

东方红高收益债集合资产 管理计划托管协议

管理人：上海东方证券资产管理有限公司

托管人：中国工商银行股份有限公司广州分行

2020年7月

目 录

一、托管协议当事人.....	1
二、订立托管协议的依据、目的、原则和解释.....	1
三、托管事项.....	2
四、托管人和管理人之间的业务监督、核查.....	2
五、计划资产保管.....	4
六、指令的发送、确认和执行.....	8
七、交易安排.....	11
八、计划开放期参与、退出的资金清算.....	13
九、越权交易.....	14
十、计划资产估值、净值计算和会计核算.....	15
十一、计划收益分配.....	15
十二、计划的费用、业绩报酬和税收.....	15
十三、计划的信息披露.....	15
十四、托管报告及有关文件档案的保存.....	16
十五、计划委托人名册的登记和保管.....	16
十六、禁止行为.....	16
十七、违约责任.....	17
十八、适用法律与争议解决.....	18
十九、托管协议的效力和文本.....	19
二十、托管协议的修改、终止和资产清算.....	19
二十一、其他事项.....	19
附件一：关联方名单.....	21
附件二：证券交易参数表（样本）.....	22
附件三：关于申购赎回相关业务说明（样本）.....	24
附件四：投资监督事项表.....	25

鉴于上海东方证券资产管理有限公司是一家依照中国法律合法成立并有效存续的公司，具有发行集合资产管理计划资格，拟发起设立东方红高收益债集合资产管理计划（以下简称“东方红高收益债集合计划”）；

鉴于中国工商银行股份有限公司广州分行系一家依照中国法律合法成立并有效存续的银行分支机构，已按照相关法律、法规的规定取得证券公司集合资产管理计划托管资格，具备履行本托管协议担任托管人的资格和能力；

鉴于上海东方证券资产管理有限公司拟担任计划的管理人，中国工商银行股份有限公司广州分行拟担任计划的托管人。

鉴于计划的委托人指“东方红高收益债集合资产管理计划”的参与人，并与上海东方证券资产管理有限公司以及中国工商银行股份有限公司广州分行签订了《东方红高收益债集合资产管理合同》，合同当事人依照该合同享有权利、承担义务。

为明确管理人和托管人之间的权利义务关系，特制订本协议。

一、托管协议当事人

（一）管理人

名称：上海东方证券资产管理有限公司

注册地址：中国上海市中山南路 318 号 2 号楼 31 层

办公地址：中国上海市中山南路 318 号 2 号楼 31 层

法定代表人：潘鑫军

成立时间：2010 年 7 月 28 日

组织形式：一人有限责任公司

注册资本：人民币叁亿元

电话：(021) 63325888*5006

联系人：蒋丹青

（二）托管人

名称：中国工商银行股份有限公司广州分行（曾用名：中国工商银行股份有限公司广东省分行营业部）

注册地址：广州市越秀区大沙头路 29 号工银大厦 21 楼

办公地址：广州市越秀区大沙头路 29 号工银大厦 21 楼

负责人：周骏

电话：020-83786666-2100

联系人：刘卓生

二、订立托管协议的依据、目的、原则和解释

（一）依据

本托管协议依据《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《运作规定》）等有关法律法规、自律性文件和中国证监会、中国证券业协会、中国证券投资基金业协会的有关规定以及《东方红高收益债集合资产管理合同》（以下简称“《集合资产管理合同》”）制定。

（二）目的

本协议的目的是明确托管人和管理人之间在计划资产保管、委托人档案资料

保管、管理和运作、委托人参与或退出计划、计划资产清算及相互监督等相关事宜中的权利、义务及责任，以确保计划资产的安全，保护委托人的合法权益。

（三）原则

管理人和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。

（四）解释

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

三、托管事项

（一）托管资产种类

本协议所称托管资产是指本协议所称托管资产是指管理人委托并实际交付托管人托管并在托管行实际托管范围内的集合计划资金。托管资产的初始形态为现金。

（二）托管资产金额

初始托管资产金额为本计划推广期结束后，托管账户的实际到账金额，该金额应与会计师事务所验资报告一致。

（三）托管时间

本计划资产托管时间始于计划成立且托管人收到计划资产之日，终止于计划终止且资产清算和分配完毕之日。

四、托管人和管理人之间的业务监督、核查

（一）托管人对管理人的业务监督和核查

1、托管人在其交易监督系统可监测范围内进行投资监督，托管人的交易监督义务以法律法规、《投资交易监督事项表》（见附件四）为准。如《投资交易监督事项表》需进行变更，由资产管理人、资产托管人以邮件、函件等各方认可的方式协商一致后加盖公章或业务章的形式进行更改。《投资交易监督事项表》启用或变更的前3个工作日内，由资产管理人将《投资交易监督事项表》以邮件、函件等各方认可的方式发送至托管人并注明生效时间。资产管理人于《投资监督事项表》变更生效后及时以邮件或公告等形式告知全体委托人（已在相关法律文件变更公告中提前披露的除外）。

因证券期货市场波动、证券发行人合并、资产管理计划规模变动、停牌等管理人之外的因素导致集合计划计划投资不符合《投资监督事项表》约定内容的，

管理人应当在流动性受限资产可出售、可转让或者恢复交易的十五个交易日内调整至符合相关要求。确有特殊事由未能在规定时间内完成调整的，管理人应当及时向中国证监会相关派出机构和证券投资基金业协会报告。

