

资产管理合同编号：【】号

资产委托人编号：【】号

上海中期-誉享半年丰集合资产管理计划
资产管理合同

管理人：上海中期期货股份有限公司

托管人：国泰君安证券股份有限公司

期货资产管理计划风险揭示书

尊敬的投资者：

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

根据有关法律法规，资产管理人【上海中期期货股份有限公司】及投资者分别作出如下承诺、风险揭示及声明：

一、资产管理人声明与承诺

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

（三）资产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

本计划为【固定收益类资产管理计划】，投资于债券等债权类资产的比例不低于80%，投资者购买本计划，可能面临的风险，包括但不限于：本计划投资债券面临的利率、汇率变化等市场风险。利率与汇率直接影响着固定收益类品种的价格和收益率，影响着企业的融资成本和利润，本计划财产投资于固定收益品种，其收益水平会受到利率、汇率变化的影响。

1、资产管理合同与证券投资基金业协会合同指引不一致所涉风险

本计划合同按照证券投资基金业协会颁布的《集合资产管理计划资产管理合同内容与格式指引（试行）》等自律规则制定，但证券投资基金业协会颁布的合同指引仅为内容与格式指引，而非格式合同。合同指引某些具体要求对本计划确不适用的，资产管理人可对相应内容做出合理调整和变动，但资产管理人应在风险揭示书中向投资者进行特别揭示。因此本计划合同与基金业协会合同指引存在不能严格一致的风险，可能会影响计划的备案和正常投资运作。

2、资产管理计划委托募集所涉风险（如涉及）

本计划管理人委托基金销售机构代理销售募集计划份额，该基金销售机构应当具有基金销售业务资格并已成为证券投资基金业协会会员。如在计划募集期间基金销售机构无法继续从事基金代理销售服务，则可能会对计划产生不利影响。

本计划代销机构中从事资产管理计划募集业务的人员（下称“从业人员”）应当具有基金从业资格，应当遵守法律、行政法规和证券投资基金业协会的自律规则，恪守职业道德和行为规范，应当参加后续执业培训。如在本计划募集期间或存续期间，从业人员未能维持其基金从业资格的，或未能遵守法律、行政法规和中国基金业协会的自律规则、职业道德或行为规范，则可能会对本计划产生不利影响。

3、资产管理计划外包事项所涉风险（如涉及）

资产管理人可能将应属本机构负责的事项以服务外包等方式交由其他机构办理，因代办机构不符合金融监管部门规定的资质要求、或不具备提供相关服务的条件和技能、或因管理不善、操作失误等，可能给计划投资者带来一定的风险。

4、资产管理计划聘请投资顾问所涉风险（如涉及）

在本计划将参考投资顾问的投资建议进行投资，因此，投资顾问的管理水平、投资研究水平、风险识别能力等因素都会影响本计划的投资收益。

（1）道德风险

投资顾问可能泄露客户投资决策计划、传播虚假信息、进行关联交易、内幕交易等风险。

（2）投资研究能力风险

在投资顾问提供研究报告或研究建议时，由于投资顾问的知识、经验、判断、决策、技能的限制等，会影响其对信息的占有和对经济形势、证券价格走势的判断，从而影响研究建议水平的风险。

（3）投资建议执行风险

管理人在对投资顾问作出的研究报告和研究建议进行识别判断时，可能存在因自身投资研究或识别能力不足而错信投资顾问发出的研究报告和研究建议，从而导致投资亏损的风险。

若投资顾问建议违反法律法规、监管机构要求、资产管理合同约定的投资条款或资产管理人需遵循的公平交易等制度，或因资产管理合同约定的其他原因，资产管理人将可能不执行投资顾问投资建议，即投资顾问的投资决策可能在特定情况下无法实施，从而影响计划的投资收益。

（4）投资顾问参与风险

因为本计划并未设置对于投资者身份的筛选机制，因此在符合本计划合同要求的前提

下，投资顾问本身和投资顾问的高级管理人员、员工或其他和投资顾问有关联关系的机构、人员将可能参与本计划，此等行为可能加大投资顾问的道德风险。

5、资产管理计划份额转让所涉风险（如涉及）

委托人可通过现时或将来法律、法规或监管机构允许的方式办理本计划的份额转让业务，其转让地点、时间、规则、费用等按照办理机构的规则执行。如果份额转让因不符合法律法规或办理机构的规则未办理成功的，委托人需要自行承担相应风险和损失。

6、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

本计划成立后需在证券投资基金业协会进行备案。除非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外，资产管理计划在完成证券投资基金业协会备案前不得开展投资活动。

因此，即使本计划成立，并不意味着本计划必然能获得证券投资基金业协会的备案。而该等备案过程可能会受到相应监管政策的影响，包括备案所需时间、能否通过备案都存在一定的不确定性。

如果在计划成立后不能及时完成备案，将可能导致本计划错过市场行情或投资机会；如果本计划在成立后无法获得证券投资基金业协会的备案，则将直接影响本计划设立目的的实现。当出现无法通过证券投资基金业协会备案的情形，本计划提前终止，由此直接影响资产委托人参与本计划的投资目的。

（二）一般风险揭示

1、本金损失风险

资产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购/参与资金本金不受损失，也不保证一定盈利及最低收益。

计划风险收益特征：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，按照资产管理人对计划产品或者服务的风险等级划分，本计划属预期风险等级【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。

2、市场风险

金融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，导致本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。本计划财产如投资于债券与上市公司的股票，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。利率直接影响着固定收益类品种的价格和收益率，影响着企业的融资成本和利润。本计划财产投资于固定收益品种和股票，其收益水平会受到利率变化的影响。

（4）上市公司经营风险

上市公司的经营情况受多种因素影响，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。如果本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，极端情况下，其股票可能面临摘牌、退市的风险，使本计划财产投资收益下降。虽然本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

本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，从而使本计划财产的实际收益下降。

（6）再投资风险

再投资风险反映了利率下降对固定收益证券（包括存款）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，本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。

3、计划运营管理风险

资产管理人依据本计划合同约定管理和运用计划财产，可能限于知识、技术、经验等因素影响其对相关信息、经济形势的判断而影响委托财产的收益水平，投资者应充分知晓本计划投资运营的相关管理风险，并愿意自行承担由此可能引致的投资亏损。

4、流动性风险

（1）本计划预计存续期限为自计划成立之日起至满[10年]。本计划的申购和赎回的时间见资产管理合同的约定。

本计划存续期内，投资者由此可能面临资金不能退出带来的流动性风险。

根据实际投资运作情况，本计划有可能提前结束或延期结束，投资者可能因此面临委托

资金不能按期退出等风险。

（2）市场整体流动性风险

证券市场的流动性受到价格、投资群体等诸多因素的影响，在不同状况下，其流动性表现是不均衡的，具体表现为：在某些时期成交活跃，流动性非常好，而在另一些时期，则可能成交稀少，流动性差。在市场流动性出现问题时，本计划的操作有可能发生建仓成本增加或变现困难的情况。

（3）个券流动性风险

由于不同投资品种受到市场影响的程度不同，即使在整体市场流动性较好的情况下，一些单一投资品种仍可能出现流动性问题，这种情况的存在使得本计划在进行投资操作时，可能难以按计划买入或卖出相应数量的证券，或买入卖出行为对证券价格产生比较大的影响，增加投资成本。这种风险在出现期货合约和个券停牌和涨跌停板等情况时表现得尤为突出。

5、信用风险

本计划在交易过程可能发生交收违约，或者本计划所投资债券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致计划财产损失。信用风险主要来自于交易对手、发行人和担保人。在本计划财产投资运作中，如果管理人的信用研究水平不足，对信用产品或交易对手的信用水平判断不准确，可能使本计划财产承受信用风险所带来的损失。

6、募集失败风险

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

资产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后三十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。

7、税收风险

本计划投资运作过程中应承担的税费，按照法律、法规和国家有关部门的规定，将由本计划财产承担。按法律法规应由管理人作为纳税义务人的，由资产管理人以计划财产代为缴纳。本计划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。

本计划所适用的税收相关法律法规及具体执行方式因相关政策调整而发生变化，本计划管理人经与资产托管人协商一致并经由本计划管理人提前公告后，可直接对本计划合同中涉及的相关税收内容进行修改和调整。

如因税收政策调整等原因导致估值计提的税费与实缴税费不同,进而存在可能需要对计划净值进行估值调整的风险。

本计划清算后,如资产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,由资产管理人向计划投资者就补缴金额进行追索。

8、法律法规、监管政策、业务规则变更风险

本计划存续期内,立法机构、监管机构、行业协会、交易所、证券登记结算机构等可能对现行有效的法律、法规、规章、规范性文件、监管政策、行业规定、自律规则、业务规则等进行调整、修订、增删、废止、解释,或发布新的监管规范、行业规定等,则本计划合同及相关计划运作规则可能需进行相应的调整,可能对投资者权益产生影响。

9、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。如在本计划存续期间管理人无法继续经营资管业务,则可能会对本计划产生不利影响。

(2) 托管人经营风险

按照我国金融监管法律规定,托管人须获得中国证监会核准的证券投资基金托管资格方可从事托管业务。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具备托管资格。如在计划存续期间托管人无法继续从事托管业务,则可能会对本计划产生不利影响。

(3) 运营服务机构经营风险

按照我国金融监管法律规定,运营服务机构须获得基金服务资格。虽运营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具备基金服务资格。如在计划存续期间运营服务机构无法继续从事基金服务业务,则可能会对本计划产生不利影响。

(4) 证券经纪商经营风险

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无法继续从事证券业务,则可能会对本计划产生不利影响。

证券及期货经纪服务商由管理人自行聘任，管理人委托其向托管人提供计划参与证券、期货交易的相关数据及凭证。若因管理人、经纪服务商或交易所、登记公司、股转系统等原因导致托管人未能及时、完整、准确获得交易数据或凭证，影响托管人履行投资监督、估值核算、账目核对等职责的，可能造成委托人财产损失。

10、多次清算风险

因本计划持有流通受限证券、投资的产品封闭期（含限售期、锁定期）超过本计划存续期等原因导致本计划财产无法及时变现的，资产管理人需在对计划财产进行清算并先行分配已变现部分，待流通受限资产可以变现时，再完成剩余计划资产的变现操作，资产管理人可根据流通受限资产的具体情况多次变现，变现后多次清算。从而造成本计划存在二次、甚至多次清算的风险。

二次（或后续多次）清算基准日由管理人安排，原则上应为本计划全部非现金资产全部变现完成之日，因二次（或后续多次）清算基准日安排不合理导致的投资者纠纷由资产管理人负责解决。

7、投资特定投资品种具有的特定风险

7.1 港股通标的范围内的证券投资风险（如有）

1、交易标的风险。可以通过港股通买卖的股票存在一定的范围限制，且港股通股票名单会动态调整，计划可能面临因标的证券被调出港股通标的的范围而无法继续买入的风险。

2、交易额度风险。港股通业务试点期间存在每日额度限制。当日额度使用完毕的，计划将面临不能通过港股通进行买入交易的风险。

3、交易时间风险。只有沪、深、港三地均为交易日且能够满足结算安排的交易日才为港股通交易日，具体以上交所、深交所证券交易服务公司在其指定网站公布的日期为准，计划可能面临如上交所、深交所开市但联交所休市而无法及时交易造成的损失风险。

4、汇率风险。作为港股通标的的联交所上市公司股票以港币报价，以人民币交收，因港股通相关结算换汇处理在交易日日终而非交易日间实时进行，计划将面临的人民币兑港币在不同交易时间结算可能产生的汇率风险。

5、交易规则差异风险。港股通股票交收方式、涨跌幅限制、订单申报的最小交易价差、每手股数、申报最大限制、股票报价价位、权益分派、转换、行权、退市等诸多方面与内地证券市场存在诸多差异；同时，港股通交易的交收可能因香港出现台风或黑色暴雨等发生延迟交收。计划可能面临由于管理人不了解交易规则的差异而导致的风险。

6、交易通讯故障风险。港股通交易中如联交所与上交所、深交所证券交易服务公司之间的报盘系统或者通信链路出现故障，计划可能面临不能申报和撤销申报的风险。

7、分级结算风险。港股通交收可能发生因结算参与人未完成与中国结算的集中交收，导致计划应收资金或证券被暂不交付或处置；结算参与人对计划出现交收违约导致计划未能取得应收证券或资金；结算参与人向中国结算发送的有关计划的证券划付指令有误导致计划资产权益受损等；计划可能面临由于结算参与人未遵守相关业务规则导致计划资产利益受到损害的风险。

7.2 上市公司公开发行股票投资风险（如有）

1、本计划拟投资上市公司公开发行股票，存在如下风险：

（1）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、财务等都会导致公司盈利状况发生变化。如本计划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，从而使本计划投资的收益下降。

（2）流动性风险：证券市场受到市场行情、投资群体等诸多因素的影响，某些实际成交活跃、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或出现变现困难，对本计划投资造成不利影响。

（3）退市风险：根据相关法律法规和交易规则，上市公司股票可能面临退市风险。启动退市程序后可能出现股票价值大幅度下跌、流动性大幅度降低等状况，从而造成计划投资出现亏损。

2、若本计划拟投资于科创板股票，除了投资于上市公司公开发行股票风险以外，还存在如下风险：

（1）科创板企业所处行业和业务往往具有研发投入规模大、盈利周期长、技术迭代快、风险高以及严重依赖核心项目、核心技术人员、少数供应商等特点，企业上市后的持续创新能力、主营业务发展的可持续性、公司收入及盈利水平等仍具有较大不确定性，进而会影响到股票价格，给本计划的净值带来波动。

（2）科创板企业可能存在首次公开发行前最近3个会计年度未能连续盈利、公开发行并上市时尚未盈利、有累计未弥补亏损等情形，可能存在上市后仍无法盈利、持续亏损、无法进行利润分配等情形，从而导致本计划所持股票价格可能下跌，或者能够用于分配的利润减少，从而使产品投资的收益下降。

（3）科创板退市制度较主板更为严格，退市时间更短，退市速度更快；退市情形更多，新增了市值低于规定标准、上市公司信息披露或者规范运作存在重大缺陷导致退市的情形；执行标准更严，明显丧失持续经营能力，仅依赖与主业无关的贸易或者不具备商业实质的关联交易维持收入的上市公司可能会被退市。因此，本计划可能存在因所持个股遭遇非预期性的退市而给计划带来损失的风险。

（4）科创板股票竞价交易设置较宽的涨跌幅限制，首次公开发行上市的股票，上市后的前5个交易日不设涨跌幅限制，其后涨跌幅限制为20%，因此股价波动风险更大，从而导致本计划净值的波动。

7.3 上市公司非公开发行股票投资风险（如有）

本计划通过投资于定向增发类股票，受股票市场的波动影响较大；定向增发股票发行政策的变化对本计划投资标的的规模有较大影响。由于股票一级市场和二级市场在市场特性、交易机制、投资特点和风险特性等方面存在着一定的差别，具体风险包括：

1、一级市场申购违规风险：由于某只股票的一级市场申购中签率持续放大，使得管理人所持有的该股票的比例或份额超过了相关法律法规或合同的有关限制所导致的风险。

2、一级市场组合的市场风险：计划资产上市时跌破发行价的可能。

3、一级市场组合的流动性风险：计划资产因发行被冻结锁定，影响计划的流动性。主要体现为两种情况：大部分计划资产被冻结，计划需要现金进行新的申购；所持计划资产在可上市流动首日，出现大量变现，导致资产不能以较低成本变现。

7.4 转融通投资风险（如有）

1、证券出借交易可能存在的信用风险、市场风险、流动性风险、权益补偿风险、操作风险、政策风险、技术风险等各类风险。

2、证券出借后，无法在合约到期前提前收回出借证券，从而可能影响计划财产的使用。

3、证券出借期间，如果发生标的证券暂停交易或者终止上市等情况，计划可能面临合约提前了结或者延迟了结等风险。

4、计划出借的证券，可能存在到期不能归还、相应权益补偿和借券费用不能支付等风险。

8、净值波动风险（如有）

本计划可能投资于公开募集基金、信托计划、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、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、于中国证券投资基金业协会官方网站公示已登记的管理人发行的私募基金等产品，投资上述产品出现如下情形之一时，将可能导致本计划出现净值波动风险：

1、估值日无法及时获取上述投资品种的最新估值价格；

2、投资上述品种后无法及时确认，上述投资品种在投资确认前估值价格波动；

3、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）。

9、关联交易风险（如有）

资产管理人可运用计划财产买卖资产管理人、资产托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司发行的证券或承销期内承销的证券；或上述主体直接或间接管理或代理销售的、或提供客户服务的、或者该等主体持有的符合本计划合同投资范围规定的投资产品。资产管理人亦可与资产管理人、资产托管人及其关联方或者与上述主体有其他重大利害关系的主体进行融资融券（如有）、收益互换（如有）、场外期权（如有）等交

易。投资者签署本计划合同即表明其已经知晓并同意本计划可能进行上述关联交易。

投资者不得因本计划进行上述关联交易或投资收益劣于资产管理人、资产托管人及其关联方管理的其他类似投资产品,而向资产管理人或资产托管人提出任何损失或损害补偿的要求。

10、资产管理计划设置份额持有人大会所涉风险

本计划设置份额持有人大会机制,请投资者理解并特别关注以下事项:

(1) 持有人大会仅在出现或需要决定资管合同约定的特定事由的情况下召开,不能取代管理人的管理工作、托管人的托管工作,份额持有人大会不得也不能通过持有人大会直接参与或者干涉计划的日常投资、托管活动;

(2) 份额持有人大会召集应于会议召开前 **10** 个工作日通知全体份额持有人,并需履行资管合同约定的表决程序,存在不能及时满足议事需求的可能性;

(3) 虽然份额持有人持有的每一资产管理计划份额拥有平等的投票权,但份额持有人大会的决议遵循多数表决的生效原则,其表决结果可能与份额持有人个别的利益诉求不同;

(4) 份额持有人大会决议须经出席会议的份额持有人所持表决权的 **2/3** 以上(含 **2/3**)通过方为有效,在决议生效前,议案存在不通过的可能性,资管计划后续的投资运作因此而存在相对不确定性;

(5) 依据份额持有人大会机制设置,特定事项可由资产管理人自行决定或由资产管理人和资产托管人协商后修改,不需召开资产管理计划份额持有人大会,请投资者特别关注此类事项。

