

合同编号：HL(2026)JH字第1号

# 华林证券固盈稳融1号集合资产管理计划 资产管理合同

计划类型：集合资产管理计划（固定收益类）

管理人：华林证券股份有限公司

托管人：中信证券股份有限公司

二〇二六年一月

# 目 录

一、前言	3
二、释义	4
三、承诺与声明	7
四、当事人及权利义务	10
五、集合计划的基本情况	16
六、集合计划的募集	19
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	23
九、集合计划份额持有人大会及日常机构	33
十、集合计划份额的登记	33
十一、集合计划的投资	33
十二、服务机构及投资顾问	41
十三、集合计划的分级	41
十四、利益冲突及关联交易	41
十五、投资经理的指定与变更	44
十六、集合计划的财产	45
十七、集合计划投资指令的发送、确认与执行	48
十八、交易及交收清算安排	51
十九、越权交易的界定	53
二十、集合计划财产的估值与会计核算	55
二十一、集合计划的费用与税收	59
二十二、集合计划的收益分配	63
二十三、集合计划的信息披露与报告	64
二十四、风险揭示	67
二十五、集合计划的变更、终止与财产清算	76
二十六、违约责任	80
二十七、争议的处理	81
二十八、资产管理合同的效力	82
二十九、其他事项	83
附件一：募集结算专用账户信息	85
附件二：资产管理计划风险揭示书	86

## 重要提示

**特别约定：**《华林证券固盈稳融 1 号集合资产管理计划资产管理合同》（以下简称“本合同”）以电子签名方式或纸质合同签订，管理人、托管人作为本合同的签署方，已经接受本合同项下的全部条款；华林证券固盈稳融 1 号集合资产管理计划的投资者作为本合同的一方，以电子签名或纸质合同的方式签署本合同即表明委托人完全接受本合同项下的全部条款，同时本合同成立。

投资者、管理人、托管人同意遵守《中华人民共和国民法典》《中华人民共和国电子签名法》《证券公司资产管理电子签名合同操作指引》的有关规定，三方一致同意委托人自签署《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。电子签名名册由管理人提供并保管。

## 一、前言

为规范华林证券固盈稳融1号集合资产管理计划(以下简称“集合计划”或“计划”)运作,明确《华林证券固盈稳融1号集合资产管理计划资产管理合同》(以下简称“本合同”、《集合资产管理合同》)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》(以下简称《证券法》)《中华人民共和国期货和衍生品法》《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》(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》)及《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》(以下简称《合同指引》)等法律法规、中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券业协会、中国证券投资基金业协会等相关自律组织的有关规定,投资者、管理人、托管人在平等自愿、公平、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,当事人按照监管规定、《华林证券固盈稳融1号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。

管理人应对资产管理计划的设立、变更等向基金业协会进行备案(具体以届时监管要求为准),并及时报送资产管理计划的运作情况、风险情况以及终止清算报告等信息。

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

## 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：指华林证券固盈稳融1号集合资产管理计划；

集合计划说明书、说明书：指《华林证券固盈稳融1号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《华林证券固盈稳融1号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；

风险揭示书：指《华林证券固盈稳融1号集合资产管理计划风险揭示书》；

《指导意见》：指中国人民银行、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》；

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、托管人：指中信证券股份有限公司；

销售机构：指管理人或与管理人签订《华林证券固盈稳融1号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；

投资顾问：投资顾问机构为管理人提供投资顾问服务；

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者，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；

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段；

工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所和北京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受托资产的行为；

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 20%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；

托管账户：资产托管人根据有关规定为资产管理计划财产开立的，专门用于资金收付、清算交收的专用银行账户；

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；

信义义务：是指托管人按恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则，根据相关法律法规和监管规定，在本合同约定范围内尽职尽责履行安全保管托管资产等托管人职责。

### 三、承诺与声明

#### (一) 管理人承诺与声明

1、在签订本合同前充分向投资者说明了有关法律法规和相关投资工具的运作市场及方式，并充分揭示了相关风险。

2、已经了解投资者的风险偏好、风险认知能力和承受能力，对投资者的财务状况进行了充分评估。

3、按照《基金法》恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用受托财产，不保证受托财产一定盈利，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、为保护投资者的利益，管理人郑重提示投资者：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，投资者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、合同变更等有关管理人向投资者披露的事项，管理人将通过管理人网站 [www.chinalin.com](http://www.chinalin.com) 发布，投资者应及时关注该网站内容。

## （二）托管人承诺与声明

1、按照《基金法》恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则安全保管受托财产，履行信义义务以及本合同约定的其他义务。

2、根据法律、行政法规、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、行政法规及合同约定履行托管人职责，维护投资者权益。

4、托管人根据法律法规或协议明确约定的投资范围、投资比例、投资限制、管理人书面提供的关联方名单（若有）等内容进行投资监督，对投资策略及其他合规性问题不承担任何形式的责任。

## （三）投资者承诺与声明

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、误导性陈述或者重大遗漏。前述信息资料如发生任何实质性变更，及时书面告知管理人或销售机构。

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》《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》《金融机构受益所有人识别管理办法》等反洗钱相关法律法规的规定，将严格遵守上述规定，不会违反任何前述规定；承诺用于投资的资金来源不属于违法犯罪所得及其收益；承诺投资的资金来源和去向不涉及洗钱、恐怖融资和逃税等行为；承诺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、受益所有人信息等资料；承诺积极履行反洗钱职责，不借助本业务进行洗钱等违法犯罪活动。

5、投资者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。如监管机构或管理人核查出存在规避监管要求的行为，投资者需及时配合管理人完成整改，如不配合完成整改，管理人有权要求投资者退出本计划。

6、签署和履行本合同系其真实意思表示。投资者为法人或依法成立的其他组织的，其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；投资者已经或将会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；投资者保证没有任何其他限制性条件妨碍管理人和托管人对该财产行使相关权利且该权利不会为任何其他第三方所质疑。

7、如果以上声明部分或全部不真实，投资者承担由此产生的法律责任并自行承担由此造成的损失。

## 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：\_\_\_\_\_

住所：\_\_\_\_\_

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、按照规定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；
- 5、认真阅读并签署风险揭示书；
- 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、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；
- 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、不得利用资产管理计划相关信息进行内幕交易或者其他不当、违法的证券期货业务活动；
- 11、保守商业秘密，不得泄露资产管理计划的投资计划、投资意向等依法依规提供信息的除外；
- 12、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）；
- 13、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

法定代表人：林立

住所：西藏自治区拉萨市柳梧新区国际总部城3幢1单元5层5号

联系地址：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

联系电话：0755-82707882-1151

网站：<http://www.chinalin.com/>

#### **（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、自行提供或者委托经中国证监会、证券投资基金业协会认可的服务机构为资产管理计划提供募集、份额登记、估值与核算、信息技术系统等服务，并对其行为进行必要的监督和检查；
- 5、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；
- 6、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法规规定、对资产管理计划财产及其他当事人的利益造成重大损失的，应当及时采取措施制止，并报告中国证监会相关派出机构及证券投资基金业协会；
- 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、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；
- 4、制作风险揭示书，向投资者充分揭示相关风险；
- 5、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；
- 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，进行投资；
- 8、按照资产管理合同约定接受投资者和托管人的监督；
- 9、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；
- 10、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；
- 11、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；
- 12、对《管理办法》第三十八条第（五）项规定的非标准化资产和相关交易主体进行充分的尽职调查，形成书面工作底稿，并制作尽职调查报告；
- 13、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；
- 14、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；
- 15、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；
- 16、编制向投资者披露的资产管理计划季度、年度等定期报告；
- 17、办理与受托财产管理业务活动有关的信息披露事项；
- 18、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；
- 19、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；

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

21、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；不得向管理人及任何第三人输送利益，不得委托第三人运作资产管理计划财产；

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

23、建立并保存投资者名单；

24、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；

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

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、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。

28、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：中信证券股份有限公司

法定代表人：张佑君

住所：广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座

通讯地址：北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦托管部

联系电话：95548-3

网站：<http://www.cs.ecitic.com/>

### **(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、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；
- 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、按照资产管理合同约定，根据管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；
- 5、复核资产管理计划资产净值和份额净值；
- 6、向管理人披露托管人及其控股股东、实际控制人或者其他关联方，以及前述机构发行的证券或者承销期内承销的证券等信息，具体以托管人面向公开披露的信息为准；
- 7、投资于《管理办法》第三十八条第（五）项规定资产时，准确、合理界定安全保管资产管理计划财产、监督管理人投资运作等职责；
- 8、监督管理人的投资运作，发现管理人的投资或者清算指令违反法律、行政法规、中国证监会的规定或者资产管理合同约定的，应当拒绝执行，立即通知管理人并及时报告中国证监会相关派出机构；
- 9、办理与资产管理计划托管业务有关的信息披露事项；
- 10、对资产管理计划财务会计报告、年度报告出具意见；
- 11、编制私募资产管理业务托管年度报告，并向证券投资基金业协会备案；
- 12、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；
- 13、不得为托管人及任何第三人输送利益，不得委托第三人托管资产管理计划财产；
- 14、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；

15、保守商业秘密，不得泄露资产管理计划的投资计划、投资意向、投资信息等，但按照法律法规或有权机关要求或本合同允许提供信息的除外；

16、法律、行政法规、中国证监会及协会规定和资产管理合同约定的其他义务。

(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，每份份额在收益分配和清算剩余财产分配上具有同等的参与权，但因其参与时间、持有期限不同，实际获得的收益可能不同。

## 五、集合计划的基本情况

(一) 名称：华林证券固盈稳融 1 号集合资产管理计划

(二) 类别：固定收益类集合资产管理计划

(三) 本计划不属于基金中基金资产管理计划 (FOF) / 管理人中管理人资产管理计划 (MOM)

(四) 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）。

(五) 投资目标、主要投资方向、投资比例、产品风险等级

### 1、投资目标

本集合计划的投资目标为：产品募集资金全部投资于债权类资产，在严格控制风险、保障流动性，追求安全性的前提下，争取获得相对稳定的投资收益。

### 2、主要投资方向

本计划募集资金全部投资于债权类资产，具体如下：

(1) 现金类资产：包括现金、期限在 1 年以内（含 1 年）的银行存款（包括活期存款、定期存款、协议存款、同业存款等各类存款，但不包括结构性存款）；

(2) 货币市场工具：包括期限在 1 年以内（含 1 年）的债券回购、质押式报价回购、中央银行票据、同业存单，以及中国证监会认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。

特别提示：本计划可参与债券回购（含债券正回购及债券逆回购）、质押式报价回购。

### 3、投资比例

（1）本计划投资于债权类资产的比例不低于资产管理计划总资产的 80%。为规避特定风险并经全体投资者同意的，投资于债权类资产的比例可以低于计划总资产 80%，但不得持续 6 个月低于计划总资产 80%。

（2）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%；管理人管理的全部集合资产管理计划投资于同一资产的资金，不得超过该资产的 25%。银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券等中国证监会认可的投资品种除外。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。（资产管理人管理的全部集合资产管理计划指标由资产管理人负责监控）

**（3）本计划的总资产不得超过净资产的 200%。**

（4）本计划参与证券正回购资金余额或证券逆回购资金余额不得超过本计划上一日资产净值的 100%，中国证监会另有规定的除外。

（5）本计划参与同业存单发行申购时，所申报的金额原则上不得超过本集合计划的总资产，所申报的数量原则上不得超过拟发行公司本次发行的总量。（本条由管理人负责监控）

（6）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该资产管理计划资产净值的 20%。

（7）本计划开放退出期内，其资产组合中 7 个工作日可变现资产的价值，不低于本计划资产净值的 10%。

（8）若资产管理计划投资于同一发行人及其关联方发行的债券的比例超过其净资产 50%的，该资产管理计划的总资产不得超过其净资产的 120%。资产管理计划投资于国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券等中国证监会认可的投资品种不受前述规定限制。（托管人对关联方数据取自上海大智慧财汇数据科技有限公司（财汇资讯）等第三方资讯数据，如管理人使用的数据与托管人不一致，则以管理人书面说明为准）

