

# 《国盛1号集合资产管理计划资产管理合同》

## 变更的征询意见函

致广发银行股份有限公司：

为符合《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》、《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》、《集合资产管理计划资产管理合同内容与格式指引（试行）》的相关要求，我公司拟根据《国盛1号集合资产管理计划资产管理合同》（以下简称“《管理合同》”）的约定对该计划相关条款进行变更，特向托管人广发银行股份有限公司征询关于《管理合同》相关条款变更的意见，变更后的《管理合同》内容详见附件合同。

我司通过本函向贵司征询意见，在与贵司达成一致意见后，我司将按照《管理合同》的约定履行资产管理合同变更程序。我司在履行必要变更流程后，将于不晚于合同变更生效当日向托管人通知合同变更生效事宜，并提供合同变更生效公告以及更新后的合同（如有）。

以上事宜，请贵行函复确认。

本函正本一式两份，贵行留存一份，我司执一份。

管理人：国盛证券资产管理有限公司

2019年10月22日

国盛资管国盛 1 号集合资产管理计划  
资产管理合同

## 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.....          | 11 |
| 六、管理人自有资金参与集合计划.....       | 18 |
| 七、集合计划的分级及止损线.....         | 19 |
| 八、集合计划客户资产的管理方式和管理权限.....  | 20 |
| 九、集合计划的成立.....             | 20 |
| 十、集合计划账户与资产.....           | 21 |
| 十一、集合计划资产托管.....           | 22 |
| 十二、集合计划的估值.....            | 22 |
| 十三、集合计划的费用、业绩报酬与税收.....    | 27 |
| 十四、集合计划的收益分配.....          | 31 |
| 十五、投资理念与投资策略.....          | 32 |
| 十六、投资决策与风险控制.....          | 34 |
| 十七、投资禁止行为.....             | 38 |
| 十八、集合计划的信息披露.....          | 39 |
| 十九、集合计划份额的转让、非交易过户和冻结..... | 41 |
| 二十、集合计划展期、终止和清算.....       | 42 |
| 二十一、当事人的权利和义务.....         | 44 |
| 二十二、违约责任与争议处理.....         | 48 |
| 二十三、风险揭示.....              | 50 |
| 二十四、合同的成立与生效.....          | 55 |
| 二十五、合同的补充、修改与变更.....       | 55 |

## 一、前言

为规范国盛资管国盛1号集合资产管理计划(以下简称“集合计划”或“计划”)运作,明确《国盛资管国盛1号集合资产管理计划资产管理合同》(以下简称“本合同”)当事人的权利与义务,依照《中华人民共和国合同法》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》(以下简称《管理办法》)、《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》(以下简称《管理规定》)等有关法律法规的规定,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》、《管理规定》、《国盛资管国盛1号集合资产管理计划说明书》(以下简称《说明书》)、本合同及其他有关规定享有权利、承担义务。

委托人承诺以真实身份参与集合计划,保证委托资产的来源及用途合法,所披露或提供的信息和资料真实,并已阅知本合同和集合计划说明书全文,了解相关权利、义务和风险,独立承担投资风险,不得损害国家利益、社会公共利益和他人合法权益。

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

托管人承诺以诚实守信、审慎尽责的原则履行托管职责,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。

合同各方按照《中华人民共和国反洗钱法》履行各方义务。

委托人、管理人、托管人同意遵守《中华人民共和国电子签名法》、《证券公司资产管理电子签名合同操作指引》的有关规定,三方一致同意委托人自签署《电子签名约定书》之日起,委托人以电子签名方式接受电子签名合同(即本合同、风险揭示书或其他文书)的,视为签署本合同、风险揭示书或其他文书,与在纸质合同、纸质风险揭示书或其他文书上手写签名或者盖章具有同等的法律效力,无须另行签署纸质合同、纸质风险揭示书或其他文书。管理人同意向托管人提供电子合同签署有关委托人信息。

## 二、释义

在本合同中，除非文义另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

集合资产管理计划、本集合计划、集合计划、本计划：指国盛资管国盛1号集合资产管理计划；

集合计划说明书、说明书：指《国盛资管国盛1号集合资产管理计划说明书》及对说明书的任何有效的修订和补充；

集合资产管理合同、资产管理合同、本合同：指《国盛资管国盛1号集合资产管理计划资产管理合同》及对该合同的任何有效的修订和补充；

托管协议：指《国盛资管国盛1号集合资产管理计划托管协议》及对该协议的任何有效修订和补充；

风险揭示书：指《国盛资管国盛1号集合资产管理计划风险揭示书》；

《管理办法》：指2018年10月22日中国证监会发布并施行的《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》；

《管理规定》：指2018年10月22日中国证监会发布并施行的《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》；

中国证监会、证监会：指中国证券监督管理委员会；

中国基金业协会、基金业协会：指中国证券投资基金业协会；

中国证券业协会、证券业协会：指中国证券业协会；

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

集合计划管理人、管理人：指国盛证券资产管理有限公司，也简称为“国盛资管”；

集合计划托管人：指广发银行股份有限公司，也简称为“广发银行”；

推广机构：指管理人、与管理人签订《国盛资管国盛1号集合资产管理计划代理推介协议》的其他符合相应资格条件的银行和证券公司等机构（若有），具体以管理人公告为准；

登记结算机构：指办理登记、存管、过户、清算和结算等登记结算业务的机构。本集合计划的登记结算机构为国盛证券资产管理有限公司或其委托的符合条件的办理集合计划登记结算业务的机构；

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

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

机构投资者：指依据中华人民共和国有关法律法规、监管规定可以投资本集合资产管理计划，在中华人民共和国境内合法注册登记或经有关政府部门批准设立的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织；

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

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

推广期：指自本集合计划启动推广之日起至本集合计划推广结束之日，具体时间见有关公告；

封闭期：特指集合计划成立日后的一个或多个期间，在此期间委托人不得参与、退出本集合计划；

开放期：指委托人可以办理集合计划参与或退出等业务的期间；

开放日：指开放期内的每个工作日；

存续期、管理期限：指计划成立并存续的期间，本集合计划固定存续期为5年，如根据本合同约定集合计划可以提前终止或延长期限的，则以实际期限为准；

工作日：指上海证券交易所和深圳证券交易所等相关交易所的正常交易日；

收益分配基准日：指本集合计划进行收益分配核算的基准日。本集合计划的收益分配基准日以管理人公告为准，且收益分配基准日后应设置或衔接开放期；

T日：指办理本集合计划业务申请的工作日；

T+n日（n指任意正整数）：指T日后的第n个工作日；

天：指自然日；

会计年度：指公历每年1月1日至12月31日；

参与：指委托人申请购买本集合计划份额的行为；

首次参与：指委托人在参与之前未持有过本集合计划份额的情形；

追加参与：指除首次参与外的其他参与情形；

退出：指委托人按集合资产管理合同规定的条件要求收回全部或部分委托资产的行为；

巨额退出：指本集合计划单个开放日累计净退出申请份额（退出申请总份额扣除参与总份额后的余额）超过上一日计划总份额 20% 的情形；

强制退出：指由管理人依据合同约定直接发起退出持有人持有份额的行为；

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

集合计划份额、计划份额、份额：指集合计划的最小单位；

元：指人民币元；

计划单位面值、单位面值：人民币 1.00 元；

集合计划资产总值、计划资产总值：指集合计划所投资的各类有价证券、银行存款本息、集合计划各项应收款以及其他资产所形成的价值总和；

集合计划资产净值、计划资产净值：指集合计划资产总值减去负债后的净资产值；

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

计划单位累计净值、累计净值：指计划单位净值与集合计划份额累计分红之和；

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

不可抗力：不可抗力是指任何不能预见、不能避免、不能克服的客观事件或因素，包括但不限于：相关法律法规的变更；国际、国内金融市场风险事故的发生；战争或动乱、自然灾害、公众通讯设备故障、电力中断、登记结算机构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等、证券交易所及登记结算公司发送的数据错误、互联网故障等；

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

### 三、合同当事人

投资者

个人填写：

姓名：\_\_\_\_\_证件类型：\_\_\_\_\_证件号码：\_\_\_\_\_

通信地址：\_\_\_\_\_邮政编码：\_\_\_\_\_

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：\_\_\_\_\_

代理人姓名：\_\_\_\_\_身份证号码：\_\_\_\_\_

联系电话：\_\_\_\_\_其他：\_\_\_\_\_

委托人的详细情况在电子签名合同数据电文中列示。

管理人

机构名称：国盛证券资产管理有限公司

法定代表人：徐丽峰

通信地址：深圳市福田区福华三路 100 号鼎和大厦 25 层

邮政编码：518040

联系电话：0755-83279948

托管人

机构名称：广发银行股份有限公司

负责人：杨明生

通信地址：北京市东城区东长安街甲 2 号

邮政编码：100005

联系电话：010-65169618

#### 四、集合资产管理计划的基本情况

##### (一) 集合资产管理计划的运作方式

开放式

##### (二) 目标规模

存续期总募集规模不设限制。

##### (三) 投资范围

1、在银行间市场和交易所市场等市场交易的国债、地方政府债、各类金融债（含次级债、混合资本债）、中央银行票据、企业债券、公司债券（含非公开发行公司债）、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、资产证券化产品（资产支持证券等）、银行间市场交易商协会注册发行的各类债务融资工具（如短期融资券、超短期融资券、中期票据、非公开定向债务融资工具等）等债券类；

2、同业存单、银行存款（包括但不限于银行定期存款、协议存款、同业存款）等存款类；

3、货币市场基金；

4、债券回购。

##### (四) 投资比例及限制

###### 1、投资比例

计划资产投资于存款、债券等债权类资产的比例不低于 80%。

###### 2、投资限制

(1) 对于信用类债券，债券发行人的外部主体评级或债项评级在 AA（含）以上（其中短期融资券、超短期融资券的债项评级不得低于 A-1）。同业存单评级和比例控制参考信用债标准。持仓标的若发生评级下调，低于合同约定的，管理人应当在标的资产可出售、可转让或者恢复交易的十五个交易日内进行减仓处理。确有特殊事由未能在规定时间内完成调整的，管理人应当及时进行信息披露。

本计划投资于同一资产的资金，不得超过该计划资产净值的 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%。银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券等中国证监会认可的投资品种除外。

本计划投资单只债券持有面额不超过其发行规模的 25%；单只债券持有市值

不超过集合计划资产净值的 25%; 持有一家公司发行的债券市值合计不得超过计划资产总值的 30%。(利率债除外)

本计划投资单一货币基金不超出净资产的 25%, 不超过该基金份额的 20%。  
(根据最新基金份额计算)

