

合同编号：【GZZG-009175-2020】

光证资管-中来股份-来宝5号员工持股
单一资产管理计划
资产管理合同

投资者：苏州中来光伏新材股份有限公司

（代苏州中来光伏新材股份有限公司第一期员工持股计划）

管理人：上海光大证券资产管理有限公司

托管人：中国工商银行股份有限公司上海市分行

目录

前言	2
一、释义	3
二、声明与承诺	7
三、当事人及权利义务	11
四、资产管理计划的基本情况	16
五、资产管理计划的成立与备案	19
六、委托资产	19
七、资产管理计划的投资	25
八、利益冲突及关联交易	29
九、投资经理的指定与变更	30
十、资金划拨指令的发送、确认和执行	30
十一、越权交易处理	33
十二、交易及清算交收安排	36
十三、委托资产的估值	39
十四、资产管理计划的费用与税收	44
十五、资产管理计划的收益分配	46
十六、信息披露与报告	47
十七、风险揭示	50
十八、管理人、托管人的更换条件和程序	55
十九、资产管理合同的变更、终止	56
二十、委托资产的清算	58
二十一、保密	62
二十二、违约责任	63
二十三、法律适用与争议的处理	64
二十四、通知与送达	65
二十五、资产管理合同的效力	66
二十六、其他事项	66
附件一：《委托资产起始运作通知书》	71
附件二：《委托财产追加通知书》	72
附件三：《第 i 期提取委托财产通知书》	73
附件四：委托人、管理人预留印鉴	74
附件五：委托人有权签字人授权通知	75
附件六：划款指令	76
附件七：单一资产管理计划风险揭示书	77
附件八：专用清算账户及资金划拨专用账户（样本）	84
附件九：投资经理的指定	85
附件十：投资经理变更通知书	86
附件十一：委托资产核心信息确认表（样本）	87
附件十二：托管人关联方名单	88
附件十三：管理人关联方名单	89
附件十四：托管人联系名单	90

前言

鉴于委托人、管理人、托管人已于 2015 年签署了编号为“GZDX-2015-043”的《光证资管-中来股份-来宝 5 号定向资产管理计划定向资产管理合同》（以下简称“原合同”），现为规范单一资产管理业务的运作，明确单一资产管理合同当事人的权利与义务，根据《中华人民共和国合同法》、《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《基金法》）、《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》（银发[2018]106 号，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》（证监会令[第 151 号]，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》（证监会公告[2018]31 号，以下简称《运作管理规定》）、《商业银行资产托管业务指引》、《单一资产管理计划资产管理合同内容与格式指引（试行）》以及《资产管理计划风险揭示书内容与格式指引（试行）》等法律、行政法规、监管部门和行业自律组织的有关规定，投资者、管理人和托管人三方在平等自愿、诚实信用原则的基础上订立本合同。特别地，自本合同生效之日起，投资者、管理人和托管人将根据《基金法》、本合同及其他有关规定享有权利、承担义务，根据原合同设立的“光证资管-中来股份-来宝 5 号定向资产管理计划”计划名称统一变更为本合同项下“光证资管-中来股份-来宝 5 号员工持股单一资产管理计划”，原合同自本合同生效之日起自动失效。

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。

管理人依照有关规定对资产管理计划的设立、变更、展期、终止、清算等行为向中国证券投资基金业协会（以下简称“证券投资基金业协会”）进行备案，并抄报管理人住所地中国证监会派出机构。

证券投资基金业协会接受本资产管理计划备案不能免除管理人按照规定真实、准确、完整、及时地披露产品信息的法律责任，也不代表证券投资基金业协会对本资产管理计划的合规性、投资价值及投资风险做出保证和判断。

投资者应当自行识别产品投资风险并承担投资行为可能出现的损失。

本单一资产管理计划主要投资于苏州中来光伏新材股份有限公司（以下简称“中来股份”）股票，包括通过二级市场购买、大宗交易等法律法规许可的方式取得并持有标的股票。产品存续期内，现金类委托资产不足以支付单一计划运作费用的，投资者承诺通过追加委托资产方式足额缴付中来股份股票锁定期间本单一计划运作费用（包括但不限于管理费、托管费等）。

投资者声明在签订本合同前，已经签署了风险揭示书及客户风险承受能力调查表，投资者阅知本合同全文，了解相关权利、义务和风险，并根据自身能力审慎决策参与本计划，对投资行为承担完全后果，独立承担投资风险。

管理人承诺以诚实守信、审慎尽责的原则管理和运用委托资产，但不保证委托资产一定盈利，也不保证最低收益，不保证最低收益，不保证本金不受损失，也不限定损失金额或比例。

托管人承诺按照本合同约定，安全保管交付至托管人且由托管人实际控制的委托财产，并履行本合同约定的其他义务，不保证委托财产盈利，也不保证最低收益，亦不保证委托财产本金不受亏损。

本合同是规定投资者、管理人和托管人基本权利义务的法律文件。

本单一资产管理计划属于权益类资产管理产品，管理人在管理本单一计划过程中可能面临多种风险，包括但不限于市场风险、流动性风险、信用风险、操作风险、合同变更风险、投资收益不确定的风险、集中度风险、管理风险、金融监管风险、政策变化风险（含税收、标的投资、产品交易结构等政策变化导致的风险）、本计划提前终止的风险、本计划投资对象可能引起的特定风险以及等其他风险。投资者在投资本单一计划之前，请仔细阅读本单一计划的资产管理合同与风险揭示书，全面认识本单一计划的风险收益特征和产品特征，并充分考虑自身的风险承受能力，理性判读市场，谨慎作出投资决策。

一、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：

《指导意见》	指 2018 年 4 月 27 日中国人民银行、中国银行保险监督管理
---------------	------------------------------------

	委员会、中国证券监督管理委员会、国家外汇管理局联合印发并实施的《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》。
《管理办法》	指2018年10月22日中国证监会公布并于公布之日起施行的《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》。
《运作管理规定》	指2018年10月22日中国证监会公布并于公布之日起施行的《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》。
《单一资管计划合同指引》	指2019年3月29日中国证券投资基金业协会发布的《单一资产管理计划资产管理合同内容与格式指引（试行）》以及《资产管理计划风险揭示书内容与格式指引（试行）》。
元	指人民币元。
中国证监会、证监会	指中国证券监督管理委员会。
单一资产管理业务投资者、委托人、投资者	指苏州中来光伏新材股份有限公司（代苏州中来光伏新材股份有限公司第一期员工持股计划）
单一资产管理业务管理人、管理人	指上海光大证券资产管理有限公司，简称“光证资管”。
单一资产管理业务托管人、托管人	指中国工商银行股份有限公司上海市分行
单一资产管理合同当事人、合同当事人	指受单一资产管理合同约定，根据合同享有权利并承担义务的管理人、托管人和投资者。
中来股份	指苏州中来光伏新材股份有限公司
员工持股计划	指苏州中来光伏新材股份有限公司第一期员工持股计划

建仓期	指员工持股计划建仓期间，即苏州中来光伏新材股份有限公司股东大会审议通过“苏州中来光伏新材股份有限公司第一期员工持股计划”之日起不超过6个月
清算抛售期/变现期	指苏州中来光伏新材股份有限公司第一期员工持股计划锁定期结束后员工持股计划股票抛售变现期间
本合同、（单一）资产管理合同	投资者、管理人和托管人签署的本单一资产管理合同及其附件，以及对该合同及其附件做出的任何有效补充及变更。
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。
计划成立日	指托管账户收到初始委托资产之日。
资产委托起始日	指投资者和托管人双方确认签收《委托资产起始运作通知书》的当日，若非同日签收，则以最后一方签收日的当日为资产委托起始日。
资产委托到期日	指合同约定的委托期限届满之日；委托期限提前届满的，合同终止日为资产委托到期日。
委托资产专用账户	指为实现资产管理目的，管理人用以为投资者提供资产管理服务的账户，包括但不限于托管专户及其他专用账户。
托管账户、托管资金账户	指专门为单一资产管理计划开立，专门用于清算交收的银行账户。
专用资金账户	指在光大证券股份有限公司营业机构开立的，专用于本合同项下单一资产管理业务使用的资金账户
其他专用账户	指以单一资产管理计划名义开立，用于本合同项下单一资产管理业务中买卖证券交易所以外交易品种的账户。
委托资金	指根据本合同，投资者首次交付给管理人的资金以及参与的资金。

委托资产、委托财产	指投资者交付给管理人管理、运用的资金，管理人因该委托资金的管理、运用、处分或者其他情形而取得的财产，也归入委托财产。
投资收益	指管理人管理、运用和处分委托财产取得的收益。
投资净收益	指管理人管理、运用和处分委托财产取得的收益，在扣除投资管理费用、应缴纳的税费及对第三人的负债后的剩余部分，可向投资者分配的收益。
不可抗力	不能预见、不能避免并不能克服的致使合同不能按期完全履行或不能履行的客观情况。不可抗力包括但不限于以下情况：1、自然力量引起的事故如水灾、火灾、地震、海啸等；2、政府的行动如颁布禁令、调整法律、法规、制度或政府征用/没收等；3、社会异常事故如战争、罢工等；4、突发停电或其他突发事件；5、银行清算系统故障，证券交易所交易平台非正常暂停或停止交易，非因资产管理人、资产托管人自身原因导致的技术系统异常事故、政策法规的修改或监管要求调整等情形。6、电信服务商原因导致资金划付的网络中断、无法使用的情形。
资产（或者资金、本金）安全	是指委托资产不被违法违规地挪用，在本合同项下不具有管理人或托管人保证委托资产不受损失或者取得最低收益的含义。在本合同附件或者补充协议中对该用语的理解均以此为准。
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等相关机构的有关业务规则，本资产管理计划在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司、深圳分公司开设的专用证券账户、在中央国债登记结算有限责任公司、银行间市场清算所股份有限公司开立的有关账户。

二、声明与承诺

（一）管理人的声明与承诺

1、管理人是依法设立的证券经营机构，并经中国证监会批准，具有从事客户资产管理业务的资格；

2、管理人承诺在投资者签订本合同前充分地向投资者说明了有关法律法规和相关投资工具的运作市场及方式，并充分揭示了相关风险；

3、管理人已经了解投资者的风险偏好、风险认知能力和承受能力，对投资者的财务状况进行了充分评估；

4、管理人承诺遵守法律、行政法规和中国证监会有关规定，遵循公平、公正原则；诚实守信，审慎尽责；坚持公平交易，避免利益冲突，禁止利益输送，保护客户合法权益；

5、按照《基金法》恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用委托财产，不保证委托财产一定盈利，不保证最低收益或本金不受损失，也不限定投资损失金额或者比例；

6、管理人保证所提供的资料和信息真实、准确、完整、合法；

7、管理人如接受其控股股东、实际控制人或者其他关联方参与本计划，管理人应当对托管账户进行监控，并及时向中国证监会相关派出机构和证券投资基金业协会报告。

（二）托管人的声明与承诺

1、托管人作为一家合法成立并有效存续的商业银行分支机构，依法取得其总行的从事资产管理业务托管业务的资格的授权；

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

3、根据法律法规、中国证监会及证券投资基金业协会的规定和资产管理合同的约定，对管理人的投资或清算指令等进行监督；

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

5、在管理人发生异常且无法履行管理职能时，依照法律法规及合同约定履行托管职责，维护投资者权益；

（三）投资者的声明与承诺

1、投资者符合《运作管理规定》合格投资者的要求，且不是管理人的董事、监事、从业人员及其配偶；

投资者具有合法的参与单一资产管理业务的资格，不存在法律、行政法规和中国证监会有关规定禁止或限制参与单一资产管理业务的情形；

合格投资者是指具备相应风险识别能力和风险承受能力，投资于单只资产管理计划不低于一定金额且符合下列条件的自然人、法人或者其他组织：

（1）具有 2 年以上投资经历，且满足下列三项条件之一的自然人：家庭金融资产不低于 300 万元，家庭金融资产不低于 500 万元，或者近 3 年本人年均收入不低于 40 万元；

（2）最近 1 年末净资产不低于 1000 万元的法人单位；

（3）依法设立并接受国务院金融监督管理机构监管的机构，包括证券公司及其子公司、基金管理公司及其子公司、期货公司及其子公司、在中国证券投资基金业协会（以下简称证券投资基金业协会）登记的私募基金管理人、商业银行、金融资产投资公司、信托公司、保险公司、保险资产管理机构、财务公司及中国证监会认定的其他机构；

（4）接受国务院金融监督管理机构监管的机构发行的资产管理产品；

（5）基本养老金、社会保障基金、企业年金等养老基金，慈善基金等社会公益基金，合格境外机构投资者（QFII）、人民币合格境外机构投资者（RQFII）；

（6）中国证监会视为合格投资者的其他情形。

在单一资产管理计划项下，合格投资者委托设立单一资产管理计划的最低规模为 1000 万元。

2、投资者承诺以真实身份参与单一资产管理业务，投资者向管理人提供的有关投资目的、投资偏好、投资限制、身份证明、财产收入情况、证券投资经验和风险承受能力等基本情况真实、完整、准确、合法，不存在任何虚假陈述、重大遗漏或误导。前述信息资料如发生任何实质性变更，投资者承诺及时书面告知管理人；

3、投资者财产的来源及用途符合国家有关规定，未使用贷款、发行债券等筹集的非自有资金投资本单一资产管理计划，且本单一资产管理计划投资事项符合法律法规的规定及投资者的业务决策程序的要求；投资者在使用筹集的资金参与本单一资产管理业务时，向管理人提供合法筹集资金的证明文件，并保证所提供证明文件真实、准确、完整、合法；

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

5、投资者如为银行类分支机构客户，投资者承诺已取得总行合法授权其参与单一资产管理业务的资格；

6、投资者签署和履行本合同系其真实意思表示，已经按照其章程或者其它内部管理文件的要求取得合法、有效的授权，且不会违反对其有约束力的任何合同和其他法律文件；投资者已经或将会取得签订和履行本合同所需的一切有关批准、许可、备案或者登记；

7、投资者声明已听取了管理人指定的专人对相关业务规则和本合同的讲解，已充分理解本合同，已清楚认知委托资产投资所存在的市场风险、管理风险、流动性风险等其他风险以及所投资品种的风险收益特征，已签署了管理人制作的风险揭示书，并承诺自行承担风险和损失；

8、投资者承认，管理人、托管人未对委托资产的收益状况作出任何承诺或担保，本合同约定的业绩报酬计提基准（如有）仅是投资目标而不是管理人或托管人对本金或收益的承诺和保证。

9、投资者承诺在本合同有效期内不实施任何使得该账户失效的行为；

10、投资者承诺遵守反洗钱、税收监管等法律法规要求，并承诺不存在洗钱情形，同意配合管理人按照反洗钱法律法规履行客户身份识别、可疑交易报告等职责；

11、投资者承诺设立的员工持股计划过程合法合规，已取得持有人的认可，已获得参与员工持股计划的员工的充分授权并代表员工持股计划对外签订资产管理合同；

12、投资者承诺，本期员工持股计划实施后，**中来股份**在同一时间全部有效存续的员工持股计划所持有的**中来股份（300393.SZ）**的股票总数不超过总股本的10%；

