

# 中金增强型债券收益集合资产管理计划

## 集合资产管理合同

合同生效日：2013年7月8日

## 目 录

第 1 部分	前言.....	3
第 2 部分	合同当事人.....	4
第 3 部分	集合计划的基本情况.....	5
第 4 部分	集合计划的参与.....	7
第 5 部分	管理人自有资金参与.....	8
第 6 部分	集合计划账户的开立与管理.....	9
第 7 部分	集合计划资产的托管.....	10
第 8 部分	集合计划费用.....	11
第 9 部分	投资收益与分配.....	12
第 10 部分	集合计划的信息披露.....	13
第 11 部分	委托人的权利与义务.....	14
第 12 部分	管理人的权利与义务.....	15
第 13 部分	托管人的权利与义务.....	17
第 14 部分	集合计划存续期间委托人的退出.....	18
第 15 部分	集合计划终止和清算.....	19
第 16 部分	不可抗力.....	20
第 17 部分	违约责任与争议处理.....	21
第 18 部分	风险揭示.....	22
第 19 部分	合同的签署和附件.....	26
第 20 部分	合同的补充、修改与变更.....	27
第 21 部分	或有事件.....	28
第 22 部分	其他事项.....	29

## 第 1 部分前言

**第一条** 依照《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国合同法》、《证券公司监督管理条例》、《证券公司客户资产管理业务管理办法》（下称《管理办法》）、《证券公司集合资产管理业务实施细则》（下称《实施细则》）等法律、行政法规和中国证监会的有关规定，管理人发起设立集合资产管理计划，委托托管人对集合计划资产进行托管。

为规范“中金增强型债券收益集合资产管理计划”（下称集合计划）运作，明确集合资产管理合同当事人的权利与义务，依照《中华人民共和国证券法》、《证券公司监督管理条例》、《中华人民共和国合同法》、《管理办法》、《实施细则》等法律、行政法规和中国证监会的有关规定，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》、《实施细则》、本合同及本合同附件《中金增强型债券收益集合资产管理计划说明书》（下称《说明书》）及其他有关规定，享有权利，承担义务。

**第二条** 委托人承诺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。

**第三条** 管理人承诺以诚实信用、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。

**第四条** 托管人承诺以诚实信用、审慎尽责的原则履行托管职责，安全保管集合计划资产，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。

**第五条** 中国证监会对本集合计划出具了无异议函/批准文件（证监许可[2008]1388号），但中国证监会对本集合计划做出的任何决定，均不表明中国证监会对本集合计划的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明参与本集合计划没有风险。

## 第 2 部分 合同当事人

### 第六条 委托人。

委托人的详细情况在各委托人分别与管理人、托管人签署的《中金增强型债券收益集合资产管理合同签署条款》(下称《签署条款》)中列示。

### 第七条 管理人名称: 中国国际金融有限公司(以下简称“中金公司”)

住所: 北京市建国门外大街1号国贸写字楼2座27层及28层(邮编: 100004)

联系地址: 北京市建国门外大街1号国贸写字楼2座27层及28层(邮编: 100004)

联系电话: 010-65051166, 传真: 010-65057589

法定代表人: 金立群

### 第八条 托管人名称: 中国建设银行股份有限公司

住所: 北京市西城区金融大街25号(邮编: 100032)

联系地址: 北京市西城区闹市口大街1号院1号楼(邮编: 100032)

联系电话: 010-67595017 传真: 010-66275830

法定代表人: 王洪章

### 第 3 部分 集合计划的基本情况

#### 第九条 名称与类型

- 1、名称：中金增强型债券收益集合资产管理计划。
- 2、类型：限定性集合资产管理计划。

#### 第十条 规模、投资范围和投资组合设计

##### 1、规模

本集合计划最低总份额为 1 亿份，目标规模 50 亿份（推广期目标规模不含参与资金利息转份额部分，存续期目标规模不含红利转份额部分）。

##### 2、投资范围

本集合计划投资的标的物为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行的公司债、国债、央行票据、金融债、企业债、可转换公司债券、分离交易的可转换公司债券、资产支持证券、短期融资券、中期票据、货币市场基金、债券型基金等固定收益品种，包括股票在内的各类证券一级市场申购，以及法律法规允许集合资产管理计划投资的其他金融工具。

##### 3、投资组合设计

固定收益品种：5 ~ 95%，包括公司债、国债、央行票据、金融债、企业债、可转换公司债券、分离交易的可转换公司债券、资产支持证券、短期融资券、中期票据、货币市场基金、债券型基金等。其中公司债投资比例为集合计划资产净值的 5 ~ 70%。除公司债之外的企业债、可转换公司债券、分离交易的可转换公司债券、资产支持证券、短期融资券、中期票据等信用类债券的投资比例不超过集合计划资产净值的 50%。

权益类资产：0 ~ 20%。本集合计划对权益类资产的投资主要是通过包括股票在内的各类证券首次发行一级市场申购来实现的，持有因在一级市场申购所形成的股票、持有股票所派发的权证、因可转换公司债券转股所形成的股票和因分离交易的可转换公司债券产生的权证等权益类资产。本集合计划不直接从二级市场买入股票、权证等权益类资产。

现金及现金等价物：5% ~ 95%。现金及现金等价物指银行存款、到期日在一年以内的政府债券。

如因包括股票在内的各类证券一级市场申购而发生投资比例超标的情况时，应在该证券可流产后 10 个交易日内将持仓比例降至许可范围内。由于本集合计划规模或市场的变化导致投资组合超过上述约定的比例不在限制之内，中金公司将在合理期限内进行调整以达到标准。

管理人应自本集合计划投资运作期开始之日起 6 个月内使集合资产管理计划的投资组合比例符合上述资产组合设计的要求。

如本集合计划成立后出现新的投资品种，或者管理人根据市场情况认为需要变更本集合计划投资范围或投资比例的，管理人可与托管人协商同意后报证监会批准，变更本集合计划的投资范围或投资比例。变更将按照本合同第 20 部分规定的程序办理。