11、本计划的产品架构风险

本计划不分级,不存在优先级份额和劣后级份额的结构化计划份额设计,无特殊架构。本计划的所有计划份额享有同等的收益分配权。

12、其他风险

(1) 顺延或暂停赎回风险

市场剧烈波动或其他原因可能导致发生本计划合同约定的巨额赎回的情形,资产管理人为了应对市场可能的流动性不足及降低资产变现损失,可能对资产委托人的赎回申请采取部分延期赎回的处理,资产委托人将因此面临赎回款项延迟到账的流动性风险。

(2) 合同变更风险

在合同变更安排中,可能存在但不限于以下潜在风险:

本计划合同约定计划份额持有人若未在约定或指定时间内以约定方式表示意见,视为

持有人同意合同变更。在此情况下，资产委托人对默认情况的忽略或误解，可能存在潜在风险。

计划份额持有人可能因未提供有效的联系方式或者未将变动后的联系方式及时通知资产管理人，而无法及时获知本计划合同变更事项，从而存在风险。

（3）提前终止风险

发生本计划合同约定情形或其他法定情形时，管理人将提前终止本产品，可能造成委托人投资本金或收益损失。

（4）战争、自然灾害、系统故障等不可抗力因素的出现，将会严重影响证券市场的运行，可能导致本计划财产的损失；金融危机、行业竞争、代理商违约等超出管理人和托管人自身直接控制能力之外的风险，也可能导致委托人利益受损。

（5）在本计划财产管理运作过程中，对主要业务人员如本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证券市场等判断有误、获取的信息不全等影响本计划的收益水平。管理人管理水平、管理手段和管理技术等对本计划收益水平存在影响。

（6）在本计划财产管理运作过程中，相关当事人在业务各环节操作过程中，因内部控制存在缺陷或者人为因素，可能造成操作失误或违反操作规程等引致的风险。

（7）电子签名方式签署合同的风险

本资产委托人如采用电子签名的方式签署资产管理合同。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资产管理合同的，则投资者将面临计划认购/申购失败的风险。

（8）估值风险

如本计划投资交易所上市的固定收益品种（除可转换债券、可交换债券外），以及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，按照本计划合同约定的估值方法为采用第三方机构（中证指数有限公司、中债金融估值中心有限公司）提供的估值价格确定公允价值，但上述第三方机构提供的估值价格与该品种当日的实际交易价格仍可能存在偏差，可能导致本计划估值存在偏差的风险。

（9）诉讼、仲裁相关风险

在本计划财产管理运作过程中，本计划发起或针对本计划、或针对本计划所投项目而发起的诉讼、仲裁或其他司法或行政程序的费用，与该等诉讼、仲裁或程序相关的律师费、案件受理费、诉讼费、仲裁费、财产保全费，以及行使由此产生的任何权利所发生的费用均由本计划财产承担，可能导致委托人利益受损。

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/机构做出以下陈述和声明，并确认其内容的真实和正确（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）：

1、本人/本机构已仔细阅读资产管理计划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/本机构知晓，管理人、代理销售机构、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、在购买本资产管理计划前，本人/本机构已符合《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代理销售机构的要求提供相关证明文件；具有相应的风险识别能力和风险承受能力，投资资金来源合法，没有非法汇集他人资金、使用贷款、发行债券等筹集的非自有资金投资本资产管理计划。【_____】

4、本人/本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/本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/本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/本机构已认真阅读并完全理解资产管理合同第二十一节“资产管理计划的费用与税收”中的所有内容。【_____】

8、本人/本机构已认真阅读并完全理解资产管理合同第二十七节“争议的处理”中的所有内容。【_____】

9、本人/本机构已经配合资产管理人或其代理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/本机构知晓，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/本机构承诺本次投资行为是为本人/本机构购买（参与）资产管理计划。【_____】

12、本人/本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/本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。【_____】

14、本人/本机构承诺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，不存在任何重大遗漏或误导。【_____】

15、本人/本机构承诺在参与本资产管理计划的投资过程中，如因存在欺诈、隐瞒或其他不符合实际情况的陈述所产生的一切责任，由本人/本机构自行全部承担。【_____】

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本计划投资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。

投资者在参与本计划投资前，应认真阅读并理解资产管理业务相关业务规则、本计划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，能够承受本计划投资风险。

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本计划投资的全部风险和损失。

投资者（自然人签字或机构盖章）：

日期：

管理人（盖章）：

日期：

销售机构经办人（签字）：

日期：

资产合法性及投资者适当性承诺书

本人/本机构以真实身份委托上海中期期货股份有限公司运用委托资产进行投资。本人/本机构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。上海中期期货股份有限公司有权要求本人/本机构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/本机构愿意配合。

本人/本机构符合期货公司资产管理业务合格投资者相关标准，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，投资于单只资产管理计划不低于一定金额且符合下列相关标准的自然人、法人或者其他组织：

（一）具有 2 年以上投资经历，且满足下列三项条件之一的自然人：家庭金融净资产不低于 300 万元，家庭金融资产不低于 500 万元，或者近 3 年本人年均收入不低于 40 万元；

（二）最近 1 年末净资产不低于 1000 万元的法人单位；

（三）依法设立并接受国务院金融监督管理机构监管的机构，包括证券公司及其子公司、基金管理公司及其子公司、期货公司及其子公司、在证券投资基金业协会登记的私募资产管理人、商业银行、金融资产投资公司、信托公司、保险公司、保险资产管理机构、财务公司及中国证监会认定的其他机构；

（四）接受国务院金融监督管理机构监管的机构发行的资产管理产品；

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

（六）中国证监会视为合格投资者的其他情形。

本人/本机构未被法律、法规或监管机构限制参与期货资产管理业务。

本人/本机构将严格遵守以上承诺，否则上海中期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，上海中期期货股份有限公司还有权依法限制本人/本机构退出该委托资产。本人/本机构承担因此造成的全部损失和法律责任。

资产委托人（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

目录

期货资产管理计划风险揭示书.....	1
资产合法性及投资者适当性承诺书.....	14
第一节前言.....	16
第二节释义.....	17
第三节承诺与声明.....	19
第四节当事人的权利与义务.....	21
第五节资产管理计划基本情况.....	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与备案.....	30
第八节资产管理计划份额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.....	38
第十节资产管理计划份额的登记.....	40
第十一节资产管理计划的投资.....	41
第十二节投资顾问.....	45
第十三节分级安排（如有）.....	46
第十四节利益冲突及关联交易.....	46
第十五节投资经理的指定与变更.....	46
第十六节资产管理计划的财产.....	47
第十七节投资指令的发送、确认和执行.....	49
第十八节交易及清算交收安排.....	52
第十九节越权交易的界定.....	54
第二十节资产管理计划的估值与会计核算.....	56
第二十一节资产管理计划的费用与税收.....	60
第二十二节收益分配.....	64
第二十三节信息披露.....	65
第二十四节风险揭示.....	68
第二十五节资产管理合同的变更、终止与财产清算.....	68
第二十六节违约责任.....	72
第二十七节争议的处理.....	74
第二十八节资产管理合同的效力.....	74
第二十九节其他.....	74
附件 1：投资监督事项表.....	79

第一节前言

为规范资产管理业务的运作，明确资产管理合同各方当事人的权利与义务，充分保护合同各方当事人的合法权益，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》（以下简称“《基金法》”）、《中华人民共和国民法典》、中国人民银行、中国银行保险监督管理委员会、中国证券监督管理委员会、国家外汇管理局联合发布的《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》（以下简称“《指导意见》”）、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》（以下简称“《管理办法》”）、《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》（以下简称“《运作规定》”）、《期货交易管理条例》、《集合资产管理计划资产管理合同内容与格式指引（试行）》等相关法律、法规规定，管理人、托管人、委托人在平等自愿、诚实信用原则的基础上订立本合同。

管理人承诺将就资产管理计划的设立、变更、展期、终止、清算等行为向中国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。

中国证券投资基金业协会接受资产管理计划的备案不能免除管理人按照规定真实、准确、完整、及时地披露资产管理计划信息的法律责任，也不代表中国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。

第二节 释义

除非特别说明，本合同中所使用的表述含义如下：

- 1、资产管理人、管理人：指【上海中期期货股份有限公司】；
- 2、资产管理计划、本计划：指【上海中期-誉享半年丰集合资产管理计划】；
- 3、委托人、投资者：指签订本合同，委托投资本资产管理计划的初始金额不低于本合同约定，且能够识别、判断和承担相应投资风险的自然、法人或其他组织；
- 4、资产托管人、托管人：指国泰君安证券股份有限公司；
- 5、本合同、资产管理合同：指委托人、托管人和管理人签署的【《上海中期-誉享半年丰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补充及变更；
- 6、资产管理业务：指管理人接受投资者委托，对受托的投资者财产进行投资和管理的金融服务；
- 7、运营服务机构：指接受管理人委托，根据与其签订的运营外包服务协议中约定的服务范围，为本计划提供【份额注册登记、计划估值】等服务的机构，本计划的运营服务机构为【国泰君安证券股份有限公司】；
- 8、份额登记机构：本计划的份额登记机构为【国泰君安证券股份有限公司】；
- 9、委托财产：指投资者拥有合法所有权或处分权、委托管理人进行管理或处分并由托管人进行托管的作为本合同标的的资产；
- 10、计划资产、计划财产：委托人拥有所有权或合法处分权、委托管理人进行管理或者处分并由资产托管人进行托管的作为本合同标的的资产及其投资运作所产生的收益；
- 11、直销募集账户：指本计划募集期开始前为本计划资产在商业银行开立的专门账户，用于接受资产委托人的委托资金，以及账户内资金与托管账户、委托人收益账户及管理人（或管理人指定的代理销售机构）账户的定向划转；
- 12、托管账户：指托管人为计划财产在商业银行开立的银行专用结算账户，用于计划财产中现金资产的归集、存放与支付，该账户不得存放其他性质资金；
- 13、资产管理产品：指《指导意见》规定的资产管理产品，包括但不限于人民币或外币形式的银行非保本理财产品，资金信托，证券公司、证券公司子公司、基金管理公司、基金管理人子公司、期货公司、期货公司子公司、保险资产管理机构、金融资产投资公司发行的资产管理产品等；
- 14、计划资产总值：指本计划拥有的各类有价证券、银行存款本息、证券交易结算资金、期货保证金、各种应收款项及其他资产的价值总和；
- 15、计划资产净值：指计划资产总值减去负债后的价值；
- 16、份额净值：指计算日计划资产净值除以计算日计划份额总数所得的数值；

17、计划份额累计净值：指本计划份额净值加上本计划历史上累计单位派息金额；

18、不可抗力：指合同各方不能预见、不能避免、不能克服的客观情况，包括但不限于洪水、火灾、地震及其它自然灾害、战争、骚乱、突发性公共卫生事件、政府征用、没收、突发停电或其他突发事件，政策法规的修改或监管要求调整等情形，非因管理人或托管人自身原因导致的技术系统出现重大故障、停止运作或瘫痪等技术异常事故，期货交易所非正常暂停或停止交易等。因中国人民银行银行间结算系统出现故障导致银行间的结算无法进行的情形，因电信服务商原因导致资金划付的网络中断、无法使用的情形，构成不可抗力事件；

19、管理费：指管理人因管理计划资产而向委托人收取的费用；

20、托管费：指托管人因保管计划资产而向委托人收取的费用；

21、管理人业绩报酬：指管理人以计划资产收益作为计提基数，按照资产管理合同规定的计算比例和方式收取的费用；

22、工作日、交易日：指上海证券交易所、深圳证券交易所共同的正常交易日；

23、T日：指本计划在规定的时间内受理资产委托人参与、退出等业务申请及其他与本资产计划有关事项发生的日期；

24、T+n日：指T日后的第n个工作日（n为整数），当n为负数时表示T日前的第n个工作日；

25、初始销售期间：指计划份额发售之日起至初始计划资产转入本计划托管账户前一工作日；

26、存续期：指本资产管理计划成立日起至终止日止；

27、资产管理计划开放日、开放日：指管理人办理资产管理计划份额参与和/或退出业务的工作日；

28、估值日：指由管理人【或运营服务机构】对计划资产进行估值并计算计划资产净值的实际日期；

29、估值核对基准日：指本合同约定的本计划管理人或接受管理人委托进行估值服务的运营外包机构与本计划托管人需要对当日估值结果进行核对的基准日期；

30、成立日：指管理人在取得验资报告后，向资产委托人及资产托管人及运营服务机构公告的资产管理计划成立之日。本计划成立日以管理人公告上记载的具体日期为准；

31、终止日：满足本合同约定的计划终止条件的当日；

32、清算日：指管理人依据本合同约定向托管人发送的告知本计划终止的通知中所载明的清算日期，其中计划首个清算日指上述通知中所载明清算期间段的起始日；

33、认购：指在资产管理计划初始销售期间，委托人按照本合同的约定购买本计划份额的行为；

34、参与：指在资产管理计划开放日，委托人按照本合同的约定购买本计划份额的行为；

35、退出：指在资产管理计划开放日，委托人按照本合同的约定将本计划份额兑换为现

金的行为；

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

37、证监会、中国证监会：指中国证券监督管理委员会；

38、基金业协会、证券投资基金业协会：指中国证券投资基金业协会；

39、证券交易所：指上海证券交易所、深圳证券交易所、香港联合交易所；

40、期货交易所：指中国金融期货交易所、郑州商品交易所、上海期货交易所、大连商品交易所、上海国际能源交易中心；

41、新三板：指全国中小企业股份转让系统；

42、投资顾问：指根据本资产管理合同及其他相关协议，为本资产管理计划提供涉及投资策略、投资决策、投资指令、交易安排等方面的建议或意见的机构。本计划的投资顾问为【上海瞰瞻资产管理有限公司】。

第三节 承诺与声明

（一）管理人的承诺与声明

1、管理人是依法设立的证券期货经营机构，并具有资产管理业务资格；

2、管理人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；

3、管理人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；

4、管理人按照《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；

5、管理人承诺遵守法律、行政法规和中国证监会等有关规定，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；

6、管理人声明禁止本公司员工以个人名义接受委托人资产管理委托或对委托人作出最低收益和分担损失的承诺。

（二）托管人的承诺与声明

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、托管人承诺按照《基金法》恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则安全保管委托财

产，履行信义义务以及本合同约定的其他义务；

3、托管人承诺根据法律法规、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；

4、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。

5、资产托管人承诺，其同时作为本计划的运营服务机构，已通过系统、人员、办公场所的独立设置实现托管职能和运营服务职能的分离，能够识别、管理和监控潜在的利益冲突。

（三）委托人的承诺与声明

1、委托人具有合法的参与资产管理业务的资格，符合《运作规定》合格投资者的要求；

2、委托人承诺以真实身份参与资产管理业务，保证提供给管理人或代理销售机构有关投资目的、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、准确、完整、合法，不存在任何虚假陈述、重大遗漏或误导。如前述信息资料发生任何实质性变更，应当及时书面告知管理人或代理销售机构；

3、委托人保证委托财产的来源及用途合法，符合有关反洗钱法律、法规的要求，委托财产中没有违反规定的公众集资，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；

4、委托人签署和履行本合同系其真实意思表示。资产委托人为法人或依法成立的其他组织的，其已经按照其章程或者其它内部管理文件的要求取得合法、有效的授权，且不会违反对其有约束力的任何合同和其他法律文件；资产委托人已经或将会取得签订和履行本合同所需的一切有关批准、许可、备案或者登记；资产委托人保证没有任何其他限制性条件妨碍管理人和托管人对该财产行使相关权利且该权利不会为任何其他第三方所质疑；

5、委托人已充分理解资产管理合同全文，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应对资产管理计划的收益状况或本金不受损失作出任何承诺，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；

6、委托人声明，已完全知悉本计划投资顾问就本计划涉及投资策略、投资指令、交易安排等方面向管理人提供投资建议及意见，在符合法律法规、监管规定和本合同约定的前提下，管理人参考投资顾问的投资建议及意见进行投资。委托人签署本合同投资本计划将视为认可并接受本计划的上述安排。

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

第四节 当事人的权利与义务

本计划设定为均等份额。除资产管理合同另有约定外，每份计划份额具有同等的合法权益。

（一）委托人的权利与义务

委托人的相关信息详见本合同文末《委托人信息表》。

本合同如采用电子方式签署，则委托人的详细信息在电子签名合同数据电文中列示。

1、委托人享有以下权利：

- （1）分享资产管理计划财产收益；
- （2）取得分配清算后的剩余资产管理计划财产；
- （3）按照本合同的约定参与、退出和转让资产管理计划份额；
- （4）根据本合同的规定，参加或申请召集资产管理计划份额持有人大会，行使相关职权，本计划不设置份额持有人大会的除外；
- （5）按照法律法规及本合同约定的时间和方式获得资产管理计划的信息披露资料；
- （6）监督管理人、托管人履行投资管理及托管义务的情况；
- （7）法律法规、中国证监会及证券投资基金业协会规定的和资产管理合同约定的其他权利。

2、委托人负有以下义务：

- （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）除公募资产管理产品外，以合伙企业、契约等非法人形式直接或者间接投资于资产管理计划的，应向管理人充分披露实际投资者和最终资金来源；
- （4）认真阅读并签署风险揭示书；
- （5）按照资产管理合同约定支付资产管理计划份额的参与款项，承担资产管理合同约定的管理费、业绩报酬（如有）、托管费、运营外包服务费（如有）、投资顾问费（如有）、审计费、税费等合理费用；
- （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）向管理人或资产管理计划代理销售机构提供法律法规规定的信息资料及身份证明文件，配合管理人或其代理销售机构完成投资者适当性管理、非居民金融账户涉税信息尽职调查、反洗钱等监管规定的工作；
- （8）不得违反资产管理合同的约定干涉管理人的投资行为；
- （9）不得从事任何有损资产管理计划及其投资者、管理人管理的其他资产及托管人托

管的其他资产合法权益的活动；

(10) 保守商业秘密，不得泄露资产管理计划的投资计划、投资意向等；不得利用资产管理计划相关信息进行内幕交易或者其他不当、违法的证券期货业务活动；

(11) 主动向管理人及/或代理销售机构核实销售人员的身份，确认其是否可以代表管理人/代理销售机构办理本计划的销售事宜。

(12) 确保其资金来源合法，不存在利用本资产管理计划，以实施违反《中华人民共和国证券法》、《上市公司收购管理办法》、《上市公司信息披露管理办法》等法规监管要求的行为。

