光证资管浦发众享添利九鼎新材 1 号
集合资产管理计划管理合同

合同编号：GZJE-2016-007

集合计划管理人：上海光大证券资产管理有限公司

集合计划托管人：上海浦东发展银行上海分行

2016 年 6 月

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 6

二、 释义 7

三、 合同当事人 10

四、 集合计划的基本情况 12

五、 集合计划的参与和退出 17

六、 管理人自有资金参与集合计划 22

七、 集合计划的分级 22

八、 集合计划客户资产的管理方式和管理权限 23

九、 集合计划的成立 23

十、 集合计划账户与资产 24

十一、 集合计划资产的托管 24

十二、 集合计划估值 25

十三、 集合计划的费用 30

十四、 投资收益与分配 32

十五、 投资理念与投资策略 32

十六、 投资决策与风险控制 33

十七、 投资限制及禁止行为 36

十八、 集合计划的信息披露 37

十九、 集合计划份额的转让、非交易过户和冻结 39

二十、 集合计划的展期 40

二十一、 集合计划终止与清算 41

二十二、 当事人的权利与义务 42

二十三、 违约责任与争议处理 47

二十四、 风险揭示 48

二十五、 合同的成立与生效 55

二十六、 合同的补充、修改与变更 55

附件 1：光证资管浦发众享添利九鼎新材 1 号资产管理计划相关账户信息 58

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

附件 2：清算划款指令签发人授权书（格式）.....59
附件 3：清算划款指令书（格式）.....1
附件 4：委托资产证券交易费率参数表（样本）.....3
附件 5：资金追加说明函（样本）.....4

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

重要提示

本《光证资管浦发众享添利九鼎新材 1 号集合资产管理计划管理合同》（以下简称“本合同”或“集合计划合同”）以纸质合同方式签订，管理人、托管人作为本合同签署方，已接受本合同项下的全部条款；委托人（即光证资管浦发众享添利九鼎新材 1 号集合资产管理计划的委托人）作为本合同一方，以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，同时本合同成立。

本资产管理计划为非保本产品，各级委托人均有无法获得收益甚至损失本金的风险。本计划的投资范围包含了股票等较高风险类的投资对象，收益水平会随之变化，进而产生收益不确定的风险。

本计划运作期间原则上不开放参与、退出及违约退出，且有关上市公司员工持股计划买卖该公司股票政策发生变化的，本计划存在运作期间投资标的无法变现的以及存续期无限延长的风险。

本计划优先级份额、次级份额配比为原则不超过 2:1，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。

若 T 日收市后计划份额净值小于或等于预警线的，资产管理人应在 T+1 日上午 9:30 点前以录音电话、电子邮件或传真形式向补仓义务人发出补仓通知，补仓义务人应在 T+2 日 12：30 之前足额补仓，补仓当日净值应达到 0.92 及以上, 否则，管理人有权在 T+2 日 13：00 开始限仓操作，将股票仓位减持至计划净值的 50%。待补仓期间，任一交易日收盘计划净值恢复至 0.92 以上，则视同补仓。在股票锁定期内，若 T 日收市后计划份额净值小于或等于平仓线，资产管理人应在 T+1 日上午 9:30 点前以录音电话、电子邮件或传真形式向补仓义务人发出补仓通知，补仓义务人应在 T+1 日 10：30 之前足额补仓，补仓当日净值应达到 1.00 及以上，如果补仓义务人 T+1 日未按约进行补仓，则次级委托人份额罚没，归优先级委托人所有。

补仓义务人追加补仓资金的，不得变更本计划优先级与次级的配比比例以及优先级、次级的份额总数。

如补仓义务人未按照合同约定及时补仓的，除按照本合同约定承担相应违约责任外，本集合计划购买的股票解禁后，管理人有权主动平仓，本合同提前终止。本集合计划所持上市公司股份解禁后，因监管部门有关上市公司股份减持监管规定的限制，导致不能平仓的，管理人不承担责任。

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

对于次级份额而言，通过份额分级，放大了次级份额的收益或损失，若市场面临下跌，次级份额的跌幅可能大于市场指数跌幅。

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**光证资管浦发众享添利九鼎新材 1 号**资产管理计划的运作，明确《**光证资管浦发众享添利九鼎新材 1 号**资产管理计划管理合同》当事人的权利与义务，依照《中华人民共和国合同法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《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投资基金业协会的有关规定，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》、《**光证资管浦发众享添利九鼎新材 1 号**资产管理计划说明书》、《**光证资管浦发众享添利九鼎新材 1 号**资产管理计划管理合同》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。

委托人特别承诺事项：

委托人为上市公司员工持股计划，且本集合计划的投资标的为该上市公司股票的，应当遵守以下限制：

（1）委托人承诺符合《证券法》、《上市公司收购管理办法》、《关于上市公司实施员工持股计划试点的指导意见关于上市公司实施员工持股计划试点的指导意见》等法律法规相关规定，通过本集合计划间接持有本集合计划名下的该上市公司股票，并结合直接或其他方式间接持有的上市公司股票情况，自行按照相关规定进行持股比例限制和相关信息披露。因委托人违规减持的责任由委托人承担，管理人不承担责任。如因委托人违规减持导致管理人承担责任（含连带责任）的，委托人应予以全面补偿并消除不利影响；

（2）委托人承诺在本集合计划购买的上市公司股票锁定期满后，按照《公司法》、《证券法》、《上市公司收购管理办法》、《上市公司信息披露管理办法》、《关于上市公司实施员工持股计划试点的指导意见》等法律法规及监管政策的规定，以及监管机构日后发布的相关规定，合法合规地减持其直接和间接持有的上市公司股份；

（3）本集合计划在下列期间不得买卖该公司股票：

① 该公司定期报告公告前30日内，因特殊原因推迟公告日期的，自原公告日前30日起至最终公告日；

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

② 该公司业绩预告、业绩快报公告前10日内；

③ 自可能对该公司股票交易价格产生重大影响的重大事项发生之日或在决策过程中，至依法披露后2个交易日内。

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

本合同中除非文意另有所指，下列词语具有如下含义：

集合计划、本集合计划或本计划	指**光证资管浦发众享添利九鼎新材 1 号集合**资产管理计划
《集合计划说明书》或《说明书》	指《**光证资管浦发众享添利九鼎新材 1 号集合**资产管理计划说明书》以及对其所有的有效修订和补充
《集合资产管理合同》、本合同、纸质合同	指《**光证资管浦发众享添利九鼎新材 1 号集合**资产管理计划管理合同》及对其的任何有效修订和补充
《证券投资基金法》	指 2013 年 6 月 1 日起正式实施的《中华人民共和国证券投资基金法》
《管理办法》	指 2013 年 6 月 26 日中国证监会公布并于公布之日起施行的《证券公司客户资产管理业务管理办法》
《实施细则》	指 2013 年 6 月 26 日中国证监会公布并于公布之日起施行的《证券公司集合资产管理业务实施细则》（证监会公告[2013]28 号）
《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》（中证协发[2012]206 号）
中国	指中华人民共和国
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

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

中国证监会	指中国证券监督管理委员会
员工持股计划	指上市公司江苏九鼎新材料股份有限公司公告的“第一期员工持股计划”,具体信息以上市公司江苏九鼎新材料股份有限公司公告为准
管理人	指上海光大证券资产管理有限公司，在本合同中有时也简称光证资管
托管人	指上海浦东发展银行上海分行，在本合同中有时也简称上海浦东发展银行，浦发银行
委托人或持有人	指依据《集合资产管理合同》合法取得本集合计划份额的投资者
投资者/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：（一）个人或者家庭金融资产合计不低于 100 万元人民币；（二）公司、企业等机构净资产不低于 1000 万元人民币。
补仓义务人	江苏九鼎集团有限公司
推广机构	指上海光大证券资产管理有限公司（直销）
注册登记业务	指本集合计划的登记、存管、清算和交收业务，具体内容包括委托人集合计划账户管理、集合计划份额注册登记、清算及集合计划交易确认、建立并保管集合计划持有人名册等
注册登记机构	指办理本集合计划注册登记业务的机构，即上海光大证券资产管理有限公司，在本合同中有时也简称光证资管
集合计划推广期间	指本集合计划开始接受委托人认购参与日至推广期结束日
集合计划运作期间	在本合同中又称投资运作期或存续期，指本集合计划成立后转入的投资运作期
成立日	指本集合计划达到《集合资产管理合同》约定的成立条件后，管理人确定的本集合计划成立的日期

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

开放期	指本集合计划存续期内委托人可以申请办理退出或申购参与的期间
工作日	指上海证券交易所和深圳证券交易所的正常交易日
开放日	指为委托人办理本集合计划参与、退出等业务的工作日
到期日	指各分类优先级按约定期限到期的工作日
分红权益登记日	指确认在注册登记机构登记在册的委托人享有某次分红收益分配的日期
元	指人民币元
集合计划收益	指集合计划利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额
集合计划资产总值	指本集合计划购买的各类证券、银行存款本息、本集合计划应收申购款以及其他资产的价值总和
A 类份额（优先级份额）	集合计划 A 类份额具有较低风险，较稳定收益的特点，计划清算时并享有优先分配权利，可以分期参与，称为 A 类份额（优先级份额）
B 类份额（次级份额/劣后级份额）	集合计划 B 类份额具有较高风险，较高收益的特点，计划清算时分配顺序劣后于 A 类份额（优先级份额）
份额净值	指集合计划资产净值除以总份额所得的每份集合计划资产的价值
份额累计净值	指每份额净值与集合计划成立以来每份额累计分红派息之和
集合计划资产估值	指计算评估集合计划资产和负债的价值，以确定集合计划资产净值和每份额净值的方法和过程
托管费	指托管人为集合计划提供托管服务而向集合计划收取的费用
管理费	指管理人为集合计划提供投资管理服务而向集合计划收取的费用

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

不可抗力	指遭受不可抗力事件一方不能预见、不能避免、不能克服的客观情况，包括但不限于自然灾害、战争、骚乱、火灾、突发性公共卫生事件、政府征用、没收、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、非因管理人或托管人自身原因导致的技术系统异常事故、法律法规变化或其他突发事件等

