

东方红-新睿 2 号 集合资产管理合同



二〇一五年三月

目 录

一、前言	2
二、合同当事人	3
三、东方红-新睿 2 号集合资产管理计划的基本情况	3
四、集合计划的参与	6
五、管理人自有资金参与集合计划	9
六、集合计划账户管理	10
七、集合计划资产托管	11
八、投资限制	11
九、集合计划的费用、业绩报酬和税收	12
十、集合计划的收益分配	16
十一、集合计划的信息披露	17
十二、委托人的权利和义务	19
十三、管理人的权利和义务	20
十四、托管人的权利与义务	22
十五、集合计划的退出	23
十六、集合计划份额的转让、非交易过户和冻结	26
十七、集合计划终止和清算	27
十八、不可抗力	28
十九、违约责任与争议处理	28
二十、风险揭示	29
二十一、合同的成立与生效	30
二十二、合同的补充、修改与变更	31

特别约定：本《东方红-新睿 2 号集合资产管理合同》（以下简称“本合同”或“集合资产管理合同”）以电子方式签订，管理人、托管人作为本合同签署方，已接受本合同项下的全部条款；委托人（即东方红-新睿 2 号集合资产管理计划的投资者）作为本合同一方，以电子签名方式签署本合同即表明委托人完全接受本合同项下的全部条款，同时本合同成立。

一、前言

为规范东方红-新睿 2 号集合资产管理计划（以下简称“集合计划”或“计划”）运作，明确《东方红-新睿 2 号集合资产管理合同》（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试行办法》（以下简称《试行办法》）、《证券公司集合资产管理业务实施细则（试行）》（以下简称《细则》）等法律法规和中国证监会的有关规定，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《试行办法》、《细则》、《东方红-新睿 2 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资产管理计划，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。

中国证监会对本集合计划出具了批准文件（证监许可[2012]250 号），但中国证监会对本集合计划作出的任何决定，均不表明中国证监会对本集合计划的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明参与本集合计划没有风险。

二、合同当事人

委托人

投资者签订《东方红-新睿 2 号集合资产管理合同》，且合同生效后，投资者即为本合同的委托人。

管理人

上海东方证券资产管理有限公司

法定代表人：王国斌

注册地址：上海市中山南路 318 号 2 号楼 31 层

邮 编： 200010

托管人

中国工商银行股份有限公司

法定代表人：姜建清

注册地址：北京市复兴门内大街 55 号

邮 编： 100140

三、东方红-新睿 2 号集合资产管理计划的基本情况

(一) 名称：东方红-新睿 2 号集合资产管理计划

(二) 类型：非限定性集合资产管理计划

(三) 目标规模

本集合计划推广期规模上限为 40 亿份（含参与资金利息转增份额），存续期不设规模上限。

(四) 投资范围和投资比例

1、投资范围

国内依法发行的权益类资产、固定收益类资产、现金类资产及法律法规允许集合计划投资的其他金融工具。

2、资产配置比例(占资产净值比例)

(1) 固定收益类资产：包括债券逆回购(期限大于7天)、政府债券(到期日在1年以上)、公司债、企业债、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、短期融资券、政策性金融债、央行票据(到期日在1年以上)、中期票据、中小企业私募债(限于有担保或者国有控股企业发行的中小企业私募债)、股票型及混合型分级基金的优先级份额、股票质押式回购业务、资产支持证券等，占资产净值的0-135%。其中，中小企业私募债券的投资比例不高于集合资产净值的40%(因规模缩水导致的被动超比例可不受限制)。本集合计划可以参与融资融券交易，也可以将其持有的股票作为融券标的证券出借给证券金融公司。本集合计划参与股票质押式回购业务，集合资产管理计划为融出方的，在股票质押回购中质权人登记为管理人。

(2) 权益类资产：股票(包括新股申购所得股票，参与定向增发所得股票)、股票型基金、混合型基金、权证等占资产净值的0-135%。其中权证上限为3%。

(3) 现金类资产：现金、银行存款(包括但不限于银行定期存款、协议存款、定活两便存款)、货币市场基金、期限为7天内(含7天)的债券逆回购、到期日在1年内(含1年)的国债、到期日在1年内(含1年)的央行票据等高流动性短期金融产品等，在集合计划封闭期和开放期内占资产净值均不低于5%。

(4) 具有折价套利机会的资产，是指通过某种交易方式使得购置价格低于二级市场价格，或者通过某些交易方式和金融工具的运用具有套利可能的资产，包括：购置价格低于当日收盘价格的大宗交易所得资产、发行价格低于获配当日收盘价的定向增发股票、购置价格低于处于锁定期间的定向增发发行价格的股票、购置价格低于单位净值的封闭式基金、可转换债券及可转换债券转换所得的股票，可交换债券及可交换债券转换所得的股票等，上述资产与现金类资产的总和不低于资产净值的50%。

(5) 卖出股指期货合约价值总额不超过集合计划持有的权益类资产总市值的20%。

(6) 买入股指期货合约价值总额不超过集合计划资产净值的10%。

(7) 在任一时点持有的权益类证券市值和买入股指期货合约价值总额的合计不超过资产净值的135%。

(8) 如集合计划投资股指期货和/或国债期货，在任何交易日终，在扣除股指期货和国债期货合约占用的交易保证金后，保持不低于集合资产管理计划资产净值5%的现金及到期日在1年以内(含1年)的政府债券。

