

合同编号：1-QB-00566019-01-001

华夏资本金汇系列 1 号集合资产管理计划 资产管理合同

资产管理人：华夏资本管理有限公司

资产托管人：中信证券股份有限公司

二〇一九年三月

华夏资本金汇系列 1 号集合资产管理计划

风险揭示书

尊敬的投资者：

当您选择投资本集合资产管理计划（简称“本计划”）时，可能获得【中等】的投资收益，但同时也存在着【中等】的投资风险。为了使您更好地了解其中的风险，特对相关风险揭示如下，请认真阅读。但本风险揭示书并不能揭示投资本集合资产管理计划的全部风险。投资者在投资本集合资产管理计划之前仍应认真阅读《华夏资本金汇系列 1 号集合资产管理计划资产管理合同》（以下简称“本合同”），全面认识本集合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，理性判断市场，谨慎做出投资决策。

一、了解拟参与的本集合资产管理计划的风险收益特征

本计划产品类型**为【固定收益类产品】**。本计划主要投资于**【银行存款、固定收益类银行理财、证券公司或其子公司发行的固定收益类资产管理计划、基金公司或其子公司发行的固定收益类资产管理计划、保险资产管理公司发行的固定收益类资产管理产品或信托公司发行的固定收益类信托计划等固定收益类金融产品、证券市场的场外期权合约、证券市场的收益互换】**。

本计划属于**风险【R3】**的投资品种，适合**风险识别、评估、承受能力【C3】**（及以上）的合格投资者。

二、了解本集合资产管理计划投资的风险

本集合资产管理计划投资可能存在的风险因素，包括但不限于：

（一）资金损失风险

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集合资产管理计划财产，但不保证委托财产中的投资本金不受损失，也不保证一定盈利及最低收益。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，本合同约定的浮动管理费计提基准（如有）仅是投资目标而不是保证。投资者充分理解投资本集合资产管理计划存在资金损失风险。

（二）市场风险

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，各个行业和证券市场的收益水平也呈周期性变化。委托财产收益水平也会随之变化而导致风险。同时，经济周期影响资金市场的走势，给本计划的固定收益投资带来一定的风险。

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，及影响企业的融资成本和利润。委托财产收益水平会受到利率变化的影响。

4、购买力风险

委托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，从而使委托财产的实际收益下降。

（三）管理风险

在委托财产管理运作过程中，资产管理人的研究水平、投资管理水平直接影响委托财产收益水平，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，都会影响委托财产的收益水平。

（四）流动性风险

在某些情况下某些投资品种的流动性不佳，由此可能影响到集合资产管理计划财产投资收益的实现。另外，本合同有效期内，资产委托人不能退出本集合资产管理计划，对资产委托人存在流动性风险。本集合资产管理计划可能提前结束或延期结束，可能导致委托资金不能按期退出，对资产委托人存在流动性风险。

（五）信用风险

指在投资过程中，交易的一方不能履行给付承诺而给另一方造成损失的可能性。资产管理人将本着审慎的原则选择交易对手，并严格审阅合约的各项条款与内容。

（六）特定的投资方法及集合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、本计划资产投资于证券市场的场外期权合约、证券市场的收益互换，其

发行人有可能无法履行其所应承担的责任。发行人的任何评级机构调低、撤回或终止发行人或其附属公司企业或其他联营公司的信用评级均可能影响发行人的偿付能力，发行人可能拒绝支付本计划所投资的证券市场期权合约和/或收益互换的到期款项，进而导致集合资产管理计划财产损失。若发行人提出或被提出破产程序或重整债务计划等相关的程序，本计划所投资的证券市场期权合约和/或收益互换发行人支付的到期款项可能显著减少或延迟。

2、本计划资产投资于银行存款、固定收益类银行理财、证券公司或其子公司发行的固定收益类资产管理计划、基金公司或其子公司发行的固定收益类资产管理计划、保险资产管理公司发行的固定收益类资产管理产品或信托公司发行的固定收益类信托计划等固定收益类金融产品，银行存款、固定收益类银行理财、证券公司或其子公司发行的固定收益类资产管理计划、基金公司或其子公司发行的固定收益类资产管理计划、保险资产管理公司发行的固定收益类资产管理产品或信托公司发行的固定收益类信托计划等固定收益类金融产品的收益情况将影响本计划委托人的投资收益情况。如果交易对手延期支付银行存款或延期兑付固定收益类金融产品本金或收益，则本计划的终止清算也将进行顺延，会对投资者的流动性需求有所影响。如果存款或固定收益类金融产品发生违约，无法全额支付银行存款或固定收益类金融产品本金或收益，则委托人将可能面临较大的损失。

3、挂钩标的的风险如下：

本计划的挂钩标的为【中证 500 指数】（交易代码为【000905.SH】），挂钩标的并不能完全代表整个股票市场。挂钩标的成份股的平均回报率与整个股票市场的平均回报率可能存在偏离。挂钩标的成份股的价格可能受到政治因素、经济因素、上市公司经营状况、投资者心理和交易制度等各种因素的影响而波动，导致指数波动，产生风险，直接影响挂钩标的的表现。

若交易所不再公布挂钩标的的价格，证券市场期权合约和/或收益互换合约计算机构有权选择提前终止相关交易并依据诚实信用及商业合理原则计算因该等提前终止交易双方需结算的款项，则委托人将可能面临损失。

若交易所在证券市场期权合约和/或收益互换合约到期日或之前对挂钩标的的计算原则、公式与方法进行了重大修改或变动，或以任何其他方式对该挂钩标

的进行了非常规的重大修改或变动，且计算机构认为该等修改或变动对交易有重大影响，则计算机构有权对交易的相关变量（包括但不限于：到期日、期初价格、期末价格、执行价格、名义数量及名义本金额等）进行调整，则委托人将可能面临损失。

若交易所未在证券市场期权合约和/或收益互换合约到期日公布挂钩标的价格，但同时未明确交易所将不再公布挂钩标的价格，则到期日顺延至交易所公布挂钩标的价格的第一个交易日。尽管有前述约定，若自到期日起 5 个交易日内，交易所一直未公布挂钩标的的价格，则计算机构有权提前终止本交易并依据诚实信用及商业合理原则计算因该等提前终止双方需结算的款项，则委托人将可能面临损失。

若由于市场原因，造成发行人无法实施与交易相关的对冲风险安排（包括但不限于就为对冲交易项下风险而进行的对冲交易，无法完成对冲头寸的建仓、减仓、维持对冲交易，或对冲交易的税费大幅度增高等）；在此情形下发行人作为非受影响方，有权提前终止本交易的全部或部分（由发行人决定），则委托人将可能面临损失。

（七）道德风险

道德风险主要指投资业务人员缺乏职业道德，不遵守公司有关规章制度，在投资过程中可能存在对投资项目把关不严、故意隐瞒投资项目存在的风险因素、人为抬高投资价格和通过项目投资进行利益输送等不当交易行为，从而导致集合资产管理计划蒙受损失的风险。

（八）集合资产管理计划不成立风险、备案不成功风险及提前终止风险

1、集合资产管理计划不成立风险。如本集合资产管理计划初始销售期限届满，集合资产管理计划认购总金额未达到规模下限（如有约定），资产管理人有权宣布本计划不成立。

2、备案不成功风险。根据法律法规的规定，本集合资产管理计划成立之日起五个工作日内应当提交中国证券投资基金业协会备案。如本集合资产管理计划未通过备案，本合同将面临不生效而无法投资运作的风险。资产管理人、资产托管人在扣除相关费用（如有）后，将本集合资产管理计划剩余财产以货币资金的形式返还给资产委托人。资产委托人对此充分知悉，并自愿承担由此导致的一切

风险和损失。

3、提前终止风险。发生本合同约定的终止情形或投资标的发生终止事件时，本集合资产管理计划将可能提前终止。

（九）操作或技术风险

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。

在委托财产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、证券公司、期货公司子公司、注册登记机构、销售机构、证券交易所、证券登记结算机构等。

在托管人履行投资监督义务过程中，因为交易习惯或者现有的技术等条件所限，托管人事实上可能难以及时、有效履行合同约定的投资监督义务。委托人在签订本合同时已充分知悉该风险，并完全理解和接受可能由该风险导致出现的经济损失。

（十）外包机构的经营风险

根据法律法规规定，从事注册登记、估值核算等行政服务外包业务的机构须获得中国证监会的认可。虽然外包机构相信其本身将按照相关法律法规的规定进行营运及管理，但无法保证其本身可以永久维持符合监管部门的法律法规要求。本计划的注册登记、估值和会计核算相关事项均外包给华夏基金管理有限公司，如在计划存续期间外包机构无法继续从事注册登记、估值核算等行政服务外包业务，可能会对计划产生不利影响。

（十一）关联交易风险

本计划的行政外包机构为管理人的母公司华夏基金管理有限公司。本计划的资产托管人为管理人的关联公司中信证券股份有限公司。管理人依照本计划投资范围进行投资时可能会与托管人、管理人及其关联方发生交易。尽管管理人和托管人均为专业机构，按照合同约定履行职责，但仍不能完全避免发生关联交易或利益冲突的可能，存在关联交易的风险。资产委托人知悉并同意管理人依据法律法规及本合同的约定进行前述关联交易，且无须取得资产委托人的个别授权。

（十二）税收政策调整风险

集合资产管理计划所适用的税收征管法律法规可能会由于国家相关税收政策调整而发生变化，投资者收益也可能因相关税收政策调整而受到影响。

根据财政部和国税总局《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》（财税〔2016〕36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》（财税〔2016〕140号）、《关于资管产品增值税有关问题的通知》（财税〔2017〕56号）等系列法规要求及其后续可能颁布的具体征收管理办法等相关文件（若有），自2018年1月1日（含）以后资管产品运营过程中发生增值税应税行为的应当缴纳增值税及附加，上述税收由委托财产承担，资产管理人有权从委托财产中直接扣除。税收政策的调整可能对集合资产管理计划的净值产生影响。

