

**旗峰 1 号策略精选集合资产管理计划  
资产管理合同  
(第四次合同变更)**

---

# 目 录

第 1 节 前言 .....	1
第 2 节 释义 .....	2
第 3 节 合同当事人 .....	4
第 4 节 集合计划的基本情况 .....	5
第 5 节 推广期参与集合计划 .....	7
第 6 节 存续期集合计划的参与和退出 .....	10
第 7 节 管理人自有资金参与集合计划 .....	14
第 8 节 集合计划的分类 .....	15
第 9 节 集合计划单位的非交易过户、转托管与冻结 .....	15
第 10 节 集合计划账户管理 .....	16
第 11 节 集合计划资产托管 .....	16
第 12 节 集合计划的估值 .....	18
第 13 节 集合计划的费用与税收 .....	22
第 14 节 投资收益与分配 .....	25
第 15 节 投资目标与投资策略 .....	26
第 16 节 投资决策与风险控制 .....	28
第 17 节 投资限制及禁止行为 .....	30
第 18 节 集合计划的会计和审计 .....	30
第 19 节 集合计划的信息披露 .....	31
第 20 节 风险揭示及风险控制与管理 .....	33
第 21 节 委托人的权利与义务 .....	37
第 22 节 管理人的权利与义务 .....	38
第 23 节 托管人的权利与义务 .....	40
第 24 节 集合计划展期 .....	42
第 25 节 集合计划终止和清算 .....	42
第 26 节 不可抗力 .....	44
第 27 节 违约责任与争议处理 .....	44
第 28 节 合同的成立、生效 .....	46
第 29 节 合同的补充与修改 .....	46
第 30 节 协议文本 .....	48

---

## 第1节 前言

为规范旗峰1号策略精选集合资产管理计划（以下简称集合计划）运作，明确集合资产管理合同当事人的权利与义务，根据《中华人民共和国民法典》、《证券公司客户资产管理业务管理办法》（以下简称《管理办法》）、《证券公司集合资产管理业务实施细则》（以下简称《实施细则》或《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。

本合同是约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》、《旗峰1号策略精选集合资产管理计划说明书》、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资产管理计划（以下简称集合计划），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《旗峰1号策略精选集合资产管理计划说明书》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。

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。

中国证监会对本集合计划出具了批准文件—《关于核准东莞证券有限责任公司设立集合资产管理计划的批复》（证监许可【2009】1113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。

委托人参与本集合计划前，请认真阅读本合同。

## 第2节 释义

在本合同中除非文意另有所指，下列词语具有以下含义：

集合计划或本集合计划：	指旗峰 1 号策略精选集合资产管理计划；
说明书：	指《旗峰 1 号策略精选集合资产管理计划说明书》；
《集合资产管理合同》或 本合同：	指《旗峰 1 号策略精选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：	指东莞证券股份有限公司；
托管人：	指招商银行股份有限公司；
推广机构：	指东莞证券股份有限公司、招商银行股份有限公司、东莞银行股份有限公司；
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机构为中国证券登记结算有限责任公司；
委托人：	指“旗峰 1 号策略精选集合资产管理计划”的参与者，包括个人投资者和机构投资者；
持有人：	指集合计划单位的持有人；
个人投资者：	指依据中华人民共和国有关法律法规规定可以投资于集合资产管理计划的自然人；
机构投资者：	指依据中华人民共和国有关法律法规规定可以投资于集合资产管理计划的企业法人、事业法人、社会团体或其它组织；
推广期：	管理人在中国证监会对集合计划出具批准文件之日起 6 个月内启动推广工作，并在启动后 60 日内完成集合计划的推广、设立。具体推广时间以集合计划的推广公告为准；
推广截止日：	指推广期内接受委托人参与申请的最后一日；
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：	指集合计划成立后，委托人可以在该日办理参与及退出等业务申请；

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、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,在推广期或开放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;
集合计划利润:	集合计划利润是集合计划投资所得红利、股息、债券利息、证券投资收益、证券持有期间的公允价值变动、银行存款利息、其他收入扣除相关费用后的余额;
单位面值:	指集合计划单位面值,每份1.00元;
单位资产净值/单位净值:	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;
单位累计净值	指单位净值加集合计划成立以来单位份额总分红金额
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:	指集合计划所投资各类有价证券、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;
资产净值:	指资产总值减去负债后的价值;
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:	指东莞证券股份有限公司、招商银行股份有限公司、东莞银行股份有限公司指定营业网点;
指定媒体:	指东莞证券股份有限公司网站( <a href="http://www.dgzq.com.cn">www.dgzq.com.cn</a> )
不可抗力:	指本合同订立以后,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；

### 第3节 合同当事人

#### 一、委托人

机构名称（自然人姓名）：

法定代表人（身份证号码）：

办公地址（联系地址）：

电话：

传真：

邮编：

联系人：

#### 二、管理人

名称：东莞证券股份有限公司

注册地址：东莞市莞城区可园南路1号金源中心30楼

法定代表人：陈照星

组织形式：股份有限公司

注册资本：15亿元

电话：0769-22100888

传真：0769-22116999

网址：[www.dgzq.com.cn](http://www.dgzq.com.cn)

#### 三、托管人

名称：招商银行股份有限公司

注册地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦

法定代表人：缪建民

组织形式：股份有限公司

注册资本：252.198亿元

电话：0755-83198888

传真：0755-83195555

网址：[www.cmbchina.com](http://www.cmbchina.com)

---

## 第4节 集合计划的基本情况

### 一、名称

旗峰1号策略精选集合资产管理计划

### 二、类型

限定性集合资产管理计划

### 三、规模及投资范围

本集合计划不设规模上限，主要投资于国内依法发行的债券、债券型基金、中期票据、股票质押回购、商业银行理财计划、货币市场基金、银行存款及中国证监会认可的其他固定收益类投资品种。

### 四、投资比例：

(1) 固定收益类资产：包括国债、金融债、中期票据、公司债、中小企业私募债、可转债、分离交易可转债、短期融资券、期限在七天以上的债券逆回购、资产支持受益凭证、资产支持证券、非公开定向债务融资工具(PPN)、股票质押回购、有预期收益率的商业银行理财计划等占资产总值的比例：0—100%；

(2) 现金类资产：包括银行存款、一年内到期的央行票据、期限在七天以内(含七天)的债券逆回购、货币市场基金等占资产总值的比例：0-100%；

(3) 证券正回购：融入资金余额不超过计划资产净值的40%；

委托人知悉，作为证券公司的客户资产管理业务，为了集合计划委托人的权益最大化，本集合计划可以投资于管理人及管理人有关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从事其他重大关联交易。委托人参与本集合计划即视为同意集合计划资产进行上述投资，事后管理人应告知托管人，同时向证券交易所报告，并在管理人网站以公告方式向委托人披露。

委托人在此同意并授权管理人将集合计划的资产投资于股票质押式回购时，质权人登记为管理人，由管理人负责本集合计划作为股票质押式回购交易融出方的交易协议签署、交易申报、盯市管理、违约处置等后续事宜。委托人签署本合同即同意以上约定。

---

如因一级市场申购发生投资比例超标，应自申购证券可交易之日起 10 个交易日内将投资比例降至许可范围内；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证券公司之外的因素，造成集合计划投资比例超标，管理人应在超标发生之日起在具备交易条件的 10 个交易日内将投资比例降至许可范围内。

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

## 五、存续期限

本集合计划不设固定管理期限。

## 六、集合计划单位面值

集合计划单位面值为 1.00 元/份。

## 七、首次参与最低金额

首次参与的最低金额为人民币 5 万元（不含参与费），超过最低参与金额的部分不设金额级差。

## 八、管理人参与事宜

管理人可以以自有资金参与本集合计划。

## 九、集合计划的分类

本集合计划不设分类。

## 十、封闭期、开放期及流动性安排

### 1、封闭期：

除开放期外的管理期间均为封闭期，临时开放期除外。封闭期内，委托人不可办理参与和退出业务。

### 2、开放期：

本集合计划每满 3 个月开放一次，每次开放 2 个工作日，开放期内投资者可参与、退出本集合计划，具体安排以管理人网站公告为准。若管理人提前结束或延长开放期，将提前于管理人网站公告。

