

合同编号：

东证融汇齐心共赢 5 号  
集合资产管理计划  
资产管理合同

二〇一六年四月

# 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.....           | 6                |
| 五、集合计划的参与和退出.....              | 9                |
| 六、管理人自有资金参与集合计划.....           | 15               |
| 七、集合计划的分级.....                 | 16               |
| 八、集合计划客户资产的管理方式、管理权限和运作方式..... | 19               |
| 九、集合计划的成立.....                 | 19               |
| 十、集合计划账户与资产.....               | 20               |
| 十一、集合计划资产托管.....               | 21               |
| 十二、集合计划的估值.....                | 21               |
| 十三、集合计划的费用.....                | 26               |
| 十四、集合计划的收益分配.....              | 27               |
| 十五、投资理念与投资策略.....              | 28               |
| 十六、投资决策与风险控制.....              | 29               |
| 十七、投资限制及禁止行为.....              | 29               |
| 十八、集合计划的信息披露.....              | 34               |
| 十九、集合计划份额的转让、非交易过户和冻结.....     | 36               |
| 二十、集合计划的展期.....                | 37               |
| 二十一、集合计划终止和清算.....             | 37               |
| 二十二、当事人的权利和义务.....             | 39               |
| 二十三、违约责任与争议处理.....             | 43               |
| 二十四、风险揭示.....                  | 45               |
| 二十五、合同的成立与生效.....              | 51               |
| 二十六、合同的补充、修改与变更.....           | 52               |
| 二十七、其他事项.....                  | 53               |
| 附件一：募集资金合法的说明.....             | <b>错误！未定义书签。</b> |

## 一、前言

为规范东证融汇齐心共赢 5 号集合资产管理计划（以下简称“集合计划”或“计划”）运作，明确《东证融汇齐心共赢 5 号集合资产管理计划资产管理合同》（以下简称“本合同”）当事人的权利与义务，依照《中华人民共和国合同法》、《证券公司客户资产管理业务管理办法》（以下简称《管理办法》）、《证券公司集合资产管理业务实施细则》（以下简称《实施细则》）等有关法律法规及中国证券业协会《证券公司客户资产管理业务规范》（以下简称《规范》）等自律性文件的规定，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《管理办法》、《细则》、《东证融汇齐心共赢 5 号集合资产管理计划说明书》（以下简称《说明书》）、本合同及其他有关规定享有权利、承担义务。

委托人承诺以真实身份参与集合计划，保证委托资产的来源及用途合法，所披露或提供的信息和资料真实，并已阅知本合同和集合计划说明书全文，了解相关权利、义务和风险，自行承担投资风险和损失。

管理人承诺以诚实守信、审慎尽责的原则管理和运用本集合计划资产，但不保证本集合计划一定盈利，也不保证最低收益。

托管人承诺以诚实守信、审慎尽责的原则履行托管职责，安全保管客户集合计划资产、办理资金收付事项、监督管理人投资行为，但不保证本集合计划资产投资不受损失，不保证最低收益。

## 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、本集合计划、集合计划：指东证融汇齐心共赢 5 号集合资产管理计划；

集合计划说明书、说明书：指《东证融汇齐心共赢 5 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《东证融汇齐心共赢 5 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《东证融汇齐心共赢 5 号集合资产管理计划托管协议》及对该

协议的任何有效修订和补充；

风险揭示书：指《东证融汇齐心共赢 5 号集合资产管理计划风险揭示书》；

《管理办法》：指 2013 年 6 月 26 日中国证监会发布并施行的《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 日中国证监会发布并施行的《证券公司集合资产管理业务实施细则》；

《员工持股计划指导意见》、《指导意见》：指 2014 年 6 月 20 日证监会公布并于公布之日起施行的《关于上市公司实施员工持股计划试点的指导意见》（证监会公告[2014]33 号）

法律法规：指中国现时有效并公布实施的法律、行政法规、行政规章及规范性文件、地方法规、地方规章及规范性文件；

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：指受集合资产管理合同约定，根据集合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【东证融汇证券资产管理有限公司】，也简称为“东证融汇”；

集合计划托管人、托管人：指中国民生银行股份有限公司】，也简称为“民生银行”；

推广机构：指符合相应资格条件的、经管理人委托的、代理推广本集合资产管理计划的机构；

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东证融汇证券资产管理有限公司；

合格投资者：指具备相应风险识别能力和承担所投资集合资产管理计划风险能力且符合下列条件之一的单位和个人：

- 1) 个人或者家庭金融资产合计不低于 100 万元人民币；
- 2) 公司、企业等机构净资产不低于 1000 万元人民币。

委托人：指依据集合资产管理合同和集合计划说明书参与本集合计划的投资人，包括个人投资者和机构投资者；

个人投资者：指具备相应风险识别能力和承担所投资集合资产管理计划风

险能力且个人或者家庭金融资产合计不低于 100 万元人民币的个人投资者；

机构投资者：具备相应风险识别能力和承担所投资集合资产管理计划风险能力且净资产不低于 1000 万元人民币的公司、企业等机构投资者；

份额持有人、持有人：指通过签订集合资产管理合同而依法取得和持有本集合计划份额的委托人；

集合计划分级：指本计划通过资产及风险收益特征的不同，将计划份额分成预期收益与预期风险不同的三个类别，即优先级份额、次 1 级份额和次 2 级份额；

优先级份额：指本集合计划份额按合同约定规则所分离的优先级份额，指按本合同约定，集合计划收益分配和终止清算时，资产分配顺序位于次级份额之前并享有预期年化收益率的份额；

次级份额：指本集合计划份额按合同约定规则所分离的次级份额（次 1 级份额和次 2 级份额）；

优先级委托人：指认购或申购本集合计划优先级份额的参与者；

次级委托人：指认购或申购本集合计划次级份额（次 1 级份额和次 2 级份额）；的参与者；

差额付款人：指深圳市齐心控股有限公司；

集合计划成立日：指集合计划经过推广达到集合资产管理合同和说明书规定的成立条件后，管理人通告集合计划成立的日期；

推广期：指集合计划自开始推广到推广完成之间的时间段，推广期具体时间见有关公告；

推广期截止日：指推广期内接受委托人参与申请的最后一日；

开放期：委托人办理参与、退出业务的日期。开放期的具体日期以管理人公告为准；

开放日：指开放期内的每个工作日；

元：中国法定货币人民币，单位“元”；

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；

T 日：指办理本集合计划业务申请的工作日；

T+n 日（n 指任意正整数）：指 T 日后的第 n 个工作日；

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：指委托人申请购买本集合计划份额的行为；

首次参与：指委托人在参与之前未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：单个开放日，委托人当日累计净退出申请份额等额的资金超过集合计划项下能够用于兑付退出申请的现金类资产总额时，即为巨额退出；

集合计划收益：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；

计划单位面值、单位面值：人民币 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；

计划单位净值、单位净值、份额净值：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；

标的股票：指本集合计划所投资的上市公司股票，本计划特指深圳齐心集团股份有限公司（股票代码：002301）；

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；不可抗力是指本合同当事人无法预见、无法克服、无法避免，且在本合同签署之后发生的，使本合同当事人无法全部或部分履行本合同的任何事件，包括但不限于相关法律法规的变更；国际、国内金融市场风险事故的发生；战争或动乱、自然灾害、公众通讯设备故障、电力中断、互联网故障等。

管理人信息披露平台：指 [www.nesc.cn](http://www.nesc.cn)。

### 三、合同当事人

委托人

个人填写:

姓名: 证件类型: 证件号码:

通信地址: 邮政编码:

联系电话: 移动电话:

电子信箱: 其他:

机构填写:

机构名称:

法定代表人:

通信地址: 邮政编码:

联系电话: 传真:

资产委托人认购的份额类别:

☐ 优先级份额

☐ 次 1 级份额

☐ 次 2 级份额

资产委托人退出计划的划入账户信息如下:

账户名称:

账号:

开户银行名称:

管理人

机构名称：东证融汇证券资产管理有限公司

法定代表人：陈健

通信地址：上海市浦东新区源深路 305 号

邮政编码: 200135

联系电话: 021-20361067

托管人

机构名称：中国民生银行股份有限公司

法人代表：洪崎

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号

邮政编码：100031

联系电话：010-58560666

## 四、集合资产管理计划的基本情况

（一）名称：东证融汇齐心共赢 5 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

集合计划成立时的规模预计不超过：

（大写）人民币叁亿贰仟万元整：（小写）¥32,000 万元（以集合计划成立时的实际募集资金金额为准）。

其中，优先级份额预计为：

（大写）人民币壹亿陆仟万元整：（小写）¥16,000 万元，具体以优先级份额委托人实际交付的资金为准；

次级（次 1 级和次 2 级）份额预计为：

（大写）人民币壹亿陆仟万元整：（小写）¥16,000 万元，其中次 1 级 8000 万元，次 2 级 8000 万元，具体以次级（次 1 级和次 2 级）份额委托人实际交付的资金为准；

集合计划资金以委托人实际交付给管理人的资金为准，但次级（次 1 级和次 2 级）份额资金不少于（大写）人民币壹亿陆仟万元整：（小写）¥16,000 万元，且优先级份额资金和次级（次 1 级和次 2 级）份额资金成立时的比例不高于 1：1。

