华兴中证500指数增强2号集合资产管理计划
资产管理合同变更的公告

华兴证券

华兴证券有限公司

二〇二一年八月二十三日

尊敬的资产委托人：

“华兴中证500指数增强2号集合资产管理计划”(以下简称“本集合计划”）由我公司担任管理人，中信建投证券股份有限公司担任托管人；本集合计划已于2021年6月4日成立，并于2021年6月7日在中国证券投资基金业协会完成成立备案。

现就《华兴中证500指数增强2号集合资产管理计划资产管理合同》（以下简称“《资产管理合同》”）条款变更事项公告如下：

根据相关法律法规和《资产管理合同》的约定，经与托管人协商，我公司拟对《资产管理合同》的条款进行变更；变更内容为：

章节	原文	修订
第二部分 释义	（二十五）封闭期：本计划的首个封闭期为自本计划成立日起至第一个开放日（不含该日）之间的期间，之后的封闭期为每相邻两个开放日之间的期间（不含开放日）。	（二十五）封闭期：指本计划存续期内除开放期以外的其他日期。
第四部分 当事人及权利义务	（二）管理人 名称：华兴证券有限公司 住所：上海市虹口区吴淞路575号2501室 联系人：李晨 通讯地址：上海市虹口区吴淞路575号2501室 联系电话：021-60156792	（二）管理人 名称：华兴证券有限公司 住所：上海市虹口区东大名路1089号2301单元 联系人：李晨 通讯地址：上海市虹口区东大名路1089号北外滩来福士东塔23楼 联系电话：021-60156792
第五部分 本计划的基本情况	（五）本计划的投资范围 本集合计划属于商品及金融衍生品类产品。投资范围包括：	（五）本计划的投资范围 本集合计划属于商品及金融衍生品类产品。投资范围包括：

	1、商品及金融衍生品类资产：证券交易所和期货交易所交易的期货和期权合约、权证、场外衍生品； 2、权益类资产：沪深交易所依法发行上市的股票（含科创板股票，含网上新股申购与网下新股申购）、优先股、港股通、存托凭证、股票型公募证券投资基金、混合型公募证券投资基金、融资融券； 3、固定收益类资产：银行存款、同业存单，证券交易所和全国银行间债券市场等国务院同意设立的交易场所交易的债券、资产支持证券、央行票据和非金融企业融资工具（含资产支持票据）等，债券型基金，货币市场基金，债券回购，转融通证券出借交易； 4、其他资产管理产品：商业银行理财计划、集合资金信托计划、证券期货经营机构管理的集合资产管理计划、保险资产	1、商品及金融衍生品类资产：证券交易所和期货交易所交易的期货和期权合约、权证； 2、权益类资产：沪深交易所依法发行上市的股票（含科创板股票，含网上新股申购与网下新股申购）、优先股、港股通、存托凭证、股票型公募证券投资基金、混合型公募证券投资基金、融资融券； 3、固定收益类资产：银行存款、同业存单，证券交易所和全国银行间债券市场等国务院同意设立的交易场所交易的债券、资产支持证券、央行票据和非金融企业融资工具（含资产支持票据）等，债券型基金，货币市场基金，债券回购，转融通证券出借交易； 4、中国证监会认可的其他投资品种。 （六）本计划的投资比例（占集合计划资产总值）

	管理产品、私募证券投资基金等金融监管部门批准或备案发行的资产管理产品； 5、中国证监会认可的其他投资品种。 本集合计划投资的其他资产管理产品，应当全部投资于上文列示的权益类资产、固定收益类资产、商品及衍生品类资产，不得投资于非标准化债权或股权资产，且按照穿透原则合并计算后任意一类/任意资产的占比不得违反本合同关于该类资产/同一资产的投资比例限制，不得违反本合同的投资限制和投资禁止。本集合计划投资于其他资产管理产品的，所投资的资产管理产品不得再投资公募证券投资基金以外的资产管理产品。 （六）本计划的投资比例（占集合计划资产总值） 1、投资于商品及金融衍生品的持仓合约价值的比例不低于资	1、投资于商品及金融衍生品的持仓合约价值的比例不低于资产管理计划总资产80%，且衍生品账户权益超过资产管理计划总资产的20%； 2、权益类资产占资产管理计划总资产的比例为：0-80%； 3、固定收益类资产占资产管理计划总资产的比例为：0-80%。 管理人将根据具体投资资产的投资限制，合理分配各资产占资产管理计划总资产的比例，以保证所投向的最终资产满足上述投资比例要求。

	产管理计划总资产80%，且衍生品账户权益超过资产管理计划总资产的20%； 2、权益类资产占资产管理计划总资产的比例为：0-80%； 3、固定收益类资产占资产管理计划总资产的比例为：0-80%； 4、其他资产管理产品占资产管理计划总资产的比例为：0-80%。 管理人将根据具体投资资产的投资限制，合理分配各资产占资产管理计划总资产的比例，以保证所投向的最终资产满足上述投资比例要求。	
第八部分 本计划的参与、退出与转让	三、参与和退出的开放日和时间 本计划采取定期开放的方式运作，即采取在封闭期内封闭运作、封闭期与封闭期之间定期开放的运作方式。	三、参与和退出的开放日和时间 本计划采取定期开放的方式运作，即采取在封闭期内封闭运作、封闭期与封闭期之间定期开放的运作方式。

	本计划的封闭期指自计划成立日起（包括计划成立日）或自每一开放期结束之日起（包括该开放期结束之日次日）三个月的期间，具体而言，本计划的第一个封闭期为计划成立日（包括计划成立日）起至三个月后的月度对日的前一日历日止；首个封闭期结束之后第一个工作日起进入首个开放期，下一个封闭期为首个开放期结束之日的下一个日历日起（包括首个开放期结束之日的下一个日历日）至该封闭期首日三个月后月度对日的前一日历日止。以此类推，本计划在封闭期内不办理参与和退出业务。 上述所述之“月度对日”指某一特定日期在后续日历月度中的对应日期，若日历月度中不存在该对应日期或日历月度中该对应日期为非工作日的，则顺延至下一个工作日。 本计划的开放期期间可以办理参与和退出业务，每个开放期	本计划的开放期为每周的周三（如当日为非工作日，则该周不开放）；除开放期以外的日期均为封闭期。本计划在开放期间办理参与和退出业务，封闭期内不办理参与和退出业务。 如发生不可抗力或其他情形致使本计划无法按时开放参与和退出业务，或依据本合同需暂停参与和退出业务的，开放期顺延至前述情形消除之日的下一个工作日。 若中国证监会有新的规定，或出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更或发生其他特殊情况，管理人将视情况对前述开放期及开放时间进行相应的调整并告知委托人。 管理人可以在其网站上信息披露的方式履行向委托人告知的义务。

	最长不超过5个工作日，最短为1个工作日。具体开放日期由管理人提前2个工作日在管理人网站上进行披露，并以披露中载明的日期为准。 例：如本计划于2021年5月26日成立，则第一个封闭期为2020年5月26日（含当日）至2021年8月25日（含当日），假设开放期为5个工作日，则第一个开放期为2021年8月26日（含当日）至2021年9月1日（含当日），第二个封闭期为2021年9月2日（含当日）至2021年12月1日（含当日）。 如发生不可抗力或其他情形致使本计划无法按时开放参与和退出业务，或依据本合同需暂停参与和退出业务的，开放期顺延至前述情形消除之日的下一个工作日。 若中国证监会有新的规定，或出现新的证券交易市场、证券	

	交易所交易时间变更或发生其他特殊情况，管理人将视情况对前述开放期及开放时间进行相应的调整并告知委托人。管理人可以在其网站上信息披露的方式履行向委托人告知的义务。	
第十一部分 资产管理计划的投资	（一）投资范围： 本集合计划属于商品及金融衍生品类产品，符合《运作规定》组合投资的要求。本集合计划的投资范围包括： 1、商品及金融衍生品类资产：证券交易所和期货交易所交易的期货和期权合约、权证、场外衍生品； 2、权益类资产：沪深交易所依法发行上市的股票（含科创板股票，含网上新股申购与网下新股申购）、优先股、港股通、存托凭证、股票型公募证券投资基金、混合型公募证券投资基金、融资融券；	（一）投资范围： 本集合计划属于商品及金融衍生品类产品，符合《运作规定》组合投资的要求。本集合计划的投资范围包括： 1、商品及金融衍生品类资产：证券交易所和期货交易所交易的期货和期权合约、权证； 2、权益类资产：沪深交易所依法发行上市的股票（含科创板股票，含网上新股申购与网下新股申购）、优先股、港股通、存托凭证、股票型公募证券投资基金、混合型公募证券投资基金、融资融券；

	3、固定收益类资产：银行存款、同业存单，证券交易所和全国银行间债券市场等国务院同意设立的交易场所交易的债券、资产支持证券、央行票据和非金融企业融资工具（含资产支持票据）等，债券型基金，货币市场基金，债券回购，转融通证券出借交易； 4、其他资产管理产品：商业银行理财计划、集合资金信托计划、证券期货经营机构管理的集合资产管理计划、保险资产管理产品、私募证券投资基金等金融监管部门批准或备案发行的资产管理产品。 5、中国证监会认可的其他投资品种。 特别提示：本计划可参与证券回购、融资融券、场外衍生品、转融通证券出借业务。 如本计划存续期间投资于场外衍生品的，将在定期报告中对	3、固定收益类资产：银行存款、同业存单，证券交易所和全国银行间债券市场等国务院同意设立的交易场所交易的债券、资产支持证券、央行票据和非金融企业融资工具（含资产支持票据）等，债券型基金，货币市场基金，债券回购，转融通证券出借交易； 4、中国证监会认可的其他投资品种。 特别提示：本计划可参与证券回购、融资融券、转融通证券出借业务。 （二）投资比例（占集合计划资产总值）： 1、投资于商品及金融衍生品的持仓合约价值的比例不低于资产管理计划总资产80%，且衍生品账户权益超过资产管理计划总资产的20%； 2、权益类资产占资产管理计划总资产的比例为：0-80%；

	当期的场外衍生品投资情况进行披露。 本计划的其他资产管理产品，应当全部投资于上文列示的权益类资产、固定收益类资产、商品及衍生品类资产，不得投资于非标准化债权或股权类资产，且按照穿透原则合并计算后任意一类/任意资产的占比不得违反本合同关于该类资产/同一资产的投资比例限制，不得违反本合同的投资限制和投资禁止。本计划投资于其他资产管理产品的，所投资的资产管理产品不得再投资公募证券投资基金以外的资产管理产品。 （二）投资比例（占集合计划资产总值）： 1、投资于商品及金融衍生品的持仓合约价值的比例不低于资产管理计划总资产 80%，且衍生品账户权益超过资产管理计划总资产的 20%; 2、权益类资产占资产管理计划总资产的比例为：0-80%;	3、固定收益类资产占资产管理计划总资产的比例为：0-80%;管理人将根据具体投资资产的投资限制，合理分配各资产占资产管理计划总资产的比例，以保证所投向的最终资产满足上述投资比例要求。

	3、固定收益类资产占资产管理计划总资产的比例为：0-80%； 4、其他资产管理产品占资产管理计划总资产的比例为：0-80%。 管理人将根据具体投资资产的投资限制，合理分配各资产占资产管理计划总资产的比例，以保证所投向的最终资产满足上述投资比例要求。	
第十八部分 越权交易的界定	三、托管人对管理人投资运作的监督 （一）托管人对下列资产管理计划的投资事项及管理人投资行为进行监督： 1．对本合同约定的投资范围进行监督； 本集合计划属于商品及金融衍生品类产品。投资范围包括： （1）商品及金融衍生品类资产：证券交易所和期货交易所交	三、托管人对管理人投资运作的监督 （一）托管人对下列资产管理计划的投资事项及管理人投资行为进行监督： 1．对本合同约定的投资范围进行监督； 本集合计划属于商品及金融衍生品类产品。投资范围包括： （1）商品及金融衍生品类资产：证券交易所和期货交易所交

	易的期货和期权合约、权证、场外衍生品； （2）权益类资产：沪深交易所依法发行上市的股票（含科创板股票，含网上新股申购与网下新股申购）、优先股、港股通、存托凭证、股票型公募证券投资基金、混合型公募证券投资基金、融资融券； （3）固定收益类资产：银行存款、同业存单，证券交易所和全国银行间债券市场等国务院同意设立的交易场所交易的债券、资产支持证券、央行票据和非金融企业融资工具（含资产支持票据）等，债券型基金，货币市场基金，债券回购，转融通证券出借交易； （4）其他资产管理产品：商业银行理财计划、集合资金信托计划、证券期货经营机构管理的集合资产管理计划、保险资产管理产品、私募证券投资基金等金融监管部门批准或备案	易的期货和期权合约、权证； （2）权益类资产：沪深交易所依法发行上市的股票（含科创板股票，含网上新股申购与网下新股申购）、优先股、港股通、存托凭证、股票型公募证券投资基金、混合型公募证券投资基金、融资融券； （3）固定收益类资产：银行存款、同业存单，证券交易所和全国银行间债券市场等国务院同意设立的交易场所交易的债券、资产支持证券、央行票据和非金融企业融资工具（含资产支持票据）等，债券型基金，货币市场基金，债券回购，转融通证券出借交易； （4）中国证监会认可的其他投资品种。 投资比例（占集合计划资产总值）： （1）权益类资产占资产管理计划总资产的比例为：0-80%；

	发行的资产管理产品。 （5）中国证监会认可的其他投资品种。 投资比例（占集合计划资产总值）： （1）权益类资产占资产管理计划总资产的比例为：0-80%; （2）固定收益类资产占资产管理计划总资产的比例为：0-80%; （3）投资于商品及金融衍生品的持仓合约价值的比例不低于资产管理计划总资产 80%，且衍生品账户权益超过资产管理计划总资产的 20%。 （4）其他资产管理产品占资产管理计划总资产的比例为：0-80%。	（2）固定收益类资产占资产管理计划总资产的比例为：0-80%; （3）投资于商品及金融衍生品的持仓合约价值的比例不低于资产管理计划总资产 80%，且衍生品账户权益超过资产管理计划总资产的 20%。
第十九部分 资产管理计划财	（十）衍生品的估值方法 中国金融期货交易所上市流通的股指期货、国债期货以估值	（十）衍生品的估值方法 中国金融期货交易所上市流通的股指期货、国债期货以估值日

产的估值和会计核算	日结算价计算估值,该日无交易的，以最近一交易日的结算价估值。 各商品期货交易所上市流通的商品期货以估值日结算价计算估值,该日无交易的，以最近一交易日的结算价估值。 场内期权以估值日所在交易所的当日结算价估值，该日无交易的，以最近一交易日的结算价估值。 其他场外衍生品按照交易对手方或第三方提供的估值日前一工作日的估值报告进行估值；如果管理人没有取得估值日前一工作日的估值报告，则按照交易对手方或第三方最近提供的估值报告估值；第三方或交易对手无法提供估值报告的，按成本估值。 从持有确认日起到卖出日或行权日止，上市交易的认沽/认购权证按估值日的收盘价估值，估值日没有交易的，按最近交	结算价计算估值,该日无交易的，以最近一交易日的结算价估值。 各商品期货交易所上市流通的商品期货以估值日结算价计算估值,该日无交易的，以最近一交易日的结算价估值。 场内期权以估值日所在交易所的当日结算价估值，该日无交易的，以最近一交易日的结算价估值。 从持有确认日起到卖出日或行权日止，上市交易的认沽/认购权证按估值日的收盘价估值，估值日没有交易的，按最近交易日的收盘价估值；未上市交易的认沽/认购权证采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量的情况下，按成本估值；停止交易、但未行权的权证，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，按成本估值。港股通权证以估值日香港证券交易所挂牌的该证券收盘价估值，

	易日的收盘价估值；未上市交易的认沽/认购权证采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量的情况下，按成本估值；停止交易、但未行权的权证，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，按成本估值。港股通权证以估值日香港证券交易所挂牌的该证券收盘价估值，该日无交易的，以最近一交易日的收盘价计算。港股通投资持有外币证券资产估值涉及到港币对人民币汇率的，以上海（深圳）证券交易所估值日终公布的港币对人民币中间价[（结算买入汇兑比率+结算卖出汇兑比率）/2]估值，或其他可以反映公允价值的汇率进行估值。 （十一）其他资产管理产品 1、如管理人在标的产品权益确认日取得并向托管人提供了标的产品权益确认原始凭证的，则以权益确认原始凭证为依据	该日无交易的，以最近一交易日的收盘价计算。港股通投资持有外币证券资产估值涉及到港币对人民币汇率的，以上海（深圳）证券交易所估值日终公布的港币对人民币中间价[（结算买入汇兑比率+结算卖出汇兑比率）/2]估值，或其他可以反映公允价值的汇率进行估值。

	入账；如管理人无法在权益确认日取得并向托管人提供标的产品的权益确认原始凭证的，则在管理人取得并向托管人提供标的产品权益确认原始凭证的提供日当天进行入账，且不对历史账务进行追溯调整； 2、如标的产品有份额净值的，以估值日前一工作日该标的产品份额净值估值，如果管理人没有取得并向托管人提供估值日前一工作日该标的产品份额净值，则按照管理人取得并向托管人提供的最近一次产品份额净值估值。如管理人无法取得并向托管人提供产品份额净值则按取得成本估值。 3、如果标的产品有万份收益的，按估值日前一工作日该标的产品的万份收益计提红利，如管理人无法取得并向托管人提供产品万份收益则不计提红利。 4、如不属于上述情况的，则管理人应向托管人提供标的产品	

	的估值方法和估值数据，并确保提供数据的真实、完整且不得篡改，托管人按管理人提供的数据进行估值。	
第二十三部分风险揭示	（二十二）所投资资产管理产品的特别风险 1、本集合计划投资于各类资产管理产品，集合计划管理人对发行资产管理产品公司的内控信息获取不全，控制力不强，并且所投资资产管理产品的投资经理的知识、经验、判断、决策等，会影响其对信息的占有和对经济形势、金融市场价格走势的判断，如更换投资经理、投资经理判断有误、投资经理的行为违反法律法规的规定、获取信息不全、或对投资工具使用不当影响资产管理产品的收益水平，从而产生风险。 2、投资资产管理产品可能面临双层收费的风险。本资产管理计划委托人需要承担双层费用，即资产管理计划费用及资产	**删除原文**

	管理计划所投资的资产管理产品需要承担费用。资产管理计划所投资的资产管理产品自身需要承担费用包括资产管理产品的管理费、托管费、业绩报酬（如有）、认购费（如有）、赎回费（如有）等，以上费用在计提时将会扣减资产管理产品的资产净值，从而造成资管计划净值下降。 3、本集合计划投资于各类资产管理产品，包括权益类、固定收益类、商品及金融衍生品类、混合类。 权益类产品主要投资于股票等权益类资产，面临市场风险、政策风险、经济周期风险等各类风险，风险相对较高，从而最终对本集合计划造成风险。 商品及金融衍生品类产品主要投资于商品及金融衍生品类资产，面临市场风险、政策风险、经济周期风险等各类风险，风险相对较高，因而最终对本集合计划造成风险。	

	固定收益类产品主要投资于存款、债券等债权类资产，面临信用风险、市场风险、政策风险、经济周期风险等各类风险，从而最终对本集合计划造成风险。 混合类产品可投资于权益类、固定收益类、商品及金融衍生品类、混合类资产，同时面临前述各类资产的投资风险，从而最终对本集合计划造成风险。 4、投资资产管理产品的估值风险。本资产管理计划投资多个底层资产管理产品，每个资产管理产品的估值时间及披露时间可能存在不一致的情形，本资产管理计划按照资管产品估值日最近的净值予以估值。在存续期内，可能存在本资产管理计划产品净值无法反映真实投资管理情况。	

