
东方红-量化 2 号
集合资产管理计划托管协议

管理人：上海东方证券资产管理有限公司

托管人：中国建设银行股份有限公司

二〇二三年二月

目 录

一、托管协议当事人.....	1
二、托管协议的依据、目的、原则和解释.....	1
三、托管人和管理人之间的业务监督、核查.....	2
四、集合计划资产的保管.....	5
五、指令的发送、确认和执行.....	9
六、交易安排.....	12
七、集合计划参与、退出及分红的资金清算.....	17
八、集合计划资产估值、资产净值计算与复核.....	19
九、集合计划收益分配.....	19
十、集合计划委托人名册的保管.....	19
十一、信息披露.....	19
十二、集合计划有关文件和档案的保存.....	20
十三、集合计划托管报告.....	20
十四、集合计划费用.....	20
十五、禁止行为.....	20
十六、违约责任和责任划分.....	21
十七、适用法律与争议解决.....	21
十八、托管协议的效力和文本.....	22
十九、托管协议的修改和终止.....	22
二十、其他事项.....	22

一、托管协议当事人

（一）管理人

名称：上海东方证券资产管理有限公司

住所：上海市黄浦区中山南路109号7层-11层

邮政编码：200010

法定代表人：杨斌

成立日期：2010年7月28日

注册资本：叁亿元

企业类型：有限责任公司

存续期间：持续经营

经营范围：证券资产管理业务；公开募集证券投资基金管理业务。

（二）托管人

名称：中国建设银行股份有限公司（简称“建设银行”）

住所：北京市西城区金融大街25号

法定代表人：田国立

成立日期：2004年9月17日

企业类型：股份有限公司

注册资本：人民币贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

存续期间：持续经营

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期、长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保管箱服务；经中国银行业监督管理委员会等监管部门批准的其他业务。

二、托管协议的依据、目的、原则和解释

（一）依据

本协议依据《中华人民共和国民法典》、《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》（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》”）等法律法规、中国证监会、中国证券业协会、中国证券投资基金业协会的有关规定以及《东方红-量化2号集合

资产管理合同》（以下简称“《集合资产管理合同》”）制订。

（二）目的

本协议的目的是明确东方红-量化2号集合资产管理计划托管人和管理人之间在集合计划参与人名册的登记、集合计划资产的保管、管理和运作、集合计划的参与、退出及相互监督等有关事宜中的权利、义务及职责，保护委托人的合法权益。

（三）原则

管理人发起设立集合资产管理计划，委托托管人对集合计划资产进行托管。双方本着平等自愿、诚实信用的原则，经协商一致，签订本协议。

（四）解释

除非文义另有所指，本协议的所有术语与《集合资产管理合同》的相应术语具有相同含义。

三、托管人和管理人之间的业务监督、核查

（一）托管人对管理人的业务监督、核查

1、根据有关法律法规、部门规章的规定、《集合资产管理合同》和本协议的约定，托管人应对管理人就集合计划资产的投资范围、资产配置比例和投资限制等行为进行监督和核查。

2、托管人发现管理人有违反有关法律法规规定、《集合资产管理合同》或本协议约定的行为，应以书面形式或录音电话通知管理人限期纠正，管理人收到通知后应及时核对确认并以书面或双方认可的其他方式向托管人发出回函，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。托管人有权随时对通知事项进行复查，督促管理人改正。托管人的监督责任仅限于发出通知，如管理人未能在规定期限内按照托管人的通知对违规行为进行纠正，托管人应当拒绝执行（因国内现行法律、法规及交易规则导致托管人无法拒绝执行的除外）并有权向管理人住所地中国证监会派出机构及证券投资基金业协会报告，由管理人原因造成的损失由管理人承担相应责任。

3、托管人发现管理人有重大违规行为，有权立即报告管理人所在地的中国证监会派出机构和证券投资基金业协会，同时通知管理人限期纠正，并有权将纠正结果报告管理人所在地的中国证监会派出机构和证券投资基金业协会。

4、托管人根据有关法律法规、部门规章的规定及《集合资产管理合同》的约定，对集合计划的下列投资范围、投资比例和投资限制等事项进行监督：

(1) 托管人对投资范围的监督

1) 权益类资产：国内依法发行的股票（包括在科创板上市的股票，以及新股申购、定向增发所得股票）、港股通标的股票、存托凭证（包括在科创板上市的存托凭证）、股票型基金（不含股票型分级基金的优先级份额）、混合型基金（不含混合型分级基金的优先级份额）等；

在未来法律法规允许的情况下，本集合计划可投资在海外上市的中国公司股票；

2) 固定收益类资产及货币市场工具：国债、地方政府债、金融债、公司债（含非公开发行公司债）、企业债、可转换债券、可分离交易债券、可交换债券（含私募可交换债券）、非公开定向债务融资工具、并购重组私募债、中小企业私募债、证券公司短期公司债、永续债、银行间及交易所上市的资产支持证券优先级、银行间市场上市的资产支持票据优先级、央行票据、短期融资券（含超短期融资券）、中期票据等银行间市场交易的投资品种以及经银行间市场交易商协会批准注册发行的其他债务融资工具等；股票型及混合型分级基金的优先级份额、债券型基金；银行存款（包括但不限于银行定期存款、协议存款、同业存款等各类存款）、同业存单、货币市场基金、债券逆回购、标准化票据等，以及监管机构允许集合计划投资的其他货币市场工具；

