

海通资管稳健精选 1 号 FOF
集合资产管理计划
资产托管协议
(第一次合同变更)

管理人：上海海通证券资产管理有限公司

托管人：交通银行股份有限公司上海市分行



目 录

一、	托管协议当事人	- 2 -
二、	订立托管协议的依据、目的和原则	- 3 -
三、	托管人和管理人之间的业务监督、核查	- 4 -
四、	集合计划相关账户的开立和集合计划的成立	- 6 -
五、	集合计划资产保管	- 9 -
六、	指令的发送、确认和执行	- 12 -
七、	交易安排	- 15 -
八、	集合计划参与、退出的资金清算	- 17 -
九、	资产净值估算与会计核算	- 19 -
十、	投资组合比例监控	- 23 -
十一、	集合计划收益分配	- 25 -
十二、	信息披露	- 26 -
十三、	集合计划费用	- 30 -
十四、	差错及其处理	- 31 -
十五、	禁止行为	- 33 -
十六、	违约责任和责任划分	- 34 -
十七、	适用法律与争议解决	- 36 -
十八、	托管协议的效力和文本	- 37 -
十九、	托管协议的修改、终止和资产清算	- 38 -
二十、	其他事项	- 40 -
二十一、	托管协议签章页	- 41 -
附件 1	- 43 -
附件 2	- 46 -
附件 3	- 48 -
附件 4	- 49 -

鉴于上海海通证券资产管理有限公司系一家依照中国法律合法成立并有效存续的股份有限公司,拟发起设立海通资管稳健精选 1 号 FOF 集合资产管理计划(以下简称“计划”);

鉴于交通银行股份有限公司上海市分行系一家依照中国法律合法成立并有效存续的商业银行分支机构,按照相关法律、法规的规定具备担任计划托管人的资格和能力;

鉴于上海海通证券资产管理有限公司担任计划管理人,交通银行股份有限公司上海市分行担任计划托管人;

为明确计划管理人和计划托管人之间的权利义务关系,特制订本协议。

在本协议中,除非文义另有所指,所有术语与《集合资产管理合同》的相应术语具有相同含义。

资产管理人承诺其知悉《中华人民共和国反洗钱法》、《金融机构大额交易和可疑交易报告管理办法》、《中国人民银行关于加强反洗钱客户身份识别有关工作的通知》(银发〔2017〕235号)、《中国人民银行关于进一步做好受益所有人身份识别工作有关问题的通知》(银发〔2018〕164号)等反洗钱相关法律法规、监管规定,将严格遵守上述规定,不会违反任何前述规定;承诺用于投资的资金来源不属于违法犯罪所得及其收益;承诺投资的资金来源和去向不涉及洗钱、恐怖融资和逃税等行为;承诺出示真实有效的身份证件或者其他身份证明文件,提供真实有效的业务性质与股权或者控制权结构、受益所有人信息等资料,并在产品受益所有人发生变化时,及时告知托管人并按托管人要求完成更新;承诺积极履行反洗钱职责,不借助本业务进行洗钱等违法犯罪活动。资产管理人承诺其不属于中国有权机关、联合国、欧盟或美国制裁名单内的企业或个人,不位于被中国有权机关、联合国、欧盟或美国制裁的国家和地区。

一、 托管协议当事人

(一) 集合计划管理人（简称“管理人”）

名称：上海海通证券资产管理有限公司

办公地址：上海市黄浦区广东路 689 号第 32 层第 01-12 室单元

法定代表人：裴长江

联系电话：021-23219000

传真：021-63410460

(二) 集合计划托管人（简称“托管人”）

名称：交通银行股份有限公司上海市分行

办公地址：上海市中山南路 99 号

负责人：徐斌

联系电话：021-63111000

二、 订立托管协议的依据、目的和原则

（一） 依据

本协议依据《中华人民共和国民法典》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券公司监督管理条例》、《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》（以下简称“《指导意见》”）、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》（以下简称《管理办法》）、《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》（以下简称《管理规定》）、《证券期货经营机构私募资产管理业务运作管理暂行规定》（以下简称“《暂行规定》”）、《商业银行资产托管业务指引》（以下简称“《托管业务指引》”）、及其他有关法律、法规与《海通资管稳健精选 1 号 FOF 集合资产管理计划资产管理合同》（以下简称《集合资产管理合同》）制订。

（二） 目的

本协议的目的是明确集合计划管理人与集合计划托管人之间在集合计划资产的保管、资金归集和划转、会计核算责任、清算交收流程、最终交收责任、集合计划档案资料保管及集合计划运作互相监督等活动中的权利、义务关系，以确保集合计划资产的安全，保护集合计划投资者的合法权益。

（三） 原则

集合计划管理人和集合计划托管人本着平等自愿、诚实信用的原则，经协商一致，签订本协议。

三、 托管人和管理人之间的业务监督、核查

(一) 集合计划托管人对集合计划管理人的业务监督、核查

根据本协议约定,托管人应对集合计划管理人就集合计划资产的核算、集合计划管理人就集合计划资产净值的计算、集合计划管理人管理费的计提和支付、集合计划托管人托管费的计提和支付、集合计划收益分配及集合计划资产清算等行为按照以下约定进行监督和核查。根据集合计划管理人提供的《投资监督事项表》(附件1),托管人对本集合计划的投资范围、投资组合比例等行为进行监督和核查。

集合计划托管人发现在前条所述事项涵盖范围内,集合计划管理人有违反本协议约定或《投资监督事项表》规定的行为时,及时以本协议约定的方式通知集合计划管理人进行纠正或以本协议下文约定的方式进行处理。集合计划管理人收到通知后应及时核对并以电话或书面形式回复集合计划托管人。集合计划托管人有权随时对通知事项进行复查,督促集合计划管理人改正或以本协议约定的方式进行处理。计划管理人未按托管人要求纠正或处理的,或托管人认为对集合计划资产有重大影响的事件,计划托管人有权向计划管理人住所地中国证监会派出机构及中国证券投资基金业协会报告。

(二) 集合计划管理人对集合计划托管人的业务监督、核查

根据《指导意见》、《管理办法》、《管理规定》、本协议及其他有关规定,集合计划管理人就集合计划托管人是否及时执行集合计划管理人的投资指令、是否将集合计划资产和自有资产分账管理、是否擅自动用集合计划资产、是否按时将分配给集合计划投资者的收益划入分红派息账户等事项,对集合计划托管人进行监督和核查。

集合计划管理人定期对集合计划托管人保管的集合计划资产进行核查。集合计划管理人发现集合计划托管人未对集合计划资产实行分账管理、擅自挪用集合计划资产、因集合计划托管人的过错导致集合计划资产灭失、减损、或处于危险状态的或违反《指导意见》、《管理办法》、《管理规定》规定及本协议约定的,集合计划管理人应立即以书面的方式要求集合计划托管人予以纠正和采取必要的

补救措施。集合计划管理人有权要求集合计划托管人赔偿集合计划因上述原因所遭受的损失。

集合计划托管人收到通知后应及时核对并以电话或书面形式回复集合计划管理人。在限期内，集合计划管理人有权随时对通知事项进行复查，督促集合计划托管人改正。在限期过后，计划托管人仍未纠正的；或管理人认为对集合计划资产有重大影响的事件，计划管理人有权向管理人住所地中国证监会派出机构及中国证券投资基金业协会报告。

（三）集合计划管理人和集合计划托管人有义务配合和协助对方依照本协议对集合计划业务执行监督、核查。集合计划管理人或集合计划托管人无正当理由，拒绝、阻挠对方根据本协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督，情节严重或经监督方提出警示仍不改正的，监督方应报告中国证监会及中国证券投资基金业协会。

集合计划管理人应当按照《指导意见》、《管理办法》、《管理规定》的规定对集合资产管理计划的运营情况单独进行年度审计。

四、 集合计划相关账户的开立和集合计划的成立

(一) 集合计划相关账户的开立

1、集合计划的银行托管专户的开设和管理

(1) 集合计划托管人应负责本集合计划的银行托管专户（以下简称“托管专户”）的开设和管理。

(2) 集合计划托管人以至少包括管理人简称、托管人简称、集合计划名的名义在其营业机构为本计划开设银行托管专户，保管本计划银行托管专户内的资金。

本集合计划的银行预留印鉴，由集合计划托管人刻制、保管和使用。本集合计划的一切货币收支活动，包括但不限于投资、支付退出金额、支付集合计划收益、收取参与款，均需通过本托管专户进行。

(3) 托管专户的开立和使用，限于满足开展本集合计划业务的需要。集合计划托管人和集合计划管理人不得假借本集合计划的名义开立其他任何银行账户；亦不得使用集合计划的任何托管专户进行本集合计划业务以外的活动。