本集合计划说明书及风险揭示书中对应内容一并调整，本次资产管理合同变更内容已经过托管人中信建投证券股份有限公司确认。

根据《资产管理合同》关于合同变更的相关约定，本次合同变更征询期间为自本公告发布之日起至2021年8月24日。本集合计划在2021年8月24日设置特殊退出开放日，委托人不同意合同变更的，应当在2021年8月24日提出退出申请；委托人未在2021年8月24日申请退出本集合计划的，视为同意合同变更，无需另行签署新合同。

在符合《资产管理合同》约定的变更生效条件后，变更后的《资产管理合同》将于2021年8月25日起生效，届时不再另行公告，本公告即成为《资产管理合同》的组成部分。2021年8月25日后首次申请参与本集合计划的投资者签署的《资产管理合同》版本以本公告附件《华兴中证500指数增强2号集合资产管理计划资产管理合同》（2021年8月修订）或届时有效的《资产管理合同》为准。

特此公告。

附件：《华兴中证500指数增强2号集合资产管理计划资产管理合同》（2021年8月修订）

华兴证券有限公司

2021年8月13日

华兴证券有限公司

华兴中证500指数增强2号
集合资产管理计划

资产管理合同
（2021年8月修订）

合同编号：HXSEC-AM-EQ-20210801

管理人：华兴证券有限公司

托管人：中信建投证券股份有限公司

目录

第一部分 前言.....1
第二部分 释义.....2
第三部分 承诺与声明.....6
第四部分 当事人及权利义务.....8
第五部分 本计划的基本情况.....13
第六部分 本计划的募集.....15
第七部分 本计划的成立与备案.....18
第八部分 本计划的参与、退出与转让.....19
第九部分 份额持有人大会及日常机构.....28
第十部分 计划份额的登记.....29
第十一部分 资产管理计划的投资.....30
第十二部分 分级安排.....36
第十三部分 利益冲突及关联交易.....37
第十四部分 投资经理的指定与变更.....39
第十五部分 资产管理计划的财产.....40
第十六部分 投资指令的发送、确认和执行.....44
第十七部分 资产管理计划的交易及清算交收安排.....48
第十八部分 越权交易的界定.....51
第十九部分 资产管理计划财产的估值和会计核算.....54
第二十部分 资产管理计划的费用与税收.....63
第二十一部分 资产管理计划的收益分配.....66
第二十二部分 信息披露与报告.....68
第二十三部分 风险揭示.....71
第二十四部分 资产管理合同的变更、终止与财产清算.....79
第二十五部分 违约责任.....85
第二十六部分 争议的处理.....86
第二十七部分 资产管理合同的效力.....87
第二十八部分 其他事项.....88

第一部分 前言

一、订立本资产管理合同的依据、目的和原则

（一）订立本资产管理合同(以下简称“本合同”)的依据是《中华人民共和国证券投资基金法》《中华人民共和国证券法》《中华人民共和国民法典》《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》《集合资产管理计划资产管理合同内容与格式指引（试行)》《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》、中国证券投资基金业协会自律规则及其他有关规定。

若因法律法规的制定或修改导致本合同的内容与届时有效的法律法规存在冲突，应当以届时有效的法律法规的规定为准，各方当事人应及时对本合同进行相应变更和调整。

（二）订立本合同的目的是在严格遵守国家有关法律法规的前提下，保护本合同各当事人合法权益，明确本合同各当事人之间权利和义务，保证本集合资产管理业务合法、合规及有效地进行。

（三）订立本合同的原则是平等自愿、诚实信用和公平的原则，维护委托人合法权益，不得损害国家利益、社会公共利益和他人的合法权益。

二、管理人应当对本集合计划的设立、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。

三、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，也不代表协会对本计划的合规性、投资价值及投资风险做出保证和判断。委托人应当自行识别产品投资风险并承担投资行为可能出现的损失。

四、本合同是规定各当事人之间权利义务关系的基本法律文件，当事人按照《管理办法》、本合同及本合同附件《华兴中证500指数增强2号集合资产管理计划说明书》《风险揭示书》及其他有关规定，享有权利、承担义务。其他与本计划相关的涉及本合同各当事人之间权利义务关系的任何文件或表述，如与本合同不一致或有冲突，均以本合同为准。

第二部分 释义

在本合同中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

（一）资产管理计划、本资产管理计划、计划、本计划、本集合计划：指华兴中证500指数增强2号集合资产管理计划。

（二）资产管理合同、本资产管理合同、本合同：指委托人、管理人及托管人三方签署的《华兴中证 500 指数增强 2 号集合资产管理计划资产管理合同》（2021 年 8 月修订）及其附件，以及对该合同及附件做出的任何有效变更及补充。

（三）计划说明书：指《华兴中证500指数增强2号集合资产管理计划计划说明书》以及对其做出的任何有效变更及补充。

（四）风险揭示书：指《华兴中证500指数增强2号集合资产管理计划风险揭示书》以及对其做出的任何有效变更及补充。

（五）法律法规：指中国现时有效并公布实施的法律、行政法规、行政规章及规范性文件、地方法规、地方规章及规范性文件。

（六）《民法典》：指《中华人民共和国民法典》。

（七）《基金法》：指《中华人民共和国证券投资基金法》。

（八）《指导意见》：指中国人民银行、中国银行保险监督管理委员会、中国证券监督管理委员会、国家外汇管理局于2018年4月27日联合印发的《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》（银发〔2018〕106号）。

（九）《管理办法》：指中国证监会于2018年10月22日发布并施行的《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》（证监会令[第151号]）。

（十）《运作规定》：指中国证监会于2018年10月22日发布并施行的《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》（证监会公告[2018]31号）。

（十一）《合同指引》：指《集合资产管理计划资产管理合同内容与格式指引（试行）》

（十二）《电子签名法》：指《中华人民共和国电子签名法》。

（十三）《电子签名合同操作指引》：指《证券公司资产管理电子签名合同操作指引》。

（十四）《电子签名约定书》：指根据《电子签名合同操作指引》第八条要

求签署的《电子签名约定书》。

（十五）中国证监会：指中国证券监督管理委员会。

（十六）基金业协会、协会：指中国证券投资基金业协会。

（十七）资产委托人、委托人、份额持有人：指签订本合同且根据本合同及相关文件合法取得本计划份额的、符合《指导意见》和《运作规定》规定条件的合格投资者。

（十八）资产管理人、管理人：指华兴证券有限公司。

（十九）资产托管人、托管人：指中信建投证券股份有限公司。

（二十）投资者：指个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者以及经监管机构同意可投资于本集合计划的其他合格投资者。

个人投资者：指依法可以投资于本集合计划的自然人。

机构投资者：指依法可以投资本集合计划，在中华人民共和国境内合法注册登记或经有权政府部门批准设立的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织，以及监管机构批准的其他合格机构。

合格境外机构投资者：指符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理办法》规定的条件，经中国证监会批准投资于中国证券市场，并且其投资额度已经取得国家外汇管理局批准的中国境外基金管理机构、保险公司、证券公司以及其他资产管理机构。

（二十一）注册登记机构：指办理注册登记业务的机构。本计划的注册登记机构为华兴证券有限公司。

（二十二）推广机构、销售机构：指管理人及其指定的销售机构。

（二十三）信义义务：托管人信义义务是指托管人按恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则，根据相关法律法规和监管规定，在本资产管理合同约定范围内尽职尽责履行安全保管托管资产等托管人职责。

（二十四）初始募集期：指自本计划发售之日起不超过60日的期间。

（二十五）封闭期：指本计划存续期内除开放期以外的其他日期。

（二十六）存续期：指本计划成立日至本计划终止日之间的期限。

（二十七）开放期：指销售机构办理本计划参与、退出等业务的期间。

（二十八）本计划成立日：指资产管理计划初始募集期结束并完成验资，经资产管理人公告本计划成立之日。

（二十九）工作日、交易日、估值日：均指推广期内各推广机构的工作日，或本集合计划成立后上海证券交易所、深圳证券交易所、中国金融期货交易所等依法设立的期货交易所的共同正常交易日。

（三十）认购：指在本计划初始募集期内，资产委托人参与本计划的行为。

（三十一）参与(本计划)：指在本计划开放期内，投资者按照指定销售机构规定的手续，参与本计划的行为。

（三十二）退出(本计划)：指在本计划开放期内，委托人按照指定销售机构规定的手续，申请部分或全部退出本计划的行为。

（三十三）元：指人民币元。

（三十四）资产管理计划资产、本计划资产、资产管理计划财产、本计划财产：指华兴中证500指数增强2号集合资产管理计划的全部资产。

（三十五）计划资产总值、计划财产总值：指本计划财产拥有的各类有价证券、银行存款本息、证券投资基金份额及其他资产的价值总和。

（三十六）计划资产净值、集合计划资产净值：指计划资产总值减去计划负债后的价值。

（三十七）计划资产估值：指计算评估资产管理计划资产和负债的价值，以确定计划资产净值和计划份额净值的过程。

（三十八）计划份额净值：指计算日计划资产净值除以当日资产管理计划份额余额总数后得出的资产管理计划每份额资产净值。

（三十九）计划份额累计净值：指计划份额净值与资产管理计划历来份额收益分配金额之和。

（四十）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

（四十一）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。

（四十二）不低于：大于等于。

（四十三）不高于：小于等于。

（四十四）每年：指每个会计年度。

（四十五）私募资产管理业务托管年度报告：指托管人根据《管理办法》第七十三条规定编制并向中国证监会相关派出机构和基金业协会报送的有关托管人私募资产管理产品整体托管业务情况的年度报告，该报告不向本资产管理计划委托人及管理人提供。

（四十六）不可抗力：指任何不能预见、不能避免、不能克服的客观情况，且在本计划成立日后发生的，使本合同当事人无法全部或部分履行本合同的事件和因素。包括但不限于有关法律法规及重大政策调整、台风、洪水、地震、流行病及其他自然灾害，战争、骚乱、火灾、政府征用、戒严、没收、恐怖主义行为、电力故障或其他突发事件、证券交易场所非正常暂停或停止交易等事件。

第三部分 承诺与声明

一、管理人的承诺与声明

（一）管理人承诺在签订本合同前已充分向委托人说明了有关法律法规和相关投资工具的运作市场及方式，充分揭示了相关风险。

（二）管理人已经了解委托人的风险偏好、风险认知能力和承受能力，对委托人的财务状况进行了充分评估。

（三）管理人承诺按照《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、托管人的承诺与声明

（一）托管人承诺按照《基金法》恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则安全保管委托财产，履行信义义务以及本合同约定的其他义务。

(二)托管人承诺根据法律法规、中国证监会及协会的规定和本合同的约定，对管理人的投资或清算指令等进行监督。

（三）托管人承诺，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及本合同的约定履责，维护委托人权益。

三、委托人的承诺与声明

（一）委托人承诺其符合《指导意见》《管理办法》《运作规定》等法律法规规定的合格投资者的要求，并且在本合同有效期内持续符合合格投资者的标准。委托人保证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。

（二）委托人承诺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。

（三）委托人承诺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本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。

（四）委托人承诺，其参与本集合计划，不违反其自身关于投资范围、杠杆约束（如有）等监管要求。委托人如以管理的产品投资本集合计划的，应确保该产品的所有投资者为符合法律法规规定的合格投资者，且均非资产管理产品。委托人承诺投资本集合计划不存在违反监管要求的产品嵌套或以投资本集合计划规避投资范围、杠杆约束等监管要求等违规行为。

（五）委托人签署和履行本合同系其真实意思表示，已经按照其章程或者其它内部管理文件的要求取得合法、有效的授权，且不会违反对其有约束力的任何合同和其他法律文件；委托人已经或将会取得签订和履行本合同所需的一切有关批准、许可、备案或者登记。

（六）委托人确认，管理人、托管人未对本集合计划资产收益状况做任何承诺或担保。

第四部分 当事人及权利义务

一、合同当事人

（一）委托人

委托人的详细情况在各委托人分别与管理人、托管人签署的合同中列示。

（二）管理人

名称：华兴证券有限公司

住所：上海市虹口区东大名路1089号2301单元

联系人：李晨

通讯地址：上海市虹口区东大名路1089号北外滩来福士东塔23楼

联系电话：021-60156792

（三）托管人

名称：中信建投证券股份有限公司

住所：北京市朝阳区安立路66号4号楼

联系人：高涵

通讯地址：北京东城区朝内大街2号凯恒中心B座10层

联系电话：010-65608073

二、本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。

三、本计划委托人的权利包括但不限于：

（一）分享本计划财产收益；

（二）取得分配清算后的剩余计划财产；

（三）按照本合同的约定参与、退出和转让本计划份额；

（四）根据本合同的规定，参加或申请召集本计划份额持有人大会(如有)，行使相关职权；

（五）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；

（六）监督管理人、托管人履行投资管理及托管义务的情况；

（七）法律法规、中国证监会及基金业协会等监管规定和本合同约定的其他权利。

四、本计划委托人的义务包括但不限于：

（一）认真阅读并遵守资产管理合同，保证投资资金的来源及用途合法；

（二）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；

（三）除公募资产管理产品外，以合伙企业、契约等非法人形式直接或者间接投资于本计划的，应向管理人充分披露实际投资者和最终资金来源；

（四）认真阅读并签署风险揭示书；

（五）按照本合同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（如有）、托管费、审计费、税费等合理费用；

（六）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；

（七）向管理人或本计划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；

（八）不得违反本合同的约定干涉管理人的投资行为；

（九）不得从事任何有损本计划及其委托人、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；

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

（十一）法律法规、中国证监会及基金业协会等监管规定和本合同约定的其他义务。

五、管理人的权利包括但不限于：

（一）按照本合同约定，独立管理和运用本计划财产；

（二）按照本合同约定，及时、足额获得管理人管理费用及业绩报酬(如有)；

（三）按照有关规定和本合同约定行使因本计划财产投资所产生的权利；

（四）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、对本计划财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，并报告证监会相关派出机构及协会；

（五）自行提供或者委托经中国证监会、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；

（六）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；

（七）法律法规、中国证监会及基金业协会等监管规定及本合同约定的其他权利。

六、管理人的义务包括但不限于：

（一）依法办理本计划的销售、登记、备案事宜；

（二）按照协会要求报送本计划产品运行信息；

（三）按照诚实信用、勤勉尽责的原则履行受托人义务，管理和运用本计划财产；

（四）对委托人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；

（五）制作风险揭示书，向委托人充分揭示相关风险；

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

（七）建立健全的内部管理制度，保证本计划财产与其管理的其他资产管理计划财产、管理人的固有财产相互独立，对所管理的不同财产分别管理，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；

（八）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财产；

（九）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；

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

（十一）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；

（十二）按照本合同约定接受委托人和托管人的监督；

（十三）以管理人的名义，代表委托人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；

（十四）召集本计划份额持有人大会，份额持有人大会设立日常机构的除外（如有）；

（十五）按照本合同约定计算并向委托人报告本计划份额净值；

（十六）确定本计划份额参与、退出价格，采取适当、合理的措施确保份额交易价格的计算方法符合法律法规的规定和合同的约定；

（十七）对非标准化资产（如有）和相关交易主体进行充分的尽职调查，形成书面工作底稿，并制作尽职调查报告；

（十八）按照本合同约定负责本计划会计核算并编制财务会计报告；

（十九）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；

（二十）按照本合同的约定确定收益分配方案，及时向委托人分配收益；

（二十一）根据法律法规与本合同约定，编制向委托人披露的本计划季度、年度等定期报告，向协会备案，并抄报证监会相关派出机构；

（二十二）办理与受托财产管理业务活动有关的信息披露事项；

（二十三）建立并保存委托人名单；

（二十四）组织并参加本计划财产清算小组，参与本计划财产的保管、清理、估价、变现和分配；

（二十五）按照法律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；

（二十六）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、协会并通知托管人和委托人；

（二十七）法律法规、中国证监会及基金业协会等监管规定和本合同约定的其他义务。

七、托管人的权利包括但不限于：

（一）按照本合同约定，依法保管本计划财产；

（二）按照本合同约定，及时、足额获得本计划托管费用；

（三）法律法规、中国证监会及基金业协会等监管规定和本合同约定的其他权利。

八、托管人的义务包括但不限于：

（一）安全保管本计划财产；

（二）除依据法律法规规定和本合同约定外，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本计划财产；

（三）对所托管的不同财产分别设置账户，确保本计划财产的完整与独立；

（四）公平对待所托管的不同财产，不得从事任何有损本计划财产及其他当事人利益的活动；

（五）按规定开立和注销本计划的托管账户及其他投资所需账户；

（六）复核计划资产净值和计划份额净值；

（七）办理与本计划托管业务有关的信息披露事项；

（八）根据相关法律法规和本合同约定，复核管理人编制的本计划财产的定期报告，并出具书面意见；

（九）编制私募资产管理业务托管年度报告，并向协会备案，抄报中国证监会相关派出机构；

（十）按照法律法规要求和本合同约定，根据管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；

（十一）管理人未按规定召集或者不能召集份额持有人大会的，托管人应依照本合同约定召集份额持有人大会，份额持有人大会设立日常机构的除外（如有）。

（十二）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；

（十三）根据法律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；

（十四）监督管理人的投资运作，发现管理人的投资或清算指令违反法律法规、中国证监会的规定或本合同约定的，应当拒绝执行，立即通知管理人，管理人拒不纠正的，应及时报告中国证监会相关派出机构和协会；

（十五）投资于《管理办法》第三十七条第（五）项规定资产时，准确、合理界定安全保管资产管理计划财产、监督管理人投资运作等职责，并向委托人充分揭示；

（十六）国家有关法律法规、中国证监会及基金业协会等监管规定及本合同约定的其他义务。

第五部分 本计划的基本情况

（一）本计划的名称

华兴中证500指数增强2号集合资产管理计划

（二）本计划的类别

商品及金融衍生品类集合资产管理计划

（三）本计划的运作方式

本计划采取定期开放方式运作，具体方式见本合同第八部分。

（四）本计划的投资目标

本集合计划投资目标为：在同期中证500指数收益率基础上持续稳定获取超额回报。

（五）本计划的投资范围

本集合计划属于商品及金融衍生品类产品。投资范围包括：

1、商品及金融衍生品类资产：证券交易所和期货交易所交易的期货和期权合约、权证；

2、权益类资产：沪深交易所依法发行上市的股票（含科创板股票，含网上新股申购与网下新股申购）、优先股、港股通、存托凭证、股票型公募证券投资基金、混合型公募证券投资基金、融资融券；

3、固定收益类资产：银行存款、同业存单，证券交易所和全国银行间债券市场等国务院同意设立的交易场所交易的债券、资产支持证券、央行票据和非金融企业融资工具（含资产支持票据）等，债券型基金，货币市场基金，债券回购，转融通证券出借交易；