托管人发现管理人违规情况时的通知方式为邮件、电话或书面通知。管理人接收通知的邮件地址：rcgroup@dfham.com，电话：021-63325888*5037/2069/1891；联系人员：风控组。

托管人还应对涉及本集合计划资产的核算、资产净值的计算、管理费、托管费和其他相关费用的计提和支付、计划收益分配及计划清算等事项的合法性、合规性进行监督和核查。托管人投资监督的准确性和完整性受限于管理人及其他中介机构提供的数据信息。托管人对管理人及其他中介机构提供的信息的准确性和完整性不做任何担保、暗示或表示，由于管理人及其他中介机构提供的信息的准确性和完整性、真实性所引起的损失由过错方承担相应责任。

2、托管人发现管理人上述行为违反有关法律法规规定、《集合资产管理合同》或本协议约定，应及时以双方认可的形式通知管理人限期纠正，管理人收到通知后应及时核对确认并以书面或双方认可的其他方式向托管人发出回函。在限期内，托管人有权随时对通知事项进行复查，督促管理人改正。管理人对托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，托管人应向管理人住所地中国证监会派出机构及证券投资基金业协会报告。

3、如托管人认为管理人的作为或不作为违反了有关法律法规、《集合资产管理合同》或本协议约定，托管人应向管理人住所地中国证监会派出机构及证券投资基金业协会报告，并有权利行使法律法规、《集合资产管理合同》或本协议规定的所有权利，以保护计划资产的安全和计划投资者的利益。

4、在本集合计划运行期间，除法律、行政法规和监管部门同时发送（含抄送）至管理人和托管人的部门规章、通知、决定、文件外，对于证券集合资产管理计划应遵守的监管部门仅发送至管理人的部门规章、通知、决定、文件等规定，管理人有义务及时向托管人书面提供，托管人收到后应书面回复并确定监督内容。

（二）管理人对托管人的业务核查

1、根据有关法律法规规定、《集合资产管理合同》、本协议约定，管理人就托管人是否及时执行管理人合法合规的投资指令、妥善保管计划的全部资产、是否对计划资产实行分账管理、是否擅自动用计划资产、是否按时将分配给委托人

的收益划入计划资金归集专户等事项，对托管人进行监督和核查。

2、管理人定期对托管人保管的计划资产进行核查。管理人发现托管人未对计划资产实行分账管理、擅自挪用计划资产、因托管人的过错导致计划资产灭失、减损、或处于危险状态的，管理人应立即以书面的方式要求托管人予以纠正和采取必要的补救措施。

3、管理人发现托管人的行为违反有关法律法规规定、《集合资产管理合同》和本协议约定，应及时以书面形式通知托管人限期纠正，托管人收到通知后应及时核对并以书面形式对管理人发出回函。在限期内，管理人有权随时对通知事项进行复查，督促托管人改正。托管人对管理人通知的违规事项未能在限期内纠正的，管理人应向管理人住所地中国证监会派出机构及证券投资基金业协会报告。

4、如管理人认为托管人的作为或不作为违反了有关法律法规、《集合资产管理合同》或本协议约定，管理人应向管理人住所地中国证监会派出机构及证券投资基金业协会报告，并有权利并有义务行使有关法律法规、《集合资产管理合同》或本托管协议赋予、给予、规定的管理人的任何及所有权利和救济措施，以保护计划资产的安全和委托人的利益。

（三）托管人与管理人在业务监督、核查中的配合、协助

管理人和托管人有义务配合和协助对方依照本协议对计划业务执行监督、核查。管理人或托管人无正当理由，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告仍不改正的，监督方应报告管理人住所地中国证监会派出机构及证券投资基金业协会。

管理人应当按照有关法律法规、《集合资产管理合同》的规定对集合资产管理计划的财务会计报告进行年度审计，将审计意见提供给客户和托管人，并报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。

管理人应积极配合和协助托管人的监督和核查，包括但不限于在规定时间内答复并改正，对托管人按照法规要求需向管理人住所地中国证监会派出机构及证券投资基金业协会报送计划监控报告的，管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

五、计划资产保管

（一）计划资产保管的原则

1、对于移交托管人且由托管人实际保管控制的资产，托管人应承担保管责任。托管人将遵守法律法规规定、《集合资产管理合同》和本协议约定，为计划持有人的最大利益处理相关事务。托管人保证恪尽职守，依照诚实信用、勤勉尽责的原则，谨慎、有效的持有并保管计划资产。

2、托管人应当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，负责计划资产托管事宜；建立健全内部风险监控制度，对负责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、托管人应当购置并保持对于计划资产的托管所必要的设备和设施（包括硬件和软件），并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，以及与中国证券登记结算有限公司数据通讯线路的畅通。

4、除依据法律法规规定、《集合资产管理合同》和本协议约定外，托管人不得为自己及任何第三人谋取利益，如托管人违反此义务，利用计划资产为自己及任何第三方谋取利益，所得利益归于计划资产。

5、托管人必须将计划资产与自有财产严格分开，将本计划资产与其托管的其他计划资产严格分开；托管人应当对本计划与托管人的其他业务和其他计划的托管业务实行严格的分账管理，保证不同计划之间在名册登记、账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立。

6、除依据法律法规规定、《集合资产管理合同》和本协议约定外，托管人不得委托第三人托管计划资产。

7、托管人应安全、完整地保管计划资产；未经管理人的正当指令，不得自行运用、处分、分配计划的任何资产。

8、对于计划应收参与款，由管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知托管人，在确定的计划资产没有到达托管人处的，托管人应及时通知管理人采取措施进行处理，由此给计划资产造成损失的，管理人应负责向有关当事人追偿。