**第十一条 存续期**

本集合计划无固定存续期限。

**第十二条** 各方同意本集合计划份额的面值为人民币壹元。

**第十三条** 单个委托人首次参与的最低金额为人民币 50,000 元，无追加参与金额限制。

**第十四条 本集合计划开始运作的条件和日期**

各方一致同意，在集合计划的推广期内，即自中国证监会批准之日起 60 天内，如果所有委托人的参与份额达到 1 亿份，委托人超过 2 人（含），经具有证券相关业务资格的会计师事务所进行验资并出具验资报告后，集合计划管理人依据《管理办法》及集合计划说明书可以决定停止集合计划的参与，报告集合计划成立，并开始运作。参与资金在推广期内产生的利息将转化成集合计划份额归委托人所有。利息金额以本集合计划注册与过户登记人的记录为准。

**第十五条** 各方一致同意，集合计划推广期满时，如果出现下列情形之一，则本集合计划设立失败：

- 1、委托人（不包括管理人）的参与份额未达到 1 亿份；
- 2、委托人数量不到 2 人；
- 3、推广期内发生使计划无法设立的不可抗力事件。

如果集合计划依据前款约定不能成立，管理人应将委托人的资金加计利息在推广期结束后 30 天内返还给委托人，各方互不承担其他责任。利息金额以本集合计划注册与过户登记人的记录为准。

## 第 4 部分 集合计划的参与

### 第十六条 参与时间

#### 1、推广期参与

本集合计划推广期自中国证监会批准设立集合计划之日开始，到推广结束之日止，最长不超过 60 日。在推广期内投资者在各推广机构的工作日内可以参与本集合计划。

若管理人决定提前结束推广期，应提前一个工作日通知推广机构和注册与过户登记人。

#### 2、存续期参与

本集合计划自成立日后 60 个工作日内开始办理参与业务。本集合计划成立后仅在开放日办理参与。

若本集合计划推广期出现超额募集情况，则将暂停办理参与业务，直至集合计划规模低于募集上限后恢复办理参与业务。

### 第十七条 参与方式

委托人同意以下列方式参与集合计划：

1. 委托人以推广期参与的方式购买集合计划份额，同意在提出推广期参与申请的同时支付参与金额；委托人可在集合计划正式成立后到原销售网点查询成交确认结果、打印成交确认单；

2. 委托人以存续期参与的方式购买集合计划份额，同意在提出存续期参与申请的同时支付参与金额；委托人可在原销售网点查询成交确认结果、打印成交确认单。

### 第十八条 参与价格

1. 推广期参与价格：在集合计划推广期内参与，每份额的参与价格为人民币壹元；

2. 存续期参与价格：在集合计划存续期内参与本集合计划，遵循“未知价”原则，以参与申请日集合计划每份额净值作为每份额的参与价格。T 日的集合计划每份额净值在当天收市后计算，并在 T+1 个工作日通告。遇意外情况，可以适当延迟计算或通告。

### 第十九条 参与费率、净参与金额及参与份额计算

净参与金额及参与份额的具体计算方式参见《说明书》第 4 部分和第 13 部分。

### 第二十条 参与程序

委托人须在推广机构指定的场所参与本计划，提出集合计划参与申请，签订合同，并须按推广机构规定的方式全额缴纳参与资金。

### 第二十一条 参与确认

委托人提交参与集合计划申请日（T 日）后，注册与过户登记人在 T+1 日对委托人申请进行确认并为委托人办理增加权益的登记手续，但委托人的申请因不符合法律、法规、本合同及其说明书的规定被拒绝参与的情形除外。对于推广期参与的委托人，可在集合计划正式成立后到原推广场所查询最终的成交确认情况、打印成交确认单；对于存续期参与的委托人，可在 T+2 个工作日之后（包括该日）向原推广场所查询参与申请的成交情况、打印成交确认单。

### 第二十二条 参与的注册登记

委托人参与成功后，注册与过户登记人在 T+1 日为委托人登记权益并办理注册登记手续，委托人自 T+2 日后的开放日起有权退出该部分集合计划份额。

### 第二十三条 暂停和拒绝参与的情形

如出现《说明书》第 13 部分第九条规定的情形，集合计划管理人可以拒绝或暂停集合计划委托人的参与申请。

## 第 5 部分 管理人自有资金参与

**第二十四条** 管理人保留在本集合计划存续期内以自有资金参与本集合计划的权利。管理人以自有资金参与本集合计划的，应当符合法律、行政法规和中国证监会的规定以及本合同的约定。

**第二十五条** 管理人自有资金参与并持有本集合计划的份额不得超过集合计划总份额的 20%。因集合计划规模变动等客观因素导致管理人自有资金参与集合计划被动超限的，管理人应在 10 个开放日内退出超限部分的参与份额。

**第二十六条** 管理人以自有资金参与集合计划份额的持有期限不得少于 6 个月。管理人有多笔自有资金参与的，按照“先进先出”原则计算管理人自有资金参与份额的持有期限。但因上条所述被动超限或下条所述解决流动性风险等原因导致参与、退出的，可不受上述持有期限限制。

**第二十七条** 为应对集合计划巨额退出，解决流动性风险，在不存在利益冲突并遵守合同约定的前提下，管理人以自有资金参与或退出可不受上条规定限制，但需事后及时告知委托人和托管人，并向管理人住所地中国证监会派出机构和中国证券业协会报告。

**第二十八条** 管理人持有的集合计划份额与委托人持有的集合计划份额享有同等权益、承担同等风险。管理人持有的集合计划份额对委托人不承担任何补偿责任。

**第二十九条** 相关风险揭示。

1. 管理人持有的集合计划份额与委托人份额享有同等权益，且不对委托人承担任何补偿责任。请投资者注意投资风险。

2. 管理人自有资金参与份额退出时，可能遭遇流动性风险，从而影响集合计划损益。管理人将认真履行职责，关注集合计划规模变动情况，尽可能控制流动性风险。

**第三十条** 管理人以自有资金参与或退出本集合计划，应当提前 5 个工作日通过管理人网站公告的方式告知委托人和托管人。但因第二十五条所述被动超限或第二十七条所述解决流动性风险等原因导致参与、退出的，管理人可在事后及时告知委托人和托管人。



## 第 6 部分 集合计划账户的开立与管理

**第三十一条** 托管人对集合计划资产单独设置账户，资金账户名称为“中金增强型债券收益集合资产管理计划”，并以管理人、托管人和集合计划联名的方式开立证券账户。账户名称以实际开立的账户名称为准。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客户资产、不同集合计划的资产相互独立。

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”）或其它符合条件的机构担任本计划的注册与过户登记人，并承担相应委托责任。注册与过户登记人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。

