

# 千石资本—道 冲 套利 3 号

资产管理计划





## 风险提示函

尊敬的投资者：

当您参与本资产管理计划时，可能获得较高的投资收益，同时也需要承担相应的投资风险，为了使您更好地了解其中的风险，根据有关法律法规，特对相关风险提示如下，请认真阅读。

（一）资产管理计划的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，但不保证一定盈利，也不保证最低收益。

（二）投资者在参与本计划之前，请仔细阅读资产管理合同，全面认识本资产管理计划的风险收益特征和产品特性，并充分考虑自身的风险承受能力和风险偏好，理性判断市场，谨慎做出投资决策。

（三）本资产管理计划存在市场风险、信用风险、流动性风险、操作风险、计划特定风险及不可抗力风险等（详见正文“风险揭示”章节），从而可能对计划财产和收益产生影响。尽管资产管理人已依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用计划财产，仍有出现高于过往最高损失的可能性。投资者应在充分了解上述风险并确认自身可以承担上述风险的前提下参与本计划。

（四）本资产管理计划通过对本计划委托财产收益分配的安排，将计划份额分成预期收益与风险不同的三个级别，即优先级计划份额、中间级计划份额、进取级计划份额。在本合同终止时，如本计划全部计划财产无法补足优先级的本金及预期收益，则进取级和中间级对差额部分不再进行补偿，故优先级份额可能面临本金损失的风险。当进取级份额不足以补足优先级份额本金及预期收益时，中间级份额需要以其份额所属财产为限补足优先级份额的本金及预期收益，故中间级份额较优先级承担更大的风险。当本计划面临损失时，将首先由进取级份额委托人的本金进行补充，故进取级份额在本计划中承担最大的风险。

（五）委托人签署本合同即表明其已认可和同意管理人聘请福建道冲投资管理有限公司作为本资产管理计划的投资顾问，并同意授权投资顾问按约定的方式为管理人管理运用计划财产提供投资顾问服务。委托人认可该投资顾问提供的投资建议，并承诺接受因资产管理人采纳该投资建议所带来的任何收益或损失。若因投资顾问违反法规或相关约定，资产管理人有权决定解聘投资顾问，在此情形下，资产管理人有权决定终止该资产管理计划。

(六) 委托人签署本合同即表明其已知晓和认可管理人委托国金道富投资服务有限公司担任本资产管理计划的行政服务机构,并同意行政服务机构按照约定的方式为管理人管理运作计划财产提供资产估值等服务。若因行政服务机构违反法规或相关约定,资产管理人有权决定解聘行政服务机构。

(七) 参与资产管理计划需要按照合同规定支付相关费用。

(八) 资产计划管理人按照法律法规和合同的规定提供标准化服务,不提供投资咨询等个性化服务。

(九) 资产计划管理人在法律法规和合同规定的范围内履行义务。

(十) 资产管理人管理的投资产品的过往业绩并不预示其未来表现。

投资存在风险。投资者在选择投资产品时存在盈利的可能,也存在亏损的风险。本风险提示并不能揭示从事投资的全部风险及反映市场的全部情形。投资者在投资本计划前,应对所有相关风险有充分的了解与认识,认真考虑是否投资本计划。

本人/本单位已经阅读风险提示并完全理解上述内容,充分了解并自愿承担本资产管理计划的风险。

投资者签章:

## 目 录

一、前言 .....	1
二、释义 .....	1
三、声明与承诺 .....	4
四、资产管理计划的基本情况 .....	4
五、计划份额的分级 .....	5
六、资产管理计划份额的初始销售 .....	8
七、资产管理计划的备案 .....	9
八、资产管理计划的参与和退出 .....	10
九、当事人及权利义务 .....	14
十、资产管理计划份额的登记 .....	19
十一、资产管理计划的投资 .....	19
十二、投资经理的指定与变更 .....	22
十三、资产管理计划的财产 .....	23
十四、投资指令的发送、确认与执行 .....	26
十五、交易及清算交收安排 .....	28
十六、越权交易的界定 .....	29
十七、资产管理计划财产的估值和会计核算 .....	31
十八、资产管理计划的费用与税收 .....	34
十九、资产管理计划的收益分配 .....	36
二十、报告义务 .....	37
二十一、风险揭示 .....	38
二十二、资产管理合同的变更、终止与财产清算 .....	42
二十三、违约责任 .....	45
二十四、争议的处理 .....	46
二十五、资产管理合同的效力 .....	46
二十六、其他事项 .....	46

## 一、前言

### (一) 订立本资产管理合同的目的、依据和原则

1、订立本资产管理合同的目的是明确资产管理合同当事人的权利义务，规范千石资本-道冲套利3号资产管理计划(以下简称“资产管理计划”或“本计划”)的运作，保护各方当事人的合法权益，确保资产管理计划财产的安全。

2、订立本资产管理合同的依据是《中华人民共和国合同法》(以下简称“《合同法》”)、《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《基金管理公司特定客户资产管理业务试点办法》(以下简称“《试点办法》”)、《基金管理公司特定多个客户资产管理合同内容与格式准则》(以下简称“《准则》”)和其他有关法律法规。若因法律法规的制定或修改导致本合同的内容存在与届时有效的法律法规的规定不一致之处，应当以届时有效的法律法规的规定为准，各方当事人应及时就本合同做出相应的变更和调整。

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

(二) 资产管理合同是规定资产管理合同当事人之间权利义务关系的基本法律文件，其他与资产管理计划相关的涉及资产管理合同当事人之间权利义务关系的任何文件或表述，如与本资产管理合同不一致或有冲突，均以本资产管理合同为准。资产管理合同的当事人包括资产委托人、资产管理人和资产托管人。资产委托人自签订资产管理合同即成为资产管理合同的当事人。自其不再持有本资产管理计划份额之日起，资产委托人不再成为资产管理计划的投资人和资产管理合同的当事人。

中国证监会接受本合同的备案并不表明对资产管理计划的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于资产管理计划没有风险。

## 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(若释义与合同正文内容不一致，以合同正文内容为准)：

- |           |  |
|-----------|--|
| 1、资产委托人   | 指委托资产管理人投资管理其委托财产的机构或个人。<br>委托人为初始委托财产不低于100万元人民币(不含费用)，且能够识别、判断和承担相应投资风险的自然、法人、依法成立的组织或中国证监会认可的其他特定客户 |
| 2、资产管理人   | 指受资产委托人委托，负责为资产委托人的利益，运用计划财产进行证券投资的专业机构。本合同中即指北京千石创富资本管理有限公司   |
| 3、资产托管人   | 指负责保管计划财产的商业银行。本合同中即指中国光大银行股份有限公司  |
| 4、本资产管理合同 | 指资产委托人、资产管理人及资产托管人三方签署的《千  |

- 石资本-道冲套利3号资产管理计划资产管理合同》及其附件，以及该三方对本合同及其附件做出的任何有效变更
- 5、本合同当事人 指受本合同约束，根据本合同享受权利并承担义务的资产委托人、资产管理人和资产托管人
- 6、委托财产 指委托人拥有合法所有权或处分权、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及其投资运作产生的收益
- 7、计划、本计划或本资产管理计划 指千石资本-道冲套利3号资产管理计划
- 8、合同生效日 指本计划初始销售期结束并完成验资、在中国证监会办理完毕备案之日。证监会的书面确认日即为合同生效日。资产管理合同自合同生效日起生效
- 9、《试点办法》 指《基金管理公司特定客户资产管理业务试点办法》
- 10、中国证监会 指中国证券监督管理委员会
- 11、工作日 指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日
- 12、估值日 委托资产的估值日为每个工作日或本合同以及中国证监会规定的其它日期
- 13、销售机构 指取得基金销售业务资格并与资产管理人签订了特定多个客户资产管理计划销售服务协议，办理本计划销售业务的机构。本合同的销售机构是指国金通用基金管理有限公司（资产管理人股东）、中信建投证券股份有限公司
- 14、注册登记业务 指本计划登记、存管、清算和交收业务，具体内容包括资产委托人计划相关账户的建立和管理、份额注册登记、交易的确认、清算和结算、代理发放红利、建立并保管份额持有人名册等
- 15、注册登记机构 指办理注册登记业务的机构，本资产管理计划的注册登记机构指国金通用基金管理有限公司（资产管理人股东）
- 16、投资顾问 指福建道冲投资管理有限公司
- 17、行政服务机构 指接受资产管理人委托，根据其与资产管理人签订的委托服务协议，为本计划提供资产估值等服务的机构，本计划的行政服务机构为国金道富投资服务有限公司（资产管理人的关联方）。
- 18、资产委托人专户账户 指注册登记机构为资产委托人开立的、记录其持有的、资产管理人所管理的计划份额余额及其变动情况的账户
- 19、资产委托人交易账户 指销售机构为资产委托人开立的、记录资产委托人通过该销售机构买卖本计划的计划份额变动及结余情况的账户

- 20、指定的清算账户 指以资产委托人名义开立的，用于归集资产委托人退出本资产管理计划资金的账户
- 21、存续期 指本计划的存续期，即自本合同生效日起的 5 年
- 22、初始销售期认购 资产委托人在本计划的初始销售期内申请认购本计划的行为
- 23、违约退出 指资产委托人在非合同约定的退出开放日主动退出资产管理计划的行为。
- 24、计划财产总值 指计划财产所拥有的各类证券及票据、银行存款本息以及其他资产的价值总和
- 25、计划资产净值 指计划财产总值扣除负债后的净资产值
- 26、计划财产估值 指计算评估计划财产和负债的价值，以确定计划资产净值的过程
- 27、计划财产专用账户 包括计划财产专用银行账户、专用证券账户及专用场外交易账户等计划财产进行投资、托管所需开立的相关账户
- 28、计划财产专用银行账户 指资产托管人根据有关规定为资产管理计划财产开立的，专门用于资金收付、清算交收的专用银行账户，即托管账户
- 29、计划财产专用证券账户 指资产托管人为计划财产开立的至少包含计划名称的股东账户
- 30、中国 就本合同而言，指中华人民共和国，但不包括香港特别行政区、澳门特别行政区及台湾地区
- 31、日 指公历日
- 32、月 指公历月
- 33、元 指人民币元
- 34、法律法规 指中国现时有效并公布实施的适用于特定客户资产管理业务的法律、行政法规、部门规章及规范性文件、地方性法规、地方政府规章及规范性文件
- 35、不可抗力 指本合同当事人不能预见、不能避免、不能克服，且在本合同生效之日后发生的，使本合同当事人无法全部履行或无法部分履行本合同的任何事件和因素，包括但不限于洪水、地震及其他自然灾害、战争、骚乱、火灾、政府征用、没收、恐怖袭击、传染病传播、法律法规变化、突发停电或其他突发事件、证券交易所或证券登记结算机构非正常暂停或停止交易或发送数据存在延误、错漏
- 36、计划份额的分级 指本计划通过计划收益分配的安排，将计划份额分成预期收益与风险不同的三个级别，即优先级份额(优先级)、



中间级份额（中间级）、进取级份额（进取级）

37、计划份额参考净值 指在计划份额净值计算的基础上，采用“虚拟清算”原则计算得到的本计划三级计划份额估计价值。计划份额参考净值是对三级计划份额价值的一个估计，并不代表计划份额持有人可获得的实际价值

### 三、声明与承诺

（一）资产委托人声明委托财产为其拥有合法处分权的资产，保证委托财产的来源及用途符合国家有关规定，保证有完全及合法的授权委托资产管理人和资产托管人进行委托财产的投资管理和托管业务，保证没有任何其他限制性条件妨碍资产管理人和资产托管人对该委托财产行使相关权利且该权利不会为任何其他第三方所质疑；资产委托人声明已充分理解本合同全文，了解相关权利、义务，了解法律法规及所投资资产管理计划的风险收益特征，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；资产委托人承诺其向资产管理人或销售机构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或销售机构。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。

（二）资产管理人保证已获得特定资产管理业务资格。资产管理人保证已在签订本合同前充分地向资产委托人说明了有关法律法规和相关投资工具的运作市场及方式，同时揭示了相关风险；已经了解资产委托人的风险偏好、风险认知能力和承受能力，对资产委托人的财务状况进行了充分评估。资产管理人承诺按照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用资产管理计划资产，但不保证资产管理计划一定盈利，也不保证最低收益。

（三）资产托管人承诺按照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则安全保管资产管理计划资产，并履行本合同约定的其他义务。

### 四、资产管理计划的基本情况

（一）资产管理计划的名称

千石资本-道冲套利3号资产管理计划

（二）资产管理计划的类型

混合、分级型

（三）资产管理计划的运作方式

有条件开放参与与退出

（四）资产管理计划的投资目标

本资产管理计划力求在有效控制投资风险的基础上，追求资产的稳健增值。

（五）资产管理计划的存续期限

本资产管理计划的存续期限为自资产管理合同生效之日起5年。经资产委托人、管理人及托管人协商一致后，可展期。

(六) 资产管理计划的最低资产要求

本资产管理计划成立时委托财产的初始资产净值不得低于 3000 万元人民币，但至多不得超过 50 亿人民币。单个资产委托人的初始资产管理计划资产不得低于 100 万元人民币。

(七) 资产管理计划份额初始面值

人民币1.000元。

(八) 资产管理计划份额的分级

本资产管理计划通过本计划委托财产收益分配的安排，将计划份额分成预期收益与风险不同的三个级别，即优先级计划份额（计划份额简称“优先级”）、中间级计划份额（计划份额简称“中间级”）、进取级计划份额（计划份额简称“进取级”）。有关本计划份额分级的规定详见本合同第五节。本资产管理计划的优先级计划份额设定为均等份额，每份优先级具有同等的合法权益；本资产管理计划的中间级计划份额设定为均等份额，每份中间级具有同等的合法权益；本资产管理计划的进取级计划份额设定为均等份额，每份进取级具有同等的合法权益。

(九) 三级份额的配比要求

优先级、中间级、进取级的认购确认份额数初始配比原则上为 17.5:1.5:1。

(十) 资产管理计划的投资顾问

资产管理人接受资产委托人委托为本计划聘请投资顾问。本资产管理计划的投资顾问为福建道冲投资管理有限公司。

无论本合同其它条款如何约定，为履行投资顾问业务之目的，资产管理人可以向投资顾问披露本合同及/或其它相关文件，但应促使投资顾问对所获信息保密。

资产管理人有权选择、聘任、更换、解聘投资顾问。投资顾问更换或解聘的，资产管理人将通过其网站进行公告。若投资顾问违反法律法规规定及本产品相关法律文件的约定，资产管理人有权解聘投资顾问；资产管理人解聘投资顾问时，有权决定是否终止本资产管理计划。

