证券代码:600346 证券简称:恒力石化 公告编号:2022-039

恒力石化股份有限公司关于开展2022年度外汇衍生品交易业务的公告

本公司董事会及全体董事保证本公告内容不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

恒力石化股份有限公司(以下简称"公司")于 2022 年 4 月 6 日召开第八届董事会第二十八次会议,审议通过了《关于开展 2022 年度外汇衍生品交易业务的议案》。具体情况如下:

一、拟开展的外汇衍生品交易业务品种

为防范和降低进出口业务和相应衍生的外币借款所面临的汇率和利率风险,结合资金管理要求和日常经营需要,公司及下属公司拟开展外汇衍生品交易业务,包括但不限于远期结售汇、人民币和其他外汇的掉期业务、远期外汇买卖、外汇掉期、外汇期权、利率互换、利率掉期、利率期权等。

二、拟开展的外汇衍生品交易业务规模

基于公司 2022 年原油进口业务、外币贷款等外汇业务金额、相关业务经营周期等情况,本着谨慎预测原则,预计公司 2022 年外汇衍生品交易业务在任何时点的余额不超过 68.27 亿美元(其他币种按当期汇率折算成美元汇总),上述金额超过公司 2021 年度经审计净资产的 30%,故需提交公司股东大会审议批准后,方可实施。同时提请股东大会授权公司董事会及相关部门开展此项业务,授权期限自股东大会审议通过之日起 12 个月内,上述额度在该授权期限内循环使用。

三、开展外汇衍生品交易业务的风险分析

1、市场风险:因外汇行情变动较大,可能产生因标的利率、汇率等市场价格波动导致外汇衍生品价格变动而造成亏损的市场风险。

2、内部控制风险:外汇衍生品交易业务专业性较强,复杂程度较高,可能会由于内部控制机制不完善而造成风险。

3、法律风险:因相关法律发生变化或交易对手违反相关法律制度可能造成合约无法正常执行而给公司带来损失。

四、公司采取的风险控制措施

1、公司制定的《外汇衍生品交易业务管理制度》中规定不得进行以投机为目的的外汇衍生品交易,所有外汇衍生品交易业务均以正常生产经营为基础,以具体经营业务为依托,以规避和防范汇率或利率风险为目的。就公司业务操作原则、审批权限、内部审核流程、责任部门及责任人、信息隔离措施、内部风险报告制度及风险处理程序等做出了明确规定,该制度符合监管部门的有关要求,满足实际操作的需要,所制定的风险控制措施切实有效。

2、公司财务部、采购部作为相关责任部门均有清晰的管理定位和职责,并且责任落实到人,通过分级管理,从根本上杜绝了单人或单独部门操作的风险,在有效地控制风险的前提下也提高了对风险的应对速度。

3、公司仅与具有合法资质的大型商业银行开展外汇衍生品交易业务,密切跟踪相关领域的法律法规,规避可能产生的法律风险。

五、会计政策及核算原则

公司根据财政部《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》、《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》等相关规定及其指南,对拟开展的外汇衍生品交易进行相应的核算和披露。

六、独立董事意见

公司独立董事认为:公司及下属公司开展外汇衍生品交易业务,是以正常生产经营为基础,防范和降低外汇汇率及利率波动对公司造成不利影响,符合公司业务发展的需要。公司开展外汇衍生品交易业务是必要的且风险可控。公司开展外汇衍生品交易业务的相关程序符合相关法律法规和《外汇衍生品交易业务管理制度》等相关规定,不存在损害公司及全体股东、特别是中小股东权益的情形。因此,我们同意此项议案,并同意提交公司股东大会审议。

特此公告。

恒力石化股份有限公司董事会

2022 年 4 月 7 日

证券代码:600346 证券简称:恒力石化 公告编号:2022-040

恒力石化股份有限公司关于开展2022年度期货套期保值业务的公告

本公司董事会及全体董事保证本公告内容不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

恒力石化股份有限公司(以下简称"公司")于 2022 年 4 月 6 日召开第八届董事会第二十八次会议,审议通过了《关于开展 2022 年度期货套期保值业务的议案》,公司下属公司拟开展期货套期保值业务,具体情况如下:

一、开展期货交易的目的

公司下属公司主要经营原油加工及石油制品生产与销售、PTA、化工品(包括但不限于苯乙烯、乙二醇、聚丙烯)等生产与销售业务,其价格受国际和国内价格的影响较大,为规避原油和产品价格的大幅波动给公司经营带来的不利影响,拟开展套期保值业务,充分利用期货市场功能,有效管理价格大幅波动的风险,提升企业经营水平,保障企业健康持续运行。