3、开放日，现金类资产不低于资产净值的 5%。

## 十一、风险收益特征及适合推广对象

本集合计划属于中低风险收益品种，适销对象是具有中低风险、中等风险、中高风险和高风险承受能力的谨慎型、稳健型、积极型和激进型的合格

---

投资者。

## 十二、集合计划成立的条件和日期

当集合计划推广期结束后，若符合下列条件：

- 1、推广过程符合法律、行政法规和中国证监会的规定；
- 2、募集金额不低于1亿元人民币（不含管理人资金）；
- 3、委托人不少于2人（不含管理人）；
- 4、符合集合资产管理合同及计划说明书的约定；
- 5、中国证监会规定的其他条件。

则管理人可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募集的资金进行验资并出具验资报告后，宣告本集合计划成立。验资报告出具后的次日为本集合计划的成立日。

若推广期尚未结束，如委托人参与金额累计已达到35亿元且人数不低于2人（不含管理人），则推广期提前终止，不再接受委托人参与，同时本集合计划成立。

推广期结束，如集合计划未达到成立条件或推广期内发生使计划无法成立的不可抗力，管理人应将参与资金加计同期银行活期存款利息返还给委托人，当事人之间互不承担其他责任。

## 十三、集合计划客户资产的管理方式和管理权限

### 1、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。

### 2、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。

## 第5节 推广期参与集合计划

### 一、推广期

管理人在中国证监会对集合计划出具批准文件之日起6个月内启动推广工作，并在启动后60日内完成集合计划的推广、设立。具体推广时间以集合计划的推广公告为准。

### 二、推广机构

---

本集合计划通过推广机构办理集合计划业务的网点公开推广，推广机构为东莞证券股份有限公司、招商银行股份有限公司、东莞银行股份有限公司。

上述推广机构办理集合计划业务的城市、网点的具体情况和联系方法，请详见本集合计划推广公告及当地推广网点的公告。

管理人可根据有关法律法规的要求，选择其他符合要求的机构代理推广本集合计划，并及时公告。推广机构可以根据情况变化增加或减少其代理推广城市（网点），并另行公告。

### 三、参与对象

中华人民共和国境内具备适当的金融投资经验和风险承受能力、属于管理人或推广机构客户的个人投资者和机构投资者（法律、法规和有关规定禁止参与者除外）。

### 四、推广期目标规模

本集合计划目标规模为 35 亿份。

### 五、集合计划单位面值

集合计划单位面值为 1.00 元/份。

### 六、推广期参与价格

每份集合计划推广期参与价格为 1.00 元，等同于面值。

### 七、推广期参与原则

- 1、本集合计划仅限于现金参与。
- 2、委托人在参与本集合计划时，需备足参与资金。
- 3、推广期内，委托人可多次参与本集合计划，但首次参与金额不得低于 100,000 元，且每次参与金额必须是 1,000 元的整数倍，在目标规模内，累计参与金额不设上限。
- 4、参与申请受理完成后，委托人不得撤销。

### 八、推广期参与程序

委托人在推广期内可在推广机构指定的场所参与本集合计划。

- (1) 委托人参与前，需按推广机构规定的方式备足参与金额。
- (2) 委托人持有效证件，在指定参与时间内到本集合计划推广网点签署风险揭示书、签订集合资产管理合同，提出参与申请。
- (3) 委托人在推广期间可多次参与，委托经受理后不得撤销。
- (4) 推广期间不设置委托人单个账户最高参与金额限制。

(5) 东莞证券下属营业网点不直接收取委托人的参与款项。

委托人参与本集合计划，必须足额交款，并以推广机构出具的交款凭证为委托人出资的最终依据。如果委托人资金在规定时间内未全额到账，则仅以其到账金额确定其有效申请份额；若到账金额低于本集合计划的参与下限，则参与申请不成功，其参与款项将被作为无效款项退回委托人账户。

当集合计划将接近目标规模时，管理人有权根据“额度分配、时间优先”的原则对委托人的参与申请进行确认。管理人在集合计划接近目标规模时，将剩余额度在推广机构进行分配，集合计划达到目标规模的当天，按参与时间的先后进行确认，参与时间以注册登记系统的确认结果为准；当计划达到目标规模后，管理人有权暂停接受委托人的参与申请。

管理人在 T+2 日对委托人参与申请的有效性进行确认，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。

#### 九、参与费率

委托人在推广期参与本集合计划，需根据参与金额的不同缴纳参与费用，具体费率如下：

参与金额	参与费率
参与金额 < 100 万元	1%
100 万元 ≤ 参与金额 < 500 万元	0.5%
500 万元 ≤ 参与金额	0

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：

$$\text{参与费} = \text{参与金额} \times \text{对应的参与费率}$$

#### 十、推广期参与份额的计算

委托人的参与资金在集合计划成立前形成的利息，在集合计划成立后按集合计划单位面值折算成集合计划单位份额，归委托人所有。参与资金的利息以注册登记机构的确认结果为准。

集合计划单位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：

$$\text{参与份额} = (\text{参与金额} - \text{参与费} + \text{参与资金利息}) \div \text{单位面值}$$

---

## 第6节 存续期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、清算由管理人指定的注册登记机构负责，本集合计划的注册登记机构是中国证券登记结算有限责任公司。

#### 1、参与的办理时间

本集合计划每满3个月开放一次，每次开放2个工作日，开放期内投资者可参与、退出本集合计划，具体安排以管理人网站公告为准。若管理人提前结束或延长开放期，将提前于管理人网站公告。

#### 2、参与的原则

(1) 存续期内，本集合计划参与价格为参与申请日集合计划单位净值；

(2) 采用金额参与的方式，即以参与金额申请；

(3) 本集合计划可以采用电子签名合同，委托人在签署电子签名约定书，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、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；

(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；当日办理业务申请仅能在当日业务办理时间内撤销；

(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。

#### 4、参与费及参与份额的计算

(1) 参与费率：本集合计划免收参与费，即参与费率为0；

---

## (2) 参与份额的计算方法:

参与份额=参与金额/参与当日集合计划单位净值

委托人参与份额保留小数点后两位，第三位四舍五入，由此产生的差额部分记入集合计划资产的损益。委托人多笔参与时，按上述公式进行逐笔计算。

## 二、集合计划的退出

### 1、退出的办理时间

存续期内，投资者可在本集合计划开放日办理退出业务，具体开放安排以管理人的公告为准。

### 2、退出的原则

(1) “未知价”原则，即退出份额的价格以退出申请日集合计划单位净值为基准进行计算；

(2) “份额退出”原则，即退出以份额申请；

(3) “先进先出”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；

(4) 退出申请一经确认不可更改或撤销。

### 3、退出的程序和确认

(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) 投资者退出申请确认后，其退出申请不得撤销；当日办理业务申请仅能在当日业务办理时间内撤销；

(3) 投资者于 T 日提交退出申请后，可于 T+2 日后在推广机构查询退出确认情况。

(4) 退出款项划付：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注册登记机构，再由注册登记机构划往推广机构，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+10 内从托管账户划出。如集合计划出现暂停估值、拒绝或暂停退出的情形时，管理人与托管人协商后，可以将划拨日期相应顺延。

### 4、退出费及退出金额的计算

(1) 退出费用

本集合计划不收取退出费用。

(2) 退出金额的计算方法

---

退出金额=退出份额×退出日集合计划单位净值-管理人业绩报酬

上述计算结果均保留小数点后两位，第三位四舍五入，由此产生的差额部分计入集合计划资产的损益。

#### **5、大额资金退出预约**

无。

#### **6、巨额退出的情形及处理方式**

(1) 巨额退出的认定：本集合计划单个开放日，集合计划退出份额确认超过上一日集合计划总份额的10%时，为巨额退出。

(2) 巨额退出的处理方式：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：当管理人认为有足够能力支付委托人的全额退出申请时，按正常的退出程序办理；

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，退出价格为下一个工作日的单位净值，委托人可在申请退出时选择将当日未获受理部分予以撤消。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。

暂停退出：本集合计划连续两个开放日发生巨额退出，管理人可按说明书及《集合资产管理合同》载明的约定，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，并应当在指定媒体上进行公告。

#### **(3) 告知客户的方式**

当发生巨额退出并采用超额部分延期退出或者发生暂停退出情形时，管理人应及时将有关情况向管理人所在地、资产管理分公司所在地中国证监会派出机构及中国证券投资基金业协会报告，并通过管理人网站通告委托人，说明有关处理方法。

#### **7、连续大额退出的情形及处理方式**

无。

#### **8、其他暂停退出的情形及处理方式**

---

发生说明书、《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认为需要暂停退出申请的，经与托管人商议一致，管理人应当立即在指定媒体上刊登暂停退出公告。

