

合同编号：XXQH- CY01

## XX 川渝 1 号集合资产管理计划 资产管理合同

管理人：XX 期货股份有限公司

托管人：中信建投证券股份有限公司

## 目录

目录.....	1
资产管理计划风险揭示书.....	3
资产合法性及投资者适当性承诺书.....	14
投资者告知书.....	15
第一节前言.....	17
第二节释义.....	17
第三节声明与承诺.....	19
第四节当事人及权利义务.....	21
第五节资产管理计划的基本情况.....	26
第六节资产管理计划的募集.....	28
第七节资产管理计划的成立和备案.....	30
第八节资产管理计划的参与和退出与转让.....	31
第九节份额持有人大会及日常机构.....	35
第十节资产管理计划份额的登记.....	35
第十一节资产管理计划的投资.....	35
第十二节利益冲突及关联交易.....	38
第十三节投资经理的指定与变更.....	39
第十四节资产管理计划的财产.....	40
第十五节投资指令的发送、确认与执行.....	41
第十六节交易及交收清算安排.....	43
第十七节越权交易.....	44
第十八节资产管理计划财产的估值和会计核算.....	47

第十九节资产管理计划的费用与税收.....	52
第二十节资产管理计划的收益分配.....	56
第二十一节信息披露与报告.....	57
第二十二节风险揭示.....	60
第二十三节资产管理合同的变更、终止与财产清算.....	69
第二十四节违约责任.....	72
第二十五节法律适用和争议的处理.....	73
第二十六节资产管理合同的效力.....	73
第二十七节 保 密.....	74
第二十八节 通知和送达.....	74
第二十九节其他事项.....	75
附件 1：费用列表.....	79
附件 2：追加/退出申请表（请仔细阅读申请表后的提示！）.....	80

## 资产管理计划风险揭示书

尊敬的投资者：

投资有风险。当您/贵机构参与 XX 川渝 1 号集合资产管理计划（以下简称“资产管理计划”或“本计划”）时，可能获得投资收益，但同时也面临着投资亏损的风险。您/贵机构在作出投资决策之前，请仔细阅读本风险揭示书和资产管理合同，充分认识本计划的风险收益特征和产品特性，认真考虑资产管理计划存在的各项风险因素，并充分考虑自身的风险承受能力，理性判断并谨慎作出投资决策。

根据有关法律法规，管理人[XX 期货股份有限公司]及投资者分别作出如下承诺、风险揭示及声明：

### 一、管理人声明与承诺

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

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

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

### 二、风险揭示

#### （一）特殊风险揭示

##### 1、资产管理合同与证券投资基金业协会合同指引不一致所涉风险；

如本计划的投资范围、产品结构设计等存在特殊约定而无法完全适用证券投资基金业协会发布的合同指引，虽然资产管理人将在本风险揭示书中进行特别揭示，但仍存在因该等特殊约定不符合法律法规、监管机构和行业自律规则的相关政策规定和要求从而导致本计划损失的风险。

##### 2、资产管理计划委托募集所涉风险（如有）

资产管理人可委托在中国证监会注册取得基金销售业务资格并已成为证券投资基金业协会会员的机构（以下简称代销机构）募集资管计划。

代销机构应当恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉，防范利益冲突，履行说明义务、反洗钱义务等相关义务，承担特定对象确定、投资者适当性审查、资管计划推介及合格投资者确认等相关责任。代销机构及其从业人员不得从事侵占计划财产和客户资金、利用资管计划相关的未公开信息进行交易等违法活动。

如代销机构丧失销售资格，或在募集期间，代销机构未能恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉履行相关义务，均会对投资者权益产生不利影响。

##### 3、资产管理计划外包事项所涉风险（如有）

资产管理人可委托具备相应资质的外包服务机构提供相应资管计划外包服务。外包服务机构相信其本身将按照相关法律的规定进行营运及管理,但无法保证其本身可以永久维持符合监管部门的金融监管法律。如在计划存续期间外包服务机构无法继续从事资管计划外包服务,则可能会对资管计划产生不利影响。

#### 4、资产管理计划份额转让所涉风险

投资者可以选择转让全部或部分其持有的资产管理计划份额。当投资者选择转让部分资产管理计划份额后,仍须满足本合同约定的最低持有资产要求。资产管理计划份额的受让方必须符合《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》第三条对合格投资者的规定;在受让份额前,受让人必须已仔细阅读本计划的相关文件资料,清晰了解并接受其中的投资风险,了解自身风险承受能力与产品风险等级匹配的情况、资产管理计划承担的费用等。在转让资产管理计划份额后,本计划的投资者人数经穿透审查后必须满足相关法规要求。

如发生不符合以上规定的情况或其他类似情形,存在投资者的份额转让申请被资产管理人拒绝的风险。

#### 5、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

本计划在证券投资基金业协会备案完成前无法进行投资操作,因备案所需时间无法准确预估且计划份额持有人在此期间无法及时赎回其投资本金,本计划及计划份额持有人均存在在备案期间错失投资机会的风险。

本计划存在资产管理人未在合同约定期限内到中国证券投资基金业协会办理相关备案手续或在中国证券投资基金业协会备案未能通过导致计划提前终止的风险。如本计划因上述原因而清算终止,本计划募集、备案及清算期间发生的费用、债务由资产管理人以自有财产承担,但仍存在对计划财产造成损失的潜在风险。

#### 6、预警机制的风险

虽然本计划设计有预警机制,且资产管理人已依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则按合同规定及时执行预警约定操作,但计划资产净值可能因为市场波动而远低于预警线。投资者的损失可能远大于原定的预警线。

#### 7、本计划锁定期风险

根据合同约定,本计划针对成立日之后申购的份额有锁定期(成立日前认购的份额无锁定期),本计划投资者仅可对其持有的已过锁定期的计划份额进行赎回。投资者持有的在锁定期内的份额可能面临资金不能赎回带来的流动性风险。

#### 8、计划分红时提取业绩报酬的风险

若本计划在分红时提取业绩报酬的,业绩报酬将从向份额持有人分配的分红资金中扣除且不超过分红资金,存在份额持有人实际收到的现金分红款或获得的红利转投份额,少于管理人披露的分配方案中载明的分红金额的情形。此外,由于分红时点不一定是本合同约定的开放日(包括临时开放日),可能存在份额持有人因计划进行分红被提取业绩报酬但无法进

行赎回的情形。

同时因分红时，计提业绩报酬的依据为累计净值增值部分，而非分红金额部分，故存在计提的业绩报酬占分红金额的比例不等于业绩报酬计提比例，甚至存在分红金额全为业绩报酬，导致虽分红但投资者实际未获得任何分红款或红利转投份额的情况。

#### 9、关于业绩报酬计提基准的风险

本合同项下的“业绩报酬计提基准”系仅作为管理人评估本计划投资表现和计算计提业绩报酬的依据，既不是对投资收益的预测，也不代表管理人对投资者保本或最低收益的承诺，更非管理人或任何第三人对投资者可取得的利益所作的任何承诺或保证。投资有风险，投资者仍可能会面临无法取得收益甚至损失本金的风险。

#### 10、计划发生亏损时已收取的业绩报酬不予退还的风险

在满足合同约定条件时，管理人将计提业绩报酬，管理人计提业绩报酬后，如果后续运作中发生净值回撤甚至亏损的情况，已计提的业绩报酬不会退还。

#### 11、收益分配的风险

本计划的收益分配章节如约定本计划可将未分配利润中未实现收益部分进行分配。该等分配方式可能出现收益分配时计划资产未变现导致托管账户中现金不足以足额支付分红款项或收益分配后计划份额净值大幅度变化等风险，前述由于分配未实现收益导致的风险由管理人负责控制。

### （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，也不保证一定盈利及最低收益。

本计划属于[R3]风险投资品种，适合风险识别、评估、承受能力[C3、C4、C5]的合格投资者及专业投资者。

#### 2、市场风险

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

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

（2）经济周期风险：随经济运行的周期性变化，市场的收益水平也呈周期性变化。资产管理计划收益水平也会随之变化，从而产生风险。

（3）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。

（4）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，导致市

场的价格和收益率的变动，使资产管理业务收益水平随之发生变化，从而产生风险。

（5）再投资风险：固定收益品种获得的本息收入或者回购到期的资金，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，从而对资产管理计划产生再投资风险。

（6）衍生品风险：金融衍生产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。

### 3、管理风险

在资产管理计划财产管理运作过程中，对主要业务人员如资产管理计划投资经理的依赖可能产生管理风险。可能因管理人对经济形势和市场等判断有误、获取的信息不全等影响资产管理计划的收益水平。管理人和托管人的管理水平、管理手段和管理技术等对资产管理计划收益水平存在影响。

### 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。

### 5、信用风险

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。

### 6、募集失败风险（集合资产管理计划）

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

管理人的责任承担方式：

（1）以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用；

（2）在资产管理计划募集期限届满（确认资产管理计划无法成立）后三十日内退还投资者已交纳的款项，并加计银行同期活期存款利息。

### 7、投资标的的风险

#### （1）固定收益投资风险

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

1）市场平均利率水平变化导致债券价格变化的风险；

2）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；

3）发行主体的风险：债券发行人出现违约导致债券无法及时兑付或付息，或由于债券发行人信用质量降低导致债券价格下降的风险；

4）流动性风险：由于债券无法及时兑付、付息，导致投资者退出、清算延期办理，或

因在存续期内投资者强制提前退出，导致计划债券折价变现造成损失的风险；

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

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

#### (2) A 股股票投资风险（如有）

1) 国家货币政策、财政政策、产业政策等的变化对证券市场产生一定的影响，导致证券市场价格水平波动的风险。

2) 宏观经济运行周期性波动，对证券市场的收益水平产生影响的风险。

3) 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、财务等都会导致公司盈利发生变化，从而导致股票价格变动的风险。

#### (3) 融资融券交易风险（如有）

##### 1) 可能放大投资损失的风险

融资融券业务具有杠杆效应，它在放大投资收益的同时也必然放大投资风险。将股票作为担保品进行融资融券交易时，既需要承担原有的股票价格下跌带来的风险，又得承担融资买入或融券卖出股票带来的风险，同时还须支付相应的利息和费用，由此承担的风险可能远远超过普通证券交易。

##### 2) 特有的卖空风险

融资融券交易中的融券交易存在着与普通证券截然不同的风险——卖空风险。普通证券投资发生的损失是有限的，最多不会超过该计划投入的全部本金，但是融券交易的负债在理论上可以无限扩大，因为证券上涨的幅度是没有上限的，而证券涨得越多，融券负债的规模就越大。

##### 3) 利率变动带来的成本加大风险

如果在从事融资融券交易期间，中国人民银行规定的同期贷款基准利率调高，证券公司将相应调高融资利率或融券费率，投资成本也因为利率的上调而增加，将面临融资融券成本增加的风险。

##### 4) 通知送达风险

在融资融券交易过程中，相关信息的通知送达至关重要。《融资融券合同》中通常会约定通知送达的具体方式、内容和要求。当证券公司按照《融资融券合同》要求履行了通知义



务后即视为送达，则若未能关注到通知内容并采取相应措施，就可能因此承担不利后果。

#### 5) 强制平仓风险

融资融券交易中，该计划与证券公司间除了普通交易的委托买卖关系外，还存在着较为复杂的债权债务关系，以及由于债权债务产生的信托关系和担保关系。证券公司为保护自身债权，对该计划信用账户的资产负债情况实时监控，在一定条件下可以对该计划担保资产执行强制平仓。

#### 6) 提前了结债务的风险

在融资融券交易中，证券公司可能在融资融券合同中与该计划约定提前了结融资融券债务的条款，该计划在从事融资融券交易期间，如果发生融资融券标的证券范围调整、标的证券暂停交易或终止上市等情况，根据该计划与证券公司签订的合同条款，该计划将可能面临被证券公司提前了结融资融券交易的风险，并可能由此给该计划造成损失。

#### 7) 监管风险

在融资融券交易出现异常或市场出现系统性风险时，监管部门、证券交易所和证券公司都将可能对融资融券交易采取相应措施，例如提高可充抵保证金证券的折算率、融资或融券保证金比例、维持担保比例和强制平仓的条件等，以维护市场平稳运行。这些措施将可能给本金带来杠杆效应降低、甚至提前进入追加担保物或强制平仓状态等潜在损失。

#### (4) 港股通交易的风险（如有）

因沪、深、港股票市场在投资环境、投资者结构以及交易标的等方面都存在一定差异，参与港股通交易可能面临如下风险：

1) 市场联动风险：与内地 A 股市场相比，由于在港股市场上外汇资金自由流动，海外资金的流动与港股价格之间表现出高度相关性，因此，投资者在参与港股市场交易时受到全球宏观经济和货币政策变动导致的系统风险相对更大。

2) 股价波动风险：由于港股市场实行 T+0 交易机制，而且不设涨跌幅限制，加之香港市场结构性产品和衍生品种类相对丰富，因此，港股通个股的股价受到意外事件驱动的影响而表现出股价波动的幅度相对 A 股更为剧烈，投资者持仓的风险相对较大。

3) 交易成本风险：参与港股投资，除因股票交易而发生的佣金、交易征费、交易费、交易系统费、印花税、过户费等税费，在不进行交易时也可能要继续缴纳证券组合费等项费用，从而导致交易成本上升。

4) 个股流动性风险：不同于在内地市场中小市值股票的成交较为活跃，在香港市场，部分中小市值港股成交量则相对较少，流动较为缺乏。因此，若重仓持有此类股票，则可能因缺乏交易对手，进而面临小量抛盘即导致股价大幅下降的风险。

#### (5) 期权、收益互换等金融衍生品投资的风险（如有）

个股期权、股指期权等金融衍生品和一般金融工具面临同样的流动性风险，同时因杠杆特性，较普通金融工具面临更大的市场风险，收益互换也较一般金融工具面临更大的信用风

险。在交易这一类金融衍生品时，如果不能按照约定的期限清偿债务，或标的证券价格波动导致担保物价值与其金融衍生品债务之间的比例低于维持担保比例，且不能按照约定的时间、数量追加担保物时，将面临担保物被证券公司强制平仓的风险。可能出现金融机构降低授信额度，或者提高相关警戒指标、平仓指标，可能给该计划造成经济损失。另外，受贷款基准利率调高影响，金融机构可能相应调高融资利率，该计划将面临资金成本上升的风险。

（6）公募基金份额、货币基金、经证监会认可的比照公募基金管理的资管产品以及现金管理类产品的投资风险（如有）

本合同无法完全限定该计划所投资公募基金份额、货币基金、经证监会认可的比照公募基金管理的资管产品以及现金管理类产品的投资风险。

（7）信托计划、资管计划、私募基金等金融产品的投资风险

本计划如投资公募基金、银行理财产品、保险理财产品、信托计划、证券公司及其资管子公司资产管理计划、保险公司及其子公司资产管理计划、期货公司及其子公司资产管理计划、基金公司及其子公司资产管理计划、私募证券投资基金等，上述金融产品的投资结果将直接导致本计划投资的收益或亏损。上述金融产品及其对应的实际资产并未保管在本计划托管人处并处于托管人实际控制之外，而是由计划管理人进行保管，上述产品及其对应的实际资产可能由于无托管人或其托管人或管理人（含本计划管理人和上述金融产品管理人）保管不善导致本计划受损。

本计划投资上述金融产品时，如因计划管理人未按约定及时向托管人提供上述所投金融产品的净值，有可能会造成本计划估值不及时或不准确，从而对计划投资者或计划资产造成损失。

本计划投资上述金融产品时，由于上述金融产品的开放日可能存在与本计划的开放日不一致的情形，从而对本计划的流动性造成一定不利影响。

本计划投资上述金融产品时，如因计划管理人未按监管要求履行穿透审核职责，可能导致上述金融产品的投资范围不符合监管要求和本计划合同投资范围的要求，可能导致本计划投资上述金融产品不符合嵌套层级的监管要求，从而对本计划财产造成一定不利影响。

（8）本计划主要投资于国有城投平台发行的债券的风险

本资产管理计划主要投资于国有城投平台发行的债券，存在投资标的地域集中，投资收益和风险受当地产业政策、经济发展等因素影响较大。存在计划投资区域较集中、流动性、投资风险无法分散的风险。

## 8、税收风险

契约式产品所适用的税收征管法律法规可能会由于国家相关税收政策调整而发生变化，投资者收益也可能因相关税收政策调整而受到影响。

## 9、其他风险

（1）关联交易的风险

1) 投资者知悉并同意, 本计划可投资于资产托管人管理的金融产品、资产管理人、资产托管人及其股东等关联方发行或承销的证券, 租用资产管理人关联方提供的证券交易单元等, 存在关联交易的风险。资产管理人承诺关联交易应按照市场通行的方式和条件进行, 投资者认可此等关联交易情形的存在并自愿承担相关投资风险。

2) 投资者知悉, 尽管资产管理人承诺谨慎勤勉地管理委托财产、公平对待各投资组合, 本计划在投资和运作过程中可能会存在一些利益冲突情形, 包括但不限于: 资产管理人、资产托管人开展不同业务类型可能产生的利益冲突; 资产管理人管理的其他资管产品(包括本计划投资经理管理的其他资管产品)基于各自投资策略需要可能与本计划存在相同、相似或相反的投资交易行为, 或者在买卖同一只证券的时间上存在先后; 其他可能产生利益冲突的情况等。该等利益冲突可能会不利于本计划, 也可能使本计划在投资运作时暂时受限, 进而可能会影响收益甚至发生损失等。投资者认可此等情形的存在并自愿承担相关投资风险。

此外, 资产管理人可以在遵循法律法规和相关原则的前提下运用固有资金进行证券投资, 该等投资也可能与本计划存在相同、相似或相反的投资交易行为, 或者在买卖同一只证券的时间上存在先后, 不排除可能影响或限制本计划的投资运作。投资者认可此等情形的存在并自愿承担相关投资风险。

## (2) 操作或技术风险

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各环节操作过程中, 因内部控制存在缺陷或者人为因素造成操作失误或违反操作规程等所引致的风险, 例如, 越权违规交易、欺诈、交易错误等风险。

技术风险: 在资产管理计划的日常交易中, 可能因为技术系统的故障或者差错而影响交易的正常进行或者导致投资者的利益受到影响。这种技术风险可能来自管理人、托管人、证券交易所、证券登记结算机构等。

## 10、相关机构的经营风险

### (1) 管理人经营风险

按照我国金融监管法律规定, 虽管理人相信其本身将按照相关法律的规定进行营运及管理, 但无法保证其本身可以永久维持符合监管部门的金融监管法律。如在计划存续期间管理人无法继续经营资产管理业务, 则可能会对资金管理计划产生不利影响。

### (2) 托管人经营风险

虽托管人相信其本身将按照相关法律的规定进行营运及管理, 但无法保证其本身可以永久维持符合监管部门的金融监管法律。如在计划存续期间托管人无法继续从事托管业务, 则可能会对资产管理计划产生不利影响。

### (3) 证券经纪商及期货经纪商经营风险

按照我国金融监管法律规定, 证券公司须获得中国证监会核准的证券经营资格方可从事证券业务。虽证券经纪商及期货经纪商相信其本身将按照相关法律的规定进行营运及管理,

但无法保证其本身可以永久维持符合监管部门的金融监管法律。如在计划存续期间证券经纪商及期货经纪商无法继续从事证券业务，则可能会对资产管理计划产生不利影响。

#### （4）运营服务机构风险

管理人委托运营服务机构履行资产估值和会计核算等职责，运营服务机构的服务能力、服务水平将直接影响前述各项职责的履行成效。在资产管理计划运作过程中，可能因运营服务机构估值错误等因素影响计划的运作效率进而影响收益水平。

### （三）本计划特定风险

#### 1、电子签名方式签署合同的风险（如有）

若投资者采用电子签名的方式签署计划合同的，若发生网络系统故障等不可抗力事件导致投资者无法采用电子签名方式签署计划合同的，则投资者将面临计划认购/申购失败的风险。

#### 2、分红时提取业绩报酬的风险（若有）

由管理人确认收益分配时间，通过分红时计提，解决管理人无法在存续期计提业绩报酬的难点。然而，所有投资者合计现金分红总额（或分红转投资），可能少于分红公告中的总额，部分依据合同约定作为业绩报酬归管理人所有，可能造成投资者误解。

#### 3、净值波动风险

按照本合同约定的估值方法，当本计划投资于公募基金份额、货币基金、经证监会认可的比照公募基金管理的资管产品以及现金管理类产品，有如下情形之一时：

- （1）估值日无法及时获取上述投资品种的最新估值价格；
- （2）估值日取得的上述投资品种的最新估值价格没有或无法排除影响估值价格的因素（例如在估值日无法排除业绩报酬对估值价格的影响）；
- （3）按照预期收益率反应的估值价格与实际兑付的收益产生差异。

