

华泰家园 16 号集合资产管理计划 资产管理合同(草案)

管理人：华泰证券（上海）资产管理有限公司

托管人：兴业银行股份有限公司

二〇一六年

目 录

一、前言	0
二、释义	0
三、合同当事人	4
四、集合资产管理计划的基本情况	5
五、集合计划的参与和退出	8
六、管理人自有资金参与集合计划	14
七、集合计划的分级	14
八、集合计划客户资产的管理方式和管理权限	18
九、集合计划的成立	18
十、集合计划账户与资产	19
十一、集合计划资产托管	19
十二、集合计划的估值	19
十三、集合计划的费用、业绩报酬	24
十四、集合计划的收益分配	26
十五、投资理念与投资策略	27
十六、投资决策与风险控制	27
十七、投资禁止行为	33
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	36
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	42
二十四、风险揭示	44
二十五、合同的成立与生效	47
二十六、合同的补充、修改与变更	48

一、前言

为规范华泰家园 16 号集合资产管理计划运作，明确《华泰家园 16 号集合资产管理计划资产管理合同》当事人的权利与义务，依照《中华人民共和国合同法》、《证券公司客户资产管理业务管理办法》、《证券公司集合资产管理业务实施细则》、《私募投资基金监督管理暂行办法》、《证券公司客户资产管理业务规范》、《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、中国证监会和中国证券业协会的有关规定，委托人、管理人、托管人在平等自愿、诚实信用原则的基础上订立本合同。本合同是规定当事人之间基本权利义务的法律文件，当事人按照《证券公司客户资产管理业务管理办法》、《证券公司集合资产管理业务实施细则》、《关于上市公司实施员工持股计划试点的指导意见》、《华泰家园 16 号集合资产管理计划说明书》、本合同及其他有关规定享有权利、承担义务。

委托人承诺以真实身份参与集合计划，保证委托资产的来源及用途合法。委托人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《华泰家园 16 号集合资产管理计划说明书》全文，了解相关权利、义务和风险，自行承担投资风险和损失。

委托人在此申明签署本集合计划管理合同即表明委托人为已具备《私募投资基金监督管理暂行办法》规定要求的合格投资者。

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

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

二、释义

在本合同中，除非文义另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

集合资产管理计划、资产管理计划、集合计划、本计划	指华泰家园 16 号集合资产管理计划；
集合计划说明书、计划说明书、说明书	指《华泰家园 16 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《华泰家园 16 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《华泰家园 16 号集合资产管理计划托管协议》；
风险揭示书	指《华泰家园 16 号集合资产管理计划风险揭示书》；
《管理办法》	指 2013 年 6 月 26 日中国证监会根据《关于修改〈证券公司客户资产管理业务管理办法〉的决定》修订并施行的《证券公司客户资产管理业务管理办法》；
《实施细则》、《细则》	指 2013 年 6 月 26 日中国证监会根据《关于修改〈证券公司集合资产管理业务实施细则〉的决定》修订并施行的《证券公司集合资产管理业务实施细则》；
《规范》	指 2012 年 10 月 19 日中国证券业协会发布并施行的《证券公司客户资产管理业务规范》；
《指导意见》	指 2014 年 6 月 20 日中国证监会发布《关于上市公司实施员工持股计划试点的指导意见》；
《员工持股计划》	指巨轮智能（002031.SZ）于 2016 年 7 月 14 日公告的巨轮智能装备股份有限公司 2016 年度第一期员工持股计划（草案）；
中国证监会、证监会	指中国证券监督管理委员会；
集合资产管理合同当事人、集合计划当事人	指受资产管理合同约定，根据资产管理合同享有权利并承担义务的集合计划管理人、集合计划托管人和委托人；
集合计划管理人、管理人	指华泰证券（上海）资产管理有限公司，也简称为“华泰资管”；
集合计划托管人、托管人	指兴业银行股份有限公司，也简称为“兴业银行”；
推广机构	指华泰证券（上海）资产管理有限公司、华泰证券股份有限公司；
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华泰证券（上海）资产管理有限公司；
份额委托人、委托人	指依据资产管理合同和计划说明书参与本集合计划的投资者，包括个人投资者和机构投资者；

次级份额委托人	指巨轮智能装备股份有限公司（代员工持股计划）
个人投资者	指依据中华人民共和国有关法律法规、监管规定可以投资于集合资产管理计划的自然人投资者；
机构投资者	指依法可以投资资产管理计划，在中华人民共和国境内合法注册登记或经有关政府部门批准设立的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织；
合格投资者	指具备相应风险识别能力和风险承担能力，投资于本集合计划的金额不低于 100 万元且符合下列相关标准的单位和个人： （一）净资产不低于 1000 万元的单位； （二）金融资产不低于 300 万元或者最近三年个人年均收入不低于 50 万元的个人。 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。 下列投资者视为合格投资者： （一）社会保障基金、企业年金等养老基金，慈善基金等社会公益基金； （二）依法设立并在基金业协会备案的投资计划； （三）投资于所管理私募基金的私募基金管理人及其从业人员； （四）中国证监会规定的其他投资者。 以合伙企业、契约等非法人形式，通过汇集多数投资者的资金直接或者间接投资于本集合计划的，本集合计划管理人或者推广机构应当穿透核查最终投资者是否为合格投资者，并合并计算投资者人数。但是，符合本条第（一）、（二）、（四）项规定的投资者投资私募基金的，不再穿透核查最终投资者是否为合格投资者和合并计算投资者人数。
集合计划成立日	指集合计划经过推广达到集合计划说明书和集合资产管理合同规定的成立条件后，管理人通告集合计划成立的日期；
推广期	指自本集合计划启动推广之日起不超过 60 个工作日的期间，具体推广时间以本集合计划管理人安排为准；
封闭期	特指成立日后的一个或多个期间，在此期间委托人不得参与、退出本集合计划；

开放期	指委托人可以办理集合计划参与、退出或其他约定业务的工作日；
开放日	指开放期内的每个工作日；
临时开放期、临时开放日	在合同变更、集合计划展期以及其他合同特别约定等基于委托人利益考虑的情形下，管理人临时设置的委托人可以办理参与或退出业务的日期，临时开放期的具体安排以管理人安排为准；
存续期、管理期限	指计划成立并存续的期间；
工作日	指上海证券交易所和深圳证券交易所等相关交易所的正常交易日；
天	指自然日；
会计年度	指公历每年1月1日至12月31日；
参与	指委托人申请购买集合计划份额的行为，包括认购和申购；认购指在推广期参与集合计划的行为，申购指在存续期参与集合计划的行为；
退出	指委托人按集合资产管理合同规定的条件要求收回全部或部分委托资产的行为；
巨额退出	指本集合计划单个开放日累计净退出申请份额（退出申请总份额扣除参与总份额后的余额）超过上一日计划总份额30%的情形；
强制退出	指由管理人发起退出委托人持有份额的行为；
计划收益	指本集合计划投资所得红利、股息、债券利息、基金红利、买卖证券价差、银行存款利息及其他合法收入；
集合计划份额、计划份额、份额	指集合计划的最小单位；
元	指人民币元；
计划单位面值、单位面值	人民币1元；
杠杆倍数	杠杆倍数 = 优先级份额 / 次级份额；
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	指计算日集合计划资产净值除以计算日集合计划总份额的金额；

计划单位累计净值、累计净值	指计划单位净值与集合计划份额累计分红之和；
计划资产估值	指计算评估本集合计划资产和负债的价值，以确定本集合计划资产净值的过程；
不可抗力	指任何不能预见，不能避免，不能克服的客观情况，包括但不限于洪水、地震及其它自然灾害、战争、骚乱、火灾、突发性公共卫生事件、政府征用、没收、法律法规变化、突发停电或其他突发事件、注册登记机构非正常的暂停或终止业务、证券交易所非正常暂停或停止交易等；
通知及送达	除非本合同另有约定，本合同项下各方之间的一切通知均应以中文写成并可由专人送达、挂号邮递、特快专递、电子邮件、传真等方式送达或以指定联系人通过录音电话方式送达。通知在下列日期视为送达日：（1）专人递送的通知，在专人递送之交付日为有效送达；（2）以挂号信（付清邮资）发出的通知，在寄出（以邮戳为凭）后的第 7 日为有效送达；（3）以特快专递（付清邮资）发出的通知，在寄出（以邮戳为凭）后的第 3 日为有效送达；（4）由传真传送，发送当日即为有效送达；（5）由电子邮件送达，以发送方服务器显示的发送时间为送达时间。本合同项下的通知，均按文首载明的地址送达，双方确认该地址为有效地址；若需更改，更改方应提前 5 个工作日书面通知对方，否则对方按原地址送达的视为已经送达。
书面通知	包括以纸质方式邮寄/递送、传真、电子邮件及手机短信等方式发送的通知。
管理人指定网站	指 http://htamc.htsc.com.cn/ ，管理人指定网站变更时以管理人公告为准。

三、合同当事人

（一）委托人

机构名称：巨轮智能装备股份有限公司

优先级 ☐

次级 ☐

法定代表人：吴潮忠

通信地址：广东省揭东经济开发区 5 号路

邮政编码：515500

联系电话：0663-3269366

传真：0663-3269266

（二）管理人

机构名称：华泰证券（上海）资产管理有限公司

法定代表人：张海波

通信地址：南京市建邺区江东中路 228 号 1 号楼 5 层

邮政编码：210000

联系电话：025-83387082

（三）托管人

机构名称：兴业银行股份有限公司

负责人：林复

通信地址：南京市中山路 268 号汇杰广场 2 楼 201 室

邮政编码：210008

联系电话：025-83177233

四、集合资产管理计划的基本情况

（一）名称：华泰家园 16 号集合资产管理计划

（二）类型：集合资产管理计划

（三）目标规模

本集合计划推广期规模上限为 4500 万份，管理人可以在目标规模限制内控制各分级份额实际募集规模。

其中，本集合计划推广期优先级份额目标规模原则上不高于 3000 万份；次级份额目标规模原则上不超过 1500 万份。管理人可以根据实际情况调整目标规模，但调整前后优先级份额与次级份额比不得超过 2: 1。