本计划投资单笔银行存款不超出净资产的 25%。

(2) 集合计划资产加权久期不超过 4.5 年, 债券以行权修正久期计算。

(3) 本集合计划参与证券回购融入资金余额不得超过集合计划资产净值的 100%, 中国证监会另有规定的除外。

(4) 本集合计划可投资于与管理人存在关联关系的证券。委托人在此同意并授权管理人将本集合计划投资于与管理人及管理人有关联关系的公司发行的证券或承销期内的证券。该交易完成后的 5 个工作日内, 管理人应书面告知资产托管机构, 通过管理人的网站告知委托人, 并同时向证券交易所报告。

如因证券市场波动、证券发行人合并、资产管理计划规模变动等管理人之外的因素, 造成集合计划投资比例超标, 管理人应在流动性受限资产可出售、可转让或者恢复交易的十五个交易日内将投资比例降至许可范围内。法律法规和本合同另有规定的从其规定。

#### (五) 管理期限

本集合计划存续期限为 5 年, 如根据本合同约定集合计划可以提前终止或延长期限的, 则以实际期限为准。

#### (六) 封闭期、开放期及流动性安排

本集合计划的封闭期为本集合计划自成立日起 3 个月。期间不办理委托人参与或退出。

本集合计划的开放期为每月 5 号起始的前三个工作日, 若 5 号为节假日, 则顺延至下一个工作日起始的前三个工作日。开放期内每个工作日为开放日, 委托人可在开放日参与或退出集合计划(合同另有约定的除外)。

开放期具体安排以管理人提前【5】个工作日在指定网站出具的公告内容为准。需要在开放期办理退出的委托人持有该集合资管计划份额应不少于 3 个月。

如在开放日内发生不可抗力或其他情形致使无法按时开放参与、退出业务的, 开放日中止, 顺延至交易恢复之日。开放日的具体调整以管理人公告为准。

管理人在开放退出期内，其资产组合中 7 个工作日可变现资产的价值，不低于该计划资产净值的 10%；主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过该资产管理计划资产净值的 20%。

(七) 集合计划份额面值

人民币 1.00 元。

(八) 参与本集合计划的最低金额

单个委托人首次参与本集合计划的初始认/申购金额为人民币 30 万元(不含认购费，下同)，追加参与的最低认/申购金额为人民币 1 万元，且认/申购金额以 1 万元为基本单位整数倍递增。

(九) 本集合计划的风险收益特征及适合推广对象

本集合计划主要投资于现金类资产及固定收益类资产，属【R2】收益品种产品，该类产品流动性较高，且存在一定风险，适合具有匹配的风险承受能力且认同集合计划投资理念的投资者，包括符合合格投资者条件的个人投资者和机构投资者(法律法规禁止投资集合资产管理计划的除外)。

本集合计划面向合格投资者推广，合格投资者累计不得超过 200 人。适合追求资产稳健增值、同时具有相应风险承受能力且法律法规允许的个人投资者和机构投资者。

合格投资者是指具备相应风险识别能力和风险承担能力，投资于单只资产管理产品不低于一定金额且符合下列条件的自然人和法人或者其他组织：

1、具有 2 年以上投资经历，且满足以下条件之一：家庭金融净资产不低于 300 万元，家庭金融资产不低于 500 万元，或者近 3 年本人年均收入不低于 40 万元。

2、最近 1 年末净资产不低于 1000 万元的法人单位。

3、金融管理部门视为合格投资者的其他情形。

投资者不得使用贷款、发行债券等筹集的非自有资金投资资产管理产品。

如未来法律法规或监管机构对合格投资者有新规定的，本集合计划将按新规定执行。

委托人经过管理人和推广机构认可后方可参与本集合计划。管理人和推广机构有权拒绝未经认可的委托人参与本集合计划。

#### （十）本集合计划的推广

##### 1、推广机构：

（1）国盛证券资产管理有限公司。

（2）与管理人签订《国盛资管国盛1号集合资产管理计划代理推介协议》（具体协议名称以实际签署为准）的其他符合条件的银行和证券公司等机构（若有）。

##### 2、推广方式

管理人应将集合资产管理合同、集合资产管理计划说明书等正式推广文件，以纸质或电子文档等方式提供给推广机构。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、中国证券业协会、基金业协会、中国证监会电子化信息披露平台或者中国证监会认可的其他信息披露平台，客观准确披露集合计划备案信息、风险收益特征、投诉电话等，使客户详尽了解本集合计划的特性、风险等情况及客户的权利、义务，但不得通过广播、电视、报刊、互联网及其他公共媒体推广本集合计划。

#### （十一）本集合计划的各项费用

1、认购/申购费：0%；

2、管理费：0.5%/年。按前一日计划净值计提，按月支付；

3、托管费：0.03%/年。按前一日计划净值计提，按月支付；

4、业绩报酬：在集合计划收益分配基准日、委托人退出日和本集合计划终止日，管理人对每笔份额持有期间年化收益率超过【业绩报酬计提基准】以上的部分提取 20%作为业绩报酬；

业绩报酬计提基准为产品发行日一年期贷款基准利率基础上加 1%，具体数值以募集公告为准。业绩报酬计提基准值自产品成立之日起每满一年可进行调整，具体调整以管理人公告为准。业绩报酬计提基准值调整的，应设置或衔接开放日。

管理人特别声明：此业绩报酬计提标准不是预期收益和保证收益率。委托人承认，资产管理合同所提及的业绩报酬计提标准仅是管理人计提业绩报酬的

标准，不构成管理人、托管人对委托财产收益状况的任何承诺或担保，在某些情况下，委托人仍可能面临投资收益甚至本金受损的风险。

5、其他费用：除交易手续费、印花税、管理费、业绩报酬、托管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费用，从集合计划资产中支付。

6、上述费用、业绩报酬及其他费用的详细情况详见本合同第十三部分“集合计划的费用、业绩报酬与税收”的相关约定。

## （十二）产品类型

本集合计划为固定收益类产品，按照固定收益类产品投资的要求进行投资。在产品成立后至到期日前，不得擅自改变产品类型。

## 五、集合计划的参与和退出

### （一）集合计划的参与

委托人参与和退出集合计划的确认、清算由管理人或其委托的符合条件的登记结算机构负责。

#### 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。本集合计划的具体推广期以管理人的推广公告为准。管理人可根据集合计划销售情况在募集期限内适当延长或缩短集合计划的发售时间，并及时公告。

##### （2）存续期参与

本集合计划开放期（不含临时开放期）内，委托人可在每个工作日参与集合计划。

#### 2、参与的原则

（1）委托人参与本集合计划前，应当在管理人或推广机构处开立相关账户。

（2）本集合计划采用电子签名合同，委托人在签署书面电子签名约定书，并以电子签名方式签署电子签名合同后方可参与本集合计划。委托人应当如实提供与签署电子签名合同相关的信息和资料，管理人和其他推广机构应当按照有关规定对委托人提供的信息和资料进行审查并如实记录。

(3) “金额参与”原则，即参与以金额申请。本集合计划单个委托人首次参与的初始认/申购金额为 30 万元人民币，追加参与的最低认/申购金额为 1 万元人民币，且认/申购金额以 1 万元为基本单位整数倍递增。首次参与指提出参与申请的委托人在参与之前未曾持有过本集合计划份额的情形。

(4) 在本集合计划推广期内，每份额参与价格为每份额的面值，集合计划每份额面值为 1.00 元人民币。开放期内，本集合计划的参与原则为“未知价”原则，即参与价格为开放期内参与当日的单位净值。

(5) 推广期内，在每日（T 日）办理认购的交易时间结束后，管理人将对委托人认购规模实行汇总统计，当委托人数达到 200 人时，T+1 日（含）起停止认购。T 日的参与申请将根据参与时间优先、时间相同情况下参与金额优先的原则（金额大者优先）进行确认，超过 200 人的认购无效，并通过管理人网站等方式对相关信息进行披露。

(6) 开放期内，每日办理申购的交易时间结束后，管理人将对当日（T 日）净申购规模实行汇总统计，当累计申购规模超过或接近预定规模（如有）时，管理人有权于 T+1 日上午九点前发出停止申购指令，在 T 日的参与申请将根据参与时间优先、时间相同情况下参与金额优先的原则（金额大者优先）对于超过预定规模（如有）的申购不予确认，并通过管理人网站等方式对相关信息进行披露。

(7) 开放期内，每日办理申购的交易时间结束后，管理人将对当日（T 日）净申购规模实行汇总统计，当委托人数达到或接近 200 人时，T+1 日（含）起停止申购。T 日的参与申请将根据参与时间优先、时间相同情况下参与金额优先的原则（金额大者优先）进行确认，超过 200 人的申购无效，并通过管理人网站等方式对相关信息进行披露。

### 3、参与的程序和确认

(1) 投资者按推广机构的具体安排，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；

委托人承诺在本集合资产管理合同有效期内，不得撤销指定账户，并妥善保管账户资料，由于委托人原因造成退出款项和收益不能及时划入指定账户及由此造成的损失，由委托人承担，管理人和托管人不承担责任。委托人办理参与业务

时应提交的文件和办理手续、办理时间、处理规则等在遵守《集合资产管理合同》规定的前提下，以推广机构的具体规定为准；

(3) 投资者签署本合同后，方可申请参与集合计划。参与申请采取“参与时间优先、时间相同情况下参与金额优先（金额大者优先）”原则进行。申请是否有效以登记结算机构的确认为准。参与申请确认有效后，构成本合同的有效组成部分；

(4) 投资者参与申请确认成功后，其参与申请和参与资金不得撤销；

(5) 投资者于T日提交参与申请后，可于T+2日后在办理参与的推广机构查询参与确认情况。

确认无效的申请，推广机构将退还委托人已交付的参与款项。

#### 4、参与费及参与份额的计算

(1) 认购费率/参与费率：0%；

(2) 参与份额的计算方法：

##### 1) 推广期参与

净认购金额=认购金额/（1+认购费率）

认购费用=认购金额-净认购金额

初始认购份额=（净认购金额/基金份额初始净值）+初始销售利息转份额

计划单位面值为1.00元。

##### 2) 开放期参与

净参与金额=参与金额/（1+参与费率）

参与费用=参与金额-净参与金额

参与份额=净参与金额/T日计划单位净值

委托人多笔参与时，按上述公式进行逐笔计算。委托人参与份额以四舍五入的方法保留小数点后两位，由此产生的差额部分计入集合计划资产的损益。

#### 5、参与资金利息的处理方式

委托人的参与资金在推广期产生的利息将折算为计划份额归委托人所有，参与资金的利息以登记结算机构的记录结果为准。

#### 6、拒绝或暂停参与的情形及处理

管理人可拒绝或暂停接受委托人参与的情形，包括但不限于：

(1) 推广期和存续期内，本集合计划规模接近或达到合同约定的最高规模上限；

(2) 战争、自然灾害等不可抗力因素导致集合计划无法正常运作；

(3) 证券交易所在交易时间非正常停市；

(4) 发生集合资产管理合同规定的暂停集合计划资产估值情况；

(5) 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；

(6) 其他可能对本集合计划业绩产生负面影响，从而损害现有委托人利益的情形；

(7) 法律、法规规定或中国证监会认定的其他情形。

如果委托人的参与被拒绝，就该委托人而言，集合资产管理合同自始无效。

发生上述第(1)、(2)、(3)项拒绝或暂停接受委托人参与情形时，管理人应当及时将拒绝或暂停接受参与的原因和处理方法以至少指定一种方式向委托人披露。在暂停参与的情况消除时，管理人应及时恢复参与业务的办理并提前3个工作日向委托人披露。

