
东方红阳光 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：招商银行股份有限公司北京分行

二零二三年三月

目录

一、托管协议当事人.....	3
二、托管协议的依据、目的和原则.....	4
三、托管事项.....	4
四、托管人与管理人之间的业务监督、核查.....	5
五、集合计划资产保管.....	9
六、指令的发送、确认及执行.....	13
七、交易及清算交收安排.....	17
八、参与和退出的资金清算.....	18
九、资产估值、净值计算与会计核算.....	20
十、集合计划收益分配程序.....	20
十一、信息披露.....	21
十二、有关文件和档案的保存.....	21
十三、集合计划的费用.....	21
十四、禁止行为.....	22
十五、违约责任.....	22
十六、争议处理.....	23
十七、托管协议的效力.....	24
十八、托管协议的修改、终止与资产清算.....	24
十九、其他事项.....	24
附件 1	25
附件 2	30
附件 3	31
附件 4	32
附件 5	33

鉴于上海东方证券资产管理有限公司是一家依照中国法律合法成立并有效存续并经中国证监会批准取得办理集合资产管理业务资格的有限公司，拟发起设立东方红阳光 2 号集合资产管理计划（以下简称“集合计划”）；

鉴于招商银行股份有限公司北京分行是一家依照中国法律合法成立并有效存续的商业银行分支机构，已按照相关法律、法规的规定取得集合计划托管人的资格，具备履行本托管协议担任托管人的能力；

为明确集合计划管理人和集合计划托管人之间的权利义务关系，特制订本协议。

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：中国上海市黄浦区中山南路 109 号 7 层-11 层

法定代表人：杨斌

成立时间：2010 年 7 月 28 日

批准设立机关：中国证监会

批准设立文号：证监许可【2010】518 号

注册资本：人民币叁亿元

经营范围：证券资产管理业务；公开募集证券投资基金业务

组织形式：有限责任公司

营业期限：持续经营

联系电话：021-63325888

传真：021-63326903

（二）托管人

名称：招商银行股份有限公司北京分行

住所：北京市西城区复兴门内大街 156 号

负责人：熊开

联系人：杨婕

联系电话：010-66426022

传真：010-66428045

二、托管协议的依据、目的和原则

（一）订立托管协议的依据

根据《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》）等有关法律法规、自律性文件和中国证监会、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《东方红阳光 2 号集合资产管理合同》（以下简称《资产管理合同》）及其他有关规定制订。

（二）订立托管协议的目的

订立本协议的目的是明确双方在集合计划资产保管相关事宜中的权利、义务要求及责任，以确保集合计划资产的安全，保障委托人、管理人、托管人的合法权益。

（三）订立托管协议的原则

管理人和托管人本着平等自愿、诚实信用的原则，经协商一致，签订本协议。

三、托管事项

（一）托管资产种类

本协议所称托管资产是指“东方红阳光 2 号集合资产管理计划”（以下简称“本集合计划”）项下按照本协议约定由资产托管人保管的一切资产。托管资产的初始形态为现金。

（二）托管资产金额

初始托管资产金额为推广期结束后，托管账户的实际到账金额，该金额应与会计师事务所验资报告一致。

（三）托管时间

本集合计划资产托管时间始于集合计划成立之日，终止于本托管协议终止且资产清算和分配完毕之日。

四、托管人与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、托管人根据《管理办法》、《运作规定》等有关法律法规、《资产管理合同》及本协议的规定，应自集合计划成立日起，对本集合计划的投资范围、集合计划资产的投资比例、投资限制、集合计划资产核算、资产净值的计算、集合计划管理费、托管费和其他相关费用的计提和支付，集合计划收益分配及集合计划资产清算等事项进行监督和核查。

（1）托管人对投资范围的监督

本资产管理计划资金按照《运作规定》的要求进行组合投资，具体可投资以下品种：

1) 权益类资产：股票（包括在科创板上市的股票，以及新股申购所得股票）、港股通标的股票（包括内地与香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）、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) 固定收益类及现金类资产：国债、地方政府债、央行票据、金融债、公司债（含非公开发行公司债）、企业债、可转换债券、可交换债（含私募可交换债）、可分离交易债券、短期融资券（含超短期融资券）、中期票据、债券型基金、中小企业私募债、股票型及混合型分级基金的优先级份额、银行间市场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、非公开定向债务融资工具，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；银行存款（包括但不限于银行定期存款、协议存款、通知存款、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:股指期货、国债期货、商品期货、场内期权等场内标准化投资品种、商品基金(含商品期货基金和商品 ETF 等);

4) 现金(活期存款);

5) 集合计划可以参与证券回购,但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;

投资者签署合同即视为已经充分理解并同意管理人可以以集合计划资产从事关联交易,包括但不限于重大关联交易、租用管理人关联方提供的证券交易单元进行交易、管理人关联方作为期货经纪商提供服务、投资于管理人或托管人及与管理人或托管人有关联方关系的公司发行或承销期内承销的证券、投资于管理人或管理人关联方所设立的资产管理产品或进行其他关联交易,管理人无需就前述具体关联交易再行分别取得投资者的授权。管理人应根据法律、行政法规、中国证监会的规定事后及时通过管理人的网站等方式告知投资者和托管人,并向中国证监会相关派出机构报告。

投资者已明确知悉并愿意承担因上述关联交易可能导致的管理人/管理人关联方双重管理及收费等事项及风险。管理人运用本计划财产从事关联交易的,应当符合产品的投资目标、投资策略和委托人利益优先原则,按照商业原则,以不优于市场一般交易条件进行,管理人负责关联交易价格的公允性,法律法规要求应当披露的,应向委托人充分披露信息。

管理人应谨慎勤勉地管理资产管理计划财产、公平对待各投资组合。

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,若法律法规另有规定的,从其规定。

(2) 托管人对资产配置比例的监督

投资于股票等股权类资产的比例不低于资产管理计划总资产 80%。

本集合计划存续期间,为规避特定风险并经全体投资者书面同意的,投资于股票等股权类资产的比例可以低于计划总资产的 80%,但不得持续 6 个月低于计划总资产的 80%。管理人在征求投资者书面同意时应当列明具体的特定风险。

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《资产管理合同》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（如需）。

在《资产管理合同》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

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）债券仅限于债项评级 AA 及以上（如无债项评级的，则主体评级为 AA 及以上；可转债、可交换债不受此条限制）；投资于单一债券，不得超过债券发行量的 10%，不超过资产净值的 20%；参与单一债券首发的认购数量不得超过该债券本次发行总量的 20%；（对于“参与单一债券首发的认购数量不得超过该债券本次发行总量的 20%；”，托管人管理人划款前提供的相关资料进行事前监控）

