

**华安理财洽洽食品增持 1 号  
集合资产管理计划  
资产管理合同**

**二〇一五年七月**

## 目 录

一、前言	1
二、释义	1
三、合同当事人	3
四、集合资产管理计划的基本情况	4
五、集合计划的参与和退出	6
六、管理人自有资金参与集合计划	7
七、集合计划份额的分级	7
八、优先级保障	9
九、集合计划客户资产的管理方式和管理权限	10
十、集合计划的成立	10
十一、集合计划账户与资产	10
十二、集合计划资产托管	12
十三、集合计划的估值	12
十四、集合计划的费用支出	14
十五、集合计划的收益分配	15
十六、投资理念与投资策略	16
十七、投资决策与风险控制	16
十八、投资限制及禁止行为	20
十九、集合计划的信息披露	21
二十、集合计划份额的转让、非交易过户和冻结	22
二十一、集合计划的展期	22
二十二、集合计划终止和清算	23
二十三、当事人的权利和义务	24
二十四、违约责任与争议处理	27
二十五、风险揭示	27
二十六、合同的成立与生效	29
二十七、合同的补充、修改与变更	29
二十八、或有事件	30

## 一、前言

为规范华安理财洽洽食品增持 1 号集合资产管理计划(以下简称“集合计划”或“计划”)运作,明确《华安理财洽洽食品增持 1 号集合资产管理计划资产管理合同》(以下简称“本合同”)当事人的权利与义务,依照《中华人民共和国合同法》、《证券公司客户资产管理业务管理办法》(以下简称《管理办法》)、《证券公司集合资产管理业务实施细则》(以下简称《细则》)、《证券公司客户资产管理业务规范》(以下简称《规范》)等法律法规、中国证监会和中国证券业协会的有关规定,委托人、管理人、托管人在平等自愿、诚实信用原则的基础上订立本合同。本合同是规定当事人之间基本权利义务的法律文件,当事人按照《管理办法》、《细则》、《华安理财洽洽食品增持 1 号集合资产管理计划说明书》(以下简称《说明书》)、本合同及其他有关规定享有权利、承担义务。

委托人承诺以真实身份参与集合计划,保证委托资产的来源及用途合法,所披露或提供的信息和资料真实,并已阅知本合同和集合计划说明书全文,了解相关权利、义务和风险,自行承担投资风险和损失。

管理人承诺以诚实守信、审慎尽责的原则管理和运用本集合计划资产,但不保证本集合计划一定盈利,也不保证最低收益。

托管人承诺以诚实守信、审慎尽责的原则履行托管职责,安全保管客户集合计划资产、办理资金收付事项、监督管理人投资行为,但不保证本集合计划资产投资不受损失,不保证最低收益。

## 二、释义

除非文义另有所指,本合同中下列词语或简称具有如下含义:

- 1、**计划、集合计划或本集合计划**:指华安理财洽洽食品增持 1 号集合资产管理计划。
- 2、**说明书**:指本《华安理财洽洽食品增持 1 号集合资产管理计划说明书》及其的任何有效修订和补充。
- 3、**《集合资产管理合同》**:指《华安理财洽洽食品增持 1 号集合资产管理计划资产管理合同》及其的任何有效修订和补充。
- 4、**《管理办法》**:指经中国证监会批准发布并于 2013 年 6 月 26 日实施的《证券公司客户资产管理业务管理办法》。
- 5、**《细则》**:指经中国证监会批准发布并于 2013 年 6 月 26 日实施的《证券公司集合资产管理业务实施细则》。
- 6、**《业务规范》**:指经中国证券业协会批准发布并于 2012 年 10 月 19 日实施的《证券公司客户资产管理业务规范》。
- 7、**元**:指人民币元。
- 8、**中国证监会**:指中国证券监督管理委员会。
- 9、**管理人**:指华安证券股份有限公司。
- 10、**托管人**:上海浦东发展银行股份有限公司
- 11、**推广机构**:华安证券股份有限公司、上海浦东发展银行股份有限公司。
- 12、**份额登记机构**:指办理本计划份额登记业务的机构。本计划的份额登记机构为中国证

券登记结算有限责任公司。

- 13、**注册登记业务**：指本计划登记、存管、过户、清算和交收业务，具体内容包括委托人集合计划账户的建立和管理、份额注册登记、清算、发放红利、建立并保管委托人名册等。
- 14、**《集合资产管理合同》当事人**：指受《集合资产管理合同》及说明书的约束，根据《集合资产管理合同》及说明书享受权利并承担义务的法律主体，包括管理人、托管人、委托人。
- 15、**委托人**：指根据《集合资产管理合同》及说明书合法取得集合计划份额的合格个人投资者或合格机构投资者。
- 16、**个人投资者**：指依法投资于集合资产管理计划且个人或者家庭金融资产合计不低于 100 万元人民币的合格投资者。
- 17、**机构投资者**：指依法投资集合资产管理计划，在中华人民共和国境内合法注册登记或经有关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合格境外机构且净资产不低于 1000 万元人民币的合格投资者。
- 18、**集合计划账户**：指份额登记机构为委托人开立的、记录其持有的集合计划份额余额及其变动情况的账户。
- 19、**交易账户**：指投资者在办理认购/申购时，在推广机构开设的资金账户，用于投资者参与、退出、分红及清算本集合计划资金的划拨。
- 20、**优先级份额**：本计划优先级份额，也称 A 类份额，根据本合同的规定获取预期收益。
- 21、**次级份额**：本计划次级份额，也称 B 类份额。本计划在扣除优先级份额的应计收益后的全部剩余收益归次级份额享有，亏损以次级份额的资产净值为限由次级份额承担。
- 22、**成立日**：本集合计划推广期结束后，集合计划的 A 类份额累计认购不低于 2000 万份且 B 类份额累计认购不低于 1000 万份且其委托人的人数为 2 人（含 2 人，其中 A 类份额和 B 类份额委托人均不少于 1 人）以上，并经管理人聘请的具有证券相关业务资格的会计师事务所对集合计划进行验资并出具验资报告后，管理人公告本集合计划成立。
- 23、**推广期**：指本集合计划自开始推广到推广完成之间的时间段，具体时间见有关公告。
- 24、**工作日**：指上海证券交易所和深圳证券交易所的正常交易日。
- 25、**T**：指本集合计划约定的特定日。
- 26、**T+n 日**(n 指任意正整数)：指本集合计划约定的特定日之后（不包括 T 日）第 n 个工作日。
- 27、**开放期**：指本集合计划存续期内委托人可以申请办理退出或申购参与的期间。
- 28、**会计年度**：指公历每年 1 月 1 日起至当年 12 月 31 日为止的期间。
- 29、**集合计划份额**：指委托人对集合计划享有资产所有权、收益分配权和其他相关权利，并承担相应义务的基本计量单位。
- 30、**集合计划份额面值**：人民币 1.00 元。
- 31、**认购**：指在计划推广期内，投资者购买集合计划份额的行为。

- 32、**申购**：指在计划开放期内，投资者购买集合计划份额的行为。
- 33、**参与**：指委托人申请购买本集合计划份额的行为。
- 34、**退出**：指委托人在集合计划开放期申请部分或全部退出集合计划的行为，不包括委托人在本集合计划终止时收回资产的行为。
- 35、**收益**：指集合计划投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券差价、银行存款利息以及集合计划的其他合法收入。
- 36、**资产总值**：指集合计划所购买的各类证券、银行存款本息及其他投资所形成的价值总和。
- 37、**资产净值**：指资产总值减去负债后的价值。
- 38、**单位净值**：指集合计划资产净值除以计划总份额。
- 39、**资产估值**：指计算评估集合计划资产的价值，以确定该资产净值和单位净值的过程。
- 40、**法律法规**：指中华人民共和国（为本合同之目的，不包括香港特别行政区、澳门特别行政区及台湾地区）现行有效的法律、行政法规、司法解释、部门规章以及其他对《集合资产管理合同》当事人有约束力的决定、决议、通知等。
- 41、**不可抗力**：指本合同当事人无法预见、无法克服、无法避免，且在本合同签署之后发生的，使本合同当事人无法全部或部分履行本合同的任何事件，包括但不限于相关法律法规的变更；国际、国内金融市场风险事故的发生；战争或动乱、自然灾害、公众通讯设备故障、电力中断、互联网故障等；
- 42、**二次清算**：指本集合计划终止，管理人对集合计划清算后，如有未能流通变现的投资标的，则集合计划在终止后继续持有该未能流通变现的投资标的，当其达到可变现状态时，管理人应立即将其变现，并进行清算分配的过程。
- 43、**关联方**：本说明书和集合资产管理合同所指关联方关系的含义与《企业会计准则第 36 号——关联方披露》中的关联方关系的含义相同。