(13) 承诺对其自身重大过失、故意导致资产管理人受到的行政处罚、民事追偿等损失进行补偿。

(14) 在向资产管理人提供的各种资料、信息、联系方式发生变更时，及时通知资产管理人。

(15) 协助资产管理人和资产托管人办理资产管理业务相关账户设立、变更及注销手续。

(16) 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) 资产管理人的权利与义务

名称：【上海中期期货股份有限公司】

住所：【中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 1701 号】

联系人：【李宁】

通讯地址【上海市浦东新区世纪大道 1701 号中国钻石交易中心 13 楼 B 座】

联系电话：【021-61090839】

1、资产管理人享有以下权利：

(1) 按照资产管理合同约定，独立管理和运用资产管理计划财产；

(2) 按照资产管理合同约定，及时、足额获得管理人管理费用及业绩报酬（如有）；

(3) 按照有关规定和资产管理合同约定行使因资产管理计划财产投资所产生的权利；

(4) 根据资产管理合同及其他有关规定，监督托管人，对于托管人违反资产管理合同或有关法律法规规定、对资产管理计划财产及其他当事人的利益造成重大损失的，应当及时采取措施制止，并报告中国证监会相关派出机构及证券投资基金业协会；

(5) 自行提供或者委托经中国证监会、证券投资基金业协会认定的服务机构为资产管理计划提供募集、份额登记、估值与核算、信息技术系统等服务，并对其行为进行必要的监督和检查；

(6) 有权获得投资顾问的投资建议服务，并对其提供的投资建议有审议、修改和最终决策权；

(7) 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；

(8) 要求委托人提供与其身份、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，及时要求委托人提交变更后的相关文件与资料，并对委托人适当性进行审慎评估。

(9) 资产管理人有权委托第三方机构作为运营服务机构为本计划提供份额登记、资产估值等服务，资产管理人与运营服务机构另行签署外包服务合同，对相关权利、义务进行约定。

(10) 资产管理人有权根据市场情况对本资产管理计划的总规模、单个委托人首次认/申购及持有的本资产管理计划总金额限制进行调整。

(11) 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。

2、资产管理人负有以下义务：

(1) 依法办理资产管理计划的销售、登记、备案事宜；

(2) 按照证券投资基金业协会要求报送资产管理计划产品运行信息；

(3) 按照诚实信用、勤勉尽责的原则履行受托人义务，管理和运用资产管理计划财产；

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

(5) 制作风险揭示书，向投资者充分揭示相关风险；

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

(7) 建立健全的内部管理制度，保证本资产管理计划财产与其管理的其他资产管理计划财产、管理人的固有财产相互独立，对所管理的不同财产分别管理，分别记账，分别投资；聘请投资顾问的，应制定相应利益冲突防范机制；

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

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

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

(11) 除规定情形或符合规定条件外，不得为管理人、托管人及其关联方提供融资；

(12) 按照资产管理合同约定接受投资者和托管人的监督；

(13) 以管理人的名义，代表投资者利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；

(14) 召集资产管理计划份额持有人大会，本计划不设份额持有人大会或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（如涉及），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) 管理人应确保本计划宣传资料真实、准确、完整，不得进行虚假宣传。管理人制作的宣传材料涉及托管人的，仅可表述为“国泰君安证券为本产品的托管人”，不得以托管人名义进行任何其他宣传，托管人有权对管理人及本计划宣传材料进行检查，管理人违反上述约定的，托管人有权向管理人追责；
- (28) 本合同的签署采用纸质合同的方式进行的，应妥善保管并按托管人要求，于合同签署完成后的 60 日内，及时向托管人移交委托人签署的合同原件；
- 本合同的签署采用电子签名的方式进行的，应确保委托人使用管理人、代理销售机构或其委托的具备相应资质的第三方认证机构颁发的有效的数字证书以电子签名方式签订本合同。管理人应确保委托人签订本合同所使用的电子签名符合《中华人民共和国电子签名法》等法律法规、监管规定的相关要求。
- 委托人完成本合同签署后，管理人、代理销售机构应当按托管人要求的格式、内容和方式向托管人发送委托人签订本合同的相关电子数据信息（以下简称“电子数据信息”），包括且不限于委托人身份信息、签约序列号、签约时间、电子协议版本号等。管理人或代理销售机构应对向托管人发送的电子数据信息的真实性、准确性和完整性负责。
- 托管人收到的电子数据信息应符合法律法规、监管规定和托管人向管理人或代理销售机

构提出的文件保存要求，且该等电子数据信息能够有效地表现所载内容，能够可靠地保证自最终形成时起内容保持完整、未被更改，并可供托管人随时调取查用。如托管人要求管理人或代理销售机构提供带有投资者电子签名的本合同电子签署信息的，管理人或代理销售机构应按照托管人的要求及时提供；

(29) 不得违反金融监督管理部门的规定，通过为单一融资项目设立多个资产管理计划的方式，变相突破投资人数限制或者其他监管要求；

(30) 不得为其他金融机构的资产管理产品提供规避投资范围、杠杆约束等监管要求的通道服务；

(31) 不得以受托管理的资产管理计划份额进行质押融资，放大杠杆；

(32) 识别本计划的投资者和所投资标的。本计划存续期内，资产委托人包含其他资产管理产品的，本计划不得进行转委托，不得再投资公募证券投资基金以外的资产管理产品；

(33) 资产管理计划投资于其他资产管理产品的，所投资的资产管理产品不得再投资除公募证券投资基金以外的其他资产管理产品；

(34) 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。

(三) 资产托管人

名称：国泰君安证券股份有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区商城路 618 号

联系人：【丛艳】

通讯地址：【上海市新闻路 669 号博华广场 19 楼】

联系电话：【021-38677336】

1、资产托管人享有以下权利：

(1) 按照资产管理合同约定，依法保管资产管理计划财产；

(2) 按照资产管理合同约定，及时、足额获得资产管理计划托管费用；

(3) 按照相关法律法规的规定和本合同约定，根据《投资监督事项表》行使投资监督权利。发现管理人的投资运作违反法律、行政法规规定或本合同《投资监督事项表》的约定时，有权拒绝执行投资指令或进行事后提示并要求管理人改正；管理人未能改正或者造成委托财产损失的，有权报告监管机构；

(4) 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。

2、资产托管人负有以下义务：

(1) 按照资产管理合同约定安全保管资产管理计划财产；

(2) 除依据法律法规规定和资产管理合同的约定外，不得为托管人及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管资产管理计划财产；

- (3) 对所托管的不同财产分别设置账户，确保资产管理计划财产的完整与独立；
- (4) 公平对待所托管的不同财产，不得从事任何有损资产管理计划财产及其他当事人利益的活动；
- (5) 按规定开立和注销资产管理计划的托管账户及其他投资所需账户；
- (6) 复核资产管理计划资产净值和份额净值；
- (7) 办理与资产管理计划托管业务有关的信息披露事项；
- (8) 根据相关法律法规和资产管理合同约定，复核管理人编制的资产管理计划财产的定期报告，并出具书面意见；
- (9) 编制托管年度报告，并向证券投资基金业协会备案，抄报中国证监会相关派出机构；
- (10) 按照法律法规要求和资产管理合同约定，根据管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；
- (11) 管理人未按规定召集或者不能召集份额持有人大会的，由托管人召集份额持有人大会，份额持有人大会设立日常机构的除外；
- (12) 保守商业秘密，除法律法规、本合同及其他有关规定另有要求外，不得向他人泄露；
- (13) 根据法律、行政法规和中国证监会的规定保存资产管理计划的会计账册，妥善保存有关的合同、协议、交易记录等文件资料，保存期限自资产管理计划终止之日起不得少于 20 年；
- (14) 依据法律、行政法规规定和本合同《投资监督事项表》（附件一）的约定，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、行政法规规定和本合同《投资监督事项表》的约定，应当拒绝执行，立即通知管理人并有权报告中国证监会相关派出机构和证券投资基金业协会；
- (15) 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 资产管理计划基本情况

- (一) 资产管理计划的名称：**【上海中期-誉享半年丰集合资产管理计划】**。
- (二) 资产管理计划的类别：**【固定收益类】**集合资产管理计划。
- (三) 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：**【在严格控制风险的前提下，实现计划资产的增值。】**
 - 2、主要投资方向：
 - (1) 固定收益类资产：银行间市场和交易所市场发行和上市交易的同业存单、央行票

据、国债、地方政府债、政策性金融债、短期融资券（包括但不限于超级短期融资券）、中期票据、金融债、企业债、公司债（包括但不限于非公开公司债）、非金融企业债务融资工具；

（2）现金管理类资产：银行存款（包括但不限于定期存款、活期存款、协议存款、结构性存款及其他银行存款）、债券逆回购（包括但不限于协议回购）、货币市场基金；

以上投资范围中，由于投资主体暂未获得相关资质或资格而无法投资的投资品种，在投资主体获得相关资质或资格后，可进行投资。

法律法规或监管机构以后允许集合资产管理业务投资的其他品种，管理人按本合同约定对合同进行变更，并向委托人充分揭示相应风险且履行登记备案等法律法规以及金融监督管理部门规定的程序后，可以将其纳入投资范围。

3、本计划投资比例：

（1）本计划投资于固定收益类资产及现金管理类资产（按市值计算）合计不低于计划总资产的80%。

4、风险等级：本资产管理计划属于【R3】风险投资品种，适合风险识别、评估、承受能力为【C3、C4 或 C5】级别的普通合格投资者及专业投资者。

（五）资产管理计划的存续期限：【10 年】。

（六）资产管理计划份额的初始募集面值：人民币【1.000】元。

（七）资产管理计划的最低初始募集规模：不得低于【1000 万元】人民币。

（八）本计划的运营服务机构为【国泰君安证券股份有限公司】，运营服务机构已完成在中国证券投资基金业协会的备案，编号为 A00005。

（九）本计划将聘请【上海瞰瞻资产管理有限公司】作为投资顾问，对本计划的投资提供投资建议。资产管理人应当负责确保本计划所聘请的投资顾问符合《运作规定》《指导意见》、《管理办法》关于投资顾问资质的规定。

（十）第三方服务机构相关事项说明

资产管理人有权根据相关法律法规或本合同约定聘请第三方服务机构为本资产管理计划提供产品募集（如有）、投资顾问（如有）、份额登记（如有）、估值核算（如有）、信息技术系统（如有）相关的服务。该等第三方服务机构提供的相关服务将对委托人的利益以及本资产管理计划的运营产生直接影响。

如因第三方服务机构原因，对合同各方的合法权益造成损害的，第三方服务机构、资产管理人应当根据相关法律法规、部门规章、规范性文件、行业自律规则的规定以及本合同、相关服务协议的约定承担责任。资产管理人于本合同项下的相关义务、责任不得因聘请第三方服务机构而免除或转移。

第六节 资产管理计划的募集

（一）资产管理计划份额的募集

1、资产管理计划份额的募集期

本资产管理计划的募集期自计划份额发售之日起不超过【60】天，募集期的具体时间由资产管理人根据相关法律法规以及《资产管理合同》的规定确定。

在募集期，资产管理人可与代理销售机构协商决定提前终止募集。资产管理人与代理销售机构协商决定提前结束募集的，资产管理人应发布提前结束募集的公告，本资产管理计划自公告之日起不再接受认购申请。

2、资产管理计划份额的募集方式

本资产管理计划的销售机构为管理人及/或管理人委托的代理销售机构。管理人可以根据需要增加、变更代理销售机构。代理销售机构应当依法、合规销售本资产管理计划。委托人认购本计划，必须与资产管理人和资产托管人签订资产管理合同，按销售机构规定的方式足额缴纳认购款项。认购的具体金额和份额以注册登记机构的确认结果为准。

资产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。

3、资产管理计划份额的募集对象

本计划仅向符合《运作规定》规定的合格投资者募集。合格投资者是指具备相应风险识别能力和风险承担能力，投资于单只资产管理计划不低于一定金额且符合下列相关标准的自然人、法人或者其他组织：

- 1) 具有 2 年以上投资经历，且满足下列三项条件之一的自然人：家庭金融净资产不低于 300 万元，家庭金融资产不低于 500 万元，或者近 3 年本人年均收入不低于 40 万元；
- 2) 最近 1 年末净资产不低于 1000 万元的法人单位；
- 3) 依法设立并接受国务院金融监督管理机构监管的机构，包括证券公司及其子公司、基金管理公司及其子公司、期货公司及其子公司、在中国证券投资基金业协会（以下简称证券投资基金业协会）登记的私募资产管理人、商业银行、金融资产投资公司、信托公司、保险公司、保险资产管理机构、财务公司及中国证监会认定的其他机构；
- 4) 接受国务院金融监督管理机构监管的机构发行的资产管理产品；
- 5) 基本养老金、社会保障基金、企业年金等养老基金，慈善基金等社会公益基金，合格境外机构投资者（QFII）、人民币合格境外机构投资者（RQFII）；
- 6) 中国证监会视为合格投资者的其他情形。

（二）资产管理计划份额的认购

1、募集期认购的价格及方式

委托人认购本计划时，按照面值（人民币【1.000】元）为基准计算计划份额。本计划认购采用金额申请的方式，认购资金应以人民币资金形式交付。

2、认购申请的确认

认购申请确认完成后，委托人不得撤销。销售机构受理申请并不表示对该申请成功的确认，而仅代表销售机构确实收到了申请。认购申请的确认以份额登记机构的确认结果为准。

本计划的委托人不少于【2】名且不得超过【200】名，若法律法规或监管机构将来另有规定的，从其规定。

管理人在募集期的每个交易日可接受的人数限制内，按照“时间优先、金额优先”的原则确认有效认购申请，超出委托人人数规模上限的认购申请为无效申请。

3、认购金额的限制

委托人在募集期首次净认购的金额不得低于【30】万元人民币（不含认购费用），并可多次认购。募集期每次追加认购金额，扣除认购费后（如有），应不低于【1】万元。

4、认购的费率

本计划的认购费率为【0】%。

5、认购份额的计算方式

认购份额=[认购金额/（1+认购费率）+募集期利息]/面值。

认购费用=认购金额*认购费率/（1+认购费率）。

净认购金额=认购金额/（1+认购费率）。

认购份额保留到小数点后2位，小数点后第3位四舍五入，由此带来的收益和损失归入计划资产。

6、资产管理计划募集资金利息的处理方式

初始销售期间募集期产生的利息在资产管理计划成立后折算为计划份额归委托人所有，该利息以银行同期活期存款利息计算，以份额登记机构的记录为准。

7、拒绝认购的情形及处理

出现以下情形之一，管理人可以拒绝委托人的认购：

- （1）本计划认购人数已达到上限；
- （2）不可抗力的原因导致本计划无法正常运作；
- （3）法律、法规规定或中国证监会认定的其他情形。

如果委托人的认购被拒绝，被拒绝的认购款项将无息退还给委托人。

（三）募集期委托人资金的管理

管理人应当将资产管理计划募集期委托人的资金存入专门账户，在资产管理计划募集行为结束前，任何机构和个人不得动用。在募集行为结束后，管理人应当及时将委托人的资金划转至本资产管理计划托管账户。

1、直销处理

资产委托人通过直销渠道认购的，应将委托财产划入如下直销募集账户：

本资产管理计划的直销募集账户信息：

募集账户名称：国泰君安运营外包户

募集账户账号：30200339021422

募集账户开户银行名称：平安银行股份有限公司上海分行营业部

募集账户大额支付号：307290002014

在本计划募集行为结束之前，募集资金任何人不能动用。对直销募集账户的监督由监督机构负责，本计划的监督机构为【国泰君安证券股份有限公司】。

直销募集账户是运营服务机构接受资产管理人委托代为提供运营服务的专用账户，并不代表运营服务机构接受委托人的认购或参与资金，也不表明运营服务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。

委托人将委托资金划入本计划直销募集账户的汇出账户为委托人收益账户，资产管理人只能将募集账户中的资金定向划拨至该计划对应的托管账户（认购、参与时）、委托人收益账户（分红、退出、清算时）及资产管理人或资产管理人委托的代理销售机构的账户（划拨认购费、参与费、退出费等在本资管合同中列明的费用时）。

2、代销处理（如有）

资产委托人通过管理人委托的代理销售机构认购本计划的，应将委托财产划入代理销售机构指定的募集专用账户，或由代理销售机构根据委托人的指令从委托人账户中进行扣划。代理销售机构指定的募集专用账户信息参考管理人与代理销售机构签署的代理销售协议。

委托人认购或参与本计划，以人民币货币资金形式交付。计划不接受现金方式认购。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**直销募集账户**，在代销机构（如有）认购或参与的投资者将认购/参与资金从在中国境内开立的自有银行账户划款至代理销售机构指定的募集专用账户。管理人应该以合同约定的方式向投资者披露募集账户信息。

第七节 资产管理计划的成立与备案

（一）资产管理计划的成立

1、资产管理计划成立应当具备以下条件：

- （1）募集过程符合法律、行政法规和中国证监会的规定；
- （2）资产管理计划的初始计划资产金额达到本合同约定的最低初始募集规模，不低于【1000】万元人民币；
- （3）资产管理计划委托人人数至少【2】人且不超过【200】人；

- (4) 单个资产委托人交付的认购金额（扣除认购费用后）满足合同约定的金额；
- (5) 符合中国证监会规定及本合同约定的其他条件。

2、资产管理计划满足上述成立条件，且募集金额缴足之日起十个工作日内，管理人应当委托具有证券相关业务资格的会计师事务所进行验资并出具验资报告。管理人应在取得验资报告后公告本资产管理计划成立，并于成立当日函告通知资产托管人【及运营服务机构】，上述计划成立公告的托管人接收邮箱为：zctgqsjs@gtjas.com；本计划成立日以管理人公告上载明的具体日期为准。托管人自本计划成立之日起开始履行监督职责。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。

