



广发资管可转债量化投资集合资产管理计划  
资产管理合同



二〇一九年 月



# 目 录

一、前言	2
二、释义	3
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	9
六、集合计划的分级及相关情况	14
七、集合计划客户资产的管理方式、管理权限和运作方式	14
八、管理人自有资金参与集合计划	15
九、集合计划的成立	15
十、集合计划账户与资产	16
十一、集合计划资产托管	16
十二、集合计划的估值	16
十三、集合计划的费用	21
十四、集合计划的收益分配	23
十五、投资理念与投资策略	24
十六、投资决策与风险控制	26
十七、投资限制及禁止行为	27
十八、集合计划的信息披露	28
十九、集合计划份额的非交易过户和冻结	30
二十、集合计划的展期	31
二十一、集合计划终止和清算	32
二十二、当事人的权利和义务	33
二十三、违约责任与争议处理	37
二十四、风险揭示	38
二十五、合同的成立与生效	43
二十六、合同的补充、修改与变更	43
二十七、或有事件	44

## 一、前言

为规范广发资管可转债量化投资集合资产管理计划(以下简称“本集合计划”)运作,明确《广发资管可转债量化投资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》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》(证监会令【第151号】),以下简称《办法》)、《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》(证监会公告[2018]31号,以下简称《规定》)、《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》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《办法》、《规定》、《广发资管可转债量化投资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。

委托人和管理人承诺其知悉《中华人民共和国反洗钱法》、《金融机构客户身份识别和客户身份资料及交易记录保存管理办法》、《金融机构大额交易和可疑交易报告管理办法》等反洗钱相关法律法规的规定,将严格遵守上述规定,不会违反任何前述规定;承诺用于投资的资金来源不属于违法犯罪所得及其收益;承诺投资的资金来源和去向不涉及洗钱、恐怖融资和逃税等行为;承诺出示真实有效的身份证件或者其他身份证明文件,提供真实有效的业务性质与股权或者控制权结构、收益所有人信息等资料;承诺积极履行反洗钱职责,不借助本业务进行洗钱等违法犯罪活动。

委托人和管理人承诺,其不属于中国有权机关、联合国、欧盟或美国制裁名单内的企业或个人,不位于被中国有权机关、联合国、欧盟或美国制裁的国家和地区。

托管人承诺以诚实守信、审慎尽责的原则履行托管职责,安全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

在本说明书中除非文义另有所指，下列词语具有以下含义：

- 集合计划或本集合计划：指广发资管可转债量化投资集合资产管理计划；
- 说明书或本说明书：指《广发资管可转债量化投资集合资产管理计划说明书》；
- 《集合资产管理合同》：指《广发资管可转债量化投资集合资产管理计划资产管理合同》；
- 合同签章页：指《集合资产管理合同》的合同签章页；
- 中国证监会：指中国证券监督管理委员会；
- 管理人：指广发证券资产管理（广东）有限公司；
- 托管人：指招商证券股份有限公司；
- 推广机构：指管理人、广发证券股份有限公司；管理人可根据有关法律法规的要求，选择其他符合要求的推广机构代理销售本集合计划。若管理人认为有必要变更代理推广机构的，委托人及托管人同意管理人在管理人网站公告后即变更生效；
- 注册登记业务：指本集合计划的登记、存管、清算和交收业务，具体内容包括委托人集合计划账户管理、集合计划单位注册登记、清算及集合计划交易确认、建立并保管集合计划持有人名册等；
- 注册登记机构：指为委托人管理集合资产管理账户、办理份额注册登记、交易确认和代理发放红利、保管委托人名册等业务的专业机构；本集合计划的注册登记人为广发证券股份有限公司；
- 委托人：指“广发资管可转债量化投资集合资产管理计划”的参与者，是管理人或推广机构的客户；
- 持有人：指依据集合资产管理合同和计划说明书参与本集合计划的所有投资者；
- 普通投资者：指专业投资者之外的投资者为普通投资者；
- 专业投资者：指符合《证券期货投资者适当性管理办法》以及中国证监会、中国证券业协会、中国证券投资基金业协会等规定条件，且经管理人认定的投资者；
- 合格投资者：指具备相应风险识别能力和风险承担能力，投资于集合资产管理计划不低于一定金额且符合法律法规、部门规章以及行业自律规



	范等规定条件的自然人和法人或者其他组织；
推广期：	指集合计划自开始推广到推广完成之间的时间段，具体推广时间以本集合计划推广公告为准；本集合计划推广期间不超过 60 天；
集合计划成立日：	指管理人宣布集合计划成立的日期；
存续期限：	指集合计划成立并存续的期间；
工作日：	指上海证券交易所和深圳证券交易所的正常交易日；
开放日：	指开放日为自本集合计划成立之日起满一年后的第一个交易日（开放参与和退出），以及自集合计划成立满一年后每个季度的第 1 个交易日（开放参与和退出）
营业时间：	指集合计划推广网点正常交易日的对外营业起止时间；
T 日：	指分红、参与、退出或其他业务的申请日；
T+n 日：	指 T 日后（不包括 T 日）的第 n 个工作日；
参与：	指委托人根据集合计划的规定，在推广期或参与日申请购买集合计划单位的行为；
退出：	指委托人根据集合计划的规定，向管理人申请卖出集合计划单位的行为；
巨额退出：	指本集合计划单个开放日，集合计划净退出申请总额超过上一日集合计划总份额的 10% 时的情形；
强制退出：	指依照合同规定，由管理人发起退出持有人持有份额的行为；
集合计划收益：	指投资所得红利、买卖证券差价（包括获配新股卖出与发行价的溢价）、银行存款利息以及其他收益；
份额面值：	指集合计划份额面值，每份 1.00 元；
资产估值：	指计算评估集合计划资产和负债的价值，以确定集合计划资产净值和单位资产净值的过程；
资产总值：	指本集合计划所拥有的各类证券及票据价值、银行存款本息以及其他投资所形成的价值总和；
资产净值：	指集合计划资产总值减去负债后的价值，集合计划资产净值的计算精确到 0.01 元，小数点后第三位四舍五入；

单位资产净值：指计算日集合计划资产净值总额除以计算日集合计划单位总份额后的价值，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；

单位累计净值：指单位资产净值加集合计划成立以来单位份额总分红金额；

清算资产：指集合计划存续期结束后对集合计划资产进行清理、确认、评估、变现后的资产净值；

推广网点：指管理人、广发证券股份有限公司指定营业网点；管理人可以根据情况变化增加或者减少推广网点，并另行公告。

指定媒体：指管理人指定网站 (www.gfam.com.cn)；

不可抗力：指合同订立以后，非任何一方当事人的过失或疏忽，而发生了当事人不能预见、无法抗拒、无法避免的事件，致使合同不能按期完全履行或不能履行的情况。不可抗力包括但不限于以下情况：  
1、自然力量引起的事故如水灾、火灾、地震、海啸等；  
2、政府的行动如颁布禁令、调整法律、法规、制度或政府征用/没收等；  
3、社会异常事故如战争、罢工等；  
4、突发停电或其他突发事件；  
5、银行清算系统故障，证券交易所非正常暂停或停止交易等。