三、 合同当事人

（一）委托人

1、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：

2、机构填写：

优先级委托人：

机构名称：上海浦东发展银行股份有限公司上海分行 法定代表人：王新浩

通信地址：上海浦东南路 588 号 邮政编码：200120

代理人姓名：张姣姣 身份证号码：

联系电话：021-68887993 其他：

次级委托人：

机构名称：江苏九鼎新材料股份有限公司 法定代表人：顾清波

通信地址：如皋市中山东路 1 号 邮政编码：226500

代理人姓名： 身份证号码：

联系电话： 其他：

（二）管理人

管理人名称：上海光大证券资产管理有限公司

法定代表人：熊国兵

住所：上海市静安区新闸路 1508 号 1701 室

联系地址：上海市静安区新闸路 1508 号 1701 室

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

联系电话：021-22169646

传真：021-22169634

联系人：金银玲

（三）托管人

托管人名称：上海浦东发展银行上海分行

负责人：王新浩

住所：上海浦东南路588号

联系电话：

传真：

联系人：

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

四、 集合计划的基本情况

(一)名称：光证资管浦发众享添利九鼎新材 1 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

推广期和存续期规模上限为 10 亿份。单个客户首次参与金额不低于 100 万元。户数均不超过 200 人。

(四)投资范围

1、投资范围

本资产管理计划主要投资于九鼎新材（股票代码 002201）股票，在严格控制投资风险的基础上，最大限度地追求计划资产的稳定增值。具体投资范围如下：

（1）权益类资产：仅限于投资江苏九鼎新材料股份有限公司依法发行上市的股票（简称：九鼎新材，代码：002201）；

（2）现金类资产：包括但不限于国债逆回购、短期融资券、央行票据、银行存款、货币型证券投资基金；

本资产管理计划投资除上述资产以外的其他资产须经全体委托人及托管人书面同意。

2、投资组合比例（占资产总值比例）

本集合计划投资组合在各类资产上的投资比例，将严格遵守相关法律法规的规定：

权益类资产投资比例为资产管理计划财产总值的0-100%，且投资江苏九鼎新材料股份有限公司依法发行上市的股票总数累计不得超过该公司股本总额的10%，现金类资产投资比例为资产管理计划财产的总值的0-100%。

委托人签署本合同，即表示同意管理人将本集合计划资产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或承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易，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、集合资产管理计划规模变动等管理人之外的因素，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，具体顺延时间由管理人确定。

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

法律法规或中国证监会允许集合计划投资其他品种的，管理人在履行合同变更程序后，可以将其纳入本计划的投资范围。

(五)管理期限

本集合计划存续期为24个月，经全体委托人一致同意可展期；若本集合计划成立日起满12个月且本集合计划的非现金资产全部变现（即现金类资产占资产管理计划资产净值比例为 100%），管理人在征得全体委托人同意的情况下有权提前终止本集合计划。

本集合计划通过二级市场购买或大宗交易的方式所获得的九鼎新材股票的锁定期为 12 个月，自最后一笔九鼎新材股票过户至本集合计划名下时起算（具体信息以上市公司江苏九鼎新材料股份有限公司公告为准），锁定期内不得买卖九鼎新材股票。

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：（1）未发生需次级 B 份额持有人及补仓义务人补仓的情形；（2）次级 B 份额持有人及补仓义务人按照集合资产管理合同约定及时补仓。

(六)封闭期、开放期

1、封闭期：

（1）本集合计划优先级份额原则上封闭运作；非开放期均为封闭期，该期间内不办理参与和退出业务。

（2）本集合计划次级份额原则上封闭运作；非开放期均为封闭期，该期间内不办理参与和退出业务。

2、开放期：

（1）本集合计划原则上不设开放期。

（2）临时开放期

当发生本合同约定的情况时，管理人可在网站公告设置临时开放期，为集合计划份额委托人办理退出或强制退出业务，但优先级份额与次级份额资产净值之比不得超过 2:1。合同约定的情况包括但不限于：合同的补充、修改与变更以及其他可能对集合计划的持续运作产生重大影响的事项；解禁卖出后，委托人可以申请临时开放期，管理人根据委托人的申请有权决定是否设置临时开放期；其他管理人认为应当开放的情况等。

临时开放期的具体安排由管理人在指定网站公告。

(七)集合计划份额面值

本集合计划份额的面值为人民币 1.00 元。

(八)参与本集合计划的最低金额

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

单个委托人首次参与本集合计划（包括优先级和次级份额）的最低金额为 1,000,000 元，追加参与资金不设金额级差。

(九)本集合计划的风险收益特征及适合推广对象

本集合计划根据风险收益特征进行分级，分为优先级份额和次级份额。

本计划优先级份额属于低风险证券投资产品。

本计划次级份额属于高风险证券投资产品。

本集合计划优先级份额适合向风险承受能力较低、资产流动性需求不高的投资者。

本集合计划次级份额适合向能够承受本金较大范围损失、资产流动性需求不高、熟悉金融市场的或具有资产配置需求的投资者。

(十)本集合计划的推广

1、推广机构：上海光大证券资产管理有限公司

2、推广方式

本集合计划将通过推广机构进行销售。

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，置备于推广机构营业场所。本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、夸大参考年化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批准或者备案信息、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，不得通过广播、电视、报刊、互联网及其他公共传播媒体或者讲座、报告会、分析会等方式向不特定对象推广本集合计划。

(十一)本集合计划的各项费用

1、参与费率：0

2、退出费率：0

3、管理费

本集合计划的年管理费率为**0.6%/年**。

4、托管费

本集合计划的年托管费率为**0.1%/年**。

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

5、业绩报酬

本集合计划不提取业绩报酬。

6、其他费用

其他费用及具体计算方法详见本合同第 13 部分集合计划的费用。

（十二）本集合计划的特别约定

1、预警线和平仓线设置

本集合计划设置预警线和平仓线，预警线为计划份额净值小于或等于【0.92】；平仓线为计划份额净值小于或等于【0.88】。

2、预警线

本集合计划存续期内，T 日收盘后，如果计划份额净值小于或等于预警线 0.92，则管理人应在 T+1 日上午 9:30 点前通知劣后级委托人或第三方补仓义务人补仓，劣后级委托人或第三方补仓义务人应在 T+2 日 12：30 之前足额补仓，补仓当日净值应达到 0.92 及以上。否则，管理人有权在 T+2 日 13：00 开始限仓操作，将股票仓位减持至计划净值的 50%。待补仓期间，任一交易日收盘计划净值恢复至 0.92 以上，则视同补仓。

3、平仓线

在股票锁定期内，如果 T 日计划份额净值小于或等于 0.88，则管理人应在 T+1 日上午 9：30 前通知劣后级委托人或第三方补仓义务人补仓，劣后级委托人或第三方补仓义务人应在 T+1 日 10：30 之前足额补仓，补仓当日净值应达到 1.00 及以上。如果劣后级委托人或第三方补仓义务人 T+1 日未按约进行补仓，则劣后级委托人份额罚没，归优先级委托人所有。

在股票锁定期外，计划存续期间 T 日收盘后，如果计划份额净值小于或等于 0.88，则管理人应在 T+1 日上午 9：30 前通知劣后级委托人或第三方补仓义务人补仓，劣后级委托人或第三方补仓义务人应在 T+1 日 10：30 之前足额补仓，补仓当日净值应达到 1.00 及以上。否则，管理人有权在 T+1 日 10：30 开始平仓操作。劣后级委托人或第三方补仓义务人在 T+1 日 12：30 之后足额补仓的，如果优先级委托人认可，可以不进行平仓操作或终止平仓操作。如果管理人平仓后,经优先级委托人许可,劣后级委托人或第三方补仓义务人在 T+1 日 16:00 之前足额补仓，则恢复其投资权限。

补仓义务人追加的增强资管计划资金，不改变资管计划单位总份数，不改变次级份额受益权项下资管计划利益的计算方法。若补仓义务人未能及时、足额补仓的，次级份额罚没灭失，并归优先级投资者所有。

4、补仓资金的取回

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

补仓义务人追加补仓资金后，T 日收盘后，如果集合计划单位净值已连续 5 个交易日高于 1.00 元时，则补仓义务人有权在 T+1 日向管理人申请取回部分或全部补仓资金（简称“退款申请”），但预估取回补仓资金后，本计划在提出退款申请前一个工作日的预估单位净值不得低于 1.00 元（含）。退出追加资金的申请经管理人确认后，将在 3 个工作日内将补仓义务人要求退出的资金划付至其指定账户。累计取回补仓资金的总额不得超过累计补仓资金的总额。补仓资金产生的收益归计划财产所有，不属于退还范围。

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

五、 集合计划的参与和退出

（一）集合计划的参与办理时间

1、推广期参与

本集合计划推广期指集合计划接受委托人认购参与日至推广期结束日。本集合计划推广期最长不超过60个工作日。

在推广期内，投资者在推广机构的工作日内可以参与本集合计划。

如本集合计划在推广期内参与金额达到10亿元，或者客户数达到200户，可提前终止推广期。管理人在推广期内使用“金额优先+金额同等情况下时间优先”方法对集合计划参与总规模实行限量控制。具体方式请参看本章节第（四）项参与费及参与份额的计算。

若管理人决定提前结束推广期，应提前一个工作日通知推广机构和注册登记机构。

（二）参与的原则

1、投资者资格要求

投资者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。

依法设立并受监管的各类集合投资产品是为单一合格投资者。

2、本集合计划采用纸质合同的方式签署，委托人在各销售网点，签署纸质合同。纸质合同在管理人、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纸质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。

3、“金额参与”原则，即参与以金额申请。本集合计划单个委托人首次参与最低金额为100万元人民币，追加参与的最低金额不设金额级差。

4、本集合计划优先级份额在推广期参与均采用“已知价”原则，即参与价格以人民币1.00元为基准进行计算份额；存续期参与采用“未知价”原则，即参与价格以参与申请日优先级份额单位净值为基准进行计算份额。次级份额推广期参与采用“已知价”原则；存续期参与采用“未知价”原则，即参与价格以参与申请日次级份额单位净值为基准进行计算份额。

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

5、推广期委托人的参与资金在集合计划成立之前所产生的利息折成集合计划份额的，该份额归委托人所有，参与资金的利息以注册登记机构的记录结果为准。存续期优先级份额委托人的参与资金在各分类优先级开放期不计算利息，自各分类优先级当期开放期结束后的下一工作日起享受收益。

6、委托人在推广期内可以多次参与本集合计划，已经受理的参与申请只能在当日交易时间结束之前撤销。

7、本集合计划推广期优先级和次级份额分开募集，先募集次级份额，再募集优先级份额。本集合计划在推广期内规模上限为 10 亿元（不含参与资金利息结转的计划份额），本资产管理计划优先级 A 份额和次级 B 份额的初始配比原则上不超过 2:1（注：不包括募集期利息折份额的部分），根据次级份额的募集规模，确定优先级份额的募集规模。

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。

（三）参与的程序和确认

1、参与程序和确认

（1）投资者按推广机构的业务规定，在推广期或开放期的交易时间段内于推广机构指定的营业网点办理；

（2）投资者应开设推广机构认可的资金账户，并在资金账户备足参与资金；若资金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，方可申请参与集合计划。参与申请经管理人确认有效后，构成本合同的有效组成部分；

（4）投资者参与申请确认成功后，其参与申请和参与资金不得撤销；

（5）投资者推广期参与的，可于推广期截止后2个工作日到办理参与的营业网点查询参与确认情况；投资者于开放期参与的，可于参与日后2个工作日到办理参与的营业网点查询参与确认情况。委托人认可管理人对其认购参与有效性的确认，除经管理人同意外，不再要求管理人提供任何有效性确认的资料。