(9) 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净值的 120%

(10) 集合计划可以参与证券回购，但融入资金余额不得超过集合计划资产净值的 40%。

管理人投资融资融券、国债期货投资标的，需事前与托管人就运作流程等协商一致。

管理人应按照《证券公司参与股指期货、国债期货交易指引》及其他相关监管规定及监管机构要求做好相关准备后，方可按照本合同的约定参与国债期货，管理人投资国债期货无须另行征求委托人意见。

本集合计划管理人将在集合计划成立之日起 6 个月内使集合计划的投资组合比例符合以上约定。如因一级市场申购或大宗交易发生投资比例超标，应在购买证券具备调整机会后五个交易日内将投资比例降至许可范围内；如因证券市场波动、投资对象合并、集合计划资产规模发生剧烈变动等因素发生比例超标，应在超标发生之日起在具备调整机会的五个交易日内将投资比例降至许可范围内。

法律法规或中国证监会允许集合计划投资其他品种的，资产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。

(五) 存续期间

1、计划期限： 不设固定存续期限。

2、封闭期： 指本集合计划成立之日起的三个月，封闭期内不办理申购、退出。

3、开放日： 指集合计划成立后推广机构为委托人办理申购、退出业务的工作日，封闭期结束后的每个工作日开放。

(六) 集合计划份额面值

人民币 1.00 元。

(七) 参与本集合计划的最低金额

认购：在推广期办理，按金额认购、份额管理。单个委托人首次参与本集合计划的最低认购金额（含认购费）为 100,000 元。多次认购（含认购费）的部分每次为 100 元的整数倍。

申购：在开放期办理，按金额申购、份额管理。单个委托人首次参与本集合计划的最低申购金额（含申购费）为 100,000 元。多次申购（含申购费）的部分每次为 100 元的整数倍。

（八）本集合计划成立的条件和日期

本集合计划推广期间，管理人在每一认购日办理认购结束后，当委托人累计认购规模达到 1 亿份、且委托人人数不低于 2 人时，管理人有权发出停止认购指令，经具有证券期货相关业务资格的会计师事务所验资后，宣布集合计划成立。

如果未达到前述条件，到推广期结束日，集合计划规模超过或等于人民币 1 亿元、且委托人人数不低于 2 人，经具有证券期货相关业务资格的会计师事务所验资后，宣布集合计划成立。

（九）本集合计划设立失败

中国证监会出具批准文件之日起至推广期结束，在集合计划规模低于人民币 1 亿元或委托人人数低于 2 人条件下，集合计划设立失败，管理人承担集合计划的全部推广费用，并将已认购资金加计同期银行活期存款利息在推广期结束后 30 个自然日内退还集合计划委托人。

四、集合计划的参与

（一）办理时间

认购在推广期内办理。本集合计划向个人投资者和机构投资者同时发售，按推广机构指定营业网点的具体安排办理。

申购在开放期办理。

（二）参与的原则

- 1、集合计划采取金额认购/申购的方式；
- 2、投资者首次参与集合计划的最低认购/申购金额（含认购/申购费）为 100,000 元；
- 3、投资者多次参与集合计划的金额（含认购/申购费）为 100 元的整数倍；

4、认购价格为份额面值。申购价格为开放期内参与当日的集合计划单位净值；

5、推广期内，在每日（T日）办理认购的交易时间结束后，管理人将对委托人认购规模实行汇总统计，当委托人累计认购规模达到1亿份且委托人数不低于2人时，管理人有权于T+1日上午九点前发出停止认购指令，根据参与时间优先的原则宣布超过预定规模的认购无效，并通过管理人网站等方式对相关信息进行披露；

6、推广期内，在每日（T日）办理认购的交易时间结束后，管理人将对委托人认购规模实行汇总统计，当委托人累计认购规模达到40亿份时，管理人将于T+1日上午九点前发出停止认购指令，根据参与时间优先的原则宣布超过40亿份的认购无效，并通过管理人网站等方式对相关信息进行披露；

7、开放期每日办理申购的交易时间结束后，管理人将对当日（T日）净申购规模实行汇总统计，当管理人认为集合计划资产规模过大导致无法找到合适的投资品种，或可能对集合计划业绩产生负面影响，从而损害集合计划现有持有人的利益时，管理人有权于T+1日上午九点前发出停止申购指令，根据参与时间优先的原则宣布超过预定规模的申购无效，并通过管理人网站等方式对相关信息进行披露。

（三）办理场所

推广机构指定的推广营业网点。如推广机构根据具体情况变更或增减其指定推广营业网点，需另行披露。

（四）参与的程序和确认

1、投资者按推广机构指定营业网点的具体安排，在推广期/开放期的交易时间段内办理；

2、投资者应开设推广机构认可的交易账户，并在交易账户备足认购/申购的货币资金；若交易账户内参与资金不足，推广机构不受理该笔参与申请。

3、投资者书面形式同意以电子签名方式签署本合同后，既可以到集合计划推广机构指定营业网点的柜台申请参与集合计划，也可以登录推广机构指定网络系统以自主下单的方式申请参与集合计划。参与申请经管理人确认有效后，构成本合同的有效组成部分；

4、投资者参与申请成功后，其参与申请和参与资金不得撤销；

5、投资者于T日提交参与申请后，一般可于T+2日后在办理参与的网点查询参与确

认情况。

(五) 参与费及参与份额的计算

1、参与费率

按参与金额采用比例费率，投资者在一天之内如果有多笔参与，适用费率按单笔分别计算。认购/申购费直接从认购/申购金额中扣除，不计入委托人认购/申购份额，不列入集合计划资产。参与费率具体见下表：

