

第一创业富显荣 1 号集合资产管理计划 资产管理合同

合同编号：（JH）FXR1H-HT2024 第 1 号

管理人：第一创业证券股份有限公司
托管人：华泰证券股份有限公司

二〇二六年三月

目 录

一、前言	4
二、释义	4
三、承诺与声明	7
四、当事人及权利义务	9
五、资产管理计划的基本情况	15
六、资产管理计划的募集	18
七、资产管理计划的成立与备案	20
八、资产管理计划的参与、退出与转让	21
九、份额持有人大会及日常机构	26
十、资产管理计划份额的登记	26
十一、资产管理计划的投资	27
十二、服务机构及投资顾问	36
十三、分级安排	36
十四、利益冲突及关联交易	36
十五、投资经理的指定与变更	39
十六、资产管理计划的财产	40
十七、投资指令的发送、确认和执行	42
十八、交易及交收清算安排	44
十九、越权交易的界定	46
二十、资产管理计划财产的估值和会计核算	48
二十一、资产管理计划的费用与税收	53
二十二、资产管理计划的收益分配	57
二十三、信息披露与报告	58
二十四、风险揭示	61
二十五、资产管理合同的变更、终止与财产清算	74
二十六、违约责任	79
二十七、争议的处理	81
二十八、资产管理合同的效力	81
二十九、其他事项	82
附件一：投资运作监督事项表	85
附件二：托管人关联方名单	87
附件三：投资指令（样本）	88
附件四：联系人名单	89
附件五：第一创业证券指令发送授权通知（样本）	90
附件六：预留印鉴	91

特别约定：本《第一创业富显荣1号集合资产管理计划资产管理合同》可以电子签名或者纸质合同手写签名、盖章方式签订，管理人、托管人作为本合同签署方，已接受本合同项下的全部条款；投资者（即第一创业富显荣1号集合资产管理计划的投资者）作为本合同一方，以电子签名或者纸质合同手写签名、盖章方式签署本合同即表明投资者完全接受本合同项下的全部条款，同时本合同成立。

投资者、管理人、托管人同意遵守《电子签名法》的有关规定，三方一致同意投资者自签署《电子签名约定书》之日起，投资者以电子签名方式接受电子签名合同（即本合同、集合计划说明书）、风险揭示书或者其他文书的，视为签署本合同、集合计划说明书、风险揭示书或者其他文书，与在纸质合同、纸质风险揭示书或其他文书上手写签名或者盖章具有同等法律效力，无须另行签署纸质合同、纸质风险揭示书或者其他文书。投资者同意并授权管理人向托管人提供中国证券登记结算有限责任公司电子合同签署有关投资者信息，供托管人完成电子合同签署的相关流程。

一、前言

(一) 订立本合同的目的、依据和原则

1、订立本《第一创业富显荣1号集合资产管理计划资产管理合同》（以下简称“集合资产管理合同”、“资产管理合同”或者“本合同”）的目的是为了明确投资者、管理人和托管人在集合资产管理业务过程中的权利、义务及职责，确保第一创业富显荣1号集合资产管理计划（以下简称“集合资产管理计划”、“资产管理计划”、“集合计划”或者“本计划”）财产的安全，保护当事人各方的合法权益，本合同是约定投资者、管理人和托管人基本权利义务的法律文件。

2、订立本合同的依据是《中华人民共和国民法典》、《中华人民共和国证券法》（以下简称“《证券法》”）、《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《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“《运作管理规定》”）、《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》”）、《集合资产管理计划资产管理合同内容与格式指引》（以下简称“《合同指引》”）等法律、行政法规以及中国人民银行、中国证监会和中国证券投资基金业协会（以下简称“基金业协会”或“协会”）的有关规定。

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

(二) 管理人将按照相关规定向基金业协会办理本计划的设立、变更备案，并及时报送资产管理计划的运行情况、风险情况以及终止清算报告等信息，具体以监管机构要求为准。

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

二、释义

在本合同中，除非文义另有所指，下列词语或者简称具有如下含义：

1、集合资产管理计划、资产管理计划、集合计划、本计划：指第一创业富显荣1号集合资产管理计划；

2、集合计划说明书、说明书：指《第一创业富显荣1号集合资产管理计划说明书》及

对说明书的任何有效的修订和补充；

3、集合资产管理合同、资产管理合同、本合同：指《第一创业富显荣1号集合资产管理计划资产管理合同》及对该合同的任何有效的修订和补充；

4、风险揭示书：指《第一创业富显荣1号集合资产管理计划风险揭示书》及对该风险揭示书的任何有效的修订和补充；

5、《管理办法》：指中国证监会发布并施行的《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》及其不时作出的修订和补充；

6、《运作管理规定》：指中国证监会发布并施行的《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》及其不时作出的修订和补充；

7、《指导意见》：指中国人民银行、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并施行的《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》及其不时作出的修订和补充；

8、中国证监会、证监会：指中国证券监督管理委员会；

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

10、集合计划管理人、管理人：指第一创业证券股份有限公司，也简称为“第一创业证券”、“第一创业”；

11、集合计划托管人、托管人：指华泰证券股份有限公司，也简称为“华泰证券”；

12、销售机构：指第一创业证券股份有限公司，及其他符合相应资格条件的、经管理人委托的、代理推广本集合资产管理计划的机构；

13、注册登记机构：指办理登记、存管、过户、清算和结算等注册登记业务的机构。本集合计划的注册登记机构为第一创业证券股份有限公司；

14、集合计划投资者、投资者：指依据集合资产管理合同和集合计划说明书参与本计划并符合《运作管理规定》等监管规则要求的合格投资者；

15、合格投资者：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产品不低于一定金额且符合下列条件的自然人、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、在基金业协会登记的私募基金管理人、商业银行、商业银行理财子公司、金融资产投资公司、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) 基本养老保险金、社会保障基金、年金基金等养老基金，慈善基金等社会公益基金，合格境外机构投资者（QFII）、人民币合格境外机构投资者（RQFII）；

(六) 中国证监会视为合格投资者的其他情形。

上述家庭金融总资产，是指全体家庭成员共有的全部金融资产，包括银行存款、股票、债券、基金份额、资产管理计划、银行理财产品、信托计划、保险产品、期货和衍生品等。家庭金融净资产是指家庭金融总资产减去全体家庭成员的全部负债；

16、份额持有人、持有人：指通过签订本合同而依法取得和持有本计划份额的投资者；

17、集合计划成立日：指本计划经过推广达到集合计划说明书和本合同约定的成立条件后，管理人公告本计划成立的日期；

18、初始募集期：指自本计划启动募集之日起不超过 60 个自然日的期间，具体募集期间以本计划推广公告为准；

19、开放期：指投资者可以办理本计划参与和/或退出等业务的工作日；

20、封闭期：指本计划成立后的封闭时间段，封闭期内不办理参与、退出业务；

21、存续期：指自本计划成立并存续的期间，本计划的管理期限为 26 个月，从本计划成立日起算；

22、工作日：指中国境内证券交易所的正常交易日；

23、T 日：指办理本计划业务申请的工作日；

24、T+n 日（n 指任意正整数）：指 T 日后的第 n 个工作日；

25、天：指自然日；

26、分红权益登记日：指确认在注册登记机构登记在册的投资者享有某次分红收益分配的日期；

27、会计年度：指公历年度的 1 月 1 日至 12 月 31 日；

28、参与：指投资者申请购买本计划份额的行为；

29、首次参与：指投资者在参与之前未持有本计划的情形；

30、追加参与：指除首次参与外的其他参与情形；

31、退出：指投资者按集合资产管理合同约定的条件要求收回全部或者部分参与资产的

行为；

32、集合计划收益：指本计划投资所得红利、股息、债券利息、基金红利、买卖证券价差、银行存款利息及其他合法收入；

33、集合计划份额、计划份额、份额：指集合计划的最小单位；

34、元：指人民币元；

35、计划单位面值、单位面值：人民币 1.00 元；

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

37、集合计划资产净值、计划资产净值：指集合计划资产总值减去负债后的净资产值；

38、集合计划单位净值、单位净值：指计算日集合计划资产净值除以计算日集合计划总份额的金额；

39、集合计划单位累计净值、累计净值：指集合计划单位净值与集合计划份额累计分红之和；

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

41、不可抗力：不可抗力是指任何不能预见、不能避免、不能克服的客观事件或者因素，包括但不限于：相关法律法规、监管政策、自律规则的变更；国际、国内金融市场风险事故的发生；战争或动乱、自然灾害、公众通讯设备故障、电力中断、互联网故障等；

42、关联方关系：集合资产管理合同和说明书所指关联方关系的含义与《企业会计准则第 36 号——关联方披露》中的关联方关系的含义相同；

43、管理人指定网站、管理人网站：指 <http://www.firstcapital.com.cn>，管理人指定网站变更时以管理人公告为准；

44、信义义务：托管人信义义务是指托管人按恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则，根据相关法律法规和监管规定，在本资产管理合同约定范围内尽职尽责履行安全保管托管资产、办理清算交割、复核审查净值信息、开展投资监督等托管人职责。

三、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公司，并经中国证监会批准，具有从事资产管理业务的资格。

2、管理人承诺已在签订资产管理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，对投资者的财务状况进行了充分评估；按照《基金法》恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用受托资产，不保证受托资产一定盈利，也不保证最低收益或者本金不受损失，以及限定投资损失金额或者比例。

3、管理人保证根据本合同所提供的资料和信息真实、准确、完整、合法。如该资料、报告是依据从托管人、投资者或第三方处获得的数据而编制的，则管理人保证编制过程的完整、真实、合法，没有任何重大遗漏或误导。

4、管理人声明不接受投资者、交易对手方或其他第三方的口头承诺或与投资者、交易对手或其他第三方私下签订补充协议。

（二）托管人的承诺与声明

1、托管人具有合法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受托资产，履行信义义务以及本合同约定的其他义务；根据法律、行政法规、中国证监会及协会的规定和资产管理合同的约定，对管理人的投资或者清算指令等进行监督。

3、托管人保证根据资产管理合同所提供的资料和信息真实、准确、完整、合法，如该资料、报告是依据从管理人、投资者或第三方处获得的数据而编制的，则托管人保证编制过程的完整、真实、合法，没有任何重大遗漏或误导。

（三）投资者的承诺与声明

1、投资者声明参与资产为其拥有合法处分权的资产，保证参与资产的来源及用途符合国家有关规定，保证有完全及合法的授权管理人和托管人进行参与资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参与资产行使相关权利且该权利不会为任何其他第三方所质疑。

2、投资者承诺未使用贷款、发行债券等筹集的非自有资金投资本计划。投资者如为私募资产管理产品（包括但不限于私募银行理财产品，私募资金信托计划，证券公司、证券公司子公司、基金管理公司、基金管理公司子公司、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、私募基金管理人发行的私募资产管理产品等），承诺其实际投资者均不属于前述类型中的资产管理产品，且其实际投资者均为符合《运作管理规定》规定的合格投资者，投资者承诺对实际投资者进行清晰完整的披露，并且已就募集资金的最终投向、用途、投资标的的结构、杠杆比例、特别条款、风险特性向实际投资者进行完整、准确

地披露，不存在任何隐瞒或者误导性陈述，亦不存在资金挪用、恶意欺诈、对实际投资者保本保收益等违反法律法规、监管规定的行为。

3、投资者承诺签署和履行本合同系其真实意思表示，已经按照其章程或者其它内部管理文件的要求取得合法、有效的授权，且不会违反对其有约束力的任何合同和其他法律文件；投资者已经取得签订和履行本合同所需的一切有关批准、许可、备案或者登记，投资事项符合法律法规的规定及其业务决策程序的要求。

4、投资者承诺符合《运作管理规定》合格投资者的要求，向管理人或者销售机构提供的有关投资目的、投资偏好、投资限制、财产收入情况和风险承受能力等基本情况真实、完整、准确、合法，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。前述信息资料如发生任何实质性变更，及时书面告知管理人或者销售机构。

5、投资者承诺已充分理解资产管理合同条款，了解相关权利义务，了解有关法律法规以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者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。投资者确认，管理人、托管人未对受托资产的本金不受损失以及收益状况作出任何承诺或担保，本合同约定的业绩报酬计提基准（如有）、业绩比较基准（如有）不是管理人的保证。

6、投资者承诺知悉和了解《中华人民共和国反洗钱法》《金融机构客户尽职调查和客户身份资料及交易记录保存管理办法》《金融机构大额交易和可疑交易报告管理办法》《金融机构反洗钱规定》等反洗钱相关法律法规的规定，将严格遵守上述规定；承诺其资金来源不属于违法犯罪所得及其收益；承诺其资金来源和去向不涉及洗钱、恐怖融资和逃税等行为；承诺出示真实有效的身份证件或者其他身份证明文件，提供真实有效的业务性质与股权或者控制权结构、受益所有人信息等资料；承诺积极履行反洗钱职责，不借助本计划进行洗钱等违法犯罪活动。

7、投资者确认，投资者于此作出的声明和承诺是真实、准确和完整的，不存在任何隐瞒、欺诈或重大遗漏，并应自行承担因违反本声明和承诺给本人的投资资产造成的损失，若给管理人或本计划财产造成损失的，还应向管理人和本计划财产承担全面、及时、恰当的赔偿责任。

四、当事人及权利义务

（一）投资者

同等风险。

(五) 投资者的权利与义务

1、投资者的权利

- (1) 分享本计划财产收益；
- (2) 取得分配清算后的剩余本计划财产；
- (3) 按照本合同的约定参与、退出和转让本计划份额；
- (4) 按照本合同约定的时间和方式获得本计划的信息披露资料；
- (5) 监督管理人、托管人履行投资管理和托管义务的情况；
- (6) 法律、行政法规、中国证监会及协会规定的和本合同约定的其他权利。

2、投资者的义务

- (1) 认真阅读并遵守本合同，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本计划的，应当向管理人充分披露实际投资者和最终资金来源；
- (4) 按照规定向管理人或者资产管理计划销售机构提供信息资料以及身份证明文件，配合管理人或者其销售机构完成投资者适当性管理、非居民金融账户涉税信息尽职调查、反洗钱等监管规定的工作；
- (5) 认真阅读并签署风险揭示书；
- (6) 在持有的本计划份额范围内，承担本计划亏损或者终止的有限责任；
- (7) 按照本合同约定支付资产管理计划份额的参与款项，承担资产管理合同约定的管理费、业绩报酬（如有）、托管费、审计费、税费等合理费用；
- (8) 不得违反本合同的约定干涉管理人的投资行为，并接受管理人的投资结果，自行承担投资损益；
- (9) 不得从事任何有损本计划及其投资者、管理人管理的其他资产以及托管人托管的其他资产合法权益的活动；
- (10) 不得利用资产管理计划相关信息进行内幕交易或者其他不当、违法的证券期货业务活动；
- (11) 保守商业秘密，不得泄露资产管理计划的投资计划、投资意向、投资信息等，依

法依规提供信息的除外；

(12) 不得违规转让其所持有的本计划份额；

(13) 投资者应当以自己的名义开立资金账户，办理指定手续，用于办理投资划款、红利款项、退出款项以及清算款项的收取，在本合同有效期内，不得撤销该账户，并妥善保管账户资料；

(14) 除非在本合同约定的退出开放期或终止日，不得要求提前终止本资产管理关系；

(15) 本计划财产及投资者需承担管理人代表本计划及投资者处理本计划涉及诉讼、仲裁或争议解决的事项所产生的费用及支出，包括但不限于律师费、仲裁费、诉讼费等，以实际发生金额为准；

(16) 法律、行政法规、中国证监会及协会规定和本合同约定的其他义务。

(六) 管理人的权利与义务

1、管理人的权利

(1) 按照本合同约定，独立管理和运用本计划财产；

(2) 按照本合同约定及时、足额获得管理人管理费用和业绩报酬（如有）；

(3) 按照有关规定和本合同约定行使因本计划财产投资所产生的权利；

(4) 自行提供或者委托经中国证监会、协会认可的服务机构为本计划提供募集、份额登记、估值与核算、信息技术系统等服务，并对其行为进行必要的监督和检查；

(5) 以管理人的名义，代表本计划行使投资过程中产生的权属登记等权利；

(6) 按照法律、行政法规和中国证监会的有关规定，要求投资者提供与其身份、财产与收入状况、证券投资经验、风险认知与承受能力和投资偏好等相关的信息和资料；

(7) 发现投资者或本计划资产涉嫌洗钱的，有权按照《中华人民共和国反洗钱法》和相关规定履行报告义务；

(8) 按照本合同的约定，停止办理本计划份额的参与，暂停办理本计划的退出事宜；

(9) 按照本合同的约定，终止本计划的运作；

(10) 本计划财产受到损害时，代表本计划及投资者向有关责任人追究法律责任（包括但不限于主动追索、仲裁、诉讼、财产保全、强制执行、向侦查机关报案等方式），相应所产生的费用及支出由本计划财产及投资者承担，前述费用及支出包括但不限于律师费、仲裁费、诉讼费等，以实际发生金额为准；

(11) 法律、行政法规、中国证监会及基金业协会规定和本合同约定的其他权利。

2、管理人的义务

- (1) 依法办理本计划的销售、登记、备案事宜；
- (2) 按照中国人民银行、中国证监会、基金业协会等监管机构和自律组织的要求报送本计划产品运作信息；
- (3) 对投资者的风险识别能力和风险承受能力进行评估，向合格投资者非公开募集资金；
- (4) 制作风险揭示书，向投资者充分揭示相关风险；
- (5) 按照诚实信用、勤勉尽责的原则履行受托人义务，管理和运用资产管理计划财产；
- (6) 配备足够的具有专业能力的人员进行投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作本计划财产；
- (7) 建立健全内部管理制度，保证本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，对所管理的不同资产管理计划的受托财产分别管理，分别记账，进行投资；
- (8) 按照资产管理合同约定接受投资者和托管人的监督；
- (9) 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相关要求以及合同的约定；
- (10) 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；
- (11) 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；
- (12) 聘请符合《证券法》规定的会计师事务所对年度财务会计报告进行审计；
- (13) 按照本合同的约定确定收益分配方案，及时向投资者分配收益；
- (14) 编制向投资者披露的资产管理计划季度、年度等定期报告；
- (15) 办理与受托财产管理业务活动有关的信息披露事项；
- (16) 组织并参加本计划财产清算小组，参与本计划财产的保管、清理、估价、变现和分配；
- (17) 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；
- (18) 对于托管人违反法律、行政法规规定或者资产管理合同，对资产管理计划财产以及其他当事人的利益造成重大损失的，应当及时采取措施制止，并报告中国证监会相关派出机构；
- (19) 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以及其他当事人利益的活动；不得向管理人以及任何第三人输送利益；不得委托第三人运作资产管理计划财产；

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

(21) 建立并保存投资者名单；

(22) 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；

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

(24) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告管理人住所地中国证监会派出机构、基金业协会并通知托管人和投资者，具体以监管机构要求为准；

(25) 保证向投资者支付的受托资金及收益返回其参与资产管理计划时使用的结算账户或其同名账户；

(26) 除必要的信息披露及监管要求外，管理人不得以托管人的名义进行营销宣传；

(27) 管理人应根据法律法规及监管规定履行反洗钱义务，并根据人民银行有关规定向托管人发送本计划“受益所有人”信息，配合托管人履行反洗钱义务；

(28) 法律、行政法规、中国证监会及基金业协会规定和本合同约定的其他义务。

(七) 托管人的权利与义务

1、托管人的权利

(1) 按照本合同约定，依法保管本计划财产；

(2) 按照本合同约定，及时、足额获得本计划托管费用；

(3) 法律、行政法规、中国证监会及基金业协会规定和本合同约定的其他权利。

2、托管人的义务

(1) 安全保管本计划财产；

(2) 按规定开立和注销资产管理计划的托管账户及其他投资所需账户；

(3) 对所托管的不同财产分别设置账户，确保本计划财产的完整与独立；

(4) 按照资产管理合同约定，根据管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；

(5) 复核本计划资产净值和份额净值；

(6) 向管理人披露托管人及其控股股东、实际控制人或者其他关联方，以及前述机构发行的证券或者承销期内承销的证券等信息；托管人应当保证该名单的真实性、准确性和完整性，若该名单发生变更时，托管人应及时书面通知管理人；