（四）投资范围

本资产管理计划仅限投资于深圳齐心集团股份有限公司【员工持股计划】认购的“齐心集团”股票，且认购标的股票的数量须低于标的股票总股本的 5%；

如股票认购完成后，资产管理计划募集资金有剩余，剩余资金仅限投资于现金及等价物（银行存款、货币市场基金、债券逆回购）。

本资产管理计划如通过大宗交易买入标的股票，则买入价格须不高于买入日前一交易日收盘价的 92%；本资产管理计划如通过大宗交易卖出标的股票，则卖出价格须不低于卖出日前一交易日收盘价的 90%。委托人在此同意并授权管理人可以将集合计划的资产投资于管理人及与管理人有关关联方关系的公司发行的证券或承销期承销的证券或者从事其他重大关联交易，但投资产品种类仅限于“齐心集团”股票、银行存款、货币市场基金、债券逆回购，管理人将遵循客户利益优先原则，在发生上述所列投资证券事项时，管理人按照法律法规及中国证监会的有关规定，应当将交易结果告知托管人，同时向证券交易所报告，通过资产管理季度报告向委托人披露。

如因一级市场申购发生投资比例超标，应自申购证券可交易之日起 10 个交易日内将投资比例降至许可范围内；如因证券市场波动、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。

本集合计划发行前，若标的股票在交易所或证监会的信息披露内容出现重大不利信息（包括但不限于标的股票被摘牌或非正常原因被强制性停牌、年度业绩亏损、公告业绩预亏、涉及重大诉讼、高级管理人员及或实际控制人外逃或涉案、标的股票公司受被证券监管部门及或交易所采取监管措施、处罚或谴责等将对标的股票股价产生严重不利影响的公开信息），优先级委托人有权决定是否继续投资本集合计划。

#### （五）管理期限

管理期限为不超过 18 个月，经协商一致，本集合计划可以提前终止，提前终止条件可见“二十一、集合计划终止和清算”。

#### （六）推广期、封闭期、开放期及流动性安排

##### 1、推广期

本集合计划的具体推广期以管理人的推广公告为准。

##### 2、封闭期

本集合计划除开放期以外的时期为封闭期，不接受委托人参与、退出。

### 3、开放期

如果本集合计划合同变更、展期或者其他管理人认为需要委托人进行资金参与或退出情形时，管理人有权临时设置开放期，开放期的具体时间、可办理的业务类型（参与或退出）等具体安排由管理人确定，并至少提前 1 个工作日在管理人信息披露平台公布。如果涉及合同变更、展期，公告事宜按照合同变更、展期通知时间等条款的要求执行。

### 4、流动性安排

集合计划可办理退出业务的开放日须保证集合计划账户中现金类资产占比不低于资产净值的 5%。

#### （七）集合计划份额面值

人民币 1.00 元。

#### （八）参与本集合计划的最低金额及人数限制

首次参与的最低金额为人民币 100 万元，追加参与的最低金额为人民币 1 万元。

本集合计划接受委托人人数不超过 200 人。

#### （九）本集合计划的风险收益特征及适合推广对象

由于本集合计划资产及收益的分配安排，本集合计划的优先级属于低风险产品，适合风险承受能力较低，追求稳健投资收益的投资者；本集合计划的次 1 级属于中风险产品，适合风险承受能力适中，追求中等预期收益的投资者；本集合计划的次 2 级属于高风险产品，适合风险承受能力较高，追求高预期收益的投资者。同时，适合的投资者是产品推广机构评定的与产品风险等级相匹配的合格投资者。

#### （十）本集合计划的推广

##### 1、推广机构：

东北证券股份有限公司。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。若管理人认为有必要变更代理推广机构的，委托人及托管人同意管理人在管理人信息披露平台公告后即变更生效。

##### 2、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，以纸质资料方式置备于推广机构营业场所。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，引导客户审慎做出投资决定。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、中国证券投资基金业协会、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，但不得向合格投资者之外的单位和个人募集资金，不得通过报刊、电台、电视台、互联网等公众传播媒体或者讲座、报告会、分析会等方式向不特定对象宣传推介。

#### （十一）本集合计划的各项费用

- 1、参与费：优先级 0%； 次级 0%；
- 2、退出费：无；
- 3、管理费：0.3%/年；
- 4、托管费：0.05%/年；
- 5、证券交易费用
- 6、与本集合计划存续期相关的费用
- 7、其他费用

上述费用的计算详见“五、集合计划的参与和退出”以及“十三、集合计划的费用”。

## 五、集合计划的参与和退出

### （一）集合计划的参与

委托人参与和退出集合计划的确认、清算由管理人负责，本集合计划的注册登记机构是东证融汇证券资产管理有限公司。

#### 1、参与对象

参与对象应当是具备相应风险识别能力和承担所投资集合资产管理计划风险的能力，且符合下列条件之一的单位和个人：

(1) 净资产不低于 1000 万元的单位；

(2) 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。

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。依法设立并受监管的各类集合产品视为单一合格投资者。

本集合计划次 2 级份额仅限【员工持股计划】中规定的标的股票上市公司的董事、监事、高管及员工发起的合法合规的持股计划进行认购。

## 2、参与的办理时间

### (1) 推广期参与

本集合计划的具体推广期以管理人的推广公告为准。管理人有权根据实际募集情况，决定延长或提前结束推广期。

### (2) 存续期参与

如果本集合计划合同变更、展期或者其他管理人认为需要委托人进行资金参与或退出情形时，管理人有权临时设置开放期，开放期的具体时间、可办理的业务类型（参与或退出）等具体安排由管理人确定，并至少提前 1 个工作日在管理人信息披露平台公布。如果涉及合同变更、展期，公告事宜按照合同变更、展期通知时间等条款的要求执行。

投资者在以上可办理参与业务的开放期内可以办理相应份额的参与业务。

## 2、参与的原则

(1) 委托人参与本集合计划，应当是合格投资者；

(2) 在推广期内，委托人以集合计划的面值（1.00 元/份额）参与；存续期内，开放期内参与价格为参与当日的相应份额单位净值；

(3) 采用金额参与的方式，即以参与金额申请；

(4) 本集合计划接受客户人数 200 人以下；

(5) 在推广期内，当集合计划募集规模接近或达到人数限制时，管理人将自次日起暂停接受参与申请；同时，存续期内管理人可以根据参与情况宣布提前结束或延期结束开放期；

(6) 本集合计划以次级份额余额（次级份额余额不得少于人民币 16500 万元）为基准，在优先级和次级份额配比不超过 1:1 且不超过人数限制的范围内对优先级份额的参与申请进行确认。在超出上述范围的当日，以份额配比限制或人数限制为上限，按“时间优先”的原则，来确定参与成功的份额，参与时间以注册登记系统的确认结果为准。此集合计划参与原则更改将遵循合同变更的相关程序。

本合同以书面方式签署，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，以书面签名方式签署本合同即表明委托人完全接受本合同项下的全部条款，同时本合同成立。

### 3、参与的程序和确认

(1) 投资者按推广机构指定营业网点的具体安排，在规定的交易时间段内办理；

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

(3) 投资者签署本合同后，方可通过推广机构的交易系统申请参与集合计划。参与申请经管理人确认后，构成本合同的有效组成部分；

(4) 投资者参与申请确认后，其参与申请和参与资金不得撤销；

(5) 投资者推广期参与的，可于计划成立后 2 个工作日内到办理参与的营业网点查询参与确认情况；存续期内，可于参与日后 2 个工作日内到办理参与的场所查询参与确认情况；

(6) 委托人同意，参与申请的情况以管理人确认的结果为准。

### 4、参与费及参与份额的计算

#### (1) 参与费率

优先级 0%；次级 0%。

#### (2) 参与份额的计算方法

##### 1) 推广期参与

参与份额 = (申请参与总金额 - 参与费) ÷ 面值

参与份数保留小数点后两位，小数点后第三位四舍五入。

##### 2) 存续期参与

参与份额=（申请参与总金额－参与费）÷对应份额单位净值

委托人参与份额以四舍五入的方法保留小数点后两位，由此产生的差额部分计入集合计划资产的损益。

#### 5、推广期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不转为份额，计入集合计划资产，利息金额以集合计划注册登记机构的记录为准。

#### 6、拒绝或暂停参与的情况及处理方式

如出现如下情形，集合计划管理人可以拒绝或暂停集合计划委托人的参与申请：

- （1）不可抗力的原因导致集合计划无法正常运作；
  - （2）本集合计划出现或可能出现超额募集情况；
  - （3）集合计划管理人、集合计划托管人或注册登记机构的技术保障或人员支持等不充分；
  - （4）推广机构对委托人资金来源表示疑虑，委托人不能提供充分证明的；
  - （5）集合计划管理人认为会有损于现有集合计划委托人利益；
  - （6）本集合计划优先级份额和次级份额的配比已超过份额配比上限；
  - （7）本集合计划的委托人超过 200 名；
  - （8）法律法规规定或中国证监会认定的其它可暂停参与的情形；
- 以上暂停参与情形除第（4）项外，集合计划管理人应当进行公告。

### （二）集合计划的退出

#### 1、退出的办理时间

退出在可办理退出业务的开放期内办理，退出业务开放期以管理人公告为准。

业务办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间。若出现新的证券交易市场或其他特殊情况，管理人有权视情况对前述退出办理的日期及时间进行相应的调整并通过管理人信息披露平台公告。