### 三、合同当事人

委托人

个人填写：

姓名：\_\_\_\_\_证件类型：\_\_\_\_\_证件号码：\_\_\_\_\_

通信地址：\_\_\_\_\_邮政编码：\_\_\_\_\_

联系电话：\_\_\_\_\_移动电话：\_\_\_\_\_电子信箱：\_\_\_\_\_

其他：\_\_\_\_\_

机构填写：

机构名称：\_\_\_\_\_法定代表人：\_\_\_\_\_

通信地址：\_\_\_\_\_ 邮政编码：\_\_\_\_\_

代理人姓名：\_\_\_\_\_ 身份证号码：\_\_\_\_\_ 联系电话：\_\_\_\_\_

其他：\_\_\_\_\_

管理人

机构名称：华安证券股份有限公司

法定代表人：李工

通信地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号

邮政编码：230081

联系电话：0551-65161666

托管人

机构名称：上海市浦东发展银行股份有限公司

法定代表人：吉晓辉

通信地址：中国上海市中山东一路 13 号

联系电话：86-21-63611226

#### 四、集合资产管理计划的基本情况

(一) 名称：华安理财洽洽食品增持 1 号集合资产管理计划

(二) 类型：集合资产管理计划

(三) 目标规模

本集合计划推广期规模上限为 1.5 亿份（不含参与资金利息转增份额，下同），其中，A 类份额的认购规模与 B 类份额的认购规模比例不超过 2:1。

(四) 参与人数

本集合计划的参与人数上限为 200 人。

(五) 投资范围和投资比例

1、投资范围

本集合计划投资范围包括中国境内依法发行的，中国证监会允许集合计划投资的金融品

种，包括国内依法发行的股票（仅投资洽洽食品股票）和现金类资产。

## 2、资产配置比例

（1）权益类资产指根据“洽洽食品股份有限公司员工持股计划”约定的投资标的（依法发行上市的洽洽食品股票），投资比例为 0-100%；

（2）现金类资产：包括银行活期存款、货币市场基金、期限在 1 年内的国债、期限在 7 天内的债券逆回购等，投资比例 0~100%。

如因证券市场波动、证券发行人合并、集合资产管理计划规模变动等管理人之外的因素，造成集合计划投资比例超标，管理人应在超标发生之日起在具备交易条件的 10 个工作日内将投资比例降至许可范围内。如遇限售期等原因导致交易条件不具备，则上述期限自动顺延，具体顺延时间由管理人确定。

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

## （六）管理期限

本集合计划存续期为 24 个月，符合约定条件可以展期。本集合计划实际管理期限由本集合计划所投金融资产变现情况决定，具体情况由管理人在指定网站提前公告。在员工持股计划锁定期届满后，当本集合计划参与投资的金融资产全部变现，即现金类资产占集合计划净值比例为 100%时，管理人有权提前结束本集合计划。

## （七）封闭期、开放期及流动性安排：

### 1、封闭期

除临时开放期外，本集合计划原则上封闭运作，不办理投资者的参与、退出业务。

### 2、开放期

（1）本集合计划原则上不设置开放期，存续期内不办理投资者的参与、退出业务。

（2）临时开放期：当发生合同约定的情况时，管理人可在网站公告设置临时开放期，为集合计划份额委托人办理参与或退出业务。合同约定的情况包括但不限于：合同的补充、修改与变更以及其他可能对集合计划的持续运作产生重大影响的事项；其他管理人认为应当开放的情况等。

临时开放期的具体安排由管理人在指定网站公告。

## （八）集合计划份额面值

人民币 1.00 元。

## （九）参与本集合计划的最低金额

首次参与计划的最低金额为人民币 100 万元；对于已经是本集合计划委托人的投资者，追加参与的金额不设限制。

## （十）本集合计划的风险收益特征及适合推广对象

本计划优先级份额属于低风险证券投资产品，属于保守型证券投资产品；本计划次级份额属于较高风险证券投资产品，属于相对积极型证券投资产品。

本计划优先级份额适合向风险承受能力较低、资产流动性需求不高的投资者；本计划次级份额适合向能够承受一定本金损失、资产流动性需求不高、熟悉金融市场的个人客户或具有资产配置需求的机构投资者。

### （十一）本集合计划的推广

1、推广机构:华安证券股份有限公司、上海浦东发展银行股份有限公司。管理人可根据有关法律法规的要求,选择其他符合要求的推广机构代理销售本集合计划。

#### 2、推广方式

管理人应将集合资产管理合同、集合资产管理计划说明书等正式推广文件,以纸质方式置于推广机构营业场所。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,推荐与客户风险承受能力相匹配的集合计划,引导客户审慎作出投资决策。管理人及推广机构应当采取有效措施,并通过管理人、中国证券业协会、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,客观准确披露集合计划备案信息、风险收益特征、投诉电话等,使客户详尽了解本集合计划的特性、风险等情况及客户的权利、义务,但不得通过广播、电视、报刊、互联网及其他公共媒体推广本集合计划。

### （十二）本集合计划的各项费用

1、认购/申购费:0

2、退出费:0

3、管理费:0.15%/年

4、托管费:0.03%/年

5、业绩报酬:0

## 五、集合计划的参与和退出

### （一）集合计划的参与

#### 1、参与的办理时间

推广期内,投资者可以在工作日内参与本集合计划。本集合计划的具体推广期以管理人的推广公告为准。

#### 2、参与的原则

（1）采用金额参与的方式,即以参与金额申请;

（2）所有参与的次级份额资金和优先级份额资金分别对应不同的中登认购/申购代码,即对应不同的参与单位净值。推广期所有投资者以计划面值参与;

（3）推广期内计划 A 类份额募集规模接近达到 1 亿元时,管理人有权根据实际情况提前结束 A 类份额推广期并启动 B 类份额推广期;B 类份额募集规模达到 A 类份额的 1/2 时,管理人可以有权根据实际情况提前结束 B 类份额推广期,并及时向投资者披露。

参与的优先级委托人和次级委托人的资金配比为 2:1。

（4）在推广期前管理人应公告推广期的具体安排,公告内容包括但不限于推广期安排、优先级份额预期收益率等。

#### 3、参与费及参与份额的计算

（1）认购费:0

（2）参与份额的计算方法:

参与份额=参与金额/集合计划单位面值

#### 4、参与资金利息的处理方式



委托人的参与资金在推广期产生的利息划归集合计划收益,优先级的资金在划款认购当日起按合同约定的预期收益率起息。

## (二) 集合计划的退出

本产品存续期不安排优先级份额和次级份额退出。

## 六、管理人自有资金参与集合计划

管理人不以自有资金参与本集合计划。

## 七、集合计划份额的分级

### (一) 分级安排：

本集合计划根据风险收益特征分为 A 类份额（优先级份额）和 B 类份额（次级份额）。

### (二) 份额配比：

本集合计划优先级和次级份额数配比始终为 2 :1 ,但本计划可以接受因利息折算份额、参与资金尾差等原因造成的配比偏离。

### (三) 收益分配：

优先级份额的预期年化收益率为【7.4】%/年,且以份额面值为基准计算,优先级份额自划款认购当日(含)起按约定预期收益率计算收益,于集合计划到期清算时一次性支付。按照本合同约定的集合计划提前终止的情形下,优先级份额的参考年化收益按实际存续天数优先获得。

当发生合同约定的优先级份额本金退出及分配预期收益的情况时,管理人可在网站提前公告。

本计划的收益优先满足优先级份额的预期收益,超出优先级份额预期收益的剩余收益分配给次级份额持有人。本计划收益不足以支付优先级预期收益时,则由次级委托人的本金(含补仓资金)进行支付。如计划的净资产不足以支付优先级的本金和预期收益的,则清算后的计划净资产全部分配予优先级,次级份额持有人或优先级保障人须对差额部分进行补偿。

### (四) 风险控制：

1、为保护全体委托人特别是优先级委托人的利益,本计划以集合计划份额净值为基础设置预警线和止损线。

2、本计划的预警线为【0.91 元/份】

在任一交易日(T 日)收市后,本资产管理计划的单位净值小于等于 0.91 元时,资产管理人将于 T 日收市后通知次级委托人。次级委托人须在 T+2 日 15:00 前追加资金,以弥补本计划的部分投资损失,并确保追加资金后的该日计划资产份额净值不低于 0.91 元。若次级份额持有人没有按照管理人发送的《追加现金通知书》于 T+2 日 15:00 之前按时、足额履行补仓义务的,优先级保障人应当于 T+2 日 15:00 之前对次级份额持有人没有履行或者没有完全履行的部分的补仓义务承担差额补充责任。

追加增强资金金额 $\geq (0.91 - T \text{ 日单位净值}) \times T \text{ 日存续总份额数}$

追加增强资金计入集合计划财产,不增加集合计划的总份额数。追加增强资金前后,集合计划总份额数不变。次级份额持有人或优先级保障人应追加的资金金额最低为 100 万元,并以 10 万元递增,追加完增强资金后,单位净值须高于预警线。

如果次级投资者或优先级保障人没有在上述约定的时间内按照前述约定的要求追加资金，，资产管理人有权按照未追加资金的日万分之五对次级委托人以出资金额计收罚息，罚息（如有）归优先级投资者所有。

## 2、本计划的止损线为【0.86 元/份】

### （1）当股票处于限售期时

在任一交易日（T 日）收市后，本资产管理计划的单位净值小于等于 0.86 元时，资产管理人将于 T 日收市后通知次级投资者，次级投资者须在 T+1 日 10:00 前追加资金，以弥补本计划的部分投资损失，并确保追加资金后的该日计划资产份额净值不低于 0.91 元。若次级份额持有人没有按照管理人发送的《追加现金通知书》于 T+1 日 10:00 之前按时、足额履行补仓义务的，优先级保障人应当于 T+1 日 10:00 之前对次级份额持有人没有履行或者没有完全履行的部分的补仓义务承担差额补充责任。