## (二) 集合计划的退出

### 1、退出的办理时间

本集合计划开放期(包括临时开放期)内，委托人可在每个工作日退出集合计划。业务办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所正常交易日的交易时间。若出现新的证券交易市场或其他特殊情况，管理人将视情况对前述退出办理的日期及时间进行相应的调整并公告。

### 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)集合计划单位净值为基准进行计算；巨额退出的情形另行约定。

(2) 采用份额退出的方式，即退出以份额申请；

(3) “先进先出”原则，即对该委托人在该销售机构参与的集合计划份额进行处理时，参与确认日期在前的集合计划份额先退出，参与确认日期在后的集合计划份额后退出。

(4) 委托人可以在推广机构规定的受理时间内撤销当日的退出申请；

(5) 若某笔退出导致该委托人的剩余金额少于 30 万元, 则余额部分必须一起退出。

### 3、退出的程序和确认

#### (1) 退出申请的提出

委托人必须根据本集合计划推广机构规定的手续, 在开放日的业务办理时间内向推广机构提出退出申请。申请退出份额数量超过委托人持有份额数量时, 申请无效。

#### (2) 退出申请的确认

T 日交易时间内提交的退出申请, 委托人可在 T+2 日 (包括该日) 之后到推广机构查询退出申请的确认情况。巨额退出、连续巨额退出的情形另行约定。

#### (3) 退出款项划付

委托人的退出申请确认后, 退出款项将在 T+5 日内从托管账户划出。如集合计划出现《集合资产管理计划合同》所述暂停估值的情形时, 管理人与托管人协商后可以将划款日期相应顺延。

### 4、退出费及退出份额的计算

#### (1) 退出费用: 0%;

#### (2) 退出金额的计算方法

本集合计划退出时以申请日计划单位净值作为计价基准, 按扣除退出费、业绩报酬后的实际金额支付。退出费和退出金额的计算公式如下:

退出金额 = (T 日计划单位净值 × 有效退出份额 - 业绩报酬) × (1 - 退出费率)

上述计算结果均以四舍五入的方法保留小数点后两位, 由此产生的差额部分计入集合计划资产的损益。退出费由委托人承担, 不列入集合计划资产。

#### (3) 收取方式

委托人退出申请确认后, 管理人将指示托管人把退出款项从集合计划托管专户划往登记结算机构, 再由登记结算机构划往各推广机构, 并通过推广机构划往申请退出委托人的指定账户, 退出款项将在 T+5 日内从托管账户划出。如集合计划出现暂停估值的情形时, 管理人与托管人协商后, 可以将划拨日期相应顺延。

### 5、退出的限制与次数

每次退出的最低份额为 10 万份，委托人可将其部分或全部集合计划份额退出。

当委托人某笔退出后导致其剩余持有金额少于 30 万元时，该部分份额将被强制退出。

本集合计划不设单个委托人退出次数限制。

#### 6、单个委托人大额退出的认定、申请和处理方式

本集合计划不设单个委托人大额退出限制条款。

#### 7、巨额退出的认定和处理方式

##### (1) 巨额退出的认定

单个开放日，委托人当日累计净退出申请份额（退出申请总份额扣除参与申请总份额之后的余额）超过上一工作日计划总份额数的 20% 时，即为巨额退出。

##### (2) 巨额退出的顺序、价格确定和款项支付

发生巨额退出时，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：

全额退出：当管理人认为有条件支付委托人的退出申请时，按正常退出程序办理。

部分顺延退出：当管理人认为支付委托人的退出申请可能会对计划资产净值造成较大波动时，管理人在当日接受净退出比例不低于上一日集合计划总份额 20% 的前提下，对其余退出申请予以延期办理。对于当日的退出申请，将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；未能受理的退出部分，委托人可选择延期办理或撤销退出申请，如委托人不进行选择则默认为委托人撤销退出申请。对于选择延期办理的退出申请，管理人将在下一个工作日内办理，并以该工作日的计划单位净值为准计算退出金额，依此类推，直至全部办理完毕为止，但不得超过正常支付时间 20 个工作日，转入下一个工作日的退出申请不享有优先权。

##### (3) 告知客户的方式

发生巨额退出并延期支付时，管理人应在 3 个工作日内在管理人指定网站公告，并说明有关处理方法。

#### 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

如果本集合计划连续 2 个开放日发生巨额退出,即认为发生了连续巨额退出。

#### (2) 连续巨额退出的顺序、价格确定和款项支付

本集合计划发生连续巨额退出,管理人可按说明书及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 20 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 20 个工作日,并在管理人指定网站上进行公告。

#### 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运转;

(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) 法律、行政法规和中国证监会认定的其他情形或其他在本合同及说明书中已载明的特殊情形。

发生上述情形之一的,管理人将在当日立即公告。已接受的退出申请,若管理人有足额支付退出申请,则管理人将足额支付退出申请;如暂时不能足额支付的,将按每个退出申请人已被接受的退出申请量占已接受退出申请总量的比例分配给退出申请人,其余部分在后续工作日予以退出。发生拒绝或暂停受理退出的情形时,管理人应将拒绝或暂停受理退出的原因和处理办法在管理人网站进行信息披露。在暂停退出的情况消除时,管理人应在不超过正常支付时间 20 个工作日内及时恢复退出业务的办理。

发生说明书、资产管理合同中未予载明的事项,但集合计划管理人有正当理由认为需要暂停接受集合计划退出申请的,应与托管人协商一致,并向委托人披露。

#### (三) 临时开放期的触发条件、程序及披露等相关安排

### 1、触发条件

本集合计划，管理人可在出现以下情况时设置临时开放期：

(1) 经征询托管人意见后拟变更集合资产管理合同的，管理人进行合同变更公告或向投资者发送合同变更征询意见函后，可视情况增设临时开放日仅允许投资者退出集合计划；

(2) 在法律法规、监管政策等变化的情况下，依照法律法规、监管政策的要求，管理人可增设临时开放日仅允许投资者退出集合计划。

### 2、临时开放程序及披露

(1) 管理人拟对本集合计划进行临时开放，应提前 2 个工作日在管理人指定网站上公告临时开放期具体事项，同时报送证券投资基金业协会。

(2) 临时开放期内投资者仅可退出本集合计划，具体退出程序按照本合同开放期内退出程序。

因设置临时开放期，投资者选择退出本集合计划的，不受持有集合资管计划份额最低期限的限制（如有）。

## 六、管理人自有资金参与集合计划

### 1、管理人可以以自有资金参与本集合计划：

在本集合计划推广期起始日至集合计划终止日内，管理人可以以自有资金参与本集合计划。

管理人以自有资金参与本集合计划，应符合《管理办法》、《管理规定》和监管机构的相关规定。

### 2、自有资金参与的金额和比例：

管理人自有资金持有本集合计划份额及对应的资产净值，均不得超过相关法律法规、监管机构规定的比例，且参与份额不超过计划总份额的 15%。

### 3、自有资金的收益分配及责任：

管理人持有计划份额与委托人持有计划份额享有同等参与收益分配的权利，与委托人持有的计划份额同等承担风险和责任。

### 4、自有资金退出的条件：

管理人自有资金参与部分在出现以下情况之一时，可以退出本集合计划：

(1) 管理人自有资金参与份额, 满足参与时间不少于 6 个月条件时, 可与其他委托人同样办理退出业务。

(2) 管理人自有资金参与本集合计划的份额及对应的资产净值, 均不得超过相关法律法规、监管机构规定的比例。因集合计划规模变动(含份额、净值变动)等客观因素导致自有资金参与集合计划的比例被动达到相关法律法规、监管机构规定的预警标准或者不符合规定标准的, 管理人应当将部分自有资金参与份额在本集合计划开放期办理退出业务或非开放期间办理份额强制退出, 以使自有资金比例在相关法律法规规定的时限内符合法规要求。法律法规另有规定时, 从其规定。

(3) 法律法规或监管机构规定的允许自有资金退出的其他情况。

5、管理人自有资金参与集合计划的持有期限不得低于 6 个月, 参与、退出时应当提前 5 个工作日告知委托人和托管人, 法律法规或本合同另有规定的除外。

6、风险揭示: 管理人自有资金退出, 可能遭遇流动性风险, 从而影响计划损益。管理人将认真履行管理人职责, 关注计划规模变动情况, 控制风险。管理人以自有资金参与本集合计划并不代表管理人对本集合计划的风险和收益水平作任何形式的判断, 管理人自有资金参与份额与其他持有计划同类份额享有同等权利并承担相同责任。

7、信息披露: 管理人及时在管理人指定网站公告自有资金参与及退出的相关情况。

## 七、集合计划的分级及止损线

本集合计划不进行分级。

本集合计划的止损线为 0.9。当本集合计划净值达至止损线后, 除不可抗力等非管理人所能控制的原因外, 管理人应当暂停交易, 清空所有持仓。由于流动性不足、交易所交易规则等市场原因无法平仓的, 未平仓部分可以顺延至下一个交易日, 直至账户资产全部变现。该平仓操作不可逆, 直至账户资产全部变现为止。

本计划计划设置止损线不意味着管理人保证以净值 0.9 作为集合计划清算值, 在平仓过程中产生的收益和损失均由集合计划承担。

## 八、集合计划客户资产的管理方式和管理权限

### (一)管理方式

委托资产的管理方式为委托人向管理人委托资金,由管理人按照本合同约定进行投资管理。委托资金的投资及核算与管理人自有资产及管理人管理的其他资产相互独立。

### (二)管理权限

委托人授权管理人在本合同约定的投资范围、委托期限以及投资限制内进行投资管理。管理人不对委托人的本金和收益做出任何承诺和保证。

## 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低于 3000 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,管理人公告本集合计划成立。