2、参与的注册登记

投资者参与成功后，注册登记机构在 T＋1 日为委托人登记权益并办理注册登记手续。

3、暂停参与的情形

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

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) 战争、自然灾害等不可抗力的原因导致集合计划无法正常运作；

(2) 管理人认为本集合计划出现或可能出现超额募集情况；

(3) 证券交易场所在交易时间非正常停市，导致无法计算当日的集合计划资产净值；

(4) 管理人认为集合计划资产规模过大，可能对集合计划业绩产生负面影响，从而损害现有集合计划委托人的利益；

(5) 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；

(6) 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；

(7) 集合计划管理人认为会有损于现有集合计划委托人利益；

(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；

发生上述暂停参与情形时，集合计划管理人应当通过管理人网站或其他方式及时报告委托人。

（四）参与费及参与份额的计算

1、参与费率

本集合计划参与费用为0。

2、参与份额的计算方法：

（1）推广期参与份额的计算

参与份额＝（参与金额＋推广期利息）/集合计划份额面值

参与份数保留小数点后两位，小数点后第三位四舍五入。

如本集合计划在推广期内参与金额达到 10 亿元或者参与的客户数达到 200 户，可提前终止推广期。

本集合计划管理人在推广期内使用“金额优先+金额同等情况下时间优先”方法对集合计划参与总规模实行限量控制。

1)推广期内参与申请金额不超过 10 亿元或参与的客户数不足 200 户（含 10 亿元或 200 户）的情形：若推广期内有效参与申请本集合计划参与的总金额不超过 10 亿元（含**(规模)**亿元）或参与的客户数不足 200 户，则所有的有效参与申请全部予以确认。

2)推广期内参与申请金额高于 10 亿元或参与的客户数达到 200 户的情形：若推广期内有效参与申请本集合计划参与的总份额超过 10 亿元或参与的客户数超过 200 户，管理人将提前终止推广期。推广期规模上限日是指，在推广期集合计划认购申请累计确认份额超过规模上限的第一个交易日。在该交易日之前的有效认购申请全部予以确认；在该交易日的有效认购申请采用“金额优先+金额

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

同等情况下时间优先”的原则给予部分确认，未确认部分的认购款项全额退还给委托人；在该交易日之下一日，管理人通知各销售网点结束产品认购，同时公告推广期提前结束；在该交易日之后的申请全部予以拒绝。

推广期末日管理人根据委托人申请单申请参与金额进行从大到小排序，在申请金额同等的情况下则按时间优先原则排序，再对排序后的申请单进行逐笔金额确认，直到累计确认金额达到本集合计划的规模上限。若加上某一笔参与金额后，该推广机构的参与总份额超出了分配限额，则对该参与申请及大于该申请单号的参与申请予以全部拒绝。超出目标规模的部分由推广机构将参与资金退回委托人指定资金账户，并停止该集合计划接受参与申请。

管理人在 T+1 个工作日（设认购截止日为 T 日）对投资者认购参与的有效性进行确认。

举例如下：**(假定产品规模为 50 亿元)**

例 1：某委托人投资 2,000,000 元参与本集合计划。假设推广期内有效参与金额不足 50 亿元，且总户数不足 200 户，该笔参与将按照 100%比例全部确认，在推广期间产生利息 60.00 元，集合计划参与价格每份 1.000 元。则其可得到的参与份额为：

参与总金额=2,000,000 元

参与份额=(2,000,000+60.00)/1.000＝2,000,060 份

即：委托人投资 2,000,000 元参与本集合计划，可得到 2,000,060 份集合计划份额（含利息折份额部分）。

例 2：某委托人投资 2,000,000 元参与本集合计划，假设该笔参与申请发生在参与末日，本次参与末日之前有效参与申请金额达到 48 亿元，共 190 户，参与末日的有效参与申请金额为 3 亿元。

首先，对所有委托人按照申请单申请金额由大到小进行排序，在申请金额同等的情况下根据申请时间优先原则进行排序，并计算申请单累计参与金额，当累计参与金额超过 2 亿元或户数超过 200 户时，对该临界序号(不含)之前的申请序号代表的参与金额全部确认，对该临界序号(含)之后的申请序号代表的参与金额全部作为未确认金额，未确认金额将于本集合计划参与结束后退回委托人账户。

假定前述委托人的申请单序号为 7，临界序号为 8，则其 2,000,000 元参与申请全部确认。确认参与份额的计算方法同例 1；

假定前述委托人的申请单序号为 9，临界序号为 8，则其参与申请作为未确认金额处理，将于本集合计划参与结束后全部退回委托人账户。

假定前述委托人的申请单序号正好为临界序号，则其参与申请作为未确认金额处理，将于本集合计划参与结束后全部退回委托人账户。

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

（2）存续期参与份额的计算

1）优先级参与份额=优先级参与金额/优先级份额的面值

2）次级参与份额=次级参与金额/次级份额单位净值

3）参与份数保留小数点后两位，小数点后第三位四舍五入。

4）本集合计划管理人在存续期内使用“金额优先+金额同等情况下时间优先”方法对集合计划参与总规模实行限量控制。

（五）参与资金利息的处理方式

委托人的参与资金在推广期产生的利息将折算为计划份额归委托人所有。

(六)集合计划的退出

本集合计划存续期内原则上不办理退出业务。但是，经全体委托人书面同意，如果本集合计划合同变更或者管理人设置临时开放期的，委托人可在临时开放期退出集合计划。

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

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

本集合计划根据风险收益特征进行分级：

（一）分级安排：

本集合计划分为优先级份额和次级份额。

优先级份额按照约定的参考年化收益率享有收益，本集合计划优先级份额（A 份额）的参考年化收益率为【6.2】%。

次级份额享有本集合计划剩余资产和收益的分配。

（二）份额配比：

在推广期和存续期，本集合计划优先级份额和次级资产净值之比原则上不超过 2:1（**优先级份额：次级份额**）。

（三）风险承担：

1、优先级份额

本集合计划优先级 A 份额的参考年化收益并不是管理人向客户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。

本集合计划在扣除 A 份额的本金和应计收益后的全部剩余收益归 B 份额所有。

如本集合计划净资产等于或低于 A 份额的本金及累计每日参考年化收益的总额，则本集合计划净资产全部分配给 A 份额后，仍存在额外未弥补的 A 份额的本金及参考年化收益总额的差额，由补仓义务人按合同约定追加补仓资金。

管理人并不承诺或保证 A 份额持有人获得自集合计划成立日起累计每日参考年化收益的总额，即如在本集合计划资产出现极端损失情况下，A 份额仍可能面临无法取得累计每日参考年化收益乃至投资本金受损的风险。

2、次级份额

本集合计划次级份额承担较大风险，享有本集合计划剩余收益。优先级份额与次级份额净值估

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

值请参考“第 12 部分 集合计划估值”

八、 集合计划客户资产的管理方式和管理权限

本集合计划由**上海光大证券资产管理有限公司**担任管理人，负责本集合计划的运作管理。

（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 万元人民币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。

本集合计划成立的时间为计划管理人根据《管理办法》及相关法规规定发布集合计划成立公告的日期。

集合计划设立完成前，委托人的参与资金只能存入集合计划份额登记机构指定的专门账户，不得动用。

（二）集合计划设立失败

集合计划推广期结束，在集合计划规模低于人民币 3000 万元或者委托人人数低于 2 人条件下，集合计划设立失败，管理人承担集合计划全部推广费用，并将已认购资金及同期利息在推广期结束后 30 工作日内退还集合计划委托人，各方互不承担其他责任。利息金额以本集合计划注册登记机构的记录为准。

（三）集合计划开始运作的条件和日期

1、条件：

自集合计划宣布成立即符合开始运作的条件。

2、日期

本集合计划自成立之日起开始运作。

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

十、 集合计划账户与资产

（一）集合计划账户的开立

托管人以集合计划的名义在托管银行开设托管专户，保管集合计划的银行存款，该托管专户是指托管人在集中清算模式下，代表所托管的包括集合计划在内的托管资产与中国证券登记结算有限责任公司进行一级结算的专用账户。集合计划的一切货币收支活动，包括但不限于投资、支付退出金额、支付计划收益、收取参与款，均需通过该账户进行。托管人可根据实际情况需要，为计划财产开立资金清算辅助账户，以办理相关的资金汇划业务。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。

托管人为本集合计划开立证券账户，证券账户名称为**“光证资管浦发众享添利九鼎新材 1 号集合资产管理计划”**［备注：账户名称以实际开立账户名称为准］

推广机构为集合计划的每一位委托人建立集合计划交易账户，记录委托人通过该推广机构买卖本集合计划份额的变动及结余情况。

管理人委托上海光大证券资产管理有限公司或其它符合条件的机构担任本计划的注册登记机构，并承担相应委托责任。注册登记机构为委托人开立集合计划账户，用于记录委托人持有的本集合资产管理计划份额。

（二）集合计划资产的构成

本集合计划的资产包括用集合计划资金投资的江苏九鼎新材料股份有限公司（简称：九鼎新材；代码：002201）的员工持股计划业务。

（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、托管人或注册登记机构的自有资产及其管理、托管的其他资产。管理人、托管人或注册登记机构的债权人不得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、 集合计划资产的托管

集合计划资产由计划管理人委托上海浦东发展银行上海分行托管，管理人已经与托管银行签订了托管协议。托管人将严格遵照有关法律法规及双方达成的托管协议对集合资产进行托管。

委托人签署本合同的行为本身即表明对现行证券交易、登记结算制度下托管人托管职能有充分的了解，并接受本合同约定的托管职责和范围。

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

十二、 集合计划估值

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

集合计划的资产总值是指通过发行计划份额方式募集资金，并依法进行投资江苏九鼎新材料股份有限公司依法发行上市的股票（简称：九鼎新材，代码：002201），以及现金类资产等资本市场投资所形成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价值。

集合计划次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。

（三）净值计算

本集合计划成立后每个工作日，管理人在计算资产净值的基础上，采用“虚拟清算”原则分别计算优先级 A 份额和次级 B 份额的单位份额参考净值。单位份额参考净值是对两级份额价值的一个估算，并不代表份额持有人可获得的实际价值。

在 T 日，令

t 为自上一个收益分配基准日（若无，则为本计划成立日）至 T 日的运作天数；

Ct 为 T 日收市后的集合计划资产净值，是集合计划资产总值减去集合计划负债后的价值；

RA 为 A 类份额的约定年化收益率；

SAt 和 SBt 分别指 T 日 A 份额和 B 份额的份额总数；

St 指 T 日集合计划份额总数，St=SAt+SBt；

NAVAt 和 NAVBt 分别指 T 日 A 类份额和 B 类份额的单位份额参考净值；

NAVt 为 T 日收市后的集合计划单位净值，定义

NAVt= Ct÷St

1、若 Ct ＜ (1+RA×t / 365) ×SAt ，则

NAVAt = Ct÷SAt

NAVBt =0

2、若 Ct ≥ (1+RA×t / 365) ×SAt ，则

NAVAt = 1＋RA×t / 365

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

NAVBt = [Ct－SAt×(1＋RA×t / 365)]÷SBt

集合计划单位净值、优先级 A 份额和次级 B 份额的单位份额参考净值的计算，精确到 0.0001 元，小数点后第五位四舍五入，由此产生的误差计入集合计划资产，国家另有规定的从其规定。

