

民生证券索菲亚 1 号  
集合资产管理计划资产管理合同

管理人：民生证券股份有限公司

托管人：兴业银行股份有限公司

# 目 录

一、前言	2
二、释义	2
三、合同当事人	6
四、集合资产管理计划的基本情况	7
五、集合计划的参与和退出	10
六、管理人自有资金参与集合计划	11
七、集合计划的分级	11
八、集合计划客户资产的管理方式和管理权限	16
九、集合计划的成立	17
十、集合计划账户与资产	17
十一、集合计划资产托管	18
十二、集合计划的估值	18
十三、集合计划的费用、业绩报酬	22
十四、集合计划的收益分配	24
十五、投资理念与投资策略	26
十六、投资决策与风险控制	27
十七、投资限制及禁止行为	28
十八、集合计划的信息披露	29
十九、集合计划份额的转让、非交易过户和冻结	30
二十、集合计划的展期	31
二十一、集合计划终止和清算	31
二十二、当事人的权利和义务	34
二十三、违约责任与争议处理	37
二十四、风险揭示	39
二十五、合同的成立与生效	42
二十六、合同的补充、修改与变更	42
二十七、或有事件	42

## 一、前言

为规范民生证券索菲亚 1 号集合资产管理计划(以下简称“集合计划”或“计划”)运作,明确《民生证券索菲亚 1 号集合资产管理计划资产管理合同》(以下简称“本合同”)当事人的权利与义务,依照《中华人民共和国合同法》、《证券公司客户资产管理业务管理办法》(以下简称《管理办法》)、《证券公司集合资产管理业务实施细则》(以下简称《细则》)、《证券公司客户资产管理业务规范》(以下简称《规范》)等法律法规、中国证监会和中国证券投资基金业协会的有关规定,委托人、管理人、托管人在平等自愿、诚实信用原则的基础上订立本合同。本合同是规定当事人之间基本权利义务的法律文件,当事人按照《管理办法》、《细则》、《民生证券索菲亚 1 号集合资产管理计划说明书》(以下简称《说明书》)、本合同及其他有关规定享有权利、承担义务。

委托人承诺以真实身份参与集合计划,保证委托资产的来源及用途合法,所披露或提供的信息和资料真实,并已阅知本合同和集合计划说明书全文,了解相关权利、义务和风险,自行承担投资风险和损失。

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

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

## 二、释义

在本合同中,除非文义另有所指,下列词语或简称具有如下含义:

集合资产管理计划、本集合计划、集合计划:指民生证券索菲亚 1 号集合资产管理计划;

集合计划说明书、说明书:指《民生证券索菲亚 1 号集合资产管理计划说明书》及对该说明书的任何有效的修订和补充;

集合资产管理合同、资产管理合同、本合同:指《民生证券索菲亚 1 号集合资产管理计划资产管理合同》及对该合同的任何有效的修订和补充;

托管协议：指《民生证券-兴业银行关于集合资产管理计划之资产托管协议（托管人结算模式）》及对该协议的任何有效的修订和补充；

风险揭示书：指《民生证券索菲亚 1 号集合资产管理计划风险揭示书》；

《管理办法》：指 2013 年 6 月 26 日中国证监会发布并施行的《证券公司客户资产管理业务管理办法》；

《实施细则》、《细则》：指 2013 年 6 月 26 日中国证监会发布并施行的《证券公司集合资产管理业务实施细则》；

《员工持股计划指导意见》、《指导意见》：指 2014 年 6 月 20 日证监会公布并于公布之日起施行的《关于上市公司实施员工持股计划试点的指导意见》（证监会公告[2014]33 号）；

中国证监会、证监会：指中国证券监督管理委员会；

集合资产管理合同当事人：指受集合资产管理合同约定，根据集合资产管理合同享有权利并承担义务的集合计划管理人、集合计划托管人和委托人；

集合计划管理人、计划管理人、管理人：指民生证券股份有限公司；

集合计划托管人、计划托管人、托管人：指兴业银行股份有限公司，也简称为“兴业银行”；

推广机构：指民生证券股份有限公司（简称“民生证券”）；

注册登记机构：指办理登记、存管、过户、清算和结算等注册登记业务的机构。本集合计划的注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司（简称“中登公司”）；

委托人：指依据集合资产管理合同和集合计划说明书参与本集合计划的投资人，包括个人投资者和机构投资者；

个人投资者：指依据中华人民共和国有关法律法规、监管规定可以投资于集合资产管理计划的自然人投资者；

机构投资者：指依法可以投资集合资产管理计划，在中华人民共和国境内合法注册登记或经有关政府部门批准设立的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织；

份额持有人、持有人：指通过签订集合资产管理合同而依法取得和持有本集合计划份额的委托人；

优先级份额：指本集合计划份额按合同约定规则所分离的优先级份额；

次级份额：指本集合计划份额按合同约定规则所分离的次级份额；

优先级委托人：指认购或申购本集合计划优先级份额的参与者，本集合计划优先级委托人为【兴业银行股份有限公司】；

次级委托人：指认购或申购本集合计划次级份额的参与者，本集合计划次级委托人为【索菲亚家居股份有限公司（代员工持股计划）】；

员工持股计划：指索菲亚家居股份有限公司公告的“索菲亚家居股份有限公司 2015 年员工持股计划”，具体信息参照上市公司公告；

资金补偿方：指江淦钧、柯建生；

集合计划成立日：指集合计划经过推广达到集合计划说明书和集合资产管理合同规定的成立条件后，管理人通告集合计划成立的日期；

推广期：指自本集合计划启动推广之日起不超过 60 个工作日的期间，具体推广时间以本集合计划推广公告为准；

封闭期：特指成立日后的一个期间，在此期间委托人不得参与、退出本集合计划；

开放期：指委托人可以办理集合计划参与、退出或其他约定业务的工作日；

开放日：指开放期内的每个工作日；

存续期、管理期限：指计划成立并存续的期间。本集合计划的存续期为 30 个月，本集合计划存续期满后，可以展期；

工作日：指上海证券交易所和深圳证券交易所等相关交易所的正常交易日；

T 日：指办理本集合计划业务申请的工作日；

T+n 日（n 指任意正整数）：指 T 日后的第 n 个工作日；

天：指自然日；

会计年度：指公历每年 1 月 1 日至 12 月 31 日；

参与：指委托人申请购买本集合计划份额的行为，包括认购和申购；认购指在推广期参与本集合计划的行为，申购指在存续期参与本集合计划的行为；

首次参与：指委托人在参与之前未曾持有过本集合计划的情形；

追加参与：指除首次参与外的其他参与情形；

退出：指委托人按集合资产管理合同规定的条件要求收回全部或部分委托资

产的行为；

强制退出：指由管理人发起退出持有人持有份额的行为；

计划收益：指本集合计划投资所得债券利息、红利、买卖证券/基金价差、银行存款利息及其他合法收入；

集合计划份额、计划份额、份额：指集合计划的最小单位；

元：指人民币元；

计划单位面值、单位面值：人民币 1.00 元；

集合计划资产总值、计划资产总值：指集合计划投资所形成的各类有价证券、银行存款本息及其他资产的价值总和；

集合计划资产净值、计划资产净值：指集合计划资产总值减去负债后的净资产值；

计划单位净值、单位净值：指计算日集合计划资产净值除以计算日集合计划总份额的金额；

计划单位累计净值、累计净值：指计划单位净值与集合计划份额累计分红之和；

标的股票：指本集合计划所投资的上市公司股票，本计划特指索菲亚（股票代码：002572）；

计划资产估值：指计算评估本集合计划资产和负债的价值，以确定本集合计划资产净值的过程；

不可抗力：指本合同当事人无法预见、无法克服、无法避免，且在本合同生效之后发生的，使本合同当事人无法全部或部分履行本合同的任何事件，包括但不限于洪水、地震及其他自然灾害、战争、骚乱、火灾、政府征用、没收、法律变化、系统故障、突发停电或其他突发事件、证券交易所非正常暂停或停止交易等；

分红权益登记日：指享有分红权益的集合计划份额的登记日期，即收益分配基准日。

管理人指定网站：指 [www.msza.com](http://www.msza.com)，管理人指定网站变更时以管理人公告为准。

### 三、合同当事人

#### (一) 委托人

##### 1、优先级委托人

###### (1) 个人填写:

姓名: 证件类型: 证件号码:

通信地址: 邮政编码:

联系电话: 移动电话: 电子信箱:

其他:

机构填写:

(2) 机构名称: 兴业银行股份有限公司

法定代表人或授权委托人: 顾卫平

住所: 上海市静安区江宁路 168 号兴业大厦 31 层

办公地址: 上海市静安区江宁路 168 号兴业大厦 7 层

联系人: 王冠

电话: 021-52629999-212726

认购、参与计划的划出账户 (及退出计划的划入账户)

户名: 兴业银行

开户银行: 兴业银行总行

账号: 801010177599000197

##### 2、次级委托人

###### (1) 个人填写:

姓名: 证件类型: 证件号码:

通信地址: 邮政编码:

联系电话: 移动电话: 电子信箱:

其他:

(2) 机构填写:

机构名称: 索菲亚家居股份有限公司(代员工持股计划)

法定代表人: 江淦钧

通信地址: 中国广东省广州市天河区体育东路108号创展中心西座905

邮政编码: 510000

代理人姓名: 潘雯姗

身份证号码: 441222197906010824

联系电话: 020-87533019

其他:

(二) 管理人

机构名称: 民生证券股份有限公司

法定代表人: 余政

办公地址: 北京市东城区建国门内大街28号民生金融中心A座16-18层

邮政编码: 100005

联系电话: 010-85127657

(三) 托管人

机构名称: 兴业银行股份有限公司

负责人或授权代表: 高建平

通信地址: 福建省福州市湖东路154号

邮政编码: 350000

联系电话: 021-52629999

## 四、集合资产管理计划的基本情况

(一) 名称: 民生证券索菲亚1号集合资产管理计划

(二) 类型: 集合资产管理计划

(三) 目标规模

集合计划成立时的规模预计不少于:

