

香港交易及結算所有限公司、香港聯合交易所有限公司及香港中央結算有限公司對本公告的內容概不負責，對其準確性或完整性亦不發表任何聲明，並明確表示，概不對因本公告全部或任何部分內容而產生或因倚賴該等內容而引致的任何損失承擔任何責任。



(於中華人民共和國註冊成立之股份有限公司，中文公司名稱為「東方證券股份有限公司」，在香港以「東方證券」(中文)及「DFZQ」(英文)開展業務)
(股份代號：03958)

海外監管公告

本公告乃根據香港聯合交易所有限公司證券上市規則第13.10B條規則作出。

茲載列公司在上海證券交易所網站刊登之《匯添富－東方證券員工持股計劃1號單一資產管理計劃資產管理合同》，僅供參閱。

承董事會命
董事長
潘鑫軍

中國·上海
2020年6月17日

於本公告日期，董事會成員包括執行董事潘鑫軍先生及金文忠先生；非執行董事劉煒先生、吳俊豪先生、周東輝先生、李翔先生、夏晶寒女士、許建國先生及陳曉波先生；以及獨立非執行董事徐國祥先生、陶修明先生、尉安寧先生、許志明先生及靳慶魯先生。

合同编号：_____

汇添富-东方证券员工持股计划 1 号 单一资产管理计划资产管理合同

资产委托人：东方证券股份有限公司（代员工持股计划）

资产管理人：汇添富基金管理股份有限公司

资产托管人：中国工商银行股份有限公司上海市分行

目录

一、前言.....	3
二、释义.....	4
三、声明与承诺.....	6
四、当事人及权利义务.....	8
五、资产管理计划的基本情况.....	12
六、资产管理计划的成立与备案.....	13
七、委托财产.....	14
八、投资政策及变更.....	17
九、利益冲突及关联交易.....	19
十、投资经理的指定与变更.....	20
十一、划款指令的发送、确认和执行.....	20
十二、交易及交收清算安排.....	23
十三、越权交易处理.....	25
十四、委托财产的估值.....	27
十五、委托财产的会计核算.....	30
十六、资产托管人对资产管理人的投资监督.....	31
十七、资产管理业务的费用与税收.....	32
十八、资产管理计划的收益分配.....	34
十九、信息披露与报告.....	35
二十、风险揭示.....	37
二十一、资产管理合同的生效、变更与终止.....	43
二十二、清算程序.....	45
二十三、违约责任.....	49
二十四、争议的处理.....	50
二十五、资产管理合同的效力.....	51
二十六、其他事项.....	51

一、前言

（一）订立本合同的依据、目的和原则

1、订立本资产管理合同的依据是《中华人民共和国证券投资基金法》、《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》（以下简称“《指导意见》”）、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》（以下简称〔证监会令第151号〕，《管理办法》）、《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》（证监会公告〔2018〕31号，以下简称《运作规定》）、《单一资产管理计划资产管理合同内容与格式指引（试行）》（以下简称“《指引》”）和其他有关法律法规。

2、订立本资产管理合同（以下或简称“本合同”）的目的是为了明确资产委托人、资产管理人和资产托管人在单一资产管理业务过程中的权利、义务及职责，确保委托财产规范运作，保护当事人各方的合法权益。

3、订立本资产管理合同应当遵循平等自愿、诚实信用、公平原则，充分保护本合同各方当事人的合法权益，不得损害国家利益、社会公共利益和他人合法权益。

（二）本合同是规定本合同当事人之间权利义务关系的基本法律文件，其他与本委托财产相关的涉及本合同当事人之间权利义务关系的任何文件或表述，如与本合同有冲突，均以本合同为准。本合同当事人按照相关法律法规、监管规定、本合同约定享有权利、承担义务。

（三）本合同的当事人包括资产委托人、资产管理人和资产托管人。各相关方签订本合同，即成为本合同的当事人。本合同的当事人按照法律法规和本资产管理合同的规定享有权利，同时需承担相应的义务。

（四）资产管理人应当对资产管理计划的设立、变更、展期、终止、清算等行为向中国证券投资基金业协会（以下简称“基金业协会”）进行备案，并抄报中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）相关派出机构。基金业协会接受资产管理计划备案不能免除资产管理人按照规定真实、准确、完整、及时地披露资产管理计划信息的法律责任，也不代表基金业协会对资产管理计划的合规性、投资价值及投资风险做出保证和判断。投资者应当自行识别产品投资风险并承担投资行为可能出现的损失。资产管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用委托财产，**但不保证投资于委托财产盈利，也不保证最低收益，亦不保证委托财产本金不受亏损。**

（五）资产托管人按照合同约定，依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则安全保管交付至托管人且由托管人实际控制的委托财产，并履行本合同约定的其他义务，不保证委托财产盈利，也不保证最低收益，**亦不保证委托财产本金不受亏损。**

（六）资产委托人确认资产管理人和资产托管人未对委托财产的投资风险和投资收益状况做出任何承诺或担保。

(七) 本资产管理合同应当适用《基金法》、《指导意见》、《管理办法》、《管理规定》及相应法律法规之规定，若因法律法规的修改或更新导致《资产管理合同》的内容与届时有效的法律法规的规定不一致，应当以届时有效的法律法规的规定为准，及时做出相应的变更和调整，同时各方当事人就该等变更或调整进行确认，签订补充协议或重新签订资产管理合同。

二、释义

在本合同中，除上下文另有约定外，下列用语应当具有如下含义：

1、资产委托人：东方证券股份有限公司（代员工持股计划）

2、资产管理人：汇添富基金管理股份有限公司

3、资产托管人：中国工商银行股份有限公司上海市分行

4、本合同：资产委托人、资产管理人和资产托管人签署的《汇添富-东方证券员工持股计划1号单一资产管理计划资产管理合同》及其附件，以及对该合同及附件做出的任何有效变更或补充

5、计划说明书：指《汇添富-东方证券员工持股计划1号单一资产管理计划计划说明书》，内容包括资产管理计划名称和类型、资产管理人与资产托管人概况、资产管理计划的投资范围、投资策略和投资限制情况、投资风险揭示、中国证监会规定的其他事项等

6、员工持股计划：经东方证券股份有限公司第四届第二十次董事会审议通过，并提交股东大会审议通过的东方证券股份有限公司员工持股计划。

7、委托财产/资产管理计划财产：指资产委托人拥有合法处分权、委托资产管理人管理并由资产托管人托管的作为本合同标的的财产

8、交易日：上海证券交易所、深圳证券交易所和香港交易所的正常交易日

9、工作日：资产管理人和资产托管人均办理相关业务的营业日

10、锁定期：根据员工持股计划相关法律文件的规定，员工持股计划所获标的股票的锁定期为12个月，自东方证券股份有限公司公告最后一笔标的股票完成登记过户之日起算。

11、建仓期：根据员工持股计划相关法律文件的规定，员工持股计划管理机构应当在东方证券股东大会审议通过员工持股计划后6个月内，根据员工持股计划的安排，完成标的股票的购买。因市场等因素资产管理人未能在东方证券股东大会审议通过本员工持股计划后6个月内完成股票的购买，资产委托人在东方证券董事会授权后允许资产管理人适当延长购买股票的期限。上述期限及其适当延长期即“建仓期”。

12、交易限制期：根据员工持股计划相关法律文件的规定，员工持股计划在下列期间不

得买卖公司（指东方证券股份有限公司，下同）股票：（1）公司审议年度报告的董事会召开前 60 日至年度报告披露当日（含首尾两天）；（2）公司审议季度报告或半年度报告的董事会召开前 30 日至季报或半年报披露当日（含首尾两天）；（3）公司业绩预告、业绩快报公告前 10 日内（含首尾两天）；以上（1）-（3）禁止买卖本公司股票的期间，包括公司延期公布业绩的期间；（4）自可能对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；（5）公司所适用的相关法律、法规、规章规定的以及中国证监会、香港证监会及公司证券上市地的交易所规定的其他期间。

13、证券账户：根据中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）有关规定和中国证券登记结算有限责任公司等相关机构的有关业务规则，本资产管理计划在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司、深圳分公司开设的专用证券账户、在中央国债登记结算有限责任公司、银行间市场清算所股份有限公司开立的有关账户

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

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

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

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

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

19、初始委托财产：按照本合同约定，资产委托人通过资产委托人指定账户向资金账户划入的首笔委托财产。

20、不可抗力：不能预见、不能避免并不能克服的客观情况，包括但不限于地震、台风、水灾、火灾、战争、暴乱、流行病、政府行为、罢工、停工、停电、通讯失败等，非因资产管理人、资产托管人自身原因导致的技术系统异常事故、政策法规的修改或监管要求调整等情形。因交易所、银行、登记结算机构的交易、结算系统出现故障导致的交易、结算无法进行的情形，因电信服务商原因导致资金划付的网络中断、无法使用的情形，亦构成不可抗力事件。

21、资产管理计划、本资产管理计划、本计划：指本合同项下的“汇添富-东方证券员工持股计划 1 号单一资产管理计划”。

三、声明与承诺

(一) 资产委托人保证委托财产的来源及用途合法，并已充分理解本合同全文，了解相关权利及义务，了解有关法律法规及所投资品种的风险收益特征，愿意承担相应的投资风险，本委托事项符合其业务决策程序的要求；承诺其向资产管理人提供的有关投资目的、投资偏好、投资限制和风险承受能力等基本情况真实、完整、准确、合法，不存在任何重大遗漏或误导，前述信息资料如发生任何实质性变更，应当及时书面告知资产管理人。资产委托人承认，资产管理人、资产托管人未对委托财产的收益状况作出任何承诺或担保，本合同约定的业绩比较基准仅是投资目标而不是资产管理人的保证。资产委托人确认在签订本合同前，资产管理人已充分地向资产委托人说明了有关法律法规和相关投资工具的运作市场及方式，同时揭示了已经合理知晓的相关风险，并已通过了解资产委托人的风险偏好、风险认知能力和承受能力，对资产委托人的财务状况进行了充分评估。鉴于本计划系为员工持股计划而设立，资产委托人承诺其持股员工与资产委托人、员工持股计划之间的任何异议、纠纷或争议等，均由资产委托人以其自身名义负责处理，与资产管理人无关，资产管理人可提供与本计划投资管理相关的必要协助，但不因此承担任何法律或经济责任。

(二) 资产管理人承诺

1、已在签订本合同前充分地向资产委托人说明了有关法律法规和相关投资工具的运作市场及方式，同时揭示了相关风险。

2、已经了解资产委托人的风险偏好、风险认知能力和承受能力，对资产委托人的财务状况进行了充分评估。

3、资产管理人承诺依照《基金法》恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用委托财产，**不保证委托财产一定盈利，也不保证最低收益或本金不受损失，以及限定投资损失金额或者比例。**

(三) 资产托管人承诺

1、依照《基金法》恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则安全保管交付至资产托管人且由资产托管人实际控制的委托财产，履行信义义务以及本合同约定的其他义务。

2、根据法律法规、中国证监会及基金业协会的规定和资产管理合同的约定，对资产管理人的投资或清算指令等进行监督。

3、**资产托管人对资产管理计划财产的保管，并非对资产管理计划财产本金或收益的保证或承诺，资产托管人不承担资产管理计划财产的投资风险。**

（四）资产委托人声明

1、符合《运作规定》合格投资者的要求，且不是资产管理人的董事、监事、从业人员及其配偶。

2、向资产管理人提供的有关投资目的、投资偏好、投资限制、财产收入情况和风险承受能力等基本情况真实、完整、准确、合法，不存在任何虚假陈述、重大遗漏或误导。前述信息资料如发生任何实质性变更，及时书面告知资产管理人。

3、财产的来源及用途符合国家有关规定，且投资事项符合法律法规的规定及业务决策程序的要求。

4、已充分理解本合同条款，了解相关权利义务，了解有关法律法规及所投资资产管理计划的风险收益特征，知晓管理人、托管人及相关机构不应对资产管理计划的收益情况或本金不受损失做出任何承诺，了解“卖者尽责，买者自负”的原则，投资于本计划将自行承担投资风险。

资产委托人确认在签署本合同前已签署相应的风险揭示书，委托人理解风险揭示书中所述内容，愿意承担本计划可能存在的风险与后果。资产委托人理解委托财产的投资、运作、托管面临本合同第十九部分中列举的各类风险，资产管理人及资产托管人就委托财产面临的前述固有风险免于承担责任。

资产委托人承诺及保证：符合法律法规、监管机构及自律组织对于本计划投资者的各项要求，包括但不限于：

1、资产委托人具备相应风险识别能力和风险承担能力，为符合要求的合格投资者：1) 具有2年以上投资经历，且满足下列三项条件之一的自然人：家庭金融资产不低于300万元，家庭金融资产不低于500万元，或者近3年本人年均收入不低于40万元；2) 最近1年末净资产不低于1000万元的法人单位；3) 依法设立并接受国务院金融监督管理机构监管的机构，包括证券公司及其子公司、基金管理公司及其子公司、期货公司及其子公司、在基金业协会登记的私募基金管理人、商业银行、金融资产投资公司、信托公司、保险公司、保险资产管理机构、财务公司及中国证监会认定的其他机构；4) 接受国务院金融监督管理机构监管的机构发行的资产管理产品；5) 基本养老金、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，合格境外机构投资者（QFII）、人民币合格境外机构投资者（RQFII）；6) 中国证监会视为合格投资者的其他情形。

2、资产委托人的资金来源合法合规，不存在使用贷款、发行债券等等集的非自有资金投资本资产管理计划的情形。

四、当事人及权利义务

(一) 资产委托人

名称：东方证券股份有限公司（代员工持股计划）

住所：上海市中山南路 119 号东方证券大厦

法定代表人：潘鑫军

(二) 资产管理人

名称：汇添富基金管理股份有限公司

住所：上海市黄浦区北京东路 666 号 H 区（东座）6 楼 H686 室

通讯地址：上海市浦东新区富城路 99 号震旦国际大楼 20 层

法定代表人：李文

联系人：邢晓君

联系电话：021-28932888

(三) 资产托管人

名称：中国工商银行股份有限公司上海市分行

住所：上海市浦东大道 9 号

联系人：胡丽君

联系电话：021-68499015

(四) 资产委托人的权利与义务

1. 资产委托人的权利

- (1) 按照本合同的约定取得资产管理计划财产收益；
- (2) 取得清算后的剩余资产管理计划财产；
- (3) 监督资产管理人及资产托管人履行投资管理和托管义务的情况；
- (4) 按照本合同的约定追加或提取委托财产；
- (5) 按照法律法规及本合同约定的时间和方式获得资产管理计划的信息披露资料；
- (6) 国家有关法律法规、监管机构规定及本合同约定的其他权利。

