# 海通-宝鼎成长 2 号集合资产管理计划
# 资产管理合同

管理人：上海海通证券资产管理有限公司

托管人：上海银行股份有限公司

二〇一五年

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

# 目 录

一、前言.....1
二、释义.....1
三、合同当事人.....5
四、集合资产管理计划的基本情况.....8
五、集合计划的参与和退出.....11
六、管理人自有资金参与集合计划.....16
七、集合计划的分级.....16
八、集合计划客户资产的管理方式和管理权限.....17
九、集合计划的成立.....17
十、集合计划账户与资产.....17
十一、集合计划资产托管.....18
十二、集合计划的估值.....18
十三、集合计划的费用、业绩报酬.....22
十四、集合计划的收益分配.....25
十五、投资理念与投资策略.....26
十六、投资决策与风险控制.....26
十七、投资限制及禁止行为.....30
十八、集合计划的信息披露.....30
十九、集合计划份额的转让、非交易过户和冻结.....33
二十、集合计划的展期.....33
二十一、集合计划终止和清算.....34
二十二、当事人的权利和义务.....35
二十三、违约责任与争议处理.....39
二十四、风险揭示.....40
二十五、合同的成立与生效.....44
二十六、合同的补充、修改与变更.....44

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

## 一、前言

为规范海通宝鼎成长 2 号集合资产管理计划运作，明确《海通宝鼎成长 2 号集合资产管理计划资产管理合同》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》、《证券公司集合资产管理业务实施细则》、《证券公司客户资产管理业务规范》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《证券公司客户资产管理业务管理办法》、《证券公司集合资产管理业务实施细则》、《海通宝鼎成长 2 号集合资产管理计划说明书》、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、准确、完整，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

在本合同中，除非文义另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

| | |
|---|---|
| 集合资产管理计划、资产管理计划、集合计划、本计划 | 指海通宝鼎成长 2 号集合资产管理计划； |
| 集合计划说明书、计划说明书、说明书 | 指《海通宝鼎成长 2 号集合资产管理计划说明书》及对说明书的任何有效的修订和补充； |
| 集合资产管理合同、资产管理合同、本合同 | 指《海通宝鼎成长 2 号集合资产管理计划资产管理合同》及对该合同的任何有效的修订和补充； |
| 托管协议 | 指《海通宝鼎成长 2 号集合资产管理计划托管协议》； |



cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

| | |
|---|---|
| 风险揭示书 | 指《海通宝鼎成长 2 号集合资产管理计划风险揭示书》； |
| 《管理办法》 | 指 2013 年 6 月 26 日中国证监会根据《关于修改〈证券公司客户资产管理业务管理办法〉的决定》修订并施行的《证券公司客户资产管理业务管理办法》； |
| 《实施细则》、《细则》 | 指 2013 年 6 月 26 日中国证监会根据《关于修改〈证券公司集合资产管理业务实施细则〉的决定》修订并施行的《证券公司集合资产管理业务实施细则》； |
| 《规范》 | 指 2012 年 10 月 19 日中国证券业协会发布并施行的《证券公司客户资产管理业务规范》； |
| 中国证监会、证监会 | 指中国证券监督管理委员会； |
| 集合资产管理合同当事人、集合计划当事人 | 指受资产管理合同约束，根据资产管理合同享有权利并承担义务的集合计划管理人、集合计划托管人和委托人； |
| 集合计划管理人、管理人 | 指上海海通证券资产管理有限公司，也简称为“海通资产管理”； |
| 集合计划托管人、托管人 | 指上海银行股份有限公司，也简称为“上海银行”； |
| 推广机构 | 指海通证券股份有限公司（简称“海通证券”）、上海海通证券资产管理有限公司（直销）以及与管理人签订《海通宝鼎成长 2 号集合资产管理计划推广代理协议》的其他银行和证券公司等； |
| 注册登记机构 | 指办理登记、存管、过户、清算和结算等注册登记业务的机构。本集合计划的注册登记机构为海通资产管理； |
| 委托人 | 指依据资产管理合同和计划说明书参与本集合计划的投资者，包括个人投资者和机构投资者； |
| 个人投资者 | 指依据中华人民共和国有关法律法规、监管规定可以投资于集合资产管理计划的自然人投资者； |
| 机构投资者 | 指依法可以投资资产管理计划，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； |



cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

| | |
|---|---|
| 合格投资者 | 指具备相应风险识别能力和风险承担能力，投资于本集合计划的金额不低于 100 万元且符合下列相关标准的单位和个人：<br>（一）净资产不低于 1000 万元的单位；<br>（二）金融资产不低于 300 万元或者最近三年个人年均收入不低于 50 万元的个人。<br>前款所称金融资产包括银行存款、股票、债券、基金份额、资产管理计划、银行理财产品、信托计划、保险产品、期货权益等。<br>下列投资者视为合格投资者：<br>（一）社会保障基金、企业年金等养老基金，慈善基金等社会公益基金；<br>（二）依法设立并在基金业协会备案的投资计划；<br>（三）投资于所管理私募基金的私募基金管理人及其从业人员；<br>（四）中国证监会规定的其他投资者。<br>以合伙企业、契约等非法人形式，通过汇集多数投资者的资金直接或者间接投资于本集合计划的，本集合计划管理人或者推广机构应当穿透核查最终投资者是否为合格投资者，并合并计算投资者人数。但是，符合本条第（一）、（二）、（四）项规定的投资者投资私募基金的，不再穿透核查最终投资者是否为合格投资者和合并计算投资者人数； |
| 份额持有人、持有人 | 指通过签订资产管理合同而依法取得和持有本计划份额的委托人； |
| 宝鼎重工 | 宝鼎重工股份有限公司； |
| 集合计划成立日 | 指集合计划经过推广达到集合计划说明书和集合资产管理合同规定的成立条件后，管理人通告集合计划成立的日期； |
| 推广期 | 指自本集合计划启动推广之日起不超过 60 个工作日的期间，具体推广时间以本集合计划管理人安排为准； |
| 封闭期 | 特指成立日后的一个或多个期间，在此期间委托人不得参与、退出本集合计划； |
| 开放期 | 指委托人可以办理集合计划退出或其他约定业务的工作日； |



cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

| | |
|---|---|
| 开放日 | 指开放期内的每个工作日； |
| 临时开放期、临时开放日 | 在合同变更、集合计划展期以及全体委托人同意的情形下，管理人临时设置的委托人可以办理退出业务的日期，临时开放期的具体安排以管理人安排为准； |
| 存续期、管理期限 | 指计划成立并存续的期间； |
| 工作日 | 指上海证券交易所和深圳证券交易所等相关交易所的正常交易日； |
| 天 | 指自然日； |
| 会计年度 | 指公历每年 1 月 1 日至 12 月 31 日； |
| 参与 | 指委托人申请购买集合计划份额的行为，即指在推广期参与集合计划的行为； |
| 首次参与 | 指委托人在参与之前未曾持有过本集合计划的情形； |
| 追加参与 | 指除首次参与外的其他参与情形； |
| 退出 | 指委托人按集合资产管理合同规定的条件要求收回全部或部分委托资产的行为； |
| 巨额退出 | 指本集合计划单个开放日累计净退出申请份额（退出申请总份额扣除参与总份额后的余额）超过上一日计划总份额 10%的情形； |
| 强制退出 | 指由管理人依据本合同的约定发起退出持有人持有份额的行为； |
| 计划收益 | 指本集合计划投资所得红利、股息、债券利息、基金红利、买卖证券价差、银行存款利息及其他合法收入； |
| 集合计划份额、计划份额、份额 | 指集合计划的最小单位； |
| 元 | 指人民币元； |
| 计划单位面值、单位面值 | 1.00 元； |
| 集合计划资产总值、计划资产总值 | 指集合计划所投资的各类有价证券、银行存款本息、集合计划各项应收款以及其他资产所形成的价值总和； |
| 集合计划资产净值、计划资产净值 | 指集合计划资产总值减去负债后的净资产值； |



cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

| | |
|---|---|
| 计划单位净值、单位净值 | 指计算日集合计划资产净值除以计算日集合计划总份额的金额； |
| 计划单位累计净值、累计净值 | 指计划单位净值与集合计划份额累计分红之和； |
| 计划资产估值 | 指计算评估本集合计划资产和负债的价值，以确定本集合计划资产净值的过程； |
| 可供分配收益 | 指截至收益分配基准日资产负债表中集合计划未分配收益与未分配收益中已实现收益的孰低数； |
| 不可抗力 | 指任何不能预见，不能避免，不能克服的客观情况，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、突发停电或其他突发事件、注册登记机构非正常的暂停或终止业务、证券交易所非正常暂停或停止交易等； |
| 通知及送达 | 除非本合同另有约定，本合同项下各方之间的一切通知均应以中文写成并可由专人送达、挂号邮递、特快专递、电子邮件、传真等方式送达或以指定联系人通过录音电话方式送达。通知在下列日期视为送达日： （1）专人递送的通知，在专人递送之交付日为有效送达；（2）以挂号信（付清邮资）发出的通知，在寄出（以邮戳为凭）后的第 7 日为有效送达；（3）以特快专递（付清邮资）发出的通知，在寄出（以邮戳为凭）后的第 3 日为有效送达；（4）由传真传送，发送当日即为有效送达；（5）由电子邮件送达，以发送方服务器显示的发送时间为送达时间。本合同项下的通知，均按文首载明的地址送达，双方确认该地址为有效地址；若需更改，更改方应提前 5 个工作日书面通知对方，否则对方按原地址送达的视为已经送达。 |
| 书面通知 | 包括以纸质方式邮寄/递送、传真、电子邮件及手机短信等方式发送的通知。 |
| 管理人指定网站 | 指 www.htsamc.com，管理人指定网站变更时以管理人公告为准。 |

## 三、合同当事人

（一）委托人



cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

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：**

传真：

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：**

**传真：**

其他：

委托人承诺：

1、委托人资产状况：本人资产状况良好，本人知悉合格投资者应具备的相应标准。本人承诺本人符合上述合格投资者要求，拥有相应的资产。

2、委托人认购资金来源：本委托人认购本计划的资金均为个人合法自有或自筹资金，本委托人未以募集的资金参与本产品。

3、委托人间收益安排：本委托人与参与本计划的其他委托人之间不存在分级收益等结构化安排。

4、委托人出资安排：本委托人承诺在宝鼎重工非公开发行获得中国证监会核准后、发行方案向中国证监会备案前，将通过一切合理、合法、合规，符合中国证监会要求且可行之手段确保出资到位，否则将承担相应违约责任。

5、锁定期要求：本委托人承诺在宝鼎重工非公开发行 A 股股份的锁定期内（自发行完成之日起 36 个月内）不通过任何方式转让本人持有的本计划份额。

6、参与及退出：管理人已与宝鼎重工就投资者的参与及退出约定具体操作备忘录，根据该操作备忘录管理人有权仅接受宝鼎重工确认的投资者参与及退出本集合计划。委托人对于上述约定知悉且无异议。

7、关联关系承诺：本委托人承诺，本人及本人配偶、直系亲属（1）非管理人及管理人的股东、董事、监事、高级管理人员或员工；（2）非管理人股东的股东、董事、监事、高级管理人员或员工；（3）非上市公司或其股东的股东、董事、



cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

监事、高级管理人员或员工；（4）本委托人承诺其与上市公司的实际控制人不存在一致行动的相关安排；（5）本委托人与前述人员无其他应披露未披露的关联关系。

8、委托人规范运作：委托人承诺遵守短线交易、内幕交易和高管持股变动管理等相关法律法规规定的义务。承诺依照《上市公司收购管理办法》第八十三条等有关法规和公司章程的规定履行信息披露义务（包括但不限于在委托人与宝鼎重工发生关联交易、要约收购等事项时，履行法定义务，将委托人与本计划份额视为一致行动关系，合并计算控制权比例等）。若存在违反上述规定情况，将全权承担有关责任。

9、委托人签署本合同并认购本集合资产管理计划即作出上述不可撤销的承诺。

（二）管理人

机构名称： 上海海通证券资产管理有限公司

法定代表人： 裴长江

通信地址： 上海市黄浦区广东路 689 号第 32 层第 01-12 室单元

邮政编码： 200001

联系电话： 021-23219000

管理人将依照法律法规要求，通过本合同约定提醒、督促委托人遵守短线交易、内幕交易和高管持股变动管理等相关法规规定，以及依照《上市公司收购管理办法》第八十三条等有关法规和公司章程的规定履行有关义务，具体提醒与督促事项如下：

（1）委托人应遵守短线交易等相关管理规则，不得将委托人持有的宝鼎重工的股票在买入后六个月内卖出，或者在卖出后六个月内买入。

（2）持有宝鼎重工的股票期间，在委托人及其关联方履行重大权益变动信息披露、要约收购等法定义务时，应将由管理人代表本计划持有的宝鼎重工的股票数量与委托人及其关联方直接持有的股票数量合并计算。

（3）委托人不得利用内幕信息通过本计划进行减持，在如下相关期间不通



cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

过本计划减持其持有的宝鼎重工的股票：①宝鼎重工定期报告公告前 30 日内，因特殊原因推迟公告日期的，自原预约公告日前 30 日起至最终公告日；②宝鼎重工业绩预告、业绩快报公告前 10 日内；③自可能对宝鼎重工股票交易价格产生重大影响的重大事件发生之日或进入决策程序之日，至依法披露后 2 个交易日内；④中国证监会及证券交易所规定的其他期间。

（4）委托人应严格按照《中华人民共和国证券法》、《上市公司收购管理办法》等法律法规及中国证监会、证券交易所的相关规定通过宝本计划进行减持并履行权益变动涉及的信息披露义务。

合同各方确认，委托人签订了本合同，即视为接受了管理人的提醒和督促事项。如若委托人未履行/遵守上述义务，则该委托人自行承担相应的法律责任。

（三）托管人

机构名称： 上海银行股份有限公司

法定代表人： 金煜

通信地址： 上海市浦东新区银城中路 168 号

邮政编码： 200120

联系电话： 021-68475888

**四、集合资产管理计划的基本情况**

（一）名称：海通宝鼎成长 2 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

本集合计划依照宝鼎重工非公开发行方案专项用于认购宝鼎重工非公开发行的 A 股股份，推广期规模上限为 2 亿元。管理人可以控制实际募集规模；若得到委托人认可，且符合法律法规要求，管理人可以调整规模上限。

本集合计划存续期不涉及开放参与安排。

本集合计划推广期和存续期内委托人均不得超过 200 人。

（四）投资范围和投资比例

1、投资范围



cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

本集合计划投资于国内沪深证券交易所上市的 A 股上市公司“宝鼎重工”非公开发行的 A 股股票（股票代码：002552）。闲置资金投资于具有良好流动性的现金管理类工具（包括现金，存款，通知存款，大额存单，期限在一年以内（含一年）的债券逆回购，货币市场基金以及中国证监会认可的其他现金管理类工具）。