（十三）投资者适当性风险

由于普通投资者投资目标和风险收益要求变化或者产品风险等级调整，在重新进行投资者适当性匹配评估并采取调整措施之前，存在产品风险等级高于投资者风险承受能力的可能。

本计划投资范围包括证券市场的场外期权合约，根据相关法律法规、监管要求，如单一委托人认购本计划份额超过募集总规模20%的，除符合本合同约定的合格投资者要求外，还应当符合《证券期货投资者适当性管理办法》专业投资者的基本标准，且最近一年末金融资产不低于2000万元人民币，具有3年以上证券、基金、期货、黄金、外汇等相关投资经验。如委托人不满足上述条件，则存在认购失败的风险。

（十四）其它风险

1、火灾、地震等自然灾害、非因管理人、托管人自身原因导致的技术系统异常事故、政策法规的修改等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。

（十五）特别说明

资产委托人应充分认识到资产管理人不存在刚性兑付的意愿，更不具备刚性

兑付的能力。本风险揭示并不能揭示投资本集合资产管理计划的全部风险。投资者在投资本集合资产管理计划之前应认真阅读本集合资产管理计划的资产管理合同和计划说明书，全面认识本集合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及个人资产规模，理性判断市场，谨慎做出投资决策。

本人/本单位作为本集合资产管理计划的委托人已经阅读风险提示并完全理解上述内容，已充分了解并谨慎评估自身风险承受能力，充分了解集合资产管理计划的风险，愿意自行承担投资本集合资产管理计划的所面临的风险和损失。

资产委托人(自然人签字或机构盖章):

法定代表人或授权代理人(签字或盖章):

日期: 年 月 日

资产委托人承诺及声明书

1、资产委托人已仔细阅读并知悉《华夏资本金汇系列 1 号集合资产管理计划资产管理合同》（以下简称“本合同”）等法律文件和其他文件的全部内容，充分理解相关权利、义务、本集合资产管理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、资产委托人保证委托财产的来源及用途符合中华人民共和国法律法规的相关规定。本人/本单位以真实身份委托华夏资本管理有限公司运用委托资产进行投资。本人/本单位承诺委托资产来源及用途合法，不属于违反规定的公众集资，符合有关反洗钱法律法规的要求。华夏资本管理有限公司有权要求本人/本单位提供资产来源及用途合法性证明，对资产来源及用途及合法性进行调查，本人/本单位愿意配合。资产委托人确认自身为法律法规规定的合格投资者，资产委托人承诺资金来源不包含任何资产管理产品，承诺投资本计划未违反多层嵌套、杠杆约束等任何法律法规及监管规定，资产委托人及其产品投资人未使用贷款、发行债券募集的非自有资金投资本计划。资产委托人充分知晓本计划的投资范围、投资限制、投资策略，并保证委托财产投资于本合同约定的投资品种及本合同项下的投资限制不违反任何适用的法律法规、监管规定、行业规则等。

3、资产委托人承诺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。

4、资产委托人已充分理解委托财产投资将可能面临下列各项风险：资金损失风险、市场风险、管理风险、流动性风险、信用风险、特定的投资方法及集合资产管理计划财产所投资的特定投资对象可能引起的特定风险、道德风险、集合资产管理计划不成立风险、备案不成功风险及提前终止风险、操作或技术风险、外包机构的经营风险、关联交易风险、税收政策调整风险、投资者适当性风险及其他风险。

5、资产委托人了解所投资品种的风险收益特征，已充分考虑自身的风险承受能力，愿意承担相应的投资风险。

6、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做出任何承诺或担保，不保证集合资产管理计划一定盈利，也不保证最低收益或委

托财产本金不受损失。资产委托人进一步承认，资产委托人完全了解“买者自负”的原则，资产委托人投资于本集合资产管理计划将自行承担投资风险。

7、资产委托人承认，签署本合同是经资产委托人独立决策作出，符合资产委托人自身的业务决策程序要求。

8、资产委托人承认，如发生任何触发法律法规规定及监管机构要求的信息披露义务的事项，本人（或机构）将按照法律法规规定及监管机构的要求自行履行信息披露义务。

9、资产委托人承认，委托财产为本人/本机构拥有合法所有权或处分权的资产，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。

10、资产委托人知悉并认可，资产管理人、资产托管人及相关机构不应当对委托财产的收益状况作出任何承诺或担保。中国证券投资基金业协会为本计划登记备案不构成对资产管理人投资能力、持续合规情况的认可；不作为对本计划委托财产安全的保证。

11、资产委托人承诺不以非法拆分转让为目的购买本计划，不会突破合格投资者标准，将本计划份额或其收益权进行非法拆分转让。

12、资产委托人承诺，管理人已对本计划可能进行的关联交易及其风险进行充分揭示，资产委托人知悉并同意管理人依据法律法规及本合同的约定进行关联交易，且无需取得资产委托人的个别授权。

13、资产委托人知悉并认可，本计划投资范围包括证券市场的场外期权合约，根据相关法律法规、监管要求，如委托人认购本计划份额超过募集总规模 20%的，除符合本合同约定的合格投资者要求外，还应当符合《证券期货投资者适当性管理办法》专业投资者的基本标准，且最近一年末金融资产不低于 2000 万元人民币，具有 3 年以上证券、基金、期货、黄金、外汇等相关投资经验。如委托人不满足上述条件，则存在认购失败的风险。

本人/本单位将严格遵守以上承诺，否则华夏资本管理有限公司有权解除资产管理合同，本人违反委托资产来源及用途合法性承诺的，华夏资本管理有限公

司还有权依法限制本人/本单位提取该委托资产。本人/本单位承担因此造成的全部损失和法律责任。

资产委托人(自然人签字或机构盖章):

法定代表人或授权代理人(签字或盖章):

日期: 年 月 日

目 录

一、前言	11
二、释义	11
三、声明与承诺	13
四、资产管理计划的基本情况	15
五、资产管理计划份额的初始销售	15
六、资产管理计划的备案	17
七、资产管理计划的参与和退出	18
八、当事人及权利义务	18
九、资产管理计划份额的登记	23
十、资产管理计划的投资	24
十一、投资经理的指定与变更	25
十二、资产管理计划的财产	26
十三、划款指令的发送、确认与执行	27
十四、交易及清算交收安排	29
十五、越权交易	30
十六、资产管理计划财产的估值和会计核算	32
十七、资产管理计划的费用与税收	35
十八、资产管理计划的收益分配	39
十九、报告义务	39
二十、风险揭示	40
二十一、资产管理合同的变更、终止	45
二十二、清算程序	46
二十三、违约责任	49
二十四、法律适用和争议的处理	50
二十五、资产管理合同的效力	50
二十六、其他事项	51

一、 前言

订立本合同的目的、依据和原则

1、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特定多个客户资产管理业务过程中的权利、义务及职责，确保华夏资本金汇系列1号集合资产管理计划（以下或简称“资产管理计划”）财产的安全，保护当事人各方的合法权益。

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法》（以下简称“《证券法》”）、《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《证券期货经营机构私募资产管理业务运作管理暂行规定》（以下简称“《暂行规定》”）、《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“《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》（“《管理规定》”）、《证券期货投资者适当性管理办法》和其他有关规定。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，各方当事人认可资产管理人根据届时有效的法律法规对本合同做出的相应变更和调整

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

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。在本合同存续期间，资产委托人自全部退出资产管理计划之日起，该资产委托人不再是资产管理计划的投资人和资产管理合同的当事人。本合同按照中国证券投资基金业协会（以下简称“基金业协会”）的要求进行备案（法律法规对备案另有规定的，从其规定），但基金业协会接受本合同草案的备案并不表明其对资产管理计划的价值和收益做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

在本合同中，除上下文另有规定外，下列用语应当具有如下含义：

1、集合资产管理计划、资产管理计划、本计划、计划：指华夏资本金汇系列1号集合资产管理计划。

2、本合同：指资产委托人、资产管理人和资产托管人签署的《华夏资本金汇系列1号集合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。

3、资产委托人、委托人：指签订本合同，认购华夏资本金汇系列1号集合资产管理计划初始金额不低于100万元人民币，能够识别、判断和承担相应投资风险且符合下列条件的自然人和法人或者其他组织。

（一）具有2年以上投资经历，且满足以下条件之一：家庭金融净资产不低于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。

（二）最近1年末净资产不低于1000万元的法人单位。

（三）金融管理部门视为合格投资者的其他情形。

4、资产管理人、管理人：本计划资产管理人指华夏资本管理有限公司。

5、资产托管人、托管人：指中信证券股份有限公司。

6、注册登记机构：指华夏基金管理有限公司。

7、华夏资本金汇系列1号集合资产管理计划（本计划、资产管理计划）：指按照本合同的约定设立，为资产委托人的利益，将特定多个资产委托人交付的资金或证券进行集中管理、运用或处分，进行证券投资活动的集合资产管理安排。

8、计划说明书：指《华夏资本金汇系列1号集合资产管理计划计划说明书》。

9、工作日/交易日：指上海证券交易所和深圳证券交易所的正常交易日。

10、日：指公历日。

11、开放日：指非计划初始销售期间，资产管理人办理计划参与、退出业务的工作日。本计划封闭运作，在计划存续期内不开放参与退出。

12、证券账户：根据中国证监会有关规定和中国证券登记结算有限责任公司（下称“中登公司”）等相关机构的有关业务规则，由资产托管人为委托财产在中登公司上海分公司、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及银行间市场清算所股份有限公司开立的有关账户及其他证券类账户。

