

国海证券安盈债券型

集合资产管理计划

托管协议

管理人：国海证券股份有限公司

托管人：中国银行股份有限公司

二〇二二年一月

鉴于国海证券股份有限公司是一家依照中国法律合法成立并有效存续的股份有限公司，按照相关法律法规的规定具备担任管理人的资格和能力；

鉴于中国银行股份有限公司是一家依照中国法律合法成立并有效存续的银行，按照相关法律法规的规定具备担任托管人的资格和能力；

鉴于国海证券股份有限公司拟担任国海证券安盈债券型集合资产管理计划的管理人，中国银行股份有限公司拟担任国海证券安盈债券型集合资产管理计划的托管人；

为明确国海证券安盈债券型集合资产管理计划管理人和托管人之间的权利义务关系，特制订本协议。

一、托管协议当事人

（一）管理人

名称：国海证券股份有限公司

注册地址：广西壮族自治区桂林市辅星路 13 号

办公地址：广西壮族自治区南宁市青秀区滨湖路 46 号

邮政编码：530028

法定代表人：何春梅

成立日期：1993 年 6 月 28 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：5,444,525,514 元人民币

存续期间：长期

经营范围：证券经纪；证券投资咨询；与证券交易、证券投资活动有关的财务顾问；证券承销与保荐；证券自营；证券资产管理；证券投资基金代销；为期货公司提供中间介绍业务；融资融券；代销金融产品。（依法须经批准的项目，经相关部门批准后方可开展经营活动。）

（二）托管人

名称：中国银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街 1 号

法定代表人：刘连舸

成立时间：1983 年 10 月 31 日

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24 号

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹元整

经营范围： 吸收人民币存款；发放短期、中期和长期贷款；办理结算；办理票据贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券；从事同业拆借；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保险箱服务；外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外汇兑换；国际结算；同业外汇拆借；外汇票据的承兑和贴现；外汇借款；外汇担保；结汇、售汇；发行和代理发行股票以外的外币有价证券；买卖和代理买卖股票以外的外币有价证券；自营外汇买卖；代客外汇买卖；外汇信用卡的发行和代理国外信用卡的发行及付款；资信调查、咨询、见证业务；组织或参加银团贷款；国际贵金属买卖；海外分支机构经营与当地法律许可的一切银行业务；在港澳地区的分行依据当地法令可发行或参与代理发行当地货币；经中国人民银行批准的其他业务。

存续期间： 持续经营

二、托管协议的依据、目的、原则和解释

（一）依据

本协议依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第 7 号〈托管协议的内容与格式〉》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及其他有关法律法规与《国海证券安盈债券型集合资产管理计划资产管理合同》（以下简称“《资产管理

合同》”）订立。

（二）目的

订立本协议的目的是明确托管人和管理人之间在集合计划财产的保管、投资运作、净值计算、收益分配、信息披露及相互监督等相关事宜中的权利、义务及职责，确保集合计划财产的安全，保护集合计划份额持有人的合法权益。

（三）原则

管理人和托管人本着平等自愿、诚实信用的原则，经协商一致，签订本协议。

（四）解释

除非文义另有所指，本协议的所有术语与《资产管理合同》的相应术语具有相同含义。

（五）若本集合计划实施侧袋机制的，侧袋机制实施期间的相关安排见资产管理合同和招募说明书的规定。

三、托管人对管理人的业务监督和核查

（一）托管人根据有关法律法规的规定对管理人的下列投资运作进行监督：

1、对集合计划的投资范围、投资对象进行监督。管理人应将拟投资的股票库、债券库等各投资品种的具体范围及时提供给托管人。管理人可以根据实际情况的变化，对各投资品种的具体范围予以更新和调整，并及时通知托管人。

本集合计划主要投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行的股票（含主板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、债券（包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、国债期货以及法律法规或中国证监会允许投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

如法律法规或监管机构以后允许集合计划投资其他品种，管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

托管人根据上述投资范围对集合计划的投资进行监督。

2、对集合计划投融资比例进行监督

集合计划的投资组合应遵循以下限制：

(1) 本集合计划债券资产的比例不低于集合计划资产的 80%，股票资产的比例不高于集合计划资产的 5%；

(2) 每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本集合计划所持有现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于集合计划资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等；

(3) 本集合计划持有一家公司发行的证券，其市值不超过集合计划资产净值的 10%；

(4) 管理人管理且由本托管人托管的全部公开募集性质的集合资产管理计划持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；

(5) 本集合计划投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过集合计划资产净值的 10%；

(6) 本集合计划持有的全部资产支持证券，其市值不得超过集合计划资产净值的 20%；

(7) 本集合计划持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；

(8) 本管理人管理且由本托管人托管的全部公开募集性质的集合资产管理计划投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；

(9) 本集合计划应投资于主体评级为 AA+及以上(含 AA+)的信用债券。本集合计划持有信用债券期间，如果其信用等级下降且不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；