本集合计划不得投资于前款约定以外的用途。

2、资产配置比例

（1）权益类资产：即本计划投资并持有 A 股上市公司“宝鼎重工”非公开发行的 A 股股票，占本计划资产总值的 0%-100%。

（2）现金类资产：占本计划资产总值的 0%-100%，包括现金，存款，通知存款，大额存单，期限在一年以内（含一年）的债券逆回购，货币市场基金以及中国证监会认可的其他现金管理类工具。

管理人应当在本集合计划成立之日起 3 个月内使本集合计划的投资组合比例符合以上约定。

如因证券市场波动、证券发行人合并、资产管理计划规模变动等证券公司之外的因素，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 个交易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。

（五）管理期限

本集合计划管理期限自本集合计划成立后至非公开发行股票登记过户之日起满 48 个月止，可展期。

本集合计划认购宝鼎重工非公开发行 A 股非公开发行股票登记过户满 36 个月后，管理人有权提前终止本集合计划。

若本集合计划参与 A 股上市公司“宝鼎重工”非公开发行股票（股票代码：002552）失败的，管理人可以提前终止本集合计划。

（六）封闭期、开放期及流动性安排：

管理期限内：

本集合计划认购宝鼎重工非公开发行股票登记过户满 36 个月后，管理人有权提前终止本集合计划。具体以管理人届时公告为准。



cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

本集合计划在宝鼎重工非公开发行获得中国证监会核准后、发行方案向中国证监会备案前本计划未能按照约定募集全部募集完成的，管理人有权宣布募集失败，本计划提前终止。

在合同变更、集合计划展期以及其他经全体委托人同意的情形下，管理人可以临时设置委托人可以办理退出业务的开放期，临时开放期的具体安排以管理人安排为准。

管理人有权根据全体委托人的指令临时调整上述开放原则以办理参与、退出业务，办理时间、参与退出价格、规模等均由管理人在合理范围内调整确定。

（七）集合计划份额面值

1.00 元。

（八）参与本集合计划的最低份额

首次参与的最低金额为 100 万元，追加参与的最低金额为 1000 元，超过最低参与金额的部分不设金额级差。

（九）本集合计划的风险收益特征及适合推广对象

本计划为股票型产品且拟认购的定增股票锁定期长具有不确定性，计划整体属于高风险品种，适合推广对象为管理人和推广机构现有的客户且为合格投资者。以上风险评级为管理人评级，推广机构评级可能与此不同。

（十）本集合计划的推广

1、推广机构：

海通证券股份有限公司

住所：上海市广东路 689 号

法定代表人：王开国

2、上海海通证券资产管理有限公司（直销）

同管理人。

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，管理人新增或变更本集合计划的推广机构时，将提前在管理人指定网站上公告。

3、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，



cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

以纸质资料或电子资料方式置备于推广机构营业场所。本集合计划应当面向合格投资者推广，合格投资者累计不得超过 200 人。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定。禁止通过签订保本保底补充协议等方式，或者采用虚假宣传、夸大预期收益和商业贿赂等不正当手段推广集合计划。

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。

（十一）本集合计划的各项费用

1、参与费（包括认购/申购费）：0%。

2、退出费：0%。

3、管理费：0.5%

4、托管费：0.05%

5、业绩报酬：本集合计划不收业绩报酬。

6、其他费用：除交易手续费、印花税、管理费、托管费之外的集合计划费用，由管理人根据有关法律法规及相应的合同或协议的具体规定，按费用实际支出金额列入当期费用，直接由集合计划资产承担。

## 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

在推广期内，投资者在工作日内可以参与本集合计划。

推广时间等推广安排由管理人确定。管理人有权决定提前结束或延长推广期。

在推广期管理人有权仅接受宝鼎重工指定的投资者参与本集合计划。

2、参与的原则



cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

（1）面值参与，参与价格为 1.00 元；

（2）采用金额参与的方式，即以参与金额申请；

（3）在推广期内，当集合计划募集规模接近或达到约定的规模上限时，管理人有权停止接受参与申请；推广期内，当本集合计划超过规模上限时，管理人有权发布停止接受参与指令；

（4）在推广期内，当集合计划参与人数达到参与人数上限后，管理人不接受任何新投资者的参与申请而只接受本集合计划份额持有人的追加参与。

（5）在推广期内，管理人使用“时间优先，金额优先”方法对集合计划募集的规模和人数进行控制，即首先按照参与时间顺序，先参与先确认，对于同样参与时间的，金额高者先确认，超过上限后的所有参与无效。

3、参与的程序和确认

（1）若本集合计划参与定向增发失败或未足额获配的，管理人有权调整上述推广期募集规则。

（2）投资者按推广机构指定营业网点的具体安排，在规定的交易时间段内办理；

（3）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；

（4）投资者签署本合同后，方可申请参与集合计划。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；

（5）委托人可多次参与本集合计划，参与申请一经确认不可更改或撤销；

（6）投资者在推广期内提交的参与申请可于推广期结束后的第 2 个工作日在办理参与的网点查询参与确认情况；

（7）本集合计划采用电子签名合同或纸质合同的方式签署。电子签名合同在管理人、托管人、委托人三方完成签署，且委托人按合同约定将参与资金划入指定账户并经注册登记机构确认有效后生效。委托人应当如实提供与签署电子签名合同相关的信息和资料，管理人和其他推广机构应当按照有关规定对委托人提供的信息和资料进行审查并如实记录。委托人保证其所提供的信息及资料真实、准确、完整，否则应当承担由此造成的一切后果；

（8）委托人同意，参与申请的情况以管理人确认的结果为准。



cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

4、参与费及参与金额的计算

（1）参与费率：0%；

（2）参与份额的计算方法：

参与费＝参与金额×参与费率／（1＋参与费率）

参与份额＝（参与金额－参与费）／计划单位面值

参与金额的计算保留到小数点后两位，小数点两位以后的部分采用去尾法处理，由此产生的差额部分计入计划资产损益。

5、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在推广期结束后划入集合计划资产。

6、拒绝或暂停参与

（1）出现下列情形，管理人可以拒绝或暂停接受委托人的参与申请：

①本集合计划规模接近或达到本合同规定的上限；

②本集合计划委托人数接近或达到法律、行政法规和资产管理合同规定的上限；

③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；

④管理人认为接受某笔或某些参与申请可能会影响或损害现有委托人利益时；

⑤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而未提供管理人要求的合法筹集资金的证明文件；

⑥法律、行政法规规定或中国证监会认定的其他情形。

（2）拒绝或暂停本集合计划的参与，管理人应提前在管理人指定网站公告。

（3）委托人的参与申请被拒绝时，被拒绝的参与款项将无息退还给委托人，各方互不承担其他责任。

（4）在暂停参与的情况消除后的 20 个工作日内，管理人将及时恢复参与业务的办理，并在管理人指定网站公告。

（二）集合计划的退出

1、退出的办理

本集合计划自非公开发行股票登记过户之日起 36 个月之后，管理人可临时



cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

设置开放期，经宝鼎重工同意后办理退出业务。

管理人有权根据全体委托人的指令临时调整上述开放原则以退出业务，办理时间、退出价格、规模等均由管理人根据全体委托人的指令在合理范围内调整确定。

若本集合计划认购非公开发行股票未足额获配，管理人有权为本集合计划份额办理部分强制退出，退出份额根据委托人持有份额的比例进行分配，退出价格为当日的集合计划单位净值。

