

编号:MADA20211-0005

上海证券翱翔蓝海 FOF 单一 资产管理计划资产管理合同

投资者：杭州联华华商集团有限公司

资产管理人：上海证券有限责任公司

资产托管人：中国建设银行股份有限公司上海市分行

二〇二一年七月

目 录

一、前言.....	2
二、释义.....	3
三、声明与承诺.....	5
四、当事人及权利义务.....	7
五、资产管理计划的基本情况.....	15
六、资产管理计划的成立与备案.....	18
七、资产管理计划财产.....	19
八、资产管理计划的投资.....	25
九 投资顾问（如有）.....	31
十、利益冲突及关联交易.....	31
十一、投资经理的指定与变更.....	33
十二、投资指令的发送、确认和执行.....	33
十三、交易及交收清算安排.....	38
十四、越权交易.....	44
十五、资产管理计划财产的估值和会计核算.....	48
十六、资产管理计划的费用与税收.....	54
十七、资产管理计划的收益分配.....	59
十八、信息披露与报告.....	60
十九、风险揭示.....	62
二十、资产管理合同的变更与终止.....	65

二十一、反洗钱.....	69
二十二、违约责任.....	71
二十三、争议的处理.....	72
二十四、资产管理合同的效力.....	72
二十五、其他事项.....	73

一、前言

(一) 订立本合同的目的、依据和原则

1、订立本资产管理合同(以下简称“本合同”或“合同”)的目的是为了明确投资者、资产管理人和资产托管人在开展单一资产管理业务过程中的权利、义务及职责。

2、订立本合同的依据是《中华人民共和国民法典》(以下简称“《民法典》”)、《中华人民共和国证券法》(以下简称“《证券法》”)、《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》(以下简称“《管理办法》”)、《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》(以下简称“《运作规定》”)、《单一资产管理计划资产管理合同内容与格式指引(试行)》和其他有关法律、法规。

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

(二)本合同的当事人包括投资者、资产管理人和资产托管人。投资者自签订本合同且本资产管理计划成立,即成为资产管理计划的投资者和本合同的当事人。在本合同存续期间,投资者自全部退出资产管理计划之日起,该投资者不再成为资产管理计划的投资者和本合同的当事人。资产管理人应当对资产管理计划的设立、变更、展期、终止、清算等行为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本资产管理计划的备案不能免除资产管理人按照

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，除上下文另有规定外，下列用语应具有如下含义：

(一) 资产管理计划、本计划、计划：指上海证券翱翔蓝海 FOF 单一资产管理计划，系本合同下资产管理人向符合条件的单一投资者销售的，由中国建设银行股份有限公司上海市分行担任资产托管人，用以取得符合条件的单一投资者资产管理计划财产并于特定账户进行投资的计划

(二) 计划说明书：指《上海证券翱翔蓝海 FOF 单一资产管理计划计划说明书》

(三) 风险揭示书：指《上海证券翱翔蓝海 FOF 单一资产管理计划风险揭示书》

(四) 资产管理合同、本合同、合同：指投资者、资产管理人和资产托管人签署的《上海证券翱翔蓝海 FOF 单一资产管理计划资产管理合同》及其附件，以及对该合同及附件做出的任何有效变更

(五) 投资者、委托人：全额支付投资款项、签署本合同，且合同生效的投资者

(六) 资产管理人：指上海证券有限责任公司

(七) 资产托管人：指中国建设银行股份有限公司上海市分行

(八) 法律法规：指中国现时有效并公布实施的法律、行政法规、部门规章及规范性文件

(九) 中国证监会：指中国证券监督管理委员会

(十) 证券投资基金业协会：指中国证券投资基金业协会

(十一) 中国结算：指中国证券登记结算有限责任公司

(十二) 银行间市场登记结算机构：指中央国债登记结算有限责任公司和银行间市场清算所股份有限公司

(十三) 证券交易所：指上海证券交易所/深圳证券交易所

(十四) 交易日：指上海证券交易所和深圳证券交易所的正常交易日

(十五) 工作日：资产管理人和资产托管人办理日常业务的营业日

(十六) T日：指资产管理人运用委托财产进行投资的日期

(十七) T+n日：指自T日起第n个工作日(不包含T日)

(十八) 证券账户：指根据中国证监会有关规定和中国结算有关业务规则，由资产托管人或资产管理人为本计划在中国结算开立的证券账户，在银行间市场登记结算机构开立的债券托管账户

(十九) 资金账户：指资产托管人根据有关规定为资产管理计划开立的、专门用于资金收付、清算交收的银行账户

(二十) 指定账户：指资产委托人用以与资金账户之间进行委托财产划付的唯一指定账户

(二十一) 资产管理计划财产、委托财产：指投资者拥有合法所有权或处分权、委托资产管理人管理并由资产托管人托管的、作为本合同标的的财产

(二十二) 资产管理计划资产总值：指资产管理计划拥有的各类证券、银行

存款本息及其他投资的价值总和

(二十三) 资产管理计划资产净值：指资产管理计划资产总值减去负债后的价值

(二十四) 资产管理计划资产估值：指计算评估资产管理计划资产和负债的价值，以确定资产管理计划资产净值的过程

(二十五) 元：指人民币元

(二十六) 估值报告日：指每月最后一个交易日或遇资产委托人追加、提取委托财产日期

(二十七) 投资报告：指年度报告和季度报告中资产管理人对报告期内资产管理计划投资运作等情况的说明

(二十八) 不可抗力：指不能预见、不能避免并不能克服的客观情况，且在本合同由合同当事人签署之日后发生的，使本合同当事人无法全部履行或无法部分履行本合同的任何事件，包括但不限于洪水、地震及其他自然灾害、战争、骚乱、火灾、政府征用、没收、法律法规变化、系统故障、突发停电或其他突发事件、证券交易所非正常暂停或停止交易。

三、声明与承诺

(一) 投资者承诺

1.符合《运作规定》合格投资者的要求，且不是资产管理人的董事、监事、从业人员及其配偶。

2.向资产管理人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，及时书面告知资产管理人。

3.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。

4.已充分理解本合同条款，了解相关权利义务，了解有关法律法规及所投资资产管理计划的风险收益特征，知晓资产管理人、资产托管人（如有）及相关机构不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。

（二）资产管理人承诺

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.根据《中华人民共和国反洗钱法》等反洗钱相关法律法规要求履行反洗钱义务，包括但不限于客户身份识别、客户身份资料和交易记录保存、大额交易和可疑交易报告。并为资产托管人开展反洗钱工作提供充分的协助，法律法规另有规定的除外。

（三）资产托管人承诺

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，对资产管理人的投资或清算指令等进行监督。

3.在资产管理人发生异常且无法履行管理职能时，依照法律法规及合同约定履行受托职责，维护投资者权益。

4.资产托管人对委托财产的保管，并非对委托财产本金或收益的保证或承诺，资产托管人不承担委托财产的投资风险；对于投资者和资产管理人约定的收益分配等内容，资产托管人不承担任何责任。

5.根据《中华人民共和国反洗钱法》等反洗钱相关法律法规要求履行反洗钱义务，包括但不限于客户身份识别、客户身份和交易资料留存、大额和可疑交易报告。并为资产管理人开展反洗钱工作提供充分的协助，法律法规另有规定的除外。

四、当事人及权利义务

(一) 投资者

全额支付投资款项、签署本合同，且合同生效的投资人即为本合同的投资者。

名称或姓名：杭州联华华商集团有限公司

住所：杭州市下城区庆春路 86 号

法定代表人：张慧勤

联系人：陈石军

联系电话：13666682877

传真电话：0571-87215588

邮编：310003

通信地址：杭州市庆春路 86 号世纪联华 7 楼财务部

(二) 资产管理人

名称：上海证券有限责任公司

住所：上海市四川中路 213 号

办公地址：上海市四川中路 213 号

法定代表人：何伟

组织形式：有限责任公司

注册资本：53.27 亿人民币

存续期间：持续经营

联系人：王京

联系电话：021-53686888

(三) 资产托管人

名称：中国建设银行股份有限公司上海市分行

住所：上海市淮海中路 200 号

办公地址：上海市陆家嘴环路 900 号

邮政编码：200120

负责人：林顺辉

授权代理人：蔡千里

组织形式：股份制商业银行分支机构

联系人：陈晨

联系电话：021-58880000

(四) 投资者的权利

根据法律法规及其他有关规定，投资者的权利包括：

- 1、按照本合同的约定取得资产管理计划财产收益；
 - 2、取得清算后的剩余资产管理计划财产；
 - 3、按照本合同的约定追加或提取委托财产；
 - 4、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；
 - 5、监督资产管理人及资产托管人履行投资管理和托管义务的情况；
 - 6、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。

(五) 投资者的义务

根据法律法规及其他有关规定，投资者的义务包括：

- 1、认真阅读并遵守资产管理合同，保证投资资金的来源及用途合法；
- 2、接受合格投资者认定程序，如实填写风险识别能力和风险承受能力问卷，如实提供资金来源、金融资产、收入及负债情况，并对其真实性、准确性和完整性负责，签署合格投资者相关文件；
- 3、承诺投资资产管理计划的最终资金来源不存在贷款、发行债券等筹集的非自有资金的情形；
- 4、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，应向资产管理人充分披露实际投资者和最终资金来源；
- 5、认真阅读并签署风险揭示书；

6、按照资产管理合同的约定支付资产管理业务的管理费、业绩报酬(如有)、托管费及税费,并承担因资产管理计划财产运作产生的其他费用;

7、按照资产管理合同的约定,将资产管理计划财产交付资产管理人和资产托管人分别进行投资管理和资产托管,以资产管理计划财产为限依法承担资产管理计划亏损或者终止的有限责任;

8、向资产管理人提供法律法规规定的信息资料及身份证明文件,配合资产管理人完成投资者适当性管理、非居民金融账户涉税信息的尽职调查、反洗钱等监管规定的工作;

9、不得违反资产管理合同的约定干涉资产管理人的投资行为;

10、不得从事任何有损资产管理计划、资产管理人管理的其他资产及资产托管人托管的其他资产合法权益的活动;

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;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;

12、配合资产管理人在反洗钱方面对投资者的尽职调查、资金来源和用途合法性审查、可疑交易调查和报告;

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。

(六) 资产管理人的权利

根据法律法规及其他有关规定,资产管理人的权利包括:

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、足额获得资产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，监督资产托管人，对于资产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，并报告证监会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、以资产管理人的名义，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、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。

（七）资产管理人的义务

根据法律法规及其他有关规定，资产管理人的义务包括：

- 1、依法办理资产管理计划的备案事宜；
- 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担能力进行评估；
- 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、资产管理人的固有财产相互独立，对所管理的不同财产分别管理，分别记账，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，不得为资产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，不得为资产管理人、资产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资产托管人的监督；
- 13、以资产管理人的名义，代表投资者利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
- 14、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；
- 15、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；
- 16、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；
- 17、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，并向证券投资基金业协会备案，抄报证监会相关派出机构；

18、办理与受托资产管理业务活动有关的信息披露事项；

19、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；

20、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资产托管人和投资者；

21、资产管理人应按照《中华人民共和国反洗钱法》等有关反洗钱的法律法规和监管要求履行反洗钱义务，包括但不限于委托人身份识别、委托人身份和交易资料留存、资金来源和用途合法性审查、大额可疑交易报告、制裁筛查等，并为资产托管人开展反洗钱工作提供充分的协助，法律法规另有规定的除外；

22、除必要的披露及监管要求外，不得以资产托管人或投资者的名义做营销宣传；

23、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。

(八) 资产托管人的权利

根据法律法规及其他有关规定，资产托管人的权利包括：

1、按照资产管理合同的约定，及时、足额获得资产管理计划托管费用；

2、根据资产管理合同及其他有关规定，监督资产管理人对资产管理计划财产的投资运作，对于资产管理人违反本合同的行为，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情形，有权报告中国证监会并采取必要措施；

- 3、按照资产管理合同的约定，依法保管资产管理计划财产；
- 4、投资者或资产管理人在反洗钱上拒绝配合合法性审查、可疑交易调查等情况的，资产托管人保留终止合作的权利；
- 5、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

根据法律法规及其他有关规定，资产托管人的义务包括：

- 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，不得为资产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、办理与资产管理计划托管业务有关的信息披露事项；
- 7、根据相关法律法规和资产管理合同约定，复核资产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；
- 8、编制资产管理计划的年度托管报告，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；
- 9、按照法律法规要求和资产管理合同约定，根据资产管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；

10、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；

11、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资产管理的会计账册，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；

12、监督资产管理人的投资运作，发现资产管理人的投资或清算指令违反法律、行政法规、中国证监会的规定及资产管理合同约定的，应当拒绝执行，立即通知资产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；

13、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、监督资产管理人投资运作等职责，并向投资者充分揭示；

14、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。

五、资产管理计划的基本情况

（一）资产管理计划的名称

上海证券翱翔蓝海 FOF 单一资产管理计划

（二）资产管理计划的类别

混合类 FOF 单一资产管理计划

（三）资产管理计划的运作方式

开放式

（四）资产管理计划的投资目标、主要投资方向、投资比例、产品风险等级

1、投资目标：

本计划为混合类 FOF 产品，在有效控制投资风险的前提下，力求实现委托资产的保值增值，为委托人谋求稳定的投资回报。

2、投资范围：

本计划为基金中基金资产管理计划，将总资产的 80% 以上投资于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，包括但不限于公开募集证券投资基金、基金管理公司及其子公司发行的资产管理产品、期货公司及其子公司发行的资产管理产品、证券公司及其子公司资产管理计划、保险公司及其子公司资产管理计划、信托计划、在基金业协会登记的私募基金管理人发行的资产管理产品。

(1) 固定收益类资产：包括但不限于现金、银行存款、货币市场工具、货币市场基金、债券逆回购、交易所和银行间上市交易的国债、地方政府债、企业债券、公司债券、各类金融债（含次级债、混合资本债）、中央银行票据、同业存单、可转换债券（含可分离交易债）、可交换债、经银行间市场交易商协会批准注册发行的各类债务融资工具（如超短期融资券、短期融资券、中期票据、集合票据、集合债券、资产支持票据（ABN）、非公开定向债务融资工具（PPN）等）、非公开公司债、资产支持证券（ABS）、债券型基金，接受国务院金融监督管理机构监管发行的固定收益类资产管理计划等固定收益类资产；

(2) 权益类资产：包括但不限于国内依法公开发行上市在沪深证券交易所市场交易的 A 股股票（包括一级市场申购和二级市场买卖）（不含 ST），股票型基金、混合型基金（包括 ETF 和 LOF）等。

(3) 接受国务院金融监督管理机构监管发行的权益类资产管理产品。

(4) 接受国务院金融监督管理机构监管发行的商品及金融衍生品类资产管

理产品(不包括投资场外衍生品)。

3、投资比例：

本计划为混合类 FOF 资产管理计划，投资组合在各类资产上的投资比例，将严格遵守相关法律法规的规定。

(1) 债券类资产占资产总值的比例：0-80%(不含)。其中，除货币基金、债券型基金、接受国务院金融监督管理机构监管发行的固定收益类资产管理计划以外部分占比为 0-20% (不含)。

(2) 权益类资产占资产总值的比例：0-50%(不含)。

(3) 接受国务院金融监督管理机构监管发行的权益类资产管理产品：0%-80% (不含)。

(4) 接受国务院金融监督管理机构监管发行的商品及金融衍生品类资产管理产品(不包括投资场外衍生品)：0%-50% (不含)。

(5) 债券正回购：本计划的总资产不得超过净资产的 200%。

(6) 本计划所投资的资产管理产品，应当按照穿透原则合并计算投资同一资产的比例以及投资同一或同类资产的金额。(管理人穿透以投资的资管产品提供的估值数据为准。)合并计算后，固定收益类、权益类、商品及金融衍生品类资产均不得超过净资产的 80%。

