

合同编号：ZG8190

华泰期货 CTA 母基金资产管理计划
资产管理合同

管理人：华泰期货有限公司

托管人：中国国际金融股份有限公司

目 录

目 录.....	2
期货公司资产管理业务风险揭示书.....	3
资产合法性及投资者适当性承诺书.....	5
第一节 前言.....	7
第二节 释义.....	7
第三节 声明与承诺.....	10
第四节 资产管理计划的基本情况.....	12
第五节 资产管理计划的募集及成立.....	13
第六节 资产管理计划的备案.....	14
第七节 资产管理计划的参与、退出与转让.....	14
第八节 当事人的权利与义务.....	20
第九节 资产管理计划份额的登记.....	24
第十节 资产管理计划的投资.....	24
第十一节 投资经理的指定与变更.....	27
第十二节 资产管理计划的财产.....	27
第十三节 划款指令的发送、确认和执行.....	29
第十四节 资产管理计划的交易及交收清算安排.....	31
第十五节 越权交易的处理.....	33
第十六节 资产管理计划财产的估值.....	34
第十七节 资产管理计划的费用与税收.....	37
第十八节 资产管理计划的收益分配.....	44
第十九节 信息披露与报告.....	45
第二十节 风险揭示.....	46
第二十一节 合同生效、变更与终止.....	48
第二十二节 资产管理计划财产的清算.....	50
第二十三节 违约责任.....	52
第二十四节 争议的处理.....	53
第二十五节 其他.....	53
附件 1：费用列表.....	58
附件 2：委托资产到账确认函（样本）.....	59
附件 3：资产管理计划起始运作通知书（给托管人）（样本）.....	60
附件 4：授权通知.....	61
附件 5：划款指令（样本）.....	63
附件 6：投资监督事项表.....	64

期货公司资产管理业务风险揭示书

尊敬的客户：

根据中国证券监督管理委员会（以下简称中国证监会）的规定，现向您提供本《期货资产管理业务风险揭示书》（以下简称风险揭示书）。请您在参与期货公司资产管理业务前，了解期货公司资产管理业务的特点和风险，谨慎评估自己的风险承受能力，特别注意以下几点：

一、您在参与资产管理业务前，必须了解有关资产管理业务的法律法规、基础知识、业务特点、风险收益特征等内容，了解期货公司是否具有开展资产管理业务的试点资格，并认真听取期货公司对相关业务规则和资产管理合同内容的讲解。

二、您在参与资产管理业务前，应综合考虑自身的资产与收入状况、投资经验、风险偏好，确信自身有承担参与资产管理业务所面临投资风险和损失的能力，审慎选择与自身风险承受能力相匹配的资产管理投资策略。

三、您参与资产管理业务通常具有市场风险、管理风险、流动性风险、信用风险及其他风险，包括但不限于政策风险、经济周期风险、利率风险、技术风险、操作风险、不可抗力因素导致的风险等。

四、您应特别关注投资期货类品种具有的特定风险，包括但不限于因保证金交易方式可能导致投资损失大于委托资产价值的风险，因市场流动性不足、交易所暂停某合约的交易、修改交易规则或采取紧急措施等原因，导致未平仓合约可能无法平仓或现有持仓无法继续持有的风险。

五、资产管理合同虽然约定了一定的止损比例，但由于持仓品种价格可能持续向不利方向变动、持仓品种因市场剧烈波动导致不能平仓等原因，委托资产亏损存在超出该止损比例的风险。

六、参与资产管理业务的资产损失由客户自行承担，期货公司不以任何方式对客户作出取得最低收益或分担损失的承诺或担保。

七、无论参与资产管理业务是否获利，都需要按约支付管理费用和其他费用，以上费用支付会对客户的账户权益产生影响。

八、委托期间，期货公司在一定条件下存在变更投资经理人选、投资顾问的可能，会对资产管理投资策略的执行产生影响。此外，如《投资顾问协议》提前终止，管理人有权决定是否提前终止本合同，可能会对委托人收益产生影响。

九、在资产管理业务运作过程中，投资顾问的研究水平、投资管理水平直接影响资产管理业务财产收益水平，如果投资顾问判断不准确、获取的信息不全、投资操作出现失误，都会影响资产管理业务财产的收益水平。

十、期货公司既往的资产管理业绩并不预示其未来表现。期货公司介绍的预期收益仅供客户参考，不构成对委托资产可能收益的承诺或暗示。

十一、本风险揭示书的揭示事项仅为列举性质，未能详尽列明客户参与期货公司资产管理业务所面临的全部风险和可能导致客户资产损失的所有因素。

以上《期货公司资产管理业务风险揭示书》的各项内容，本人/本单位已阅读并完全理解。

(请抄写以上划线部分)

客户签章：

签署日期： 年 月 日

资产合法性及投资者适当性承诺书

本人/本单位以真实身份委托华泰期货有限公司运用委托资产进行投资。本人/本单位承诺委托资产来源及用途合法，不属于违反规定的公众集资，符合有关反洗钱法律法规的要求。华泰期货有限公司有权要求本人/本单位提供资产来源及用途合法性证明，对资产来源及用途及合法性进行调查，本人/本单位愿意配合。

本人/本单位符合期货公司资产管理业务合格投资者相关标准，符合《私募投资基金监督管理暂行办法》第十二条规定的“净资产不低于 1000 万元的单位”、“金融资产不低于 300 万元或者最近三（3）年个人年均收入不低于 50 万元的个人”条件，或符合《私募投资基金监督管理暂行办法》第十三条“合格投资者”的规定。

本人/本单位未被法律、法规或监管机构限制参与期货资产管理业务。

本人/本单位将严格遵守以上承诺，否则华泰期货有限公司有权解除资产管理合同，本人违反委托资产来源及用途合法性承诺的，华泰期货有限公司还有权依法限制本人/本单位提取该委托资产。本人/本单位承担因此造成的全部损失和法律责任。

承诺人：

（签章）

日期： 年 月 日

管理人：华泰期货有限公司

法定代表人：吴祖芳

住所地：广州市越秀区东风东路 761 号丽丰大厦 20 层、29 层 04 单元

联系地址：广州市越秀区东风东路 761 号丽丰大厦 20 层、29 层 04 单元

联系人：韦瑜

联系电话：020-83901124

邮箱地址：zcglb@htfc.com

委托人：

身份证号码/营业执照号：

托管人：中国国际金融股份有限公司

住所地：北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层

联系地址：北京市朝阳区建国门外大街 1 号 国贸大厦 2 座 6 层

联系人：段智颖

联系电话：010-65051166

邮箱地址：CICC_AC@cicc.com.cn

第一节 前言

为规范资产管理业务的运作，明确资产管理合同各方当事人的权利与义务，充分保护合同各方当事人的合法权益，根据《中华人民共和国合同法》、《期货交易管理条例》、《期货公司监督管理办法》、《私募投资基金监督管理暂行办法》、《期货公司资产管理业务试点办法》、《期货公司资产管理业务管理规则（试行）》、《期货公司资产管理合同指引》及其补充规定等相关法律、法规规定，管理人、托管人、委托人在平等自愿、诚实信用原则的基础上订立本合同。

本合同是规定合同当事人之间权利义务关系的基本法律文件，其他与资产管理计划相关的涉及各当事人之间权利义务关系的任何文件或表述，如与本合同不一致或有冲突，均以本合同为准。

若因法律法规的制定或修改导致本合同的内容存在与届时有效的法律法规的规定不一致之处，应当以届时有效的法律法规的规定为准，各方当事人应及时就本合同做出相应的变更和调整。

本合同将在中国证券投资基金业协会（以下简称“中基协”或“基金业协会”）备案，但中基协接受本合同的备案并不表明其对资产管理计划的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于资产管理计划没有风险。

第二节 释义

第一条 除非特别说明，本合同中所使用的表述含义如下：

1. 管理人、资产管理人：华泰期货有限公司；
2. 委托人、客户：指签订本合同，符合《私募投资基金监督管理暂行办法》第十二条或第十三条的规定，委托投资单个资产管理计划初始金额不低于 100 万元人民币，且能够识别、判断和承担相应投资风险的自然人、法人、依法成立的组织或中国证监会认可的其他特定投资者；
3. A 类份额委托人：指投资本计划份额的初始金额不得低于 100 万元人民币并满足《私募投资基金监督管理暂行办法》中对合格投资者的要求，且是能够识别、判断和承担相应投资风险的自然人、法人、依法成立的组织或中国证监会认可的其他特定投资者。本计划仅对 A 份额收取浮动投资顾问费。

4. B 类份额委托人：指投资本计划份额的初始金额不得低于 300 万元人民币并满足《私募投资基金监督管理暂行办法》中对合格投资者的要求，且是能够识别、判断和承担相应投资风险的自然人的、法人、依法成立的组织或中国证监会认可的其他特定投资者。本计划不对 B 份额收取浮动投资顾问费。

5. 托管人、资产托管人：中国国际金融股份有限公司；

6. 本合同：委托人、托管人和管理人签署的《华泰期货 CTA 母基金资产管理计划资产管理合同》及其附件，以及对该合同及附件做出的任何有效补充及变更；

7. 资产管理业务：指期货公司非公开募集资金或者接受财产委托设立资产管理计划并担任管理人，根据资产管理合同的约定，为委托人的利益进行投资，并按照合同约定收取管理费及业绩报酬的业务活动；

8. 委托资产、委托财产、计划资产、计划财产：委托人拥有所有权或合法处分权、委托管理人进行管理的作为本合同标的的货币资金；

9. 资管结算账户：委托人开立或指定的用于办理委托资产汇入、追加、提取和清退的银行账户；

10. 托管账户：托管人为委托资产在具有基金托管资格的商业银行处开立的用于保管、管理和运用本委托资产的专用银行账户；

11. 资产管理账户：管理人按照规定为资产管理计划开立的专门用于投资管理的证券账户、期货账户和资金账户等相关账户；

12. 初始委托资产金额：委托人初次向华泰期货 CTA 母基金资产管理计划（以下称“本计划”或“计划”）项下的托管账户划拨的委托资产金额；

13. 委托资产净值：指委托资产总值减去负债后的价值。其计算保留小数点后二位，小数点后第三位四舍五入；

14. 份额净值：又称单位净值，计算方法为委托资产净值除以计划当前的份额。初始委托时，份额净值为 1.00 元，初始份额为初始委托资产金额/初始份额净值；份额净值的计算保留到小数点后四位，小数点后第五位四舍五入；份额的计算保留到小数点后二位，小数点后第三位四舍五入；

15. 份额参考净值：管理人在计算资产净值的基础上，采用“虚拟清算”原则计算各类份额的参考净值。份额参考净值只是对份额价值的一个估算，并不代表份额持有人可获得的实际价值；

16. 投资顾问：指根据本资产管理合同及其他相关协议，为本计划提供涉及投资策略、投资决策、划款指令、交易安排等方面的建议或意见的机构；

17. 管理费：指管理人因管理委托资产而向委托人收取的费用；

18. 托管费：指托管人因保管委托资产而向委托人收取的费用；

19. 业绩报酬：管理人以委托资产收益作为计提基数，按照资产管理合同规定的计算比例和方式收取的费用；

20. 投资顾问服务费：本计划投资顾问因提供投资策略、投资决策、划款指令、交易安排等方面的建议而收取的费用；

21. 工作日：上海证券交易所、深圳证券交易所、中国金融期货交易所、上海期货交易所、郑州商品交易所、大连商品交易所及其他中国证券交易所、证券衍生品交易所或商品衍生品交易所的正常交易且托管人正常营业日；

22. 资产管理计划起始运作日：管理人向托管人发出《资产管理计划起始运作通知书》（附件3）中约定的日期；

23. 对日：指某一日期之后一段时间内的对应日期，若该日为非工作日或日历季度中不存在对应日期的，则顺延至下一个工作日；

24. 收益分配基准日：指核算收益分配的基准日期；

25. 初始销售期间：指计划份额发售之日起至资产管理计划成立日；

26. 存续期：指本计划起始运作日起至终止日；

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

28. 参与：指在资产管理计划开放日，委托人按照本合同的规定参与本计划份额的行为；

29. 退出：指在资产管理计划开放日，委托人按照本合同的规定退出本计划份额的行为；

30. 违约退出：指委托人在非合同约定的退出开放日退出资产管理计划的行为；

31. 划款指令：指管理人在运用委托资产时，向托管人发出的资金划拨及其他款项支付的指令；

32. 不可抗力：不可抗力是指合同双方不能预见、不能避免、不能克服的客观情况，包括但不限于自然灾害、地震、台风、水灾、洪水、火灾、地震及其它自然灾害、战争、

骚乱、突发性公共卫生事件、政府征用、没收、突发停电或其他突发事件、非因本合同任何一方原因导致的技术系统出现重大故障、停止运作或瘫痪、设备故障、网络黑客攻击及卫星传送中断、证券或期货交易所非正常暂停或停止交易以及政策、法律、法规、监管规则的修改或监管要求调整（包括但不限于监管/主管部门出台与本计划相关的任何书面或口头的规则、规范、政策、通知、指令、指引、备忘录、意见或问答等）等情形。因中国人民银行银行间结算系统出现故障导致银行间的结算无法进行的情形，因电信服务商原因导致资金划付的网络中断、无法使用的情形，构成不可抗力事件。