## 五、计划份额的分级

(一) 概要

本资产管理计划通过对本计划委托财产收益分配的安排，将计划份额分成预期收益与风险不同的三个级别，即优先级计划份额（计划份额简称为“优先级”）、中间级计划份额（计划份额简称为“中间级”）、进取级计划份额（计划份额简称为“进取级”）。优先级、中间级、进取级分别募集并按照合同约定的比例进行初始配比，所募集的三级份额的委托资产合并运作。

在合同终止，完成本资产管理计划委托财产清算并扣除清算费用、交纳所欠税款及清偿计划债务后的全部清算后资产，优先分配优先级的本金和约定应得收

益，即优先级为低风险且预期收益相对稳定的计划份额。本资产管理计划优先分配优先级的本金和约定应得收益，其次分配中间级的本金和约定应得收益，最后的剩余清算净资产，全部分配给进取级份额。

## （二）资产收益分配规则

在合同存续期内本资产管理计划每三个月进行收益分配。

在每个开放日（或到期终止日和提前终止日），优先级、中间级、进取级的资产及收益的分配规则如下：

1、优先级预期年收益率为 6.0%，其对应收益（称之为“预期收益”）分配金额以计划份额初始面值为基准进行计算，则预期收益具体计算公式如下：

优先级预期收益=优先级计划份额的初始面值 $\times$ 6.0% $\times$ T/365。

其中：T为资产委托人收益分配基准日所持有份额的持有天数，T=成立日或上一收益分配基准日后一日至本期收益分配基准日。

优先级收益每日计提，每个开放日支付已计提至收益分配基准日且未支付的收益。

2、中间级预期年收益率为 7.0%，其对应收益（称之为“预期收益”）分配金额以计划份额初始面值为基准进行计算，则预期收益具体计算公式如下：

中间级预期收益=中间级计划份额的初始面值 $\times$ 7.0% $\times$ T/365。

其中：T为资产委托人收益分配基准日所持有份额的持有天数，T=成立日或上一收益分配基准日后一日至本期收益分配基准日。

每个开放日支付至收益分配基准日应支付且未支付的收益。

如果，该计划全部清算后资产等于或小于优先级的本金和预期收益，则将该计划全部清算后资产按优先级的份额比例全部分配给优先级持有者。中间级、进取级所得为零，也不再承担优先级的损失。

如果，该计划全部清算后资产大于优先级的本金和预期收益且小于中间级的本金和预期收益，则将该计划全部清算后资产，分配优先级的本金及预期收益之后的剩余净资产等比例分配给中间级份额持有人，进取级所得为零，也不再承担中间级的损失。

如果，该计划全部清算后资产大于优先级的本金和预期收益与中间级的本金和预期收益之和，则将该计划全部清算后资产，首先分配优先级的本金及预期收益，其次分配给中间级的本金及预期收益，最后全部分配给进取级份额。

3、本资产管理计划在扣除本合同约定的其他费用后，优先分配优先级的本金和预期收益，其次分配中间级的本金和约定应得收益，最后的剩余清算净资产，全部分配给进取级份额。

## （三）计划份额的配比

本资产管理计划优先级、中间级、进取级的初始认购份额配比原则上为 17.5:1.5:1。资产管理人有权根据本计划的实际初始销售情况，将优先级、中间级、进取级的份额初始配比不高于 17.5:1.5:1。合同生效后，资产管理人将三类份额的最终配比通知资产委托人，份额配比数值保留至小数点后 2 位，小数点后

第 3 位四舍五入。

(四) 预警止损机制

见本合同资产管理计划的投资部分。

(五) 优先级的本金及预期收益优先获取机制

优先级份额的收益按优先级计划份额的初始面值的 6.0% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = 1.000 \times 6.0\% \times Fa$$

$$h = 1.000 \times 6.0\% \div 365 \times Fa$$

H 为优先级份额预期提取的年化预期收益

h 为每日应计提的优先级份额收益

Fa 为优先级计划份额余额

优先级份额的收益按日计提，会计上作为负债项列示。

(六) 计划份额参考净值的计算

资产管理人在计划份额净值计算的基础上，采用“虚拟清算”原则，计算三级计划份额参考净值。计划份额参考净值是对三级计划份额价值的一个估计，并不代表计划份额持有人可获得的实际价值。

设 T 日为分级运作期内的计划份额净值计算日，Tn 为上一开放日（合同生效未满 3 个月的，上一开放日指合同生效日当日）至 T 日的运作天数，NVT 为 T 日收市后的计划资产净值，Fa 为 T 日优先级份额的份额余额，Fb 为 T 日中间级份额的份额余额，Fc 为 T 日进取级份额的份额余额，NAV<sub>aT</sub> 为 T 日优先级份额的份额净值，NAV<sub>bT</sub> 为 T 日中间级份额的份额净值，NAV<sub>cT</sub> 为 T 日进取型份额的份额净值，Ra（Ra=6%）为优先级份额的基准年收益率，Rb（Rb=7%）为中间级份额的基准年收益率，Y 为运作当年实际天数。

优先级份额、中间级份额与进取级份额参考净值计算公式包括以下三种情况：

(1) 当  $NVT < Fa \times 1.0000$  时，则优先级份额、中间级份额、进取级份额在运作期内第 T 日份额净值为：

$$NAV_{aT} = NVT / Fa;$$

$$NAV_{bT} = 0;$$

$$NAV_{cT} = 0;$$

(2) 当  $Fa \times 1.0000 \leq NVT < Fa \times 1.000 + Fb \times 1.0000 \times (1 + Rb \times Tn / Y)$  时，则优先级份额、中间级份额、进取级份额在运作期内第 T 日份额净值为：

$$NAV_{aT} = 1.0000;$$

$$NAV_{bT} = (NVT - NAV_{aT} \times Fa) / Fb;$$

$$NAV_{cT} = 0;$$

(3) 当  $NVT \geq Fa \times 1.0000 + Fb \times 1.0000 \times (1 + Rb \times Tn / Y)$  时，则优先级份额、中间级份额、进取级份额在运作期内第 T 日份额净值为：

$$NAV_{aT} = 1.0000;$$

$$NAV_{bT} = 1.0000 \times (1 + Rb \times Tn / Y);$$

$$NAVcT = (NVT - Fa \times NAVaT - Fb \times NAVbT) / Fc;$$

上述三类份额净值的计算，均保留到小数点后4位，小数点后第5位四舍五入。本合同终止（或提前终止）后，委托人资产的清算和分配以财产清算通知为准。

计算NAVcT的过程中，NAVaT、NAVbT小数点后位数全部保留。

## 六、资产管理计划份额的初始销售

### （一）资产管理计划份额的初始销售期间

初始销售期间自计划份额发售之日起原则上不超过1个月，资产管理人可与销售机构协商后提前终止初始销售，并在资产管理人和销售机构网站及时公告，即视为履行完毕提前终止初始销售的程序。资产管理人发布公告提前结束初始销售的，本资产管理计划自公告之时起不再接受认购申请。

### （二）销售方式

本资产管理计划销售机构为国金通用基金管理有限公司（资产管理人股东）、中信建投证券股份有限公司。具体地点、联系方式等请见本计划《投资说明书》。

本资产管理计划三级份额将先后分别进行初始销售。在初始销售期间，先行销售中间级份额、进取级份额；中间级份额、进取级份额销售结束后，再进行优先级份额的销售。三级份额各自具体的销售起始日和结束日以资产管理人网站公告为准。

具体销售机构名单、联系方式以本资产管理计划的《投资说明书》为准。

### （三）销售对象

委托投资单个资产管理计划初始金额不低于100万元人民币（不含认购费用），且能够识别、判断和承担相应投资风险的自然、法人、依法成立的组织或中国证监会认可的其他特定客户。

### （四）资产管理计划份额的认购和持有限额

本资产管理计划采取全额缴款认购的方式。单个委托人在初始销售期间的认购金额不得低于100万元人民币（不含认购费用），并可多次认购。追加委托投资金额单笔最低限额为人民币1万元，资产委托人可多次追加委托投资金额，对单一资产委托人在初始销售期累计委托投资金额不设上限。

### （五）资产管理计划份额的认购费用

本资产管理计划不收取认购费用。

### （六）初始销售期间的认购程序

1、资产管理人委托销售机构进行销售的，由销售机构完成对投资者的尽职调查工作，并将相关资料提供给资产管理人。

2、认购程序。资产委托人办理认购业务时应提交的文件和办理手续、办理时间、处理规则等在遵守本合同规定的前提下，以销售机构的具体规定为准。

3、认购申请的确认。认购申请受理完成后，投资者不得撤销。销售网点受理认购申请并不表示对该申请是否成功的确认，而仅代表销售网点确实收到了认

购申请。如认购优先级、中间级、进取级份额的人数总和超过200人或者优先级、中间级、进取级份额所占比例不满足合同约定，则按照先确认进取级、再确认中间级，后优先级份额按照时间优先、金额优先的原则进行确认，确保本合同生效时本资产管理计划优先级份额、中间级份额、进取级份额之和的初始认购份额配比符合第五章“计划份额的分级”中份额配比的条件。

认购申请采取时间优先、金额优先原则进行确认。按照以上原则，对于排序在前的资产委托人的有效认购申请全额予以确认，其余资产委托人的认购资金予以返还。申请是否有效应以注册登记机构的确认并且资产管理合同生效为准。投资者应在本合同生效后到各销售网点查询最终确认情况和有效认购份额。

为确保资产管理计划中优先级份额、中间级、进取级份额的初始配比近似17.5:1.5:1或因委托人数量控制因素，资产管理人有权根据份额发售的金额、委托人数等状况提前终止某一类或两类份额的发售。

(七) 资产管理人、销售机构应当在具备基金销售业务资格的商业银行或者从事客户交易结算资金存管的指定商业银行，或者中国证券登记结算有限责任公司开立资产管理计划销售结算专用账户。

资产管理人应当将资产管理计划初始销售期间客户的资金存入专门账户，在资产管理计划初始销售行为结束前，任何机构或个人不得动用。

(八) 资产管理计划初始销售资金利息的处理方式

初始销售期间产生的利息在资产管理合同生效后折算为资产管理计划份额归委托人所有，其中利息转份额的具体数额以注册登记机构的记录为准。

## 七、资产管理计划的备案

(一) 资产管理计划备案的条件

本计划初始销售期限届满，客户委托的初始资产合计不低于人民币3000万元、委托人数不少于2人不超过200人时，本计划即符合备案的条件。

(二) 资产管理计划的备案

初始销售期限届满，符合资产管理计划备案条件的，资产管理人应当自初始销售期限届满之日起10日内聘请法定验资机构验资，自收到验资报告之日起10日内，向中国证监会提交验资报告及客户资料表，办理相关备案手续。客户资料表应包括委托人名称、委托人身份证明文件号码、通讯地址、联系电话、参与资产管理计划的金额和其他信息。

(三) 资产管理合同的生效

自中国证监会书面确认之日起，资产管理计划备案手续办理完毕，资产管理合同生效。资产委托人的认购款项（不含认购费用）加计其在初始销售期形成的利息将折算为资产管理计划份额归资产委托人所有，其中利息转份额的具体数额以注册登记机构的记录为准。

(四) 资产管理计划不能满足备案条件的处理方式

资产管理计划初始销售期限届满，本计划不具备备案条件的，资产管理人应

以其固有财产承担因初始销售行为而产生的债务和费用,在计划初始销售期届满后30日内由资产管理人返还客户已缴纳的认购款项,并加计银行同期存款利息。资产管理人、资产托管人及销售机构不得请求报酬。资产管理人、资产托管人和销售机构为计划初始销售支付之一切费用应由各方各自承担。

## 八、资产管理计划的参与和退出

### (一) 参与和退出场所

本资产管理计划参与和退出场所为资产管理人直销机构的营业场所,或按销售机构提供的其他方式办理参与和退出。本计划销售机构为国金通用基金管理有限公司(资产管理人股东)、中信建投证券股份有限公司。

### (二) 参与和退出的开放日和时间

1、除资产管理合同另有约定外,本资产管理计划存续内每满3个月开放一次份额的参与和退出。

2、开放日为本计划成立日起每届满3个月的对应日(T日),如遇非工作日则顺延。开放日,资产委托人于T日提交参与申请后,资产管理人于T+2日进行份额确认,资产委托人可于T+3日后在办理参与的网点查询参与确认情况。资产管理人对申请的份额进行确认后需保证优先级、中间级、进取级委托人持有的份额配比不高于17.5:1.5:1。

3、除资产管理合同另有约定外,本资产管理计划在存续期内除开放日外不接受计划份额的参与,也不接受违约退出。

4、申请退出的委托人必须在开放日T-30日至T-20日的工作日之间向销售机构及其销售网点提交资产管理计划退出申请,未提交申请书的,销售机构及其销售网点有权拒绝受理委托人的退出申请。

5、申请参与的委托人必须在开放日T-20日至T-1日的工作日之间向销售机构及其销售网点提交资产管理计划参与申请,未提交申请书的,销售机构及其销售网点有权拒绝受理委托人的参与申请。

5、每个开放日,管理人和进取级、中间级委托人需要配合优先级委托人做好参与和退出的工作,如果优先级委托人无法顺利参与和退出,则本计划提前终止。

存续期间,资产管理人有权调整开放日以及委托人必须提交申请书的时间。资产管理人提前3个工作日在资产管理人网站公告或委托人认可的其他形式告知前述调整事项即视为履行了告知义务。

若中国证监会会有新的规定,或出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更或其他特殊情况,资产管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整并告知资产委托人。资产管理人网站上发布公告即视为履行了告知义务。