2. 资产委托人的义务

- (1) 认真阅读并遵守资产管理合同，保证投资资金的来源及用途合法；
- (2) 接受合格投资者认定程序，如实填写风险识别能力和风险承担能力问卷，如实提供资金来源、金融资产、收入及负债情况，并对其真实性、准确性和完整性负责，签署合格投资者相关文件；
- (3) 除公募资产管理产品外，以合伙企业、契约等非法人形式直接或者间接投资于资产管理计划的，应向管理人充分披露实际投资者和最终资金来源；
- (4) 认真阅读并签署风险揭示书；
- (5) 按照本合同的约定，将委托财产交付资产管理人和资产托管人分别进行投资管理和资产托管，以委托财产为限依法承担资产管理计划亏损或者终止的有限责任；
- (6) 及时、全面、准确地向资产管理人告知其投资目的、投资偏好、投资限制和风险承受能力等基本情况，向资产管理人提供身份证明文件及其他必要的资料，配合资产管理人为完成投资者适当性管理、非居民金融账户涉税信息的尽职调查、反洗钱目的进行的尽职调查及对资产委托人投资风险承受能力进行测评；
- (7) 不得违反本合同的约定干涉资产管理人的投资行为；
- (8) 按照本合同的约定缴纳资产管理计划的管理费、托管费，并承担因委托财产运作产生的税费及其他费用；
- (9) 保守商业秘密，不得泄露委托财产投资计划、投资意向等；不得利用资产管理计划相关信息进行内幕交易或者其他不当、违法的证券期货业务活动；
- (10) 在签署本合同前，向资产管理人、资产托管人书面告知资产委托人的关联方发行的证券名单或其他禁止交易的证券名单，在上述证券名单发生变更时，及时书面通知资产管理人和资产托管人；
- (11) 不得从事任何有损资产管理计划、管理人及管理人管理的其他资产、托管人及托管人托管的其他资产合法权益的活动；
- (12) 国家有关法律法规、监管机构规定及本合同约定的其他义务。

(五) 资产管理人的权利与义务

1. 资产管理人的权利

- (1) 自本合同生效之日起，按照本合同的约定，独立管理和运用资产管理计划财产；
- (2) 按照本合同的约定，及时、足额获得资产管理费用；
- (3) 根据本合同及其他有关规定，监督资产托管人，对于资产托管人违反了本合同或

有关法律法规规定、对资产管理计划财产及其他当事人的利益造成重大损失的，应及时采取措施制止，同时通知资产委托人并报告中国证监会相关派出机构及基金业协会；

(4) 按照有关规定和资产管理合同约定行使因资产管理计划财产投资所产生的权利；

(5) 自行提供或者委托经中国证监会、基金业协会认定的服务机构为资产管理计划提供估值与核算、信息技术系统等服务，并对其行为进行必要的监督和检查；

(6) 以管理人的名义，代表资产管理计划行使投资过程中产生的权属登记等权利；

(7) 国家有关法律法规、监管机构规定及本合同约定的其他权利。

2. 资产管理人的义务

(1) 依法办理资产管理计划的备案事宜；

(2) 按照基金业协会要求报送资产管理计划产品运行信息；

(3) 自本合同生效之日起，按照诚实信用、勤勉尽责的原则履行受托人义务，管理和运用资产管理计划财产；

(4) 对投资者的风险识别能力和风险承受能力进行评估；

(5) 制作风险揭示书，向投资者充分揭示相关风险；

(6) 配备足够的具有专业能力的人员进行投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作资产管理计划财产；

(7) 建立健全内部管理制度，保证本资产管理计划财产与其管理的其他资产管理计划财产、资产管理人的固有财产相互独立，对所管理的不同财产分别管理、分别记账，分别投资；

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

(9) 按照本合同接受资产委托人和资产托管人的监督；

(10) 按照本合同的规定，负责资产管理计划会计核算并编制财务会计报告；

(11) 按照法律法规与本合同的规定，编制向投资者披露的资产管理计划季度及年度等定期报告，并向证券投资基金业协会备案，抄报证监会相关派出机构；

(12) 保守商业秘密，不得泄露资产管理计划的投资计划、投资意向等，法律法规、监管机构、司法机关另有要求、审计要求及本合同另有规定的除外；

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

(14) 公平对待所管理的不同财产，不得从事任何有损资产管理计划财产及其他当事人

利益的活动；

(15)除法律法规规定或本合同另有约定的情形或符合规定条件外,不得为资产管理人、资产托管人及其关联方提供融资；

(16)以管理人的名义,代表投资者利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；

(17)按照本合同的约定确定收益分配方案,及时向投资者分配收益；

(18)办理与受托财产管理业务活动有关的信息披露事项；

(19)按照法律、行政法规和中国证监会的规定,保存资产管理计划的会计账册,妥善保存有关的合同、协议、交易记录等文件、资料和数据,保存期限自资产管理计划终止之日起不得少于 20 年；

(20)面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时,及时报告中国证监会相关派出机构、证券投资基金业协会并通知托管人和投资者；

(21)国家有关法律法规、监管机构规定及本合同约定的其他义务。

(六)资产托管人的权利与义务

1. 资产托管人的权利

(1)按照本合同的约定,及时、足额获得资产管理计划托管费用；

(2)按照本合同的约定,依法保管资产管理计划财产；

(3)国家有关法律法规、监管机构规定及本合同约定的其他权利。

2. 资产托管人的义务

(1)安全保管资产管理计划财产；

(2)设立专门的资产托管部门,具有符合要求的营业场所,配备足够的、合格的熟悉资产托管业务的专职人员,负责委托财产托管事宜；

(3)对所托管的不同财产分别设置账户,确保资产管理计划财产的完整与独立；

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

(5)按照规定开设和注销资产管理计划的托管账户及证券账户；

(6)根据相关法律法规和本合同约定,复核资产管理人编制的资产管理计划财产的定期报告,并出具书面意见；

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

(8) 编制托管年度报告，并向证券投资基金业协会备案，抄报中国证监会相关派出机构；

(9) 按照法律法规要求和本合同的约定，根据资产管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；

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

(11) 公平对待所托管的不同财产，不得从事任何有损资产管理计划财产及其他当事人利益的活动；

(12) 办理与资产管理计划托管业务有关的信息披露事项；

(13) 根据法律、行政法规和中国证监会的规定保存资产管理计划的会计账册，妥善保存有关的合同、协议、交易记录等文件资料，保存期限自资产管理计划终止之日起不得少于 20 年；

(14) 国家有关法律法规、监管机构规定及本合同约定的其他义务。

五、资产管理计划的基本情况

(一) 资产管理计划的名称

汇添富-东方证券员工持股计划 1 号单一资产管理计划

(二) 资产管理计划的类别

权益类单一资产管理计划

(三) 资产管理计划的运作方式

本计划建仓期内不开放提取，且建仓完成后封闭运作一年，建仓期完成之日以管理人书面通知委托人的日期为准。

(四) 资产管理计划的投资目标、主要投资方向、投资比例、产品风险等级；

1、投资目标

在严格控制风险的前提下，资产管理人根据资产委托的需求，在投资期限内持有标的股票，分享上市公司成长过程中带来的投资回报，努力为委托人谋求委托财产的稳定增值。

2、主要投资方向

主要投资于东方证券股份有限公司发行的 H 股股票：东方证券（03958.hk），闲置资金可投资于银行存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券、货币市场基金、逆回购等流动性管理工具。

3、投资比例

本计划建仓期完成后投资于权益类资产的比例不低于总资产的 80%。

4、产品风险等级

本计划主要投资于单一标的，属于较高风险收益特征的产品，本计划的风险等级为 R4 级，适合 C4-C5 级的投资者。

（五）资产管理计划的存续期限

自本计划成立日起 5 年。如发生本合同约定的计划提前终止或展期情形时，本计划可提前终止或展期。

（六）资产管理计划的最低资产要求

资产管理计划首期缴付资金不得少于 1000 万元。

六、资产管理计划的成立与备案

（一）资产管理计划成立的条件

资产管理计划的初始募集规模不得低于 1000 万元人民币，法律法规另有规定的除外。

（二）资产管理计划自员工持股计划经东方证券股份有限公司股东大会批准，且员工持股计划向本计划账户划付委托资金之后，资产管理人书面通知资产委托人及资产托管人资产管理计划成立。资产管理人应在资产管理计划成立后 5 个工作日内报证券投资基金业协会备案，抄报中国证监会相关派出机构。资产管理计划成立前，任何机构和个人不得动用投资者参与资金。

资产管理计划在成立后备案完成前，不得开展投资活动，以现金管理为目的，投资于银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券、货币市场基金等中国证监会认可的投资品种的除外。资产管理人应于资产管理计划获得基金业协会备案确认当日书面通知资产托管人。

七、委托财产

（一）委托财产的保管与处分

1、资产管理计划财产的债务由资产管理计划财产本身承担责任，资产委托人以其出资为限对资产管理计划财产的债务承担责任。

2、委托财产独立于资产管理人、资产托管人的固有财产，并独立于管理人管理的和托管人托管的其他财产。资产管理人、资产托管人不得将委托财产归入其固有财产。**资产托管人仅对实际交付并控制下的计划财产承担保管职责，对于证券登记机构、期货经纪公司或结算机构等非资产托管人保管的财产不承担责任。**

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

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

5、委托财产产生的债权不得与不属于委托财产本身的债务相互抵销。非因委托财产本身承担的债务，资产管理人、资产托管人不得主张其债权人对委托财产强制执行。上述债权人向资产管理人或资产托管人对委托财产主张权利时，资产管理人或资产托管人应明确向上述债权人告知委托财产的独立性。

（二）委托财产相关账户的开立和管理

1、托管账户、证券账户和期货账户

资产托管人按照规定开立本计划的托管账户、证券账户。资产委托人和资产管理人应当在开户过程中给予必要的配合，并提供所需资料。资产管理人负责开立委托财产投资所需其他账户。

托管账户、证券账户和期货账户的持有人名称应当符合法律法规及开户机构的有关规定。资产管理人和资产托管人有权为本合同目的使用该托管账户、证券账户和期货账户等投资所需账户。

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

当本合同项下托管账户被有权机关查询、冻结或扣划款项时，资产托管人按照有权机关要求依法予以执行，因此影响托管账户资金划付的，资产托管人不负任何责任。相关手续办理完毕后，资产托管人可以根据业务需要通知资产管理人，但法律法规或监管要求另有规定的除外。

2、资产委托人指定账户

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

（三）委托财产的移交

委托财产相关账户开立完毕后，资产委托人应通过其指定账户及时将初始委托财产足额划拨至资产托管人为本委托财产开立的资金账户并于当日通知资产托管人，资产托管人应于委托财产资金账户收到初始委托财产的当日向资产委托人及资产管理人发送《委托财产到账通知书》。

本合同委托财产应以现金形式交付，初始委托财产不得低于 1000 万元人民币

（四）委托财产的追加

在本合同有效期内，资产委托人有权以书面通知或指令的形式追加委托财产。追加委托财产比照初始委托财产办理移交手续，资产管理人、资产托管人应按照本合同的约定分别管理和托管追加部分的委托财产。

（五）委托财产的提取

本计划锁定期内不开放委托财产提取。锁定期结束后，委托人可以按照本合同约定的方式提取委托财产。锁定期结束后的首次提取时间以管理人的公告为准。

1、本计划将以份额（按初始出资人民币 1 元，对应 1 份计划份额）提取的形式，提取委托资产。资产委托人提前【3】个工作日与资产管理人沟通拟在 T 日提取的预估份额数量，且原则上 T 日提取委托资产不超过上一日委托财产总份额的 5%。资产委托人应在不晚于 T 日向资产管理人出具书面的《提取委托财产通知书》（附件 9），T 日提取的份额以 T 日收盘后的净值予以确认，并于 T+3 日前向委托人支付。

2、在本合同存续期内，如遇资产委托人需要提取委托财产，资产委托人需提前 3 个工作日通知资产管理人并抄送资产托管人。资产委托人要求资产管理人发送财产划拨指令，通知资产托管人将相应财产从相关账户向投资者账户划付，资产托管人应于划拨财产当日以书面形式或其他各方认可的形式分别通知资产管理人和资产委托人。资产委托人不按照约定提前通知的，由此可能造成的损失（包括但不限于变现损失）和延误应由资产委托人自行承担。

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

3、原则上，本计划的单次提取以上一日委托财产份额的 5%为限。在本合同存续期内，若资产委托人需要提取委托财产，在委托人申请一次性提取委托资产超过上一日委托财产份额的 5%时，为巨额提取。出现巨额提取时，即委托人申请一次性提取委托资产超过上一日委托财产份额的 5%时，管理人可根据当时的资产组合状况决定一次性全额支付或部分支付。

（1）全额支付：当管理人认为有能力支付委托人全部提取申请时，按正常划款程序执行；

（2）部分支付：当管理人认为支付委托人的提取申请有困难或认为支付委托人的提取申请可能会对委托财产净值造成较大波动时，管理人在当日执行提取比例不低于上一日委托财产份额 5%的情况下，对超出部分的提取份额不予以确认，并及时通知委托人可确认提取的份额数量和不予以确认提取的份额数量。。

（3）当出现一次巨额提取后，在委托人的下一次提取前，若管理人认为有必要，可与委托人协商一致，安排下一次提取方案，届时以管理人书面通知或公告为准。

4、因不可抗力原因导致本委托财产无法正常运作时，暂停委托财产提取。

资产委托人不按照约定提前通知的，由此可能造成的损失（包括但不限于变现损失）和延误应由资产委托人自行承担。

八、投资政策及变更

(一) 资产委托人的投资状况

1、资产委托人的投资偏好

资产委托人对委托财产的投资范围及投资标的的风险收益特征有充分了解。

2、资产委托人的风险承受能力

资产委托人是具备一定证券投资认知、具有一定风险承受能力的特定客户。

3、资产委托人的风险认知能力

资产委托人拟合同约定的期限内投资于证券市场，期望获得合理的回报。资产委托人理解并能承受委托财产出现的波动。

(二) 产品风险等级

本计划的风险等级为 R4，属于中等风险投资品种(最低为 R1, 最高为 R5)，适合风险识别、评估、承受能力评级为 C4 -C5 的合格投资者。资产委托人确认具备与本计划相匹配的风险识别能力和风险承受能力。