本集合计划存续期规模上限 50 亿元。管理人可以临时调整确定各次开放的目标规模。

本集合计划推广期和存续期委托人不超过 200 人。

（四）投资范围和投资比例

1、投资范围

本集合计划主要投资于国内依法发行的股票(仅限于巨轮智能(002031.SZ)股票),同时还可以投资于现金类资产。

2、资产配置比例

(1) 权益类资产: 占本计划资产的 0%-100%, 主要投资于国内依法发行的股票(仅限于巨轮智能(002031.SZ)股票)。

(2) 现金类资产: 占本计划资产的 0%-100%, 包括货币市场基金、银行存款、现金等。

管理人应当在本集合计划成立之日起 6 个月内使本集合计划的投资组合比例符合以上约定。

如因证券市场波动、证券发行人合并、资产管理计划规模变动等证券公司之外的因素,造成集合计划投资比例超标,管理人应在超标发生之日起在具备交易条件的 10 个交易日内将投资比例降至许可范围内。如遇限售期等原因导致交易条件不具备,则上述期限自动顺延。

(五) 管理期限

本集合计划管理期限按《员工持股计划》的约定执行,预期为 24 个月,可展期。

本集合计划完成全部股票购买满 12 个月后,本集合计划投资目的提前实现的(即本集合计划权益类资产全部变现时),管理人可以提前终止本集合计划。

次级份额委托人如果需要延长上述管理期限,应于管理期限届满前 20 个工作日内书面通知优先份额委托人、管理人和托管人,经另外几方全体一致书面同意后,并经管理人公告之后,可以延长管理期限。

(六) 封闭期、开放期及流动性安排:

自巨轮智能装备股份有限公司公告本次员工持股计划股票购买完成时之日起 12 个月内为封闭期,期间不得退出。

管理期限内:

1、优先级份额经管理人同意后可以参与,优先级份额参与时间及业务安排由管理人确定并提前公告。

2、次级份额经管理人同意后可以参与,次级份额参与时间及业务安排由管理人确定并提前公告。

3、如本集合计划持有的标的股票处在限售期，则不允许任何委托人退出。次级委托人在限售期期满后至本集合计划管理期限到期日前需退出的，在获得所有优先级份额委托人及管理人同意后，可以退出。

4、管理人办理各分级份额的参与业务，办理时间、规模等均由管理人提前公告。

（七）每份分级集合计划份额面值

每份分级份额的面值均为 1.00 元。

（八）参与本集合计划的最低金额

分级份额首次参与的最低金额为 100 万元，追加参与的最低金额为 1000 元，超过部分不设金额级差。

（九）本集合计划的风险收益特征及适合推广对象

本集合计划为股票型产品，计划整体属于高风险品种，适合推广对象为推广机构的客户且为合格投资者客户。鉴于本计划采用分级结构，不同级别计划份额具有不同风险收益特征：其中优先级份额为中等风险收益品种，适合具有一定风险承受能力的合格投资者，次级份额为高风险收益品种，适合具有较高风险承受能力的合格投资者。

本集合计划管理人有权仅接受指定委托人的参与申请。

（十）本集合计划的推广

1、推广机构：

（1）华泰证券（上海）资产管理有限公司

住所：上海市浦东新区东方路 18 号保利广场 E 座 21 层

法定代表人：张海波

（2）华泰证券股份有限公司

住所：南京市江东中路 228 号

法定代表人：周易

管理人可根据有关法律法规的要求，选择其他符合要求的推广机构代理销售本集合计划，管理人新增或变更本集合计划的推广机构时，将提前在管理人指定网站上公告。

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，以纸质资料或电子资料方式置备于推广机构营业场所。本集合计划应当面向合格投资者推广，合格投资者累计不得超过 200 人。推广机构应当了解客户的投资需求和风险偏好，详细介绍产品特点并充分揭示风险，推荐与客户风险承受能力相匹配的集合计划，引导客户审慎作出投资决定。禁止通过签订保本保底补充协议等方式，或者采用虚假宣传、夸大预期收益和商业贿赂等不正当手段推广集合计划。

管理人及推广机构应当采取有效措施，并通过管理人、中国证券投资基金业协会、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，但不得通过广播、电视、报刊、互联网及其他公共媒体推广本集合计划。

（十一）本集合计划的各项费用

1、参与费（包括认购/申购费）：0%。

2、退出费：0%。

3、管理费：0.3% /年。

4、托管费：0.05% /年。

5、业绩报酬：本集合计划不提取业绩报酬。

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

五、集合计划的参与和退出

（一）集合计划的参与

1、参与的办理时间

（1）推广期参与

在推广期内，投资者在工作日内可以参与本集合计划。管理人有权在推广期仅募集特定的分级份额，管理人有权仅接受管理人指定的委托人参与。

（2）存续期参与

1) 存续期, 优先级份额经管理人同意后可以参与。优先级份额在开放期可以参与。管理人须依照优先级持有人申请, 按优先级份额计划单位净值办理。优先级份额参与和退出时间及业务安排由管理人提前公告;

2) 管理人有权在不损害持有人利益的前提下办理各分级份额的参与业务。办理时间、规模等均由管理人提前公告。

2、参与的原则

(1) 面值参与, 即推广期分级份额的参与价格为 1.00 元; 产品存续期参与价格以各级份额单位净值为准;

(2) 采用金额参与的方式, 即以参与金额申请;

(3) 在推广期内, 当集合计划募集规模接近或达到分级份额约定的规模或比例上限时, 管理人有权停止接受相应分级份额的参与申请; 推广期内, 当本集合计划分级份额超过规模/比例上限时, 管理人有权发布提前结束推广期的公告, 停止接受参与申请;

(4) 在推广期及存续期内, 当集合计划参与人数达到参与人数上限后, 管理人不接受任何新投资者的参与申请, 但可接受本集合计划份额委托人的追加参与。

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

3、参与的程序和确认

(1) 推广期内, 本计划可以首先发售次级份额, 再募集优先级份额。推广期最终确认的优先级份额与次级份额的比例原则上不超过 2:1。参与申请的受理及有效申请份额并不代表申请确认成功, 管理人在推广期根据份额比例约定及实际募集情况, 采用“时间优先, 金额优先”方法确认最终参与份额和人数。募集资金接近或达到规模上限等情况下, 管理人有权决定提前结束推广期。

在推广期和存续期, 管理人有权仅接受管理人指定的投资者参与各分级份额。

(2) 投资者按推广机构指定营业网点的具体安排, 在规定的交易时间段内办理;

(3) 投资者应开设推广机构认可的交易账户, 并在交易账户备足认购/申购

的货币资金；若交易账户内参与资金不足，推广机构不受理该笔参与申请；

(4) 投资者签署本合同后，方可申请参与集合计划。参与申请经管理人确认后有效后，构成本合同的有效组成部分；

(5) 委托人可多次参与本集合计划，参与申请一经确认不可更改或撤销；

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

(7) 本集合计划采用纸质合同的方式签署。

(8) 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：0%；

(2) 参与份额的计算方法：

推广期参与份额 = 参与金额 / 计划份额单位面值

存续期参与份额 = 参与金额 / 各级计划份额单位净值

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

5、参与资金利息的处理方式

委托人的参与资金在推广期产生的利息将在推广期结束后划入集合计划托管账户，计入集合计划委托资产。

6、拒绝或暂停参与

(1) 出现下列情形，管理人可以拒绝或暂停接受委托人的参与申请：

① 本集合计划分级份额规模或杠杆比例接近或达到本合同规定的上限；

② 本集合计划委托人数接近或达到法律、行政法规和资产管理合同规定的上限；

③ 战争、自然灾害等不可抗力的原因导致集合计划无法正常运作；

④ 管理人认为接受某笔或某些参与申请可能会影响或损害现有委托人利益时；

⑤ 法人或者依法成立的其他组织用筹集的资金参与集合计划而未提供管理人要求的合法筹集资金的证明文件；

⑥ 法律、行政法规规定或中国证监会认定的其他情形。

(2) 除上述第④、⑤项规定的情形外,拒绝或暂停本集合计划的参与,管理人应提前在管理人指定网站公告。

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

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

(二) 集合计划的退出

1、退出的办理

(1) 存续期内,如本集合计划持有的标的股票处在限售期,则不允许任何委托人退出;

(2) 存续期内,集合计划自巨轮智能装备股份有限公司公告本次员工持股计划股票购买完成时之日起 12 个月内为封闭期,期间不得退出。

(3) 存续期内,次级委托人在限售期期满后至本集合计划管理期限到期日前需退出的,在获得所有优先级份额委托人及管理人同意后可以退出,按次级份额计划单位净值办理。

(4) 管理人办理各分级份额的退出业务,办理时间、规模等均由管理人提前公告。

2、退出的原则

(1) 采用份额退出的方式,即退出以份额申请;