追加增强资金金额  $\geq (0.91 - T \text{ 日单位净值}) \times T \text{ 日存续总份额数}$

追加增强资金计入集合计划财产，不增加集合计划的总份额数。追加增强资金前后，集合计划总份额数不变。次级份额持有人或优先级保障人应追加的资金金额最低为 100 万元，并以 10 万元递增，追加完增强资金后，单位净值须高于预警线。

如果次级投资者或优先级保障人没有在上述约定的时间内按照前述约定的要求追加资金，自次级份额持有人或优先级保障人未能按照资管合同的约定追加增强资金的下一个交易日起，次级份额持有人即不可撤销地放弃其所持份额并指定由优先级委托人享有，次级份额持有人持有份额所对应的利益将全部向优先受益人进行分配，同时，次级委托人享有的相关权益全部由优先级份额持有人享有。次级份额持有人与优先级份额持有人之间的上述行为为无需另行办理相关手续。自次级份额持有人放弃份额后，本集合计划财产扣除相关费用后全部归属于优先级份额持有人，优先级份额持有人无义务追加增强资金。全体委托人同意，次级份额持有人在前述条件下放弃其持有的份额应被视为其主动承担本集合计划项下的投资风险，而不属于对其违约责任的追究，管理人对次级份额持有人的该等损失亦不承担责任。次级份额持有人在此承诺：次级份额持有人的上述份额放弃的承诺不可撤销、不可变更，并放弃任何抗辩权。

如次级份额持有人或优先级保障人由于电话停机、无人接听等原因导致管理人无法及时通知到次级份额持有人或优先级保障人的，管理人不承担任何责任，仍将按上述约定执行相关操作。

### （2）如股票处于流通状态时

在任一交易日（T 日）收市后，本资产管理计划的单位净值小于等于 0.86 元时，资产管理人将于 T 日收市后通知次级投资者，次级投资者须在 T+1 日 10:00 前追加资金，以弥补本计划的部分投资损失，并确保追加资金后的该日计划资产份额净值不低于 0.91 元。次级份额持有人没有按照管理人发送的《追加现金通知书》于 T+1 日 10:00 之前按时、足额履行补仓义务的，优先级保障人应当于 T+1 日 10:00 之前对次级份额持有人没有履行或者没有完全履行的部分的补仓义务承担差额补充责任。

追加增强资金金额  $\geq (0.91 - T \text{ 日单位净值}) \times T \text{ 日存续总份额数}$

次级份额持有人或优先级保障人应追加的资金金额最低为 100 万元，并以 10 万元递增，

追加完增强资金后，单位净值须高于预警线。

如果次级投资者或优先级保障人没有在上述约定的时间内按照前述约定的要求追加资金，管理人将自 T+1 日 10:00 起进行强制平仓，对集合计划进行变现。管理人将以可变现为第一原则，尽可能地在可变现的交易日内将其完全变现，并将全部证券变现当日为本计划的终止日进行计划财产的清算。在次级份额持有人按时足额追加增强资金前，管理人只接受卖出证券的投资建议。

如次级份额持有人或优先级保障人由于电话停机、无人接听等原因导致管理人无法及时通知到次级份额持有人或优先级保障人的，管理人不承担任何责任，仍将按上述约定执行相关操作。

### 3、补仓资金的提取

当集合计划的份额净值连续 10 个工作日高于 1.100 元以上（含）的，次级份额持有人或者优先级保障人可以向管理人申请提取一定比例的补仓资金，但提取补仓资金之后，资产管理计划的份额净值不得低于 1.000 元。

经管理人同意后，资产管理人在收到申请之日（T 日，含当日）起的 5 个工作日内出具划款指令并通知资产托管人向次级份额持有人或者优先级保障人支付提取资金。

### （五）流动性安排

为确保本资产管理计划到期时资产的顺利变现。本集合计划到期终止前 3 日，管理人将集合计划资产替换为活期存款、货币市场基金、期限不超过 3 天的债券逆回购、到期或回售权行权期限不超过 3 天的债券、现金等短期金融工具或以其他有效形式进行流动性安排，以保证本集合计划到期终止时全部资产以现金形式进行兑付返还。

### （六）A 类份额和 B 类份额集合计划份额净值计算

按照上述本计划资产及收益的分配规则，需对 A 类与 B 类单独进行计划份额净值计算，并按各自的计划份额净值进行资产分配及份额转换。

假设 NAV 为本计划在截止 T 日计划资产净值，NAV<sub>a</sub> 为 T 日 A 类计划份额净值，NAV<sub>b</sub> 为 T 日 B 类计划份额净值。A 类预期年收益率为 R<sub>a</sub>，t 为持有的天数，Y 为 A 类份额数量，L 为 B 类份额数量。

截止当日 T 的计划 A 类与 B 类计划份额净值计算公式如下：

若 T 日计划资产净值能够覆盖 A 类份额本金及预期收益的：

- 1、 $NAV_a = 1 + R_a \times t / 360$
- 2、 $NAV_b = (NAV - Y \times NAV_a) / L$

若 T 日计划资产净值不能覆盖 A 类份额本金及预期收益的：

- 1、 $NAV_a = NAV / Y$
- 2、 $NAV_b = 0$

计算 A 类与 B 类份额净值时，各自保留小数点后 4 位，小数点后第 5 位四舍五入，由此产生的计算误差归入计划资产，并由计划管理人通知计划托管人对账务进行调整。

## 八、优先级保障

根据委托人与洽洽食品股份有限公司控股股东合肥华泰集团股份有限公司的另行约定，洽洽食品股份有限公司控股股东合肥华泰集团股份有限公司（优先级保障人）为本计划次级

份额持有人,按照本合同第八章约定按时、足额履行补仓义务提供不可撤销的差额补充责任。

在主合同项下补仓义务履行期间内,资产管理计划次级份额持有人没有履行或者没有完全履行其补仓义务(补仓义务的具体履行时间和补仓金额,以管理人届时向次级份额持有人发出的《追加现金通知书》为准)的,管理人有权直接要求优先级保障人承担差额补充责任,直至本集合计划份额净值达到预警线或以上。

当本集合计划的份额净值连续 10 个工作日在 1.100 元以上的,且当集合计划触发补仓义务时,优先级保障人均按照合同约定按时、足额履行补仓义务的,优先级保障人可以向管理人申请提取一定比例的补仓资金,但提取补仓资金之后,本集合计划的份额净值不少于 1.000 元。

## 九、集合计划客户资产的管理方式和管理权限

### (一) 管理方式

委托资产的管理方式为委托人向管理人委托资金,由管理人按照本合同约定进行投资管理。委托资金的投资及核算与管理人自有资产及管理人管理的其他资产相互独立。

### (二) 管理权限

委托人授权管理人在本合同的约定的投资范围、委托期限以及投资限制内进行投资管理。管理人并不对委托人的本金和收益作出任何承诺和保证。

## 十、集合计划的成立

### (一) 集合计划成立的条件和日期

本计划推广期终止时,管理人聘请具有证券相关业务资格的会计师事务所对集合计划进行验资,并出具验资报告,若满足计划的成立条件,则在委托人参与资金实际交付并经管理人确认以后,计划即可宣告成立。具体成立日期以管理人公告为准。本计划成立条件:

- 1、推广过程符合法律、行政法规和中国证监会的规定;
- 2、募集资金不低于 3000 万元人民币,不超过 5 亿元人民币;
- 3、参与客户不少于 2 人(含),不超过 200 人;
- 4、符合本合同及说明书的相关约定;
- 5、相关法律、法规规定的其他条件

### (二) 集合计划设立失败

若所有委托人的募集金额总额未达到 3000 万元或委托人少于 2 人,或设立推广期内发生使本集合计划无法成立的不可抗力事件,本集合计划设立失败,管理人应以自有资产承担全部推广费用,将委托人参与资金及期间利息,在推广期结束后 3 个工作日退还给委托人。利息金额以本集合计划注册与过户登记人的记录为准。

### (三) 集合计划开始运作的条件和日期

集合计划成立之日起开始运作,具体成立日期以管理人公告为准。

## 十一、集合计划账户与资产

### (一) 集合计划账户的开立

托管人为本集合计划开立证券账户、资金账户以及其他相关账户。资金账户名称应当是“华安理财洽洽食品增持 1 号集合资产管理计划”,证券账户名称应当是“华安证券 - 浦发银行 - 华安理财洽洽食品增持 1 号集合资产管理计划”,账户名称以实际开立为准。集

合计划资金账户及证券账户，与集合计划管理人、集合计划托管人、集合计划推广机构和集合计划注册登记机构自有财产的账户以及其他集合计划和其他客户财产的账户相互独立。

### 1、指定资金账户

指定资金账户指委托人在推广机构开设的资金账户，用于委托人参与、退出本集合计划的资金划款。委托人在本合同有效期内，不得注销、变更该专用账户，如因故造成变更或撤销账户的，委托人应及时将情况通知推广机构，并根据推广机构的要求履行相应的手续。否则，由此产生的损失由委托人承担。

### 2、集合计划银行托管账户的开立和管理

托管人在其营业机构为集合计划开立专门的托管账户。托管账户的名称为：华安理财洽洽食品增持 1 号集合资产管理计划（以实际开立为准）。该账户预留印鉴由托管人刻制、保管和使用，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。托管银行账户与管理人、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。集合计划资产的一切货币收支活动均通过本集合计划银行账户进行。管理人应配合托管人办理开立账户事宜并提供相关资料。管理人承诺并保证，未经托管人同意不得撤销托管银行账户或变更托管银行账户预留印鉴。