(7) 监督管理人的投资运作，发现管理人的投资或者清算指令违反法律、行政法规、

中国证监会的规定或者资产管理合同约定的，应当拒绝执行，立即通知管理人并及时报告中国证监会相关派出机构，具体以监管机构要求为准；

(8) 办理与本计划托管业务有关的信息披露事项；

(9) 对本计划财务会计报告、年度报告出具意见；

(10) 编制托管年度报告，报送管理人所在地中国证监会派出机构，具体以监管机构的要求为准；

(11) 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以及其他当事人利益的活动；

(12) 不得为托管人以及任何第三人输送利益，不得委托第三人托管资产管理计划财产；

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

(15) 法律、行政法规、中国证监会及协会规定和资产管理合同约定的其他义务。

五、资产管理计划的基本情况

(一) 资产管理计划的名称

第一创业富显荣 1 号集合资产管理计划。

(二) 资产管理计划的类别

混合类集合资产管理计划。

(三) 资产管理计划的运作方式

封闭式。

(四) 资产管理计划的投资目标、主要投资方向、投资比例

1、投资目标

本计划为混合类资产管理计划，管理人在严格控制风险的基础上，通过对全球经济形势、中国经济发展、证券市场估值水平等的研判，力争为资管计划资产获取回报。

上述投资目标仅供投资者参考，不构成管理人保证投资者参与资产本金不受损失或取得投资收益的承诺。

2、主要投资方向

(1) 权益类资产：国内依法发行并在证券交易所交易的股票（含主板、创业板、科创

板、北交所及其他经中国证监会核准/注册上市的 A 股股票，含且不限于二级市场股票、新股申购、北京证券交易所战略配售股票、股票增发、通过询价转让/大宗交易等方式受让的上市公司股东转让的股票等)、沪港股票市场交易互联互通机制允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票(“沪港通标的股票”)、深港股票市场交易互联互通机制允许买卖的规定范围内的香港联合交易所市场的股票(“深港通标的股票”);

(2) 固定收益类资产(含现金类资产): 现金、各类银行存款(包括银行活期存款、银行同业存款、银行定期存款和银行协议存款等各类存款, 不含结构性存款)、债券逆回购等;

(3) 期货和衍生品类: 以证券公司为交易对手方的场外衍生品, 仅限收益互换(含跨境收益互换);

(4) 资产管理产品: 股票型公开募集证券投资基金、货币市场基金、QDII 基金、证券公司或其资产管理子公司发行的 QDII 资产管理产品、基金公司或其子公司发行的 QDII 资产管理产品。

3、投资比例

(1) 权益类资产的投资比例为资产总值的 20%(含)-100%(不含)。

(2) 固定收益类资产(含现金类资产)的投资比例为资产总值的 0%(含)-80%(不含)。

(3) 参与债券逆回购资金余额不得超过本计划上一日资产净值的 100%, 中国证监会另有规定的除外。

(4) 期货和衍生品类资产的持仓合约价值低于资产总值的 80%(不含)或期货和衍生品账户权益不超过资产总值的 20%(不含)。

(5) 本计划总资产不得超过本计划资产净值的 200%, 计算总资产时, 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, 中国证监会另有规定的除外。

(6) 本计划投资于上述资产管理产品的, 计算本计划总资产时按照穿透原则合并计算所投资资产管理产品的总资产; 本计划投资于上述资产管理产品中的公开募集证券投资基金的, 按照穿透原则合并计算投资同类资产的金額需符合本计划资产配置比例的要求; 本计划投资于上述资产管理产品中其他资产管理产品的, 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額需符合本计划资产配置比例的要求。本计划按照所投资资产管理产品披露投资组合的频率更新计算计划所投资资产的金額或比例。

本计划主要通过投资国内依法发行并在证券交易所交易的股票(含主板、创业板、科创板、北交所及其他经中国证监会核准/注册上市的 A 股股票, 含且不限于二级市场股票、新

股申购、北京证券交易所战略配售股票、股票增发、通过询价转让/大宗交易等方式受让的上市公司股东转让的股票等)、沪港股票市场交易互联互通机制允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票(“沪港通标的股票”)、深港股票市场交易互联互通机制允许买卖的规定范围内的香港联合交易所市场的股票(“深港通标的股票”)、股票型公募基金(运作方式为开放式)、QDII基金、证券公司或其资产管理子公司发行的QDII资产管理产品以及基金公司或其子公司发行的QDII资产管理产品等配置权益类资产,结合本计划的投资策略及管理人的持续跟踪研究,如管理人评估届时权益类资产具有较高投资价值,且目标标的具备相应的投资机会时,将提高对权益类资产的配置,此时权益类资产投资比例可能超过80%。

(五) 资产管理计划的产品风险等级

本计划属于R5(高风险)等级的产品,适合且仅能向风险承受能力为C5(激进型)级及以上或符合专业投资者标准的合格投资者销售。

(六) 资产管理计划的存续期限

本计划的管理期限为26个月,从本计划成立日起算。在符合本合同约定的展期条件下可展期,但按照本合同约定出现本计划应当终止的情形时,本计划将提前终止并进行清算。

(七) 资产管理计划的最低初始募集规模

本计划成立时计划财产的初始资产净值不得低于人民币1000万元,本计划初始募集期及存续期不设规模上限。

管理人有权根据实际情况调整初始募集期及存续期规模上限,并在管理人指定网站公告。

(八) 资产管理计划份额的初始募集面值

本计划的初始募集面值为人民币1.00元。

(九) 资产管理计划的费用

1、本计划销售相关费用

本计划认购费率、参与费率、退出费率为0。

2、本计划运作相关费用

以下费用将从本计划资产中扣除:

费用类型	费率	收费方式
固定管理费	1.5%/年	固定管理费每日计提,按季支付
管理人业绩报酬	年化收益率0%以上部分计提20%	在投资者退出、本计划分红及计划清算时,对符合业绩报酬提取条件的份额计

费用类型	费率	收费方式
		提业绩报酬，业绩报酬从分红资金、退出资金中支付
托管费	0.01%/年	托管费每日计提，按季支付
其他费用	证券交易费用、证券账户开户费、本计划成立后的信息披露费用、注册登记费用、审计费和汇划费，税费，以及按照法律法规及本合同的约定可以在本计划财产中列支的其他费用。	按费用实际支出金额支出。

（十）资产管理计划的分级安排

本计划是否根据风险收益特征进行分级：否。

（十一）资产管理计划的份额登记、估值核算服务机构

第一创业证券股份有限公司（基金业协会业务登记编码：A00020）。

（十二）预警止损机制

本计划不设预警止损机制。

六、资产管理计划的募集

（一）资产管理计划的募集期限、募集对象、销售机构和募集方式

1、募集期限

本计划的初始募集期为自本计划启动募集之日起不超过 60 个自然日的期间，具体募集期间以本计划推广公告为准；管理人有权根据本计划销售的实际情况延长（但最长不得超过 60 个自然日）或缩短募集期限，此变更适用于所有销售机构。

2、募集对象

本计划适合且仅能向风险承受能力为 C5（激进型）级及以上或符合专业投资者标准的合格投资者销售。合格投资者人数累计不得超过 200 人。

3、销售机构

第一创业证券股份有限公司及其他符合相应资格条件的、经管理人委托的、代理推广本计划的机构。

4、募集方式

销售机构应当根据了解的客户情况，推荐与客户风险承受能力相匹配的集合资产管理计划，引导客户审慎作出投资决定，不得误导投资者购买与其风险承受能力不相符合的产品，

不得向风险识别能力和风险承受能力低于产品风险等级的投资者销售集合资产管理计划。

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、电视台、互联网等公众传播媒体或者讲座、报告会、分析会等方式，布告、传单、短信、微信、博客和电子邮件等载体向不特定对象宣传推介，但管理人、销售机构通过设置特定对象确定程序的官网、客户端等互联网媒介向已注册特定对象进行宣传推介的除外，禁止通过签订保本保收益补充协议等方式，或者采用虚假宣传、夸大预期收益和商业贿赂等不正当手段推广集合资产管理计划。

（二）资产管理计划的认购事项

1、认购费用及认购份额的计算

（1）认购费率

本计划无认购费，即认购费率为 0。

（2）认购份额的计算方法

净认购金额=认购金额÷（1+认购费率）

认购费用=认购金额-净认购金额

认购份额=（净认购金额+应计利息）÷1

注：本计划份额计算时采用四舍五入，保留至 0.01 份，由此产生的误差计入本计划财产；多笔参与时，按上述公式进行逐笔计算。

2、认购申请的确认

投资者按销售机构指定营业网点的具体安排，在规定的交易时间段内办理认购，投资者以书面签名或电子合同方式签署本合同后，方可通过销售机构的交易系统申请参与本计划。

销售机构受理认购申请并不代表投资者认购成功，而仅代表销售机构确实收到了认购申请，认购申请受理完成后，投资者不得撤销认购申请。认购申请采取“时间优先、金额优先、申请单号优先”原则进行确认，认购申请是否成功且有效应以注册登记机构的确认并且本计划成立为准。投资者可于本计划成立后 2 个工作日后到各销售机构查询认购确认情况。

3、初始认购资金的管理及利息处理方式

销售机构应当将本计划初始募集期间投资者的资金存入募集账户，在本计划募集期限结束前，任何机构和个人不得动用。本计划成立前，认购款在募集账户产生的利息将折算为本计划份额归投资者所有，其中利息金额以注册登记机构的记录为准。未经注册登记机构确认的认购款项将退还给投资者（无利息）。

（三）资产管理计划的最低认购金额、支付方式

(1) 投资者首次认购本计划的最低认购金额为人民币 1,000,000 元（不含认购费），超额部分不设金额级差，管理人可以根据法律法规的规定及本计划运作的实际情况设置和调整最低认购金额（但最低不得低于人民币 100 万元），并提前披露。投资者可以多次参与本计划，投资者多次参与本计划的每次最低参与金额为人民币 10,000 元，超过部分不设金额级差。

(2) 投资者应开设销售机构认可的交易账户，并在交易账户备足认购的货币资金；若交易账户内资金不足，销售机构将不受理该笔认购申请。

(四) 资产管理计划的募集账户

管理人应当将本计划募集期间投资者的资金存放在募集结算专用账户（募集账户），管理人将在本计划推广公告中披露本计划募集账户信息。

(五) 投资者的认购参与资金（不含认购费用）加计其在初始募集期间产生的利息将折算为本计划份额归投资者所有，利息金额以本计划注册登记机构的记录为准。

七、资产管理计划的成立与备案

(一) 资产管理计划成立的条件和日期

初始募集期限届满时，本计划的初始募集规模不低于人民币 1000 万元且其投资者的人数为 2 人至 200 人（含管理人自有资金参与份额），募集过程符合法律法规和中国证监会的规定。

本计划的募集金额缴足之日起 10 个工作日内，管理人应当公告本计划成立。

托管人于托管账户收到募集资金的当日向管理人发送《资金到账通知书》。

(二) 资产管理计划募集失败

初始募集期限届满，在本计划初始募集规模低于人民币 1000 万元或投资者的人数少于 2 人条件下，本计划募集失败。本计划募集失败的，管理人应当以其固有财产承担本计划因募集行为而产生的债务和费用，在募集期届满后 30 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。

(三) 资产管理计划的成立和备案

本计划成立前，任何机构和个人不得动用投资者参与资金。

管理人应当在本计划成立之日起 5 个工作日内将本合同、投资者名单与认购金额、资产缴付证明等材料向基金业协会备案，具体以监管机构的要求为准。

(四) 本计划在完成备案前，可以以现金管理为目的，投资于银行活期存款、货币市场

基金等中国证监会认可的投资品种。

(五) 资产管理计划无法完成备案的,应当及时告知投资者,并按照合同约定履行终止清算程序。

八、资产管理计划的参与、退出与转让

(一) 资产管理计划的参与、退出

1、参与和退出的场所

本计划的参与和退出场所为管理人及代理销售机构(如有)的营业场所或按照管理人及代理销售机构(如有)提供的其他方式办理参与和退出。

2、参与和退出的开放日和时间

本计划成立后封闭运作,存续期内不办理参与和退出,本合同另有约定的除外。

3、临时开放期

因法律、法规、规章、中国证监会、基金业协会的规定、证券登记结算机构业务规则以及证券交易所等交易规则修订或因本计划运作的实际情况需要变更合同时,管理人有权设定临时开放期,为投资者办理退出业务,临时开放期的具体安排以管理人公告为准。

4、参与和退出的方式、价格、程序及确认等

(1) “未知价”原则,即参与价格为注册登记机构受理参与申请当日本计划的单位净值,退出价格为注册登记机构受理退出申请当日本计划单位净值。

(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) 参与和退出申请的确认:本计划存续期内封闭运作,不办理参与业务。

在临时开放期内,对于投资者的退出申请,销售机构受理退出申请并不表示对该申请是否成功的确认,而仅表示销售机构确实收到了该申请。申请是否有效应以注册登记机构的确认为准。对于开放日当日(T日)交易时间结束前受理的有效退出申请,在正常情况下,本计划注册登记机构在T+2日对该申请的有效性进行确认。投资者可在申请日后第3个工作日起查询确认情况。

对于投资者的退出申请,管理人按照先进先出的原则予以确认,也即是按照投资者份额参与的先后次序进行顺序退出的方式确定退出份额并适用相应的退出费率(如有)。

(4) 参与和退出申请的款项支付:投资者退出申请确认成功后,管理人应按照本合同约定向投资者支付退出款项,退出款项于确认之日起7个工作日内从托管账户中划出。在发生巨额退出的情形时,款项的支付办法参照本合同的有关条款处理。如本计划出现暂停估值

的情形时，管理人与托管人协商后，可以将划拨日期相应顺延。投资者申请退出份额数量超过投资者持有份额数量时，申请无效。

(5) 管理人可根据本计划运作的实际情况并不影响投资者实质利益的前提下调整上述原则。管理人必须在新规则开始实施前在管理人指定网站公告告知投资者。

5、参与和退出的金额限制

因法律、法规、规章、中国证监会、基金业协会的规定、证券登记结算机构业务规则以及证券交易所等交易规则修订或因本计划运作的实际情况需要变更合同时，管理人有权设定临时开放期，因不同意合同变更需要退出本计划的，投资者应当选择一次性全部退出本计划，否则管理人有权发起强制退出投资者持有的本计划全部份额。

如相关法律法规变更导致前述约定不再符合法律法规规定的，管理人有权根据变更后的法律法规要求，合理调整对参与金额和退出份额的数量限制，管理人必须在新规则开始实施前在管理人网站指定公告告知投资者。

6、参与和退出的费用

(1) 参与费用

本计划封闭运作，存续期内不办理参与业务。

(2) 退出费用

本计划无退出费，即退出费率为0。

7、参与份额和退出金额的计算

(1) 参与份额的计算

本计划封闭运作，存续期内不办理参与业务。

(2) 退出金额的计算

退出费=(退出份额×注册登记机构受理申请当日本计划的单位净值-管理人业绩报酬(如有))×退出费率；

退出金额=退出份额×注册登记机构受理申请当日本计划的单位净值-管理人业绩报酬(如有)-退出费；

注：退出金额结果按照四舍五入方法，保留小数点后两位，多笔退出时，按上述公式进行逐笔计算。

8、巨额退出或连续巨额退出、延期支付及延期退出的情形和处理方式

(1) 巨额退出的认定

单个开放日中，本计划净退出申请的份额(退出总份额扣除参与总份额后的余额)超过

本计划上一日总份额的 20%时，即认为本计划发生了巨额退出。

(2) 巨额退出的处理方式

当出现巨额退出时，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、部分顺延退出。巨额退出的价格由注册登记机构受理申请当日的本计划单位净值决定。

在发生巨额退出的情形下，为避免投资者利益因单位净值的小数点保留精度受到重大影响，管理人可以通过设立巨额退出情形下的净值精度应急调整机制从而提高单位净值的精度，从而尽量减轻本计划单位净值异常波动的可能，从整体上减轻对投资者利益的影响。若管理人启用净值精度应急调整机制的，管理人将通过公告、邮件等方式告知投资者。

全额退出：当管理人认为有能力支付投资者的退出申请时，按正常退出程序执行。

部分顺延退出：当本计划支付投资者的退出申请可能会对本计划的资产净值造成较大波动或造成本计划存在流动性困难时，管理人在当日正常接受的退出份额不低于上一日本计划总份额的 20%的前提下，对其余退出申请延期办理。对于当日的退出申请，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；投资者可在申请退出时选择将当日未获受理部分予以撤销，如投资者不撤销未获处理部分，未受理部分自动延迟至下一个工作日办理。转入下一个工作日的退出申请不享有优先权，并以该工作日的本计划单位资产净值为依据计算退出金额，以此类推，直到全部退出为止。

(3) 连续巨额退出：如果本计划连续两个开放日以上发生巨额退出，如本计划支付投资者的退出申请可能会对本计划的资产净值造成较大波动或造成本计划存在流动性困难的，管理人可以暂停接受退出申请；已经接受的退出申请可以延缓支付退出款项。暂停和延缓期限不得超过 20 个工作日。连续巨额退出的价格由注册登记机构受理申请当日的本计划单位净值决定。

(4) 告知投资者的方式

当本计划出现巨额退出并发生部分顺延退出的，或出现连续巨额退出并发生暂停退出的，管理人应及时在管理人指定网站公告，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及时在管理人指定网站公告。

10、单个投资者大额退出

本计划不设置单个投资者大额退出及预约申请安排。但在单个开放日，集合计划净退出申请份额(退出申请总数扣除参与申请总数后的余额)超过上一日集合计划总份额的 20%时，将触发巨额退出机制。

11、拒绝或暂停参与的情况及处理方式

本计划封闭运作，存续期内不办理参与业务。

12、拒绝或暂停退出的情况及处理方式

发生下列情形时，管理人可以拒绝或暂停受理本计划的退出申请：

- (1) 不可抗力的原因导致本计划无法正常运作；
- (2) 证券交易场所交易时间非正常停市，导致当日本计划资产净值无法计算；
- (3) 管理人认为接受某笔或某些退出申请可能会影响或损害现有投资者利益时；
- (4) 因市场剧烈波动或者其他原因导致本计划的现金出现困难时，管理人可以暂停办理本计划的退出；
- (5) 法律、行政法规和中国证监会认定的其他情形或其他在本合同中已载明且中国证监会无异议的特殊情形。

拒绝或暂停受理退出的方式包括：

管理人将在当日立即公告。已接受的退出申请，若管理人有足额支付能力，则管理人将足额支付；如暂时不能足额支付的，将按每个退出申请人已被接受的退出申请量占已接受退出申请总量的比例分配给退出申请人，其余部分在后续工作日予以兑付。同时，在出现上述连续巨额退出的情形时，对已接受的退出申请可延期支付退出款项，但不得超过正常支付时间 20 个工作日，并在管理人指定网站进行公告。

如果发生暂停退出，在暂停结束重新开放退出时，管理人将提前在管理人指定网站对重新开放退出进行公告。

发生本合同未予载明的事项，但管理人有正当理由认为需要暂停接受本计划退出申请的，应向投资者披露。

投资者认可上述关于退出的原则及处理方法，接受管理人依据法律法规及本合同的约定所作出的延期退出或暂停退出的决定。

13、本计划向投资者支付的受托资金及收益应当返回其参与本资产管理计划时使用的结算账户或者同名账户。

(二) 资产管理计划的份额转让

本计划存续期间，在各项条件均满足的情况下，投资者可以通过证券交易所等中国证监会认可的交易平台转让本计划份额，受让方必须是符合《运作管理规定》规定和本合同约定的合格投资者，份额转让应遵守相应的交易场所的相关规定及要求，并按规定办理份额变更登记手续。

管理人和托管人无需就本计划份额转让事宜与投资者另行签订协议。但投资者与受让人

应签署转让协议，并将该转让协议发送给管理人、托管人书面确认，托管人在管理人已书面同意的情况下予以确认。受让方首次参与本计划，应先与管理人、托管人签订资产管理合同。

管理人可以视情况开放本计划的份额转让，管理人应在本计划开放份额转让前5个工作日通过网站公告，份额转让事宜以管理人公告为准。

（三）资产管理计划份额的非交易过户

非交易过户是指不采用参与、退出等交易方式，将一定数量的本计划份额按照一定的规则从某一投资者账户转移到另一投资者账户的行为。本计划注册登记机构只受理因继承、司法执行、以及经注册登记机构认可的其他形式财产分割或转移引起的计划份额非交易过户。

办理非交易过户业务必须提供注册登记机构规定的资料，对于符合条件的非交易过户申请按注册登记机构的有关规定办理，申请人按照注册登记机构规定的标准缴纳过户费用。

（四）资产管理计划份额的冻结

本计划注册登记机构只受理国家有权机关依法要求的本计划份额冻结与解冻事项。

（五）证券期货经营机构及其子公司自有资金参与、退出资产管理计划

1、证券期货经营机构及其子公司自有资金参与的条件

在初始募集期间或存续期内，证券期货经营机构及其子公司可以以自有资金参与本计划。证券期货经营机构包括证券公司、基金管理公司、期货公司及前述机构依法设立的从事私募资产管理业务的子公司，具体范围以中国证监会、基金业协会等监管机构的要求为准。如参与，则证券期货经营机构及其子公司以自有资金参与本计划的份额合计不得超过本计划总份额的50%。法律法规或者中国证监会对证券期货经营机构及其子公司自有资金投资比例另有规定的，从其规定。