4）投资于一家公司发行的股票，不超过其总股本的 4.99%，且不超过流通股本的 10%（同一家公司在内地和香港同时上市的 A+H 股合并计算）；投资于单一股票不得超过本计划资产净值的 20%，如该股票同时在 A 股和港股上市，则合并计算；投资于单一创业板或科创板股票不得超过资产净值的 10%，全部创业板及科创板股票不得超过资产净值的 50%；不得投资于权证、*ST、ST、SST、S*ST 股票、股票定增。

5）投资于单一基金不得超过资产净值的 20%（货币基金、指数基金、债券基金不受此限制）；投资于单分级基金 B 类份额不得超过资产净值的 10%，所有分级基金 B 类份额的比例不超过资产净值的 30%。

6）本集合计划不得持有股指期货多头合约。在任何交易日日终，投资的股

票市值减“股指期货空单市值的绝对值”不低于集合计划资产净值的 0%且不超过 100%。

7) 本集合计划投资范围中的各类基金均包含 QDII 基金;

8) 《资产管理合同》中涉及债券主体及债项评级的, 评级公司不包括中债资信评估有限责任公司;

9) 证券法规规定和集合计划管理合同约定禁止从事的其他投资。

上述投资限制中第 1)、2) 条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, 本集合计划的投资限制也将自动作相应的调整。

管理人应向托管人提供履行托管职责所必需的相关材料, 并保证向托管人提供的材料的真实性、准确性、合法合规性和完整性, 由于管理人提供材料不实给托管人或集合计划财产造成的损失, 由管理人承担赔偿责任。

2、托管人发现上述事项中管理人的行为违反《管理办法》、《运作规定》、《资产管理合同》及本协议的相关规定时, 应及时以书面或双方认可的其他形式通知管理人限期纠正, 并及时报告相关监管机构。管理人收到通知后应及时核实并在下一工作日前以书面或双方认可的其他形式给托管人发出回函, 说明违规原因及纠正期限, 并保证在规定期限内及时改正。在限期内, 托管人有权随时对通知事项进行复查。管理人对托管人通知的违规事项未能在限期内纠正或者造成集合计划资产损失的, 托管人应及时报告相关监管机构。

3. 若《资产管理合同》等相关协议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并通知管理人后予以监督。

(二) 管理人对托管人的业务监督、核查

1、根据《管理办法》、《运作规定》、《资产管理合同》及本协议有关规定, 管理人对托管人是否及时执行管理人合法合规的投资指令; 妥善保管集合计划的全部托管资产; 托管人是否按约定执行管理人的分配指令; 是否对集合计划资产实行分账管理; 是否擅自动用集合计划资产、是否按时将分配给委托人的收益划入计划资金归集专户等行为进行监督和核查。

2、管理人发现托管人的行为违反《管理办法》、《运作规定》、《资产管理合同》及本协议有关规定, 应及时以书面或双方认可的其他形式通知托管人限期纠

正，并及时报告相关监管机构。托管人收到通知后应及时核对并在下一工作日前以书面或双方认可的其他形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。在限期内，管理人有权随时对通知事项进行复查。托管人对管理人通知的违规事项未能在限期内纠正的，管理人应报并及时报告相关监管机构。

（三）托管人与管理人在业务监督、核查中的配合与协助

管理人和托管人有义务相互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，监督方应报告相关监管机构。

五、集合计划资产保管

（一）集合计划资产保管的原则

1、托管人应安全、完整地保管集合计划的资产。

委托人的债权人通过司法机关对委托资产采取强制措施，由此造成委托资产损失的，管理人和托管人不承担任何责任。

2、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，对负责集合计划资产托管的部门和人员的行为进行事先控制和事后监督，防范和减少风险。

3、托管人应当购置并保持对于集合计划资产的托管所必要的设备和设施（包括硬件和软件），并及时对设备和设施进行维修、维护和更换，以保持设备和设施的正常运行。

4、除依据《管理办法》、《运作规定》、《资产管理合同》及本协议有关规定外，托管人不得为自己及任何第三人谋取利益，托管人用集合计划资产为自己及任何第三方谋取利益，所得利益归于集合计划资产；托管人不得将集合计划资产转为其自有财产；违反此款规定的，将承担相应的责任，包括但不限于恢复集合计划资产的原状、承担赔偿责任。

集合计划资产独立于管理人、托管人的自有资产。托管人为集合计划设立独立的账户，本集合计划资产与托管人托管的其他资产实行严格的分账管理，保证不同资产之间在账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立。

5、除《管理办法》、《运作规定》、《资产管理合同》及本协议另有规定外，托管人未经管理人的有效指令，不得自行运用、处分、分配集合计划的任何资产，由此造成托管资产的损失，由托管人赔偿。

6、除依据《管理办法》、《运作规定》、《资产管理合同》及本协议另有规定外，托管人不得委托第三方托管集合计划资产。

7、对于集合计划的应收款，由管理人负责与登记结算机构及有关当事人确定到账日期并通知托管人。在确定的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，由管理人采取措施进行催收，由此给集合计划资产造成损失的，管理人应负责向有关当事人追偿。

（二）集合计划推广期间及募集资金的验资

1、集合计划推广期和开放期内，委托人为参与集合计划而投入的货币资金存入登记结算机构指定的专门账户。在集合计划设立完成、开始投资运作之前，任何人不得动用该部分资金。

2、集合计划推广期满，由管理人聘请符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所进行验资，出具验资报告。

3、验资报告出具后，由管理人宣布并公告集合计划成立。管理人应将属于集合计划的全部资金划入本集合计划的托管账户中。

4、如果在推广期满后集合计划未达到成立条件，由管理人按《资产管理合同》规定办理相关退款事宜。

（三）集合计划银行托管账户的开立和管理

1、托管人在其营业机构为集合计划开立银行托管账户，账户名称应为“东方红阳光2号集合资产管理计划”[备注：账户名称以实际开立账户名称为准]，预留印鉴为托管人印章；托管账户可出款日期以开户行执行中国人民银行《人民币银行结算账户管理办法》的具体要求为准。该账户用于办理本集合计划参与及退出资金、收益分配等资金往来相关业务。托管账户与管理人、托管人和销售机构自有资金账户以及其他集合计划资金账户相互独立。集合计划资产的一切货币