### (三) 参与和退出的方式、价格及程序等

1、“未知价”原则,即资产管理计划的优先级参与和退出价格以开放日当日的优先级份额净值为基准进行计算,资产管理计划的中间级参与和退出价格以

开放日当日的中间级份额净值为基准进行计算,资产管理计划的进取级参与和退出价格以开放日当日的进取级份额净值为基准进行计算。

2、资产管理计划委托人参与和退出的方式,即参与以金额申请,退出以份额申请。

3、委托人办理参与、退出等业务时应提交的文件和办理手续、办理时间、处理规则等在遵守本合同规定的前提下,以各销售机构的具体规定为准。

4、当日的份额参与和退出申请可以在当日开放时间结束前撤销,在当日的开放时间结束后不得撤销。

5、份额参与和退出申请的确认。销售机构受理参与或退出申请并不表示对该申请是否成功的确认,而仅代表销售机构确实收到了参与或退出申请。申请是否有效应以注册登记机构的确认为准。注册登记机构应在法律法规规定的时限内对资产委托人参与、退出申请的有效性进行确认。客户可在销售机构办理业务后的第 3 个工作日至各销售网点查询最终确认情况。

如将开放当日全部有效参与申请确认后,投资者总人数不超过 200 人,则注册登记机构对参与申请全部予以确认。如将开放当日全部有效参与申请确认后,投资者总人数超过 200 人,则注册登记机构按照时间优先、金额优先的原则确认参与申请,确保本资产管理计划委托人数不超过 200 人,对未予确认的参与资金予以返还。

若开放期末,优先级、中间级、进取级的份额配比在约定范围之外时,资产管理人将采用先确认进取级份额后,根据确认的进取级份额确认中间级和优先级份额,以保证份额配比在约定范围之内。

委托人退出资产管理计划时,资产管理人按先进先出的原则,份额确认日期在前的计划份额先退出,确认日期在后的计划份额后退出,以确定所适用的退出费率(如有)及业绩报酬。

6、份额参与和退出申请的款项支付。份额参与采用全额交款方式,若资金在规定时间内未全额到账则参与不成功,已交付的委托款项将退回委托人账户。投资者退出申请成交后,资产管理人应按规定向委托人支付退出款项,退出款项在自受理资产委托人有效退出申请之日起不超过 7 个工作日内划往资产委托人银行账户。在发生巨额退出时,退出款项的支付办法按本合同和有关法律法规规定办理。

7、资产管理人在不损害资产委托人权益的情况下可更改上述原则,但最迟应在新的原则实施前 3 个工作日告知资产委托人。资产管理人网站发布公告或委托人认可的其他形式告知即视为履行了告知义务。

#### (四) 参与和退出的金额限制

投资者在资产管理计划存续期开放日购买资产管理份额的,如投资者在提交参与申请时未持有资产管理计划份额,则首次参与金额应不低于 100 万元人民币(不含参与费用),在开放日内追加参与的,每次参与金额应不低于 1 万元人民币(不含参与费用)。



当投资者持有的份额高于100万份时,投资者可以选择全部或部分退出份额;选择部分退出份额的,投资者在退出后持有的份额不得低于100万份。当资产管理人发现投资者申请部分退出资产管理计划将致使其在部分退出申请确认后持有的计划份额低于100万份的,资产管理人有权适当减少该投资者的退出份额,以保证部分退出申请确认后投资者持有的计划份额不低于100万份。

当投资者持有的计划份额低于100万份(含100万份)时,需要退出计划的,投资者必须选择一次性全部退出资产管理计划。

资产管理人可根据市场情况,合理调整对参与金额和退出份额的数量限制,资产管理人进行前述调整必须提前3个工作日告知资产委托人。资产管理人在资产管理人网站公告前述调整事项即视为履行了告知义务。

#### (五) 参与和退出的费用

##### 1、参与费用

本资产管理计划不收取参与费用。

##### 2、退出费用

本资产管理计划不收取退出费用。

3、资产管理人可以在法律法规和本合同规定范围内调低参与费率、退出费率或调整收费方式。如降低费率或调整收费方式,资产管理人应在调整实施前3个工作日告知资产委托人。资产管理人在其公司网站公告前述调整事项即视为履行了告知义务。

#### (六) 拒绝或暂停参与、暂停退出的情形及处理

1、在如下情况下,资产管理人可以拒绝接受投资者的参与申请:

(1) 如接受该申请,将导致本计划资产委托人超过200人。

(2) 如接受该申请,将导致本计划优先级、中间级、进取级委托人份额配比超过17.5:1.5:1。

(3) 根据市场情况,资产管理人无法找到合适的投资品种,或其他可能对资产管理计划业绩产生负面影响,从而损害现有资产管理计划资产委托人的利益的情形。

(4) 如接受该申请,将导致本计划资产总规模超过本合同约定的上限。

(5) 因资产管理计划收益分配、或资产管理计划内某个或某些证券进行权益分派等原因,使资产管理人认为短期内接受参与可能会影响或损害现有资产管理计划资产委托人利益的。

(6) 法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

资产管理人决定拒绝接受某些资产委托人的参与申请时,参与款项将退回资产委托人账户。

2、在如下情况下,资产管理人可以暂停接受投资者的参与申请:

(1) 因不可抗力导致无法受理资产委托人的参与申请。

(2) 证券交易场所交易时间临时停市,导致资产管理人无法计算当日资产管理计划资产净值。

(3) 发生本资产管理计划合同规定的暂停资产管理计划资产估值情况。

(4) 如接受该申请, 将导致本计划优先级、中间级、进取级委托人份额配比超过 17.5: 1.5: 1。

(5) 法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

资产管理人决定暂停接受全部或部分参与申请时, 应当告知资产委托人。在暂停参与的情形消除时, 资产管理人应及时恢复参与业务的办理并告知资产委托人。

3、在如下情况下, 资产管理人可以暂停接受资产委托人的退出申请:

(1) 因不可抗力导致资产管理人无法支付退出款项。

(2) 证券交易场所交易时间临时停市, 导致资产管理人无法计算当日资产管理计划资产净值。

(3) 发生本资产管理计划合同规定的暂停资产管理计划资产估值的情况。

(4) 法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一的, 资产管理人应当及时告知资产委托人。已经注册登记机构确认的退出申请, 资产管理人应当足额支付; 如暂时不能足额支付, 应当按单个退出申请人已被接受的退出申请量占已接受的退出申请总量的比例分配给退出申请人, 其余部分在后续开放日予以支付。

在暂停退出的情况消除时, 资产管理人应及时恢复退出业务的办理并及时告知资产委托人。

4、暂停资产管理计划的参与、退出时, 资产管理人应按规定告知资产委托人。

5、暂停参与或退出期间结束, 资产管理计划重新开放时, 资产管理人应按规定告知资产委托人并报中国证监会备案。

(七) 巨额退出的认定及处理方式

1、巨额退出的认定

单个工作日内, 本资产管理计划需处理的退出申请总份额超过本资产管理计划上一工作日资产管理计划总份额的 10% 时, 即认为本资产管理计划发生了巨额退出。

2、巨额退出的处理方式

出现巨额退出时, 资产管理人可以根据本资产管理计划当时的资产状况决定接受全额退出或部分退出。

(1) 接受全额退出: 当资产管理人认为有能力兑付资产委托人的全部退出申请时, 按正常退出程序执行。对开放日提出的退出申请, 如构成巨额退出的, 应当按照本资产管理合同约定全额接受退出, 但退出款项支付时间可适当延长, 最长不应超过 15 个工作日。

(2) 部分延期退出: 当全额兑付资产委托人的退出申请有困难, 或兑付资产委托人的退出申请进行的资产变现可能使资产管理计划资产净值发生较大波动时, 资产管理人可在该工作日接受部分退出申请, 其余部分的退出申请在后续

工作日予以受理。对于需要部分延期办理的退出申请，除资产委托人在提交退出申请时明确做出不参加顺延下一个工作日退出的表示外，自动转为下一个工作日退出处理，转入下一个工作日的退出申请的退出价格为下一个工作日的资产管理计划份额净值，以此类推，直到全部退出为止，但是若下一个工作日为非退出开放日，则委托人的退出申请在开放期最后一个工作日全部处理，退出价格为该日的资产管理计划份额净值。部分退出导致资产委托人持有的计划份额资产净值低于 100 万元人民币的，资产管理人可按全额退出处理。发生部分延期退出时，资产管理人可以适当延长退出款项的支付时间，但最长不应超过 15 个工作日。

(3) 巨额退出的通知：当发生巨额退出并部分延期退出时，资产管理人应当在 3 个交易日内通知资产委托人，并说明有关处理方法。

#### (八) 非交易过户

1、资产管理人及注册登记机构只受理继承、捐赠、司法强制执行和经注册登记机构认可的其他情况下的非交易过户。其中：“继承”是指资产委托人死亡，其持有的计划份额由其合法的继承人继承；“捐赠”是指资产委托人将其合法持有的计划份额捐赠给福利性质的基金会或社会团体的情形；“司法强制执行”是指司法机构依据生效司法文书将资产委托人持有的计划份额强制划转给其他自然人、法人、社会团体或其他组织的情形。

2、办理非交易过户业务必须提供注册登记机构规定的相关资料。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；申请人按注册登记机构规定的标准缴纳过户费用。

## 九、当事人及权利义务

### (一) 资产委托人

#### 1、资产委托人概况

资产委托人情况见合同签署页的“资产委托人”。

每份计划份额具有同等的合法权益，本合同另有规定的除外。

#### 2、资产委托人的权利

- (1) 分享资产管理计划财产收益；
- (2) 参与分配清算后的剩余资产管理计划财产；
- (3) 按照本合同的约定参与和退出资产管理计划；
- (4) 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；
- (5) 委托资产管理人聘请福建道冲投资管理有限公司作为本资产管理计划的投资顾问，并委托资产管理人代表本资产管理计划与投资顾问签订相关协议；
- (6) 按照本合同约定的时间和方式获得资产管理计划的运作信息资料；
- (7) 国家有关法律法规、监管机构及本合同规定的其他权利。

#### 3、资产委托人的义务

- (1) 遵守本合同，保证以真实身份参与资产管理计划；
- (2) 保证委托资金来源合法，按照本合同约定交纳购买资产管理计划份额的

款项及规定的费用；

(3) 在持有的资产管理计划份额范围内，承担资产管理计划亏损或者终止的有限责任；

(4) 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；

(5) 向资产管理人或其销售机构提供法律法规规定的信息资料及身份证明文件，配合资产管理人履行反洗钱义务；

(6) 确保其资金来源合法，不存在利用本资产管理计划，以实施违反《中华人民共和国证券法》、《上市公司收购管理办法》、《上市公司信息披露管理办法》等法规监管要求的行为；

(7) 确保向资产管理人提供真实有效的信息资料；若其自身或一致行动人合计持股达到上市公司已发行股份的5%等情况发生，则将根据法律法规要求，自行积极履行相关信息披露义务或根据资产管理人要求由管理人代为进行披露；

(8) 不得违反本合同的规定干涉资产管理人的投资行为；

(9) 不得从事任何有损资产管理计划及其他资产委托人、资产管理人管理的其他资产及资产托管人托管的其他资产合法利益的活动；

(10) 保守商业秘密，不得泄露委托财产投资计划、投资意向等；

(11) 按照本合同的规定缴纳资产管理费、托管费、业绩报酬（如有）及资产管理合同约定的费用，并承担因资产管理计划财产运作产生的其他费用；

(12) 接受资产管理人进行的尽职调查，应资产管理人要求提供相关证明文件、资料，并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；

(13) 保证购买资产管理计划份额的款项来源及用途合法；

(14) 承诺对其自身重大过失、故意导致资产管理人受到的行政处罚、民事追偿等损失进行补偿；

(15) 国家有关法律法规、监管机构及本合同规定的其他义务。

## (二) 资产管理人

### 1、资产管理人概况

名称：北京千石创富资本管理有限公司

住所：北京市海淀区西三环北路87号14层4-1406

通信地址：北京市海淀区西三环北路87号国际财经中心D座14层

法定代表人：尹庆军

联系人：韦峰

联系电话：010-88005888，4000-2000-18

传真：010-88005666

### 2、资产管理人的权利

(1) 按照本合同的约定，独立管理和运用资产管理计划财产；

(2) 依照本合同的约定，及时、足额获得资产管理人报酬；

(3) 依照有关规定行使因资产管理计划财产投资于证券所产生的权利；

(4)根据本合同,监督资产托管人,对于资产托管人违反本合同规定的行为,有权暂停支付托管费,直到资产托管人采取相应补救措施;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,或对资产管理计划运作产生重大影响的,应及时采取措施制止,并报告中国证监会;

(5)自行销售或委托有基金销售资格的机构销售资产管理计划,制定和调整有关资产管理计划销售的业务规则,并对销售机构的销售行为进行必要的监督;

(6)自行担任或者委托经中国证监会认定可办理开放式证券投资基金份额登记业务的其他机构担任资产管理计划份额的注册登记机构,并对注册登记机构的代理行为进行必要的监督和检查;

(7)有权对资产委托人进行尽职调查,要求资产委托人提供相关证明文件、资料,并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;

(8)资产管理人接受资产委托人的委托,代表资产管理计划与投资顾问福建道冲投资管理有限公司另行签署相关投资顾问协议(“投资顾问协议”),对相关权利、义务进行约定,包括但不限于下列内容:

①投资顾问的权利

I、按照本合同的约定,及时、足额获得投资顾问费用;

II、国家有关法律法规、监管机构及本合同、投资顾问协议规定的其他权利;

②投资顾问的义务

I、自投资顾问协议及本合同生效之日起,按照诚实信用、勤勉尽责的原则为资产管理计划提供相关服务;

II、在履行投资顾问职责过程中,禁止从事内幕交易、操作市场等违规行为;

III、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外,不得向他人泄露;

IV、不得提供任何有损委托财产及其他当事人利益的投资建议;

V、投资建议不得违反本合同的投资限制及禁止行为;

VI、国家有关法律法规、监管机构及本合同、投资顾问协议规定的其他义务;

(9)资产管理人有权委托国金道富投资服务有限公司作为行政服务机构为本计划提供资产估值等服务,资产管理人与行政服务机构另行签署委托服务协议(以下简称“委托服务协议”),对相关权利、义务进行约定,包括但不限于下列内容:

①行政服务机构的权利

I、按照委托服务协议的规定,及时、足额获取服务报酬;

II、国家有关法律法规、监管机构及本合同、委托服务协议规定的其他权利。

②行政服务机构的义务

I、自委托服务协议及本合同生效之日起,按照诚实信用、勤勉尽责的原则为资产管理计划提供相关资产估值等服务;