T 日集合计划单位净值、A 份额和 B 份额的单位份额参考净值在工作日收市后计算，并在净值报告日公告。

（四）份额净值的计算方法

A 份额净值=T 日日终 A 份额资产净值/T 日日终 A 份额数

B 份额净值=T 日日终 B 份额资产净值/T 日日终 B 份额数

上述 A、B 类份额的资产净值具体以管理人确认为准。

（五）估值目的

集合计划资产估值的目的是客观、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、计算参与和退出及委托到期清算集合计划的基础。

（六）估值对象

运用集合计划资产所持有的一切金融资产和金融负债。

（七）估值日

本集合计划成立后，对资产进行估值之每个交易日。

（八）估值方法

除管理人在资产购入时特别标注并给托管人正式书面通知及另有规定外，本计划购入的资产均默认按交易性金融资产核算与估值。如国内证券投资会计原则及方法发生变化，由管理人与托管人另行协商确定估值方法，并以签署托管协议补充协议的方法确定有关内容。

1、债券估值方法

（1）在证券交易所市场挂牌交易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的估值意见，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。

（2）在证券交易所市场挂牌交易未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去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所含的债券应收利息得到的净价估值；如果估值日无交易，

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

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的估值意见，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。

（3）首次发行未上市债券采用估值技术确定的公允价值进行估值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

（4）交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券，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，按成本进行后续计量。

（5）在对银行间市场的固定收益品种估值时，应主要依据第三方估值机构公布的收益率曲线及估值价格。

（6）同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

（7）在任何情况下，资产管理人如采用本项第（1）－（6）小项规定的方法对计划资产进行估值，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）－（6）小项规定的方法对计划资产进行估值不能客观反映其公允价值的，资产管理人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形成的债券估值，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。

2、 股票的估值方法

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。

2）上市流通股票估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件，以最近交易日的收盘价估值。

3）上市流通股票估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化或者证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，使投资品种潜在估值调整对前一估值日的资产净值的影响在0.5%以上的，可参考停牌股票的估值方法，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。

4）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。

5）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收盘价进行估值。

6）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收盘价进行估值。

7）非公开发行股票等其他方式获取且有明确锁定期的股票，按以下方法估值：

a.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收盘价作为估值日该非公开发行股票的价值。

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

b.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）。

c. 股票的首个估值日为上市公司公告的股份上市日所对应的日历日。

8）停牌股票可根据具体情况采用指数收益法。

3、 银行定期存款或通知存款估值方法，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。如提前支取或利率发生变化，将及时进行账务调整。债券逆回购以成本估值并按其商定利率在持有期内逐日计提应收利息。

4、商业银行理财计划等以成本列示，到期确认投资收益。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。

5、本计划持有的货币市场基金，按基金管理公司公布的估值日前一交易日的每万份收益计算。

6、 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。

7、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.

如管理人或托管人发现集合估值违反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份额持有人利益时，应立即通知对方，共同查明原因，双方协商解决。

根据有关法律法规，资产净值计算和会计核算的义务由管理人承担。本集合的会计责任方由管理人担任，因此，就与本集合计划有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照管理人对集合资产净值的计算结果对外予以公布。

8、 暂停估值的情形：集合计划投资所涉及的证券交易所遇法定节假日或其它原因暂停营业时，或因其它任何不可抗力致使管理人或托管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，管理人或托管人必须及时完成估值工作。

（九）估值程序

日常估值由管理人进行。用于披露的资产净值由管理人完成估值后，将估值结果报送托管人，托管人按照规定的估值方法、时间与程序进行复核；托管人复核无误签章后返回给管理人；报告期

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

末估值复核与集合资产管理计划会计账目的核对同时进行。

托管人在此与管理人约定，托管人在各分类优先级份额到期日及季度及年度报告期末进行估值复核，日常估值数据以管理人为准。

集合计划次级份额净值的计算，精确到0.0001元，小数点后第五位四舍五入。

（十）差错处理

1、 当发生净值计算错误时，由管理人负责处理，由此给委托人和集合计划造成损失的，由管理人对委托人或者计划先行支付赔偿金。管理人和托管人应根据实际情况界定双方承担的责任，经确认后按以下条款进行赔偿。

（1）集合计划的会计责任方由管理人担任。与计划有关的会计问题，如经管理人和托管人在平等基础上充分讨论后，尚不能达成一致时，按会计责任方的建议执行，由此给委托人和计划造成的损失，由管理人负责赔付；

（2）如管理人净值计算出错，托管人在复核过程中没有发现，且造成委托人损失的，由双方各自承担相应的赔偿责任；

（3）如管理人和托管人对计划份额净值的计算结果，虽然多次重新计算和核对，尚不能达成一致时，为避免不能按时向委托人报告份额净值的情形，以管理人的计算结果对外公布，由此给委托人和计划造成的损失，由管理人负责赔付；

（4）如管理人与托管人协商不一致，以管理人为准。如管理人和托管人协商一致，采用本协议规定的方法确定一个价格进行估值的情形下，若管理人净值计算出错，托管人在复核过程中没有发现，且造成计划或委托人损失的，由管理人和托管人各自承担相应的赔偿责任。

2、由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误，有关会计制度变化或由于其他不可抗力原因，管理人和托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误而造成的份额净值计算错误，管理人、托管人可以免除赔偿责任。但管理人、托管人应积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

3、法律法规、部门规章或者监管部门另有规定的，从其规定。如果行业有通行做法，管理人和托管人应本着平等和保护委托人利益的原则进行协商。

（十一）暂停披露净值的情形

1、与本计划投资有关的证券交易场所遇法定节假日或因其他原因停市时；

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

2、因不可抗力或其他情形致使管理人、托管人无法准确评估集合资产管理计划资产价值时

(十二)特殊情形的处理

由于本计划所投资的各个市场及其登记结算机构发送的数据错误，或由于其他不可抗力原因，管理人和托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误或即使发现了错误，但因前述原因无法纠正的，由此造成的集合资产管理计划资产计价错误，管理人和托管人免除赔偿责任。但管理人和托管人应当积极采取必要的措施消除或减少由此造成的影响。

由于注册登记机构发送的数据有误，处理方法等同于交易数据错误的处理方法。

由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误，有关会计制度变化、管理人或托管人托管业务系统出现重大故障或由于其他不可抗力原因，管理人和托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误或即使发现了错误，但因前述原因无法纠正而造成的份额净值计算错误，管理人、托管人免除赔偿责任。但管理人、托管人应积极采取必要的措施消除或减少由此造成的影响。

十三、 集合计划的费用

(一)集合计划费用计提方法、计提标准和支付方式

1、托管人的托管费

本集合计划应给付托管人托管费，按前一日的资产净值的年费率计提。本集合计划的年托管费率为**0.1%**计算方法如下：

H ＝ E ×**0.1%**÷ 365

H 为每日应计提的托管费；

E 为前一日集合计划资产净值。

托管人的托管费每日计算，托管费计算逐日累计至每月月底，按**季度**支付，由托管人于次**季度**首日起5个工作日内依据管理人划款指令从本集合计划资产中一次性支付，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。闰年2月29日不计算。

2、管理人的管理费

本集合计划应给付管理人管理费，按前一日的资产净值的年费率计提。本集合计划的年管理费率为**0.6%**。计算方法如下：

H ＝ E ×**0.6%**÷ 365

H 为每日应计提的管理费；

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

E 为前一日集合计划资产净值。

管理人的管理费每日计算，逐日累计至每月月底，按**季度**支付，由托管人于次**季度**首日起5个工作日内依据管理人划款指令从本集合计划资产中一次性支付，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。闰年2月29日不计算。

3、证券交易费用

本集合计划应按规定比例支付经手费、证管费、过户费、印花税、证券结算风险基金、佣金等费用。

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。在次月首日起 10 个工作日内支付给提供交易单元的券商。

4、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，按与会计师事务签定协议所规定的金额，在被审计的会计期间，按直线法在每个自然日内平均摊销。如金额较小，可以一次进入各集合计划费用。

5、按照国家有关规定可以列入的其他费用

银行结算费用、银行间市场账户维护费、开户费、银行账户维护费、银行间交易费、转托管费、注册登记机构收取的相关费用等集合计划运营过程中发生的相关费用。

银行结算费用，一次计入集合计划费用；

银行间市场账户维护费，按银行间市场规定的金额，在相应的会计期间按日平均摊销；

开户费、银行账户维护费、银行间交易费、转托管费在发生时一次计入集合计划费用；

与集合计划运营有关的其他费用，如果金额较小，或者无法对应到相应会计期间，可以一次进入集合计划费用；如果金额较大，并且可以对应到相应会计期间，应在该会计期间内按直线法摊销。

上述计划费用中第 3 至 5 项费用由管理人根据有关法律法规及相应协议的规定，按费用实际支出金额支付。

(二)不列入集合计划费用的项目

集合计划推广期间的费用，管理人和托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或集合计划资产的损失，以及处理与本集合计划运作无关的事项发生的费用等不列入本集合计划费用。

(三)管理人提取业绩报酬

本集合计划不提取业绩报酬。

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

十四、 投资收益与分配

（一）收益的构成

本集合计划收益指集合计划利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额，集合计划已实现收益指集合计划收益减去公允价值变动收益后的余额。

（二）可供分配收益

可供分配收益指截至收益分配基准日（即可供分配收益计算截至日）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。

（三）收益分配原则（优先级到期还本付息）

1、本集合计划存续期内不进行收益分配。

2、法律、法规或中国证监会另有规定的，从其规定。

十五、 投资理念与投资策略

（一）投资目标

本资产管理计划主要投资于江苏九鼎新材料股份有限公司依法发行上市的股票（简称：九鼎新材；代码：002201），力争为投资者带来稳健回报。

（二）投资理念

注重资产安全性，以宏观经济研究和公司基本面研究主导投资，在市场可控风险下进行买入操作。

（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，根据本合同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

根据本合同的约定进行主动管理，努力为委托人谋求收益，力争实现委托人资产持续稳健增值。

3、现金类资产投资策略

本集合计划以市场价值分析为基础，采用稳健的投资组合策略，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。

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

如果按照法律法规、中国证监会等相关监管机构的要求，资产管理人需要履行相关信息披露义务，资产委托人应当给予必要的配合。

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》等有关法律文件；

2、宏观经济发展态势、微观经济运行环境和证券市场走势。这是本集合计划投资决策的基础；

3、投资对象收益和风险的配比关系。在充分权衡投资对象的收益和风险的前提下作出投资决策，是本集合计划维护投资者利益的重要保障。针对产品的特点，在衡量投资收益与风险之间的配比关系时，力争保护投资者的本金安全，在此基础上为投资者争取较高的收益。