(10) 本集合计划投资于主体评级 AAA 的信用债券比例不低于本集合计划持有的全部信用债资产的 50%；

(11) 本集合计划投资于主体评级 AA+的信用债券比例最高不超过本集合计划持有的全部信用债资产的 50%；

以上信用债券不含可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券。因证券市场波动、集合计划规模变动等管理人之外的因素致使集合计划不符合该比例限制的，管理人不得主动新增上述对应信用债券的投资；

(12) 本集合计划应投资于信用级别评级为 AA+以上(含 AA+)的资产支持证券。本集合计划持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；

(13) 集合计划财产参与股票发行申购，本集合计划所申报的金额不超过本集合计划的总资产，本集合计划所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

(14)本集合计划进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过集合计划资产净值的 40%，进入全国银行间同业市场进行债券回购的最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；

(15)本管理人管理且由本托管人托管的全部公开募集性质的开放式集合资产管理计划持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；本管理人管理且由本托管人托管的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的集合资产管理计划品种以及中国证监会认定的特殊投资组合可不受前述比例限制；

(16)本集合计划主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过集合计划资产净值的 15%；因证券市场波动、上市公司股票停牌、集合计划规模变动等管理人之外的因素致使集合计划不符合该比例限制的，管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

(17)本集合计划与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与资产管理合同约定的投资范围保持一致；

(18) 集合计划资产总值不得超过集合计划资产净值的 140%；

(19) 本集合计划参与国债期货投资，应遵循下列限制：

1) 在任何交易日日终，持有的买入国债期货合约价值，不得超过集合计划资产净值的 15%；

2) 在任何交易日日终，持有的卖出国债期货合约价值不得超过集合计划持有的债券总市值的 30%；

3) 本集合计划所持有的债券（不含到期日在一年以内的政府债券）市值和买入、卖出国债期货合约价值，合计（轧差计算）不低于集合计划资产的 80%；

4) 本集合计划在任何交易日内交易（不包括平仓）的国债期货合约的成交金额不得超过上一交易日集合计划资产净值的 30%；

(20) 法律法规及中国证监会规定的其它投资比例限制。

除上述（2）、（9）、（11）、（12）、（16）、（17）情形之外，因证券/期货市场波动、证券发行人合并、集合计划规模变动等管理人之外的因素致使集合计划投资比例不符合上述规定投资比例的，管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。

管理人应当自资产管理合同生效之日起 6 个月内使集合计划的投资组合比例符合资产管理合同的有关约定。在上述期间内，本集合计划的投资范围、投资策略应符合资产管理合同的约定。托管人对集合计划的投资的监督与检查自资产管理合同生效之日起开始。

当法律法规或监管部门取消上述限制时，如适用于本集合计划的，管理人在履行适当程序后，则本集合计划投资不再受相关限制。

管理人运用集合计划财产买卖管理人、托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合集合计划的投资目标和投资策略，遵循集合计划份额持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到托管人的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交管理人董事会审议。管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

（二）托管人应根据有关法律法规的规定及《资产管理合同》的约定，对集合计划资产净值计算、各类集合计划份额净值计算、应收资金到账、集合计划费用开支及收入确定、集合计划收益分配、相关信息披露中登载集合计划业绩表现数据等进行复核。

（三）托管人在上述第（一）、（二）款的监督和核查中发现管理人违反上述约定，应及时提示管理人，管理人收到提示后应及时核对确认并以书面形式对托管人发出回函并改正。在限期内，托管人有权随时对提示事项进行复查。管理人对托管人提示的违规事项未能在限期内纠正的，托管人应及时向中国证监会报告。

（四）托管人发现管理人的投资指令违反法律法规、本协议的规定，应当拒绝执行，及时提示管理人，并依照法律法规的规定及时向中国证监会报告。托管人发现管理人依据交易程序已经生效的指令违反法律法规、本协议规定的，应当及时提示管理人，并依照法律法规的规定及时向中国证监会报告。

（五）管理人应积极配合和协助托管人的监督和核查，包括但不限于：在规定时间内答复托管人并改正，就托管人的疑义进行解释或举证，提供相关数据资料和制度等。

四、管理人对托管人的业务核查

（一）在本协议的有效期内，在不违反公平、合理原则以及不妨碍托管人遵守相关法律法规及其行业监管要求的基础上，管理人有权对托管人履行本协议的情况进行必要的核查，核查事项包括但不限于托管人安全保管集合计划财产、开设集合计划财产的资金账户和证券账户等投资所需账户、复核管理人计算的集合计划资产净值和各类集合计划份额净值、根据管理人指令办理清算交收、相关信息披露和监督集合计划投资运作等行为。

（二）管理人发现托管人擅自挪用集合计划财产、未对集合计划财产实行分账管理、无

正当理由未执行或延迟执行管理人资金划拨指令、泄露集合计划投资信息等违反法律法规、《资产管理合同》及本协议有关规定时，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，管理人应依照法律法规的规定报告中国证监会。