3) 商品及金融衍生品类资产：权证、国债期货、股指期货、商品期货、利率互换、场内期权、CRMW、商品基金（含商品期货基金和商品ETF）等；

4) 现金（活期存款）；

5) 本集合计划可以参与融资融券交易，也可以将其持有的股票作为融券标的证券出借给证券金融公司。本集合计划可以参与证券回购，但集合计划的总资产不得超过该计划净资产的200%，中国证监会另有规定的除外。

法律法规或中国证监会允许集合计划投资其他品种的，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。

管理人在投资海外上市的中国公司股票、商品期货、利率互换、场内期权、CRMW、参与融资融券交易前，应与托管人就清算交收、核算估值、系统支持进行确

认，确保双方均准备就绪方可进行投资。

(2) 托管人对资产配置比例的监督

1) 投资于存款、债券等债权类资产的比例低于资产总值的 80%；

2) 投资于股票等股权类资产的比例低于资产总值的 80%；

3) 商品及金融衍生品类资产的持仓合约价值低于资产总值的 80%，或者衍生品账户权益不超过资产总值的 20%；其中，权证市值上限为资产净值的 3%；集合计划投资股指期货的，在任何交易日日终，集合计划买入、卖出股指期货合约价值轧差计算后不超过资产总值的 80%；集合计划投资国债期货的，在任何交易日日终，集合计划买入、卖出国债期货合约价值轧差计算后不超过资产总值的 80%；

其中，“商品及金融衍生品类资产的持仓合约价值”托管人按照买入、卖出期货持仓合约价值（轧差）、期权市值口径计算；“衍生品账户权益”托管人按照期权、期货结算备付金和存出保证金之和计算；若相关法律法规、监管部门及自律组织有强制规定的，从其规定，调整投资监督口径前，管理人将及时通知托管人。

因证券期货市场波动、证券发行人合并、资产管理计划规模变动等管理人之外的因素导致集合计划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本合同约定的投资比例的，管理人应当在流动性受限资产可出售、可转让或者恢复交易的二十个交易日内调整至符合相关要求。确有特殊事由未能在规定时间内完成调整的，管理人应当及时向中国证监会相关派出机构报告。

在本合同到期日前一个月内，因资产管理计划财产变现需要，本资产管理计划财产的投资比例限制可以不符合上述规定。

(3) 托管人对投资限制的监督

为维护委托人的合法权益，除投资范围及比例部分规定的限制外，本集合计划还需遵循以下限制：

1) 集合资产管理计划的总资产不得超过该计划净资产的 200%，中国证监会另有规定的除外；

2) 本集合计划投资于同一资产的资金，不得超过集合计划资产净值的 25%；银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券等中国证监会认可的投资品种除外；

3) 本集合计划投资范围中的各类基金均包含 QDII 基金；

4) 证券法规规定和集合资产管理合同约定禁止从事的其他投资。

上述投资限制系根据集合资产管理业务的相关法规而制定。若相关法规有所变化，履行适当程序后，本集合计划的投资限制也将作相应的调整。

5、若《集合资产管理合同》中关于托管人的监督、核查内容与本托管协议内容不符，以本托管协议中的相关约定为准，未监控事项待托管人具备投资监督条件后再行监督。

(二) 管理人对托管人的业务监督、核查

1、根据有关法律法规规定、《集合资产管理合同》和本协议的约定，管理人就托管人是否及时执行管理人合法合规的指令、妥善保管集合计划的有关资产、是否将集合计划资产分账管理、是否擅自动用集合计划资产、是否按时将退出资金和分红收益划入管理人在登记公司开立的本集合计划清算备付金账户等事项，对托管人进行监督和核查。

2、管理人发现托管人的行为违反法律法规规定、《集合资产管理合同》和本协议的约定，应制止且以书面形式或录音电话通知托管人限期纠正，并及时报告管理人所在地的中国证监会派出机构和证券投资基金业协会。托管人收到通知后应及时核对并以书面或双方认可的其他方式给管理人发出回函，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。管理人有权随时对通知事项进行复查，督促托管人改正。

3、管理人发现托管人有重大违规行为，应立即报告管理人所在地的中国证监会派出机构和证券投资基金业协会，同时通知托管人限期纠正，并将纠正结果报告管理人所在地的中国证监会派出机构和证券投资基金业协会。

(三) 托管人与管理人在业务监督、核查中的配合、协助

管理人和托管人有义务配合和协助对方依照本协议对集合计划业务执行监督、核查。管理人或托管人无正当理由，拒绝、阻挠对方根据本协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督，情节严重或经监督方提出警告仍不改正的，监督方应报告管理人所在地的中国证监会派出机构和证券投资基金业协会。