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

(3) 退出申请一经确认不可更改或撤销。

3、退出的程序和确认

(1) 退出申请的提出

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

(2) 退出申请的确认

委托人可在 T+2 日(包括该日)(T 日指委托人提出申请日)之后到推广机构

网点取得 T 日退出申请成交确认单，若交易未成功或数据不符，委托人可与为其办理手续的推广机构网点人员联系并进行核实。

（3）退出款项划付

委托人的退出申请确认后，退出款项将在 T+2 日内从托管账户划出。如集合计划出现暂停估值的情形，管理人与托管人协商后，可以将划拨日期相应顺延。

4、退出费及退出份额的计算

（1）退出费用：0%；

（2）退出金额的计算方法：退出金额=退出份额×退出价格。

本集合计划退出金额的计算方法以本部分合同约定进行计算。

5、退出的限制与次数

委托人单笔退出最低份额为 1000 份；若某笔退出导致该委托人在某推广机构持有的份额少于 1000 份，则余额部分必须一起退出。委托人在某一开放日的退出次数不受限制。若管理人为分级份额统一办理强制退出亦按此限制办理。

6、单个委托人大额退出的认定、申请和处理方式

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

7、巨额退出的认定和处理方式

（1）巨额退出的认定

单个开放日，委托人当日累计净退出申请份额（退出申请总份额扣除参与申请总份额之后的余额）超过上一工作日计划总份额数的 30%时，即为巨额退出。

（2）巨额退出的顺序、价格确定和款项支付

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

全额退出：当管理人认为有条件支付委托人的退出申请时，按正常退出程序办理。

部分顺延退出：当管理人认为支付委托人的退出申请可能会对计划资产净值造成较大波动时，管理人在当日接受净退出比例不低于集合计划总份额的 30%的前提下，对其余退出申请予以延期办理。对于当日的退出申请，将按单个账户退出申请量占退出申请总量的比例，确定当日受理的退出份额；未能受理的退出部

分，委托人可选择延期办理或撤销退出申请。对于选择延期办理的退出申请，管理人将在下一个工作日内办理，并以管理人公布的计划单位净值为准计算退出金额，依此类推，直至全部办理完毕为止，转入下一个工作日的退出申请不享有优先权。

（3）告知客户的方式

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

8、连续巨额退出的认定和处理方式

（1）连续巨额退出的认定

如果本集合计划连续 2 个开放日发生巨额退出，即认为发生了连续巨额退出。

（2）连续巨额退出的顺序、价格确定和款项支付

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

9、拒绝或暂停退出的情形及处理

发生下列情形时，管理人可以拒绝或暂停受理委托人的退出申请：

（1）不可抗力的原因导致集合计划无法正常运转；

（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支付出现困难时，管理人可以暂停接受集合计划的退出申请；

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

发生上述情形之一的，已接受的退出申请，集合计划管理人将足额支付；如暂时不能支付的，可支付部分即按每个申请人已被接受的退出申请量占已接受退出申请总量的比例分配给申请人，未支付部分将暂停支付，延期支付期限不得超

过 20 个工作日，集合计划管理人将依据发生的情形制定相应的处理办法，在后续工作日予以支付，并进行及时披露。

发生《集合资产管理合同》、《集合计划说明书》中未予载明的事项，但集合计划管理人有正当理由认为需要暂停接受集合计划参与、退出申请的，可以暂停接受委托人的退出申请，并向委托人及时披露。

六、管理人自有资金参与集合计划

本集合计划管理人不以自有资金参与。

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。

优先级份额预期收益及本金在分配顺序上优先于次级份额参与形成份额对应的资产和次级份额委托人按本合同规定追加的财产的本金和收益。优先级份额预期收益以及次级份额委托人的履约与否均不构成管理人对优先级份额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。次级份额以其资产承担风险，在全面履行本合同约定义务的前提下享有全部剩余收益；次级份额委托人负有合同约定的追加义务，次级份额委托人可以以自身资金或由巨轮智能装备股份有限公司董事长吴潮忠先生追加资金入本集合计划。

本集合计划清算资产优先分配优先级份额的本金和收益，在次级份额委托人全面履行本合同规定义务的前提下再向其分配次级份额的本金和收益；若次级份额委托人未全面履行本合同规定的义务，则其丧失要求分配投资本金和收益的权利，即资产计划财产均归属于优先级份额委托人。具体清算安排请见本合同“集合计划终止和清算”部分和管理人届时公告。

当本集合计划终止或提前终止时，巨轮智能装备股份有限公司董事长吴潮忠先生对优先级份额本金和次级份额的本金承担不可撤销的连带补足责任。如本合同项下债务履行期间和期限届满时，次级委托人没有履行或者没有全部履行其债务，管理人有权直接要求巨轮智能装备股份有限公司董事长吴潮忠先生承担补足责任，代为履行次级委托人未履行的本集合计划合同项下债务。

在计划资产足以支付优先级份额本金和收益的情况下，分级份额收益如下安排：

1、优先级份额的预期收益率为年化 5.7%；

2、次级份额在全面履行本合同约定义务的前提下在计划终止日享有扣除优先级本金及预期收益及管理费、托管费等费用后的全部剩余收益。

3、本集合计划在成立之后每半年支付一次管理费、托管费及优先级份额的预期收益。若计划持有的现金资产足以支付上述费用和分配上述收益的，由管理人直接以现金资产支付；若计划持有的现金资产不足以支付上述费用和分配上述收益的，由次级份额委托人自行或巨轮智能装备股份有限公司董事长吴潮忠先生至少在集合计划成立每满半年的前 3 个工作日追加资金以补足上述差额部分。资金直接划入本集合计划托管账户，不增加其持有份额。追加的具体金额由管理人计算，并至少在集合计划成立每满半年的前 5 个工作日通知次级份额委托人。

上述预期收益率的表述并不是管理人对委托人最低收益的保证或承诺，委托人的本金仍然存在亏损的风险。

（二）份额配比（杠杆倍数）

推广期内，本计划根据本合同约定及管理人实际安排在目标规模内募集分级份额。原则上，本集合计划的优先级份额规模与次级份额规模的比例不超过 2:1，即杠杆倍数不超过 2。

存续期间，本集合计划优先级份额数与次级份额数的比例不超过 2:1，即杠杆倍数不超过 2，若杠杆倍数超过 2，则由次级份额委托人或巨轮智能装备股份有限公司董事长吴潮忠先生追加资金，使本集合计划的杠杆倍数降至 2 倍以下。

管理人每日对集合计划单位净值实行监控，设置单位净值的预警线和平仓线，并有权据此要求次级份额委托人采取相应的履约保障措施。本集合计划的预警线、平仓线见下表：

预警线	平仓线
0.93 元	0.87 元

本集合资产管理计划的预警线和平仓线由管理人负责计算并监控，托管人对于本资产管理计划是否触及预警线或平仓线，以及触及预警线或平仓线后的处置措施不进行监督。

（三）风险承担

1、次级份额的追加资金

在下列情形发生时，次级份额委托人应当按照本合同约定以其自有资金或由巨轮智能装备股份有限公司董事长吴潮忠先生追加资金入本集合计划：

（1）计划存续期内，任何一个工作日（T日）的计划单位净值低于预警线时，管理人应立即以本合同约定的通知方式（若同时以多种通知方式通知的，以最先到达的通知时间为准）在T+1日上午10时前通知次级份额委托人以其自有资金或巨轮智能装备股份有限公司董事长吴潮忠先生追加资金。本资产管理计划的资金补偿方可自行决定是否于T+1日追加资金。自T+1日起至资产管理计划份额净值恢复至预警线以上止，资产管理计划禁止买入，只能卖出。

（2）计划存续期内，任何一个工作日（T日）的计划单位净值低于平仓线时，管理人应立即以本合同约定的通知方式（若同时以多种通知方式通知的，以最先到达的通知时间为准）在T+1日上午9点前通知次级份额委托人以其自有资金或由巨轮智能装备股份有限公司董事长吴潮忠先生追加资金。该委托人应在计划单位净值低于平仓线之日起的第二个工作日上午前（T+1日上午10:30前）追加资金使计划单位净值至少回升至预警线。否则，视为次级份额委托人违约。

（3）次级份额委托人根据本条上述约定自行或由巨轮智能装备股份有限公司董事长吴潮忠先生追加资金的，资金直接划入本集合计划托管账户，不增加其持有份额。

2、次级份额追加资金的提取

（1）本合同各方一致同意，仅在以下情况下，次级份额委托人或巨轮智能装备股份有限公司董事长吴潮忠先生可以申请提取其自行追加的部分资金：

在次级份额委托人或巨轮智能装备股份有限公司董事长吴潮忠先生履行了对集合资产管理计划的追加义务后，如果计划单位净值连续5个工作日超过1.05元，次级份额委托人或巨轮智能装备股份有限公司董事长吴潮忠先生有权向资产管理人提交提取其自行追加的部分资金的申请，委托人或巨轮智能装备股份有限公司董事长吴潮忠先生应明确申请提取的金额，并保证提取该金额后按申请提取当日数据估算的计划单位净值不低于1.05元，资产管理人应在收到该申请之日起2个工作日内办理该部分金额的划付。

为免疑义，即使计划单位净值连续5个工作日超过1.05元，但若追加资金已经由资产管理计划向优先级份额委托人进行了分配，或者已经用于支付相关资产

管理业务费用，则优先级份额委托人无义务向资产管理计划返还资金，资产管理人也无义务办理该部分金额的提取，但对于追加金额的剩余部分（如有），则资产管理人应按前述约定为其办理提取。