➤ **暂停退出的情形**

出现下列情况之一时，管理人可以暂停接受委托人的退出申请：

(1) 不可抗力的原因导致集合计划无法正常运作；

(2) 证券交易场所在交易时间非正常停市，导致管理人无法计算当日单位资产净值；

(3) 因市场剧烈波动或其他原因而出现连续巨额退出，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；

(4) 法律、法规、规章规定的其他情形或其他在说明书、《集合资产管理合同》已载明且中国证监会无异议的特殊情形。

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，管理人将足额支付；如暂时不能支付的，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兑付。同时，在出现上述第(3)项的情形时，对已接受的退出申请可延期支付退出款项，但不得超过正常支付时间二十个工作日，并在指定媒体上公告。

➤ **暂停退出的处理方式**

具体程序安排明确如下：

(1) 发生说明书、《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认为需要暂停退出申请的，管理人需在公司内部进行讨论并做出决议；

(2) 决议后，公司需以正式文件确认；

(3) 管理人以正式文件确认后，致函托管人协商；

(4) 托管人必须以正式函件表明其同意与否；如托管人明确不同意，则管理人在开放期内对退出申请需正常办理；

(5) 如果托管人明确表示同意，管理人应立即向证监会及所在地派出机构通报，将管理人的有关正式文件和托管人的同意函件传给证监会及所在地派出机构；

(6) 管理人应立即在指定媒体上刊登暂停退出的公告。

---

暂停退出期间，管理人将每周至少刊登提示性公告一次；暂停退出期间结束、集合计划重新接受退出申请时，管理人应至少提前一个工作日在指定媒体上刊登重新接受退出的公告，并在重新开放日公告最近一个工作日单位资产净值。

## 第7节 管理人自有资金参与集合计划

### 1、自有资金参与的条件

管理人可以自有资金参与本集合计划，应符合《管理办法》、《实施细则》、《证券公司客户资产管理业务规范》和中国证监会及中国证券业协会的相关规定。

### 2、自有资金的参与方式

在存续期内，管理人可以自有资金参与本集合计划。

### 3、自有资金参与的金额和比例

管理人以自有资金参与本集合计划的份额，不得超过本集合计划总份额的 20%，因集合计划规模变动等客观因素导致自有资金参与集合计划被动超限的，管理人应当在超限之日起的最近开放期内将部分自有资金参与份额退出，以符合法规要求。集合计划存续期间，管理人自有资金参与集合计划的持有期限不得少于 6 个月。

### 4、自有资金的收益分配

管理人以自有资金参与份额与同类型其他份额投资者享有同等收益分配权利和义务。

### 5、自有资金责任承担方式和金额

管理人以自有资金参与份额与同类型其他份额投资者享有同等权利和义务。

### 6、自有资金退出的条件

管理人以自有资金参与、以参与本集合计划持有的份额退出时，应当提前 5 个工作日通过管理人网站公告，告知委托人和托管人。

为应对流动性风险，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集合计划可不受上述限制，但需事后及时告知委托

---

人和托管人，并向管理人住所地、资产管理分公司所在地中国证监会派出机构及中国证券投资基金业协会报告；

#### 7、风险揭示和信息披露：

集合计划管理人按上述约定以自有资金参与本集合计划份额，不能构成对本集合计划份额本金及收益不受损失的保证。

管理人自有资金退出时应当提前5个工作日公告委托人和托管人。

## 第8节 集合计划的分类

本集合计划不设分类。

## 第9节 集合计划单位的非交易过户、转托管与冻结

### 一、非交易过户

管理人只受理继承、司法强制执行等情况下的非交易过户申请。其中继承是指委托人死亡，其持有的集合计划单位由其合法的继承人继承；司法强制执行是指司法机构依据生效司法文书将委托人持有的集合计划单位强制划转给其他自然人、法人或其他组织。符合条件的非交易过户申请应按注册登记机构的要求提交相关文件，自申请受理日起2个月内办理并按注册登记机构规定的标准收费。

### 二、转托管

委托人在变更办理集合计划参与与退出等业务的推广机构（网点）时，推广机构（网点）之间不能通存通兑的，可办理已持有集合计划的转托管。

### 三、冻结

注册登记机构受理依法要求的本集合计划单位份额的冻结与解冻。集合计划份额被冻结的，被冻结部分产生的权益一并冻结。

### 四、转让

本集合计划份额暂时不可转让，未来，在转让条件及技术成熟的情况下可以转让，且管理人需提前10个工作日公告相关安排。

---

## 第10节 集合计划账户管理

### （一）指定资金账户

指定资金账户指委托人在推广机构开设的资金账户，用于委托人参与、退出本集合计划的资金划款。委托人在本合同有效期内，不得注销、变更该专用账户，如因故造成变更或撤销账户的，委托人应及时将情况通知推广机构，并根据推广机构的要求履行相应的手续。否则，由此产生的损失由委托人承担。

### （二）集合计划托管银行账户开立与管理

托管人对本集合计划资产单独设置账户，托管账户的名称为：“旗峰 1 号策略精选集合资产管理计划”，用于办理对应集合计划参与及退出资金、收益分配等资金往来相关业务。托管银行账户与管理人、托管人和推广机构自有资金账户以及其他集合计划资金账户相互独立。

### （三）集合计划证券账户的开立与管理

托管人为本集合计划开立专门的证券账户，证券账户名称为：“东莞证券—招行—旗峰 1 号策略精选集合资产管理计划”。

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相互独立、集合计划资产与其他客户资产相互独立、不同集合计划的资产相互独立。管理人、托管人不得将集合计划资产归入其自有资产。管理人、托管人破产或者清算时，集合计划资产不属于其破产财产或者清算财产。

## 第11节 集合计划资产托管

### 一、资产托管协议

为确保集合计划资产的安全，保护委托人的合法权益，集合计划资产应交由托管人负责托管，管理人与托管人必须按照《管理办法》、《实施细则》、本合同及其他有关规定签订《集合资产管理计划资产托管协议》（以下简称“托管协议”），以明确托管人与管理人之间在集合计划资产保管、资产管理 and 运作及相互监督等相关事宜中的权利、义务及职责，确保集合计划资产

---

的安全，保护委托人的合法权益。

如本合同与托管协议出现冲突，以托管协议为准。

委托人签署本合同的行为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了解，并接受本合同约定的托管职责和范围。

## 二、托管人对管理人的监督核查

根据《管理办法》、《实施细则》、《集合资产管理合同》、说明书和有关法规的规定，托管人应自合同生效日起，对管理人就集合计划资产的投资范围、投资组合比例、投资限制、集合计划资产的核算、资产净值计算、管理人管理费、托管费的计提和支付，收益分配、清算资产分配等事项进行监督和核查。管理人应自本集合计划成立之日起三个月内使集合计划的资产配置比例达到合同要求。

1、托管人发现管理人有违反《管理办法》、《实施细则》、《集合资产管理合同》或托管协议、说明书和有关法律、法规规定的行为，应及时以书面形式通知管理人限期纠正，管理人收到通知后应及时核对确认并在三个工作日内以书面形式对托管人发出回函。在限期内，托管人有权随时对通知事项进行复查，督促管理人改正。管理人对托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，托管人应报告中国证监会。

2、如托管人认为管理人的作为或不作为违反了法律法规、《集合资产管理合同》或本托管协议，托管人有权利行使法律法规、《集合资产管理合同》或本托管协议赋予托管人的所有权利和补救措施，以保护集合计划资产的安全和持有人的利益。

## 三、管理人对托管人的监督核查

根据《管理办法》、《实施细则》、《集合资产管理合同》和有关法规的规定，管理人就托管人是否及时执行管理人合法合规的指令、是否将集合计划资产和自有资金分账管理、是否将不同集合计划资产分账管理、是否擅自动用集合计划资产、是否按时将分配给持有人的收益、退出款项和清算资产分配等资金划出托管账户等事项，对托管人进行监督和核查。

1、管理人发现托管人未对集合计划资产实行分账管理、擅自挪用集合计划资产、因托管人的过错导致集合计划资产灭失、减损、或处于危险状态的，管理人应立即以书面的方式要求托管人予以纠正和采取必要

---

的补救措施。

2、管理人发现托管人的行为违反《管理办法》、《集合资产管理合同》和有关法规的规定，应及时以书面形式通知托管人限期纠正，托管人收到通知后应及时核对并以书面形式对管理人发出回函。在限期内，管理人有权随时对通知事项进行复查，督促托管人改正。托管人对管理人通知的违规事项未能在限期内纠正的，管理人应报告中国证监会。