集合计划单位：指每份集合计划；

元：指人民币元。



### 三、合同当事人

#### (一) 委托人

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：

机构名称：\_\_\_\_\_ 法定代表人：\_\_\_\_\_

通信地址：\_\_\_\_\_ 邮政编码：\_\_\_\_\_

经办人姓名：\_\_\_\_\_ 身份证号码：\_\_\_\_\_

联系电话：\_\_\_\_\_ 其他：\_\_\_\_\_

#### (二) 管理人

机构名称：广发证券资产管理（广东）有限公司

法定代表人：孔维成

通信地址：广东省广州市天河区天河北路 183-187 号大都会广场 36 楼

邮政编码：510075

联系电话：（020）87555888、95575

传真：（020）87553569

#### (三) 托管人

机构名称：招商证券股份有限公司

法定代表人：官少林

通信地址：深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45楼

邮政编码：518034

联系电话：0755-82943666

#### 四、集合资产管理计划的基本情况

(一) 名称：广发资管可转债量化投资集合资产管理计划

(二) 类型：集合资产管理计划

(三) 产品类型：固定收益类产品

(四) 目标规模

本集合计划推广期规模上限为10亿元（不含参与资金利息转份额部分），存续期规模上限 15 亿份。

(五) 投资范围和投资比例

##### 1、投资范围

投资范围包括国内依法发行的股票、债券、股指期货、可转债、可交债、公募基金等品种。如法律法规或监管机构以后允许集合计划投资其他品种，本集合计划管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

##### 2、资产配置比例

(1) 股票、股票型或混合型基金(含 ETF 和 LOF 基金)、股指期货等市值占计划总资产的比例：0%-20%；

(2) 可转债、可交债等债券，以及现金类资产（包括但不限于银行定期存款、协议存款、同业存款等各类存款、货币市场基金、期限为 7 天内（含 7 天）的债券逆回购等）市值占计划总资产的比例：80%-100%；

本集合完成备案前不开展股票投资，管理人可以现金管理为目的，投资于银行各类存款、货币市场基金等。

本集合计划的建仓期为自产品成立之日起 6 个月。建仓期内，本集合计划的投资范围、投资策略应当符合合同的约定。

管理人应当在自建仓期结束后使本计划投资组合的比例符合本合同的约定。非因管理人主观因素导致突破前述比例限制的，管理人应当在流动性受限资产可出售、可转让或者恢复交易的 15 个交易日内调整至符合要求。

委托人在此同意并授权管理人可以将集合计划的资产投资于管理人、托管人及与管理人、托管人有关联方关系的公司发行的证券或承销期内承销的证券，或从事其他重大关联交易；管理人将遵循客户利益优先原则，在发生上述所列投资



证券事项时，管理人按照法律法规及中国证监会的有关规定，应当将交易结果告知托管人，同时向证券交易所报告，通过资产管理季度报告向委托人披露。

法律法规或中国证监会允许集合计划投资其他品种的，资产管理人在履行合同变更程序后，可以将其纳入本计划的投资范围。

#### **(六) 管理期限**

本集合计划管理期限为 9 年。

#### **(七) 封闭期、开放期及流动性安排**

1、封闭期：本集合计划第一个封闭期为自本集合计划成立之日起一年。封闭期内不办理参与、退出业务。

2、开放期：自本集合计划成立之日起满一年后的第一个交易日（开放参与和退出），以及自集合计划成立满一年后每个季度的第 1 个交易日（开放参与和退出）。

3、如果本集合计划合同变更或者展期等特殊情形时，管理人有权临时设置开放期，开放期的具体时间等具体安排由管理人确定，并至少提前 1 个工作日在管理人信息披露平台公布。临时开放期只允许退出，不允许参与。如果涉及合同变更、公告事宜按照合同变更通知时间等条款的要求执行。

#### **(八) 集合计划份额面值**

人民币 1.00 元。

#### **(九) 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 300,000 元，追加参与的最低金额为人民币 10,000 元。

#### **(十) 本集合计划的风险收益特征及适合推广对象**

本集合计划属中风险产品，适合稳健型及以上的普通投资者以及全部的专业投资者，同时以上投资者应是可认购本产品的合格投资者。管理人委托的其他推广机构对该产品的适当性匹配意见和标准，不得低于以上管理人评定的适当性匹配意见和标准。

#### **(十一) 本集合计划的推广**

1、推广机构

管理人、广发证券股份有限公司, 管理人可根据有关法律法规的要求, 选择其他符合要求的推广机构代理销售本集合计划。若管理人认为有必要变更代理推广机构的, 委托人及托管人同意管理人在管理人网站公告后即变更生效。

## 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, 以书面或电子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, 但不得向合格投资者之外的单位和个人募集资金, 不得通过报刊、电台、电视台、互联网等公众传播媒体或者讲座、报告会、分析会等方式向不特定对象宣传推介。

## (十二) 本集合计划的各项费用

- 1、参与费
- 2、退出费
- 3、管理费
- 4、托管费
- 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
- 8、税收

上述费用的计算详见“五、集合计划的参与和退出”以及“十一、集合计划的费用”。

## 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

在推广期内，投资者在工作日内可以参与本集合计划。

### (2) 存续期参与

投资者在集合计划开放期内的工作日可以办理参与本集合计划的业务。

## 2、参与的原则

(1) “未知价”原则，即存续期参与的价格，以受理申请当日集合计划每份额单位净值为基准进行计算；

(2) 采用金额参与的方式，即以参与金额申请；

(3) 在推广期内，当集合计划募集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。集合计划推广期参与价格为 1.00 元，等同于面值。

## 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，并在交易账户备足认购/申购的货币资金；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后，构成本合同的有效组成部分；

(4) 投资者参与申请确认后，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、参与人数：不超过 200 人。

5、管理人不以自有资金参与本集合计划。

## 6、参与费及参与份额的计算

(1) 参与费率：1%

参与费由委托人承担，不列入集合计划资产。参与费的计算公式如下：

参与费=参与金额×对应的参与费率

(2) 参与份额的计算方法:

委托人的参与资金在集合计划成立前形成的利息(按银行同期活期存款利率计算),在集合计划成立后按集合计划份额面值折算成集合计划份额,归委托人所有。参与资金的利息以管理人注册登记系统的确认结果为准。

集合计划份额以四舍五入的方法保留小数点后两位,由此误差产生的损失由成立后的集合计划资产承担,产生的收益归集合计划资产所有。

委托人参与份额的计算方法如下:

在推广期参与的:参与份额=(参与金额-参与费+参与资金利息)÷集合计划份额面值

在开放期参与的:参与份额=(参与金额-参与费)÷参与申请日集合计划单位净值

## 7、拒绝或暂停参与

出现下列情形,管理人可以拒绝或暂停接受委托人的参与申请:

- (1) 本集合计划份额接近或达到规模上限;
- (2) 集合计划资产规模过大,使管理人无法找到合适的投资品种,或可能对集合计划业绩产生负面影响,从而损害委托人的利益;
- (3) 战争、自然灾害等不可抗力的原因导致集合计划无法正常运行;
- (4) 管理人认为接受某笔或某些参与申请可能会影响或损害现有委托人利益时;
- (5) 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而未提供管理人要求的合法筹集资金的证明文件;
- (6) 参与的委托人达 200 人;
- (7) 法律、行政法规规定或中国证监会认定的其他情形。