(大写)人民币壹亿壹仟贰佰捌拾万元整:(小写)¥112,800,000.00元(以



集合计划成立时的实际募集资金金额为准)。

其中，优先级份额预计为：

(大写)人民币捌仟肆佰陆拾万元整：(小写)¥84,600,000.00元，具体以优先级份额委托人实际交付的资金为准；

其中，次级份额预计为：

(大写)人民币贰仟捌佰贰拾万元整：(小写)¥28,200,000.00元，具体以次级份额委托人实际交付的资金为准。

集合计划资金以委托人实际交付给管理人的资金为准，但优先级份额资金和次级份额资金成立时的比例不高于 3: 1。

#### (四) 投资范围和投资比例

##### 1、投资范围

本集合计划投资范围为索菲亚家居股份有限公司(股票代码;002572)股票，闲置资金可投资流动性良好的金融工具，包括银行存款、票据、国债、债券逆回购、货币市场基金等。

##### 2、资产配置比例

(1) 股票：占集合计划资产总值的 0-100%，投资于索菲亚家居股份有限公司(股票代码;002572)股票；

本集合计划不得投资于本合同约定外的其他股票。

(2) 其他：闲置资金可投资流动性良好的金融工具，包括银行存款、票据、国债、债券逆回购、货币市场基金等。

法律法规或中国证监会允许集合计划投资其他品种的，经资产管理人与优先级委托人协商一致，在履行合同变更程序后，可以将其纳入本计划的投资范围。

#### (五) 管理期限

管理期限为 30 个月，可提前终止，期满可以展期。

#### (六) 封闭期、开放期及流动性安排：

1、封闭期：封闭期为自成立之日起到计划终止之日止，封闭期内不办理参与、退出业务。

2、开放期：无开放期安排。

3、流动性安排

管理人将对集合计划的流动性进行安排，集合计划在开放期将保持适当的现

金、活期存款或其他高流动性短期金融工具。

(七) 集合计划份额面值

人民币 1.00 元。

(八) 参与本集合计划的最低金额

首次参与的最低金额为人民币 1,000,000 元,追加参与的最低金额为人民币 1 元。

(九) 本集合计划的风险收益特征及适合推广对象

本集合计划优先级份额属预期风险较低,预期收益适中的投资品种,适合追求资产稳健增值、同时具有一定风险承受能力的投资者;

本集合计划次级份额属预期风险较高,预期收益较高的投资品种,适合能够承受本金较大范围损失、资产流动性需求不高、熟悉金融市场的或具有资产配置需求的投资者。

(十) 本集合计划的推广

1、推广机构:民生证券股份有限公司

2、推广方式

管理人应将集合资产管理合同、集合资产管理计划说明书等正式推广文件,以纸质资料或电子资料方式置备于推广机构营业场所。

推广机构应当了解客户的投资需求和风险偏好,详细介绍产品特点并充分揭示风险,推荐与客户风险承受能力相匹配的集合计划,引导客户审慎作出投资决定。禁止通过签订保本保底补充协议等方式,或者采用虚假宣传、夸大预期收益和商业贿赂等不正当手段推广集合计划。

管理人及推广机构应当采取有效措施,并通过管理人、中国证券投资基金业协会、中国证监会电子化信息披露平台或者中国证监会认可的其他信息披露平台,客观准确披露集合计划备案信息、风险收益特征、投诉电话等,使客户详尽了解本集合计划的特性、风险等情况及客户的权利、义务,但不得通过广播、电视、报刊及其他公共媒体推广本集合计划。

(十一) 本集合计划的各项费用

1、认购/申购费: 无;

2、退出费: 无;

- 3、管理费：0.1%/年；
- 4、托管费：0.1%/年；
- 5、证券交易费用；
- 6、与本集合计划存续期相关的费用；
- 7、其他费用。

## 五、集合计划的参与和退出

### （一）集合计划的参与

#### 1、参与的办理时间

##### （1）推广期参与

本集合计划经管理人与托管人、代理推广机构确立推广期后推广。推广期的具体时间安排详见管理人公告。

##### （2）存续期参与

本集合计划各类份额在存续期不办理参与业务。

#### 2、参与的原则

（1）在推广期内，委托人以集合计划的面值（1.00元/份额）参与；

（2）采用金额参与的方式，即以参与金额申请；

（3）本集合计划可接受人数上限为200人；

（4）在推广期及存续期内，当集合计划募集或参与规模接近或达到约定的规模上限时，管理人将自次日起暂停接受参与申请；同时，存续期内管理人可以根据参与情况提前结束或延期结束开放期；

（5）优先级份额、次级份额配比不得超过3:1。

#### 3、参与的程序和确认

（1）投资者按推广机构指定营业网点的具体安排，在规定的交易时间段内办理；

（2）投资者应开设推广机构认可的交易账户，并在交易账户备足参与的货币资金；若交易账户内参与资金不足，推广机构不受理该笔参与申请；

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

（4）投资者参与申请确认成功后，其参与申请和参与资金不得撤销；

(5) 投资者于 T 日提交参与申请后，可于 T+2 日后在办理参与的网点查询参与确认情况。

#### 4、参与费及参与份额的计算

(1) 参与费率：本集合计划免收参与费，即参与费率为 0

(2) 参与份额的计算方法：参与份额 = (参与金额 + 利息) / 计划单位面值

#### 5、参与资金利息的处理方式

委托人的参与资金在推广期产生的利息将按活期利率折算为计划份额归委托人所有，利息金额以集合计划注册登记机构的记录为准。

### (二) 集合计划的退出

本集合计划存续期内不设开放期，不接受投资者的退出申请。

## 六、管理人自有资金参与集合计划

管理人不以自有资金参与本集合计划。

## 七、集合计划的分级

### (一) 集合计划的分级概要

本集合计划通过集合计划资产及收益的不同分配安排，将计划份额划分成预期收益与风险不同的两个类别，即优先级份额和次级份额，两类份额合并运作。

(二) 份额配比：优先级、次级的份额配比不超过 3:1。

(三) 杠杆比例：本集合计划优先级、次级的份额配比不超过 3:1。

### (四) 风险承担

#### 1. 优先级份额

(1) 本集合计划优先级份额享有 7.40%/年的预期年化收益率（扣除管理费和托管费以后）。应付优先级收益以优先级委托人实际持有的优先级份额面值为基准进行计算，计算方法如下：

优先级收益 = 优先级实际持有的计划份额 × 1.00 × 优先级预期收益率【7.40】% × 自优先级委托人向本计划交付委托资金之日起至本计划终止之日的运作天数 / 365

本合同经各方协商一致而延期的，资产管理人、资产托管人与优先级、次级

委托人重新协商确定预期收益率，并且各方以书面形式签署确认。

(2) 优先级份额预期收益率仅为根据本计划的分级比例及计划份额净值的未来表现而测算的参考收益率，并不是管理人向委托人保证其资产本金不受损失或者保证其取得最低收益的承诺。优先级份额可能出现净值损失。

(3) 本集合计划退出或者终止、清算时，优先支付优先级委托人的本金及预期收益。若优先级的预期年化收益无法实现，或本金出现亏损，差额由资金补偿方进行补偿，资金补偿方并对此承担不可撤销的补偿责任。

## 2. 次级份额

次级委托人优先承担集合计划的损失。同时，集合计划的收益在扣除管理费、托管费、其他各项费用以及优先级份额预期年化收益后的剩余收益由次级份额享有（在资金补偿方按本合同约定履行补仓承诺的前提下）。

### (五) 预警、平仓安排及资金补偿方的补仓承诺

为保护全体委托人特别是优先级委托人的利益，集合计划每个交易日计算集合计划单位净值，并将集合计划单位净值等于 0.92 元设置为预警线，将集合计划单位净值等于 0.88 元设置为平仓线。

#### 1. 限售期内预警和平仓机制

(1) 预警线为 0.92 元。在限售期内，当集合计划单位净值于 T 日收盘后低于预警线 0.92 元时，资金补偿方应当在 T+2 个工作日内足额追加资金。资金追加后，集合计划参考单位净值不得低于 0.92 元。

(2) 若资金补偿方没有遵守上述追加资金的要求，无论之后本资管计划净值是否能够恢复到预警线以上，以及之后资金补偿方是否能够足额追加，自 T+3 日起，本资管计划项下所有资产及收益全部归优先级委托人享有，优先级份额净值计算方法自 T+3 日起调整为“资产管理计划资产净值/优先级总份额”，次级份额净值为零。

发生上述情形时，本计划待所投资股票解除限售后，管理人有权且应当对本计划项下的非现金资产进行变现操作并将变现的资产全部分配给优先级份额委托人。若解除限售后，由于各种原因（包括但不限于停牌等）导致本计划资产未能完全变现的，则资金补偿方应追加相当于未变现部分计划资产净值的资金；同时，如优先级委托人获得的分配财产仍低于优先级本金、预期收益分配的总和的，

则资金补偿方还应追加差额补足资金。

## 2. 解禁后预警和平仓机制

(1) 预警线为 0.92 元。当集合计划单位净值于 T 日收盘后低于预警线 0.92 元时，资金补偿方应当在 T+2 个工作日内足额追加资金。资金追加后，集合计划参考单位净值不得低于 0.92 元。

(2) 若资金补偿方没有遵守上述追加资金的要求，T+3 日开盘后管理人应当立即按市价委托方式进行连续减仓操作至持有股票市值不超过资管计划净值的 50%。

(3) 平仓线为 0.88 元。当集合计划单位净值于 T 日收盘后低于平仓线 0.88 元时，自 T+1 日起，管理人将对资产管理计划持有的全部证券资产按市价委托方式立即进行连续的变现操作，该变现操作是不可逆的，直至资管财产全部变现为止，资管计划提前终止。