（三）托管人应积极配合管理人的核查行为，包括但不限于：提交相关资料以供管理人核查托管财产的完整性和真实性，在规定时间内答复管理人并改正。

五、集合计划财产的保管

（一）集合计划财产保管的原则

1、集合计划财产应独立于管理人、托管人的固有财产。

2、托管人应安全保管集合计划财产，未经管理人的合法合规指令或法律法规、《资产管理合同》及本协议另有规定，不得自行运用、处分、分配集合计划的任何财产。

3、托管人按照规定开设集合计划财产的资金账户、证券账户等投资所需账户。

4、托管人对所托管的不同集合计划财产分别设置账户，确保集合计划财产的完整与独立。

5、除依据《基金法》、《运作办法》、《资产管理合同》及其他有关法律法规规定外，托管人不得委托第三人托管集合计划财产。

（二）集合计划的银行账户的开设和管理

1、托管人应负责本集合计划的银行账户的开设和管理。

2、托管人以本集合计划的名义开设本集合计划的银行账户。本集合计划的银行预留印鉴由托管人保管和使用。本集合计划的一切货币收支活动，包括但不限于投资、支付赎回金额、支付集合计划收益、收取申购款，均需通过本集合计划的银行账户进行。

3、本集合计划银行账户的开立和使用，限于满足开展本集合计划业务的需要。托管人和管理人不得假借本集合计划的名义开立其他任何银行账户；亦不得使用本集合计划的银行账户进行本集合计划业务以外的活动。

4、集合计划银行账户的管理应符合法律法规的有关规定。

（三）集合计划进行定期存款投资的账户开设和管理

管理人以集合计划名义在托管人认可的存款银行的指定营业网点开立存款账户,托管人负责该账户银行预留印鉴的保管和使用。在上述账户开立和账户相关信息变更过程中,管理人应提前向托管人提供开户或账户变更所需的相关资料。

(四) 集合计划证券账户、结算备付金账户及其他投资账户的开设和管理

1、托管人应当代表本集合计划,以托管人和本集合计划联名的方式在中国证券登记结算有限责任公司开设证券账户。

2、本集合计划证券账户的开立和使用,限于满足开展本集合计划业务的需要。托管人和管理人不得出借或转让本集合计划的证券账户,亦不得使用本集合计划的证券账户进行本集合计划业务以外的活动。

3、托管人以自身法人名义在中国证券登记结算有限责任公司开立结算备付金账户,用于办理托管人所托管的包括本集合计划在内的全部集合计划在证券交易所进行证券投资所涉及的资金结算业务。结算备付金的收取按照中国证券登记结算有限责任公司的规定执行。

4、本集合计划的期货相关账户,由托管人负责开立或协助管理人开立,用于本集合计划的期货交易。管理人、托管人可与期货经纪商等机构签署必要协议,约定期货相关账户的开立、管理等事项。

5、在本托管协议生效日之后,本集合计划被允许从事其他投资品种的投资业务的,涉及相关账户的开设、使用的,若无相关规定,则托管人应当比照并遵守上述关于账户开设、使用的规定。

(五) 债券托管专户的开设和管理

《资产管理合同》生效后,管理人负责以集合计划的名义申请并取得进入全国银行间同业拆借市场的交易资格,并代表集合计划进行交易;由管理人负责向中国人民银行报备,在上述手续办理完毕之后,托管人负责以集合计划的名义在中央国债登记结算有限责任公司和银行间市场清算所股份有限公司分别开设银行间债券市场债券托管账户,并代表集合计划进行银行间债券市场债券和资金的清算。

(六) 集合计划财产投资的有关有价凭证的保管

集合计划财产投资的实物证券、银行定期存款存单等有价凭证由托管人负责妥善保管。托管人对其以外机构实际有效控制的有价凭证不承担保管责任。

(七) 与集合计划财产有关的重大合同及有关凭证的保管

托管人按照法律法规保管由管理人代表集合计划签署的与集合计划有关的重大合同及有关凭证。管理人代表集合计划签署有关重大合同后应在收到合同正本后 30 日内将一份正本的原件提交给托管人。除本协议另有规定外，管理人在代表集合计划签署与集合计划有关的重大合同时应保证集合计划一方持有两份以上的正本，以便管理人和托管人至少各持有一份正本的原件。对于无法取得两份以上的正本的，管理人应向托管人提供加盖公章的合同复印件，未经双方协商或未在合同约定范围内，合同原件不得转移。重大合同由管理人与托管人按规定各自保管不低于法律法规规定的最低期限。