4、中国证监会认可的其他投资品种。

（六）本计划的投资比例（占集合计划资产总值）

1、投资于商品及金融衍生品的持仓合约价值的比例不低于资产管理计划总资产80%，且衍生品账户权益超过资产管理计划总资产的20%；

2、权益类资产占资产管理计划总资产的比例为：0-80%；

3、固定收益类资产占资产管理计划总资产的比例为：0-80%；

管理人将根据具体投资资产的投资限制，合理分配各资产占资产管理计划总资产的比例，以保证所投向的最终资产满足上述投资比例要求。

（七）本计划的产品风险等级

本集合计划是一款以追求相对收益为目标的理财产品，属于R4（中高风险）的投资品种。适合风险承受能力为“C4（积极型）”及以上的投资者。

本集合计划面向符合法律规定的合格投资者募集，对于未经管理人认可的委托人，管理人有权拒绝其参与申请。

（八）本计划的存续期限

本集合计划存续期为10年，出现资产管理合同约定的终止情形时，本计划终止并进行清算。

（九）本计划份额的初始募集面值

本计划份额的初始募集面值为1元。

（十）本计划的最低初始募集规模。

本计划初始募集的资产合计不低于1000万元人民币。

（十一）本计划的分级安排

本集合计划不分级。

（十二）服务机构信息

管理人华兴证券有限公司（在基金业协会登记的业务登记编码为PT0300030922）为本计划提供份额登记、估值与核算、信息披露、信息技术系统等服务。

第六部分 本计划的募集

一、本计划的募集对象

本计划向合格投资者募集，计划份额持有人累计不得超过200人。

合格投资者是指具备相应风险识别能力和风险承担能力，投资于本计划的金额不低于100万元且符合下列条件的自然人、法人或者其他组织：

（一）具有2年以上投资经历，且满足以下条件之一的自然人：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。

（二）最近1年末净资产不低于1000万元的法人单位；

（三）依法设立并接受国务院金融监督管理机构监管的机构，包括证券公司及其子公司、基金管理公司及其子公司、期货公司及其子公司、在中国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；

（四）接受国务院金融监督管理机构监管的机构发行的资产管理产品；

（五）基本养老金、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）；

（六）中国证监会视为合格投资者的其他情形。

投资者不得使用《指导意见》规范的资产管理产品资金投资本集合计划。

二、本计划的募集方式

本计划将通过管理人的直销网点/推广机构向特定客户进行销售，具体发售方式见《计划说明书》。投资者认购本计划，必须与管理人和托管人签订资产管理合同，按销售机构规定的方式足额缴纳认购款项。投资者认购的具体金额和本计划份额以注册登记机构的确认结果为准。

推广机构应将本计划资产管理合同、计划说明书等正式推广文件，置备于推广机构。本计划应当面向合格投资者推广，客户风险承受能力应与本计划相匹配，推广机构应当了解客户的投资需求和风险偏好，详细介绍产品特点并充分揭示风险，引导客户审慎做出投资决定。禁止通过签订保本保底补充协议等方式，或者采用虚假宣传、夸大收益和商业贿赂等不正当手段推广本计划。

管理人及推广机构应当采取有效措施，通过管理人、证券投资基金业协会、

中国证监会电子化信息披露平台或者中国证监会认可的其他信息披露平台，客观准确披露本计划批准或者备案信息、风险收益特征、投诉电话等，使投资者详尽了解本计划的特性、风险等情况及投资者的权利、义务，但不得向合格投资者之外的单位和个人募集资金，不得公开或变相公开募集资产管理计划，不得通过报刊、电台、电视、互联网等传播媒体或者讲座、报告会、传单、布告、自媒体等方式向不特定对象推广本计划。

三、本计划的募集期限

本计划初始募集期自计划份额发售之日起不超过60天，具体时间由管理人根据相关法律法规以及本合同确定，以管理人的信息披露为准。

四、本计划认购费用

本计划的认购费率为0.00%。

认购费用的计算方式：认购费用＝认购金额/(1+认购费率)×认购费率

五、本计划认购申请的确认

（一）认购程序。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、处理规则等在遵守本合同规定的前提下，以销售机构的具体规定为准。

（二）认购申请的确认。认购申请受理完成后，投资者不得撤销。销售网点受理认购申请并不表示对该申请是否成功的确认，而仅代表销售网点确实收到了认购申请，申请是否有效应以注册登记机构的确认并且本计划成立为准。投资者应在本计划成立后到各销售网点查询最终确认情况和有效认购份额。

（三）投资者签订本合同、其认购的本计划份额经注册登记机构确认且本计划成立后正式成为本计划委托人。

（四）注册登记机构可按照“时间优先，金额优先”的原则在初始募集期届满后对认购金额申请予以确认。在采用本原则进行确认时，认购时间在前者被优先确认，认购时间相同时认购金额高的投资者优先被确认。未被确认的投资者的认购资金于初始募集期届满后三十日内予以返还，并加计认购资金在募集结算专用账户中产生的利息，利息金额按银行同期活期存款利率计算，并以本计划注册登记机构的记录为准，申请是否有效应以注册登记机构的确认为准并以本计划成立为生效前提。投资者应在本计划成立后到各销售网点查询最终确认情况和有效认购份额。

六、认购份额的计算方式

认购份额的计算方法如下：

净认购金额=认购金额/(1+认购费率)

认购份额=（净认购金额+初始募集期内认购资金的利息）/ 每份额面值（人民币壹元）

认购份额的计算保留到小数点后2位，小数点后2位以后的部分四舍五入，由此产生的误差产生的收益或损失由计划财产承担。

七、初始认购资金的管理

管理人应将本计划募集期间客户的资金存放于下列计划募集结算专用账户，在本计划初始募集行为结束前，任何个人和机构不得动用。

募集结算专用账户名称：华兴证券有限公司

账　　号：121922106810697

开户银行：招商银行上海外滩支行

八、本计划的最低认购金额和支付方式

认购资金应以现金形式交付。投资者初始单笔认购金额不低于100万元人民币（最低认购金额不包含认购费）并可追加认购，单笔最低追加金额为1万元人民币（不含认购费用）。

九、本计划销售机构委托募集账户（如有）的披露渠道和查询方式由销售机构向投资者提供。

十、初始认购资金（不含认购费用）的利息处理方式

初始募集期间，就认购申请被确认的投资者，认购资金（不含认购费用）在募集账户中产生的利息不计入本计划资产，募集结算专用账户中产生的利息计入本计划资产，并折算为资产管理计划份额归投资者所有，利息金额按银行同期活期存款利率计算并以注册登记机构的记录为准。

第七部分 本计划的成立与备案

一、本计划成立的条件

（一） 本计划初始募集规模不低于1000万元；

（二） 委托人人数不少于2人，且不超过200人；

（三） 募集过程符合法律、行政法规和中国证监会的规定。

二、本计划的募集金额缴足之日起10个工作日内，管理人应当委托具有证券相关业务资格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日起5个工作日内报协会备案，抄报中国证监会相关派出机构。本计划成立日前，任何机构和个人不得动用投资者参与资金。

三、本计划募集失败的处理方式

募集期届满，本计划未达到本合同约定的成立条件的，本计划募集失败，则管理人应当承担下列责任：

（一）以固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用；

（二）在募集期届满后30日内返还投资者已缴纳的款项，并加计在募集结算专用账户中产生的利息，利息金额按银行同期活期存款利率计算，并以本计划注册登记机构的记录为准。

由于监管政策及指导意见的不时更新与变动，本计划可能存在无法成立或无法进行备案的风险，全体委托人确认，管理人及托管人对此不承担任何责任。

四、本计划成立日后备案完成前，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。

第八部分 本计划的参与、退出与转让

一、本计划运作期间的开放期内，委托人可办理参与和退出业务。

二、参与和退出场所

本计划参与和退出场所为管理人的直销网点，或按销售机构提供的其他方式办理参与和退出。

管理人直销账户信息：

户名：华兴证券有限公司

账号：121922106810896

开户行：招商银行上海外滩支行

大额支付号：308290003038

三、参与和退出的开放日和时间

本计划采取定期开放的方式运作，即采取在封闭期内封闭运作、封闭期与封闭期之间定期开放的运作方式。

本计划的开放期为每周的周三（如当日为非工作日，则该周不开放）；除开放期以外的日期均为封闭期。本计划在开放期间办理参与和退出业务，封闭期内不办理参与和退出业务。

如发生不可抗力或其他情形致使本计划无法按时开放参与和退出业务，或依据本合同需暂停参与和退出业务的，开放期顺延至前述情形消除之日的下一个工作日。

若中国证监会有新的规定，或出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更或发生其他特殊情况，管理人将视情况对前述开放期及开放时间进行相应的调整并告知委托人。

管理人可以在其网站上信息披露的方式履行向委托人告知的义务。

四、临时开放期的触发条件、程序及披露等相关安排

本集合计划存续期内管理人有权视情况设置临时开放期，临时开放原则上仅适用于集合计划资产管理合同变更时，接受委托人的退出申请。临时开放的具体安排（包括但不限于开放日期、可办理的业务及其规则等）以管理人的披露为准。

五、参与和退出的方式、价格、程序及确认

（一）“未知价”原则，即本计划的参与和退出价格以参与和退出申请提交

日所在交易日收市后计算的各类计划份额净值为基准进行计算。

（二）本计划采用金额参与和份额退出的方式，即参与以金额申请，退出以份额申请。

（三)委托人办理参与、退出等业务时应提交的文件和办理手续、办理时间、处理规则等在遵守本合同规定的前提下，以销售机构的具体规定为准。

（四）当日的参与和退出申请可以在当日开放时间结束前撤销，在当日的开放时间结束后不得撤销。

（五）参与和退出申请的确认。销售网点受理参与和退出申请并不表示对该申请是否成功的确认，而仅代表销售网点确实收到了参与或退出申请。参与申请采取时间优先、金额优先原则进行确认，退出申请按先进先出的方式处理。申请是否有效应以注册登记机构的确认为准。注册登记机构应在法律法规规定的时限内对委托人参与、退出申请的有效性进行确认。委托人可在当个开放期结束后至各销售网点查询最终确认情况。

对于认购参与的委托人，注册登记机构在集合计划成立日为委托人办理增加权益的登记手续；存续期参与的委托人在T日提交参与申请后，注册登记机构在T＋1 日根据管理人的确认结果为委托人办理增加权益的登记手续；存续期退出的委托人在T日提交退出申请后，注册登记机构在T＋1日根据管理人的确认结果为委托人办理减少权益的登记手续。委托人的申请因不符合法律法规、本合同及《集合计划说明书》的规定被拒绝参与、退出的情形除外。

（六）参与和退出申请的款项支付。参与采用全额交款方式，若资金在规定时间内未全额到账则参与不成功，为无效申请，已交付的委托款项将退回委托人指定资金账户。委托人退出申请确认后，管理人应按规定向委托人支付退出款项，在发生巨额退出时，退出款项的支付办法按本合同和有关法律法规规定处理。

认购参与时，若参与申请成交，T+3日内参与款划往集合计划的募集结算专用账户。存续期参与时，若参与申请成交，T+3日内参与款划往集合计划的托管账户。

委托人退出申请成功后，管理人应指示托管人于T+7日内将退出款项从集合计划托管账户划出至集合计划募集结算专用账户，再由登记结算机构将退出款项分别划至各推广机构指定账户。推广机构收到退出款后于2个工作日内划往退出委托人指定的账户。在发生巨额退出的情形时，款项的支付办法参照合同的有关

条款处理。

（七）管理人在不损害委托人权益的情况下，经与销售机构协商一致，可更改上述原则，但最迟应在新的原则实施前3个工作日告知委托人。同时，管理人应提前书面告知销售机构。

六、参与和退出的金额限制

（一）参与的金额限制

投资者在本计划存续期开放日首次购买本计划份额的，应符合合格投资者标准，且参与金额应不低于100万元人民币（不含参与费用），已持有本计划份额的委托人在本计划存续期开放日追加购买资产管理计划份额的除外。现有委托人在本计划存续期开放期追加参与本计划份额的，单笔追加金额应不低于1万元人民币（不含参与费用）。

（二）退出的金额限制

当委托人持有的计划份额所对应的计划资产净值大于100万元人民币时，委托人可以选择全部或部分退出本计划；选择部分退出本计划的，委托人在退出后持有的计划份额所对应的计划资产净值不得小于100万元。当管理人发现委托人申请部分退出本计划将致使其在部分退出申请确认后持有的计划份额所对应的计划份额资产净值小于100万元人民币的，管理人有权部分确认退出份额，以保证部分退出申请确认后委托人持有的计划份额所对应的计划资产净值大于或等于100万元。当委托人持有的计划份额所对应的计划资产净值小于或等于100万元人民币时，需要退出本计划的，委托人必须选择一次性全部退出本计划，委托人未选择一次性退出的，管理人有权强制全部退出。

在符合上述规定的前提下，管理人可根据市场情况，合理调整对参与金额和退出份额的数量限制并告知委托人。

七、参与和退出的费用

本计划参与费率为0.00%；

退出费率如下

持有期限（D）	退出费率
D＜1080天	2.0%
1080天≤D	0%
集合计划终止清算	0%

资产委托人退出时按照“先进先出”的原则,即参与确认时间在先的份额先退出，参与确认日期在后的份额后退出，并分别确定适用的退出费率。

资产委托人通过临时开放日退出的，不收取退出费用。

八、参与份额和退出金额的计算方式

（一）本计划参与份额的计算方式

本计划参与份额的计算方式如下：

净参与金额=参与金额/（1+参与费率）

1、推广期参与份额的计算

参与份额=（净参与金额+推广期利息）/集合计划份额面值。

2、存续期参与份额的计算

参与份额＝净参与金额/T日集合计划份额净值

其中，参与份额的计算结果保留到小数点后2位，小数点2位以后的部分四舍五入，由此产生的误差产生的收益或损失由计划财产承担。

（二）本计划退出金额的计算方式

本计划退出金额的计算方式如下：

退出金额＝退出份额×T日集合计划份额净值-业绩报酬（如有）

退出费用=退出金额×退出费率

净退出金额＝退出金额-退出费用

退出费用的计算结果保留到小数点后两位，小数点后第三位四舍五入。

资产委托人申请退出时，如申请退出部分份额适用不同退出费率，则各部分的净退出金额应当独立计算。

其中，净退出金额的计算结果保留到小数点后2位，小数点2位以后的部分四舍五入，由此产生的误差产生的收益或损失由计划财产承担。

九、参与资金的利息处理方式

本计划成立日后，投资者参与本计划时的参与资金均不计利息，参与申请被确认的投资者以参与资金（不含参与费用）折算参与份额，参与资金（不含参与费用)在募集账户及募集结算专用账户中产生的利息(如有)不计入本计划资产。

十、巨额退出和连续巨额退出

（一）认定标准

若本计划于某个开放期内的计划份额净退出申请超过前一交易日的计划总

份额的10%，即认定为计划发生了巨额退出。同一开放期（仅适用于开放期多于一个工作日的情形）内连续2个开放日以上（含2个交易日）发生巨额退出，即认定为计划发生了连续巨额退出。

（二）退出顺序、退出价格确定和退出款项支付

出现巨额退出时，管理人和销售机构协商一致，可以根据本计划当时的资产状况决定接受全额退出或部分退出。出现连续巨额退出时，如管理人认为有必要，可暂停接受计划份额退出申请；已经接受的退出申请可以延缓支付退出款项，但不得超过20个工作日，并应当及时告知委托人。

1.全额退出：当管理人和销售机构认为有能力兑付委托人的全部退出申请时，管理人接受全额退出，并按正常退出程序执行。

2.部分退出：当管理人认为支付委托人的退出申请有困难或认为因支付委托人的退出申请而进行的财产变现可能会对计划资产净值造成较大波动时，管理人在当日接受退出比例不低于上一交易日计划总份额的10%的前提下，可对其余退出申请延期办理。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；对于未能退出部分，委托人在提交退出申请时可以选择延期退出或取消退出。选择延期退出的，将自动转入下一个开放日继续退出，直到全部退出为止；选择取消退出的，当日未获受理的部分退出申请将被撤销。延期的退出申请与下一开放日退出申请一并处理，无优先权并以下一开放日的各类计划份额净值为基础计算退出金额，以此类推，直到全部退出为止。如委托人在提交退出申请时未作明确选择，委托人未能退出部分作自动延期退出处理。

（三）告知客户方式

当发生巨额退出、连续巨额退出时，管理人应当通过在管理人网站上信息披露、信函、传真、电子邮件、录音电话等本合同规定的方式之一及时告知委托人。

（四）单个委托人大额退出的预约申请

本集合计划不设单个委托人大额退出及预约申请安排。但在单个开放日，集合计划净退出申请份额(退出申请总数扣除参与申请总数后的余额)超过上一日集合计划总份额的10％时，将触发巨额退出机制。

十一、延期支付及延期退出的情形和处理方式

发生下列情形时，管理人可延期支付退出款项或延期办理委托人退出申请：

（一）因不可抗力导致管理人不能支付退出款项。

（二）发生本合同规定的暂停计划资产估值情况。

（三）证券/期货交易所交易时间非正常停市，导致管理人无法计算当日计划资产净值。

（四）同一开放期内连续两个或两个以上交易日发生巨额退出。

（五）发生继续接受退出申请将损害现有份额持有人利益的情形时。

（六）当前一估值日计划资产净值50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与托管人协商确认后，管理人可延期支付退出款项或延期办理退出申请。

（七）法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一且管理人决定延期支付或延期退出时，已确认的退出申请，可足额支付的，管理人应足额支付，暂时不能足额支付的，管理人应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给退出申请人，未支付部分可延期支付。若出现上述第（四）款所述情形，按本合同的相关条款处理。在延期退出的情况消除时，管理人应及时恢复退出业务的办理并及时告知委托人。

十二、拒绝或暂停参与、暂停退出的情形及处理方式；

（一）在如下情况下，管理人可以拒绝接受投资者的参与申请：

1.本计划份额持有人达到200户；

2.根据市场情况，管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对本计划业绩产生负面影响，从而损害现有委托人的利益的情形；

3.因本计划所持某个或某些证券进行权益分派等原因，使管理人认为短期内接受参与可能会影响或损害现有委托人利益的；。

4.管理人认为接受某笔或某些参与申请可能会影响或损害其他委托人利益的；

5.法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

管理人决定拒绝接受某些投资者的参与申请时，参与款项将退回投资者账户。

（二）在如下情况下，管理人可以暂停接受投资者的参与申请：

1.因不可抗力导致无法受理委托人的参与申请；

2.证券、期货交易场所交易时间临时停市，导致管理人无法计算当日计划资产净值和计划份额净值；

3.发生本合同规定的暂停计划资产估值情况；

4.法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

管理人决定暂停接受全部或部分参与申请时，应当告知委托人。在暂停参与的情形消除时，管理人应及时恢复参与业务的办理并予以告知委托人。

（三）在如下情况下，管理人可以暂停接受委托人的退出申请：

1.因不可抗力导致管理人无法支付退出款项。

2.证券交易场所交易时间临时停市，导致管理人无法计算当日计划资产净值和计划份额净值。

3.发生本合同规定的暂停本计划资产估值的情况。

4.连续两个或两个以上开放日发生巨额退出。

5.法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一的，管理人应当及时告知委托人。在暂停退出的情况消除时，管理人应及时恢复退出业务的办理并及时告知委托人。

十三、本计划不接受违约退出。

十四、本计划投资运作期间的份额转让

集合计划份额的转让指集合计划存续期间，管理人申请并开通份额转让事宜之后，委托人通过证券交易所以及中国证监会认可的其他方式，向合格投资者转让其持有的本集合计划份额，份额转让应遵守交易场所相关规定及要求，并按规定办理份额变更登记手续。受让方首次参与集合计划，应先与管理人、托管人签订资产管理合同。