(4) 如集合计划全部资产变现并扣除相关费用后优先级委托人获得的分配财产仍低于优先级本金、预期收益分配的总和的，则资金补偿方还应追加差额补足资金。

## 3. 差额补足金额的计算

差额补足金额=应付托管人托管费总额+应付管理人管理费总额+资管计划优先级委托人委托资金\* $(1+【7.40】\%*$ 优先级资金自交付之日起至全部本金及收益分配完毕止的实际天数/365)+资管计划应承担的其他未支付税费 - 资管计划已向优先级委托人分配的资金

### (六) 追加资金的使用、返还和清算

#### 1、追加资金的使用

资金补偿方交付的追加资金自进入集合计划资金账户之日起即成为本集合计划项下资产，不增加委托人的份额。追加资金作为其他收入入账。

#### 2、追加资金的返还

(1) 当资金补偿方追加资金后，集合计划单位净值在某交易周最后一个交易日  $T_1$  日达到或超过 1.05 元时，资金补偿方可以于  $T_1+1$  日在所追加资金的额度内提出部分提取资金的申请，提取后集合计划单位净值不低于 1.00 元。经管理人同意后，资产管理人在收到申请之日 ( $T_1+1$ ，含当日) 起的 5 个工作日内出具划

款指令，通知资产托管人向资金补偿方支付提取资金（如在管理人收到申请至管理人出具划款指令当日期间，集合计划单位净值低于 1.00 元，则该申请无效，管理人不予出具划款指令）。资金补偿方存续期间可以申请提取资金的金额如下：

提取资金金额= $\min$ [资金补偿方存续期间追加且尚未提取的资金总金额，（申请提取前一日（ $T_1$ 日）的集合计划资产净值-1.00\*集合计划份额总数）]。

（2）追加资金在集合计划资金账户期间产生的利息和其他收益不予返还，计入本集合计划项下资产，归全体委托人所有。

### （七）资金补偿机制及资金补偿方

为保障本集合计划委托人利益，本计划由江淦钧和柯建生为资金补偿方，对优先级的本金及预期收益承担资金补偿义务。资金补偿方与管理人签订《民生证券索菲亚 1 号集合资产管理计划资金补偿合同》（以下简称，《资金补偿合同》）。委托人购买计划份额的行为视为同意该《资金补偿合同》的约定。

#### 1. 资金补偿方的基本情况

资金补偿方 1：江淦钧

住所地：中国广东省广州市天河区体育东路 108 号创展中心西座 905

身份证号：440104196401133139

资金补偿方 2：柯建生

住所地：中国广东省广州市天河区体育东路 108 号创展中心西座 905

身份证号：440104196410306310

（1）江淦钧和柯建生目前共持有 2.24 亿股索菲亚股票，市值达到 80 亿元。其中：流通股 5600 万股，市值 20 亿元左右；高管限售股 1.68 亿股，市值 60 亿元左右。

（2）稳定的分红收入，江淦钧和柯建生每年可从索菲亚获得丰厚的分红收入，其中，2014 年获得分红收入 7840 万元。

（3）二级市场股票减持。江淦钧和柯建生目前共持有索菲亚流通股 5600 万股，市值达到 20 亿元，江淦钧和柯建生可通过二级市场减持对本集合计划进行资金追加。

#### 3. 资金补偿的性质、范围

资金补偿为不可撤销的补偿责任。

补偿范围包括：优先级委托人的本金及预期年化收益、应付托管人托管费总

额、应付管理人管理费总额及资管计划应承担的其他未支付税费之和与本集合计划终止清算时优先级委托人实际收到金额（含终止清算时分配金额、存续期累计退出金额和累计分红金额）的差额部分。

#### 4. 补偿安排

如根据资产管理合同及《资金补偿合同》，资金补偿方需承担补偿责任的，补偿安排如下：

资金补偿方应在收到管理人发出的《履行资金补偿责任通知书》后的3个工作日内，将《履行资金补偿责任通知书》载明的补偿款项划入本计划在托管人处开立的账户中，由管理人支付给委托人。

#### 5. 资金补偿方责任及违约处理

本资金补偿方在资金补偿范围内承担不可撤销的资金补偿责任，若资金补偿方违约，管理人及优先级委托人可就应补偿而未补偿部分对资金补偿方进行追偿。

资金补偿安排为资金补偿方对优先级委托人的补偿承诺及责任，并不是管理人保证委托人资产本金不受损失或者保证其取得最低收益的承诺。若资金补偿方违约，管理人及优先级委托人可就应补偿而未补偿部分对资金补偿方进行追偿，但管理人不对此承担相应责任。

预警、平仓监控，资金补偿方的资金追加和取回由管理人负责，托管人不承担监控职责。

#### （八）分级的净值计算公式

集合计划份额单位净值 = 集合计划资产净值 / 集合计划份额总数

集合计划份额总数为优先级和次级的份额总数。

1. 未触发本合同“七、集合计划的分级”、“（五）预警、平仓安排及资金补偿方的补仓承诺”、“1. 限售期内预警和平仓机制”中（2）约定的条件时：

优先级的份额参考净值计算公式如下：

（1）如果 T 日集合计划资产净值  $\geq (1 + R \times \frac{T}{365}) \times$  优先级份额

优先级份额单位净值 =  $1 + R \times \frac{T}{365}$ ；

次级份额单位净值 = (T 日集合计划净资产 - 优先级份额净值) / 次级份额数；

R：优先级参与的预期收益率，R 保留到小数点后四位四舍五入计算；



$T$ ：本公式中的天数分段计算，第一段计算天数为优先级委托人向本计划交付委托资金之日至第一个优先级收益分配基准日（含）之间的实际天数；此后，每段计算天数为上一个优先级收益分配基准日（不含）至下一次优先级收益分配基准日（含）之间的实际天数；最后一段计算天数为上一个优先级收益分配基准日（不含）至计划终止日的实际天数。

(2). 如果  $T$  日集合计划资产净值  $\leq (1 + R \times \frac{T}{365}) \times$  优先级份额

优先级份额单位净值 =  $T$  日集合计划净资产 / 优先级份额数；

次级份额单位净值 = 0；

$R$ ：优先级参与的预期收益率， $R$  保留到小数点后四位四舍五入计算；

$T$ ：本公式中的天数分段计算，第一段计算天数为优先级委托人向本计划交付委托资金之日至第一个优先级收益分配基准日（含）之间的实际天数；此后，每段计算天数为上一个优先级收益分配基准日（不含）至下一次优先级收益分配基准日（含）之间的实际天数；最后一段计算天数为上一个优先级收益分配基准日（不含）至计划终止日的实际天数。

2、触发本合同“七、集合计划的分级”、“（五）预警、平仓安排及资金补偿方的补仓承诺”、“1. 限售期内预警和平仓机制”中（2）约定的条件时：

优先级份额单位净值 =  $T$  日集合计划净资产 / 优先级份额数；

次级份额单位净值 = 0；

由于分级份额净值涉及 TA 数据，分级份额净值由管理人计算并复核，托管人不对分级份额净值进行复核。

## 八、集合计划客户资产的管理方式和管理权限

### （一）管理方式

本集合计划由管理人自主管理。

### （二）管理权限

本集合计划资产由管理人全权管理。

## 九、集合计划的成立

### （一）集合计划成立的条件和日期

集合计划的参与资金总额（含参与费）不低于 3 千万元人民币且其委托人的人数为 2 人（含）以上，并经管理人聘请的具有证券相关业务资格的会计师事务所对集合计划进行验资并出具验资报告时，管理人宣布本集合计划成立。

集合计划设立完成前，委托人的参与资金只能存入证券登记结算机构指定的专门账户或资产托管机构的募集专户，不得动用。

### （二）集合计划设立失败

集合计划推广期结束，在集合计划规模低于人民币 3 千万元或委托人的人数少于 2 人条件下，集合计划设立失败，管理人承担集合计划的全部推广费用，并将已认购资金及同期利息在推广期结束后 30 个工作日内退还集合计划委托人。

### （三）集合计划开始运作的条件和日期

1、条件：本集合计划公告成立。

2、日期：本集合计划自成立之日起开始运作。

管理人发起设立集合资产管理计划后 5 日内，应当将发起设立情况报中国证券投资基金业协会备案，同时抄送证券公司住所地中国证监会派出机构。

## 十、集合计划账户与资产

### （一）集合计划账户的开立

托管人以托管人的名义在托管银行开设托管专户，保管集合计划的银行存款，该托管专户是指托管人在集中清算模式下，代表所托管的包括集合计划在内的托管资产与中国证券登记结算有限责任公司进行一级结算的专用账户。集合计划的一切货币收支活动，包括但不限于投资、支付退出金额、支付计划收益、收取参与款，均需通过该账户进行。托管人可根据实际情况需要，为计划财产开立资金清算辅助账户，以办理相关的资金汇划业务。管理人应当在开户过程中给予必要的配合，并提供所需资料。

托管人为本计划开立的证券账户名称应当是“民生证券-兴业银行-民生证券索菲亚 1 号集合资产管理计划”。

管理人和托管人对集合计划资产独立核算、分账管理，保证集合计划资产与

其自有资产、集合计划资产与其他委托人资产、不同集合计划的资产相独立。

推广机构为集合计划的每一位委托人建立集合计划交易账户，记录委托人通过该推广机构买卖本集合计划份额的变动及结余情况。

集合计划管理人委托中国证券登记结算有限责任公司（简称“中登公司”）担任本计划的份额登记机构，并承担相应委托责任。份额登记机构为委托人开立集合计划账户，用于记录委托人持有的本集合资产管理计划份额。

以上账户名称以实际开立账户名称为准。

## （二）集合计划资产的构成

本集合计划资产的构成主要有：

- 1、银行存款和应计利息；
- 2、其他资产：集合计划所拥有的股票、债券、基金、应收款项、其它投资等资产。

## （三）集合计划资产的管理与处分

集合计划资产由托管人托管，并独立于管理人及托管人的自有资产及其管理、托管的其他资产。管理人或托管人的债权人无权对集合计划资产行使冻结、扣押及其他权利。除依照《管理办法》、《细则》、《集合资产管理合同》、《说明书》及其他有关规定处分外，集合计划资产不得被处分。