13、托管账户：指资产托管人根据有关规定为本集合资产管理计划财产开立的专门用于清算交收的银行账户。

14、资产管理计划财产、委托财产：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。

15、计划资产总值：指资产管理计划资产拥有的各类有价证券、银行存款本息及其他资产的价值总和。

16、计划资产净值：指资产管理计划资产总值减去负债后的价值。

17、计划份额净值：指计算日资产管理计划资产净值除以计算日资产管理计划份额总数所得的数值。

18、资产管理计划资产估值：指计算、评估资产管理计划资产和负债的价值，以确定资产管理计划资产净值和份额净值的过程。

19、初始销售期间：指资产管理合同及/或计划说明书中载明，并经中国证监会核准的计划初始销售期限，自计划份额发售之日起最长不超过 1 个月。

20、存续期：指本合同生效至终止之间的期限。

21、认购：指在资产管理计划初始销售期间，资产委托人按照本合同的约定购买本计划份额的行为。

22、参与：指在资产管理计划开放日，资产委托人按照本合同的规定参与本计划份额的行为。本计划封闭运作，在计划存续期内不开放参与退出。

23、退出：指在资产管理计划开放日，资产委托人按照本合同的规定退出本计划份额的行为。本计划封闭运作，在计划存续期内不开放参与退出。

24、违约退出：指资产委托人在非合同约定的退出开放日退出资产管理计划的行为。本资产管理计划不接受违约退出。

25、销售机构：指符合中国证监会规定的条件，取得基金销售资格并接受资产管理人委托，办理本计划认购、参与、退出等业务的机构。本计划销售机构为郑州银行股份有限公司。

26、不可抗力：指本合同当事人不能预见、不能避免、不能克服的客观情况。

三、声明与承诺

（一）资产委托人声明其为符合《指导意见》《管理办法》《管理规定》要求的合格投资者，且不是资产管理人的董事、监事、从业人员及其配偶。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,了解挂钩标的的特定风险,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。资产委托人承诺其从事本项委托不会引致任何违反法律法规的关联交易、内幕交易或利益输送。资产委托人保证其认购金额不低于 100 万人民币且符合法律法规认可的下列合格投资者要求之一,其中:

(1) 机构投资者最近 1 年末净资产不低于 1,000 万元;

(2) 自然人投资者具有 2 年以上投资经历,且满足以下条件之一:家庭金融净资产不低于 300 万元,家庭金融资产不低于 500 万元,或者最近三年本人年均收入不低于 40 万元。

资产委托人不应使用贷款、发行债券等筹集的非自有资金投资本计划。

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,不保证资产管理计划一定盈利,也不保证最低收益或委托财产本金不受损失。资产委托人进一步承认,资产委托人完全了解“买者自负”的原则,资产委托人投资于本资产管理计划将自行承担投资风险。资产委托人知晓法律法规规章和相关规范性文件对合格投资者的界定及要求,承诺无论资金来源、投资经历、财务实力、风险识别能力和风险承担能力等条件均满足相关规定标准,并认可本资产管理合同一旦满足约定的生效条件即对本人发生确定法律约束力。

(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财产,但不保证本金不受损失,不保证资产管理计划一定盈利,也不保证最低收益,资产管理人未对委托财产的收益状况作出任何承诺或担保。资产管理人对本计划的合规性负责,由于资产管理计划本身的合规性问题给委托资产造成损失的,托管人不承担责任。

(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财产,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：华夏资本金汇系列 1 号集合资产管理计划。

(二) 资产管理计划的类别：固定收益类。

(三) 资产管理计划的运作方式：封闭式，存续期内不开放参与、退出，不接受违约退出申请。

(四) 资产管理计划的投资目标：追求在有效控制风险的前提下力争为投资者实现投资收益。

(五) 资产管理计划的存续期限：自合同生效之日起至 2019 年 10 月 28 日止。

(六) 资产管理计划的初始资产规模限制

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 5000 万元人民币，但中国证监会另有规定的除外。

(七) 资产管理计划份额的初始销售面值：人民币 1.00 元。

(八) 其他

资产管理计划应当设定为均等份额。除资产管理合同另有约定外，每份计划份额具有同等的合法权益。

(九) 挂钩标的

本计划的挂钩标的为【中证 500 指数】（交易代码为【000905.SH】）。

五、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、销售方式、销售对象

1、初始销售期间

本资产管理计划的初始销售期间自计划份额发售之日起最长不超过 30 天，具体时间由资产管理人根据相关法律法规以及本合同的规定确定，并在计划说明书中披露。

如果在此期间提前满足《管理规定》规定的条件的，资产管理人可提前终止初始销售。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日起不再接受认购申请。

2、销售方式

本计划将通过销售机构销售网点向特定合格投资者进行销售，具体销售机构名单、地点、

联系方式等见《计划说明书》。

3、销售对象

符合《管理规定》要求，委托投资本计划的初始金额不低于 100 万人民币，且能够识别、判断和承担相应投资风险的自然人、企业法人、事业法人、社会团体或其他组织，以及中国证监会允许的其他客户等。本计划的资产委托人不得超过 200 人。法律法规将来另有规定的，从其规定。

本资产管理计划的销售对象需同时符合下列相关合格投资者标准：

- (1) 机构投资者最近 1 年末净资产不低于 1,000 万元；
- (2) 自然人投资者具有 2 年以上投资经历，且满足以下条件之一：家庭金融净资产不低于 300 万元，家庭金融资产不低于 500 万元，或者最近三年本人年均收入不低于 40 万元。

(二) 资产管理计划份额的认购和持有限额

初始销售期间，每一计划份额的认购价格为 1.00 元人民币。认购资金应以现金形式交付。投资者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），并可多次追加认购，初始销售期间单笔最低追加认购金额为 10 万元人民币（不含认购费用）。

(三) 资产管理计划份额和认购费用的计算

本资产管理计划不收取认购费用，有效认购资金在初始销售期间产生的利息将折算成计划份额归投资者所有，其中利息转份额以注册登记机构的记录为准。

认购份额=（认购金额+认购期间利息）/计划份额初始销售面值

认购份额计算结果按照四舍五入方法，保留到小数点后两位，由此误差产生的损失由资产管理计划财产承担，产生的收益归资产管理计划财产所有。

(四) 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，可以委托销售机构代为完成投资者尽职调查工作，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，以各销售机构的具体规定为准。

投资者适当性管理。资产管理人应了解投资者情况，遵守投资者适当性管理的相关规定。资产管理人委托销售机构进行销售的，由委托销售机构代为完成投资者适当性管理工作，并将相关资料提供给资产管理人。

资产管理人委托销售机构进行销售的，由销售机构代为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。

3、认购申请的确认。

销售机构受理认购申请并不表示该申请一定成功,而仅代表销售机构确实收到了认购申请。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。

认购申请一经受理,不得撤销。对于认购申请,注册登记机构按照时间优先、金额优先的原则进行确认,确保本资产管理计划委托人数不超过 200 人,对未予确认的认购资金予以返还。但该认购申请受限于单一资产委托人最低资产要求。

(五) 初始销售期间客户资金的管理

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,在资产管理计划成立之前,任何机构和个人不得动用。

六、资产管理计划的备案

(一) 资产管理计划备案的条件

本资产管理计划初始销售期限届满,符合下列条件的,资产管理人应当按照规定办理验资和资产管理计划备案手续:

资产管理计划委托人人至少 2 人且不超过 200 人,资产管理计划的初始资产合计不低于 5000 万元人民币,中国证监会另有规定的除外。

(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,自资产管理计划成立之日起五个工作日内,向基金业协会提交资产管理合同、验资报告或资产缴付证明及客户资料表等材料,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。

自基金业协会书面确认之日起,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)加计在初始销售期形成的利息将在资产管理计划成立后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。

法律法规对备案另有规定的,从其规定。

（三）资产管理计划销售失败的处理方式

资产管理计划销售期限届满，不能满足本计划成立条件的，资产管理人应当：

- 1、以其固有财产承担因销售行为而产生的债务和费用。
- 2、在资产管理计划销售期限届满后 30 日内返还客户已缴纳的款项，并加计银行同期活期存款利息。

七、资产管理计划的参与和退出

（一）参与和退出

本资产管理计划封闭运作，在计划存续期内不开放参与退出，也不接受违约退出申请。

（二）非交易过户和转让

本资产管理计划不接受非交易过户和转让。

八、当事人及权利义务

（一）资产委托人

1、资产委托人概况

签署本合同且合同正式生效的投资者即为本合同的资产委托人。

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）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。
- （6）资产管理计划设定为均等份额，除资产管理合同另有约定外，资产委托人持有的每份计划份额具有同等的合法权益。

- （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。
- （2）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，配合资产管理人或其销售机构就资产委托人风险承受能力、反洗钱、投资者适当性、非居民金融账户涉税信息等事项进行的尽职调查；并在上述文件或资料发生变更时，及时提交变更后的相关文件与资料。
- (6) 不得违反本合同的规定干涉资产管理人的投资行为。
- (7) 不得从事任何有损资产管理计划及其投资人、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权益的活动。
- (8) 按照本合同的约定缴纳固定管理费、浮动管理费、托管费以及因资产管理计划财产运作产生的其他费用。
- (9) 主动关注资产管理人和销售机构发布的公告。
- (10) 保守商业秘密，不得泄露委托财产投资计划、投资意向等。法律法规规定或有权机关要求的除外。
- (11) 保证投资本集合资产管理计划的资金的来源合法，主动了解所投资品种的风险收益特征；