第三节 声明与承诺

第二条 管理人的声明与承诺

1. 管理人是依法设立的期货经营机构，并经中国证监会批准，具有资产管理业务资格；

2. 管理人承诺遵守法律、行政法规和中国证监会等有关规定，诚实守信，审慎尽责，坚持公平交易，避免利益冲突，禁止利益输送，保护客户合法权益；

3. 管理人声明不以任何方式向委托人承诺或担保取得最低收益或分担损失；

4. 管理人声明禁止本公司员工以个人名义接受委托人资产管理委托或对委托人作出最低收益和分担损失的承诺。

5. 管理人保证已在签订本合同前充分地向委托人说明了有关法律法规和相关投资工具的运作市场及方式，同时揭示了相关风险；要求本计划销售机构了解投资者的风险偏好、风险认知能力和承受能力，对本计划投资者的财务状况进行了充分评估。管理人承诺依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用委托资产，不保证委托财产一定盈利，也不保证最低收益。

6. 管理人保证本计划不是专门用于申购新股、炒作风险警示股票（ST 股票）。

7. 管理人保证：

(1) 管理人不存在法律法规、上海证券交易所和深圳证券交易所禁止或限制其投资证券市场的情形；

(2) 管理人的注册资本不低于 100 万元；

(3) 管理人提供的资质证明材料及其他所有资料内容真实、准确、完整、合法，能够提供托管人要求的注册资料等；

(4) 本计划的募集和投资者管理遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《私募投资基金监督管理暂行办法》等相关规定。管理人已经按照相关监管规定进行登记并提供登记证明文件；

(5) 管理人无重大债务纠纷、法律诉讼和违约拖欠记录；

(6) 符合监管部门要求的其他条件。

第三条 委托人的声明与承诺

1. 委托人承诺具有合法的参与资产管理业务的资格，满足《私募投资基金监督管理暂行办法》对合格投资者的要求，不存在法律、行政法规和中国证监会有关规定禁止或限制参与资产管理业务的情形；

2. 委托人承诺以真实身份参与资产管理业务，同时，委托人提供给管理人的信息和资料以及有关投资目的、投资偏好、投资限制和风险承受能力等基本情况真实、准确、完整、合法。如委托人信息、资料和联系方式发生变更，应当及时书面告知管理人；

3. 委托人承诺委托资产的来源及用途合法，符合有关反洗钱法律、法规的要求，且委托资产中没有违反规定的公众集资；

4. 委托人声明其投资本计划的财产为其拥有合法所有权或处分权的资产，保证有完全及合法的授权委托管理人和托管人进行该财产的投资管理和托管业务。委托人承诺没有任何其他限制性条件妨碍管理人和托管人对该委托财产行使相关权利且该权利不会为任何其他第三方所质疑；

5. 委托人声明对市场及产品风险具有适当的认识，已了解资产管理方案和投资策略的风险收益特征，委托人接受管理人的审慎评估并经自我评估认为具备参与资产管理业务的风险承受能力；

6. 委托人声明已听取了管理人对相关业务规则、合同条款、资产管理方案和交易策略的讲解，已充分理解本合同全文，了解相关权利、义务，了解法律法规及所投资资产管理计划的风险收益特征，已经阅读并理解风险揭示书的相关内容，并承诺自行承担投资风险和损失；

7. 委托人声明管理人未对委托资产的收益状况作出任何承诺或保证；

8. 委托人声明已完全知悉本计划投资顾问就本计划涉及投资策略、投资决策、划款指令、交易安排等方面向管理人提供投资建议及意见，在符合法律法规、监管规定和本合同约定的前提下，管理人按照投资顾问的投资建议及意见执行。委托人签署本合同

投资本计划将视为认可并接受本计划的上述安排。

如果以上声明部分或全部不真实，委托人承担由此产生的法律责任及其自身损失，同时赔偿管理人、托管人及投资顾问因此遭受的一切损失。

第四条 托管人的声明与承诺：

1. 托管人承诺具有中国证监会认可的从事资产托管业务的资格；
2. 托管人承诺按照诚实信用、勤勉尽责的原则安全保管客户委托资产，履行本合同约定的义务。

第五条 除上述明示的声明与承诺外，任何一方不向另一方作出任何其他默示的声明和承诺。

第四节 资产管理计划的基本情况

第六条 资产管理计划的基本情况如下：

1. 名称：华泰期货 CTA 母基金资产管理计划；
2. 类别：期货资管一对多；
3. 运作方式：本计划成立后每月最后一个工作日为开放日，委托人可在开放日办理参与、退出业务。管理人有权视市场情况更改本计划的开放日及设置临时开放日，管理人更改本计划的开放日及设置临时开放日的，应至少提前 1 个工作日通知委托人和托管人；
4. 存续期限：本计划存续期限为起始运作日起 3 年。本计划起始运作日以管理人收到托管人出具的《委托资产到账确认函》（附件 2）后向托管人发出《资产管理计划起始运作通知书》（附件 3）确定的日期为准。管理人提前 3 个工作日在网站公告，可对本计划进行展期。
5. 初始份额净值：人民币 1.00 元；
6. 分级情况：本计划根据投资顾问收取浮动投资顾问服务费的不同，分为 AB 两类份额。两类份额的收益分配区别仅在于浮动投资顾问服务费的收取（仅对 A 类份额收取浮动投资顾问服务费），两类份额的其它费用收取、收益分配及其它合法权益完全均等；
7. 风险收益特征：本计划具有中高风险（R4）的特征，适合风险承受能力为积极型（C4）和激进型（C5）的投资者。

第五节 资产管理计划的募集及成立

第七条 自本合同生效后且募集资金按照本合同约定成功到账后，本计划成立。委托人的认购款项加计其在初始销售期形成的利息将折算为相应的资产管理计划份额归委托人所有，其中利息转份额的具体数额以份额登记机构的记录为准。

第八条 资产管理计划份额的销售

1. 资产管理计划份额的销售方式、销售期间、销售对象

本计划通过【 管理人 管理人委托的代销机构】向特定客户进行销售，初始销售期间自计划份额发售之日起最长不超过 1 个月。

A 类份额委托人投资本计划份额的初始金额不得低于 100 万元人民币，B 类份额委托人投资本计划份额的初始金额不得低于 300 万元人民币，且 AB 份额委托人均需满足《私募投资基金监督管理暂行办法》中对合格投资者的要求，且是能够识别、判断和承担相应投资风险的自然人、法人、依法成立的组织或中国证监会认可的其他特定投资者。

2. 资产管理计划份额的认购和持有限额

认购资金应以货币形式交付。A 份额委托人投资本计划份额的初始金额不得低于 100 万元人民币，B 份额委托人投资本计划份额的初始金额不得低于 300 万元人民币，AB 两类份额委托人均可多次认购，初始销售期间追加认购金额应为 10 万元的整数倍。

3. 资产管理计划份额的认购费用

本计划无认购费用。

4. 初始销售期间客户资金的管理

委托人应将委托资金存入以下募集账户，在资产管理计划初始销售行为结束前，任何机构和个人不得动用。

本计划的募集账户信息：

户 名：华泰期货有限公司-资金募集专用户

账 号：3602028929200895264

开户行：工商银行广州市第三支行

管理人不接受现金认购，委托人须从在中国境内银行开设的自有银行账户划款至募集账户，并在备注中注明：“***（客户姓名）认购华泰期货 CTA 母基金资产管理计划”。

5. 初始销售期间委托资金在募集账户的利息

委托人的认购资金在初始销售期间发生的利息收入在资产管理计划成立后折算计划份额归委托人所有。利息转份额的具体数额以份额登记机构的记录为准。

认购份额 = (认购金额 + 认购金额利息) / 初始份额净值

计划份额计算结果保留到小数点后二位，小数点后第三位四舍五入，由此误差产生的收益或损失由本计划委托资产承担。

第九条 资产管理计划销售失败的处理方式

资产管理计划销售期限届满，不能满足本合同第十条条件的，视作销售失败，管理人应当：

1. 以其固有财产承担因销售行为而产生的债务和费用；
2. 在资产管理计划销售期限届满后三十（30）日内返还客户已缴纳的款项，并加计银行同期活期存款利息。

计划初始销售失败的，管理人和托管人不得请求报酬。管理人和托管人为计划初始销售支付之一切费用应由各方各自承担。

第六节 资产管理计划的备案

第十条 资产管理计划备案的条件

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

1. 资产管理计划委托人人数不少于 2 人且不超过 200 人。资产管理计划的初始资产合计不低于 200 万元人民币；
2. 法律法规另有规定的，从其规定。

第十一条 资产管理计划的备案

初始销售期限届满，符合资产管理计划备案条件的，管理人应当自初始销售期限届满之日起五（5）个工作日内按照相关规定向基金业协会申请办理相关备案手续。

第十二条 资产管理计划备案手续自基金业协会出具备案确认函后办理完毕。

第七节 资产管理计划的参与、退出与转让

第十三条 参与和退出场所及方式

本计划的参与和退出将通过以下场所及方式：

- 管理人总部及分支机构（营业部）
- 销售机构（如有）指定的销售网点
- 管理人总部、分支机构（营业部）和代销机构制定的销售网点

第十四条 管理人不以自有资金参与本计划。

第十五条 参与和退出的开放日和时间

- 本计划存续期内不设开放日。
- 本计划在存续期内设开放日，同时，以下约定将适用：

1. 从计划起始运作日起每个月的最后一个工作日为参与和退出的开放日，开放日设为 T 日。

2. 参与本计划需要在开放日前 10 个工作日内向管理人提出申请，即在 T-10 日至 T-1 日之间向本计划管理人提出预约参与申请。退出本计划需要在开放日前 20 个工作日内向管理人提出申请，即在 T-20 日至 T-1 日之间向本计划管理人提出预约退出申请。但管理人根据法律法规、金融监管部门的要求或本合同的规定公告暂停参与、退出时除外。

3. 根据届时有效的法律法规及监管机构的相关规定，委托人可以通过交易所交易平台向符合条件的特定客户转让其持有的资产管理计划份额。

4. 若出现交易市场或交易所的交易时间变更，或者发生影响本计划正常运作的重大事项等特殊情形，管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整，并通知委托人。管理人提前 3 个工作日在网站公告前述调整事项即视为履行了告知义务。

第十六条 参与和退出申请

本计划在开放日是否接受委托人的参与申请： 是 否

本计划在开放日是否接受委托人的退出申请： 是 否

第十七条 参与和退出的方式、价格及程序

1. 参与和退出的方式

(1) “未知价”原则，即资产管理计划份额的参与和退出价格以开放当日（T 日）收市后计算的对应类别的计划份额净值为基准进行计算；

(2) 参与以金额申请，退出以份额申请。

2. 参与和退出的价格

(1) 参与价格为开放当日（T 日）对应类别的资产管理计划份额净值。

(2) 退出价格为开放当日（T 日）对应类别的资产管理计划份额净值。

3. 参与和退出的程序

(1) 申请

委托人办理参与、退出等业务应提交本人或经办人的身份证明文件、授权文件、业务申请表等文件。委托人参与计划份额的，应当签署资产管理合同，但委托人在提交参与申请时已持有本计划份额的除外。

委托人在提交参与申请时须按照管理人规定的方式全额支付参与资金，在提交退出申请时须持有足够的计划份额余额，否则所提交的参与、退出申请无效而不予确认。

(2) 确认

管理人受理参与和退出申请并不表示对该申请是否成功的确认，而仅代表管理人确实收到了参与或退出申请。申请是否有效应以管理人的确认为准。

管理人按照“时间优先，时间相同、金额较大优先”的原则对本计划参与申请进行确认。在本计划已达到本合同约定的委托人人数上限时，除已持有计划份额的委托人追加购买计划份额申请外，管理人对其他未确认的参与申请做无效申请处理，无效的参与申请资金予以返还。

管理人按照“先进先出”的原则对本计划退出申请进行确认。在本计划低于本合同约定的规模下限时，管理人依据本合同约定宣布本计划终止。

管理人将交易时间结束前收到的参与和退出申请作为当日申请处理，其他参与和退出申请在下一工作日处理。如下一工作日不是开放日，则该申请无效。管理人应配备相应人员来完成委托人参与和退出份额登记的相关工作，并将份额登记确认表在份额登记日发给托管人，并对份额登记数据的准确性负责。