如未来条件允许，本集合计划可以开放份额转让，具体的时间和安排将由管理人确定，并在开放转让前5个工作日进行信息披露。

十五、非交易过户的受理条件与流程

（一）管理人及注册登记机构只受理继承、捐赠、司法强制执行和经注册登记机构认可的其他情况下的非交易过户。其中：

“继承”是指委托人死亡，其持有的计划份额由其合法的继承人继承。

“捐赠”是指委托人将其持有的计划份额向公益机构转赠，或将其持有的计划份额产生的收益向公益机构转赠。

“司法强制执行”是指司法机构依据生效司法文书将委托人持有的计划份额强制划转给其他自然人、法人、社会团体或其他组织的情形。

（二）办理非交易过户业务必须提供注册登记机构规定的相关资料。符合条件的非交易过户申请自申请受理日起2个月内办理；申请人按注册登记机构规定的标准缴纳过户费用。

十六、管理人以自有资金参与本计划

（一）自有资金参与的条件

管理人以自有资金参与本计划，应符合法律、行政法规和中国证监会的规定，并按《中华人民共和国公司法》和公司章程的规定，获得公司股东会、董事会或其他授权程序的批准。

（二）自有资金的参与方式

在推广期和存续期内，管理人有权以自有资金参与本集合计划，与集合计划其他客户份额享有同等权益，承担同等风险。

（三）自有资金参与的份额比例

若自有资金参与本集合计划，则参与本集合计划的自有资金不得超过集合计划总份额的20%。管理人及其附属机构以自有资金参与本集合计划的份额合计不得超过本集合计划总份额的50%（未来监管机构对自有资金参与有新规定的，本集合计划将按照新规定执行）。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被动超限的，自有资金应当在符合法律法规及本合同约定的前提下进行调整。

（四）自有资金的退出

集合计划存续期间，管理人自有资金参与集合计划的持有期限不得少于 6个月。参与、退出时，应当提前5个工作日告知委托人和托管人。当出现巨额退出时，为解决流动性风险，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本合同约定的前提下，管理人以自有资金参与或退出计划可不受 “持有期限不得少于6个月”，“提前5个工作日告知客户和托管人” ，“参与本集合计划的自有资金不得超过该集合计划总份额的 20%” 限制，但需事后及时告知委托人和托管人，并向住所地中国证监会派出机构及监管机构指定的协会报告。

委托人同意，集合计划存续期内当法律法规或有关针对自有资金投资集合计划的政策发生变化时，管理人经与托管人协商，可以对本合同及《集合计划说明书》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，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，管理人应将更新或修改内容报中

国证监会批准或基金业协会备案。更新或修改的内容在管理人网站信息披露满5个工作日后生效。委托人对更新或修改的内容有异议，可在更新或修改内容生效前按照本合同的规定申请退出集合计划，委托人未退出的，视为同意更新或修改。

十七、管理人应定期将本计划委托人变更情况报送协会。

第九部分 份额持有人大会及日常机构

经管理人、委托人、托管人协商一致同意，本集合计划不设份额持有人大会及日常机构。

第十部分 计划份额的登记

一、资产管理计划的注册登记业务指资产管理计划的登记、存管、清算和结算业务，具体内容包括资产委托人资产管理计划账户建立和管理、资产管理计划份额的注册登记、资产管理计划销售业务的确认、清算和结算、代理发放红利、建立并保管资产委托人名册等。

二、本计划的注册登记业务由华兴证券有限公司负责办理。

三、资产管理人委托其他机构代为办理本计划份额登记业务的，应当与有关机构签订委托代理协议。本计划注册登记机构的权限和职责如下：

（一）注册登记机构享有如下权利：

1.建立和管理资产委托人的资产管理计划账户；

2.取得注册登记费；

3.保管资产委托人开户资料、交易资料、资产委托人名册等；

4.在法律法规允许的范围内，制定和调整注册登记业务的相关规则；

5.法律法规规定的其他权利。

（二）注册登记机构承担如下义务：

1.配备足够的专业人员办理资产管理计划的注册登记业务；

2.严格按照法律法规和资产管理合同规定的条件办理资产管理计划的注册登记业务；

3.妥善保存登记数据，并将资产管理计划委托人名称、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，其保存期限自资产管理计划账户销户之日起不得少于20 年；

4.按资产管理合同和计划说明书规定为资产委托人办理非交易过户等业务，并提供其他必要服务；

5.法律法规规定的其他义务。

四、本计划全体份额持有人同意管理人、注册登记机构或其他份额登记义务人将本计划委托人名称、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。

第十一部分 资产管理计划的投资

一、本资产管理计划的投资目标

本集合计划的投资目标为：在同期中证500指数收益率基础上持续稳定获取超额回报。

二、本资产管理计划的投资范围及比例

（一）投资范围：

本集合计划属于商品及金融衍生品类产品，符合《运作规定》组合投资的要求。本集合计划的投资范围包括：

1、商品及金融衍生品类资产：证券交易所和期货交易所交易的期货和期权合约、权证；

2、权益类资产：沪深交易所依法发行上市的股票（含科创板股票，含网上新股申购与网下新股申购）、优先股、港股通、存托凭证、股票型公募证券投资基金、混合型公募证券投资基金、融资融券；

3、固定收益类资产：银行存款、同业存单，证券交易所和全国银行间债券市场等国务院同意设立的交易场所交易的债券、资产支持证券、央行票据和非金融企业融资工具（含资产支持票据）等，债券型基金，货币市场基金，债券回购，转融通证券出借交易；

4、中国证监会认可的其他投资品种。

特别提示：本计划可参与证券回购、融资融券、转融通证券出借业务。

（二）投资比例（占集合计划资产总值）：

1、投资于商品及金融衍生品的持仓合约价值的比例不低于资产管理计划总资产80%，且衍生品账户权益超过资产管理计划总资产的20%；

2、权益类资产占资产管理计划总资产的比例为：0-80%；

3、固定收益类资产占资产管理计划总资产的比例为：0-80%；

管理人将根据具体投资资产的投资限制，合理分配各资产占资产管理计划总资产的比例，以保证所投向的最终资产满足上述投资比例要求。

如未来法律法规取消或修改相关要求，本集合计划将按照最新法律法规进行相应调整，并按照本合同的约定履行合同变更程序。

法律法规或中国证监会允许集合计划投资其他品种的，管理人在按照本合同的约定履行合同变更程序后，可以将其纳入本集合计划的投资范围。

本计划成立日后备案完成前，管理人可以现金管理为目的，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。

三、投资比例超限的处理方式及流程

本集合计划的建仓期自本计划成立日起不超过 6 个月，管理人将在集合计划成立日起6个月内，使集合计划的投资组合比例符合上述约定。因证券市场波动、投资对象合并、集合计划规模变动等外部因素，致使本集合计划的组合投资比例不符合上述约定的，管理人将在流动性受限资产可出售、可转让或者恢复交易的15个工作日内调整至符合相关要求。确有特殊事由未能在规定时间内完成调整的，管理人应当及时向所在地中国证监会派出机构及基金业协会报告。

四、本资产管理计划的风险收益特征；

本集合计划是一款以追求相对收益为目标的理财产品，属于R4（中高风险）的投资品种。适合风险承受能力为“C4（积极型）”及以上的投资者。

本集合计划面向符合法律规定的合格投资者募集，对于未经管理人认可的委托人，管理人有权拒绝其参与申请。

五、业绩比较基准

本集合计划业绩比较基准为同期中证500指数收益率。

六、本资产管理计划的投资策略

（一）决策依据

1、《管理办法》、《运作规定》等有关法律法规以及集合资产管理合同（和说明书）；依法决策是本集合计划进行投资的前提。

2、宏观经济发展态势、微观经济运行环境和政策环境；这是本集合计划投资决策的基础。

3、利率变动和证券市场走势。

4、基于对资本市场金融产品收益/风险的度量和控制。在充分权衡投资对象的收益和风险的前提下作出投资决策，是本集合计划维护委托人利益的重要保障。

（二）决策程序

1、自上而下的资产配置。公司资产管理业务投资管理委员会基于资产管理

事业部的研究支持，决定投资组合中各类资产的分配比例、重点投资范围以及重大投资决策，赋予投资经理在一定时间范围内实施投资行为的幅度空间。

研究支持包括：依托公司内外部研究资源，资产管理事业部通过对宏观经济政策研究以及数量模型分析，把握宏观经济与证券市场波动的趋势，在对各种投资策略进行研究评估后，定期拟定资产配置建议和拟采取的投资策略，一并递交投资管理委员会讨论确定。

2、自下而上的证券选择。投资经理在既定的资产配置比例和投资策略安排下，借助资产管理事业部研究团队、公司内外部研究资源和集合计划的收益-风险特征，在备选库的范围内，结合自身对证券市场和上市公司的分析判断，决定具体的投资品种、规模并决定买卖时机。

研究支持主要包括：投资策略的收益风险评估，整合研究资源，定期编制和维护备选库，及时向投资经理提供具体的趋势变化分析。

3、有效监控下的决策执行。通过严格的交易制度和实时的前、后台监控功能，保证投资指令在合法、合规的前提下得到高效地执行。

4、绩效评估与动态调整。风险控制与评估组根据本集合计划特征，设计科学合理的风险监控指标体系，在投资管理委员会批准后，定期对集合计划资产进行定性和定量相结合的风险、绩效评估，并提供风险与绩效评估报告，供投资管理委员会和投资经理随时了解投资组合承担的风险水平，检验既定的投资策略。绩效评估能够确认投资组合是否实现了投资预期、组合收益的来源及投资策略成功与否，投资经理据以检讨投资策略，进而调整投资组合。

5、全程监控投资风险

资管内控小组依据相关法律法规、集合计划的合同与说明书等制定集合计划的《风险控制指引书》，并经公司风险管理部、投资经理、交易员确认后四方签字确认，作为风险控制的重要文件。

在投资决策过程中，风险管理部负责配合资产管理事业部对集合计划的投资限制、市场风险、流动性风险及信用风险等投资风险进行事前评估、事中监控以及事后跟踪分析，并在整个投资流程完成后，对投资风险及绩效做出评估，提供给投资经理等相关人员，并对投资组合的调整进行监督。

（三）投资管理的方法和标准

本集合投资策略基于中证500指数期货基差进行调整。

1、当中证500指数期货贴水较大时，本集合计划将主要投资于中证500指数期货多头，并适当采取金融衍生品的统计套利策略、股票量化对冲策略、固定收益证券等绝对收益方向的资产或策略来增厚收益。

2、当中证500指数期货贴水较小时，本集合计划将适当减少中证500指数期货多头配置，通过增加基本面+量化选股等阿尔法策略的配置权重，并辅以优选公募基金组合的方式，获取超越基准指数的相对收益。

3、当中证500指数期货基差波动较大时，本集合计划将在1、2两种策略中进行切换。

七、投资限制和投资禁止

（一）投资品种限制

为维护集合计划委托人的合法权益，本集合计划投资品种限制为：

1、权益类资产：

（1）不得主动投资于ST、*ST、SST、S*ST及处于退市整理期的上市公司股票；

（2）不得参与股票非公开增发。

2、固定收益类资产：

（1）投资于公司债、企业债、非政策性金融债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、非公开定向债务融资工具、可转换公司债券、可交换公司债券的，所投资债券发行人主体及债项评级（若有）不低于 AA，短期融资券评级不低于A-1，评级展望达到稳定及以上。如多家机构评级结果同时出现时，应以各评级机构给出的最低评级结果为准（本计划所称评级机构仅包括：中证鹏元资信评估股份有限公司、东方金诚国际信用评估有限公司、中诚信国际信用评级有限责任公司、上海新世纪资信评估投资服务有限公司、大公国际资信评估有限公司、联合资信评估股份有限公司）。

（2）投资于优先级资产支持证券、优先级资产支持票据的，债项评级不低于AA；本计划不投资于次级资产支持证券、次级资产支持票据。

（3）债券回购交易期限不得大于364天。

（二）投资比例限制

（1）投资单只股票的股数不得超过上市公司总股本的 4.99%，同时不得超过上市公司流通股本的10%；

（2）投资单只债券的张数不得超过该债券发行总量的20%；

（3）参与股票发行申购时，本计划所申报的金额不得超过本计划的总资产，本计划所申报的股票数量不得超过拟发行股票公司本次发行股票的总量。

（4）参与债券（包括但不限于可转换公司债券、可交换公司债券等债券）发行申购时，本计划申报的金额不得超过本计划的总资产，且申报的数量不得超过拟发行公司本次发行的总量；

（5）本计划的总资产占净资产的比例不得超过200%；

（6）债券回购余额（包括正、逆回购）合计余额占上一日资产管理计划资产净值之比小于等于100%；

（7）本计划投资于同一资产的资金，不得超过资产管理计划资产净值的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；

（8）本计划投资于资产支持证券时，基础资产不得包含信托计划、私募基金、资管产品及其收（受）益权。

如法律法规或监管部门修改或取消上述限制，履行合同变更程序后，本集合计划可相应调整投资组合限制的规定，则本集合计划不受上述限制。

（二）投资禁止

本计划财产禁止从事下列行为：

1、违规将集合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、将集合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、挪用集合计划资产；

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小于中国证监会规定的最低限额；

8、使用集合计划资产进行不必要的交易；

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、行政法规和中国证监会禁止的其他行为。

八、本资产管理计划的建仓期为本计划成立日起6个月。建仓期的投资活动，应当符合本资产管理合同约定的投向和资产管理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，本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。

九、委托人同意，本集合计划为商品及金融衍生品类集合资产管理计划，存续期间为规避特定风险，投资于商品及金融衍生品的持仓合约价值的比例可以低于资产管理计划总资产80%，但不得持续6个月低于本计划总资产80%。

上述“特定风险”包括但不限于：

1、证券市场短期内发生急剧波动，管理人基于其判断认为资产买入行为将不利于本计划利益；

2、因市场原因，管理人暂时无法确定合适的投资标的。

十、本计划投资的资产组合的流动性应与参与、退出安排相匹配，本计划开放退出期内，其资产组合中7个工作日可变现资产的价值，不低于计划资产净值的10%。本计划主动投资于流动性受限资产的市值在开放退出期内合计不得超过计划资产净值的20%。本计划流动性安排由管理人负责控制。

第十二部分 分级安排

本集合计划不进行分级安排。

第十三部分 利益冲突及关联交易

（一）本计划存在或可能存在利益冲突情形：在不违反法律法规的强制性规定、不违反本合同约定并严格遵守管理人内部有关投资决策管理及关联交易管理等制度的前提下，管理人可能将本计划投资于管理人、托管人及前述机构的控股股东、实际控制人或者其他关联方发行的证券（包括但不限于股票、债券、资产支持证券以及管理人管理的资产管理计划，本章下同）或者承销期内承销的证券（以下统称“关联交易”）。

（二）本计划存在利益冲突的处理方式、披露方式、披露内容和披露频率

1、管理人将本计划资产投资于管理人、托管人及前述机构的控股股东、实际控制人或者其他关联方发行的证券或者承销期内承销的证券的，管理人应当建立健全内部审批机制和评估机制，并应当遵循委托人利益优先原则，事后向委托人和托管人披露，并采取切实有效措施，防范利益冲突，保护委托人合法权益。

管理人以本计划资产从事重大关联交易的，应事先取得委托人同意，并有充分证据证明未损害委托人利益。

2、委托人授权并同意管理人从事前文所述之关联交易（含重大关联交易），委托人签署本合同即表明其已经充分理解并对前述关联交易（含重大关联交易）作出事先同意及授权，在发生具体关联交易时，管理人无需另行分别取得委托人的事先授权，委托人不得因本单一计划投资收益劣于管理人或托管人及其关联方管理的其他类似投资产品，而向管理人或托管人提出任何损失或损害补偿的要求，但该等关联交易投资应按照市场通行的方式和条件参与，公平对待本计划财产，防止利益冲突，不得损害委托人利益。

3、本计划在投资运作过程中存在关联交易的，管理人应当依照法律法规、监管规定、自律组织规则及交易所规则等要求就上述关联交易向监管机构、基金业协会或交易所等有权机构报告或备案，并依法通过定期报告或临时报告等形式进行相关披露。

（三）管理人运用计划资产从事关联交易的，应事后及时、全面、客观的向委托人和托管人进行披露。

（四）托管人应根据管理人要求提供托管人关联方信息，如果因托管人未及时向管理人提供或提供的信息不准确导致管理人无法审查相关投资是否构成关

联交易的，管理人不承担相关责任。

第十四部分 投资经理的指定与变更

一、资产管理计划投资经理由资产管理人负责指定。

二、本计划的投资经理的资料如下：

张岩先生，上海交通大学高级金融学院（SAIF）金融MBA，武汉大学金融学学士，现任华兴证券有限公司资产管理事业部执行总经理。张岩先生曾任深圳天风天成资产管理有限公司执行董事、天风证券股份有限公司资产配置中心总经理等职务，并曾经担任中国期货业协会资产管理业务委员会委员。张岩先生管理的集合资产管理计划曾连续3年获得Wind五星评级、曾获“2016年度金牛券商集合资产管理计划”。

本集合计划投资经理具有基金从业资格，最近三年未被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚。

三、投资经理离职或因故不能履行其职责时，管理人可以根据需要变更投资经理。投资经理变更后，管理人自变更之日起3个工作日通过管理人网站信息披露、信函、传真、电子邮件等本合同规定的方式之一通知份额持有人和托管人，即视为履行了告知义务。投资经理发生变更时，原投资经理应当妥善保管投资业务资料，及时办理投资业务的移交手续，新投资经理或者临时投资经理应当及时接收。投资经理的选任与变更情况应报中国证监会/基金业协会备案。

第十五部分 资产管理计划的财产

一、资产管理计划财产的保管与处分

（一）本计划财产的债务由计划财产本身承担责任，委托人以其出资为限对本计划财产的债务承担责任。

（二）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。

（三）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。

（四）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。

（五）本计划财产产生的债权不得与不属于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委托人。

（六） 非现金类财产的保管

1．证券类资产的保管

本计划投资形成的证券类资产，由相关法定登记或托管机构根据法律法规的规定实行第三方保管。

2．投资于《管理办法》第三十七条第（五）项规定资产（如有）及其他非现金类财产的保管

在符合法律法规、监管要求及本合同约定的前提下，本计划投资于《管理办法》第三十七条第（一）至（三）项规定以外的非标准化债权类资产、股权类资产、商品及金融衍生品类资产等其他非现金类资产时，管理人应于完成投资后及时办理计划资产的确权事宜，负责保管相关权利凭证（如有）及行权依据，并及时将相关权利凭证及行权依据的复印件或扫描件交付托管人。

本计划所涉及的相关财产的抵、质押权的设立、变更、解除、行使以及抵、质押物的保管、抵、质押物财产价值的监控等，由管理人作为抵、质押权人根据

法律法规、监管规定及其与相关当事人签订的抵押合同或质押合同负责办理。管理人应当保证行使抵、质押权时，所得资金汇回托管账户，并通过电话、电子邮件或管理人与托管人认可的其他方式告知托管人账户收入情况。

管理人对计划财产行使权利的依据、资产持有情况的任何形式的变更，都应于变更后 5 个工作日内向托管人提交书面说明、变更后的权利凭证和行权依据（复印件或扫描件）。

对于上述实质上由管理人保管的计划财产，管理人不得将其进行抵押或转让，并对相关财产的安全和完整负责。

（七）对于因为管理计划投资产生的应收资产，应由管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知托管人，到账日托管账户未收到应收资产的，托管人应及时通知管理人采取措施进行催收，由此给计划造成损失的，管理人应负责向有关当事人追偿。