拒绝或暂停本集合计划的参与,管理人应提前在管理人指定网站公告。

委托人的参与申请被拒绝时,被拒绝的参与款项将无息退还给委托人,各方互不承担其他责任。

在暂停参与的情况消除后的20个工作日内,管理人将及时恢复参与业务的办



理，并在管理人指定网站公告。

## （二）集合计划的退出

### 1、退出的办理时间

投资者在集合计划开放期内的工作日可以办理退出本集合计划的业务。

### 2、退出的原则

（1）“未知价”原则，即退出集合计划的价格以退出申请日（T日）集合计划每份额单位净值为基准进行计算；

（2）采用份额退出的方式，即退出以份额申请；

（3）委托人申请退出时，管理人按“先进先出”的原则，即按照委托人份额参与的先后次序进行顺序退出的方式确定退出份额。

### 3、退出的程序和确认

#### （1）退出申请的提出

委托人必须根据集合计划推广网点规定的手续，在工作日的业务办理时间内向推广网点提出退出申请。

#### （2）退出申请的确认

委托人可于T+2日以后（含T+2日）到推广网点取得T日退出申请成交确认单，若交易未成功或数据不符，委托人可与为其办理手续的网点人员联系并进行核实。

#### （3）退出款项划付

委托人T日的退出资金将于T+5日内从托管账户划出。

### 4、退出份额约定

委托人退出时按份额退出集合计划，委托人可申请将其持有的部分或全部集合计划单位退出。参与份额单笔退出最低份额为10,000份，若某笔退出导致该委托人在同一推广机构处持有的份额余额少于100,000份，则管理人对该余额部分做强制退出处理。

退出支付金额计量单位为人民币元，按四舍五入法保留到小数点后两位，由此误差产生的损失由集合计划资产承担，产生的收益归集合计划资产所有。

### 5、退出费

本集合计划不收取退出费用。

## 6、巨额退出的认定和处理方式

巨额退出时,管理人可通过正回购、卖出股票资产、赎回基金、解付银行存款等方式及时变现资产或者筹措资金。当以上措施仍无法满足客户退出资金需求时,管理人启动巨额赎回条款。

### (1) 巨额退出的认定

单个开放日,集合计划净退出申请总额超过上一日集合计划总份额的 10%时,为巨额退出。

### (2) 巨额退出的顺序、价格确定和款项支付

巨额退出申请发生时,管理人可以根据本集合计划当时的现金情况决定全额退出、顺延退出或者暂停退出。

全额退出:当管理人认为有条件支付委托人的退出申请而不会损害委托人利益时,按正常退出程序办理。

顺延退出:巨额退出申请发生时,管理人在当日接受退出份额超过上一日本集合计划总份额10%的前提下,可以对其余退出申请延期办理,但延期时间不得超过二十个工作日。对于当日的退出申请,应当按单个账户退出申请量占退出申请总量的比例,确定当日受理的退出份额;未受理部分可延迟至下一个工作日办理,并以该工作日当日的单位净值为依据计算退出金额,但委托人可在申请退出时选择将当日未获受理部分予以撤销。如顺延后仍发生巨额退出,且管理人未宣布暂停退出,仍继续按比例受理退出份额。

### (3) 告知客户的方式

发生巨额退出并延期支付时,管理人将通过邮寄、传真、管理人指定媒体或者说明书、《集合资产管理合同》规定的其他方式、在三个工作日内通知委托人,说明有关处理方法,同时在指定媒体(管理人网站)上公告。

## 8、连续巨额退出的认定和处理方式

### (1) 连续巨额退出的认定

连续两个开放日净退出份额申请均超过上一日集合计划总份额的 10%时,为连续巨额退出。

### (2) 连续巨额退出的顺序、价格确定和款项支付



暂停退出：本集合计划发生连续巨额退出，管理人可按说明书及《集合资产管理合同》载明的规定，暂停接受退出申请，但暂停期限不得超过二十个工作日；已经接受的退出申请可以延缓支付退出款项，但不得超过正常支付时间二十个工作日，并应当在指定媒体（管理人网站）上进行公告。

#### 9、拒绝或暂停退出的情形及处理

发生下列情形时，管理人可以拒绝或暂停受理委托人的退出申请：

- (1) 不可抗力的原因导致集合计划无法正常工作；
- (2) 证券交易场所交易时间非正常停市，导致当日集合计划资产净值无法计算；
- (3) 管理人认为接受某笔或某些退出申请可能会影响或损害现有委托人利益时；
- (4) 因市场剧烈波动等原因而出现连续巨额退出，或者其他原因，导致本集合计划的现金支付出现困难时，管理人可以暂停接受集合计划的退出申请；
- (5) 其他：发生本说明书、《集合资产管理合同》中未予载明的事项，但管理人有正当理由需要暂停退出时。

#### 10、强制退出

强制退出包括以下两种情况：

- ① 某笔退出导致该委托人持有的份额余额少于 100,000 份，则管理人对该余额部分做强制退出处理；
- ② 本集合计划存续期间，由于委托人自身的原因，致使其所拥有的本集合计划的份额被司法机关强制要求退出。

### 六、集合计划的分级及相关情况

本集合计划不分级。

### 七、集合计划客户资产的管理方式、管理权限和运作方式

#### (一) 管理方式和管理权限

本集合计划严格按照法律法规、《管理合同》、《说明书》约定的管理方式，

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，管理人对本计划进行管理的权限来源为法律法规、《管理合同》、《说明书》。

## （三）运作方式

运作方式：本集合计划的运作方式为开放式。

## 八、管理人自有资金参与集合计划

本集合计划无管理人自有资金参与。

## 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（不含参与费）不低于 1000 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后，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集合计划份额登记机构指定的专门账户，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 1000 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 20 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：集合计划宣告成立。

2、日期：集合计划成立之日起，管理人可按合同约定开始运作。



## 十、集合计划账户与资产

管理人和托管人对集合计划按照《办法》、《规定》的有关规定，以“广发资管可转债量化投资集合资产管理计划”的名义开立托管账户；以“广发资管可转债量化投资集合资产管理计划”的名义在中国证券登记结算有限公司开设证券账户，证券账户名称应为“广发证券资管—招商证券—广发资管可转债量化投资集合资产管理计划”（以实际开立为准）。

管理人和托管人对集合计划资产独立核算、分账管理，保证集合计划资产独立于管理人和资产托管机构的自有资产、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。管理人、资产托管机构不得将集合计划资产归入其自有资产。

管理人、资产托管机构破产或者清算时，集合计划资产不属于其破产财产或者清算财产。

注册与过户登记人为集合计划的每一位委托人建立集合计划账户，记录其全部持有的本集合计划份额及其变动情况。

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。

## 十一、集合计划资产托管

本集合计划资产交由招商证券股份有限公司负责托管，并签署了托管协议。托管人的托管职责以托管协议的约定为准。

## 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：

本集合计划的资产总值是指用集合计划的资金购买的各类有价证券、银行存款、回购、货币市场基金、集合计划各项应收款以及其他投资所形成的价值总和。

### （二）资产净值：

集合计划资产净值是指本集合计划资产总值减去负债后的净资产值。集合计

划资产净值的计算精确到 0.01 元，小数点后第三位四舍五入。

### （三）单位净值：

集合计划单位净值是指计算日集合计划资产净值总额除以计算日集合计划的份额后的价值。单位净值的计算精确到 0.0001 元，小数点后第五位四舍五入。法规另有规定的，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. 股票估值方法