特别说明：本集合计划终止或提前终止进行资产变现时，管理人可不受投

资比例限制的指标约束，管理人在此情形下的超限行为不认为管理人违约。

#### 4、产品风险等级

根据《证券期货投资者适当性管理办法》《证券经营机构投资者适当性管理实施指引(试行)》，经由管理人审慎评估，本计划的产品风险等级为 R1（低风险），适合风险识别、评估、承受能力为【保守型（C1）、谨慎型（C2）、稳健型（C3）、积极型（C4）、激进型（C5）】的普通投资者及专业投资者，具体以销售机构确认的风险等级为准。投资者承诺并确认自身风险承受能力符合本计划要求，自愿承担参与本计划投资所产生的全部风险。

#### （六）存续期限

本计划存续期限为自成立之日起【10】年，存续期限届满可展期。

根据合同约定，本计划可提前终止。

#### （七）最低初始规模

本计划的最低初始募集规模为 1000 万元。本计划份额的初始募集面值为人民币 1.00 元。

单个投资者首次参与集合计划的最低金额为人民币 30 万元（不含参与费，下同），追加参与不设级差。投资者将红利再投资不受上述限制。如未来法律法规或监管机构对参与最低金额有新规定的，本集合计划初次最低金额可以按照新规定执行，新增参与最低金额不变。

参与本集合计划采取全额缴款参与的方式。集合计划投资者在推广期内可多次参与，参与申请一经受理不得撤销。

#### （八）集合计划的费用

- 1、参与费率：0%。
- 2、退出费率：0%。
- 3、管理费率：0.05%/年
- 4、托管费率：0.01%/年
- 5、其他费用：其他费用详见本合同第二十一章“集合计划的费用与税收”。

#### （九）本计划无分级安排。

#### （十）份额登记、估值与核算、信息技术系统服务机构

本计划的份额登记、估值与核算、信息技术系统服务由资产管理人负责完成。

其中，估值与核算需由资产托管人复核。

## 六、集合计划的募集

### (一) 集合计划的募集对象、募集方式、募集期限

#### 1、募集对象

本集合计划面向合格投资者销售，合格投资者的人数不少于2人且不超过200人。

投资者应确保自身具备集合计划投资者合格投资者条件。合格投资者是指具备相应风险识别能力和风险承担能力，投资于单只资产管理计划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，且满足下列三项条件之一的自然人：家庭金融资产不低于300万元，家庭金融资产不低于500万元，或者近3年本人年均收入不低于40万元；

(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、在中国证券投资基金业协会登记的私募基金管理人、商业银行、商业银行理财子公司、金融资产管理公司、信托公司、保险公司、保险资产管理机构、财务公司及中国证监会认定的其他机构；

(4) 接受国务院金融监督管理机构监管的机构发行的资产管理产品；

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

(6) 中国证监会视为合格投资者的其他情形。

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。

## 2、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。本集合计划的销售机构包括：

(1) 华林证券股份有限公司。

(2) 与管理人签订《华林证券固盈稳融1号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、证券公司以及中国证监会认可的其他金融机构等（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。

## 3、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。

### （二）集合计划的认购事项

#### 1、认购费率

本集合计划认购费率：0%。

#### 2、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，可于 T+1 日后在办理参与的销售机构查询参与确认情况。

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。

### 3、认购份额计算方式

净认购金额=认购金额/（1+认购费率）

认购费用=认购金额-净认购金额

初始认购份额=（净认购金额/基金份额初始净值）+初始销售利息转份额

### 4、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。

#### （三）资管计划最低认购金额及支付方式

1、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 30 万元（不含参与费，下同）。

2、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。

#### （四）集合计划募集结算专用账户和销售机构委托募集账户

本集合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，新增募集账户信息以管理人或销售机构公告为准。

## 七、集合计划的成立与备案

### （一）集合计划的成立

#### 1、集合计划成立的条件

集合计划初始募集期结束后，若本集合计划满足下列条件，则本集合计划即

可宣告成立：

(1) 募集过程符合法律、行政法规和中国证监会的规定；

(2) 集合计划募集金额不低于人民币 1000 万元（含投资者参与资金利息转增份额）；

(3) 投资者不少于 2 人不超过 200 人；

(4) 符合中国证监会规定以及本合同的约定其他条件；

集合计划设立完成前，投资者的参与资金只能存入在华林证券股份有限公司开立的指定的专门账户或资产托管机构的募集专户，不得动用。

## **2、集合计划成立的日期**

管理人应当自资产管理计划的募集金额缴足之日起 10 个工作日内，公告资产管理计划成立。

本集合计划开始运作的日期为本集合计划的成立日。成立日以管理人发布的成立公告为准。

## **3、集合计划设立失败的处理**

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，并将已认购资金及其所产生的银行同期活期存款利息，在初始募集期结束后 30 日内退还集合计划投资者，退还完毕各方互不承担其他责任。利息具体金额以登记结算机构确认结果为准。

### **（二）集合计划的备案**

管理人应在资产管理计划成立之日起 5 个工作日内向基金业协会履行备案手续。

在资产管理计划完成备案前，可以以现金管理为目的，投资于银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券、货币市场基金等中国证监会认可的投资品种。无论资产管理合同的投资范围中是否包括上述投资标的，管理人按照本条进行投资，均视为符合本计划的投资范围和投资比例，不违反资产管理合同的任何约定。

资产管理计划无法完成备案的，管理人应当及时告知投资者，并按照资产管

理合同约定履行终止清算程序。

## 八、集合计划的参与、退出与转让

### （一）参与和退出场所

（1）华林证券股份有限公司。

（2）与管理人签订《华林证券固盈稳融1号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）。

2、开放期：本集合计划成立后，每周一、周二、周三为申购开放日和赎回开放日，委托人可申请参与或退出集合计划。若开放期遇法定节假日、非工作日，则当日不开放，且开放期不顺延。具体的业务办理时间以管理人公告为准（含临时开放）。

管理人可以根据业务实际情况，设置临时开放期。管理人应提前至少1个工作日在管理人网站公告具体安排。

3、业务办理时间（交易时间）：本计划投资者须在开放日当天8:30-11:30提交参与、退出或交易撤销申请，否则管理人有权拒绝接受投资者的交易申请，相关风险、责任、损失由投资者自行承担。

管理人有权根据管理运作实际情况，对上述业务办理时间（交易时间）进行调整。如涉及业务办理时间调整时，管理人应提前至少1个工作日在管理人网站上予以公告。

### （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）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集合计划被动超限的，管理人通过设置临时开放期办理超出份额的退出手续；

(2) 在合同的补充、修改与变更后，管理人通过设置临时开放日的方式，合理保障投资者选择退出资产管理计划的权利；

(3) 因无法预测或无法控制的系统故障、设备故障、通讯故障、金融危机、行业竞争、代销机构违约、托管人违约等超出集合计划管理人自身直接控制能力外的风险或不可抗力因素的出现，导致集合计划资产无法正常运作或出现损失或投资者利益受损的情况，为合理保障投资者选择退出资产管理计划的权利，可设置临时开放日；

(4) 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。

管理人不得利用临时开放期变更开放募集，从而突破《运作规定》对于开放次数的限制。

## **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、参与方式**

投资者在提交参与申请时须按照销售机构规定的方式全额支付参与资金。

#### **2、参与价格**

(1) 在集合计划募集期内参与，每份额的参与价格为 1 元；

(2) 在集合计划存续期参与，以参与申请日（T 日）集合计划每份额净值作为每份额的参与价格。T 日的集合计划每份额净值在 T 日计算，并在 T+1 日告知投资人。如遇不可抗力，可以适当延迟计算及告知。

#### **3、参与的原则**

(1) 存续期参与“未知价”原则，即存续期参与的价格，以受理申请当日的集合计划每份净值为基准进行计算。

(2) “金额参与”原则，即参与以金额申请。本集合计划的单个投资者首次参与最低金额为 30 万元人民币（不含参与费，下同），追加参与不设级差。

(3) 当日的参与申请可以在销售机构规定的时间内撤销。

(4) 当集合计划募集规模接近或达到合同或管理人约定的规模上限时，管理人将自次日起暂停接受参与申请。

(5) 管理人有权按照产品投资策略拒绝投资者的参与申请。

#### **4、参与程序和确认**

(1) 投资者按销售机构指定营业网点的具体安排，在交易时间段内办理。

(2) 投资者应开设推广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，推广机构不受理该笔参与申请。

(3) 投资者签署本合同后，方可申请参与本集合计划。参与申请经管理人确认有效后，构成本合同的有效组成部分；若投资者的参与申请未被管理人确认有效，则本合同自动解除，管理人不对投资者参与申请未得到成功确认承担任何责任。

(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) 募集期参与的投资者，可在集合计划正式成立后在销售机构指定网点或销售机构指定网络系统查询成交情况；存续期参与的，投资者 T 日提交参与申请后，可在 T+2 日后（含该日）在销售机构指定网点或销售机构指定网络系统查询成交情况。

投资者认可管理人对其认购参与有效性的确认，除经管理人同意外，不再要求管理人提供任何有效性确认的资料。

(6) 投资者参与成功后，注册登记机构在 T+1 日为投资者登记权益并办理注册登记手续。

#### **5、退出方式**

本集合计划委托人只能于本集合计划的赎回开放日办理退出申请。

在提交退出申请时须持有足够的份额余额，否则所提交的退出申请无效而不予确认。

#### **6、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【30】万元，则余额部分必须一起退出。

## 7、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+1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+2日后（含该日）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。如遇不可抗力，可以适当延迟支付并及时告知投资者。

### (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【30】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。

(5) 管理人在不损害投资者权益的情况下，经与销售机构协商一致，可更改上述原则，但最迟应在新的原则实施前3个工作日内告知投资者。管理人提前

3 个工作日在其网站上公告即视为履行了向投资者告知的义务。同时，管理人应提前书面告知销售机构。

#### **（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 30 万元人民币（不含参与费，下同）。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。

管理人在存续期到期日强制退出全部投资者的份额。

如出现临时开放的情况，退出原则如下：

（1）投资者退出时只能一次性退出其持有的全部集合计划份额，如其该笔退出申请并非持有的集合计划全部份额时，则视为投资者同意管理人作出相应合同变更、展期等安排。

（2）采用份额退出的方式，即退出以份额申请。

（3）“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。

（4）当日的退出申请可以且只能在当日交易时间结束之前撤销。

#### **（六）参与和退出的费用**

1、参与费率：0%。

2、退出费率：0%。

#### **（七）参与份额与退出金额的计算方式**

1、参与份额计算方式

净参与金额=参与金额/（1+参与费率）

参与费用=参与金额-净参与金额

参与份额=净参与金额/T 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（如有）后的实际金额支付。退出费和退出金额的计算公式如下：

退出金额=（T日计划单位净值×有效退出份额－业绩报酬）×（1－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。

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30万时，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计入本计划资产，参与资金的利息以登记结算机构的记录结果为准。

### （九）巨额退出或连续巨额退出

#### 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20%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20%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) 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行；

(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个工作日内向投资者披露。

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

经管理人同意后，投资者可以通过证券交易所、协议转让以及中国证监会认

可的其他方式，向合格投资者转让其持有的计划份额，并按规定办理份额变更登记手续。

资产管理人应当在接受份额转让申请前，对受让人的合格投资者身份和资产管理计划的投资者人数进行合规性审查。转让后，持有计划份额的合格投资者合计不得超过二百人。受让方首次参与本计划的，应当先与资产管理人、资产托管人签订资产管理合同。

资产管理人有权在符合法律法规的前提下，制定本计划的份额转让的相关业务规定，投资者应当按照该等业务规定进行份额转让。

### **（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）证券期货经营机构及其子公司自有资金参与集合计划**

#### **1、证券期货经营机构及其子公司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，证券期货经营机构及其子公司可以以自有资金参与本集合计划。

证券期货经营机构及其子公司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%。**证券期货经营机构及其子公司**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证券期货经营机构及其子公司自有资金参与本集合计划份额被动超标的，管理人应当依照中国证监会规定及本合同约定及时调整达标。