3、如管理人认为托管人的作为或不作为违反了法律法规、《管理办法》、《集合资产管理合同》，管理人有权行使法律法规、《集合资产管理合同》或本托管协议赋予管理人的权利和补救措施，以保护集合计划资产的安全和持有人的利益。

## 第12节 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。

1、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。

2、估值对象：集合计划所拥有的债券、基金、股票质押式回购和银行存款本息、其它投资等资产。

3、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。

4、估值方法：

估值应符合《管理合同》、《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。

4.1 固定收益类投资品种的具体估值方法如下：

(1) 回购交易以成本列示，按商定利率在实际持有期间内逐日计提利息；

(2) 在证券交易所市场挂牌交易实行净价交易的债券按估值日收盘

---

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，按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，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) 在证券交易所市场挂牌交易未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去所含的债券应收利息得到的净价进行估值；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，按最近交易日债券收盘价减去所含的债券应收利息得到的净价估值；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，可参考监管机构和行业协会估值意见，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。

(4) 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。

(5) 全国银行间债券市场交易的债券等固定收益品种，采用中债登公布的收益率曲线及估值价格确定公允价值。

(6) 同一债券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。

(7) 银行理财计划按购买成本列示，按约定收益率在实际持有期间内逐日计提利息。

#### 4.2 投资证券投资基金的估值方法

货币基金以成本列示，每日按照基金公司公布的估值日前一日万份收益估值计算红利收入。

#### 4.3 存款的估值方法

银行存款以成本列示，按确定利率在实际持有期间内逐日计提利息。

#### 4.4 股票质押式回购的估值方法

(1) 对于投资股票质押式回购交易的，以成本列示，按协议或预期收益在实际持有期间内逐日计提利息。

(2) 异常情况处理：

##### A、股票质押回购提前购回

提前购回约定利率与到期购回一致，不影响集合计划估值。利息补

---

偿金计入集合计划收入。

#### B、股票质押回购延期购回

延期购回利率与到期购回的利率不一致的，管理人与托管人在综合考虑估值影响的前提下，与托管人确定估值方法。原则上以以下方式估值：在向交易所发出延期购回的当日起，以延期购回利率计提利息，直至延期购回到期日。

融入方自发起初始交易指令至发出延期购回指令的期间，因原股票质押式回购交易商定利率与延期购回利率不一致所产生的应付资金差额，自发出延期购回指令当日一笔作为收入入账。

#### C、股票质押回购违约部分估值方式

如有确凿证据表明发生融入方违约，常规的估值不能客观反映资产公允价值的，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，按最能反映资产公允价值的方法估值。

4.5 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。

4.6 如有新增事项或变更事项，按国家最新规定估值。

#### 5、估值程序：

管理人应每个工作日对集合计划资产估值。集合计划资产净值和集合计划份额单位资产净值由管理人负责计算，托管人对集合计划资产净值、集合计划份额单位资产净值进行复核，法律法规有明确规定的除外。管理人应于每个工作日结束后计算得出当日的集合计划资产净值、集合计划份额单位资产净值。托管人应在收到集合计划资产净值估值结果后对净值计算结果进行复核，并以双方约定的方式将复核结果传送给管理人；如果托管人的估值结果与管理人的估值结果存在差异，且双方经协商未能达成一致，管理人有权按照其对集合计划净值的计算结果对外予以公布，由此产生的估值错误，由过错方承担相应赔偿责任，托管人有权将相关情况报集合计划管理人住所地、资产管理分公司所在地中国证监会派出机构，及中国证券投资基金业协会备案。

---

如管理人或托管人发现估值违反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委托人利益的情形，应立即通知对方，共同查明原因，双方协商解决。

#### 6、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以内发生差错时，视为本集合计划单位净值错误。管理人计算的集合计划单位资产净值由托管人复核确认后公告。当发生净值计算错误时，由管理人负责处理。由此给集合计划委托人和集合计划造成损失的，由管理人先行对委托人或者集合计划支付赔偿金。在管理人赔偿后，管理人和托管人应根据实际情况界定双方承担的责任。

(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) 本集合计划的会计责任方由管理人担任，与本集合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；由此给委托人和集合计划财产造成的损失，由管理人负责全部赔付，托管人不承担任何责任。

(4) 因集合计划估值错误给委托人造成损失的应先由管理人承担，管理人对不应由其承担的责任，有权向过错人追偿。在没有其他责任人情况下，管理人计算的计划资产净值、计划单位净值已由托管人复核确认后公告的，由此造成的委托人或集合计划资产的损失应先由管理人承担，后由管理人按照托管人的过错程度向托管人追偿。

(5) 由于证券交易所及注册登记机构发送的数据错误，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。

(6) 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。

7、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约定完成估值工作。

(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；

由于不可抗力原因，或由于证券交易所及注册登记机构发送的数据错误，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，但未能发现错误的，由此造成的资产估值错误，管理人和托管人可以免除赔偿责任。但管理人、托管人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

## 第13节 集合计划的费用与税收

### 一、费用的种类

- (1) 管理人的管理费和业绩报酬
- (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、注册登记费用
- (6) 本集合计划成立后的会计师费和律师费
- (7) 按照国家有关规定可以列入的其他费用

### 二、计提方法、标准和支付方式

- (1) 托管费：

本集合计划托管人托管费按前一日集合计划资产净值的0.15%年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的托管费；

---

E 为前一日集合计划资产净值。

集合计划托管费每日计提，按季支付。经管理人与托管人双方核对无误后，由托管人根据管理人指令于每季度初 5 个工作日内将托管费用从集合计划资产中一次性支付给托管人。

(2) 管理费：

本集合计划管理人管理费按前一日集合计划资产净值的 1% 年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 1\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的管理费；

E 为前一日集合计划资产净值。

集合计划管理费每日计提，按季支付。经管理人与托管人双方核对无误后，由托管人根据管理人指令于每季度初 5 个工作日内将管理费用从集合计划资产中一次性支付给管理人。

(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。

(4) 证券交易费用：本集合计划证券交易费用包括集合计划运作期间投资所发生的交易手续费、开放式基金的认（申）购和赎回费、印花税等有关税费，作为交易成本直接扣除。

(5) 证券账户开户费用：证券账户开户费由托管人在开户时先行垫付，产品在证券账户开户一个月内成立的，经管理人与托管人核对无误后，自证券账户开户一个月内由托管人从集合计划中扣划；如证券账户开户一个月内产品未能成立，由管理人在收到托管人缴费通知后的 5 个工作日内支付给托管人，托管人不承担垫付开户费用义务。

(6) 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，例如本集合计划成立后的信息披露费用、注册登记费用等，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。

(7) 增值税等应纳税费：

本集合计划运营过程中发生的增值税应税行为，以管理人为增值税纳税人，法律法规有其他规定的，从其规定；本集合计划运营过程中发生的增值

税及附加税费在本集合计划委托资产中列支，集合计划应每月计征应交增值税及附加税费，由管理人、托管人根据规定在纳税申报期结束前将应交增值税及附加税费款项划至管理人指定的缴税账户，管理人按规定缴纳增值税及附加税费。法律、法规及其他规范性文件对资产管理计划运营过程中发生的应税行为另有规定的，管理人根据规定执行。

### 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、管理人的业绩报酬

本集合计划在集合计划分红日、委托人份额退出或集合计划终止清算时，管理人根据实际年化收益率提取业绩报酬。

本集合计划业绩报酬计提基准为 3.6%，对于集合计划实际年化收益率大于对应份额业绩报酬计提基准的部分，管理人按照 60%的比例计提业绩报酬。业绩报酬计提基准是管理人通过深入分析国内外宏观经济形势、社会资金及金融市场利率走势，依据所投资品种综合收益预测，并不是管理人向委托人承诺的预期收益或保证收益，委托人将自行承担投资风险。

#### 1、业绩报酬提取原则

(1) 在符合业绩报酬计提条件时，本集合计划在分红日、委托人份额退出和本集合计划终止清算时计提业绩报酬；

(2) 分红时提取业绩报酬的，业绩报酬从分红资金中扣除；委托人份额退出时提取业绩报酬的，业绩报酬从退出资金中扣除；集合计划终止清算时提取业绩报酬的，业绩报酬从清算资产中扣除。

#### 2、业绩报酬计算方法

以上一个发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日（以下简称“上一个业绩报酬计提日”）到本次业绩报酬计提日为计提区间计算年化收益率 R。