2、退出的原则

（1）采用份额退出的方式，即退出以份额申请；在集合计划成立后至非公开发行实施前，退出价格按面值办理；

（2）“先进先出”原则，即按照委托人份额参与的先后次序进行顺序退出的方式确定退出份额；

（3）退出申请一经确认不可更改或撤销；

（4）退出申请应取得宝鼎重工同意。

3、退出的程序和确认

（1）退出申请的提出

委托人必须根据本集合计划推广机构网点规定的手续，在开放日的业务办理时间内向推广机构网点提出退出申请。退出申请数量超过委托人持有份额数量时，申请无效。

若管理人为委托人统一办理强制退出则不需委托人另行提出退出申请。

（2）退出申请的确认

管理人有权仅接受宝鼎重工认可的委托人申请退出。对于宝鼎重工未认可退出的委托人，管理人将确认其退出申请失败。委托人可在管理人确认后的 2 个工作日（包括该日）之后到推广机构网点取得 T 日退出申请成交确认单，若交易未成功或数据不符，委托人可与为其办理手续的推广机构网点人员联系并进行核实。

（3）退出款项划付

委托人的退出申请确认后，退出款项将在管理人确认后的 2 个工作日内从托管账户划出。如集合计划出现暂停估值的情形，管理人与托管人协商后，可以将



cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

划拨日期相应顺延。

4、退出费及退出份额的计算

（1）退出费用：0%；

（2）退出金额的计算方法

本集合计划退出金额的计算方法以本部分合同约定或管理人届时安排为准进行计算。

5、退出的限制与次数

委托人单笔退出最低份额为 1000 份；若某笔退出导致该委托人在某推广机构持有的份额少于 1000 份，则余额部分必须一起退出。委托人在某一开放日的退出次数不受限制。

6、单个委托人大额退出的认定、申请和处理方式

本集合计划不设大额退出限制条款，但因单个委托人大额退出导致出现巨额退出，则根据巨额退出的认定和处理方式办理。

7、巨额退出的认定和处理方式

（1）巨额退出的认定

单个开放日，委托人当日累计净退出申请份额（退出申请总份额扣除参与申请总份额之后的余额）超过上一工作日计划总份额数的 10%时，即为巨额退出。

（2）巨额退出的顺序、价格确定和款项支付

发生巨额退出时，管理人可以根据本集合计划当时的资产组合状况决定全额退出、部分顺延退出或暂停退出：

全额退出：当管理人认为有条件支付委托人的退出申请时，按正常退出程序办理。

部分顺延退出：当管理人认为支付委托人的退出申请可能会对计划资产净值造成较大波动时，管理人在当日接受净退出比例不低于集合计划总份额 10%的前提下，对其余退出申请予以延期办理。对于当日的退出申请，将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；未能受理的退出部分，委托人可选择延期办理或撤销退出申请。对于选择延期办理的退出申请，管理人将在下一个工作日内办理，并以管理人公布的计划单位净值为准计算退出金额，依此类推，直至全部办理完毕为止，转入下一个工作日的退出申请不享有优先权。



cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

（3）告知客户的方式

发生巨额退出并延期支付时，管理人应在 3 个工作日内在管理人指定网站公告，并说明有关处理方法。

8、连续巨额退出的认定和处理方式

（1）连续巨额退出的认定

如果本集合计划连续2个开放日发生巨额退出,即认为发生了连续巨额退出。

（2）连续巨额退出的顺序、价格确定和款项支付

本集合计划发生连续巨额退出，管理人可按本合同载明的规定，暂停接受退出申请，但暂停期限不得超过 20 个工作日；已经接受的退出申请可以延缓支付退出款项，但不得超过正常支付时间 20 个工作日，并在管理人指定网站上进行公告。

9、拒绝或暂停退出的情形及处理

发生下列情形时，管理人可以拒绝或暂停受理委托人的退出申请：

（1）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）管理人认为接受某笔或某些退出申请可能会影响或损害现有委托人利益时；

（4）因市场剧烈波动等原因而出现连续巨额退出，或者其他原因，导致本集合计划的现金支付出现困难时，管理人可以暂停接受集合计划的退出申请；

（5）法律、行政法规和中国证监会认定的其他情形或其他在说明书、资产管理合同中已载明的特殊情形。

## 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、集合计划的分级

本集合计划不设置分级收益等结构化安排。



cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

## 八、集合计划客户资产的管理方式和管理权限

（一）管理方式：管理人以主动管理方式管理计划资产。

（二）管理权限：管理人在本合同约定范围内行使管理人权限。

## 九、集合计划的成立

（一）集合计划成立的条件和日期

集合计划的参与资金总额（含参与费）不低于 3000 万元且其委托人的人数为 2 人（含）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，管理人宣布本集合计划成立。

（二）集合计划设立失败

集合计划推广期结束，在集合计划规模低于 3000 万元或委托人的人数少于 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，并将已认购资金及活期利息在推广期结束后 30 个工作日内退还集合计划委托人。

若本集合计划尚未成立即申购标的股票非公开发行失败或在宝鼎重工非公开发行获得中国证监会核准后、发行方案向中国证监会备案前本计划未能按照约定募集全部募集完成的，管理人可以按集合计划设立失败处理。

（三）集合计划开始运作的条件和日期

1、开始运作的条件：本集合计划公告成立。

2、开始运作的日期：本集合计划自成立之日起开始运作。

管理人应在本集合资产管理计划成立后 5 个工作日内，应当将发起设立情况报中国证券业协会备案，同时抄送管理人住所地中国证监会派出机构。

## 十、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。资金账户名称应当是“海通宝鼎成长 2 号集合资产管理计划”，证券账户名称应当是“海通资产管理－上海银行－海通宝鼎成长 2 号集合资产管理计划”。以上账户以实际开立账户名称为准。

（二）集合计划资产的构成

本集合计划资产的构成主要有：



cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

集合计划所拥有的有价证券、银行存款本息、应收款项、其他投资等资产及孳息。

（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》、《规范》、《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。

## 十一、集合计划资产托管

本集合计划资产交由上海银行负责托管，并签署了托管协议。

托管方式为：银行托管。

签订的托管协议已经明确了托管人和管理人之间在计划资产的保管、资金归集和划转、会计核算责任、清算交收流程、最终交收责任、集合计划档案资料保管及集合计划运作互相监督等活动中的权利、义务关系，以确保计划资产的安全，保护委托人的合法权益。

## 十二、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其所购买的各类证券、银行存款本息、集合计划各项应收款以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集合计划资产总值减去负债后的余额。

（三）单位净值

集合计划单位净值是指集合计划资产净值除以当日集合计划份额总数计算得到的每集合计划份额的价值。

（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



cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

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

集合计划所拥有的一切有价证券、银行存款本息、应收款项、其它投资等资产。

（六）估值日

指本集合计划成立后的每周的第一个工作日，工作日即上海证券交易所和深圳证券交易所的正常交易日。

（七）估值方法

1、估值基本原则

（1）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。

（2）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。

（3）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，管理人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。

管理人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。

（4）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，管理人应当根据具体情况与资产托管机构进行商定，按最能反映公允价值的价格估值，并向委托人披露。

2、具体投资品种估值方法

（1）股票估值方法



cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

1）上市流通股票按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；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，以最近交易日的收盘价估值；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考监管机构或行业协会有关规定，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。

2）未上市股票的估值

①首次发行未上市的股票，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，按成本价估值；

②送股、转增股、配股和公开增发新股等发行未上市的股票，按估值日在证券交易所上市的同一股票的市价进行估值；

③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，按估值日在证券交易所上市的同一股票的市价进行估值；

④非公开发行且在发行时明确一定锁定期的股票按如下方法进行估值：

A、估值日在证券交易所上市交易的同一股票的以第 1）条确定的估值价格低于非公开发行股票的初始取得成本时，应采用在证券交易所上市交易的同一股票的以第 1）条确定的估值价格作为估值日该非公开发行股票的价值；