证券期货经营机构及其子公司持有计划份额与其他投资者持有的本计划份额享有同等参与收益分配的权利，也承担与所持本计划份额相对应损失的责任。证券期货经营机构及其子公司投入自有资金参与本计划份额不承担任何补偿责任。

2、证券期货经营机构及其子公司自有资金参与、退出的条件

（1）证券期货经营机构及其子公司自有资金参与本计划的持有期限不得少于6个月。

（2）证券期货经营机构及其子公司自有资金在存续期内参与、退出本计划时应当提前5个工作日以公告或其他方式通知全体投资者，并书面征求托管人意见。投资者不同意证券期货经营机构及其子公司自有资金参与、退出的，应当在管理人通知的退出开放日提出退出申请。未提出退出申请的，视同投资者已经同意证券期货经营机构及其子公司自有资金参与、退出。

(3) 投资者和托管人签署本合同即视为同意证券期货经营机构及其子公司可以自行决定在初始募集期间以自有资金参与本计划。

但在发生以下特殊情形时，证券期货经营机构及其子公司自有资金参与、退出可以不受上述条件限制，但事后管理人应及时将自有资金参与、退出情况告知投资者和托管人，并向住所地中国证监会派出机构报告，具体以监管机构的要求为准：

(1) 因规模变动等客观因素导致证券期货经营机构及其子公司自有资金参与份额比例被动超限或可能被动超限（即证券期货经营机构及其子公司自有资金投资比例被动超过或可能被动超过《证券公司风险控制指标计算标准规定》等中国证监会对证券期货经营机构及其子公司自有资金投资比例的规定，或证券期货经营机构及其子公司以自有资金参与本计划的份额合计超过或可能超过本计划总份额的 50%），证券期货经营机构及其子公司在发生上述超限情形或可能超限情形之日起 5 个工作日内退出超限部分的参与份额，5 个工作日后仍超限的，证券期货经营机构及其子公司将在其后 5 个工作日处理。

(2) 为应对本计划巨额赎回以解决流动性风险，在不存在利益冲突并遵守本合同约定的前提下，证券期货经营机构及其子公司自有资金参与及其后续退出本计划。

3、风险揭示和信息披露

(1) 证券期货经营机构及其子公司以自有资金参与本计划的份额，享有与其他投资者份额相同的收益分配权，且不对本计划其他投资者承担任何补偿责任。请投资者注意投资风险。

(2) 证券期货经营机构及其子公司自有资金退出，可能遭遇流动性风险，从而影响本计划损益。管理人将认真履行管理人职责，关注本计划规模变动情况，控制流动性风险。

(3) 管理人将按照法律法规及基金业协会的要求披露自有资金的参与、退出情况及持有期限等信息。

(六) 管理人将按照法律法规及基金业协会的要求，定期将本计划投资者变更情况报送基金业协会，具体以监管机构的要求为准。

九、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。

十、资产管理计划份额的登记

(一) 资产管理计划的份额登记结算业务

本计划份额的登记结算业务指本计划的登记、存管、结算和交收业务，具体内容包括投资者账户管理、份额注册登记、结算及交易确认、资产分配、建立并保管本计划投资者资料表等。

(二) 本计划的份额登记结算业务由管理人负责办理。

(三) 本计划投资者同意并授权管理人、份额登记机构或其他份额登记义务人将本计划投资者名称、身份信息以及本计划份额明细等数据备份至中国证监会认定的机构。

十一、资产管理计划的投资

(一) 资产管理计划的投资目标

本计划为混合类资产管理计划，管理人在严格控制风险的基础上，通过对全球经济形势、中国经济发展、证券市场估值水平等的研判，力争为资管计划资产获取回报。

上述投资目标仅供投资者参考，不构成管理人保证投资者参与资产本金不受损失或取得投资收益的承诺。

(二) 资产管理计划的投资范围

(1) 权益类资产：国内依法发行并在证券交易所交易的股票（含主板、创业板、科创板、北交所及其他经中国证监会核准/注册上市的 A 股股票，含且不限于二级市场股票、新股申购、北京证券交易所战略配售股票、股票增发、通过询价转让/大宗交易等方式受让的上市公司股东转让的股票等）、沪港股票市场交易互联互通机制允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票（“沪港通标的股票”）、深港股票市场交易互联互通机制允许买卖的规定范围内的香港联合交易所市场的股票（“深港通标的股票”）；

(2) 固定收益类资产（含现金类资产）：现金、各类银行存款（包括银行活期存款、银行同业存款、银行定期存款和银行协议存款等各类存款，不含结构性存款）、债券逆回购等；

(3) 期货和衍生品类：以证券公司为交易对手方的场外衍生品，仅限收益互换（含跨境收益互换）；

(4) 资产管理产品：股票型公开募集证券投资基金、货币市场基金、QDII 基金、证券公司或其资产管理子公司发行的 QDII 资产管理产品、基金公司或其子公司发行的 QDII 资产管理产品。

本计划投资于场外衍生品的，实际投资的场外衍生品类型、场外衍生品账户权益占资产总值的比例情况、场外衍生品挂钩标的情况与场外衍生品的收益结构等情况，将通过定期报

告或在管理人指定网站公告等方式向投资者披露。

（三）资产管理计划的投资策略

1、管理人的决策依据

本计划以国家有关法律、法规和本合同的有关规定为决策依据，并以维护本计划投资者利益作为最高准则。具体决策依据包括：

（1）《管理办法》、《运作管理规定》等有关法律法规及《集合资产管理合同》等法律文件；

（2）宏观经济发展态势、微观经济运行环境和证券市场走势，为本计划投资决策的市场基础；

（3）投资对象收益和风险的配比关系。在充分权衡投资对象的收益和风险的前提下作出投资决策，是本计划维护投资者利益的重要保障。针对产品的特点，在衡量投资收益与风险之间的配比关系时，力争保护投资者的本金安全，在此基础上为投资者争取较高的收益。

2、管理人的决策程序

管理人资产管理业务投资决策体系由管理人资产管理业务委员会、资产管理业务部门、投资经理三级体系组成。

管理人资产管理业务委员会是管理人资产管理业务的最高决策机构，下设投资管理委员会负责确定以下事项：

（1）在资产管理业务委员会授权范围内，对资产管理业务部门的投资品种、投资规模等进行授权；

（2）审议资产管理业务部门超出授权限额但未超过监管规定限额的投资；

（3）核准资产管理业务部门投资经理的任职资格；

（4）讨论与决定其他涉及客户资产管理投资业务的重大事宜。

资产管理业务部门的主要职责是：

（1）确定客户资产管理业务投资、研究工作的政策，约束客户资产投资管理的整体过程；

（2）讨论、提名投资经理人选，并报公司资产管理业务委员会下设的投资管理委员会审批；

（3）对投资经理进行适当的定级和授权；

（4）审批超过投资经理授权权限但未超过投资管理委员会授权权限的投资事宜；

（5）制定客户资产管理相关的具体投资研究交易制度；

(6) 建立和维护投资品池；

(7) 讨论与决定其他涉及客户资产管理业务的具体事宜。

投资经理是资产管理业务具体产品的直接管理人，在管理人授权范围内进行投资管理。

3、管理人投资管理的方法和标准

本计划将充分发挥管理人的研究和投资管理优势，在分析和判断宏观经济运行状况和金融市场运行趋势的基础上，在资产配置、类属配置和交易策略层面实施积极管理策略；在严格控制风险的前提下，力争实现组合风险和收益的最优配比。

(1) 资产配置策略

本计划主要通过投资国内依法发行并在证券交易所交易的股票（含主板、创业板、科创板、北交所及其他经中国证监会核准/注册上市的 A 股股票，含但不限于二级市场股票、新股申购、北京证券交易所战略配售股票、股票增发、通过询价转让/大宗交易等方式受让的上市公司股东转让的股票等）、沪港股票市场交易互联互通机制允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票（“沪港通标的股票”）、深港股票市场交易互联互通机制允许买卖的规定范围内的香港联合交易所市场的股票（“深港通标的股票”）、股票型公募证券投资基金（运作方式为开放式）、QDII 基金、证券公司或其资产管理子公司发行的 QDII 资产管理产品以及基金公司或其子公司发行的 QDII 资产管理产品等配置权益类资产，此外管理人将在产品合同约定的投资范围内结合定性以及定量分析，自上而下地实施整体资产配置策略，通过预测各大类资产未来收益率变化情况，在不同的大类资产之间进行动态调整和优化，力争规避市场风险，提高本计划资产收益率。

(2) 现金资产及债券逆回购投资策略

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

(3) 新股投资策略

本计划基于对宏观经济、资本市场的深入分析和理解，通过对中国境内证券交易所发行的新股深入研究，精选具有估值优势和成长优势的网上新股申购股票。在符合北交所战略配售股票发行规则及具备参与资格的情况下，可能对北交所战略配售股票进行投资。通过对发行的新股所属行业公司的估值指标（如 PE、PB、PE/GPS、股息率等）、成长性指标（主营业务收入增长率、净利润增长率、毛利率增长率、净利润现金保障倍数等）、现金流量指标和

其他财务指标进行分析，从中选出价值相对低估、成长性确定、现金流量状况好、盈利能力和偿债能力强的公司，作为本产品的备选新股标的；再通过与市场整体估值水平、行业估值水平主要竞争对手估值水平的比较，确定拟参与投资股票申购的价格和数量。

（4）定向增发股票及询价转让投资策略

管理人将根据行业所处的生命周期、行业的竞争结构、竞争结构的演变态势、行业景气程度、以及政府的产业政策等宏观政策，对行业的相对投资价值进行排序，从而确定初步的行业配置方案。

本计划从估值水平和发展前景两个角度出发，分析不同类别的定向增发及询价转让项目对企业基本面与所处行业的影响。采取定性和定量分析相结合的方法对影响上市公司（含主板、创业板、科创板、北交所）定向增发及询价转让项目未来的价值进行全面的分析，精选股价受益或未能充分体现定向增发及询价转让项目发展潜力的股票。

本计划的股票定量分析方法将在现有定向增发及询价转让项目的基础之上，分析市场现有定向增发及询价转让项目中各行业公司的估值指标、成长性指标、现金流指标和其他财务指标，从中选出价值相对低估、成长性确定、现金流量状况好、盈利能力和偿债能力强的公司，作为本计划的备选定向增发及询价转让股票；再通过分析备选股票所带来的公司资产收益率、资产周转率等变量的时间序列，以及通过对市场整体估值水平、行业估值水平、主要竞争对手估值水平的比较，并参考国际市场估值水平来评估其投资价值。

在定量分析的基础上，从定向增发及询价转让项目目的、定向增发及询价转让受让方的对象结构、定向增发及询价转让项目类别，多层面地分析备选定向增发及询价转让项目所对应的公司的业务环节的竞争优势和劣势、分析定向增发及询价转让项目对公司未来的影响，公司管理方面的优势和劣势等，经过严格的定量分析和定性分析，从战略角度评估参与定向增发及询价转让的可能损益和风险成本，形成是否参与的意见。管理人根据初步确定的行业配置方案，从中挑选出合适的投资标的，在符合监管规定的前提下，本计划可能全部投资于单一标的股票的定向增发及询价转让。

在定向增发及询价转让股票锁定期结束后，管理人将根据对股票内在投资价值和成长性的判断，结合股票市场环境的分析，选择适当的时机卖出。

（5）二级市场股票投资策略

本计划主要通过二级市场竞价交易、大宗交易投资于二级市场股票。管理人多种理念方式精选个股，通过企业价值的快速成长或重新估值实现投资资产的增值。深入研究，对企业、行业的发展脉络进行全方位的分析，对上市公司业绩尤其是业绩的质量进行分析，基于对上

市公司的业绩质量、成长性与投资价值的综合权衡，选出中长期持续增长或未来阶段性高速增长且价值被低估的优质企业作为投资对象。在深入研究基本面的基础上，坚持价值投资理念，准确把握投资机会，不为短期波动影响。

通过实地调研等方式进行广泛和深入的研究，结合自上而下的判断，确定具有长期投资价值的公司股票申请股票库入库。价值判断的主要方面包括：公司所属行业的长期发展前景、公司的核心竞争力、公司的管理能力和治理结构、公司的历史表现、估值合理性、业务模式简单清晰、突出优势地位和竞争力、公司历史表现等方面。挑选合适股票标的进行长期投资，耐心持有等待其价值的持续稳定增加。

保持逆向思维，战略关注并投资周期性行业的拐点机会，捕捉业绩反转、超预期、估值修复、事件驱动等投资机会，熊市末牛市初的系统性机会等。

跟踪因并购重组、整体上市、增发等各类特殊原因而产生的具有较高确定性收益的股票投资机会，或获取该事件产生的低风险稳定收益，如具有现金选择权的并购套利等。

管理人将密切关注当前已经实施定向增发及询价转让，且还处于锁定期的上市公司，当二级市场股价跌破定向增发价及询价转让价格时，综合考察定向增发及询价转让数量、定向增发发行对象及询价转让受让方、剩余锁定期限、定向增发及询价转让目的等因素，深入了解发行人的行业背景、市场地位、盈利能力等，并结合当前市场环境，择机买入并在解禁日临近或解禁后再择机卖出，以获取破发回补的收益。

（6）股票型公募证券投资基金投资策略

按照资产配置要求，将股票型公募证券投资基金进行合理分类，初步划分为宽基、行业板块、主题境外等，并根据需要进行细分和调整。对股票型公募证券投资基金以定量分析为主，主要考虑基金的可投资性、独特性、成本等方面，注重于基金规模，流动性、跟踪误差等因素。

（7）收益互换投资策略

本计划可投资于收益互换场外衍生品类资产，挂钩标的为香港联合交易所首次公开发行股票，获取与挂钩标的涨跌幅相关的投资回报（收益或亏损），管理人结合市场情况确定挂钩标的及投资方案。

在此类收益互换的交易商选择上，仅考虑行业内领先的证券公司。管理人依据自己的专业知识与研究能力，持续跟踪锚定香港市场个股的内在投资价值、成长性变化，密切分析香港股票市场宏观环境、行业趋势等核心影响因素，对收益互换的挂钩标的、产品结构、期限和流动性设置等核心要素的系统化分析，筛选综合收益率高、风险相对可控、流动性匹配的

此类收益互换进行投资。

在本集合计划投资此类收益互换时，管理人将代表本集合计划签订交易确认书、履约保障协议（若适用）及其他相关投资交易协议和文件，及从事与各投资交易协议及其项下交易有关的任何行为（包括但不限于履行投资交易协议、投资交易协议项下任何交易及履约保障协议项下的任何义务，及与上述协议和交易有关的修改、展期、提前终止，计算和支付相关终止净额及未付款项等）。投资者同意并接受管理人的前述协议签署及履行安排。在完成收益互换投资后，管理人将及时以公告方式披露投资要素等信息。

（8）QDII 产品投资策略

管理人将采用定量和定性研究相结合的方式筛选 QDII 产品（QDII 基金、证券公司或其资产管理子公司发行的 QDII 资产管理产品、基金公司或其子公司发行的 QDII 资产管理产品），对 QDII 产品管理人做出综合性评价。对 QDII 产品的评价包括风格评价、业绩评价、投资经理评估等，重点衡量基金风格是否清晰稳定、中长期业绩及风险控制能力是否良好；对 QDII 产品管理人的评价主要从综合实力、管理水平、运作合规等方面进行分析，并持续跟踪投资标的的业绩表现，加强和 QDII 产品管理人的沟通考察，动态调整投资产品权重等。

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

（四）投资比例

1、资产配置比例

（1）权益类资产的投资比例为资产总值的 20%（含）-100%（不含）。

（2）固定收益类资产（含现金类资产）的投资比例为资产总值的 0%（含）-80%（不含）。

（3）参与债券逆回购资金余额不得超过本计划上一日资产净值的 100%，中国证监会另有规定的除外。

（4）期货和衍生品类资产的持仓合约价值低于资产总值的 80%（不含）或期货和衍生品账户权益不超过资产总值的 20%（不含）。

（5）本计划总资产不得超过本计划资产净值的 200%，计算总资产时，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，中国证监会另有规定的除外。

（6）本计划投资于上述资产管理产品的，计算本计划总资产时按照穿透原则合并计算所投资资产管理产品的总资产；本计划投资于上述资产管理产品中的公开募集证券投资基金的，按照穿透原则合并计算投资同类资产的金额需符合本计划资产配置比例的要求；本计划投资于上述资产管理产品中其他资产管理产品的，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需符合本计划资产配置比例的要求。本计划按照所投资资产管理产品披露投资组合的频率更新计算计划所投资资产的金额或比例。

法律法规或中国证监会允许集合计划投资其他品种的,资产管理人在履行合同变更程序后,可以将其纳入本计划的投资范围。

本计划主要通过投资国内依法发行并在证券交易所交易的股票(含主板、创业板、科创板、北交所及其他经中国证监会核准/注册上市的 A 股股票,含且不限于二级市场股票、新股申购、北京证券交易所战略配售股票、股票增发、通过询价转让/大宗交易等方式受让的上市公司股东转让的股票等)、沪港股票市场交易互联互通机制允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票(“沪港通标的股票”)、深港股票市场交易互联互通机制允许买卖的规定范围内的香港联合交易所市场的股票(“深港通标的股票”)、股票型公募证券投资基金(运作方式为开放式)、QDII 基金、证券公司或其资产管理子公司发行的 QDII 资产管理产品以及基金公司或其子公司发行的 QDII 资产管理产品等配置权益类资产,结合本计划的投资策略及管理人的持续跟踪研究,如管理人评估届时权益类资产具有较高投资价值,且目标标的具备相应的投资机会时,将提高对权益类资产的配置,此时权益类资产投资比例可能超过 80%。

2、总资产占净资产的比例

本计划总资产不得超过本计划资产净值的 200%,计算总资产时,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,中国证监会另有规定的除外;

3、组合投资要求比例

本计划投资于同一资产的资金,不得超过本计划资产净值的 25%;除以收购公司为目的设立的资产管理计划、专门投资于未上市企业股权的资产管理计划外,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%,单一融资主体及其关联方的非标准化资产,视为同一资产合并计算;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。全部投资者均为符合中国证监会规定的专业投资者(专业投资者不包括募集两个以上投资者资金设立的私募资产管理产品)且单个投资者投资金额不低于 1000 万元的封闭式集合资产管理计划,以及完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的资产管理计划等中国证监会认可的其他集合资产管理计划,不受前述关于投资于同一资产的比例限制。

4、投资比例超限的处理方式和流程

如因证券期货市场波动、证券发行人合并、资产管理计划规模变动等管理人主观因素之

外的因素，造成本计划投资比例不符合法律、行政法规和中国证监会规定的投资比例或者本合同约定的投资比例的，管理人应自超标发生之日起在流动性受限资产可出售、恢复交易或者具备交易条件的 20 个工作日内将投资比例调整至符合相关要求的范围内。确有特殊事由未能在前述约定时间内完成调整的，管理人应当及时向管理人住所地中国证监会派出机构和基金业协会报告，具体以监管机构的要求为准。

（五）资产管理计划的投资限制及禁止行为

1、为维护投资者的合法权益，本计划的投资限制为：

（1）管理人管理的全部资产管理计划合计持有单一上市公司发行的股票不得超过该上市公司可流通股票的 30%。

（2）本计划投资于上市公司定增股票、询价转让股票及北交所战略配售股票等具有一定期限限售期的股票的解禁日不得晚于资管计划的到期日。

（3）本计划参与股票等证券发行申购时，所申报的金额原则上不得超过本计划的总资产，且所申报的数量原则上不得超过拟发行公司本次发行的总量。

（4）本计划投资于一家上市公司所发行的股票，不得超过该上市公司总股本的 4.99%，不得超过该上市公司流通股本的 10%。

（5）本计划投资收益互换的合约价值及账户权益均不超过资管计划资产净值的 25%。

（6）本计划投资除公开募集证券投资基金以外的其他资产管理产品的，该等资产管理产品不得再投资除公开募集证券投资基金以外的其他资产管理产品，金融监管机构另有规定的除外。

（7）本计划投资除公开募集证券投资基金以外的其他资产管理产品的，该等资产管理产品不得投资《管理办法》第三十八条第（五）项规定资产。

（8）对于本计划拟投资品种，法律法规、中国证监会规定、自律规则对本计划的规模、穿透后投资者、交易资格等有明确要求的，如本计划届时不满足相关要求，不得开展相应的投资。

（9）现行有关法律法规修订变化后，若上述投资限制与之产生抵触，应以有关法律法规规定为准，同时管理人应通过合同变更的形式明确相应修订内容；如法律法规或监管部门修改或取消上述限制，履行适当程序后，本计划可相应调整投资组合限制的规定。