年化收益率 R 计算公式如下：

$$R=100%*(P1-P0)/(P*D)*(当年天数)$$

P1=业绩报酬计提日的单位累计净值

P0=上一业绩报酬计提日的单位累计净值

---

P=上一业绩报酬计提日的单位净值

D=计提区间存续天数

R=年化收益率

业绩报酬的计算公式为：

$$E=K*(R-R_0)*60\%*D/(当年天数)$$

E=业绩报酬

R<sub>0</sub>=业绩报酬计提基准

K=业绩报酬计提日对应的份额×上一业绩报酬计提日单位净值

### 3、业绩报酬的支付

提取业绩报酬时，由管理人向托管人发送业绩报酬划款指令，托管人根据管理人指令将业绩报酬划拨给注册登记机构，由注册登记机构支付给管理人。若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

## 第14节 投资收益与分配

### 一、集合计划收益的构成

集合计划的收益包括：集合计划投资所得债券利息、红利、买卖证券价差、股票质押式回购利息、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、集合计划可供分配利润

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。

### 三、收益分配原则

(1) 每一份份额享有同等的分配权。

(2) T日日终参与成功的计划份额不享有T日分红权益，自T+1日起享有分红权益；T日退出的计划份额享有T日分红权益，自T+1日起不享有分红权益。

(3) 集合计划收益的分配默认采用红利再投资方式，委托人可以通过推广机构或交易系统选择采用现金分红方式。

---

(4) 集合计划收益分配次数每年不超过2次；具体分配基准、比例、时间等以管理人公告为准。

(5) 收益分配时发生的银行转账等手续费用由委托人自行承担。

(6) 法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

#### 四、收益分配方式说明

收益分配方案由管理人公布并实施，收益分配方案须载明集合计划收益分配对象、分配时间、分配方式等内容。收益分配方案由管理人拟定并通知托管人，由管理人公告确定。

委托人可选择现金红利或红利转投，本集合计划收益分配方式默认为红利转投。委托人选择红利转投，即将现金红利按除权日的单位净值自动转为计划份额进行再投资；委托人选择现金红利，即管理人将现金红利款划往推广机构账户，再由推广机构划入委托人账户，现金红利款自款项从集合计划托管账户划出之日起7个工作日内到达委托人账户。

### 第15节 投资目标与投资策略

#### 一、投资目标

本集合计划在有效控制投资风险基础上，力争获得稳定的投资回报。

#### 二、投资策略

##### 1、资产配置策略

本集合计划基于深入分析国内外宏观经济走势、市场资金运动及各项宏观经济政策对金融市场特别是货币市场和债券市场的影响，判断本集合计划资产在股票质押式回购、债券、现金类资产上的配置比例，并动态配比以规避系统性风险的影响，降低组合的波动性，最大限度保障资产的安全性。

##### 2、固定收益投资策略

本集合计划主要投资久期和产品避险期相匹配的债券，按买入并持有方式操作保证债券组合收益的稳定性，管理人将在有效控制整体资产风险的基础上，根据对宏观经济发展状况、金融市场运行特点等因素的分析确定组合整体框架，对债券市场、收益率曲线以及各种债券品种价格的变化进行预测，相机而动、积极调整。

---

管理人将充分利用现有行业与公司研究力量，根据发债主体的经营状况和现金流等情况对其信用风险进行评估，以此作为品种选择的基本依据。

### 3、股票质押式回购投资策略

本集合计划重点投资股票质押式回购业务，获取稳定收益，管理人已建立完善的股票质押式回购项目评估体系，在综合考察融入方财务状况、业务发展情况、信用报告、以及具体项目所属行业、投资规模、投资周期等情况判断其还款付息能力。对不具有还款付息能力的项目予以拒绝，对于具有还款付息能力的项目将根据项目的风险情况以及质押标的股票等情况决定收益率、期限、质押率、质押比例和预警线及平仓线。管理人还将持续跟踪融入方的资质以及质押股票情况，做好风险控制措施。

## 第16节 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、《集合资产管理合同》、《说明书》等有关法律性文件；
- 2、宏观经济情况、财政政策和货币政策的调整以及汇率、利率变化趋势；
- 3、投资对象流动性、收益和风险的配比关系。

### 二、集合计划的投资程序

(1) 管理人 大集合资产管理投资决策委员会是管理人董事会和公司领导班子会议授权下，本集合计划管理人进行资产管理投资运作的最高决策机构，贯彻落实有关法律法规、管理人的公司制度，授权并监督管理人的资产管理业务部门的工作。

(2) 管理人 资产管理部投资总监负责领导资产管理业务的投资团队管理所属各资产管理计划，监控投资决策和投资执行过程；在公司大集合资产管理投资决策委员会授予的权限范围内，对产品重大资产投资项目进行审核。

(3) 管理人 深圳分公司大集合固定收益类管理小组对本集合计划的投资决策等提出指导性意见，确定具体的投资策略；如遇重大事项按制度规定上报公司大集合资产管理投资决策委员会批准。

(4) 管理人 投资经理依据大集合资产管理投资决策委员会及大集合固定收益类管理小组决议，制定交易策略，进行具体品种的交易。

### 三、风险控制

结合本集合计划的风险收益特征，管理人在公司风险管理相关制度框架内，制定了一套风险控制方案，包括事前预防、事中控制和事后完善三个层面。

#### (1) 事前预防

指集合计划运作前，针对本集合计划可能面临的主要风险，进行有计划的风险控制措施。具体包括：

- A、相关授权安排与集合计划主办人员行为约束；
- B、投资运作流程优化设计；
- C、创建证券投资库。

---

## (2) 事中监控

指本集合计划开始运作后至存续期结束前，根据本集合计划运作期间内集合计划的风险收益特征，进行有针对性的风险控制措施。具体包括：

A、积极运用本合同中约定的各种证券投资策略进行资产配置动态调整；

B、严格执行集合计划资产的止损策略；

C、通过制度保障获得公司相关部门在风险管理和控制方面的支持，提高本集合计划资产风险管理效率。

## (3) 事后完善

指在本集合计划存续期内，当风险事件发生后，管理人对风险事件进行归因分析和评价总结，并针对既有的风险制度和操作环节中存在的漏洞进行补充和修正，以防止未来类似事件再次发生。

---

## 第17节 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、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40%，中国证监会另有规定的除外；

2、证券法规规定和集合计划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，履行合同变更程序后，本集合计划可相应调整投资组合限制的约定。

### 二、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。

## 第18节 集合计划的会计和审计

### 一、会计政策

1、集合计划的会计年度为公历每年1月1日至12月31日。

2、集合计划核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位。

3、会计制度按国家有关的会计制度执行。

---

4、本集合计划独立建账、独立核算。

5、本集合计划会计责任人为管理人。

## 二、年度审计

1、本集合计划管理人聘请具有证券相关业务资格的会计师事务所及其注册会计师对集合计划进行年度相关审计工作，会计师事务所及其注册会计师与计划管理人、计划托管人相互独立。

2、会计师事务所更换经办注册会计师，应事先征得管理人同意。

3、管理人认为有充足理由更换会计师事务所，报中国证监会备案后可以更换。更换会计师事务所需在5个工作日内公告。

## 第19节 集合计划的信息披露

### 一、信息披露的原则

本集合计划的信息披露将严格按照《管理办法》、《实施细则》、本合同及其他有关规定进行。本集合计划信息披露事项将在管理人指定媒体上公告：东莞证券股份有限公司网站：[www.dgzq.com.cn](http://www.dgzq.com.cn)

### 二、信息披露的内容及时间

#### 1、定期公告

(1) 单位资产净值公告：本集合计划存续期内每周第一个工作日披露集合计划上周最后一个工作日的单位净值。

(2) 资产管理报告：每三个月公布一次季报，于截止日后十五个工作日内公布；每年公布一次年报，于截止日后六十个工作日内公布；内容包括但不限于报告期内集合计划的运作情况、资产配置状况及价值变动情况。

上述报告由管理人负责编制，经托管人复核后于管理人网站公告，并由管理人报其住所地中国证监会派出机构备案。

(3) 资产托管报告：每三个月公布一次季报，于截止日后十五个工作日内公布；每年公布一次年报，于截止日后六十个工作日内公布；内容应说明报告期内管理人在投资运作、资产净值的计算、集合计划费用开支等问题上，是否存在任何损害委托人利益的行为，是否严格遵守了《管理办法》、《实施细则》等有关法律法规，在各重要方面的运作是否严格按照集合计划