## 第 7 部分 集合计划资产的托管

**第三十二条** 集合计划资产由管理人、委托人委托中国建设银行股份有限公司托管，管理人已经与托管银行签订了托管协议。托管人将严格遵照有关法律法规及双方达成的托管协议对集合资产进行托管。

本合同前言中“保护集合计划资产的安全”及第四十三条中“保管集合计划的资产”是指托管人在现行证券交易、登记结算制度赋予的权限下，在本合同及托管协议约定的托管职责范围内，实现此项义务。

委托人签署本合同的行为本身即表明对现行证券交易、登记结算制度下托管人托管职能有充分的了解，并接受本合同约定的托管职责和范围。

## 第 8 部分 集合计划费用

**第三十三条 投资交易费用。**本集合计划应按规定比例在发生投资交易时计提并支付经手费、证管费、过户费、印花税、席位费和证券结算风险基金等，直接计入当期费用；

本集合计划向所租用交易单元的券商支付佣金（该佣金已扣除风险金），其费率由管理人根据有关政策法规确定，并在发生投资交易时按每笔成交金额计提，在每季度首日起 10 个工作日内依据管理人划款指令支付给提供交易单元的券商。

**第三十四条 托管费。**各方同意本集合计划应给付托管人托管费，按前一日的资产净值的 0.2% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的托管费；

E 为前一日的集合计划资产净值。

托管人的托管费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付，由托管人于次月首日起 5 个工作日内依据管理人划款指令从本集合资产管理计划资产中一次性支取。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

**第三十五条 管理费。**本集合计划应给付管理人管理费，按前一日的资产净值的 0.75% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.75\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的管理费；

E 为前一日集合计划资产净值。

管理人的管理费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付，由托管人于次月首日起 5 个工作日内依据管理人划款指令从本集合计划资产中一次性支付给管理人，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

**第三十六条 费用调整。**集合计划管理人和托管人可磋商酌情变更集合计划管理费和托管费，变更将按照本合同第 20 部分规定的程序办理。

**第三十七条 与本集合计划相关的审计费。**在存续期间发生的集合计划审计费用，在合理期间内摊销计入集合计划。

本集合计划的年度审计费，按与会计师事务所签订协议所规定的金额，在被审计的会计期间，按直线法在每个自然日内平均摊销。

**第三十八条 其他事项。**银行结算费用、银行账户维护费、银行间市场账户维护费、开户费、银行间交易相关维护费、转托管费等集合计划运营过程中发生的按照国家有关规定可以计入集合计划费用的相关费用。

银行结算费用、银行账户维护费，在发生时一次计入集合计划费用；

银行间市场账户维护费，按银行间市场规定的金额，在相应的会计期间按日平均摊销或一次性计入费用；

开户费、银行间交易相关维护费、转托管费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，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，并且可以对应到相应会计期间，必须在该会计期间内按直线法摊销。

**第三十九条 集合计划的税收。**

本集合计划运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律法规执行。

## 第 9 部分 投资收益与分配

**第四十条 收益的构成。**本集合计划的投资收益由红利、股息、债券利息、基金红利、买卖证券价差、银行存款利息以及其他合法收入构成。集合计划的净收益为集合计划的收益扣除按照国家有关规定及本合同约定可以在集合计划收益中扣除的费用后的余额。

**第四十一条 收益分配原则和方式。**各方一致同意实施收益分配时应遵循以下原则：

- 1、每份集合计划单位享有同等分配权；
- 2、当年收益先弥补上一年度亏损后，方可进行当年收益分配；
- 3、如果投资当期出现净亏损，则不进行收益分配；
- 4、收益分配后单位净值不能低于面值；
- 5、在符合有关分红条件的前提下，净收益每年至少分配一次，但若成立不满三个月可不进行收益分配，年度分配在当年会计年度结束后的四个月内完成；
- 6、委托人可以选择收益分配方式为现金或再投资于本集合计划，委托人可以修改分红方式。选择采取红利再投资方式的，分红资金按分红实施日次日的单位净值转成相应的集合计划单位（红利再投资不受本计划份额上限的限制）；选择现金方式的，将现金分红划入委托人指定银行账户；
- 7、年度收益分配比例不低于年度可分配收益的60%；
- 8、红利分配时所发生的银行转账等费用由管理人承担；
- 9、法律、法规或监管机关另有规定的，从其规定。

**第四十二条 收益分配方案。**各方一致同意本集合计划收益分配方案由管理人拟定，包括集合计划收益的范围、集合计划净收益、分配对象、分配原则、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容，由托管人核实后确定，通过推广场所通告投资者。

## 第 10 部分 集合计划的信息披露

**第四十三条 定期报告。**包括集合计划净值通告、对账单、集合资产管理计划的季度（年度）资产管理报告、季度（年度）托管报告和年度审计报告。

1、集合计划净值通告。每开放日披露截止前一个开放日的经过托管人审核的集合计划的每份额净值。

2、对账单。集合计划存续期间，管理人应当按照说明书的约定每季度向委托人提供对账单，说明委托人持有集合计划份额的数量及净值，期间参与、退出明细以及收益分配等情况。

3、集合计划的季度资产管理报告和季度托管报告。管理人、托管人分别在每季度结束之日起 15 日（以《实施细则》规定的工作日计算，不含法定节假日）内向委托人提供季度资产管理报告和季度托管报告。资产管理报告对报告期内集合计划资产的配置状况、价值变动情况做出说明；托管报告对报告期内集合计划资产的托管情况做出说明。集合计划季度资产管理报告的财务数据经托管人审核并出具意见。季度报告应报中国证券业协会备案，同时抄送管理人住所地中国证监会派出机构。

4、集合计划的年度资产管理报告和年度托管报告。管理人、托管人在每年度结束之日起 3 个月内向委托人提供年度资产管理报告和年度托管报告。资产管理报告对报告期内集合计划资产的配置状况、价值变动情况做出说明；托管报告对报告期内集合计划资产的托管情况做出说明。年度资产管理报告的财务数据经托管人审核并出具意见。年度报告应报中国证券业协会备案，同时抄送管理人住所地中国证监会派出机构。

5、管理人聘请会计师事务所对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委托人和托管人，并报中国证券业协会备案，同时抄送管理人住所地中国证监会派出机构。

### **第四十四条 信息披露文件的存放与查阅**

经过托管人审核的集合计划净值通告、集合资产管理季度报告和托管季度报告、集合资产管理年度报告和托管年度报告及其他临时通告放置于管理人网站（www.cicc.com.cn）供委托人查阅。

