

受托人管理信托财产应恪尽职守，履行诚实、信用、谨慎、有效管理的义务。受托人依据本信托合同约定管理信托财产所产生的风险，由信托财产承担；受托人违背信托合同、处理信托事务不当使信托财产受到损失，由受托人以固有财产赔偿；不足赔偿时，由投资者自担。

中融-润京汇金量化1号证券投资集合资金 信托计划

资金信托合同

合同编号：2014201008023601-

目 录

第一条 释义.....	2
第二条 信托当事人.....	6
第三条 信托目的.....	6
第四条 信托规模和信托期限.....	7
第五条 信托计划的推介和成立.....	7
第六条 信托单位的认购.....	8
第七条 信托财产的保管、管理、运用和处分.....	11
第八条 信托单位的申购.....	20
第九条 信托单位的赎回.....	23
第十条 信托受益权的继承、承继、赠与及转让.....	25
第十一条 信托财产承担的各项费用和税费.....	26
第十二条 信托财产估值.....	28
第十三条 信托利益的计算和分配.....	29
第十四条 信托计划的终止与清算.....	31
第十五条 委托人的权利和义务.....	32
第十六条 受托人的权利和义务.....	33
第十七条 受益人的权利与义务.....	33
第十八条 信托计划的信息披露.....	34
第十九条 受益人大会召集、议事及表决的程序和规则.....	35
第二十条 受托人的职责终止和新受托人选任方式.....	36
第二十一条 风险揭示与承担.....	36
第二十二条 保密义务.....	39
第二十三条 违约责任.....	40
第二十四条 争议的解决方式.....	40
第二十五条 通知.....	41
第二十六条 其他条款.....	41
第二十七条 合同生效及合同份数.....	41
第二十八条 填写事项.....	42
认购（申购）风险申明书.....	46
附件一：估值方法.....	52
附件二：MAC 地址绑定确认函.....	54
附件三：MAC 地址绑定流程.....	55
附件四：投资顾问承诺函.....	56

第一条 第一条 释义

就本合同而言，除非本合同文意另有所指，下列词语具有如下规定之含义：

1. 本合同/信托合同：指受托人与委托人签署的编号为 2014201008023601 的《中融-润京汇金量化 1 号证券投资集合资金信托计划资金信托合同》及其任何有效修订与补充。

2. 信托计划/本信托计划：指“中融-润京汇金量化 1 号证券投资集合资金信托计划”。

3. 信托文件：指规定委托人、受托人、受益人之间权利义务关系的法律文件，包括但不限于信托合同、《信托计划说明书》以及《认购（申购）风险申明书》、信托计划成立公告、申购申请书、申购确认书、赎回申请书、赎回确认书、受益人大会文件、信托受益权转让文件等。

4. 《信托计划说明书》：指《中融-润京汇金量化 1 号证券投资集合资金信托计划说明书》及其任何有效修订与补充。

5. 《认购（申购）风险申明书》：指《中融-润京汇金量化 1 号证券投资集合资金信托计划认购（申购）风险申明书》及其任何有效修订与补充。

6. 《保管协议》：指受托人与保管人签署的编号为中融信托—兴业保管 2014 第 99 号（统）—2014201008023603 的《中融-润京汇金量化 1 号证券投资集合资金信托计划资金保管协议》及其任何有效修订与补充。

7. 《投资顾问合同》：指受托人与投资顾问签署的编号为 2014201008023602 的《中融-润京汇金量化 1 号证券投资集合资金信托计划投资顾问合同》及其任何有效修订与补充。

8. 《保管协议之操作协议》：指受托人与证券经纪服务商等各方签署的编号为 2014201008023604 的《中融-润京汇金量化 1 号证券投资集合资金信托计划保管协议之操作协议》及其任何有效修订与补充。

9. 《期货投资操作备忘录》：指受托人与期货经纪服务商等各方签署的编号为 2014201008023605 的《中融-润京汇金量化 1 号证券投资集合资金信托计划期货投资操作备忘录》及其任何有效修订及补充。

10. 委托人：指信托计划的投资者，该等投资者于信托计划设立时（或信托计划存续期间）通过向受托人交付信托资金参与信托计划而获得相应信托受益权。

11. 受托人：指中融国际信托有限公司。

12. 受益人：指合法持有信托受益权的自然人、法人或者依法成立的其他组织。

信托受益权因转让、继承、赠与等发生移转后，受益人为以受让或其他合法方式取得信托受益权的人。

13. 保管人：指兴业银行股份有限公司。

14. 投资顾问：指安徽润京资产管理有限公司。

15. 证券经纪服务商：指西藏同信证券股份有限公司。

16. 期货经纪服务商：指南华期货股份有限公司

17. 授权代表：指投资顾问以授权委托书的形式授权的、专门就本信托计划项下的投资顾问服务向受托人发出投资建议并且与受托人接洽的人士。投资顾问变更授权代表的，应当事先书面通知受托人，并取得受托人的书面同意。

18. 受益权/信托受益权：本信托计划项下的受益人根据信托文件约定在信托计划项下所享有的权利，包括但不限于获得信托利益分配的权利。

19. 认购（申购）资金：指委托人在信托计划推介期（或募集期）向受托人交付的、划入信托计划专用银行账户的用于认购（申购）信托单位的资金。

20. 信托资金：指委托人向受托人交付的、经受托人确认认购成功并进入信托财产专户的、用于认购（申购）信托单位的资金。

21. 信托计划资金：指委托人以及与委托人具有共同投资目的的其他投资者向受托人交付的信托资金的总额。

22. 信托财产：指受托人根据信托合同承诺信托而取得的本信托计划项下的信托资金及受托人按信托文件约定对信托资金管理、运用、处分或者因其他情形而取得的财产。其中，以现金形态存在的信托财产为现金类信托财产，以非现金形态存在的信托财产为非现金类信托财产。

23. 信托财产专户：指信托计划专用银行账户、信托计划专用证券账户和信托计划专用证券资金账户和信托计划专用股指期货账户的统称。信托计划专用银行账户指受托人在保管人处开立的信托财产专用账户，即信托财产保管账户；信托计划专用证券账户指受托人在中国证券登记结算公司开设的信托计划证券交易账户；信托计划专用证券资金账户指受托人在证券经纪服务商处开设的证券资金账户；信托计划专用股指期货账户是指以本信托计划名义开设的信托专用期货账户和信托专用期货资金账户。

24. 信托利益：指受益人在信托计划项下信托财产中享有的经济利益，全体受益人可获分配的信托利益总额为信托财产总值扣除应由信托财产承担的税费、费用后的余额。

25. 信托收益：指受益人投资信托计划获得的投资收益，为其获得分配的全部信托利益中超出委托人交付的信托资金的部分。

26. 特定信托利益：指投资顾问（以信托计划受益人身份）基于其持有的信托单位享有的信托利益。

27. 信托利益分配账户：指受益人于信托合同中指定的用于接收受托人分配的信托利益的人民币银行结算账户。

28. 信托单位：指信托受益权的份额化表现形式，用以表征信托计划项下信托受益权的均等份额，是计算各受益人享有信托利益的计量单位。其计算精确到小数点后 2 位（即精确到 0.01），小数点 2 位以后的部分四舍五入，由此产生的损益归入信托财产。1 份信托单位对应 1 份信托受益权份额。本信托计划推介期内一份信托单位价格为人民币 1 元，对应 1 元信托资金。

29. 信托财产总值：指根据本合同确定的估值方法估算的信托计划项下的各类证券、银行存款本息及其他资产的价值之和。

30. 信托财产值：指信托财产总值减去信托计划承担的税费、费用及其他负债后的价值。

31. 信托财产净值：指信托财产值扣除根据信托合同应分配给投资顾问的特定信托利益后的余额。

32. 信托单位值：指信托财产值与信托单位总份数之比，其计算公式为：信托单位值=信托财产值/信托单位总份数，其结果以元为单位，采用四舍五入的方法精确到小数点后 4 位（即精确到 0.0001），由此产生的损益归入信托财产。

33. 信托单位净值：指信托财产净值与信托单位总份数之比，其计算公式为：信托单位净值=信托财产净值/信托单位总份数，其结果以元为单位，采用四舍五入的方法精确到小数点后 4 位（即精确到 0.0001），由此产生的损益归入信托财产。

34. 估值日：指受托人按照信托合同约定的估值方法对信托财产进行估值的日期。受托人于信托计划存续期内的每个交易日进行信托财产的估值。

35. 周估值日：指每周最后一个交易日。

36. 月估值日/月估值基准日：指每月的开放日。

37. 估值基准日：指受托人计算用于公布的信托单位净值之日，周估值日、月估值日、信托计划终止日为估值基准日。

38. 推介期：指受托人为设立本信托计划，向投资者推介本信托计划并募集信托资金的期间。

39. 募集期: 指在信托计划存续期内受托人根据信托文件的约定开放募集信托单位、向投资者推介并且募集信托资金的期间。

40. 封闭期: 指受益人持有的信托单位不得申请赎回的期限。信托计划成立之日起至第 11 个开放日(含)为本信托计划的封闭期。封闭期内, 受益人不得赎回信托单位。

41. 开放日: 指信托单位申购和赎回的日期, 为信托计划成立后每个信托月度最后一个自然日(如遇非交易日则顺延至该日后最近的一个交易日)。

42. 认购/申购: 指信托计划推介期/募集期内投资者按照信托合同的约定购买本信托计划信托单位的行为。

43. 赎回: 指信托计划存续期内受益人按照信托合同的约定要求受托人支付其持有的部分或全部信托单位对应的全部信托利益的行为; 赎回完成后, 赎回的信托单位即不再存续。

44. 信托月度: 指信托计划成立之日(含该日)或每月信托计划成立之日对应的日期(含该日, 如该月无对应的日期, 则为该月的最后一日), 至下月信托计划成立之日对应的日期(不含该日, 如该月无对应的日期, 则为该月的最后一日)为一个完整的信托月度。

45. 信托季度: 指自信托计划成立之日(含该日)起, 每三个信托月度构成一个完整的信托季度。

46. 信托年度: 指自信托计划成立之日(含该日)起, 每十二个信托月度构成一个完整的信托年度。

47. 交易日: 指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日。T 日指交易日。T+1 日: 指 T 日的下一交易日, 依此类推。

48. 工作日: 指中华人民共和国国务院规定的金融机构营业日。

49. 中国: 指中华人民共和国(就本合同而言不包括香港特别行政区、澳门特别行政区和台湾地区)。

50. 适用法律: 指中国中央和地方立法部门、行政部门(包括但不限于审批部门、工商局或其他政府部门)颁布的适用于本协议项下相关事项的所有法律、法规、规章、规定、解释和其他规范性文件及司法部门颁布的相关司法解释。

51. 交易规则: 指上海证券交易所、深圳证券交易所、中国金融期货交易所、各证券业协会及中国证券登记结算有限公司、中央国债登记结算有限责任公司、中国人民银行等公布的各项业务规则。

52. 关联方：指按照公司法和企业会计准则的规定，能够直接或间接控制或共同控制信托财产管理、运用、处分，或对信托财产的管理、运用、处分能够施加重大影响的当事方，包括但不限于受托人、投资顾问的股东、实际控制人、董事、监事、高级管理人员等。

53. 不可抗力：指受托人不能预见、不能避免、不能克服的客观情况，包括但不限于法律法规或政策变化、政府限制、有关交易所、清算机构或其它市场暂停交易、电子或机械设备或通讯线路失灵、电话或其它接收系统出现问题、盗窃、战争、罢工、社会骚乱、恐怖活动、火灾、自然灾害等。

第二条 信托当事人

1. 委托人

本合同的委托人为本合同标题为“填写事项”条款记载的委托人。

2. 受托人

受托人名称：中融国际信托有限公司

法定代表人：刘洋

住所：哈尔滨市南岗区嵩山路 33 号

联系地址：上海市浦东新区银城中路 8 号 37 层

邮政编码：200120

联系电话：021-60359536

传真：021-60359447

3. 受益人及信托利益分配账户

本信托为自益信托，本信托计划设立时的受益人与委托人为同一人。

受益人指定的信托利益分配账户为本合同标题为“填写事项”条款载明的信托利益分配账户。

第三条 信托目的

委托人为有效运用资金，基于对受托人的信任，通过本合同设定双方的信托关系。按信托合同的约定，委托人将资金信托给受托人，受托人按信托文件的约定，以受托人的名义对本信托计划信托财产进行专业化的管理、运用，以实现信托财产的投资收益。

第四条 信托规模和信托期限

1. 信托计划的规模：信托计划设立时的预计募集规模为人民币 6000 万元，最低募集金额为人民币 3000 万元（“最低募集金额”）。信托计划推介期内，受托人有权根据信托计划实际募集情况调整最低募集金额并通过在受托人的网站 (www.zritc.com)公告的方式向委托人进行披露。

2. 信托期限：本信托计划期限为 10 年，自信托计划成立日起算。全体委托人同意授权投资顾问在本信托计划期限届满前三个月以发送函件的方式，向受托人确认延期与否及延期期限。