（2）次级份额委托人提取金额以以下孰低者为限：

（a）当计划单位净值连续 5 个工作日超过 1.05 元的超额部分（连续超过 1.05 元期间内的资产管理计划委托资产净值简单算术平均值-集合计划份额总数*1.05）扣除当期资产管理计划费用后的余额；

（b）次级份额委托人已经追加但尚未提取的金额。

（3）巨轮智能装备股份有限公司董事长吴潮忠先生提取金额以以下孰低者为限：

（a）当计划单位净值连续 5 个工作日超过 1.05 元的超额部分（连续超过 1.05 元期间内的资产管理计划委托资产净值简单算术平均值-集合计划份额总数*1.05）扣除当期资产管理计划费用后的余额；

（b）巨轮智能装备股份有限公司董事长吴潮忠先生已经追加但尚未提取的金额。

（4）根据本条上述约定提取资金的，资金直接划回其追加资金出资账户，不减少其持有份额。

3、次级份额的违约责任

次级份额委托人违反本合同第七条第（一）款、第（二）款、第（三）款第 1 项第（2）约定，则次级份额各委托人均视为违约，则自次级份额委托人违约之日起，即不可撤销、不可恢复地永久性地不再享有其参与本资产管理计划的所有本金及收益，该本金及收益由管理人按照本合同约定在计划资产清算时向优先级份额进行分配。在不违反监管部门规定的前提下，管理人有权对产品作清盘处理，处理所得收入在扣除相关费用后，根据约定分配给份额持有人。若本计划持有的股票处于锁定期，则等锁定期结束后对产品作清盘处理。若次级份额委托人违约之日，本集合计划资产可以变现的，管理人有权于当日起将资产变现，并相应开展集合计划终止清算。次级份额委托人违约的界定包括但不限于其以自有资金或由巨轮智能装备股份有限公司董事长吴潮忠先生追加参与但未足额追加参与的情况。

如次级份额委托人违约且在计划终止时，经管理人估算的优先级份额的投资收益低于本合同第七条第（一）款预期收益，则次级份额委托人和巨轮智能装备

股份有限公司董事长吴潮忠先生对优先级份额享有的本金及预期收益承担不可撤销的连带补足责任。管理人有权向次级份额委托人及巨轮智能装备股份有限公司董事长吴潮忠先生无限追索，管理人以前述追偿所得为限向优先级份额委托人进行二次分配，二次分配在扣除应付管理费、托管费后分配优先级份额的本金和收益，使得优先级份额的投资收益达到预期收益，本集合资管计划存续期间（含二次清算及分配期间），优先级份额按日连续计提收益。**如出现相关合同内容与本条内容冲突或不符的，则以本条约定为准，本合同各方一致同意，无异议。**

上述安排并不是管理人保证委托人资产本金不受损失或者保证其取得最低收益的承诺。若次级委托人或巨轮智能装备股份有限公司董事长吴潮忠先生违约，管理人就应补足而未补足部分对次级委托人或巨轮智能装备股份有限公司董事长吴潮忠先生进行追偿。

八、集合计划客户资产的管理方式和管理权限

（一）管理方式

管理人以主动管理方式管理计划资产。

（二）管理权限

管理人在本合同约定范围内行使管理人权限。

九、集合计划的成立

（一）集合计划成立的条件和日期

集合计划的参与资金总额不低于 3000 万元、优先级份额总净值与次级份额总净值的初始比例不低于 2:1（因参与资金尾差导致的比例偏差除外）且其委托人的人数为 2 人（含）以上，并经过管理人聘请的具有证券相关业务资格的会计师事务所对集合计划进行验资并出具验资报告后，管理人宣布本集合计划成立。

（二）集合计划设立失败

集合计划推广期结束，在集合计划规模低于 3000 万元或委托人的人数少于 2 人条件下，集合计划设立失败，管理人承担集合计划的全部推广费用，并将已认购资金及活期存款利息在推广期结束后 30 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、开始运作的条件：本集合计划公告成立。

2、开始运作的日期：本集合计划自成立之日起开始运作。

管理人应在本集合资产管理计划成立后 5 个工作日内，应当将发起设立情况

报中国证券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“华泰家园 16 号集合资产管理计划”，证券账户名称应当是“华泰证券资管－兴业银行－华泰家园 16 号集合资产管理计划”。以上账户以实际开立账户名称为准。

（二）集合计划资产的构成

本集合计划资产的构成主要有：

集合计划所拥有的各类有价证券、银行存款本息、其他投资等资产及孳息。

（三）集合计划资产的管理与处分

集合计划资产由托管人托管，并独立于管理人及托管人的自有资产及其管理、托管的其他资产。管理人或托管人的债权人无权对集合计划资产行使冻结、扣押及其他权利。除依照《管理办法》、《细则》、《规范》、《指导意见》、《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兴业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：银行托管模式。

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

十二、集合计划的估值

管理人应当制订健全、有效的估值政策和程序，并定期对其执行效果进行评估，保证集合资产管理计划估值的公平、合理。

（一）资产总值

集合计划资产总值是指其所购买的各类证券、银行存款本息、集合计划各项应收款以及其他资产的价值总和。

（二）资产净值

集合计划资产净值是指集合计划资产总值减去负债后的余额。

（三）单位净值

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

优先级和次级份额单位净值计算如下：

（1）优先级份额计划单位净值

当计划资产净值足以覆盖优先级份额本金和对应收益时，优先级份额计划单位净值按预期收益率计算，计算公式如下：

T 日优先级份额单位净值 $Nav_{A,T} = (1 + R_A \times t) \times 1.00 -$ 优先级份额累计分红。其中： R_A 为优先级份额预期年化收益率； t 为集合计划成立以来的存续年限，年限以 365 天进行计算。

当计划资产净值不足以覆盖优先级份额本金和对应收益时，优先级份额计划单位净值按剩余计划净资产与优先级份额数进行计算。

T 日优先级份额单位净值 $Nav_{A,T} = T$ 日计划资产净值 / 优先级份额数

优先级份额单位净值的计算精确到 0.0001 元，小数点后第五位四舍五入。

（2）次级份额计划单位净值

T 日次级份额单位净值 $Nav_{B,T} = \text{Max} (0.0000, (T \text{ 日计划资产净值} - Nav_{A,T} \times T \text{ 日优先级份额总数}) / T \text{ 日次级份额总数})$

次级份额仅在全面履行本合同约定义务的前提下享有收益。

次级份额单位净值的计算精确到 0.0001 元，小数点后第五位四舍五入。

（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

集合计划所拥有的一切有价证券、银行存款本息、应收款项、其它投资等资产。

（六）估值日

指本集合计划成立后的每个工作日，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

1、估值基本原则

（1）对存在活跃市场的投资品种，估值日有交易的，采用估值日的收盘价确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化，且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，采用最近交易市价确定公允价值。

（2）存在活跃市场的投资品种，估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，使潜在估值调整对资产净值的影响较大的，可以参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。

（3）对不存在活跃市场的投资品种，其潜在估值调整对资产净值的影响较大的，可以采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定公允价值。

采用前述估值技术确定公允价值的，管理人应当尽可能使用市场参与者在定价时考虑的所有市场参数，并通过定期校验，确保估值技术的有效性。

管理人运用前述估值技术得出的结果，应当反映估值日在公平条件下进行正常商业交易所采用的交易价格。

（4）采用前述原则仍不能客观反映相关投资品种的公允价值的，管理人应当根据具体情况与资产托管机构进行商定，按最能反映公允价值的价格估值，并向委托人披露。

2、具体投资品种估值方法

（1）股票估值方法

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

2）在任何情况下，资产管理人如采用本项第1）小项规定的方法对委托财产

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

(2) 银行存款估值方法

银行存款每日按当日银行存款余额计提存款利息。银行定期存款或通知存款以本金列示，按协议或合同利率逐日确认利息收入。

(3) 货币市场基金的估值

货币市场基金按照该基金前一工作日公布的每万份收益逐日计提收益。

(4) 其他品种的估值由管理人和托管人按照估值原则协商确定。

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

(6) 相关法律法规以及监管部门另有新规定的，从其规定。

(八) 估值程序

集合计划的日常估值(含分级资产净值和分级份额净值)每个工作日由管理人进行，托管人复核。用于公开披露的集合计划单位净值由管理人完成估值后，将估值结果加盖业务章后以书面形式报送托管人，集合计划托管人进行复核，托管人复核无误后签章返回给管理人。

由于证券交易所、注册登记机构发送的数据错误或其他不可抗力造成估值错误的，管理人和托管人免于承担责任。

(九) 估值错误与遗漏的处理方式

1、本集合计划单位净值的计算精确到0.0001元，小数点后第五位四舍五入。当资产估值导致本集合计划单位净值小数点后四位以内(含第四位)发生差错时，视为本集合计划单位净值错误。

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

3、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，应根据法律法规的规定对委托人或集合计划资产支付赔偿金，根据实际情况向委托人或集合计划资产支付赔偿金额。

4、由于证券交易所、注册登记机构发送的数据错误或其他不可抗力造成估值错误的，管理人和托管人免于承担责任。

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

6、前述内容如法律法规或监管机构另有规定的，按其规定处理。

（十）估值复核

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

管理人更改原则进行估值的，要及时通知托管人。托管人要认真核查管理人采用的估值政策和程序。

当管理人和托管人对计划估值方法存有异议时，托管人有权要求管理人做出合理解释，通过积极商讨达成一致意见。

（十一）暂停估值的情形

当出现下列情形致使集合计划管理人无法准确评估集合计划资产价值时，可暂停估值。但估值条件恢复时，集合计划管理人必须按规定完成估值工作。

（1）集合计划投资所涉及的证券交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

（2）因不可抗力或其他情形致使集合计划管理人、托管人无法准确评估集合计划资产价值时。

（十二）特殊情形的处理

由于战争、自然灾害等不可抗力原因，或由于证券交易所及注册登记机构发送的数据错误，管理人和托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，