四、集合计划资产的保管

(一) 集合计划资产保管的原则

1、托管人按照规定代理开立集合计划财产的资金账户、证券账户、债券托管专户及其他账户，对所托管的不同集合计划财产分别设置账户。托管人对在中国证券登记结算有限责任公司、上海清算所开立的证券账户和在中央国债登记结算有限责任公司开设的银行间债券市场债券托管账户中的证券以及在托管人之处开立的银行账户内的资金负有安全保管职责，因登记公司自身原因造成资产损失的除外。对于管理人在其他机构投资的证券以及在托管人之外开立的银行账户内的资金，托管人负责保管管理人提供的相关凭证，托管人对有价凭证的保管，并不保证该有价凭证对应的实际资产的不致灭失，托管人按照法律法规及协会指引等规定要求承担保管责任。实物证券的保管根据相关规定办理，如规定存放于中央国债登记结算有限责任公司、上海清算所或中国证券登记结算有限责任公司等其他机构的，按规定办理。如无规定的，由托管人负责存管。管理人委托的期货公司对本集合计划期货保证金账户资产承担保管责任。

2、托管人未经管理人的指令，不得自行运用、处分、分配集合计划的任何资产（不包含托管人依据中国结算公司结算数据完成场内交易交收、集合计划资产开户银行扣收结算费和账户维护费等费用）。

3、对于因为集合计划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通知托管人。到账日集合计划资产没有到达托管人处的，托管人应及时通知管理人采取措施进行催收，由此给集合计划造成损失的，管理人应向有关当事人追偿集合计划的损失。

4、托管人应当设立专门的托管部门，具有符合要求的营业场所；配备足够的、合格的熟悉集合计划托管业务的专职人员，负责集合计划资产托管事宜；建立健全内部风险监控制度，防范和减少风险。

5、除依据有关法律法规规定、《集合资产管理合同》另有约定外，托管人不得委托第三人托管集合计划资产。

（二）集合计划的银行账户的开设和管理

1、托管人可以集合计划的名义在其营业机构代理开立集合计划的专用银行账户，并根据管理人合法合规的指令办理资金收付。本集合计划的银行预留印鉴由托管人保管和使用。

2、集合计划银行账户的开立和使用，限于满足开展本集合计划业务的需要。

托管人和管理人不得假借本集合计划的名义开立任何其他银行账户；亦不得使用集合计划的任何账户进行本集合计划业务以外的活动。

3、集合计划银行账户的开立和管理应符合银行业监督管理机构的有关规定。

4、在符合法律法规、部门规章规定的条件下，托管人可以通过托管人专用账户办理集合计划资产的支付。

5、管理人应于资产管理计划到期后及时完成收益兑付、费用结清及其他应收应付款项资金划转，在确保后续不再发生款项进出后的10个工作日内向托管人发出销户申请。

（三）集合计划证券账户的开设和管理

1、托管人应当代理本集合计划，以管理人、托管人和本集合资产管理计划联名的方式在中国证券登记结算有限责任公司开立专门的证券账户。

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

3、集合计划证券账户卡的管理和运用由管理人负责。

4、证券账户的开户费由管理人先行垫付，待本资产管理计划起始运作后，管理人可向托管人发送划款指令，将垫付的开户费从资产管理计划托管账户中扣还管理人。账户注销时，在遵守中国结算的相关规定下，由管理人和托管人协商确认主要办理人，尤其负责注销本计划项下的证券账户。账户注销期间，主要办理人如需另一方提供配合的，另一方应予以配合。

（四）债券托管专户的开设和管理

集合资产管理合同生效后，在符合监管机构要求的情况下，管理人负责以集合计划的名义申请并取得进入全国银行间同业拆借市场的交易资格，并代表集合计划进行交易；托管人负责以集合计划的名义在中央国债登记结算有限责任公司、上海清算所开设银行间债券市场债券托管账户，并代表集合计划进行债券交割和资金结算。

（五）开放式基金账户由管理人负责以管理人、托管人和本集合资产管理计划联名的方式开立，并授权托管人接受资料和查询账户变动情况。账户预留地址为托管人办公地址，预留银行账户为托管人为本集合计划开立的专用银行账户。

管理人开立基金账户或变更基金账户相关信息，需事先征得托管人同意。未经托管人同意，使用或变更基金账户产生的责任由管理人承担。集合资产管理计划申购、赎回基金的确认单（传真件）以及其他相关资料管理人应及时传真给托管人。

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

（六）期货账户的开设和管理

1、期货账户的开立

管理人负责以本集合计划的名义，与期货公司签订有关协议，开立期货资产账户，用于存放本集合计划期货保证金。同时为本集合计划申请专用交易编码，托管人应配合提供有关申请资料。本计划《期货经纪业务协议》及《交易编码申请表》由管理人负责保管。

2、管理人应将托管人为本计划资产开立的托管专用银行账户指定为本集合计划期货资产账户对应的唯一银行结算账户，并负责开通银期转账手续。管理人应确保将用于银期转账的操作密码安全的移交给托管人且仅移交给托管人，未经托管人书面同意，管理人不得撤销、变更银期转账业务，不得变更本集合计划期货资产账户对应的银行结算账户。