第五条 信托计划的推介和成立

1. 信托计划的推介期

本信托计划的推介机构为中融国际信托有限公司，推介期拟定为 2015 年 1 月 26 日至 2015 年 3 月 13 日。受托人有权根据本信托计划募集情况变更推介期结束时间，并在受托人网站 (www.zritc.com) 上进行公告。

2. 信托计划的成立

(1) 信托计划的成立条件

信托计划在满足以下条件时成立：本信托计划推介期结束或推介期内，募集的信托资金达到最低募集金额，受托人宣布信托计划成立。

受托人宣布信托计划成立之日为信托计划成立日。

信托计划成立的，委托人将认购资金划付至受托人开立的信托计划专用银行账户之日（含）至信托计划成立日（不含）期间的利息，按照推介期内中国人民银行公布的届时有有效的人民币活期存款利率于信托计划成立后首个银行系统结息日后 10 个工作日内支付给受益人。在前述利息返还前，发生信托受益权转让、赠与、继承/承继情形的，前述利息分配给分配时该信托受益权对应的受益人，受托人返还该等利息之后即不再承担利息返还的任何相关责任。所需资金划付费由委托人自行承担，直接从前述款项中扣收。

(2) 信托计划未成立

如推介期届满，本信托计划未成立，受托人应于推介期结束之日起十个工作日内将委托人交付的认购资金返还给委托人，并在信托计划专用银行账户首个银行系统结息日后的十个工作日内按照推介期内中国人民银行公布的届时有有效的人民币活期存款利率，向委托人支付该笔信托资金自向信托计划专用银行账户的交付日（含

该日)至受托人返还给委托人之日(不含该日)期间的利息。受托人返还前述全部款项之后,受托人就信托合同所列事项免除一切相关责任。

第六条 信托单位的认购

1. 信托单位的认购条件

(1) 认购资格

① 委托人应为符合法律法规规定条件的合格投资者。其中自然人委托人人数不超过 50 人,但单笔委托金额在 300 万元以上的自然人委托人和合格的机构委托人数量不受限制。受托人按照“时间优先、金额优先”的原则接受投资者的认购申请,并保留拒绝接受投资者认购申请的权利。推介期结束或提前届满后,受托人不再接受投资者认购本信托计划信托单位的申请。

② 前条所称合格投资者,是指符合下列条件之一,能够识别、判断和承担信托计划相应风险的具有完全民事行为能力的自然人、法人或依法成立的其他组织:

- i. 投资一个信托计划的最低金额不少于 100 万元人民币的自然人、法人或者依法成立的其他组织;
- ii. 个人或家庭金融资产总计在其认购时超过 100 万元人民币,且能提供相关财产证明的自然人。
- iii. 个人收入在最近三年内每年收入超过 20 万元人民币或者夫妻双方合计收入在最近三年内每年收入超过 30 万元人民币,且能提供相关收入证明的自然人。

全体委托人一致认可,投资顾问有权且应当认购本信托计划项下不低于 100 万份的信托单位,投顾认购不低于壹佰万份信托单位后即享有本信托计划的特定信托利益。

(2) 委托人的承诺和保证

委托人向受托人承诺与保证:

- ① 委托人为本条第(1)项规定的合格投资者。
- ② 认购信托单位的资金为来源合法的自有或管理的资金,非为毒品犯罪、黑社会性质的组织犯罪、恐怖活动犯罪、走私犯罪、贪污贿赂犯罪、破坏金融管理秩序犯罪、金融诈骗犯罪等犯罪所得,不存在任何已有的或潜在的法律纠纷,且可用于本合同约定之用途。委托人承诺委托人有合法且完整的权利将资金用于本信托计划,该等运用符合法律、法规、规范性文件及其他相关合同的要求,并符合相关

产业政策。

③ 认购信托单位完全符合其财务需求、目标和条件，对其而言是合理、恰当而且适宜的投资。

④ 认购信托单位遵守并完全符合对其有约束力的任何投资政策、指引和限制、合同、承诺及法律法规、政府命令、判决及裁决。

⑤ 认购信托单位未损害其债权人的合法权益。

⑥ 已就认购信托单位取得了一切必要的权力、权利及授权。委托人为自然人且已有配偶的，认购信托单位并交付信托资金已取得其配偶的同意。

委托人在此确认，委托人系独立作出本款项下的承诺与保证，未依赖受托人或受托人的任何关联机构。

受托人系在委托人前述承诺与保证的基础上与委托人订立本合同。受托人不对前述承诺与保证的真实性、完整性承担任何责任或负担任何义务。若任何上述承诺与保证不真实、虚假或存在重大遗漏导致信托合同项下义务不能履行或不能完全履行、信托合同终止或被撤销、或被追究任何经济或行政的责任及遭致的相应损失均由委托人自行承担。

2. 信托资金币种及信托单位认购价格

本信托计划项下委托人交付的信托资金币种为人民币。推介期内，每份信托单位面值1元，认购价格1元。

3. 最低认购金额

每一委托人单笔认购的信托单位不得低于壹佰万份，单笔交付的信托资金不得低于人民币壹佰万元，超过部分按壹拾万元的整数倍增加。受托人可调整委托人认购资金下限并在受托人网站上予以公告。

4. 认购资金的交付

(1) 受托人开立如下信托计划专用银行账户（“保管账户”）作为接收委托人认购资金的银行账户：

账户名：中融国际信托有限公司

开户行：兴业银行上海分行

账 号：216200100100977056

(2) 委托人应于信托合同签署后3日内（以不晚于信托计划推介期结束日为前提）将其在信托合同项下的信托资金支付至前述信托计划专用银行账户。

(3) 本信托计划不直接接受现金认购。委托人应在前款规定的期限内将其在本公

同项下承诺交付的信托资金通过银行划款的方式支付至信托计划专用银行账户，并注明：“XX（委托人姓名或名称）认购中融-润京汇金量化1号证券投资集合资金信托计划信托单位【】万份”。委托人交付信托资金的付款账户须以委托人本人名义开立，且须与信托利益分配账户一致。委托人未按本款规定交付信托资金的，受托人有权拒绝委托人的认购。

(4) 前述信托计划专用银行账户内的资金于信托计划成立时计入信托财产。

5. 认购文件

(1) 委托人认购信托单位，须向受托人提交如下签约必备证件：

① 委托人为自然人，应持本人有效身份证件原件及复印件、信托利益分配账户的银行存折/卡；若授权他人办理，还需持授权委托书、被授权人有效身份证件原件及复印件。

② 委托人为机构，应持营业执照副本原件和复印件、组织机构代码证复印件、法定代表人（负责人）身份证件原件及复印件、法定代表人（负责人）身份证明书、开户许可证复印件或用于信托利益分配账户的说明函、机构公章、代理人/经办人身份证件原件及复印件、法定代表人（负责人）授权委托书（以上文件均需加盖公章）。

③ 委托人认购信托单位，应在推介期内签署信托合同和《认购（申购）风险申明书》一式两份。

6. 认购成功

同时满足以下条件时，委托人的认购成功：

- (1) 经委托人签署的有效认购文件在信托计划推介期结束日前送达受托人；
- (2) 认购资金在信托计划推介期结束日前到达信托计划专用银行账户；
- (3) 受托人接受并确认委托人的认购；
- (4) 信托计划成立。

7. 认购的撤回

信托计划成立前，委托人可向受托人申请撤销其与受托人签署的信托合同并要求受托人退还其已交付的信托资金。委托人应于推介期内根据受托人要求提交有效的书面申请及身份证明等文件。如因委托人未按规定提交有效的撤回申请，或超出申请时间提交申请，导致撤回失败的，受托人不承担任何责任。受托人确认委托人的撤回申请有效的，应在确认之日起十个工作日内将委托人已交付的信托资金返还委托人。委托人在此确认，受托人应委托人的申请退还其交付的信托资金的，不计同期银行存款利息。

8. 受托人未接受认购

受托人未接受并确认委托人的认购申请的，受托人应于推介期结束之日起十个工作日内通知委托人其认购未成功，委托人签署并向受托人提交的认购文件于推介期结束之日自动失效，受托人于推介期结束之日起十个工作日内将委托人交付的认购资金返还给委托人，并在信托计划专用银行账户的银行系统结息日后十个工作日内按照推介期内中国人民银行公布的届时有效的人民币活期存款利率，向委托人支付该笔信托资金自向信托计划专用银行账户的交付日（含该日）至受托人返还给委托人之日（不含该日）期间的利息。

9. 信托文件和签约必备文件的管理

委托人签署的信托合同正本一份、《认购（申购）风险申明书》一份及其提供的签约必备证件原件（委托人及其授权代理人、经办人的身份证明文件、信托利益分配账户银行卡/存折为其复印件）由受托人持有。

10. 本合同项下委托人交付的信托资金金额为本合同标题为“填写事项”条款载明的金额，委托人认购的信托单位数量为本合同标题为“填写事项”条款载明的数量。

11. 认购费

委托人认购信托单位时，需另外缴纳认购费用，认购费用为认购资金的1%。认购费用主要用于支付信托计划发行前及发行过程中相关机构为本信托计划所作的各项准备工作所发生的费用，受托人对该笔费用的支付不承担任何追缴义务，仅为代收代付。本认购费用需与信托资金一同划入信托计划专用银行账户，认购费用不计入信托财产。如本信托计划不成立，则认购费及其利息的处理方式按照本信托计划不成立受托人返还认购资金的方式返还给认购人。受托人将认购费支付至相关发行机构指定的账户。

第七条 信托财产的保管、管理、运用和处分

1. 信托财产的保管

受托人选任兴业银行股份有限公司作为信托财产保管人，签订《保管协议》并开立信托计划专用银行账户用于保管信托资金。受托人按照有关规定开立上海、深圳证券交易所股东账户、股指期货专用账户，选任西藏同信证券股份有限公司作为本信托计划指定的证券经纪服务商，签订《保管协议之操作协议》并在证券交易经纪机构为本信托计划开立信托计划专用证券资金账户。选任南华期货股份有限公司

作为本信托计划指定的期货经纪服务商，签订《期货投资操作备忘录》并在期货交易经纪机构为本信托计划开立期货资金专用账户。受托人聘任安徽润京资产管理有限公司担任本信托计划的投资顾问，签订《投资顾问合同》。

2. 信托财产的管理方式

委托人在此确认，授权并同意受托人将信托计划信托财产按照如下约定进行管理，对如下信托财产管理方式没有任何异议：

(1) 受托人应当将信托财产与其固有财产分别管理、分别记账；不得将信托财产归入其固有财产或使信托财产成为其固有财产的一部分。

(2) 在有利于信托目的实现的前提下，受托人可依法将部分信托事务委托他人处理。

(3) 受托人指派专门的信托经理处理本信托计划项下的信托事务。

(4) 受托人必须为本信托计划开设信托计划专用银行账户，并对信托计划的资金进行单独管理。本信托计划的一切资金往来均需通过信托计划专用银行账户进行。受托人应完整记录并保留信托财产和信托财产使用情况的报表和文件，定期向委托人和受益人报告信托资金的管理、运用和处分情况，随时接受委托人或受益人的查询。

(5) 受托人不得假借本信托计划的名义开立其他账户，亦不得使用本信托计划项下的信托计划专户进行本信托计划以外的任何活动。

3. 投资范围与限制

(1) 投资范围

受托人将本信托计划项下信托资金投资于上海、深圳证券交易所 A 股股票，股指期货、证券投资基金、债券、国债逆回购，银行存款，新股申购（仅限于网上参与）。

委托人在此确认并授权，在不违反国家相关法律法规的前提下，由受托人与投资顾问就改变信托计划信托财产投资范围进行协商，受托人与投资顾问协商一致后可以改变本信托计划信托财产的投资范围，无须受益人大会另行表决通过。

(2) 证券投资限制

① 投资于一家上市公司所发行的股票，不得达到或超过该上市公司已发行股份的 5%，且不得导致以受托人名义持有的该上市公司股票达到或超过该公司已发行股份的 5%。受托人有权拒绝投资顾问下达的可能导致以受托人名义持有一家上市公司的股票达到或超过该上市公司已发行股份 5%的投资建议。

② 投资于一家上市公司发行的股票，依买入成本计算，不得超过买入日前一

交易日信托财产总值的 50%。

③ 投资于一家基金管理公司管理的单一基金的投资额，依买入成本计算，不得超过买入日前一交易日信托财产总值的 50%。

④ 不得投资于 ETF 套利、债券回售。

⑤ 不得投资于权证和*ST 上市公司公开发行的股票。被动持有上述证券的，投资顾问或其指定的授权代表应下达减持的投资建议，以使信托计划持有的上述证券在五个交易日内重新符合本款要求，否则受托人有权直接进行减持操作。