II、在提供委托服务过程中,按照资产管理人的安排与资产托管人进行估值

核对、处理估值差错及其他服务；

III、对提供委托服务过程中知晓的本计划资产净值、份额净值等数据及其他保密信息，除法律法规、本合同及其他有关规定另有规定外，不得向他人泄露；

IV、国家有关法律法规、监管机构及本合同、委托服务协议规定的其他义务；

(10) 国家有关法律法规、监管机构及本合同规定的其他权利。

### 3、资产管理人的义务

(1) 办理资产管理计划的备案手续；

(2) 自本合同生效之日起，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用资产管理计划财产；

(3) 以专业化的经营方式管理和运作资产管理计划财产；

(4) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的资产管理计划财产与旗下基金财产、其他委托财产和资产管理人的财产相互独立，对所管理的不同财产分别管理、分别记账，进行投资；

(5) 除依据法律法规、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，不得委托第三人运作资产管理计划财产；

(6) 办理或者委托经中国证监会认定可办理开放式证券投资基金份额登记业务的其他机构代为办理资产管理计划份额的登记事宜；

(7) 以资产管理人的名义，代表资产委托人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；

(8) 依据本合同接受资产委托人和资产托管人的监督；

(9) 按照《试点办法》和本合同的规定，编制并向资产委托人报告资产管理计划财产的投资报告，对报告期内资产管理计划财产的投资运作等情况做出说明；

(10) 按照《试点办法》和本合同的规定，编制特定资产管理业务定期报告，并向中国证监会备案；

(11) 计算并根据本合同的规定向资产委托人报告资产管理计划份额净值；

(12) 进行资产管理计划会计核算；

(13) 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，监管机构另有规定的除外；

(14) 保存资产管理计划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，保存期限不少于15年；

(15) 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；

(16) 国家有关法律法规、监管机构及本合同规定的其他义务。

### (三) 资产托管人

#### 1、资产托管人概况

名称：中国光大银行股份有限公司

住所：北京市西城区太平桥大街25号中国光大中心

法定代表人：唐双宁

联系地址：北京市西城区太平桥大街25号中国光大中心

## 2、资产托管人的权利

(1) 依照本合同的规定，及时、足额获得资产托管费；

(2) 根据相关法律法规及本合同附件一《交易监控合规表》规定，监督及查询资产管理人对资产管理计划财产的投资运作，发现管理人的投资或清算指令违反法律、行政法规、中国证监会的规定或者本合同附件一《交易监控合规表》约定的，有权要求其改正或拒绝执行；对于资产管理人违反本合同附件一《交易监控合规表》规定的行为，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情形，有权报告中国证监会并采取必要措施；

(3) 根据本合同的规定，依法保管资产管理计划财产；

(4) 国家有关法律法规、监管机构及本合同规定的其他权利。

## 3、资产托管人的义务

(1) 根据本合同规定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，负责财产托管事宜；

(3) 对所托管的不同财产分别设置账户，确保委托财产与资产托管人的自有资产以及保管的其他财产相互独立；

(4) 除依据法律法规、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，不得委托第三人托管资产管理计划财产；

(5) 按规定开设和注销资产管理计划的计划财产专用银行账户和专用证券账户；

(6) 与资产管理人或资产管理人委托的行政服务机构核对资产管理计划份额净值；

(7) 复核资产管理人编制的资产管理计划财产的投资报告，并出具书面意见；

(8) 编制资产管理计划的年度托管报告，并向中国证监会备案；

(9) 按照本合同的规定，根据资产管理人或资产管理人委托的行政服务机构的投资指令，及时办理清算、交割事宜；

(10) 按照法律法规及监管机构的有关规定，保存资产管理计划财产管理业务活动有关的合同、协议、交易记录等文件、资料，保存期限不少于15年；

(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) 保守商业秘密。除法律法规、监管规定或应司法、行政等机关要求对外提供，向聘请的审计、法律等外部专业顾问提供或本合同另有规定外，不得向他人泄露；

(13) 按照法律法规及本合同附件一《交易监控合规表》的规定监督资产管理人的投资运作，资产托管人发现投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反本合同附件一《交易监控合规表》约定的，有权拒绝执行，通知资产管理人并报告中国证监会；资产托管人发现依据交易程序已经生效的投资指令违反

法律、行政法规和其他有关规定，或者违反本合同附件一《交易监控合规表》约定的，有权通知资产管理人并报告中国证监会。

(14) 国家有关法律法规、监管机构及本合同规定的其他义务。

## 十、资产管理计划份额的登记

(一) 本资产管理计划份额的注册登记业务指本资产管理计划的登记、存管、清算和交收业务，具体内容包括资产委托人账户管理、份额注册登记、清算及交易确认、收益分配、建立并保管资产管理计划客户资料表等。

(二) 本资产管理计划的注册登记业务由国金通用基金管理有限公司（资产管理人股东）办理。

(三) 注册登记机构的职责

1、建立和保管资产委托人账户资料、交易资料、资产管理计划客户资料表等，并将客户资料表提供给资产管理人。

2、配备足够的专业人员办理本资产管理计划的注册登记业务。

3、严格按照法律法规和本资产管理合同规定的条件办理本资产管理计划的注册登记业务。

4、严格按照法律法规和本资产管理合同规定计算业绩报酬（如有），并提供交易信息和计算过程明细给资产管理人。

5、保管资产管理计划客户资料表及相关的参与和退出等业务记录15年以上。

6、对资产委托人的账户信息负有保密义务，因违反该保密义务对资产委托人、资产管理人、资产托管人或资产管理计划带来的损失，须承担相应的赔偿责任，但司法强制检查及按照法律法规的规定进行披露的情形除外。

7、按照资产管理合同，为资产委托人办理非交易过户等业务，提供资产管理计划收益分配等其他必要的服务。

8、在法律法规允许的范围内，制定和调整注册登记业务的相关规则。

9、法律法规规定及本合同约定的其他职责。

## 十一、资产管理计划的投资

(一) 投资目标

本资产管理计划力求在有效控制投资风险的基础上，追求资产的稳健增值。

(二) 投资范围

本计划允许投资的金融工具包括：

1、权益类金融产品：A股股票、交易所上市的股票型/混合型基金（含交易所上市的封闭式及开放式证券投资基金、LOF、ETF基金）、网上新股申购；

2、固定收益类金融产品：国债、债券逆回购；

3、金融衍生品：股指期货；

4、现金类金融产品：现金、银行存款（包括银行活期存款、银行定期存款和银行协议存款等各类存款）、货币市场基金；



在满足法律法规或监管部门要求的前提下，资产管理人在履行适当程序后，可以相应调整本资产管理计划的投资范围。

### （三）投资策略

本计划聘请福建道冲投资管理有限公司作为投资顾问，投资顾问将主要采取如下投资策略：

充分利用现有投资品种如ETF、股指期货和股票等，采取ETF基金折溢价套利、ETF成份股事件套利、期现套利等策略。根据市场变化，适时捕捉市场利差等套利机会，用对冲套利的方法进行投资管理，形成投资风险可预控、收益可提前锁定、短期操作为主的投资管理创新模式，实现投资产品的保值和增值。

### （四）投资限制

本资产管理计划的投资应遵循以下限制：

1、参与股票发行申购时，所申报的金额不得超过本计划的总资产，所申报的股票数量不得超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

2、投资于一家上市公司所发行的股票，不得超过该上市公司总股本的4.9%，不超过流通股本的10%；

3、按成本计算，投资于一家上市公司所发行的股票，不得超过本计划资产净值的5.0%；按成本计算，投资于中小板或创业板股票的投资总额不得超过计划资产净值的10%；

4、（1）若T日本计划资产净值高于1.02时，本计划的风险敞口不超过计划资产净值的20%；

（2）若T日本计划资产净值不高于1.02时，则T+1日不得持有股指期货合约多头；本计划的风险敞口不超过计划资产净值的10%；现金类资产不低于计划资产净值的20%；

其中，风险敞口指：ABS（权益类金融产品市值+买入期货合约价值-卖出期货合约价值）；

5、不得投资于S、St、\*ST、S\*ST及SST类股票；

6、不得投资于权证，但持有因所持股票所派发的权证除外；

7、不得投资于非公开发行股票、融资融券、债券正回购交易、中小企业私募债；

8、不得投资于封闭期超过本计划存续期限届满日前10个工作日的证券等。

资产管理人应当自资产管理合同生效日起1个月内使该计划的投资比例符合上述约定。

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投资比例的，资产管理人应当在10个工作日内调整完毕。

在满足法律法规和监管部门要求的前提下，管理人在履行适当程序后，可以相应调整本资产管理计划的投资限制。

### （五）投资禁止行为

本资产管理计划财产禁止从事下列行为：

- 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、利用资产管理计划资产为资产管理计划委托人之外的任何第三方谋取不正当利益、进行利益输送；
- 5、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；
- 6、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。

（六）资产委托人或其授权代理人行使资产管理计划财产投资于证券所产生的权利的原则及方法：

- 1、不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司的经营管理；
- 2、有利于资产管理计划财产的安全与增值；

资产管理人按照国家有关法律法规的规定代表资产委托人独立行使股东权利，保护资产委托人的利益。

（七）预警止损机制

为保护全体委托人特别是优先委托人的利益，本计划设置预警线和止损线。

- 1、预警线：本计划单位净值0.990元。

在本计划存续期内任何一个工作日（T日）收盘后，经管理人估算的计划资产单位净值不高于预警线的，资产管理人将不接受投资顾问的买入、开仓、申购、认购类投资建议，且投资顾问应于T+1日13:30前发送卖出、平仓、赎回类投资建议，否则管理人将有权对本计划非现金类资产进行不可逆变现，直至本计划的现金类资产占本计划总资产净值比例不低于70%。

- 2、止损线：本计划单位净值0.980元。

在计划存续期内，当单位净值在任何一个工作日（T日）收盘后，经管理人估算的计划资产单位净值不高于止损线的：

若T+1日13:30以前，进取级委托人足额划拨增强资金至本计划托管账户（以本计划专用银行托管账户是否到账为依据）使计划资产估算净值高于预警线，则本计划正常运作。

若T+1日13:30以前，进取级委托人未足额追加增强资金至本计划托管账户（以本计划专用银行托管账户是否到账为依据）使计划资产估算净值高于预警线，自T+1日13:30起，将不接受投资顾问的买入、开仓、申购、认购类投资建议，且投资顾问应于T+1日13:30前发送卖出、平仓、赎回类投资建议，否则管理人将有权对本计划非现金类资产进行不可逆变现，直至本计划的资产全部变现，变现完毕后本资产管理计划提前结束。

若在计划资产全部变现完成后的5个交易日前，进取级委托人足额划拨增强资金至本计划托管账户（以本计划专用银行托管账户是否到账为依据）使计划资产估算净值大于等于1.000元，则计划继续运作；反之，本计划提前终止。

- 3、追加的增强资金既不改变委托人持有的份额，也不改变本计划的总份额，

会计上作其他收入处理。增强资金应归入本计划财产一并投资运作，并在计划终止时依据合同约定的分配机制进行清算，以弥补优先级本金。

当追加增强资金后，本计划单位净值连续5个交易日在1.000元以上时，增强资金追加人可以向资产管理人要求取回追加的增强资金。增强资金追加人要求取回增强资金的，必须一次性取回，且取回增强资金后的本计划单位净值不能低于1.000元。本计划终止时，若计划单位净值大于1.000元，优先退回多次交付的增强资金，退回追加资金后计划单位净值不低于1.000元。

#### （八）业绩比较基准

本资产管理计划无业绩比较基准。

#### （九）风险收益特征

本资产管理计划为混合型产品，产品的预期收益和预期风险高于货币型资产管理计划、固定收益型资产管理计划，净值波动性可能低于股票型资产管理计划。

#### （十）投资顾问的聘任

资产管理人接受全体资产委托人的委托聘请福建道冲投资管理有限公司作为本计划的投资顾问，由其在资产管理人授权的范围内根据本计划的投资范围、策略及限制为本计划提供投资顾问服务。投资顾问向资产管理人发送投资建议书或投资策略建议，应保证投资建议合法合规，不得违反法律法规、本合同及资产管理人公司内部的投资管理规定等。若因投资顾问违反法律法规、合同等相关规定，资产管理人有权决定解聘投资顾问，在此情形下，资产管理人有权决定终止该资产管理计划。资产管理人不承担因合理执行该等投资建议而引起的任何损失或风险。除法规另行规定外，资产管理人与投资顾问之间不承担连带责任。具体事宜以管理人和投资顾问另行签署的《投资顾问协议》为准。

委托人签署本合同即表明其已认可和同意管理人聘请福建道冲投资管理有限公司作为本资产管理计划的投资顾问，并同意授权投资顾问按约定的方式为管理人管理运用计划财产提供投资顾问服务。委托人认可该投资顾问提供的投资建议，并承诺接受因资产管理人采纳该投资建议所带来的任何收益或损失。

## 十二、投资经理的指定与变更

### （一）投资经理的指定

#### 1、投资经理的指定

资产管理计划投资经理由资产管理人负责指定。

#### 2、本计划投资经理

本资产管理计划的投资经理简历如下：

付瑶，上海财经大学经济学硕士，5年阳光私募基金市场开拓及证券研究经验，在证券投资类产品的设计和开发方面具有丰富的实践经验现任北京千石创富资本管理有限公司特定资产管理部产品经理、产品副总监。

李一帅女士，伦敦政治经济学院硕士。2011年8月至2012年10月在北京北大青鸟有限责任公司任财务分析员。2013年6月加盟北京千石创富资本管理有限公

司,现任北京千石创富资本管理有限公司特定资产管理部产品经理、总经理助理。

## (二)投资经理的变更

资产管理人可根据业务需要变更投资经理,并在变更后及时告知资产委托人。资产管理人自变更之日起3个工作日内在资产管理人公司网站公告调整事项即视为履行了告知义务。

# 十三、资产管理计划的财产

## (一)资产管理计划财产的保管与处分

1、资产管理计划财产独立于资产管理人、资产托管人的固有财产,并由资产托管人保管。资产管理人、资产托管人不得将计划财产归入其固有财产。

2、除本条第3款规定的情形外,资产管理人、资产托管人因资产管理计划财产的管理、运用或者其他情形而取得的财产和收益归入资产管理计划财产。

3、资产管理人、资产托管人可以按本合同的约定收取管理费、托管费以及本合同约定的其他费用。资产管理人、资产托管人以其自有财产承担法律责任,其债权人不得对资产管理计划财产行使请求冻结、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,计划财产不属于其清算财产。