4、资产管理计划的风险收益特征

本计划产品风险等级为 R4 中高风险，适合 C4 积极型及以上的投资者。

(五) 资产管理计划的存续期限

委托管理期限为：【贰】年，自初始委托资产的委托资产运作起始日起计算。

经各方当事人一致同意，可提前终止或者延长管理期限。

(六) 资产管理计划的最低资产要求

委托人初始委托资产合计不低于人民币 1000 万元。

(七) 资产管理计划的预警和止损

当本计划单位资产净值低于 0.95 时，本计划触及预警条件。

当本计划单位资产净值低于 0.90 时，本计划触及平仓条件。

出现前述情况时，资产管理人应于触及预警或平仓条件后【24】小时内将有关情况告知投资者，并于【叁】个工作日内向投资者递交书面报告。

(八) 资产管理计划的服务机构

估值与核算机构为：上海证券有限责任公司（基金业协会业务登记编码为：证监许可【2002】203号）

信息技术系统服务机构为：恒生电子股份有限公司

六、资产管理计划的成立与备案

(一) 资产管理计划成立的条件及其他事项。

资产管理计划的初始委托资产总额不低于 1000 万元人民币，且发行过程符合法律、行政法规和中国证监会的规定。

(二) 资产管理计划的成立与备案

资产管理计划在受托资产入账后，资产管理人书面通知投资者资产管理计划成立。资产管理人应在资产管理计划成立后 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。资产管理计划成立前，任何机构和个人不得动用投资者参与资金。

(三) 资产管理合同的生效

本合同是约定合同当事人之间权利义务关系的法律文件。自三方法定代表人(负责人)或授权代理人签字或盖章并加盖委托人公章或合同专用章、管理人公章、托管人公章之日起成立,且自委托资产起始运作之日起生效。

(四)资产管理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。

七、资产管理计划财产

(一)委托资产的种类、数额、交付时间、交付方式、管理期限、管理类型

1、委托资产的种类:现金

2、委托资产数额:委托人初始委托资产合计不低于人民币【10000000】元,大写:壹仟万元整(其中现金资产为人民币【10000000】元,大写:壹仟万元整)大小写不一致的,以大写为准。具体委托资产数额以实际划入托管账户金额为准。

(1)初始委托资产(现金部分)交付时间及交付方式:在托管账户等投资运作相关账户开立完毕后,委托人应自收到管理人《账户开立通知书》(附件3)之日起的【壹拾】个工作日内,将初始委托资产(现金部分)足额划拨至本委托资产的托管账户,并电话通知托管人同时向管理人和托管人发送《第 期委托资产通知书》(附件4)。

托管人查询资金到账后,应及时向管理人以传真或双方认可的其他形式发送《第 期委托资产确认书》(附件5)。管理人自收到确认书传真件之日当日签署《第 期委托资产(现金资产)起始运作通知书》(附件6)并以传真或双方

认可的其他形式发送给委托人及托管人。以管理人签章确认《第 期委托资产(现金资产) 起始运作通知书》(附件 6) 的当日作为委托资产运作起始日。

(2) 初始委托资产 (非现金部分) 交付时间及交付方式 : 委托人与管理人协商一致后 , 以管理人指定的方式办理委托资产的转移。管理人确认无误后 , 签署《第 期委托资产 (非现金资产) 起始运作通知书》(附件 7) , 并与“委托资产证券清单”(附件 8) (如有) 、及加盖管理人预留印章的中国证券登记结算有限公司出具的划转确认书复印件或原件 (如有) , 以传真或双方认可的其他形式发送给委托人及托管人。以管理人签章确认《第 期委托资产(非现金资产) 起始运作通知书》(附件 7) 的当日作为委托资产运作起始日。

(3) 追加委托资产交付的时间及方式 : 在本资产管理计划合同有效期内 , 委托人有权追加委托资产 , 必须提前【叁】个工作日告知管理人。委托人每次追加资产均应同时向管理人和托管人发送《第 期委托资产通知书》(附件 4) , 交付及确认方式参照初始委托资产交付方式执行。

管理人及托管人对追加委托资产的处理方式参照初始委托资产交付方式执行。

3、委托管理期限为 : 【贰】年 , 自初始委托资产的委托资产运作起始日起计算。经各方当事人一致同意 , 可提前终止或者延长管理期限。

如发生法律法规或本合同约定终止的情形 , 本合同终止。

(二) 资产管理计划财产的保管与处分

1、资产管理计划财产的债务由资产管理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、资产管理计划财产独立于资产管理人、资产托管人的固有财产，独立于资产管理人管理的和资产托管人托管的其他财产，并由资产托管人保管。资产管理人、资产托管人不得将资产管理计划财产归入其固有财产。

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

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

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

6、资产托管人对在中国结算开立的证券账户、在银行间市场登记结算机构开设的债券托管账户中的证券和在资产托管人开立的资金账户内的资金负有保管职责，因中国结算和银行间市场登记结算机构自身原因造成资产损失的，资产托管人不承担责任。因资产管理人投资运作注册登记在中国结算和银行间市场登记结算机构以外机构的证券，以及在资产托管人以外开立的银行账户内的资金，资产管理人对其安全性负责，由资产托管人保管资产管理人提供的相关凭证，资产管理人对该凭证的真实性、合法性、有效性、完整性负责，资产托管人对该凭

证的真实性、合法性、有效性、完整性不承担责任；实际存管在交易对手、中介机构等其他机构的证券和存放在资产托管人以外银行账户内的资金，对该等证券或资金的任何损失，资产托管人不承担任何责任。

7、资产托管人未经资产管理人的指令，不得自行运用、处分、分配资产管理计划财产的任何资产(不包含资产托管人依据中国结算结算数据完成场内交易交收、托管资产开户银行或交易/登记结算机构扣收交易费、结算费和账户维护费等费用)。

8、对于因为资产管理计划财产投资产生的应收资产，应由资产管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知资产托管人，到账日应收资产没有到达资产托管人处的，资产托管人应及时通知资产管理人采取措施进行催收，由此给资产管理计划财产造成损失的，资产管理人应负责向有关当事人追偿损失。如资产管理人怠于履行前述追偿义务、相关当事人未予赔偿或赔偿不足以弥补资产管理计划财产损失的，资产管理人应当承担损害赔偿责任。如资产托管人已按合同约定履行前述通知义务，资产托管人对此不承担任何责任。

(三) 资产管理计划财产相关账户的开立和管理

管理人应自开立托管账户之日起【伍】个工作日内，以《账户开立通知书》(附件3)方式告知委托人。

委托人移交、追加委托财产的划出账户与提取委托财产的划入账户必须为以委托人名义开立的同一账户。特殊情况导致移交、追加与提取的账户不一致时，委托人应向管理人、托管人出具符合相关法律法规规定的书面说明，并获得管理人、托管人的书面同意。

1、托管账户

(1) 托管账户是指在资产托管人指定营业机构为资产管理计划单独开立的银行结算账户。托管账户不得提现，不得通兑，不得透支，托管账户项下不得购买本票、汇票、支票等可流通票据。资产管理人授权资产托管人为托管账户开通网上银行，托管账户网上银行转账密码由资产托管人保管。资产管理人委托资产托管人负责办理托管账户项下资金的划拨。托管账户户名应符合相关规定，并以实际开立的账户名称为准。

(2) 资产管理计划财产由资产托管人托管期间，本资产管理计划项下的一切货币收支活动，包括但不限于投资、支付费用、资产划拨等，均需通过托管账户进行。除支付账户开户费、账户管理费、网银开户费、网银服务费和银行结算手续费可以由托管账户开户行自行扣收外，资产管理人使用托管账户中的资金，必须事先向资产托管人发送划款指令，经资产托管人审核无误后方能划款。

(3) 资产管理计划资产由资产托管人托管期间，托管账户项下预留印鉴以实际刻制的印章名称为准，以及资产托管人被授权人个人名章 1 枚。托管账户项下预留印鉴由资产托管人保管。

(4) 资产管理人和资产托管人不得假借委托财产的名义开立其他任何银行账户。除法律法规和规章另有规定外，资产管理人、资产托管人双方不得采取使得该托管账户无效的任何行为。

2、交易所证券账户

资产托管人或资产管理人根据中国结算的规定为本资产管理计划开设证券账户。证券账户的开户费由资产管理人先行垫付，待本资产管理计划起始运作后，资产管理人可向资产托管人发送划款指令，将垫付的开户费从资产管理计划托管账户中扣还资产管理人。账户注销时，在遵守中国结算的相关规定下，由资产管

理人和资产托管人协商确认主要办理人，由其负责注销本计划项下的证券账户。账户注销期间，主要办理人如需另一方提供配合的，另一方应予以配合。

3、银行间市场相关账户

《资产管理合同》生效后，资产管理人负责以资产管理计划的名义申请并取得进入全国银行间同业拆借市场的交易资格，并代表资产管理计划进行交易；资产托管人根据中国人民银行、银行间市场登记结算机构的有关规定，在银行间市场登记结算机构开立债券账户和资金结算账户，并代表资产管理计划进行银行间市场债券的结算。

4、场外开放式基金账户

场外开放式基金账户由资产管理人根据基金公司要求填写相关资料后开立。资产管理人应指定托管资金账户作为开放式基金交易及回款的唯一结算账户。资产管理人应及时将开放式基金账户的信息发送资产托管人。

资产管理人选择通过机构投资者场外投资业务平台（简称“FISP”）参与开放式基金投资的，应由资产管理人在 FISP 系统登记产品信息，由资产托管人对银行账户信息进行验证。产品登记成功后，由投资资产管理人在线向基金销售机构提交开户申请，账户开立信息通过 FISP 反馈资产管理人和资产托管人。

5、资产管理人投资股指期货之前，应与资产托管人、期货公司三方共同就股指期货开户、清算、估值、交收、费用等事宜另行签署《期货投资托管操作三方备忘录》。

6、其他事项

以上相关账户的开立和使用，仅限于满足本资产管理计划投资需要，资产管理人、资产托管人两方均不得出借和转让，亦不得使用上述账户从事本合同规定

以外的活动。

其它暂未涉及的账户之管理参照上述规定，未尽事宜届时另行商处。

(四) 资产管理计划财产的提取

委托人可以在本计划存续期间工作日按照本款规定申请提取委托资产。委托人需提取委托资产的，应提前【叁】个工作日书面通知管理人并抄送托管人《第 期提取委托资产通知书》（附件 9）。管理人和托管人不承担由于委托人通知不及时造成的资产变现损失。

委托人需提取的现金资产在管理人收到《第 期提取委托资产通知书》（附件 9）后次日起的五个工作日内支付给委托人，但委托人提取后的委托资产余额不得低于 1000 万元人民币。托管人应于划拨财产当日以其他各方认可的形式分别通知管理人及委托人。

(五) 委托期限届满时资产清算和返还的期限、方式按照本合同第二十章的相关资产清算与返还的约定执行。

(六) 管理人应按合同约定管理在本计划存续期间存放于专用证券账户和托管账户内的委托资产，不得挪用专用证券账户和托管账户内的资产，不得将专用证券账户和托管账户内的资产为任何人设立任何质押担保和可能对委托资产造成损失的其他处置。

八、资产管理计划的投资

(一) 投资目标

本计划为混合类单一产品，在有效控制投资风险的前提下，力求实现委托资产的保值增值，为委托人谋求稳定的投资回报。

(二) 投资范围及比例

1、投资范围：

本计划为基金中基金资产管理计划，将总资产的 80%以上投资于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，包括但不限于公开募集证券投资基金、基金管理公司及其子公司发行的资产管理产品、期货公司及其子公司发行的资产管理产品、证券公司及其子公司资产管理计划、保险公司及其子公司资产管理计划、信托计划、在基金业协会登记的私募基金管理人发行的资产管理产品。

(1) 固定收益类资产：包括但不限于现金、银行存款、货币市场工具、货币市场基金、债券逆回购、交易所和银行间上市交易的国债、地方政府债、企业债券、公司债券、各类金融债(含次级债、混合资本债)、中央银行票据、同业存单、可转换债券(含可分离交易债)、可交换债、经银行间市场交易商协会批准注册发行的各类债务融资工具(如超短期融资券、短期融资券、中期票据、集合票据、集合债券、资产支持票据(ABN)、非公开定向债务融资工具(PPN)等)、非公开公司债、资产支持证券(ABS)、债券型基金、接受国务院金融监督管理机构监管发行的固定收益类资产管理计划等固定收益类资产；

(2) 权益类资产：包括但不限于国内依法公开发行上市在沪深证券交易所市场交易的 A 股股票(包括一级市场申购和二级市场买卖)(不含 ST)，股票型基金、混合型基金(包括 ETF 和 LOF)等。

(3) 接受国务院金融监督管理机构监管发行的权益类资产管理产品。

(4) 接受国务院金融监督管理机构监管发行的商品及金融衍生品类资产管理产品(不包括投资场外衍生品)。

2、投资比例：

本计划为混合类单一资产管理计划，投资组合在各类资产上的投资比例，将严格遵守相关法律法规的规定。

(1) 债券类资产占资产总值的比例：0-80%(不含)。其中，除货币基金、债券型基金、接受国务院金融监督管理机构监管发行的固定收益类资产管理计划以外部分占比为 0-20% (不含)。

(2) 权益类资产占资产总值的比例：0-50%(不含)。

(3) 接受国务院金融监督管理机构监管发行的权益类资产管理产品：0%-80% (不含)。

(4) 接受国务院金融监督管理机构监管发行的商品及金融衍生品类资产管理产品(不包括投资场外衍生品)：0%-50% (不含)。

(5) 债券正回购：本计划的总资产不得超过净资产的 200%。

(6) 本计划所投资的资产管理产品，应当按照穿透原则合并计算投资同一资产的比例以及投资同一或同类资产的金额。(管理人穿透以投资的资管产品提供的估值数据为准。)合并计算后，固定收益类、权益类、商品及金融衍生品类资产均不得超过净资产的 80%。

(三) 投资策略

1、本资产配置组合在参照中证转债指数的基础上，聚焦降低配置组合的回撤和波动，中长期能极大降低风险而大幅提升风险收益比，通过搭配特色组合，整体形成动态平衡但具有弹性的组合收益回报。

2、组合方案的管理人将随时关注市场变化情况，对未来走势进行科学预判，在严格全面控制风险及不违反资产配置比例限制的前提下，灵活调节投资仓位，

选择具有趋势性交易机会的投资品种。

3、根据委托人资金配置规模的增减、时间跨度的变化，可适时对组合方案内大类资产的配比权重进行调整，以确保组合方案可以动态匹配资金流通、预期收益和风险控制等方面的需求。

经委托人和管理人协商一致，可对投资政策进行变更，变更投资政策应以书面形式作出，并及时通知托管人。投资政策变更应为调整投资组合留出必要的时间。

4、管理人建立了相对完善的产品投资价值评价体系，涵盖接受国务院金融监督管理机构监管（包括但不限于私募基金管理人、基金公司及其子公司、券商及其资管子公司、期货公司等）发行的产品。从基金分类、长短期业绩表现、归因分析、基金经理和基金管理人等五大维度调研对管理人精选的及投顾建议中的标的基金进行综合评判和打分。此外，本资产管理计划也会参考上海证券基金评价中心的定量分析研究结果，在此基础上甄选出具有业绩可持续性的优秀基金作为投资标的。