（1）股票按估值日其所在交易市场的收盘价估值；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，且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件，以最近交易日的收盘价估值；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的或者证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，将参考监管机构或行业协会有关规定，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。

（2）流通受限股票（包括但不限于非公开发行股票、首次公开方式股票时公司股东公开发售股票、通过大宗交易取得带限售期的股票等），按照中基协公布的最新估值指引进行估值

在任何情况下，资产管理人如采用本项第（1）—（2）小项规定的方法对委托财产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果资产管理人认为按本项第（1）—（2）小项规定的方法对委托财产进行估值不能客观反映其公允价值的，资产管理人可根据具体情况，并与资产托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

#### 2. 证券投资基金估值方法

（1）持有的交易所基金（包括封闭式基金、上市开放式基金（LOF）等），



按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考监管机构或行业协会有关规定，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值；

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

(3) 持有的货币市场基金，按估值日前一交易日基金管理公司的每万份收益计算；

(4) 认购的新发行的未上市交易的交易所基金按成本估值，基金公司公布净值的按照净值估值；

(5) 在任何情况下，资产管理人如采用本项第（1）—（4）项规定的方法对委托财产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果资产管理人认为按本项第（1）—（4）项规定的方法对委托财产进行估值不能客观反映其公允价值的，资产管理人可根据具体情况，并与资产托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

### 3、投资固定收益品种的估值方法

(1) 同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

(2) 在证券交易所市场流通的债券，按如下估值方式处理：

交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种，选取估值日第三方估值机构提供的相应品种对应的估值净价估值。若第三方估值机构无估值数据，且估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本进行后续计量。

交易所上市交易的可转换债券，以估值日收盘价减去可转换债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；交易所上市交易的可交换债券，以估值日收盘价进行估值；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，可转换债券按最近交易日收盘价减去可转换债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值，可交换债券按最近交易日收盘价进行估值。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。

(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) 银行间债券、同业存单的估值采用中央国债登记结算有限责任公司提供的中债收益率曲线估值价格计算。

(5) 对在银行间市场上市交易的资产支持证券，应主要依据第三方估值机构公布的收益率曲线及估值价格估值。对在银行间市场上市交易且中债登公司未提供价格的，按成本估值。对在交易所上市的资产支持证券品种，选取估值日第三方估值机构提供的相应品种对应的估值净价估值。若第三方估值机构无估值数据，且估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本进行后续计量。

(6) 保证收益的资产支持证券按照成本列示，按预期收益率逐日计提应收利息，到期回款时根据实际回款金额与计提收益的差额确认损益；保本浮动收益的资产支持证券按成本列示，到期回款时根据实际回款金额确认收益。

(7) 在任何情况下，资产管理人如采用本项第（1）—（6）小项规定的方法对计划资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果资产管理人认为按本项第（1）—（6）小项规定的方法对计划资产进行估值不能客观反映其公允价值的，资产管理人在综合考虑市场成交价、市场报价、流动性、收益率曲线等多种因素基础上形成的债券估值，资产管理人可根据具体情况与资产托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

### 3、存款的估值方法

持有的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。

4、股指期货估值：股指期货合约以估值当日结算价进行估值；估值当日无结算价的，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。

4. 如有新增事项或变更事项，按国家最新规定估值。

5. 当市场发生极端的流动性不足或者证券被停牌，合同终止无法变现的资产处理由合同各方根据相关法律法规，视具体情况就资产变现、估值等事宜协商解决。

6. 如资产管理人或资产托管人发现计划估值违反资产管理合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护计划份额持有人利益时，应立即通知对方，共同查明原因，双方协商解决。



7. 根据有关法律法规，资产管理计划净值计算和会计核算的义务由资产管理人承担。本计划财产的会计责任方由资产管理人担任。

8. 若本产品运营过程中，投资收益涉及增值税的，按照最新规定缴纳增值税。资产管理人应在本计划起始运作日前与资产托管人沟通本计划的《增值税计算方案》，并于起始运作日前将方案提供给资产托管人。

#### （八）估值程序：

集合计划资产的日常估值由管理人进行。用于公开披露的资产净值由管理人完成估值后，将估值结果按约定形式报送托管人，托管人按照规定的估值方法、时间与程序进行复核；托管人复核无误后将结果返回给管理人。月末、年中和年末估值复核与会计账目的核对同时进行。

估值结果精确到 0.0001 元，小数点第五位四舍五入。

#### （九）估值错误与遗漏的处理方式：

1、管理人和托管人应采取必要、适当、合理的措施确保资产估值的准确性和及时性。当单位资产净值计价出现错误时，管理人应当予以纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大。当 T 日的错误偏差达到资产净值的 0.5% 时，管理人应当公告。

2、因单位资产净值计算错误给委托人造成损失的，管理人应当承担赔偿责任。管理人在赔偿委托人后，有权向有关责任方追偿。由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误，或由于不可抗力原因，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估值错误，管理人、托管人可以免除赔偿责任。

3、前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，按其规定处理。

4、本集合计划的会计责任方由计划管理人担任。因此，就与本集合计划有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后仍无法达成一致的意见，计划管理人有权按照其对计划净值的计算结果对外予以公布，托管人不承担由此导致的损失。

#### （十）暂停披露净值的情形：

1、与本集合计划投资有关的证券交易场所遇法定节假日或因其他原因停市时；

2、因不可抗力或其他情形致使管理人、托管人无法准确评估集合资产管理计划资产价值时。

### (十一) 特殊情形的处理

1、按前面(七)估值方法中的规定进行估值时，所造成的差异不作为错误处理。

2、由于本集合资产管理计划所投资的各个市场及其登记结算机构发送的数据错误，国家会计政策变更、市场规则变更等，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的，由此造成的估值错误，管理人和托管人免除赔偿责任。但管理人和托管人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

如果法律、法规、规章及中国证监会另有规定的，从其规定。

## 十三、集合计划的费用

### (一) 集合计划费用支付标准、计算方法、支付方式和时间

#### 1、管理费：

管理费包括固定管理费以及业绩报酬。

(1) 管理人的固定管理费按资产净值的 1.3%年费率计提。

在通常情况下，固定管理费按前一日资产净值的 1.3%年费率计提。

计算方法如下：

$$G=E \times 1.3\% \div 365$$

其中：G 为每日应计提的固定管理费，E 为前一日资产净值。

固定管理费每日计提，逐日累计至每个自然月月末，按月支付。集合计划每满一个自然月，由集合计划管理人向集合计划托管人发送集合计划固定管理费划款指令，集合计划托管人复核后于次月前 5 个工作日内从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，支付日期顺延。

#### (2) 业绩报酬

当委托人申请退出或集合计划终止退出时，管理人根据委托人持有份额年化收益率 R 提取业绩报酬，业绩报酬从退出总金额中扣除，以现金支付。

具体计算方法如下：

年化收益率 R	计提比例	业绩报酬 (S) 计算方法
---------	------	---------------



R≤8%	0%	S=0
8%<R	20%	S=(R-8%)×20%×K×(持有天数/365)