4、资产管理计划财产产生的债权不得与不属于资产管理计划财产本身的债务相互抵消。非因资产管理计划财产本身承担的债务,国家、有权机关要求执行的情况除外,资产管理人、资产托管人不得主张其债权人对资产管理计划财产强制执行。上述债权人对资产管理计划财产主张权利时,资产管理人、资产托管人应明确告知资产管理计划财产的独立性。

## (二)银行账户的开设和管理

(1)计划托管人应负责本计划有关的银行账户的开设和管理,计划管理人应配合计划托管人办理开立账户事宜并提供相关资料。

(2)计划托管人以计划的名义在托管银行代理开设托管专户,保管计划的银行存款。该账户的开设和管理由计划托管人负责,本计划的一切货币收支活动,包括但不限于投资、支付退出金额、支付计划收益、收取参与款,均需通过该账户进行。管理人在确定托管账户名称时应考虑满足三方存管、银行间市场开户要求等需要。

托管账户信息如下:

托管账户户名:千石资本道冲套利3号资产管理计划

开户行:中国光大银行北京金融街支行

(3)托管专户的开立和使用,限于满足开展托管业务的需要。计划托管人和计划管理人不得假借本计划的名义开立其他任何银行账户;亦不得使用本计划的任何银行账户进行本计划业务以外的活动。

(4)托管专户的管理应符合《人民币银行结算账户管理办法》、《现金管理暂行条例》、《支付结算办法》和中国人民银行利率管理的有关规定以及其他有关

规定。

(三) 计划的证券账户和证券资金账户的开设和管理

(1) 计划托管人应当以计划的名义在中国证券登记结算有限责任公司开设证券账户，用于本计划证券投资的清算和存管，证券账户名称应为“千石资本-光大银行-道冲套利3号资产管理计划”。计划管理人应配合计划托管人办理开立账户事宜并提供相关资料。

(2) 本计划证券账户的开立和使用，限于满足开展本计划业务的需要。计划托管人和计划管理人不得出借和未经另一方同意擅自转让本计划的任何证券账户；亦不得使用本计划的任何证券账户进行本计划业务以外的活动。

(3) 本计划证券账户的开立和证券账户卡的保管由托管人负责，管理和使用由管理人负责。

(4) 计划托管人协助计划管理人以计划名义在营业网点开立证券资金账户，并按照计划管理人营业网点开户的流程和要求，签订相关的协议，并办理三方存管，银证转账需采用无密码交验模式，计划托管人应根据计划管理人的指令，进行银证转账和银期转账的操作。

(5) 交易所证券交易资金采用第三方存管模式，即用于证券交易结算资金全额存放在计划管理人作为本计划开设证券资金账户中，场内的证券交易资金清算由计划管理人选择的证券营业部负责。计划托管人不负责办理场内的证券交易资金清算，也不负责保管证券交易资金账户内存放的资金。

(四) 基金账户的开设和管理

(1) 计划管理人应当以计划的名义在拟投资基金的注册登记人处开设基金账户，并在该基金的销售机构开设基金交易账户。基金账户名称应为“千石资本-道冲套利3号资产管理计划”。

(2) 本计划基金账户和基金交易账户的开立和使用限于满足开展本计划业务的需要。计划托管人和计划管理人不得出借和未经另一方同意擅自转让本计划的任何基金账户或基金交易账户；亦不得使用本计划的任何基金账户或基金交易账户进行本计划业务以外的活动。

(3) 本计划基金账户和基金交易账户的管理和使用由管理人负责。

(五) 债券托管专户的开设和管理

资产管理合同生效后，资产管理人和资产托管人相互配合，根据中国人民银行及中央国债登记结算有限责任公司、银行间清算所股份有限公司的有关规定，在债券登记结算机构开立债券托管账户，并代表委托财产进行银行间市场债券的结算。管理人负责委托资产在银行间市场的债券交易，托管人负责银行间债券交割与资金划拨。

(六) 股指期货账户的开立和管理

管理人应为本计划在期货公司开立期货资产账户，用于存放本计划股指期货保证金，期货公司为本计划申请股指期货交易编码，托管人负责在中国建设银行进行期货保证金银行结算专户的开立。管理人在办理期货保证金账户开户、申请

交易编码、银期转账开通手续时，应将在中国建设银行开立的期货保证金银行结算专户指定为本计划期货资产账户对应的唯一银行结算账户，未经托管人书面同意，管理人不得变更本计划期货保证金账户对应的银行结算账户。

托管人负责期货保证金银行结算专户的管理和资金划拨工作。托管人保证，期货保证金银行结算账户仅能进行银期转账，以及与本计划的银行托管账户之间进行跨行转账的资金往来。

#### （七）其他账户的开设和管理

开立定期存款账户时，定期存款账户的户名应与托管账户户名一致，本着便于委托资产的安全保管和日常监督检查的原则，存款行应尽量选择托管账户所在地的分支机构。对于跨行定期存款投资，管理人必须和存款机构签订定期存款协议，约定双方的权利和义务，该协议作为划款指令附件。该协议中必须有如下明确条款：“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；本息到期归还或提前支取的所有款项必须划至托管专户（明确户名、开户行、账号等），不得划入其他任何账户”。并依照本协议交接原则对存单交接流程予以明确。如定期存款协议中未体现前述条款，托管人有权拒绝定期存款投资的划款指令。对于跨行存款，管理人需提前5天与托管人就定期存款协议及存单交接流程进行沟通（托管人定期存款业务联系人：王晶 010-63639140；wangjing321@cebbank.com）。除非存款协议中规定存款证实书由存款行保管或存款协议作为存款支取的依据，存单交接原则上采用存款行上门服务、资产管理人负责监交的方式。特殊情况下，采用资产管理人交接存单的方式。在取得存款证实书后，托管人保管证实书正本。管理人需对跨行存款的利率政策风险、存款行的选择及存款协议承担责任，并指定专人在核实存款行授权人员身份信息后，负责印鉴卡与存款证实书等凭证的监交或交接，以确保与托管人所交接凭证的真实性、准确性和完整性。托管人对投资后处于托管人实际控制之外的资产不承担保管责任。跨行定期存款账户的预留印鉴为托管人托管业务专用章与托管业务授权人名章。

因业务发展而需要开立的其他账户，应由资产托管人或管理人根据有关法律、法规的规定开立。新账户按有关规则管理并使用。

#### （八）募集资金的移交验证

本计划初始销售期限届满，客户委托的初始资产合计不低于人民币3000万元、委托人数不少于2人不超过200人时，本计划即符合备案的条件。资产管理人应将属于资产管理计划财产的全部资金划入资产托管人开立的计划财产专用银行账户。资产管理人应当自初始销售期限届满之日起10日内聘请法定验资机构验资，自收到验资报告之日起10日内，向中国证监会提交验资报告及客户资料表，办理相关备案手续。

自中国证监会书面确认之日起，资产管理计划备案手续办理完毕，资产管理合同生效。资产委托人的认购参与款项（不含认购费用）加计其在初始销售期形成的利息在资产管理合同生效后折算成相应的资产管理计划份额归资产委托人

所有，其中利息转份额的具体数额以注册登记机构的记录为准。

若资产管理计划初始销售期限届满，未能达到资产管理合同生效的条件，由资产管理人按规定办理退款等事宜。

#### 十四、投资指令的发送、确认与执行

在本条项下，资产管理人委托行政服务机构（国金道富投资服务有限公司）履行“投资指令的发送、确认与执行”职责及其他相关职责。资产管理人与资产托管人确认，除非本条项下另有除外规定，本条项下应由资产管理人履行的职责均由行政服务机构履行。在本条项下业务实际操作过程中，资产托管人与行政服务机构对接、联系，未能联系到行政服务机构或与行政服务机构不能达成一致时，资产托管人可直接与资产管理人联系。

##### （一）交易清算授权

行政服务机构应向资产管理人提供预留印鉴和授权人签字样本，资产管理人收到行政服务机构提供的预留印鉴和授权人签字样本后应向资产托管人提供，事先书面通知（以下称“授权通知”）资产托管人有权发送指令的人员名单，注明相应的交易权限，并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。资产托管人在收到授权通知后立即电话与资产管理人（而非行政服务机构）确认。资产管理人（而非行政服务机构）与资产托管人双方电话确认后，该授权通知于通知载明时间生效。行政服务机构、资产管理人和资产托管人对授权文件负有保密义务，其内容不得向被授权人及相关操作人员以外的任何人泄露。

##### （二）投资指令的内容

指令是资产管理人在管理、运用计划财产时，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投资指令应写明款项事由、支付时间、到账时间、金额、收付款账户等执行支付所需信息，加盖预留印鉴并由被授权人签字。

##### （三）投资指令的发送、确认和执行的程序和程序

投资指令由“授权通知”确定的有权发送人代表资产管理人用传真的方式或其他资产托管人和资产管理人确认的方式向资产托管人发送。资产管理人有义务在发送指令后与资产托管人以电话方式进行确认。

对于被授权人在其授权范围内发出的指令，资产管理人不得否认其效力。资产管理人应按照有关法律法规和本合同的规定，在其合法的经营权限和交易权限内发送划款指令，被授权人应按照其授权权限发送划款指令。

资产管理人方应在15:00之前向资产托管人发送付款指令，15:00之后发送付款指令的，资产托管人不能保证划款成功。如资产管理人要求当天某一时点到账，应至少提前2工作小时向资产托管人发送付款指令并与资产托管人电话确认。资产管理人指令传输不及时，未能留出足够的执行时间，致使指令未能及时执行的，资产托管人不承担由此导致的损失。资产托管人收到资产管理人发送的指令

后,应立即依据“授权通知”规定的方法审慎验证有关内容(包括指令是否符合《投资政策列表》的规定、被授权人的印鉴和签名形式是否表面相符,以及指令是否符合被授权人的授权范围),复核无误后应在规定期限内执行,不得延误。对缺乏被授权人印鉴和签名或印鉴和签名不符或超越被授权人授权范围的划款指令,资产托管人应当拒绝执行,并立即通知资产管理人进行核查。资产托管人仅根据被授权人预留印鉴和签名进行表面相符性的形式审查,对其真实性不承担责任。

资产管理人向资产托管人下达指令时,应确保资产管理计划财产专用银行账户有足够的资金余额,对资产管理人在没有充足资金的情况下向资产托管人发出的指令,资产托管人可不予执行,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损失的责任。

资产管理人应在交易结束后将银行间同业市场债券交易成交单加盖印章后及时传真给资产托管人,并电话确认。如果银行间簿记系统已经生成的交易需要取消或终止,资产管理人应提前书面通知资产托管人。若托管人在簿记系统已做确认的则视情况决定如何处理。

本资产管理计划财产在交易所场内交易的资金清算交割,由资产管理人委托的证券经营机构直接根据相关登记结算公司的结算规则办理。

本资产管理计划财产专用银行账户发生的银行结算费用等银行费用(包括手续费,邮电费,账户开户费等),由托管账户开户银行直接从计划财产专用银行账户中扣划,无须资产管理人出具划款指令,但扣划之前需与资产管理人核对有关金额;有关证券账户的开户手续费扣划需要管理人出具划款指令但扣划之前需与资产托管人核对有关金额。

资产托管人发现资产管理人发送的指令违反《基金法》、《试点办法》、本合同或其他有关法律法规的规定时,不予执行,并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,由此造成的损失由资产管理人承担。

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时,有权拒绝执行,并及时通知资产管理人改正。

#### (四) 资产管理人更换被授权人的程序

行政服务机构撤换被授权人或改变被授权人的权限,必须提前至少二个工作日,使用传真向资产管理人发出被授权人变更通知并预留新的被授权人的印鉴和签字样本,同时电话通知资产管理人。电话通知当日,行政服务机构应将通知原件递交资产管理人。

资产管理人接到行政服务机构撤换被授权人或改变被授权人的权限的通知后,必须提前至少一个工作日,使用传真向资产托管人发出被授权人变更通知并预留新的被授权人的印鉴和签字样本,同时电话通知资产托管人。资产托管人收



到变更通知当日电话向资产管理人（而非行政服务机构）确认。被授权人变更通知于通知载明的时间生效日生效。资产管理人在此后三日内将被授权人变更通知的正本送交资产托管人存档。资产管理人更换被授权人通知生效后，对于已被撤换的原被授权人发送的指令或被改变授权人员超权限发送的指令，资产管理人（而非行政服务机构）、行政服务机构不承担责任。

#### （五）交易指令

资产管理人应将投资者参与、退出计划的数据通过双方商定的方式提供资产托管人，资产管理人应对传送的此类数据的真实性、准确性负责。

### 十五、交易及清算交收安排

在本条项下，资产管理人委托行政服务机构（国金道富投资服务有限公司）履行“交易及清算交收安排”职责及其他相关职责。资产管理人与资产托管人确认，除非本条项下另有除外规定，本条项下应由资产管理人履行的职责均由行政服务机构履行。在本条项下业务实际操作过程中，资产托管人与行政服务机构对接、联系，未能联系到行政服务机构或与行政服务机构不能达成一致时，资产托管人可直接与资产管理人联系。

#### （一）选择代理证券买卖的证券经纪商的程序

资产管理人（非行政服务机构）负责选择代理本资产管理计划财产证券买卖的证券经营机构，并与其签订证券交易委托代理协议。本计划的证券经纪商为中信建投证券股份有限公司（以下简称“中信建投证券”）。

资产管理人应及时将本资产管理计划财产证券交易单元号、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和行政服务机构。

#### （二）交易数据发送和接收

1、资产管理人按与资产托管人协商确定的方式委托中信建投证券通过规定的方式（包括专线连接、电话拨号、电子邮件、人工等）在本委托财产运作周期内每个交易日上午9：30之前向资产托管人传送上一交易日柜台交易清算数据和资金清算明细数据。

2、本计划的交易数据传输具体操作按照资产管理人（而非行政服务机构）、资产托管人及中信建投证券签订的《资产管理计划之操作协议》的约定执行。

3、托管人每日根据收到的交易数据、清算数据和清算划款指令，进行账务处理。

#### （三）证券交易的资金清算与交割

##### 1、证券交易资金的清算

（1）资产管理人的投资指令执行后，因本计划投资于证券发生的所有场内交易的清算交割，由资产管理人（而非行政服务机构）选择的证券营业部负责办理；场外划款有资产托管人负责办理。

