

编号: JYST2015DZ057

金鹰穗通定增 57 号资产管理计划 资产管理合同

资产委托人: 成都嘉恒达商贸有限公司

资产管理人: 金鹰基金管理有限公司

资产托管人: 中国工商银行股份有限公司广东省分行营业部

目 录

一、前言.....	1
二、释义.....	1
三、声明与承诺.....	2
四、当事人及权利义务.....	4
五、委托财产.....	9
六、投资政策及变更.....	12
七、投资经理的指定与变更.....	14
八、投资指令的发送、确认和执行.....	14
九、交易及交收清算安排.....	16
十、越权交易处理与投资监督.....	18
十一、委托财产的估值.....	20
十二、委托财产的会计核算.....	23
十三、资产管理业务的费用与税收.....	23
十四、委托财产投资所产生的权利的行使.....	26
十五、报告义务.....	26
十六、风险揭示.....	27
十七、资产管理合同的生效、变更与终止.....	29
十八、清算程序.....	31
十九、违约责任.....	35
二十、争议的处理.....	36
二十一、其他事项.....	36

一、前言

订立本合同的依据、目的和原则

1、订立本资产管理合同的依据是《中华人民共和国合同法》、《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《基金管理公司特定客户资产管理业务试点办法》（证监会令第 83 号）（以下简称“《试点办法》”）和其他有关法律法规。

2、订立本资产管理合同（以下或简称“本合同”）的目的是为了明确资产委托人、资产管理人和资产托管人在特定资产管理业务过程中的权利、义务及职责，确保委托财产的安全，保护当事人各方的合法权益。

3、订立本资产管理合同的原则是平等自愿、诚实信用、充分保护本合同各方当事人的合法权益。

二、释义

在本合同中，除上下文另有规定外，下列用语应当具有如下含义：

- 1、资产委托人、委托人：成都嘉恒达商贸有限公司
- 2、资产管理人、管理人：金鹰基金管理有限公司
- 3、资产托管人、托管人：中国工商银行股份有限公司广东省分行营业部
- 4、投资顾问：上海朱雀秦兵投资有限公司
- 5、首钢股份：北京首钢股份有限公司（代码：000959）
- 6、本合同：资产委托人、资产管理人和资产托管人签署的《金鹰穗通定增 57 号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变更或补充
- 7、委托财产：指资产委托人拥有合法处分权、委托资产管理人管理并由资产托管人托管的作为本合同标的的财产
- 8、交易日：上海证券交易所和深圳证券交易所的正常交易日
- 9、工作日：资产管理人和资产托管人均办理相关业务的营业日
- 10、证券账户：根据中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）有关规定和中国证券登记结算有限责任公司等相关机构的有关业务规则，由资产

托管人为委托财产在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司、深圳分公司开设的专用证券账户、在中央国债登记结算有限责任公司、银行间市场清算所股份有限公司开立的有关账户及其他证券类账户

11、资金账户：资产托管人根据有关规定为委托财产开立的专门用于清算交收的银行账户

12、资产委托人指定账户：指资产委托人用以与资金账户之间进行委托财产划付的唯一指定账户。

13、委托财产总值：指委托财产购买的各类证券、银行存款本息及其他投资等的价值总和。

14、委托财产净值：指委托财产总值减去负债包括管理费、托管费、交易佣金等后的价值。

15、委托财产估值：指计算评估委托财产和负债的价值，以确定委托财产净值过程。

16、初始委托财产：截至委托财产运作起始日，资产委托人通过资产委托人指定账户向资金账户划入的委托财产。

17、不可抗力：不能预见、不能避免并不能克服的客观情况。

三、声明与承诺

（一）资产委托人保证委托财产的来源及用途合法，并已充分理解本合同全文，了解相关权利及义务，了解有关法律法规及所投资品种的风险收益特征，愿意承担相应的投资风险，本委托事项符合其业务决策程序的要求；承诺其向资产管理人提供的有关投资目的、投资偏好、投资限制和风险承受能力等基本情况真实、完整、准确、合法，不存在任何重大遗漏或误导，前述信息资料如发生任何实质性变更，应当及时书面告知资产管理人。

资产委托人承诺认购本资产管理计划的资金全部为自有资金，资金来源合法合规。

资产委托人承诺已知悉并同意资产管理人与首钢股份签署了《北京首钢股份有限公司与金鹰基金管理有限公司之附条件生效的非公开发行股份认购协议》

和《北京首钢股份有限公司与金鹰基金管理有限公司之附条件生效的非公开发行股份认购协议之补充协议》，本资产管理计划拟以不超过 10 亿元人民币认购首钢股份非公开发行股票，认购不超过 203,665,998 股股票数量。

资产委托人承诺在首钢股份（代码：000959）非公开发行获得证监会核准后，至少在主承销商要求的缴款日期前一个工作日根据资产管理人的通知将主承销商要求的缴款金额扣除该日委托财产现金部分后的金额及时足额划拨至本计划托管账户。。资产委托人承诺同意本次参与认购首钢股份非公开发行的违约金为主承销商要求的缴款金额的1%。若本次非公开发行获得中国证监会核准后，资产委托人没有按照本合同将认购金额足额支付至本计划托管账户，资产委托人应自资产管理人发出书面要求后两个工作日内支付违约金至资产管理人指定账户。

资产委托人承诺委托财产不存在直接或间接来源于本计划拟认购的首钢股份（代码：000959）的发行人及其关联方(包括但不限于:发行人的控股股东、实际控制人或其控制的关联人、董事、监事、高级管理人员、主承销商、法律顾问、会计师、土地评估师、资产评估师等中介机构及前述各中介机构项目主办、经办人员及与上述机构与人员存在关联关系的关联方等)的情况。资产委托人承认，资产管理人、资产托管人未对委托财产的收益状况作出任何承诺或担保，本合同约定的业绩比较基准仅是投资目标而不是资产管理人的保证。资产委托人确认在签订本合同前，资产管理人已充分地向资产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，同时揭示了已经合理知晓的相关风险，并已通过了解资产委托人的风险偏好、风险认知能力和承受能力，对资产委托人的财务状况进行了充分评估。

资产管理人按本合同约定将委托资产投资于首钢股份三年期定向增发股票及合同约定的其他金融工具，资产管理人在本合同生效后按照投资顾问投资建议进行投资。资产管理人不承担调查所投资对象的风险控制能力、对投资项目进行尽职调查是否充分、后期管理措施是否得当的义务，也不对投资对象的财产状况、经营状况、资信状况等承担责任，委托人自行承担投资风险。

因本计划依据合同约定和投资顾问的投资建议进行投资，资产管理人不进行主动管理，资产委托人对投资对象风险亦有明确认知，因此资产委托人同意豁免资产管理人尽职调查、制作相关报告、风险揭示的义务。

资产委托人同意资产管理人在资产管理合同期限届满、提前终止时，如本计划持有无法变现资产，本计划自动延期至资产变现日。

（二）资产管理人保证已在签订本合同前充分地向资产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；已经了解资产委托人的风险偏好、风险认知能力和承受能力，对资产委托人的财务状况进行了充分评估。资产管理人承诺依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则执行投资决策以外与资产管理计划财产运作有关的事务性管理工作，除保本产品外，不保证委托财产一定盈利，也不保证最低收益。

（三）资产托管人承诺依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则安全保管委托财产，并履行本合同约定的其他义务。

四、当事人及权利义务

（一）资产委托人

名称：成都嘉恒达商贸有限公司

联系人：陈霞

联系地址：四川省乐山市翡翠路 529 号四川恒邦集团

法定代表人：颜台萍

联系电话：0833-2699020

电子邮件地址：chenxia342@163.com

（二）资产管理人

名称：金鹰基金管理有限公司

注册地址：广东省珠海市吉大九洲大道东段商业银行大厦 7 楼 16 单元

办公地址：广东省广州市天河区体育西路 189 号城建大厦 22、23 楼

法定代表人：凌富华

联系人：张倩

联系电话：010-57385538

（三）资产托管人

名称：中国工商银行股份有限公司广东省分行营业部

办公地址：广州市大沙头路 29 号 2102

法定代表人或负责人：沈晓东

联系人：陈晓虹

联系电话：020-83786666-2115

(四) 资产委托人的权利与义务

1. 资产委托人的权利

- (1) 按照本合同的约定取得其委托财产投资运作产生的收益；
- (2) 监督资产管理人、投资顾问及资产托管人履行投资管理和托管义务的情况；
- (3) 按照本合同的规定追加或提取委托财产；
- (4) 按照本合同约定的时间和方式向资产管理人及资产托管人查询委托财产的投资运作、托管等情况；
- (5) 根据《试点办法》和本合同的规定，定期从资产管理人和资产托管人处获得资产管理业务及资产托管业务相关报告；
- (6) 享有委托财产投资所产生的权利，并可授权资产管理人或资产托管人代为行使部分因委托财产投资所产生的权利；
- (7) 国家有关法律法规、监管机构及本合同规定的其他权利。