六、指令的发送、确认及执行

管理人发送的指令包括电子指令和纸质指令。

电子指令包括管理人发送的电子指令（采用深证通金融数据交换平台发送的电子指令、采用 SWIFT 电子报文发送的电子指令、通过中国银行托管网银发送的电子指令）、自动产生的电子指令（托管人的全球托管系统根据管理人的授权通过预先设定的业务规则自动产生的电子指令）。电子指令一经发出即被视为合法有效指令，传真纸质指令作为应急方式备用。管理人通过深证通金融数据交换平台发送的电子指令，托管人根据 USER ID 和 APP ID 唯一识别管理人身份，管理人应妥善保管 USER ID 和 APP ID，托管人身份识别后对于执行该电子指令造成的任何损失托管人不承担责任，但托管人有过错的除外。

（一）管理人对发送指令人员的书面授权

1、管理人应当事先向托管人发出书面通知（以下称“授权通知”），载明管理人有权发送指令的人员名单（以下称“指令发送人员”）及各个人员的权限范围。管理人应向托管人提供指令发送人员的人名印鉴的预留印鉴样本和签字样本。

2、管理人向托管人发出的授权通知应加盖公章并由法定代表人或其授权签字人签署，若由授权签字人签署，还应附上法定代表人的授权书。管理人向托管人以传真的形式发送授权通知后同时电话通知托管人。授权通知自托管人电话确认后于通知载明的生效时间起生效。通知载明的生效时间不得早于电话确认时间。管理人在此后 3 个工作日内将授权通知原件送交托管人。

3、管理人和托管人对授权通知及其更改负有保密义务，其内容不得向指令发送人员及相关操作人员以外的任何人披露、泄露。

（二）指令的内容

指令是管理人在运作集合计划财产时，向托管人发出的资金划拨及投资指令。相关登记结算公司向托管人发送的结算通知视为管理人向托管人发出的指令。

（三）指令的发送、确认和执行

1、指令由“授权通知”确定的指令发送人员代表管理人用传真的方式或其他双方确认的方式向托管人发送。对于指令发送人员发出的指令，管理人不得否认其效力。但如果管理人已经撤销或更改对指令发送人员的授权，并且托管人已收到该通知，则对于此后该指令发送人员无权发送的指令，或超权限发送的指令，管理人不承担责任。

2、管理人应按照《基金法》、《运作办法》、《资产管理合同》和有关法律法规的规定，在其合法的经营权限和交易权限内，并依据相关业务规则发送指令。指令发出后，管理人应及时电话通知托管人。

3、托管人在接受指令时，应对指令的要素是否齐全、印鉴是否与授权通知相符等进行表面真实性的检查，对合法合规的指令，托管人应在规定期限内执行，不得有不合理延误。

4、管理人应在交易结束后将银行间同业市场债券交易成交单经有权人员签字并加盖公章后及时传真给托管人。

5、管理人在发送指令时，应为托管人执行指令留出执行指令时所必需的时间。因管理人原因导致指令传输不及时未能留出足够的执行时间，致使指令未能及时执行所造成的损失由管理人承担。

（四）管理人发送错误指令的情形和处理程序

管理人发送错误指令的情形主要包括：指令要素错误、无投资行为的指令、预留印鉴错误等情形。

托管人发现管理人的指令错误时，有权拒绝执行，并及时通知管理人改正。对管理人更正并重发送后的指令经托管人核新对确认后方能执行。

（五）托管人依照法律法规暂缓、拒绝执行指令的情形和处理程序

托管人发现管理人的指令违反法律法规规定或者《资产管理合同》约定，应当不予执行，并及时通知管理人要求其变更或撤销相关指令，若管理人在托管人发出上述通知后仍未变更或撤销相关指令，托管人应当拒绝执行，并向中国证监会报告。

管理人向托管人下达指令时，应确保集合计划的银行存款账户有足够的资金余额，确保集合计划的证券账户有足够的证券余额。对超头寸的指令，以及超过证券账户证券余额的指

令，托管人可不予执行，但应及时通知管理人，由此造成的直接损失，由管理人承担。

（六）托管人未按照管理人指令执行的处理方法

托管人因未正确执行管理人合法合规的指令，致使本集合计划的利益受到损害，托管人应承担相应的责任。除此之外，托管人对执行管理人的合法合规指令对集合计划造成的损失不承担任何责任。

（七）被授权人员及授权权限的变更

管理人若对授权通知的内容进行修改（包括但不限于指令发送人员的名单的修改，及/或权限的修改），应当至少提前 1 个工作日通知托管人；修改授权通知的文件应由管理人加盖公章并由法定代表人或其授权签字人签署，若由授权签字人签署，还应附上法定代表人的授权书。管理人对授权通知的修改应当以传真的形式发送给托管人，同时电话通知托管人。管理人对授权通知的内容的修改自托管人电话确认后于通知载明的生效时间起生效。通知载明的生效时间不得早于电话确认时间。管理人在此后 3 个工作日内将对授权通知修改的文件原件送交托管人。