### **第四十五条 重大事项披露和披露方式**

本集合计划存续期间，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，如集合计划分红、决定终止计划、更换计划托管人、变更投资主办人员、变更推广机构、巨额退出并导致延期退出以及托管人或管理人认为需披露的其他事项，管理人将通过管理人的网站（www.cicc.com.cn）等多种方式在重大事项发生之日起两个工作日内通告委托人，并及时向管理人住所地中国证监会派出机构报告；其中，如果管理人将集合计划的资产投资于管理人、及与管理人有关联方关系的公司发行的证券，管理人将按照法律法规及中国证监会的有关规定，在首次交易完成之日起 2 个工作日内同时向交易所报告。

## 第 11 部分 委托人的权利与义务

### 第四十六条 委托人的权利

- 1、取得集合计划收益；
- 2、依据本合同知悉有关集合计划投资运作的信息，包括集合计划的资产配置、投资比例、损益状况等；
- 3、按照本合同的约定，参与、退出集合计划；
- 4、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。

### 第四十七条 委托人的义务

- 1、承诺委托资金的来源及用途合法，向管理人如实提供财务状况及投资意愿等基本情况；
- 2、自然人委托人不得用筹集的他人资金参与集合计划；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，应当提供合法筹集资金的证明文件；
- 3、按照本合同约定划付委托资金，承担相应税费，支付合同约定的管理费、托管费和其他费用；
- 4、按本合同约定承担集合计划可能的投资损失；
- 5、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。

## 第 12 部分 管理人的权利与义务

### 第四十八条 管理人的权利

- 1、根据本合同的约定，独立运作集合计划的资产；
- 2、根据本合同的约定，收取管理费；
- 3、按照本合同的约定，停止或暂停办理集合计划的参与，暂停办理集合计划的退出事宜；
- 4、根据本合同的约定，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、法律、行政法规、中国证监会有关规定及本合同约定的其他权利。

### 第四十九条 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，为委托人的最大利益服务，按照本合同约定的投资比例和投资限制，以专业技能管理集合计划的资产；
- 2、不得向委托人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；
- 3、不得挪用集合计划资产；
- 4、建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度；
- 5、根据中国证监会有关规定、本合同和托管协议的约定，接受托管人的监督；
- 6、管理人负责集合资产管理计划资产净值估值等会计核算业务，编制集合资产管理计划财务报告，并接受托管人的复核；
- 7、按规定出具资产管理报告，保证委托人能够及时了解有关集合计划资产投资组合、资产净值、费用与收益等信息；
- 8、保守集合计划的商业秘密，在集合计划有关信息向委托人披露前，不泄露集合计划的投资安排、投资意向等信息（法律、行政法规、中国证监会另有规定或相关司法部门、监管机构另有要求的除外）；
- 9、按照本合同约定向委托人分配集合计划的收益；
- 10、依法对托管人的行为进行监督，如发现托管人违反法律、行政法规和中国证监会的规定，或者违反托管协议的，应当予以制止，并及时报告住所地中国证监会派出机构；
- 11、按照有关法律、行政法规、中国证监会有关规定及《说明书》的约定，指定注册与过户登记人办理集合计划的开户登记事务及其他与注册登记相关的手续；
- 12、按照法律、行政法规、中国证监会有关规定和本合同的约定，及时向申请退出集合计划的委托人支付委托资金及收益款项；
- 13、按相关法律法规规定年限妥善保存与集合计划有关的合同、协议、推广文件、交易记录、会计账册等文件、资料；
- 14、在集合计划到期或因其他原因终止时，妥善处理有关清算和委托人资产的返还事宜；
- 15、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、托管人和中国证监会报告；
- 16、因自身或其代理人的过错造成集合计划资产损失的，向委托人承担赔偿责任；
- 17、因托管人过错造成集合计划资产损失时，代委托人向托管人追偿；
- 18、因管理人单方面解除本合同给委托人、托管人造成经济损失时，对委托人、托管人予以赔偿；
- 19、法律、行政法规、中国证监会有关规定及本合同约定的其他义务；
- 20、每一会计年度结束后，聘请会计师事务所对本集合计划的运营情况进行单项审计，并将审计结果报证监会派出机构备案，报送托管人，同时向委托人披露。
- 21、在与关联方发生交易行为时，公平对待关联方及非关联方。





## 第 13 部分 托管人的权利与义务

### 第五十条 托管人的权利

- 1、对集合计划资产进行托管，依法保管集合计划的资产；
- 2、按照本合同的约定收取托管费；
- 3、依据《管理办法》、《实施细则》、《托管协议》及本合同的规定监督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、行政法规、中国证监会的有关规定或者本合同约定的，要求其改正，或拒绝执行；
- 4、查询集合计划的经营运作情况；
- 5、法律、行政法规、中国证监会有关规定及本合同、《托管协议》约定的其他权利。

### 第五十一条 托管人的义务

- 1、遵循诚实信用、勤勉尽责的原则安全保管集合计划的资产、办理资金收付事项；非依法律、行政法规和中国证监会有关规定或合同约定，不得擅自动用或处分集合计划资产；
- 2、依法为每个集合计划开立专门的资金账户和专门的证券账户；
- 3、复核、审查管理人计算的集合计划的资产净值；
- 4、负责集合计划投资活动的清算交割，执行管理人的指令，负责办理集合计划名下的资金往来；
- 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、行政法规、中国证监会的有关规定或者本合同约定的，应当要求其改正；未能改正的，应当拒绝执行(依据交易程序已经生效的指令除外)，并向管理人住所地中国证监会派出机构报告；
- 5、保守集合计划的商业秘密，在集合计划有关信息向委托人披露前予以保密，不向他人泄露（法律、行政法规、中国证监会另有规定或相关司法部门另有要求的除外）；
- 6、按规定出具集合计划托管报告；
- 7、按相关法律法规规定年限妥善保存与集合计划有关的合同、协议、交易记录、会计账册等文件、资料；
- 8、在集合计划到期或因其他原因终止时，协同管理人进行必要的清算活动；
- 9、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；
- 10、因过错导致集合计划资产损失的，向委托人承担赔偿责任；
- 11、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；
- 12、因托管人单方解除本合同给委托人、管理人造成经济损失的，对委托人、管理人予以赔偿；
- 13、法律、行政法规、中国证监会有关规定和本合同、《托管协议》约定的其他义务。