# 十一、集合计划资产托管

本集合计划资产交由兴业银行股份有限公司负责托管，并签署了托管协议。托管人将按照双方达成的托管协议对本计划资产进行托管。托管人的托管职责以托管协议的约定为准，如管理合同、说明书与托管协议相关内容相冲突的，相关约定以托管协议为准。

# 十二、集合计划的估值

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

（一）资产总值：集合计划投资所形成的各类有价证券、银行存款本息及其他资

产的价值总和。

(二) 资产净值: 本集合计划资产总值减去负债后的净资产值。

(三) 单位净值: 集合计划资产净值除以集合计划份额总数后的价值。单位净值的计算精确到0.0001元,小数点后第五位四舍五入。国家另有规定的,从其规定。

(四) 估值目的: 客观、准确地反映集合计划资产的价值。经集合计划资产估值后确定的集合计划单位净值,是进行信息披露、计算参与和退出集合计划的基础。

(五) 估值对象: 运用集合计划资产所持有的一切金融资产和金融负债。

(六) 估值日: 集合计划成立后,管理人与托管人每个工作日均对集合计划资产进行估值。

(七) 估值方法:

#### 1、估值方法

##### (1) 股票估值方法

1) 上市流通股票按估值日其所在证券交易所的收盘价估值;估值日无交易的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化的,以最近交易日的收盘价估值;估值日无交易,如有充足证据表明采用指数收益法计算得到的停牌股票价值不能真实地反映股票的公允价值,计划管理人可以与计划托管人协商采用其它估值方法,对停牌股票进行估值。

##### 2) 未上市股票的估值:

①首次发行的股票,采用估值技术确定公允价值进行估值,在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下,按成本估值。

②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,按估值日其所在证券交易所上市的同一种股票的以第1)条确定的估值价格进行估值。

③送股、转增股、配股和公开增发新股等方式发行的股票,按估值日该上市公司在证券交易所挂牌的同一种股票的以第1)条确定的估值价格进行估值。

##### ④非公开发行有明确锁定期的股票按如下方法进行估值:

A、估值日在证券交易所上市交易的同一种股票的以第1)条确定的估值价格低于非公开发行股票初始取得成本时,应采用在证券交易所上市交易的同一种股票的以第1)条确定的估值价格作为估值日该非公开发行股票的价值;

B、估值日在证券交易所上市交易的同一种股票的以第1)条确定的估值价格

高于非公开发行股票的首个取得成本时，应按下列公式确定估值日该非公开发行股票的价值：

$$FV = C + (P - C) \times \frac{D_l - D_r}{D_l}$$

其中：FV 为估值日该非公开发行股票的价值；C 为该非公开发行股票的首个取得成本（因权益业务导致市场价格除权时，应于除权日对其首个取得成本作相应调整）；P 为估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价； $D_l$  为该非公开发行股票锁定期所含的交易所的交易天数； $D_r$  为估值日剩余锁定期，即估值日至锁定期结束所含的交易所的交易天数，不含估值日当天。

C、股票的首个估值日为上市公司公告的股份上市日所对应的日历日。

## （2） 债券估值方法

1) 在证券交易所市场挂牌交易的实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，按最近交易日的收盘价估值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将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。如有充足证据表明最近交易日收盘价不能真实地反映公允价值的，应对最近交易日的收盘价进行调整，确定公允价值进行估值。

2) 在证券交易所市场挂牌交易的未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，按最近交易日债券收盘价减去所含的最近交易日债券应收利息后的净价进行估值；估值日无交易，但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。如有充足证据表明最近交易日收盘价（净价）不能真实地反映公允价值的，应对最近交易日的收盘价（净价）进行调整，确定公允价值进行估值。

3) 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。

4) 在银行间债券市场交易的债券根据行业协会指导的处理标准或意见并综合考虑市场成交价、市场报价、流动性及收益率曲线等因素确定其公允价值进行

估值。

### (3) 资产支持受益凭证估值方法

1) 交易所以大宗交易方式转让的资产支持受益凭证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

2) 全国银行间市场交易的资产支持受益凭证，根据行业协会指导的处理标准或意见并综合考虑市场成交价、市场报价、流动性及收益率曲线等因素确定其公允价值进行估值。

### (4) 基金估值方法

1) 在证券交易所交易、登记的上市流通封闭式基金、ETF 基金、场内登记的 LOF 基金等，以其估值日在证券交易所挂牌的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值。在场外交易、登记的开放式基金（含场外登记的 LOF 基金）按前一日基金份额净值估值；如果估值日分红除权确认，则按前一日基金份额净值减单位分红额后的差额估值。估值日未公布前一日基金份额净值的，以最近公布的基金份额净值估值；在基金首次公布份额净值之前按照购入成本估值。

2) 未上市的封闭式基金按估值日的份额净值估值，若估值日未公布份额净值，按最近公布的份额净值估值。

3) 货币市场基金按照该基金公布的每万份收益逐日计提收益。

### (5) 银行存款估值方法

银行存款以成本列示，按商定的存款利率以当日银行营业终了的存款余额为基数在实际持有期间内逐日计提应收利息。

### (6) 期货估值办法（如投资股指期货、商品期货）

上市流通的股指期货、商品期货按估值日其所在交易所的结算价估值；估值日无结算价的，以最近交易日的结算价估值。

### (7) 其他资产的估值方法

其他资产按国家有关规定进行估值。

(8) 估值对象的估值方法国家有最新规定的，按其规定进行估值。

### (八) 估值程序：

1、管理人应每工作日对集合计划资产估值。用于集合计划信息披露的集合计划资产净值和集合计划单位资产净值由管理人负责计算，托管人复核。管理人应于每个工作日结束后计算得出当日的集合计划单位资产净值，并以双方约定的方式发送给托管人。托管人应在收到上述估值结果后对净值计算结果进行复核，并以双方约定的方式将复核结果传送给管理人；如果托管人的估值结果与管理人的估值结果存在差异，且双方经协商未能达成一致，管理人有权按照其对集合计划净值的计算结果对外予以公布，由此产生的估值错误，托管人不承担赔偿责任，托管人有权将相关情况报集合计划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备案。

## 2、集合计划账册的对账

(1) 管理人和托管人在本集合计划成立后，应按照双方约定的同一记账方法和会计处理原则，分别独立地设置、登录和保管本集合计划的全套账册，对双方各自的账册定期进行核对，互相监督，以保证集合计划资产的安全。

### (九) 估值错误与遗漏的处理方式：

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

2、本计划管理人和本计划托管人应采取必要、适当、合理的措施确保本计划资产估值的准确性和及时性。当估值出现错误时，本计划管理人应当立即公告、予以纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大。错误偏差达到或超过本计划资产净值的 0.5% 时，本计划管理人应通报本计划托管人并报本计划管理人住所地中国证监会派出机构备案。

3、因发生估值差错导致本计划资产或本计划持有人损失的，由本计划管理人负责赔偿，本计划管理人在赔偿本计划资产或本计划持有人后，对不应由其承担的责任，有权根据过错责任原则，向存在过错的一方追偿。

## 十三、集合计划的费用、业绩报酬

### (一) 集合计划费用的种类

### 1、集合计划管理人的管理费

本集合计划管理费按日计提，计算方法如下：

$$G = E \times 0.1\% \div 365$$

G 为每日应计提的集合计划管理费

E 为集合计划初始委托金额

集合计划管理费每日计提，逐日累计。集合计划管理费第一次支付时间为本计划成立满 15 个月之时；其后，每满 3 个月支付一次；最后一次在本计划清算完时进行支付。

集合计划管理费经集合计划管理人与集合计划托管人核对一致后，由集合计划托管人于上述管理费支付月的第 21 日后的 3 个工作日内从集合计划资产中一次性支付给集合计划管理人。

### 2、集合计划托管人的托管费

本集合计划托管费按日计提，计算方法如下：

$$T = E \times 0.1\% \div 365$$

T 为每日应计提的集合计划托管费

E 为集合计划初始委托金额

集合计划托管费每日计提，逐日累计。集合计划托管费第一次支付时间为本计划成立满 15 个月之时；其后，每满 3 个月支付一次；最后一次在本计划清算完时进行支付。

集合计划托管费经集合计划管理人与集合计划托管人核对一致后，由集合计划托管人于上述托管费支付月的第 21 日后的 3 个工作日内从集合计划资产中一次性支付给集合计划托管人。

### 3、证券交易费用

集合计划投资运作期间发生的交易手续费、开放式基金的认（申）购和赎回费、印花税等有关税费，在收取时从集合计划中扣除。交易佣金的费率由集合计划管理人本着保护委托人利益的原则，按照法律法规的规定确定。

### 4、年度专项审计费用、律师费和信息披露费用

集合计划成立后的会计师费、律师费和信息披露费用，以及按照国家有关规定可以列入的其他费用，由集合计划管理人本着保护委托人利益的原则，按照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定，上述费用分别在发生时扣除。



计划推广期发生的会计师费、律师费和信息披露费等相关费用，不得列入计划费用。

5、银行结算费用、银行间市场账户维护费、开户费等集合计划运营过程中发生的相关费用。

银行结算费用、银行间市场账户维护费、开户费，分别在发生时一次计入集合计划费用。

与集合计划运营有关的其他费用，如果金额较小（实际发生的费用不影响集合计划估值日单位净值小数点后 4 位的），或者无法对应到相应会计期间，可以一次进入集合计划费用；如果金额较大（实际发生的费用影响集合计划估值日单位净值小数点后 4 位的），并且可以对应到相应会计期间，应该在该会计期间内按直线法摊销。

6、上述集合计划费用中第 3 项、第 4 项和第 5 项费用，以及按照国家有关规定可以列入的其他费用，由集合计划托管人根据有关法律法规及相应协议的规定，在协议规定的时间按费用实际支出金额划拨，列入集合计划费用。

## （二） 不列入集合计划费用的项目

计划推广期发生的信息披露费、会计师费、律师费等相关费用，不得列入计划费用。集合计划管理人和集合计划托管人因未履行或未完全履行义务导致费用支出或集合计划资产的损失，以及处理与集合计划运作无关的事项发生的费用等不列入集合计划费用。