13、投资者特别承诺事项

投资者特此承诺员工持股计划的设立已满足以下要求：

（1）依法合规原则

员工持股计划已严格按照法律、行政法规的规定履行程序，真实、准确、完整、及时地实施信息披露。任何人不得利用员工持股计划进行内幕交易、操纵证券市场等证券欺诈行为。

（2）自愿参与原则

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

（3）风险自担原则

员工持股计划参与人已充分知悉，参与员工持股计划盈亏自负，风险自担，与其他投资者权益平等。

（4）其他特别承诺事项

员工持股计划来源于**中来股份**员工自有资金及法律、行政法规允许的合法合规资金来源等。投资者承诺未使用贷款、发行债券等筹集的非自有资金投资资产管理产品。

员工持股计划单个员工所获股份权益对应的股票总数累计不得超过公司股本总额的1%。

中来股份员工参与**第一期员工持股计划**所获公司股份权益，应当与员工通过其他方式拥有的公司股份权益合并计算，按照有关规定履行信息披露义务。

投资者将遵守中国证监会关于信息敏感期不得买卖股票的规定，在本计划成立后及时、准确的向管理人提供信息敏感期信息，并承诺不利用任何内幕信息进行交易。

中来股份董事、监事、高级管理人员（如有）等关联方通过本计划持有**中来股份**股票以及所持有股票变动的，投资者承诺将监督以上人员按照相关规定准确、

及时履行信息披露义务，不进行短线交易、内幕交易、操纵市场等禁止性法律行为。

三、当事人及权利义务

（一）合同当事人

投资者姓名（或公司名称）：苏州中来光伏新材股份有限公司（代苏州中来光伏新材股份有限公司第一期员工持股计划）

注册地址：江苏省常熟市沙家浜镇常昆工业园区青年路

通讯地址：江苏省常熟市沙家浜镇常昆工业园区青年路

法定代表人：林建伟

联系人：李娜

联系电话：0512-52933702

管理人：上海光大证券资产管理有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 799 号 3 号楼 26 层

通讯地址：上海市静安区新闸路 1508 号 6 层

法定代表人：熊国兵

联系人：金银玲

联系电话：021-22167193

传真：021-22169999

网址：www.ebscn-am.com

托管人：中国工商银行股份有限公司上海市分行

注册地址：上海市浦东大道 9 号

通讯地址：上海市浦东大道 9 号

负责人或授权代表：高翀

联系人：胡丽君

联系电话：021-58885888

（二）投资者的权利和义务

1、投资者的权利

- （1）按照本合同约定取得其委托资产投资运作产生的收益；
- （2）按照本合同的约定追加或提取委托资产；
- （3）取得委托资产清算后的剩余资产，包括但不限于利息、投资收益等；
- （4）依据法律法规及本合同约定的时间和方式，获得本资产管理计划的信息披露材料；
- （5）监督管理人及托管人履行投资管理和托管义务的情况；
- （6）法律法规、中国证监会及证券投资基金业协会规定及本合同约定的其他权利。

2、投资者的义务

- （1）认真阅读并遵守资产管理合同，保证投资资金的来源及用途合法；
- （2）接受合格投资者认定程序，如实填写风险识别能力和风险承担能力问卷，如实提供资金来源、金融资产、收入及负债情况，并对其真实性、准确性和完整性负责，签署合格投资者相关文件；
- （3）承诺投资资产管理计划的最终资金来源不存在为贷款、发行债券等筹集的非自有资金的情形；除公募资产管理产品外，以合伙企业、契约等非法人形式直接或者间接投资于资产管理计划的，应向管理人充分披露实际投资者和最终资金来源；
- （4）认真阅读并签署风险揭示书；
- （5）按照资产管理合同的约定支付资产管理业务的管理费、业绩报酬（如有）、托管费及税费，并承担因委托财产运作产生的其他费用；
- （6）按照资产管理合同的约定，及时、足额地将委托财产交付管理人和托管人分别进行投资管理和资产托管，以委托财产为限依法承担资产管理计划亏损或者终止的有限责任；
- （7）向管理人提供法律法规规定的信息资料及身份证明文件，配合管理人完成投资者适当性管理、非居民金融账户涉税信息的尽职调查、反洗钱等监管规定的工作；
- （8）在向管理人、托管人提供的各种资料、信息发生变更时，投资者应于

相关变更发生后 5 个工作日内书面通知管理人、托管人；

(9) 及时、全面、准确地向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；

(10) 保守商业秘密，不得泄露委托资产投资计划、投资意向等；不得利用本计划相关信息进行内幕交易或者其他不当、违法的证券期货业务活动；

(11) 不得违反本合同的约定干涉管理人的投资行为；

(12) 不得从事任何有损资产管理计划及其投资者、管理人管理的其他资产及托管人托管的其他资产合法权益的活动；

(13) 投资者交付的委托资产净值不得低于人民币壹仟万元；

(14) 投资者自行承担投资风险；

(15) 法律法规、中国证监会及证券投资基金业协会规定及本合同约定的其他义务。

(三) 管理人的权利和义务

1、管理人的权利

(1) 自本合同生效之日起，按照本合同的约定，独立管理和运用资产管理计划财产；

(2) 依据合同约定，及时、足额收取管理费、业绩报酬（如有）；

(3) 按照有关规定，要求投资者提供与其身份、财产与收入状况、证券投资经验、风险认知与承受能力和投资偏好等相关的信息和资料；

(4) 根据本合同及其他有关规定，监督托管人，对于托管人违反本合同或有关法律法规规定、对委托资产及其他当事人的利益造成重大损失的，应及时采取措施制止，并报告管理人住所地中国证监会派出机构及中国证券投资基金业协会；

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

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

(7) 合同期限届满、提前终止或投资者提取委托资产时，有权以委托资产

现状方式向投资者返还；

(8) 法律法规、中国证监会及证券投资基金业协会规定及本合同约定的其他权利。

2、管理人的义务

(1) 依法办理资产管理计划的备案事宜；

(2) 按照证券投资基金业协会要求报送资产管理计划产品运行信息；

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

(4) 对投资者的风险识别能力和风险承担能力进行评估；

(5) 制作风险揭示书，向投资者充分揭示相关风险；

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

(7) 建立健全的内部管理制度，保证本资产管理计划财产与其管理的其他资产管理计划财产、管理人的固有财产相互独立，对所管理的不同财产分别管理，分别记账，分别投资；聘请投资顾问的，应制定相应利益冲突防范机制；

(8) 除依据法律法规、本合同及其他有关规定外，不得为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；

(9) 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，依法依规提供信息的除外；

(10) 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；

(11) 除规定情形或符合规定条件外，不得为管理人、托管人及其关联方提供融资；

(12) 按照本合同约定接受投资者和托管人的监督；

(13) 以管理人的名义，代表投资者利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；

(14) 对非标准化资产（如有）和相关交易主体进行充分的尽职调查，形成书面工作底稿，并制作尽职调查报告；

(15) 按照资产管理合同约定负责资产管理计划会计核算并编制财务会计报

告；

(16) 按照资产管理合同的约定确定收益分配方案，及时向投资者分配收益；

(17) 根据法律法规与资产管理合同的规定，编制向投资者披露的资产管理计划季度、年度等定期报告，并向证券投资基金业协会备案，抄报管理人住所地中国证监会派出机构；

(18) 办理与受托财产管理业务活动有关的信息披露事项；

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

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

(21) 管理人应根据法律法规及监管规定履行反洗钱义务，并根据人民银行有关规定向托管人发送本计划“受益所有人”信息，配合托管人履行反洗钱义务；

(22) 除必要的信息披露及监管要求外，管理人不得以托管人的名义进行营销宣传；

(23) 法律法规、中国证监会及证券投资基金业协会规定的和本合同约定的其他义务。

(四) 托管人的权利和义务

1、托管人的权利

(1) 按照本合同约定，依法保管委托资产；

(2) 按照本合同约定，及时、足额获得资产托管费；

(3) 法律法规、中国证监会及证券投资基金业协会规定的和本合同约定的其他权利。

2、托管人的义务

(1) 安全保管资产管理计划财产；

(2) 除依据法律法规规定和资产管理合同的约定外，未经管理人和委托人同意不得为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；

(3) 对所托管的不同财产分别设置账户，确保资产管理计划财产的完整与

独立；

(4) 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；

(5) 按规定开设和注销资产管理计划的托管账户；

(6) 办理与资产管理计划托管业务有关的信息披露事项；

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

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

(9) 按照法律法规要求和资产管理合同约定，根据管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；

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

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

(12) 监督管理人的投资运作，发现管理人的投资或清算指令违反法律、行政法规、中国证监会的规定及资产管理合同约定的，应当拒绝执行，立即通知管理人并及时报告管理人住所地中国证监会派出机构和证券投资基金业协会；

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

(14) 建立与管理人的对账机制，复核、审查管理人计算的资产管理计划资产净值；

(15) 国家有关法律法规、监管机构及本合同规定的其他义务。

四、资产管理计划的基本情况

(一) 资产管理计划的名称

光证资管-中来股份-来宝 5 号员工持股单一资产管理计划

(二) 资产管理计划的类别

权益类单一资产管理计划

(三) 资产管理计划的运作方式

开放式

(四) 资产管理计划的投资目标、主要投资方向、投资比例及产品风险等级

1、投资目标

在规范投资的前提下，力求实现委托资产的保值增值，为投资者谋求投资回报。

2、主要投资方向

本计划主要投资于权益类资产。委托资产的投资范围包括：

权益类资产：中来股份股票（包括通过二级市场购买、大宗交易等法律法规许可的方式获得的股票，股票代码：300393.SZ）；

本计划可投资于现金管理工具，包括但不限于银行存款（包括但不限于银行定期存款、协议存款、同业存款等各类存款）、货币市场基金、国债等。

本单一计划的资产不得投资于管理人、托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司发行的证券或承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易，本合同另有约定的除外。

在单一计划运作过程中，对于超过本合同约定投资范围和比例的投资（如有），管理人、投资者及托管人应事先签订补充协议。

本计划在成立后备案完成前，不得开展投资活动，以现金管理为目的，投资于银行活期存款、货币市场基金、国债的除外。

产品备案通过后，管理人应在开展投资活动前主动将备案证明通过传真或者电子邮件方式发送至托管人。

3、投资比例

(1) 权益类资产：本计划投资于中来股份股票比例为资产总值的 80-100%；

(2) 现金管理工具投资比例为资产总值的 0-20%；

(3) 本计划的总资产不得超过净资产的 200%。

投资者不可撤销地同意并授权管理人在本计划存续期间，为规避证券期货市场异常波动、证券期货市场或本计划发生重大流动性风险事件、证券期货市场或本计划发生重大信用风险事件等特定风险，本计划投资于权益类资产的比例可以低于计划总资产的 80%，但不得持续 6 个月低于计划总资产的 80%。

本计划在建仓期和变现期期间，资产组合的投资比例可不受上述投资比例限制，但应当符合本合同约定的投向和资产管理计划的风险收益特征。除建仓期和变现期之外的本计划其他存续期内，权益类资产投资比例不得持续 6 个月低于计划总资产的 80%。如遇到本计划投资于权益类资产的比例持续 6 个月低于计划总资产的 80% 的情形，管理人应当向在相应类别资产的比例低于计划总资产的 80% 的五个工作日内向托管人及投资者提供书面说明文件。

本单一计划存续期间，管理人将按照合同约定的投向和比例进行资产管理计划的投资运作，资产管理计划改变投向和比例的，将事先取得投资者的同意，并按规定履行合同变更流程。除建仓期、变现期、上述规避特定风险情形与非因管理人主观因素导致突破上述投资限制的情形外，在本单一资产管理计划运作过程中，对于超过本合同约定投资范围和比例的投资（如有），管理人、投资者及托管人应事先签订补充协议，并为托管人调整投资监督事项预留充分的准备时间。

如非因管理人主观因素导致突破上述比例限制的，管理人应在超标发生之日起在具备交易条件的 15 个交易日内将投资比例降至许可范围内。

4、产品风险等级

本计划属于中等风险投资品种，本计划的产品风险等级为 R3（中等风险），仅适合向风险承受能力等级为 C3 及高于 C3 的合格投资者推广。本计划存续期间，管理人可根据实际情况调整风险等级。

（五）资产管理计划的存续期

本计划存续期为从资产管理计划成立日起至 2021 年 12 月 31 日。如发生本合同约定的计划提前终止或展期情形时，本计划可提前终止或展期。

（六）资产管理计划的最低资产要求

1、投资者初始委托财产合计为不低于人民币 1000 万元。

2、委托资产的初始形态可以为现金资产或非现金类资产，具体种类、数量、金额见《委托资产起始运作通知书》。

3、委托金额为委托资产专用账户收到初始委托资产当日的总价值，其中证券类资产价格以收到初始委托资产当日的收盘价计算（当日无交易的，以最近一日收盘价计算）。

4、在委托期限内，投资者可以按照本合同的约定追加或提取委托资产，追加或提取委托资产后的委托金额按照本合同约定计算。

（七）资产管理计划的估值与核算、信息技术系统等服务机构

管理人自行提供资产管理计划的估值与核算、信息技术系统等服务。

五、资产管理计划的成立与备案

（一）资产管理计划的成立

管理人确认委托资产全部到账后，应于当日向投资者、托管人通过传真或邮件的方式发送《委托资产起始运作通知书》，管理人发送通知书当日即为资产委托起始日。

（二）资产管理计划的备案

管理人应在资产管理计划成立后 5 个工作日内报证券投资基金业协会备案，抄报管理人住所地中国证监会派出机构。资产管理计划成立前，任何机构和个人不得动用投资者参与资金。

资产管理计划在成立后备案完成前，不得开展投资活动，以现金管理为目的，投资于银行活期存款、货币市场基金、国债的除外。管理人应于资产管理计划获得基金业协会备案确认当日书面通知托管人。

六、委托资产

（一）委托资产基本情况

委托资产的主要来源为“苏州中来光伏新材股份有限公司第一期员工持股计划”资金，即中来股份员工自有资金及其他合法合规方式获得的资金等。

1、员工持股计划系依据《中华人民共和国公司法》、《中华人民共和国证券法》、《关于上市公司实施员工持股计划试点的指导意见》等有关法律、行政

法规、规章、规范性文件的规定成立。

2、员工持股计划资金来源为中来股份正式员工合法薪酬、自筹资金及其他合法合规方式获得的资金等。

3、员工持股计划设立后，由光证资管对员工持股计划的全部资产进行受托管理。员工持股计划的主要投资范围为中来股份股票。

（二）委托资产的保管与处分

1、本计划财产的债务由本计划财产本身承担责任，投资者以其出资为限对资产管理计划财产的债务承担责任。

2、委托资产独立于管理人、托管人的固有资产，并独立于管理人管理的和托管人托管的其他财产。管理人、托管人不得将委托资产归入其固有资产。托管人仅对实际交付并控制下的计划财产承担保管职责。

3、管理人、托管人因委托资产的管理、运用或者其他情形而取得的资产和收益应当归入委托资产。

4、管理人、托管人有权按照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。管理人、托管人以其自有资产承担法律责任，其债权人不得对委托资产行使请求冻结、扣押和其他权利。管理人、托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，委托资产不属于其清算资产。

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

6、管理人和托管人对委托资产的保管并非对投资者本金或收益的保证或承诺，不承担投资者的投资风险。

7、非现金类财产的保管

1) 证券类资产及证券交易资金的保管

资产管理计划投资形成的证券类资产，由相关法定登记机构根据法律法规的规定实行第三方保管；证券交易结算资金由相关证券经纪商和存管银行保管。对于在未经托管人同意的情况下管理人自行变更证券经纪商或存管银行造成的损失，及因证券经纪商原因导致证券交易结算资金无法正常转帐支取造成的损失，托管人不承担责任。

2) 对于已划出托管账户以及处于托管人实际控制之外的资产, 托管人不承担保管职责。

(三) 委托资产相关账户的开立和管理

1、委托资产专用账户的开立

(1) 托管账户

托管账户是指管理人、托管人、投资者为履行本合同在托管人下属营业机构为该单一资产管理计划单独开立的银行结算账户。银行结算账户通过托管人“第三方存管”平台与专用资金账户建立唯一对应关系。