⑥ 不得投资于证券回购融资交易等风险较大的投资品种；不得投资于融资融券。

⑦ 不得用于可能承担无限责任的投资，也不得用于资金拆借、贷款、抵押融资或者对外担保等；不得投资 S、S*ST、SST 类上市公司公开发行的股票。

⑧ 不得投资于与受托人或投资顾问存在或可能存在关联关系的上市公司发行的证券产品。

⑨ 持有所有创业板上市公司发行的股票，依买入成本计算，不得超过投资时前一交易日信托财产总值的 30%；

⑩ 信托计划投资于所有 ST 上市公司发行的股票，依买入成本计算，不得超过投资时前一交易日信托财产总值的 30%；

⑪ 不得进行大宗交易，不得进行一级市场交易（网上新股申购除外）及场外交易。

（3）股指期货投资限制

① 信托计划参与套保套利交易时，应当按照套保套利方案执行；

② 各合约同一方向套保、套利持仓合计不得超过该方向获批套保、套利额度；

③ 信托计划卖出股指期货合约市值不得超过信托计划持有的买入股指期货合约及权益类证券市值总和的 110%。每个交易日股指期货收盘后，信托计划卖出股指期货合约市值超过信托计划持有的买入股指期货合约及权益类证券市值总和的 110%时，受托人有权于次一交易日自行选择持仓合约及时间进行强制平仓使股指期货头寸降到规定比例以内，由此产生的盈亏由信托财产承担；

④ 集合信托计划参与套保交易时，在任何交易日日终持有的卖出股指期货合约价值总额不得超过集合信托计划持有的权益类证券总市值的 20%；在任何交易日日终持有的买入股指期货合约价值总额不得超过信托资产净值的 10%；

信托计划参与套保交易时，受托人有权在股指期货收盘前对股指期货合约的持

仓比例进行限制。受托人有权在交易日 15:00 至收盘期间自由选择持仓合约及平仓时间对信托计划的持仓情况进行调整，直至股指期货头寸降到规定比例以内，由此产生的盈亏由信托财产承担；

⑤ 信托计划参与套保交易时不得进行期货合约的频繁开平仓；

⑥ 信托计划进行期现套利交易，应当在买入（卖出）期货市场合约的同时或者相近时刻在证券市场上卖出（买入）价值相当的股票、基金等有价值证券；

信托计划进行跨期套利交易，应当在同时或者相近时刻在同一期货品种不同月份合约间进行价值相当、方向相反的交易；

信托计划进行跨品种套利交易，应当在同时或者相近时刻在不同品种的合约间进行价值相当、方向相反的交易；

⑦ 当期货账户保证金风险率（ $\text{风险率} = \text{持仓保证金} / \text{期货账户权益} * 100\%$ ）达到或超过 60% 时，受托人将限制投资顾问期货开仓交易。当风险率达到或超过 100% 且接到期货公司追保通知时，受托人应及时以录音电话方式提示投资顾问追加保证金。如因投资顾问未追加足够保证金导致被期货经纪商强行平仓造成的盈亏由信托财产本身承担；

⑧ 股指期货套期保值有效性监控指标为盈亏比，股指期货套期保值组合的累计盈亏比应在 80%—125% 之间。若该信托计划在每个交易日股指期货收盘后超过本指标限制，受托人录音电话提示投资顾问风险，若该信托计划多次超过上述指标，受托人有权不重复通知；

⑨ 信托计划进行跨期套利交易时，每个交易日股指期货收盘后套利持仓组合的风险敞口比例不得超过 10%。其中， $\text{风险敞口比例} = (\text{多头期货市值} - \text{空头期货市值}) / \max(\text{多头期货市值}, \text{空头期货市值})$ 。受托人有权在交易日 15:00 至收盘期间自由选择持仓合约及时间对信托计划的持仓情况进行调整，直至符合约定，由此产生的盈亏由信托财产承担；

信托计划实际运行过程中，受托人有权根据中国金融期货交易所要求或相关监管规定对股指期货交易进行限制及调整；

⑩ 信托计划存续期间若监管部门对以上相关投资比例、投资范围等规定进行调整的，受托人在履行了适当手续后，可以对投资限制进行相应调整；

⑪ 受托人指定专职的交易人员负责逐日盯市，适时监控，关注交易对象的风险变化情况和证券、股指期货市值变动情况，随时进行风险的评估与监控。若受托人通知投资顾问时由于投资顾问电话停机、无人接听等原因导致受托人无法及时通知

到投资顾问，受托人不承担任何责任，并有权按约定执行相关操作。

4. 信托财产的运用方式

委托人确认、授权并同意受托人将信托财产按照如下约定进行管理运用，对如下信托财产运用方式没有任何异议：

(1) 信托财产的运用采取投资顾问投资建议和受托人下达交易指令相结合的方式：

① 投资顾问根据其对证券市场及各证券产品或期货市场及各期货产品的研究成果，实时向受托人发出投资建议；受托人根据本合同约定及法律规定，对投资顾问发出的投资建议作出投资决策，并下达交易指令；

② 投资顾问通过 MAC 地址经受托人确认的电脑、向受托人资管系统发送投资建议，具体 MAC 地址见《MAC 地址绑定确认函》。

③ 当出现以下情形时，受托人有权拒绝投资顾问发出的投资建议，直接按照信托文件的约定运用信托财产，进行相关交易操作：i 投资顾问出具签名、密押或指令密码不符的投资建议或无效的投资建议；ii 投资顾问在信托计划期限届满前五个交易日内未逐步发出信托财产变现的投资建议，或仍发出再买入证券产品或股指期货开仓的投资建议；iii 信托计划提前终止时，投资顾问未及时发出变现信托财产的投资建议，或发出与变现信托财产无关的投资建议；iv 根据受托人的合理判断，投资顾问发出的投资建议投资于与受托人和/或投资顾问存在或可能存在关联关系的主体所发行的证券产品的；v 经受托人合理判断投资顾问的投资建议涉嫌对敲、操纵市场、明显偏离市场均价等情况，或如果接到沪、深交易所就前述情况发出的口头或书面警告后，投资顾问不听劝阻继续向受托人发出该等投资建议的，受托人有权拒绝接受投资顾问的任何投资建议，直至因执行前述涉嫌对敲、内幕交易、操纵市场、明显偏离市场均价的投资建议而买入的证券产品全部卖出为止；vi 执行投资顾问的投资建议将导致违反本合同标题为“投资范围与限制”条款规定的投资范围和投资限制的；vii 投资顾问的投资建议本身违反或执行其投资建议将导致违反法律法规的规定、信托合同的其他规定和/或《投资顾问合同》的规定，或将导致受托人遭受任何有权机关的处罚或承担任何法律责任的，或发生信托文件和/或《投资顾问合同》规定的受托人有权拒绝投资顾问投资建议的其他情形的，受托人有权拒绝投资顾问投资建议。

④ 委托人签署包括本合同在内的信托文件，即表示委托人认可受托人就本信托计划信托财产采取本款所述运用方式。

⑤ 信托计划的投资运作（包括投资顾问投资建议与受托人指令）应遵守《证券法》及其他相关法律、法规和规章以及监管部门的通知、决定等的规定，遵守上海证券交易所、深圳证券交易所、中国金融期货交易所、各证券业协会及中国证券登记结算有限公司、中央国债登记结算有限责任公司、中国人民银行等公布的各项业务规则，履行规定的义务。

(2) 投资建议

① 投资建议应包括信托计划编号、拟交易的证券名称和号码、买入或卖出方向、多头空头方向、属性、委托数量或区间、委托价格或区间、委托日期和时间等要素。满足如下条件的投资建议方为有效的投资建议：

- i. 符合相关法律法规、规章的规定以及监管部门的通知、决定的要求，并符合信托合同等信托文件的规定且是可执行的；
- ii. 不存在内幕交易、操纵市场、与受托人、投资顾问或受托人、投资顾问关联方之间的交易，或者交易报价与当时市场价格有明显差异并损害信托财产利益的情形或其他任何损害信托财产的情形。

② 投资顾问特别陈述与保证

投资顾问在此承诺：其或其授权代表依据信托文件发出的任何委托人投资建议，均符合《证券法》及其他相关法律、法规和规章以及监管部门的通知、决定等的规定，符合上海证券交易所、深圳证券交易所、中国金融期货交易所、各证券业协会及中国证券登记结算有限公司、中央国债登记结算有限责任公司、中国人民银行等公布的各项业务规则的要求，符合信托文件的规定；不投资于与其有关联关系的证券品种。

③ 投资建议仅限当日有效。

④ 投资建议的发出方式

i. 投资顾问可以通过录音电话、传真等方式向受托人发出投资建议，委托人同意上述全部人工电话指令录音或指令传真为投资建议的有效证据，不得提出异议。

ii. 对场内交易的证券品种，投资顾问应当通过 MAC 地址经受托人确认的电脑、向受托人资产管理系统以电子方式发出投资建议，录音电话或传真作为备选方式。以传真方式下达投资建议的，投资顾问或其指定的授权代表应立即与受托人交易人员以电话确认。

iii. 投资顾问或其指定的授权代表应当遵守受托人“资产管理系统”的各项管

理规则，投资顾问或其指定的授权代表下达的投资建议内容以受托人电脑记录资料为准。投资顾问承担关于绑定的电脑、MAC 地址和用户基本信息（包括但不限于计算机名称、用户名、密码等）的妥善保管义务，如投资顾问为机构的，应建立内部完善的保管制度和保密制度，指派专人妥善保管所绑定的 MAC 地址对应的电脑终端并建立严格的专项使用制度，采取适当措施防止 MAC 地址泄露、被盗，或相关电脑终端遗失、被盗，以及其他一切可能的未经投资顾问许可的使用该 MAC 地址或其对应的电脑终端的行为。

《MAC 地址绑定确认函》中所述的电脑及对应的 MAC 地址为电脑终端的确认标识，本信托计划绑定的电脑最多不超过 3 台，并按附件所示 MAC 地址绑定流程进行绑定。投资顾问将仅通过书面方式修改绑定的电脑及对应的 MAC 地址，修改 MAC 地址绑定的书面确认函亦由投资顾问加盖公章、由法定代表人签字或盖章，并在受托人交易系统完成激活后，方可生效。在此之前，原绑定电脑及对应的 MAC 地址继续有效。受托人有权在未收到有效的 MAC 地址确认函的情况下，拒绝未经确认的 MAC 地址发送的任何投资建议，相应的投资风险将由投资顾问承担。

投资顾问在此无条件承诺：通过经验证的账户名和密码及绑定的电脑及对应的 MAC 地址下发的全部投资建议均视为投资顾问或其指定的授权代表的真实意思表示。凡使用绑定的 MAC 地址及用户名发出的交易指令，均视为投资顾问亲自下达的投资建议，投资顾问将按信托文件约定的方式对绑定的 MAC 地址下发的全部投资建议及其后果承担相应责任，并放弃一切抗辩。投资顾问将严格保密相关用户名和密码等账户信息，因投资顾问或其指定的授权代表、相关工作人员违反前述承诺，造成的一切后果均由投资顾问承担。

全体委托人无条件的认可《MAC 地址绑定确认函》所确认的 MAC 地址下发的全部投资建议；由于任何原因导致的投资建议错误、丢失、延误、篡改或数据被破坏，受托人均不承担任何责任；全体委托人作出上述承诺时已经充分考虑并认识到 MAC 地址绑定存在技术风险，包括但不限于黑客侵袭、运营商网络通讯故障、因自然灾害引发的网络故障等，且愿意承担该风险。

⑤ 投资建议的执行。受托人根据有效的投资建议进行投资交易。由于系统和线路故障、市场流动性和波动性风险导致受托人未能全部完成投资建议，受托人不对由此导致的任何损失承担任何责任。受托人对投资顾问发出的投资建议进行审查，并有权根据信托文件、《投资顾问合同》、相关法律法规的规定拒绝执行投资顾问

发出的投资建议。

(3) 受托人指令的发出

受托人指令由受托人授权的交易人员发出。

5. 信托财产的变现

(1) 投资顾问在信托计划期限届满前五个交易日内应逐步发出信托财产变现的投资建议，不再买入证券或期货开仓；原则上，至信托计划期限届满前第二个交易日（含当日），信托计划不得再持有证券产品或期货产品，但因股票停牌或有关法律、法规、规范性文件和政策规定等原因导致无法全部变现信托计划项下信托财产除外。投资顾问未按期发出相关投资建议以达到以上要求时，受托人有权在超过上述规定期限的第二个交易日直接发出受托人指令进行相关交易操作以满足上述要求。

(2) 信托计划提前终止时，若投资顾问未及时发出变现信托财产的投资建议，受托人有权直接发出信托财产的变现指令直至信托财产全部变现。

(3) 在支付信托计划各种费用和进行受益人信托利益分配时，如果信托财产中现金资产总量不足，受托人有权直接变现部分信托财产以满足该等现金需求。

6. 信托计划的预警线及止损线

(1) 预警线

为保护全体受益人的信托利益，本信托计划将 0.85 元设置为信托计划的预警线。

受托人于每个交易日（T 日）盘中实时估算信托单位值。当 T 日下午收盘后受托人估算的信托单位值小于或等于预警线时，受托人应及时以录音电话、电子邮件或传真形式向投资顾问提示投资风险。其后持续触及预警线，受托人不再进行提示。