### 3、自有资金的收益分配及责任

证券期货经营机构及其子公司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

证券期货经营机构及其子公司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) 证券期货经营机构及其子公司自有资金参与份额，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) 证券期货经营机构及其子公司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、证券期货经营机构及其子公司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，并取得其同意。投资者如不同意，可根据管理人公告在指定临时开放期申请退出本集合计划，投资者未申请退出的，即视为同意；托管人如不同意的，可向管理人出具书面异议，未出具书面异议的，即视为同意。法律法规或本合同另有规定的除外。

6、风险揭示：证券期货经营机构及其子公司自有资金退出，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。证券期货经营机构及其子公司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，证券期货经营机构及其子公司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，证券期货经营机构及其子公司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【中信证券股份有限公司】负责托管。

## 十一、集合计划的投资

### (一) 投资目标

本集合计划的投资目标为：产品募集资金全部投资于债权类资产，在严格控制风险、保障流动性，追求安全性的前提下，争取获得相对稳定的投资收益。

### (二) 投资范围

本计划募集资金全部投资于债权类资产，具体如下：

(1) 现金类资产：包括现金、期限在 1 年以内（含 1 年）的银行存款（包括活期存款、定期存款、协议存款、同业存款等各类存款，但不包括结构性存款）；

(2) 货币市场工具：包括期限在 1 年以内（含 1 年）的债券回购、质押式报价回购、中央银行票据、同业存单，以及中国证监会认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。

**特别提示：**本计划可参与债券回购（含债券正回购及债券逆回购）、质押式报价回购。

### **(三) 投资策略**

#### **1、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。

#### **2、决策程序**

管理人资产管理业务的投资管理决策体系由资产管理业务决策委员会、资产管理部投资决策小组、投资经理构成。

(1) 资产管理业务决策委员会在战略层面予以决策

资产管理业务决策委员会负责公司资产管理业务议事协调和组织决策等工作，在遵守相关法律法规及内部规章制度的基础上，根据资产管理业务合同的要求对于业务发生过程中的重大投资事项进行决策。

资产管理业务决策委员会是公司开展资产管理业务的决策机构，资产管理部是资产管理业务决策的执行机构。资产管理部内设置投资决策小组，在公司资产管理业务决策委员会的授权下对资产管理业务的投资事宜进行相关投资及研究等方面的工作。

(2) 投资经理进行战术性组合配置及优化

投资经理为资产管理业务的实际执行人，负责公司资产管理业务的具体操作和管理。投资经理根据研究部门及其他咨询机构提供的研究报告以及其他信息来源，综合分析，提出集合计划的资产配置建议和具体的参数设定方案。

### (3) 交易员根据投资指令实施投资交易

交易员主要职责是按照投资经理的交易指令进行交易操作；及时向投资经理提示市场出现的异常交易状况并提供建议；进行交易记录、汇总与报告；对投资经理发出的不符合有关法律法规及公司投资管理制度规定和投资组合限制的交易指令，有权停止执行并立即向资产管理部负责人报告。

### (4) 风险管理部进行风险控制

风险管理部根据监管部门规章制度和公司风控制度，对资产管理业务进行全程监控，通过事前防范、实时监控、自动预警、定期和不定期抽查的方式，有效防范资产管理业务风险。

## 3、投资管理的方法和标准

### (1) 投资管理方式

受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。

## 4、集合计划投资策略

本集合计划将本着稳健投资的理念，通过对宏观经济的研究，在低风险资产间进行合理配置。本计划主要投资于银行存款、债券回购、质押式报价回购等现金类资产及货币市场工具，在严格控制风险、保障流动性，追求安全性的前提下，争取获得相对稳定的投资收益。

### (1) 银行存款投资策略

本计划在向交易对手银行进行询价的基础上，选取利率报价较高的银行进行存款投资，在投资过程中注重对交易对手信用风险的评估和选择，在严格控制风险的前提下决定各银行存款的投资比例。

### (2) 同业存单投资策略

本计划通过对货币政策的研判，关注市场的资金面状况，包括银行间市场的流动性状况、银行的负债需求等，在投资过程中注重对不同发行主体信用风险和

流动性风险的评估和选择,在控制风险的前提下决定同业存单的选取及投资比例。

### (3) 债券回购投资策略

本计划将逆回购投资作为流动性管理的手段并获取融出资金的收益,将对回购利率与短期债券收益率、同业存单收益率、存款利率进行比较,并在对资金面进行综合分析的基础上,判断是否存在利差套利空间。

### (4) 现金管理策略

本集合计划将在确定总体流动性要求的基础上,结合不同类型货币市场工具的流动性和货币市场预期收益水平、银行存款的期限、债券逆回购、质押式报价回购的预期收益率来确定现金类资产的配置,并定期对现金类资产组合平均剩余期限以及投资品种比例进行适当调整。

以上内容为管理人对于本计划全部或者部分投资品种相应投资策略的阐述,不构成对于本计划投资范围、投资比例及限制的补充,也不构成管理人的承诺。

## (四) 投资比例

### 1、投资比例

(1) 本计划投资于债权类资产的比例不低于资产管理计划总资产的 80%。为规避特定风险并经全体投资者同意的,投资于债权类资产的比例可以低于计划总资产 80%,但不得持续 6 个月低于计划总资产 80%。

(2) 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%;管理人管理的全部集合资产管理计划投资于同一资产的资金,不得超过该资产的 25%。银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券等中国证监会认可的投资品种除外。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。(资产管理人管理的全部集合资产管理计划指标由资产管理人负责监控)

**(3) 本计划的总资产不得超过净资产的 200%。**

(4) 本计划参与证券正回购资金余额或证券逆回购资金余额不得超过本计划上一日资产净值的 100%,中国证监会另有规定的除外。

(5) 本计划参与同业存单发行申购时,所申报的金额原则上不得超过本集合计划的总资产,所申报的数量原则上不得超过拟发行公司本次发行的总量。(本条由管理人负责监控)

(6) 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该资产管理计划资产净值的 20%。

(7) 本计划开放退出期内，其资产组合中 7 个工作日可变现资产的价值，不低于本计划资产净值的 10%。

(8) 若资产管理计划投资于同一发行人及其关联方发行的债券的比例超过其净资产 50%的，该资产管理计划的总资产不得超过其净资产的 120%。资产管理计划投资于国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券等中国证监会认可的投资品种不受前述规定限制。（托管人对关联方数据取自上海大智慧财汇数据科技有限公司（财汇资讯）等第三方资讯数据，如管理人使用的数据与托管人不一致，则以管理人书面说明为准）

特别说明：本集合计划终止或提前终止进行资产变现时，管理人可不受投资比例限制的指标约束，管理人在此情形下的超限行为不认为管理人违约。

## 2、投资比例超限的处理方式和流程

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 20 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。

## 3、本计划投资于其他资产管理产品时投资比例的计算方式

本计划投资其他资产管理产品的（如有），管理人将按照所投资资产管理产品向管理人披露投资组合的频率，按照穿透原则合并计算大类资产配置比例、总资产占净资产比例，如计算后发现相关指标超标的，管理人将及时进行调整，但因所投资资产管理产品处于非开放期、相关资产处于封闭期、锁定期、限售期、停牌、涨跌停板、市场成交量有限、发行人或其他付款义务人违约等非管理人原因导致无法及时调整的，管理人不承担责任，管理人将在所投资资产管理产品可退出或相关资产可出售、可转让或者恢复交易后及时调整。

投资者充分知悉、理解并认可，管理人对于上述比例的监控，将依赖并受限于所投资资产管理产品披露其投资组合的全面性、准确性和及时性，属于事

后有限范围的监控。由于本计划所投资的资产管理产品管理人未及时提供投资组合信息或提供投资组合信息有限或有误，导致管理人无法监控或监控数据错误的，管理人不承担责任。

#### （五）投资限制和投资禁止

##### 1、投资限制

为维护委托人的合法权益，本集合计划投资的投资限制为：

本集合计划不得投资于以下金融工具：

- 1) 股票；
- 2) 可转换债券、可交换债券；
- 3) 金融衍生品；
- 4) 以定期存款利率为基准利率的浮动利率债券，已进入最后一个利率调整期的除外；（本条由管理人负责监控）
- 5) 信用等级在 AA+ 以下的债券、资产支持证券；

若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集合计划出现超限的情况，管理人应于 20 个交易日内调整到本合同约定的限制之内。

现行有关法律法规修订变化后，若上述投资限制与之产生抵触，应以有关法律法规规定为准，同时管理人应通过合同变更的形式明确相应修订内容；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，本计划可相应调整投资组合限制的规定。

##### 2、禁止行为

本集合计划的禁止行为包括：

（1）不得直接或者间接投资于违反国家产业政策、环境保护政策的项目（证券市场投资除外），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。

（2）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；

- (3) 将集合计划资产用于可能承担无限责任的投资；
- (4) 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；
- (5) 挪用集合计划资产；
- (6) 募集资金不入账或者其他任何形式的账外经营；
- (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。

上述投资禁止行为由管理人自行监控。

#### **(六) 业绩比较基准及确定依据**

本集合计划不设业绩比较基准。

#### **(七) 风险收益特征**

根据《证券期货投资者适当性管理办法》《证券经营机构投资者适当性管理实施指引(试行)》，经由管理人审慎评估，本计划的产品风险等级为 R1（低风险），适合风险识别、评估、承受能力为【保守型（C1）、谨慎型（C2）、稳健型（C3）、积极型（C4）、激进型（C5）】的普通投资者及专业投资者，具体以销售机构确认的风险等级为准。投资者承诺并确认自身风险承受能力符合本计划要求，自愿承担参与本计划投资所产生的全部风险。

#### **(八) 建仓期**

本集合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。

#### **(九) 资产组合的流动性**

本集合计划在开放期保持适当比例的现金或者其他高流动性金融资产，以保持本集合计划整体流动性充足，其中开放退出期内资产组合中 7 个工作日可变现资产的价值不低于集合计划资产净值的 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本集合计划资产净值的 20%，实现资产组合的流动性与参与、退出安排相匹配。

#### （十）资产管理计划的预警与止损

根据集合计划的投资策略、潜在的收益波动水平、可能出现的最大回撤幅度等，本集合计划以集合计划单位净值为基础设置预警线和止损线。

##### 1、本集合计划的预警安排

本集合计划的预警线为【0.9500 元】。在本集合计划存续期内任何一个交易日（T 日）日终，本集合计划单位净值等于或低于预警线，同时当且仅当 T-1 日本集合计划单位净值高于预警线的情况下，管理人将于 T+1 日内以管理人网站公告、邮件、短信或者其他管理人和投资者认可的方式进行信息披露，持续等于或低于预警线管理人将不再另行披露。

特别示例如下：

假设本集合计划 2026 年 3 月 16 日单位净值高于预警线，2026 年 3 月 17 日单位净值低于预警线，管理人将于 2026 年 3 月 18 日向投资者披露，若该情况持续至 2026 年 3 月 20 日，期间持续低于预警线的情况管理人不再另行披露；若后续运作期间单位净值再次升高回落至预警线，管理人将于 T+1 日内进行信息披露，持续等于或低于预警线期间不再另行披露，如此往复。特别提醒投资者在集合计划单位净值等于或低于预警线的情况下及时关注单位净值的波动。

##### 2、本集合计划的止损安排

本集合计划的止损线为【0.9200 元】。在本集合计划存续期内任何一个交易日（T 日）日终，本集合计划单位净值等于或低于止损线的，T+1 日本集合计划终止，按照资产管理合同的约定组织清算集合计划资产。

本集合计划的预警和止损机制的启动及操作由资产管理人自行负责执行。托管人根据与管理人的估值核对结果对预警、止损事项进行事后监督，托管人如若发现经核对的单位净值触及上述第 1、2 条所述情况的，应当及时向管理人予以提示。