但未能发现错误的，由此造成的资产估值错误，管理人和托管人可以免除赔偿责任。但管理人、托管人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

十三、集合计划的费用、业绩报酬

（一）费用种类

- 1、管理人的管理费；
- 2、托管人的托管费；
- 3、证券交易费用；
- 4、本集合计划成立后的审计费；
- 5、银行汇划费；
- 6、按照国家有关规定可以列入的其他费用。

（二）集合计划费用支付标准、计算方法、支付方式和时间

1、管理费：

本集合计划的管理费按前一日计划资产净值计提，管理费的年费率为0.30%。

计算方法如下：

$$H = E \times 0.30\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的集合计划管理费

E为前一日计划资产净值（成立当日以成立当日的资产净值计提）

管理费每日计提，逐日累计，按半年支付，经管理人与托管人双方核对无误后，于集合计划每满半年之后5个工作日内由管理人向托管人出具划款指令，托管人复核无误后进行集中支付。若集合计划剩余的现金类资产不足以支付管理费，管理人有权以本合同约定的通知方式（若同时以多种通知方式通知的，以最先到达的通知时间为准）通知次级份额委托人和巨轮智能装备股份有限公司董事长吴潮忠先生。次级份额委托人或巨轮智能装备股份有限公司董事长吴潮忠先生需最晚在管理人通知次级份额后2个工作日内以不低于不足部分的资金额追加入本集合计划。

2、托管费：

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

$$H = E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的托管费

E 为前一日计划资产净值（成立当日以成立当日的资产净值计提）

托管费每日计提，逐日累计，按半年支付，经管理人与托管人双方核对无误后，于集合计划每满半年之后5个工作日内由管理人向托管人出具划款指令，托管人复核无误后进行集中支付。若集合计划剩余的现金类资产不足以支付托管费，管理人有权以本合同约定的通知方式（若同时以多种通知方式通知的，以最先到达的通知时间为准）通知次级份额委托人和巨轮智能装备股份有限公司董事长吴潮忠先生。次级份额委托人或巨轮智能装备股份有限公司董事长吴潮忠先生需最晚在管理人通知次级份额后2个工作日内以不低于不足部分的资金额追加入本集合计划。

3、管理费和托管费的调整

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

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

5、与本集合计划相关的审计费

在存续期间发生的集合计划审计费用，在合理期间内摊销计入集合计划。

6、管理人的业绩报酬

管理人不收取业绩报酬。

7、其他费用

上述（一）中第3、6项费用由管理人本着保护委托人利益的原则，按照公允的市场价格确定，法律、行政法规另有规定时从其规定，并由托管人根据法律、法规及相应协议的规定，按费用实际支出金额支付，列入当期集合计划费用。

当本计划持有现金不足给付相应费用时，管理人有权以本合同约定的通知方式（若同时以多种通知方式通知的，以最先到达的通知时间为准）通知次级份额委托人和巨轮智能装备股份有限公司董事长吴潮忠先生。次级份额委托人或巨轮智能装备股份有限公司董事长吴潮忠先生需最晚在管理人通知次级份额后

2个工作日内以不低于不足部分的资金额追加入本集合计划。资金直接划入本集合计划托管账户，不增加其持有份额。次级份额委托人或巨轮智能装备股份有限公司董事长吴潮忠先生未能按照本条约定支付费用的，在不违反监管部门规定的前提下，管理人有权对产品作清盘处理，处理所得收入在扣除相关费用后，根据约定分配给份额持有人。

（三）不列入集合计划费用的项目

集合计划成立前发生的费用，以及存续期间发生的与推广有关的费用，不得在集合计划资产中列支。本集合计划注册登记费用不列入集合计划费用项目。管理人和托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或集合计划资产的损失以及处理与集合计划运作无关的事项发生的费用等不得列入集合计划费用。

其他不列入集合计划费用的具体项目依据中国证监会有关规定执行。

十四、集合计划的收益分配

（一）收益的构成

收益包括：集合计划投资所得股息、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）收益分配原则

1、同一类集合计划份额享有同等分配权；

2、在优先级份额收益分配日，若优先级份额单位净值高于份额面值，管理人对优先级份额委托人进行收益分配，具体分配比例由管理人决定。收益分配后，优先级份额单位净值不得低于份额面值。

3、本集合计划存续期内，在符合收益分配的条件下，每半年向优先级份额持有人分配一次投资收益。具体分配时间由管理人提前公告。

4、存续期内，本集合计划不向次级份额委托人分配收益。

5、法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。在法律法规和监管机构允许的范围内，管理人、托管人协商一致，可以对上述收益分配条件和时间进行调整，并在管理人网站上公告。

届时，若计划持有的现金资产足以分配上述收益的，由管理人直接以现金资

产向优先级份额持有人分配；若计划持有的现金资产不足以分配上述收益的，则次级份额委托人或巨轮智能装备股份有限公司董事长吴潮忠先生应于收益分配日之前向本计划追加资金以补足上述差额部分。因上述分配导致本计划单位份额净值低于预警线或平仓线的，次级份额委托人和巨轮智能装备股份有限公司董事长吴潮忠先生应按本合同规定追加资金。

上述优先级份额持有人的收益分配并不减轻或免除次级份额委托人的追加资金及差额补足义务。

（三）收益分配方案的确定与披露：本集合计划收益分配方案由集合计划管理人拟定，至少在 T-3 日通知托管人，至少在 T-2 日（T 为权益登记日）之前将收益分配方案以至少一种指定方式进行信息披露。

（四）收益分配方式：本集合计划的采取现金分红方式，管理人将现金红利款划往推广机构账户，再由推广机构划入委托人账户，现金红利款自款项从集合计划托管账户划出之日起 7 个工作日内到达委托人账户。

十五、投资理念与投资策略

（一）投资理念

在《员工持股计划》的约定范围内进行主动管理，在有效控制投资风险的前提下，力争实现委托人资产持续稳健增值。

（二）投资策略

根据《员工持股计划》的约定，结合管理人对于标的股票的估值、未来走势等判断进行主动管理，在有效控制投资风险的前提下，力争实现委托人资产持续稳健增值。

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、《管理暂行办法》、《管理办法》、《细则》、《规范》、《集合资产管理合同》、《说明书》等有关法律性文件；
- 2、国内外经济形势、利率变化趋势以及行业与上市公司基本面研究；

3、投资对象收益和风险的匹配关系，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。

4、应按照《员工持股计划》的约定通过二级市场购买股票（含大宗交易），所购股票锁定期不少于 12 个月，自公司公告最后一笔标的股票登记过户至本资产管理计划名下之日起算。

5、出售股票应遵循《员工持股计划》以及《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，但前述规定中违反法律法规规定的除外。

6、证券法规规定和集合计划管理合同约定禁止从事的其他投资。

（二）集合计划的投资程序

投资管理程序分为投资研究、投资决策、投资执行、业绩和流动性分析、投资核对和监督五个环节：

1、投资辅助人员定期就目前宏观经济、金融形势、货币政策方向及利率水准等总体经济数据现状进行分析，为投资决策提供科学的依据。

2、投资主办根据员工持股计划的约定，加强对投资标的的研究，并提出相关投资建议。

3、根据投资决策流程，投资建议若需审核批准，则经过审核批准后执行。

4、投资交易指令由集中交易室统一执行，严格执行投资与交易分离制度。

5、投资主办必须定期进行投资总结，对已发生的投资进行业绩和流动性分析，为未来的投资拟定方向

6、公司华泰证券合规法律部与风险管理部、公司风险管理委员会和合规风控部对投资决策和投资执行的过程进行合规性监督检查，防范投资管理过程中的违规风险。

（三）风险控制

1、风险管理理念

本集合计划管理人——华泰资管始终秉承“高效、诚信、稳健、创新”的核心价值观和“追求风险可控的合理收益”的风险管理理念，将风险管理放在与业务发展同等重要的位置。在风险管理模式和手段上，逐步实现了由事后控制向事前审核、事中监控和事后评估的转变，全面实行了集中化风险管理模式，完善了定性判断和定量分析相结合的风险管理技术手段。

2、风险管理主要内容

- (1) 确立加强风险管理的指导思想，制定业务风险管理的目标和原则；
- (2) 建立层次分明、权责明确的业务风险管理机制；
- (3) 建立完善的业务风险控制流程；
- (4) 对业务面临的风险进行全面、系统的评估，制定详细、可行的风险管理方案；
- (5) 确定集合资产管理业务风险控制措施和报告制度；
- (6) 保障业务风险管理制度的持续性和有效性，制定可行的制度评价、检查机制。

3、风险管理体系

公司建立严密有效的多级风险防范体系，集合资产管理业务的风险管理工作纳入公司的风险管理体系。公司风险管理组织架构包括四个主要部分：董事会、总经理及风险管理委员会、首席风险官及合规风控部、各其他职能部门以及业务部门。