集合计划设立完成前,委托人的参与资金只能存入证券登记结算机构指定的专门账户,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 3000 万元或委托人的人数少于 2 人条件下,或推广期内发生使本集合计划无法设立的不可抗力,集合计划设立失败,管理人承担集合计划的全部推广费用,并将已认购资金及利息(以登记结算机构的记录为准)在推广期结束后 30 个工作日内退还集合计划委托人,退还完毕各方互不承担其他责任。

### (三)集合计划开始运作的条件和日期

1、条件:本集合计划公告成立。

2、日期:本集合计划自成立之日起开始运作。

管理人发起设立集合资产管理计划后 5 个工作日内,应当将发起设立情况报相关监管机构或自律组织等备案。

## 十、集合计划账户与资产

### （一）集合计划相关账户的开立与管理

#### 1、托管账户

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

（2）该托管专用账户名称应为“国盛资管国盛1号集合资产管理计划”[备注：账户名称以实际开立账户名称为准]，托管账户预留印鉴为“广发银行股份有限公司托管业务专用章（XX）”和管理人法定代表人（授权代表）人名章各一枚。（券商结算模式必须为管理人名义开户）；

#### 2、投资交易账户

（1）托管人根据管理人委托按中国证券登记结算有限责任公司相关规定为委托资产开立专用证券账户及其他相关账户，专用证券账户的持有人名称应当符合证券登记结算机构的有关规定。

（2）本合同当事人应当在开户过程中给予开立账户方必要的配合，并提供所需资料。

（3）与委托资产投资有关的其他账户，由管理人与托管人根据相关法律法规和本合同的规定协商一致后办理，新账户按有关规则使用并管理。

（4）集合计划账户、专用交易单元应由集合计划管理人报证券交易所备案。

### （二）集合计划资产的构成

本集合计划资产的构成主要有：

集合计划所拥有的银行存款本息、债券及其他投资等资产。

### （三）集合计划资产的管理与处分

集合计划资产由托管人托管，并独立于管理人及托管人的自有资产及其管理、

托管的其他资产。管理人或托管人的债权人无权对集合计划资产行使冻结、扣押及其他权利。除依照《管理办法》、《管理规定》、《集合资产管理合同》、《说明书》及其他有关规定处分外，集合计划资产不得被处分。

## 十一、集合计划资产托管

本集合计划资产交由广发银行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：集合计划资产总值是指其所购买的各类证券、银行存款本息以及其他资产的价值总和。

（二）资产净值：集合计划资产净值是指集合计划资产总值减去负债后的余额。

（三）单位净值：集合计划单位净值是指集合计划资产净值除以当日集合计划份额总数计算得到的每集合计划份额的价值

（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：集合计划所拥有的银行存款本息、债券等所有资产。

（六）估值日：估值日指本集合计划成立后的每个工作日，即上海证券交易所和深圳证券交易所的正常交易日。

（七）估值方法：

估值应符合本合同、《证券公司客户资产管理业务规范》中的估值原则、《证券公司客户资产管理业务估值方法指引》、及其他法律、法规、自律规则的规定，如法律法规未做明确规定的，参照行业通行做法处理。资产管理人、资产托管人的估值数据应依据合法的数据来源独立取得。对于固定收益类投资品种的估值应

依据中国基金业协会证券投资基金估值工作小组的指导意见及指导价格估值。

#### 1、投资固定收益品种的估值方法

(1) 在证券交易所市场挂牌交易实行净价交易的债券按第三方估值机构公布的收益率曲线及估值价格估值；第三方估值机构未公布的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近第三方估值机构公布的收益率曲线及估值价格估值。；如果第三方估值机构未公布的，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考监管机构和行业协会估值意见，或者参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。

(2) 在证券交易所市场挂牌交易实行全价交易的债券（含可转债），选取第三方估值机构提供的估值全价减去估值全价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。第三方估值机构未公布的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近第三方估值机构公布的估值价格估值。如果第三方估值机构未公布的，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考监管机构和行业协会估值意见，或者参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。

(3) 首次发行未上市债券按第三方估值机构公布的估值价格估值，如第三方估值机构未公布估值价格，可采用估值技术确定公允价值，如无法以估值技术确定公允价值，则按成本法确定估值价格。

(4) 在对银行间市场的固定收益品种估值时，以第三方估值机构公布的估值价格估值，如第三方估值机构未公布估值价格，可采用估值技术确定公允价值，如无法以估值技术确定公允价值，则按成本法确定估值价格。

(5) 对在银行间市场、交易所上市交易的资产支持证券，按成本估值。

(6) 私募债按成本估值；

(7) 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、投资证券投资基金的估值方法

(1) 持有的交易所上市基金（包括封闭式基金、上市开放式基金（LOF）、创新型分级基金等），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，或者类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值；

(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份额净值估值；估值日前一交易日基金份额净值无公布的，按此前最近交易日的基金份额净值估值；

(3)持有的货币市场基金及理财债券基金，按基金管理公司公布的估值日前一交易日的每万份收益计提红利；

(4)持有的基金处于封闭期的，按照最新公布的份额净值估值；没有公布份额净值的，按照成本估值。

### 3、投资证券衍生品的估值方法（若有）

股指期货以估值日金融期货交易所的当日结算价估值，该日无交易的，以最近一日的结算价估值。

### 4、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。

5、估值方法是指管理人和托管人协商一致的，被市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的确定公允价值的方法。如有确凿证据表明按上述规定不能客观反映集合计划资产公允价值的，管理人可根据具体情况，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，在与托管人商议后，按最能反映集合计划资产公允价值的方法估值。

6、相关法律法规、监管部门及自律组织等有强制规定的，从其规定。如有新增事项或更新规定，按国家最新规定估值。

### （八）估值程序：

集合计划的日常估值由管理人每日日终前进行，托管人复核。用于公开披露的集合计划单位净值由管理人完成估值后，将估值结果以传真或以其他双方认可的书面方式发送至托管人，集合计划托管人进行复核，托管人复核无误后返回给管理人。当管理人与托管人的估值结果不一致时，各方应本着勤勉尽责的态度重新计算核对。如果仍无法达成一致，应以管理人的估值结果为准。如因管理人估值错误，由此给集合计划财产或委托人造成损失的，由管理人承担相应责任，托

管人无过错的不承担责任。

(九) 单位净值错误与遗漏的处理方式：

1、本集合计划单位净值的计算精确到 0.0001 元，小数点后第五位四舍五入。当资产估值导致本集合计划单位净值小数点后四位（含）以内发生差错时，视为本集合计划单位净值错误。当发生净值计算错误时，由管理人负责处理。因计划份额净值发生估值差错造成集合计划委托人和集合计划造成损失的，由管理人负责先行赔偿，赔偿原则如下：赔偿仅限于因差错而导致的委托人的直接损失；管理人代表本集合计划保留要求相关当事人返还不当得利的权利；管理人在赔偿后，有权向有关责任方追偿；如果管理人计算的计划单位资产净值错误，且已由托管人复核确认后披露的，由此给计划或计划委托人造成的损失，就实际支付的赔偿金额，管理人和托管人按照各方的过错程度各自承担相应责任。

2、管理人和托管人应采取必要、适当、合理的措施确保本集合计划资产估值的准确性和及时性。当估值出现错误时，本集合计划管理人应当立即予以纠正，通知托管人并采取合理的措施防止损失进一步扩大。

3、本计划的会计责任方由管理人担任，与本计划有关的会计问题，如经双方在平等基础上充分讨论后，尚不能达成一致时，按管理人的建议执行；或者管理人和托管人对计划净值的计算结果，虽然多次重新计算和核对，尚不能达成一致时，为避免不能按时公布计划净值的情形，以管理人的计算结果对外公布；如因管理人计算错误由此给委托人和集合计划财产造成的损失由管理人承担，托管人无过错的不承担任何责任。

4、特殊情形的处理

管理人按估值方法的第 4 项存款的估值方法进行估值时，所造成的误差不作为计划单位净值错误处理。

由于不可抗力原因，或由于证券交易所及登记结算机构非正常暂停或停止交易、发送的数据错误，或由于管理人或托管人不可控制的其他原因，管理人或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、集合计划资产净值计算错误，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减轻或消除由此造成的影响。

5、法律法规或者监管部门另有规定的，从其规定。如果行业有通行做法，

双方当事人应本着平等和保护集合计划持有人利益的原则进行协商确定处理原则。

(十) 暂停估值的情形：当出现下列情形致使集合计划管理人无法准确评估集合计划资产价值时，可暂停估值。但估值条件恢复时，集合计划管理人必须按规定完成估值工作。

1、集合计划投资所涉及的证券交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

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

#### (十一) 计划会计制度

按国家有关部门规定的会计制度执行。

#### (十二) 计划账册的建账和对账

##### 1、集合计划账册的建账

集合计划会计核算责任由管理人承担，托管人也应按国家有关规定，独立地设置、记录和保管本集合计划的全套账册。

##### 2、凭证保管及核对

证券交易凭证由托管人和管理人分别保管并据此建账。

管理人与托管人对集合计划账册每日核对一次。经对账发现双方的账目存在不符的，管理人和托管人应及时查明原因并纠正，保持双方的账册记录完全相符。

#### (十三) 集合计划财务报表与报告的编制和复核

##### 1、财务报表的编制

集合计划财务报表由管理人编制，托管人复核。

##### 2、报表复核

托管人在收到管理人编制的集合计划财务报表后，进行独立的复核。核对无误后，在核对过的集合计划财务报表上加盖托管人和管理人业务公章，各留存一份。核对不符时，应及时通知管理人共同查出原因，进行调整，调整以国家有关规定为准。

##### 3、报表的编制与复核时间安排

季度报告，即季度资产管理报告、季度资产托管报告，应于每个季度结束后

的1个月内完成,本集合计划成立不足3个月或者存续期间不足3个月时,可以不编制当期的季度报告;管理人应在每个季度结束后按时完成季度报告,以邮件方式或其他双方约定的方式将季度报告提供托管人复核;托管人应在3个工作日内完成复核,并将复核结果书面通知管理人。

上述报告应由管理人于每年度截止日后4个月内通过管理人网站通告。集合计划成立不足3个月时,可以不编制当期的年度报告。

年度报告,即年度资产管理报告、年度资产托管报告,在会计年度结束后4个月内完成,本集合计划成立不足3个月或者存续期间不足3个月时,可以不编制当期的年度报告。管理人应在会计年度结束后按时完成年度报告,以邮件方式或其他双方约定的方式将有关报表提供托管人复核;托管人应在15个工作日内完成复核,并将复核结果通知管理人。