## 第 14 部分 集合计划存续期间委托人的退出

### 第五十二条 退出办理的场所

本集合计划在存续期的退出将通过集合计划推广机构在推广机构指定的场所进行。

### 第五十三条 退出办理的开放日及时间

#### 1、开放日及开放时间

本集合计划成立后在开放日办理参与和退出。具体为集合计划成立后自首次办理参与或退出业务起的每个工作日。上海证券交易所和深圳证券交易所同时开放交易日为本集合计划的工作日。具体业务办理时间以推广机构公布时间为准。

若出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更或其他特殊情况，集合计划管理人将视情况对前述开放日及具体业务办理时间进行相应的变更，变更将按照本合同第 20 部分规定的程序办理。

#### 2、退出的开始时间

本集合计划的退出自本集合计划成立日后 60 个工作日起开始办理。

管理人最迟于该开始日三个工作日前通过推广机构通知委托人。

### 第五十四条 退出的原则

1、“未知价”原则，即退出集合计划的价格以退出日（T 日）收市后计算的单位净值为基准进行计算，并在 T+1 日公告。遇特殊情况，经管理人和托管人一致同意，可以适当延迟计算和公告；

2、“份额退出”原则，即退出以份额申请；

3、“先进先出”原则，即委托人先退出较早参与的份额；

4、集合计划管理人可根据集合计划运作的实际情况并在不影响委托人实质利益的前提下变更上述原则，变更将按照本合同第 20 部分规定的程序办理。

5、除非巨额退出，退出一般不受限制。

### 第五十五条 退出申请的款项支付

集合计划退出的登记结算将按照注册与过户登记人（中国证券登记结算有限责任公司）的有关规定办理。

若注册与过户登记人确认委托人退出申请成功后，集合计划管理人应指示集合计划托管人于 T+3 日内将退出款项从集合计划托管专户划出。推广机构收到退出款后于两个工作日内划往退出委托人指定的银行账户。在发生巨额退出的情形时，款项的支付办法参照《说明书》的有关条款处理。

### 第五十六条 退出的价格和费用

1、退出价格：为受理申请日（T 日）收市后计算的单位净值。

2、本集合计划的退出费率按照持有时间递减，即相关集合计划份额持有时间越长，所适用的退出费率越低，退出费用等于退出金额乘以所适用的退出费率。实际执行的退出费率在《说明书》第 13 部分中载明。

### 第五十七条 退出的注册登记

1、委托人退出集合计划成功后，注册与过户登记人在 T+1 日为委托人扣除权益并办理扣除权益的注册登记手续。

2、管理人可在法律法规允许的范围内，对上述注册登记办理时间进行变更，变更将按照本合同第 20 部分规定的程序办理。

### 第五十八条 拒绝或暂停退出的情况及处理方式

如出现《说明书》第 13 部分第九条规定的情形，集合计划管理人可以拒绝接受或暂停集合计划委托人的退出申请。

### 第五十九条 巨额退出的认定及处理方式

当出现巨额退出时，集合计划管理人可以根据本集合计划当时的资产组合状况决定全额退出、部分顺延退出、暂停接受退出申请或延缓支付退出款项。具体的认定及处理方式请参见《说明书》第 13 部分。

## 第 15 部分 集合计划终止和清算

### 第六十条 集合计划的终止

集合计划的终止是指由于约定情形的出现,管理人清算集合计划资产并将集合计划剩余资产按一定标准返还给委托人,同时注销该集合计划的行为。

本集合计划终止时,管理人和托管人应该遵照中国证监会相关规定或指示,采取必要和适当的措施将本集合计划资产中的现金投资以及任何相关权利凭证和权利证明转给委托人或者委托人以书面形式指定的其他人。

如果因任何原因托管人退出本计划或不能履行有关义务,管理人应立即寻找其他有资格的托管人进行替代,管理人应在尽可能短的时间内与新的托管人签署托管协议,并完成有关法律手续以确保新的托管人承担本计划项下的有关托管义务。委托人和管理人在此期间应继续履行本合同项下的有关义务。

各方一致同意,出现下列情形之一时,本集合计划应当终止:

- 1、 管理人因重大违法、违规行为,被中国证监会取消业务许可的;
- 2、 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;
- 3、 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;
- 4、 存续期内,集合计划净值低于人民币 3000 万元时,管理人有权公告终止并清算本集合计划;
- 5、 存续期内,任一开放日集合计划委托人少于 2 人时;
- 6、 不可抗力发生导致本集合计划不能存续;
- 7、 法律、法规规定或中国证监会规定的其他情况。

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。

### 第六十一条 集合计划的清算

本集合计划终止的,管理人和托管人应当在扣除管理费、托管费等费用后,将集合资产按照委托人拥有份额的比例,以货币形式分配给委托人。

资产清算主体:本集合计划终止后,由管理人负责本集合计划的资产清算,托管人协同管理人进行必要的清算活动。

清算程序:管理人应按以下程序进行:

- 1、 当本集合计划终止后,对计划资产进行清理和确认;
- 2、 对资产进行评估和变现;
- 3、 聘请具有证券从业资格的会计师事务所进行审计;
- 4、 将清算结果报告中国证监会;
- 5、 将清算结果报告委托人;
- 6、 对资产进行分配。

清算费用是指管理人在进行资产清算过程中发生的所有合理费用,清算费用由管理人优先从清算资产中支付。

本集合计划终止的,管理人应当在发生终止情形之日起 5 日内(以《实施细则》规定的工作日计算,不含法定节假日)将终止情况向委托人披露并开始清算集合计划资产;清算过程中如发生重大事项须及时报告委托人和管理人住所地中国证监会派出机构及中国证券业协会。

管理人应当在清算结束后 15 日内(以《实施细则》规定的工作日计算,不含法定节假日),将清算结果报告委托人并报中国证券业协会备案,同时抄送住所地中国证监会派出机构。

计划清算账册及有关文件由托管人按相关法律法规规定年限妥善保存。

## 第 16 部分 不可抗力

**第六十二条** 本合同中的不可抗力指遭受不可抗力事件一方不能预见，不能避免，不能克服的客观情况，包括但不限于洪水、地震及其它自然灾害、战争、骚乱、火灾、突发性公共卫生事件、政府征用、没收、法律法规变化、突发停电或其他突发事件、注册与过户登记人非正常的暂停或终止业务、证券交易所非正常暂停或停止交易、中国人民银行以及其它机构的结算系统发生故障等。管理人或托管人因不可抗力不能履行本合同时，应及时通知其他各方并采取适当措施防止委托人损失的扩大。

