

---

合同编号: GLA-S-2014-54- 号

国联安-工银量化恒盛精选 C 类 2 期资产管理计划资产管理合同

资产管理人: 国联安基金管理有限公司

资产托管人: 中国工商银行股份有限公司上海市分行

## 风险提示函

尊敬的投资者：

感谢您对国联安-工银量化恒盛精选C类2期资产管理计划（“本计划”）的关注。由于本计划的投资范围中包括债券，进行债券交易有一定的风险，可能发生亏损，您在购买本计划前应仔细阅读以下内容，了解本计划投资于债券等固定收益产品的相关风险。另外，本产品采用结构化设计，有特别的风险向您提示。

一、投资者应当了解债券的基础知识、相关法律法规、上海证券交易所、深圳证券交易所业务规则，充分了解债券交易风险。

二、投资者应当了解我国债券市场尚属新兴加转轨的市场，市场波动较为频繁。因此，投资者的投资可能会面临较大的市场风险。

四、投资者应当认真阅读《国联安-工银量化恒盛精选C类2期资产管理计划资产管理合同》、《国联安-工银量化恒盛精选C类2期资产管理计划投资说明书》等法律文件，了解本产品的风险收益特征，并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断本产品是否和投资者的风险承受能力相适应。

五、本产品的《国联安-工银量化恒盛精选C类2期资产管理计划资产管理合同（草案）》已经中国证监会备案，但中国证监会接受该合同（草案）的备案并不表明其对资产管理计划的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于资产管理计划没有风险。

六、资产管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用投资资产，但不保证本产品一定盈利，也不保证最低收益。资产管理人管理的基金的业绩不构成对本产品业绩表现的保证。

七、本计划为结构化产品，特别向您提示以下风险：

由于本计划的运作采用杠杆机制，本计划的优先级份额具有低风险、收益相对稳定的特征；一般级份额则具有高风险、高预期收益的特征。对于优先级份额持有人，虽然本计划设立了风险控制和利益保护机制，但约定收益的获得和分配仍具有不确定性，在极端情况下，优先级份额持有人仍可能会面临无法取得约定收益甚至损失本金的风险。

本人/本机构已经充分理解本资产管理计划的投资风险及结构化风险收益特征并愿意承担相关的风险。本人/本机构已经充分理解本计划的管理人按照资产委托人的指示聘请北京乐瑞资产管理有限公司为投资顾问，投资顾问在法律法规和本合同约定范围内的投资建议资产管理人将遵照执行，因执行投资顾问建议引起的相关风险由全体资产委托人承担。

投资者（法定代表人或授权代表）签字：

（加盖公章）

年 月 日

## 目 录

一、 前言.....	3
二、 释义.....	3
三、 声明与承诺.....	6
四、 资产管理计划的基本情况.....	7
五、 资产管理计划份额的初始销售.....	8
六、 资产管理计划的备案.....	9
七、 资产管理计划的参与和退出.....	10
八、 当事人及权利义务.....	15
九、 投资顾问.....	20
十、 资产管理计划份额的登记.....	20
十一、 资产管理计划的投资.....	21
十二、 投资经理的指定与变更.....	25
十三、 资产管理计划的财产.....	25
十四、 投资指令的发送、确认与执行.....	26
十五、 交易及清算交收安排.....	29
十六、 越权交易.....	32
十七、 资产管理计划财产的估值和会计核算.....	35
十八、 资产管理计划的费用与税收.....	40
十九、 资产管理计划的收益分配.....	42
二十、 报告义务.....	43
二十一、 风险揭示.....	45
二十二、 资产管理合同的变更、终止.....	48
二十三、 清算程序.....	49
二十四、 违约责任.....	52
二十五、 法律适用和争议的处理.....	53
二十六、 资产管理合同的效力.....	54
二十七、 其他事项.....	54

## 一、 前言

订立本合同的目的、依据和原则

1、订立本资产管理合同（以下或简称“本合同”）的目的是为了明确资产委托人、资产管理人和资产托管人在特定多个客户资产管理业务过程中的权利、义务及职责，确保资产管理计划财产的安全，保护当事人各方的合法权益。

2、订立本资产管理合同的依据是《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《基金管理公司特定客户资产管理业务试点办法》（以下简称“《试点办法》”）、《基金管理公司特定多个客户资产管理合同内容与格式准则》（以下简称“《准则》”）和其他有关法律法规。若因法律法规的制定或修改导致本合同的内容存在与届时有效的法律法规的规定不一致之处，应当以届时有效的法律法规的规定为准，各方当事人应及时就本合同做出相应的变更和调整。

3、订立本资产管理合同的原则是平等自愿、诚实信用、充分保护本合同各方当事人的合法权益。

资产委托人自签订资产管理合同即成为资产管理合同的当事人。在本合同存续期间，资产委托人自全部退出资产管理计划之日起，该资产委托人不再是资产管理计划的投资人和资产管理合同的当事人。本合同按照中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）的要求提请备案，但中国证监会接受本合同草案的备案并不表明其对资产管理计划的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于资产管理计划没有风险。

## 二、 释义

在本合同中，除上下文另有规定外，下列用语应当具有如下含义：

1、本合同：指资产委托人、资产管理人和资产托管人签署的《国联安-工银量化恒盛精选 C 类 2 期资产管理计划资产管理合同》及其附件，以及对该合同及附件做出的任何有效变更和补充

2、资产委托人：指签订本合同，委托投资单个资产管理计划初始金额不低于 100 万元人民币，且能够识别、判断和承担相应投资风险的自然人、法人、依法成立的组织或中国证监会认可的其他特定客户

3、资产管理人：指国联安基金管理有限公司

4、资产托管人：指中国工商银行股份有限公司上海市分行

5、投资顾问：指根据合同为资产管理人证券投资提供证券买卖建议或投资组合管理等服务并取得收入的金融机构。本计划投资顾问为北京乐瑞资产管理有限公司。

6、注册登记机构：指资产管理人或其委托的经中国证监会认定可办理开放式证券投资基金份额登记业务的机构，本计划注册登记机构为国联安基金管理有限公司

7、资产管理计划、本计划、计划：指按照本合同的约定设立，为资产委托人的利益，将特定多个资产委托人交付的资金或证券进行集中管理、运用或处分，进行证券投资活动的集合资产管理安排，即国联安-工银量化恒盛精选 C 类 2 期资产管理计划

8、投资说明书：指《国联安-工银量化恒盛精选 C 类 2 期资产管理计划投资说明书》，内容包括资产管理计划概况、资产管理合同的主要内容、资产管理人与资产托管人概况、投资风险揭示、初始销售期间、中国证监会规定的其他事项等

9、工作日：资产管理人和资产托管人均办理相关业务的营业日

10、交易日：上海证券交易所和深圳证券交易所的正常交易日

11、开放日：指非计划初始销售期间，资产管理人办理计划参与、退出业务的工作日

12、证券账户：根据中国证监会、中国银监会和中国证券登记结算有限责任公司（下称“中登公司”）等相关机构的有关业务规则，由资产托管人为委托财产在中登公司上海分公司、深圳分公司开设的专用证券账户、在中央国债登记结算有限责任公司及银行间市场清算所股份有限公司开立的有关账户及其他证券类账户

13、资金账户：指资产托管人根据有关规定为资产管理计划财产开立的专门

用于清算交收的银行账户

14、期货账户：指资产托管人根据有关规定为资产管理计划财产开立的与期货相关的账户

15、资产管理计划财产、委托财产：指资产委托人拥有合法处分权、委托资产管理人管理并由资产托管人托管的作为本合同标的的财产

16、计划资产总值：指本资产管理计划资产拥有的各类有价证券、银行存款本息及其他资产的价值总和。

17、计划资产净值：指本资产管理计划资产总值减去负债后的价值。

18、计划份额净值：指计算日资产管理计划资产净值除以计算日资产管理计划份额总数所得的数值。

19、资产管理计划资产估值：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。

20、初始销售期间：指资产管理合同及投资说明书中载明，并经中国证监会核准的计划初始销售期限，自计划份额发售之日起最长不超过 1 个月

21、存续期：指本合同生效至终止之间的期限

22、认购：指在资产管理计划初始销售期间，资产委托人按照本合同的约定购买本计划份额的行为

23、参与：指在资产管理计划开放日，资产委托人按照本合同的规定参与本计划的行为

24、退出：指在资产管理计划开放日，资产委托人按照本合同的规定退出本计划的行为

25、违约退出：指资产委托人在本合同约定的开放日之外的日期主动退出资产管理计划的行为。

26、代理销售机构：指符合中国证监会规定的条件，取得基金销售资格并接受资产管理人委托，代为办理本计划认购、参与、退出等业务的机构

27、不可抗力：指本合同当事人不能预见、不能避免、不能克服的客观情况

28、优先（级）份额：指本资产管理计划的优先级份额，根据本合同的规定优先获取约定收益。

29、一般（级）份额：指本资产管理计划的一般级份额，根据本合同的规定

享有在扣除优先级份额的应计收益与相关管理费用后的全部剩余收益，并以一般级份额持有人所持的份额资产净值为限承担亏损

30、优先（级）委托人：指持有本资产管理计划的优先级份额的资产委托人

31、一般（级）委托人：指持有本资产管理计划的一般级份额的资产委托人

32、投资年度：指合同生效日起每满一年的期间，第一个投资年度指合同生效日至其对应的年度对日的上一交易日，第二个投资年度指第一个投资年度最后一日的下一自然日至其年度对日的上一个交易日，以此类推

33、季度对日：指某一日期之后各季度的对应日期，如 2014 年 1 月 1 日的季度对日为之后各季度的 1 日，即 2014 年 4 月 1 日、2014 年 7 月 1 日等，对于每日的 30 日、31 日等月末特殊时间且下个季度没有该天的，季度对日对应各季度的最后一日，如 2014 年 11 月 30 日，对应的季度对日为 2015 年 2 月 28 日

34、年度对日指某一日期之后每年的对应日期，规则如季度对日

### 三、声明与承诺

（一）资产委托人声明委托财产为其拥有合法所有权或处分权的资产，保证委托财产的来源及用途符合国家有关规定，保证有完全及合法的授权委托资产管理人和资产托管人进行委托财产的投资管理和托管业务，保证没有任何其他限制性条件妨碍资产管理人和资产托管人对该委托财产行使相关权利且该权利不会为任何其他第三方所质疑；资产委托人声明已充分理解本合同全文，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，愿意承担相应的投资风险，本委托事项符合其业务决策程序的要求；资产委托人承诺其向资产管理人或代理销售机构提供的有关投资目的、投资偏好、投资限制和风险承受能力等基本情况真实、完整、准确、合法，不存在任何重大遗漏或误导。前述信息资料如发生任何实质性变更，应当及时书面告知资产管理人或代理销售机构。资产委托人承认，资产管理人、资产托管人未对委托财产的收益状况作出任何承诺或担保，本合同约定的业绩比较基准仅是投资目标而不是资产管理人的保证。

资产委托人保证其签署并履行本合同均在其权利和营业范围之内，并已采取

必要的公司行为进行适当授权，且其从事本项委托资产管理（包括另行指定第三方享有本合同项下资产委托人的权利或履行资产委托人的义务）不违反或者不违法规避对其有约束力或有影响的法律、公司章程或合同的限制；资产委托人并保证其有权将本合同项下委托财产委托资产管理人运作并投资本合同项下投资工具；资产委托人确认和保证投资范围及各项投资限制的规定符合对其适用的相关法律法规、行业要求及其公司内部管理制度。