二、开展期货套期保值业务情况

根据生产经营计划,本着谨慎原则,2022 年预计开展期货套期保值所需保证金不超过人民币 45.71 亿元(其他币种按当期汇率折算成人民币汇总),采用滚动建仓的方式,额度可以循环使用。期限自董事会审议通过之日起 12 个月。开展期货套期保值业务,需要使用一定比例的银行授信额度或自有资金作为保证金,缴纳保证金不会对公司的资金使用计划造成不利影响。

三、风险分析及风险控制措施

(一)风险分析

公司下属公司开展期货交易业务不以投机为目的,主要为规避原油和产品价格的大幅波动对公司带来的影响,但同时也会存在一定的风险:

1、价格波动风险:期货行情变动较大,可能产生价格变化方向与公司预测判断相背离的情况,造成期货交易的损失。

2、资金风险:期货交易采取保证金和逐日盯市制度,如投入金额过大,可能会带来相应的资金风险。此外,在期货价格波动巨大时,甚至可能存在未及时补充保证金而被强行平仓带来实际损失的风险。

3、内部控制风险:期货交易专业性较强,复杂程度较高,可能会产生由于内控体系不完善造成风险。

4、技术风险:由于无法控制和不可预测的系统故障、网络故障、通讯故障等造成交易系统非正常运行,使交易指令出现延迟、中断或数据错误等问题,从而带来相应风险。

5、政策风险:由于国家法律、法规、政策变化以及期货交易所交易规则的修改和紧急措施的出台等原因,从而导致期货市场发生剧烈变动或无法交易的风险。

(二)风险控制措施

1、公司制定了期货套期保值业务的相关管理制度,明确了开展套期保值业务的组织机构及职责、审批授权、业务流程、风险管理等内容,通过严格的内部控制指导和规范执行,形成较为完整的风险控制体系。

2、将套期保值业务与下属公司生产、经营相匹配,最大程度对冲价格波动风险。

3、公司将合理调度自有资金用于套期保值业务,严格控制套期保值的资金规模,合理计划和使用保证金。

4、公司内控审计部定期或不定期对套期保值业务进行检查,监督套期保值工作的开展,控制风险。

5、设立符合要求的交易、通讯及信息服务设施系统,保证交易系统的正常运行,确保交易工作正常开展。当发生错单时,及时采取相应处理措施,并减少损失。

6、加强对国家及相关管理机构相关政策的把握和理解,及时合理地调整套期保值思路与方案。

四、开展期货套期保值业务的会计核算原则

公司根据《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 24 号——套期保值》、《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》等相关规定及其指南,对期货套期保值业务进行相应核算和披露。

五、独立董事意见

独立董事认为:公司已建立健全相关内控制度,通过加强内部管理,落实风险防范措施,控制投资风险。根据实际情况及市场变化开展商品期货套期保值业务符合生产经营的需要,合理规避原油和产品价格的大幅波动所带来的经营风险,具有必要性和可行性,不存在损害公司及全体股东特别是中小股东利益的情形。相关审议程序符合相关法律法规、规范性文件的规定。因此,我们同意此事项。

特此公告。

恒力石化股份有限公司董事会

2022 年 4 月 7 日

陕国投·恒力石化
第六期员工持股单一资金信托信托合同

合同编号:2202023

信托公司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。信托公司依据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。信托公司因违背信托合同、处理信托事务不当而造成信托财产损失的,由信托公司以固有财产赔偿;不足赔偿时,由投资者自担。

释义

除非本合同文意另有所指,下列词语具有如下含义:

1、本合同/本信托合同/信托合同:指编号为【2202023】的《陕国投·恒力石化第六期员工持股单一资金信托信托合同》及对该合同的任何有效修订与补充。

2、本信托/信托:指受托人设立的"陕国投·恒力石化第六期员工持股单一资金信托"。

3、委托人:指信托项下信托合同中的委托人,须为符合法律法规、监管规范中要求的合格投资者标准。

4、受托人/陕国投:指陕西省国际信托股份有限公司。

5、受益人:指委托人在信托合同中指定的享有信托受益权的自然人、法人或者依法成立的其他组织。本信托设立时为自益信托,本信托的受益人与委托人为同一人。

6、信托受益权:指受益人按信托合同的约定享有信托利益的权利。

7、信托资金/认购资金/追加认购资金:指委托人交付给受托人的资金。

8、信托资金总额:指本信托项下委托人交付的信托资金的总和。

9、信托财产:指受托人因承诺信托而取得的财产。受托人因信托财产的管理运用、处分或者其他情形而取得的财产,也归入信托财产。

10、信托利益:指受益人持有的信托受益权所对应的信托财产净值。

11、估值日:指受托人计算信托财产总值、信托财产净值、信托单位净值的日期,即信托成立后的每个交易日及信托终止日。

12、估值基准日:指每月 20 日(如遇节假日为该日之前最近一个工作日)。

13、证券经纪人:指受托人根据委托人/受益人的指令聘请的证券经纪服务机构,具体以委托人/受益人指令为准。

14、保管人/保管银行:指【 】。

15、保管协议:指受托人与保管人签署的编号为【 】的《陕国投·恒力石化第六期员工持股单一资金信托资金保管协议》,以及对前述文件的任何补充和修订。

16、信托财产专户: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。

17、信托单位:用于计算、衡量信托财产净值以及委托人认购的计量单位,每信托单位面值为人民币 1 元。信托单位的计算精确到小数点后第二位(即精确到 0.01),小数点后第三位四舍五入。

18、信托财产总值:指按信托文件约定的估值方法计算的本信托信托财产的价值总和。信托财产总值的计算精确到小数点后第 2 位(即精确到 0.01),小数点后第 3 位四舍五入。

19、信托财产净值:指信托财产总值减去应由信托财产承担的税费与费用、负债后的余额。信托财产净值的计算精确到小数点后第 2 位(即精确到 0.01),小数点后第 3 位四舍五入。

20、信托单位净值:指信托财产净值与信托单位总份额之比,其计算公式为:信托单位净值=信托财产净值/信托单位总份额,其结果以元为单位,信托单位净值的计算精确到小数点后 4 位(即精确到 0.0001),小数点后第 5 位四舍五入,由此产生的损益归入信托财产。

21、信托文件:指本信托合同、认购风险申明书、保管合同等与信托相关的文件。前述文件之间的约定不一致的,以本信托合同的约定为准。

22、信托份额确认书:记载委托人持有的信托单位份额及其变化、认购、赎回资金以及信托单位净值等内容的清单。

23、工作日:指除周六、周日和中国的法定节假日之外的任何一天,不包括中国政府宣布临时调整为休息日的周一至周五,但包括中国政府宣布为临时工作日的周六和周日。

24、交易日:指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日。

25、开放日:用于申购或赎回信托单位的日期,本信托开放日为每个工作日。

26、信托年度:指自信托成立日起每满一年的期间,如信托成立日为 M 月 T 日,则信托成立日起每年的 M 月 T 日为一个信托年度届满之日,当年 M 月无 T 日的,以该月最后一日为一个信托年度届满之日。

27、保障基金公司:指中国信托业保障基金有限责任公司。

28、信托业保障基金:是指《信托业保障基金管理办法》规定,主要由信托业市场参与者共同筹集,用于化解和处置信托业风险的非政府性行业互助资金。本计划的信托业保障基金由信托财产缴纳。

29、保障基金分配日:指保障基金公司就本信托项下的保障基金认购资金向受托人进行收益或本金分配之日(或与受托人进行结算之日)。

30、信托公司保障基金专户:指信托公司按照《信托业保障基金管理办法》及银监会关于信托业保障基金认购相关规定,在商业银行开设的用于保障基金资金归集与缴纳的专用账户。

31、不可抗力事件:指本合同各方不能合理控制、不可预见或则使预见亦无法避免的事件,该事件妨碍、影响或延误任何一方根据本合同履行其全部或部分义务。该事件包括但不限于地震、台风、洪水、火灾、其他天灾、战争、骚乱、罢工或其他类似事件、新法规颁布或对原法规的修改等政策因素。

一、信托当事人

本信托为设立时自益信托。各委托人/受益人的信息如下:

1、委托人

委托人名称:

法定代表人:

住所:

联系地址:

联系人:

联系电话:

电子邮箱:

2、受托人

受托人名称:陕西省国际信托股份有限公司

法定代表人:薛季民

住所:西安市高新区科技路 50 号金桥国际广场 C 座 24—27 层

联系地址:北京市东城区建国门内大街 28 号民生金融中心 B 座 6 层

联系人:郭闻雁 联系电话:010-85140230

传真:010-85140246 电子邮箱:guomy@siti.com.cn

3、受益人

本信托为设立时自益信托,本信托的受益人与委托人为同一人。

受益人信托利益分配账户:

户名:

账号:

开户银行名称:

大额支付号:

二、信托目的

委托人基于对受托人的信任,通过信托合同设定双方的信托关系。委托人自愿将其合法拥有的或具有合法处分权的资金委托给受托人,由受托人进行相应管理,受托人根据委托人的意愿将信托资金投资于股票、可转换公司债、私募证券投资基金、银行存款、货币市场基金、信托业保障基金等。受托人按委托人的意愿以本信托的名义投资,并为受益人的利益或者特定目的管理、运用和处分信托财产。