七、交易及清算交收安排

（一）管理人负责选择代理本集合计划证券、期货买卖的证券、期货经营机构。

1、选择代理证券买卖的证券经营机构的程序

管理人根据相关标准进行考察后确定证券经营机构的选择。管理人与被选择的证券经营机构签订委托协议（或交易单元租用协议），并按照法律法规的规定向中国证监会报告。管理人应将委托协议（或交易单元租用协议）的原件及时送交托管人。

2、相关信息的通知

管理人应及时以书面形式通知托管人集合计划专用交易单元的号码、券商名称、佣金费率等集合计划基本信息以及变更情况，其中交易单元租用应至少在首次进行交易的 10 个工作日前通知托管人，交易单元退租应在次日内通知托管人。

3、管理人负责选择代理本集合计划期货交易的期货经纪机构，并与其签订期货经纪合同，其他事宜根据法律法规、《资产管理合同》的相关规定执行，若无明确规定的，可参照有关证券经营机构选择的规则进行。本集合计划在投资期货产品前，管理人、期货经纪机构应与托管人签订相关协议或操作备忘录。

（二）集合计划清算交收

1、因本集合计划投资于证券发生的所有场内、场外交易的清算交收，由托管人负责根据相关登记结算公司的结算规则办理。

2、由于管理人或托管人原因导致集合计划资金透支、超买或超卖等情形的，由责任方承担相应的责任。管理人同意在发生以上情形时，托管人应按照中国证券登记结算有限责任公司的有关规定办理。

3、由于管理人或托管人原因导致集合计划无法按时支付清算款时，责任方应对由此给集合计划财产造成的损失承担相应的赔偿责任。

4、管理人应保证在交收日（T+1 日）10:00 前集合计划银行账户有足够的资金用于交易所的证券交易资金清算，如集合计划的资金头寸不足则托管人应按照中国证券登记结算有限责任公司的有关规定办理。

5、管理人应保证托管人在执行管理人发送的划款指令时，集合计划银行账户或资金交收账户上有充足的资金。集合计划的资金头寸不足时，托管人有权拒绝管理人发送的划款指令，因管理人原因导致资金头寸不足造成的损失，由管理人负责赔偿。管理人在发送划款指令时应充分考虑托管人的划款处理时间。对于要求当天到账的指令，应在当天 15:00 前发送；对于要求当天某一时点到账，则指令需提前 2 个工作小时发送，并相关付款条件已经具备。对于新股申购网下公开发行业务，管理人应在网下申购缴款日（T 日）的前一工作日下班前将新股申购指令发送给托管人，指令发送时间最迟不应晚于 T 日上午 10:00 时。

对于中国证券登记结算有限责任公司实行T+0非担保交收的业务，管理人应在交易日14:00前将划款指令发送至托管人。

因管理人指令传输不及时，致使资金未能及时划入中国证券登记结算有限责任公司所造成的损失由管理人承担，包括赔偿在深圳市场引起其他托管客户交易失败、赔偿因占用中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司最低备付金带来的利息损失。在集合计划资金头寸充足的情况下，托管人对管理人符合法律法规、《资产管理合同》、本协议的指令不得不合理拖延或拒绝执行。

（三）资金、证券账目和交易记录核对

管理人和托管人应对本集合计划的资金、证券账目及交易记录进行核对。

（四）申购、赎回和集合计划转换的资金清算

1、T 日，投资者进行集合计划申购、赎回和转换申请，管理人和托管人分别计算集合计划资产净值，并进行核对；管理人将双方盖章确认的或管理人决定采用的集合计划份额净值以集合计划份额净值公告的形式传真至相关信息披露媒介。

2、T+1 日，登记机构根据 T 日集合计划份额净值计算申购份额、赎回金额及转换份额，更新集合计划份额持有人数据库；并将确认的申购、赎回及转换数据向托管人、管理人传送。管理人、托管人根据确认数据进行账务处理。

3、集合计划托管账户与“集合计划清算账户”间实行申购资金于 T+2 进行交收，赎回资金于 T+7 内进行交收。

4、集合计划托管账户与“集合计划清算账户”间的资金清算遵循“净额清算、净额交收”的原则，即按照托管账户当日应收资金（包括申购资金及集合计划转换转入款）与托管账户应付额（含赎回资金、赎回费、集合计划转换转出款及转换费）的差额来确定托管账户净应收额或净应付额，以此确定资金交收额。当存在托管账户净应收额时，管理人负责将托管账户净应收额在交收日 16:00 前从“集合计划清算账户”划到集合计划托管账户；当存在托管账户净应付额时，托管人按管理人的划款指令将托管账户净应付额在交收日 16:00 前划到“集合计划清算账户”。

5、管理人未能按上款约定将托管账户净应收额全额、及时汇至集合计划托管账户，由此产生的责任应由该管理人承担(不可抗力或管理人无过错的情况除外)；托管人未能按上款约定将托管账户净应付额全额、及时汇至“集合计划清算账户”，由此产生的责任应由托管人承担(不可抗力或托管人无过错的情况除外)。