（二）计划推广期间及募集资金的验资

1、集合计划设立推广期满，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并出具验资报告。管理人应不迟于集合计划成立当日向托管人提供注册会计师事务所正式出具的验资报告及管理人出具的加盖公章的成立公告。资产管理人应为项目运作前做好准备，并为资产托管人

做好营运准备留出必要且合理的时间。资产管理人收到资产托管人出具的书面“托管营运起始运作通知书”，确认资产接收情况后，开展日常投资运作业务。资产托管人确认资产接收情况后开始承担日常划款核算等托管义务。若资产管理人未收到资产托管人出具的“托管营运起始运作通知书”，自行开展投资运作业务，导致由交易失败、估值核对不一致等引发的委托资产损失，资产托管人不承担任何责任。

2、在托管人确认本计划资产划入托管专户后，托管人正式承担托管职责。

3、如果在推广期满后，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）计划的银行账户的开设和管理

1、托管人负责本计划资金托管账户的开设和管理，管理人应配合托管人办理开立账户事宜并提供相关资料。

2、本计划的托管银行为本计划开立托管账户，托管行预留印鉴，至少要加盖一枚托管人银行印鉴，并由托管人保管和使用。委托人和管理人应当在开户过程中给予必要的配合。托管专户由托管人负责管理，委托资产托管期间的一切货币收支活动，包括但不限于投资、支付费用、资产划拨、追加资产和提取资产等，均需通过该账户进行。托管专户内的银行存款利息按约定的存款利率【0.72%】计算。[备注：账号户名以托管人实际开立为准]。该托管账户是指托管人在集中清算模式下，代表所托管的包括本计划在内的托管资产与中国证券登记结算有限责任公司进行二级结算的专用账户。

3、托管账户的开立和使用，限于满足开展托管业务的需要。托管人和管理人不得假借本计划的名义开立其他任何无关银行账户；亦不得使用本计划的任何银行账户进行本计划业务以外的活动。

4、托管账户的管理应符合《人民币银行结算账户管理办法》、《现金管理暂行条例》、《利率管理暂行规定》、《人民币利率管理规定》、《支付结算办法》以及其他有关规定。

（四）计划的证券账户和证券交易资金结算账户的开设和管理

1、托管人应当以计划的名义在中国证券登记结算有限责任公司开设证券账户，用于本计划证券投资的清算和存管，证券账户名称应为“东方证券资管—工商银行—东方红高收益债集合资产管理计划”[备注：账户名称以实际开立账户

名称为准]。管理人应配合托管人办理开立账户事宜并提供证券开户费划款凭证截图和相关资料。销户时，由托管人办理证券账户销户的，管理人协助提供证券账户销户相关资料。

2、本计划证券账户的开立和使用，限于满足开展本计划业务的需要。托管人和管理人不得出借和未经另一方同意擅自转让本计划的任何证券账户；亦不得使用本计划的任何证券账户进行本计划业务以外的活动。

3、本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、托管人应当以托管人的名义在中国证券登记结算有限责任公司开立证券交易资金结算账户，用于计划的证券交易资金清算。

（五）基金账户的开设和管理

托管人负责开立开放式证券投资基金账户，管理人应给予必要的配合，并指定基金公司按月向托管人发送基金对账单。

托管人对账单接收传真为：020-83786666-3846，

接收邮箱为：gzzctgbsj@gd.icbc.com.cn。

若基金公司没有按要求向托管人提供对账单，托管人有权要求管理人配合索要或根据管理人提供基金账户信息（账号、查询密码等）在基金公司网站上查询。

（六）银行间债券账户及其他账户的开设和管理

银行间债券账户以管理人备案户名为准开立债券账户。备案工作由管理人办理，托管人协助办理，开户工作由托管人办理，管理人协助办理。

若投资存款，存款证实书不得被质押或以任何方式被抵押，不得用于背书转让。定期存款不得办理自动约转，到期后需转回托管户。定期存单应由托管人保管，要留托管人预留印鉴，托管人保管定期存单，定期存单当面移交，到期后资金必须划回托管账户。

本计划募集户开户工作和相关管理工作由资产管理人负责。由管理人自行开立，托管人可以协助配合，账户开立完成后，由管理人负责管理。

因业务发展而需要开立的其他账户，应根据法律法规的规定和《集合资产管理合同》的约定开立，并按有关规则管理并使用。除托管账户以外的交易账户、资金帐户均应该设置本项目托管账户为唯一回款帐号，管理人以及托管人应共同

维护保障委托财产安全。

(七) 与计划资产有关的重大合同的保管

1、由管理人代表计划签署的与计划有关的重大合同的原件分别由托管人、管理人保管。除本协议另有规定外，管理人在代表计划签署与计划有关的重大合同时，应保证计划一方持有两份以上的正本，以便管理人和托管人至少各持有一份正本的原件。

2、合同的保管期限为自《集合资产管理合同》终止之日起 20 年。

3、与计划资产有关的重大合同，根据需要由托管人以计划的名义签署的，由管理人以传真方式下达签署指令(含有效授权内容)，合同原件由托管人保管，但托管人应将该合同原件的复印件盖章(骑缝章)后，交管理人一份。如该合同需要加盖管理人公章，则管理人至少应保留一份合同原件。