(12) 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：华夏资本管理有限公司

住所：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）

办公地址：北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座9层

邮政编码：100033

法定代表人：李生平

组织形式： 有限责任公司

注册资本： 3.5 亿元人民币

存续期间： 持续经营

联系人： 田宇

联系电话： 010-88066036

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所产生的权利。
- (4) 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本合同或有关法律法规规定的行为，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，应当及时采取措施制止，并报告中国证监会。
- (5) 自行销售或者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的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) 资产管理人有权根据市场情况对本资产管理计划的总规模、单个资产委托人首次参与金额、每次参与金额及持有的本计划总金额限制进行调整。
- (8) 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；
- (9) 委托其他机构对投资涉及的资产进行尽职调查、资产评估等；
- (10) 以受托人的名义，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；
- (11) 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) 按照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用资产管理计划财产。
- (3) 按照本合同的约定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其管理的基金财产、其他委托财产和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，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) 按照本合同的约定接受资产委托人和资产托管人的监督。

(8) 以资产管理人名义, 在投资所涉交易对手等当事人违反相关合同项下义务, 或者发生其他可能影响委托财产安全的情形时, 代表委托人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为。

(9) 根据《管理办法》和本合同的规定, 编制并向资产委托人报送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(如适用)。

(10) 根据《管理办法》和本合同的规定, 编制特定资产管理业务季度及年度报告, 并向中国证监会备案(如适用)。

(11) 计算并按照本合同的约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) 保存资产管理计划资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。

(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) 资产管理人在投资所涉交易对手等当事人违反相关合同项下义务, 或者发生其他可能影响委托财产安全的情形时, 为实现委托人的最大利益, 应及时采取适当有效的措施避免委托财产损失的发生或扩大, 包括行使投资者权利、提起诉讼或仲裁在内的各种手段收回委托财产本金和收益。

(17) 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: 中信证券股份有限公司

住所: 广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座

通讯地址: 北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦

法定代表人: 张佑君

联系人: 吴俊文

联系电话: 95548-32、资产托管人的权利

(1) 按照本合同的约定, 及时、足额获得资产托管费。

(2) 根据本合同及其他有关规定, 监督资产管理人对资产管理计划财产的投资运作, 对于资产管理人违反本合同或有关法律法规规定的行为, 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) 按照本合同的约定, 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) 安全保管资产管理计划财产; 对于已经划转出托管账户资产, 以及处于托管人实际控制之外的资产不承担保管责任。

(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) 对所托管的不同资产管理计划财产分别设置账户, 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资金账户、证券账户等投资所需账户。

(6) 复核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 (如适用)。

(9) 按照本合同的约定, 根据资产管理人的投资指令, 及时办理清算、交割事宜。

(10) 按照法律法规及监管机构的有关规定, 保存资产管理计划资产管理业务活动有关的合同、协议、凭证等文件资料。

(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、本合同及其他有关规定另有要求外, 不得向他人泄露。

(13) 根据法律法规及本合同的规定监督资产管理人的投资运作, 资产托管人发现资产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约定的, 应当拒绝执行, 并向中国证监会相关派出机构和证券投资基金业协会报告。

(14) 办理与集合资产管理计划托管业务活动有关的信息披露事项。

(15) 向资产管理人提供按照《企业会计准则》确定的控股股东、实际控制人及其他关联方名单，以供核查本计划可能进行的关联交易。

(16) 国家有关法律法规、监管机构及本合同规定的其他义务。

九、资产管理计划份额的登记

(一) 本集合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华夏基金管理有限公司负责办理。

(三) 注册登记机构履行如下职责：

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，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。本合同各方特别同意，资产管理人可委托华夏基金管理有限公司办理本资产管理计划份额的后台运营业务，各方承诺对资产管理人委托的第三方机构华夏基金管理有限公司的相关操作进行配合；对于为本资产管理计划的后台运营而由资产管理人、资产托管人、第三方机构华夏基金管理有限公司等相关方签署的相关协议、备忘录或其他文件，资产委托人均予以认可。

4、严格按照法律法规和本资产管理合同规定计算浮动管理费。

5、保存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 20 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或资产管理计划带来的损失，须承担相应的赔偿责任，但法律法规或监管机构另有规定的除外。

7、按本资产管理计划合同，为资产委托人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、法律法规规定的其他职责。

(四) 注册登记机构履行上述职责后，有权取得注册登记费。

十、资产管理计划的投资

(一) 投资目标：追求在有效控制风险的前提下力争为投资者实现投资收益。

(二) 投资范围

(1) 银行存款、固定收益类银行理财、证券公司或其子公司发行的固定收益类资产管理计划、基金公司或其子公司发行的固定收益类资产管理计划、保险资产管理公司发行的固定收益类资产管理产品或信托公司发行的固定收益类信托计划等固定收益类金融产品；

(2) 证券市场的场外期权合约、证券市场的收益互换。资产管理人应当根据本合同确定的投资范围进行合理的投资，不得擅自超越该投资范围。本计划投资不涉及任何场内交易。

资产管理计划投资于其他资产管理产品的（如有），则所投资的资产管理产品不再投资除公募基金以外的其他资产管理产品。

(三) 投资策略

本计划投资银行存款或理财等固定收益类金融产品时，资产管理人通过采取合理措施，甄别交易对手，与交易对手签署相关协议，约定本计划与交易对手的权利与义务，尽可能规避交易对手方风险并获得较好回报。

本计划投资证券市场的场外期权合约和/或收益互换时，资产管理人选择信用情况良好的证券市场的场外期权合约和/或收益互换交易对手方，尽可能规避交易对手方风险，对证券市场的场外期权合约和/或收益互换的风险收益以及投资时机进行充分评估后，投资于定制化的证券市场的场外期权合约和/或收益互换。

(四) 投资限制

本合同委托财产的投资组合将遵循以下限制：

- 1、本计划不得违反资产管理合同中的投资范围的规定；
- 2、投资于存款、债券等债权类资产的比例不低于资产管理计划总资产 80%；
- 3、投资于同一资产的资金，不超过本计划资产净值的 25%；
- 4、投资于场外期权合约、收益互换的资金，不超过本计划资产净值的 20%；
- 5、法律法规、中国证监会以及本合同规定的其他投资限制。

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

- 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）风险收益特征

本计划属于【R3】风险的集合资产管理计划品种，适合风险识别、评估、承受能力【C3】（及以上）的合格投资者。

（七）投资政策的变更

经资产委托人、资产管理人和资产托管人协商一致可对投资政策进行变更，变更投资政策应以书面形式做出。投资政策变更应为调整投资组合留出必要的时间。

（八）投资建仓期

本计划的建仓期自产品成立之日起不超过一个月。

十一、投资经理的指定与变更

（一）投资经理的指定

资产管理计划的投资经理由资产管理人负责指定，本计划的投资经理的资料如下：

本资产管理计划的投资经理简介：

周柏含，商学硕士，曾任华夏基金机构理财部委托类专户投资经理，负责委托类专户的投资管理工作。

（二）投资经理的变更

1、投资经理变更的条件

如本集合资产管理计划的投资经理因故无法履行其职能的，资产管理人可以变更投资经理。

2、投资经理变更的程序

资产管理人有权决定变更投资经理。投资经理变更后，资产管理人应在 5 日内将新投资经理的姓名和简历通知资产委托人及资产托管人。资产管理人在其网站公告签署变更事项即视为履行了告知义务。

十二、资产管理计划的财产

（一）集合资产管理计划财产的保管与处分

1、集合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。资产管理人、资产托管人不得将资产管理计划财产归入其固有财产。资产托管人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。

2、除本款第3项规定的情形外，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、资产托管人可以按照本合同的约定收取固定管理费、浮动管理费、托管费以及本合同约定的其他费用。资产管理人、资产托管人以其固有财产承担法律责任，其债权人不得对集合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，资产管理计划财产不属于其清算财产。

4、集合资产管理计划财产产生的债权不得与不属于集合资产管理计划财产本身的债务相互抵销。非因集合资产管理计划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集合资产管理计划财产强制执行。上述债权人对集合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）集合资产管理计划财产相关账户的开立和管理

1、资产托管人按照规定开立资产管理计划财产的资金账户，资金账户预留印鉴，要加盖托管人印鉴，并由托管人保管和使用。委托人和管理人应当在开户过程中给予必要的配合。托管专户由托管人负责管理，委托资产托管期间的一切货币收支活动，包括但不限于投资、支付费用、资产划拨、追加资产和提取资产等，均需通过该账户进行。托管专户内的银行存款利息按托管人公布的银行同业利率为准。账号户名以托管人实际开立为准。

资产托管人对存放于资金账户的现金资产以及其他由资产托管人实际控制的财产进行保管。对于证券登记机构、期货经纪公司、基金公司、结算机构、票据保管机构、他行定期存款等非资产托管人保管的财产，资产托管人不承担保管责任。

2、本计划的定期存单应由托管人保管，要留托管人预留印鉴，托管人保管定期存单，定期存单当面移交，到期后资金必须划回托管账户。存款证实书不得被质押或以任何方式被

抵押，不得用于背书转让。

3、本计划不开立证券账户、债券账户、投资基金账户、期货账户等账户，如需开立，需经资产委托人、资产管理人和资产托管人协商一致并应为开立账户留出必要的时间。

十三、划款指令的发送、确认与执行

（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，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”）。授权通知中应包括被授权人的名单、权限、电话、传真、预留印鉴和签字样本，并注明相应的交易权限、授权生效时间，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。授权通知由管理人盖章。资产托管人在收到授权通知当日向资产管理人确认。授权通知须载明授权生效日期。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收到该通知时生效。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

划款指令是在管理资产管理计划财产时，资产管理人向资产托管人发出的资金划拨及其他款项支付的指令。管理人发给托管人的指令应写明款项事由、支付时间、最迟到账时间、大小写划款金额、付款账户信息、收款账户信息等，加盖预留印鉴并由被授权人签字或签章。