2、禁止行为

本计划的禁止行为包括：

（1）违规将本计划资产用于资金拆借、贷款、抵押融资或者对外担保等用途；

(2) 将本计划资产用于可能承担无限责任的投资；

(3) 向投资者做出保证其资产本金不受损失或者保证其取得最低收益的承诺；

(4) 侵占、挪用本计划资产；

(5) 募集资金不入账或者其他任何形式的账外经营；

(6) 接受单一客户参与资金低于中国证监会规定的最低限额；

(7) 以获取佣金或者其他不当利益为目的，使用本计划资产进行不必要的交易；

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

(9) 为违法或者规避监管的证券期货业务活动提供交易便利；

(10) 利用本计划进行商业贿赂；

(11) 利用本计划或者职务便利为投资者以外的第三方谋取不正当利益；

(12) 直接或者间接向投资者返还管理费；

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

(14) 为本人或他人违规持有金融机构股权提供便利；

(15) 开展借贷、担保、明股实债等投资活动，中国证监会、协会另有规定的除外；

(16) 通过设置无条件刚性回购安排变相从事借贷活动，产品投资收益不与投资标的的经营业绩或者收益挂钩；

(17) 投向保理资产、融资租赁资产、典当资产等与资产管理相冲突的资产及其收（受）益权，以及投向从事前述业务的公司的股权；

(18) 投资于不符合国家产业政策、环境保护政策的项目（证券市场投资除外），包括但不限于以下情形：

- 1) 投资项目被列入国家发展和改革委员会发布的淘汰类产业目录；
- 2) 投资项目违反国家环境保护政策要求；
- 3) 通过穿透核查，资产管理计划最终投向上述投资项目。

(19) 将本计划财产用于投资于房地产价格上涨过快热点城市普通住宅地产项目或用于支付土地出让价款或补充流动资金；前述关于“房地产价格上涨过快热点城市”、“普通住宅地产项目”、“房地产开发企业”之认定，以中国证券投资基金业协会《证券期货经营机构私募资产管理计划备案管理规范第4号——私募资产管理计划投资房地产开发企业、项目》及其不时做出的修订和补充之规定为准；

(20) 从事或者变相从事信贷业务，或者直接投向信贷资产，中国证监会、协会另有规定的除外；

(21) 通过委托贷款、信托贷款等方式从事经营性民间借贷活动；

(22) 违规为地方政府及其部门提供融资，要求或者接受地方政府及其部门违规提供担保；

(23) 直接或者间接投资法律法规和国家政策禁止进行债权或股权投资的行业和领域；

(24) 通过投资于资产管理产品变相扩大投资范围或者规避监管要求；

(25) 法律法规和中国证监会禁止的其他行为。

(六) 资产管理计划的业绩比较基准及确定依据

本计划不设业绩比较基准。

(七) 资产管理计划的风险收益特征及适合推广对象：

本计划属于 R5（高风险）等级的产品，适合且仅能向风险承受能力为 C5（激进型）级及以上或符合专业投资者标准的合格投资者销售。

(八) 资产管理计划的建仓期

管理人将在本计划成立之日起 6 个月内，使本计划的投资组合比例符合上述关于投资比例的约定。建仓期的投资活动，应当符合本合同约定的投向和本计划的风险收益特征。资产管理计划完成备案前，可以以现金管理为目的，投资于银行活期存款、货币市场基金等中国证监会认可的投资品种。

(九) 本计划投资的资产组合的流动性与本计划参与、退出的安排相匹配：本计划在存续期内封闭运作，拟投资于股票、收益互换、资管产品、债券逆回购等资产，管理人将结合市场环境并对投资标的内在投资价值和成长性予以判断，在产品到期前择机变现。

十二、服务机构及投资顾问

本计划是否聘请服务机构及投资顾问：否。

十三、分级安排

本计划是否根据风险收益特征进行分级：否。

十四、利益冲突及关联交易

(一) 资产管理计划存在或可能存在利益冲突的情形

本计划存在或可能存在如下利益冲突的情形：

- 1、若发生管理人开展的不同业务之间的敏感信息不当流动和使用，导致管理人其他业务与管理人资产管理业务可能存在利益冲突；
- 2、若发生不同投资经理管理的资产管理计划的持仓、交易等重大非公开信息的不当流动和使用，导致管理人管理的不同资产管理计划之间可能存在利益冲突；
- 3、若发生管理人从业人员利用知悉的敏感信息参与资产管理计划且未按规定进行申报和披露的，导致管理人从业人员与资产管理计划及投资者之间可能存在利益冲突；
- 4、其他可能存在的管理人、管理人从业人员与资产管理计划及管理人管理的不同资产管理计划之间可能存在的利益冲突情形。

（二）资产管理计划存在利益冲突的处理方式及披露

1、利益冲突的处理方式

管理人制定了信息隔离墙管理办法及利益冲突管理办法，并在业务开展过程中严格执行业务隔离和利益冲突防范的机制，对利益冲突进行识别和管理，若发现存在利益冲突情形的，管理人将遵循如下原则及时予以处理，维护本计划及投资者的合法权益：

（1）在处理涉及到公司、从业人员与客户之间的利益冲突时，严格坚持客户利益至上的原则；

（2）在处理涉及到客户与客户之间的利益冲突时，严格坚持公平对待客户的原则。

2、利益冲突的披露

对于实际发生的利益冲突情形，管理人将自发现之日起5个工作日内通过管理人网站公告将利益冲突的具体情形及管理人的处理安排等告知投资者。

（三）资产管理计划的关联交易

管理人可运用本计划财产从事关联交易，关联交易包括一般关联交易和重大关联交易，管理人制定的划分标准、管控机制包括：

1、关联方范围

本计划所称关联方包括：

（1）本计划管理人、管理人的控股股东、实际控制人及其他关联方（含管理人公司的一级全资子公司及控股子公司）；

（2）本计划的托管人、托管人的控股股东、实际控制人及其他关联方；

（3）本计划的投资顾问（如有）、投资顾问的控股股东、实际控制人及其他关联方；

（4）与管理人、本计划的托管人、投资顾问（如有）有其他重大利害关系的机构；

(5) 监管机构、基金业协会、管理人内部管理制度另有要求的，管理人遵照执行；
上述第(1)项为管理人全部资产管理计划的关联方；第(2)(3)项为本计划的关联方。

2、关联交易范围

本计划涉及的关联交易的具体类型包括但不限于：

(1) 本计划财产投资于管理人、管理人的控股股东、实际控制人及其他关联方（含管理人公司的一级全资子公司及控股子公司）担任管理人的资产管理产品（含公募基金）；

(2) 本计划财产投资于管理人对外作为投资顾问管理的资产管理产品；

(3) 本计划财产投资于投资顾问（如有）担任管理人的资产管理产品（含公募基金）；

(4) 本计划财产以本计划关联方或者以本条第(4)、(5)、(6)项规定的资产管理产品为交易对手，进行询价交易（包括但不限于银行间市场、交易所固收平台、大宗交易平台、场外基金申购、协议存款、逆回购交易等）；

(5) 本计划财产开展逆回购交易，质押券为管理人、管理人的控股股东、实际控制人及其他关联方（含管理人的一级全资子公司及控股子公司）发行的证券；

(6) 监管机构、基金业协会、管理人内部管理制度另有要求的，管理人遵照执行。

3、一般关联交易和重大关联交易

关联交易分为一般关联交易和重大关联交易，实行分类管理。重大关联交易是指投资于本计划关联方发行或承销期内承销的证券、投资于关联方产品的（本计划为FOF产品，或本计划投资于货币基金，或关联产品为公募基金、投资金额不超过该资管产品净值10%且不超过公募基金份额10%的除外）、与关联方及关联方产品为交易对手开展非标准化资产交易或金额及比例重大（固定收益类单笔交易金额超过资管产品净值20%或金额超过2亿元，权益类、衍生品及其他标准化资产单笔交易金额超过资管产品净值10%或金额超过3000万元）的询价交易、以管理人及其关联方发行证券作为质押券开展的金额及比例重大（固定收益类单笔交易金额超过资管产品净值20%或金额超过2亿元，权益类、衍生品及其他标准化资产单笔交易金额超过资管产品净值10%或金额超过3000万元）的逆回购交易等需强化审批、披露、报告的关联交易；一般关联交易是指除重大关联交易以外的其他关联交易。监管机构和基金业协会对于一般关联交易和重大关联交易的区分标准有明确规定的，以监管机构和基金业协会的相关要求为准。

投资者在此同意并授权管理人可以将本计划财产投资于一般关联交易。管理人将本计划财产投资于一般关联交易的，应在交易完成后，定期书面告知投资者和托管人并向管理人

住所地中国证监会派出机构报告，具体以监管机构的要求为准。

管理人将本计划财产投资于重大关联交易的，应当遵守法律、行政法规、中国证监会的规定和本合同约定，逐笔通过公告或其他方式提前通知投资者，投资者约定时间内未提出异议的视为同意。投资者提出异议的处理方式，由管理人在通知中明确。同时，管理人应事后及时告知投资者和托管人，并向中国证监会相关派出机构报告，具体以监管机构的要求为准。

4、关联交易的内部控制机制

管理人应当遵循诚信、公平原则，以公平、合理的市场价格进行交易，防范利益冲突，禁止利益输送。公司制定了相应的内控管理制度，明确了关联交易的范围及类型、审批程序、信息披露、关联数据库管理、稽核审计等内控机制并执行，参与关联交易管理的部门包括业务部门、内控部门等前中后台部门，管理人参与关联交易管理的部门按照内控机制的要求对关联交易进行审批。

5、关联方名单披露方式

本计划的关联方名单信息将通过公告的形式在管理人指定网站上披露或其他适当的方式通知投资者。若管理人指定网站变更，管理人将提前进行相关信息的详细披露。

6、托管人有义务将托管人关联方名单在华泰证券专业机构服务平台 <https://inst.htsc.com/incos/visitor/InfoDisclosure> 上披露，并在关联方名单发生变更时在上述网站上及时更新。管理人和投资者均可进行查询。

7、其他

除将本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者承销期内承销的证券外，管理人不得将本计划财产直接或者通过投资其他资产管理计划等间接形式，或通过与他人进行交叉融资安排等方式，违规为管理人、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提供或者变相提供融资。全部投资者均为符合中国证监会规定的专业投资者（专业投资者为私募资产管理产品的，穿透认定该私募资产管理产品的投资者均为符合中国证监会规定的专业投资者且单个投资者投资金额不低于 1000 万元）且单个投资者投资金额不低于 1000 万元，并且事先取得投资者同意的除外。

十五、投资经理的指定与变更

（一）投资经理的指定

1、本计划投资经理由管理人负责指定，投资经理不得同时办理客户资产管理业务和自

营业务。

2、本计划投资经理

本计划投资经理是何羽立。

本计划投资经理简介：何羽立，伯明翰大学（英）国际商务硕士研究生，多年证券从业经验。先后于第一创业投资管理有限公司、第一创业证券股份有限公司从事研究及投资工作，具有丰富的权益市场投资研究经验并有扎实的证券、财务和法律专业基础；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

管理人可根据业务实际需要或者人员调整的安排变更投资经理，并在变更后及时公告告知投资者和托管人。管理人应当确保变更后的投资经理符合法律法规的规定及本合同的约定。

十六、资产管理计划的财产

（一）资产管理计划财产的保管与处分

1、本计划财产为信托财产，其债务由本计划财产本身承担责任，投资者以其出资为限对本计划财产的债务承担责任。

2、本计划财产独立于管理人和托管人的固有财产，并独立于管理人管理的和托管人托管的其他财产。管理人、托管人不得将本计划财产归入其固有财产。

3、管理人、托管人因本计划财产的管理、运用或者其他情形而取得的财产和收益，归入本计划财产。

4、管理人、托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，本计划财产不属于其清算财产。

5、管理人、托管人以其固有财产承担法律责任，其债权人不得对本计划财产行使请求冻结、扣押和其他权利。

6、本计划财产产生的债权不得与不属于本计划财产本身的债务相互抵消。非因本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本计划财产强制执行。上述债权人对本计划财产主张权利时，管理人、托管人应明确告知本计划财产的独立性，采取合理措施并及时通知投资者。

7、托管人应安全、完整地保管本计划财产，未经本合同约定或管理人的指令，托管人不得自行运用、处分、分配本计划财产；管理人对本计划财产的管理和运用以及托管人对本计划财产的保管并非对投资者对本金或收益的保证或承诺。

（二）资产管理计划财产相关账户的开立和管理

管理人或托管人按照规定为本计划开立托管账户、证券账户和期货账户等投资所需账户。证券账户和期货账户的持有人名称应当符合证券、期货登记结算机构的有关规定。各方应当在开户过程中给予必要的配合，并提供所需材料。开立的上述资产管理计划财产账户与管理人、托管人、募集机构和计划份额登记机构自有的财产账户以及其他计划财产账户相独立。

1、资产管理计划托管账户的开立和管理

（1）托管人为本资产管理计划单独开立托管账户。托管账户的名称应当包含本资产管理计划名称，具体名称以实际开立为准。本资产管理计划的一切货币收支活动，包括但不限于投资、支付赎回金额、支付计划收益、收取认购/申购款，均需通过该托管账户进行。

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

（3）托管账户的管理应符合有关法律法规的规定。

2、资产管理计划证券账户的开立和管理

（1）资产管理人或托管人按照规定开立资产管理计划财产的证券账户。双方应当在开户过程中给予必要的配合，并提供所需资料。证券账户的持有人名称应当符合证券登记结算机构的有关规定。

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

3、银行间债券市场的相关账户的开立和管理（如有）

管理人负责以本资产管理计划的名义申请并取得全国银行间同业拆借市场的交易资格，并代表本计划进行交易；托管人负责以计划资产的名义在中央国债登记结算有限责任公司和银行间市场清算所股份有限公司开设银行间债券市场债券托管账户，并代表本计划进行债券和资金的清算。管理人、托管人应互相配合并提供相关资料。

4、开放式证券投资基金账户的开立和管理（如有）

（1）管理人负责为本计划开立所需的基金账户。

（2）管理人在开立计划账户时应将托管账户作为赎回款、分红款指定收款账户。

5、投资定期存款的银行账户的开立和管理（如有）

计划财产投资定期存款在存款机构开立的银行账户，包括实体或虚拟账户，其预留印鉴

经各方商议后预留。本着便于计划财产的安全保管和日常监督核查的原则，存款行应尽量选择托管人经办行所在地的分支机构。对于任何的定期存款投资，管理人都必须和存款机构签订定期存款协议，约定双方的权利和义务，该协议作为投资指令附件。该协议中必须有如下明确条款：“存款证实书不得被质押或以任何方式被抵押，并不得用于转让和背书；本息到期归还或提前支取的所有款项必须划至托管账户（明确户名、开户行、账号等），不得划入其他任何账户。”如定期存款协议中未体现前述条款，托管人有权拒绝对定期存款投资的投资指令。在取得存款证实书后，托管人保管证实书正本或者复印件。管理人应该在合理的时间内进行定期存款的投资和支取事宜，若管理人提前支取或部分提前支取定期存款，若产生息差（即本计划财产已计提的资金利息和提前支取时收到的资金利息差额），该息差的处理方法由管理人和托管人双方协商解决。

6、期货投资账户的开立和管理（如有）

管理人、托管人应当按照相关规定开立期货资金账户，在期货交易所获取交易编码。期货资金账户名称及交易编码对应名称应按照有关规定设立。

7、其他账户的开立和管理

因计划投资需要开立的其他账户应根据有关法律法规的规定由管理人与托管人协商一致后开立，新账户按有关规则管理并使用。

十七、投资指令的发送、确认和执行

（一）投资指令的授权

1、管理人应当事先向托管人提供加盖管理人公章和法定代表人（或授权代表）名章的书面授权通知书（下称“授权通知”），指定有权向托管人发送投资指令的被授权人员（下称“被授权人”），包括被授权人的名单、权限、预留印鉴、签字样本或签章，并注明相应的交易权限及授权通知生效日期。

2、授权通知应当以传真或双方认可的其他方式送达托管人。授权通知应当载明生效日期，生效日期不早于托管人收到传真件或扫描件之日。托管人收到的传真件或扫描件与原件所载不一致的，以传真件或扫描件为准。

3、管理人撤换被授权人或改变被授权人的权限，必须至少提前一个工作日使用传真方式或管理人与托管人一致认可的其他方式向托管人以“授权通知”的格式发出由管理人加盖公章和被授权人签字的变更通知，同时电话或以其他管理人与托管人一致认可的方式通知托管人。被授权人变更的通知须列明新授权的起始日期，原授权通知同时失效。管理人更换被

授权人的通知生效后,对于已被撤换人员无权发送的指令,或被改变授权人员超越权限发送的指令,管理人不承担任何责任。如管理人没有按照上述约定方式执行变更通知程序或被授权人变更的通知因任何理由不生效而导致托管人对变更授权文件提出异议的,则该授权变更不生效。

授权变更原件由管理人保管。授权变更原件与传真件或扫描件不一致的,以托管人收到的传真件或扫描件为准。

(二) 投资指令的内容

投资指令是管理人在管理本计划财产时,管理人向托管人发出的资金划拨及其他款项支付的指令。管理人发给托管人的指令应当写明款项事由、支付时间、金额、收款账户信息等,加盖预留印鉴并有被授权人签字或签章。

本计划资金账户发生的银行结算费用等银行费用,由资产托管人直接从资金账户中扣划,无须资产管理人出具指令。

(三) 投资指令的发送、确认及执行等程序

指令由管理人用传真方式或其他管理人与托管人一致认可的方式向托管人发送。管理人应当在发送指令后与托管人以录音电话、通过托管人提供的网上服务平台或者其他管理人与托管人一致认可的方式进行确认,因管理人未能及时与托管人进行指令确认,致使资金未能及时到账所造成的损失,由过错方承担责任。托管人确认指令有效后,方可执行指令。

对于被授权人依照授权通知发送的指令,管理人不得否认其效力。被授权人应按照有关法律法规规定和本合同的约定,在其交易权限内以传真或双方认可的其他方式向托管人发送指令,管理人在发送指令时,应当为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,还需给托管人留有至少2个工作小时的复核和审批时间。管理人向托管人发送要求当日支付的场外投资指令的最晚时间为每个工作日的15:30,对于超过15:30的指令,托管人尽力配合执行,但不保证当日完成在银行的划付流程。有效投资指令是指指令要素准确无误、预留印鉴相符、相关的指令附件齐全且头寸充足的投资指令。由管理人原因造成的指令传输不及时、发送指令错误,未能留出足够划款所需时间、资金账户中未有足额余额,致使资金未能及时到账所造成的损失,由过错方承担责任。

托管人收到管理人发送的指令后,应当对指令是否由被授权人发送、指令的要素是否齐全、指令印鉴与签字是否与预留的授权文件内容表面相符进行审慎验证,复核无误后应在规定期限内及时执行,不得延误。若存在管理人未按时提供被授权人的预留印鉴和签字样本、表面一致性不符或出现本条第(五)项约定的管理人发出错误指令的情形时,托管人有权拒

绝执行，并应及时与管理人指定人员进行电话联系和沟通，并要求管理人重新发送经修改的指令。托管人可以要求管理人提供相关交易凭证、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投资指令的有效性。

管理人向托管人下达指令时，应确保本计划资金账户有足够的资金余额，对管理人在没有充足资金的情况下向托管人发送的指令，托管人可不予执行，并立即通知管理人。管理人应按照本合同约定向托管人发送指令。

（四）托管人依法暂缓、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违反法律法规规定或本合同约定的，应当要求改正，未能改正的，应当拒绝执行，并应及时以书面形式通知管理人并向中国证监会派出机构报告，具体以监管机构的要求为准。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法规的规定或本合同约定的，应及时以书面形式通知管理人并向中国证监会派出机构报告，具体以监管机构的要求为准。

（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。托管人发现管理人的指令错误时，应按照本条第（三）项规定的程序进行处理，由此造成的损失，由过错方承担。

（六）投资指令的保管

投资指令若以传真或双方认可的其他形式发出，则正本由管理人保管，托管人保管指令传真件或扫描件，当二者不一致时，以托管人收到的投资指令传真件或扫描件为准。

（七）其他相关责任

托管人正确执行管理人符合法律法规规定、本合同约定的投资指令，本计划财产发生损失的，由过错方承担。因托管人过错未能及时或正确执行符合法律法规规定、本合同约定的投资指令而导致本计划财产损失的，托管人应当承担相应的赔偿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。

十八、交易及交收清算安排

本计划财产证券交易采用证券公司结算模式，投资于证券交易所发生的所有场内交易的资金清算交割，由本计划证券经纪服务协议约定的证券经纪商负责。资金清算为其他交易场所场外投资的，托管人凭投资指令和相关投资文件进行资金划拨。