可能导致本计划的净值波动风险。

### （四）不可抗力等其他风险

战争、自然灾害等不可抗力因素的出现，将会严重影响市场的运行，可能导致资产管理计划财产的损失。

## 三、投资者声明

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

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

【\_\_\_\_\_】

2、本人/机构知晓，管理人、销售机构、托管人及相关机构不应当对资产管理计划财产

的收益状况作出任何承诺或担保。【\_\_\_\_\_】

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

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

5、本人/机构已认真阅读并完全理解资产管理合同第四节“当事人的权利与义务”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十一节“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十九节“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二十五节“法律适用和争议的处理”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/机构知悉管理人将应属本机构负责的事项以服务外包委托等方式交由其他机构办理的，因外包服务机构不符合或失去证券监管机关规定的资质、或不具备相关的提供服务的条件、或因管理不善、操作失误等，可能给投资者带来一定的风险。【\_\_\_\_\_】

14、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：

募集机构经办人（签字）[集合资产管理计划适用]：

日期：

## 资产合法性及投资者适当性承诺书

本人/本单位以真实身份委托 XX 期货股份有限公司运用委托资产进行投资。本人/本单位承诺委托资产来源及用途合法，不属于违反规定的公众集资，符合有关反洗钱法律法规的要求。XX 期货股份有限公司有权要求本人/本单位提供资产来源及用途合法性证明，对资产来源及用途及合法性进行调查，本人/本单位愿意配合。

本人/本单位符合期货公司资产管理业务合格投资者相关标准，具备相应风险识别能力和风险承受能力，属于符合下列条件的自然人和法人或者其他组织：

（一）具有 2 年以上投资经历，且满足以下条件之一：

- 1、家庭金融净资产不低于 300 万元；
- 2、家庭金融资产不低于 500 万元；
- 3、近 3 年本人年均收入不低于 40 万元。

（二）最近 1 年末净资产不低于 1000 万元的法人单位。

（三）金融管理部门视为合格投资者的其他情形。

本人/单位会配合管理人及/或募集机构履行尽职调查、适当性管理、反洗钱、针对非居民金融账户涉税信息的尽职调查，并按照要求签署、提交声明、告知书等相关文件。保证向管理人及/或其募集机构提供的信息和资料真实、完整、准确、合法，不存在任何重大遗漏或误导，前述信息资料如发生重大变化，将及时书面告知管理人及/或其募集机构。

本人/本单位未使用贷款、发行债券等筹集的非自有资金投资资产管理产品。

本人/本单位未被法律、法规或监管机构限制参与期货资产管理业务。

本人/本单位将严格遵守以上承诺，否则 XX 期货股份有限公司有权解除资产管理合同，本人违反委托资产来源及用途合法性承诺的，XX 期货股份有限公司还有权依法限制本人/本单位提取该委托资产。本人/本单位承担因此造成的全部损失和法律责任。

投资者（自然人签字或机构法定代表人签字）：

（机构盖章）

日期：\_\_\_\_\_年\_\_\_\_月\_\_\_\_日

## 投资者告知书

尊敬的投资者：

本计划通过直销机构（管理人）或代销机构（如有）进行募集。投资者认购或参与本计划，以人民币货币资金形式交付，在直销机构认购或参与的投资者须将资金从在中国境内开立的自有银行账户划款至募集结算资金专用账户，在代销机构认购或参与的投资者按代销机构的规定缴付资金。

募集结算资金专用账户由管理人委托份额登记机构开立，该账户仅用于本计划募集期间和存续期间认购、参与、退出、分红、费用等资金的归集与支付以及计划财产清算过程中剩余资产的归集与分配。

募集结算资金专用账户是份额登记机构接受管理人委托代为提供资产管理计划服务的专用账户，并不代表份额登记机构接受投资者的认购、参与资金，也不表明份额登记机构对本计划的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本计划没有风险。在募集结算资金专用账户的使用过程中，除非有足够的证据证明是因份额登记机构的原因造成的损失外，管理人应就其自身操作不当等原因所造成的损失承担相关责任，份额登记机构对于管理人的投资运作不承担任何责任。

募集结算资金专用账户信息如下：

账户名称：XX 川渝 1 号集合资产管理计划

账号：3110710005910008059

开户行：中信银行北京来福士支行

大额支付号：302100011421

中信建投证券股份有限公司作为上述募集结算资金专用账户的账户监督机构，仅对上述募集结算资金专用账户进行有效监督，对其他账户（包括但不限于本计划其他募集结算资金账户）不承担任何监督责任。在募集结算资金专用账户的监督过程中，除非有足够的证据证明是因账户监督机构的原因造成的损失外，管理人应就其自身操作不当等原因所造成的损失承担相关责任，账户监督机构对于管理人的投资运作不承担任何责任。

（一）本人/机构已认真阅读《投资者告知书》，清楚认识并认可关于募集结算资金专用账户的上述告知内容，并愿意自行承担由此可能导致的一切风险和损失。

（二）本人/机构已知晓投资者信用风险信息管理的有关规定：

知晓国家关于建设社会信用体系的总体要求和内容、中国证监会关于证券期货市场诚信监督管理办法的规定以及中国期货业协会关于投资者信用风险信息管理的规定。

当出现投资者信用风险信息管理制度中所列信用风险情形时，本人/机构同意期货公司将此类信用风险信息报送至中国期货业协会行业信息管理平台，并同意由中国期货业协会按照投资者信用风险信息管理制度使用和管理此类信用风险信息。

投资者具有查询本人/本机构信用风险信息及对本人/本机构信用风险信息提出异议的权利。



投资者（自然人签字或机构盖章）：

法定代表人或授权代理人（签字或盖章）：

日期：\_\_\_\_\_年\_\_\_\_\_月\_\_\_\_\_日

## 第一节前言

### 一、订立本资产管理合同的目的、依据和原则

(一) 订立本资产管理合同的目的是明确资产管理合同当事人的权利义务，规范本计划的运作，保护各方当事人的合法权益，确保资产管理计划财产的安全。

(二) 订立本资产管理合同的依据是《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》、《中华人民共和国民法典》、《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》)、《集合资产管理计划资产管理合同内容与格式指引(试行)》、中国证券投资基金业协会(以下简称证券投资基金业协会)自律规则及其他有关规定。若因法律法规的制定或修改导致本合同的内容存在与届时有效的法律法规的规定不一致之处,应当以届时有效的法律法规的规定为准,各方当事人应及时就本合同做出相应的变更和调整。

(三) 订立本资产管理合同的原则是平等自愿、诚实信用、公平,维护投资者合法权益,不得损害国家利益、社会公共利益和他人合法权益。

二、资产管理合同是规定资产管理合同当事人之间权利义务关系的基本法律文件,其他与资产管理计划相关的涉及资产管理合同当事人之间权利义务关系的任何文件或表述,如与本资产管理合同不一致或有冲突,均以本资产管理合同为准。资产管理合同的当事人包括投资者、管理人和托管人。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。自其不再持有本资产管理计划份额之日起,不再成为资产管理计划的投资者和资产管理合同的当事人。

三、证券投资基金业协会接受资产管理计划备案不能免除管理人按照规定真实、准确、完整、及时地披露产品信息的法律责任,也不代表证券投资基金业协会对资产管理计划的合规性、投资价值及投资风险做出保证和判断。投资者应当自行识别产品投资风险并承担投资行为可能出现的损失。

四、管理人承诺以诚实守信、审慎尽责的原则管理和运用计划资产,但不保证计划资产一定盈利,亦不担保计划资产的最低收益或者分担损失。管理人过往业绩仅供投资者参考,不构成管理人保证计划资产不受损失或取得最低收益的承诺。

五、托管人作为计划资产的托管机构承诺按照诚实信用、勤勉尽责的原则安全保管投资者的计划资产,并履行本合同约定的相关义务。

六、管理人确认已向投资者说明资产管理业务的风险,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做出承诺;投资者确认,已充分理解本合同内容,自行承担风险和损失。

七、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。

## 第二节释义

在本合同中，除上下文另有规定外，下列用语应当具有如下含义（若释义与合同正文内容不一致，以合同正文内容为准）：

1、资产管理计划、本计划、计划、集合计划、本集合计划：指 XX 川渝 1 号集合资产管理计划。

2、资产管理合同、本合同、合同：指投资者、管理人和托管人签署的《XX 川渝 1 号集合资产管理计划资产管理合同》及其附件，以及对该合同及附件做出的任何有效变更。

3、投资者、计划份额持有人：指依据本合同参与资产管理计划的投资者。

4、管理人：指 XX 期货股份有限公司。

5、托管人：指中信建投证券股份有限公司。

6、运营服务机构：指管理人委托的具有资质的办理注册登记、估值核算等业务的机构，本计划运营服务机构为中信建投证券股份有限公司。

7、投资顾问：根据资产管理合同及其他相关协议，为本计划提供投资方面的建议或意见并收取投资顾问费的机构。本计划不聘请投资顾问。

8、中国证券投资基金业协会（简称“证券投资基金业协会”）：基金行业相关机构自愿结成的全国性、行业性、非营利性社会组织。

9、委托财产：指投资者拥有合法处分权、委托管理人管理的财产。

10、资产管理计划资产总值：指资产管理计划拥有的各类有价证券、银行存款本息、应收参与款及其他资产的价值总和。

11、资产管理计划资产净值：指资产管理计划资产总值减去资产管理计划负债后的价值。

12、资产管理计划份额净值：指计算日资产管理计划资产净值除以计算日资产管理计划份额总数。

13、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和资产管理计划份额净值的过程。

14、工作日、交易日：指中国外汇交易中心暨全国银行间同业拆借中心、上海证券交易所、深圳证券交易所、中国金融期货交易所的正常交易日。

15、T 日：指办理日常参与、退出、业绩报酬计提或办理其他集合资产管理计划业务的工作日。

16、T+n 日：指自 T 日起的第 n 个工作日（不包含 T 日）。

17、证券账户：根据中国证监会有关规定和中国证券登记结算有限责任公司（下称“中国结算”）等相关机构的有关业务规则，由托管人为资产管理计划财产开设的证券账户。

18、期货账户：即期货交易资金账户。指管理人以本计划名义在期货经纪商处开立的用于存放本计划期货保证金的账户，其用途包括出入金、支付期货交易结算款和相关费用等。

19、募集结算资金专用账户：募集结算资金专用账户为本计划的份额登记机构负责开立的注册登记手续。该账户仅用于本计划募集期间和存续期间认购、参与、退出、分红、清盘、

费用等资金的归集与支付以及计划财产清算过程中剩余资产的归集与分配。募集结算资金专用账户是份额登记机构接受管理人委托代提供资产管理计划服务的专用账户，并不代表份额登记机构接受投资者的认购、参与资金，也不表明份额登记机构对本计划的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本计划没有风险。

20、托管账户（托管资金专门账户）：指托管人根据有关规定为本资产管理计划开立的专门用于清算交收的银行账户，其资金密码及账户在银行的预留印鉴由托管人保管并使用，管理人不得使用或在未经托管人许可的情况下擅自修改。

21、初始募集期间：指资产管理合同中载明的计划初始募集期限。

22、存续期：指资产管理计划成立之日起至终止之间的期限。

23、认购：指在资产管理计划初始募集期间，投资者按照本合同的规定购买本计划份额的行为。

24、参与：指在资产管理计划开放日，投资者按照本合同的规定参与本计划份额的行为。

25、退出：指在资产管理计划开放日，投资者按照本合同的规定将本计划份额兑换为现金的行为。

26、募集机构：指取得基金募集业务资格并与管理人签订了资产管理计划募集服务协议，办理本计划募集业务的机构。

27、运作年度：按照算头不算尾原则计算，例如首个运作年度为自本计划成立日至本计划成立日次年对日的前 1 日之间的期限。

28、流动性受限资产：指由于法律法规、监管、合同或操作障碍等原因无法以合理价格予以变现的资产，包括但不限于到期日在 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）、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券等。

29、不可抗力：指本合同当事人不能预见、不能避免、不能克服，且在本合同生效之日后发生的，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和因素，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、恐怖袭击、传染病传播、法律法规变化（新法律法规颁布或对原法律法规的修改等政策因素）、突发停电或其他突发事件、证券交易所或证券登记结算机构非正常暂停或停止交易或发送数据存在延误、错漏。

### 第三节 声明与承诺

#### 一、管理人承诺与声明

1、保证是依法设立的期货经营机构或其资产管理子公司，已向中国期货业协会履行登记备案手续且已向中国证券投资基金业协会申请备案。

2、管理人承诺遵守法律、行政法规和中国证监会的有关规定，诚实守信，审慎尽责，坚持公平交易，避免利益冲突，禁止利益输送，保护客户合法权益；

3、管理人声明不以任何方式向投资者承诺或担保取得最低收益或分担损失；

4、管理人声明禁止本公司员工以个人名义接受投资者的资产管理委托或对投资者做出最低收益和分担损失的承诺。

5、管理人保证在签订本合同前充分向投资者说明了有关法律法规和相关投资工具的运作市场及方式，并充分揭示了相关风险。已经了解投资者的风险偏好、风险认知能力和承受能力，按照期货资产管理业务法规对投资者的财务状况进行了充分评估。

6、管理人承诺按照《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。

## 二、托管人的声明与承诺

1、托管人具有中国证监会认可的从事资产托管业务的资格。

2、承诺依照（相关法律法规）恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则安全保管委托财产，并履行信义义务以及本合同约定的其他义务。

3、托管人承诺遵守法律、行政法规和中国证监会有关规定，根据法律法规、中国证监会及证券投资基金业协会的规定和资产管理合同的约定，对管理人的投资或清算指令等进行监督。不保证资产管理计划财产本金不受投资损失或取得最低收益。

4、在管理人发生异常且无法履行管理职能时，依照法律法规及合同约定召集份额持有人大会，维护投资者权益，份额持有人大会设立日常机构的除外。

## 三、投资者的声明与承诺

1、投资者承诺以真实身份参与资产管理业务，其向管理人或募集机构提供的有关投资目的、投资偏好、投资限制、财产收入情况和风险承受能力等基本情况真实、完整、准确、合法，不存在任何虚假陈述、重大遗漏或误导，前述信息资料如发生任何实质性变更，应当及时书面告知管理人或募集机构。

2、投资者声明委托财产为其拥有合法处分权的资产，保证委托财产的来源及用途符合有关反洗钱法律法规的要求和其他国家有关规定，且委托资产中没有违反规定的公众集资。投资者保证没有使用贷款、发行债券等筹集的非自有资金投资资产管理计划，本委托投资事项符合法律法规的规定及其业务决策程序的要求。不存在法律、行政法规和中国证监会有关规定禁止或限制参与资产管理业务的情形，保证有完全及合法的授权委托管理人和托管人进行委托财产的投资管理和托管业务，保证没有任何其他限制性条件妨碍管理人和托管人对该委托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。

3、投资者声明已充分理解本合同全文，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，愿意承担相应的投资风险。

4、投资者声明已接受管理人的审慎评估并经自我评估认为具备参与资产管理业务的风

险承受能力；管理人及其募集机构已充分披露资产管理计划的交易结构、资金投向、费用安排、收益分配、投资风险、利益冲突情况以及可能影响投资者合法权益的其他重要信息。

5、投资者声明已了解了资产管理计划相关业务规则、合同条款、资产管理方案和交易策略，已经阅读并理解风险提示书的相关内容，承诺自行承担投资风险和损失。投资者承认，管理人、托管人未对委托财产的收益状况做出任何承诺或担保，没有明示或暗示刚性兑付的情况。

## 第四节当事人及权利义务

### 一、投资者

#### （一）投资者概况

签署本合同且合同正式生效的特定客户即为本合同的投资者。投资者的详细情况在资产管理合同签署页列示。

#### （二）根据法律法规及其他有关规定，投资者的权利，包括但不限于：

- 1、本资产管理计划为均等份额。除资产管理合同另有约定外，每份份额具有同等的合法权益，所有投资者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、按照法律法规和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、监督管理人及托管人履行投资管理和托管义务的情况；
- 7、国家法律法规、中国证监会及证券投资基金业协会规定的和本资产管理合同约定的其他权利。

#### （三）根据法律法规及其他有关规定，投资者的义务，包括但不限于：

- 1、保证以真实身份参与资产管理计划；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、除公募资产管理产品外，以合伙企业、契约等非法人形式直接或者间接投资于资产管理计划的，应向管理人充分披露实际投资者和最终资金来源；
- 4、认真阅读并签署风险揭示书；
- 5、按照资产管理合同约定支付资产管理计划份额的参与款项，承担资产管理合同约定的代销费（如有）、业绩报酬（如有）、托管费、审计费、税费等合理费用；并承担因资产管理计划财产运作产生的其他费用；

6、在持有的资产管理计划份额范围内，承担资产管理计划亏损或者终止的有限责任；

7、及时、全面、准确地向管理人告知其投资目的、投资偏好、投资限制和风险承受能力等基本情况；

8、向管理人或资产管理计划募集机构提供法律法规规定的信息资料及身份证明文件，配合管理人或其募集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；

9、不得违反本合同的规定干涉管理人的投资行为；

10、不得从事任何有损资产管理计划及其他投资者、管理人管理的其他资产及托管人托管的其他资产合法利益的活动；

11、保守商业秘密，不得泄露委托财产投资计划、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、提供正确、完整的各种资料、信息、联系方式等信息资料及身份证明文件。如发生变更时，及时书面通知管理人，并配合管理人或募集机构重新进行风险承受能力划分工作（如需），如适当性匹配结果显示，变化后投资者风险承受能力不匹配本计划的风险等级时，本计划提前终止，如投资者主动要求继续持有本计划并且不属于风险承受能力最低类别投资者的，应当配合管理人完成规定的流程，否则管理人有权拒绝投资者继续持有本计划份额；如投资者提供的资料、信息、联系方式有误，或变更后未及时书面通知管理人导致管理人未能及时联系投资者，管理人免责；

13、协助管理人办理资产管理业务相关账户设立、变更及注销手续；

14、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。

## 二、管理人

### （一）管理人概况

名称：XX 期货股份有限公司

住所：XX

通讯地址：XX

联系人：XX

联系电话：XX

（二）根据《基金法》、《管理办法》、《运作规定》及其他有关规定订明管理人的权利，包括但不限于：

1、按照本合同的约定，独立管理和运用资产管理计划财产；

2、依照本合同的约定，及时、足额获得管理人管理费用及业绩报酬（如有）；

3、依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、根据本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，或对资产管理计划

运作产生重大影响的，应及时采取措施制止，并报告中国证监会相关派出机构及证券投资基金业协会；

5、自行募集或委托有基金募集资格的机构募集资产管理计划，制定和调整有关资产管理计划募集的业务规则，并对募集机构的募集行为进行必要的监督；

6、自行担任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份额登记、估值与核算等服务，并对份额登记机构的代理行为进行必要的监督和检查；

7、管理人有权委托中信建投证券股份有限公司作为运营服务机构为本计划提供估值核算等服务，管理人与运营服务机构另行签署运营服务协议（以下简称“运营服务协议”）（以实际签署的协议名称为准），对相关权利、义务进行约定；

8、要求投资者提供与其身份、财产与收入状况、资金来源及用途、资产管理需求、风险认知与承受能力等相关的信息和资料，并在上述文件和资料发生变更时，及时提交变更后的相关文件与资料，并对投资者适当性进行审慎评估；

9、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；

10、管理人有权根据市场情况对本资产管理计划的总规模、单个投资者首次认购、参与金额、每次参与金额及持有的本资产管理计划总金额限制进行调整；

11、当投资者风险承受能力或本计划风险等级发生变化，导致投资者风险承受能力与本计划风险等级不匹配且不愿意继续持有高于自身风险等级的产品，或者投资者成为风险承受能力最低类别投资者时，管理人有权要求该等投资者退出本计划，由此导致本计划投资者不足 2 人时，管理人有权提前终止本计划；

12、国家有关法律法规、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。

（三）根据《基金法》、《管理办法》、《运作规定》及其他有关规定订明管理人的义务，包括但不限于：

1、依法办理资产管理计划的募集，按规定向证券投资基金业协会履行登记及备案手续；  
2、按照证券投资基金业协会要求报送资产管理计划产品运行信息；  
3、按照诚实信用、勤勉尽责的原则履行受托人义务，管理和运用资产管理计划财产；  
4、对投资者的风险识别能力和风险承受能力进行评估，向符合法律法规规定的合格投资者非公开募集资金；

5、制作风险揭示书，向投资者充分揭示相关风险；

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

7、建立健全内部管理制度、风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证本资产管理计划财产与其管理的其他资产管理计划财产、管理人的固有财产相互独立，对