4、因管理人将自己保管的本计划重大合同在未经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，由管理人负责赔偿。

5、因托管人将自己保管的本计划重大合同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，由托管人负责赔偿。

(八) 其他事项的约定

管理人应配合托管人办理集合计划运作前的相关准备工作，应不迟于资金托管账户开设前向托管人提供《证券交易参数表》、《关于申购赎回相关业务说明》。

六、指令的发送、确认和执行

(一) 管理人对发送指令人员的授权

1、管理人应当事先向托管人发出授权通知，向托管人提供指令的预留印鉴样本和被授权人签字样本，并在授权通知上载明管理人被授权人名单及联系方式。管理人应指定至少两名以上的被授权人。

2、管理人向托管人发出授权通知应加盖公章。托管人在收到授权通知后以回函或双方认可的方式确认。授权通知自托管人收到通知时生效(如果授权通知载明的生效日期与该日期不一致时，以后到日期为生效日期)。资产托管人收到通知的日期晚于通知载明的生效日期的，则通知应当自资产托管人收到该通知的下一个交易日生效。

3、管理人和托管人对授权通知及其更改负有保密义务，其内容不得向有权发送指令人员及相关操作人员以外的任何人披露、泄露。

（二）划款指令的内容

1、划款指令包括管理人在运作计划资产时，向托管人发出的资金划拨书面文书，包括收款指令、付款指令（含退出、收益分配付款指令）及其他资金划拨指令等。

2、管理人发给托管人的划款指令应写明款项事由、支付时间、最晚到账时间、收款人开户银行、大小写金额、收付款人账户名称、账号等要素信息，加盖预留印鉴并由被授权人签字。

（三）划款指令的发送、确认和执行

1、划款指令的发送

（1）划款指令需有划款指令授权书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，代表管理人用传真的方式向托管人发送，并电话确认托管人收到指令。管理人必须确保头寸充足，并提前两小时向托管人发送划款指令，对于头寸不足，以及小于两小时划款时间的指令，托管人不保证当日完成在银行的划付流程。

（2）指令由“授权通知”确定的有权发送人（下称“被授权人”）代表管理人向托管人发送。发送方式以双方约定的电子直连、网银、传真或者邮件等方式进行。托管人应指定专人接收管理人的指令。托管人应预先书面或以双方认可的方式通知管理人接收人名单和联系方式。

2、指令的接收及确认

（1）管理人有义务在发送指令后及时与托管人进行电话确认，因管理人未能及时与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不由托管人承担。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相符进行审慎验证，管理人应负责其印鉴真实性。对于有权发送指令人员发出的指令，管理人不得否认其效力，但如果管理人已经撤销或更改对有权签署、发送指令人员的授权，并且授权变更通知已生效，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，管理人不承担责任。划款指令原件与托管人收到的传真件不一致时以托管人收到的传真为准。

(2) 托管人可以要求管理人传真提供相关交易凭证、合同或其他有效会计资料，以确保托管人有足够的资料来判断指令的有效性。

3、指令的执行

(1) 托管人确认指令有效后，方可执行指令。

(2) 托管人在复核后应在规定期限内执行适当的指令，不得延误。指令执行完毕后，托管人应通知管理人。托管人发现管理人的指令违反法律法规、《集合资产管理合同》或本协议约定的，应当要求改正，未能改正的，应当拒绝执行，并向管理人住所地中国证监会派出机构及证券投资基金业协会报告。

(3) 中国证券登记结算公司向托管人发送的结算通知视为管理人向托管人发出的有效指令，托管人应予以执行。

4、执行中相关问题的处理方法

(1) 管理人下达的指令必须要素齐全，词语准确，管理人下达的指令要素不全或语意模糊的，托管人有权附注相应的说明后立即将指令退还给管理人，要求其重新下达有效的指令。

(2) 托管人因故意或过失错误执行指令或未及时执行指令，致使本计划资产的利益受到损害，应负赔偿责任。除此之外，托管人依据本协议约定正确执行管理人的指令，对计划资产造成的损失，不承担任何形式的责任。

(3) 管理人在发送指令时，应为托管人执行指令留出执行指令时所必需的时间。如托管人收到划款指令的时间与划款指令中要求的到账时间之间小于两个小时的，托管人应尽力在指定时间内完成资金划拨，但不保证资金划拨成功，因此导致指令未能及时执行的，所造成的损失由管理人承担。

(4) 管理人应确保计划的银行存款账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。对超头寸的指令，以及超过证券账户证券余额的指令，托管人可不予执行，由此造成的损失，由管理人负责赔偿。

(四) 被授权人的更换

1、管理人若对授权通知的内容进行修改（包括但不限于有权发送指令人员的名单、联系方式的修改，指令上预留印鉴和签字样本的修改等），应当至少提前 1 个工作日通知托管人；授权变更通知的文件应由管理人加盖公章，管理人应在授权变更通知中提供新被授权人的权限及其签字样本。管理人对授权通知的修改应当以传真的形式发送给托管人，同时电话通知托管人，托管人收到变更通知

后以回函或双方认可的方式确认。管理人对授权通知的内容的修改，自托管人收到变更通知时生效（如果变更授权通知载明的生效日期与该日期不一致时，以后到日期为生效日期）。资产托管人收到通知的日期晚于通知载明的生效日期的，则通知应当自资产托管人收到该通知的下一个交易日生效。管理人在此后三个工作日内将被授权人变更通知的正本送交托管人，传真件与正本记载不一致的，以传真件为准。对于被授权人在授权权限内发出的指令，管理人不得否认其效力。在被授权人的更换生效前，原被授权人及其签字继续有效。