收支活动均通过本集合计划托管账户进行。管理人应配合托管人办理账户开立事宜并提供相关资料, 并保证所提供账户开户材料的真实性和有效性, 且在相关资料变更后及时将变更的资料提供给托管人。

2、集合计划银行托管账户的开立和使用, 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; 亦不得使用本集合计划的任何账户进行本集合计划业务以外的活动。

3、集合计划银行托管账户的开立和管理应符合《人民币银行结算账户管理办法》、《现金管理条例》、《中国人民银行利率管理的有关规定》、《关于大额现金支付管理的通知》、《支付结算办法》以及中国人民银行、中国银监会的其他规定。

(四) 集合计划证券账户的开立和管理

1、托管人根据管理人委托按中国证券登记结算有限责任公司相关规定在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司、深圳分公司为本集合计划分别开立证券账户, 用于本集合计划证券投资的清算和存管。托管人对账户业务发生情况进行如实记录。管理人应配合托管人办理账户开立事宜并提供相关资料。

2、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转让集合计划的任何证券账户, 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、集合计划证券账户的开立和证券账户卡的保管由托管人负责, 管理和使用由管理人负责。

集合计划证券账户应由集合计划管理人当报证券交易所备案。

(五) 债券账户的开设和管理

合同生效后, 托管人根据中国人民银行、中央国债登记结算有限责任公司(以下简称“中债登”)和银行间市场清算所股份有限公司(以下简称“上清所”)的有关规定, 在中债登和上清所开立债券账户和债券资金结算账户, 并代表集合计划进行银行间市场债券交易的结算。

(六) 期货账户的开立和管理

托管人、管理人、管理人选择的期货公司根据《证券公司参与股指期货交易指引》、《人民币银行结算账户管理办法》、《期货交易管理条例》、《关于规范期货保证金存取业务有关问题的通知》、《中国金融期货交易所交易细则》等股指期

货法律法规，为集合计划开设期货投资相关账户及交易编码；期货结算银行为招商银行股份有限公司。

资产管理人应以书面或双方认可的其他形式将期货公司提供的本委托资产期货保证金账户信息及初始资金密码，保证金监控中心的登录用户名及密码，期货公司在招商银行股份有限公司分支机构开立的保证金账户信息，期货交易所交易编码告知资产托管人。资金密码重置由管理人进行，重置后务必及时通知托管人。

（七）基金账户的开立和管理

基金账户由资产管理人根据投资需要按照相关规定开立，完成账户开立后，资产管理人应以书面或双方认可的其他形式将基金账户信息告知资产托管人。

（八）其他账户的开立和管理

因业务发展而需要开立的其他账户，可以根据法律法规和《资产管理合同》的规定，经管理人与托管人进行协商后办理。新账户按照有关规则使用并管理。

法律、法规等有关规定对相关账户的开立和管理另有规定的，从其规定办理。

（九）账户注销

产品到期或提前结束需要注销委托资产相关账户时，需由资产管理人和资产托管人相互配合，在完成资产变现、结清权益、缴清费用和其它相关清算事项后，进行账户注销。

（十）与集合计划有关的重大合同的保管

1、与集合计划投资有关的重大合同的签署及保管，除本协议另有规定外，由管理人负责，托管人协助。管理人应将合同原件的复印件交托管人一份，合同原件由管理人保管。管理人应保证合同复印件与原件一致。保管期限按照《资产管理合同》、本协议约定及国家有关规定确定。

2、与集合计划资产有关的重大合同，根据需要由托管人以集合计划的名义签署的合同，托管人应将该合同原件的复印件交管理人一份，合同原件由托管人保管。托管人应保证合同复印件与原件一致。保管期限按照国家有关规定确定。

3、因管理人将自己保管的本集合计划重大合同在未经托管人书面同意的情况下，用于抵质押、担保或债权转让或作其他处分而造成集合计划资产损失，由

管理人负责。

4、因托管人将自己保管的本集合计划重大合同在未经管理人书面同意的情况下，用于抵质押、担保或债权转让或作其他处分而造成集合计划资产损失，由托管人负责。

5、管理人和托管人应完整保管各自的记录集合计划业务活动的原始凭证、记账凭证、集合计划账册、交易记录、持有人名册和合同等，自集合资产管理合同终止之日起保存期限为 20 年以上。集合计划托管人变更后，管理人和原托管人有义务协助新托管人接收集合计划的有关文件。

六、指令的发送、确认及执行

（一）投资指令的授权

授权通知的内容：资产管理人应事先向资产托管人提供书面授权通知（以下简称“授权通知”），指定投资指令的被授权人员及被授权印鉴，授权通知的内容包括被授权人的名单、签章样本、权限和预留印鉴。资产管理人撤换被授权人员、改变被授权人员的权限或更改被授权印鉴，须提前向资产托管人提供变更后的新的授权通知。授权通知应加盖资产管理人公司公章并写明生效时间。

授权通知的确认：计划成立时的授权通知，在资产托管人确认收妥原件后于授权通知载明的生效时间生效。由于人员、权限或印鉴变更而提供的变更后的新的授权通知，资产管理人必须提前至少一个交易日，使用传真方式或其他资产管理人和资产托管人认可的方式向资产托管人发送，同时电话通知资产托管人，变更后的新的授权通知经资产托管人确认后于授权通知载明的生效时间生效，同时原授权通知失效。

授权通知的保管：资产管理人在与资产托管人电话确认授权通知后的三个工作日内将授权通知的正本送交资产托管人。资产管理人应确保授权通知的正本与传真件一致。若变更后的新的授权通知正本内容与资产托管人收到的传真件不一致的，以资产托管人收到的已生效的传真件为准。资产管理人和资产托管人对授权通知负有保密义务，其内容不得向授权人、被授权人及相关操作人员以外的任何人泄露。

资产管理人应事先书面向资产托管人提供指令启用函。指令启用函应明确资产管理人采取电子指令的业务类型、启用日期、紧急情况下发送传真指令的号码、指令确认的电话号码等。启用函应加盖资产管理人公章。

（二）投资指令的内容

投资指令是在管理资产管理计划时，资产管理人向资产托管人发出的交易成交单、交易指令及资金划拨类指令（以下简称“指令”）。指令应加盖预留印鉴并由被授权人签章。资产管理人发给资产托管人的资金划拨类指令应写明款项事由、时间、金额、出款和收款账户信息等。