2. 资产委托人的义务

- (1) 按照本合同的约定，将委托财产交付资产管理人和资产托管人分别进行投资管理和资产托管；
- (2) 及时、全面、准确地向资产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，向资产管理人提供身份证明文件及其他必要的资料，配合资产管理人为反洗钱目的进行的尽职调查及对资产委托人投资风险承受能力进行测评；
- (3) 按照本合同的约定缴纳资产管理业务的管理费、托管费，并承担因委托财产运作产生的其他费用；
- (4) 保守商业秘密，不得泄露委托财产投资计划、投资意向等；
- (5) 在签署本合同前，向资产管理人、资产托管人书面告知资产委托人的关联方发行的证券名单或其他禁止交易的证券名单，在上述证券名单发生变更时，及时书面通知资产管理人和资产托管人；

(6) 保证在首钢股份（代码：000959）非公开发行获得证监会核准后，至少在主承销商要求的缴款日期前一个工作日根据资产管理人的通知将主承销商要求的缴款金额扣除该日委托财产现金部分后的金额及时足额划拨至本计划托管账户。若资产委托人没有按照本合同约定将认购金额足额支付至本计划托管账户，资产委托人应向资产管理人支付主承销商要求的缴款金额的 1% 作为违约金。

(7) 保证委托财产的来源为自有资金，且合法合规，主动了解所投资品种的风险收益特征，并符合其业务决策程序的要求；

(8) 同意指定上海朱雀秦兵投资有限公司为本计划的投资顾问，向资产管理人提供投资建议，同意承担资产管理人执行投资顾问的建议所产生的一切风险与结果。

(9) 资产委托人无条件接受资产管理人在资产管理合同期限届满、提前终止时，如本计划持有无法变现资产，本计划自动延期至资产变现日。

(10) 国家有关法律法规、监管机构及本合同规定的其他义务。

(五) 资产管理人的权利与义务

1. 资产管理人的权利

(1) 自本合同生效之日起，根据投资顾问的投资建议管理及运作委托财产；

(2) 按照本合同的约定，及时、足额获得资产管理人报酬；

(3) 根据本合同及其他有关规定，监督资产托管人，对于资产托管人违反了本合同或有关法律法规规定的行为，对委托财产及其他当事人的利益造成重大损失的，应及时采取措施制止，同时通知资产委托人并报告中国证监会；

(4) 经资产委托人授权，代理资产委托人行使部分因委托财产投资所产生的权利；

(5) 根据本合同约定代表本计划聘请上海朱雀秦兵投资有限公司为本计划的投资顾问，与投资顾问签署投资顾问协议，当投资顾问的投资建议违反资产管理人应遵守的法律法规、监管机构要求、本合同约定的投资条款及资产管理人的投资交易等有关原则和制度时，有权不按投资顾问的建议进行投资；

(6) 国家有关法律法规、监管机构及本合同规定的其他权利。

2. 资产管理人的义务

(1) 办理本合同备案手续；

(2) 自本合同生效之日起, 资产管理人承诺依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则执行投资决策以外与资产管理计划财产运作有关的事务性管理工作;

(3) 自合同生效之日起, 在投资顾问的投资建议不违反相关法律法规、监管机构要求、本合同约定的投资条款及资产管理人的投资交易等有关原则和制度的前提下, 执行投资顾问的投资建议, 如果投资顾问不提供投资建议则不对资产管理计划财产进行任何投资操作 (本合同另有约定的除外);

(4) 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旗下基金财产、其他委托财产和资产管理人的财产相互独立, 对所管理的不同财产分别管理、分别记账, 进行投资;

(5) 除法律法规、本合同及其他有关规定外, 不得为资产管理人及任何第三人谋取利益, 未经资产委托人同意不得委托第三人运作委托财产;

(6) 按照本合同接受资产委托人和资产托管人的监督;

(7) 按照《试点办法》和本合同的规定, 编制并向资产委托人报送委托财产的投资报告, 对报告期内委托财产的投资运作等情况做出说明;

(8) 按照《试点办法》和本合同的规定, 编制季度及年度报告, 并向中国证监会备案;

(9) 保守商业秘密, 不得泄露委托财产投资计划、投资意向等;

(10) 保存委托财产管理业务活动的全部会计资料, 并妥善保存有关的合同、协议、交易记录及其他相关资料;

(11) 公平对待所管理的不同财产, 不得从事任何有损委托财产及其他当事人利益的活动;

(12) 国家有关法律法规、监管机构及本合同规定的其他义务。

(六) 资产托管人的权利与义务

1. 资产托管人的权利

(1) 按照本合同的约定, 及时、足额获得资产托管费;

(2) 根据本合同及其他有关规定监督资产管理人对委托财产的投资运作, 对于资产管理人违反本合同或有关法律法规规定的行为, 对委托财产及其他当事人的利益造成重大损失的情形, 应及时呈报中国证监会并采取必要措施;

(3) 按照本合同的约定, 依法保管委托财产;

(4) 经资产委托人授权, 代理资产委托人行使部分因委托财产投资所产生的权利;

(5) 国家有关法律法规、监管机构及本合同规定的其他权利。

2. 资产托管人的义务

(1) 安全保管委托财产;

(2) 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, 负责委托财产托管事宜;

(3) 对所托管的不同财产分别设置账户, 确保委托财产的完整与独立;

(4) 除法律法规、本合同及其他有关规定外, 不得为资产托管人及任何第三人谋取利益, 未经资产委托人同意不得委托第三人托管委托财产;

(5) 按规定开设和注销委托财产的资金账户、证券账户等投资所需账户;

(6) 复核资产管理人编制的委托财产的投资报告, 并出具书面意见;

(7) 保守商业秘密。除法律法规、本合同及其他有关规定另有规定或经有权机关要求的披露外, 不得向他人泄露;

(8) 编制委托财产年度托管报告, 并向中国证监会备案;

(9) 按照本合同的约定, 根据资产管理人的投资指令, 及时办理清算、交割事宜;

(10) 按照法律法规及本合同的规定监督资产管理人的投资运作。资产托管人发现资产管理人的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定, 或者违反本合同约定的, 应当拒绝执行, 立即通知资产管理人和资产委托人并及时报告中国证监会。资产托管人发现资产管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他规定, 或者违反本合同约定的, 应当立即通知资产管理人和资产委托人并及时报告中国证监会;

(11) 公平对待所托管的不同财产, 不得从事任何有损委托财产及其他当事人利益的活动;

(12) 国家有关法律法规、监管机构及本合同规定的其他义务。

五、委托财产

（一）委托财产的保管与处分

1、委托财产独立于资产管理人、资产托管人的固有财产。资产管理人、资产托管人不得将委托财产归入其固有财产。资产托管人对实际交付并控制下的计划财产承担保管职责，对于证券登记机构或结算机构等非资产托管人保管的财产不承担责任。

2、资产管理人、资产托管人因委托财产的管理、运用或者其他情形而取得的财产和收益归入委托财产。

3、资产管理人、资产托管人可以按本合同的约定收取管理费、托管费以及本合同约定的其他费用。资产管理人、资产托管人以其自有财产承担法律责任，其债权人不得对委托财产行使请求冻结、扣押和其他权利。资产管理人、资产托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，委托财产不属于其清算财产。

4、委托财产产生的债权不得与不属于委托财产本身的债务相互抵销。非因委托财产本身承担的债务，资产管理人、资产托管人不得主张其债权人对委托财产强制执行。上述债权人对委托财产主张权利时，资产管理人、资产托管人应明确告知委托财产的独立性，采取合理措施并及时通知资产委托人。