本计划财产证券交易所的清算交割，由证券经纪商通过中国证券登记结算有限公司上海

分公司/深圳分公司/北京分公司及清算代理银行办理。

本计划财产银行间市场的清算交割，由托管人通过中央结算公司、上清所办理。

（一）交易所市场资金清算

1、交易所市场交易的资金清算由证券经纪商根据中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司/北京分公司的结算数据办理。本计划证券投资的清算交割，由证券经纪商通过中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司/北京分公司及清算代理银行办理。

2、证券经纪商代理本计划与中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司/北京分公司完成证券资金结算，并承担由证券经纪商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证券经纪商无法正常完成结算业务，责任由管理人承担。

3、管理人应加强内部控制，控制证券交易前端风险，避免出现透支买卖，同时防范操作风险，以确保发送给托管人的投资指令有足够的头寸用于交收或银证转账。

4、对于因任何原因导致的证券资金交收违约事件，相关各方应及时协商解决。

5、本计划场内证券投资的具体操作按照管理人、托管人及证券经纪机构签署的《证券经纪服务协议》（以实际名称为准）的约定执行。

（二）银行间交易清算

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

2、资产管理人可与资产托管人协商，通过取消银行间债券交易成交单发送的授权书等方式约定豁免逐笔银行间债券交易成交单的发送。如未授权，管理人应在交易结束后将银行间同业市场债券交易成交单及时传真给托管人，并电话确认。如果银行间中债综合业务平台或上海清算所客户终端系统已经生成的交易需要取消或终止，管理人应书面通知托管人。

3、银行间交易结算方式采用券款对付的，托管账户与本计划在登记结算机构开立的 DVP 资金账户之间的资金调拨，除了登记结算机构系统自动将 DVP 资金账户资金退回至托管账户之外，应当由管理人出具资金划款指令，托管人审核无误后执行。由于管理人未及时出具指令导致本计划在托管账户的头寸不足或者 DVP 资金账户头寸不足导致的损失，由过错方承担相应的责任。

（三）其他场外交易资金清算

其他场外投资资金清算由托管人凭投资指令和相关投资文件进行资金划拨。

（四）其他资金清算

资金清算为支付税费的，托管人审核付款用途符合本合同约定后，凭投资指令和相关单据（若有）进行资金划拨。

（五）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，本计划的资金头寸不足时，托管人有权拒绝管理人发送的投资指令。管理人在发送投资指令时应充分考虑托管人的划款处理所需的合理时间，如因管理人原因导致无法按时支付证券清算款，由此造成的损失由管理人承担。

在资金头寸充足的情况下，托管人对管理人符合法律法规、本合同的指令不得拖延或拒绝执行。如由于托管人的原因导致本计划无法按时支付证券清算款，由此造成的损失由托管人承担。

（六）资金和证券账目的对账

管理人和托管人每日对本计划的资金账目和证券账目进行核对，做到账实相符、账账相符。

（七）可用资金余额的确认

管理人可以向托管人申请开通专业机构服务平台账号，以便查询托管账户余额或明细情况。

十九、越权交易的界定

（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本合同约定而进行的投资交易行为，包括：

- 1、违反有关法律法规的规定和本合同约定进行的投资交易行为；
- 2、法律法规禁止的超买、超卖行为；
- 3、法律法规规定以及本合同约定的其他情形。

越权交易的例外情形：如因证券期货市场波动、证券发行人合并、资产管理计划规模变动等管理人主观因素之外的因素，造成本计划投资比例不符合法律、行政法规和中国证监会规定的投资比例或者本合同约定的投资比例的，不视为越权交易，管理人应当按照本合同约定予以处理。

管理人应在有关法律法规规定和本合同约定的范围内运用本计划财产进行投资管理，不得违反有关法律法规的规定和本合同的约定进行越权交易。

（二）越权交易的处理程序

1、违反有关法律法规规定和本合同约定进行的投资交易行为

托管人根据附件一的《投资运作监督事项表》，发现管理人的投资指令违反法律法规的规定，或者违反本合同约定的，应当拒绝执行并立即要求管理人改正；未能改正或者造成本计划财产损失的，托管人应当及时通知管理人并报告中国证监会派出机构，具体以监管机构的要求为准。

托管人根据附件一的《投资运作监督事项表》，发现管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律法规的规定，或者违反本合同约定的，应当立即通知管理人并有权报告管理人住所地中国证监会派出机构，管理人在收到通知后应当及时核对或纠正，具体以监管机构的要求为准。

管理人应向托管人主动报告越权交易，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越权事项未能在限期内纠正的，托管人应报告中国证监会派出机构，具体以监管机构的要求为准。

2、法律法规禁止的超买、超卖行为

托管人在行使监督职能时，如果发现本计划财产投资证券过程中出现超买或超卖现象，应立即提醒管理人，由管理人负责解决，由此给本计划财产造成的损失由管理人承担。

3、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）托管人对管理人投资运作的监督

1、托管人按照法律法规规定及本节约定对管理人的投资行为行使监督权，托管人对计划财产的监督和检查自本资产管理计划成立日起开始。

2、本合同附件一的《投资运作监督事项表》是托管人实施投资监督的依据，托管人仅就《投资运作监督事项表》中约定的事项对投资运作进行监督，托管人按照《投资运作监督事项表》的约定履行了相应义务即完成了本合同项下的监督义务。

因管理人未依照《投资运作监督事项表》进行投资给本计划托管财产造成财产损失的，由管理人承担责任。

3、托管人对计划财产的投资监督和检查自本合同生效之日起开始执行。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。

4、如因投资需要或法律法规修改导致托管人监督事项发生变化的，各方除履行必要的合同变更流程外，还应为托管人调整监督事项留出必要的时间。

5、经投资者、管理人确认同意，托管人投资监督的及时性、准确性和完整性受限于管

理人、证券经纪商（如有）以及其他中介机构提供的数据和信息，合规投资的责任在管理人，托管人对这些机构信息的及时性、准确性和完整性不作任何担保、暗示或表示。如因上述机构提供信息的真实性、准确性和完整性存在瑕疵而所引发的损失，由过错方承担。

二十、资产管理计划财产的估值和会计核算

（一）资产管理计划财产的估值

1、估值目的

客观、准确地反映本计划财产的价值。经本计划估值后确定的本计划单位净值，是进行信息披露、计算参与和退出本计划计价的基础。

2、估值时间

估值日指本计划成立后的每个工作日，即中国境内证券交易所的正常交易日。

管理人、托管人应于估值日（T日）后第一个工作日对估值日的对本计划份额净值进行核对。

3、估值对象

运用本计划所持有的一切金融资产和金融负债。

4、估值方法及其调整

估值应符合《企业会计准则》、其他相关法律法规的规定和本合同的约定，如法律法规未做明确规定的，参照行业通行做法处理。管理人、托管人的估值数据应依据合法的数据来源独立取得。

（1）股票的估值方法

1) 上市流通的股票，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，且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，以最近交易日的收盘价估值；估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化或者证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，使投资品种潜在估值调整对前一估值日的资产净值的影响在0.5%以上的，可参考停牌股票的估值方法，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。

2) 首次发行未上市的股票，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本价估值。

3) 送股、转增股、配股和公开增发新股等发行未上市的股票，按估值日在证券交易所上市的同一种股票的收盘价进行估值。

4) 流通受限股票（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、通过大宗交易取得的带限售期的股票等）按以下公式进行估值：

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

其中：

FV：估值日该流通受限股票的价值

S：估值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，该流动性折扣一般由第三方估值基准服务机构提供，具体估值机构由管理人和托管人协商约定。

（2）公开募集证券投资基金估值方法

1) 交易所上市基金估值：

①持有的 ETF 基金、境内上市定期开放式基金、封闭式基金，按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；若估值日无交易的，且最近交易日后市场环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如估值日无交易，且最近交易日后市场环境发生了重大变化的，可使用最新的基金份额净值为基础或参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素调整最近交易市价，确定公允价值。

②持有的境内上市开放式基金（LOF），按估值日的基金份额净值估值。

③持有的境内上市交易型货币市场基金，如披露基金份额净值，则按估值日的基金份额净值估值；如披露万份（百份）收益，则按前一估值日后至估值日期间（含节假日）的万份（百份）收益计提估值日基金收益。

④以所投资基金的基金份额净值或万份（百份）收益估值的，若所投资基金与资产管理计划估值频率一致但基金份额净值或万份（百份）收益披露时间晚于资产管理计划估值时间的，按其最近公布的基金份额净值或万份（百份）收益进行估值或计提基金收益。

2) 非上市基金估值：

①持有的境内非货币市场基金（包括托管在场外的上市开放式基金（LOF）），按估值日的基金份额净值估值。

②持有的境内货币市场基金，按基金管理公司公布的前一估值日后至估值日期间（含节假日）的万份收益计提估值日基金收益。

③以所投资基金的基金份额净值或万份收益估值的，若相关基金与资产管理计划估值频率一致但基金份额净值或万份收益披露时间晚于资产管理计划估值时间的，按其最近公布的基金份额净值或万份收益进行估值或计提基金收益。

3) 持有的基金处于封闭期的, 按照最新公布的份额净值估值; 没有公布份额净值的, 按照成本估值。

4) 持有的基金发生分红除权、折算或拆分, 应根据基金份额净值或收盘价、单位基金份额分红金额、折算拆分比例、持仓份额等因素合理确定公允价值。

(3) 银行定期存款或协议存款估值方法

银行定期存款或协议存款以本金列示, 按合同利率或协议利率逐日确认利息收入, 同时使用第三方估值基准服务机构提供的减值计量结果计提预期信用损失, 具体机构由管理人和托管人协商约定。

(4) 衍生品类资产的估值方法

非交易所交易的场外收益互换以及其他金融衍生品, 依据交易商提供的合约盈亏估值结果或估值报告确认合约损益。

(5) 持有的公开募集证券投资基金(含货币基金)以外的其他资产管理产品(证券公司或其资产管理子公司发行的 QDII 资产管理产品、基金公司或其子公司发行的 QDII 资产管理产品。), 该资产管理产品的管理人或其委托的估值核算机构定期公布净值的, 按照最新公布的净值估值(若公布净值的同时, 也提供扣除掉业绩报酬后的虚拟净值, 优先选择按虚拟净值估值); 不公布净值的, 按照成本估值。如所投资资产管理产品公布的净值(含虚拟净值)错误等管理人和托管人之外的原因, 导致本计划估值错误的, 本计划管理人和托管人予以免责。管理人、托管人根据所投资资产管理产品管理人所公布提供的产品净值进行估值, 如相关资产管理产品未按时同步提供净值给托管人, 托管人根据管理人转发的数据进行估值。

投资者签署本合同, 即表明其已经知晓并认可本计划可采用上述虚拟净值的估值方式。投资者不得因本计划采用虚拟估值方式引起产品净值差异情况, 而向管理人或托管人提出任何损失或损害补偿的要求。

(6) 托管账户存款及证券资金账户内的资金按约定利率在实际持有期间内逐日计提利息, 在利息到账日以实收利息入账, 并冲减已计提部分。

(7) 持有的证券回购资产在回购期间, 按照实际利率逐日计提回购应计利息。

(8) 如有新增事项或变更事项, 按法律法规、监管规定有关最新规定估值。

(9) 如管理人或托管人发现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投资者利益时, 应立即通知对方, 共同查明原因, 双方协商解决。

5、估值程序

本计划资产的日常估值由管理人进行。管理人应于每个估值日(T日)后第一个工作日

对估值日的计划份额净值进行核对。

当管理人与托管人的估值结果不一致时，各方应本着勤勉尽责的态度重新计算核对。如果仍无法达成一致，应以管理人的估值结果为准。如因管理人估值错误，由此给本计划财产或投资者造成损失的，由管理人承担责任。

6、估值错误的处理

(1) 本计划单位净值的计算精确到 0.0001 元，小数点后第五位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。当资产估值导致本计划单位净值小数点后四位以内发生差错时，视为本计划单位净值错误。管理人计算的本计划单位资产净值由托管人复核确认后公告。当发生净值计算错误时，由管理人负责处理。

(2) 管理人和托管人应采取必要、适当、合理的措施确保本计划资产估值的准确性和及时性。当本计划单位净值的计算出现错误时，管理人、托管人立即予以纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大。当本计划计价出现错误偏差达到资产净值的 0.5% 时，管理人应当通报托管人。

当管理人计算的本计划资产净值已由托管人复核确认后公告的，由此造成的投资者或本计划财产的损失，应根据法律法规的规定对投资者或本计划支付赔偿金，就实际向投资者或本计划支付的赔偿金额，由管理人和托管人根据过错各自承担相应的责任。

由于管理人和托管人任何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，进而导致集合计划资产净值计算错误造成投资者或集合计划资产的损失，以及由此造成以后交易日集合计划资产净值计算顺延错误而引起的投资者或本计划财产的损失，由提供错误信息的当事人一方负责赔偿。

(3) 本计划的会计责任方由管理人担任，与本计划有关的会计问题，如经双方在平等基础上充分讨论后，尚不能达成一致时，按管理人的处理方法执行；或者管理人和托管人对本计划净值的计算结果，虽然多次重新计算和核对，尚不能达成一致时，为避免不能按时公布计划净值的情形，以管理人的计算结果对外公布；由此给投资者和本计划财产造成的损失，由管理人承担责任。

(4) 若被诉人为托管人，管理人应当为托管人提供估值方法合理性的说明和支持。若托管人因此承担赔偿责任，应由托管人先行对投资者或者本计划支付赔偿金，在托管人赔偿后，托管人有权按上述条款就管理人承担责任的部分向管理人追索；若被诉人为管理人，托管人应当为管理人提供必要的支持。若管理人因此承担赔偿责任，管理人有权按上述条款就托管人承担责任的部分向托管人追索。

(5) 由于证券交易所及其登记结算公司发送的数据错误, 或由于其他不可抗力原因, 管理人和托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查, 但是未能发现该错误的, 由此造成的集合计划资产估值错误, 管理人和托管人可以免除赔偿责任。但管理人和托管人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

(6) 法律法规或者监管部门另有规定的, 从其规定。如果行业有通行做法, 双方当事人应本着平等和保护投资者利益的原则进行协商确定处理原则。

7、估值调整的情形与处理

如有确凿证据表明按本合同约定的估值方法不能客观反映本计划财产公允价值的, 管理人可根据具体情况, 在综合考虑市场成交价、市场报价、流动性、收益率曲线等多种因素基础上, 在与托管人商议后, 及时采用公允价值计量方法对本计划财产净值进行调整。对于本合同约定的估值方法未列明的新增投资品种, 由管理人与托管人协商一致后进行估值。

8、暂停估值的情形

当出现下列情形致使管理人无法准确评估本计划财产价值时, 可暂停估值。但估值条件恢复时, 管理人必须按规定完成估值工作。

- (1) 本计划投资所涉及的证券交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时;
- (2) 因不可抗力或其他情形致使管理人、托管人无法准确评估本计划财产价值时;
- (3) 中国证监会认可的其他情形。

估值条件恢复时, 管理人必须按规定完成估值工作。

9、资产管理计划单位净值的确认

管理人应于估值日(T日)后第一个工作日对估值日的计划份额净值进行核对, 以传真或双方认可的其他方式发送给托管人。托管人进行复核无误后, 以签名、盖章或其他双方认可的方式发回给管理人, 由管理人负责通过指定方式进行披露。月末、年中和年末估值复核与会计账目的核对同时进行。

当管理人与托管人的估值结果不一致时, 各方应本着勤勉尽责的态度重新计算核对。如果仍无法达成一致, 应以管理人的估值结果为准。如因管理人估值错误, 由此给本计划财产或投资者造成损失的, 由管理人承担责任。

10、特殊情况的处理

(1) 管理人按法律法规规定和本合同约定的公允价值进行估值时, 所造成的误差不作为本计划单位净值错误处理。

- (2) 由于不可抗力的原因或由于证券交易场所或注册登记机构发送的数据错误, 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，仍未能发现错误的，由此造成的本计划财产估值错误，管理人和托管人可以免除赔偿责任，但管理人和托管人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

（二）资产管理计划的会计政策

本计划的会计政策按照《证券投资基金会计核算业务指引》及如下约定执行：

- 1、本计划的会计年度为公历年度的1月1日至12月31日。
- 2、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。
- 3、本计划的会计核算应符合相关法律法规规定及本合同的约定，如法律法规未有明确规定的，参照行业通行做法处理。
- 4、本计划财产单独建账、单独核算。
- 5、管理人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，按照本合同约定编制会计报表。
- 6、托管人应当定期与管理人就本计划财产的会计核算、报表编制等进行核对及确认。

二十一、资产管理计划的费用与税收

（一）资产管理计划费用种类

- 1、管理人的固定管理费及业绩报酬（浮动管理费）；
- 2、托管人的托管费；
- 3、证券交易费用；
- 4、证券账户开户费；
- 5、本计划成立后的信息披露费用、注册登记费用、审计费和汇划费；
- 6、按照法律法规及本合同的约定可以在本计划财产中列支的其他费用。

（二）资产管理计划费用支付标准、计算方法、支付方式和时间

1、管理费

（1）固定管理费

本计划管理人固定管理费按本计划前一日净值的1.5%年费率计提，计算方法如下：

$$H=E \times 1.5\% \div 365$$

H为每日应计提的固定管理费；

E为本计划前一日净值。

本计划固定管理费每日计提，按季支付。管理人于每季度首月前5个工作日内向托管人

出具固定管理费投资指令，经托管人核对无误后从本计划财产中一次性支付给管理人。

管理人费用收入账户（含管理费、第一创业证券交易佣金）

户名：第一创业证券股份有限公司

账号：4000023319200099986

开户银行：工行深圳分行福田支行

（2）业绩报酬（浮动管理费）

1) 管理人收取业绩报酬的原则：

①同一投资者不同时间多次参与本计划的，对投资者每笔参与份额分别计算年化收益率、计提业绩报酬；

②在投资者退出、本计划分红及计划清算时，对符合业绩报酬提取条件的份额计提业绩报酬；

③在本计划分红时提取业绩报酬的，业绩报酬从分红资金中扣除；

④在投资者退出及本计划清算时提取业绩报酬的，业绩报酬从退出资金或清算资金中扣除；

⑤投资者申请退出时，管理人按“先进先出”的原则，即按照投资者份额参与的先后次序进行顺序退出的方式确定退出份额，计算、提取退出份额对应的业绩报酬。

2) 业绩报酬的计提方法

每笔参与份额以上一个发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日（如该笔参与份额不存在上一个发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日，则初始募集期参与的为注册登记机构份额注册登记日，存续期参与的为份额参与日，红利再投资的为分红除权日，下同）到本次业绩报酬计提日的年化收益率，作为计提业绩报酬的基准。

本计划提取业绩报酬的频率不得超过每6个月一次，因投资者退出本计划，管理人按照本合同约定提取业绩报酬的，不受前述提取频率的限制。

年化收益率的计算公式如下：

$$R = \frac{(P_1 - P_0)}{P_0^*} \div D \times 100\%$$

P_1 为业绩报酬计提日的计划单位累计净值；

P_0 为上一个发生业绩报酬计提日的计划单位累计净值；

P_0^* 为上一个发生业绩报酬计提日的计划单位净值；

D 表示上一个发生业绩报酬计提日到本次业绩报酬计提日的天数/365(1年按365天计算)；

R 为年化收益率。

管理人业绩报酬计提如下：

年化收益率	计提比例	业绩报酬计算公式
$0 \leq R$	20%	$Y=M*R*20\%*D$

其中：

Y =业绩报酬；

M =每笔参与份额在上一个发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日的资产净值总额。

初始募集期参与的份额首次计提业绩报酬的上一个业绩报酬计提日指注册登记机构确认初始募集期参与份额的注册登记日；开放期参与的份额首次计提业绩报酬的上一个业绩报酬计提日指参与日。

3) 业绩报酬支付：由于业绩报酬的计算涉及注册登记数据，业绩报酬由管理人计算，托管人不承担复核责任。托管人根据管理人的投资指令于计提日后七个工作日内从本计划财产中一次性支付给管理人。费用计提如有四舍五入的差异，以注册登记机构确认的金额为准。

业绩报酬属于管理费，法律法规或者监管机构对固定管理费和业绩报酬（浮动管理费）的收取比例上限有新的规定的，按照新规定执行。

2、托管费：

本计划托管人托管费按本计划前一日净值的0.01%年费率计提，计算方法如下：

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

H 为每日应计提的托管费；

E 为本计划前一日净值。

本计划托管费每日计提，按季支付。管理人于每季度首月前5个工作日内向托管人出具托管费投资指令，经托管人核对无误后从本计划资产中一次性支付给托管人。

托管人费用收入账户

户名：华泰证券股份有限公司

账号：491068633089

开户银行：中国银行江苏省分行营业部

若本计划现金资产不足以支付管理费和托管费的，则相应顺延至本计划现金资产足以支

付之日支付。

管理人和托管人协商一致可以调低管理费率或者托管费率,并通过管理人网站公告告知投资者。

3、证券交易费用

证券交易费用指本计划进行各类投资品种的投资交易而形成的费用,包括但不限于:印花税、交易所经手费、证管费、银行间交易手续费、场外基金办理要求的申购赎回费等费用、结算费、过户费、佣金等各项费用,证券交易费用在交易发生时直接计入当期费用;以上各项费用的费率标准按照相关法规政策执行,其中交易佣金的费率由管理人本着保护本计划及投资者利益的原则,按照法律法规的规定确定。

