
东方红添盈1号集合资产管理计划 资产管理合同

合同编号：（JH）东方红-广农商-2020第1号

管理人：上海东方证券资产管理有限公司

托管人：广州农村商业银行股份有限公司

2023年6月

目录

一、前言.....	2
二、释义.....	3
三、承诺与声明.....	7
四、当事人及权利义务.....	10
五、资产管理计划的基本情况.....	16
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.....	29
十、资产管理计划份额的登记.....	29
十一、资产管理计划的投资.....	29
十二、利益冲突及关联交易.....	41
十三、投资经理的指定与变更.....	44
十四、资产管理计划的财产.....	44
十五、指令的发送、确认和执行.....	45
十六、交易安排.....	48
十七、越权交易的界定.....	50
十八、资产管理计划财产的估值和会计核算.....	55
十九、资产管理计划的费用与税收.....	59
二十、资产管理计划的收益分配.....	63
二十一、信息披露与报告.....	64
二十二、风险揭示.....	67
二十三、资产管理合同的变更、终止与财产清算.....	76
二十四、违约责任.....	81
二十五、争议的处理.....	83
二十六、资产管理合同的效力.....	83
二十七、其他事项.....	84
二十八、附件.....	86

一、前言

为规范东方红添盈1号集合资产管理计划(以下简称“本计划”或“资产管理计划”)运作,明确《东方红添盈1号集合资产管理计划资产管理合同》(以下简称“本合同”或“资产管理合同”)当事人的权利与义务,依照《中华人民共和国民法典》、《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称《基金法》)、《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《运作管理规定》)、《集合资产管理计划资产管理合同内容与格式指引(试行)》等有关法律法规的规定,委托人、管理人、托管人在平等自愿、诚实信用原则的基础上订立本合同。本合同是规定当事人之间基本权利义务的法律文件,当事人按照《指导意见》、《管理办法》、《运作管理规定》、《东方红添盈1号集合资产管理计划说明书》(以下简称“计划说明书”)、本合同及其他相关法律法规享有权利、承担义务。

以电子签名方式签署的,委托人、管理人、托管人同意遵守《中华人民共和国电子签名法》、《证券公司资产管理电子签名合同操作指引》的有关规定,三方一致同意委托人自签署《电子签名约定书》之日起,委托人以电子签名方式接受电子签名合同(即本合同、计划说明书)、《东方红添盈1号集合资产管理计划风险揭示书》(以下简称“风险揭示书”)或其他文书的,视为签署本合同、计划说明书、风险揭示书或其他文书,与在纸质资产管理合同、纸质风险揭示书、纸质计划说明书或其他文书上手写签名或者盖章具有同等的法律效力。委托人、管理人同意向托管人提供中国证券登记结算公司电子合同签署有关委托人信息,供托管人完成电子合同签署的相关流程。

管理人将对资产管理计划的设立、变更、展期、终止、清算等行为向证券投资基金业协会进行备案,并抄报中国证监会相关派出机构。

委托人、管理人已知悉:基金业协会接受本计划备案不能免除管理人按照规定真实、准确、完整、及时地披露产品信息的法律责任,也不代表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。委托人自行识别产品投资风险并承担投资行为可能出现的损失。

投资者自签订资产管理合同即成为资产管理合同的当事人。在本计划存续期间,投资者自全部退出资产管理计划之日起,该投资者不再是资产管理计划的投资人和资产管理合同的当事人。

二、释义

本合同中除非文意另有所指，下列词语具有如下含义：

本计划、计划、资产管理计划、集合计划：	指依据《东方红添盈1号集合资产管理计划资产管理合同》和《东方红添盈1号集合资产管理计划说明书》所设立的东方红添盈1号集合资产管理计划。
本合同、资产管理合同：	指《东方红添盈1号集合资产管理计划资产管理合同》及其的任何修订和补充。
计划说明书：	指《东方红添盈1号集合资产管理计划说明书》，一份披露资产管理计划名称和类型、管理人与托管人概况、投资范围、投资策略、投资限制、投资风险、收益分配和风险承担安排、管理人和托管人报酬、与资产管理计划财产管理和运用有关的其他费用、参与费和退出费等投资者承担的费用、投资者的重要权利和义务、募集期间、信息披露、利益冲突情况、可能影响投资者合法权益的其他重要事项等涉及资产管理计划的信息，供委托人选择并决定是否提出资产管理计划参与申请的要约邀请文件。
风险揭示书：	指《东方红添盈1号集合资产管理计划风险揭示书》，一份针对资产管理计划，以醒目方式充分揭示资产管理计划的市场风险、信用风险、流动性风险、操作风险、关联交易的风险等各类风险的文件。
《指导意见》：	指2018年4月27日由中国人民银行、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》。
《管理办法》：	指2018年10月22日由中国证券监督管理委员会发布并施行的《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》。
《运作管理规定》：	指2018年10月22日由中国证券监督管理委员会发布并施行的《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》。
管理人：	指上海东方证券资产管理有限公司（简称“东证资管”、“东方红”）。
托管人：	广州农村商业银行股份有限公司（简称“广州农商行”）。

销售机构：	指与管理人签订本集合计划销售代理协议的机构和/或上海东方证券资产管理有限公司（直销），具体销售机构以管理人公告为准。
份额登记机构：	指办理本计划份额登记、存管、过户、清算和结算等登记业务的机构。本计划的份额登记机构为上海东方证券资产管理有限公司。
合同当事人：	指受资产管理合同约定，根据资产管理合同享受权利并承担义务的法律主体。
委托人、投资者：	<p>指参与认购本计划份额的合格投资者。</p> <p>合格投资者：指具备相应风险识别能力和风险承受能力，投资于本计划不低于100万元且符合下列条件的自然人、法人或者其他组织：</p> <p>（1）具有2年以上投资经历，且满足下列三项条件之一：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；</p> <p>（2）最近1年末净资产不低于1000万元的法人单位；</p> <p>（3）依法设立并接受国务院金融监督管理机构监管的机构，包括证券公司及其子公司、基金管理公司及其子公司、期货公司及其子公司、在中国证券投资基金业协会（以下简称证券投资基金业协会）登记的私募基金管理人、商业银行、金融资产投资公司、信托公司、保险公司、保险资产管理机构、财务公司及中国证监会认定的其他机构；</p> <p>（4）接受国务院金融监督管理机构监管的机构发行的资产管理产品；</p> <p>（5）基本养老金、社会保障基金、企业年金等养老基金，慈善基金等社会公益基金，合格境外机构投资者（QFII）、人民币合格境外机构投资者（RQFII）；</p> <p>（6）中国证监会视为合格投资者的其他情形。</p>
初始募集期：	指资产管理计划份额发售开始至结束之间的时间段。资产管理计划的初始募集期不得超过60日。
成立日：	指资产管理计划成立的日期。资产管理计划份额发售之日起，资

	产管理计划净参与申请额超过人民币1000万元且委托人超过2人的，管理人可以根据资产管理计划参与申请的实际情况决定停止资产管理计划的发售，并在资产管理计划的募集金额缴足之日起10个工作日内委托符合规定的会计师事务所进行验资并出具验资报告。资产管理计划在取得验资报告后，由管理人公告资产管理计划成立，并宣告资产管理计划成立的日期。
建仓期：	指本计划成立之日起6个月内的期间。管理人在建仓期内逐渐使资产管理计划所投资产符合法律法规和本合同约定的投向和比例。
存续期：	指资产管理计划成立至终止的时间。经履行合同约定的程序后，可展期。
开放期：	本集合计划自计划成立日起每自然周开放一次，开放期为每周一、每周三和每周五，如遇非工作日本集合计划不开放，顺延至当周下一工作日，若当周无下一个工作日的，则不再顺延。具体开放日期以管理人公告为准。委托人在开放期可以办理参与和退出。
初始募集期参与、认购：	指在初始募集期内本计划委托人购买本计划份额的行为。
参与、申购	指在资产管理计划开放日，投资者按照本合同的规定参与本计划份额的行为。
退出：	指本计划委托人根据本合同约定，于开放日赎回本计划相应类别份额的行为。
违约退出	指投资者在非合同约定的退出开放日退出资产管理计划的行为，本计划不接受违约退出。
工作日：	指管理人和托管人均办理相关业务的营业日。
交易日：	指上海证券交易所和深圳证券交易所的正常交易日。
T日：	指日常参与、退出或办理其他资产管理计划业务的申请日。
T+n日：	指自T日起第n个工作日（不包含T日）。
年、年度、会计年度：	指公历每年1月1日起至当年12月31日为止的期间。
年度对日	指某一特定日期在后续日历年度中的对应日期，若该日历年度中不存在对应日期的，则该年度对日为该特定日期在后续日历年度

	中的对应月度的最后一日。如该年度对日为非工作日的，则顺延至下一个工作日。
月度对日	指某一特定日期在后续日历月度中的对应日期，若该日历月度中不存在对应日期的，则该月度对日为该特定日期在后续日历月度中的对应月度的最后一日。如该月度对日为非工作日的，则顺延至下一个工作日；
考核日	本计划第一个考核日为本计划成立后9个月的月度对日，之后的考核日为第一个考核日后每满6个月的月度对日。
管理人自有资金：	指管理人参与本计划的本金。
计划收益：	指本计划利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额。
资产管理计划账户：	指份额登记机构给委托人开立的用于记录委托人持有本计划份额情况的登记账户。
份额：	指资产管理计划的最小单位。
份额面值：	指人民币1.00元。
资产、资产总值：	指本计划通过发行计划份额方式募集资金，并依法进行有价证券交易等资本市场投资所形成的各类资产的价值总和。
资产净值：	指本计划资产总值扣除负债后的净资产值。
本计划单位净值	指计算日本计划资产净值除以计算日本计划总份额的金额。
某类集合计划份额的单位净值	指计算日该类集合计划份额的资产净值除以计算日该类集合计划份额余额总数的金额。
某类集合计划份额的累计单位净值	指该类集合计划份额的单位净值与该类集合计划份额累计分红之和。
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。
不可抗力：	指遭受不可抗力事件一方不能预见，不能避免，不能克服的客观情况，包括但不限于洪水、地震及其它自然灾害、战争、骚乱、

	火灾、突发性公共卫生事件、政府征用、没收、法律法规变化或其他突发事件、份额登记机构非正常的暂停或终止业务、证券交易场所非正常暂停或停止交易等。管理人或托管人因不可抗力不能履行资产管理合同时，应及时通知其他各方并采取适当措施防止委托人损失的扩大。
中国：	指中华人民共和国。
法律法规：	指中国现时有效并公布实施的法律、行政法规、行政规章、地方法规、地方规章及规范性文件。
元：	指中国法定货币人民币，单位“元”。
中国证监会：	指中国证券监督管理委员会。
基金业协会：	指中国证券投资基金业协会。
资金前端控制制度：	指根据《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》，交易所、中国证券登记结算有限责任公司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的制度。
7个工作日可变现资产	包括可在交易所、银行间市场正常交易的股票、债券、非金融企业债务融资工具、期货及期权合约以及同业存单，7个工作日内到期或者可支取的逆回购、银行存款，7个工作日内能够确认收到的各类应收款项等。
流动性受限资产	是指由于法律法规、监管、合同或者操作障碍等原因无法以合理价格予以变现的资产，包括到期日在10个交易日以上的逆回购与银行定期存款（含协议约定有条件提前支取的银行存款）、资产支持证券（票据）、流动受限的新股以及非公开发行股票、停牌股票、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券和非金融企业债务融资工具等资产。

三、承诺与声明

（一）管理人承诺

1、管理人保证已获得集合资产管理计划业务资格。在签订本合同前充分向投资

者说明了有关法律法规和相关投资工具的运作市场及方式，并充分揭示了相关风险。

2、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。

3、管理人按照《基金法》恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用委托财产，不保证委托财产一定盈利，也不保证最低收益或本金不受损失，以及限定投资损失金额或者比例。

（二）托管人承诺

1、托管人按照《基金法》恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则安全保管委托财产，履行信息披露义务以及本合同约定的其他义务。托管人具备为本集合计划提供托管服务的资质和内部授权。

2、根据法律法规、中国证监会及基金业协会的规定和资产管理合同的约定，对管理人的投资或清算指令等进行监督。

3、在管理人发生异常且无法履行管理职能时，依照法律法规的规定、本合同的约定以及中国证监会、证券投资基金业协会的要求履行相关托管人职责，维护投资者权益。

（三）投资者声明

1、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，不存在任何虚假陈述、重大遗漏或误导。前述信息资料如发生任何实质性变更，及时书面告知管理人或销售机构。

2、投资者投资于资产管理计划的财产为其拥有合法所有权或处分权的资产，财产的来源及用途符合国家有关规定，未使用贷款、发行债券等筹集的非自有资金投资资产管理计划，且投资事项符合法律法规的规定及业务决策程序的要求。

3、投资者已充分理解本合同条款，了解相关权利义务，了解有关法律法规及所投资资产管理计划的风险收益特征，知晓管理人、托管人及相关机构不应对资产管理计划的收益状况或本金不受损失做出任何承诺，了解“卖者尽责，买者自负”的原则，投资于本计划将自行承担投资风险。

4、同意管理人、份额登记机构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。

5、投资者用于投资本计划的资金前端没有来自其他资产管理产品，投资本计划不构成多层嵌套情形，不存在以投资本计划规避投资范围、杠杆约束等监管要求等违规行为。

6、投资者保证没有任何其他限制性条件妨碍管理人对该资产管理计划财产行使投资管理权；保证有完全及合法的授权委托管理人和托管人进行资产管理计划财产的投资管理和托管业务，而且该等委托不会为任何其他第三方所质疑。

7、投资者确认，管理人、托管人未对资产管理计划财产的收益状况及本金安全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）不是管理人的保证。

8、投资者确认在签署本合同前已签署相应的风险揭示书，投资者理解风险揭示书中所述内容，愿意承担本计划可能存在的风险与后果。投资者理解资产管理计划财产的投资、运作、托管面临本合同“风险揭示”章节中列举的各类风险，管理人及托管人就资产管理计划财产面临的前述固有风险免于承担责任。

9、委托人根据本合同约定选择以指定或授权邮件发送通知或发表意见时，已明确知悉通过邮件形式进行的所有风险，应严格管理指定或授权邮箱的使用权限、保持系统安全稳定，由该指定或授权邮箱地址发出的邮件均为委托人有效意见，委托人对邮件内容均予以确认，因委托人指定邮箱地址或邮件内容所引起的任何争议、纠纷以及造成的任何损失与管理人无涉。

10、投资者承诺及保证：符合《运作规定》等法律法规、监管机构及自律组织对于本计划投资者的各项要求，包括但不限于：

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

（2）投资者承诺以真实身份参与本计划，资金来源合法合规，不存在使用贷款、发行债券等筹集的非自有资金投资本资产管理计划的情形。

（3）投资者以其管理的私募资产管理产品投资于本资产管理计划的，该产品的所有投资者为符合法律法规规定的合格投资者且资产管理计划财产来源合法合规，且均非资产管理产品；如相关监管机构或自律组织要求管理人提供本计划向上穿透

后的投资者信息资料表（包括名称、证件类型、证件号码、持有份额数量等信息，监管机构或自律组织另有规定的从其规定）的，投资者应配合提供；投资者承诺投资本计划后不存在违反监管要求的产品嵌套，以及以投资本计划从事规避投资范围、杠杆约束等监管要求的通道业务等违法违规行为。

投资者在此申明签署本合同即表明投资者为已具备《证券期货投资者适当性管理办法》、《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》、《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》等规定要求的合格投资者，投资者承诺使用真实身份和自有资金参与本集合计划，并承诺财产的来源及用途符合法律、行政法规的规定且未使用贷款、发行债券等筹集的非自有资金投资本集合计划。

四、当事人及权利义务

（一）投资者、管理人和托管人的基本情况

1、投资者

签署本合同且合同正式生效的投资者即为本合同的投资者。投资者的详细情况在合同签署页列示。

2、管理人

机构名称：上海东方证券资产管理有限公司

法定代表人：杨斌

住所：上海市黄浦区中山南路109号7层-11层

通信地址：上海市黄浦区外马路108号供销大厦8层

联系人：渔英强

联系电话：021-53952685

3、托管人

机构名称：广州农村商业银行股份有限公司

法定代表人：蔡建

住所：广州市黄埔区映日路9号

通讯地址：广州市天河区华夏路1号信合大厦16楼

邮政编码：510623

联系人：杨华

联系电话：020-28019492

（二）本计划设定为均等份额。每份份额具有同等的合法权益。

（三）投资者的权利和义务

1、投资者的权利

- （1）分享本计划财产收益；
- （2）取得分配清算后的本计划的剩余财产；
- （3）按照本合同的约定参与、退出和转让本计划份额；
- （4）按照法律法规及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及托管义务的情况；
- （6）资产管理计划设定为均等份额。除本合同另有约定外，每份份额具有同等的合法权益；
- （7）因管理人过错导致委托人合法权益受到损害的，委托人有权得到赔偿；
- （8）法律法规、中国证监会及证券投资基金业协会规定的和资产管理合同约定的其他权利。

2、投资者的义务

- （1）认真阅读并遵守本合同及计划说明书，保证委托资金的来源及用途合法，不得非法汇集他人资金参与本计划；
- （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担能力问卷，如实提供资金来源、金融资产、收入及负债情况，并对其真实性、准确性和完整性负责，签署合格投资者相关文件；
- （3）除公募资产管理产品外，以合伙企业、契约等非法人形式直接或者间接投资于资产管理计划的，应向管理人充分披露实际投资者和最终资金来源；
- （4）向管理人或销售机构提供法律法规规定的信息资料及身份证明文件，配合管理人或其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）若以电子签署方式签署合同的，如实提供与签署电子签名合同相关的信息和资料；
- （7）以自己的名义在销售机构网点开立资金账户，办理指定手续，用于办理委托划款、红利款项、退出款项以及清算款项的收取，并承诺在本合同有效期内，不得撤销该账户，并妥善保管账户资料；
- （8）按照本合同的约定支付本计划份额的参与款项，承担本合同约定的管理费、业绩报酬、托管费、审计费、税费等合理费用；
- （9）不得违反本合同的约定干涉管理人的投资行为；

(10) 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及托管人托管的其他资产合法权益的活动；

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

(12) 不得违规转让其所拥有的本计划份额；

(13) 除非在本合同规定的开放期或终止日，不得要求提前终止委托资产管理关系；

(14) 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；

(15) 投资者以其管理的私募资产管理产品（以下简称“该产品”）投资于本资产管理计划的，该产品的所有投资者为符合法律法规规定的合格投资者且资产管理计划财产来源合法合规，且均非资产管理产品；如相关监管机构或自律组织要求管理人提供本计划向上穿透后的投资者信息资料表的，投资者应配合提供；投资者承诺投资本计划后不存在违反监管要求的产品嵌套，以及以投资本计划从事规避投资范围、杠杆约束等监管要求的通道业务等违法违规行为；

(16) 投资者以其管理的资产管理产品投资于本资产管理计划的，应提供向上穿透后的最终投资者信息资料表，包括名称、证件类型、证件号码、认购份额类型、认购金额等信息

(17) 在本计划存续期间及时关注管理人的短信、电话、邮件、传真以及其公司网站公告；

(18) 法律法规、中国证监会及基金业协会规定和本合同约定的其他义务。

(四) 管理人的权利和义务

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资产；

(2) 按照本合同约定，及时、足额获得管理费用及业绩报酬；

(3) 按照有关规定和本合同约定，行使因本计划资产投资所产生的权利；

(4) 根据本合同及其他有关规定，监督托管人，对于托管人违反本合同或有关法律法规规定、对本计划资产及其他当事人的利益造成重大损失的，应当及时采取措施制止，并报告中国证监会相关派出机构及基金业协会；

(5) 自行提供或者委托经中国证监会、基金业协会认定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；

(6) 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；

(7) 按照本合同及计划说明书的约定, 停止办理本计划份额的参与, 暂停办理本计划的退出事宜;

(8) 根据本合同及计划说明书的约定, 终止本计划的运作;

(9) 本计划资产受到损害时, 向有关责任人追究法律责任;

(10) 有权对投资者进行尽职调查, 要求投资者提供相关证明文件、资料, 并在上述文件和资料发生变更时, 及时提交变更后的相关文件与资料;

(11) 法律法规、中国证监会、基金业协会规定的及本合同约定的其他权利。

2、管理人的义务

(1) 具备开展资产管理业务所需的相关主体资格与内部授权, 依法办理本计划的销售、登记、备案事宜;

(2) 按照基金业协会要求报送本计划产品运行信息;

(3) 按照诚实信用、勤勉尽责的原则履行受托人义务, 管理和运用本计划资产;

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

(5) 制作风险揭示书, 向投资者充分揭示相关风险;

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

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

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

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

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

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

(12) 按照本合同约定接受投资者和托管人的监督;

(13) 以管理人的名义, 代表投资者利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为;

(14) 按照本合同的约定计算并向投资者报告本计划相应类别的份额净值;

(15) 确定本计划各类份额参与、退出价格, 采取适当、合理的措施确保份额交

易价格的计算方法符合法律法规的规定和合同的约定；

(16) 按照本合同的约定负责本计划会计核算并编制财务会计报告；

(17) 聘请具有证券相关业务资格的会计师事务所对年度财务会计报告进行审计；

(18) 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；

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

(20) 办理与受托资产管理业务活动有关的信息披露事项；

(21) 建立并保存投资者名单；

(22) 如管理人未履行合同义务，则管理人应承担相应违约责任；如管理人因违反法律法规及本合同的规定致使投资资金损失的，管理人应就委托人的损失承担相应赔偿责任；

(23) 管理人应按相关合同文件规定亲自处理投资事务，自主决策，并亲自履行向证券交易经纪机构下达交易指令的义务，不得将投资管理职责委托他人行使；

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

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

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

(27) 建立健全资金前端控制内部控制制度和应急预案；

(28) 按照交易所有关规定，向托管人提供资金前端控制最高额度或申请盘中紧急调整最高额度的相关信息，并向交易所申报资金前端控制的自设额度；

(29) 应履行法律法规和监管机构规定的对委托资产的反洗钱义务，包括但不限于客户身份识别、交易对手身份识别（如需）、尽职调查、受益所有人穿透识别、黑名单监测等工作。管理人承诺委托资产资金的投资运作不得涉及违法犯罪，不得用于洗钱。如发现客户委托资产涉嫌洗钱罪的，按照《中华人民共和国反洗钱法》和相关规定履行报告义务并通知托管人。

(30) 法律法规、中国证监会及基金业协会规定的和本合同约定的其他义务。

(五) 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、计划说明书的约定，及时、足额获得本计划托管费用；
 - (3) 查询本计划的经营运作情况；
 - (4) 法律法规、中国证监会及基金业协会规定的和本合同约定的其他权利。

2、托管人的义务

- (1) 安全保管本计划资产；
- (2) 除依据法律法规规定和资产管理合同的约定外，不得为托管人及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管资产管理计划财产；
- (3) 对所托管的不同财产分别设置账户，确保资产管理计划财产的完整与独立；
- (4) 公平对待所托管的不同财产，不得从事任何有损本计划资产及其他当事人利益的活动；
- (5) 按规定开立和注销资产管理计划的托管账户及其他投资所需账户；
- (6) 复核资产管理计划资产净值和各类集合计划份额的单位净值；
- (7) 办理与资产管理计划托管业务有关的信息披露事项；
- (8) 根据相关法律法规和资产管理合同约定，复核管理人编制的资产管理计划财产的定期报告，并出具书面意见；
- (9) 编制托管年度报告，并向证券投资基金业协会备案，抄报中国证监会相关派出机构；
- (10) 按照法律法规要求和资产管理合同约定，根据管理人的划款指令，及时办理清算、交割事宜；
- (11) 保守商业秘密，除法律法规、本合同及其他有关规定另有要求外，不得向他人泄露；
- (12) 如托管人未履行合同义务，则托管人应承担相应违约责任；如托管人因违反法律法规及本合同的规定致使投资资金损失的，托管人应就委托人的损失承担相应赔偿责任。
- (13) 根据法律、行政法规和中国证监会的规定保存本计划的会计账册，妥善保存有关的合同、协议、交易记录等文件资料，保存期限自本计划终止之日起不得少于20年；
- (14) 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，并向中国证监会相关派出机构和基金业协会报告；
- (15) 建立健全资金前端控制内部控制制度和应急预案；

(16) 及时为管理人申报最高额度相关信息，并反馈管理人；

(17) 对交易参与者申报信息的真实、完整进行事后稽核；具备条件的，应当进行事前核验；

(18) 国家有关法律法规、监管机构及资产管理合同规定的其他义务。

五、资产管理计划的基本情况

(一) 名称：东方红添盈1号集合资产管理计划

(二) 类型：集合资产管理计划（固定收益类）

(三) 运作方式：定期开放式

(四) 投资目标

在控制和分散投资组合风险的前提下，力争实现组合资产长期稳健增值。

(五) 投资范围和投资比例、预警止损操作

1、投资范围

(1) 权益类资产：国内依法上市公开发行的股票（含新股）和指数股票型ETF。

(2) 债券类资产：仅限于在银行间、上海证券交易所或深圳证券交易所上市流通（含一级市场、二级市场）的国债、央行票据、地方政府债、政策性金融债、金融债（不含次级债、二级资本债、混合资本债）、公司债（不含非公开公司债）、企业债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、资产支持证券优先级（底层资产不包括产品）、资产支持票据优先级（底层资产不包括产品）、公募可转换债券。

(3) 现金管理类资产：银行存款、同业存单、国债逆回购（交易对手需为持牌金融机构，不得为公募基金、资管计划）。

(4) 集合计划可以参与债券正回购，但集合计划的总资产不得超过该计划净资产的140%。

2、投资比例

(1) 投资于本合同约定的权益类资产不超过本计划净资产的20%；

(2) 投资于存款、债券等债权类资产的比例不低于本计划总资产的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，投资于存款、债券等债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。

上述投资比例中第（2）款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。本集合计划的建仓

期为产品成立之日起的6个月，计划管理人应当在本计划建仓期结束后使本计划的投资组合符合法律、行政法规、中国证监会规定和本合同约定的投向和比例。

3、预警线和止损线：

本计划设置预警线**0.98**、止损线**0.96**；执行预警止损线的估值方式需为能体现产品市场公允价值的估值方式。

1) 预警线**0.98**：

任一交易日（T日）日终本计划单位净值小于或等于预警线时：

①管理人应以书面或邮件的形式及时通知委托人，管理人应降低账户的股票仓位至不超过产品净资产的**15%**；

②原则上不允许单只可转债转股，但转（换）股后的股票总市值大于转股前的债券市值的**110%**（含）且预计在转股后5个工作日内能全部卖出的除外；

③**T+1**日起**20**个工作日内逐步降低正回购比例至不高于净资产的**20%**；

④当本计划单位净值回升至**1.00**元以上时，上述限制自动取消。

2) 止损线：**0.96**。

任一交易日（T日）日终本计划单位净值小于或等于止损线时，管理人应以书面或邮件的形式及时通知全体委托人，并从**T+1**日起对本计划持有的资产执行强制卖出操作，直至本计划的资产全部变现，本计划提前结束；若全体委托人在**T+1**日未提出异议，则管理人从**T+1**日起对本计划持有的资产执行强制卖出操作，直至本计划的资产全部变现，本计划提前结束（若全体委托人对资产强制卖出操作起始日期有其他要求的，管理人应按照修订后的日期进行止损操作，全体委托人可以提出异议终止止损操作，修订后的日期或提出异议前本计划已变现的资产不受影响）；期间变现所得现金经全体委托人同意后可进行逆回购、同业存单或**1**年以内的利率债等现金管理操作。本集合计划投资于存款、债券等债权类资产的比例低于**80%**的持续时间达到**6**个月后，本集合计划提前终止进入清算程序。