特别提示：本计划设置【0.9200】元为止损线，并不代表资产管理人完成止损后计划份额净值等于止损线，根据资产管理人变现操作的交易执行情况，本计划执行止损后的计划份额净值可能低于止损线。

## 十二、服务机构及投资顾问

### （一）服务机构

本集合计划不聘请估值与核算、信息技术系统等服务机构。

### （二）投资顾问

本集合计划不聘请投资顾问。

## 十三、集合计划的分级

本集合计划不分级。

## 十四、利益冲突及关联交易

### （一）集合计划存在的或可能存在利益冲突的情形

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，或者从事其他关联交易；

2、管理人及其子公司有权以自有资金参与本集合计划；

3、管理人的董事、监事、从业人员及其配偶、控股股东、实际控制人或者其他关联方均有权参与本集合计划；

4、法律法规、中国证监会等监管机构规定的其他情形。

### （二）关联方及关联交易的定义、分类标准及管控机制

#### 1、关联方及关联交易的定义

关联方包括管理人、管理人股东、管理人股东控制和参股的企业、控制管理人股东的企业、子公司，托管人、托管人控股股东及实际控制人、托管人控制的企业等，管理人董事、监事、高级管理人员及其关系密切家庭成员控制、共同控制或施加重大影响的企业等。

关联交易指在不违反法律法规的强制性规定、不违反本合同的约定并严格遵守管理人内部关联交易管制等制度的前提下，本计划资产管理人运用受托财产投资资产管理人/资产托管人或资产管理人/资产托管人关联方发行或承销期内承

销的证券、管理的证券投资基金、管理人关联方互为交易对手的交易以及发生资产管理人认定的其他类型的关联交易，但投资者或托管人各自就其自身或其关联方另有限制或书面通知管理人的除外。

管理人、托管人关联方名单以公开信息披露为准。

## 2、关联交易的分类

管理人在运用受托管理资产从事关联交易时，将按照法律法规及中国证监会的有关规定，对关联交易按照重要性原则区分为一般关联交易和重大关联交易并进行分层管理。

## 3、重大关联交易的管控机制

重大关联交易认定标准如下：

(1) 将本计划的资产投资于管理人、托管人及管理人、托管人的控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司等发行的单证券的资金或与管理人关联方互为交易对手发生交易行为时，单证券交易金额达到本计划净值的20%（含）以上且交易金额300万元（含）以上的；投资关联方承销期内承销的证券且单只证券预计中签金额达到本计划净值的20%（含）以上且交易金额300万元（含）以上的；投资于关联方管理的证券投资基金且单只基金投资金额超过资产管理计划净值20%（含）以上且交易金额300万元（含）以上属于重大关联交易。

(2) 其他法律法规、监管准则、自律规则或按照实质重于形式原则认定的重大关联交易情形。

重大关联交易需先经管理人履行内部审批程序，由管理人设置的资产管理业务决策委员会审批，委员会设主任委员一名，主任委员由公司首席执行官担任。其他委员由分管资产管理业务公司领导、首席风险官、合规总监、资产管理部负责人以及主任委员指定的其他人员组成。合规法律部、风险管理部等部门视需要指定人员列席会议。该委员会表决采取一人一票制，每位委员都享有相同的一票投票权，不得弃权，主任委员具有一票否决权，投赞成票超过委员人数三分之二（含）以上为有效通过。

此外，重大关联交易还需履行如下程序后方可进行。

管理人拟运用本集合计划的资产从事重大关联交易的（包括单笔或多笔合

计)，应对关联交易事项应遵循审慎评估原则，并提前5个工作日采取逐笔征询或公告确认等方式事先取得投资者同意，并有充分证据证明未损害投资者利益。投资者如有异议的，应于征询函发送后5个工作日内书面回复，如投资者未提出书面异议的，管理人方可开展该次重大关联交易。同时管理人事后应对重大关联交易进行单独披露，并按相关规定报告或备案。

管理人应在该事项发生之日起5个工作日内通过管理人指定网站进行披露。集合计划存续期间，管理人自有资金参与计划的持有期限不得少于6个月，参与、退出时，提前5个工作日通过管理人网站公告告知投资者和托管人。如管理人的董事、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集合计划，该部分投资者参与份额与集合计划其他客户份额享有同等权益、承担同等风险，管理人应在该事项发生之日起五个工作日内通过管理人网站进行披露。

#### 4、一般关联交易的管控机制

投资者在此不可撤销地同意并授权管理人可以将本计划的资产从事以下一般关联交易：

(1) 将本计划的资产投资于管理人、托管人及管理人、托管人的控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司等发行的单证券的资金或与管理人关联方互为交易对手发生交易行为时，单证券交易金额未达上述重大关联交易认定标准；投资于关联方企业承销期内承销的证券且单只证券预计中签金额未达上述重大关联交易认定标准；投资于关联方管理的证券投资基金且单只基金投资金额未达上述重大关联交易认定标准的属于一般关联交易。

(2) 其他符合法律法规、监管准则和自律规则认定的一般关联交易。

一般关联交易经管理人相应内部审批程序审批通过后方可进行，管理人设置两级审批流程，资产管理计划需参与关联交易的，由投资经理书面说明关联交易的必要性，定价依据等，经部门负责人审批后，由合规法律部、风险管理部审核后方可进行交易，审批人员亦需重点审核关联交易的必要性、交易价格公允性等，确保该关联交易符合本资产管理计划投资者的利益。

管理人在一般关联交易发生后，应及时告知投资者和托管人，事后单独以函件或定期报告的形式进行披露并按照最新监管要求履行报告义务。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。

以上关联交易投资应按照市场通行的方式和条件参与，公平对待受托财产，防止利益冲突，不得损害投资者利益。资产管理计划在投资运作过程中存在利益冲突情形的，资产管理人应当坚持投资者利益优先原则，从充分维护投资者利益角度积极处理该等利益冲突情形，防范利益输送等违法违规行为。在发生该等利益冲突时，资产管理人应当视具体利益冲突情形选择在向投资者提供的定期报告或临时报告中进行披露。

### **（三）其他利益冲突的情形**

除前述规定外，管理人不得将本计划的受托资产，通过直接投资、投资其他资产管理计划或者与他人进行交叉融资安排等方式，违规为本机构、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。

管理人禁止违规关联交易，遵循投资者利益优先原则对非禁止性关联交易进行专项审批和管控，防范利益冲突，保护投资者合法权益。法律法规、监管准则和自律规则对资管计划关联交易另有规定的，管理人按届时有效的规定执行。

## **十五、投资经理的指定与变更**

本集合计划投资经理由资产管理人负责指定。

### **（一）投资经理简介**

本集合计划投资经理基本情况：

管理人指定夏炎担任本计划的投资经理，投资经理已取得基金从业资格，最近三年未被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚。

夏炎先生简介：

华林证券资产管理部投资经理，基金从业资格编号：A20251120011793。

北京科技大学数学系本硕，14年投资研究经验，专注于股票、债券等大类资产及相关衍生品领域。2011年起，先后任职于国盛证券研究所（研究岗）、赣州银行金融市场部（分析师、债券交易员）、深圳鼎诚汇富股权资产管理有限公司（固收投资负责人）、厦门复兴东方私募基金管理有限公司（投资经理）。

2025年11月加入华林证券资产管理部任投资经理，将继续深耕权益、债券等大类资产以及相关衍生品的投资研究等相关工作，研究功底扎实、投资经验丰富。

## **(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，无需另行征询投资者的意见。在投资经理变更之日起5个工作日内向中国证券投资基金业协会报告。

## **十六、集合计划的财产**

### **(一) 集合计划的财产的保管与处分**

1、集合计划财产为信托财产，其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、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；

6、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销。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集

合计划财产强制执行。上述债权人对集合计划财产主张权利时，管理人、托管人应当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和管理**

### **1、托管账户的开设和管理**

(1) 资产托管人应负责本计划托管账户的开设和管理，资产管理人应配合资产托管人办理开立账户事宜并提供相关资料。

(2) 资产托管人以本计划的名义在具有托管资格的商业银行开设托管账户（账户户名以实际开立为准）。该账户的开设和管理由资产托管人负责，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。管理人在确定托管账户名称时应考虑满足三方存管、银行间市场开户要求等需要。

(3) 托管账户的开立和使用，限于满足开展托管业务的需要。资产托管人和资产管理人不得假借本计划的名义开立其他任何银行账户；亦不得使用本计划的任何银行账户进行本计划业务以外的活动。

(4) 托管账户的管理应符合法律法规、监管机构以及本合同的要求。

### **2、证券账户的开设和管理**

(1) 资产托管人应当以本计划的名义在中国证券登记结算有限责任公司开设证券账户，用于本计划证券投资的清算和存管。资产管理人应配合资产托管人办理开立账户事宜并提供相关资料。

(2) 本计划证券账户的开立和使用，限于满足开展本计划业务的需要。资产托管人和资产管理人不得出借和未经另一方同意擅自转让本计划的任何证券账户；亦不得使用本计划的任何证券账户进行本计划业务以外的活动。

(3) 本计划证券账户的开立由资产托管人负责，管理和使用由资产管理人负责。

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

本资产管理计划由证券经纪商完成资产管理计划的日常证券交易的资金结

算工作，相关结算规则依据证券交易所等市场的规定执行，交易佣金参照资产管理人与证券经纪商约定的费率实施，相关清算数据的传输和接收规则根据资产管理人与证券经纪商签署的《经纪服务协议》（具体协议名称以实际签署为准）执行。

### 3、基金账户的开设和管理（如有）

因本计划投资证券投资基金的需要，由资产管理人为本计划在资产管理人指定的基金公司或第三方销售机构以本产品的名义开立基金账户，用于办理本计划投资于开放式基金时的基金份额登记和交割，并确保在产品存续期间托管账户为所投资的基金发生分红和赎回时的唯一资金回款账户。管理人需及时书面告知托管人该账户的相关信息。持有基金期间，管理人需及时将基金认购、申购、分红或赎回等业务单据的复印件或扫描件发送给托管人。

### 4、债券托管专户的开设和管理（如有）

资产管理合同生效后，资产管理人和资产托管人相互配合，根据中国人民银行及中央国债登记结算有限责任公司、银行间市场清算所股份有限公司的有关规定，在债券登记结算机构开立债券托管账户，并代表计划财产进行银行间市场债券的结算。管理人负责本计划在银行间市场的债券交易，托管人负责银行间债券交割与资金划拨。

### 5、定期存款（如有）

存款账户必须以资产管理计划名义开立，账户名称为资产管理计划名称，存款账户开户文件上加盖资产托管人预留印鉴及资产管理人公章。存款证实书原件由托管人负责保管。

本计划投资银行存款时，资产管理人应当与存款银行签订存款协议，存款协议须约定将托管人为本计划开立的托管账户指定为唯一回款账户。为防范特殊情况下的流动性风险，定期存款协议中应当约定提前支取条款。

本计划所投资定期存款存续期间，资产管理人、资产托管人应当与存款银行建立定期对账机制，确保银行存款业务账目及核对的真实、准确。

### 6、其他账户的开设和管理（如有）

因业务发展而需要开立的其他账户，应由资产托管人或资产管理人根据有关法律法规的规定开立。新账户按有关规则管理并使用。

## 十七、集合计划投资指令的发送、确认与执行

### （一）投资指令的授权

资产管理人应向资产托管人提供预留印鉴样本和被授权人签字样本或名章样本，事先书面通知(以下称“授权通知”)资产托管人有权发送指令的人员名单，注明相应的交易权限。授权通知应由资产管理人法定代表人或授权签字人签字或签章并加盖公章，若由授权签字人签署，还应附上法定代表人的授权书。资产管理人应将授权通知以传真或者双方约定的其他方式发送资产托管人，资产托管人在收到授权通知传真件或者扫描件后立即电话与资产管理人确认。资产管理人与资产托管人双方电话确认无异议后，授权通知于通知载明时间生效，该生效时间不得早于资产托管人收到授权通知传真件或扫描件并经与资产管理人电话确认无异议的时点。如早于，则以资产托管人收到授权通知传真件或扫描件并经与资产管理人电话确认无异议的时点为授权通知的生效时间。资产管理人在电话确认后三个工作日内将授权通知的正本交送资产托管人。如果授权通知正本与传真件或扫描件内容不同，以托管人收到的传真件或扫描件为准，由此产生的责任由资产管理人承担。