（三）划款指令的发送、确认和执行的程序和程序

指令由“授权通知”确定的被授权人代表资产管理人用传真方式或其他资产托管人和资产管理人认可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托管人以录音电话的方式进行确认。传真以获得收件人（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“授权通知”规定的方法确认指令有效后，方可执行指令。

对于被授权人依照“授权通知”发出的指令，资产管理人不得否认其效力。资产管理人应按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，发送人应依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,至少提前两个小时(工作时间:工作日 9:00-11:30, 13:00-17:00)向托管人发送划款指令。托管人对于小于两个小时划款时间的指令,不保证当日完成在银行的划付流程。

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。

资产托管人收到资产管理人发送的指令后,应对传真划款指令进行表面一致性的形式审查,验证指令的书面要素是否齐全、审核印鉴和签名是否和预留印鉴和签名样本相符,复核无误后依据本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联系和沟通,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传真提供相关交易凭证、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指令时,应确保本计划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为不执行该指令而造成的损失。划款指令原件与托管人收到的传真件不一致时以托管人收到的传真件为准。

(四) 资产托管人依照法律法规暂缓、拒绝执行指令的情形和处理程序

资产托管人发现资产管理人发送的指令违反《基金法》、《管理规定》、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,由此造成的损失由资产管理人承担。

(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时,应当拒绝执行,并及时通知资产管理人改正。

(六) 更换被授权人的程序

资产管理人撤换被授权人员或改变被授权人员的权限,必须提前至少一个交易日,使用传真方式或其他资产管理人和资产托管人认可的方式向资产托管人发出由管理人盖章的被授权人变更通知,并提供新被授权人签字及签章样本,同时电话通知资产托管人,资产托管人收到变更通知当日通过电话向资产管理人确认。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,自通知载明的生效时间开始生效。资产托管人收到通知的日期同于

或晚于通知载明的生效日期的，则通知自资产托管人收到该通知的下一个交易日生效。如托管人收到的扫描件与原件不符，以托管人收到的扫描件为准。资产管理人在电话告知后三日内将被授权人变更通知的正本送交资产托管人。被授权人变更通知生效后，对于已被撤换的人员无权发送的指令，或新被授权人员超权限发送的指令，资产管理人不承担责任。

（七）划款指令的保管

划款指令若以传真形式发出，则正本由资产管理人保管，资产托管人保管指令传真件。当两者不一致时，以资产托管人收到的投资指令传真件为准。

（八）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，资产托管人不承担任何形式的责任。在正常业务受理渠道和指令规定的时间内，因资产托管人原因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，但银行托管专户余额不足或资产托管人如遇到不可抗力的情况除外。

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资产管理人过错造成的情形，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，资产托管人不承担因正确执行有关指令而给资产管理人或资产管理计划财产或任何第三人带来的损失，相应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。

十四、交易及清算交收安排

（一）委托财产投资于非担保交收的投资品种时，资产管理人应为资产托管人划款预留合理的执行时间。

委托财产投资于场外期权/收益互换时，需要管理人提供场外期权/收益互换交易确认书后，书面明确期权费/固定收益后方可进行指令划付。如指令划付前无法提供交易确认书，则需管理人提供期权/收益互换交易的甲方与乙方签订的书面授权书以及经授权的邮箱发送的期权/收益互换交易相关信息（包括但不限于交易时间、交易标的、期权费/固定收益金额，期权/收益互换名义金额等）。

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。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。资产管理人在发送划款指令时应充分考虑资产托管人的划款处理所需的合理时间。如由于资产管理

人的原因导致无法按时支付投资交易清算款项，由此造成的直接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、本合同的指令无合理理由不得拖延或拒绝执行。如由于资产托管人的原因导致计划财产无法按时支付投资交易清算款项，由此造成的直接损失由资产托管人承担。

（二）可用资金余额的确认

资产托管人应于每个工作日上午 9:30 前、以及每日日终完成当日投资交易资金结算并核实账户资金余额后，将可用资金余额以双方认可的方式提供给资产管理人。

十五、越权交易

（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或超出本合同项下投资限制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。

资产管理人应在有关法律法规和本合同规定的权限内运用资产管理计划财产进行投资管理，不得违反有关法律法规和本合同的约定，超越权限管理、从事证券投资。

（二）越权交易的处理程序

- 1、违反有关法律法规和本合同规定进行的投资交易行为

资产托管人对于承诺监督的越权交易中，发现资产管理人的投资指令违反法律法规的规定，或者违反本合同约定的，应当拒绝执行，立即通知资产管理人并有权及时报告中国证监会。

资产托管人对于承诺监督的越权交易中，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有权及时报告中国证监会。

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，资产托管人应报告中国证监会。

- 2、法律法规禁止的超买、超卖行为

资产托管人在行使监督职能时，如果发现资产管理计划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，由此给资产托管人及资产管理计划财产造成的损失由资产管理人承担。如果因非资产托管人的原因发生超买行为，资产管理人必须于 T+1 日上午 12:00 前完成融资，确保完成清算交收。

3、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，资产管理人应当在可交易之日起【15】个交易日内调整完毕。

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，所发生的收益归本资产管理计划财产所有。

（三）资产托管人对资产管理人的投资监督

1、资产托管人对资产管理人的投资行为行使监督权。若资产管理人的投资行为违反法律法规、中国证监会规定及本合同约定的投资范围、投资限制、投资禁止行为等，资产托管人应当提示资产管理人及时纠正。

2、委托人确认，托管人投资监督的准确性和完整性受限于管理人及其他中介机构提供的信息。托管人对管理人及其他中介机构提供的信息的准确性和完整性不做任何担保、暗示或表示，并且对由于管理人及其他中介机构提供的信息的准确性和完整性、真实性所引起的损失不承担任何责任。

3、委托人同意，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以外的因素致使资产管理计划投资不符合法律、行政法规和中国证监会规定的投资比例或者本合同约定内容的，不属于越权交易，应当属于被动超标。资产管理人应在流动性受限资产可出售、可转让或者恢复交易的15个交易日进行调整，以达到标准。如因停牌等原因致使本资产管理计划无法在15个交易日内调整完毕的，资产管理人应当在该原因消失后立即进行调整。本合同终止前十个交易日内，资产管理人有权对资产管理计划财产所投资证券进行变现（如适用），由此造成投资限制、投资范围不符合投资政策规定的，不属于越权交易，应当属于被动超标。因被动超标而对资产管理计划财产造成的损失由集合资产管理计划财产承担。

4、托管人发现管理人违规情况时的通知方式为邮件、电话或书面通知。管理人接收通知的邮件地址：hxzbrc@chinaamc.com、电话：010-88066948。

联系人员：王艺霖。

5、在托管人履行投资监督义务过程中，因为交易习惯或者现有的技术等条件所限，托管人事实上可能难以及时、有效履行合同约定的投资监督义务。委托人在签订本合同时以充

分知悉该风险，并完全理解和接受可能由该风险导致出现的经济损失。

十六、资产管理计划财产的估值和会计核算

（一）资产管理计划财产的估值

1、估值目的

资产管理计划财产估值目的是客观、准确地反映资产管理计划财产的价值。

2、估值时间

本计划存续期间，资产管理人与资产托管人每周对计划财产进行估值并核对。资产管理人于每周第一个交易日计算上周最后一个交易日的集合资产管理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。资产管理人于产品终止日的交易结束后计算当日的集合资产管理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，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。

3、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。

4、估值对象

资产管理计划所拥有的资产及负债。

5、估值方法

本计划按以下方式进行估值：

按照《证券投资基金会计核算业务指引》估值。

本计划持有的银行存款以本金列示，按利率逐日计提利息。

本计划持有的固定收益类银行理财、证券公司或其子公司发行的固定收益类资产管理计划、基金公司或其子公司发行的固定收益类资产管理计划、保险资产管理公司发行的固定收益类资产管理产品或信托公司发行的固定收益类信托计划等固定收益类金融产品，如该金融产品的管理人为该金融产品定期公布金融产品份额净值的，则以估值日前一交易日公布的金融产品份额净值进行估值，估值日前一交易日未公布金融产品份额净值的，以前最近一次公布的金融产品份额净值计算；如该金融产品的管理人不对该金融产品定期公布份额净值的，则以该金融产品管理人公布的该金融产品的预期收益率等指标进行估值，即该金融产品以本金列示，并按该金融产品管理人公布的预期收益率等指标逐日计提预期收益；估值日该

金融产品管理人既不公布金融产品份额净值，也不公布金融产品的预期收益率等指标的，采用历史成本进行估值。

本计划持有的证券市场的场外期权合约采用期权合约成本（即期权费）进行估值。

收益互换根据交易对手或第三方提供的估值基准日的估值报告于每个估值日更新保证金和合约损益。交易对手无法提供估值报告的，按成本估值。本计划收益互换的估值方为交易对手方，每个估值日的合约价值为截至该估值日交易对手方应支付而未支付的收益金额，每个估值日的盯市金额=合约价值+预付金余额（固定收益）。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。

6、估值程序

资产管理人于每周第一个交易日计算上周最后一个交易日的资产管理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。资产管理人于产品终止日的交易结束后计算当日的集合资产管理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，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。集合资产管理计划财产净值是指集合资产管理计划资产总值减去负债后的价值。资产管理计划资产份额净值计算保留小数点后3位，小数点后第4位四舍五入。

7、估值错误的处理

如资产管理人或资产托管人发现计划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。

当计划资产估值错误偏差达到计划财产净值的0.5%时，资产管理人和资产托管人应该立即更正并在定期报告中报告资产委托人。资产管理人计算的计划财产净值已由资产托管人复核确认、但因资产估值错误给资产委托人造成损失的，由资产管理人与资产托管人按照管理费率 and 托管费率的比例各自承担相应的责任，但由于管理人或第三方提供数据有误导致资产托管人复核有误的，托管人不承担责任。