5、管理人对库存有效基金绩效进行量化筛选，有如下要求：

收益指标：业绩大于同策略市场中位数

风险指标：最大回撤小于同策略市场上四分位数

其他指标：在收益率、风险两类指标基础上，可以综合考虑单只基金/基金经理的詹森指数、夏普比率、索提诺比率等相关指标，选择综合表现较好的产品

6、决策依据

本资产管理计划以国家有关法律、法规和本合同的有关规定为决策依据，并以维护单一计划委托人利益作为准则。具体决策依据包括：

(1) 《管理办法》、《运作规定》、《指导意见》、《上海证券交易所蓝筹FOF单一资产管理计划资产管理合同》等有关法律性文件。

(2) 国内外经济形势变化，国家各项财政、产业、货币政策调整及利率变化趋势。

(3) 投资对象收益和风险的匹配关系，本单一计划将在充分权衡投资对象的风险和收益的前提下做出相应的投资决策。

(四) 投资限制及投资禁止

1、为切实维护委托人的合法权益，委托资产的投资还应遵循以下限制：

(1) 关联方证券的投资限制见本合同的相关规定。管理人将委托资产投资于管理人、托管人及与管理人、托管人有关联方关系的公司发行的证券，须事先书面通知委托人和托管人，委托人应当在【伍】个工作日内予以书面答复管理人，并抄送托管人。委托人同意的，管理人应当及时将交易结果告知委托人和托管人，并向证券交易所报告。

(2) 委托人通过专用证券账户持有上市公司股份，或者通过专用证券账户和其他证券账户合并持有上市公司股份，发生应当履行公告、报告、要约收购等法律、行政法规和中国证监会规定义务情形的，应当由委托人履行相应的义务，管理人、托管人应当予以配合。

(3) 相关法律法规及中国证监会禁止的其他行为。

若法律法规或监管部门变更或取消上述限制，履行当时法律要求的适当程序后，本计划投资可不受上述规定限制。

2、本资产管理计划的禁止行为包括：

(1) 违规将资产管理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) 将资产管理计划资产用于可能承担无限责任的投资；

(3) 向委托人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) 挪用资产管理计划资产；

(5) 募集资金不入账或者其他任何形式的账外经营；

(6) 接受单一委托人参与资金低于中国证监会规定的最低限额；

(7) 使用资产管理计划资产进行不必要的交易；

(8) 内幕交易、利益输送、操纵证券价格、不正当关联交易及其他违反公平交易规定的行为；

(9) 资产管理计划的总资产超过该计划净资产的 200%；

(10) 资产管理计划所投资的资产管理产品投资除公募基金以外的其他资产管理产品；

(11) 法律、行政法规和中国证监会禁止的其他行为。

如法律法规或监管部门修改或取消上述限制，本计划可相应调整投资组合限制的规定，并在实施前告知委托人，不需要征求委托人的意见。

(五) 建仓期；

本资产管理计划的建仓期为 6 个月。资产管理人应当自本合同生效之日起 6 个月内使本资产管理计划的投资组合比例符合本合同的有关约定。建仓期内，不受上述投资比例限制，建仓期内的投资活动，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。建仓期结束后，资产管理计划的资产组合应当符合法律、行政法规、中国证监会规定和合同约定的投向和比例。

(六) 投资政策的变更

本合同订立的投资范围在本合同存续期间如需变更,须经委托人、管理人和托管人三方协商一致。。

(七) 业绩报酬计提基准

本单一计划的业绩报酬计提基准为 10%, 管理人对年化收益率 R 超过业绩报酬计提基准的收益部分提取 10%的业绩报酬。

(八) 风险收益特征

本计划产品风险等级为 R4 中高风险, 适合 C4 积极型及以上的投资者。

(九) 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、委托人追加或提取资产导致的产品规模波动等资产管理人之外的因素导致资产管理计划投资不符合法律、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, 资产管理人应当在流动性受限资产可出售、可转让或者恢复交易的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, 资产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。

九 投资顾问 (如有)

本单一计划不聘请投资顾问。

十、利益冲突及关联交易

(一) 利益冲突

管理人应避免资产管理计划存在或可能存在利益冲突的情形。利益冲突是指

公司利益与客户利益不一致，公司不同客户之间利益不一致，以及公司不同业务之间利益不一致的情况。本资产管理计划运作过程中可能涉及的利益冲突情形包括但不限于管理人自营部门与资管部门之间的利益冲突、管理人资管部门发起的不同产品之间的利益冲突等。

管理人应避免资产管理计划存在或可能存在利益冲突的情形。公司建立并执行信息隔离墙制度，通过对存在利益冲突的各项业务在部门/机构设置、人员、资金、账户、系统等方面的独立运作、分开管理，办公场所相互隔离等措施防范公司与客户之间、不同客户之间、公司不同业务之间的利益冲突。同时，本资产管理计划与管理人设立的其他产品及管理人关联方所设立的资产管理产品均独立运作，管理人应公平对待不同理财产品，严禁直接或者通过与第三方的交易安排在不同理财产品之间进行利益输送。

1、资产管理计划存在利益冲突的，管理人应尽快消除利益冲突的情形，并在发现利益冲突情形之日起 10 个工作日内以公告方式向投资者进行披露，披露内容应包括利益冲突情形、处理方式、处理结果等内容。

2、本资产管理计划与管理人设立的其他产品及管理人关联方所设立的资产管理产品均独立运作。

（二）关联交易披露

管理人运用受托管理资产从事关联交易的，事后及时、全面、客观的向投资者和托管人进行披露。运用受托管理资产从事重大关联交易的，应事先取得投资者同意，并有充分证据证明未损害投资者利益。构成“重大关联交易”的标准详见附件 18。

托管人关联方名单以托管人公开披露的最新报告中股东变动、主要股东持股

情况、财务报表附注等章节涉及的关联方为准。

十一、投资经理的指定与变更

本资产管理计划投资经理由管理人负责指定。

本资产管理计划投资经理的姓名、从业简历、学历及兼职情况、投资经理的投资管理、投资研究、投资咨询等相关业务经验、是否取得基金从业资格，以及最近三年是否被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚等信息详见“投资经理详细资料”（附件 10）。

管理人如需变更投资经理，应于变更投资经理之日电话通知委托人及托管人指定的联系人，即刻生效。并自变更投资经理之日前【伍】个工作日内以《变更投资经理告知函》（附件 11）及“投资经理详细资料”（附件 10）通知委托人及托管人。如委托人不同意的，应自管理人出具《变更投资经理告知函》（附件 11）发出之日起【伍】个工作日内回函，如未在规定时间内回函的，代表委托人同意投资经理变更。

十二、投资指令的发送、确认和执行

（一）交易清算授权

自托管账户开立之日起至本合同终止之日止，管理人直接向托管人发出划款指令，托管人根据本合同的规定，按照管理人的划款指令办理如下资金划付：（1）托管账户项下证券交易结算资金的划拨；（2）托管账户向其他账户的资金支付等。

同时委托人承诺，在上述授权有效期期间，委托人不向托管人以任何形式（包

括但不限于网上银行、柜面、电话银行等)发出任何划款指令。托管人有权拒绝执行委托人发出的任何划款指令,由此造成的损失管理人、托管人免责。

本合同签署生效后,资产管理人应向资产托管人提供《授权通知书》(附件12),内容包括被授权人名单、预留印鉴及被授权人签字样本,授权文件应注明被授权人相应的权限及有效时限,并规定资产管理人向资产托管人发送指令时资产托管人确认被授权人身份的方法,授权文件应加盖单位公章。

资产托管人在收到授权文件原件并经资产管理人电话确认后,授权文件即生效。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并经电话确认的时点。如早于,则以资产托管人收到授权文件并经电话确认的时点为授权文件的生效时间。

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。

前述授权文件,管理人应于生效后1个工作日内提供扫描件或复印件供投资者备案。

(二) 投资指令的内容

《资产管理划款指令》(附件13)是资产管理人在运用资产管理计划财产时,向资产托管人发出的资金划拨及其他款项支付的指令。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、金额、收付款账户信息等,按授权文件加盖预留印鉴并由被授权人签字。

(三) 投资指令的发送、确认及执行时间与程序

指令由《授权通知书》(附件12)确定的有权发送人(下称“被授权人”)代

表管理人用传真的方式（传真号：021-53686313）或其他资产托管人和资产管理人协商一致的方式向资产托管人发送。资产管理人有义务在发送指令后及时与资产托管人进行电话确认，对于因资产管理人未能及时与资产托管人进行指令确认，致使资金未能及时划拨所造成的损失，资产托管人不承担任何责任。资产托管人依照《授权通知书》（附件 12）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。

资产管理人尽量于划款前 1 个工作日向资产托管人发送指令并确认。对于要求当天到账的指令，必须在当天 15:30 前向资产托管人发送，15:30 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，并且相关付款条件已经具备，资产托管人视付款条件具备时为指令送达时间。对新股申购网下发行业务，资产管理人应在网下申购缴款日（T 日）的前一工作日下班前将指令发送给资产托管人，指令发送时间最迟不应晚于 T 日上午 10:00。对于中国结算实行 T+0 非担保交收的业务，资产管理人应在交易日 14:00 前将划款指令发送至资产托管人。因资产管理人指令传输不及时，致使资金未能及时划入中国结算指定交收账户所造成的损失由资产管理人承担。包括赔偿在该市场引起其他托管客户交易失败、赔偿因占用结算参与者最低备付金带来的利息损失。资产管理人应确保资产托管人在执行指令时，托管资金账户有足够的资金余额，在资金头寸充足的情况下，资产托管人对资产管理人符合法律法规、本合同要求的指令不得拖延或拒绝执行。

资产托管人收到资产管理人发送的指令后，应立即审慎验证指令的要素是否

齐全，并将指令所载签字和印鉴与授权通知进行表面相符性检查及权限范围核对，复核无误后应在规定期限内执行，不得延误。指令执行完毕后，资产托管人于每日日终给资产管理人发送当日的《资金账户报告》。

(四) 资产托管人依法暂缓、拒绝执行指令的情形和处理程序；

若资产托管人发现资产管理人的指令违反本合同约定的，应拒绝执行，立即通知资产管理人，同时向中国证监会相关派出机构及证券投资基金业协会报告。资产托管人向中国证监会相关派出机构及证券投资基金业协会进行报告后，有权将相关情况书面告知投资者。

(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，指令中重要信息模糊不清或不全等。

资产托管人发现资产管理人的指令错误时，应拒绝执行，并及时通知资产管理人改正，同时向中国证监会相关派出机构及证券投资基金业协会报告。资产托管人向中国证监会相关派出机构及证券投资基金业协会进行报告后，有权将相关情况书面告知投资者。如需撤销指令，资产管理人应出具书面说明，并加盖业务用章。

非因资产托管人自身原因未履行本合同约定的监督义务外，资产托管人因执行资产管理人的表面相符的指令和依据交易程序已经生效的指令而对资产管理计划财产造成的损失不承担赔偿责任。

(六) 更换投资指令被授权人的程序

委托人、管理人撤换被授权人员或改变被授权人员的权限，必须提前至少一个工作日，将被授权人变更通知原件寄送给托管人，同时电话通知托管人。管理

人撤换被授权人员或改变被授权人员的权限,在通知托管人的同时应将相关情况抄送委托人。被授权人变更通知,自变更通知书上注明的生效日起生效,若该日期早于托管人收到被授权人变更通知原件之日的,则被授权人变更通知自托管人收到的日期起开始生效。被授权人变更通知应加盖管理人公章并由法定代表人或授权代表签署,若由授权代表签署,还应附上授权书。

(七) 投资指令的保管

划款指令产生的数据信息、业务凭证及有关规定的反映交易真实情况的合同、业务凭证、单据和其他资料等应妥善保管。

管理人应保存电子版划款指令,电子版划款指令应设置专门文件夹予以保存;纸质划款指令交易完成后,应专门放至档案袋归档保存。

托管人收到的指令传真件、扫描件等非原件形式与原件不一致的,以资产托管人收到的指令传真件、扫描件等非原件形式为准。

(八) 相关责任

对资产管理人在托管账户没有充足资金的情况下向资产托管人发出的指令致使资金未能及时清算所造成的损失由资产管理人承担。因资产管理人原因造成的传输不及时、未能留出足够执行时间、未能及时与资产托管人进行指令确认致使资金未能及时清算或交易失败所造成的损失由资产管理人承担。

资产托管人根据本合同相关规定履行形式审核职责,如果资产管理人的指令存在事实上未经授权、欺诈、伪造或未能及时提供授权通知等情形,且资产托管人已尽到合理的审核义务仍不能察觉该等情形,资产托管人不承担因执行有关指令或拒绝执行有关指令而给资产管理人或委托财产或任何第三方带来的损失

(九) 其他事项

管理人应在银行间交易成交后,及时将通知单、相关文件及划款指令加盖公章后发至托管人并电话确认,由托管人完成后台交易匹配及资金交收事宜。经管理人与托管人协商一致,且由管理人出具书面委托后,管理人可授权托管人根据外汇交易中心发送的成交数据,在中债综合业务平台或上海清算所综合业务系统自行完成交易确认操作。如果银行间结算系统已经生成的交易需要取消或终止,管理人要书面通知托管人。

本计划财产在证券交易所场内交易的资金清算交割,由托管人通过中国结算上海分公司/深圳分公司及清算代理银行办理。托管人视中国结算向其发送的清算数据为有效指令,无须管理人向托管人另行出具划款指令。

本计划财产参与未上市债券,管理人应代表本计划财产与对手方签署相关合同或协议,明确约定债券过户具体事宜。否则,管理人需对所参与债券的过户事宜承担相应责任。

本计划财产资金账户发生的银行结算费用、银行账户维护费等银行费用,由托管人直接从资金账户中扣划,无须管理人出具划款指令。

十三、交易及交收清算安排

本产品参与交易所场内证券投资,采取托管人结算模式,资产管理人、资产托管人应遵守本合同下述(一)和(二)之约定。

(一) 选择代理证券买卖的证券经营机构的程序

资产管理人负责选择代理本资产管理计划财产证券买卖的证券经营机构,并被选中的证券经营机构签订委托协议,使用其交易单元作为资产管理计划财产的交易单元。资产管理人应提前十个工作日书面通知资产托管人,并依据资产托

管人要求提供相关资料，以便资产托管人申请办理接收结算数据手续。

资产管理人应及时将资产管理计划财产交易单元专用号、佣金费率等基本信息以及变更情况以书面形式通知资产托管人。

（二）投资证券后的清算交收安排

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，签订《托管银行证券资金结算协议》，如拟投资港股通，还需签订《港股通结算补充协议》，用以具体明确资产管理人与资产托管人在证券交易资金结算业务中的程序与责任。

1、结算备付金与保证金

根据中国结算规定，在每月前3个交易日内，中国结算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。资产托管人在中国结算调整最低结算备付金、结算保证金当日，在《资金账户报告》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，并根据中国结算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。如因调整最低备付金、结算保证金后造成透支，资产管理人应在调整最低备付金、结算保证金当日上午12:00之前补足透支款。

2、清算交收

资产托管人负责资产管理计划财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国结算结算数据办理；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自身过错在清算上造成资产管理计划财产的直接损失，应由资产托管人负责赔偿，但因中国人民银行、中国结算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过错造成清算资金无法按时到账的情形，资产托管人免责；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；如果因为资产管理人未事先通知需要单独结算的交易，造成资产管理计划财产损失的由资产管理人承担；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 日中国结算的资金交收。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 12:00 前补足头寸，确保资金交收。如果未遵循上述规定备足资金头寸，影响了资产管理计划财产自身的清算交收及资产托管人与中国结算之间的一级交收，由此给资产托管人、本资产管理计划财产及资产托管人托管的其他资产造成的损失由资产管理人负责。