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。

集合计划银行账户的开立和管理应符合《人民币银行结算账户管理办法》、《现金管理条例》、《中国人民银行利率管理的有关规定》、《关于大额现金支付管理的通知》、《支付结算办法》以及中国人民银行、中国银监会的其他规定。

### 3、集合计划证券账户的开立和管理

托管人在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司、深圳分公司为本集合计划分别开立专门的证券账户，用于本集合计划证券投资的清算和存管。集合计划证券账户名称为：华安证券-浦发银行-华安理财洽洽食品增持 1 号集合资产管理计划（以中国证券登记结算有限责任公司规定为准）。托管人对账户业务发生情况进行如实记录。管理人应配合托管人办理开立账户事宜并提供相关资料。

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集合计划的任何证券账户，亦不得使用集合计划的任何账户进行本集合计划业务以外的活动。

集合计划证券账户的开立和证券账户卡的保管由托管人负责，管理和使用由管理人负责。

### 4、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《资产管理合同》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。

## （二）集合计划资产的构成

集合计划的资产包括集合计划所拥有的各类有价值证券、银行存款本息、其他应收的款项

以及其他投资等的价值总和。

其主要构成是：银行存款及其应计利息；清算备付金及其应计利息；应收证券交易清算款；应收参与款；其他根据有关规定缴纳的保证金；股票、债券、基金投资等及其分红或应收利息、应收红利；其他资产等。

### （三）集合计划资产的管理与处分

集合计划资产由托管人托管，并独立于管理人及托管人的自有资产及其管理、托管的其他资产。管理人或托管人的债权人无权对集合计划资产行使冻结、扣押及其他权利。除依照《管理办法》、《细则》、《集合资产管理合同》、《说明书》及其他有关规定处分外，集合计划资产不得被处分。

## 十二、集合计划资产托管

本集合计划资产交由上海浦东发展银行负责托管，并签署托管协议。托管方式为银行托管。托管人的托管职责以托管协议的约定为准，如管理合同、说明书与托管协议冲突，相关约定以托管协议为准。

## 十三、集合计划的估值

管理人应当制订健全、有效的估值政策和程序，并定期对其执行效果进行评估，保证集合资产管理计划估值的公平、合理。

### （一）资产总值

集合计划资产总值是指集合计划投资所形成的各类有价证券、银行存款本息及其他资产的价值总和。

### （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）集合计划单位净值

指集合计划资产净值除以集合计划的份额总数所得的数值。集合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。国家另有规定的，从其规定。

### （四）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单位净值，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

集合计划成立后，管理人与托管人每个工作日均对集合计划资产进行估值。

### （七）估值方法

估值应符合本合同、《证券公司客户资产管理业务规范》中的估值原则、《证券公司客户资产管理业务估值方法指引》、及其他法律、法规的规定，如法律法规未做明确规定的，参照行业通行做法处理。资产管理人、资产托管人的估值数据应依据合法的数据来源独立取得。

#### 1、投资债券的估值方法

（1）同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按不同市场分别按中债估值和市价

估值。

(2) 在证券交易所市场挂牌交易, 按市价估值。

(3) 在对银行间市场的债券品种按中债估值

在任何情况下, 集合计划管理人如采用本项第(1)一(3)小项规定的方法对集合计划资产进行估值, 均应被认为采用了适当的估值方法。但是, 如果集合计划管理人认为按本项第(1)一(3)小项规定的方法对集合计划资产进行估值不能客观反映其公允价值的, 集合计划管理人可根据具体情况与集合计划托管人商定后, 按最能反映公允价值的价格估值。

## 2、投资货币市场工具的估值方法

持有的货币市场基金, 按基金管理公司公布的估值日前一交易日的每万份收益计提红利; 银行定期存款或通知存款以本金列示, 按协议或合同利率逐日确认利息收入。若提前支取或利率发生变化, 将及时进行账务调整。

## 3、投资权益类资产的估值方法

对存在活跃市场的投资品种, 估值日有交易的, 采用估值日的收盘价确定公允价值; 估值日无交易, 但最近交易日后经济环境未发生重大变化, 且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的, 采用最近交易市价确定公允价值。

对存在活跃市场的投资品种, 估值日无交易, 且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件, 使潜在估值调整对资产净值的影响较大的, 可以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, 确定公允价值。

对不存在活跃市场的投资品种, 其潜在估值调整对资产净值的影响较大的, 可以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, 确定公允价值。采用前述估值技术确定公允价值的, 应当尽可能使用市场参与者在定价时考虑的所有市场参数, 并通过定期校验, 确保估值技术的有效性。

运用前述估值技术得出的结果, 应当反映估值日在公平条件下进行正常商业交易所采用的交易价格。

采用前述原则仍不能客观反映相关投资品种的公允价值的, 计划管理人应当根据具体情况与计划托管人进行商定, 按最能反映公允价值的价格估值, 并向客户披露。

## (八) 估值程序

集合计划的日常估值由管理人进行, 托管人复核。用于公开披露的集合计划单位净值由管理人完成估值后, 将估值结果加盖业务章后以书面形式报送托管人, 集合计划托管人进行复核, 托管人复核无误后签章返回给管理人。当管理人与托管人的估值结果不一致时, 各方应本着勤勉尽责的态度重新计算核对。如果仍无法达成一致, 应以管理人的估值结果为准。如因管理人估值错误, 由此给集合计划财产或委托人造成损失的, 由管理人承担责任, 托管人不承担责任。

由于证券交易所、注册登记机构发送的数据错误或其他不可抗力造成估值错误的, 管理人和托管人免于承担责任。

## (九) 估值错误与遗漏的处理方式

集合计划单位净值的计算, 精确到小数点后四位, 小数点后第五位四舍五入。当资产估

值导致本集合计划单位净值或 A 类份额或 B 类份额单位净值小数点后四位以内发生差错时，视为计划单位净值错误。国家另有规定的，从其规定。

管理人和托管人将采取必要、适当、合理的措施确保资产估值的准确性、及时性。当集合计划单位净值发生差错时，管理人和托管人应当予以纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大。错误偏差达到计划资产净值的 0.5% 时，管理人应当通报托管人并立即披露。

因计划单位净值发生估值差错造成计划资产及委托人损失的，由管理人负责先行赔偿，赔偿原则如下：赔偿仅限于因差错而导致的委托人的直接损失；管理人代表本计划保留要求相关当事人返还不当得利的权利；管理人在赔偿后，有权向有关责任方追偿；如果管理人计算的计划单位净值错误，且已由托管人复核确认后披露的，由此给计划或计划委托人造成的损失，就实际支付的赔偿金额，管理人和托管人按照各方的过错程度各自承担相应责任。

管理人按估值方法的第（2）项进行估值时，所造成的误差不作为集合计划单位净值错误处理。

针对净值处理错误，如法律法规或监管机构另有规定的，从其规定办理。

#### （十）暂停估值的情形

当出现下列情形致使集合计划管理人无法准确评估集合计划资产价值时，可暂停估值。但估值条件恢复时，集合计划管理人必须按规定完成估值工作。

- 1、集合计划投资所涉及的证券交易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集合计划管理人、托管人无法准确评估集合计划资产价值时；

#### （十一）特殊情形的处理

由于不可抗力原因或公众通讯设备故障、互联网故障、注册登记机构非正常暂停或终止业务、证券交易所非正常暂停或停止交易、证券交易所、登记结算公司等机构发送的数据错误等非管理人或托管人的原因，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，由此造成计划资产或委托人损失，管理人和托管人可以免除赔偿责任。但管理人和托管人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

### 十四、集合计划的费用支出

#### （一）集合计划费用支付标准、计算方法、支付方式和时间

##### 1、管理费

在通常情况下，集合资产管理费按前一日集合资产净值 0.15% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年管理费率} \div 360$$

备注：H 为每日应计提的集合资产管理费

E 为前一日集合计划资产净值

管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由托管人根据管理人的指令于次月从集合计划资产中一次性支付。

##### 2、托管费

在通常情况下，集合资产的托管费按前一日集合计划资产净值 0.03% 的年费率计提。计算方法如下：



$$H = E \times \text{年托管费率} \div 360$$

备注：H 为每日应计提的集合资产托管费

E 为前一日集合计划资产净值

托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由托管人根据管理人的指令于次月从集合计划资产中一次性支付。

### 3、投资交易费用

投资交易费用指集合计划进行各类投资品种的投资交易而形成的费用,包括但不限于:印花税、交易所经手费、证管费、银行间交易手续费、场外基金办理要求的申购赎回等费用、结算费、过户费、佣金、证券结算风险基金等各项费用,投资交易费用在交易发生时直接计入当期费用;以上各项费用的费率标准按照相关法规政策执行,其中本集合计划支付的佣金费率,由管理人根据有关政策法规确定。

### 4、与本集合计划相关的审计费

在存续期间发生的集合计划审计费用,在合理期间内摊销计入集合计划。

本集合计划的年度审计费,按与会计师事务所签定协议所规定的金额,在被审计的会计期间,按直线法在每个自然日内平均摊销。

### 5、按照国家有关规定可以列入的其他费用

银行结算费用、银行间市场账户维护费、开户费、银行账户维护费、银行间交易费、转托管费、注册与过户登记人收取的相关费用等集合计划运营过程中发生的相关费用。

银行结算费用,在发生时一次计入集合计划费用;

银行间市场账户维护费,按银行间市场规定的金额,在发生时一次性计入费用;