(3) 款项支付

参与采用全额交款方式，若资金在本合同约定的开放日和时间内未全额到账则参与不成功。若参与不成功或无效，管理人将委托人已缴付的参与款项本金退回资管结算账户。

委托人退出申请确认成功后，管理人应按规定向委托人支付退出款项。正常情况下，

退出款项于 T+5 日内划往委托人指定的银行结算账户。在发生交易确认延期时，退出款项的支付办法按本合同和有关法律法规的规定处理。

第十八条 参与和退出的金额限制

1. 委托人提交参与申请前未持有本计划份额的，参与金额应不低于 100 万元（不含参与费用）。

已持有计划份额的委托人追加参与计划份额的，每次参与的最低金额为 10 万元，以 10 万元的整数倍增加。

2. 委托人持有的计划资产净值高于 100 万元时，可以选择全部或部分退出计划份额；选择部分退出计划份额的，委托人在退出后持有的计划资产净值不得低于 100 万元。当管理人发现委托人申请部分退出计划份额将致使其在部分退出申请确认后持有的计划资产净值低于 100 万元的，管理人有权适当减少该委托人的退出份额，直至该退出申请确认后，委托人持有的计划资产净值不低于 100 万元。

当委托人申请退出计划份额时，所持有的计划资产净值低于 100 万元（含 100 万元）的，委托人必须选择一次性全部退出计划份额。

3. 管理人可以根据市场情况、本计划运作情况，在法律法规允许的情况下，调整上述规定的数量或比例限制。

第十九条 参与和退出的费用

1. 本计划的参与费率为 0%。

2. 本计划的退出费率为 0%。

3. 如本计划收取参与费，则委托人支付的参与费用不列入本计划资产。

第二十条 参与份额与退出金额的计算方式

份额的参与价格以参与资金全额到账日（需为参与开放日）清算估值后计算的份额净值为基准进行计算；份额的退出价格以退出日（需为退出开放日）清算估值后计算的份额净值为基准进行计算。

1. 计划净参与份额的计算

净参与份额 = 参与金额 ÷ (1 + 参与费率) ÷ T 日计划份额净值

参与份额计算结果按照四舍五入方法，保留到小数点后二位，因计算误差产生的损失由本计划承担，产生的收益归本计划所有。

2. 本计划净退出金额的计算

净退出金额=退出份数×T 日计划份额净值×(1-退出费率) -退出份数需提取的投资顾问服务费等

净退出金额计算结果以人民币元为单位,按照四舍五入方法,保留到小数点后二位,因计算误差产生的损失由本计划承担,产生的收益归本计划所有。

第二十一条 巨额退出

1. 巨额退出的认定

在单个开放日中,本计划的净份额退出申请超过上一日本计划总份额的 10%,为巨额退出。

2. 巨额退出的处理方式

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

3. 有能力兑付委托人的全部退出申请时,按正常退出程序执行。

4. 部分延期退出:当管理人认为兑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进行的资产变现可能使计划资产净值发生较大波动时,资产管理人在当日接受退出比例不低于上一日计划总份额 10%的前提下,对其余退出申请延期办理。对于当日的退出申请,应当按单个委托人申请退出份额占当日申请退出总份额的比例,确定该委托人当日受理的退出份额;未受理部分除委托人在提交退出申请时选择将当日未获受理部分予以撤销者外,延迟至下一开放日办理。转入下一开放日的退出申请不享有退出优先权,退出价格为申请退出时相对应的开放日的价格,以此类推,直到全部退出为止。

当发生巨额退出并延期划付退出款时,管理人应当通过邮件、传真、本合同约定的方式,在退出开放日结束后的 3 个工作日内及时告知委托人,说明有关处理方法。

第二十二条 违约退出

本计划存续期内不接受违约退出。

第二十三条 拒绝或暂停参与的情形

出现以下情形之一,管理人可以拒绝或暂停参与:

1. 本计划的委托人人数达到上限 200 人;
2. 不可抗力的原因导致本计划无法正常运行;
3. 证券交易所在交易时间非正常停市;

4. 发生本合同约定的暂停本计划资产估值情况；
5. 根据市场情况，管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对本计划业绩产生负面影响，从而损害现有计划份额持有人的利益的情形；
6. 因本计划收益分配、或计划内某个或某些证券进行权益分派等原因，使管理人认为短期内接受参与可能会影响或损害现有计划份额持有人利益的；
7. 管理人认为接受某笔或某些参与会有损于现有委托人利益，或违反有关法律法规；
8. 法律法规规定或金融监管部门认定的其他情形。

委托人的参与被拒绝，被拒绝的参与款项本金将退还给委托人。

管理人决定暂停接受计划参与申请时，应当通过、传真、电话、电子邮件、手机短信、网站公告等本合同约定的方式之一告知委托人。在暂停参与的情形消除时，管理人应及时恢复办理本计划参与业务，并以前述方式告知委托人。

第二十四条 资产管理计划份额的转让

根据届时有效的法律法规及监管机构的相关规定，委托人可以通过交易所交易平台向符合条件的特定客户转让其持有的资产管理计划份额。

第二十五条 非交易过户

1. 管理人只受理继承、捐赠、司法强制执行情况下的非交易过户。其中：“继承”是指委托人死亡，其持有的计划份额由其合法的继承人继承；“捐赠”是指委托人将其合法持有的计划份额捐赠给福利性质的基金会或社会团体的情形；“司法强制执行”是指司法机构依据生效司法文书将委托人持有的计划份额强制划转给其他自然人、法人、社会团体或其他组织的情形。

2. 办理非交易过户业务必须提供管理人规定的相关资料。符合条件的非交易过户申请自申请受理日起2个月内办理；申请人按管理人规定的标准缴纳过户费用。

3. 上述非交易方式过户，受让人不符合投资者适当性规定的，管理人有权对所需过户份额作退出处理。

第二十六条 本计划参与和退出的开放日和时、原则、金额限制发生变化时，管理人应提前三（3）个工作日告知委托人和托管人。管理人提前三（3）个工作日通过传真、电话、电子邮件、手机短信、网站公告等本合同约定的方式之一通知委托人以及发给托管人盖章版的正式通知，即视为履行了告知义务。

第八节 当事人的权利与义务

第二十七条 管理人享有以下权利：

1. 要求委托人提供与其身份、财产与收入状况、资金来源及用途、资产管理需求、风险认知与承受能力等相关的信息和资料，对客户适当性进行审慎评估；
2. 对委托资产进行独立管理和运用；
3. 按合同约定及时、足额收取管理费、业绩报酬及其他费用；
4. 依照有关规定行使因资产管理计划财产投资所产生的权利；
5. 对委托人进行尽职调查，要求委托人提供相关证明文件、资料，并在上述文件和资料发生变更时，及时提交变更后的相关文件与资料；
6. 根据本合同，监督托管人，对于托管人违反本合同约定的行为，有权通知托管人采取相应补救措施；对资产管理计划财产及其他当事人的利益造成重大损失的，或对资产管理计划运作产生重大影响的，及时采取措施制止，并报告中国证监会；
7. 有权获得投资顾问的投资建议服务，并对其提供的投资建议有审议、修改和最终决策权；
8. 代表资产管理计划与投资顾问另行签署相关投资顾问协议（“投资顾问协议”），对相关权利、义务进行约定；
9. 自行销售或者委托有基金销售资格的机构销售资产管理计划，制定和调整有关资产管理计划销售的业务规则；
10. (适用 不适用) 管理人有权委托_____作为外包服务机构为本计划提供资产估值、份额登记等服务，管理人与外包服务机构另行签署委托服务协议(以下简称“委托服务协议”)，对相关权利、义务进行约定；
11. 按合同约定终止资产管理委托；
12. 国家有关法律法规、监管机构以及本合同约定的其他权利。

第二十八条 管理人负有以下义务：

1. 募集资金，设立资产管理计划，办理计划份额的销售和登记事宜；
2. 办理资产管理计划的备案手续；
3. 制定和执行资产管理投资策略，诚实信用、勤勉尽责，以专业技能管理和运用委托资产，不得从事有损委托人利益的行为；

4. 办理或委托外包服务机构办理资产管理计划份额的登记事宜；
5. 按照资产管理合同的约定确定资产管理计划收益分配方案，及时向客户分配收益；
6. 按合同约定的风险提示机制，及时通知客户相关的亏损情况；
7. 每日向中国期货市场监控中心投资者查询系统提供委托资产的盈亏、净值信息供委托人查询；
8. 计算并按照本合同的约定向委托人报告资产管理计划份额净值，进行会计核算；
9. 按法律和合同约定向委托人提供资产管理报告；
10. 在合同终止时，按照合同约定将账户剩余资产返还委托人；
11. 妥善保管与委托资产有关的账册、凭证、交易记录、合同等资料；
12. 保守委托人商业秘密，但法律法规、本合同及监管机构另有规定的除外；
13. 以管理人的名义，代表委托人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
14. 接受和配合托管人对委托资产有关投资行为的监督；
15. 监督托管人的托管行为；
16. 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的委托财产与自有资产、其他委托财产相互独立，对所管理的不同委托人资产分别管理，分别记账；
17. 公平对待所管理的不同财产，不得从事任何有损资产管理计划财产及其他当事人利益的活动；
18. 组织并参加委托资产清算小组，参与委托资产的保管、清理、估价、变现和分配；
19. 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告金融监管部门并通知委托人和托管人；
20. 除法律法规、本合同及其他有关规定外，不得为管理人及任何第三人谋取利益，未经委托人同意不得委托第三人运作委托财产；
21. 自本合同生效之日起，按照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用委托资产；确保委托资产的管理和运用不违反法律、行政法规、部门规章或监管机构、自律组织、交易所或登记公司的规定或要求，因管理人未满足前述承诺而产生的一切法律责任和经济损失均由管理人承担；

22. 国家有关法律法规、监管机构以及本合同约定的其他义务。

第二十九条 委托人享有以下权利：

1. 按照合同约定获得委托资产的投资收益和清算后的剩余资产；
2. 按合同约定的时间和方式查询委托资产的盈亏、净值等数据信息；
3. 按合同约定的时间和方式获得资产管理计划的报告；
4. 监督管理人及托管人履行投资管理和托管义务的情况；
5. 委托人持有的同类资产管理计划份额设定为均等份额，除资产管理合同另有约定外，委托人持有的每份同类计划份额具有同等的合法权益；
6. 国家有关法律法规、监管机构以及本合同约定的其他权利。

第三十条 委托人负有以下义务：

1. 及时、全面、准确地向管理人告知其投资目的、投资偏好、投资限制和风险承受能力等基本情况，并向管理人提供法律法规规定的信息资料及身份证明文件，配合管理人履行反洗钱义务；
2. 向管理人提供的各种资料、信息、联系方式发生变更时，及时书面通知管理人；
3. 按照合同约定的时间足额交付委托资产；
4. 按照合同约定支付管理费、业绩报酬（如有）、托管费、投资顾问服务费，并承担因委托资产运作产生的交易费用、合同印刷费、税费及其他费用，根据实际发生金额列入或摊入当期委托资产的运作费用，具体详见《费用列表》（附件1）；
5. 保守管理人、托管人的商业秘密，不得泄露委托资产管理账户投资计划、投资意向等；
6. 自行承担投资风险和损失；
7. 不干涉管理人执行资产管理投资策略，合同有明确约定的情况除外；
8. 协助管理人办理资产管理业务相关账户设立、变更及注销手续；
9. 不得从事任何有损资产管理计划、管理人管理的其他资产及托管人托管的其他资产合法权益的活动；
10. 国家有关法律法规、监管机构以及本合同约定的其他义务。

第三十一条 托管人享有以下权利：

1. 保管本合同约定的委托资产；
 - (1) 按合同约定及时、足额获得委托资产托管费；

(2) 根据本合同及其他有关规定，监督管理人对委托资产的投资运作，对于管理人违反本合同或有关法律法规规定的行为，对委托资产及其他当事人的利益造成重大损失的情形，有权报告中国证监会并采取必要措施；

(3) 除法律法规另有规定的情况外，托管人对因管理人过错造成的委托资产损失不承担责任；

2. 国家有关法律法规、监管机构及本合同约定的其他权利。

第三十二条 托管人负有以下义务：

1. 按照中国证监会规定及合同约定开设托管账户，确保客户委托资产与托管人自有资产及其他客户的委托资产相互独立；

2. 安全保管客户委托资产，不得擅自动用或处分托管资产；

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

4. 对所托管的不同财产分别设置账户，确保资产管理计划财产的完整与独立；

5. 根据管理人划款指令，及时办理清算、交割等事宜；

6. 对资产管理计划委托资产的投资范围和投资限制进行监督（托管人对委托资产的投资监督事项详见本合同附件 6），若发现管理人的投资运作违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反本合同时，应当拒绝执行，立即要求管理人改正，管理人未能改正或造成客户委托资产损失的，应及时通知委托人并向管理人住所地证监局报告；若发现管理人依据交易程序已经生效的划款指令违反法律、行政法规或其他有关规定，或者违反本合同约定的，应当立即通知管理人并及时报告中国证监会；

7. 按照约定的方式、时间向管理人提供客户委托资产信息；

8. 保守管理人和委托人的商业秘密；

9. 按照规定保存相关合同、协议、凭证等文件资料；

10. 复核资产管理计划份额参考净值、资产管理计划份额净值；

11. 除法律法规、本合同及其他有关规定外，不得为托管人及任何第三人谋取利益，未经委托人同意不得委托第三人托管委托资产；

12. 公平对待所托管的不同资产，不得从事任何有损委托资产及其他当事人利益的活动；

13. 法律、行政法规和中国证监会规定及合同约定的其他义务。

第九节 资产管理计划份额的登记

第三十三条 本计划份额的登记业务指本计划的登记、存管、清算和交收业务，具体内容包括委托人账户管理、份额注册登记、清算及交易确认、收益分配、建立并保管资产管理计划客户资料表等。