(三) 委托财产的投资政策

1、投资目标

在严格控制风险的前提下，资产管理人根据资产委托的需求，在投资期限内持有标的股票，分享上市公司成长过程中带来的投资回报，努力为委托人谋求委托财产的稳定增值。

2、投资范围

主要投资于东方证券股份有限公司发行的 H 股股票东方证券 (03958. hk)，闲置资金可投资于银行存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券、货币市场基金、逆回购等流动性管理工具。

本计划可以投资于资产管理人管理的公募证券投资基金，本计划建仓期完成后投资于权益类资产的比例不低于总资产的 80%。为规避股市、债市等市场趋势性风险，经资产委托人同意后，投资于股票等权益类资产的比例可以低于计划总资产 80%，但不得持续 6 个月低于计划总资产 80%。

资产委托人在此确认并同意，在本计划投资范围内，资产管理人可以运用委托财产投资于管理人、托管人及前述机构的控股股东、实际控制人或者其他关联方发行的证券、证券投资基金或者承销期内承销的证券。资产委托人签署本合同即视为已经充分理解并同意资产管理人从事该等关联交易，资产管理人无需就该等具体关联交易分别取得资产委托人

的个别授权,但该种投资行为应按照市场通行的方式和条件参与,公平对待委托财产,防止利益冲突,不得损害投资者利益。

3、投资策略

本资产管理计划主要通过集中持有上市公司的股票,分享上市公司成长过程中的分红收益及股票增值收益。

本计划投资于现金管理工具主要用于提高资金效率。

4、投资限制

(1) 本计划自建仓结束后投资于东方证券 H 股的比例不低于本计划总资产的 80%;

(2) 本计划买入和卖出东方证券 H 股的操作应遵守锁定期和交易限制期的约束,具体的锁定期的起始时间以东方证券公告为准,且锁定期为一年,交易限制期以东方证券书面通知为准;

其中,交易限制期是指根据员工持股计划相关法律文件的规定,员工持股计划在下列期间不得买卖公司(指东方证券股份有限公司,下同)股票:(1)公司审议年度报告的董事会召开前 60 日至年度报告披露当日(含首尾两天);(2)公司审议季度报告或半年度报告的董事会召开前 30 日至季报或半年报披露当日(含首尾两天);(3)公司业绩预告、业绩快报公告前 10 日内(含首尾两天);以上(1)-(3)禁止买卖本公司股票的期间,包括公司延期公布业绩的期间;(4)自可能对公司股票交易价格产生重大影响的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;(5)公司所适用的相关法律、法规、规章规定的以及中国证监会、香港证监会及公司证券上市地的交易所规定的其他期间。

(3) 锁定期结束后只可卖出股票,不可再买入;

(4) 本计划锁定期结束后,投资于流动性管理工具的比例不低于本计划总资产的 10%,委托人大额提取导致低于 10%的情形,资产管理人应在 15 个交易日(交易限制期除外)内调整完毕,如遇到标的公司的交易限制期,则待解除交易限制之后再作调整;如因市场环境或标的公司股票成交额等因素导致资产管理人难以在 15 个交易日内调整完毕,资产管理人可与资产委托人商议延长调整期。

(5) 本计划投资于东方证券 H 股的比例不超过总股本(A+H 合并计算)的 0.4%;

(6) 法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的,从其规定。

因证券市场波动、上市公司合并、资产管理计划规模变动等资产管理人之外的因素致使资产管理计划投资不符合资产管理合同约定的投资比例的,资产管理人应当在流动性受限资

产可出售、可转让或者恢复交易的 15 个交易日内调整完毕。法律法规另有规定的从其规定。

5、本合同委托财产的投资禁止行为包括：

- (1) 承销证券；
- (2) 违反规定向他人贷款或提供担保；
- (3) 从事承担无限责任的投资；
- (4) 从事内幕交易、操纵证券价格及其他不正当的证券交易活动；
- (5) 法律法规、中国证监会以及本合同规定禁止从事的其他行为。

6、建仓期

本计划的建仓期为自本计划成立之日起六个月。若因市场情况、交易限制期等因素资产管理人未能在 6 个月内完成建仓的，资产委托人在东方证券董事会授权后允许资产管理人适当延长建仓期。建仓期完成之日以管理人书面通知委托人的日期为准。

本计划建仓期的投资活动，应当符合本资产管理合同约定的投向和资产管理计划的风险收益特征。以现金管理为目的，投资于银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券、货币市场基金等中国证监会认可的投资品种的除外。

建仓期结束后，资产管理计划的资产组合应当符合法律、行政法规、中国证监会规定和合同约定的投向和比例。

(四) **委托人确认**，本章约定的事项不代表资产托管人的监督职责，资产托管人的监督职责仅以本合同第十六章“资产托管人对资产管理人的投资监督”约定为准。

九、利益冲突及关联交易

(一) 关联交易及利益冲突情形

在本计划投资范围内，资产管理人可以运用委托财产投资于管理人、托管人及前述机构的控股股东、实际控制人或者其他关联方发行的证券、证券投资基金或者承销期内承销的证券。

(二) 关联交易及利益冲突的应对及处理

资产委托人签署本合同即视为已经充分理解并同意资产管理人从事前文已经明确列明的关联交易情形，资产管理人无需就前述具体关联交易再行分别取得资产委托人的授权，但该等关联交易投资应按照市场通行的方式和条件参与，公平对待委托财产，防止利益冲突，不得损害投资者利益。对于资产管理计划在投资运作过程中从事除前述列明情形以外的其他

关联交易的，资产管理人事后应当及时、全面、客观的向资产委托人和托管人进行披露；若该等关联交易构成重大关联交易的（除本计划投资东方证券股份有限公司发行的 H 股股票东方证券（03958.hk）之外），则资产管理人应当事先取得资产委托人的同意，并应当提供充分证据证明未损害资产委托人利益。

资产管理计划在投资运作过程中存在利益冲突情形的，资产管理人应当坚持资产委托人利益优先原则，从充分维护资产委托人利益角度积极处理该等利益冲突情形，防范利益输送等违法违规行为。在发生该等利益冲突时，资产管理人应当视具体利益冲突情形选择在向资产委托人提供的定期报告或临时报告中进行披露，具体披露内容包括利益冲突情形、处置方式、对资产委托人利益的影响等。

十、投资经理的指定与变更

委托财产投资经理由资产管理人负责指定。

资产管理人可以根据需要变更投资经理，投资经理变更后，资产管理人应及时通知资产委托人及资产托管人。

本委托财产投资经理为姚宗辉。

投资经理简历：姚宗辉先生拥有十六年证券基金从业经验，曾任职于上海航空、申银万国证券研究所、马可孛罗至真资产管理公司、申万巴黎基金，先后担任股票研究部分析师、首席分析师、高级分析师等职。2010 年 5 月加入汇添富基金，担任汇添富基金管理股份有限公司专户投资部投资经理至今。姚宗辉先生长期负责金融、消费品行业研究，对相关行业和上市公司理解深刻。姚宗辉先生拥有中南大学管理学硕士学位。

投资经理均已取得基金从业资格，最近三年无被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚的情况。

资产管理人可以根据需要变更投资经理，投资经理变更后，资产管理人应在 5 个工作日通知资产委托人及资产托管人。**资产管理人在其网站就投资经理变更事宜进行相应公告，即视为已经履行了相应告知程序。**

十一、划款指令的发送、确认和执行

（一）交易清算授权

资产管理人应向资产托管人提供预留印鉴和有权人（“授权人”）签字样本，事先书面通知（以下称“授权通知”）资产托管人有权发送划款指令的人员名单（“被授权人”），注明相应的交易权限并预留被授权人的名单、权限、电话、传真、预留印鉴和签字样本，规定资产管理人向资产托管人发送指令时资产托管人确认有权发送人员身份的方法。授权通知由授权人签字并应加盖资产管理人公章。授权通知须载明授权生效日期。资产管理人应电话确认资产托管人收到该授权通知。授权通知自通知载明的生效日期开始生效。资产托管人收到通知的日期晚于通知载明生效日期的，则通知自资产托管人确认收到该通知时生效。资产管理人和资产托管人对授权通知负有保密义务，其内容不得向相关人员以外的任何人泄露。

（二）划款指令的内容

划款指令是资产管理人在运用委托财产时，向资产托管人发出的资金划拨及其他款项支付的指令。资产管理人发给资产托管人的指令应写明款项事由、付款日期、付款金额、付款及收款账户信息等，书面指令还应加盖资产管理人在授权通知中授权的印章及被授权人签字或签章。本委托财产进行的证券交易所内的证券投资不需要资产管理人发送划款指令，资产托管人以中登公司发送的交收指令进行处理。

（三）指令的发送、确认和执行程序

指令由“授权通知”确定的被授权人代表资产管理人用资产托管人网上资产托管业务信息服务平台（简称托管网银）、电子直连划款指令或资产托管人和资产管理人认可的其他方式向资产托管人发送，若资产管理人已与资产托管人建立深证通指令直连或使用资产托管人托管网银，资产管理人应优先以深证通直连划款指令或者托管网银形式发送的指令（统称电子指令）形式向资产托管人发送指令，并应事先书面向资产托管人指定各业务类型划款指令的发送主渠道，以邮件发送指令扫描件或传真作为应急方式备用。若资产管理人未与资产托管人建立深证通指令直连，且未申请托管网银的，指令由资产管理人用邮件发送指令扫描件/传真方式或资产托管人和资产管理人认可的其他方式向资产托管人发送。资产管理人有义务在发送指令后及时与资产托管人以录音电话的方式进行确认。指令以获得收件人（资产托管人）确认该指令已成功接收之时视为送达。因资产管理人未能及时与资产托管人进行指令确认，致使资金未能及时到账所造成的损失，资产托管人不承担责任。资产托管人依照本合同的约定对指令进行审查后，方可执行指令。

对于资产管理人依照“授权通知”发出的指令，资产管理人不得否认其效力。资产管理人应依照相关法律法规以及本合同的规定，在其合法的经营权限和交易权限内发送划款指令，

发送人应按照其授权权限发送划款指令。资产管理人在发送指令时，应为资产托管人留出执行指令所必需的时间。须于发送指令日完成划款的指令，资产管理人应给资产托管人预留出距划款截至时点至少 2 个工作小时的指令执行时间。由资产管理人原因造成的指令传输不及时、未能留出足够划款所需时间，致使资金未能及时到账所造成的损失由资产管理人承担相应的责任。资产托管人收到资产管理人发送的指令后，应对划款指令进行形式审查，验证指令的要素是否齐全、审核书面指令上的签章是否和授权通知中预留的签章样本相符，复核无误后依据资产管理合同约定在规定期限内及时执行，不得延误。若存在异议或不符，资产托管人立即与资产管理人指定人员进行电话沟通和沟通，并要求资产管理人重新发送经修改的指令。资产托管人可以要求资产管理人以电子邮件、传真或双方认可的其他方式提供相关交易凭证、合同或其他有效会计资料，以确保资产托管人有足够的资料来判断指令的有效性。

资产管理人向资产托管人下达划款指令时，应确保付款账户有足够的资金余额，对资产管理人在付款账户没有充足资金的情况下向资产托管人发出的指令，资产托管人有权拒绝执行，并立即通知资产管理人，资产托管人不承担因不执行该指令而造成的损失。

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

资产管理人应将银行间同业拆借中心的成交通知单加盖印章后以传真或电子邮件方式发送给资产托管人。在本资产管理计划财产申购/认购开放式基金时，资产管理人应在向资产托管人提交划款指令的同时将经有效签章的基金申购/认购申请书以传真或电子邮件方式送达资产托管人。

指令及相关资料若资产管理人以电子邮件发送扫描件或传真形式向资产托管人发出，则正本由资产管理人保管，资产托管人保管传真件、扫描件。当两者不一致时，以资产托管人收到的传真件、扫描件为准。

（四）资产托管人依法暂缓、拒绝执行指令的情形和处理程序

资产托管人在本合同第十六章约定的投资监督事项范围内发现资产管理人发送的指令违反《基金法》、本合同或其他有关法律法规的规定时，不予执行，并应及时以书面形式通知资产管理人纠正，资产管理人收到通知后应及时核对，并以书面形式对资产托管人发出回函确认。

（五）资产管理人发送错误指令的情形和处理程序

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

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

知资产管理人及时改正。

（六）更换被授权人的程序

资产管理人撤换被授权人或改变被授权人的权限，必须提早至少一个交易日，以原件形式向资产托管人发出由授权人签字和资产管理人加盖公章的被授权人变更通知，并提供新被授权人签字样本，同时电话确认资产托管人收到新的授权书。被授权人变更通知须载明新授权生效日期。被授权人变更通知，自通知载明的生效日期开始生效。资产托管人收到通知的日期晚于通知载明生效日期的，则通知自资产托管人确认收到该通知之日的下一工作日起生效。更换被授权人通知生效后，对于已被撤换的人员无权发送的指令，或新被授权人超权限发送的指令，资产管理人不承担责任。

（七）划款指令的保管

指令及相关资料若资产管理人以电子邮件发送扫描件或传真形式向资产托管人发出，则正本由资产管理人保管，资产托管人保管传真件、扫描件。当两者不一致时，以资产托管人收到的传真件、扫描件为准。

（八）其他相关责任

资产托管人正确执行资产管理人符合本合同规定、合法合规的划款指令，资产管理计划财产发生损失的，由资产管理人承担责任。在正常业务受理渠道和指令规定的时间内，因资产托管人过错未能及时或正确执行符合本合同规定、合法合规的划款指令而导致资产管理计划财产受损的，资产托管人应承担相应的责任，但付款账户余额不足、不可抗力或其他非因资产托管人原因的情况除外。