B、估值日在证券交易所上市交易的同一股票的以第 1）条确定的估值价格高于非公开发行股票的初始取得成本时，应按下列公式确定估值日该非公开发行股票的价值：

FV＝C＋(P－C)×(Dl－Dr) / Dl

其中：FV 为估值日该非公开发行股票的价值；C 为该非公开发行股票的初始取得成本（因权益业务导致市场价格除权时，应于除权日对其初始取得的成本作相应调整）；P 为估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价；Dl 为该非公开发行股票锁定期所含的交易所的交易天数；Dr 为估值日剩余锁定期，即估值日至锁定期结束所含的交易所的交易天数，不含估值日当天。

3）在任何情况下，资产管理人如采用本项第 1）－2）小项规定的方法对委托财产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果资产管理人认为按本项第 1）－2）小项规定的方法对委托财产进行估值不能客观反映其公允价值的，资产管理人可根据具体情况，并与资产托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。



cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

（2）逆回购交易以成本列示，按实际利率在实际持有期间内逐日计提利息。

（3）持有的货币市场基金，按估值日前一交易日基金管理公司的每万份收益计算；

（4）银行存款估值方法

银行存款每日按当日银行存款余额计提存款利息。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。

（5）其他品种的估值由管理人和托管人按照估值原则协商确定。

（6）如有新增事项或变更事项，按国家最新规定估值，管理人应于新规定实施后及时在管理人指定网站进行公告。

（7）相关法律法规以及监管部门另有新规定的，从其规定。

（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。

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

1、本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。当资产估值导致本集合计划单位净值小数点后四位以内（不含第四位）发生差错时，视为本集合计划单位净值错误。

2、管理人和托管人应采取必要、适当、合理的措施确保本集合计划资产估值的准确性和及时性。当估值出现错误时，本集合计划管理人应当立即予以纠正，通知托管人并采取合理的措施防止损失进一步扩大，托管人有义务配合管理人采取任何合理措施防止损失进一步扩大。

3、当资产管理计划估值出现错误时，资产管理人和资产托管人应该立即采取更正措施。如资产管理人或资产托管人发现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资产委托人利益时，应立即通知对方，共同查明原因，协商解决。当估值结果不一致时，以管理人估值结果为准。



cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

4、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。

5、管理人按估值基本原则的第（3）项进行估值时，所造成的误差不作为计划单位净值错误处理。

6、前述内容如法律法规或监管机构另有规定的，按其规定处理。

（十）估值复核

集合计划资产净值由管理人完成估值后，将估值结果以双方约定的形式报送托管人，托管人按照托管协议规定的估值方法、时间与程序进行复核；如托管人复核无误，则将核对结果反馈给管理人；月末、年中和年末估值复核与集合计划会计账目的核对同时进行。若无法协商一致的，由管理人最终确认的最能恰当反映公允价值的价格进行估值。

管理人更改原则进行估值的，要及时通知托管人。当管理人和托管人对计划估值方法存有异议时，托管人有权要求管理人做出合理解释，通过积极商讨达成一致意见。

（十一）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。

（十二）特殊情形的处理

由于战争、自然灾害等不可抗力原因，或由于证券交易所及注册登记机构发送的数据错误，管理人和托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，由此造成的资产估值错误，管理人和托管人可以免除赔偿责任。但管理人、托管人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

## 十三、集合计划的费用、业绩报酬

（一）费用种类



cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

1、管理人的管理费；

2、托管人的托管费；

3、证券交易费用；

4、本集合计划成立后的审计费；

5、银行汇划费；

6、管理人的业绩报酬；

7、按照国家有关规定可以列入的其他费用。

（二）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：

本集合计划的管理费按前一日集合计划资产净值计提，管理费的年费率为0.5%。计算方法如下：

H ＝ E×0.5%÷365

H为每日应计提的集合计划管理费

E为前一日集合计划资产净值

管理费每日计提，逐日累计，于每年12月20日支付，如遇节假日则顺延。由管理人向托管人发送管理费划付指令，托管人复核后于2个工作日内从集合计划资产中一次性扣除支付给管理人，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

当本计划持有现金不足给付相应费用时，顺延至计划持有足额现金时支付；如计划存续期内现金一直不足，则在计划清算资产中支付。

2、托管费：

本集合计划托管人托管费按前一日集合计划资产净值的 0.05%年费率计提，计算方法如下：

H ＝ E×0.05%÷365

H 为每日应支付的托管费

E 为前一日集合计划资产净值

托管费每日计提，逐日累计，于每年12月20日支付，如遇节假日则顺延。由管理人向托管人发送托管费划付指令，托管人复核后于2个工作日内从集合计划资产中一次性扣除支付给托管人，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

当本计划持有现金不足给付相应费用时，顺延至计划持有足额现金时支付；



cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

如计划存续期内现金一直不足，则在计划清算资产中支付。

3、管理费和托管费的调整

管理人可调减管理费，也可和托管人协商调减托管费，并在新的费率开始实施前3个工作日内在管理人指定网站公告。

4、证券交易费用：本集合计划投资运作期间所发生的交易手续费、开放式基金的认（申）购和赎回费、中登公司收取相关保证金或费用、印花税等有关税费，作为交易费用在交易过程中直接扣除。

本集合计划向所租用交易单元的券商支付佣金（该佣金已扣除风险金），其费率由管理人根据有关政策法规确定。在每季度首日起 10 个工作日内支付给提供交易单元的券商。

当本计划持有现金不足给付相应费用时，管理人有权以本合同约定的通知方式（若同时以多种通知方式通知的，以最先到达的通知时间为准）通知委托人。委托人需最晚在次月首日起 5 个工作日内以不低于不足部分的资金额参与本集合。委托人未能按照本条约定支付的，若管理人垫付相关款项，则管理人有权按照同期贷款利率收取垫付款项利息，垫付款项本金和利息可以从计划资产中扣除偿付管理人。

5、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订协议所约定的金额，在被审计的会计期间，按直线法在每个自然日内平均摊销。

当本计划持有现金不足给付相应费用时，管理人有权以本合同约定的通知方式（若同时以多种通知方式通知的，以最先到达的通知时间为准）通知委托人。委托人需最晚在次月首日起 5 个工作日内以不低于不足部分的资金额参与本集合。委托人未能按照本条约定支付的，若管理人垫付相关款项，则管理人有权按照同期贷款利率收取垫付款项利息，垫付款项本金和利息可以从计划资产中扣除偿付管理人。

6、其他费用

上述（一）中第 3、5、7 项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、行政法规另有规定时从其规定，并由托管人根据法



cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

律、法规及相应协议的规定，按费用实际支出金额支付，列入当期集合计划费用。

当本计划持有现金不足给付相应费用时，管理人有权以本合同约定的通知方式（若同时以多种通知方式通知的，以最先到达的通知时间为准）通知委托人。委托人需最晚在次月首日起 5 个工作日内以不低于不足部分的资金额参与本集合。委托人未能按照本条约定支付的，若管理人垫付相关款项，则管理人有权按照同期贷款利率收取垫付款项利息，垫付款项本金和利息可以从计划资产中扣除偿付管理人。

（三）不列入集合计划费用的项目

集合计划成立前发生的费用，以及存续期间发生的与推广有关的费用，不得在集合计划资产中列支。本集合计划注册登记费用不列入集合计划费用项目。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得列入集合计划费用。