（三）指令的发送、确认和执行

指令的发送：资产管理人通过资产托管人网上托管银行系统录入或电子直连对接等方式，向资产托管人发送电子划款指令或投资指令。

（1）网上托管银行方式（含电子直连对接方式）

网上托管银行是指资产托管人基于 Internet 网络，向资产管理人提供的客户服务软件，实现资产管理人与资产托管人之间指令处理、数据传输、业务查询、资料传递和信息服务等直通式处理。

资产管理人和资产托管人另行签订《招商银行网上托管银行服务协议》，具体事宜以《招商银行网上托管银行服务协议》的约定为准。

对于资产管理人通过网上托管银行方式发送的指令，资产管理人不得否认其效力。

（2）在应急情况下，资产管理人应事先书面告知资产托管人并说明原因后，以传真或电子邮件方式发送划款指令作为应急措施。

对于资产管理人通过预留传真/电子邮箱号码发出的指令，资产管理人不得否认其效力。

对于通过非预留传真/电子邮箱号码发送的指令，资产托管人需通过录音电话与资产管理人在《指令启用函》指定的指令确认电话号码核对指令日期、指令张数、指令类型、付款产品名称、收款方名称、金额、用途等。

变更或新增接收指令的传真/电子邮箱号码，资产管理人应事先向资产托管人更新《指令启用函》。

（3）划款指令附件的发送

资产管理人向资产托管人发送指令的同时，通过网上托管银行、《指令启用函》中的预留传真号码或预留指令附件发送电子邮箱提供相关合同、交易凭证或其他证明材料。资产管理人对该等资料的真实性、有效性、完整性和合法合规性负责。

资产管理人在发送指令时，应确保相关出款账户有足够的资金余额，并为资产托管人留出执行指令所必需的时间。

1、对于新股、新债申购等网下公开发行业务，资产管理人应于网下申购缴款日的 10:00 前将指令发送给资产托管人。

2、对于期货出入金业务，资产管理人应于交易日期货出入金截止时间前 2 小时将期货出入金指令发送至资产托管人。

3、对上海证券交易所认购权证行权交易，资产管理人应于行权日 15:00 前将需要交付的行权金额及费用书面通知资产托管人，资产托管人在 16:00 前支付至中国证券登记结算有限责任公司指定账户。

4、对于银行间业务，资产管理人应于交易日 15:00 前将银行间成交单及相关划款指令发送至资产托管人。资产管理人应与资产托管人确认资产托管人已完成证书和权限设置后方可进行资产管理计划的银行间交易。

5、对于指定时间出款的交易指令，资产管理人应提前 2 小时将指令发送至资产托管人；对于资产管理人于 15:00 以后发送至资产托管人的指令，资产托管人应尽力配合出款，但不保证出款一定成功。资产管理人首次进行场内交易前应 与资产托管人确认交易单元和股东代码设置无误后方可进行。

6、对于本集合计划成立后的信息披露费用，由资产托管人收到资产管理人发送的指令后，对指令进行审查。

指令的确认：资产管理人有义务在发送指令后与资产托管人以录音电话的方式进行确认。指令以获得资产托管人确认该指令已成功接收之时视为送达资产托管人。对于依照“指令启用函”发出的指令，资产管理人不得否认其效力。

指令的执行：资产托管人确认收到资产管理人发送的指令后，应对指令进行一致性审查，验证指令的要素是否齐全，还应审核印鉴和签章是否和预留印鉴和签章样本相符，指令复核无误后应在规定期限内及时执行，不得延误。若存在要素不符或其他异议，资产托管人应及时与资产管理人进行电话确认，暂停指令的

执行并要求资产管理人重新发送指令。资产托管人有权要求资产管理人提供相关交易凭证、合同或其他有效会计资料，以确保资产托管人有足够的资料来判断指令的有效性。资产托管人待收齐相关资料并判断指令有效后重新开始执行指令。资产管理人应在合理时间内补充相关资料，并给资产托管人预留必要的执行时间。在指令未执行的前提下，若资产管理人撤销指令，资产管理人应在原指令上注明“作废”并加盖预留印鉴及被授权人签章后提供给资产托管人，并电话通知资产托管人。

正常情况下由资产托管人依据资产管理人发出的出入金指令，通过期货结算银行银期转账系统进行出入金操作。

当结算银行银期转账系统出现故障等其他紧急情况时，资产管理人可以使用期货公司提供的银期转账系统办理出入金或非银期转账手工出入金。

资产管理人使用银期转账系统办理出入金，入金由资产托管人依据资产管理人提供的划款指令将款项由银行托管账户划至期货结算账户，由资产管理人通过期货公司的银期转账系统办理入金操作，出金由资产管理人通过期货公司的银期转账系统出金后，再发送指令给资产托管人，由资产托管人依据资产管理人提供的划款指令将款项由期货结算账户划往委托资产银行托管账户。

非银期转账手工出入金，入金由资产托管人依据资产管理人提供的划款指令通过结算银行的网银系统划往期货公司指定账户后，由资产管理人通知期货公司进行入金操作，出金由资产管理人通知期货公司出金后，再发送指令给资产托管人，由资产托管人依据资产管理人提供的划款指令通过结算银行的网银系统划往集合计划银行托管账户。

执行完期货出金或入金的操作后，资产管理人应通过其交易系统或终端系统查询出金划出情况和入金到账情况。

（四）资产托管人依照法律法规暂缓、拒绝执行指令的情形和处理程序

资产托管人发现资产管理人发送的指令有可能违反《管理办法》、《运作规定》、《资产管理合同》或其他有关法律法规的规定时，应暂缓执行指令，并及时通知资产管理人，资产管理人收到通知后应及时核对并纠正；如相关交易已生效，则应通知资产管理人在 10 个工作日内纠正或采取其他补救措施，并报告中国证监会。

（五）资产管理人发送错误指令的情形和处理程序

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

（六）指令的保管

指令若以传真形式发出，则正本由资产管理人保管，资产托管人保管指令传真件。当两者不一致时，以资产托管人收到的指令传真件为准。

（七）相关责任

对资产管理人在没有充足资金的情况下向资产托管人发出的指令致使资金未能及时清算所造成的损失由资产管理人承担。因资产管理人原因造成的传输不及时、未能留出足够执行时间、未能及时与资产托管人进行指令确认致使资金未能及时清算或交易失败所造成的损失由资产管理人承担，但如遇到不可抗力的情况除外。资产托管人按照本协议约定及法律法规的规定正确执行资产管理人发送的有效指令，由于资产管理人过错造成资产管理计划发生损失的，由资产管理人承担相应责任。在正常业务受理渠道和指令规定的时间内，因资产托管人原因未能及时或正确执行合法合规的指令而导致资产管理计划受损的，资产托管人应承担相应的责任，但如遇到不可抗力的情况除外。