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,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,但是未能发现该错误的,由此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。

8、暂停估值的情形

(1) 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,而资产管理人为保障投资者的利益,决定延迟估值的情形;

(4) 中国证监会认定的其他情形。

9、资产管理计划份额净值的确认

用于向资产委托人报告的计划份额净值由资产管理人负责计算,资产托管人进行复核。如经相关各方在平等基础上充分讨论后,仍无法达成一致的意见,按照资产管理人对计划财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。计划资产份额净值的计算保留到小数点后3位,小数点后第4位四舍五入。

(二) 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主要会计责任方。

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、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、会计制度执行国家有关会计制度。

5、本计划单独建账、独立核算。

6、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,按照本合同约定编制会计报表。

7、资产托管人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并

以书面方式确认。

十七、资产管理计划的费用与税收

（一）资产管理业务费用的种类

- 1、资产管理人的固定管理费。
- 2、资产托管人的资产托管费。
- 3、资产管理人的浮动管理费。
- 4、资产管理计划的证券交易费用（包括但不限于本计划投资的所有金融工具的交易费、经手费、印花税、证管费、过户费、手续费、经纪商佣金、权证交易的结算费及其他类似性质的费用等）。
- 5、为了委托财产利益，除去资产管理人和资产托管人因自身原因而导致的、与委托财产有关的诉讼、追索费用。
- 6、资产管理计划成立与之相关的会计师费、律师费和审计费（若有）。
- 7、资产管理计划财产的银行汇划费用。
- 8、资产管理计划成立后与之相关的信息披露费用（如有）。
- 9、按照国家有关规定和本合同约定，可以在计划资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、资产管理人的固定管理费

资产管理计划财产的年管理费率为 0.70%。计算方法如下：

$$H = E \times 0.70\% \div \text{当年天数} \times \text{当期存续天数}$$

H 为每周应计提的固定管理费

E 为本计划初始设立规模

当期存续天数指上周最后一个交易日（不含）到本周最后一个交易日（含）的实际天数；首次计时指合同生效日（含）到首周最后一个交易日（含）的实际天数。

本计划的固定管理费自资产管理合同生效日起，每周最后一个交易日、终止日计提，计划终止后支付。经资产管理人与资产托管人核对一致后，由资产托管人根据管理人出具的指令于集合资产管理计划终止后三个工作日内从集合资产管理计划资产中一次性支付给资产管理人。

户名： 华夏资本管理有限公司

开户行：中国建设银行深圳市分行营业部

账号：44201501100052551736

2、资产托管费

资产管理计划财产的年托管费率为 0.02%。计算方法如下：

$$H=E \times 0.02\% \div \text{当年天数} \times \text{当期存续天数}$$

H 为每周应计提的托管费

E 为本计划初始设立规模

当期存续天数指上周最后一个交易日（不含）到本周最后一个交易日（含）的实际天数；首次计时指合同生效日（含）到首周最后一个交易日（含）的实际天数。

本计划的托管费自本资产管理合同生效日起，每周最后一个交易日、终止日计提，计划终止后支付。经资产管理人与资产托管人核对一致后，由资产托管人根据管理人出具的指令于集合资产管理计划终止后三个工作日内从集合资产管理计划资产中一次性支付给资产托管人。

托管费为包含增值税的含税价款，增值税税率为 6%。

户名：中信证券股份有限公司

账号：7116810187000000370

开户银行：中信银行北京瑞城中心支行

大额支付号：302100011681

3、浮动管理费

浮动管理费计提基准约定如下：

（1）若产品观察期内任一天挂钩标的收盘价较期初观察价格涨幅大于 20%，浮动管理费计提基准=3.50%；

（2）若产品观察期内所有交易日中，挂钩标的收盘价较期初观察价格涨幅均不大于 20%，且挂钩标的的期末观察价格较期初观察价格跌幅不大于 0，则浮动管理费计提基准=3.50%+（期末观察价格/期初观察价格-1）*22.50%；

（3）若产品观察期内所有交易日中，挂钩标的收盘价较期初观察价格涨幅均不大于 20%，且挂钩标的的期末观察价格较期初观察价格跌幅大于 0，则浮动管理费计提基准=3.50%。

其中，挂钩标的收盘价【中证 500 指数】（交易代码为【000905.SH】）的收盘价。若因不可抗力该收盘价未能公布，由资产管理人酌情认定。

本计划运营过程中发生的增值税应税行为所产生的增值税应税金额,由资产管理人按照相关税收法规计算后自行从本计划委托财产中划扣,将可能影响本计划的收益。

产品观察期指期初观察日(含)至期末观察日(含)之间未发生市场中断事件的所有原定交易日。期初观察价格为挂钩标的在期初观察日的收盘价。期初观察日为资产管理合同生效日的下一个原定交易日,若期初观察日发生市场中断事件,则顺延至下一个未发生市场中断事件的原定交易日。原定交易日指根据交易所开市安排,其原定正常开展证券交易并提供交易相关服务的日期,资产管理人对原定交易日的定义有解释权。期末观察日为资产管理合同终止日的前一原定交易日,若期末观察日发生市场中断事件,则向后顺延至下一个未发生市场中断事件的原定交易日。期末观察价格为挂钩标的在期末观察日的收盘价。

市场中断事件指标的证券在标的证券观察期间的任一原定交易日发生交易中断、交易所中断、提早闭市、标的停牌、标的涨跌停、指数发行人不再公布指数等影响对冲、交易、观察标的价格等事件。其中,交易中断、交易所中断、提早闭市等市场中断事件相关定义同《中国证券期货市场场外衍生品交易权益类衍生品定义文件(2014年版)》。(1)交易中断:除非交易双方在交易有效约定中另行约定,指相关权益类标的或占相关股票指数成份股比重20%或以上的股票在估值时间前两小时内或交易双方约定时间内被相关交易所采取暂停或限制交易的措施,包括但不限于停牌、盘中临时停牌、暂缓进入交收或技术性停牌等措施(2)交易所中断:除非交易双方在交易有效约定中另行约定,指交易所在估值时间前两小时内或交易双方约定时间内发生实质性中断或影响全体市场参与者正常开展交易活动或获取市值的事件,包括但不限于涉及全体权益类标的或占相关股票指数成份股比重20%或以上的股票的暂缓进入交收、技术性停牌及临时停市等事件,但提早闭市除外。(3)提早闭市:指相关交易所在交易所交易日于预定收市时间之前闭市。

浮动管理费计提基准的计算保留到小数点后第6位,小数点后第6位以后的部分舍去。

如果集合资产管理计划份额总数 $\times 1.00$ 元/份额 $\times (1 + \text{浮动管理费计提基准} \times \text{集合资产管理计划存续期间的实际运作天数}/365)$ 小于集合资产管理计划终止后可供分配财产,则存在超额部分=集合资产管理计划终止后可供分配财产—集合资产管理计划份额总数 $\times 1.00$ 元/份额 $\times (1 + \text{浮动管理费计提基准} \times \text{集合资产管理计划存续期间的实际运作天数}/365)$,则管理人的浮动管理费为超额部分的5%。

如果集合资产管理计划份额总数 $\times 1.00$ 元/份额 $\times (1 + \text{浮动管理费计提基准} \times \text{集合资产管理计划存续期间的实际运作天数}/365)$ 大于或等于集合资产管理计划终止后可供分配财产,不存在超额部分,则浮动管理费为0。

集合资产管理计划终止后可供分配财产为在集合资产管理计划终止日后委托财产支付完依据本节第(一)款中约定的除浮动管理费外可以在计划财产中列支的全部费用后的财产。

浮动管理费在集合资产管理计划终止后计算并一次性计提,由资产管理人于集合资产管理计划终止后三个工作日内向托管人发送委托浮动管理费划付指令,经资产托管人核对一致后从集合资产管理计划资产中一次性支付给资产管理人。

根据《基金管理公司特定客户资产管理子公司风险控制指标管理暂行规定》等相关规定,资产管理人管理费收入均应计提风险准备金。

资产管理人指定的接收固定/浮动管理费的银行账户信息:

账户名称: 华夏资本管理有限公司

账号: 44201501100052551736

开户行: 中国建设银行深圳市分行营业部

风险准备金收款账户:

账户名称: 华夏资本管理有限公司

账号: 11050137510000001547

开户行: 中国建设银行股份有限公司北京复兴支行

(3) 管理人接受浮动管理费账户信息:

户名: 华夏资本管理有限公司

开户行: 中国建设银行深圳市分行营业部

账号: 44201501100052551736

4、上述(一)中所列其他费用根据有关法规、本合同及相应协议规定,按费用实际支出金额列入当期费用,由资产托管人从计划财产中支付。

(三) 不列入资产管理计划业务费用的项目

1、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。

2、资产管理人和资产托管人处理与计划运作无关的事项发生的费用。

3、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入计划费用的项目。

(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、托管费率等相关费率。

(五) 资产管理业务的税收

合同各方当事人应根据国家法律法规规定，履行纳税义务。根据财政部和国家税务总局《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》（财税【2016】140 号文）、《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》（财税【2017】2 号文）、《关于资管产品增值税有关问题的通知》（财税【2017】56 号文）及其后续颁布的具体征收管理办法等相关文件（若有），就本计划营运过程中发生的增值税等应税行为，管理人需要承担相应纳税义务的，各方一致同意：除本计划已列明的资产管理业务费用产生的税费由各收取方自行缴纳外，管理人有权以计划财产予以预提税费或其他方式从计划财产中扣除相关应缴增值税税费及其附加，委托人不以任何方式要求管理人向其返还或补偿该等税费。