第三十四条 本计划份额的份额登记机构为管理人或管理人委托的在中国证券投资基金业协会备案的私募基金外包服务机构。

第三十五条 份额登记机构的职责

1. 建立和保管委托人账户资料、交易资料、资产管理计划客户资料表等，并将客户资料表提供给管理人；
2. 配备足够的专业人员办理本计划的份额登记业务；
3. 严格按照法律法规和本合同约定的条件办理本计划的份额登记业务；
4. 严格按照法律法规和本合同约定计算业绩报酬，并提供交易信息和计算过程明细给管理人；
5. 保管资产管理计划客户资料表及相关的各类业务记录 15 年以上；
6. 对委托人的账户信息负有保密义务，因违反该保密义务对委托人、管理人、托管人或资产管理计划带来的损失，须承担相应的赔偿责任，但司法强制检查及按照法律法规的规定进行披露的情形除外；
7. 按照本合同，为委托人办理非交易过户等业务，提供资产管理计划收益分配等其他必要的服务；
8. 在法律法规允许的范围内，制定和调整份额登记业务的相关规则；
9. 法律法规规定及本合同约定的其他职责。

第十节 资产管理计划的投资

第三十六条 本计划的投资范围和投资比例

1. 现金管理类：现金、银行存款（包括银行活期存款、银行定期存款和银行协议存款等各类存款）、短期国债、期限在一年以内（含一年）债券逆回购、开放式的货币市场基金（含管理人管理的开放式货币市场基金），投资比例为按市值计算为委托资产净值的 0-100%；

2. 金融衍生品：国内四家交易所（中国金融期货交易所、上海期货交易所、郑州商品交易所、大连商品交易所）或其他中国证券交易所、证券衍生品交易所或商品衍生品交易所依法上市交易的、具有充足流动性的商品期货与金融期货，投资比例为根据交易所规定的保证金比例计算的持仓保证金占用为委托资产净值的 0-35%；

3. 集合资产管理计划：证券公司、期货公司、信托公司、银行、保险公司、基金公司等金融机构依法设立的集合资产管理计划，投资比例按市值计算为委托资产净值的 0-100%。

4. 经中国证券监督管理委员会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。

在满足法律法规或监管部门要求的前提下，经管理人、委托人、托管人三方协商一致并履行适当程序后，可以相应调整本计划的投资范围。因证券及期货市场波动、本计划规模变动、期货交易所调整期货交易保证金收取比例等管理人之外的因素致使本计划投资不符合投资比例的，管理人应当在 10 个交易日内调整完毕。

本合同项下的资产管理账户不可以参与股指期货以外的期货交割业务。

第三十七条 本计划的投资策略

本计划主要运用中国多元化投资策略进行期货的分散化趋势投资，并辅以一定的现金管理，力求实现委托资产的保值增值。

第三十八条 本计划的投资限制

1. 除根据中国多元化策略投资的涉及空头头寸的期货或类似合约外，禁止从事其他承担无限责任的投资（托管人对此项不进行监督）；

2. 禁止投资于股票、权证等权益类证券；

3. 禁止持有进入交割月的商品期货合约。

现行有关法律法规修订变化后，若上述投资限制与之冲突，以相关法律法规规定为准。

第三十九条 投资禁止行为

本计划财产禁止从事下列行为：

1. 承销证券；

2. 向他人贷款或提供担保；

3. 除根据中国多元化策略投资的涉及空头头寸的期货或类似合约外，从事承担无

限责任的投资；

4. 利用资产管理计划资产为资产管理计划委托人之外的任何第三方谋取不正当利益、进行利益输送；
5. 从事内幕交易、操纵证券价格及其他不正当的证券交易活动；
6. 法律法规、中国证监会以及本合同约定禁止从事的其他行为。

第四十条 本计划的预警线

当本计划的份额净值 T 日收盘清算后跌破 0.55 元时，管理人应于 T+1 日 09:00 前通过录音电话或邮件形式对投资顾问进行风险提示。

T+1 日起，本计划的期货持仓占委托资产净值的比例不得高于 15%，直至份额净值回升至 0.55 元及以上。

第四十一条 本计划的清盘线

当本计划的份额净值 T 日收盘清算后跌破 0.50 元时，管理人应于 T+1 日 09:00 前以录音电话、短信或邮件形式通知投资顾问及委托人，并于 T+1 日起平仓清盘，并办理终止清算事宜，本计划提前终止。

由于非管理人所能控制的原因，例如：地震、水灾、火灾等不可抗力因素或者计算机系统、通讯系统、互联网系统、电力系统故障，以及持仓品种价格可能持续向不利方向变动或持仓品种因市场剧烈波动导致无法及时平仓的情形下，委托资产亏损存在超出该止损比例的风险，委托人须承担由此导致的损失。

上述平仓清盘由管理人负责执行，如管理人未按照本合同的约定进行平仓清盘，由此对委托资产或委托人造成的损失，托管人不承担任何责任。

第四十二条 投资顾问

管理人和委托人一致同意聘请元胜投资管理(上海)有限公司为本计划的投资顾问，由其在管理人授权的范围内根据本计划的投资范围、策略及限制为本计划提供投资顾问服务。

投资顾问的基本信息：

名称：元胜投资管理（上海）有限公司

法定代表人：YING MING OR

无论本合同其它条款如何约定，为履行投资顾问业务之目的，管理人可以向投资顾问披露开展投资顾问服务所必需的本计划的文件和资料，包括但不限于获取本合同

及委托资产的盈亏、净值等数据信息，但应促使投资顾问对所获信息保密。具体事宜由管理人与投资顾问另行签署《投资顾问协议》进行约定。

管理人有权决定是否接受投资顾问的投资建议，并有权自行作出投资决策。管理人应当对投资顾问提供的专业服务行为进行合规监控和风险监测，发现投资顾问有违法违规行为的应当及时制止，并向中国证监会相关派出机构和协会报告。

委托人认可管理人执行投资顾问的投资建议，由此带来的任何投资风险或因投资造成的损失，由委托人自行承担，委托人承诺不向管理人及投资顾问主张因采纳该指定投资事项而造成计划资产损失的赔偿责任。

除法规另行规定外，管理人与投资顾问之间不承担连带责任。

管理人有权选择、聘任、更换、解聘投资顾问。投资顾问更换或解聘的，管理人将通过其网站进行公告。

第十一节 投资经理的指定与变更

第四十三条 投资经理的指定

本计划的投资经理由管理人负责指定。

第四十四条 本计划投资经理

本计划的指定投资经理为：宋文尧，具体简历如下：

宋文尧，华泰期货资产管理总部产品经理兼投资经理。英国帝国理工学院管理学硕士，2010年入职华泰期货有限公司，先后从事分析师、产品经理等职务，现任公司资产管理部投资经理。

第四十五条 投资经理的变更

管理人可根据业务需要变更投资经理，并在变更后及时通过邮件或录音电话通知委托人，管理人应在管理人公司网站公告调整事项，同时，管理人有权决定是否提前终止本合同。

第十二节 资产管理计划的财产

第四十六条 资产管理计划财产的保管与处分

1. 本计划财产独立于管理人、托管人的自有资产，并由托管人保管。管理人、托

管人不得将本计划财产归入其自有财产。托管人对实际交付并控制下的委托资产承担保管职责，对于非托管人保管的财产不承担责任；

2. 管理人、托管人对不同客户的委托资产独立建账、独立核算、分账管理；

3. 管理人、托管人因对本计划财产进行管理、运用或其他情形而取得的财产和收益归入本计划财产；

4. 管理人、托管人可以按本合同的约定收取管理费、托管费、投资顾问服务费以及本合同约定的其他费用，相关费用从委托资产中列支；

5. 管理人、托管人与第三方发生债务纠纷的，应以其自有资产承担法律责任，不得将委托资产用于清偿债务，债权人不得对委托资产行使请求冻结、扣押、强制执行和其他权利。上述债权人对委托资产主张权利时，管理人、托管人应明确告知委托资产的独立性，采取合理措施并及时通知委托人。如该债务纠纷因委托人引起，则管理人可以就因该纠纷而产生的一切费用，包括但不限于律师费、诉讼费等向委托人追偿并要求委托人赔偿一切损失；

6. 管理人、托管人因依法解散、被撤销或宣告破产等原因进行清算时，委托资产不属于其破产财产或者清算财产；

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

8. 如发生有权机关对委托资产强制执行的情形，管理人、托管人应及时通知委托人，托管人依法进行司法协助的，不对委托资产由此造成的后果承担责任。

9. 对于因为本计划投资产生的应收资产和本计划申购过程中产生的应收资产，应由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，到账日计划资产没有到达计划托管账户的，托管人应及时通知管理人采取措施进行催收。

第四十七条 资产管理计划财产相关账户的开立与管理

1. 资产管理计划投资期货类品种的，管理人应按照期货资产管理业务开户管理规定为资产管理计划开立与撤销专门用于投资管理的期货账户（以下简称“期货资产管理账户”），申请或者注销交易编码，对期货资产管理账户及其交易编码进行单独标识、单独管理；

2. 资产管理计划投资证券等非期货类品种的，管理人应当遵守相关市场的开户规定，开立或者撤销用于投资管理的证券账户及其他交易账户（以下简称“非期货资产管理账户”）；管理人保证，不通过本计划证券账户下设子账户、分账户、虚拟账户等方式违规进行证券交易，不得出借或转让证券账户，亦不得使用证券账户进行本计划业务以外的活动。管理人保证不利用该证券账户从事法律、行政法规、部门规章所禁止的行为。

3. 在资产管理计划相关账户的开立、变更、使用、撤销过程中，委托人应当提供必要的协助和配合；

4. 资产管理账户仅供资产管理计划使用，并且只能由管理人使用或管理，委托人不得将资产管理账户挂失、冻结、注销、转托管、转指定或提供他人使用，中国证监会另有规定的除外；

5. 资管结算账户未经管理人、托管人同意不得更改；委托人要求变更资管结算账户，必须向管理人、托管人提供变更的合理依据，并及时通知管理人和托管人；

6. 托管账户未经各方同意不得更改。

第十三节 划款指令的发送、确认和执行

第四十八条 管理人从事资产管理业务的投资活动时，委托资产只能在托管账户和本计划对应的资产管理账户之间划转。

第四十九条 管理人应事先书面授权通知（以下简称“授权通知”）托管人有权发送指令的人员名单，并注明相应的授权范围、授权生效时间、预留印鉴和被授权人签字样本。授权通知（格式和内容见附件 4）由管理人加盖公章并由管理人法定代表人或授权代表签字，若由授权代表签字，还应附上法定代表人授权书。授权通知发出后，应同时以电话形式向托管人确认，如通过传真或电子邮件发送扫描件方式发出的，应在此后三个工作日内将授权书的正本送交托管人。传真件或扫描件如与正本不一致，托管人以传真件或扫描件为准并及时通知管理人。

第五十条 划款指令（格式和内容见附件 5）应写明款项事由、支付时间、金额、收付款账户等，加盖预留印鉴并有被授权人签字。

第五十一条 划款指令的发送可采用传真或邮件。管理人有义务在发送指令后与

托管人以电话的方式进行确认。传真或扫描件以获得收件人（托管人）确认该指令已成功接收之时视为送达。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，托管人不承担责任。指令若以传真或扫描件形式发出，则正本由管理人保管，托管人保管指令传真件或扫描件。当两者不一致时，以托管人收到的投资指令传真件或扫描件为准。

第五十二条 托管人对指令的预留印鉴、签字样本等表面真实性审核无误后，应在两个工作小时内执行指令，不得延误。场外及限时发送指令的截止时间为当天 14:30，银期转账指令的截止发送时间为当天的 15:00，如遇特殊情况晚于截止时间，托管人尽量完成，但不承担因延误发送指令造成的任何损失。

第五十三条 对于指令发送人员发出的指令，管理人不得否认其效力。若存在异议或不符，托管人应立即与管理人指定人员进行电话联系和沟通，暂停指令的执行并要求管理人重新发送修改后的指令。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。上述材料应加盖管理人印章。托管人不负责审查管理人发送指令同时提交的其他文件资料的合法性、真实性、完整性和有效性，管理人应保证上述文件的合法、真实、完整和有效。如因管理人提供的上述文件不合法、不真实、不完整或没有效力而影响托管人的审核或任何第三人带来损失，托管人不承担任何形式的责任。若指令存在与授权文件中预留印鉴样本、签字样本、名章样本、权限等要素不符的，托管人无义务执行，托管人立即与管理人指定人员进行电话联系和沟通，并要求管理人重新发送经修改的指令。托管人将按照前述指令确认、审查程序进行重新表面一致性审查，托管人认为审查无误的，才开始执行指令，对于前述情形因此造成的任何延误或后果，托管人不承担任何责任。