#### 2、退出的原则

- （1）“未知价”原则，即退出集合计划的价格以退出申请日（T 日）该类份

额的单位净值为基准进行计算；

(2) 采用份额退出的方式，即退出以份额申请；

(3) “先进先出”原则，委托人在退出集合计划份额时，按先进先出的原则进行处理，即先确认的份额先退出，后确认的份额后退出；

(4) 委托人单笔退出本集合计划不设最低份额限制；委托人部分退出集合计划份额时，如其该笔退出完成后在该推广机构剩余的集合计划份额低于 1 万份时，则管理人自动将该委托人在该推广机构的集合计划全部份额退出给委托人。

(5) 委托人可将其部分或全部集合计划份额退出。

### 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，在本集合计划开放期的业务办理时间内向推广机构网点提出退出申请。申请退出份额数量超过委托人持有份额数量时，申请无效。

#### (2) 退出申请的确认

管理人在委托人提出退出申请的下一个工作日对该交易的有效性进行确认。巨额退出和单个委托人大额退出的情形按本合同具体的约定办理。

#### (3) 退出款项划付

若注册登记机构确认委托人退出申请成功，退出款项将在退出申请确认后 3 个工作日内划拨至委托人账户。如集合计划出现暂停估值的情形时，管理人与托管人协商后，可以将划拨日期相应顺延。

### 4、退出费及退出份额的计算

#### (1) 退出费用

本集合计划无退出费用。

#### (2) 退出金额的计算方法

本集合计划退出时以相应份额退出申请受理日（T 日）单位净值作为计价基准进行退出金额计算。退出金额的计算公式如下：

退出金额 = T 日相应份额单位净值 × 退出份额

上述计算结果均以四舍五入的方法保留小数点后两位，由此产生的差额部分计入集合计划资产的损益。

## 5、退出的限制与次数

持有本集合计划份额的委托人仅可在可办理退出业务的开放期内申请退出（若发生巨额退出，管理人决定推迟退出安排或拒绝接受退出申请的除外），退出的次数无限制。

## 6、单个委托人大额退出的认定、申请和处理方式

### （1）单个委托人大额退出的认定

大额退出指单个委托人从本集合计划中一次退出份额达到或超过 300 万份（含 300 万份）。

### （2）单个委托人大额退出的申请和处理方式

大额退出委托人需在退出日的前 5 个工作日提出预约申请，否则管理人和推广机构有权拒绝其退出申请。

## 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等额的资金超过集合计划项下能够用于兑付退出申请的现金类资产总额时，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，根据集合计划当时的资产组合状况，委托人当日累计净退出申请份额等额的资金超过集合计划项下能够用于兑付退出申请的现金类资产总额，管理人有权推迟集合计划的本次退出安排，直至集合计划项下现金类资产能够用于兑付退出申请时，退出价格为实际办理退出当天的单位净值。

### （3）告知委托人的方式

发生巨额退出并采用超额部分延期退出时，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，管理人可按说明书及资产管理合同载明的规定，推迟退出安排或拒绝接受退出申请；已经接受的退出申请可以延缓支付退出

款项，但须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转；
- （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出现困难时，管理人可以暂停接受集合计划的退出申请；
- （5）发生巨额退出或连续巨额退出的情形；
- （6）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且中国证监会无异议的特殊情形。

## 六、管理人自有资金参与集合计划

本集合计划约定，管理人可以以自有资金参与次 1 级的份额认购。

#### 1、自有资金的参与方式和金额

推广期内，管理人可以以自有资金参与次 1 级的份额认购。

#### 2、自有资金的收益分配

管理人自有资金参与份额按合同约定享有次 1 级委托人持有计划份额享有的参与收益分配的权利。

#### 3、自有资金责任承担方式和金额

在本集合计划存续期间，管理人以其初始认购的次 1 级的资金为限承担有限责任。

#### 4、自有资金退出的条件

管理人于推广期认购的次 1 级份额的自有资金在集合计划存续期内不退出。因集合计划规模变动等客观因素导致自有资金参与集合计划被动超限退出部分除外。

#### 5、因集合计划规模变动等客观因素导致自有资金参与集合计划被动超限时

的处理原则及处理措施：因集合计划规模变动等客观因素导致自有资金参与集合计划被动超限的，管理人在满足持有期限要求且约定责任解除后，管理人将在 10 个工作日内公告退出安排后退出。

管理人以自有资金参与单个集合计划的份额，不得超过集合计划总份额的 20%。

## 七、集合计划的分级

### （一）集合计划的分级概要

本集合计划通过集合计划资产及收益的不同分配安排，份额划分为优先级、次 1 级和次 2 级三级份额，所募集的集合计划资产合并运作。

（二）份额配比：根据本集合计划的募集规则，优先级在委托人初始有效认购集合计划总份额中的份额占比为 1/2，次 1 级在委托人初始有效认购集合计划总份额中的份额占比为 1/4，次 2 级在委托人初始有效认购集合计划总份额中的份额占比为 1/4。

（三）优先级/次级比例：本集合计划推广期内，优先级、次 1 级与次 2 级的份额比例为 1:1，优先级/次级比例为 1。存续期内，优先级的份额与次 1 级及次 2 级的份额之和的比例不超过 1: 1，优先级/次级比例不超过 1。

### （四）风险承担

#### 1、优先级及次1级份额

（1）本集合计划优先级份额预期年化收益率 6.95%。

（2）本集合计划次 1 级份额预期年化收益率 8.0%。

（2）优先级份额及次 1 级预期年化收益率仅为根据本计划的分级比例以及计划份额净值的未来表现而测算的参考收益率，并不是管理人向委托人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。优先级份额可能出现净值损失。

（3）本集合计划退出或终止、清算时，优先支付优先级、次 1 级委托人的本金及预期收益。若优先级、次 1 级的预期年化收益无法实现，或本金出现亏损，差额由差额付款人进行补偿，差额付款人并对此承担不可撤销的补偿责任。

#### 2、次2级份额

（1）次 2 级委托人优先承担集合计划的损失。同时，集合计划的收益在扣除

管理费、托管费、其他各项费用、优先级份额预期年收益以及次1级份额预期年收益后的剩余收益由次2级份额享有（在差额付款人按本合同约定履行补仓承诺的前提下）。

（2）本集合计划的次2级委托人仅限员工持股计划规定的标的股票上市公司的董事、监事、高管及员工发起的合法合规的员工持股计划进行认购。

#### （五）预警线与止损线的设置及差额付款人的补仓承诺

本资产管理计划所投资标的证券根据上市公司员工持股计划的约定在本资产管理计划购买完成标的证券后的 12 个月的对应日为限售期，以资产管理计划的资产净值（指资产管理计划所投资资产的总市值及追加保证金合计）为参数，进行盯市管理：所投资股票限售解禁前，预警线设定为资产管理计划单位净值达到 0.95 元，限售解禁后，预警线设定为产品单位净值 0.95 元，止损线设定为资产管理计划单位净值达到 0.9 元。

资产净值是指本集合计划所投资资产的总市值及追加保证金合计。

#### （1）解禁前预警线

所投资股票限售解禁前：当以 T 日收盘价计算，资产净值低于预警线，则资产管理人须在 T+1 个交易日 12 时前以录音电话或传真形式向差额付款人提示投资风险，差额付款人须在 T+2 个交易日 17:00 前，向本集合计划托管账户内追加补足资金（以下简称“补足资金”），使得单位净值不低于预警线。如差额付款人未能按照约定时间补足资金且单位净值低于预警线的，自 T+3 个工作日起，集合计划的优先级委托人有权向差额付款人收取违约金，作为优先级委托人的超额收益；违约金按每个日历日应缴未缴补足资金的万分之五为标准收取。自 T+3 个工作日起，如连续 10 个交易日（不包括标的股票停牌的交易日）资产单位净值高于预警线标准，则可退还全部或部分补足资金；但退还补足资金后，资产单位净值须不低于预警线。

#### （2）解禁后预警线和止损线

所投资股票限售解禁后：当以 T 日收盘价计算，资产单位净值低于预警线 0.95 元，则资产管理人须在 T+1 个交易日 9 时 30 分前以录音电话或传真形式向差额付款人提示投资风险，差额付款人须在 T+2 个交易日 15:00 前，向本集合计划托管账户内追加补足资金，使得单位净值不低于预警线。否则，管理人有权自

主变现品种，直至本计划以市值计算的仓位（指本计划持有的标的股票仓位，数据以管理人估值结果为准）降低至集合计划资产净值的50%以下。若在变现过程中触及止损线的，按照止损线约定处理。

若以T日收盘价计算，单位净值低于（含）止损线，管理人应当日（T日）股市收市后以录音电话或传真形式向差额付款人提示投资风险，并要求其应于T+1日下午13:00前追加资金至本集合计划托管账户内使本单位净值高于或等于预警线；若T+1日下午13:00之前，差额付款人未及时追加资金使本单位净值高于或等于预警线，则管理人自T+1日下午13:00起开始平仓操作，直至集合计划资产全部变现为止。如果差额付款人在管理受托人止损变现完成后的10个交易日（不包括标的股票停牌的交易日）内追加资金使单位净值大于或等于预警线，本集合计划继续运作；否则，本集合计划提前终止。差额付款人追加的资金属于集合计划财产，于到帐日当日计入集合计划财产总值。自T+1个交易日起，如连续10个交易日（不包括标的股票停牌的交易日），资产净值高于标的资产管理计划的初始募集规模，则可退还全部或部分补足资金；但退还补足资金后，资产净值须不低于标的资产管理计划的初始募集规模。

差额付款人的补足资金当日计入本集合计划的资产总值，但不视为集合计划份额的申购，不折算成集合计划的份额，集合计划份额总数不变，也不改变优先级份额与次级份额的份额配比关系。