### 十三、集合计划的费用、业绩报酬与税收

#### (一) 费用种类

- 1、管理人的管理费;
- 2、托管人的托管费;
- 3、证券交易费用;
- 4、证券账户开户费;
- 5、本集合计划成立后的信息披露费用;
- 6、本集合计划成立后的会计师费和律师费;
- 7、因集合计划资金划付支付的银行汇划费;
- 8、集合计划运营过程中发生的增值税以及与集合计划缴纳税收有关的手续费、汇款费等。除法律法规另行规定外,管理人和托管人不对委托人承担的各类税负进行代扣代缴;

#### 9、业绩报酬;

#### 10、按照国家有关规定可以列入的其他费用。

#### (二) 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:

本集合计划的管理费按前一日集合计划的资产净值计提,管理费的年费率为

0.5%。计算方法如下：

$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$

H 为每日应计提的集合计划管理费

E 为前一日集合计划资产净值

集合计划管理费每日计提，按月支付。经管理人与托管人双方核对无误后，由托管人于次月首日起 5 个工作日内从集合计划资产中一次性支付给管理人。

## 2、托管费：

本集合计划的托管费按前一日集合计划的资产净值计提，托管费的年费率为 0.03%。计算方法如下：

$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$

H 为每日应计提的集合计划托管费

E 为前一日集合计划资产净值

集合计划托管费每日计提，按月支付。经管理人与托管人双方核对无误后，由托管人于次月首日起 5 个工作日内从集合计划资产中一次性支付给托管人。

托管费收入账户信息：

户 名：同业托管业务收入

账 号：5102730000

开户银行：广发银行股份有限公司深圳分行

## 3、管理费和托管费的调整

管理人和托管人可协商调减管理费和托管费，并在新的费率开始实施前 3 个工作日在管理人指定网站公告。管理人公告管理费、托管费等费用的调整，应在公告前将相关公告传真至托管人，并与托管人电话确认。

## 4、证券交易费用

本集合计划投资运作期间所发生的经手费、证管费、过户费、印花税、交易单元费和证券结算风险基金等，直接计入投资成本或者作为当期费用，其费率由管理人根据有关政策法规确定。本集合计划向所租用交易单元的券商支付佣金（该佣金已经扣除风险金），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 个工作日内支付给提供交易单元的券商。

## 5、其他费用

银行结算费用、银行账户维护费用，在发生时一次性计入本集合计划费用。

银行间市场账户维护费，按银行间市场规定的金额，在发生时一次性计入本集合计划费用。

开户费、银行间交易相关维护费用、转托管费用、注册登记相关费用（包括但不限于服务月费、登记结算费、年度电子合同服务费等）等集合计划运营过程中发生的相关费用，在发生时一次性计入本集合计划费用。

在本集合计划存续期间发生的、与集合计划相关的审计费（按与会计师事务所签定协议所规定的金额）、律师费、信息披露费以及按照国家有关规定可以列入的其他费用等，在相应的会计期间，按直线法在每个自然日内平均摊销。

在本集合计划清算过程中因处置未变现集合计划资产而产生的全部费用（包括但不限于诉讼费、仲裁费、律师费、公证费、拍卖费及其他形式的资产处置费等费用），在发生时可计入本集合计划费用。

6、其他费用：其他费用由管理人本着保护委托人利益的原则，按照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定，由托管人按费用实际支出金额支付，列入当期集合计划费用。本合同项下的管理费、业绩报酬、托管费及其他管理人或托管人收取的各类费用均为包含增值税的含税价。

### （三）不列入集合计划费用的项目

集合计划成立前发生的费用，以及存续期间发生的与推广有关的费用，不得在集合计划资产中列支。管理人和托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或集合计划资产的损失以及处理与集合计划运作无关的事项发生的费用等不得列入集合计划费用。

### （四）业绩报酬

#### 1、收取业绩报酬的原则：

符合业绩报酬提取条件时，在本集合计划收益分配基准日、委托人退出日和本集合计划终止日计提并支付业绩报酬。

#### 2、业绩报酬的计提方法：

本集合计划的业绩报酬计提基准为产品发行日一年期贷款基准利率基础上加1%，业绩报酬的计提比例为20%，具体业绩报酬计提基准值以募集公告为准。自产品成立之日起每满一年，管理人可根据一年期贷款基准利率的变化对业绩报

酬计提基准值进行调整,并通过管理人公告进行公布。业绩报酬计提基准值调整的应设置或衔接开放日。

在本集合计划的收益分配基准日、委托人退出日和本集合计划终止日,以每笔份额上一个发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日(如上一个发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日不存在,推广期参与的为本集合计划成立日,存续期参与的为参与当日)至本次业绩报酬计提日期间的年化收益率作为计提业绩报酬的基准,年化收益率在业绩报酬计提基准以上则提取 20%的业绩报酬。

按公式表示如下:

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

A 为业绩报酬计提日的累计单位净值;

B 为上一个业绩报酬计提日的累计单位净值;

C 为上一个业绩报酬计提日的单位净值;

D 为上一业绩报酬计提日与本次业绩报酬计提日间隔天数;

| 年化收益率 (R)                | 计提比例 | 业绩报酬 (H) 计算方法                                                            |
|--------------------------|------|--------------------------------------------------------------------------|
| $R \leq \text{业绩报酬计提基准}$ | 0    | $H = 0$                                                                  |
| $R > \text{业绩报酬计提基准}$    | 20%  | $H = (R - \text{业绩报酬计提基准}) \times 20\% \times C \times F \times D / 365$ |

注: F 为提取业绩报酬的份额。

具体业绩报酬计提金额以管理人公告为准。

### 3、业绩报酬支付:

由管理人向托管人发送业绩报酬划付指令,托管人复核后于 5 个工作日内将业绩报酬支付给管理人。若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。

### (五) 税费缴纳

根据财政部和国家税务总局《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》(财税【2016】140 号文)、《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》(财税【2017】2 号文)、《关于资管产品增值税有关问题的通知》(财税【2017】56 号文)及其后续颁布的具体征收管理办法等相关文件(若有)中

“资管产品运营过程中发生的增值税应税行为”需缴纳的增值税及附加相关规定，资管产品应缴纳的增值税及附加由委托资产承担，由此会导致委托资产投资收益减少。后续颁布的法律、法规、规章等如有新的规定，按新的规定执行。本合同第十三条约定收取的管理费、托管费、业绩报酬（若有）均不含上述提到的“资管产品运营过程中发生的增值税应税行为”需缴纳的增值税及附加。如果管理人在向委托人交付相关收益或资产后税务机关要求管理人缴纳相关税费的，委托人应按照管理人通知要求进行缴纳；委托人不得要求管理人以任何方式向其返还或补偿该等税费。

#### 十四、集合计划的收益分配

##### （一）收益的构成

收益包括：集合计划投资所得红利、票息、买卖证券价差、银行存款利息及其他合法收入。集合计划的净收益为集合计划收益扣除按照国家有关规定可以在集合计划收益中扣除的费用后的余额。

（二）可供分配利润：指截至收益分配基准日资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

##### （三）收益分配的条件

集合计划单位净值不低于面值，且有可供分配利润时，管理人可以进行收益分配。

##### （四）收益分配原则

- 1、同一类集合计划份额享有同等分配权；
- 2、收益分配基准日的份额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；
- 3、T日参与的计划份额不享有当日收益分配权益，自下一工作日起享有收益分配权益；T日退出的计划份额享有当日收益分配权益，自下一工作日期不享有收益分配权益；
- 4、当期收益先弥补上一年度亏损后，方可进行当年收益分配；
- 5、若成立不满三个月不进行收益分配；
- 6、本集合计划的默认分红方式为现金分红，委托人可以选择现金分红或者

红利再投资分红方式。选择采取现金分配的，管理人向托管人发送划付指令，托管人根据指令将收益分配款项划入登记结算机构，登记结算机构将收益分配款划入相应推广机构结算账户，由推广机构划入委托人的交易账户，现金红利在现金红利款自款项从集合计划托管账户划出之日起7个工作日内划转到委托人的交易账户；选择采取红利再投资方式的，分红资金扣除管理人应计提业绩报酬（如有）后按分红除权日的单位净值转成相应的集合计划份额，红利再投资形成的集合计划份额计算保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分采用去尾法，由此产生的差额部分计入集合计划资产。

7、收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由委托人自行承担。

8、法律法规另有规定的从其规定。

在符合上述原则和具备收益分配条件的情况下，分红时间和分配比例由管理人根据实际情况决定。

（五）收益分配预告的确定与披露：本集合计划收益分配预告由集合计划管理人拟定，至少在T-5日通知托管人，至少在T-5日（T为权益登记日）之前将收益分配预告在管理人网站进行信息披露。

## 十五、投资理念与投资策略

### （一）投资目标

本集合计划以追求绝对收益为目标，在有效控制投资组合风险的前提下，追求资产净值的长期增值。

### （二）投资理念

严控风险，以资产净值的稳健增长为导向；灵活配置，把握具有较高确定性的投资机会。

### （二）投资策略

本集合计划在投资策略上充分发挥管理人在资产配置方面的特长，根据不同的市场行情调整债券投资策略，以期能为投资者创造长期稳健的投资回报。通过对投资债券、回购做出规划（包括债券组合的规模、投资期限、期间的流动性安排等），综合运用期限结构管理策略、久期管理策略、信用债策略等多种方法，结合债券的流动性、信用风险分析等多种因素，对个券进行积极的管理；同时跟

踪市场行情，及时调整策略，在做好风险控制的同时，获取组合收益。

### （1）债券组合投资策略

通过全面研究 GDP、物价等主要经济变量，分析宏观经济运行的可能情景，并预测财政政策、货币政策等宏观经济政策取向，分析金融市场资金供求状况变化趋势及结构，预测利率水平变动趋势以及收益率曲线形状变化趋势。在定性分析的基础上，结合定量分析工具以确定组合的久期及期限结构管理策略。

#### a) 久期策略

分析未来较长一段时间市场利率的变化趋势，当预期市场利率将上升，导致中长债持有期收益低于短期债券或者货币市场工具收益时，降低债券组合久期；而当预期利率水平稳定或者下降，导致中长期债券持有收益高于短期债券和货币市场工具收益时，上调债券组合久期。

#### b) 期限结构管理策略

在确定组合久期的基础上，本集合计划针对收益率曲线形态变化确定合理的组合期限结构，在长期、中期和短期债券间进行动态调整。一般而言，在预期收益率曲线变陡、变平、不变或平行移动时，分别采用子弹策略、哑铃策略和梯形策略。

#### c) 信用债投资策略

通过研究市场整体信用风险趋势，结合信用债券的供需情况以及替代资产相对吸引力，分析信用利差趋势，并结合利率风险，确定组合的信用债投资比例，然后依据信用风险和流动性风险进行个券选择。根据经济运行周期阶段，分析发行主体所处行业发展前景、财务状况、债务水平等因素，评价发行人的信用风险，并根据发行条款，分析债券的信用级别。根据债券到期收益率相对于市场收益率曲线的偏离程度，结合其期限、信用等级、流动性等因素，确定其相对投资价值，在相似的信用风险下，选择具有相对价值的品种进行投资。