由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误，有关会计制度变化、管理人或托管人托管业务系统出现重大故障或由于其他不可抗力原因，管理人和托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误而造成的份额净值计算错误，管理人、托管人可以免除赔偿责任。但管理人、托管人应积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

## 第 17 部分 违约责任与争议处理

### 第六十三条 违约责任

1、 由于本合同一方当事人的过错，造成本合同不能履行或者不能完全履行的，由有过错的一方承担违约责任；如属本合同多方当事人的过错，根据实际情况，由多方当事人分别承担各自应负的违约责任。

2、 各方同意发生下列情况对集合计划资产造成损失时，当事人可以免责：

(1) 不可抗力的发生；

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

(3) 在没有欺诈或过失的情况下，管理人对按照本合同规定的投资原则行使或不行使其投资权而造成的损失。

3、 本合同当事人违反合同规定，给其他当事人造成直接损失的，应进行赔偿。

4、 因当事人之一违约而导致其他当事人损失的，委托人应先于其他受损方获得赔偿。

5、 因违约方有欺诈、重大过失或通过关联交易输送利益等恶意违约行为使集合计划资产遭受损失，其责任由违约方承担。

6、 在委托人的集合计划资产被司法机关或其他政府机构扣押和查封的情况下，管理人和托管人没有义务代表委托人就针对集合计划资产所提起的司法或行政程序进行答辩，但是可以提供必要的协助。

7、 如本计划资产违反本合同约定的投资比例投资于流通受限证券而产生流动性风险，托管人不承担损失赔偿责任。

8、 如本计划违反法律法规的相关规定投资于存在关联关系的股票，托管人不承担损失赔偿责任。

### 第六十四条 责任划分

1、 如果管理人和托管人其中一方违约，给集合计划资产造成损失的，应由违约方就直接损失进行赔偿，另一方可接受计划参与人委托向违约方追偿；如果管理人和托管人两方都违反合同，给集合计划资产造成损失的，应根据实际情况，由双方分别承担各自应负的违约责任，双方互不承担连带赔偿责任。

2、 在本合同履行过程中，除托管人因侵占、挪用或有其他重大过失而造成集合计划资产损失外，托管人对全体委托人及集合计划承担的赔偿责任最高限额为托管人就履行本合同已经获取的收入总额。

**第六十五条** 在发生违约的情况下，本合同能继续履行的，应当继续履行。

**第六十六条 争议的处理。** 因本合同引起的或与本合同有关的任何争议，由合同签订各方协商解决，协商不成的，合同签订各方一致同意将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会并按其仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为北京。

## 第 18 部分 风险揭示

**第六十七条** 委托人投资于本集合计划可能面临以下风险，有可能因下述风险导致委托人本金或收益损失。管理人承诺以诚实信用，谨慎勤勉的原则管理和运用集合计划资产，管理人与托管人均制定并执行相应的内部控制制度和风险管理制度，以降低风险发生的概率。但这些制度和办法不能完全防止风险出现的可能，管理人不保证集合计划一定盈利，也不保证最低收益。

### （一）市场风险

本集合计划主要投资于证券市场，而证券市场价格因受各种因素的影响而引起的波动将对本集合资产管理计划资产产生潜在风险，主要包括：

#### 1、政策风险

货币政策、财政政策、产业政策、地区发展政策等国家政策的变化对证券市场产生一定的影响，导致市场价格波动，影响集合资产管理计划收益而产生风险。

#### 2、经济周期风险

证券市场是国民经济的晴雨表，而经济运行具有周期性的特点。宏观经济运行状况将对证券市场的收益水平产生影响，从而产生风险。

#### 3、利率风险

金融市场利率波动会导致股票市场及债券市场的价格和收益率的变动，同时直接影响企业的融资成本和利润水平。集合计划投资于股票和债券，收益水平会受到利率变化的影响。

#### 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、新股/新债申购风险

新股/新债申购风险是指获配新股/新债上市后其二级市场交易价格下跌至申购价以下的风险。由于网下获配新股有一定的锁定期，锁定期期间股票价格受各种市场因素、宏观政策因素等的影响，股票价格有可能下跌到申购价以下。

#### 6、购买力风险

本集合计划投资的目的是使集合计划资产保值增值，如果发生通货膨胀，集合计划投资于证券所获得的收益可能会被通货膨胀抵消，从而影响集合计划资产的保值增值。

#### 风险防范措施：

本集合计划对投资范围和投资比例进行明确限制，通过承担适当的市场风险以获取投资收益。

管理人将基于宏观经济和上市公司的深入研究，应用相关投资经验与投资技术，在本说明书与合同约定范围内，制定合理的资产配置策略与投资决策，及时根据市场发展情况调整组合，减少市场风险对投资收益的影响。

托管人将根据托管协议的规定，对管理人投资行为进行监督，降低因管理人违反本合同规定投资而产生超出本集合计划承受范围之外的市场风险。

### （二）流动性风险

指集合计划资产不能迅速转变成现金，或者转变成现金会对资产价格造成重大不利影响的风险。在计划存续期间，可能会发生个别偶然事件，如出现巨额退出的情形，短时间客户大量退出或出现集合计划到期时，证券资产无法变现的情况，上述情形的发生在特殊情况时可能会出现交易量急剧减少的情形，此时出现巨额退出，则可能会导致计划资产变现困难，从而产生流动性风险，甚至影响本计划单位净值。

流动性风险按照其来源可以分为两类：外生流动性风险和内生流动性风险。

#### 1、外生流动性风险

所谓外生流动性风险指的是由于来自资产管理人外部冲击造成证券流动性的下降，这样的外部冲击可能是影响所有证券的事件，也可能只是影响个别证券的事件，但是其结果都是使得所有证券、某类证券或者单只证券的流动

性发生一定程度的降低，造成证券持有者可能增加变现损失或者交易成本。

## 2、内生流动性风险

所谓内生流动性风险是指由于本集合计划组合的资产需要及时调整仓位而面临的不能按照事前期望价格成交的风险，该风险可以以本集合资产管理计划资产变现（或购买证券）时成交价格小于（或大于）事前期望价格所产生的最大成本来度量。内生流动性风险在一定程度上是可控的，但其可控程度取决于流动性风险的来源及外部冲击。