开户费、银行账户维护费、银行间交易费、转托管费在发生时一次计入集合计划费用;

与集合计划运营有关的其他费用,如果金额较小,或者无法对应到相应会计期间,可以在发生时一次进入集合计划费用;如果金额较大,并且可以对应到相应会计期间,应在该会计期间内按直线法摊销。

上述计划费用中第(3)至(5)项费用由管理人根据有关法律法规及相应协议的规定,按费用实际支出金额支付。

#### (二) 不列入集合计划费用的项目

本计划推广期间的费用,管理人、托管人因未履行或未完全履行义务,从而导致的费用支出或本计划资产的损失,以及处理与本计划运作无关的事项而发生的费用,均不列入本计划费用。

## 十五、集合计划的收益分配

### (一) 收益的构成

- 1、投资所得收益;
- 2、买卖证券价差;
- 3、证券持有期间的公允价值变动;
- 4、银行存款利息;
- 5、已实现的其他合法收入。

本集合计划净收益为集合计划收益扣除按照有关规定可以在集合计划收益中扣除的费

用后的余额。

## （二）收益分配原则

本计划分为 A 类份额和 B 类份额两部分，收益分配原则如下：

- 1、每一份 A 类份额享有同等的分配权，每一份 B 类份额享有同等的分配权；
- 2、集合计划存续期间不进行分红，A 类、B 类委托人到期获得收益分配；
- 3、本集合计划到期后 A 类份额按约定的预期收益率，优先获取收益分配。B 类份额享有本集合计划剩余收益。B 类份额为 A 类份额的本金及预期收益提供保证。
- 4、法律、法规或监管机构另有规定的从其规定。

## 十六、投资理念与投资策略

### （一）投资目标

本计划在控制风险和保持资产适当流动性的基础上，通过积极主动的投资管理，力争实现计划资产的长期稳定增值。

### （二）投资理念

通过自上而下的宏观研究和自下而上的个券研究，进行积极投资及合理的资产配置，在有效控制风险的前提下，深入挖掘权益类证券的投资价值，谋求集合资产当期收益和长期稳定增值的统一。

### （三）投资策略

本计划将运用多种积极管理增值策略，重点投资于股票（仅限于洽洽食品股票）和现金类资产，在严格控制信用风险的前提下，追求较高的稳健收益。

#### （1）资产配置策略

本集合计划通过综合分析国内外宏观经济态势、利率走势、信用风险、证券市场估值水平等因素，根据本合同的约定进行主动管理，力争实现委托人资产持续稳健增值。

#### （2）股票投资策略

根据本合同的约定进行主动管理，努力为委托人谋求收益，实现委托人资产持续稳健增值。

#### （3）现金类资产投资策略

本集合计划以市场价值分析为基础，采用稳健的投资组合策略，通过对现金类管理工具的组合操作，在严格控制风险的同时，兼具资产流动性，以追求稳定的当期收益。

## 十七、投资决策与风险控制

### （一）计划的决策依据

计划以国家有关法律、法规和本合同的有关规定为决策依据，并以维护计划委托人利益作为最高准则。具体决策依据包括：

- 1、《管理办法》、《细则》、《规范》、《集合资产管理合同》、《说明书》等有关法律性文件；
- 2、根据宏观经济发展态势、微观经济运行环境和有关经济政策以及证券市场趋势制定投资策略；
- 3、利率走势与通货膨胀预期；
- 4、发债主体信用分析和上市公司价值发现；

5、根据所投资品种的预期收益和风险的匹配关系。

本计划以力争计划的资产安全和流动性为重要衡量标准，在此基础上争取较高的收益。

## (二) 计划的投资程序

严格、明确的投资流程是本计划控制投资风险，进行组合投资的制度保障。本计划采取公司资产管理业务项目准入与投资决策委员会、资产管理部投资决策小组领导下的投资主办负责制。

### 1、决策机构

管理人资产管理业务投资决策机构分为三级：公司资产管理业务项目准入与投资决策委员会、资产管理部投资决策小组和投资主办。

#### (1) 公司资产管理业务项目准入与投资决策委员会

公司资产管理业务项目准入与投资决策委员会是公司客户资产管理业务日常运作的最高决策机构，公司资产管理业务项目准入与投资决策委员会根据分工对公司资产管理业务重要和重大事项进行决策。

公司资产管理业务项目准入与投资决策委员会主要担负以下职能：根据市场状况、公司战略目标和监管要求，在公司董事会的授权范围内，确定资管业务发展方向，审核年度和季度投资计划，确定或调整投资风险限额；在股东大会和董事会的决策范围内，确定或调整公司资产管理业务的投资目标、投资方向、资产配置比例、投资策略；确定资管业务的重要风险控制指标、实时监控以及稽查方案，并组织实施；审核主动投资类、融资类和银证合作等各类资产管理业务产品方案、重要条款变更和产品终止清算方案，确定和调整产品投资主办人选；在规定限额内，研究审批权益类投资按成本计算的投资金额在3000万元以上，固定收益类投资按成本计算的投资金额在5000万元以上的单个品种的投资方案；根据需要，对资产管理部门以及投资人员投资授权权限进行调整；研究审议客户资产管理业务部门提请审议的与客户资产管理业务有关的其他事项。

#### (2) 资产管理部投资决策小组

管理人资产管理部投资决策小组接受公司资产管理业务项目准入与投资决策委员会监督，并根据本计划投资方案和投资范围进行业务运作，严禁突破计划和方案的范围越权经营。主要担负以下职能：具体确定资金运用范围和仓位比例；制定阶段性投资策略；对投资主办上报投资方案进行讨论，并确定最终投资方案；对投资主办行为进行监督和审核等。

#### (3) 投资主办

投资主办人员在公司资产管理业务项目准入与投资决策委员会、资产管理部投资决策小组授权范围内，主要担负以下职能：负责投资方案的具体实施；投资组合的构建与日常管理；交易指令的下达；根据市场变化提请投资决策小组及时对投资策略组织讨论、调整等。

### 2、决策程序

本计划管理人对计划的投资职能由计划管理人资产管理部执行。该部门的整个投资业务流程包括以下环节：确定投资目标和投资原则；开展投资分析与研究；制定投资策略与资产配置比例；进行投资组合管理；交易实施；风险管理与组合的调整。

#### (1) 确定投资目标和投资原则

公司投资决策委员会根据国家有关法律法规的规定、《集合资产管理合同》、公司资产

管理业务有关管理制度，确定本计划投资目标、投资原则以及资产配置原则等。

#### (2) 开展投资分析与研究

资产管理部下属研究部从宏观经济形势、行业发展趋势、市场趋势、投资标的评价结果等多个角度综合分析，运用定性和定量方法进行研究，经过评级、估值和风险评判，通过严格的筛选程序，构建投资对象一级备选库，撰写研究报告和市场投资策略，并根据市场变化情况，适时做出调整。

#### (3) 制定投资策略与资产配置比例

资产管理部投资决策小组综合考虑政治、经济及资本市场状况等因素，根据投资目标、投资原则以及资产配置原则和研究建议，确定投资对象二级备选库，提出投资对象核心备选库名单及调整建议，确定投资策略和将总体资产分配到不同类型资产的比例，并报公司资产管理业务决策小组审议。

#### (4) 进行投资组合管理

投资主办在授权范围内，根据投资策略与资产配置比例，从投资对象备选库中选择合适的投资标的构建投资组合，并负责进行投资组合的日常管理。

#### (5) 交易实施

投资主办根据投资组合管理需要，做出投资决定，通过电子或书面形式向资产管理部下属集中交易室发出交易指令。交易室根据投资限制和市场情况对交易指令进行审查，确认无误后，交易员按交易指令确定的种类、价格、数量、时间予以执行，将交易结果及时反馈投资主办。如果市场和个别证券交易出现异常情况，交易员应及时提示投资主办。

#### (6) 风险管理与组合的调整

在投资决策过程中，公司风险管理部负责对计划的投资限制、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，提供给公司资产管理业务决策小组、公司相关分管领导、资产管理部等相关人员，监督资产管理部对投资组合进行实时调整。资产管理部也设置专门的风控管理岗承担部门内部风险管理工作。

公司风险管理部负责对本计划投资的合规性风险、操作风险、道德风险以及其他风险进行监督和检查，稽核部负责对本计划的运行开展常规稽核和专项稽核。

### (三) 风险控制

#### 1、风险控制原则

公司资产管理业务内部控制应当遵循以下原则：

(1) 合法合规原则。公司资产管理业务内部控制机制以及相关制度必须严格遵守国家法律、法规、规章和相关规定。

(2) 健全性原则。内部控制机制必须覆盖公司与资产管理业务相关的各个部门和各级岗位，并渗透到决策、执行、监督、反馈等各个环节。

(3) 全面性原则。资产管理业务内部控制制度必须涵盖公司资产管理业务的各个环节，并普遍适用于相关岗位的每一个员工，不留有制度上的空白或漏洞。

(4) 有效性原则。通过科学的内控手段和方法，建立合理、切实可行的内部控制程序，维护内部控制制度的有效执行。任何员工不得拥有超越制度约束的权力。

(5) 独立性原则。公司负责资产管理业务的部门和岗位应当保持一定的相对独立性，公司资产管理业务客户资产与公司自有资产、其他资产的运作必须分离。

(6) 相互制衡原则。公司资产管理业务的部门和岗位设置必须权责分明、相互制衡。

(7) 防火墙原则。公司负责资产管理业务的部门和人员与公司投资银行业务、经纪业务、自营业务和固定收益等部门，必须在物理和制度上适当隔离。

(8) 审慎性原则。公司资产管理业务内部控制的核心是风险控制，内部控制机制的建立应以审慎经营、防范和化解风险为出发点。

(9) 适时性原则。公司资产管理业务内部控制制度的制定应当具有前瞻性，并且必须随着公司经营战略、经营方针、经营理念等内部环境的变化和国家法律法规、政策制度等外部环境的变化及时进行相应的修改或完善。