对于资产管理人拟通过资产托管人电子服务平台发送指令的，资产管理人需与资产托管人签署相关服务协议，并提供授权文件及其他资产托管人要求的材料，由资产托管人为资产管理人的被授权人在电子服务平台配置相关操作权限。

资产管理人撤换被授权人或改变被授权人的权限，必须提前至少一个工作日，使用传真、电子邮件发送扫描件或者双方约定的其他方式向资产托管人发出被授权人变更通知并预留新的被授权人的签字样本或名章样本，同时电话通知资产托管人，资产托管人收到变更通知当日电话向资产管理人确认无异议。被授权人变更通知于通知载明的生效时间生效，该生效时间不得早于资产托管人收到变更通知传真件或扫描件并经与资产管理人电话确认无异议的时点。如早于，则以资产托管人收到变更通知传真件或扫描件并经与资产管理人电话确认无异议的时点为变更通知的生效时间。如果授权文件正本与传真件或扫描件内容不同，以托管人收到的传真件或扫描件为准，由此产生的责任由资产管理人承担。

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

及相关操作人员以外的任何人泄露。

## **(二) 投资指令的内容**

投资指令是资产管理人在管理、运用计划财产时，向资产托管人发出的资金划拨及其他款项支付的指令。对于通过传真或电子邮件发送扫描件的指令，资产管理人发给资产托管人的投资指令应写明款项事由、支付时间、到账时间、金额、收付款账户等执行支付所需信息，加盖预留印鉴并由被授权人签字或加盖名章；对于通过电子服务平台发送的指令或由电子平台推送给资产管理人并需资产管理人确认后才能发送的指令，由资产管理人的被授权人向资产托管人发送指令时应写明以下要素：划付模式、资金用途、支付时间、金额、账户信息等（以上内容统称为“指令的书面要素”）。

## **(三) 投资指令的发送、确认和执行程序**

投资指令由“授权通知”确定的有权发送人代表资产管理人用传真、电子邮件发送扫描件或电子服务平台的方式向资产托管人发送。对于通过传真或电子邮件发送扫描件方式发送的指令，资产管理人有义务在发送指令后与资产托管人以电话方式进行确认，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资产管理人承担。对于通过电子服务平台发送的指令，资产管理人需在指令跟踪界面查看指令是否完成。

对于被授权人在其授权范围内发出的指令，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投资指令，被授权人应按照其授权权限发送投资指令。

资产管理人应在工作日 15:00 之前向资产托管人发送付款指令，15:00 之后发送付款指令的，资产托管人不能保证划款成功。如资产管理人要求当天某一时点划款，应至少提前 2 个工作小时（工作时间：工作日 9:00-11:30, 13:00-17:00）向资产托管人发送付款指令并与资产托管人电话确认。资产管理人传输指令时，需要为资产托管人留出足够的执行时间。资产托管人收到资产管理人发送的指令后，应立即对指令进行审查，审查的方式限于验证指令的前述书面要素是否齐全、审核指令用章和签发人的签名或名章是否和预留印鉴样本、被授权人的签字样本或名章样本相符、操作权限是否与授权文件一致；对于电子服务平台方式发送的指令，视为由资产管理人有效发送，资产托管人审查的方式限于验证指令的前述

书面要素是否齐全。当托管人验证相符后应在规定期限内执行，不得延误。资产管理人应保证发送指令同时提交的文件资料的合法性、真实性、完整性和有效性，避免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。若指令存在与授权文件中预留印鉴样本、签字样本、名章样本、权限等要素不符的，托管人无义务执行指令，在该等情况下，资产托管人立即与资产管理人指定人员进行电话联系和沟通，并要求资产管理人重新发送经修改的指令，就管理人修改后重新发送的指令，托管人将按照前述指令确认、审查程序重新进行审查，托管人审查无误的，才开始执行指令。

资产管理人向资产托管人下达指令时，应确保资产管理计划托管账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指令，资产托管人不予执行，并立即通知资产管理人。

本资产管理计划托管账户发生的银行结算费用等银行费用（包括手续费，邮电费，账户开户费等），由托管账户开户银行直接从计划托管账户中扣划，无须资产管理人出具投资指令；有关证券账户的开户手续费扣划需要管理人出具投资指令但扣划之前需与资产托管人核对有关金额。

若资产管理人选择通过经纪商提供的自助转账方式进行托管账户与交易资金账户之间资金划转的，资产管理人应自行监控并保障资金划转安全，确保资金用途符合法律法规要求及合同约定。

#### **（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业协会报告。

#### **（五）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划款指令的情形包括：划款指令违反法律法规或合同有关规定，划款指令发送人员无权或超越权限发送划款指令及交割信息错误，划款指令中重要信息模糊不清或划款指令要素不全等。

资产管理人申请撤回已发送的有效划款指令的情形包括：因投资决策改变、市场行情变化、产品头寸管理需要等原因，管理人单方面申请撤回已发送至托管人的有效划款指令。资产托管人在履行监督职能时，发现资产管理人的划款指令

错误时，有权拒绝执行，并及时通知资产管理人改正。资产管理人申请撤回通过资产托管人的电子服务平台已发送至资产托管人的有效划款指令，在指令到达托管人支付处理环节之前，可通过电子服务平台的指令撤回功能进行指令撤销操作。已到达支付节点的电子服务平台发送的划款指令或通过传真、邮件发送的划款指令须先向资产托管人电话确认指令支付进度，如果指令尚未执行，需电子邮件发送加盖公章或预留印鉴的书面说明函并电话确认，资产托管人收到指令作废说明函并确认后，将撤回划款指令作废；如果资产托管人在收到说明函并确认时该划款指令已执行，则由过失方承担因执行该划款指令而造成损失的责任。

#### **（六）投资指令的保管**

指令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指令传真件或扫描件为准。指令若以电子服务平台方式提交，则以电子数据的形式保管。

#### **（七）相关责任**

在正常业务受理渠道和指令规定的时间内，因资产托管人过错未能正确执行合法合规的指令而导致本计划受损的，资产托管人应承担相应的责任，但如遇到不可抗力的情况除外。

如因资产管理人的指令或授权文件存在事实上未经授权、欺诈、伪造或未能按时提供或更新被授权人员的预留印鉴或签字样本等非资产托管人原因造成的情形，只要资产托管人根据本合同约定履行审查义务，资产托管人不承担因执行有关划款指令而造成的损失，相关责任由资产管理人承担。

## **十八、交易及交收清算安排**

### **（一）选择代理证券买卖的证券经营机构的程序**

管理人负责选择代理本计划财产证券买卖的证券经纪机构，并与其签订证券经纪合同，管理人、托管人和证券经纪机构可就本计划参与证券交易的具体事项另行签订协议。

### **（二）证券交易所证券交易清算交收安排**

1、证券经纪机构代理本计划财产与中国证券登记结算公司（下称“中登公司”）完成证券交易及非交易涉及的证券资金结算业务，并承担由证券经纪机构

原因造成的正常结算、交收业务无法完成的责任；若由于管理人原因造成的正常结算业务无法完成，责任由管理人承担。

本计划其他证券交易由托管人或相关机构负责结算。

2、对于任何原因发生的证券资金交收违约事件，相关各方应当及时协商解决。

### **（三）开放式基金投资的清算交收安排**

1、开放式基金申购（认购）相应的资金划拨由托管人依据管理人的划款指令逐笔划付。管理人申购（认购）开放式基金时，应将划款指令连同基金申购（认购）申请单一并传真或邮件的形式给托管人。托管人审核无误后，应及时将划款指令交付执行。管理人应实时调整当日可用资金余额。管理人在收到基金申购（认购）确认回单后，应立即以电子邮件、传真或管理人及托管人双方认可的其他方式发送至托管人。

2、管理人赎回开放式基金时，应在向基金管理公司或代销机构发出基金赎回申请书的同时将赎回申请书传真或邮件的形式给托管人；管理人在收到赎回确认回单后，应及时传真或邮件的形式给托管人。

3、为确保本集合计划财产会计核算及估值的及时处理，管理人应于开放式基金交易（包括认购、申购、赎回、基金转换、红利再投资、现金分红等）的确认日及时获取确认单等单据，要求并督促基金管理公司于当日发送至管理人，管理人收到后应立即传真或邮件的形式给托管人。

### **（四）银行间交易资金结算安排**

1、资产管理人负责对交易对手的资信控制，按银行间债券市场的交易规则进行交易，并负责解决因交易对手不履行合同或不及时履行合同而造成的纠纷及损失。

2、资产管理人可与资产托管人协商，通过取消银行间债券交易成交单发送的授权书等方式约定豁免逐笔银行间债券交易成交单的发送。如未授权，资产管理人则应在交易结束后将银行间同业市场债券交易成交单加盖印章后及时以传真、邮件或以资产托管人和资产管理人协商一致的其他方式发送给资产托管人，并电话确认。如果银行间中债综合业务平台或上海清算所客户终端系统已经生成的交易需要取消或终止，资产管理人应书面通知资产托管人。

3、银行间交易结算方式采用券款对付的，托管账户与该产品在登记结算机构开立的 DVP 资金账户之间的资金调拨，除了中债登和上清所系统自动将 DVP 资金账户资金退回至托管账户的之外，应当由资产管理人出具资金划款指令，资产托管人审核无误后执行。资产管理人需要及时出具指令，以避免导致该产品托管账户的头寸不足或者 DVP 资金账户头寸不足，进而产生损失。

#### **（五）其他场外交易资金结算**

本计划其他场外投资相应的资金划拨由资产托管人依据资产管理人的指令逐笔划付。资产管理人应将指令连同相关投资证明文件一并以传真方式或其他资产管理人和资产托管人认可的方式发送至资产托管人。资产托管人进行审核无误后，应及时将指令交付执行。

#### **（六）资金、证券账目及交易记录的核对**

资产管理人和资产托管人定期对资产管理计划计划财产的资金账目、证券账目、交易记录进行核对。实物账目的核对方式和内容由管理人和托管人协商确定。

#### **（七）参与和退出的资金清算**

本计划参与和退出的确认、清算由资产管理人或其委托的注册登记机构（如有）负责。

资产管理人或其委托的注册登记机构应保证不晚于每个开放日（T日）后的份额确认日内向资产托管人发送该开放日的上述有关数据，并保证相关数据的准确、完整。资产托管人应及时查收参与或转入资金的到账情况并根据资产管理人划款指令及时划付退出或转出款项。

资产管理人在出具划款指令前应该确保托管账户有足够的预留资金，如托管账户内资金不足，由资产管理人承担相关的责任，资产托管人不承担垫款义务。

## **十九、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受托资产市值变化、投资组合规模变动（受托资产的参与或退出）等资产管理人之外的因素致使受托资产的投资

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

### **2、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法律法规或本合同约定的情形不构成本节所述越权交易，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法律法规或本合同约定的情形，为被动超标，不属于越权交易。发生被动超标时，资产管理人应当在本合同第十一章“集合计划的投资”章节相关条款规定的交易日期限内（含被动超标当日）进行调整，以达到法律法规或本合同的要求。

（2）法律法规对被动超标另有规定的从其规定。

因被动超标而对资产管理计划财产造成的损失由计划财产承担。

3、资产托管人对资产管理计划财产投资的监督和检查自本计划成立之日起开始。

## 二十、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）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。

### （二）估值时间

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，以及国家法律法规规定需要对外披露本集合计划净值的非交易日。