（六）本计划的风险等级

本计划属于中低风险（**R2**）固定收益类产品。

如果相关法律法规规则要求或因实际情况需要等，需调高或调低本计划风险等级的，管理人可以调整产品风险等级，并及时以公司网站公告等方式告知投资者，无需进行合同变更，法律法规另有规定的除外。

（七）存续期限

本计划到期日为**2025年6月24日**，经全体委托人同意可展期。本计划提前结束的，存续期提前届满。

(八) 单位份额面值

本计划单位份额面值为1.0000元。

(九) 最低初始募集规模

本计划初始募集期规模不低于1000万元人民币，但法律法规、监管机构及自律组织另有规定的除外。

(十) 资产管理计划的份额登记、估值与核算、信息技术系统等服务机构

本计划的份额登记机构为上海东方证券资产管理有限公司。管理人未委托其他服务机构代为办理本计划的估值与核算、信息技术服务。

(十一) 投资顾问

本计划不聘请投资顾问。

(十二) 分级安排

本计划不设分级安排。

(十三) 是否为基金中基金资产管理计划（FOF）或管理人中管理人资产管理计划（MOM）

否。

六、资产管理计划的募集

(一) 资产管理计划的募集对象、募集方式、募集期限

1、募集对象

本计划面向符合条件的合格投资者募集。

本计划适合向风险承受能力高于中低风险等级承受能力（含中低风险等级）、对资产流动性需求有一定要求的投资者。本计划委托人的风险承受能力应当与本计划的风险等级相匹配。本计划投资者人数累计不得超过二百人。

2、募集方式

本计划通过管理人和/或管理人委托的代销机构进行募集。本计划销售机构及其从业人员以非公开方式向投资者募集资金。具体销售机构名单、联系方式以管理人相应公告为准。

3、募集期限

本计划的募集期限由管理人在募集期开始前确定，并在份额发售公告或说明书中披露。在募集期结束前，管理人有权根据本计划的销售情况延长或缩短募集期。初始募集期自本计划份额发售之日起不超过60天。在初始募集期内，投资者在工作日

内可以认购本集合计划。

初始募集期内，在每日（T日）办理认购的交易时间结束后，管理人将对投资者认购规模实行汇总统计，当累计认购达到1000万份且投资者数不低于2人时，管理人有权于T+1日上午九点前发出停止认购指令，根据参与时间优先、时间相同情况下参与金额优先（金额大者优先）的原则（参与时间以销售机构提供的数据为准，下同）宣布超过预定规模（如有）的认购无效，并通过管理人网站等方式对相关信息进行披露。

初始募集期内，在每日（T日）办理认购的交易时间结束后，管理人将对投资者人数实行汇总统计，当累计投资者数达到200人时，管理人将于T+1日上午九点前发出停止认购指令，在T日的参与申请中根据参与时间优先、时间相同情况下参与金额优先（金额大者优先）的原则宣布超过200人的认购无效，并通过管理人网站等方式对相关信息进行披露。

（二）资产管理计划的认购事项

1、认购费用

本计划的认购费为0。

2、认购的程序

投资者在销售机构规定的交易时间段内办理认购申请。投资者应在销售机构开设其认可的交易账户，并在交易账户备足认购的货币资金，若交易账户内参与资金不足，销售机构不受理该笔参与申请。当日办理业务申请仅能在当日业务办理时间内撤销。

投资者通过纸质合同或电子合同的方式签署本合同后，方可申请认购资产管理计划。认购申请采取“时间优先、时间相同情况下金额优先（金额大者优先）”原则进行。

投资者承诺在本集合资产管理合同有效期内，不得撤销指定账户，并妥善保管账户资料，由于投资者原因造成退出款项和收益不能及时划入指定账户及由此造成的损失，由投资者承担，管理人和托管人不承担责任。投资者办理认购业务时应提交的文件和办理手续、办理时间、处理规则等在遵守资产管理合同规定的前提下，以销售机构的具体规定为准

3、认购申请的确认

认购申请的确认以管理人的确认结果为准。投资者募集期认购的，可于资产管理计划成立后2个工作日内到办理认购的营业网点查询认购确认情况。销售机构受理认购申请并不表示对该申请是否成功的确认，而仅代表销售机构确实收到了该申请。

申请是否有效应以份额登记机构的确认并且资产管理合同生效为准。投资者应在本合同生效后到各销售网点查询最终确认情况和有效认购份额。确认无效的申请，销售机构将退还投资者已交付的认购款项。

本计划募集人数上限为200人，且管理人可以设置募集规模上限。超额募集的控制措施具体见本合同第八条资产管理计划存续期的参与、退出和转让中“资产管理计划规模、人数超额募集的控制措施”。

4、认购份额的计算方式

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

某类集合计划的认购份额=（净认购金额+认购金额在初始募集期内的利息）/面值

投资者多笔认购时，按上述公式进行逐笔计算。认购份额及认购费用的计算结果保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此产生的差额部分计入资产管理计划财产。

（三）初始认购资金的管理及利息处理方式

销售机构应当将资产管理计划募集期间投资者的初始认购资金存入募集结算资金专用账户，在募集结束前，任何机构和个人不得动用。

投资者的认购参与款项（不含认购费用）加计其在初始销售期形成的利息将折算为本计划相应类别份额归投资者所有，利息金额以本计划份额登记机构的记录为准。

（四）本计划的最低认购金额、支付方式

投资者首次参与本计划的最低认购金额为人民币100万元（不含认购费）。超过最低认购金额部分的金额级差为10万元。管理人可以对本计划最低认购金额进行调整（但需满足法律法规及监管规定），并在管理人网站公告告知投资者。认购资金应以现金形式交付。

（五）本资产管理计划募集结算专用账户和销售机构委托募集账户（如有）等信息，具体以销售机构网站公示、相关业务办理说明或通知为准。

七、资产管理计划的成立与备案

（一）资产管理计划成立的有关事项

1、资产管理计划成立的条件

本计划的初始募集规模不低于1000万元人民币，投资者人数不少于2人且不超过200人，募集过程符合法律、行政法规和中国证监会的规定。

2、资产管理计划的募集金额缴足之日起10个工作日内，管理人应当委托符合规定的会计师事务所进行验资并出具验资报告，并在取得验资报告后公告本计划成立。

3、资产管理计划募集失败的处理方式

资产管理计划募集期结束，在资产管理计划规模低于人民币1000万元或投资者的人数少于2人条件下，资产管理计划设立失败，管理人承担资产管理计划的全部募集行为而产生的费用，并将已认购资金及同期利息在募集期结束后30日内退还资产管理计划投资者。

(二) 资产管理计划的募集金额缴足之日起10个工作日内，管理人应当委托符合规定的会计师事务所进行验资并出具验资报告，并在取得验资报告后公告本计划成立。管理人应在本计划成立之日起5个工作日内报证券投资基金业协会备案，抄报中国证监会相关派出机构。资产管理计划成立前，任何机构和个人不得动用投资者参与资金。

(三) 资产管理计划在成立后备案完成前的投资活动

资产管理计划在成立后备案完成前，不得开展投资活动，以现金管理为目的，投资于银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券、货币市场基金等中国证监会认可的投资品种的除外。

(四) 资产管理计划募集失败的处理方式

1、初始募集期届满，本计划未达到成立条件的，管理人应当承担下列责任：

(1) 以固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用；

(2) 在初始募集期届满后30日内退还投资者已缴纳的款项，并加计银行同期活期存款利息。

2、本集合计划初始募集期内，发生影响或可能影响本集合计划募集和运作的情形（包括但不限于市场环境及法律法规变动、证监会或相关自律组织不时发布的监管意见、窗口指导等），管理人有权视情况决定本集合计划募集失败。

3、集合计划募集失败的，投资者应退还所有已签署的集合计划认购文件。

八、资产管理计划的参与、退出与转让

(一) 参与和退出的开放日和时间

本集合计划自计划成立日起每自然周开放一次，开放期为每周一、每周三和每

周五，如遇非工作日本集合计划不开放，顺延至当周下一工作日，若当周无下一个工作日的，则不再顺延。具体开放安排以管理人公告为准，届时管理人网站上发布公告即视为履行了告知义务。本计划不接受违约退出。

业务办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间。

若中国证监会会有新的规定，或出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更或其他特殊情况，管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整并告知投资者。

（二）本计划运作期间的参与

1、参与的场所

本计划的参与将通过销售机构进行。投资者应当在销售机构办理资产管理计划销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理资产管理计划份额的参与。具体销售机构名单、联系方式以管理人相应公告为准。

2、参与的开放日和时间

本计划可在开放期办理份额的参与业务。

3、参与价格

初始募集期以单位份额面值参与，开放期以参与申请日（T日）当日的对应类别份额的单位净值参与。存续期参与资金无相关利息，不进行利息转份额的处理。

4、参与的原则

（1）采用金额参与的方式，即参与以金额申请。投资者签署本合同、风险揭示书后，方可申请参与集合计划。参与申请采取“时间优先、时间相同情况下金额优先（金额大者优先）”原则进行。

（2）在存续期内，管理人有权在本计划总份额接近或达到目标规模的当日，对于截至该当日已提交的合格参与申请按“时间优先、时间相同金额优先”原则予以确认，并于次日停止接受其他委托人的参与。

5、参与的程序和确认

（1）若以电子签署方式签署合同的，投资者按销售机构指定营业网点的具体安排或通过销售机构的指定系统，在规定的交易时间段内签署电子合同。

（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/申购的货币资金；若交易账户内参与资金不足，销售机构不受理该笔参与申请。

（3）投资者签署本合同后，方可申请参与本计划。参与申请经管理人确认后，构成本合同的有效组成部分。

（4）投资者参与申请确认后，其参与申请和参与资金不得撤销；当日办理

业务申请仅能在当日业务办理时间内撤销。

(5) 管理人有权视本计划运作情况采取预约参与制度，具体以管理人通知为准。采取预约参与制度的，委托人未向管理人预约或预约未经管理人认可，管理人有权拒绝其参与。

6、参与费用及参与份额的计算

(1) 参与费用

本计划的参与费率为0。

(2) 参与份额的计算方法

净参与金额=参与金额/（1+参与费率）

参与费用=参与金额-净参与金额

参与份额=净参与金额/参与申请日某类集合计划份额的单位净值

投资者多笔参与时，按上述公式进行逐笔计算。参与份额及参与费用的计算结果保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此产生的差额部分计入资产管理计划财产。

7、参与的限制和支付方式

投资者在本计划存续期开放日购买本计划份额的，投资者应符合合格投资者标准，且参与金额应满足本计划最低参与金额限制（即不低于100万元人民币，不含参与费用），已持有本计划份额的投资者在本计划存续期开放日追加购买本计划份额的除外，追加参与不设最低金额限制。

管理人可以对本计划最低参与金额进行调整（但需满足法律法规及监管规定），并在管理人网站公告告知投资者。参与资金应以现金形式交付。

(三) 本计划运作期间的退出

1、退出的场所

本计划的退出将通过销售机构进行。投资者应当在销售机构办理资产管理计划销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理资产管理计划份额的退出。

2、退出的开放日和时间

本计划可在开放期办理份额的退出业务。

3、临时开放期的触发条件、程序及披露

当发生合同变更、展期或监管规定等需要临时开放的情况时，管理人可公告临时开放期，投资者可在临时开放期退出本计划（但不得参与本计划），临时开放期具体安排以管理人公告为准。

4、退出的原则

(1) “未知价”原则，即退出计划的价格以退出日本计划各类份额的单位净值为基准进行计算。

(2) 采用份额退出的方式。

(3) “先进先出”原则，即对该投资者在该销售机构参与的集合计划份额进行处理时，参与确认日期在前的集合计划份额先退出，参与确认日期在后的集合计划份额后退出。

5、退出的程序和确认

1) 退出申请的提出：投资者必须根据本集合计划销售机构规定的手续，在开放日的业务办理时间内向销售机构提出退出申请。申请退出份额数量超过投资者持有份额数量时，申请无效。

2) 退出申请的确认：T日交易时间内提交的退出申请，投资者可在T+2日（包括该日）之后到销售机构查询退出申请的确认情况。巨额退出、连续巨额退出的情形另行约定。

3) 退出款项的支付：投资者退出申请确认后，管理人将指示托管人把退出款项从集合计划银行托管资金账户划往份额登记机构，再由份额登记机构划往各销售机构，并通过销售机构划往申请退出投资者的指定账户，退出款项将在T+3日内从银行托管资金账户划出。如集合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。

6、退出费用及退出金额的计算

(1) 退出费用

本计划的退出费率为0。

(2) 退出金额的计算方法

某笔集合计划份额的退出金额=某笔集合计划份额的退出份额×退出申请日某笔集合计划份额对应的某类集合计划份额的单位净值-某笔集合计划份额的管理人业绩报酬（如有）

退出金额结果按照四舍五入方法，保留小数点后两位。

7、退出的限制与次数

单个投资者最低持有规模不得低于30万元。

每次退出的最低份额为10,000份。

当投资者持有的该类别计划份额资产净值高于30万元人民币时，投资者可以选择退出资产管理计划份额，每次退出的最低份额为10,000份；选择退出资产管理计划份额的，投资者在退出后持有的该类别计划份额资产净值应当不低于30万元人民币。

当管理人发现投资者申请部分退出资产管理计划将致使其在部分退出申请确认后持有的该类别计划资产净值低于30万元人民币的，管理人有权适当减少该投资者的退出份额，以保证部分退出申请确认后投资者持有的该类别计划资产净值不低于30万元人民币。

因客观原因导致投资者持有的该类别计划份额资产净值低于或等于30万元人民币时，需要退出计划的，投资者应当一次性全部退出资产管理计划。在开放期，委托人退出次数不受限制。

8、单个委托人大额退出无需预约。

9、巨额退出的认定和处理方式

(1) 巨额退出的认定

本计划单个开放日（T日），本计划净退出申请份额超过上一日本计划总份额的10%时，即认为发生了巨额退出。如果计划连续两个开放日以上发生巨额退出，即认为发生了连续巨额退出。

(2) 巨额退出、连续巨额退出的顺序、价格确定和款项支付

当出现巨额退出与连续巨额退出时，管理人可以根据本计划当时的资产组合状况决定全额退出或部分顺延退出。

1) 全额退出：当计划管理人认为有能力支付委托人的退出申请时，按正常退出程序执行。

2) 部分顺延退出：当计划管理人认为支付委托人的退出申请有困难或认为支付委托人的退出申请可能会对计划的资产净值造成较大波动时，与托管人协商后，计划管理人在当日接受退出比例不低于计划总份额的10%的前提下，对其余退出申请延期予以办理。对于当日的退出申请，应当按单个账户退出申请量占退出申请总量的比例，确定当日受理的退出份额；未能受理的退出部分，除委托人在提交退出申请时明确做出不参加顺延下一个工作日退出的表示外，自动转为下一个工作日退出处理，退出价格为下一个工作日的该类别计划份额净值。转入下一个工作日的退出申请不享有优先权，并以此类推，直到全部退出为止。

3) 暂停退出：本计划连续2个开放日发生巨额退出，如管理人认为有必要，与托管人协商后，可暂停接受退出申请，已经接受的退出申请可以延缓支付退出款项，但不得超过正常支付时间20个工作日，并应在销售机构网点公告。

(3) 巨额退出、连续巨额退出的报告

当发生巨额退出或连续巨额退出并采用部分顺延退出时，管理人应在3个工作日内报告委托人，并说明有关处理方法。发生巨额退出时，管理人暂停或暂缓办理退出

业务的期限不得超过20个工作日。

10、拒绝或暂停参与的情形及处理方式

(1) 初始募集期和存续期内，本集合计划投资者人数或规模接近或达到合同约定的最高规模上限（如有）；

(2) 战争、自然灾害等不可抗力的原因导致集合计划无法正常工作；

(3) 证券交易所在交易时间非正常停市；

(4) 发生集合资产管理合同规定的暂停集合计划资产估值情况；

(5) 管理人认为接受某笔或某些参与申请可能会影响或损害现有投资者利益时；

(6) 集合计划资产规模过大，使管理人无法找到合适的投资品种，或可能对业绩产生负面影响，或其他损害现有委托人的利益；

(7) 其他可能对本集合计划业绩产生负面影响，从而损害现有投资者利益的情形；

(8) 投资者经过管理人和销售机构认可后方可参与本集合计划。管理人和销售机构有权拒绝未经认可的投资者参与本集合计划；

(9) 法律、法规规定或中国证监会认定的其他情形或其他在本合同及说明书中载明的特殊情形。

如果投资者的参与被拒绝，被拒绝的参与款项将无息退还给投资者，各方互不承担其他责任。

11、拒绝或暂停退出的情形及处理

发生下列情形时，与托管人协商后，管理人可以拒绝或暂停受理委托人的退出申请：

(1) 不可抗力导致本计划无法正常工作；

(2) 证券交易场所交易时间非正常停市、份额登记机构、证券登记结算机构或银行结算系统无法正常工作等，导致当日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) 因市场剧烈波动等原因而出现连续巨额退出，或者其他原因，导致本集合计划的现金支付出现困难时，管理人可以暂停接受集合计划的退出申请；

(5) 法律法规、规章规定的其他情形或其他在本合同、计划说明书中已载明且中国证监会无异议的特殊情形。

发生上述情形之一的，管理人将及时告知投资者。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。发生拒绝或暂停受理退出的情形时，管理人应将拒绝或暂停受理退出的原因和处理办法在管理人网站进行信息披露。在暂停退出的情况消除时，管理人应在不超过正常支付时间20个工作日内及时恢复退出业务的办理。

发生说明书、资产管理合同中未予载明的事项，但管理人有正当理由认为需要暂停接受集合计划退出申请的，应与托管人协商一致，并向投资者披露。

（四）资产管理计划份额的转让

本计划存续期间，在管理人同意的前提下，委托人可以通过证券交易所等中国证监会认可的交易平台转让其持有的本计划份额，管理人应及时通知托管人该份额转让事宜。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，且受让方应符合法律法规及本计划关于合格投资者的要求。

（五）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，将一定数量的计划份额按照一定的规则从某一委托人计划账户转移到另一委托人计划账户的行为。证券登记结算机构只受理因继承、捐赠、司法执行、以及其他形式财产分割或转移引起的计划份额非交易过户。对于符合条件的非交易过户申请按证券登记结算机构的有关规定办理。

（六）资产管理计划份额的冻结

证券登记结算机构只受理国家有权机关依法要求的资产管理计划份额冻结与解冻事项。当本计划份额处于冻结状态时，份额登记机构或其他相关机构有权拒绝本计划份额的退出、非交易过户等业务的申请。

（七）资产管理计划份额的强制司法执行

投资者持有的资产管理计划份额被强制司法执行时，管理人将对该资产管理计划份额进行相应的控制（控制手段包括限制退出等）；管理人不允许该资产管理计划份额退出，并依法配合司法机关对该资产管理计划份额的强制执行。

（八）资产管理计划计划份额的转托管

本计划存续期间投资者不得将其所拥有的资产管理计划份额进行转托管；如本计划存续期间法律法规或管理人对转托管事宜有新的规定，则转托管的处理方式以管理人公告为准。

（九）管理人自有资金参与资产管理计划

全体投资者和托管人在此同意并授权管理人可以以自有资金于初始募集期参与本集合计划，存在下述第3条第（2）项被动超标情形时自有资金可以退出本集合计划。如果管理人以自有资金参与本集合计划的：

1、自有资金参与的条件和方式

管理人在募集期及开放期可以以自有资金参与本计划。管理人以自有资金参与本计划，应符合法律法规、监管规定和本合同的相关规定。

2、自有资金参与的金额和比例

管理人自有资金持有本集合计划份额及对应的资产净值，均不得超过相关法律法规、监管机构规定的比例。

3、自有资金退出的条件

管理人自有资金参与部分在出现以下情况之一时，可以退出本集合计划：

(1) 管理人自有资金参与份额，满足参与时间不少于相关法律法规、监管机构或自律组织规定的期限时，可与其他投资者同样办理退出业务。

(2) 管理人自有资金参与本集合计划的份额及对应的资产净值，均不得超过相关法律法规、监管机构规定的比例。因集合计划规模变动等客观因素导致自有资金参与集合计划的比例被动达到相关法律法规、监管机构规定的预警标准或者不符合规定标准的，管理人应当将部分自有资金参与份额在本集合计划开放期办理退出业务或非开放期间办理份额强制退出，以使自有资金比例在相关法律法规规定的时限内符合法规要求。法律法规另有规定时，从其规定。

(3) 法律法规或监管机构规定的允许管理人自有资金退出的其他情况。

4、管理人自有资金参与集合计划的持有期限不得低于6个月。除上述第3点中第(2)项情形之外，管理人自有资金参与、退出本计划的，为保护投资者权益，管理人应当提前5个工作日告知全体投资者和资产托管人，管理人应当给予各方充分的考虑时间，并取得其同意。

为免疑义，全体投资者和托管人同意管理人可以以自有资金于初始募集期参与本集合计划，管理人无需就具体参与行为另行取得全体投资者和托管人同意。

5、为应对巨额退出以解决流动性风险，或者中国证监会认可的其他情形，在不存在利益冲突并遵守合同约定的前提下，管理人参与的自有资金参与、退出可不受本条前述约定限制，但应当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。

6、自有资金的收益分配、责任承担方式和金额

管理人自有资金参与份额享有与其他份额同等的分配权，也有承担与计划份额相对应损失的责任。

7、风险揭示

管理人自有资金退出时，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。

8、信息披露

管理人及时在管理人指定网站公告自有资金参与及退出的相关情况。

（十）集合计划份额的分类

因集合计划管理费核算的需要，本集合计划可为每位委托人设置不同类别的份额。各类份额合并运作，适用相同的管理费和托管费计算方式，不同类别份额的管理费、托管费分别计算，从相应类别份额的资产净值中扣除，并分别核算业绩报酬和各类份额单位净值。

各类份额单位净值的计算公式为：

$$T\text{日某类集合计划份额的单位净值} = T\text{日该类集合计划份额的资产净值} / T\text{日该类集合计划份额余额总数}$$

（十一）管理人应定期将本计划投资者变更情况报送基金业协会。

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）份额登记机构

本计划的份额登记业务由管理人办理。管理人为资产管理计划份额持有人提供登记服务，配备安全、完善的电脑系统及通讯系统，准确、及时地为资产管理计划投资者办理资产管理计划账户、资产管理计划份额的登记、管理、托管与转托管，股东名册的管理，权益分配时红利的登记、权益分配时红利的派发，资产管理计划交易份额的清算过户和资产管理计划交易资金的交收等服务。

（二）本计划全体投资者在此同意管理人或其他份额登记义务人将资产管理计划投资者名称、身份信息以及资产管理计划份额明细等数据备份至中国证监会认定的机构。

十一、资产管理计划的投资

（一）投资目标

在控制和分散投资组合风险的前提下，力争实现组合资产长期稳健增值。

（二）投资范围及比例

详见本合同“五、资产管理计划的基本情况”中“（五）投资范围和投资比例、预警止损操作”。

本计划符合《运作管理规定》组合投资的要求。

（三）投资比例超限的处理方式及流程

由于包括但不限于证券市场波动、债券发行人合并、组合规模变动等管理人之外的原因导致的投资比例不符合本合同约定的投资限制或投资禁止政策，为被动超标。发生被动超标时，管理人应在符合法律法规和监管规定的前提下，在发生不符合法律法规或投资政策且可交易之日起的20个交易日内进行调整，以满足法律法规及投资政策的要求。法律法规另有规定的从其规定。

（四）本计划的风险收益特征

本计划属于中低风险（R2）固定收益类产品。

如果相关法律法规规则要求或因实际情况需要等，需调高或调低本计划风险等级的，管理人可以调整产品风险等级，并及时以公司网站公告等方式告知投资者，无需进行合同变更，法律法规另有规定的除外。

（五）投资策略

1、本计划投资组合整体配置思路

本计划将投资目标分为收益目标和风险目标两个部分，收益目标是组合的目标收益率，风险目标是在投资过程中投资者的风险承受能力。控制风险是本计划首要考虑目标，尽力避免产品净值出现过大的波动（包括但不限于合同所约定的产品清盘线），其次考虑收益目标。本计划投资组合的配置流程为：

首先考虑产品的净值情况，如果产品已经有一定盈利作为安全垫的情况下，则在配置大类资产权重时，将在投资限制范围内增配股票资产。如果产品在净值为1附近或者略有亏损的情况下，则在配置大类资产权重时，降低股票资产权重，放弃一部分边际效应一般的交易性机会，控制产品的市场风险，减少产品的净值波动。

其次，从资产选择以及配置权重的角度，采用自上而下的方法：先对国内外宏观经济情况进行判断，之后判断宏观情景假设下各资产板块的盈利前景和潜在风险，最后选择这样的情景假设下债券和股票的合理比例，以及债券和股票应当配置什么行业、什么证券等微观因素。

最后，在资产的择时选择上，区分配置性基础仓位和交易性仓位。基础仓位跟随宏观经济趋势的判断，不频繁调整。交易性仓位捕捉市场的预期差进行交易。投研团队会研判市场对经济基本面的一致预期，并评估当前市场价格是否已经反映了当前预期，反映是否充分。在市场预期错误或者价格对市场的预期过度反应时进行止盈

或者反向下注的交易操作。

2、权益类资产投资策略

股票和转债作为收益增强品种，投资过程中以追求绝对收益为目标。

股票投资遵循价值投资方法，自下而上精选符合“幸运的行业+能干的管理层+合理的价格”三者兼具的个股。具体而言，幸运的行业指的是发展前景广阔、竞争格局有序、政策大力支持、有较强盈利能力和成长性的行业。能干的管理层则需要具备优秀的管理能力、忠诚可靠的人品、开阔的视野和专注的精神等品质，管理层能够顺应行业特征和行业发展阶段的要求，采取与之适应的经营特征和经营策略，并坚决贯彻执行并最终取得成功。除以上两点外，着重考虑股票标的的估值区间，因为低估值带来的安全边际不仅是控制风险的手段，更是本计划获取股票市场回报的主要来源。

转债投资上，结合正股资质、转股溢价率以及对理论价值的偏离预估转债下跌、上涨的空间与弹性，确定相应的配置比例。转债投资上，一方面自上而下，综合宏观基本面、流动性、股市估值水平以及转债的估值水平，确定转债仓位水平和转债板块性策略；另一方面自下而上，结合正股信用资质、正股基本面分析、估值分析和条款价值分析，挖掘估值合理、基本面扎实、信用风险较低、性价比较高的转债品种。