## （三） 集合计划的税收

本集合计划运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律法规执行。

# 十四、集合计划的收益分配

## （一） 收益的构成

收益包括：集合计划投资所得债券利息、红利、股息、买卖证券价差、银行存款利息及其他合法收入。

集合计划的净收益为集合计划收益扣除按照国家有关规定可以在集合计划

收益中扣除的费用后的余额。

(二) 收益分配: 本计划存续期间, 按优先级份额收益分配时间及分配金额进行确定; 本计划终止时, 进行到期清算分配。

### (三) 收益分配原则

1、同一类份额享有同等分配权;

2、集合计划存续期内, 优先级份额进行收益分配, 不对次级份额进行收益分配; 集合计划到期清算时, 对优先级份额和次级份额进行收益分配, 次级份额委托人按本合同约定获得剩余收益(资金补偿方未违约的情况下);

3、集合计划终止时, 在优先保证优先级份额本金及预期年化收益率后, 再进行次级份额的收益分配;

4、收益分配时发生的银行转账或其他手续费用由委托人自行承担;

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

### (四) 收益分配对象

本集合计划的委托人。

### (五) 收益分配时间

优先级份额收益在本计划成立满 15 个月的当月第 20 日为收益分配基准日, 按照优先级份额预期年化收益率分配第一次收益; 其后, 每满 3 个月的当月第 20 日为收益分配基准日, 按照优先级份额预期年化收益率分配当期优先级份额收益; 最后一期优先级份额收益按照优先级份额预期年化收益率在分配优先级本金时一同分配。

如本计划在进行收益分配时, 没有足够现金资产分配优先级收益, 则资金补偿方应对优先级应分配收益的不足部分追加资金进行补偿。

### (六) 收益分配方式

本集合计划的收益分配方式为现金分红。

### (七) 收益分配方案的内容

收益分配方案须载明收益的范围、可供分配利润、分配对象、分配原则、分配时间、分配金额及比例、分配方式等内容。

### (八) 收益分配方案的确定与披露

本集合计划收益分配方案由管理人拟定，由托管人复核后由管理人向委托人公告。管理人需书面向托管人提供收益分配资料（包括不限于两级委托资产本金金额），托管人据此复核收益分配金额，若由于未及时提供资料或提供数据有误导致分配金额有误，托管人不承担责任。

#### （九）收益分配中发生的费用

收益分配时发生的银行转账等手续费用由集合计划委托人自行承担。

（十）若本资管计划成立，则对于本计划初始销售期间优先级委托人交付的资金，应按合同约定的预期收益率从优先级委托人交付资金当日开始计算。

如本资管计划不成立，则次级委托人应以优先级委托人交付的资金为基数，以合同约定的预期收益率为基准，按优先级委托人交付资金之日起（含）至本资产管理计划募集失败确定日（含）间的实际天数为基础，向优先级委托人支付补偿金。该部分补偿金由资产管理人从次级委托人交付给资产管理人的财产中扣除并转给优先级委托人，剩余款项返还给次级委托人。

## 十五 投资理念与投资策略

### （一）投资目标

根据“员工持股计划”的约定，在集合计划通过主动管理，投资于“员工持股计划”约定的股票。

### （二）投资理念

本集合计划在积极控制风险的前提下，根据“员工持股计划”的约定进行主动管理，力争实现委托人资产持续稳健增值。

### （三）投资策略

#### 1、资产配置策略

本集合计划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“员工持股计划”的约定进行主动管理，力争实现委托人资产持续稳健增值。

#### 2、股票投资策略

管理人积极研究索菲亚家居股份有限公司的投资价值，结合基本面、资金面、技术面的分析，根据“员工持股计划”的约定进行主动管理，努力为委托人谋求

收益，实现委托人资产持续稳健增值。

(1) 所投资流通股在市场上的质押比例不得超过 50%；

(2) 不得将资产管理计划所持有的标的进行质押融资；

(3) 根据《关于上市公司实施员工持股计划试点的指导意见》相关规定，员工持股计划所购买的股票将锁定 12 个月。但在本集合计划净值下跌触及本集合计划规定的平仓线，且资金补偿方没有履行补仓义务的情况下，管理人有权对本计划项下股票进行平仓；

(4) 在下列期间，本集合计划不得买卖公司股票：

公司定期报告公告前 30 日内，因特殊原因推迟公告日期的，自原公告日前 30 日起至最终公告日；

公司业绩预告、业绩快报公告前 10 日内；

自可能对公司股票交易价格产生重大影响的重大事项发生之日或在决策过程中，至依法披露后 2 个交易日内。

### 3、现金类资产投资策略

管理人将根据“员工持股计划”的相关规定，通过对现金类管理工具的组合操作，在严格控制风险的同时，兼具资产流动性，以追求稳定的当期收益。

## 十六 投资决策与风险控制

### (一) 集合计划的决策依据

集合计划以国家有关法律、法规和本合同的有关规定为决策依据，并以维护集合计划委托人利益作为最高准则。具体决策依据包括：

1、《管理办法》、《细则》、《规范》、《集合资产管理合同》、《说明书》等有关法律性文件；

2、宏观经济发展态势、微观经济运行环境和证券市场走势。这是本计划投资决策的基础。

3、投资对象收益和风险的配比关系。在充分权衡投资对象的收益和风险的前提下做出投资决策，是本计划维护委托人利益的重要保障。针对本计划的特点，在衡量投资收益与风险之间的配比关系时，以追求委托人的本金安全为第一要旨，在此基础上为委托人争取较高的收益。

## （二）集合计划的投资程序

管理人资产管理业务投资决策体系由管理人资产管理专业委员会、投资决策小组、投资主办人三级体系组成。

管理人资产管理专业委员会是管理人资产管理业务的最高决策机构，投资决策小组是投资管理业务的决策机构，投资主办人是资产管理业务具体项目的直接管理人，在管理人授权范围内进行投资管理。

## （三）风险控制

在建立风险管理体系时严格遵循全面性原则、审慎性原则、独立性原则、有效性原则、适时性原则、防火墙原则以及定性和定量相结合原则。

# 十七、投资限制及禁止行为

## （一）投资限制

为维护委托人的合法权益，本集合计划的投资限制为：

- 1、不得投资于除索菲亚(002572)之外的股票；闲置资金仅限于投资银行存款、央行票据、国债、债券逆回购、货币基金。
- 2、投资于一家上市公司流通股，原则上不得超过该上市公司流通股本的10%；
- 3、现行有关法律法规修订变化后，若上述投资限制与之相抵触，应以有关法律法规规定为准；
- 4、证券法规规定和集合计划管理合同约定禁止从事的其他投资。如法律法规或监管部门修改或取消上述限制，履行适当程序后，本集合计划可相应调整投资组合限制的规定。

## （二）禁止行为

本集合计划的禁止行为包括：

- 1、违规将集合计划资产用于资金拆借、贷款、抵押融资或者对外担保等用途；
- 2、将集合计划资产用于可能承担无限责任的投资；
- 3、向客户做出保证其资产本金不受损失或者保证其取得最低收益的承诺；
- 4、挪用集合计划资产；
- 5、募集资金不入账或者其他任何形式的账外经营；

- 6、募集资金超过计划说明书约定的规模；
- 7、接受单一客户参与资金低于中国证监会规定的最低限额；
- 8、使用集合计划资产进行不必要的交易；
- 9、内幕交易、利益输送、操纵证券价格、不正当关联交易及其他违反公平交易规定的行为；
- 10、法律、行政法规和中国证监会禁止的其他行为。

## 十八、集合计划的信息披露

### （一）定期报告

定期报告包括集合计划单位净值报告、集合计划的资产管理季度（年度）报告、托管季度（年度）报告、年度审计报告和对账单。

#### 1、集合计划单位净值报告

**披露时间：**在本集合计划封闭期内，每周第一个工作日公布前一工作日的集合计划单位净值、单位累计净值；在每一开放日的次日公布前一工作日集合计划单位净值、单位累计净值。

**披露方式：**本集合计划的信息披露将严格按照《管理办法》、《实施细则》、本合同及其他有关规定进行。本集合计划的计划单位净值、计划累计单位净值等信息将在管理人指定网站上披露，委托人可随时查阅。若管理人指定网站变更，管理人将提前进行相关信息的详细披露。

#### 2、集合计划的资产管理季度报告和托管季度报告

管理人、托管人在每季度分别向委托人提供一次准确、完整的管理季度报告和托管季度报告，对报告期内集合计划资产的配置状况、价值变动情况、重大关联交易做出说明。上述报告应于每季度截止日后 15 个工作日内通过管理人网站通告。集合计划成立不足 2 个月时，管理人、托管人可以不编制当期的季度报告。

#### 3、集合计划的资产管理年度报告和托管年度报告

管理人、托管人在每年度分别向委托人提供一次准确、完整的管理年度报告和托管年度报告，对报告期内集合计划资产的配置状况、价值变动情况、重大关联交易做出说明。上述报告应于每个会计年度截止日后 3 个月内通过管理人网站通告。集合计划成立不足 3 个月时，管理人、托管人可以不编制当期的年度报告。

#### 4、年度审计报告

管理人应当聘请具有证券相关业务资格的会计师事务所对本集合计划的运营情况进行年度审计,并在每年度结束之日起3个月内将审计报告提供给托管人,通过管理人网站向委托人提供。

#### 5、对账单

管理人以电子邮件或纸质方式寄送给委托人发送季度数据对账单,对账单内容应包括委托人持有计划份额的数量及净值,参与、退出明细,以及收益分配等情况。

### (二) 临时报告

集合计划存续期间,发生对集合计划持续运营、客户利益、资产净值产生重大影响的事件,管理人应当以管理人指定网站、推广机构网站、或其他途径方式及时向客户披露。临时报告的情形包括但不限于:

- 1、集合计划运作过程中,负责集合资产管理业务的高级管理人员或投资主办人员发生变更,或出现其他可能对集合计划的持续运作产生重大影响的事项;
- 2、暂停受理或者重新开始受理参与或者退出申请;
- 3、发生巨额退出并延期支付;
- 4、集合计划终止和清算;
- 5、集合计划存续期满并展期;
- 6、管理人以自有资金参与和退出;
- 7、合同的补充、修改与变更;
- 8、与集合计划有关的重大诉讼、仲裁事项;
- 9、负责本集合计划的代理推广机构发生变更;
- 10、集合计划投资于管理人及与管理人有关关联方关系的公司发行的证券;
- 11、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;
- 12、管理人、托管人因解散、破产、撤销等原因不能履行相应职责。

## 十九、集合计划份额的转让、非交易过户和冻结

### (一) 集合计划份额的转让

集合计划存续期间,优先级份额可以通过证券交易所等中国证监会认可的交易平台转让集合计划份额,本集合计划存续期间次级份额不得进行转让。受让

方首次参与集合计划，应先与管理人、托管人签订集合资产管理合同。

### （二）集合计划份额的非交易过户

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

### （三）集合计划份额的冻结

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

## 二十、集合计划的展期

本集合计划是否可以展期：是

本集合计划可以展期的：

（一）在存续期间，本集合计划运营规范，管理人、托管人未违反本合同、《说明书》的约定，经各方协商一致，可以展期；

（二）集合计划展期期间继续计算优先级份额收益，继续计提管理费、托管费。

## 二十一、集合计划终止和清算

（一）有下列情形之一的，集合计划应当终止：

- 1、计划存续期间，客户少于 2 人；
- 2、计划存续期满且不展期；
- 3、计划存续期间，次级份额委托人少于 1 人；
- 4、管理人因重大违法、违规行为，被中国证监会取消业务资格的；
- 5、托管人因重大违法、违规行为，被监管机构取消业务资格而管理人未能在合理时间与新的托管人签订托管协议的；
- 6、管理人、托管人因解散、破产、撤销等原因不能履行相应职责的；
- 7、战争、自然灾害等不可抗力的发生导致本集合计划不能存续；
- 8、法律、法规规定或中国证监会规定的其他终止情形。



(二) 有下列情形之一的，集合计划可以提前终止：

1、本集合计划持有的上市公司股票解禁后，如满足如下任一条件，管理人根据市场情况变现资产，并有权在资产全部变现后提前终止合同：(1) 未发生需资金补偿方补仓的情形，(2) 资金补偿方按照合同约定及时补仓。

2、资金补偿方未按照合同约定及时补仓造成违约的，管理人有权在所投资的股票解禁后进行平仓并全部变现后，本合同提前终止。

3、本集合计划项下资产全部变现，即现金类资产占集合计划净值比例为100%。

(三) 集合计划的清算

#### 1、集合计划的清算小组

(1) 自集合计划终止之日起2个工作日内成立清算小组；

(2) 集合计划清算小组成员由集合计划管理人、集合计划托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师组成。清算小组可以聘请必要的工作人员；

(3) 集合计划清算小组负责本集合计划资产的保管、清理、估价、变现和分配。集合计划清算小组可以依法以集合计划的名义进行必要的民事活动。

#### 2、集合计划清算程序

(1) 集合资产管理计划终止日后3个工作日内启动清算程序，并由集合计划清算小组将终止事项向委托人披露；

(2) 集合计划清算小组统一接管集合计划资产；

(3) 集合计划清算小组对集合计划资产进行清理和确认；

(4) 集合计划清算小组对集合计划资产进行估价；

(5) 集合计划清算小组对集合计划资产进行变现；

(6) 集合计划清算小组出具集合计划清算报告

(7) 集合计划清算小组于资产管理计划终止日后7个工作日内披露集合计划清算报告；

(8) 清算报告披露后2个工作日内进行集合计划剩余资产的分配；

(9) 集合计划清算小组注销集合计划相关账户；

(10) 清算结束后15个工作日内，集合计划清算小组将清算结果报中国证券投资基金业协会备案，同时抄送管理人住所地中国证监会派出机构。

### 3、清算费用

清算费用是指清算小组在进行集合计划清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由清算小组从集合计划资产中支付。

### 4、集合计划剩余资产的分配

(1)清算报告披露后2个工作日内，管理人和托管人应当在扣除清算费用、管理费、托管费等费用后，将集合计划资产按照优先委托人、次级委托人的顺序，以货币形式全部分派给优先及次级委托人，之后注销集合计划专用证券账户和资金账户。

(2)优先级份额优先按照预期年化收益率获得清算资产的分配，次级份额享有剩余资产和收益的分配。

如本计划在清算资产分配时，本计划资产净值大于或等于优先级的本金、预期收益分配的总额但变现金额低于优先级的本金、预期收益分配的总额，则资金补偿方应追加相应资金，追加资金金额为计划变现金额与优先级本金、预期收益分配总额的差额。如本计划资产净值等于或低于优先级的本金、预期收益分配的总额，则资产净值全部分配给优先级，但若分配时计划资产未完全变现，则资金补偿方应追加相当于未变现部分计划资产净值的资金，如果优先级委托人获得的分配财产仍低于优先级本金、预期收益分配的总和，则资金补偿方还应追加差额补足资金。对于资金补偿方应追加的资金，本计划管理人或优先级份额持有人有权向资金补偿方进行强制追偿。

(3)若本集合计划在终止之日有未能流通变现的证券，管理人可针对该部分未能流通变现证券制定二次清算方案，该方案应经托管人认可，并通过管理人网站进行披露。

若本集合计划在终止之日有未能流通变现的证券，集合计划清算小组应根据二次清算方案的规定，对该部分未能流通变现的证券在可流通变现后进行二次清算，将变现后的资产扣除相关费用后按照委托人拥有份额的比例，以货币形式全部分配给委托人。并注销集合计划专用证券账户和资金账户。在进行二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。未返还委托人的计划资产照常计提管理费及托管费。

(4)对于由计划交纳、注册登记机构收取的最低结算备付金和交易单元保

证金，在注册登记机构对其进行调整交收日才能收回，届时，集合计划清算小组将及时按照委托人拥有份额的比例或者集合资产管理合同的约定，以货币资金的形式全部分配给委托人，并注销集合计划专用证券账户和资金账户。

#### 5、集合计划清算的报告

集合计划清算程序终止后五个工作日内由集合计划清算小组在集合计划管理人公司网站上披露，并在集合计划清算程序终止后的十五个工作日内将清算结果向中国证券投资基金业协会备案，同时抄送管理人住所地中国证监会派出机构。

清算过程中的有关重大事项将及时披露。

## 二十二、当事人的权利和义务

### （一）委托人的权利和义务

#### 1、委托人的权利

- （1）取得集合计划收益；
- （2）通过管理人网站查询等方式知悉有关集合计划运作的信息，包括资产配置、投资比例、损益状况等；
- （3）按照本合同及《说明书》的约定，参与和退出集合计划；
- （4）按持有份额取得集合计划清算后的剩余资产；
- （5）因管理人、托管人过错导致合法权益受到损害的，有权得到赔偿；
- （6）法律、行政法规、中国证监会的有关规定及本合同约定的其他权利。

#### 2、委托人的义务

（1）委托人应认真阅读本合同及《说明书》，并承诺委托资金的来源及用途合法，不得非法汇集他人资金参与本集合计划；法人或者依法成立的其他组织，用筹集的资金参与集合计划的，应当向管理人或其他推广机构提供合法募集资金的证明文件（见附件二）；

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

- （3）按照本合同及《说明书》约定承担集合计划的投资损失；
- （4）不得违规转让其所拥有的计划份额；
- （5）遵守反洗钱法律法规要求，并承诺不存在洗钱情形，积极配合管理人

按照反洗钱法律法规履行身份识别、异常交易报告等职责；

(6) 法律、行政法规、中国证监会的有关规定及本合同约定的其他义务。

## (二) 管理人的权利和义务

### 1、管理人的权利

(1) 根据本合同及《说明书》的约定，独立运作集合计划的资产；

(2) 根据本合同及《说明书》的约定，收取管理费等费用；

(3) 按照本合同及《说明书》的约定，停止办理集合计划份额的参与，暂停办理集合计划的退出事宜；

(4) 根据本合同及《说明书》的约定，终止本集合计划的运作；

(5) 监督托管人，并针对托管人的违约行为采取必要措施保护委托人的利益；

(6) 行使集合计划资产投资形成的投资人权利；

(7) 集合计划资产受到损害时，向有关责任人追究法律责任；

(8) 管理人有权按照反洗钱法律法规要求履行异常交易报告职责；

(9) 法律、行政法规、中国证监会的有关规定及本合同约定的其他权利。

### 2、管理人的义务

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

(2) 进行资产估值等会计核算；

(3) 根据中国证监会有关规定、本合同、《说明书》和托管协议的约定，接受托管人的监督；

(4) 依法对托管人、代理推广机构的行为进行监督，如发现托管人、代理推广机构违反法律、行政法规和中国证监会的规定，或者违反托管协议、代理推广协议的，应当予以制止；

(5) 按规定出具资产管理报告，保证委托人能够了解有关集合计划投资组合、资产净值、费用与收益等信息；

(6) 按照本合同及《说明书》约定向委托人分配集合计划的收益；

(7) 按照法律法规、中国证监会的有关规定和本合同及《说明书》的约定，

及时向申请退出集合计划的委托人支付退出款项；

(8) 妥善保存与集合计划有关的合同、协议、推广文件、客户资料、交易记录、会计账册等文件、资料和数据；

(9) 在集合计划到期或其他原因解散时，与托管人一起妥善处理有关清算和委托人资金的返还事宜；

(10) 在解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产或因其他原因不能继续履行管理人职责时，及时向委托人和托管人报告；