认购费：

认购金额 (M)	适用认购费率
M<100 万	1.2%
100 万≤M<500 万	0.8%
M≥500 万	1000 元/笔

申购费：

申购金额 (M)	适用申购费率
M<100 万	1.5%
100 万≤M<500 万	1.0%
M≥500 万	1000 元/笔

2、认购份额的计算方法

$$\text{认购费} = \text{认购金额} \times \text{认购费率}$$

$$\text{净认购金额} = \text{认购金额} - \text{认购费} + \text{认购金额在推广期内产生的利息}$$

$$\text{认购份额} = \text{净认购金额} \div \text{集合计划份额面值}$$

3、申购份额的计算方法

$$\text{申购费} = \text{申购金额} \times \text{申购费率}$$

$$\text{净申购金额} = \text{申购金额} - \text{申购费}$$

$$\text{申购份额} = \text{净申购金额} \div \text{申购价格}$$

集合计划份额面值为 1.00 元。集合计划份额保留小数点后两位，第三位四舍五入。

(六) 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将折算为计划份额归委托人所有，其中利息以中国证券登记结算有限责任公司的记录为准。

五、管理人自有资金参与集合计划

管理人以自有资金参与本集合计划的：

（一）自有资金参与的条件

在本集合计划推广期起始日至集合计划终止日内，管理人可以以自有资金参与本集合计划。

在本集合计划存续期间，为应对集合计划巨额退出，解决流动性风险，在不存在利益冲突并遵守合同约定的前提下，管理人可以自有资金参与本集合计划，但需事后及时告知委托人和托管人，并按相关规定报监管机构备案。

管理人以自有资金参与本集合计划，应符合《管理办法》、《细则》、《规范》和监管机构的相关规定。

（二）自有资金参与的金额和比例

管理人自有资金持有本集合计划份额不超过集合计划总份额的20%。

（三）自有资金收益分配、责任承担方式和金额

管理人持有计划份额与委托人持有计划份额享有同等参与收益分配的权利，也有承担与计划份额相对应损失的责任。

（四）自有资金退出的条件

管理人自有资金参与部分在出现以下情况之一时，可以退出本集合计划：

1、管理人自有资金参与份额，满足参与时间不少于6个月条件时，可与其他委托人同样办理退出业务。

2、因集合计划规模变动等客观因素导致自有资金参与集合计划被动超过法律、法规及本合同规定比例。

3、法律法规或监管机构规定的允许自有资金退出的其他情况。

（五）管理人自有资金参与集合计划的持有期限不得低于6个月，参与、退出时应当提前5个工作日告知委托人和托管人。

（六）为应对巨额退出，解决流动性风险，在不存在利益冲突并遵守合同约定的前提下，管理人参与的自有资金参与、退出可不受上述限制，但需事后及时告知委托人和托管人。

(七)因集合计划规模变动等客观因素导致自有资金参与集合计划被动超限时处理原则及处理措施:

因集合计划规模变动等客观因素导致自有资金参与集合计划的比例超过计划总份额的20%时,管理人在具备参与、退出本计划条件之日起10个交易日内可以将自有资金比例降至许可范围内。

(八) 风险揭示

管理人自有资金退出,可能遭遇流动性风险,从而影响计划损益。管理人将认真履行管理人职责,关注计划规模变动情况,控制风险。

(九) 信息披露

管理人及时在管理人指定网站公告自有资金参与的相关情况。

六、集合计划账户管理

本集合计划根据相关法律法规开立集合计划托管银行账户、证券账户以及证券交易资金账户以及股指期货交易编码,与管理人、托管人、推广机构和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。

(一) 集合计划托管银行账户的开立和管理

根据《试行办法》、《细则》和相关规定,托管人将以集合资产管理计划的名义开立专用托管银行账户,保管集合计划的银行存款。该账户的开设和管理由托管人负责,管理人提供必要协助。本集合计划成立后的一切货币收支活动,均需通过该托管银行账户进行。

托管银行账户的开立和使用,仅限于满足开展本集合计划的需要。

(二) 集合计划证券账户、证券交易资金账户的开立和管理

托管人为本集合计划在中国证券登记结算有限责任公司上海/深圳分公司代理开立专门的证券账户,证券账户名称为“东证资管—工商银行—东方红-新睿2号集合资产管理计划”(以实际开立为准)。

集合计划证券账户的开立和使用,仅限于满足开展本集合计划的需要。

托管人以集合计划托管人的名义在中国证券登记结算有限责任公司上海/深圳分公司开立并管理集合计划证券交易资金账户,用于证券和资金清算。

(三) 集合计划期货资产账户的开立和管理

若本集合计划投资于股指期货,管理人应为本集合计划在期货公司处开立期货资产账

户，用于存放本集合计划股指期货保证金，并为本集合计划申请交易编码，托管人应配合提供有关资料。管理人在办理期货保证金账户开户、申请交易编码、银期转账开通手续时，应将托管账户指定为本集合计划期货资产账户对应的唯一银行结算账户，未经托管人书面同意，管理人不得变更本集合计划期货保证金账户对应的银行结算账户。未经托管人书面同意，管理人不得撤销银期转账业务。对本计划项下存放于期货资产账户的委托资产，托管人无保管义务。