2、托管人更改接受管理人指令的人员及联系方式，应预先书面或以双方认可的方式通知管理人。

七、交易安排

（一）交易单元安排

1、管理人负责安排专用交易单元用于本计划的投资运作，并将用于计划交易的专用交易单元向证券交易所、证券登记结算机构、管理人住所地中国证监会派出机构及证券投资基金业协会备案。

2、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。

3、管理人在集合计划业务开展十个工作日前，将专用单元信息书面告知托管人，并配合托管人办理交易单元合并清算和清算及交易数据接收手续。

（二）证券交易的资金清算与交割

1、证券交易资金的清算

（1）托管人负责办理因本计划投资于证券发生的所有场内、场外交易的清算交割。

（2）本计划交易所证券投资的清算交割，由托管人根据相关登记结算公司的结算规则办理。

（3）如果因为托管人自身原因在清算上造成计划资产的损失，应由托管人负责赔偿；如果因为管理人买空、卖空造成计划资产清算困难和风险的，托管人发现后应立即通知管理人，由管理人负责解决，由此给计划资产或托管人造成的损失由管理人承担。

（4）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，如

果因资产管理人或证券经营机构等非资产托管人原因发生超买行为，资产管理人必须于 T+1 日上午 10 时之前划拨资金，用以完成清算交收。如未能按时完成融资，资产托管人有权通知资产委托人及相关部门。

如由于资产管理人的原因导致无法按时支付证券清算款，给资产托管人和委托财产造成损失的，由此造成的损失由资产管理人承担。

(5) 集合计划参与 T+0 交易所非担保交收交易的责任认定及处理程序

集合计划参与 T+0 交易所非担保交收交易的，集合计划管理人应确保托管组合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。如由于资产管理人的原因导致 T+0 非担保交收失败，由此给资产托管人、资产托管人托管的其他资产组合造成的损失，由集合计划管理人承担。T+0 交易所非担保交收业务款项不建议提前调出，如因管理人提前调出资金到账问题引起后续风险由资产管理人承担。

2、结算方式

支付结算按中国人民银行、中国银监会的有关规定办理。

3、资金划拨

管理人的资金划拨指令，托管人在复核无误后应在规定期限内执行，不得延误。如管理人的资金划拨指令有违法、违规的或超头寸，托管人应不予执行并立即书面通知管理人要求其变更或撤销相关指令，若管理人在托管人发出上述通知后仍未变更或撤销相关指令，托管人应不予执行，并应向管理人住所地中国证监会派出机构及证券投资基金业协会报告。

资金划拨指令的下达程序应当按照本协议第六条规定的程序办理。

4、开放式基金认购、申购、赎回的交易安排

管理人与托管人在办理开放式基金认购、申购、赎回中的权利、义务、职责遵照有关法律法规规定执行。

管理人申购（认购）开放式基金时，应将划款指令连同基金申购（认购）申请单传真至托管人。托管人审核无误后，应及时将划款指令交付执行，并对划款指令执行情况进行查询，将执行结果通知管理人。管理人在收到基金公司发送的申购确认书后应及时且不晚于当日 16:30 传真托管人。

管理人赎回开放式基金时，应在向基金管理公司或代销机构发出基金赎回申

请书的同时，连同收款通知传真托管人，并于收到基金管理公司或代销机构发送的基金赎回确认书后及时且不晚于当日 16:30 传真托管人。托管人应及时查询到帐情况并反馈管理人。

（三）交易记录、资金和证券账目的对账

对计划的资金、证券账目，由双方每日对账一次，确保双方账账相符。

（四）集合计划投资定期存款的约定及处理程序

集合计划投资定期存款（含同业存款、协议存款等）时，集合计划管理人应确保托管组合有足额头寸用于上述交易，至少提前一个工作日将签署完成的定期存款协议交付托管人，且在当日 14 时之前出具有效划款指令，并确保定期存款的期限不低于一个月。

八、计划开放期参与、退出的资金清算

（一）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。

（二）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，更新集合计划委托人数据库；并将确认的参与、退出数据向集合计划托管人传送。管理人、托管人根据确认数据进行账务处理。

（三）管理人负责开立结算账户，用于本集合计划参与、中间参与和退出环节的清算交收。

（四）集合计划结算账户与集合计划托管账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 日内交收，退出资金和退出费用在 T+2 日内交收。

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

当托管账户存在净应收额（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“集合计划结算账户”划至“集合计划托管账户”，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。当托管账户存在净应付额（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账户净应付额从“集合计划托管账户”划至管理人指定的“集合计划结算账户”，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。

九、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《集合资产管理合同》约定而进行的投资交易行为，包括：

- 1、违反有关法律法规和《集合资产管理合同》投资范围、投资比例、投资禁止行为的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；
- 3、其他违反有关法律法规的规定以及违反或超出《集合资产管理合同》项下资产委托人授权的投资交易行为。

资产管理人应在有关法律法规和《集合资产管理合同》规定的权限内运用委托财产进行投资管理，不得违反有关法律法规和《集合资产管理合同》的约定，运作委托财产。

（二）对越权交易的处理

- 1、违反有关法律法规和《集合资产管理合同》投资范围、投资比例、投资禁止行为的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，发现资产管理人的投资指令违反法律、行政法规和其他规定，或者违反《集合资产管理合同》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。

