

华菁CTA量化1号集合资产管理计划

2020年3季度托管人履职报告

本托管人依据 华菁证券有限公司 与我司签署的《资产管理合同》(以下简称《管理合同》) 及相关法律法规履行托管责任，现将本报告期间托管情况报告如下：

一、本托管人在报告期间，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在损害资产委托人利益的行为。

- (一)本托管人以诚实守信、审慎尽责的原则履行托管职责，安全保管托管专户内委托资产;非依法规定、行政法规或管理合同约定，不得擅自用或处分托管资产;
- (二)根据管理合同约定，执行管理人划款指令，办理托管账户项下资金往来;
- (三)妥善保管与委托资产有关的会计账册、凭证、合同等资料;
- (四)根据《管理合同》规定，对资产管理人运用投资组合资产进行投资的行为进行了监督;
- (五)为投资组合单独设立托管专户，与自有账户以及所托管的其他非本投资组合的托管专户分别保管，实行了严格的分账管理，维护投资组合资产的独立性。

二、本计划托管人复核了管理人的 2020年3季度报告中财务数据，该数据与托管人数据一致。

托管人：中信证券股份有限公司

二零二零年十月二十二日