(2) 止损线

为保护全体受益人的信托利益，本信托计划将 0.80 元设置为信托计划的止损线。当信托计划 T 日的信托单位净值（T+1 日出具的 T 日估值表的信托单位净值）小于或等于 0.80 元时，自该日该时点开始，受托人都应拒绝投资顾问下达的买入及债券逆回购的投资建议，投资顾问有权在 T+1 日 9:30 前（以追加资金到达信托计划专用银行账户的时间为准）追加资金使信托单位净值大于 0.85 元（以 T 日下午收盘时的信托单位净值为准）。否则，信托计划于 T+1 日（T 日后的第一个工作日）上午 9:30 即刻进入终止清算流程。T+1 日开盘后对信托计划持有的全部证券资产按市价委托方式进行变现、对信托计划持有的开放式基金进行全部赎回，直至信托财产全部变现为止。变现完成后，信托计划终止，信托财产向受益人进行分配。

(3) 预警和止损的特别约定

如因投资顾问或授权代表电话停机、无人接听等原因导致受托人无法及时通知到投资顾问或授权代表的，受托人不承担任何责任，受托人仍按照上述约定执行相关操作。此外，若因支付相关税、费造成受托人估算的信托单位值在 T 日收盘时小于等于预警线的，受托人参照上述方式进行操作。

(4) 追加资金的追加和退回

投资顾问有权决定是否追加资金以在必要时提高产品的单位净值。投资顾问追加的信托资金计入信托财产总额，但不增加投资顾问持有的信托单位份额，不影响委托人持有的信托单位份额的比例。

在投资顾问向信托计划追加信托资金后，若 T+1 日出具的 T 日估值表上的信托单位净值大于 0.85 元，则投资顾问可于 T+1 日向受托人提出申请，经受托人确认后，信托计划向投资顾问退回符合条件的追加资金。

a. 资金金额按如下方式计算：

退回投资顾问资金金额 = 单位信托份额退回投资顾问资金 × T 日信托计划份额总数

其中：

(1) 单位信托份额退回投资顾问资金不得高于单位份额投资顾问累计权益，同时，退回信托资金后，本信托计划的信托单位净值不低于 0.82 元；

(2) 如遇到开放日信托计划向投资顾问退回资金，则 T 日信托计划份额总数为本开放日申购、赎回前的份额数。

b. 单位份额投资顾问累计权益 = Σ 投资顾问第 i 次向信托计划追加资金金额 / 当日信托计划信托份额总数 - Σ 信托计划第 j 次向投资顾问退回资金金额 / 当日信托计划信托份额总数

其中：

(1) Σ 表示求和；

(2) $i = 1、2、3、4、5\dots、n$

$j = 1、2、3、4、5\dots、n$ ；

(3) 如遇到开放日投资顾问向信托计划追加资金或信托计划向投资顾问退回资金，则当日信托计划信托份额总数为本开放日申购、赎回前的份额数量；

(4) 投资顾问追加资金单位份额权益保留至小数点后四位（四舍五入）。

c. 单位份额投资顾问累计权益大于 0 时，委托人不得认购、申购信托计划份额。

d. 如遇到开放日投资顾问向信托计划追加资金或信托计划向投资顾问退回资金，则计算受益人申购、赎回所需的信托单位净值所需的当日信托计划资产净值为信托财产增加投资顾问向信托计划追加资金或减少信托计划向投资顾问退回资金后的净值。

第八条 信托单位的申购

1. 信托单位的申购条件

(1) 信托计划存续期内，符合本合同约定的合格投资者均可向受托人提出申购信托单位的申请；

(2) 申购信托单位的投资者须作出本合同标题为“信托单位的认购”条款约定的承诺和保证；

(3) 申购金额要求

申购前不持有本信托计划信托单位的投资者，申购信托资金不得低于人民币壹佰万元，超过部分按**壹拾万元**的整数倍增加。申购前已持有且仍持有本信托计划信托单位的受益人，每次申购资金不低于人民币**壹拾万元**，并可按**壹拾万元**的整数倍增加。受托人可调整申购资金下限并在受托人网站上予以公告。

2. 申购程序

(1) 投资者申购信托单位的，须于每一开放日前第三个工作日前将申购文件送达受托人，并须通过银行划款的方式支付申购资金使其于开放日当日 12:00 点前到达信托计划专用银行账户并注明“XX（投资者姓名或名称）申购中融-润京汇金量化 1 号证券投资集合资金信托计划信托单位，申购金额【】元”，将申购费用（如有，下同）支付至受托人指定的银行账户且使其于开放日当日 12:00 点前到达该账户。受托人对投资人的申购申请进行审核，并根据申请申购信托单位的投资者的具体情况及信托计划的具体情况决定是否接受该等申请。

(2) 前条所述申购文件，系指：

- ① 信托合同、《认购(申购)风险申明书》一式两份（未持有信托单位的投资者适用）；
- ② 申购申请书一式两份；
- ③ 申购资金划入信托计划专用银行账户的入账证明复印件一份；
- ④ 身份证明文件复印件一份（自然人提供身份证复印件，机构投资者需提供营业执照复印件、组织机构代码证复印件、法定代表人身份证复印件

及其身份证明)；

- ⑤ 信托利益分配账户银行存折/卡复印件一份(未持有信托单位的投资者适用)，信托利益分配账户应以申购信托单位的投资者本人名义开立，且须与划付申购资金的银行账户相同，并须在信托财产分配结束前或投资者退出信托计划前保持有效(机构投资者需提供开户许可证复印件或机构信托利益分配账户的说明函)。

自然人委托人应在上述文件中签字；如为机构委托人，上述文件需加盖公章并经机构法定代表人或负责人签章，若授权他人签章须提供授权委托书。

(3) 受托人将根据本条第 1 款规定的条件以及本款前述申购资金支付要求，于每个开放日审核投资者的申购申请。受托人经审查同意投资者的申购申请的，于开放日后首个交易日确认投资者的申购成功，并于对应的开放日后十个工作日内向其出具《中融-润京汇金量化 1 号证券投资集合资金信托计划申购确认书》，投资者交付的申购资金于对应的开放日后首个工作日计入信托财产；申购资金到达信托计划专用银行账户之日(含)至申购资金归入信托财产之日(不含)之间产生的利息，按照开放日中国人民银行公布的届时有效的人民币活期存款利率与信托利益一并支付给受益人。所需资金划付费由投资者自行承担，直接从前述款项中扣收。投资者申购是否成功，以受托人向其发放《中融-润京汇金量化 1 号证券投资集合资金信托计划申购确认书》为准。受托人经审查未同意投资者申购申请的，于对应的开放日后五个工作日内通知投资者其申购未成功，投资者签署并向受托人提交的申购文件于该开放日自动失效，受托人于该开放日后十个工作日内将申购资金返还至投资者划付申购资金的银行账户，并在信托计划专用银行账户的银行系统结息日后的十个工作日内按照开放日中国人民银行公布的届时有效的人民币活期存款利率将申购资金到达信托计划专用银行账户之日(含)至受托人返还给投资者之日(不含该日)期间的利息返还至投资者划付申购资金的银行账户。

3. 申购价格及申购份数

投资者申购信托单位的，每一份信托单位的申购价格为受托人确认投资者申购申请之开放日的信托单位净值。

投资者申购的信托单位份数=申购资金/申购价格。申购份数的计算保留到小数点后 2 位(即精确到 0.01)，小数点 2 位以后的部分四舍五入，由此产生的损益归入信托财产。

4. 申购费用

同本合同标题为“认购费”的条款所约定的内容。

5. 申购文件的管理

信托合同正本中的一份、申购申请书、《认购(申购)风险说明书》、委托人提交的签约必备证件原件（委托人及其授权代理人、经办人的身份证明文件、信托利益分配账户银行卡/存折为其复印件）由受托人持有。《中融-润京汇金量化1号证券投资集合资金信托计划申购确认书》作为信托合同的附件，由受托人和受益人分别持有。

6. 自然人委托人人数的特别限制

若在某一开放日如受托人接受符合条件的全部申购申请和赎回申请将导致本信托计划项下投资金额（以委托人实际交付的信托资金金额为准）小于300万元人民币的自然人超过50人的，受托人有权根据信托计划的实际情况采取相应措施（包括但不限于按照“时间优先、金额优先”的原则拒绝部分投资者的申购申请），以保证本信托计划项下投资金额小于300万元人民币的自然人人数符合法律法规的要求。

7. 暂停申购

发生以下情形时，受托人可以决定本信托计划暂停办理申购，不接受任何投资人的申购申请并在其网站发布暂停申购的公告：

- (1) 信托财产总值过大，受托人认为继续扩大信托计划规模会影响信托计划投资业绩，从而损害现有受益人利益的；
- (2) 因受托人营业场所和证券交易机构等相关方的一方或多方技术系统出现故障导致无法正常进行工作；
- (3) 因不可抗力事件导致无法办理申购手续的；
- (4) 因其他任何不可预知的原因导致办理申购可能损害现有受益人利益的；
- (5) 法律法规允许的其他情形或获银行业监督管理机构批准的特殊情形。

8. 申购申请的撤回

开放日前第三个工作日前，委托人可向受托人申请撤销其与受托人签署的信托合同并要求受托人退还其已交付的申购资金。委托人应于开放日前第三个工作日前根据受托人要求提交有效的书面申请及身份证明等文件。如因委托人未按规定提交有效的撤回申请，或超出申请时间提交申请，导致撤回失败的，受托人不承担任何责任。受托人确认委托人的撤回申请有效的，应在确认之日起十个工作日内将委托人已交付的申购资金返还委托人。委托人在此确认，受托人应委托人的申请退还其交付的申购资金的，不加计同期银行存款利息。

第九条 信托单位的赎回

1、赎回条件

- (1) 封闭期内的信托单位不得赎回，受益人可以申请全部或部分赎回已超过封闭期的信托单位。投资顾问（以信托计划受益人身份）持有的信托单位不得赎回。
- (2) **持有金额要求。**受益人申请部分赎回的，赎回信托单位份额为**壹拾万份**的整数倍，赎回后受益人持有的信托单位份数与受益人提交赎回申请之日之前最近一个开放日的信托单位净值之乘积**不得低于人民币壹佰万元**。否则，受益人应全部赎回。受益人不愿意全部赎回的，受托人不接受受益人部分赎回申请。

2、赎回程序

- (1) 受益人要赎回信托单位的，须于每个开放日前第十个工作日之前向受托人提出赎回申请，提交赎回申请文件。赎回申请提出后，受益人可撤销该笔申请，撤销申请最后期限为对应开放日之前的第五个工作日（不含开放日前第五个工作日当日）。

- (2) 前述赎回申请文件，系指：

- ① 自然人受益人：本人的身份证明原件及复印件一式两份、信托利益分配账户银行存折/卡复印件一式两份。委托他人办理的，还需提供代理人的身份证明原件及复印件以及委托人签署的授权委托书。

机构受益人：若经办人为机构法定代表人或负责人本人，须提供机构营业执照副本复印件及组织机构代码证复印件（需加盖公章）一式两份、机构法定代表人或负责人身份证件原件和机构法定代表人或负责人证明书一式两份、开户许可证复印件或用于信托利益分配账户的说明函一式两份；若经办人不是机构法定代表人或负责人本人，还需提供经办人身份证件原件和由机构法定代表人或负责人签名并加盖公章的授权委托书。

- ② 受益人签署的赎回申请书一式两份。

受托人根据本条第 1 款规定的条件及信托计划的实际情况审核受益人的赎回申请，经审核同意的，于受益人提交赎回申请对应的开放日确认其赎回申请。受托人确认委托人的赎回申请的开放日为赎回开放日。受托人制作赎回确认书，于赎回开放日后五个工作日内向委托人发送。受托人经审核不同意受益人的赎回申请的，于

赎回开放日后五个工作日内以本合同规定的方式通知受益人。

3、赎回费用

在本信托计划存续期间，受益人申请赎回信托单位的，无需交纳赎回费用。

4、赎回信托单位的信托利益的支付

(1) 受托人在赎回开放日后五个工作日内将赎回信托单位划款指令转交保管人。

保管人根据受托人出具的划款指令将受益人基于赎回的信托单位可获分配的信托利益扣除赎回费用（如有）后向受益人信托利益分配账户划付。

(2) 受益人基于赎回的信托单位可获分配的信托利益的计算公式为：

受益人基于赎回的信托单位可获分配的信托利益=受托人确认受益人可赎回信托单位份数×赎回开放日信托单位净值-赎回费用（如有）。

5、巨额赎回

(1) 如果申请在本信托计划某一个开放日赎回的信托单位份额合计达到或超过该开放日前一个开放日存续的信托单位总份数的 20%的，即认为发生了巨额赎回。

(2) 巨额赎回的处理方式

发生巨额赎回时，受托人有权根据该开放日信托计划的资产组合状况选择采取如下处理方式中的一种：

① 全部赎回：当受托人认为有能力支付该开放日委托人申请赎回的全部信托单位的信托利益时，按正常赎回程序执行；

② 部分暂停赎回：当受托人认为支付所有申请赎回的信托单位的信托利益有困难或可能会对信托计划的信托财产净值造成较大波动时，受托人有权于该开放日暂停部分信托单位的赎回。对于单个受益人的赎回申请，应当按照其申请赎回信托单位份数占受托人审核并确认有效的申请在该开放日赎回的信托单位总份数的比例以及本条第 1 款规定的赎回条件，确定该单个受益人的赎回份数；受托人未予确认的申请赎回部分，受益人就该部分信托单位提交的赎回申请于该开放日失效。