本计划托管账户以管理人证照开立, 账户名称为“光证资管—工行—苏州中来光伏新材股份有限公司”, 账户名称以实际开立为准。委托资产托管期间托管账户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。

托管账户的开立和使用, 仅限于满足开展单一资产管理业务的需要。管理人和托管人不得假借投资者的名义开立任何其他银行账户。除法律法规另有规定或有权机关另有要求外, 管理人、托管人双方均不得采取使得该账户无效的任何行为。

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

(2) 证券账户

管理人应于单一资产管理合同备案后七个工作日内, 根据投资者资产的安排开立专用证券账户(以《中国证券登记结算有限责任公司特殊机构及产品证券账户业务指南》的规定为准), 用于买卖证券交易所的交易品种。投资者只能在中登公司上海分公司或深圳分公司各开立一个专用证券账户。

投资者授权管理人开立、使用、注销和转换专用证券账户, 且提供必要协助。

在专用证券账户开立或注销时, 若有需要, 管理人应代理投资者向证券登记结算机构申请办理证券在专用证券账户与普通证券账户之间的划转。

专用证券账户仅供单一资产管理业务使用, 并且只能由管理人使用, 不得转

托管或者转指定，中国证监会另有规定的除外。投资者、管理人不得将专用证券账户以出租、出借、转让或者其他方式提供给他人使用。

管理人应当自专用证券账户办理成功之日起三个工作日内，将专用证券账户报证券交易所备案。备案前，不得使用该账户进行交易。

管理人按照规定对于本计划开立的证券账户等投资所需账户进行变更。委托人和托管人应当在上述账户变更过程中给予必要的配合。

（3）专用资金账户（专用资金台账账户）

专用资金账户在光大证券股份有限公司下属营业机构开立，并与投资者在指定的托管人下属营业机构开立的银行结算账户建立对应关系，并应当签署《客户交易结算资金银行存管协议书》。

（4）银行存款账户（如有）

委托财产投资定期存款在存款机构开立的银行账户，包括实体或虚拟账户，其预留印鉴中均应包含产品托管人指定印鉴。本着便于委托财产的安全保管和日常监督核查的原则，存款行应尽量选择托管人经办行所在地的分支机构。对于任何的定期存款投资，管理人都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”。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。在取得存单、存款证实书后，托管人保管存单、存款证实书正本。管理人应该在合理的时间内进行定期存款的投资和支取事宜，若管理人提前支取或部分提前支取定期存款，若产生息差（即本委托财产已计提的资金利息和提前支取时收到的资金利息差额），该息差的处理方法由管理人和托管人双方协商解决。

（5）专用基金账户（如有）

1) 管理人负责为资产管理计划开立所需的基金账户。

2) 管理人在开立基金账户时应将托管专户作为赎回款、分红款指定收款账户。

3) 管理人在开立基金账户时应将基金账户信息和对账单等资料加盖业务章

后扫描发至托管人处，由托管人留存。

4) 托管人有权随时向基金注册登记人查询该账户资料。如基金注册登记人将开放式基金对账单邮寄管理人的，管理人应于每季度结束后十个工作日内将开放式基金对账单发送给托管人。

(6) 其他专用账户（如有）

委托资产投资于符合法律法规规定和单一资产管理合同约定的其他投资品种时，管理人应按照相关规定开立相关账户，并负责管理账户，必要时投资者提供协助，账户开立后管理人应及时将账户资料复印件加盖经预留的管理人业务章后交付托管人留存。此账户的开立和管理应符合法律法规的规定，并且仅限于满足开展本单一资产管理业务的需要。

2、委托资产专用账户的管理

(1) 管理人、托管人通过委托资产专用账户为投资者提供资产管理服务，对委托资产独立核算、分账管理，并保证委托资产与管理人、托管人的自有资产、其他客户资产相互独立。

(2) 托管账户的开立和管理应符合有关法律法规的规定。

(3) 管理人、托管人不得将委托资产专用账户以出租、出借、转让或者其他方式提供给他人使用。

(四) 委托资产的移交

1、投资者应当将委托资产中的现金资产足额划拨至托管账户，托管人负责查询与核实；同时，投资者将委托资产中的非现金资产足额划拨至专用证券账户及其他专用账户（如有），管理人负责查询到账情况。

2、初始委托资产组成

委托资产的初始形态可以为现金资产，或者投资者合法持有的股票、债券或中国证监会认可的其他金融资产，具体种类、数量、金额见《委托资产起始运作通知书》“初始委托资产明细表”。

委托金额为委托资产专用账户收到初始委托资产当日的总价值，其中证券类资产价格以收到初始委托资产当日的收盘价计算（当日无交易的，以最近一日收盘价计算）。

初始委托财产价值不得低于 1000 万元人民币。

委托人应及时将初始委托财产足额划拨至本委托财产开立的托管账户、证券账户或其他专用账户。

管理人确认初始委托财产足额到账后，向委托人和托管人发送《委托资产起始运作通知书》（样本见附件一），管理人发送即日起该通知书生效。

管理人签章的《委托资产起始运作通知书》载明的日期作为委托财产运作起始日。

（五）委托资产的追加

在合同有效期内，委托人有权以书面通知（样本见附件二）的形式追加委托财产。追加委托财产比照初始委托财产办理移交手续，管理人、托管人应按照本合同的约定分别管理和托管追加部分的委托财产。

（六）委托资产的提取

在合同有效期内，委托人如需要提取委托财产，应提前至少五个工作日以书面形式（样本见附件三）通知管理人并抄送托管人。管理人同意后，应当在该通知载明的提取时间（如非工作日，顺延至下一工作日）向托管人发送划款指令，托管人审核无误后按照划款指令将相应资产划往指定账户，托管人应于划拨财产当日以书面形式或其他各方认可的形式通知管理人、委托人。管理人和托管人不承担由于投资者通知不及时造成的资产变现损失。

投资者应为管理人预留充足的变现时间，以保证托管账户中的资金足以支付提取金额。管理人和托管人不承担由于提取委托资产进行资产变现或投资者通知不及时造成的损失。委托资产无法及时变现的，管理人有权延期支付或以委托资产现状方式向投资者返还，管理人无需承担任何责任。

投资者移交、追加本单一资产管理计划的划出账户与提取本单一资产管理计划的划入账户必须为以投资者名义开立的同一账户（以下称“投资者账户”），如移交、追加与提取的账户与以下账户不一致时，管理人与托管人均有权拒绝此部分转入资金作为委托财产或转出委托资产的申请。

投资者账户基本信息如下：

账户名称：苏州中来光伏新材股份有限公司

开户行：宁波银行苏州常熟支行

账号：75060122000223455

七、资产管理计划的投资

（一）投资目标

在规范投资的前提下，力求实现委托资产的保值增值，为投资者谋求投资回报。

（二）投资范围及投资比例

1、投资范围

本计划主要投资于权益类资产。委托资产的投资范围包括：

权益类资产：中来股份股票（包括通过二级市场购买、大宗交易等法律法规许可的方式获得的股票，股票代码：300393.SZ）；

本计划可投资于现金管理工具，包括但不限于银行存款（包括但不限于银行定期存款、协议存款、同业存款等各类存款）、货币市场基金、国债等。

2、投资比例

（1）权益类资产：本计划投资于中来股份股票比例为资产总值的 80-100%；

（2）现金管理工具投资比例为资产总值的 0-20%；

（3）本计划的总资产不得超过净资产的 200%；

（三）投资比例超限的处理方式

如非因管理人主观因素导致突破上述比例限制的，管理人应在超标发生之日起在具备交易条件的 15 个工作日内将投资比例降至许可范围内。

（四）风险收益特征

本计划属于中等风险投资品种，本计划的产品风险等级为 R3（中等风险），仅适合向风险承受能力等级为 C3 及高于 C3 的合格投资者推广。本计划存续期间，管理人可根据实际情况调整风险等级。

（五）投资策略

1、资产配置策略

管理人通过综合分析国内外宏观经济态势、利率走势、信用风险、证券市场估值水平等因素，根据本合同的约定进行主动管理，力争实现投资者资产持续稳健增值。

2、股票等权益类投资策略

管理人通过结合证券市场趋势，合理配置中来股份股票（包括但不限于通过二级市场购买、大宗交易等法律法规许可的方式获得的股票，股票代码：300393.SZ）。

3、现金管理工具投资策略

本计划将投资于银行存款（包括但不限于银行定期存款、协议存款、同业存款等各类存款）、货币市场基金、国债等高流动性短期金融产品来保障资产的流动性。

4、投资策略的变更

经投资者、管理人之间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作出，并及时通知托管人。投资政策变更应为调整投资组合留出必要的时间。变更投资范围需签订补充协议。

（六）决策依据

本计划以国家有关法律、法规和本合同的有关规定为决策依据，并以维护本计划投资者利益作为最高准则。具体决策依据包括：

1、《指导意见》、《管理办法》、《运作管理规定》、《关于上市公司实施员工持股计划试点的指导意见》、本合同及其它有关法律性文件。

2、宏观经济发展态势、微观经济运行环境和证券市场走势。

3、投资对象收益和风险的配比关系。本计划将在充分权衡投资对象的风险和收益的前提下做出投资决策。

4、风险管理的要求。

（七）投资程序

1、管理人的研究员通过自身研究及借助外部研究服务机构的研究服务，为本单一计划的投资管理提供决策依据。

2、投资经理根据研究支持体系和本单一计划的收益-风险特征，结合对市场的分析判断，在投资策略和投资决策委员会授权范围内自主决策投资。

3、管理人交易人员依据投资经理指令，制定交易策略，统一执行投资组合计划。

4、管理人风险管理部门对投资计划的过程进行日常监督和风险控制，投资

经理根据本单一计划退出的情况控制投资组合的流动性。

5、管理人在确保本单一计划委托利益的前提下，有权根据环境变化的实际需要对上述投资程序做出调整。

（八）投资限制及禁止行为

1、投资限制

本合同委托财产的投资将遵循以下限制：

（1）员工持股计划的股票来源为通过二级市场购买、大宗交易等法律法规许可的方式获得中来股份（300393.SZ）一定数量的股票。

（2）中来股份员工持股计划购买的中来股份股票的锁定期为 12 个月，自公司公告最后一笔标的股票过户至本员工持股单一资产管理计划名下时起算。

（3）除中国证监会、交易所等监管机构另有相关规定外，本单一计划在下列期间不得买卖中来股份股票：

1) 中来股份定期报告公告前三十日内，因特殊原因推迟报告公告日期的，自原公告日前三十日起至最终公告日；

2) 中来股份业绩预告、业绩快报公告前十日内；

3) 自可能对中来股份股票及其衍生品种交易价格产生较大影响的重大事件发生之日或者在决策过程中，至依法披露后二个交易日内；

4) 中国证监会及深圳证券交易所规定的其他限制；

5) 其他法律法规不得买卖中来股份股票的情形。

光证资管在决定买卖公司股票时应及时咨询中来股份董事会秘书是否处于股票买卖敏感期。

（4）本单一计划购买完成中来股份股票后，中来股份全部有效的员工持股计划所持有的股票总数（不包括员工在中来股份首次公开发行股票上市前获得的股份、通过二级市场自行购买的股份及通过股权激励获得的股份）累计不得超过中来股份股本总额的 10%，单个员工所获股份权益对应的股票总数累计不得超过中来股份股本总额的 1%。

（5）本单一计划总资产不得超过本产品净资产的 200%。

（6）本单一计划不直接或间接投向管理人、托管人及其关联方发行的证券或承销期内承销的证券及非标资产。

(7) 不得从事相关法律法规及中国证监会禁止的其他行为。

(8) 管理人管理的全部资产管理计划合计持有单一上市公司发行的股票不得超过该上市公司可流通股票的 30%。完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的资产管理计划、公募基金，以及中国证监会认定的其他投资组合可不受前述比例限制。

如因证券市场波动、证券发行人合并、单一资产管理计划规模变动等管理人之外的因素，导致本单一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合同约定的投资比例的，管理人应当在流动性受限资产可出售、可转让或者恢复交易的 15 个交易日内调整至符合相关要求。确有特殊事由未能在规定时间内完成调整的，管理人应当及时向中国证监会相关派出机构和基金业协会报告。因本单一计划投资管理需要，本单一计划的建仓期、清算抛售期/变现期不受上述投资比例的限制。

2、禁止行为

本合同委托资产的投资禁止行为包括：

(1) 不得直接或者间接投资法律法规和国家政策禁止进行债权或股权投资的行业和领域；

(2) 不得将委托资产用于可能承担无限责任的投资。

(3) 不得投资于不符合国家产业政策、环境保护政策的项目（证券市场投资除外），包括但不限于以下情形：

1) 投资项目被列入国家发展改革委最新发布的淘汰类产业目录；

2) 投资项目违反国家环境保护政策要求；

3) 通过穿透核查，投资标的最终投向上述投资项目；

(4) 不得违反《证券期货经营机构私募资产管理计划备案管理规范》，且最终投向不得违反其限制。

(5) 不得从事内幕交易、操纵市场、利益输送等违法违规行为。

(6) 不得直接投资商业银行信贷资产；

(7) 不得违规为地方政府及其部门提供融资；

(8) 不得要求或者接受地方政府及其部门违规提供担保；

(9) 不得直接或者间接投资法律、行政法规和国家政策禁止投资的行业或

领域；

(10) 国家法律法规等禁止的其他情形。

(九) 建仓期的投资活动，应当符合本合同约定的投向和资产管理计划的风险收益特征。以现金管理为目的，投资于银行活期存款、货币市场基金、国债除外。本计划建仓期结束后，本计划投资组合的比例应符合以上约定。

(十) 投资者不可撤销地同意并授权管理人在本计划存续期间，为规避证券期货市场异常波动、证券期货市场或本计划发生重大流动性风险事件、证券期货市场或本计划发生重大信用风险事件等特定风险，本计划投资于权益类资产的比例可以低于计划总资产的 80%，但不得持续 6 个月低于计划总资产的 80%。

(十一) 本计划投资的资产组合的流动性与追加、提取安排相匹配。

在本计划运作过程中，如本计划现金类资产不足，且因非管理人原因无法及时变现非现金类资产的，管理人有权拒绝或延后满足投资者提取委托资金申请，或根据实际情况部分满足投资者的资产提取申请。

(十二) 委托人确认，本章约定的事项不代表托管人的监督职责，托管人的监督职责仅以本合同第十一章（三）“托管人对管理人投资运作的监督”约定为准。

八、利益冲突及关联交易

（一）利益冲突

本计划不存在利益冲突的情形。

（二）关联交易

管理人应于合同生效前提供关联方名单，并在合同期限内根据变化及时更新关联方名单。管理人运作、管理委托资产涉及与管理人关联方进行关联交易的，应当事先取得投资者的同意，否则不得对委托资产进行处置，同时事后应告知投资者和托管人。

九、投资经理的指定与变更

委托资产投资经理由管理人负责指定。投资经理信息见附件（九）投资经理的指定及变更通知书。

管理人有权根据需要变更投资经理，投资经理变更后，管理人应在 10 个工作日内及时通知投资者。

十、资金划拨指令的发送、确认和执行

（一）交易清算授权

1、管理人应指定专人向托管人发送指令。

2、管理人应向托管人提供书面授权文件（若资产管理人同时向资产托管人出具了资产管理业务统一授权通知和单个授权通知的，以统一授权书为准），该文件应加盖管理人公章。文件内容包括被授权人名单、电话、传真、预留印鉴及被授权人签字样本，授权文件应注明被授权人相应的权限及有效时限，规定管理人向托管人发送指令时托管人确认有权发送人员身份的方法。

3、授权通知应注明生效日期，自其中注明的生效日期起开始生效。若托管人收到授权通知的日期晚于其中注明的生效日期，授权通知自托管人收到的日期起开始生效。授权通知应以原件形式送达托管人。