其中：

$$R = \frac{A - C}{B} \times \frac{365}{T} \times 100\%$$

R：委托人持有期年化收益率

S=业绩报酬

A=退出申请日或集合计划终止退出日单位资产累计净值；

C=上一次业绩报酬提取日单位资产累计净值（若无，则取参与日）；

B=上一次业绩报酬提取日单位资产净值（若无，则取参与日）；

K=退出份额(或业绩报酬计提份额)×上一次业绩报酬提取日单位资产净值；  
(若无，则取参与日)

T:委托人份额持有天数

委托人退出时，托管人根据管理人的指令将退出金额（含业绩报酬）划拨给注册登记机构，由注册登记机构将业绩报酬支付给管理人，并将扣除业绩报酬的退出款项转入委托人的交易账户。

管理人的业绩报酬的计算和复核工作由管理人完成。托管人对业绩报酬的计算不承担复核义务和责任。

## 2、托管费

托管人的托管费按资产净值的 0.10% 年费率计提。

在通常情况下，托管费按前一日资产净值的 0.10% 年费率计提。

计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div 365$$

H 为每日应计提的托管费，E 为前一日资产净值。

托管费每日计提，逐日累计至每个自然月月末，按月支付。集合计划每满一个自然月，由集合计划管理人向集合计划托管人发送集合计划托管费划款指令，集合计划托管人复核后于次月前 5 个工作日内从集合计划资产中一次性支付给托管人。若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

### 3、证券交易费用

集合计划运作期间投资所发生的银行结算费、交易手续费、账户开户费、账户管理费、印花税等有关税费，作为交易成本按实际发生金额直接扣除，其费率由管理人根据有关政策法规确定。

### 4、与本集合计划存续期相关的费用

本集合计划存续期间发生的注册登记机构收取的TA系统月度服务费、登记结算费、信息披露费用、会计师费、审计费和律师费以及按照国家有关规定可以列入的其他费用等，由托管人根据有关法规及相应协议的规定，依管理人的指令，按费用实际支出金额从集合计划资产中支付，列入集合计划费用，在每个自然日内按照直线法均匀摊销。

### 5、其他费用

除交易手续费、印花税、管理费、托管费、其它服务费之外的集合计划费用，由管理人根据有关法律法规及相应的合同或协议的具体规定，按费用实际支出金额列入或摊入当期费用，由管理人向托管人发送划付指令，通知托管人从集合计划资产中支付。

### 6、税收

本集合计划和本合同各方当事人应根据法律法规的规定各自履行纳税义务。本集合计划运营过程中发生的应税行为，相应税款由本集合计划资产承担，如依据相关法律法规或税务机关的规定，以管理人为纳税人或扣缴义务人的，管理人可以在委托资产中列支。本合同履行期间，法律法规发生变更的，按照变更后法律法规执行。

## 十四、集合计划的收益分配

### （一）收益的构成

集合计划收益包括：集合计划收益是集合计划投资所得红利、股息、买卖证券价差、证券持有期间的公允价值变动、银行存款利息、理财产品利息、逆回购利息、其他收入扣除相关费用后的余额。

### （二）可供分配利润

集合计划可供分配利润指截至收益分配基准日，集合计划未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。



集合计划已实现收益指计划利润减去公允价值变动收益后的余额。

### （三）收益分配原则

- 1、同一类份额享有同等分配权；
- 2、当期收益先弥补上一年度亏损后，方可进行当年收益分配；
- 3、收益分配基准日的单位净值减去每单位集合计划份额收益分配金额后不能低于面值。

### （四）收益分配方案的确定与披露

集合计划收益分配方案由管理人拟定，须载明可供分配利润、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，托管人复核分配总金额后由管理人通过推广代销网点、管理人网站告知委托人。管理人至少在收益分配日前 1 个工作日之前将收益分配方案向委托人公告。

### （五）收益分配方式

集合收益分配以现金方式进行，经投资者认可，收益可做转份额处理。

在符合有关收益分配条件的前提下，每次分配比例不低于可供分配利润的 20%。红利发放日距离收益分配基准日的时间不超过 15 个工作日。

## 十五、投资理念与投资策略

### （一）投资目标

本产品通过对可转换债券的积极投资，在严格控制风险的基础上，追求客户资产的长期稳定增值。

### （二）投资理念

本产品以量化分析和深入基本面研究为基础，利用可转债“进可攻、退可守”的特性，在有效控制流动性和风险的前提下，构建择时体系，以可转债的债性锁定下行风险，以股性分享股市成长带来的收益。

### （四）投资策略

#### （1）可转债策略

一般认为影响转债投资价值的因素众多，主要从股价、公司基本面等股票因

素，无风险利率、信用利差等利率因素进行考虑。实际上，对于可转债投资而言，期权定价、条款博弈和股票因素、利率因素的研究同样重要。

可转债的收益来源分为股票上涨驱动、债底驱动、期权定价驱动和条款博弈四个方面。

对于偏股型转债，利用传统的多因子模型，寻找可以预测可转债收益率的因子。产品不仅选取了成长、价值、估值等传统因子，从正股的角度，筛选正股具备上涨空间的可转债，通过正股股价上涨，以获得较高的投资收益。

另外，产品还选取到期收益率、转股溢价率等指标，测试这些因子的选债能力，对可转债进行优选。

到期收益率：到期收益率表征持有可转债的安全垫属性，到期收益率越高的可转债，持有的机会成本越低。

转股溢价率：转股溢价率可以表征可转债的估值高低。若转股溢价率过高，表明可转债价格预支了可转债的后续涨幅。

对于偏债型可转债，对于平价较低的可转债，如果到期收益率足够高，产品可以以逸待劳，通过持有可转债等待契机。

我们会自下而上的角度基于信用评价体系对公司个体层面进行信用分析，通过基本面对个券进行研究和跟踪：

我们会重点从实控人风险、业务结构、资产质量、财务指标以及融资渠道等五个主要维度对发债主体进行研究。

i. 实控人风险：我们会搜集并研究公司及其实际控制人的发展及投资历史情况

ii. 业务结构：我们会对公司主营业务以及相关行业进行深入研究，重点关注公司业务的稳定性、优劣势、发展及投资计划等。回避业务不确定性较大、业务上没有明显优势以及扩张速度过快过度投资的企业。

iii. 资产质量：我们会对公司主要资产价值进行评估，重点关注公司资产的变现能力、抵押融资能力、受限资产比例等。回避资产受限比例过高、资产流动性较差的企业。

iv. 财务指标：我们会对公司财务杠杆、盈利能力、现金流、偿债能力等多方位财务指标进行分析，通过横向、纵向两个维度比较分析公司财务指标的合理性。重点关注杠杆比率是否合理、盈利能力是否与业务属性相匹配、是否存在可疑的关联交易、现金流是否与收入匹配、偿债指标是否安全等。回避财务指标明



显弱于行业平均、存在造假嫌疑、偿债压力过大的企业。

v. 融资渠道：最后我们会对公司再融资能力进行分析，包括大股东或地方政府等外部支持、境内外股票/债券市场认可程度、银行授信情况等。

本集合计划还将通过构建多头和空头的组合，对冲多头的部分或全部风险构建市场中性策略，获得稳健的低风险收益。

## (2) 股指期货策略

根据股指期货合约的设计安排，股指期货到期日的价格必定收敛到现货指数的价格。因此，在合约期内存在一个合理价值，当指数期货的价格背离这个合理价值时，可以通过同时买卖股指期货及相对应的指数进行套利。