3、债券类资产投资策略

1) 杠杆投资策略：综合宏观经济、货币政策、资金面状况、通胀状况等因素，预测债券市场走势及债券收益率和融资成本之间的利差水平，并据此调整债券投资组合仓位，通过杠杆水平的变动来争取提高组合收益率。

2) 类属配置策略：通过研究经济周期所处的阶段，结合不同类型固定收益品种的信用风险、市场风险、税赋水平、流动性等特点以及各类型债券间的利差水平，制定债券类属配置策略。

3) 久期配置策略：通过研究分析宏观经济走势、货币政策、资金面状况等因素，判断利率走势。如果预计利率下降，将适当拉长组合久期，反之则相反，通过调整债券久期来提高组合收益率。

4) 个券精选策略：通过发行人的股东背景、行业分析、偿债能力、盈利能力等因素的分析，结合个券的收益率，在严控组合信用风险的前提下，提高组合的收益率。

4、决策程序

(1) 决策依据

集合计划以国家有关法律、法规和《集合资产管理合同》的有关规定为决策依据，并以维护集合计划投资者利益作为最高准则。具体决策依据包括：

1) 《指导意见》、《管理办法》、《运作规定》、《集合资产管理合同》、《说明书》等有关法律性文件;

2) 国内外经济形势、利率变化趋势以及行业与上市公司基本面研究;

3) 投资对象收益和风险的匹配关系, 本计划将在充分权衡投资对象的风险和收益的前提下做出投资决策。

(2) 投资程序

严格、明确的投资流程是本集合计划控制投资风险, 进行组合投资的制度保障。本计划采取投资决策委员会领导下的投资经理负责制, 具体为投资决策委员会对产品投资组合做出战略性资产配置等重大决策; 投资经理在研究部门对具体投资品种的深入研究并提出投资建议的前提下, 进行战术性的投资操作, 最后, 管理人设有专门的部门, 对产品投资组合进行全方位、全过程的监测和管理。

1) 投资决策委员会

投资决策委员会是公司旗下产品的最高决策机构, 负责审议和确定产品的投资策略、资产配置方案; 负责对重大投资管理事项行使最终决策权; 审议投资绩效分析报告; 对产品投资的相关决策权限做出规定, 审批超出权限的投资计划; 负责其他与产品投资相关的重大事项。

2) 投资经理

研究部门在对行业和市场发展的研究基础上, 按照一定的定价、估值标准和考察调研情况, 出具宏观经济分析、投资策略、债券分析、行业分析和上市公司研究等各类报告和投资建议, 筛选出预期收益高于市场平均水平的证券, 构筑证券库, 为投资经理提供决策依据。

投资经理是公司范围内做出投资决策的基础性层次, 负责依据投资决策委员会的决议制定投资策略并实施, 具体职责包括: 通过考察调研当时的市场、行业、公司、个股方面的动态变化情况, 通过对证券库内的证券进行检验, 考虑其的流动性、相关市场信息等, 根据资产配置原则和市场风险分析, 构建投资组合。制定证券投资的具体操作方案, 并运用现代的组合管理技术, 提高投资组合的风险回报率。并在研究员对上市公司进行跟踪分析基础上, 及时更新上市公司的盈利预测, 并根据市场状况和资产配置策略的变化对投资组合进行调整和优化。

3) 交易员依据投资经理的指令在集合计划专用席位实施投资交易。

4) 风险管理部门进行全过程的风险监控。

(六) 投资限制及禁止行为

1、投资比例限制

(1) 投资于本合同约定的权益类资产不超过本计划净资产的20%；

(2) 投资于存款、债券等债权类资产的比例不低于本计划总资产的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，投资于存款、债券等债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。

上述投资比例中第(2)款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。

2、权益类资产投资限制

(1) ETF投资限制

按买入成本计，投资单只宽基ETF的比例不得超过产品净资产（产品净资产规模均以上一日产品净资产规模为准，下同）的10%，其余单只ETF的投资比例不得超过产品净资产的6%；投资单只同一指数股票型ETF的比例不得超过本计划净资产的10%，且不得超过该指数股票型ETF总规模的10%。同一指数股票型ETF的单日购买量也不得超过该指数股票型ETF前20个非停牌交易日日均成交量的40%。

(2) 入池限制（不包括新股）

基于管理人的投资策略构建股票和指数股票型ETF池，对入池股票和指数股票型ETF作以下限制（入池股票详见合同附件《可投股票及ETF清单》）：

①指数优选股票池入池限制：

(a) 股票必须是沪深300指数（000300.SH）、中证500指数（000905.SH）和创业板指数300（399012.SZ）指数的成份股，以中证指数有限公司和深圳证券信息有限公司公布的最新股票池为准。

(b) 上市公司的ROE不得低于2%（以最近一期的扣非摊薄ROE为准）。

②指数股票型ETF池入池限制：

指数股票型ETF前20个非停牌交易日日均成交量小于1000万不得入池。

(3) 集中度限制

1) 按买入成本计，投资单只股票的比例不得超过产品净资产的5%，且不得超过上市公司总股本的5%（不含）和流通股本的10%（不含），也不得超过该股票前20个非停牌交易日日均成交量的40%。

2) 按买入成本计，投资同一行业股票的比例不得超过产品净资产的10%（行业以申万二级行业分类进行控制，申万二级行业分类由财汇数据提供）。

3) 按买入成本计，总市值100亿元以下的股票投资比例不得超过产品净资产的3%。

4) 按买入成本计, 投资于创业板、科创板的股票不得超过产品净资产的10%。

(4) 准入要求

1) 持有的股票市盈率超过行业平均市盈率1.5倍的市值占该组合股票投资市值的比例不得超过40%，市盈率超过行业平均市盈率3倍的市值占该组合股票投资市值的比例不得超过20%（行业以申万二级行业分类进行控制，申万二级行业分类由财汇数据提供）。

2) 不得投资以下股票：

①S、ST、*ST、S*ST及SST类股票、期货、融资融券交易，期权与权证；

②定向增发股票、新三板股票；

③上市公司已披露正在接受监管部门立案调查，或已披露近1年被证监会调查，或最近一年内受到监管部门处罚，或者面临行政、刑事处罚；

④最近一年度财务报表被会计师事务所拒绝出具意见或出具保留意见的股票；

⑤上市公司存在重大未决诉讼或上市公司存在重大违约或逾期记录；

⑥上市公司最近2年内有重大负面信息的标的公司；

⑦投资时上市公司账面商誉占比过高，商誉价值超过其净资产价值30%的股票；

⑧投资时大股东所持标的公司股份高比例用于质押融资，质押比率超过其持有上市公司股份总数70%的股票；

⑨投资时标的公司前十大股东中有多家资管（信托）产品持股且持股比例合计超过40%的股票；

⑩上市公司前6个月内股票价格波动幅度超过200%的股票【波动幅度=（前6个月最高价格-前6个月最低价格）/前6个月最低价格】。

3) 本计划可参与新股网下配售，持有的新股在打开涨停板后的5个交易日内卖出。

3、债券类资产投资限制

(1) 集中度限制（以下比例均以投资成本计算；产品净资产规模均以前一日产品净资产规模为准）

1) 资产支持证券、资产支持票据的总额不得超过产品净资产的20%。

2) 公募可转债不得超过产品净资产的15%。

3) 投资于单一信用债券不超过该债券发行规模的20%。

4) 投资于单一信用债券的额度不得超过产品净资产的10%（以成本价计算，下同）；投资于一家公司（包括一个集团内的不同子公司）、同一实际控制人（实际控制人可推算至政府部门下属一级企事业单位）控制的公司发行的债券总额合计不得

超过产品净资产的10%（利率债发行主体除外）。

5) 投资于同一行业债券的比例不得超过产品净资产的30%（行业以申万二级行业分类进行控制，申万二级行业分类由财汇数据提供），但金融债、同业存单、利率债除外。

6) 投资于管理人及其关联方发行或承销期内承销的债券的总额不超过产品净资产的30%（包括但不限于投资于管理人及其关联方发行或承销期内承销的债券），投资前应由管理人以书面或邮件通知的形式事先取得全体委托人同意。不得直接或间接承接管理人自营账户或其受托管理产品持有的债券。

（2）准入要求

1、信用债（不含公募可转债）

1) 企业债、公司债、短期融资券等信用债的主体评级和债项评级须为AA+及以上（无债项评级的，以主体评级为准）且评级展望为稳定及以上，短期融资券债项评级须为A-1级以上；公募可转债主体评级和债项评级（无债项评级的，以主体评级为准）须为AA+及以上且评级展望为稳定及以上。

2) 资产支持证券和资产支持票据的债项评级须为AA+（含）以上；不得投资融资租赁、小额贷款公司发行的资产支持证券和资产支持票据。

3) 发债主体连续2年盈利且资产负债率不超过75%；发行人为AAA级央企，其资产负债率不得超过80%；发债主体是金融机构的资产负债率不受本条约束。

4) 所有债券采用最新评级及评级展望。

5) 信用评级机构仅限于大公国际资信评估有限公司、中诚信国际信用评级有限责任公司、中诚信证券评估有限公司、联合资信评估有限公司、联合信用评级有限公司、上海新世纪资信评估投资服务有限公司、东方金诚国际信用评级有限公司、中证鹏元资信评估股份有限公司、远东资信评估有限责任公司、标普信用评级（中国）有限公司、惠誉博华信用评级有限公司及安融信用评级有限公司；如债券信用评级机构为中证鹏元资信评估股份有限公司或东方金诚国际信用评级有限公司，则其评级结果须至少下调半级（如评为AA+则视作AA）。对遭受监管严重处罚的信用评级机构，在处罚执行期间对其出具的评级报告不予采纳。

6) 负面清单，即禁止投资符合以下情形之一的标的：

(a) 全体委托人将定期提供债券投资负面清单，对于清单内客户，严禁新增投资其发行的各类债券，前期已投资业务应视市场情况尽快择机退出。（委托人指定发送该负面清单的专用邮箱：【linweisigrbank@163.com、719692860@qq.com】）

(b) 禁止投资法律法规或监管机关规定禁止从事的行为。

(c) 禁止投资于主营业务为两高一剩行业、平台发行的债券。

“两高一剩”是指高污染、高耗能的资源性的行业和产能过剩行业，主要包括：B0610烟煤和无烟煤开采洗选、B0620褐煤开采洗选、B0690其他煤炭采选、B1110煤炭开采和洗选专业及辅助性活动、C1713棉印染精加工、C1723毛染整精加工、C1733麻染整精加工、C1743丝印染精加工、C1752化纤织物染整精加工、C1910皮革鞣制加工、C1931毛皮鞣制加工、C2211木竹浆制造、C2212非木竹浆制造、C2221机制纸及纸板制造、C2222手工纸制造、C2223加工纸制造、C2231纸和纸板容器制造、C2239其他纸制品制造、C2521炼焦、C2522煤制合成气生产、C2523煤制液体燃料生产、C2524煤制品制造、C2529其他煤炭加工、C2611无机酸制造、C2612无机碱制造、C2614 有机化学原理制造、C2621氮肥制造、C2622磷肥制造、C2911 轮胎制造、C3011水泥制造、C3041平板玻璃制造、C3110炼铁、C3120炼钢、C3140铁合金冶炼、C3216铝冶炼、C3731金属船舶制造、电石*、黄磷*、电石法聚氯乙烯*、多晶硅*、（带*号行业名称指国民经济代码下的细分行业或具体产品）。上述均指生产性行业，不含批发零售业。

(d) 发债主体近三年有债务违约记录的；发债主体涉及可能带来重大不利影响的诉讼事项（诉讼金额占净资产的比例超过5%及以上，管理人判断可能危及公司偿债能力的）；有公开媒体报道发债主体或其实际控制人涉及贪污腐败等重大负面信息的，管理人判断可能危及公司偿债能力的；发债主体为近两年连续亏损的企业。

(e) 禁止投资以不良资产为标的的ABS、ABN（对于不良资产经重组或其他方式转为正常类标的的除外）；禁止投资ABS、ABN的次级或优先级的最后一级。

(f) 禁止投资债项级别或主体信用级别在90天内有下调记录的债券。

(g) 禁止投资出现延迟支付本息情况的债券。

(h) 不得投资永续债、金融机构次级债、二级资本债、混合资本债、中小企业私募债、非标资产。

(i) 禁止投资存在内幕交易、操纵市场的情形；不得用于贷款、抵押融资或者对外担保。

信用债券的投资范围限于《信用债发行人清单》所载发行人（金融机构除外）发行的债券（详见合同附件，下同）。

II、资产支持证券（含资产支持票据）

原始权益人为非金融机构，则原始权益人须作为差额补足方且原始权益人需符合上述信用债准入要求。原始权益人应在合同附件《信用债发行人清单》内；可投资资产支持证券详见合同附件《可投资资产支持证券清单》。

III、公募可转债投资限制

1) 评级准入

公募可转债主体信用评级或债项评级须为AA+及以上（无债项评级的，以主体评级为准）。

2) 公募可转债的准入条件

A、集中度限制

持有单只可转换债的规模不得超过该可转债发行规模的20%。

B、期限要求

单只可转债的剩余期限不超6年。

C、发行人要求

主业稳定，资产负债率不超过75%（金融机构除外）；AAA级央企作为发债主体，资产负债率不得超过80%（金融机构除外）；前三年财务报表的审计意见正常；最近两个会计年度盈利；最近一期末的净资产不低于人民币10亿元。

4) 公募可转债的转换标的公司须满足以下情况：

A、上市公司主业稳定，资产负债率不超过75%（金融机构除外）；AAA级央企作为发债主体，资产负债率不得超过80%（金融机构除外）；前三年财务报表的审计意见正常；上市公司最近两个会计年度盈利；

B、上市公司最近一期末的净资产不低于人民币10亿元；

C、上市公司不得存在以下情况：

(a) 不得为广州农村商业银行股份有限公司及其股东；

(b) S、ST、*ST、S*ST及SST类上市公司；

(c) 上市公司近2年存在不利于正常经营的重大诉讼事项发生；近2年存在重大违约或近期（24个月内）逾期、欠息等不良信用记录；近2年存在被证监会调查，或被交易所公开谴责或者面临行政、刑事处罚；近2年内有重大负面信息（如涉大量民间借贷、腐败事件、股份或资产被司法冻结等），管理人判断可能危及公司偿债能力的；

(d) 上市公司为无实质经营的壳公司；股权关系复杂且不透明，关联企业众多且关联交易频繁、异常；涉嫌存在大股东借名上市公司融资或对外担保的；近期存在金融机构抽贷等情形；上市公司或大股东涉及高杠杆资本运作、频繁资产重组；上市公司或大股东涉及大量互联网金融业务；上市公司股东中有多家资管产品持股且持股比例较高（单个或合计）；

(e) 大股东所持标的公司股份用于质押融资的比例高于70%，特别是质押融资

已经临近或突破补仓或平仓线的；

(f) 上市公司股价近期出现过非系统性原因闪崩；长时间停牌，或因股价负面异常波动停牌。

(g) 上市公司所属行业为产能过剩或高污染、高耗能（两高一剩）、房地产等限制性行业；

5) 转（换）股限制方面：

A、转（换）股后的股票总市值需大于转股前的债券市值的**110%**（含）；

B、允许因转（换）股而被动持有二级市场股票。管理人行权换股后，单只股票持仓上限应不超过上市公司总股本的**4.99%**（含），且需在转（换）股后的五个工作日内卖出股票，经全体委托人以书面或邮件的形式同意后可放开本条限制。

C、管理人不得行使回售选择权，经全体委托人以书面或邮件的形式同意后可放开本条限制。

6) 其他：

A、可参与可转换债券一级市场打新，打新获得的可转债在上市后**5**个交易日内卖出。

B、不得投资私募发行的可转债。

7) 可投可转债详见合同附件《可投可转债清单》。

(3) 期限要求

1) 如产品剩余期限为**1**年以上时，则信用债券（公募可转债除外）组合久期不得超过**3**；如产品剩余期限为**1**年或者剩余期限不足**1**年时，则信用债券(公募可转债除外)组合久期不得超过**1**；经全体委托人以书面或邮件的形式一致同意后，信用债券（公募可转债除外）组合久期可放宽至不超过**2**。

2) 债券（金融债、利率债、公募可转债除外）剩余期限最长不超过**5**年。如有投资者回售选择权的，可以按行权日计算剩余期限。

(4) 杠杆比例

债券正回购比例最高不得超过产品净资产的**40%**。

4、现金管理类资产投资限制

存放同业须选择全国性中资银行为交易对手，且不得为全体委托人共同出具的负面清单交易对手。同业存单的发行机构应为主体信用评级为**AA**级以上中资银行，且不得为村镇银行。（委托人指定发送该负面清单的专用邮箱为：

【linweisigrbank@163.com、719692860@qq.com】）

5、其他投资限制

(1) 本集合计划的负债比例（总资产/净资产）上限不得超过**140%**；

(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%**；管理人管理的全部集合资产管理计划投资于同一资产的资金，不得超过该资产的**25%**。银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券等中国证监会认可的投资品种除外；

(3) 集合计划参与股票、债券、可转债、可交换债等证券发行申购时，申报的金额不得超过集合计划的总资产，申报的数量不得超过拟发行公司本次发行的总量；

(4) 本集合计划不投资公募可交换债；

(5) 投资于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，其底层资产将不包括产品；

(6) 债券逆回购比例不得超过产品净资产的**40%**；

(7) 法律法规、中国证监会以及本合同规定的其他投资限制。

6、其他交易限制要求

(1) 若产品所持的债券发行人主体或其关联方出现信用违约（简称“违约债券”），持有的违约债券份额占产品净资产超过**10%**（含），管理人只能买入银行存款、同业存单、债券逆回购、国债、地方政府债、央行票据，并及时将上述情况告知全体委托人。若违约发生2个月后违约债券面值仍占产品净资产超过**10%**，全体委托人有权以书面或邮件的形式要求本集合计划提前终止并进入清算程序。

(2) 计划到期日前**10**个交易日内禁止进行买入交易，只能进行卖出交易；不晚于计划到期日前的第**5**个交易日赎回或卖出本计划投资的全部非现金类资产（指除合同约定的现金管理类资产之外的资产）；计划到期前**1**个交易日，不得进行任何买入操作以及国债逆回购交易；计划到期当日**13:00**之后，管理人有权进行强制平仓。

(3) 当信用类债券的债项评级或主体评级下降而导致信用类债券评级不符计划产品投资规定时，本计划应在自可交易之日起**10**个交易日内将不符合规定的信用类债券卖出。

(4) 禁止其他按照有关法律、法规的规定禁止从事的行为。

(5) 由于包括但不限于证券市场波动、债券发行人合并、组合规模变动等管理人之外的原因导致的投资比例不符合本合同约定的投资限制或投资禁止政策，为被动超标。发生被动超标时，管理人应在符合法律法规和监管规定的前提下，在发生不符合法律法规或投资政策且可交易之日起的**20**个交易日内进行调整，以满足法律法规及投资政策的要求。法律法规另有规定的从其规定。

7、禁止性事项

本计划的投资禁止行为包括：

- (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) 向客户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) 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) 募集资金超过计划说明书约定的规模；
- (7) 接受单一客户参与资金低于中国证监会规定的最低限额；
- (8) 使用本计划资产有意进行有损委托人利益的交易；
- (9) 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；
- (10) 法律法规和中国证监会禁止的其他行为。

(七) 资产管理计划的建仓期

管理人将在资产管理计划成立之日起的6个月为建仓期。建仓期内的投资活动，应当符合本合同约定的投向和本计划的风险收益特征，以现金管理为目的，投资于银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券、货币市场基金等中国证监会认可的投资品种的除外。建仓期结束后，资产管理计划的资产组合应当符合法律、行政法规、中国证监会规定和合同约定的投向和比例。

(八) 投资的资产组合的流动性

1、本计划所投资的资产组合的流动性与本合同约定的参与、退出安排相匹配，确保在开放期保持适当比例的现金或其他高流动性资产。

本计划开放退出期内，主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过资产净值的20%，资产组合中7个工作日可变现资产的价值不低于计划资产净值的10%。

2、本计划为固定收益类产品，可投资于国内依法发行债券、货币市场工具、上市的股票等，一般情况下，这些资产市场流动性较好，但不排除在特定阶段、特定市场环境下特定投资标的出现流动性较差的情况。因此，本计划在设立本合同时，详细列明参与原则、参与的程序、参与的金额限制、单个委托人大额退出的认定、申请和处理方式以及巨额退出的认定和方式，以确保开放退出期内可能面临的流动性风险。

十二、利益冲突及关联交易

（一）关联交易及利益冲突情形

1、关联方范围

管理人对本计划“关联方”的范围界定为：

- （1）本计划管理人；
- （2）本计划托管人；
- （3）持有管理人5%以上股权的股东，即东方证券股份有限公司；
- （4）管理人控股股东和实际控制人的其他控股子公司，详见东方证券股份有限公司作为上市公司公开披露的定期报告；
- （5）管理人的控股子公司，目前暂无；
- （6）管理人的合营企业和联营企业，目前暂无；
- （7）法律法规、监管机构及管理人认定的其他关联法人、自然人或产品。

关联方具体范围有变化或更新的，请以管理人网站公告为准。

2、一般关联交易和重大关联交易

（1）重大关联交易

重大关联交易主要包括管理人运用计划资产投资于管理人及其控股股东、实际控制人或者与管理人有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，超过一定限额（如有）购买管理人管理的资产管理产品（含公募基金），以及中国证监会、基金业协会等相关监管部门或自律组织认定的其他符合重大关联交易的情形等。

（2）一般关联交易

一般关联交易是指除重大关联交易以外的其他关联交易，包括在一定限额内（如有）购买管理人管理的资产管理产品（含公募基金）以及其他管理人根据其公司制度认定为一般关联交易的情形。

重大关联交易和一般关联交易的区分标准应由管理人董事会审议通过，法律法规、中国证监会、基金业协会等相关监管部门或自律组织另有规定的，遵照相关规定执行。

3、关联交易审批程序

管理人按照重要性原则实行分层管理，除特殊情形外，一般关联交易需经公司相关业务部门发起内部审批流程，由风控部门、总经理或总经理办公会审批；重大关联交易按一般关联交易履行完审批程序后，再提请董事会决议，董事会承担重大关

联交易事项的审批决策职责。同时，重大关联交易除履行内部审批程序外，还需事先得到委托人同意后执行。法律法规另有规定的，从其规定。

4、除上述关联交易事项外，本计划在投资和运作过程中可能还会存在一些其他的利益冲突情形，包括但不限于：管理人、托管人开展不同业务类型可能产生的利益冲突；管理人管理的其他资管产品（包括本计划投资经理管理的其他资管产品）基于各自投资策略需要可能与本计划存在相同、相似或相反的投资交易行为，或者在买卖同一只证券的时间上存在先后；其他可能产生利益冲突的情况等。

此外，管理人可以在遵循法律法规和相关原则的前提下运用自有资金进行证券投资，该等投资也可能与本计划存在相同、相似或相反的投资交易行为，或者在买卖同一只证券的时间上存在先后，不排除可能影响或限制本计划的投资运作。

5、特别风险提示

提示投资者注意：管理人以资产管理计划资产从事一般关联交易、重大关联交易（以下统称关联交易），均存在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。管理人承诺关联交易应按照市场通行的方式和条件进行。此外，管理人运用资产管理计划财产从事关联交易时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，进而可能影响资产管理计划财产的投资收益。管理人遵循投资者利益优先和审慎原则，根据本合同的约定参与关联交易，尽管管理人确认将确保该等交易安排合法合规、不存在利益输送等违法违规行为，但该等交易仍构成关联交易，存在利益冲突风险。

除了上述风险以外，一般关联交易、重大关联交易还分别存在以下风险：

（1）对于本计划涉及的一般关联交易事项，管理人可以根据本合同的约定与投资者的授权以资产管理计划资产从事一般关联交易，管理人无需就前述具体一般关联交易再行分别取得投资者授权，因此投资者承担管理人未经投资者另行同意直接开展一般关联交易的风险。

（2）对于本计划涉及的重大关联交易事项，为保护投资者权益，管理人应当根据本合同的约定提前取得投资者同意，但投资者仍然面临关联交易可能造成的风险。

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。

（二）关联交易及利益冲突的应对及处理

1、投资者签署本合同即视为已经充分理解并同意管理人以本计划资产从事本合同约定的一般关联交易，管理人无需就前述具体一般关联交易再行分别取得投资者的授权，且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。但该等一般关联交易投资应按照市场通行的

方式和条件参与，管理人应公平对待委托财产，防止利益冲突，不得损害投资者利益，并依据相关要求履行信息披露和监管报告义务。

2、对于本计划涉及的重大关联交易事项，为保护投资者权益，管理人应当提前取得其同意，并依据相关要求履行信息披露和监管报告义务。具体方式为：

由管理人于管理人网站向投资者信息披露，并且管理人须在信息披露后3个工作日内以书面或者通过管理人网站（由管理人决定）向本计划投资者发送征询意见函，投资者应在征询意见函指定的日期内按指定的形式回复意见，管理人采取如下权利保障措施及安排：

（1）投资者回复不同意的，管理人应保障其退出权利，投资者应按照管理人届时具体安排提出退出本计划的申请。管理人未在征询意见期间设置开放期供该投资者退出的，管理人不得开展该项重大关联交易；

（2）投资者回复不同意且逾期未申请退出的，则管理人有权在征询意见函中说明的意见回复期届满后的第一个工作日将其持有的全部资产管理计划份额强制退出本计划（退出价格为强制退出当日资产管理计划财产份额净值），由此发生的相关税费、或有损失由该投资者自行承担；

（3）投资者在征询意见函规定期限内未回复意见的，视同该投资者同意，管理人不再另行通知；

（4）投资者回复意见不明确的，则视为该投资者不同意，按照以上（1）、（2）投资者不同意的方式处理。

3、资产管理计划在投资运作过程中存在利益冲突情形的，管理人应当坚持投资者利益优先原则，从充分维护投资者利益角度积极处理该等利益冲突情形，防范利益输送等违法违规行为。在发生损害投资者利益的利益冲突时，管理人应当视具体利益冲突情形和重要程度选择在向投资者提供的定期报告或临时报告中披露，具体披露内容包括利益冲突情形、处置方式、对投资者利益的影响等。管理人承诺谨慎勤勉地管理资产管理计划财产、公平对待各投资组合。

4、本章所列的关联方范围、重大关联交易与一般关联交易的划分标准、关联交易审批程序，除法律法规强制规定列为关联方、重大关联交易或对审批程序有强制要求者外，系管理人公司制度的规定。管理人将及时在官网公告前述事项的有关内容（包括前述事项的变化或更新），请投资者予以关注。关于前述事项变化或更新的相关公告较本合同更为详细或与本合同不一致的，以相关公告的规定为准。

十三、投资经理的指定与变更

（一）投资经理的指定

本计划投资经理由管理人负责指定。管理人指定本计划投资经理为周琰和孙启超，其具体信息如下：

周琰女士：上海东方证券资产管理有限公司投资经理，上海财经大学经济学硕士，证券从业9年，曾任富国基金管理有限公司固定收益部投资经理助理，上海东方证券资产管理有限公司固定收益研究员。