3、期货交易结算

本计划的期货交易清算及资金交割由管理人与期货公司另行签订有关协议，并约定由该期货公司负责。

4、期货资产账户下委托资产的保管

期货公司负责期货资产账户下委托资产的保管。如果期货公司严重违法违规或者风险控制不力导致保证金出现缺口，根据法律法规处理。

本计划资产期货保证金账户仅能用于支付本计划资产在中国金融期货交易所期货交易清算款和相关费用以及向托管专用银行账户划回清算款，不得向其他任何账户划付资金。

5、数据的传输与接收

（1）管理人应要求期货公司指定专门联系人负责数据的发送；同时，托管人应指定专门联系人负责接收期货公司发送的结算数据。在首次办理入金手续前三

个交易日内，管理人应督促期货公司将指定联系人的联系方式通知托管人，并要求期货公司承诺仅将结算数据发送给托管人指定的专门联系人。

(2) 管理人应要求期货公司对所发送的数据的准确性、完整性、真实性负责，并向管理人和托管人提供期货经纪合同项下登录中国期货保证金监控中心的登录用户名及密码等要素，方便托管人登录及查询。

(3) 为便于托管人及时进行结算和结算数据核对，管理人应要求期货公司在获得中国金融期货交易所发布的结算数据后，以中国期货市场监控中心标准格式，在 18 点前将本计划资产的当日成交数据通过深证通发送给托管行指定联系人，期货公司需留人等待托管人确认无误。因中国金融期货交易所原因而造成数据延迟发送的，期货公司应及时电话通知托管人，并在收到数据后立即发送至托管人，同时向托管人进行电话确认数据是否接收成功。

(七) 本集合计划如需参加期权交易，应当按照现有证券账户开立方式向中国证券登记结算有限责任公司申请新开立一个普通证券账户，管理人负责将该证券账户指定交易在证券公司或期货公司，由相应证券公司（或期货公司）为本集合计划开立衍生品合约账户后，再通过该证券公司（或期货公司）参与期权交易。

(八) 集合资产管理计划推广活动结束后，管理人应将属于集合计划的全部资金划入托管人代理开立的集合计划银行账户；同时，在规定时间内，管理人应当聘请符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所对集合资产管理计划进行验资，并出具验资报告。出具的验资报告由参加验资的 2 名或 2 名以上中国注册会计师签字方为有效。

(九) 与集合计划资产有关的重大合同的保管

与集合计划资产有关的重大合同的原件分别由托管人、管理人保管。重大合同包括集合资产管理合同、托管协议及其附件。除本协议另有规定外，管理人在代表集合计划签署与集合计划有关的重大合同时，应保证集合计划一方持有两份以上的正本，以便管理人和托管人至少各持有一份正本的原件。

五、指令的发送、确认和执行

(一) 交易清算授权

管理人应向托管人提供《预留印鉴授权通知书》（以下简称“授权文件”），内容包括被授权人名单、预留印鉴及被授权人签字样本，授权文件应注明被授权

人相应的权限及有效时限，并规定管理人向托管人发送指令时托管人确认被授权人身份的方法。

托管人在收到授权文件原件并接到管理人电话确认后，授权文件即生效。如果授权文件中载明具体生效时间的，该生效时间不得早于托管人收到授权文件并经电话确认的时点。如早于，则以托管人收到授权文件并经电话确认的时点为授权文件的生效时间。

管理人更换被授权人、更改或终止对被授权人的授权，应立即将新的授权文件以传真或邮件等双方认可的方式通知托管人，经电话确认后生效，原授权文件同时废止。新的授权文件在发出后7个工作日内送达文件正本。新的授权文件生效之后、正本送达之前，托管人按照新的授权文件内容执行有关业务，如果新的授权文件正本与托管人收到的传真或邮件等内容不同，由此产生的责任由管理人承担。

管理人和托管人对授权文件负有保密义务，其内容不得向被授权人及必要操作人员以外的任何人泄露。但法律法规规定或有权机关要求的除外。

（二）投资指令的内容

投资指令（“指令”）是管理人在运用资产管理计划财产时，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写明款项事由、支付时间、到账时间、金额、收付款账户信息等，按授权文件加盖预留印鉴并由被授权人签字。

（三）投资指令的发送、确认及执行时间与程序

指令由被授权人代表管理人用传真的方式或其他托管人和管理人确认的方式向托管人发送。管理人有义务在发送指令后及时与托管人进行电话确认，对于因管理人原因未能及时与托管人进行指令确认，致使资金未能及时划拨所造成的损失，由管理人承担责任。托管人依照授权文件规定的方法确认指令有效后，方可执行指令。对于被授权人发出的指令，管理人不得否认其效力。管理人应按照有关法律法规和本协议的规定，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。

管理人于划款前向托管人发送指令并确认。对于要求当天到账的指令，必须在当天15:30前向托管人发送，15:30之后发送的，托管人尽力执行，但不能保证

划账成功。如果要求当天某一时点到账的指令，则指令需要至少提前 2 个工作小时发送，并相关付款条件已经具备，托管人视付款条件具备时为指令送达时间。对新股申购网下发行业务，管理人应在网下申购缴款日（T 日）的前一工作日下班前将指令发送给托管人，指令发送时间最迟不应晚于 T 日上午 10:00。对于中国证券登记结算有限责任公司实行 T+0 非担保交收的业务，管理人应在交易日 14:00 前将划款指令发送至托管人。因管理人原因导致指令传输不及时，致使资金未能及时划入中国证券登记结算有限责任公司指定交收账户所造成的损失由管理人承担，包括赔偿在该市场引起其他托管客户交易失败、赔偿因占用结算参与人最低备付金带来的利息损失。管理人应确保托管人在执行指令时，资金账户有足够的资金余额，在资金头寸充足的情况下，托管人对管理人符合法律法规、《集合资产管理合同》、本协议的指令不得拖延或拒绝执行。