资产托管人根据本协议相关规定履行审核职责，如果资产管理人的指令存在事实上未经授权、欺诈、伪造或未能及时提供授权通知等情形，因执行有关指令或拒绝执行有关指令而给资产管理人或资产管理计划或任何第三方带来的损失，由资产管理人承担相应责任，但资产托管人未按合同约定尽审核义务执行指令而造成损失的情形除外。

七、交易及清算交收安排

（一）交易单元安排

管理人负责安排专用交易单元用于各集合计划的投资运作。所有本集合计划在交易所的投资交易活动，应当集中在专用交易单元上。管理人应及时将集合计

划专用交易单元、佣金费率等基本信息以及变更情况以书面或双方认可的其他形式通知资产托管人。

（二）投资交易所证券及银行间市场的清算交收安排

资产管理人和资产托管人在委托财产场内清算交收及相关风险控制方面的职责按照附件 1《托管银行资金结算规定》的要求执行

（三）期货交易及清算交收

资产管理人所选择的期货公司负责办理委托资产的期货交易的清算交割。

1、资产管理人应责成其选择的期货公司通过深证通向资产托管人(深证通小站号: K0213)及资产管理人发送以中国期货市场监控中心格式显示本产品成交结果的交易结算报告及参照中国期货市场监控中心格式制作的显示本产品期货保证金账户权益状况的交易结算报告。经资产托管人同意,可采用电子邮件的传送方式作为应急备份方式传输当日交易结算数据。

正常情况下当日交易结算报告的发送时间应在交易日当日的 17:00 之前。因交易所原因而造成数据延迟发送的,资产管理人应告知期货公司及时通知资产托管人,并在恢复后告知期货公司立即发送至资产托管人,并电话确认数据接收状况。

2、资产管理人应责成其选择的期货公司对发送的数据的准确性、完整性、真实性负责。并向资产托管人提供书面的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。

由于交易结算报告的记载事项出现与实际交易结果和权益不符造成本产品估值计算错误的,应由资产管理人负责向数据发送方追偿。

八、参与和退出的资金清算

（一）集合计划参与和退出业务的基本安排

1、委托人参与和退出集合计划的确认、清算由管理人或其委托的登记结算机构负责。

2、管理人于每一开放日(T日)的次工作日(T+1日)下午 15:00 之前,向托管人发送开放日集合计划参与和退出有关数据。管理人也可委托登记结算机

构向托管人发送数据。管理人应保证相关数据的准确、完整。

3、管理人应于产品成立时向托管人提供集合计划销售机构的网点信息，内容包括：销售网点代码、网点的参与退出结转时间，登记结算机构是中登公司的还需注明销售网点归属（中登深圳或中登上海）。运作过程中如相关网点信息有变更需及时向托管人提供变更信息。

4、管理人或管理人委托的登记结算机构通过与托管人建立的系统发送有关数据，如因各种原因，该系统无法正常发送，双方可协商处理。双方各自按有关规定保存数据，保存期限不少于二十年。

5、除参与款项到达集合计划托管账户需双方按约定方式对账外，退出和分红资金划拨时，管理人需向托管人下达指令，托管人依据管理人的指令及时将退出款项划拨到管理人在登记结算机构开立的账户或登记结算机构指定的账户。

（二）参与资金的清算与交收

1、推广期参与资金

推广期内，有效参与资金应按时划入管理人开立的募集专户，并按有关规定计算利息。在集合计划设立完成后，管理人将确保按时将集合计划资产划入托管人开立的集合计划银行托管账户。

2、开放期参与资金

管理人或管理人委托的登记结算机构于每一开放日（T 日）的次工作日（T+1 日）计算委托人 T 日参与集合计划的份额，并将清算确认的有效数据和资金数据汇总传输给托管人。管理人和托管人据此进行参与集合计划会计处理。

T+2 日内，管理人或管理人委托的登记结算机构应将确认后的有效参与款划到在托管人的营业机构开立的集合计划银行托管账户。如款项不能按时到账，由管理人负责处理。

（三）退出资金

1、T+1 日，管理人或其委托的登记结算机构将 T 日退出确认数据汇总传输给托管人。管理人和托管人据此进行退出集合计划的会计处理。

2、若登记结算机构确认委托人退出申请成功，管理人应指示托管人按照指令要求日期内将退出款项从集合计划托管账户划至专用结算账户。划款当日管理人和托管人对退出资金进行账务处理。销售机构收到退出款后于两个工作日内划往退出委托人指定的银行账户。

集合计划银行托管账户与结算账户间的参与和退出资金结算遵循“全额清算、净额交收”的原则，每日按照应收参与资金与应付退出资金的差额来确定净应收额或净应付额。当存在净应收额时，管理人应在交收日 15:00 时之前从集合计划专用结算备付金账户划往银行托管账户；当存在净应付额时，托管人按照管理人的划款指令将净应付额划往集合计划专用结算备付金账户。

九、资产估值、净值计算与会计核算

（一）集合计划资产估值

管理人及托管人应当按照《资产管理合同》的约定进行估值。

（二）集合计划资产净值的计算、复核

集合计划的日常估值由管理人进行，托管人复核。用于公开披露的集合计划单位净值由管理人完成估值后，将估值结果以传真或其他双方认可的书面方式发送至托管人，集合计划托管人进行复核，托管人复核无误后以传真或其他双方认可的方式返回给管理人。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，由此给集合计划财产或委托人造成损失的，由管理人承担相应责任。

（三）集合计划单位净值错误的处理

集合计划单位净值错误的处理按照《资产管理合同》的约定执行。

十、集合计划收益分配程序

管理人将集合计划收益分配方案通知托管人，并向委托人公告经托管人复核后的收益分配方案。

在分配方案公布后，管理人制定具体分配事宜，并就现金分红的金额（如有）向集合计划托管人下达付款指令，托管人按照管理人的指令及时进行分红资金清算。

管理人和托管人分别进行收益分配的账务处理。

十一、信息披露

托管人和管理人应按《管理办法》、《运作规定》、《资产管理合同》、本协议、中国证监会关于集合计划信息披露的其他规定及其他有关规定进行信息披露，拟公开披露的信息在公开披露之前应予以保密，不得向任何第三方泄漏。除依前述规定应予以披露的信息外，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，但根据本协议、《资产管理合同》及法律法规需要披露的除外。