（二）资产管理计划募集失败的处理方式

1、资产管理计划募集期结束，未达到成立条件的，资产管理计划募集失败，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) 在募集期届满后三十日内返还投资者已缴纳的款项，并加计银行同期活期存款利息（按照募集账户开立的银行所公布的当期活期存款利息率计算委托人认购资金所对应的利息），利息金额以本资产管理计划份额登记机构的记录为准；
- (3) 将托管人已盖章的合同及其他相关协议在募集期限届满后 10 日内如数原件返还托管人。未能如数返还的，应向托管人书面说明原因、去向并加盖公章。

2、资产管理人、资产托管人及代理销售机构（如有）不得请求报酬。资产管理人、资产托管人和代理销售机构（如有）为计划初始销售募集支付之一切费用应由各方各自承担。

（三）资产管理计划的备案

管理人应当在本计划成立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。

资产管理计划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】的除外。

若本计划未通过证券投资基金业协会的备案，则本计划提前终止，进入清算程序，具体终止时间以管理人公告为准。

第八节 资产管理计划份额的参与和退出与转让

（一）参与和退出的场所、时间

1、参与和退出的场所

本资产管理计划的销售机构为直销机构（管理人）及/或管理人委托的代理销售机构。管理人可以根据需要增加、变更代理销售机构。

委托人应当在销售机构办理计划销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办

理资产管理计划份额的参与和退出。

2、参与和退出的时间

本资产管理计划开放日（以下简称为 T 日或开放日）为本计划成立之后每周周二（如遇到非交易日，默认顺延至下一个交易日）。

本计划设置份额锁定期，经管理人同意，基金份额持有人可赎回持有期低于【180 天】的基金份额，未经管理人同意的，委托人不得赎回持有期低于【180 天】的计划份额（募集期内认购所得的计划份额，自本计划成立之日起算；存续期内申购所得的计划份额，自该笔份额申购申请之日起算；即该笔份额锁定期自该笔份额申购申请之日（含）起至该笔份额锁定期结束日（不含））。

委托人的计划份额持有期每满【180】天后，如需赎回，可顺延至最近一个开放日进行赎回。如委托人未在最近一个开放日提出赎回申请，则计划份额自动进入下一个锁定期。（注：新的锁定起始日以该笔份额持有到期日为起点开始计算。）（举例：若本计划成立于 2021 年 1 月 20 日，则第一个固定开放日为 2021 年 1 月 26 日，若委托人 A 在 2021 年 1 月 26 日申购申请了 300 万份额（该笔份额第一个锁定期的起始日为 2021 年 1 月 26 日），则该笔份额的第一个锁定期结束日期为 2021 年 7 月 25 日（为周日，下一个开放日为 2021 年 7 月 27 日可申请赎回），若委托人 A 对该笔份额中的 100 万份额发起赎回申请，则剩余 200 万份额的第二个锁定期的起始日为 2021 年 7 月 25 日，以此类推。

若委托人 A 在第一个锁定期结束日期后的下一个开放日未进行任何赎回申请，则该 300 万份额的第二个锁定期的起始日仍为 2021 年 7 月 25 日；（注：本举例采用的时间段仅供解释本计划锁定期所用，可能与本计划实际成立日、申赎日（开放日）等不相符。）

当出现以下情形时，管理人可设置临时开放日为委托人办理退出，委托人退出不受份额锁定期限制：

1、法律、法规、行业指引、自律规则发生变化，本资产管理计划相应内容需要进行变更，委托人不同意变更并请求退出资产管理计划；

2、本合同约定的其他条件。

临时开放日只允许退出，不允许参与，具体以资产管理人公告或书面通知为准。资产管理人网站公告或以本计划合同约定的其他形式告知前述临时开放事项即视为履行了告知义务。管理人应在每个临时开放日前一交易日 17:00 前通知托管人及运营服务机构。

（二）参与和退出的预约登记

委托人通过管理人直销参与本计划的，应在参与预约登记期间【T-14日至T-1日（自然日）12点前】（T指开放日）内进行参与预约登记，并将参与资金汇入本计划直销募集账户。参与预约登记成功以委托人已签署合同并且参与资金到达直销募集账户为准。若委托人未在参与预约登记期间内参与预约登记成功，则管理人有权拒绝接受该委托人在当期开放日的参与申请。

委托人通过管理人直销退出本计划的，应于退出预约登记期间（【T-14日至T-5日】）（T指开放日）之间填写管理人提供的申请表进行退出预约登记。退出预约登记成功以管理人收到申请表并经管理人确认为准。若委托人未在退出预约登记期间内退出预约登记成功，则管理人有权拒绝接受该委托人在当期开放日的退出申请。

委托人通过代理销售机构参与、退出本计划的，应根据代理销售机构制定的规则和流程办理参与、退出业务。

（三）参与和退出的方式、价格及程序

1、本计划参与和退出采用未知价原则，即计划的参与价格和退出价格以委托人提交参与或退出申请的开放日的计划份额净值为基准进行计算。

投资者、管理人一致确认份额登记机构仅根据募集机构提交的份额参与和/或退出申请中所载明的申请时间办理份额登记手续，对于募集机构提交的上述申请中所载明时间的准确性，份额登记机构不负有审核义务。

2、本计划采用金额参与和份额退出的方式，即参与以金额申请，退出以份额申请。

3、计划份额的退出遵循“先进先出”原则，即按照委托人认购、参与和红利再投资所得份额的先后次序进行退出。

4、委托人在提交参与申请时须按照销售机构规定的方式全额支付参与资金，在提交退出申请时须持有足够的计划份额余额，否则所提交的参与、退出申请无效而不予确认。

（四）参与和退出申请的确认

委托人的参与和退出申请受理完成后，不得撤销。销售机构受理申请并不表示对该申请成功的确认，而仅代表销售机构确实收到了申请。参与和退出申请的确认以份额登记机构的确认结果为准。

本计划的人数规模上限为【200】人。管理人在开放期的每个工作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，份额登记机构在【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】日起三十日内返还委托人已缴纳的款项。

委托人退出申请确认成功后，管理人将在退出确认日后【5】个工作日内支付退出款项。

（五）参与和退出的金额限制

委托人购买资产管理计划份额的，投资者应符合合格投资者标准。委托人首次净参与的

金额不低于【30】万元人民币（不含参与费用），在开放日内追加参与的，追加金额应为【1】万元起。

当委托人持有的计划份额资产净值高于【30】万元时，委托人可以选择全部或部分退出资产管理计划份额，选择部分退出资产管理计划份额的，委托人退出后持有的计划份额资产净值不得低于【30】万元。

当管理人确认委托人申请部分退出计划份额将致使部分退出申请确认后其所持有的计划资产净值低于【30】万元的，管理人应当将该委托人所持剩余份额做全部退出处理，该等退出不受本合同关于计划份额退出的期限限制。

委托人申请退出计划份额时，持有计划资产净值低于【30】万元（含【30】万元）的，委托人只能一次性全部退出持有份额，委托人没有一次性全部退出的，管理人应当将该委托人所持份额做全部退出处理。

（六）参与和退出的费率

1、参与费率

本资产管理计划参与费率为【0】%。

2、退出费率

本资产管理计划退出费率为【0】%。

（七）参与份额与退出金额的计算方式

1、参与份额计算

参与份额=参与金额/(1+参与费率)/参与价格

参与费用=参与金额*参与费率/(1+参与费率)

净参与金额=参与金额/(1+参与费率)

参与份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。

2、退出金额计算

退出金额=退出份数×退出价格-退出费用（如有）-应计提业绩报酬（如有）-浮动投资顾问费（如有）

退出费用=退出份数×退出价格×退出费率（如有）

退出费用（如有）由退出资产管理计划份额的委托人承担，在委托人退出资产管理计划份额时收取。

退出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。

（八）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委托人的参与申请：

（1）本计划的委托人人数达到本合同约定的人数上限；

(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，从而损害现有委托人的利益的情形；

(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委托人利益的情形；

(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委托人利益的情形；

(5) 证券/期货经纪服务机构未及时提供估值所需资料，导致管理人【（或其委托的运营服务机构）、】托管人无法对开放日计划资产进行估值的情形；

(6) 法律法规规定、经中国证监会认定或本合同约定的其他情形。

管理人决定拒绝接受某些委托人的参与申请时，应当告知委托人，并将参与款项退回委托人账户。

2、在如下情形下，管理人可以暂停接受委托人的参与申请：

(1) 因不可抗力导致无法受理委托人的参与申请的情形；

(2) 证券交易场所交易时间临时停市，导致管理人无法计算开放日当日计划资产净值的情形；

(3) 发生本合同约定的暂停计划资产估值的情形；

(4) 证券/期货经纪服务机构曾发生过未提供且参与日前未补全估值所需资料，导致管理人【（或其委托的运营服务机构）、】托管人无法对开放日计划资产进行正常估值的情形；

(5) 法律法规规定、经中国证监会认定或本合同约定的其他情形。

管理人决定暂停接受全部或部分参与申请时，应当告知委托人。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委托人。

3、在如下情形下，管理人可以暂停接受委托人的退出申请：

(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开放日当日计划资产净值的情形；

(3) 接受退出申请可能会影响或损害其他委托人利益的情形；

(4) 发生本合同约定的暂停计划资产估值的情形；

(5) 证券/期货经纪服务机构曾发生过未提供且退出日前未补全估值所需资料，导致管理人【（或其委托的运营服务机构、）】托管人无法对开放日计划资产进行正常估值的情形；

(6) 法律法规规定、经中国证监会认定或本合同约定的其他情形。

发生上述情形之一的，管理人应当告知委托人。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确认金额占已接受的退出总确认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委托人。

（九）巨额退出、大额退出和连续巨额退出的认定及处理方式

1、巨额退出、大额退出和连续巨额退出的认定

（1）巨额退出的认定

单个开放日中，本计划需处理的净退出申请份额超过本计划上一工作日计划总份额的【20】%时，即认为本计划发生了巨额退出。

（2）单个委托人大额退出的认定

单个委托人单日退出【份额超过 1000 万份】，即视为单个委托人大额退出。

（3）连续巨额退出的认定

本计划不设连续巨额退出限制。

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委托人的全部退出申请时，按正常退出程序执行。

（2）部分延期退出：当管理人认为支付委托人的退出申请有困难或认为因支付委托人的退出申请而进行的财产变现可能会对计划资产净值造成较大波动时，管理人在当日接受退出比例不低于上一工作日计划总份额的【20】%的前提下，可对其余退出申请延期办理。对于当日的退出申请，应当按单个账户退出申请量占退出申请总量的比例，确定当日受理的退出份额；对于未能退出部分，委托人在提交退出申请时可以选择延期退出或取消退出。选择延期退出的，将自动转入【下一个交易日】继续退出，直到全部退出为止；选择取消退出的，当日未获受理的部分退出申请将被撤销。延期的退出申请与【下一个交易日】退出申请（如有）一并处理，无优先权并以【下一个交易日】的计划份额净值为基础计算退出金额，以此类推，直到全部退出为止。本计划不就延期退出份额的相应款项计算利息。如委托人在提交退出申请时未作明确选择，委托人未能退出部分作自动延期退出处理。

（3）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，在开放日结束后的三个工作日内通知委托人，并说明相关处理方法。

3、单个委托人大额退出的预约申请机制

委托人必须提前【10】个工作日直接或通过代理销售机构向管理人预约申请，否则管理人有权拒绝其退出申请。若触发巨额退出的条件，管理人将按照巨额退出的流程办理。

（十）计划份额的转让

委托人可以通过中国证监会认可的交易场所或协议转让等方式，向符合条件的特定合格投资者转让其持有的计划份额，其转让地点、时间、规则、费用等按照办理机构的规则执行。管理人应当在份额转让前，对受让人的合格投资者身份和本资产管理计划的投资者人数进行

合规性审查，转让期间及转让后，持有份额的合格委托人数量合计不得超过法定及本合同约定的人数，转让后投资者仍然持有计划份额的，其所持本计划资产净值应不低于【30】万元。受让方首次参与本资产管理计划的，应当先与管理人、托管人签订本合同。如果份额转让因不符合法律法规或办理机构的规则未办理成功的，委托人应当自行承担相应风险和损失。

（十一）非交易过户的认定及处理方式

1、资产管理人及份额登记机构只受理继承、捐赠、司法强制执行和经份额登记机构认可、符合法律法规的其他情况下的非交易过户；无论在上述何种情况下，接受划转的主体必须是依法可以持有本资产管理计划份额的投资人。其中：

“继承”是指资产委托人死亡，其持有的计划份额由其合法的继承人继承。

“捐赠”是指资产委托人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。

“司法强制执行”是指司法机构依据生效司法文书将资产委托人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，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。

（十二）计划份额的冻结与解冻

本资产管理计划的份额冻结与解冻只包括人民法院、人民检察院、公安机关及其他国家有权机构依法要求的计划份额冻结与解冻事项，以及计划份额登记机构认可、符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻。

（十三）管理人自有资金参与

管理人可以自有资金参与本计划，自有资金参与份额根据其持有比例，与其他份额持有人共同平等承担风险，共同平等享受计划资产收益分配。管理人自有资金并不承担补偿其他投资亏损或收益的情况。

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

管理人以自有资金参与本资产管理计划的份额不得超过本计划总份额的【20%】。管理人及其附属机构以自有资金参与本资产管理计划的份额合计不得超过本计划总份额的【50%】。因本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本合同的约定及时调整达标。本合同当事人一致同意，该条款由资产管理人自行监控。

为应对本资产管理计划巨额退出以解决流动性风险，或者中国证监会认可的其他情形，在不存在利益冲突并遵守合同约定的前提下，管理人及其附属机构以自有资金参与及其后续退出本资产管理计划可不受本条上述规定的限制，但应当及时告知投资者和托管人，并向相关派出机构及证券投资基金业协会报告。

（十四）管理人的报告义务

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

资产管理计划份额持有人大会由资产管理计划份额持有人组成，资产管理计划份额持有人的合法授权代表有权代表资产管理计划份额持有人出席会议并表决。资产管理计划份额持有人持有的每一资产管理计划份额拥有平等的投票权。

（一）资产管理计划份额持有人大会的召开事由

1、当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开资产管理计划份额持有人大会：

- （1）决定延长资产管理计划期限；
- （2）决定修改资产管理合同的重要内容或者提前终止资产管理计划；
- （3）决定更换资产管理人、资产托管人；
- （4）决定调高资产管理人、资产托管人和投资顾问（如有）的报酬标准；
- （5）本合同约定的其他情形。

各方也可以不召开份额持有人大会，通过协商一致并签署补充协议的方式决定上述事项。

2、除上述列明的事项之外，征得资产托管人同意后，资产管理人有权决定是否召开资产管理计划份额持有人大会审议。

（二）资产管理计划份额持有人大会的日常机构

本资产管理计划未设资产管理计划份额持有人大会日常机构。经管理人、托管人及全体委托人一致同意，本资产管理计划未来可根据相关的法律法规及中国证监会的相关规定，设立资产管理计划份额持有人大会日常机构。

（三）资产管理计划份额持有人大会的召集

1、除法律法规规定或本合同另有约定外，资产管理计划份额持有人大会由资产管理人负责召集。

2、代表资产管理计划份额【20%】以上（含【20%】）的资产管理计划份额持有人就同一事项书面要求召开资产管理计划份额持有人大会的，应当向资产管理人提出书面提议。资产管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的资产管理计划份额持有人代表。资产管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 30 日内召开；资产管理人决定不召集，代表资产管理计划份额【20%】以上（含【20%】）的资产管理计划份额持有人有权自行召集。资产管理计划份额持有人依法自行召集资产管理计划份额持有人大会的，应于会议召开前 10 个工作日通知资产管理人，资产管理人有权出席资产管理计划份额持有人大会，资产管理计划份额持有人应当予以配合，不得阻碍资产管理人出席资产管

理计划份额持有人大会。

3、资产管理人进入解散、清算状态且无法正常履行管理职能的，资产托管人有权召集资产管理计划份额持有人大会。

4、资产管理计划份额持有人大会的召集人负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。**资产托管人对于由管理人或委托人召集的资产管理计划份额持有人大会的召集过程不负有监督义务。**

（四）召开资产管理计划份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

1、召开资产管理计划份额持有人大会，召集人最迟应于会议召开前 10 个工作日通知全体资产管理计划份额持有人，资产管理计划份额持有人大会通知应至少载明以下内容：

- （1）会议召开的时间、地点和出席方式；
- （2）会议拟审议的主要事项、议事程序和表决方式；
- （3）授权委托书的内容要求（包括但不限于授权代表身份、代理权限和代理有效期限等）、送达的期限、地点；
- （4）会议联系人姓名、电话及其他联系方式；
- （5）出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；
- （6）召集人需要通知的其他事项。

2、采取通讯方式开会并进行表决的情况下，由会议召集人决定通讯方式和书面表决方式，并在会议通知中说明本次资产管理计划份额持有人大会所采取的具体通讯方式、书面表决意见的寄交截止时间和收取方式。

（五）资产管理计划份额持有人大会的召开方式、会议方式

1、资产管理计划份额持有人大会的召开方式包括现场开会和通讯方式开会。

2、现场开会由资产管理计划份额持有人亲自或委派授权代表出席。通讯方式开会应当以书面方式进行表决；资产管理计划份额持有人出具书面表决意见并在表决截止时间以前送达给资产管理人的，视为出席了会议。

（六）资产管理计划份额持有人大会召开条件

1、现场开会

代表资产管理计划份额持有人大会召开日资产管理计划总份额 2/3 以上（含 2/3）的资产管理计划份额持有人或代表出席会议，现场会议方可举行。资产管理人不派代表列席的，不影响表决效力。未能满足上述条件的情况下，则召集人可另行确定并通知重新开会的时间。

2、通讯方式开会

资产管理人以网站公告或以本计划合同约定的其他形式将资产管理计划份额持有人大会的提案送达投资人处，即视为通讯方式的会议已经召开，出具书面意见的资产管理计划份额持有人所代表的资产管理计划份额总份额占资产管理计划份额持有人大会召开日资产管理计划总份额 2/3 以上（含 2/3）的，通讯方式的会议视为有效召开。

（七）资产管理计划份额持有人大会的表决

1、议事内容：资产管理计划份额持有人大会不得对事先未通知的议事内容进行表决。若出现资产管理人进入解散、清算状态且无法正常履行管理职能的情形，并且资产管理计划份额持有人大会作出提前终止本资产管理计划的决议的，资产管理计划份额持有人大会须同时作出本资产管理计划财产处置方案、资产管理计划清算方案等方案。