2、集合计划证券账户的开设和管理

(1) 集合计划托管人应当以本集合计划名义，在本计划成立后尽快以至少包括“管理人+托管人+本集合计划名”的联名方式在中国证券登记结算有限责任公司开立沪、深证券账户，具体账户名称以实际开立情况为准。

(2) 本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。集合计划托管人和集合计划管理人不得出借和擅自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证券账户进行本集合计划业务以外的活动。

3、集合计划基金账户的开立与管理

见附件 4《开放式基金投资业务操作规程》。

4、集合计划期货账户的开立与管理（如有）

托管人以至少包含管理人、托管人、本集合计划名称的名义在期货经纪商处开立期货账户，并按照期货交易所相关规定与管理人、期货经纪商共同申请交易编码，如期货交易所最新规定，则以期货交易所最新规定为准。集合计划期货

账户的开立与管理具体事宜由管理人、托管人、期货经纪商签署的“期货操作备忘录”另行约定。

5、银行间债券市场债券托管专户的开设和管理

银行间债券市场债券托管专户开立前，管理人负责向相关监管部门进行报备，托管人给予必要的配合。托管人负责以本集合计划的名义在中央国债登记结算有限责任公司或上海清算所开设债券托管（乙类或B类）账户，并代表本集合计划进行债券和资金的清算，管理人给予必要的配合。管理人和托管人共同代表集合计划签订全国银行间债券市场债券回购主协议等其他相关协议，协议正本由托管人保管。管理人代表集合计划与交易对手就每笔交易达成协议，银行间债券交易的资金清算和债券交割由托管人办理。管理人应及时将债券成交通知单及划拨指令传真给托管人，托管人据此办理资金收付和债券交割。

6、其他账户的开立和管理

在本托管协议订立日之后，本集合计划被允许从事其他投资品种的投资业务的，涉及相关账户的开设、使用的，则集合计划托管人应当根据有关法律法规的规定和上述关于账户开设、使用的规定开立。新账户按有关规则管理并使用。

（二）集合计划成立时募集资金的验证和入账

1、集合计划募集期间，管理人和销售机构应当将投资者为参与集合计划而投入的募集资金存入注册登记机构指定的募集账户。在集合计划设立完成、开始投资运作之前，任何人不得动用该募集账户资金。

2、集合计划募集期结束后，集合计划管理人应在七个工作日内将全部认购资金从注册登记机构开立的专门募集账户转入集合计划托管人开立的银行托管专户内。集合计划管理人应当聘请具有证券相关业务资格的会计师事务所对集合资产管理计划进行验资。会计师事务所出具验资报告后，管理人方可宣告集合计划成立，并同时将验资报告和集合计划成立通知书（原件）提供给托管人。本集合计划的成立金额以验资报告所载金额为准。

如果在募集期满后集合计划未达到成立条件，按《集合资产管理合同》规定办理退款事宜。

（三）募集资金和委托资产的计息

如本集合计划募集成功,集合计划募集期产生的利息在本集合计划成立时转为投资者的参与份额。

集合计划存续期间,托管专户利率由计划管理人与开户行协商确定,该利息为集合计划的利息收益。管理人与开户银行商定的利率应由开户银行当日书面通知托管人。

五、 集合计划资产保管

(一) 集合计划资产保管的原则

1、集合计划托管人对集合计划资产保管的原则：安全保管银行托管专户内的集合计划资产，遵守《指导意见》、《管理办法》、《管理规定》、《集合资产管理合同》及其他集合计划有关规定处理集合计划事务，并依照诚实信用、勤勉尽责的原则保管集合计划资产。

2、集合计划托管人应当设立专门的托管部门，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉集合计划托管业务的专职人员，负责集合计划资产托管事宜；建立健全内部风险监控制度，对负责集合计划资产托管的部门和人员的行为进行事先控制和事后监督，防范和减少风险。

3、集合计划托管人应当购置并保持对于集合计划资产的托管所必要的设备和设施（包括硬件和软件），并及时对设备和设施进行维修、维护和更换，以保持设备和设施的正常运行。

4、除依据《指导意见》、《管理办法》、《管理规定》、《集合资产管理合同》及其他有关规定外，托管人不得为自己及任何第三人谋取利益，集合计划托管人用集合计划资产为自己及任何第三方谋取利益，所得利益归于集合计划资产；集合计划托管人不得将集合计划资产转为其自有财产；违反此款规定的，将承担相应的责任，包括但不限于恢复集合计划资产的原状、承担赔偿责任。

5、集合计划托管人必须将集合计划资产与自有资产严格分开，将本集合计划资产与其托管的其他资产严格分开；集合计划托管人应当为集合计划建立独立的账簿，与集合计划托管人的其他业务和其他资产的托管业务实行严格的分账管理。集合计划管理人必须将集合计划与其自有资金严格分开，将本集合计划资产与其管理的其他资产严格分开。

6、除依据《指导意见》、《管理办法》、《管理规定》、《集合资产管理合同》及其他有关规定外，集合计划托管人不得委托第三人托管本集合计划资产。

7、集合计划托管人未经集合计划管理人的正当有效指令，不得自行运用、处分、分配集合计划的任何资产。

8、对于集合计划产生的应收资产，由集合计划管理人负责与有关当事人确

定到账日期并书面通知托管人，到账日集合计划应收资产没有到达托管人处的，托管人应及时通知集合计划管理人采取措施进行催收。由此给集合计划造成损失的，应由集合计划管理人负责向有关当事人追偿。

9、集合计划资产独立于计划管理人和托管人的自有资产。管理人、托管人不得将集合计划资产归入其自有资产。管理人、托管人破产或者清算时，集合计划资产不属于其破产财产或者清算财产。

10、因计划管理人违反法律法规及监管规定将自己管理或控制的集合计划资产在未经计划托管人同意的情况下，用于抵（质）押、担保或债权转让或作其他权利处分而造成计划资产损失，由计划管理人承担赔偿责任。

11、因计划托管人违反法律法规及监管规定将自己保管的集合计划资产在未经管理人同意的情况下，用于抵（质）押、担保或债权转让或作其他权利处分而造成计划资产损失，由计划托管人负责赔偿。

（二）与集合计划资产有关的合同的保管

由集合计划管理人代表集合计划签署的与集合计划有关的合同的原件分别由集合计划托管人、集合计划管理人保管。除本协议另有规定外，集合计划管理人在代表集合计划签署与集合计划有关的合同时，应保证集合计划一方持有两份以上的正本，以便集合计划管理人和集合计划托管人至少各持有一份正本的原件。如上述合同仅一份正本，先由集合计划管理人取得，并将该合同的复印件与正本核对无误后加盖集合计划管理人公章送达集合计划托管人处。

有关集合计划的合同的正本或参照本协议约定托管人获得的有关合同的复印件自集合资产管理合同终止之日起保存期限为 20 年，集合计划管理人可以保留其作为合同签署方面应持有的合同正本。

（三）电子签名合同数据的传输、核对与保管（如有电子签名，适用以下条款）

本计划采用电子签名方式签署《集合资产管理合同》的，根据中国证监会和中国证券投资基金业协会等的相关要求，管理人应及时向注册登记机构传输投资者已签署的电子签名合同数据，并及时对从注册登记机构获取的电子签名合同数据进行核对，并将核对后的电子签名合同核对结果数据传输给注册登记机构。托管人应及时从注册登记机构接收经管理人核对通过的电子签名合同数据，并将

上述电子签名合同数据传输给注册登记机构进行封存。

（四） 集合计划管理人和集合计划托管人应完整保管各自的记录集合计划业务活动的原始凭证、记账凭证、集合计划账册、交易记录、持有人名册和合同等，自集合资产管理合同终止之日起保存期限为 20 年。

（五） 集合计划托管人变更后，管理人和原托管人有义务协助新托管人接收集合计划的有关文件。

（六） 集合计划资产投资的有关实物证券凭证的保管

实物证券凭证由集合计划托管人存放于托管人的保管库。保管凭证由集合计划托管人持有。实物证券的购买和转让，由集合计划托管人根据集合计划管理人的指令办理。托管人仅对存放于托管人处的实物证券凭证承担保管责任。托管人对实物证券凭证的保管并不保证该等凭证所对应的实际资产不致灭失。管理人对于实物证券凭证的有效性、合法性、真实性承担责任。