（二）投资程序

投资决策与操作流程控制包括投资研究流程、投资对象备选库的确定、资产配置与重大投资项目提案的形成、投资决议的形成与执行程序、投资组合跟踪与反馈以及核对与监督过程。

1、投资分析和研究

管理人的投资与研究部内设研究小组，从宏观经济形势、行业发展趋势、市场趋势、投资标的评价结果等多个角度综合分析，运用定性和定量方法进行研究，经过评级、估值和风险评判，通过严格的筛选程序，构建备选库，撰写研究报告，制定投资策略建议和投资建议，并根据市场变化情况，适时做出调整。

2、制定资产配置策略

管理人的投资与研究部内设投资决策委员会，投资决策委员会根据研究部门的研究成果，在考虑市场运行趋势的基础上，对投资策略和投资建议进行仔细讨论并确定资产配置策略，规定本集合计划在不同类型资产上的配置比例。

3、构建与调整投资组合

本集合计划投资经理（即投资主办人员）在投资决策委员会授权的范围内，根据投资决策委员会确定的投资原则和资产配置比例，从备选库中选择合适的投资标的构建投资组合，并负责进行投资组合的日常管理。

4、风险管理与组合的调整

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

合规风控委员会是公司的最高风险控制机构，负责监控本集合计划的投资运作和交易，对本集合计划的投资组合进行绩效和风险评估，根据市场变化对投资组合的资产配置和调整提出风险控制意见。投资经理需根据合规风控委员会的风险控制意见，调整组合结构，优化组合的风险收益配比，在维护资产安全的前提下，获取较高的资本增值。

（三）风险控制

1、风险控制的原则

在建立风险管理体系时应严格遵循以下原则：

（1）全面性原则：风险管理制度应覆盖管理人业务的各项工作和各级人员，并渗透到决策、执行、监督、反馈等各个环节；

（2）审慎性原则：风险管理的核心是有效防范各种风险，管理人组织体系的构成、内部管理制度的建立都要以防范风险、审慎经营为出发点；

（3）独立性原则：风险管理工作应保持高度的独立性和权威性，并贯彻到业务的各具体环节；

（4）有效性原则：风险管理制度应当符合国家法律法规和监管部门的规章，具有高度的权威性，成为所有员工严格遵守的行动指南；执行风险管理制度不能存在任何例外，任何员工不得拥有超越制度或违反规章的权力；

（5）适时性原则：风险管理制度应随着国家法律、法规、政策制度的改变以及业务的发展变化及时进行相应修改和完善；

（6）防火墙原则：管理人内部对投资管理、研究策划、市场开发、风险管理、综合支持等职能通过组织与岗位分设，且相互制衡，以达到风险防范的目的。因业务需要知悉内幕信息的人员，应严格遵守管理人的保密协议；

（7）定性和定量相结合原则：建立完备的风险管理指标体系，使风险管理更具客观性和可操作性。

2、投资风险管理程序

（1）研究业务的风险控制

研究工作应保持独立、客观，不受任何部门及个人的不正当影响；建立严密的研究工作业务流程，形成科学、有效的研究方法；建立投资产品备选库制度，研究部门根据投资产品的特征，在充分研究的基础上建立和维护备选库。建立研究与投资的业务交流制度，保持畅通的交流渠道；建立研究报告质量评价体系，不断提高研究水平。

（2）投资业务的风险控制

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

集合计划的投资应确立科学的投资理念，根据决策的风险防范原则和效率性原则制定合理的决策程序；在进行投资时应有明确的投资授权制度，并应建立与所授权限相应的约束制度和考核制度。建立严格的投资禁止和投资限制制度，保证集合计划投资的合法合规性。建立投资风险评估与管理制度，将重点投资限制在规定的风险权限额度内；对于投资结果建立科学的投资管理业绩评价体系。

（3）交易业务的风险控制

建立专门的交易部和集中交易制度，投资指令通过交易部完成；应建立交易监测系统、预警系统和交易反馈系统，完善相关的安全设施；交易部应对交易指令进行审核，建立公平的交易分配制度；交易记录应完善，并及时进行反馈、核对并存档保管；同时应建立科学的投资交易绩效评价体系。

（4）会计核算的风险控制

管理人根据法律法规及业务的要求建立会计制度，并根据风险控制点建立严密的会计系统，对于不同集合计划独立建账，独立核算；管理人通过复核制度、凭证制度、合理的估值方法和估值程序等会计措施真实、完整、及时地记载每一笔业务并正确进行会计核算和业务核算。同时还建立会计档案保管制度，确保档案真实完整。

（5）信息披露

管理人建立了完善的信息披露制度，保证公开披露的信息真实、准确、完整。管理人应设立信息披露负责人，并建立相应的程序进行信息的收集、组织、审核和发布工作，以此加强对信息的审查核对，使所公布的信息符合法律法规的规定，同时加强对信息披露的检查和评价，对存在的问题及时提出改进办法。

4、全程风险管理控制

（1）建立风险控制构架，完善风险控制制度和体系。

在制度管理方面，除了管理人的基本制度和内控规范外，针对资产管理业务还系统地制定了投资管理、交易、风险控制、产品开发、客户服务和营运管理等制度，对资产管理业务的投资决策体系、投资管理流程、权限管理、交易工作流程、可投资证券库的建立及维护程序、产品开发程序、客户服务机制等都做出了具体的规定。

在组织构架方面，将市场营销、投资管理、交易执行、综合支持、风险管理等予以内部岗位分设，通过职能分离形成制衡，并设立了独立的风控岗位加强风险监管。

（2）风险识别：对各类风险及各个风险点进行全面有效识别。

管理人已按照资产管理业务流程，对本集合计划的设计开发、合同签订、委托人开户、投资决策、投资执行、交易、财务清算与资金、客户管理等各环节风险点进行全面梳理。本集合资产管理

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

计划的主要风险为市场风险、流动性风险、信用风险和管理风险等。

（3）风险度量：综合运用各类分析方法，评估各类风险及各个风险点的风险水平。

对于本集合资产管理计划已建立了风险管理指标体系，包括合规性指标、配置管理指标、权限管理指标、市场风险指标、流动性风险指标、信用风险指标等。管理人已建立风险管理绩效评估系统，借助量化手段进行风险评估。

（4）风险处理：依据各类风险及各个风险点的风险水平，参照既定的风险控制目标，建议并监督实施一定的控制措施。

根据设定的风控指标、投资范围及其他限定性条件在投资管理系统中设置阀值或限制，当投资及交易出现超出限定范围情况时，系统可自动预警；通过资产管理业务的交易系统等对业务进行实时监控；对于资产配置的策略、计划和组合，不同的决策层面定期进行评估、检讨，分析业务风险并进行相应调整；对于重大突发风险，则启动应急机制。

（5）风险报告与反馈：建立自下而上的风险报告程序，使各个层面及时掌握风险状况，从而以最快速度自上而下做出决策反馈。

管理人制定了多层的业务报告制度，投资管理及风险状况每日需报告部门领导，周报、月报、季报需分别上报管理人部门领导、管理人分管领导和管理人风控部门，投资实施及风险状况受到多重的监管。

（6）监督与检查：评估风险管理的有效性，适时加以修正。

管理人风险控制部门定期或不定期地检查业务内控的有效性，对内控机制的设计或运行中的缺陷提出改进意见，完善风控措施。

十七、 投资限制及禁止行为

（一）投资限制

为维护集合计划委托人的合法权益，本集合计划的投资限制为：

（1）不得投资九鼎新材以外的股票。

（2） 买卖上市公司股票应遵守《公司法》、《证券法》、《上市公司收购管理办法》、《上市公司信息披露管理办法》、《关于上市公司实施员工持股计划试点的指导意见关于上市公司实施员工持股计划试点的指导意见》等法律法规及监管政策的规定。

（3）本计划不得在下列期间买卖上市公司股票：

1）上市公司定期报告公告前 30 日内，因特殊原因推迟公告日期的，自原公告日前 30 日起至

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

最终公告日；

2）上市公司业绩预告、业绩快报公告前 10 日内；

3）自可能对上市公司股票交易价格产生重大影响的重大事项发生之日或在决策过程中，至依法披露后 2 个交易日内。

管理人在决定买卖上市公司股票时，上市公司董事会秘书有义务向管理人提供股票是否处于买卖敏感期信息。

（4）中国证监会规定的其他行为。

（5）本集合资产管理合同约定禁止从事的其他投资。

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。

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）报告、资产托管季度（年度）报告和年度审计报告。

1、集合计划单位净值报告。

自集合计划成立之日起，每周第一个工作日披露上周最后一个工作日单位净值。

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

2、集合计划的资产管理季度报告和托管季度报告。

管理人、托管人在每季度分别向委托人提供一次准确、完整的季度资产管理报告和季度资产托管报告，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。上述报告应于每季度截止日后 15 个工作日内通过管理人网站通告，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 2 个月时，管理人、托管人可以不编制当期的季度报告。集合计划终止当季，管理人、托管人可以不编制当季报告。

3、集合计划的资产管理年度报告和托管年度报告

管理人、托管人在每年度分别向委托人提供一次准确、完整的年度资产管理报告和年度资产托管报告，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。上述报告应于每个会计年度截止日后 3 个月内通过管理人网站通告，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。集合计划终止当年，管理人、托管人可以不编制当年报告。

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资产管理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，通过管理人网站向委托人提供，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。

5、对账单

管理人在每季度结束后的 15 个工作日内，通过书面或电子邮件等方式向委托人提供对账单，对账单内容应包括集合计划产品特性，投资风险提示，委托人持有计划份额的数量及净值，参与、退出明细，收益分配以及计划的差异性、风险等情况。

（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，管理人应当以管理人网站公告方式或委托人认可的其他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；

（2）暂停受理或者重新开始受理参与或者退出申请；

（3）集合计划终止和清算；

（4）合同的补充、修改与变更；

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

（5）与集合计划有关的重大诉讼、仲裁事项；

（6）负责本集合计划的推广机构发生变更；

（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）其他管理人认为的重大事项。

（三）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》、集合资产管理合同及其他有关规定进行。集合计划的信息披露事项将以下列方式进行披露。

1、管理人网站信息披露

本计划《说明书》、《集合资产管理合同》、其他备查文件、相关报告等有关集合计划的信息，将在集合计划管理人网站（网址）上披露，委托人可随时查阅。

2、管理人、托管人、推广机构指定营业网点查询

本计划《说明书》、《集合资产管理合同》、其他备查文件、相关报告等文本存放在集合计划管理人、集合计划托管人和集合计划推广机构的住所，委托人可在营业时间内免费查阅，也可按工本费购买复印件。对委托人按上述方式所获得的文件及其复印件，集合计划管理人和集合计划托管人保证其内容与所披露的内容完全一致。