6、管理人应将每个开放日的申购、赎回、转换开放式集合计划的数据传送给托管人。管理人应对传递的申购、赎回、转换开放式集合计划的数据真实性负责。托管人应及时查收申购资金的到账情况并根据管理人指令及时划付赎回款项。

八、集合计划资产净值计算和会计核算

（一）集合计划资产净值的计算和复核

1、集合计划资产净值是指集合计划资产总值减去负债后的价值。某一类别集合计划份额净值是指计算日某一类别集合计划资产净值除以当日该类集合计划份额的余额数量计算，精确到 0.0001 元，小数点后第 5 位四舍五入。管理人可以设立大额赎回情形下的净值精度应急调整机制。国家另有规定的，从其规定。

2、管理人应每个工作日对集合计划资产估值。估值原则应符合《资产管理合同》、《证券投资基金会计核算业务指引》及其他法律法规的规定。集合计划净值信息由管理人负责计算，托管人复核。管理人应于每个开放日交易结束后计算当日的集合计划资产净值和各类集合计划份额净值，并在盖章后以双方约定的方式发送给托管人。托管人应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，由管理人按规定对外公布。月末、年中和年末估值复核与集合计划会计账目的核对同时进行。

3、当相关法律法规或《资产管理合同》规定的估值方法不能客观反映集合计划财产公允价值时，管理人可根据具体情况，并与托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

4、管理人、托管人发现集合计划估值违反《资产管理合同》订明的估值方法、程序以及相关法律法规的规定或者未能充分维护集合计划份额持有人利益时，双方应及时进行协商和纠正。

5、当任一类集合计划份额净值小数点后4位以内(含第4位)发生估值错误时，视为该类集合计划份额净值错误。集合计划份额净值计算出现错误时，管理人应当立即予以纠正，通报托管人，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；错误偏差达到或超过集合计划份额净值的0.25%时，管理人应当通报托管人并报中国证监会备案；错误偏差达到或超过集合计划份额净值的0.5%时，管理人应当公告，并报中国证监会备案。如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。

6、由于管理人对外公布的任何集合计划净值数据错误，导致该集合计划财产或集合计划份额持有人的实际损失，管理人应对此承担责任。若托管人计算的净值数据正确，则托管人对该损失不承担责任；若托管人计算的净值数据也不正确，则托管人也应承担部分未正确履行复核义务的责任。如果上述错误造成了集合计划财产或集合计划份额持有人的不当得利，且管理人及托管人已各自承担了赔偿责任，则管理人应负责向不当得利之主体主张返还不当得利。如果返还金额不足以弥补管理人和托管人已承担的赔偿金额，则双方按照各自赔偿金额的比例对返还金额进行分配。

7、由于不可抗力原因，或由于证券、期货交易所、期货公司及登记结算公司发送的数据错误等，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集合计划资产估值错误，管理人、托管人免除赔偿责任。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。

8、如果托管人的复核结果与管理人的计算结果存在差异，且双方经协商未能达成一致，管理人可以按照其对集合计划份额净值的计算结果对外予以公布，托管人可以将相关情况报中国证监会备案。

（二）集合计划会计核算

1、集合计划账册的建立

管理人和托管人在《资产管理合同》生效后，应按照双方约定的同一记账方法和会计处理原则，分别独立地设置、登记和保管集合计划的全套账册，对双方各自的账册定期进行核对，互相监督，以保证集合计划财产的安全。若双方对会计处理方法存在分歧，应以管理人的处理方法为准。

2、会计数据和财务指标的核对

管理人和托管人应定期就会计数据和财务指标进行核对。如发现存在不符，双方应及时查明原因并纠正。

3、集合计划财务报表和定期报告的编制和复核

集合计划财务报表由管理人和托管人每月分别独立编制。月度报表的编制，应于每月终了后 5 个工作日内完成；《资产管理合同》生效后，招募说明书的信息发生重大变更的，管理人应当在三个工作日内，更新招募说明书并登载在规定网站上。招募说明书其他信息发生变更的，管理人至少每年更新一次；产品资料概要的信息发生重大变更的，管理人应当在三个工作日内，更新产品资料概要，并登载在规定网站及销售机构网站或营业网点。产品资料概要其他信息发生变更的，管理人至少每年更新一次。集合计划终止运作的，管理人不再更新招募说明书和产品资料概要。管理人应当在每年结束之日起三个月内，编制完成集合计划年度报告，将年度报告登载在规定网站上，并将年度报告提示性公告登载在规定报刊上。管理人应当在上半年结束之日起两个月内，编制完成集合计划中期报告，将中期报告登载在规定网站上，并将中期报告提示性公告登载在规定报刊上。管理人应当在季度结束之日起 15 个工作日内，编制完成集合计划季度报告，将季度报告登载在规定网站上，并将季度报告提示性公告登载在规定报刊上。