六、 指令的发送、确认和执行

(一) 集合计划管理人向托管人发送指令人员的授权方法

1、集合计划管理人应向集合计划托管人提供预留印鉴和授权人签字样本，事先书面通知（以下称“授权通知”）集合计划托管人有权发送指令的人员名单，注明相应的交易权限，并规定集合计划管理人向集合计划托管人发送指令时集合计划托管人确认有权发送人员身份的方法。授权通知应由集合计划管理人加盖公章并由法定代表人或其授权代表签署，若由授权代表签署，还应附上法定代表人的授权书。集合计划管理人应在授权通知生效日前将授权通知传真给托管人，集合计划托管人在收到授权通知传真件当日向集合计划管理人进行电话确认，授权通知的生效日期以授权通知上载明的生效日期为准，在此后5个工作日内管理人应将授权通知原件正本送交计划托管人。集合计划投资于期货所涉及的交易清算的授权具体事宜（若有）由管理人、托管人、期货经纪商签署的“期货操作备忘录”另行约定。

2、授权通知的修改

集合计划管理人若对授权通知的内容进行修改，应当至少提前2个工作日通知集合计划托管人并发送传真件。修改授权通知的文件（传真件及原件）应由集合计划管理人加盖公章并由法定代表人或其授权代表签署，若由授权代表签署，还应附上法定代表人的授权书，并注明对授权通知内容进行修改的生效时间。集合计划管理人对授权通知的修改应当以双方约定的形式发送给集合计划托管人，同时电话通知集合计划托管人，集合计划托管人收到变更通知的传真件后电话向集合计划管理人确认。集合计划管理人接到托管人的电话确认视为通知已送达托管人。集合计划管理人对授权通知的修改在修改授权通知的文件注明的生效时间开始生效。集合计划管理人在发出授权修改通知的传真件后5个工作日内将对授权通知修改的文件原件送交集合计划托管人。

3、集合计划管理人和集合计划托管人对授权通知及其更改负有保密义务，其内容不得向指令发送人员及相关操作人员以外的任何人披露、泄露。

(二) 管理人向托管人发送指令的内容

1、指令包括计划管理人在运作计划资产时，向计划托管人发出的资金划拨书面文书，包括收款指令、付款指令及其他资金划拨指令等。

2、计划管理人发给计划托管人的指令应写明款项事由、支付时间、到账时间、收款人开户银行、金额、收款人账户名称、账号等执行支付所需信息，加盖预留印鉴并由被授权人签字。

3、管理人必须在 15:30 之前向托管人发送付款指令，15:30 之后发送付款指令的，托管人不能保证划款成功。如管理人要求当天某一时点到账，必须至少提前 2 小时向托管人发送付款指令并与托管人电话确认。管理人指令传输不及时，未能留出足够的执行时间，致使指令未能及时执行的，由管理人承担相应责任；如遇特殊情形，视业务情况由双方当事人协商解决。

（三）指令的发送、确认和执行

1、指令的发送

（1）指令需有授权通知确定的预留印鉴和签字，并由有权发送指令人员在指令上签字后，代表计划管理人用约定的方式向计划托管人发送并电话通知计划托管人指定人员。

（2）计划托管人应指定专人接收计划管理人的指令，并预先通知计划管理人接收人名单和联系方式。

2、指令的确认

（1）计划托管人在接收指令时，应对指令是否由有权发送指令人员发送、指令的要素是否齐全、指令印鉴与签字是否与预留的授权文件内容表面相符进行检查，如发现问题，应及时通知管理人。经确认的指令，计划管理人不得否认其效力，但如果计划管理人已经撤销或更改对有权签署、发送指令人员的授权，并且书面通知计划托管人且生效的，则对于此后该类相关人员无权发送的指令或超权限发送的指令所造成的损失，计划管理人不负有赔偿责任。

（2）计划托管人可以要求计划管理人传真提供相关交易凭证或单据、合同或其他有效资料，以确保计划托管人有足够的资料来判断指令的有效性。

（3）计划托管人仅根据计划管理人提供的授权文件进行表面相符性的形式审查，管理人保证指令的真实性。

3、指令的执行

(1) 计划托管人仅执行符合本协议约定的指令。

(2) 指令执行完毕后，计划托管人应通知计划管理人。

(3) 相关登记结算机构向计划托管人发送的结算通知视为计划管理人向计划托管人发出的符合本协议约定的指令，计划托管人应予以执行。

4、执行中相关问题的处理方法

(1) 计划管理人下达的指令必须要素齐全，词语准确，计划管理人下达的指令要素不全或语意模糊的，计划托管人有权终止执行并及时通知管理人修正。

(2) 集合计划托管人因按本协议约定执行集合计划管理人投资指令而产生的相关法律责任，由集合计划管理人承担。集合计划托管人因自身原因未按本协议约定执行集合计划管理人符合本协议约定的指令，致使本集合计划的利益受到损害的，由集合计划托管人承担违约责任。

(3) 计划管理人在发送指令时，应为计划托管人执行指令留出执行指令时所必需的时间。指令传输不及时，未能留出足够的执行时间，致使指令未能及时执行的，由管理人承担相应责任；如遇特殊情形，视业务情况由双方当事人协商解决。

(4) 计划管理人应确保计划的银行托管专户有足够的资金余额，确保计划的证券账户有足够的证券余额；计划托管人应于每个工作日日终与管理人核对托管专户的现金余额。对超头寸的指令，以及超过证券账户证券余额的指令，托管人不予执行并及时通知计划管理人，由此造成的损失，由计划管理人负责赔偿。

5、期货投资数据传输和接收（如有）

集合计划投资于期货所涉及的数据传输和接受具体事宜由管理人、托管人、期货经纪商签署的“期货操作备忘录”另行约定。

6、期货保证金账户的资金划拨和清算（如有）

集合计划投资于期货所涉及的托管专户与期货保证金账户的资金划拨与清算相关事宜由管理人、托管人、期货经纪商签署的“期货操作备忘录”另行约定。

七、 交易安排

(一) 集合计划管理人建立集合计划投资主办人员制度, 即应当指定专门人员具体负责集合计划的投资管理事宜。

投资主办人员应当依法取得从业资格, 具有三年以上投资管理、投资研究、投资咨询等相关业务经验, 具备良好的诚信记录和职业操守, 且最近三年未被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚。

(二) 交易单元安排

1、计划在证券交易所的投资交易活动, 应当集中在专用交易单元上进行。管理人需将用于计划交易的专用交易单元向相关机构(包括但不限于证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司)备案, 并向托管人书面提供专用交易单元的名称、编号、佣金费率明细表等信息及其变更情况。

2、管理人需确认上述事宜完成后方可进行场内交易。

(三) 证券交易的资金清算与交割

1、资金划拨

托管人依据本协议第六章的约定对管理人的资金划拨指令进行验证和执行。

2、结算方式

支付结算主要以转账形式进行, 如中国人民银行有更快捷安全可行的结算方式, 托管人可根据需要进行调整(限本集合计划专门账户使用)。

3、证券交易资金的清算

(1) 因本集合计划投资于证券发生的所有场内、场外交易的清算交割, 全部由集合计划托管人负责办理。

(2) 本集合计划证券投资场内交易的清算交割, 由集合计划托管人根据相关登记结算公司的结算规则办理。

(3) 本集合计划证券投资场外交易的清算交割, 由计划托管人或管理人根据相关结算要求办理。

(4) 本集合计划投资非担保交收, 计划管理人应在 T 日 15:00-15:15 将当日非担保交收应付款项书面告知计划托管人。

本计划的证券交易所证券投资的结算交收模式为托管人结算模式。

本计划证券交易所证券投资的清算交割，由托管人根据交通银行股份有限公司与管理人签订的托管协议及相关协议约定，由托管人负责办理。

本计划证券交易所证券投资涉及 T+0 日非担保、RTGS 交收的业务，管理人应在 T+0 日 15:00 前书面通知托管人办理交收，否则托管人不能保证相关清算交割成功、且不承担因此造成的损失。

管理人应当根据托管协议及相关协议约定按时履行资金交收义务，并承担对托管人的最终资金交收责任，如因管理人的投资运作造成本计划资产无法按时完成清算交割的，由管理人负责解决，托管人给予必要的配合，由此给本计划及托管人造成的损失由管理人承担。如因托管人的自身原因在清算上造成本计划资产的损失，应由托管人负责赔偿本计划的直接损失。

为防范清算交收风险，本计划持有同一发行人发行的证券集中度（持仓规模占净资产规模）超过 50%时，不得进行交易所正回购交易，如违反上述规定，由此造成的损失，由管理人承担。

4、网银使用

计划管理人授权计划托管人为本计划开通网银功能用于本计划的资金划付。在资产托管人开通计划管理人网银查询功能后，计划管理人能够通过该网银系统对托管专户内的资金情况进行查询。