2、资产管理计划份额持有人所持每份资产管理计划份额享有一票表决权。

3、资产管理计划份额持有人大会决议须经出席会议的资产管理计划份额持有人所持表决权的 2/3 以上通过方为有效。

4、资产管理计划份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

（八）资产管理计划份额持有人大会决议的效力

资产管理人召集的资产管理计划份额持有人大会决议，自资产管理人通知之日起生效，并自生效之日起对全体资产管理计划份额持有人、资产管理人、资产托管人均有约束力。

资产托管人召集的资产管理计划份额持有人大会决议，自资产托管人通知之日起生效，并自生效之日起对全体资产管理计划份额持有人、资产管理人、资产托管人均有约束力。

资产管理计划份额持有人召集的资产管理计划份额持有人大会决议自通过之日起，对全体资产管理计划份额持有人有约束力；该等决议内容通知至资产管理人和资产托管人之日起，对资产管理人和资产托管人有约束力。

（九）资产管理计划份额持有人大会决议的披露

资产管理计划份额持有人大会决定的事项，应通过在资产管理人网站公告或电子邮件、传真等形式通知全体资产管理计划份额持有人、资产托管人和其他相关当事人。

（十）本资产管理计划存续期间，上述关于资产管理计划份额持有人大会召开事由、召集、召开条件、议事程序、表决条件、决议的效力、决议的披露等规定，凡是直接引用法律法规或监管部门规定的部分，如将来法律法规或监管部门的规定修改导致相关内容被取消或变更，或者相关部分与届时有效的法律法规或监管部门的规定相冲突，则资产管理人经与资产托管人协商一致并提前公告后，可直接对本部分的相关内容进行修改和调整，无需召开资产管理计划份额持有人大会审议。

（十一）资产管理计划份额持有人大会不得直接参与或者干涉资产管理计划的投资管理活动，但出现资产管理人进入解散、清算状态且无法正常履行管理职能的除外。

第十节 资产管理计划份额的登记

（一）本资产管理计划份额的份额登记业务指本资产管理计划的登记、存管、清算和交收业务，具体内容包括资产委托人账户管理、份额注册登记、清算及交易确认、收益分配、建立并保管资产管理计划资产委托人资料表等。

(二)本资产管理计划的注册登记业务由资产管理人委托国泰君安证券股份有限公司办理,管理人应当与国泰君安证券股份有限公司签订委托代理协议或服务合同,但资产管理人依法应承担的注册登记职责不因委托而免除。

(三) 份额登记机构的职责

- 1、建立和保管资产委托人账户资料、交易资料、资产管理计划资产委托人资料表等;
- 2、配备足够的专业人员办理本资产管理计划的份额登记业务;
- 3、严格按照法律法规规定和本资产管理合同约定的条件办理本资产管理计划的份额登记业务;
- 4、按照法律法规的要求,保管资产管理计划资产委托人资料表及相关的参与和退出等业务记录;
- 5、对资产委托人的账户信息负有保密义务,因违反该保密义务对资产委托人、资产管理人、资产托管人或资产管理计划带来的直接损失,须承担相应的赔偿责任,但司法强制检查或者其他按照法律法规的规定进行披露的情形除外;
- 6、按照本资产管理合同为资产委托人办理非交易过户等业务;
- 7、在法律法规允许的范围内,制定和调整份额登记业务的相关规则;
- 8、严格按照法律法规和本资产管理合同规定计算业绩报酬(如有),并提供交易信息和计算过程明细给资产管理人;
- 9、接受资产管理人的监督;
- 10、法律法规规定及本合同约定的其他职责。

(四)资产管理人委托份额登记机构办理本资产管理计划的份额登记业务的,应当与有关机构签订委托代理协议,并列明代为办理资产管理计划份额登记机构的权限和职责。资产管理人依法应承担的份额登记职责不因委托而免除。

(五)全体资产管理计划份额持有人同意管理人、份额登记机构或其他份额登记义务人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) 本计划的投资目标

在严格控制风险的前提下,实现计划资产的增值。

(二) 本计划的投资范围及比例

1、投资范围

(1) 固定收益类资产: 银行间市场和交易所市场发行和上市交易的同业存单、央行票据、国债、地方政府债、政策性金融债、短期融资券(包括但不限于超级短期融资券)、中

期票据、金融债、企业债、公司债（包括但不限于非公开公司债）、非金融企业债务融资工具；

（2）现金管理类资产：银行存款（包括但不限于定期存款、活期存款、协议存款、结构性存款及其他银行存款）、债券逆回购（包括但不限于协议回购）、货币市场基金。

以上投资范围中，由于投资主体暂未获得相关资质或资格而无法投资的投资品种，在投资主体获得相关资质或资格后，可进行投资。

法律法规或监管机构以后允许集合资产管理业务投资的其他品种，管理人按本合同约定对合同进行变更，并向委托人充分揭示相应风险且履行登记备案等法律法规以及金融监督管理部门规定的程序后，可以将其纳入投资范围。

2、投资比例

（1）本计划投资于固定收益类资产及现金管理类资产（按市值计算）合计不低于计划总资产的80%。

（三）投资比例超限的处理方式及流程

（1）本资产管理计划的投资比例不得违反合同约定，如有改变，除超出比例范围投资于较低风险资产外，应当先行取得投资者书面同意，并履行合同变更、登记备案等法律法规以及金融监督管理部门规定的程序。委托人签署本计划合同即表明一致同意前述超比例投资低风险资产不视为管理人违反合同约定进行投资。

（2）在本计划到期日前 15 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。

（3）因证券期货市场波动、证券发行人合并、资产管理计划规模变动等证券期货经营机构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，证券期货经营机构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，证券期货经营机构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。法律、行政法规、金融监管部门另有规定的，从其规定。

（四）风险收益特征；

本资产管理计划属于【R3】风险投资品种，适合风险识别、评估、承受能力为【C3、C4或C5】级别的普通合格投资者及专业投资者。

（五）业绩比较基准：

本计划不设置业绩比较基准。

（六）本计划的投资策略

通过对宏观经济、利率走势、资金供求、信用风险状况、证券市场走势等方面的分析和预测，综合运用类属资产配置策略、收益率曲线策略、久期策略、套利策略、个券选择策略等，力求规避风险并实现委托财产的保值增值。

（七）本计划的投资限制

1、本计划的计划资产总值占计划资产净值的比例不得超过【120%】；

2、除短期融资券、超短期融资券及利率债以外，信用类债券（即非政策性金融债、企业债、公司债（含非公开发行公司债）、中期票据、非公开定向债券融资工具）的债项评级在 AA（含）以上或主体评级在 AA（含）以上；短期融资券、超短期融资券债项评级为 A-1 级，或主体评级在 AA（含）以上；本计划参考的评级机构不包含中债资信评估有限责任公司以及中证指数有限公司，如同时有两家及以上评级机构评级的，应采用最新发布的评级；若债券无债项评级，则主体评级需在 AA（含）以上；如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；

3、本计划投资于同一资产的资金，不得超过计划资产净值的 25%；本管理人管理的全部集合资产管理计划投资于同一资产的金额，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、债券逆回购除外。同一资产的认定及计算方式：债券、资产支持证券、同业存单、各类资产管理产品按【单只证券或产品市值】进行计算）。

4、本计划参与债券等证券发行申购时，单个资产管理计划所申报的金额不得超过该资产管理计划的总资产，单个资产管理计划所申报的数量不得超过拟发行公司本次发行的总量；

5、债券逆回购（沪深交易所标准券逆回购除外）的质押品资质不得超出本计划约定的投资限制；

6、本计划主动投资于流动性受限资产的市值在开放退出期内（即开放日）合计不得超过计划资产净值的 20%；

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

因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等非资产管理人主观因素导致突破上述投资限制的，资产管理人应当在流动性受限资产可出售、可转让或恢复交易的 15 个交易日内调整至符合要求。法律法规另有规定的，从其规定。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。

（八）投资禁止行为

本资产管理计划财产禁止从事下列行为：

- 1、向他人贷款或提供担保；
- 2、从事承担无限责任的投资；
- 3、利用资产管理计划资产为资产管理计划委托人之外的任何第三方谋取不正当利益、

进行利益输送；

- 4、未经委托人书面同意，不得擅自转让、质押委托资产投资所产生的权益；
- 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、直接投资商业银行信贷资产；
- 7、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、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、直接或者间接投资非标准化债权类资产、非标准化股权类资产和非标准化商品及金融衍生品类资产；
- 10、法律法规、监管规定以及本合同规定禁止从事的其他行为。

若法律法规或监管部门取消或变更上述限制，则本资产管理计划不再受相关限制或以变更后的规定为准。

（九）建仓期

本计划的建仓期为产品成立之日起 6 个月。管理人自本资产管理计划成立之日起【6】个月内使本计划的投资组合比例符合上述投资限制的约定。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、货币市场基金的除外。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、中国证监会规定和本合同约定的投向和比例。

（十）本计划存续期间，为规避特定风险并经全体投资者同意的，投资于对应类别资产的比例可以低于计划总资产 80%，但不得持续 6 个月低于计划总资产 80%，特定风险主要指趋势性风险，包括但不限于对股市、债市、衍生品市场风险的判断，调整资产配置比例的情形等特殊风险。

（十一）投资的资产组合的流动性与参与、退出安排

管理人应当确保本资产管理计划所投资的资产组合的流动性与本资产管理合同约定的参与、退出安排相匹配，确保在开放期保持适当比例的现金或者其他高流动性金融资产，且限制流动性受限资产投资比例。

管理人应当确保本资产管理计划开放退出期内，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%。

第十二节 投资顾问

管理人和委托人一致同意聘请【上海瞰瞻资产管理有限公司】为本计划的投资顾问。本计划投资顾问已在中国证券投资基金业协会备案为【符合提供投资建议条件的第三方机构】。投资顾问应当恪尽职守，遵循诚实、信用、审慎、公平的原则，凭借自身的专业能力为本计划提供投资顾问服务。管理人应切实履行主动管理职责，依法应当承担的责任不因聘请投资顾问而免除。

（一）投资顾问的基本信息：

名称：【上海瞰瞻资产管理有限公司】

住所：上海市金山区吕巷镇璜溪西街88号2幢2458室

通讯地址：北京市东城区首东国际大厦A座505室

法定代表人：李勇

联系人：史鋆龙

联系电话：18301417705

（二）投资顾问的权利和义务

投资顾问有权获取为开展投资顾问服务所必需的本计划的文件和信息资料，包括但不限于获取本合同及计划资产的盈亏、净值等数据信息。投资顾问应：

1、自投资顾问协议及本合同生效之日起，按照诚实信用、勤勉尽责的原则为本计划提供投资建议；

2、在履行投资顾问职责过程中，禁止从事内幕交易、操纵市场等违规行为；

3、保守商业秘密，除法律法规、本合同及其他有关规定另有规定外，不得向他人泄露；

4、不得提供任何有损计划财产及其他当事人利益的投资建议；

5、投资建议不得违反本合同的投资限制及禁止行为；

6、国家有关法律法规、监管机构及本合同、投资顾问协议（如有）规定的其他义务。

具体事宜由管理人与投资顾问另行签署《投资顾问协议》进行约定。

（三）更换、解聘投资顾问的条件和程序

根据资产管理计划实际情况，经全体委托人以书面形式表示同意，管理人可以变更、解聘投资顾问；但投资顾问违反法律法规、监管规定及本合同、投资顾问协议的，管理人有权不经委托人同意直接解聘投资顾问，并可以终止该资产管理计划。管理人更换或解聘投资顾问的，管理人将通过其网站或者销售机构的信息披露平台进行公告。

（四）管理人应切实履行主动管理职责，依法应当承担的责任不因聘请投资顾问而免除。

资产管理人应当负责确保本计划所聘请的投资顾问符合《证券期货经营机构私募资产管理业务运作管理暂行规定》、《指导意见》、《管理办法》关于投资顾问资质的规定。

第十三节 分级安排（如有）

本计划无份额分级。

第十四节 利益冲突及关联交易

（一）资产管理计划存在的或可能存在利益冲突的情形

在本计划存续期内，管理人可能运用委托资产投资于管理人、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、其他金融产品或者承销期内承销的证券。

投资者签署本合同即视为已经充分理解并同意管理人从事该等关联交易，管理人无需就该等具体关联交易分别取得投资者的个别授权，但该种投资行为应按照市场通行的方式和条件参与，管理人应采取切实有效措施，公平对待委托财产，防止利益冲突，不得损害投资者利益。投资者不得因本计划投资收益劣于管理人及其关联方管理的其他类似投资产品，而向管理人或托管人提出任何损失或损害补偿的要求。

投资者应事前将其关联方、关联证券或其他禁止交易证券明确告知管理人。若投资者未能事前将其关联方、关联证券或其他禁止交易证券明确告知管理人致使资产管理计划财产发生违规投资行为的，由投资者承担责任。

（二）资产管理计划存在利益冲突的处理方式、披露方式、披露内容以及披露频率

投资者在此对上述列举的存在的或可能存在的利益冲突情形表示知悉，确认并同意豁免上述情形，其中，涉及关联交易的，按以下约定进行处理：

管理人运用受托资产从事关联交易的，应遵循客户利益优先的原则，事后及时、全面、客观的向委托人和托管人进行披露。管理人应通过管理人网站或者本合同约定的联系方式，在事项发生之日起五日内告知委托人和托管人。

管理人运用受托管理资产从事重大关联交易的，应事先取得投资者同意，并有充分证据证明未损害委托人利益，事后及时、全面、客观的向委托人和托管人进行披露。管理人应通过管理人网站或者本合同约定的联系方式，在事项发生之日起五日内告知委托人和托管人，并按照资产管理合同的约定在资产管理计划年度报告和季度报告中予以披露，同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。

第十五节 投资经理的指定与变更

（一）投资经理的指定

本计划的投资经理由管理人负责指定。

本计划的指定投资经理为：**【邓宁宁】**。

邓宁宁毕业于山东大学，学士学历。自 2010 年起任职于上海中期期货股份有限公司，期货从业资格号 F0256594，投资咨询证号 Z0001831，基金从业资格号 F8040000000007。

本计划投资经理符合法律法规规定的以下条件。

- (1) 已取得期货或证券、基金等从业资格；
- (2) 具有 3 年以上投资管理、投资研究、投资咨询等相关业务经验；
- (3) 具有良好的诚信记录及职业操守，且最近三年未被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚；
- (4) 期货业协会规定的其他条件。

管理人承诺该投资经理不得同时办理资产管理业务和其他业务。

(二) 投资经理的变更

管理人可根据业务需要变更投资经理，并在变更后及时以电话、传真或者邮件的方式告知委托人及托管人，委托人不同意投资经理变更的，有权提前退出本资产管理计划。管理人应在管理人公司网站公告调整事项。

第十六节 资产管理计划的财产

(一) 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、计划资产独立于管理人、托管人的固有财产，并独立于管理人管理和托管人托管的其他财产。管理人、托管人不得将计划资产归入其固有财产。

3、除本合同另有约定外，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。

4、管理人、托管人可以按照本合同的约定收取管理费、托管费以及本合同约定的其他费用。管理人、托管人以其固有财产承担法律责任，其债权人不得对计划资产行使请求冻结、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，计划资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。非因计划财产本身承担的债务，管理人、托管人不得主张其债权人对计划资产强制执行。上述债权人对计划资产主张权利时，管理人、托管人应明确告知计划资产的独立性，采取合理措施并由管理人及时通知投资者。

6、管理人、托管人不得违反法律法规的规定和资产管理合同约定擅自将委托财产资产用于抵押、质押、担保或设定任何形式的优先权或其他第三方权利。

7、托管期间，如相关监管机构或法规对计划资产的保管事宜另有规定的，从其规定。

8、对于委托财产的投资事宜，根据相关法律规定，需由管理人代表委托财产签订相关协议、开立相关账户及办理相关手续，由于管理人从事上述事宜造成的后果由管理人承担。

9、对于因为计划资产投资产生的应收资产，应由管理人负责与有关当事人确定到账日期并书面通知托管人，到账日计划资产没有到达托管账户的，由此给计划资产造成损失的，管理人应负责向有关当事人追偿计划资产的损失。

10、如发生有权机关对计划资产强制执行的情形，管理人应及时通知委托人。

（二）计划资产相关账户的开立与管理

1、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遵循“原账户来，原账户去”的原则。如委托人要求变更账户，必须向管理人、托管人提供变更的合理依据，及时通知管理人、托管人，并征得管理人、托管人同意。

2、托管账户

托管账户即本计划的托管专户或银行结算账户。托管人应为本计划在商业银行开立托管账户，并按“第三方存管”模式要求和客户交易结算资金管理账户建立对应关系，管理人应给予必要的配合，并提供所需资料。托管账户名称以实际开立账户为准。

托管账户的预留印鉴由托管人制作、保管和使用，并根据管理人符合本合同约定的指令办理资金收付。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，均需通过托管账户进行。托管账户的开立和使用，仅限于满足本计划开展业务的需要。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、专用证券账户

托管人为本计划在中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中登公司”）开立专用证券账户，具体账户名称以实际开立账户为准。

4、证券资金台账

管理人为本计划在证券经纪机构处开立，用于本计划证券交易用途的账户。本账户内的资金信息与客户交易结算资金管理账户同步，管理人不能发起对该账户的取现操作。

5、客户交易结算资金管理账户

存管银行为本计划开立的，管理本计划用于证券买卖用途的交易结算资金存管专户，记载本计划证券交易结算资金的变动明细，记载托管账户和证券资金台账之间的银证转账对应关系。本账户通过“第三方存管”平台与证券资金台账同步，并与托管账户建立唯一对应关系。

6、托管人和管理人不得出借或转让证券账户、证券资金台账，亦不得使用证券账户或证券资金台账进行本计划业务以外的活动。管理人应确保本计划存续期间存放在专用证券账户和证券资金台账上的计划财产安全，不得挪用专用证券账户和证券资金台账上的资产，不得将专用证券账户和证券资金台账上的资产为任何人设立任何质押担保和可能对本计划造

成损失的其他处置。因管理人原因造成的本计划项下存放在专用证券账户上证券资产和划入证券资金台账上资金的安全性问题及由此给本计划带来的任何损失,应由管理人承担全部赔偿责任。