### 风险防范措施：

本集合计划管理人将保留一定的现金或现金等价物，托管人根据合同约定监督集合计划投资比例，以保持组合的较高流动性，满足委托人退出需求。

当出现巨额退出情况时，管理人将尽可能采用全额退出方式，若管理人认为支付委托人的退出申请有困难或认为支付委托人的退出申请可能会对集合计划的资产净值造成较大波动时，为保护委托人利益，管理人可采取部分顺延方式，并及时通知委托人。具体退出方式及退出顺序参见《说明书》第13部分。

## （三）管理风险

本集合计划为动态管理的投资组合，存在管理风险。

管理人在管理本集合计划，做出投资决定的时候，会运用其投资技能和风险分析方法，但是这些技能和方法不能保证一定会达到预期的结果。

管理人在管理本计划时，管理人的内部控制制度和风险管理制度可能没有被严格执行而对集合计划资产产生不利影响，特别是可能出现本集合计划资产与管理人自有资产、或管理人管理的其他集合计划资产之间产生利益输送。

### 风险防范措施：

管理人运作本集合计划过程中将采取严格的防火墙措施、独立会计核算制度和反向交易限制，防止本集合计划资产与管理人自有资产、或管理人管理的其他集合计划资产之间产生利益输送问题。

本集合计划聘请第三方独立审计师，定期对本集合计划投资与运作情况进行审计，检查管理人各项相关内部控制制度和风险管理制度是否得到有效执行，并向监管机构与委托人提供审计意见。

## （四）信用风险

集合计划在交易过程中可能发生交收违约或者所投资债券的发行人违约、拒绝支付到期本息的情况，从而导致集合计划财产损失。

### 风险防范措施：

管理人将严格控制所投资债券的信用等级，并选择商业信誉好的交易对手，以降低信用风险。

## （五）本集合计划投资公司债的风险

本集合计划资产投资于公司债面临的风险主要有：

1. 利率风险：利率提高时，公司债价格就降低；公司债的剩余期限越长，利率风险越大。
2. 信用风险：若发行债券的公司不能按时支付债券利息或偿还本金，将给公司债投资带来信用风险损失。
3. 流动性风险：由于市场整体流动性相对不足，可能导致所投资的公司债不能迅速转变成现金，或者不能应付可能出现的投资者大额赎回，从而对资产净值造成不利影响。
4. 再投资风险：若购买短期、低利率公司债而没有购买长期、高利率公司债，则在短期债券到期收回现金时，可能找不到原本可以购买的高利率债券，从而产生再投资风险。
5. 回收性风险：当市场利率下降时，此前发行的有回收性条款的高息公司债，就有可能被强制收回，产生回收性风险。
6. 通胀风险：通货膨胀会使货币实际购买力下降，通胀期间，实际利率是票面利率扣除通胀率。

上述风险可能导致本集合计划资产因投资于公司债而产生投资损失，从而对本集合计划份额净值带来不利影响。

### 风险防范措施：

针对利率、再投资风险和通胀风险，管理人将分散投资，购买不同期限、不同品种公司债；针对流动性风险，管理人将尽量选择交易活跃的公司债；针对信用和回购风险，管理人将在选择公司债时尽可能了解公司盈利和偿债能力。管理人将权衡风险与收益，选择经营状况佳、信誉好的公司债券；同时在持有债券期间，对发债公司保持足

够关注，以尽可能避免因投资公司债而带来的风险。

#### （六）本集合计划投资可转换公司债券的风险

本集合计划投资于可转换公司债券面临的风险，除上述投资公司债的风险外，还包括：

1. 到期不能转股的风险：股票价格不仅受公司盈利水平和发展前景的影响，而且受国家宏观经济形势及政治、经济政策、投资者的投资偏好、投资项目预期收益等因素的影响。如果因公司股票价格走势低迷或可转换公司债券持有人的投资偏好等原因有可能导致可转换公司债券到期未能实现转股。

2. 到期转股不经济的风险：股票价格可能会由于公司未来经营状况或市场大势变化而产生波动，并有可能在转股期内公司股价无法达到转股价格。尽管仍可将其所持可转换公司债券转换为公司流通股，但可能无法实现原本预期的资本利得。

3. 可转换公司债券自身特有风险：可转换公司债券作为一种复合型衍生金融产品，具有股票与债券的双重特性，其二级市场价格受到市场利率、票面利率、剩余期限、转股价格、上市公司股票价格、赎回条款及回售条款、投资者的心理预期等诸多因素的影响，因此价格波动较为复杂，甚至可能会出现异常波动或与其投资价值严重背离的现象，使投资面临较大风险。

风险防范措施：

除上述投资公司债的风险防范措施外，针对可转换公司债券上述风险特征，管理人将加强对可转换公司债券的研究，控制可转换公司债券的总体投资比例和市场风险暴露。对于因申购获配的可转换公司债券将在可流通过后尽早卖出，减少二级市场风险。

#### （七）本集合计划投资分离交易的可转换公司债券的风险

分离交易的可转换公司债券中的债券和认股权证两种金融工具一次发行、分离上市交易，对集合计划资产而言同时面临债券及认股权证的投资风险。

##### ● 债券风险

1. 利率风险：分离出的公司债作为一种固定收益的金融工具，其二级市场价格变动一般与利率水平变化呈反向变动，因此，未来市场利率的变化将直接影响债券二级市场交易价格。

2. 违约风险：公司债存续期如果出现对发行人经营管理和偿债能力有重大负面影响的事件，将有可能影响债券利息和本金的支付。

3. 市场流动性风险：由于债券的特殊性，可能会出现二级市场交易不活跃甚至出现无法持续成交的情况，从而使债券缺乏流动性，导致投资回报无法顺利实现。

4. 未提供担保的风险：对符合不设担保条件的分离交易的可转换公司债券，由于未提供担保措施，如果发行人生产经营发生重大变化，债券可能因未提供担保而增加风险。

##### ● 认股权证风险

1. 标的证券价格发生不利变动的风险：认股权证的标的证券如为A股股票，当市场环境、发行人经营状况等发生不利变化时，会造成公司股票价格波动，影响认股权证的价格，从而可能给认股权证的投资造成损失。

2. 认股权证价格下跌的风险：认股权证持有人可以在行权期按行权价格认购公司股票，如果公司股票价格不断下降，则认股权证内在价值也将不断下降；如果在公司股票价格低于行权价格时，认股权证内在价值将为零。