托管人收到管理人发送的指令后，应立即审慎验证指令的要素是否齐全，并将指令所载签字和印鉴与授权通知进行表面真实性及权限范围核对，复核无误后应在规定期限内执行，不得延误。管理人应确保托管人在执行指令时，资金账户有足够的资金余额，资金头寸不足时，托管人应拒绝管理人发送的指令，并视银行账户资金余额足够时为指令送达时间。

（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有可能违反本协议约定或其他有关法律法规的规定时，应暂缓执行指令，并及时通知管理人，管理人收到通知后应及时核对并纠正；如相关交易已生效，则应通知管理人在 10 个工作日内纠正，并有权报告相关监管部门。对于管理人违反本协议或其他有关法律法规的规定造成资产管理计划财产损失的，由管理人承担相应责任。

对于管理人的有效指令和通知，除非违反本协议约定或有关法律法规的规定或具有本条第（四）项和第（五）项所述错误，托管人不得无故拒绝或拖延执行，否则应就资产管理计划或管理人由此产生的损失负赔偿责任。

对于托管人按照本协议正确执行管理人的合法及符合本协议约定指令对资产管理计划财产造成的损失，由管理人过错造成的，由管理人承担相应责任。

（五）管理人发送错误指令的情形和处理程序

管理人发送错误指令的情形包括指令发送人员无权或超越权限发送指令及交

割信息，指令中重要信息模糊不清或不全等。

托管人在履行监督职能时，发现管理人的指令错误时，有权拒绝执行，并及时通知管理人改正。如需撤销指令，管理人应出具书面说明，并加盖业务用章。

托管人因执行管理人的合法指令和依据交易程序已经生效的指令而对资产管理计划财产造成的损失，由管理人过错造成的，由管理人承担相应责任。

（六）投资指令相关其他事项

1、投资指令原件由管理人保管。

2、管理人应在银行间交易成交后，及时将通知单、相关文件及划款指令加盖公章后发至托管人并电话确认，由托管人完成后台交易匹配及资金交收事宜。如果银行间结算系统已经生成的交易需要取消或终止，管理人要书面通知托管人。

3、管理人在发送投资指令时，应向托管人发送投资划款指令并确认，如需在划款当日下达投资划款指令，管理人应为托管人留出执行指令所必需的时间，遇到特殊情况双方协商处理。因管理人过错造成指令传输不及时、管理人未能给托管人留出足够的划款时间，致使资金未能及时到账造成的损失，由管理人承担相应责任。

4、本资产管理计划财产在证券交易所场内交易的资金清算交割，由托管人通过中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司及清算代理银行办理。托管人视中国证券登记结算有限责任公司向其发送的清算数据为有效指令，无须管理人向托管人另行出具划款指令。

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

6、资产管理计划财产参与认购未上市债券时，管理人应代表资产管理计划财产与对手方签署相关合同或协议，明确约定债券过户具体事宜。否则，管理人需对所认购债券的过户事宜承担相应责任。

六、交易安排

（一）选择代理证券买卖的证券经营机构的程序

管理人负责选择代理本资产管理计划财产证券买卖的证券经营机构，并和被选中的证券经营机构签订委托协议，使用其交易单元作为资产管理计划财产的交易单元。管理人应不晚于本计划成立日将交易单元等信息书面通知托管人，并依

据托管人要求提供相关资料，以便托管人申请办理接收结算数据手续。

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

（二）投资证券后的清算交收安排

管理人与托管人应根据有关法律法规及相关业务规则，签订《托管银行证券资金结算协议》，如拟投资港股通，还需签订《港股通结算补充协议》，用以具体明确管理人与托管人在证券交易资金结算业务中的程序与责任。

1、结算备付金与保证金

根据中国证券登记结算有限责任公司规定，在每月前 3 个工作日内，中国证券登记结算有限责任公司对结算参与人的最低结算备付金、结算保证金限额进行重新核算、调整。托管人在中国证券登记结算有限责任公司调整最低结算备付金、结算保证金当日，在《资金账户报告》中反映调整后的最低备付金和结算保证金。管理人应预留最低备付金和结算保证金，并根据中国证券登记结算有限责任公司确定的实际最低备付金、结算保证金数据为依据安排资金运作，调整所需的现金头寸。

2、清算交收

托管人负责资产管理计划财产买卖证券交易的清算交收。证券交易所场内资金结算由托管人根据中国证券登记结算有限责任公司结算数据办理；其他场外资金汇划由托管人根据管理人的指令具体办理。