③ 巨额赎回的公告：当发生巨额赎回并部分暂停赎回时，受托人应通过邮递、传真、电话或网上公告等方式在开放日后五个工作日内通知申请赎回的受益人，说明有关处理方法。

6、暂停赎回

发生下列情形时，受托人可以暂停接受受益人的赎回申请并在受托人网站予以公告：

- (1) 不可抗力的原因导致信托计划无法正常运行;
- (2) 证券交易场所在交易时间非正常停市;
- (3) 届时信托计划项下现金资产不足;
- (4) 暂停估值;
- (5) 法律法规、信托文件或监管机构规定的其他情形。

第十条 信托受益权的继承、承继、赠与及转让

1. 继承和承继

受益人为自然人的，其持有的信托受益权可以被继承。

继承人应向受托人办理信托受益权继承登记确认手续。办理该等手续时应提交如下文件：继承法律文件、信托合同、有效身份证件原件及复印件、证明被继承人死亡的有效法律文件原件及复印件和受托人要求的其他文件。未到受托人处进行确认登记的不能对抗受托人。

受益人为机构的，其持有的信托受益权可依法承继。承继人持承继文件、信托合同、承继人有效营业执照副本和组织机构代码证(原件和加盖公章的复印件)受托人要求的其他文件前往受托人处办理登记确认。未到受托人处进行登记的不能对抗受托人。

2. 赠与

受益人可以将其持有的信托受益权赠与。受赠人应为本合同标题为“认购资格”条款规定的合格投资者。信托受益权不得向自然人拆分赠与；机构持有的信托受益权不得向自然人赠与或拆分赠与。

赠与人和受赠人应持有效证件（个人为有效身份证件原件和复印件，机构则需持营业执照副本和组织机构代码证(原件和加盖公章的复印件)、授权委托书(或介绍信)、被授权人和法定代表人（负责人）的身份证件复印件、原信托合同、经公证的赠与合同等文件及受托人要求的其他文件，前往受托人处办理登记确认。未到受托人处进行登记的不能对抗受托人。

但投资顾问（以信托计划受益人身份）持有的信托受益权不得赠与。

3. 转让

受益人可以通过签署《信托受益权转让协议》的方式向符合本合同标题为“认购资格”条款规定的合格投资者转让信托受益权。信托受益权不得向自然人拆分转让，机构持有的信托受益权不得向自然人转让和拆分转让。

受益人转让信托受益权的，转让方和受让方应持信托合同原件、《信托受益权转让协议》、转让方及受让方的身份证明（个人为有效身份证件原件和复印件，机构则需持营业执照副本和组织机构代码证的原件和加盖公章的复印件）等文件及受托人要求的其他文件至受托人处办理信托受益权转让手续。未办理该等手续的，不得对抗受托人。

但投资顾问（以信托计划受益人身份）持有的信托受益权不得转让。

第十一条 信托财产承担的各项费用和税费

1. 信托财产承担的费用

除非委托人另行支付，受托人因处理信托事务发生的下述费用（“信托费用”）由信托财产承担：

- (1) 保管人收取的保管费；
- (2) 受托人收取的信托管理费；
- (3) 信托文件、账册的制作及印刷费；
- (4) 信托计划成立后信托财产管理运用、处分而发生的费用，包括但不限于以下费用：管理、运用、处分信托财产而发生的税费和交易费用（包括但不限于中国证券登记结算有限公司沪深两市股东账户开办费、证券开户费、专项差旅费、期货开户费、期货账户管理费、中介费、公司年审银行专户余额询证费、银行专户管理费、银行划款手续费、交易手续费、交易佣金、交易印花税、财产转移书据印花税、营业税金及附加等）；信息披露费用；信托计划终止时发生的清算费用、评估费、审计费（如有）；因受托本信托计划项下信托财产而增加的监管费等业务规费；受益人大会召开费用；
- (5) 受托人为保护和实现信托财产而发生的费用，包括但不限于审计费、律师费、诉讼费等；
- (6) 按法律法规和本合同的规定，其他应由信托财产支付的费用。

受托人负责上述各项费用的核算工作，并应妥善保管上述费用的相关单据、凭证。除非特别说明，上述费用均在发生时由受托人指令保管人从信托财产专户中支付。受托人如以固有财产先行垫付信托费用的，受托人有权从信托财产中优先受偿。

2. 信托费用计提方法、计算标准和支付方式

- (1) 保管人保管费

保管人按《保管协议》提供保管服务，收取保管费。

保管费计算方法和支付方式：

保管费计算方法：以上一自然日的信托财产净值为基础（首日计提时以信托计划成立日信托资金为基础），按照 0.15% 的年费率，逐日计提，按信托月支付。

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

H 为当日应计提的保管费。

E 为上一自然日信托财产净值（首日计提时为信托计划成立日信托资金）。

支付方式：每个开放日及信托计划终止后的五个工作日内，由保管人根据受托人出具的划款指令从信托计划专用银行账户中扣除，并支付给保管人指定的银行账户。

(2) 受托人的信托管理费

受托人管理信托事务，收取信托管理费。投资顾问服务产生的费用从信托管理费中支付。

① 第一部分信托管理费：

MAX 取最大值，按日计提

计算方法：以上一自然日的信托财产净值为基础（首日计提时为信托计划成立日信托资金），按以下公式逐日计提，按信托月支付。

$$H = \text{Max} (E \times 0.5\% \div 365, X \div 365)$$

H 为当日应计提的受托人信托管理费。

E 为上一自然日信托财产净值（首日计提时为信托计划成立日信托资金）。

X 为受托人每年最低收取的信托管理费，X=20 万元。

支付方式：每个开放日及信托计划终止后的五个工作日内，由保管人根据受托人出具的划款指令从信托计划专用银行账户中扣除，并支付给受托人指定的银行账户。

委托人在此确认，受托人有权收取每信托年度不低于 20 万元的第一部分信托管理费。

非因受托人的原因导致信托目的不能实现，信托计划提前终止时，受托人对此不承担任何责任，受托人已收取的信托管理费无需返还。

②第二部分信托管理费

第二部分信托管理费以上一自然日的信托财产净值为基础（首日计提时以信托计划成立日信托资金为基础），按照 1.0% 的年费率，按日计提，按信托月支付。

$$H = E \times 1.0\% / 365$$

H 为当个自然日应计提的第二部分信托管理费。

E 为上一自然日信托财产净值（首日计提时为信托计划成立日信托资金）。

支付方式：每个开放日及信托计划终止后的五个工作日内，由保管人根据受托人出具的划款指令从信托计划专用银行账户中扣除，并支付给受托人指定的银行账户。

(3) 其他信托费用

律师费、审计费、代销服务费（如有）等其他信托费用在发生时据实支付，由受托人根据业务实际情况，向保管人出具划款指令，从信托计划专用银行账户中据实支付。

3. 信托税费

信托税费是指在运用信托财产过程中按照国家有关法律、法规规定应当缴纳的税金及其他费用。应当由信托财产承担的税费，根据法律法规规定办理。

委托人、受托人、受益人作为各纳税主体，应根据取得的收益按照有关法律、法规的规定，自行纳税，除非法律法规另有规定，受托人不承担代扣代缴义务。

4. 不列入信托费用的费用

受托人因违背信托文件导致的费用支出，以及处理与信托事务无关的事项发生的费用不列入信托费用。

第十二条 信托财产估值

信托财产的日常估值由受托人进行，保管人复核。

1. 估值日期

受托人于每个估值基准日后三个工作日内向委托人、受益人披露估值基准日的信托单位净值。如因系统等客观原因无法及时披露信托单位净值，受托人应及时向委托人、受益人披露并通知保管人，并应立即采取措施排除故障，于该等故障排除后及时披露估值结果。

2. 特别提示

鉴于受托人系于每一交易日收盘后扣除当日应由信托财产承担的信托费用和信托税费后估算当日信托财产值、信托财产净值及信托单位值、信托单位净值，受托人因交易需要于盘中实时估算信托单位值、信托单位净值时并未扣除当日应由信托财产承担的信托费用和税费，且盘中信托计划持有的证券产品或期货资产的市场价格处于变化之中，因此受托人盘中实时估算的信托单位值与信托单位净值与收盘后估算的信托单位值、信托单位净值存在不一致。

3. 估值方法

信托财产估值方法参见本合同附件“估值方法”。

第十三条 信托利益的计算和分配

声明：受托人、保管人、证券经纪服务商、为本信托计划出具法律意见书的律师事务所、投资顾问均不对本信托计划的业绩表现或者信托收益做出任何承诺、保证或任何保底暗示。

1. 信托利益的计算

本信托计划项下信托利益归属于全体受益人，各受益人按其持有的信托单位份额根据信托合同的约定享有相应的信托利益。

2. 受益人的信托利益分配

(1) 特定信托利益

投资顾问（以信托计划受益人身份）基于其持有的信托单位享有特定信托利益。特定信托利益的计算和分配方式如下：

① 计算方式

受托人于每个开放日计算投资顾问基于其享有的特定受益权可获分配的特定信托利益（“特定信托利益”）。每一开放日投资顾问可获分配的特定信托利益的计算公式为：

$$\text{特定信托利益} = [(T_i - \text{MAX}(T_0, T_1, T_2, \dots, T_{i-1}))] \times \text{信托单位总份数} \times 20\%$$

T_i 为该开放日信托单位值

$T_0, T_1, T_2, \dots, T_{i-1}$ 分别为以前各开放日信托单位净值（其中 T_0 指信托计划成立时信托单位初始值 1 元）

信托单位总份数指该开放日接受申购、赎回前的信托单位总份数。

如果该开放日的信托单位值并未大于信托计划成立以来以前各开放日的信托单位净值中的最大值，即上一公式计算结果为负或者为零，则投资顾问（以信托计划

受益人的身份)在该开放日不享有特定信托利益。

② 分配方式

每个开放日及信托计划终止后的五个工作日内,由保管人根据受托人出具的划款指令,将以上计提的特定信托利益从信托计划专用银行账户中扣除,并向投资顾问指定账户划拨。

委托人签署本合同,即表明其认可前述特定信托利益分配方式;除投资顾问以外的其他委托人、受益人无权要求投资顾问(以信托计划受益人的身份)退还其已收取的特定信托利益。

(2) 普通信托利益

① 计算方式

普通信托利益=信托利益-特定信托利益。

② 分配方式

- i. 受益人申请赎回信托单位的,受托人审核同意其赎回申请后在赎回开放日后五个工作日内向其支付赎回的信托单位对应的信托利益,其计算方式及支付方式参见本合同标题为“赎回信托单位的信托利益的支付”条款的规定。
- ii. 信托计划终止,包括投资顾问在内的每一受益人可获分配的信托利益=信托计划清算后的剩余信托财产扣除信托费用和信托计划终止日投资顾问(以信托计划受益人身份)享有的特定信托利益(如有)后的余额×(截止信托计划终止时该受益人持有的信托单位份数/截止信托计划终止时信托单位总份数)。受托人应以现金方式分配信托利益,于信托计划终止后五个工作日内将信托利益支付至受益人指定的信托利益分配账户。
- iii. 除前述第i种情形外,信托计划存续期间不进行普通信托利益的分配。

(3)若发生本合同标题为“信托计划终止时信托财产无法全部变现的处理方法”条款规定的情形的,受托人按该条规定对信托财产进行第一次清算(定义见后,下同)后按本条的规定向受益人分配并支付信托利益;于信托计划终止时信托计划持有的全部未能变现的信托财产全部变现完成后按该条规定进行第二次清算(定义见后,下同),并于该等信托财产全部变现完成后五个工作日内按本条规定以变现所得为限向受益人分配并支付信托利益。

(4)若任一受益人持有的信托受益权的归属存在法律纠纷的,受托人有权暂停

向该受益人支付信托利益直至相关争议得到解决（以取得生效的法院判决、仲裁裁决或其他有权机关作出的有法律效力的、终局的裁决、决定为标志）。

3. 信托利益分配账户

受益人应在信托财产最终分配完毕之前或其持有的信托单位全部赎回且赎回资金支付完毕前保持信托利益分配账户有效。受益人变更信托利益分配账户的，应持受托人要求的其他文件至受托人营业场所或指定的代理机构办理信托利益分配账户变更手续。

如果信托财产最后分配完毕之前或受益人持有的信托单位全部赎回且赎回信托单位的信托利益支付完毕前受益人信托利益分配账户发生变更，但未按本款规定办理信托利益分配账户变更手续，受托人不对由此导致的任何损失承担任何责任。