（2）本计划场内证券投资的清算交割，由资产管理人（而非行政服务机构）选择的证券营业部直接根据相关登记结算公司的结算规则办理。

## 2、结算方式

支付结算按中国人民银行、中国银监会、中国证券登记结算有限公司的有关规定办理。

## 3、资金划拨

资产管理人的资金划拨指令,计划托管人在复核无误后应在规定期限内执行,不得延误。如资产管理人的资金划拨指令有违法、违规的,计划托管人应不予执行并立即书面通知资产管理人要求其变更或撤销相关指令,若资产管理人在计划托管人发出上述通知后仍未变更或撤销相关指令,计划托管人应不予执行,并报告中国证监会。

## 4、开放式基金认购、申购、赎回的交易安排

资产管理人(而非行政服务机构)与计划托管人在办理开放式基金认购、申购、赎回中的权利、义务、职责遵照有关法律法规规定执行。

资产管理人申购(认购)开放式基金时,应将划款指令连同基金申购(认购)申请单传真至计划托管人。计划托管人审核无误后,应及时将划款指令交付执行,并对划款指令执行情况进行查询,将执行结果通知资产管理人。资产管理人应及时向基金销售机构索取开放式基金申购(认购)确认单并在收到后传真给托管人,以作为双方进行会计核算的依据。

资产管理人赎回开放式基金时,应同时向基金管理公司或代销机构和计划托管人发出基金赎回申请书。计划托管人应及时查询到帐情况并反馈资产管理人。资产管理人应及时向基金销售机构索取开放式基金赎回确认单,并传真给托管人,以作为双方进行会计核算的依据。对于因基金管理公司不能在约定的时间提供开放式基金交易确认凭证、分红凭证、拆分数据等,致使托管人在核算估值日缺乏必要的核算依据而造成的资产核算和估值差错,托管人不承担相关责任。

### (四) 证券清算交割及账目核对

每日上午12:00之前资产管理人和托管人核对上一个交易日的证券清算款、银行托管专户、期货保证金结算账户的存款余额以及上一交易日证券交易资金账户余额。

### (五) 证券清算交割处理

资金划转的方式在符合银行资金结算的有关规定的的前提下可由托管人和资产管理人共同商定。托管人和资产管理人的每日清算差额大于0.10元人民币的,托管人和资产管理人查明原因后协商解决,确认一方出错的,由出错方调整。托管人和资产管理人的每日清算差额小于或等于0.10元人民币的,托管人按照资产管理人计算的清算金额每日调整,但对于频繁且持续的差异,双方查找原因并协商解决。

## 十六、越权交易的界定

### (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及本合同附件一《交易监控合规

表》的规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附件一《交易监控合规表》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。

资产管理人应在本合同规定的权限内运用计划财产进行投资管理，不得违反本合同的约定，超越权限管理、从事证券投资。

资产托管人对资产管理人的投资行为行使监督权。资产托管人根据附件一《交易监控合规表》约定，对本计划的投资范围及投资比例进行监督。资产托管人根据附件一《交易监控合规表》对计划财产投资的监督和检查自本资产管理计划建账估值之日起开始。

## (二) 处理方式和程序

1、违反有关法律法规和本合同附件一《交易监控合规表》规定进行的投资交易行为

资产托管人发现资产管理人的投资指令违反法律法规的规定，或者违反本合同附件一《交易监控合规表》约定，有权拒绝执行、通知资产管理人，并有权报告中国证监会。

资产托管人发现资产管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他规定，或者违反本合同附件一《交易监控合规表》约定的，有权通知资产管理人并报告中国证监会。

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。在限期内，资产委托人和资产托管人有权随时对通知事项进行复查，督促资产管理人改正。资产管理人对资产委托人和资产托管人通知的越权事项未能在限期内纠正的，资产托管人有权报告中国证监会。

## 2、法律法规禁止的超买、超卖行为。

资产托管人如果发现委托财产投资证券过程中出现超买或超卖现象，有权提醒资产管理人，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。如果因资产管理人原因发生超买行为，必须于 T+1 日 11:00 前完成融资，保证完成清算交收。

3、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) 资产委托人确认，资产托管人投资监督的准确性和完整性受限于资产管理人、证券经纪商及其他中介机构提供的数据和信息。资产托管人对这些机构的信息的准确性和完整性不作任何担保、暗示或表示，并对上述机构提供的信息的真实性、准确性和完整性所引起的损失不承担任何责任。

(四) 资产托管人无投资责任，对任何资产管理人的投资行为（包括但不限于其投资策略及决定）或其投资回报不承担任何责任。资产托管人不会因为提供投资监督报告而承担任何因资产管理人违规投资所产生的有关责任，也没有义务去采取任何手段回应任何与投资监督报告有关的信息和报道。但如果收到资产委托人的书面指示，资产托管人将对投资监督报告所述的违规行为提供有关资料。

## 十七、资产管理计划财产的估值和会计核算

在本条项下，资产管理人委托行政服务机构（国金道富投资服务有限公司）履行“资产管理计划财产的估值和会计核算”职责及其他相关职责。资产管理人与资产托管人确认，除非本条项下另有除外规定，本条项下应由资产管理人履行的职责均由行政服务机构履行。在本条项下业务实际操作过程中，资产托管人与行政服务机构对接、联系，未能联系到行政服务机构或与行政服务机构不能达成一致时，资产托管人可直接与资产管理人联系。

### （一）估值目的

计划财产估值的目的是客观、准确地反映计划财产的价值。

计划财产按照法律法规和本合同规定的估值方法和程序进行。计划资产净值是指计划财产总值减去负债后的净资产值。计划资产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。

### （二）估值核对日及估值时间

资产管理计划存续期间T+1日完成T日估值，估值核对确认日为每周最后一个交易日，资产管理人与资产托管人在估值核对确认日对资产管理计划财产进行估值核对确认。

### （三）估值依据

估值应符合本合同、《证券投资基金会计核算业务指引》及其他法律、法规的规定，如法律法规未做明确规定的，参照证券投资基金的行业通行做法处理。估值数据依据合法的数据来源独立取得。

### （四）估值方法

本计划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、权证等），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）交易所上市实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

（3）交易所上市未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含截止最近交易日的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易

市价，确定公允价格。

(4)交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。交易所上市的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

(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、债券和权证，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、因持有股票而享有的配股权，采用估值技术确认公允价值。

4、全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值。

5、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。

6、开放式基金（包括托管在场外的上市开放式基金 LOF）以估值日前一交易日基金净值估值，估值日前一交易日开放式基金份额净值未公布的，以前最近一个交易日基金份额净值计算。

7、货币市场基金按估值日的前一工作日每万份收益计提每日货币基金收益。

8、银行存款和债券逆回购按照成本估值，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。

9、期货以估值日的结算价估值，若估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。法律法规另有规定的，从其规定。

10、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。

11、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。

12、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。

#### (五) 估值对象

资产管理计划财产项下所有股票（含新股申购）、证券投资基金、股指期货、现金、银行存款以及券商现金管理类资产管理计划、债券逆回购。

#### (六) 估值程序与资产管理计划份额净值的确认

资产管理人于每个估值核对确认日计算本估值日的计划财产净值并以传真

方式或其他资产管理人和资产托管人认可的方式发送给资产托管人。资产托管人对净值计算结果复核后，签名、盖章并以传真方式或其他资产管理人和资产托管人认可的方式传送给资产管理人。

计划份额净值的计算精确到0.0001元，小数点后第五位四舍五入，相关法律法规另有规定的，从其规定。

#### (七) 估值错误的处理

如资产管理人或资产托管人发现资产管理计划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。

根据有关法律法规，资产管理计划资产净值计算和会计核算的义务由资产管理人（而非行政服务机构）承担。本计划的会计责任方由资产管理人（而非行政服务机构）担任。因此，就与本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，仍无法达成一致意见，以资产管理人或行政服务机构的意见为准，资产托管人不承担由此导致的损失。

当计划财产估值出现错误时，资产管理人和资产托管人应该立即协商采取更正措施，并按本合同约定的报告方式向委托人及时披露（披露方式参见第二十条报告义务中临时报告）。

#### (八) 暂停估值的情形

1、资产管理计划投资所涉及的证券交易场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资产管理人、资产托管人无法准确评估资产管理计划财产价值时；

3、占资产管理计划相当比例的投资品种的估值出现重大转变，资产管理人为保障委托人的利益决定暂停估值的；

4、中国证监会认定的其他情形。

#### (九) 特殊情形的处理

1、资产管理人按估值方法的第（11）项进行估值时，所造成的误差不作为资产管理计划财产估值错误处理；

2、由于不可抗力原因，或由于证券交易场所及登记结算公司发送的数据错误，资产管理人和资产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，由此造成的资产管理计划财产估值错误，资产管理人和资产托管人可以免除赔偿责任。但资产管理人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

#### (十) 资产管理计划的会计政策

资产管理计划的会计政策比照证券投资基金现行政策执行：

1、资产管理人为本计划的会计责任方。

2、本计划的会计年度为公历年度的1月1日至12月31日。

3、本计划核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位。

4、本计划单独建账、独立核算；资产管理人及资产托管人各自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。资产托管人应定期与资产管理人就资产管理计划的会计核算、报表编制等进行核对。

## 十八、资产管理计划的费用与税收

### (一) 计划费用的种类

- 1、资产管理人的管理费；
- 2、资产托管人的托管费；
- 3、注册登记机构的注册登记费；
- 4、销售机构的销售服务费；
- 5、计划的证券交易费用(包括但不限于经手费、印花税、证管费、过户费、手续费、券商佣金、权证交易的结算费及其他类似性质的费用等)；
- 6、计划财产的银行汇划费用；
- 7、资产管理合同生效以后与计划相关的会计师费和律师费；
- 8、资产管理合同生效后与之相关的信息披露费用；
- 9、按照国家有关规定和本合同约定，可以在计划财产中列支的印刷费等其他费用。

### (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

资产管理人的管理费按前一日计划资产净值的 0.15% 年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.15\% \div 365$$

H为每日应计提的管理费

E为前一日的计划资产净值

合同生效后，管理费每日计提，按季支付，于资产管理合同生效之日的次季起，每季度首日起3个工作日内由资产管理人向资产托管人发送资产管理计划管理费划款指令，经资产托管人复核后于3个工作日内从资产管理计划财产中支付给资产管理人，若遇法定节假日、休息日，支付日期相应顺延至该日后第一个工作日，若遇不可抗力或计划财产无法变现致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

#### 2、资产托管人的托管费

本资产管理计划的托管费按前一日计划资产净值的 0.12% 年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.12\% \div 365$$

H为每日应计提的托管费

E为前一日的计划资产净值

合同生效后，托管费每日计提，按季支付，由资产管理人于资产管理合同生效之日的次季起，每季度首日起3个工作日内向资产托管人发送资产管理计划托

管费划款指令，经资产托管人复核后于3个工作日内从资产管理计划财产中支付给资产托管人，若遇法定节假日、休息日，支付日期相应顺延至该日后第一个工作日，若遇不可抗力或计划财产无法变现致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

### 3、注册登记机构的注册登记费

注册登记机构的注册登记费按前一日计划资产净值的0.15%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div 365$$

H为每日应计提的注册登记费

E为前一日的计划资产净值

合同生效后，注册登记费每日计提，按季支付，由资产管理人于资产管理合同生效之日的次季起，每季度首日起3个工作日内向资产托管人发送资产管理计划注册登记费划款指令，经资产托管人复核后于3个工作日内从资产管理计划财产中支付给注册登记机构，若遇法定节假日、休息日，支付日期相应顺延至该日后第一个工作日，若遇不可抗力或计划财产无法变现致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

注册登记机构指定收取注册登记费的银行账户为：

户 名：国金通用基金管理有限公司

开 户 行：中国民生银行北京西长安街支行

账 号：0137014210003763

### 4、销售机构销售服务费；

销售机构的销售服务费分为两部分：

(1) 优先级份额销售服务费按前一日优先级计划份额资产净值的0.5%年费率计提。计算方法如下：

$$H = Ea \times 0.5\% \div 365$$

H为每日应计提的销售服务费

Ea为前一日的优先级份额计划资产净值

(2) 中间级份额销售服务费按前一日中间级计划份额资产净值的1%年费率计提。计算方法如下：

$$H = Eb \times 1\% \div 365$$

H为每日应计提的销售服务费

Eb为前一日的中间级份额计划资产净值

合同生效后，销售服务费每日计提，按季支付，由资产管理人于资产管理合同生效之日的次季起，每季度首日起3个工作日内向资产托管人发送资产管理计划销售服务费划款指令，经资产托管人复核后于3个工作日内从资产管理计划财产中支付给代销机构，若遇法定节假日、休息日，支付日期相应顺延至该日后第一个工作日，若遇不可抗力或计划财产无法变现致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。



5、上述第(一)款第5—9项费用根据有关法规及相应协议规定,按费用实际支出金额列入或摊入当期费用,由资产托管人从计划财产中支付。

6、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计划财产的损失,以及处理与资产管理计划财产无关的事项发生的费用等不得列入资产管理计划费用。

(三)资产管理业务的税收

本计划运作过程中涉及的各纳税主体,其纳税义务按国家税收法律、法规执行。组合根据实际从登记结算机构收到的股息、利息等相关收入直接确认收益。资产委托人应缴纳的税收,由资产委托人负责,资产管理人不承担代扣代缴或纳税的义务

(四)费用调整

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

## 十九、资产管理计划的收益分配

(一)资产管理计划收益的构成

资产管理计划利润指利息收入、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;资产管理计划已实现收益指资产管理计划利润减去公允价值变动收益后的余额。