说明书及《集合资产管理合同》的约定进行；若管理人未遵守有关规定，托管人应说明发现的问题，托管人就此采取的措施及管理人的改进状况。

资产托管报告由托管人负责编制，经管理人复核确认后于管理人网站公告，并由管理人报其住所地中国证监会派出机构备案。

#### (4) 年度审计报告

年度审计报告由管理人聘请的会计师事务所负责编制，由管理人负责于管理人网站公告，并由管理人报其住所地中国证监会派出机构备案。

## 2、临时公告

在集合计划运作过程中发生如下可能对委托人权益产生重大影响的事件时，管理人将按照法律、法规、《集合资产管理合同》及中国证监会的有关规定在管理人网站及时公告，并备置于各推广网点，并办理相关的审批或报备手续。

- (1) 出现第 25 节第一条事由导致集合计划终止和清算；
- (2) 管理人或托管人及其董事、监事和高级管理人员受到重大处罚；
- (3) 投资经理更换；
- (4) 投资于管理人、托管人及与管理人、托管人有关关联方关系的公司发行的证券及其他关联事项；
- (5) 暂停受理参与或退出申请；
- (6) 暂停参与或退出期间公告；
- (7) 发生巨额退出并延期支付；
- (8) 开始或者重新开始参与、退出等业务的办理；
- (9) 资产计价出现错误达到集合计划资产净值 0.5%时；
- (10) 分红公告；
- (11) 管理人、托管人因重大违法、违规行为，被中国证监会取消相关业务资格；
- (12) 管理人、托管人因解散、破产、撤销、停止营业，不能履行相应职责。
- (13) 其他重大事项。

## 3、澄清公告与说明

在任何公共传播媒介中出现的或者在市场上流传的消息可能对委托人的收益预期产生误导性影响或引起较大恐慌时，相关的信息披露义务人知悉后

---

应当立即对该消息进行澄清，并将有关情况立即报告中国证监会。

### 三、对账单寄送安排

每月初5个工作日内向客户寄送上月对账单，对账单通过邮局递送或以电子文件形式寄送，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。

### 四、信息披露文件的存放与查阅

集合计划说明书、资产净值公告、资产管理报告、资产托管报告及清算报告等文本文件在编制完成后，将存放于管理人、托管人办公场所，供委托人在办公时间查阅。委托人在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复制件或复印件。

管理人、托管人保证该方提供或披露的文本的内容与所公告的内容完全一致。委托人按上述方式所获得的文件或其复印件，管理人、托管人应保证委托人在该方获得的文件内容与所公告的内容完全一致。

管理人和托管人应当妥善保存客户开户资料、委托记录、交易记录和与内部管理、业务经营有关的各项资料，任何人不得隐匿、伪造、篡改或者毁损。上述资料的保存期限自集合资产管理合同终止之日起不得少于二十年。

## 第20节 风险揭示及风险控制与管理

### 一、风险揭示

委托人投资于本集合计划的主要可能风险如下：

#### （一）市场风险

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、新股询价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和基金、股票定价产生影响，从而产生风险。

---

### 3、利率风险

金融市场利率波动会导致基金、债券市场及货币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。本集合计划投资于基金、债券和货币市场，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，从而导致新股发行定价与估值有偏差。

### 5、购买力风险

本集合计划投资目的是委托人资产保值增值，如果发生通货膨胀，投资于证券所获得的收益可能会被通货膨胀抵消，从而影响投资者资产的保值增值。

### 6、基金公司经营管理风险

本集合计划所投资的各项基金公司管理的证券投资基金，如果基金公司经营管理不善，有可能导致其管理的基金净值下降，从而使本集合计划收益下降。

风险防范措施：针对市场风险，管理人将基于宏观经济和公司的深入研究，制定合理的投资策略，并及时根据市场发展情况进行调整，减少市场风险对投资收益的影响。

#### （二）信用风险

指集合计划在投资交易过程发生交收违约，导致集合计划资产损失。

风险防范措施：针对信用风险，管理人将集合计划资产投资于公开发行的基金、债券等产品，对于债券品种，管理人将选择信用评级较好的债券品种，以最大程度的避免信用风险。

#### （三）流动性风险

指集合计划相应资产不能迅速转变成现金以满足集合计划退出、清算要求的风险。

风险防范措施：针对流动性风险，本集合计划对投资范围、投资对象和投资比例有着明确约定，管理人将保持一定的现金类资产比例，托管人根据合同约定监督集合计划的投资比例，以保持组合的较高流动性，尽可能满足委托人的退出需求。

#### （四）管理风险

---

在集合计划投资管理运作过程中，可能因管理人对经济形势和证券市场等判断有误、获取的信息不全等影响集合计划的收益水平。管理人和托管人的管理水平、管理手段和管理技术等对集合计划收益水平存在影响。可能存在投资收益为负的风险，即产品到期时，累计可能会产生亏损的风险。

风险防范措施：针对管理风险，管理人已经建立了完善的投资决策流程与风险控制机制，在运作本集合计划过程中将采取严格的防火墙措施，同时本集合计划聘请第三方独立审计师，定期对本集合计划的投资与运作情况进行审计，以减少管理风险。

### **（五）操作或技术风险**

指相关当事人在业务各环节操作过程中，因内部控制存在缺陷或者人为因素造成操作失误或违反操作规程等引致的风险，例如，越权违规交易、会计部门欺诈、交易错误、IT系统故障等风险。

风险防范措施：针对这一风险，管理人采用了铭创的投资交易及风控系统、恒生的登记过户系统等专业系统应用于集合计划投资运作流程中，同时相关的系统已经经过多次测试，已经达到上线的要求。另外，管理人对计划运作过程中的关键岗位都安排了双人复核、风控专员实时监控等手段以减少操作或技术风险。

### **（六）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，或者投资违反法规及有关规定，新股申购违反证监会有关新股发行的投标询价制度的相关规定风险。

风险防范措施：针对这一风险，管理人建立了多层次的风险控制体系，严格遵守各项法律和规章制度，同时运用完善的系统支持，保证业务合规有序发展。

### **（七）集合计划提前终止的风险**

指计划管理人、托管人在集合计划存续期间，因重大违法违规，被中国证监会取消相关业务资格，或因解散、破产、撤销等原因不能履行相应职责等原因造成集合计划提前终止的风险。

风险防范措施：针对这一风险，管理人及托管人都制定了完善的公司治理架构，有着严格的风险控制体系，各项财务指标满足设立集合资产管理计划的要求，同时管理人及托管人接受上级部门的监管，并接受监管部门的指

导。另外，管理人还聘请外部审计机构对管理人的经营状况及集合计划的运作情况进行审计，以最大程度减小这一风险。

## （八）其他风险

### （1）投资中小企业私募债的风险

本集合计划根据流动性需求以及收益率要求合理的投资中小企业私募债券。私募债面向于规模较小的企业，信用风险和流动性风险可能高于普通信用债。

（a）信用风险。中小企业私募债是中小微企业发行的，信用等级较低，违约风险较高，可能出现因企业盈利状况恶化等因素导致企业违约或延迟支付到期本息的风险；

（b）流动性风险。鉴于发行主体是中小企业，且为非公开发行方式，中小企业私募债的流动性受到一定限制，可能出现不能迅速变卖或需支付较高的变卖成本导致委托人收益受到损失的风险；

（c）利率风险。中小企业私募债利率水平较高，利率波动对企业的融资成本和利润水平影响较大，可能导致证券市场的价格和收益率的大幅变动，使集合计划收益水平随之发生变化。

### （2）投资股票质押式回购的风险

#### （a）质押标的流动性风险

本集合计划投资于股票质押式回购，可能存在所质押的股票市场价格波动导致质押物价值下降，因市场交易量不足，导致质押的证券不能迅速、低成本地转变为现金的或变现后的价值不能覆盖本息等情况，或者标的证券停牌无法处置等情况导致投资者无法获得预期收益甚至可能本金亏损的风险。还可能存在资产管理计划在股票质押回购待购回期间提前终止，但回购未到期或违约处置未完成可能导致投资者无法及时收回投资的风险。

#### （b）融入方信用风险

由于融入方财务状况恶化、项目投资规模与周期超预期、行业不景气等原因可能造成融入方违约，无法按照协议中约定的时间、价格、数量进行回购，出现违约，从而给集合计划带来风险。