所管理的不同财产分别管理，分别记账，分别投资；聘请投资顾问的，应制定相应利益冲突防范机制；

8、除依据法律法规、本合同及其他有关规定外，不得为管理人及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作资产管理计划财产；

9、保守商业秘密，不得向任何第三方泄露资产管理计划的投资计划、投资意向等，但依法依规、本合同及监管机构另有规定的除外；

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

11、除规定情形或符合规定条件外，不得为管理人、托管人及其关联方提供融资；

12、按照本合同的约定接受和配合投资者和托管人对委托资产有关投资行为等的监督；

13、以管理人的名义，代表投资者利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；

14、召集资产管理计划份额持有人大会，份额持有人大会设立日常机构的除外；

15、按照资产管理合同约定计算并向投资者报告资产管理计划份额净值；

16、确定资产管理计划份额参与、退出价格，采取适当、合理的措施确保份额交易价格的计算方法符合法律法规的规定和合同的约定；

17、对非标准化资产和相关交易主体进行充分的尽职调查，形成书面工作底稿，并制作尽职调查报告；

18、按照资产管理合同约定负责资产管理计划会计核算并编制财务会计报告；

19、聘请具有证券相关业务资格的会计师事务所对年度财务会计报告进行审计；

20、按照资产管理合同的约定确定收益分配方案，及时向投资者分配收益；

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

22、办理与受托财产管理业务活动有关的信息披露事项；

23、建立并保存投资者名单；

24、组织并参加资产管理计划财产清算小组，参与资产管理财产的保管、清理、估价、变现和分配；

25、按照法律、行政法规和中国证监会的规定，保存资产管理计划的会计账册，妥善保存有关的合同、协议、交易记录等文件、资料和数据，保存期限自资产管理计划终止之日起不得少于 20 年；

26、面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会相关派出机构、证券投资基金业协会并通知托管人和投资者；

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

### 三、托管人

（一）托管人概况

名称：中信建投证券股份有限公司

住所：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

通讯地址：北京东城区朝内大街 2 号凯恒中心 B 座 10 层

联系人：高涵

联系电话：010-65608073

（二）根据《基金法》、《管理办法》、《运作规定》及其他有关规定订明托管人的权利，包括但不限于：

- 1、按照本合同约定，依法保管资产管理计划财产；
- 2、依照本合同的规定，及时、足额获得资产管理计划托管费；
- 3、根据相关法律法规及本合同的规定，监督及查询管理人对资产管理计划财产的投资运作，发现管理人的投资或清算指令违反法律、行政法规、中国证监会的规定或者本合同约定的，有权要求其改正或拒绝执行；对于管理人违反本合同规定的行为，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；
- 4、根据本合同的规定，依法保管资产管理计划财产；
- 5、如管理人未按照资产管理合同的约定进行预警止损（如有）操作，托管人有权向监管机构或证券投资基金业协会报告；
- 6、可以通过中国期货市场监控中心有限责任公司（以下简称监控中心）投资者查询服务系统查询资产管理计划的期货交易结算结果；
- 7、国家有关法律法规、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）根据《基金法》、《管理办法》、《运作规定》及其他有关规定订明托管人的义务，包括但不限于：

- 1、根据本合同规定安全保管资产管理计划财产，不得擅自用或处分托管资产；
- 2、除依据法律法规、本合同及其他有关规定外，不得为托管人及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管资产管理计划财产；
- 3、对所托管的不同财产分别设置账户，确保资产管理计划财产的完整与独立；
- 4、公平对待所托管的不同财产，不得从事任何有损资产管理计划财产及其他当事人利益的活动；
- 5、按规定开设和注销资产管理计划的托管账户、证券账户（如有）及其他投资所需账户，托管账户开立及使用的相关费用由计划资产承担；
- 6、与管理人或管理人委托的运营服务机构核对资产管理计划资产净值和份额净值；
- 7、办理与资产管理计划托管业务有关的信息披露事项；
- 8、根据相关法律法规和资产管理合同约定，复核管理人编制的资产管理计划财产的定

期报告，并出具书面意见；

9、编制托管年度报告，并向证券投资基金业协会备案，抄报中国证监会相关派出机构；

10、按照本合同的规定，根据管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；

11、保守商业秘密。除法律法规、监管规定或应司法、行政等机关要求对外提供，向聘请的审计、法律等外部专业顾问提供或本合同另有规定外，不得向他人泄露；

12、根据法律、行政法规和中国证监会的规定保存资产管理计划的会计账册，妥善保存有关的合同、协议、交易记录等文件资料，保存期限自资产管理计划终止之日起不得少于 20 年；

13、按照法律法规及本合同的规定监督管理人的投资运作，发现管理人违反法律、行政法规中国证监会的规定或资产管理合同约定的，或者违反本合同约定的，应当拒绝执行，立即要求管理人改正；管理人未能改正或造成委托资产损失的，应及时通知管理人并及时报告中国证监会相关派出机构和证券投资基金业协会；

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。

## 第五节 资产管理计划的基本情况

一、资产管理计划的名称

XX川渝1号集合资产管理计划。

二、资产管理计划的类别

**【固定收益类】**集合资产管理计划。

三、运作方式

开放式。

四、投资目标、主要投资方向、投资比例、产品风险等级与投资范围

1、投资目标

本计划主要投资于债券资产,严格管理投资比例,力争实现计划资产的长期稳健收益。

2、主要投资方向

银行存款、证券交易所债券、银行间市场债券、短期融资券、中期票据、资产支持证券、非金融企业债务融资工具、股指期货、国债期货、商品期货、公募基金份额（不含货币基金）、货币基金、经证监会认可的比照公募基金管理的资管产品、债券正回购、债券逆回购、现金及现金管理类工具。

证券公司的资产管理计划、证券公司资管子公司的资产管理计划、证券公司私募子公司的私募基金、基金公司的资产管理计划、基金公司子公司的资产管理计划、期货公司及其子公司的资产管理计划、银行理财、保险公司及其子公司的资产管理计划、私募基金以及其他监管部门认可的投资品种。

3、投资比例

（1）本计划的总资产占净资产的比例不得超过 200%，计算本计划的总资产时应当按照

穿透原则合并计算所投资资产管理产品的总资产。

(2) 本计划按市值法计算投资于同一资产的资金不超过该计划资产净值的 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。

(3) 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，不低于本资产管理计划资产净值的 10%。本资产管理计划主动投资于流动性受限资产的市值在开放退出期内合计不得超过本资产管理计划资产净值的 20%。

(4) 本计划不得投资于以非上市股权、非上市债权、委托贷款及其它《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》第三十七条第（五）项规定的资产为投资标的的资产管理计划和私募基金。

(5) 本计划不投资资产支持证券、资产支持票据劣后级。

(6) 按市值计算，投资于重庆市、四川省内下辖全区域国有城投平台（地方政府融资平台）发行的债券、货币市场工具、现金、银行存款、逆回购、证券交易存出保证金（即证券公司开立的证券资金账户现金余额）合计市值占计划总资产的比例不小于 80%。

(7) 本计划拟投资资产支持证券基础资产不包含信托计划、私募基金、资管产品及其收（受）益权。

(8) 本计划投资于其他私募资产管理产品的，按照穿透原则合并计算的投资同一资产的比例以及投资同一或同类资产的金额，应当符合《管理办法》及证监会相关规定，且该私募资产管理产品不得再投资除公募基金以外的资管计划。

(9) 资产管理人应当在本计划存在私募基金产品形式投资者时，不得投资私募基金，确保不涉及多层嵌套。当全部私募基金投资者退出后，必须严格按照相关规定，穿透底层投资标的，确保不涉及多层嵌套。

(10) 法律法规、中国证监会以及本合同规定的其他投资限制。

管理人自本合同生效之日起 6 个月内使本计划的投资组合比例符合本合同的有关约定。由于包括但不限于证券市场波动、上市公司合并、组合规模变动等管理人之外的原因导致的投资比例不符合本合同约定的投资限制或投资禁止政策，为被动超标。管理人应在发生不符合法律法规或投资政策之日起的 10 个交易日内调整完毕。如发生证券停牌或其他非管理人可以控制的原因导致管理人不能履行调整义务的，则调整期限相应顺延。管理人应当自证券恢复交易之日起的 10 个交易日内调整完毕，法律、行政法规、金融监管部门另有规定的，从其规定。

在本计划到期日前 10 个交易日内，因计划财产变现需要，本计划财产的投资比例限制可以不符合上述计划配置比例规定。

在满足法律法规和监管部门要求的前提下，管理人在履行适当程序后，可以相应调整本

资产管理计划的投资限制。

#### 4、产品风险等级

基于本计划的投资范围及投资策略，本计划不承诺保本及最低收益，属预期风险等级【R3】级的投资品种，适合具有【C3、C4 或 C5】级别风险识别、评估、承受能力的合格投资者及专业投资者。

#### 五、存续期限

本集合计划管理期限为 18 个月（可展期），自计划成立日起算，管理人有权根据本合同的约定决定提前终止本集合计划。

#### 六、初始募集面值

人民币 1.00 元。

#### 七、资产管理计划的最低初始募集规模

本资产管理计划初始募集规模不得低于【1000 万】元人民币。

#### 八、分级安排

本资产管理计划不分级。

#### 九、资产管理计划的运营服务机构

本资产管理计划由管理人委托中信建投证券股份有限公司（证券投资基金业协会登记的外包业务备案编号为 A00016）担任本计划的运营服务机构。

#### 十、自有资金参与情况

管理人自有资金参与本集合资产管理计划的持有期限不得少于 6 个月（如有）。参与、退出时，应当提前 5 个工作日告知投资者和托管人。

管理人以自有资金参与单个集合资产管理计划的份额不得超过该计划总份额的 20%。管理人及其附属机构以自有资金参与本集合资产管理计划的份额合计不得超过该计划总份额的 50%。因本集合资产管理计划规模变动等客观因素导致前述比例被动超标的，管理人应当依照中国证监会规定及资产管理合同的约定及时调整达标。

管理人自有资金实际参与本资产管理计划情况由管理人在公司网站上进行公告并按要求备案，网站地址：<http://www.XX.com>。

## 第六节 资产管理计划的募集

#### 一、资产管理计划份额的初始募集期限

初始募集期间自资产管理计划份额发售之日起不超过 60 天，管理人可与募集机构协商后提前终止或延长初始募集期间，并在管理人或代理募集机构网站及时公告或通过短信、邮件、传真、电话等任一方式告知投资者前述事项，即视为履行完毕通知义务。

#### 二、资产管理计划份额的募集方式

本计划通过管理人或其委托的代销机构进行募集。投资者认购本计划，必须与管理人和托管人签订资产管理合同，按管理人规定的方式足额缴纳认购款项。认购的具体金额和份额

以管理人的确认结果为准。

本计划的代销机构的聘用和变更事宜由管理人 XX 期货股份有限公司在官网公告，网址为：<http://www.XX.com>。

本资产管理计划聘用第三方代销机构为资产管理计划提供服务，需签署书面销售协议明确约定双方权利义务和责任。

**管理人及其委托的代销机构不得向合格投资者之外的单位和个人募集资金，不得通过报刊、电台、电视、互联网等公众传播媒体或者讲座、报告会、分析会和布告、传单、手机短信、微信、博客和电子邮件等方式，向不特定对象宣传推介。**

### 三、资产管理计划份额的募集对象

委托投资本计划的投资者应当符合《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》及《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》规定的合格投资者的相关标准。合格投资者是指具备相应风险识别能力和风险承担能力，并且应当符合监管要求的合格投资者条件。

本资产管理计划的投资者不得超过 200 名。若法律法规将来另有规定的，从其规定。

### 四、资产管理计划份额的最低认购金额、支付方式

投资者初始净认购金额（扣除认购费）不低于人民币【30】万元，并可多次认购，认购期间净追加委托投资金额（扣除认购费）应不低于【1】万元人民币，除非本合同另有约定，认购一经受理不得撤销。

### 五、资产管理计划份额的认购费用

本计划不收取认购费。

### 六、初始募集期间的认购程序

（一）管理人委托募集机构进行募集的，由募集机构完成对投资者的尽职调查工作，并应当于十个工作日内将相关资料提供给管理人。

（二）认购程序。投资者办理认购业务时应提交的文件和办理手续、办理时间、处理规则等在遵守本合同规定的前提下，以管理人或销售机构的具体规定为准。

（三）认购申请的确认。认购申请受理完成后，不得撤销。募集机构受理认购申请并不表示对该申请成功的确认，而仅代表募集机构确实收到了认购申请。认购的确认以管理人的确认结果为准。

（四）本计划的人数规模上限为 200 人。管理人在初始募集期间超过可接受的人数限制的部分，按照“时间优先、金额优先”的原则确认有效认购申请。超出资产管理计划人数规模上限的认购申请为无效申请。

通过代销机构进行认购的，人数规模控制以管理人和代销机构约定的方式为准。

投资者应考虑到其申请被拒绝或被部分确认的可能性，并应在本合同生效后到各募集机构查询最终确认情况和有效认购份额。认购不成功的，管理人或募集机构或募集网点将退还投资者的认购资金，并加计银行同期活期存款利息。

### 七、认购份额的计算方式

认购份额=净认购金额÷面值

认购份额保留到小数点后 2 位，小数点后第 3 位四舍五入，由此产生的误差计入资产管理计划财产。

### 八、初始认购资金的管理及利息处理方式

资产管理计划份额初始募集期间，计划投资者认购本计划，以人民币转账形式交付。本计划不接受现金方式认购。专业投资机构以外的投资者通过直销机构或代销机构认购的，应于本合同约定的初始募集期间结束前至少提前【1】个工作日将认购份额所需资金缴付至本合同约定的募集结算资金专用账户或按代销机构的规定缴付认购份额所需资金。专业投资机构通过直销机构或代销机构认购的，应于本合同约定的初始募集期间结束前将认购份额所需资金缴付至本合同约定的募集结算资金专用账户或按代销机构的规定缴付认购份额所需资金。

管理人和代销机构应当将初始募集期间募集的投资者资金存入专门账户。该账户由本计划的份额登记机构负责开立。该账户仅用于本计划初始募集期间和存续期间认购、参与、退出、分红、费用等资金的归集与支付以及计划财产清算过程中剩余资产的归集与分配。在计划初始募集行为结束之前，任何机构和个人不得动用。

**本计划募集结算资金专用账户信息请参见投资者告知书。**

投资者的资金自到达募集结算资金专用账户之日起的活期存款利息，将折算为资产管理计划份额归投资者所有，其中利息转份额的具体数额以份额登记机构的记录为准。在计划成立之前，任何机构和个人不得动用计划财产，托管人也不得接受管理人任何划款指令对计划财产进行划拨。

## 第七节 资产管理计划的成立和备案

### 一、资产管理计划成立的条件

集合计划初始募集规模不低于 1000 万元，投资者人数不少于 2 人，且不超过 200 人，募集过程应符合法律、行政法规和中国证监会的规定。

### 二、资产管理计划的成立

本计划的募集金额缴足之日起 10 个工作日内，管理人应委托具有证券相关业务资格的会计师事务所进行验资并出具验资报告，管理人取得验资报告后，公告本计划成立。本计划具体的成立日期以管理人公告日期为准。

### 三、资产管理计划的备案

管理人应在资产管理计划成立起 5 个工作日内报证券投资基金业协会备案，抄报中国证监会相关派出机构。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。本计划在证券投资基金业协会完成备案后，方可进行投资运作（资产管理计划在成立后完成备案前，不得开展投资活动，但以现金管理为目的，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除外)。管理人应在备案完成后五个工作日内将加盖管理人公章的备案函打印件以邮件的形式发送给托管人。如果资产管理计划备案失败,托管人有权终止为该资产管理计划提供托管服务。

#### 四、资产管理计划初始募集失败的处理

(一) 初始募集期限届满,不符合计划合同生效条件的,则本计划初始募集失败。

(二) 募集期届满,资产管理计划未达到成立条件的,管理人应当承担下列责任:

- 1、以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用;
- 2、在募集期届满后 30 日内退还投资者已缴纳的款项,并加计银行同期活期存款利息。

#### 五、资产管理计划备案失败的处理

本计划应该在证券投资基金业协会规定的期限内完成备案手续,若不能满足备案条件或管理人放弃本计划备案的,管理人应及时通知投资者和托管人。若管理人放弃本计划备案或本计划未能成功通过备案,且管理人决定终止时,本计划相应终止,具体流程参见本合同“资产管理合同的变更、终止与财产清算”章节。

## 第八节 资产管理计划的参与和退出与转让

### 一、参与和退出场所

本资产管理计划的募集机构为直销机构(管理人)及/或管理人委托的代理募集机构。投资者应当在募集机构办理募集业务的营业场所或按募集机构提供的其他方式办理计划份额的参与和退出。管理人可以根据需要增加、变更代理募集机构,并予以公告。

### 二、本资产管理计划份额存续期间参与和退出规则如下:

#### (一) 参与和退出的开放时间

本计划为开放型产品。

**固定开放日:** 本计划成立后每周二、周四为开放日(遇非交易日均顺延到下一个交易日),投资者可在开放日办理参与退出业务。

**份额锁定期:** 本计划针对成立日之后申购的份额有锁定期(成立日前认购的份额无锁定期),锁定期为自该计划份额被确认之日起满 1 年(申购的份额自申购确认之日起算,例如:一笔份额确认日为 2021 年 11 月 16 日,则其锁定期为 2021 年 11 月 16 日至 2022 年 11 月 15 日),即本计划投资者仅可对其持有的已过锁定期的计划份额进行赎回。

#### (二) 参与和退出的方式、价格及程序

##### 1、参与和退出的方式

投资者参与本计划,采用金额申请的方式,以银行账户划款缴纳参与款项。投资者退出本计划,采用份额申请的方式。

投资者退出计划时,管理人按先进先出的原则,按投资者认购、参与和红利再投资(如有)计划份额的时间先后次序进行顺序退出。

##### 2、参与和退出的价格



“未知价”原则，即计划的参与价格、退出价格以受理申请当日收市后计算的计划份额净值为基准进行计算。

投资者参与计划时，按照参与申请对应的开放日的计划份额净值为基准计算参与份额；投资者退出计划时，按照退出申请对应的开放日的计划份额净值为基准计算退出金额。

本计划无参与费和退出费。

### （三）出资方式及认缴期限

本计划不接受现金参与，在直销机构参与的投资者应在参与有效期内将参与资金从在中国境内开立的自有银行账户划款至本合同“投资者告知书”中约定的募集结算资金专用账户，在代销机构参与的投资者按代销机构的规定缴付资金。

管理人于参与确认后一个工作日内将参与资金划入计划托管账户。

### （四）参与和退出申请的确认

投资者的参与申请受理完成后，不得撤销。募集机构受理申请并不表示对该申请成功的确认，而仅代表募集机构确实收到了申请。参与和退出申请的确认以管理人的确认结果为准。

本资产管理计划的人数规模上限为 200 人。管理人在开放日可接受的人数限制内，按照“时间优先、金额优先”的原则确认有效参与申请。超出计划人数规模上限的参与申请为无效申请。

在正常情况下，管理人在【T+2】日内对 T 日参与和退出申请的有效性进行确认。若参与不成功，管理人应在【T+2】日起三十日内退还投资者已缴纳的款项。

### （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，且投资者首次参与的净参与金额应不低于【30 万】元人民币，已持有份额的投资者在开放日内追加购买的，扣除参与费的净追加金额应不低于【1】万元人民币。

1、当投资者持有的计划财产净值高于【30 万】元时，若投资者选择部分退出计划份额，投资者在退出后持有的资产管理计划份额净值不得低于【30 万】元，管理人有权适当减少该投资者的退出份额，以保证部分退出申请确认后投资者持有的计划资产净值不低于 30 万元；

2、当投资者申请退出计划份额时，其持有的计划财产净值低于【30 万】元（含 30 万元）的，必须选择一次性退出全部计划份额，投资者没有一次性全部退出持有份额的，管理人应当将该投资者所持份额做全部退出处理。如因持有低于下限导致强赎的份额不受锁定期的限制。

### （六）参与或退出的资金清算

1、T 日，计划投资者进行参与或退出申请。T+1 日，管理人和托管人分别计算 T 日计划资产净值、计划份额净值，并进行核对；管理人向份额登记机构发送计划资产净值等数据。

2、T+2 日内，管理人或其委托的份额登记机构按照本合同约定计算参与份额、退出金

额，并将确认的参与、退出数据向托管人传送，特殊情况除外。管理人、托管人根据确认数据进行账务处理。

3、计划份额持有人退出申请确认后，管理人将在【T+5 日（包括 T+5 日）】内支付退出款项，本合同另有约定的情况除外。（托管人根据管理人的退出款项划款指令进行划款，将退出款项划往管理人指定的份额登记机构，并由份额登记机构将退出款项划入计划份额持有人的指定资金账户或代销机构指定的资金账户）。本计划退出款划付产生的银行转账等手续费用由计划财产承担。在发生巨额退出时，款项的支付办法参照本合同有关条款处理。