4、管理人和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；但法律法规规定或有权机关要求的除外。

（二）投资指令的内容

投资指令（格式见附件六）是在管理计划财产时，管理人向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、付款日期、金额、收、付款账户信息等，加盖预留印鉴并有被授权人签字或签章。

（三）投资指令的发送、确认及执行时间与程序

投资指令由“授权通知”确定的被授权人代表管理人用托管人网上资产托管业务信息服务平台（简称托管网银）、电子直连划款指令（管理人发送指令的指

定传真号码为：021-22169767/22169824，指定邮箱为：@ebscn.com 为后缀的邮箱）或托管人和管理人认可的其他方式向托管人发送。对于采用“深证通电子指令”、“托管通电子指令”或“电子直联”方式发送指令的，管理人、托管人应签署电子直联相关协议，双方应遵守该协议关于“电子直联”方式的具体托管操作安排。若管理人已与托管人建立深证通指令直连或使用托管人托管网银，管理人应优先以深证通直连或者托管网银、或托管人和管理人认可的其他方式向托管人发送指令，并应事先书面向托管人指定各业务类型划款指令的发送主渠道，以电子邮件发送指令扫描件或传真作为应急方式备用。若管理人未与托管人建立深证通指令直连，且未申请托管网银的，指令由管理人用电子邮件发送指令扫描件、传真方式或托管人和管理人认可的其他方式向托管人发送。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。指令以获得收件人（托管人）确认该指令已成功接收之时视为送达。因管理人未能及时与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，托管人不承担责任。托管人依照本合同的约定对指令进行审查后，方可执行指令。

对于被授权人依照“授权通知”发出的指令，管理人不得否认其效力。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，发送人应按照其授权权限发送划款指令。管理人向托管人发送有效划款指令时，应确保托管人有足够的处理时间，除需考虑资金在途时间外，还需给托管人留有至少 2 个工作小时（托管人的工作时间为 09:00-11:30，13:00-17:00）的复核和审批时间。管理人在每个工作日的 15:00 以后发送的要求当日支付的划款指令，托管人不保证当天能够执行。有效划款指令是指指令要素（包括付款人、付款账号、收款人、收款账号、金额（大、小写）、款项事由）准确无误、预留印鉴相符、相关的指令附件齐全且头寸充足的划款指令。由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管理人承担。

托管人收到管理人发送的指令后，应对划款指令进行表面一致性的形式审查，验证指令的要素是否齐全、审核书面指令上的签章是否和授权通知中预留的签章样本相符，复核无误后依据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，托管人立即与管理人指定人员进行电话联系和沟通，并要求管理人重新发送经修改的指令。托管人可以要求管理人传真、邮件或双方认可的其他

方式提供相关交易凭证、合同或其他有效会计资料，以确保托管人有足够的资料来判断指令的有效性。管理人应保证上述资料合法、真实、完整和有效。如因管理人提供的资料不合法、不真实、不完整或失去效力而影响托管人的审核或给计划财产、第三人带来损失的，托管人不承担任何形式的责任。

管理人向托管人下达指令时，应确保本计划托管账户有足够的资金余额，对管理人在没有充足资金的情况下向托管人发出的指令，托管人有权拒绝执行，并立即通知管理人，托管人不承担因为不执行该指令而造成的损失。

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

在本资产管理计划财产申购/认购开放式基金时，管理人应在向托管人提交划款指令的同时将经有效签章的基金申购/认购申请书以传真或电子邮件方式送达托管人。

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

（四）托管人依法暂缓、拒绝执行指令的情形和处理程序

托管人在本合同第十一章第（三）款约定的投资监督事项范围内发现管理人发送的指令违反《基金法》、本合同或其他有关法律法规的规定时，不予执行，并应及时以书面形式通知管理人纠正，管理人收到通知后应及时核对，并以书面形式对托管人发出回函确认，由此造成的损失由管理人承担。

（五）管理人发送错误指令的情形和处理程序

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指令要素不全，未按照本合同约定的传真号码、电子邮箱或双方认可的其他形式发送划款指令等。托管人在履行监督职能时，发现管理人的指令错误时，有权拒绝执行，并及时通知管理人改正。

（六）撤回指令的处理程序

管理人撤回已发送至托管人的有效指令，须向托管人传真或者邮件发送加盖预留印鉴的书面通知并电话确认，托管人收到书面通知并得到确认后，将撤回指令作废；如果托管人在收到书面通知并得到确认时该指令已执行，则托管人不承担因为执行该指令而造成损失的责任。

（七）更换投资指令被授权人的程序

管理人更换被授权人、更改或终止对被授权人的授权，应当至少提前一个工作日向托管人提供新的被授权人的姓名、权限、预留印鉴和签字样本。同时电话确认托管人收到新的授权书。授权变更通知应注明生效日期，自其中注明的生效日期起开始生效。若托管人收到授权变更通知的日期晚于其中注明的生效日期，授权变更通知自托管人收到的日期起开始生效。被授权人变更通知生效前，托管人仍应按原约定执行指令，管理人不得否认其效力。授权变更通知应以原件形式送达托管人。

（八）投资指令的保管

投资指令以传真/电子邮件形式发出，原件由管理人保管，托管人保管指令传真件/邮件。当两者不一致时，以托管人收到的投资指令传真件/邮件为准。

（九）其他相关责任

托管人正确执行管理人符合本合同规定、合法合规的划款指令，计划财产发生损失的，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计划财产受损的，托管人应承担相应的责任，但托管资金专户余额不足或托管人遇到不可抗力或其他非因托管人原因的情况除外。

如管理人的划款指令存在事实上未经授权、欺诈、伪造或未能按时提供划款指令人员的预留印鉴和签字样本等非托管人原因造成的情形，只要托管人根据本合同相关规定对有关印鉴与签名表面真实性审核无误，托管人不承担因正确执行有关指令而给管理人或计划财产或任何第三人带来的损失，全部责任由管理人承担，但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。

十一、越权交易处理

（一）越权交易的界定

越权交易是指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者的授权而进行的投资交易行为，包括：

- （1）违反有关法律法规和本合同投资范围的规定进行的投资交易行为。

- (2) 法律法规禁止的超买、超卖行为；
- (3) 其他违反有关法律法规的规定以及违反或超出本合同项下委托人授权的投资交易行为。

(二) 越权交易的处理程序

1、托管人在本合同第十一章（三）约定的投资监督事项范围内，发现管理人的投资指令违反法律、行政法规和其他规定，或者违反本合同约定的，应当拒绝执行，立即通知管理人和委托人并及时报告中国证监会、基金业协会。

2、托管人在本合同第十一章（三）约定的投资监督事项范围内，发现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，应当立即通知管理人和委托人。

3、管理人应向投资者和托管人主动报告越权交易，在本计划存续期内，投资者和托管人有权随时对通知事项进行复查，督促管理人改正。管理人对投资者和托管人通知的越权事项未能在限期内纠正的，托管人应报告管理人住所地中国证监会派出机构及中国证券投资基金业协会。

4、若越权交易发生收益，则收益扣除损失与交易费用的余额归委托资产所有，收益不足以充抵损失与交易费用的部分由管理人承担。

(三) 托管人对管理人投资运作的监督

1、托管人自本资产管理合同生效之日起，托管人根据以下约定在托管人系统支持及可观测范围内对下列资产管理计划的投资事项及管理人投资行为进行监督，如本章节的约定与本合同其他章节不一致的，托管人履行监督职责的内容及标准以本章节（三）“托管人对管理人投资运作的监督”为准，具体如下：

(1) 对本合同约定的投资范围进行监督：

本计划主要投资于权益类资产。委托资产的投资范围包括：

权益类资产：中来股份股票（包括通过二级市场购买、大宗交易等法律法规许可的方式获得的股票，股票代码：300393.SZ）；

本计划可投资于现金管理工具，包括但不限于银行存款（包括但不限于银行定期存款、协议存款、同业存款等各类存款）、货币市场基金、国债等。

管理人拟运用本计划资产实施对上述未明确列示投资品或本合同签署后市

场新增交易品种的投资的，或拟进行 ETF 基金场内申赎交易的，应根据法律法规履行规定的程序，并应于开始实施投资前与托管人就此类投资品的会计核算、估值、清算、监督、系统支持等达成一致。

(2) 对本计划以下投资比例进行监督：

- 1) 权益类资产：本计划投资于中来股份股票比例为资产总值的 80-100%；
- 2) 现金管理工具投资比例为资产总值的 0-20%；
- 3) 本计划的总资产不得超过净资产的 200%；

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

托管人发现管理人的投资运作不符合上述投资比例限制时，应当提示管理人及时纠正，管理人收到提示后应及时核对，并以书面形式向托管人进行解释或举证。

托管人有权随时对通知事项进行复查，督促管理人改正。对管理人的违规事项，托管人应报告管理人住所地中国证监会派出机构及中国证券投资基金业协会。

2、托管人按照本款约定对计划财产的投资监督和检查自本合同生效之日起开始执行，自本计划进入清算程序之日起终止监督。

3、托管人仅依据法律法规或本章节明确约定的投资范围、投资比例等内容进行投资监督，对投资策略及其他合规性问题不承担任何形式的责任。

4、托管人投资监督的真实性、准确性和完整性受限于管理人、证券经纪商及其他中介机构提供的数据和信息，托管人对上述数据信息的真实性、准确性、及时性和完整性不作任何担保、暗示或表示，对上述机构提供数据信息的错误、遗漏或延迟所引起的损失不承担任何责任。

5、如需托管人对本计划关联交易进行监督的，管理人应于合同生效前提供关联方名单，并在合同期限内根据变化及时更新关联方名单。若管理人没有及时提供关联方信息，导致托管人无法及时对关联方证券进行监督，所产生的一切后果，托管人不承担责任。

6、如因投资需要或法律法规修改导致托管人监督事项发生变化的，各方除履行必要的合同变更流程外，还应为托管人调整监督事项留出必要的时间。

7、管理人经托管人催告仍不按约定与托管人对账，导致托管人无法及时履

行投资监督职责，托管人不承担由此造成的损失。

8、托管人仅依据与管理人核对一致的本计划财务报表中列示的投资品及其市值，计算本第十一章第（三）款列示的监督指标、监督本计划的投资范围。

十二、交易及清算交收安排

（一）选择证券、期货经纪机构的程序

委托人授权管理人、托管人与光大证券股份有限公司签订《证券经纪服务协议》，同意委托光大证券股份有限公司作为证券经纪服务商为本计划项下的证券资产及资金提供证券经纪服务。本计划财产投资于证券发生的所有场内交易的清算交割由经纪服务商（光大证券股份有限公司）负责根据相关登记结算公司的结算规则办理。托管人对存放在证券经纪服务商的资金不行使保管职责。

（二）投资证券后的清算交收安排

1、场内外证券资金结算处理程序

（1）场内证券资金结算

管理人向托管人发送银证转账指令，划拨场内投资资金。本着安全保管本计划财产的原则，在不影响本计划投资管理且和管理人协商一致的前提下，托管人可根据管理人的指令定期或不定期将证券资金账户余额划入托管资金账户。

本计划的银行管理账户与证券资金账户通过“第三方存管”平台同步，经纪服务商日终清算完成后将交易所格式数据以约定方式发送给管理人、托管人。管理人、托管人根据 T 日交易数据各自进行清算并与经纪服务商 T+1 日提供的证券资金账户对账单进行核对。管理人、托管人双方核对 T 日交易清算金额如果发现差异时按以下情况分别处理：

a. 当日证券清算差异小于 1.00 元的，不查差异原因，以证券经纪服务商提供的对账单为准；

b. 当日证券清算差异大于（含等于）1.00 元的，管理人发现问题后即刻通知托管人，并同时与证券经纪服务商立即逐笔核对 T 日交易明细并查明差异原因，如是管理人差错，则由管理人自行调整，并将结果通知托管人；如是证券经纪服务商差错，则证券经纪服务商将调整后的相关数据和资料重新发送管理人及托管

人。

（2）场外证券资金结算

管理人负责场外交易的实施，托管人负责根据管理人划款指令以及相关交易附件进行指令审核并完成场外交易资金的划付。

2、无法按时支付证券清算款的责任认定及处理程序

管理人应确保托管人在执行管理人发送的指令时，有足够的头寸进行交收。对于场外证券交易，资产管理计划财产的资金头寸不足时，托管人有权拒绝管理人发送的划款指令。如由于非托管人的原因导致无法按时支付证券清算款，给资产管理计划财产造成损失的，管理人应承担赔偿责任。

在资金头寸充足的情况下，托管人对管理人在正常业务受理渠道和指令规定的时间内发送的符合法律法规、本合同的指令不得拖延或拒绝执行。如由于托管人的原因导致资产管理计划财产无法按时支付证券清算款，由此造成的损失由托管人承担，但托管人如遇到不可抗力的情况除外。

（三）开放式基金投资的清算交收安排

1. 开放式基金申购（认购）相应的资金划拨由托管人依据管理人的划款指令逐笔划付。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）申请单一并传真至托管人。托管人审核无误后，应及时将划款指令交付执行。管理人应实时调整当日可用资金余额。管理人在收到基金申购（认购）确认回单后，应立即传真至托管人。

2. 管理人赎回开放式基金时，应在向基金管理公司或代销机构发出基金赎回申请书的同时将赎回申请书传真至托管人；管理人在收到赎回确认回单后，应及时传真至托管人。

3. 为确保本计划财产会计核算及估值的及时处理，管理人应于开放式基金交易（包括认购、申购、赎回、基金转换、红利再投资、现金分红等）的确认日及时获取确认单等单据的传真件，要求并督促基金管理公司于当日传真给管理人，管理人收到后应立即传真至托管人。

（四）投资银行存款的特别约定

管理人因运用委托财产投资定期存款等存款类资产投资而在存款机构开立的存款账户，管理人应确保该账户的任何有效预留印鉴中均应包含托管人指定印鉴。在管理人运用委托财产投资银行定期存款等存款类投资时，应及时将存款银

行出具的存款证实书原件交托管人保管。托管人仅负责对其所收到的存款证实书原件进行保管，不负责对其真实性进行辨别，不对存款证实书对应存款的本金及收益的安全承担任何责任和义务。

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

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

（四）其他场外交易资金结算

1、管理人负责场外交易的实施，托管人负责根据管理人划款指令和相关投资文件进行场外交易资金的划付。管理人应将划款指令连同相关交易文件一并传真至托管人，托管人根据本合同第十部分约定审核后及时执行划款指令。

2、相关交易文件中约定的其他转让或划款条件由管理人负责审核，托管人不承担审核职责。管理人同时应以书面形式通知托管人相关收款账户名、账号、交易费率等。投资或收益分配资金必须回流到本计划托管资金账户内，不得划入其他账户。

（五）资金、证券账目及交易记录的核对

管理人和托管人定期对计划资产的证券账目、实物券账目、交易记录进行核对。

对计划财产的资金账目，以管理人与托管人约定方式核对，确保相关各方账账相符。

对计划财产的证券账目，由相关各方根据外部第三方对账数据定期进行对账。

对计划财产的交易记录，管理人与托管人核对估值结果之前，应保证所有实

际交易记录与会计账簿上的交易记录完全一致，如果实际交易记录与会计账簿记录不一致，造成会计核算不完整或不真实，由此导致的损失由管理人承担。

十三、委托资产的估值

（一）估值目的

客观、准确地反映本计划资产的价值。经估值后确定的资产净值，是管理人进行信息披露、计算投资回报的基础。

（二）估值的时间、确认及程序

资产净值是指资产总值减去负债后的价值。资产净值的计算保留到小数点后2位，小数点后第3位四舍五入。资产份额净值的计算保留到小数点后4位，小数点后第5位四舍五入。

管理人、托管人于每个工作日的下一工作日（T+1日）对T日委托资产净值进行估值并对估值结果核对确认。估值原则应符合本合同、《指导意见》、《证券投资基金会计核算业务指引》及其他法律、法规的规定。