如果资产管理人的划款指令存在事实上未经授权、欺诈、伪造或未能按时提供划款指令人员的预留印鉴和签字样本等非资产托管人原因造成的情形，只要资产托管人根据本合同相关规定验证有关印鉴与签名无误，全部责任由资产管理人承担，但资产托管人未尽审核义务执行划款指令而造成损失的情况除外。

十二、交易及交收清算安排

（一）选择代理证券、期货交易的证券、期货经营机构的程序

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

资产管理人应及时将委托财产专用交易单元号、佣金费率等基本信息以及变更情况及时以书面形式通知资产托管人。

资产管理人应在本计划成立前至少提前 2 个工作日，主动向资产托管人反馈《托管系统参数信息维护表》（附件 1）并提供证券交易单元租用协议，并确保提供参数的准确性与完整性，因参数提供不及时、不完整、不准确，造成的直接经济损失由资产管理人承担相应的责任。

（二）投资证券后的清算交收安排

1、资产托管人在清算和交收中的责任

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

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

本资产管理计划投资于期货发生的资金交割清算由资产管理人选定的期货经纪公司负责办理，资产托管人对由于期货交易所期货保证金制度和清算交割的需要而存放在期货经纪公司的资金不行使保管职责，资产管理人应在期货经纪协议或其他协议中约定由选定的期货经纪公司承担资金安全保管责任。

2、证券交易所证券资金结算

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

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

3、无法按时支付证券清算款的责任认定及处理程序

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

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

4、委托财产参与 T+0 交易所非担保交收债券交易的责任认定及处理程序

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

(三) 委托财产投资存款类资产的约定

资产管理人因运用委托财产投资定期存款等存款类资产投资而在存款机构开立的存款账户,资产管理人应确保该账户的任何有效预留印鉴中均应包含资产托管人指定印鉴。在资产管理人运用委托财产投资银行定期存款等存款类投资时,应及时将存款银行出具的存款证实书原件交资产托管人保管。资产托管人仅负责对其所收到的存款证实书原件进行保管,不负责存款证实书真伪的辨别,不对存款证实书对应存款的本金及收益的安全承担任何责任和义务。

资产管理人在运用委托财产投资银行存款类资产之前,资产管理人均应与存款机构签订存款协议,约定资产管理人与存款机构双方的权利和义务,该协议作为划款指令附件。该协议中应明确约定存款证实书不得被质押或以任何方式被抵押,并不得用于转让和背书;本息到期或提前支取的所有款项必须划至托管账户,不得划入其他任何账户。若资产管理人提前支取或部分提前支取定期存款等存款类资产,若产生息差,则息差处理方法由资产管理人与存款机构商定后通知资产托管人。

办理委托财产投资银行存款类资产的开户预留印鉴留存、全部提前支取、部分提前支取、到期支取时,应由存款银行或资产管理人至资产托管人处办理印鉴留存、送、取证实书。存款银行或资产管理人经办人员应携带单位介绍信/授权书以及个人身份证件,以便资产托管人进行核对。资产托管人将存款证实书原件移交给资产管理人或存款银行上门经办人员后不再承担对存款证实书原件的保管责任。

(四) 资金、证券账目的核对

资产管理人和资产托管人定期对资产的证券账目、实物券账目进行核对。

十三、越权交易处理

(一) 越权交易的界定

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

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

资交易行为；

(2) 法律法规禁止的超买、超卖行为；

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

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

(二) 对越权交易的处理

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

资产托管人在本合同第十六章约定的投资监督事项范围内，发现资产管理人的投资指令违反法律、行政法规和其他规定，或者违反本合同约定的，应当拒绝执行，立即通知资产管理人和资产委托人并及时报告中国证监会、基金业协会。

资产托管人在本合同第十六章约定的投资监督事项范围内，发现资产管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他规定，或者违反本合同约定的，应当立即通知资产管理人和资产委托人。

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

2、法律法规禁止的超买、超卖行为。

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

3、违反或超出本合同项下资产委托人授权的投资交易行为

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

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

(三) 被动超标

1、由于包括但不限于证券、期货市场波动、上市公司合并、组合规模变动等资产管理

人之外的原因导致的投资比例不符合本合同约定的投资限制或投资禁止政策，为被动超标。发生上述情形时，资产管理人应在发生不符合法律法规或投资政策之日起的 15 个交易日内进行调整，以满足法律法规及投资政策的要求。法律法规另有规定的从其规定。

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

十四、委托财产的估值

（一）资产净值计算、复核的依据、时间和程序

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

资产管理人每个交易日对委托财产进行估值。资产管理人与资产托管人在每个估值日（以下简称‘估值核对日’）对资产净值进行核对。估值原则应符合本合同、《证券投资基金会计核算业务指引》及其他法律法规的规定。资产管理人应于每个估值核对日交易结束后计算当日的资产净值并以电子直连、电子邮件、传真或其他经双方认可的方式发送给资产托管人。资产托管人对净值计算结果复核后，以电子直连、电子邮件、传真或其他双方认可的方式传送给资产管理人，由资产管理人在本合同约定的时间提交资产委托人。资产管理人应优先使用电子直连方式与资产托管人进行计划财产估值核对。

资产净值计算和会计核算的义务由资产管理人承担。因此，就与委托财产有关的会计问题，本委托财产的会计责任方是资产管理人。如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致意见，以资产管理人对资产净值的计算结果为准。

（二）估值方法

1、估值对象

委托财产项下所有的股票、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产。

2、估值方法

本产品按以下方式进行估值：

（1）证券交易所上市的有价证券的估值

1) 交易所上市的有价证券（包括股票等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，以最近交易日的市

价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

2) 对于在交易所上市交易的固定收益品种，按照中证提供的相应品种对应的估值净价估值，交易所未实行净价交易的债券样采用收盘全价减去债券收盘价后所含的应收利息得到的净价估值。对于在银行间上市交易的固定收益品种，按照中债提供的相应品种对应的估值净价估值。

3) 对于部分特殊证券（第三方估值机构未提供价格的，基本面发生重大变化或债券发生重大违约等因素导致价格不公允的证券），资产管理人与资产托管人协商一致后，采用估值技术确定公允价值。

(2) 处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

1) 送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市价（收盘价）估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值。

2) 首次公开发行未上市的股票、债券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

3) 首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的市价（收盘价）估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

(3) 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。

(4) 证券投资基金的估值

1) 上市证券投资基金的估值

(i) 非货币市场基金按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；

(ii) 无市价的场内货币市场基金按照实际增加的份额数量确认收益；有市价的场内货币市场基金按收盘价估值，并按照实际增加的份额数量确认收益；

(iii) 若估值日无交易，且最近交易日后市场环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后市场环境发生了重大变化的，可使用最新的基金份额净值为基础或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。

2) 非上市证券投资基金的估值

(i) 非交易所上市的开放式基金（包括场外登记的 LOF、ETF 等），以估值日前一交易日该基金的份额净值估值；估值日前一交易日该基金份额净值未公布的，以前最近一个交

易日基金份额净值计算；尚未公布过基金份额净值的，按成本估值；

(ii) 货币市场基金和货币型理财基金，按估值日前一交易日该基金的每万份收益计提估值日基金收益。

3) 基金分红除权、拆分和折算等情况的估值

如果所投资基金前一估值日至估值日期间发生分红除权、拆分或折算，管理人根据基金份额净值或收盘价、单位基金份额分红金额、折算拆分比例、持仓份额等因素合理确定公允价值。

(5) 银行存款、回购等固定收益工具按照约定利率在持有期内逐日计提应收利息，在利息到账日以实收利息入账。

(6) 估值计算中涉及港币或其他外币币种对人民币汇率的，可参考当日中国人民银行或其授权机构公布的人民币汇率中间价，或其他可以反映公允价值的汇率进行估值。

如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，资产管理人可根据具体情况与资产托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

3、暂停估值的情形

(1) 委托财产投资所涉及的交易场所遇法定假日或因其它原因暂停营业时；

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

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

(4) 中国证监会认定的其他情形。

4、估值差错处理

如资产管理人或资产托管人发现资产估值违反本合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护资产委托人利益时，应立即通知对方，共同查明原因，协商解决。

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

由于一方当事人提供的信息错误，另一方当事人在采取了必要合理的措施后仍不能发现该错误，进而导致计划财产净值计算错误造成资产委托人的损失，以及由此造成以后交易日

计划财产净值计算顺延错误而引起的资产委托人的损失，由提供错误信息的当事人一方负责赔偿。

由于证券交易所及其注册登记公司发送的数据错误或其他不可抗力等原因造成的计划资产估值错误，资产管理人和资产托管人可以免除赔偿责任。但资产管理人和资产托管人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

资产管理人按本合同约定的按公允价值进行估值时，所造成的误差不作为计划资产估值错误处理。

5、资产管理计划资产净值的确认

资产管理计划的资产净值由资产管理人负责计算，资产托管人负责进行复核。如经在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照资产管理人对资产管理计划资产净值的计算结果为准。

资产管理计划财产净值即计划财产净值，是指计划资产总值减去负债后的价值。资产净值的计算保留到小数点后 2 位，小数点后第 3 位四舍五入。计划资产份额净值的计算保留到小数点后 4 位，小数点后第 5 位四舍五入。

十五、委托财产的会计核算

（一）会计政策

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

（二）会计核算方法

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

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

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

十六、资产托管人对资产管理人的投资监督

资产托管人根据以下约定在资产托管人系统支持及可观测范围内对资产管理人的投资行为进行监督，如本合同其他章节的约定与本款约定不一致的，资产托管人对资产管理人投资行为的监督内容与标准均以本第十六章约定为准：

（一）资产托管人对下述投资范围进行监督：

本计划主要投资于

东方证券股份有限公司发行的 H 股股票东方证券（03958.hk），闲置资金可投资于银行存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券、货币市场基金、逆回购等流动性管理工具。

本计划可以投资于资产管理人管理的公募证券投资基金，本计划建仓期完成后投资于权益类资产的比例不低于总资产的 80%。

资产管理人拟运用本计划资产实施对上述未明确列示投资品或本合同签署后市场新增交易品种的投资的，或拟进行 ETF 基金场内申赎交易的，应根据法律法规履行规定的程序，并应于开始实施投资前与资产托管人就此类投资品的会计核算、估值、清算、监督、系统支持等达成一致。

（二）资产托管人对下述委托财产投资比例限制进行监督：

（1）本计划自建仓结束后投资于东方证券 H 股的比例不低于本计划总资产的 80%；

（2）本计划投资于东方证券 H 股的比例不超过总股本（A+H 合并计算）的 0.4%；

发生被动超标情形的，资产管理人应在 15 个交易日内进行调整，以达到规定的投资比例限制要求。法律法规另有规定的从其规定。

（三）资产托管人按本章约定对资产管理人的投资监督和检查自本计划成立之日起开始，自本计划进入清算程序之日起终止监督。

（四）如因投资政策变更需调整上述监督职责的，资产管理人应提前以书面形式通知资产托管人，由三方当事人就此另行协商并达成书面一致后实施。

（五）资产托管人履行投资监督义务受限于资产管理人、证券经纪机构及其他中介机构提供的数据和信息，资产托管人对上述机构提供信息的真实性、准确性、及时性和完整性不作任何担保、暗示或表示，对上述机构提供信息的错误、遗漏或延迟所引起的损失不承担任何责任。

（六）资产托管人仅依据与资产管理人核对一致的本计划财务报表中列示的投资品及其市值，计算本章列示的监督指标、监督本计划的投资范围。

十七、资产管理业务的费用与税收

(一)资产管理业务费用的种类

- 1、资产管理人的管理费；
- 2、资产托管人的托管费；
- 3、委托财产拨划支付的银行费用及资金账户银行费用等；
- 4、委托财产的证券、期货交易费用及开户费用；
- 5、资产管理计划成立后的资产管理计划信息披露费用；
- 6、资产管理计划成立后与资产管理计划有关的会计师费、审计费、律师费、仲裁费、诉讼费等；
- 7、按照法律法规及本合同的约定可以在委托财产中列支的其他费用。

(二)费用计提方法、计提标准和支付方式

1. 资产管理人的管理费

本计划的管理费按前一日委托财产净值的年费率计提。计算方法如下：

本计划的年管理费率为 0.10%

$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$

H 为每日应计提的委托财产管理费

E 为前一日委托财产净值，首日按本计划成立规模计算

本计划的管理费自本计划成立日(含)起，每日计提，逐日累计至每季季末，按季支付，由资产托管人根据与资产管理人核对一致的财务数据，自动在季初的第[3]个交易日按照指定的账户路径进行资金支付，资产管理人无需再出具资金划拨指令。费用自动扣划后，资产管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系资产托管人协商解决。若因战争、自然灾害等不可抗力致使无法按时支付的，则在不可抗力情形消除后的首个工作日支付。计划终止后，依据清算程序支付尚未支付的管理费。

资产管理人管理费收费账户信息如下：

户 名：汇添富基金管理股份有限公司

账 号：1001278609013304657

大额支付号：102290027868

开户银行：022786-工行上海市延安西路支行

上述资产管理人的账户信息如有变更，资产管理人可单独决定而无须变更本合同，但须

在账户信息变更生效前至少三个工作日通知资产托管人。

2. 资产托管人的托管费

本计划的托管费按前一日委托财产净值的年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$ ，本计划的年托管费率为 0.02%

H 为每日应计提的委托财产托管费

E 为前一日委托财产净值，首日按本计划成立规模计算

本计划的托管费自本计划成立日(含)起，每日计提，逐日累计至每季季末，按季支付，由资产托管人根据与资产管理人核对一致的财务数据，自动在季初的第 3 个交易日按照指定的账户路径进行资金支付，资产管理人无需再出具资金划拨指令。费用自动扣划后，资产管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系资产托管人协商解决。若因战争、自然灾害等不可抗力致使无法按时支付的，则在不可抗力情形消除后的首个工作日支付。计划终止后，依据清算程序支付尚未支付的托管费。