（四）集合计划投资于期货所涉及的交易具体事宜（如投资股指期货、商品期货等）由管理人、托管人、期货经纪商签署的“期货操作备忘录”另行约定。

八、 集合计划参与、退出的资金清算

（一） 募集期参与

募集期的资金清算见本协议第四章第二节：集合计划成立时募集资金的验证和入账。

（二） 存续期参与、退出

1、T日，投资者进行集合计划参与和退出，管理人计算集合计划资产净值，托管人进行复核；管理人将双方盖章确认的前一日集合计划净值通告在各销售网点、管理人的网站上告知投资者。

2、T+1日 15:00 前，注册登记机构根据 T 日集合计划单位净值计算参与份额、转换金额、退出金额，更新集合计划投资者数据库；并将确认的参与、退出数据向集合托管人传送。管理人、托管人根据确认数据进行账务处理。

3、管理人指定为产品特别开立且由注册登记机构认可的银行账户作为集合计划的资金清算，用于本集合计划参与、中间参与和退出环节的清算交收。

4、集合计划资金清算账户与集合计划托管专户之间的资金清算时间安排为：参与资金（不含参与费用）在 T+2 日清算，退出资金和退出费用在 T+3 日内清算。

5、集合计划“托管专户”与“集合计划资金清算账户”之间的资金清算，采取“净额清算、净额交收”的原则，即按照托管专户每日应收资金和应付资金的差额来确定托管专户每日的资金交收净额。

当托管专户存在净应收额（集合计划应收参与款大于应付退出款）时，管理人将净应收额从“集合计划资金清算账户”划至“集合计划托管专户”，在资金划出后管理人应立即通知托管人，在资金到账后托管人应立即通知管理人进行账务处理。当托管专户存在净应付额（集合计划应付退出款大于应收参与款）时，托管行按管理人的划款指令将托管专户净应付额从“集合计划托管专户”划至管理人指定的“集合计划资金清算账户”，托管人在资金划出后立即通知管理人，管理人确认资金到账后立即通知托管人进行账务处理。

（三） 其他

1、集合计划管理人和集合计划托管人应当按照《集合资产管理合同》等有关约定，在集合计划参与和退出的时间、场所、方式、程序、价格、费用、收款或付款等各方面相互配合，积极履行各自的义务，保证集合计划的参与和退出工作能够顺利进行。

2、集合计划份额登记由集合计划管理人办理。

3、计划管理人应将投资者参与及退出数据通过双方约定的方式提供给托管人。管理人应对传送的此类数据的真实性、准确性负责。

九、 资产净值估算与会计核算

（一） 资产总值

集合计划的资产总值是指通过发行计划份额方式募集资金，并依法进行基金、股票、债券交易等资本市场投资所形成的各类资产的价值总和。

（二） 资产净值

集合计划资产净值是指本集合计划资产总值减去负债后的净资产值。

（三） 单位净值

集合计划份额净值是指估值日集合计划资产净值除以计划总份额。

（四） 估值目的

本集合计划资产估值的目的是客观、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份额净值，是进行信息披露、计算参与和退出集合计划的基础。

（五） 估值对象

运用集合计划资产所持有的一切金融资产和金融负债。

（六） 估值日

计划的估值日为本计划相关的证券交易场所的交易日。

（七） 集合计划资产估值

1、 估值方法

管理人及托管人应当按照《资产管理合同》的约定进行估值。

2、 估值程序

集合计划资产的日常估值由管理人进行。管理人于每个工作日的下一工作日内完成估值后，将估值结果发送至托管人，托管人按法律法规、产品合同规定的估值方法、时间、程序进行复核无误后返回给管理人；月末、年中和年末估值复核与会计账目的核对同时进行，但管理人根据法律法规或本产品合同的规定暂停估值时除外。由管理人负责在指定媒体上进行披露。

3、特殊情形的处理

本集合计划管理人按上述估值方法进行估值时,所造成的误差不作为集合计划份额净值错误处理。

4、暂停通告净值的情形

(1) 集合计划投资涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因停市时;

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

(3) 中国证监会认定的其他情形。

5、集合计划单位净值的确认及错误的处理方式

(1) 本计划单位净值的计算精确到0.0001元,小数点后第五位四舍五入。当资产估值导致本计划单位净值小数点后四位以内(含第四位)发生差错时,视为本计划单位净值错误。

(2) 本计划管理人和本计划托管人应采取必要、适当、合理的措施确保本计划资产估值的准确性和及时性。当估值出现错误时,本计划管理人应当立即公告、予以纠正,并采取合理的措施防止损失进一步扩大。错误偏差达到或超过本计划资产净值的0.5%时,集合计划管理人应当立即通报集合计划托管人,并向投资者披露。

(3) 因集合计划份额资产净值计算错误给集合计划资产及投资者造成损失的,应先由管理人承担赔偿责任。管理人在赔偿后,对不应由其承担的责任,有权向其他有关差错责任方追偿。当管理人计算的计划资产净值、计划单位净值已由托管人复核确认后公告的,由此造成的投资者或集合计划资产的损失,应根据法律法规的规定对投资者或集合计划资产支付赔偿金,就实际向投资者或计划支付的赔偿金额,由管理人与托管人按照管理费率 and 托管费率的比例各自承担相应的责任。集合计划管理人具有向当事人追偿不当得利的权利。如法律法规或监管机关另有规定的,按其规定处理。

(4) 由于不可抗力原因,或由于证券交易所、登记结算公司等机构发送的数据错误,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,但仍未能发现错误的,由此造成的计划资产估值错误,本管理人和托管人可以免

除赔偿责任。但本管理人和托管人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

6、前述内容如法律法规或监管机构另有规定的，按其规定处理。

（八）集合计划会计制度

本集合计划的会计核算按国家有关部门规定的会计制度执行，国家无明确规定的，由管理人和托管人根据《企业会计准则》及国家有关的会计制度和业内通行做法协商确定。管理人和托管人应遵循双方约定的同一记账方法和会计处理原则，若双方对会计处理方法存在分歧，应以管理人的处理方法为准。

集合计划会计核算责任人由管理人承担，与本计划有关的会计问题，如经双方在平等基础上充分讨论后，尚不能达成一致时，按管理人的建议执行；或者管理人和托管人对计划净值的计算结果，虽然多次重新计算和核对，尚不能达成一致时，为避免不能按时公布计划净值的情形，以管理人的计算结果对外公布；由此给投资者和集合计划财产造成的损失，由管理人承担赔偿责任，托管人不负赔偿责任。

（九）集合计划财务报表与报告的编制和复核

1、集合计划资产管理季度报告和集合计划资产托管季度报告应在每季度结束起1个月内、集合计划资产管理年度报告和集合计划托管年度报告应在每会计年度结束后4个月内公告；集合计划成立不足3个月或者存续期间不足3个月的，管理人/托管人可以不编制当期的季度报告/年度报告。

2、集合计划管理人每个季度终了后20个工作日内完成季度报告，并将有关报告提供集合计划托管人复核，集合计划托管人在收到日起5个工作日内进行复核，并将复核结果书面通知集合计划管理人。

集合计划管理人在会计年度结束后3个月内完成年度报告，并将有关报告提供集合计划托管人复核，集合计划托管人在收到日起1个月内复核，并将复核结果书面通知集合计划管理人。

3、集合计划托管人在复核过程中，发现双方的报表存在不符时，集合计划管理人和集合计划托管人应共同查明原因，进行调整，调整以双方认可的账务处理方式为准；若双方无法达成一致，则以集合计划管理人的账务处理为准。核对

无误后，集合计划托管人在集合计划管理人提供的报告上加盖公章，双方各自留存一份。如果集合计划管理人与集合计划托管人不能于应当发布通告之日之前就相关报表达成一致，集合计划管理人有权按照其编制的报表对外发布通告，由此产生的信息披露错误，由管理人承担相应责任，集合计划托管人有权就相关情况报计划管理人住所地中国证监会派出机构，及中国证券投资基金业协会备案。

十、 投资组合比例监控

(一) 集合计划管理人严格按照《指导意见》、《管理办法》、《管理规定》、《集合资产管理合同》的规定经与托管人协商确认后向托管人提供《投资监督事项表》(见附件1), 作为托管人对管理人投资行为进行监督的依据。

资产管理合同当事人协商一致可对《投资监督事项表》进行变更, 管理人将变更后的《投资监督事项表》加盖公章后以书面方式提交托管人, 同时提供《集合资产管理合同》变更生效的书面依据, 并经托管人回函确认后生效。托管人在收到更新的《投资监督事项表》及进行回函确认前, 仍按原《投资监督事项表》对计划管理人的投资行为进行监督。