3、（管理人）客服电话

本集合计划披露的有关集合计划的信息，委托人可以通过管理人客服电话（电话）查询。

（四）信息披露文件的存放及查阅

本集合计划的定期公告与报告、临时公告与报告存放在管理人、托管人的办公场所，委托人可在办公时间查阅。

管理人和托管人应当妥善保存客户开户资料、委托记录、交易记录和与内部管理、业务经营有关的各项资料，任何人不得隐匿、伪造、篡改或者毁损。

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

本计划成立后，管理人可以按照规定办理份额转让事宜。

申请份额转让事宜之后，管理人、代理推广机构的客户之间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。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

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

产管理合同。

委托人之间的份额转让，应遵从集合资产管理合同的业务规定办理。

法律、行政法规以及相关监管规则规定不得通过集合计划份额转让变相规避限售期的，委托人不得进行份额转让。

（二）集合计划的非交易过户

非交易过户是指不采用参与、退出等集合计划交易方式，将一定数量的集合计划份额按照一定规则从某一委托人集合计划账户转移到另一委托人集合计划账户的行为。

注册登记机构只受理继承以及其他形式财产分割或转移等情况下的非交易过户。具体业务规则以注册登记机构业务规则为准。

委托人办理因上述原因引起的非交易过户须提供注册登记机构要求的相关证明文件等材料到注册登记机构处办理。对于符合条件的非交易过户申请自申请受理日起2个月内办理，并按注册登记机构规定的标准收费。

（三）其他情形

集合计划份额冻结、解冻的业务，由注册登记机构办理。

集合计划注册登记机构只受理国家有关机关依法要求的集合计划份额的冻结与解冻以及注册登记机构认可的其他情况的集合计划份额的冻结与解冻。

当集合计划份额处于冻结状态时，集合计划注册登记机构或其他相关机构有权拒绝集合计划份额的退出、非交易过户等业务的申请。

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，经全体委托人同意后方可展期，并符合本集合计划运营规范，管理人、托管人未违反《集合资产管理合同》、《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。

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

（二）展期的安排

1、通知展期的时间

不晚于在集合计划到期前 1 个月。

2、通知展期的方式

管理人将通书面形式通知委托人。

3、委托人回复的方式

委托人应当在管理人网站公告之日起 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或按本合同规定办理集合计划份额转让手续；若委托人未回复意见或回复意见不明确的，则视为不同意展期。

（四）展期的实现

如果同意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各委托人人数低于 2 人则集合计划到期终止，将按照《集合资产管理合同》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、 集合计划终止与清算

（一）有下列情形之一的，集合计划应当终止：

1、 存续期届满且未展期；

2、 管理人因重大违法、违规行为，被中国证监会取消业务资格的；

3、 托管人因重大违法、违规行为，被监管机构取消业务资格而管理人未在 30 个工作日内与新的托管人签订托管协议的；

4、 管理人因停业、解散、破产、撤销等原因不能履行相应职责的；

5、 托管人因解散、破产、撤销等原因不能履行相应职责时，管理人未在 30 个工作日内与新的托管人签订托管协议的；

6、 存续期内，任一开放日集合计划委托人少于 2 人时；

7、 在委托人、托管人、管理人一致同意的情况下，本集合计划可以提前终止；

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

8、 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；

9、 法律、法规规定或中国证监会规定的其他情况。

本计划未满12个月提前终止时，次级份额投资者应向优先级份额投资者支付资金成本，具体计算公式为：

优先级份额认购本金 *优先级份额参考年化收益率* (N+30)/365

N:为资产管理计划存续天数

（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、托管费及管理人业绩报酬（如有）后，将集合计划资产按照委托人拥有份额的比例或者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，注销集合计划专用证券账户和资金账户。优先级份额优先按照约定的参考年化收益率获得清算资产的分配和投资本金的返还，次级份额享有剩余资产和收益的分配。如果优先级份额无法按约定的参考年化收益率获得收益时，次级份额分配资产为零：（1）清算资产大于优先级份额本金时，首先分配优先级份额本金，剩余清算资产按照委托人拥有优先级份额的比例分配；（2）清算资产小于等于优先级份额本金时，按照委托人拥有优先级份额的比例分配。在优先级份额本金和收益获得偿还前，不对次级份额进行收益分配。

4、清算结束后15个工作日内由集合计划清算小组在管理人网站公布清算结果。管理人应当在清算结束后15日内将清算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。

5、若本集合计划在终止之日有未能流通变现的证券，管理人可针对该部分未能流通变现证券制定二次清算方案，该方案应经集合计划清算小组认可，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，并将变现后的资产扣除相关费用后按照委托人拥有份额的比例或者集合资产管理合同的约定，以货币形式全部分配给委托人，并注销集合计划专用证券账户和资金账户。在进行二次清算的变现过程中，变现的资金以现金保存，不得再进行投资。

二十二、 当事人的权利与义务

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

一、委托人的权利和义务

（一）委托人的权利

1、根据本合同约定的优先、次级份额取得集合计划收益；

2、通过管理人网站查询等方式知悉有关集合计划投资运作的信息，包括集合计划的资产配置、投资比例、损益状况等；

3、按照本合同及《说明书》的约定，参与、退出集合计划；

4、根据本合同约定的优先、次级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、优先级委托人享有优先返还本金和分配收益的权利；

7、法律、行政法规、中国证监会的有关规定及本合同、《说明书》约定的其他权利。

（二）委托人的义务

1、委托人应认真阅读本合同及《说明书》，并保证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》约定划付委托资金，承担本合同约定管理费、托管费及其他费用；

3、按本合同及《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、由于集合计划净值波动，导致优先级份额无法按照约定的参考年化收益率获得参考收益，次级委托人（即补仓义务人）应按照合同约定进行补仓；

6、未经优先级委托人和资产管理人书面同意，次级委托人不得将持有的本计划项下次级份额以转让、抵押、担保等方式处置，不得以任何形式丧失部分或全部次级份额的所有权、处置权、财产权和收益权等；

7、法律、行政法规、中国证监会的有关规定及本合同、《说明书》约定的其他义务；

8、委托人承诺员工参与员工持股计划所获公司股份权益，应当与员工通过其他方式拥有的公司股份权益合并计算，按照有关规定履行信息披露义务。参与员工持股计划的员工因参加员工持股计划，其股份权益发生变动，依据法律应当履行相应义务的，应当依据法律履行；员工持股计划持有公司股票达到公司已发行股份总数的 5%时，将依据法律规定履行相应义务。委托人买卖上市公司股票的，须遵守《公司法》、《证券法》、《上市公司收购管理办法》、《上市公司信息披露管理办法》、《关于上市公司实施员工持股计划试点的指导意见关于上市公司实施员工持股计划试点的指导意见》等法律法规及监管政策的规定；

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

（三）次级份额持有人特别承诺事项

本计划次级份额持有人江苏九鼎新材料股份有限公司所代表的员工持股计划，特此承诺本员工持股计划的设立满足以下要求：

（1）依法合规原则

员工持股计划已严格按照法律、行政法规的规定履行程序，真实、准确、完整、及时地实施信息披露，无任何利用员工持股计划进行内幕交易、操纵证券市场等证券欺诈行为。员工认购员工持股计划的资金来源为其合法薪酬、自筹资金等合法合规的方式，且单个员工所获股份权益对应的股票总数累计未超过公司股本总额的 1%。

（2）自愿参与原则

员工持股计划遵循公司自主决定，员工自愿参加，不存在以摊派、强行分配等方式强制员工参加员工持股计划的情形。

（3）风险自担原则

员工持股计划参与人已充分知悉参与员工持股计划以及认购本计划的风险，参与员工持股计划盈亏自负，风险自担，与其他投资者权益平等。

（4）及时、准确信息披露原则

本计划次级份额持有人江苏九鼎新材料股份有限公司所代表的员工持股计划，承诺按照包括但不限于《关于上市公司实施员工持股计划试点的指导意见》、《中小板信息披露业务备忘录第 7 号：员工持股计划》等法律法规要求在定期报告中及时、准确披露报告期内员工持股计划的实施情况。若上市公司董事、监事、高级管理人员参与员工持股计划的，均将按照法律法规要求及时、准确的履行信息披露义务；员工参与员工持股计划所获公司股份权益，将与员工通过其他方式拥有的公司股份权益合并计算，按照法律法规要求履行信息披露义务

（5）监督与敏感信息保密义务

上市公司董事、监事、高级管理人员（如有）等关联方通过员工持股计划参与认购本公司股票以及所持有股票变动的，委托人承诺将监督以上人员按照相关规定准确、及时履行信息披露义务，并监督以上人员不进行短线交易、内幕交易、操纵市场等禁止性法律行为。

本计划次级份额持有人江苏九鼎新材料股份有限公司所代表的员工持股计划除承诺员工持股计划符合以上原则外，在本计划投资股票解禁期，另需对管理人履行如下义务：次级委托人将遵守中国证监会关于信息敏感期不得买卖股票的规定，在本计划成立后及时、准确的向管理人提供信息敏感期信息，并承诺不利用任何内幕信息进行交易。

二、管理人的权利和义务

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

（一）管理人的权利

1、根据本合同及《说明书》的约定，独立运作集合计划的资产；

2、根据本合同及《说明书》的约定，收取管理费等费用；

3、按照本合同及《说明书》的约定，停止办理集合计划的参与，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、《说明书》约定的其他权利。

（二）管理人的义务

1、在集合计划投资管理活动中恪尽职守，履行诚实信用、谨慎勤勉的义务，为委托人服务，以专业技能管理集合计划的资产，依法保护委托人的财产权益；

2、建立健全内部风险控制、财务管理及人事管理等制度；

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、管理人负责集合资产管理计划资产净值估值等会计核算业务，编制集合资产管理计划财务报告，并接受托管人的复核；

5、按规定出具资产管理报告，保证委托人能够及时了解有关集合计划资产投资组合、资产净值、费用与收益等信息；

6、保守集合计划的商业秘密，在集合计划有关信息向委托人披露前，不泄露集合计划的投资安排、投资意向等信息（法律、行政法规、中国证监会另有规定或相关司法部门、监管机构另有要求的除外）；

7、按照本合同及《说明书》约定向委托人分配集合计划的收益；

8、依法对托管人、推广机构的行为进行监督，如发现托管人、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、推广协议的，应当予以制止，并及时报告管理人住所地中国证监会派出机构及中国证券投资基金业协会；；

9、按照有关法律、行政法规、中国证监会有关规定及《说明书》的约定，指定注册登记机构办理集合计划的开户登记事务及其他与注册登记相关的手续；

10、按照法律、行政法规、中国证监会有关规定和本合同及《说明书》的约定，及时向退出集

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

合计划的委托人支付退出款项；

11、按相关法律法规妥善保存与集合计划有关的合同、协议、推广文件、交易记录、会计账册等文件、资料和数据；

12、在集合计划终止时，与托管人一起妥善处理有关清算和委托人资产的返还事宜；

13、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；

14、因管理人过错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；

15、因托管人过错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；

16、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专项审计，集合计划审计报告应当在每年度结束之日起 3 个月内，报送中国证券投资基金业协会备案并抄送管理人住所地中国证监会派出机构，报送托管人，同时向委托人披露；