如果本集合计划触及预警线或止损线，差额付款人追加资金未按照约定时间到账，或者追加资金虽然按照约定时间到账，但低于管理人要求的最小补仓额度的，则被视为差额付款人违约的，优先级份额持有人有权根据本集合计划所投资标的证券是否处于限售期之内，根据合同约定对差额付款人进行追偿。

追加资金在集合计划资金账户期间产生的利息和其他收益不予返还，计入本集合计划项下资产，归全体委托人所有。

本集合计划的预警、补仓、提保、触及止损线的平仓行为由管理人负责监控并执行。

#### （六）资金补偿机制及差额付款人

为保障本集合计划委托人利益，本计划由深圳市齐心控股有限公司为差额付款人，对优先级、次1级的本金及预期收益承担动态补仓及差额补足义务。差额

付款人与优先级委托人、次1级委托人签订《东证融汇齐心共赢5号集合资产管理计划差额付款合同》（以下简称《差额付款合同》）。委托人购买计划份额的行为视为同意该《差额付款合同》的约定。

1、差额付款人基本情况

差额付款人：

营业执照号：

住所：

2、差额付款人资质及实力

3、资金补偿的性质、范围

资金补偿的性质为不可撤销的补偿责任。

补偿范围为：优先级委托人、次1级委托人的本金及预期年化收益之和与本集合计划终止清算时优先级委托人、次1级委托人实际收到金额（含终止清算时分配金额、存续期累计退出金额和累计分红金额）的差额部分。

4、差额付款人责任及违约处理

差额付款人的动态补仓及差额补足义务的实际履行与追索付款与管理人无关，由差额补足对象各自自行向差额付款人主张。

## 八、集合计划客户资产的管理方式、管理权限和运作方式

（一）管理方式

本集合计划资产由管理人自主管理。

（二）管理权限

本集合计划资产由管理人全权管理。

（三）运作方式

本集合计划的运作方式为封闭式。

## 九、集合计划的成立

（一）集合计划成立的条件和日期

集合计划参与资金总额不低于 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。

集合计划设立完成前,委托人的参与资金只能存入管理人为募集资金开立的专门账户,不得动用。

## (二) 集合计划设立失败

集合计划推广期结束,在集合计划参与资金总额低于 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,并将已认购资金及同期利息(按银行同期活期存款利率计算)在推广期结束后 20 个工作日内退还集合计划委托人。

## (三) 集合计划开始运作的条件和日期

1、条件:本集合计划经验资及管理人公告成立。

2、日期:本集合计划自成立之日起开始运作。

管理人发起设立集合资产管理计划后 5 日内,应当将发起设立情况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。

# 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、资金账户以及其他相关账户。资金账户名称应当是“集合资产管理计划名称”(以托管人最终开立的账户名称为准),证券账户名称应当是“管理人名称—托管机构名称—集合资产管理计划名称”。

因业务发展而需要开立的其他账户,可以根据法律法规和本合同的规定,经管理人与托管人进行协商后办理。新账户按有关规则使用并管理。

集合计划账户、专用交易单元应由集合计划管理人报证券交易所、证券登记结算机构,并向中国证券投资基金业协会备案。

## (二) 集合计划资产的构成

本集合计划资产的构成主要有集合计划所拥有的股票、债券、基金、和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产。

## (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》、《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中国民生银行股份有限公司负责托管，并签署了托管协议。托管方式为：托管人结算模式。托管人将按照双方达成的托管协议对本计划资产进行托管。托管人的托管职责以托管协议的约定为准，如管理合同、说明书与托管协议冲突，相关约定以托管协议为准。

## 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根据本合同“第四条（四）投资范围”所购买的各类资产的价值总和。

### （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。单位净值的计算精确到 0.0001 元，小数点后第五位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

优先级和次级（次 1 级和次 2 级）集合计划份额单位净值计算：

1、当本集合计划净资产大于优先级份额净资产与次 1 级份额净资产之和时：

（1）优先级份额资产净值的计算如下：

优先级份额的资产净值=优先级份额的本金+ D 日的应付收益-已分配收益

D 日的应付收益=优先级份额的本金×优先级份额约定的预期年化收益率×优先级份额的持有天数/当年实际天数

（2）次 1 级份额资产净值的计算如下：

次 1 级份额的资产净值=次 1 级份额的本金+ D 日的应付收益-已分配收益

D 日的应付收益=次 1 级份额的本金×次 1 级份额约定的预期年化收益率×  
次 1 级份额的持有天数/当年实际天数

(3) 次 2 级份额资产净值的计算如下:

次 2 级净资产 = 集合计划净资产 - 优先级份额净资产-次 1 级净资产

次 2 级份额净值计算公式:

次 2 级份额净值 = 次 2 级净资产 / 次 2 级份额

2、当本集合计划净资产小于优先级份额净资产与次 1 级份额净资产之和，  
但大于优先级份额净资产时:

(1) 优先级份额资产净值的计算如下:

优先级份额的资产净值=优先级份额的本金+ D 日的应付收益-已分配收益

D 日的应付收益=优先级份额的本金×优先级份额约定的预期年化收益率×  
优先级份额的持有天数/当年实际天数

(2) 本集合计划次 1 级份额资产净值等于本集合计划资产净值减去优先级  
份额资产净值:

次 1 级净资产 = 集合计划净资产 - 优先级份额净资产

次 1 级份额净值计算公式:

次 1 级份额净值 = 次 1 级净资产 / 次 1 级份额

(3) 本集合计划次 2 级份额资产净值等于零。

3、当本集合计划净资产小于优先级份额净资产时:

(1) 优先级份额资产净值的计算如下:

优先级净资产 = 集合计划净资产

优先级份额净值计算公式:

优先级份额净值 = 优先级净资产 / 优先级份额

(2) 本集合计划次 1 级份额资产净值等于零。

(3) 本集合计划次 2 级份额资产净值等于零。

(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  
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

集合计划所拥有的股票、权证、债券、基金和银行存款本息、应收款项、其它投资等一切金融资产和金融负债。

### （六）估值日

估值日指本集合计划成立后的每个工作日，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

估值应符合本合同、《证券公司客户资产管理业务规范》中的估值原则、《证券公司客户资产管理业务估值方法指引》、及其他法律、法规的规定，如法律法规未做明确规定的，参照行业通行做法处理。资产管理人、资产托管人的估值数据应依据合法的数据来源独立取得。对于固定收益类投资品种的估值应依据中国证券业协会基金估值工作小组的指导意见及指导价格估值。

1、a. 上市流通的股票，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，以最近交易日的市价（收盘价）估值；

b. 在证券交易所市场流通的债券和权证，按如下估值方式处理：

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，按最近交易日的收盘价估值。

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，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。

c. 封闭式基金按照其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；场内交易的交易型指数基金 ETF 和上市型开放式基金 LOF 按照其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值，托管在场外的交易型指数基金 ETF 和上市型开放式基金 LOF 按照估值日前一交易日交易型指数基金 ETF 和上市型开放式基金 LOF 单位净值估值，估值日前一交易日基金单位净值未公布的，以前最近一个交易日基金份额单位净值计算，LOF、ETF 在场内的，以估值日该证券收盘价估值，该日无交易的，以最近一日收盘价计算。

2、未上市的股票按以下情况分别处理：配股和增发新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市价估值；首次公开发行的股票，按成本价估值。

3、非公开发行股票估值方法如下：估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价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市价作为估值日该非公开发行股票的市值；

估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价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：

$$FV = C + (P - C) \times \frac{D_l - D_r}{D_l}$$

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；P 为估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价； $D_l$  为该非公开发行股票锁定期所含的交易天数； $D_r$  为估值日剩余锁定期，即估值日至锁定期结束所含的交易天数（不含估值日当天）。

4、配股权证，从配股除权日起到配股确认日止，按收盘价高于配股价的差额估值；如果收盘价低于配股价，则估值增值额为零。

5、银行间债券的估值采用中央国债登记结算有限责任公司提供的中债收益率曲线估值价格计算。

6、开放式证券投资基金以公布的估值日前一日开放式基金单位净值估值。货币市场基金按成本估值，每天按公布的前一开放日万份收益计提收益。估值日无交易的，按最近交易日基金单位净值估值。

7、银行存款以成本列示，按商定利率在实际持有期间内逐日计提利息。

8、如有确凿证据表明按上述规定不能客观反映集合计划资产公允价值的，管理人可根据具体情况，在综合考虑市场成交价、市场报价、流动性、收益率曲线等多种因素基础上，在与托管人商议后，按最能反映集合计划资产公允价值的方法估值。

如有新增事项或变更事项，按国家有关最新规定估值。

#### （八）估值程序

集合计划资产的日常估值由管理人进行。资产管理人应于估值日交易结束后计算当日集合计划、优先级份额和次级（次 1 级和次 2 级）份额的资产净值并以电话方式与资产托管人核对，并在核对一致后将估值清单和估值结果发送至优先级委托人指定邮箱（邮箱地址：\_\_\_\_\_）。管理人每周最后一个工作日

（如遇节假日，则以节假日前最近一个工作日为估值日）交易结束清算后计算当日的集合计划资产总值、净值，以双方约定的方式发送给托管人。托管人按照规定的估值方法、时间与程序进行复核；托管人进行复核无误后，签名、盖章并发回给管理人，由管理人负责在指定媒体上进行披露。月末、年中和年末估值复核与会计账目的核对同时进行。

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等原因造成估值错误的，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。