4、其他费用

在存续期间发生的本计划审计费用,由本计划承担,在被审计的会计期间,按直线法在每个自然日内平均摊销。

银行间市场账户开户费及维护费、证券账户开户费、存续期间信息披露费、电子合同服务费、注册登记费、银行汇划手续费、账户管理费、会计师费及律师费等本计划运营过程中发生按照国家有关规定可以列入的其他相关费用,按费用实际支出金额支出,列入或摊入当期本计划费用。

(三) 不列入资产管理计划费用的项目

本计划成立前发生的费用(包括但不限于计划初始募集期发生的信息披露费、会计师费、律师费等相关费用),以及存续期间发生的与募集有关的费用,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本计划资产的损失,以及处理与本计划运作无关的事项或者不合理安排所发生的费用等不得列入本计划费用。

(四) 税收

各方一致同意:就本计划投资运营过程中发生的增值税应税行为,无论是否以管理人作为纳税主体,该等增值税及附加税费均由本计划财产承担,管理人有权以本计划财产予以缴纳,如管理人垫付了相应税费等款项的,管理人有权向投资者追索垫付的税费和孳息款项,投资者应按管理人通知向管理人指定账户返还垫付款。投资者已知悉并同意,本计划资产承担上述税费可能导致资产变现损失或投资收益减损。

除前述约定外,本计划已列明的资产管理业务费用产生的税费应当由各收款方自行缴纳。

二十二、资产管理计划的收益分配

本计划的收益分配方案依据法律法规的规定及本合同的约定执行：

（一）收益的构成

收益包括：本计划投资所得收益、利息、红利、银行存款利息及其他合法收入。

本计划的净收益为本计划收益扣除按照国家有关规定及本合同约定的可以在本计划收益中扣除的费用后的余额。

（二）可供分配利润：指截至收益分配基准日资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数，实际分配利润的比例由管理人根据本计划运作的实际情况确定。

（三）收益分配原则

- 1、每一计划份额享有同等分配权；
- 2、收益分配基准日的份额净值减去每单位计划份额收益分配金额后不能低于面值；
- 3、收益分配时发生的银行转账或者其他手续费用由投资者自行承担；
- 4、本计划默认现金红利方式，可选择红利再投资方式；
- 5、本计划成立不满6个月可不进行收益分配；
- 6、法律法规或者监管机关另有规定的，从其规定。

（四）收益分配对象

分红权益登记日所有持有本计划的投资者。

（五）收益分配时间

本计划存续期间，管理人根据具体情况进行收益分配，具体分配时间以管理人公告为准，但收益分配的间隔期间不得短于6个月。

（七）收益分配方案的确定与披露

本计划收益分配方案由管理人拟定并向投资者公告。

（八）收益分配中发生的费用收益分配时发生的银行转账等手续费用由本计划投资者自行承担，分红款项将于本次分红权益登记日起T+5个工作日内从托管户划出。

（九）收益分配方案的实施

本计划默认现金红利方式，可选择红利再投资方式。投资者可修改分红方式。选择现金分红方式的，管理人将现金红利在扣除业绩报酬(如有)后款划往销售机构账户，再由销售机构划入投资者账户；选择红利再投资方式的，分红资金在扣除业绩报酬(如有)后按分红除权日当日的单位净值自动转为本计划的份额。红利再投资形成的本计划份额计算保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此产生的差额计入本计划资产的损益。

二十三、信息披露与报告

本计划的信息披露和报告将严格按照《管理办法》、《运作管理规定》及其他法律法规的规定和本合同的约定进行，向投资者提供资产管理合同、计划说明书、风险揭示书、资产管理计划净值、资产管理计划参与及退出价格、定期报告、重大事项的临时报告、清算报告等信息披露文件。管理人披露的资产管理计划净值、资产管理计划参与及退出价格应当经托管人复核。

（一）定期报告

定期报告包括本计划单位净值报告、本计划的资产管理季度及年度报告、托管年度报告、年度审计报告和对账单。

1、本计划单位净值报告

披露时间：本计划存续期内每个工作日（如遇节假日，则以节假日前最近一个工作日为估值日）的计划单位净值及计划累计单位净值将于第二个工作日在管理人网站上公布。

披露方式：本计划的单位净值、累计单位净值等信息将在管理人指定网站上披露，投资者可随时查阅。若管理人指定网站变更，管理人将提前进行相关信息的详细披露。

资产管理计划参与价格为注册登记机构受理参与申请当日本计划的单位净值，退出价格为注册登记机构受理退出申请当日本计划单位净值。

2、本计划的季度报告和年度报告

（1）本计划的资产管理季度报告

管理人每季度结束之日起一个月内向投资者提供一次准确、完整的管理季度报告，对报告期内本计划的运作情况做出说明。资产管理季度报告由管理人编制，经托管人复核财务数据后由管理人通过管理人网站公告，具体以监管机构的要求为准。

本计划成立不足3个月或存续期间不足3个月的，可以不编制当期的季度报告。

（2）本计划的资产管理年度报告和托管年度报告

管理人每年度结束之日起四个月内向投资者提供一次准确、完整的管理年度报告，对报告期内本计划的运作情况做出说明。资产管理年度报告由管理人编制，经托管人复核财务数据后由管理人通过管理人网站公告，具体以监管机构的要求为准。托管人在每年度结束之日起四个月内向投资者提供一次年度托管报告，年度托管报告由管理人通过管理人网站公告。

本计划成立不足3个月或存续期间不足3个月的，可以不编制当期的年度报告。

（3）资产管理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) 本计划投资表现;
- 4) 本计划投资组合报告;
- 5) 本计划运用杠杆情况(如有);
- 6) 本计划财务会计报告;
- 7) 本计划支付的管理费、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) 本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。

资产管理季度报告应当披露前述除第6)项之外的其他信息。

3、年度审计报告

管理人应当进行年度审计,应当同时对客户资产管理业务的运营情况进行审计,并要求符合《证券法》规定的会计师事务所就本计划出具单项审计意见。

管理人应当将本计划的单项审计意见通过管理人网站公告,具体以监管机构的要求为准。本计划成立不足3个月或存续期间不足3个月时,可以不编制当期的年度审计报告,产品终止当年,无需出具年度审计报告。

4、对账单

管理人至少每个季度以电子或者其他形式向投资者提供对账单,如有调整,管理人将以公告形式通知投资者。对账单内容应包括投资者持有计划份额的数量及净值,参与、退出明细,以及收益分配等情况。

投资者应向管理人提供电子邮箱地址等资料,因投资者未正常提供以上信息、邮件运营商系统平台故障及内部操作等非管理人原因导致投资者未能获得电子对账单的,管理人不承担任何责任。

(二) 临时报告

本计划存续期间,发生对本计划持续运营、投资者利益、资产净值产生重大影响的事件,管理人应当在事项发生之日起5日内以管理人指定网站公告或其他途径和方式及时向投资者披露。临时报告的情形包括但不限于:

- 1、管理人或托管人变更;

2、本计划运作过程中，负责本计划的投资经理发生变更，或出现其他可能对本计划的持续运作产生重大影响的事项；

3、暂停受理或者重新开始受理参与或者退出申请；

4、本计划终止和清算；

5、本合同的补充、修改与变更；

6、与本计划有关的重大诉讼、仲裁事项；

7、负责本计划的代理销售机构发生变更；

8、管理人、托管人因重大违法违规，被中国证监会取消相关业务资格；

9、管理人、托管人因解散、破产、撤销等原因不能履行相应职责；

10、资产计价出现错误（当资产估值导致本计划单位净值小数点后四位以内发生差错时，视为本集合计划单位净值错误）；

11、管理费、托管费等费用计提方式或费率发生变更；

12、其他发生对本计划持续运营、投资者利益、资产净值产生重大影响的事件。

（三）托管人履职报告

1、托管人履职报告作为管理人季度报告、年度报告内容的一部分，由托管人完成管理人季度报告、年度报告的复核工作后，确定托管人履职报告内容并向管理人反馈，由管理人根据本合同约定的方式向投资者披露。托管人履职报告内容包括托管人履职情况、对管理人投资运作的监督情况及有关报告财务数据的复核意见等。

2、管理人应当在每季度结束后 20 个自然日内向托管人提供其编制的季度报告、当期财务会计报告（如有）供托管人复核，托管人复核管理人季度报告、当期财务会计报告中的财务数据后，于 5 个工作日内向管理人反馈复核意见。

3、管理人应当在每年度结束后 3 个月内向托管人提供其编制的年度报告、当期财务会计报告供托管人复核，托管人复核管理人年度报告、当期财务会计报告中的财务数据后，于 15 个自然日内向管理人反馈复核意见。

4、因资产管理计划成立不足三个月或者存续期间不足三个月，管理人未编制资产管理计划当期的季度报告和年度报告的，托管人不编制当期托管人履职报告。

（四）管理人的董事、监事、从业人员及其配偶、控股股东、实际控制人或者其他关联方参与本计划的，管理人应当按照相关法律法规的规定和本合同的约定通过管理人网站或其他途径和方式向投资者披露，并向管理人住所地中国证监会派出机构报告，具体以监管机构的要求为准。

（五）向监管机构的报告

管理人、托管人应当按照《指导意见》、《管理办法》、《运作管理规定》及其他相关法律法规的规定和本合同的约定，履行向中国人民银行、中国证监会、基金业协会等监管机构和自律组织的报告义务。

二十四、风险揭示

本计划面临包括但不限于以下风险：本计划属于【R5（高风险）等级】等级的产品，适合且仅能向风险承受能力为【C5（激进型）级】及以上或者符合专业投资者标准的合格投资者销售。

（一）特殊风险揭示

1、本合同部分内容与基金业协会合同指引不一致所涉风险

本合同是基于基金业协会发布的《集合资产管理计划资产管理合同内容与格式指引》而制定的，管理人对合同指引相关内容做出了合理的调整以及增加了其他内容，导致本合同与基金业协会合同指引不一致的风险。

2、本计划委托募集所涉风险

管理人可以委托取得基金销售业务资格的代理销售机构推广销售本计划，代理销售机构可能存在违法违规地公开宣传本计划、虚假宣传本计划、以保本保收益引诱投资者购买本计划、未能履行投资者适当性审查工作等行为导致投资者合法权益受损的风险。

3、募集失败的风险

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

管理人的责任承担方式：

（1）以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用；

（2）在本计划募集期限届满（确认本计划无法成立）后三十日内退还投资人已缴纳的款项，并加计银行同期存款利息。

4、本计划未在基金业协会完成备案手续或不予备案情形所涉风险

管理人在本计划成立后5个工作日内向基金业协会办理备案手续。本计划面临因未能在基金业协会履行备案手续或基金业协会不予备案导致本计划财产不能进行投资运作的风险。

5、本计划份额转让所涉风险

管理人若开放本计划份额转让的，则本计划份额在相应的交易场所转让，并非集中竞价

交易，可能不具有一个活跃的转让市场，且相应的交易场所可能会根据需要暂停或终止转让服务，存在流动性风险；本计划份额转让实行非担保交收，申报转让（受让）本计划份额时，相应的交易场所对本计划份额（资金）余额事先不实行检查、控制，本计划份额登记机构也不实行担保交收，份额转让风险由转让方、受让方自行控制和承担。

6、其他特殊风险

（1）投资股票的风险

本计划拟投资于国内依法发行并在证券交易所交易的股票，具体风险包括但不限于：

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，导致市场价格水平波动的风险；

2) 宏观经济运行周期性波动，对股票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。

（2）投资上市公司定向增发股票及询价转让股票的风险

本集合计划拟投资于中国境内证券交易所上市公司非公开发行股票（定向增发）及询价转让股票，受股票市场的波动、定向增发股票发行政策及询价转让股票监管政策等影响较大。具体风险包括但不限于：

1) 定向增发及询价转让的申购违规风险：

由于某只股票的定向增发及询价转让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) 不能灵活地进行组合调整和止损的风险

由于本计划可能投资于国内证券交易所上市的 A 股股票的非公开发行股票（定向增发）及询价转让股票，而非公开发行股票及询价转让股票往往有一定锁定期，锁定期内本计划持有的非公开发行股票及询价转让股票不能转让变现，并可能存在因法律法规、监管政策限制等原因出现锁定期被延长或是减持受限的情形，从而造成本计划流动性降低的风险。在遇到市场或所投证券出现不利波动时，管理人难以根据市场判断对投资组合进行调整；股票价格下跌到增发价格以下时，管理人无法进行止损操作。本计划资产存在承担损失的风险。

此外，由于参与定向增发及询价转让股票的投资者相对集中，锁定期结束后可能出现短期内同步减持，对于交易量较小的股票流动性有限，存在难以及时进行减持变现的风险。

3) 非公开发行股票及询价转让股票估值的风险

本计划投资有明确锁定期的非公开发行股票及询价转让股票，按监管机构或行业协会有

关规定、合同约定确定公允价值，故本计划的净值可能由于估值方法的原因偏离所持有股票的收盘价所对应的净值。

4) 政策风险

由于定增等再融资工具政策及询价转让监管政策变化较快，可能在产品存续期间出现再次收紧的可能，如果将来延长锁定期、对减持行为进行重新约束，将对本计划持有的资产变现造成较大影响，从而影响本计划的运作期限设置、资产处置等，投资者需注意此风险。

5) 认购失败风险

本计划如参与上市公司非公开发行（定向增发）及询价转让股票的，可能存在因报价不成功而无法认购的风险。

6) 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、财务因素等都会导致公司盈利发生变化，从而导致本计划投资收益变化。

(3) 投资标的行业集中度较高的风险

在符合监管规定及合同约定的前提下，本集合计划投资的股票可能存在行业集中度较高的情况，本计划业绩表现除了受到股票市场总体景气度的影响外，很大程度上取决于该上市公司所处行业以及上市公司自身的未来表现，可能与市场总体表现存在较大的差异。在遇到个股及其所在行业出现大幅不利调整后，可能导致本计划净值发生较大波动或大幅调整后无法及时卖出变现的风险，投资者可能面临由此产生的亏损等相关风险。

(4) 逆回购风险

本计划投资于债券逆回购，存在交易对手的信用风险，交易对手未能履行合约，或在交易期间未如约支付已借出证券产生的所有利息和分红，从而对本计划的资产净值造成不利影响的风险。

(5) 投资北交所战略配售股票（如有）及北交所网上新股申购的风险

本计划在符合监管政策且具备配售资格的情况下可能投资于北交所战略配售股票，以及北交所网上新股申购，北京证券交易所股票在上市门槛、公司盈利能力、发行价格、交易机制、涨跌幅限制以及退市制度等方面与深交所及上交所上市的 A 股股票不同，面临包括但不限于投资于北交所股票的战略配售股票及网上申购新股定价风险、股价波动较大风险、流动性风险、政策风险、战配配售获配及网上新股申购不成功等风险：

1) 北交所企业普遍具有技术新、前景不确定、业绩波动大、风险高等特征，市场可比公司较少，传统估值方法可能不适用，发行定价难度较大。此外，北交所股票竞价交易设置

较宽的涨跌幅限制，首次公开发行上市的股票上市后的首个交易日不设涨跌幅限制，其后涨跌幅限制为 30%，可能产生股价波动大的风险，导致获配新股二级市场交易价格下跌至申购价以下。若本计划成功配售到的战略配售股票及网上新股申购股票定价过高，则其上市后存在跌破发行价的风险。

2) 北交所战略配售股票有一定的锁定期，锁定期内股票价格受各种市场因素、宏观政策因素等的影响，股票价格有可能下跌到配售价以下，锁定期内管理人难以根据市场判断对投资组合进行调整，股票价格下跌到配售价格以下时，管理人无法进行变现操作。此外，由于战配配售投资者相对集中，锁定期结束后可能出现短期内同步减持，对于交易量较小的股票流动性有限，存在难以及时进行减持变现的风险，本计划资产存在承担损失的风险。

3) 根据北交所战略配售股票发行规则，可能存在战略配售股票发行不成功，导致本计划无法参与战略配售；或战略配售股票发行成功，但本计划未成功获配售或未获预期配售比例；或因政策变化等情况，导致本计划不具备参与北交所战略配售的资格等情形，上述情形可能导致本计划投资策略、投资收益受到影响。

4) 若本计划拟参与北交所战略配售及网上新股申购，投资者可能需按照管理人通知要求对其是否存在不符合北京证券交易所证券发行相关规定进行核查，并及时、真实、准确、完整地回复核查结果，投资者未作出回复、投资者及管理人存在不符合北京证券交易所证券发行相关规定的情形的，管理人不得进行该标的证券的战略配售及网上申购。如因投资者未作出回复、投资者及管理人存在不符合北京证券交易所证券发行相关规定的情形导致未成功参与北交所战略配售及网上申购的，相关风险将由本计划承担，管理人对此无需承担任何责任。

5) 在北交所战略配售及网上新股申购过程中，管理人进行投资管理时均会基于过往的知识、经验报价并签署配售协议，若报价没有被接受，则可能导致北交所战略配售失败或网上新股申购失败。北交所战略配售标的在投资前均经管理人细致研究，但不排除投资期间因标的上市公司所处的宏观经济环境、国内外相关行业市场和资本市场状况等不可控因素以及标的上市公司自身风险因素发生变化，将可能导致标的上市公司股票价格大幅下跌，从而导致损失。

6) 本计划为管理人主动管理的产品，管理人有权自主决定本计划参与北交所战略配售及网上新股申购标的、价格、数量，投资标的的卖出时间等，因此管理人的投资水平和管理能力将影响具体投资标的的投资收益。

7) 北京证券交易所交易机制与沪深交易所主板市场存在差异，上市公司数量相对较少，

市场的整体流动性可能不如沪深证券交易所,可能影响本计划战略配售股票减持变现或出现网上新股申购股票无法及时成交的情形。

8) 中小企业经营风险。北交所为新设交易所,北交所主要服务创新型中小企业,该类企业往往具有规模小、对技术依赖高、迭代快、议价能力不强等特点,抗市场风险和行业风险能力较弱;部分中小企业可能尚处于初步发展阶段,业务收入、现金流及盈利水平等具有较大不确定性,或面临较大波动,个股投资风险加大。

9) 退市风险。根据北交所退市制度,上市企业退市情形较多,一旦所投资的北交所上市企业进入退市流程,有可能退入新三板创新层或基础层挂牌交易,或转入退市公司板块,可能无法及时将该企业调出投资组合,从而面临退出难度较大、流动性变差、变现成本较高以及股价大幅波动的风险,可能对本计划净值造成不利影响。

10) 北京证券交易所相关法规、交易所业务规则,可能根据市场情况进行修改,或者制定新的法律法规和业务规则,存在法律政策变动风险。若战略配售股票减持或网上新股申购相关法律法规、监管政策发生变化,可能导致本计划不能及时卖出标的股票或出现网上新股申购股票无法及时成交,投资者将面临不能完全及时退出的风险,或导致可能对本计划投资运作产生影响。

上述的揭示事项仅为列举性质,未能详尽列明北交所战略配售及网上新股申购交易的所有风险,投资者在参与本计划前,应当认真阅读有关法律法规和交易所业务规则等相关规定,对其他可能存在的风险因素也应当有所了解和掌握,并确信自己已做好足够的风险评估与财务安排,避免因本计划参与北交所战略配售及网上新股申购交易遭受难以承受的损失。

(6) 开展收益互换的风险

在本计划符合《证券公司收益互换业务管理办法》第十三条规定的情况下本计划可能开展收益互换业务,收益互换投资风险:

1) 流动性风险。收益互换作为场外市场的交易,是以证券期货市场场外衍生品交易主协议及其补充协议等标准法律文本,结合交易确认书等定制的法律文本所构成的协议群,客观上流通和转让能力较差,存在无法及时变现或变现时间不可预测的风险。

2) 交割失败等操作风险。收益互换交易可能发生因系统故障或特殊原因造成交割失败,但交割失败并不必然被视为违约。交割失败可能导致预期的现金流安排发生变化而产生风险。