其他不列入集合计划费用的具体项目依据中国证监会有关规定执行。

（四）管理人的业绩报酬

本集合计划不收取管理人业绩报酬。

## 十四、集合计划的收益分配

（一）收益的构成

收益包括：集合计划投资所得股息、债券利息、红利、买卖证券/基金价差、银行存款利息及其他合法收入。集合计划的净收益为集合计划收益扣除按照国家有关规定可以在集合计划收益中扣除的费用后的余额。

（二）可供分配收益

指截至收益分配基准日资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

（三）收益分配原则

1、本集合计划发生现金收益分配、本金归还等现金支付时，银行收取的与此有关的的任何费用均由委托人承担。

2、本集合计划进行收益分配、本金归还时所涉及的相关税负由委托人自行承担，管理人不承担代扣代缴等纳税义务。



cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

3、若本集合计划在存续期间不进行收益分配，则本集合计划也可在终止清算后将货币资金分派给委托人，由此产生的相关的税负由委托人自行承担，管理人不承担代扣代缴等纳税义务。

4、收益分配金额由管理人负责计算，托管人仅根据管理人指令做资金汇划。

5、具体收益分配比例、分配时间及分配方式由管理人决定并通知全体委托人。

6、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

## 十五、投资理念与投资策略

（一）投资目标和理念

本集合计划以宝鼎重工非公开发行的 A 股股票（股票代码“002552”）为投资目标。

（二）投资策略

1、股票投资策略

本集合计划主要投资于宝鼎重工非公开发行的 A 股股票（股票代码“002552”）。

2、现金管理策略

对计划资产未投资于定向增发的部分，通过投资于固定收益类、现金类资产和其他资产提高资金运用效率，实现对计划收益补充、增厚的目的。

## 十六、投资决策与风险控制

（一）集合计划的决策依据

集合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，并以维护集合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》等有关规范性文件；

2、根据宏观、微观经济环境和有关经济政策以及证券市场趋势制定投资策略；

3、根据所投资品种的预期收益和风险的匹配关系。本集合计划将在控制风



cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

险的前提下追求收益的最大化。

（二）集合计划的投资程序

管理人执行本集合计划的投资职能。管理人的投资业务流程简述如下：研究团队负责证券库构建及维护；投资团队负责品种选择及投资组合建立；集中交易室执行交易；合规与风控部负责投资组合绩效评估和风险评估；投资决策委员会负责审批产品投资策略和投资经理提交的资产配置、投资计划等投资策略，该委员会由总经理、分管投研副总经理、投资总监、权益投资总监、固定收益投资总监、投资主办人及其他相关人员组成，是公司投资决策的最高权力机构。

1、投资决策程序

（1）确定投资原则和投资限制

投资团队根据国家有关法律、行政法规的规定、资产管理合同、管理人的有关管理制度，拟定本集合计划投资的基本原则和投资限制。

（2）进行投资分析与研究

研究团队从宏观、中观、微观多层面分析经济状态和资本市场等。根据分析、研究结果以及对流动性的预测，制定投资策略建议。

（3）制定投资策略与资产配置比例

投资团队综合考虑政治、经济及资本市场状况等因素，根据投资目标、原则、限制和研究建议，拟定投资策略，包括整体资产配置策略（期限结构和资产结构）、存款资产配置方案、存款银行选择方案等，报投资决策委员会审批通过。

（4）进行投资组合管理

投资主办人对组合进行密切的日间监控及流动性影响分析，提出流动性优化方案；在授权范围内，根据各投资品种的资产配置比例，确定具体的投资品种、数量、价位、策略等，构建、优化和调整投资组合，进行投资组合的日常管理以及完善和加强存款银行和交易对手管理。

2、投资交易程序

投资主办人根据投资组合管理需要，作出投资决定，通过电子系统向集中交易室发出交易指令。交易员根据投资限制和市场情况，向投资主办人确认后，按交易指令确定的种类、价格、数量、时间予以执行。如果市场和个别证券交易出现异常情况，及时提示投资主办人。



cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

3、投资风险的监控与绩效评估

投资绩效评估系统或人员定期对计划资产的安全性、流动性进行分析，并对资产收益率、收益的潜在来源、投资的特征等进行分析计算，将计划资产实际投资业绩与业绩比较基准以及与同行业同类产品分别进行比较，对投资绩效予以评价并进行业绩归因。

（三）风险控制

1、风险控制目标

保障本集合计划的规范运作，控制本集合计划的运作风险，维护计划份额持有人、托管人和管理人的合法权益。

2、风险控制的原则

本集合计划管理人对投资风险控制的主要原则是：全面性原则、预防性原则、独立性原则、及时性原则、定量与定性相结合的原则。

投资风险是指投资未能根据国内外政治经济环境、行业发展趋势、投资对象基本面的变化及时调整投资组合，或投资在决策、交易执行过程中存在纰漏，从而造成资产损失的风险。投资风险的具体内容包括市场风险、流动性风险、交易风险和其他风险，其中市场风险和流动性风险构成投资最主要的风险，也成为评估投资风险和进行风险管理的关键。

3、风险控制组织架构

管理人的风险管理架构分为三个层次：

（1）第一层次为董事会下设的合规与风险控制委员会；

（2）第二层次为管理人内设的合规与风控部；

（3）第三层次为各业务部门和职能部门的一线风险管理。

合规与风险控制委员会履行如下职责：制定委员会的议事规则；对公司业务各环节的风险进行检查、监控、评估及处置，定期审核合规与风控部提交的风险和投资绩效评估报告，提出相应的建议和风控措施，并监督落实；根据监管制度和相关业务规则的变化，提醒和审核业务制度和流程并及时进行调整和更新；监督合规与风险控制委员会决议的执行；对新业务、新产品进行风险评估；听取经营层对风险议题的专题报告；听取投资主办人对重大市场变化的风险分析报告和投资绩效报告；调查风险事件，对于重大风险事件，及时向董事长、总经理及合



cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

规负责人报告。

合规与风控部为风险管理职能部门，全面负责公司风险管理工作，包括全面审核公司资产管理业务经营活动、业务流程的合规性；组织完善资产管理业务的风险评估体系，对公司业务及内部管理活动的关键风险指标和绩效进行衡量与评估；依托风险管理信息系统平台，对资产管理业务进行实时监控；组织、监督各项风险防范措施的落实。

资产管理业务各相关部门进行专门的业务管理与监督。后台清算部门、估值部门、信息技术部门都负有相应的风险管理职责，从不同角度对资产管理业务的资金、财务、信息技术等相关风险进行专业化控制。

4、投资风险管理程序

（1）风险识别：对各个业务环节的割裂风险和风险点进行识别。

（2）风险测量：运用定性、定量方法估计风险发生的概率和损失。

（3）风险控制：通过各种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。

（4）风险评价：对风险控制体系、风险识别、测量、控制等执行情况和效果进行分析和评价。

（5）风险报告：将风险测量、评价情况以及风险事件处置情况以一定程序进行报告。

5、全程风险管理控制

为贯彻投资收益与投资风险相匹配原则，充分实现委托人的投资意愿，最大程度上保障委托人利益，海通资产管理在建立科学投资流程的基础上，通过定量与定性相结合、人机控制相结合等方式将风险控制落实在投资管理的全过程。

首先，从事前的证券选择与组合构建、事中的组合实施与监控、事后的组合风险评估与绩效分析等建立科学的收益与风险评估系统，确保集合计划的管理符合客户投资目标。

事前风险控制主要体现在研究环节和投资决策环节，包括证券库制度、投研会议制度等。

事中风险控制主要体现在投资决策和决策执行过程中，主要包括授权授信、风险监控。



cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

事后风险控制主要为业绩评价和稽核、风险管理评价。

其次，全面评估投资过程中的各类风险，将其量化成风险控制指标嵌入技术系统，借助IT技术系统实现风险在事前、事中以及事后的强制性、适时性控制，以确保投资决策的有效贯彻和客户利益的充分保障。