七、集合计划资产托管

东方红-新睿 2 号集合资产管理计划资产交由托管人负责托管，管理人与托管人必须按照《试行办法》、《细则》、本合同及其他有关规定签订托管协议。

八、投资限制

为维护委托人的合法权益，本集合计划投资禁止从事下列行为：

- 1、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%。
- 2、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；
- 3、将集合计划资产用于可能承担无限责任的投资；
- 4、将集合计划投资于一家公司发行的证券超过资产净值的 10%；
- 5、管理人将其所管理的客户资产投资于一家公司发行的证券，按证券面值计算，超过该证券发行总量的 10%；
- 6、本集合计划投资于管理人及与管理人有关联方关系的公司发行的证券（包括管理人母公司保荐（主承销）的证券）的资金超过资产净值的 7%。因集合计划资产申购新股新券或参与大宗交易，致使投资不符合本规定的，管理人应在具备调整机会的五个工作日内进行调整，以符合上述规定。法律法规另有规定时，从其规定；
- 7、投资于信托公司发行的产品；
- 8、集合计划申购新股，申报的金额超过集合计划的现金总额，申报的数量超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；
- 9、在任一时点，集合资产管理计划持有的权益类证券市值和买入股指期货合约价值

总额的合计超过资产净值的 135%;

10、如集合计划投资股指期货和/或国债期货,在任何交易日日终,在扣除股指期货和国债期货合约占用的交易保证金后,持有的现金及到期日在 1 年以内的(含 1 年)政府债券低于集合资产管理计划资产净值的 5%;

11、集合计划持有的卖出股指期货合约价值总额超过集合计划持有的权益类资产总市值的 20%;

12、集合计划持有的买入股指期货合约价值总额超过集合计划资产净值的 10%;

13、中国证监会禁止的其他行为。

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,则本集合计划不受上述限制。

本计划管理人应当自集合计划合同生效之日起 6 个月内使集合计划的投资组合比例符合合同的约定。由于证券市场波动、上市公司合并或集合计划规模变动等管理人之外的原因导致的投资组合不符合上述约定的比例不在限制之内,但集合计划管理人应在具备调整机会的五个工作日内进行调整,以达到标准。法律法规另有规定的从其规定。

九、集合计划的费用、业绩报酬和税收

(一) 集合计划费用计提方法、计提标准和支付方式

1、托管费

(1) 按资产净值的 0.25%年费率计提。

(2) 按前一日计划资产净值计算,按日计提,按月支付。在每个月最后一个工作日收市后,由管理人向托管人发送集合计划托管费划付指令,托管人复核后于次月前 5 个工作日内从集合计划中支付给托管人。若遇法定节假日、休息日或战争、自然灾害等不可抗力致使无法按时支付的,顺延至最近可支付日支付。

(3) 托管费计算方法如下:

$$C=i \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$$

注: C为每日应计提的托管费, i为前一日的资产净值。

2、管理费

(1) 根据集合计划前一日的累计单位净值(X)分档收取:

集合计划前一日累计单位净值 (X)	适用管理费率(年)
$X < 0.95$	0
$0.95 \leq X \leq 1.20$	1.0%
$X > 1.20$	1.5%

(2) 按前一日计划资产净值计算, 按日计提, 按月支付。在每个月最后一个工作日收市后, 由管理人向托管人发送集合计划管理费划付指令, 托管人复核后于次月前 5 个工作日内从集合计划中支付给管理人。若遇法定节假日、休息日或战争、自然灾害等不可抗力致使无法按时支付的, 顺延至最近可支付日支付。

(3) 管理费计算方法如下:

$$G = i \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$$

注: G为每日应计提的管理费, i为前一日的资产净值。

3、证券交易费用

集合计划投资运作期间发生的交易佣金、开放式基金的认(申)购和赎回费、印花税等有关费用, 作为交易费用在收取时从集合计划中扣除。交易佣金的费率由管理人本着保护委托人利益的原则, 按照法律法规的规定确定。

4、集合计划注册登记费用

根据中国证券登记结算有限责任公司规定的注册登记费用, 按费用实际支出金额支付, 列入当期计划费用。

5、集合计划成立后的信息披露费用、会计师费和律师费, 以及按照国家有关规定可以列入的其他费用。

由管理人本着保护委托人利益的原则, 按照公允的市场价格确定, 法律法规另有规定时从其规定。并由托管人根据法律法规及相应协议的规定, 按费用实际支出金额支付, 列入当期计划费用。

(二) 不列入集合计划费用的项目

集合计划推广期间的费用, 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) 管理人的业绩报酬

1、管理人收取业绩报酬的原则

- (1) 按委托人每笔参与份额分别计算年化收益率并计提业绩报酬。
- (2) 符合业绩报酬计提条件时，在本集合计划分红日、委托人退出日和本集合计划终止日计提业绩报酬。
- (3) 集合计划分红日提取业绩报酬的，业绩报酬从分红资金中扣除。在委托人退出和集合计划终止时提取业绩报酬的，业绩报酬从退出资金中扣除。
- (4) 委托人在集合计划分红日退出的，退出份额按照退出时应计提的业绩报酬金额计提业绩报酬。

2、业绩报酬的计提方法

业绩报酬计提日为本集合计划分红日、委托人退出日或本集合计划终止日。每份集合计划份额的业绩报酬以该份额 X 日至本次业绩报酬计提日期间的年化收益率 R，作为计提业绩报酬的基准。

对于 2014 年 5 月 7 日之前（含 2014 年 5 月 7 日）参与的份额，X 日为 2014 年 5 月 7 日前该份额最近一个发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日，如该日不存在，则推广期参与的为本集合计划成立日，存续期参与的为参与当日；