(二) 托管人根据《投资监督事项表》对集合计划管理人的投资行为进行监督, 但集合计划管理人应考虑托管人系统首次开发及后续修改、测试所需的时间。

(三) 监督处理方式

1、场内交易监督

托管人在每个交易日次日根据接收的交易清算数据对集合计划管理人交易日的场内交易进行审核。如发现投资运作违反《投资监督事项表》的有关约定时, 在未出现透支的情况下, 托管人应完成与中国证券登记结算有限责任公司的一级清算, 同时通过书面形式向集合计划管理人出具《提示函》督促集合计划管理人进行纠正。托管人有权随时对通知事项进行复查, 督促集合计划管理人改正。集合计划管理人对托管人通知的违规事项未能按托管人要求纠正的, 托管人有权报告计划管理人住所地中国证监会派出机构及中国证券投资基金业协会。

2、场外交易监督

托管人根据《投资监督事项表》的规定, 对集合计划管理人发送给托管人的场外清算划款指令进行审核, 如果符合要求, 则立即执行; 如果发现集合计划管理人的投资行为不符合规定, 则在交易合同未生效的情况下提示集合计划管理人, 并有权拒绝执行; 如交易合同已生效, 则托管人依指令进行划款, 同时书面通知集合计划管理人进行纠正。对于通过全国银行间同业拆借中心达成的债券交

易（包括现券买卖、债券质押式回购、债券买断式回购、债券远期、债券借贷等），托管人收到场外清算划款指令，视同交易合同已生效，托管人依指令进行划款，通知集合计划管理人进行纠正。集合计划管理人对托管人通知的违规事项未能按托管人要求纠正的，托管人有权报告计划管理人住所地中国证监会派出机构及中国证券投资基金业协会。

3、为减少业务差错，提高工作效率，托管人与集合计划管理人之间应加强对相关法律、法规、合同及投资监管方面的规定的沟通和信息数据的事先交流。

（四）管理人认可托管人投资监督的真实性、准确性和完整性受限于计划管理人及其他中介机构提供的数据和信息，合规投资责任在集合计划管理人。托管人对这些机构的信息真实性、准确性和完整性不作任何担保、暗示或表示。

托管人无投资责任，管理人应按照本合同约定及法律法规要求进行投资运作，资产托管人根据本合同投资监督事项表约定进行投资监督，但对投资决策及投资回报不承担责任。托管人不会因为提供投资监督报告而承担任何因集合计划管理人违规投资所产生的有关责任，也没有义务去采取任何手段回应任何与投资监督报告有关的信息和报道。但如收到集合计划管理人的书面指示，托管人将对投资监督报告所述的违规行为提供有关资料。

十一、 集合计划收益分配

（一） 集合计划收益分配的依据

1、本集合计划收益指集合计划利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额，集合计划已实现收益指集合计划利润减去公允价值变动收益后的余额。

2、收益分配应该符合《集合资产管理合同》及说明书关于收益分配原则的规定。

（二） 集合计划收益分配的时间和程序

1、管理人将集合计划收益分配方案通知托管人，并向投资者公告收益分配方案；

2、在分配方案公布后，管理人制定具体分配事宜，并就现金分红的金额（如有）向托管人下达付款指令，托管人按照管理人的指令及时进行分红资金清算。管理人应于收益分配基准日起 10 个工作日内向托管人发送当期收益分配指令，托管人在复核后 5 个工作日内划入投资者指定收取收益的账户；

3、管理人和托管人分别进行收益分配的账务处理。

十二、 信息披露

（一） 保密义务

1、集合计划管理人和集合计划托管人对集合计划的有关信息均应恪守保密的义务。集合计划管理人与集合计划托管人对集合计划的任何信息，不得在其对外披露之前，先行对双方以外的任何机构、组织和个人泄露。但依据法律、法规、监管规定或应司法、行政等机关要求对外提供，向所聘请的审计、法律等外部专业顾问提供的以及本协议另有约定的除外。

2、集合计划管理人和集合计划托管人除了为履行法律法规、《集合资产管理合同》及本协议规定的义务所必要之外，不得为其他目的使用、利用其所知悉的集合计划的有关信息，并且应当将有关信息限制在为履行前述义务而需要了解该有关信息的职员范围之内。

（二） 集合计划管理人和集合计划托管人在信息披露中的职责和信息披露程序

1、集合计划管理人是本集合计划信息披露责任人。

2、本集合计划信息披露的所有文件，包括《集合资产管理合同》和本协议规定的集合计划资产净值通告、集合计划季度管理报告和托管报告、年度管理报告和托管报告及其他必要的通告文件，集合计划管理人和集合计划托管人按照规定予以披露。如计划管理人在对外披露的文件中涉及托管人的，应经托管人同意。计划托管人在对外披露的文件中涉及管理人的，也应经管理人同意。

集合计划管理人应当按照《指导意见》、《管理办法》、《管理规定》的规定对集合资产管理计划的运营情况单独进行年度审计。

3、对于法律、法规和中国证监会规定的本集合计划需披露的信息，集合计划管理人和集合计划托管人负有积极配合、互相督促、彼此监督，保证其履行按照法定方式和时限披露的义务。

4、本集合计划的信息披露，必须在管理人网站和销售网点通告投资者。

（三） 信息披露文件的存放和查阅

本计划说明书、季度资产管理报告、季度资产托管报告、年度资产管理报告、

年度资产托管报告、临时报告等文本存放在本计划管理人、托管人和销售机构的办公场所和营业场所，投资者可免费查阅。投资者在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。投资者也可以直接登录本计划管理人网站进行查阅。

本计划管理人和本计划托管人保证所报告的内容真实、准确、完整。

（四）信息披露的内容和时间

1、资产净值报告

本集合计划的封闭期内，管理人应当至少每周公告一次经托管人复核的计划份额净值。在本集合计划的开放期内，管理人应当在每个工作日披露经托管人复核的上一个工作日的计划单位净值。

2、资产管理报告

计划资产管理报告季报及年报（财务数据经托管人复核）在每季度结束之日起1个月内或每一会计年度截止日后4个月内公告。集合计划成立不足3个月或者存续期间不足3个月的，管理人可以不编制当期的季度报告。集合计划成立不足3个月或者存续期间不足3个月的，管理人可以不编制当期的年度报告。内容包括：

- （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，包括计提基准、计提方式和支付方式；
- （8）资产管理计划投资收益分配情况；
- （9）投资经理变更、重大关联交易等涉及投资者权益的重大事项；
- （10）本合同约定的其他需要以定期报告形式披露的事项；
- （11）中国证监会规定的其他事项。

资产管理计划季度报告应当披露前款除第（6）项之外的其他信息。

3、资产托管报告

计划资产托管报告（格式见附件 2）在每季度结束之日起 1 个月内及每一会计年度截止日后 4 个月内公告。集合计划成立不足 3 个月或者存续期间不足 3 个月的，托管人可以不编制当期的季度报告。集合计划成立不足 3 个月或者存续期间不足 3 个月的，托管人可以不编制当期的年度报告。

计划资产托管报告内容包括对资产管理报告中的财务指标、净值表现、计划资产配置状况、价值变动情况、重大关联交易等内容发表复核意见，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

4、年度报告

每会计年度结束之日起 4 个月内，集合计划管理人应向投资者提供准确、完整的资产管理年度报告及集合计划审计报告，对报告期内集合计划资产的业绩表现、收益分配、投资策略、内部监察、投资组合、会计报表等情况做出详细的说明；托管人应向投资者提供准确、完整的资产托管年度报告，对报告期内管理人在投资运作、净值计算、费用开支问题是否符合法律、法规、集合计划说明书及合同的规定做出详细的说明。

按照《管理办法》的规定，本计划管理人进行年度审计时，应对集合资产管理计划的运营情况单独进行审计。

（五）重大事项的披露

集合计划存续期间，发生资产管理合同约定或可能影响投资者利益的重大事项时，在事项发生之日起五日内向投资者披露。临时报告的情形包括但不限于：

（1）集合计划运作过程中，负责集合资产管理业务的高级管理人员或投资经理员发生变更，或出现其他可能对集合计划的持续运作产生重大影响的事项；

（2）暂停受理或者重新开始受理参与或者退出申请；

（3）发生巨额退出并延期支付；

（4）集合计划终止和清算；

（5）集合计划存续期满并展期；

（6）管理人以自有资金参与和退出；

（7）合同的补充、修改与变更；

（8）与集合计划有关的重大诉讼、仲裁事项；

(9) 负责本集合计划的代理销售机构发生变更；

(10) 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（含资产支持证券）或承销期内承销的证券（含资产支持证券）的；本计划从事重大关联交易的；