资产托管人对于承诺监督的越权交易，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《集合资产管理合同》约定的，应当立即通知资产管理人。

资产管理人应向资产托管人主动报告越权交易。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。资产管理人对资产托管人通知的越权事项未能及时纠正的，资产托管人应报告中国证监会。

- 2、违反或超出《集合资产管理合同》项下资产委托人授权的投资交易行为
资产管理人进行违反或超出《集合资产管理合同》项下资产委托人授权的投资交易行为，应向资产托管人主动报告，限期及时改正，并及时报告中国证监会。

- 3、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，所发生的收益归本委托财产所有。

十、计划资产估值、净值计算和会计核算

参照《集合资产管理合同》第十二章的相关约定执行。

十一、计划收益分配

参照《集合资产管理合同》第十四章的相关约定执行。

十二、计划的费用、业绩报酬和税收

参照《集合资产管理合同》第十三章的相关约定执行。

十三、计划的信息披露

（一）保密义务

1、除按照法律法规规定和《集合资产管理合同》约定进行信息披露以外，管理人和托管人对计划的有关信息均应恪守保密的义务。管理人与托管人对计划的任何信息，不得在其公开披露之前，先行对双方以外的任何机构、组织和个人泄露。法律法规另有规定或有权机关要求披露的除外。

2、管理人和托管人除为合法履行法律法规、《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、利用其所知悉的计划的保密信息，并且应当将保密信息限制在为履行前述义务而需要了解该保密信息的职员范围之内。但是，如下情况不应视为管理人或托管人违反保密义务：

（1）非因管理人和托管人的原因导致保密信息被披露、泄露或公开；

（2）管理人和托管人根据法律法规或中国证监会等监管机构和自律组织的命令、决定所作出的信息披露或公开。

（二）管理人和托管人在信息披露中的职责和信息披露程序

1、管理人和托管人均是本计划信息披露义务人。

2、对于法律、法规和中国证监会规定的、本计划需披露的信息，管理人和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。

3、本计划的信息披露的公告，必须符合《管理办法》、《运作规定》、《集合资产管理合同》、本协议及其它有关规定。

（三）信息披露文本的存放

予以信息披露的文本存放在管理人、托管人的办公场所和营业场所，并接受委托人的查询和复制要求。管理人、托管人应为文本存放、委托人查询有关文件提供必要的场所和其他便利。

管理人和托管人应保证文本的内容与所公告的内容完全一致。

十四、托管报告及有关文件档案的保存

(一) 托管人按照《管理办法》、《运作规定》、《集合资产管理合同》和本协议有关规定出具计划托管情况报告。

(二) 管理人和托管人应完整保存各自的记录计划业务活动的计划委托人名册、原始凭证、记账凭证、计划账册、交易记录和重要合同等，保存期限为自《集合资产管理合同》终止之日起 20 年。

(三) 有关计划的全部合同的正本，应由托管人负责保管，保存期限为自《集合资产管理合同》终止之日起 20 年，管理人有权保留其作为合同签署方面应持有的合同正本。

十五、计划委托人名册的登记和保管

(一) 注册登记机构负责编制计划委托人名册，管理人负责保管计划委托人名册。

(二) 委托人名册的内容包括但不限于委托人姓名、证件类型和号码、持有计划的份额、联系地址和联系方式。

(三) 管理人负责向注册登记机构索取计划成立日、每季度末最后一个交易日的委托人名册，并妥善保管。为托管人履行有关法律法规、《集合资产管理合同》、本协议规定的职责之目的，管理人应当提供任何必要的协助。

十六、禁止行为

(一) 管理人、托管人须遵守《管理办法》、《运作规定》的规定，不得从事《管理办法》、《运作规定》禁止的任一行为。

(二) 除法律法规、《集合资产管理合同》和本协议另有规定，管理人、托管人不得为自身和任何第三人谋取利益。

(三) 管理人与托管人对计划运作过程中任何尚未按有关法律法规规定的方式公开披露的信息，不得对他人泄露，法律法规另有规定的除外。

(四) 托管人对管理人的正当指令不得拖延和拒绝执行，管理人不得向托管人发送违规的、超头寸的交易指令。

(五) 除根据管理人指令或《集合资产管理合同》、本协议或法律法规另有规定以外, 托管人不得动用或处分计划资产。

(六) 托管人、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。

(八) 法律法规、《集合资产管理合同》和本《托管协议》禁止的其他行为。

十七、违约责任

(一) 如果由于管理人或托管人违反本协议, 造成本协议不能履行或者不能完全履行的, 由违约方承担违约责任; 如果由于双方原因, 造成本协议不能履行或者不能完全履行的, 根据实际情况, 由双方当事人分别按过错程度承担各自应负的违约责任。

(二) 本协议任何一方当事人的违约行为给计划资产或委托人造成实际损害的, 违约方应就直接损失承担赔偿责任, 另一方有权利并且有义务代表计划对违约方进行追偿。但是发生下列情况, 当事人可以免责:

1、管理人和/或托管人按照当时有效的法律法规或中国证监会的规定作为或不作为而造成的损失等;

2、在没有欺诈、故意或重大过失的情况下, 管理人由于按照合同规定的投资原则行使或不行使其投资权而造成的损失等;

3、在没有过错或过失的情况下, 托管人执行管理人的生效指令对集合计划资产造成的损失, 托管人不承担责任;