(10) 成本效益原则。公司资产管理业务通过科学的经营管理方法，降低运作成本，提高经济效益，以合理的控制成本，努力实现效益最佳的内部控制效果。

## 2、风险控制体系

公司集合资产管理业务内部控制体系包括内部控制体系主体和内部控制制度体系。

公司内部控制体系的主体包括董事会、董事会风险控制和投资决策委员会、经营管理层、公司资产管理业务项目准入与投资决策委员会、风险管理部、稽核部、法律事务室、资产管理部以及其他相关部门和岗位。公司根据自身经营的特点，设立顺序递进、权责统一、严密有效的四道内部控制防线。包括：

(1) 建立一线岗位自控与互控为基础的第一道内控防线。各岗位责任明确，有详细的岗位职责和业务流程，各岗位人员在授权范围内承担责任。直接与客户、技术系统、资金、有价证券、重要空白凭证、业务用章等接触的岗位，必须严格实行双人负责制度。属于单人单岗处理的业务，原则上由上一级主管履行监督职责。

(2) 建立部门与部门之间、各部门内设部门之间的自控和互控为基础的第二道内控防线。公司在相关部门之间建立合理的重要业务处理凭证传递机制和顺畅的信息传递制度，相关部门分别在授权范围内承担各自职责，并相互监督制衡。各部门在内部自行检查、发现和消除各类风险隐患，规范业务流程，完善内控管理。

(3) 建立风险管理部、稽核部和法律事务室对各部门、各岗位、各项业务全面实施监督反馈的第三道内控防线。风险管理部对业务运作中的风险进行识别、评估、监测、反馈、防范并提出改进建议，对业务风险进行事前审核、事中监测和事后检查，审核和管理合同文本。稽核部对业务经营活动开展常规稽核和非常规稽核，检查和评价公司内部制度的建设和执行情况。法律事务室对重大投资和经营活动提供法律咨询和监督，处理仲裁、诉讼以及其他法律纠纷。

(4) 建立以董事会及董事会风险控制与投资决策委员会、经营管理层、公司资产管理业务项目准入与投资决策委员会为主体的第四道内控防线。董事会及董事会风险控制与投资决策委员会代表董事会对公司集合资产管理业务风险进行总体控制，发现公司内部控制中出现的隐患并组织解决，对公司风险管理部、稽核部等部门的工作予以监督、指导。公司资产管理业务项目准入与投资决策委员会负责贯彻和落实公司资产管理业务有关内控制度，研究确定客户资产投资策略和配置原则，审议投资对象和进行投资授权。

公司内部控制制度体系按照其所管理的层次,由三个层次的制度构成:第一层次是公司章程;第二层次是公司资产管理业务管理和内部控制制度;第三层次是公司资产管理部及相关部门根据业务需要制定的实施细则及操作流程等。

### 3、风险管理程序

风险管理程序包括风险识别、风险测量、风险控制、风险评价和风险报告,以上环节构成了一套完整、紧密、有效的风险管理过程。

风险识别是对管理人所面临的,以及潜在的各种风险加以判断、归类和鉴定风险性质的过程。

风险测量是指估计和预测风险发生的概率和可能造成的损失,并根据这两个因素的结合来衡量风险大小的程度。

风险控制是指通过减少风险的手段和建立必要的内部管理制度,实现以合理的成本在最大限度内防范风险和减少损失。

风险评价是指分析风险识别、风险测量和风险控制的情况和运行效果的过程。

风险报告是指将风险事件及处置、风险评价情况以一定程序进行报告的过程。

### 4、合规检查机制

管理人建立公司和部门合规检查分级管理制度。

公司风险管理部是对资产管理业务进行合规检查的职能部门,对资产管理业务相关部门开展合规检查,并向公司提交合规检查报告。

资产管理部负责人作为第一责任人,对本部门业务风险控制要切实履行相应职责。部门设立合规监督员以独立身份对有关资产管理业务的内部运行定期或不定期进行检查,并向公司风险管理部和资产管理部提交资产管理合规检查内部报告。

## 十八、投资限制及禁止行为

### (一) 投资限制

为维护委托人的合法权益,本集合计划的投资限制为:

1、管理人将其管理的委托人资产投资于本公司及与本公司有关联方关系的公司发行的证券或承销期内承销的证券,或者从事其他重大关联交易的,应当遵循委托人利益优先原则,事先取得委托人的同意,事后告知资产托管机构和委托人,同时向证券交易所报告,并采取切实有效措施,防范利益冲突,保护委托人合法权益。

2、集合计划参与证券回购融入资金余额超过集合计划资产净值的 40%,中国证监会另有规定的除外。

3、股票买卖须遵守本合同约定及《员工持股计划指导意见》相关规定。

4、中国证监会规定的其他行为。

5、本集合资产管理合同约定禁止从事的其他投资。

如法律法规或监管部门修改或取消上述限制,履行适当程序后,本集合计划可相应调整投资组合限制的规定。

### (二) 禁止行为

本集合计划的禁止行为包括:

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低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。

## 十九、集合计划的信息披露

### （一）定期报告

定期报告包括集合计划单位净值报告、集合计划的资产管理季度（年度）报告、托管季度（年度）报告、年度审计报告和对账单。

#### 1、集合计划资产净值报告

自集合计划成立之日起，管理人至少每周在其网站上公布一次集合计划资产净值。

#### 2、集合计划的资产管理季度报告和托管季度报告

管理人每季度向委托人提供资产管理季度报告，托管季度报告在每季度由托管人先行提供给管理人，由管理人代托管人向委托人提供。资产管理季度报告和托管季度报告应对报告期内集合计划资产的配置状况、价值变动、托管情况等作出详细的说明；资产管理季度报告中数据须经托管人复核。上述报告应于每季度结束后的15个工作日内在管理人网站上进行披露。集合资产管理合同生效不满2个月的，可以不编制当期的季度报告。

#### 3、集合计划的资产管理年度报告和托管年度报告

管理人每年度向委托人提供资产管理年度报告，托管年度报告在每年由托管人先行提供给管理人，由管理人代托管人向委托人提供。资产管理年度报告和托管年度报告对报告期内集合计划资产的配置状况、价值变动、托管情况等作出详细的说明；资产管理年度报告中数据须经托管人复核。上述报告应于每会计年度结束后的3个月内在管理人网站上进行披露。集合资产管理合同生效不满3个月的，可以不编制当期的年度报告。

### （4）年度审计报告

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本集合计划的运营情况进行年度审计，并在每年度结束之日起3个月内将审计报告提供给托管人，通过管理人网站向委托人提供。

### （5）对账单

在集合计划成立后，管理人应当每月至少向委托人提供一次书面或电子对账单，说明集合计划的差异性和风险，委托人持有集合计划份额的数量及净值，参与、退出明细，以及收益分配等情况。对账单的提供形式为邮寄或电子邮件，委托人可以选择提供方式，默认的提供方式为电子形式（管理人将根据实际情况选择使用电子邮件、手机信息、管理人网站服务等方式）。

## 2、临时报告

集合计划存续期间，发生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，管理人通过管理人网站及时向客户披露。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主办人员发生变更，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) 合同的补充、修改与变更；

(6) 与集合计划有关的重大诉讼、仲裁事项；

(7) 负责本集合计划的代理推广机构发生变更；

(8) 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；

(9) 管理人、托管人因解散、破产、撤销等原因不能履行相应职责；

(10) 其他根据法律法规和中国证监会的有关规定应当披露的重大事项。

## 二十、集合计划份额的转让、非交易过户和冻结

(一) 集合计划份额的转让

所有集合计划份额不得转让。

受让方首次参与集合计划，应先与管理人、托管人签订集合资产管理合同。

(二) 集合计划份额的非交易过户

所有集合计划份额不得进行非交易过户。

(三) 集合计划份额的冻结

集合计划登记结算机构只受理国家有权机关依法要求的集合计划份额冻结与解冻事项。

## 二十一、集合计划的展期

本集合计划可以展期。

(一) 展期的条件：

1、在存续期间，本集合计划运营规范，管理人、托管人未违反本合同、说明书的约定；

2、展期没有损害委托人利益的情形；

3、托管人同意继续托管展期后的集合计划资产；

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：

(1) 展期备案及公告

本集合计划存续期届满前，管理人可以决定到期清算终止，或展期继续管理本集合计划，本集合计划存续期届满拟展期时，管理人应当于原存续期届满 1 个月前与托管人协商展期事宜。管理人在收到托管人同意展期的书面文件后 5 个工作日内在管理人网站进行公告，通知委托人。

(2) 委托人答复

委托人应当在管理人网站公告后的 20 个工作日内书面或管理人约定的其他方式明确



意见。若委托人不同意展期，委托人有权在本集合计划届满日到推广机构办理退出手续；意见答复不同意展期且逾期未办理退出手续的，管理人有权在存续期届满后将相关份额强制退出计划；逾期未办理退出手续且未有意见答复或答复意见不明确的，视同委托人同意本合同展期，管理人不再另行通知。