(11) 管理人、托管人因重大违法违规，被中国证监会取消相关业务资格；

(12) 管理人、托管人因解散、破产、撤销等原因不能履行相应职责；

(13) 集合计划分红；

(14) 资产计价出现错误（当资产估值导致本集合计划单位净值小数点后四位以内（含第四位）发生差错时，视为本集合计划单位净值错误）；

(15) 管理费、托管费等费用计提方式或费率发生变更；

(16) 其他对集合计划持续运营、客户利益、资产净值产生重大影响的事件。

（六）澄清公告和说明

在任何公共传播媒介中出现或者在市场上流传的消息可能对投资者的收益预期产生误导性影响或引起较大波动时，信息披露责任人知悉后应当立即对该消息进行澄清，并将有关情况立即报告给中国证监会。

十三、 集合计划费用

（一） 集合计划费用的种类

以《资产管理合同》约定为准。

（二） 不列入集合计划费用的项目

上述费用，根据有关法规及相应协议规定，可列入资产管理计划财产费用。

其中，资产管理计划成立前发生的费用，以及存续期间发生的与募集有关的费用，不列入集合计划费用。

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运作无关的事项发生的费用等不列入集合计划费用。

（三） 管理人业绩报酬

管理人负责计算和复核业绩报酬，于每个业绩报酬计提日计提业绩报酬，由托管人按照管理人指令从本集合计划资产中一次性支取，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。当发生业绩报酬计算错误时，由管理人负责处理。由此给集合计划投资者和集合计划造成损失的，由管理人承担相应责任。

（四） 集合计划的税收

本集合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。

十四、 差错及其处理

（一） 差错类型

本计划运作过程中，如果由于管理人、托管人、注册登记机构、或代理销售机构或投资者自身的过错造成差错，导致其他当事人遭受损失的，过错的责任人应当对由于该差错遭受损失的当事人（“受损方”）按下述“差错处理原则”承担赔偿责任并给予赔偿。

上述差错的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、下达指令差错、系统故障差错、因技术原因引起的差错等，其中系统故障差错、因技术原因引起的差错属于不可抗力，按不可抗力的约定执行。本协议第九章“资产净值估算与会计核算”所述的估值错误根据该章所述原则和办法处理差错。

（二） 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财产损失时，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财产损失时，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、资产管理合同或其他规定，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。

（三）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，需要修改注册登记机构的交易数据的，由注册登记机构进行更正，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由差错的责任方进行更正和赔偿损失；

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，并向投资者披露。

十五、 禁止行为

（一） 集合计划管理人、集合计划托管人不得进行现行法律法规、本集合资产管理合同禁止的任一行为；

（二） 除法律法规及中国证监会另有规定，集合计划管理人、集合计划托管人不得利用计划资产为自身和除集合计划投资者以外的任何第三人谋取利益；

（三） 集合计划管理人与集合计划托管人对集合计划经营过程中任何尚未按有关法规规定的方式公开披露的信息，不得对他人泄露，但依据法律、法规、监管规定或因司法、行政等机关要求对外提供，向所聘的审计、法律等外部专业顾问提供的以及本协议另有约定的除外；

（四） 集合计划托管人对集合计划管理人的符合本协议规定的指令不得拖延和拒绝执行；

（五） 除根据集合计划管理人指令或《集合资产管理合同》另有规定的，集合计划托管人不得动用或处分集合计划资产；

（六） 集合计划托管人、集合计划管理人应在行政上、财务上互相独立，其高级管理人员不得相互兼职；

（七） 《集合资产管理合同》中规定的禁止投资的行为。

十六、 违约责任和责任划分

(一) 如果由于集合计划管理人或集合计划托管人的过错, 造成本协议不能履行或者不能完全履行的, 由有过错的一方承担违约责任; 如果由于双方的过错, 造成本协议不能履行或者不能完全履行的, 根据实际情况, 由双方分别承担各自应负的违约责任。

(二) 本协议当事人应保证向本协议另一方提供的数据、信息真实完整, 并承担相应的法律责任。如果本协议一方当事人提供的信息和数据不真实或不完整是由于另一方提供的数据或信息不真实、不完整等原因所致, 由此造成的损失由初始过错方承担。

(三) 本协议任何一方当事人的违约行为给集合计划资产造成实际损害的, 违约方应承担赔偿责任, 但是发生下列情况, 当事人可以免责:

1、管理人按照本协议约定的投资方向和内容如实履行投资运作职责但本集合计划资产却未能实现盈利的;

2、托管人按照本协议约定履行了托管职责, 对于由此导致的集合计划资产损失;

3、托管人对存放或存管在托管人以外的机构的集合计划资产以及交由证券公司、期货公司等其他机构负责清算交收的资产(包括但不限于期货保证金、合约等)及其收益, 因该机构故意、欺诈、疏忽、过失、破产等原因给集合计划资产造成的损失;

4、管理人及托管人对由于第三方(包括但不限于交易所、登记公司、期货公司等)发送的数据错误给计划资产造成的损失等。

5、发生本协议规定的不可抗力事项的。

(四) 当事人一方违约, 另一方在职责范围内有义务及时采取必要的措施, 尽力防止损失的扩大。

(五) 违约行为虽已发生, 但本托管协议能够继续履行的, 在最大限度地保护集合计划投资者利益的前提下, 集合计划管理人和集合计划托管人应当继续履行本协议。

（六）由于本协议一方当事人违约给本协议另一方当事人及其管理或托管的资产造成的损失由违约方承担赔偿责任。

（七）如果由于本协议一方当事人（违约方）的违约行为给集合计划资产或集合计划资产投资者造成损失，而另一方当事人（守约方）依据法院判决、仲裁裁决对集合计划资产或集合计划投资者承担了赔偿责任，赔偿了集合计划资产或集合计划投资者的损失，则守约方有权向违约方追索，违约方应赔偿和补偿守约方由此发生的费用支出及由此遭受的损失。

（八）由于不可抗力原因，集合计划管理人或集合计划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，由此造成集合计划资产或集合计划投资者损失，集合计划管理人或集合计划托管人免除赔偿责任。但集合计划管理人和集合计划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。

（九）本协议所指损失均为直接损失。

十七、 适用法律与争议解决

(一) 本协议适用中华人民共和国法律并从其解释。

(二) 计划管理人、计划托管人之间因本协议产生的或与本协议有关的争议可首先通过友好协商或调解解决，托管协议当事人不愿通过协商、调解解决或协商、调解不成的，则任何一方有权将争议提交管理人所在地有管辖权的法院进行诉讼。

(三) 除提交诉讼的争议之外，各方当事人仍应履行本协议的其他规定。争议处理期间，双方当事人应恪守计划管理人和计划托管人职责，各自继续忠实、勤勉、尽责地履行《集合资产管理合同》和托管协议规定的义务，维护计划持有人的合法权益。

十八、 托管协议的效力和文本

（一） 本协议经双方当事人盖章以及双方法定代表人/负责人或授权签字人签字，并报中国证券投资基金业协会备案（同时抄送管理人住所地中国证监会派出机构）后生效。本协议的有效期自生效日起至第十九条第（二）款所述之情形发生时止。

（二） 托管人的托管职责以本协议的约定为准，如《集合资产管理合同》、说明书与本协议不一致，相关约定以本协议为准。

（三） 本协议一式肆份，管理人执壹份，托管人执贰份，上报监管部门壹份，每份具有同等法律效力。

十九、 托管协议的修改、终止和资产清算

(一) 本协议双方当事人经协商一致,可以对协议进行修改。

(二) 发生以下情况,本托管协议终止:

- 1、集合计划终止;
- 2、本集合计划更换集合计划托管人;
- 3、发生《指导意见》、《管理办法》、《管理规定》或其他法律法规规定的终止事项。

(三) 计划终止后的资产清算

1、集合计划的清算小组

自发生终止情形之日起5个工作日内开始组织清算资产管理计划资产,成立清算小组,管理人组织集合计划财产清算小组并进行集合计划清算。

①集合计划财产清算小组组成:集合计划财产清算小组成员由管理人、托管人组成。集合计划财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

②集合计划财产清算小组职责:集合计划财产清算小组负责集合计划财产的保管、清理、估价、变现和分配。集合计划财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。

2、集合计划清算程序

①《资产管理合同》终止情形出现时,由集合计划财产清算小组统一接管集合计划;

②对集合计划财产和债权债务进行清理和确认;

③对集合计划财产进行估值和变现;

④制作清算报告;

⑤聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计;