托管费收费账户信息如下：

账户名称：特定客户资产托管收入

账号：1001688911500886063

开户机构：中国工商银行上海市分行业务处理中心

上述资产托管人的账户信息如有变更，资产托管人可单独决定而无须变更本合同，但须在账户信息变更生效前至少三个工作日通知资产管理人。

3. 上述(一)中 4 到 7 费用由资产托管人根据其他有关法规及相应协议的规定，按费用支出金额支付，列入或摊入当期委托财产运作费用。

除证券交易结算费用、资金划拨费用、托管账户开立及维护费用等交易所、登记结算机构、开户银行等自动扣缴的费用由收费机构自动扣收外，其他各项费用均由资产托管人根据资产管理人指令或约定方式从计划财产支付。

(三) 不列入资产管理业务费用的项目

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

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

(五) 税收

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

鉴于资产管理人为本资产管理计划的利益投资、运用基金财产过程中，可能因法律法规、税收政策的要求而成为纳税义务人，就归属于基金的投资收益、投资回报和/或本金承担纳税义务。因此，本资产管理计划运营过程中由于上述原因发生的增值税等税负，仍由本资产管理计划财产承担，届时资产管理人与资产托管人可通过本资产管理计划托管账户直接缴付，或划付至资产管理人账户并由资产管理人依据税务部门要求完成税款申报缴纳。

十八、资产管理计划的收益分配

本资产管理计划收益分配政策比照证券投资基金现行政策执行。

（一）可供分配利润的构成

本资产管理计划可供分配利润为截至收益分配基准日计划未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

资产管理计划收益包括：计划投资所得红利、股息、债券利息、证券投资收益、证券持有期间的公允价值变动、银行存款利息以及其他收入。因运用计划财产带来的成本或费用的节约计入收益。

（二）收益分配原则

1、每一计划份额享有同等分配权。

2、本资产管理计划收益分配方式为现金分红。收益分配时发生的银行转账等手续费用由资产委托人自行承担。

3、在符合有关计划收益分配条件的前提下，本计划收益每年最多分配 4 次，且每次收益分配的基准日仅在标的公司股息分配日之后，收益分配日与提取日不为同一日。

4、若本合同生效不满 3 个月则可不进行收益分配。

5、收益分配的基准日为可供分配利润的计算截止日。

6、法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

（三）收益分配方案的确定与通知

计划收益分配方案中应载明截至收益分配基准日的可供分配利润、计划收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。

计划收益分配方案由资产管理人拟定，并由资产托管人复核后确定，资产管理人按法律法规的规定向中国证监会备案并告知资产委托人。

在收益分配方案公布后，资产管理人依据具体方案的规定就支付的现金收益向资产托管人发送划款指令，资产托管人按照资产管理人的指令及时进行现金收益的划付。

十九、信息披露与报告

(一) 向资产委托人提供的报告

1、年度报告

资产管理人应当在每年结束后四个月内，编制完成年度报告并经资产托管人复核其中本计划的财务数据后，向资产委托人披露投资状况、投资表现、风险状况等信息。资产管理人在 2 个月内完成年度报表，在年度报告完成当日，将有关报告提供资产托管人复核其中本计划的财务数据，资产托管人在收到后 2 个月内复核，并将复核结果书面通知资产管理人。资产托管人复核内容仅为报告中的财务数据（本合同约定的资产托管人无复核义务的数据除外）。委托财产运作不到 3 个月的及本计划终止的当年，不编制当期年度报告。

2、季度报告

资产管理人应当在每季度结束之日起 1 个月内，编制完成季度报告，经资产托管人复核其中本计划的财务数据后，向资产委托人披露投资状况、投资表现、风险状况等信息。资产管理人在 15 日内完成季度报表，在季度报告完成当日，将有关报告提供资产托管人复核其中本计划的财务数据，资产托管人在收到后 15 日内进行复核，并将复核结果书面通知资产管理人。资产托管人复核内容仅为报告中的财务数据（本合同约定的资产托管人无复核义务的数据除外）。委托财产运作不足 3 个月、以及资产管理计划终止的当季度，资产管理人可以不编制当期季度报告，不编制当期季度报告。

3、净值报告及每日估值表

本计划成立后，资产管理人每天向资产委托人报告一次当期未经资产托管人复核的计划财产净值和每日估值表。

本计划接收每日估值表的邮箱为：dfcwyy@orientsec.com.cn

4、临时报告

发生本合同约定的、可能影响资产委托人利益的重大事项时，资产管理人应在事项发生之日起五日内向资产委托人披露。

5、为免疑义，资产管理人向资产委托人提供的上述报告，不包括反映本计划交易过程

的交易明细及交易凭证等信息。

(二)向监管机构提供的报告

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

(三)资产管理人向资产委托人提供报告及资产委托人信息查询的方式、资产委托人授权联系人

向资产委托人提供的报告，将严格按照有关规定通过以下至少一种方式进行。资产委托人信息查询将通过以下至少一种方式进行：

1、资产管理人网站

资产管理合同、计划说明书、定期报告、临时报告等有关本资产管理计划的信息将在资产管理人网站上披露，资产委托人可随时查阅。

资产管理人网站：www.99fund.com

2、邮寄服务

资产管理人向资产委托人邮寄定期报告、临时报告等有关本计划的信息。资产委托人在合同签署页上填写的通信地址为送达地址。通信地址如有变更，资产委托人应当及时通知资产管理人。

3、传真或电子邮件

如资产委托人留有传真号、电子邮箱等联系方式的，资产管理人也可通过传真、电子邮件、电报等方式将报告信息通知资产委托人。

4、资产委托人授权联系人名单见本合同附件 2。

(四)信息保密义务

资产委托人根据上述资产管理合同的约定从资产管理人处获取的相关数据，仅供用于资产委托人了解本资产管理计划委托资产的相关投资状况，不得擅自以任何形式对外泄露、报导、转送，资产委托人不利用获取的相关数据进行内幕交易、不公平交易或者操作市场等其他违反证券法等法律法规的规定，不得向除资产委托人所指定数据接收人之外的其他方披露该等数据，法律法规另有规定或监管机关另有要求的除外。

资产委托人须采取必要的措施，将相关数据的知情者控制在最小范围内，不得在公司内部非业务相关部门或个人之间以任何形式传播，保证相关信息不被内部工作人员及外部相关人员利用获取的相关数据进行违法违规的交易。如违反前述义务，资产委托人应赔偿管理人因此造成的所有损失。

二十、风险揭示

本计划投资可能面临以下各项风险，包括但不限于：

（一）本计划的一般风险

1、本金损失风险

管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用计划财产，但不保证计划财产本金不受损失，也不保证一定盈利及最低收益。

在发生揭示的风险及其他尚不能预知的风险而导致本计划项下计划财产重大损失的，委托人可能发生委托本金损失的风险。

本计划的风险等级为 R4，属于中等风险投资品种（最低为 R1，最高为 R5），适合风险识别、评估、承受能力评级为 C4 -C5 的合格投资者。资产委托人确认具备与本计划相匹配的风险识别能力和风险承受能力。

2、市场风险

证券市场价格受到经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素的影响，导致委托资产收益水平变化，产生风险。其主要包括：

（1）经济周期风险

随经济运行的周期性变化，证券市场的收益水平也呈周期性变化。委托资产投资于债券和股票，收益水平也会随之变化，从而产生风险。

（2）政策风险

因国家宏观政策（如货币政策、财政政策、税收政策、行业政策、地区发展政策等）发生变化，导致市场价格波动而产生风险。

（3）权益风险

本计划投资的股票面临经济周期风险、政策风险、行业风险、上市公司经营风险等，这些都会导致股票价格发生波动，进而影响本计划的投资收益。此外，本计划在投资管理中将维持较高股票投资比例，因此无法完全规避股票市场的下跌风险。投资者须在理性判断的基础上做出投资选择。

（4）利率风险

金融市场利率的波动会导致证券市场价格和收益率的变动。利率直接影响着债券的价格和收益率，影响着企业的融资成本和利润。委托资产投资于债券和股票，其收益水平会受

到利率变化的影响。

（5）购买力风险

委托资产的利润将主要通过现金形式来分配，而现金可能因为通货膨胀的影响而导致购买力下降，从而使委托资产的实际收益下降。

（6）上市公司经营风险

上市公司的经营好坏受多种因素影响，如管理能力、财务状况、市场前景、行业竞争、人员素质等，这些都会导致企业的盈利发生变化。如果委托资产所投资的上市公司经营不善，其股票价格可能下跌，或者能够用于分配的利润减少，使委托资产投资收益下降。（7）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。

（8）再投资风险

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

3、管理风险

在委托资产管理运作过程中，资产管理人的研究水平、投资管理水平直接影响委托资产收益水平，如果资产管理人对经济形势和证券市场判断不准确、获取的信息不全、投资操作出现失误，都会影响委托资产的收益水平。

4、流动性风险

委托资产要随时应对资产委托人的提取，如果委托资产不能迅速转变成现金，或者变现时对委托资产净值产生冲击成本，都会影响委托资产运作和收益水平。尤其是在资产委托人大额提取委托资产时，如果委托资产变现能力差，可能会产生委托资产仓位调整的困难，导致流动性风险，从而影响委托资产收益。

5、关联交易及利益冲突的风险

（1）资产委托人知悉并同意，在不存在违反监管要求的产品嵌套，不存在规避投资范围、杠杆约束等监管要求的违规行为，符合相关法律法规、投资指引、资产委托人禁限投要求及其他与关联交易相关的规定的前提下，本计划可投资于资产管理人管理的金融产品，可投资于资产管理人或资产管理人的股东、资产托管人或资产托管人的股东、资产委托人或资产委托人的股东等关联方发行或承销的证券，租用资产管理人关联方提供的证券交易单元

等，无需取得资产委托人的同意。资产管理人应当建立健全内部审批机制和评估机制，遵循投资者利益优先原则，于事后及时、全面、客观地向资产委托人和资产托管人进行充分披露，并采取切实有效措施，防范利益冲突，保护资产委托人合法权益。

(2) 资产委托人应事前就其关联方、关联证券或其他禁止交易证券明确告知资产管理人。资产委托人未能事前就其关联证券或其他禁止交易证券明确告知资产管理人致使委托财产发生违规投资行为的，资产管理人、资产托管人不承担任何责任。

(3) 资产委托人知悉，尽管资产管理人承诺谨慎勤勉地管理委托财产、公平对待各投资组合，本计划在投资和运作过程中可能存在一些利益冲突情形，包括但不限于：资产管理人、资产托管人开展不同业务类型可能产生的利益冲突；资产管理人管理的其他资管产品（包括本计划投资经理管理的其他资管产品）基于各自投资策略需要可能与本计划存在相同、相似或相反的投资交易行为，或者在买卖同一只证券的时间上存在先后；其他可能产生利益冲突的情况等。

此外，资产管理人可以在遵循法律法规和相关原则的前提下运用自有资金进行证券投资，该等投资也可能与本计划存在相同、相似或相反的投资交易行为，或者在买卖同一只证券的时间上存在先后，不排除可能影响或限制本计划的投资运作。

6、操作风险

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。

在计划的各种交易行为或者后台运作中，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投资者的利益受到影响。这种技术风险可能来自基金管理公司、注册登记机构、销售机构、证券交易所、证券注册登记机构等。

7、税收风险

财政部、国家税务总局财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》第四条规定：“资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。”鉴于资产管理计划合同中资产管理人收取的管理费并不包括资产管理计划运营过程中发生的税款，本资产管理计划运营过程中需要缴纳增值税及其附加税的，将由资产委托人承担并从资产管理计划资产中支付，因此可能增加资产委托人的投资税费成本。

在本资产管理计划存续期间，税收征管部门可能会对增值税等应税行为的认定以及适

用的税率等进行调整。届时，资产管理人将执行更新后的政策，可能会因此导致委托财产实际承担的税费发生变化，并可能会影响到资产委托人的收益。

8、交易资金前端风险控制业务风险

本资产管理计划由资产管理人作为交易参与者通过交易单元在证券交易所进行证券交易。根据《证券交易资金前端风险控制业务规则》等有关规定，证券交易所、证券登记机构对交易参与者相关交易单元的全天净买入申报金额总量实施额度管理，并通过交易所对交易参与者实施前端控制。可能存在如下风险：

(1) 资产管理人、资产托管人操作失误，合计资产总额发生变动导致最高额度未能及时变更等，存在影响产品正常交易、无法有效进行风险控制等风险。

(2) 因不可抗力、意外事件、技术故障或者重大差错等原因导致资金前端控制出现异常，中国结算及沪、深交易所采取最高额度调整、暂停资金前端控制、限制交易单元接入等处置措施，产生业务风险。

(二) 资产管理计划面临的特定风险

1、特定投资方法及资产管理计划所投资的特定投资对象可能引起的特定风险

(1) 股票投资风险

本计划主要投资于股票等权益类资产，股票面临经济周期风险、政策风险、行业风险、上市公司经营风险等，上述因素都会导致股票价格发生波动，进而影响本计划的投资收益。

(2) 债券投资的利率风险及价格波动风险

利率是影响债券价格的重要因素，债券投资面临着由于市场利率波动而导致的债券价格波动风险。此外，信用债信用风险的变化、债券市场流动性不足等其他因素均可能导致债券价格的波动。

(3) 本产品可投资于银行协议存款，由于银行协议存款具有固定期限，如资产委托人在存续期内提取委托财产，资产管理人可能需提前支取银行存款（如存款协议中有提前支取条款），此时提前支取部分的资金将按照协议约定的提前支取利率计算利息，该利率可能低于协议约定的到期支取利率，从而影响委托财产的收益。

(4) 港股通机制下，港股投资面临的风险

1) 港股价格波动的风险。

港股市场实行当日回转交易机制（即当日买入的股票，在交收前可以于当日卖出），同时对个股不设涨跌幅限制，每日涨跌幅空间相对较大；加之香港金融市场结构性产品和衍生品种类相对丰富以及做空机制的存在；港股股价受到意外事件影响可能表现出比 A 股更为剧

烈的价格波动，本资产管理计划持有港股的价格波动风险可能相对较大。

2) 汇率风险。

本资产管理计划将投资港股通标的股票，在交易时间内提交订单依据的港币买入参考汇率和卖出参考汇率，并不等于最终结算汇率。港股通交易日日终，中国证券登记结算有限责任公司进行净额换汇，将换汇成本按成交金额分摊至每笔交易，确定交易实际适用的结算汇率。故本资产管理计划承担港元对人民币汇率波动的风险，以及因汇率大幅波动引起账户透支或资金被额外占用的风险。