（二）委托财产相关账户的开立和管理

1、资金账户、证券账户

资产托管人按照规定开立委托财产的资金账户、证券账户等投资所需账户。资产委托人和资产管理人应当在开户过程中给予必要的配合，并提供所需资料。

资产托管人以资产管理计划名义开立委托财产的资金账户【备注：账户名称以实际开立为准】，保管计划的银行存款，该资金账户是指托管人在集中清算模式下，代表所托管的包括本计划在内的托管资产与注册登记机构（本资产管理计划的注册登记机构同时为管理人）进行结算的专用账户。本计划的托管银行预留印鉴，至少要加盖一枚托管人银行印鉴，并由托管人保管和使用。该账户的开设和管理由托管人负责，本计划的一切货币收支活动，包括但不限于投资、支付费用、资产划拨、追加资产、提取资产、支付计划收益、收取参与款等，均需通过

该账户进行。

证券账户的持有人名称应至少包含资产委托人（或产品）名称。资产管理人和资产托管人有权为本合同目的使用该资金账户、证券账户等投资所需账户。

委托财产存放于资产托管人开立的资金账户中的存款利率适用资产托管人公布的人民币活期存款利率。在本合同存续期内，若中国人民银行调整基准利率或利率浮动区间，则本合同委托财产资金账户中的存款利率将依据资产托管人的业务规则作相应调整。

2、资产委托人指定账户

资产委托人指定账户由资产委托人以其自身名义开立。资产委托人移交、追加委托财产的划出账户与提取委托财产的划入账户原则上应为以资产委托人名义开立的同一账户。资产委托人应当通过资产委托人指定账户向资金账户划拨委托财产；资产委托人提取委托财产时，应通过资金账户向资产委托人指定账户划拨委托财产。资产委托人提取委托财产时，资产管理人、资产托管人应核对并确保资产委托人提取的委托财产划入资产委托人指定账户。如因特殊情况导致资产委托人移交、追加委托财产的账户或提取委托财产的账户不是资产委托人指定账户，资产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，并取得资产管理人和资产托管人的同意，否则资产管理人和资产托管人均有权拒绝接受该部分资金的移交、追加与提取。

资产委托人指定账户信息如下：

账户名称： 成都嘉恒达商贸有限公司

账号： 117159451744

开户银行名称： 中国银行成都双楠支行

（三）委托财产的移交

委托财产相关账户开立完毕后，资产委托人应通过其指定账户及时将初始委托财产足额划拨至资产托管人为本委托财产开立的资金账户后，托管人应于收到委托人通知并确认委托人初始委托资产足额到达银行托管专户当日内向委托人

及管理人以传真方式发送《委托资产起始运作通知书》(附件一),经资产委托人及资产管理人双方确认签收后的当日作为委托财产运作起始日。

本合同委托财产应以现金形式交付,初始委托财产不得低于 3000 万元人民币。

(四) 委托财产的追加

在本合同有效期内,资产委托人有权以书面通知或指令的形式追加委托财产。追加委托财产比照初始委托财产办理移交手续,托管人应于收到委托人通知并确认委托人追加委托资产足额到达银行托管专户当日内向委托人及管理人以传真方式发送《委托资产追加确认书》(附件二),经资产委托人及资产管理人双方确认签收后的当日作为委托财产追加确认日。资产管理人、资产托管人应按照本合同的约定分别管理和托管追加部分的委托财产。

(五) 委托财产的提取

1、在本合同存续期内,在委托财产可实现变现的前提下,当委托财产净值高于 3000 万元人民币时,资产委托人可以提取部分委托财产,但提取后的委托财产净值不得低于 3000 万元人民币;当委托财产净值少于 3000 万元人民币时,资产委托人不得提前提取,但经合同各方当事人协商一致可以提前终止本合同。

2、在本合同存续期内,如遇资产委托人需要提取委托财产,资产委托人需提前通知(《委托财产提取通知书》附件三)资产管理人并抄送资产托管人。资产委托人要求资产管理人发送财产划拨指令,通知资产托管人将相应财产从相关账户划拨至资产委托人指定账户,资产托管人应于划拨财产当日以书面形式分别通知其他两方。如资产委托人提取的资产超过计划的现金资产,资产管理人有权拒绝资产委托人提取资产。

资产管理人、资产托管人对于提取或追加委托财产的确认比照《证券投资基金会计核算业务指引》中实收基金的确认方法。

3、在本合同存续期内,资产委托人一次性提取委托财产低于或等于 1000 万元的,需提前 2 个工作日书面通知资产管理人和资产托管人,一次性提取委托财产超过 1000 万元的,需提前 5 个工作日书面通知资产管理人和资产托管人。资产委托人不按照约定提前通知的,由此可能造成的损失(包括但不限于变现损

失)和延误应由资产委托人自行承担。

4、份额转让

本资产管理计划持有非公开发行股票并且在非公开发行股票锁定期内的,不允许资产委托人办理份额转让,在上述期间以外的,资产委托人可以通过交易所交易平台,按照交易所平台的规则向符合条件的特定客户转让其持有的资产管理计划份额。资产委托人申请转让其持有的资产管理计划份额的,应提前 1 个月书面向资产管理人提出申请。

六、投资政策及变更

(一)资产委托人的投资状况

1、资产委托人的投资偏好

资产委托人对境内证券市场具有较高的投资偏好,了解国内市场证券投资风险。

2、资产委托人的风险承受能力

风险承受能力相对较强。

3、资产委托人的风险认知能力

资产委托人具有完全的认知能力,能够承担完全的民事法律责任。

(二)委托财产的投资政策

1、投资目标

本产品根据投资顾问的投资建议进行投资运作,力争实现委托财产的稳健增值。

2、投资范围

本资产管理计划投资于非公开发行 A 股等金融工具,包括:

(1) 委托人指定投资对象:北京首钢股份有限公司(以下简称“首钢股份”,股票代码:000959)三年期非公开发行的限售股票。投资规模占资产净值的 0-100%。

(2) 现金管理类金融工具:包括货币市场工具、银行存款(包括但不限于银行活期存款、银行定期存款、协议存款、同业存款等各类存款)、货币型基金(含管理人管理的货币基金)等,规模占资产净值的 0-100%。

3、投资策略

管理人按照投资顾问的投资建议进行投资。

4、投资限制

(1) 本合同委托财产的投资组合将遵循以下限制：

1. 符合本合同约定的投资范围和投资限制。
2. 本计划不得在二级市场买入股票、权证等权益类资产。
3. 法律法规、中国证监会以及本合同规定的其他投资限制。

由于包括但不限于证券市场波动、上市公司合并、组合规模变动等资产管理人之外的原因导致的投资比例不符合本合同约定的投资限制或投资禁止政策，为被动超标。发生上述情形时，资产管理计划应在发生不符合法律法规或投资政策之日起的 10 个交易日内进行调整，以满足法律法规及投资政策的要求。法律法规另有规定的从其规定。

(2) 本合同委托财产的投资禁止行为包括：

- A. 承销证券；
- B. 向他人贷款或者提供担保；
- C. 从事承担无限责任的投资；
- D. 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- E. 法律法规、中国证监会、中国银监会禁止的其他活动。

5、业绩比较基准

无

6、投资政策的变更

经资产委托人与资产管理人协商一致可对投资政策进行变更，变更投资政策应以书面形式作出。投资政策变更应为调整投资组合及资产托管人做好营运准备留出必要、合理的时间。资产管理人应及时告知资产托管人该等变更。

7、委托人所指定的投资顾问相关约定

1、投资顾问概况

单位名称	上海朱雀秦兵投资有限公司	法定代表人	严鸿宴
成立时间	2014 年 12 月 5 日	注册资本	1000 万元
企业类型	有限责任公司	营业执照	310115002512916

组织机构代码	32431118-X	税务登记证	31011532431118X
公司住所	上海市浦东新区牡丹路 60 号 1104-A 室		
联系人	邱元超	联系电话	13488701357

上海朱雀秦兵投资有限公司拥有中国证券投资基金业协会颁发的私募投资基金管理人登记证书，登记编号为 P1007183。

2、资产委托人同意聘请【上海朱雀秦兵投资有限公司】作为投资顾问向本计划提供投资建议，在遵守法律法规、监管机构要求、本合同约定投资条款及资产管理人的投资交易规则等有关规则和制度的前提下，由投资顾问为本计划的投资管理提供投资建议，并由资产管理人执行该等投资建议；如投资顾问未履行相关规则和制度，资产管理人有权不按照投资建议执行，由此给计划财产带来的投资收益和损失由计划资产承担。除本合同另有约定，如果投资顾问不提供投资建议，资产管理人将不进行任何操作。具体投资建议的执行由投资顾问与资产管理人另行签署投资顾问协议进行明确。