4、管理人或其委托的份额登记机构应对注册登记数据的准确性负责。托管人应及时查收参与资金的到账情况并根据管理人指令及时划付退出款项。

#### （七）拒绝或暂停参与、暂停退出的情形及处理

1、在如下情形下，管理人可以拒绝接受投资者的参与申请：

- （1）本资产管理计划的投资者人数达到上限 200 人；
- （2）根据市场情况，管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对计划业绩产生负面影响，从而损害现有投资者的利益的情形；

（3）因本计划持有的某个或某些证券进行权益分派等原因，使管理人认为短期内接受参与可能会影响或损害现有投资者利益的情形；

（4）管理人认为接受某笔或某些参与申请可能会影响或损害其他投资者利益的情形；

（5）法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

管理人决定拒绝接受某些投资者的参与申请时，参与款项将退回投资者账户。

2、在如下情形下，管理人可以暂停接受投资者的参与申请：

- （1）因不可抗力导致无法受理投资者的参与申请的情形；
- （2）证券交易场所交易时间临时停市，导致管理人无法计算当日计划资产净值的情形；
- （3）发生本合同规定的暂停计划资产估值的情形；
- （4）法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

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

3、在如下情形下，管理人可以暂停接受投资者的退出申请：

- （1）因不可抗力导致管理人无法支付退出款项的情形；
- （2）证券交易场所交易时间临时停市，导致管理人无法计算当日计划资产净值的情形；
- （3）发生本合同规定的暂停计划资产估值的情形；
- （4）法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一的，管理人应当告知投资者。已接受的退出申请，管理人应当足额支付；如暂时不能足额支付，应当按单个退出申请人已被接受的退出金额占已接受的退出总金额的比例将可支付金额分配给退出申请人，其余部分在后续工作日予以支付。

在暂停退出的情况消除时，管理人应及时恢复退出业务的办理并以信函、电话、手机短信、电子邮件、网站公告等方式之一告知投资者。

#### （八）巨额退出的认定及处理方式

##### 1、巨额退出的认定标准

单个开放日中，本资产管理计划需处理的净退出申请份额超过本资产管理计划上一工作日计划总份额的【10%】时，即认为本资产管理计划发生了巨额退出。

##### 2、巨额退出的处理方式

当本计划出现巨额退出时，管理人可以根据本计划当时的资产组合状况决定全额退出或部分延期退出。

（1）全额退出：当管理人认为有能力支付投资者的全部退出申请时，按正常退出程序执行。

（2）部分延期退出：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计划总份额【10%】的前提下，对其余退出申请予以延期办理。对于当日的退出申请，将按单个账户退出申请量占退出申请总量的比例，确定当日受理的退出份额；未能受理的退出部分，投资者可选择延期办理或撤销退出申请。对于选择延期办理的退出申请，管理人将在下一个交易日内办理，并以该交易日的计划份额净值为准计算退出金额，依此类推，直至全部办理完毕为止。本资产管理计划不就延期退出份额的相应款项计算利息。

3、巨额退出顺序、退出价格确定、退出款项支付、告知客户方式，以及单个客户大额退出的预约申请等事宜，相关约定应符合公平、合理、公开的原则。

4、巨额退出部分延期退出的通知：当发生巨额退出并且管理人决定执行部分延期退出时，管理人应当选择信函、电话、手机短信、电子邮件、网站公告等方式之一，在交易日结束后的三个工作日内通知投资者，并说明相关处理方法。

#### （九）非交易过户的认定及处理方式

1、管理人及份额登记机构只受理继承、捐赠、司法强制执行和经管理人及份额登记机构认可的其他情况下的非交易过户。其中：

（1）“继承”是指投资者死亡，其持有的计划份额由其合法的继承人继承。

（2）“捐赠”仅指投资者将其合法持有的计划份额捐赠给福利性质的基金会或社会团体的情形。

（3）“司法强制执行”是指司法机构依据生效司法文书将投资者持有的计划份额强制划转给其他自然人、法人、社会团体或其他组织的情形。

2、办理非交易过户业务必须提供份额登记机构规定的相关资料，且本计划份额的受让主体应是依法可以持有本计划份额的合格投资者。符合条件的非交易过户申请自申请受理日起 2 个月内办理；申请人按份额登记机构规定的标准缴纳过户费用。非交易过户后的投资者

应当符合投资者适当性的要求，否则管理人有权要求该投资者及时退出本计划，此退出不受计划封闭期的限制。

#### （十）资产管理计划份额的转让

在具备可行条件且经管理人公告或通知后，投资者可以向符合条件的特定客户转让其持有的资产管理计划份额。投资者可通过证券交易所以及中国证监会现时或将来法律、法规或监管机构认可的方式，办理转让业务。其转让地点、时间、规则、费用等应遵守交易场所相关规定及要求，按照办理机构的规则执行。转让期间及转让后，持有计划份额的合格投资者数量合计不得超过 200 人，且转让后所有投资者应符合合格投资者的有关规定和条件。

管理人应定期将资产管理计划投资者变更情况报送证券投资基金业协会。

### 第九节 份额持有人大会及日常机构

本计划不设置份额持有人大会及日常机构。

### 第十节 资产管理计划份额的登记

一、本计划的注册登记业务由管理人委托的份额登记机构办理。份额登记机构应履行如下注册登记职责：

- 1、配备足够的专业人员办理本计划份额的登记业务；
- 2、严格按照法律法规和本合同规定的条件办理本计划份额的登记业务；
- 3、保存计划份额持有人名册及相关的认购、参与与退出等业务记录 20 年以上；
- 4、对计划份额持有人的账户信息负有保密义务，因违反该保密义务对投资者或本计划带来的损失，须承担相应的赔偿责任，但司法强制检查情形及法律法规及中国证监会规定的和本合同约定的其他情形除外；
- 5、法律法规及中国证监会规定的和本合同约定的其他义务。

二、管理人委托**中信建投证券股份有限公司**办理本计划的注册登记业务，与之签订委托服务协议（以实际签署的协议名称为准），但管理人依法应承担的注册登记职责不因委托而免除。

三、投资者同意管理人、份额登记机构或其他份额登记义务人，将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。

### 第十一节 资产管理计划的投资

#### 一、投资目标

本计划主要投资于债券资产，在控制净值波动的基础上，严格管理投资比例，力争实现计划资产的长期稳健收益。

#### 二、投资范围

银行存款、证券交易所债券、银行间市场债券、短期融资券、中期票据、资产支持证券、非金融企业债务融资工具、股指期货、国债期货、商品期货、公募基金份额（不含货币基金）、

货币基金、经证监会认可的比照公募基金管理的资管产品、债券正回购、债券逆回购、现金及现金管理类工具。

证券公司的资产管理计划、证券公司资管子公司的资产管理计划、证券公司私募子公司的私募基金、基金公司的资产管理计划、基金公司子公司的资产管理计划、期货公司及其子公司的资产管理计划、银行理财、保险公司及其子公司的资产管理计划、私募基金以及其他监管部门认可的投资品种。

管理人在满足法律法规和监管部门要求并为运营服务机构和托管人相关系统准备留出必要的调整时间，并参照本合同“资产管理合同的变更、终止与财产清算”章节中的相关约定履行变更程序后可以相应调整本计划的投资范围。

### 三、投资策略和风险收益特征：

#### 1、投资策略

本计划的投资策略包括以下几方面：

(1) 本资产管理计划主要投资于重庆市、四川省内下辖全区域国有城投平台发行的债券。

(2) 适当侧重收益率与流动性两个目标：一方面，根据收益率目标，本计划将持有相当数量剩余期限与本计划存续期相近的收益较高、流动性适中的债券，为本计划贡献长期稳健收益；另一方面，根据流动性要求，本计划将配置一定数量的流动性高、收益适中的债券，有效控制债券投资组合的风险。

(3) 把握市场的主要波动，进行积极投资：积极投资策略主要是指根据利率预期调整集合计划债券投资组合的久期，同时选择低估值的债券进行投资、把握市场的低风险套利机会，以争取获得适当的超额收益，提高整体组合收益率。

(4) 本计划将根据宏观经济和整体市场估值水平的变化结合管理人的判断进行多类别资产配置。

(5) 本资产管理计划以实现绝对正收益为投资目标。在科学严谨的资产配置框架下，通过对期货市场投资品种的监控，通过量化的方法寻找风险较低确定性较强的对冲套利型机会来获利，如期现套利、跨期套利、跨品种对冲等。

#### 2、风险收益特征

基于本计划的投资范围及投资策略，本计划不承诺保本及最低收益，属预期风险等级【R3】级的投资品种，适合具有【C3、C4、C5】级别风险识别、评估、承受能力的合格投资者及专业投资者。

### 四、资产管理计划的建仓期

本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。

投资限制：

1、本计划的总资产占净资产的比例不得超过 200%，计算本计划的总资产时应当按照穿透原则合并计算所投资资产管理产品的总资产。

2、本计划按市值法计算投资于同一资产的资金不超过该计划资产净值的 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。

3、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，不低于本资产管理计划资产净值的 10%。本资产管理计划主动投资于流动性受限资产的市值在开放退出期内合计不得超过本资产管理计划资产净值的 20%。

4、本计划不得投资于以非上市股权、非上市债权、委托贷款及其它《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》第三十七条第（五）项规定的资产为投资标的的资产管理计划和私募基金。

5、本计划不投资资产支持证券、资产支持票据劣后级。

6、按市值计算，投资于重庆市、四川省内下辖全区域国有城投平台（地方政府融资平台）发行的债券、货币市场工具、现金、银行存款、逆回购、证券交易存出保证金（即证券公司开立的证券资金账户现金余额）合计市值占计划总资产的比例不小于 80%。

7、本计划拟投资资产支持证券基础资产不包含信托计划、私募基金、资管产品及其收益（受）益权。

8、本计划投资于其他私募资产管理产品的，按照穿透原则合并计算的投资同一资产的比例以及投资同一或同类资产的金额，应当符合《管理办法》及证监会相关规定，且该私募资产管理产品不得再投资除公募基金以外的资管计划。

9、资产管理人应当在本计划存在私募基金产品形式投资者时，不得投资私募基金，确保不涉及多层嵌套。当全部私募基金投资者退出后，必须严格按照相关规定，穿透底层投资标的，确保不涉及多层嵌套。

10、法律法规、中国证监会以及本合同规定的其他投资限制。

管理人自本合同生效之日起 6 个月内使本计划的投资组合比例符合本合同的有关约定。由于包括但不限于证券市场波动、上市公司合并、组合规模变动等管理人之外的原因导致的投资比例不符合本合同约定的投资限制或投资禁止政策，为被动超标。管理人应在发生不符合法律法规或投资政策之日起的 10 个交易日内调整完毕。如发生证券停牌或其他非管理人可以控制的原因导致管理人不能履行调整义务的，则调整期限相应顺延。管理人应当自证券恢复交易之日起的 10 个交易日内调整完毕，法律、行政法规、金融监管部门另有规定的，从其规定。

在本计划到期日前 10 个交易日内，因计划财产变现需要，本计划财产的投资比例限制

可以不符合上述计划配置比例规定。

在满足法律法规和监管部门要求的前提下，管理人在履行适当程序后，可以相应调整本资产管理计划的投资限制。

#### 五、投资禁止行为

本资产管理计划财产禁止从事下列行为：

- 1、承销证券；
- 2、违反规定向他人贷款或提供担保；
- 3、从事承担无限责任的投资；
- 4、利用资产管理计划资产为资产管理计划投资者之外的任何第三方谋取不正当利益、进行利益输送；
- 5、从事内幕交易、操纵证券价格及其他不正当的证券及期货交易活动；
- 6、资产管理计划不得直接投资商业银行信贷资产；
- 7、不得违规为地方政府及其部门提供融资，不得要求或者接受地方政府及其部门违规提供担保；
- 8、不得直接或者间接投资法律、行政法规和国家政策禁止投资的行业或领域；
- 9、法律法规、中国证监会以及本合同规定禁止从事的其他行为。

#### 六、预警机制

本计划的预警线为资产管理计划份额净值=0.9000 元（预警线的计算以资产管理人与资产托管人核对一致的日终净值为准，下同）。

当 T 日计划份额净值低于或等于预警线时，管理人应于 T+10 日（含）前以管理人网站公告、邮件、短信或者其他管理人和计划份额持有人共同认可的方式向本计划份额持有人发出预警通知，但本计划可以继续投资运作（包括新增投资）。

#### 七、业绩比较基准

本资产管理计划不设置业绩比较基准。

## 第十二节 利益冲突及关联交易

### 一、本集合计划存在或可能存在的利益冲突情形

1、全体份额持有人充分知悉并认可，管理人可能运用集合计划财产进行关联交易，包括但不限于：

（1）运用集合计划财产投资于管理人、托管人及前述机构的控股股东、实际控制人或者其他关联方发行的证券或承销期内承销的证券或发行的金融产品。

（2）运用集合计划财产与管理人及子公司、管理人及子公司设立或担任投资顾问的金融产品进行对手方交易。

（3）运用集合计划财产投资于管理人及其子公司设立的或担任投资顾问的金融产品。

全体份额持有人知悉并确认，虽然管理人积极遵循投资者利益优先的原则、遵守相关法

法律法规的规定操作、积极防范利益冲突，但依然不能避免未来可能发生的关联交易风险，进而可能影响份额持有人的利益。份额持有人知悉并接受关联交易风险。全体份额持有人特此同意并授权管理人在管理运用本集合计划财产时可进行上述投资交易，管理人根据上述授权进行投资交易时，无需事先取得份额持有人的同意。

2、全体份额持有人充分知悉并理解，尽管管理人承诺谨慎勤勉地管理委托财产、公平对待各投资组合，本计划在投资和运作过程中可能仍会存在一些利益冲突情形，包括但不限于：管理人、托管人开展不同业务类型可能产生的利益冲突；管理人管理的其他资管产品（包括本计划投资经理管理的其他资管产品）基于各自投资策略需要可能与本计划存在相同、相似或相反的投资交易行为，或者在买卖同一只证券的时间上存在先后；其他可能产生利益冲突的情况等。该等利益冲突可能会不利于本计划，也可能使本计划在投资运作时暂时受限，进而可能会影响收益甚至发生损失等。全体份额持有人认可此等情形的存在并自愿承担相关投资风险。

此外，管理人可以在遵循法律法规和相关原则的前提下运用自有资金进行证券投资，该等投资也可能与本计划存在相同、相似或相反的投资交易行为，或者在买卖同一只证券的时间上存在先后，不排除可能影响或限制本计划的投资运作。全体份额持有人认可此等情形的存在并自愿承担相关投资风险。

## 二、利益冲突的处理和披露

1、管理人运用集合计划财产进行上述第一款第 1 项所列投资交易的，应当遵守法律、行政法规、中国证监会的规定和本合同约定的投资目标、投资策略，并遵循份额持有人利益优先原则，防范利益冲突。

2、管理人运用集合计划财产进行上述第一款第 1 项所列投资交易的，交易前无需另行取得份额持有人的同意或通知份额持有人。在交易完成后的合理时间内，管理人应将交易的情况书面通知托管人，并通过本合同约定的方式告知份额持有人。如果法律法规、监管规定、自律组织规则及交易所规则等要求管理人就上述投资交易向监管机构、证券投资基金业协会或交易所等有权机构报告或备案，管理人按相关规定办理。

## 第十三节 投资经理的指定与变更

### 一、投资经理的指定

#### 1、投资经理的指定

资产管理计划投资经理由管理人负责指定。

#### 2、本计划投资经理

本委托资产投资经理为：

【XX，XX 大学管理学学士。曾任 XX 金融市场部交易员、XX 期货资产管理部交易员，现任 XX 期货资产管理部投资经理，主要负责投资研究、投资管理及产品开发设计等工作。】

【XX，XX 大学经济学硕士，现任 XX 期货资管部投资经理。2011 年进入期货行业并一直



致力于品种研究及套利策略的研发。多次获得交易所优秀分析师的称号。团队在多年的研究探索中，发现了一套行之有效的商品套利分析方法及操作策略。形成了独特的交易方式。】

截至合同签订时，投资经理已具备三年以上投资管理、投资研究、投资咨询等相关业务经验，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。

## 二、投资经理的变更

资产管理人可根据业务需要变更投资经理，在变更前 5 个工作日内告知投资者及资产托管人，并在投资经理变更生效前安排不同意变更的投资者退出本计划。资产管理人通过电子邮件或在资产管理人公司网站公告调整事项即视为履行了告知义务。

投资者不同意投资经理变更的，可在管理人公告明确的时间内退出本计划。投资者未与管理人公告明确的时间内申请退出的，视为同意投资经理变更。投资者退出本计划后，就投资经理变更事宜，其对合同补充或修改的异议将不影响合同的变更。投资者同意，无论其是否提出退出申请，管理人就投资经理变更事宜而变更合同的行为均不应被视为或裁定为管理人的违约行为。

# 第十四节 资产管理计划的财产

## 一、资产管理计划财产的保管与处分

（一）资产管理计划财产是独立于管理人、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。

（二）除本条第 3 款规定的情形外，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。

（三）管理人、托管人可以按本合同的约定收取代销费、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，其债权人不得对资产管理计划财产行使请求冻结、扣押和其他权利。管理人、托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，资产管理计划财产不属于其清算财产。

（四）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消。非因资产管理计划财产本身承担的债务，国家、有权机关要求执行的情况除外，管理人、托管人不得主张其债权人对资产管理计划财产强制执行。上述债权人对资产管理计划财产主张权利时，管理人、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。

（五）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。

（六）对于本资产管理计划的投资事宜，根据相关法律规定，可能出现管理人代表本资产管理计划签订相关协议、开立相关账户及办理相关手续等情况由管理人承担相应责任。

## 二、账户开立与管理

托管人按照规定开立计划财产的托管账户等，管理人应给予必要的配合。

#### （一）托管账户的开立和管理

1、托管人以本计划的名义在银行开设托管账户，保管计划的银行存款。该账户的开设和管理由托管人负责，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。

2、托管账户的开立和使用，限于满足开展托管业务的需要。托管人和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。

3、托管账户的管理应符合《人民币银行结算账户管理办法》、《现金管理暂行条例》、《支付结算办法》和中国人民银行利率管理的有关规定以及其他有关规定。

#### （二）证券账户的开设和管理

1、托管人应当在中国结算开设证券账户，用于本计划证券投资的清算和存管，证券账户名称应按照相关规定命名。管理人应配合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。托管人和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。

#### （三）期货账户的开立和管理

1、管理人应当代表本计划，按照相关规定开立期货账户，在上海期货交易所、大连商品交易所、郑州商品交易所和中国金融期货交易所等期货交易所获取交易编码。期货账户名称及交易编码对应名称应按照有关规定设立。

2、本计划的管理人授权托管人选择具有期货保证金存管资格的商业银行办理相关银期转账业务。

#### （四）其他账户的开立和管理

1、因业务发展需要而开立的其他账户，可以根据法律法规和计划合同的规定，由管理人负责开立。新账户按有关规定使用并管理。

2、法律法规等有关规定对相关账户的开立和管理另有规定的，从其规定办理。

## 第十五节 投资指令的发送、确认与执行

### 一、投资指令的授权

授权通知的内容：管理人应事先向托管人提供书面授权通知（以下称“授权通知”），指定投资指令的被授权人员及被授权印鉴，授权通知的内容包括被授权人的名单、签章样本、权限和预留印鉴。授权通知应由管理人加盖公章。

授权通知的确认：管理人在发送授权通知当日通过电话向托管人确认，授权通知自托管人确认收到后于授权通知载明的生效时间生效（如托管人收到授权通知的时间晚于授权通知载明的生效时间，则授权通知自托管人确认收到授权通知的时间生效）。

由于人员、权限或印鉴变更而提供的变更后的新的授权通知，管理人必须提前至少一个交易日，使用传真方式或其他管理人和托管人认可的方式向托管人发送，同时电话通知托管人，变更后的新的授权通知经托管人确认后于授权通知载明的生效时间生效（资管托管人确认收妥新的授权通知的时间晚于新的授权通知载明的生效时间的，新的授权通知于资管托管人确认收妥后生效），同时原授权通知失效。

**授权通知的保管：**管理人在与托管人电话确认授权通知后的五个工作日内将授权通知的正本送交托管人。管理人应确保授权通知的正本与传真件一致。传真件和原件不一致的，以托管人收到的传真件内容为准。管理人和托管人对授权通知负有保密义务，其内容不得向授权人、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