孙启超先生：上海东方证券资产管理有限公司投资经理，伦敦政治经济学院经济学硕士，证券从业6年，曾任上海东方证券资产管理有限公司固定收益研究员。

本计划投资经理已经依法取得基金从业资格，具有三年以上投资管理、投资研究、投资咨询等相关业务经验，具备良好的诚信记录和职业操守，且最近三年未被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚。

（二）投资经理的变更

管理人可以根据需要变更投资经理，无需履行合同变更程序。投资经理变更后，管理人应在5个工作日内通知投资者及托管人。管理人在其网站就投资经理变更事宜进行相应公告，即视为已经履行了相应告知程序。

十四、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、本计划财产的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、托管人可以按照本合同的约定收取管理费、托管费以及本合同约定的其他费用。管理人、托管人以其固有财产承担法律责任，其债权人不得对本计划财产行使请求冻结、扣押和其他权利。管理人、托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，本计划财产不属于其清算财产。

5、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销。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。

（二）本计划财产相关账户的开立和管理

托管人按照规定开立资产管理计划财产的资金账户、证券账户等投资所需账户，管理人应给予必要的配合，并提供所需资料。证券账户和期货账户（如有）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。资金账户名称应当是“资产管理计划名称”，证券账户、期货账户（如有）名称应当是“证券期货经营机构名称—托管人名称—资产管理计划名称”，具体以实际开立为准。托管人应在资产管理计划成立前将资金账户信息书面通知管理人。资金账户由托管人负责管理，委托资产托管期间的一切货币收支活动，包括但不限于投资、支付费用、资产划拨、追加资产和提取资产等，均需通过该账户进行。托管专户内的银行存款利息按同期活期存款利率（目前为0.3%）计算，如遇人民银行调整活期存款利率的，托管专户的银行存款利率随之调整。

因业务发展而需要开立的其他账户，可以根据法律法规和本合同的规定，经管理人与托管人进行协商后进行办理。新账户按有关规则使用并管理。

十五、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列明资金划拨指令的授权人及预留印鉴的授权通知书（如附件一）。预留印鉴包括但不限于管理人预留的人员姓名、人员权限、印章样本、有权签字人签字或名章样本。管理人需在授权通知书上加盖公章及法定代表人签章，对预留印鉴进行授权。同时，授权通知书还需同时载明管理人投资监督联络人及邮箱地址。管理人通过托管网银服务系统发送划款指令的，管理人应事先向托管人提供《乐托管系统申请表》，明确管理人有权发送托管网银指令的人员名单及对应的权限（以下简称“托管网银授权通知书”），并由管理人加盖公章并经法定代表人或授权代表签章（若由授权代表签署，还应附上法定代表人的授权书）。

授权通知应以原件形式送达资产管理计划托管人，同时电话通知托管人，授权通知应注明生效日期，自其中注明的生效日期起开始生效。若托管人收到授权通知的日期晚于其中注明的生效日期，授权通知自托管人收到的日期起开始生效。管理人和托管人对预留印鉴负有保密义务，其内容不得向相关人员以外的任何人泄露。

（二）划款指令的内容

划款指令是指在管理资产管理计划财产时，管理人向托管人发出的资金划拨及其他款项收付的指令。划款指令的内容包括划款指令出具日期、划款事由、指令的执行时间、支付金额、收款账户信息、大额支付行号等，并加盖预留印鉴。

（三）划款指令的发送、确认及执行时间与程序

1、指令由“授权通知”确定的指令发送人员代表集合计划管理人用电子直联、传真或邮件的方式向集合计划托管人发送。集合计划托管人依照“授权通知”规定的方法确认指令有效后，方可执行指令。对于指令发送人员发出的指令，集合计划管理人不得否认其效力。但如果集合计划管理人已经撤销或更改对指令发送人员的授权，且管理人已经书面通知集合计划托管人，则对于此后该指令发送人员无权发送的指令，或超权限发送的指令，集合计划管理人不承担责任。

2、资产管理计划管理人应按照《管理办法》和有关法律法规的规定，在其合法的经营权限和交易权限内，并依据相关业务规则发送指令。指令发出后，管理人应及时电话、电子邮件通知托管人。

管理人向托管人发送划款指令时应确保预留托管人至少2个工作小时的处理时间（托管人的工作时间为8:30-11:30,13:30-17:00），对于当日15:00之后收到的指令，托管人应尽力在指定时间内完成资金划拨,但不承担执行失败的责任。资产管理计划托管人发现资产管理计划管理人的指令违法、违规或违反资产管理合同约定的，有权不予执行，并及时书面通知管理人。

管理人在发送划款指令时，应为托管人执行划款指令留出执行指令时所必需的时间。因管理人原因指令传输不及时未能留出足够的执行时间，致使指令未能及时执行所造成的损失由管理人承担。若托管人因投资监督需要要求管理人发送相关交易解释、说明等文件，则视托管人收到上述有效文件时间为收到划款指令时间。划款当日如有超过5000万元的指令，如管理人迟于划款当日9:30后报托管人预留头寸，对指令造成的影响托管人不承担责任。

管理人发送指令时应同时向托管人发送必要的投资合同、划款指令、费用发票（如有）等划款证明文件的复印件或扫描件。托管人仅对管理人提交的划款指令按照本合同约定进行表面一致性审查，托管人不负责审查管理人发送指令同时提交的其他文件资料的合法性、真实性、完整性和有效性，管理人应保证上述文件资料合法、真实、完整和有效。如因管理人提供的上述文件不合法、不真实、不完整或失去效力而影响托管人的审核或给任何第三人带来损失，托管人不承担任何形式的责任。

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，未按照本合同约定的传真号码、邮箱地址或双方认可的其他形式发送划款指令等。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，并及时通知管理人纠正。托管人按管理人最后确认的正确指令执行。如错误指令系托管人按照正常的监管职能无法判断，发送该等错误指令引发的损失不由托管人承担。

（四）托管人依照法律法规暂缓、拒绝执行指令的情形和处理程序

托管人发现管理人发送的指令违反《基金法》、本合同的规定时，不予执行，并及时通知管理人纠正，管理人收到通知后应及时处理，管理人存在过错的，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、指令账户信息不全或有误、预留印鉴不全或不符、交割信息错误，指令中重要信息模糊不清或不全等。托管人在履行监督职能时，如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。

（六）更换划款指令被授权人的程序

管理人若对授权通知的内容进行修改（包括但不限于指令发送人员的名单的修改，及/或权限的修改），应当至少提前1个工作日通知托管人；修改授权通知的文件应由管理人加盖公章并由法定代表人或其授权代表签署，若由授权代表签署，还应附上法定代表人的授权书。管理人对授权通知的修改应当以原件的形式发送给托管人，同时电话通知托管人，授权变更通知应注明生效日期，自其中注明的生效日期起开始生效。若托管人收到授权变更通知的日期晚于其中注明的生效日期，授权变更通知自托管人收到的日期起开始生效。

（七）划款指令的保管

划款指令若以传真、扫描形式发出，则正本由管理人保管，托管人保管指令传真件、扫描件。管理人应确保两者一致，如两者不一致造成的损失由管理人承担。

（八）相关责任

在正常业务受理渠道和指令规定的时间内，因托管人原因未能及时或正确执行符合本合同规定、合法合规的划款指令而导致基金财产受损的，托管人应承担相应的责任，但托管资金账户余额不足或托管人如遇到不可抗力的情况除外。对管理人在没有充足资金的情况下向托管人发出的指令，托管人有权拒绝执行，托管人不承担因为不执行该指令而造成的损失。

十六、交易安排

本委托资产投资于证券发生的所有场内、场外交易的资金清算交割，全部由托管人负责办理。资金清算为场外投资的，托管人凭管理人指令和相关投资文件进行资金划拨。

本委托资产证券投资的清算交割，由托管人通过中央结算公司、上清所、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。

1、管理人负责选择代理本委托财产证券买卖的证券经营机构，并与其签订证券交易单元使用协议。

2、管理人应及时将委托财产的证券交易单元号、佣金费率等基本信息以及变更情况及时以书面形式通知托管人。

3、资产管理人应提前通知资产托管人，并将《新增交易单元说明函》或《共用交易单元说明函》及时送达资产托管人，确保资产托管人申请接收结算数据。首次进行场内交易前资产管理人应配合托管人办妥专用交易单元合并清算手续并与资产托管人确认已完成交易单元和股东代码设置后方可进行交易。如果因资产管理人未事先通知资产托管人增加或者共用交易单元等事宜，致使资产托管人接收数据不完整，造成清算差错的责任由资产管理人承担。

（一）交易所市场资金清算

交易所市场资金清算详见附件《托管银行证券资金结算协议》。

（二）银行间交易清算

托管人根据管理人指令进行银行间债券交易的资金结算。管理人在买入银行间债券、银行间逆回购首期和银行间正回购到期时以传真方式或以其他双方认可的方式向托管人发出划款指令。

托管人审核管理人指令的真实性、合法性、完整性后，根据管理人传真的划款指令办理资金划拨，托管人协助跟踪该指令所载款项的到账时间，管理人根据托管人反馈的指令及时调整委托资产当日可用资金余额；如托管人对上述指令真实性、合法性、完整性有异议，应及时与管理人进行沟通；如发现上述指令违反法律法规及本合同所规定的投资范围，且指令尚未生效或相关协议尚未生效的，托管人有权拒绝执行该指令，及时书面通知管理人，并电话确认。

对于乙类账户托管人根据投资指令的要求完成证券交割和资金交收，并根据相关规定支付交易费用。托管人应定期将办理业务所发生的交易费用清单或发票提交管理人。

（三）非担保交收约定

根据《中国证券登记结算有限责任公司关于上海证券交易所上市权证登记结算业务实施细则》、《中国证券登记结算有限责任公司关于深圳证券交易所上市权证登记结算业务实施细则》，为确保非担保交收业务的正常交收，即于发生国债买断式回购到期购回、权证行权、大宗专场、专项资产管理计划转让以及部分发行类业务（股配债、老股东配售的增发、公司债场内分销）以及通过上交所固定收益证券综合电子平台达成的私募债券转让和通过深圳综合协议平台的公司债、私募债转让等非担保交收业务，管理人应于交易当日15:00前将该交易书面告知托管人并进行电话确认。如需托管人交易当日进行划款的，管理人需要在交易当日14:00分前将划款指令发送给托管人，同时将权证申报明细单传真或电子邮件发送至资产托管人，并与资产托管人进行电话确认，以保证当日权证行权资金交收的顺利进行。若资产管理人未及时通知资产托管人有关行权信息而导致行权失败，资产托管人不承担责任。

如因资产管理人原因在本计划托管账户头寸不足的情况下交易，并最终占用托管人所托管其他产品在中国结算公司的备付金而交收成功的，管理人应在日终前补足交收款项,并承担可能造成的损失；若是占用了资产托管人其他托管产品存放中国结算公司的备付金而导致托管人所托管的其他产品交收失败的，所有损失将由资产管理人承担。同时，资产托管人保留根据上海银行间市场同业拆借利率向管理人追索利息的权利。

（四）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管理人指令和相关投资文件进行资金划拨。

（五）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，凭管理人指令和相关单据（若有）进行资金划拨。

（六）资金划拨指令的执行

管理人的资金划拨指令，托管人在复核无误后应在规定期限内执行，不得以不合理延误。如发现管理人的资金划拨指令有违法、违规的或超头寸，托管人应不予执行并立即书面通知管理人要求其变更或撤销相关指令，若管理人在托管人发出上述通知后仍未变更或撤销相关指令，托管人应不予执行，并报中国证券投资基金业协会备案，同时抄送管理人住所地中国证监会派出机构。

资金划拨指令的下达程序应当按照本合同第十三条约定的程序办理。

（七）资金和证券账目的对账

管理人和托管人每日对资产的资金账目和证券账目进行核对，做到账实相符、

账账相符。每日日终管理人将当日估值结果发送至托管人，经托管人核对无误后将核对估值结果发送至管理人。

（八）可用资金余额的确认

管理人可以向托管人申请开通托管账户的网上银行查询功能，负责查询托管账户现金流情况。

（九）清算备付金及保证金清算条款

据中国证券登记结算有限责任公司的规定，清算备付金账户内的资金按市场规则每月调整，交易保证金账户内的资金按市场规则每月调整，因此清算备付金账户内的资金、利息以及交易保证金账户内的资金及利息需等中国证券登记结算有限责任公司退款后（备付金退款时间约为合同结束后2个月，保证金退款时间约为合同结束后7个月）方可清算。该笔清算资金在扣除相关费用后划往指定账户。

十七、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的投资范围和投资比例限制而进行的投资交易行为，包括：

- 1、违反有关法律法规和本合同规定进行的投资交易行为。
- 2、法律法规禁止的超买、超卖行为。

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

（二）越权交易的处理程序

- 1、违反有关法律法规和本合同规定进行的投资交易行为

托管人发现管理人的划款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，立即通知管理人和委托人并及时报告中国证监会。

托管人发现管理人依据交易程序已经生效的划款指令违反法律、行政法规和其他规定，或者违反本合同约定的，应当立即通知管理人和委托人并及时报告中国证监会。

管理人对托管人通知的越权事项应在限期内纠正，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。

管理人应向托管人主动报告越权交易，并应在定期报告中向委托人披露当期越权交易情况。

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，如果发现资产管理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，由此给资产管理计划财产造成的损失由管理人承担。如果因管理人原因发生超买行为，管理人必须于T+1日上午11:00前完成融资,确保完成清算交收。

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

（三）托管人对管理人的投资监督

1、托管人根据法律法规或本合同明确约定的投资范围、投资比例、投资限制、委托人或管理人书面提供的关联方名单（若有）等内容进行投资监督，对投资策略及其他合规性问题不承担任何形式的责任。托管人具体对以下投资范围、投资比例、投资限制、委托人或管理人书面提供的关联方名单（若有）等内容进行监督：

“1、投资范围

（1）权益类资产：国内依法上市公开发行的股票（含新股）和指数股票型ETF。

（2）债券类资产：仅限于在银行间、上海证券交易所或深圳证券交易所上市流通（含一级市场、二级市场）的国债、央行票据、地方政府债、政策性金融债、金融债（不含次级债、二级资本债、混合资本债）、公司债（不含非公开公司债）、企业债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、资产支持证券优先级（底层资产不包括产品）、资产支持票据优先级（底层资产不包括产品）、公募可转换债券。

（3）现金管理类资产：银行存款、同业存单、国债逆回购（交易对手需为持牌金融机构，不得为公募基金、资管计划）。（其中交易所回购的交易对手托管人不负责监督，由委托人与管理人自行把控）

（4）集合计划可以参与债券正回购，但集合计划的总资产不得超过该计划净资产的140%。

2、投资比例限制

（1）投资于本合同约定的权益类资产不超过本计划净资产的20%；

（2）投资于存款、债券等债权类资产的比例不低于本计划总资产的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，投资于存款、债券等债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。

上述投资比例中第（2）款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。

3、权益类资产投资限制

(1) ETF投资限制(托管人按照本合同约定的《可投股票及ETF清单》进行监控)按买入成本计,投资单只宽基ETF的比例不得超过产品净资产(产品净资产规模均以前一日产品净资产规模为准,下同)的10%,其余单只ETF的投资比例不得超过产品净资产的6%;投资单只同一指数股票型ETF的比例不得超过本计划净资产的10%,且不得超过该指数股票型ETF总规模的10%。同一指数股票型ETF的单日购买量也不得超过该指数股票型ETF前20个非停牌交易日日均成交量的40%。

(2) 入池限制(不包括新股)(托管人仅按照本合同约定的《可投股票及ETF清单》进行监控,对于入池限制无需监控)

(3) 集中度限制

1) 按买入成本计,投资单只股票的比例不得超过产品净资产的5%,且不得超过上市公司总股本的5%(不含)和流通股本的10%(不含),也不得超过该股票前20个非停牌交易日日均成交量的40%。

2) 按买入成本计,投资同一行业股票的比例不得超过产品净资产的10%(行业以申万二级行业分类进行控制,申万二级行业分类由财汇数据提供)。

3) 按买入成本计,总市值100亿元以下的股票投资比例不得超过产品净资产的3%。

4) 按买入成本计,投资于创业板、科创板的股票不得超过产品净资产的10%。

(4) 准入要求(托管人仅按照本合同约定的《可投股票及ETF清单》进行监控,对于准入要求无需监控。)

4、债券类资产投资限制

(1) 集中度限制(以下比例均以投资成本计算;产品净资产规模均以前一日产品净资产规模为准)

1) 资产支持证券、资产支持票据的总额不得超过产品净资产的20%。

2) 公募可转债不得超过产品净资产的15%。

3) 投资于单一信用债券不超过该债券发行规模的20%。

4) 投资于单一信用债券的额度不得超过产品净资产的10%(以成本价计算,下同);投资于一家公司(包括一个集团内的不同子公司)、同一实际控制人(实际控制人可推算至政府部门下属一级企事业单位)控制的公司发行的债券总额合计不得超过产品净资产的10%(利率债发行主体除外)。

5) 投资于同一行业债券的比例不得超过产品净资产的30%(行业以申万二级行业分类进行控制,申万二级行业分类由财汇数据提供),但金融债、同业存单、利率

债除外。

6) 投资于管理人及其关联方发行或承销期内承销的债券的总额不超过产品净资产的30% (包括但不限于投资于管理人及其关联方发行或承销期内承销的债券), 投资前应由管理人以书面或邮件通知的形式事先取得全体委托人同意。不得直接或间接承接管理人自营账户或其受托管理产品持有的债券。

(2) 准入要求

I、信用债 (不含公募可转债) (托管人根据全体委托人向托管人提供的负面清单及本合同约定的《信用债发行人清单》进行监控)

全体委托人将定期提供债券投资负面清单, 对于清单内客户, 严禁新增投资其发行的各类债券, 前期已投资业务应视市场情况尽快择机退出。(委托人指定发送该负面清单的专用邮箱: 【linweisigrbank@163.com、719692860@qq.com】)

信用债券的投资范围限于《信用债发行人清单》所载发行人 (金融机构除外) 发行的债券 (详见合同附件, 下同)。

II、资产支持证券 (含资产支持票据) (托管人仅据本合同约定的《信用债发行人清单》及《可投资资产支持证券清单》进行监控)

原始权益人应在合同附件《信用债发行人清单》内; 可投资资产支持证券详见合同附件《可投资资产支持证券清单》。

III、公募可转债投资限制。(托管人仅据本合同约定的《可投可转债清单》进行监控)

可投可转债详见合同附件《可投可转债清单》。

(3) 期限要求

1) 如产品剩余期限为1年以上时, 则信用债券 (公募可转债除外) 组合久期不得超过3; 如产品剩余期限为1年或者剩余期限不足1年时, 则信用债券 (公募可转债除外) 组合久期不得超过1; 经全体委托人以书面或邮件的形式一致同意后, 信用债券 (公募可转债除外) 组合久期可放宽至不超过2。

2) 债券 (金融债、利率债、公募可转债除外) 剩余期限最长不超过5年。如有投资者回售选择权的, 可以按行权日计算剩余期限。

(4) 杠杆比例

债券正回购比例最高不得超过产品净资产的40%。

5、现金管理类资产投资限制

存放同业须选择全国性中资银行为交易对手, 且不得为全体委托人共同出具的负面清单交易对手。同业存单的发行机构应为主体信用评级为AA级以上中资银行,

且不得为村镇银行。（委托人指定发送该负面清单的专用邮箱为：
【linweisigrbank@163.com、719692860@qq.com】）

6、其他投资限制

（1）本集合计划的负债比例（总资产/净资产）上限不得超过**140%**；

（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%**；
管理人管理的全部集合资产管理计划投资于同一资产的资金，不得超过该资产的**25%**。
银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券等中国证监会认可的投资品种除外；

（3）集合计划参与股票、债券、可转债、可交换债等证券发行申购时，申报的金额不得超过集合计划的总资产，申报的数量不得超过拟发行公司本次发行的总量；

（4）本集合计划不投资公募可交换债；

（5）投资于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，其底层资产将不包括产品；

（6）债券逆回购比例不得超过产品净资产的**40%**；

（7）法律法规、中国证监会以及本合同规定的其他投资限制。

7、其他交易限制要求

（1）若产品所持的债券发行人主体或其关联方出现信用违约（简称“违约债券”），持有的违约债券份额占产品净资产超过**10%**（含），管理人只能买入银行存款、同业存单、债券逆回购、国债、地方政府债、央行票据，并及时将上述情况告知全体委托人。若违约发生**2**个月后违约债券面值仍占产品净资产超过**10%**，全体委托人有权以书面或邮件的形式要求本集合计划提前终止并进入清算程序。

（2）计划到期日前**10**个交易日内禁止进行买入交易，只能进行卖出交易；不晚于计划到期日前的第**5**个交易日赎回或卖出本计划投资的全部非现金类资产（指除合同约定的现金管理类资产之外的资产）；计划到期前**1**个交易日，不得进行任何买入操作以及国债逆回购交易；计划到期当日**13:00**之后，管理人有权进行强制平仓。

（3）当信用类债券的债项评级或主体评级下降而导致信用类债券评级不符计划产品投资规定时，本计划应在自可交易之日起**10**个交易日内将不符合规定的信用类债券卖出。

（4）禁止其他按照有关法律、法规的规定禁止从事的行为。

（5）由于包括但不限于证券市场波动、债券发行人合并、组合规模变动等管理人之外的原因导致的投资比例不符合本合同约定的投资限制或投资禁止政策，为被动超标。发生被动超标时，管理人应在符合法律法规和监管规定的前提下，在发生不

符合法律法规或投资政策且可交易之日起的20个交易日内进行调整，以满足法律法规及投资政策的要求。法律法规另有规定的从其规定。”

2、托管人对资产管理计划财产的投资限制的监督和检查自本合同生效之日起开始。

3、托管人发现资产管理人的划款指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反本合同时，应当拒绝执行，立即通知管理人和委托人，并及时报告中国证监会；托管人发现管理人依据交易程序已经生效的划款指令违反法律、行政法规或其他有关规定，或者违反本合同约定的，应当立即通知管理人和委托人并及时报告中国证监会。管理人收到通知后应及时核对或纠正，并以书面形式向托管人进行解释或举证。

4、在限期内，托管人有权随时对通知事项进行复查，督促管理人改正。管理人对托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，资产托管人应报告中国证监会。

十八、资产管理计划财产的估值和会计核算

管理人应当制订健全、有效的估值政策和程序，并定期对其执行效果进行评估，保证资产管理计划估值的公平、合理。

（一）估值目的

客观、准确地反映计划资产的价值。经计划资产估值后确定的本计划各类份额的单位净值，是进行信息披露、计算参与和退出计划的基础。

（二）估值对象

资产管理计划财产项下所有金融资产及负债。

（三）估值日

本计划成立后，每个交易日对资产进行估值。

（四）估值程序

管理人每个工作日对计划资产进行估值，由管理人完成后，与托管人对当日的资产估值结果进行核对。托管人收到管理人发送的当日资产估值结果，按本合同规定的估值方法进行复核，资产估值结果复核无误后由双方约定的方式给管理人；报告期末资产估值复核与集合资产管理计划会计账目的核对同时进行。

（五）估值方法

估值坚持公允价值计量，符合本合同、《企业会计准则》、《资产管理产品相关会计处理规定》、《指导意见》以及中国证监会关于资产管理计划对金融工具进行核

算与估值的规定、资产管理计划净值计价及风险控制要求及其他法律、法规、自律组织的规定，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。对于固定收益类投资品种的估值应依据中国基金业协会证券投资基金估值工作小组的指导意见及指导价格估值。

本计划按以下方式进行估值：

（1）投资固定收益品种的估值方法

1) 同一固定收益品种同时在两个或两个以上市场交易的，按其所处的市场分别估值。

2) 已上市交易或挂牌转让的不含权固定收益品种，选取估值日第三方估值基准服务机构提供的相应品种当日的估值全价进行估值。

3) 已上市交易或挂牌转让的含权固定收益品种，选取估值日第三方估值基准服务机构提供的相应品种当日的唯一估值全价或推荐估值全价进行估值。

4) 对于交易所市场上市交易的公开发行的可转债等有活跃市场的含转股权的债券，实行全价交易的债券按估值日收盘价作为估值全价；实行净价交易的债券按估值日收盘价并加计每百元税前应计利息作为估值全价。

5) 对于含投资人回售权的固定收益品种，行使回售权的，在回售登记日至实际收款日期间以第三方估值基准服务机构提供的相应品种当日的唯一估值全价或推荐估值全价进行估值，同时充分考虑发行人的信用风险变化对公允价值的影响。回售登记期截止日（含当日）后未行使回售权的按照长待偿期所对应的价格进行估值。

6) 已上市或挂牌转让且不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。

7) 对于未上市或未挂牌转让且不存在活跃市场的固定收益品种，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定其公允价值。

8) 对于发行人已破产、发行人未能按时足额偿付本金或利息，或者有其它可靠信息表明本金或利息无法按时足额偿付的债券投资品种，第三方估值基准服务机构如在提供推荐价格的同时提供价格区间作为公允价值的参考范围以及公允价值存在重大不确定性的相关提示的，基金管理人在与基金托管人协商一致后，可采用价格区间中的数据作为该债券投资品种的公允价值。

（2）投资股票的估值方法

1) 上市流通股票按估值日其所在证券交易所的收盘价估值。

2) 上市流通股票估值日无交易的，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。

3) 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。

4) 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一股票的收盘价进行估值。

5) 流通受限股票（指在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票），按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

（3）投资证券投资基金的估值方法

1) 持有的交易所上市基金（包括封闭式基金、上市开放式基金（LOF）、创新型分级基金等），按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考监管机构或行业协会有关规定，或者类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值；

2) 持有的场外基金（包括托管在场外的上市开放式基金（LOF）），按估值日前一交易日的基金份额净值估值；估值日前一交易日基金份额净值无公布的，按此前最近交易日的基金份额净值估值；

3) 持有的货币市场基金及理财债券基金，按基金管理公司公布的估值日前一交易日的每万份收益计提红利；

4) 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）存款的估值方法

持有的银行定期存款或通知存款以本金列示，按协议或合同利率逐日确认利息收入。

若本计划现行估值汇率不再发布或发生重大变更，或市场上出现更为公允、更适合本计划的估值汇率时，管理人与托管人协商一致后可根据实际情况调整本计划的估值汇率。

（5）估值技术是指管理人和托管人协商一致的，被市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的确定公允价值的方法。如有确凿证据表明按上述规定不能客观反映计划资产公允价值的，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，按最能反映计划资产公允价值的方法估值。

(6) 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。如有新增事项或更新规定，按国家最新规定估值。

(六) 估值错误的处理

1、本集合计划各类份额的单位净值的计算精确到0.0001元，小数点后第五位四舍五入。当资产估值导致本集合计划各类份额的单位净值小数点后四位（含）以内发生差错时，视为本集合计划各类份额的单位净值错误。当发生净值计算错误时，由管理人负责处理。因计划份额净值发生估值差错造成集合计划投资者和集合计划损失的，由管理人负责先行赔偿，赔偿原则如下：赔偿仅限于因差错而导致的投资者的直接损失；管理人代表本集合计划保留要求相关当事人返还不当得利的权利；管理人在赔偿后，有权向有关责任方追偿；如果管理人计算的计划单位资产净值错误，且已由托管人复核确认后披露的，由此给计划或计划投资者造成的损失，就实际支付的赔偿金额，管理人和托管人按照各方的过错程度各自承担相应责任。