⑥将清算报告在管理人网站公布,报证券投资基金业协会备案,并抄报中国证监会相关派出机构;

⑦对集合计划剩余财产进行分配。

3、清算费用

清算费用是指集合计划财产清算小组在进行集合计划清算过程中发生的所

有合理费用，清算费用由集合计划财产清算小组优先从集合计划财产中支付。

4、集合计划剩余资产的分配

清算结束后 15 个工作日内，管理人和托管人应当在扣除清算费用、管理费、业绩报酬及托管费等费用后，将集合计划资产按照投资者拥有集合计划份额的比例或集合资产管理合同的约定或其他合理方式以货币资金的形式全部分派给投资者。

5、资产管理计划延期清算处理方式

若本集合计划在终止之日有未能流通变现的资产，清算小组应在该资产可流通变现时及时变现，在计提相关费用后按本集合计划投资者持有的计划份额比例进行再次分配并履行相应的告知义务，直至所有未能流通变现的资产全部清算完毕。资产管理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证券投资基金业协会报告。

6、资产管理计划财产清算报告的告知安排

清算结束后 5 个工作日内由管理人或集合计划清算小组在管理人网站公布清算结果，报证券投资基金业协会备案，并抄报中国证监会相关派出机构。

7、资产管理计划财产相关账户注销中的职责及相应的办理程序

托管人按照规定注销资产管理计划财产的托管账户等投资所需账户，管理人应给予必要的配合。

8、资产管理计划财产清算账册及文件由管理人保存 20 年以上。

9、集合计划的清算安排应当符合相关法律、法规、政策的规定。

二十、 其他事项

本协议未尽事宜，当事人依据《集合资产管理合同》、有关法律、法规和规定协商办理。

二十一、 托管协议签章页

(本页无正文，为《海通资管稳健精选 1 号 FOF 集合资产管理计划资产托管协议》签字页)

集合计划管理人：上海海通证券资产管理有限公司（公章）



蔡晋江

法定代表人或授权签字人：

签订日： 年 月 日

(本页无正文，为《海通资管稳健精选 1 号 FOF 集合资产管理计划资产托管协议》签字页)

集合计划托管人：交通银行股份有限公司上海市分行（合同专用章）



负责人或授权签字人：



签订日： 年 月 日

附件 1

投资监督事项表

本集合计划托管人按照本投资监督事项表的约定对管理人的投资进行监督。

(一) 投资范围和投资比例

(1) 投资范围:

本集合计划投资范围主要为公开募集证券投资基金以及中国证监会认可的比照公募基金管理的资产管理产品, 包括股票型基金(仅包含指数型基金和 ETF 基金)、混合型基金、债券型基金、货币市场基金, 剩余资产可以投资于国内依法发行的国债、地方政府债、央行票据、金融债、政策性金融债、企业债、公司债、可转换公司债(含可分离交易可转债)、可交换债券、各类债务融资工具(如短期融资券和超短期融资券、中期票据、集合票据、集合债券、PPN 等)、资产支持证券、国债期货、债券回购、大额可转让定期存单、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单、现金以及法律法规或中国证监会允许投资的其他品种。

受限于外部数据提供商的原因, 中国证监会认可的比照公募基金管理的资产管理产品暂无分类标准, 该类资产由管理人认定, 并向托管人提供。

(2) 资产配置比例

本计划为基金中基金(FOF)资产管理计划, 投资于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占计划资产总值的比例不低于 80%。

1) 债权类资产: 占集合计划资产总值的 80-100%; 包括债券型基金、货币市场基金、国内依法发行的国债、地方政府债、央行票据、金融债、政策性金融债、企业债、公司债、可转换公司债(含可分离交易可转债)、可交换债券、各类债务融资工具(如短期融资券和超短期融资券、中期票据、集合票据、集合债券、PPN 等)、资产支持证券、债券逆回购、大额可转让定期存单、银行存款、同业存单、现金;

2) 股权类资产: 占集合计划资产总值的 0-20%; 包括混合型基金、股票型基金(仅包含指数型基金和 ETF 基金)等;

3) 投资于金融衍生品的持仓合约价值轧差计算不超过资产管理计划总资产

的 80%，且衍生品账户权益不超过资产管理计划总资产的 20%；

4) 债券正回购：债券正回购融入资金余额不超过计划前一日资产净值的【40%】。

(二) 为维护集合计划投资者的合法权益，本集合计划的投资限制为：

为维护投资者的合法权益，本集合计划的投资限制为：

(1) 本集合计划投资同一资产的资金，不超过本集合计划资产净值的 20%；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；

(2) 管理人管理的全部资产管理计划合计持有单一上市公司发行的股票不得超过该上市公司可流通股票的 30%；

(3) 在开放退出期内，7 个工作日内可变现资产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本计划资产净值的 20%；

(4) 本计划投资债券的债项评级必须为 AA 及以上（短期融资券、超短期融资券除外），若无债项评级的，则以主体评级为准，主体评级必须为 AA 及以上；

(5) 本集合计划投资的可债券、可交债不得转股；

(6) 短期融资券、超短期融资券债项评级为 A-1 级（若如无债项评级的，则以主体评级为准，主体评级必须为 AA 及以上）；

(7) 所有非公开方式发行的债券（包括非公开发行公司债、非公开项目收益债及非公开定向债务融资工具（PPN））的投资比例不超过计划资产总值的 50%；所有可转换债券、可交换债券、资产支持证券的投资比例不超过资产总值的 20%；

(8) 本集合计划的总资产占净资产的比例不超过 140%，中国证监会另有规定的除外；

(9) 本集合资产管理计划投资资产支持证券的限制要求如下：

1) 资产支持证券仅可投资于优先级份额且信用评级不低于 AA+，投资比例不超过计划资产总值的 20%；

2) 仅投资于在上海/深圳证券交易所挂牌的资产支持证券。

(10) 债券正回购、逆回购：本集合计划的债券正回购资金余额或逆回购资金余额不得超过集合计划前一日资产净值的 40%。

以上评级均不采用中债资信评估有限责任公司提供的评级结果。

(11) 本计划投资于其他资产管理产品的，计算本计划的总资产应当按照穿透原则合并计算所投资资产管理产品的总资产。

本计划应当按照所投资资产管理产品披露投资组合的频率，及时更新计算本计划所投资资产的金额或者比例。

附件 2

海通资管稳健精选 1 号 FOF 集合资产管理计划托管报告（格式 1）

本计划托管人——交通银行股份有限公司上海市分行根据《海通资管稳健精选 1 号 FOF 集合资产管理计划托管协议》（以下简称《托管协议》），在托管海通资管稳健精选 1 号 FOF 集合资产管理计划的过程中，严格遵守《指导意见》、《管理办法》、《管理规定》及有关法律法规，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害本计划份额持有人利益的行为。

年月日至月日，计划管理人——上海海通证券资产管理有限公司在海通资管稳健精选 1 号 FOF 集合资产管理计划的投资运作、计划资产净值的计算、计划费用开支问题上，托管人未发现损害计划份额持有人利益的行为。

计划管理人所编制,并经托管人复核的《海通资管稳健精选 1 号 FOF 集合资产管理计划》年第季度（或年度）资产管理报告中的主要财务指标、净值表现、会计报表/告（若有）、投资组合报告、重大关联交易（若有）等信息真实、准确。

交通银行股份有限公司上海市分行资产托管部

年月日

海通资管稳健精选 1 号 FOF 集合资产管理计划托管报告（格式 2）

本计划托管人——交通银行股份有限公司上海市分行根据《海通资管稳健精选 1 号 FOF 集合资产管理计划资产托管协议》（以下简称《托管协议》），在托管海通资管稳健精选 1 号 FOF 集合资产管理计划的过程中，严格遵守《指导意见》、《管理办法》、《管理规定》及有关法律法规，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害计划份额持有人利益的行为。

年月日至月日，计划管理人——上海海通证券资产管理有限公司在海通资管稳健精选 1 号 FOF 集合资产管理计划的计划资产净值的计算、计划费用开支问题上，托管人未发现损害计划份额持有人利益的行为。由于市场波动等原因，个别工作日托管人发现海通资管稳健精选 1 号 FOF 集合资产管理计划个别监督指标不符合《托管协议》的约定，托管人及时通知了计划管理人，计划管理人根据规定进行了调整。

计划管理人所编制,并经托管人复核的《海通资管稳健精选 1 号 FOF 集合资产管理计划》年第季度（或年度）资产管理报告中的主要财务指标、净值表现、会计报表/告（若有）、投资组合报告、重大关联交易（若有）等信息真实、准确。