如果因为托管人自身原因在清算上造成资产管理计划财产的直接损失，应由托管人负责赔偿，但因中国人民银行、中国证券登记结算有限责任公司和银行间市场登记结算机构资金结算系统以及其他机构的结算系统发生故障等非托管人的原因造成清算资金无法按时到账的情形，托管人免责；如果因为管理人原因未事先通知托管人增加交易单元等事宜，致使托管人接收数据不完整，造成清算差错的责任由管理人承担；如果因为管理人原因未事先通知需要单独结算的交易，造成资产管理计划财产损失的由管理人承担；管理人应采取合理措施，确保在 T 日日终有足够的资金头寸用于 T+1 日中国证券登记结算有限责任公司的资金交收。如因管理人原因导致资金头寸不足，管理人应在 T+1 日上午 12:00 前保证头寸充足，确保资金交收。如果未遵循上述规定备足资金头寸，影响了资产管理计划财

产自身的清算交收及托管人与中国证券登记结算有限责任公司之间的一级交收，由此给托管人、本委托财产及托管人托管的其他资产造成的直接损失由管理人负责。

如果由于管理人违反市场操作规则的规定进行超买、超卖及质押券欠库等原因造成资产管理计划财产投资清算困难和风险的，托管人在预清算结束后应通知管理人预透支和预欠库事项，管理人应保持联系方式畅通，后续补缴由管理人负责解决，由此给托管人、本委托财产及托管人托管的其他资产造成的直接损失由管理人承担。

根据中国证券登记结算有限责任公司结算规定，管理人在进行融资回购业务时，用于融资回购的债券将作为偿还融资回购到期购回款的质押券。如因管理人原因造成债券回购交收违约或因折算率变化造成质押欠库，导致中国证券登记结算有限责任公司欠库扣款或对质押券进行处置造成的投资风险和损失由管理人承担。实行场内T+0非担保交收的资金清算按照托管人的相关规定流程执行。

（三）资金、证券和期货账目及交易记录的核对

管理人按日进行交易记录的核对。管理人和托管人每月对资产管理计划财产的证券账目、实物券账目进行核对。

（四）资金余额的确认

托管人于T+1日上午09:30以前以邮件、传真或双方认可的其他传送方式将T日资产管理计划财产投资交易清算后的《资金账户报告》发送给管理人。每日日终，完成当日投资交易资金结算并核实账户资金余额后，以邮件、传真或双方认可其他的传送方式发送《资金账户报告》进行资金余额的确认。

（五）选择期货经纪机构及期货投资资金清算安排（如有）

本资产管理计划投资于期货前，管理人负责选择为本资产管理计划提供期货交易服务的期货经纪公司，并与其签订期货经纪合同。管理人投资期货之前，应与托管人、期货公司三方共同就期货开户、清算、估值、交收、费用等事宜另行签署《期货投资托管操作三方备忘录》。本资产管理计划投资于期货发生的资金交割清算由管理人选定的期货经纪公司负责办理，托管人对由于期货交易所期货保证金制度和清算交割的需要而存放在期货经纪公司的资金不行使保管职责，管理人应在期货经纪协议或其他协议中约定由选定的期货经纪公司承担资金安全保管

责任。

(六) 投资银行存款的特别约定

1、资产管理人和资产托管人的职责

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

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

2、相关协议的签署

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

(1) 存款账户必须以本资产管理计划名义开立。

(2) 协议须约定存款类型、期限、利率、计息方式、金额、账号、起止时间，存款银行经办行名称、地址及进款账户。

(3) 协议须约定将资产托管人为本计划开立的托管银行账户指定为唯一回款账户，任何情况下，存款银行都不得将存款本息划往任何其他账户。

(4) 资金划转过程中存款银行需要使用过渡账户的，存款银行须保证资金在过渡账户中不出现滞留，不被挪用。

(5) 存款银行有义务保证本集合计划存款投资在存续期内的安全。

(6) 协议须约定存款银行不得接受资产管理人或资产托管人任何一方单方面提出的对该笔存款投资进行更名、转让、挂失、质押、担保、撤销变更印鉴及回款账户信息等任何可能导致财产转移的申请。

(7) 协议须明确，存款银行对存款证实书的真实性负责，并承担移交过程中

由于存款证实书丢失、损毁、被人为调换等所引发的一切后果。正常情况下，同城存款银行应在存款证实书开立后2个工作日内将原件移交托管行保管；异地存款银行应在存款证实书开立后5个工作日内将原件移交资产托管人保管。

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

(1) 由存款银行/资产管理人提供上门送、取单服务。在上门送、取单时，存款银行/资产管理人经办人员应携带单位介绍信/授权书以及个人身份证件，以便资产托管人进行核查。资产管理人上述事项被授权人员与资产管理人负责洽谈存款事宜并签订存款协议的人员不能为同一人。

(2) 资产管理人与资产托管人双方协商一致的其他办理方式。

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

5、如发生逾期支取，由责任人承担相应利息损失及逾期支取手续费。

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

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

（七）本集合计划通过第三方销售机构参与开放式基金投资的特别约定

本集合计划可以通过第三方基金销售机构渠道投资开放式基金。为维护投资者利益、保障资产安全，资产管理人应负责制订选择第三方基金销售机构的标准和程序，并据此选择第三方销售机构。资产管理人确保所选择的销售机构在中国证监会注册取得基金销售业务资格，符合开展前述各类产品销售业务的各项资质和要求。对于第三方基金销售机构原因给本集合计划造成损失的，相关责任不由托管人承担。