### （三）估值对象

本集合计划所拥有的银行存款本息、债券回购等资产及负债。

### （四）估值方法及其调整

本计划资产的估值，参照《企业会计准则》《资产管理产品相关会计处理规定》《指导意见》以及中国证监会关于资产管理计划对金融工具进行核算与估值的规定、资产管理计划净值计价及风险控制要求及资产管理合同约定的估值方法进行。如国内证券投资会计原则及方法发生变化，由管理人与托管人另行协商确定估值方法。

#### 1、固定收益品种估值方法

（1）对于已上市或已挂牌转让的不含权固定收益品种（本合同另有规定的除外），选取第三方估值基准服务机构提供的相应品种当日的估值净价，具体估值机构由管理人和托管人协商约定。

如在证券交易所交易的固定收益品种，优先采用中证指数有限公司提供的估值数据；如在全国银行间市场交易的固定收益品种，优先采用中债金融估值中心有限公司提供的估值数据。

（2）对于已上市或已挂牌转让的含权固定收益品种（本合同另有规定的除外），选取第三方估值基准服务机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价，具体估值机构由管理人和托管人协商约定。

对于含投资者回售权的固定收益品种，行使回售权的，在回售登记日至实际

收款日期间选取第三方估值基准服务机构提供的相应品种的唯一估值净价或推荐估值净价，同时应充分考虑发行人的信用风险变化对公允价值的影响。回售登记期截止日（含当日）后未行使回售权的按照长待偿期所对应的价格进行估值。

（3）对于未上市或未挂牌转让且不存在活跃市场的固定收益品种，一般应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定其公允价值。

## 2、证券投资基金估值方法

（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）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；

（3）开放式基金（包括托管在场外的上市开放式基金 LOF）以估值日前一交易日】基金单位净值估值，估值日前一交易日开放式基金单位净值未公布的，以前最近一个交易日基金单位净值计算。

## 3、银行定期存款或通知存款估值方法

银行定期存款或通知存款以本金列示，按协议或合同利率逐日确认利息收入。如提前支取或利率发生变化，将及时进行账务调整。

5、托管账户存款及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。

6、持有的证券回购资产在回购期间，按照实际利率逐日计提回购应计利息。

7、如有新增事项或变更事项，按国家最新规定估值。

8、暂停估值的情形：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或因任何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，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。

由于不可抗力原因，或由于证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司发

送的数据错误，管理人和托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，由此造成的资产估值错误，管理人和托管人可以免除赔偿责任。但管理人、托管人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

#### **（五）估值程序**

集合计划的日常估值由管理人每日日终前进行，托管人于每日日终前完成复核。用于公开披露的集合计划单位净值由管理人完成估值后，将估值结果发送至托管人，集合计划托管人进行复核，并将复核结果反馈给管理人。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。

#### **（六）估值错误的处理**

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。

#### **（七）估值调整的情形与处理**

如有确凿证据表明前述估值方法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的基础上，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。

#### **（八）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。

#### **（九）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，但托管人有权向监管机构报告。

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。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。计划资产份额净值的计算保留到小数点后 4 位，小数点后第 5 位四舍五入，由此产生的差额部分计入集合计划资产的损益。

#### **（十）特殊情形的处理**

管理人按估值方法的第 1 项固定收益品种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。

#### **（十一）会计政策**

- 1、会计年度为公历年度的 1 月 1 日至 12 月 31 日。
- 2、核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位。
- 3、会计核算制度执行国家有关会计制度。
- 4、资产管理计划独立建账、独立核算。

管理人应保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，编制会计报表；托管人应定期与管理人就资产管理计划的会计核算、报表编制等进行核对。

## 二十一、集合计划的费用与税收

### (一) 费用种类

- 1、管理人的管理费；
- 2、托管人的托管费；
- 3、投资顾问费用（如有）；
- 4、外包服务费（如有）；
- 5、集合计划财产开立账户需要支付的费用、资金结算汇划费（含赎回划款手续费）、账户管理与维护费、网银开户相关费用等；
- 6、集合计划财产的证券交易费用、开户费用（包括但不限于本计划所有金融工具的交易费、工商登记及变更费用（如有）、经手费、印花税、过户费、手续费、经纪商佣金等类似性质的费用）；
- 7、本计划存续期间发生的信息披露费用、与受托财产运作相关的或者为维护投资者利益支出的会计师费、律师费、诉讼费、仲裁费和财产保全费等合理费用；
- 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、按照国家有关规定和资产管理合同约定，可以在集合计划财产中列支的其他费用。

### (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

本集合计划管理费按前一日集合计划资产净值的 0.05% 年费率计提，计算方法如下：

$$M = E \times 0.05\% \div 365$$

M 为每日应计提的集合计划管理费

E 为前一日集合计划总资产净值

集合计划成立后，管理费按前一日计划资产净值计算，每日计提，按季支付。经管理人与托管人双方核对无误后，由集合计划托管人于次季度首日 5 个工作日

内或本集合计划终止日，按照指定的账户路径进行资金支付，管理人无需再出具资金划拨指令。费用自动扣划后，管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系托管人协商解决，若受托财产现金形式资产不足以支付或遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

**管理费收入账户信息：**

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**

本集合计划托管费按前一日集合计划资产净值的 0.01%年费率计提，计算方法如下：

$$H=E \times 0.01\% \div 365$$

H 为每日应计提的集合计划托管费

E 为前一日集合计划总资产净值

集合计划成立后，托管费按前一日计划资产净值计算，每日计提，按季支付。经管理人与托管人双方核对无误后，由集合计划托管人于次季度首日起 5 个工作日内或本集合计划终止日，按照指定的账户路径进行资金支付，管理人无需再出具资金划拨指令。费用自动扣划后，管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系托管人协商解决，若受托财产现金形式资产不足以支付或遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

**托管费收入账户信息：**

户 名：中信证券股份有限公司

账 号：0200012719201656174

开户银行：中国工商银行股份有限公司北京燕莎支行

大额支付行号：102100001274

**3、管理费和托管费的调整**

经管理人、托管人协商一致，管理人可调整管理费和托管费，如需调整，管理人须在开放期前在管理人网站公告，投资者不同意即可在开放期退出。新的管理费和托管费征收方案自开放期后开始执行。

### （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（若有）

（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。

（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，在相应的会计期间进行预提。

（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、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。

#### **（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受托资产承担，由此会导致受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（如有）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。

#### **（六）银行间费用（若有）**

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，由托管人从受托资产中扣划，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受托资产投资会产生的银行间费用，并确保账户中有足够资金用于银行间费用的支付，如因托管账户中的资金不足以支付银行间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。如受托资产未起始运作，

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。

## 二十二、集合计划的收益分配

### （一）可分配利润的构成

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

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

### （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。
- 3、本合同中关于“利益”、“收益”的表述，并不意味着管理人保证投资者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。

如集合计划份额净值连续5个交易日高于1.0000元，管理人可进行分红。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，投资者可以选择现金分红或者红利再投资分红方式。投资者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。

投资者选择红利再投分红方式的，分红资金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将现金收益划付至管理人账户。

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分配方式、分配金额等要素进行核对。若划至管理人账户，托管人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。

## **二十三、集合计划的信息披露与报告**

### **（一）信息披露的种类及内容**

- 1、集合计划合同、计划说明书和风险揭示书；
- 2、集合计划净值；
- 3、集合计划定期报告，包括季度报告和年度报告；
- 4、集合计划临时报告；
- 5、清算报告。

### **（二）集合计划份额净值**

披露时间：本集合计划成立后的每个申购开放日、赎回开放日披露集合计划份额净值、累计净值。

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网站或 APP 公告形式向投资者披露，除非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。

### **（三）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，经托管人复核财务数据后由管理人公告，并报相关监管机构或自律组织。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，同时应根据法律法规、监管规定、自律组织规则等要求向监管机构或基金业协会等有权机构备案或报告（如需）。

#### 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，经托管人复核财务数据后由管理人公告，并报相关监管机构或自律组织等备案。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，同时应根据法律法规、监管规定、自律组织规则等要求向监管机构或基金业协会等有权机构备案或报告（如需）。

集合计划的年度报告内容包括但不限于下列信息：

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

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

### （四）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5个工作日内及时通过管理人网站等方式及时向客户披露，同时应根据法律法规、监管规定、自律组织规则等要求向监管机构或基金业协会等有权机构备案或报告（如需）。

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）集合计划存续期内任何一个交易日（T日）日终，集合计划单位净值等于或低于预警线，同时当且仅当T-1日本集合计划单位净值高于预警线（管理人将于T+1日内以管理人网站公告、邮件、短信或者其他管理人和投资者认可的方式进行信息披露，持续等于或低于预警线管理人将不再另行披露）；

（5）集合计划终止和清算；

（6）管理人以自有资金参与和退出；

（7）合同的补充、修改与变更；

（8）与集合计划有关的重大诉讼、仲裁事项；

（9）负责本集合计划的代理销售机构发生变更；

（10）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；

（11）管理人、托管人因解散、破产、撤销等原因不能履行相应职责；

(12) 集合计划收益分配；

(13) 管理费、托管费等费用计提方式或费率发生变更；

(14) 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。

(五) 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受托资产的投资运作、托管等情况。

(六) 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。

**(七) 管理人、托管人向监管机构报告的种类、内容、时间和途径**

管理人、托管人将根据《指导意见》《管理办法》《运作规定》及其他法律、行政法规、监管规定及要求及时进行报告。

## 二十四、风险揭示

本集合计划面临的风险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》《资产管理计划风险揭示书内容与格式指引》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、资产管理计划委托募集所涉风险

管理人可以委托具有证监会核准的基金销售/代销金融产品资格的机构代

理销售本计划，若代销机构发生管理不善、操作失误等，或存在违法违规地公开宣传、虚假宣传、以保本保收益引诱投资者购买、未能履行投资者适当性审查工作、挪用侵占产品财产等行为，导致投资者合法权益受损的风险。

### 3、资产管理计划提前终止清算的风险；

如出现集合资产管理合同第二十五章“集合计划的变更、终止与财产清算”约定的情形，本资产管理计划将提前终止和清算，委托人可能面临投资收益受到影响的风险。

根据本合同约定因监管政策变化、市场情况等原因导致本资产管理计划投资策略无法实施，或者本计划投资策略已不适当当时的市场环境，管理人可以在存续期内提前终止本计划。委托人可能面临资产管理计划提前终止，未能实现预期投资计划，投资收益受到影响的风险。

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

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。

### 5、电子合同签署风险（如有）

本计划投资者如采用电子签名的方式签署相关合同，在电子合同签署过程中，由于投资者向销售机构提供的个人（或机构）信息不全或有误被管理人、托管人或注册登记机构确认需补正的，投资者面临补正上述信息后重新签署电子合同的风险；管理人、销售机构或注册登记机构电子合同相关系统出现故障或人为操作因素，导致投资者电子签名合同数据没有被系统接收，投资者面临重新签署电子合同的风险。

### 6、参与和退出不确定的风险

（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）本集合计划单个开放日，集合计划累计净退出申请份额超过前一日集合计划总份额的20%时，即认为发生了巨额退出。当出现巨额退出时，管理人将根据集合资产组合状况决定投资者全额退出或者部分顺延退出。

(3) 如其该笔退出完成后在该销售机构剩余的集合计划份额低于 30 万份，则管理人自动将该投资者在该销售机构的全部剩余份额退出给投资者。

(4) 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。

## 7、预警止损机制的风险

本集合计划以集合计划单位净值为基础设置预警线和止损线，预警线为 0.9500 元，止损线为 0.9200 元。

虽然本集合计划设置了预警止损机制，且管理人将依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则按照合同规定及时执行预警或止损操作，但并不承诺和保证卖出的价格水平，卖出价格均以实际成交价格或所投资资产管理产品管理人确认的净值为准，管理人对此不承担任何责任。管理人也不保证投资者不受损失或取得收益，且但在市场严重缺乏流动性等极端情况下，本集合计划终止时的单位净值仍有可能远低于本合同规定的预警或止损线，投资者已充分认可和承担上述情况可能带来的相应后果。