对于 2014 年 5 月 7 日之后（不含 2014 年 5 月 7 日）参与的份额，X 日为份额参与日。

$$R = \frac{A - B}{C} \times \frac{360}{D} \times 100\%$$

- A 为业绩报酬计提日的累计单位净值；
- B 为 X 日的累计单位净值；
- C 为 X 日的单位净值；
- D 为 X 日与本次业绩报酬计提日间隔天数；

(1) 分红日提取业绩报酬

集合计划分红日提取业绩报酬的，按该笔集合计划份额的年化收益率计算，可提取的业绩报酬如下：

年化收益率 (R)	计提比例	H1 计算方法
R ≤ 5%	0%	H1 = 0

R>5%	20%	$H1 = \max(0, (R - 5\%) \times 20\% \times C \times F \times \frac{D}{360} -$ 该笔份额在X日后已计提的业绩报酬总额)
------	-----	---

管理人在分红日可提取的业绩报酬不应超过该笔份额本次分红金额的 20%，故业绩报酬上限如下：

$$H2 = Div \times F \times 20\%$$

注：Div 为本次分红日每份分红金额

F 为该笔提取业绩报酬的份额。

因此，管理人提取业绩报酬的实际金额为：

$$H = \min(H1, H2)$$

(2) 委托人退出日或集合计划终止日提取业绩报酬

退出日或集合计划终止日提取业绩报酬的，该笔集合计划份额提取的业绩报酬如下：

年化收益率 (R)	计提比例	业绩报酬 (H) 计算方法
R≤5%	0%	$H = 0$
R>5%	20%	$H = \max(0, (R - 5\%) \times 20\% \times C \times F \times \frac{D}{360} -$ 该笔份额在X日后已计提的业绩报酬总额)

3、业绩报酬支付：

由管理人向托管人发送业绩报酬划付指令，托管人于 5 个工作日内将业绩报酬划拨给注册登记机构，由注册登记机构将业绩报酬支付给管理人。若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

(四) 集合计划的税收

集合计划运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家有关法律法规执行。

十、集合计划的收益分配

（一）集合计划收益构成

收益包括：集合计划投资证券所得红利、股息、债券利息、买卖证券差价、银行存款利息以及已实现的其他合法收入。

计划净收益是计划收益扣除按国家有关规定可以在计划收益中提取的有关费用等项目后得出的余额。

期末可供分配利润指截止收益分配基准日未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低者。

（二）收益分配的条件

集合计划单位净值不低于面值，且有可供分配利润时，管理人可以进行收益分配。

（三）收益分配原则

1、收益采用现金分配或红利再投资方式，每位委托人获得的分红收益金额或再投资份额保留小数点后两位，第三位四舍五入；

2、每一集合计划份额享有同等分配权；

3、计划收益分配基准日的单位净值减去每单位份额收益分配金额后不能低于初始面值；

4、本集合计划的默认分红方式为现金分红，委托人可以选择现金分红或者红利再投资分红方式。选择采取现金分配的，管理人向托管人发送划付指令，托管人根据指令将收益分配款项划入注册登记机构，注册登记机构将收益分配款划入相应推广机构结算备付金账户，由推广机构划入委托人的交易账户，现金红利扣除管理人应提业绩报酬后在 T+7 日内划转到委托人的交易账户；选择采取红利再投资方式的，分红资金扣除管理人应提业绩报酬后按 T 日的单位净值转成相应的集合计划单位；

5、收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由委托人自行承担；

6、法律法规另有规定的从其规定。

（四）收益分配方案的确定与披露

集合计划收益分配方案中将载明集合计划收益的范围、可供分配利润、收益分配对象、分配原则、权益登记日和除权除息日、红利发放日、分配数额及比例、分配方式等内容。

集合计划收益分配方案由管理人拟定，经托管人复核后确定，并在确定之日起3个工作日内在管理人网站进行信息披露。收益分配方案确定后，按相关规定报监管机构备案。

十一、集合计划的信息披露

(一) 集合计划的信息披露将严格按照《试行办法》、《细则》、《集合资产管理合同》、《说明书》及其他有关规定进行。

(二) 《说明书》、《集合资产管理合同》

管理人依据《试行办法》和《细则》提供《说明书》、《集合资产管理合同》以备投资者查阅。

(三) 集合计划成立后信息披露的内容和披露时间

1、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) 集合计划单位净值报告。

自集合计划成立之日起，每周第一个工作日披露上周末单位净值；开放期内每个工作日披露截止前一个工作日的单位净值。

(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。资产管理季度报告由管理人编制，经托管人复核后由管理人公告，并按相关规定报监管机构备案。上述报告应于每季度结束后的15个工作日内由管理人负责披露。集合资产管理合同生效不满二个月的，可以不编制季度报告。

集合计划投资股指期货和/或国债期货的，管理人应当在资产管理季度报告中充分披

露集合资产管理计划参与股指期货和/或国债期货交易的有关情况，包括投资目的、持仓情况、损益情况等，并充分说明投资股指期货和/或国债期货对集合资产管理计划总体风险的影响以及是否符合既定的投资目的。

(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。资产管理年度报告由管理人编制，经托管人复核后由管理人公告，并按相关规定报监管机构备案。上述报告应于每会计年度结束后的60个工作日内由管理人负责披露。集合资产管理合同生效不满三个月的，可以不编制年度报告。