二、资产管理计划财产相关账户的开立和管理

管理人和托管人对集合计划资产单独设置账户，集合计划使用集合计划名称由托管人开立托管账户，以管理人、托管人和集合计划联名的方式开立证券账户，并以集合计划的名义开立银行间债券托管账户，以上账户的具体账户名以实际开立的名称为准。托管人根据管理人提交的开户申请开立上述账户，管理人应配合托管人办理开立账户事宜并提供相关资料。管理人和托管人对集合计划资产独立核算、分账管理，保证集合计划资产与其自有资产、集合计划资产与其他客户资产、不同集合计划的资产相互独立。

管理人、托管人依据相关法律法规及本合同的约定对本集合计划的各类账户进行管理。

（一）集合计划银行托管账户的开立和管理

托管人在具有托管资格的商业银行为本集合计划开立银行托管账户，账户名称以实际开立的账户为准。该账户用于办理本集合计划参与及退出资金、收益分配等资金往来相关业务。托管账户与管理人、托管人和推广机构自有资金账户以及其他集合计划资金账户相互独立。本集合计划资产的一切货币收支活动均通过本集合计划托管账户进行。

1、集合计划银行托管账户的开立和使用，限于满足开展本集合计划业务的需要。托管人和管理人不得假借本集合计划的名义开立任何其他银行账户；亦不

得使用本集合计划的任何账户进行本集合计划业务以外的活动。

2、本集合计划银行托管账户的开立和管理应符合《人民币银行结算账户管理办法》《现金管理暂行条例》《支付结算办法》以及中国人民银行、中国银监会的其他规定。

（二）集合计划证券账户和资金账户的开立和管理

1、托管人根据管理人委托按中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中登公司”）相关规定在中登公司为本集合计划分别开立证券账户。

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

本集合计划账户、专用交易单元（如有）应由管理人报证券交易所、证券登记结算机构备案。

本集合计划证券账户卡的保管由托管人负责，管理和运用由管理人负责。托管人以自身名义在中登公司开立结算资金账户，用于办理托管人所托管的本集合计划在证券交易所进行证券投资所涉及的资金结算业务。

（三）债券账户的开设和管理

本计划成立日后，资产管理人负责以资产管理计划的名义申请并取得进入全国银行间同业拆借市场的交易资格，并代表本计划进行交易；托管人根据中国人民银行、中央国债登记结算有限责任公司（以下简称“中债登”）和银行间市场清算所股份有限公司（以下简称“上清所”）的有关规定，在中债登和上清所开立债券账户和债券资金结算账户，并代表集合计划进行银行间市场债券交易的结算。

（四）期货账户的开立和管理

管理人选择的期货公司根据《证券公司参与股指期货、国债期货交易指引》《人民币银行结算账户管理办法》《期货交易管理条例》《关于规范期货保证金存取业务有关问题的通知》《中国金融期货交易所交易细则》等法律法规，为本集合计划开设期货投资相关账户及交易编码。

管理人应以书面形式将期货公司提供的本计划资产期货资金账户信息及初始资金密码，中国期货市场监控中心的登录用户名及密码，期货公司开立的保证金账户信息，期货交易所交易编码告知资产托管人。资金密码重置由管理人进行，

重置后务必及时通知托管人。

（五）基金账户的开立和管理

1、基金账户由管理人根据投资需要按照相关规定开立；

2、管理人在开立基金账户时应将托管账户作为赎回款、分红款的指定收款账户；

3、完成账户开立后，管理人应以书面形式将基金账户信息告知托管人。

（六）其他账户的开立和管理

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

法律、法规等有关规定对相关账户的开立和管理另有规定的，从其规定办理。

第十六部分 投资指令的发送、确认和执行

一、交易清算授权

授权通知的内容：资产管理人应在首次发送指令前向资产托管人提供授权文件（以下称授权通知，附件 2），指定划款指令的被授权人员及被授权印鉴，授权通知的内容包括被授权人的名单、签章样本、权限和预留印鉴。资产管理人撤换被授权人员、改变被授权人员的权限或更改被授权印鉴，须提供变更后的新的授权通知。授权通知应加盖资产管理人公司公章，并写明生效时间。资产管理人通过电子邮件或传真等双方认可的形式向资产托管人发送授权通知后，应及时与资产托管人通过录音电话确认，以保证资产托管人及时查收。授权通知自通知载明的生效时间开始生效，资产托管人收到授权通知的时间晚于通知载明的生效时间的，则授权通知自资产托管人收到该通知的时间生效。

资产管理人在与资产托管人电话确认授权通知后的三个工作日内将授权通知的正本送交资产托管人。资产管理人应确保授权通知的正本与扫描件或传真件一致。若授权通知正本内容与资产托管人收到的扫描件或传真件不一致的，以资产托管人收到的已生效的扫描件或传真件为准。

由于人员、权限或印鉴变更而提供的变更后的新的授权通知（包括但不限于变更指令发送人员、预留印鉴、签章样本等），应当至少提前 1 个工作日通知资产托管人；修改授权通知的文件应由资产管理人加盖公章。资产管理人对授权通知的修改应当以传真或电子邮件的形式发送给资产托管人，同时向资产托管人电话确认。资产管理人对授权通知的内容的修改自新的授权通知载明的生效时间开始生效，资产托管人收到新的授权通知的时间晚于通知载明的生效时间的，则新的授权通知自资产托管人收到该通知的时间生效。资产管理人在此后 3 个工作日内将对授权通知修改的文件正本送交资产托管人。若授权通知修改的正本内容与资产托管人收到的扫描件或传真件不一致的，以资产托管人收到的已生效的扫描件或传真件为准。

资产管理人和资产托管人对授权通知负有保密义务，其内容不得向授权人、被授权人及相关操作人员以外的任何人泄露。

二、投资指令的内容

指令是资产管理人在运作集合计划资产时，向资产托管人发出的资金划拨及

其他款项支付的指令。资产管理人发给资产托管人的指令应写明款项事由、支付时间、金额、付款账户、收款账户（包括收款人户名、账号、开户银行）等，加盖预留印鉴并有被授权人签字或签章（附件3）。

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

三、指令的发送、确认及执行时间与程序

指令由授权通知确定的被授权人代表资产管理人用传真、电子邮件或其他资产托管人和资产管理人书面确认过的方式向资产托管人发送，资产管理人有义务在发送指令后与资产托管人以录音电话的方式进行确认。因资产管理人过错未能及时与资产托管人进行指令确认，致使资金未能及时到账所造成的损失由资产管理人依法承担。

对于采用电子直联方式发送指令的，管理人、托管人应签署《管理人服务平台托管业务服务协议》(以实际签约名称为准)，管理人需在指令跟踪界面查看指令是否完成，双方应遵守该协议关于电子直联方式的具体托管操作安排。

资产管理人应按照《基金法》《管理办法》和本合同的规定，在其合法的经营权限和交易权限内发送指令，被授权人应按照其授权权限发送指令。对于被授权人在其授权范围内依法发出的指令，资产管理人不得否认其效力。

资产托管人收到资产管理人发送的指令后，应立即按照“表面一致性”原则审慎验证有关内容及印鉴和签名，审查的方式为验证指令的内容是否符合本合同约定、审核指令用章和签发人的签名或名章是否和预留印鉴样本、被授权人的签字样本或名章样本相符、操作权限是否与授权文件一致等，复核无误后应在规定期限内执行，不得延误。因托管人过错未正确执行指令的，由托管人就由此造成的损失依法承担相应责任。管理人向托管人发送指令的同时，应提供相关合同、交易凭证或其他证明材料(但第三方提供的资料除外)，并对该等资料的真实性、准确性、有效性、完整性和合法合规性负责。资产管理人向托管人发送有效划款指令时，应确保托管人有足够的处理时间，除需考虑资金在途时间外，还需给托管人留有2个工作小时（托管人工作日工作时间为9:00-11:30，13:00-17:00）的复核和审批时间。资产管理人在每个工作日的15:00以后发送的要求当日支付的划款指令，托管人应本着勤勉尽责的原则积极处理，但不保证当天能够执行。有效划款指令是指指令要素（包括付款人、付款账号、收款人、收款账号、金额（大、

小写）、款项事由、支付时间）准确无误、预留印鉴相符、相关的指令附件齐全且头寸充足的划款指令。由资产管理人过错造成的指令传输不及时、未能留出足够划款所需时间，致使资金未能及时到账所造成的损失由资产管理人依法承担。资产管理人向资产托管人下达指令时，应确保本计划托管账户有足够的资金余额，对资产管理人在没有充足资金的情况下向资产托管人发出的指令，资产托管人可不予执行，并立即通知资产管理人。在资金余额充足的情况下，资产托管人对资产管理人符合本合同的指令不得拖延或拒绝执行。

对于新股、新债申购等网下公开发行业务，管理人应于网下申购缴款日的11:30前将指令发送给托管人。

对于银行间业务，管理人应于交易日15:00前将银行间成交单及相关划款指令发送至托管人。管理人应与托管人确认托管人已完成证书和权限设置后方可进行本计划的银行间交易。资产管理人应将银行间同业拆借中心的成交通知单加盖印章后发送给托管人并电话确认。

对于指定时间出款的交易指令，管理人应提前2个工作小时将指令发送至托管人；对于管理人于15:00以后发送至托管人的指令，托管人不保证当日出款，由此产生的任何损失，由责任人依法承担。

四、管理人发送错误指令的情形和处理程序

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

五、资产托管人依照法律法规暂缓、拒绝执行指令的情形和处理程序

资产托管人发现资产管理人发送的指令违反《基金法》《管理办法》、本合同或其他有关法律的规定，不予执行，并应及时以电子邮件或录音电话的方式通知资产管理人纠正，资产管理人收到通知后应及时核对，并以电子邮件或录音电话的方式对资产托管人发送确认，因管理人过错造成的损失由资产管理人依法承担。

六、投资指令的保管

指令若以传真形式发出或以扫描件方式发送，则正本由管理人保管，托管人保管指令传真件或扫描件。当两者不一致时，以管理人发送给托管人的指令传真件或扫描件为准。指令通过电子直连方式发送的，以电子服务平台中的记录为准。

七、其他相关责任

（一）资产托管人由于自身过错造成未按照或者未及时按照资产管理人发送的正常指令执行，给资产委托人造成损失的，应负赔偿责任。

（二）对管理人在没有充足资金的情况下向托管人发出的指令致使资金未能及时清算所造成的损失由责任人依法承担。因管理人过错造成的传输不及时、未能留出足够执行时间、未能及时与托管人进行指令确认致使资金未能及时清算或交易失败所造成的损失由管理人依法承担。在正常业务受理渠道和指令规定的时间内，因托管人自身过错原因造成未能及时或正确执行合法合规的指令而导致委托财产受损的，托管人应承担相应的责任，但如遇到不可抗力的情况除外。

第十七部分 资产管理计划的交易及清算交收安排

一、选择证券经纪机构的程序

资产管理人负责选择代理本计划财产证券买卖的证券经纪机构，并根据需要与其签订专用证券交易单元租用协议。

资产管理人应及时将资产管理计划财产专用席位号、佣金费率等基本信息以及变更情况以书面形式通知资产托管人。资产管理人应配合资产托管人在计划财产开始进行场内交易前办妥专用交易单元合并清算手续。

二、投资证券后的清算交收安排

（一）本计划投资于证券发生的所有场内、场外交易的资金清算交割，全部由资产托管人负责办理。

本计划所有场内证券交易的清算交割由资产托管人作为特别结算参与人代理所托管资产管理计划与中登公司进行结算，场内证券投资的应付清算款由资产托管人根据中登公司的交收数据主动从托管账户中扣收。

本资产管理计划证券投资的清算交割，由资产托管人通过中登公司上海分公司/深圳分公司及清算代理银行办理。

（二）证券交易所证券资金结算

资产托管人、资产管理人应共同遵守中登公司制定的相关业务规则和规定，该类规则和规定自动成为本条款约定的内容。

资产管理人在投资前，应充分知晓与理解中登公司针对各类交易品种制定结算业务规则和规定。

资产托管人代理资产管理计划与中登公司完成证券交易及非交易涉及的证券资金结算业务，并承担由资产托管人原因造成的正常结算、交收业务无法完成的责任；若由于资产管理人原因造成的正常结算业务无法完成，责任由资产管理人依法承担。

对于任何原因发生的证券资金交收违约事件，相关各方应当及时协商解决。

三、期货交易及清算交收

资产管理人负责选择为本计划资产提供期货交易服务的期货经纪公司，并与其签订期货经纪合同。资产管理人、资产托管人和期货经纪公司等可就资产管理计划参与期货交易的具体事项另行签订协议约定。

资产管理人所选择的期货公司负责办理本计划的期货交易的清算交割，资产托管人对由于期货交易所期货保证金制度和清算交割的需要而存放在期货经纪公司的资金不行使保管职责，资产管理人应在期货经纪协议或其他协议中约定由选定的期货经纪公司承担资金安全保管责任。

四、银行间交易资金结算安排

（一）资产管理人负责对交易对手的资信监控，按银行间债券市场的交易规则进行交易，并依法对交易对手违约行为行为相关权利。

（二）资产管理人应在交易结束后将银行间同业市场债券交易成交单加盖业务印章后及时以传真、电子邮件或以资产托管人和资产管理人协商一致能够留痕的其他方式发送给资产托管人。如果银行间中债综合业务平台或上海清算所客户终端系统已经生成的交易需要取消或终止，资产管理人应书面通知资产托管人。

（三）资产管理人发送有效指令（包括原指令被撤销、变更后再次发送的新指令）的截止时间为当天的15:00。如资产管理人要求当天某一时点到账，则交易结算指令需提前2个工作小时(工作时间：工作日9:00-11:30,13:00-17:00)发送。由资产管理人过错违反本协议约定造成指令、成交单传输不及时、未能留出足够的操作时间，致使资金未能及时到账、债券未能及时交割所造成的损失由资产管理人依法承担。

（四）资产管理人向资产托管人下达指令时，应确保计划资产托管账户有足够的资金余额，对资产管理人在没有充足资金的情况下向资产托管人发出的指令，资产托管人可不予执行，并立即通知资产管理人。资产管理人确认该指令不予取消的，资金备足并通知资产托管人的时间视为指令收到时间。

（五）银行间交易结算方式采用券款对付的，托管账户与该产品在登记结算机构开立的DVP资金账户之间的资金调拨，除了中债登和上清所系统自动将DVP资金账户资金退回至托管账户的之外，应当由资产管理人出具资金划款指令，资产托管人审核无误后执行。由于资产管理人未及时出具指令导致该产品在托管账户的头寸不足或者DVP资金账户头寸不足导致的损失，由责任人依法承担责任。资产管理人在开立相应银行间交易账户后，应及时通知资产托管人，给与资产托管人足够时间进行运营操作准备，双方商议一致后确认此结算安排的起始时间。

五、其他场外交易资金结算

（一）本计划其他场外投资相应的资金划拨由资产托管人依据资产管理人的

划款指令逐笔划付。资产管理人应将划款指令连同相关投资证明文件一并以传真、电子邮件或其他资产管理人和资产托管人认可的能够留痕的其他方式发送至资产托管人。资产托管人进行形式审核无误后，应及时将划款指令交付执行。

（二）资产管理人应确保资产托管人在执行资产管理人发送的指令时，有足够的头寸进行交收。资产管理计划的资金头寸不足时，资产托管人有权拒绝资产管理人发送的划款指令。资产管理人在发送划款指令时应充分考虑资产托管人的划款处理所需的合理时间。如由于资产管理人过错导致无法按时支付证券清算款，由此造成的损失由资产管理人依法承担。

（三）在资金头寸充足的情况下，在正常业务受理渠道和时间内，资产托管人对资产管理人符合本合同规定的指令不得拖延或拒绝执行，如由于资产托管人原因导致资产管理计划无法按时支付证券清算款，由此造成的损失由资产托管人承担，但托管账户余额不足或资产托管人遇不可抗力的情况除外。

六、资金、证券账目及实物账目的核对

资产管理人和资产托管人每个交易日结束后核对资产管理计划资金账目、证券账目和交易记录，确保双方账目相符。实物账目的核对方式和内容由管理人和托管人通过电子邮件等能够留痕的方式协商一致确定。

七、参与、退出净额结算

资产管理计划托管账户与募集结算专用账户间的资金结算遵循“全额清算、净额交收”的原则，每日按照托管账户应收资金与应付资金的差额来确定托管账户净应收额或净应付额，以此确定资金交收额。当存在托管账户净应收额时，资产管理人应在资金划款日15:00之前从募集结算专用账户划到资产管理计划托管账户；当存在托管账户净应付额时，资产管理人应在资金划款日13:00之前将划款指令发送给资产托管人，资产托管人按资产管理人的划款指令将托管账户净应付额在资金划款日15:00之前划往募集结算专用账户。

第十八部分 越权交易的界定

一、越权交易的界定

（一）越权交易是指管理人违反有关法律法规及本合同的规定而进行的投资交易行为，包括：

1、违反本合同约定的投资范围和投资比例限制等进行的投资交易行为；

2、法律法规禁止的超买、超卖行为。

非因管理人主动投资行为导致的下列不符合投资政策的情形不构成本章所述越权交易，应当属于被动超标：

（1）由于管理人之外的原因导致的投资比例出现不符合本合同约定的投资政策的情形，为被动超标，不属于越权交易。发生被动超标时，管理人应当在本合同第十一部分“资产管理计划的投资”相关条款规定的工作日期限内（不含被动超标当日）进行调整，以达到投资政策的要求。

（2）本计划终止前（含终止日）的10个工作日内（本集合计划提前终止情形除外），管理人有权对集合计划资产所投资证券进行变现，由此造成投资比例、投资范围不符合投资政策规定的，视为被动超标，不属于越权交易。

（3）法律法规对被动超标另有规定的从其规定。

（二）管理人应在本合同规定的权限内运用集合计划资产进行投资管理，不得违反本合同的约定，超越权限从事投资。

二、越权交易的处理程序

（一）对于托管人承诺监督的越权交易，托管人发现管理人的投资指令违反本合同约定的，应当拒绝执行，立即通知管理人，管理人拒不纠正的，应当依据相关法律法规的要求报告中国证监会或基金业协会。

（二）对于托管人承诺监督的越权交易，托管人发现管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反本合同约定的，应立即通知管理人，管理人拒不纠正的，应依据相关法律法规的要求报告中国证监会或基金业协会。因托管人正确执行该指令（托管人有过错的除外）造成的直接损失由管理人依法承担责任。

（三）管理人应向托管人主动报告越权交易。托管人应当督促管理人在限期内改正并在该期限内对通知事项进行复查。管理人对托管人通知的越权事项未能在限期内纠正的，托管人应依据相关法律法规的要求报告中国证监会或基金业协

会。

（四）托管人在行使监督职能时，如果发现集合计划资产投资过程中出现超买或超卖现象，应立即提醒管理人，由此给集合计划资产造成的损失由管理人依法承担。如果因管理人原因发生交易所场内超买行为，必须于证券交易资金交收日上午10:00点之前完成融资，保证完成有关清算交收义务。超买超卖交易所发生的损失及相关交易费用由管理人负担，所发生的收益归本集合计划资产所有。

三、托管人对管理人投资运作的监督

（一）托管人对下列资产管理计划的投资事项及管理人投资行为进行监督：

1．对本合同约定的投资范围进行监督；

本集合计划属于商品及金融衍生品类产品。投资范围包括：

（1）商品及金融衍生品类资产：证券交易所和期货交易所交易的期货和期权合约、权证；

（2）权益类资产：沪深交易所依法发行上市的股票（含科创板股票，含网上新股申购与网下新股申购）、优先股、港股通、存托凭证、股票型公募证券投资基金、混合型公募证券投资基金、融资融券；