## 2、展期的期限

本集合计划展期的期限以展期公告中的展期期限为准。

### （三）展期的安排：

#### 1、通知展期的时间

管理人拟展期的，管理人应当在收到托管人同意展期的书面文件后 5 个工作日内向委托人发送展期提示性公告。

#### 2、通知展期的方式

管理人将通过管理人网站通知委托人。

#### 3、委托人回复的方式

委托人应当在管理人网站公告后的 20 个工作日内以书面或管理人约定的其他方式明确意见。

### （四）委托人不同意展期的处理办法

管理人应对不同意展期的委托人退出事宜作出公平、合理安排。具体措施包括：

（1）若委托人不同意展期，委托人有权在本集合计划届满日到推广机构办理退出手续。

（2）若委托人未在存续期届满日前（含届满日）到推广机构办理退出手续，则管理人有权选择为其办理份额退出。

### （五）展期的实现

截至到期日，如果同意集合计划展期的委托人人数不少于 2 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 3000 万元人民币的，则本集合计划展期将于原存续期届满后第 1 个工作日成立。集合计划展期成立后 5 个工作日内，管理人应当将展期情况报基金业协会备案，并同时抄送管理人住所地中国证监会派出机构。

## 二十二、集合计划终止和清算

### （一）集合计划的终止

集合计划的终止是指由于约定情形的出现，管理人清算集合计划资产并将集合计划剩余资产按本合同约定返还给委托人，同时注销该集合计划的行为。

本集合计划终止时，管理人和托管人应该遵照中国证监会相关规定或指示，采取必要和适当的措施，在扣除管理费、托管费等费用后，将集合计划资产按照本合同的约定，以货币的形式分派给委托人或者委托人以书面形式指定的其他人。如出现下列情形之一，本集合计划应当终止：

1、管理人因重大违法、违规行为，被中国证监会取消业务资格的；

2、托管人因重大违法、违规行为，被监管机构取消业务资格而管理人未在 30 个工作日内与新的托管人签订托管协议的；

3、管理人因停业、解散、破产、撤销等原因不能履行相应职责的；

4、托管人因解散、破产、撤销等原因不能履行相应职责时，管理人未在 30 个工作日

内与新的托管人签订托管协议的；

5、存续期内，任一开放日集合计划委托人少于 2 人时；

6、战争、自然灾害等不可抗力发生导致本集合计划不能存续；

7、本集合计划持有的上市公司股票解禁后，如满足如下任一条件，管理人根据市场情况变现资产，并有权在资产全部变现后提前终止合同：（1）未发生需次级委托人补仓的情形，（2）次级委托人或优先级保障人按照集合资产管理合同约定及时补仓；

8、次级委托人未按照合同约定及时补仓造成违约的，管理人有权在所投资的股票解禁后进行平仓，本合同提前终止；

9、员工持股计划提前结束；

10、本集合计划参与投资的金融资产全部出清，即现金类资产占集合计划净值比例为 100%；

11、法律、法规规定或中国证监会规定的其他情况。

管理人决定终止产品的，应当在当日收市后向客户做出公告，并停止新的投资行为。

## （二）集合计划的清算

1、自集合计划终止之日起 1 个工作日内成立集合计划清算小组，集合计划清算小组按照本合同的约定与监管机构的相关规定进行集合计划清算；

2、清算过程中发生重大事项的，管理人将及时公布；

3、计划终止后三个工作日内，清算小组应当对本集合计划持有的全部非现金资产进行变现，并在扣除管理费、托管费等应由集合计划承担的费用后，对优先级委托人的利益进行返还支付，剩余资产分配给次级委托人；

清算小组完成清算后，应注销集合计划专用证券账户和资金账户；

4、清算结束后 5 个工作日内由集合计划清算小组在管理人网站公布清算结果；

5、管理人在集合计划清算结束后 15 日内，将清算结果向中国证券业协会备案。

## 二十三、当事人的权利和义务

### （一）委托人的权利和义务

#### 1、委托人的权利

（1）取得集合计划收益；

（2）通过管理人网站查询等方式知悉有关集合计划运作的信息，包括资产配置、投资比例、损益状况等；

（3）按照本合同及《说明书》的约定，参与和退出集合计划；

（4）按持有份额取得集合计划清算后的剩余资产；

（5）因管理人、托管人过错导致合法权益受到损害的，有权得到赔偿；

（6）法律法规和中国证监会规定及本合同约定的其他权利。

#### 2、委托人的义务

（1）委托人应认真阅读本合同及《说明书》，并承诺委托资金的来源及用途合法，不得非法汇集他人资金参与本集合计划；

（2）按照本合同及《说明书》约定交付委托资金，承担本合同约定的管理费、托管费和其他费用；

- (3) 按照本合同及《说明书》约定承担集合计划的投资损失；
- (4) 不得违规转让其所拥有的计划份额；
- (5) 以自己的名义在参与网点开立资金账户，办理指定手续，用于办理委托划款、退出款项、红利款项、清算款项的收取。并承诺在本合同有效期内，不得撤销该账户，并妥善保管账户资料；
- (6) 除非在本合同规定的开放日或终止日，不得要求提前终止委托资产管理关系；
- (7) 及时登陆管理人网站查询关于本计划的所有信息披露和公告情况；
- (8) 次级委托人按照合同约定追加增强资金；
- (9) 法律法规及本合同约定的其他义务。

## (二) 管理人的权利和义务

### 1、管理人的权利

- (1) 根据本合同及《说明书》的约定，独立运作集合计划的资产；
- (2) 根据本合同及《说明书》的约定，收取管理费等费用；
- (3) 根据本合同及《说明书》的约定，本集合计划每期资金到期按合同第五条办理。
- (4) 按照本合同及《说明书》的约定，停止办理集合计划份额的参与，暂停办理集合计划的退出事宜；
- (5) 根据本合同及《说明书》的约定，终止本集合计划的运作；
- (6) 监督托管人，并针对托管人的违约行为采取必要措施保护委托人的利益；
- (7) 行使集合计划资产投资形成的投资人权利；
- (8) 集合计划资产受到损害时，向有关责任人追究法律责任；
- (9) 法律、行政法规和中国证监会规定及本合同约定的其他权利。

### 2、管理人的义务

- (1) 在集合计划投资管理活动中恪尽职守，履行诚实信用、谨慎勤勉的义务，以专业技能管理集合计划的资产，为委托人的最大利益服务，依法保护委托人的财产权益；
- (2) 进行资产估值等会计核算；
- (3) 根据中国证监会有关规定、本合同、《说明书》和托管协议的约定，接受托管人的监督；
- (4) 依法对托管人的行为进行监督，如发现托管人违反法律、行政法规和中国证监会的规定，或者违反托管协议的，应当予以制止；
- (5) 按规定出具资产管理报告，保证委托人能够了解有关集合计划资产投资组合、资产净值、费用与收益等信息；
- (6) 按照本合同及《说明书》约定向委托人分配集合计划的收益；
- (7) 妥善保存与集合计划有关的合同、协议、推广文件、客户资料、交易记录、会计账册等文件、资料和数据；
- (8) 在集合计划到期或其他原因解散时，与托管人一起妥善处理有关清算和委托人资金的返还事宜；
- (9) 在解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产或因其他原因不能继续履行管理人职责时，及时向委托人和托管人报告；

(10) 因管理人违反法律法规、监管要求或者本合同的约定导致本合同全部或部分无效、集合计划资产损失或损害优先级委托人合法权益时，应承担赔偿责任；

(11) 因托管人违反本合同导致集合计划资产损失或损害委托人合法权益时，代委托人向托管人追偿；

(12) 法律、行政法规和中国证监会规定及本合同约定的其他义务。

### (三) 托管人的权利与义务

#### 1、托管人的权利

(1) 依法对集合计划的资产进行托管；

(2) 按照本合同、《说明书》和托管协议的约定收取托管费；

(3) 监督管理人集合计划的经营运作，发现管理人的投资或清算指令违反法律法规、中国证监会的有关规定或者本合同、《说明书》和托管协议约定的，要求其改正；未能改正的，应当拒绝执行；

(4) 查询集合计划的经营运作情况；

(5) 法律法规、中国证监会有关规定和本合同、《说明书》以及托管协议约定的其他权利。

#### 2、托管人的义务

(1) 依法为集合计划开立专门的资金账户和专门的证券账户等相关账户；

(2) 非依法律、行政法规和中国证监会有关规定或合同约定，不得擅自用或处分集合计划资产；

(3) 在集合计划托管活动中恪尽职守，履行诚实信用、谨慎勤勉的义务，保管集合计划的资产，确保集合计划资产的独立和安全，依法保护委托人的财产权益；

(4) 安全保管集合计划资产，执行管理人的投资或清算指令，负责办理集合计划名下的资金往来；

(5) 定期核对资产管理业务资产情况；

(6) 监督管理人集合计划的经营运作，发现管理人的投资或清算指令违反法律法规、中国证监会的有关规定和本合同、《说明书》以及托管协议约定的，应当要求其改正；未能改正的，应当拒绝执行；