管理人向托管人下达指令时，应确保托管账户及其他账户有足够的资金余额，对管理人在没有充足资金的情况下向托管人发出的指令，托管人有权拒绝执行，并立即通知管理人，托管人不承担因为不执行该指令而造成的损失。

第五十四条 管理人应按照有关法律法规和本合同的规定，在其合法的经营权限和交易权限内发送划款指令，指令发送人员应按照其授权权限发送划款指令。

第五十五条 管理人在发送指令时，应为托管人留出执行指令所必需的时间。

第五十六条 托管人发现管理人的指令错误时，有权拒绝执行，并及时通知管理人改正。委托人若修改或要求托管人终止执行已经发送的指令，应先电话通知托管人，若托

管人还未执行原指令，管理人可重新发送新指令并在原指令上注明“停止执行”字样并由指令签发人签字后发送托管人，托管人收到新指令和停止执行的指令后，应停止执行原指令并按新指令执行；但若原指令在托管人收到管理人通知前已执行，则应向管理人电话说明，托管人不承担因为执行原指令而造成的损失或责任。

第五十七条 管理人若变更授权通知（包括但不限于变更指令发送人员、联系方式、预留印鉴、签字样本等），必须提前至少一（1）个工作日，使用传真向托管人发出由法定代表人（或其授权签字人）签字并加盖公章的指令发送人员变更通知，同时电话通知托管人，托管人收到变更通知当日向管理人电话确认。被授权人变更通知，自管理人收到托管人以电话方式或其他管理人和托管人认可的方式确认时由载明的生效时间开始生效。管理人在此后三（3）日内将被授权人变更通知的正本送交托管人。变更授权通知书面正本内容与托管人收到的传真不一致的，以托管人收到的传真为准。被授权人变更的通知生效后，对于原指令发送人员无权发送的指令，或原指令发送人员超权限发送的指令，管理人不承担责任。

第十四节 资产管理计划的交易及交收清算安排

第五十八条 期货投资资金清算与交收

本计划的投资范围包含期货类的，管理人与托管人，应就期货保证金保管、期货交易、出入金、交易及结算数据发送等事项，签订协议或操作备忘录明确各方权利义务。本计划投资于期货发生的资金交割清算由管理人选定的期货经纪公司负责办理，托管人对由于期货交易所期货保证金制度和清算交割的需要而存放在期货经纪公司的资金不行使保管职责，管理人应在期货经纪协议或其他协议中约定由选定的期货经纪公司承担资金安全保管责任。

本计划若需要变更或新增期货经纪商，管理人需提前三十个工作日通知托管人。若管理人未按要求提前通知托管人而私自变更或新增期货经纪商，由此产生的任何风险或后果，托管人不承担任何责任。

第五十九条 证券经营机构的选择及证券投资资金清算与交收

本计划的投资范围包含证券类的，管理人负责选择代理本计划证券买卖的证券经营机构，并与其及托管人就证券资金转账、交易及结算数据发送等事项签订相关协议明确

各方权利义务。

本计划若需要变更或新增证券经纪商或在证券经纪商办理“撤销指定”、“转托管”、“销户”业务的，管理人需提前三十个工作日通知托管人并征得托管人同意。若管理人未按要求提前通知托管人并征得托管人同意而私自变更或新增证券经纪商或在证券经纪商办理上述业务的，由此产生的任何风险或后果，托管人不承担任何责任。

第六十条 其它投资类型的资金清算与交收

本计划投资范围包含其它投资类型的，管理人负责选择相关投资类型的经营机构，并应责成该经营机构按照本计划要求完成投资、交易及结算数据发送等事项，如有必要，应与其及托管人签订相关协议明确各方权利义务。

第六十一条 无法按时清算的责任认定及处理程序

管理人应保证托管人在执行管理人发送的资金划款指令时，各类投资账户及托管账户上有充足的资金。出现账户资金余额不足时，托管人有权拒绝管理人发送的资金划款指令，但须在一（1）个工作小时内反馈给管理人，并视账户资金余额足够时为指令送达时间，资金余额补足时间不得晚于划款日当日 14:00 前。管理人在发送资金划款指令时应充分考虑托管人的划款处理时间，一般为两（2）个工作小时。托管人不承担由于指令传输不及时、未能留出足够的划款时间，致使资金未能及时到账所造成的损失。在账户资金余额充足的情况下，托管人对管理人符合法律法规、本合同约定的指令不得拖延或拒绝执行。如由于托管人故意或重大过失导致委托财产无法按时清算，由此造成的直接损失由托管人承担。资金划拨成功后，托管人应及时将划拨流水以邮件或电话形式通知管理人。

托管人对执行管理人形式上符合相关法律法规、本合同规定的指令对委托资产造成的损失不承担赔偿责任。

如果管理人的划款指令存在事实上未经授权、欺诈、伪造或未能按时提供划款指令人员的预留印鉴和签字样本等非托管人原因造成的情形，只要托管人根据本合同相关规定验证有关印鉴与签名无误，托管人不承担因正确执行有关指令而给管理人或委托资产或任何第三人带来的损失，全部责任由管理人承担。

第六十二条 资金及交易记录的核对

托管人应每月或根据管理人的要求向管理人提供资金流水，双方核对。

第六十三条 可用资金余额的确认

托管人应定期或根据管理人的要求将托管账户的可用资金余额以双方认可的方式提供给管理人。托管账户的可用资金有变动时，托管人应及时通知管理人。

第十五节 越权交易的处理

第六十四条 越权交易的界定

越权交易是指管理人违反有关法律法规的规定以及违反或超出本合同项下委托人的授权而进行的投资交易行为，包括：

- (1) 违反有关法律法规和本合同约定进行的投资交易行为；
- (2) 法律法规禁止的超买、超卖行为。

因证券及期货市场波动、资产管理计划规模变动、期货交易所调整期货交易保证金收取比例等管理人以外的因素致使本计划投资不符合本合同的情况除外。如发生上述因管理人以外的因素致使本计划投资不符合本合同的情况，托管人有权通知管理人，管理人应在十（10）个交易日内进行调整，以达到标准。

管理人应在有关法律法规和本合同约定的权限内运用委托资产进行投资管理，不得违反有关法律法规和本合同的约定超越权限管理、从事违规投资。

第六十五条 对越权交易的处理

- (1) 违反有关法律法规和本合同约定进行的投资交易行为

托管人发现管理人的投资或清算指令违反法律、行政法规、中国证监会的规定或者资产管理合同约定的，应当要求管理人限时改正，管理人应及时核对、改正并以书面形式向托管人进行解释或举证；管理人未能及时改正或者造成客户委托资产损失的，托管人应当及时通知委托人，并报告期货公司住所地、资产管理分公司所在地中国证监会派出机构、基金业协会。

- (2) 法律法规禁止的超买、超卖行为

托管人在行使监督职能时，如果发现委托资产投资证券过程中出现超买或超卖现象，应立即提示管理人，由管理人负责解决，由此给委托资产造成的损失由管理人承担。如因管理人原因发生超买行为，超买部分的交易由管理人负责完成。

- (3) 越权交易所发生的损失及相关交易费用由管理人负担，所发生的收益归本计划的财产所有。

第十六节 资产管理计划财产的估值

第六十六条 估值目的

客观、准确地反映资产管理计划委托资产的价值，并为计划份额的参与和退出等提供计价依据。经估值后确定的价值，是进行信息披露、计算参与和退出本计划的基础。

第六十七条 估值时间和估值核对日

管理人于本计划正常交易日后的每个交易日对上一交易日的计划资产进行估值。管理人可以根据金融监管部门的规定、证券市场情况和本计划增加证券投资品种等情况，在与托管人协商一致后，对本计划估值的时间进行调整，并由管理人及时通知计划委托人。

第六十八条 估值依据

估值应符合本合同及其他法律、法规的规定，如法律法规未做明确规定的，参照证券投资基金的行业通行做法处理。估值数据依据合法的数据来源独立取得。

第六十九条 估值对象

资产管理计划所拥有的基金、债券、期货、银行存款等资产及负债。

第七十条 估值方法

本计划按以下方式进行估值：

(1) 证券交易所上市的有价证券的估值

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

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

C. 交易所上市未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息(自债券计息起始日或上一付息日至估值当日的利息)得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘

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

D. 交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。交易所上市的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

(2) 处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

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

B. 首次公开发行未上市的股票、债券和权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

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

(3) 因持有股票而享有的配股权，从配股除权日起到配股确认日止，如果收盘价高于配股价，按收盘价高于配股价的差额估值。收盘价等于或低于配股价，则估值为零。

(4) 全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

(5) 同一债券、开放式基金同时在两个或两个以上市场交易的，按债券、开放式基金所处的市场分别估值。

(6) 开放式基金（包括托管在场外的上市开放式基金 LOF）以估值日前一交易日基金净值估值（货币市场基金按估值日前一交易日每万份收益估值；估值日前一交易日没有基金每万份收益的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近公告的基金每万份收益估值），估值日前一交易日开放式基金份额净值未公布的，以前最近一个交易日基金份额净值计算。尚未公布过基金份额净值的，应以账面价值估值。如果前一开放日至估值日该基金分红除权，则按前一开放日基金份额净值减单位份额分红额后的差额估值。

(7) 银行存款按照约定利率在持有期内逐日计提应收利息，在利息到账日以实收利息入账。

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

(9) 协议存款按照约定利率在持有期内逐日计提应收利息,在利息到账日以实收利息入账。

(10) 各类集合资管计划、资产支持证券、集合信托计划等按成本估值,在收到利息或投资收益时按实际收入入账。

(11) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的,管理人可根据具体情况与托管人商定后,按最能反映公允价值的价格估值。根据有关法律法规,计划资产净值计算和会计核算的义务由管理人承担。本计划的会计责任方由管理人担任。因此,就与本计划有关的会计问题,如经相关各方在平等基础上充分讨论后,仍无法达成一致意见,以管理人的意见为准,管理人负责对外解释并承担相应责任。

(12) 相关法律法规以及监管部门有强制规定的,从其规定。如有新增事项,按国家最新规定估值。

第七十一条 估值程序

管理人、托管人应在每个交易日对委托资产净值进行核对。管理人应于每个估值核对日交易结束后计算当日的资产净值并以传真或其他经双方认可的方式发送给托管人。托管人对净值计算结果复核后,签名、盖章并以传真或其他双方认可的方式传送给管理人。如对估值过程有异议的,经相关各方在平等基础上充分讨论后,仍无法达成一致的意见,按照管理人的计算结果为准。

第七十二条 估值错误的处理

如管理人或托管人发现计划资产估值违反本合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护委托人利益时,应立即通知对方,共同查明原因,协商解决。

当计划资产估值错误偏差达到计划委托资产净值的 0.5%时,管理人和托管人应该立即更正并在定期报告中报告委托人。管理人计算的委托资产净值已由托管人复核确认,但因委托资产估值错误给委托人造成损失的,由管理人与托管人按照管理费和托管费的比例各自承担相应的责任。

由于一方当事人提供的信息错误,另一方当事人在采取了必要合理的措施后仍不能

发现该错误，进而导致委托资产净值计算错误造成委托人的损失，以及由此造成以后交易日委托资产净值计算顺延错误而引起的委托人的损失，由提供错误信息的当事人一方负责赔偿。

由于交易市场、交易所发送的数据错误，或其他不可抗力等原因，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，由此造成的计划资产估值错误，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。

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

第七十三条 暂停估值的情形

- (1) 计划投资所涉及的交易场所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；
- (2) 因不可抗力或其他情形致使管理人、托管人无法准确评估资产管理计划委托资产价值时；
- (3) 占资产管理计划相当比例的投资品种的估值出现重大转变，而管理人为保障投资者的利益，决定延迟估值的情形；
- (4) 中国证监会认定的其他情形。

第七十四条 资产管理计划份额净值的确认

委托资产净值是委托资产总值减去负债后的价值，计算保留到小数点后二位，小数点后第三位四舍五入；委托资产的份额净值的计算保留到小数点后四位，小数点后第五位四舍五入；份额的计算保留到小数点后二位，小数点后第三位四舍五入。用于向委托人报告的计划份额净值由管理人负责计算，托管人进行复核。如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意見，按照管理人对委托资产净值的计算结果为准。

第十七节 资产管理计划的费用与税收

第七十五条 资产管理业务费用包括但不限于以下内容：

1. 管理费
2. 托管费
3. 业绩报酬

收取 不收取

4. 投资顾问服务费

收取 不收取

5. 代销机构的销售服务费

6. 合同印刷费

7. 税费

8. 交易手续费

9. 银行账户相关费用

第七十六条 管理费的支付标准、计算方法、支付时间、支付方式

1. 管理费的支付标准及计算方法：

若管理费按照年费率收取，则适用以下约定：

本计划的管理费按前一日委托资产净值的 0.25% 的年费率按日计提，按月度汇总支付。每日应计提的管理费计算公式如下：

每日应计提的管理费 = 前一日委托资产净值 × 0.25% ÷ 365 天

若管理费按照固定金额收取，则适用以下约定：

本计划的管理费为每年元。

若本计划管理费有保底收费，则适用以下约定：

若计划终止时管理人累计应收取的管理费不足万，则不足部分由管理人于计划终止后的 5 个工作日内向托管人发送划款指令，托管人复核后从资产管理计划财产中一次性支付给管理人。