(1) 一级风险防范

一级风险防范是指公司董事会对集合资产管理业务的风险进行管理和防范，其主要职责为：设定风险管理的总体目标、基本政策；决定风险管理的机构设置及职责。

(2) 二级风险防范

二级风险防范是指公司总经理及风险管理委员会对集合资产管理业务实际运作风险的管理与防范。公司总经理是集合资产风险管理第一责任人，根据董事会的授权和批准，结合集合资产管理经营目标，具体负责实施风险管理工作。公司总经理对集合资产全面风险管理执行的有效性承担主要责任。公司总经理下设风险管理委员会，风险管理委员会为非常设机构，其主要职责为：制定公司风险管理政策，确定公司风险管理运行机制；分解董事会确定的风险管理额度；日常经营和重大投资业务的风险评估和决策。

(3) 三级风险防范

三级风险防范是指首席风险官及合规风控部对集合资产管理业务各项风险的管理与防范。公司设首席风险官，负责全面风险管理工作，首席风险官由董事

会提名、聘任。首席风险官为公司高级管理人员，并不得兼任或者分管与其职责相冲突的职务或部门。公司设立合规风控部履行风险管理职责，在首席风险官领导下推动全面风险管理工作，监测、评估、报告公司整体风险水平，并为业务决策提供风险管理建议；协助、指导和检查各部门风险管理工作；对创新业务和重大风险业务或项目进行独立风险审核及评估。

（4）四级风险防范

四级风险防范指各业务部门及职能部门负责各自条线的风险管理工作，主动执行公司各项风险管理制度。公司各部门负责人是风险管理的第一责任人，应当全面了解并在决策中充分考虑与业务相关的各类风险，及时识别、评估、应对、报告相关风险，并承担风险管理有效性的直接责任。公司集合资产管理相关部门对自身业务风险进行自我检查和控制，根据经营计划、业务规则及本部门具体情况制定本部门的工作流程及风险控制措施，达到：

a. 一线岗位双人双职双责，互相监督；直接与交易、资金、电脑系统、重要空白支票、业务用章接触的岗位，实行双人负责；属于单人、单岗处理的业务，强化后续的监督机制；

b. 公司内部相关部门、相关岗位之间相互监督制衡。部门之间和岗位之间建立重要业务凭据顺畅传递的渠道，各部门和岗位分别在授权范围内承担各自的职责，将风险控制在最小范围内。

4、风险管理流程

（1）建立控制环境

公司制定风险管理目标和风险管理制度，设立相应的风险管理部门。公司内部组织结构的设计方面，体现部门之间职责既有分工，又相互合作与制衡的原则。集合计划投资管理、运营、清算、财务等工作岗位有明确的授权分工，各岗位的操作相互独立，并且有独立的报告系统。各工作岗位之间相互核对、相互牵制，以减少舞弊或错误与遗漏发生的风险。

在明确的岗位责任制度基础上，设置科学、合理、标准化的业务操作流程，每项业务操作有清晰、书面化的操作手册，同时，规定完备的处理手续，保存完整的业务记录，制定严格的检查、复核标准。

（2）风险评估

风险评估包括风险识别和风险分析。风险识别是指对集合资产管理业务面临的各种风险因素进行甄别；风险分析是指对风险的重大程度、风险发生可能性进行分析预测，拟定风险应对措施等。

集合资产管理业务风险评估包括事前评估和事后评估。集合资产管理业务事前评估指在开展集合资产管理业务前，针对业务流程和特点，对业务开展过程中可能存在的风险进行评估。集合资产管理业务的事后评估指开展集合资产管理业务后对于风险进行的定期评估与不定期评估。

（3）风险报告

建立完善的风险报告制度。风险报告制度要求各部门之间以及部门内部的操作必须有书面文件予以记录，各个部门、各个岗位对风险管理情况和风险隐患按一定程序向部门领导及合规风控部作书面报告；合规风控部对于日常操作中发现的或认为具有潜在可能的问题应编制风险报告向总经理及首席风控官报告，并负责追踪整改情况。

5、风险管理具体措施

（1）市场风险管理

公司建立科学严谨的从客户资产投资决策会议到投资主办的多层次投资决策体系、完备的投资授权制度；组建覆盖权益投资、固定收益投资、衍生品、量化策略等各类型投资的投资研究队伍及专业化投资决策小组；通过运行投资例会制度、证券池制度、止盈止损制度等一系列投资管理控制制度，同时以投资交易管理系统作为辅助控制手段来达到控制市场风险的目的。

（2）合规性风险管理

公司风险管理委员会和合规风控部对集合资产管理业务的合法、合规性进行全面和重点的分析和检查，控制集合资产管理业务在合规性方面的风险。

（3）信用风险管理

信用风险控制实行事前、事中、事后三个环节同时把控的原则；建立信用分析会议制度，综合考虑债券发行人所有制性质以及实际控制人情况、发债主体盈利与现金流、发债主体偿债能力与偿债意愿及担保情况对债券主体及债项进行评级；建立动态禁止投资黑名单制度；对于特殊券种、特殊发行主体及低于一定评级的债券品种实行特别审批制度。

（4）流动性风险管理

公司将流动性风险管理工作纳入绩效考核，并建立问责制度；对流动性风险实施事前、事中、事后全方位管理；投资主办投资过程中对流动性以“宁多勿少”为原则，特别关注产品开放赎回期及季末、年末等特殊时期；公司通过建立流动性风险应急预案防止风险扩大化。

（5）操作风险管理

通过建立健全各项操作制度、岗位职责，建立岗位复合制度，发现风险事件及时统计、定期归纳回顾，修订流程、制度，并辅以一定的奖惩措施的方法将操作风险降至最低。

（6）法律风险管理

通过加强合规法务人员的配备，提高对公司资产管理各业务的覆盖，同时加强对员工法律意识及相关法律法规知识的培训来达到控制法律风险的目的。

（7）信息技术风险管理

公司的信息技术服务由母公司提供外包服务，公司仍需将通过明确岗位职能、健全相关制度，以及通过各种方式如培训、讲座、邮件提醒等提高员工的信息技术风险防范意识的多种途径，防范和化解信息技术风险。

（8）投资风险管理的

a、风险控制是集合计划投资管理的重要环节，公司根据投资决策的不同层次建立完善的计划投资风险控制系统。

b、母公司合规法律部与风险管理部定期或不定期对公司投资管理制度、投资决策程序的合法性、合规性、有效性及集合计划运作过程中的合法性、合规性进行全面检查评价。

c、客户资产管理投资决策委员会通过审批各集合计划的整体投资策略报告、季度投资策略报告以及集合计划投资授权方案，从而控制各集合计划的投资风险。

d、公司合规风控负责人、合规风控部通过定期或不定期对集合计划风险水平进行评价，加强对集合计划投资风险的控制。

e、交易员负责对集合计划投资的日常交易行为进行实时监控，防止违法、违规和异常交易行为的发生。

f、合规风控部对投资制度的执行情况、投资过程的合法性、合规性进行日

常具体的检查。

g、合规风控部建立与投资业务同步的风险监控系统，根据公司对投资风险管理的要求，对投资执行进行全程实时监控及事后核对检查。

h、母公司合规法律部对《华泰证券股份有限公司信息隔离墙管理制度（试行）》以及公司制定的相关制度流程的执行情况实施一线监督和控制。

i、公司对与投资管理有关的往来金融机构（场外交易市场的交易对手、托管机构）制定严格的选择和评级标准，择优选用相关往来金融机构，并根据上述机构的风险及提供服务的质量进行定期评级，择优汰劣。

j、公司在集合计划投资管理过程中高度重视流动性风险的控制和管理，建立完备的计划流动性风险的监测、分析和评价和实时管理体系。综合采取选择流动性好的投资品种、降低持股集中度、增加现金比例等措施，控制流动性风险。

（9）其他风险管理措施。

除了上述针对特定投资风险采取专门的管理措施之外，本集合计划还针对各个可能的风险点建立各种风险防范和控制措施，以及建立风险管理与控制相匹配的技术支持系统，实现对集合资产管理业务全流程、实时、动态的风险管理与控制。

十七、投资禁止行为

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、投资于除巨轮智能外的上市公司股票；

11、股票抛售遵守《员工持股计划》及《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；

12、根据巨轮智能《员工持股计划》约定的依法发行上市的巨轮智能股票，投资比例为 0-100%，资管计划所持有的巨轮智能股票总数不超过公司股本总额的 10%；

13、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、托管季度（年度）报告、年度审计报告和对账单。

1、集合计划单位净值报告

披露时间：本集合计划存续期内每周披露一次单位净值信息，于每周一披露上周五的产品单位净值。

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》、《指导意见》、本合同及其他有关规定进行。本集合计划的计划单位净值等信息将在管理人指定网站上向委托人披露，本集合计划委托人可随时查阅。

2、集合计划的资产管理季度报告和托管季度报告

管理人每季度向委托人提供一次准确、完整的管理季度报告，对报告期内集合计划资产的配置状况、价值变动情况、重大关联交易做出说明。资产管理季度报告由管理人编制，经托管人复核后由管理人向本集合计划委托人披露，并报中国证券投资基金业协会备案，同时抄送管理人住所地中国证监会派出机构。上述报告应由管理人于每季度截止日后 15 个工作日内通过管理人指定网站向本集合计划委托人披露。集合计划成立不足 2 个月时，管理人可以不编制当期的季度报告。

3、集合计划的资产管理年度报告和托管年度报告

管理人每年度向委托人提供一次准确、完整的管理年度报告，对报告期内集合计划资产的配置状况、价值变动情况、重大关联交易做出说明。资产管理年度

报告由管理人编制，经托管人复核后由管理人向本集合计划委托人披露，并报中国证券投资基金业协会备案，同时抄送管理人住所地中国证监会派出机构。托管人在每年度向委托人提供一次托管报告。上述报告应由管理人于每个会计年度截止日后 3 个月内通过管理人指定网站向本集合计划委托人披露。集合计划成立不足 3 个月时，管理人/托管人可以不编制当期的年度报告。

