绩报酬提取风险

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

## 9、税收风险

契约式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。

## 10、资金前端控制风险

根据证券交易资金前端风险控制要求，需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行额度限制。当某笔竞价交易申报导致关联交易单元全天净买入申报金额达到或者超过其自设额度限制的，交易所技术系统拒绝接受该关联交易单元后续竞价交易买入申报。在发生未能及时撤销竞价交易买入申报（债券质押式回购卖出申报）或竞价交易卖出成交（债券质押式回购买入成交）以达到全天净买入金额低于其自设额度以及向交易所申请临时调整额度来不及时，本资管计划将面临不能及时进行交易所竞价交易买入的风险。

## 11、其他风险

① 关联交易风险。管理人可以将集合计划的资产投资于管理人及与管理人有关联方关系的公司、托管人及与托管人有关联方关系的公司发行或承销的证券。关联交易可能造成投资者误解，产生法律纠纷。

② 技术风险。在集合资产管理计划的日常交易中，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、证券交易所、证券登记结算机构等。

③ 操作风险，操作风险是指那些由于不合理的内部程序，人为造成的或者是系统性的，由外部事件引发损失的风险。

④ 不可抗力风险。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，可能导致委托资产的损失，从而带来风险。

⑤ 管理人、托管人因停业、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。

⑥ 金融市场危机、行业竞争、托管行违约等超出管理人自身直接控制能力之外的风险，也可能导致投资者利益受损。

⑦ 其他不可预知、不可防范的风险。

## 12、本集合计划特有风险

① 集合计划达到一定规模或一定人数时，管理人有权停止认/申购。投资者可能面临因上述原因而无法参与本集合计划的风险。

②本集合计划存续期间，当计划的投资者少于2人，集合计划将终止。投资者可能面临集合计划因上述原因终止而停止投资的风险。

③当投资者某笔退出导致其剩余持有份额对应的资产净值小于【40】万元时，该部分份额将被强制退出。强制退出会导致投资者的计划份额减少至零。

④本合同签署后，因法律、法规、规章、中国证监会的规定、中国证券业协会、基金业协会自律管理规则、证券登记结算机构业务规则以及证券交易所交易规则颁布或修订，管理人和托管人协商一致后，可对本合同与上述法律法规和相关政策不一致的地方进行更新或修改并及时在管理人网站公告修改内容。更新或修改的内容在管理人网站公告满五个个工作日后生效。投资者可能面临由于上述原因发生合同变更的风险。

⑤除因法律、法规、规章、中国证监会的规定、中国证券业协会、基金业协会自律管理规则、证券登记结算机构业务规则以及证券交易所交易规则颁布或修订以外的合同变更时，管理人将向投资者发送合同变更征询意见函，投资者可选择在开放期退出或继续参与本集合计划。部分投资者可能因为未能提供有效的联系方法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。另外，合同中约定：

a、“投资者不同意变更的，应在征询意见发出后的最近一个开放期或临时开放期内（以下统称“指定开放期”）提出退出本集合计划的申请；投资者未在前述时间回复意见的也未在指定开放期退出计划的，视为投资者同意合同变更”，在此情况下，投资者对默认情况的忽略或误解，可能存在潜在风险。

b、“对于明确答复不同意合同变更但逾期未退出本集合计划的投资者，管理人将统一在合同变更生效日次一工作日做强制退出处理（退出价格为退出当日的计划单位净值）”，在此情况下，会导致投资者的计划份额减少至零。

#### ⑥税收政策相关风险

本合同第二十章约定收取的管理费、托管费、业绩报酬（若有）均不含“资管产品运营过程中发生的增值税应税行为”需缴纳的增值税及附加。本计划在运营过程中发生的增值税等应税行为需缴纳的增值税及相关附加，由委托资产承担，将导致集合计划收益减少，净值下降，从而带来风险。

⑦本集合计划成立后，相关材料需要报相关监管机构或自律组织等备案。管理人按照监管机构或自律组织等的要求补正可能涉及到本合同的修改，管理人居时与托管人达成一致后公告补正后的合同，各方按补正后的合同享有权利、履行义务。上述合同的修改会给投资者带来一定的风险。