如果由于资产管理人违反市场操作规则的规定进行超买、超卖及质押券欠库等原因造成资产管理计划财产投资清算困难和风险的，资产托管人在预清算结束后应通知资产管理人预透支和预欠库事项，资产管理人应保持联系方式畅通，后续补缴等事宜由资产管理人负责解决，由此给资产托管人、本资产管理计划财产和资产托管人托管的其他资产造成的损失由资产管理人承担。

根据中国结算结算规定，资产管理人在进行融资回购业务时，用于融资回购的债券将作为偿还融资回购到期购回款的质押券。如因资产管理人原因造成债券回购交收违约或因折算率变化造成质押欠库，导致中国结算欠库扣款或对质押券进行处置造成的投资风险和损失由资产管理人承担。

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。

(三) 资金、证券和期货账目及交易记录的核对

资产管理人和资产托管人每月对资产管理计划财产的证券账目、实物券账目、交易记录进行核对。

(四) 资金余额的确认

资产托管人于 T+1 日上午 09:30 以前向资产管理人传真 T 日资产管理计划财产投资交易清算后的《资金账户报告》。每日日终,完成当日投资交易资金结算并核实账户资金余额后,传真《资金账户报告》进行资金余额的确认。(五) 投资银行存款的特别约定

1、资产管理人和资产托管人的职责

资产管理人应当加强对本产品投资银行存款风险的评估与研究,建立健全银行存款投资的业务流程、岗位职责、风险控制措施和监察稽核制度,严格测算与控制投资银行存款的风险敞口,针对不同类型存款银行建立相关投资限制制度,切实防范有关风险。由于资产管理人提前支取或部分提前支取存款投资导致的息差(即本产品已计提的资金利息和提前支取时收到的资金利息差额),资产管理人负责解决。

资产托管人负责依据资产管理人提供的银行存款投资合同/协议、投资指令、支取通知等有关文件办理资金的支付以及存款证实书的接收、保管与交付,切实履行托管职责。资产托管人负责依据托管合同的约定对存款开户证实书进行保管,不负责存款开户证实书真假的辨别,不承担存款开户证实书对应存款的本金及收益的安全。

2、相关协议的签署

资产管理人在投资银行存款之前,需与存款银行签订具体存款协议。具体存款协议应包括但不限于以下内容:

(1) 存款账户必须以本资产管理计划名义开立。

- (2) 协议须约定存款类型、期限、利率、计息方式、金额、账号、起止时间，存款银行经办行名称、地址及进款账户。
- (3) 协议须约定将资产托管人为本计划开立的托管银行账户指定为唯一回款账户，任何情况下，存款银行都不得将存款本息划往任何其他账户。
- (4) 资金划转过程中存款银行需要使用过渡账户的，存款银行须保证资金在过渡账户中不出现滞留，不被挪用。
- (5) 存款银行有义务保证本产品存款投资在存续期内的安全。
- (6) 协议须约定存款银行不得接受资产管理人或资产托管人任何一方单方面提出的对该笔存款投资进行更名、转让、挂失、质押、担保、撤销变更印鉴及回款账户信息等任何可能导致财产转移的申请。
- (7) 协议须明确，存款银行对存款证实书的真实性负责，并承担移交过程中由于存款证实书丢失、损毁、被人为调换等所引发的一切后果。正常情况下，同城存款银行应在存款证实书开立后 2 个工作日内将原件移交托管行保管；异地存款银行应在存款证实书开立后 5 个工作日内将原件移交资产托管人保管。

3、办理本资产管理计划财产投资银行存款的开户、全部提前支取、部分提前支取或到期支取，可采取以下方式：

- (1) 由资产管理人和资产托管人的授权代表持授权委托书共同全程办理，资产管理人上述事项被授权人员与资产管理人负责洽谈存款事宜并签订存款协议的人员不能为同一人。
- (2) 由存款银行/资产管理人提供上门送、取单服务。在上门送、取单时，存款银行/资产管理人经办人员应携带单位介绍信/授权书以及个人身份证件，以便资产托管人进行核查。资产管理人上述事项被授权人员与资产管理人负责洽谈存款事宜并签订存款协议的人员不能为同一人。
- (3) 资产管理人与资产托管人双方协商一致的其他办理方式。

4、本产品投资银行存款或办理存款支取时，资产管理人需提前发送银行存款投资合同/协议、投资指令、支取通知等有关文件到资产托管人处，以便资产托管人有足够的时间履行相应的业务操作程序。

5、如发生逾期支取，资产托管人不承担相应利息损失及逾期支取手续费。

6、本产品投资银行存款时，应本着便于存款证实书安全保管和日常监督检查的原则，尽可能选择托管账户开户行所在地的银行机构办理。

7、对于已移交资产托管人保管的存款开户证实书等实物凭证，资产托管人应确保安全保管；对未按约定将存款开户证实书等实物凭证移交资产托管人保管的，资产托管人应向资产管理人进行必要的催缴和风险提示；提示后仍不将相关实物凭证送达资产托管人保管的，出于托管履职和尽责，资产托管人可视情况采取必要的风险控制措施：（1）建立风险预警机制，对于实物凭证未送达集中度较高的存款银行，主动发函资产管理人尽量避免在此类银行进行存款投资；（2）在定期报告中，对未按约定送达资产托管人保管的实物凭证信息进行规定范围信息披露；（3）未送达实物凭证超过送单截止日后30个工作日，且累计超过3笔（含）以上的，部分或全部暂停配合资产管理人办理后续新增存款投资业务，直至实物凭证送达我行保管后解除。实物凭证未送达但存款本息已安全划回托管账户的，以及因发生特殊情况由资产管理人提供相关书面说明并重新承诺送单截止时间的，可剔除不计。

（七）托管产品通过第三方销售机构参与开放式基金投资的特别约定

本产品可以通过第三方基金销售机构渠道投资开放式基金。为维护产品持有人利益、保障资产安全，资产管理人应负责制订选择第三方基金销售机构的标准和程序，并据此选择第三方销售机构。资产管理人确保所选择的销售机构在中国

证监会注册取得基金销售业务资格并已成为中国证券投资基金业协会会员,符合开展前述各类产品销售业务的各项资质和要求。对于第三方基金销售机构原因给本产品造成损失的,相关责任由资产管理人承担。

十四、越权交易

(一) 越权交易的界定

越权交易是指资产管理人违反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。

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

(二) 越权交易的处理程序

1、违反本合同投资范围规定进行的投资交易行为

资产托管人在行使监督职责时,发现资产管理人的投资指令违反本合同约定的,有权拒绝执行,立即通知资产管理人,资产管理人应以书面形式向资产托管人进行解释、举证,并提出处理方案,同时抄送投资者。在期限内,资产托管人有权随时对通知事项进行复查,督促资产管理人改正;未能在限期内改正的,资产托管人应通知投资者,并报告中国证监会相关派出机构及证券投资基金业协会。

资产托管人在行使监督职责时,发现资产管理人依据交易程序已经生效的指令违反本合同约定的,执行后应立即通知资产管理人和投资者并及时报告中国证监会。因执行该指令造成的损失,资产托管人不承担任何责任。

资产托管人发现资产管理人可能存在违反本合同约定,但难以明确界定时,

应立即报告投资者。投资者在合理时间内予以答复的，资产托管人按投资者的答复执行；投资者在合理时间内未予以答复的，资产托管人视同投资者认可资产管理人的行为。由此产生的一切损失，资产托管人不承担任何责任。

资产管理人应向投资者和资产托管人主动报告越权交易。在投资者规定限期内，投资者和资产托管人有权随时对资产管理人报告的越权交易事项进行复查，督促资产管理人改正。资产管理人对投资者和资产托管人通知的越权事项未能在限期内纠正的，资产托管人应通知投资者，并报告中国证监会。

2、越权交易所发生的损失及相关交易费用由资产管理人负担，所发生的收益归本资产管理计划财产所有。

（三）资产托管人对资产管理人投资运作的监督

1、资产托管人根据合同的约定，对下述资产投资范围、投资对象进行监督。

本资产管理计划财产将投资于以下金融工具：

需列明本计划财产将投资的金融工具。

2、托管人对管理人的投资行为行使监督权

托管人根据合同的约定，对下述资产投资范围、投资比例进行监督。

1、投资范围：

（1）固定收益类资产：包括但不限于现金、银行存款、货币市场工具、货币市场基金、债券逆回购、交易所和银行间上市交易的国债、地方政府债、企业债券、公司债券、各类金融债（含次级债、混合资本债）、中央银行票据、同业存单、可转换债券（含可分离交易债）、可交换债、经银行间市场交易商协会批准注册发行的各类债务融资工具（如超短期融资券、短期融资券、中期票据、集合票据、集合债券、资产支持票据（ABN）、非公开定向债务融资工具（PPN）

等)、非公开公司债、资产支持证券(ABS)、债券型基金等固定收益类资产;

(2) 权益类资产:包括但不限于国内依法公开发行上市在沪深证券交易所市场交易的A股股票(包括一级市场申购和二级市场买卖)(不含ST),股票型基金、混合型基金(包括ETF和LOF)等。

(3) 接受国务院金融监督管理机构监管发行的权益类资产管理产品。

(4) 接受国务院金融监督管理机构监管发行的商品及金融衍生品类资产管理产品(不包括投资场外衍生品)。

2、投资比例:

本计划为混合类单一资产管理计划,投资组合在各类资产上的投资比例,将严格遵守相关法律法规的规定。

(1) 债券类资产占资产总值的比例:0-80%(不含)。

(2) 权益类资产占资产总值的比例:0-50%(不含)。

(3) 接受国务院金融监督管理机构监管发行的权益类资产管理产品:0%~80%(不含)。

(4) 接受国务院金融监督管理机构监管发行的商品及金融衍生品类资产管理产品:0%~50%(不含)。

(5) 债券正回购:本计划的总资产不得超过净资产的200%。

托管人履行投资监督义务受限于管理人提供的数据和信息的,由管理人对所提供信息的真实性、准确性和完整性负责。

托管人对本条约定的委托资产的投资监督和检查自本资产管理计划合同生效之日起开始。

3、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、上市公司合并、已投资持有的证券在持有期间信用评级下降、上市公司受到监管机关处罚或谴责、上市公司股票被特别处理、上市公司年度财务审计报告未被出具标准无保留意见、委托人追加或提取资产导致的产品规模波动等，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，以达到投资政策的要求。

(2) 法律法规对被动超标另有规定的从其规定。

(3) 因被动超标而对资产管理计划财产的损失由资产管理计划财产承担，对于上述第(1)项约定的被动超标的情形，因资产管理人未按照上述第(1)项约定的时间及时调整导致资产管理计划财产损失扩大的，资产管理人应承担该扩大损失的赔偿责任。

4、资产托管人对资产管理计划财产投资范围的监督和检查自本合同生效之日起开始，对投资比例限制的监督和检查自6个月的建仓期后开始在本合同到期日前一个月内，因资产管理计划财产变现需要，本资产管理计划财产的投资比例限制可以不符合上述规定。

5、投资比例限制如需变更，资产管理人应与投资者、资产托管人达成一致，完成合同变更或签订补充协议等程序，并应为资产托管人调整监督事项留出必要的时间。

6、投资者确认，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，合规投资的最终责任在资产管理人。

资产托管人无投资责任，对任何资产管理人的投资行为（包括但不限于其投资策略及决定）或其投资回报不承担任何责任。资产托管人不会因提供投资监督报告而对资产管理人违规投资承担责任。

十五、资产管理计划财产的估值和会计核算

（一）估值目的

资产管理计划资产估值的目的是客观、准确地反映资产管理计划资产是否保值、增值，依据经资产管理计划资产估值后确定资产管理计划资产净值。

（二）估值时间

本资产管理计划成立后，管理人与托管人每个交易日对上一交易日委托资产进行估值并核对。

（三）估值程序

管理人与托管人每个交易日对上一交易日委托资产进行估值并以电话或双方认可的其他形式核对。

（四）估值方法

1、证券交易所上市的有价证券的估值方法：

（1）证券交易所上市的有价证券（包括股票、权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

(2) 证券交易所上市实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

(3) 证券交易所上市未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

(4) 证券交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值；对在交易所市场挂牌转让的资产支持证券和私募证券，用估值技术进行估值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。管理人应持续评估上述做法的适当性，并在情况发生改变时与托管人协商并做出适当调整。

(5) 对于只在上交所固定收益平台或者深交所综合协议平台交易的债券，采用估值技术确定公允价值；在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

2、处于未上市期间的有价证券的估值方法应区分如下情况处理：

(1) 送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市价(收盘价)估值；该日无交易的，以最近一日的市价(收盘价)估值；

(2) 首次公开发行未上市的股票、债券和权证，采用估值技术确定公允价

值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值；

(3) 首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在证券交易所上市后，按证券交易所上市的同一股票的市价(收盘价)估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

3、证券投资基金的估值方法：

(1) 上市流通的证券投资基金按估值日前一日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日前一日无交易的，以最近交易日的收盘价估值；

(2) 其他证券投资基金按估值日公布的基金份额净值估值，当日未公布的，以最近交易日公布的基金份额净值为准。(如果本计划以开放式证券投资基金为主要投资对象，场外投资的开放式证券投资基金按照估值当日基金份额净值估值，当日无净值的，以最近交易日取得的基金份额净值为准。)

(3) 持有的货币市场基金，按估值日前一日公布的每万份收益估值，估值日前一日未公布的，以最近交易日公布的每万份收益估值(如果本计划以开放式证券投资基金为主要投资对象，持有的货币市场基金，按估值日前一日的每万份收益估值，估值日前一日未公布的，以最近交易日公布的每万份收益估值)

(4) 全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值。

(5) 同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

(6) 期货合约按估值日其所在交易所的结算价估值；估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。

(7) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，

资产管理人可根据具体情况与资产托管人商定后,按最能反映公允价值的价格估值。

(8) 相关法律法规以及监管部门有强制规定的,从其规定。如有新增事项,按国家最新规定估值。

(9) 银行存款以成本列示,利息在实际收到时入账。

(10) 接受国务院金融监督管理机构监管的机构发行的私募基金产品,包括但不限于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发行的资产管理产品,按照估值日前一日私募基金产品公布的单位净值估值,如估值日前一日单位净值未公布的,以前最近一个交易日公布的产品份额净值估值。

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

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

(五) 估值对象

资产管理计划财产项下所有的股票、权证、债券、证券投资基金、商品期货和银行存款本息、应收款项、其他投资等资产。

(六) 估值错误的处理

1、资产管理人和资产托管人将采取必要、适当、合理的措施确保资产管理计划财产估值的准确性、及时性。

2、因估值导致资产管理计划财产净值误差在 - 0.5% (含) 至 0.5% (含)

之间的，不需要做重新估值处理。

3、因估值导致资产管理计划财产净值低估超过 0.5%的，需要重新估值。

4、因估值导致资产管理计划财产净值高估超过 0.5%的，需要重新估值，并由资产管理人和资产托管人分别退还多计的管理费和托管费。

5、当资产管理人计算的资产管理计划财产净值与资产托管人的计算结果不一致时，相关各方应本着勤勉尽责的态度重新计算核对，如果最后仍无法达成一致，应以资产管理人的计算结果为准，由此造成的损失由资产管理人承担赔偿责任，资产托管人不负赔偿责任。