#### （c）限售股风险

股票质押式回购的标的证券为有限售条件股份的，如融入方发生违约，违约处置时标的证券仍处于限售期的，存在无法及时处置的风险。

---

#### (d) 司法冻结风险

股票质押式回购的标的证券被质押后，因资金融入方原因导致标的证券被司法冻结或强制执行的，存在无法被及时处置的风险。

#### (e) 股票质押式回购业务的估值风险

鉴于本集合计划对股票质押式回购业务采用成本计价、以协议约定利率计提利息并在协议期间摊销的估值方法，在极端情况下（质押标的触及平仓线且融入方违约、处置期间质押标的连续停牌或成交量不足等），可能出现质押标的处置日集合计划估值有较大波动，由此产生估值风险。

#### (f) 未履行职责风险

证券公司未按照约定尽职履行交易申报、合并管理、盯市、违约处置等职责从而损害客户利益的风险。

#### (3) 采用电子签名合同管理方式所带来的风险

本集合计划合同可以采用电子签名合同方式进行集合计划资产管理合同的签署、核对、收集、整理和保管，在运用电子签名方式进行集合计划合同管理过程中，由于系统故障、人员操作失误、相关机构之间衔接不畅等原因，可能导致委托人参与申请无法及时确认、委托人资料信息错误、委托人无法查询交易信息等情形，从而导致风险。

## 第21节 委托人的权利与义务

### 一、委托人的权利

- 1、取得集合计划收益；
- 2、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、按照本合同的约定，参与分配集合计划清算后的剩余资产；
- 5、因管理人、托管人违约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。

### 二、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

---

意愿的基本情况；

2、按照本合同约定缴纳委托资金，承担相应税费，支付合同约定的管理费、托管费、业绩报酬和其他费用；

3、按照本合同约定承担集合计划可能的投资损失；

4、查询集合计划的经营运作情况，包括但不限于认购参与、申购参与与退出集合计划申请的情况，查询本委托人集合计划净值情况、集合计划公告的其他情况等；

5、委托人承诺其知悉反洗钱相关法律法规的规定，并承诺将严格遵守上述规定，不会实施任何违反反洗钱规定的非法行为；积极配合管理人进行相应的客户身份识别及反洗钱客户风险等级划分、反洗钱可疑交易报送、涉嫌恐怖融资可疑交易报送等工作；

6、法律、行政法规、中国证监会的有关规定和本合同约定的其他义务。

### 三、委托人特别承诺同意的事项

委托人同意将集合计划资产投资于管理人、托管人及与管理人、托管人有关联方关系公司发行的证券，但其投资比例应严格遵守《管理办法》的规定。交易完成五个工作日内，管理人应书面通知托管人，通过管理人的网站告知委托人，并向证券交易所报告。

## 第22节 管理人的权利与义务

### 一、管理人的权利

1、根据集合资产管理合同的约定，独立运作集合计划的资产；

2、根据集合资产管理合同的约定，收取管理费、业绩报酬费；

3、按照集合资产管理合同的约定，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、根据集合资产管理合同的约定，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集合资产管理合同及托管协

---

议约定的其他权利。

## 二、管理人的义务

1、在集合计划投资管理活动中恪尽职守，履行诚实守信、审慎尽责的义务，以专业技能管理集合计划的资产，为委托人利益服务，依法保护委托人的财产权益；

2、遵循公平、诚信的原则，禁止任何形式的利益输送；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；保证集合资产管理账户与证券自营账户之间或者不同的证券资产管理账户之间不得发生交易，有充分证据证明已依法实现有效隔离的除外；

3、根据中国证监会有关规定、集合资产管理合同和托管协议的约定，接受托管人的监督；

4、按合同约定的时间和方式向委托人寄送对账单，说明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，并按规定出具资产管理报告；

5、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、推广代理协议的，应当予以制止，并及时报告住所地中国证监会派出机构；

6、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的除外）；

7、按照集合资产管理合同约定向委托人分配集合计划的收益；

8、办理集合计划的开户登记事务及其他手续；为集合计划建立独立完整的账户、核算、报告、审计和档案管理制度，设定清晰的清算流程和资金划转路径，公司风控、稽核等部门应对集合资产管理业务的运营和管理实施有效监控和核查；

9、及时向退出集合计划的委托人支付退出款项；

10、妥善保存与集合计划有关的合同、客户资料、交易记录、业务档案等文件、资料和数据，保存期限不得少于 20 年。

11、在集合计划到期或因其他原因解散时，与托管人一起妥善处理有关清算和委托人资产的返还事宜；

12、违反法律、行政法规和中国证监会的有关规定，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，及时向委托人和托管人报告；

13、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；

14、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，追偿费用由违约方承担；

15、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；

16、聘请具有证券相关业务资格的会计师事务所，对每个集合计划的运营情况进行年度审计，并将集合计划审计报告在每年度结束之日起 60 日内，向委托人和托管人提供，并报管理人住所地中国证监会派出机构备案；

17、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或查封的情况下，管理人无义务就针对集合计划资产所提出司法或行政程序进行答辩，但是应提供必要的协助；

18、按照反洗钱的规定对委托人进行身份识别，了解客户及其交易目的和交易性质的基础上，进行反洗钱客户风险等级划分，履行大额交易、可疑交易以及涉嫌恐怖融资可疑交易的报告义务；

19、法律、行政法规和中国证监会规定及合同约定的其他义务。

## **第23节 托管人的权利与义务**

### **一、托管人的权利**

1、对集合计划资产进行托管；

2、按照集合资产管理合同的约定收取托管费；

3、监督管理人对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、中国证监会的规定或者集合资产管理合同约定的，予以制止；

4、查询集合计划的运作情况；

5、法律、行政法规、中国证监会有关规定、集合资产管理合同及托管协议约定的其他权利。

### **二、托管人的义务**

- 
- 1、在集合计划托管活动中恪尽职守，履行诚实守信、审慎尽责的义务，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；
  - 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、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合同约定，不得擅自动用或处分集合计划资产；
  - 4、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、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；管理人未能改正的，并且管理人的投资或清算指令尚未生效执行的应当拒绝执行，并向管理人住所地中国证监会派出机构报告；
  - 6、复核管理人计算的集合计划的资产净值；
  - 7、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、行政法规或、中国证监会另有规定的除外）；
  - 8、按规定出具集合计划托管报告；
  - 9、妥善保存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，保存期不少于 20 年；
  - 10、在集合计划到期或因其他原因解散时，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；
  - 11、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；
  - 12、因自身过错导致集合计划资产损失的，向委托人承担赔偿责任；
  - 13、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，追偿费用由违约方承担；
  - 14、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；
  - 15、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或查封的情况下，托管人无义务就针对集合计划资产所提出司法或行政程序进行答辩，但是应提供必要的协助；
  - 16、法律、行政法规和中国证监会规定及合同约定的其他义务。

---

## 第24节 集合计划展期

不展期。

## 第25节 集合计划终止和清算

### 一、有下列情形之一的，本集合计划应当终止：

- 1、集合计划存续期内，委托人少于2人（不含管理人）；
- 2、集合计划管理人因重大违法违规，被中国证监会取消相关业务资格；
- 3、集合计划托管人因重大违法、违规行为，被中国证监会取消相关业务管理资格，而管理人未能在合理时间与新的托管人签订托管协议；
- 4、计划管理人因解散、破产、撤销、停止营业，不能履行相应职责；
- 5、集合计划托管人因解散、破产、撤销、停止营业等原因不能履行相应职责，而管理人未能在合理时间与新的托管人签订托管协议；
- 6、战争、自然灾害等不可抗力力的发生导致本集合计划不能存续；
- 7、法律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、集合计划的终止时间

- 1、如果委托人持有集合计划份额至集合计划终止，则其合同自集合计划资产分配结束之日终止；
- 2、如果委托人在开放日将其持有的集合计划份额全部退出，则其合同自其集合计划份额全部退出之日终止；
- 3、法律法规及中国证监会规定的其他情形。

### 三、集合计划的清算

#### 1、资产清算主体

本集合计划终止后5个工作日内，由管理人、托管人或其接管人组织成立清算小组，共同负责有关计划的清算事宜。

#### 2、清算原则

管理人和托管人在扣除清算费用、管理费、托管费等费用并按照合同约定提取业绩报酬后，将集合计划资产按照委托人持有集合计划份额的比例，

---

以现金形式分派给委托人。

### 3、清算程序

- (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及管理人所在地的派出机构；
- (5) 将清算结果报告委托人；
- (6) 对资产进行分配。