交通银行股份有限公司上海市分行资产托管部

年月日

附件 3

划款指令（样本）

海通证券专用表

编号:XXXXX		201 年月日		
管 理 人 填 写:	*请于 201 年月日时前支付下列款项:			
	*金额大写:			
	*金额小写:			
	付	*账户名:	收	*账户名:
	方	*账户号:	方	*账户号:
	信	*开户银行:	信	*开户银行:
	息	大额支付号:	息	大额支付号:
	*资金用途			
	备注: *附件共页请将划款凭证复印件传真至:			
	*管理人在托管人处预留印鉴:		*经办:	*审批
		*复核:		
托 管 人 填 写:	*托管人签收回执(本回执表示托管人已经收到本传真,但并不表示托管人对传真内容明示或默示的认可或处理。)			
	*签收人:		*签收时间	
	*经办:		*产品在银行处预留印 鉴	
	*复核:			
	*审批:			
银 行 填 写:	*处理意见或结果(*附凭证共页):			
	(盖银行业务印鉴)			

开放式基金投资业务操作规程

第一章 总则

根据管理人与托管人签订的海通资管稳健精选 1 号 FOF 集合资产管理计划的资产管理合同及托管协议,为明确计划管理人和计划托管人在基金产品投资开放式基金的账户开立、投资运作、资产保管及业务监督等操作事宜的具体要求,制定本操作规程。

第二章 日常操作

第一条 账户开立。

(一) 基金直销账户的开立

1. 管理人负责在产品计划投资的基金公司开立直销账户,该账户名下资产的管理和运用由管理人负责。管理人和托管人不得出借或转让产品的任何基金账户,亦不得使用产品的任何账户进行产品投资以外的活动。

2. 管理人在完成账户开立后,应及时将账户开户确认书加盖管理人预留印章后发送托管人。

3. 基金账户指定的银行存款账户须为相对应的托管银行结算账户。

(二) 基金代销账户的开立

1. 管理人负责在代销机构上海天天基金销售有限公司(以下简称“天天基金”)开立基金账户,该账户名下资产的管理和运用由管理人负责。管理人和托管人不得出借或转让产品的任何基金账户,亦不得使用产品的任何账户进行产品投资以外的活动。

2. 管理人在完成账户开立后,应及时将账户开户确认书加盖管理人预留印章后发送托管人。

3. 管理人负责代销机构的选择和审核,因天天基金出现违法、违规行为影响产品投资运作、资产安全的,托管人一律免责。

4. 基金账户指定的银行存款账户须为相对应的托管银行结算账户。

第二条 日常交易

(一) 通过代销机构为产品进行基金申赎的,日常交易流程补充约定如下:

1、基金申购：

(1) 管理人在基金申购日(T日)向托管人发送《付款指令》和向代销机构出具的《开放式基金申购申请书》，托管人在规定的时间内进行划款。

(2) 代销机构在T+1日(非QDII基金)或T+2日(QDII基金)16:00前向管理人和托管人发送《开放式基金申购确认单》，如果托管人没有收到以上确认单，管理人有义务将从代销机构取得的确认单及时转发给托管人。管理人与托管人依据确认单进行后续的会计处理。在管理人没有特别告知的情况下，托管人默认非QDII基金都是在T+1日进行申购份额确认，默认QDII基金都是在T+2日进行申购份额确认，如个别基金不能在T+1日(非QDII基金)或T+2日(QDII基金)确认，管理人应提前通过书面形式告知托管人，并明确确认日期。

2、基金赎回：

代销机构在赎回确认日16:00前向管理人和托管人发送《开放式基金赎回确认单》，如果托管人没有收到以上确认单，管理人有义务将从代销机构取得的确认单转发给托管人。管理人与托管人依据确认单进行后续的会计处理。在管理人没有特别告知的情况下，托管人默认非QDII基金都是在T+1日进行赎回金额确认，默认QDII基金都是在T+2日进行赎回金额确认，如个别基金不能在T+1日(非QDII基金)或T+2日(QDII基金)确认，管理人应提前通过书面形式告知托管人，并明确确认日期。

托管银行结算账户收到基金赎回款当日，代销机构未向管理人和托管人发送《开放式基金赎回确认单》的，管理人应通过书面方式向托管人确认相关基金赎回确认信息进行会计处理，下一交易日取得《开放式基金赎回确认单》发送托管人。

3、基金分红：

(1) 基金(非货币基金)的分红方式选择红利转投的，代销机构应在红利到账日16:00前向管理人和托管人发送《开放式基金分红确认单》，如果托管人没有收到以上确认单，管理人有义务将从代销机构取得的确认单转发给托管人。管理人与托管人依据确认单进行后续的会计处理。

(2) 对于货币基金，代销机构在红利到账日16:00前向管理人和托管人发送《货币基金分红确认单》，如果托管人没有收到以上确认单，管理人有义务将

从代销机构取得的确认单转发给托管人。管理人与托管人依据确认单进行后续的会计处理。

4、基金转换：

代销机构在基金转换确认日 16:00 前向管理人和托管人发送《开放式基金转换确认单》，如果托管人没有收到以上确认单，管理人有权义务将从代销机构取得的确认单转发给托管人。管理人与托管人依据确认单进行后续的会计处理。管理人应确认代销机构基金转换完成日期，并敦促代销机构及时发送《开放式基金转换确认单》。

5、基金的账实核对工作：

(1) 代销机构应在月初的 5 个工作日内，向管理人和托管人发送上月基金对账单。管理人和托管人在收到对账单后应进行账实核对，如发现问题应共同查明原因，并进行后续处理。

(2) 代销机构不能每月提供对账单的，管理人应向托管人出具书面说明，同时告知出具对账单的频率和时间，原则上频率不低于季度。

(3) 在账实核对一致的情况下，如代销机构提供的对账单上记载的基金份额与实际登记在基金公司的份额不一致的，由此给产品资产造成的损失，托管人不承担相应责任。

6、其他规定：

(1) 对由于代销机构发送确认单不及时而对托管的产品净值造成影响的，托管人不承担相应责任。

(二) 通过直销机构申赎基金的情况，日常交易流程补充约定如下：

1、基金申购：

(1) 管理人在基金申购日 (T 日) 向托管人发送《付款指令》和向直销机构出具的《开放式基金申购申请书》，托管人在规定的时间内进行划款。

(2) 管理人在 T+1 日 (非 QDII 基金) 或 T+2 日 (QDII 基金) 向托管人发送《开放式基金申购确认单》。管理人与托管人依据确认单进行后续的会计处理。在管理人没有特别告知的情况下，托管人默认非 QDII 基金都是在 T+1 日进行申购份额确认，默认 QDII 基金都是在 T+2 日进行申购份额确认，如个别基金不能在 T+1 日 (非 QDII 基金) 或 T+2 日 (QDII 基金) 确认，管理人应提前通过书面

形式告知托管人，并明确确认日期。

2、基金赎回：

管理人在确认日向托管人发送《开放式基金赎回确认单》。管理人与托管人依据确认单进行后续的会计处理。在管理人没有特别告知的情况下，托管人默认非 QDII 基金都是在 T+1 日进行赎回金额确认，默认 QDII 基金都是在 T+2 日进行赎回金额确认，如个别基金不能在 T+1 日（非 QDII 基金）或 T+2 日（QDII 基金）确认，管理人应提前通过书面形式告知托管人，并明确确认日期。

托管银行结算账户收到基金赎回款当日，管理人未取得《开放式基金赎回确认单》的，管理人应通过书面方式向托管人确认相关基金赎回确认信息进行会计处理，下一交易日取得《开放式基金赎回确认单》发送托管人。

3、基金分红：

(1) 基金（非货币基金）的分红方式选择红利转投的，管理人应在红利到账日 16:00 前向托管人发送《开放式基金分红确认单》，管理人与托管人依据确认单进行后续的会计处理。

(2) 对于货币基金，管理人在红利到账日 16:00 前向托管人发送《货币基金分红确认单》，管理人与托管人依据确认单进行后续的会计处理。

4、基金转换：

管理人在基金转换确认日 16:00 前向托管人发送《开放式基金转换确认单》，管理人与托管人依据确认单进行后续的会计处理。管理人应询问直销机构基金转换完成日期，及时索取《开放式基金转换确认单》发送托管人。

5、基金的账实核对工作：

(1) 管理人应在月初的 5 个工作日内，向托管人发送上月基金对账单。管理人和托管人根据基金对账单进行账实核对，如发现问题应共同查明原因，并进行后续处理。

(2) 直销机构不能每月提供对账单的，管理人应向托管人出具书面说明，同时告知出具对账单的频率，原则上频率不低于季度。