按有关规定须经托管人复核的信息披露文件，由管理人起草、并经托管人复核后由管理人公告。

十二、有关文件和档案的保存

管理人和托管人应按各自职责完整保存集合计划账册、原始凭证、记账凭证、交易记录、公告、重要合同等文件档案及相应的电子文档，保存年限不能低于二十年。

十三、集合计划的费用

集合计划费用按照《资产管理合同》的约定计提和支付。

资产托管人指定收取托管费的银行账户为：

户 名：其他应付款-托管费收入

开 户 行：招商银行北京分行运营中心

账 号：911059720620091010

资产管理人指定收取管理费的银行账户为：

户 名：上海东方证券资产管理有限公司

账 号：1001244309006593163

开户银行：工商银行上海市分行营业部

十四、禁止行为

（一）除《管理办法》、《运作规定》、《资产管理合同》及本协议另有规定外，管理人、托管人不得利用集合计划资产为自身和任何第三人谋取利益。

（二）管理人不得在没有充足资金的情况下向托管人发出资金划出指令，也不得违规向托管人发出指令。同时，托管人对管理人的符合本协议规定的指令不得拖延或拒绝执行。

（三）除根据管理人的指令或《资产管理合同》另有规定外，托管人不得动用或处分集合计划资产。

（四）管理人、托管人不得从事《管理办法》、《运作规定》、《资产管理合同》、本协议和其他法律法规规定的禁止行为。

十五、违约责任

（一）一方当事人未履行或者未完全履行本托管协议的，由违约的一方承担违约责任；如双方当事人均有违约情形，按照过错程度由双方当事人分别承担各自应负的违约责任。

（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；给集合计划资产造成损失的，应就直接损失进行赔偿，另一方当事人有权利及义务代表集合计划向违约方追偿。但是发生下列情况，当事人可以免责：

1、不可抗力。不可抗力是指本协议签署之后发生的任何不能预见、不能避免、不能克服的客观事件或因素，包括但不限于：相关法律法规的变更；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。如果任何一方因不可抗力及其他情形不能履行本协议时，可根据不可抗力的影响部分或全部免除该方的责任；一方因不可抗力不能履行本协议时，应及时通知另一方，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集合计划资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协议，该方不能减轻或免除相应责任。

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

3、在没有过错的情况下，管理人由于按照《资产管理合同》规定的投资原则投资或不投资造成的直接损失或潜在损失等；

4、在没有过错的情况下，托管人执行管理人的生效指令对集合计划资产造成的损失；

5、在计划运作过程中，管理人及托管人按照法律、行政法规的规定以及本协议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、管理人和托管人不因另一方的失职行为给集合计划财产或委托人造成的损失承担连带责任；

7、其他《资产管理合同》或本协议规定可免责的事项。

（三）一方当事人违约，另一方当事人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；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）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持有人利益的前提下，管理人和托管人应当继续履行本协议。

十六、争议处理

因本协议产生或与之相关的争议，当事人应通过协商、调解解决，协商、调解不能解决的，任何一方均有权将争议提交上海国际经济贸易仲裁委员会并按其仲裁规则进行仲裁，仲裁地点在上海，仲裁裁决是终局的，对各方均具有法律约束力。

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《资产管理合同》和本托管协议规定的义务，维护集合计划持有人的合法权益。托管人继续履行托管人职责期间，应继续根据《资产管理合同》和本托管协议约定收取托管费，并享有相应的权利。

十七、托管协议的效力

本托管协议经双方当事人盖章以及双方法定代表人或法定代表人授权的代理人签章之日成立，自《资产管理合同》生效之日起生效。本托管协议的有效期限自其生效之日起至第十八条第（二）款所述之情形发生时止。

本托管协议一式两份，托管协议双方当事人各持一份。

十八、托管协议的修改、终止与资产清算

（一）托管协议的修改

本协议双方当事人经协商一致，可以对协议进行修改。

（二）发生以下情况，本托管协议终止：

- 1、《资产管理合同》终止；
- 2、托管人解散、撤销、破产或由其他托管人接管集合计划；或被监管机构撤销业务许可、责令停业整顿等原因；
- 3、管理人解散、撤销、破产或由其他管理人接管其资产管理权；或被监管机构撤销业务许可、责令停业整顿等原因；
- 4、经管理人与托管人协商一致终止本托管协议；
- 5、根据相关法律法规、监管机构的要求或《资产管理合同》的约定出现集合计划终止情形。

（三）集合计划终止后的资产清算

集合计划终止，管理人与托管人应当按照《资产管理合同》的约定对集合计划资产进行清算。

十九、其他事项

除本协议有明确定义外，本协议的用语定义适用《资产管理合同》相同用语的约定。本协议未尽事宜，当事人依据《资产管理合同》、有关法律、法规等规定协商办理。

附件 1

托管银行证券资金结算规定

资产托管人和资产管理人为确保证券交易资金结算业务安全、高效运行，有效防范结算风险，规范结算行为，进一步明确资产托管人与其代理结算客户在证券交易资金结算业务中的责任，根据《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券登记结算管理办法》、《中国证券登记结算有限责任公司结算参与人管理规则》等有关法律法规、部门规章及相关业务规则，资产管理人和资产托管人就参与中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“结算公司”）多边净额结算业务相关事宜规定如下：

第一条 资产托管人系经中国银监会、中国证监会、中国保监会及其他相关部门核准具备证券投资基金、保险资产、企业年金基金以及其他与结算公司结算业务相关的托管业务资格的商业银行；资产管理人系经中国证监会、中国保监会批准设立的证券公司、基金管理公司、保险公司、保险资产管理公司等投资管理机构。

第二条 资产管理人管理并由资产托管人托管的资产在证券交易所市场达成的符合多边净额结算要求的证券交易，采取托管银行结算模式的（包括公募基金、专户账户、企业年金、社保基金等），应由资产托管人与结算公司办理证券资金结算业务；资产托管人负责参与结算公司多边净额结算业务，资产管理人应当按照资产托管人提供的清算结果，按时履行交收义务，并承担对资产托管人的最终交收责任。

第三条 资产管理人和资产托管人同意遵守结算公司制定的业务规则。

第四条 多边净额结算方式下，证券和资金结算实行分级结算原则。资产托管人负责办理与结算公司之间证券和资金的一级清算交收；同时负责办理与资产管理人之间证券和资金的二级清算交收。