（三）估值对象

本计划所持有的全部资产。

（四）估值方法

本计划按以下方式进行估值：

1、投资股票的估值方法

(1) 上市流通股股票按估值日其所在证券交易所的收盘价估值。

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

(3) 首次发行未上市的股票，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本价估值。

(4) 送股、转增股、配股和公开增发新股等发行未上市的股票，按估值日在证券交易所上市的同一种股票的收盘价进行估值。

(5) 首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按估值日在证券交易所上市的同一种股票的收盘价进行估值；在考虑投资策略的情况下，

也可以参照第(6)条的方法估值。

(6)流通受限的股票，包括非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等（不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票），按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

2、投资固定收益品种的估值方法

(1)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。

(2)在证券交易所市场挂牌交易实行净价交易的债券按估值日收盘价估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考监管机构和行业协会估值意见，或者参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。

(3)在证券交易所市场挂牌交易未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价减去所含的债券应收利息得到的净价估值；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考监管机构和行业协会估值意见，或者类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。

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

(5)对于只在上交所固定收益平台或者深交所综合协议平台交易的债券，按照成本估值。

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

(7)对在银行间市场上市交易的资产支持证券，应主要依据第三方估值机构公布的收益率曲线及估值价格估值。对在银行间市场上市交易且中债登公司未提供价格的，按成本估值。对在交易所上市的资产支持证券品种，鉴于其交易不活跃，各产品的未来现金流也较难确认的，按成本估值。

(8) 中小企业私募债采用估值技术确定的公允价值进行估值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

(9) 保证收益的商业银行理财计划按照成本列示，按预期收益率逐日计提应收利息，到期回款时根据实际回款金额与计提收益的差额确认损益；保本浮动收益商业银行理财计划按成本列示，到期回款时根据实际回款金额确认收益。用于估值的收益率等信息由管理人提供，托管人根据管理人提供的收益率信息完成估值；如果由于管理人采用的估值方式不合适或提供的份额净值信息不及时不准确，导致本计划估值不公允，托管人不承担由此造成的损失。

(10) 约定收益的证券公司专项资产管理计划按照成本列示，按预期收益率逐日计提应收利息，到期回款时根据实际回款金额与计提收益的差额确认损益；浮动收益的专项资产管理计划按成本列示，到期回款时根据实际回款金额确认收益。用于估值的收益率等信息由管理人提供，托管人根据管理人提供的收益率信息完成估值；如果由于管理人采用的估值方式不合适或提供的份额净值信息不及时不准确，导致本计划估值不公允，托管人不承担由此造成的损失。

3、投资证券投资基金的估值方法

(1) 持有的交易所上市基金(包括封闭式基金、上市开放式基金(LOF)、创新型分级基金等)，按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考监管机构或行业协会有关规定，或者类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。

(2) 持有的场外基金(包括托管在场外的上市开放式基金(LOF))，按估值日前一交易日的基金份额净值估值；估值日前一交易日基金份额净值无公布的，按此前最近交易日的基金份额净值估值。

(3) 持有的货币市场基金及理财债券基金，则按披露的前一估值日至估值日期间(含节假日)的万份(百份)收益计提估值日基金收益。

(4) 场内持有的分级基金的母基金，按照取得成本确认成本。母基金能够在交易所交易的，按照第(1)条规定的方法估值；不能在交易所交易的，按照第(2)条规定的方法估值。

(5) 持有的基金处于封闭期的，按照最新公布的份额净值估值；没有公布份

额净值的，按照成本估值。

4、投资银行存款的估值方法

持有的银行存款以本金列示，按协议或合同利率逐日确认利息收入。

5、回购以成本列示，按实际利率在回购期间内逐日计提应收或应付利息。

6、在任何情况下，管理人如采用上述规定的方法对计划资产进行估值，均应该被认为采用了适当的估值方法。但是，当有充足证据表明资产管理计划相关资产的计量方法已不能真实公允反映其价值时，管理人应当与托管人进行协商，及时采用公允价值计量方法对资产管理计划资产净值进行调整。

7、如有新增事项、未涉及事项或变更事项，按行业惯例或国家有关最新规定估值。

（五）估值错误的处理

如管理人或托管人发现资产估值违反本合同约定的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护投资者利益时，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，委托资产的会计责任方由管理人担任，因此，就与本资产有关的会计问题，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，以管理人的意见为准，但管理人需尽善良、谨慎的合理注意义务，确保相关会计问题以及估值方式、方法和程序符合相关法律法规的规定，合法、公允。

当委托资产估值出现错误时，管理人和托管人应当立即予以纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大。

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委托人的损失，由提供错误信息的当事人一方负责赔偿。

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

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。

（六）估值调整的情形与处理

1、管理人作为估值的第一责任人，应定期评估第三方估值机构的估值质量，并对估值价格进行检验，防范可能出现的估值偏差。当出现投资品估值偏差，估值机构发布的估值不能体现公允价值时，管理人应综合第三方估值机构估值结果，经与托管人协商，谨慎确定公允价值，并按相关法规的规定，发布相关公告，充分披露确定公允价值的方法、相关估值结果等信息。

2、如有确凿证据表明按本合同约定的估值方法进行估值不能客观反映本计划公允价值的，管理人可根据具体情况与托管人商定后，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。

（七）暂停估值的情形

- 1、与本计划投资有关的证券交易所遇法定节假日或因其他原因停市时；
- 2、因不可抗力或其他情形致使管理人、托管人无法准确评估集合资产管理计划资产价值时；
- 3、中国证监会认定的其他情形。

（八）资产管理计划资产净值的确认

本计划资产总值是指本计划所投资的各项有价证券、银行存款本息、本计划各项应收款以及其他资产所形成的价值总和。

本计划资产净值是指本计划资产总值减去负债后的净资产值。

（九）特殊情况的处理

由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误，有关会计制度变化、管理人或托管人托管业务系统出现重大故障或由于其他不可抗力原因，管理人、托管人免除赔偿责任。但管理人、托管人应积极采取必要的措施消除由此造成的影响。由于注册与过户登记人发送的数据有误，处理方法等同于交易数据错误的处理方法。

（十）资产账册的建立

管理人和托管人在本合同生效后，应按照相关各方约定的同一记账方法和会计处理原则，分别独立地设置、登录和保管委托资产的全套账册，对相关各方各自的账册定期进行核对，互相监督，以保证资产的安全。若双方对会计处理方法

存在分歧，应以管理人的处理方法为准。

经对账发现相关各方的账目存在不符的，管理人和托管人必须及时查明原因并纠正，保证相关各方平行登录的账册记录完全相符。

(十一) 资产管理计划的会计政策

本计划的会计政策比照现行政策并按照本资产管理合同约定执行：

- 1、资产管理人为计划财产的会计责任方；
- 2、计划财产的会计年度为公历年的1月1日至12月31日；
- 3、计划财产的会计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的会计制度；
- 5、本计划财产独立建帐、独立核算；
- 6、资产管理人应保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关规定编制计划财产会计报表；
- 7、托管人应定期与管理人就资产管理计划的会计核算、报表编制等进行核对（以估值表等的形式）。

十四、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、管理人的管理费；
- 2、托管人的托管费；
- 3、管理人的业绩报酬；
- 4、银行间费用（如有）
- 5、委托资产拨划支付的银行费用及托管账户银行费用等；
- 6、委托资产的证券交易费用等相关费用；
- 7、按照法律法规及本合同的约定可以在委托资产中列支的其他费用，包括但不限于会计师事务所的审计费用，如涉及诉讼、仲裁，还有案件受理、律师代理、申请执行或公证等相关费用。

(二) 管理费和托管费计提方法、计提标准和支付方式

- 1、管理人固定管理费

每日计提的固定管理费以前一日委托资产净值为基数，计算方法如下：

$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$ ，本委托资产年管理费率为 0.5%

H 为每日应计提的固定管理费

E 为前一日委托资产净值

管理费自资产运作起始日起每日计提，每半年支付一次（每年 6 月 30 日、12 月 31 日后 5 个工作日内支付），届时由管理人向托管人发送管理费支付的划款指令，托管人收到指令进行形式审核无误后予以执行。若因战争、自然灾害等不可抗力致使无法按时支付的，则在不可抗力情形消除后的首个工作日支付。计划终止后，依据清算程序支付尚未支付的管理费。

2、托管人的托管费

每日计提的托管费以前一日委托资产净值为基数，计算方法如下：

$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$ ，本委托资产年托管费率为 0.03%，年托管费不到 5 万按 5 万收取。

H 为每日应计提的委托资产托管费

E 为前一日委托资产净值

托管费自资产运作起始日起每日计提，每半年支付一次（每年 6 月 30 日、12 月 31 日后 5 个工作日内支付），届时由管理人向托管人发送托管费支付的划款指令，托管人收到指令进行形式审核无误后予以执行。自本合同签订之日起，若资产管理计划存续期每满一年资产托管费累计计提不足 5 万元，则按 5 万元/年收取。若因战争、自然灾害等不可抗力致使无法按时支付的，则在不可抗力情形消除后的首个工作日支付。计划终止后，依据清算程序支付尚未支付的托管费。

3、管理人的业绩报酬

本单一资产管理计划不收取业绩报酬。

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

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

(三) 不列入资产管理业务费用的项目

本计划成立前发生的费用不得在计划资产中列支。管理人和托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或委托资产的损失，以及处理与本委托资产运作无关的事项发生的费用等不列入委托资产运作费用。

（四）费率调整

管理人和托管人与投资者协商一致后，可根据市场发展情况调整资产管理费率和资产托管费率。

（五）税收

本合同各方当事人应根据国家法律法规规定，履行纳税义务。投资者应缴纳的税收由投资者负责，管理人不承担代扣代缴或纳税的义务。

为免歧义，本合同各方特别约定如下优先适用条款：如依据相关法律法规或财政税务主管部门的规定，就本计划投资运营过程中发生的增值税应税行为及其他应税行为，管理人需要承担相应纳税义务的，该税费由计划财产承担，管理人有权以计划财产予以缴纳，且无需事先征得投资者的同意（除本约定外，本计划已列明的资产管理业务费用产生的税费由各收款方自行缴纳的，相关方应自行缴纳）；管理人在向投资者交付利益或资产后税务机关要求管理人缴纳相关税费的，投资者应按照管理人通知要求缴纳相应税费（具体以管理人通知为准），管理人亦有权以计划剩余财产直接缴纳；投资者不得要求管理人以任何方式向其返还或补偿该等税费。如管理人因此垫付相应税费等款项的，管理人有权向投资者追索垫付的税费和孳息款项，投资者应按管理人通知向管理人指定账户返还垫付款。投资者已知悉并同意，计划资产承担上述税费可能导致资产变现损失或投资收益减损。

（六）如委托资产无法变现或不足，无法从委托资产中足额提取管理费、托管费、其他费用及纳税款项的，管理费、托管费、其他费用及纳税款项由投资者另行支付。

十五、资产管理计划的收益分配

（一）可供分配利润的构成

投资收益包括：投资所得利息；银行存款利息；其它孳息等合法收入。

投资净收益为单一计划当期实现的收益扣除按照国家有关规定及资产管理

合同规定可以在计划收益中扣除当期费用后的余额。

可供分配收益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、以可供分配利润为限，收益分配后委托财产净值不得低于委托财产本金；
- 2、在本合同有效期内，由管理人视产品运作情况决定是否进行收益分配并制定收益分配方案，包括收益分配的基准、次数、比例、时间等。

（三）收益分配方案的确定与通知

收益分配方案由管理人根据本合同拟定，包括单一计划净收益、分配对象、分配原则、分配时间、至收益分配基准日的可供分配利润等内容。计划收益分配方案由管理人拟定，并由托管人复核后确定，管理人按法律法规的规定向中国证监会备案并告知委托人。

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

（四）收益分配的执行方式

本计划收益分配原则上采取以现金形式向委托人分配，法律法规另行规定的除外。

收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用，以及相关税负由委托人自行承担。

法律法规或中国证监会另有规定的从其规定。

十六、信息披露与报告

（一）向投资者披露信息的种类、内容、频率和方式

资产管理计划运作期间，管理人应当按照以下要求向投资者披露相关信息：

- （1）每周披露一次资产净值；
- （2）每季度结束之日起一个月内披露季度报告，每年度结束之日起四个月内披露年度报告；
- （3）发生资产管理合同约定的或者可能影响投资者利益的重大事项时，在

事项发生之日起五日内向投资者披露；

(4) 中国人民银行、中国证监会及其派出机构、证券投资基金业协会等监管部门规定的其他要求事项。

(二) 定期报告

1、季度报告

管理人应当在每季度结束之日起一个月内，编制管理季度报告，发送投资者，并报管理人所在地中国证监会派出机构和证券投资基金业协会备案，季度报告包括但不限于管理人履职报告；托管人履职报告；资产管理计划投资表现；资产管理计划投资组合报告；资产管理计划运用杠杆情况（如有）；资产管理计划投资收益分配情况；资产管理计划支付的管理费、托管费、业绩报酬（如有）等费用的计提基准、计提方式和支付方式；投资经理变更、重大关联交易等涉及投资者权益的重大事项；中国证监会规定的其他事项。

资产管理计划成立不足三个月或者存续期间不足三个月的，管理人可以不编制资产管理计划当期的季度报告。

2、年度报告

管理人、托管人应当在每年度结束之日起四个月内，分别编制管理年度报告和托管年度报告，由管理人发送投资者，并报中国证监会相关派出机构和证券投资基金业协会备案。年度报告包括但不限于管理人履职报告；托管人履职报告；资产管理计划投资表现；资产管理计划投资组合报告；资产管理计划运用杠杆情况（如有）；资产管理计划财务会计报告；资产管理计划支付的管理费、托管费、业绩报酬（如有）等费用的计提基准、计提方式和支付方式；投资经理变更、重大关联交易等涉及投资者权益的重大事项；中国证监会规定的其他事项。管理人在3个月内完成年度报告后，将有关报告提供托管人复核其中本计划的财务数据，托管人在收到后1个月内复核，并将复核结果书面通知管理人。托管人复核内容仅为报告中的财务数据（本合同约定的托管人无复核义务的数据除外）。

资产管理计划成立不足三个月或者存续期间不足三个月的，管理人可以不编制资产管理计划当期的年度报告，托管人可以不编制当期的年度托管报告。

3、净值报告：本计划每周向投资者披露一次经托管人复核的计划资产净值。

4、托管人履职报告（以下称“托管报告”）

1) 托管人履职报告作为管理人季度报告、年度报告内容的一部分，由托管人完成管理人季度报告、年度报告的复核工作后，确定托管人履职报告内容并向管理人反馈，同时在管理人、托管人协商一致的季度报告、年度报告上盖章确认，由管理人根据本合同约定的方式向投资者披露。托管人履职报告内容包括托管人履职情况、对管理人投资运作的监督情况及有关报告财务数据的复核意见等。

2) 管理人应当在每季度结束后 20 日内向托管人提供其编制的季度报告供托管人复核，托管人复核管理人季度报告中的财务数据后（本合同约定的托管人无复核义务的数据除外），于 10 日内向管理人反馈复核意见。

3) 管理人应当在每年度结束后向托管人提供其编制的年度报告、当期财务会计报告供托管人复核，托管人复核管理人年度报告、当期财务会计报告中的财务数据后（本合同约定的托管人无复核义务的数据除外），于一个月内向管理人反馈复核意见。