投资指令是在管理委托资产时，管理人向托管人发出的资金划拨类指令（以下简称“指令”）。指令应加盖预留印鉴并由被授权人签章。管理人发给托管人的资金划拨类指令应写明款项事由、支付时间、金额、收款账户信息等。

## 三、指令的发送、确认和执行

**指令的发送：**管理人应按照相关法律法规以及本合同的规定，在其合法的经营权限和交易权限内依照授权通知的授权用扫描邮件方式或其他托管人和管理人认可的方式向托管人发送。管理人在发送指令时，应确保本委托资产银行托管账户有足够的资金余额，并为托管人留出执行指令所必需的时间。

**指令的确认：**管理人有义务在发送指令后与托管人以电话的方式进行确认。指令以获得托管人确认该指令已成功接收之时视为送达托管人。对于依照授权通知发出的指令，管理人不得否认其效力。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，由责任方承担。托管人依照授权书规定的方法确认指令有效后，方可执行指令。

**指令的执行：**托管人确认收到管理人发送的指令后，应对指令进行审查，验证指令的要素是否齐全，传真指令还应审核印鉴和签章和预留印鉴和签章样本的一致性，指令复核无误后应在规定期限内及时执行，不得延误。若存在要素不符或其他异议，托管人应及时与管理人进行电话确认，暂停指令的执行并要求管理人重新发送指令。托管人可以要求管理人传真提供相关交易凭证、合同或其他有效会计资料，以确保托管人有足够的资料来判断指令的有效性。托管人待收齐相关资料并判断指令有效后重新开始执行指令。管理人应在合理时间内补充相关资料，并给托管人预留必要的执行时间。由于管理人的原因造成的指令传输不及时、未能留出足够划款所需时间，致使资金未能及时到账所造成的损失由管理人承担。除需考虑资金在途时间外，管理人原则上应当为托管人留有 2 个工作小时的复核和审批时间。在指令未执行的前提下，若管理人撤销指令，管理人应在原指令上注明“作废”并加盖预留印鉴及被授权人签章后传真给托管人，与托管人进行电话确认。

## 四、托管人依照法律法规暂缓、拒绝执行指令的情形和处理程序

托管人发现管理人发送的指令有可能违反本合同或其他有关法律法规的规定时, 托管人有权暂缓执行指令, 并及时通知管理人, 管理人收到通知后应及时核对并纠正; 如相关交易已生效, 则应通知管理人在 10 个工作日内纠正, 并报告监管机构。如根据法律法规、交易所有关交易清算规则, 托管人只能在事后发现管理人投资行为违反法律法规或本合同约定的, 托管人在及时通知管理人, 即视为履行了对管理人的投资监督职责, 对于管理人违反法律法规或本合同约定给投资者/委托资产造成的损失, 由管理人承担责任。

#### 五、管理人发送错误指令的情形和处理程序

管理人发送错误指令的情形包括指令发送人员无权或超越权限发送指令及交割信息错误, 指令中重要信息模糊不清或不全等。托管人在履行监督职能时, 以通常合理的注意义务, 发现管理人的指令错误时, 有权拒绝执行, 并及时通知管理人纠正。

六、管理人撤换被授权人员、改变被授权人员的权限或更改被授权印鉴, 须提供变更后的新的授权通知。授权通知应加盖管理人公司公章并写明生效时间。

#### 七、指令的保管

指令若以传真或扫描件形式发出, 则正本由管理人保管, 托管人保管指令传真件或扫描件。传真件或扫描件和原件不一致的, 以托管人保管的传真件或扫描件内容为准。

#### 八、其他相关责任

在正常业务受理渠道和指令规定的时间内, 因托管人原因未能及时或正确执行符合本合同规定、合法合规的划款指令而导致计划财产受损的, 托管人应承担相应的责任, 但托管账户及其他账户余额不足或托管人如遇到不可抗力的情况除外。

如果管理人的划款指令存在事实上未经授权、欺诈、伪造或未能按时提供划款指令人员的预留印鉴和签字样本等非托管人原因造成的情形, 只要托管人根据本合同相关规定验证有关印鉴与签名无误, 有关指令给管理人或计划财产或任何第三人带来的损失, 全部责任由管理人承担, 但托管人未尽审核义务执行划款指令而造成损失的情况除外。

## 第十六节 交易及交收清算安排

### 一、选择代理证券及期货买卖的证券经纪商和期货经纪商的程序

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。

管理人应及时将本计划财产证券交易单元号、佣金费率等基本信息以及变更情况及时以书面形式通知托管人和运营服务机构。

### 二、投资证券后的清算交收安排

(一) 本计划通过证券经纪机构进行的交易由证券经纪机构作为结算参与人代理本计划进行结算; 本计划其他证券交易由托管人或相关机构负责结算。

#### (二) 证券交易所资金结算

托管人、管理人应共同遵守中国证券登记结算有限责任公司 (简称“中国结算”) 制定

的相关业务规则 and 规定，该等规则 and 规定自动成为本条款约定的内容。

管理人在投资前，应充分知晓与理解中国结算针对各类交易品种制定结算业务规则 and 规定。

证券经纪机构代理本计划财产与中国结算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。

（三）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、场外资金的清算交收安排

（一）本计划相应的资金划拨由托管人依据管理人的划款指令执行。管理人应将划款指令连同相关投资证明文件一并传真至托管人。托管人审核无误后，应及时将划款指令交付执行。

（二）管理人应确保托管人在执行管理人发送的指令时，有足够的头寸进行交收。计划的资金头寸不足时，托管人有权拒绝管理人发送的划款指令。管理人在发送划款指令时应充分考虑托管人的划款处理所需的合理时间。如由于管理人的原因导致无法按时支付清算款，由此造成的损失由管理人承担。

（三）在资金头寸充足的情况下，在正常业务受理渠道和时间内，托管人对管理人符合法律法规、本合同规定的指令不得拖延或拒绝执行，如由于托管人的过错导致本计划无法按时支付清算款，由此造成的损失由托管人承担，但托管账户余额不足或托管人遇不可抗力的情况除外。

### 四、资金、证券账目及交易记录的核对

管理人或其委托的运营服务机构和托管人定期对资产的资金、证券账目、实物券账目、交易记录进行核对。

### 五、选择期货经纪机构及期货投资资金清算安排

本计划投资于期货前，管理人负责选择为本计划提供期货交易服务的期货经纪公司，并与其签订期货经纪合同。管理人、托管人和期货公司可就本计划参与期货交易的具体事项另行签订协议。

本计划投资于期货发生的资金交割清算由管理人选定的期货经纪公司负责办理，管理人应在期货经纪协议或其他协议中约定由选定的期货经纪公司承担资金安全保管责任。

## 第十七节 越权交易

### 一、越权交易的界定

越权交易是指管理人违反有关法律法规的规定以及违反或超出本合同约定而进行的投资交易行为，包括：

（一）违反有关法律法规和本合同规定进行的投资交易行为。

（二）法律法规禁止的超买、超卖行为。

因证券及期货市场波动、上市公司合并、资产管理计划规模变动等管理人以外的因素致使资产管理计划投资不符合本合同的情况除外。如发生上述因投资管理人以外的因素致使资产管理计划投资不符合情况，托管人有权通知管理人，管理人应在 10 个工作日内进行调整，以达到标准。

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

## 二、越权交易的处理程序

### （一）违反本合同投资范围和投资比例限制规定进行的投资交易行为

托管人在行使监督职责时，发现管理人的划款指令违反本合同约定的，应当拒绝执行，立即通知管理人，管理人不纠正的，有权依据相关法律法规的要求报告中国证监会或基金业协会。

托管人在行使监督职责时，发现管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反本合同约定的，应立即通知管理人，管理人不纠正的，有权依据相关法律法规的要求报告中国证监会或基金业协会。

管理人应向托管人主动报告越权交易。托管人有权督促管理人在限期内改正并在该限期内对通知事项进行复查。管理人对托管人通知的越权事项未能在限期内纠正的，托管人有权依据相关法律法规的要求报告中国证监会或基金业协会。

### （二）法律法规禁止的超买、超卖行为

管理人在进行投资活动时不得有法律法规禁止的超买、超卖行为。托管人如果发现资产管理计划财产投资过程中出现超买或超卖现象，有权提醒管理人，由管理人负责解决，由此给资产管理计划财产造成的损失由管理人承担。

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

### （四）托管人对管理人投资运作的投资监督

托管人对管理人的投资行为行使监督权，对本计划以下投资范围、投资限制及投资比例进行监督：

#### 1、本计划投资范围：

银行存款、证券交易所债券、银行间市场债券、短期融资券、中期票据、资产支持证券、非金融企业债务融资工具、股指期货、国债期货、商品期货、公募基金份额（不含货币基金）、货币基金、经证监会认可的比照公募基金管理的资管产品、债券正回购、债券逆回购、现金及现金管理类工具。

证券公司的资产管理计划、证券公司资管子公司的资产管理计划、证券公司私募子公司的私募基金、基金公司的资产管理计划、基金公司子公司的资产管理计划、期货公司及其子公司的资产管理计划、银行理财、保险公司及其子公司的资产管理计划、私募基金以及其他

监管部门认可的投资品种。

2、本计划的投资限制及投资比例：

（1）本计划的总资产占净资产的比例不得超过 200%，计算本计划的总资产时应当按照穿透原则合并计算所投资资产管理产品的总资产。

（2）本计划按市值法计算投资于同一资产的资金不超过该计划资产净值的 25%；银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券等中国证监会认可的投资品种除外。

（3）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，不低于本资产管理计划资产净值的 10%。本资产管理计划主动投资于流动性受限资产的市值在开放退出期内合计不得超过本资产管理计划资产净值的 20%。

（4）本计划不得投资于以非上市股权、非上市债权、委托贷款及其它《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》第三十七条第（五）项规定的资产为投资标的的资产管理计划和私募基金。

（5）本计划不投资资产支持证券、资产支持票据劣后级。

（6）按市值计算，投资于重庆市、四川省内下辖全区域国有城投平台（地方政府融资平台）发行的债券、货币市场工具、现金、银行存款、逆回购、证券交易存出保证金（即证券公司开立的证券资金账户现金余额）合计市值占计划总资产的比例不小于 80%。对于债券是否属于国有城投平台（地方政府融资平台）发行的债券由管理人负责认定。

（7）本计划拟投资资产支持证券基础资产不包含信托计划、私募基金、资管产品及其收（受）益权。

（8）法律法规、中国证监会以及本合同规定的其他投资限制。

（9）预警线：见“资产管理计划的投资”章节。

3、托管人对计划财产的监督和检查自本计划建账估值之日起开始。

4、经投资者、托管人及管理人协商一致，可就投资范围和投资限制等投资政策做出调整进行变更，相关变更应为投资监督流程以及运营服务机构的估值调整留出充足的时间。

5、托管人发现管理人的投资运作违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反本合同约定的，有权拒绝执行，通知管理人，并报告中国证监会；托管人发现管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规或其他有关规定，或者违反本合同约定的，有权通知管理人并报告中国证监会或证券投资基金业协会。管理人收到通知后应及时核对或纠正，并以电话、邮件或书面形式向托管人进行解释或举证。

6、托管人发现管理人可能存在违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反本合同约定，但难以明确界定时，有权报告管理人。管理人应在三个工作日内予以答复，管理人在三个工作日内未予以答复的，托管人有权报告中国证监会或证券投资基金业协会。

7、在限期内，托管人有权随时对通知事项进行复查，督促管理人改正。管理人对托管

人通知的违规事项未能在限期内纠正的，托管人有权报告中国证监会或证券投资基金业协会。

8、本计划存续期间，托管人需对管理人投资范围、投资比例、投资限制进行盘后监督，而非实时监督。因管理人未依照本合同的投资范围、投资比例、投资限制进行投资给计划财产或者投资者造成财产损失的，由管理人承担相应责任。托管人在本合同约定范围内，对本计划的直接投资履行监督职能，托管人不穿透监督本计划所投资的私募管理产品（如有）的投资运作。

9、托管人投资监督工作的真实性、准确性、及时性和完整性受限于管理人、证券经纪商、期货经纪商及其他机构提供的数据、信息以及计划估值结果的真实性、准确性、及时性和完整性。

#### （五）通知与送达

以上托管人对管理人的通知，可采用电子邮件或双方约定的其他方式（包括但不限于电话、函件、传真、短信等方式）。

管理人接收投资监督通知的具体联系方式（包括但不限于联系人姓名、电子邮箱及电话号码）由管理人在本计划成立之前提供给托管人。

发送电子邮件的，邮件发送至指定电子邮箱即为送达；如因邮箱原因（包括但不限于变更或注销等）导致发送失败的，邮箱发送之时视为送达。

## 第十八节 资产管理计划财产的估值和会计核算

在本资产管理计划中，运营服务机构（中信建投证券股份有限公司）接受管理人委托，根据与管理人签署的委托服务协议（以实际签署的协议名称为准）履行约定的“资产管理计划财产的估值和会计核算”的工作，管理人依法应承担的估值核算职责不因委托而免除。

在业务实际操作过程中，托管人与管理人委托的运营服务机构对接、联系，未能联系到运营服务机构或与运营服务机构不能达成一致时，托管人可直接与管理人联系。

### 一、估值目的

计划财产估值的目的是客观、准确地反映计划财产的价值。

计划财产估值按照法律法规和本合同规定的估值方法和程序进行。计划资产净值是指计划财产总值减去负债后的净资产值。计划资产净值的计算保留到 2 位，小数点后第 3 位四舍五入。计划份额净值的计算保留到小数点后 4 位，小数点后第 5 位四舍五入。

### 二、估值时间

自本计划成立后第二个工作日起，管理人（或其委托的运营服务机构）与托管人在每个工作日对前一工作日的计划财产进行估值并核对。

### 三、估值依据

估值应符合本合同、《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》、《证券投资基金会计核算业务指引》及其他法律、法规的规定，如法律法规未做明确规定的，参照证券投资基金的行业通行做法处理。估值数据依据合法的数据来源独立取得。



#### 四、估值方法

本计划按以下方式进行估值：

##### （一）证券交易所上市的有价证券的估值

1、交易所上市的有价证券（包括股票、权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的市价（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。港股通的汇率使用外汇交易中心公布的港币对人民币汇率中间价。如估值日为外汇交易中心节假日且香港交易所交易日的，取外汇交易中心公布的最近交易日的汇率，如有调整，由管理人与托管人另行协商约定。

2、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，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且债券发行机构未发生影响债券价格的重大事件的，按最近交易日的收盘价估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考监管机构和行业协会估值意见，或者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、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，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且债券发行机构未发生影响债券价格的重大事件的，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含截止最近交易日的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考监管机构和行业协会估值意见，或者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、交易所上市的资产支持证券，主要采用第三方机构提供的估值价格。管理人（而非运营服务机构）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一致后做出适当调整。

##### （二）处于未上市期间的有价证券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收盘价估值；该日无交易的，以最近一日的收盘价估值。

2、流通受限股票（是指在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票），可按以下公式确定估值基准日该流通受限股票的价值：

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

其中：

FV：估值基准日该流通受限股票的价值

S：估值基准日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值

LoMD：该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣。

其中：LoMD 采用第三方机构（如中证指数有限公司）提供的流通受限股票流动性折扣。

（三）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，主要采用第三方机构提供的估值价格和估值技术。

（四）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。

（五）交易所上市流通的基金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。未在交易所上市流通的基金，按照前一日份额净值估值，若无前一日份额净值，则按最近公布的基金份额净值估值。本计划产品投资场外开放式基金的，如管理人（而非运营服务机构）在标的开放式基金权益确认日提供了权益确认原始凭证，则在确认日当天以原始凭证为依据入账；如管理人（而非运营服务机构）无法在权益确认日提供上述产品的权益确认原始凭证，则在原始凭证提供日进行确认，且不对历史已核对确认账务追溯调整，管理人（而非运营服务机构）明确书面申请并愿意承担相关责任且经托管人同意的除外。

（六）期货以估值日的结算价估值，若估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。法律法规另有规定的，从其规定。

（七）资管计划持有的场内期权衍生工具，按估值日的结算价估值；估值日没有交易的，按最近交易日的结算价估值。

（八）对于场外期权、场外收益互换等场外衍生品交易（若有），其估值遵循如下原则和方法：

1、管理人在投资交易时，应及时提供准确完整的交易文件；在合约到期结算时，应及时提供准确完整的到期结算单。

2、场外期权、场外收益互换根据交易对手或指定第三方提供的估值基准日的合约盈亏估值结果或价值报告确认合约损益及保证金。

3、管理人需敦促交易对手方或指定第三方按照本合同约定的估值核对日或至少按周提供合约价值报告及存出保证金（非履约保证金）对账单。管理人（而非运营服务机构）需确保其交易对手方或指定第三方机构提供的上述估值数据的准确、公允、完整。

4、如按周提供合约价值报告的，本计划开放日需交易对手方或指定第三方提供更新的合约价值报告；如未及时提供，则本计划暂停估值，如本计划依据本款约定导致开放申购赎回延迟的，管理人应当负责及时告知全体份额持有人。

5、因管理人未能及时提交真实、准确、完整的交易文件、结算清单或者交易对手方或指定第三方机构提供的估值数据的不准确、不公允、不完整或不及时导致估值暂停、申赎暂停或估值不准确的，由此产生的责任由管理人（非运营服务机构）承担。

（九）本合同一经签署即表明投资者已经知悉上述条款并接受此种情形下产生的流动性风险。

（十）债券、回购等计息资产按照约定利率在持有期内逐日计提应收利息，在利息到账日以实收利息为准，若有差异则于实收利息到账日计入本计划损益。

（十一）银行存款、证券资金账户内资金及债券等计息资产按照约定利率在持有期内逐日计提应收利息，在利息到账日以实收利息入账，并冲减已计提部分；证券、期货资金账户内资金不计提利息，以实际结息数为准。

（十二）交易所上市不存在活跃市场的有价证券（如资产支持证券和私募债等），采用第三方估值机构（中证指数有限公司）提供的估值价格和估值技术估值。

（十三）对于投资的证券公司资产管理计划、期货公司资产管理计划、商业银行理财产品、基金公司及其子公司资产管理计划、信托计划、私募产品，其估值时遵循如下原则和方法：

1、如管理人在上述标的产品权益确认日提供了权益确认原始凭证，则在确认日当天以原始凭证为依据入账；如管理人无法在权益确认日提供上述产品的权益确认原始凭证，则在原始凭证提供日进行确认，且不对历史已核对确认账务追溯调整，管理人明确书面申请并愿意承担相关责任且经托管人同意的除外；

2、如果上述产品有份额净值的，以管理人或其指定的第三方机构提供的标的产品最新份额净值进行估值；如果上述产品不公布份额净值，则以成本进行估值；因前述估值方法安排而产生的任何责任均由管理人自行承担，与托管人、运营服务机构无关。

3、针对按份额净值估值的场外标的产品，按照标的产品最新份额净值进行估值。托管人在实际收到标的产品最新份额净值时及时入账，且不对历史已核对确认账务追溯调整，管理人明确书面申请并愿意承担相关责任且经托管人同意的除外。本计划开放日需以标的产品最新份额净值进行估值，如未及时提供最新份额净值，则本计划暂停估值，由此造成的相关责任均由管理人承担。如本计划依据本款约定导致开放申购赎回暂停或延迟的，管理人应当负责及时告知全体份额持有人。

4、如果持有证券公司发行的集合类现金资产管理计划且管理人或其指定的第三方机构每日提供万份收益的，则该标的产品每日以前一交易日的万份收益计提红利。

（十四）管理人需保证其直接提供的或指定第三方机构提供的净值数据真实、准确、完整、及时、有效。

（十五）全国中小企业股份转让系统挂牌的股票

1、全国中小企业股份转让系统挂牌的股票，且实行做市商交易的或者实行竞价（包含集合竞价）交易的，以其估值日在全国中小企业股份转让系统挂牌的市价（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，由管理人出具估值意见说明函，调整最近交易市价，确定公允价格；

2、全如果未来监管机构或行业协会等出台关于全国中小企业股份转让系统挂牌的股票

的统一的估值标准或方法，则参照新的标准或方法。管理人须在更改估值方法前至少提前十个工作日发函与托管人对估值方法的修改进行确认，并提前一个工作日将修改估值方法的声明通知到计划份额持有人，即视为对本计划的计划份额持有人尽了告知义务，不再征询计划份额持有人意见。

（十六）如存在上述估值约定未覆盖的投资品种，管理人可根据具体情况，在与托管人商议后，按最能反映该投资品种公允价值的方法估值。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，管理人可根据具体情况与托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