第五条 资产托管人依据交易清算日（T 日）清算结果，按照结算业务规则，与结算公司完成最终不可撤销的证券与资金交收处理；同时在规定时限内，与资产管理人完成不可撤销的证券、资金交收处理。

第六条 资产管理人管理资产交收违约应遵循谁过错谁赔偿的原则。

（一）因资产管理人头寸匡算错误等资产管理人原因导致的交收违约实际损失，由资产

管理人承担。

（二）因资产托管人操作失误等资产托管人原因导致的交收违约实际损失，由资产托管人承担。

（三）由第三方过错导致的交收违约损失，按照最大程度保护资产管理人管理托管资产持有人合法权益的原则，由双方协商处理，并由双方共同承担向第三方追偿的责任。

除依据相关法律法规和本规定约定外，资产托管人不得擅自用资产管理人管理托管资产的证券和资金从事证券交易。资产托管人擅自用资产管理人管理托管资产的证券和资金造成损失的，应当对资产管理人管理资产及资产管理人遭受的实际损失承担赔偿责任。资产托管人擅自用资产管理人管理托管资产的证券和资金得到盈利的，所有因此而取得的收益归于托管资产，且资产管理人不承担任何相关费用。

若资产管理人过错且利用自有资金或按照中国证监会规定使用风险准备金垫付资金交收透支，由此产生的收益归托管资产，由此产生的实际损失由资产管理人承担。

第七条 资产托管人按照结算公司的规定，以资产托管人自身名义向结算公司申请开立相关结算备付金账户、证券交收账户以及按照结算公司相关业务规定应开立的其他结算账户，用于办理资产托管人所托管资产在证券交易所市场的证券交易及非交易涉及的资金和证券交收业务。

第八条 根据结算公司业务规则，资产托管人依法向资产管理人管理资产收取存入结算公司的最低结算备付金、交收价差保证金及结算保证金等担保资金，该类资金的收取金额及其额度调整按照结算公司规则以及资产管理人和资产托管人的其他书面协议或约定执行。

若资产管理人管理资产结算备付金账户日末余额低于其最低结算备付金限额的，资产管理人应于规定时间内补足款项。

第九条 资产托管人收到结算公司按照与结算银行商定利率计付的结算备付金（含最低备付金）、交收价差保证金等资金利息后，于收息当日向资产管理人管理资产支付。

第十条 资产托管人于交易清算日（T日），根据结算公司按照证券交易成交结果计算的资金清算数据和证券清算数据以及非交易清算数据，分别用以计算资产管理人管理资产资金和证券的应收或应付净额，形成资产管理人当日交易清算结果。资产托管人应及时、高效、安全地完成托管资产的证券交易资金清算交收，对于结算公司已退还各托管资产的交收资金应及时计入各托管资产的银行账户。

第十一条 资产托管人完成托管资产清算后，对于交收日可能发生透支的情况，应及时与资产管理人沟通。

资产托管人于交收日（T+1 日）根据交易所或结算公司数据计算的资产管理人 T 日交易清算结果，完成资产管理人管理资产资金、证券的交收。

第十二条 资产管理人对资产托管人提供的清算数据存有异议，应及时与资产托管人沟通，但资产管理人不得因此拒绝履行或延迟履行当日的交收义务。经双方核实，确属资产托管人清算差错的，资产托管人应予以更正并赔偿托管资产及资产管理人实际损失；若经核实，确属结算公司清算差错的，资产管理人应配合资产托管人与结算公司沟通。若因资产管理人在托管交易单元上进行非托管资产交易等事宜，致使资产托管人接收清算数据不完整不正确，造成清算差错的，责任由资产管理人承担。

第十三条 为确保资产托管人与结算公司的正常交收，不影响资产托管人所有托管资产的正常运作，正常情况下，交易日（T 日）日终资产管理人应保证其管理的各托管资产资金账户有足够的资金可完成与结算公司于交收日（T+1 日）的资金交收。

第十四条 若资产管理人管理资产资金账户 T 日余额无法满足 T+1 日交收要求时，资产管理人应按照《托管协议》或《备忘录》中约定的时点补足金额，未有约定的，应于 T+1 日 12:00 前补足金额，确保资产托管人及时完成清算交收。对于创新产品，补足金额的时点可在托管协议或其他文件中约定。

第十五条 资产管理人未按本规定第十四条约定时限补足透支金额，其行为构成资产管理人资金交收违约，资产托管人依法按以下方式处理，且资产管理人应予以配合：

（一）资产管理人应在不晚于结算公司规定的时点前两个小时向资产托管人书面指定托管资产证券账户内相当于透支金额价值 120% 的证券（按照前一交易日的收盘价计算）作为交收履约担保物。资产管理人未能按时指定的，资产托管人依法自行确定相关证券作为交收履约担保物，并及时书面通知资产管理人。资产管理人未及时向资产托管人指定或指定错误的，相关责任由资产管理人承担。

资产托管人可向结算公司申请，由结算公司协助将相关交收履约担保物予以冻结，资产管理人应向资产托管人出具同意结算公司协助资产托管人冻结其证券账户内相应证券的书面文件（对于企业年金基金等涉及资产托管人、资产管理人及委托人或受托人的托管资产，资产管理人向资产托管人出具的书面文件应经资产管理人委托人或受托人确认。委托人或受托人与资产托管人、资产管理人签署的合同、操作备忘录等法律文件中有相关内容的，视为确认）。

（二）资产管理人于 T+2 日在结算公司规定时间前补足相应资金的，资产托管人可向结算公司申请解除对相关证券的冻结；否则，资产管理人应配合资产托管人对冻结证券予以处置，如资产管理人不配合，资产托管人依法对冻结证券进行处置，但须及时书面通知资产管理人。

（三）证券处置产生的资金，如相关交易尚未完成交收的，应首先用于完成交收，不足部分资产管理人及时补足。

第十六条 资产管理人知晓并确认，资产管理人管理资产中用于融资回购的债券将作为资产托管人相关结算备付金账户偿还融资回购到期购回款的质押券，若资产管理人债券回购交收违约，结算公司依法对质押券进行处置，但须及时书面通知资产管理人。资产管理人应就债券回购交收违约后结算公司对质押券的处置以及资产管理人委托人或受托人所应承担的委托债券投资风险，预先书面告知资产管理人委托人或受托人，并由资产管理人委托人或受托人签字确认。委托人或受托人与资产托管人、资产管理人签署的合同、操作备忘录等法律文件中有相关内容的，视为确认。