资产委托人知悉并认可，本资产管理计划将聘请北京乐瑞资产管理有限公司作为投资顾问，对于投资顾问不违反法律法规、本合同约定的投资建议，资产管理人将遵照执行，资产委托人同意此等安排，并愿意承担由此产生的风险和责任。

（二）资产管理人保证已在签订本合同前充分地向资产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，同时揭示了相关风险；已经了解资产委托人的风险偏好、风险认知能力和承受能力，对资产委托人的财务状况进行了充分评估。资产管理人承诺依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用资产管理计划财产，除保本资产管理计划外，不保证资产管理计划一定盈利，也不保证最低收益。

（三）资产托管人承诺依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则安全保管资产管理计划财产，并履行本合同约定的其他义务。

#### 四、资产管理计划的基本情况

##### （一）资产管理计划的名称

国联安-工银量化恒盛精选 C 类 2 期资产管理计划。

##### （二）资产管理计划的类别

结构化债券型。

##### （三）资产管理计划的运作方式

定期开放。

##### （四）资产管理计划的投资目标

在严控风险的前提下，力争实现资产的长期稳健增值。

##### （五）资产管理计划的存续期限

20 年。

#### （六）资产管理计划的初始资产规模限制

单个资产委托人的初始资产管理计划财产不得低于 100 万元人民币，各资产委托人的初始委托财产合计不得低于 3000 万元人民币，且不得超过 50 亿元人民币，但中国证监会另有规定的除外。

#### （七）资产管理计划份额的初始销售面值

人民币 1.00 元。

#### （八）计划份额类别设置

本资产管理计划委托资产分为优先级份额和一般级份额两个份额类别。两类份额的委托资产合并运作。募集时，优先级份额与一般级份额的初始配比原则上不超过 4:1。

### 五、资产管理计划份额的初始销售

#### （一）资产管理计划份额的初始销售期间、销售方式、销售对象

##### 1、初始销售期间

本资产管理计划的初始销售期间自计划份额发售之日起最长不超过1个月，具体时间由资产管理人根据相关法律法规以及本合同的规定确定，并在投资说明书中披露。

##### 2、销售方式

本资产管理计划通过国联安基金管理有限公司或其委托的代理销售机构进行销售。具体销售机构名单、联系方式以本资产管理计划的《投资说明书》为准。

本资产管理计划优先级委托人有一位，一般级委托人有两位，资产管理人通过定向方式向委托人销售。

##### 3、销售对象

初始委托投资金额不低于 100 万元且能够识别、判断和承担相应投资风险的自然人、法人、依法成立的组织或中国证监会认可的其他特定客户。

#### （二）资产管理计划份额的认购和持有限额

认购资金应以现金形式交付。投资者在初始销售期间的认购金额不得低于 100 万元人民币（不含认购费用），并可多次认购，初始销售期间追加认购金额应为 10 万元的整数倍。

### （三）资产管理计划份额的认购费用

本资产管理计划无认购费用。

### （四）初始销售期间的认购程序

1、尽职调查。资产管理人可对投资者进行尽职调查。资产管理人委托代理销售机构进行销售的，可以委托代理销售机构代为完成投资者尽职调查工作，并将相关资料提供给资产管理人。

2、认购程序。资产委托人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，以各销售机构的具体规定为准。

#### 3、认购申请的确认。

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认购申请。申请是否有效应以注册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。

认购申请一经受理，不得撤销。

### （五）初始销售期间客户资金的管理

资产管理人应当将资产管理计划初始销售期间客户的资金存入专门账户，在资产管理计划初始销售行为结束前，任何机构和个人不得动用。

## 六、资产管理计划的备案

### （一）资产管理计划备案的条件

本资产管理计划初始销售期限届满，符合下列条件的，资产管理人应当按照规定办理验资和资产管理计划备案手续：

资产管理计划委托人人数至少 2 人且不超过 200 人，资产管理计划的初始资产合计不低于 3000 万元人民币且不超过 50 亿元人民币，中国证监会另有规定的除外。

### （二）资产管理计划的备案

初始销售期限届满，符合资产管理计划备案条件的，资产管理人应当自初始销售期限届满之日起 10 日内聘请法定验资机构验资，自收到验资报告之日起 10 日内，向中国证监会提交验资报告及客户资料表，办理相关备案手续。客户资料

表应包括委托人名称、委托人身份证明文件号码、通讯地址、联系电话、参与资产管理计划的金额和其他信息。

自中国证监会书面确认之日起，资产管理计划备案手续办理完毕，资产管理合同生效。资产委托人的认购参与款项（不含认购费用）加计其在初始销售期形成的利息将折算为资产管理计划份额归资产委托人所有，其中利息转份额的具体数额以注册登记机构的记录为准。

### （三）资产管理计划销售失败的处理方式

资产管理计划销售期限届满，不能满足上述备案条件的，资产管理人应当：

- 1、以其固有财产承担因销售行为而产生的债务和费用。
- 2、在资产管理计划销售期限届满后 30 日内返还客户已缴纳的款项，并加计银行同期活期存款利息。

## 七、资产管理计划的参与和退出

### （一）参与和退出场所

本资产管理计划的参与和退出将通过资产管理人或其委托的代理销售机构进行。

### （二）参与和退出的开放日和时间

本资产管理计划每季度开放一次计划份额的参与和退出。本资产管理计划优先级委托人有一位，一般级委托人有两位，初始销售后不再接受新委托人参与，仅接受初始销售期间认购本计划委托人的参与和退出，同时本计划在存续期内原则上不开放一般级委托人的参与业务。开放期原则上不超过 3 个工作日。本资产管理计划开放日为本资产管理合同生效日的季度对日（含）起连续 3 个工作日，若其中遇非交易日，则开放日递延。开放日可办理资产委托人的参与与退出业务。开放时间为开放日的上午 9 点半至下午 3 点。

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其他特殊情况，资产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资产委托人。**资产管理人除了网站上发布公告履行了告知义务外，还将通过传真、邮件等直接通知委托人。**

### (三) 参与和退出的方式、价格及程序等

1、“未知价”原则，即资产管理计划的参与和退出价格以受理申请当日收市后计算的资产管理计划两级份额参考净值为基准进行计算。

2、资产管理计划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。

3、资产委托人办理参与、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，以各销售机构的具体规定为准。

4、当日的参与与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。

5、参与和退出申请的确认。销售机构受理参与或退出申请并不表示对该申请是否成功的确认，而仅代表销售机构确实收到了参与或退出申请。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资产委托人参与、退出申请的有效性进行确认。客户可在销售机构办理业务后的第 5 个工作日至各销售网点查询最终确认情况。

如将开放日当日全部有效参与申请确认后，投资者总人数不超过 200 人，则注册登记机构对参与申请全部予以确认。如将开放当日全部有效参与申请确认后，投资者总人数超过 200 人，则注册登记机构按照时间优先、金额优先的原则确认参与申请，确保本资产管理计划的委托人数不超过 200 人，对未予确认的参与资金予以返还。

资产委托人退出资产管理计划时，资产管理人按先进先出的原则，份额确认日期在先的计划份额先退出，确认日期在后的计划份额后退出，以确定所适用的浮动投资顾问费。

6、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，已交付的委托款项将退回资产委托人账户。投资者退出申请成交后，资产管理人应按规定向资产委托人支付退出款项，退出款项在自受理资产委托人有效退出申请之日起 7 个工作日内划往资产委托人银行账户。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办理。

7、资产管理人在不损害资产委托人权益的情况下可更改上述原则，但最迟应在新的原则实施前 3 个工作日告知资产委托人。**资产管理人除了网站发布公告**

履行告知义务外，还将通过传真、邮件等直接通知委托人。

#### （四）参与和退出的金额限制

投资者在资产管理计划存续期开放日购买资产管理计划份额的，如投资者在提交参与申请时未持有资产管理计划份额，则首次参与金额应不低于 100 万元人民币（不含参与费用），在开放日内追加参与的，每次追加参与的金额应不低于【10】万元人民币。

当投资者持有的计划份额资产净值高于 100 万元人民币时，投资者可以选择全部或部分退出资产管理计划份额；选择部分退出资产管理计划份额的，投资者在退出后持有的计划份额资产净值不得低于 100 万元人民币。当资产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计划资产净值低于 100 万元人民币的，资产管理人有权适当减少该投资者的退出金额，以保证部分退出申请确认后投资者持有的计划资产净值不低于 100 万元人民币。

当投资者持有的计划资产净值低于 100 万元人民币（含 100 万元人民币）时，需要退出计划的，投资者必须选择一次性全部退出资产管理计划。

在每一开放期结束后，资产管理人需将本计划两类份额的比例控制在 3:1~4:1 的范围内。为此，资产管理人有权停止优先级投资人的参与。若因投资人的参与，致使两类份额的比例高于 4:1 的，资产管理人有权以“时间优先，时间相同金额优先”的原则就优先级投资人的参与进行部分确认，未确认的金额予以退还。

该资产管理计划之一般级在合同生效期间原则上不接受投资委托人参与和退出申请。在每个开放期结束后的次一交易日，如果优先级和一般级的净资产规模比例低于 3:1，一般级份额持有人有权于该工作日后的三个工作日内部分退出本计划，但退出后优先级和一般级的比例不高于 4:1。如果一般级份额持有人未能部分退出使两类份额的比例控制在 3:1~4:1 的范围内，则本计划于前述三个工作日后的下一工作日终止。

资产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，资产管理人进行前述调整必须提前 3 个工作日告知资产委托人。**资产管理人在网站公告前述调整事项即视为履行了告知义务。**

#### （五）参与和退出的费用

## 1、参与费用

本资产管理计划不收取参与费用。

## 2、退出费用

本资产管理计划不收取退出费用。

### (六) 拒绝或暂停参与、暂停退出的情形及处理

1、在如下情况下，资产管理人可以拒绝接受投资者的参与申请：

(1) 如接受该申请，将导致本计划的资产委托人超过200人。

(2) 根据市场情况，资产管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对资产管理计划业绩产生负面影响，从而损害现有资产管理计划资产委托人的利益的情形。

(3) 如接受该申请，将导致本计划资产总规模超过本合同约定的上限。

(4) 因资产管理计划收益分配、或资产管理计划内某个或某些证券进行权益分派等原因，使资产管理人认为短期内接受参与可能会影响或损害现有资产管理计划资产委托人利益的。

(5) 资产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资产管理计划资产委托人利益的。

(6) 法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

资产管理人决定拒绝接受某些资产委托人的参与申请时，参与款项将退回资产委托人账户。

2、在如下情况下，资产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资产委托人的参与申请。

(2) 证券交易场所交易时间临时停市，导致资产管理人无法计算当日资产管理计划财产净值。

(3) 发生本资产管理计划合同规定的暂停资产管理计划资产估值情况。

(4) 法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

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

3、在如下情况下，资产管理人可以暂停接受资产委托人的退出申请：

- (1) 因不可抗力导致资产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，导致资产管理人无法计算当日资产管理计划财产净值。
- (3) 发生本资产管理计划合同规定的暂停资产管理计划资产估值的情况。
- (4) 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，资产管理人应当及时告知资产委托人。已接受的退出申请，资产管理人应当足额支付；如暂时不能足额支付，应当按单个退出申请人已被接受的退出申请量占已接受的退出申请总量的比例分配给退出申请人，其余部分在后续开放日予以支付。