（3）固定收益类资产：银行存款、同业存单，证券交易所和全国银行间债券市场等国务院同意设立的交易场所交易的债券、资产支持证券、央行票据和非金融企业融资工具（含资产支持票据）等，债券型基金，货币市场基金，债券回购，转融通证券出借交易；

（4）中国证监会认可的其他投资品种。

投资比例（占集合计划资产总值）：

（1）权益类资产占资产管理计划总资产的比例为：0-80%；

（2）固定收益类资产占资产管理计划总资产的比例为：0-80%；

（3）投资于商品及金融衍生品的持仓合约价值的比例不低于资产管理计划总资产80%，且衍生品账户权益超过资产管理计划总资产的20%。

管理人将根据具体投资资产的投资限制，合理分配各资产占资产管理计划总值的比例，以保证所投向的最终资产满足上述投资比例要求。

2．对本计划以下投资限制进行监督：

（1）不得主动投资于ST、*ST、SST、S*ST及处于退市整理期的上市公司股票；

（2）不得参与股票非公开增发；

（3）投资于公司债、企业债、非政策性金融债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、非公开定向债务融资工具、可转换公司债券、可交换公司债券的，所投资债券发行人主体及债项评级（若有）不低于 AA，短期融资券评级不低于 A-1，评级展望达到稳定及以上。如多家机构评级结果同时出现时，应各评级机构给出的最低评级结果为准（本计划所称评级机构仅包括：中证鹏元资信评估股份有限公司、东方金诚国际信用评估有限公司、中诚信国际信用评级有限责任公司、上海新世纪资信评估投资服务有限公司、大公国际资信评估有限公司、联合资信评估股份有限公司）。

（4）投资于优先级资产支持证券、优先级资产支持票据的，债项评级不低于 AA；本计划不投资于次级资产支持证券、次级资产支持票据。

（5）债券回购交易期限不得大于 364 天。

（6）投资单只股票的股数不得超过上市公司总股本的 4.99%，同时不得超过上市公司流通股本的 10%；

（7）投资单只债券的张数不得超过该债券发行总量的 20%；

（8）参与股票发行申购时，本计划所申报的金额不得超过本计划的总资产，本计划所申报的股票数量不得超过拟发行股票公司本次发行股票的总量。

（9）参与债券（包括但不限于可转换公司债券、可交换公司债券等债券）发行申购时，本计划申报的金额不得超过本计划的总资产，且申报的数量不得超过拟发行公司本次发行的总量；

（10）本计划的总资产占净资产的比例不得超过 200%；

（11）债券回购余额（包括正、逆回购）合计余额占上一日资产管理计划资产净值之比小于等于 100%；

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

如涉及穿透监控的，管理人应在每月的前 5 个工作日提供下层产品的资产情况表，托管人予以复核，如因管理人未提供或未及时提供下层产品资产情况表或提供的下层产品资产情况表无法满足托管人复核要求的，导致托管人无法进行复核的，相关责任由管理人依法承担。

第十九部分 资产管理计划财产的估值和会计核算

一、估值目的

客观、准确地反映集合计划资产的价值。经集合计划资产估值后确定的集合计划资产每计划份额净值，是计算参与和退出集合计划的基础。

二、估值时间

估值日指本计划成立日后的每个工作日，管理人与托管人在每个估值日对集合计划资产进行估值处理并核对。

三、估值方法

本集合计划实行净值化管理，坚持公允价值计量原则。估值应符合本合同及法律法规的规定。

（一）银行存款以成本列示，每日按照约定利率计提收益，在利息到账日以实收利息入账，并冲减已计提部分。

（二）股票的估值方法

交易所上市流通的股票（含科创板股票）、存托凭证，以估值日证券交易所挂牌的该证券收盘价估值，该日无交易的，以最近一交易日的收盘价估值。

港股通股票以估值日香港联合交易所挂牌的该证券收盘价估值，该日无交易的，以最近一交易日的收盘价估值。港股通投资持有外币证券资产估值涉及到港币对人民币汇率的，以上海（深圳）证券交易所估值日终公布的港币对人民币中间价[（结算买入汇兑比率+结算卖出汇兑比率）/2]估值，或其他可以反映公允价值的汇率进行估值。

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的情况下，按成本估值。

送股、转增股、配股和公开增发新股等发行未上市股票，按估值日交易所上市的同一股票的收盘价估值，该日无交易的，以最近一交易日收盘价估值。

优先股采用中央国债登记结算有限责任公司提供的估值数据进行估值，未提供估值数据的，采用估值技术确定的公允价值进行估值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本进行估值。

优先股如有约定股息率，按照约定股息率每日计提收益。

流通受限股票按以下公式确定估值日该流通受限股票的价值：

FV=S×（1-LoMD）

其中：

FV：估值日该流通受限股票的价值

S：估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值

LoMD：该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣，采用中央国债登记结算有限责任公司提供的数据。

（三）证券投资基金的估值方法

上市流通的证券投资基金以估值日证券交易所挂牌的该基金收盘价估值，该日无交易的，以最近一交易日的收盘价估值。

场外开放式证券投资基金（包括场外购买的上市型开放式基金LOF、浮动净值型货币基金）以估值日前一交易日基金单位净值估值，估值日前一交易日单位净值未披露的，以此前最近一个交易日基金单位净值估值。如遇到基金拆分、到期、转型及封转开等情况，管理人应与托管人共同协商确定估值办法，无法达成一致的，以管理人意见为准。

固定净值型货币基金以成本估值，按估值日前一交易日万份收益计提红利。

（四）债券的估值方法

同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按该债券品种所处的市场分别估值。

首次发行未上市或未挂牌转让的债券品种采用估值技术确定的公允价值进行估值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

交易所市场上市交易或挂牌转让的债券选取估值日中证指数有限公司提供的相应品种对应的唯一估值净价或推荐估值净价估值。未提供估值净价的，采用估值技术确定的公允价值进行估值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本进行估值。

交易所市场上市交易的可转换债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有收盘价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大变化的，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后发生了影响公允价值计量的重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，按照本协议约定的方式调整最近交易市价，确定公允价格。

对于银行间市场上的债券品种，采用中央国债登记结算有限责任公司提供的唯一估值净价或推荐估值净价进行估值，未提供估值净价的，采用估值技术确定的公允价值进行估值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本进行估值。

（五）资产支持证券的估值方法

交易所市场挂牌转让的资产支持证券采用估值日中证指数有限公司提供的唯一估值净价或推荐估值净价进行估值，未提供估值净价的，采用估值技术确定的公允价值进行估值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本进行估值。

对于银行间市场上的资产支持证券，采用中央国债登记结算有限责任公司提供的唯一估值净价或推荐估值净价进行估值，未提供估值净价的，采用估值技术确定的公允价值进行估值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本进行估值。

（六）同业存单的估值方法

对于银行间市场上的同业存单，采用中央国债登记结算有限责任公司提供的唯一估值净价或推荐估值净价进行估值，未提供估值净价的，采用估值技术确定的公允价值进行估值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本进行估值。

（七）中央银行票据的估值方法

对于银行间市场上的中央银行票据，采用中央国债登记结算有限责任公司提供的唯一估值净价或推荐估值净价进行估值，未提供估值净价的，采用估值技术确定的公允价值进行估值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本进行估值。

（八）非金融企业债务融资工具

对于银行间市场上的非金融企业债务融资工具，采用中央国债登记结算有限责任公司提供的唯一估值净价或推荐估值净价进行估值，未提供估值净价的，采用估值技术确定的公允价值进行估值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本进行估值。

（九）回购的估值方法

回购交易以成本列示，按商定利率在实际持有期间内逐日计提利息，在利息

到账日以实际利息入账,并冲减已计提部分。

（十）衍生品的估值方法

中国金融期货交易所上市流通的股指期货、国债期货以估值日结算价计算估值,该日无交易的，以最近一交易日的结算价估值。

各商品期货交易所上市流通的商品期货以估值日结算价计算估值,该日无交易的，以最近一交易日的结算价估值。

场内期权以估值日所在交易所的当日结算价估值，该日无交易的，以最近一交易日的结算价估值。

从持有确认日起到卖出日或行权日止，上市交易的认沽/认购权证按估值日的收盘价估值，估值日没有交易的，按最近交易日的收盘价估值；未上市交易的认沽/认购权证采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量的情况下，按成本估值；停止交易、但未行权的权证，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，按成本估值。港股通权证以估值日香港证券交易所挂牌的该证券收盘价估值，该日无交易的，以最近一交易日的收盘价计算。港股通投资持有外币证券资产估值涉及到港币对人民币汇率的，以上海（深圳）证券交易所估值日终公布的港币对人民币中间价[（结算买入汇兑比率+结算卖出汇兑比率）/2]估值，或其他可以反映公允价值的汇率进行估值。

（十一）本计划参与融资融券、转融通证券出借业务，按照相关法律法规和行业协会的相关规定进行估值，确保估值的公允性。

（十二）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。

（十三）如资产管理人与资产托管人协商一致认为按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，或上述方法无法满足估值需要时，资产管理人可根据具体情况与资产托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

（十四）如资产管理人或资产托管人发现资产估值违反本合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护资产委托人利益时，应立即通知对方，共同查明原因，双方协商解决。

四、估值对象

集合计划所拥有的各种有价证券、银行存款本息、集合计划应收款项、其它投资等资产。

五、估值程序

日常估值由管理人进行，以电子对账、邮件或其他书面方式与托管人进行核对。估值结果于估值日当日核对一致。用于披露的计划资产净值由管理人完成估值后将估值结果交托管人，托管人按照约定的估值方法、时间与程序进行复核，复核后“以电子对账、邮件或其他书面方式”告知管理人，复核无误后签章返回给管理人，由管理人披露。月末、年中和年末估值复核与本集合计划会计账目的核对同时进行。

六、估值错误的处理

（一）管理人和托管人将采取必要、适当、合理的措施确保本计划资产估值的准确性、及时性。当计划份额净值小数点后4位以内(含第4位)发生差错时，视为计划份额净值错误。

（二）估值错误的处理原则和方法

1、估值错误与遗漏的处理

（1）每计划份额净值的估值结果精确到0.0001元，小数点后第5位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

（2）管理人和托管人采取必要、适当、合理的措施确保集合计划资产估值的准确性和及时性。当计划份额净值出现错误时，管理人、托管人立即予以纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大。

管理人计算的资产管理计划净值已由托管人复核确认，但因财产估值错误给委托人造成损失的，由管理人与托管人按照过错各自依法承担相应的责任。因估值导致资产管理计划份额净值出现错误时，管理人应当立即纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大。

如资产管理人和资产托管人对资产管理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，为避免不能按时披露资产管理计划净值的情形，以资产管理人的计算结果披露。

由于一方当事人提供的信息错误，另一方当事人在采取了必要合理的措施后仍不能发现该错误，进而导致资产管理计划净值计算错误造成委托人的损失，以及由此造成以后交易日计划资产净值计算顺延错误而引起的委托人的损失，由提供错误信息的当事人一方依法负责赔偿。

（3）前述内容如法律法规另有规定的，按其规定处理。

2、差错处理

（1）差错类型

差错指管理人、托管人、登记结算机构、推广机构在运作过程中发生的差错，主要类型包括但不限于：资料申报差错、数据传输差错、数据计算差错、系统故障差错、下达指令差错等。

因技术原因引起的差错，若系同行业现有技术水平无法预见、无法避免、无法克服，则属不可抗力。

（2）差错处理原则

1）差错已发生

差错已发生但尚未给当事人造成损失时，差错责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正差错发生的费用由差错责任方承担；由于差错责任方未及时更正已产生的差错，给当事人造成损失的由差错责任方依法承担；若差错责任方已经积极协调，并且有协助义务的当事人有足够的时间进行更正而未更正，则有协助义务的当事人应当依法承担相应赔偿责任。差错责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认，确保差错已得到更正；

2）差错的责任方仅对由其差错可能导致有关当事人的直接损失负责，不对间接损失负责，并且仅对差错的有关直接当事人负责，不对第三方负责；

3）不当得利

因差错而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但差错责任方仍应对差错负责，如果由于获得不当得利的当事人不返还或不全部返还不当得利造成其他当事人的利益损失，则差错责任方应依法赔偿受损方的损失，并在其支付的赔偿金额的范围内对获得不当得利的当事人享有要求交付不当得利的权利；如果获得不当得利的当事人已经将此部分不当得利返还给受损方，则受损方应当将其已经获得的赔偿额加上已经获得的不当得利返还的总和超过其实际损失的差额部分支付给差错责任方；

4）差错调整采用尽量恢复至假设未发生差错的正确情形的方式；

5）差错责任方拒绝进行赔偿或未按规定对受损方进行赔偿的，如果因管理人过错造成集合资产管理计划资产损失时，托管人应为集合资产管理计划的利益向管理人追偿，如果因托管人过错造成集合资产管理计划资产损失时，管理人应为集合资产管理计划的利益向托管人追偿。除管理人和托管人之外的第三方造成

集合资产管理计划资产的损失，并拒绝进行赔偿时，由管理人负责向差错方追偿；

6)如果出现差错的当事人未按规定对受损方进行赔偿，并且依据法律法规、本合同或其他规定，集合计划管理人自行或依据法院判决、仲裁裁决对受损方承担了赔偿责任，则集合计划管理人有权向出现过错的当事人进行追索，并有权要求其赔偿或补偿由此发生的费用和遭受的损失；

7）由于交易所及登记结算公司发送的数据错误，集合计划管理人和托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误的，由此造成的集合计划资产估值错误，集合计划管理人和托管人免除赔偿责任。但集合计划管理人和托管人应当积极采取必要的措施消除或减轻由此造成的影响；

8）按法律、法规规定的其他原则处理差错。

（3）差错处理程序

差错被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

1）查明差错发生的原因，列明所有的当事人，并根据差错发生的原因确定差错的责任方；

2）根据差错处理原则或当事人协商的方法对因差错造成的损失进行评估；

3）根据差错处理的方法，需要修改登记结算机构的交易数据的，由登记结算机构进行更正，并就差错的更正向有关当事人进行说明。

4）根据差错处理原则或当事人协商的方法对差错进行更正，由差错的责任方依法赔偿损失；

5）集合计划资产净值计算错误偏差达到集合计划资产净值0.5%时，集合计划管理人应当通报托管人，并向委托人披露。

七、估值调整的情形与处理

（一）管理人作为主会计人应定期评估第三方估值机构的估值质量，并对估值价格进行检验，防范可能出现的估值偏差。当出现投资品估值偏差，估值机构发布的估值不能体现公允价值时，管理人应综合第三方估值机构估值结果，经与托管人协商，谨慎确定公允价值，并按相关法规的规定进行信息披露，充分披露确定公允价值的方法、相关估值结果等信息。

（二）如有确凿证据表明按本合同约定的估值方法进行估值不能客观反映本计划公允价值的，管理人可根据具体情况与托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事

项，按国家最新规定估值。

八、暂停估值的情形

（一）与集合计划投资有关的证券交易场所非正常停市时；

（二）因不可抗力或其他情形致使管理人、托管人无法准确评估集合计划资产价值时；

（三）中国证监会认可的其他情形。

出现以上情形，可以暂停估值，但估值条件恢复时，管理人、托管人必须按规定完成估值工作。管理人应在暂停估值和恢复估值发生后及时在管理人网站和/或推广网点向委托人披露。

九、资产管理计划份额净值的确认

用于信息披露的计划资产净值和计划份额净值由管理人负责计算，托管人负责复核。管理人应于每个工作日计算当日的计划资产净值和计划份额净值并发送给托管人。托管人对净值计算结果复核确认后发送给管理人，由管理人按约定向委托人披露。

十、特殊情况的处理

由于集合计划所投资的各个市场及其登记结算机构发送的数据错误，或由于其他不可抗力原因，管理人和托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误的，由此造成的集合计划资产计价错误，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。

由于登记结算机构发送的数据有误，处理方法等同于交易数据错误的处理方法。

十一、资产管理计划的会计政策

本计划的会计政策比照现行政策并按照本资产管理合同约定执行：

（一）资产管理人为计划财产的会计责任方；

（二）计划财产的会计年度为公历年的1月1日至12月31日；

（三）计划财产的会计核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位；

（四）会计制度执行国家有关的会计制度；

（五）本计划财产独立建账、独立核算；

（六）资产管理人应保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按

照有关规定编制计划财产会计报表；

（七）管理人应定期与托管人就资产管理计划的会计核算、报表编制等进行核对。

第二十部分 资产管理计划的费用与税收

一、交易成本

本集合计划在发生投资交易时按规定比例支付的经手费、证管费、过户费、结算费、印花税、佣金、交易手续费等，直接计入当期费用。

二、托管费

按前一日集合计划资产净值的0.02%年费率计提。计算方法为：

H＝E×0.02%÷当年天数

H为每日集合计划应计提的托管费；

E为前一日集合计划资产净值。

托管人的托管费每日计算，逐日累计，每季度支付一次，当季托管费的支付，由管理人于次季度首日起七个工作日内向托管人发送托管费划款指令，托管人复核后按照指令从集合计划资产中支付给托管人。

经托管人书面同意，管理人有权根据市场情况调低托管费率和支付频率，并及时向委托人披露。

托管人接收托管费的账户信息如下：

开户行：工商银行北京东城支行营业室

账户名称：中信建投证券股份有限公司

账号：0200080719027304381

三、管理费

（一）固定管理费的计算和提取

固定管理费按前一日集合计划资产净值的1.5%年费率计提。计算方法为：

H＝E×1.5%÷当年天数

H为每日集合计划应计提的固定管理费；

E为前一日集合计划资产净值。

管理人的固定管理费每日计算，逐日累计，每季度支付一次，当季固定管理费的支付，由管理人于次季度首日起七个工作日内向托管人发送固定管理费划款指令，托管人复核后按照指令从集合计划资产中支付给管理人。

管理人有权根据市场情况调低固定管理费率和支付频率，并及时向委托人披露。

（二）业绩报酬的计算和提取

本集合计划不计提业绩报酬。

（三）管理人收取固定管理费的账户为：

账户名称：华兴证券有限公司

账　　号：121922106810206

开户银行：招商银行上海分行营业部

四、与集合计划相关的会计师费

集合计划在存续期间发生的审计费用，由集合计划承担。

五、其他事项

与集合计划运营有关的其他费用包括：银行结算费用、银行间市场账户维护费、开户费、本计划成立日后与计划相关的资产评估师费、会计师费、律师费、信息披露费用、印刷费、UKEY费用、仲裁费、诉讼费、公告费、送达费、保全费、公证费、执行费、拍卖费用、本计划终止清算费用及其他费用。

与集合计划运营有关的其他费用，如果金额较大，并且影响本计划份额净值且可以对应到相应会计期间的，可以在该会计期间内按直线法摊销；不满足上述条件的其他情形，可以一次计入集合计划费用。

本计划成立日前的律师费、会计师费和信息披露费等费用，登记结算费，以及存续期发生的与推广有关的费用，不从集合计划资产中列支。

本合同中约定的收费账户信息若发生变更的，新的收费账户信息（托管费收费账户除外）由管理人以书面形式告知托管人，新的托管费收费账户信息由托管人以书面形式告知管理人。

集合计划运作过程中涉及的各纳税主体，依照国家法律法规的规定履行纳税义务。

各方一致同意，本集合计划运营过程中产生的增值税等应税行为，如需按照相关规定或税务机关的要求计算和缴纳增值税及附加税等税费，并由管理人履行相应纳税义务的，应由本集合计划资产承担上述相关税费，管理人有权从集合计划资产中提取与应缴纳税费等额的款项，具体提取时间及提取金额由管理人根据相关税费征缴情况确定并向托管人出具划款指令，托管人复核后按照管理人划款指令从集合计划资产中一次性支付给管理人。委托人进一步同意，管理人在向委托人交付相关收益或资产后，税务机关要求管理人就已交付收益