（十七）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。

如管理人或托管人发现资产管理计划估值违反本合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护计划份额持有人利益时，应立即通知对方，共同查明原因，双方协商解决。根据有关法律法规，资产管理计划资产净值计算和会计核算的义务由管理人承担。本计划的会计责任方由管理人担任，因此，**就与本计划有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，以管理人对资产管理计划资产净值的计算结果为准。**

#### 五、估值对象

资产管理计划财产项下所有中国证监会依法核准或注册的公开募集基金、现金、银行存款以及中国证监会所认可的其他品种。

#### 六、估值程序与资产管理计划份额净值的确认

管理人或其委托的运营服务机构于每个估值核对确认日计算本估值日的计划资产净值并以传真方式或其他双方认可的方式发送给托管人。托管人对净值计算结果复核后，签名、盖章并以传真方式或其他管理人和托管人认可的方式传送给管理人。

计划份额净值的计算精确到 0.0001 元，小数点后第五位四舍五入，相关法律法规另有规定的，从其规定。

#### 七、估值错误的处理

管理人和托管人将采取必要、适当、合理的措施确保资产管理计划资产估值的准确性、及时性。当计划净值发生计算错误超过计划净值 0.5% 时，视为估值错误。

如管理人或托管人发现资产管理计划估值违反本合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定，导致计划净值发生计算错误超过计划净值的 0.5% 时，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，协商解决。

根据有关法律法规，资产管理计划资产净值计算和会计核算的义务由管理人承担。本计划的会计责任方由管理人担任。因此，就与本计划有关的会计问题，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，以管理人的意见为准。

当计划财产估值出现错误时，管理人和托管人应该立即协商采取更正措施，并按本合同约定的报告方式向投资者及时披露（披露方式参见第十九节报告义务中临时报告）。

因前述估值方法安排而产生的任何责任均由管理人自行承担，与托管人、运营服务机构无关。

#### 八、暂停估值的情形

- （一）资产管理计划投资所涉及的期货交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；
- （二）证券/期货交易经纪服务机构等中介机构、管理人或其指定的第三方机构未能提供估值所需资料，导致运营服务机构、托管人无法对资产进行正常估值时；
- （三）因不可抗力或其他情形致使管理人、托管人无法准确评估资产管理计划财产价值时；
- （四）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，管理人为保障投资者的利益决定暂停估值的；
- （五）中国证监会认定的其他情形。

#### 九、特殊情形的处理

由于不可抗力原因，或由于期货交易所发送的数据错误，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，由此造成的资产管理计划财产估值错误，管理人、运营服务机构和托管人可以免除赔偿责任。但管理人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

对于因税收规定调整或其他原因导致计划实际缴纳税金与估值计提的应交税金有差异的，计划将在相关税金调整日或实际支付日进行相应的估值调整。相关估值调整不作为计划资产估值错误处理。

#### 十、资产管理计划的会计政策

资产管理计划的会计政策比照证券投资基金现行政策执行：

- （一）管理人为本计划的会计责任方。
- （二）本计划的会计年度为公历年度的 1 月 1 日至 12 月 31 日。
- （三）本计划核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位。
- （四）本计划会计核算制度执行国家有关会计制度。
- （五）本计划独立建账、独立核算；管理人（或其委托的运营服务机构）及托管人各自保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，编制会计报表。管理人应定期与托管人就资产管理计划的会计核算、报表编制等进行核对。

## 第十九节 资产管理计划的费用与税收

### 一、资产管理业务费用的种类

- （一）管理费。

(二) 托管费。

(三) 运营服务费。

(四) 业绩报酬 (如有)。

(五) 本计划的期货交易费用 (包括但不限于经手费、印花税、证管费、过户费、手续费、券商佣金、权证交易的结算费及其他类似性质的费用等)。

(六) 与本计划相关的审计费、会计师费、律师费及其他合理费用。

(七) 银行账户的资金结算汇划费、账户维护费。

(八) 资产管理计划财产开立账户需要支付的费用。

(九) 诉讼费、仲裁费、财产保全费及财产保全保险费 (如有)。

(十) 按照国家有关规定和本合同约定, 可以在计划资产中列支的其他费用。

## 二、费用计提方法、计提标准和支付方式

### (一) 管理费

#### 1. 管理费

本计划的管理费按计划资产净值的【0.7%】年费率计提, 管理费的计算方法如下:

$$H = E \times \text{年管理费率} \div 365$$

H 为每日应计提的管理费

E 为前一日的计划资产净值

本计划的管理费自计划成立日起, 每日计提, 按季支付, 于计划成立之日的下一季度起, 每季度首日起 10 个工作日内由管理人向托管人发送资产管理计划管理费划款指令, 经托管人复核后于 10 个工作日内从资产管理计划财产中支付上季度管理费给管理人。

管理人指定的接收管理费的银行账户信息:

账户名称 (接收管理费): XX 期货股份有限公司

账号: 411060700010141608884

开户行: 交通银行郑州期货大厦支行

#### 2. 管理人的业绩报酬

##### 1) 业绩报酬的提取时间

本计划业绩报酬提取基准日为分红除息日、份额持有人退出日及计划终止日。

本计划业绩报酬提取频率不超过每 6 个月一次。因投资者退出本计划, 管理人按资产管理合同的约定提取业绩报酬的, 不受前述提取频率的限制。

##### 2) 业绩报酬的计算

本计划业绩报酬计提基准为  $R=7.5\%$  (年化), 计提期间的委托资产净值超过业绩报酬计提基准的部分收取  $TB=20\%$  的业绩报酬。具体如下:

第  $i$  个计划份额持有人持有的第  $j$  笔投资的期间年化收益率  $R_{i,j} = (NAV_1 - HWM_{i,j}) / HWM_0$

$\times \frac{365}{T_{ij}} \times 100\%$ ，则业绩报酬计提的条件为：

当  $R_{i,j} \leq R$  时，不计提业绩报酬；

当  $R_{i,j} > R$  时，资产管理人对期间实际收益率超过  $R$  的部分提取  $TB$  比例作为业绩报酬，即

$$PF_{i,j} = F_{i,j} \times (R_{i,j} - R) \times HWM_0 \times TB \times \frac{T_{ij}}{365};$$

$PF_{i,j}$ ：本计提基准日第  $i$  个计划份额持有人第  $j$  笔投资的业绩报酬；

$F_{i,j}$ ：权益登记日、计划终止、提取时，表示在本计提基准日第  $i$  个计划份额持有人持有的第  $j$  笔投资的计划份额余额；退出提取时，表示在本计提基准日第  $i$  个投资者退出份额中第  $j$  笔投资的计划份额；

$T_{ij}$ ：第  $i$  个计划份额持有人第  $j$  笔投资的上一次计提业绩报酬计提日至本次固定计提确认日、退出确认日及计划终止确认日之间的实际天数；若该笔份额还未计提过业绩报酬，则  $T_{ij}$  为第  $i$  个计划份额持有人第  $j$  笔投资的参与确认日至本次固定计提确认日、退出确认日及计划终止确认日之间的实际天数；

$NAV_i$ ：本计提基准日计划份额累计净值；

$HWM_{i,j}$ ：第  $i$  个计划份额持有人第  $j$  笔投资的高水位，为该笔份额最近一次成功提取业绩报酬时对应的业绩报酬计提基准日的计划份额累计净值；若该笔份额还未提取过业绩报酬，则  $HWM_{i,j}$  为该笔份额认购确认日/参与申请日/除权除息日的计划份额累计净值；

$HWM_0$ ：为该笔份额最近一次成功提取业绩报酬时对应的业绩报酬计提基准日的计划份额净值；若该笔份额还未提取过业绩报酬，则  $HWM_0$  为该笔份额认购确认日/参与申请日/除权除息日的计划份额净值；

如果  $PF_{i,j}$  计算结果为负或者为零，则该计提日第  $i$  个计划份额持有人第  $j$  笔投资提取的业绩报酬为零，资产管理人就该笔投资不提取业绩报酬。

计算出的  $PF_{i,j}$  从赎回资金/分红资金/清盘资金中扣除。

某计提日资产管理人计提的业绩报酬总额为该计提日所有单个计划份额持有人各笔投资业绩报酬之和。某计提日单个计划份额持有人计提的业绩报酬总额为该计划份额持有人持有的各笔投资业绩报酬之和。

业绩报酬金额的计算保留到小数点后 2 位，小数点后第 3 位四舍五入，由此带来的收益和损失归入计划资产。

**特别提示：**本合同项下的“业绩报酬计提基准”系仅作为管理人评估本计划投资表现和计算计提业绩报酬的依据，既不是对投资收益的预测，也不代表管理人对投资者保本或最低收益的承诺，更非管理人或任何第三人对投资者可取得的利益所作的任何承诺或保证。投资有风险，投资者仍可能会面临无法取得收益甚至损失本金的风险。

### 3) 业绩报酬支付

**托管人不承担业绩报酬复核义务**，管理人在单个计划份额持有人【退出或分红或清算】款项（以下简称“退出金额”）中分别予以相应扣除，即退出金额支付日，托管人根据管理人的指令将退出金额（含业绩报酬）划拨到计划募集账户，管理人将归管理人所有的业绩报酬支付给管理人后，将剩余的退出金额支付给计划份额持有人。

**业绩报酬的收款账户同管理人管理费收款账户保持一致。**

## （二）托管费

本计划的托管费按计划资产净值的【0.02%】年托管费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times \text{年托管费率} \div 365$$

H 为每日应计提的托管费

E 为前一日的计划资产净值

本计划的托管费自计划成立日起，每日计提，按季支付，于计划成立之日的下一季度起，每季度首日起 10 个工作日内由管理人向托管人发送资产管理计划托管费划款指令，经托管人复核后于 10 个工作日内从资产管理计划财产中支付上季度托管费给托管人。

## （三）运营服务费

本计划运营服务费用，年费率为【0.02%】。

计算方法如下：

$$H = E \times \text{年运营服务费率} \div 365$$

H：每日应计提的运营服务费

E：前一日资产管理计划资产净值

本计划的运营服务费自计划成立日起，每日计提，按季支付。于计划成立之日的下一季度起，每季度首日起 10 个工作日内由管理人向托管人发送资产管理计划运营服务费划款指令，经托管人复核后于 10 个工作日内从资产管理计划财产中支付上季度运营服务费给运营服务机构。

（四）本节第一条中的其他费用根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由托管人从计划财产中支付。

## 三、不列入资产管理计划业务费用的项目

（一）资产管理计划成立前发生的费用，以及存续期间发生的与募集有关的费用，不得在计划资产中列支。

（二）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计划财产的损失。

（三）管理人和托管人处理与计划运作无关的事项或不合理事项所发生的费用。

（四）其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入计划费用的项目。

## 四、费用调整

管理人、托管人与投资者协商一致，可根据市场发展情况调整代销费率和托管费率，并报证券投资基金业协会备案。



## 五、资产管理业务的税收

1) 根据国家税收法律、法规相关要求, 本计划运营过程中如发生增值税应税行为, 使得本管理人成为增值税纳税人的, 源于本计划增值税应税行为而形成的增值税及其附加税费等相关税负由本计划资产承担。相关税款由管理人计算后向托管人出具划款指令, 由托管人划付至管理人指定的税款缴纳专用账户并由管理人依据税务部门要求完成相关税款申报缴纳。

2) 本计划清算后, 如管理人被税务机关要求补缴由本计划增值税应税行为而形成的应由本计划资产承担的增值税及其附加税费等相关税负的, 管理人有权向投资者就补缴金额进行追索。

3) 本计划运作过程中涉及除增值税及其附加税费以外的各纳税主体、扣缴主体, 其纳税义务、扣缴义务按国家税收法律、法规执行。

4) 如将来本计划所适用的税收征管法律法规及具体执行方式由于国家相关税收政策、管理人主管税务机关指导意见、中国证监会相关规定、行业指引、自律规则及有关政策调整而发生变化, 则管理人经与托管人协商一致并由管理人提前公告后, 可直接对本合同中涉及的相关内容进行修改和调整。

## 第二十章 资产管理计划的收益分配

本计划收益的构成: 是指将本计划的累计未支付利润。

### 一、收益分配原则与执行方式

1、本计划收益分配的基准为计划的累计未支付利润。本计划的累计未支付利润是指本计划的利息收入、投资收益、公允价值变动收益及其他收入等资产运作产生的各项收入扣除管理费、代销费、托管费、运营服务费等资产运作产生的各项费用后的余额。

2、本计划收益分配日为每自然年度的 6 月 20 日及 12 月 20 日(遇节假日自动顺延至下一个工作日), 管理人有权视资产管理计划运作情况自主决定是否进行分配。如分配, 由管理人向托管人发送划付指令及红利计算明细表并加盖管理人预留印鉴, 托管人根据指令将现金红利款项划往份额登记机构, 并由份额登记机构将现金红利款项划往相应的募集机构, 由募集机构划入计划份额持有人的指定资金账户。现金红利款在分红权益登记日后七个工作日内划转到计划份额持有人账户。

3、本计划成立运作不满 3 个月不进行收益分配。

4、本计划收益分配方式默认为现金分红。

5、本计划的收益分配方案具体以管理人公告为准。

6、每一计划份额享有同等分配权。

7、法律法规或监管机关另有规定的, 从其规定。

### 二、收益分配方案的确定与通知

收益分配方案由管理人根据本合同制定, 包括收益分配的范围、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。

管理人应当于收益分配登记日前，将收益分配方案交由托管人复核。托管人应于收到收益分配方案后完成对收益分配方案的复核，并将复核意见书面通知管理人（或管理人委托的份额登记机构）。

### 三、收益分配的执行

托管人根据管理人的收益分配方案和提供的红利金额的数据，在红利发放日进行处理。

## 第二十一节信息披露与报告

### 一、运作期报告

#### （一）管理人向投资者提供的报告种类、内容和提供时间

##### 1、净值披露

本计划净值披露频率不低于资产管理计划的开放频率。管理人应当在通过手机短信、网站公告、电子邮件等其中任一形式向投资者披露净值。

##### 2、季度报告

管理人应当在每季度结束之日起 1 个月内，向投资者披露经托管人复核的计划份额净值、主要财务指标以及投资组合情况等信息。

季度报告包括但不限于下列信息：（一）管理人履职报告；（二）托管人履职报告；（三）资产管理计划投资表现；（四）资产管理计划投资组合报告；（五）资产管理计划运用杠杆情况（如有）；（六）资产管理计划支付的管理费、托管费、销售费、业绩报酬（如有）等费用情况；（七）资产管理计划投资收益分配情况；（八）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；（九）中国证监会规定的其他事项。

##### 3、年度报告

管理人应当在每年结束之日起 4 个月内，编制完成计划年度报告并经托管人复核本资产管理计划财务数据，向投资者披露投资状况、投资表现、风险状况等信息。托管人在收到年度报告后 45 日内完成复核本资产管理计划财务数据，并将复核结果书面通知管理人。资产管理计划合同生效未满 3 个月，不编制当期的年度报告。

年度报告包括但不限于下列信息：（一）管理人履职报告；（二）托管人履职报告；（三）资产管理计划投资表现；（四）资产管理计划投资组合报告；（五）资产管理计划运用杠杆情况（如有）；（六）资产管理计划财务会计报告；（七）资产管理计划支付的管理费、托管费、销售费、业绩报酬（如有）等费用的计提基准、计提方式和支付方式；（八）资产管理计划投资收益分配情况；（九）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；（十）中国证监会规定的其他事项。

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。

##### 4、临时报告

发生本合同约定的、可能影响投资者利益的重大事项时，管理人应及时履行报告义务，在事项发生之日起五日内向投资者披露。涉及托管人的，托管人应及时向管理人告知相关事项。

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资产管理计划，应向投资者充分披露。

托管人应当按照中国证监会以及证券投资基金业协会的规定和本合同的约定，对管理人（或其委托的运营服务机构）编制的资产净值、份额净值、份额参与退出价格、定期报告和定期更新的招募说明书（如有）等向投资者披露的资产管理计划相关财务数据进行复核确认；托管人须进行复核的信息仅限于其在履行职责过程中制作或者获取的，以一定形式记录、保存的信息及数据。

5、管理人的董事、监事、从业人员及其配偶、控股股东、实际控制人或者其他关联方参与资产管理计划，管理人应向投资者充分披露。

## （二）管理人向投资者提供报告及投资者信息查询的方式

管理人向投资者提供的报告，将严格按照有关规定通过以下至少一种方式进行。投资者信息查询将通过以下至少一种中国证监会允许的、本合同约定的方式进行。

### 1、邮寄服务

管理人向投资者邮寄定期报告、临时报告等有关本计划的信息。投资者在合同签署页上填写的通信地址为送达地址。通信地址如有变更，投资者应当及时通知管理人。

### 2、传真、电子邮件或手机短信等

如投资者办理资产管理计划认购、参与或退出等业务时留有传真号、电子邮箱、手机及电话号码等联系方式的，管理人也可通过传真、电子邮件、手机短信、电话、电报等方式将报告信息通知投资者。投资者上述联系方式若发生变更应当及时通知管理人。

### 3、运营服务机构投资人服务平台

管理人可通过中信建投证券股份有限公司管理人平台向投资者进行信息披露，投资者通过该服务平台查询的计划信息取决于管理人的披露情况。份额持有人可根据管理人的授权，登陆该服务平台查询计划份额、交易确认流水、份额净值等信息。

本计划的信息披露义务人为管理人，运营服务机构仅为服务平台的运营方，非履行计划信息披露的义务人，不代替管理人完成信息披露的工作。运营服务机构不对管理人通过该服务平台披露的任何信息的合法合规性、真实性、准确性、完整性、及时性、有效性承担任何责任。

### 4、管理人公司网站

投资者可通过登陆管理人网站进行查询相关披露的信息。

本计划管理人网址为： [www.XX.com](http://www.XX.com)。

## 二、向监管机构提供的报告

管理人、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。

(一) 资产管理计划成立之日起五个工作日内, 资产管理人应当报证券投资基金业协会备案。资产管理合同发生变更的, 于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。资产管理人应向证券投资基金业协会报送合同变更的备案报告, 备案报告应说明变更内容、变更是否涉及改变投向和比例、托管人对本次变更的意见、合同变更告知方式、合同变更是否设置开放期、退出情况及是否有巨额退出情况发生等, 并附上相关材料。

(二) 资产管理计划展期的, 资产管理人应当于资产管理合同展期之日起五个工作日内将展期备案报告等材料报证券投资基金业协会备案。展期备案报告应当说明展期是否符合相关法律法规、合同约定, 以及展期是否存在损害投资者利益情况, 集合资产管理计划展期是否符合集合资产管理计划的成立条件。

(三) 资产管理计划终止的, 资产管理人应当自终止之日起五个工作日内报证券投资基金业协会备案, 说明产品终止原因, 以及是否符合法律法规要求和合同约定。

资产管理人应当自发生终止情形之日起五个工作日内开始组织清算资产管理计划资产。资产管理人应当在清算结束后五个工作日内, 将清算备案报告报证券投资基金业协会备案, 并附上清算结果、清算后的财产分配情况等相关材料。

(四) 资产管理人应当于每月十日前向证券投资基金业协会报送资产管理计划的持续募集情况、投资运作情况、资产最终投向等信息。为加强资产管理计划事中事后运行风险管理, 资产管理人还应按照证券投资基金业协会要求按时报送资产管理计划的融资杠杆水平、延期兑付情况等运行信息, 定期报送压力测试信息。

(五) 资产管理人应当在每季度结束之日起一个月内, 编制私募资产管理业务管理季度报告, 向证券投资基金业协会报送。

资产管理人、托管人应当在每年度结束之日起四个月内, 分别编制私募资产管理业务管理年度报告和托管年度报告, 向证券投资基金业协会报送。

资产管理人的年度审计和私募资产管理业务的内部控制情况审计结果, 应在每年度结束之日起四个月内向证券投资基金业协会报送。

(六) 资产管理人应在每季度结束之日起一个月内、每年度结束之日起四个月内, 向投资者提供资产管理计划的季度报告和年度报告, 并同时向证券投资基金业协会报送。

(七) 资产管理人在资产管理计划发生以下情形, 对资产管理计划持续运行、投资者利益、资产净值产生重大影响时, 应当于五个工作日内向证券投资基金业协会报告:

- 1、以资产管理计划资产从事重大关联交易的;
- 2、涉及产品重大诉讼、仲裁、财产纠纷的, 以及出现延期兑付、负面舆论、群体性事件等重大风险事件的;
- 3、资产管理计划因委托财产流动性受限等原因延长清算时间的;
- 4、发生其他对持续运行、投资者利益、资产净值产生重大影响事件的。