资产管理人应在本计划起始运作日前与资产托管人沟通本计划的《增值税计算方案》，并于起始运作日前将方案提供给资产托管人。

十八、资产管理计划的收益分配

本计划存续期内不进行收益分配。

十九、报告义务

（一）资产管理合同生效公告

资产管理人应当在资产管理合同生效后在资产管理人网站上公告。

（二）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个会计年结束后四个月内，编制完成计划年度投资管理报告并经托管人复核，向资产委托人披露投资状况、投资表现、风险状况等信息。资产管理人在年度报告完成当日，将有关报告提供资产托管人复核，资产托管人在收到后 20 个工作日内进行复核，并将复核结果书面通知资产管理人。资产管理人向委托人披露复核后的年度报告。资产管理计划成立不足 3 个月或者存续期间不足 3 个月的，资产管理人可不编制当期年度报告。

（2）季度报告

资产管理人应当在每年季度结束之日起一个月内，编制完成季度投资管理报告，经托管人复核后，向资产委托人披露投资状况、投资表现、风险状况等信息。资产管理人在季度报告完成当日，将有关报告提供资产托管人复核，资产托管人在收到后 10 个工作日内进行复

核，并将复核结果书面通知资产管理人。资产管理人向委托人披露复核后的季度报告。资产管理计划成立不足 3 个月或者存续期间不足 3 个月的，资产管理人可不编制当期季度报告。

（3）临时报告

发生可能影响资产委托人利益的重大事项时，资产管理人应及时通过本合同约定的方式向资产委托人披露。

（4）集合资产管理计划份额净值报告

资产管理人每周通过管理人网站向资产委托人报告一次经资产托管人复核的上周最后一个交易日的集合资产管理计划份额净值。

（5）清算报告

本计划清算完成后，清算报告报中国证券投资基金业协会后的 5 个工作日内，以合同约定的方式告知委托人。

2、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《管理办法》及其他有关规定进行。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）资产管理人网站

资产管理人网站：<https://fund.chinaamc.com/capital>。

（2）邮寄服务

资产管理人或销售机构可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。资产委托人在开户合约书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。

（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、风险揭示

本集合资产管理计划投资可能存在的风险因素，包括但不限于：

（一）资金损失风险

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集合资产管理计划

财产，但不保证委托财产中的投资本金不受损失，也不保证一定盈利及最低收益。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，本合同约定的浮动管理费计提基准（如有）仅是投资目标而不是保证。投资者充分理解投资本集合资产管理计划存在资金损失风险。

（二）市场风险

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，各个行业和证券市场的收益水平也呈周期性变化。委托财产收益水平也会随之变化而导致风险。同时，经济周期影响资金市场的走势，给本计划的固定收益投资带来一定的风险。

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，及影响企业的融资成本和利润。委托财产收益水平会受到利率变化的影响。

4、购买力风险

委托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，从而使委托财产的实际收益下降。

（三）管理风险

在委托财产管理运作过程中，资产管理人的研究水平、投资管理水平直接影响委托财产收益水平，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，都会影响委托财产的收益水平。

（四）流动性风险

在某些情况下某些投资品种的流动性不佳，由此可能影响到集合资产管理计划财产投资收益的实现。另外，本合同有效期内，资产委托人不能退出本集合资产管理计划，对资产委托人存在流动性风险。本集合资产管理计划可能提前结束或延期结束，可能导致委托资金不能按期退出，对资产委托人存在流动性风险。

（五）信用风险

指在投资过程中，交易的一方不能履行给付承诺而给另一方造成损失的可能性。资产管理人将本着审慎的原则选择交易对手，并严格审阅合约的各项条款与内容。

（六）特定的投资方法及集合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、本计划资产投资于证券市场的场外期权合约、证券市场的收益互换，其发行人有可能无法履行其所应承担的责任。发行人的任何评级机构调低、撤回或终止发行人或其联属公司企业或其他联营公司的信用评级均可能影响发行人的偿付能力，发行人可能拒绝支付本计划所投资的证券市场期权合约和/或收益互换的到期款项，进而导致集合资产管理计划财产损失。若发行人提出或被提出破产程序或重整债务计划等相关的程序，本计划所投资的证券市场期权合约和/或收益互换发行人支付的到期款项可能显著减少或延迟。

2、本计划资产投资于银行存款、固定收益类银行理财、证券公司或其子公司发行的固定收益类资产管理计划、基金公司或其子公司发行的固定收益类资产管理计划、保险资产管理公司发行的固定收益类资产管理产品或信托公司发行的固定收益类信托计划等固定收益类金融产品，银行存款、固定收益类银行理财、证券公司或其子公司发行的固定收益类资产管理计划、基金公司或其子公司发行的固定收益类资产管理计划、保险资产管理公司发行的固定收益类资产管理产品或信托公司发行的固定收益类信托计划等固定收益类金融产品的收益情况将影响本计划委托人的投资收益情况。如果交易对手延期支付银行存款或延期兑付固定收益类金融产品本金或收益，则本计划的终止清算也将进行顺延，会对投资者的流动性需求有所影响。如果存款或固定收益类金融产品发生违约，无法全额支付银行存款或固定收益类金融产品本金或收益，则委托人将可能面临较大的损失。

3、挂钩标的的风险如下：

本计划的挂钩标的为【中证 500 指数】（交易代码为【000905.SH】），挂钩标的并不能完全代表整个股票市场。挂钩标的成份股的平均回报率与整个股票市场的平均回报率可能存在偏离。挂钩标的成份股的价格可能受到政治因素、经济因素、上市公司经营状况、投资者心理和交易制度等各种因素的影响而波动，导致指数波动，产生风险，直接影响挂钩标的的表现。

若交易所不再公布挂钩标的的价格，证券市场期权合约和/或收益互换合约计算机构有权选择提前终止相关交易并依据诚实信用及商业合理原则计算因该等提前终止交易双方需结算的款项，则委托人将可能面临损失。

若交易所在证券市场期权合约和/或收益互换合约到期日或之前对挂钩标的的计算原

则、公式与方法进行了重大修改或变动，或以任何其他方式对该挂钩标的进行了非常规的重大修改或变动，且计算机构认为该等修改或变动对交易有重大影响，则计算机构有权对交易的相关变量（包括但不限于：到期日、期初价格、期末价格、执行价格、名义数量及名义本金等）进行调整，则委托人将可能面临损失。

若交易所未在证券市场期权合约和/或收益互换合约到期日公布挂钩标的的价格，但同时未明确交易所将不再公布挂钩标的的价格，则到期日顺延至交易所公布挂钩标的的价格的第一个交易日。尽管有前述约定，若自到期日起 5 个交易日内，交易所一直未公布挂钩标的的价格，则计算机构有权提前终止本交易并依据诚实信用及商业合理原则计算因该等提前终止双方需结算的款项，则委托人将可能面临损失。

若由于市场原因，造成发行人无法实施与交易相关的对冲风险安排（包括但不限于就为对冲交易项下风险而进行的对冲交易，无法完成对冲头寸的建仓、减仓、维持对冲交易，或对冲交易的税费大幅度增高等）；在此情形下发行人作为非受影响方，有权提前终止本交易的全部或部分（由发行人决定），则委托人将可能面临损失。

（七）道德风险

道德风险主要指投资业务人员缺乏职业道德，不遵守公司有关规章制度，在投资过程中可能存在对投资项目把关不严、故意隐瞒投资项目存在的风险因素、人为抬高投资价格和通过项目投资进行利益输送等不当交易行为，从而导致集合资产管理计划蒙受损失的风险。

（八）集合资产管理计划不成立风险、备案不成功风险及提前终止风险

1、集合资产管理计划不成立风险。如本集合资产管理计划初始销售期限届满，集合资产管理计划认购总金额未达到规模下限（如有约定），资产管理人有权宣布本计划不成立。

2、备案不成功风险。根据法律法规的规定，本集合资产管理计划成立之日起五个工作日内应当提交中国证券投资基金业协会备案。如本集合资产管理计划未通过备案，本合同将面临不生效而无法投资运作的风险。资产管理人、资产托管人在扣除相关费用（如有）后，将本集合资产管理计划剩余财产以货币资金的形式返还给资产委托人。资产委托人对此充分知悉，并自愿承担由此导致的一切风险和损失。

3、提前终止风险。发生本合同约定的终止情形或投资标的发生终止事件时，本集合资产管理计划将可能提前终止。

（九）操作或技术风险

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。

在委托财产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、证券公司、期货公司子公司、注册登记机构、销售机构、证券交易所、证券登记结算机构等。

在托管人履行投资监督义务过程中，因为交易习惯或者现有的技术等条件所限，托管人事实上可能难以及时、有效履行合同约定的投资监督义务。委托人在签订本合同时已充分知悉该风险，并完全理解和接受可能由该风险导致出现的经济损失。

（十）外包机构的经营风险

根据法律法规规定，从事注册登记、估值核算等行政服务外包业务的机构须获得中国证监会的认可。虽然外包机构相信其本身将按照相关法律法规的规定进行营运及管理，但无法保证其本身可以永久维持符合监管部门的法律法规要求。本计划的注册登记、估值和会计核算相关事项均外包给华夏基金管理有限公司，如在计划存续期间外包机构无法继续从事注册登记、估值核算等行政服务外包业务，可能会对计划产生不利影响。

（十一）关联交易风险

本计划的行政外包机构为管理人的母公司华夏基金管理有限公司。本计划的资产托管人为管理人的关联公司中信证券股份有限公司。管理人依照本计划投资范围进行投资时可能会与托管人、管理人及其关联方发生交易。尽管管理人和托管人均为专业机构，按照合同约定履行职责，但仍不能完全避免发生关联交易或利益冲突的可能，存在关联交易的风险。资产委托人知悉并同意管理人依据法律法规及本合同的约定进行前述关联交易，且无须取得资产委托人的个别授权。