在暂停退出的情况消除时，资产管理人应及时恢复退出业务的办理并及时告知资产委托人。

4、暂停资产管理计划的参与、退出时，资产管理人应按规定告知资产委托人并报中国证监会备案。

5、暂停参与或退出期间结束，资产管理计划重新开放时，资产管理人应按规定告知资产委托人并报中国证监会备案。

### (七) 巨额退出的认定及处理方式

#### 1、巨额退出的认定

单个开放日中，本资产管理计划需处理的退出申请总份额超过本资产管理计划上一工作日资产管理计划总份额的10%时，即认为本资产管理计划发生了巨额退出。

#### 2、巨额退出的处理方式

出现巨额退出时，资产管理人可以根据本资产管理计划当时的资产状况决定接受全额退出或部分退出。

(1) 接受全额退出：当资产管理人认为有能力兑付资产委托人的全部退出申请时，按正常退出程序执行。对开放日提出的退出申请，如构成巨额退出的，应当按照本资产管理合同约定全额接受退出，但退出款项支付时间可适当延长，最长不应超过15个工作日。

(2) 部分延期退出：当全额兑付资产委托人的退出申请有困难，或兑付资产委托人的退出申请进行的资产变现可能使资产管理计划资产净值发生较大波

动时，资产管理人可在该工作日接受部分退出申请，其余部分的退出申请在后续工作日予以受理。对于需要部分延期办理的退出申请，除资产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，转入下一个工作日的退出申请的退出价格为下一个工作日的资产管理计划份额净值，以此类推，直到全部退出为止，但是若下一个工作日为非退出开放日，则委托人的退出申请在开放期最后一个工作日全部处理，退出价格为该日的资产管理计划份额净值。部分退出导致资产委托人持有的计划份额资产净值低于100万元人民币的，资产管理人可按全额退出处理。发生部分延期退出时，资产管理人可以适当延长退出款项的支付时间，但最长不应超过15个工作日。

（3）巨额退出的通知：当发生巨额退出并部分延期退出时，资产管理人应当在3个交易日内通知资产委托人，并说明有关处理方法；同时资产管理人应当分别报中国证监会和资产管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。

## 八、当事人及权利义务

### （一）资产委托人

#### 1、资产委托人概况

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

#### 2、资产委托人的权利

- （1）分享资产管理计划财产收益。
- （2）参与分配清算后的剩余资产管理计划财产。
- （3）按照本合同的约定参与和退出资产管理计划。
- （4）监督资产管理人及资产托管人履行投资管理和托管义务的情况。
- （5）按照本合同约定的时间和方式获得资产管理计划的运作信息资料。
- （6）国家有关法律法规、监管机构及本合同规定的其他权利。

#### 3、资产委托人的义务

- （1）遵守本合同。
- （2）承担购买资产管理计划份额的款项及规定的费用。

(3) 在持有的资产管理计划份额范围内，承担资产管理计划亏损或者终止的有限责任。

(4) 及时、全面、准确地向资产管理人告知其投资目的、投资偏好、投资限制和风险承受能力等基本情况。

(5) 向资产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，配合资产管理人或其销售机构就资产委托人风险承受能力、反洗钱等事项进行的尽职调查。

(6) 不得违反本合同的规定干涉资产管理人的投资行为。

(7) 不得从事任何有损资产管理计划及其投资人、资产管理人管理的其他资产及资产托管人托管的其他资产合法权益的活动。

(8) 按照本合同的约定承担资产管理费、托管费、浮动投资顾问费以及因资产管理计划财产运作产生的其他费用。

(9) 国家有关法律法规、监管机构及本合同规定的其他义务。

## (二) 资产管理人

### 1、资产管理人概况

名称：国联安基金管理有限公司

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 9 楼

法定代表人：庹启斌

联系人：杨欣源

联系电话：021-38992915

传真：021-50151889

### 2、资产管理人的权利

(1) 按照本合同的约定，独立管理和运用资产管理计划财产。

(2) 依照本合同的约定，及时、足额获得资产管理人报酬。

(3) 依照有关规定行使因资产管理计划财产投资所产生的权利。

(4) 根据本合同及其他有关规定，监督资产托管人；对于资产托管人违反本合同或有关法律法规规定的行为，对资产管理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，并报告中国证监会。

(5) 自行销售或者委托有基金销售资格的机构销售资产管理计划，制定和

调整有关资产管理计划销售的业务规则，并对销售机构的销售行为进行必要的监督。

(6) 自行担任或者委托经中国证监会认定的可办理开放式证券投资基金份额登记业务的其他机构担任资产管理计划份额的注册登记机构，并对注册登记机构的代理行为进行必要的监督和检查。

(7) 资产管理人有权根据市场情况对本资产管理计划的总规模、单个资产委托人首次参与金额、每次参与金额及持有的本计划总金额限制进行调整。

(8) 资产委托人同意聘请北京乐瑞资产管理有限公司作为投资顾问对本计划提供投资建议，投资顾问有权按照本资产管理合同及相关法律法规的要求向资产管理人发送投资建议函，当投资顾问的投资建议不违反资产管理人应遵守的法律法规、监管机构要求、本合同约定的投资条款及资产管理人的公平交易、风险控制等有关原则和制度时，资产管理人将执行投资顾问的投资建议。具体投资建议的执行由投资顾问与资产管理人另行签署投资顾问协议进行明确。

资产管理人依据本合同及投资顾问协议的规定，根据投资顾问的投资建议进行投资，由此给资产委托人和资产管理计划造成损失的，资产管理人不承担任何责任。

(9) 国家有关法律法规、监管机构及本合同规定的其他权利。

### 3、资产管理人的义务

(1) 办理资产管理计划的备案手续。

(2) 自本合同生效之日起，按照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用资产管理计划财产。

(3) 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资产管理计划财产。

(4) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的资产管理计划财产与其管理的基金财产、其他委托财产和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，进行投资。

(5) 除依据法律法规、本合同及其他有关规定外，不得为资产管理人及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作资产管理计划财产。

(6) 办理或者委托经中国证监会认定可办理开放式证券投资基金份额登记业务的其他机构代为办理资产管理计划份额的登记事宜。

- (7) 按照本合同的约定接受资产委托人和资产托管人的监督。
- (8) 以资产管理人的名义，代表资产委托人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为。
- (9) 根据《试点办法》和本合同的规定，编制并向资产委托人报送资产管理计划财产的投资报告，对报告期内资产管理计划财产的投资运作等情况做出说明。
- (10) 根据《试点办法》和本合同的规定，编制特定资产管理业务季度及年度报告，并向中国证监会备案。
- (11) 计算并按照本合同的约定向资产委托人报告资产管理计划份额净值。
- (12) 进行资产管理计划会计核算。
- (13) 保守商业秘密，不得泄露资产管理计划的投资计划、投资意向等，监管机构另有规定的除外。
- (14) 保存资产管理计划资产管理业务活动的全部会计资料，并妥善保存有关的合同、协议、交易记录及其他相关资料。
- (15) 公平对待所管理的不同财产，不得从事任何有损资产管理计划财产及其他当事人利益的活动。
- (16) 国家有关法律法规、监管机构及本合同规定的其他义务。

### (三) 资产托管人

#### 1、资产托管人概况

名称：中国工商银行股份有限公司上海市分行

住址：上海市浦东大道 9 号 9 楼

法定代表人：成善栋

联系人：王鹏

联系电话：68499909

传真：021-68499477

#### 2、资产托管人的权利

- (1) 按照本合同的约定，及时、足额获得资产托管费。
- (2) 根据本合同及其他有关规定，监督资产管理人对资产管理计划财产的投资运作，对于资产管理人违反本合同或有关法律法规规定的行为，对资产管理

计划财产及其他当事人的利益造成重大损失的情形，有权报告中国证监会并采取必要措施。

（3）按照本合同的约定，依法保管资产管理计划财产。

（4）国家有关法律法规、监管机构及本合同规定的其他权利。

### 3、资产托管人的义务

（1）安全保管资产管理计划财产。

（2）设立专门的资产托管部门，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉资产托管业务的专职人员，负责财产托管事宜。

（3）对所托管的不同资产管理计划财产分别设置账户，确保资产管理计划财产的完整与独立。

（4）除依据法律法规、本合同及其他有关规定外，不得为资产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。

（5）按规定开设和注销资产管理计划的资金账户、证券账户和期货账户等投资所需账户。

（6）复核资产管理计划份额净值。

（7）复核资产管理人编制的资产管理计划财产的投资报告，并出具书面意见。

（8）编制资产管理计划的年度托管报告，并向中国证监会备案。

（9）按照本合同的约定，根据资产管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜。

（10）按照法律法规及监管机构的有关规定，保存资产管理计划资产管理业务活动有关的合同、协议、凭证等文件资料。

（11）公平对待所托管的不同财产，不得从事任何有损资产管理计划财产及其他当事人利益的活动。

（12）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。

（13）根据法律法规及本合同的规定监督资产管理人的投资运作，资产托管人发现资产管理人的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反本合同约定的，应当拒绝执行，立即通知资产管理人并及时报告中国证监会；资产

托管人发现资产管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反本合同约定的，应当立即通知资产管理人并及时报告中国证监会。

(14) 国家有关法律法规、监管机构及本合同规定的其他义务。

## 九、投资顾问

### (一) 投资顾问基本情况

名称：北京乐瑞资产管理有限公司

住所：北京市石景山区八大处高科技园区西井路 3-3-8587

办公地址：北京市东城区东滨河路 3#雍和艺术区 1 号楼 203

邮政编码：100013

注册资本：2000 万

法定代表人：唐毅亭

联系人：李佩颖

电话：010-84218872

网站：[www.lowrisk.com.cn](http://www.lowrisk.com.cn)

### (二) 投资顾问职责

资产委托人同意聘请【北京乐瑞资产管理有限公司】作为投资顾问，投资顾问应根据相关法律法规及合同约定向资产管理人提供投资顾问服务。有关投资顾问服务的具体约定由投资顾问与资产管理人另行签署投资顾问协议进行明确。

在投资顾问投资建议不违反法律法规、本合同及资产管理人需遵循的政策、内部制度的前提下，资产管理人将执行其投资建议。

## 十、资产管理计划份额的登记

(一) 本资产管理计划份额的注册登记业务指本资产管理计划的登记、存管、清算和交收业务，具体内容包括资产委托人账户管理、份额注册登记、清算及交易确认、收益分配、建立并保管资产管理计划客户资料表等。

(二) 本资产管理计划的注册登记业务由资产管理人或资产管理人委托经中

国证监会认定的可办理开放式证券投资基金份额登记业务的其他机构办理。资产管理人委托经中国证监会认定可办理开放式证券投资基金份额登记业务的其他机构代为办理本资产管理计划注册登记业务的，应当与有关机构签订委托代理协议，并列明代为办理资产管理计划份额登记机构的权限和职责。