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

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

8、前述内容如法律法规或监管机构另有规定的，按其规定处理。

(七) 估值调整的情形与处理

(八) 暂停估值的情形

1、资产管理计划投资所涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

2、因不可抗力或其它情形致使资产管理人、资产托管人无法准确评估本计划资产价值时；

3、占资产管理计划相当比例的投资品种的估值出现重大转变，而资产管理人为保障投资者的利益，已决定延迟估值；

4、中国证监会和本合同认定的其它情形。

(九) 资产管理计划财产及资产净值的确认

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

资产管理人每交易日对资产管理计划财产进行估值，并由资产托管人复核。估值原则应符合本合同、《证券投资基金会计核算业务指引》及其他法律法规的规定。资产管理人应于每个交易日计算资产管理计划资产净值并与资产托管人核对，由资产管理人提交投资者。

资产管理计划财产净值计算和会计核算的义务由资产管理人承担。本资产管理计划财产的会计责任方为资产管理人，因此，就与资产管理计划财产有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致意见，以资产管理人对资产管理计划财产净值的计算结果为准，由此造成的损失由资产管理人承担赔偿责任，资产托管人不负赔偿责任。

(十) 资产账册的建立

资产管理人和资产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、登录和保管资产管理计划财产的全套账册，对相关各方各自的账册定期进行核对，互相监督，以保证资产管理计划财产的安全。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。

经对账发现相关各方的账目存在不符的，资产管理人和资产托管人必须及时查明原因并纠正，保证相关各方平行登录的账册记录完全相符。

(十一) 资产管理计划财产的会计核算

1、会计政策

(1) 本资产管理计划财产的会计年度为每年 1 月 1 日至 12 月 31 日。

(2) 记账本位币为人民币，记账单位为元。

(3) 资产管理计划财产的会计核算按《证券投资基金会计核算业务指引》执行。

2、会计核算方法

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

(2) 资产管理人、资产托管人应保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，编制会计报表。

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

(4) 实收资产管理计划财产采用份额法进行核算。

3、建账日和运作起始日为资产托管人接到经投资者及资产管理人双方确认签收的《资产管理计划财产起始运作通知书》回传件后的下一工作日。追加资产时,运作起始日为资产托管人接到经投资者及资产管理人双方确认签收的《资产管理计划财产追加运作通知书》回传件后的下一工作日。

十六、资产管理计划的费用与税收

(一) 资产管理计划费用的种类

1、资产管理人的管理费；

- 2、资产托管人的托管费；
- 3、资产管理人依据本合同收取的业绩报酬；
- 4、账户的资金结算汇划费、账户维护费；
- 5、资产管理计划财产开立账户需要支付的费用，资产管理计划终止后产生的清算费用；
- 6、资产管理计划财产的证券交易费用；
- 7、按照法律法规及本合同的约定可以在资产管理计划财产中列支的其他费用。

上述资产管理业务费用由资产管理人在法律法规规定的范围内按照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定。

(二) 不列入资产管理计划财产费用的项目

资产管理计划成立前发生的费用，不得在资产管理计划财产中列支。资产管理人和资产托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或资产管理计划财产的损失，以及处理与本计划财产运作无关的事项发生的费用等不列入资产管理计划财产运作费用。

(三) 费用计提方法、计提标准和支付方式

1、资产管理人的管理费

资产管理计划财产的年管理费率为 0.3%，计算方法如下：

$$\text{管理费} = \text{前一日资产管理计划财产净值} \times \text{年管理费率} \div 365$$

资产管理计划财产管理费自资产管理计划成立日起，每日计提，按月支付。

资产托管人根据与资产管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内按照指定的账户路径进行资金支付，资产管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法

定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，资产管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系资产托管人协商解决。

在首期支付管理费前，资产管理人应向资产托管人出具正式函件指定管理费的收款账户。资产管理人如需要变更此账户，应提前 5 个工作日向资产托管人出具书面的收款账户变更通知。

2、资产托管人的托管费

资产管理计划财产的年托管费率为 0.015%，计算方法如下：

托管费 = 前一日资产管理计划财产净值 × 年托管费率 ÷ 365

资产管理计划财产托管费自资产管理计划成立日起，每日计提，按月支付。资产托管人根据与资产管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内按照指定的账户路径进行资金支付，资产管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，资产管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系资产托管人协商解决。

3、业绩报酬

在两类情况下管理人将根据年化收益率（R）、业绩报酬计提基准（RE）提取业绩报酬（E），一类是委托人提取资产或本资产管理计划终止清算时提取业绩报酬，称为退出提取；另一类是分红时提取业绩报酬，称为分红提取。分红提取的业绩报酬计提频率不高于六个月一次。本资产管理计划的业绩报酬计提基准为 10%，管理人对年化收益率 R 超过业绩报酬计提基准的收益部分提取 10% 的业绩报酬。

（1）管理人对委托人的每笔计划份额按参与时间的不同加以区分，对每笔计划份额分别计算年化收益率并计提业绩报酬。

(2) 退出提取

当委托人提取资产或本资产管理计划终止清算时，管理人根据年化收益率 (R) 提取业绩报酬，业绩报酬按累进方式计算，从委托人提取资金清算款中以现金支付。

A 为业绩报酬计提日的单位累计净值；

C 为上一个业绩报酬计提日的单位累计净值；

C'为上一个业绩报酬计提日的单位净值；

D 表示上一业绩报酬计提日到本次业绩报酬计提日的间隔天数；

E=业绩报酬；

K=退出份额×上一个业绩报酬计提日的单位净值；

年化收益率 $R=(A-C)/C' \times 365 / D \times 100\%$ ；

业绩报酬计提日为计划分红日、委托人退出日或资产管理计划清算日。以上一个发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日(对委托人每笔计划份额，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资产管理计划成立日，存续期参与的为参与确认日)至本次业绩报酬计提日期间的年化收益率 R，作为计提业绩报酬的基准。

(3) 分红提取

当发生分红时，管理人将根据年化收益率 (R) 提取业绩报酬，业绩提取方式与退出提取相同。

注：业绩报酬涉及的间隔天数计算管理人以确认日计算。

因取值精度原因，实际业绩报酬计提结果以会计责任方计提结果为准。

(4) 如管理人已经提取业绩报酬，即使委托人退出本资产管理计划时净值

有所下跌，则该部分已提取业绩报酬亦不退还委托人。

(5) 管理人的业绩报酬的计算和复核工作由管理人完成。

业绩报酬在业绩报酬计提日计提，由管理人在计提当日向托管人发送业绩报酬计提金额，托管人据此进行财务处理。若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延，业绩报酬以管理人提供的数据为准。

提取业绩报酬时，托管人根据管理人的指令将业绩报酬划拨给管理人。

4、本委托资产的证券交易费用包括但不限于交易佣金，交易佣金具体费率参见“产品参数说明函”(附件15)，其他交易费用收费标准、支付方法根据证券监督管理部门、交易所、中国证券登记结算公司有关规定办理。

5、上述(一)中4到6项费用由资产托管人根据其他有关法规及相应协议的规定，在费用发生时，直接列入当期费用。

(四) 资产管理人和资产托管人与投资者协商一致后，可根据投资变更情况和市场发展情况调整资产管理费率和资产托管费率，并报中国证监会备案。

(五) 税收

资产管理计划财产和投资者根据国家法律法规规定，履行纳税义务。

在本资管计划运作期间产生的税费，管理人有权按照法律法规规定履行进行扣缴。如依据相关法律法规或税务机关的规定，就本计划营运过程中发生的增值税等应税行为，管理人需要承担相应纳税义务的，各方一致同意：除本计划已列明的资产管理业务费用产生的税费由各收款方自行缴纳外，管理人有权通过出具划款指令给托管人的方式，以委托财产予以预提税费或其他方式从委托财产中扣除相关应缴增值税税费；管理人在向委托人交付利益或资产后税务机关要求管理人缴纳相关税费的，委托人应按照管理人通知要求进行补缴，管理人亦有权以委

托人的剩余计划财产予以缴纳；委托人不得以任何方式要求管理人向其返还或补偿该等税费；委托人未按照本条款约定缴纳税款给管理人造成损失的，承担全部赔偿责任。以上管理人有权扣除的税费均需由管理人向托管人发送划款指令，由托管人按管理人的划款指令划付款项。涉及增值税和相关附加税费的任何事宜均由管理人与委托人协商确定，与托管人无关，托管人不承担任何责任。

十七、资产管理计划的收益分配

（一）资产管理计划利润的构成

资产管理计划利润指利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额；资产管理计划已实现收益指资产管理计划利润减去公允价值变动收益后的余额。

（二）资产管理计划可供分配利润

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

（三）收益分配原则

本资产管理计划收益分配应遵循下列原则：

（1）本计划存续期内，收益分配日不设置固定日期，收益分配采用现金分配的方式。

（2）当委托人提取委托资产时，管理人根据委托资产收益情况确定收益分配日期、收益分配金额等，并告知委托人。

（3）收益分配的金额计量单位为人民币元，按四舍五入法保留到小数点后两位，由此误差产生的损失由计划资产承担，产生的收益归计划资产所有。

(4) 法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

(四) 收益分配方案

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

(五) 收益分配的确定与通知

资产管理计划收益分配方案由资产管理人拟订,由资产托管人复核,由资产管理人通知委托人进行确认;

(六) 收益分配的执行方式

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

十八、信息披露与报告

(一) 向投资者提供的报告

1、年度报告

资产管理人应当在每年结束后2个月内,编制完成资产管理计划财产年度报告,资产管理人在年度报告完成当日,将其发送资产托管人,资产托管人收到后2个月内复核其中的财务数据,并将复核结果书面通知资产管理人,由资产管理人将年度报告送交投资者。资产管理合同成立未满3个月或者存续期间不足3个月的,可不编制上一年度资产管理合同财务年度报告。

年度报告包括但不限于下列信息:

- ①资产管理人履职报告；
- ②资产托管人履职报告；
- 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。

2、季度报告

资产管理人应当在每季度结束之日起 10 个工作日内，编制完成资产管理计划财产季度报告，资产管理人在季度报告完成当日，将其发送资产托管人，资产托管人收到后 10 个工作日内复核其中的财务数据，并将复核结果书面通知资产管理人，由资产管理人将季度报告送交投资者。资产管理合同成立未满 3 个月或者存续期间不足 3 个月的，可不编制上一季度资产管理合同财务季度报告。

季度报告包括但不限于下列信息：

- ①资产管理人履职报告；
- ②资产托管人履职报告；
- 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。

3、发生资产管理合同约定或可能影响投资者利益的重大事项时，在事项发生之日起五日内向投资者披露。

（二）向监管机构提供的报告

资产管理人、资产托管人应当根据法律法规和监管机构的要求履行报告义务，列明资产管理人、资产托管人向监管机构报告的种类、内容、时间和途径等有关事项。

（三）投资者可向资产管理人查询资产管理计划财产投资运作情况、向资产托管人查询资产管理计划财产托管情况。投资者能够按照资产管理合同约定的时间和方式查阅或者复制所披露的信息资料。

十九、风险揭示

（一）市场风险

证券市场价格受到经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素的影响，导致资产管理计划财产收益水平变化，产生风险，主要包括：

1、政策风险

因国家宏观政策（如货币政策、财政政策、行业政策、地区发展政策等）发生

变化，导致市场价格波动而产生风险。

2、经济周期风险

随经济运行的周期性变化，证券市场的收益水平也呈周期性变化。资产管理计划财产投资于债券和股票，收益水平也会随之变化，从而产生风险。

3、利率风险

金融市场利率的波动会导致证券市场价格和收益率的变动。利率直接影响着债券的价格和收益率，影响着企业的融资成本和利润。资产管理计划财产投资于债券和股票，其收益水平会受到利率变化的影响。

4、上市公司经营风险

上市公司的经营好坏受多种因素影响，如管理能力、财务状况、市场前景、行业竞争、人员素质等，这些都会导致企业的盈利发生变化。如果资产管理计划财产所投资的上市公司经营不善，其股票价格可能下跌，或者能够用于分配的利润减少，使资产管理计划财产投资收益下降。虽然资产管理计划财产可以通过投资多样化来分散这种非系统风险，但不能完全规避。

5、购买力风险

资产管理计划财产的利润将主要通过现金形式来分配，而现金可能因为通货膨胀的影响而导致购买力下降，从而使资产管理计划财产的实际收益下降。

6、债券收益率曲线风险

债券收益率曲线风险是指与收益率曲线非平行移动有关的风险，单一的久期指标并不能充分反映这一风险的存在。

7、再投资风险

再投资风险反映了利率下降对固定收益证券利息收入再投资收益的影响，这

与利率上升所带来的价格风险(即前面所提到的利率风险)互为消长。具体为当利率下降时,资产管理计划财产从投资的固定收益证券所得的利息收入进行再投资时,将获得比之前较少的收益率。

(二) 管理风险

在资产管理计划财产管理运作过程中,资产管理人的研究水平、投资管理水平直接影响资产管理计划财产收益水平,如果资产管理人对经济形势和证券市场判断不准确、获取的信息不全、投资操作出现失误,都会影响资产管理计划财产的收益水平。

(三) 流动性风险

资产管理计划财产要随时应对投资者的提取,如果资产管理计划财产不能迅速转变成现金,或者变现时对资产管理计划财产净值产生冲击成本,都会影响资产管理计划财产运作和收益水平。尤其是在投资者大额提取资产管理计划财产时,如果资产管理计划财产变现能力差,可能会产生资产管理计划财产仓位调整的困难,导致流动性风险,从而影响资产管理计划财产收益。

(四) 信用风险

信用风险是债务人的违约风险,主要体现在信用产品中。在资产管理计划财产投资运作中,如果资产管理人的信用研究水平不足,对信用产品的判断不准确,可能使资产管理计划财产承受信用风险所带来的损失。

(五) 本金损失风险

(六) 投资标的风险

(七) 关联交易风险

(八) 操作或技术风险

(九) 税收风险

(十) 特定投资方法及特定投资对象风险

(十一) 外包事项风险

(十二) 未在证券投资基金业协会完成备案的风险

(十三) 聘请投资顾问风险

(十四) 其他风险

1、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，可能导致资产管理计划财产的损失；

2、金融市场危机、行业竞争、代理商违约等超出资产管理人和资产托管人自直接控制能力之外的风险，也可能导致投资者利益受损。

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

二十、资产管理合同的变更与终止

(一) 本合同的解除与终止的情形包括下列事项：

1、合同期限届满而未延期的；

2、 本合同可以自委托人、托管人和管理人签署协商一致确认书之日起提前终止，终止后的清算流程按本合同约定进行。因委托人单方原因提前终止本合同的，由此产生的损失由委托人自行承担。若投资标的因相关当事人的违约提前终止的，本合同也一并终止，由此产生的损失由违约方承担。如资产管理人怠于向违约方追责的，资产管理人应当负责赔偿委托人的损失。

3、 委托人依法解散、被依法撤销或被依法宣告破产的；

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、未在证券投资基金业协会完成备案或不予备案的情形；

7、法律法规、监管要求规定的其他情形。

若有本款任一情况出现，本委托合同即刻解除，进入终止清算。

(二) 管理人违反法律、行政法规的规定，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。同时，投资者有权解除本合同。

(三) 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6项约定的情形除外。

(四) 本合同变更的条件

1、因法律法规或中国证监会、证券投资基金业协会的相关规定、要求发生变化必须变更资产管理合同的，管理人可以与托管人协商后修改资产管理合同，并由管理人按照合同约定及时向投资者披露变更的具体内容。

2、因其他原因需要变更资产管理合同的，经委托人、管理人和托管人协商一致后，可对资产管理合同内容进行变更，资产管理合同另有约定的除外。资产管理计划改变投向和比例的，应当事先取得委托人同意。

3、如委托人不同意变更合同，可以要求提前终止，经委托人、管理人和托管人协商同意后，资产管理合同可以提前终止。

4、资产管理合同发生变更的，管理人应按照证券投资基金业协会要求及时向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。