集合计划投资股指期货和/或国债期货的，管理人应当在资产管理年度报告中充分披露集合资产管理计划参与股指期货和/或国债期货交易的有关情况，包括投资目的、持仓情况、损益情况等，并充分说明投资股指期货和/或国债期货对集合资产管理计划总体风险的影响以及是否符合既定的投资目的。

(4) 年度审计报告。

管理人进行年度审计，应当同时对客户资产管理业务的运营情况进行审计，并要求具有证券相关业务资格的会计师事务所就本集合资产管理计划出具单项审计意见。

管理人应当将审计结果按相关规定报监管机构备案，并将本集合资产管理计划的单项审计意见提供给委托人和托管人。

(5) 对账单。

管理人应按照有关法律法规的规定编制对账单，对委托人持有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作出说明，在每个季度结束后向委托人提供。对账单的提供形式为邮寄或电子形式，委托人可以选择提供方式，默认的为电子形式（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以下可能对集合计划运作产生重大影响的事件时，管理人必须按照法律法规和中国证监会的有关规定，及时在管理人网站进行信息披露：

(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，管理人应当及时

将有关情况向住所地中国证监会派出机构报告，并向委托人披露；

- (2) 集合计划资产的估值错误导致错误偏差达到计划资产净值的 0.5%；
- (3) 暂停受理或者重新开始受理参与或者退出申请；
- (4) 发生巨额退出并导致延期退出的情形；
- (5) 集合计划终止和清算；
- (6) 合同的补充、修改与变更；
- (7) 与集合计划有关的重大诉讼、仲裁事项；
- (8) 负责本集合计划的代理推广机构发生变更；
- (9) 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；
- (10) 管理人、托管人因解散、破产、撤销等原因不能履行相应职责；
- (11) 管理人将集合计划的资产投资于管理人及与管理人有关关联方关系的公司发行的证券或与管理人有关关联方关系的公司承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易；
- (12) 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。

(四) 信息披露方式

1、推广期内推广机构指定营业网点柜台查询。《集合资产管理合同》、《说明书》等文本存放在管理人和推广机构指定营业网点柜台，委托人可免费查阅，并可在合理时间内取得上述文件。

2、管理人网站信息披露。《集合资产管理合同》、《说明书》、定期报告和临时报告等有关集合计划的信息将在管理人网站上披露，委托人可随时查阅。

管理人网站：www.dfham.com

3、邮寄服务

管理人设立客户服务部门，在集合计划存续期间按本合同约定向委托人邮寄资产管理报告、托管报告和对账单。

十二、委托人的权利和义务

(一) 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、授权管理人可以将本集合计划资产投资于本集合计划管理人及与管理人有关关联方关系的公司发行的证券（包括管理人母公司保荐（主承销）的证券），但不得超过本集合计划资产净值的 7%；
- 6、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；
- 7、法律法规、中国证监会的有关规定和本合同及《说明书》约定的其他权利。

（二）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；委托人应当以真实身份参与集合计划；自然人不得用筹集的他人资金参与集合计划，法人或者依法成立的其他组织，用筹集的资金参与集合计划的，应当向管理人或其他推广机构提供合法筹集资金的证明文件；委托人承诺在参与集合资产管理计划之前，已经是管理人或者其他推广机构的客户；
- 2、按照本合同及《说明书》约定缴纳委托资金，承担本合同约定的费用；
- 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、法律法规、中国证监会的有关规定和本合同及《说明书》约定的其他义务。

十三、管理人的权利和义务

（一）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、业绩报酬；
- 3、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；
- 4、根据本合同及《说明书》的约定，终止本集合计划的运作；

- 5、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；
- 6、代为行使集合计划资产投资形成的投资人权利；
- 7、集合计划资产受到损害时，向有关责任人追究法律责任；
- 8、法律法规、中国证监会的有关规定和本合同及《说明书》约定的其他权利。

（二）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、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；
- 3、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，并及时报告；
- 4、按规定出具资产管理报告，保证委托人能够及时了解有关集合计划投资组合、资产净值、费用与收益等信息；
- 5、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，不泄露集合计划的投资安排、投资意向等信息（法律法规、中国证监会另有规定的除外）；
- 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、根据委托人的授权，可以将本集合计划的资产投资于本集合计划管理人及与管理人有关关联方关系的公司发行的证券（包括管理人母公司保荐（主承销）的证券）不得超过本集合计划资产净值的 7%；
- 8、按照法律法规、中国证监会的有关规定和本合同及《说明书》的约定，及时向申请退出集合计划的委托人支付退出款项；
- 9、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，保存期不少于二十年；
- 10、在集合计划终止或因其他原因解散时，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；
- 11、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；
- 12、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；

13、因托管人过错造成集合计划资产损失时，代委托人向托管人追偿；

14、因管理人单方面解除本合同给委托人、托管人造成经济损失时，对委托人、托管人予以赔偿；

15、管理人自身对《说明书》、《资产管理报告》等所有向委托人披露的涉及本集合计划基本情况和信息的真实性、准确性、完整性负责；

16、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。管理人没有及时提供的相关法律规定，托管人不承担监督的职责。

17、法律法规、中国证监会有关规定和本合同及《说明书》约定的其他义务。

十四、托管人的权利与义务

（一）托管人的权利

- 1、依法保管集合计划的资产；
- 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，要求其改正或拒绝执行；
- 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。

（二）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；
- 2、非依法律、行政法规和中国证监会有关规定或合同约定，不得擅自动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、执行管理人的投资或者清算指令，负责办理集合计划名下的资金往来；