3) 最大损失可能风险。与普通金融工具相比,收益互换交易波动性强,可能获得较高收益但也可能面临较大损失,属于高风险投资品种。由于各种风险因素的存在,在最不利

情况下，本计划投资收益互换的损失总额可能达到或者超过全部初始交易金额。

4) 收益互换等场外衍生品的估值与实际价值不一致风险。由于场外衍生产品不存在如场内交易一样的竞价机制，场外衍生产品的公允价值形成机制尚不健全。场外衍生品估值价格主要由交易对手方根据相关合同约定定期提供给本计划管理人和托管人，如交易对手不能及时、准确、完整提供场外衍生产品定价结果和合约具体损益变动情况，将会给本计划场外衍生产品合约的估值造成不利影响，本计划持有的场外衍生品估值可能与场外衍生品实际价值产生背离，对本计划的净值公允性、投资收益计算、费用计算、受托资产计算等造成不利影响。

5) 提前终止等法律风险

收益互换的合约存续期内可能发生提前终止等事件，导致双方提前结束交易。此外，在从事收益互换交易期间，如果本计划因管理人自身原因导致信用状况严重恶化、出现丧失民事行为能力、破产、解散等协议约定的提前终止情形，本计划将面临被证券公司公司提前终止收益互换交易的风险。上述情况都可能对本计划的投资收益造成损失，极端情况下投资者可能面临损失全部本金的风险。

6) 证券公司因流动性要求调整业务规模影响本计划的风险

因资产流动性要求，证券公司对收益互换业务规模有一定控制，可能存在因调整业务规模而导致投资者无法进行特定规模以上权益类收益互换交易的风险。

7) 证券公司不能履约的风险

证券公司因停业、解散、撤销、破产，或者被有权机构撤销相关业务许可、责令停业整顿等原因不能履行收益互换交易，可能给投资者带来风险。

8) 标的异常情况风险

当挂钩标的股票发生异常情况，如挂钩标的股票停牌等，投资者可能面临因证券公司对标的异常情况处理措施而导致遭受损失的风险。

9) 预付金/履约保证金不能任意取回的风险

投资者向证券公司提供收益互换交易的预付金/履约保证金后，只有在符合收益互换协议约定条件下方可提取预付金/履约保证金。因此，本计划面临提交预付金/履约保证金后存在不能任意取回的风险。

10) 杠杆风险

本计划开展收益互换可能具有杠杆效应，价格剧烈波动会放大收益或损失，在某些情况下甚至会导致投资亏损高于初始投资金额。

11) 跨境收益互换投资特有风险

本计划可能通过投资跨境收益互换并挂钩香港市场基石投资和锚定投资股票的市场表现。因香港市场交易规则有别于内地 A 股市场规则，港股股价可能表现出比 A 股更为剧烈的股价波动，价格剧烈波动会放大跨境收益互换收益或损失，在某些情况下甚至会导致投资亏损高于预付金/履约保证金。

香港市场基石投资和锚定投资股票可能面临一定锁定期，即在锁定期内，本计划持有的收益互换合约无法提前了结，亦不能转让变现，并可能存在因法律法规、监管政策限制等原因出现挂钩港股标的锁定期被延长或是减持受限的情形，从而造成本计划持有的收益互换合约流动性降低的风险。在遇到市场或所投证券出现不利波动时，管理人难以根据市场判断对收益互换合约进行调整，存在市场或挂钩标的出现大幅调整后无法及时卖出变现的风险，可能给本计划带来损失。受境外证券市场不可控因素的影响，本计划持有的收益互换合约挂钩的股票在可流通后可能发生亏损，进而导致本计划持有的收益互换合约亦发生亏损，届时，投资者需要自行承担由此产生的投资损失。本计划持有的收益互换合约挂钩标的解禁后，是否提前了结合约由交易对手按照合同约定处理，合约挂钩标的的处置也将由交易对手执行，可能导致该笔收益互换合约出现投资亏损。

跨境收益互换的投资收益以外汇形式体现，受人民币与外汇间汇率变动的影响较大。如果本计划存续期间内出现人民币汇率较大波动，投资者可能会因此而遭受损失。

此外，境内外市场交易日不完全一致可能导致本计划投资标的止损无法操作的风险。

(7) 港股通范围内股票的投资风险

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和总额度限制。总额度余额少于一个每日额度的，交易所证券交易服务公司自下一港股通交易日起停止接受买入申报，本计划将面临不能通过港股通进行买入交易的风险；在香港联合交易所有限公司开市前阶段，当日额度使用完毕的，新增的买单申报将面临失败的风险；在联交所持续交易时段，当日额度使用完毕的，当日本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。本计划投资港股通股票，在交易时间内提交订单依据的港币买入参考

汇率和卖出参考汇率，并不等于最终结算汇率。作为港股通范围内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，本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，汇率波动可能对本计划的投资收益造成损失。

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

6) 境外市场的风险。本计划通过港股通投资于香港市场，在市场进入、投资额度、可投资对象、税务政策等方面都有一定的限制，而且此类限制可能会不断调整，这些限制因素的变化可能对本计划进入或退出当地市场造成障碍，从而对投资收益以及正常的申购赎回产生直接或间接的影响。

7) 香港市场交易规则有别于内地 A 股市场规则，此外，在港股通机制下参与香港股票投资还将面临包括但不限于如下特殊风险：港股市场实行 T+0 回转交易，且对个股不设涨跌幅限制，港股估价可能表现出比 A 股更为剧烈的股价波动；只有沪、深港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，在内地开市香港休市的情形下，港股通不能正常交易，港股不能及时卖出，可能带来一定的流动性风险；香港出现台风、黑色暴雨或者联交所规定的其他情形时，联交所将可能停市，本计划将面临在停市期间无法进行港股通交易的风险；出现深交所、上交所证券交易服务公司认定的交易异常情况时，深交所、上交所证券交易服务公司可能暂停提供部分或者全部港股通服务，本计划将面临在暂停服务期间无法进行港股通交易的风险；由于中国结算是在汇总投资者意愿后再向香港结算提交投票意愿中国结算对投资者设定的意愿征集期比香港结算的征集期稍早结束；投票没有权益登记日的，以投票截止日的持有作为计算基准；投票数量超出持有数量的，按照比例分配持有基数。以上所述因素可能会给本计划投资带来特殊交易风险。

(8) 未设置预警止损机制的风险

本计划不设预警止损机制，本计划存续期内如投资发生大幅亏损，极端情况下投资者可能面临损失全部本金的风险。

(9) 投资公开募集证券投资基金的估值风险

本计划投向公开募集证券投资基金，如所投公开募集证券投资基金的净值披露日期晚于

本资管计划的估值核对日,在存续期间,资管计划单位净值可能无法反映真实投资管理情况。

(10) 从事重大关联交易、一般关联交易所涉风险

按照资产管理合同约定,管理人在本计划存续期内可运用本计划财产从事关联交易,关联交易包括一般关联交易和重大关联交易。

管理人制定了关联交易内控管理制度,明确了关联交易的类型和范围、审批程序、信息披露、关联数据库管理、稽核审计等内控机制并严格执行,但按照上述标准及机制进行关联交易管理时,需按照各方提供的关联方名单进行关联交易的审查,存在无法监控全部关联交易类型的风险;同时,本计划进行关联交易时虽然积极遵循投资者利益优先的原则、遵守相关法律法规的规定进行操作、防范利益输送,但仍可能存在一定的利益冲突风险,由此造成的损失由本计划财产承担。此外,资产管理人运用计划财产从事关联交易时,管理人无法确保选择进行交易的实际交易结果(就投资完成后的实际损益情况而言)比进行类似的非关联交易的实际交易结果更优,或者关联交易行为可能依照相关法律法规、监管机构、自律组织的规定被限制相关权利的行使,从而可能影响受托资产的投资收益,投资者应密切关注关联交易的信息披露,知悉了解相关的投资信息。

管理人从事一般关联交易的,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一般关联交易。该等事先约定同意、事后统一披露的方式可能造成投资者无法及时知悉本计划从事一般关联交易并采取措施,投资者愿承担由此造成的参与财产损失。

管理人从事重大关联交易的,可能因为重大关联交易金额或比例较高对本计划的投资运作产生较大影响。此外,对于重大关联交易,管理人将事先取得投资者同意,若投资者未及时更新有效联系方式,可能影响管理人征求意见的效率,进而可能影响本计划的投资策略实施。

(11) 大宗交易的特有风险

本计划可参与交易所大宗交易市场股票买卖。除股票投资面临的市场风险、行业风险、个股风险外,根据减持相关监管政策,通过大宗交易受让大股东集中竞价交易买入股份以外的股份,或者受让其他股东持有的特定股份等相关法律法规规定的特定情形,受让方在6个月内不得以任何方式进行转让。受限股份的大宗交易和受让方后续相关交易在减持时间、数量、方式上需遵守法律、行政法规、中国证监会、中国证券业协会、中国证券投资基金业协会和沪深交易所的有关规定,从而导致投资标的实际变现周期延长。此外,如减持政策发生变化导致锁定期延长、减持数量减少等,将对本计划持有的资产变现造成较大影响,从而影响本计划的运作期限、资产处置等。

（12）投资 QDII 产品所涉风险

本计划可能投资于 QDII 产品从而间接投资于境外市场的风险包括但不限于：

1) 投资于海外证券的风险：投资于海外证券市场时，因各国或地区处于不同产业景气循环周期阶段，将对投资收益产生影响，海外证券市场可能由于对于负面的特定事件、该国或地区特有的政治因素、法律法规、市场状况、经济发展趋势的反映较境内证券市场有诸多不同，并且投资市场如香港和新加坡等证券交易市场对每日证券交易价格并无涨跌幅上下限的规定，因此这些国家或地区证券的每日涨跌幅空间相对较大，以上所述因素可能会带来市场的急剧下跌，从而带来投资风险的增加；

2) 汇率风险：指经济主体持有或运用外汇的经济活动中，因汇率变动而蒙受损失的可能性，QDII 等产品投资于海外市场，可能涉及到多种外汇币种的投资，外汇与人民币汇率波动、外汇之间交叉汇率的波动都有可能对 QDII 等产品以计价币种公布的净值造成不利或有利的影 响。

（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本计划财产，但不保证本计划财产中的认（申）购资金本金不受损失，也不保证一定盈利及最低收益。

2、市场风险

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

（1）政策风险

货币政策、财政政策、产业政策和证券市场监管政策等国家政策的变化对证券市场产生一定的影响，可能导致证券价格波动，从而影响收益。

（2）经济周期风险

证券市场受宏观经济运行的影响，而经济运行具有周期性的特点，而周期性的经济运行周期表现将对证券市场的收益水平产生影响，从而对收益产生影响。

（3）利率风险

利率风险是指由于利率变动而导致的资产价格和资产利息的损益。利率波动会直接影响企业的融资成本和利润水平，导致证券市场的价格和收益率的变动，使集合计划资产管理业务收益水平随之发生变化，从而产生风险。

（4）购买力风险

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

(5) 再投资风险

再投资风险反映了利率下降对固定收益证券利息收入再投资收益的影响。当利率下降时,资产管理计划财产从投资的固定收益证券所得的利息收入进行再投资时,收益率将比此前下降。

3、管理风险

在本计划运作过程中,管理人的知识、经验、判断、决策、技能等,会影响其对信息的获取和对经济形势、金融市场价格走势的判断,管理人精选出的投资品种业绩表现不一定持续优于其他投资品种,如管理人判断有误、获取信息不全、或对投资工具使用不当等影响本计划的收益水平,从而产生风险,该风险由本计划财产及投资者承担。投资者应充分知晓投资运营的相关风险,其风险应由投资者自担。

4、流动性风险

流动性风险是指金融资产不能迅速转变成现金,或者转变成现金会对资产价格造成重大不利影响的风险。流动性风险将主要表现在以下几个方面:本计划的资产不能迅速转变成现金,或变现成本很高;不能应付可能出现的投资者赎回的风险等。这些风险的主要形成原因是:

(1) 市场整体流动性相对不足。证券市场的流动性受到市场行情、投资群体等诸多因素的影响,在某些时期成交活跃,流动性较好;而在另一些时期,则可能成交稀少,流动性较差。在市场流动性相对不足时,交易变现有可能增加变现成本,对本计划的资产净值造成不利影响。这种风险在投资者提前赎回时表现尤为突出。

(2) 证券市场中流动性不均匀,存在个股和个券流动性风险。由于流动性存在差异,即使在市场流动性比较好的情况下,一些个股和个券的流动性可能仍然比较差,这种情况的存在使得管理人在进行个股和个券操作时,可能难以按计划买入或卖出预期的数量,或买入、卖出行为对个股和个券价格产生比较大的影响,增加个股和个券的建仓成本或变现成本。这种风险在出现个股和个券停牌或涨跌停板等情况时表现得尤为突出。

(3) 若本计划投资于债券回购,可能因政策或交易所规则发生变化而出现质押债券折算率下调、债券暂停上市、债券延迟兑付或不兑付等情况,可能继而导致本计划出现资金流动性不足,需要投资者及时足额追加投资资金以避免出现欠库或透支的情况,也可能增加本计划资产净值的波动性。

(4) 本计划财产不能应付可能出现的投资者大额赎回的风险。在本计划运作期间，可能会发生投资者大额赎回的情形，可能会产生仓位调整的困难，导致流动性风险，甚至影响收益水平。

(5) 管理人因停业、解散、撤销、破产，或者被中国证监会撤销相关业务许可等原因不能履行职责的风险。管理人因停业、解散、撤销、破产，或者被中国证监会撤销相关业务许可等原因不能履行职责，可能导致受托资产的损失，从而带来风险。

5、信用风险

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

(1) 交易品种的信用风险：投资于同业存单等固定收益类产品，存在着发行人不能按时足额还本付息的风险；此外，当发行人信用评级降低时，本计划所投资的标的可能面临价格下跌风险。

(2) 交易对手的信用风险：交易对手未能履行合约，或在交易期间未如约支付已借出证券产生的所有股息、利息和分红，从而对本计划的资产净值造成不利影响的风险。

6、证券交易资金前端控制的风险

根据上海证券交易所、深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司于2017年12月1日联合发布的《上海证券交易所 深圳证券交易所 中国证券登记结算有限责任公司证券交易资金前端风险控制业务规则》的要求，沪深交易所及中国结算自2018年6月1日起对交易参与人相关交易单元的全天净买入申报金额总量实施额度管理，并通过交易所对交易参与人实施前端控制，本计划管理人作为交易参与人需通过结算参与人（也即是本计划托管人）向中国结算报告资金前端控制最高额度信息，且交易参与人需在最高额度内向交易所申报资金前端控制的自设额度，由交易所根据该额度实施资金前端控制。基于上述资金前端控制的机制，则存在买入申报金额不符合前端控制自设额度限制时，被交易所拒绝接受买入申报从而交易失败的风险，以及出现前端控制异常情况，导致无法买入申报从而交易失败的风险。

7、税收风险

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。

8、本计划提前终止的风险

本计划运作期间，当本计划投资者少于2人或者其他本计划约定的提前终止情形出现时，

导致集合计划提前终止的风险。本计划存续期内若市场发生重大变动、国家政策出现重大调整或突发性事件，或管理人认为需要提前终止本计划的其他情形时，管理人有权提前终止本计划。在提前终止情形下，客户面临不能按预定期限持有本计划的风险。

9、合同变更风险

管理人就合同变更征求投资者意见期间，未明确提出异议的投资者、不同意合同变更但逾期未提出退出申请的投资者均视为同意修改或变更合同和说明书。部分投资者可能因为未能提供有效的联系方式或者未能将变动后的联系方式及时通知管理人，而无法及时获知合同变更事项，如果投资者因上述情况未能按时退出本计划，可能会被视为同意合同变更，从而存在风险。

10、投资者可能无法参与的风险

由于本计划适合且仅向符合《运作管理规定》规定的风险承受能力 C5（激进型）或符合专业投资者标准的合格投资者销售，本计划还可能设定规模上限，管理人将根据合同约定对投资者类型或规模上限进行控制，因此投资者可能面临着因上述原因而无法参与本计划的风险。

11、投资者强制退出的风险

因不同意合同变更需要在临时开放期退出本计划的，投资者应当选择一次性全部退出本计划，否则管理人有权发起强制退出投资者持有的本计划全部份额。

12、巨额赎回情形下净值精度应急调整机制的风险

当本计划发生巨额赎回情形且管理人决定采取净值精度应急调整机制，届时赎回净值可能发生变动，投资者退出金额可能会由于净值精度提高而产生差异，将直接影响到投资者的投资收益。举例如下：

假设本计划退出申请日单位净值为 A（净值精度调整前），投资者退出份额为 X，则退出申请日单位净值精度误差最高为 ± 0.00005 元（即四舍五入小数点后第 5 位最大误差），由此计算的单位净值 A 调整精度后对投资者退出总金额的最大影响为 $\pm X * 0.00005$ 元。

13、其他风险

（1）操作与技术风险：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造成操作失误或违反操作规程等导致的风险，例如，越权违规交易、会计部门欺诈、交易错误、IT 系统故障等风险。

在本计划的各种交易行为或者后台运作中，可能因为 IT 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、注

册登记机构、销售机构、证券交易所、证券登记结算机构等。

(2) 发生不可抗力事件的风险：战争、自然灾害等不可抗力因素的出现，将会严重影响证券市场的运行，可能导致本计划资产的损失。金融市场危机、行业竞争、代理机构违约等超出管理人自身直接控制能力之外的风险，可能导致投资者利益受损。

(3) 延期风险：本计划预计存续期限到期时，如本计划项下仍持有非货币资金形式财产的，管理人须对计划财产进行变现处置的，本计划可能需要延期，由此可能造成投资者获得分配的时间具有不确定性。

对上述风险的具体描述请见《第一创业富显荣 1 号集合资产管理计划风险揭示书》。

二十五、资产管理合同的变更、终止与财产清算

(一) 资产管理合同的变更

1、全体投资者、管理人和托管人协商一致后，可以对资产管理合同内容进行变更，资产管理合同另有约定的除外。资产管理计划改变投向和比例的，应当事先取得投资者同意。本计划合同需要进行变更的，经管理人和托管人应书面达成一致后，以短信或其他方式通知投资者，并在管理人网站公告。投资者不同意变更的，应在公告发布之日起至合同变更生效日内的开放日提出退出申请，如在公告发布之日起至合同变更生效日内无开放日，则管理人将在公告中公布合同变更生效日前设定的临时开放日。未提出退出申请的，视同投资者已经同意合同变更。管理人应在公告中披露临时开放日、合同变更生效日。

2、本合同签署后，因法律、行政法规、中国证监会、基金业协会的规定、证券登记结算机构业务规则以及证券交易所等监管规则修订，自该修订生效之日起，本合同相关内容及条款按该修订办理并在管理人网站告知投资者。投资者特此授权管理人经与托管人协商一致后，可以对本合同及说明书与修订后的监管规则不一致的内容进行更新或修改，更新或修改的内容不得违反法律、行政法规和中国证监会的有关规定，更新或修改的内容在管理人网站公告满 5 个工作日后生效。投资者对更新或修改的内容有异议，可在更新或修改内容生效前申请退出本计划。

3、本计划也可以经全体投资者、管理人和托管人协商一致，签署书面补充协议的方式完成合同变更，该合同变更方式不受上述变更流程的限制。

4、合同变更后，投资者、管理人和托管人的应当按照变更后的合同行使相关权利，履行相应义务。

5、投资者、管理人、托管人不得通过签订补充协议、修改合同等任何方式，约定保证

集合计划资产投资收益、承担投资损失，或排除投资者自行承担投资风险和损失。

6、本合同发生变更的，管理人应当自资产管理合同变更之日起5个工作日内报协会备案，具体以监管机构的要求为准。

（二）管理人或托管人的变更

1、发生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、宣告破产导致本计划由其他管理人承接时：

原管理人应当就变更管理人的事项与新任管理人和托管人达成书面一致后，以短信或其他方式通知投资者，并在管理人网站公告。投资者不同意变更管理人的，应在公告发布之日起至管理人变更生效日内的开放日提出退出申请，如在公告发布之日起至管理人变更生效日内无开放日，则管理人将在公告中公布管理人变更生效日前设定的临时开放日。未提出退出申请的，视同投资者已经同意管理人变更。

2、发生托管人被依法撤销基金托管资格或者依法解散、被撤销、宣告破产导致本计划由其他托管人承接时：

原管理人应当就变更托管人的事项与原托管人和新任托管人达成书面一致后，以短信或其他方式通知投资者，并在管理人网站公告。投资者不同意变更托管人的，应在公告发布之日起至托管人变更生效日内的开放日提出退出申请，如在公告发布之日起至托管人变更生效日内无开放日，则管理人将在公告中公布托管人变更生效日前设定的临时开放日。未提出退出申请的，视同投资者已经同意托管人变更。

3、新任管理人或新任托管人自变更生效日起接任本计划的管理人或托管人，应当按照本合同关于管理人和托管人权利义务和职责的约定履行管理人和托管人职责。新任管理人或新任托管人接任之前，原管理人或原托管人应依据法律法规和本合同的约定继续履行相关职责。原管理人或原托管人在继续履行相关职责期间，仍有权按照本合同的约定收取管理费、业绩报酬（如有）或托管费。