三、信托期限

本信托期限预计为 36 个月,自本信托成立之日起算。如发生信托文件规定的信托提前终止或延期情形时,本信托予以提前终止或延期。

本信托存续期满时,除本合同约定的自动延期的情形外,若信托当事人协商一致,则本信托可以延期。

四、信托单位份额的认购

提示:投资者在申请加入本信托前,务请仔细阅读信托文件的全部内容,包括本信托合同、认购风险申明书等信托文件所载的条款及条件。投资者的任何认购申请均可能全部或者部分不获接纳。本信托成立后,投资者认购信托单位份额需经受托人同意,否则受托人有权拒绝投资者的认购。

(一)信托单位份额的认购条件

1.委托人之资格

委托人须为具有完全民事行为能力的自然人、法人或者依法成立的其他组织。

2.资金合法性要求

委托人保证交付的认购资金是其合法所有或合法管理并有权支配的财产,非为借贷资金、其他负债资金及非法财产。

3.委托人之认购资金最低限额要求

首次认购时,委托人的首次认购金额不低于人民币 100 万元,超过部分按照 1 万元的整数倍增加。

(二)信托单位份额的认购费用

委托人认购信托单位份额时,本信托不收取认购费用。

(三)认购资金的交付

受托人在指定银行开立以下账户作为接受委托人信托资金的专用银行账户。信托专用银行账户在信托存续期内不可撤销。

户 名:陕西省国际信托股份有限公司

开户行:

账 号:

受托人不接受现金认购,委托人须从在中国境内银行开设的自有银行账户划款至信托专用银行账户。

(四)信托合同的签署

1.委托人签署认购风险申明书一式叁份(首次认购时适用)。

2.委托人签署信托合同一式叁份(首次认购时适用)。

3.委托人提交的信托利益分配账户在分配结束前不得取消。

4.受托人要求提交的其他资料。

(五)信托单位的认购时间

委托人需在其拟进行认购/申购的开放日前向受托人提交《信托资金认购/申购申请书》(格式见附件 3),确定其认购时间及认购信托资金金额,信托单位的认购时间按以下方式确定:

1.推介期内交付的信托资金,在信托成立日认购为信托单位;

2.本信托成立后的存续期内交付的信托资金,受托人在收到认购文件且认购资金足额到账之后一次性用于认购信托单位。

(六)信托单位的认购份额

信托成立日信托资金认购的信托单位份额=信托资金÷1 元

信托成立后的存续期内信托资金追加认购/申购的信托单位份额=信托资金÷申购开放日信托单位净值。

认购完成后,不足百分之一份信托单位的信托资金归属于信托财产。

(七)信托单位份额的确认

1.保管银行确认资金到达信托专用银行账户后,受托人根据委托人提交的信托文件制作信托认购份额确认书一式两份,并向委托人提供信托认购份额确认书正本一份。

2.信托认购份额确认书是记载委托人持有的信托单位份额及其认购资金、等内容的清单。当出现信托认购份额确认书与信托合同不一致的情况时,委托人持有的信托单位份额由受托人盖章的信托认购份额确认书确定。

(八)信托文件的管理

信托合同正本中的一份、信托认购申请书、身份证明文件、信托利益分配账户复印件和入账证明复印件由受托人持有。

(九)认购不成功的处理办法

如果委托人已经交付了资金,但因故未能成功认购的,受托人将在获悉其不能认购之日起的五个工作日内返还其交付的认购资金本金。

(十)本信托不成立的处理方法

如果委托人已经认购但本信托不能成立,受托人将在本信托预计成立日之后五个工作日内返还委托人已交付的款项。

五、信托资金的赎回

(一)持有期限要求

委托人赎回信托资金需经受托人同意,否则受托人将拒绝委托人的赎回申请。

(二)信托单位份额赎回手续

委托人需在其拟进行赎回的开放日前向受托人提交《赎回申请书》(格式见附件 4)。

(三)信托单位份额的赎回审核

1.委托人可以申请赎回其持有的部分或全部信托单位份额,部分赎回的,每次赎回的信托单位份额不得低于 100 万份,赎回后委托人最低持有的信托单位份额与赎回开放日信托单位净值之乘积不得低于人民币 100 万元,否则受托人不接受其赎回申请,除非该委托人全部赎回。若信托财产中现金资产无法足额支付委托人在赎回日的赎回金额,则受托人有权拒绝赎回。

2.受托人收到委托人(受益人)赎回申请书后,以赎回申请载明的赎回日期为赎回开放日。赎回申请书经受托人审核符合第五条第(二)款约定的赎回条件,则受托人制作赎回确认书(赎回的信托单位份额确认在赎回开放日下一日),并向委托人(受益人)提供正本一份。