### （2）可转债投资策略

可转债不同于一般的企业债券，其投资人具有在一定条件下转股、回售的权利，因此其理论价值等于作为普通债券的基础价值加上可转债内含选择权的价值。本集合计划投资于可转债，主要目标是在控制本集合计划净值下行风险的同时，分享股票升值的收益潜力。可转换债券的价值主要取决于其债券价值和转股权价

值，本集合计划将对可转换债券的价值进行评估，选择具有较高投资价值的可转换债券。

通过对发行公司的基本面进行分析，包括所处行业的景气度、公司成长性、市场竞争力等，并参考同类公司的估值水平，判断可转换债券的股权投资价值；基于对利率水平、票息率、派息频率及信用风险等因素的分析，判断其债券投资价值；采用国外成熟的量化分析定价模型，估算可转换债券的转股权价值。综合以上因素，对可转换债券进行定价分析，制定可转换债券的投资策略。

此外，本计划还将根据新发可转债的预计中签率、模型定价结果，积极参与可转债新券的申购。

## 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《集合资产管理合同》的有关规定为决策依据，并以维护集合计划委托人利益作为最高准则。具体决策依据包括：

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

2、国内外经济形势、利率变化趋势以及行业与上市公司基本面研究；

3、投资对象收益和风险的匹配关系，本集合计划将在充分权衡投资对象的风险和收益的前提下做出投资决策。

### （二）集合计划的投资程序

#### 1、投资决策程序

严格的投资管理制度和程序可以保证投资理念的正确执行，避免重大风险的发生。本计划采取公司投资决策委员会和投资业务部门投资决策小组领导下的投资主办负责制。管理人设立风险管理部，对集合资产管理计划进行绩效分析和风险评估。

#### 2、研究分析

宏观策略分析师和行业分析师在借鉴外部研究成果的基础上，开展宏观经济及政策分析、证券期货市场分析、行业及上市公司分析；定量分析师负责量化策略的研究、模型的构建、检验、维护和运行结果的报告。通过以上研究工作，为

公司投资决策委员会、部门投资决策小组以及投资主办提供独立、统一的投资决策支持。

### 3、投资决策

公司投资决策委员会是客户资产管理方面的最高决策机构，定期就投资管理重大问题进行讨论，确定投资策略以及对部门投资决策小组的授权。

投资业务部门投资决策小组定期和不定期召开会议，对宏观经济形势、利率趋势、证券期货市场走势等进行综合分析，根据计划投资目标和模型运行结果作出判断，确定集合计划下一阶段的大类资产配置比例；审核投资主办提交的投资计划以及审核其他涉及计划投资管理的重大问题。

### 4、组合构建

投资主办在投资决策小组核定的资产配置比例范围内，结合集合计划有关投资品种、投资限制等规定完成投资组合的构建。

### 5、交易执行

管理人设置独立的集中交易室，交易员负责在合法合规的前提下，执行投资主办的投资指令，并实施一线风险监控。

### 6、风险与绩效评估

风险管理部对集合计划的投资行为进行合规性监控，对投资过程中存在的风险隐患进行风险提示，并就投资组合提出风险管理建议；定期或不定期对集合计划进行风险和绩效评估，对投资组合承担的风险水平以及是否符合既定的投资策略提供相关报告。

### 7、组合监控与调整

投资主办将跟踪经济状况、证券期货市场和上市公司的发展变化，结合集合计划参与和退出的现金流量情况，以及组合风险与绩效评估的结果，对投资组合进行监控和调整，使之不断得到优化。

## （三）风险控制

### 1、风险控制原则

（1）全员参与原则。公司所有部门、全体员工都是风险管理的责任主体，根据各部门、岗位职责的要求承担相应的风险管理责任与义务，做到风险控制人人有责，各风险管理单元是风险管理的第一道防线；

(2) 适应性原则。公司风险管理必须与经营规模、业务范围、竞争状况相适应,在风险可控、可承受的基础上,实现收益和风险之间的平衡;

(3) 全面性原则。风险管理必须涵盖公司各部门、各项业务、各项管理、各个环节、各个岗位,贯穿于业务操作及管理全过程;

(4) 统一性原则。风险管理计量、汇总、预警和监控应实现同一业务、同一客户相关风险计量信息的集中统一管理;

(5) 透明性原则。公司应确保风险信息沟通和披露的及时、准确、完整,公司的风险管理状况应充分接受内、外部的监督;

(6) 前瞻性原则。公司应合理预测可能发生的风险,并采取相应的措施和手段加以控制。

## 2、风险控制架构

针对本计划在运作过程中面临的风险,管理人制定了一系列严密有效的风险控制制度,并建立了由董事会、监事(会)、经理层风险管理委员会、风险管理部门、各风险管理单元组成的风险管理体系,且建立和完善对风险的事前防范、事中监测和控制、事后稽查和提示的管理机制。各风险管理单元岗位人员在各个风险控制环节合理分工、相互独立、相互制衡,有效隔离和控制风险。

## 3、风险控制流程

(1) 建立风险管理环境:具体包括制定风险管理战略、目标,设置相应的组织机构,配备相应的人力资源与技术系统,设定风险管理的时间范围与空间范围等内容。

(2) 识别风险:辨识组织系统与业务流程中存在什么样的风险,为什么会存在以及如何引起风险。

(3) 分析风险:检查存在的控制措施,分析风险发生的可能性及其引起的后果。

(4) 度量风险:评估风险水平的高低,既有定性的度量手段,也有定量的度量手段。定性的度量是把风险水平划分为若干级别,每一种风险按其发生的可能性与后果的严重程度分别进入相应的级别。定量的方法则是设计一些风险指标,测量其数值的大小。

(5) 处理风险:将风险水平与既定的标准相对比,对于那些级别较低的风

险，则承担它，但需加以监控。而对较为严重的风险，则实施一定的管理计划，对于一些后果极其严重的风险，则准备相应的应急处理措施。

(6) 监视与检查：对已有的风险管理系统要监视及评价其管理绩效，在必要时适时加以改变。

(7) 报告与咨询：建立风险管理的报告系统，使管理人管理层及监管部门了解管理人风险管理状况，并向其咨询意见。

(8) 评估与总结：主要针对风险控制过程中业务人员的业绩和工作效果进行评价和总结。

#### 4、风险控制措施

委托人投资于本集合计划会面临市场风险、流动性风险、信用风险、操作风险等其他风险。本计划管理人针对这些风险采取以下风险管理措施。

##### (1) 市场风险管理

市场风险是本集合计划需要控制的主要风险。市场风险的管理主要通过研究分析、投资决策、交易执行和风控操作来贯穿事前、事中、事后的执行。

| 事前      | 事中      | 事后   |
|---------|---------|------|
| 决策授权管理  | 集中交易制度  | 绩效评估 |
| 系统权限管理  | 投资审批流程  | 风险报告 |
| 投资备选池管理 | 风控阈值设置  | 内部稽核 |
| 投资策略管理  | IT 实时监控 |      |
| 风控策略    | 风险量化评估  |      |

##### (2) 流动性风险管理

为保证投资组合的变现能力，管理人将对组合资产的流动性指标进行监控。通过交易周期安排和品种搭配进行流动性调整，使整体组合的流动性良好；或通过降低持股、持券集中度、增加现金比例等方式提高组合资产的流动性。针对应对赎回产生的流动性风险，管理人将综合考虑组合资产的变现能力和计划持有人的现金需求，采取相应控制措施对集合计划的流动性作出安排。

##### (3) 信用风险管理

集合计划均投资于具有良好信用等级的证券，并通过分散化投资以分散信用风险。同时，本计划选择商业信誉好的交易对手，以降低信用风险。

#### (4) 操作风险管理

管理人通过职责分离、岗位制衡、授权管理、操作标准、记录完整、及时考核等业务控制方式防止操作风险,使风险管理工作覆盖集合资产管理计划各环节。

#### (5) 合规性风险管理

管理人的合规部门对业务开展的关键环节严格把关,从授权和制度上防止合规风险的发生;同时,管理人业务定期报告监管部门,时刻接受监管部门的业务指导和合规检查。

#### (6) 其他风险管理措施

除了上述针对特定投资风险采取专门的管理措施之外,管理人还针对各个可能的风险点建立各种风险防范和控制措施,以及建立风险管理与控制相匹配的信息技术系统支持,实现对集合资产管理业务全流程、实时、动态的风险管理与控制。

### 十七、投资禁止行为

本集合计划的禁止行为包括:

- 1、违规将集合计划资产用于资金拆借、贷款、抵押融资或者对外担保等用途;
- 2、将集合计划资产用于可能承担无限责任的投资;
- 3、向客户做出保证其资产本金不受损失或者保证其取得最低收益的承诺;
- 4、挪用集合计划资产;
- 5、募集资金不入账或者其他任何形式的账外经营;
- 6、募集资金超过合同及计划说明书约定的规模;
- 7、接受单一客户参与资金低于中国证监会规定的最低限额;
- 8、使用集合计划资产进行不必要的交易;
- 9、内幕交易、利益输送、操纵证券价格、不正当关联交易及其他违反公平交易规定的行为;
- 10、法律、行政法规和中国证监会禁止的其他行为。

## 十八、集合计划的信息披露

### （一）集合计划单位净值报告

披露时间：本集合计划开放期间，每个工作日披露前一个工作日的单位净值；本集合计划封闭期间，每周第一个工作日披露上一周最后一个工作日的单位净值。

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

### （二）集合计划定期报告

定期报告包括集合计划的资产管理季度（年度）报告、托管季度（年度）报告和年度财务会计报告。

#### 1、集合计划的资产管理季度报告和托管季度报告

管理人每季度向投资者提供一次季度报告，资产管理季度报告由管理人根据监管要求编制，经托管人复核后由管理人公告，并报相关监管机构或自律组织等备案。托管人每季度向投资者提供一次季度托管报告。上述报告应由管理人于每季度截止日后1个月内通过管理人网站披露，同时报送中国证监会相关派出机构、证券投资基金业协会。集合计划成立不足3个月或者存续期间不足3个月时，可以不编制当期的季度报告。

集合计划的季度报告内容包括但不限于下列信息：

- （1）管理人履职报告；
- （2）托管人履职报告；
- （3）资产管理计划投资表现；
- （4）资产管理计划投资组合报告；
- （5）资产管理计划运用杠杆情况（如有）；
- （6）资产管理计划支付的管理费、托管费、业绩报酬（如有）等费用的计提基准、计提方式和支付方式；
- （7）资产管理计划投资收益分配情况；
- （8）投资经理变更、重大关联交易等涉及投资者权益的重大事项；
- （9）中国证监会规定的其他事项。