或资产缴纳上述相关税费，或者在本集合计划清算后，管理人被税务机关要求补缴上述相关税费的，委托人应按照管理人要求进行补缴。

各方一致同意，增值税相关法律法规、税收政策等如发生变化，管理人有权决定按新的规定执行。

六、不列入集合计划费用的项目

本计划成立日前发生的费用以及存续期间发生的与推广有关的费用，管理人和托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或集合计划资产的损失，以及处理与集合计划资产运作无关事项或不合理事项所发生的费用等不列入本集合计划的费用。

七、收费账户的变更

本合同中约定的收费账户信息若发生变更的，新的收费账户信息（托管费收费账户除外）由资产管理人以书面形式告知资产托管人，新的托管费收费账户信息由资产托管人以书面形式告知资产管理人。**本合同各方一致同意，账户信息的变更于上述通知送达日或通知载明的生效日期（以较晚发生的日期为准）生效，账户信息的变更无须另行修改本合同。**

第二十一部分 资产管理计划的收益分配

一、资产管理计划收益分配方案依据现行法律法规以及合同约定执行。

二、可供分配利润的构成

集合计划收益由债券利息、基金红利、买卖证券价差、银行存款利息以及其他合法收入构成。

本资产管理计划可供分配利润为截至收益分配基准日计划未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

三、收益分配原则

（一）集合计划份额的每一份额享有同等分配权；

（二）集合计划收益分配基准日的计划份额净值减去每单位集合计划份额收益分配金额后不能低于面值；

（三）当期收益先弥补上一年度亏损后，方可进行当年收益分配；

（四）在符合本合同约定的分红条件和收益分配原则的前提下，本集合计划可以进行收益分配，分配频率不高于六个月一次，收益分配的相关事宜由管理人决定并以管理人信息披露为准。

（五）集合计划红利发放日距离收益分配基准日（即可供分配利润计算截至日）的时间不得超过15个工作日；

（六）法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。在法律法规和监管机构允许的范围内，管理人、托管人协商一致，可以对上述收益分配条件和时间进行调整，并在管理人网站上信息披露。

四、集合计划的收益分配方式

（一）集合计划默认分红方式为红利再投资，委托人可以选择现金分红或红利再投资分红方式。委托人同意遵守登记结算机构的业务规则（包括但不限于现有规则、对现有规则的修订、以及以后新制订的规则）。管理人分红时以登记结算机构登记的分红方式为准。

（二）委托人选择采取默认红利再投资形式的，分红资金按分红除权日的集合计划每计划份额净值（免收参与费用）转成同类集合计划份额。集合计划份额计算要保留到小数点后两位，小数点后第三位四舍五入，由此产生的差额部分计入集合计划资产的损益。

五、收益分配方案的确定与通知

（一）计划收益分配方案中应载明截止收益分配基准日的可供分配利润、计划收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。

（二）计划收益分配方案由管理人拟订，由托管人复核，由管理人通知委托人。托管人仅核实收益分配总额，不负责核实分配给每个委托人的明细金额。

六、收益分配的执行方式

收益分配方案确定后，管理人依据具体方案的规定进行收益分配，托管人依据收益分配方案配合执行管理人收益分配划款指令。

计划收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由委托人自行承担。当委托人的现金红利小于一定金额，不足于支付银行转账或其他手续费用时，注册登记机构可将计划份额持有人的现金红利自动转为同类计划份额。

第二十二部分 信息披露与报告

一、管理人应向委托人提供下列信息披露文件：

（一）资产管理合同、计划说明书和风险揭示书；

（二）资产管理计划净值，资产管理计划参与、退出价格；

（三）资产管理计划定期报告，至少包括季度报告和年度报告；

（四）重大事项的临时报告；

（五）资产管理计划清算报告；

（六）中国证监会规定的其他事项。

二、资产管理计划运作期间，管理人应定期向委托人披露以下信息：

（一）净值报告

本计划每周第一个交易日向委托人披露一次经托管人复核的计划资产净值和计划份额净值。

（二）季度报告和年度报告

1．管理人应于每季度结束之日起一个月内披露季度报告，每年度结束之日起四个月内披露年度报告，披露报告期内资产管理计划运作情况。本计划成立不足三个月或者存续期间不足三个月的，管理人可以不编制当期的季度报告和年度报告。

2．年度报告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委托人权益的重大事项；

（10）中国证监会规定的其他事项。

3．季度报告应当披露前款除第（6）项之外的其他信息。

4．资产管理计划年度财务会计报告应当经具有证券相关业务资格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。

（三）托管人履职报告

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

2.管理人应当在每季度结束后20日内向托管人提供其编制的季度报告供托管人复核本资产管理计划财务数据，托管人复核管理人季度报告有关本资产管理计划财务数据后，于10日内向管理人反馈复核意见。

3．管理人应当在每年度结束后三个月内向托管人提供其编制的年度报告当期财务会计报告供托管人复核，托管人复核管理人年度报告有关本资产管理计划财务数据后，于一个月内向管理人反馈复核意见。

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

三、临时报告

发生资产管理合同约定或可能影响委托人利益的重大事项时，在事项发生之日起五日内向委托人披露。

四、向资产委托人提供报告及资产委托人信息查询的具体方式

（一）委托人信息查询范围

委托人可根据本合同约定的时间和方式查阅或复制计划所披露的信息资料。

（二）委托人向管理人查询信息的方式

管理人通过以下至少一种方式进行披露信息即视为履行了通告或告知义务，委托人可通过以下方式向管理人查阅本合同约定披露的信息资料：

1.资产管理人网站

定期报告、计划份额净值报告、临时报告等本合同约定披露或告知的信息、资料可在管理人网站上披露，委托人可随时查阅。

2.邮寄服务

管理人或代销机构可向委托人邮寄定期报告等本合同约定披露或告知的信息、资料。委托人在本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，委托人应当及时以书面方式或以管理人规定的其他方式通知管理人。

3.传真或电子邮件

如委托人留有传真号、电子邮箱、电话等联系方式的，管理人也可通过传真、电子邮件、电报、录音电话等方式将本合同约定披露或告知的信息、资料告知委托人。

（三）委托人向托管人查询信息的方式

委托人可通过电话、传真或电子邮件等联系方式，经由管理人向托管人查询有关信息披露资料。

五、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资产管理计划，应向委托人充分披露。

六、管理人、托管人向监管机构的报告

管理人、托管人应当在每年度结束之日起四个月内，分别编制私募资产管理业务管理年度报告和私募资产管理业务托管年度报告，并报中国证监会相关派出机构和基金业协会备案。

第二十三部分 风险揭示

一、资产管理计划投资将可能面临下列各项风险，包括但不限于：

（一）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。

本集合计划属于 R4（中高风险）风险投资品种，适合风险识别、评估、承受能力C4（积极型）及以上的合格投资者。

（二）资产管理合同与基金业协会合同指引不一致所涉风险

本资产管理合同是基于基金业协会发布的《集合资产管理计划资产管理合同内容与格式指引（试行）》而制定的，管理人根据自身实际情况，对《合同指引》相关内容做出了相应调整，可能导致本合同被基金业协会认定为与《合同指引》不完全一致，从而要求管理人重新修订完善的风险。管理人将及时根据基金业协会的要求提交说明材料，如涉及合同变更的，管理人将按照本合同的约定履行合同变更程序。

（三）市场风险

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

1、政策风险。货币政策、财政政策、产业政策等国家宏观经济政策的变化对资本市场产生一定的影响，导致市场价格波动，影响集合资产管理计划的收益而产生风险。

2、经济周期风险。经济运行具有周期性的特点，受其影响，集合资产管理计划的收益水平也会随之发生变化，从而产生风险。

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

4、上市公司经营风险。上市公司的经营状况受多种因素影响，如市场、技术、竞争、管理、财务等都会导致公司盈利状况发生变化。如集合资产管理计划

所投资的上市公司经营不善，与其相关的证券价格可能下跌，或者能够用于分配的利润减少，从而使集合资产管理计划投资收益下降。

5、权证风险。权证具有杠杆效应且价格波动剧烈，会放大收益或损失，在某些情况下本金甚至会全部损失。

6、购买力风险。集合资产管理计划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，从而使集合资产管理计划的实际收益下降。

7、再投资风险。固定收益品种获得的本息收入或者回购到期的资金，可能由于市场利率的下降面临资金再投资的收益率小于原来利率，从而对本集合计划产生再投资风险。

（四）管理风险

在集合资产管理计划运作过程中，管理人及投资经理的知识、经验、判断、决策、技能等，会影响其对信息的占有和对经济形势、金融市场价格走势的判断，投资经理基于自身判断及客观情况，有权作出投资或不投资的决定；如管理人变更投资经理、投资经理判断有误、获取信息不全、或对投资策略调整不及时、投资工具使用不当等影响集合资产管理计划的收益水平，从而产生风险。

（五）流动性风险

集合资产管理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的风险。流动性风险按照其来源可以分为：

1、市场整体流动性相对不足。证券市场的流动性受到市场行情、投资群体等诸多因素的影响，在某些时期成交活跃，流动性好；而在另一些时期，可能成交稀少，流动性差。在市场流动性相对不足时，投资品种交易变现有可能增加变现成本，对集合资产管理计划造成不利影响。

证券市场中流动性不均匀，存在单一证券流动性风险。由于流动性存在差异，即使在市场流动性比较好的情况下，一些证券的流动性可能仍然比较差，从而使得集合资产管理计划在进行上述证券操作时，可能难以按计划买入或卖出相应的数量，或买入卖出行为对上述证券价格产生比较大的影响，增加上述证券的建仓成本或变现成本。

2、集合资产管理计划中的资产不能应付可能出现的委托人巨额退出或大额退出的风险。在集合资产管理计划开放期间，可能会发生巨额退出或大额退出的

情形，巨额退出或大额退出可能会产生本集合计划仓位调整的困难，导致流动性风险，甚至影响计划份额净值。

（六）信用风险

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

1、交易品种的信用风险。投资于固定收益类产品，存在着发行人不能按时足额还本付息的风险；此外，当发行人信用评级降低时，集合资产管理计划所投资的标的可能面临价格下跌风险。

2、交易对手的信用风险。交易对手未能履行合约，或在交易期间未如约支付已借出证券产生的所有股息、利息和分红，将使集合资产管理计划面临交易对手的信用风险。

此外，本集合计划存在债券回购交收违约后结算公司对质押券处置的风险。

（七）募集失败风险

本计划的成立需符合相关法律法规的规定，本计划可能存在不能满足成立条件从而无法成立的风险。在发生募集失败时，管理人的责任承担方式如下：

1．以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用；

2．在本计划募集期限届满（确认资产管理计划无法成立）后三十日内返还投资者已交纳的款项，并加计银行同期活期存款利息。

（八）关联交易风险

根据本合同的约定，管理人可以将本集合计划的资产投资于管理人、托管人及管理人或托管人的控股股东、实际控制人或者其他有关联方关系的公司发行的证券或承销期内承销的证券，可能存在因管理人未遵循公平原则开展交易，由此损害委托人利益的风险。

（九）委托人参与、退出集合计划风险

1、自本集合计划成立之日起按本合同第八部分第三条的规则开放，管理人仅在开放日为本集合计划办理参与、退出手续，委托人无法在封闭期内退出本集合计划，可能给委托人带来一定的风险。

2、出现拒绝或暂停接受委托人参与（退出）的情况导致投资者不能及时参与（退出）的风险，具体参见本合同第八部分“本计划的参与、退出与转让”。

3、集合计划发生巨额退出或连续巨额退出而引起委托人无法全部退出或因

暂停退出使委托人在一定时间内的退出申请被拒绝，从而导致委托人无法按时退出的风险。

（十）税收风险

本集合计划运营过程中产生的增值税等应税行为，如需按照相关规定或税务机关的要求计算和缴纳增值税及附加税等税费，并由管理人履行相应纳税义务的，将由本集合计划资产承担上述相关税费，管理人有权从集合计划资产中提取与应缴纳税费等额的款项，其可能会使集合计划净值或实际收益降低。

（十一）估值风险

由于监管规则调整、市场异常波动、行业惯例操作、管理人经验技术等原因可能导致本集合计划的估值无法准确反映本集合计划投资品种的实际价值，而存在集合计划资产出现亏损的风险。

（十二）合同变更风险

1、管理人应将拟进行合同变更的内容书面通知托管人。经托管人同意后的合同拟变更内容应当及时在管理人网站上向委托人披露，同时约定合同变更征询期。

2、管理人有权在合同变更征询期对本集合计划设置特殊退出开放日，不同意合同变更的委托人，应在该退出开放日办理本集合计划的退出事宜，委托人未退出的视为同意合同变更。本资产管理合同变更生效后，委托人有权在任何开放日按照本资产管理合同的相关约定申请退出。

3、管理人应事先将变更后的合同生效之日通过管理人网站向委托人披露。

4、本集合计划的合同变更等有关事项，管理人将仅通过管理人网站进行信息披露，委托人应及时关注该网站内容。

（十三）特殊风险

本集合计划存在规模和人数限制，当集合计划规模或人数接近或达到上限时，存在委托人参与失败的风险。

初次参与本集合计划的最低金额为人民币100万元（不含参与费），对本集合计划份额的持有人，其新增参与资金的最低金额为1万元人民币，可能导致委托人参与失败的风险。

委托人可以选择全部退出，也可以选择部分退出，但在退出后持有的计划资产净值不得小于本集合计划要求的最低申购金额限制。即当份额持有人申请部分

退出集合计划份额将致使其在部分退出申请确认后持有的以开放日计划份额净值计价的该类集合计划资产净值小于本集合计划要求的最低参与金额，则管理人自动将该委托人在该类集合计划全部份额退出给委托人，可能导致委托人退出失败或被强制退出的风险。

因本集合计划委托人数少、参与金额高，存在个别委托人退出导致集合计划巨额退出或提前终止的风险。

（十四）电子合同风险

本集合计划如采用电子签名合同方式签订，在合同签订过程中可能存在无法预测或无法控制的系统故障、设备故障、通讯故障，从而导致电子合同无法及时签订，从而影响委托人的投资收益。电子合同签订后，委托人凭密码进行交易，委托人通过密码登陆后所有操作均将视同本人行为，如委托人设置密码过于简单或不慎泄露，可能导致他人在未经授权的情况下操作委托人账户，给委托人造成潜在损失。

（十五）管理人、托管人风险

担任集合资产管理计划管理人的证券公司、资产托管机构，因停业整顿、解散、撤销、破产，或者被中国证监会撤销相关业务许可等原因不能履行职责，可能给委托人带来一定的风险。

（十六）科创板股票相关投资风险

1、公司风险：科创板企业普遍具有技术新、前景不确定、业绩波动大、风险高等特征，企业上市后的持续创新能力、主营业务发展的可持续性、公司收入及盈利水平等仍具有较大不确定性，可能存在首次公开发行前未能连续盈利、公开发行并上市时尚未盈利、有累计未弥补亏损等情形，以及上市后仍无法盈利、持续亏损、无法进行利润分配等情形，从而影响资产管理计划的收益而产生风险。

2、价格波动风险：科创板企业市场可比公司较少，发行定价难度较大，上市后可能存在股价波动的风险，且科创板股票竞价交易设置较宽的涨跌幅限制，首次公开发行上市后的前 5 个交易日不设涨跌幅限制，其后涨跌幅限制为 20%，存在价格波幅较大而导致亏损的风险。

3、差异风险：科创板股票在发行规则、报价要求、交易机制、临时停牌情形和严重异常波动股票核查制度、特别表决权机制、股权激励制度等方面与上交所主板市场股票交易存在差异；且科创板退市制度较主板更为严格，退市时间更

短，速度更快；退市情形更多，执行标准更严；可能影响资产管理计划的收益而产生风险。

4、政策风险：红筹公司注册地、境外上市地等地法律法规对当地投资者提供的保护,可能与境内法律为境内投资者提供的保护存在差异；科创板股票相关法律、行政法规、部门规章、规范性文件和交易所业务规则，可能根据市场情况进行修改，或者制定新的法律法规和业务规则，具有一定的政策风险。

（十七）金融衍生品投资风险

1、投资于股指期货、商品期货、国债期货、期权等金融衍生品时，由于金融衍生品的高杠杆性等特征，对金融衍生品的投资具有较高的风险，若行情向不利方向剧烈变动，本资产管理计划可能承受超出保证金甚至本资产管理计划资产本金的损失。

2、相关交易所实行保证金制度、当日无负债结算制度、涨跌停板制度、持仓限额和大户持仓报告制度、风险准备金制度以及国务院期货监督管理机构规定的其他风险管理制度。本资产管理计划可能因保证金不足而被采取限制开仓、强制平仓，导致无法规避对冲系统性风险，进而可能给本资产管理计划造成重大损失。

3、相关交易所可能对交易品种的套期保值或套利实行额度管理，本计划如拟进行某交易品种的套期保值或套利交易的，可能因无法申请额度或无法及时获得额度而不能开展相关交易。

4、相比于其他交易品种，金融衍生品的投资交易可能更加频繁，频繁操作将可能增加管理人、期货经纪人等相关方操作失误的可能性，存在操作风险。

（十八）所投资基金产品的风险

本集合计划投资公开募集证券投资基金，集合计划管理人对发行基金产品公司的内控信息获取不全，控制力不强，并且所投资基金产品的投资经理的知识、经验、判断、决策、技能等，会影响其对信息的占有和对经济形势、金融市场价格走势的判断，如变更投资经理、投资经理判断有误、投资经理的行为违反法律法规的规定、获取信息不全、或对投资工具使用不当等影响基金产品的收益水平，从而产生风险。

（十九）存托凭证投资风险

本资产管理计划的投资范围包括存托凭证，若投资可能面临中国存托凭证价

格大幅波动甚至出现较大亏损的风险，以及与创新企业、境外发行人、中国存托凭证发行机制以及交易机制等相关的风险。

（二十）参与转融通证券出借业务的风险

本集合计划参与转融通证券出借业务，面临的风险包括但不限于：

1、流动性风险。面临大额退出时，可能因证券出借原因，发生无法及时变现支付赎回款项的风险。

2、信用风险。证券出借对手方可能无法及时归还证券，无法支付相应权益补偿及借券费用的风险。

3、市场风险。证券出借后可能面临出借期间无法及时处置证券的市场风险。

（二十一）参与融资融券交易的风险

本集合计划参与融资融券交易，如不能按照约定期限清偿债务或维持担保比例，且不能依约追加担保品，将面临担保物被证券公司强制平仓的风险；如出现强制平仓的，证券公司有权自主选择平仓的证券品种、数量、价格、时机和顺序，均可能对本集合计划财产造成损失。

本集合计划参与融资融券交易期间，如因交易所、监管机关要求或证券公司自身管理需要发生融资融券标的证券范围或融资融券保证金比例调整等情况，可能面临被证券公司限制交易或提前了结融资融券交易的风险。