第十七条 由于资产管理人原因，其管理资产发生证券超额卖出或卖出回购质押债券而导致证券交收违约行为的，资产托管人暂不交付其相应的应收资金，并依法按照结算公司有关违约金的标准向资产管理人收取违约金。资产管理人须在两个交易日内补足相关证券及其权益。资产管理人未能补足的，资产托管人依法根据结算公司相关业务规则进行处理，由此产生的实际损失由资产管理人承担，收益归托管资产所有。

第十八条 因资产管理人原因发生资金交收违约时，资产托管人依法采取以下风险管理措施，但须提前书面通知资产管理人：

- （一）按照结算公司标准计收违约资金的利息和违约金；
- （二）按结算公司标准调高资产管理人管理资产的最低备付金或结算保证金比例；
- （三）报告监管部门及结算公司；
- （四）按照结算公司业务规则向结算公司申报暂停资产管理人的相关结算业务；
- （五）根据监管部门或结算公司要求采取的其他措施。

第十九条 如因资产管理人原因造成资产托管人对结算公司出现违约情形时，结算公司实施相关风险管理措施引发的后果由资产管理人自行承担，由此造成资产管理人管理资产及资产托管人实际损失，资产管理人应负责赔偿。

如因资产托管人原因造成未及时将资产管理人应收资金支付给资产管理人或未及时委托证券登记结算机构将资产管理人应收证券划付到资产管理人证券账户的，资产托管人应当对资产管理人承担违约责任；如因资产托管人原因造成对结算公司交收违约的，相应后果由资产托管人承担。以上造成的托管资产及资产管理人的实际损失，资产托管人应负责赔偿。

第二十条 本规定任何一方未能按本规定的约定履行各项义务均将被视为违约,除法律法规或结算公司业务规则另有规定,或本规定另有约定外,违约方应承担因其违约行为给对方和托管资产造成的实际损失。如双方均有违约情形,则根据实际情况由双方分别承担各自应负的违约责任。

第二十一条 如果协议的一方或双方因不可抗力不能履行本规定时,可根据不可抗力的影响部分或全部免除责任。不可抗力是指资产托管人或资产管理人不能预见、不可避免、不能克服的客观情况。任何一方因不可抗力不能履行本规定时,应及时通知对方并在合理期限内提供受到不可抗力影响的证明,并采取适当措施防止损失的扩大。

第二十二条 本规定未尽事宜及因履行本规定而产生的争议或纠纷,如经友好协商未能解决的,采取以下第_1_种方式解决:(1)提交上海国际仲裁委员会根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁,仲裁地点在上海,仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力,仲裁费用由败诉方承担。(2)向有管辖权的法院提起诉讼解决。

第二十三条 资产管理人和资产托管人本规定适用于现在及以后由资产管理人管理、资产托管人托管的所有业务品种。

第二十四条 本规定有效期间,若因法律法规、结算公司业务规则发生变化导致本规定的内容与届时有效的法律法规、业务规则的规定不一致的,应当以届时有效的法律法规、业务规则的规定和上述协议的约定为准,协议双方应根据最新的法律法规、业务规则和上述协议对本规定进行相应的修改和补充。

附件 2

授权通知书

招商银行北京分行资产托管部：

根据《东方红阳光 2 号集合资产管理计划资产管理合同》，我单位授权以下人员向你行发送资产管理合同项下相关业务通知和指令。现将指令发送用章样本及有关人员签字样本及相应权限留给你行，请在使用时核验。上述被授权人在授权范围内向你行发送指令的真实性、准确性及合法性由我单位负全部责任。

姓名	权限	签字样本	印章样本
赖晨玲	经办、复核		
蒋莹	经办、复核		
蒋丹青	经办、复核		
焦斌	经办、复核		
常琦	经办、复核		
赖辉	经办、复核		
指令发送用章	(用章样本)		
备注：1、指令发送用章须与个人签字或个人印章同时出具，方为有效。			
2、权限类型：经办、复核、审批。			

上海东方证券资产管理有限公司（公章）

20 年 月 日

附件 3

东方红阳光 2 号集合资产管理计划场外划款指令（样本）

20 年 月 日

编号：

付款方名称：

付款方账号：

页数：第 页，共 页

请于_____年____月____日____时前支付下列款项（共____笔）：

金额大写：

金额小写：

收款方名称：

收款账号：

开户银行：

对方银行电子联行号（非必填项）：

资金用途（限 15 个字以内）：

管理人备注： 附件_____张 ☐ 加急

预留印鉴：

经办：

审批：

复核：

托管银行审核：

附件 4

东方红阳光 2 号集合资产管理计划银期划款指令（样本）

年 月 日

编号：

银行托管账户户名：

银行托管账户账号：

页数：第 页，共 页

请于_____年__月__日__时前支付下列款项（共__笔）：		
金额大写：		
金额小写：		
资金用途：		银期转账
		☐ 活期转期货保证金（转出） ☐ 期货保证金转活期（转入）
管理人备注： 附件_____张 ☐ 加急		
预留印鉴：	经办：	审批：
	复核：	
托管银行核算经办：	备注	
托管银行核算复核：		
托管银行清算经办：	托管银行审批人：	
托管银行清算复核：		
托管银行室经理：		
传真标识：已传真 ☐		

（此格式专门用于银行结算专户与期货保证金账户之间的资金划转）

附件 5

参与期货账户信息（样本）

上海东方证券资产管理有限公司、招商银行股份有限公司北京分行：

上海东方证券资产管理有限公司（东方红阳光 2 号资产管理计划）已完成股指期货开户手续

具体信息如下：

期货公司期货账户账号：

期货公司期货保证金账户：

 开户行：

 户名：

 账号：

丙方会员号：

 上海（会员号）：

 郑州（交易所编码）：

 上海（交易所编码）：

 中金所（会员号）：

 大连（会员号）：

 中金所（交易所编码）：

 大连（交易所编码）：

 中金所席位号（6 位）：

 郑州（会员号）：

本业务资金密码：

本业务交易密码：

本业务保证金监控中心查询账号：

密码：

XX 期货有限公司

日期： 年 月 日

本页无正文，为《东方红阳光 2 号集合资产管理计划托管协议》签字页。

管理人：上海东方证券资产管理有限公司（盖章）

法定代表人或授权代理人（签章）：

签署日期：20 年 月 日

托管人：招商银行股份有限公司北京分行（盖章）

负责人（签章）：

签署日期：20 年 月 日