若中国证监会等监管机构对集合资产管理计划参与上述标的的信息披露另有规定的，从其规定。

## 2、集合计划的资产管理年度报告和托管年度报告

管理人每年度向投资者提供一次准确、完整的管理年度报告，资产管理年度报告由管理人根据监管要求编制，经托管人复核后由管理人公告，并报相关监管机构或自律组织等备案。托管人每年度向投资者提供一次托管报告。上述报告应由管理人于每年度截止日后4个月内通过管理人网站披露，同时报送中国证监会相关派出机构、证券投资基金业协会。集合计划成立不足3个月或者存续期间不足3个月时，可以不编制当期的年度报告。

集合计划的年度报告内容包括但不限于下列信息：

- (1) 管理人履职报告；
- (2) 托管人履职报告；
- (3) 资产管理计划投资表现；
- (4) 资产管理计划投资组合报告；
- (5) 资产管理计划运用杠杆情况（如有）；
- (6) 资产管理计划财务会计报告；
- (7) 资产管理计划支付的管理费、托管费、业绩报酬（如有）等费用的计提基准、计提方式和支付方式；
- (8) 资产管理计划投资收益分配情况；
- (9) 投资经理变更、重大关联交易等涉及投资者权益的重大事项；
- (10) 中国证监会规定的其他事项。

若中国证监会等监管机构对集合资产管理计划参与上述标的的信息披露另有规定的，从其规定。

## 3、年度财务会计报告

集合资产管理计划年度财务会计报告应当经具有证券相关业务资格的会计师事务所审计，审计机构应当对资产管理计划会计核算及净值计算等出具意见。

### （三）集合计划临时报告

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项，管理人应当在事项发生之日起五日内及时通过管理人网站等方式

及时向投资者披露。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经理人员发生变更，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) 管理人以自有资金参与和退出；
- (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销售机构发生变更；
- (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) 集合计划收益分配；
- (12) 管理费、托管费等费用计提方式或费率发生变更；
- (13) 其他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，以及根据法律法规及本合同约定应当披露的情形。

以上事项应在发生之日起五个工作日内按监管要求向中国证监会相关派出机构、证券投资基金业协会报送。

(四) 资产管理人、资产托管人应当保证投资者能够按照资产管理合同约定的时间和方式查询委托资产的投资运作、托管等情况。

(五) 集合计划管理人的董事、监事、从业人员及其配偶、控股股东、实际控制人或者其他关联方参与集合计划，应通过管理人指定网站向投资者充分披露，同时报送中国证监会相关派出机构、证券投资基金业协会。

## 十九、集合计划份额的转让、非交易过户和冻结

### (一) 集合计划份额的转让

集合计划存续期间，在具备可交易条件时客户可以通过证券交易所等中国证监会认可的交易平台转让集合计划份额。

受让方首次参与本集合计划，应先签订集合资产管理合同。

## （二）集合计划份额的非交易过户

非交易过户是指不采用参与、退出等交易方式，将一定数量的集合计划份额按照一定的规则从某一投资者集合计划账户转移到另一投资者集合计划账户的行为。集合计划登记结算机构只受理因继承、捐赠、司法执行、以及其他形式财产分割或转移引起的计划份额非交易过户。对于符合条件的非交易过户申请按登记结算机构的有关规定办理。

## （三）集合计划份额的冻结

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

## 二十、集合计划展期、终止和清算

（一）集合计划的展期：本集合计划在符合一定的条件下可以展期。

### 1、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）中国证监会规定的其他条件。

### 2、展期的程序和安排

#### （1）展期的公告

集合计划符合展期条件拟展期时，管理人应当在计划存续期届满前1个月征询托管人是否同意继续托管展期后的集合计划资产。在获得托管人同意后，管理人在管理人指定网站上公告，并将同时公告集合计划的具体展期方案。

#### （2）委托人答复

管理人应在上述公告后10个工作日内通过管理人指定网站或以书面或电子邮件等方式将展期相关事宜通知委托人，征求委托人意见，委托人应根据管理人指定网站公告要求在规定的期限内明确意见。若委托人同意本集合计划展期，则委托人应根据管理人指定网站公告要求在规定的期限内向管理人出具书面同意意见。截至存续期届满日，委托人未给出明确答复的，视为不同意展期。

### (3) 不同意展期的委托人所持有份额的处理办法

展期经管理人指定网站公告后,管理人将在本集合计划原存续期届满之日按照本合同约定将不同意展期的委托人份额全部退出。

### (4) 展期的成立

存续期满,集合计划符合展期条件,并且同意本集合计划展期的委托人不少于2人,本集合计划在原存续期届满日的次日实现展期,否则本集合计划不能展期。

### (5) 展期的失败

若集合计划展期失败,本集合计划将进入清算终止程序。

### 3、展期的期限

管理人应在公告具体展期方案时确定展期的具体期限,每次展期期限不超过五年。

4、资产管理计划展期的,管理人应当自资产管理合同展期之日起五个工作日内报证券投资基金业协会备案,并抄报中国证监会相关派出机构。

### (二) 有下列情形之一的,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资格,而无其他适当的管理人承接其原有权利、义务的;

2、托管人因重大违法、违规行为,被监管机关取消业务许可,不能继续担任集合计划托管人,而无其他适当的托管机构承接其原有权利、义务的;

3、管理人因解散、破产、撤销等原因不能履行相应职责,而无其他适当的管理人承接其原有权利、义务的;

4、托管人因解散、破产、撤销等原因不能履行相应职责,而无其他适当的托管机构承接其原有权利、义务的;

5、集合计划存续期间,本集合计划委托人少于2人;

6、集合计划存续期间,本集合计划单位资产净值达至0.9;

7、如遇监管要求提前终止或清理本集合计划,或管理人认为有必要时,经管理人指定网站发布提前终止公告满三个工作日,集合计划可提前终止;

8、不可抗力的发生导致本集合计划不能存续;

9、法律、行政法规、本合同及中国证监会规定的其他终止情形。

管理人应当自资产管理计划终止之日起五个工作日内报证券投资基金业协会备案,并抄报中国证监会相关派出机构。

### (三) 集合计划的清算

1、自集合计划终止之日起5个工作日内根据监管要求备案并开始组织清算资产管理计划资产;

2、清算过程中的有关重大事项应当及时公布;

3、管理人和托管人应当在扣除清算费用、管理费、业绩报酬及托管费等费用后,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,本集合计划未持有流通受限的证券,则本集合计划清算结束,注销集合计划证券账户和托管账户;

4、清算结束后5个工作日内在管理人网站公布清算结果,并完成备案工作;

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,并注销集合计划证券账户和托管账户;

6、管理费、托管费计提规则是以当日资产净值为基数在下一日计提,对于合同最后一日管理费、托管费则以当日资产净值为基数在当日计提;

7、管理人应匡算合同终止日下一个月的最低备付金及交易保证金,并保证有足够的资金进行场内清算。

## 二十一、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) 按照本合同约定取得集合计划收益;

(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) 按合同约定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、监管机构的有关规定及本合同约定的其他权利。

## 2、委托人的义务

(1) 委托人应认真阅读本合同及《说明书》，并承诺委托资金的来源及用途合法，不得非法汇集他人资金参与本集合计划；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；

(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、税费和其他费用；

(3) 按照本合同及《说明书》约定承担集合计划的投资损失；

(4) 不得违反法律法规及本合同约定转让其所拥有的计划份额；

(5) 本集合计划采用电子签名合同，委托人应当如实提供与签署电子签名合同相关的信息和资料。委托人应当以自己的名义开立资金账户，办理指定手续，用于办理委托划款、红利款项、退出款项以及清算款项的收取。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；

(6) 除非在本合同约定的可办理退出业务的开放期或终止日，不得要求提前终止委托资产管理关系；

(7) 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；

(8) 法律、行政法规、监管机构的有关规定及本合同约定的其他义务。

## (二) 管理人的权利和义务

### 1、管理人的权利

(1) 根据本合同及《说明书》的约定，独立运作集合计划的资产；

(2) 根据本合同及《说明书》的约定，收取管理费、业绩报酬等相关费用；

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

(4) 根据本合同及《说明书》的约定，终止本集合计划的运作；

(5) 监督托管人，并针对托管人的违约行为采取必要措施保护委托人的利益；

- (6) 代表委托人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) 更换公司相关业务主要负责人以及投资主办人员;
- (9) 委托符合条件的机构担任本集合计划的登记结算机构, 负责集合计划份额的登记结算等事宜;

(10) 法律、行政法规、监管机构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资产投资组合、资产净值、费用与收益等信息;

(6) 按照本合同、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、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, 成立清算小组按照监管机构的相关规定进行集合计划清算, 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、托管人的

合法权益时，应承担赔偿责任；

(12) 因托管人违反本合同导致集合计划资产发生直接损失或损害委托人合法权益时，代委托人向托管人追偿；

(13) 确保本合同、说明书、托管协议及本集合计划相关文本相关约定保持一致。

(14) 法律、行政法规、中国证监会有关规定和本合同、说明书、《托管协议》约定的其他义务。

### (三) 托管人的权利与义务

#### 1、托管人的权利

(1) 依照法律规定、本合同、说明书和《托管协议》的约定对集合计划资产进行托管；

(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) 托管协议与本合同、说明书约定不一致的，托管人的托管职责以托管协议的约定为准。

(6) 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) 依法按本合同约定为集合计划开立托管账户和证券账户等相关账户，确保集合计划资产与管理人、托管人的自有资产以及其他托管资产相互独立；

(2) 安全保管集合计划资产、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本合同、说明书及托管协议约定，不得擅自动用或处分集合计划资产；非因托管人原因造成的，处于托管人实际控制之外账户中的资产，托管人不承担保管责任；

(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，依法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) 托管人自委托资金进入托管账户之日起履行托管职责。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) 法律、行政法规、中国证监会有关规定和本合同、说明书及《托管协议》约定的其他义务。

## 二十二、违约责任与争议处理

### (一) 违约责任

1、由于合同当事人过错,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;如当事人均有过错的,按照过错程度各自承担应负的责任。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。但是发生下列情况的,当事人可以免责:

(1) 不可抗力

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及其他当事人损失扩大。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等监管机构的规定作为或不作为而造成的损失等；

(3) 在没有过错的情况下，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) 在没有过错的情况下，托管人执行管理人的生效指令对集合计划资产造成的损失；

(5) 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。

(6) 管理人或托管人任一方不因另一方的失职行为而给集合计划财产或委托人造成的损失向委托人承担连带责任。

(7) 相关法律、行政法规和规定的变更。

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，由此造成计划财产或委托人损失，管理人和托管人免除赔偿责任。但是管理人和托管人应积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