七、投资经理的指定与变更

委托财产投资经理由资产管理人负责指定。

资产管理人可以根据需要变更投资经理。

本投资经理与资产管理人管理的证券投资基金的基金经理不得相互兼任。

本委托财产投资经理为张倩女士。

投资经理简历：

张倩女士，暨南大学金融学硕士，具备基金从业资格，曾任职东莞证券资产管理部、广州证券资产管理部，2014 年 12 月加入金鹰基金管理有限公司。。

八、投资指令的发送、确认和执行

（一）交易清算授权

资产管理人应向资产托管人提供预留印鉴和有权人（“授权人”）签字样本，事先书面通知（以下称“授权通知”）资产托管人有权发送投资指令的人员名单

(“被授权人”), 注明相应的交易权限并预留被授权人签字样本。授权通知由授权人签字并盖章。资产托管人在收到授权通知当日向资产管理人确认。授权通知须载明授权生效日期。授权通知自通知载明的生效日期开始生效。资产托管人收到通知的日期晚于通知载明生效日期的, 则通知自资产托管人收到该通知时生效。资产管理人和资产托管人对授权文件负有保密义务, 其内容不得向相关人员以外的任何人泄露。

(二) 投资指令的内容

投资指令是资产管理人在运用委托财产时, 向资产托管人发出的资金划拨及其他款项支付的指令。资产管理人发给资产托管人的指令应写明款项事由、支付时间、最迟到账时间、大小写划款金额、收款账户信息等, 加盖预留印鉴并有被授权人签字。

(三) 指令的发送、确认和执行程序

指令由授权通知确定的被授权人代表资产管理人用加密传真或资产托管人和资产管理人确认的其他方式向资产托管人发送, 资产管理人有义务在发送指令后与资产托管人以电话方式进行确认, 因资产管理人未能及时与资产托管人进行指令确认, 致使资金未能及时到账所造成的损失不由资产托管人承担。对于授权通知指定的被授权人发出的指令, 资产管理人不得否认其效力。资产管理人应按照国家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, 发送人应按照其授权权限发送划款指令。资产管理人在发送指令时, 应为资产托管人留出执行指令所必需的时间, 一般为 2 个小时。对于小于两小时划款时间的指令, 托管人不保证当日完成在银行的划付流程, 由资产管理人原因造成的指令传输不及时、未能留出足够划款所需时间, 致使资金未能及时到账所造成的损失托管人不承担责任。

资产托管人收到资产管理人发送的指令后, 应立即审查指令内容及指令发送人员是否为被授权人, 审查无误后应在规定期限内执行, 不得延误。投资指令原件与传真件或通过资产托管人和资产管理人确认的其他方式发送的扫描件不一致时, 以托管人收到的传真件或通过资产托管人和资产管理人确认的其他方式发送的扫描件为准。

资产管理人向资产托管人下达指令时,应确保委托财产银行账户有足够的资金余额,对资产管理人在没有充足资金的情况下向资产托管人发出的指令,资产托管人有权拒绝执行,并立即通知资产管理人,资产托管人不承担因不执行该指令而造成的损失。

资产托管人依据本合同约定正确执行资产管理人的划款指令,对委托财产发生的损失,不承担任何形式的责任。

资产托管人仅依据被授权人预留印鉴和签名进行表面相符性的形式审查,对其真实性不承担责任。

(四) 资产管理人发送错误指令的情形和处理程序

资产管理人发送错误指令的情形包括指令发送人员无权或超越权限发送指令及交割信息错误,指令中重要信息模糊不清或不全等。

资产托管人在履行监督职能时,发现资产管理人的指令错误,有权拒绝执行,并及时通知资产管理人及时改正。

(五) 更换被授权人的程序

资产管理人撤换被授权人或改变被授权人的权限,必须提早至少一个交易日,向资产托管人发出由授权人签字和盖章的被授权人变更通知,并提供新被授权人签字样本,同时电话通知资产托管人,资产托管人收到变更通知当日向资产管理人确认。被授权人变更通知须载明新授权生效日期。被授权人变更通知,自通知载明的生效日期开始生效。资产托管人收到通知的日期晚于通知载明生效日期的,则通知自资产托管人收到该通知的下一工作日生效。更换被授权人通知生效后,对于已被撤换的人员无权发送的指令,或新被授权人超权限发送的指令,资产管理人不承担责任。

九、交易及交收清算安排

(一) 选择代理证券交易的证券经营机构的程序

1、资产管理人负责选择代理本委托财产证券买卖的证券经营机构,并与其签订交易单元使用协议。

资产管理人应及时将委托财产专用交易单元号、佣金费率等基本信息以及变

更情况及时以书面形式通知资产托管人。

（二）投资证券后的清算交收安排

1、资产托管人在清算和交收中的责任

本委托财产投资于证券发生的所有场内、场外交易的资金清算交割，全部由资产托管人负责办理。

本委托财产证券投资的清算交割，由资产托管人通过中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中登公司”）上海分公司/深圳分公司及清算代理银行办理。

2、证券交易所证券资金结算

资产托管人、资产管理人应共同遵守中登公司制定的相关业务规则 and 规定，该等规则 and 规定自动成为本条款约定的内容。

资产管理人在投资前，应充分知晓与理解中登公司针对各类交易品种制定结算业务规则 and 规定，并遵守资产托管人为履行结算参与人的义务所制定的业务规则与规定。

3、无法按时支付证券清算款的责任认定及处理程序

资产管理人应确保资产托管人在执行资产管理人发送的指令时，有足够的头寸进行交收。对于场外证券交易，资产管理计划财产的资金头寸不足时，资产托管人有权拒绝资产管理人发送的划款指令。对于证券交易所证券交易，如果因资产管理人或证券经营机构等非资产托管人原因发生超买行为，资产管理人必须于 T+1 日上午 10 时之前划拨资金，用以完成清算交收。如由于非资产托管人的原因导致无法按时支付证券清算款，给资产托管人和委托财产造成损失的，由此造成的损失由资产管理人承担。

在资金头寸充足的情况下，资产托管人对资产管理人符合法律法规、本合同的指令不得拖延或拒绝执行。如由于资产托管人的原因导致委托财产无法按时支付证券清算款，由此造成的损失由资产托管人承担。

4、委托财产参与 T+0 交易所非担保交收债券交易的责任认定及处理程序

委托财产参与 T+0 交易所非担保交收债券交易的，资产管理人应确保有足额头寸用于上述交易，并必须于 T+0 日 14 时之前出具有效划款指令（含不履约申报申请），并确保指令要素（包括但不限于交收金额、成交编号）与实际交收信息一致。如由于资产管理人的原因导致 T+0 非担保交收失败，给委托财产和资产托管

人造成损失的，资产管理人应承担赔偿责任。

（三）资金、证券账目及交易记录的核对

资产管理人和资产托管人定期对资产的证券账目、实物券账目、交易记录进行核对。

十、越权交易处理与投资监督

（一）越权交易的界定

越权交易是指资产管理人违反有关法律法规的规定以及违反本合同约定而进行的投资交易行为，包括：

（1）违反有关法律法规和本合同投资范围、投资比例、投资禁止行为的规定进行的投资交易行为；

（2）法律法规禁止的超买、超卖行为；

（3）其他违反有关法律法规的规定以及违反或超出本合同项下资产委托人授权的投资交易行为。

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

（二）对越权交易的处理

1、违反有关法律法规和本合同投资范围、投资比例、投资禁止行为的规定进行的投资交易行为

资产托管人对于承诺监督的越权交易，发现资产管理人的投资指令违反法律、行政法规和其他规定，或者违反本合同约定的，应当拒绝执行，立即通知资产管理人和资产委托人并及时报告中国证监会。

资产托管人对于承诺监督的越权交易，发现资产管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他规定，或者违反本合同约定的，应当立即通知资产管理人和资产委托人。

资产管理人应向资产委托人和资产托管人主动报告越权交易。资产委托人和资产托管人有权随时对通知事项进行复查，督促资产管理人改正。资产管理人对资产委托人和资产托管人通知的越权事项未能及时纠正的，资产托管人应报告中