2、管理人和托管人应采取必要、适当、合理的措施确保本集合计划资产估值的准确性和及时性。当估值出现错误时，本集合计划管理人应当立即予以纠正，通知托管人并采取合理的措施防止损失进一步扩大。

3、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，按管理人的建议执行；或者管理人和托管人对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；如因管理人过错给投资者和集合计划财产造成的损失由管理人承担。

4、前述内容如法律法规、监管机构或自律组织另有规定的，按其规定处理。如果行业有通行做法，管理人及托管人应本着平等和保护集合计划持有人利益的原则进行协商确定处理原则。

(七) 估值调整的情形与处理

管理人应当确定合理的估值方法和科学的估值程序，并定期对其执行效果进行评估，必要时调整完善，保证本计划估值的公平、合理。当有充足证据表明本计划相关资产的计量方法已不能真实公允反映其价值时，管理人与托管人进行协商后，可采用公允价值计量方法对计划资产净值进行调整。

(八) 暂停估值的情形

1、资产管理计划财产所涉及的证券交易场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计划资产价值时；
 - 3、占资产管理计划相当比例的投资品种的估值出现重大转变，而管理人为保障投资者的利益，决定延迟估值的情形；
 - 4、中国证监会认定的其他情形。

（九）特殊情况的处理

管理人按估值方法的第（5）、（6）项以及本合同规定的公允价值进行估值时，所造成的误差不作为计划估值错误处理。

由于不可抗力原因，或由于证券交易所、中证登记公司、银行间市场登记结算机构及份额登记机构发送的数据错误，或由于管理人或托管人不可控制的其他原因，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，但未能发现错误的，由此造成的资产管理计划财产估值错误，管理人和托管人免除赔偿责任。但管理人和托管人应当积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。

（十）资产管理计划的会计核算

1、会计政策

- （1）本资产管理计划的会计年度为每年1月1日至12月31日。
- （2）记账本位币为人民币，记账单位为元。
- （3）资产管理计划财产的会计核算参照《资产管理产品相关会计处理规定》等国家有关会计制度法规及监管机关、自律机构有关规定执行。

2、会计核算方法

- （1）管理人、托管人应根据有关法律法规的相关规定，对资产管理计划财产独立建账、独立核算。
- （2）管理人、托管人应保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，编制会计报表。
- （3）托管人应定期与管理人就资产管理计划财产的会计核算、报表编制等进行核对。

十九、资产管理计划的费用与税收

（一）从资产管理计划财产中支付的费用种类

- 1、管理人业绩报酬（如有）；
- 2、管理人的管理费、托管人的托管费；
- 3、因本计划资金划拨支付给银行的划拨费用；

-
- 4、本计划存续期间和清算期间发生的有关会计师费、律师费等；
 - 5、资产管理计划财产的证券、期货（如有）等账户的开户费用以及证券、期货（如有）等投资交易费用；
 - 6、资产管理计划成立后的资产管理计划信息披露费用；
 - 7、资产管理计划成立后与资产管理计划有关（包括违约处置）的注册登记费、会计师费、审计费、律师费、仲裁费、诉讼费、保全费及其他实现债权所产生的费用等（如有）；
 - 8、本计划运营过程中发生的增值税以及与缴纳税收有关的手续费、汇款费等；
 - 9、本合同约定、法律法规规定可以在本计划资产中列支的其他费用。

（二）费用支付标准、计算方法、支付方式和时间

1、托管人的托管费

不同类别份额的托管费分别计算，从相应类别份额的资产净值中扣除。不同类别份额的分类情况及分类条件详见“八、资产管理计划的参与、退出与转让”“（九）集合计划份额的分类”。

本计划各类别份额的托管费按前一自然日该类份额资产净值的年费率计提。本计划的年托管费率为0.03%。计算方法如下：

$$H=E \times 0.03\% \div 365$$

H 为各类份额每日应计提的托管费；

E 为前一自然日该类份额资产净值。

托管人的托管费每日计提，按季支付，于下个季度首日起5个工作日内按管理人指令从本计划资产中一次性支付，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。若管理人在约定的托管费支付日未向托管人发送托管费划付指令的，托管人有权在托管费支付日当日或下一个工作日自行扣收全部或部分应付未付托管费。若因不可抗力或本计划资产无法及时变现致使无法按时支付托管费的，则在不可抗力或无法变现情形消除后的首个工作日与管理人协商一致后支付。费用扣划后，基金管理人应对支付实际情况进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

2、管理人的固定管理费

不同类别份额的管理费分别计算，固定管理费从相应类别份额的资产净值中扣除。不同类别份额的分类情况及分类条件详见“八、资产管理计划的参与、退出与转让”“（九）集合计划份额的分类”。

本计划各类别份额的固定管理费按前一自然日该类份额资产净值的0.1%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.1\% \div 365$$

H 为各类份额每日应计提的固定管理费；

E 为前一自然日该类份额资产净值。

本计划各类别份额的固定管理费每日计提，按自然季度支付。由托管人根据管理人发送的投资指令，在根据与管理人核对一致的估值数据以及按照上述公式进行核对后，按指令的时间在每个自然季初的5个工作日内向管理人指定的管理费账户进行资金支付。若因不可抗力或持有的资产管理计划财产无法及时变现致使无法按时支付的，则在不可抗力或无法变现的情形消除后的首个工作日支付。本合同终止（包括提前或延期）后，依据清算程序支付管理人尚未收取的管理费。

3、管理人的业绩报酬

（1）管理人收取业绩报酬的原则

1) 按投资者每笔参与份额分别计算年化净收益率并计提业绩报酬。

2) 符合业绩报酬计提条件时，在委托人份额退出日或本集合计划终止日计提业绩报酬。

3) 委托人申请退出时，管理人按“先进先出”的原则，即按照委托人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

业绩报酬计提日为委托人份额退出日或本集合计划终止日。每份集合计划份额的业绩报酬以该笔份额上一个实际发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日（如无上一个实际发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日，初始募集期参与的为本集合计划成立日，存续期参与的为参与当日，下同）至本次业绩报酬计提日期间的年化净收益率R，作为计提业绩报酬的基准。

$$R = \frac{A - B}{C} \times \frac{365}{D} \times 100\%$$

A为本次业绩报酬计提日某类集合计划份额的累计单位净值；

B为该笔份额上一个实际发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日的累计单位净值；

C为该笔份额上一个实际发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日的单位净值；

D为该笔份额上一个实际发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日与本次业绩报酬计提日的间隔天数。

本计划业绩报酬（Hi）按累进方式计算，具体如下：

1) 当 $0\% < R \leq \mathbf{【5.5\%】}$ 时，管理人对委托人退出份额对应规模按0.2%/年计提业绩报酬（Gi），即 $G_i = \text{退出日或终止日该笔份额资产净值} \times 0.2\% \times (D \div 365)$ ，该集合计划

份额收益扣除 G_i 后需为正值，否则不得计提，且计提的业绩报酬不得超过该笔集合计划份额 0% 以上的超额收益部分的 60%，计算公式为 $H_i = \min[(R - 0\%) \times 60\% \times C \times F \times (D \div 365), G_i]$ ，其中 F 为该笔提取业绩报酬的份额。

2) 当【5.5%】 $< R \leq$ 【5.7%】时，管理人在1)的基础上，再对该笔集合计划份额【5.5%】以上的超额收益部分提取10%的业绩报酬，计算公式为：

$$H_i = \min[(5.5\% - 0\%) \times 60\% \times C \times F \times (D \div 365), G_i] + (R - 5.5\%) \times 10\% \times C \times F \times (D \div 365)$$

3) 当【5.7%】 $< R \leq$ 【5.9%】时，管理人在2)的基础上，再对该笔集合计划份额【5.7%】以上的超额收益部分提取15%的业绩报酬，计算公式为：

$$H_i = \min[(5.5\% - 0\%) \times 60\% \times C \times F \times (D \div 365), G_i] + [(5.7\% - 5.5\%) \times 10\% + (R - 5.7\%) \times 15\%] \times C \times F \times (D \div 365)$$

4) 当 $R >$ 【5.9%】时，管理人在3)的基础上，再对该笔集合计划份额【5.9%】以上的超额收益部分提取20%的业绩报酬，计算公式为：

$$H_i = \min[(5.5\% - 0\%) \times 60\% \times C \times F \times (D \div 365), G_i] + [(5.7\% - 5.5\%) \times 10\% + (5.9\% - 5.7\%) \times 15\% + (R - 5.9\%) \times 20\%] \times C \times F \times (D \div 365)$$

业绩报酬计提基准仅用于约定计提业绩报酬的标准，不构成资产管理人对集合计划收益的承诺或保证。

在委托人退出和集合计划终止时提取业绩报酬的，业绩报酬 H_i 从退出资金中扣除。

(3) 业绩报酬支付

由管理人向托管人发送业绩报酬划付指令，托管人于5个工作日内将业绩报酬划拨给登记结算机构，由登记结算机构将业绩报酬支付给管理人。若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

4、上述（一）中其他项费用由托管人根据其他有关法规及相应协议的规定，按费用支出金额根据管理人的投资指令进行支付，列入或摊入当期资产管理计划财产运作费用。

(三) 不列入资产管理业务费用的项目

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

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

3、其他根据相关法律法规及中国证监会、基金业协会的有关规定不得列入计划

费用的项目。

（四）管理人和托管人可协商调减托管费，并在新的费率开始实施前3个工作日在管理人指定网站公告。管理人公告托管费等费用的调整，应在公告前将相关公告传真至托管人，并与托管人电话确认。本合同另有约定的，从其约定。

（五）税收

本计划运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按其适用的税收法律法规执行。因境外投资收到的分红、利息、股息等相关收入以标的管理人或其境外行政管理人派发的金额为准，直接确认收益。投资者应缴纳的税收，由投资者负责，管理人不承担代扣代缴或纳税的义务。

本资产管理计划在投资和运作过程中如发生增值税等应税行为，相应的增值税、附加税费以及可能涉及的税收滞纳金等由资产管理计划财产承担，届时管理人可通过本计划托管账户直接缴付，或划付至管理人账户并由管理人按照相关规定申报缴纳。如果管理人先行垫付上述增值税等税费的，管理人有权从资产管理计划财产中划扣抵偿。若本计划存续期间进行收益分配或开放赎回后，因本计划资产管理计划财产运营所涉相关税费存在应缴但未缴情形的，或本计划终止后出现税务主管部门向管理人/托管人追缴本计划资产管理计划财产运营的相关税收及可能涉及的滞纳金等的，管理人、托管人有权向投资者追偿。托管人根据管理人发送的符合本合同约定的投资指令进行相应的资金汇划。

二十、资产管理计划的收益分配

（一）收益的构成

本计划收益包括：

- 1、投资所得红利、股息、债券利息和基金红利；
- 2、买卖证券价差；
- 3、银行存款利息；
- 4、其他合法收入。

（二）收益分配原则

- 1、每一份额享有同等分配权；
- 2、收益分配的基准日为可供分配利润的计算截止日。计划收益分配基准日该类别份额的份额净值减去每单位份额收益分配金额后不能低于初始面值。
- 3、本计划在存续期间不分红，展期时在原终止日向委托人进行收益分配除外。

4、收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。

5、法律法规或中国证监会另有规定的从其规定。

（三）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，由管理人在网站公示报告委托人。管理人至少T-1工作日之前（T为权益登记日）将收益分配方案向委托人公告，具体以管理人的公告为准。

（四）收益分配方式

本计划仅限现金分配方式。管理人向托管人发送划付指令，托管人根据指令将收益分配款项划入登记结算机构，登记结算机构将收益分配款在除权除息日后3个工作日内划入相应销售机构结算账户，由销售机构划入投资者的交易账户。

二十一、信息披露与报告

（一）向投资者提供的报告

1、年度报告

管理人每年度向投资者提供一次准确、完整的管理年度报告，年度报告的内容应包括但不限于下列信息：

- （1）管理人履职报告；
- （2）托管人履职报告；
- （3）资产管理计划投资表现；
- （4）资产管理计划投资组合报告；
- （5）资产管理计划运用杠杆情况（如有）；
- （6）资产管理计划财务会计报告；
- （7）资产管理计划支付的管理费、托管费、业绩报酬（如有）等费用的计提基准、计提方式和支付方式；
- （8）资产管理计划投资收益分配情况；
- （9）投资经理变更、重大关联交易等涉及投资者权益的重大事项；
- （10）中国证监会规定的其他事项。

资产管理年度报告由管理人编制，经托管人复核后由管理人公告，并报相关监管机构或自律组织等备案。上述报告应由管理人于每年度截止日后4个月内通过管理人网站通告。本集合计划成立不足3个月或存续期间不足3个月时，可以不编制当期的年度报告。若中国证监会等监管机构对集合资产管理计划信息披露时间另有规定

的，从其规定。

2、季度报告

管理人每季度向投资者提供一次准确、完整的管理季度报告，季度报告的内容应包括但不限于下列信息：

- (1) 管理人履职报告；
- (2) 托管人履职报告；
- (3) 资产管理计划投资表现；
- (4) 资产管理计划投资组合报告；
- (5) 资产管理计划运用杠杆情况（如有）；
- (6) 资产管理计划支付的管理费、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；
- (7) 资产管理计划投资收益分配情况；
- (8) 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；
- (9) 中国证监会规定的其他事项。

资产管理季度报告由管理人编制，经托管人复核后由管理人公告，并报相关监管机构或自律组织等备案。上述报告应由管理人于每季度截止日后一个月内通过管理人网站通告。本集合计划成立不足三个月或存续期间不足三个月时，可以不编制当期的季度报告。若中国证监会等监管机构对集合资产管理计划信息披露时间另有规定的，从其规定。

3、净值报告

本计划成立后，开放期内每个工作日披露截至前一个工作日经托管人复核的集合计划份额净值。封闭期内每周第一个工作日披露前一个工作日经托管人复核的集合计划的份额净值。本集合计划的计划份额净值、计划累计份额净值等信息将在管理人指定网站上向合格投资者披露，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。

4、临时报告

发生本合同约定的、可能影响投资者利益的重大事项时，管理人或托管人应当在事件发生之日起5日内及时通知投资者：

- (1) 投资经理发生变动；
- (2) 投资顾问（如有）发生变动；
- (3) 涉及管理人、计划财产、资产托管业务的重大诉讼；
- (4) 管理人、托管人托管业务部门与本合同项下资产管理计划财产相关的行为

受到监管部门的严重行政处罚；

(5) 管理人及其董事、总经理及其他高级管理人员、投资经理受到严重行政处罚，托管人的托管业务或托管业务部门负责人受到严重行政处罚；

(6) 法律法规、监管机构、自律组织的其他事项。

5、资产管理计划年度财务会计报告应当经符合规定的会计师事务所审计，审计机构应当对资产管理计划会计核算及净值计算等出具意见。

6、为免疑义，管理人向投资者提供的上述报告，不包括反映本计划交易过程的交易明细及交易凭证等信息。

7、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，应向投资者充分披露。

(二) 向投资者提供报告及投资者信息查询的方式

管理人向投资者提供的报告，将严格按照以下至少一种方式进行。在存有代销机构的情况下，管理人将上述信息通知到代销机构，视为已通知到投资者。投资者有义务随时与代销机构保持联系，了解有关本计划的各项信息。

1、管理人网站

资产管理合同、计划说明书、定期报告、临时报告等有关本资产管理计划的信息将在管理人网站上披露，投资者可随时查阅。

管理人网站：www.dfham.com

2、邮寄服务

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

3、传真或电子邮件

如投资者留有传真号、电子邮箱等联系方式的，管理人也可通过传真、电子邮件、电报等方式将报告信息通知投资者。

(三) 向监管机构提供的报告

管理人、托管人应当根据法律法规和监管机构及自律组织的要求履行报告义务。

(四) 信息保密义务

投资者根据上述资产管理合同的约定从管理人处获取的相关数据，仅供用于投资者了解本资产管理计划资产管理计划财产的相关投资状况，不得擅自以任何形式对外泄露、报导、转送，投资者不利用获取的相关数据进行内幕交易、不公平交易或者操作市场等其他违反证券法等法律法规的规定，不得向除投资者所指定数据接收

人之外的其他方披露该等数据，法律法规另有规定或监管机关另有要求的除外。

投资者须采取必要的措施，将相关数据的知情者控制在最小范围内，不得在公司内部非业务相关部门或个人之间以任何形式传播，保证相关信息不被内部工作人员及外部相关人员利用获取的相关数据进行违法违规的交易。如违反前述义务，投资者应赔偿管理人因此造成的所有损失。

二十二、风险揭示

计划投资可能面临下列各项风险，包括但不限于：

（一）资产管理计划面临的一般风险

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

在发生揭示的风险及其他尚不能预知的风险而导致本计划项下计划财产重大损失的，投资者可能发生本金损失的风险。

本计划为固定收益类资产管理产品，风险等级为R2，具有中低风险和收益的特征，适合风险识别、评估、承受能力评级为C2、C3、C4、C5的合格投资者和专业投资者。

如果相关法律法规规则要求或因实际情况需要等，需调高或调低本计划风险等级的，管理人可以调整产品风险等级，并及时以公司网站公告等方式告知投资者，无需进行合同变更，法律法规另有规定的除外。

2、市场风险

证券、期货市场价格受到经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素的影响，导致资产管理计划财产收益水平变化，产生风险，主要包括：

（1）政策风险

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

（2）经济周期风险

随经济运行的周期性变化，证券、期货市场的收益水平也呈周期性变化。资产管理计划财产投资于债券与上市公司的股票，收益水平也会随之变化，从而产生风险。

（3）利率及汇率风险

金融市场利率的波动会导致证券市场价格和收益率的变动。利率直接影响着债

券的价格和收益率，影响着企业的融资成本和利润。资产管理计划财产投资于债券和股票，其收益水平会受到利率变化的影响。同时汇率波动会对利率水平造成影响，从而影响债券的价格和收益率，最终影响资产投资的收益水平。

（4）企业经营风险

企业的经营好坏受多种因素影响，如管理能力、财务状况、市场前景、行业竞争、人员素质等，这些都会导致企业的盈利发生变化。如果资产管理计划财产所投资的企业经营不善，其股票及债券价格可能下跌，或者能够用于分配的利润减少，使资产管理计划财产投资收益下降。虽然资产管理计划财产可以通过投资多样化来分散这种非系统风险，但不能完全规避。

（5）购买力风险

资产管理计划财产的利润将主要通过现金形式来分配，而现金可能因为通货膨胀的影响而导致购买力下降，从而使资产管理计划财产的实际收益下降。

（6）债券收益率曲线风险

债券收益率曲线风险是指与收益率曲线非平行移动有关的风险，单一的久期指标并不能充分反映这一风险的存在。

（7）再投资风险

再投资风险反映了利率下降对固定收益证券本息收入再投资收益的影响，这与利率上升所带来的价格风险（即前面所提到的利率风险）互为消长。具体为当利率下降时，资产管理计划财产从投资的固定收益证券所得的本息收入进行再投资时，将获得比之前较少的收益率。

3、管理风险

在资产管理计划财产管理运作过程中，管理人的研究水平、投资管理水平直接影响资产管理计划财产收益水平，如果管理人对经济形势和证券、期货市场判断不准确、获取的信息不全、投资操作出现失误，都会影响资产管理计划财产的收益水平。

资产管理人依据资产管理合同的约定管理和运用资产管理计划财产所产生的风险，由资产管理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

本计划在建仓时，若标的流动性差，可能会产生一定的冲击成本，从而影响资产管理计划财产的收益水平。

在市场或个股流动性不足的情况下，管理人可能无法迅速、低成本地调整投资

计划，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，从而对计划收益造成不利影响。

在投资者在开放期内参与或退出资产管理计划导致资产管理计划财产规模变动时，可能存在现金不足的风险和现金过多带来的收益下降风险。

当本计划出现巨额退出或连续巨额退出等本合同约定情形，管理人有权暂停退出、延期退出或延期支付退出款项，该等情形的发生将直接影响投资者投资变现。

本计划在封闭期内不接受投资者的退出申请，也不接受违约退出，从而导致投资者的投资无法及时变现，有一定的流动性风险。

5、信用风险

信用风险是债务人的违约风险，主要体现在信用产品中。在资产管理计划财产投资运作中，如果管理人的信用研究水平不足，对信用产品的判断不准确，可能使资产管理计划财产承受信用风险所带来的损失。

本计划交易对手方发生交易违约（未能实现交易时的承诺按时足额还本付息或者未能按时履约等）或者计划持仓债券的发行人拒绝或者未按时支付债券本息，导致资产管理计划财产损失。

6、募集失败风险

初始募集期届满，如资产管理计划未达到成立条件，或初始募集期内发生使本集合计划无法成立的不可抗力，集合计划募集失败，投资者将因此面临终止投资的风险。

管理人应当承担下列责任：

- （1）以固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用；
- （2）在募集期届满后三十日内返还投资者已缴纳的款项，并加计银行同期活期存款利息。返还完毕各方互不承担其他责任。

7、关联交易及利益冲突风险

（1）投资者知悉，管理人可以根据本合同约定的程序和方式以资产管理计划财产从事一般关联交易、重大关联交易（以下统称关联交易），均存在因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。管理人承诺关联交易应按照市场通行的方式和条件进行。此外，管理人运用资产管理计划财产从事关联交易时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，进而可能影响资产管理计划财产的投资收益。管理人遵循投资者利益优先和审慎原则，根据本合同的约定参与关联交易，尽管管理人确认将确保该等交易安排合法合规、不存在利益输送等违法违规行为，但该等交易仍构成关联交易，存在利益冲突风险。

除了上述风险以外，一般关联交易、重大关联交易还分别存在以下风险：

1) 对于资产管理计划涉及的一般关联交易事项，管理人可以根据本合同的约定与投资者的授权以资产管理计划资产从事一般关联交易，管理人无需就前述具体一般关联交易再行分别取得投资者授权，因此投资者承担管理人未经投资者另行同意直接开展一般关联交易的风险。

2) 对于资产管理计划涉及的重大关联交易事项，为保护投资者权益，管理人应当根据本合同的约定提前取得投资者同意，但投资者仍然面临关联交易可能造成的风险。

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。

管理人承诺关联交易应按照市场通行的方式和条件进行，投资者认可此等关联交易情形的存在并自愿承担相关投资风险。

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

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

8、操作或技术风险

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引致的风险，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。

在计划的各种交易行为或者后台运作中，可能因为技术系统的故障或者差错而影响交易的正常进行或者导致投资者的利益受到影响。这种技术风险可能来自基金管理公司、注册登记机构、销售机构、证券交易所、证券注册登记机构等。

9、税收风险

根据财政部和国家税务总局《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税

政策的通知》（财税[2016]140号文）、《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》（财税[2017]2号文）、《关于资管产品增值税有关问题的通知》（财税[2017]56号文）及其后续颁布的具体征收管理办法等相关文件（若有）中“资管产品运营过程中发生的增值税应税行为”需缴纳的增值税及附加相关规定，资管产品应缴纳的增值税及附加由计划资产承担，管理人有权以计划财产予以缴纳，且无需事先征得投资者的同意，由此会导致计划资产投资收益减少。如果管理人在向投资者交付相关收益或资产后税务机关要求管理人缴纳相关税费的，投资者应按照管理人通知要求进行缴纳；投资者不得要求管理人以任何方式向其返还或补偿该等税费。

本合同约定收取的管理费、托管费、业绩报酬（如有）均不含上述“资管产品运营过程中发生的增值税应税行为”需缴纳的增值税及附加。本计划在运营过程中发生的增值税等应税行为需缴纳的增值税及相关附加，由计划资产承担，将导致计划收益减少，净值下降，从而带来风险。

此外，在本资产管理计划存续期间，税收征管部门可能会对增值税等应税行为的认定以及适用的税率等进行调整。届时，管理人将执行更新后的政策，可能会因此导致资产管理计划财产实际承担的税费发生变化。该等情况下，管理人有权根据法律法规及税收政策的变化相应调整税收处理，该等调整可能会影响到投资者的收益。由于前述税收政策变化导致对资产管理计划财产的收益影响，将由持有存续资产管理计划单位的投资者承担。对于现有税收政策未明确事项，本资产管理计划主要参照行业协会建议方案进行处理，可能会与税收征管认定存在差异，从而产生税费补缴及滞纳金，该等税费及滞纳金将由资产管理计划财产承担。

资产管理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。

10、交易所资金前端控制带来的风险

本资产管理计划由管理人作为交易参与人通过交易单元在上海和深圳证券交易所进行证券交易。根据《证券交易资金前端风险控制业务规则》等有关规定，证券交易所、证券登记机构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。可能存在如下风险：

（1）管理人操作失误，合计资产总额发生变动导致最高额度未能及时变更等，存在影响产品正常交易、无法有效进行风险控制等风险。

（2）因不可抗力、意外事件、技术故障或者重大差错等原因导致资金前端控制出现异常，中国结算及沪、深交易所采取最高额度调整、暂停资金前端控制、限制交易单元接入等处置措施，产生业务风险。

本资产管理计划可能因上述业务规则而无法完成某笔或某些交易，由此造成的损益由计划财产承担。

11、巨额退出造成份额净值波动加大的风险

集合计划T日发生巨额退出时，由于T日的管理费、托管费按照前一日集合计划资产净值计提；同时，本集合计划份额净值的计算精确到0.0001元，小数点后第五位四舍五入，退出金额以T日计划份额净值为基准进行计算，因四舍五入原因可能造成一定偏差。当剩余集合计划份额数远小于退出份额数时，当日计划份额净值可能发生较大波动。投资者应关注份额净值波动情况并承担由此带来的风险及后果。

12、本计划展期或提前终止的风险

若发生本合同约定的展期或提前终止情形时，将可能导致投资者无法按照预期安排投资或无法按时收回投资或投资收回金额、时间不及预期等风险。

13、集合计划投资者达到人数上限时无法参与的风险

本集合计划投资者人数上限200人。集合计划达到一定人数时，管理人有权停止认/申购。投资者可能面临因上述原因而无法参与本集合计划的风险。

14、合同变更的风险

(1) 根据本合同约定，资产管理合同可以依照约定程序进行合同变更。投资者可能面临合同变更的风险。

(2) 除本合同约定可由管理人自行决定变更、以及可由管理人和托管人协商后变更的事项外，如需发生变更的，管理人将向投资者发送合同变更征询意见函，投资者可选择在指定开放期退出或继续参与本集合计划。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。另外，合同中约定：

1) “投资者不同意变更的，应在征询意见函发出后的最近一个开放期或管理人设置的合同变更临时开放期内（以下统称“指定开放期”）提出退出本集合计划的申请；投资者未在前述时间回复意见也未在指定开放期退出计划的，视为投资者同意合同变更”。在此情况下，投资者对默认情况的忽略或误解，可能存在潜在风险。