(11) 因管理人违反本合同导致集合计划财产损失或损害委托人、托管人的合法权益时，应承担赔偿责任；

(12) 因托管人违反本合同导致集合计划财产损失或损害委托人合法权益时，代委托人向托管人追偿；

(13) 法律、行政法规、中国证监会的有关规定及本合同约定的其他义务。

### (三) 托管人的权利与义务

#### 1、托管人的权利

(1) 依法对集合计划的资产进行托管；

(2) 按照本合同和托管协议的约定收取托管费；

(3) 监督管理人集合计划的投资运作，发现管理人的投资或清算指令违反本合同和托管协议约定的，要求其改正；未能改正的，应当拒绝执行；

(4) 查询集合计划的经营运作情况；

(5) 法律法规、中国证监会有关规定和本合同以及托管协议约定的其他权利。

#### 2、托管人的义务

(1) 按照托管协议的约定依法为集合计划开立专门的资金账户和专门的证券账户等相关账户；

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

(3) 按照托管协议的约定保管集合计划资产，执行管理人的投资或者清算指令，负责办理集合计划名下的资金往来；

(4) 按照托管协议的约定定期核对资产管理业务资产情况；

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

(6) 按照托管协议的约定复核管理人计算的集合计划的资产净值；

(7) 对集合计划的有关信息恪守保密的义务，在集合计划有关信息对外披露之前，不得先行对管理人、托管人以外的任何机构、组织和个人泄露（但依据法律、法规、监管规定或应司法、行政等机关要求对外提供，向所聘请的审计、法律等外部专业顾问提供的以及托管协议和本合同另有约定的除外）；

(8) 按照托管协议的约定出具集合计划托管情况的报告；

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

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

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

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

(13) 因管理人过错造成集合计划资产损失的，代委托人向管理人追偿。

(14) 法律、行政法规、中国证监会的有关规定及本合同约定的其他义务。

## 二十三、违约责任与争议处理

### (一) 违约责任

1、管理人、托管人在履行各自职责的过程中，违反法律、行政法规的规定或者本合同约定，给计划财产或者委托人造成损害的，应当分别对各自的行为依法承担赔偿责任；因共同行为给计划财产或者委托人造成损害的，根据实际情况，由双方分别承担各自应负的违约责任。但是发生下列情况的，当事人可以免责：

#### (1) 不可抗力

不可抗力是指本合同当事人无法预见、无法克服、无法避免，且在本合同生效之后发生的，使本合同当事人无法全部或部分履行本合同的任何事件，包括但

不限于洪水、地震及其他自然灾害、战争、骚乱、火灾、政府征用、没收、法律变化、系统故障、突发停电或其他突发事件、证券交易所非正常暂停或停止交易等。

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

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

(3)管理人由于按照合同规定的投资原则行使或不行使其投资权而造成的损失等；

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

(5)托管人对存放或存管在托管人以外的机构的集合计划资产或交由证券公司、期货公司等其他机构负责清算交收的集合计划资产(包括但不限于期货保证金、期货合约等)及其收益，因该等机构故意、欺诈、疏忽、过失、破产等原因给集合计划资产造成的损失，由相关责任方承担，托管人不承担责任。但是，该等损失的产生与托管人的违约或未尽职行为存在因果关系的，托管人应按其过错大小承担相应法律责任。

(6)本合同当事人应保证向本合同另一方提供的数据、信息真实完整，并承担相应的法律责任。如果该方提供的信息和数据不真实或不完整是由于另一方提供的数据或信息不真实、不完整等原因所致，由此造成的损失由初始过错方承担。

(7)管理人及托管人对由于第三方(包括但不限于交易所、注册与过户登记人、期货公司等)发送的数据错误给集合计划资产造成的损失等。但是，在此情况下，管理人及托管人尽合理注意发现该等数据错误。

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

续履行。

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

4、由于管理人、托管人不可抗力的因素导致业务出现差错，管理人和托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现错误的，由此造成计划财产或委托人损失，管理人和托管人免除赔偿责任。但是管理人和托管人应积极采取必要的措施消除或减轻由此造成的影响。

5、一方当事人依据本合同向另一方当事人赔偿的损失，仅限于直接损失。

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

7、托管人不会因为提供投资监督报告而承担任何因集合计划管理人违规投资所产生的有关责任，但托管人未依约履行监管义务的除外。

## （二）争议的处理

因履行本合同发生的争议，由协议签订各方协商解决，协商不成的，均可向管理人及托管人住所地有管辖权的人民法院提起诉讼，诉讼费用由败诉方承担。

## 二十四、风险揭示

本集合计划面临包括但不限于以下风险：

### （一）市场风险

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

#### 1、政策风险

货币政策、财政政策、产业政策和证券市场监管政策等国家政策的变化对证券市场产生一定的影响，可能导致证券价格波动，从而影响收益。

#### 2、经济周期风险

证券市场受宏观经济运行的影响，而经济运行具有周期性的特点，而周期性



的经济运行周期表现将对证券市场的收益水平产生影响，从而对收益产生影响。

### 3、利率风险

利率风险是指由于利率变动而导致的资产价格和资产利息的损益。利率波动会直接影响企业的融资成本和利润水平，导致证券市场的价格和收益率的变动，使集合计划资产管理业务收益水平随之发生变化，从而产生风险。

### 4、上市公司经营风险

上市公司的经营状况受多种因素影响，如市场、技术、竞争、管理、财务因素等都会导致公司盈利发生变化，从而导致集合计划投资收益变化。

5、衍生品风险。金融衍生产品具有杠杆效应且价格波动剧烈，会放大收益或损失，在某些情况下甚至会导致投资亏损高于初始投资金额。

### 6、购买力风险

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

## （二）管理风险

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

## （三）流动性风险

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

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

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

## （五）本集合计划特有风险

### 1、收益分级的风险

（1）收益杠杆风险。本集合计划份额所分离的两类份额优先级份额、次级

份额面临因为特定的结构性收益分配所形成的投资风险，集合计划的次级份额的净值变动幅度将大于优先份额的净值变动幅度。其风险程度直接与杠杆率有关。

(2) 极端情况下的损失风险。优先级份额具有低风险、收益相对稳定的特征，但是本集合计划为优先份额设置的收益率并非保证收益，在极端情况下，如果集合计划在短期内发生大幅度的投资亏损，优先级份额可能不能获得收益甚至可能面临投资本金受损的风险。次级份额可能面临损失所有本金和收益的风险。

## 2. 本集合计划设立失败的风险

“员工持股计划”未通过相应的股东大会审议导致本集合计划设立失败。

## 3. 资金补偿机制及违约风险

为保障本集合计划委托人利益，本计划由江淦钧和柯建生为资金补偿方，对优先级的本金及预期收益承担资金补偿义务。但存在资金补偿方违约、未履行补偿义务的风险。

### 4. 委托人的特有风险

#### (1) 优先级委托人的特有风险

##### 1) 预期收益无法实现甚至损失本金的风险

本集合计划优先级份额享有预期年化收益率（扣除管理费和托管费以后）。但优先级份额预期年化收益率并不是管理人向委托人保证其资产本金不受损失或者保证其最低收益的承诺，优先级委托人仍然存在收益无法保障甚至本金损失的风险

##### 2) 资金补偿方未履行补仓承诺及资金补偿义务的风险

当资产单位净值跌破本合同中设定的平仓线时，资金补偿方可能不按约定履行补仓承诺，则优先级份额将失去追加资金对其本金和预期收益的保护，在股票价格下跌幅度较大时，将面临收益和本金损失的风险。

若优先级的预期年化收益无法实现，或本金出现亏损，差额由资金补偿方进行补偿，资金补偿方并对此承担不可撤销的补偿责任。但存在资金补偿方违约、未履行补偿义务的风险。

#### (2) 次级委托人的特有风险

次级委托人享有本集合计划剩余收益，但须优先保证集合计划各项费用的支付，以及优先级份额的本金及预期年化收益。所以面临股票价格下跌幅度较大，

存在本金损失的风险。

## 二十五、合同的成立与生效

### （一）合同的成立与生效

本合同经管理人、托管人和委托人签署后成立。

本合同成立后，同时满足以下条件时生效：

- （1）委托人参与资金实际交付并确认；
- （2）本集合计划成立。

本集合计划终止，本合同终止。但本合同项下的清算条款、违约责任条款、争议解决条款仍然有效。

### （二）合同的组成

《民生证券索菲亚1号集合资产管理计划资金补偿合同》（附件一）和《募集资金合法说明》样本（附件二）为本合同附件；《民生证券索菲亚1号集合资产管理计划说明书》是本合同不可分割的一部分，与合同具有同等法律效力，《说明书》与本合同不一致的，以本合同为准。

经管理人确认有效的委托人参与、退出本集合计划的申请材料及各推广机构出具的集合计划参与、退出业务受理有关凭证等与合同具有同等法律效力。

## 二十六、合同的补充、修改与变更

1、本合同签署后，经委托人、管理人、托管人协商一致后，可以进行修改及变更，法律、法规、规章、中国证监会另有规定除外。

2、合同变更后，委托人、管理人和托管人的应当按照变更后的合同行使相关权利，履行相应义务。

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

## 二十七、或有事件

本合同所称的或有事件是指，根据相关法律法规的规定，管理人可能以独资

或者控股方式成立具有独立法人资格的从事资产管理业务的公司。

委托人在此同意，如果或有事件发生，在管理人、托管人、优先级委托人协商一致的基础上，管理人有权将本合同中由管理人享有的权利和由管理人承担的义务转让给上一条所述的从事资产管理业务的公司，并无须就此项变更和委托人另行签订专项协议。但在转让前管理人应以信息披露的形式通告委托人。管理人应当保证受让人具备开展此项业务的相关资格，并向托管人提供监管机构相关批复文件复印件。