其他

2. 管理费的支付方式：

管理人按合同约定收取的管理费应从托管账户中扣付。在每月度结束后，由管理人根据与托管人核对一致的估值表出具划款指令，托管人复核无误后执行。管理人接收管理费的账户信息如下：

账户名称：华泰期货有限公司

账号：3602028909004848229

开户行：工商银行广州市第三支行

若遇法定节假日、休息日或战争、自然灾害等不可抗力或计划财产无法变现致使管理人无法按时扣付的，顺延至不可抗力结束后或者最近可扣付日执行。

第七十七条 业绩报酬的支付标准、计算方法、支付时间、支付方式

管理人不对本计划收取业绩报酬。

第七十八条 根据市场发展情况管理人与委托人协商一致可以对资产管理费比率和业绩报酬比率进行调整，但需在清算前五（5）个工作日内就新的资产管理费比率和业绩报酬比率达成书面的补充约定；如一方不同意调整或者协商无果的，双方仍将按照资产管理合同约定的标准执行。

第七十九条 托管账户的管理及收费

1. 托管人负责托管账户的管理，每日按前一日的委托资产净值的 0.15% 年费率计提托管费，且不低于 5 万元/年（本计划的存续期不满一年的，按一年计算），按日计提，按月度支付。

2. 每日应计提的托管费的计算方法如下：

每日应计提的托管费 = 前一日的委托资产净值 × 年托管费率 ÷ 365 天

3. 托管费的支付方式：托管人按合同约定收取的托管费应从托管账户中扣付。在每月度结束后，由管理人根据与托管人核对一致的估值表出具划款指令，托管人复核无误后执行。年支付总额不足 5 万元的，在年度最后一次支付中补足。如本计划的存续期不满一年的，则在最后一次支付中补足至 5 万元。托管人接收托管费的账户信息如下：

户名：中国国际金融股份有限公司

账号：11001085100056000400

开户银行：中国建设银行北京国贸支行

若遇法定节假日、休息日或战争、自然灾害等不可抗力或计划财产无法变现致使管理人无法按时扣付的，顺延至不可抗力结束后或者最近可扣付日执行。

第八十条 投资顾问服务费支付标准、计算方法、支付时间、支付方式

本计划不收取投资顾问服务费。

本计划收取投资顾问服务费，具体标准及支付方式、支付时间是：

本计划的投资顾问服务费分为固定和浮动两部分。

1. 固定投资顾问服务费自委托资产运作起始日起按照 0.75% 的年费率按前一日委托资产净值为基数每日计提，每季度汇总收取一次。

每日应计提的投资顾问服务费计算公式如下：

每日应计提的投资顾问服务费 = 前一日委托资产净值 × 0.75% ÷ 365 天

2. 浮动投资顾问服务费具体计算方法如下：

本计划的浮动投资顾问服务费仅针对 A 类份额委托人收取。

自本计划项下的委托资产运作起始日起至最近的第一个开放日，以及以后每个季度为一个浮动投资顾问服务费计算周期（以下简称“计算周期”）。以每个季度最后一个交易日收盘清算估值后的计划份额及份额净值作为该计算周期期末的计划份额及份额净值，每个计算周期结束时，管理人就组合中参与时间相同的计划财产分别按其在该计算周期内新增收益的 20% 计提浮动投资顾问服务费。浮动投资顾问服务费在每个计算周期结束、委托人退出资产管理计划份额或本合同终止时提取。如本合同于非计算周期末的日期终止，浮动投资顾问服务费应如同该终止日为计算周期末般计算。

(1) 于每个计算周期结束，就同一时间参与的计划财产而言，该计算周期的浮动投资顾问服务费计算方式如下：

$$PF_n = \begin{cases} 0, & \text{当 } NAV_n \leq HWM_n \text{ 时} \\ U \times (NAV_n - HWM_n) \times 20\%, & \text{当 } NAV_n > HWM_n \text{ 时} \end{cases}$$

其中：

PF_n 为第 n 个计算周期应计的浮动投资顾问服务费；

NAV_n 为第 n 个计算周期期末的计划份额净值；

HWM_n 为第 n 个计算周期期末的高水线，其计算方法为：

$HWM_n = \text{Max}(NAV_{n-1}, HWM_{n-1})$, $HWM_1 = NAV_0 =$ 该部分计划财产参与时的初始计划份额净值；

U 为该笔计划财产当前的份额。

管理人按该计算周期期末的计划份额净值赎回部分份额以支付浮动投资顾问服务费，对计划份额净值不造成任何影响。用于支付浮动投资顾问服务费而赎回的份额按以下方式计算：

$$U_{pf} = PF_n / NAV_n$$

(2) 如委托人于任一计算周期内退出（含违约退出）资产管理计划份额或本合同

于任一计算周期内终止，就同一时间参与的计划财产而言，该计算周期的浮动投资顾问服务费计算方式如下：

$$PF' = \begin{cases} 0, & \text{当 } NAV' \leq HWM_n \text{ 时} \\ U \times (NAV' - HWM_n) \times 20\%, & \text{当 } NAV' > HWM_n \text{ 时} \end{cases}$$

其中：

PF' 为该计算周期内应计的浮动投资顾问服务费；

NAV' 为该部分计划财产份额退出时或本合同终止时的计划份额净值；

HWM_n 为第 n 个浮动投资顾问服务费计算周期期末的高水线，其计算方法为：

$HWM_n = \text{Max}(NAV_{n-1}, HWM_{n-1})$, $HWM_1 = NAV_0$ = 该部分计划财产参与时的计划份额净值；

U 为资产委托人退出的计划财产份额或合同终止时持有的计划财产份额。

浮动投资顾问服务费在赎回确认金额中扣除，对计划份额净值计算不会造成任何影响。

浮动投资顾问服务费计算举例：

初始销售期，委托人 A（以下称 A）以 1.00 元/份认购 1,000 万份，即 1,000 万元；到计划的第一次开放日，计划份额净值变为 0.98 元。委托人 B（以下称 B）以 0.98 元/份参与 100 万份，即 98 万元。此时资管计划总份额 1,100 万份，资产净值 1,078 万元。

到了第一个计算周期期末，计划净值上升至 1.10 元：

- 对于 A 而言，该计算周期的高水线为 1.00 元；收益为 $(1.10 - 1.00) \times 1,000$ 万份额 = 100 万元，应收浮动投资顾问服务费 20 万元，以计划份额净值 1.10 元计，等于 181,818.18 份。因此，从 A 持有份额中扣减 181,818.18 份作为浮动投资顾问服务费，剩余份额 9,818,181.82 份。

- 对于 B 而言，该计算周期的高水线为 0.98 元；收益为 $(1.10 - 0.98) \times 100$ 万份额 = 12 万元，应收浮动投资顾问服务费 24,000 元，以计划份额净值 1.10 元计，等于 21,818.18 份。因此，从 B 持有份额中扣减 21,818.18 份作为浮动投资顾问服务费，剩余份额 978,181.82 份。

此时资管计划总份额 10,796,363.64 份，资产净值 11,876,000.00 元

到了第二个计算周期期末，计划份额净值回落至 1.05 元。委托人 C（以下称 C）以 1.05

元/份参与 100 万份，即 105 万元。此时资管计划总份额 11,796,363.64 份，资产净值 12,386,181.82 元。

- 对于 A 而言，该计算周期的高水线为 1.10；A 的新增收益为负，浮动投资顾问服务费为 0。因此，A 的份额不变，于下一个计算周期的高水线仍为 1.10 元。

- 对于 B 而言，该计算周期的高水线为 1.10；B 的新增收益为负，浮动投资顾问服务费为 0。因此，B 的份额不变，于下一个计算周期的高水线仍为 1.10 元。

在第二个计算周期期末后的第一个开放日，计划份额净值上升至 1.20 元，B 在这次开放中退出。

- B 在退出时新增收益为 $(1.20-1.10) \times 978,181.82 \text{ 份} = 97,818.18 \text{ 元}$ ，应收浮动投资顾问服务费 19,563.64 元，以计划份额净值 1.20 计，等于 16,303.03 份。因此，从 B 的持有份额中扣减 16,303.03 份作为浮动投资顾问服务费，剩余份额为 961,878.79 份。以计划份额净值 1.20 元计，B 最终在扣掉浮动投资顾问服务费后的资金为 1,154,254.55 元。

到了第三个计算周期期末，计划份额净值回落至 1.15 元。

- A 在该计算周期新增收益为 $(1.15-1.10) \times 9,818,181.82 \text{ 份} = 490,909.09 \text{ 元}$ ，应收浮动投资顾问服务费 98,181.82 元，以计划份额净值 1.15 计，等于 85,375.49 份。因此，从 A 的持有份额中扣减 85,375.49 份作为浮动投资顾问服务费，剩余份额 9,732,806.32 份。以计划份额净值 1.15 元计，A 的资产净值变为 11,192,727.27 元。A 于下一个计算周期的高水线改为 1.15；

- C 在该计算周期新增收益为 $(1.15-1.05) \times 100 \text{ 万份} = 10 \text{ 万元}$ ，应收浮动投资顾问服务费 2 万元，以计划份额净值 1.15 计，等于 17,391.30 份。因此，从 C 的持有份额中扣减 17,391.30 份作为浮动投资顾问服务费，剩余份额为 982,608.70 份。以计划份额净值 1.15 元计，C 的资产净值变为 1,130,000.00 元。C 于下一个计算周期的高水线改为 1.15。

管理人负责浮动投资顾问服务费的计算并向托管人提供 Excel 格式的工作底稿，并应配备相应人员来完成由浮动投资顾问服务费所涉及的份额扣减、登记的相关工作。管理人应在（就固定投资顾问服务费而言）每个季度或（就浮动投资顾问服务费而言）计算周期结束后、或如本合同于非计算周期末的日期终止，则该日期所在季度结束后的 3 个工作日之内，就到期应付给投资顾问的费用向投资顾问提交一份经托管人核实的明细

单。该等明细单应包括经托管人确认的委托资产净值。管理人应在投资顾问确认同意该等明细单后的 3 个工作日内下达指令托管人从托管账户中扣除投资顾问服务费至投资顾问的指定账户。

第八十一条 代销机构的销售服务费

1. 销售服务费按前一日委托资产净值 0.75% 的年费率收取，每日计提，按月支付。销售服务费的计算方法如下：

每日应计提的后续销售服务费=前一日的委托资产净值 \times 0.75%/365

2. 销售服务费的支付方式：在每月度结束后，由管理人汇总该月度应提取的销售服务费并以邮件的方式向托管人发出账目明细。若托管人对收取费用有异议，需在 3 个工作日内向管理人以邮件或电话方式提出意见，若无回复，视为确认无误，之后管理人向托管人发出划款指令，托管人在收到划款指令后的 3 个工作日内依据管理人出具的划款指令从托管账户划转至代销机构的指定账户。

若遇法定节假日、休息日或战争、自然灾害等不可抗力致使管理人无法按时扣付上述费用的，顺延至不可抗力结束后或者最近可扣付日执行。

第八十二条 委托资产运作产生的交易手续费、银行账户相关费用、中国证券登记结算有限公司证券账户卡办理费用、合同印刷费、税费等其他费用，根据实际发生金额列入或摊入当期委托资产运作费用，具体详见《费用列表》（附件 1）。

在取得委托人的书面确认后，管理人可以调高交易手续费收取的比例，并将新的收取比例通知托管人。

交易所或第三方金融机构调整税费征收种类或相关费率时，以上税费也随之调整，具体调整时间以管理人通过邮件、电话或短信的方式之一进行的通知为准。

第八十三条 不列入资产管理计划业务费用的项目

1. 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计划财产的损失；
2. 管理人和托管人处理与计划运作无关的事项发生的费用；
3. 其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入计划费用的项目。

第八十四条 费用的调整

管理人和托管人与委托人协商一致，可根据市场发展情况调整管理费率和托管费率，并报中基协备案。

第八十五条 管理人编制并向委托人提供资产管理报告，资产管理报告应说明投资经

理简介、期末资产配置、期末净值、报告期内风险控制情况、管理费、托管费、投资顾问服务费、交易费用、税费及其他费用的支出等情况。

第八十六条 资产管理业务的税收

上述条款提及的税费应在计算委托资产净值时予以扣除，交易所或第三方金融机构调整税费征收种类或相关费率时，以上税费也随之调整，具体调整时间以管理人通知为准，通知的方式可以是邮件、电话或短信，只要管理人采取了其中任一种通知方式，即视为管理人已经通知。

本计划运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。本计划根据实际从登记结算机构收到的股息、利息等相关收入直接确认收益。委托人应缴纳的税收，由委托人负责，管理人不承担代扣代缴或纳税的义务。