## 十七、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，本集合计划投资的投资限制为：

1、本计划投资范围约定以外的其他投资事项；

2、证券法规规定和集合计划管理合同约定禁止从事的其他投资。

如全体委托人同意并经管理人和托管人认可，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。

（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。

禁止行为托管人不负责监督，由管理人进行监督。

## 十八、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



cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

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

披露时间：本集合计划存续期内每周第一个工作日披露上周最后一个工作日的单位净值信息。

披露方式：本集合计划的信息披露将严格按照《管理办法》、《实施细则》、本合同及其他有关规定进行。本集合计划的计划单位净值等信息将在管理人指定网站上向委托人披露，本集合计划委托人可随时查阅。

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一次准确、完整的管理季度报告，对报告期内集合计划资产的配置状况、价值变动情况、重大关联交易做出说明。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向本集合计划委托人披露，并报中国证券投资基金业协会备案，同时抄送管理人住所地中国证监会派出机构。法律、法规、行政政策对管理人报备有新规定的，按新规定执行。托管人在每季度向委托人提供一次季度托管报告。上述报告应由管理人于每季度截止日后 15 个工作日内通过管理人指定网站向本集合计划委托人披露。集合计划成立不足 2 个月时，管理人/托管人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一次准确、完整的管理年度报告，对报告期内集合计划资产的配置状况、价值变动情况、重大关联交易做出说明。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向本集合计划委托人披露，并报中国证券投资基金业协会备案，同时抄送管理人住所地中国证监会派出机构。法律、法规、行政政策对管理人报备有新规定的，按新规定执行。托管人在每年度向委托人提供一次托管报告。上述报告应由管理人于每个会计年度截止日后 3 个月内通过管理人指定网站向本集合计划委托人披露。集合计划成立不足 3 个月时，管理人/托管人可以不编制当期的年度报告。

4、年度审计报告

证券公司进行年度审计，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报中国证券投资基金业协会备案，同时抄送管理人住



cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

所地中国证监会派出机构，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。法律、法规、行政政策对管理人报备有新规定的，按新规定执行。

5、对账单

管理人应当每个季度以邮寄或电子邮件方式向委托人寄送对账单，委托人可以选择寄送方式，默认的寄送方式为电子邮件。对账单内容应包括委托人持有集合计划的风险和差异性、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。

委托人应向管理人提供正确、有效的邮寄或者电子邮箱地址，采用电子邮件方式的，电子对账单自管理人系统发出即视为送达；采用邮寄方式的，对账单自邮局寄出即视为送达。

（二）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，管理人应当以管理人指定网站、推广机构网站或网点、或其他途径和方式及时向客户披露。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发生变更，或出现其他可能对集合计划的持续运作产生重大影响的事项；

（2）暂停受理或者重新开始受理参与或者退出申请；

（3）发生巨额退出并延期支付；

（4）集合计划终止和清算；

（5）集合计划存续期满并展期；

（6）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）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；

（10）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；

（11）管理人、托管人因解散、破产、撤销等原因不能履行相应职责；

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

（13）管理费、托管费等费用计提方式或费率发生变更；



cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

（14）其他对集合计划持续运营、客户利益、资产净值产生重大影响的事件。

## 十九、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

本集合计划存续期内不可进行份额转让。，

（二）集合计划份额的非交易过户

非交易过户是指不采用参与、退出等交易方式，将一定数量的集合计划份额按照一定的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登记结算机构的有关规定办理。

（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、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）展期的安排

1、通知展期的时间

在集合计划到期前 3 个月且不超过 1 个月期间内。

2、通知展期的方式

管理人将通过管理人指定网站通知委托人。

3、委托人回复的方式



cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

委托人应当在管理人指定网站公告之日起 20 个工作日内以书面或管理人约定的其他方式明确回复意见。

（三）委托人不同意展期的处理办法

若委托人明确回复不同意展期，委托人有权在存续期届满日前（含届满日）到推广机构办理退出手续（管理人可以在公告中约定开放日，为委托人办理退出手续）；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，则管理人有权决定强制将其份额退出或视为委托人同意管理人的展期安排。

若委托人未回复意见或回复意见不明确的，视为同意展期，管理人不再另行通知确认。

（四）展期的实现

如果同意本集合计划展期的委托人人数不少于 2 人，则集合计划存续期将依法展期；

如果同意本集合计划展期的委托人人数低于 2 人则集合计划到期终止，将按照本合同等相关法律文件的规定办理计划到期终止和清算事宜。

## 二十一、集合计划终止和清算

（一）有下列情形之一的，集合计划应当终止

1、计划存续期间，客户少于 2 人；

2、计划存续期满且不展期；

3、管理人因重大违法、违规行为，被中国证监会取消相关业务资格；

4、托管人因重大违法、违规行为，被中国证监会取消相关业务资格，而无其他适当的托管机构承接其原有权利、义务的；

5、管理人因解散、破产、撤销等原因不能履行相应职责；

6、托管人因解散、破产、撤销等原因不能履行相应职责；

7、因战争、自然灾害等不可抗力的发生导致本集合计划不能存续；

8、法律、行政法规及中国证监会规定的其他终止情形。

（二）有下列情形之一的，管理人可以终止本集合计划

1、本集合计划自宝鼎重工非公开发行股票登记过户之日起 36 个月后；

2、本集合计划主要投资于定向增发股票，若本集合计划申购定向增发失败



cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

或在宝鼎重工非公开发行获得中国证监会核准后、发行方案向中国证监会备案前本计划未能按照约定募集全部募集完成的，则管理人有权提前终止本集合计划，管理人不承担相关责任。

（三）集合计划的清算

1、自集合计划终止之日起 5 个工作日内，管理人开始清算计划资产。管理人也可以组织成立集合计划清算小组进行资产清算。管理人或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、清算过程中的有关重大事项应当及时公布；

3、清算结束后 15 个工作日内，管理人或集合计划清算小组应当在扣除清算费用、管理费、业绩报酬、托管费等本合同约定的费用后，将集合计划资产按照集合资产管理合同的约定或其他合理方式以货币资金的形式全部分派给委托人。由计划交纳的最低结算备付金和交易保证金根据注册登记机构规则，在收回后再向委托人进行分配；

4、清算结束后 15 个工作日内由管理人或集合计划清算小组在管理人网站公布清算结果；

5、若本集合计划在终止之日有未能流通变现的证券，管理人可对此制定二次清算方案，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，对前述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本合同的约定或其他合理方式，以货币形式全部分配给委托人。

6、委托人自行承担收益的缴税事项。

## 二十二、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；



cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

（4）按合同约定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、行政法规、中国证监会的有关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及相应的违约责任；

（4）不得违规转让其所拥有的计划份额；

（5）法律、行政法规、中国证监会的有关规定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）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）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、行政法规、中国证监会有关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；



cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

（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、代理推广机构的行为进行监督，如发现托管人、代理推广机构违反法律、行政法规和中国证监会的规定，或者违反托管协议、代理推广协议的，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）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；

（8）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；

（9）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；

（10）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；

（11）因管理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，应承担赔偿责任；

（12）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；

（13）法律、行政法规、中国证监会有关规定和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；



cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

（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）安全保管集合计划资产，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）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还事宜；