7、因业务发展而需要开立的其他账户,应由托管人或管理人根据有关法律法规的规定开立、管理和使用。如该账户是由管理人负责开立的,管理人应保证该账户专款专用。相应的投资回款及收益,也由管理人负责及时原路划回托管账户。管理人开立此类账户后需及时通知托管人。

8、(如有)管理人根据与托管人、期货公司三方签定的期货投资操作备忘录的约定,开立相关期货账户。

(三) 与计划资产有关的重大合同的保管

由资产管理人代表本资产管理计划签署的与本资产管理计划有关的重大合同的原件应当由资产管理人保管。资产管理人应向资产托管人提供加盖授权业务章的合同复印件或原件的扫描件,未经双方协商或未在合同约定范围内,合同原件不得转移。

因资产管理人未按本协议约定及时向资产托管人移交复印件或扫描件导致的法律责任,由资产管理人自行承担。

第十七节 投资指令的发送、确认和执行

(一) 资产管理人对发送指令人员的书面授权

资产管理人应按本合同的约定事先书面通知(以下称“授权通知”)资产托管人有权发送指令的人员名单、签字样本、相应权限、预留印鉴、启用日期等。资产管理人向资产托管人发出的授权通知应加盖公章。资产管理人将加盖公章的授权通知通过传真或电子邮件发送扫描件方式发出后,同时向资产托管人确认(确认方式包括但不限于电话、邮件、短信或其他管理人和托管人一致认可的方式,下同);授权通知自资产托管人收到传真或扫描件并确认后,方视为通知送达。授权通知在送达后,自其载明的启用日期开始生效,通知送达的日期晚于载明的启用日期的,则通知送达时生效。资产管理人应在此后三个交易日内将授权通知的正本送交资产托管人并与其确认。传真件或扫描件如与正本不一致,资产托管人以传真件或扫描件为准并及时通知资产管理人。

资产管理人和资产托管人对授权文件负有保密义务,其内容不得向授权人及相关操作人员以外的任何人泄露。

(二) 划款指令的内容

划款指令是指资产管理人在管理、运用计划资产时,向资产托管人发出的资金划拨及其他款项收付的投资指令。资产管理人发给资产托管人的划款指令应写明款项事由、支付时间、金额、收付款账户信息等执行支付所需信息。

管理人通过托管人的电子指令平台提交场外投资指令的，应根据托管人的要求进行办理，如管理人提交电子指令的同时上传签章纸质指令扫描件的，管理人应确保电子指令与签章纸质指令扫描件的一致性，如不一致，托管人有权拒绝执行。

当本计划进行场外投资，资产管理人要求资产托管人从托管资金账户向指定的收款账户划款时，资产管理人应向资产托管人提供以下资料：

- 1、投资交易相关文件（当事人签署版）；
- 2、收款账户证明文件；
- 3、资产托管人认为必要的投资划款相关支持性文件。

资产管理人应确保所提供的上述文件合法、真实、完整和有效。交易文件应载明真实的资金来源为本计划，并明确上述投资到期或产品赎回后本金及收益将返回至本计划托管资金账户，如确有真实原因致使交易文件不能载明上述内容的，资产管理人应在上述投资到期或产品赎回/终止后将本金及收益返回至本计划托管资金账户。**如果资产管理人无法提供上述交易文件的，资产托管人有权拒绝执行投资划款指令。**资产管理人应确保上述交易文件的始终有效性、真实性、完整性、准确性。本计划投资的产品的资产管理人或投资顾问为资产管理人的，资产管理人承诺不进行任何利益输送的行为；在持有上述投资标的或产品期间，上述投资标的或产品的交易文件有任何变更的，资产管理人应负责审查同意该变更的行为不得损害本计划投资者实际利益；在持有上述投资标的或产品期间，资产管理人对上述投资标的或产品不得进行抵押、质押、非交易过户或其他任何有损本计划投资者利益的行为。

本合同对拟投资标的的进行穿透约定的（例如投资某基金，对该基金的投向或如何运作进行约定），以该投资标的的交易/法定文件的具体约定为准，但资产管理人仍应确保本计划合同中穿透约定内容的真实性、准确性和完整性。**【资产管理人应审查本合同穿透约定与该投资标的的交易/法定文件的具体约定是否一致，如不一致但资产管理人仍向资产托管人发出投资划款指令的，资产托管人有权拒绝执行，但应立即通知资产管理人。】**

（三）划款指令的发送、确认和执行

划款指令由授权通知确定的被授权人代表资产管理人用传真或电子邮件发送扫描件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与资产托管人以电话方式进行确认。传真或扫描件以获得收件人（资产托管人）确认该指令已成功接收之时视为送达。资产托管人依照授权通知约定的方法确认指令有效后，方可执行指令。

经资产管理人与资产托管人协商一致后，可采用除上述发送传真、电子邮件发送扫描件之外的其他方式（如电子指令平台、深证通数据交换平台等）进行指令的发送、确认与执行。**如通过电子指令平台提交指令，管理人须在指令跟踪界面查看划款指令是否完成。**

对于被授权人依照“授权通知”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。**资产管理人在发送指令时，应为资产托管人留**

出执行指令所必需的时间。除需考虑资金在途时间外，资产管理人还需为资产托管人留有 2 个工作小时的复核和审批时间。在每个交易日的 13:00 以后接收资产管理人发出的场内交易、赎回、场外投资划款指令的，资产托管人不保证当日完成划转流程；在每个交易日的 14:30 以后接收资产管理人发出的其他划款指令，资产托管人不保证当日完成在银行的划付流程。

资产托管人收到资产管理人发送的指令后，如为电子指令平台提交指令，应验证电子指令要素是否齐备。如为传真或电子邮件发送扫描件划款指令，应对传真或扫描划款指令进行审查，验证指令的书面要素是否齐全、审核印鉴和签名是否和预留印鉴和签名样本相符，复核无误后依据本合同约定在规定期限内及时执行，不得延误。若对指令进行审查时或对指令要素如账户信息、金额、汇路存在异议或不符，资产托管人立即与资产管理人进行联系和沟通，并要求资产管理人重新发送经修改的指令。资产托管人可以要求资产管理人传真或电子邮件方式提供相关交易凭证、合同或其他有效会计资料，以确保资产托管人有足够的资料来判断指令的有效性。资产管理人应将银行间市场成交单通过传真或电子邮件发送扫描件方式发送给资产托管人，资产管理人和资产托管人另有约定的除外。

资产管理人应保证其随指令同时提交的其他文件资料的合法、真实、完整和有效，托管人仅根据管理人发送的符合本合同约定的划款指令及投资主协议进行资金划付，其他与该投资相关的从协议或与履约保障有关的协议或决议的签订及生效属于管理人的投资管理职责，投资者签署本计划合同即视为已知悉相关风险并同意上述安排。

资产管理人向资产托管人下达指令时，应确保托管账户及其他账户有足够的资金余额，对资产管理人在没有充足资金的情况下向资产托管人发出的指令，资产托管人有权拒绝执行，并立即通知资产管理人，由此造成的损失由相关方承担责任。

（四）资产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

资产托管人发现资产管理人发送的投资指令违反本合同《投资监督事项表》的约定时，不予执行，并应及时通知资产管理人并有权报告监管机构，资产托管人发现资产管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反本合同《投资监督事项表》约定的，应当立即通知资产管理人并有权报告监管机构。资产管理人收到通知后应及时核对，并以书面形式对资产托管人发出回函确认。

（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错误，指令中重要信息模糊不清或不全等。资产托管人在履行监督职能时，发现资产管理人的指令错误时，有权拒绝执行，并及时通知资产管理人改正。

（六）资产管理人更换被授权人的程序

资产管理人撤换被授权人员或改变被授权人员的权限，必须提前至少三个交易日，向资产托管人以传真或电子邮件发送扫描件方式或其他资产管理人和资产托管人认可的方式发

送加盖公章的被授权人变更通知（包括姓名、相应权限、预留印鉴、签字样本、启用日期等），同时通知资产托管人。被授权人变更通知自资产托管人收到传真或扫描件并确认后，方视为通知送达。被授权人变更通知在送达后，自其载明的启用日期起开始生效。通知送达的日期晚于载明的启用日期的，则通知送达时生效，原授权文件同时废止。被授权人变更通知生效前，资产托管人仍应按原约定执行指令，资产管理人不得否认其效力。资产管理人在此后三个交易日内将被授权人变更通知的正本送交资产托管人并与其确认。传真件或扫描件如与正本不一致，资产托管人以传真件或扫描件为准并及时通知资产管理人。

（七）交易指令

管理人应将投资者参与、退出计划的数据通过双方商定的方式提供托管人，资产管理人应对传送的此类数据的真实性、准确性和完整性负责。

（八）指令的保管

指令若以电子指令平台形式提交，则以电子数据的形式保管。资产管理人的划款指令若以传真或扫描件或电子指令形式发出，则正本由资产管理人保管，资产托管人保管指令传真件或扫描件或电子指令。当两者不一致时，以资产托管人收到的指令传真件或扫描件或电子指令为准。

（九）相关责任

在遵循本合同约定的业务受理渠道及在指令预留处理的时间内，因资产托管人原因未能及时或正确执行符合本合同规定的划款指令而导致资产管理计划财产受损的，资产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资产托管人如遇到不可抗力的情况除外。

如果资产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资产托管人原因造成的情形，只要资产托管人根据本合同相关约定验证有关印鉴与签名无误，因资产托管人正确执行有关指令而给资产管理人或资产管理计划财产或任何第三人带来的损失，全部责任由资产管理人承担。

第十八节 交易及清算交收安排

（一）场内交易的资金清算交收安排

1、代理证券买卖的证券经营机构

资产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，资产管理人、资产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。

2、本计划投资证券后的清算交收安排

（1）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；

（2）证券交易所证券资金结算

资产托管人、资产管理人应共同遵守中登公司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。

资产管理人在投资前，应充分知晓与理解中登公司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登公司完成证券交易及非交易涉及的证券资金结算业务，并承担由证券经纪机构原因造成的正常结算、交收业务无法完成的责任；若由于资产管理人原因造成的正常结算业务无法完成，责任由资产管理人承担。

如证券经纪机构及托管资金账户开立银行的业务规则允许且技术支持，管理人可以通过自助转账方式，自行完成托管账户与证券交易资金账户、信用账户及衍生品账户之间的资金划拨，而无需事前经托管人同意或向托管人出具任何形式的指令。管理人选择通过自助转账方式进行资金划转的，应自行监控并保障资金划转安全，因此对计划资产造成损失的，由管理人承担。

（二）选择期货经纪机构及期货投资资金清算安排（如有）

本计划投资于期货前，资产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。资产管理人、资产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资产管理人选定的期货经纪公司负责办理。

如期货经纪机构及托管资金账户开立银行的业务规则允许且技术支持，管理人可以通过自助转账方式，自行完成托管账户与期货保证金账户之间的资金划拨，而无需事前经托管人同意或向托管人出具任何形式的指令。管理人选择通过自助转账方式进行资金划转的，管理人应监控并保障资金划转安全。

（三）其他交易的清算与交收

其他交易的清算与交收由托管人依据管理人符合本合同约定的有效资金划拨指令和其他相关文件进行资金划拨。

（四）参与、退出的资金清算

1、本计划份额参与、退出的确认及清算由管理人或其指定的份额登记机构负责。

2、管理人或其委托的份额登记机构应将每个开放日的参与、退出数据传送给托管人。管理人应对传递的参与、退出数据的真实性、准确性、完整性负责。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及转换款项。

3、管理人应在 T+5 日前将参与净额（不包含参与费）划至托管账户。如参与净额未能如期到账，托管人应及时通知管理人采取措施进行催收，由此给计划造成损失的，由责任方承担，管理人负责向责任方追偿计划的损失。

4、管理人应在退出确认日后【4】个交易日内向托管人发送退出的划拨指令并保证托管账户预留足额资金，托管人依据划款指令在退出确认日后【5】个交易日（包含退出产生的应付费用）内划至管理人指定账户。涉及代理销售机构退出资金的交收，管理人应在与代理销售机构约定的退出资金交收日之前向托管人发送退出的划拨指令并保证托管账户预留足额资金，若管理人无法在与代理销售机构约定的退出资金交收日完成资金交收而引起代理销售机构相关损失，由管理人承担。若退出金额未能如期划拨，由此造成的损失，由责任方承担，管理人负责向责任方追偿计划的损失。

（五）无法按时清算的责任认定及处理程序

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。

资产管理人应保证其发送的资金划拨指令合法有效、指令签章与预留印鉴表面一致、指令要素正确且托管账户上有充足的资金。上述任一条件不满足时，托管人有权拒绝管理人发送的资金划拨指令，并视上述所有条件满足时间为指令送达时间。资产管理人在发送资金划拨指令时应保证资产托管人的划款处理时间，一般为2个工作小时。由于上述任一条件不满足导致资金未能及时出账所造成的损失，由相关责任方承担。在计划财产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、行政法规和本合同约定的指令不得无故拖延或拒绝执行。

（六）资金、证券账目及交易记录的核对

资产管理人应定期与资产托管人对计划资产的证券账目、期货账目、实物券账目、交易记录进行核对。

1、交易记录的核对

资产管理人按【日】进行交易记录的核对。对资产委托人披露净值之前，必须保证披露当天所有实际交易记录与会计账簿上的交易记录完全一致。如果实际交易记录与会计账簿记录不一致，造成本计划资产会计核算不完整或不真实，由此导致的损失由相关责任方承担。

2、资金账目的核对

资金账目按【日】核对。

3、证券账目的核对

资产管理人应定期和资产托管人核对证券账目，确保双方账目相符。

第十九节 越权交易的界定

（一）越权交易的界定

越权交易是指资产管理人违反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主动投资交易行为，包括：

1、违反有关法律法规和本合同规定进行的投资交易行为。

2、法律法规禁止的超买、超卖行为（如有）。

（二）越权交易的处理程序

发生越权交易的，资产管理人应当及时采取有效措施进行纠正。如因越权交易行为导致任何一方损失的，应当由过错方承担赔偿责任。

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

（三）资产托管人的投资监督范围

资产托管人根据法律法规要求和本合同约定对资产管理人的相关投资行为进行监督，监督范围以本合同之附件《投资监督事项表》为限确定。

1、资产托管人仅根据其实际获得的、与本计划所直接投资的资产有关的客观数据对资产管理人的投资行为进行监督，资产托管人的监督范围不包括新股新债申报金额与数量、盘中监控或跨产品合并计算等事项，以上事项仅由管理人负责监控并执行。如因管理人提供底层数据材料的提供频率、脱敏处理、可披露程度等原因导致托管人实际监督范围受限的，由此造成的后果由相应责任方承担。

资产托管人对资产管理人进行计划资产投资的监督和检查自本资产管理计划成立之日起开始，至本计划终止日起结束。

2、投资监督的处理程序

（1）场内交易：资产托管人根据经核对的估值数据对管理人的场内交易进行事后监督。如发现资产管理人的投资运作存在违反《投资监督事项表》规定的越权行为时，资产托管人应及时通知资产管理人进行纠正；资产管理人收到通知后及时核查，并以电话或书面形式向资产托管人进行解释或举证。

（2）场外交易：资产托管人根据《投资监督事项表》规定，对资产管理人发送给资产托管人的场外投资划款指令进行审核，如果发现资产管理人的投资行为不符合规定，有权拒绝执行。

（3）在资产托管人要求资产管理人改正期间，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。资产管理人对资产托管人通知的越权事项未能按照资产托管人要求纠正的以及发生资产托管人认为可能对计划资产产生重大不利影响的情况时，资产托管人有权报告中国证监会，资产管理人并就因其越权投资管理而致使资产委托人及计划资产遭受的损失承担赔偿责任。

（4）法律法规禁止的超买、超卖行为（如有）。

资产托管人在行使监督职能时，如果发现资产管理计划资产投资证券过程中出现超买或超卖现象，应立即提醒资产管理人，由资产管理人负责解决。如果因资产管理人原因发生超买行为，资产管理人必须于证券交易资金交收日上午 10:00 之前完成融资，保证完成清算交收。

（四）资产委托人确认，资产托管人投资监督的真实性、准确性和完整性受限于资产管理人、证券经纪商、期货经纪商及其他中介机构提供的数据和信息，由于上述机构提供的信息的错误和遗漏所引起的损失由责任方承担。

第二十节 资产管理计划的估值与会计核算

（一）计划资产的估值

1、估值目的

客观、准确地反映计划资产的价值，并为计划份额的参与和退出等提供计价依据。

2、估值时间

本计划的估值核对基准日为每个交易日。

管理人、托管人应于估值核对基准日【的次一交易日】对估值核对基准日的计划资产净值及份额净值进行核对。

3、估值依据

估值应符合本合同约定及其他法律、法规的规定，如法律法规未做明确规定的，参照证券投资基金行业通行做法处理。

4、估值对象

本计划的估值对象为资产管理计划所拥有的所有资产及负债。

（1）计划资产总值计算保留到小数点后【2】位，小数点后第【3】位四舍五入。

（2）计划资产净值计算保留到小数点后【2】位，小数点后第【3】位四舍五入。

（3）本计划资产份额净值保留到小数点后【3】位，小数点后第【4】位四舍五入，由此产生的收益或损失由本计划资产承担。

5、估值方法

本计划按以下方式进行估值：

（1）证券交易所上市的有价证券的估值

A、证券交易所上市的有价证券（如股票、交易所上市交易的基金、供股权等），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，以最近交易日的市价（收盘价）估值。

B、证券交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（包括但不限于债券、资产支持证券等投资品种，但可转换债券除外），选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值。如第三方估值机构不发布估值价的，采用相应估值技术确认公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按历史成本估值。

C、对在证券交易所市场上市交易的可转换债券，选取每日收盘价作为估值全价，减去其中所含当日的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，以最近交易日债券

收盘价作为全价，减去其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。

(2) 处于未上市流通期间的有价证券应区分如下情况处理：

A、首次公开发行未上市的有价证券（如股票、交易所上市交易的基金、可转换债券等）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历史成本估值。

B、首次公开发行未上市的固定收益品种（包括但不限于债券、资产支持证券等投资品种，但可转换债券除外），选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值。如第三方估值机构不发布估值价的，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，按历史成本估值。