国证监会。

2、法律法规禁止的超买、超卖行为。

资产托管人在行使监督职能时,如果发现委托财产投资证券过程中出现超买或超卖现象,应立即提醒资产管理人,由资产管理人负责解决,由此给委托财产造成的损失由资产管理人承担。如果因资产管理人或证券经营机构等非资产托管人原因发生超买行为,资产管理人必须于 T+1 日上午 10:00 前完成融资,用以完成清算交收。

3、违反或超出本合同项下资产委托人授权的投资交易行为

资产管理人进行违反或超出本合同项下资产委托人授权的投资交易行为,应向资产委托人和资产托管人主动报告,限期及时改正,并及时报告中国证监会。

4、越权交易所发生的损失及相关交易费用由资产管理人负担,所发生的收益归本委托财产所有。

(三)被动超标

1、由于包括但不限于证券市场波动、上市公司合并、组合规模变动等资产管理人之外的原因导致的投资比例不符合本合同约定的投资限制或投资禁止政策,为被动超标。发生上述情形时,资产管理人应在发生不符合法律法规或投资政策之日起的 10 个交易日内进行调整,以满足法律法规及投资政策的要求。法律法规另有规定的从其规定。

2、本合同终止前 10 个交易日内,资产管理人有权对委托财产所投资证券进行变现,由此造成投资比例、投资范围不符合投资政策规定的,视为被动超标,不构成越权交易,不属于资产管理人违反本合同的情形。

(四)资产托管人对委托资产的投资监督

1、资产托管人根据本合同的约定,对下述投资范围、投资对象进行监督。

本委托财产将投资于以下金融工具:

(1) 委托人指定投资对象:北京首钢股份有限公司(以下简称“首钢股份”,股票代码:000959)三年期非公开发行的限售股票。投资规模占资产净值的 0-100%。

(2) 现金管理类金融工具：包括货币市场工具、银行存款（包括银行活期存款、银行定期存款、协议存款、同业存款等各类存款）、货币型基金（含管理人管理的货币基金）等，规模占资产净值的 0-100%。

2、资产托管人根据合同的约定对下述委托财产投资比例限制进行监督：

(1) 符合本合同约定的投资范围和投资限制。

(2) 本计划不得在二级市场买入股票。

(3) 法律法规、中国证监会以及本合同规定的其他投资限制。

发生被动超标情形的，资产管理计划应在十个交易日内进行调整，以达到规定的投资比例限制要求。法律法规另有规定的从其规定。

3、资产托管人对委托财产的投资限制的监督和检查自本委托财产起始运作之日起开始。在履行交易监督事项过程中，托管人根据行业惯例在其当时技术与专业能力范围内提供，托管人无法监督之事项，由资产管理人自行监督。

4、如因投资政策变更需调整上述监督职责的，资产管理人应提前以书面形式通知资产托管人，由三方当事人就此另行协商。

5、因第三方数据原因，导致交易监督数据有误或无法监督的，托管人不承担责任。

十一、委托财产的估值

（一）资产净值计算、复核的依据、时间和程序

资产净值是指资产总值减去负债后的价值。资产净值的计算保留到小数点后 2 位，小数点后第 3 位四舍五入。

资产管理人每个工作日对委托财产进行估值。资产管理人与资产托管人在每月双方约定的固定日（以下简称‘估值核对日’）对资产净值进行核对。估值原则应符合本合同、《证券投资基金会计核算业务指引》及其他法律法规的规定。资产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加密传真或其他经双方认可的方式发送给资产托管人。资产托管人对净值计算结果复核后，签名、盖章并以加密传真或其他双方认可的方式传送给资产管理人，由资

产管理人在本合同约定的时间提交资产委托人。

资产净值计算和会计核算的义务由资产管理人承担。因此，就与委托财产有关的会计问题，本委托财产的会计责任方是资产管理人。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，以资产管理人对资产净值的计算结果为准。

(二) 估值方法

1、估值对象

委托财产项下所有的股票、基金和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产。

2、估值方法

本产品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、封闭式基金、上市开放式基金（LOF）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，确定公允价格；

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，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) 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，估值日前一交易日开放式基金单位净值未公布的，以此前最近一次公布的基金净值计算。

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，资产管理人可根据具体情况与资产托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

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。

3、暂停估值的情形

(1) 委托财产投资所涉及的交易场所遇法定假日或因其它原因暂停营业时；

(2) 因其他任何不可抗力致使资产管理人、资产托管人无法准确评估委托财产价值时；

(3) 占委托财产相当比例的投资品种的估值出现重大转变，而资产管理人为保障资产委托人的利益，决定延迟估值并征得资产托管人同意的；

(4) 中国证监会认定的其他情形。

4、估值差错处理

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。

当委托财产估值出现错误时，资产管理人和资产托管人应该立即更正，并报告资产委托人，并说明采取的措施。

十二、委托财产的会计核算

（一）会计政策

- 1、本项委托财产的会计年度为每年 1 月 1 日至 12 月 31 日。
- 2、记账本位币为人民币，记账单位为元。
- 3、委托财产的会计核算按《证券投资基金会计核算业务指引》执行。

（二）会计核算方法

1、资产管理人、资产托管人应根据有关法律法规和资产委托人的相关规定，按照相关各方约定的同一记账方法和会计处理原则，对委托财产单独建账、独立核算。若双方对会计处理方法存在分歧，应以资产管理人的处理方法为准。

2、资产管理人应保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，编制会计报表。

3、资产托管人应定期与资产管理人就委托财产的会计核算、报表编制等进行核对。经对账发现相关各方的账目存在不符的，资产管理人和资产托管人必须及时查明原因并纠正，保证相关各方平行登录的账册记录完全相符。

十三、资产管理业务的费用与税收

（一）资产管理业务费用的种类

- 1、资产管理人的管理费；
- 2、资产托管人的托管费；
- 3、投资顾问的业绩报酬；
- 4、委托财产拨划支付的银行费用；
- 5、委托财产的证券交易费用及开户费用；
- 6、按照法律法规及本合同的约定可以在委托财产中列支的其他费用。

(二) 费用计提方法、计提标准和支付方式

1. 资产管理人的管理费

委托财产管理费按前一日委托财产净值的年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$ ，本委托财产年管理费率为 0.2%

H 为每日应计提的委托财产管理费

E 为前一日委托财产净值

委托财产管理费自资产运作起始日起（含），每日计提，按季支付。资产管理人于每季度初起五个工作日内向资产托管人发送委托财产管理费划付指令，资产托管人复核后从委托财产中支付给资产管理人。

2. 资产托管人的托管费

委托财产托管费按前一日委托财产净值的年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$ ，本委托财产年托管费率为 0.05%

H 为每日应计提的委托财产托管费

E 为前一日委托财产净值

委托财产托管费自资产运作起始日起（含），每日计提，按季支付。资产管理人于每季度初起五个工作日内向资产托管人发送委托财产托管费划付指令，资产托管人复核后从委托财产中支付给资产托管人。

如本计划现金资产无法支付管理费、托管费时，资产委托人应及时追加资金至本计划托管户支付。如委托人追加资金不足或未及时追加资金的，在计划资产变现后或委托人足额追加后及时支付。

3. 投资顾问的业绩报酬

3.1 业绩报酬计提原则

①按委托人每笔参与资金分别计算收益率并计提业绩报酬，实行单笔核算。

②在符合业绩报酬计提条件时，在委托人提取资金时和委托资产运作终止日计提业绩报酬。

③在委托人提取资金和委托资产运作终止时提取业绩报酬的，业绩报酬从提取的资金中扣除。

④委托人提取委托资金时，按先进先出法计算相应的业绩报酬等费用。

⑤在委托人提取资金和委托资产运作终止时，业绩报酬按委托人提取资金时

或委托资产终止时的该笔资产净值计算。

3.2 收益率的计算

以该笔资产运作起始日到本次业绩报酬计提日的收益率, 作为计提该笔资产业绩报酬的基准。收益率的计算公式如下:

$$R = \frac{P_1 - P_0}{P_0}$$

业绩报酬计提日为委托人资金提取日或委托资产运作终止日;

P_1 为业绩报酬计提日该笔委托资产份额净值;

P_0 该笔资产运作起始日单位净值;

R 为收益率。

3.3 提取业绩报酬的方式

投资顾问业绩报酬公式为:

当 $R \leq 0$ 时, 不提取投资顾问业绩报酬

当 $R > 0$ 时, 投资顾问业绩报酬 $Y = A \times R \times 10\%$

Y 为每笔委托资产应提的业绩报酬, A 为每笔委托资产在资产运作起始日的金额。

14.2.3.4 业绩报酬支付

在业绩报酬计提日后的 10 个工作日内, 由资产管理人向资产托管人发送资产管理计划资产管理人的投资顾问业绩报酬划付指令, 资产托管人不承担复核义务, 资产托管人根据资产管理人指令从资产管理计划财产中一次性支付给投资顾问。

投资顾问收取投资顾问业绩报酬的账户信息:

户名: 上海朱雀秦兵投资有限公司

账号: 121914350410802

开户银行: 招商银行股份有限公司上海金桥支行

4. 上述(一)中 3 到 7 项费用由资产托管人根据其他有关法规及相应协议的规

定，按费用支出金额支付，列入或摊入当期委托财产运作费用。

(三) 不列入资产管理业务费用的项目

资产管理人和资产托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或委托财产的损失，以及处理与本委托财产运作无关的事项发生的费用等不列入委托财产运作费用。

(四) 资产管理人和资产托管人与资产委托人协商一致后，可根据市场发展情况调整资产管理费率和资产托管费率，并报中国证监会备案。

(五) 税收

委托财产运作中产生的纳税义务，由委托财产承担。资产委托人从委托财产中获得的各项收益，由资产委托人根据国家法律法规的规定，自行办理纳税申报并履行纳税义务。资产管理人、资产托管人依据法律法规规定履行各自的纳税义务。

十四、委托财产投资所产生的权利的行使

在本合同有效期内，资产委托人将采取以下第二种方式行使委托财产投资所产生的权利：

(一) 自行行使，但资产管理人及资产托管人应提供必要的协助；

(二) 授权资产管理人代为行使，资产管理人应履行谨慎勤勉的义务。委托财产投资于证券所产生的信息披露义务由资产管理人承担。委托财产投资于证券所产生的义务，特别是信息披露义务由资产管理人承担，资产委托人和资产托管人应为资产管理人履行义务提供便利。

十五、报告义务

(一) 向资产委托人提供的报告

(1) 年度报告

资产管理人应当在每年结束后三个月内，编制完成年度报告并经资产托管人复核，向资产委托人披露投资状况、投资表现、风险状况等信息。资产管理人在 60 日内完成年度报表，在年度报告完成当日，将有关报告提供资产托管人复核，资产托管人在收到后 30 日内复核，并将复核结果书面通知资产管理人。委托财产运作不到 6 个月的及本合同终止的当年，不编制当期年度报告。

(2) 临时报告

资产管理人、资产托管人应当保证资产委托人能够按照资产管理合同约定的时间和方式查询资产管理计划财产的投资运作、托管等情况。

发生本合同约定的、可能影响资产委托人利益的重大事项时，资产管理人、资产托管人应按照法律法规和中国证监会的有关规定，及时进行报告。

①涉及资产管理人、计划财产、资产托管业务的诉讼。

②资产管理人、资产托管人托管业务部门与本合同项下资产管理计划财产相关的行为受到监管部门的调查。

③资产管理人及其董事、总经理及其他高级管理人员、投资经理受到严重行政处罚，资产托管人的托管业务或托管业务部门负责人受到严重行政处罚。

④法律法规和中国证监会规定的其他事项。

(二) 向监管机构提供的报告

资产管理人、资产托管人应当根据法律法规和中国证监会等监管机构的要求履行报告义务。

十六、风险揭示

(一) 市场风险

证券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，导致委托财产收益水平变化，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。委托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。利率直接影响着债券的价格和收益率，影响着企业的融资成本和利润。委托财产投资于债券和股票，其收益水平会受到利率变化的影响。

4、上市公司经营风险

上市公司的经营好坏受多种因素影响，如管理能力、财务状况、市场前景、行业竞争、人员素质等，这些都会导致企业的盈利发生变化。如果委托财产所投资的上市公司经营不善，其股票价格可能下跌，或者能够用于分配的利润减少，使委托财产投资收益下降。虽然委托财产可以通过投资多样化来分散这种非系统风险，但不能完全规避。

5、购买力风险

委托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，从而使委托财产的实际收益下降。

6、再投资风险

再投资风险反映了利率下降对固定收益证券利息收入再投资收益的影响，这与利率上升所带来的价格风险（即前面所提到的利率风险）互为消长。具体为当利率下降时，委托财产从投资的固定收益证券所得的利息收入进行再投资时，将获得比之前较少的收益率。

（二）流动性风险

在市场或个股流动性不足的情况下，投资顾问可能无法迅速、低成本地调整投资计划，从而对计划收益造成不利影响。

（三）管理风险

本资产管理计划由投资顾问对计划投资出具投资建议，在投资建议不违反资产管理人应遵守的法律法规、监管机构要求、本合同约定的投资条款及资产管理人需遵循的公平交易等制度的前提下，资产管理人将执行投资顾问的投资建议，

反之，资产管理人将可能不执行投资顾问投资建议。投资顾问的投资建议直接影响本资产管理计划的收益水平。此外，由于投资顾问的知识、经验等因素而影响其对相关信息、经济形势和证券价格走势的判断，可能导致其建议投资品种的业绩表现低于其他投资品种，资产管理人对投资建议的执行受送达时间、市场因素（如价格、数量等）等影响，投资建议的内容可能无法完全实现，对此资产管理人不承担任何责任。

（四）信用风险

信用风险是债务人的违约风险，主用体现在信用产品中。在委托资产投资运作中，如果资产管理人的信用研究水平不足，对信用产品的判断不准确，可能使委托资产承受信用风险所带来的损失。

（五）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

本计划主要投资于非公开发行的股票，非公开发行的股票由于存在锁定期、休市、长期停牌等因素导致本计划终止时股票无法变现，以及市场价存在跌破定向增发价格的可能，委托人可能面临不能如期收回本金和收益的风险。

（六）其它风险

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，可能导致委托财产的损失；

2、金融市场危机、行业竞争、代理商违约等超出资产管理人自身直接控制能力之外的风险，也可能导致资产委托人利益受损。

十七、资产管理合同的生效、变更与终止

（一）资产管理合同是约定资产管理合同当事人之间权利义务关系的法律文

件。资产委托人为法人的，本合同自资产委托人、资产管理人和资产托管人加盖公章以及各方法定代表人或授权代表签章之日起成立；资产委托人为自然人的，本合同自资产委托人本人或授权代理人签章、资产管理人和资产托管人加盖公章以及双方法定代表人或授权代表签章之日起成立。本合同自成立之日起生效。

（二）本合同自生效之日起对资产委托人、资产管理人、资产托管人具有同等的法律约束力。

（三）本合同的有效期限为 48 个月。合同期满前 2 个月，本合同各方可协商合同是否续约。在合同各方当事人无异议的情况下，应就续约事宜签订补充协议，并报中国证监会备案。

（四）资产委托人、资产管理人和资产托管人协商一致后，可对本合同内容进行变更。

（五）本合同终止的情形包括下列事项：

- 1、合同期限届满而未延期的；
- 2、经合同各方当事人协商一致决定终止的；
- 3、资产管理人被依法取消特定客户资产管理业务资格的；
- 4、资产管理人依法解散、被依法撤销或被依法宣告破产的；
- 5、资产托管人依法解散、被依法撤销或被依法宣告破产的；
- 6、投资顾问依法解散、被依法撤销或被依法宣告破产的。
- 7、资产委托人提前 10 个交易日书面通知资产管理人和资产托管人，经资产管理人和资产托管人书面同意，终止本合同的；
- 8、计划持有的定向增发股票上市流通并全部变现后，资产管理人可提前终止合同。
- 9、合同生效后，本计划未能成功投资非公开发行股票时，资产管理人决定终止合同的
- 10、法律法规和本合同规定的其他情形。