4、年度审计报告

管理人进行年度审计，应当同时对客户资产管理业务的运营情况进行审计，并要求会计师事务所就本集合资产管理计划出具单项审计意见。

管理人应当将审计结果报中国证券投资基金业协会备案，同时抄送管理人住所地中国证监会派出机构，并将本集合资产管理计划的单项审计意见提供给委托人和托管人。

5、对账单

管理人应当每个季度通过网站或交易客户端等方式向委托人提供对账单信息。对账单内容应包括委托人持有集合计划的风险和差异性、各分级份额的数量及净值，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，管理人应当以管理人指定网站、推广机构网站或网点、或其他途径和方式及时向客户披露。临时报告的情形包括但不限于：

（1）集合计划运作过程中，负责集合资产管理业务的高级管理人员发生变更，或出现其他可能对集合计划的持续运作产生重大影响的事项；

（2）暂停受理或者重新开始受理参与或者退出申请；

（3）发生巨额退出并延期支付；

（4）集合计划终止和清算；

（5）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）负责本集合计划的代理推广机构发生变更；

（8）集合计划投资于管理人及与管理人有关联方关系的公司发行的证券；

（9）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；

(10) 管理人、托管人因解散、破产、撤销等原因不能履行相应职责;

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

(12) 管理费、托管费等费用计提方式或费率发生变更;

(13) 其他对集合计划持续运营、客户利益、资产净值产生重大影响的事件。

十九、集合计划份额的转让、非交易过户和冻结

(一) 集合计划份额的转让

集合计划存续期间,集合计划分级份额不转让。

(二) 集合计划份额的非交易过户

非交易过户是指不采用参与、退出等交易方式,将一定数量的集合计划份额按照一定的规则从某一委托人集合计划账户转移到另一委托人集合计划账户的行为。集合计划注册登记机构只受理因继承、捐赠、司法执行、以及其他形式财产分割或转移引起的计划份额非交易过户。对于符合条件的非交易过户申请按登记结算机构的有关规定办理。

(三) 集合计划份额的冻结

集合计划登记结算机构只受理国家有权机关依法要求的集合计划份额冻结与解冻事项。

二十、集合计划的展期

本集合计划在法律法规许可的前提下,根据员工持股计划的相关要求运作,预期为 24 个月,经管理人、委托人、托管人协商一致,可以展期。

(一) 展期的条件

1、在存续期间,本集合计划运营规范,管理人、托管人未违反《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。

(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 20 个工作日。

2、通知展期的方式

管理人以官网公告的方式通知全部委托人。

3、委托人回复的方式

委托人应当在管理人公告起 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，管理人有权为该委托人在存续期届满日前（含届满日）按照管理人的公告办理强制退出。若委托人未回复意见或回复意见不明确的，并未在上述期限内办理退出手续，视为同意展期，管理人不再另行通知确认。

（四）展期的实现

如果同意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、集合计划终止和清算

（一）有下列情形之一的，集合计划应当终止

- 1、计划存续期间，客户少于 2 人；
- 2、管理人因重大违法、违规行为，被中国证监会取消相关业务资格；
- 3、托管人因重大违法、违规行为，被中国证监会取消相关业务资格，而无其他适当的托管机构承接其原有权利、义务的；
- 4、管理人因解散、破产、撤销等原因不能履行相应职责；
- 5、托管人因解散、破产、撤销等原因不能履行相应职责；
- 6、因战争、自然灾害等不可抗力力的发生导致本集合计划不能存续；
- 7、法律、行政法规及中国证监会规定的其他终止情形。

（二）有下列情形之一的，管理人可以终止本集合计划

- 1、本集合计划完成股票购买满 12 个月后，本集合计划投资目的提前实现的（即本集合计划权益类资产全部变现时），管理人可以提前终止本集合计划；

2、员工持股计划提前结束且计划资产变现完毕。

3、次级份额委托人或巨轮智能装备股份有限公司董事长吴潮忠先生未能按照本协议约定追加资金的，在不违反监管部门规定的前提下，管理人有权对产品作清盘处理。

（三）集合计划的清算

1、根据上市公司公告的《员工持股计划》，在计划终止时巨轮智能装备股份有限公司董事长吴潮忠先生对优先级和次级的本金承担差额补足责任。若产品存续期届满前第5个工作日（R日）计划累计单位净值低于1.00，管理人应立即以本合同约定的通知方式（若同时以多种通知方式通知的，以最先到达的通知时间为准）在R+1日上午10时前吴潮忠先生追加资金，追加资金须于R+3日13:00以前到达托管账户，到账追加资金须使计划累计单位净值回升至1.00。

自集合计划终止之日起5个工作日内，管理人开始清算计划资产。管理人也可以组织成立集合计划清算小组进行资产清算。管理人或集合计划清算小组按照监管机构的相关规定进行集合计划清算；

2、清算过程中的有关重大事项应当及时公布；

3、清算结束后15个工作日内，管理人或集合计划清算小组应当在扣除清算费用、管理费、托管费等本合同约定的费用后，将集合计划资产按照集合资产管理合同的约定或其他合理方式以货币资金的形式全部分派给委托人。若次级份额委托人未全面履行本合同约定的各项义务，则其不再享有其参与本资产管理计划的所有本金及收益。由计划缴纳的最低结算备付金和交易保证金根据注册登记机构规则，在收回后再向委托人进行分配，并注销集合计划专用证券账户和资金账户；

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

5、若本集合计划在终止之日有未能流通变现的证券，管理人可对此制定二次清算方案，该方案应经托管人认可，并通过管理人网站进行披露。管理人应根据二次清算方案的规定，对前述未能流通变现的证券在可流通变现后进行二次清算，并将变现后的资产按照本合同的约定或其他合理方式，以货币形式全部分配给委托人。

6、委托人自行承担收益的缴税事项。

7、任何情况下，优先级份额委托人参与后不足一年集合计划提前终止的，资管计划应按本合同约定及时分配该优先级份额委托人参与资金及预期收益，对于优先级委托人的该笔参与资金，优先级委托人有权收取一定金额的补偿金，该等金额按照合同约定的预期收益率以三十天计算。计划管理人于本条约定的分配当日通知次级份额委托人，次级份额委托人应于收到通知后两日内将资金划入托管户。

二十二、当事人的权利和义务

（一）委托人的权利和义务

1、委托人的权利

（1）取得集合计划收益；

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

（3）按照本合同及《说明书》的约定，参与和退出集合计划；

（4）按合同约定取得集合计划清算后的剩余资产；

（5）因管理人、托管人过错导致合法权益受到损害的，有权得到赔偿；

（6）法律、行政法规、中国证监会的有关规定及本合同约定的其他权利。

2、委托人的义务

（1）委托人应认真阅读本合同及《说明书》，并承诺委托资金的来源及用途合法，不得非法汇集他人资金参与本集合计划；

（2）按照本合同及《说明书》约定交付委托资金，承担本合同约定的管理费、托管费和其他费用；

（3）按照本合同及《说明书》约定承担集合计划的投资损失及相应的违约责任；

（4）不得违规转让其所拥有的计划份额；

（5）次级份额委托人设立的员工持股计划过程合法合规，已取得参与员工的认可。次级份额委托人有完全及合法的权利委托或授权管理人对委托资产进行投资管理，自行办理次级份额委托人与其员工持股计划参与员工之间的代持及代管理等手续。如果委托人为法人，则签署和履行本合同不会与其章程、内部规章、

以其为一方主体的任何其他合同或其他法律文件及其在该等法律文件中的义务发生冲突，且不违反适用于委托人的任何现行法律、法规、规章、条例、司法判决、裁定、仲裁裁决和行政授权、命令及决定，并履行了委托人的内部程序。

（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，临时开放；

（4）根据本合同及《说明书》的约定，终止本集合计划的运作；

（5）监督托管人，并针对托管人的违约行为采取必要措施保护委托人的利益；

（6）行使集合计划资产投资形成的投资人权利；

（7）集合计划资产受到损害时，向有关责任人追究法律责任；

（8）法律、行政法规、中国证监会有关规定及本合同约定的其他权利。

2、管理人的义务

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

（2）进行资产估值等会计核算；

（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和本合同约定的其他义务。

(三) 托管人的权利与义务

1、托管人的权利

(1) 依法对集合计划的资产进行托管；

(2) 按照本合同、《说明书》和托管协议的约定收取托管费；

(3) 监督管理人集合计划的经营运作，发现管理人的投资或清算指令违反法律法规、中国证监会的有关规定或者本合同、《说明书》和托管协议约定的，要求其改正；未能改正的，应当拒绝执行；

(4) 查询集合计划的经营运作情况；

(5) 托管协议与本合同、说明书约定不一致的，托管人的托管职责以托管协议的约定为准；

(6) 法律法规、中国证监会有关规定和本合同、《说明书》以及托管协议约定的其他权利。

2、托管人的义务

(1) 依法为集合计划开立专门的资金账户和专门的证券账户等相关账户；

(2) 非依法律、行政法规和中国证监会有关规定或合同约定，不得擅自动用或处分集合计划资产；

(3) 在集合计划托管活动中恪尽职守，履行诚实信用、谨慎勤勉的义务，保管集合计划的资产，确保集合计划资产的独立和安全，依法保护委托人的财产权益；

(4) 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；资产托管人仅对集合计划托管账户内的资金进行保管，不对处于自身实际控制之外的账户及财产承担责任。