3) 港股通交易日风险。

根据现行的港股通规则，只有境内、香港两地均为交易日且能够满足结算安排的交易日才为港股通交易日。因此会存在港股通交易日不连贯的情形（如内地市场因放假等原因休市而香港市场照常交易但非港股通交易日时，香港出现台风、黑色暴雨或者香港联交所规定的其他情形导致停市时，出现交易异常情况交易所可能暂停提供部分或者全部港股通服务的情形时），并使得本资产管理计划所持有的港股在后续港股通交易日开市交易时有可能出现价格波动骤然增大，进而导致本资产管理计划所持有的港股在资产估值上出现波动增大的风险，进而影响净值出现较大波动。

4) 港股通额度限制带来的风险。

现行的港股通规则，对港股通设有每日额度上限；本资产管理计划可能因为港股通市场每日额度不足，面临不能通过港股通进行买入交易的风险，进而可能错失投资机会。

5) 交收制度带来的流动性风险。

根据港股通在证券交收时点上的交收安排，本资产管理计划在港股通交易日卖出股票，该港股通交易日后第2个港股通交易日才能完成清算交收，卖出的资金在该港股通交易日后第3个港股通交易日才能回到人民币资金账户。因此交收制度的不同以及港股通交易日的设定原因，本资产管理计划可能面临卖出港股后资金不能及时到账，而造成赎回款支付时间比正常情况延后而给投资人带来流动性风险。

6) 港股通制度下对公司行为的处理规则带来的风险。

根据现行的港股通规则，本资产管理计划因所持港股通股票权益分派、转换、上市公司被收购等情形或者异常情况，所取得的港股通股票以外的香港联交所上市证券，只能通过港股通卖出，但不得买入；因港股通股票权益分派或者转换等情形取得的香港联交所上市股票的认购权利在联交所上市的，可以通过港股通卖出，但不得行权；因港股通股票权益分派、转换或者上市公司被收购等所取得的非联交所上市证券，可以享有相关权益，但不得通过港

股通买入或卖出。本资产管理计划存在因上述规则，投资收益得不到最大化甚至受损的风险。

（5）投资于单一标的的风险

本计划主要投资于东方证券 H 股，存续期内单一证券的投资集中度较高。本计划由于流动性管理的需求，将保证一定比例的流动性管理工具，因此本计划的净值表现将于标的公司存在一定的差异。

同时在锁定期满之后由于提取委托财产，本计划将对计划中的股票进行减持，届时标的的流动性将直接影响组合资产净值的表现。由于股票减持带来的损失由资产委托人承担。

（6）锁定期风险

本计划所持有的股票存在法定或承诺的锁定期，由于锁定期、休市、停牌、交易限制期等因素导致股票无法变现，委托人可能面临不能如期收回本金和收益的风险。

（7）份额提取的风险

本计划将设置份额提取机制，即委托人提取委托财产的形式将以份额数量乘以提取日净值的方式来确定最终提取金额。由于遵循未知价原则，实际提取的金额将与提取确认日的净值挂钩，提取的金额将与提取确认日的委托财产的收益或损失相关。

（8）巨额提取带来的流动性风险

本计划由于投资于单一标的，若发生巨额提取，本计划中的流动性资产不足以支付委托人的提取款项，届时将通过出售标的的股票来满足委托人的提取需求。届时由委托财产提取而导致需要被动卖出标的公司，将会影响本计划的收益甚至发生亏损，巨额提取产生的风险将由委托人承担。

（9）资产委托人未及时、准确披露相关信息导致本资产管理计划违规交易的风险

资产委托人未及时、准确披露相关信息导致本资产管理计划违规交易，资产委托人承担一切责任，与资产管理人无关。如管理人因执行该等委托人指令而遭受相关处罚及/或损失的，资产委托人有义务协助管理人为消除监管处罚而配合监管部门调查并负责提供相关证据资料，同时赔偿管理人因此遭受的一切损失。

2、不能完成备案的风险

本计划成立后需在基金业协会进行备案，在完成基金业协会备案前不得开展投资活动。因此，即使本计划成立，并不意味着本计划必然能获得基金业协会的备案。而该等备案过程可能会受到相应监管政策的影响，包括备案时间所需时间、能否通过备案都存在一定的不确定性。

如果在计划成立后不能及时完成备案，将可能导致本计划错过市场行情或投资机会；如果本计划在成立后无法获得基金业协会的备案，则将直接影响本计划设立目的的实现。当出现无法通过基金业协会备案的情形，资产管理人将有权决定提前终止本计划，由此直接影响资产委托人参与本计划的投资目的。

3、资产管理合同与证券投资基金业协会合同指引不一致所涉风险：

本资产管理合同虽然已在能够满足本计划投资需要的前提下涵盖了合同指引明确要求的条款，但合同指引主要为概括性、原则性约定，因此本资产管理合同具体条款的约定不可避免的比合同指引更为复杂、更为具体，也不可避免地与合同指引不完全相同。

投资人应当认真阅读本资产管理合同，理解本资产管理合同的全部条款，独立做出是否签署本资产管理合同的决定。

（三）其他风险

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

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

二十一、资产管理合同的生效、变更与终止

（一）资产管理合同是约定资产管理合同当事人之间权利义务关系的法律文件。资产委托人为法人的，本合同自资产委托人、资产管理人和资产托管人加盖公章或合同专用章之日起成立；资产委托人为自然人的，本合同自资产委托人本人或授权代理人签章、资产管理人和资产托管人加盖公章或合同专用章之日起成立。本合同自资产管理计划成立之日起生效。

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

（三）本合同的有效期限至本计划终止日止。本合同另有约定的，从其约定。合同期满前2个月前，本合同各方可协商合同是否续约。在资产管理计划运作规范，资产管理人、资产托管人未违反法律、行政法规、中国证监会规定和资产管理合同的约定，本计划展期没有损害投资者利益，且合同各方当事人在合同期满前2个月前无异议的情况下，本合同自动顺

延，本计划的存续期限相应顺延。

（四）因法律法规或中国证监会、基金业协会的相关规定、要求发生变化必须变更资产管理合同的，资产管理人可以与资产托管人协商后修改本合同，并由资产管理人按照本合同约定及时向投资者披露变更的具体内容。

因其他原因需要变更资产管理合同的，资产委托人、资产管理人和资产托管人书面协商一致后，可对本合同内容进行变更。本合同发生变更的，资产管理人应按照证券投资基金业协会要求及时向证券投资基金业协会备案，并抄报中国证监会相关派出机构。

（五）如果资产管理人被依法撤销资产管理业务资格或者依法解散、被撤销、宣告破产，资产委托人可选择符合条件的其他资产管理人承接本资产管理计划项下资产管理人相关权利义务。发生此等情形时，新的资产管理人与委托人及托管人重新签署资产管理合同，原资产管理人应当向新的资产管理人交接本资产管理计划资产管理事务。

如果资产托管人被依法撤销基金托管资格或者依法解散、被撤销、宣告破产，经资产委托人及资产管理人协商一致，可选择符合条件的其他资产托管人承接本资产管理计划项下资产托管人相关权利义务。发生此等情形时，原资产托管人应当向新的资产托管人交接本资产管理计划资产托管事务。

（六）本计划及本合同终止的情形包括下列事项：

- 1、本计划存续期限届满而未延期的；
- 2、经合同各方当事人协商一致决定终止的；
- 3、资产管理人被依法撤销资产管理业务资格或者依法解散、被撤销、宣告破产，且在六个月内没有新的资产管理人承接的；
- 4、资产托管人依法撤销基金托管资格或者依法解散、被撤销、宣告破产，且在六个月内没有新的资产托管人承接的；
- 5、本计划未在基金业协会完成备案或基金业协会对本计划不予备案；；
- 6、法律法规和本合同规定的其他情形。

（七）资产管理人应当在 5 个工作日内将签订的资产管理合同报中国证监会备案。对本合同任何形式的变更、补充，资产管理人应当在变更或补充发生之日起 5 个工作日内报基金业协会备案，并抄报中国证监会相关派出机构，前述第（六）条第 5 项约定的情形除外。

二十二、清算程序

（一）清算组的成立及三方当事人职责

自本计划终止事由发生之日起五个工作日内，资产管理人和资产托管人开始组成清算组，负责委托财产的保管、清理、估价、变现、确认和分配，具体职责如下：

1、资产委托人

（1）确认清算方案，收到资产管理人发送的经资产托管人复核其中财务数据（本合同约定的资产托管人无复核义务的数据除外）的清算方案后 3 个工作日内未提出书面异议的，表示资产委托人接受该清算方案，资产管理人按照清算方案开展工作；

（2）确认清算报告，收到资产管理人发送的经资产托管人复核其中财务数据（本合同约定的资产托管人无复核义务的数据除外）的清算报告后 3 个工作日内未提出书面异议的（合同另有约定的按合同约定执行）表示资产委托人接受该清算报告。

2、资产管理人

（1）资产变现；

（2）除交易所、银行等自动扣收的费用外，对清算期间资金支付出具划款指令；

（3）出具会计报表；

（4）清算期间的会计核算；

（5）编制清算报告；

（6）配合资产托管人办理账户注销工作；

（7）与资产管理人义务相关的其他职责。

3、资产托管人

（1）清算期间的财产保管；

（2）复核资产管理人划款指令，进行资金划付；

（3）委托财产资金、证券账户的注销；

（4）清算期间发生资金变动的当日，提供日终资金调节表；

（5）复核资产管理人出具的会计报表；

（6）复核资产管理人出具的清算报告、清算方案中的财务数据（本合同约定的资产托管人无复核义务的数据除外）；

（7）与资产托管人义务相关的其他职责。

（二）清算程序

1、确认进入清算环节的财产状况

计划终止日起 2 个工作日内，资产管理人应出具加盖业务章的计划终止日的估值表、清算方案并发送至资产托管人，资产托管人收到后在 2 个工作日内复核其中的财务数据（本合同约定的资产托管人无复核义务的数据除外）并以传真、电子邮件或资产管理人与资产托管人认可的其他形式发送资产管理人，资产管理人收到后发送资产委托人确认。资产管理人拟进行二次或多次清算的，后续清算时，对除末次清算外的清算分配，资产管理人应于每次清算时出具加盖业务章的本次清算方案并发送至资产托管人，资产托管人收到后在 2 个工作日内复核其中财务数据（本合同约定的资产托管人无复核义务的数据除外），以传真、电子邮件或资产管理人与资产托管人认可的其他形式发送资产管理人，资产管理人收到后发送资产委托人确认。资产管理人应确保于资产委托人对清算方案确认无异议后方可向资产托管人出具划款指令。资产管理人仅在最后一次清算时编制清算报告，其他各次清算资产管理人仅编制清算方案。

2、资产的变现

计划终止后，委托财产不应仍持有可变现可流通的非现金资产，如遇特殊情况，委托财产仍持有可流通非现金资产的，由委托人与管理人协商确定后续变现事宜；委托财产持有的流通受限证券，如未到期回购、未上市新股或休市、停牌、暂停交易、处于交易限制期的证券等，于限制条件解除后由资产管理人进行变现处理。**资产委托人应接受上述由于资产变现产生的收益或损失。**

本计划终止后资产管理人应及时与资产委托人确认清算方案，尽快完成本计划的清算。本计划清算期限或因外部因素的影响（包括但不限于标的股票的交易限制期、交易所结算备付金规则等）有可能超过 30 个工作日，届时资产管理人提前与资产委托人沟通预估的清算期限。本计划存续期满后，若资产管理计划所持资产仍包含标的股票的，由委托人与管理人协商确定处置办法。

资产管理人拟进行二次或多次清算的，应向资产委托人进行披露。在进行二次或多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。计划终止日至资产全部完成变现前，资产管理人、资产托管人不收取管理费、托管费。

3、清算费用的来源和支付方式

清算费用是指清算小组在进行资产管理计划财产清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由资产管理计划财产清算小组优先从资产管理计划财产中支付。清算费用包括但不限

于：

- (1) 聘请会计师（如需）、律师（如需），以及其他工作人员所发生的报酬；
- (2) 资产管理计划资产的保管、清理、估价、变现和分配产生的费用；
- (3) 信息披露所发生的费用；
- (4) 诉讼、仲裁、保全等维护计划委托财产利益所发生的费用；
- (5) 其他与清算事项有关的费用。

除交易所、登记结算机构、开户银行等自动扣缴的费用外，所有清算费用由资产管理人向资产托管人出具指令，由资产托管人根据资产管理人符合本合同约定的指令以及经资产托管人复核其中财务数据（本合同约定的资产托管人无复核义务的数据除外）的清算方案或清算报告办理支付。

4、向资产委托人支付部分清算财产

各次清算时，计划财产按下列顺序清偿：

- (1) 支付清算费用；
- (2) 交纳所欠税款；
- (3) 清偿计划财产债务；
- (4) 应扣除、预留或预提的其他款项；
- (5) 向资产委托人进行分配。

各次清算时，计划财产未按前款（1）、（2）、（3）、（4）项约定清偿前，不分配给资产委托人。

各次清算时，向资产委托人支付的清算款金额计算方法为：将当前变现后的剩余现金资产扣除资产管理计划当前的清算费用、当前应付税款、清偿当前资产管理计划的债务、扣除下月或下季度需增加冻结的结算备付金及交易保证金、匡算并预留后期应付税费等所需充足头寸，并预提 10 万元清算备用资金。其中下月或下季度需增加冻结的结算备付金及交易保证金的金额和后期税费的金额由资产管理人进行匡算，资产托管人不对匡算金额进行复核。

当次清算方案经资产委托人确认后，资产管理人方可向资产托管人出具划款指令，资产托管人对清算方案是否已经资产委托人确认无审核义务。资产托管人根据资产管理人符合本合同约定的指令以及经其复核其中财务数据（本合同约定的资产托管人无复核义务的数据除外）的清算方案，向资产委托人支付部分清算财产。