（六）资产管理人应当在 5 个工作日内将签订的资产管理合同报中国证监会备案。对本合同任何形式的变更、补充，资产管理人应当在变更或补充发生之

日起 5 个工作日内报中国证监会备案。

十八、清算程序

（一）清算组的成立及三方当事人职责

自合同终止之日起，资产管理人和资产托管人组成清算组，负责委托财产的保管、清理、估价、变现、确认和分配，具体职责如下：

1、资产委托人

（1）确认清算方案，收到后 3 个工作日内未提出书面异议的，资产管理人及资产托管人按照清算方案开展工作；

（2）确认清算报告，收到清算报告后 3 个工作日内未提出书面异议的（合同另有约定的按合同约定执行）表示接受。

2、资产管理人

（1）资产变现；

（2）除交易所、银行等自动扣收的费用外，对清算期间资金支付出具划款指令；

（3）清算期间的会计核算；

（4）编制清算报告并签章；

（5）配合资产托管人办理账户注销工作；

（6）与资产管理人义务相关的其他职责。

3、资产托管人

（1）清算期间的财产保管；

（2）出具进入清算环节的委托财产清单；

（3）复核资产管理人划款指令，进行资金划付；

（4）委托财产资金、证券等账户的注销；

（5）清算期间发生资金变动的当日，提供日终资金调节表；

（6）复核资产管理人出具的清算报告并签章；

（7）与资产托管人义务相关的其他职责。

（二）清算程序

1、合同终止

资产管理人、资产托管人根据合同约定或业务操作实际情况对资产委托人提出的合同到期终止或提前终止申请进行书面确认,资产管理人和资产托管人在收到资产委托人的终止确认函后进行盖章确认。本合同的终止日根据以下情形进行确认:

(1) 对于合同到期终止的情形,以合同到期日为本合同的终止日;

(2) 对于合同提前终止的情形,自资产管理人和资产托管人盖章确认后的下一自然日,作为本合同的终止日。

如本项规定的本合同的终止日为非工作日的,则自动顺延至其后的第一个工作日。

2、确认进入清算环节的财产状况

(1) 合同终止日起 2 个工作日内,资产管理人应出具加盖业务章的合同终止前最后一个自然日委托财产资产负债表、利润表,资产托管人应进行复核确认并加盖业务章回传资产管理人。

(2) 合同终止日起 3 个工作日内,资产托管人出具合同终止前最后一个自然日财产清单,列示该委托财产在资产托管人处托管的证券、资金等财产余额,并加盖业务章传真至资产管理人。

3、资产的变现

合同终止后,委托财产不应仍持有可流通非现金资产,如遇特殊情况,委托财产仍持有可流通非现金资产的,在 3 个交易日内(含合同终止日当日)由资产管理人进行强制变现处理;委托财产持有的流通受限证券,如未到期回购、未上市新股或休市、停牌、暂停交易的证券等,自限制条件解除日起(含解除当日)2 个交易日内完成变现。资产委托人应接受上述由于资产变现产生的收益或损失。

4、向资产委托人支付部分清算财产

合同终止日起 3 个工作日内,按合同终止时委托财产的资产负债情况,由资产管理人向资产托管人出具划款指令,资产托管人复核无误后,向资产委托人支付部分清算财产,计算方法为:

(1) 由资产托管人匡算合同终止的下一月及下一季度需冻结的结算备付金及交易保证金,并以双方认可的方式提供资产管理人,由资产管理人进行复核。

(2) 按合同终止时库存银行存款扣除账面应付款项、扣除下月或下季度需增加冻结的结算备付金及交易保证金，并预提 10 万元清算备用资金后向资产委托人支付首期清算款。

若委托财产后续清算，出现账面剩余资产不足以支付相关负债的，委托人有义务于收到资产管理人、资产托管人联合发出的收款通知后当日内将款项补足。如遇资产委托人未及时补足该款项的情形，由资产管理人负责向资产委托人进行追讨。

5、清理委托财产债权、债务

委托财产债权主要包括应收银行存款、备付金利息等，于相应账户注销时结清，资产托管人另有规定的以其规定为准，金额一般以开户银行实际支付金额为准。

委托财产债务主要包括委托财产应付管理费、托管费、券商佣金、证券变现交易费用、银行费用、销户费用等等。除交易所、登记公司等自动扣缴的费用外，所有清偿由资产管理人、资产托管人核对无误后，由资产管理人向资产托管人出具划款指令，由资产托管人复核后办理支付。原则上委托财产债务清偿应于合同终止后 30 个工作日内完成。

管理费、托管费计提规则是以当日资产净值为基数在下一日计提，对于合同最后一日费用则以当日资产净值为基数在当日计提。合同终止后按合同相关条款约定可继续计提管理费、托管费的，按合同约定执行。

6、确认主要清算事项完成后的财产状况，出具清算报告。

主要清算事项完成的标志是：

(1) 非现金资产变现完成；

(2) 除按登记公司、资产托管人清算规则要求暂不能完成的销户、备付金、保证金解冻等事项外（详见（三）清算未结事项），应付管理费、托管费、交易费用等债务清偿完成；

资产管理人应于主要清算事项完成后的 10 个工作日内编制清算报告并加盖业务章传真给资产托管人，资产托管人于 5 个工作日内完成复核，加盖业务章回传资产管理人，由资产管理人向资产委托人提交。资产管理人向资产委托人提交清算报告后 3 个工作日内资产委托人未提出书面异议的，表示资产委托人接受此

报告。

（三）清算未结事项

由于登记公司最低备付金、交易保证金制度及资产托管人清算规则的影响，以下作为清算未结事项：

1、委托财产账户销户

委托财产证券资产完成变现后，资产托管人负责证券账户和资金账户的销户工作，销户过程中资产管理人、资产委托人应给予必要的配合。证券账户和资金账户的销户原则上应于收到资产管理人、资产委托人提供资料后的 10 个工作日内完成。

2、备付金账户、保证金账户的销户及剩余财产支付

对于在备付金账户、保证金账户中剩余财产按照中国证券登记结算有限责任公司相关政策执行，最长于合同终止后 2 个季度可以完成清理。备付金账户利息以登记公司实际支付为准。利息结清后，资产托管人向资产管理人提供书面确认数据，由资产管理人向资产托管人出具划款指令，资产托管人复核无误后，向资产委托人支付所有剩余财产，并于当日注销该委托财产备付金账户和保证金账户。剩余财产支付过程中发生的银行费用，由资产委托人负担。向资产委托人支付的资金账户利息，以销户时账户开户银行实际支付为准。

3、资产托管人完成上述未结事项后，以书面传真或电子邮件的方式，通知资产委托人实际划付的金额，并抄送给资产管理人。

4、备付金、保证金账户内剩余资产清理时间表

剩余财产所在 账户名称	剩余财产清理条件	清理最长完成时间
备付金账户	每月初调整，上月没有买入交易，最低备付金调整至零，可销户	合同终止后 2 个月
保证金账户	上月没有交易，席位保证金调整至零，可销户	完成所有资产变现后 4 个月

5、账户销户时间表

账户类别	销户条件	销户最长完成时间
交易所股东账户	账户内资产全部变现	变现后可申请销户
银行间账户	账户内资产全部变现	变现后可申请销户

备付金账户、保证金账户	备付金账户、保证金账户中剩余财产全部清理完成，上一结息日至销户日利息结清	完成所有资产变现后 2 个季度
-------------	--------------------------------------	-----------------

十九、违约责任

(一) 因本合同当事人的违约行为造成本合同不能履行或者不能完全履行的，由违约的一方承担违约责任；如属当事人双方或多方当事人的违约，根据实际情况，由违约方分别承担各自应负的违约责任。但是发生下列情况，当事人应当免责：

- 1、不可抗力；
2. 计算机系统故障、网络故障、通讯故障、电力故障、计算机病毒攻击及其它非资产管理人、资产托管人故意造成的意外事故；
- 3、资产管理人及/或资产托管人按照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；
- 4、资产管理人按照本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；
- 5、资产委托人未能事前向资产管理人及资产托管人履行信息披露义务（如告知关联证券或其他禁止交易证券等），致使发生违规投资行为的，资产管理人与资产托管人均不承担任何责任，资产委托人需就资产管理人与资产托管人由此遭受的损失承担赔偿责任。

(二) 资产管理人、资产托管人在履行各自职责的过程中，违反法律法规的规定或者本合同约定，给委托财产或者资产委托人造成损害的，应当分别对各自的行为依法承担赔偿责任；因共同行为委托财产或者资产委托人造成损害的，应当承担连带赔偿责任。

(三) 在发生一方或多方违约的情况下，在最大限度地保护资产委托人利益的前提下，本合同能够继续履行的应当继续履行。非违约方当事人在职责范围内有义务及时采取必要的措施，防止损失的扩大。没有采取适当措施致使损失进一步扩大的，不得就扩大的损失要求赔偿。非违约方因防止损失扩大而支出的合理