5、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，并向中国证监会报告；

6、复核、审查管理人计算的集合计划的资产净值；

7、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）；

8、按规定出具集合计划托管情况的报告；

9、妥善保管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；

10、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还事宜；

11、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；

12、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；

13、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；

14、因托管人单方解除本合同给委托人、管理人造成经济损失的，对委托人、管理人予以赔偿；

15、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其他义务。

十五、集合计划的退出

（一）退出的含义

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。

（二）委托人退出安排

1、退出的办理时间

退出在开放期办理。

2、退出原则

(1) 先进先出，以份额申请。申请退出份额精确到小数点后两位。委托人可将其全部或部分集合计划份额退出；

(2) 以委托人申请退出当日的集合计划单位净值为基准计算退出金额，巨额退出的情形另行规定。

3、退出的办理场所

推广机构指定的推广营业网点。如推广机构根据具体情况变更或增减其指定推广营业网点，需另行披露。

4、退出的申请和确认

(1) 委托人按推广机构指定营业网点的安排，在开放期的交易时间段内办理；

(2) 委托人应填写交易申请表，同时其在推广机构指定营业网点必须有足够的集合计划份额；

(3) 推广机构指定营业网点受理申请表后，检查委托人持有的集合计划份额，符合退出约定的，委托人退出申请成功；

(4) 委托人于 T 日提交退出申请后，一般可于 T+2 日在网点查询退出确认情况；

(5) 退出款项将在 T+7 日内转入委托人的交易账户。

5、集合计划的退出费

退出费由委托人承担，用于推广机构指定营业网点退出业务办理等各项费用。

(1) 退出费率：

份额存续时间 (L)	适用退出费率
L < 365 个自然日	0.5%
365 个自然日 ≤ L < 730 个自然日	0.3%
L ≥ 730 个自然日	0

(2) 退出金额的计算公式

退出金额为退出总额扣减退出费后的余额，计算结果保留到小数点后两位，第三位四舍五入。

退出总额 = 退出份额 × 单位净值 - 业绩报酬

退出费 = 退出总额 × 退出费率

退出金额=退出总额-退出费

(3) 收取方式

委托人退出申请被确认后，退出费按实际被确认的退出总额和退出费率为基准计算。退出费直接从退出总额中扣除。

(三) 巨额退出的认定和处理方式

1、巨额退出的认定

当每一个开放日本集合计划净退出申请份额超过上一工作日集合计划总份额的 10%，即认为是发生了巨额退出。

2、巨额退出的处理方式

当出现巨额退出时，管理人可以根据本计划当时的资产组合状况决定全额退出或部分顺延退出。

(1) 全额退出：当管理人认为有能力支付投资者的退出申请时，按正常退出程序执行。

(2) 部分顺延退出：当管理人认为支付委托人的退出申请有困难或认为兑付委托人的退出申请可能对计划的资产净值造成较大波动时，管理人在当日接受退出比例不低于上一日计划总份额的 10%的前提下，对其余退出申请延期办理，但最长不得超过 20 个工作日。对于当日的退出申请，应当按单个账户退出申请量占退出申请总量的比例，确定当日受理的退出份额；未能退出部分，除投资者在提交退出申请时明确选择不参加顺延退出外，选择参加顺延退出的投资者的未退出份额将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不享有退出优先权并将以下一个工作日的单位净值为准进行计算，并以此类推，直到全部退出为止。委托人在提出退出申请时可选择将当日未获受理部分予以撤销。

(3) 当发生巨额退出并顺延退出时，管理人应立即通过在管理人的公司网站刊登公告等途径向委托人公布信息，并说明有关处理方法。

(四) 连续巨额退出的认定和处理方式

1、连续巨额退出的认定

本集合计划连续两个开放日（含两日）以上发生巨额退出，即认为发生了连续巨额退出。

2、连续巨额退出的处理方式

出现连续巨额退出时，管理人可采用全额退出或部分顺延退出(具体含义见前款巨额退出的处理方式)方式处理，当管理人认为有必要时，也可拒绝或暂停接受退出申请，并对已经接受的退出申请，采用全额退出或部分顺延退出方式处理。

(五) 拒绝或暂停退出的情形及处理

1、发生下列情形时，管理人可以在开放期拒绝或暂停受理委托人的退出申请：

- (1) 战争、自然灾害等不可抗力的原因导致集合计划无法正常运作；；
- (2) 证券交易场所交易时间非正常停市，导致当日集合计划资产净值无法计算；
- (3) 因市场剧烈波动或其他原因而出现连续巨额退出，导致本集合计划的现金支付出现困难；
- (4) 法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

2、拒绝或暂停受理退出的方式包括：

- (1) 拒绝、暂停受理某笔或数笔退出申请；
- (2) 拒绝、暂停受理某个或数个开放日的全部退出申请；
- (3) 法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

已接受的退出申请，管理人应足额支付；如暂时不能足额支付的，可支付部分按每个退出申请人已被接受的退出申请量占已接受退出申请总量的比例分配给退出申请人，未支付部分由管理人按照发生的情况制定相应的处理办法在后续工作日予以支付。