(7) 复核、审查管理人计算的集合计划的资产净值；

(8) 保守集合计划的商业秘密，在集合计划有关信息向委托人披露前予以保密，不向他人泄露（法律法规、中国证监会另有规定或有权机关要求的除外）；

(9) 按规定出具集合计划托管情况的报告；

(10) 妥善保存与集合计划托管业务有关的合同、协议、交易记录、会计账册等文件、资料和数据，保存期不少于二十年；

(11) 在集合计划终止时，与管理人一起妥善处理有关清算和委托人资产的返回事宜；

(12) 在解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产时，及时报告委托人和管理人；

(13) 因违反本合同导致集合计划资产损失或损害委托人合法权益时，应承担赔偿责

任；

(14) 因管理人过错造成集合计划资产损失的，代委托人向管理人追偿；

(15) 法律、行政法规和中国证监会规定和本合同约定的其他义务。

## 二十四、违约责任与争议处理

### (一) 违约责任

1、管理人、托管人在履行各自职责的过程中，违反法律、行政法规的规定或者本合同约定，给计划财产或者委托人造成损害的，应当分别对各自的行为依法承担赔偿责任；因共同行为给计划财产或者委托人造成损害的，应当承担连带赔偿责任。但是发生下列情况的，当事人可以免责：

#### (1) 不可抗力

不可抗力是指本合同当事人无法预见、无法克服、无法避免，且在本合同生效之后发生的，使本合同当事人无法全部或部分履行本合同的任何事件，包括但不限于洪水、地震及其它自然灾害、战争、骚乱、火灾、突发性公共卫生事件、政府征用、没收、法律法规变化等。

一方因不可抗力不能履行本合同时，应及时通知另一方，并在合理期限内提供受到不可抗力影响的证明，同时采取适当措施防止集合计划资产损失扩大。任何一方当事人迟延履行合同义务后，发生了上述不可抗力事件致使合同当事人无法全部或部分履行本合同，该方不能减轻或免除相应责任。

(2) 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；

2、合同当事人违反本合同，给其他当事人造成实际经济损失的，应当承担赔偿责任。在发生一方或多方当事人违约的情况下，合同能继续履行的，应当继续履行。

3、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。

4、由于托管人不可控制的因素导致业务出现差错，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，托管人免除赔偿责任。但是托管人应积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

5、由于管理人违反法律法规、监管要求或其他原因，导致本合同全部或部分无效的，管理人除应当返还优先级委托人委托的本金之外，还应当按照每年百分之(XX%)向优先级委托人支付违约金，并赔偿优先级委托人的实际损失。

6、在发生违约的情况下，本合同能继续履行的，应当继续履行。

### (二) 争议的处理

因履行本合同发生的争议，由协议签订各方协商解决，协商不成的，任何一方均有权将争议提交托管人所在地法院解决。

## 二十五、风险揭示

本集合计划面临包括但不限于以下风险：

### (一) 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、产业政策和证券市场监管政策等国家政策的变化对证券市场产生一定的影响，可能导致证券价格波动，从而影响收益。

#### 2、经济周期风险

证券市场受宏观经济运行的影响，而经济运行具有周期性的特点，而周期性的经济运行周期表现将对证券市场的收益水平产生影响，从而对收益产生影响。

#### 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，使集合计划资产管理业务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、财务因素等都会导致公司盈利发生变化，从而导致集合计划投资收益变化。

#### 5、购买力风险

投资者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，从而使投资者的实际收益下降。

### （二）信用风险

信用风险，又称违约风险，指交易一方不依照约定条款履约而使另一方发生损失的可能性。信用风险又可分为两类：一类为对手风险，是指衍生合约交易的一方可能出现违约而给另一方造成损失的可能性；另一类是发行者风险，是指标的资产的发行者可能出现违约而给衍生交易者带来损失的可能性。

### （三）流动性风险

流动性风险是指因市场交易量不足，导致证券不能迅速、低成本地转变为现金的风险。流动性风险主要有两种类型：一种与特定的产品或市场有关，称为市场流动性风险；另一种与交易业务的资金有关，称为资金流动性风险。

### （四）操作风险

操作风险是指在交易和结算过程中，由于信息系统或内控系统不完善、管理失误、控制缺失、电脑系统故障、人为差错或失误而导致的风险。在本集合计划中还包括风险定价过程中的模型风险，即交易人员或风险管理人员使用了错误的模型，或模型参数选择不当，导致对交易价值错误估计引起的风险。

### （五）合规风险

在本计划管理或运作过程中，违反国家法律、法规的规定，或者集合计划投资违反法规及集合资产管理合同有关规定的风险。

### （六）管理风险

在集合资产管理计划运作过程中，管理人的知识、经验、判断、决策、技能等，会影响其对信息的获取和对经济形势、金融市场价格走势的判断，如管理人判断有误、获取信息不

全、或对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。

#### （七）合同变更风险

由于业务规则变化或其它原因可能会导致本集合计划的资产管理合同发生变更，委托人可能不同意合同变更，从而产生风险。

#### （八）收益分级风险

1、杠杆风险。本集合计划份额所分离的两类份额优先级份额、次级份额面临因特定的结构性收益分配所形成的投资风险，集合计划的次级份额的净值变动幅度将大于优先级份额的净值变动幅度。其风险程度直接与杠杆率有关。

2、极端情况下的损失风险。优先级份额具有低风险、收益相对稳定的特征，但是本集合计划为优先级份额设置的收益率并非保证收益，在极端情况下，如果集合计划在短期内发生大幅度的投资亏损，优先级份额可能不能获得收益甚至可能面临投资受损的风险。

#### （九）本集合计划特有风险

1、次级委托人可能面临损失本金的风险。

2、优先级份额预期收益率并不是管理人向客户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。

3、委托人资金流动性风险：根据本集合计划的规定，委托人不得提前赎回其集合计划单位，因此委托人在资金流动性方面会受一定影响。

## 二十六、合同的成立与生效

### （一）合同的成立与生效

本合同经管理人、托管人和委托人签署后成立。

本合同成立后，同时满足以下条件时生效：

- （1）委托人参与资金实际交付并确认；
- （2）本集合计划依法有效成立。

本集合计划终止，本合同终止。但本合同项下的清算条款、违约责任条款、争议解决条款仍然有效。

本合同签署地为管理人住所地。

### （二）合同的组成

《华安理财洽洽食品增持 1 号集合资产管理计划说明书》、经管理人确认有效的委托人参与、退出本集合计划的申请材料及各推广机构出具的集合计划参与、退出业务受理有关凭证等为本合同的附件，是本合同不可分割的一部分，与合同具有同等法律效力。《说明书》如有与本合同不一致之处，以本合同为准。

## 二十七、合同的补充、修改与变更

1、本合同签署后，因法律、法规、规章、中国证监会的规定、证券登记结算机构业务规则以及证券交易所等交易规则修订，自该修订生效之日起，本合同相关内容及条款按该修订办理并在管理人网站公告。委托人经管理人、托管人书面同意，可以对本集合计划合同及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，更新或修改的内容在管理人网站公告满五个工作日后生效。

本集合计划成立后,相关材料需要报中国证券业协会备案,同时抄送管理人所在地中国证监会派出机构。管理人按照协会的要求补正备案材料涉及到本合同修改的,管理人经与托管人协商一致后,由管理人公告补正后的合同,补正的内容在管理人网站公告满五个工作日后生效。

2、由于其他原因需要变更合同的,管理人和托管人应书面达成一致并在管理人网站公告。管理人须在公告后两个工作日内以电子邮件或信函方式向委托人发送合同变更征询意见,委托人不同意变更的,应在征询意见发出后的 10 个工作日内以书面方式告知管理人;委托人未在前述时间回复意见的,视为委托人接受变更。委托人不同意变更的,本集合计划管理人将于变更公告期满后安排特殊开放期间为不同意变更的委托人办理退出本集合计划的相关手续。

3、合同变更后,委托人、管理人和托管人的应当按照变更后的合同行使相关权利,履行相应义务。

4、管理人、托管人不得与委托人通过签订补充协议、修改合同等任何方式,约定保证集合计划资产投资收益、承担投资损失,或排除委托人自行承担投资风险和损失。

## **二十八、或有事件**

本合同所称的或有事件是指,根据相关法律法规的规定,管理人可能以独资或者控股方式成立具有独立法人资格的从事资产管理业务的公司。

委托人在此同意,如果或有事件发生,在管理人与托管人协商一致的基础上,管理人有权将本合同中由管理人享有的权利和由管理人承担的义务转让给上一条所述的从事资产管理业务的公司,并无须就此项变更和委托人另行签订专项协议。但在转让前管理人应以信息披露的形式通告委托人。管理人保障委托人退出本专项计划的权利,并在届时的通告中对相关事项作出合理安排。

管理人应当保证受让人具备开展此项业务的相关资格,并向托管人提供监管机构相关批复文件复印件。

管理人应按照监管机构的要求办理转让手续。

**管理人、托管人确认,已向委托人明确说明集合计划的风险,不保证委托人资产本金不受损失或取得最低收益;委托人确认,已充分理解本合同的内容,自行承担投资风险和损失。**

本合同未尽事宜,当事人依据有关法律、法规、规章的规定办理。

本合同应由委托人本人签署,当委托人为机构时,应由法定代表人或其授权代表签署。

(以下无正文)



( 本页无正文 , 为《华安理财洽洽食品增持 1 号集合资产管理计划资产管理合同》签字页 )

委托人签字/盖章 :

管理人 ( 华安证券股份有限公司 )

公 章 :

托管人 ( 上海浦东发展银行股份有限公司 )

公 章 :

签订日期 : \_\_\_\_\_ 年 \_\_\_\_ 月 \_\_\_\_ 日