3、因集合计划估值错误给委托人造成损失的应先由管理人承担，管理人对不应由其承担的责任，有权向过错人追偿。当管理人计算的计划资产净值、计划单位净值已由托管人复核确认后公告的，由此造成的委托人或集合计划资产的损失，就实际支付的赔偿金额，管理人和托管人按照各方的过错程度各自承担相应责任。

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、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）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；

由于证券交易所及注册登记机构发送的数据错误，或由于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

#### （一）计划费用的种类

- 1、托管人的托管费；
- 2、管理人的管理费；
- 3、证券交易费用；
- 4、与本集合计划存续期相关的费用；
- 5、按照国家有关规定可以列入的其他费用。

#### （二）计划费用计提标准、计提方法和支付方式

##### 1、托管费

（1）按委托资产本金的 0.05% 年费率计提。

（2）托管费按前一日资产净值计提。本计划的托管费自本资产管理计划成立之日起，每日计提，按季支付。每个季度的托管费由集合计划管理人向集合计划托管人发送集合计划托管费划付指令，集合计划托管人复核无误后收到管理人指令后 3 个工作日内予以支付。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

（3）托管费计算方法如下：

$$C = i \times \text{年托管费率} \div 365$$

注：C 为每日应计提的托管费，i 为前一日的委托资产净值。

##### 2、管理费

（1）按委托资产本金的 0.3% 年费率计提。

（2）管理费按前一日资产净值计提。本计划的管理费自本资产管理计划成立之日起，每日计提，按季支付。每个季度的管理费由集合计划管理人向集合计划托管人发送集合计划管理费划付指令，集合计划托管人复核无误后收到管理人指令后 3 个工作日内予以支付。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

(3) 管理费计算方法如下:

$$C=i \times \text{年管理费率} \div 365$$

注: C 为每日应计提的管理费, i 为前一日的委托资产净值。

### 3、证券交易费用

集合计划投资运作期间发生的银行结算费、交易手续费、账户开户费、账户管理费、开放式基金的认(申)购和赎回费、印花税等有关税费,在收取时从集合计划中扣除,其费率由管理人根据有关政策法规确定。

### 4、与本集合计划存续期相关的费用

本集合计划存续期间发生的注册登记机构收取的 TA 系统月度服务费、登记结算费、信息披露费用、会计师费、审计费和律师费以及按照国家有关规定可以列入的其他费用等,由托管人根据有关法规及相应协议的规定,依管理人的指令,按费用实际支出金额从集合计划资产中支付,列入集合计划费用,在每个自然日内按照直线法均匀摊销。

### 5、其他费用

除交易手续费、印花税、管理费、托管费、服务费、资金汇划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或摊入当期费用,由管理人向托管人发送划付指令,通知托管人从集合计划资产中支付。

### (三) 不列入计划费用的项目

计划推广期发生的信息披露费、会计师费、律师费等相关费用,不得列入计划费用。管理人和托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或计划资产的损失,以及处理与计划运作无关事项发生的费用等不列入计划费用。

### (四) 税收

集合计划运作过程中涉及的各项纳税主体,依照国家法律法规的规定履行纳税义务。

## 十四、集合计划的收益分配

### (一) 收益的构成

收益包括:集合计划投资所得债券利息、红利、股息、买卖证券价差、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）可供分配利润

集合计划可供分配利润指截至收益分配基准日集合计划未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。集合计划已实现收益指计划利润减去公允价值变动收益后的余额。

## （三）收益分配原则

1、每一份优先级份额享有同等的分配权， 每一次 1 级份额享有同等的分配权，每一次 2 级份额享有同等的分配权；

2、在依次保证优先级份额的预期年化收益率、次 1 级份额的预期年化收益率后，再进行次 2 级份额的收益分配；

3、本集合计划自成立后每季度的最后一个月的 20 日管理人以现金分红的方式向优先级、次 1 级份额委托人分配收益。收益分配后，优先级、次 1 级类份额参考净值均不低于 1.00 元；

4、收益分配时发生的银行转账或其他手续费用由委托人自行承担；

5、法律、法规或监管机构另有规定的从其规定。

## （四）收益分配方案

收益分配方案由管理人披露，包括集合计划收益的范围、集合计划净收益、分配对象、分配原则、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容，由托管人复核后确定，通过管理人信息披露平台通告委托人。

## （五）收益分配方式

本集合计划收益分配的方式为现金分配。

# 十五、投资理念与投资策略

## （一）投资目标

根据“员工持股计划”的约定，本集合计划通过主动管理，投资于“员工持股计划”约定的股票。

## （二）投资理念

本集合计划在积极控制风险的前提下，根据“员工持股计划”的约定进行主动管理，力争实现委托人资产持续稳健增值。

### （三）投资策略

#### 1、资产配置策略

本集合计划通过综合分析国内外宏观经济态势、利率走势、信用风险、证券市场估值水平等因素，根据“员工持股计划”的约定进行主动管理，力争实现委托人资产持续稳健增值。

#### 2、股票投资策略

管理人积极研究深圳齐心集团股份有限公司的投资价值，结合基本面、资金面、技术面的分析，根据“员工持股计划”的约定进行主动管理，努力为委托人谋求收益，实现委托人资产持续稳健增值。

#### 3、现金类资产投资策略

管理人将根据“员工持股计划”的相关规定，通过对现金类管理工具的组合操作，在严格控制风险的同时，兼具资产流动性，以追求稳定的当期收益。

## 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》、《实施细则》、《管理规范》、《集合资产管理合同》、《说明书》等有关法律性文件。

2、宏观经济发展态势、微观经济运行环境和证券市场走势。

3、利率走势与通货膨胀预期。

4、地区及行业发展状况。

5、发债主体信用分析和上市公司价值发现。

6、投资对象收益和风险的配比关系。本计划将在充分权衡投资对象的风险和收益的前提下做出投资决策。

### （二）集合计划的投资程序

本计划的投资程序具体为：管理人董事会下设的业务决策小组决定证券资产管理业务阶段性投资策略和资产配置方案；投资部门负责组织落实具体产品的投

资策略及资产配置方案；投资主办人拟定投资策略进行战术性的投资操作；交易运作部门执行具体交易计划。

1、业务决策小组负责确定证券资产管理业务阶段性投资策略和资产配置方案。业务决策小组通过定期和不定期的会议，对宏观经济形势和证券市场走势等进行综合分析，确定证券资产管理业务阶段性投资策略和资产配置方案。

2、投资部门负责根据业务决策小组确定的投资策略及资产配置方案，组织落实具体产品的投资策略及资产配置方案。

3、投资主办人负责根据业务决策小组及投资部门制订的投资策略，结合产品合同约定，在授权范围内，组织拟定投资组合方案，进行投资操作。

4、交易运作部门依据投资主办人的投资指令在集合计划专用席位实施投资交易。交易运作部门收到交易指令并对其合规性和操作性进行检查后，如果符合要求立即执行交易指令。若发现有违反监管法规或公司制度的交易指令将拒绝执行并反馈。

### （三）风险控制

#### 1、风险管理的原则和内容

##### （1）风险管理的原则

1) 全面性原则：风险管理应当覆盖管理人所有业务、各个部门和分支机构、全体工作人员，贯穿决策、执行、监督、反馈全过程，嵌入管理人业务流程和操作环节；

2) 重要性原则：风险管理应当在对风险进行全面控制的基础上，对重要业务、重大事项、主要操作环节和高风险领域实施重点控制；

3) 适应性原则：风险管理工作应当与管理人业务范围、经营规模、组织架构和风险状况等相适应，并随着市场、技术和法律环境的变化及时加以调整和完善；

4) 成本效益原则：风险管理应当权衡实施成本与预期收益，以适当的成本实现有效的风险控制。

##### （2）风险管理的内容

1) 风险识别与评估，指对风险进行分类，全面、系统、持续地收集可能影响实现公司经营目标的内外部信息，识别面临的风险，并对各种风险进行分析和

排序，确定重点关注和优先控制的风险。

2) 风险应对与管控，主要指选择与风险偏好相适应的风险回避、降低、转移和承受等风险应对策略，实现以合理的成本在最大限度内防范风险和减轻损失。

3) 风险监控与报告，指建立自下而上的风险报告制度，使风险信息得到及时有效地沟通，将风险事件及处置、风险评价情况以一定程序进行报告。

## 2、风险管理体系

管理人建立董事会及下设的专业决策机构、经理层、风险管理部门、各业务部门和岗位四级风险管理体系。

董事会负责确定包括公司风险偏好和风险容忍度在内的公司风险管理总体目标和基本政策，决定重大风险的解决方案，督促、检查和评价公司风险管理工作。董事会下设的专业决策机构，针对经营管理、投资管理等各方面的风险和控制措施向董事会提出相关建议，并在董事会的授权范围内进行决策。

经理层遵循董事会设定的风险管理总体目标，执行董事会制定的风险管理政策。

风险管理部门具体负责日常风险管理工作，对各部门风险管理措施的充分性和有效性进行分析，为业务决策提供风险管理建议。

各部门负责全面识别、评估、应对与报告其相关业务的各类风险，并针对主要风险点和风险性质，结合业务实际制订并执行统一的业务流程、操作规范和风险控制措施。

## 3、风险管理的具体措施

### (1) 风险控制制度

根据上述风险控制设计理念，管理人制定、完善并执行证券资产管理的各项风险控制制度。

管理人制定了一系列专门的风险控制制度，主要包括：董事会层面的《东证融汇证券资产管理有限公司风险管理制度》、《东证融汇证券资产管理有限公司危机管理制度》；公司管理层面的《东证融汇证券资产管理有限公司风险控制指标管理办法》、《东证融汇证券资产管理有限公司流动性风险管理办法》和《东证融汇证券资产管理有限公司信息隔离墙管理办法》等制度和管理办法。