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

(二)收益分配原则

1、每一计划份额按收益分配细则享有分配权。

2、本资产管理计划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,本计划每3个月进行一次收益分配。

4、收益分配基准日:收益分配基准日为开放日前两个工作日(T-2日),若遇法定节假日、休息日,则收益分配基准日期调整至上一工作日。

5、资产管理人在每个收益分配基准日确定收益分配方案后,在5个工作日内进行收益分配。

7、本计划采用现金分红的方式进行收益分配。

8、法律法规或监管机构另有规定的,从其规定。

(三)存续期的收益分配细则

本计划的收益优先满足优先份额的基本收益,其次满足中间级份额的基本收益,超出优先级份额基本收益及中间级份额基本收益的超额收益,分配给进取级份额持有人。

1、优先份额收益分配金额计算公式如下：

优先级份额预期收益=优先级计划份额的初始面值 $\times 6.0\% \times T/365$

其中：T为资产委托人收益分配基准日所持有份额的持有天数，T=成立日或上一收益分配基准日后一日至本期收益分配基准日。

2、中间级份额收益分配金额计算公式如下：

中间级份额预期收益=中间级计划份额的初始面值 $\times 7.0\% \times T /365$ 。

其中：T为资产委托人收益分配基准日所持有份额的持有天数，T=成立日或上一收益分配基准日后一日至本期收益分配基准日。

(四) 终止清算及提前终止时收益分配原则

本计划的收益优先满足优先份额的基本收益，其次满足中间级份额的基本收益，超出优先级份额基本收益及中间级份额基本收益的超额收益，分配给进取级份额持有人。

如果，收益率不足优先级份额预期收益率时，首先由进取级份额委托人的本金进行补充，若进取级份额委托人的本金不足以满足优先级份额的预期收益率时则由中间级份额委托人的本金进行补充。若进取级份额与中间级份额委托人本金都无法满足优先级份额预期收益率时，则中间级、进取级份额委托人收益为零，进取级份额与中间级份额委托人以出资为限，也不再承担优先级的损失。

如果，收益率满足优先级份额预期收益率且不满足中间级份额预期收益率时，则由进取级份额委托人的本金进行补充。进取级份额委托人收益为零，也不再承担中间级的损失。

本计划终止清算日为计划成立日起五年后的年度对应日。

## 二十、报告义务

(一) 运作期报告

1、资产管理人向资产委托人提供的报告种类、内容和提供时间

(1) 年度报告

资产管理人应当在每年结束之日起 3 个月内，编制完成计划年度报告并经资产托管人复核，向资产委托人披露投资状况、投资表现、风险状况等信息。资产管理人应于每年结束之日起 45 日内完成年度报告，并将年度报告提供资产托管人复核，资产托管人在收到后 45 日内完成复核，并将复核结果书面通知资产管理人。资产管理计划合同生效未满 3 个月，不编制当期的年度报告。

(2) 净值报告

资产管理人每周至少应向资产委托人报告一次经资产托管人复核的计划份额净值，若因资产托管人原因无法复核或无法及时复核的，资产管理人在报告计划份额净值时，应如实告知资产委托人。

(3) 上述向资产委托人提供的报告中涉及证券投资明细的报告，原则上每季度至多报告一次。

(4) 临时报告

发生本合同约定的、可能影响委托人利益的重大事项时，资产管理人应及时履行报告义务，涉及资产托管人的，资产托管人应及时向资产管理人告知相关事项。

## 2、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

资产管理人向资产委托人提供的报告，将严格按照《试点办法》及其他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中国证监会允许的、本合同约定的方式进行。

### (1) 网站

定期报告、份额净值报告、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。

### (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、电子邮件或手机短信等

如委托人办理资产管理计划认购、参与或退出等业务时留有传真号、电子邮箱、手机及电话号码等联系方式的，资产管理人也可通过传真、电子邮件、手机短信、电话、电报等方式将报告信息通知资产委托人。资产委托人上述联系方式若发生变更应当及时通知资产管理人。

## 3、资产托管人向资产委托人提供计划资产托管情况查询的方式

资产托管人按照规定定期向资产委托人提供资产托管报告，置于托管人办公地点备查，委托人可在营业时间前来查询。

### (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监管机构的要求履行报告义务。

## 二十一、风险揭示

本资产管理人提示投资者充分了解资产管理计划投资的风险和收益特征，建议投资者在选择本计划之前，通过正规的途径，对本计划进行充分、详细的了解。投资者应对自己的资金状况、投资期限、收益预期、风险承受能力和风险偏好做出客观合理的评估后，再做出是否投资的决定。

本资产管理人提醒投资者“买者自负”投资原则，在投资者做出投资决策后，计划的运营状况与计划净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责。

本资产管理人将按照本资产管理合同的约定，依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用计划资产，在风险控制的基础上为投资者争取最大的投资收益，但不保证本计划一定盈利，也不保证最低收益。请投资者正确认识和对待本计划未来可能的收益和风险。

本计划在投资管理过程中面临的各项风险包括但不限于：

### (一) 市场风险

证券市场价格受到经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素的影响，导致资产管理计划财产收益水平变化，产生风险，主要包括：

#### 1、政策风险

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

#### 2、经济周期风险

随经济运行的周期性变化，证券市场的收益水平也呈周期性变化。资产管理计划财产投资于债券与上市公司的股票，收益水平也会随之变化，从而产生风险。

#### 3、利率风险

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

#### 4、上市公司经营风险

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

#### 5、购买力风险

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

### （二）信用风险

指本计划在交易过程发生交收违约，或者本计划所投资债券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致计划财产损失。信用风险主要来自于交易对手、发行人和担保人。在资产管理计划财产投资运作中，如果资产管理人的信用研究水平不足，对信用产品或交易对手的信用水平判断不准确，可能使资产管理计划财产承受信用风险所带来的损失。

### （三）流动性风险

指计划资产不能迅速转变成现金，或者不能应付可能出现的投资者大额赎回等的风险。

#### 1、市场整体流动性风险

证券市场的流动性受到价格、投资群体等诸多因素的影响，在不同状况下，其流动性表现是不均衡的，具体表现为：在某些时期成交活跃，流动性非常好，而在另一些时期，则可能成交稀少，流动性差。在市场流动性出现问题时，本计划的操作有可能发生建仓成本增加或变现困难的情况。

#### 2、个股和个券流动性风险

由于不同投资品种受到市场影响的程度不同，即使在整体市场流动性较好的情况下，一些单一投资品种仍可能出现流动性问题，这种情况的存在使得本计划

在进行投资操作时，可能难以按计划买入或卖出相应数量的证券，或买入卖出行为对证券价格产生比较大的影响，增加投资成本。这种风险在出现个股和个券停牌和涨跌停板等情况时表现得尤为突出。

### 3、大额申购/赎回风险

本资产管理计划存续期内定期开放申赎，其规模将随着投资人对计划份额的申购与赎回而不断变化，若是由于投资人的连续大量申购而导致本资产管理人在短期内被迫持有大量现金；或由于投资人的连续大量赎回而导致本资产管理人被迫抛售所持有的证券以应付赎回的现金需要，则可能使计划资产净值受到不利影响。

### 4、顺延或暂停赎回风险

本资产管理计划开放日，由于市场剧烈波动或其他原因可能导致发生本合同约定的巨额退出的情形，资产管理人为了应对市场可能的流动性不足及降低资产变现损失，可能对资产委托人的退出申请采取部分延期退出的处理，资产委托人将因此面临退出款项延迟到账的流动性风险。

## （四）操作风险

1、在资产管理计划财产管理运作过程中，对主要业务人员如资产管理计划投资经理的依赖可能产生管理风险。可能因资产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资产管理计划的收益水平。资产管理人和资产托管人的管理水平、管理手段和管理技术等对资产管理计划收益水平存在影响。

2、在资产管理计划财产管理运作过程中，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，可能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、内幕交易、欺诈、交易错误等。

3、在资产管理计划的各项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资产管理公司、注册登记机构、销售机构、证券交易所、证券登记结算机构等等。

4、税务风险：在投资各国或地区市场时，因各国、地区税务法律法规的不同，可能会就股息、利息、资本利得等收益向各国、地区税务机构缴纳税金，包括预扣税，该行为可能会使得资产回报受到一定影响。各国、地区的税收法律法规的规定可能变化，或者加以具有追溯力的修订，所以可能须向该等国家或地区缴纳委托财产销售、估值或者出售投资当日并未预计的额外税项。

5、法律及政治管制风险：由于各个国家/地区适用不同法律法规的原因，可能导致委托财产的某些投资行为在部分国家/地区受到限制或合同不能正常执行，或使资产管理计划违反国家法律法规或资产管理计划合同的规定，从而使得委托财产面临损失的可能性。

## （五）本计划特定风险

### 1、产品结构导致的风险

本计划为结构化产品，资产管理人并不承诺或保证本合同终止时优先级份额

的本金及预期收益。

(1) 优先级份额的特定风险：优先级份额的预期收益率为固定利率，其主要特定风险是利率风险。金融市场利率的上升和金融行业基本利率水平的上升将导致该级份额的基准收益率与上述利率间的利差收窄，相对投资收益降低。在本合同终止时，如全部计划财产尚未补足对优先级的本金及预期收益，则差额部分不再进行补偿。

(2) 中间级份额的特定风险：中间级通过对优先级的基准收益优先分配权的让渡，获取相较于优先级份额更高的收益率，但当进取级份额不足以补足优先级份额本金及预期收益时，中间级份额需要以其份额所属财产为限补足优先级份额的本金及预期收益。在此过程中，中间级份额的预期收益与风险都将得到一定程度的放大，从而将表现出较高收益与较高风险的特征。

(3) 进取级份额的特定风险：进取级通过对优先级、中间级的基准收益优先分配权的让渡，获取扣除本合同相关费用后的全部超额收益分配权，其主要特定风险是投资杠杆放大效应所带来的风险。在此过程中，进取级的预期收益与风险都将得到一定程度的放大，从而将表现出高收益与高风险的特征。

## 2、预警止损机制的风险

虽然本计划设计有预警止损机制，且资产管理人已依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则按合同规定及时执行预警止损，但在极端情况下，计划终止时的单位净值仍有可能远低于本资产管理计划的止损线。

## 3、投资顾问风险

本计划由受托人按照投资顾问的“投资建议”进行投资交易。投资顾问的投资服务能力、服务水平将直接影响本计划的收益水平。在本计划投资管理运作过程中，可能因投资顾问对经济形势和证券市场等判断有误、获取的信息不全等因素影响本计划的收益水平。

## 4、行政服务机构风险

本计划资产管理人委托行政服务机构履行投资指令发送、交易及清算交收安排、资产估值和会计核算等职责，行政服务机构的服务能力、服务水平将直接影响前述各项职责的履行成效。在本计划运作过程中，可能因行政服务机构指令发送有误、估值错误等因素影响本计划的运作效率进而影响收益水平。

## 5、特殊投资标的的投资风险

### (1) 债券投资特定风险

债券等固定收益类品种除存在上述市场风险、信用风险和流动性风险等外，还存在其自身的特定风险，包括：

1) 再投资风险：债券偿付本息后以及回购到期后可能由于市场利率的下降面临资金再投资的收益率低于原来利率。

2) 债券回购风险：债券回购为提升整体投资组合收益提供了可能，但也存在一定的风险。债券回购的主要风险包括信用风险、投资风险及波动性加大的风险，其中，信用风险指回购交易中交易对手在回购到期时，不能偿还全部或部分

证券或价款，造成计划净值损失的风险；投资风险是指在进行回购操作时，回购利率大于债券投资收益而导致的风险以及由于回购操作导致投资总量放大，致使整个投资组合风险放大的风险；而波动性加大的风险是指在进行回购操作时，在对投资组合收益进行放大的同时，也对投资组合的波动性(标准差)进行了放大，即投资组合的风险将会加大。回购比例越高，风险暴露程度也就越高，对计划净值造成损失的可能性也就越大。

#### (2) 期货投资风险：

进行期货交易风险较大，损失的总额可能超过本计划的全部初始保证金以及追加保证金。期货交易采用保证金制度，每日进行结算，保证金预留过多会导致资金运用效率过低，减少预期收益。保证金不足将有被强行平仓的风险，使得原有的投资策略不能得以实现。

在某些市场情况下，可能会难以或无法将持有的未平仓合约平仓。例如，这种情况可能在市场达到涨跌停板时出现。出现这类情况，保证金有可能无法弥补全部损失，本计划必须承担由此导致的全部损失。

由于国家法律、法规、政策的变化、期货交易所交易规则的修改、紧急措施的出台等原因，本计划持有的未平仓合约可能无法继续持有，本计划必须承担由此导致的损失。

#### (六) 不可抗力等其他风险

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，可能导致资产管理计划财产的损失；

2、金融市场危机、行业竞争、代理商违约等超出资产管理人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。

## 二十二、资产管理合同的变更、终止与财产清算

### (一) 合同的变更

资产委托人、资产管理人和资产托管人协商一致后，可对本合同内容进行变更。

资产管理合同约定资产管理人有权变更合同内容的情形可由资产管理人根据相关法律法规规定及资产管理合同的约定办理合同变更，并至少应于变更前2日书面通知资产委托人和资产托管人，上述情形包括：

1、资产管理计划认购、参与、退出、非交易过户的原则、时间、业务规则等变更。

2、因相应的法律法规发生变动而应当对资产管理合同进行变更。

3、对资产管理合同的变更不涉及合同当事人权利义务关系发生变化。

4、对资产管理合同的变更对资产委托人、资产托管人利益无不利影响。

本合同另有约定的除外。

### (二) 合同变更的备案

对资产管理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个工作日内将资产管理合同样本报中国证监会备案。

### （三）合同终止的情形

资产管理合同终止的情形包括下列事项：

- 1、资产管理合同存续期限届满而未延期的；
- 2、资产管理合同的委托人人数少于2人；
- 3、投资顾问被解聘，且资产管理人决定终止的；
- 4、资产管理人被依法取消特定客户资产管理业务资格的；
- 5、资产管理人依法解散、被依法撤销或被依法宣告破产的；
- 6、资产托管人被依法取消基金托管资格的；
- 7、资产托管人依法解散、被依法撤销或被依法宣告破产的；
- 8、经全体委托人、资产管理人和资产托管人协商一致决定终止的；
- 9、当本计划资产份额净值跌至止损线（如有）或以下时，本计划提前终止。
- 10、法律法规和本合同规定的其他情形。

### （四）资产管理计划财产的清算

本合同终止时，应当按法律法规和本合同的有关规定对计划资产进行清算

#### 1、资产管理计划财产清算小组

(1) 资产管理计划终止，进入清算阶段后，由资产管理计划财产清算小组统一接管计划财产。

(2) 资产管理计划财产清算小组组成：资产管理计划财产清算小组成员由资产管理人、资产托管人、行政服务机构指定的人员组成。资产管理计划财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

(3) 资产管理计划财产清算小组负责资产管理计划财产的保管、清理、估价、变现和分配。资产管理计划财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。