## 8、投资标的所涉风险

本计划管理人将按照集合资产管理合同第十一章“集合计划的投资”的约定进行投资。以下虽然列出了相关投资标的的特定风险，但并不表示本计划将必然投资以下投资标的，亦不代表本计划仅投资于以下投资标的。

### (1) 债券投资风险

债券投资具有信用风险、市场风险、流动性风险、违约风险及其他各类风险。

1) 信用风险，指债券发行人无法按期还本付息的风险。如果本计划购买或持有资信评级较低的信用债，将面临显著的信用风险。

2) 流动性风险，是指本计划在短期内无法以合理价格买入或卖出债券，从而遭受损失的风险。

3) 市场风险，由于市场环境或供求关系等因素导致的债券价格波动的风险。债券市场不同期限、不同类属债券之间的利差变动导致相应期限和类属债券价格变化的风险。

4) 违约风险，本计划在回购期间因回购标准券使用率、回购放大倍数或资金交收等行为违反交易所规则及证券公司约定时，证券公司有权直接对投资者账户内资金或证券进行处分，包括但不限于：限制交易和限制取款、冻结、强制平

仓、扣划资金等，由此可能给本计划造成经济损失。

### **(2) 投资债券回购的特有风险**

A、信用风险：逆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，造成计划净值损失的风险；

B、投资风险：在进行正回购操作时，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；

C、波动性加大的风险：在进行正回购操作时，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，对受托财产净值造成损失的可能性也就越大。

D、受托资产用于融资回购的债券，将作为托管人相关结算备付金账户偿还融资回购到期购回款的质押券，若管理人债券回购交收违约，存在托管人及结算公司有权依法对质押券进行处置的风险。

### **(3) 现金管理风险**

本计划如为开放式，必须保持一定的现金比例以应付资产委托人的追加/提取需求，在管理现金头寸时，有可能存在现金不足的风险和现金过多而带来的机会成本风险。此外，本计划也可能由于向资产委托人分配收益而面临现金不足的风险。

### **(4) 交易中断的风险**

本计划存续期内，可能会因政策变化、监管要求或证券经纪商等第三方机构的原因导致本计划的证券账户被暂停交易或被终止交易，由此可能会导致本计划遭受损失。

## **9、从事重大关联交易、一般关联交易所涉风险**

管理人对与托管人有关的关联交易的监控受限于托管人提供或公开披露的关联方名单及关联证券名单的真实性、准确性、全面性和及时性，如托管人未能提供或公开披露关联方名单及关联证券名单的，管理人将无法监控与托管人有关的关联交易，无法向投资者、托管人进行披露。

管理人根据资产管理合同约定从事关联交易的，虽然管理人将依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则按照市场公允定价进行公平交易，但仍可能存在被监

管层否定的政策风险和相应的关联交易风险。此外，管理人运用集合计划资产从事关联交易时可能依照相关法律法规、其他规范性文件被限制相关权利的行使，进而可能影响投资者的利益。此外，若将来法律、行政法规及中国证监会及基金业协会的相关规定对于集合计划的关联交易做出新的监管要求的，本计划将参照届时最新的监管要求执行，该等操作可能会对集合计划的投资收益造成影响。

特别地，由于管理人已通过资产管理合同取得了投资者对一般关联交易的概括授权，因此管理人运用集合计划财产进行资产管理合同约定的一般关联交易的，不会在交易前逐笔取得投资者的同意，也不会交易前逐笔通知投资者，但会在交易后合理时间内将一段时间内的一般关联交易情况通知投资者。上述安排导致投资者无法在交易前获知一般关联交易的情况、也无法决定管理人是否进行某笔一般关联交易的风险。在管理人进行一般关联交易时，虽然管理人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操作、积极防范利益冲突，但依然不能避免一般关联交易可能发生的投资损失。投资者知悉并接受上述一般关联交易的授权模式及其风险。

管理人可能从事资管合同约定的重大关联交易。交易前管理人将向投资者介绍具体交易情况并征求投资者意见，投资者同意后方可投资。虽然管理人积极遵循投资者利益优先和平等自愿、遵守相关法律法规的规定进行操作、积极防范利益冲突，但该等仍可能因管理人运用集合计划资产从事关联交易被监管部门认为存在重大风险，且管理人无法确保选择进行关联交易的实际交易结果（就投资结束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，进而可能影响集合计划投资者的利益。

## （二）资产管理计划面临的一般风险

### 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，也不保证一定盈利以及最低收益。

### 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，从而影响受托资产的净值。

#### （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，即使是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、税收风险

根据本合同约定，依据相关法律法规或税务机关的认定，资管计划投资及运营过程中发生增值税应税行为，以管理人为增值税纳税人的，除本资管计划已列明的资产管理业务费用（如管理费、托管费等）由各收费方自行缴纳外，管理人有权以计划受托资产予以缴纳，且无需另行征得投资者的同意。管理人按照税务机关的要求进行核算，从本集合计划应税收入中扣除，以管理人为增值税纳税人进行缴纳。因资管计划税费增加，存在导致可分配收益减少的风险。

## 7、操作或技术风险

在集合计划的日常交易中，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。管理人、托管人、证券交易所、证券登

记结算机构等在业务操作过程中，因操作失误或违反操作规程而引起的风险。

#### 8、监管政策风险

因法律法规、政策、监管规定（包括但不限于监管/主管部门或自律组织出台与资产管理合同项下业务相关的任何书面或口头的规则、规范、政策、通知、指令、指引、备忘录、意见或问答等）对集合计划管理和运作安排的要求的不确定性及其任何变化，均可能导致本计划备案时被要求调整或备案最终失败，或在运行过程中被要求调整或提前终止，导致无法及时开始投资或投资安排无法实现或无法正常投资等。在该等情况下，管理人将依据法律法规和监管要求对本计划进行调整或提前终止本计划，可能影响投资人的投资计划和投资收益。

#### 9、适当性管理相关风险

（1）投资者有义务保证其提供的相关信息及材料真实、准确、完整。管理人评定投资者的风险承受能力、做出适当性匹配意见系基于投资者提供的相关信息及证明材料真实、准确、完整的前提下做出；如投资者提供的信息及材料不真实、不准确或不完整，存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，可能会导致投资者的风险承受能力评定、适当性匹配意见存在偏差、与实际不符的风险，管理人有权拒绝为投资者提供服务或拒绝接受投资者的交易申请、业务申请，相关风险、责任、损失由投资者自行承担。

（2）投资者在信息发生重要变化、可能影响管理人对其做出的投资者类别划分、风险承受能力认定时，应主动告知管理人，以便管理人做出调整。若投资者未能及时有效告知管理人，则存在适当性匹配意见与实际不符的风险，进而可能产生的相应风险、责任、损失应由投资者自行承担。

（3）投资者或产品的信息发生变化时，管理人有权主动调整投资者的投资者分类、产品的风险等级以及适当性匹配意见，此时管理人应告知投资者上述情况，并承担未履行告知义务的相关责任。管理人做出主动调整的，投资者的交易或者购买产品的资格可能受到影响，进而产生相应的风险。

#### 10、估值风险

本集合计划采用的估值方法有可能不能充分反映和揭示本计划所持资产的实际价值，或经济环境发生重大变化时，在一定时期内可能高估或低估本计划资产净值。管理人将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，与托管人协商，调整相应投资品种的估值，使调整后的本计划资产净值更公允地反映集合计划资产价值。

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。可能存在公布的计划净值虽经托管人复核但管理人与托管人对估值结果尚未达成一致的风险。

#### 11、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，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。

### （三）其他风险

#### （1）本集合计划不能成立的风险

本集合计划可能存在由于推广期满后募集规模低于 1,000 万份、或投资者少于 2 人，导致集合计划不满足成立条件，从而无法成立的风险。

#### （2）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，可能导致集合计划资产的损失。行业竞争、代理商违约等超出管理人自身直接控制能力之外的风险，可能导致集合计划或者投资者利益受损。

（3）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，可能导致受托资产的损失，从而带来风险。

（4）金融市场危机、行业竞争、托管人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。

#### （5）其他不可预知、不可防范的风险。

## 二十五、集合计划的变更、终止与财产清算

### (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、APP 公告或电子邮件形式向投资者披露。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或电子邮件形式向投资者披露，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或电子邮件等方式向投资者发送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日一工作日做强制退出处理。

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。

## **(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。

发生以上两种情况的，本资产管理计划自动终止。

## **(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) 符合集合计划的成立条件；

(4) 中国证监会规定的其他条件。

### **2、展期的程序与期限**

#### **(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或以书面或电子邮件等方式将展期相关事宜通知投资者，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，默示同意展期。

### (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，存续受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。

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、管理人被依法撤销资产管理业务资格或者依法解散、被撤销、宣告破产，且在 6 个月内没有新的管理人承接；
- 3、托管人被依法撤销基金托管资格或者依法解散、被撤销、宣告破产，且在 6 个月内没有新的托管人承接；
- 4、经全体投资者、管理人和托管人协商一致决定终止；
- 5、持续五个工作日投资者少于 2 人的；
- 6、持有人大会决议提前终止资产管理合同（如有）；
- 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、在本集合计划存续期内任何一个交易日日终，本集合计划份额净值等于或低于止损线，T+1 日本集合计划终止；
- 9、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）管理人要求停止开展此类资产管理产品的，经管理人书面通知委托人及托管人后，管理人有权终止本计划，且不承担任何责任；

10、不可抗力的发生导致本集合计划不能存续；

11、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，资产管理计划的清算由管理人组织发起，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月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；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；

6、管理人应于主要清算事项完成后的 10 个工作日内聘请具有证券相关业务资格的会计师事务所编制清算审计报告并提供给托管人，托管人于 5 个工作日内完成复核，返还给管理人。管理人应当在清算结束后 5 个工作日内在管理人网站公布清算报告，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；

7、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；

8、集合计划财产清算账册及文件由管理人保存 20 年以上。

## 二十六、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。任何一方当事人迟延履行合同义务后，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、托管人对于存放在托管人之外的委托财产的任何损失，及基于从第三方机构（包括但不限于证券交易所、期货交易所等）合法获得的信息及合理信赖上述信息而操作导致委托财产的任何损失等；

6、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，仅限于直接经济损失。

（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）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。

（八）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。

## 二十七、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【深圳国际仲裁院】进行仲裁，按照仲裁时届时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点在深圳，仲裁是终局的，对各方都有约束力。

## 二十八、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。投资者为机构的，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。

本合同若通过电子方式签署，托管人仅认可通过中国证券登记结算有限责任公司系统进行合同文本及电子数据相关传输保存。

### （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经注册登记系统确认；
- 2、本集合计划满足依法有效成立条件。
- 3、受托资产进入托管账户。

本集合计划终止，本合同终止。但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。

### （三）本合同的有效期限

本合同有效期限 10 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。

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。

### （四）合同的组成

《华林证券固盈稳融 1 号集合资产管理计划说明书》《华林证券固盈稳融 1 号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，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。

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推广机构出具的集合计划参与、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。

## 二十九、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。业绩报酬计提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。

或有事件：资产托管人获得监管机构批复或核准可以独资或者控股的具有独立法人资格的子公司（“托管子公司”）从事托管业务。资产管理人、投资者皆同意，如果或有事件发生，资产托管人有权单方在资产托管人网站以公告通知的方式将本合同中应由资产托管人享有的权利和承担的义务概括转让给托管子公司。自该等公告通知载明的指定时间（含）起，上述概括转让被视为自动完成，本合同项下托管人变更为托管子公司，各方无须就此另行签订协议。资产托管人保证托管子公司具备开展此项业务的相关资格和能力。

本合同一式肆份，管理人、托管人、投资者各执壹份，其余壹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。