(五) 资产管理计划展期应符合以下条件：

(1) 资产管理计划运作规范，管理人、托管人未违反法律、行政法规、中国证监会规定和资产管理合同的约定；

(2) 资产管理计划展期没有损害投资者利益的情形；

(3) 中国证监会规定的其他条件。

(六) 本合同到期且不展期的，管理人应当在委托期限届满前【壹拾】个工作日内将委托资产全部变现，各方另有约定或无法变现的除外。如前述期间内无法变现，管理人应当在具备变现条件后【壹拾伍】个工作日内及时变现，不可变现期间管理人、托管人对该部分暂时不能变现的委托资产不收取管理费和托管费。资产管理计划在发生终止情形之日起五个工作日内由管理人发起并开始组织清算资产管理计划资产，以及财产清算的有关事项。

1、清算时，如专用证券账户内有无法变现或因协商结转而不需变现的有价证券，其清算价格按下列标准计算：

(1) 未上市的一级市场申购新股清算价格按发行价计算；

(2) 无法变现的有价证券的清算价格按前一个交易日的收盘价格计算。

(3) 若存在无法变现的证券，则资管计划延期或根据委托人的指令进行处置。

2、管理人应当在委托期满或本合同终止、解除之日起【伍】个工作日内，向委托人提交经托管人复核的《委托资产管理清算报告》，委托人应当自收到清算报告之日起【伍】个工作日内对《委托资产管理清算报告》的内容进行核

对并向管理人、托管人书面确认。托管人在委托人签字确认之日起【伍】个工作日内根据管理人的指令向管理人支付剩余管理费和向托管人支付剩余托管费。在付清所有应付款项后，管理人应在【伍】个工作日内代理委托人将专用证券账户内的证券（若有）划转至委托人的普通证券账户，划转完成后，管理人代理委托人办理注销专用证券账户，并向托管人发出划款指令，托管人应根据管理人的划款指令将托管账户中的资金划入委托人指定的账户。

在委托财产移交前，由托管人负责保管。保管期间，任何当事人均不得运用该委托财产。保管期间产生的收益归委托财产所有，发生的保管费用由委托财产承担。因委托人原因导致委托财产无法转移的，托管人和管理人可以在协商一致后按照有关法律法规进行处理。

如因本合同各方当事人意见不一致，致使委托资产管理清算报告未能书面确认的，管理人应按当事人各自主张的结算金额中最小金额向托管人发送指令，托管人按指令将委托资产划至指定账户。未完成的委托资产清算工作由本合同各方当事人继续协商，或按本合同约定的争议解决方式处理。

3、管理人应在资产委托到期日之前将委托资产中的证券资产变现。如委托资产中有不能变现的证券资产，则管理人可代理委托人将专用证券账户内的证券资产划转至委托人的普通证券账户或将资产委托期限自动顺延，证券可变现后管理人应在【壹拾伍】个工作日内及时变现，不可变现期间管理人、托管人对该部分暂时不能变现的委托资产不收取管理费和托管费；托管人根据管理人的指令将管理费、托管费等费用从托管账户划往指定收款账户后，将托管账户内的属于委托人的剩余现金资产返还给委托人，管理人将委托资产中无法变现的非证券资产移交给委托人。

根据中国结算的规定，结算备付金、结算保证金账户内的资金按市场规则每月调整，因此结算备付金、结算保证金账户内的资金、利息需等中国结算退款后方可清算。该笔清算资金在扣除相关费用后划往委托人的指定账户。

4、资产管理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；

5、资产管理计划财产清算完毕后，各方当事人承担在资产管理计划财产相关账户注销中的职责及相应的办理程序。托管人根据管理人的指示按照规定注销资产管理计划财产的托管账户等投资所需账户，管理人应给予必要的配合。如因本合同相关当事人故意拖延等行为造成销户不及时而出现直接损失或造成相关费用，应当对各自行为承担赔偿责任。

6、资产管理计划财产清算账册及文件由管理人保存 20 年以上。

二十一、反洗钱

1、资产管理人和资产托管人应按照所在国家 / 地区反洗钱和反恐怖融资方面的法律法规和监管要求，建立健全洗钱和恐怖融资风险管理体系，建立并有效执行反洗钱和反恐怖融资内部控制制度，设立反洗钱和反恐怖融资专门机构或者指定内设机构负责反洗钱和反恐怖融资工作，建立健全和执行客户身份识别、客户身份资料和交易记录保存制度、大额交易和可疑交易监控和报告制度、洗钱和恐怖融资风险自评估制度、反恐怖融资管理机制、制裁筛查机制等相关制度，依法执行联合国安理会制裁决议或国际金融制裁相关要求，开展反洗钱和反恐怖融资内部审计，做好境外洗钱和恐怖融资风险管控和合规经营工作，做好跨境业务的洗钱风险、制裁风险和恐怖融资风险防控，制定反洗钱和反恐怖融资培训制度，

开展反洗钱和反恐怖融资宣传,并对可疑客户及可疑交易及时采取有效的风险控制措施。

资产管理人和资产托管人应在符合相关法律法规和监管要求的前提下,共同推进反洗钱和反恐怖融资的合作,为调查涉嫌洗钱、恐怖融资或其他违法犯罪活动提供必要协助。资产管理人和资产托管人应为其自对方获得的与反洗钱和反恐怖融资相关的信息严格保密。如果资产托管人发现资产管理人在协议期间被列入国际组织、当地监管或有关外国政府的制裁名单或制裁范围,或资产托管人发现资产管理人客户及业务涉嫌洗钱和恐怖融资、核武器扩散、国内/国际制裁违规或其他违法犯罪活动,或属于资产托管人拒绝接受的客户,资产托管人有权中止或拒绝办理相关业务。

对于因资产管理人任何与反洗钱和反恐怖融资直接相关的作为(或不作为)而导致任何一方对资产托管人进行任何调查、索赔、请求、收费、控告的,资产管理人应赔偿资产托管人因该等调查、索赔、请求、收费和控告所遭受的直接损失并使其免受直接损失(包括但不限于任何法律成本和费用)。

2、具有下列情形之一的,资产托管人有权拒绝提供托管服务或通过其他方式终止与资产管理人的托管业务关系:

(1) 投资者或资产管理人属于被联合国、中国或其他司法管辖区有权机关发布名单实施制裁的人员及实体;

(2) 投资者或资产管理人从事洗钱、恐怖融资或其他违法犯罪行为被司法机关定罪量刑;

(3) 投资者或资产管理人涉嫌洗钱、恐怖融资或其他违法犯罪行为被诉讼或调查,并使资产托管人遭受或可能遭受巨大声誉、财务等损失;

(4) 有合理理由怀疑投资者或资产管理人涉嫌洗钱、恐怖融资或其他违法犯罪行为，要求投资者或资产管理人提供证明交易合法性、真实性等相关材料，投资者或资产管理人无合理理由拒绝配合；

(5) 投资者所提供的身份证件、签证等相关证件经核查或鉴定为虚假证件，或为冒用他人身份证件的人员；

(6) 当地监管或我行反洗钱及金融制裁合规政策规定的其他情形；

(7) 资产托管人认可的其他情形

二十二、违约责任

(一) 资产管理人、资产托管人在履行各自职责的过程中，违反法律法规规定或者本合同约定，给资产管理计划财产或者投资者造成的直接损失，应当分别对各自的行为依法承担赔偿责任。但是发生下列情况的，当事人免责：

1、不可抗力；

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

3、资产托管人对因所引用的证券经纪商及其他中介机构提供的信息的真实性、准确性和完整性存在瑕疵所引起的损失不承担任何责任；

4、在没有欺诈或过失的情况下，资产管理人由于按照本合同规定的投资原则进行投资所造成的损失等；

5、在没有欺诈或过失的情况下，资产托管人由于按照资产管理人的有效指令执行而造成的损失等；

6、投资者未能事前就其关联证券或其他禁止交易证券明确告知资产管理人

致使资产管理计划财产发生违规投资行为的,资产管理人与资产托管人均不承担任何责任,投资者并就资产管理人与资产托管人由此遭致的损失承担赔偿责任。

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

(三)本合同当事人一方造成违约后,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。

二十三、争议的处理

对于因本合同的订立、内容、履行和解释或与本合同有关的争议,合同当事人应尽量通过协商、调解途径解决。不愿或者不能通过协商、调解解决的,任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会进行仲裁,仲裁地点为上海。仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力,仲裁费用由败诉方承担。

争议处理期间,合同当事人应恪守各自的职责,继续忠实、勤勉、尽责地履行资产管理合同规定的义务,维护投资者的合法权益。

本合同受中国法律管辖。

二十四、资产管理合同的效力

(一)本合同是约定合同当事人之间权利义务关系的法律文件。投资者为法人或其他组织,本资产管理合同经投资者、资产管理人和资产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)或授权代理人签字或盖章之日起成立;如投资者为自然人,本资产管理合同经投资者本人签字或授权的代理人签字、资

产管理人和资产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)或授权代理人签字或盖章之日起成立。

(二)资产管理计划在受托资产入账后,资产管理人书面通知投资者资产管理计划成立。

(三)本合同正本一式四份,当事人各执一份,报证券投资基金业协会备案一份。每份均具有同等的法律效力。

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

(五)本合同的有效期限为【贰】年。

(六)投资者自签订资产管理合同即成为资产管理合同的当事人。

二十五、其他事项

本合同项下的所有文件、文本,如开展业务时仅发送传真件的,资产管理人应定期将相关原件寄送给资产托管人,并确保原件与传真件保持一致。在原件未寄达资产托管人之前,传真件效力等同于原件,如其与原件不一致,以托管人收到的传真件为准,由此产生的责任由管理人承担。。

资产管理人传真号码:(021)53686100-7009

资产托管人传真号码:(021)63861711或63867171或63870131

如未来中国证监会或其他监管机构对资产管理合同的内容与格式作出其他要求,委托人、管理人和托管人应立即展开协商,根据中国证监会的相关要求修改本合同的内容和格式。如与本合同相关的法律法规变动,本合同从其变化的条

款。

委托人、管理人、托管人不得通过签订补充协议、修改合同等任何方式，约定保证委托资产投资收益、承担投资损失，或排除委托人自行承担投资风险和损失。

管理人确认已向委托人说明单一资产管理业务的风险，不以任何方式对委托人资产本金不受损失或者取得最低收益作出承诺；委托人确认，已充分理解本合同内容，自行承担风险和损失。

本合同项下应由资产托管人向资产委托人、资产管理人发出的书面文件、扫描件、传真、信函等应加盖的印章，资产托管人指定为“中国建设银行股份有限公司基金托管部上海分部”印章。

本合同如有未尽事宜，由合同当事人各方按有关法律法规的规定协商解决。

(本页无正文，为《上海证券翱翔蓝海 FOF 单一资产管理计划资产管理合同》
签署页)

投资者： (签字或公章或合同专用章)

法定代表人 (负责人) 或授权代理人：



资产管理人：上海证券有限责任公司（公章或合同专用章）



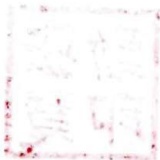
法定代表人（负责人）或授权代理人：

资产托管人：中国建设银行股份有限公司上海市分行（公章或合同专用章）



负责人或授权代理人：

签署日期：二〇二一年七月八日



附件 1：委托人授权书

尊敬的管理人上海证券有限责任公司、托管人中国建设银行股份有限公司上海市分行：

我司于【 】年【 】月【 】日签署的编号为【MADA20211-0005】的《上海证券翱翔蓝海 FOF 单一资产管理计划资产管理合同》（以下简称“资产管理合同”），我司以委托人身份授权以下人员发送该合

同项下相关通知等书面文件。现将书面文件用章样本及有关人员签字样本及相应权限留给管理人与托管人，请在使用时核验。下述被授权人在授权范围内向管理人及托管人发送书面文件的真实性、准确性及合法性由我司负全部责任。

姓名	权限	签/章样本	联系电话及传真
李锐高	该合同项下的权利收取	李锐高	13510961048
书面文件发送用章	(用章样本)		
备注：1、书面文件用章须与个人签章（若有）同时出具，方为有效。 2、权限类型：_____			


 委托人盖章：
 法定代表人（或授权人）：
 日期：____年__月__日



附件 2：单一资产管理计划合同业务用章样本

预留业务章名称	预留业务章印鉴
委托人_____业务专用章（如有）	
管理人 <u>上海证券有限责任公司</u> 业务专用章（如有）	
托管人 资产托管业务专用章	

委托人杭州联华华商集团有限公司（签章）：

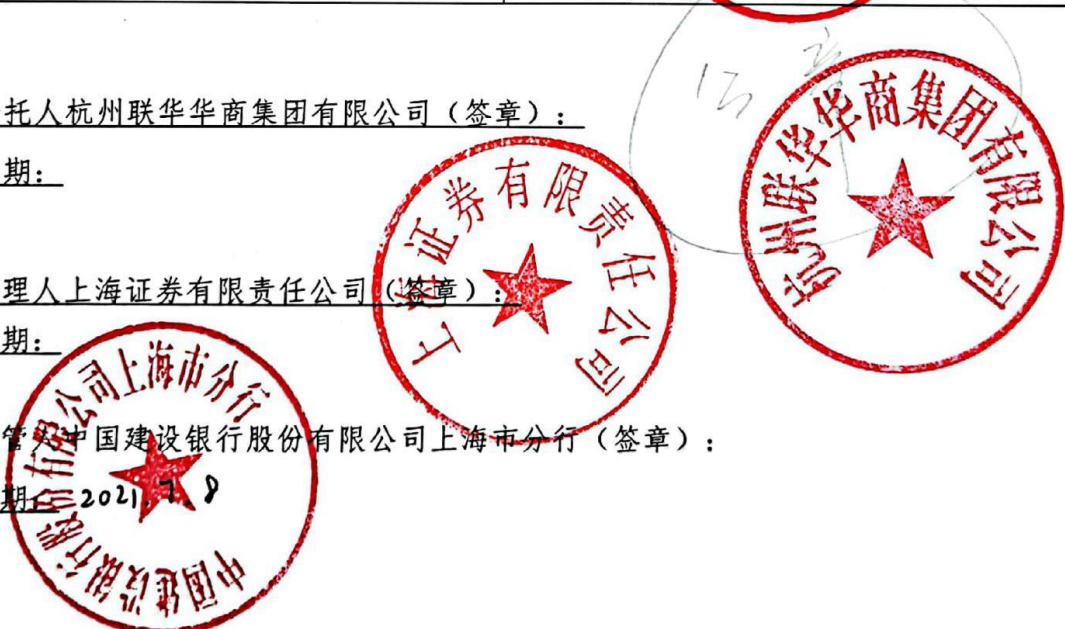
日期：

管理人上海证券有限责任公司（签章）：

日期：

托管人中国建设银行股份有限公司上海市分行（签章）：

日期：2021.7.8



附件 3：《账户开立通知书》（格式）

尊敬的委托人_____：

本合同项下账户的目录：

托管账户

户名：

账号：

开户行：

委托人指定提取委托财产的接收账户

户名：

账号：

开户银行：

管理费及业绩报酬收款账户

户名：上海证券有限责任公司

账号：1001235909013305037

开户银行：工行南京东路支行

托管费收款账户

户名：托管费收入暂收暂付户

账号：310280000156313999000000019

开户银行：中国建设银行股份有限公司上海分行运行中心

其他账户（若有）

1. _____ 账户，账号 _____；

2. _____ 账户，账号 _____；

3. _____ 账户，账号 _____；

4. _____ 账户，账号 _____；

5. _____ 账户，账号 _____。

特此通知。

管理人（业务盖章）：

日期：____年__月__日

回 执

尊敬的管理人_____：

本委托人确认于____年__月__日收悉《账户开立通知书》，对
通知书中所列账户等事项无异议。

委托人（业务盖章）：

日期：____年__月__日

附件 4：《第××期委托资产通知书》（格式）

尊敬的管理人_____、托管人_____：

本委托人拟委托现金资产_____元（大写_____）。

本期委托资产交付日（即交付日）：____年__月__日。

本期委托资产到期提取日（即提取日）：____年__月__日。

请托管人收到本通知后，及时确认到账资金并向管理人发送经贵行签章确认的《第__期委托资产确认书》。

特此通知。

委托人（业务盖章）：

日期：____年__月__日

附件 5：《第××期委托资产确认书》（格式）

尊敬的管理人_____：

本托管人确认：_____资产管理计划项下托管账户（账号：_____）于____年__月__日收到来自（来源账号）_____转入委托现金资产_____元（大写_____）。