(四)赎回信托资金的计算与支付

1.赎回资金的计算:

赎回资金=委托人(受益人)申请赎回的信托单位份额×赎回开放日信托单位净值。

2.赎回资金的支付

受托人在赎回开放日后的 5 个工作日内将划款指令转交保管银行。保管银行根据受托人出具的划款指令将赎回资金向受益人信托利益分配账户划拨。

(五)信托资金赎回费用

委托人赎回信托资金,其赎回费用为零。

(六)赎回文件的管理

信托份额确认书、赎回申请、赎回确认书作为信托合同的附件,由受托人处归档,以备委托人查询。

六、信托资金的管理与运用

(一)受托人投资管理方式

1、受托人管理方式

本信托为事务管理类信托。委托人自主决定信托的设立、信托财产的管理、运用和处分方式、信托财产运用程序等事项。信托设立之前委托人或委托人指定的第三方对上述事项进行了充分的尽职调查,尽职调查工作由委托人或其指定的第三方自行负责,委托人完全了解上述事项的全部瑕疵,对投资信托及信托可能面临的风险有完整充分的认识,自愿承担上述尽职调查的所有责任及投资风险,免除受托人的尽职调查责任。

受托人按照委托人的意愿确定信托财产的管理、运用和处分方式等事项,受托人仅依法履行必须由受托人或必须以受托人名义履行的管理职责,包括信托财产专户日常管理、清算分配及提供或出具必要文件以配合委托人管理信托财产等事务,受托人不承担主动管理职责。信托设立时受托人按照委托人的意愿和信托存续期间受托人按照委托人的指令对信托财产进行管理、运用和处分所产生的一切风险和责任由信托财产承担,由此导致受益人利益损失的,由受益人自行承担。受托人对因此导致的一切后果免除责任。

2、信托投资范围

委托人同意由受托人根据委托人的意愿将信托资金投资于股票、可转换公司债、私募证券投资基金、银行存款、货币市场基金、信托业保障基金等。

如法律法规规定受托人需取得特定资质后方可投资某产品,则受托人须在获得相应资质后开展此项业务。经委托人与受托人协商一致后,本信托可以调整投资范围、调整投资限制,但调整的投资范围和投资限制均应符合法律法规及监管政策的要求。

3、"私募证券投资基金"

本信托可能投资一个或多个私募证券投资基金,具体以届时委托人发送的投资指令载明的为准。本信托所投资的私募证券投资基金(以下简称为"标的基金")的具体投资范围、投资限制、投资比例等以标的基金的法律文件约定为准。本信托因投资标的基金而涉及的所有交易文件(包括但不限于标的基金的法律文件等)均为受托人根据委托人的指示签署,委托人对所有交易文件的全部内容均已知悉并确认,自愿承担由此导致的所有风险及损失。

受托人仅代表本信托作为标的基金的委托人,受托人无义务对标的基金的投资范围、投资限制、投资比例进行审核监控,受托人不对标的基金层面的交易进行风险控制,若标的基金管理人违反标的基金的投资范围、投资限制、投资比例等条款(或其投资范围、投资限制、投资比例未违反法律法规规定,但此道成的损失由信托财产承担,与受托人无关。标的基金存续期间若调整投资范围、投资限制、投资比例等要素,本信托受托人有权不另行向本信托受益人进行披露。委托人知悉并同意标的基金的投资范围、投资比例、投资限制调整不影响本信托继续持有标的基金,受托人无需另行征得信托委托人/受益人的同意,无需向信托委托人/受益人进行披露。委托人已知悉标的基金的法律文件约定的全部内容,充分了解并自愿承担标的基金相关投资风险。

(二)信托财产运用程序

受托人按照委托人下达的投资指令对信托财产进行管理运用。委托人出具的投资指令应符合信托文件中关于投资范围、投资限制等的规定,将投资指令以传真、录音电话或电子邮件等形式发送给受托人,受托人审核后执行有效的投资指令,并否决违反信托文件的投资指令。因交易条件不能满足、证券交易所闭市、违反法律法规、合同约定以及指雷委托人或受托人利益等原因导致投资指令不能执行,则该投资指令作废。受托人根据委托人的投资指令下达交易指令、做出的交易行为引起的风险和产生的后果由信托财产承担。

(三)信托投资限制

信托财产管理运用应遵守以下投资限制:

①禁止将信托财产投资或持有正回购。

②禁止将信托财产用于贷款、抵押融资或对外担保等用途。

③禁止将信托财产用于可能承担无限责任的投资。

④禁止将信托财产投资于与受托人有关联关系的企业发行的证券。

⑤禁止将本信托所持有的标的进行质押融资。

⑥本信托直接或间接投资股票时,仅限于投资恒力石化(股票代码:600346.SH);除参与恒力石化股份有限公司发行的可转债优先配售外(如有),不得主动投资于任何可转债。