本集合计划管理人将运用自主开发的定价模型和套利策略，在交易时间段内实时监控定价偏差，及时捕捉可能的套利机会。

## 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、《办法》、《规定》、《集合资产管理合同》、《说明书》等有关法律性文件；

2、对宏观经济、企业行业发展态势、公司经营情况及价值分析；基于投资与风险控制相结合的动态管理体系；综合市场判断，对交易时机、资金管理、以及投资品种、固定收益品种的利率、收益率曲线等的研究等。

3、参与证券投资的收益和风险的配比关系。

### (二) 集合计划的投资程序

1、管理人的研究员通过自身研究，为本集合的投资管理提供决策依据；

2、投资主办人根据上述报告，结合对市场的分析判断，在投资策略和投资决策委员会授权范围内自主决策投资；

3、管理人的交易人员依据投资主办人指令，制定交易策略，统一执行投资组合计划；

4、管理人的风控部门对投资计划的过程进行日常监督和风险控制，投资主办人根据本集合计划退出的情况控制投资组合的流动性；

5、管理人在确保本集合计划委托人利益的前提下，有权根据环境变化和实际需要对上述投资程序做出调整，但应在调整之日起五个工作日内公告。

### **（三）风险控制**

广发资产管理业务风险控制的目标是通过完善流程和制度，强化内部控制并最大限度降低操作风险；通过深入研究和分析，加强对市场风险的识别和评估，将可能的损失控制在可承担的目标范围内。为有效防范和化解风险，已在整个公司系统和资产管理业务内部建立了一整套科学完整的风险管理制度和完善的风险管理组织体系，能够较好地控制各种业务风险。此外，管理人外部的各种监管机构和监管措施对集合计划的风险控制也起到重大作用。

集合计划在实行严格的内部风险控制的同时，也接受上级监管部门、托管银行、中介审计机构的监督。

1、管理人定期向当地监管机构报送资产管理业务的情况汇报，并接受监管部门的指导；

2、托管银行根据托管人的职责履行监督义务，对管理人的资金流向、投资运作、信息披露等各方面进行监督；

3、外部审计机构每年定期对集合计划的运作情况进行审计，并出具审计报告。

## **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、本集合计划总资产不得超过该计划净资产的 200%；
- 2、管理人管理的全部资产管理计划及公开募集证券投资基金（以下简称公募基金）合计持有单一上市公司发行的股票不得超过该上市公司可流通股票的 30%。中国证监会另有规定的除外；
- 3、本集合计划投资于同一资产的资金，不得超过资产净值的 25%；管理人管理的全部集合资产管理计划投资于同一资产的资金，不得超过该资产的 25%。
- 4、本集合计划参与股票、债券、可转换公司债券、可交换公司债券等证券发行申购时，所申报的金额不得超过该资产管理计划的总资产，所



申报的数量不得超过拟发行公司本次发行的总量；

5、 法律、法规及有关规定和《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，管理人征求托管人同意后，本集合计划可相应调整投资组合限制的规定并在管理人网站上公告则本集合计划不受上述限制。

## **(二) 禁止行为**

本集合计划的禁止行为包括：

1、 利用资产管理计划从事内幕交易、操纵市场或者其他不当、违法的证券期货业务活动；

2、 泄露因职务便利获取的未公开信息、利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关交易活动；

3、 为违法或者规避监管的证券期货业务活动提供交易便利；

4、 从事不公平交易、利益输送等损害投资者合法权益的行为；

5、 利用资产管理计划进行商业贿赂；

6、 侵占、挪用资产管理计划财产；

7、 利用资产管理计划或者职务便利为投资者以外的第三方谋取不正当利益；

8、 直接或者间接向投资者返还管理费；

9、 以获取佣金或者其他不当利益为目的，使用资产管理计划财产进行不必要的交易；

10、 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他行为。

## **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：封闭期以及开放期内每天披露一次集合计划单位净值。

披露方式： 管理人网站（[www.gfam.com.cn](http://www.gfam.com.cn)）。

## 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、持仓比例及相应的投资风险、价值变动情况、重大关联交易；资产管理计划参与股指期货交易的有关情况，包括投资目的、持仓情况、损益情况、对集合计划总体风险的影响以及是否符合既定的投资目的等做出说明。上述报告应于每季度截止日后 1 个月内内通过管理人网站（[www.gfam.com.cn](http://www.gfam.com.cn)）通告。集合计划成立不足 3 个月或者存续期间不足 3 个月的，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、持仓比例及相应的投资风险、价值变动情况、重大关联交易；资产管理计划参与股指期货交易的有关情况，包括投资目的、持仓情况、损益情况、对集合计划总体风险的影响以及是否符合既定的投资目的等做出说明。上述报告应于每个会计年度截止日后 4 个月内通过管理人网站（[www.gfam.com.cn](http://www.gfam.com.cn)）通告。集合计划成立不足 3 个月或者存续期间不足 3 个月的，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。集合计划成立不足3个月时，可以不编制审计报告。产品终止当年，无需出具年度审计报告。

## 5、对账单

管理人应当每季度以以下其中一种方式向委托人或推广机构提供对账单：

- (1) 电子邮件；
- (2) 管理人信息披露平台（<https://www.gfam.com.cn/>）；
- (3) 柜台系统；
- (4) 网上交易等自助终端系统。

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。

委托人可通过以上一种方式自行或通过推广机构查询对账单，如需帮助可咨询全国统一客服热线 95575。



## （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，管理人应当在其网站（[www.gfam.com.cn](http://www.gfam.com.cn)）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；
- 6、合同的补充、修改与变更；
- 7、与集合计划有关的重大诉讼、仲裁事项；
- 8、负责本集合计划的代理推广机构发生变更；
- 9、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；
- 10、管理人、托管人因解散、破产、撤销等原因不能履行相应职责；
- 11、其他。

## 十九、集合计划份额的非交易过户和冻结

### （一）集合计划份额的转让

集合计划存续期间，客户可以通过证券交易所、机构间私募产品报价与服务系统、证券公司柜台交易系统等中国证监会认可的交易平台转让集合计划份额。管理人和托管人无需就本集合计划份额转让事宜与委托人另行签订协议。受让方首次参与集合计划，应先与管理人、托管人签订资产管理合同。本集合计划份额的转让不收取手续费。

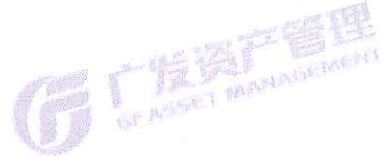
### （二）集合计划份额的非交易过户

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、司法划扣两种情况。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**

本集合计划在一定条件下可以展期。

### **（一）展期的条件**

- 1、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；
- 2、展期没有损害委托人利益的情形；
- 3、托管人同意继续托管展期后的集合计划资产；
- 4、管理人认为集合计划有必要进行展期；
- 5、中国证监会规定的其他条件。

### **（二）展期的程序与期限**

- 1、展期的程序：托管人同意；展期通知；委托人回复，为不同意展期委托人的份额办理退出；展期备案；展期实现。
- 2、展期的期限：管理人可以决定展期的期限并通知委托人。