管理人应及时完成报表编制，将有关报表提供给托管人复核，托管人在收到后应及时进行复核，并将复核结果书面通知管理人；管理人应留足充分的时间，便于托管人复核相关报表及报告。

托管人在复核过程中，发现双方的报表存在不符时，管理人和托管人应共同查明原因，进行调整，调整以双方认可的账务处理方式为准；若双方无法达成一致以管理人的账务处理为准。核对无误后，托管人在管理人提供的报告上加盖托管业务部门公章或者出具加盖托管业务部门公章的复核意见书或进行电子确认，双方各自留存一份。如果管理人与托管人不能于应当发布公告之日之前就相关报表达成一致，管理人有权按照其编制的报表对外

发布公告，托管人有权就相关情况报中国证监会备案。

九、集合计划收益分配

（一）集合计划收益分配的依据

1、集合计划收益分配是指将该集合计划期末可供分配利润根据持有该集合计划份额的数量按比例向该集合计划份额持有人进行分配。期末可供分配利润采用期末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。

2、收益分配应该符合《资产管理合同》关于收益分配原则的规定。

（二）集合计划收益分配的时间和程序

1、集合计划收益分配方案由管理人根据《资产管理合同》的相关规定制定。

2、管理人应于收益分配日之前将其制定的收益分配方案提交托管人复核，托管人应于收到收益分配方案后完成对收益分配方案的复核，复核通过后管理人应当在 2 日内在规定媒介公告；如果管理人与托管人不能于收益分配日之前就收益分配方案达成一致，托管人有义务将收益分配方案及相关情况的说明提交中国证监会备案并书面通知管理人，在上述文件提交完毕之日起管理人有权对外公告其拟订的收益分配方案，且托管人有义务协助管理人实施该收益分配方案，但有证据证明该方案违反法律法规及《资产管理合同》的除外。

3、本集合计划收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的集合计划份额进行再投资；若投资者不选择，本集合计划默认的收益分配方式是现金分红。

4、托管人根据管理人的收益分配方案和提供的现金红利金额的数据，在红利发放日将分红资金划入管理人指定账户。如果投资者选择转购集合计划份额，管理人和托管人则应当进行红利再投资的账务处理。

十、集合计划信息披露

（一）保密义务

管理人和托管人除为履行法律法规、《资产管理合同》及本协议规定的义务所必要之外，

不得为其他目的使用、利用其所知悉的集合计划的信息，并且应当将集合计划的信息限制在为履行前述义务而需要了解该信息的职员范围之内。但是，如下情况不应视为管理人或托管人违反保密义务：

1、非因管理人和托管人的原因导致保密信息被披露、泄露或公开；

2、管理人和托管人为遵守和服从法院判决、仲裁裁决或中国证监会等监管机构的命令、决定所做出的信息披露或公开。

（二）管理人和托管人在信息披露中的职责和信息披露程序

1、管理人和托管人应根据相关法律法规、《资产管理合同》的规定各自承担相应的信息披露职责。管理人和托管人负有积极配合、互相督促、彼此监督，保证其履行按照法定方式和时限披露的义务。

2、本集合计划信息披露的所有文件，包括《资产管理合同》和本协议规定的定期报告、临时报告、集合计划净值信息及其他必要的公告文件，由管理人和托管人按照有关法律法规的规定予以公布。

3、集合计划年度报告中的财务会计报告应当经过符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所审计。

4、本集合计划的信息披露，应通过中国证监会规定媒介进行；管理人、托管人可以根据需要在其他公共媒介披露信息，但是其他公共媒介不得早于规定媒介披露信息，并且在不同媒介上披露同一信息的内容应当一致。

5、信息文本的存放与备查

依法必须披露的信息发布后，管理人、托管人应当按照相关法律法规规定将信息置备于各自住所，供社会公众查阅、复制。管理人和托管人应保证文本的内容与所公告的内容完全一致。

6、对于因不可抗力等原因导致集合计划信息的暂停或延迟披露的（如暂停披露集合计划净值信息），管理人应及时向中国证监会报告，并与托管人协商采取补救措施。不可抗力等情形消失后，管理人和托管人应及时恢复办理信息披露。

（三）托管人报告

托管人应按《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》和其他有关法律法规的规定于每个上半年度结束后两个月内、每个会计年度结束后三个月内在集合计划中期报告及年度报告

中分别出具托管人报告。

十一、集合计划费用

（一）管理人的管理费

本集合计划管理费按前一日集合计划资产净值的 0.4%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E\times 0.4\%\div \text{当年天数}$$

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，逐日累计至每月月末，按月支付，由管理人向托管人发送集合计划管理费划付指令，经托管人复核后于次月前5个工作日内从集合计划财产中一次性支付给管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

（二）托管人的托管费

本集合计划托管费按前一日集合计划资产净值的0.1%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E\times 0.1\%\div \text{当年天数}$$