第十四条 信托计划的终止与清算

1. 信托计划的终止

(1) 有以下情形之一的，信托计划终止：

- ① 信托计划期限届满；
- ② 本信托计划的存续违反信托目的；
- ③ 信托目的已实现或者无法实现；
- ④ 本信托计划被撤销或被解除；
- ⑤ 受益人大会决定终止信托计划；
- ⑥ 受托人认为有必要终止信托计划的，决定提前终止信托计划并提前一个月公告；
- ⑦ 由于法律法规、市场变动将对信托计划运行产生重大影响，使得信托计划无法持续稳健运行，受托人决定终止信托计划的；
- ⑧ 受托人职责终止，未能按照有关规定产生新受托人；
- ⑨ 全体受益人放弃信托受益权或全体受益人赎回信托份额；
- ⑩ 信托合同及法律、行政法规规定的其他事由。

2. 信托计划的清算

信托计划终止后，受托人应负责信托财产的保管、清理、变现，保管人提供必要的协助。

受托人在信托计划终止后十个工作日内编制信托事务清算报告，并以信托文件

约定的方式报告委托人与受益人。委托人及受益人在此承诺并确认，清算报告无须审计。委托人与受益人或其继承人或承继人在信托事务清算报告公布之日起三个工作日内未提出书面异议的，受托人就清算报告所列事项解除责任。

3. 信托计划终止时信托财产无法全部变现的处理方法

发生本条第 1 款规定的信托计划终止情形时，如果信托计划项下信托财产因停牌、法律法规禁止或限制交易等外部原因而无法于信托计划终止之日全部变现的，则受托人应于信托计划终止后先对信托财产的现金部分进行清算（“第一次清算”）并按照本合同标题为“信托利益的计算和分配”条款的规定进行分配。

未能在信托计划终止之日变现的信托财产由受托人统一管理。受托人将积极寻求最快的变现方式（包括但不限于大宗交易、恢复上市交易后的快速变现等）尽快完成变现工作。无论采取哪一种变现方式，变现的价格将严格按照市场公允价格确定。

未能在信托计划终止之日变现的信托财产全部变现完毕后，受托人再次依照本条规定对信托计划终止时未能变现之信托财产变现所得财产进行清算（“第二次清算”）并按照本合同标题为“信托利益的计算和分配”条款的规定进行分配。

4. 信托计划终止后信托财产的归属和分配

信托计划终止后，信托财产归属于全体受益人所有。受托人将按照本合同标题为“信托利益的计算和分配”条款的规定对信托财产进行分配。

第十五条 委托人的权利和义务

1. 除根据本合同其他条款享有的权利外，委托人进一步享有如下权利：

- (1) 有权向受托人了解信托财产的管理、处分及收支情况，并有权要求受托人做出相应说明；
- (2) 行使法律、行政法规和本合同约定的其他权利。

2. 除根据本合同的其他条款承担义务外，委托人还应履行下列义务：

- (1) 保证参与信托计划的委托人为唯一受益人；
- (2) 须符合《信托公司集合资金信托计划管理办法》所规定的合格投资人条件，未非法汇集他人资金参与信托计划；
- (3) 保证签署本合同、交付信托资金及参与本信托计划未损害其债权人的利益；
- (4) 履行法律、行政法规和本合同约定的其他义务。

第十六条 受托人的权利和义务

1. 除根据本合同其他条款享有权利外，受托人进一步享有如下权利：

- (1) 依据本合同约定的方式，管理、运用、处分信托财产；
- (2) 在有利于信托目的实现的前提下，可以委托他人代为管理信托财产、处理相关的信托事务；
- (3) 按照本合同的约定以信托财产支付信托费用并收取信托管理费；
- (4) 行使法律、行政法规和本合同约定的其他权利。

2. 除根据本合同的其他条款承担义务外，受托人还应履行下列义务：

- (1) 应当遵守本合同的约定，本着忠实于受益人最大利益的原则处理信托事务；受托人管理信托财产，必须恪尽职守，履行诚实、信用、谨慎、有效管理的义务；
- (2) 保存处理信托事务的完整记录，保存期限自本信托计划终止日起不得少于十五年；
- (3) 履行法律、行政法规和本合同约定的其他义务。

第十七条 受益人的权利与义务

1. 本合同项下受益人除根据法律及本合同的其他条款享有权利，受益人还享有下列权利：

- (1) 按本合同约定享有信托受益权，获得信托利益；
- (2) 在受托人违反信托目的处分信托财产或者管理、处分信托财产有重大过失的情况下，有权提请人民法院撤销该处分行为，并有权要求受托人恢复信托财产的原状或者予以赔偿；
- (3) 有权向受托人查询与其信托财产相关的信息，受托人应在不损害其他受益人合法权益的前提下，准确、及时、完整地提供相关信息，不得拒绝、推诿；
- (4) 行使法律、行政法规和本合同约定的其他权利。

2. 除根据本合同的其他条款承担义务外，受益人还应履行下列义务：

- (1) 对委托人、受托人以及处理信托事务的情况和资料及依本合同约定获得的有关信托计划的所有信息负有保密的义务，未经委托人和受托人同意，不得向委托人和受托人以外的人透露。但法律另有规定的除外；
- (2) 善意行使受益人的权利，不得损害其他方的合法权利和利益；
- (3) 受益人应当登陆受托人公司网站查阅本信托计划信托单位净值、信息披露和

相关公告等内容;

(4) 履行法律、行政法规和本合同约定的其他义务。

第十八条 信托计划的信息披露

受托人应通过合适的途径向委托人和受益人披露本信托计划的相关信息以及相关投资情况，并不得收取信息披露费用。但是，应委托人的特殊要求而以其他途径进行信息披露的，因此发生的费用由委托人承担。

1. 定期披露

- (1) 自信托计划成立日起，受托人于每个估值基准日后的三个工作日内在受托人网站（www.zritc.com）向委托人、受益人披露该估值基准日的信托单位净值并随时应委托人、受益人要求披露上一个交易日信托单位净值。
- (2) 受托人每季度制作该季度的信托资金管理报告，于该季度终了后十个工作日内向委托人和受益人进行披露。

2. 临时披露

本信托计划存续期间出现下列情形之一的，受托人将于获知情况后的两个工作日内编制临时报告向委托人、受益人披露，并向监管机关报告：

- (1) 召开受益人大会。
- (2) 提前终止信托计划。
- (3) 更换投资顾问、保管人、证券经纪服务商。
- (4) 受托人的法定名称、住所发生变更。
- (5) 受托人的董事长、总经理及信托经理发生变动。
- (6) 涉及受托人管理职责、信托财产的诉讼。
- (7) 受托人、投资顾问受到中国银监会或其派出机构或其他监管部门的调查。
- (8) 受托人及其董事长、总经理、信托经理受到行政处罚。
- (9) 关联交易事项。
- (10) 收益分配事项。
- (11) 信托财产净值计价错误达百分之零点五（含）以上。
- (12) 中国银监会规定的其他事项。

3. 信息披露方式

除本合同另有规定外，受托人在有关披露事项的报告、报表或通知制作完毕并审核无误后，应以下列形式之一报告委托人与受益人：

- (1) 在受托人的公司网站（www.zritc.com）上发布；
- (2) 本信托计划信托经理所在的受托人营业场所存放备查；
- (3) 来函索取时按委托人、受益人预留地址寄送；
- (4) 按委托人、受益人预留电子邮件地址发送电子邮件。

如因委托人、受益人预留地址或电子邮件地址的原因导致受托人不能及时有效通知，其损失由委托人、受益人承担。

4. 其他信息的披露

- (1) 本信托计划存续期间，受托人与投资顾问协商一致改变本信托计划信托财产投资范围的，受托人应于做出改变信托计划信托财产投资范围决定的三个工作日内在受托人网站（www.zritc.com）向委托人、受益人披露。
- (2) 其它与本信托计划相关且应当披露的信息根据法律、行政法规和监管规章的规定进行披露。

第十九条 受益人大会召集、议事及表决的程序和规则

1. 受益人大会由信托计划的全体受益人组成，依照有关规定行使职权。
2. 除本合同已另有规定，如下事项应提交受益人大会审议决定：
 - (1) 提前终止信托计划或者延长信托期限；
 - (2) 改变信托财产运用方式；
 - (3) 更换受托人；
 - (4) 提高受托人的信托管理费标准；
 - (5) 受托人提议的其他事项。
3. 受益人大会不得对未经公告的事项进行表决。
4. 受益人大会由受托人负责召集，受托人未按规定召集或不能召集时，代表信托单位百分之十以上的受益人有权自行召集。
5. 召集受益人大会，召集人应当至少提前十个工作日公告受益人大会的召开时间、会议形式、审议事项、议事程序和表决方式等事项。受益人大会不得就未经公告的事项进行表决。受益人大会可以采取现场方式召开，也可以采取通讯等方式召开。
6. 每一信托单位具有一票表决权，受益人可以委托代理人出席受益人大会并行使表决权。信托单位赎回的，自赎回开放日起不再具有表决权。
7. 受益人大会应当有代表百分之五十以上信托单位的受益人参加，方可召开；

大会就审议事项作出决定,应当经参加大会的受益人所持表决权的三分之二以上通过;但更换受托人、改变信托财产运用方式、提前终止信托合同,应当经参加大会的受益人全体通过。受益人大会决定的事项,应当及时通知相关当事人,并向中国银行业监督管理委员会报告。

第二十条 受托人的职责终止和新受托人选任方式

1. 有下列情形之一的,受托人职责终止:
 - (1) 受托人被依法撤销、被宣告破产、依法解散、法定资格丧失的;
 - (2) 受托人违反信托目的处分信托财产、管理、运用、处分信托财产有重大过失或违反法律法规或监管规定的,受益人大会决定终止的;
 - (3) 法律法规规定的其他情形。
2. 受益人大会决定终止受托人职责应遵守下列全部程序和条件:
 - (1) 本合同所规定的受托人信托管理费、其他信托费用、信托税费已经全部结清;
 - (2) 受益人已经支付信托财产和信托事务的移交的全部费用;
 - (3) 新受托人已经确定,且新受托人书面同意继任受托人的义务与职责。
3. 受托人职责终止时,受托人应向受益人做出处理信托事务的报告,并向新受托人办理信托财产和信托事务的移交手续。自全部移交手续办理完毕之日起,原受托人在本合同项下的权利和义务终止。
4. 受托人依法终止其职责时,新受托人由受益人大会选任。如果有关法律法规或政府部门已经对新受托人的选任方式有了明确规定或安排,则在出现需要重新选任受托人的情况时应按照该等规定或安排进行。受益人大会确定新受托人人选的,应将下列文件送达给原受托人:
 - (1) 变更新受托人的通知;
 - (2) 新受托人同意履行本信托计划项下原受托人义务与职责的确认书。

第二十一条 风险揭示与承担

本信托计划在管理过程中可能面临各种风险,委托人在决定认购前,应谨慎衡量下文所述之风险因素及承担方式,以及信托文件的所有其他资料。

1. 风险揭示

(1) 市场风险

- 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，可能导致市场价格波动，从而影响本信托计划的收益。

- 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，宏观经济所处的经济周期将会对证券市场的收益水平产生影响，从而对本信托计划收益产生影响。
- ③利率风险。利率直接影响着债券的价格和收益率，影响着企业的融资成本和利润。金融市场利率的波动会导致证券市场价格和收益率的变动。本信托计划收益水平可能会受到利率变化和货币市场供求状况的影响。
- ④购买力风险。本信托计划的目的是信托财产的保值增值，如果发生通货膨胀，则投资于证券所获得的收益可能会被通货膨胀抵消，从而影响到信托财产的保值增值。
- ⑤上市公司经营风险。上市公司的经营状况受多种因素影响，如法人治理结构、管理能力、市场前景、行业竞争等，这些都会导致企业的盈利发生变化。如果本信托计划所投资的上市公司经营不善，其股票价格可能下跌，或者能够用于分配的利润减少，使本信托计划收益下降。
- ⑥创业板投资风险。创业板强调公司的自主创新能力和高成长性，但创业板市场上市公司发展相对不成熟，且创业板股票实行直接退市制度，存在较大的退市风险；创业板上市公司规模相对较小，市场估值困难，估值结果稳定性差，较大数量的股票买卖行为可能诱发股价出现大幅波动。信托计划投资于创业板股票，可以分享创业板上市公司发展而带来的收益，也可能因创业板风险造成相应信托财产的损失。
- ⑦股指期货的投资风险。股指期货市场的风险规模大、涉及面广，具有放大性、复杂性等特征。股指期货的风险成因主要有股指频繁波动、保证金交易的杠杆效应、非理性投机及市场机制不健全等。投资者需要关注的是来自于期货本身的交易机制的风险，即来自于期货交易所特有的保证金机制所产生的杠杆效应，每日结算制度所产生的对投资者短期的资金压力，以及期货高于现货市场的敏感性。股指期货投资适用于风险承受能力较高的投资者。投资者在投资股指期货前应当充分了解股指期货的投资风险，谨慎、理性的进行股指期货投资。

