

华菁全天候量化1号集合资产管理计划

2021年4季度托管人履职报告

本托管人依据华兴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;非依法律规定、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、依据基金管理人或委托的第三方机构提供的标的产品(包括但不限于场内及场外标的产品)的交易确认、行情和权益变动等信息进行估值或减值计量(其中数据的真实性、准确性、完整性、有效性和标的价值的公允性由基金管理人或委托的第三方机构负责);依据基金管理人提供的税务信息和纳税判定标准去识别并核算本基金运营过程中发生的增值税应税行为(其中税务信息和纳税判定标准的真实性、准确性、完整性以及适用性由基金管理人负责),根据《管理合同》、《证券投资基金法》及有关法律法规的规定,本计划托管人复核了管理人的2021年4季度报告中的财务数据,其中财务指标、净值表现、收益分配情况(如有)、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容与托管人计算的数据一致。

托管人:中信证券股份有限公司

二零二二年一月十九日