管理人应按照监管机构的要求办理转让手续。

（注：已成立客户资产管理业务子公司的除外。）

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

本合同应由委托人本人签署，当委托人为机构时，应由法定代表人或其授权代表签署。

本页无正文，为《民生证券索菲亚1号集合资产管理计划资产管理合同》合同签署页

委托人签字/盖章：

管理人：民生证券股份有限公司（盖章）

法定代表人或授权代理人（签字）

托管人：兴业银行股份有限公司（盖章）

法定代表人或授权代理人（签字）

签订日期：年月日

## 附件一：资金补偿合同

### 民生证券索菲亚 1 号集合资产管理计划资金补偿合同

集合资产管理计划管理人：民生证券股份有限公司（以下简称“管理人”）

住所地：北京市东城区建国门内大街 28 号民生金融中心 A 座 16-20 层

法定代表人：余政

电话：010-85127657 传真：010-85127906 邮编：100005

资金补偿方 1：江淦钧

住所地：中国广东省广州市天河区体育东路 108 号创展中心西座 905

电话：

传真：

邮编：

资金补偿方 2：柯建生

住所地：中国广东省广州市天河区体育东路 108 号创展中心西座 905

电话：

传真：

邮编：

鉴于：

资金补偿方——江淦钧和柯建生自愿对民生证券索菲亚 1 号集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”、“资产管理计划”或“集合计划”）优先级份额的本金及预期年化收益进行差额补偿，并承担资产管理计划项下的补仓义务（见《民

生证券索菲亚 1 号集合资产管理计划资产管理合同》(以下简称《资产管理合同》)。为落实资金补偿机制,维护集合计划投资者合法权益,依照《中华人民共和国合同法》等法律法规及规范性文件的规定,管理人和资金补偿方在平等自愿、诚实信用、充分保护集合计划投资者及相关当事人的合法权益的原则基础上,特订立《民生证券索菲亚 1 号集合资产管理计划资金补偿合同》(以下简称“本合同”或《资金补偿合同》)。

《资金补偿合同》的当事人包括管理人、资金补偿方和集合计划份额持有人。集合计划投资者自依《资产管理合同》取得集合计划份额,即成为集合计划份额持有人和《资金补偿合同》的当事人,其持有集合计划份额的行为本身即表明其对《资金补偿合同》的承认、接受和同意。资金补偿方在此也自愿接受《资产管理合同》内容的约束。

除非本资金补偿合同另有约定,本《资金补偿合同》所使用的词语或简称与其在《资产管理合同》中的释义部分具有相同含义。

#### 一、资金补偿期间

资金补偿期间为本集合计划存续期及完成终止清算的期间。

#### 二、资金补偿的方式

在资金补偿期间,资金补偿方在资金补偿范围内承担不可撤销的以现金资产进行补偿的责任。

#### 三、资金补偿程序

1、触发资金补偿方补偿义务的,管理人在【2】个工作日内,向资金补偿方发出书面《履行资金补偿责任通知书》,《履行资金补偿责任通知书》应当载明需资金补偿方补偿的金额以及本集合计划在托管人处开立的托管账户信息。

2、资金补偿方应在收到管理人发出的《履行资金补偿责任通知书》后的【3】个工作日内,将《履行资金补偿责任通知书》载明的补偿款项划入本集合计划在托管人处开立的托管账户中,由管理人支付给集合计划优先级份额持有人。

#### 四、本计划存续期间资金补偿方承担的义务

##### (一) 预警、平仓安排及资金补偿方的补仓承诺

集合计划每个交易日计算集合计划单位净值,并将集合计划单位净值等于 0.92 元设置为预警线,将集合计划单位净值等于 0.88 元设置为平仓线。

## 1. 限售期内预警和平仓机制

(1) 预警线为 0.92 元。在限售期内，当集合计划单位净值于 T 日收盘后低于预警线 0.92 元时，资金补偿方应当在 T+2 个工作日内足额追加资金。资金追加后，集合计划参考单位净值不得低于 0.92 元。

(2) 若资金补偿方没有遵守上述追加资金的要求，无论之后本资管计划净值是否能够恢复到预警线以上，以及之后资金补偿方是否能够足额追加，自 T+3 日起，本资管计划项下所有资产及收益全部归优先级委托人享有，优先级份额净值计算方法自 T+3 日起调整为“资产管理计划资产净值/优先级总份额”，次级份额净值为零。

发生上述情形时，本计划待所投资股票解除限售后，管理人有权且应当对本计划项下的非现金资产进行变现操作并将变现的资产全部分配给优先级份额委托人。若解除限售后，由于各种原因（包括但不限于停牌等）导致本计划资产未能完全变现的，则资金补偿方应追加相当于未变现部分计划资产净值的资金；同时，如优先级委托人获得的分配财产仍低于优先级本金、预期收益分配的总和的，则资金补偿方还应追加差额补足资金。

## 2. 解禁后预警和平仓机制

(1) 预警线为 0.92 元。当集合计划单位净值于 T 日收盘后低于预警线 0.92 元时，资金补偿方应当在 T+2 个工作日内足额追加资金。资金追加后，集合计划参考单位净值不得低于 0.92 元。

(2) 若资金补偿方没有遵守上述追加资金的要求，T+3 日开盘后管理人应当立即按市价委托方式进行连续减仓操作至持有股票市值不超过资管计划净值的 50%。

(3) 平仓线为 0.88 元。当集合计划单位净值于 T 日收盘后低于平仓线 0.88 元时，自 T+1 日起，管理人将对资产管理计划持有的全部证券资产按市价委托方式立即进行连续的变现操作，该变现操作是不可逆的，直至资管财产全部变现为止，资管计划提前终止。

(4) 如集合计划全部资产变现并扣除相关费用后优先级委托人获得的分配财产仍低于优先级本金、预期收益分配的总和的，则资金补偿方还应追加差额补足资金。



## （二）追加资金的使用、返还

### 1、追加资金的使用

资金补偿方交付的追加资金自进入集合计划资金账户之日起即成为本集合计划项下资产，不增加委托人的份额。追加资金作为其他收入入账。

### 2、追加资金的返还

（1）当资金补偿方追加资金后，集合计划单位净值在某交易周最后一个交易日  $T_1$  日达到或超过 1.05 元时，资金补偿方可以于  $T_1+1$  日在所追加资金的额度内提出部分提取资金的申请，提取后集合计划单位净值不低于 1.00 元。经管理人同意后，资产管理人在收到申请之日（ $T_1+1$ ，含当日）起的 5 个工作日内出具划款指令，通知资产托管人向资金补偿方支付提取资金（如在管理人收到申请至管理人出具划款指令当日期间，集合计划单位净值低于 1.00 元，则该申请无效，管理人不予出具划款指令）。资金补偿方存续期间可以申请提取资金的金额如下：

提取资金金额 =  $\min$ [资金补偿方存续期间追加且尚未提取的资金总金额，（申请提取前一日（ $T_1$  日）的集合计划资产净值 -  $1.00 \times$  集合计划份额总数）]。

（2）追加资金在集合计划资金账户期间产生的利息和其他收益不予返还，计入本集合计划项下资产，归全体委托人所有。

## 五、本计划收益支付或清算时，资金补偿方应承担的义务

1、如本计划在进行收益支付时，没有足够现金资产分配优先级收益，则资金补偿方应对优先级应分配收益的不足部分追加资金进行补偿。

2、本计划在清算资产分配时，本计划资产净值大于或等于优先级的本金、预期收益分配的总额但变现金额低于优先级的本金、预期收益分配的总额，则资金补偿方应追加相应资金，追加资金金额为计划变现金额与优先级本金、预期收益分配总额的差额。如本计划资产净值等于或低于优先级的本金、预期收益分配的总额，则资产净值全部分配给优先级，但若分配时计划资产未完全变现，则资金补偿方应追加相当于未变现部分计划资产净值的资金，如果优先级委托人获得的分配财产仍低于优先级本金、预期收益分配的总和，则资金补偿方还应追加差额补足资金。对于资金补偿方应追加的资金，本计划管理人或优先级份额持有人有权向资金补偿方进行强制追偿。

3、管理人最迟应在补偿资金全额划入本集合计划在托管人处所开立的托管

账户后的3个工作日内(含),将补偿资金支付给集合计划优先级份额持有人。

六、若存在已计提的违约金,且终止清算时本计划资产不足以支付该部分违约金,则资金补偿方还需将已计提的违约金支付予优先级份额委托人。已计提的违约金金额以管理人按照《资产管理合同》约定计提的金额为准。

#### 七、适用法律及争议解决方式

本《资金补偿合同》适用中华人民共和国法律。因履行本合同发生的争议,由协议签订各方协商解决,协商不成的,均可向管理人住所地有管辖权的人民法院提起诉讼,诉讼费用由败诉方承担。

#### 八、其他条款

1、管理人应向本集合计划的份额持有人披露本《资金补偿合同》。

2、本合同未规定的,适用《资产管理合同》的有关规定。

3、本《资金补偿合同》自管理人、资金补偿方加盖公司公章或签字后成立,自本集合计划成立之日起生效。

4、本集合计划终止并完成所有清算工作后,管理人、资金补偿方全面履行了本合同规定的义务,且管理人全面履行了其在《资产管理合同》项下的义务的,本合同终止。

5、本合同正本一式柒份,合同三方各执一份,本集合计划委托人各执一份,其余报送相关监管部门备案。每份具有同等的法律效力。

(本页为签署页，无正文)

管理人：民生证券股份有限公司（公章）

法定代表人或其授权代表：（签字或盖章）

签署日期： 年 月 日

资金补偿方 1：江淦钧（签字或盖章）

签署日期： 年 月 日

资金补偿方 2：柯建生（签字或盖章）

签署日期： 年 月 日

## 附件二：募集资金合法的说明

### 募集资金合法说明

民生证券股份有限公司：

与民生证券股份有限公司所签订的《民生证券索菲亚 1 号集合资产管理计划资产管理合同》，其中我司认购民生证券索菲亚 1 号集合资产管理计划的资金均为募集资金，来源合法。

特此说明

客户名称（盖章）

年 月 日

## 附件三：专用清算账户及资金划拨专用账户

注意：账户如有变更，请及时通知相关各方。

### 1) 托管账户

户 名：兴业银行基金托管专户

账 号：051010100100000144

开户银行：兴业银行总行

### (2) 托管费收入账户

户 名：证券公司客户资产管理计划托管业务收入

开户银行：兴业银行广州分行

账 号：399410191675000100

### (3) 管理费收入账户

户 名：民生证券股份有限公司

账 号：321200100100055103

开户银行：兴业银行北京世纪坛支行