七、集合计划参与、退出及分红的资金清算

（一）推广期参与

1、集合计划推广期间，在集合计划委托人参与本集合计划申请日（T日）后第2个工作日，即T+2日，销售机构将参与资金足额划入其在中国证券登记结算公司开立的结算备付金账户。

2、中国证券登记结算公司于委托人参与本集合计划申请日（T日）后第2个工作日，即T+2日将参与资金划入认购专户。

3、集合计划推广期结束，中国证券登记结算公司将参与资金划入管理人在中国证券登记结算公司开立的结算备付金账户。

4、管理人应将全部参与资金从管理人在中国证券登记结算公司开立的结算备付金账户转入托管人为集合计划代理开立的托管专户。管理人应当聘请符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所对集合资产管理计划进行验资并出具验资报告，并提供给托管人。

5、若集合计划推广活动结束，不能满足集合资产管理合同生效的条件，由管理人按规定办理资产返还事宜。

以上事项如中国证监会另有新规定，按新规定执行。

（二）存续期参与和退出业务处理的基本规定

1、存续期内集合计划参与和退出的确认、清算由管理人指定的注册登记机构负责办理。

2、管理人原则上每个工作日15:00前向托管人发送前一工作日上述有关数据，并保证相关数据的准确、完整。

3、管理人通过与托管人建立的加密传真系统或预留印鉴方式发送有关数据，如因各种原因，该系统无法正常发送，双方可协商解决处理方式。管理人向托管

人发送的数据，双方各自按有关规定保存。

4、如管理人委托其他机构办理本集合计划的注册登记业务，应保证上述相关事宜按时进行。

5、关于集合计划清算备付金的设立和管理

为满足存续期内退出及分红资金汇划的需要，由管理人在中国登记结算公司以集合计划的名义开立集合计划清算备付金账户，该账户由管理人管理。

6、对于集合计划参与过程中产生的应收资产，应由管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知托管人，到账日集合计划资产没有到达托管人处的，托管人应及时通知管理人采取措施进行催收，由此给集合计划造成损失的，管理人应负责向有关当事人追偿集合计划的损失。

7、退出和分红资金划拨规定

拨付退出款或进行集合计划分红时，如集合计划银行账户有足够的资金，托管人应按时拨付；因集合计划银行账户没有足够的资金，导致托管人不能按时拨付，如系管理人的原因造成，责任由管理人承担。

8、资金指令

除参与款项到达托管人处的集合计划账户需双方按约定方式对账外，全额划出、退出和分红资金划拨时，管理人需向托管人下达指令。

资金指令的格式、内容、发送、接收和确认方式等与投资指令相同。

(三) 存续期集合计划资金清算时间安排

1、存续期集合计划资金清算时间安排为：参与资金在 T+2 日内清算，退出资金在 T+2 日内清算。

2、T+1 日 15:00 前，管理人将 T 日参与、退出确认的有效数据汇总传输给托管人。管理人和托管人据此进行参与、退出的集合计划会计处理。

3、集合计划的参与退出款按净额资金模式进行交收。

当托管账户存在净应收额时，资金交收日的 15:00 前管理人将净应收额从资金清算的集合计划备付金账户划到集合计划的托管账户，托管人在资金到账后应通知管理人，并将有关书面凭证传真给管理人进行账务处理。

当托管账户存在净应付额时，资金交收日当日 9:30 前管理人将次日的划款指令传真给托管人，资金交收日 14:00 前托管人按管理人的划款指令将净应付额

划向资金清算的集合计划清算备付金账户。托管人在资金划出后应通知管理人，并将有关书面凭证交给管理人进行账务管理。

4、出现特殊情况时，管理人和托管人双方可协商处理。

（四）集合计划现金分红

1、管理人将其决定的分红方案通知托管人，并及时披露。

2、管理人对集合计划分红进行账务处理并核对后，管理人向托管人发出现金分红的划款指令，托管人应及时将资金划入管理人为本集合计划在中国登记结算公司开立的集合计划清算备付金账户。

3、管理人在下达指令时，应给托管人留出必需的划款时间。

（五）集合计划的参与、退出和分红的资金交收规则以中国登记结算公司规则为准。

（六）集合计划成立时，管理人应将计划募集资金本金全额划入托管账户，部分利息于集合计划成立时划入，部分利息于中国登记结算公司结息日划入托管账户，具体以中国登记结算公司规则为准。管理人应确保托管账户实际到账款项与计划验资报告金额（含利息）一致。如果发现不一致的情况，托管人应书面通知管理人，由管理人负责解决并承担相应责任。

八、集合计划资产估值、资产净值计算与复核

参照《集合资产管理合同》第十一章的相关约定执行。

九、集合计划收益分配

参照《集合资产管理合同》第十三章的相关约定执行。

十、集合计划委托人名册的保管

集合计划注册登记机构负责编制和保管集合计划委托人名册。

按照《集合资产管理合同》的有关规定，本集合计划的注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司。

十一、信息披露

（一）保密义务

除非有权机关依法提出要求，托管人和管理人应按法律法规、部门规章、集

合资产管理合同和中国证监会关于集合计划信息披露的有关规定进行信息披露，拟披露的信息在披露之前应予保密，不得向他人泄露。除依前述规定应予披露的信息外，任何一方不得通过正式和非正式的途径向外披露任何其他信息。