费用由违约方承担。

（四）一方依据本合同向另一方赔偿的损失，仅限于直接损失。

二十、争议的处理

（一）对于因本合同的订立、内容、履行和解释或与本合同有关的争议，合同当事人应尽量通过协商解决；协商不成的，各方一致同意提请广东证券期货业协会进行调解。调解不成的，应提交广州金融仲裁院根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为广州，仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力，仲裁费由败诉方承担。争议处理期间，合同当事人应恪守各自的职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行资产管理合同规定的义务，维护资产委托人的合法权益。

（二）本合同适用中华人民共和国法律并依据其解释。

二十一、其他事项

如将来中国证监会对资产管理合同的内容与格式有其他要求的，资产委托人、资产管理人和资产托管人应立即展开协商，根据中国证监会的相关要求修改本合同的内容和格式。

本合同如有未尽事宜，由合同当事人各方按有关法律法规和规定协商解决。本合同一式陆份，资产管理人，资产委托人，资产托管人各执贰份，每份具有同等的法律效力。

承诺函

本人/本机构声明委托财产为本人/本机构拥有合法所有权或处分权的资产，保证委托财产的来源及用途符合国家有关规定，特别地，保证与本资产管理计划参与的定向增发的股票的发行人无关联关系。保证有完全及合法的授权委托资产管理人和资产托管人进行委托财产的投资管理和托管业务。

本人/本机构承诺委托财产全部为自有资金，资金来源合法合规，承诺在首钢股份（代码：000959）非公开发行获得证监会核准后，根据资产管理人的通知按时足额将委托资金划拨到托管账户。

本人/本机构承诺委托财产不存在直接或间接来源于本计划拟认购的首钢股份的发行人及其关联方（包括但不限于：发行人的控股股东、实际控制人或其控制的关联人、董事、监事、高级管理人员、主承销商、法律顾问、会计师、土地评估师、资产评估师等中介机构及前述各中介机构项目主办、经办人员及与上述机构与人员存在关联关系的关联方等）的情况。

本人/本机构声明已充分理解本合同全文，了解相关权利、义务及该投资组合的风险收益特征，愿意承担依据有关法律法规并按照与资产管理人及资产托管人之间协议约定相应的投资风险，（特别是：如参与的定向增发的股票价格大幅下跌，可能造成委托人的本金损失，以及如果发生非公开发行股票在合同终止时因故停牌等情形，可能导致委托人不能及时变现的流动性风险；），本委托事项符合本人/本机构业务决策程序的要求；本人/本机构承诺向资产管理人提供的有关投资目的、投资偏好、投资限制和风险承受能力等基本情况真实、完整、准确、合法，不存在任何虚假、重大遗漏或误导。前述信息资料如发生任何实质性变更，本人/本机构应当及时书面告知资产管理人或销售机构。

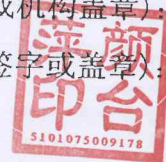
本人/本机构承诺充分知晓资产管理人不承担调查所投资对象的风险控制能力、对投资项目进行尽职调查是否充分、后期管理措施是否得当的义务，也不对投资对象的财产状况、经营状况、资信状况等承担责任，本人/本机构承诺自行承担投资风险。

本人/本机构承认，资产管理人、资产托管人未对委托财产的收益状况作出任何承诺或担保，资产管理合同约定的业绩比较基准仅是投资目标而不是资产管理人的保证。

本人/本机构指定并授权资产管理人代表资产管理计划聘请上海朱雀秦兵投资有限公司作为本计划的投资顾问,授权上海朱雀秦兵投资有限公司提供投资建议进行投资管理,同意自行承担由此产生的风险,因此产生的一切投资风险与资产管理人及资产托管人无关。

资产委托人(自然人签字或机构盖章):

法定代表人或授权代表(签字或盖章):



日期: 年 月 日

(本页无正文, 为金鹰穗通定增 57 号资产管理计划资产管理合同签署页)

资产委托人:

自然人(签字):



法人或其他组织(盖章):

法定代表人或授权代表(签字):

签署日期: 年 月 日

签署日期: 年 月 日

资产管理人: 金鹰基金管理有限公司(章)

法定代表人或授权代表:



凌家华

资产托管人: 中国工商银行股份有限公司广东省分行营业部(章)



负责人或授权代表:



签署日期: 年 月 日

附件一

委托财产起始运作通知书

致：管理人及委托人：

根据三方共同签署的《金鹰穗通定增 57 号资产管理计划资产管理合同》，金鹰基金管理有限公司担任本委托资产的管理人， 年 月 日，委托人已将初始委托资产（初始委托资产明细见附表）转入本委托资产开立的委托资产专用账户中，本委托资产已经具备正式投资运作的条件。

请贵委托人及管理人收到本通知后，向本托管人签章确认已收悉本通知，委托人及管理人签收后回传托管人并与其确认收到后的当个工作日（若非同日确认，以最后一方确认日的当个工作日）作为资产委托起始日。

附：初始委托资产明细表如下，其中

现金资产：人民币 元（大写人民币 元正）

托管人：中国工商银行股份有限公司广东省分行营业部

年 月 日

回 执

致：托管人

本委托人、本管理人向委托人确认已收悉《委托资产起始运作通知书》，对通知书中所列初始委托资产的金额等事项无异议。同时，本委托人确认，以管理人/托管人确认签收本回执的当日（若非同日常收，以最后一方签收日的当日）作为资产委托起始日。

委托人：

年 月 日

管理人：金鹰基金管理有限公司（业务盖章）

年 月 日

附件二

委托资产追加确认书

致：管理人及委托人

根据三方共同签署的《金鹰穗通定增 57 号资产管理计划资产管理合同》，金鹰基金管理有限公司担任本委托资产的管理人， 年 月 日，委托人已将追加委托资产追加委托资产（明细见附表）转入本委托资产开立的委托资产专用账户中。

请贵委托人及管理人收到本通知后，向本托管人签章确认已收悉本通知，经管理人/委托人签收后回传委托人并与其确认收到后的当个工作日（若非同日确认，以最后一方确认日的当个工作日）计入委托资产并开始运作。

附：追加委托资产明细表如下，其中

现金资产：人民币 元（大写人民币 元正）

托管人：中国工商银行股份有限公司广东省分行营业部

年 月 日

回 执

致：托管人

本委托人、本管理人向委托人确认已收悉《委托资产追加确认书》，对通知书中所列追加委托资产的金额等事项无异议。同时，本委托人确认，以管理人/托管人确认签收本回执的当日（若非同日签收，以最后一方签收日的当日）作为追加资产进入委托资产之日。

委托人：

年 月 日

管理人：金鹰基金管理有限公司（业务盖章）

年 月 日

附件三

委托资产提取通知书

致：管理人并托管人

本委托人将于 年 月 日提取委托资产现金资产人民币¥ 元(大写人民币 元整)。管理人签收后回传委托人并与其确认收到。

本期委托资产划出账户信息如下：

户名：

账号：

开户行：

委托人：【预留印鉴】

年 月 日

回 执

尊敬的委托人：

本管理人确认已收悉委托人于 年 月 日向我方发送的《委托资产提取通知书》，本管理人将于 年 月 日之前向委托人指定账户返还上述金额的委托资产。

金鹰基金管理有限公司

年 月 日

附件四 预留印鉴样本

金鹰基金管理有限公司（作为管理人）、中国工商银行股份有限公司广东省分行营业部（作为托管人）与成都嘉恒达商贸有限公司（作为委托人）已签署《金鹰穗通定增 57 号资产管理计划资产管理合同》。以下为委托人、管理人和托管人的预留印鉴，该印鉴用于《委托资产起始运作通知书》、《委托资产追加通知书》、《委托资产提取通知书》等本合同项下相关文件的盖章。

合同当事人任一方更改预留印鉴，必须提前至少一个交易日，使用传真方式或邮件形式向其他合同当事人发出加盖公章的授权变更文件，同时电话通知其他合同当事人，其他合同当事人收到变更通知当日通过录音电话向变更预留印鉴的一方确认。授权变更文件应载明生效日期。变更预留印鉴的一方在此后三日内将授权变更文件的正本送交其他合同当事人。更换授权变更文件生效后，对于已被撤换的人员无权发送的指令，或被改变授权人员超权限发送的指令，变更预留印鉴的一方不承担责任。

委托人预留印鉴	管理人预留印鉴	托管人预留印鉴
(用章样本)	(用章样本)	(用章样本)

委托人（公章）：

年 月 日

管理人（公章）：

年 月 日

托管人（公章）：

年 月 日