(2) 保管人/证券经纪服务商/期货经纪服务商/投资顾问操作风险

- ①按照相关法律法规规定，保管人/证券经纪服务商/期货经纪服务商/投资顾问

须具备法律法规规定的条件方可经营证券投资信托计划保管/证券经纪服务/期货经纪服务商/投资顾问业务。虽保管人/证券经纪服务商/期货经纪服务商/投资顾问相信其本身将按照相关法律法规的规定进行营运及管理，但无法保证其本身可以永久符合并维持相关法律法规和监管部门的监管要求。如在本信托计划存续期间保管人/证券经纪服务商/期货经纪服务商/投资顾问无法继续从事保管/证券经纪服务/期货经纪服务商/投资顾问业务，则可能会对本信托计划产生不利影响。

- ② 保管人/证券经纪服务商/期货经纪服务商/投资顾问在业界信誉良好。但若本信托计划存续期间保管人/证券经纪服务商/期货经纪服务商/投资顾问不能遵守交易文件约定对本信托计划实施管理，则可能对本信托计划产生不利影响。

(3) 投资于信托计划的风险

- ① 受益人资金流动性风险
- ② 受益人不得赎回其持有的在封闭期内的信托单位，受益人持有信托单位的封闭时间和金额均有一定要求，因此受益人在资金流动性方面会受一定影响。
- ③ 信托利益不确定的风险
- ④ 信托利益受多项因素影响，包括证券市场价格波动、投资操作水平、国家政策变化等，信托计划既有盈利的可能，亦存在亏损的可能。

(4) 信托财产变现的风险

由于本信托计划终止，受托人须变现信托财产并以变现所得向受益人分配信托利益，信托财产变现收入可能低于其购入成本，从而导致信托财产遭受损失。

(5) 管理风险

由于受托人的经验、技能等因素的限制，可能会影响其在管理信托财产的过程中对信息的占有和经济形势的判断，导致信托财产管理运用的风险，将会影响到信托收益或给信托财产造成损失，从而使委托人或受益人遭受损失。

(6) 其他风险

- ① 战争、自然灾害、重大政治事件等不可抗力以及其它不可预知的意外事件可能导致信托财产遭受损失。
- ② 金融市场危机、行业竞争等超出受托人自身直接控制能力之外的风险，可能

导致信托财产遭受损失。

- ③直接或间接因受托人所不能控制的情况、环境导致受托人延迟或未能履行其在本计划中的义务，或因前述情况、环境直接或间接导致信托财产损失或价格剧烈波动从而不能及时完成止损变现的风险。该等情况、环境包括但不限于政府限制，有关交易所、清算所或其它市场暂停交易，“受托人资产管理系统”发生任何故障，电子或机械设备或通讯线路失灵，电话或其它接收系统出现问题，盗窃、战争、罢工、社会骚乱、恐怖活动、自然灾害等。

由于交易所、银行、证券经纪服务商、期货经纪服务商等中介机构资金划付、交易、清算等电子系统技术障碍造成资金不能及时划付、交易不能及时执行等结果从而影响到信托财产的投资运作效率。

2. 风险承担

受托人依据信托合同的约定管理、运用信托资金导致信托财产受到损失的，由信托财产承担。受托人违反信托文件的规定处理信托事务，致使信托财产遭受损失的，由受托人以固有财产赔偿；不足赔偿时，由投资者自担。

如遇国家金融政策重大调整或市场状况变化，或因其他不可抗力致使信托财产受损失的，全部损失由信托财产承担。

第二十二条 保密义务

本合同双方同意，对其中一方或其代表提供给另一方的有关本合同及双方签署的本合同项下交易的所有重要方面的信息及/或本合同所含信息予以保密，但以下情况除外：（A）为进行本合同拟议之交易而向投资者披露；（B）向与本交易有关而需要获知以上信息并受保密协议约束的律师、会计师、顾问和咨询人员披露；（C）根据适用的法律法规的要求，向中国的有关政府部门或者管理机构披露；及（D）根据适用的法律法规的要求所做的披露；但是，进行上述披露之前，披露方应通知另一方其拟进行披露及拟披露的内容。

第二十三条 违约责任

1. 一般原则

若委托人或受托人未履行其在本合同项下的义务，或一方在本合同项下的

承诺或保证虚假、不真实或存在任何误导性遗漏，视为该方违反本合同。违约方应赔偿因其违约而给守约方造成的全部损失。

2. 委托人违约

委托人发生第 1 款规定的任何一项或多项违约事件的，受托人有权行使如下一项或多项权利：

- ① 要求委托人限期纠正其违约行为；
- ② 要求委托人赔偿受托人因其违约而遭受的实际损失和本合同履行后预期可获得的利益；若委托人违约导致本合同项下信托被撤销或被确认无效，由此给信托计划项下其他的信托受益人和信托计划的财产造成损失的，受托人还有权要求委托人赔偿信托财产和其他受益人的实际损失；
- ③ 本合同及法律法规规定的其他权利。

3. 受托人违约

受托人违反本合同第十六条第 2 款规定的义务的，应赔偿因其违约而给委托人造成的全部实际损失。

4. 免责条款

受托人对如下事项对委托人或信托财产造成的损失不承担违约责任：

- (1) 因不可抗力造成的损失；
- (2) 受托人按照信托合同的约定管理、运用、处分信托财产，作为或不作为而造成的信托财产损失或潜在损失；
- (3) 受托人按照当时有效的法律法规或监管机构的监管要求作为或不作为而造成的信托财产损失，且不论因何种原因导致受托人应遵守该等法律法规或监管机构的监管要求；
- (4) 其他因受托人不能预见或无法控制的原因而造成的损失。

第二十四条 争议的解决方式

本协议未尽事项或与本协议有关的争议，应首先通过友好协商解决。协商不成的，任何一方可向本合同签署地（即北京市西城区）有管辖权的人民法院提起诉讼。在争议解决期间，除争议条款外，本合同的其余部分应继续履行。

第二十五条 通知

1. 委托人、受益人、受托人以挂号信、传真、特快专递、电子邮件的方式，就

处理信托事务过程中需要通知的事项通知本合同各方。通知在下列日期视为送达被通知方：

- (1) 专人送达：通知方取得的被通知方签收单所示日。
 - (2) 挂号信邮递：发出通知方持有的国内挂号函件收据所示日后第 5 日。
 - (3) 传真：收到成功发送确认之日。
 - (4) 特快专递：发出通知方持有的发送凭证上邮戳日起第 4 日。
 - (5) 电子邮件：发件人邮件系统显示已成功发送之日。
2. 受托人选择在其网站（www.zritc.com）公告通知的，通知在公告之日起第十五个工作日即视为送达。
3. 一方通讯地址或联系方式发生变化，应以书面形式在发生变化后的十个工作日内（至迟在信托计划结束前）通知另一方。发生变动的一方未将有关变化及时通知其对方，除非法律另行规定，应对由此而造成的影响和损失负责。

第二十六条 其他条款

1. 《认购（申购）风险申明书》和《信托计划说明书》是本合同不可分割的组成部分，和本合同具有同等法律效力。若本合同规定的内容与《信托计划说明书》不一致的，以本合同为准。
2. 本合同各条款的标题仅为方便而设，不得被视为等同于该条款所包括的全部内容，或被用来解释该等条款或本合同。
3. 本合同生效后，除本合同另有约定或法律法规另有规定的以外，委托人、受托人以及受益人任何一方不得擅自变更、撤销、解除或终止本合同。如需要变更本合同，须经各方协商一致并达成书面协议。

第二十七条 合同生效及合同份数

如果委托人为法人或其他组织，本合同自委托人和受托人法定代表人（负责人）或其授权代理人签字或盖章，并加盖双方公章或合同专用章之日生效；如果委托人为自然人，则本合同自委托人签字，受托人法定代表人或其授权代理人签字或盖章，并加盖受托人公章或合同专用章之日生效。

本合同一式贰份，委托人、受托人各执壹份，每份具有同等效力。

第二十八条 填写事项

委 托 人	机 构 委 托 人	法人名称			
		法定代表人(负责人) 姓名		法定代表人 (负责人)身 份证明文件类 型	
		法定代表人(负责人) 身份证明文件号码		法定代表人 (负责人)身 份证明文件有 效期	
		经营范围			
		控股股东或 实际控制人姓名/名称		控股股东或 实际控制人身 份证明文件类 型	
		控股股东或 实际控制人身份证明 文件号码		控股股东或 实际控制人身 份证明文件有 效期	
		住所及邮编			
		主要办事机构所在地 及邮编			
		通讯地址及邮编			
		传真			
		电子邮箱(请填写常 用邮箱)			

		证件类型 (如有营业执照, 请填写营业执照)		证件号码 (如有营业执照, 请填写营业执照注册号)	
		证件有效期			
		组织机构代码		税务登记证号码	
		授权办理人姓名		授权办理人身份证明文件类型	
		授权办理人身份证明文件号码		授权办理人身份证明文件有效期	
自然人委托人		姓名		性别	
		国籍		职业	
		身份证明文件类型		身份证明文件号码	
		身份证明文件有效期		联系电话	
		住所地(住所地与经常居住地不一致的, 请填写经常居住地)及邮编			
		通讯地址及邮编			
		传真			
		电子邮箱(请填写常用邮箱)			
		代理人姓名		代理人身份证号	
	代理人联系电话		代理人手机		
信托利益分配账户		开户名称			
		开户银行			
		银行账(卡)号			

	大额支付系统号（备注：该号可向开户行咨询）	
认购信托单位	封闭期	
	单价	
	数量	大写：份 小写：份
	信托资金金额	大写：人民币 小写：¥
委托人类型 (请在您的选项处划“√”)		<input type="checkbox"/> 自然人 <input type="checkbox"/> 法人或其他组织
委托人信息确认		<p>(请委托人亲自抄写如下表述:)</p> <p>上述信息系本人/本机构亲自填写，本人/本机构确保填写的信息详实、正确、有效，如因本人/本机构填写错误或未填写导致的任何损失由本人/本机构承担，受托人不承担任何法律责任。</p> <p>委托人（自然人签名/其他机构盖公章并法定代表人签字或盖章）：</p>

(以下无正文)

(此页无正文，为编号为 2014201008023601 的《中融-润京汇金量化 1 号证券投资集合资金信托合同》签署页)

委托人:

(自然人签字/法人名称及公章)

法定代表人(负责人)(或授权代理人)签字或盖章:

受托人: 中融国际信托有限公司

(公章或合同专用章)

法定代表人(或授权代理人)签字或盖章:

签署地点: 北京市西城区

签署日期: 年 月 日

认购（申购）风险申明书

编号： 2014201008023601- -1

一、签订目的

1. 本编号为 2014201008023601- -1 的《认购（申购）风险申明书》（以下简称《认购（申购）风险申明书》）是编号为 2014201008023601《中融-润京汇金量化 1 号证券投资集合资金信托合同》不可分割的部分。
2. 本《认购（申购）风险申明书》中所指的委托人、受托人、受益人与编号为 2014201008023601 的《中融-润京汇金量化 1 号证券投资集合资金信托合同》所指的委托人、受托人、受益人相一致。
3. 本《认购（申购）风险申明书》是为了更好地向委托人及受益人揭示受托人在运作信托资金中遇到的风险，更好地明确风险发生时各方的责任而制定的。

二、委托人在此声明如下：

1. 委托人系依据《信托公司集合资金信托计划管理办法》规定的合格投资者。委托人具备全部必须的权利和授权，可以自身的名义用自己合法所有的资金认购信托单位，且并未非法汇集他人资金参与本信托计划。
2. 委托人已全面了解了本信托计划的相关信息，在本《认购（申购）风险申明书》上签字，即表明委托人本人已认真阅读并理解全部的信托文件（包括但不限于信托合同及其附件、《信托计划说明书》以及本《认购（申购）风险申明书》），已了解本信托计划可能产生的风险和造成的损失，并愿意依法承担相应的信托投资风险。
3. 委托人签署和执行本《认购（申购）风险申明书》是自愿的，是其真实意思的表示，并取得了所有必需的合法授权。上述授权及授权项下的签署和执行未违背委托人的公司章程或任何对委托人有约束力的法规或合同，委托人为签署和执行本《认购（申购）风险申明书》所需的手续均已合法、有效地办理完毕。

三、受托人在此声明如下：

1. 受托人系依据中华人民共和国法律成立、持有中国银行业监督管理委员会颁发的《中华人民共和国金融许可证》并经工商行政管理部门核准登记的企业法人，具备所有必要的按照营业执照经营金融业务的资格。

2. 受托人有资格签署本《认购（申购）风险说明书》及有关文件，有权履行本《认购（申购）风险说明书》项下权利和义务。
3. 受托人承诺将严格按照信托合同中约定的方式对委托人基于信托合同所交付的信托资金进行管理、运用和处分。

四、风险的揭示

受托人承诺恪尽职守，遵循诚实、信用、谨慎、有效管理的原则管理和运用信托财产，但不承诺信托财产本金不受损失、不承诺最低收益。信托财产在投资管理运用过程中，存在以下风险：