（三）资产管理计划的展期

1、本计划存续期届满时，管理人可以决定到期清算终止，或根据本合同约定进行展期。

2、展期的条件

下列条件全部满足后，本计划可以展期：

（1）本计划运作规范，管理人、托管人未违反法律法规、中国证监会规定和本合同的约定；

（2）本计划展期没有损害投资者利益的情形；

- (3) 资产托管机构同意继续托管展期后的本计划财产；
- (4) 符合本计划的成立条件；
- (5) 中国证监会规定的其他条件。

3、展期的程序

(1) 在本计划存续期届满前，管理人可按合同约定对本计划进行展期，展期的程序与因其他原因需要变更合同的程序保持一致，具体方式为：

管理人将以短信或其他方式通知投资者，并在管理人网站公告展期的期限、展期变更生效日等。投资者不同意展期的，应在公告发布之日起至合同变更生效日内的开放日提出退出申请，如在公告发布之日起至合同变更生效日内无开放日，则管理人将在公告中公布合同变更生效日前设定的临时开放日。未提出退出申请的，视同投资者已经同意合同展期。

(2) 若展期成立，管理人应在本计划展期后 5 个工作日内，将展期情况报中国证券投资基金业协会备案，具体以监管机构的要求为准。

(3) 本计划可以连续展期，且展期次数不限。

4、展期的实现

(1) 同意本计划展期的投资者人数（含管理人）不少于 2 人，且展期变更生效日符合展期条件的，本计划在展期变更生效日实现展期，否则本计划不能展期。

(2) 同意展期的投资者需同意继续持有本计划未能流通变现的证券和资产，且同意展期的投资者持有的本计划资产净值不低于本计划未能流通变现证券和资产的规模，否则本计划不能展期。

5、展期的失败

若本计划展期失败，本计划在本合同约定的终止情形发生后进入清算程序。

(四) 资产管理计划的终止

有下列情形之一的，本计划应当终止：

- 1、本计划存续期届满且不展期；
- 2、经全体投资者、管理人和托管人协商一致决定终止的；
- 3、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；
- 4、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；
- 5、本计划存续期间，持续 5 个工作日投资者少于 2 人；

6、本计划成立后，未在基金业协会完成备案或未通过基金业协会的产品备案或未取得产品的备案确认函的，则管理人有权终止本计划，且不承担任何责任；

7、不可抗力的发生导致本计划不能存续；

8、因监管政策或监管规则的变化导致本产品违反相关监管政策或监管规则要求的，或监管机构通知（无论是口头或书面形式的通知）管理人停止开展此类资产管理产品的，则管理人有权停止开放本计划份额的参与并终止本计划，且不承担任何责任；

9、本计划若投资上市公司定增股票、询价转让股票及北交所战略配售股票等具有一定期限限售期的股票，在所持上市公司股票全部解禁并在资产全部变现后，管理人有权决定提前终止本计划；

10、法律、行政法规、中国证监会规定以及本计划合同约定的其他终止情形。

管理人应当自本计划终止之日起5个工作日内报基金业协会备案，前述第6项约定的情形除外，具体以监管机构的要求为准。

（五）资产管理计划的清算

1、本计划财产清算小组

本计划在发生终止情形起5个工作日内，由管理人和托管人组织成立本计划财产清算小组，在本计划财产清算小组接管本计划财产之前，管理人和托管人应按照本合同的约定继续履行保护本计划财产安全的职责。

本计划财产清算小组成员由管理人、托管人组成，清算小组可以聘用必要的工作人员，本计划财产清算小组负责本计划财产的保管、清理、估价、变现和分配，本计划财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。

2、本计划清算程序

- （1）本计划终止情形发生后，由本计划财产清算小组负责统一接管本计划财产；
- （2）本计划财产清算小组根据情况确定具体的清算期限；
- （3）本计划财产清算小组对本计划财产进行清理和确认；
- （4）对本计划财产进行评估和变现；
- （5）制作清算报告；
- （6）将清算报告报基金业协会并告知投资者，具体以监管机构的要求为准；
- （7）对本计划财产进行分配。

3、本计划清算费用

清算费用是指本计划财产清算小组在进行本计划财产清算过程中发生的所有合理费用，

清算费用由本计划财产清算小组优先从本计划财产中支付。

4、本计划财产清算及剩余资产的分配

依据本计划财产清算的分配方案,将本计划财产清算后的全部剩余资产扣除清算费用后,按本计划投资者持有的计划份额比例进行分配,本合同另有约定的除外,本计划财产按照以下顺序进行分配:

(1) 支付清算费用;

(2) 缴纳所欠税款;

(3) 清偿本计划债务:本计划债务主要包括应付管理费、托管费、银行间账户维护费、交易佣金、证券交易费用、银行汇划费用、销户费、管理人代表本计划及投资者处理本计划涉及诉讼、仲裁或争议解决的事项所产生的费用及支出等,除交易所、证券登记结算机构等自动扣缴的费用外,其他费用的清偿由管理人、托管人核对无误后,由管理人向托管人出具投资指令,由托管人复核后支付。

(4) 按本计划投资者所持计划份额比例进行分配;

(5) 清算后的剩余财产,原则上以货币资金形式进行分配;本合同另有约定的,从其约定;但不得违反中国证监会规定。

本计划财产未按前述第(1)、(2)、(3)项约定进行清偿前,不得分配给本计划投资者。

5、二次清算的处理方式

若本计划在终止之日有未能流通变现的证券或金融产品,管理人可对此制定二次清算方案,该方案应经托管人认可,并通过管理人网站进行披露。管理人应根据二次清算方案的规定,对前述未能流通变现的证券或金融产品可在流通变现后进行二次清算,并将变现后的资产按照投资者拥有份额的比例或本合同的约定,以货币形式分配给投资者,二次清算期间,管理人、托管人继续按照本合同约定计提管理费、托管费及其他费用。发生二次清算情形的,管理人应当及时向管理人住所地中国证监会派出机构报告,具体以监管机构的要求为准。

6、延期清算的处理方式

本计划因受托财产流动性受限等原因延期清算的,管理人应当及时向管理人住所地中国证监会派出机构报告,具体以监管机构的要求为准。

7、本计划清算报告的告知安排

清算结果由本计划财产清算小组结束后通过管理人网站向投资者进行披露,并报告基金业协会,具体以监管机构的要求为准。

8、本计划相关账户销户

(1) 证券类账户销户

本计划证券类资产完成变现、结清相关权益、缴清相关费用后，管理人或托管人负责证券类账户的销户工作，销户过程中其他各方应给以必要的配合。

(2) 银行托管账户销户

本计划财产清算完毕后，管理人应向托管人申请注销本计划银行托管账户，托管人应予以配合。

(3) 与本计划财产有关的其他账户的销户：由管理人与托管人协商一致后办理。

9、本计划存续及清算期间，为支付本计划财产承担的各项税费，管理人有权预留相应金额，若预留金额不足以支付实际需缴存的税费的，差额部分由管理人通知投资者补足，管理人不承担垫付责任，投资者应当及时追加资金，不得以任何理由拒绝补足义务。

本计划清算期间，为支付最低备付金、结算保证金，管理人应预留相应金额，若预留金额不足以支付实际需缴存的备付金、保证金金额的，差额部分由管理人通知投资者补足，管理人不承担垫付责任，投资者应当及时追加资金，不得以任何理由拒绝补足义务。

10、本计划清算账册及文件应当由管理人自清算完毕之日起保存 20 年以上。

(六) 管理人应当自资产管理计划终止之日起 5 个工作日内报告基金业协会，并在资产管理计划清算结束后 5 个工作日内将清算报告报送基金业协会，具体以监管机构的要求为准。

二十六、违约责任

(一) 由于本合同当事人过错，造成本合同不能履行或者不能完全履行的，由有过错的一方承担违约责任；如当事人均有过错的，各自承担应负的责任。本合同当事人违反本合同，给其他当事人造成直接经济损失的，应当承担赔偿责任。但是发生下列情况的，当事人可以免责：

1、不可抗力

不可抗力是指本合同当事人无法预见、无法克服、无法避免，且在本合同签署之后发生的，使本合同当事人无法全部或部分履行本合同的任何事件，包括但不限于相关法律法规及监管规则的变更；国际、国内金融市场风险事故的发生；战争或动乱、自然灾害、公众通讯设备故障、电力中断、互联网故障等。

一方因不可抗力不能履行本合同时，应及时通知其他方，并在合理期限内提供受到不可抗力影响的证明，同时采取适当措施防止本计划财产及其他当事人损失扩大。任何一方当事

人迟延履行合同义务后,发生了上述不可抗力事件致使合同当事人无法全部或部分履行本合同,该方不能减轻或免除相应责任;

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

3、在没有欺诈、故意或重大过失的情况下,管理人由于按照合同规定的投资原则行使或不行使其投资权而造成的损失等;

4、在没有欺诈、故意或重大过失的情况下,托管人执行管理人的生效指令对本计划财产造成的损失;

5、在本计划运作过程中,管理人及托管人按照法律、行政法规的规定以及本合同的约定履行了相关职责,但由于其控制能力之外的第三方原因或其他原因而造成运作不畅、出现差错和损失的;

6、管理人或托管人任一方不因另一方的失职行为而给本计划财产或投资者造成的损失向投资者承担连带责任。

7、投资者未能事前就其关联交易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致使资产管理计划资产发生违规投资行为的,管理人与托管人均不承担任何责任;

8、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、中国结算等)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;

9、法律法规规定及本合同约定的其他情况。

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

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

(四)由于不可抗力原因或注册登记机构非正常暂停或终止业务、证券交易所非正常暂停或停止交易、证券交易所、登记结算公司等机构发送的数据错误等非管理人或托管人的原因,管理人和托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查,但是未能发现该错误的,由此造成计划资产或投资者损失,管理人和托管人可以免除赔偿责任。但管理人和托管人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

(五)一方当事人依据本合同向其他方当事人赔偿的损失,仅限于直接损失。

(六) 投资者的债权人通过司法机关对本计划财产采取强制措施，由此造成本计划财产损失，管理人和托管人不承担任何责任，但管理人和托管人应及时将前述强制措施情况告知投资者。

二十七、争议的处理

(一) 发生纠纷时，本合同当事人可以通过协商或者调解予以解决。当事人不愿通过协商、调解解决或者协商、调解不成的，应提交深圳国际仲裁院并按其仲裁规则进行仲裁，仲裁地点在深圳。仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力。仲裁费由败诉方承担。

(二) 纠纷处理期间，相关各方当事人应恪守职责，各自继续忠实、勤勉、尽责地履行本合同约定的义务，维护本计划及投资者的合法权益。

(三) 本合同适用并按照中华人民共和国法律（不包括香港、澳门特别行政区及台湾地区的法律）解释。

二十八、资产管理合同的效力

(一) 合同的成立

本合同是约定投资者、管理人和托管人之间权利义务关系的法律文件。本合同经管理人、托管人和投资者签署后成立，投资者为机构的，本合同自投资者、管理人和托管人加盖公章或合同专用章以及各方法定代表人、执行事务合伙人或授权代表签字或签章之日起成立，投资者为自然人的，本合同自投资者本人签字、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签章之日起成立。

合同签署方式（包括但不限于书面、电子等）可能由于法律法规、监管要求、系统技术等等发生改变，各方同意管理人基于投资者的利益有权按规定采用新的签署方式，并及时进行信息披露。

(二) 合同的生效

本合同成立后，同时满足以下条件时生效：

- (1) 投资者参与资金实际交付并确认；
- (2) 本计划成立。

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。本计划终止，本合同终止，但本合同项下的财产清算条款、违约责任条款、争议解决条款等仍然有效。

(三) 合同的组成

《第一创业富显荣 1 号集合资产管理计划说明书》是管理人对于本计划重要事项的说明，是本合同重要附件，与本合同具有同等法律效力。

经管理人确认有效的投资者参与、退出本计划的申请材料和各销售机构出具的本计划参与、退出业务受理有关凭证等为本合同的附件，是本合同不可分割的一部分，与合同具有同等法律效力。

（四）本合同的有效期限

本合同的有效期限为 26 个月，从本计划成立日起算。在符合本合同约定的展期条件下可展期，但按照本合同约定出现本计划应当终止的情形时，本计划将提前终止并进行清算。

（五）投资者自签署本合同即成为本合同的当事人，在本计划存续期间，投资者自全部退出本计划之日起，该投资者不再是本合同的当事人。

二十九、其他事项

（一）本合同所称的或有事件是指，根据相关法律法规的规定，管理人可能以独资或者控股方式成立具有独立法人资格的从事资产管理业务的公司。

（二）投资者在此同意，如果或有事件发生，在管理人与托管人协商一致的基础上，管理人有权将本合同中由管理人享有的权利和由管理人承担的义务转让给本条上一款所述的从事资产管理业务的公司，并无须就此项变更和投资者另行签订专项协议。但在转让前管理人应以在管理人网站公告投资者。管理人保障投资者退出本计划的权利，并在届时的公告中对相关事项作出合理安排。

（三）管理人应当保证受让人具备开展此项业务的相关资格，并向托管人提供监管机构相关批复文件复印件。

（四）管理人应按照监管机构的要求办理转让手续。

（五）合同其他方签署本合同即视为知悉/授权托管人可为订立、履行个人作为一方当事人的合同所必需或为履行法定职责或者法定义务所必需而处理个人信息；托管人承诺对上述个人信息的处理合法合规，其他方亦已知悉其享有《个人信息保护法》项下所有相关权利。如果个人信息系由一方向另一方提供的，该方承诺已告知并获得相关个人同意向另一方提供个人信息，且个人已知晓个人信息的使用用途。

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

失。

本合同一式叁份，管理人、投资者、托管人各执一份，管理人需按照监管要求报备相关机构的份数另计，每份均具有同等法律效力。

（本页以下无正文）

附件一：投资运作监督事项表

投资运作监督事项表

序号	监督项目	监督内容
一	投资范围	<p>(1) 权益类资产：国内依法发行并在证券交易所交易的股票（含主板、创业板、科创板、北交所及其他经中国证监会核准/注册上市的 A 股股票，含且不限于二级市场股票、新股申购、北京证券交易所战略配售股票、股票增发、通过询价转让/大宗交易等方式受让的上市公司股东转让的股票等）、沪港股票市场交易互联互通机制允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票（“沪港通标的股票”）、深港股票市场交易互联互通机制允许买卖的规定范围内的香港联合交易所市场的股票（“深港通标的股票”）；</p> <p>(2) 固定收益类资产（含现金类资产）：现金、各类银行存款（包括银行活期存款、银行同业存款、银行定期存款和银行协议存款等各类存款，不含结构性存款）、债券逆回购等；</p> <p>(3) 期货和衍生品类：以证券公司为交易对手方的场外衍生品，仅限收益互换（含跨境收益互换）。</p> <p>(4) 资产管理产品：股票型公开募集证券投资基金、货币市场基金、QDII 基金、证券公司或其资产管理子公司发行的 QDII 资产管理产品、基金公司或其子公司发行的 QDII 资产管理产品。</p>
二	投资限制	<p>(1) 权益类资产的投资比例为资产总值的 20%（含）-100%（不含）。</p> <p>(2) 固定收益类资产（含现金类资产）的投资比例为资产总值的 0%（含）-80%（不含）。</p> <p>(3) 参与债券逆回购资金余额不得超过本计划上一日资产净值的 100%，中国证监会另有规定的除外。</p> <p>(4) 期货和衍生品类资产的持仓合约价值低于资产总值的 80%（不含）或期货和衍生品账户权益不超过资产总值的 20%（不含）。</p> <p>(5) 本计划投资收益互换的合约价值及账户权益均不超过资管计划资产净值的 25%。</p> <p>(6) 本计划投资于同一资产的资金，不得超过本计划资产净值的 25%。</p>

	<p>除以收购公司为目的设立的资产管理计划、专门投资于未上市企业股权的资产管理计划外。</p> <p>(7) 本计划参与股票等证券发行申购时, 所申报的金额原则上不得超过本计划的总资产, 且所申报的数量原则上不得超过拟发行公司本次发行的总量, 管理人应当及时向托管人提供参与证券发行申购相关材料。</p> <p>(8) 本计划投资于一家上市公司所发行的股票, 不得超过该上市公司总股本的 4.99%, 不得超过该上市公司流通股本的 10%。</p> <p>(9) 本计划总资产不得超过本计划资产净值的 200%, 计算总资产时, 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, 中国证监会另有规定的除外。</p> <p>(10) 本计划投资于上述资产管理产品的, 计算本计划总资产时按照穿透原则合并计算所投资资产管理产品的总资产; 本计划投资于上述资产管理产品中的公开募集证券投资基金的, 按照穿透原则合并计算投资同类资产的金額需符合本计划资产配置比例的要求; 本计划投资于上述资产管理产品中其他资产管理产品的, 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額需符合本计划资产配置比例的要求。本计划按照所投资资产管理产品披露投资组合的频率更新计算计划所投资资产的金額或比例。</p>
--	---

附件二：托管人关联方名单

前十名股东和主要控股子公司清单

序号	股东名称（全称）	关联类型
1	江苏省国信集团有限公司	前十大股东
2	香港中央结算（代理人）有限公司	
3	江苏交通控股有限公司	
4	江苏高科技投资集团有限公司	
5	江苏省苏豪控股集团有限公司	
6	香港中央结算有限公司	
7	杭州灏月企业管理有限公司	
8	中国证券金融股份有限公司	
9	江苏苏豪国际集团股份有限公司	
10	江苏宏图高科技股份有限公司	
11	华泰联合证券有限责任公司	直接持股 50%以上 子公司
12	华泰期货有限公司	
13	华泰紫金投资有限责任公司	
14	江苏股权交易中心有限责任公司	
15	华泰创新投资有限公司	
16	华泰证券（上海）资产管理有限公司	
17	华泰国际金融控股有限公司	
18	上海盛钜资产经营管理有限公司	
19	南方基金管理股份有限公司	重大利害关系联营 公司
20	华泰柏瑞基金管理有限公司	

说明：

本关联方名单为托管业务口径，供管理人监控关联交易使用。管理人与投资者可通过华泰证券专业机构服务平台<https://inst.htsc.com/incos/visitor/InfoDisclosure>查询最新名单。

附件三：投资指令（样本）

投资指令（样本）

第一创业证券股份有限公司__ __专用表

第一创业*****集合资产管理业务	
编号：202* 年第 * 号	
指令日期：202* 年 ** 月 **日	
*****资产托管部： 敬请贵部根据以下提供的收款人名称、开户行、账号、到账日期和划款金额划款。	
资金划出账户：	
账号：	
开户行：	
到账时间：	
收款人：	
开户行：	
账号：	
划款金额（小写）：	
划款金额（大写）：	
资金用途：	
备注：	
管理人签章：	托管人签章：
审批人：	审批人：
复核人：	复核人：
经办人：	经办人：

附件四：联系人名单

第一创业富显荣 1 号集合资产管理计划

(合同编号：(JH) FXR1H-HT2024 第 1 号)

第一创业证券股份有限公司			
邮寄地址：深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 19 楼		邮政编码：518048	
岗 位	姓 名	分 机	EAMIL
估值对账	杨云龙	0755-23838106	yangyunlong2307@fcsc.com
投资指令经办	雷岩	0755-23838065	leiyang@fcsc.com
托管人联系人：吴小龙		传真电话：025-83387215	
邮寄地址：南京市建邺区江东中路 228 号		邮政编码：210019	
岗 位	姓 名	电 话	EMAIL
协调人	吴小龙	025-83388440	wuxiaolong@htsc.com
资金清算	李雪梅	025-83387967	lixuemei@htsc.com
估值核算	张梦辰	025-83388437	zhangmengchen@htsc.com

附件五：第一创业证券指令发送授权通知（样本）

尊敬的托管人：

根据资产管理计划合同（包括但不限于托管协议、备忘录）的相关约定，我公司授予雷岩等同志负责托管在贵司的所有资产管理产品的运营管理工作。本授权书变更或终止时我公司另行通知。我公司有效授权人员，指定如下：

授权范围	授权人员	签字样本
指令经办	雷岩	
	杨晓文	
指令复核	周南鸿	
	黄小芳	
指令审批	孙蕤	
	黄焕元	

划款指令签发业务章（预留印鉴章）：

由上述对应授权范围内任一签字样本签署的投资指令均有效。

本授权书自 年 月 日起生效。

第一创业证券股份有限公司

年 月 日

附件六：预留印鉴

以下为管理人、托管人的预留印鉴，该印鉴用于该集合资产管理业务项下书面文件（如各类通知书、申请书、投资指令、回执）等的盖章和说明。

管理人预留印鉴	
托管人预留印鉴	

管理人：第一创业证券股份有限公司（公章）



托管人：华泰证券股份有限公司

（公章或合同专用章）