（三）注册登记机构履行如下职责：

- 1、建立和保管资产委托人账户资料、交易资料、资产管理计划客户资料表等，并将客户资料表提供给资产管理人。
- 2、配备足够的专业人员办理本资产管理计划的注册登记业务。
- 3、严格按照法律法规和本资产管理合同规定的条件办理本资产管理计划的注册登记业务。
- 4、严格按照法律法规和本资产管理合同规定计算浮动投资顾问费，并提供交易信息和计算过程明细给资产管理人。
- 5、接受资产管理人的监督。
- 6、保持资产管理计划客户资料表及相关的参与和退出等业务记录 15 年以上。
- 7、对资产委托人的账户信息负有保密义务，因违反该保密义务对资产委托人或资产管理计划带来的损失，须承担相应的赔偿责任，但法律法规或监管机构另有规定的除外。
- 8、按本资产管理计划合同，为资产委托人提供资产管理计划收益分配等其他必要的服务。
- 9、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。
- 10、法律法规规定的其他职责。

（四）注册登记机构履行上述职责后，有权取得注册登记费。

## 十一、资产管理计划的投资

（一）投资目标

通过投资交易所、银行间债券等标的，发掘市场的息差交易机会，构建优良的债券组合，获得稳定的票息收入和交易价差收入。

（二）投资范围

本计划的投资对象包括：

- 1、法律、法规或中国证监会允许投资的固定收益投资产品（包括但不限于在上海和深圳交易所以及相关的交易所场外交易平台、银行间债券市场等法定交易场所上市的固定收益证券）：国债、央行票据、金融债、企业债券、公司债券、非公开定向融资工具、资产支持证券、资产支持票据、金融机构次级债、债券回购；经银行间市场交易商协会注册发行的各类债务融资工具（含短期融资券、超短期融资券、中期票据等）；债券型基金等标准化固定收益类金融产品；
- 2、类权益类产品（属于固定收益类金融产品，下同）：仅能通过一级市场申购可转换公司债券；
- 3、货币市场工具和存款工具：包括但不限于货币市场基金、现金、银行存款等；
- 4、法律、法规或中国证监会允许基金管理公司特定客户资产管理业务投资的其他金融工具。

资产委托人在此不可撤销的承诺，委托人认可管理人采纳本计划的投资顾问的投资建议进行投资，由此带来的任何投资风险或因投资造成的损失，由委托人自行承担。

### （三）投资策略

1、债券配置策略：根据产品期限、风险要素、债券基本面来确定选择债券标的。适合构建组合的债券的发行主体包括国有企业及其全资子公司；财务情况优良的地方国有企业或其控股公司；行业领军企业；净资产情况良好经营性现金流稳定的企业；负债率低、持续经营良好的企业。包括中期票据、短期融资券、公司债券和企业债券。

2、期限配置策略：通过买入期限大致相匹配的品种来控制产品的流动性风险。

3、交易投资策略：在利率下行的大背景下，债券市场存在大量的交易机会。使用一级半申购交易、中间交易业务、息差交易、利差交易等策略，可在债券一级半市场，二级市场利率债券和信用债券的波动中获得不错的收益。

### （四）预警与止损策略

1、预警线为 0.980 元。在本计划存续期内任何一个工作日（T 日）收盘后，，经管理人估算的计划份额净值≤0.980 元时，则资产管理人应于下一交易日 9:00

之前通知全体资产委托人。

2、止损线为 0.950 元。在本计划存续期内任何一个工作日 (T 日) 收盘后,, 经管理人估算的计划份额净值 $\leq 0.950$  元时, 则资产管理人将在下一交易日 9:00 起对本资产管理计划资产进行强制止损并平仓, 平仓完毕后本资产管理计划进入清算程序。

#### (五) 投资限制

本资产管理计划财产的投资组合应遵循以下限制:

- 1、符合本合同约定的投资范围和投资限制;
- 2、本计划参与可转债的一级市场申购时, 所申报的保证金不得超过本计划资产净值 20%, 且所申报的可转债数量不得超过拟发行可转债公司本次发行可转债的总量的 50%。如持有新可转债, 在可实现的前提下, 应在可转债上市 3 个交易日内卖出;
- 3、本计划所投标的评级公司必须限于中诚信国际、联合资信、大公国际、上海新世纪以及鹏元资信评级五家;
- 4、本计划所投标的为中诚信国际、联合资信、大公国际、上海新世纪评级的, 要求主体和债项评级必须为 AA (含) 级以上, 或要求债项评级必须为 AA+ (含) 级以上; 短期融资券主体评级在 AA (含) 以上且债项评级为不低于 A-1;
- 5、本计划所投标的为鹏元评级的, 要求债项评级必须在 AA+ 级 (含) 以上, 如无债项评级, 发行主体评级必须在 AA+ 级 (含) 以上;
- 6、本计划投资于融资平台类债券占比不超过本计划资产总值的 80%;
- 7、本计划投资于单只债券, 其市值不得超过本计划资产总值的 30% (以成本价计算);
- 8、本计划投资于单一公开发行债券不得超过该债券发行规模的 10%;
- 9、本计划投资于货币市场基金、债券型基金等各类固定收益产品不得超过该固定收益产品存续规模的 10%;
- 10、本计划投资于债券正回购比例不超过本计划资产净值的 60%;
- 11、对于非公开定向债务融资工具 (PPN) (须为国企发行)、资产支持票据 (ABN)、资产支持证券 (ABS), 持仓不得超过净资产的 30%; 融资平台类债券占比不超过总资产的 80%, 且非公开定向债务融资工具 (PPN)、资产支持票据 (ABN)、资产支持证券 (ABS) 和融资平台类债券合计占比不超过总资产的 90%;

12、对于非公开定向债务融资工具（PPN）、资产支持票据（ABN）、资产支持证券（ABS），债项评级必须为 AA（含）级以上，如无债项评级，可参考发行主体评级，发行主体的最新评级须在 AA 级（含）以上；

13、法律法规、中国证监会以及本合同规定的其他投资限制。

由于证券、期货市场波动、上市公司合并、组合规模变动等资产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。发生上述情形时，资产管理人应在发生不符合法律法规或投资政策之日起的尽快进行调整，以满足法律法规及本合同约定的投资政策的要求。法律法规另有规定的从其规定。

#### （五）建仓期

委托财产投资组合的建仓期为合同生效后的【二十个】工作日。建仓期内各投资品种的投资比例可以低于投资政策中规定的投资比例下限，但不得高于投资政策中规定的投资比例上限。

#### （六）投资禁止行为

本资产管理计划财产禁止从事下列行为：

- 1、承销证券；
- 2、向他人贷款或提供担保；
- 3、从事承担无限责任的投资；
- 4、从事内幕交易、操纵证券价格及其他不正当的证券交易活动；
- 5、法律法规、中国证监会以及本合同规定禁止从事的其他行为。

#### （七）业绩比较基准

一般级份额年化收益率 10%。

#### （八）风险收益特征

本资产管理计划属于债券型资产管理计划，属于中低风险、中低收益的资产管理计划品种，其预期风险与预期收益高于现金管理型资产管理计划，但低于股票型及混合型资产管理计划。

#### （九）投资政策的变更

经资产委托人、资产管理人和资产托管人协商一致可对投资政策进行变更，变更投资政策应以书面形式做出。投资政策变更应为调整投资组合留出必要的时间。

## 十二、投资经理的指定与变更

### （一）投资经理的指定

#### 1、投资经理的指定

资产管理计划投资经理由资产管理人负责指定，且本投资经理与资产管理人所管理的证券投资基金的基金经理不相互兼任。

#### 2、本计划投资经理

本资产管理计划财产投资经理为杨欣源。

投资经理简历：

杨欣源先生，香港大学 MBA。2001 年 9 月至 2008 年 4 月，在 SunGard 金仕达有限公司任金融事业部一风控产品部副总监。2008 年 5 月至 2011 年 4 月，在华宝兴业基金管理有限公司担任数量投资部的高级数量分析师，从事金融工程方面的研究工作。2011 年 5 月加入国联安基金管理有限公司，担任量化投资部副总监，负责构建主动量化投资模型，建设主动量化投资团队。目前在其他机构无兼职。

### （二）投资经理的变更

资产管理人可根据业务需要变更投资经理，并在变更后三个工作日及时告知资产委托人。

## 十三、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、资产管理计划财产独立于资产管理人、资产托管人的固有财产。资产管理人、资产托管人不得将资产管理计划财产归入其固有财产。资产托管人对实际交付并控制下的计划财产承担保管职责，对于证券登记机构、期货经纪公司或结算机构等非资产托管人保管的财产不承担责任。

2、除本款第 3 项规定的情形外，资产管理人、资产托管人因资产管理计划财产的管理、运用或者其他情形而取得的财产和收益归入资产管理计划财产。

3、资产管理人、资产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。资产管理人、资产托管人以其固有财产承担法律责任，其债权人不得对资产管理计划财产行使请求冻结、扣押和其他权利。资产管理人、资产托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，资产管理计划财产不属于其清算财产。

4、资产管理计划财产产生的债权不得与不属于资产管理计划财产本身的债务相互抵销。非因资产管理计划财产本身承担的债务，资产管理人、资产托管人不得主张其债权人对资产管理计划财产强制执行。上述债权人对资产管理计划财产主张权利时，资产管理人、资产托管人应明确告知资产管理计划财产的独立性。

## （二）资产管理计划财产相关账户的开立和管理

资产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，资产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。

# 十四、投资指令的发送、确认与执行

## （一）交易清算授权

资产管理人应向资产托管人提供预留印鉴和有权人（“授权人”）签字样本，事先书面通知（以下称“授权通知”）资产托管人有权发送投资指令的人员名单（“被授权人”）。授权通知中应包括被授权人的名单、权限、电话、传真、预留印鉴和签字样本，并注明相应的交易权限，规定资产管理人向资产托管人发送指令时资产托管人确认有权发送人员身份的方法。授权通知由授权人签字并盖章。资产托管人在收到授权通知当日向资产管理人确认。授权通知须载明授权生效日期。授权通知自通知载明的生效日期开始生效。资产托管人收到通知的日期晚于通知载明生效日期的，则通知自资产托管人收到该通知时生效。资产管理人和资产托管人对授权文件负有保密义务，其内容不得向相关人员以外的任何人泄露。

## （二）投资指令的内容

投资指令是在管理资产管理计划财产时，资产管理人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、到账时间、金额、收款账户信息等，加盖预留印鉴并有被授权人签字或签章。

本资产管理计划财产进行的证券交易所内的证券投资不需要资产管理人发送投资指令，资产托管人以中登公司发送的交收指令进行处理。

### （三）投资指令的发送、确认和执行的时间和程序

指令由“授权通知”确定的被授权人代表资产管理人用传真方式或其他资产托管人和资产管理人认可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托管人以录音电话的方式进行确认。传真以获得收件人（资产托管人）确认该指令已成功接收之时视为送达。因资产管理人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，资产托管人不承担责任。资产托管人依照“授权通知”规定的方法确认指令有效后，方可执行指令。

对于被授权人依照“授权通知”发出的指令，资产管理人不得否认其效力。资产管理人应按照相关法律法规以及本合同的规定，在其合法的经营权限和交易权限内发送划款指令，发送人应按照其授权权限发送划款指令。资产管理人在发送指令时，应为资产托管人留出执行指令所必需的时间。由资产管理人原因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承担。