## （2）风险控制措施

### 1) 市场风险控制

①资产配置的风险控制，对可分散的非系统性风险，充分考虑整体组合的风险指标和个别投资品种的风险暴露值，尽量利用组合分散投资规避不必要的风险。

②投资品种的风险控制，须根据产品法律文件的约定及产品的投资风格和理念选择投资品种；投资决策应有充分的投资依据。

### 2) 流动性风险控制

①针对产品法律文件关于流动性的限制，坚持稳健投资、组合分散原则，投资于流动性较好的资产。

②针对客户赎回导致的流动性问题，通过加强对客户沟通与宣传、分析客户行为方式、预测客户参与和退出等方法使集合计划的参与和退出较为平稳地进行。

### 3) 合规风险控制

管理人合规风险管理部和管理人母公司稽核审计部，通过对资产管理业务过程中的遵规守法情况以及公司内部控制制度的实施和落实情况进行监督、检查和评价，及时、准确地发现问题并提出警示，最大限度降低资产管理业务的违规风险。

### 4) 操作风险控制

①根据经营计划、业务规则及自身具体情况制定部门及岗位职责和操作流程，并严格执行。

②投资主办须通过电脑或其他可以留痕的方式下达或修改交易指令，交易日志应及时核对、报告并存档。

③产品估值应遵循公认会计准则，采取合理的估值方法和科学的估值程序，公允地反映产品在估值时点的净值。

### 5) 管理风险控制

①资产管理业务相关人员须树立风险管理观念，忠于职守，勤勉尽责，严格遵守国家法律法规和公司各项规章制度。

②应充分发挥集体决策的作用，通过定期召开会议，研究宏观经济形势及市

场状况，避免决策的随意性。

③资产管理新产品开发应在进行了充分的市场调研和自身管理能力评估的基础上，开发适应不同客户需求和风险偏好的产品。

#### 6) 道德风险控制

①加强对员工的守法意识、职业道德的教育，加强员工的业务培训，提高业务素质 and 责任心，建立激励和约束相结合的机制。

②对违反公司各项制度的员工按照公司相关规定严肃处理，对违反从业人员规定的员工及时上报监管部门进行处罚，对违反有关法律者应移交司法机关处理

(3) 本集合计划在实行严格的内部风险控制的同时，也接受托管银行、上级监管机构和自律组织、中介审计机构以及委托人的外部风险监督。

## 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，本集合计划的投资限制为：

1、根据《关于上市公司实施员工持股计划试点的指导意见》相关规定，员工持股计划所购买股票将锁定 12 个月。但在本集合计划净值下跌触及到本集合计划规定的止损线，且差额付款人没有履行补仓义务的情况下，管理人有权在满足证监会公告[2014]33 号《关于上市公司实施员工持股计划试点的指导意见》的前提下对本计划项下优先级资金和次 1 级资金所对应的相应比例的股票第一时间进行平仓。

2、在公开可能的可能涉及股价波动的敏感窗口期，包括：(1) 上市公司定期报告公告前 30 日内；(2) 上市公司业绩预告、业绩快报公告前 10 日内；(3) 其他可能影响股价的重大事件发生之日起至公告后 2 个交易日。以上区间内本计划不进行股票的买卖操作，除非：1) 本合同约定的止损条款已经被触发；或者 2) 本计划因存续期限即将届满而必须卖出股票兑付投资者本金和预期收益。

3、法律法规及中国证监会限制的其他行为。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。

如法律法规或监管部门修改或取消上述限制，履行适当程序后，本集合计划

可相应调整投资组合限制的规定，则本集合计划不受上述限制。

## （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、募集资金超过本合同约定的规模及配比；
- 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。

## 十八、集合计划的信息披露

本集合计划的信息披露方式可以为在管理人信息披露平台披露、发送电子邮件或委托人认可的其他方式。

委托人应向管理人提供正确、有效的邮寄或电子邮箱地址。

### （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：集合计划成立之后每日向优先级委托人报告上一交易日项目净值。集合计划单位净值计算由管理人估算，由托管人复核。

披露方式：在管理人网站上披露，供委托人查阅。

#### 2、集合计划的资产管理季度报告和托管季度报告

管理人在每季度首月月底前向委托人、托管人提供一次准确、完整的管理季度报告，资产管理季度报告由管理人编制，资产托管人对其中的财务报表、投资组合报告进行复核。托管人在每季度向委托人提供一次季度托管报告。上述报告应于每季度截止日后 15 个工作日内通过本合同约定方式披露，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。本集合计划成立不足 2 个月时，管理人/托管人可以不编制当期的季度报告。产品终止当季，无需编制当季度报告。

### 3、集合计划的资产管理年度报告和托管年度报告

管理人在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，资产托管人对其中的财务报表、投资组合报告进行复核。托管人在每年度向委托人提供一次年度托管报告。上述报告应于每个会计年度截止日后 3 个月内通过本合同约定方式披露，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。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。产品终止当年，无需编制年度报告。

### 4、年度审计报告

管理人应当聘请具有证券相关业务资格的会计师事务所对本集合计划的运营情况进行年度审计，并在每年度结束之日起 3 个月内将审计报告提供给托管人，通过本合同约定的信息披露方式向委托人提供。

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。本集合计划成立不足 3 个月时，可以不编制当期的年度报告。产品终止当年，无需进行年度审计。

### 5、对账单

管理人应当每个季度以电子方式（包括但不限于电子邮件、管理人信息披露平台、柜台系统、网上交易等自助终端系统等）向委托人提供对账单，对账单内容应包括委托人持有计划份额的数量及净值，参与、退出明细，以及收益分配等情况。

## （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，管理人应当以通过本合同约定方式及时向客户披露。临时报告的情形包括但不限于：

- 1、管理人或托管人变更；
- 2、集合计划运作过程中，负责集合资产管理业务的高级管理人员或投资主办人员发生变更，或出现其他可能对集合计划的持续运作产生重大影响的事项；
- 3、发生巨额退出并延期支付；
- 4、集合计划终止和清算；
- 5、合同的补充、修改与变更；
- 6、与集合计划有关的重大诉讼、仲裁事项；
- 7、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；
- 8、管理人、托管人因解散、破产、撤销等原因不能履行相应职责；
- 9、管理费、托管费等费用计提方式或费率发生变更；
- 10、其他可能影响委托人权益的重大事项；
- 11、其他根据法律法规和中国证监会的有关规定应当披露的重大事项。

## 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

集合计划存续期间，委托人在技术条件许可的条件下，可以通过证券交易所等中国证监会认可的交易平台转让集合计划份额。份额转让的具体事宜（包括交易平台、时间、业务规则等）由管理人在集合计划份额开始转让前公告。管理人和托管人无需就本集合计划份额转让事宜与委托人另行签订协议。受让方首次参与集合计划，应先与管理人、托管人签订集合资产管理合同。

### （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管理人的有关规定办理。

### （三）集合计划份额的冻结

管理人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

本集合计划不得展期。

## 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、管理人因重大违法、违规行为，被中国证监会取消业务资格，而无其他适当的管理人承接其原有权利、义务的；
- 2、托管人因重大违法、违规行为，被监管机关取消业务许可，不能继续担任集合计划托管人，而无其他适当的托管机构承接其原有权利、义务的；
- 3、管理人因解散、破产、撤销等原因不能履行相应职责，而无其他适当的管理人承接其原有权利、义务的；
- 4、托管人因解散、破产、撤销等原因不能履行相应职责，而无其他适当的托管机构承接其原有权利、义务的；
- 5、集合计划存续期间，本集合计划委托人少于 2 人；
- 6、集合计划存续期满且不展期；
- 7、不可抗力发生导致本集合计划不能存续；
- 8、法律、行政法规、本合同及中国证监会规定的其他终止情形。

(二) 有下列情形之一的，集合计划可以提前终止：

- 1、本集合计划持有的上市公司股票解禁后，如满足如下任一条件，管理人根据市场情况变现资产，并有权在资产全部变现后提前终止合同：(1) 未发生需差额付款人补仓的情形，(2) 差额付款人按照合同约定及时补仓；
- 2、差额付款人未按照合同约定及时补仓造成违约的，管理人有权在所投资的股票解禁后进行平仓，本合同提前终止；
- 3、员工持股计划提前结束；
- 4、本集合计划项下资产全部变现，即现金类资产占集合计划净值比例为 100%。
- 5、差额付款人发生信用风险时，优先级委托人有权提前终止集合计划。

### （三）集合计划的清算

1、自集合计划终止之日起五个工作日内成立集合计划清算小组，集合计划清算小组按照监管机构的相关规定进行集合计划清算；

2、清算过程中的有关重大事项应当及时公布；

3、清算结束后 5 个工作日内，管理人和托管人应当在扣除清算费用、管理费、业绩报酬及托管费等费用后，将集合计划资产按照委托人持有集合计划份额的比例或集合资产管理合同的约定以货币资金的形式全部分派给委托人，并根据相关规定进行集合计划专用证券账户和资金账户的注销事宜；

优先级份额和次 1 级依次按照预期年化收益率获得清算资产的分配，次 2 级份额享有剩余资产和收益的分配。若优先级的预期年化收益无法实现，或本金出现亏损，差额由差额付款人进行补偿，差额付款人并对此承担不可撤销的补偿责任。