若委托财产后续清算，出现账面剩余资产不足以支付相关负债的，资产委托人有义务

于收到资产管理人发出的收款通知后当日将款项补足。如遇资产委托人未及时补足该款项的情形，由资产管理人负责向资产委托人进行追讨。

5、清理委托财产债权、债务

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

委托财产债务主要包括委托财产应付管理费、托管费、券商佣金、证券、期货变现交易费用、银行费用、销户费用等。除交易所、登记公司、开户机构等自动扣缴的费用外，所有清偿由资产管理人向资产托管人出具划款指令，由资产托管人根据资产管理人符合本合同约定的指令及经其复核其中财务数据（本合同约定的资产托管人无复核义务的数据除外）的清算方案或清算报告办理支付。当次清偿款项支付所对应的清算方案或清算报告经资产委托人确认无异议后，资产管理人方可向资产托管人出具划款指令，资产托管人对该清算方案或清算报告是否已经资产委托人确认无审核义务。

6、确认主要清算事项完成后的财产状况，出具清算报告。

主要清算事项完成的标志是：

（1）非现金资产变现完成：

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

资产管理人应于主要清算事项完成后的10个工作日内编制清算报告并加盖业务章以传真、电子邮件或资产管理人与资产托管人认可的其他形式发送给资产托管人，资产托管人于5个工作日内完成对其中财务数据（本合同约定的资产托管人无复核义务的数据除外）的复核，加盖业务章以传真、电子邮件或资产管理人与资产托管人认可的其他形式发送资产管理人，由资产管理人向资产委托人提交。资产管理人向资产委托人提交清算报告后3个工作日内资产委托人未提出书面异议的，表示资产委托人接受此清算报告。

资产委托人在此同意，上述清算报告及清算方案不需进行审计，亦不需要律师出具法律意见，除非法律法规或监管部门要求必须进行审计或必须由律师出具法律意见。

（三）清算未结事项

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

1、委托财产账户销户

委托财产证券、期货资产完成变现后，资产托管人根据资产管理人申请负责证券账户、和资金账户的销户工作，销户过程中资产管理人、资产委托人应给予必要的配合。资产管理人按规定注销资产管理计划的期货账户等其他投资账户。

2、备付金账户、保证金账户的销户及剩余财产支付

对于在备付金账户、保证金账户中剩余财产按照中国证券登记结算有限责任公司相关政策执行，最长于计划终止后2个季度可以完成清理。备付金账户利息以登记公司实际支付为准。利息结清后，资产托管人向资产管理人提供书面确认数据，由资产管理人向资产托管人出具划款指令，资产托管人根据资产管理人符合本合同约定的指令以及经其复核其中财务数据（本合同约定的资产托管人无复核义务的数据除外）的清算报告，向资产委托人支付所有剩余财产。清算报告经资产委托人确认后，资产管理人方可向资产托管人出具划款指令，资产托管人对清算报告是否已经资产委托人确认无审核义务。剩余财产支付过程中发生的银行费用，由资产委托人负担。向资产委托人支付的资金账户利息，以销户时账户开户银行实际支付为准。

（四）资产管理计划因委托财产流动性受限等原因延期清算的，资产管理人应当及时向中国证监会相关派出机构和证券投资基金业协会报告。

资产管理人应当在资产管理计划清算结束后五个工作日内将清算结果报基金业协会备案，并抄报中国证监会相关派出机构。

（五）资产管理人、资产托管人等机构应当按照法律法规和中国证监会的规定保存资产管理计划的会计账册，妥善保存有关的合同、协议、交易记录等文件、资料和数据，任何人不得隐匿、伪造、篡改或者销毁。保存期限自资产管理计划终止之日起不少于二十年。

二十三、违约责任

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

1、不可抗力；

2. 计算机系统故障、网络故障、通讯故障、电力故障、计算机病毒攻击等意外事故，因资产管理人、资产托管人故意或重大过失造成的计算机系统故障、网络故障、通讯故障、

电力故障、计算机病毒攻击等除外；

3、资产管理人及/或资产托管人按照有效的法律法规或中国证监会的规定作为或不作为而造成的损失；

4、资产管理人按照本合同规定的投资原则行使或不行使其投资权而造成的损失；

5、资产委托人未能事前向资产管理人及资产托管人履行信息披露义务（如告知关联证券或其他禁止交易证券等），致使发生违规投资行为的，资产管理人与资产托管人均不承担任何责任，资产委托人需就资产管理人与资产托管人由此遭受的损失承担赔偿责任。

6、因证券市场波动、上市公司合并、计划财产规模变动等资产管理人之外的因素致使计划财产投资不符合本合同项下约定的投资策略的，将不视为资产管理人的违约行为；

7、资产委托人理解资产管理计划财产的投资、运作、保管面临本合同第二十章中列举的各类风险，资产管理人及资产托管人就资产管理计划财产面临的上述固有风险免于承担责任；

8、资产管理人及资产托管人对因所引用的投资对象、证券经纪商及其他中介机构等第三方提供的信息的真实性、准确性和完整性存在瑕疵所造成的损失。

（二）资产管理人或资产托管人任一方不因另一方的失职行为而给计划财产或资产委托人造成的损失向资产委托人承担连带责任。

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

（四）一方依据本合同向另一方赔偿的损失，仅限于直接损失。

二十四、争议的处理

（一）对于因本合同的订立、内容、履行和解释或与本合同有关的争议，合同当事人应尽量通过协商途径解决。不愿或者不能通过协商解决的，任何一方均有权将争议提交上海国际经济贸易仲裁委员会，按提交仲裁申请时该会有效之仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为上海。仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力，仲裁费用由败诉方承担。争议处理期间，合同当事人应恪守各自的职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行资产管理合同规定的义务，维护资产委托人的合法权益。

(二) 本合同适用中华人民共和国法律并依据其解释。

二十五、资产管理合同的效力

(一) 资产管理合同是约定资产管理合同当事人之间权利义务关系的法律文件。资产委托人为法人的，本合同自资产委托人、资产管理人、资产托管人加盖公章或合同专用章之日起成立；资产委托人为自然人的，本合同自资产委托人本人签字、资产管理人、资产托管人加盖公章或合同专用章之日起成立。

(二) 本资产管理计划在受托财产划入托管账户后，由资产管理人书面通知资产委托人及资产托管人本资产管理计划成立。资产管理人应当在资产管理计划成立之日起五个工作日内，将资产管理合同、投资者名单与委托资产价值、验资报告或者资产缴付证明等材料报基金业协会备案，并抄报中国证监会相关派出机构。

(三) 本合同自员工持股计划经东方证券股份有限公司股东大会批准，且员工持股计划向本计划账户划付委托资金之日起生效。本合同自生效之日起对资产委托人、资产管理人、资产托管人具有同等的法律约束力。

(四) 本合同有效期至本计划终止日止。本合同另有约定的，从其约定。

(五) 投资者自签订资产管理合同即成为本合同的当事人。

二十六、其他事项

本合同如有未尽事宜，由合同当事人各方按有关法律法规和规定协商解决。

本合同一式叁份，当事人各执壹份，每份具有同等的法律效力。

(以下无正文)

(本页无正文, 为东方证券股份有限公司、汇添富基金管理股份有限公司、中国工商银行股份有限公司上海市分行签署的《汇添富-东方证券员工持股计划 1 号单一资产管理计划资产管理合同的签署页)

资产委托人: 东方证券股份有限公司

签署日期: 年 月 日

资产管理人: 汇添富基金管理股份有限公司

签署日期: 年 月 日

资产托管人: 中国工商银行股份有限公司上海市分行

签署日期: 年 月 日

附件 1：托管系统参数信息维护表（样本）

参数	明细			
场内交易参数	券商1名称			
	席位号	上海		深圳
	清算编号（深圳为主席位号）	上海（清算编号）		深圳（主席位号）
	券商2名称			
	席位号	上海		深圳
	清算编号（深圳为主席位号）	上海（清算编号）		深圳（主席位号）

附件 2：资产委托人授权联系人名单

致：汇添富基金管理股份有限公司

我司作为资产委托人，特授权以下人员作为授权联系人接收及发送《汇添富-东方证券员工持股计划 1 号单一资产管理计划资产管理合同》下各项委托人与管理人、托管人的联系邮件，接收各项报告。

自然人/机构	指定授权联系人	联系电话	邮箱

委托人：
年 月 日

附件 3 《委托财产到账通知书》（样本）

汇添富-东方证券员工持股计划 1 号单一资产管理计划

委托财产到账通知书

东方证券股份有限公司（代员工持股计划），

汇添富基金管理股份有限公司（资产管理人）：

根据《汇添富-东方证券员工持股计划 1 号单一资产管理计划资产管理合同》的要求，特将委托财产资金到账情况通知如下。

投资者初始委托财产已于 XX 年 XX 月 XX 日划拨至托管/证券账户，本计划已经具备成立的条件。

初始委托财产清单如下：

中国工商银行股份有限公司上海市分行（资产托管人）

XX 年 XX 月 XX 日

回 执

本资产管理人向资产托管人确认已收悉《委托财产到账通知书》，对通知中所列初始委托财产无异议。同时，本资产管理人确认，三方以委托财产划入本计划托管/证券账户后资产管理人书面通知投资者资产管理计划成立之日为本计划的成立日。

汇添富基金管理股份有限公司（资产管理人）

XX 年 XX 月 XX 日

附件 4 《汇添富-东方证券员工持股计划 1 号单一资产管理计划成立通知书》（样本）

汇添富-东方证券员工持股计划 1 号单一资产管理计划成立通知书

东方证券股份有限公司（代员工持股计划）：

并中国工商银行股份有限公司上海市分行（资产托管人）：

我司已确认收到资产托管人关于汇添富-东方证券员工持股计划 1 号单一资产管理计划的到账通知，根据《汇添富-东方证券员工持股计划 1 号单一资产管理计划资产管理合同》的约定，本计划的成立日为委托财产划入本计划托管/证券账户之日后资产管理人书面通知投资者资产管理计划成立之日，即 XX 年 XX 月 XX 日。

特此通知。

汇添富基金管理股份有限公司（资产管理人）

XX 年 XX 月 XX 日

附件 5 资金账户（即“托管账户”）信息

户名：

账号：

开户行：

附件 6 资产委托人指定账户信息

资产委托人指定银行账户信息如下：

户 名：

开户行：

账 号：

附件 7：风险揭示书

汇添富-东方证券员工持股计划 1 号单一资产管理计划风险揭示书

尊敬的委托人：

投资有风险。当您/贵机构认购或追加资产管理计划时，可能获得投资收益，但同时也面临着投资亏损的风险。您/贵机构在做出投资决策之前，请仔细阅读本风险揭示书和资产管理合同，充分认识本计划的风险收益特征和产品特性，认真考虑资产管理计划存在的各项风险因素，并充分考虑自身的风险承受能力，理性判断并谨慎做出投资决策。根据有关法律法规，资产管理人[汇添富基金管理股份有限公司]及投资者分别作出如下承诺、风险揭示及声明：

一、资产管理人声明与承诺

（一）资产管理人向投资者声明，中国证券投资基金业协会（以下简称“证券投资基金业协会”）为资产管理计划办理备案不构成对资产管理人投资能力、持续合规情况的认可；不作为对资产管理计划财产安全的保证。

（二）资产管理人保证在投资者签署资产管理合同前已（或已委托销售机构）向投资者揭示了相关风险；已经了解投资者的风险偏好、风险认知能力和承受能力。

（三）资产管理人承诺按照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理运用资产管理计划财产，不保证资产管理计划财产一定盈利，也不保证最低收益。

二、风险揭示

（一）本计划的一般风险

1、本金损失风险

管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用计划财产，但不保证计划财产本金不受损失，也不保证一定盈利及最低收益。

在发生揭示的风险及其他尚不能预知的风险而导致本计划项下计划财产重大损失的，委托人可能发生委托本金损失的风险。

本计划的风险等级为 R4，属于中等风险投资品种(最低为 R1, 最高为 R5)，适合风险识别、评估、承受能力评级为 C4 -C5 的合格投资者。资产委托人确认具备与本计划相匹配的风险识别能力和风险承受能力。

2、市场风险

证券市场价格受到经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素的影响，导致委托资产收益水平变化，产生风险。其主要包括：

(1) 经济周期风险

随经济运行的周期性变化，证券市场的收益水平也呈周期性变化。委托资产投资于债券和股票，收益水平也会随之变化，从而产生风险。

(2) 政策风险

因国家宏观政策（如货币政策、财政政策、税收政策、行业政策、地区发展政策等）发生变化，导致市场价格波动而产生风险。

(3) 权益风险

本计划投资的股票面临经济周期风险、政策风险、行业风险、上市公司经营风险等，这些都会导致股票价格发生波动，进而影响本计划的投资收益。此外，本计划在投资管理中将维持较高股票投资比例，因此无法完全规避股票市场的下跌风险。投资者须在理性判断的基础上做出投资选择。

(4) 利率风险

金融市场利率的波动会导致证券市场价格和收益率的变动。利率直接影响着债券的价格和收益率，影响着企业的融资成本和利润。委托资产投资于债券和股票，其收益水平会受到利率变化的影响。

(5) 购买力风险

委托资产的利润将主要通过现金形式来分配，而现金可能因为通货膨胀的影响而导致购买力下降，从而使委托资产的实际收益下降。

(6) 上市公司经营风险

上市公司的经营好坏受多种因素影响，如管理能力、财务状况、市场前景、行业竞争、人员素质等，这些都会导致企业的盈利发生变化。如果委托资产所投资的上市公司经营不善，其股票价格可能下跌，或者能够用于分配的利润减少，使委托资产投资收益下降。(7) 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。

(8) 再投资风险

再投资风险反映了利率下降对固定收益证券利息收入再投资收益的影响，这与利率上升所带来的价格风险（即前面所提到的利率风险）互为消长。具体为当利率下降时，委托资

产从投资的固定收益证券所得的利息收入进行再投资时，将获得比之前较少的收益率。

3、管理风险

在委托资产管理运作过程中，资产管理人的研究水平、投资管理水平直接影响委托资产收益水平，如果资产管理人对经济形势和证券市场判断不准确、获取的信息不全、投资操作出现失误，都会影响委托资产的收益水平。

4、流动性风险

委托资产要随时应对资产委托人的提取，如果委托资产不能迅速转变成现金，或者变现时对委托资产净值产生冲击成本，都会影响委托资产运作和收益水平。尤其是在资产委托人大额提取委托资产时，如果委托资产变现能力差，可能会产生委托资产仓位调整的困难，导致流动性风险，从而影响委托资产收益。