1、市场风险

- 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，可能导致市场价格波动，从而影响本信托计划的收益。
- 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，宏观经济所处的经济周期将会对证券市场的收益水平产生影响，从而对本信托计划收益产生影响。
- ③利率风险。利率直接影响着债券的价格和收益率，影响着企业的融资成本和利润。金融市场利率的波动会导致证券市场价格和收益率的变动。本信托计划收益水平可能会受到利率变化和货币市场供求状况的影响。
- ④购买力风险。本信托计划的目的是信托财产的保值增值，如果发生通货膨胀，则投资于证券所获得的收益可能会被通货膨胀抵消，从而影响到信托财产的保值增值。
- ⑤上市公司经营风险。上市公司的经营状况受多种因素影响，如法人治理结构、管理能力、市场前景、行业竞争等，这些都会导致企业的盈利发生变化。如果本信托计划所投资的上市公司经营不善，其股票价格可能下跌，或者能够用于分配的利润减少，使本信托计划收益下降。
- ⑥创业板投资风险。创业板强调公司的自主创新能力和高成长性，但创业板市场上市公司发展相对不成熟，且创业板股票实行直接退市制度，存在较大的退市风险；创业板上市公司规模相对较小，市场估值困难，估值结果稳定性差，较大数量的股票买卖行为可能诱发股价出现大幅波动。信托计划投资于创业板股票，可以分享创业板上市公司发展而带来的收益，也可能因创业板风险造成相应信托财产的损失。

⑦ 股指期货的投资风险。股指期货市场的风险规模大、涉及面广，具有放大性、复杂性等特征。股指期货的风险成因主要有股指频繁波动、保证金交易的杠杆效应、非理性投机及市场机制不健全等。投资者需要关注的是来自于期货本身的交易机制的风险，即来自于期货交易所特有的保证金机制所产生的杠杆效应，每日结算制度所产生的对投资者短期的资金压力，以及期货高于现货市场的敏感性。股指期货投资适用于风险承受能力较高的投资者。投资者在投资股指期货前应当充分了解股指期货的投资风险，谨慎、理性的进行股指期货投资。

2、保管人/证券经纪服务商/期货经纪服务商/投资顾问操作风险

① 按照相关法律法规规定，保管人/证券经纪服务商/期货经纪服务商/投资顾问须具备法律法规规定的条件方可经营证券投资信托计划保管/证券经纪服务/期货经纪服务/投资顾问业务。虽保管人/证券经纪服务商/期货经纪服务商/投资顾问相信其本身将按照相关法律法规的规定进行营运及管理，但无法保证其本身可以永久符合并维持相关法律法规和监管部门的监管要求。如在本信托计划存续期间保管人/证券经纪服务商/期货经纪服务商/投资顾问无法继续从事保管/证券经纪服务/期货经纪服务/投资顾问业务，则可能会对本信托计划产生不利影响。

② 保管人/证券经纪服务商/期货经纪服务商/投资顾问在业界信誉良好。但若本信托计划存续期间保管人/证券经纪服务商/期货经纪服务商/投资顾问不能遵守交易文件约定对本信托计划实施管理，则可能对本信托计划产生不利影响。

3、投资于信托计划的风险

受益人资金流动性风险。受益人不得赎回其持有的在封闭期内的信托单位，受益人持有信托单位的封闭时间和金额均有一定要求，因此受益人在资金流动性方面会受一定影响。

信托利益不确定的风险。信托利益受多项因素影响，包括证券市场价格波动、投资操作水平、国家政策变化等，信托计划既有盈利的可能，亦存在亏损的可能。

4、信托财产变现的风险

由于本信托计划终止，受托人须变现信托财产并以变现所得向受益人分配信托利益，信托财产变现收入可能低于其购入成本，从而导致信托财产遭受

损失。

5、管理风险

由于受托人的经验、技能等因素的限制，可能会影响其在管理信托财产的过程中对信息的占有和经济形势的判断，导致信托财产管理运用的风险，将会影响到信托收益或给信托财产造成损失，从而使委托人或受益人遭受损失。

6、其他风险

- ①战争、自然灾害、重大政治事件等不可抗力以及其它不可预知的意外事件可能导致信托财产遭受损失。
- ②金融市场危机、行业竞争等超出受托人自身直接控制能力之外的风险，可能导致信托财产遭受损失。
- ③直接或间接因受托人所不能控制的情况、环境导致受托人延迟或未能履行其在本计划中的义务，或因前述情况、环境直接或间接导致信托财产损失或价格剧烈波动从而不能及时完成止损变现的风险。该等情况、环境包括但不限于政府限制，有关交易所、清算所或其它市场暂停交易，“受托人资产管理系统”发生任何故障，电子或机械设备或通讯线路失灵，电话或其它接收系统出现问题，盗窃、战争、罢工、社会骚乱、恐怖活动、自然灾害等。

由于交易所、银行、证券经纪服务商、期货经纪服务商等中介机构资金划付、交易、清算等电子系统技术障碍造成资金不能及时划付、交易不能及时执行等结果从而影响到信托财产的投资运作效率。

本信托计划仅适合于具有较强风险识别、风险评估和风险承受能力的合格投资者。委托人/受益人对此有充分的理解和认识，并愿意承受信托计划的投资风险。

受托人依据信托文件管理信托财产所产生的风险和损失，由信托财产承担；受托人因违背信托文件、处理信托事务不当而造成信托财产损失的，由受托人以固有财产赔偿；不足赔偿时，由投资者自担。保管银行承担保管人职责，并不表明对投资者交付的信托资金提供任何形式的担保，也不表明保管人承担其他投资风险。

五、委托人认购信托单位数量

委托人认购的信托单位数量为：【 】份信托单位

委托人交付的信托资金金额为：人民币【 】元（小写：¥【 】）

六、本《认购（申购）风险申明书》生效

1. 如果委托人为法人或其它组织，本《认购（申购）风险申明书》自委托人和受托人法定代表人（负责人）或其授权代理人签字或盖章，并加盖双方公章或合同专用章之日生效。如果委托人为自然人，则本《认购（申购）风险申明书》自委托人签字，受托人法定代表人或其授权代理人签字或盖章，并加盖受托人公章或合同专用章之日生效。
2. 本《认购（申购）风险申明书》壹式肆份，委托人、受托人各执贰份；每份均具有同等法律效力。

认购（申购）风险申明书
确认签章页

委托人确认：

（委托人亲自摘抄本签字页如下括号内文字处）

（委托人签署本《认购（申购）风险申明书》即表示已认真阅读并理解本《认购（申购）风险申明书》及所有信托文件，自愿加入信托计划并依法承担信托投资风险。）

委托人：

（自然人签名/法人名称及公章）

法定代表人（负责人）（或授权代理人）签字或签章：

受托人：中融国际信托有限公司（公章或合同专用章）

法定代表人（或授权代理人）签章：

年 月 日

附件一：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，以最近一个交易日的收盘价估值。
- (2) 未上市股票的估值
 - ① 首次发行未上市的股票，按成本计量；
 - ② 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挂牌的同一股票的市价估值；该日无交易的，以最近一个交易日的收盘价估值；
 - ③ 首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的市价估值；当日没有收盘价的，以最近一个交易日收盘价为准；
 - ④ 非公开发行有明确锁定期的流通受限股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

2. 债券估值方法

- (1) 证券交易所市场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，按最近一个交易日的收盘价估值；
- (2) 证券交易所市场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应收利息(自债券计息起始日或上一起息日至估值当日的利息)得到的净价进行估值，估值日没有交易的，按最近一个交易日债券收盘净价估值；
- (3) 发行未上市债券,按成本进行计量；
- (4) 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；
- (5) 在全国银行间债券市场交易的债券采用估值技术确定公允价值；

3. 权证估值方法

- (1) 信托持有的权证，从持有确认日起到卖出日或行权日止，上市交易的权证按估值日在证券交易所挂牌的该权证的收盘价估值；估值日没有交易的，按最近一个交易日的收盘价估值；
- (2) 未上市交易的权证，按成本计量；因持有股票而享有的配股权，从配股除权日起到配股确认日止，如果收盘价高于配股价，按收盘价高于配股价的差额估值。收盘价等于或低于配股价，则估值为零。
- (3) 停止交易、但未行权的权证，如果收盘价高于行权价，按收盘价高于行权价

的差额估值。收盘价等于或低于行权价，则估值为零。

4. 证券投资基金估值方法

(1) 上市交易的基金以估值日其所在交易所的收盘价估值，估值日无交易的，以最近一个交易日的收盘价估值；

(2) 开放式基金：

① 非货币市场基金：以估值日交易日的基金单位净值进行估值，未公布净值的按最近公布日净值计算；

② 货币市场基金：货币基金以本金 1 元估值，货币式基金的待分配收益每日按基金万份收益计提处理，并于实际结转份额时转入货币式基金份额，实际结转份额以基金公司确认份额为准；

③ 处于募集期内的证券投资基金，按其成本估值；

④ 同一基金同时在两个或两个以上市场交易的，按其所处的市场分别估值。

5. 股指期货估值方法

信托计划投资的股指期货合约，以估值日当日结算价进行估值，估值日当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。

6. 商业银行理财产品以产品收益率应计收益计算。

7. 银行存款及证券账户资金以每个估值日日末余额列示，银行存款及证券账户资金每日计提利息，实际到账的款项以入账金额为准。

8. 股利收入的确认采用权责发生制原则。

9. 在任何情况下，受托人如采用本附件规定的方法对信托财产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如有确凿证据表明按上述规定不能客观反映信托财产公允价值的，受托人可根据具体情况按最能反映信托财产公允价值的方法估值。

10. 国家有最新规定的，按其规定进行估值。

附件二：MAC 地址绑定确认函

中融国际信托有限公司：

本人/机构【 】（身份证号或营业执照注册号：【 】）
作为中融-润京汇金量化 1 号证券投资集合资金信托计划（以下简称“本信托计划”）
的投资顾问，现已确认【 】，身份证号【 】将通过如
下方式向你公司（以下称“受托人”）的资产管理系统下达投资建议：

- ①电脑（计算机名称： ）及对应的 MAC 地址（ ）；
- ②电脑（计算机名称： ）及对应的 MAC 地址（ ）；
- ③电脑（计算机名称： ）及对应的 MAC 地址（ ）。

投资顾问：安徽润京资产管理有限公司（公章）

法定代表人（签字或盖章）

自然人（签字或盖章）

年 月 日

附件三：MAC 地址绑定流程

受托人所管理的信托产品，只能通过已经绑定 MAC 地址的电脑向受托人交易系统下达投资建议。未绑定 MAC 地址的电脑无法登录交易系统。关于网卡绑定，具体步骤如下：

1. 受托人根据信托经理提交的项目移交通知书，审核授权委托书中被授权人的身份证、授权人签字样本、授权邮箱和联系方式；
2. 确认被授权人身份准确无误后，在交易系统中新增用户代码和名称及匹配项目和菜单权限；
3. 系统权限设置完毕后，发送交易软件的安装程序、操作手册、用户名和密码至被授权人的授权邮箱中（用户名和密码只能发送至授权邮箱，其他邮箱无效）；
4. 被授权人收到邮件后，进行相应的交易系统安装及登录，客户首次登录系统后，系统会弹出提示：操作员对此站点无操作权限，请联系管理员；在客户进行登录的同时，交易系统的柜员日志查询中出现一条提示：柜员登录无站点权限；
5. 被授权人向系统管理员电话确认，系统管理员接收到咨询电话，核实被授权人的身份证号码及机器的 MAC 地址，信息匹配完成后方可绑定授权，一个柜员号可以绑定 3 台机器。

附件四：投资顾问承诺函

投资顾问作为委托人认购信托单位的，向受托人承诺与保证：

(1) 投资顾问为本合同规定的合格投资者。

(2) 认购信托单位的资金为来源合法的**自有资金**，非为**募集资金**，非为毒品犯罪、黑社会性质的组织犯罪、恐怖活动犯罪、走私犯罪、贪污贿赂犯罪、破坏金融管理秩序犯罪、金融诈骗犯罪等犯罪所得，不存在任何已有的或潜在的法律纠纷且可用于本合同约定之用途。委托人承诺委托人有合法且完整的权利将资金用于本信托计划，该等运用符合法律、法规、规范性文件及其他相关合同的要求，并符合相关产业政策。

(3) 认购信托单位完全符合其财务需求、目标和条件，对其而言是合理、恰当而且适宜的投资。已就认购信托单位取得了一切必要的权力、权利及授权。

(4) 认购信托单位遵守并完全符合对其有约束力的任何投资政策、指引和限制、合同、承诺及法律法规、政府命令、判决及裁决。

(5) 认购信托单位未损害其债权人的合法权益。

投资顾问在此确认，投资顾问系独立作出本款项下的承诺与保证，未依赖受托人或受托人的任何关联机构。

受托人系在投资顾问前述承诺与保证的基础上与投资顾问订立本合同。受托人不对前述承诺与保证的真实性、完整性承担任何责任或负担任何义务。若任何上述承诺与保证不真实、虚假或存在误导性遗漏导致本合同项下义务不能履行或不能完全履行、本合同终止或被撤销、或被追究任何经济或行政的责任及遭致的相应损失均由投资顾问自行承担。

投资顾问：安徽润京资产管理有限公司（公章）

法定代表人：聂瑞（签字或签章）

签署日期： 年 月 日

签署地点：北京市西城区