（二十二）本集合计划运营事项所涉风险

本集合计划份额登记、估值核算等运营服务由华兴证券有限公司办理，因服务机构经营风险、技术系统故障、操作失误等，可能使得服务事项发生差错，给本集合计划运营带来风险。

（二十三）产品备案风险

本资产管理计划存在因监管政策等原因导致备案不成功的风险。如集合计划备案不成功，管理人可在收到备案不成功信息后三十日内，将已认购资金及投资收益（如有）返还委托人。

（二十四）其他风险

1、技术风险。在集合资产管理计划的日常交易中，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委托人的利益受到影响。这种技术风险可能来自管理人、托管人、证券交易所、证券登记结算机构等等。

2、操作风险。管理人、托管人、证券交易所、证券登记结算机构等在业务

操作过程中，因操作失误或违反操作规程而引起的风险。

3、结算风险。在集合计划运作过程中，投资交易结算流程出现的问题，可能导致本集合计划不能适时完成投资交易，影响本集合计划收益或导致或有负债。

4、第三方风险。在集合计划运作过程中，管理人、托管人、推广机构、期货经纪人等可能使用第三方服务供应商提供的系统、数据及其他服务。因该等第三方服务供应商未能及时提供，或其提供的服务不准确、不完整，本集合计划收益可能受损。

5、对账单寄送风险。管理人每季度结束后的1个月内以信函方式向委托人寄送对账单，由于寄送距离较远等原因，可能导致委托人收到对账单的时间有所延迟，或由于委托人地址、联系方式等信息错误、信函在寄送途中丢失等原因，导致委托人无法收到对账单，从而带来风险。

6、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，可能导致委托资产的损失，从而带来风险。

7、根据本合同约定本集合计划在终止之日或委托人退出时有未能流通变现的投资品种，管理人可针对该部分未能流通变现的投资品种制定二次清算方案，并对未变现投资品种进行二次清算。由此可能导致委托人无法按照本合同的约定及时收到分配的剩余现金财产。

8、其他不可预知、不可防范的风险。

本风险揭示的揭示事项仅为列举性质，未能详尽列明委托人参与本资产管理计划所面临的全部风险和可能导致委托人资产损失的所有因素。

二、管理人应当单独编制风险揭示书作为合同附件。委托人应充分了解并谨慎评估自身风险承受能力，并做出自愿承担风险的陈述和声明。

第二十四部分 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

（一）依法律法规变更合同的方式及程序

因法律法规、中国证监会或基金业协会等监管规定或要求发生变化必须变更资产管理合同的，管理人可以与托管人协商后更新或修改资产管理合同（包括但不限于对备案程序的约定以及投资范围和投资限制的调整），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，管理人应将更新或修改内容报中国证监会或其规定的机构批准或备案。更新或修改的内容在管理人网站信息披露满5个交易日后生效。如果委托人对更新或修改的内容有异议，可按照本合同的约定申请退出集合计划。管理人将确保更新或修改的内容在管理人网站信息披露至生效日之间至少有 1个退出日。委托人未退出的，视为同意更新或修改。

委托人特此授权管理人以不影响委托人权利义务的前提下对本合同及说明文件等法律文本中的文字性错误进行勘误，勘误内容在管理人网站信息披露，信息披露之时立即生效。

（二）非因法律法规变更合同的方式及程序

因法律法规及监管要求以外的其他原因需要变更资产管理合同的，可通过以下方式予以变更：

1、通过管理人网站信息披露的方式变更合同

管理人可通过管理人网站信息披露的方式变更资产管理合同，具体变更流程如下：

（1）管理人应将拟进行合同变更的内容书面通知托管人，托管人应于收到通知后及时书面回复。经托管人同意后的合同拟变更内容应当及时在管理人网站上向委托人披露，同时约定合同变更征询期及变更事项的生效日。

（2）管理人有权在合同变更征询期对本集合计划设置特殊退出开放日，不同意合同变更的委托人，应在该退出开放日办理本集合计划的退出事宜，委托人未退出的，视为同意合同变更。

（3）通过管理人网站信息披露的方式变更资产管理合同的，管理人将仅通过管理人网站披露相关通告，委托人应及时关注该网站内容。

2、合同当事人书面协商一致变更合同

委托人同意并确认，全体委托人、管理人、托管人可就本合同变更事项协商一致并以签署补充协议等书面形式对资产管理合同进行变更。

3、本计划改变投向和比例的，应当事先取得委托人同意。具体变更依据本部分（二）“非因法律法规变更合同的方式及程序”所列方式及程序操作。

（三）管理人应当合理保障合同变更后委托人选择退出本计划的权利。

二、本合同发生变更的，管理人应按照基金业协会要求及时向基金业协会备案，并抄报中国证监会相关派出机构。

三、管理人和托管人职责终止的情形及更换

（一）管理人职责终止的情形

有下列情形之一的，管理人职责终止：

1、管理人被依法撤销资产管理业务资格；

2、管理人依法解散、被依法撤销或宣告破产；

3、法律法规及中国证监会规定的或本合同约定的其他情形。

（二）托管人职责终止的情形

有下列情形之一的，托管人职责终止：

1、托管人被依法撤销资产托管业务资格；

2、托管人依法解散、被依法撤销或宣告破产；

3、法律法规及中国证监会规定的或本合同约定的其他情形。

（三）管理人和托管人的变更程序

1、管理人的变更程序

（1）新任管理人由全体委托人、托管人一致同意并共同选定。全体委托人、托管人应于上述管理人职责终止事项发生后20个工作日内发起新任管理人的选定程序。管理人职责终止事项发生6个月内未选定新任管理人的，本集合计划终止。

（2）新任管理人的选任结果应向相关监管机构备案，备案完成后变更管理人生效。

（3）管理人应于变更管理人生效后的5个工作日内在管理人网站信息披露。

（4）管理人职责终止的，管理人应妥善保管集合计划管理业务资料，及时向临时管理人或新任管理人办理集合计划管理业务的移交手续，临时管理人或新任管理人应及时接收。新任管理人或临时管理人应与托管人核对集合计划资产总

值和净值。

（5）管理人职责终止的，应当按照法律法规规定聘请会计师事务所对集合计划资产进行审计，审计费用在集合计划资产中列支。

（6）管理人换任后，如果原任或新任管理人要求，应按其要求替换或删除集合计划名称中与原任管理人有关的名称字样。

2、托管人的变更程序

（1）新任托管人由管理人和全体委托人一致同意并共同选定。管理人和全体委托人应于上述托管人职责终止事项发生后20个工作日内发起新任托管人的选定程序。托管人职责终止事项发生6个月内未选定新任托管人的，本集合计划终止。

（2）新任托管人的选任结果应向相关监管机构备案，备案完成后变更托管人生效。

(3)管理人应于变更托管人生效后的5个工作日内在管理人网站信息披露。

（4）托管人职责终止的，托管人应妥善保管集合计划管理业务资料，及时向临时托管人或新任托管人办理集合计划管理业务的移交手续，临时托管人或新任托管人应及时接收。新任托管人或临时托管人应与管理人核对集合计划资产总值和净值。

（5）托管人职责终止的，应当按照法律法规规定聘请会计师事务所对集合计划资产进行审计，审计费用在集合计划资产中列支。

四、资产管理计划的展期

本集合计划存续期为10年，可以展期。

（一）展期的条件

1、本集合计划运作规范，管理人、托管人未违反法律、行政法规、中国证监会规定和本合同的约定；

2、本集合计划展期没有损害委托人利益的情形；

3、符合本合同规定的本集合计划的成立条件；

4、中国证监会规定的其他条件。

（二）展期的程序与期限

1、展期的程序：托管人同意；展期通知；委托人回复，为不同意展期委托人的份额办理退出；展期备案；展期实现。

2、展期的期限：在满足合同约定的展期条件情况下，管理人以展期通知的形式予以明确。

（三）展期的安排

1、通知展期的时间

本集合计划拟展期的，管理人应当于不晚于集合计划到期日前1个月通知委托人及托管人。

2、通知展期的方式

若管理人拟展期的，管理人应当及时以管理人网站信息披露、信函、传真、电子邮件、录音电话等本合同规定的方式之一通知委托人，征求委托人意见。

3、委托人回复的方式

委托人可以通过信函、传真、电子邮件、网站、电话或其他约定方式回复。截至存续期届满日，委托人未给出明确答复的，视为同意展期。

（四）委托人不同意展期的安排

若委托人不同意展期，委托人有权按照管理人披露内容在存续期届满日前（含届满日）到推广机构办理退出手续。截至存续期届满日，委托人未给出明确答复的，视为同意展期。截至存续期届满日，委托人明确回复不同意展期但未到推广机构办理退出手续的，管理人可予以强制退出。

（五）展期的安排

同意本集合计划展期的委托人的人数不少于2人，且不超过200人；在原存续期届满日后第1个工作日，本集合计划参与资金总额不低于1千万元人民币，则本集合计划展期。

五、资产管理计划终止的情形，包括但不限于下列事项：

（一）资产管理计划存续期届满且不展期；

（二）经全体委托人、管理人和托管人协商一致决定终止的；

（三）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；

（四）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；

（五）持续五个工作日委托人少于2人的；

（六）未在基金业协会完成备案或不予备案的情形；

（七）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。

管理人应当自本计划终止之日起五个工作日内报基金业协会备案，并抄报中国证监会相关派出机构，前述第（六）项约定的情形除外。

委托人同意，如本集合计划在终止之日有未变现的证券，管理人可针对该部分未变现证券制定二次清算方案，该方案应经托管人认可（但因上述第四项原因终止除外），并应予以披露。

六、资产管理计划的清算

管理人应在本计划发生终止情形之日起五个工作日内开始组织清算资产管理计划资产。

（一）资产管理计划财产清算小组

1、清算小组的组成

管理人负责成立清算小组组织清算工作。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。

2、清算小组的职责

本集合计划清算小组负责集合计划资产的保管、清理、估价、变现和分配。清算小组可以依法进行必要的民事活动。

（二）资产管理计划财产清算的程序

本集合计划财产清算应按以下程序进行：

1、当本集合计划终止后，对集合计划资产进行清理和确认；

2、对集合计划资产进行评估和变现；

3、对集合计划资产进行分配。

4、聘请具有证券相关业务资格的会计师事务所进行审计。

（三）清算费用

清算费用是指管理人在进行资产清算过程中发生的所有合理费用。清算费用由管理人优先从集合计划清算资产中支付。

（四）资产管理计划财产清算及剩余资产的分配

本集合计划终止后15个工作日内，管理人和托管人应当在扣除本集合计划清算费用、管理费、业绩报酬（如有）、托管费、税费等费用后，将集合计划可分配资产按照委托人拥有份额的比例或本合同的约定，以货币形式分配给委托人。

（五）资产管理计划延期清算的处理方式

如本集合计划在终止之日因持有流动性受限资产或其他投资品种等原因导致本计划资产无法及时变现的，在上述资产可变现时（具体时机由管理人决定），管理人应及时完成变现操作，并按照本合同第二十四部分“资产管理合同的变更、终止与财产清算”中的“六、资产管理计划的清算”的相关约定对本计划财产进行二次清算。本计划持有多只无法及时变现的证券或其他投资产品的，管理人可按相关约定进行多次变现及清算，并于每次清算后将变现后的资产以货币形式分配给委托人。二次清算及其后的清算期间不计提管理费和托管费。涉及多次清算的情形，在所有资产全部变现并进行分配后聘请具有证券相关业务资格的会计师事务所进行审计。

本集合计划因委托财产流动性受限等原因延期清算的，管理人应当及时向中国证监会相关派出机构和基金业协会报告。

（六）资产管理计划财产清算报告的告知安排

管理人应当在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。

管理人或销售机构在本计划清算结束后20个工作日内，将清算结果按照委托人提供的联系方式或由管理人通过管理人网站告知委托人。

（七）资产管理计划财产相关账户的注销

计划财产清算完毕后，托管人、管理人应按照相关规定注销本计划托管账户、证券账户及其他本计划投资所需账户，并互相给予必要的配合。

（八）资产管理计划财产清算账册及文件的保存

本计划财产清算账册及文件由管理人保存20年以上。

第二十五部分 违约责任

一、本合同当事人违反本合同，应当承担违约责任。给合同其他当事人造成经济损失的，应当承担赔偿责任。在发生一方或多方违约的情况下，本合同能继续履行的，应当继续履行。

二、管理人、托管人及其他第三方机构在履行各自职责的过程中，因违反法律法规或者本合同约定，给计划财产或者委托人造成损害的，应按过错原则分别对各自的行为承担赔偿责任。

发生下列情况的，当事人可以免责：

（一）不可抗力；

（二）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；

（三）管理人由于按照本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。

（四）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；

（五）管理人和/或托管人因所引用的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所引起的损失；

（六）委托人理解委托财产的投资、运作、托管面临本合同、风险揭示书中列举的各类风险，管理人及托管人就委托财产面临的上述固有风险免于承担责任。

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，管理人和托管人可以免除赔偿责任。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、本合同一方当事人依据本合同向另一方当事人赔偿的损失，仅限于直接损失。

第二十六部分 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，合同当事人可以通过协商或者调解予以解决。当事人不愿通过协商、调解解决或者协商、调解不成的，采取以下第（一）种方式解决：

（一）向北京仲裁委员会申请仲裁，仲裁地北京市，以该会当时有效的仲裁规则为准，仲裁裁决是终局性的，并对各方当事人具有约束力。

（二）向被告所在地有管辖权的人民法院提起诉讼。

二、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、尽责地履行本合同规定的义务，维护委托人的合法权益。

三、本合同受中华人民共和国法律管辖。

第二十七部分 资产管理合同的效力

一、本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。委托人为法人的，本合同自委托人、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之日起成立；委托人为自然人的，合同自委托人本人签字、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之日起成立（如采用电子方式签署合同的，应该满足相关电子合同签约成立的条件）。

委托人于本计划募集期认购本计划份额的，本合同自本计划成立日起生效；委托人于本计划成立日后参与本计划的，本合同自委托人的参与资金按照本合同约定划至指定账户并且被确认参与成功之日起生效。

二、本合同自生效之日起对委托人、管理人、托管人具有同等的法律约束力。

三、本合同有效期自本合同生效日起至委托人全部退出本计划之日或本计划终止之日止。本合同终止后，本合同中与本计划清算、资金交收、违约责任、争议解决相关的条款继续有效。

四、委托人自签订本合同即成为本合同的当事人。在本计划存续期间，委托人自全部退出计划之日起不再是本合同的当事人。

第二十八部分 其他事项

一、本合同各方当事人应对签署和履行本合同过程中所接触和获取的其他方当事人的数据、信息和其它涉密信息承担保密义务，非经其他方当事人同意，不得以任何方式向第三人泄露或用于非本合同之目的(法律法规或司法监管部门要求的除外)。本保密义务不因合同终止而终止。

二、如将来监管部门对本合同的内容与格式有其他要求的，委托人、管理人和托管人应立即展开协商，根据监管相关要求修改本合同的内容和格式。

三、本合同项下的任何一项通知、通告的通知及送达：

（一）各方同意，任何一方可以电子邮件、邮寄、传真、录音电话等方式中的任何一种方式按照本合同第四部分“当事人及权利义务”中载明的联系信息向其他方发出通知。通知以电子邮件方式发出的，以发件人电子邮件系统显示发送成功时视为送达；以邮寄方式发出的，以被通知方签收时为送达；以传真方式发出的，以发件人传真机显示传真已发出时视为送达；以电话方式发出的，以电话接通时为送达。

（二）除上述通知方式外，管理人有权采用在其网站信息披露的形式通知委托人，信息披露内容于披露之日或者另行载明的生效日生效。

（三）任何一方变更信息的，应当书面通知其他方，否则自行承担信息不能及时变更或送达的风险和责任。

四、本合同一式叁份，当事人各执壹份，每份具有同等的法律效力。

（以下无正文）

本页无正文，为《华兴中证500指数增强2号集合资产管理计划资产管理合同》（2021年8月修订）签署页

资产委托人：

自然人（签字）：

（或）法人或其他组织（公章或合同专用章）

法定代表人或授权代表：

签署日期：　　年　月　日

资产管理人：华兴证券有限公司

法定代表人或授权代表：

签署日期：　　年　月　日

资产托管人：中信建投证券股份有限公司

法定代表人或授权代表：

签署日期：　　年　月　日

附件1：投资者（委托人）信息表

请各当事人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，由投资者自行承担。

投资者请填写：

（一）投资者

1、自然人

姓名：

证件名称：□身份证、□军官证、□护照、□港澳台回乡证或台胞证

证件号码：□□□□□□□□□□□□□□□□□□

联系地址：

联系电话：

电子邮箱：

2、机构

名称：

统一社会信用代码：

法定代表人或负责人：

联系地址：

联系电话：

电子邮箱：

（二）投资者认购/申购金额

大写（人民币）：

小写（￥）：

（三）投资者账户

投资者认购、参与本计划的划出账户与退出款的划入账户，必须为以投资者名义开立的同一个账户。特殊情况导致认购、参与和退出的账户名称不一致时，投资者应出具符合相关法律法规规定的书面说明并提供相关证明。账户信息如下：

账户名称：

账号：

开户银行名称：

附件2：授权通知书

中信建投证券股份有限公司：

根据《华兴中证500指数增强2号集合资产管理计划资产管理合同》，我公司授权以下人员代表我公司向贵公司发送投资指令。现将指令发送用章样本及有关人员签字样本、名章样本及相应权限留给贵公司，请在使用时核验。本授权通知书适用于“华兴中证500指数增强2号集合资产管理计划”上述被授权人在授权范围内向你司发送指令的真实性、准确性及合法性由我公司负全部责任。

姓名	权限	签字样本	名章样本
	经办、复核		
	经办、复核		
	经办、复核		
	经办、复核		
指令 发送 用章	（预留印鉴）		
备注：1.指令发送用章须与个人签字或个人名章同时出具，方为有效（经办、复核不可以是同一人）； 2.权限类型：经办、复核； 3.本授权的生效时限：自【】年【】月【】日之当日生效。			

资产管理人：

（公章）

法定代表人（或授权代表）签字（或盖章）：

【】年【】月【】日

附件 3：投资指令

<table>
<tr><td colspan="6">编号：【】;【】年【】月【】日；第【】页，共【】页</td></tr>
<tr><td></td><td colspan="5">划付模式：</td></tr>
<tr><td rowspan="10">管理人填写</td><td colspan="5">请于【】年【】月【】日【】时前支付下列款项：</td></tr>
<tr><td colspan="5">金额大写：人民币【】元

金额小写：￥【】</td></tr>
<tr><td rowspan="6">付方账户信息</td><td colspan="2">账户类型：</td><td rowspan="6">收方账户信息</td><td colspan="2">账户类型：</td></tr>
<tr><td colspan="2">☐银行账户 ☐证券资金账户</td><td colspan="2">☐银行账户 ☐证券资金账户</td></tr>
<tr><td colspan="2">☐期货资金账户</td><td colspan="2">☐期货资金账户</td></tr>
<tr><td colspan="2">户名：</td><td colspan="2">户名：</td></tr>
<tr><td colspan="2">账号：</td><td colspan="2">账号：</td></tr>
<tr><td colspan="2">开户机构：</td><td colspan="2">开户机构：</td></tr>
<tr><td colspan="5">资金用途：</td></tr>
<tr><td colspan="5">备注： 附件共__页</td></tr>
<tr><td colspan="3">指令用章</td><td colspan="2">经办：

复核：</td></tr>
<tr><td>托管人填写</td><td colspan="3">处理意见或结果（附件共__页）：
☐ 对授权人员身份进行复核

☐ 对预留印鉴进行复核

☐ 其他</td><td colspan="2">经办：

审批：（盖业务章）</td></tr>
</table>