= 7 * GB3 ⑦法律法规或信托文件约定的其他投资限制。

现行有关法律法规修订变化后,若上述投资限制与之产生抵触,应以有关法律法规规定为准。经委托人与受托人协商一致后,本信托可以调整投资范围、调整投资限制,但调整的投资范围和投资限制均应符合法律法规及监管政策的要求。

按照投资性质分类,本信托设立时属于权益类产品,投资于权益类资产比例不低于 80%,本信托存续期间,如属于高风险类型的产品超出比例范围投资较低风险资产,无需另行征得委托人/受益人的同意。

(四)本信托的预警

本信托的设置预警线为信托单位净值=【 】元;受托人于每个交易日对信托财产进行估值,估值结果以受托人计算结果为准。

如 T 日信托单位净值低于预警线,则受托人在 T+2 日内以短信、电子邮件、录音电话或传真等形式向委托人进行风险提示。

(五)信托财产的保管

1、受托人必须开设信托财产专户对信托财产进行单独管理,信托财产的保管账户和信托财产专户为同一账户。

2、在信托期限内,保管人对保管账户内全部信托资金进行保管。具体保管事宜,以受托人和保管人另行签署的《保管协议》为准。

3、保管人接受受托人的委托并签署《保管协议》,办理合同约定的保管业务。保管人与委托人(受益人)不发生合同权利义务关系。保管人对本信托项下资金的保管并非对本信托资金或收益的保证或承诺,也不承担本信托的投资风险。

4、受托人不得假借本信托的名义开立除信托财产专户外的其他账户,亦不得使用本信托项下的信托财产专户进行本信托以外的任何活动。

(六)保障基金认购条款

本信托保障基金由信托财产缴纳

①信托资金的 1%将专项用于认购保障基金,作为本信托项下信托财产投资组合的一部分。认购金额计算至小数点后二位,小数点二位以后的部分四舍五入。

本信托认购保障基金的认购金额=存续的信托单位份额×1 元×1%

②银监会、信托业协会或保障基金公司等机构对保障基金认购标准、认购方式或具体交付时点、收益计算及基金分配等进行调整的,受托人有权单方相应调整本信托项下认购资金金额、交付方式或具体交付时点、收益计算及基金分配等约定。

受托人于本信托成立之日将本信托认购资金从信托财产专户划付至信托公司保障基金专户,并将按照《信托业保障基金管理办法》及银监会关于信托业保障基金认购相关规定以及本合同约定,定期将本信托认购资金及受托人应交付保障基金公司的其他认购资金一并划付至保障基金公司基金专户用于认购保障基金。

委托人不得主张以其在本信托项下对保障基金的权益,与委托人(或本信托)对受托人的任何债务主张抵销;在委托人或本信托存在对受托人应付未付费用或其他负债时,受托人有权直接以委托人在本信托项下对保障基金的权益等额抵扣,不足抵扣的,受托人有权继续从本信托受偿或向委托人追偿。

七、信托财产估值

(一)估值流程

本信托估值日为信托成立后的每个交易日及信托终止日,本信托成立日起,受托人将于 T+1 日对 T 日信托财产进行估值,其中周一对前一周周五、周六、周日的信托财产进行估值。保管人每个交易日对托管资产进行估值,并与受托人进行核对。

(二)信托单位净值的计算

信托单位净值=信托财产净值/信托单位总份额。

信托单位净值的计算结果以元为单位,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。

(三)信托单位净值的披露

本信托存续期间,委托人、受益人有权按照法律法规的相关规定向受托人查询信托单位净值。

(四)估值原则

交易性金融财产和可供出售金融财产按其公允价值估值。

(五)估值方法

1、单位价值的确定:本信托持有资产的库存数量和单位价值按照公允价值计算,无公允价值的按取得该资产时的单位价值计算。具体确认原则如下(如有):

(1)证券交易所上市的有价证券的估值

A、交易所上市的有价证券(包括股票、权证、封闭式基金、上市开放式基金(LOF)等),以其估值日在证券交易所挂牌的市价(收盘价)估值;估值日无交易的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化,以最近交易日的市价(收盘价)估值;如最近交易日后经济环境发生了重大变化的,可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易市价,确定公允价格。

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

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

D、交易所上市不存在活跃市场的有价证券,采用中证估值价或者估值技术确定公允价值。交易所上市的资产支持证券,采用中证估值价或者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,可参考近期投资价格进行估值。

(2)处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理:

A、送股、转增股、配股和公开增发的新股,按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市价(收盘价)估值;该日无交易的,以最近一日的市价(收盘价)估值;