（八）资产管理人发现违反法律、行政法规、中国证监会规定、自律规则、合同约定行为的，应于发现后二个工作日内向证券投资基金业协会报告。

托管人监督管理人的投资运作，发现管理人的投资或清算指令违反法律、行政法规、中国证监会的规定或者资产管理合同约定的，应当拒绝执行，并向证券投资基金业协会报告。

资产管理人因私募资产管理业务被中国证监会及相关派出机构、其他金融监督管理机构采取行政监管措施或行政处罚，或被中国证券业协会、中国期货业协会、交易场所和登记结算机构采取自律管理措施或纪律处分的，应在收到相关措施或处理决定后二个工作日内向证券投资基金业协会报告。

资产管理人、托管人向证券投资基金业协会报送的备案、运行信息，应按规定抄报或报送中国证监会、相关派出机构。

三、投资者可以在中国期货业协会网站查询有关期货公司资产管理业务登记备案情况。

## 第二十二节 风险揭示

本计划管理人提示投资者充分了解资产管理计划投资的风险和收益特征，建议投资者在选择本计划之前，通过正规的途径，对本计划进行充分、详细的了解。投资者应对自己的资金状况、投资期限、收益预期、风险承受能力和风险偏好做出客观合理的评估后，再做出是否投资的决定。

本管理人提醒投资者“买者自负”投资原则，在投资者做出投资决策后，计划的运营状况与计划净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责。

本管理人将按照计划合同的约定，依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用计划资产，在风险控制的基础上为投资者争取最大的投资收益，但不保证本计划一定盈利，也不保证最低收益。请投资者正确认识和对待本计划未来可能的收益和风险。

本计划管理人在管理、运用或处分财产过程中，资产管理计划可能面临的风险，包括但不限于：

### （一）特殊风险揭示

#### 1、资产管理合同与证券投资基金业协会合同指引不一致所涉风险；

如本计划的投资范围、产品结构等存在特殊约定而无法完全适用证券投资基金业协会发布的合同指引，虽然资产管理人将在本风险揭示书中进行特别揭示，但仍存在因该等特殊约定不符合法律法规、监管机构和行业自律规则的相关政策规定和要求从而导致本计划损失的风险。

#### 2、资产管理计划委托募集所涉风险（如有）

资产管理人可委托在中国证监会注册取得基金销售业务资格并已成为证券投资基金业协会会员的机构（以下简称代销机构）募集资管计划。

代销机构应当恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉，防范利益冲突，履行说明义务、反洗钱义务等相关义务，承担特定对象确定、投资者适当性审查、资管计划推介及合格投资者确认

等相关责任。代销机构及其从业人员不得从事侵占计划财产和客户资金、利用资管计划相关的未公开信息进行交易等违法活动。

如代销机构丧失销售资格，或在募集期间，代销机构未能恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉履行相关义务，均会对投资者权益产生不利影响。

### 3、资产管理计划外包事项所涉风险（如有）

资产管理人可委托具备相应资质的外包服务机构提供相应资管计划外包服务。外包服务机构相信其本身将按照相关法律的规定进行营运及管理，但无法保证其本身可以永久维持符合监管部门的金融监管法律。如在计划存续期间外包服务机构无法继续从事资管计划外包服务，则可能会对资管计划产生不利影响。

### 4、资产管理计划份额转让所涉风险

投资者可以选择转让全部或部分其持有的资产管理计划份额。当投资者选择转让部分资产管理计划份额后，仍须满足本合同约定的最低持有资产要求。资产管理计划份额的受让方必须符合《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》第三条对合格投资者的规定；在受让份额前，受让人必须已仔细阅读本计划的相关文件资料，清晰了解并接受其中的投资风险，了解自身风险承受能力与产品风险等级匹配的情况、资产管理计划承担的费用等。在转让资产管理计划份额后，本计划的投资者人数经穿透审查后必须满足相关法规要求。

如发生不符合以上规定的情况或其他类似情形，存在投资者的份额转让申请被资产管理人拒绝的风险。

### 5、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

本计划在证券投资基金业协会备案完成前无法进行投资操作，因备案所需时间无法准确预估且计划份额持有人在此期间无法及时赎回其投资本金，本计划及计划份额持有人均存在在备案期间错失投资机会的风险。

本计划存在资产管理人未在合同约定期限内到中国证券投资基金业协会办理相关备案手续或在中国证券投资基金业协会备案未能通过导致计划提前终止的风险。如本计划因上述原因而清算终止，本计划募集、备案及清算期间发生的费用、债务由资产管理人以自有财产承担，但仍存在对计划财产造成损失的潜在风险。

### 6、预警机制的风险

虽然本计划设计有预警机制，且资产管理人已依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则按合同规定及时执行预警约定操作，但计划资产净值可能因为市场波动而远低于预警线。投资者的损失可能远大于原定的预警线。

### 7、本计划锁定期风险

根据合同约定，本计划针对成立日之后申购的份额有锁定期（成立日前认购的份额无锁定期），本计划投资者仅可对其持有的已过锁定期的计划份额进行赎回。投资者持有的在锁定期内的份额可能面临资金不能赎回带来的流动性风险。

#### 8、计划分红时提取业绩报酬的风险

若本计划在分红时提取业绩报酬的，业绩报酬将从向份额持有人分配的分红资金中扣除且不超过分红资金，存在份额持有人实际收到的现金分红款或获得的红利转投份额，少于管理人披露的分配方案中载明的分红金额的情形。此外，由于分红时点不一定是本合同约定的开放日（包括临时开放日），可能存在份额持有人因计划进行分红被提取业绩报酬但无法进行赎回的情形。

同时因分红时，计提业绩报酬的依据为累计净值增值部分，而非分红金额部分，故存在计提的业绩报酬占分红金额的比例不等于业绩报酬计提比例，甚至存在分红金额全为业绩报酬，导致虽分红但投资者实际未获得任何分红款或红利转投份额的情况。

#### 9、关于业绩报酬计提基准的风险

本合同项下的“业绩报酬计提基准”系仅作为管理人评估本计划投资表现和计算计提业绩报酬的依据，既不是对投资收益的预测，也不代表管理人对投资者保本或最低收益的承诺，更非管理人或任何第三人对投资者可取得的利益所作的任何承诺或保证。投资有风险，投资者仍可能会面临无法取得收益甚至损失本金的风险。

#### 10、计划发生亏损时已收取的业绩报酬不予退还的风险

在满足合同约定条件时，管理人将计提业绩报酬，管理人计提业绩报酬后，如果后续运作中发生净值回撤甚至亏损的情况，已计提的业绩报酬不会退还。

#### 11、收益分配的风险

本计划的收益分配章节如约定本计划可将未分配利润中未实现收益部分进行分配。该等分配方式可能出现收益分配时计划资产未变现导致托管账户中现金不足以足额支付分红款项或收益分配后计划份额净值大幅度变化等风险，前述由于分配未实现收益导致的风险由管理人负责控制。

### （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，也不保证一定盈利及最低收益。

本计划属于[R3]风险投资品种，适合风险识别、评估、承受能力[C3、C4、C5]的合格投资者及专业投资者。

#### 2、市场风险

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

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

（2）经济周期风险：随经济运行的周期性变化，市场的收益水平也呈周期性变化。资产管理计划收益水平也会随之变化，从而产生风险。

（3）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。

（4）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，导致市场的价格和收益率的变动，使资产管理业务收益水平随之发生变化，从而产生风险。

（5）再投资风险：固定收益品种获得的本息收入或者回购到期的资金，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，从而对资产管理计划产生再投资风险。

（6）衍生品风险：金融衍生产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。

### 3、管理风险

在资产管理计划财产管理运作过程中，对主要业务人员如资产管理计划投资经理的依赖可能产生管理风险。可能因管理人对经济形势和市场等判断有误、获取的信息不全等影响资产管理计划的收益水平。管理人和托管人的管理水平、管理手段和管理技术等对资产管理计划收益水平存在影响。

### 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。

### 5、信用风险

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。

### 6、募集失败风险（集合资产管理计划）

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

管理人的责任承担方式：

（1）以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用；

（2）在资产管理计划募集期限届满（确认资产管理计划无法成立）后三十日内退还投资者已交纳的款项，并加计银行同期活期存款利息。

### 7、投资标的的风险

（1）固定收益投资风险

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

1）市场平均利率水平变化导致债券价格变化的风险；



2) 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;

3) 发行主体的风险: 债券发行人出现违约导致债券无法及时兑付或付息, 或由于债券发行人信用质量降低导致债券价格下降的风险;

4) 流动性风险: 由于债券无法及时兑付、付息, 导致投资者退出、清算延期办理, 或因在存续期内投资者强制提前退出, 导致计划债券折价变现造成损失的风险;

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

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

## (2) A 股股票投资风险(如有)

1) 国家货币政策、财政政策、产业政策等的变化对证券市场产生一定的影响, 导致证券市场价格水平波动的风险。

2) 宏观经济运行周期性波动, 对证券市场的收益水平产生影响的风险。

3) 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、财务等都会导致公司盈利发生变化, 从而导致股票价格变动的风险。

## (3) 融资融券交易风险(如有)

### 1) 可能放大投资损失的风险

融资融券业务具有杠杆效应, 它在放大投资收益的同时也必然放大投资风险。将股票作为担保品进行融资融券交易时, 既需要承担原有的股票价格下跌带来的风险, 又得承担融资买入或融券卖出股票带来的风险, 同时还须支付相应的利息和费用, 由此承担的风险可能远远超过普通证券交易。

### 2) 特有的卖空风险

融资融券交易中的融券交易存在着与普通证券截然不同的风险——卖空风险。普通证券投资发生的损失是有限的, 最多不会超过该计划投入的全部本金, 但是融券交易的负债在理论上可以无限扩大, 因为证券上涨的幅度是没有上限的, 而证券涨得越多, 融券负债的规模就越大。

### 3) 利率变动带来的成本加大风险

如果在从事融资融券交易期间, 中国人民银行规定的同期贷款基准利率调高, 证券公司

将相应调高融资利率或融券费率，投资成本也因为利率的上调而增加，将面临融资融券成本增加的风险。

#### 4) 通知送达风险

在融资融券交易过程中，相关信息的通知送达至关重要。《融资融券合同》中通常会约定通知送达的具体方式、内容和要求。当证券公司按照《融资融券合同》要求履行了通知义务后即视为送达，则若未能关注到通知内容并采取相应措施，就可能因此承担不利后果。

#### 5) 强制平仓风险

融资融券交易中，该计划与证券公司间除了普通交易的委托买卖关系外，还存在着较为复杂的债权债务关系，以及由于债权债务产生的信托关系和担保关系。证券公司为保护自身债权，对该计划信用账户的资产负债情况实时监控，在一定条件下可以对该计划担保资产执行强制平仓。

#### 6) 提前了结债务的风险

在融资融券交易中，证券公司可能在融资融券合同中与该计划约定提前了结融资融券债务的条款，该计划在从事融资融券交易期间，如果发生融资融券标的证券范围调整、标的证券暂停交易或终止上市等情况，根据该计划与证券公司签订的合同条款，该计划将可能面临被证券公司提前了结融资融券交易的风险，并可能由此给该计划造成损失。

#### 7) 监管风险

在融资融券交易出现异常或市场出现系统性风险时，监管部门、证券交易所和证券公司都将可能对融资融券交易采取相应措施，例如提高可充抵保证金证券的折算率、融资或融券保证金比例、维持担保比例和强制平仓的条件等，以维护市场平稳运行。这些措施将可能给本金带来杠杆效应降低、甚至提前进入追加担保物或强制平仓状态等潜在损失。

#### (4) 港股通交易的风险（如有）

因沪、深、港股票市场在投资环境、投资者结构以及交易标的等方面都存在一定差异，参与港股通交易可能面临如下风险：

1) 市场联动风险：与内地 A 股市场相比，由于在港股市场上外汇资金自由流动，海外资金的流动与港股价格之间表现出高度相关性，因此，投资者在参与港股市场交易时受到全球宏观经济和货币政策变动导致的系统风险相对更大。

2) 股价波动风险：由于港股市场实行 T+0 交易机制，而且不设涨跌幅限制，加之香港市场结构性产品和衍生品种类相对丰富，因此，港股通个股的股价受到意外事件驱动的影响而表现出股价波动的幅度相对 A 股更为剧烈，投资者持仓的风险相对较大。

3) 交易成本风险：参与港股投资，除因股票交易而发生的佣金、交易征费、交易费、交易系统费、印花税、过户费等税费，在不进行交易时也可能要继续缴纳证券组合费等项费用，从而导致交易成本上升。

4) 个股流动性风险：不同于在内地市场中小市值股票的成交较为活跃，在香港市场，

部分中小市值港股成交量则相对较少，流动较为缺乏。因此，若重仓持有此类股票，则可能因缺乏交易对手，进而面临小量抛盘即导致股价大幅下降的风险。

（5）期权、收益互换等金融衍生品投资的风险（如有）

个股期权、股指期权等金融衍生品和一般金融工具面临同样的流动性风险，同时因杠杆特性，较普通金融工具面临更大的市场风险，收益互换也较一般金融工具面临更大的信用风险。在交易这一类金融衍生品时，如果不能按照约定的期限清偿债务，或标的证券价格波动导致担保物价值与其金融衍生品债务之间的比例低于维持担保比例，且不能按照约定的时间、数量追加担保物时，将面临担保物被证券公司强制平仓的风险。可能出现金融机构降低授信额度，或者提高相关警戒指标、平仓指标，可能给该计划造成经济损失。另外，受贷款基准利率调高影响，金融机构可能相应调高融资利率，该计划将面临资金成本上升的风险。

（6）公募基金份额、货币基金、经证监会认可的比照公募基金管理的资管产品以及现金管理类产品的投资风险（如有）

本合同无法完全限定该计划所投资公募基金份额、货币基金、经证监会认可的比照公募基金管理的资管产品以及现金管理类产品导致的相关未知风险。

（7）信托计划、资管计划、私募基金等金融产品的投资风险

本计划如投资公募基金、银行理财产品、保险理财产品、信托计划、证券公司及其资管子公司资产管理计划、保险公司及其子公司资产管理计划、期货公司及其子公司资产管理计划、基金公司及其子公司资产管理计划、私募证券投资基金等，上述金融产品的投资结果将直接导致本计划投资的收益或亏损。上述金融产品及其对应的实际资产并未保管在本计划托管人处并已处于托管人实际控制之外，而是由计划管理人进行保管，上述产品及其对应的实际资产可能由于无托管人或其托管人或管理人（含本计划管理人和上述金融产品管理人）保管不善导致本计划受损。

本计划投资上述金融产品时，如因计划管理人未按约定及时向托管人提供上述所投金融产品的净值，有可能会造成本计划估值不及时或不准确，从而对计划投资者或计划资产造成损失。

本计划投资上述金融产品时，由于上述金融产品的开放日可能存在与本计划的开放日不一致的情形，从而对本计划的流动性造成一定不利影响。

本计划投资上述金融产品时，如因计划管理人未按监管要求履行穿透审核职责，可能导致上述金融产品的投资范围不符合监管要求和本计划合同投资范围的要求，可能导致本计划投资上述金融产品不符合嵌套层级的监管要求，从而对本计划财产造成一定不利影响。

（8）本计划主要投资于重庆市、四川省内下辖全区域国有城投平台发行的债券的风险

本资产管理计划主要投资于重庆市、四川省内下辖全区域国有城投平台发行的债券，存在投资标的地域集中，投资收益和风险受当地产业政策、经济发展等因素影响较大。存在计划投资区域较集中、流动性、投资风险无法分散的风险。

## 8、税收风险

契约式产品所适用的税收征管法律法规可能会由于国家相关税收政策调整而发生变化，投资者收益也可能因相关税收政策调整而受到影响。

## 9、其他风险

### （1）关联交易的风险

1) 投资者知悉并同意，本计划可投资于资产托管人管理的金融产品、资产管理人、资产托管人及其股东等关联方发行或承销的证券，租用资产管理人关联方提供的证券交易单元等，存在关联交易的风险。资产管理人承诺关联交易应按照市场通行的方式和条件进行，投资者认可此等关联交易情形的存在并自愿承担相关投资风险。

2) 投资者知悉，尽管资产管理人承诺谨慎勤勉地管理委托财产、公平对待各投资组合，本计划在投资和运作过程中可能会存在一些利益冲突情形，包括但不限于：资产管理人、资产托管人开展不同业务类型可能产生的利益冲突；资产管理人管理的其他资管产品（包括本计划投资经理管理的其他资管产品）基于各自投资策略需要可能与本计划存在相同、相似或相反的投资交易行为，或者在买卖同一只证券的时间上存在先后；其他可能产生利益冲突的情况等。该等利益冲突可能会不利于本计划，也可能使本计划在投资运作时暂时受限，进而可能会影响收益甚至发生损失等。投资者认可此等情形的存在并自愿承担相关投资风险。

此外，资产管理人可以在遵循法律法规和相关原则的前提下运用固有资金进行证券投资，该等投资也可能与本计划存在相同、相似或相反的投资交易行为，或者在买卖同一只证券的时间上存在先后，不排除可能影响或限制本计划的投资运作。投资者认可此等情形的存在并自愿承担相关投资风险。

### （2）操作或技术风险

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各环节操作过程中，因内部控制存在缺陷或者人为因素造成操作失误或违反操作规程等所引致的风险，例如，越权违规交易、欺诈、交易错误等风险。

技术风险：在资产管理计划的日常交易中，可能因为技术系统的故障或者差错而影响交易的正常进行或者导致投资者的利益受到影响。这种技术风险可能来自管理人、托管人、证券交易所、证券登记结算机构等。

## 10、相关机构的经营风险

### （1）管理人经营风险

按照我国金融监管法律规定，虽管理人相信其本身将按照相关法律的规定进行营运及管理，但无法保证其本身可以永久维持符合监管部门的金融监管法律。如在计划存续期间管理人无法继续经营资产管理业务，则可能会对资金管理计划产生不利影响。

### （2）托管人经营风险

虽托管人相信其本身将按照相关法律的规定进行营运及管理，但无法保证其本身可以永

久维持符合监管部门的金融监管法律。如在计划存续期间托管人无法继续从事托管业务，则可能会对资产管理计划产生不利影响。

### （3）证券经纪商及期货经纪商经营风险

按照我国金融监管法律规定，证券公司须获得中国证监会核准的证券经营资格方可从事证券业务。虽证券经纪商及期货经纪商相信其本身将按照相关法律的规定进行营运及管理，但无法保证其本身可以永久维持符合监管部门的金融监管法律。如在计划存续期间证券经纪商及期货经纪商无法继续从事证券业务，则可能会对资产管理计划产生不利影响。

### （4）运营服务机构风险

管理人委托运营服务机构履行资产估值和会计核算等职责，运营服务机构的服务能力、服务水平将直接影响前述各项职责的履行成效。在资产管理计划运作过程中，可能因运营服务机构估值错误等因素影响计划的运作效率进而影响收益水平。

## （三）本计划特定风险

### 1、电子签名方式签署合同的风险（如有）

若投资者采用电子签名的方式签署计划合同的，若发生网络系统故障等不可抗力事件导致投资者无法采用电子签名方式签署计划合同的，则投资者将面临计划认购/申购失败的风险。

### 2、分红时提取业绩报酬的风险（若有）

由管理人确认收益分配时间，通过分红时计提，解决管理人无法在存续期计提业绩报酬的难点。然而，所有投资者合计现金分红总额（或分红转投资），可能少于分红公告中的总额，部分依据合同约定作为业绩报酬归管理人所有，可能造成投资者误解。

### 3、净值波动风险

按照本合同约定的估值方法，当本计划投资于公募基金份额、货币基金、经证监会认可的比照公募基金管理的资管产品以及现金管理类产品，有如下情形之一时：

- （1）估值日无法及时获取上述投资品种的最新估值价格；
- （2）估值日取得的上述投资品种的最新估值价格没有或无法排除影响估值价格的因素（例如在估值日无法排除业绩报酬对估值价格的影响）；
- （3）按照预期收益率反应的估值价格与实际兑付的收益产生差异。

可能导致本计划的净值波动风险。

## （四）不可抗力等其他风险

战争、自然灾害等不可抗力因素的出现，将会严重影响市场的运行，可能导致资产管理计划财产的损失。

上述风险揭示内容仅为列举性质，未能详尽列明投资者参与我公司资产管理业务所面临的全部风险和可能导致资产损失的所有因素。投资者在签约前，应当认真阅读并理解相关业务规则、资产管理业务合同及相关风险揭示内容。管理人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。

## 第二十三节 资产管理合同的变更、终止与财产清算

### 一、合同变更的条件、程序

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。

非因法律、法规及有关政策发生变化的原因而导致合同变更时，可采用以下两种方式中的一种进行资产管理计划合同变更。

（一）全体投资者、管理人和托管人协商一致后，可对本合同内容进行变更，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，应当事先取得投资者同意。