2) “对于明确答复不同意合同变更但逾期未退出本集合计划的投资者，管理人将统一在合同变更生效日次一工作日做强制退出处理（退出价格为退出当日的计划份额净值）”，在此情况下，会导致投资者的计划份额减少至零。

(二) 资产管理计划面临的特定风险

1、投资标的风险及特定的投资方法及资产管理计划财产所投资的特定投资对象

可能引起的特定风险

（1）债券投资的利率风险及价格波动风险

利率是影响债券价格的重要因素，当利率上升时，债券价格将下跌；当利率下降时，债券的价格将上升。债券投资面临着由于市场利率波动而导致的债券价格波动风险。此外，信用债信用风险的变化、债券市场流动性不足等其他因素均可能导致债券价格的波动，债券投资面临着债券价格波动的风险。

（2）股票投资及股票价格波动风险

本计划投资的股票面临经济周期风险、政策风险、行业风险、上市公司经营风险等，这些都会导致股票价格发生波动，进而影响本计划的投资收益。此外，本计划在投资管理中可能将维持部分股票投资比例，因此无法完全规避股票市场的下跌风险。投资者须在理性判断的基础上做出投资选择。

（3）基金投资风险

1) 价格波动风险，由于投资标的的价格会有波动，基金的净值也会因此发生波动。封闭式基金的价格与基金的净值之间是相关的，一般来说基本是同方向变动的，如果基金净值严重下跌，一般封闭式基金的价格也会下跌。而开放式基金的价格就是基金份额净值，开放式基金的申购和赎回价格会随着净值的下跌而下跌。所以本计划会面临基金价格变动的风险。如果基金价格下降到买入成本之下，在不考虑分红因素影响的情况下，本计划会面临亏损风险。

2) 流动性风险，对于封闭式基金而言，当要卖出基金的时候，可能会面临在一定的价格下无法卖出而要降价卖出的风险；另外，巨额赎回风险是开放式基金所特有的一种风险，即当单个交易日基金的净赎回申请超过基金总份额的百分之十时，本计划将可能无法及时赎回持有的全部基金份额，影响本计划的资金安排。

（4）回购业务的风险

1) 信息提供的风险

本计划开展回购交易时，如果根据届时法律规定、监管政策并按照交易对手的要求需要提供本计划投资者、资产规模、财务状况、偿付能力、杠杆水平等相关产品信息及资料，投资者同意管理人向相关交易对手和监管机构提供该等信息，否则可能影响本计划正常开展回购交易。因投资者不符合相关要求或未配合提供相关信息及资料所产生的后果由投资者承担，管理人不承担任何责任。

2) 正回购的投资风险

正回购即融资回购，是一方以一定规模证券向另一方作抵押融入资金，并承诺在日后再从另一方购回所抵押证券的交易行为。抵押证券所获得的资金可以再行投

资或抵押，相当于放大原始资金的倍数，具有较大的投资风险。

2、未在证券投资基金业协会完成备案或无法及时完成备案的风险

本计划成立后需在基金业协会进行备案。除非以现金管理为目的投资于银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券、货币市场基金等中国证监会认可的投资品种外，资产管理计划在完成基金业协会备案前不得开展投资活动。

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

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

3、预警线和止损线风险

本计划设置预警线**0.98**、止损线**0.96**；执行预警止损线的估值方式需为能体现产品市场公允价值的估值方式。

1) 预警线**0.98**：

任一交易日（T日）日终本计划单位净值小于或等于预警线时：

①管理人应以书面或邮件的形式及时通知委托人，管理人应降低账户的股票仓位至不超过产品净资产的**15%**；

②原则上不允许单只可转债转股，但转（换）股后的股票总市值大于转股前的债券市值的**110%**（含）且预计在转股后**5**个工作日内能全部卖出的除外；

③**T+1**日起**20**个工作日内逐步降低正回购比例至不高于净资产的**20%**；

④当本计划单位净值回升至**1.00**元以上时，上述限制自动取消。

2) 止损线：**0.96**。

任一交易日（T日）日终本计划单位净值小于或等于止损线时，管理人应以书面或邮件的形式及时通知全体委托人，并从**T+1**日起对本计划持有的资产执行强制卖出操作，直至本计划的资产全部变现，本计划提前结束；若全体委托人在**T+1**日未提出异议，则管理人从**T+1**日起对本计划持有的资产执行强制卖出操作，直至本计划的资产全部变现，本计划提前结束（若全体委托人对资产强制卖出操作起始日期有其他要求的，管理人应按照修订后的日期进行止损操作，全体委托人可以提出异议终止止损操作，修订后的日期或提出异议前本计划已变现的资产不受影响）；期间变现所

得现金经全体委托人同意后可进行逆回购、同业存单或1年以内的利率债等现金管理操作。本集合计划投资于存款、债券等债权类资产的比例低于80%的持续时间达到6个月后，本集合计划提前终止进入清算程序。

4、触及止损线后提前结束的风险

本集合计划运行期间，在本集合计划被强制止损、所有投资标的全部变现，本集合计划提前终止，从而给委托人带来一定的风险。

5、使用电子签名合同的风险

投资者若以电子签名方式签订本集合计划合同及风险揭示书的，投资者签订《电子签名约定书》，即表明投资者同意在销售机构认购/参与集合资产管理计划过程中使用电子合同、电子签名。投资者通过身份验证登录销售机构指定的网络系统，确认同意接受相关电子签名合同、风险揭示书或其他文书的，视为签署合同、签署风险揭示书或其他文书，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的法律效力，无须另行签署纸质合同、纸质风险揭示书或其他文书。投资者应积极采取安全措施、妥善保管密码，经投资者密码等有效身份验证登录投资者账户后的所有操作视同投资者本人行为，投资者需承担由此产生的一切民事责任和法律后果。

此外，若以电子签署方式签署合同的，由于使用电子签名，在集合计划的交易过程当中，可能存在以下风险：

（1）由于互联网和移动通讯网络数据传输等原因，交易指令可能会出现中断、停顿、延迟、数据错误等情况；

（2）投资者账号及密码信息泄露或客户身份可能被仿冒；

（3）由于互联网和移动通讯网络上存在黑客恶意攻击的可能性，网络服务器可能会出现故障及其他不可预测的因素，交易信息可能会出现错误或延迟；

（4）投资者的网络终端设备及软件系统可能会受到非法攻击或病毒感染，导致电子签名合同数据无法传输或传输失败。

（三）其它风险

1、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，可能导致资产管理计划财产的损失；

2、金融市场危机、行业竞争、代理商违约等超出管理人自身直接控制能力之外的风险，也可能导致投资者利益受损。

此外，依照“风险”作为一种“可能性”的固有属性，任何风险揭示（包括本合同及相关风险提示函所揭示事项）均无法穷尽未来可能出现的所有风险，投资者与资产

管理计划财产仍可能面临其他会造成损失的不确定因素和风险，此事项属于管理人揭示的重要风险。

二十三、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、各方书面一致同意，以下事项可由管理人自行决定变更：

- （1）调低管理人的报酬标准；
- （2）投资经理的变更；
- （3）调高或调低本计划的风险等级；
- （4）法律法规规定或本资产管理合同约定的其他情形。

2、各方书面一致同意，以下事项可由管理人和托管人协商后变更：

- （1）调低托管人的报酬标准；
- （2）因法律、法规、规章、中国证监会的规定、证券投资基金业协会自律管理规则、证券登记结算机构业务规则以及证券交易所等交易规则颁布或修订，或相关监管机构或自律组织对本集合计划备案补正意见的要求涉及到合同修改的，管理人经与托管人协商，可以对本集合计划合同及说明书与新的法律法规或有关政策不一致的内容进行更新或修改，或根据相关监管机构或自律组织备案补正意见的要求对本合同及说明书进行修改，更新或修改的内容不得违反法律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五个工作日后生效；
- （3）法律法规规定或本资产管理合同约定的其他情形。

3、除特别约定所述事项外，前文第1项、第2项所述之外的其余事项如需发生变更的，管理人和托管人应书面达成一致并在管理人网站公告。管理人须在公告后5个工作日内以管理人指定网站公告或邮寄等方式向投资者发送合同变更征询意见函。投资者不同意变更的，应在征询意见函发出后的最近一个开放期或管理人设置的合同变更临时开放期内（以下统称“指定开放期”）提出退出本集合计划的申请；投资者未在前述时间回复意见也未在指定开放期退出计划的，视为投资者同意合同变更。投资者不同意变更的，管理人对其采取如下权利保障措施及后续安排：

投资者不同意变更的，管理人保障其退出集合计划的权利；对于明确答复不同意合同变更但逾期未退出本集合计划的投资者，管理人将统一在合同变更生效日次日一工作日做强制退出处理（退出价格为退出当日的计划份额净值）。

投资者同意，无论其是否提出退出申请，管理人经与托管人书面达成一致后变

更本合同的行为均不应被视为或裁定为管理人或托管人的违约行为。

合同变更于指定开放期结束后的第一个工作日起生效，公告内容即成为本合同组成部分。

资产管理计划改变投向和比例的，应当事先取得投资者和托管人同意，并履行合同变更程序。

特别约定：

(1) 在本集合计划投资者人数少于3名（含3名）的情况下，经全体投资者、管理人、托管人同意，也可通过签署补充协议的方式进行合同变更，采用该等方式变更合同的，可不受上述合同变更程序限制。

(2) 合同附件《可投股票及ETF清单》、《可投资产支持证券清单》、《可投可转债清单》、《信用债发行人清单》（以下简称《投资清单》）的变更通过以下程序进行：管理人通过授权邮箱以邮件方式向全体委托人和托管人发送变更后的《投资清单》（可变更上述附件中的任何一个或多个），全体委托人和托管人均通过授权邮箱明确回复同意变更的意见后，该变更生效，生效时间为管理人收到最后一方回复同意的意见之日。

管理人授权邮箱：yuyingqiang@dfham.com、yaoxueqiao@dfham.com、yaokaiwen@dfham.com、zhouyan@dfham.com

委托人授权邮箱：linweisigrbank@163.com、719692860@qq.com、1851208246@qq.com

托管人授权邮箱：zctg_gzhs@grcbank.com、qingmiao@grcbank.com、liqing@grcbank.com

变更上述邮箱地址的，需通过原授权邮箱地址向其他两方发送新的授权邮箱地址及变更起始时间，自邮件注明的变更起始时间起，其他两方接受新的授权邮箱地址发送的意见，并不再接受原授权邮箱地址发送的任何意见。

4、发生下列事项时，应由承接的管理人或托管人承接合同相应的权利与义务，并按上述第3项履行合同变更程序：

(1) 管理人被依法撤销资产管理业务资格或者依法解散、被撤销、宣告破产，资产管理计划由其他管理人承接。发生此等情形时，原管理人应当向新的管理人交接本资产管理计划资产管理事务。

(2) 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，资产管理计划由其他托管人承接。发生此等情形时，原托管人应当向新的托管人交接本资产管理计划资产托管事务。

5、管理人应当合理保障合同变更后投资者选择退出资产管理计划的权利，具体以管理人相关公告为准。

6、资产管理合同发生变更的，管理人应按照证券投资基金业协会要求及时向证券投资基金业协会备案，并抄报中国证监会相关派出机构。合同变更后，投资者、管理人和托管人应当按照变更后的合同行使相关权利，履行相应义务。

（二）资产管理计划/合同的展期

本集合计划存续期满，若符合展期的条件，则可以展期：

1、展期的条件

（1）资产管理计划运作规范，管理人、托管人未违反法律、行政法规、中国证监会规定和资产管理合同的约定；

（2）资产管理计划展期没有损害投资者利益的情形；

（3）中国证监会规定的其他条件。

本集合计划展期的，还应当符合本集合计划的成立条件。

2、展期的程序与期限

（1）展期的程序：

1) 展期的公告

集合计划符合展期条件拟展期时，管理人在管理人指定网站上公告，管理人将同时公告集合计划的具体展期方案。

2) 投资者答复

管理人应在上述公告后15个工作日内通过管理人指定网站或以书面或电子邮件等方式将展期相关事宜通知投资者，征求投资者意见，投资者应根据管理人指定网站上公告要求在规定的期限内明确意见。若投资者同意本集合计划展期，则投资者应根据管理人指定网站公告要求在规定的期限内重新签订资产管理合同。截至存续期届满日，投资者未给出明确答复的，视为不同意展期。

3) 不同意展期的投资者所持有份额的处理办法

展期经管理人指定网站公告后，不同意展期的投资者，可以在原存续期届满前的开放日通过销售机构办理退出手续；未在原存续期届满前的开放日办理退出手续的，管理人保障投资者到期合法终止合同的权利，管理人将在本集合计划原存续期届满之日将该部分投资者份额全部退出。

4) 展期的成立

存续期满，集合计划符合展期条件，管理人将在存续期满后10个工作日之内公告本集合计划展期成立。

5) 展期的失败

若集合计划展期失败，本集合计划将进入清算终止程序。

(2) 展期的期限：管理人应在公告具体展期方案时确定展期的具体期限。

3、展期情况备案

本集合计划展期后5个工作日内，管理人将展期情况公告并按照法律法规要求报相关监管机构或自律组织等备案。

(三) 资产管理计划合同的终止

资产管理计划合同终止的情形，包括但不限于下列事项：

1、合同期限届满而未展期的；

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、持续五个工作日计划投资者少于2人的；

6、未在证券投资基金业协会完成备案或发生不予备案的情形；

7、全体委托人有权根据考核日产品实际收益率情况以书面或邮件的形式要求提前终止本计划/合同；

8、若在投资过程中，管理人存在投资策略漂移等违反合同约定的行为时，全体委托人有权以书面或邮件的形式要求提前终止本计划/合同。

9、法律、行政法规、中国证监会规定及资产管理合同约定的其他情形。

管理人应当自资产管理计划终止之日起五个工作日内报证券投资基金业协会备案，并抄报中国证监会相关派出机构，前述第6项约定的情形除外。

(四) 资产管理计划的清算

1、清算小组的成立及职责

资产管理计划在发生终止情形之日起五个工作日内成立财产清算小组，按照监管机构的相关规定进行集合计划清算。资产管理计划财产清算小组由管理人和托管人组成，清算小组可以聘用必要的工作人员。

清算小组负责资产管理计划财产的保管、清理、估价、变现、确认和分配，可以依法进行必要的民事活动。管理人和托管人应当在扣除清算费用、管理费、业绩报酬及托管费等费用后，将集合计划资产按照投资者拥有集合计划份额的比例或集合资产管理合同的约定以货币资金的形式全部分派给投资者，并注销集合计划专用证券

账户和资金账户。具体职责如下：

(1) 管理人

- 1) 资产变现；
- 2) 编制清算报告并签章；
- 3) 除交易所、银行等自动扣收的费用外，对清算期间资金支付出具投资指令；
- 4) 配合托管人办理账户注销工作；
- 5) 与管理人义务相关的其他职责。

(2) 托管人

- 1) 清算期间的财产保管；
- 2) 复核管理人出具的清算报告并签章；
- 3) 复核管理人投资指令，进行资金划付；
- 4) 清算期间发生资金变动的当日，提供日终资金调节表；
- 5) 资产管理计划财产资金、证券等账户的注销；
- 6) 与托管人义务相关的其他职责。

2、清算程序

(1) 合同终止的确认

资产管理计划合同终止的情形出现当日为本合同终止日。

合同终止时如遇特殊情况，资产管理计划因委托财产流动性受限等原因延期清算（即延长清算时间）的，资产管理人应当及时向中国证监会相关派出机构和证券投资基金业协会报告。

(2) 清理资产管理计划财产债权、债务

除交易所、登记公司等自动扣缴的费用外，所有资产管理计划财产债务清偿由管理人、托管人核对无误后，由管理人向托管人出具投资指令，由托管人复核后办理支付。

管理费、托管费计提规则是以当日资产净值为基数在下一日计提，合同终止日的管理费、托管费以当日资产净值为基数在当日计提。本合同终止后，资产管理人不再计提管理费，资产托管人不再计提托管费。

清算过程中发生的费用由资产管理计划财产承担。

所有流动性受限资产恢复交易后，全部资产变现到账后10个工作日内完成这部分资产清算。

证券交易所、中登的备付金和保证金届时按实际回款日期另行支付。

(3) 编制清算报告

管理人应根据资产管理计划终止日的资产负债情况编制清算报告，并经托管人复核，由管理人向投资者披露。

(4) 向投资者支付清算财产

清算报告披露后，按清算报告的分配约定，由管理人向托管人出具投资指令，经托管人复核无误后，向投资者支付清算财产。

资产管理人应当在资产管理计划清算结束后五个工作日内将清算结果报基金业协会备案，并抄报中国证监会相关派出机构。

3、相关账户销户

资产管理计划财产清算完毕后，托管人按照规定注销资产管理计划财产的资金账户、证券账户等投资所需账户，管理人应给予必要的配合。

4、清算账册及文件的保存

资产管理计划财产清算账册及文件由管理人保存20年以上。

二十四、违约责任

(一) 管理人、托管人在履行各自职责的过程中，违反法律、行政法规的规定或者本合同约定，给计划财产或者委托人造成损害的，应当分别对各自的行为依法承担赔偿责任。但是发生下列情况的，当事人可以免责：

1、不可抗力

不可抗力是指遭受不可抗力事件一方不能预见，不能避免，不能克服的客观情况，包括但不限于洪水、地震及其它自然灾害、战争、骚乱、火灾、突发性公共事件、政府征用、没收、法律法规变化、突发停电或其他突发事件、份额登记机构非正常的暂停或终止业务、证券交易场所非正常暂停或停止交易等。

由于证券交易所及证券登记结算机构发送的数据错误，有关会计制度变化、管理人或托管人托管业务系统出现重大故障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，仍然可能影响委托人正常参与、退出、取款或证券交易等的，管理人有权决定暂停或终止本计划的全部或部分参与、退出，且管理人、托管人免除赔偿责任。但管理人、托管人应积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

一方因不可抗力不能履行本合同时，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资产管理计划财产损失扩大。任何一方当事人延迟履行合同义务后，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、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。

5、投资者未能事前向资产管理人及资产托管人履行信息披露义务（如告知关联证券或其他需告知事项等），致使发生违规投资行为的，资产管理人与资产托管人均不承担任何责任；

6、因证券市场波动、上市公司合并、计划财产规模变动等资产管理人之外的因素致使计划财产投资不符合本合同项下约定的投资策略的，将不视为资产管理人的违约行为；

7、投资者理解资产管理计划财产的投资、运作、保管面临本合同“风险揭示”章节中列举的各类风险，资产管理人及资产托管人就资产管理计划财产面临的上述固有风险免于承担责任；

8、投资者及资产托管人对因所引用的投资对象、证券经纪商及其他中介机构提供的信息的真实性、准确性和完整性存在瑕疵，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。

9、管理人、托管人对于基于从第三方机构（包括但不限于证券交易所、期货交易所等）合法获得的信息及合理信赖上述信息而操作导致资产管理计划财产的任何损失等。

10、托管人在没有过失的情况下，资产托管人由于按照本合同规定行使托管职责而造成的损失等。

11、其他法律法规、中国证监会规定的不可抗力情形。

（二）合同当事人违反本合同，给其他当事人造成经济损失的，应当承担赔偿责任。在发生一方或多方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）由于管理人、托管人不可控制的因素导致业务出现差错，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，但是未能发现错误的，由此造成计

划财产或委托人损失，管理人和托管人免除赔偿责任。但是管理人和托管人应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另一方当事人赔偿的损失，指全部经济损失。

（六）管理人违反法律、行政法规的有关规定，被中国证监会依法撤销证券资产管理业务许可、责令停业整顿，或者因停业、解散、撤销、破产等原因不能履行职责的，应当按照有关监管要求妥善处理有关事宜。

（七）管理人或托管人任一方不因另一方的失职行为而给资产管理计划财产或委托人造成的损失向委托人承担连带责任。

二十五、争议的处理

（一）对于因本合同的订立、内容、履行和解释或与本合同有关的争议，合同当事人应尽量通过协商或调解途径解决。不愿或者不能通过协商或调解解决的，任何一方均有权将争议提交中国广州仲裁委员会，按提交仲裁申请时该会有效之仲裁规则进行仲裁。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。争议处理期间，合同当事人应恪守各自的职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行资产管理合同规定的义务，维护投资者的合法权益。

（二）本合同适用中华人民共和国法律并依据其解释。

二十六、资产管理合同的效力

（一）合同签署的方式

1、资产管理合同是约定资产管理合同当事人之间权利义务关系的法律文件。本合同的签署应当采用纸质合同或电子合同（仅限于通过中登签署的电子合同）的方式进行，由管理人、托管人、投资者共同签署。

通过纸质方式签署本合同的，本合同正本一式三份，投资者、管理人、托管人各执一份，每份均具有同等法律效力。投资者为法人的，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或授权代表签字或盖章。投资者为自然人的，资产管理合同由投资者本人签字、管理人和托管人加盖公章或合同专用章以及双方法定代表人或授权代表签字或盖章。

通过电子合同方式签署本合同的，管理人、托管人及投资者认可电子合同的法律效力。

2、投资者在签署合同后方可进行认购、参与。

(二) 合同的成立与生效

1、合同的成立

本合同经管理人、托管人和投资者共同签署后合同即告成立。

2、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经管理人确认成功，募集资金到达托管账户；

(2) 本计划成立。

资产管理合同自生效之日起对投资者、管理人、托管人具有同等的法律约束力。

(三) 合同的有效期限

本计划存续期以资产管理合同第五章“(七) 存续期限”约定的期限为准，在合同约定的条件下可以展期、提前终止。本计划终止，本合同终止。但本合同项下的清算条款、违约责任条款、争议解决条款仍然有效。

(四) 合同的组成

计划说明书、风险揭示书、经管理人确认有效的委托人参与或退出本计划的申请材料及各销售机构出具的受理委托人参与或退出本计划业务的有关凭证、投资者通过电子签名方式产生的数据电文等均为本合同的附件，是本合同不可分割的一部分，与本合同具有同等法律效力。

(五) 投资者自签订资产管理合同即成为资产管理合同的当事人。在本计划存续期间，投资者自全部退出本计划之日起，该投资者不再是资产管理合同的当事人。

二十七、其他事项

(一) 如将来法律法规、中国证监会、基金业协会或其他有权机构对资产管理合同的内容与格式有其他要求的，管理人和托管人应立即展开协商，根据法律法规、中国证监会、基金业协会或其他有权机构的相关要求修改本合同的内容和格式。

(二) 本合同项下任何一方向对方发出的通知、信件等，应当发送至本合同约定的地址、联系人。一方当事人变更名称、地址、联系人和联系电话的，应当在变更后5日内及时书面通知对方当事人，对方当事人实际收到变更通知前的送达仍为有效送达。未按约定方式通知变更的，原约定的当事人、送达地址和联系人、联系电话仍然有效。

任何一方当事人向另一方当事人所发出的通知、信件等书面材料自交邮后的第

3日视为送达。若送达日为非工作日,则视为在下一工作日送达。

本合同约定的地址、联系人亦为双方工作联系往来、法律文书及争议解决时人民法院或仲裁机构的法律文书送达地址, 人民法院或仲裁机构发出的各类诉讼材料(包括起诉状、证据材料、开庭传票、各类通知书、裁判文书等)向合同任何一方当事人的上述地址送达的, 视为有效送达。上述送达地址持续适用于主合同履行期间、人民法院一审、二审、再审和执行期间以及仲裁裁决和执行期间。

合同各方或人民法院、仲裁机构为主合同的履行、变更、解除和争议解决, 按上述送达地址向对方邮寄、发送相关文书时, 若发生送达不成情形(包括但不限于无人签收、地址不详、地址搬迁、长期未自取等), 以文书退回之日视为送达之日; 按上述邮寄地址直接送达文书时, 若发生送达不成情形(包括但不限于无人签收、地址不详、地址搬迁、拒收等), 以送达人在送达回证上记明情况之日或以留置或张贴文书之日视为送达之日。

各方确认合同的编号、名称、送达地址均系本方填写, 明确知晓各方或人民法院、仲裁机构按上述地址送达文书时, 即使送达不成, 亦具有推定送达的法律后果。

合同送达条款与争议解决条款均为独立条款, 不受合同整体或其他条款的效力的影响。

本合同其他条款约定的事项如已约定送达及通知方式的,按照相应条款的约定执行。

(三) 本合同相关事项需征求投资者意见或约定投资者可以邮件形式要求或表达意见的, 如投资者选择以邮件形式接收相关通知和/或回复、表达意见, 投资者接收通知和/或回复、表达意见的邮箱地址为合同签署页其预留的邮箱, 合同对相关事项另有约定授权邮箱的除外。由该指定邮箱地址发出的邮件均为投资者有效意见, 与投资者发送的书面意见具有同样效力。投资者变更其指定邮箱地址或变更其授权权限的, 需由投资者通过原指定邮箱地址向管理人发送新的指定邮箱地址及变更起始时间, 自邮件注明的变更起始时间起, 管理人接受新的指定邮箱地址发送的投资者意见、并不再接受原指定邮箱地址发送的任何意见。

(四) 本合同如有未尽事宜, 由合同当事人各方按有关法律法规和规定协商解决。

二十八、附件

附件一：投资指令授权通知书

投资指令授权通知书

广州农村商业银行股份有限公司：

自“东方红添盈 1 号集合资产管理计划”成立之日起至该计划终止清算完毕之日止，我公司向贵行发送管理运用委托资产的投资指令的被授权人及其权限为：

1、被授权人及权限：

赖晨玲或蒋莹或蒋丹青或焦斌或常琦或马鹏（以上任意一人签章即有效）：投资指令经办

赖晨玲或蒋莹或蒋丹青或焦斌或常琦或马鹏（以上任意一人签章即有效）：投资指令复核

2、投资指令被授权人印章样式：

3、预留印鉴：

管理人投资监督联络人及邮箱地址：风控组【rcgroup@dfham.com】

（公 章）

法定代表人（授权代理人）：

年 月 日

附件二：投资指令/划款指令（样本）

投资指令/划款指令

广州农村商业银行股份有限公司：

敬请贵行根据以下提供的收款人名称、开户行、账号、划款日期和划款金额划款。

划款日期	年月日	最迟到账时间	年月日
付款人		收款人	
账号		账号	
开户行		开户行	
		大额支付行号	
划款金额 (大写)			
划款金额 (小写)			
划款事由：			
资产管理人签章：		资产托管人签章：	
经办人：		经办人：	
复核人：		复核人：	
		审批人：	

附件三：专用清算账户及资金划拨专用账户

专用清算账户及资金划拨专用账户

注意：账户如有变更，请及时通知相关各方。

托管账户

户名：

账号：

开户银行：

管理费/业绩报酬收款账户

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

托管费收款账户

户名：广州农村商业银行股份有限公司资产托管部

账号：05871999000000695

开户行：广州农村商业银行股份有限公司华夏支行

大额支付号：314581001006

附件四：投资清单

A、《可投股票及ETF清单》

若下述证券调整出沪深300指数（000300.SH）、中证500指数（000905.SH）、和创业板指数300（399012.SZ）指数的成份股的，则《可投股票及ETF清单》自动作相应调整。