⑧金融产品的投资风险：金融产品的投资风险包括发行人的信用风险和管理能力风险。发行人的信用风险指金融产品发行人在产品运行过程中违反相关合同约定的风向；发行人的管理能力风险是指在市场波动情况下，金融产品发行人在选择具体投资标的时体现出的风险，

⑨净值波动风险：本产品不设预期收益率，投资者将面临产品净值波动的风险。

以上所述因素可能会给本集合计划投资带来特殊风险。

### 13、特别提示

本集合计划依法设立，投资者在申请参与本集合计划之前应认真阅读集合资产管理合同及说明书等集合计划文件，并确保理解相关条款和业务规则，包括但不限于：

#### ①提前终止条款

存续期内，本集合计划投资者不足2人时，本集合计划提前终止。

#### ②强制退出条款

单个投资者退出后其持有的份额对应的资产净值最低为【40】万元。若某笔退出导致该投资者剩余持有的份额对应的资产净值低于【40】万元，则管理人对该余额部分作强制退出处理。强制退出会导致投资者的计划份额减少至零。

#### ③巨额退出事件风险

在集合计划存续期间可能发生投资者大量甚至巨额退出集合计划的情形，若出现合同约定的巨额退出，将可能导致集合计划面临流动性风险，增加集合计划所持有证券的变现成本，造成计划资产损失。对于投资者而言，在发生巨额退出时可能面临所持有集合计划份额被部分顺延退出或暂停退出的风险。

### 三、投资者声明

作为本计划的投资者，本人/机构已充分了解并谨慎评估自身风险承受能力，自愿自行承担投资该计划所面临的风险。本人/机构作出以下陈述和声明，并确认（自然人投资者在每段段尾“【      】”内签名，机构投资者在本页、尾页盖章，加盖骑缝章）其内容的真实和正确：

1、本人/机构已仔细阅读资产管理业务相关法律文件和其他文件，充分理解相关权利、义务、本计划运作方式及风险收益特征，愿意承担由上述风险引致的全部后果。【      】

2、本人/机构知晓，管理人、销售机构、托管人及相关机构不应当对资产管理计划财产的收益状况作出任何承诺或担保。【      】

3、本人/机构符合《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》有关合格投资者的要求，并已按照管理人或销售机构的要求提供相关证明文件。  
【      】

4、本人/机构已认真阅读并完全理解资产管理合同的所有内容，并愿意自行承担购买资产管理计划的法律责任。【      】

5、本人/机构已认真阅读并完全理解资产管理合同 第四章 “当事人及权利义务”的所有内容，并愿意自行承担购买资产管理计划的法律责任。  
【      】

6、本人/机构已认真阅读并完全理解资产管理合同 第五章 “集合资产管理计划的基本情况”的所有内容，并愿意自行承担购买资产管理计划的法律责任。  
【      】

7、本人/机构已认真阅读并完全理解资产管理合同第二十章“集合计划的费

用与税收”中的所有内容。【\_\_\_\_\_】

8、本人/机构已认真阅读并完全理解资产管理合同第二十五章“违约责任”与第二十六章“争议的处理”中的所有内容。【\_\_\_\_\_】

9、本人/机构已经配合管理人或其销售机构提供了法律法规规定的信息资料及身份证明文件，以配合上述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以及反洗钱等监管规定的工作。

本人/机构承诺上述信息资料及身份证明文件真实、准确、完整、有效。

【\_\_\_\_\_】

10、本人/机构知晓，证券投资基金业协会为资产管理计划办理备案不构成对管理人投资能力、持续合规情况的认可；不作为对资产管理计划财产安全的保证。【\_\_\_\_\_】

11、本人/机构承诺本次投资行为是为本人/机构购买（参与）资产管理计划。【\_\_\_\_\_】

12、本人/机构承诺不以非法拆分转让为目的购买资产管理计划，不会突破合格投资者标准，将资产管理计划份额或其收益权进行非法拆分转让。

【\_\_\_\_\_】

13、本人/机构知悉本风险揭示书的揭示事项仅为列举性质，未能详尽列明投资者参与资产管理计划所面临的全部风险和可能导致投资者资产损失的所有因素。【\_\_\_\_\_】

投资者（自然人签字或机构盖章）：

日期：

管理人（盖章）：

日期：

销售机构经办人（签字） [集合资产管理计划适用]：

日期：