4 因资产管理计划成立不足三个月或者存续期间不足三个月，管理人未编制资产管理计划当期的季度报告和年度报告的，托管人不编制当期托管人履职报告。

（三）重大事项报告

发生资产管理合同约定的或者可能影响投资者利益的重大事项时，管理人在事项发生之日起五日内向投资者披露。披露的情形包括但不限于：

- 1、投资经理发生变更，或出现其他可能对本计划的持续运作产生重大影响的事项；
- 2、本计划出现暂停估值情形；
- 3、本计划终止和清算；
- 4、与本计划有关的重大诉讼、仲裁事项；
- 5、计划投资于管理人、托管机构及其控股股东、实际控制人或者与其他重大利害关系的公司发行或者承销的证券，或者从事其他重大关联交易；
- 6、管理人、托管人因重大违法违规，被中国证监会取消相关业务资格；
- 7、管理人、托管人因解散、破产、撤销等原因不能履行相应职责；
- 8、其他管理人认为对投资者利益可能产生重大影响的事项。

（四）披露方式

管理人采用邮件方式向投资者披露相关信息，投资者、管理人、托管人用于

接收和披露相关信息的邮箱地址以本合同“二十四、通知与送达”约定为准。

（五）投资者应当履行下列信息披露义务

1、投资者应当按照《关于上市公司实施员工持股计划试点的指导意见》的相关要求做好信息披露工作。

2、投资者应当按照《上海证券交易所上市公司员工持股计划信息披露工作指引》做好信息披露工作。

3、参与员工持股计划的员工因参加员工持股计划，其股份权益发生变动，依据法律应当履行相应义务的，应当依据法律履行；员工持股计划持有中来股份股票达到中来股份已发行股份总数的5%时，应当依据法律规定履行相应义务。

（六）管理人、托管人向监管机构的报告

管理人、托管人应当在每年度结束之日起四个月内，分别编制私募资产管理业务管理年度报告和私募资产管理业务托管年度报告，并由管理人报中国证监会相关派出机构和证券投资基金业协会备案。

相关法律法规另有规定的，本计划将按照金融管理部门最新规定及时履行信息披露与监管报告义务。

十七、风险揭示

本单一资产管理计划可能面临的风险，包括但不限于以下几项：

（一）一般风险揭示

1、本金损失风险

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资产管理计划财产，但不保证资产管理计划财产中的认（申）购资金本金不受损失，也不保证一定盈利及最低收益。

本计划属于中等风险投资品种，本计划的产品风险等级为 R3，仅适合向风险承受能力等级为 C3 及高于 C3 的合格投资者推广。

2、市场风险

市场风险是指投资品种的价格因受经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素影响而引起的波动，导致收益水平变化，产生风险。市场风险主要

包括：

(1) 政策风险。货币政策、财政政策、产业政策等国家宏观经济政策的变化对资本市场产生一定的影响，导致市场价格波动，影响单一资产管理业务的收益而产生风险。

(2) 经济周期风险。经济运行具有周期性的特点，受其影响，单一资产管理业务的收益水平也会随之发生变化，从而产生风险。

(3) 利率、汇率风险。利率风险是指由于利率变动而导致的资产价格和资产利息的损益。利率波动会直接影响企业的融资成本和利润水平，导致证券市场的价格和收益率的变动，使单一资产管理业务的收益水平随之发生变化，从而产生风险。汇率波动范围将影响国内资产价格的重估，从而影响委托资产的净值。

(4) 购买力风险。单一资产管理业务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，从而使单一资产管理业务的实际收益下降。

(5) 再投资风险。固定收益品种获得的本息收入或者回购到期的资金，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，从而对单一资产管理业务产生再投资风险。

3、管理风险

在单一资产管理计划运作过程中，管理人依据资产管理合同约定管理和运用资产管理计划财产所产生的风险，由资产管理计划财产及投资者承担。投资者应充分知晓投资运营的相关风险，其风险应由投资者自担。管理人的知识、经验、判断、决策、技能等，会影响其对信息的获取和对经济形势、金融市场价格走势的判断，如管理人判断有误、获取信息不全、或对投资工具使用不当等影响单一资产管理计划的收益水平，从而产生风险，投资者请特别注意。

4、流动性风险

单一资产管理业务不能迅速转变成现金，或者转变成现金会对资产价格造成重大不利影响的风险。流动性风险按照其来源可以分为两类：

(1) 市场整体流动性相对不足。证券市场的流动性受到市场行情、投资群体等诸多因素的影响，在某些时期成交活跃，流动性好；而在另一些时期，可能成交稀少，流动性差。在市场流动性相对不足时，交易变现有可能增加变现成本，

对单一资产管理业务造成不利影响。

(2) 证券市场中流动性不均匀，存在个券流动性风险。由于流动性存在差异，即使市场流动性比较好的情况下，一些个券的流动性可能仍然比较差，从而使得单一资产管理业务在进行个券操作时，可能难以按计划买入或卖出相应的数量，或买入卖出行为对个券价格产生比较大的影响，增加个券的建仓成本或变现成本。

5、信用风险

信用风险是指发行人是否能够实现发行时的承诺，按时足额还本付息的风险，或者交易对手未能按时履约的风险。

(1) 交易品种的信用风险：投资于公司债券、可转换债券等固定收益类产品，存在着发行人不能按时足额还本付息的风险；此外，当发行人信用评级降低时，资产管理计划所投资的债券可能面临价格下跌风险。

(2) 交易对手的信用风险：交易对手未能履行合约，或在交易期间未如约支付已借出证券产生的所有利息和分红，将使资产管理计划面临交易对手的信用风险。

6、税收风险

本合同各方当事人应根据国家法律法规规定，履行纳税义务。依据相关法律法规或税务机关的认定，本计划投资及运营过程中发生增值税（含附加税费）等应税行为，以管理人为纳税人或由管理人代扣代缴的，除本计划已列明的资产管理业务费用（如管理费、业绩报酬、托管费等）由各收费方自行缴纳外，管理人有权在资产管理计划资产中计提并以资产管理计划资产予以缴纳或代扣代缴，且无需事先征得投资者的同意。从资产管理计划资产中扣缴税费可能导致资产管理计划税费支出增加、净值和实际收益降低，从而降低投资者的收益水平，管理人特别提示投资者注意上述风险。

7、担任单一资产管理业务管理人、托管人，因停业、解散、撤销、破产，或者被中国证监会撤销相关业务许可、责令停业整顿等原因不能履行职责，可能给投资者带来一定的风险。

8、投资银行存款的相关风险

(1) 提前支取风险：银行存款正常到期之前无法提前支取、因提前支取造

成利息损失、提出提前支取申请但存入银行无法按时足额提取的风险。

(2) 信用风险：银行存款存入银行无法按时足额还本付息的风险。

(3) 利率风险：投资者收益可能低于以银行存款或其它方式运用资金而产生的收益。

(4) 政策风险：货币政策、财政政策、产业政策等国家宏观经济政策的变化对资本市场产生一定的影响，导致市场价格波动，影响委托资产的收益而产生风险。

(5) 不可抗力风险：不可抗力风险是指由于战争、重大自然灾害等不可抗力因素的出现，将会严重影响证券市场的运行，可能导致委托资产的损失，从而带来风险。

9、关联交易的风险（如有）

在征得投资者事先同意后，本计划可资产投资于管理人、托管人及前述机构的控股股东、实际控制人或者其它关联方发行的证券或承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易。本计划可能因上述关联交易造成损失。

10、根据《上海证券交易所、深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司证券交易资金前端风险控制业务规则》等有关规定，证券交易所、中国结算对管理人相关交易单元的全天净买入申报金额总量实施额度管理，并通过证券交易所对本计划实施资金前端控制。本计划可能因上述业务规则而无法完成某笔或某些交易，可能造成损失。

11、其他风险

(1) 技术风险。在单一资产管理业务的日常交易中，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管理人、托管人、证券登记结算机构等等。

(2) 操作风险。管理人、托管人、证券登记结算机构等在业务操作过程中，因操作失误或违反操作规程而引起的风险。

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

(4) 因监管政策变化，存在监管机构书面或口头叫停本单一资产管理业务或禁止投资相关证券等风险。

(5) 其他不可预知、不可防范的风险。

(二) 特定风险揭示

1、员工持股计划股票锁定期风险

员工持股计划所持有股票的锁定期为 12 个月，且锁定期结束后不一定会立即减持，导致员工持股计划参与员工实际持股期限较长。锁定期期间证券市场上的系统风险和市场风险不确定性较大，使本计划面临较大的流动性风险和投资风险。一般来说，个股的趋势与大盘的趋势具有很强的正相关性，在股市大幅下跌的时候这种相关性将进一步增强。因此，在锁定期内，个股可能因为大盘调整的影响而出现股价下跌。

2、若中来股份员工持股计划存续期间发生被 ST、*ST、暂停或终止上市、涉及跨市场吸收合并、公司缩股、减资或公司分立等事件时，本资产管理计划面临无法及时变现从而影响本计划投资收益的风险。

3、因市场流动性问题及价格剧烈波动、股份解禁后无法变现或出现亏损的风险。

4、本计划提前终止或延期的风险：管理人会按照投资者的委托行使资产管理计划名下股份的相关股东权益，并按照投资者的委托统一决策安排资产管理计划名下股份的退出及资产管理计划存续期限问题，投资者因上述安排可能存在提前结束投资或延期退出的风险。

5、本计划存在所有持有的股票因监管部门关于上市公司股票减持限制（如《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定（证监会公告〔2017〕9号，2017年5月26日）》（简称“《减持若干规定》”））无法按时减持而导致本计划存续期无限期延长或进行二次清算的风险，也间接存在计划损益分配波动性加大和分配时限拉长的风险。

6、税收政策风险

根据中华人民共和国财政部和国家税务总局关于资产管理行业税收相关政策的规定，管理人作为纳税义务人，有义务针对资产管理过程中产生的投资收益按照最新税收征管要求进行纳税，因此会对本单一计划项下投资收益产品影响。由于上述税务新政在具体实践上尚有不明确之处，因此，相关的税收政策存在变动的可能。

7、集中度风险

本产品主要投资于中来股份股票，投资标的集中度高，投资标的股票价格的波动将直接影响本单一计划资产净值的变化，本产品存在较大集中度风险。

8、未在证券投资基金业协会完成备案的风险

本合同签署后须向基金业协会进行备案，存在协会备案不通过的不确定性。因此，即使本合同签署，并不意味着必然能获得基金业协会的备案通过。而该等备案过程可能会受到相应监管政策的影响，包括备案时间所需时间、能否通过备案都存在一定的不确定性。

当出现无法通过基金业协会备案的情形，本计划可能面临按照最新监管政策或指导变更合同或提前终止的不确定性，由此直接影响本计划的投资运作。

9、无法足额提取金额的风险

对于每笔委托资产，经管理人确认的拟提取金额，不构成管理人保证委托财产本金不受损失或者取得最低投资收益的承诺，投资者承担委托资产到期可能无法足额提取到预约的提取金额的风险。

十八、管理人、托管人的更换条件和程序

（一）管理人和托管人职责终止的情形

1、有下列情形之一的，管理人职责终止：

- （1）被依法取消资产管理资格；
- （2）依法解散、被依法撤销或被依法宣告破产；
- （3）法律法规及中国证监会规定的和本合同约定的其他情形。

2、有下列情形之一的，托管人职责终止：

- （1）被依法取消基金托管资格；
- （2）依法解散、被依法撤销或被依法宣告破产；
- （3）法律法规及中国证监会规定的和本约定的其他情形。

（二）管理人和托管人的更换程序

1、管理人的更换程序

- （1）提名：新任管理人由投资者提名。

(2) 决议：新任管理人由投资者确认。

(3) 临时管理人：新任管理人产生之前，由原管理人继续担任。

(4) 交接：管理人职责终止的，管理人应妥善保管资产管理业务资料，及时向新任管理人办理资产管理业务的移交手续，新任管理人与投资者及托管人重新签署资产管理合同。。

2、托管人的更换程序

(1) 提名：新任托管人由管理人或投资者提名。

(2) 决议：新任托管人由管理人和投资者协商一致书面确认。

(3) 临时托管人：新任托管人产生之前，由原托管人继续担任。

(4) 交接：托管人职责终止的，托管人应妥善保管资产管理业务资料，及时向新任托管人办理资产管理业务的移交手续，新任托管人应及时接收。新任托管人应与管理人核对资产总值。

十九、资产管理合同的变更、终止

(一) 合同的变更

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

2、因其他原因需要变更资产管理合同的，经投资者、管理人和托管人书面协商一致后，可对资产管理合同内容进行变更，本合同另有约定的除外。资产管理计划改变投向和比例的，应当事先取得投资者同意。

3、发生下列事项时，投资者、管理人、托管人应重新签署资产管理合同：

(1) 管理人被依法撤销资产管理业务资格或者依法解散、被撤销、宣告破产，本计划由其他管理人承接；

(2) 托管人被依法撤销资产管理业务托管资格或者依法解散、被撤销、宣告破产，本计划由其他托管人承接；

(二) 本计划终止的情形包括下列事项：

1、合同期限届满而未续期的；

- 2、经合同各方当事人协商一致决定终止的；
- 3、管理人被依法撤销资产管理业务资格或者依法解散、被撤销、被宣告破产，且在六个月内没有新的管理人承接；
- 4、托管人被依法撤销基金托管资格或者依法解散、被撤销、被宣告破产，且在六个月内没有新的托管人承接；
- 5、未在证券投资基金业协会完成备案或不予备案的情形；
- 6、本合同继续存续可能给管理人造成声誉或经济损失的；
- 7、投资者依法解散或被撤销的；
- 8、法律、行政法规、中国证监会规定及本合同约定的其他情形。
- 9、托管人发现投资者、管理人有下列情形的，有权终止托管服务：
 - (1) 违反资产管理目的，不当处分资产管理计划财产的；
 - (2) 未能遵守或履行合同约定有关承诺、义务、陈述或保证；
 - (3) 被依法取消从事资产管理业务的相关资质或经营异常；
 - (4) 被依法解散、被依法撤销、被依法宣告破产或失联；
 - (5) 法律法规明确规定和合同约定的其他情形。

出现上述第 9 项下（1）、（2）、（3）款事由，托管人要求终止托管服务的，应与合同当事人签署托管终止协议，将托管资金移交至继任托管人；如投资者或管理人拒不签署终止协议或未落实继任托管人，托管银行有权采用止付措施，或公告解除托管协议，不再履行托管职责；托管人发现上述第 9 项下（4）款事由，有权立即对托管资金账户采取止付措施。

（三）合同的展期

本合同终止前，在符合下列条件的情况下，经投资者、管理人、托管人协商一致，本合同可以展期：

- 1、资产管理计划运作规范，管理人、托管人未违反法律、行政法规、中国证监会规定和资产管理合同的约定；
- 2、资产管理计划展期没有损害投资者利益的情形；
- 3、中国证监会规定的其他条件。

（四）合同的备案

管理人应当在本计划成立后 5 个工作日内将本合同、投资者名单与认购金额、

资产缴付证明等材料报证券投资基金业协会备案，并抄报管理人所在地中国证监会派出机构。

管理人应当自资产管理合同变更之日起 5 个工作日内报证券投资基金业协会备案，并抄报管理人所在地中国证监会派出机构。

本计划的终止日即为本合同的终止日。管理人应当自本计划终止之日起 5 个工作日内报证券投资基金业协会备案，并抄报管理人所在地中国证监会派出机构，前述第（二）条第 5 项约定的情形除外。

（五）其他

管理人违反法律、行政法规的规定，被中国证监会依法撤销证券资产管理业务许可、责令停业整顿，或者因停业、解散、撤销、破产等原因不能履行职责的，应当按照有关监管要求妥善处理有关事宜。