发生拒绝或暂停受理退出的情形时，管理人应将拒绝或暂停受理退出的原因和处理办法在管理人网站进行信息披露。在暂停退出的情况消除时，管理人应及时恢复退出业务的办理。

十六、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

集合计划存续期间，在集合计划具备交易条件后，客户可以通过证券交易所等中国证监会认可的交易平台转让集合计划份额。

（二）集合计划的非交易过户

非交易过户是指不采用参与、退出等集合计划交易方式，将一定数量的集合计划单位按照一定规则从某一委托人集合计划账户转移到另一委托人集合计划账户的行为。集合计划注册登记机构只受理因继承、捐赠、司法执行、以及其他形式财产分割或转移引起的计划份额非交易过户。对于符合条件的非交易过户申请按注册登记机构的有关规定办理。

（三）集合计划的冻结

集合计划注册登记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。

十七、集合计划终止和清算

（一）有下列情形之一的，集合计划终止：

- 1、本计划存续期间，计划的委托人少于2人；
- 2、管理人因重大违法、违规行为，被中国证监会取消业务资格；
- 3、管理人因停业、解散、破产、撤销等原因不能履行相应职责；
- 4、托管人因重大违法违规，被中国证监会取消相关业务资格不能履行职责，且无其他适当的托管机构承接托管人原有的权利和义务；
- 5、托管人因解散、破产、撤销、丧失集合资产管理计划托管机构资格、停止营业等事由，不能继续担任托管人的职务，且无其他适当的托管机构承接托管人原有的权利及义务；
- 6、战争、自然灾害等不可抗力发生导致集合计划不能存续；
- 7、法律法规和中国证监会规定的其他情况。

（二）集合计划的清算

- 1、自集合计划终止之日起5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监管机构的相关规定进行集合计划清算；
- 2、集合计划终止后15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，

并报监管机构备案；清算过程中的有关重大事项须及时公布；

3、清算结果披露后 7 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委托人拥有集合计划份额的比例以货币资金的形式全部分派给委托人，并注销集合计划专用证券账户和资金账户。

若本集合计划在终止之日有未能流通变现的证券，管理人可针对该部分未能流通变现证券制定二次清算方案，该方案应经托管人认可，并通过管理人网站进行披露。管理人应根据二次清算方案的规定，对该部分未能流通变现的证券在可流通变现后进行二次清算，并将变现后的资产按照委托人拥有份额的比例，以货币形式全部分配给委托人。

十八、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、地震及其他自然灾害、战争、骚乱、火灾、政府征用、没收、法律变化等。

如果因不可抗力或证券交易场所非正常暂停或停止交易等其他突发事件不能履行本合同时，可根据不可抗力或有关突发事件的影响部分或全部免除责任。一方因不可抗力或突发事件不能履行本合同时，应及时通知另一方，并在合理期限内提供受到不可抗力或突发事件影响的证明，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或突发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。

十九、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) 战争、自然灾害等不可抗力和其他突发事件；

(2) 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；

(3) 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；

(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。

2、合同当事人违反本合同，给其他当事人造成直接经济损失的，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、因一方当事人违约而导致其他当事人损失的，委托人应先于其他受损方获得赔偿。

5、由于管理人、托管人不可控制的因素导致业务出现差错，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，但是未能发现错误的，由此造成计划财产或委托人损失，管理人和托管人免除赔偿责任。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。

6、一方当事人依据本合同向另一方当事人赔偿的损失，仅限于直接损失。

(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有管辖权的法院提起诉讼。

二十、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。

（二）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。

（三）流动性风险

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。流动性风险还包括由于本集合计划在开放期出现投资者大额或巨额赎回，致使本集合计划没有足够的现金应付集合计划退出支付的要求所导致的风险。

（四）信用风险

信用风险是指发行人是否能够实现发行时的承诺，按时足额还本付息的风险，或者交易对手未能按时履约的风险。

（五）本集合资产管理计划特有风险。

（六）其他风险

对上述风险的具体描述请参考《东方红-新睿2号集合资产管理计划风险揭示书》和《说明书》。

二十一、合同的成立与生效

（一）合同的成立与生效

在本合同已加盖管理人、托管人公章后由管理人提交公证机关公证，作为证明本合同内容的唯一依据，委托人以电子签名方式签署后即告成立。

本合同成立后，同时满足以下二个条件时生效：

- （1）委托人参与资金实际交付并经中国证券登记结算有限责任公司注册登记系统确

认；

(2) 本集合计划依法有效成立。

(二) 《东方红-新睿2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或数据电文和各推广机构出具的集合计划参与、退出业务受理有关凭证、委托人通过电子签名方式产生的数据电文等为本合同的附件，是本合同不可分割的一部分。

(三) 委托人的实际参与份额以中国证券登记结算有限责任公司注册登记系统确认的份额为准。

二十二、合同的补充、修改与变更

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。

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。另外，管理人须在公告后两个工作日内向委托人邮寄合同变更征询意见函。委托人不同意变更的，应在征询意见函发出后的十五个工作日内提出退出申请，未提出退出申请的，视同委托人已经同意合同变更；若委托人未对合同变更事项表态，也未在征询意见函发出后的十五个工作日内提出退出申请的，视同委托人已经同意合同变更。合同变更于公告日起二十个工作日后生效，公告内容即成为本合同组成部分。管理人应及时将变更后的合同按相关规定报监管机构备案。

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。

委托人、管理人、托管人不得通过签订补充协议、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。

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。

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：_____

个人（签字）：_____

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：_____ 移动电话：_____ 电子信箱：_____

机构（盖章）：_____

法定代表人或授权代表：

管理人：上海东方证券资产管理有限公司（盖章）

托管人：中国工商银行股份有限公司（盖章）

签订日期： 年 月 日