B、首次公开发行未上市的股票、债券和权证,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下,按发行价估值。

C、首次公开发行有明确锁定期的股票,同一股票在交易所上市后,按交易所上市的同一股票的市价(收盘价)估值;非公开发行有明确锁定期的股票,按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

(3)开放式基金(包括保管在场外的上市开放式基金(LOF))以估值日当日基金净值估值,估值日当日开放式基金单位净值未公布的,以此前最近一个工作日基金净值计算。尚未公布过基金份额净值的,应以账面价值估值。如果前一开放日至估值日该基金分红除权,则按前一开放日基金份额净值减单位份额分红额后的差额估值。

(4)货币市场基按前一估值日后至估值日间(含节假日)的万份收益计提估值日基金收益。

(5)银行存款估值方法:

银行定期存款或通知存款以本金列示,按协议或合同利率逐日确认利息收入。如提前支取或利率发生变化,将及时进行账务调整;银行活期存款以本金列示,利息不计提,在实际到账日计入信托计划财产。

(6)国债逆回购实行按日计息,实际计息天数按资金占用自然日数计算。回购计息按照计尾不计头的原则,在买入回购次日开始计提;回购交易费用计入成本,计息基数为预计收益减交易费用。

(7)保障基金估值方法:保障基金按实际缴付本金和实际收益计入信托财产总值,不逐日计提收入。

(8)标的基金的估值:某估值日标的基金的基金份额价值=标的基金管理人或托管人或基金服务机构提供的能够公允反映持有份额价值的单位净值×该估值日本信托持有标的基金的总份额数。标的基金的管理人、托管人、基金服务机构以标的基金的法律文件约定为准。若标的基金的管理人或托管人或基金服务机构未提供估值基准日的数据的,则以标的基金的管理人或托管人或基金服务机构提供的估值基准日之前最近一个日期的数据进行估值。(委托人特别确认,本信托投资的标的基金的财产净值以标的基金的管理人或托管人或基金服务机构提供的估值基准日的数据进行估值,因标的基金的管理人或托管人或基金服务机构估值不准确或未及时提供估值结果,导致受托人和保管人未能针对持有标的基金份额的财产净值进行有效或正确估值的,由此产生的风险及损失由信托财产承担,受托人和保管人对此不承担责任)。

(9)国家有最新规定的,按其规定进行估值。

在任何情况下,受托人采用上述(1)-(9)项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,委托人对此知悉并认可。

2、信托财产净值计算时的用及负债处理

(1)按信托文件约定可以列入信托财产的费用,按权责发生制原则计入信托财产,每日计提或待摊;

(2)因管理信托财产而产生的债务,按权责发生制原则增加信托财产的负债。

3、估值复核程序:信托财产的日常估值由受托人进行,保管人进行复核。用于公开披露的信托单位净值由受托人完成估值后,经授权人员签字确认后将估值结果以双方约定形式发送给保管人,保管人进行复核并经授权人员签字确认后将估值结果以双方约定形式发送给受托人,具体以《保管协议》约定的为准。如因系统等客观原因无法及时完成估值的,由委托人、受托人与保管人三方另行协商。

八、信托相关税费

(一)信托财产承担的费用

1、保管人的保管费;

2、受托人报酬;

3、信托财产管理运用、处分而发生的税费和交易费用(包括但不限于文件或账册制作、印刷费用;信息披露费用;银行资金汇划和账户服务费;邮寄费;信托终止清算时所发生费用以及受托人为履行受托职责而发生的其他费用);

4、律师费;

5、审计费(如有);

6、按有关规定,其他应支付的税费和费用。

受托人以其固有财产先行支付的,对信托财产享有优先受偿的权利。依法应由受托人自行承担的以及委托人或受益人另行支付的除外。

(二)相关费用计提方法、计提标准和支付方式

1、保管费

保管人提供保管服务,收取保管费。信托资金保管费以【当日仍存续的信托单位份额×1 元】为基础,按【 】%/年收取,按日计提,按季支付。计算方法为:

每日计提的保管费=当日仍存续的信托单位份额×1 元×【 】%÷365

每自然季度应支付的信托资金保管费为该自然季度已计提未支付的信托资金保管费之和;若信托存续不满一年提前终止,保管费按实际存续天数计算收取。

支付方式:保管费由受托人根据签署的相关合同或协议,向保管人出具的划款指令,由保管银行根据受托人出具的划款指令从信托财产专户中扣除,并向指定账户划拨。保管费在每自然季度末月 20 日后的 5 个工作日内支付,应支付的最后一次保管费在信托终止后 5 个工作日内支付。