### **（三）展期的安排**

#### **1、通知展期的时间**

本集合计划拟展期的，管理人应当于原存续期届满前1个月内通知委托人。

#### **2、通知展期的方式**

管理人决定展期的，管理人应当及时通过管理人信息披露平台或以书面或电子邮件形式通知委托人，征求委托人意见。

#### **3、委托人回复的方式**

委托人可以通过书面、传真、电子邮件、网站、电话或其他约定方式回复。截至存续期届满日，委托人未给出明确答复的，视为同意展期。

### **（四）委托人不同意展期的处理办法**



若有委托人不同意展期，委托人有权在存续期届满前（含届满日）到推广机构办理退出手续。截至存续期届满日，委托人未给出明确答复的，视为同意展期。

### （五）展期的实现

如果同意集合计划展期的委托人人数不少于2人，且符合集合计划的成立条件，则集合计划存续期将依法公告展期；否则，管理人将按照《资产管理合同》等相关法律文件的规定办理计划到期终止和清算事宜。

## 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、资产管理计划存续期届满且不展期；
- 2、证券期货经营机构被依法撤销资产管理业务资格或者依法解散、被撤销、被宣告破产，且在六个月内没有新的管理人承接；
- 3、托管人被依法撤销基金托管资格或者依法解散、被撤销、被宣告破产，且在六个月内没有新的托管人承接；
- 4、经全体投资者、证券期货经营机构和托管人协商一致决定终止的；
- 5、发生资产管理合同约定的应当终止的情形；
- 6、集合资产管理计划存续期间，持续五个工作日投资者少于二人；
- 7、法律、行政法规及中国证监会规定的其他情形。

自集合计划终止之日，与集合计划有关的所有交易应立即停止。

### （二）集合计划的清算

- 1、自集合计划终止之日起 5 个工作日内成立集合计划清算小组，集合计划清算小组按照监管机构的相关规定进行集合计划清算；
- 2、清算过程中的有关重大事项应当及时公布；
- 3、清算结束后 20 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委托人拥有集合计划份额的比例或集合资产管理合同的约定以货币资金的形式全部分派给委托人，并注销集合计划专用证券账户和资金账户；
- 4、清算结束后 15 个工作日内由集合计划清算小组在管理人网站公布清

算结果；

5、若本集合计划在终止之日有未能流通变现的证券，管理人可对此制定二次清算方案，该方案应经托管人认可，并通过管理人网站进行披露。管理人应根据二次清算方案的规定，对前述未能流通变现的证券在可流通变现后进行二次清算，并将变现后的资产按照委托人拥有份额的比例或本合同的约定，以货币形式全部分配给委托人。

## 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、监管机关有关规定及本合同约定的属于委托人其他权利。

#### 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；委托人应当以真实身份参与集合计划；自然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，应当向管理人或其他推广机构提供合法筹集资金的证明文件；委托人承诺在参与集合资产管理计划之前，已经是管理人或者其他推广机构的客户；

（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）以自己的名义在推广网点开立资金账户，用于办理委托资金、退出款



项、红利款项、清算款项的收取，并承诺在本合同有效期内，不得撤销该账户，并妥善保管账户资料；

(5) 除非在法律规定或合同约定的期间，不得要求提前终止委托资产管理关系；

(6) 不得向他人转让其所持有的全部或者部分集合计划份额，法律、法规及有关规定另有规定的除外；

(7) 按照合同约定承担集合计划可能的投资损失；

(8) 及时登陆管理人网站查询关于本集合计划的所有信息披露和公告情况；

(9) 遵守反洗钱法律法规要求，并承诺不存在洗钱情形，同意配合管理人按照反洗钱法律法规履行身份识别、异常交易报告等职责；

(10) 委托人提供的客户信息应当真实、准确、完整。委托人的信息发生重大变化、可能影响自身风险承受能力的，应当及时告知销售机构和计划管理人；

(11) 法律、法规及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) 按照合同约定，独立运作集合计划的资产；

(2) 按照合同约定，收取管理费等相关费用；

(3) 作为计划管理人，代表委托人行使因投资相关证券所产生的权利；

(4) 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；

(5) 按照本合同约定，终止集合计划的运作；

(6) 在不违反公平、合理原则以及不妨碍集合计划托管人遵守相关法律法规及其行业监管要求的基础上监督托管人；

(7) 代表集合计划行使集合计划资产投资形成的投资人权利；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、法规、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) 妥善保管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资产损失或损害委托人合法权益时，应承担赔偿责任；

(12) 因托管人违反本合同导致集合计划资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) 按照反洗钱法律法规要求履行异常交易报告义务；

(14) 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、《说明书》和托管协议的约定收取托管费；



(3) 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或者本合同、《说明书》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、《说明书》以及托管协议约定的其他权利。

## 2、托管人的义务

(1) 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，不得擅自自动用或处分集合计划资产；

(3) 在集合计划托管活动中恪尽职守，履行诚实信用、谨慎勤勉的义务，保管集合计划的资产，确保集合计划资产的独立和安全，依法保护委托人的财产权益；

(4) 安全保管集合计划资产，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；

(5) 定期核对资产管理业务资产情况；

(6) 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；

(7) 复核、审查管理人计算的集合计划的资产净值；

(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予以保密，不向他人泄露（法律法规、中国证监会另有规定或有权机关要求的除外）；

(9) 按规定出具集合计划托管情况的报告；

(10) 妥善保管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；

(11) 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；

(12) 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；

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

(14) 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;

(15) 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, 给计划资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; 因共同行为给计划资产或者委托人造成损害的, 应当承担连带赔偿责任。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, 包括但不限于地震、海啸、台风、飓风、洪水、战争、暴乱、政变、重大传染病流行、适用法律和监管政策发生重大变化等。

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。

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、托管人不可控制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，由此造成计划资产或委托人损失，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、托管人对于没有保管在托管人处的有价证券及其他集合计划资产不负有保管责任，由于非托管人的过错致使其保管的资产发生毁损或灭失的，托管人不承担赔偿责任。

委托人的债权人通过司法机关对集合计划资产采取强制措施，由此造成集合计划资产损失的，托管人不承担任何责任。

## （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，各方一致同意请证券期货纠纷调解委员会进行调解。调解不成的，各方一致同意将争议提交广州仲裁委员会并按其仲裁规则进行仲裁。根据该会届时有效的仲裁规则在广州仲裁解决。仲裁裁决是终局的，对仲裁各方当事人均具有约束力。

除争议事项之外，各方当事人仍应继续履行本协议的其他规定，维护持有人的合法权益。

本合同受中华人民共和国法律管辖。

## 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、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。

#### 7、其他风险

管理人在进行债券回购业务中，可能面临债券回购交收违约后结算公司对质押券处置的风险。

### **(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) 强制退出风险**

参与份额单笔退出最低份额为 10,000 份，若某笔退出导致该委托人在同一推广机构处持有的份额余额少 100,000 份，则管理人对该余额部分做强制退出处理。因此委托人在同一推广机构持有的份额少于 100,000 份，有被强制退出的风险。