（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、中国证监会有关规定和本合同约定的其他义务。



cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

## 二十三、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（如因自身过错，导致本集合资产管理计划未能按照本合同约定有效募集成立的），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

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。任何一方当事人延迟履行合同义务后，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）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）托管人由于执行管理人的合法有效指令对集合计划资产造成的损失等；

（5）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。

（6）相关法律、行政法规和规定的变更。

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、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



cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

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。

5、如委托人违反本合同的约定，其应承担管理人的损失,包括但不限于管理人依据《附条件生效的非公开发行股份认购协议》及其补充协议向宝鼎重工承担的任何赔偿、违约责任。

6、管理人违反法律、行政法规的有关规定，被中国证监会依法撤销证券资产管理业务许可、责令停业整顿，或者因停业、解散、撤销、破产等原因不能履行职责的，应当按照有关监管要求妥善处理有关事宜。

7、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资产或委托人造成的损失向委托人承担连带责任。

（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法院提起诉讼解决。

## 二十四、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



cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

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）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。

（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）管理人因停业、解散、撤销、破产，或者被中国证监会撤销相关业务许可等原因不能履行职责的风险

管理人因停业、解散、撤销、破产，或者被中国证监会撤销相关业务许可等原因不能履行职责，可能导致委托资产的损失，从而带来风险。

（五）信用风险

集合计划在交易过程中发生交收违约，或者集合计划所投资债券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，或由于债券发行人信用质量降低导致债券价格下降，造成集合计划资产损失的风险。

（六）其他风险

1、操作风险，指那些由于不合理的内部程序，人为造成的或者是系统性的，由外部事件引发损失的风险。

2、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，



cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

可能导致委托资产的损失，从而带来风险。

（七）本集合计划特有风险

1、定向增发投资风险

本集合计划主要投资于宝鼎重工定向增发，可能存在以下风险：

（1）定向增发的股票有 36 个月的限售锁定期，锁定期间的投资标的价格有可能发生较大的波动。当管理期届满，管理人在二级市场转让股份以实现变现，存在因二级市场股价较低致使本集合计划未能达到预期回报目标甚至亏损的风险。

（2）根据《上市公司证券发行管理办法》等相关法律法规的规定，上市公司非公开发行股票需要履行一系列的法定程序并满足一定的条件才能成功，因此本集合计划存在因上市公司非公开发行失败或在宝鼎重工非公开发行获得中国证监会核准后、发行方案向中国证监会备案前本计划未能按照约定募集全部募集完成而未能认购到定增股票的风险。

（3）集合计划参与定向增发，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，造成参与失败的风险。

（4）集合计划申购报价符合相关要求，但仍未能获得配售或未能足额获得配售的风险。

2、提前终止条款

（1）当存续期内，计划委托人少于 2 人，本计划提前终止。

（2）本集合计划认购宝鼎重工非公开发行 A 股非公开发行股票登记过户满 36 个月后，管理人可以提前终止本集合计划。

（3）本集合计划主要投资于定向增发股票，若本集合计划申购定向增发失败或在宝鼎重工非公开发行获得中国证监会核准后、发行方案向中国证监会备案前本计划未能按照约定募集全部募集完成的，则管理人有权提前终止本集合计划，管理人不承担相关责任。

3、电子签名信息保护

本计划资产管理合同可以采用电子签名方式签署，可能存在因网络中断或不运作、传送安全系统失灵、系统遭受非法攻击等多种因素造成数据的损坏或丢失。



cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

委托人签署电子签名合同进行交易的，应积极采取安全措施，加强账户、密码的保护。

4、合同变更条款

在合同变更安排中，可能存在但不限于以下潜在风险：

（1）默认处理的风险。合同中约定委托人若未在约定或指定时间内以约定方式表示意见，视为委托人同意合同变更。在此情况下，委托人对默认情况的忽略或误解，可能存在潜在风险。

（2）强制退出风险。合同中约定委托人不同意变更的，管理人保障其退出集合计划的权利；对于明确答复不同意合同变更但逾期未退出本集合计划的委托人，管理人将统一在合同变更生效日次一工作日做强制退出处理。在此情况下，会导致委托人的份额减少至零。

（八）资产管理计划份额不可转让的风险

本集合计划存续期内不可进行份额转让。

（九）特别提示

1、本集合计划主要投资于宝鼎重工非公开发行股票。本集合计划参与定向增发如未获配或未足额获配，管理人有权提前终止本集合计划。

2、委托人签署本合同后并不代表本集合计划已成立，仅当集合计划的参与资金总额（含参与费）不低于 3000 万元且其委托人的人数为 2 人（含）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，管理人方可宣布本集合计划成立。

3、本集合计划成立后，其余募集资金应在宝鼎重工非公开发行获得证监会核准后、发行方案于证监会备案前募集到位。

4、非公开发行的股票有 36 个月的限售锁定期，锁定期间内委托人不得转让产品份额或退出本集合计划。

5、本集合计划管理人有权仅接受宝鼎重工认可的委托人的参与申请，也仅接受宝鼎重工认可的委托人的退出申请。委托人申请参与及退出可能因宝鼎重工不认可而确认失败，委托人签署资产管理合同和风险揭示书即表示对此无异议。



cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

## 二十五、合同的成立与生效

（一）合同的成立与生效

本合同以电子签名或纸质合同方式签署，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；委托人作为本合同一方，以电子签名或纸质合同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。本合同经管理人、托管人和委托人签署后成立。资产管理合同未经正式签署前，任何一方使用、引用合同全部或部分条款及内容的，均由使用、引用方承担由此产生的法律后果。

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）本集合计划成立。

（二）合同的组成

《海通宝鼎成长 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等为本合同的附件，是本合同不可分割的一部分，与本合同具有同等法律效力。

但若说明书中的内容与本合同中的相关内容不一致的，以本合同中的表述为准。

## 二十六、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。委托人特此授权管理人经与托管人协商，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。若委托人对更新或修改的内容有异议，应在更新或修改内容于管理人指定网站公告之日起 10 个工作日内按照本合同的规定申请退出本集合计划，未申请退出的，视为无异议。

2、非因前项约定事由且非经管理人、托管人及全体委托人一致同意，本合同不得作出任何修改和变更。由于其他原因需要变更合同的，管理人和托管人应



cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

书面达成一致并在管理人指定网站公告。管理人须在公告后 5 个工作日内以管理人指定网站公告或书面通知等方式向委托人发送合同变更征询意见。经全体委托人一致同意的，方可变更合同，否则视为合同变更失败。

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（以下统称“指定期”）内提出退出本集合计划的申请或明确答复不同意合同变更；委托人未在前述时间回复意见、也未在指定期退出计划或答复意见不明确的，视为委托人同意合同变更。

委托人不同意变更的，管理人对其采取如下权利保障措施及后续安排：委托人不同意变更的，管理人保障其退出集合计划的权利，管理人可在指定期内设置临时开放日为委托人办理退出集合计划的业务；对于明确答复不同意合同变更但逾期未退出本集合计划的委托人，管理人将统一在合同变更生效日次一工作日做强制退出处理。合同变更生效日以管理人公告为准。集合计划份额的退出价格为退出当日的集合计划份额单位净值。

委托人同意，无论其是否同意合同变更或提出退出申请，管理人变更本合同的行为均不应被视为或裁定为管理人的违约行为。

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、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委托代理人签署。



cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

（本页无正文，为《海通宝鼎成长 2 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：上海海通证券资产管理有限公司（盖章）

法定代表人或委托代理人：（签字）

托管人：上海银行股份有限公司（盖章）

法定代表人或委托代理人：（签字）

签订日期： 年 月



cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站