4、清算结束后 5 个工作日内由集合计划清算小组在管理人信息披露平台公布清算结果；

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，并通过管理人信息披露平台进行披露。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委托人持有份额的比例或本合同的约定，以货币形式全部分配给委托人；

6、本集合计划清算时的支付顺序为：

（1）管理人的管理费、托管人的托管费、税收、注册登记费、证券交易费以及其他各种应由集合计划承担的费用；

（2）在保证以上费用的支付后，

1) 按照本合同“七、（五）、1、（2）”约定，差额付款人未违约时：

A. 优先级份额的本金和预期年化收益；

B. 次 1 级份额的本金和预期年化收益；

C. 次 2 级本金；

D. 若集合计划清算时，集合计划账户内有差额付款人已追加但未返还的资金，则该部分资金首先用于弥补集合计划的各项费用、优先级份

额的本金及预期年化收益、次 1 级份额的本金及预期年化收益以及次 2 级份额的本金。若仍有剩余，则剩余资金返还给差额付款人。

E. 次 2 级收益。

2) 按照本合同“七、（五）、1、（2）”约定，差额付款人违约时：

保证费用的支付后，剩余资产全部由优先级享有。

在所有委托人一致同意的条件下，可以改变以上支付顺序。

7. 该产品终止前，未经优先级委托人许可，次级投资人不得退出（管理人自有资金参与比例超出监管限制除外）。

## 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）通过管理人信息披露平台查询等方式知悉有关集合计划运作的信息，包括资产配置、投资比例、损益状况等；

（3）按照本合同及《说明书》的约定，参与和退出集合计划；

（4）按持有份额取得集合计划清算后的剩余资产；

（5）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；法人或者依法成立的其他组织，用筹集的资金参与集合计划的，应当向管理人或其他推广机构提供合法筹集资金的证明文件（见附件二）；

（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；

（4）不得违规转让其所拥有的计划份额；

（5）除非在本合同约定的开放期或终止日，不得要求提前终止委托资产管

理关系；

（6）遵守反洗钱法律法规要求，并承诺不存在洗钱情形，积极配合管理人按照反洗钱法律法规履行身份识别、异常交易报告等职责；

（7）当本集合计划的股票投资对象因重大事项长期停牌或其他事项导致到期仍持有上市公司股票时，如果优先级、次 1 级份额委托人到期要求退出，深圳市齐心控股有限公司承诺以优先级、次 1 级份额到期当日的参考单位资产净值受让申请退出的优先级、次 1 级份额。

（8）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）担任本集合计划的注册登记机构，负责集合计划份额的注册登记等事宜；

（9）管理人有权按照反洗钱法律法规要求履行异常交易报告职责；

（10）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；

（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) 妥善保管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及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；

(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，并及时报告证券公司住所地、资产管理分公司所在地中国证监会派出机构及中国证券投资基金业协会；

(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、托管协议约定的其他义务。

## 二十三、违约责任与争议处理

### (一) 违约责任

1、由于合同当事人过错，造成本合同不能履行或者不能完全履行的，由有过错的一方承担违约责任；如当事人均有过错的，各自承担应负的责任。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。但是发生下列情况的，当事人可以免责：

#### (1) 不可抗力

不可抗力是指本合同当事人无法预见、无法克服、无法避免，且在本合同签署之后发生的，使本合同当事人无法全部或部分履行本合同的任何事件，包括但不限于相关法律法规的变更；国际、国内金融市场风险事故的发生；战争或动乱、自然灾害、公众通讯设备故障、电力中断、互联网故障等。

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

(4) 在没有过错或重大过失的情况下托管人执行管理人依据交易程序已经成立的投资指令对集合计划资产造成的损失，托管人不承担责任；

(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、计算机病毒攻击等其他原因而造成运作不畅、出现差错和损失的；

(6) 管理人或托管人任一方不因另一方的失职行为而给集合计划财产或委

托人造成的损失向委托人承担连带责任；

(7) 管理人未能事前就其关联方名单明确告知托管人致使本集合计划发生违规投资行为的，托管人不承担任何责任；

(8) 在本集合计划运行期间，对于证券集合资产管理计划应遵守的监管部门仅发送至管理人且未公开发布的通知、决定、文件等规定，如管理人未及时向托管人提供相关监管要求的，托管人不承担因此产生的责任；

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

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、一方当事人依据本合同向另一方当事人赔偿的损失，仅限于直接损失。

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、托管人对于没有保管在托管人处的有价证券及其他集合计划资产不负有保管责任，由于非托管人的过错致使其保管的资产发生毁损或灭失的，托管人不承担赔偿责任。

委托人的债权人通过司法机关对集合计划资产采取强制措施，由此造成集合计划资产损失的，管理人和托管人不承担任何责任。

## （二）争议的处理

因履行本合同引起的或与本合同有关的任何争议，由合同签订各方协商解决；协商不成的，各方一致同意请证券期货纠纷调解委员会进行调解。调解不成的，合同签订各方一致同意按以下第 1 种方式解决争议：

1. 将争议提交上海仲裁委员会并按其仲裁规则进行仲裁；
2. 向托管人所在地人民法院提起诉讼。

仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力。仲裁费用由败诉方承担。

除提起诉讼的争议之外，各方当事人仍应履行本协议的其他规定。争议处理期间，相关各方当事人应恪守职责，各自继续忠实、勤勉、尽责地履行说明书、托管协议和本合同规定的义务，维护持有人的合法权益。

本合同受中华人民共和国法律管辖。

## 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。

#### 6、再投资风险

固定收益品种获得的本息收入或者回购到期的资金，可能由于市场利率的下降面临资金再投资的收益率低于原来收益率，从而对本集合计划产生再投资风险。

#### 7、其他风险

管理人在投资债券或进行债券回购业务中，可能面临债券投资的市场风险或债券回购交收违约后结算公司对质押券处置的风险。

### （二）管理风险

在集合资产管理计划运作过程中，管理人的知识、经验、判断、决策、技能等，会影响其对信息的获取和对经济形势、金融市场价格走势的判断，如管理人判断有误、获取信息不全、或对投资工具使用不当等影响集合资产管理计划的收益水平，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。本集合计划对股票进行减持过程中，因证券市场或集合计划所投资股票的流动性不足，或所投资股票被停牌、除牌等情况，从而导致股票不能及时减持而造成损失的风险。流动性风险还包括由于本集合计划在可办理退出的临时开放期出现投资者巨额赎回，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

信用风险是指集合计划所投资的债券等固定收益类证券的发行人是否能够实现发行时的承诺，按时足额还本付息的风险，或者交易对手未能按时履约的风险。

集合计划所投资的公司债券、可转换债券等固定收益类产品，如出现债券发行人违约、倒闭、无法或拒绝支付到期本息，或由于债券发行人信用等级降低导致债券价格下降，从而存在交易品种的信用风险，将造成集合计划资产损失。

集合计划在交易过程中可能发生交易对手未能履行合约，或在交易期间未如约支付已借出证券产生的所有股息、利息和分红的情况，从而存在交易对手的信用风险，将导致集合计划财产损失。

#### （六）合规性风险

指集合计划管理或运作过程中，违反国家法律、法规的规定，或者集合计划投资违反集合资产管理合同有关规定的风险。

#### （七）委托人认知风险

可能存在由于委托人对本计划缺乏足够的认知和了解而造成的投资偏离预期的风险。

#### （八）份额无法退出的风险

1、本集合计划封闭期内、仅办理参与业务的开放期内不办理退出，故委托人存在无法退出的风险。

2、本集合计划可以展期，若有委托人不同意展期，管理人为不同意展期委托人的份额办理退出。但如果遇股票停牌的情况，则委托人可能仍然无法退出，此时亦存在无法退出的风险。

#### （九）参与申请被拒绝的风险

本集合计划存在参与人申请被拒绝的风险，包括但不限于如下情况：

（1）若本集合计划已达优先级/次级比例上限，优先级份额委托人的参与申请存在被拒绝的风险。

（2）推广期内，委托人达 200 人，后续委托人的参与申请存在被拒绝的风险。

（3）自然人用筹集的他人资金参与集合计划的，或法人用筹集的资金参与集合计划但未能提供合法筹集资金的证明文件时存在参与申请被拒绝的风险。

### （十）集合计划设立失败风险

本集合计划推广期结束时，如果委托人少于 2 人，或者本集合计划的参与金额小于 3000 万元，导致本集合计划设立失败的风险。

### （十一）集合资产管理合同变更风险

在合同变更安排中，可能存在但不限于以下潜在风险：

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。

部分委托人可能因为未能提供有效的联系方式或者未能将变动后的联系方式及时通知管理人，而无法及时获知合同变更事项，如果委托人因上述情况未能按时退出本计划，可能会被视为同意合同变更，从而存在风险。

### （十二）本集合计划特有风险

#### 1、收益分级风险

（1）杠杆风险。本集合计划份额所分离的三类份额优先级份额、次 1 级、次 2 级份额面临因特定的结构性收益分配所形成的投资风险，集合计划的次 2 级份额的净值变动幅度将大于优先份额、次 1 级份额的净值变动幅度。其风险程度直接与杠杆率有关。