尽管本合同有其他约定，但如因监管政策变化、监管机关书面或者口头要求停止本合同项下业务的，管理人有权停止投资被停止的业务或者提前终止本计划，本合同项下的被停止业务所涉及的部分委托资产（含因投资产生的合同约定的权利和义务）或者计划提前终止后的全部委托资产（含因投资产生的合同约定的权利和义务）在扣除管理费、托管费等相关费用后均由投资者直接承接。

二十、委托资产的清算

（一）委托资产清算程序与清算报告

本计划终止的（含提前终止），管理人和托管人开始组成清算组，负责委托财产的保管、清理、估价、变现、确认和分配，具体职责如下：

1、管理人

- （1）资产变现；
- （2）除交易所、银行等自动扣收的费用外，对清算期间资金支付出具划款指令；
- （3）出具会计报表；
- （4）清算期间的会计核算；
- （5）编制清算报告；
- （6）配合托管人办理账户注销工作；

(7) 与管理人义务相关的其他职责。

2、托管人

(1) 清算期间的财产保管；

(2) 复核管理人划款指令，进行资金划付；

(3) 委托财产资金、证券账户的注销；

(4) 清算期间发生资金变动的当日，提供日终资金调节表；

(5) 复核管理人出具的会计报表；

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

(7) 与托管人义务相关的其他职责。

(二) 清算程序

1、资产的变现

计划终止后，委托财产不应仍持有可变现可流通的非现金资产，如遇特殊情况，委托财产仍持有可流通非现金资产的，由管理人进行强制变现处理；委托财产持有的流通受限证券，如未到期回购、未上市新股或休市、停牌、暂停交易的证券等，于限制条件解除后由管理人进行变现处理。委托人应接受上述由于资产变现产生的收益或损失。

管理人拟进行二次或多次清算的，应向委托人进行披露。在进行二次或多次清算的变现过程中，变现的资金以现金保存，不得再进行投资。计划终止日至资产全部完成变现前，管理人、托管人继续按本合同第十四章第（二）款约定的费率及计算方法收取管理费、托管费。

2、非现金资产返还

在按本合同足额收取管理费、托管费等费用后可办理委托资产移交手续。委托资产移交可以采取现金方式、非现金资产方式（包括但不限于股票、债券、基金等）或者两者的混合方式，移交方式由管理人决定。任何情况下，管理人不承担必须将委托资产全部变现的义务。在合同终止日前，如仍有非现金资产无法变现的，管理人和投资者协商一致的，本计划可延期终止或管理人将非现金资产现状返还投资者。非现金资产的保管与转移由资产投资者与资产管理人协商处理，资产托管人不承担责任。

委托资产在委托资产清算日至委托资产移交前, 托管人继续履行本合同约定的托管责任。在该托管期间, 任何当事人均不得运用该财产。托管期间的收益归属于委托资产, 发生的管理费、托管费用由被托管的委托资产承担。管理人、托管人继续按本合同第十四章第(二)款约定的费率及计算方法收取管理费、托管费。因投资者原因导致委托资产无法转移的, 委托人和管理人可以在协商一致后按照有关法律法规进行处理。

3、清算费用的来源和支付方式

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

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

除交易所、登记结算机构、开户银行等自动扣缴的费用外, 所有清算费用由管理人向托管人出具指令, 经托管人复核其中财务数据(本合同约定的托管人无复核义务的数据除外)后, 由托管人根据管理人符合本合同约定的指令办理支付。

4、向委托人支付部分清算财产

各次清算时, 计划财产按下列顺序清偿:

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

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

各次清算时, 向委托人支付的清算款金额计算方法为: 将当前变现后的剩余

现金资产扣除资产管理计划财产当前的清算费用、当前应付税款、清偿当前资产管理计划的债务、扣除下月或下季度需增加冻结的结算备付金及交易保证金、匡算并预留后期应付税费等所需充足头寸，并预提 10 万元清算备用资金。其中下月或下季度需增加冻结的结算备付金及交易保证金的金额和后期税费的金额由管理人进行匡算，托管人不对匡算金额进行复核。

托管人根据管理人符合本合同约定的指令并经其复核其中财务数据（本合同约定的托管人无复核义务的数据除外）后，向委托人支付部分清算财产。

若委托财产后续清算，出现账面剩余资产不足以支付相关负债的，委托人有义务于收到管理人发出的收款通知后当日内将款项补足。如遇委托人未及时补足该款项的情形，由管理人负责向委托人进行追讨。

5、清理委托财产债权、债务

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

委托财产债务主要包括委托财产应付管理费、托管费、券商佣金、证券、期货变现交易费用、银行费用、销户费用等。除交易所、登记公司、开户机构等自动扣缴的费用外，所有清偿由管理人向托管人出具划款指令，由托管人根据管理人符合本合同约定的指令并经其复核其中财务数据（本合同约定的托管人无复核义务的数据除外）后办理支付。

7、确认主要清算事项完成后的财产状况，出具清算报告。

主要清算事项完成的标志是：

(1) 非现金资产变现完成或移交完成；

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

管理人应于主要清算事项完成后编制清算报告并加盖业务章以传真、电子邮件或管理人与托管人认可的其他形式发送给托管人，托管人于 5 个工作日内完成对其中财务数据（本合同约定的托管人无复核义务的数据除外）的复核，加盖业务章以传真、电子邮件或管理人与托管人认可的其他形式发送管理人，由管理人

向委托人提交。管理人向委托人提交清算报告后 3 个工作日内委托人未提出书面异议的，表示委托人接受此清算报告。

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

（五）专用证券账户的注销

管理人应当于合同到期后且资产完全按照清算方案分配给投资者十五个工作日内向证券登记结算机构申请注销专用证券账户并注销其他投资所需账户。

（六）托管账户的注销

托管人应当于合同到期日后且资产完全按照清算方案分配给投资者后及时注销托管账户，管理人应给予必要的配合。

（七）备付金账户、保证金账户的销户及剩余财产支付

对于在备付金账户、保证金账户中剩余财产按照中国证券登记结算有限责任公司相关政策执行，最长于计划终止后 2 个季度可以完成清理。备付金账户利息以登记公司实际支付为准。利息结清后，托管人向管理人提供书面确认数据，由管理人向托管人出具划款指令，托管人根据管理人符合本合同约定的指令并经其复核其中财务数据（本合同约定的托管人无复核义务的数据除外）后，向委托人支付所有剩余财产。剩余财产支付过程中发生的银行费用，由委托人负担。向委托人支付的托管账户利息，以销户时账户开户银行实际支付为准。

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

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

（九）管理人应保存资产管理计划财产清算账册及文件 20 年以上。

二十一、保密

（一）管理人、托管人应就委托资产以及相关信息（包括但不限于本合同内容、委托资管投资管理情况以及其他方提供的商业秘密）承担保密责任。除法律、

法规的规定、监管部门、有权机关和行业自律组织要求和本合同另有约定外，未经投资者事先书面同意，不得以任何方式披露或利用该信息。

(二) 任何一方对于在本合同履行过程中获知的对方的数据和信息，未经该方事先书面同意，不得用于本合同外的目的，不得告知非本合同当事方或与允许非本合同当事方使用，法律法规另有规定、监管、有权机关和行业自律组织及审计要求或本合同另有约定的除外。

(三) 如经他方事先书面同意而将有关信息告知非本合同当事方或允许非本合同当事方使用，应当与该方签订保密合同。

(四) 本保密义务不因本合同的终止而终止。

二十二、违约责任

(一) 任何一方不履行本合同或履行本合同不符合约定的，构成违约。对因此给守约方造成的直接损失，违约方应承担相应的赔偿责任。如属当事人双方或多方当事人的违约，造成本合同不能履行或者不能完全履行的，根据实际情况，由违约方分别承担各自因过错责任应负的违约责任。但是发生下列情形，当事人应当免责：

- 1、不可抗力；
- 2、投资者及/或管理人及/或托管人按照有效的法律法规或监管部门的规定作为或不作为而造成损失；
- 3、管理人按照本合同规定的投资原则行使或不行使其投资权而造成损失；
- 4、托管人对存放在托管人以外机构的资产，因该等机构欺诈、疏忽、过失、破产等原因给委托资产带来的损失不承担责任；
- 5、管理人及托管人对交由证券公司等其他机构负责清算交收的委托资产及收益，因该等机构欺诈、疏忽、过失、破产等原因给委托资产造成的损失，由相关责任方承担，托管人及管理人不承担责任；
- 6、对于本资产管理计划的结构设计、投资运作模式而产生的相关责任，托管人不予承担。

7、托管人因违反法律法规或本合同，给资产管理计划资产造成损失的，应承担赔偿责任。管理人及其他第三方机构等相关机构因发生违法违规行为给资产管理计划资产造成损害的，应当由各机构自行承担责任。除非法律法规另有规定外，管理人或托管人任一方不因另一方的失职行为而给计划财产或委托人造成的损失向委托人承担连带责任。

8、计算机系统故障、网络故障、通讯故障、电力故障、计算机病毒攻击等意外事故，因管理人、托管人故意或重大过失造成的计算机系统故障、网络故障、通讯故障、电力故障、计算机病毒攻击等除外；

9、委托人理解资产管理计划财产的投资、运作、保管面临本合同第十七章中列举的各类风险，管理人及托管人就资产管理计划财产面临的上述固有风险免于承担责任；

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

(二) 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。

二十三、法律适用与争议的处理

本合同适用中华人民共和国法律。

因履行本合同发生的争议，由当事人协商解决，协商不成的，提交上海国际仲裁中心，按照该会现时有效的仲裁规则在上海仲裁。仲裁裁决是终局性的，对各方均有约束力。争议处理期间，相关各方当事人应恪守职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行本合同规定的义务，维护委托人的合法权益。

争议处理期间，合同当事人仍应履行本合同规定的义务，维护投资者的合法权益。

二十四、通知与送达

(一) 本合同任一方方向本合同对方发出与本合同有关的通知，应采取书面形式且以中文书就，并以专人送达、传真、挂号信、特快专递或电子邮件的方式发出。

各方用于通知的相关信息如下：

1、投资者：苏州中来光伏新材股份有限公司（代苏州中来光伏新材股份有限公司第一期员工持股计划）

住所地：江苏省常熟市沙家浜镇常昆工业园区青年路

联系地址：江苏省常熟市沙家浜镇常昆工业园区青年路

法定代表人：林建伟

联系人：李娜

联系电话：0512-52933702

邮箱地址：stock@jolywood.cn

2、管理人：上海光大证券资产管理有限公司

住所地：中国(上海)自由贸易试验区杨高南路 799 号 3 号楼 26 层

联系地址：上海市静安区新闸路 1508 号 6 层

法定代表人：熊国兵

联系人：金银玲

联系电话：021-22167193

邮箱地址：jiny1@ebcn.com

3、托管人联系人名单以附件十三约定为准

(二) 任何通知或书面通讯的收到日是指：

1、如经专人送达，送达之日为收到日；

2、如经特快专递或挂号信送达，则为被通知方在签收单上签收所示日；

3、如通过传真发送，则为被通知方收到成功发送的传真并由通知方电话确认之日；

4、如以电子邮件形式送达，则为被通知方服务器接收之日。

5、一方通讯地址或联络方式发生变化，应自发生变化之日起7日内通知另外两方。如果通讯地址或联络方式发生变化的一方（简称“变动一方”），未将有关变化及时通知另外两方，除非适用法律另有规定，变动一方应对由此而造成的影响和损失承担责任。

二十五、资产管理合同的效力

（一）合同成立与生效

本合同自投资者、管理人和托管人法定代表人或授权签字人或负责人签字（或签章）并加盖公司公章（或合同专用章）之日成立并生效，原编号为“GZDX-2015-043”的《光证资管-中来股份-来宝5号定向资产管理计划定向资产管理合同》自本合同生效之日起终止，计划项下所有操作均以本合同为准。投资者自签订资产管理合同即成为合同的当事人。

本合同是约定投资者、管理人、托管人之间权利义务关系的法律文件，本合同自生效之日起对投资者、管理人、托管人具有同等法律约束力。

本合同生效之日起，原合同即失效，委托人、管理人、托管人按照本资产管理合同履行权利与义务。

（二）合同有效期

本合同有效期同本计划存续期限。本合同另有约定的，从其约定。

二十六、其他事项

（一）合同终止，不影响管理费、托管费等费用结算条款的效力。

（二）投资者、管理人、托管人不得通过签订补充协议、修改合同等任何方式，约定保证委托资产投资收益、承担投资损失，或排除投资者自行承担投资风险和损失。

（三）如将来监管部门对资产管理合同的内容与格式有其他要求的，投资者、

管理人和托管人应立即展开协商,根据监管部门的相关要求修改本合同的内容和格式。

(四)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,或另行签订补充协议,补充协议为本合同不可分割的组成部分,与本合同具有同等法律效力。

(五)本合同项下投资者、管理人、托管人之间相互发送的书面文件、传真、信函等(如各类通知书、投资方向说明等)应加盖的印章,三方一致同意使用预留印鉴,投资者及管理人预留印鉴样本见附件四。

本合同如有未尽事宜,由合同当事人各方按有关法律法规和规定协商解决。本合同一式五份,投资者、管理人各执二份,托管人执一份。

(以下无正文)

(本页无正文, 为合同编号【GZZG-009175-2020】的《光证资管-中来股份-来宝5号员工持股单一资产管理计划资产管理合同》之签署页)

管理人确认已向投资者说明单一资产管理业务的规则和风险, 不以任何方式对投资者资产本金不受损失或者取得最低收益作出承诺; 投资者确认, 已充分理解本合同内容, 自行承担投资风险和损失。

投资者、管理人、托管人不得通过签订补充合同、修改合同等任何方式, 约定管理人保证委托资产投资收益或承担投资损失, 或排除投资者自行承担投资风险和损失。

投资者: 苏州中来光伏新材股份有限公司

(代苏州中来光伏新材股份有限公司第一期员工持股计划)

法定代表人或授权人:

签署日期: 二零 年 月 日

(本页无正文，为合同编号【GZZG-009175-2020】的《光证资管-中来股份-来宝5号员工持股单一资产管理计划资产管理合同》之签署页)

管理人：上海光大证券资产管理有限公司

法定代表人或授权人：

签署日期：二零 年 月 日

（本页无正文，为合同编号【GZZG-009175-2020】的《光证资管-中来股份-来宝5号员工持股单一资产管理计划资产管理合同》之签署页）

托管人：中国工商银行股份有限公司上海市分行

负责人或授权代表：

签署日期：二零 年 月 日

附件一：《委托资产起始运作通知书》

（样本，实际模板可由委托人和管理人商定，其变更不作为合同的修改）

尊敬的委托人：

根据三方共同签署的单一资产管理合同，中国工商银行股份有限公司上海市分行担任本委托资产的托管人，光证资管担任本委托资产的管理人。年 月 日，委托人已将初始现金委托资产（初始委托资产明细见附表）转入本委托资产开立的委托资产专用账户中，本委托资产已经具备正式投资运作的条件。附：

初始委托资产明细表如下，其中

现金资产：人民币 .00 元（大写人民币元正）

委托期限：X 个月，全部资产变现后管理人有权提前终止

投资要素明细表如下：

资产管理计划名称：光证资管-中来股份-来宝 5 号员工持股单一资产管理计划【合同编号：GZZG-009175-2020】			
投资品种名称：_____			
投资期限	收益起算日	收益到期日	分配日
年	20 年 月 日	20 年 月 日	201 年 月 日
投资本金	人民币元，以实际划入资产托管账户中的委托金为准。		

请贵委托人收到本通知后，向本管理人/托管人签章确认已收悉本通知，委托人签收后回传管理人/托管人并与其确认收到后的当日（若非同日确认，以最后一方确认日当日）作为委托资产运作起始日。