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。

8、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，管理人和托管人不承担任何责任。

9、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。

## （二）适用法律及争议的处理

1、本合同适用中华人民共和国法律，并从其解释。

2、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，任何一方均有权将争议提交管理人住所地人民法院通过诉讼方式解决。

## 二十三、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、购买力风险

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

### （二）管理风险

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

### （三）流动性风险

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

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

管理人、托管人因停业、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）信用风险

信用风险是指债务人或交易对手未能履行金融工具项下的义务或信用质量发生变化，影响金融工具的价值，从而给债权人或金融工具持有人带来损失的风险。

### （六）使用电子签名合同的风险

本集合计划合同及风险揭示书以电子签名方式签订，委托人签订书面《电子签名约定书》，即表明委托人同意在推广机构参与集合资产管理计划过程中使用电子合同、电子签名。委托人通过身份验证登录推广机构指定的网络系统，确认同意接受相关电子签名合同、风险揭示书或其他文书的，视为签署合同、签署风险揭示书或其他文书，与在纸质合同、纸质风险揭示书或其他文书上手写签名或者盖章具有同等的法律效力，无须另行签署纸质合同、纸质风险揭示书或其他文

书。委托人应妥善保管密码，经委托人密码等有效身份验证登录委托人账户后的所有操作视同委托人本人行为，委托人需承担由此产生的一切民事责任和法律后果。

此外，由于使用电子签名，在集合计划的交易过程当中，可能存在以下风险：

1、由于互联网和移动通讯网络数据传输等原因，交易指令可能会出现中断、停顿、延迟、数据错误等情况；

2、委托人账号及密码信息泄露或客户身份可能被仿冒；

3、由于互联网和移动通讯网络上存在黑客恶意攻击的可能性，网络服务器可能会出现故障及其他不可预测的因素，交易信息可能会出现错误或延迟；

4、委托人的网络终端设备及软件系统可能会受到非法攻击或病毒感染，导致电子签名合同数据无法传输或传输失败。

#### （七）其他风险

1、技术风险。在集合资产管理计划的日常交易中，可能因为技术系统的故障或者差错而影响交易的正常进行或者导致委托人的利益受到影响。这种技术风险可能来自管理人、托管人、证券交易所、证券登记结算机构等。

2、操作风险，操作风险是指那些由于不合理的内部程序，人为造成的或者是系统性的，由外部事件引发损失的风险。

3、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，可能导致委托资产的损失，从而带来风险。

4、客户通过专用证券账户持有或者通过专用证券账户和其他证券账户合并持有上市公司股份达到规定比例时，应由其自行履行法律、行政法规和中国证监会规定的公告、报告、要约收购等义务，并自行承担未及时履行义务的法律风险。

5、金融市场危机、行业竞争、托管行违约等超出管理人自身直接控制能力之外的风险，也可能导致委托人利益受损。

6、其他不可预知、不可防范的风险。

#### （八）本集合计划特有风险

1、集合计划达到一定规模或一定人数时，管理人有权停止认/申购。委托人可能面临因上述原因而无法参与本集合计划的风险。

2、本集合计划存续期间，当计划的委托人少于2人，集合计划将终止。委

托人可能面临集合计划因上述原因终止而停止投资的风险。

3、本集合计划的参与份额单笔退出最低份额为 10 万份，若某笔退出导致该委托人的剩余持有金额少于 30 万元，则余额部分必须一起退出。强制退出会导致委托人的计划份额减少至零。

4、本合同签署后，因法律、法规、规章、中国证监会的规定、中国证券业协会、基金业协会自律管理规则、证券登记结算机构业务规则以及证券交易所交易规则颁布或修订，管理人和托管人协商一致后，可对本合同与上述法律法规和相关政策不一致的地方进行更新或修改并及时在管理人网站公告修改内容。更新或修改的内容在管理人网站公告满五个工作日后生效。委托人可能面临由于上述原因发生合同变更的风险。

5、除因法律、法规、规章、中国证监会的规定、中国证券业协会、基金业协会自律管理规则、证券登记结算机构业务规则以及证券交易所交易规则颁布或修订以外的合同变更时，管理人将向委托人发送合同变更征询意见函，委托人可选择在开放期退出或继续参与本集合计划。部分委托人可能因为未能提供有效的联系方式或者未能将变动后的联系方式及时通知管理人，而无法及时获知合同变更事项，如果委托人因上述情况未能按时退出本计划，可能会被视为同意合同变更，从而存在风险。另外，合同中约定：

(1)“委托人不同意变更的，应在征询意见发出后的最近一个开放期或临时开放期内（以下统称“指定开放期”）提出退出本集合计划的申请；委托人未在前述时间回复意见的也未在指定开放期退出计划的，视为委托人同意合同变更”，在此情况下，委托人对默认情况的忽略或误解，可能存在潜在风险。

(2)“对于明确答复不同意合同变更但逾期未退出本集合计划的委托人，管理人将统一在合同变更生效日次一工作日做强制退出处理（退出价格为退出当日的计划单位净值）”，在此情况下，会导致委托人的计划份额减少至零。

#### 6、税收政策相关风险

本合同第十三条约定收取的管理费、托管费、业绩报酬（若有）均不含“资管产品运营过程中发生的增值税应税行为”需缴纳的增值税及附加。本计划在运营过程中发生的增值税等应税行为需缴纳的增值税及相关附加，由委托资产承担，将导致集合计划收益减少，净值下降，从而带来风险。

7、本集合计划成立后，相关材料需要报相关监管机构或自律组织等备案。管理人按照监管机构或自律组织等的要求补正可能涉及到本合同的修改，管理人届时与托管人达成一致后公告补正后的合同，各方按补正后的合同享有权利、履行义务。上述合同的修改会给委托人带来一定的风险。

8、金融产品的投资风险：金融产品的投资风险包括发行人的信用风险和管理能力风险。发行人的信用风险指金融产品发行人在产品运行过程中违反相关合同约定的风向；发行人的管理能力风险是指在市场波动情况下，金融产品发行人在选择具体投资标的时体现出的风险，

9、净值波动风险：本产品不设预期收益率，委托人将面临产品净值波动的风险。

以上所述因素可能会给本集合计划投资带来特殊风险。

#### （九）特别提示

本集合计划依法设立，投资者在申请参与本集合计划之前应认真阅读集合资产管理合同及说明书等集合计划文件，并确保理解相关条款和业务规则，包括但不限于：

##### 1、提前终止条款

存续期内，本集合计划委托人少于2人或单位资产净值达至0.9，导致本集合计划提前终止。

##### 2、强制退出条款

本集合计划委托人单笔退出份额最低为10万份，单个委托人退出后其持有的金额最低为30万元。若某笔退出导致该委托人剩余持有的金额低于30万元，则管理人对该余额部分作强制退出处理。强制退出会导致委托人的计划份额减少至零。

##### 3、业绩报酬计提方法

管理人按照合同约定收取业绩报酬，但不同的业绩报酬计提原则，比如“先进先出法”、“后进先出法”等不同方法可能导致计算的业绩报酬出现不同，从而影响委托人的实际收益水平。

##### 4、电子签名信息保护

委托人签署电子签名合同进行交易的，应积极采取安全措施，加强账户、密

码的保护。

#### 5、巨额退出事件风险

在集合计划存续期间可能发生委托人大量甚至巨额退出集合计划的情形,若出现合同约定的巨额退出,将可能导致集合计划面临流动性风险,增加集合计划所持有证券的变现成本,造成计划资产损失。对于委托人而言,在发生巨额退出时可能面临所持有集合计划份额被部分顺延退出或暂停退出的风险。

### 二十四、合同的成立与生效

#### (一) 合同的成立与生效

本合同经管理人、托管人和委托人签署后成立。

本合同成立后,同时满足以下条件时生效:

(1) 委托人参与资金实际交付并确认;

(2) 管理人公告本集合计划成立。

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

#### (二) 合同的组成

《国盛资管国盛1号集合资产管理计划说明书》、《国盛资管国盛1号集合资产管理计划风险揭示书》是管理人对于本集合计划重要事项的说明,是本合同重要附件,与合同具有同等法律效力。

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、委托人通过电子签名方式产生的数据电文等为本合同的附件,是本合同不可分割的一部分,与合同具有同等法律效力。

### 二十五、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、证券业协会及中国基金业协会自律管理规则、证券登记结算机构业务规则以及证券交易所等交易规则颁布或修订,自相关规定颁布或修订生效之日起,本合同相关内容及条

款按该颁布或修订的规定变更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五个工作日后生效。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。

本集合计划成立后,相关材料需要报相关监管机构或自律组织等备案。管理人按照监管机构或自律组织等的要求补正备案材料涉及到本合同修改的,委托人特此授权管理人经与托管人协商一致后,由管理人公告补正后的合同,补正的内容在管理人网站公告满五个工作日后生效。

2、由于其他原因需要变更合同的,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5个工作日内以管理人指定网站公告或邮寄等方式向委托人发送合同变更征询意见函。委托人不同意变更的,应在征询意见函发出后的5个工作日内(以下统称“指定开放期”)提出退出本集合计划的申请;委托人未在前述时间回复意见也未在指定开放期退出计划的,视为委托人同意合同变更。委托人不同意变更的,管理人对其采取如下权利保障措施及后续安排:

委托人不同意变更的,管理人保障其退出集合计划的权利;对于明确答复不同意合同变更但逾期未退出本集合计划的委托人,管理人将统一在合同变更生效日次一工作日做强制退出处理(退出价格为退出当日的计划单位净值)。

委托人同意,无论其是否提出退出申请,管理人经与托管人书面达成一致后变更本合同的行为均不应被视为或裁定为管理人或托管人的违约行为。

合同变更于指定开放期结束后的第一个工作日起生效,公告内容即成为本合同组成部分。管理人应在合同变更生效日起5个工作日内将相关情况报相关监管机构或自律组织等备案。

3、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。

特别约定:在本集合计划委托人人数少于3名(含3名)的情况下,经全体委托人、管理人、托管人同意,也可通过签署补充协议的方式进行合同变更,采用补充协议方式变更合同的,可不受上述合同变更程序限制。

4、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。

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并加盖其公章。

本合同一式四份，管理人、托管人、委托人各执一份，其余按照有关监管部门的要求备案，每份均具有同等法律效力。

本页无正文，为《国盛资管国盛1号集合资产管理合同》签字页。

委托人签字/盖章：

管理人：国盛证券资产管理有限公司（盖章）

法定代表人或授权代理人（签章）：

签署日期： 年 月 日

托管人：广发银行股份有限公司（盖章）



主要负责人（签章）：

签署日期： 年 月 日