第十八节 资产管理计划的收益分配

第八十七条 计划收益的构成包括：

1. 买卖投资标的价差或投资标的的估值增加、分红；
2. 银行存款利息；
3. 已实现的其他合法收入。

第八十八条 计划净收益

本计划的净收益为计划实现的收益扣除按照国家有关规定及资产管理合同规定可以在计划收益中扣除费用后的余额。

第八十九条 计划净收益分配时间

本计划原则上在份额退出或计划终止后一次性分配委托人收益，但管理人有权根据计划运作情况临时增设收益分配日。

第九十条 计划净收益分配原则

1. 每一计划份额对计划净收益享有均等分配权；
2. 计划净收益在份额退出或计划终止后直接以现金方式分配，在收益分配基准日以转换为计划份额的方式分配，每位委托人获得的分配金额保留至小数点后二位；
3. 计划净收益在以现金方式分配时发生的银行转账等手续费用由委托人自行承担；
4. 每次收益分配不得高于该次可供分配收益上限，可供分配收益指截止至收益分配

基准日未分配净收益与未分配净收益中已实现净收益的孰低者。

第十九节 信息披露与报告

第九十一条 存续期报告

1. 管理人向委托人提供的报告种类、内容和提供时间

(1) 年度报告

管理人应当在每年度结束之日起 20 个工作日内，利用经托管人复核的相关数据编制完成计划年度报告并，向委托人披露委托资产净值、主要费用、投资表现、风险和合规情况等信息。若本合同生效不足一年，管理人可以不编制当期年度报告。

(2) 临时报告

发生可能影响委托人利益的重大事项时，管理人必须按照法律法规和中国证监会的有关规定，及时进行报告。

法律法规和中国证监会规定的其他事项。

2. 管理人向委托人提供报告产委托人信息查询的方式

管理人向委托人提供的报告，将严格按照期货资管适用的相关法律法规规定通过以下至少一种方式进行：

(1) 管理人网站内受密码保护的委托人账户

(2) 邮寄服务

委托人在合同签署页上填写的通信地址为送达地址。通信地址如有变更，委托人应当及时通知管理人。

(3) 传真、电子邮件或手机短信等

如委托人办理资产管理计划认购、参与或退出等业务时留有传真号、电子邮箱、手机及电话号码等联系方式的，管理人也可通过传真、电子邮件、手机短信、电话、电报等方式将报告信息通知委托人。委托人上述联系方式若发生变更应当及时通知管理人。

第九十二条 委托人可以在中国期货业协会网站 (www.cfachina.org) 查询有关管理人资产管理业务资格、从业人员的情况。

第二十章 风险揭示

第九十三条 本计划在投资管理过程中可能面临的各项风险包括但不限于：

1. 市场风险

金融市场价格受到经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素的影响，导致资产管理计划财产收益水平变化，产生风险，主要包括：

(1) 政策风险

因国家宏观政策（如货币政策、财政政策、行业政策、地区发展政策等）发生变化，导致市场价格波动而产生风险。

(2) 经济周期风险

随经济运行的周期性变化，证券市场的收益水平也呈周期性变化。资产管理计划财产投资于债券与上市公司的股票，收益水平也会随之变化，从而产生风险。

(3) 利率风险

金融市场利率的波动会导致证券市场价格和收益率的变动。利率直接影响着固定收益类品种的价格和收益率，影响着企业的融资成本和利润。资产管理计划财产投资于固定收益品种，其收益水平会受到利率变化的影响。

(4) 购买力风险

资产管理计划财产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，从而使资产管理计划财产的实际收益下降。

2. 信用风险

本计划在交易过程可能发生交收违约，或者本计划所投资债券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致计划财产损失。信用风险主要来自于交易对手、发行人和担保人。在资产管理计划财产投资运作中，如果管理人的信用研究水平不足，对信用产品或交易对手的信用水平判断不准确，可能使资产管理计划财产承受信用风险所带来的损失。

3. 流动性风险

当计划资产不能迅速转变成现金，或者不能应付可能出现的投资者大额赎回时，会出现如下风险：

(1) 市场整体流动性风险

证券市场的流动性受到价格、投资群体等诸多因素的影响，在不同状况下，其流动

性表现是不均衡的，具体表现为：在某些时期成交活跃，流动性非常好，而在另一些时期，则可能成交稀少，流动性差。在市场流动性出现问题时，本计划的操作有可能发生建仓成本增加或变现困难的情况。

(2) 期货合约和个券流动性风险

由于不同投资品种受到市场影响的程度不同，即使在整体市场流动性较好的情况下，一些单一投资品种仍可能出现流动性问题，这种情况的存在使得本计划在进行投资操作时，可能难以按计划买入或卖出相应数量的证券，或买入卖出行为对证券价格产生比较大的影响，增加投资成本。这种风险在出现期货合约和个券停牌和涨跌停板等情况时表现得尤为突出。

(3) 资产管理计划止损风险

本计划达到清盘线时，由本计划管理人强制止损，将持仓证券卖出，并对本计划进行清算。

4. 特定的投资方法及委托资产所投资的特定投资对象可能引起的特定风险本计划采取的投资策略和投资对象可能存在使基金收益不能达到投资目标或者本金损失的风险。

本计划可投资资产支持证券等产品风险受其所投资的基础资产影响较大，而本合同中未明确限定所投资资产支持证券等产品所对应基础资产范围，因此本计划存在由于投资前述产品导致的相关未知风险。

5. 操作风险

(1) 在资产管理计划财产管理运作过程中，对主要业务人员如资产管理计划投资经理的依赖可能产生管理风险。可能因管理人对经济形势和证券市场等判断有误、获取的信息不全等影响资产管理计划的收益水平。管理人和托管人的管理水平、管理手段和管理技术等对资产管理计划收益水平存在影响。

(2) 在资产管理计划财产管理运作过程中，相关当事人在业务各环节操作过程中，因内部控制存在缺陷或者人为因素，可能造成操作失误或违反操作规程等引致的风险，例如，越权违规交易、内幕交易、欺诈、交易错误等。

(3) 本计划投资资产支持证券等产品时，存在由于拟投资产品的管理人恶意挪用资金或操作风险导致的损失。

6. 投资顾问风险

本计划将参考投资顾问的投资建议进行投资，因此，投资顾问可能存在信用风险、道德风险，同时投资顾问的投资研究水平、风险识别能力等因素都会影响本计划的投资损益。此外，如《投资顾问协议》提前终止，管理人有权决定是否提前终止本合同，可能会对委托人收益产生影响。

7. 相关机构的经营风险

(1) 管理人经营风险

按照我国金融监管法律规定，虽管理人相信其本身将按照相关法律的规定进行营运及管理，但无法保证其本身可以永久维持符合监管部门的金融监管法律。如在本计划存续期间管理人无法继续经营资管业务，则可能会对本计划产生不利影响。

(2) 托管人经营风险

按照我国金融监管法律规定，托管人须获得中国证监会核准的证券投资基金托管资格方可从事托管业务。虽托管人相信其本身将按照相关法律的规定进行营运及管理，但无法保证其本身可以永久维持符合监管部门的金融监管法律。如在基金存续期间托管人无法继续从事托管业务，则可能会对基金产生不利影响。

(3) 证券经纪商经营风险

按照我国金融监管法律规定，证券公司须获得中国证监会核准的证券经营资格方可从事证券业务。虽证券经纪商相信其本身将按照相关法律的规定进行营运及管理，但无法保证其本身可以永久维持符合监管部门的金融监管法律。如在基金存续期间证券经纪商无法继续从事证券业务，则可能会对基金产生不利影响。

8. 其他风险

(1) 战争、自然灾害等不可抗力因素的出现，将会严重影响证券市场的运行，可能导致资产管理计划财产的损失；

(2) 金融市场危机、行业竞争、代理商违约等超出管理人和托管人自身直接控制能力之外的风险，也可能导致委托人利益受损。

第九十四条 管理人应当有效执行资产管理业务风险控制制度，对资产管理账户日常交易情况进行风险识别、监测，及时执行风险控制措施。

第二十一节 合同生效、变更与终止

第九十五条 合同的生效

委托人为法人的，本合同经委托人、管理人和托管人加盖公章或合同专用章以及各方法定代表人或授权代表签字或盖章之日起生效；委托人为自然人的，本合同经委托人本人签字或授权的代理人签字、管理人和托管人加盖公章或合同专用章以及双方法定代表人或授权代表签字之日起生效。

本合同可以纸质合同方式签署，也可以电子签名方式签署。以纸质合同方式签署的，遵循上述约定，以电子签名方式签署的，管理人或代销机构向托管人提供相应电子签名合同数据。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；投资者作为本合同一方，以纸质合同方式或电子签名方式签署本合同即表明投资者完全接受本合同项下的全部条款。以电子签名方式签署本合同的，投资者、管理人、托管人同意遵守《中华人民共和国电子签名法》的有关规定。投资者以电子签名方式接受电子签名合同、文书（包括但不限于本合同、风险揭示书、与投资者适当性管理相关的评估、确认、告知、警示等各类文件或其他文书）的，视为签署本合同、文书，与在纸质合同、文书上手写签名或者盖章具有同等的法律效力，无须另行签署纸质合同、文书。

第九十六条 合同的变更

委托人、管理人和托管人协商一致，可以变更本合同。

第九十七条 在以下情形下，管理人有权变更合同内容，并至少应于变更前 2 日书面通知委托人和托管人，上述情形包括：

1. 投资经理的变更；
2. 资产管理计划认购、参与、退出、非交易过户的原则、时间、业务规则等变更；
3. 因相应的法律法规发生变动而应当对资产管理合同进行变更；
4. 对本合同的变更不涉及当事人权利义务关系发生变化；
5. 对本合同的变更对委托人或托管人的利益无实质性不利影响。

第九十八条 本合同履行过程中，如果相关法律、法规、规章、政策及证券或期货交易所规则发生变化，委托人、管理人和托管人各方依照上述变化可以通过签署补充协议的方式变更本合同与此相关部分的条款。补充协议由委托人、管理人和托管人各方签章后生效，补充协议效力优先。

第九十九条 本合同任何形式的变更、补充，管理人应当按照中基协的要求将资产管理合同样本报中基协备案。

第一百条 合同的终止

1. 自然终止的情形包括下列事项：

- (1) 资产管理合同的委托人少于 2 名；
- (2) 管理人被依法取消特定客户资产管理业务资格的；
- (3) 管理人或托管人依法解散、被依法撤销或被依法宣告破产的；
- (4) 托管人被依法取消基金托管资格的；
- (5) 触发止损条件，按照合同的约定提前终止的；
- (6) 因产品特性及其特定风险，发生系统技术、第三方支持或监管政策等客观条件匮乏或丧失，且资产管理人认为实质影响本合同目的之实现的；
- (7) 如果发生不可抗力事件，本合同各方应立即互相协商，以找到公平的解决办法，并且应尽一切合理努力将不可抗力事件的后果减小到最低限度。若不可抗力事件的发生使得本合同的履行成为不可能或不切实际或继续履行对一方将造成实质性不利影响，则任何一方均可通知对方终止本合同；
- (8) 法律法规和本合同约定的其他情形。

2. 经委托人、管理人和托管人协商一致，可以终止本合同。

3. 当委托资产发生权属变更等重大情形，可能影响到资产管理业务正常进行的，管理人有权终止本合同。

第一百〇一条 《投资顾问协议》提前终止，管理人有权决定是否提前终止本合同。

第二十二节 资产管理计划财产的清算

第一百〇二条 当资产管理合同终止时，管理人和托管人对委托资产进行清算。

1. 清算程序

- (1) 管理人和托管人根据计划财产的情况确定清算期限；
- (2) 管理人和托管人对计划财产进行清理和确认；
- (3) 对计划财产进行评估和变现；
- (4) 管理人制作清算报告，托管人审核并盖章；
- (5) 对计划财产进行分配。

2. 清算费用

清算费用是指管理人和托管人在进行计划清算过程中发生的所有合理费用，清算费

用由计划财产优先从计划财产中支付。

3. 剩余财产的分配

依据资产管理计划财产清算的分配方案,将资产管理计划财产清算后的全部剩余资产扣除资产管理计划财产清算费用及各项负债后,按资产管理计划的委托人持有的不同类型的计划份额比例分别进行分配。计划财产按下列顺序清偿:

- (1) 支付资产管理合同终止时尚未支付完成的管理费、业绩报酬、违约金、托管费、投资顾问服务费及其他相关费用;
- (2) 交纳所欠税款(委托人必须自行缴纳的税收);
- (3) 清偿委托资产债务;
- (4) 返还委托人。

如果资产管理合同终止时,本计划账户有流通受限的证券,管理人和托管人在完成本款(1)、(2)、(3)后,可将账户中的现金类资产返还给委托人,但需预留足够的现金资产作为剩余委托资产的管理费、托管费及其他相关费用。

在流通受限的证券恢复交易后的十(10)个工作日内,管理人须将该证券变现。待所有证券全部变现且计提相关费用后,管理人按委托人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。