（2）份额配比风险。本计划优先级和次级（次 1 级和次 2 级）的比例控制在一定的比例范围之内，按照本计划的认购程序，两类份额存在认购失败、募集失败的风险。

（3）极端情况下的损失风险。优先级份额和次 1 级份额具有收益相对稳定的特征，但优先级份额和次 1 级份额预期年化收益率并不是管理人向委托人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，在极端情况下，如果集合计划在短期内发生大幅度的投资亏损，优先级和次 1 级份额可能存在收益无法保障甚至本金受到损失的风险。

#### 2、管理期限不确定的终止风险

当满足资产管理合同约定的提前终止条件时，本集合计划可提前终止。当本集合计划存续期届满，投资对象因重大事项长期停牌时，本集合计划资产无法变现，管理期限可能进一步顺延。即集合计划终止时，集合计划的实际存续期限可

能小于或长于合同约定的存续期限，委托人面临存续期限不定的风险。

### 3、本集合计划设立失败的风险

“员工持股计划”未通过相应的股东会审议导致本集合计划设立失败。

### 4、资金补偿机制及违约风险

为保障本集合计划委托人利益，本计划由深圳市齐心控股有限公司为差额付款人，对优先级的本金及预期收益、次 2 级的本金承担差额补足义务。但存在差额付款人违约、未履行补偿义务的风险。

### 5、委托人的特有风险

#### （1）优先级及次 1 级委托人的风险

##### 1) 预期收益无法实现甚至本金损失的风险

本集合计划优先级及次 1 级份额享有预期年化收益率（扣除管理费和托管费以后）。但优先级及次 1 级份额预期年化收益率并不是管理人向委托人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，优先级及次 1 级委托人仍然存在收益无法保障甚至本金损失的风险。

##### 2) 差额付款人未履行补仓承诺及差额补足义务的风险

当资产单位净值跌破本合同中设定的止损线时，差额付款人可能不按约定履行补仓承诺，则优先级及次 1 级份额将失去追加资金对其本金和预期收益的保护，在股票价格下跌幅度较大时，将面临收益和本金损失的风险。

若优先级及次 1 级的预期年化收益无法实现，或本金出现亏损，差额由差额付款人进行补偿，差额付款人并对此承担不可撤销的补偿责任。但存在差额付款人违约、未履行补偿义务的风险。

##### 3) 追偿失败的风险

当资产单位净值跌破本合同中设定的止损线时，管理人根据合同约定对本计划项下的非现金资产进行止损平仓操作。直至集合计划财产全部变现，本计划及本合同提前终止，差额付款人对优先级的本金和收益承担不可撤销的补偿责任，优先级委托人根据其于差额付款人签订的《差额付款合同》对差额付款人进行追偿，但存在追偿失败的风险。

#### （2）次 2 级委托人的风险

##### 1) 次 2 级份额享有本集合计划剩余收益，但须优先保证集合计划各项费用

的支付，以及优先级份额、次 1 级份额的本金及预期年化收益。所以存在本金损失的风险。

## 2) 强行平仓的风险

当集合计划单位净值于 T 日收盘后低于平仓线 0.90 元时，自 T+1 日起，管理人将对资产管理计划持有的全部证券资产进行连续的变现操作，该变现操作是不可逆的，直至资管财产全部变现为止，集合计划提前终止。

3) 次 2 级委托人还存在受到违约惩罚的风险及管理人止损操作后其收益甚至本金损失的风险。

## (十三) 其他风险

(1) 因技术因素产生的风险。在本集合计划的日常交易中，可能因为技术系统的故障或者差错而影响交易的正常进行或者导致委托人的利益受到影响。这种技术风险可能来自管理人、注册登记机构、推广机构、证券交易所、证券登记结算机构等；

(2) 因资产管理业务快速发展而在制度建设、人员配备、内控制度建立等方面不完善而产生的风险；

(3) 因人为因素导致操作失误或违反操作规程等而造成的风险，如内幕交易、越权违规交易、欺诈行为等产生的风险；

(4) 因行业竞争等因素可能导致的风险；

(5) 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，可能导致委托资产的损失，从而带来风险；

(6) 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，可能给委托人带来的法律风险、市场风险以及其他投资风险；

(7) 集合计划托管人因重大违法、违规行为，被中国证监会取消业务资格等而导致本集合计划终止的风险；

(8) 集合计划托管人因停业、解散、破产、撤销等原因不能履行相应职责导致本集合计划终止的风险；

(9) 对主要业务人员如投资主办人的依赖而可能产生的风险；

(10) 因业务竞争压力而可能产生的风险；

(11) 金融市场危机、行业竞争、代理商违约、托管银行违约等超出集合计划管理人自身直接控制能力外的风险可能导致集合计划或者集合计划委托人利益受损；

(12) 突发偶然事件的风险：指超出集合计划管理人自身直接控制能力之外的风险，可能导致集合计划或集合计划委托人利益受损。

其中“突发偶然事件”指任何无法预见、不能避免、无法克服的事件或因素，包括但不限于以下情形：

- 1) 集合计划终止时，证券资产无法变现的情形；
- 2) 相关法律法规的变更，直接影响集合计划运行；
- 3) 交易所停市、上市证券停牌，直接影响集合计划运行；
- 4) 无法预测或无法控制的系统故障、设备故障、通讯故障。

(13) 其他意外导致的风险。

## 二十五、合同的成立与生效

### (一) 合同的成立与生效

本合同经管理人、托管人和委托人签署后成立。本计划资产管理合同的签署应当采用书面的方式进行。合同签署方式（包括但不限于书面、电子等）可能由于法律法规、监管要求、系统技术等等发生改变，各方同意管理人基于投资者的利益有权按规定采用新的签署方式，并及时进行信息披露。

本合同成立后，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) 合同的终止

本合同在同时满足以下三个条件之日终止。

- 1、本集合计划终止；
- 2、本集合计划资产完成清算；
- 3、清算结束后，本集合计划资产以货币资金的形式到达委托人资金账户。

### (三) 合同的组成

《东证融汇齐心共赢 5 号集合资产管理计划说明书》是本合同不可分割的一部分，与合同具有同等法律效力。

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与合同具有同等法律效力。

## 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信息披露平台通告委托人。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，更新或修改的内容在管理人信息披露平台通告委托人满 5 个工作日后生效。委托人对更新或修改的内容有异议，可在更新或修改内容生效前按照本合同的规定申请退出本集合计划。

2、若管理人认为有必要变更代理推广机构的，委托人及托管人同意管理人在管理人信息披露平台公告后即变更生效。管理人无需就增加或变更推广机构事宜征求托管人、委托人意见或与托管人、委托人另行签订协议。

3、由于其他原因需要变更合同的，管理人和托管人应书面达成一致并在管理人信息披露平台通告委托人。管理人须在公告后 10 个工作日内以电子或者网站公告方式向委托人发送合同变更征询意见函（或通知）。委托人应在征询意见函（或通知）指定的日期内按指定的形式回复意见。委托人不同意变更的，应在征询意见发出后的 10 个工作日内的开放日或 10 个工作日期限届满后的首个开放日（以下统称“指定开放日”）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、也未在指定开放日退出计划或答复意见不明确的，视为委托人同意合同变更。委托人向管理人书面答复不同意合同变更事项的，又未在指定开放日内提出退出申请的，则委托人其已以行为表明其对合同变更的最终确定的意思表示应为同意上述全部变更事项。

集合计划份额的委托人同意，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。

变更事项自征询意见函（或通知）指定的日期届满的次工作日开始生效，对合同各方均具有法律效力。

4、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。

5、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。

## 二十七、其他事项

### （一）或有事件

本合同所称的或有事件是指，根据相关法律法规的规定，管理人以独资或者控股方式成立具有独立法人资格的从事资产管理业务的公司。

委托人、托管人在此同意，本合同管理人的各项权利义务自该从事资产管理业务子公司成立并取得证券业务经营许可证之日起可以由该子公司享有和履行，且管理人无需就此项变更与委托人或托管人另行签订专项协议。但管理人应提前在管理人信息披露平台进行公告。

管理人应当保证受让人具备开展此项业务的相关资格，并向托管人提供监管机构相关批复文件复印件。

### （二）其他事项

本集合计划发行前，若标的股票在交易所或证监会的信息披露内容出现重大不利信息（包括但不限于标的股票被摘牌或非正常原因被强制性停牌、年度业绩亏损、公告业绩预亏、涉及重大诉讼、高级管理人员及或实际控制人外逃或涉案、公司受被证券监管部门及或交易所采取监管措施、处罚或谴责等，将对标的股票股价产生严重不利影响的公开信息），则优先级委托人有权终止投资且无需承担任何责任。

本计划发行前，本计划及或员工持股计划等须履行向证监会相应监管部门备案手续。法律法规另有规定的除外。

本合同自股东大会对本次员工持股计划审议通过后生效。

管理人、托管人确认，已向委托人明确说明集合计划的风险，不保证委托人资产本金不受损失或取得最低收益；委托人确认，已充分理解本合同的内容，自行承担投资风险和损失。

本合同应由委托人本人签署，当委托人为机构时，应由法定代表人或其授权

代表签署并加盖其公章。

本合同一式 份，管理人、托管人、委托人、差额付款人各执贰份，  
每份均具有同等法律效力。

本页无正文，为《东证融汇齐心共赢 5 号集合资产管理合同》签字页。

委托人签字/盖章：

管理人： 东证融汇证券资产管理有限公司（公章或合同专用章）

托管人： 中国民生银行股份有限公司（公章或合同专用章）

差额付款人： 深圳市齐心控股有限公司（公章或合同专用章）

签订日期： 2016 年      月      日