### 4、清算费用

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出。

### 5、二次清算安排

委托人同意，如本集合计划在终止之日有未能流通变现的证券，管理人可针对该部分未能流通变现证券制定二次清算方案，该方案应经托管人认可，并通过管理人网站进行披露。

若本集合计划在终止之日有未能流通变现的证券，管理人应根据上述二次清算方案的约定，对该部分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，以货币形式全部分配给委托人。

### 6、清算公告

本集合计划终止后 5 个工作日内管理人开始清算集合计划资产；清算过程中的有关重大事项须及时向委托人报告；清算结果由管理人清算结束后 10 个工作日内向委托人报告，清算结束后 15 个工作日内报住所地中国证监会派出机构备案。

### 7、集合计划剩余资产的分配

本集合计划终止之日起30个工作日内，管理人和托管人应当在扣除清算费用、管理费、托管费及业绩报酬等费用后，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。

### 8、清算账册及文件的保存

集合计划清算账册及有关文件由托管人按相关法律法规妥善保存，保存期不少于二十年。

---

## 第26节 不可抗力

不可抗力是指本合同订立以后，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；
- 6、管理人或托管人业务系统出现重大故障或其他不可抗力因素，管理人和托管人已经采取必要、恰当、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。

不可抗力发生时，遭受不可抗力的一方当事人应及时通知其他方当事人，并尽最大努力保护其他方当事人的合法权益。

## 第27节 违约责任与争议处理

### 一、违约责任

1、当事人一方不履行本合同中约定的义务或者履行义务不符合本合同约定的，该当事人应当赔偿由此给对方当事人造成的损失。

2、当事人多方不履行本合同约定的义务或者履行义务不符合本合同约定的，当事人分别承担与其过错相适应的违约责任。

3、因本合同的当事人违反本合同的约定给集合计划资产造成实际损害的，应由违约方赔偿损失，赔偿的损失范围限于直接损失。在发生下列情况，当事人可以免责：

(1) 管理人及托管人按照中国证监会的规定或当时有效的法律、法规或规章实施的作为或不作为而造成的损失等；

(2) 管理人没有欺诈或重大过失的情况下，由于按照本合同或说明

---

书约定的投资原则而投资或不投资而造成的损失等；

(3) 托管人按照本合同和托管协议的约定履行了托管职责，对于由此导致的集合计划资产损失不承担责任；

(4) 按照本集合计划估值方法得出的估值与其他估值方法得出的估值有偏差的；

(5) 涉及集合计划及投资者自身的税务事项及其潜在风险的；

(6) 不可抗力。

当事人违约，其他方在职责范围内有义务及时采取必要的措施，尽力防止损失的扩大。

违约行为虽已发生，但本合同能够继续履行的，在最大限度地依法保护持有人合法权益的前提下，管理人和托管人应当继续履行本合同。

4、因托管人不能控制的管理人行为造成集合资产或委托人损失的，由管理人自行承担赔偿责任，托管人不承担赔偿责任。

## 二、争议的处理

发生纠纷时，本合同当事人可以通过协商或者调解予以解决。当事人不愿通过协商解决或者协商不成的，各方可以向广东证券期货业协会申请调解；若协商或调解不成的，可提交华南国际经济贸易仲裁委员会仲裁。仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力。仲裁费用按仲裁认定的责任对应承担。

纠纷处理期间，相关各方当事人应恪守管理人和托管人职责，各自继续忠实、勤勉、尽责地履行说明书、托管协议和本合同约定的义务，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。

---

## 第28节 合同的成立、生效

### 一、合同成立的条件

本合同经管理人、托管人的法定代表人或其授权代理人在合同签章页上签字/章、加盖公章并满足下列之一情况后成立：

- 1、委托人为自然人的，委托人本人在合同签章页上签字或盖章；
- 2、委托人为法人的，法定代表人或其授权代理人在合同签章页上签字或盖章、加盖公章；
- 3、委托人为其他组织的，其负责人或其授权代理人在合同签章页上签字或盖章、加盖公章。

### 二、合同生效的条件

本合同全部满足下列两种情况后生效：

- 1、本集合计划成立；
- 2、注册登记机构对委托人参与金额予以确认。

## 第29节 合同的补充与修改

### 一、合同的补充与修改

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 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约定申请退出本集合计划；委托人未在更新或修改内容生效前提出异议或未按照合同的约定申请退出的，视为同意变更。

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方

---

式向委托人发送合同变更征询意见。委托人不同意变更的，应在征询意见发出后的 10 个工作日内的开放日或 10 个工作日期限届满后的首个开放日或管理人指定的临时开放日（以下统称“指定开放日”）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，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前一个工作日做强制退出处理。**

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。

3、合同变更后，委托人、管理人和托管人应当按照变更后的合同行使相关权利，履行相应义务。

4、对本合同任何形式的变更、补充，管理人应当在变更或补充发生之日起五个工作日内报中国证券投资基金业协会备案，同时抄送管理人住所地、资产管理分公司所在地中国证监会派出机构。

**二、在不影响委托人权益且不增加委托人义务的情况下，管理人或托管人于下列情形可不经本合同其他当事人同意，按如下约定变更本合同：**

1、合同履行期间内，若东莞证券股份有限公司的资产管理部门与东莞证券股份有限公司分离，依法成立独立的企业法人且依法承继东莞证券股份有限公司集合资产管理人的业务与资质，则由新法人直接变更为本集合计划的集合资产管理人，本合同项下的所有关于管理人的权利义务均由其承继。

2、合同履行期间，若招商银行股份有限公司的资产托管部门与招商银行股份有限公司分离，依法成立独立的企业法人且依法承继原招商银行股份有限公司资产托管人的业务与资质，则由新法人直接变更为本集合计划的集合资产托管人，本合同项下的所有关于托管人的权利义务均由其承继。

**三、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投资收益、承担投资损失，或排除应由委托人自行承担的投资风险和损失。**

### 第30节 协议文本

一、《旗峰 1 号策略精选集合资产管理计划说明书》是本合同的组成部分，与合同具有同等法律效力。

二、本合同签章页（即《合同签章页》）将用于各方当事人签章并由委托人、管理人、托管人各保存一份。

三、合同一式五份，委托人、管理人、托管人各持有并保存一份，报监管部门备案两份，每份均具有同等法律效力。

---

# 旗峰 1 号策略精选集合资产管理计划资产管理合同

## 签章页

合同编号：

第一条 鉴于《旗峰 1 号策略精选集合资产管理计划资产管理合同》（下称《合同》）、《旗峰 1 号策略精选集合资产管理计划说明书》（下称《说明书》）是约定当事人之间基本权利义务的法律文件，委托人、管理人、托管人签订签章页，并同意接受《合同》与《说明书》的约束。自本签章页生效之日起，委托人即与其他两方共同成为《合同》的当事人。

第二条 委托人承诺以真实身份参与集合资产管理计划，保证委托资产的来源及用途合法，所提供的资料真实、合法、完整，没有汇集他人资金参与本集合计划，并已阅知本合同签章页、《合同》、《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、谨慎勤勉的原则管理和运用本集合计划资产，但不保证本计划一定盈利，也不保证最低收益。代理推广机构对集合资产管理计划的业绩也不承担任何担保和责任。如法律文书中载明投资收益预期，该预期仅供客户参考，不代表集合计划在存续期内的实际收益，也不构成管理人保证客户资产本金不受损失或者取得最低投资收益的承诺。

第四条 托管人承诺按照《合同》、《托管协议》的约定，以诚实信用、谨慎勤勉的原则履行托管职责，安全保管集合计划资产，但不保证本集合计划投资不受损失，不保证最低收益。

第五条 本合同签章页经三方签字盖章，（如果委托人是自然人则应由本人签署，当委托人为机构时，应由法定代表人或其授权代表人签署，并加盖委托人公章或合同专用章。）且委托人按合同约定将参与资金划入指定账户并得到注册登记机构确认有效后生效。本合同记载项下的权力质押以注册登记机构的登记为准。如本签章页未生效，参与资金将全额退回委托人，各方互不承担其他责任和风险。

第六条 委托人特此声明，其独立、自主、谨慎做出投资决策并签署本合同签章页，同时认可其他当事人以套印方式加盖公章具有法律效力。本合同签章页一式三份，委托人、管理人、托管人三方各持一份，具有同等法律效力。

管理人确认，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。

管理人

托管人

委托人  
身份证件名称及号码

（盖章签字）

（盖章签字）

（签字 / 盖章）

年 月 日

---