资产托管人收到资产管理人发送的指令后，应对传真划款指令进行形式审查，验证指令的书面要素是否齐全、审核印鉴和签名是否和预留印鉴和签名样本相符，复核无误后依据本合同约定在规定期限内及时执行，不得延误。若存在异议或不符，资产托管人立即与资产管理人指定人员进行电话联系和沟通，并要求资产管理人重新发送经修改的指令。资产托管人可以要求资产管理人传真提供相关交易凭证、合同或其他有效会计资料，以确保资产托管人有足够的资料来判断指令的有效性。

资产管理人向资产托管人下达指令时，应确保本计划银行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，资产托管人有权拒绝执行，并立即通知资产管理人，资产托管人不承担因为不执行该指令而造成的损失。

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传真给资产托管人。在本资产管理计划财产申购/认购开放式基金时，资产管理人应在向资产托管人提交划款指令的同时将经有效签章的基金申购/认购申请书以传真形式

送达资产托管人。

**(四) 资产托管人依照法律法规暂缓、拒绝执行指令的情形和处理程序**

资产托管人发现资产管理人发送的指令违反《基金法》、《试点办法》、本合同或其他有关法律法规的规定时，不予执行，并应及时以书面形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，并以书面形式对资产托管人发出回函确认，由此造成的损失由资产管理人承担。

**(五) 资产管理人发送错误指令的情形和处理程序**

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

**(六) 更换被授权人的程序**

资产管理人撤换被授权人员或改变被授权人员的权限，必须提前至少一个交易日，使用传真方式或其他资产管理人和资产托管人认可的方式向资产托管人发出由授权人签字和盖章的被授权人变更通知，并提供新被授权人签字样本，同时电话通知资产托管人，资产托管人收到变更通知当日通过电话向资产管理人确认。被授权人变更通知须载明新授权生效日期。被授权人变更通知，自通知载明的生效时间开始生效。资产托管人收到通知的日期晚于通知载明的生效日期的，则通知自资产托管人收到该通知时生效。资产管理人在电话告知后三日内将被授权人变更通知的正本递交资产托管人。被授权人变更通知生效后，对于已被撤换的人员无权发送的指令，或新被授权人员超权限发送的指令，资产管理人不承担责任。

**(七) 投资指令的保管**

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

**(八) 相关责任**

资产托管人正确执行资产管理人符合本合同规定、合法合规的划款指令，资产管理计划财产发生损失的，资产托管人不承担责任。在正常业务受理渠道和指令规定的时间内，因资产托管人原因未能及时或正确执行符合本合同规定、合法

合规的划款指令而导致资产管理计划财产受损的，资产托管人应承担相应的责任，但银行托管专户余额不足或资产托管人如遇到不可抗力的情况除外。

如果资产管理人的划款指令存在事实上未经授权、欺诈、伪造或未能按时提供划款指令人员的预留印鉴和签字样本等非资产托管人原因造成的情形，且资产托管人根据本合同相关规定验证有关印鉴与签名无误，资产托管人不承担因正确执行有关指令而给资产管理人或资产管理计划财产或任何第三人带来的损失，全部责任由资产管理人承担，但资产托管人未尽审核义务执行划款指令而造成损失的情况除外。

## 十五、交易及清算交收安排

### （一）选择代理证券买卖的证券经营机构的程序

资产管理人负责选择代理本资产管理计划财产证券买卖的证券经营机构，并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资产托管人。

### （二）投资证券后的清算交收安排

#### 1、资产托管人在清算和交收中的责任

（1）本资产管理计划财产投资于证券发生的所有场内、场外交易的资金清算交割，全部由资产托管人负责办理。本资产管理计划财产所有场内证券交易的清算交割由资产托管人作为结算参与人代理所托管资产管理计划财产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指令主动从银行托管专户中扣收。

本资产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、清算代理银行及其他登记结算机构办理。

#### （2）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，该等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，并遵守资产托管人为履行结算参与人的义务所制定的业务规则与规定。

资产托管人代理资产管理计划财产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，责任由资产管理人承担。

（3）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。

## 2、无法按时支付证券清算款的责任认定及处理程序

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。对于场外证券交易，资产管理计划财产的资金头寸不足时，资产托管人有权拒绝资产管理人发送的划款指令。对于证券交易所证券交易，若资产管理计划财产的资金头寸不足时，资产管理人应在中登公司规定的最终交收时间前补足款项。如由于非资产托管人的原因导致无法按时支付证券清算款，给资产托管人和资产管理计划财产造成损失的，资产管理人应承担赔偿责任。

在资金头寸充足的情况下，资产托管人对资产管理人在正常业务受理渠道和指令规定的时间内发送的符合法律法规、本合同的指令不得拖延或拒绝执行。如由于资产托管人的原因导致资产管理计划财产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，但资产托管人如遇到不可抗力的情况除外。

## 3、资产管理计划财产参与 T+0 交易所非担保交收债券交易的责任认定及处理程序

资产管理计划财产参与 T+0 交易所非担保交收债券交易的，资产管理人应确保有足额头寸用于上述交易，并必须于 T+0 日 14 时之前出具有效划款指令（含不履约申报申请），并确保指令要素（包括但不限于交收金额、成交编号）与实际交收信息一致。如由于非资产托管人的原因导致 T+0 非担保交收失败，给资产托管人造成损失的，资产管理人应承担赔偿责任。对于 T+0 非担保交收交易，若管理人未能于 T+0 日 14 时之前出具有效划款指令（含不履约申报申请）的，托管人有权根据相关登记结算公司的数据，从托管账户中直接扣划相应资金用于资金交收。

### （三）资金、证券账目及交易记录的核对

资产管理人和资产托管人定期对资产的证券账目、实物券账目、交易记录进行核对。

### （四）参与或退出的资金清算

1、T 日，客户进行参与或退出申请，资产管理人和资产托管人分别计算资产管理计划财产净值，并进行核对；资产管理人向资产委托人报告并向注册登记机构发送资产管理计划份额净值。

2、T+1 日下午 14: 00 前，注册登记机构根据 T 日资产管理计划份额净值计算参与份额或退出金额，更新资产委托人数据库；并将确认的参与或退出汇总数据向资产管理人传送，资产管理人将参与或退出汇总数据传送资产托管人。资产管理人、资产托管人根据确认数据进行账务处理。

3、资产管理人应开立并管理专门用于办理资产管理计划参与和退出款项清算的“清算账户”。资产管理计划资金账户与清算账户间的资金清算遵循“全额清算、净额交收”的原则。

4、资产管理计划参与和退出款项采用轧差交收的结算方式，净额在最晚不迟于 T+3 日 16: 00 前在资产管理人开立的清算账户和资金账户之间交收。

5、如果当日为净应收款，资产托管人应及时查收资金是否到账，对于未准时到账的资金，应及时通知资产管理人划付。对于未准时划付的资金，资产托管人应及时通知资产管理人划付，由此产生的责任应由资产管理人承担。如果当日为净应付款，资产托管人应根据资产管理人的指令及时进行划付。对于未准时划付的资金，资产管理人应及时通知资产托管人划付，由此产生的责任应由资产托管人承担。

6、注册登记机构应将每个开放日的参与或退出汇总数据传送给资产管理人，资产管理人将参与或退出汇总数据传送资产托管人。资产管理人或注册登记机构应对传递的数据真实性负责。资产托管人应及时查收参与资金的到账情况并根据资产管理人指令及时划付退出款项。

### （五）选择期货经纪机构及期货投资资金清算安排

本资产管理计划投资于期货前，资产管理人负责选择为本资产管理计划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

管人和期货公司等可就资产管理计划参与国债期货交易的具体事项另行签订协议。

本资产管理计划投资于期货发生的资金交割清算由资产管理人选定的期货经纪公司负责办理，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。

## 十六、越权交易

### （一）越权交易的界定

越权交易是指资产管理人违反有关法律法规的规定以及违反或超出本合同项下资产委托人的授权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。

资产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，超越权限管理、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

资产托管人对于承诺监督的越权交易中，发现资产管理人的投资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，立即通知资产管理人并有权及时报告中国证监会。

资产托管人对于承诺监督的越权交易中，发现资产管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他规定，或者违反本合同约定的，应当立即通知资产管理人并有权及时报告中国证监会。

资产管理人应向资产委托人和资产托管人主动报告越权交易。在限期内，资产委托人和资产托管人有权随时对通知事项进行复查，督促资产管理人改正。资产管理人对资产委托人和资产托管人通知的越权事项未能在限期内纠正的，资产托管人应报告中国证监会。

## 2、法律法规禁止的超买、超卖行为

资产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，应立即提醒资产管理人，由资产管理人负责解决，由此给资产托管人及资产管理计划财产造成的损失由资产管理人承担。如果因非资产托管人的原因发生超买行为，资产管理人必须于 T+1 日上午 10: 00 前完成融资，确保完成清算交收。

3、因证券市场波动、上市公司合并、资产管理计划规模变动等资产管理人之外的因素致使资产管理计划投资不符合投资比例的，资产管理人应当尽快调整完毕。

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

### （三）资产托管人对资产管理人的投资监督

1、资产托管人对资产管理人的投资行为行使监督权。资产托管人根据本合同有关资产管理计划财产投资政策的约定，承诺对本计划如下投资事项进行监督：

#### （1）对投资范围的监督

本计划的投资对象包括：

法律、法规或中国证监会允许投资的固定收益投资产品（包括但不限于在上海和深圳交易所以及相关的交易所场外交易平台、银行间债券市场等法定交易场所上市的固定收益证券）：国债、央行票据、金融债、企业债券、公司债券、非公开定向融资工具、资产支持证券、资产支持票据、金融机构次级债、债券回购；经银行间市场交易商协会注册发行的各类债务融资工具（含短期融资券、超短期融资券、中期票据等）；债券型基金等标准化固定收益类金融产品；

类权益类产品（属于固定收益类金融产品，下同）：仅能通过一级市场申购可转换公司债券；

货币市场工具和存款工具：包括但不限于货币市场基金、现金、银行存款等；

法律、法规或中国证监会允许基金管理公司特定客户资产管理业务投资的其他金融工具。

#### （2）对投资限制的监督

本资产管理计划财产的投资组合应遵循以下限制：

符合本合同约定的投资范围和投资限制;

本计划参与可转债的一级市场申购时,所申报的保证金不得超过本计划资产净值 20%,且所申报的可转债数量不得超过拟发行可转债公司本次发行可转债的总量的 50%。如持有新可转债,在可实现的前提下,应在可转债上市 3 个交易日内卖出;

本计划所投标的评级公司必须限于中诚信国际、联合资信、大公国际、上海新世纪以及鹏元资信评级五家;

本计划所投标的为中诚信国际、联合资信、大公国际、上海新世纪评级的,要求主体和债项评级必须为 AA (含) 级以上,或要求债项评级必须为 AA+ (含) 级以上;短期融资券主体评级在 AA (含) 以上且债项评级为不低于 A-1;

本计划所投标的为鹏元评级的,要求债项评级必须在 AA+ 级 (含) 以上,如无债项评级,发行主体评级必须在 AA+ 级 (含) 以上;

本计划投资于单只债券,其市值不得超过本计划资产总值的 30% (以成本价计算);

本计划投资于单一公开发行债券不得超过该债券发行规模的 10%;

本计划投资于货币市场基金、债券型基金等各类固定收益产品不得超过该固定收益产品存续规模的 10%;

本计划投资于债券正回购比例不超过本计划资产净值的 60%;

法律法规、中国证监会以及本合同规定的其他投资限制。

### (3) 对投资禁止行为的监督

本资产管理计划财产禁止从事下列行为:

承销证券;

向他人贷款或提供担保;

从事承担无限责任的投资;

从事内幕交易、操纵证券价格及其他不正当的证券交易活动;

法律法规、中国证监会以及本合同规定禁止从事的其他行为。

2、资产托管人发现资产管理人的投资运作不符合上述投资限制时,应当提示资产管理人及时纠正,资产管理人收到提示后应及时核对,并以书面形式向资产托管人进行解释或举证。

3、资产托管人对资产管理人的投资监督和检查自本合同生效之日起开始。

## 十七、资产管理计划财产的估值和会计核算

### （一）资产管理计划财产的估值

#### 1、估值目的

资产管理计划财产估值目的是客观、准确地反映资产管理计划财产的价值，并为计划份额的参与和退出等提供计价依据。

#### 2、估值时间

资产管理人与资产托管人在每个工作日对资产管理计划财产进行估值核对。

#### 3、估值依据

估值应符合本合同、《证券投资基金会计核算业务指引》及其他法律、法规的规定，如法律法规未做明确规定，参照证券投资基金的行业通行做法处理。

#### 4、估值对象

资产管理计划所拥有的股票、债券、权证、基金和银行存款本息等资产及负债。

#### 5、估值方法

本计划按以下方式进行估值：

##### （1）证券交易所上市的有价证券的估值

A、交易所上市的有价证券（包括股票、权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；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，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

B、交易所上市实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

C、交易所上市未实行净价交易的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；估值日没有交易的，且最近交易日后经

济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含截止最近交易日的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

D、交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。交易所上市的资产支持证券，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。

(2) 处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

A、送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市价（收盘价）估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值。

B、首次公开发行未上市的股票、债券和权证，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。

C、首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的市价（收盘价）估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

(3) 因持有股票而享有的配股权，采用估值技术确认公允价值。

(4) 全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，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。

(5) 同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

(6) 开放式基金（包括托管在场外的上市开放式基金 LOF）以估值日前一交易日基金净值估值，估值日前一交易日开放式基金份额净值未公布的，以此前最近一个交易日基金份额净值计算。

(7) 期货以估值日的结算价估值，若估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。法律法规另有规定的，从其规定。

(8) 按照约定利率在持有期内逐日计提应收利息，在利息到账日以实收利

息入账。

(9) 中小企业私募债券采用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估值技术，确定中小企业私募债券的公允价值。中小企业私募债券采用估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。法律法规对中小企业私募债券估值有最新规定的，从其规定。

(10) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，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。

(11) 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。

## 6、估值程序

资产管理人于每个估值日交易结束后计算本估值日的计划财产净值并与资产托管人进行核对。

## 7、估值错误的处理

如资产管理人或资产托管人发现计划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，协商解决。

当计划资产估值错误偏差达到计划财产净值的 0.5%时，资产管理人和资产托管人应该立即更正并在定期报告中报告资产委托人。资产管理人计算的计划财产净值已由资产托管人复核确认、但因资产估值错误给资产委托人造成损失的，由资产管理人与资产托管人按照管理费率和托管费率的比例各自承担相应的责任。

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，进而导致计划财产净值计算错误造成资产委托人的损失，以及由此造成以后交易日计划财产净值计算顺延错误而引起的资产委托人的损失，由提供错误信息的当事人一方负责赔偿。

由于证券交易所及其注册登记公司发送的数据错误，或其他不可抗力等原因，资产管理人和资产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，由此造成的计划资产估值错误，资产管理人和资产托管

人可以免除赔偿责任。但资产管理人和资产托管人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

资产管理人按本合同约定的按公允价值进行估值时，所造成的误差不作为计划资产估值错误处理。

#### 8、暂停估值的情形

(1) 计划投资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资产管理人、资产托管人无法准确评估资产管理计划财产价值时；

(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，而资产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。

#### 9、资产管理计划份额净值的确认

用于向资产委托人报告的计划份额净值由资产管理人负责计算，资产托管人进行复核。如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照资产管理人对计划财产净值的计算结果为准。

资产管理计划财产净值即计划财产净值，是指计划资产总值减去负债后的价值。计划资产份额净值的计算保留到小数点后 3 位，小数点后第 4 位四舍五入。

#### （二）资产管理计划的会计政策

资产管理计划的会计政策比照证券投资基金现行政策执行：

1、资产管理人为本计划的主要会计责任方。

2、本计划的会计年度为公历年 1 月 1 日至 12 月 31 日。

3、计划核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位。

4、会计制度执行国家有关会计制度。

5、本计划单独建账、独立核算。

6、资产管理人及资产托管人各自保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照本合同约定编制会计报表。

7、资产托管人定期与资产管理人就资产管理计划的会计核算、报表编制等进行核对并以书面方式确认。

### (三) 优先级份额和一般级份额净值的计算

资产管理人根据两类份额的收益分配规则, 采用下述规则计算并报告优先级份额和一般级份额净值。存续期内的计划份额净值是对两类计划份额价值的估算, 由资产管理人计算并由资产托管人复核, 并不代表资产委托人可获得的实际价值或资产管理人对收益、本金的任何承诺。

资产委托人认可资产管理人计算的两类计划份额净值。

整体计划份额净值, 优先级份额净值和一般级份额净值在当天收市后计算。

设  $T$  日为本计划估值日,  $t$ : 自资产管理计划合同生效日或某一委托投资期的起始日至  $T$  日的实际天数。,  $F_a$  为  $T$  日 A 级份额余额,  $F_b$  为  $T$  日 B 级份额余额,  $NAV_a$  为  $T$  日 A 级份额参考净值,  $NAV_b$  为  $T$  日 B 级份额参考净值,  $NV$  为  $T$  日本计划净值,  $NV_t$  为本计划  $T$  日闭市后的资产净值。 $R_a$ : 优先级份额的约定年化收益率, 该年化收益率由一般级委托人及优先级委托人协商一致后, 于每个投资年度前五个工作日书面通知资产管理人 (具体格式见附件一); 如果一般级委托人与优先级委托人未就优先级份额的约定年化收益率达成一致, 则本资产管理合同于本投资年度结束时终止, 组合进入清算环节。

计算公式:

(1) 当  $F_a \times (1 + \frac{t}{365} \times R_a) > NV$  时:

$$NAV_a = \frac{NV}{F_a}$$

$$NAV_b = 0$$

(2) 当  $F_a \times (1 + \frac{t}{365} \times R_a) \leq NV$  时:

$$NAV_a = 1 + \frac{t}{365} \times R_a$$

$$NAV_b = \frac{NV - NAV_a \times F_a}{F_b}$$

优先级份额与一般级份额净值的计算过程, 保留到小数点后 3 位, 小数点后第 4 位四舍五入, 优先级份额与一般级份额净值的计算结果, 保留到小数点后 2 位, 小数点后第 3 位四舍五入, 由此产生的误差计入计划财产。

#### （四）计划份额折算

在每个浮动投资顾问费的定期计提日，通过份额折算，将两类计划份额净值调整为 1.00 元。

### 十八、资产管理计划的费用与税收

#### （一）资产管理业务费用的种类

- 1、资产管理费。
- 2、资产托管费。
- 3、浮动投资顾问费。
- 4、计划的证券、期货交易费用及开户费用。
- 5、与计划相关的验资费、会计师费和律师费。
- 6、资产管理计划财产的银行汇划费用。
- 7、按照国家有关规定和本合同约定，可以在计划资产中列支的其他费用。

#### （二）费用计提方法、计提标准和支付方式

##### 1、资产管理费

资产管理计划财产的年管理费率为 0.20%。计算方法如下：

$$H = E \times \underline{0.20\%} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的固定管理费

E 为前一日的计划财产净值

本计划的固定管理费自资产管理计划财产运作起始日起，每日计提，按自然季度支付。由资产管理人向资产托管人发送划款指令，资产托管人复核后于下自然季度季初三个工作日之内，从资产管理计划财产中一次性支付给资产管理人。

##### 2、资产托管费

资产管理计划财产的年托管费率为 0.10%。计算方法如下：

$$H = E \times \underline{0.10\%} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的托管费

E 为前一日的计划财产净值

本计划的托管费自资产管理计划财产运作起始日起，每日计提，按自然季度

支付。由资产管理人向资产托管人发送划款指令，资产托管人复核后于下自然季度季初三个工作日之内，从资产管理计划财产中一次性支付给资产托管人。

### 3、浮动投资顾问费

#### (1) 浮动投资顾问费计提比例及计提时点

浮动投资顾问费为一般委托人在业绩基准 10%之上超额收益的 30%，在以下时点计算或计提并支付。

1) 退出计提日：一般委托人全部或部分退出资产管理计划时计提并一次性支付。

2) 定期计提日：资产管理计划每满一个投资年度时计提并一次性支付。一般委托人的每笔认购份额运作满（或超过）一年，方可计提浮动投资顾问费。

3) 终止计提日：资产管理计划终止财产清算完毕时计提并一次性支付。

退出计提日与定期计提日重合的，浮动投资顾问费不重复计提。退出或违约退出的份额按照先进先出的原则对相应份额分别计算并计提浮动投资顾问费。

#### (2) 浮动投资顾问费计算方法

浮动投资顾问费为在上述 1) -3) 时点计提并一次性支付。

浮动投资顾问费=  $S_i \times NAV_0 \times [(NAV_1 - NAV_0) / NAV_0 - B \times T / 365] \times 30\%$

$S_i$  为浮动投资顾问费提取日一般级份额总份额数

$NAV_0$  为第  $i$  笔一般级份额对应的认购及申购价格或上次收益分配后的单位净值

$NAV_1$  浮动投资顾问费提取日第  $i$  笔一般级份额提取浮动投资顾问费前的份额净值

$B$  为一般级份额浮动投资顾问费比较基准，即 10%

$T$  为第  $i$  笔一般级份额自上次浮动投资顾问费提取日起的实际持有天数，如之前无浮动投资顾问费提取的，则为自合同生效日起的实际持有天数

退出计提日的浮动投资顾问费由注册登记机构负责计算，定期计提日和终止计提日的浮动投资顾问费由资产管理人负责计算，资产托管人不承担复核义务。退出计提日的浮动投资顾问费由注册登记机构从退出款中支付给本计划投资顾问。定期计提日和终止计提日的浮动投资顾问费由资产管理人向资产托管人发送划款指令，由资产托管人从资产管理计划财产中支付给本计划投资顾问。

4、上述（一）中所列其他费用根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由资产托管人从计划财产中支付。

### （三）不列入资产管理计划业务费用的项目

1、资产管理人和资产托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或计划财产的损失。

2、资产管理人和资产托管人处理与计划运作无关的事项发生的费用。

3、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入计划费用的项目。

### （四）费用调整

资产管理人和资产托管人与资产委托人协商一致，可根据市场发展情况调整管理费率和托管费率。

### （五）资产管理业务的税收

本计划运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。资产委托人必须自行缴纳的税收，由资产委托人负责，资产管理人不承担代扣代缴或纳税的义务。

## 十九、资产管理计划的收益分配

（一）本计划每满一个投资年度之日（该日为非工作日，则改为下一工作日）为优先级收益分配基准日，按照约定年化收益率对优先级计划份额进行一次收益分配。现金红利款将不晚于 7 个工作日到达优先级委托人收益分配账户。