①可投股票清单

序号	证券名称	证券代码	序号	证券名称	证券代码
1	鲍斯股份	300441	386	美凯龙	601828
2	北方导航	600435	387	南京高科	600064
3	北新建材	000786	388	欧普康视	300595
4	财通证券	601108	389	人民网	603000
5	超图软件	300036	390	瑞丰新材	300910
6	晨鸣纸业	000488	391	山西焦煤	000983
7	创业慧康	300451	392	陕西煤业	601225
8	电投能源	002128	393	上海瀚讯	300762
9	福莱特	601865	394	水晶光电	002273
10	福耀玻璃	600660	395	苏州银行	002966
11	歌尔股份	002241	396	天味食品	603317
12	海信视像	600060	397	通策医疗	600763
13	航发控制	000738	398	通化东宝	600867
14	航天信息	600271	399	新媒股份	300770
15	亨通光电	600487	400	星网锐捷	002396
16	华安证券	600909	401	星宇股份	601799
17	华工科技	000988	402	许继电气	000400
18	冀中能源	000937	403	张江高科	600895
19	捷捷微电	300623	404	浙江医药	600216
20	凯莱英	002821	405	中国铁建	601186
21	科顺股份	300737	406	中国银行	601988
22	迈克生物	300463	407	振芯科技	300101
23	内蒙一机	600967	408	正海生物	300653
24	南网能源	003035	409	中国核电	601985
25	容大感光	300576	410	中国交建	601800
26	三七互娱	002555	411	中国通号	688009
27	山煤国际	600546	412	中国西电	601179
28	陕国投 A	000563	413	中航沈飞	600760
29	圣邦股份	300661	414	中信银行	601998
30	圣湘生物	688289	415	中远海控	601919
31	石头科技	688169	416	中粮资本	002423
32	硕贝德	300322	417	中密控股	300470
33	天士力	600535	418	中泰化学	002092
34	外高桥	600648	419	安迪苏	600299
35	威孚高科	000581	420	奥克股份	300082
36	伟明环保	603568	421	保利发展	600048
37	五矿资本	600390	422	北元集团	601568
38	西安银行	600928	423	博腾股份	300363
39	一汽解放	000800	424	财达证券	600906
40	易瑞生物	300942	425	长江电力	600900
41	鱼跃医疗	002223	426	大族激光	002008
42	招商港口	001872	427	帝尔激光	300776

序号	证券名称	证券代码	序号	证券名称	证券代码
43	浙商银行	601916	428	东方国信	300166
44	艾迪精密	603638	429	广发证券	000776
45	安克创新	300866	430	国网信通	600131
46	安图生物	603658	431	红日药业	300026
47	柏楚电子	688188	432	宏发股份	600885
48	宝信软件	600845	433	鸿利智汇	300219
49	滨江集团	002244	434	湖南黄金	002155
50	长亮科技	300348	435	华测导航	300627
51	赤峰黄金	600988	436	华策影视	300133
52	大秦铁路	601006	437	华东医药	000963
53	电科院	300215	438	华菱钢铁	000932
54	东富龙	300171	439	华谊集团	600623
55	飞科电器	603868	440	华友钴业	603799
56	风华高科	000636	441	金山办公	688111
57	贵州茅台	600519	442	京东方 A	000725
58	国瓷材料	300285	443	晶瑞电材	300655
59	海康威视	002415	444	久之洋	300516
60	和邦生物	603077	445	绝味食品	603517
61	恒力石化	600346	446	领益智造	002600
62	华创阳安	600155	447	鲁西化工	000830
63	惠云钛业	300891	448	潞安环能	601699
64	冀东水泥	000401	449	杉杉股份	600884
65	佳都科技	600728	450	上汽集团	600104
66	健康元	600380	451	深圳燃气	601139
67	精测电子	300567	452	盛和资源	600392
68	康龙化成	300759	453	双鹭药业	002038
69	理邦仪器	300206	454	苏泊尔	002032
70	良品铺子	603719	455	汤臣倍健	300146
71	隆华科技	300263	456	卫宁健康	300253
72	绿地控股	600606	457	仙乐健康	300791
73	芒果超媒	300413	458	新易盛	300502
74	内蒙华电	600863	459	药明康德	603259
75	欧派家居	603833	460	银江技术	300020
76	普利制药	300630	461	裕同科技	002831
77	三美股份	603379	462	鞍钢股份	000898
78	山鹰国际	600567	463	宝钢股份	600019
79	思瑞浦	688536	464	东华能源	002221
80	斯迪克	300806	465	方大特钢	600507
81	天孚通信	300394	466	飞凯材料	300398
82	通富微电	002156	467	凤凰传媒	601928
83	欣旺达	300207	468	抚顺特钢	600399
84	新大陆	000997	469	富祥药业	300497
85	星源材质	300568	470	光明乳业	600597
86	渝农商行	601077	471	广汽集团	601238
87	奥飞数据	300738	472	贵州百灵	002424
88	博创科技	300548	473	航天电子	600879
89	长信科技	300088	474	虹软科技	688088
90	成都银行	601838	475	华侨城 A	000069
91	法拉电子	600563	476	华新水泥	600801

序号	证券名称	证券代码	序号	证券名称	证券代码
92	分众传媒	002027	477	淮北矿业	600985
93	甘李药业	603087	478	金域医学	603882
94	高德红外	002414	479	景嘉微	300474
95	格林美	002340	480	酒钢宏兴	600307
96	古井贡酒	000596	481	凯利泰	300326
97	光环新网	300383	482	康泰生物	300601
98	国泰君安	601211	483	柳工	000528
99	航天发展	000547	484	蒙草生态	300355
100	合盛硅业	603260	485	片仔癀	600436
101	横店东磁	002056	486	旗滨集团	601636
102	湖北能源	000883	487	赛升药业	300485
103	华测检测	300012	488	上港集团	600018
104	华西证券	002926	489	上海环境	601200
105	华域汽车	600741	490	太极股份	002368
106	健帆生物	300529	491	天宇股份	300702
107	江苏银行	600919	492	信维通信	300136
108	江西铜业	600362	493	徐工机械	000425
109	今世缘	603369	494	浙江龙盛	600352
110	金风科技	002202	495	中国建筑	601668
111	金科股份	000656	496	中国卫星	600118
112	晶晨股份	688099	497	中国中免	601888
113	九阳股份	002242	498	中际旭创	300308
114	科博达	603786	499	中粮科技	000930
115	口子窖	603589	500	中信证券	600030
116	绿盟科技	300369	501	中颖电子	300327
117	洛阳钼业	603993	502	云铝股份	000807
118	美亚柏科	300188	503	昭衍新药	603127
119	明阳智能	601615	504	浙商证券	601878
120	南极电商	002127	505	中储股份	600787
121	启明星辰	002439	506	中国电信	601728
122	强力新材	300429	507	中国外运	601598
123	睿创微纳	688002	508	中航高科	600862
124	上海医药	601607	509	中航西飞	000768
125	韶钢松山	000717	510	中联重科	000157
126	申万宏源	000166	511	洲明科技	300232
127	太极实业	600667	512	招商公路	001965
128	天下秀	600556	513	兆易创新	603986
129	卧龙电驱	600580	514	郑煤机	601717
130	中国广核	003816	515	指南针	300803
131	中国联通	600050	516	中材科技	002080
132	中国神华	601088	517	中国宝安	000009
133	中国石化	600028	518	重庆钢铁	601005
134	中国银河	601881	519	紫金银行	601860
135	中航光电	002179	520	中信特钢	000708
136	中集集团	000039	521	重庆百货	600729
137	长电科技	600584	522	无锡银行	600908
138	城建发展	600266	523	新雷能	300593
139	驰宏锌锗	600497	524	扬农化工	600486
140	东方财富	300059	525	洋河股份	002304

序号	证券名称	证券代码	序号	证券名称	证券代码
141	光大证券	601788	526	药石科技	300725
142	河钢股份	000709	527	英科医疗	300677
143	华发股份	600325	528	盈趣科技	002925
144	华能水电	600025	529	招商南油	601975
145	华数传媒	000156	530	招商蛇口	001979
146	建发股份	600153	531	中鼎股份	000887
147	健友股份	603707	532	中国电建	601669
148	金证股份	600446	533	中国软件	600536
149	立昂微	605358	534	中航机电	002013
150	辽宁成大	600739	535	中航重机	600765
151	宁波华翔	002048	536	中科软	603927
152	宁德时代	300750	537	中南传媒	601098
153	珀莱雅	603605	538	中石科技	300684
154	普洛药业	000739	539	奥瑞金	002701
155	森马服饰	002563	540	百联股份	600827
156	山西证券	002500	541	碧水源	300070
157	上海机电	600835	542	博思软件	300525
158	上海莱士	002252	543	长沙银行	601577
159	深科技	000021	544	楚天科技	300358
160	斯达半导	603290	545	达安基因	002030
161	宋城演艺	300144	546	东北证券	000686
162	天坛生物	600161	547	东航物流	601156
163	通裕重工	300185	548	烽火通信	600498
164	同仁堂	600085	549	工商银行	601398
165	图南股份	300855	550	国投资本	600061
166	丸美股份	603983	551	华利集团	300979
167	王府井	600859	552	节能风电	601016
168	伟星新材	002372	553	力源信息	300184
169	我武生物	300357	554	马钢股份	600808
170	厦门国贸	600755	555	上海贝岭	600171
171	信邦制药	002390	556	深圳能源	000027
172	兴齐眼药	300573	557	生益科技	600183
173	阳光电源	300274	558	四川路桥	600039
174	伊利股份	600887	559	天银机电	300342
175	玉禾田	300815	560	拓普集团	601689
176	越秀金控	000987	561	卫士通	002268
177	张裕A	000869	562	五粮液	000858
178	招商轮船	601872	563	厦门钨业	600549
179	中国化学	601117	564	新奥股份	600803
180	爱美客	300896	565	新和成	002001
181	长川科技	300604	566	新潮中宝	600208
182	长江证券	000783	567	兴业银行	601166
183	晨光股份	603899	568	壹网壹创	300792
184	第一创业	002797	569	宇信科技	300674
185	东方电气	600875	570	正海磁材	300224
186	东方雨虹	002271	571	郑州银行	002936
187	东兴证券	601198	572	中简科技	300777
188	光大银行	601818	573	中兴通讯	000063
189	光迅科技	002281	574	北京君正	300223

序号	证券名称	证券代码	序号	证券名称	证券代码
190	海澜之家	600398	575	富瀚微	300613
191	杭钢股份	600126	576	广电运通	002152
192	花园生物	300401	577	广州港	601228
193	华天科技	002185	578	国联证券	601456
194	济川药业	600566	579	国药股份	600511
195	捷佳伟创	300724	580	国药一致	000028
196	金钼股份	601958	581	海天味业	603288
197	凯普生物	300639	582	华鲁恒升	600426
198	康拓红外	300455	583	汇顶科技	603160
199	科大讯飞	002230	584	金隅集团	601992
200	浪潮信息	000977	585	晶澳科技	002459
201	立高食品	300973	586	晶科科技	601778
202	利亚德	300296	587	巨星科技	002444
203	联泓新科	003022	588	君正集团	601216
204	联化科技	002250	589	凯赛生物	688065
205	联美控股	600167	590	乐普医疗	300003
206	牧原股份	002714	591	泸州老窖	000568
207	宁沪高速	600377	592	迈瑞医疗	300760
208	荣盛石化	002493	593	美的集团	000333
209	锐科激光	300747	594	南玻 A	000012
210	三诺生物	300298	595	南大光电	300346
211	上海家化	600315	596	南钢股份	600282
212	视源股份	002841	597	平安银行	000001
213	数字认证	300579	598	璞泰来	603659
214	双汇发展	000895	599	谱尼测试	300887
215	天齐锂业	002466	600	七一二	603712
216	彤程新材	603650	601	齐鲁银行	601665
217	万华化学	600309	602	青岛银行	002948
218	西部证券	002673	603	容百科技	688005
219	信立泰	002294	604	三环集团	300408
220	扬杰科技	300373	605	山东钢铁	600022
221	云南白药	000538	606	上海建工	600170
222	锡业股份	000960	607	上海新阳	300236
223	新天绿能	600956	608	顺络电子	002138
224	银泰黄金	000975	609	苏宁环球	000718
225	用友网络	600588	610	太钢不锈	000825
226	智飞生物	300122	611	泰格医药	300347
227	中科电气	300035	612	厦门银行	601187
228	中直股份	600038	613	小商品城	600415
229	浙江东方	600120	614	新产业	300832
230	震安科技	300767	615	新钢股份	600782
231	中国核建	601611	616	兖矿能源	600188
232	中国人保	601319	617	易事特	300376
233	中国中铁	601390	618	迎驾贡酒	603198
234	中牧股份	600195	619	豫园股份	600655
235	爱施德	002416	620	浙富控股	002266
236	北方华创	002371	621	浙江鼎力	603338
237	北方稀土	600111	622	正泰电器	601877
238	长城汽车	601633	623	值得买	300785

序号	证券名称	证券代码	序号	证券名称	证券代码
239	长城证券	002939	624	中国平安	601318
240	晨曦航空	300581	625	中国卫通	601698
241	达仁堂	600329	626	中炬高新	600872
242	电连技术	300679	627	中信建投	601066
243	鼎龙股份	300054	628	新凤鸣	603225
244	东风汽车	600006	629	一品红	300723
245	二三四五	002195	630	亿联网络	300628
246	复星医药	600196	631	中兵红箭	000519
247	钢研高纳	300034	632	中环股份	002129
248	海大集团	002311	633	中金黄金	600489
249	杭氧股份	002430	634	中科曙光	603019
250	恒瑞医药	600276	635	中粮糖业	600737
251	红塔证券	601236	636	中泰证券	600918
252	宏达电子	300726	637	紫光国微	002049
253	华大基因	300676	638	TCL 科技	000100
254	华泰证券	601688	639	爱乐达	300696
255	火星人	300894	640	安琪酵母	600298
256	坚朗五金	002791	641	常山药业	300255
257	金丹科技	300829	642	晨光生物	300138
258	金地集团	600383	643	迪安诊断	300244
259	九州通	600998	644	东岳硅材	300821
260	九洲药业	603456	645	广汇能源	600256
261	开山股份	300257	646	贵州燃气	600903
262	科沃斯	603486	647	国联股份	603613
263	朗新科技	300682	648	海亮股份	002203
264	立中集团	300428	649	恒生电子	600570
265	柳钢股份	601003	650	华致酒行	300755
266	陆家嘴	600663	651	吉比特	603444
267	欧普照明	603515	652	京沪高铁	601816
268	鹏鼎控股	002938	653	巨化股份	600160
269	鹏都农牧	002505	654	科蓝软件	300663
270	浦东金桥	600639	655	莱克电气	603355
271	潜能恒信	300191	656	蓝思科技	300433
272	深南电路	002916	657	辽港股份	601880
273	圣元环保	300867	658	南京银行	601009
274	首创环保	600008	659	瑞芯微	603893
275	通威股份	600438	660	三峡能源	600905
276	万向钱潮	000559	661	上海钢联	300226
277	西部矿业	601168	662	生物股份	600201
278	北大荒	600598	663	顺丰控股	002352
279	博雅生物	300294	664	唐山港	601000
280	彩虹股份	600707	665	天合光能	688599
281	长春高新	000661	666	天健集团	000090
282	当升科技	300073	667	同花顺	300033
283	道氏技术	300409	668	新宝股份	002705
284	德方纳米	300769	669	新城控股	601155
285	东山精密	002384	670	新强联	300850
286	东吴证券	601555	671	兴业证券	601377
287	方正证券	601901	672	养元饮品	603156

序号	证券名称	证券代码	序号	证券名称	证券代码
288	菲利华	300395	673	怡亚通	002183
289	贵阳银行	601997	674	以岭药业	002603
290	海南矿业	601969	675	亿纬锂能	300014
291	海油发展	600968	676	中材国际	600970
292	寒锐钴业	300618	677	中航产融	600705
293	华润微	688396	678	中航电子	600372
294	环旭电子	601231	679	中金岭南	000060
295	汇川技术	300124	680	中煤能源	601898
296	吉林敖东	000623	681	中文传媒	600373
297	金城医药	300233	682	中芯国际	688981
298	金力永磁	300748	683	卓胜微	300782
299	金龙鱼	300999	684	包钢股份	600010
300	景旺电子	603228	685	北摩高科	002985
301	开立医疗	300633	686	贝泰妮	300957
302	老板电器	002508	687	彩讯股份	300634
303	丽珠集团	000513	688	大华股份	002236
304	利安隆	300596	689	赣锋锂业	002460
305	隆基绿能	601012	690	格力电器	000651
306	麦捷科技	300319	691	广东宏大	002683
307	农业银行	601288	692	广晟有色	600259
308	攀钢钒钛	000629	693	恒逸石化	000703
309	鹏辉能源	300438	694	鸿远电子	603267
310	洽洽食品	002557	695	华润三九	000999
311	荃银高科	300087	696	江丰电子	300666
312	三一重工	600031	697	晶盛机电	300316
313	山东药玻	600529	698	聚灿光电	300708
314	圣农发展	002299	699	聚飞光电	300303
315	世茂股份	600823	700	美亚光电	002690
316	苏交科	300284	701	木林森	002745
317	太阳纸业	002078	702	南京证券	601990
318	桃李面包	603866	703	青岛港	601298
319	天华超净	300390	704	青岛啤酒	600600
320	铜陵有色	000630	705	闰土股份	002440
321	爱建集团	600643	706	三钢闽光	002110
322	安科生物	300009	707	三友化工	600409
323	白云山	600332	708	山西汾酒	600809
324	百润股份	002568	709	思源电气	002028
325	长安汽车	000625	710	天风证券	601162
326	长飞光纤	601869	711	拓尔思	300229
327	传化智联	002010	712	韦尔股份	603501
328	传音控股	688036	713	稳健医疗	300888
329	大博医疗	002901	714	沃森生物	300142
330	东方盛虹	000301	715	新诺威	300765
331	东华软件	002065	716	新兴铸管	000778
332	恩捷股份	002812	717	兴发集团	600141
333	涪陵榨菜	002507	718	兴蓉环境	000598
334	光威复材	300699	719	英唐智控	300131
335	广联达	002410	720	韵达股份	002120
336	国投电力	600886	721	振华科技	000733

序号	证券名称	证券代码	序号	证券名称	证券代码
337	国元证券	000728	722	中国中车	601766
338	海尔智家	600690	723	中国中冶	601618
339	杭州银行	600926	724	中科创达	300496
340	恒立液压	601100	725	中山公用	000685
341	华峰化学	002064	726	中铁工业	600528
342	锦浪科技	300763	727	重庆燃气	600917
343	科伦药业	002422	728	紫金矿业	601899
344	科锐国际	300662	729	常熟银行	601128
345	美畅股份	300861	730	大中矿业	001203
346	千方科技	002373	731	东鹏饮料	605499
347	瑞普生物	300119	732	福斯特	603806
348	三角防务	300775	733	光弘科技	300735
349	上海临港	600848	734	广和通	300638
350	首钢股份	000959	735	国电南瑞	600406
351	数码视讯	300079	736	国金证券	600109
352	数字政通	300075	737	海格通信	002465
353	隧道股份	600820	738	华阳股份	600348
354	塔牌集团	002233	739	杰瑞股份	002353
355	天地科技	600582	740	康泰医学	300869
356	天津港	600717	741	蓝晓科技	300487
357	天山铝业	002532	742	澜起科技	688008
358	物产中大	600704	743	人福医药	600079
359	西部建设	002302	744	日月股份	603218
360	湘财股份	600095	745	三花智控	002050
361	雅戈尔	600177	746	三只松鼠	300783
362	圆通速递	600233	747	山东高速	600350
363	云南铜业	000878	748	深天马 A	000050
364	宝丰能源	600989	749	胜宏科技	300476
365	宝新能源	000690	750	水羊股份	300740
366	贝达药业	300558	751	万邦达	300055
367	崇达技术	002815	752	万孚生物	300482
368	东方证券	600958	753	万科 A	000002
369	东软载波	300183	754	万泰生物	603392
370	东阳光	600673	755	西南证券	600369
371	方大炭素	600516	756	先导智能	300450
372	富满微	300671	757	移为通信	300590
373	工业富联	601138	758	银河磁体	300127
374	桂冠电力	600236	759	中国海防	600764
375	国网英大	600517	760	中国巨石	600176
376	海螺水泥	600585	761	中国铝业	601600
377	豪迈科技	002595	762	中国能建	601868
378	恒华科技	300365	763	中国太保	601601
379	华兰生物	002007	764	中航电测	300114
380	华熙生物	688363	765	中科三环	000970
381	江苏租赁	600901	766	中顺洁柔	002511
382	康恩贝	600572	767	中微公司	688012
383	立讯精密	002475	768	中伟股份	300919
384	玲珑轮胎	601966	769	中银证券	601696
385	迈为股份	300751	770	中远海发	601866

②可投指数股票型ETF基金清单

序号	证券名称	证券代码	序号	证券名称	证券代码
1	MSCI 中国 A 股国际通 ETF	512160	150	华夏中证动漫游戏 ETF	159869
2	博时 5G50ETF	159811	151	华夏中证科创创业 50ETF	159783
3	博时港股通消费 ETF	513960	152	华夏中证旅游主题 ETF	562510
4	博时恒生高股息 ETF	513690	153	华夏中证内地低碳经济主题 ETF	159790
5	博时红利 ETF	515890	154	华夏中证全指房地产 ETF	515060
6	博时龙头家电 ETF	159730	155	华夏中证全指证券公司 ETF	515010
7	博时上证自然资源 ETF	510410	156	华夏中证细分食品饮料产业主题 ETF	515170
8	博时新能源汽车 ETF	159824	157	华夏中证新能源汽车 ETF	515030
9	博时央企创新驱动 ETF	515900	158	汇添富 MSCI 中国 A50 互联互通 ETF	560050
10	博时中证科创创业 50ETF	588390	159	汇添富国证生物医药 ETF	159839
11	大成中证全指医疗保健设备与服务 ETF	516610	160	汇添富中证光伏产业 ETF	516290
12	富国上证综指 ETF	510210	161	汇添富中证沪港深张江自主创新 50ETF	517850
13	富国中证 800 银行 ETF	159887	162	汇添富中证能源 ETF	159930
14	富国中证大数据产业 ETF	515400	163	汇添富中证全指医疗器械 ETF	159797
15	富国中证港股通互联网 ETF	159792	164	汇添富中证新能源汽车产业 ETF	516390
16	富国中证沪港深创新药产业 ETF	159748	165	汇添富中证医药卫生 ETF	159929
17	富国中证价值 ETF	512040	166	汇添富中证主要消费 ETF	159928
18	富国中证军工龙头 ETF	512710	167	嘉实国证绿色电力 ETF	159625
19	富国中证科创创业 50ETF	588380	168	嘉实沪深 300ETF	159919
20	富国中证科技 50 策略 ETF	515750	169	嘉实基本面 50ETF	512750
21	富国中证旅游主题 ETF	159766	170	嘉实上证科创板新一代信息技术 ETF	588100
22	富国中证农业主题 ETF	159825	171	嘉实中证 500ETF	159922
23	富国中证全指家用电器 ETF	561120	172	嘉实中证大农业 ETF	516550
24	富国中证全指建筑材料 ETF	516750	173	嘉实中证电池主题 ETF	562880
25	富国中证全指证券公司 ETF	515850	174	嘉实中证科创创业 50ETF	588400
26	富国中证稀土产业 ETF	159713	175	嘉实中证软件服务 ETF	159852
27	富国中证细分化工产业主题 ETF	516120	176	嘉实中证稀土产业 ETF	516150
28	富国中证细分机械设备产业主题 ETF	159886	177	嘉实中证稀有金属主题 ETF	562800
29	富国中证现代物流 ETF	516910	178	嘉实中证新能源 ETF	159875
30	富国中证消费 50ETF	515650	179	嘉实中证信息安全主题 ETF	159613
31	富国中证消费电子主题 ETF	561100	180	嘉实中证主要消费 ETF	512600
32	富国中证芯片产业 ETF	516640	181	建信上证 50ETF	510800
33	富国中证新华社民族品牌工程 ETF	561130	182	建信易盛郑商所能源化工期货 ETF	159981
34	富国中证医药 50ETF	515950	183	建信中证全指证券公司 ETF	515560
35	富国中证银行 ETF	515280	184	金融 ETF	510230
36	富国中证智能汽车主题 ETF	515250	185	景顺长城国证新能源车电池 ETF	159757
37	工银瑞信国证新能源车电池 ETF	159840	186	景顺长城中证港股通科技 ETF	513980
38	工银瑞信中证沪港深互联网 ETF	159856	187	景顺长城中证红利低波动 100ETF	515100
39	工银上证科创板 50 成份 ETF	588050	188	景顺中证 500 增强策略 ETF	159610
40	工银深证红利 ETF	159905	189	南方 MSCI 中国 A50 互联互通 ETF	159602
41	工银中证科技龙头 ETF	516050	190	南方标普中国 A 股大盘红利低波 50ETF	515450
42	广发创业板 ETF	159952	191	南方恒生中国企业 ETF	159954
43	广发国证半导体芯片 ETF	159801	192	南方中证 1000ETF	512100
44	广发国证新能源车电池 ETF	159755	193	南方中证 500ETF	510500
45	广发中证 100ETF	512910	194	南方中证 500 增强策略 ETF	560100
46	广发中证 500ETF	510510	195	南方中证创新药产业 ETF	159858