（二）信息披露的内容

集合计划的信息披露参照《集合资产管理合同》第十七章的相关约定执行。

（三）管理人和托管人在信息披露中的职责和信息披露程序

管理人和托管人应根据相关法律法规、部门规章、《集合资产管理合同》的规定，各自指定人员承担相应的集合计划信息披露职责。管理人和托管人负有积极配合、互相督促、彼此监督、保证其履行按照法定方式和时限披露的义务。

十二、集合计划有关文件和档案的保存

（一）管理人按相关法律法规、部门规章妥善保存与集合计划有关的合同、协议、推广文件、交易记录、会计账册等文件、资料，保存期限不少于20年；托管人按相关法律法规、部门规章妥善保存与集合计划托管业务有关的合同、协议、交易记录、会计账册等文件、资料，保存期限不少于20年。

（二）管理人应及时将与本集合计划账务处理、资金划拨等有关合同、协议传真或邮件发送给托管人。

十三、集合计划托管报告

托管人应按《管理办法》和中国证监会的有关规定出具托管人报告。

十四、集合计划费用

见《集合资产管理合同》第十二章的相关约定。

十五、禁止行为

（一）除《管理办法》、其他法律法规、部门规章、《集合资产管理合同》及中国证监会另有规定，管理人、托管人不得为自身和任何第三人谋取利益；

（二）管理人与托管人对集合计划经营过程中任何尚未按有关法规规定的方式披露的信息，不得对他人泄露，法律法规、部门规章另有规定、有权机关另有要求的除外；

（三）管理人不得在没有充足资金的情况下向托管人发出投资指令和退出、

分红资金的划拨指令，也不得违规向托管人发出指令。同时，托管人对管理人的正常指令不得拖延和拒绝执行；

（四）除根据管理人指令或《集合资产管理合同》另有规定的，托管人不得动用或处分任何集合计划资产；

（五）托管人、管理人不得进行法律法规、部门规章、《集合资产管理合同》和本《托管协议》禁止的其他行为。

十六、违约责任和责任划分

（一）如果由于管理人或托管人的过错，造成本协议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；如果由于双方的过错，造成本协议不能履行或者不能完全履行的，根据实际情况，由双方分别承担各自应负的违约责任。管理人和托管人相互不承担连带责任。

（二）当事人违约，给另一方当事人造成损失的，应就直接损失进行赔偿。但是发生下列情况，当事人免责：

1、战争、自然灾害等不可抗力；

2、管理人及托管人按照中国证监会的规定或当时有效的法律、法规或规章的作为或不作为而造成的损失等；

3、在没有欺诈或过失的情况下，管理人由于按照本《集合资产管理合同》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。

（三）当事人一方违约，另一方在职责范围内有义务及时采取必要的措施，尽力防止损失的扩大。

（四）违约行为虽已发生，但本托管协议能够继续履行的，在最大限度地保护集合计划参与人利益的前提下，管理人和托管人应当继续履行本协议。

十七、适用法律与争议解决

（一）本协议适用中华人民共和国法律并从其解释。

（二）因本协议产生或与之相关的争议，双方当事人应通过协商、调解解决，协商、调解不能解决的，则任何一方有权将争议提交上海国际经济贸易仲裁委员会并按其届时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点在上海。仲裁裁决是终局的，对仲裁各方当事人均具有约束力。争议处理期间，双方当事人应恪守管理人和托

管人职责，各自继续忠实、勤勉、尽责地履行集合资产管理合同和本托管协议规定的义务，维护集合计划委托人的合法权益。

十八、托管协议的效力和文本

(一) 本协议经双方当事人加盖公章或合同专用章以及双方法定代表人或授权代表签字或盖章，自首份集合资产管理合同生效之日起生效。本协议的有效期限自生效日起至本协议规定其效力终止之情形发生时止。

(二) 本协议一式贰份，协议双方各执壹份，每份具有同等法律效力。

十九、托管协议的修改和终止

(一) 本协议双方当事人经协商一致，可以对协议进行修改。修改后的新协议，其内容不得与《集合资产管理合同》的规定有任何冲突。管理人应在新协议变更完成后5个工作日内将相关情况报中国证券投资基金业协会备案，同时抄送所在地中国证监会派出机构。

(二) 发生以下情况，本托管协议终止：

- 1、集合计划或《集合资产管理合同》终止；
- 2、变更托管人并终止本协议的；
- 3、托管人依据《集合资产管理合同》的约定停止担任集合计划的托管人；
- 4、发生《管理办法》或其他法律法规、部门规章规定的终止事项。

二十、其他事项

本协议未尽事宜，当事人依据《集合资产管理合同》、有关法律、法规和规定协商办理。

(本签字页仅供《东方红-量化2号集合资产管理计划托管协议》各方签字或盖章使用, 本页无正文)

管理人(上海东方证券资产管理有限公司)

公章或合同专用章:

法定代表人或授权代表人(签字或盖章):

2023年 月 日

托管人(中国建设银行股份有限公司)

公章或合同专用章:

法定代表人或授权代表人(签字或盖章):

2023年 月 日