4、在计划运作过程中, 管理人及托管人按照法律、行政法规的规定以及本合同的约定履行了相关职责, 但由于其控制能力之外的第三方原因或其他原因而造成运作不畅、出现差错和损失的。

5、管理人或托管人任一方不因另一方的失职行为而给集合计划财产或委托人造成的损失向委托人承担连带责任。

6、相关法律、行政法规和规定的其他情形。

7、托管人仅对与关联方名单所列明的关联方之间的交易实施监督, 管理人未能事前就其关联方名单明确告知托管人致使本集合计划发生违规投资行为的, 托管人不承担任何责任。

8、管理人违反本协议第四条第(一)款第4项约定的义务, 未及时向托管

人提供相关监管要求的，托管人不承担因此产生的责任。

9、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或交由证券公司、期货公司等其他机构负责清算交收的集合计划资产（包括但不限于期货保证金、期货合约等）及其收益，因该等机构欺诈、疏忽、过失、破产等原因给集合计划资产造成的损失等。

（三）如果由于本协议一方当事人（“违约方”）的违约行为，给另一方当事人（“守约方”）造成任何损失，违约方应赔偿守约方由此遭受的直接损失。

（四）如果由于本协议一方当事人（“违约方”）的违约行为给计划资产或委托人造成损失，而另一方当事人（“守约方”）赔偿了计划资产或委托人的损失，则守约方有权向违约方追索，违约方应赔偿守约方由此遭受的直接损失。

（五）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。如当事人一方明知对方的违约行为，有能力而不采取必要的措施，导致计划资产的损失进一步扩大的，不履行监督、补救职责的一方对损失的扩大部分负有对计划的连带赔偿责任。

（六）违约行为虽已发生，但本托管协议能够继续履行的，在最大限度地保护计划持有人利益的前提下，管理人和托管人应当继续履行本协议。

（七）由于不可抗力原因或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。但是管理人和托管人应积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

十八、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）管理人、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，任何一方均有权将争议提交上海国际经济贸易仲裁委员会并按其届时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点在上海，仲裁裁决是终局的，对各方均具有法律约束力。

（三）除提起仲裁的争议之外，各方当事人仍应履行本协议的其他规定。争

议处理期间，双方当事人应恪守管理人和托管人职责，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。

十九、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/或授权代表签字，自本协议签订之日起生效。管理人在发起设立计划后 5 日内，将发起设立情况向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。本协议的有效期自生效日起至第二十条第（二）款所述之情形发生时止。

（二）本协议壹式肆份，协议双方各执贰份，每份具有同等法律效力。

二十、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。修改后的新协议，其内容不得与《集合资产管理合同》的规定有任何冲突。

（二）发生以下情况，本托管协议终止：

- 1、计划或《集合资产管理合同》终止；
- 2、托管人解散、依法被撤销、破产，被监管机关取消托管业务资格或由其他托管人接管计划资产；
- 3、管理人解散、依法被撤销、破产，被依法取消资产管理业务资格或由其他管理人接管计划资产管理权；
- 4、法律法规规定的其他终止事项。

（三）计划终止后的资产清算

参照《集合资产管理合同》第二十章第（二）款的相关约定执行。

二十一、其他事项

本协议未尽事宜，当事人应当依据《集合资产管理合同》、有关法律、法规和相关规定协商办理。

（此页无正文，为上海东方证券资产管理有限公司与中国工商银行股份有限公司广州分行关于东方红高收益债集合资产管理计划托管协议签署页）

管理人(章)

上海东方证券资产管理有限公司

法定代表人或授权代表(签字)

托管人(章)

中国工商银行股份有限公司广州分行

法定代表人或授权代表(签字)

签订地:

签订日: 年 月 日

附件一：关联方名单

管理人应及时将最新的管理人关联方名单以书面或双方认可的其他方式通知托管人；如有更新，管理人应及时发送托管人知悉。

附件二：证券交易参数表（样本）

中国工商银行资产托管部：

根据《东方红高收益债集合资产管理计划托管协议》，对东方红高收益债集合资产管理计划投资运作中涉及的交易参数约定如下：

(1) 组合信息：

	交易席位	清算编号	股东代码
上海			
深圳		---	

(2) 证券交易费用参照表

		佣金		备注
		费率%	最小值(元)	
上海	股票		无	
	债券		无	如区分债券类型请注明
	普通基金		无	
	权证		无	
	ETF		无	
		无	
深圳	股票		无	
	债券		无	如区分债券类型请注明
	普通基金		无	
	权证		无	
	ETF		无	
		无	

品种		上海		深圳
		标准佣金%	最小值(元)	标准佣金%
回购	GC003			
	GC007			
	GC014			
	GC028			
	GC091			
	GC182			
	GC001			
	GC002			

	GC004			
			

注：本表未包括品种或代码，请自行补充。

(3) 组合佣金汇总计算方式：

①上海： 完全汇总 分笔汇总 按合同号汇总

②深圳： 完全汇总 分笔汇总 按合同号汇总

(4) 佣金扣费方式：

①上海： 原始费率不含费 原始费率含经手费证管费

原始费率含经手费证管费结算费

原始费率含经手费证管费结算费过户费

②深圳： 原始费率不含费 原始费率含经手费证管费

原始费率含经手费证管费结算费

原始费率含经手费证管费结算费过户费

(5) 组合佣金计算的中间精度为：

2位 4位

其他_____

注：如上海、深圳不同，请特别说明。

(5) 组合持有债券税费信息

扣税 不扣税

部分债种扣税，包括：_____

(6) 银行存款、备付金等计息方式：

以前一日余额计息 以当日余额计息

特此告知，请作好组合运营前的准备工作。

上海东方证券资产管理有限公司
（盖章）

二〇 年 月 日

附件三：关于申购赎回相关业务说明（样本）

中国工商银行资产托管部：

根据我司与贵部签订的《东方红高收益债集合资产管理计划托管协议》，为做好东方红高收益债集合资产管理计划的运营工作，现就该产品申购赎回业务相关情况通知贵部，请作好相关准备工作。