序号	证券名称	证券代码	序号	证券名称	证券代码
47	广发中证传媒 ETF	512980	196	南方中证科创创业 50ETF	159780
48	广发中证创新药产业 ETF	515120	197	南方中证全指房地产 ETF	512200
49	广发中证环保 ETF	512580	198	南方中证全指医疗保健 ETF	159877
50	广发中证建筑工程 ETF	516970	199	南方中证全指证券 ETF	512900
51	广发中证军工 ETF	512680	200	南方中证申万有色金属 ETF	512400
52	广发中证全指电力 ETF	159611	201	南方中证物联网主题 ETF	159896
53	广发中证全指家用电器 ETF	560880	202	南方中证新能源 ETF	516160
54	广发中证全指信息技术 ETF	159939	203	南方中证银行 ETF	512700
55	广发中证全指医药卫生 ETF	159938	204	鹏华港股科技 ETF	159751
56	广发中证稀有金属 ETF	159608	205	鹏华国证半导体芯片指数 ETF	159813
57	国联安上证科创板 50 成份 ETF	588180	206	鹏华国证证券龙头 ETF	159993
58	国联安中证全指半导体 ETF	512480	207	鹏华中证传媒 ETF	159805
59	国联安中证全指证券公司 ETF	159848	208	鹏华中证港股通医药卫生综合 ETF	513700
60	国泰 CES 半导体芯片 ETF	512760	209	鹏华中证光伏产业 ETF	159863
61	国泰沪深 300 增强策略 ETF	561300	210	鹏华中证国防 ETF	512670
62	国泰上证综合 ETF	510760	211	鹏华中证酒 ETF	512690
63	国泰中证 500ETF	561350	212	鹏华中证内地低碳经济主题 ETF	159885
64	国泰中证 800 汽车与零部件 ETF	516110	213	鹏华中证细分化工产业 ETF	159870
65	国泰中证动漫游戏 ETF	516010	214	鹏华中证畜牧养殖 ETF	159867
66	国泰中证钢铁 ETF	515210	215	鹏扬中证数字经济主题 ETF	560800
67	国泰中证港股通 50ETF	159712	216	平安中证光伏产业 ETF	516180
68	国泰中证港股通科技 ETF	513020	217	平安中证新能源汽车产业 ETF	515700
69	国泰中证光伏产业 ETF	159864	218	平安中证畜牧养殖 ETF	516760
70	国泰中证沪港深创新药产业 ETF	517110	219	平安中证医药及医疗器械创新 ETF	516820
71	国泰中证环保产业 50ETF	159861	220	浦银安盛 MSCI 中国 A 股 ETF	515780
72	国泰中证基建 ETF	159619	221	浦银安盛中证 ESG120 策略 ETF	516720
73	国泰中证计算机主题 ETF	512720	222	浦银安盛中证证券公司 30ETF	516730
74	国泰中证军工 ETF	512660	223	上投摩根 MSCI 中国 A 股 ETF	515770
75	国泰中证科创创业 50ETF	588360	224	泰康国证公共卫生与健康 ETF	159760
76	国泰中证煤炭 ETF	515220	225	泰康沪深 300ETF	515380
77	国泰中证全指家用电器 ETF	159996	226	泰康中证内地低碳经济主题 ETF	560560
78	国泰中证全指建筑材料 ETF	159745	227	泰康中证智能电动汽车 ETF	159720
79	国泰中证全指软件 ETF	515230	228	天弘国证生物医药 ETF	159859
80	国泰中证全指通信设备 ETF	515880	229	天弘中证电子 ETF	159997
81	国泰中证全指证券公司 ETF	512880	230	天弘中证光伏产业 ETF	159857
82	国泰中证生物医药 ETF	512290	231	天弘中证沪港深线上消费主题 ETF	517280
83	国泰中证细分化工产业 ETF	516220	232	天弘中证沪港深云计算 ETF	517390
84	国泰中证细分机械设备产业主题 ETF	516960	233	天弘中证机器人 ETF	159770
85	国泰中证消费电子主题 ETF	561310	234	天弘中证计算机主题 ETF	159998
86	国泰中证新材料主题 ETF	159761	235	天弘中证全指医疗保健设备与服务 ETF	159873
87	国泰中证新能源汽车 ETF	159806	236	天弘中证全指证券公司 ETF	159841
88	国泰中证畜牧养殖 ETF	159865	237	天弘中证食品饮料 ETF	159736
89	国泰中证医疗 ETF	159828	238	天弘中证银行 ETF	515290
90	国泰中证有色金属 ETF	159881	239	添富中证 800ETF	515800
91	国泰中证智能汽车主题 ETF	159889	240	西部利得创业板大盘 ETF	159814
92	海富通中证港股通科技 ETF	513860	241	西部利得深证红利 ETF	159708
93	华安 CES 港股通精选 100ETF	513900	242	易方达 MSCI 中国 A50 互联互通 ETF	563000
94	华安创业板 50ETF	159949	243	易方达创业板 ETF	159915

序号	证券名称	证券代码	序号	证券名称	证券代码
95	华安沪深 300ETF	515390	244	易方达恒生港股通新经济 ETF	513320
96	华安上证 180ETF	510180	245	易方达沪深 300 发起式 ETF	510310
97	华安上证科创板 50ETF	588280	246	易方达沪深 300 非银 ETF	512070
98	华安上证科创板新一代信息技术 ETF	588260	247	易方达沪深 300 医药 ETF	512010
99	华安中证电子 50ETF	515320	248	易方达上证 50ETF	510100
100	华安中证光伏产业 ETF	159618	249	易方达上证科创板 50ETF	588080
101	华安中证内地新能源主题 ETF	516270	250	易方达深证 100ETF	159901
102	华安中证申万食品饮料 ETF	516900	251	易方达中证 500ETF	510580
103	华安中证细分医药 ETF	512120	252	易方达中证 500 质量成长 ETF	159606
104	华安中证新能源汽车 ETF	516660	253	易方达中证创新药产业 ETF	516080
105	华宝化工 ETF	516020	254	易方达中证港股通医药卫生综合 ETF	513200
106	华宝金融科技 ETF	159851	255	易方达中证红利 ETF	515180
107	华宝双创龙头 ETF	588330	256	易方达中证军工 ETF	512560
108	华宝中证 800 地产 ETF	159707	257	易方达中证科创创业 50ETF	159781
109	华宝中证电子 50ETF	515260	258	易方达中证科技 50ETF	159807
110	华宝中证港股通互联网 ETF	513770	259	易方达中证内地低碳经济主题 ETF	516070
111	华宝中证军工 ETF	512810	260	易方达中证人工智能主题 ETF	159819
112	华宝中证科技龙头 ETF	515000	261	易方达中证生物科技主题 ETF	159837
113	华宝中证全指证券公司 ETF	512000	262	易方达中证石化产业 ETF	516570
114	华宝中证细分食品饮料产业主题 ETF	515710	263	易方达中证稀土产业 ETF	159715
115	华宝中证医疗 ETF	512170	264	易方达中证现代农业主题 ETF	562900
116	华宝中证银行 ETF	512800	265	易方达中证香港证券投资主题 ETF	513090
117	华泰柏瑞创业板科技 ETF	159773	266	易方达中证消费 50ETF	159798
118	华泰柏瑞沪港深云计算 ETF	159738	267	易方达中证新能源 ETF	516090
119	华泰柏瑞沪深 300ETF	510300	268	易方达中证医疗 ETF	159847
120	华泰柏瑞上证红利 ETF	510880	269	易方达中证银行 ETF	516310
121	华泰柏瑞上证科创板 50 成份 ETF	588090	270	易方达中证云计算与大数据主题 ETF	516510
122	华泰柏瑞中证 1000ETF	516300	271	易方达中证智能电动汽车 ETF	516590
123	华泰柏瑞中证 500 增强策略 ETF	561550	272	银华恒生港股通中国科技 ETF	513160
124	华泰柏瑞中证电力 ETF	561560	273	银华中证 5G 通信主题 ETF	159994
125	华泰柏瑞中证动漫游戏 ETF	516770	274	银华中证创新药产业 ETF	159992
126	华泰柏瑞中证港股通 50ETF	513550	275	银华中证港股通消费主题 ETF	159735
127	华泰柏瑞中证港股通科技 ETF	513150	276	银华中证港股通医药卫生综合 ETF	159776
128	华泰柏瑞中证光伏产业 ETF	515790	277	银华中证光伏产业 ETF	516880
129	华泰柏瑞中证红利低波动 ETF	512890	278	银华中证基建 ETF	516950
130	华泰柏瑞中证沪港深创新药 ETF	517120	279	银华中证科创创业 50ETF	159782
131	华泰柏瑞中证沪港深互联网 ETF	517050	280	银华中证内地地产主题 ETF	159768
132	华泰柏瑞中证科技 100ETF	515580	281	银华中证全指证券公司 ETF	159842
133	华泰柏瑞中证全指医疗保健 ETF	516790	282	银华中证虚拟现实主题 ETF	159786
134	华泰柏瑞中证物联网主题 ETF	516330	283	永赢中证全指医疗器械 ETF	159883
135	华泰柏瑞中证稀土产业 ETF	516780	284	招商创业板大盘 ETF	159991
136	华泰柏瑞中证智能汽车主题 ETF	516520	285	招商国证食品饮料 ETF	159843
137	华夏 MSCI 中国 A50 互联互通 ETF	159601	286	招商沪深 300 增强策略 ETF	561990
138	华夏创成长 ETF	159967	287	招商上证港股通 ETF	513990
139	华夏创蓝筹 ETF	159966	288	招商上证消费 80ETF	510150
140	华夏国证半导体芯片 ETF	159995	289	招商深证 100ETF	159975
141	华夏恒生中国内地企业高股息率 ETF	159726	290	招商中证电池主题 ETF	561910
142	华夏沪港通恒生 ETF	513660	291	招商中证红利 ETF	515080

序号	证券名称	证券代码	序号	证券名称	证券代码
143	华夏沪深 300ETF	510330	292	招商中证沪港深 500 医药卫生 ETF	517990
144	华夏上证 50ETF	510050	293	招商中证科创创业 50ETF	588300
145	华夏上证科创板 50 成份 ETF	588000	294	招商中证全指软件 ETF	159899
146	华夏饲料豆粕期货 ETF	159985	295	招商中证全指医疗器械 ETF	159898
147	华夏中证 100ETF	159845	296	招商中证畜牧养殖 ETF	516670
148	华夏中证 500ETF	512500	297	中金 MSCI 中国 A 股国际质量 ETF	515910
149	华夏中证 5G 通信主题 ETF	515050	298	中证银行 ETF	512820

B、《可投资产支持证券清单》

序号	证券名称	证券代码
1	20 中联重科 ABN001 优先 A2	082000538
2	21 中联重科 ABN001 优先 A1	082100799
3	21 中联重科 ABN002 优先 A1	082101326
4	21 中联重科 ABN002 优先 A2	082101327
5	22 中联重科 ABN001 优先 A1	082280257

C、《可投可转债券清单》

序号	债券代码	债券名称	发行人名称
1	110043	无锡转债	无锡农村商业银行股份有限公司
2	110045	海澜转债	海澜之家集团股份有限公司
3	110048	福能转债	福建福能股份有限公司
4	110053	苏银转债	江苏银行股份有限公司
5	110057	现代转债	上海现代制药股份有限公司
6	110061	川投转债	四川川投能源股份有限公司
7	110062	烽火转债	烽火通信科技股份有限公司
8	110067	华安转债	华安证券股份有限公司
9	110079	杭银转债	杭州银行股份有限公司
10	110081	闻泰转债	闻泰科技股份有限公司
11	110083	苏租转债	江苏金融租赁股份有限公司
12	113011	光大转债	中国光大银行股份有限公司
13	113013	国君转债	国泰君安证券股份有限公司
14	113037	紫银转债	江苏紫金农村商业银行股份有限公司
15	113043	财通转债	财通证券股份有限公司
16	113044	大秦转债	大秦铁路股份有限公司
17	113045	环旭转债	环旭电子股份有限公司
18	113046	金田转债	宁波金田铜业(集团)股份有限公司
19	113047	旗滨转债	株洲旗滨集团股份有限公司
20	113049	长汽转债	长城汽车股份有限公司
21	113051	节能转债	中节能风力发电股份有限公司
22	113054	绿动转债	绿色动力环保集团股份有限公司
23	113055	成银转债	成都银行股份有限公司
24	113056	重银转债	重庆银行股份有限公司
25	113057	中银转债	中国银河证券股份有限公司
26	113616	韦尔转债	上海韦尔半导体股份有限公司
27	113631	皖天转债	安徽省天然气开发股份有限公司
28	113641	华友转债	浙江华友钴业股份有限公司
29	123108	乐普转 2	乐普(北京)医疗器械股份有限公司
30	127005	长证转债	长江证券股份有限公司

序号	债券代码	债券名称	发行人名称
31	127012	招路转债	招商局公路网络科技控股股份有限公司
32	127014	北方转债	北方国际合作股份有限公司
33	127016	鲁泰转债	鲁泰纺织股份有限公司
34	127018	本钢转债	本钢板材股份有限公司
35	127020	中金转债	深圳市中金岭南有色金属股份有限公司
36	127022	恒逸转债	恒逸石化股份有限公司
37	127024	盈峰转债	盈峰环境科技集团股份有限公司
38	127028	英特转债	浙江英特集团股份有限公司
39	127032	苏行转债	苏州银行股份有限公司
40	127038	国微转债	紫光国芯微电子股份有限公司
41	127039	北港转债	北部湾港股份有限公司
42	127040	国泰转债	江苏国泰国际集团股份有限公司
43	127056	中特转债	中信泰富特钢集团股份有限公司
44	127058	科伦转债	四川科伦药业股份有限公司
45	127064	杭氧转债	杭氧集团股份有限公司
46	128034	江银转债	江苏江阴农村商业银行股份有限公司
47	128035	大族转债	大族激光科技产业集团股份有限公司
48	128048	张行转债	江苏张家港农村商业银行股份有限公司
49	128136	立讯转债	立讯精密工业股份有限公司

D、《信用债发行人清单》

序号	机构全称	序号	机构全称
1	TCL 科技集团股份有限公司	105	深圳市特发集团有限公司
2	安徽出版集团有限责任公司	106	深圳市投资控股有限公司
3	安徽古井集团有限责任公司	107	深圳市资本运营集团有限公司
4	安徽省交通控股集团有限公司	108	深圳顺丰泰森控股(集团)有限公司
5	安徽省能源集团有限公司	109	四川成渝高速公路股份有限公司
6	百联集团有限公司	110	四川川投能源股份有限公司
7	北京国有资本运营管理有限公司	111	四川省投资集团有限责任公司
8	北京京能清洁能源电力股份有限公司	112	唐山港集团股份有限公司
9	北京控股集团有限公司	113	天马微电子股份有限公司
10	北京市顺义区国有资本经营管理有限公司	114	王府井集团股份有限公司
11	北京首创生态环保集团股份有限公司	115	潍柴控股集团有限公司
12	北京首农食品集团有限公司	116	无锡市市政公用产业集团有限公司
13	北京水务投资中心	117	五矿资本控股有限公司
14	北控水务(中国)投资有限公司	118	五凌电力有限公司
15	北控水务集团有限公司	119	武汉商贸集团有限公司
16	北新建材集团有限公司	120	武商集团股份有限公司
17	比亚迪股份有限公司	121	厦门国际港务股份有限公司
18	成都环境投资集团有限公司	122	厦门夏商集团有限公司
19	成都市兴蓉环境股份有限公司	123	徐工集团工程机械股份有限公司
20	大秦铁路股份有限公司	124	云南铜业股份有限公司
21	东风汽车集团股份有限公司	125	韵达控股股份有限公司
22	东莞市交通投资集团有限公司	126	漳州市九龙江集团有限公司
23	福建发展高速公路股份有限公司	127	招商局港口集团股份有限公司
24	福建省能源集团有限责任公司	128	招商局公路网络科技控股股份有限公司
25	福建省投资开发集团有限责任公司	129	招商局集团有限公司

序号	机构全称	序号	机构全称
26	福州国有资本投资运营集团有限公司	130	浙江沪杭甬高速公路股份有限公司
27	光明食品(集团)有限公司	131	浙江吉利控股集团有限公司
28	广东省高速公路有限公司	132	浙江省国有资本运营有限公司
29	广东省公路建设有限公司	133	浙江省交通投资集团有限公司
30	广东省路桥建设发展有限公司	134	浙江省金融控股有限公司
31	广西桂冠电力股份有限公司	135	浙江省能源集团有限公司
32	广州智能装备产业集团有限公司	136	郑州自来水投资控股有限公司
33	国家电网有限公司	137	中材科技股份有限公司
34	国家开发投资集团有限公司	138	中电海康集团有限公司
35	国家能源集团新能源有限责任公司	139	中广核风电有限公司
36	国家能源投资集团有限责任公司	140	中国宝武钢铁集团有限公司
37	国寿投资保险资产管理有限公司	141	中国北方工业有限公司
38	国投电力控股股份有限公司	142	中国北方稀土(集团)高科技股份有限公司
39	国网新源控股有限公司	143	中国兵器工业集团有限公司
40	杭州市金融投资集团有限公司	144	中国兵器装备集团有限公司
41	杭州市商贸旅游集团有限公司	145	中国长江电力股份有限公司
42	杭州市实业投资集团有限公司	146	中国长江三峡集团有限公司
43	河北建投交通投资有限责任公司	147	中国船舶重工集团有限公司
44	河南交通投资集团有限公司	148	中国第一汽车集团有限公司
45	河南省交通运输发展集团有限公司	149	中国电信股份有限公司
46	河南水利投资集团有限公司	150	中国电子科技集团有限公司
47	河南中原高速公路股份有限公司	151	中国东方电气集团有限公司
48	湖北交通投资集团有限公司	152	中国葛洲坝集团股份有限公司
49	湖北能源集团股份有限公司	153	中国光大控股有限公司
50	湖南省高速公路集团有限公司	154	中国广核电力股份有限公司
51	华宝投资有限公司	155	中国广核集团有限公司
52	华鲁控股集团有限公司	156	中国贵州茅台酒厂(集团)有限责任公司
53	华能澜沧江水电股份有限公司	157	中国国际海运集装箱(集团)股份有限公司
54	华能资本服务有限公司	158	中国国新控股有限责任公司
55	华润股份有限公司	159	中国航空工业集团有限公司
56	华润医药控股有限公司	160	中国航空技术国际控股有限公司
57	华数数字电视传媒集团有限公司	161	中国航空技术深圳有限公司
58	江苏凤凰出版传媒集团有限公司	162	中国航天科技集团有限公司
59	江苏宁沪高速公路股份有限公司	163	中国核工业集团有限公司
60	江苏省广电有线信息网络股份有限公司	164	中国核能电力股份有限公司
61	江苏省国信集团有限公司	165	中国华电集团有限公司
62	江苏省农垦集团有限公司	166	中国华能集团有限公司
63	江苏洋河集团有限公司	167	中国化学工程集团有限公司
64	江西省出版传媒集团有限公司	168	中国机械工业集团有限公司
65	龙源电力集团股份有限公司	169	中国建材集团有限公司
66	泸州老窖股份有限公司	170	中国建银投资有限责任公司
67	泸州老窖集团有限责任公司	171	中国节能环保集团有限公司
68	内蒙古伊利实业集团股份有限公司	172	中国巨石股份有限公司
69	南方工业资产管理有限责任公司	173	中国科学院控股有限公司
70	南京新工投资集团有限责任公司	174	中国联合网络通信有限公司
71	宁波开发投资集团有限公司	175	中国蒙牛乳业有限公司
72	宁波通商集团有限公司	176	中国能源建设股份有限公司

序号	机构全称	序号	机构全称
73	宁波舟山港股份有限公司	177	中国燃气控股有限公司
74	宁波舟山港集团有限公司	178	中国石化上海石油化工股份有限公司
75	山东出版集团有限公司	179	中国石油化工股份有限公司
76	山东重工集团有限公司	180	中国石油化工集团有限公司
77	陕西投资集团有限公司	181	中国石油天然气股份有限公司
78	陕西延长石油(集团)有限责任公司	182	中国石油天然气集团有限公司
79	上海百联集团股份有限公司	183	中国外运股份有限公司
80	上海宝钢包装股份有限公司	184	中国五矿集团有限公司
81	上海城投(集团)有限公司	185	中国冶金科工股份有限公司
82	上海大宁资产经营(集团)有限公司	186	中国冶金科工集团有限公司
83	上海纺织(集团)有限公司	187	中国医药投资有限公司
84	上海国际港务(集团)股份有限公司	188	中国远洋海运集团有限公司
85	上海国际集团有限公司	189	中国中材国际工程股份有限公司
86	上海国际集团资产管理有限公司	190	中国中车股份有限公司
87	上海国有资产经营有限公司	191	中国中车集团有限公司
88	上海华谊(集团)公司	192	中国中化股份有限公司
89	上海汽车集团股份有限公司	193	中国中药控股有限公司
90	上海上报资产管理有限公司	194	中航机载系统有限公司
91	上海上实(集团)有限公司	195	中化国际(控股)股份有限公司
92	上海市信息投资股份有限公司	196	中化能源股份有限公司
93	上海外高桥集团股份有限公司	197	中联重科股份有限公司
94	上海文化广播影视集团有限公司	198	中粮集团有限公司
95	上海新世界(集团)有限公司	199	中石油昆仑燃气有限公司
96	上海医药集团股份有限公司	200	中铁铁龙集装箱物流股份有限公司
97	申能(集团)有限公司	201	中文天地出版传媒集团股份有限公司
98	深圳高速公路集团股份有限公司	202	中央汇金投资有限责任公司
99	深圳国际控股有限公司	203	中银集团投资有限公司
100	深圳能源集团股份有限公司	204	中远海运控股股份有限公司
101	深圳市创新投资集团有限公司	205	重庆高速公路股份有限公司
102	深圳市机场(集团)有限公司	206	重庆渝富控股集团有限公司
103	深圳市燃气集团股份有限公司	207	紫金矿业集团股份有限公司
104	深圳市水务(集团)有限公司		

附件五：托管银行证券资金结算协议

托管人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》、《中国证券登记结算有限责任公司、上海证券交易所、深圳证券交易所债券质押式回购交易结算风险控制指引》等有关法律法规、部门规章及相关业务规则，托管人、管理人双方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达成如下约定：

第一条管理人管理并由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、证券公司资产管理产品、期货公司资产管理产品、银行理财产品、保险产品、保险资产管理产品、信托产品等），应由托管人与结算公司办理证券资金结算业务；托管人负责参与结算公司多边净额结算业务，管理人应当按照托管人提供的清算结果，按时履行交收义务，并承担对托管人的最终交收责任。

第二条托管人、管理人双方同意遵守结算公司制定的业务规则。

第三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。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；同时负责办理与管理人之间证券和资金的二级清算交收。

第四条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，与管理人完成不可撤销的证券、资金交收处理。

第五条管理人管理资产交收违约应遵循谁过错谁赔偿的原则。

（一）因管理人头寸匡算错误等管理人原因导致的交收违约实际损失，由管理人承担。

（二）因托管人操作失误等托管人原因导致的交收违约实际损失，由托管人承担。

（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，托管人不得擅自用管理人管理托管资产的证券和资金从事证券交易。托管人擅自用管理人管理托管资产的证券和资金造成损失的，应当对管理人管理资产及管理人遭受的实际损失承担赔偿责任。托管人擅自用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，且管理人不承担任何相关费用。若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管理人承担。

第六条托管人按照结算公司的规定，以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。

第七条根据结算公司业务规则，托管人依法向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管理人、托管人双方的其他书面协议或约定执行。若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，管理人应于规定时间内补足款项。

第八条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，于收息当日向管理人管理资产支付。

第九条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，分别用以计算管理人管理资产资金和证券的应收或应付净额，形成管理人当日交易清算结果。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。

第十条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，应及时与管理人沟通。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管理人T日交易清算结果，完成管理人管理资产资金、证券的交收。

第十一条管理人对托管人提供的清算数据存有异议，应及时与托管人沟通，但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，确属托管人清算差错的，托管人应予以更正并赔偿托管资产及管理人实际损失；若经核实，确属结算公司清算差错的，管理人应配合托管人与结算公司沟通。若因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，责任由管理人承担。

第十二条为确保托管人与结算公司的正常交收，不影响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。

第十三条若因管理人管理导致管理资产资金账户T日余额无法满足T+1日交收要求时，管理人应按照《资产管理合同》或《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资产管理合同或托管协议或其他文件中约定。

第十四条管理人知晓并同意，当管理人对托管人发生资金交收违约时，托管人有权向结算公司申报冻结管理人管理资产的证券账户内与违约资金等额的证券，申报冻结证券的证券品种、数量可由托管人确定。管理人未按本规定第十三条约定时限补足透支金额，其行为构成管理人资金交收违约，托管人依法按以下方式处理，且管理人应予以配合：

（一）管理人应在不晚于结算公司规定的时点前两个小时向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。管理人指定的证券需得到托管人同意，若由于证券评级或者流动性等原因不满足托管人要求或者管理人未能按时指定的，托管人依法自主确定相关证券作为交收履约担保物，并及时书面通知管理人。管理人未及时向托管人指定或指定错误的，相关责任由管理人承担。

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，管理人应向托管人出具同意结算公司协助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托管人、管理人及委托人或受托人的托管资产，管理人向托管人出具的书面文件应经管理人委托人或受托人确认。委托人或受托人与托管人、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）管理人于T+2日在结算公司规定时间前补足相应资金的，托管人可向结算公司申请解除对相关证券的冻结；否则，管理人应配合托管人对冻结证券予以处置，如管理人不配合，托管人依法对冻结证券进行处置，但须及时书面通知管理人。

（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，不足部分管理人及时补足。

第十五条管理人知晓并同意，当管理人原因导致管理资产中用于质押式回购应付资金不足且对托管人发生资金交收违约、但托管人未对结算公司交收违约的情况

下，托管银行有权向结算公司申报将管理人管理资产中的回购质押券划转至托管银行的证券处置账户，申报划转的质押券品种、数量可由托管人确定。

管理人知晓并确认，管理人管理资产中用于融资回购的债券将作为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，但须及时书面通知管理人。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管理人委托人或受托人所应承担的委托债券投资风险，及时书面告知管理人委托人或受托人，并由管理人委托人或受托人签字确认。委托人或受托人与托管人、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。

第十六条由于管理人原因，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，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管理人收取违约金。管理人须在两个交易日内补足相关证券及其权益。管理人未能补足的，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管理人承担，收益归托管资产所有。

第十七条因管理人原因发生资金交收违约时，托管人依法采取以下风险管理措施，但须提前书面通知管理人：

- （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。

第十八条如因管理人原因造成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管理人自行承担，由此造成管理人管理资产及托管人实际损失，管理人应负责赔偿。如因托管人原因造成未及时将管理人应收资金支付给管理人或未及时委托证券登记结算机构将管理人应收证券划付到管理人证券账户的，托管人应当对管理人承担违约责任；如因托管人原因造成对结算公司交收违约的，相应后果由托管人承担。以上造成的托管资产及管理人的实际损失，托管人应负责赔偿。

第十九条管理人管理产品出现融资回购规模较大、融资回购规模增长较快，回购未到期金额与债券托管量占比较高，低信用等级质押券入库占比过高，单只债券入库集中度过高，经多次催告仍未补足欠库等情形之一或托管人认定的其他高风险情形的，托管人可以根据《中国证券登记结算有限责任公司、上海证券交易所、深圳证券交易所债券质押式回购交易结算风险控制指引》的相关规定采取以下措施：

- （一）要求管理人降低该产品回购规模；
- （二）要求管理人降低某只或某些债券的入库占比；
- （三）对管理人征收额外现金保证金；
- （四）提请中国结算、证券交易所对管理人采取相关自律监管措施，或者限制管理人融资回购交易；
- （五）向中国证监会各派出机构或中国证券业协会、中国基金业协会报告；
- （六）托管人认为必要的其他措施。

第二十条若因法律法规、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、业务规则的规定为准。

（以下无正文）

（此页无正文，为《东方红添盈1号集合资产管理计划资产管理合同》签署页。）

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

投资者

1、自然人

姓名：

证件名称：身份证、军官证、护照

证件号码：

住所：

通讯地址：

联系人：

邮政编码：

联系电话：

邮箱：

传真：

2、法人或其他组织

名称：

统一社会信用代码：

法定代表人或授权代表：

住所：

通讯地址：

联系人：

邮政编码：

联系电话：

邮箱：

传真：

（如采取电子签名合同，投资者的详细情况在电子签名合同数据电文中列示。）

（此页无正文，为《东方红添盈1号集合资产管理计划资产管理合同》签署页。）

投资者：

自然人（签字）：或法人或其他组织（盖章）：

法定代表人或授权代表（签字或盖章）：

签署日期： 年 月 日

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表：

签署日期： 年 月 日

托管人：广州农村商业银行股份有限公司（盖章）：

负责人或授权代表：

签署日期： 年 月 日