(3) 对在全国银行间债券市场交易的固定收益品种（包括但不限于债券、资产支持证券、非公开定向债务融资工具、同业存单等投资品种），选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值。如第三方估值机构不发布估值价的，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，按历史成本估值。

(4) 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。

特别地，上述选用第三方估值机构提供的估值价进行估值的固定收益品种，其中：证券交易所固定收益品种优先按照中证指数有限公司（简称“中证”）提供的估值净价估值，银行间固定收益品种优先按照中央国债登记结算有限责任公司（简称“中债”）提供的估值净价估值。若管理人需调整前述对应第三方机构的，则以书面形式通知托管人。

(5) 期货交易所上市的期货合约以估值日的结算价估值。若估值当日无结算价的，采用最近交易日结算价估值。

(6) 本计划持有的公募证券投资基金估值

A、未在证券交易所上市交易的基金，按估值日前一交易日的基金份额净值估值；估值日前一交易日基金份额净值无公布的，按此前最近交易日公布的基金份额净值估值。

B、货币市场基金以成本列示，按基金管理公司公布的前一交易日（含节假日）的每万份收益计提收益。

(7) 本计划持有的券商收益凭证，如收益凭证投资协议中有明确预期或固定收益率的，按成本列示并每日加计应收利息（或应计收益）进行估值；没有约定的，按照凭证发行方提供的定期价值报告估值，如无法提供的，由管理人与托管人根据本金与收益结算条款协商估值方法（其中包含按历史成本估值）。

(8) 本计划持有的资产管理产品（银行理财产品、信托计划、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、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、私募基金等场外投资品种），按照以下方法估值：

A、场外投资标的合同或场外投资标的管理人出具的相关公告能够提供固定收益率的投资标的，按成本列示，并每日加计应收利息（或应计收益）进行估值；

B、按面值及每万份收益计价的投资标的，以成本列示，按投资标的管理人、场外投资

标的运营服务机构或场外投资标的的托管人提供的最新（含节假日）每万份收益计提收益；

C、按份额净值计价的投资标的，按照投资标的的管理人、投资标的的运营服务机构或投资标的的托管人提供的最新份额净值估值，如前述投资标的的管理人、运营服务机构或托管人未提供份额净值依据，则按成本估值。

（9）银行存款每日计提应收利息，按本金加应收利息计入资产，证券、期货、期权资金账户内资金不计提利息，以实际结息数为准。

（10）如存在上述条款未覆盖的投资品种或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协商一致，并将加盖其公章的估值方法调整说明函递交托管人后，按最能反映公允价值的价格进行估值。

（11）上述估值方法，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。

6、汇率

本计划港股通投资持有外币证券资产的估值涉及到港币对人民币汇率的，可参考估值日当日中国人民银行或其授权机构公布的人民币汇率中间价，或其他可以反映公允价值的汇率进行估值。

7、估值程序

管理人负责对委托财产进行估值、计算计划资产净值，并负责与托管人进行核对。管理人作为本委托财产的会计主体，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，由此造成的后果由管理人承担。

在法律法规和中国证监会允许的情况下，管理人与托管人可以各自委托第三方机构进行计划资产估值，但不改变管理人与托管人对计划资产估值各自承担的责任。

8、资产净值的确认

本计划估值应符合法律、法规规定及本合同约定，如无明确规定或约定的，应由管理人【（或管理人委托的运营服务机构）】与托管人协商一致确定。用于向委托人报告的计划份额净值由管理人负责计算，托管人进行复核。如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照管理人对计划资产净值的计算结果为准。

9、估值错误的处理

如管理人或托管人发现计划资产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委托人利益时，应立即通知对方，共同查明原因，协商解决。

当计划资产估值错误偏差达到计划资产净值的【0.5】%时，管理人应该立即更正并在定期报告中报告委托人。管理人计算的计划资产净值已由托管人复核确认、但因计划资产估值错误给委托人造成损失的，由管理人与托管人按照管理费率和托管费率的比例各自承担相应的责任。

由于一方当事人提供的信息错误，另一方当事人在采取了必要合理的措施后仍不能发现

该错误，进而导致计划资产净值计算错误造成委托人的损失，以及由此造成以后交易日计划资产净值计算顺延错误而引起的委托人的损失，由提供错误信息的当事人一方负责赔偿。

管理人按本合同约定的按公允价值进行估值时，所造成的误差不作为计划资产估值错误处理。

10、估值调整的情形与处理

如发生估值调整的情形，由管理人与托管人、运营服务机构（如有）协商解决。

11、暂停估值的情形

（1）计划投资所涉及的交易场所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

（2）证券/期货经纪服务机构等外部机构未能提供估值所需资料，导致管理人（或其委托的运营服务机构）、托管人无法对计划资产进行正常估值时；

（3）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资产价值时；

（4）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，而管理人为保障投资者的利益，决定延迟估值的情形；

（5）管理人或托管人有合理理由认为根据现有的材料无法准确估值的情形；

（6）中国证监会认定的其他情形。

12、资产管理计划份额净值的确认

本计划估值核对基准日的计划份额净值由管理人负责计算，托管人进行复核。如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照管理人对计划资产净值的计算结果为准。

13、特殊情况的处理

由于不可抗力原因，或由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误，或国家会计政策变更、市场规则变更等，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，但未能发现错误或虽发现错误但因前述原因无法更正的，由此造成的计划资产估值错误，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减轻或消除由此造成的影响。

（二）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：

1、资产管理人为本计划的主要会计责任方。

2、本计划的会计年度为公历年度的1月1日至12月31日。

3、计划核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位。

4、会计制度执行国家有关会计制度。

5、本计划单独建账、独立核算。

6、资产管理人及资产托管人各自保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，

按照本合同约定编制会计报表。

7、资产托管人定期与资产管理人就资产管理计划的会计核算、报表编制等进行核对并以书面方式确认。

第二十一节 资产管理计划的费用与税收

（一）与资产管理计划有关的费用

- 1、管理费。
- 2、托管费。
- 3、运营服务费。
- 4、业绩报酬。
- 5、投资顾问费。
- 6、资产管理计划成立后的银行汇划费用。
- 7、按照国家有关规定和本合同约定，可以在资产管理计划资产中列支的其他费用。

管理人和托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或资产管理计划财产的损失，以及处理与资产管理计划财产运作无关事项或不合理事项所发生的费用等不得列入资产管理计划的费用。

（二）费用计提方法、计提标准和支付方式

1、管理费

管理费率为年费率【0.5】%。在通常情况下，管理费按前一自然日计划资产净值的年费率计提。计算方法如下：

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

H 为每日应计提的管理费

E 为前一自然日的计划资产净值

管理费自计划成立日起，每日计提，按【自然季度】支付。自下一【自然季度】开始，托管人根据管理人提交的划款指令进行付费。费用扣划后，管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系托管人协商解决。

资产管理人指定收取管理费的银行账户为：

户名：【上海中期期货股份有限公司】

开户行：【平安银行上海分行营业部】

账号：【11014508417000】

2、托管费

托管费率为年费率【0.025】%。在通常情况下，托管费按前一自然日计划资产净值的年费率计提。计算方法如下：

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

H 为每日应计提的托管费

E 为前一自然日的计划资产净值

托管费自计划成立日起，每日计提，按【自然季度】支付。自下一【自然季度】开始，托管人根据管理人提交的划款指令进行付费。费用扣划后，管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系托管人协商解决。

托管人指定收取托管费的银行账户为：

户名：国泰君安证券股份有限公司

开户行：【招商银行股份有限公司上海张江支行】

账号：【415900000010916】

大额支付号：【308290003492】

3、运营服务费

运营服务费率按年费率【0.025】%。在通常情况下，运营服务费按前一自然日计划资产净值的年费率计提。计算方法如下：

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

H 为每日应计提的运营服务服务费

E 为前一自然日的计划资产净值

运营服务费自计划成立日起，每日计提，按【自然季度】支付。自下一【自然季度】开始，托管人根据管理人提交的划款指令进行付费。费用扣划后，管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系托管人协商解决。

运营服务机构指定收取运营服务费的银行账户为：

户名：国泰君安证券股份有限公司

开户行：【招商银行股份有限公司上海张江支行】

账号：【415900000010916】

大额支付号：【308290003492】

4、业绩报酬

本计划不收取业绩报酬。

5、投资顾问费

(1) 固定投资顾问费

固定投资顾问费率为年费率【0.5】%。在通常情况下，固定投资顾问费按前一自然日计划资产净值的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times \text{年投资顾问费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的固定投资顾问费

E 为前一自然日的计划资产净值

固定投资顾问费自计划成立日起，每日计提，按【自然季度】支付。自下一【自然季度】开始，托管人根据管理人提交的划款指令进行付费。费用扣划后，管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系托管人协商解决。

（2）浮动投资顾问费

1) 本计划浮动投资顾问费计提基准为年化【5.5%】。

2) 浮动投资顾问费的计提基准日：【委托人退出日、分红权益登记日、计划清算日】

3) 浮动投资顾问费的计算：采用单个委托人单笔投资年化收益差额法计提，即在浮动投资顾问费计提基准日，资产委托人每笔所持份额或退出份额在持有期（即下述公式中的“T”，下同）的年化收益率大于浮动投资顾问费计提基准时，分别计算每笔份额在上一成功计提基准日至本次计提基准日持有期间的年化收益率（R），对超出浮动投资顾问费计提基准的持有期差额收益按【60%】比例进行计提。

浮动投资顾问费的具体计算及支付如下：

①【退出或计划清算】时提取浮动投资顾问费

T_n = 【退出日或清算日】的计划份额累计净值；

T_0 = 认购或参与日（以下简称“参与日”）或该资产委托人最近一次成功计提浮动投资顾问费基准日（以下简称“最近报酬日”）的计划份额累计净值；

T_1 = 参与日或最近报酬日的计划份额净值；

T = 该资产委托人最近一次浮动投资顾问费成功计提日（若无最近一次浮动投资顾问费成功计提日，则认购所得份额为本计划成立日，参与所得份额为参与确认日）至本次浮动投资顾问费计提日之间的实际天数；

E = 浮动投资顾问费；

B = 浮动投资顾问费计提基准；

K = 当日退出份额数量（退出时）或浮动投资顾问费计提基准日（非退出时）持有的份额数量；

$R = (T_n - T_0) / T_1 \times 365 / T \times 100\%$ ；

浮动投资顾问费计提的条件为（R 为年化收益率）：

当 $R - B > 0$ 时，对超出浮动投资顾问费计提基准部分提取【60%】的浮动投资顾问费，即 $E = K \times T_1 \times (R - B) \times T / 365 \times 【60%】$ ；

当 $R - B \leq 0$ 时，不提取浮动投资顾问费。

②分红提取浮动投资顾问费

当发生分红时，管理人或管理人委托的运营服务机构在分红权益登记日先按“退出或计划清算时提取浮动投资顾问费”的方法计算每个资产委托人的应计提浮动投资顾问费金额，然后在派发分红时从分红金额中扣除浮动投资顾问费；当分红金额不足以扣除浮动投资顾问费时，以分红金额为限进行扣除。

浮动投资顾问费采用按账户计提的方式,多次参与退出的计划份额在确定份额参与日或最近报酬日时采用“先进先出”法。

浮动投资顾问费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

4) 浮动投资顾问费的支付

浮动投资顾问费由【管理人或运营服务机构】负责计算及复核,并由管理人在委托人分红或退出或清算款项(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(含浮动投资顾问费)划拨到募集账户,管理人扣除归投资顾问所有的应计提浮动投资顾问费后,将剩余的退出金额支付给委托人。

浮动投资顾问费提取频率不得超过每6个月一次,委托人赎回日、计划清算日以及合同约定的其他浮动投资顾问费计提基准日遇非交易日顺延的情况除外。

投资顾问指定收取投资顾问费的银行账户为:

户名: 上海瞰瞻资产管理有限公司

开户行: 中国建设银行股份有限公司上海宝武大厦支行

账号: 31050168460000000085

6、上述第(一)款中第【6】-【7】项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或摊入当期计划资产运作费用,由资产托管人按照资产管理人的划款指令从计划资产中支付。

除业绩报酬及浮动投资顾问费外,上述条款提及的税费应在计算计划资产净值时予以扣除,交易所或第三方金融机构调整税费征收种类或相关费率时,以上税费也随之调整,具体调整时间以管理人通知为准。

7、不列入资产管理计划费用的项目

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。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资产管理计划资产的损失,以及处理与资产管理计划资产无关的事项发生的费用等不得列入资产管理计划费用。

(三) 资产管理计划的税收

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,使得资产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。

2、本计划清算后,如资产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,资产管理人有权向资产委托人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、资产委托人应缴纳的税收，由资产委托人负责，资产管理人不承担代扣代缴或纳税的义务。

5、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、资产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，则资产管理人经与资产托管人协商一致并由资产管理人提前公告后，可直接对本合同中涉及的相关内容进行修改和调整。

（四）费用调整

1、本计划调低各项费用，经资产管理人和托管人协商一致（包括但不限于加盖资产管理人公章的函件、授权邮箱发送的邮件等书面文件或托管人认可的其他方式）后生效执行，资产管理人应通过本计划合同约定的通知方式告知份额持有人；**若调高各项费用，则应取得全体份额持有人的书面同意或者经由份额持有人大会决议通过。**

2、本计划存续期限届满前合同各方未按照本计划合同约定进行展期的，则自存续期届满之日（不含）起本计划停止计提管理费、托管费、运营服务费、投资顾问费。如本计划后续成功展期的，原计划存续期限届满之日至成功展期期间的上述费用，需按照原计划合同或相关补充协议的约定补充计提。

第二十二节 收益分配

（一）收益分配是指将本资产管理计划的可分配收益根据持有资产管理计划份额的数量按比例向计划份额持有人进行分配。

（二）本计划可供分配收益为截止收益分配基准日本计划的累计未支付利润和已实现收益的孰低数。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、公允价值变动及其他收入等本计划运作产生的各项收入扣除管理费、托管费、运营服务等本计划运作产生的各项费用后的余额；本计划已实现收益指累计未支付利润减去公允价值变动收益后的余额。

（三）收益分配原则、方式及收益分配方案的确定

1、收益分配原则和方式：

（1）【本计划的收益分配方式为现金方式和红利再投资。】本计划收益分配默认采用现金方式，红利再投资是将现金红利按照计划分红除权日的计划份额净值自动转为计划份额。

（2）同等份额的享有同等分配权。

（3）收益分配基准日的份额净值减去每份份额收益分配金额后不能低于本计划初始面

值。

(4) 当期收益先弥补上一年度亏损后，方可进行当年收益分配。

(5) 计划份额持有人可以选择收益分配方式。计划份额持有人变更收益分配方式的，应当通过销售机构提交申请，由份额登记机构进行处理。

(6) 在符合有关计划分红条件和收益分配的前提下，资产管理人有权决定是否对计划进行收益分配，收益分配基准日与收益分配比例由资产管理人决定，但每年进行不超过2次收益分配，间隔不得低于6个月。

(7) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

2、收益分配方案的确定

(1) 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。

(2) 管理人应当于分红权益登记日前，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财务数据的复核，并将复核意见书面通知管理人。资产管理人应确保分配原则、分配时间及分配方式符合法律规定和合同约定，并保证资料的准确性。复核通过后，管理人通过网站公告或以本计划合同约定的其他形式通知计划份额持有人收益分配方案。

(四) 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。

第二十三节信息披露

(一) 信息披露的职责

资产管理人作为本计划的信息披露义务人，应当按照法律法规的要求，主动、真实、准确、完整、及时向投资者定期披露计划特定信息，包括但不限于净值报告、各类定期报告、临时报告等。

(二) 信息披露的形式

本计划的信息披露可选择下列任何一种方式进行，并自披露之日起五个工作日届满之日视为送达委托人：

1、邮寄服务

资产管理人或代理销售机构向资产委托人邮寄定期报告、临时报告等有关本计划的信息。资产委托人在开户合约书上填写的通信地址为送达地址。通信地址如有变更，资产委托人应当及时通知资产管理人。

2、传真或电子邮件或手机短信等

如委托人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，资产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资产委托人。资产委托人上述联系方式若发生变更应当及时通知资产管理人。

3、管理人网站

【<http://www.shcifco.com/>】管理人通过管理人网站向资产委托人提供报告和信息查询，内容包括净值报告等。

（三）信息披露的内容及时间

1、本资产管理计划运作期间，管理人至少每【周】披露一次经托管人复核的资产管理计划份额净值。

2、本资产管理计划运作期间，管理人应当向资产委托人提供下列信息披露文件：

- （1）本合同、计划说明书和风险揭示书；
- （2）资产管理计划净值、资产管理计划参与、退出价格；
- （3）资产管理计划定期报告，至少包括季度报告和年度报告；
- （4）重大事项的临时报告；
- （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的情况；
- （6）资产管理计划清算报告；
- （7）发生可能影响资产委托人利益的重大事项时，在事项发生之日起五日内向资产委托人披露；
- （8）中国证监会规定的其他事项。

托管人对上述信息披露事项中的资产管理计划净值以及定期报告中的财务数据承担复核义务。

3、自计划成立之日起，管理人于每个会计年度截止日后四个月内披露年度报告，在每季度结束之日起一个月内披露季度报告。

年度报告包括但不限于下列信息：

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

(9) 投资经理变更、重大关联交易等涉及投资者权益的重大事项；

(10) 中国证监会规定的其他事项。

资产管理计划季度报告应当披露前款除第(6)项之外的其他信息。

资产管理计划成立不足三个月或者存续期间不足三个月的，管理人可以不编制资产管理计划当期的季度报告和年度报告。

托管人负责出具托管人履职报告，并对上述信息披露事项中定期报告中的财务数据承担复核义务。

4、临时报告

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5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；
- (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。

发生本合同约定的、可能影响委托人利益的重大事项时，包括但不限于上述需向证券投资基金业协会报告的重大事项，以及其他对计划资产净值产生重大影响的事件等，资产管理人应在事项发生之日起5个工作日内向投资者披露。

5、清算报告

计划终止，管理人应于计划终止后20个工作日内做出处理资产管理计划事务的清算报告，并在20个工作日内送达计划委托人，在资产管理计划清算结束后5个工作日内将清算结果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。