每日应付的每笔优先级计划份额对应的收益计算公式如下：

每日应付的每笔优先级计划份额对应的收益=该笔计划份额对应的优先级资金金额×约定年化收益率÷365。

约定年化收益率具体见附件一中约定的年化收益率。

优先级首次收益分配基准日的计算按照优先级计划份额首次认购本计划之日（含）至该收益分配基准日（不含）的实际运作天数计算，其余收益分配基准日的计算方式按照上一次收益分配基准日（含）至该收益分配基准日（不含）的实际运作天数计算；最后一次收益分配通过本计划的财产清算

实现。

本计划存续期间不对一般级进行收益分配。

(二) 本资产管理计划收益分配方式为现金分红。收益分配时发生的银行转账等手续费用由资产管理计划财产承担。

(三) 法律法规或监管机构另有规定的, 从其规定。

本资产管理计划收益分配方案由资产管理人拟定, 由资产托管人复核。资产管理人应在公司网站通知资产委托人。

## 二十、报告义务

### (一) 资产管理合同生效报告

资产管理人应当在资产管理合同生效的次日在资产管理人网站上披露资产管理合同生效报告或者通过电子邮件告知资产委托人。

### (二) 运作期报告

#### 1、资产管理人向资产委托人提供的报告种类、内容和提供时间

##### (1) 年度报告

资产管理人应当在每年结束之日起 3 个月内, 编制完成计划年度报告并经托管人复核, 向资产委托人披露投资状况、投资表现、风险状况等信息。资产管理人应于每年结束之日起 45 日内完成年度报告, 并将年度报告提供资产托管人复核, 资产托管人在收到后 45 日内完成复核, 并将复核结果书面通知资产管理人。

资产管理合同生效不足 3 个月以及资产管理合同终止的当年, 资产管理人可以不编制当期年度报告。

##### (2) 季度报告

资产管理人应当在每季度结束之日起 15 个工作日内, 编制完成计划季度报告并经资产托管人复核后, 向资产委托人披露投资状况、投资表现、风险状况等信息。资产管理人应于每季度结束之日起 8 个工作日内完成季度报告, 并将季度报告提供资产托管人复核, 资产托管人在收到后 7 个工作日内完成复核, 并将复核结果书面通知资产管理人。

资产管理合同生效不足 2 个月以及资产管理合同终止的当季度, 资产管理人

可以不编制当期季度报告。

(3) 净值报告

资产管理人每月将经资产托管人复核的上月最后一个交易日的计划份额净值，以及各类份额净值以各方认可的形式提交资产委托人。

(4) 临时报告

资产管理人、资产托管人应当保证资产委托人能够按照资产管理合同约定的时间和方式查询资产管理计划财产的投资运作、托管等情况。

发生本合同约定的、可能影响资产委托人利益的重大事项时，资产管理人、资产托管人应按照法律法规和中国证监会的有关规定，及时报告。

①投资经理发生变动。

②涉及资产管理人、计划财产、资产托管业务的诉讼。

③资产管理人、资产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调查。

④资产管理人及其董事、总经理及其他高级管理人员、投资经理受到严重行政处罚，资产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。

⑤法律法规和中国证监会规定的其他事项。

上述向资产委托人提供的报告中涉及证券投资明细的，原则上每季度至多报告一次。

## 2、向资产委托人提供报告及资产委托人信息查询的方式

资产管理人向资产委托人提供的报告，将严格按照《试点办法》及其他有关规定通过以下至少一种方式进行。资产委托人信息查询将通过以下至少一种中国证监会允许的、本合同约定的方式进行。

(1) 资产管理人网站

《资产管理合同》、《投资说明书》、定期报告、临时报告等有关本资产管理计划的信息可在资产管理人网站上披露，资产委托人可随时查阅。

资产管理人网站：**【www.gtja-allianz.com】**

(2) 邮寄服务

资产管理人或代理销售机构向资产委托人邮寄定期报告、临时报告等有关本计划的信息。资产委托人在开户合约书上填写的通信地址为送达地址。通信地址

如有变更，资产委托人应当及时通知资产管理人。

### （3）传真或电子邮件

如资产委托人留有传真号、电子邮箱等联系方式的，资产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资产委托人。

## （二）向监管机构提供的报告

### 1、特定资产管理业务季度报告和年度报告

资产管理人应当在每季度结束之日起的 15 个工作日内，完成特定资产管理业务季度报告，并报中国证监会备案。特定资产管理业务季度报告应当就公平交易制度执行情况和特定资产管理业务与证券投资基金之间的业绩比较、异常交易行为做专项说明，并由投资经理、督察长、总经理分别签署。

资产管理人、资产托管人应当在每年结束之日起 3 个月内，完成特定资产管理业务管理年度报告和托管年度报告，并报中国证监会备案。

### 2、业绩明显差距分析报告

资产管理人应当分析所管理的证券投资基金和资产管理计划财产投资计划的业绩表现。在一个委托投资期间内，若投资目标和投资策略类似的证券投资基金和其他特定客户资产管理计划之间的业绩表现有明显差距，则应出具书面分析报告，由投资经理、督察长、总经理分别签署后报中国证监会备案。

## 二十一、风险揭示

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：

### 市场风险

证券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。

4、债券发行主体的经营风险。债券发行主体的经营状况受多种因素的影响，如管理能力、行业竞争、市场前景、技术更新、财务状况、新产品研究开发等都会导致公司盈利发生变化。如果本计划所投资的发行主体经营不善，使本计划投资收益下降，并可能产生违约风险。虽然本计划可以通过投资多样化来分散这种非系统风险，但不能完全避免。

5、通货膨胀风险。本计划投资的目的是计划资产的保值增值，如果发生通货膨胀，本计划投资于证券所获得的收益可能会被通货膨胀抵消，从而影响计划资产的保值增值。

#### 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利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利息收入进行再投资时，将获得比之前较少的收益率。

#### 8、波动性风险

波动性风险主要存在于可转债的投资中，具体表现为可转债的价格受到其相对应股票价格波动的影响，同时可转债还有信用风险与转股风险。

#### 信用风险

信用风险主要指债券、短期融资券、超短期融资券、中期票据等信用证券发行主体信用状况恶化，到期不能履行合约进行兑付的风险，另外，信用风险也包括证券交易对手因违约而产生的证券交割风险。

#### 管理风险

本计划由北京乐瑞资产管理有限公司作为投资咨询顾问，在其投资建议不违反法律法规、本合同及资产管理人需遵循的政策、内部制度的前提下，资产管理

人将执行其投资建议。其知识、技能、经验、判断等主观因素会影响其对相关信息和经济形势、证券价格走势的判断，从而影响资产管理计划财产收益水平。

### 流动性风险

本计划投资组合中债券会因各种原因面临较高的流动性风险，使证券交易的执行难度提高，买入成本或变现成本增加。

### 操作风险

在本计划的运作过程中，可能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，或者技术系统的故障差错而影响交易的正常进行甚至导致本计划份额持有人利益受到影响。这种风险可能来自资产管理人、资产托管人、注册登记机构、销售机构、证券交易所和证券登记结算机构等。

### 合规性风险

合规风险指计划管理或运作过程中，违反国家法律、法规的规定，或者违反本计划合同有关规定的风险。

## 本计划特有的风险

### 1、优先级份额特有的风险

本计划为优先级设置的收益率并非收益保证，在极端情况下，若本计划发生大幅度的投资亏损，计划资产净值不能满足优先级的本金和收益，优先级份额可能不能获得收益，甚至可能面临本金投资受损的风险。

### 2、一般级份额特有的风险

本资产管理计划合同终止并清算时，清算后计划净资产在满足优先级的本金、基本收益分配后，剩余清算净资产再按本合同约定进行分配。如清算时计划净资产等于或低于优先级的本金、基本收益分配的总额，则清算后净资产全部分配给优先级。因此，一般级在可能获取放大的收益预期的同时，也将面临更大的投资受损的风险，极端情况下，一般级可能遭受部分甚至全部本金的损失。

### 3、产品净值低于止损线的风险

为了控制本资产管理计划的下行风险，本计划设置了止损线，若达到止损线后，计划资产由于流动性等原因不能及时低成本地进行变现，计划份额净值存在大大低于止损线的风险。

### 4、资产管理合同提前终止风险

为了控制本资产管理计划的下行风险,本计划设置了如下的止损线以及提前终止条款:

止损线为 0.950 元。在本计划存续期内任何一个工作日 (T 日) 收盘后, 经管理人估算的计划份额净值  $\leq 0.950$  元时, 则资产管理人将在下一交易日 9:00 起对本资产管理计划资产进行强制止损并平仓, 平仓完毕后本资产管理计划进入清算程序。

若发生资产管理合同提前终止的情况, 所有资产份额持有人均面临计划提前终止的风险。对于组合中的债券将通过卖出变现, 由于市场的波动以及流动性等原因可能会给计划资产带来额外的损失。

#### 其他风险

- 1、因本计划业务快速发展而在制度建设、人员配备、风险管理和内控制度等方面不完善而产生的风险;
- 2、因金融市场危机、行业竞争压力可能产生的风险;
- 3、战争、自然灾害等不可抗力因素的出现, 可能严重影响证券市场运行, 导致本计划资产损失;
- 4、其他意外导致的风险。

## 二十二、资产管理合同的变更、终止

(一) 全体资产委托人、资产管理人和资产托管人协商一致后, 可对本合同内容进行变更, 资产管理合同另有约定的除外。

(二) 资产管理合同需要展期的, 资产管理人应当在资产管理合同期限届满 1 个月前, 需取得资产托管人和代表计划份额  $2/3$  以上的资产委托人同意。资产管理合同展期的, 资产管理人应当按照资产管理合同约定的方式通知资产委托人, 并对不同意展期的资产委托人的退出事宜作出公平、合理的安排。

(三) 对资产管理合同任何形式的变更、补充, 资产管理人应当在变更或补充发生之日起 5 个工作日内将资产管理合同样本报中国证监会备案。在资产管理计划运作期间开放参与和退出或发生资产委托人违约退出的, 资产管理人应当于每季度结束之日起 15 个工作日内将客户资料表报中国证监会备案。

(四) 资产管理合同终止的情形包括下列事项:

- 1、资产管理合同存续期限届满而未延期的。
- 2、资产管理合同的委托人少于 2 人的。
- 3、资产管理人被依法取消特定客户资产管理业务资格的。
- 4、资产管理人依法解散、被依法撤销或被依法宣告破产的。
- 5、资产托管人依法解散、被依法撤销或被依法宣告破产的。
- 6、经全体委托人、资产管理人和资产托管人协商一致决定终止的。
- 7、因触及本合同计划止损线而提前终止的。
- 8、一般级委托人与优先级委托人未就优先级份额的约定年化收益率达成一致而终止的。
- 9、法律法规和本合同规定的其他情形。

## 二十三、清算程序

### （一）清算组的成立及职责

本合同终止事由发生之日起 30 个工作日内，由资产管理人及资产托管人组织成立资产管理计划财产清算小组。负责计划的保管、清理、估价、变现和分配等相关事宜，也可以依法进行必要的民事活动。双方具体职责如下：

- 1、资产管理人
  - (1) 资产变现；
  - (2) 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划款指令；
  - (3) 出具会计报表；
  - (4) 清算期间的会计核算；
  - (5) 编制清算报告并签章；
  - (6) 配合资产托管人账户注销工作；
  - (7) 代表计划财产清算小组聘请会计师事务所、律师事务所；
  - (8) 向资产委托人发布清算通知、清算报告；
  - (9) 将计划财产清算报告报中国证监会备案；
  - (10) 履行与资产管理人义务相关的其他职责。
- 2、资产托管人