#### 2、清算程序

(1) 资产管理计划财产清算小组负责资产管理计划财产的保管、清理、估价、变现和分配。

(2) 清算小组在本计划终止后20个工作日内编制计划财产清算报告，由资产管理人或销售机构按照资产委托人提供的联系方式或由资产管理人通过其公司网站告知资产委托人。资产委托人在此同意，上述报告不再另行审计，除非法律法规或监管部门要求必须进行审计的。

(3) 清算小组根据计划财产清算报告完成清算财产的分配，本计划清算办理完毕。

(4) 除合同当事人三方另有约定外，计划财产期末移交采取现金方式，在计划终止日前，资产管理人必须将投资组合内所有证券变现。合同终止后，资产管理计划仍持有可流通非现金资产的，在5个交易日内（含合同终止日当日）由资产管理人进行强制变现处理；资产管理计划持有的流通受限证券，如未到期回购、未上市新股等，自限制条件解除日起（含解除当日）3个交易日内完成变现。未变现资产于清算期间损益由全体资产委托人享有或承担。未变现资产在清算期间



不提取管理费、托管费等相关费用。对该部分暂时不能变现的资产，资产管理人在其清算期间内，不再计提管理费、托管费。

### 3、清算费用

清算费用是指资产管理计划财产清算小组在进行计划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、律师，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，由资产托管人复核后办理支付。

### 4、计划剩余财产的分配

依据资产管理计划资产清算的分配方案，将资产管理计划资产清算后的全部剩余资产，按资产管理计划的投资人持有的计划份额比例进行分配。计划资产按下列顺序清偿：

- (1) 支付清算费用。
- (2) 交纳所欠税款。
- (3) 清偿计划债务。

(4) 按第五章第（二）项约定的分配机制计算三类份额在合同终止日各自净资产总额，以剩余资产为限按优先级份额净资产总额优先对优先级份额进行分配，其次分配给中间级份额，剩余资产分配给进取级份额。

如存在资产管理计划资产未能及时变现的，资产管理人应在清算报告中列明与未变现资产相关的估值方法、费用计提及分配方法等的处理程序。

计划资产未按前款（1）、（2）、（3）项规定清偿前，不分配给计划份额持有人。

### 5、计划资产清算报告的告知安排

资产管理人编制清算报告交资产托管人复核后，由资产管理人向中国证监会备案，销售机构应向资产委托人履行告知义务。

### 6、计划资产清算账册及文件由计划资产管理人保存 15 年以上。

#### （五）资产管理计划资产相关账户的注销

在证券资产变现完毕、相关权益结清后 5 个工作日内，资产管理人将委托资产托管人注销资产管理计划资产证券账户的通知书及其他销户资料寄送资产托管人，资产托管人原则上应于收到资产管理人、资产委托人提供资料后的 10 个工作日内完成证券账户注销。

资产管理人在开放式基金变现完毕、相关权益结清后 15 个工作日内完成场外开放式基金账户注销，并向资产托管人出具销户确认通知书。

计划资产清算完毕后,资产托管人注销资产管理计划的资金账户,资产管理人应给予必要的配合。

## 二十三、违约责任

(一)资产管理合同当事人违反本合同,应当承担违约责任。给其他合同当事人造成损害的,应对受损方所遭受的直接损失依法承担赔偿责任。

(二)在发生一方或多方违约的情况下,本合同能继续履行的,应当继续履行。

(三)本合同当事一方造成违约后,其他当事方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。

(四)本计划封闭运作,本计划存续期内不开放退出,也不允许委托人于非开放日违约退出。

### (五) 免责条款

资产管理人及资产托管人不就下列情形下委托财产遭致的损失承担任何责任:

1、资产管理人及资产托管人按照中国证监会的规定或当时有效的法律法规的作为或不作为而造成的损失等;

2、在没有欺诈或过错的情况下,资产管理人由于按照本合同规定的投资原则进行的投资所造成的损失、或接受投资顾问的投资建议进行投资所造成的损失等;

3、在没有欺诈或过错的情况下,资产托管人由于按照资产管理人符合本合同约定的有效指令执行而造成的损失等;

4、本合同任何一方应保证本合同规定必须由其提供的信息、数据真实完整,并承担相应的法律责任。但如果该当事人方提供的信息和数据不真实或不完整是由于本合同任何另一方提供的信息不完整和不真实所造成的,由此导致的后果由初始过错方承担,该当事人不承担违约责任。

5、对于无法预见、无法抗拒、无法避免且在本合同签署之日后发生的不可抗力事件,导致协议当事人方无法全部履行或部分履行本合同的,任何一方当事人不承担违约责任,但是,协议各方当事人应当在合理行为能力范围内勤勉尽责,以降低此类事件对委托财产和其他当事人方的影响。

6、资产托管人对由于第三方(包括但不限于交易所、登记公司等)发送的数据错误给本计划财产造成的损失等。

(六)资产管理人承诺依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用计划财产。但资产管理人不保证计划财产一定盈利,也不保证最低收益。因证券市场波动、上市公司合并、计划财产规模变动、投资顾问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,资产管理人将进行调整,并不因此承担任何责任。

(七)本合同所指损失均为直接损失。

## 二十四、争议的处理

有关本合同的签署和履行而产生的任何争议及对本合同项下条款的解释,均适用中华人民共和国法律法规(为本合同之目的,在此不包括香港、澳门特别行政区及台湾地区法律法规),并按其解释。

各方当事人同意,因本合同而产生的或与本合同有关的一切争议,合同当事人应尽量通过协商、调解途径解决。经友好协商未能解决的,应提交中国国际经济贸易仲裁委员会进行仲裁,仲裁地点为北京。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。

## 二十五、资产管理合同的效力

1、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。资产管理合同经资产委托人、资产管理人、资产托管人三方盖章及法定代表人或授权代表签字(委托人为自然人的,则由其本人或授权代表签字)之日起成立。于资产管理计划备案手续办理完毕,获中国证监会书面确认之日起生效。

2、资产管理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。

3、资产管理合同的有效期限为5年,发生本合同规定的计划提前终止或展期情形除外。本合同终止后,财产清算条款依然有效。

## 二十六、其他事项

本合同各方当事人应对签署和履行本合同过程中所接触和获取的其他方当事人的数据、信息和其它涉密信息承担保密义务,非经其他方当事人同意,不得以任何方式向第三人泄露或用于非本合同之目的(法律法规或司法监管部门要求或审计需要的除外)。本保密义务不因合同终止而终止。

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。

对本合同的合同签署页、任何有效修改、补充均是本合同的有效组成部分,与本合同具有同等的法律效力。

本合同一式叁份,合同当事人各执壹份,每份具有同等的法律效力。

(以下无正文)

## 附件 1:

## 交易监控合规表

序号	项目	监控内容
1	监控范围	1、权益类金融产品：股票、股票型/混合型基金（含 LOF、ETF 基金）、网上新股申购； 2、固定收益类金融产品：国债、债券逆回购； 3、金融衍生品：股指期货； 4、现金类金融产品：现金、银行存款（包括银行活期存款、银行定期存款和银行协议存款等各类存款）、货币市场基金。
2	监控比例及限制	1、参与股票发行申购时，所申报的金额不得超过本计划的总资产，所申报的股票数量不得超过拟发行股票公司本次发行股票的总量； 2、投资于一家上市公司所发行的股票，不得超过该上市公司总股本的4.9%，不超过流通股本的10%； 3、按成本计算，投资于一家上市公司所发行的股票，不得超过本计划资产净值的5%； 4、按成本计算，创业板股票持仓合计不得超过计划资产净值的10%； 5、不得投资于S、St、*ST股票； 6、不得投资于权证，但持有因所持股票所派发的权证除外； 7、不得投资于非公开发行股票、债券正回购交易、中小企业私募债。
3	止损线	预警线=单位净值 0.99 元；止损线=单位净值 0.98 元。

附件 2:

中国光大银行证券类资产托管产品核实信息表

托 管 人	中国光大银行 总行	业务人员及其 工 作职责	办公电话	手机
		总行业务处长 高迎春	010-63639166	13901007606
		总行核算 凌冶淞	010-63639141	13488775165
		总行清算(非担保 交收) 周晓漫	010-63639155	13911988943
		总行清算(非担保 交收) 李国强	010-63639184	13601061974
		跨行存款 王 晶	010-63639140	13910587399
		数据接收 薛 冬		010-63639177 (6); 13161508433
		指定邮寄地址及邮编		指定传真
		北京西城区太平桥大街 25 号; 100033		010-63639145/63639146 63639147/63639153
托 管 人	中国光大银行 北京中心	业务人员及其 工作职责	办公电话	手机
		副主任 方杰	010-66567609	18600152323
		核算主管 李 响	010-66567606	13810174168
		清算主管 王 玉屏	010-66567085	13366123978
		指定邮寄地址及邮编		指定传真
		北京市西城区宣武门内大街 1 号托管业务中心 邮编: 100031		01066567016/7049/7158/7320
托 管 人	中国光大银行 上海中心	业务人员及其 工作职责	办公电话	手机
		中心主任 王嵩峰	021-23050578	18019783598
		张俊	021-23050742	13761948063
		苏韧韬	021-23050748	13611808905
		指定邮寄地址及邮编		指定传真
		上海市浦东世纪大道 1118 号 邮编: 200121		021-23050747

千石资本-道冲套利 3 号资产管理计划资产管理合同

托 管 人	中国 光大 银行 深圳 中心	业务人员及其 工作职责	办公电话	手机
		杨莉莉	0755-83524031	13428969039
		戴涛	0755-83053505	18948168202
		指定邮寄地址及邮编		指定传真
		深圳市福田区竹子林四路紫竹七道 18 号 邮编：518040		0755-83053363
托 管 人	中国 光大 银行 西安 中心	业务人员及其 工作职责	办公电话	手机
		中心主任 张津琦	029-87236261	15991652740
		李琮	029-87236268	13474532855
		指定邮寄地址及邮编		指定传真
		西安市红光街 33 号 邮编：710000		029-87236115

## 附件 3:

管理人业务人员联系核实信息表

管理人	北京千石创富 资本管理有限公司	业务人员及其工作职责	办公电话	手机
		付瑶业务协调	010-88005724	15210048194
		于晓莲清算负责人	010-88005873	
		宋红元基金会计	010-88005878	
		石迎春客户服务	010-88005812	
		指定邮寄地址及邮编	指定传真	
		北京市海淀区西三环北路国际财经中心 D 座 14 层 100089		010-88005666

附件 4：

划款指令预留印鉴

中国光大银行投资与托管业务部：

本印鉴作为在光大银行办理北京千石创富资本管理有限公司旗下产品的资金划转业务时的专用印章或签字（签章）。

基金清算部业务章	
审批人签章	
复核人签章	
经办人签章	

以上资料生效日期为        年    月    日。

北京千石创富资本管理有限公司  
年    月    日



附件 5：

证券交易参照表

中国光大银行投资与托管业务部：

根据《资产管理计划之操作协议》，对投资运作中涉及的交易参数约定如下：

	交易单 元	股东账户卡名称	股东代码
上海			
深圳			

		股票		债券		基金	
		费率	最小值	费率	最小值	费率	最小 值
上海	佣金						
	印花税						
	过户费						
	经手费						
	风险结算金						
	证管费						
深圳	佣金						
	印花税						
	过户费						
	经手费						
	风险结算金						
	证管费						

需另行说明的情况如下，请选择。

1、佣金中是否包含经手费和证管费（ ）

A 包括              B 不包括

2、注明佣金的计算方法（在括号处选择☑☐）

（1） 上海按成交记录明细计算佣金（ ）；

（2） 上海按申请编号汇总计算佣金（ ）；

（3） 深圳按成交记录明细计算佣金（ ）；

（4） 深圳按申请编号汇总计算佣金（ ）；

（5） 深圳佣金按照汇总金额计算（ ）；

（6） 当佣金包含经手费征管费时，计算佣金时先判断最低值然后再减去（经手费+征管费）（ ）；

（7） 当佣金包含经手费征管费时，计算佣金时先减去（经手费+征管费），然后判断最低值（ ）；

3、深圳计算佣金保留位数：

（1）（计算佣金过程中）深圳佣金保留位数（ ）；

（2）（佣金在扣除经手费和征管费时）深圳佣金计算时费用保留位（ ）；

4、经手费、征管费费用承担方式（ ）

A 券商承担      B 产品承担      C 计入成本

5、移动平均加权保留位数（ ）；

6、交易所国债以（ ）计提佣金；

A 全价      B 净价

7、交易所非国债以（ ）计提佣金；

A 全价      B 净价

附件 6: 行政服务机构业务人员联系核实信息表

行政服 务机构	国金道富投 资服务有限公司	业务人员及其工 作职责	办公电话	手机
		刘晓芳基金会计	021-60935538	18665936685
		王静静基金会计	021-6093582	18506839651
		江晗 TA	021-60935805	13810777585
		指定邮寄地址及邮编		指定传真
		上海市浦东新区芳甸路 1088 号紫竹国际大 厦		021-60935766

(本页为千石资本-道冲套利 3 号资产管理计划资产管理合同签署页, 请资产委托人务必确保填写的资料正确有效, 如因填写错误导致的任何损失, 资产管理人和资产托管人不承担任何责任)

委托人请填写:

(一) 资产委托人

1、自然人

姓名:

证件名称: 身份证☐、军官证☐、护照☐

证件号码:

2、法人或其他组织

名称:

营业执照号码:

组织机构代码证号码:

法定代表人或负责人:

联系地址:

邮编:

联系电话:

联系人:

(二) 资产委托人认购或参与金额

人民币 元整 (¥ )

用于认购 ☐ 优先级份额 ☐ 中间级份额 ☐ 进取级份额

(三) 资产委托人账户

资产委托人认购、参与计划的划出账户与退出计划的划入账户, 必须为以资产委托人名义开立的同一个账户。特殊情况导致认购、参与和退出计划的账户名称不一致时, 资产委托人应出具符合相关法律法规规定的书面说明。账户信息如下:

账户名称:

账号:

开户银行名称:

(本页无正文，为本资产管理计划资产管理合同签署页)

资产委托人(自然人签字或机构盖章):

法定代表或授权代理人(签字或盖章):

资产管理人: 北京千石创富资本管理有限公司(盖章)



法定代表或授权代理人(签字或盖章):



资产托管人: 中国光大银行股份有限公司(盖章)



法定代表或授权代理人(签字或盖章):



签署日期: 二〇一四年 月 日

经办机构: (盖章) 经办人员: (签字或盖章)