3. 认股权证价格波动风险：影响认股权证价格的因素通常包括但不限于：宏观经济环境、标的证券价格、标的证券价格波动幅度、股息、利率、权证存续期、发行人经营状况等多种因素，以上各种因素的变化可能导致认股权证价格发生大幅变动。同时认股权证具有杠杆效应，其波动幅度往往超过标的证券价格的波动幅度。因此投资于认股权证的风险通常会高于投资于标的证券的风险。

4. 市场操纵风险：由于认股权证的杠杆效应，不能排除市场上的某些投资者试图通过操纵标的证券价格，在认股权证市场套利的情况。当出现这种情况时，认股权证价格可能出现剧烈波动，从而使认股权证投资遭受重大损失。

风险防范措施：

除上述投资公司债的风险防范措施外，针对分离交易的可转换公司债券的风险特征，管理人将根据本集合计划约定的投资限制，及时卖出高风险的认股权证，以风险预防与风险分散相结合的动态风险管理方式，权衡风险与收



益，选择经营状况佳、信誉好的发行主体，严格控制投资比例。

#### **(八) 合规性风险**

指集合计划管理或运作过程中，违反国家法律、法规的规定，或者集合计划投资违反法规及本合同有关规定的风险。

风险防范措施：

本集合计划由托管人根据《说明书》、本合同约定以及托管协议的规定对资金划拨和管理人投资管理过程进行监控，监督投资交易是否违反相关法律、法规和本合同的规定，降低合规性风险。

#### **(九) 委托人认知风险**

可能存在由于委托人对本计划缺乏足够的认知和了解而造成的投资偏离预期的风险。

#### **(十) 其它风险**

1、计划管理人、托管人因重大违法、违规行为，被中国证监会取消业务资格等而导致本集合计划终止的风险；  
2、计划管理人、托管人因解散、破产、撤销等原因不能履行相应职责导致本集合计划终止的风险；  
3、突发偶然事件的风险：指超出集合计划管理人自身直接控制能力之外的风险，可能导致集合计划或集合计划委托人利益受损。

其中“突发偶然事件”指任何无法预见、不能避免、无法克服的事件或因素，包括但不限于以下情形：

- (1) 发生可能导致集合计划短时间内发生巨额退出的情形；
  - (2) 集合计划终止时，证券资产无法变现的情形；
  - (3) 相关法律法规的变更，直接影响集合计划运行；
  - (4) 交易所停市、上市证券停牌，直接影响集合计划运行；
  - (5) 无法预测或无法控制的系统故障、设备故障、通讯故障。
- 4、管理人操作或者技术风险、电力故障等都可能对本集合计划的资产净值造成不利影响；
- 5、因集合计划业务快速发展而在制度建设、人员配备、内控制度建立等方面不完善而产生的风险；
- 6、因人为因素而产生的风险，如内幕交易、欺诈行为等产生的风险；
- 7、对主要业务人员如投资经理的依赖而可能产生的风险；
- 8、因业务竞争压力而可能产生的风险；
- 9、金融市场危机、行业竞争、代理商违约、托管银行违约等超出集合计划管理人自身直接控制能力外的风险可能导致集合计划或者集合计划委托人利益受损；
- 10、战争、自然灾害等不可抗力因素的出现，将会严重影响证券市场的运行，可能导致集合计划资产的损失。

## 第 19 部分 合同的签署和附件

**第六十八条** 委托人、管理人及托管人签署《签署条款》即视为同意并接受本合同的条款。本合同于《签署条款》生效时对各当事人产生效力。

**第六十九条** 本合同的附件《说明书》及《签署条款》是本合同不可分割的组成部分，与本合同具有同等法律效力。

## 第 20 部分 合同的补充、修改与变更

**第七十条** 本合同签署后，因法律、法规、规章、中国证监会的规定、证券登记结算机构业务规则以及证券交易所等交易规则修订，自该修订生效之日起，本合同相关内容及条款按该修订办理并在管理人网站公告。委托人特此授权管理人经与托管人协商，可以对本集合计划合同及说明书与新的法律法规或有关政策不一致的内容进行更新或修改，更新或修改的内容不得违反法律法规和中国证监会的有关规定，更新或修改的内容在管理人网站公告满 10 个工作日后生效。委托人对更新或修改的内容有异议，可在更新或修改内容生效前按照本合同的规定申请退出本集合计划。

**第七十一条** 由于其他原因需要变更合同的，管理人和托管人应以书面方式就合同变更内容达成一致，并由管理人以管理人网站公告的方式予以公布并征询委托人意见。委托人不同意合同变更的，应在管理人公告指定的期限内（自公告之日起不少于 10 个工作日，下称“异议期”）提出退出本集合计划的申请，管理人将按照本合同约定为其办理集合计划份额退出。委托人在异议期内未回复意见或未提出退出申请的（包括书面回复不同意合同变更但未提出退出申请的），视为委托人同意合同变更。委托人同意，无论其是否提出退出申请，按照上述约定进行的合同变更均不应被视为或裁定为管理人或托管人的违约行为。委托人在异议期内参与集合计划的，视为同意合同变更并接受变更后的合同。

**第七十二条** 合同变更自异议期届满时起生效。同意合同变更的委托人无需就合同变更与管理人、托管人另行签署变更后的合同或关于合同变更的补充协议，经管理人公告的合同变更内容自变更生效时起自动成为变更后合同的组成部分。合同变更生效后，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。

**第七十三条** 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。

## 第 21 部分 或有事件

**第七十四条** 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。

**第七十五条** 委托人在此同意，如果或有事件发生，在管理人与托管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。管理人保障委托人退出本集合计划的权利，并在届时的通告中对相关事项作出合理安排。

**第七十六条** 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。

**第七十七条** 管理人应按照监管机构的要求办理转让手续。

## 第 22 部分 其他事项

**第七十八条** 本合同未尽事宜，当事人依据有关法律、法规、规章和《说明书》的规定办理。

**第七十九条** 定义：除本合同另有定义之外，词语在本合同中使用具有与在《说明书》中使用相同的含义。

**第八十条** 管理人、托管人确认，已向委托人明确说明集合计划的风险，并不保证委托人资产本金不受损失或者取得最低收益；委托人确认，已充分理解本合同内容，自行承担风险和损失。

**委托人保证：**身份真实、准确、完整，没有汇集他人资金参与本集合计划。