- (1) 清算期间的财产保管;
- (2) 出具进入清算环节的计划财产清单;
- (3) 复核资产管理人划款指令, 进行资金划付;
- (4) 计划财产资金、证券等账户的注销;
- (5) 清算期间发生资金变动的当日, 提供日终资金调节表;
- (6) 复核资产管理人出具的会计报表;
- (7) 复核资产管理人出具的清算报告并签章;
- (8) 履行与资产托管人义务相关的其他职责。

### (二) 资产核对与变现

- 1、合同终止日起 2 个工作日内, 资产托管人向资产管理人出具合同终止前最后一个自然日财产清单, 列示计划财产的证券余额和资金余额;
- 2、合同终止日起 2 个工作日内, 资产管理人向资产托管人出具合同终止前最后一个自然日计划财产资产负债表和计划存续期的利润表, 资产托管人自收到后 1 个工作日内进行复核确认;
- 3、合同终止日后, 计划财产不应仍持有可流通非现金资产, 如遇特殊情况, 计划财产仍持有可流通非现金资产的, 在合同终止日起 2 个交易日内由资产管理人进行强制变现处理; 计划财产持有的流通受限证券, 如未到期回购、未上市新股或休市、停牌、暂停交易的证券等, 自限制条件解除日起(含解除当日) 2 个交易日内完成变现。

### (三) 清理计划财产债权、债务

- 1、计划财产债权主要包括银行存款、截至清算结束日的银行存款利息、交易保证金、备付金及备付金利息等, 于相应账户注销时结清, 证券登记结算机构另有规定的以相关规定为准, 金额一般以开户银行实际支付金额为准。
- 2、计划财产债务主要包括计划财产应付管理费、托管费、银行间账户维护费、券商佣金、证券变现交易费用、银行汇划费用、销户费用等等。除交易所、登记结算机构等自动扣缴的费用外, 所有清偿由资产管理人、资产托管人核对无误后, 由资产管理人向资产托管人出具划款指令, 由资产托管人复核后办理支付。计划财产债务清偿应于合同终止后 3 个工作日内完成。对财产支付过程中产生的银行汇划费用, 资产管理人和资产托管人应进行匡算并在计划财产中预提。

3、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，对于最后一个计提日的费用则以当日资产净值为基数在当日计提。

#### （四）清算报告

1、资产管理人和资产托管人应在合同终止后 5 个工作日内完成计划财产的清理、确认、评估和变现等事宜，并出具清算报告和剩余财产的分配方案。如遇上述特殊情况，则应在计划财产全部变现后 3 个工作日内完成。

2、在清算报告出具后，如合同规定应聘请会计师事务所进行清算审计的，需由会计师事务所出具审计报告。

3、在清算报告出具后，如合同规定应聘请律师事务所出具法律意见书，需由律师事务所出具法律意见书。

#### （五）支付清算财产

自计划的清算报告报中国证监会备案，并告知资产委托人后的下一个工作日，按清算完成后计划财产的资产负债情况及双方确认的剩余财产的分配方案，由资产管理人向资产托管人出具划款指令，资产托管人复核无误后，向资产委托人支付清算财产，具体安排如下：

1、资产托管人匡算合同终止日的下月及下季度需调整的支付的结算备付金、交易保证金及截至计划财产支付日前一日的相关银行存款账户利息，按照资产托管人和中登公司规定的利率计息，并由资产管理人进行复核；

2、资产管理人将按复核的结果，向计划财产垫付结算备付金、交易保证金及截至计划财产支付日前一日的相关银行存款账户利息；

3、资产托管人依据清算报告及剩余财产的分配方案向注册登记机构支付清算款。

#### （六）账户销户

##### 1、计划财产账户销户

计划财产的证券资产完成变现后，资产托管人按规定注销资产管理计划财产的资金账户、证券账户、期货账户等投资所需账户，资产管理人应给予必要的配合。

##### 2、支付垫付资金

对于在结算备付金账户、交易保证金账户中剩余财产按照中登公司相关政策

执行，最长于合同终止后 2 个季度可以完成清理。结算备付金账户和交易保证金账户利息以中登公司实际支付为准。资产托管人资金账户利息于该计划所有资金往来业务结束日结清。相关利息结清后，资产托管人应向资产管理人提供书面确认数据，由资产管理人向资产托管人出具划款指令，资产托管人复核无误后将结算公司支付的结算备付金、交易保证金以及中登公司实际支付的利息、资产托管人资金账户利息划付到资产管理人指定帐户，并注销该计划财产的资金账户。对资金划付过程中产生的银行汇划费用，资产管理人和资产托管人应进行匡算并在支付款项中扣除。

#### （七）其它

本计划的净资产优先满足优先级份额的本金和约定收益，在扣除优先级份额本金和应计约定收益后的全部剩余净资产按本合同的约定分配给一般级份额。

如本计划的净资产低于或等于优先级份额的本金和约定收益，则本计划净资产全部分配予优先级份额持有人后，仍存在未弥补的优先级份额本金和约定收益，则不再由本计划进行弥补。

约定收益并不是资产管理人向优先级份额持有人保证其本金不受损失或者保证其取得约定收益的承诺，在极端情况下，优先收益份额持有人仍可能会面临无法取得约定收益甚至损失本金的风险。

### 二十四、违约责任

（一）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损失的，应当承担赔偿责任；如属本合同当事人双方或多方当事人的违约，根据实际情况，由违约方分别承担各自应负的违约责任；因共同行为给其他当事人造成损害的，应当承担连带赔偿责任。但是发生下列情况，当事人应当免责：

- 1、资产管理人及和/或资产托管人按照中国证监会的规定或当时有效的法律法规的作为或不作为而造成的损失等。
- 2、在没有故意或重大过失的情况下，资产管理人由于按照本合同规定的投资原则而行使或不行使其投资权而造成的损失等。
- 3、不可抗力。

4、计算机系统故障、网络故障、通讯故障、电力故障、计算机病毒攻击及其它非资产管理人、资产托管人故意造成的意外事故。

(二)资产委托人主动在非开放日要求退出资产管理计划的,属于违约退出。

1、违约退出的认定。

资产委托人在合同约定的开放日之外的日期或时间主动提出退出申请的,视为违约退出。

2、违约退出的处理。

(1)违约退出的方式、金额限制等。参照本合同“资产管理计划的参与和退出”、“资产管理计划的费用与税收”等条款的约定。

(2)违约退出的程序。资产委托人违约退出的,需向资产管理人、资产托管人提供书面退出申请文件,由本计划注册登记机构直接办理违约退出申请。资产委托人在工作日 15:00 前提交退出申请文件的,注册登记机构在收到符合要求的申请文件当日受理退出申请,资产委托人在工作日 15:00 后及非工作日提交退出申请文件的,注册登记机构视为资产委托人在下一个工作日提交的申请文件。

(3)违约退出的价格。违约退出份额净值为违约退出当日计算得出的计划份额净值。

(4)违约退出费用。资产委托人违约退出的,应支付退出金额(扣除管理费、托管费和浮动投资顾问费等费用后的实际退出金额)的 2%作为违约退出费用,违约退出费用全额归入资产管理计划财产。

(三)在发生一方或多方违约的情况下,在最大限度地保护资产委托人利益的前提下,本合同能够继续履行的应当继续履行。非违约方当事人在职责范围内有义务及时采取必要的措施,防止损失的扩大。没有采取适当措施致使损失进一步扩大的,不得就扩大的损失要求赔偿。非违约方因防止损失扩大而支出的合理费用由违约方承担。

(四)一方依据本合同向另一方赔偿的损失,仅限于直接损失。

## 二十五、法律适用和争议的处理

有关本合同的签署和履行而产生的任何争议及对本合同项下条款的解释,均

适用中华人民共和国法律法规（为本合同之目的，在此不包括香港、澳门特别行政区及台湾地区法律法规），并按其解释。

各方当事人同意，因本合同而产生的或与本合同有关的一切争议，合同当事人应尽量通过协商、调解途径解决。经友好协商未能解决的，应提交中国国际仲裁委员会根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为北京，仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力，仲裁费由败诉方承担。

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，维护资产委托人的合法权益。

## 二十六、资产管理合同的效力

（一）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。资产委托人为法人的，本合同自资产委托人、资产管理人和资产托管人加盖公章以及各方法定代表人或授权代表签章之日起成立；资产委托人为自然人的，本合同自资产委托人本人签章或授权的代理人签章、资产管理人和资产托管人加盖公章以及双方法定代表人或授权代表签章之日起成立。本合同于资产管理计划备案手续办理完毕，获中国证监会书面确认之日起生效。

（二）本合同自生效之日起对资产委托人、资产管理人、资产托管人具有同等的法律约束力。

（三）本合同有效期 20 年。

## 二十七、其他事项

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。

本合同一式肆份，资产管理人执壹份，资产委托人执壹份，资产托管人执两份，每份具有同等的法律效力。

（以下无正文）

附件一：

国联安-工银量化恒盛精选 C 类 2 期资产管理计划优先级份额要素确认函

国联安基金管理有限公司：

根据签订的编号为【20xxxxxxxx】号的《国联安-工银量化恒盛精选 C 类 2 期资产管理计划资产管理合同》，于\_\_\_\_\_年\_\_\_\_月\_\_\_\_日设定《国联安-工银量化恒盛精选 C 类 2 期资产管理计划》的优先级份额要素。

经一般级委托人与优先级委托人的协商之后，一致同意将本计划的优先级份额要素为：

优先级金额	优先级份额约定年化收益率	优先级期限 (起息日) 年 月 日—(到期日) 年 月 日

特此确认。

优先级委托人：

经办（前台）：

复核（前台）：

复核（前台处长）：

审批：

申请人盖章：

日期： 年 月 日

一般级委托人：

法定代表人或授权代表：

（签字或盖章）

日期： 年 月 日

以下表格内容为优先级内部使用，与资产管理人及一般级委托人无关。

投资组合名称	投资组合代码

(请资产委托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, 资产管理人和资产托管人不承担任何责任)

委托人请填写:

### （一）资产委托人

## 1、自然人

姓名：

证件名称: 身份证□、军官证□、护照□

## 2、法人或其他组织

名称:

营业执照号码:

组织机构代码证号码:

法定代表人或负责人:

联系地址：

邮编:

联系电话

## (二) 资产委托人认购金额

人民币 元整 (￥ )

### (三) 资产委托人认购份额类别:

(请选择优先级份额或一般级份额)

#### (四) 资产委托人账户

资产委托人认购、参与计划的划出账户与退出计划的划入账户，必须为以资产委托人名义开立的同一个账户。特殊情况导致认购、参与和退出计划的账户名称不一致时，资产委托人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:

(本页无正文，为国联安-工银量化恒盛精选 C 类 2 期资产管理计划资产管理合同签署页。)

资产委托人：

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）：

签署日期： 年 月 日      签署日期： 年 月 日

资产管理人：国联安基金管理有限公司

法定代表人或授权代理人：

签署日期： 年 月 日

资产托管人：中国工商银行股份有限公司上海市分行

法定代表人或授权代理人：

签署日期： 年 月 日