#### **(六) 巨额退出风险**

本集合计划规定当委托人一次申请退出份额超过上一日集合计划总份额的 10% 时的情形，应按巨额退出程序办理，委托人可能存在巨额退出不成功的风险。

#### **(七) 本产品可能存在委托人参与本金损失的风险**

1、本产品不保证本金和/或收益不受损失，证券市场波动等因素导致本产品持有的投资组合出现价格波动，可能导致委托人参与本金出现亏损。

2、由于管理人的投资知识、经验、判断和决策能力、投资技能等存在的局限性，其可能存在对市场信息的获取不全、对经济形势、金融市场价格走势的判断失误或对投资工具使用不当等情况，以上因素可能导致委托人参与本金出现损失。

#### **(八) 因管理人的业务或者经营状况发生变化，存在可能导致委托人参与本金亏损的风险**

管理人自身的经营状况发生不利变化，出现了业务萎缩，关键人员流失、财务状况出现亏损等情况，导致管理人无法有效的对产品进行投资管理和运作，可能导致委托人参与本金或原始本金出现损失。

#### **(九) 因管理人的业务或者经营状况发生变化，存在可能影响客户判断的风险**

管理人自身的经营状况发生不利变化，出现了业务萎缩，关键人员流失、财务状况出现亏损等情况，客户由于没有及时了解和掌握以上信息，可能导致客户没有对自己所持有产品的后续投资策略做出准确的判断。

## （十）本产品存在以下限制委托人权利行使期限或者可解除合同期限等内容

本集合计划第一个封闭期为自本集合计划成立之日起一年。封闭期内不办理参与、退出业务。委托人将面临在封闭期内无法退出本集合计划的风险。

## （十一）操作风险

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

## （十二）关联交易的风险

关联交易的风险，管理人遵循客户利益优先和审慎原则，在实际投资操作中可能会参与投资管理人、托管人及与管理人、托管人有关联方关系的公司发行的证券或承销期内承销的证券，或者投资于管理人及其关联方（包括但不限于管理人）担任管理人的其他资产管理产品，或从事其他重大关联交易，委托人应密切关注关联交易的信息披露，知悉了解相关的投资信息。

## （十三）本集合计划特有的风险

### 1、信用风险

对于可转债、可交债交易而言，信用风险发生的概率极小，原因可转债在到期前可通过促进投资人转股实现退出。发行人可以通过下调转股价，或者提升上市公司经营业绩从而达到转股条件。但在上市公司经营情况出现剧烈变化的情况下，也会发生无法偿付债券的风险。

### 2、量化模型的风险

集合计划的投资依赖各种量化投资模型，因为模型不能有效的、完全的刻画市场运行中的真实状况，模型在测算、评估时存在误差（历史表现不保证未来表现），模型中的参数估计存在误差，或者市场条件突然发生改变等因素，数量模型的可靠性将对本集合计划的收益产生影响。同时，量化模型对相关数据的准确性和可靠性依赖较高，个别研究报告或其它材料的数据是否准确可靠，对本集合计划的业绩表现会有所影响。

3、股指期货投资具有杠杆性，当出现不利行情时，股指期货的杠杆作用将放大投资的损失，可能导致投资者的收益遭受较大损失；在股指期货的每日无负债结算制度下，若股指期货价格发生大幅波动时，可能出现保证金不足并须追加保证金的问题，如果没有在规定的时间内追加足额保证金，计划所持股指期货将被强制平仓。因此投资者进行股指期货交易面临较大的市场风险。



(十四) 本集合计划依照当前关于资产管理业务的法律法规、相关监管规定和政策设计的。如关于资产管理业务的法律法规、相关监管规定发生变化,可能影响集合计划的募集、投资运作、估值清算等事项的正常进行,并可能影响集合计划的收益,也可能导致集合计划违反国家法律、法规或者其他合同的有关规定,进而导致本集合计划变更合同或提前终止等。

(十五) 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、托管人因停业、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人员配备、内控机制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主办人的依赖而可能产生的风险;

8、在现行股指期货交易结算模式下,集合计划资产进行股指期货投资相关交易及结算数据由期货公司负责发送,管理人及托管人据以履行股指期货相关会计核算、估值等职责。若因期货公司、中金所或其他原因造成期货公司向管理人、托管人传送的集合计划在中金所的交易及结算数据不准确、不完整或不真实,将

为集合计划资产带来风险；

9、因业务竞争压力而可能产生的风险；

10、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；

11、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。

## 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。委托人通过代理推广机构网上交易系统签署电子合同的，当委托人已以与代理推广机构约定的方式确认合同签署成功，则表示委托人已签署和确认本合同。

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）其他：本计划成立。

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

《广发资管可转债量化投资集合资产管理计划说明书》、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和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为本合同的附件，是本合同不可分割的一部分，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，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5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。

2、若管理人认为有必要变更代理推广机构的,委托人及托管人同意管理人在管理人网站公告后即变更生效。

3、由于上述之外其他原因需要变更合同的,管理人经托管人同意后对本合同做出调整和补充的,管理人和托管人应书面达成一致并在管理人网站公告。管理人须在公告后10个工作日内以电子或者网站公告方式向委托人发送合同变更征询意见。委托人应在该征求意见公告发出后的10个工作日内给出答复,逾期未作答复的,视为委托人同意全部变更事项。若委托人不同意合同变更事项的,则应当在管理人发出的上述征求意见公告中确定的开放日内提出退出申请。

上述全部变更事项自上述征求意见公告中确定的开放日期届满之日起第一个工作日开始生效,对合同各方均具有法律效力。委托人退出本集合计划后对资产管理合同补充或修改的异议将不影响合同的变更。委托人同意,无论其是否提出退出申请,管理人变更合同的行为均不应被视为或裁定为管理人的违约行为。法律、法规或本合同对合同的补充与修改另有规定的,依其规定。

4、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。

5、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

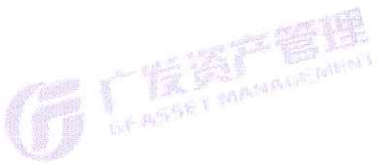
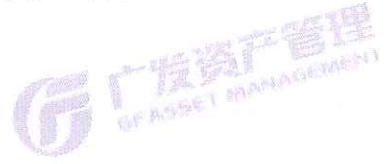
本合同所称的或有事件是指,管理人被依法撤销资产管理业务资格或者依法解散、被撤销、被宣告破产;或(及)托管人被依法撤销基金托管资格或者依法解散、被撤销、被宣告破产。。

委托人在此同意,如果或有事件发生,在管理人、托管人与受让人协商一致的基础上,管理人、托管人有权将本合同中由管理人、托管人享有的权利和由管理人、托管人承担的义务转让给具备从事资产管理业务、托管业务的公司,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、托管人应当保证受让人具备开展此项业务的相关资格,

并将相关批复文件复印件存档备查。

管理人、托管人应按照监管机构的要求办理转让手续。

如果或有事件发生，在六个月内没有受让人承接的，本集合计划应当终止。





管理人、托管人确认，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。

本合同根据委托人的风险承受能力和本产品的风险等级做出的委托人适合参与本计划的适当性匹配意见不表明管理人对本计划的风险和收益作出实质性判断或保证。

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。

委托人签字/盖章：

管理人：广发证券资产管理(广东)有限公司（盖章）

法定代表人或授权代理人（签章）：

孔继成

托管人：招商证券股份有限公司（盖章）

法定代表人或授权代理人（签章）：

秦湘

签订日期：\_\_\_\_\_年\_\_\_\_\_月\_\_\_\_\_日