6、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的，管理人应及时向投资人充分披露。

7、向监管机构提供的报告

资产管理人向投资者提供下列信息披露文件，应当及时报送中国证监会相关派出机构、证券投资基金业协会：

- (1) 资产管理合同、计划说明书和风险揭示书；
- (2) 资产管理计划净值，资产管理计划参与、退出价格；
- (3) 资产管理计划定期报告，至少包括季度报告和年度报告；
- (4) 重大事项的临时报告；
- (5) 资产管理计划清算报告；
- (6) 中国证监会规定的其他事项。

(四) 委托人可以在中国期货业协会网站(www.cfachina.org)查询有关期货公司资产管理业务资格、从业人员、主要投资策略、投资方向及风险特征等基本情况。

（五）特定计划类别信息披露要求

本计划属于【固定收益类】资产管理计划，资产管理人应当通过醒目方式向投资者充分披露和提示产品的投资风险，包括但不限于产品投资债券面临的利率、汇率变化等市场风险以及债券价格波动情况，产品投资每笔非标准化债权类资产的融资客户、项目名称、剩余融资期限、到期收益分配、交易结构、风险状况等。

（六）管理人应当按照相关法律法规和有权机关不时作出的要求，将相关信息披露文件及时报送中国证监会相关派出机构以及中国证券投资基金业协会。

（七）除按照《管理办法》、《运作规定》中关于信息披露的有关规定及本合同进行披露以外，管理人和托管人对披露前的委托财产管理计划信息、从对方获得的业务信息应予保密，不得向任何第三方泄露。法律、法规另有规定的以及审计需要的除外。

第二十四节 风险揭示

签署本资产管理计划合同前，投资者应当了解本计划的相关风险，认真阅读本计划合同及《期货资产管理计划风险揭示书》。签署本计划合同，投资者将被视为已注意到并认真考虑了本计划的相关风险，且投资者将被视为承认并同意承担《期货资产管理计划风险揭示书》所列风险。《期货资产管理计划风险揭示书》作为本计划合同一部分，与本计划合同具有同等法律效力。

本计划风险揭示内容详见本计划合同正文前单列的《期货资产管理计划风险揭示书》。

第二十五节 资产管理合同的变更、终止与财产清算

（一）资产管理合同变更的条件和程序

1、出现下列情况时，资产管理人有权与资产托管人协商后通过公告或本计划合同约定的其他形式变更合同，并由管理人按照本合同约定及时向投资者披露变更的具体内容：

- （1）调低【参与费、退出费、管理费、投资顾问费、业绩报酬、托管费、运营服务费】；
- （2）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；
- （3）不涉及本合同当事人权利义务发生变化或对委托人利益无实质不利影响的；
- （4）按照法律法规或本合同规定，资产管理人有权变更本合同的其他情形。

2、因其他原因需要变更资产管理合同的，可采用以下三种方式中的一种进行变更：

- （1）全体资产委托人、资产管理人和资产托管人协商一致后，可通过签署书面补充协

议对本资产管理合同内容进行变更，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。

(2) 管理人、托管人首先就本合同拟变更事项及变更方式达成一致。管理人就本合同变更事项以书面或电子方式向全体资产委托人发送合同变更征询意见函（或通知），但是该合同变更征询意见函（或通知）的内容须事先征得托管人同意。全体资产委托人应在征询意见函（或通知）指定的日期内按指定的形式回复意见。

资产委托人不同意变更的，应在征询意见函（或通知）指定的日期内明确回复。资产委托人未在指定日期内回复意见或回复意见不明确的，视为资产委托人【同意】合同变更。

(3) 通过份额持有人大会决议通过进行变更。

3、管理人应在本计划合同变更生效前设置临时开放期，强制退出所有不同意合同变更的资产委托人所持全部份额，该等退出不受本合同中关于计划退出的期限限制（如有），具体退出规则以管理人通知为准。

4、对资产管理合同任何形式的变更、补充，资产管理人应当在变更或补充发生之日起【5】个工作日内报基金业协会备案，并抄报中国证监会相关派出机构。

(二) 因资产管理人、资产托管人职责终止导致的合同变更

1、资产管理人职责终止的情形

有下列情形之一的，资产管理人职责终止：

- (1) 被依法取消私募资产管理业务资格；
- (2) 依法解散、被依法撤销或被依法宣告破产；
- (3) 资产管理计划由其他管理人承接；
- (4) 法律法规及中国证监会规定的和资产管理合同约定的其他情形。

2、资产托管人职责终止的情形

有下列情形之一的，资产托管人职责终止：

- (1) 被依法取消基金托管资格；
- (2) 依法解散、被依法撤销或被依法宣告破产；
- (3) 资产管理计划由其他托管人承接；
- (4) 法律法规及中国证监会规定的和资产管理合同约定的其他情形。

3、资产管理人的更换程序

(1) 经资产管理计划份额持有人大会（如有）决议或各方当事人协商一致并签署补充协议形成书面意见，本计划可以更换资产管理人；

(2) 资产管理人更换后，新任资产管理人与资产托管人书面协商一致后，由新任资产管理人在变更生效后5个工作日内公告通知资产委托人；

(3) 资产管理人职责终止的，资产管理人应妥善保管资产管理计划资料，及时向新任资产管理人办理资产管理计划的移交手续，新任资产管理人应及时接收。新任资产管理人应

与资产托管人核对计划资产总值和净值及其他资产托管人认为需要复核的材料；

(4) 资产管理人更换后，如果原任或新任资产管理人要求，应按其要求替换或删除计划名称中与原资产管理人有关的名词字样。

4、资产托管人的更换程序

(1) 经资产管理计划份额持有人大会（如有）决议或各方当事人协商一致形成书面意见，本计划可以更换资产托管人；

(2) 资产托管人更换后，管理人与新任资产托管人书面协商一致后，由资产管理人在变更生效后5个工作日内公告通知资产委托人；

(3) 资产托管人职责终止的，应当妥善保管计划财产和托管业务资料，及时办理计划财产和托管业务的移交手续，新任资产托管人应当及时接收。新任资产托管人与资产管理人核对计划资产总值和净值及其他资产管理人认为需要符合的材料。

5、资产管理人与资产托管人同时更换的条件和程序

(1) 资产管理人和资产托管人的更换分别按上述程序进行；

(2) 由资产管理人在变更生效后5个工作日内公告通知资产委托人。

6、新任资产管理人接收资产管理计划，或新任资产托管人接收计划财产和托管业务前，原资产管理人或原资产托管人应继续履行相关职责，并保证不做出对资产委托人的利益造成损害的行为。原资产管理人或原资产托管人在继续履行相关职责期间，仍有权按照资产管理合同的规定收取管理费或托管费。

(三) 资产管理计划的展期

本计划存续期满前【1个月】，本合同各方应协商本计划是否展期，经管理人、托管人及投资者协商一致后本计划可展期，资产管理计划展期应符合以下条件：

- 1、经管理人、托管人及全体委托人协商一致；
- 2、资产管理计划展期的，应当符合资产管理计划的成立条件；
- 3、法律、行政法规、中国证监会规定和本合同约定的其他情形。

(四) 资产管理计划终止

发生下列事项的，资产管理计划终止：

- 1、资产管理计划期限届满且不展期的；
- 2、经全体委托人、资产管理人和资产托管人协商一致决定终止的；
- 3、份额持有人大会（如有）决议提前终止资产管理计划的；
- 4、资产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、资产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、资产管理合同的委托人人数持续五个工作日少于2人；

- 7、未在证券投资基金业协会完成备案或不予备案的情形；
- 8、本计划委托人退出本计划全部份额的；
- 9、本计划达到止损线（如有）且管理人完成平仓操作，将可变现的非现金资产全部变现的；
- 10、本计划存续期内，管理人根据计划运作情况，经提前 10 个工作日通知全体委托人和托管人的；
- 11、法律、行政法规、中国证监会规定及本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 7 项约定的情形除外。

（五）资产管理计划财产的清算

1、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，自本计划终止之日起 5 个交易日内由资产管理人组织成立清算小组，开始清算程序。管理人应向托管人送达书面通知，通知中应注明计划清算日（简称“计划清算日”）。若存在多次清算的情况，则管理人需及时书面通知托管人后续每个具体清算日期。

（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资产管理人、资产托管人组成。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。

2、清算程序

（1）清算小组成立后，由管理人负责接管非现金类计划财产；由托管人接管现金类计划财产。

（2）由管理人对计划财产和债权债务进行清理和确认。

（3）由管理人对计划财产进行估值和变现。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，在计划终止日前，资产管理人必须将投资组合内所有证券变现。计划终止时，若计划财产仍持有暂时无法流通变现的证券，如未到期回购、未上市新股、在证券锁定期内等，对该类证券在其限制条件解除后进行资产清算。

（4）由管理人制作清算报告。

（5）由管理人对计划财产进行分配。

（6）由管理人负责及时通知委托人清算财产变现情况。

（7）本计划清算完毕，本资产管理合同终止。

3、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。

4、资产管理计划财产按下列顺序清偿：

- (1) 支付清算费用；
 - (2) 交纳所欠税款；
 - (3) 清偿资产管理计划债务；
 - (4) 按资产委托人持有的计划份额比例进行分配并分别扣除应计提业绩报酬（如有）。
- 资产管理计划财产未按前款(1)－(3)项规定清偿前，不分配给资产委托人。

5、二次清算

因持有流通受限证券、投资的产品封闭期（含限售期、锁定期）超过计划存续期等原因导致本计划财产无法及时变现的，资产管理人应当于本计划终止后对计划财产进行清算并先行分配已变现部分。待上述资产可以变现时，资产管理人及时完成剩余可变现计划资产的变现操作后进行二次清算，并将该部分财产另行分配给全体计划份额持有人。本计划持有多个流通受限的证券及投资产品的，资产管理人按本款约定进行多次变现及清算。【二次清算期间（即自本计划首次清算完毕之日（不含）起至本计划第二次清算完毕之日止），资产管理人、资产托管人不计提管理费、托管费、运营服务费（如有）、投资顾问费（如有）及业绩报酬（如有）。】二次清算流程同一次清算。

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。

6、计划财产清算报告的告知安排

资产管理人在本计划终止后【10】个工作日内编制计划财产清算报告，由资产管理人或代理销售机构按照资产委托人提供的联系方式或由资产管理人通过其公司网站告知资产委托人。资产委托人在此同意，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。

7、自清算结果报告公布【20】个工作日内，按照本款第4条确定的顺序分配给委托人的金额后，向委托人支付其实际应得的委托资金和收益。

8、资产管理计划财产清算账册及文件由资产管理人保存至少20年。

9、管理人应当在清算结束后5个工作日内将清算结果报基金业协会备案并抄报中国证监会相关派出机构，并通知资产委托人完成清算财产的分配，本计划清算办理完毕。

（六）资产管理计划财产相关账户的注销

资产管理计划财产清算完毕后，资产托管人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，资产管理人应给予必要的配合。

第二十六节 违约责任

（一）本合同当事人违反合同，应当承担违约责任。给其他当事人造成经济损失的，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。

（二）资产管理人、资产托管人在履行各自职责的过程中，违反法律法规的规定或者本合同约定，给计划资产或者资产委托人造成损害的，应当分别对各自的行为依法承担赔偿责任；因共同行为给计划资产或者资产委托人造成损害的，应当按各自过错承担相应责任。

但是资产委托人在此知悉并接受，发生下列情况，资产管理人或资产托管人可以免于承担相应赔偿责任：

1、资产管理人和/或资产托管人按照中国证监会和基金业协会的规定或当时有效的法律法规、本合同约定的作为或不作为而造成的损失等；

2、在没有故意或重大过失的情况下，资产管理人由于按照本合同规定的投资原则而行使或不行使其投资权而造成的损失等；

3、资产托管人由于按照资产管理人符合本合同约定的有效指令执行而造成的损失等；

4、资产委托人未能事前就其关联交易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资产发生违规投资行为的；

5、资产管理人、资产托管人对由于第三方（包括但不限于交易所、中登公司、中国期货市场监管中心等）发送或提供的数据错误及合理信赖上述信息而操作给本计划资产造成的损失等；

6、不可抗力；

7、法律法规规定及本合同约定的其他情况。

（三）本合同一方当事人造成违约后，其他当事人应当采取适当措施防止损失的扩大；没有采取适当措施致使损失扩大的，不得就扩大的损失要求赔偿。守约方因防止损失扩大而支出的合理费用由违约方承担。

（四）因一方当事人违约而导致其他当事人损失的，资产委托人应先于其他受损方获得赔偿。

（五）由于资产管理人、资产托管人不可控制的因素导致业务出现差错，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，但是未能发现错误或虽发现错误但因前述原因或不可抗力原因未能纠正的，由此造成计划资产或资产委托人损失，资产管理人和资产托管人可以免除赔偿责任。但是资产管理人和资产托管人应积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

（六）本计划托管人仅承担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，更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。

（七）一方当事人依据本合同向另一方当事人赔偿的损失，仅限于直接损失。

第二十七节争议的处理

有关本合同的签署和履行而产生的任何争议及对本合同项下条款的解释，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，合同当事人应尽可能通过协商、调解途径解决。经友好协商未能解决的，应提交上海仲裁委员会金融仲裁院，根据该会届时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁的地点在上海市。仲裁裁决是终局的并对各方当事人具有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

除争议所涉内容之外，本合同的其他部分应当由本合同当事人继续履行。

第二十八节资产管理合同的效力

（一）签署方式

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。

【本合同的签署采用纸质合同方式进行的，委托人为法人或者其他组织的，本合同经委托人、管理人、托管人加盖公章（或合同专用章）以及各方法定代表人/执行事务合伙人或其授权代表签章之日起成立；委托人为自然人的，本合同经委托人本人签字、管理人、托管人加盖公章（或合同专用章）以及双方法定代表人或其授权代表签章之日起成立。】

【本合同的签署采用电子签名方式进行的，投资者以电子签名方式签署本合同后本合同即告成立。投资者电子签名与在纸质合同上手写签名或盖章具有同等法律效力，无须另行签署纸质合同。】

（二）合同生效

资产管理合同成立后，本合同自委托人的参与资金实际交付、份额登记机构确认参与份额之日起生效。

资产管理合同的有效期为合同生效之日起至本计划全部资产清算分配完毕之日终止。

资产管理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。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。

第二十九节其他

（一）【本合同的签署采用纸质合同的方式进行的，由管理人、托管人、委托人共同签署，一式三份，管理人、托管人和委托人各持一份。管理人应妥善保管并按托管人要求及时

向托管人移交三方签署的合同原件。】

【本合同的签署采用电子签名的方式进行的，可采取以下方式：

1、电子合同由委托人签署。管理人与托管人双方同时签署纸质合同，纸质合同原件一式贰份，由管理人与托管人各执壹份，管理人确保委托人以电子签名方式签署的合同内容与管理人和托管人签署的纸质合同内容保持一致。

2、由管理人、托管人、委托人共同采用电子签名签署本合同，该等电子签名与纸质合同上手写签名或盖章具有同等法律效力。在各方签署完成后，管理人应当确保电子签约数据（包括但不限于电子合同、电子签名信息）存储在符合法律法规及监管要求规定的信息系统，并向委托人、托管人提供相应电子合同的查询、下载渠道。】

（二）委托人确认，管理人、托管人可通过套印公司公章（或合同专用章）、法定代表人或授权代表签章的方式与委托人签署本合同，管理人、托管人以套印方式签署本合同的法律效力等同于直接签章，对合同各方具有约束力。

（三）委托人在签署本合同后方可进行认购、参与。

（四）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。

附件 1：投资监督事项表

（以下无正文）

委托人信息表

（请委托人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，由委托人自行承担）

委托人请填写：

（一）委托人

1、自然人

姓名：

证件名称：身份证☐、军官证☐、护照☐

证件号码：

联系地址：

邮编：

联系电话：

2、法人或其他组织

名称：

营业执照号码：

组织机构代码证号码：

统一社会信用代码（如有）：

法定代表人/执行事务合伙人：

联系地址：

邮编：

联系人：

联系电话：

（二）委托人账户

资产委托人指定账户即为计划合同中约定的“委托人收益账户”。委托人认购、参与计划的划出账户与清算退出计划的划入账户，必须为以委托人名义开立的同一个账户。特殊情况导致认购、参与和清算退出计划的账户信息不一致，委托人申请变更委托人账户信息的，应出具符合相关法律法规规定的书面说明并提供相关证明。管理人仅对委托人提供的前述材料进行审查，因变更委托人账户信息所导致的责任由委托人自行承担，但管理人存在过错的

（本页为【《上海中期-誉享半年丰集合资产管理计划资产管理合同》】签署页）

管理人：【上海中期期货股份有限公司】

法定代表人/授权代表：（签章）

日期：年 月 日

委托人：（签章）

日期：年 月 日

托管人：国泰君安证券股份有限公司

法定代表人或授权代表：（签章）

日期：年 月 日

附件 1：投资监督事项表

投资监督事项表

资产托管人根据经核对的本计划估值数据以本表为限对计划资产的投资进行监督。

1、投资范围

详见本合同第十一节“（二）本计划的投资范围及比例”之“1、投资范围”。

2、投资比例和投资限制

（1）投资比例

详见本合同第十一节“（二）本计划的投资范围及比例”之“2、投资比例”。

（2）投资限制

1) 本计划的计划资产总值占计划资产净值的比例不得超过【120%】；

2) 除短期融资券、超短期融资券及利率债以外，信用类债券（即非政策性金融债、企业债、公司债（含非公开发行公司债）、中期票据、非公开定向债券融资工具）的债项评级在 AA（含）以上或主体评级在 AA（含）以上；短期融资券、超短期融资券债项评级为 A-1 级，或主体评级在 AA（含）以上；本计划参考的评级机构不包含中债资信评估有限责任公司以及中证指数有限公司，如同时有两家及以上评级机构评级的，应采用最新发布的评级；若债券无债项评级，则主体评级需在 AA（含）以上；如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；

3) 本计划投资于同一资产的资金，不得超过计划资产净值的 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、债券逆回购除外。同一资产的认定及计算方式：债券、资产支持证券、同业存单、各类资产管理产品按【单只证券或产品市值】进行计算）。

4) 本计划主动投资于流动性受限资产的市值在开放退出期内（即开放日）合计不得超过计划资产净值的 20%；

5) 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，不低于该计划资产净值的 10%。

3、预警止损机制

本计划不设置【预警线、止损线】。