（十二）税收政策调整风险

集合资产管理计划所适用的税收征管法律法规可能会由于国家相关税收政策调整而发生变化，投资者收益也可能因相关税收政策调整而受到影响。

根据财政部和国税总局《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》（财税〔2016〕36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》（财税〔2016〕140号）、《关于资管产品增值税有关问题的通知》（财税〔2017〕56号）等系列法规要求及其后续可能颁布的具体征收管理办法等相关文件（若有），自2018年1月1日（含）以后资管产品运营过程中发生增值税应税行为的应当缴纳增值税及附加，上述税收由委托财产承担，资产管理人有权从委托财产中直接扣除。税收政策的调整可能对集合资产管理计划的净值产生影响。

（十三）投资者适当性风险

由于普通投资者投资目标和风险收益要求变化或者产品风险等级调整，在重新进行投资者适当性匹配评估并采取调整措施之前，存在产品风险等级高于投资者风险承受能力的可能。

本计划投资范围包括证券市场的场外期权合约，根据相关法律法规、监管要求，如单一委托人认购本计划份额超过募集总规模 20%的，除符合本合同约定的合格投资者要求外，还应当符合《证券期货投资者适当性管理办法》专业投资者的基本标准，且最近一年末金融资产不低于 2000 万元人民币，具有 3 年以上证券、基金、期货、黄金、外汇等相关投资经验。如委托人不满足上述条件，则存在认购失败的风险。

（十四）其它风险

1、火灾、地震等自然灾害、非因管理人、托管人自身原因导致的技术系统异常事故、政策法规的修改等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。

（十五）特别说明

资产委托人应充分认识到资产管理人不存在刚性兑付的意愿，更不具备刚性兑付的能力。本风险揭示并不能揭示投资本集合资产管理计划的全部风险。投资者在投资本集合资产管理计划之前应认真阅读本集合资产管理计划的资产管理合同和计划说明书，全面认识本集合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及个人资产规模，理性判断市场，谨慎做出投资决策。

二十一、资产管理合同的变更、终止

（一）全体资产委托人、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，但下列资产管理人有权单独变更合同内容的情形除外：

1、投资经理的变更。

2、其他对资产委托人利益无实质性不利影响情形的变更，或法律法规或中国证监会的

相关规定发生变化需要对本合同进行变更的,资产管理人可与资产托管人协商后修改资产管理合同,并由资产管理人按照本合同的约定向资产委托人披露变更的具体内容。

(二)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券投资基金业协会备案。法律法规另有规定的,从其规定。

(三)资产管理合同终止的情形包括下列事项:

- 1、资产管理计划存续期限届满而未延期的。
- 2、资产管理计划存续期间,持续五个工作日的委托人少于 2 人的。
- 3、资产管理人被依法取消特定客户资产管理业务资格的。
- 4、资产托管人被依法撤销基金托管资格。
- 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、资产托管人依法解散、被依法撤销或被依法宣告破产的。
- 7、经资产委托人、资产管理人和资产托管人协商一致决定终止的。
- 8、法律法规和本合同规定的其他情形。

二十二、清算程序

(一)清算组的成立及职责

本合同终止事由发生之日起 5 个工作日内,由资产管理人及资产托管人组织成立资产管理计划财产清算小组。负责计划的保管、清理、估价、变现和分配等相关事宜,也可以依法进行必要的民事活动。双方具体职责如下:

1、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) 编制清算报告并签章;
- (6) 配合资产托管人账户注销工作;
- (7) 代表计划财产清算小组聘请会计师事务所、律师事务所;
- (8) 向资产委托人发布清算通知、清算报告;
- (9) 将计划财产清算报告报监管机构备案,

(10) 履行与资产管理人义务相关的其他职责。

2、资产托管人

- (1) 清算期间的财产保管;
- (2) 出具进入清算环节的计划财产清单;
- (3) 复核资产管理人划款指令, 进行资金划付;
- (4) 计划财产资金、证券等账户的注销;
- (5) 清算期间发生资金变动的当日, 提供日终资金调节表;
- (6) 复核资产管理人出具的会计报表;
- (7) 复核资产管理人出具的清算报告并签章;
- (8) 履行与资产托管人义务相关的其他职责。

(二) 资产核对与变现

1、合同终止日起 2 个工作日内, 资产托管人向资产管理人出具合同终止前最后一个自然日财产清单, 列示计划财产的证券余额和资金余额;

2、合同终止日起 2 个工作日内, 资产管理人向资产托管人出具合同终止前最后一个自然日计划财产资产负债表和计划存续期的利润表, 资产托管人自收到后 1 个工作日内进行复核确认;

3、合同终止日后, 计划财产不应仍持有可流通非现金资产, 如遇特殊情况, 计划财产仍持有可流通非现金资产的, 在合同终止日起 2 个交易日内由资产管理人进行强制变现处理。

(三) 清理计划财产债权、债务

1、计划财产债权主要包括银行存款、截至清算结束日的银行存款利息、交易保证金、备付金及备付金利息等, 于相应账户注销时结清, 证券登记结算机构另有规定的以相关规定为准, 金额一般以开户银行实际支付金额为准。

2、计划财产债务主要包括计划财产应付管理费、托管费、银行间账户维护费、券商佣金、证券变现交易费用、银行汇划费用、销户费用等等。除交易所、登记结算机构等自动扣缴的费用外, 所有清偿由资产管理人、资产托管人核对无误后, 由资产管理人向资产托管人出具划款指令, 由资产托管人复核后办理支付。计划财产债务清偿应于合同终止后 5 个工作日内完成。对财产支付过程中产生的银行汇划费用, 资产管理人和资产托管人应进行匡算并在计划财产中预提。

此外, 清算费用由清算小组优先从资产管理计划资产中列支, 清算费用是指清算小组在

进行资产管理计划清算过程中发生的以下合理费用，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) 其他与清算事项相关的费用。

(四) 清算报告

1、资产管理人和资产托管人应在合同终止后 5 个工作日内完成计划财产的清理、确认、评估和变现等事宜，并出具清算报告和剩余财产的分配方案。如遇上述特殊情况，则应在计划财产全部变现后 3 个工作日内完成。

2、在清算报告出具后，如合同规定应聘请会计师事务所进行清算审计的，需由会计师事务所出具审计报告。

3、在清算报告出具后，如合同规定应聘请律师事务所出具法律意见书，需由律师事务所出具法律意见书。

(五) 支付清算财产

自计划的清算报告报监管机构备案，并告知资产委托人后的下一个工作日，按清算完成后计划财产的资产负债情况及双方确认的剩余财产的分配方案，由资产管理人向资产托管人出具划款指令，资产托管人复核无误后，向资产委托人支付清算财产。

资产管理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、清偿资产管理计划项下所欠债务。
- 4、支付固定管理费、浮动管理费、托管费等。
- 5、按资产委托人持有的资产管理计划份额比例进行分配，资产管理合同另有约定的除外。

在托管人对清算报告复核确认前及资产管理计划财产未按前款 1-4 项规定清偿前，不分配给资产管理计划资产委托人。组合到期清算时，为支付最低备付金（如适用），资产管理人应预留相应金额，若预留金额不足以支付实际需缴存的备付金金额的，差额部分由管理人通知资产委托人补足。

(六) 账户销户

1、计划财产账户销户

计划财产的证券资产完成变现后,资产托管人按规定注销资产管理计划财产的资金账户等投资所需账户,资产管理人应给予必要的配合。

(七) 资产管理计划财产清算报告的告知安排

清算报告报中国证券投资基金业协会后的 5 个工作日内,以合同约定的方式告知委托人。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或管理人认为有必要进行审计的。

(八) 资产管理计划财产清算账册及文件的保存

资产管理计划财产清算账册及有关文件应保存 20 年以上。

二十三、违约责任

(一) 当事人违反本合同,应当承担违约责任,给合同其他当事人造成损失的,应当承担赔偿责任;如属本合同当事人双方或多方当事人的违约,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、资产管理人及和/或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、在没有故意或重大过失的情况下,资产管理人由于按照本合同规定的投资原则而行使或不行使其投资权而造成的损失等。

3、不可抗力。

(二) 资产委托人主动在非开放日要求退出资产管理计划的,属于违约退出。

1、违约退出的认定。

资产委托人在合同约定的开放日之外的日期或时间主动提出退出申请的,视为违约退出。

2、违约退出的处理。

本计划不可违约退出。

(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、法律适用和争议的处理

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根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁，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

（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各方法定代表人（负责人）或授权代表签字或盖章并加盖公章（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的代理人签字、资产管理人和资产托管人双方法定代表人（负责人）或授权代表签字或盖章并加盖公章（或合同专用章）之日起成立。本计划在取得验资报告之后成立。本合同于资产管理计划备案手续办理完毕，获中国基金业协会书面确认之日起生效。

（二）资产委托人通过销售机构以电子形式签署本合同的，与资产委托人签署纸质版资产管理合同具备同等法律效力，资产委托人均受本合同约束。

（三）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。本合同存续期限为自合同生效之日起至 2019 年 10 月 28 日。

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、监管部门要求的除外）。本保密义务不因合同终止而终止。

本合同一式叁份，资产管理人执壹份，资产委托人执壹份，资产托管人执壹份，每份具有同等的法律效力。

（以下无正文）

(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☐、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) 资产委托人认购金额

人民币_____元整(¥_____)

(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并提供相关证明。账户信息如下:

账户名称:

账号:

开户银行名称:

资产委托人:

自然人（签字）： _____ 或 法人或其他组织（盖章）： _____

签署日期： 年 月 日

签署日期： 年 月 日

资产管理人：华夏资本管理有限公司



签署日期： 年 月 日

资产托管人：中信证券股份有限公司



签署日期：2019年3月22日