4. 剩余财产清算报告的告知安排

清算过程中的有关重大事项须及时报告委托人。管理人在本计划终止后十(10)个工作日内编制资产管理计划清算报告,经托管人审核无误盖章。委托人在此同意并认可经托管人确认的上述报告,上述报告不再另行审计,法律法规或监管部门要求必须进行审计的情况除外。

托管人对清算报告确认无误盖章后发送管理人,管理人依据清算报告向托管人发出指令,从托管账户中扣除委托人资产管理合同项下应付未付的款项后,一次性返还委托人委托资产及相关收益。

5. 清算资料的保存

计划财产清算账册及文件由管理人保存十(10)年以上。

6. 资产管理计划相关账户的注销

剩余财产清算完毕且资金划拨至委托人资管结算账户后,管理人和托管人相互配合按照规定注销资产管理计划的托管账户、证券账户、期货账户及其他账户,委托人应给

予必要的配合。

第二十三章 违约责任

第一百〇三条 若任何一方（简称“违约方”）违反义务，妨碍对方（简称“守约方”）权利，则视为违约，应当承担违约责任，且赔偿守约方所遭受的损失。

第一百〇四条 在发生一方或多方违约的情况下，本合同能继续履行的，应当继续履行。出现违约的情况时，守约方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。

第一百〇五条 免责条款

1. 管理人或托管人对按照中国证监会的规定或当时有效的法律法规、本合同约定的作为或不作为而造成的损失等不承担责任。

2. 在没有欺诈或过错的情况下，管理人对由于按照本合同约定的投资原则而行使或不行使其投资权而造成的损失等不承担责任。

3. 在没有欺诈或过错的情况下，托管人对由于按管理人符合本合同约定的有效指令执行而造成的损失等不承担责任。

4. 因证券市场波动、上市公司合并、计划财产规模变动、投资顾问等管理人之外的因素致使计划财产投资不符合本合同项下约定的投资策略的，管理人将进行调整，并不因此承担任何责任。

5. 委托人未能事前就其关联证券或其他禁止交易证券明确告知管理人致使资产管理计划财产发生违规投资行为的，管理人与托管人均不承担任何责任。

6. 由于地震、火灾、战争等不可抗力因素导致的交易中断、延误或影响一方履行其在本合同项下的义务等，该方不承担相应责任，有权在不可抗力造成的延误期内中止履行，但应当在条件允许的范围内采取一切必要的补救措施以减少因不可抗力造成的损失。但一方迟延履行其在本合同项下的义务后发生不可抗力事件的，该方对无法履行或迟延履行其在本合同项下的义务不能免除责任。

7. 由于国家有关法律、法规、规章、政策及证券或期货交易所规则的改变、紧急措施的出台等导致委托人所承担的风险，管理人不承担责任。

8. 由于通讯系统繁忙、中断，计算机交易系统故障，网络及信息系统故障，电力中

断等原因导致指令传达、执行出现延迟、中断或数据错误，管理人没有过错的，管理人不承担责任。

9. 由于互联网上黑客攻击、非法登陆等风险的发生给委托人造成的损失，管理人和托管人不承担责任。

10. 托管人对因为管理人投资产生的存放或存管在托管人以外机构的委托资产，由于该等机构或该机构会员单位等本合同当事人外第三方的欺诈、疏忽、过失或破产等原因给委托资产造成的损失等。

11. 法律法规规定及本合同约定的其他情况。

第一百〇六条 上述损失均为直接损失。

第二十四节 争议的处理

第一百〇七条 凡因本合同引起的或与本合同有关的任何争议，各方可以自行协商解决；也可向中国期货业协会或广东证券期货业协会申请调解。协商或调解不成的，可以提请仲裁或者提起诉讼。各方也可以不经过协商或调解直接提请仲裁或者提起诉讼。各方同意提请中国国际经济贸易仲裁委员会仲裁，仲裁地在北京，以该会当时有效的仲裁规则为准，各方同意适用仲裁普通程序，仲裁庭由三人组成。仲裁裁决是终局性的，并对各方当事人具有约束力，除裁决另有规定外，仲裁费由败诉方承担。

第二十五节 其他

第一百〇八条 《期货公司资产管理业务风险揭示书》、《资产合法性及投资者适当性承诺书》及其他补充协议为本合同不可分割的组成部分，与本合同具有同等法律效力。

第一百〇九条 本合同壹式叁份，管理人、委托人、托管人各执壹份。本合同除在所列各空白处填写资料外，管理人、委托人及托管人如有其它约定，均须另行签订补充或修改协议，不得在本合同上直接加注。任何在本合同上自行添加的条款或对条款的修改均属无效，不具法律效力。

附件 1：费用列表

附件 2：委托资产到账确认函（样本）

附件 3：资产管理计划起始运作通知书（给托管人）（样本）

附件 4：授权通知（样本）

附件 5：划款指令（样本）

附件 6：投资监督事项表

（以下无正文）

(请委托人务必确保填写的资料正确有效,如因填写错误导致的任何损失,管理人和托管人不承担任何责任)

委托人请填写:

(一) 委托人

1、自然人

姓名:

证件名称: 身份证、军官证、护照

证件号码:

联系地址:

邮编:

电子邮箱:

联系电话:

2、法人或其他组织

名称:

营业执照号码:

组织机构代码证号码:

法定代表人或负责人:

联系地址:

邮编:

电子邮箱:

联系人:

联系电话:

(二) 委托人认购的份额类别

请确认认购本计划 A 类份额 B 类份额

(本计划仅对 A 类份额收取浮动投资顾问服务费, 不对 B 类份额收取浮动投资顾问服务费, 敬请投资者在认购的时候注意。)

(三) 委托人认购金额

人民币 _____ 元整 (¥ _____)

(四) 委托人账户

委托人认购计划的划出账户与清算退出计划的划入账户, 必须为以委托人名义开立的同一个账户。特殊情况导致认购和清算退出计划的账户名称不一致时, 委托人应出具符合相关法律法规规定的书面说明并提供相关证明。账户信息如下:

户 名:

账 号:

开户行:

(本页为《华泰期货 CTA 母基金资产管理计划资产管理合同》签署页)

管理人：华泰期货有限公司（公章或合同专用章）

法定代表人或授权代理人：（签章）

签署日期：【 】年【 】月【 】日

委托人：

（签章）

签署日期：【 】年【 】月【 】日

托管人：中国国际金融股份有限公司（公章或合同专用章）

法定代表人或授权代理人：（签章）

签署日期：【 2017 】年【 12 】月【 6 】日



附件 1：费用列表

费用项目	计费方式
管理费	按前一日委托资产净值的 0.25 % 的年费率按日计提，按月度汇总支付。
托管费	本计划的托管费按前一日委托资产净值的 0.15% 的年费率按日计提，按月度汇总支付，且不低于 5 万元/年。
认购/参与费用	0%
业绩报酬	管理人不对本计划收取业绩报酬。
投资顾问服务费	本计划的投资顾问服务费分为固定和浮动两部分。固定投资顾问服务费按照前一日委托资产净值的 0.75% 的年费率按日计提，按季度汇总支付。浮动投资顾问服务费的具体收取见合同约定。
代销机构的销售服务费	销售服务费按前一日委托资产净值 0.75% 的年费率收取，每日计提，按月支付。
交易手续费	具体以管理人与相关经纪商约定的为准。
合同印刷费	本合同涉及的印刷费用从委托资产中列支。
银行账户相关费用	委托人应根据银行业税费征收的规定支付托管账户的银行账户相关费用，包括但不限于汇划费，具体收取标准以托管人实行的费率为准。
中国证券登记结算有限公司证券账户卡办理费用	该费用由管理人代为办理时垫付，管理人于首期扣取管理费时委托托管人从委托资产中一并扣除，具体收取标准以中国证券登记结算有限公司相关规定为准。
税收	委托人应根据国家法律法规的规定及资产管理合同的约定履行因委托资产运作产生的相关纳税义务。

附件 2：委托资产到账确认函（样本）

华泰期货有限公司：

根据各方共同签署的《华泰期货 CTA 母基金资产管理计划资产管理合同》（合同编号：ZG8190），贵司担任本计划的管理人，我行担任本计划的托管人。

20 年 月 日，委托人已将初始委托资产以货币形式共计元人民币转入本计划开立的托管账户中，本计划在我方已经具备正式投资运作的条件。

请管理人收到本通知后，向本行签章确认已收悉本通知，并明确本计划的起始运作日。

中国国际金融股份有限公司（签章）

年 月 日

附件 3：资产管理计划起始运作通知书（给托管人）（样本）

中国国际金融股份有限公司：

我司作为《华泰期货 CTA 母基金资产管理计划资产管理合同》（合同编号：ZG8190）的管理人，现确认已收悉贵行作为托管人发出的《委托资产到账确认函》，对通知中所列初始委托资产的金额、数量等事项无异议。

同时，我司已向中国证券投资基金业协会办理完成备案手续，本管理人确认，20年月日作为本计划的起始运作日。本计划起始运作日已确认份额份（包含认购资金打款到募集账户所产生的利息折算的份额）。

华泰期货有限公司（公章）

年 月 日

附件 4：授权通知

致：中国国际金融股份有限公司资产托管部

兹就贵公司作为托管人与我司（作为管理人）的所有计划托管服务业务，我司授权以下人员代表我司向贵公司发送相关计划项下资金划拨指令以及其他相关通知。本授权委托书含指令发送用章样本、有关人员签字样本、相应权限及日常业务往来用章样本，本授权委托书交由贵公司保存，请在使用时核验。本授权委托书所指定被授权人在授权范围内向贵公司发送指令的真实性、准确性及合法性由我司负全部责任。

事件类型	姓名	权限	签字或签章	预留业务印章
资金划拨		经办 A		
		经办 B		
		复核 A		
		复核 B		
*使用说明：1. 用于管理人向托管人发送划款指令；2. 资金划付指令需上述经办 1 人、复核 1 人，并加盖预留业务印章为有效印鉴；3. 预留业务印章可以是单位公章，或财务章；				
注册登 记 数据发 送		经办 A		
		经办 B		
		复核 A		
		复核 B		
*使用说明：1. 用于管理人向托管人发送份额登记指令；2. 份额登记指令需上述经办 1 人、复核 1 人，并加盖预留业务印章为有效印鉴；3. 预留业务印章可以是单位公章，或财务章；				
估值结果 确认 / 份 额登记结 果确认	——	经办 A	——	
	——	经办 B	——	
	——	复核 A	——	
	——	复核 B	——	

*使用说明：1. 用于管理人向托管人发送估值结果/份额登记结果确认；2. 预留业务印章可以是单位公章，或财务章；			
其他事项 (如有)		经办 A	
		经办 B	
		复核 A	
		复核 B	
*使用说明：1. 用于其他事项的指令发送，用途请在“备注”中注明。2. 备注：			

本授权通知生效日期为：【 】年【 】月【 】日

本授权通知有效期至我司向贵公司提供新的授权书委托原件或书面终止执行本授权委托书的
通知至贵公司时为止。

管理人(公章)：

法定代表人（或授权人）签章：

:

附件 5：划款指令（样本）

划款指令

_____ 计划专用表

编号： _____ 年第 _____ 号		
指令日期： _____ 年 _____ 月 _____ 日		
中国国际金融股份有限公司：		
敬请贵公司根据以下提供的收款人名称、开户行、账号和划款金额划款。		
付款人：		
开户行：		
账 号：		
收款人：		
开户行：		
账 号：		
划款金额(小写)：		
划款金额(大写)：		
划款用途：		
备注：		
经办人员	复核人员	预留业务印章

附件 6：投资监督事项表

<p>一、投资范围</p>
<p>1. 现金管理类：现金、银行存款（包括银行活期存款、银行定期存款和银行协议存款等各类存款）、短期国债、期限在一年以内（含一年）债券逆回购、开放式的货币市场基金（含管理人管理的开放式货币市场基金），投资比例为按市值计算为委托资产净值的 0-100%；</p> <p>2. 金融衍生品：国内四家交易所（中国金融期货交易所、上海期货交易所、郑州商品交易所、大连商品交易所）或其他中国证券交易所、证券衍生品交易所或商品衍生品交易所依法上市交易的、具有充足流动性的商品期货与金融期货，投资比例为根据交易所规定的保证金比例计算的持仓保证金占用为委托资产净值的 0-35%；</p> <p>3. 集合资产管理计划：证券公司、期货公司、信托公司、银行、保险公司、基金公司等金融机构依法设立的集合资产管理计划，投资比例按市值计算为委托资产净值的 0-100%。</p> <p>4. 经中国证券监督管理委员会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。</p>
<p>二、投资限制</p>
<p>1. 本合同项下的资产管理账户不可以参与股指期货以外的期货交割业务。</p> <p>2. 禁止投资于股票、权证等权益类证券；</p> <p>3. 禁止持有进入交割月的商品期货合约。</p>

本计划的建仓期为计划成立之日起三个月。在建仓期内，管理人应积极调整各类资产投资比例，使其逐步符合本投资监督事项表要求，托管人仅对投资范围进行监督。建仓期结束后，投资组合中各类资产投资比例应符合本投资监督事项表要求，托管人按照本投资监督事项表履行监督职能。