17、在与关联方发生交易行为时，保证对关联方及非关联方公平对待；

18、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、托管人的权利和义务

（一）托管人的权利

1、依法托管集合计划的资产；

2、按照本合同、《说明书》和托管协议的约定收取托管费；

3、监督管理人集合计划的经营运作，发现管理人的投资或清算指令违反法律法规、中国证监会的有关规定或者本合同、《说明书》和托管协议约定的，要求其改正；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及本合同、《说明书》、《托管协议》约定的其他权利。

（二）托管人的义务

1、 依法为集合计划开立专门的资金账户和专门的证券账户等相关账户；

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，执行管理人的投资划款或者清算指令，负责办理集合计划名下的

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

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，并及时报告管理人住所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、 因托管人过错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，委托人向管理人追偿，托管人可进行相应配合。

15、 法律法规、中国证监会有关规定及本合同、《说明书》、《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、管理人、托管人在履行各自职责的过程中，违反法律、行政法规的规定或者本合同约定，给本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；因共同行为给本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；

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

（4）在本计划运作过程中，管理人及托管人按照法律、行政法规的规定以及本合同的约定履行了相关职责，但由于其控制能力之外的第三方原因或其他原因而造成运作不畅、出现差错和损失的。

2、合同当事人违反本合同，给其他当事人造成直接经济损失的，应当承担赔偿责任。在发生一方或多方当事人违约的情况下，合同能继续履行的，应当继续履行。

3、本合同一方当事人造成违约后，其他当事人应当采取适当措施防止损失的扩大；没有采取适当措施致使损失扩大的，不得就扩大的损失要求赔偿。守约方因防止损失扩大而支出的合理费用由违约方承担。

4、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或减少由此造成的影响。

5、一方当事人依据本合同向另一方当事人赔偿的损失，仅限于直接经济损失。

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。

（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中国国际经济贸易仲裁委员会（仲裁地：上海）并按其仲裁规则进行仲裁解决。

二十四、 风险揭示

委托人投资于本计划可能面临以下风险，有可能因下述风险导致委托人本金或收益损失。管理人承诺以诚实信用，谨慎勤勉的原则管理和运用集合计划资产，管理人制定并执行相应的内部控制制度和风险管理制度，以降低风险发生的概率。但这些制度和方法不能完全防止风险出现的可能，管理人不保证本计划一定盈利，也不保证最低收益。本计划面临的风险包括但不限于以下风险：

1、市场风险

本集合计划主要投资于证券市场，而证券市场中的投资品价格因受各种因素的影响而引起的波动将对本集合资产管理计划资产产生潜在风险，主要包括：

A、宏观经济层面的风险

（1） 政策风险

货币政策、财政政策、产业政策、地区发展政策等国家政策的变化对证券市场产生一定的影响，导致市场价格波动，影响集合资产管理计划收益而产生风险。

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

（2） 经济周期风险

证券市场是国民经济的晴雨表，而经济运行具有周期性的特点。宏观经济运行状况将对证券市场的收益水平产生影响，从而产生风险。

（3） 利率风险

金融市场利率波动会导致股票市场及债券市场的价格和收益率的变动，同时直接影响企业的融资成本和利润水平。集合计划投资于债券，收益水平会受到利率变化的影响，从而产生风险。

（4） 购买力风险

本集合计划投资的目的是使集合计划资产保值增值，如果发生通货膨胀，集合计划投资于证券所获得的收益可能会被通货膨胀抵消，从而影响集合计划资产的保值增值。

（5） 再投资风险

由于金融市场利率下降造成的无法通过再投资而实现参考年化收益的风险。

B、上市公司的经营风险

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。

C、基金的业绩风险

所投资的证券投资基金由于其管理人的投资失误，造成业绩下降，也会影响到集合计划的收益率。

D、债券的市场风险

（1）交易品种的信用风险

投资于公司债券等固定收益类产品，存在着发行人不能按时足额还本付息的风险；此外，当发行人信用评级降低时，计划所投资的债券可能面临价格下跌风险。

（2）债券收益率曲线风险

债券收益率曲线风险是指与收益率曲线非平行移动有关的风险，单一的久期指标并不能充分反映这一风险的存在。

2、流动性风险

指集合计划资产不能迅速转变成现金，或者转变成现金会对资产价格造成重大不利影响的风险。

流动性风险按照其来源可以分为两类：外生流动性风险和内生流动性风险。

（1） 外生流动性风险

外生流动性风险指的是由于来自资产管理人外部冲击造成证券流动性的下降，这样的外部冲击

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

可能是影响所有证券的事件，也可能只是影响个别证券的事件，但是其结果都是使得所有证券、某类证券或者单只证券的流动性发生一定程度的降低，造成证券持有者可能增加变现损失或者交易成本。

（2） 内生流动性风险

所谓内生流动性风险是指由于本集合计划组合的资产需要及时调整仓位而面临的不能按照事前期望价格成交的风险，该风险可以以本集合资产管理计划资产变现（或购买证券）时成交价格小于（或大于）事前期望价格所产生的最大成本来度量。内生流动性风险在一定程度上是可控的，但其可控程度取决于流动性风险的来源及外部冲击。

根据《公司法》、《证券法》、《关于上市公司实施员工持股计划试点的指导意见关于上市公司实施员工持股计划试点的指导意见》、等法律法规及监管政策的规定，委托人为员工持股计划。极端情况下可能存在合同约定的卖出操作无法完成。如遇前述情况，则合同有效期自动顺延，具体顺延时间由管理人确定。

3、管理风险

本集合计划为动态管理的投资组合，存在管理风险。

在集合计划管理运作过程中，可能因管理人对经济形势和证券市场等判断有误、获取的信息不全等影响集合计划的收益水平。管理人和托管人的管理水平、管理手段和管理技术等对集合计划收益水平存在影响。

管理人在管理本集合计划，做出投资决定的时候，会运用其投资技能和风险分析方法，但是这些技能和方法不能保证一定会达到预期的结果。

管理人在管理本计划时，管理人的内部控制制度和风险管理制度可能没有被严格执行而对集合计划资产产生不利影响，特别是可能出现本集合计划资产与管理人自有资产、或管理人管理的其他集合计划资产之间产生利益输送。

4、信用风险

信用风险是指证券投资中存在的交易对手在交收过程中的违约风险。

本集合计划在固定收益类证券投资过程中，所直接或间接投资的公司债、企业债、金融债、短期融资券等，存在发行人无法支付到期本息的风险。我国目前处于信用债券发展的初级阶段，由于缺乏历史数据，难以准确估计信用债的违约率和违约损失率，本集合计划投向的债券首发申购仍然存在发行人无法支付到期本息的风险。集合计划在交易过程中可能发生交收违约或者所投资债券的发行人倒闭、信用评级被降低、违约、拒绝支付到期本息的情况，从而导致集合计划财产损失。

5、合规性风险

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

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法规及《集合资产管理合同》有关规定的风险。

6、操作风险

指相关当事人在业务各环节操作过程中，因内部控制存在缺陷或者人为因素造成操作失误或违反操作规程等所引致的风险，例如，越权违规交易、会计部门欺诈、交易错误、IT系统故障等风险。

7、合同变更风险

管理人经托管人同意后可以对本合同做出调整和补充。管理人将及时通过管理人网站或书面形式（由管理人决定）就合同变更内容向委托人征询意见。在征得委托人意见后，管理人确定是否变更管理合同。

8、份额转让风险

本计划成立后，委托人可以按照规定申请份额转让事宜。份额转让交易平台可以是证券交易所，也可以是中国证监会认可的其他交易平台。委托人通过交易平台转让份额的价格与份额净值可能不一致。

9、对账单风险

本集合计划以邮寄或者电子邮件等方式向委托人提供对账单信息，可能由于委托人提供的联系信息不准确，或者投递系统出现故障，导致无法正常获得对账单信息。委托人应向管理人提供正确、有效的邮寄地址或者电子邮箱，采用电子邮件方式的，电子对账单自管理人系统出发出即视为送达；采用邮寄方式的，对账单自邮局寄出即视为送达。

10、收益分级风险

(1) 杠杆风险。本集合计划份额所分离的两类份额优先级份额、次级份额面临因特定的结构性收益分配所形成的投资风险，集合计划的次级份额的净值变动幅度将大于优先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。在推广期，本集合计划优先级份额与次级份额资产净值之比不超过2:1(优先级:次级)。但由于本集合计划开放参与退出业务，优先级份额与次级份额之比可能出现较大变化；而且由于净值波动，优先级市值和次级市值之比可能出现较大变化。

(3) 极端情况下的损失风险。优先级份额具有中风险、收益相对稳定的特征，但是本集合计划为优先级份额设置的收益率并非保证收益，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，优先级份额可能不能获得收益甚至可能面临投资受损的风险。次级份额可能面临损失所有本金和收益的风险。

11、其它风险

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

（1） 计划管理人、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；

（2） 计划管理人、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；

（3） 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。

（4） 管理人操作或者技术风险、电力故障等都可能对本集合计划的资产净值造成不利影响；

（5） 因集合计划业务快速发展而在人员配备、内控机制建立等方面不完善而产生的风险；

（6） 因人为因素而产生的风险，如内幕交易、欺诈行为等产生的风险；

（7） 对主要业务人员如投资主办人的依赖而可能产生的风险；

（8） 因业务竞争压力而可能产生的风险；

（9） 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；

（10） 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，可能导致集合计划资产的损失。

（11） 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全部份额退出给委托人。

12、 特别风险揭示：

1、设立失败风险

本集合计划推广期规模下限为 3000 万元。委托人可能面临因推广期募集规模未达到下限而导致集合计划设立失败的风险。

2、提前结束推广风险

本集合计划推广期规模上限为 10 亿元，参与人数上限为 200 人。委托人可能面临因集合计划

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

规模达到上限或参与人数达到上限而无法参与本集合计划的风险。

3、流动性风险

本集合计划自成立之日起进入封闭期，在终止前不设开放期，委托人将面临在封闭期内无法退出集合计划的风险。

若本集合计划的委托人为员工持股计划，且通过本集合计划二级市场买入该上市公司股票的，自公司公告最后一笔上市公司股票过户至本集合计划，12 个月内不得卖出，期间无法变现，存在较高的流动性风险。

4、提前终止风险

1、 本集合计划存续期间，当委托人少于 2 人，或集合计划单位净值触及（或低于）平仓线，或本集合计划参与江苏九鼎新材料股份有限公司（简称：九鼎新材；代码：002201）的员工持股计划，则管理人有权提前终止本集合计划。委托人可能面临集合计划因上述原因终止而停止投资的风险。

5、参与申请被确认无效的风险

委托人提出的参与申请，可能因为合同填写不符合要求、款项划转不成功等原因被管理人确认无效。对于确认无效的参与申请，“推广机构将退还委托人已交付的参与款项本金（无息），集合资产管理合同自始无效。”