2、受托人报酬

受托人经营信托业务,收取受托人报酬。受托人报酬以【当日仍存续的信托单位总份额×1 元】为基础,按照【 】%/年收取,按日计提,按季支付。计算方法为:

每日计提的受托人报酬=当日仍存续的信托单位总份额×1 元×【 】%÷365

每自然季度应支付的受托人报酬为该自然季度已计提未支付的受托人报酬之和;若信托存续不满一个信托年度提前终止,受托人报酬按实际存续天数计算收取。

支付方式:受托人报酬由受托人根据签署的相关合同或协议,向保管人出具的划款指令,由保管银行根据受托人出具的划款指令从信托财产专户中扣除,并向指定账户划拨。受托人报酬在每个自然季度末月 20 日后五个工作日内支付,应支付的最后一次受托人报酬在信托终止后 5 个工作日内支付。

3、其他税费及费用

信托财产管理运用、处分而发生的税费和交易费用按照法律及国家有关部门的规定办理。应由信托财产承担的税费和费用,由受托人根据实际情况,向保管人出具划款指令,从信托财产专户中扣划。

4、若在信托费用支付时点,信托财产专户无足够现金类信托财产,则应付未付的相关费用延期至信托财产专户内有足够现金类信托财产时再行支付。

九、委托人的权利和义务

1、委托人承诺:委托人为符合《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》第五条规定的合格投资者,投入本合同项下的信托资金来源合法,不存在非法汇集他人资金的情形,并可以用于证券投资;委托人投入本合同项下的信托资金是其合法所有且拥有完全处分权的资金,不是毒品犯罪、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,不是银行信贷资金、借贷资金或其他负债资金,认购信托单位未损害委托人的债权人的合法利益;受托人不对委托人认购资金的合法性和合规性负有或承担任何责任,也不对委托人是否遵守适用于其的任何法律、法规或监管政策负有或承担任何责任;委托人若为金融产品代理人,须保证该金融产品的投资者亦是信托的合格投资者。

2、委托人有义务向受托人提供相关监管规定所要求提供的有关资料;

3、委托人有权向受托人了解信托资金的管理情况,并要求受托人做出说明;

4、委托人可以随时查阅信托资金进行证券投资所涉证券、资金账户的余额及交易明细情况;

5、作为委托人签署本信托合同,表示已认真阅读、理解并同意所有的信托文件及相关附件内容,并愿意依法承担相应的信托投资风险;

6、本合同、法律法规约定的其他权利义务。

十、受托人的权利和义务

1、受托人从事信托活动,应当遵守法律、法规和本合同的约定,不得损害国家利益、社会公众利益和受益人的合法权益。如遇国家金融政策重大调整,及时通知委托人。双方应就资金运用、收益分配等内容进行协商和调整;

2、信托财产不属于受托人的自有财产,受托人终止时,信托财产不属于其清算财产或破产财产;

3、受托人应当为委托人、受益人以及处理信托事务的情况和资料保密,但法律法规或者信托文件另有规定的除外;

4、受托人应负责交易、清算、结算以及估值等相关事宜,应当对本合同项下信托资金实行单独记账、单独管理,进行独立的会计核算。按委托人要求发送估值表;向委托人/受益人披露信托财产净值。

5、受托人应妥善保存信托财产管理、分配的完整记录至少十五年,以便委托人或受益人日后查询;

6、受托人按本信托的约定收取信托报酬;

7、受托人以信托财产为限向受益人承担分配信托利益的义务;

8、受托人应为本信托配备合格的交易、清算、结算、估值等相关工作的专职人员,并建立相关的业务系统,完善相关业务流程;

9、受托人在受托运作信托财产时,应严格按照本合同约定投资运作信托财产;法律法规另有规定的,从其规定;

10、受托人应恪尽职守。

11、受托人保证本信托运作、相关账户的使用依法合规,并在监管机关要求或其他必需的情况下,履行其应尽的法律、合规义务。

12、受托人开展该信托业务应当与受托人固有财产证券投资业务建立严格的"防火墙"制度,实施人员、操作和信息的独立运作,不得利用所管理的信托财产为受托人,或者为委托人、受益人之外的第三方谋取不正当利益或进行利益输送;

13、本合同、法律法规规定的其他权利义务。

十一、受益人的权利与义务

1、受益人有权利按照本合同约定取得本信托项下的信托利益;

2、受益人不得以信托受益权偿还债务、提供质押担保;

3、受益人可以转让受益权(但不得拆分转让),机构所持有的信托受益权,不得向自然人转让或拆分转让。受益人保证受让人是符合法律法规要求的受让人,须遵守信托文件约定的相关转让手续;

4、受益人可以随时向受托人了解信托资金的管理情况,并要求受托人做出说明;

5、本合同、法律法规规定