（以下无正文）

（本页无正文，为《华林证券固盈稳融1号集合资产管理计划资产管理合同》HL(2026)JH字第1号之签署页）

投资者：

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：

管理人：华林证券股份有限公司

法定代表人或授权代理人：

签署日期：

托管人：中信证券股份有限公司

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

华林证券固盈稳融1号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

### 华林证券固盈稳融1号集合资产管理计划风险揭示书

尊敬的投资者：

投资有风险。当您/贵机构认购或申购资产管理计划时，可能获得投资收益，但同时也面临着投资亏损的风险。您/贵机构在做出投资决策之前，请仔细阅读本风险揭示书和资产管理合同等文件，充分认识资产管理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，理性判断并谨慎做出投资决策。

本计划属于【R1】低风险投资品种，适合风险识别、评估、承受能力为【保守型（C1）、谨慎型（C2）、稳健型（C3）、积极型（C4）、激进型（C5）】的普通投资者及专业投资者。根据有关法律法规，管理人【华林证券股份有限公司】以及投资者分别作出如下承诺、风险揭示以及声明：

#### 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“协会”或“基金业协会”）办理资产管理计划备案不作为对资产管理计划财产安全和投资者收益的保证，也不表明协会对备案材料的真实性、准确性、完整性作出保证。

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

（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》《资产管理计划风险揭示书内容与格式指引》及相关法律法规

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情况下，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、资产管理计划委托募集所涉风险

管理人可以委托具有证监会核准的基金销售/代销金融产品资格的机构代理销售本计划，若代销机构发生管理不善、操作失误等，或存在违法违规地公开宣传、虚假宣传、以保本保收益引诱投资者购买、未能履行投资者适当性审查工作、挪用侵占产品财产等行为，导致投资者合法权益受损的风险。

## 3、资产管理计划提前终止清算的风险；

如出现集合资产管理合同第二十五章“集合计划的变更、终止与财产清算”约定的情形，本资产管理计划将提前终止和清算，委托人可能面临投资收益受到影响的风险。

根据本合同约定因监管政策变化、市场情况等原因导致本资产管理计划投资策略无法实施，或者本计划投资策略已不适当当时的市场环境，管理人可以在存续期内提前终止本计划。委托人可能面临资产管理计划提前终止，未能实现预期投资计划，投资收益受到影响的风险。

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

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。

## 5、电子合同签署风险（如有）

本计划投资者如采用电子签名的方式签署相关合同，在电子合同签署过程中，由于投资者向销售机构提供的个人（或机构）信息不全或有误被管理人、托管人或注册登记机构确认需补正的，投资者面临补正上述信息后重新签署电

子合同的风险；管理人、销售机构或注册登记机构电子合同相关系统出现故障或人为操作因素，导致投资者电子签名合同数据没有被系统接收，投资者面临重新签署电子合同的风险。

#### 6、参与和退出不确定的风险

(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) 本集合计划单个开放日，集合计划累计净退出申请份额超过前一日集合计划总份额的 20%时，即认为发生了巨额退出。当出现巨额退出时，管理人将根据集合资产组合状况决定投资者全额退出或者部分顺延退出。

(3) 如其该笔退出完成后在该销售机构剩余的集合计划份额低于 30 万份，则管理人自动将该投资者在该销售机构的全部剩余份额退出给投资者。

(4) 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。

#### 7、预警止损机制的风险

本集合计划以集合计划单位净值为基础设置预警线和止损线，预警线为 0.9500 元，止损线为 0.9200 元。

虽然本集合计划设置了预警止损机制，且管理人将依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则按照合同规定及时执行预警或止损操作，但并不承诺和保证卖出的价格水平，卖出价格均以实际成交价格或所投资资产管理产品管理人确认的净值为准，管理人对此不承担任何责任。管理人也不保证投资者不受损失或取得收益，且但在市场严重缺乏流动性等极端情况下，本集合计划终止时的单位净值仍有可能远低于本合同规定的预警或止损线，投资者已充分认可和承担上述情况可能带来的相应后果。

#### 8、投资标的所涉风险

本计划管理人将按照集合资产管理合同第十一章“集合计划的投资”的约定进行投资。以下虽然列出了相关投资标的的特定风险，但并不表示本计划将必然投资以下投资标的，亦不代表本计划仅投资于以下投资标的。

##### (1) 债券投资风险

债券投资具有信用风险、市场风险、流动性风险、违约风险及其他各类风险。

1) 信用风险，指债券发行人无法按期还本付息的风险。如果本计划购买或持有资信评级较低的信用债，将面临显著的信用风险。

2) 流动性风险，是指本计划在短期内无法以合理价格买入或卖出债券，从而遭受损失的风险。

3) 市场风险，由于市场环境或供求关系等因素导致的债券价格波动的风险。债券市场不同期限、不同类属债券之间的利差变动导致相应期限和类属债券价格变化的风险。

4) 违约风险，本计划在回购期间因回购标准券使用率、回购放大倍数或资金交收等行为违反交易所规则及证券公司约定时，证券公司有权直接对投资者账户内资金或证券进行处分，包括但不限于：限制交易和限制取款、冻结、强制平仓、扣划资金等，由此可能给本计划造成经济损失。

## **(2) 投资债券回购的特有风险**

A、信用风险：逆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，造成计划净值损失的风险；

B、投资风险：在进行正回购操作时，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；

C、波动性加大的风险：在进行正回购操作时，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，对受托财产净值造成损失的可能性也就越大。

D、受托资产用于融资回购的债券，将作为托管人相关结算备付金账户偿还融资回购到期购回款的质押券，若管理人债券回购交收违约，存在托管人及结算公司有权依法对质押券进行处置的风险。

## **(3) 现金管理风险**

本计划如为开放式，必须保持一定的现金比例以应付资产委托人的追加/提取需求，在管理现金头寸时，有可能存在现金不足的风险和现金过多而带来的机会成本风险。此外，本计划也可能由于向资产委托人分配收益而面临现金不足的风险。

## **(4) 交易中断的风险**

本计划存续期内，可能会因政策变化、监管要求或证券经纪商等第三方机构

的原因导致本计划的证券账户被暂停交易或被终止交易，由此可能会导致本计划遭受损失。

#### 9、从事重大关联交易、一般关联交易所涉风险

管理人对与托管人有关的关联交易的监控受限于托管人提供或公开披露的关联方名单及关联证券名单的真实性、准确性、全面性和及时性，如托管人未能提供或公开披露关联方名单及关联证券名单的，管理人将无法监控与托管人有关的关联交易，无法向投资者、托管人进行披露。

管理人根据资产管理合同约定从事关联交易的，虽然管理人将依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则按照市场公允定价进行公平交易，但仍可能存在被监管层否定的政策风险和相应的关联交易风险。此外，管理人运用集合计划资产从事关联交易时可能依照相关法律法规、其他规范性文件被限制相关权利的行使，进而可能影响投资者的利益。此外，若将来法律、行政法规及中国证监会及基金业协会的相关规定对于集合计划的关联交易做出新的监管要求的，本计划将参照届时最新的监管要求执行，该等操作可能会对集合计划的投资收益造成影响。

特别地，由于管理人已通过资产管理合同取得了投资者对一般关联交易的概括授权，因此管理人运用集合计划财产进行资产管理合同约定的一般关联交易的，不会在交易前逐笔取得投资者的同意，也不会交易前逐笔通知投资者，但会在交易后合理时间内将一段时间内的一般关联交易情况通知投资者。上述安排导致投资者无法在交易前获知一般关联交易的情况、也无法决定管理人是否进行某笔一般关联交易的风险。在管理人进行一般关联交易时，虽然管理人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操作、积极防范利益冲突，但依然不能避免一般关联交易可能发生的投资损失。投资者知悉并接受上述一般关联交易的授权模式及其风险。

管理人可能从事资管合同约定的重大关联交易。交易前管理人将向投资者介绍具体交易情况并征求投资者意见，投资者同意后方可投资。虽然管理人积极遵循投资者利益优先和平等自愿、遵守相关法律法规的规定进行操作、积极防范利益冲突，但该等仍可能因管理人运用集合计划资产从事关联交易被监管部门认为存在重大风险，且管理人无法确保选择进行关联交易的实际交易结果（就投资结束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，进而可能影响集合计划投资者的利益。

## （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，也不保证一定盈利以及最低收益。

### 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，从而影响受托资产的净值。

#### （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、税收风险

根据本合同约定，依据相关法律法规或税务机关的认定，资管计划投资及运

营过程中发生增值税应税行为，以管理人为增值税纳税人的，除本资管计划已列明的资产管理业务费用（如管理费、托管费等）由各收费方自行缴纳外，管理人有权以计划受托资产予以缴纳，且无需另行征得投资者的同意。管理人按照税务机关的要求进行核算，从本集合计划应税收入中扣除，以管理人为增值税纳税人进行缴纳。因资管计划税费增加，存在导致可分配收益减少的风险。

#### 7、操作或技术风险

在集合计划的日常交易中，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。管理人、托管人、证券交易所、证券登记结算机构等在业务操作过程中，因操作失误或违反操作规程而引起的风险。

#### 8、监管政策风险

因法律法规、政策、监管规定（包括但不限于监管/主管部门或自律组织出台与资产管理合同项下业务相关的任何书面或口头的规则、规范、政策、通知、指令、指引、备忘录、意见或问答等）对集合计划管理和运作安排的要求的不确定性及其任何变化，均可能导致本计划备案时被要求调整或备案最终失败，或在运行过程中被要求调整或提前终止，导致无法及时开始投资或投资安排无法实现或无法正常投资等。在该等情况下，管理人将依据法律法规和监管要求对本计划进行调整或提前终止本计划，可能影响投资人的投资计划和投资收益。

#### 9、适当性管理相关风险

（1）投资者有义务保证其提供的相关信息及材料真实、准确、完整。管理人评定投资者的风险承受能力、做出适当性匹配意见系基于投资者提供的相关信息及证明材料真实、准确、完整的前提下做出；如投资者提供的信息及材料不真实、不准确或不完整，存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，可能会导致投资者的风险承受能力评定、适当性匹配意见存在偏差、与实际不符的风险，管理人有权拒绝为投资者提供服务或拒绝接受投资者的交易申请、业务申请，相关风险、责任、损失由投资者自行承担。

（2）投资者在信息发生重要变化、可能影响管理人对其做出的投资者类别划分、风险承受能力认定时，应主动告知管理人，以便管理人做出调整。若投资者未能及时有效告知管理人，则存在适当性匹配意见与实际不符的风险，进而可

能产生的相应风险、责任、损失应由投资者自行承担。

(3) 投资者或产品的信息发生变化时，管理人有权主动调整投资者的投资者分类、产品的风险等级以及适当性匹配意见，此时管理人应告知投资者上述情况，并承担未履行告知义务的相关责任。管理人做出主动调整的，投资者的交易或者购买产品的资格可能受到影响，进而产生相应的风险。

## 10、估值风险

本集合计划采用的估值方法有可能不能充分反映和揭示本计划所持资产的实际价值，或经济环境发生重大变化时，在一定时期内可能高估或低估本计划资产净值。管理人将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，与托管人协商，调整相应投资品种的估值，使调整后的本计划资产净值更公允地反映集合计划资产价值。

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。可能存在公布的计划净值虽经托管人复核但管理人与托管人对估值结果尚未达成一致的风险。

## 11、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，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。

## 12、其他风险

### (1) 本集合计划不能成立的风险

本集合计划可能存在由于推广期满后募集规模低于 1,000 万份、或投资者少于 2 人，导致集合计划不满足成立条件，从而无法成立的风险。

### (2) 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

能导致集合计划资产的损失。行业竞争、代理商违约等超出管理人自身直接控制能力之外的风险，可能导致集合计划或者投资者利益受损。

(3) 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，可能导致受托资产的损失，从而带来风险。

(4) 金融市场危机、行业竞争、托管人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。

(5) 其他不可预知、不可防范的风险。

### 三、投资者声明

作为资产管理计划的投资者，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）其内容的真实和准确：

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二十一章“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二十六章至第二十七章“违约责任与争议的处理”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，中国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）：

日期：