5、关联交易及利益冲突的风险

(1) 资产委托人知悉并同意，在不违反监管要求的产品嵌套，不存在规避投资范围、杠杆约束等监管要求的违规行为，符合相关法律法规、投资指引、资产委托人禁限投要求及其他与关联交易相关的规定的前提下，本计划可投资于资产管理人管理的金融产品，可投资于资产管理人或资产管理人的股东、资产托管人或资产托管人的股东、资产委托人或资产委托人的股东等关联方发行或承销的证券，租用资产管理人关联方提供的证券交易单元等，无需取得资产委托人的同意。资产管理人应当建立健全内部审批机制和评估机制，遵循投资者利益优先原则，于事后及时、全面、客观地向资产委托人和资产托管人进行充分披露，并采取切实有效措施，防范利益冲突，保护资产委托人合法权益。

(2) 资产委托人应事前就其关联方、关联证券或其他禁止交易证券明确告知资产管理人。资产委托人未能事前就其关联证券或其他禁止交易证券明确告知资产管理人致使委托财产发生违规投资行为的，资产管理人、资产托管人不承担任何责任。

(3) 资产委托人知悉，尽管资产管理人承诺谨慎勤勉地管理委托财产、公平对待各投资组合，本计划在投资和运作过程中可能存在一些利益冲突情形，包括但不限于：资产管理人、资产托管人开展不同业务类型可能产生的利益冲突；资产管理人管理的其他资管产品（包括本计划投资经理管理的其他资管产品）基于各自投资策略需要可能与本计划存在相同、相似或相反的投资交易行为，或者在买卖同一只证券的时间上存在先后；其他可能产生利益冲突的情况等。

此外，资产管理人可以在遵循法律法规和相关原则的前提下运用固有资金进行证券投资，该等投资也可能与本计划存在相同、相似或相反的投资交易行为，或者在买卖同一只证

券的时间上存在先后，不排除可能影响或限制本计划的投资运作。

6、操作风险

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。

在计划的各种交易行为或者后台运作中，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投资者的利益受到影响。这种技术风险可能来自基金管理公司、注册登记机构、销售机构、证券交易所、证券注册登记机构等。

7、税收风险

财政部、国家税务总局财政[2016]140 号《关于明确金融房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》第四条规定：“资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。”鉴于资产管理计划合同中资产管理人收取的管理费并不包括资产管理计划运营过程中发生的税款，本资产管理计划运营过程中需要缴纳增值税及其附加税的，将由资产委托人承担并从资产管理计划资产中支付，因此可能增加资产委托人的投资税费成本。

在本资产管理计划存续期间，税收征管部门可能会对增值税等应税行为的认定以及适用的税率等进行调整。届时，资产管理人将执行更新后的政策，可能会因此导致委托财产实际承担的税费发生变化，并可能会影响到资产委托人的收益。

8、交易资金前端风险控制业务风险

本资产管理计划由资产管理人作为交易参与者通过交易单元在证券交易所进行证券交易。根据《证券交易资金前端风险控制业务规则》等有关规定，证券交易所、证券登记机构对交易参与者相关交易单元的全天净买入申报金额总量实施额度管理，并通过交易所对交易参与者实施前端控制。可能存在如下风险：

（1）资产管理人、资产托管人操作失误，合计资产总额发生变动导致最高额度未能及时变更等，存在影响产品正常交易、无法有效进行风险控制等风险。

（2）因不可抗力、意外事件、技术故障或者重大差错等原因导致资金前端控制出现异常，中国结算及沪、深交易所采取最高额度调整、暂停资金前端控制、限制交易单元接入等处置措施，产生业务风险。

（二）资产管理计划面临的特定风险

1、特定投资方法及资产管理计划所投资的特定投资对象可能引起的特定风险

（1）股票投资风险

本计划主要投资于股票等权益类资产，股票面临经济周期风险、政策风险、行业风险、上市公司经营风险等，上述因素都会导致股票价格发生波动，进而影响本计划的投资收益。

（2）债券投资的利率风险及价格波动风险

利率是影响债券价格的重要因素，债券投资面临着由于市场利率波动而导致的债券价格波动风险。此外，信用债信用风险的变化、债券市场流动性不足等其他因素均可能导致债券价格的波动。

（3）本产品可投资于银行协议存款，由于银行协议存款具有固定期限，如资产委托人在存续期内提取委托财产，资产管理人可能需提前支取银行存款（如存款协议中有提前支取条款），此时提前支取部分的资金将按照协议约定的提前支取利率计算利息，该利率可能低于协议约定的到期支取利率，从而影响委托财产的收益。

（4）港股通机制下，港股投资面临的风险

1) 港股价格波动的风险。

港股市场实行当日回转交易机制（即当日买入的股票，在交收前可以于当日卖出），同时对个股不设涨跌幅限制，每日涨跌幅空间相对较大；加之香港金融市场结构性产品和衍生品种类相对丰富以及做空机制的存在；港股股价受到意外事件影响可能表现出比 A 股更为剧烈的价格波动，本资产管理计划持有港股的价格波动风险可能相对较大。

2) 汇率风险。

本资产管理计划将投资港股通标的股票，在交易时间内提交订单依据的港币买入参考汇率和卖出参考汇率，并不等于最终结算汇率。港股通交易日日终，中国证券登记结算有限责任公司进行净额换汇，将换汇成本按成交金额分摊至每笔交易，确定交易实际适用的结算汇率。故本资产管理计划承担港元对人民币汇率波动的风险，以及因汇率大幅波动引起账户透支或资金被额外占用的风险。

3) 港股通交易日风险。

根据现行的港股通规则，只有境内、香港两地均为交易日且能够满足结算安排的交易日才为港股通交易日。因此会存在港股通交易日不连贯的情形（如内地市场因放假等原因休市而香港市场照常交易但非港股通交易日时，香港出现台风、黑色暴雨或者香港联交所规定的其他情形导致停市时，出现交易异常情况交易所可能暂停提供部分或者全部港股通服务的情形时），并使得本资产管理计划所持有的港股在后续港股通交易日开市交易时有可能出现价格波动骤然增大，进而导致本资产管理计划所持有的港股在资产估值上出现波动增大的

风险，进而影响净值出现较大波动。

4) 港股通额度限制带来的风险。

现行的港股通规则，对港股通设有每日额度上限；本资产管理计划可能因为港股通市场每日额度不足，面临不能通过港股通进行买入交易的风险，进而可能错失投资机会。

5) 交收制度带来的流动性风险。

根据港股通在证券交收时点上的交收安排，本资产管理计划在港股通交易日卖出股票，该港股通交易日后第 2 个港股通交易日才能完成清算交收，卖出的资金在该港股通交易日后第 3 个港股通交易日才能回到人民币资金账户。因此交收制度的不同以及港股通交易日的设定原因，本资产管理计划可能面临卖出港股后资金不能及时到账，而造成赎回款支付时间比正常情况延后而给投资人带来流动性风险。

6) 港股通制度下对公司行为的处理规则带来的风险。

根据现行的港股通规则，本资产管理计划因所持港股通股票权益分派、转换、上市公司被收购等情形或者异常情况，所取得的港股通股票以外的香港联交所上市证券，只能通过港股通卖出，但不得买入；因港股通股票权益分派或者转换等情形取得的香港联交所上市股票的认购权利在联交所上市的，可以通过港股通卖出，但不得行权；因港股通股票权益分派、转换或者上市公司被收购等所取得的非联交所上市证券，可以享有相关权益，但不得通过港股通买入或卖出。本资产管理计划存在因上述规则，投资收益得不到最大化甚至受损的风险。

(5) 投资于单一标的的风险

本计划主要投资于东方证券 H 股，存续期内单一证券的投资集中度较高。本计划由于流动性管理的需求，将保证一定比例的流动性管理工具，因此本计划的净值表现将于标的公司存在一定的差异。

同时在锁定期满之后由于提取委托财产，本计划将对计划中的股票进行减持，届时标的的流动性将直接影响组合资产净值的表现。由于股票减持带来的损失由资产委托人承担。

(6) 锁定期风险

本计划所持有的股票存在法定或承诺的锁定期，由于锁定期、休市、停牌、交易限制期等因素导致股票无法变现，委托人可能面临不能如期收回本金和收益的风险。

(7) 份额提取的风险

本计划将设置份额提取机制，即委托人提取委托财产的形式将以份额数量乘以提取日净值的方式来确定最终提取金额。由于遵循未知价原则，实际提取的金额将与提取确认日的净值挂钩，提取的金额将与提取确认日的委托财产的收益或损失相关。

（8）巨额提取带来的流动性风险

本计划由于投资于单一标的，若发生巨额提取，本计划中的流动性资产不足以支付委托人的提取款项，届时将通过出售标的的股票来满足委托人的提取需求。届时由委托财产提取而导致需要被动卖出标的的公司，将会影响本计划的收益甚至发生亏损，巨额提取产生的风险将由委托人承担。

（9）资产委托人未及时、准确披露相关信息导致本资产管理计划违规交易的风险

资产委托人未及时、准确披露相关信息导致本资产管理计划违规交易，资产委托人承担一切责任，与资产管理人无关。如管理人因执行该等委托人指令而遭受相关处罚及/或损失的，资产委托人有义务协助管理人为消除监管处罚而配合监管部门调查并负责提供相关证据资料，同时赔偿管理人因此遭受的一切损失。

2、不能完成备案的风险

本计划成立后需在基金业协会进行备案，在完成基金业协会备案前不得开展投资活动。因此，即使本计划成立，并不意味着本计划必然能获得基金业协会的备案。而该等备案过程可能会受到相应监管政策的影响，包括备案时间所需时间、能否通过备案都存在一定的不确定性。

如果在计划成立后不能及时完成备案，将可能导致本计划错过市场行情或投资机会；如果本计划在成立后无法获得基金业协会的备案，则将直接影响本计划设立目的的实现。当出现无法通过基金业协会备案的情形，资产管理人将有权决定提前终止本计划，由此直接影响资产委托人参与本计划的投资目的。

3、资产管理合同与证券投资基金业协会合同指引不一致所涉风险；

本资产管理合同虽然已在能够满足本计划投资需要的前提下涵盖了合同指引明确要求的条款，但合同指引主要为概括性、原则性约定，因此本资产管理合同具体条款的约定不可避免的比合同指引更为复杂、更为具体，也不可避免地与合同指引不完全相同。

投资人应当认真阅读本资产管理合同，理解本资产管理合同的全部条款，独立做出是否签署本资产管理合同的决定。

（三）其他风险

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

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

三、投资者声明

作为本计划的投资者，本人/机构已充分了解并谨慎评估自身风险承受能力，自愿自行承担投资该计划所面临的风险。本人/机构做出以下陈述和声明，并确认（机构投资者在本页、尾页盖章，加盖骑缝章）其内容的真实和正确：

1、本人/机构已仔细阅读资产管理业务相关法律文件和其他文件，充分理解相关权利、义务、本计划运作方式及风险收益特征，愿意承担由上述风险引致的全部后果。【_____】

2、本人/机构知晓，资产管理人、销售机构、资产托管人及相关机构不应当对资产管理计划财产的收益状况作出任何承诺或担保。【_____】

3、在购买本资产管理计划前，本人/机构已符合《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》有关合格投资者的要求并已按照管理人或销售机构的要求提供相关证明文件。【_____】

4、本人/机构已认真阅读并完全理解资产管理合同的所有内容，并愿意自行承担购买资产管理计划的法律责任。【_____】

5、本人/机构已认真阅读并完全理解资产管理合同第四章“当事人及权利义务”的所有内容，并愿意自行承担购买资产管理计划的法律责任。【_____】

6、本人/机构已认真阅读并完全理解资产管理合同第十七章“资产管理业务的费用与税收”中的所有内容。【_____】

7、本人/机构已认真阅读并完全理解资产管理合同第二十四章“争议的处理”中的所有内容。【_____】

8、本人/机构已经配合资产管理人或其销售机构提供了法律法规规定的本人/本机构及其受益所有人的信息资料及身份证明文件，以配合上述机构完成投资者适当性管理、非居民金融账户涉税信息尽职调查以及反洗钱等监管规定的工作。本人/机构承诺上述信息资料及身份证明文件真实、准确、完整、有效，并承诺在上述文件和资料发生变更时，及时提交变更后的相关文件与资料。【_____】

9、本人/机构知晓，证券投资基金业协会为资产管理计划办理备案不构成对资产管理人投资能力、持续合规情况的认可；不作为对资产管理计划财产安全的保证。【_____】

10、本人/机构承诺本次投资行为是为本人/机构以其真实身份和自有资金（包括合法

募集的资金)购买(参与)资产管理计划,本人/机构承诺未使用贷款、发行债券等筹集的非自有资金投资本计划。【_____】

11、本人/机构承诺不以非法拆分转让为目的购买资产管理计划,不会突破合格投资者标准,将资产管理计划份额或其收益权进行非法拆分转让。【_____】

12、本机构承诺本次签署并履行本合同均在其权力和营业范围之内,并已采取必要的公司行为进行适当授权,且不违反对其有约束力或有影响的法律、公司章程或合同的限制;并保证其有权将本合同项下委托财产用于资产管理计划、投资本合同项下投资工具;投资范围及各项投资限制的规定并符合相关法律法规、行业要求及其公司内部管理制度。

14、本人/机构知悉本风险揭示书的揭示事项仅为列举性质,未能详尽列明投资者参与资产管理计划所面临的全部风险和可能导致投资者资产损失的所有因素。【_____】

投资者(自然人签字或机构盖章):

日期:

资产管理人(盖章):

日期:

附件 9:《提取委托财产通知书》样本

汇添富基金管理股份有限公司并中国工商银行上海市分行:

根据三方共同签署的《汇添富-东方证券员工持股计划 1 号单一资产管理计划资产管理合同》，本资产委托人将于 年 月 日提取委托财产份额： 份，并转入下列账户：

开户银行：

户名：

账号：

资产委托人:东方证券股份有限公司（代员工持股计划）

（签章）：

年 月 日

附件 10：预留印鉴样本

委托人预留印鉴	东方证券股份有限公司（代员工持股计划） （用章样本）
管理人预留印鉴	汇添富基金管理股份有限公司 （用章样本）
托管人预留印鉴	中国工商银行上海市分行 （用章样本）