管理人：上海光大证券资产管理有限公司（业务盖章）

年 月 日

附件二：《委托财产追加通知书》

（样本，实际模板可由委托人和管理人商定，其变更不作为合同的修改）

编号：

上海光大证券资产管理有限公司：

根据与贵公司签署的《光证资管-中来股份-来宝 5 号员工持股单一资产管理计划资产管理合同》（编号： ），本委托人对于下述业务予以通知。

本委托人追加委托财产元人民币（大写：元人民币），上述委托财产将于年月日划入银行托管账户。

本期委托财产的起始日为：

本期委托财产的提取日为：本期追加委托财产份额以前一交易日的净值为准进行确认。

委托人：

（签字或盖章）

年 月 日

附件三：《第 i 期提取委托财产通知书》

（样本，实际模板可由委托人和管理人商定，其变更不涉及合同的修改）

【xxx】第 i 期提取委托财产通知书

编号：

尊敬的管理人、托管人：

本委托人于年 月 日提取委托财产现金资产价值人民币元（大写人民币元整）。

委托人提取委托财产的回款账户信息如下，委托人已确认下述账户信息与委托人移交委托财产的来款账户信息一致：

账户名称：

账号：

开户银行名称：

大额系统支付号：

委托人：

（签字或盖章）：

年 月 日

附件四：委托人、管理人预留印鉴

（样本，实际模板可由委托人和管理人商定，其变更不涉及合同的修改）

为方便业务往来，根据《光证资管-中来股份-来宝5号员工持股单一资产管理计划资产管理合同》，如下为委托人、管理人的业务预留印鉴。该授权自本合同生效之日起生效，该授权有效期至本合同终止日。

委托人预留印鉴如下：

委托人预留印鉴

委托人（公章）：

年 月 日

管理人预留印鉴如下：

管理人预留印鉴

管理人（公章）：

年 月 日

附件五：委托人有权签字人授权通知

（样本, 实际模板可由委托人和管理人商定，其变更不涉及合同的修改）

上海光大证券资产管理有限公司：

根据《光证资管-中来股份-来宝 5 号员工持股单一资产管理计划资产管理合同》，委托人有权签字人及预留印鉴为如下。该授权自 2020 年月日起生效，该授权有效期至《光证资管-中来股份-来宝 5 号员工持股单一资产管理计划资产管理合同》终止日。

有权签字人签名样本与预留印鉴如下：

预留印鉴

注：有权签字人签字同时加盖预留印鉴指令方有效。

附件六：划款指令

划款指令

（样本，实际模板可由托管人和管理人商定，其变更不涉及合同的修改）

年月日编号：

付款户名：	收款户名：
付款账号：	收款账号：
开户行：	开户行：
大写金额：	小写金额：
划款方式：人行大额支付系统（）	
用途及备注：	
管理公司 经办人： 复核人： 审核签发人：	管理人预留印鉴盖章处：

附件七：单一资产管理计划风险揭示书

尊敬的投资者：

投资有风险。当您/贵机构参与资产管理计划时，可能获得投资收益，但同时也面临着投资亏损的风险。您/贵机构在作出投资决策之前，请仔细阅读本风险揭示书和资产管理合同，充分认识本计划的风险收益特征和产品特性，认真考虑资产管理计划存在的各项风险因素，并充分考虑自身的风险承受能力，理性判断并谨慎作出投资决策。

根据有关法律法规，管理人【上海光大证券资产管理有限公司】及投资者分别作出如下承诺、风险揭示及声明：

一、管理人声明与承诺

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

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

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

二、风险揭示

（一）特殊风险揭示

1、员工持股计划股票锁定期风险

员工持股计划所持有股票有 12 个月锁定期，且锁定期结束后不一定会立即减持，导致员工持股计划参与员工实际持股期限较长。锁定期期间证券市场上的系统风险和市场风险不确定性较大，使本计划面临较大的流动性风险和投资风险。一般来说，个股的趋势与大盘的趋势具有很强的正相关性，在股市大幅下跌的时候这种相关性将进一步增强。因此，在锁定期内，个股可能因为大盘调整的影响而出现股价下跌。

2、若中来股份员工持股计划存续期间发生被 ST、*ST、暂停或终止上市、涉及跨市场吸收合并、公司缩股、减资或公司分立等事件时，本资产管理计划面临无法及时变现从而影响本计划投资收益的风险。

3、因市场流动性问题及价格剧烈波动、股份解禁后无法变现或出现亏损的风险。

4、本计划提前终止或延期的风险:管理人会按照投资者的委托行使资产管理计划名下股份的相关股东权益,并按照投资者的委托统一决策安排资产管理计划名下股份的退出及资产管理计划存续期限问题,投资者因上述安排可能存在提前结束投资或延期退出的风险。

5、本计划存在所有持有的股票因监管部门关于上市公司股票减持限制(如《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定(证监会公告(2017)9号,2017年5月26日)》(简称“《减持若干规定》”))无法按时减持而导致本计划存续期无限期延长或进行二次清算的风险,也间接存在计划损益分配波动性加大和分配时限拉长的风险。

6、税收政策风险

根据中华人民共和国财政部和国家税务总局关于资产管理行业税收相关政策的规定,管理人作为纳税义务人,有义务针对资产管理过程中产生的投资收益按照最新税收征管要求进行纳税,因此会对本单一计划项下投资收益产品影响。由于上述税务新政在具体实践上尚有不明确之处,因此,相关的税收政策存在变动的可能。

7、集中度风险

本产品主要投资中来股份股票,投资标的集中度高,投资标的股票价格的波动将直接影响本单一计划资产净值的变化,本产品存在较大集中度风险。

8、未在证券投资基金业协会完成备案的风险

本合同签署后须向基金业协会进行备案,存在协会备案不通过的不确定性。因此,即使本合同签署,并不意味着必然能获得基金业协会的备案通过。而该等备案过程可能会受到相应监管政策的影响,包括备案时间所需时间、能否通过备案都存在一定的不确定性。

当出现无法通过基金业协会备案的情形,本计划可能面临按照最新监管政策或指导变更合同或提前终止的不确定性,由此直接影响本计划的投资运作。

9、无法足额提取金额的风险

对于每笔委托资产,经管理人确认的拟提取金额,不构成管理人保证委托财产本金不受损失或者取得最低投资收益的承诺,投资者承担委托资产到期可能无法足额提取到预约的提取金额的风险

（二）一般风险揭示

1、本金损失风险

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

本计划属于中等风险投资品种，本计划的产品风险等级为 R3，仅适合向风险承受能力等级为 C3 及高于 C3 的合格投资者推广。

2、市场风险

资产管理计划的投资品种价格因受经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素影响而引起的波动，导致收益水平变化产生的风险。主要包括：政策风险、经济周期风险、利率风险、购买力风险、再投资风险、企业经营风险等。具体为：

（1）政策风险

货币政策、财政政策、产业政策等国家宏观经济政策的变化对资本市场产生一定的影响，导致市场价格波动，影响单一资产管理业务的收益而产生风险。

（2）经济周期风险

经济运行具有周期性的特点，受其影响，单一资产管理计划的收益水平也会随之发生变化，从而产生风险。

（3）利率风险

金融市场利率的波动会直接影响企业的融资成本和利润水平，导致证券市场的价格和收益率的变动，使单一资产管理业务收益水平随之发生变化，从而产生风险。

（4）购买力风险

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

（5）企业经营风险

企业的经营状况受多种因素影响，如市场、技术、竞争、管理、财务等会导致公司盈利状况发生变化。如单一资产管理业务所投资的企业经营不善，与其相关的证券价格可能下跌，或者能够用于分配的利润减少，从而使单一资产管理业务收益水平下降。

（6）再投资风险

再投资风险是债券持有者在持有期得到的利息收入、到期时得到的本息、出售时得到的资本收益等，用它们来再投资所能实现的报酬可能会低于当初购买该债券的收益率的危险。在利率走低时，债券价格上升，但再投资收益率就会降低，再投资的风险加大。当利率上升时，债券价格会下降，但是利息的再投资收益会上升。

3、管理风险

资产管理计划运作过程中，管理人依据资产管理合同约定管理和运用资产管理计划财产所产生的风险，由资产管理计划财产及投资者承担。投资者应充分知晓投资运营的相关风险，其风险应由投资者自担。

4、流动性风险

资产管理计划因市场整体或投资品种流动性不足、应付可能出现的投资者巨额退出或大额退出等原因，不能迅速转变成现金，或者转变成现金会对资产价格造成重大不利影响的危险。

流动性风险按照其来源可以分为两类：

(1) 市场整体流动性相对不足。证券市场的流动性受到市场行情、投资群体等诸多因素的影响，在某些时期成交活跃，流动性好；而在另一些时期，可能成交稀少，流动性差。在市场流动性相对不足时，交易变现有可能增加变现成本，对委托财产造成不利影响。

(2) 证券市场中流动性不均匀，存在个股和个券流动性风险。由于流动性存在差异，即使是在市场流动性比较好的情况下，一些个股和个券的流动性可能仍然比较差，从而在进行个股和个券操作时，可能难以买入和卖出预期的数量，或买入卖出行为对个股和个券价格产生比较大的影响，增加个股和个券的建仓成本或变现成本。

5、信用风险

交易对手方未能实现交易时的承诺，按时足额还本付息的危险，或者交易对手未能按时履约的危险。

6、投资标的的危险（适用于商品及金融衍生品、非标准化债权、未上市股权及收益权等）

本计划投资标的的价值取决于投资对象的经营状况，原股东对所投资企业的管理和运营，相关市场宏观调控政策、财政税收政策、产业政策、法律法规、经济周期的变化以及区域市场竞争格局的变化等都可能影响所投资企业经营状况，进而影响资产管理计划投资标的的价值。

7、税收风险

契约式产品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。

8、其他风险

（1）关联交易风险

虽然管理人积极遵循委托人利益优先的原则、遵守相关法律法规的规定进行操作、积极防范利益冲突，但仍可能因管理人运用委托财产从事关联交易被监管部门认为存在利益输送、内幕交易的风险，进而可能影响委托人的利益。该类证券价格可能会出现下跌，从而使本计划收益下降，甚至带来本金损失。

此外，管理人运用计划财产从事关联交易时可能依照相关法律法规、监管机构、自律组织的规定被限制相关权利的行使，进而可能影响委托财产的投资收益。

（2）操作或技术风险

技术风险。在单一资产管理业务的日常交易中，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管理人、托管人、证券交易所、证券登记结算机构等。

操作风险。管理人、托管人、证券交易所、证券登记结算机构等在业务操作过程中，因操作失误或违反操作规程而引起的风险。

（3）资金前端控制风险

沪、深交易所和中国结算对交易参与人的全天净买入申报金额总量实施额度管理，并通过交易所对交易参与者实施前端控制。相关产品存在买入申报金额不符合资金前端控制额度设置，被交易所拒绝买入申报的风险。

如因员工持股计划等特殊业务类型需要，客户应就买入申报需求提前与管理人进行协商确认。未经协商确认导致买入申报被拒绝的，由委托人自行承担由此造成的损失。

三、投资者声明

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

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

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

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

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

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

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

7、本人/机构已认真阅读并完全理解资产管理合同“资产管理计划的费用与税收”章节中的所有内容。【____】

8、本人/机构已认真阅读并完全理解资产管理合同“法律适用与争议的处理”章节中的所有内容。【____】

9、本人/机构已经配合管理人或其销售机构提供了法律法规规定的信息资料及身份证明文件，以配合上述机构完成投资者适当性管理、非居民金融账户涉税信息尽职调查以及反洗钱等监管规定的工作。

本人/机构承诺上述信息资料及身份证明文件真实、准确、完整、有效。

【____】

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

11、本人/机构承诺本次投资行为是为本人/机构购买（参与）资产管理计划。【____】

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

【____】

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

投资者（自然人签字或机构盖章）：

日期：

管理人（盖章）：

日期：

附件八：专用清算账户及资金划拨专用账户（样本）

《光证资管-中来股份-来宝5号员工持股单一资产管理计划资产管理合同》
（合同编号：GZZG-009175-2020）
专用清算账户及资金划拨专用账户

注意：账户如有变更，变更方应提前三个工作日通知相关各方。

（1）托管费收入账户

户名：证券公司资产管理计划托管收入

账号：1001688911500887116

开户银行：中国工商银行上海市分行业务处理中心

（2）管理费及业绩报酬收入账户

户名：上海光大证券资产管理有限公司

账号：中国光大银行上海分行营业部

开户银行：36510188000562328

附件九：投资经理的指定

投资经理的指定

上海光大证券资产管理有限公司经研究决定指定_沈晓春_为【光证资管-中来股份-来宝 5 号员工持股单一资产管理计划】投资经理。

上海光大证券资产管理有限公司（预留印鉴）

日期： 年 月 日

附：投资经理简介

沈晓春，工学学士。历任光大证券证券投资部投资经理、上海光大证券资产管理有限公司投资经理。具有丰富的股票投资、新股申购、定增增发、股票质押等投资决策经验；擅长价值投资，注重风险控制；经历多次牛熊转换，投资心态成熟。17 年证券投资与研究经验，已取得基金从业资格，最近三年未被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚。

附件十：投资经理变更通知书

投资经理变更通知书

因工作需要，上海光大证券资产管理有限公司决定，自即日起任命_____先生/女士为光证资管-中来股份-来宝5号员工持股单一资产管理计划投资经理，原投资经理_____不再担任本单一资产管理计划投资经理的职务。

特此通知。

上海光大证券资产管理有限公司（预留印鉴）

日期： 年 月 日

附：投资经理简介

附件十一：委托资产核心信息确认表（样本）

委托资产核心信息确认表

委托人、管理人在此确认，截止本合同生效之日，现有委托资产核心要素如下：

期数	第 i 期本金 (万元)	追加生效日	投资标的
第 1 期			通过二级市场买入中来股份股票 XX 股，锁定期 12 个月
第 2 期			
.....			
合计			

新合同生效后，除非另有约定，上述核心要素保持不变。

委托人：（盖章）
年 月 日

管理人：（盖章）
年 月 日

附件十二：托管人关联方名单

托管人关联方名单以中国工商银行股份有限公司（股票代码：601398）公开披露的最新报告中股东变动、主要股东持股情况、财务报表附注等章节涉及的关联方为准。

附件十三：管理人关联方名单

序号	管理人关联方名单
1	光大证券股份有限公司
2	光大资本投资有限公司
3	光大富尊投资有限公司
4	光大期货有限公司
5	上海光大证券资产管理有限公司
6	光大证券金融控股有限公司
7	光大发展投资有限公司
8	光大保德信基金管理有限公司
9	光大幸福国际租赁有限公司
10	光大证券（国际）有限公司
11	新鸿基金融集团有限公司

附件十四：托管人联系名单

中国工商银行股份有限公司上海市分行					
指令联系人信息					
姓名	职责	电话 1	电话 2	邮箱	传真
杨学荣	指令处理(证券、其他)	021-68499005		yyz11@sh.icbc.com.cn	
黄佳一	指令处理(基金、信托)	021-68499684		yyz12@sh.icbc.com.cn	
陈琛	指令处理(保险)	021-68499341		yyz14@sh.icbc.com.cn	
彭云霞	应急联系人	021-68499747			
高蕾	营运主管	021-68499118		gaolei@sh.icbc.com.cn	
数据接收联系信息					
数据接收邮箱	数据接收邮箱: yysj1@sh.icbc.com.cn				
	深证通小站号: K0276				
	注: 数据和对账单接收邮箱若有增减。由电子邮箱 [yysj1@sh.icbc.com.cn] 发送指定				
数据接收联系人:	朱婕 021-68499547				
地址	上海市浦东大道 9 号				