6、合同变更风险

本计划的合同变更条款中，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“委托人不同意变更的，委托人不同意变更的，委托人应在征询意见函发出后的二十个工作日或最近一个开放期内或按照管理人公告内容的安排提出退出本集合计划的申请”，“逾期未退出且未有意见答复的，视同委托人同意本合同变更。”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。

7、A 份额极端情况下的损失风险

本集合计划为 A 份额设置的参考年化收益率并非保证收益，在极端情况下，如果集合计划发生大幅度的投资亏损，A 份额可能不能获得参考年化收益甚至可能面临本金投资受损的风险。

8、B 份额的特定风险

（1）杠杆机制风险

在集合计划合同生效之日起的产品存续期内，本集合计划在扣除 A 份额的应计收益分配后的全部剩余收益将归 B 份额享有，亏损以 B 份额的资产净值为限由 B 份额承担。因此，B 份额在可能获取放大的集合计划资产增值收益预期的同时，也将承担集合计划投资的全部亏损，并承担一定补仓

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

义务。极端情况下，B 份额可能遭受全部的投资损失。

（2）杠杆率变动风险

B 份额具有高风险的特性，由于内含杠杆机制，集合计划资产净值的波动将以一定的杠杆倍数反映到 B 份额的参考净值波动上。但是，B 份额的参考年化收益杠杆率并不是固定的，存在杠杆率变动风险。B 份额参考净值越高，杠杆率越低，收益放大效应越弱；B 份额参考净值越低，杠杆率越高，收益放大效应越强。

9、展期风险和展期失败风险

（1）展期的风险。若委托人不同意本计划展期的，可在本集合计划存续期届满日申请退出本集合计划。若委托人未在本集合计划存续期满日申请退出本集合计划，则视为同意本集合计划的展期，并继续参与本集合计划。在此情况下，委托人对集合计划展期处理的忽略或误解，可能存在潜在风险。

（2）展期失败的风险。若本计划展期不符合集合计划成立条件和展期条件，则集合计划展期失败，集合计划在本合同约定的终止情形发生后进入清算程序。在此情况下，会导致集合计划清算。

10、产品集中度风险

本产品投资某一标的股票的投资成本上限为成立规模的 95%，投资标的集中度高，投资标的股票价格的波动将直接影响本集合计划资产净值的变化，本产品存在较大集中度风险。

11、管理期限不确定的风险

集合计划终止时，集合计划的实际投资期限可能小于预期投资期限，委托人面临投资期限不定的风险：

（1）提前变现及提前终止风险

当发生下列情形时，集合计划应当终止：

a. 本集合计划参与投资的金融资产全部出清，即现金类资产占集合计划净值比例为 100%时，管理人有权终止本集合计划；

b. 本集合计划持有的上市公司的股票解禁后，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）未发生需次级份额持有人补仓的情形，（2）次级份额持有人按照集合计划管理合同约定及时补仓。如次级份额持有人未按照合同约定及时补仓，所投资的股票解禁后，管理人有权主动平仓，本合同提前终止。本集合计划所持上市公司股份解禁后，存在因监管部门有关上市公司股份减持监管规定的限制而无法随时变现的风险。

（2）展期风险

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

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

期限可能进一步顺延的风险。

本集合计划所持上市公司股份解禁后，存在因监管部门有关上市公司股份减持监管规定的限制而无法随时变现，而导致管理期限进一步延长的风险。

二十五、 合同的成立与生效

(一)合同的成立与生效

本合同经资产委托人的法定代表人/负责人或授权代理人签字（或盖章）并加盖公章，并由资产管理人和资产托管人加盖公章以及各方法定代表人/负责人或授权代理人签字（或盖章）之日起成立。（资产委托人为自然人时，由资产委托人本人签字或授权代理人签字。）

本合同成立后，满足以下条件时生效：委托人参与资金实际交付并确认。

(二)合同的组成

《光证资管浦发众享添利九鼎新材 1 号集合资产管理计划说明书》、《光证资管浦发众享添利九鼎新材 1 号集合资产管理计划风险揭示书》、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。附件内容与本合同相关内容有冲突的，以本合同的表述为准。

(三）其他事项

本合同一式捌份，优先级委托人、次级委托人、管理人和托管人各执贰份，每份具有同等法律效力。本集合计划成立后，相关材料需报中国证监会指定机构备案，同时抄送管理人住所地中国证监会派出机构。

二十六、 合同的补充、修改与变更

1、本合同生效后，因国家法律、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变化或修订，自该变化或修订生效之日起，本合同相关内容及条款按该变化或修订进行变更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国家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网站公告满 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

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

退出本集合计划，未在上述期间申请退出本集合计划的，视为同意，管理人不再另行通知。

2、除上述 1 所述情形外，为了委托人的利益，在当期优先级份额委托人书面同意的前提下，管理人和托管人经书面达成一致后可以变更本合同，并以委托人认可的方式告知或在管理人网站公告。管理人须在公告后 5 个工作日内以书面、以委托人认可的方式告知或管理人网站公告方式（由管理人决定）向委托人发送合同变更征询意见函，并采取如下权利保障措施及安排：

（1）委托人不同意变更的，管理人保障其退出权利，委托人应在征询意见函发出后的二十个工作日或最近一个开放期内或按照管理人公告内容的安排提出退出本集合计划的申请；

（2）委托人不同意变更且逾期未退出的，则管理人有权在征询意见函或公告中说明的意见回复期限届满后将相关份额强制退出计划或提供转让安排（退出/转让价格为退出当日集合计划当日净值），由此发生的相关税费或或有损失由委托人自行承担；

（3）委托人未回复意见且逾期未退出，视同委托人同意本合同变更，管理人不再另行通知；

（4）委托人回复意见不明确的，则视为该委托人不同意变更，按照上述(1)-(2)处理。

本合同满足法律法规要求的集合计划成立要件后，本合同变更生效。

自合同变更生效之日起，变更后的内容即成为本合同组成部分。

3、委托人同意，管理人经与托管人书面达成一致后依据本合同的规定采取的合同变更行为均不应被视为或裁定为管理人或托管人的违约行为。

4、合同变更后，委托人、管理人和托管人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。

（以下无正文）

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

（签署页）

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者取得最低收益；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，应由法定代表人或者其授权代表签署。

优先级委托人（公章）：

（法定代表人/负责人或其授权代理人人签字或盖章）：

次级委托人（公章）（自然人为本人签字）：

（法定代表人/负责人或其授权代理人签字或盖章）：

管理人：（公章）

（法定代表人或其授权签字人签字或盖章）

托管人：上海浦东发展银行上海分行（公章）

（法定代表人/负责人或其授权签字人签字或盖章）

签订日期：年　　月　　日

合同签署地：

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

附件 1：光证资管浦发众享添利九鼎新材 1 号集合资产管理计划相关账户信息

管理人管理费收入账户信息：

户名：上海光大证券资产管理有限公司

账号：36510188000562328

开户行： 中国光大银行上海分行营业部

托管人托管费收入账户信息：

户名：

账号：

开户行：

光证资管浦发众享添利九鼎新材 1 号集合资产管理计划募集账户信息

账户名称：

银行账号：

开户银行：

开户银行代码：

光证资管浦发众享添利九鼎新材 1 号集合资产管理计划募集账户信息

账户名称：上海光大证券资产管理有限公司（直销）

银行账号：36760188000052063

开户银行： 光大银行上海常德支行

大额支付号：303290000761

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

附件 2：清算划款指令签发人授权书（格式）

上海浦东发展银行上海分行：

敬启者：

兹就贵行与我司于　　年　　月　　日签署的编号为的《光证资管浦发众享添利九鼎新材 1 号集合资产管理计划资产管理合同》（以下简称“该合同”）出具本函。

该合同中所定义的词语在本函中应具有相同的含义。

我司特此授权下列人员于　　年　　月　　日至　　年　　月　　日期间，代表我司签发本合同项下的有关划款指令或通知：

授权签发人（预留签字或名章）：

划款指令签发业务章（预留印鉴章）：

管理人（公章）：

法定代表人或授权代表：

（签字或盖章）

年　　月　　日

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

附件 3：清算划款指令书（格式）

划款指令

第　　号

致：上海浦东发展银行上海分行

根据贵我双方及资管计划资产委托人签署的《光证资管众享添利九鼎新材 1 号集合资产管理》(编号：_____)之约定，特向贵行申请就该协议项下的托管账户进行如下划款：

申请时间：　　年　　月　　日　　单位：元

付款户名：	收款户名：
付款账号：	收款账号：
开户行：	开户行：
金额小写：	金额大写：
划款时间：　　年　　月　　日	
资金用途及情况说明： 如有附件请在此列明附件名称，如有需要可以另附页。	经办人： 复核人： 授权签发人： 资产管理人签章：

重要提示：接此指令后，经审核无误应按照指令条款进行划款。

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

附件 4：

双方联系人

1、管理人：

岗　　位	姓 名	联系方式
数据发送人员	刘思文	021-22167084
	李广宇	021-62158012
协调人	张胜洪	021-62152308

2、托管人:上海浦东发展银行上海分行

岗　　位	姓 名	联系方式
保管运作 A		
保管运作 B		
数据接收 A	杨舒晴	021-61616394/61616597
数据接收 B		
乙方协调人	欧文俊	021-68887659

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

附件 5：委托资产证券交易费率参数表（样本）

上海浦东发展银行上海分行：

根据我司与贵行于　　年　　月　　日签署的编号为的《光证资管浦发众享添利九鼎新材 1 号集合资产管理计划资产管理合同》，特对的委托财产投资运作中涉及的交易参数约定如下：

	交易单元号	股东代码
上海		
深圳		

		股票		债券		基金（含 ETF）		权证	
		费率‰	最小值（元）	费率‰	最小值（元）	费率‰	最小值（元）	费率‰	最小值（元）
上海	佣金		/		/		/		/
深圳	佣金		/		/		/		/

管理人（公章）：

年　月日

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

附件 6：资金追加说明函（样本）

资金追加说明函

资产管理人及资产托管人：

本人于　　年　　月　　日收到资产管理人的通知，因“光证资管浦发众享添利九鼎新材 1 号集合资产管理计划”　　年　　月　　日的份额净值低于补仓线，需补足资金人民币（大写），（小写）元。本人将根据已签署的《光证资管浦发众享添利九鼎新材 1 号集合资产管理计划资产管理合同》约定的义务于

年　　月　　日　　点之前将补仓资金合计人民币（大写）元，（小写）元划至“光证资管浦发众享添利九鼎新材 1 号集合资产管理计划”的托管账户。追加资金的付款账户信息为：

账户名称：光证资管浦发众享添利九鼎新材 1 号集合资产管理计划

账号：

开户行：

开户银行代码：

特此说明。

B 类份额委托人（签章）

身份证号码（自然人）：

年　　月　　日

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