一、开放期申购赎回资金清算日期及现金分红到账日期

开放期申购资金清算日为：T+___

开放期赎回资金清算日为：T+___

现金分红到账日为：D+___

注：T 日为申请日，D 日为除权除息日。

二、TA 数据核算方式（请选择）

合并代销商 分代销商

三、集合计划 TA 结算账户信息

账户名称：上海东方证券资产管理有限公司

账 号：03492300040016128

开 户 行：中国农业银行股份有限公司上海卢湾支行

大额支付号：103290028025

上海东方证券资产管理有限公司
（盖章）

二〇 年 月 日

附件四：东方红高收益债集合资产管理计划投资监督事项表

<p>投资范围</p>	<p>(1) 权益类资产：中国境内依法发行的股票（包括在科创板上市的股票，以及新股申购、定向增发所得股票）、存托凭证（包括在科创板上市的存托凭证）、港股通标的股票、股票型基金（不含股票型分级基金的优先级份额）、混合型基金（不含混合型分级基金的优先级份额）等； 在未来法律法规允许的情况下，本集合计划可投资在海外上市的中国公司股票。</p> <p>(2) 固定收益类资产及货币市场工具：国债，地方政府债，金融债，公司债（含非公开发行公司债），企业债，可转换债券，可分离交易债券，可交换债券（含私募可交换债券），非公开定向债务融资工具，并购重组私募债、证券公司短期公司债、永续债、银行间及交易所上市的资产支持证券（含次级；底层资产不包括资管产品或其收益权）、银行间市场上市的资产支持票据（含次级；底层资产不包括产品）、央行票据、短期融资券（含超短期融资券）、中期票据等银行间市场交易的投资品种以及经银行间市场交易商协会批准注册发行的其他债务融资工具等；股票型及混合型分级基金的优先级份额、债券型基金；银行存款（包括但不限于银行定期存款、协议存款、同业存款等各类存款）、同业存单、货币市场基金、债券逆回购、标准化票据等，以及监管机构允许集合计划投资的其他货币市场工具；</p> <p>(3) 商品及金融衍生品类资产：权证（仅限因持有股票派发）、股指期货、国债期货、商品期货、场内期权、利率互换、CRMW 等场内衍生品、商品基金（含商品期货基金和商品 ETF 等）；</p> <p>(4) 现金（活期存款）；</p> <p>(5) 集合计划可以参与证券回购，但集合计划的总资产不得超过该计划净资产的 200%，中国证监会另有规定的除外； 本集合计划投资范围中的各类基金均包含 QDII 基金。 因托管人系统限制，可对如下投资范围暂时不做监督，待系统上线后履行监督职责： 管理人在投资存托凭证（包括在科创板上市的存托凭证）、权证、期权、利率互换、CRMW 等场内衍生品、商品基金（含商品期货基金和商品 ETF 等）、在海外上市的中国公司股票前，应与托管人就清算交收、核算估值、系统支持进行确认，确保双方均准备就绪方可进行投资。</p>
<p>投资比例</p>	<p>1、投资于存款、债券等债权类资产的比例低于资产管理计划总资产的 80%； 2、投资于股票等股权类资产的比例低于资产管理计划总资产的 30%； 3、投资于商品及金融衍生品类资产的持仓合约价值低于资产管理计划总资产的 80%，或者衍生品账户权益不超过资产管理计划总资产的 20%；其中，权证市值上限为资产净值的 3%；集合计划投资股指期货的，在任何交易日日终，集合计划买入、卖出股指期货合约价值轧差计算后不超过资产总值的 80%；集合计划投资国债期货的，在任何交易日日终，集合计划买入、卖出国债期货合约价值轧差计算后不超过资产总值的 80%； 4、可交换私募债、并购重组私募债、资产支持证券（含次级）、资产支持票据（含次级）合计投资比例不超过计划资产净值的 50%；</p>
<p>投资限制</p>	<p>为维护委托人的合法权益，除投资范围及比例部分规定的限制外，本集合计划</p>

	<p>还需遵循以下限制：</p> <ol style="list-style-type: none">1、集合计划参与股票、债券、可转换公司债券、可交换公司债券等证券发行申购时，申报的金额不得超过集合计划的总资产，申报的数量不得超过拟发行公司本次发行的总量；2、集合资产管理计划的总资产不得超过该计划净资产的 200%，中国证监会另有规定的除外；3、本集合计划投资于同一资产的资金，不得超过集合计划资产净值的 25%；银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券等中国证监会认可的投资品种除外。
--	---

备注：托管人在其交易监督系统可监测范围内进行投资监督。对无法通过公开市场上第三方数据供应商获取相关信息而导致托管行无法监督的事项，由管理人履行监督责任。

管理人：上海东方证券资产管理有限公司（业务章）

托管人：中国工商银行股份有限公司广州分行（业务章）

2020 年 月 日