（二）管理人、托管人首先就本合同拟变更事项达成一致。管理人就本合同变更事项在管理人网站发布征求意见公告。管理人须在公告后十五个工作日内以书面方式向投资者发送合同变更征询意见函（或通知）。投资者应在征询意见函（或通知）指定的日期内按指定的形式回复意见。投资者不同意变更的，管理人应在征询意见函（或通知）指定的日期内增设临时开放日，允许不同意变更的投资者退出本计划；投资者未在指定日期内回复意见或未在指定的日期内退出本计划的，视为投资者同意合同变更。变更事项自征询意见函（或通知）指定的日期届满的次工作日开始生效，对合同各方均具有法律效力。

除非另有约定，上述第（二）款中管理人发出的征询意见函（或通知）应以中文书面完成，征询意见函（或通知）被视为收到的日期依照本合同第二十八节“通知和送达”章节中的约定执行。

管理人应当合理保障合同变更后投资者选择退出资产管理计划的权利。

### 二、合同变更的备案

对资产管理合同任何形式的变更、补充，管理人应当在变更或补充发生之日起 5 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。

### 三、发生以下事项需要变更合同的处理方式、披露方式以及合同当事人的权利及义务：

（一）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，资产管理计划由其他管理人承接；

（二）托管人被依法撤销托管资格或者依法解散、被撤销、宣告破产，资产管理计划由其他托管人承接。

### 四、资产管理计划展期应符合以下条件：

（一）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；

（二）资产管理计划展期没有损害投资者利益的情形；

(三) 中国证监会规定的其他条件；

资产管理计划展期的，应当符合资产管理计划的成立条件。

## 五、合同终止的情形

资产管理计划合同终止的情形包括下列事项：

(一) 投资者委托资产发生权属变更等可能影响管理人资产管理业务正常运行的重大变更时，管理人有权提前终止合同；

(二) 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；

(三) 托管人被依法撤销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；

(四) 经全体投资者、管理人和托管人协商一致决定终止的；

(五) 集合资产管理合同的投资者人数持续五个工作日少于 2 人的；

(六) 未在证券投资基金业协会完成备案或不予备案的情形；

(七) 计划存续期满且不展期的；

(八) 法律、行政法规、中国证监会规定及资产管理合同约定的其他情形。

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（八）项约定的情形除外。

## 六、资产管理计划财产的清算

本合同终止时，应当按法律法规和本合同的有关规定对计划资产进行清算。自资产管理合同终止事由发生之日起 5 个工作日内，管理人应当组织计划财产清算小组对计划财产进行清算。管理人未按照合同约定及时组织清算组对计划财产进行清算，给计划财产或投资者造成损失的，管理人应承担赔偿责任。

### (一) 资产管理计划财产清算小组

1、资产管理计划终止，进入清算阶段后，由资产管理计划财产清算小组统一接管计划财产。

2、资产管理计划财产清算小组组成：资产管理计划财产清算小组成员由管理人、托管人指定的人员组成。资产管理计划财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

3、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。

### (二) 清算程序

1、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。

2、清算小组在本计划终止后 20 个工作日内编制计划财产清算报告，由管理人或募集机构按照投资者提供的联系方式或由管理人通过其公司网站告知投资者。投资者在此同意，上

述报告不再另行审计，除非法律法规或监管部门要求必须进行审计的。

3、清算小组根据计划财产清算报告完成清算财产的分配，本计划清算办理完毕。

4、除合同当事人三方另有约定外，计划财产期末移交采取现金方式。合同终止后，资产管理计划仍持有可流通非现金资产的，在 5 个交易日内（含合同终止日当日）由管理人进行强制变现处理；未变现资产于清算期间损益由全体投资者享有或承担。计划终止日至资产全部清算完毕之日期间，本计划继续计提托管费、运营服务费，其计提方法继续按照本合同的约定执行，其估值方法继续按本合同的规定计算；在此期间，本计划不再计提管理费。

### （三）清算费用

清算费用是指资产管理计划财产清算小组在进行计划清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由资产管理计划财产清算小组优先从资产管理计划财产中支付。清算费用包括但不限于：

- 1、聘请会计师、律师，以及其他工作人员所发生的报酬；
- 2、资产管理计划资产的保管、清理、估价、变现和分配产生的费用；
- 3、信息披露所发生的费用；
- 4、诉讼仲裁所发生的费用；
- 5、其他与清算事项有关的费用。

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

### （四）计划剩余财产的分配

依据资产管理计划资产清算的分配方案，管理人将资产管理计划资产清算后的全部剩余资产，按资产管理计划的投资者持有的计划份额比例进行分配。计划资产按下列顺序清偿：

- 1、支付清算费用。
- 2、交纳所欠税款。
- 3、支付代销费、管理人的业绩报酬（如有）、托管费和运营服务等计划相关费用。
- 4、清偿其他对外债务。
- 5、按投资者持有的计划份额比例进行分配。

如存在资产管理计划资产未能及时变现的，管理人应在清算报告中列明与未变现资产相关的估值方法、费用计提及分配方法等的处理程序。

计划资产未按前款 1、2、3、4 项规定清偿前，不分配给计划份额持有人。

（五）资产管理计划延期清算处理方式，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。

### （六）计划资产清算报告的告知安排

管理人编制清算报告交托管人复核后，由管理人向中国证监会备案，募集机构应向投资者履行告知义务。



（七）计划资产清算账册及文件由管理人保存 20 年以上。

#### 七、资产管理计划资产相关账户的注销

在衍生品类及权益类资产变现完毕、相关权益结清后 10 个工作日内，管理人将完成期货账户等投资所需账户注销并向托管人出具销户确认通知书。计划资产清算完毕后，托管人注销资产管理计划的托管账户等投资所需账户，管理人应给予必要的配合。

## 第二十四节 违约责任

一、资产管理合同当事人违反本合同，应当承担违约责任。给其他合同当事人造成损害的，应对受损方所遭受的直接损失依法承担赔偿责任。如属本合同当事人双方或多方当事人的违约，根据实际情况，由违约方分别承担各自应负的违约责任。

二、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。

#### 四、免责条款

管理人及托管人不就下列情形下委托财产遭致的损失承担任何责任：

（一）管理人及托管人按照中国证监会的规定或当时有效的法律法规的作为或不作为而造成的损失等；

（二）在没有欺诈或过错的情况下，管理人由于按照本合同规定的投资原则进行的投资所造成的损失等；

（三）在没有欺诈或过错的情况下，托管人由于按照管理人符合本合同约定的有效指令执行而造成的损失等；

（四）本合同任何一方应保证本合同规定必须由其提供的信息、数据真实完整，并承担相应的法律责任。但如果该当事人方提供的信息和数据不真实或不完整是由于本合同任何另一方提供的信息不完整和不真实所造成的，由此导致的后果由初始过错方承担，该当事人不承担违约责任。

（五）对于无法预见、无法抗拒、无法避免且在本合同签署之日后发生的不可抗力事件，导致协议当事人方无法全部履行或部分履行本合同的，任何一方当事人不承担违约责任，但是，协议各方当事人应当在合理行为能力范围内勤勉尽责，以降低此类事件对委托财产和其他当事人方的影响。

（六）托管人需根据被授权人预留印鉴和签名进行审查。本计划的托管人仅承担法定的以及本合同约定的相关责任及义务，管理人不得对托管人所承担的责任进行虚假宣传，不得含有虚假的内容或误导性陈述，不得以托管人名义或利用托管人商誉进行非法募集资金、承诺投资收益等违规活动，否则托管人有权解除合同，并向管理人追究违约责任和侵权责任。

（七）管理人承诺依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用计划财产。但

管理人不保证计划财产一定盈利，也不保证最低收益。因期货市场波动、上市公司合并、计划财产规模变动等管理人之外的因素致使计划财产投资不符合本合同项下约定的投资策略的，管理人将进行调整，并不因此承担任何责任。

（八）托管人对本计划项下的资产行使以下保管职责：计划存续期间存放于托管账户的资金；用于收益分配及清算而存放于托管账户的资金；由于投资从托管账户向各投资账户往来划拨的资金等。【本合同的履行涉及托管人赔偿责任的，托管人承担的全部累计赔偿数额上限不超过托管人本年度已经收取的托管费。】

（九）投资者应当事前就其关联证券或其他禁止交易证券等投资者自身违法违规原因明确告知管理人。

五、本合同所指损失均为直接损失。

## 第二十五节法律适用和争议的处理

有关本合同的签署和履行而产生的任何争议及对本协议项下条款的解释，均适用中华人民共和国法律法规（为本合同之目的，在此不包括香港、澳门特别行政区及台湾地区法律法规），并按其解释。

各方当事人同意，因本合同而产生的或与本合同有关的一切争议，合同当事人应尽量通过协商、调解途径解决。当事人不愿通过协商、调解解决或者协商、调解不成的，可以向管理人所在地或托管人注册地有管辖权的人民法院提起诉讼。

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。

## 第二十六节资产管理合同的效力

### 一、合同成立

资产管理合同是约定资产管理合同当事人之间权利义务关系的法律文件。投资者为法人的，本合同经投资者、管理人和托管人加盖公章或合同专用章以及三方法定代表人或授权代表签字或盖章之日起成立；投资者为自然人的，本合同经投资者本人签字、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或授权代表签字或盖章之日起成立。

### 二、合同生效

本合同生效应当同时满足如下条件：

- （一）本合同经投资者、管理人和托管人合法签署；
- （二）投资者认购资金实际交付并经管理人确认成功，投资者获得计划份额；
- （三）本计划依法有效成立，对本合同各方具有法律效力。

当满足上述合同生效的条件后，本合同生效。

### 三、合同签署

本合同可由当事人采取纸质合同方式签署或当事人通过符合《电子签名法》等法律法规、

监管规定有关要求的电子签名方式签署。电子签名与签署纸质合同具有同等法律效力。

#### （1）采用纸质合同方式签署

本合同采用纸质合同（包括套印版的纸质合同，可以由管理人或其选择的机构套印印刷）方式签署的，投资者为机构（法人或其他组织）的，本合同自当事人各方法定代表人或授权代表签字（或盖章）并加盖公章或合同专用章之日起成立。投资者为自然人的，本合同自投资者本人签字或授权代表签字、管理人和托管人加盖公章或合同专用章以及法定代表人或授权代表签字（或盖章）之日起成立。

本合同采用纸质合同方式签署的，亦可采用套印托管人或/及管理公章（或合同专用章）、法定代表人/执行事务合伙人或授权代表签字（或盖章）的套印版纸质合同方式与投资者进行签署，套印版纸质合同的生效及法律效力等同于管理人和托管人直接签署。

管理人负责保证募集行为合法合规性，投资者签署资管合同等法律文件的真实性、准确性、完整性。如因投资者签署合同等法律文件不真实不准确不完整、募集行为不合法合规导致的任何责任，由管理人自行承担。

资管合同一式叁份，当事人各执壹份，每份合同均具有同等的法律效力。管理人应当妥善保管并及时向托管人移交需由托管人保管的资管合同原件。

#### （2）采用电子签名方式签署

本合同采用电子签名方式签署的，自各方当事人以符合《电子签名法》等法律法规、监管规定有关要求的电子签名方式签署本合同之日起成立。

管理人负责确保签约系统得到托管人认可，并确保投资者签署本合同所使用的签约系统、电子签名符合《电子签名法》等法律法规、监管机关及自律组织的相关要求。管理人负责确保提供给托管人的电子数据信息的真实性、准确性、完整性、及时性和合法合规性。

三、本合同自生效之日起对投资者、管理人、托管人具有同等的法律约束力。

四、本合同有效期为资产管理计划合同生效日至资产管理计划合同终止日。

五、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。在资产管理计划存续期间，投资者自全部退出资产管理计划之日起，该投资者不再是资产管理合同的当事人。

## 第二十七节 保 密

一、本合同各方应就计划资产以及相关信息承担保密责任。除法律、法规的规定和监管部门要求外，未经对方书面同意，任何一方不得以任何方式披露或利用该信息。

二、在本合同终止后，各方当事人均应持续履行保密义务，保密义务不因本合同的解除、终止而终止。

## 第二十八节 通知和送达

一、合同各方应按照本合同中约定的各自的通讯方式，以专人、特快专递、传真、电子邮件等方式进行本合同项下相关事宜的通知和相关文件的送达。

二、通知在下列日期视为送达被通知方：

- （一）专人送达：被通知方在签收单或回执单上签收所示日；
- （二）邮寄送达：被通知方在签收单上或回执单签收所示日，若通知方自成功寄出之日起 5 个工作日内未收到被通知方回执或异议的视为已经送达；
- （三）传真：传真发送当日（通知方应电话确认传真发送成功）；
- （四）采用电子邮件送达的，以发出方电子系统显示成功发送之日视为送达之日。

三、一方通讯地址或联络方式发生变化，变化方应提前 5 个工作日以书面形式通知其他合同方；如果在合同终止前 1 个月内发生变化，变化方应提前 3 个工作日以书面形式通知其他合同方。

四、如果通讯地址或联络方式发生变化的一方，未将有关变化及时通知对方，除非法律另有规定，未通知方应对由此而造成的影响和损失承担责任。

## 第二十九节其他事项

如将来中国证监会等监管机构对资产管理合同的内容与格式有其他要求的，投资者、管理人和托管人应立即展开协商，根据中国证监会等监管机构的相关要求修改本合同的内容和格式。

本合同如有未尽事宜，由合同当事人各方按有关法律法规和规定协商解决。

对本合同的合同签署页、任何有效修改、补充均是本合同的有效组成部分，与本合同具有同等的法律效力。

本合同一式叁份，各方各执壹份，每份具有同等的法律效力。

（以下无正文）

特别提示：投资者务必确保填写的资料正确有效，如因填写错误导致的任何损失，管理人和托管人不承担任何责任）

投资者请填写：

（一）投资者信息

1、自然人

姓名：

证件名称：☐ 身份证 ☐ 永久居留证

证件号码：

通讯地址：\_\_\_\_\_ 邮编：\_\_\_\_\_

联系电话：\_\_\_\_\_ 电子邮箱：\_\_\_\_\_

2、法人或其他组织

名称：

统一社会信用代码：\_\_\_\_\_ 法定代表人或负责人：\_\_\_\_\_

住所：\_\_\_\_\_ 邮编：\_\_\_\_\_

联系人：\_\_\_\_\_ 联系电话：\_\_\_\_\_ 电子邮箱：\_\_\_\_\_

投资人授权之代理人：

证件名称：身份证 ☐ 军官证 ☐ 护照 ☐

证件号码：\_\_\_\_\_

通讯地址：\_\_\_\_\_ 邮编：\_\_\_\_\_

联系电话：\_\_\_\_\_ 电子邮箱：\_\_\_\_\_

（二）投资者根据自身实际情况从以下选项中作出选择（在符合的“☐”中打“√”）：

☐ 投资者是管理人；

☐ 投资者是管理人管理的其他资产管理计划；

☐ 投资者是管理人的董事、监事、高级管理人员、期货从业人员及其配偶；

☐ 投资者是管理人的董事、监事、高级管理人员、期货从业人员的父母、子女；

☐ 投资者是管理人的股东、实际控制人；

☐ 投资者与管理人存在其他关联关系（请补充填写）。

☐ 投资者与管理人无关联关系。

（三）产品信息

产品代码：\_\_\_\_\_

产品名称：XX 川渝 1 号集合资产管理计划

产品风险等级：R3（中等风险）

重要提示：本产品适合风险承受能力为 C3/C4/C5 的普通投资者及专业投资者投资。产品风险等级超过投资人风险承受能力或不匹配时不允许继续参与该资产管理计划。

(四) 投资者认购、参与

认购/参与金额：人民币（¥）\_\_\_\_\_元

（大写人民币）：\_\_\_\_\_元整。

(五) 投资者账户

投资者认购、参与计划的划出账户与退出计划的划入账户，必须为以投资者名义开立的同一个账户。

账户名称：

账号：

开户银行名称：

（本页无正文，为投资者与 XX 期货股份有限公司及中信建投证券股份有限公司签订的《XX 川渝 1 号集合资产管理计划资产管理合同》的签署页）

投资者（自然人本人签字）：

法定代表人或授权签字人：

签署日期：\_\_\_\_\_年\_\_\_\_月\_\_\_\_日

管理人：XX 期货股份有限公司

法定代表人或授权签字人：

签署日期：\_\_\_\_\_年\_\_\_\_月\_\_\_\_日

托管人：中信建投证券股份有限公司

法定代表人或授权签字人：

签署日期：\_\_\_\_\_年\_\_\_\_月\_\_\_\_日

## 附件 1：费用列表

费用项目	计费方式
管理人收取的年管理费率	0.7%
管理人收取的业绩报酬	业绩报酬计提时产品收益 7.5%以上部分提取 20%
托管人收取的托管费	0.02%/年
运营服务机构的运营服务费	0.02%/年
期货交易手续费	按期货经纪商标准收取
证券交易手续费	过户费、佣金、印花税等按证券经纪商标准收取
其他交易费用	按实际费用收取
<p>有关交易手续费的备注说明：</p> <p>1、本表中期货交易手续费包含交易所收取的费用，交易所收费标准以交易所通告为准；</p> <p>2、投资者保障基金按照中国证券监督管理委员会《关于期货交易所、期货公司缴纳期货投资者保障基金有关事项的规定》以及每年期货公司分类监管结果收取，本表中交易手续费不包含投资者保障基金；</p> <p>3、期货公司有权根据交易规则变化等新情况按照《资产管理合同》或与管理人签署的期货备忘录、结算服务协议等约定的通知方式与客户协商并确定交易手续费标准。如客户未在规定时间内提出回复，视为客户认可期货制定的交易手续费标准。</p>	

上述费用标准仅简要表述，具体详见本合同正文各章节。

投资者确认（签名/盖章）：

日期：\_\_\_\_\_年\_\_\_\_月\_\_\_\_日



## 附件 2：追加/退出申请表（请仔细阅读申请表后的提示！）

产品代码：_____ 名称：XX 川渝 1 号集合资产管理计划风险等级：R3			
投资者名称			
证件类型		证件号码	
证件有效期	_____ 至 _____	联系地址	
联系电话		电子邮箱	
<input type="checkbox"/> 追加/申购	追加/申购金额：小写（¥）_____元（填写须明确、大小写须一致） 大写（人民币）_____ <b>重要提示：本产品适合风险承受能力为 C3/C4/C5 的普通投资者及专业投资者投资。产品风险等级超过投资人风险承受能力或不匹配时不允许继续参与该资产管理计划。</b>		
<input type="checkbox"/> 退出/赎回	退出（赎回）份额：_____份 部分退出（赎回）时，是否接受部分比例确认或全部强制退出处理： <input type="checkbox"/> 是 <input type="checkbox"/> 否		
<b>投资者（或机构授权人）签署</b> 本人（机构）已知晓有关法律法规以及该产品的产品文件，保证所提供的资料真实、有效，并自愿遵守相关条款，自行承担投资风险。  <b>自然人（本人）签名：机构（指定授权人）签署：</b> <b>申请日期：年月日 申请日期：_____年____月____日</b>			
<b>投资者银行账户信息：</b> 账户名称： 账号：_____ 开户行：			
<b>免责声明：</b> 本公司对由于以下原因造成交易失败等后果不承担责任： 1、投资者应保证其依法有权投资本公司所管理或销售的产品，并且其用于投资本公司产品的资金来源合法，不存在任何瑕疵，否则由此引起的一切责任由投资者自行承担。 2、投资者应保证所填写的信息真实、完整、准确和有效。如有变化，投资者应及时联系本公司变更有关资料。因投资者未能及时变更有关资料导致的损失由投资者自行承担。 3、投资者未完全填妥有关交易所需的各项表单或未提交所需要的全部材料。 4、投资者应妥善保管交易证件和交易密码。任何使用个人投资者的证件、交易密码、机构投资者的预留印鉴等进行的交易操作均视为投资者所为，由此造成的结果由投资者承担。			
<b>注意事项：</b> 1、投资者应在本公司规定的交易时间内及时提交交易申请。 2、办理交易业务申请时，均需携带投资者（或经办人）有效身份证件及相关证明文件。 3、本申请的受理不表明投资者的申请得以确认，申请结果以登记机构确认结果为准。 4、投资者认购（参与）金额和退出（违约退出）份额应符合产品文件规定的数额限制。 5、投资者投资资管产品所需资金应在规定的时间前全额划入本公司指定的直销专户，否则视为无效申请。 6、投资者提交交易申请时，相应的产品及其份额应处于正常状态。 7、由于战争、自然灾害、通讯技术故障等不可抗力因素导致的损失由投资者自行承担。			