(5) 定期核对资产管理业务资产情况；

(6) 监督管理人集合计划的经营运作，发现管理人的投资或清算指令违反法律法规、中国证监会的有关规定和本合同、《说明书》以及托管协议约定的，应当要求其改正；未能改正的，应当拒绝执行；

(7) 复核、审查管理人计算的集合计划的资产净值；

(8) 保守集合计划的商业秘密，在集合计划有关信息向委托人披露前予以保密，不向他人泄露（法律法规、中国证监会另有规定或有权机关要求的除外）；

(9) 按规定出具集合计划托管情况的报告；

(10) 妥善保存与集合计划托管业务有关的合同、协议、交易记录、会计账册等文件、资料和数据，保存期不少于二十年；

(11) 在集合计划终止时，与管理人一起妥善处理有关清算和委托人资产的返还事宜；

(12) 在解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产时，及时报告委托人和管理人；

(13) 因违反本合同导致集合计划资产损失或损害委托人合法权益时，应承担赔偿责任；

(14) 法律、行政法规、中国证监会有关规定和本合同约定的其他义务。

二十三、违约责任与争议处理

(一) 违约责任

1、本合同生效后，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，给计划财产或者委托人造成损害的，应当分别对各自的行为依法承担赔偿责任；因共同行为给计划财产或者委托人造成损害的，

应当承担连带赔偿责任。但是发生下列情况的，当事人可以免责：

(1) 不可抗力

一方因不可抗力不能履行本合同时，应及时通知另一方，并在合理期限内提供受到不可抗力影响的证明，同时采取适当措施防止集合计划资产损失扩大。任何一方当事人延迟履行合同义务后，发生了上述不可抗力事件致使合同当事人无法全部或部分履行本合同，该方不能减轻或免除相应责任。

(2) 管理人和/或托管人按照当时有效的法律法规或中国证监会的规定作为或不作为而造成的损失等；

(3) 管理人由于按照合同规定的投资原则行使或不行使其投资权而造成的损失等；

(4) 托管人由于执行管理人的合法有效指令对集合计划资产造成的损失等；

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

(6) 相关法律、行政法规和规定的变更。

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

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

4、由于管理人、托管人不可控制的因素导致业务出现差错，管理人和托管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、管理人或托管人任一方不因另一方的失职行为而给集合计划资产或委托人造成的损失向委托人承担连带责任。

（二）争议的处理

因履行本合同发生的争议，由协议签订各方协商解决，协商不成的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会（上海）进行仲裁解决。仲裁地点为上海市。仲裁裁决是终局的，对各方当事人均有约束力。仲裁费用由败诉方承担。

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。

（二）管理风险

在集合资产管理计划运作过程中，管理人的知识、经验、判断、决策、技能等，会影响其对信息的获取和对经济形势、金融市场价格走势的判断，如管理人判断有误、获取信息不全、或对投资工具使用不当等影响集合资产管理计划的收益水平，从而产生风险。

（三）流动性风险

因市场交易量不足，导致证券不能迅速、低成本地转变为现金的风险。流动性风险还包括由于本集合计划在开放期出现投资者大额或巨额赎回，致使本集合计划没有足够的现金应付集合计划退出支付的要求所导致的风险。

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

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

（五）信用风险

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

（六）其他风险

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

2、战争、自然灾害等不可抗力因素的出现，将会严重影响证券市场的运行，可能导致委托资产的损失，从而带来风险。

（七）本集合计划特有风险

1、因特定的结构性收益分配所形成的投资风险

从计划资产整体运作来看，本计划为股票型产品，计划整体属于高风险产品，其风险收益水平高于混合型和债券型集合资产管理计划。

在本计划存续期内，对于优先级份额委托人来说，由于计划资产及收益的分配安排，将表现出中等风险、但收益比次级份额稳定的特征，其预期收益和预期风险要低于普通的股票型集合资产管理计划。虽然优先级份额具有相对稳定收益

和本金保护的安排，但考虑到投资风险的不确定性，其预期收益的获得及其分配也具有不确定性。在本计划资产出现极端损失情况或次级份额委托人违约情况下，优先级份额仍可能面临无法取得预期收益乃至投资本金受损的风险。次级份额委托人的履约与否不构成管理人对优先级份额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。

在本计划存续期内，对于次级份额委托人来说，由于计划资产及收益的分配安排，将表现出较高风险、收益相对较高的特征，其预期收益和预期风险要高于普通的债券型集合资产管理计划，并且高于优先级份额。由于本计划的资产和收益分配将优先满足优先级份额的收益分配，在本计划资产出现前段所述的极端损失的情况下，次级份额可能面临本金全部损失，甚至需要承担追加参与且参与资金全部损失的风险。在次级份额委托人发生违约时，将不再享有本金及收益，存在较大的投资风险。

优先级份额、次级份额的预期收益与预期风险存在显著差异，次级份额承担较高的投资风险。

2、特定投资对象风险

本计划根据《员工持股计划》的约定主要投资于巨轮智能（002031.SZ）股票，因此本计划可能因投资权益类资产而面临较高的市场系统性风险，以及该特定投资对象可能引起的特定风险（包括但不限于上市公司股价波动风险、上市公司经营风险、股票锁定期风险、资产管理计划延期的风险）。

3、特定的投资方法风险

本计划集中持有单一上市公司股票，且所持有的股票存在一年或更长的锁定期，锁定期内股票无法变现，因此委托人将面临无法及时退出本计划获取退出款项的特殊流动性风险。

4、提前终止风险

（1）当存续期内，计划委托人少于2人，本计划提前终止。

（2）本集合计划成立满24个月后，本集合计划投资目的实现时（即本集合计划股票已全部变现），管理人可以终止本集合计划。

（3）员工持股计划提前结束且计划资产变现完毕时，本计划提前终止；

（4）次级份额委托人或巨轮智能装备股份有限公司董事长吴潮忠先生未能

按照本条约定追加资金的，在不违反监管部门规定的前提下，管理人有权对产品作清盘处理。

5、合同变更风险

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

6、优先级份额委托人不能按期收取收益的风险

管理人有权向优先级份额按期支付对应收益，当本计划持有现金不足给付相应收益时，次级份额委托人或其指定的第三方需在收益支付日前三个工作日内以不低于不足部分的资金额追加入本集合计划。若次级份额委托人或其指定的第三方未履行参与义务，则优先级份额委托人存在不能按期收取收益的风险。

7、本合同约定，本集合计划完成股票购买满 24 个月后，本集合计划投资目的实现时（即本集合计划权益类资产全部变现），管理人可以终止本集合计划。此处之“投资目的实现时”并不包括次级份额取得本金及正收益，因此，管理人执行本条款可能造成次级份额无法获得正收益甚至本金全部损失。次级份额委托人完全理解本条款约定内容，并且对管理人在符合合同约定的任一时间执行本条款无异议。

二十五、合同的成立与生效

（一）合同的成立与生效

本合同以纸质合同方式签署，管理人、托管人作为本合同签署方，已接受本合同项下的全部条款；委托人作为本合同一方，以纸质合同方式签署本合同即表明委托人完全接受本合同项下的全部条款。本合同经管理人、托管人和委托人签署后成立。资产管理合同未经正式签署前，任何一方使用、引用合同全部或部分条款及内容的，均由使用、引用方承担由此产生的法律后果。

本合同成立后，同时满足以下条件时生效：

- （1）委托人参与资金实际交付并确认；
- （2）本集合计划成立。

（二）合同的组成

《华泰家园 16 号集合资产管理计划说明书》、经管理人确认有效的委托人参

与、退出本集合计划的申请材料和各推广机构出具的集合计划参与、退出业务受理有关凭证等为本合同的附件，是本合同不可分割的一部分，与本合同具有同等法律效力。

说明书内容不得超出本合同，若说明书中的内容与本合同中的相关内容不一致的，以本合同中的表述为准。

二十六、合同的补充、修改与变更

1、本合同签署后，因法律、法规、规章、中国证监会的规定、证券登记结算机构业务规则以及证券交易所等交易规则修订，自该修订生效之日起，本合同相关内容及条款按该修订办理并在管理人网站公告并书面通知委托人。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。若委托人对更新或修改的内容有异议，应在更新或修改内容于管理人指定网站公告之日起 10 个工作日内按照本合同的规定申请退出本集合计划，未申请退出的，视为无异议。

2、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指定网站公告。管理人须在指定网站公告或书面通知等方式向委托人发送合同变更征询意见。

委托人不同意变更的，应在征询意见发出后的 10 个工作日内（以下统称“指定期”）内书面答复不同意合同变更意见，如果无法取得委托人一致同意的，合同条款不变更。

3、若委托人同意变更或未在前述时间回复意见，视为委托人同意合同变更。合同变更后，委托人、管理人和托管人的应当按照变更后的合同行使相关权利，履行相应义务。

4、委托人、管理人、托管人不得通过签订补充协议、修改合同等任何方式，约定保证集合计划资产投资收益、承担投资损失，或排除委托人自行承担投资风险和损失。

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

本合同应由委托人本人签署，当委托人为机构时，应由法定代表人或委托代理人签署。

本合同一式捌份，管理人、托管人、委托人各执一份，其余按照有关监管部门的要求备案，每份均具有同等法律效力。

（本页无正文，为《华泰家园 16 号集合资产管理计划资产管理合同》签字页）

委托人：巨轮智能装备股份有限公司（盖章）

管理人：华泰证券（上海）资产管理有限公司（盖章）

托管人：兴业银行股份有限公司（盖章）

签订日期：2016 年 7 月