特此通知。

托管人（业务盖章）：

日期：____年__月__日

附件6：《第××期委托资产（现金资产）起始运作通知书》（格式）

尊敬的委托人_____、托管人_____：

本管理人于____年__月__日收到托管人_____出具的《第__期委托资产确认书》，该委托资产为：_____元（大写_____）。

本管理人确认：

本期委托资产起始运作日（即起始运作日）：____年__月__日，
本期委托资产到期日（即到期日）：____年__月__日。

特此通知。

管理人（业务盖章）：

日期：____年__月__日

附件 7：《第××期委托资产（非现金资产）起始运作通知书》
（格式）

尊敬的委托人_____、托管人_____：

本管理人于____年__月__日收到委托人_____移交的委托资产（非现金资产）类型：_____，经确认该委托资产实际价值为：_____元（大写_____）。

本管理人确认：

本期委托资产起始运作日（即起始运作日）：____年__月__日。

特此通知。

管理人（业务盖章）：

日期：____年__月__日

附件 8：《委托资产证券清单》（格式）

尊敬的托管人_____：

根据三方共同签署的《上海证券翔翔蓝海FOF单一资产管理计划资产管理合同》（合同编号： ），贵行担任本委托资产的托管人，我司担任本委托资产的管理人。

经我司与中国证券登记结算有限责任公司确认，本资产管理计划合同项下证券形式初始委托资产已到达专用证券账户，清单如下：

非现金资产期初余额：人民币_____元

（其中证券类资产以____年__月__日交易所收盘价计算。）

市场	证券代码	证券名称	证券数量 (单位)	期初入账价 值(元)
合计				

管理人（业务盖章）：

日期：____年__月__日

附件 9：《第__期提取委托资产通知书》（格式）

尊敬的管理人_____、托管人_____：

本委托人将于____年__月__日提取委托资产（对应《第__期委托资产通知书》）现金资产价值人民币_____元（大写人民币_____元整），按照资产管理合同的规定，管理人签收后回传委托人并与其确认收到。

本委托人确认，本期委托资金年化业绩报酬基准利率为（年化）：

【_____】

特此通知。

委托人（业务盖章）：

日期：____年__月__日

回 执

尊敬的委托人_____：

本管理人确认于____年__月__日收悉《第__期提取委托资产通知书》，对确认书中所列委托资产的金额、数量、年化业绩报酬基准利率等事项无异议。

本管理人将于____年__月__日按通知办理。

管理人（业务盖章）：

日期：____年__月__日

附件 10：投资经理详细资料

投资经理姓名：左阳、王博生

左阳：

左阳先生拥有南开大学数学学士、清华大学数学硕士学位，从事固定收益研究和投资工作 11 年。曾在平安信托、国泰君安证券和太平资产等机构担任固定收益投资经理。擅长固定收益产品管理和利率、衍生品交易。

该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、行政处罚等。

王博生：

王博生先生为美国雪城大学应用统计与金融风险管理双硕士，CFA。2015 年加入上海证券基金评价研究中心，历任高级分析师、分析师，2019 年加入上海证券资产管理总部，担任投资经理，主要负责 FOF 投资与研究，包括私募基金的尽调、筛选与风控，对投资策略、风格、业绩等方面进行定性/定量分析。

该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、行政处罚等。

附件 11：《变更投资经理告知函》（格式）

尊敬的委托人_____、托管人_____：

本管理人于____年__月__日变更投资经理，按《_____资产管理计划合同》第七条约定通知委托人及托管人：

1. 新任投资经理：
 2. 变更日：____年__月__日
- 即刻生效。

特此告知。

管理人（业务盖章）：

日期：____年__月__日

回 执

尊敬的管理人_____：

本委托人确认于____年__月__日收悉《变更投资经理告知函》及投资经理详细资料。

委托人（业务盖章）：

日期：____年__月__日

附件 12：管理人授权通知书

尊敬的托管人中国建设银行股份有限公司上海市分行：

兹就贵行与我司合作的由贵行作为托管人、我司作为管理人的“上海证券翔翔蓝海 FOF 单一资产管理计划”业务，我公司授权以下人员发送该合同项下资金划拨指令以及其他相关通知。现将指令发送用章样本及有关人员签字样本、日常业务往来用章样本及相应权限留给你行，请在使用时核验。上述被授权人在授权范围内向你行发送指令的真实性、准确性及合法性由我公司负全部责任。本授权从【 】年【 】月【 】日起生效，授权期限同合同有效期，如有变更将另行通知。

姓名	权限	签字样本	印章样本
	经办 A		
	经办 B		
	经办 C		
	复核 A		
	复核 B		
	签发 A		
	签发 B		
指令发送用章	(用章样本)		
日常业务往来用章	(用章样本)		
备注： 1. 指令发送用章须与个人签字或个人印章同时出具，划款指令方为有效。 2. 划款指令权限类型：经办、复核、签发。			

管理人盖章：

法定代表人（或授权人）：

日期：____年__月__日

附件 13: 资产管理划款指令第__号 (格式)

致: _____

单位: 元

付款户名:	收款户名:
付款账号:	收款账号:
开户行:	开户行:
付款金额 (小写):	
付款金额 (大写):	
付款日期: ____年__月__日	到账日期: ____年__月__日__时
划款用途 (事由):	
发出人预留签章 (印章):	托管人预留签章 (印章):
发出人预留签字:	托管人预留签字:
签发人:	签发人:
复核人:	复核人:
经办人:	经办人:
密押 (发出人填写):	密押 (托管分部填写): 提示支行信息: (1) 请将事由内容作为发报摘要 (2) <input type="checkbox"/> 加急 <input type="checkbox"/> 交换 <input type="checkbox"/> 其他_____
托管人反馈信息栏: 1、该指令已执行 2、该指令未执行, 原因如下: _____资产托管业务专用章	开户行反馈信息栏: 1、该指令已执行 2、该指令未执行, 原因如下: 核押: 复核: 经办: 支行签章 (印章)

附件 14-1：资产管理计划资产托管项下管理人联系人员确认表

姓名	电话	传真	手机	电子邮件	岗位
方励斌	021-53686202			fanglibin@shzq.com	项目协调人
钱喆	021-53686610			qianzhe@shzq.com	会计核算与估值 A
胡一鸣	021-53686609			huyiming@shzq.com	会计核算与估值 B
周磊磊	021-53686609			zhouleilei@shzq.com	付款及收款指令 A
韩懿	021-53686328			hanyi@shzq.com	付款及收款指令 B
					开放式基金投资 单据 A
					开放式基金投资 单据 B
					投资监督 A
					投资监督 B
					数据发送 A
					数据发送 B

附件 14-2：资产管理计划资产托管项下托管人联系人员确认表

业务联系部门：中国建设银行股份有限公司基金托管部上海分部

办公地址：上海市淮海中路 200 号 7 楼 邮政编码：200021 电话总机：021-63181818

新一代划款总行指令传真号码：021-38130168, 指令接收邮箱：tgzl.zh@vip.ccb.com, sh_zctgyyb.sh@ccb.com

接收数据专用深圳通小站号：K0252

姓名	分机	传真	直线、手机	客户服务岗位说明
马伟琪	8773	63861711 或 63867171 或 63870131	13621883030	清算岗位
王洁	8783		13917721031	清算岗位
章军	8733		13817245578	清算岗位
沈晓羚	8763		13801696394	清算岗位
秦军	8713		13817582695	清算岗位、银行间债券交割
刁维敏	8723		13901909183	清算岗位兼资产托管营运协调人
黄海	8722		13701958062	核算岗位兼资产托管营运协调人
庄韵捷	8742		15921505651	核算岗位
马文华	8738		13816390707	核算岗位
张婷	8752		15201736125	核算岗位
应茹佳	8778		13918259030	核算岗位
朱骏晖	8604		18521724958	核算岗位
张涵钦	8788		15801783767	监督岗位、银行间债券交割
刘雯	8748		13818006480	监督岗位兼监督协调人

附件 15：产品参数说明函（格式）

产品参数说明函

XXX 资产托管部：

为配合《XXXXXX》正常运营，现对《XXXXXX》投资运作中涉及的交易参数约定如下：

一、 产品组合信息：

1、 资产代码：XXXXXX（如有分级，请注明分级代码信息，如产品主代码 XXXXXX、优先级 XXXXXX、一般分级 XXXXXX 等）

二、 证券交易费用：

1、 佣金费率：

		佣金		备注
		费率%	起点金额	
上海	股票			
	债券			
	基金			
	权证			
	ETF			
	资产证券			
深圳	股票			
	债券			
	基金			
	权证			
	ETF			
	资产证券			

品种		上海		深圳	
		费率%	起点金额	费率%	起点金额
回购	1 天国债				
	2 天国债				
	3 天国债				
	4 天国债				
	7 天国债				
	14 天国债				
	28 天国债				
	63 天国债	N/A	N/A		
	91 天国债				
	182 天国债				
	273 天国债	N/A	N/A		
	1 天企业债				
	2 天企业债	N/A	N/A		
	3 天企业债				
7 天企业债					

与 XXX 产品一致

注：1、本表未包括品种，请自行补充；2、“佣金费率”设置章节，新产品如与同一管理人旗下另一产品一致，请直接在“与 XXX 产品一致”选项上打勾，无需填写佣金费率表格。

三、证券交易费用(续)：

2、债券利息税设置：税前 税后

股利税设置：税前 税后

3、佣金计算方式：

上海：按汇总方式 按成交记录 按申请编号

深圳：按汇总方式 按成交记录 按申请编号

注：请在相应设置上打勾

4、佣金计算过程中的保留位数：

上海保留 2 位小数；深圳保留 4 位小数

5、费用配置：

股票：

上海：佣金费率不含费用；佣金费率含经手费、证管费、结算费、过户费；

佣金费率含经手费、证管费、结算费，不含过户费；

深圳：佣金费率不含费用；佣金费率含经手费、证管费、结算费、过户费；

佣金费率含经手费、证管费、结算费，不含过户费；

债券、基金、权证、ETF、资产证券、回购：

上海：佣金费率不含费用；佣金费率含经手费、证管费、结算费、过户费；

佣金费率含经手费、证管费、结算费，不含过户费；

深圳：佣金费率不含费用；佣金费率含经手费、证管费、结算费、过户费；

佣金费率含经手费、证管费、结算费，不含过户费；

注：1、请在相应设置上打勾，计算佣金时按照净价金额计算；

2、未包括品种，请自行补充。

三、预提待摊：

审计费金额： 起止日期：XXXX-XX-XX 至 XXXX-XX-XX

信息披露费金额： 起止日期：XXXX-XX-XX 至 XXXX-XX-XX

注：如有其他费用，请自行补充。

四、TA 结转设置：

申购资金结转日为：T+X

赎回资金结转日为：T+X

转入款结转日为：T+X

转出款结转日为：T+X

申购款计息利率(如有申购款利息，请注明对应的销售网点代码)：

申购款停留天数：

TA 版本：如恒生 2.4、金证 1.0 等 (TA 版本确认，请查看附件 1，专户、单一产品
无需提供)

注：1、T 日为申请日，如果销售网点结转天数不一致，请注明销售网点代码。

2、申购款计息利率及停留天数按照产品 TA 需要设置，如无请略过。

管理人：

日期：

附件 16：《投资结果书面告知函》（格式）

尊敬的委托人_____：

本管理人于____年__月__日按《上海证券翱翔蓝海 FOF 单一资产管理计划资产管理合同》约定的投资范围，履行管理人职责，将委托资产进行了以下投资：

1. 投资标的：
2. 投资金额：
3. 交易结构：
4. 投资期限：
5. 交易对手：
6. 是否有第三方机构参与（如有应列明）：

若委托人对上述投资结果有异议，应于本告知函出具之日起五个工作日内书面告知本管理人。

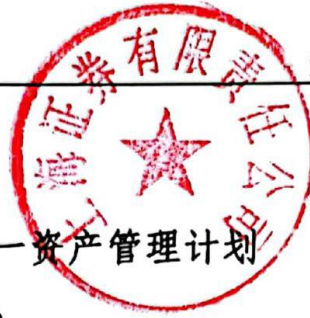
委托人未在规定时间内表示异议，本管理人视委托人认可该投资结果，由此产生的任何风险及法律后果将由委托人自行承担。

管理人亦未对委托资产本金不受损失或取得最低收益作出任何承诺。

特此告知。

管理人（业务盖章）：

日期：____年__月__日



附件 17:

上海证券翱翔蓝海 FOF 单一资产管理计划
风险揭示书

尊敬的客户:

上海证券有限责任公司(以下简称“本公司”)已经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)批准,具有开展资产管理业务的资格。为使您更好地了解单一资产管理业务的风险,根据法律、行政法规和中国证监会的有关规定,请您认真阅读本风险揭示书,慎重决定是否参与。

一、了解管理人资产管理业务资格

管理人经中国证监会批准具有受托资产管理业务资格(证监机构字[2002]203号)。

二、了解单一资产管理业务,区分风险收益特征

您在参与单一资产管理业务前,请务必了解单一资产管理业务的基础知识、业务特点、风险收益特征等内容,并认真听取管理人、托管人等对相关业务规则和单一资产管理合同内容的讲解。

单一资产管理业务是专门为机构和高端个人投资者提供的理财服务,可根据不同理财需求和风险偏好为客户量身定制不同的产品。单一资产管理业务的委托资产交由托管人托管,由管理人进行专业的

投资运作。

但是，单一资产管理业务也存在着一定的风险，管理人、托管人不承诺投资者资产本金不受损失或者取得最低收益。

三、了解单一资产管理业务普通风险

本资产管理计划可能面临的普通风险，包括但不限于以下几项：

（一）市场风险

市场风险是指投资品种的价格因受经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素影响而引起的波动，导致收益水平变化，产生风险。市场风险主要包括：

1、政策风险

货币政策、财政政策、产业政策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，影响单一资产管理业务的收益而产生风险。

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、利率风险

金融市场利率的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，使单一资产管理业务收益水平随之发生变化，从而产生风险。

4、购买力风险

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

5、上市公司经营风险

上市公司的经营状况受多种因素影响，如市场、技术、竞争、管理、财务等会导致公司盈利状况发生变化。如单一资产管理业务所投资的上市公司经营不善，与其相关的证券价格可能下跌，或者能够用于分配的利润减少，从而使单一资产管理业务收益水平下降。

6、金融衍生品风险

由于金融衍生品具有杠杆效应且价格波动剧烈，会放大收益或损失，在某些情况下甚至会导致投资亏损高于初始投资金额。因此，如果资产管理计划投资于金融衍生品，可能会影响资产管理计划的收益水平。

（二）管理风险

在资产管理计划运作过程中，管理人的知识、经验、判断、决策、技能等，会影响其对信息的获取和对经济形势、金融市场价格走势的判断，如管理人判断有误、获取信息不全、对投资工具使用不当等影响资产管理计划的收益水平。

（三）流动性风险

委托资产不能迅速转变成现金，或者转变成现金会对资产价格造成重大不利影响的风险。流动性风险按照其来源可以分为：

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，对委托资产造成不利影响。

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，从而在进行个股和个券操作时，可能难以买入和卖出预期的数量，或买入卖出行为对个股和个券价格产生比较大的影响，增加个股和个券的建仓成本或变现成本。

（四）信用风险

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

1、交易品种的信用风险：投资于公司债券等固定收益类产品，存在着发行人不能按时足额还本付息的风险；此外，当发行人信用评级降低时，单一资产管理业务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，按时支付回购款，将使单一资产管理业务面临交易对手的信用风险。

（五）再投资风险

计划提前终止以及计划到期偿付本息后，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的风险。

（六）其他风险

1、技术风险。在单一资产管理业务的日常交易中，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。

2、操作风险。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。

3、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。

4、沪深市场证券交易资金前端风险控制相关风险

根据证券交易所、中登公司的相关规定，证券交易所、中登公司根据最高额度和自设额度对资产管理人的关联交易单元的全天净买入申报金额总量实施额度管理，并对资产管理人实施前端控制，其中，最高额度为按照证券交易所、中登公司对于最高额度的定义计算的额度，自设额度为资产管理人自行申报的低于最高额度的额度，自设额度应低于最高额度。如果本计划或资产管理人管理的其他资产管理计划下的某笔交易导致资产管理人关联交易单元全天净买入申报金额达到或超过自设额度的，证券交易所将拒绝接受该笔交易及该关联交易单元后续竞价交易买入申报，本计划的相关投资交易将无法成功申报。尽管资产管理人可在规定时间内通过资产托管人向中登公司申请盘中紧急调整最高额度或自设额度，但调整能否成功取决于是否在申请时间内、中登公司及证券交易所是否同意等诸多因素，并且调整完成需要一段时间，此时本计划仍然存在无法及时完成投资的风险。因上述原因可能导致资产管理人无法完成投资，继续影响本计划投资收益、给委托资产造成损失。因不可抗力、意外事件、技术故障、重大差错等原因导致资金前端控制出现异常的，证券交易所、中登公司

可以采取调整额度、暂停实施资金前端控制、限制交易单元交易权限等处置措施。因资金前端控制异常情况以及证券交易所、中登公司采取的相应措施可能影响资产管理人的投资，继而影响委托资产的投资收益、给委托资产造成损失。

(七)担任单一资产管理业务管理人的证券公司或担任单一资产管理业务托管人的资产托管机构，因停业、解散、撤销、破产，或者被有权机构撤销相关业务许可等原因不能履行职责，可能给投资者带来一定的风险。

四、了解单一资产管理业务特定风险

(一) 债券的市场风险

(1) 交易品种的信用风险

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

(2) 债券收益率曲线风险

债券收益率曲线风险是指与收益率曲线非平行移动有关的风险，单一的久期指标并不能充分反映这一风险的存在。

(二) 流动性风险

指计划资产不能迅速转变成现金，或者转变成现金会对资产价格造成重大不利影响的风险。在计划存续期间，可能会发生个别偶然事件，如短时间委托人大量提取委托资产或计划到期时出现交易量急剧

减少的情形，此时可能会导致计划资产变现困难，从而产生流动性风险，甚至影响本计划份额净值。流动性风险按照其来源可以分为两类：外生流动性风险和内生流动性风险。

（三）本计划设立失败风险

本计划推广期结束时，若计划未符合成立条件或设立推广期内发生使本计划无法设立的不可抗力（包括但不限于战争、自然灾害）事件，则委托人将面临本计划设立失败的风险。

（四）委托资产退出及业绩报酬分配原则

委托人提取委托资产，管理人将按照合同约定收取业绩报酬。本单一计划管理人收取业绩报酬，请委托人阅读并了解“业绩报酬”相关内容，另外，如管理人已经提取业绩报酬，即使委托人退出本单一计划时计划净值低于委托资产，则该部分已提取业绩报酬亦不退还委托人。

（五）投资于金融机构发行的私募资产管理计划（包括但不限于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发行的私募资产管理产品）的特殊风险。

1、私募作为一种资本募集方式，是与公募相对应的概念，是指通过非公开方式面向少数机构投资者或个人募集资金。投资私募基金需要签署相关协议的，管理人代表产品进行签署，委托人认可所有管理人签署的交易文件内容；

2、投资该产品面临市场风险、流动性风险、信用风险和操作风险，除此以外，私募资管产品还存在以下风险：

(1) 管理风险，即私募基金的管理公司的投资管理能力不足，不能给投资者带来理想投资回报的风险。

(2) 项目风险，私募基金所投资项目无法及时按期兑付本息，导致本资产管理计划投资损失的风险。

(3) 信息披露相关风险，私募基金的信息透明度普遍不高，一般不公开其投资组合情况，本资产管理计划作为投资者，可能无法及时、准确了解其资金运作情况和风险状况。

五、了解自身特点，制定适当的单一资产管理业务方案

投资者在参与单一资产管理业务前，应综合考虑自身的资产与收入状况、投资经验、风险偏好，制定与自己风险承受能力相匹配的单一资产管理业务方案。

由上可见，参与单一资产管理业务存在一定的风险，您存在盈利的可能，也存在亏损的风险；管理人不承诺确保您委托的资产本金不受损失或者取得最低收益。

您在参与单一资产管理业务前，已了解单一资产管理业务的基础知识、业务特点、风险收益特征等内容，并已认真听取证券公司对相关业务规则和单一资产管理合同内容的讲解。

您已了解通过专用证券账户持有或者通过专用证券账户和其他证券账户合并持有上市公司股份达到规定比例时，应由您自行履行法律、行政法规和中国证监会规定的公告、报告、要约收购等义务，并自行承担未及时履行义务的法律責任。

六、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条“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八条“资产管理计划的投资”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十六条“资产管理计划的费用与税收”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二十三条“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。【 】

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单一资产管理业务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。

投资者在参与单一资产管理业务前，应认真阅读并理解相关业务规则、《单一资产管理合同》及本风险揭示书的全部内容，并确信自身已做好足够的风险评估与财务安排，避免因参与单一资产管理业务而遭受难以承受的损失。

单一资产管理业务的投资风险由投资者自行承担，证券公司、资产托管机构不以任何方式对投资者资产本金不受损失或者取得最低收益作出承诺。

特别提示：投资者在本风险揭示书上签字，表明投资者已经理解并愿意自行承担参与单一资产管理业务的风险和损失。

委托人



(签字/盖章)



签署日期：

(注：自然人委托人，请签字；机构委托人，请加盖机构公章并由法定代表人或其授权代理人签字)

附件 18：资产管理总部关联交易管理实施细则（2021 年 4 月修订）

第一条 为规范公司资产管理总部（以下简称“总部”）资产管理计划参与关联交易，保护投资者及相关当事人的合法权益，根据《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《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》、《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等法律法规和《上海证券有限责任公司关联交易管理制度(修订)》等公司内部管理制度，制定本细则。

第二条 本细则规定的资产管理计划，包括公司发行的私募资产管理计划和设立管理的投资者人数不受 200 人限制的集合资产管理计划（下称“大集合产品”），本细则第十四条另有规定的除外。

第三条 总部资产管理计划参与关联交易是指总部资产管理计划与本公司、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之间发生的证券投资交易行为，包括但不限于资产管理计划投资于关联方发行的债券或者承销期内承销的债券，认购关联方发行的基金、集合资产管理计划、信托计划或理财产品等，或者为关联方提供单一资产管理业务服务、关联方认购公司发行的集合资产管理计划等。

资产管理计划参与关联交易涉及的标的额达到或超过人民币

1000 万元的关联交易，属于重大关联交易。本条第三款另有规定的除外。

资产管理计划投资于关联方承销期内承销的债券，涉及的标的额达到或超过公司最近一期经审计净资产值 5%且超过 1000 万元的关联交易，属于重大关联交易。

第四条 关联交易应当遵循投资者利益优先的原则，保证交易公平、公允，防范利益冲突，保护投资者合法权益。

第五条 投资经理作为资产管理计划的第一责任人，有责任了解并掌握法律法规、公司制度、所管理资产管理计划合同中对关联交易的各项要求并严格遵守。

第六条 总部资产管理计划参与重大关联交易的，应当遵守法律、行政法规、中国证监会的规定、合同约定及本制度规定，并履行公司相关内部审批程序，事先取得投资者的同意，事后及时告知投资者和托管人，并向中国证监会相关派出机构和证券投资基金业协会报告。

第七条 公司董事、监事、从业人员及其配偶不得参与公司管理的单一资产管理计划。

第八条 公司资产管理计划不得参与关联方发行或承销期内承销的股票（网上新股申购关联方承销的股票除外），不得直接或通过投资其他资产管理计划等间接形式，为关联方提供非标融资。法律法规另有规定的除外。

第九条 除本实施细则规定之外，若资产管理计划合同中对关联交易的范围和流程作出了特别约定，则投资经理应首先遵守合同的各项约定。

第十条 总部运营管理团队定期或不定期从公司董事会办公室获取公司关联方名单，定期或不定期从托管机构获取托管机构关联方名单。获取关联方名单后，运营管理团队应及时将名单发送给投资经理、研究员、交易员以及合规风控团队。合规风控团队收到关联方名单后，在 032 投资交易系统中设置关联方禁止交易风控指标及关联方清单。

第十一条 资产管理计划参与关联交易的，投资经理应制订关联交易情况说明书（见附件 19），经团队负责人审批后，由运营管理团队审核确认交易金额未超过公司核定的关联交易金额上限，并同时提交合规风控团队审核。涉及重大关联交易的，还需经总部投资决策小组审议。

第十二条 总部负责人审批或者总部投资决策小组审议通过后，运营管理团队应当将该事项报备董事会办公室审核。董事会办公室审核通过后方可开展关联交易。每年年初，总部各投资团队应各自预估当年资产管理计划可能参与关联交易的金额，报运营管理团队汇总，提交总部负责人审批后，最终由公司有关机构审批年度最高限额。总部所有资产管理计划参与关联交易的金额上限遵循公司年度日常关联交易的相关规定。

第十三条 资产管理计划参与关联交易后，投资经理应当立即通知运营团队，由运营团队履行信息披露事项。

第十四条 大集合产品运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、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者承销期内承销的证券，或者从事本细则第三条规定的重大关联交易，除应当遵守前述关联交易内部控制相关规定外，还应当遵守本条所作特别规范。

（一）应当符合产品的投资目标和投资策略，遵循投资者利益优先原则，防范利益冲突，按照市场公平合理价格执行。经办人员应事先得到托管人的同意，重大关联交易应当报公司董事会办公室，由董事会办公室提交公司董事会审议通过，并经过三分之二以上的独立董事通过，若涉及标的超过董事会决策权限，由董事会报请股东会审议通过后实施。

（二）资产管理总部每半年将大集合产品实施关联交易的情况进行汇总，形成报告报送公司董事会办公室，由董事会办公室提交公司董事会审查。

（三）大集合产品实施关联交易的信息披露参照本细则以及《资产管理总部大集合产品信息披露管理办法》的规定执行。

第十五条 本实施细则未尽事宜，按国家有关法律、行政法规、部门规章、其他规范性文件、行业自律准则和公司有关规定执行。

第十六条 本实施细则由资产管理总部解释。

第十七条 本实施细则自发布之日起施行。原《资产管理总部关联交易管理实施细则》（[2020]7号）同时废止。

投资决策小组会议情况：

上海证券翱翔蓝海 FOF 单一资产管理计划
资产管理合同之补充协议（一）

委托人

名称：杭州联华华商集团有限公司

通讯地址：杭州市下城区庆春路 86 号

法定代表人：张慧勤

联系人：李锐高

联系电话：13510961048



管理人

名称：上海证券有限责任公司

通讯地址：上海市黄浦区四川中路 213 号久事商务大厦 7 楼

法定代表人：何伟

联系人：王兆

联系电话：021-53686316



托管人

名称：中国建设银行股份有限公司上海市分行

通讯地址：上海市陆家嘴环路 900 号

负责人：林顺辉

授权代理人：房师新

联系人：陈晨

联系电话：021-58880000



鉴于：

委托人、管理人和托管人已于 2021 年 7 月 8 日签订编号为 MADA20211-0005 的《上海证券翱翔蓝海 FOF 单一资产管理计划资产管理合同》（以下统一简称“《资产管理合同》”）。现经各方协商一致，达成如下补充约定：

一、各方一致同意，对《资产管理合同》相关条款作如下变更：

具体变更内容如下：

涉及条款	变更前	变更后
八、资产管理计划的投资	<p>（七）业绩报酬计提基准</p> <p>本单一计划的业绩报酬计提基准为 10%，管理人对年化收益率 R 超过业绩报酬计提基准的收益部分提取 10%的业绩报酬。</p>	<p>（七）业绩报酬计提基准</p> <p>本单一计划的业绩报酬计提基准为 6%，管理人对年化收益率 R 超过业绩报酬计提基准的收益部分提取 10%的业绩报酬。</p>
十六、资产管理计划的费用与税收	<p>3、业绩报酬</p> <p>在两类情况下管理人将根据年化收益率（R）、业绩报酬计提基准（RE）提取业绩报酬（E），一类是委托人提取资产或本资产管理计划终止清算时提取业绩报酬，称为退出提取；另一类是分红时提取业绩报酬，称为分红提取。分红提取的业绩报酬计提频率不高于六个月一次。本资产管理计划的业绩报酬计提基准为 10%，管理人对年化收益率 R 超过业绩报酬计提基准的收益部分提取 10%的业绩报酬。</p>	<p>3、业绩报酬</p> <p>在两类情况下管理人将根据年化收益率（R）、业绩报酬计提基准（RE）提取业绩报酬（E），一类是委托人提取资产或本资产管理计划终止清算时提取业绩报酬，称为退出提取；另一类是分红时提取业绩报酬，称为分红提取。分红提取的业绩报酬计提频率不高于六个月一次。本资产管理计划的业绩报酬计提基准为 6%，管理人对年化收益率 R 超过业绩报酬计提基准的收益部分提取 10%的业绩报酬。</p>

二、委托人签署本补充协议前，已充分阅读并知悉上述条款变更内容以及可能给委托财产或自身权益造成的影响，愿意自行承担由此可能导致的投资风险。

三、本补充协议所使用之术语，如无例外之说明，应与《资产管理合同》相同之术语具有相同之含义。本补充协议与《资产管理合同》约定不一致的，以本补充协议约定为准，本补充协议未作约定处，以《资产管理合同》的约定为准。

四、本补充协议由委托人、管理人法定代表人、托管人负责人或各方授权代理人签字或盖章并加盖公章或合同专用章后生效，自本补充协议生效日起按变更后条款约定执行。

五、本补充协议一式叁份，委托人、管理人和托管人各执壹份，具有同等法律效力。

六、本补充协议是对《资产管理合同》进行的变更或补充，管理人应当按照基金业协会的相关要求进行备案。

(以下无正文)

上海市分行
(15)

有限公司

有限公司

(本页无正文,为《上海证券翱翔蓝海 FOF 单一资产管理计划资产管理合同之补充协议
(一)》之签署页)

委托人(公章):杭州联华华商集团有限公司

法定代表人或授权代理人(盖章或签字):



签署日期:2022年10月14日

管理人(公章):上海证券有限责任公司

法定代表人或授权代理人(盖章或签字):



签署日期:2022年10月14日

托管人(盖章):中国建设银行股份有限公司上海市分行

负责人或授权代理人(盖章或签字):



签署日期:2022年9月20日

(以最后一方签署日期为生效日期)