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，逐日累计至每月月末，按月支付，由管理人向托管人发送集合计划托管费划付指令，经托管人复核后于次月前5个工作日内从集合计划财产中一次性支付给托管人。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

（三）销售服务费

本集合计划A类计划份额不收取销售服务费，C类计划份额的销售服务费年费率为0.2%。

销售服务费按前一日C类计划份额资产净值的0.2%年费率计提。销售服务费的计算方法如下：

$$H=E\times 0.2\%\div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的C类计划份额销售服务费

E为前一日的C类计划份额的资产净值

销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由管理人向托管人发送集合计划销售服务费划付指令，经托管人复核后于次月前5个工作日内从集合计划财产中划出。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

（四）从集合计划财产中列支管理人的管理费、托管人的托管费、C类计划份额的销售服务费之外的其他集合计划费用，应当依据有关法律法规、《资产管理合同》的规定执行。

（五）对于违反法律法规、《资产管理合同》、本协议及其他有关规定（包括集合计划费用的计提方法、计提标准、支付方式等）的集合计划费用，不得从任何集合计划财产中列支。

（六）本集合计划支付给管理人、托管人的各项费用均为含税价格，具体税率适用中国税务机关的相关规定。

十二、集合计划份额持有人名册的保管

集合计划份额持有人名册至少应包括集合计划份额持有人的名称和持有的集合计划份额。集合计划份额持有人名册由集合计划登记机构根据管理人的指令编制和保管，管理人和托管人应分别保管集合计划份额持有人名册，集合计划登记机构对其保存期限自集合计划账户销户之日起不少于20年，法律法规另有规定或有权机关另有要求的除外。如不能妥善保管，则按相关法规承担责任。

在托管人要求或编制中期报告和年度报告前，管理人应将有关资料送交托管人，不得无故拒绝或延误提供，并保证其真实性、准确性和完整性。托管人不得将所保管的集合计划份额持有人名册用于集合计划托管业务以外的其他用途，并应遵守保密义务。

十三、集合计划有关文件档案的保存

（一）管理人应保存集合计划财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料，托管人应保存集合计划托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料，保存期限不低于法律法规规定的最低期限。

（二）管理人和托管人应按本协议第十条的约定对各自保存的文件和档案履行保密义务。

十四、托管人和管理人的更换

（一）管理人职责终止后，仍应妥善保管集合计划管理业务资料，并与新任管理人或临时管理人及时办理集合计划管理业务的移交手续。托管人应给予积极配合，并与新任管理人或临时管理人核对集合计划资产总值和净值。

（二）托管人职责终止后，仍应妥善保管集合计划财产和集合计划托管业务资料，并与新任托管人或临时托管人及时办理集合计划财产和集合计划托管业务的移交手续。管理人应给予积极配合，并与新任托管人或临时托管人核对集合计划资产总值和净值。

（三）其他事宜见《资产管理合同》的相关约定。

十五、禁止行为

（一）《基金法》第二十条、第三十八条禁止的行为。

（二）《基金法》第七十三条禁止的投资或活动。

（三）除根据管理人的指令或《资产管理合同》、本协议另有规定外，托管人不得动用或处分集合计划财产。

（四）管理人、托管人的高级管理人员和其他从业人员不得相互兼职。

（五）法律法规、《资产管理合同》和本协议禁止的其他行为。

法律法规或监管部门调整上述限制的，本集合计划从其规定。

十六、托管协议的变更、终止与集合计划财产的清算

（一）托管协议的变更

本协议双方当事人经协商一致，可以对协议进行变更。变更后的新协议，其内容不得与《资产管理合同》的规定有任何冲突。变更后的新协议应当报中国证监会备案。

（二）托管协议的终止

发生以下情况，本托管协议应当终止：

- 1、《资产管理合同》终止；
- 2、本集合计划更换托管人；
- 3、本集合计划更换管理人；
- 4、发生《基金法》、《运作办法》或其他法律法规规定的终止事项。

（三）集合计划财产的清算

管理人和托管人应按照《资产管理合同》及有关法律法规的规定对本集合计划的财产进行清算。

十七、违约责任和责任划分

（一）本协议当事人不履行本协议或履行本协议不符合约定的，应当承担违约责任。

（二）因本协议当事人违约给集合计划财产或者集合计划份额持有人造成损害的，应当分别对各自的行为依法承担赔偿责任，因共同行为给集合计划财产或者集合计划份额持有人造成损害的，应当承担连带赔偿责任。对损失的赔偿，仅限于直接损失。但是发生下列情况，当事人免责：

1、管理人及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；

2、管理人由于按照《资产管理合同》规定的投资原则而行使或不行使其投资权而造成的损失等；

3、不可抗力；

4、托管人对存放或存管在托管人以外机构的集合计划资产，或交由证券公司等其他机构负责清算交收的集合计划资产及其收益不承担任何责任；

5、计算机系统故障、网络故障、通讯故障、电力故障、计算机病毒攻击及其它非管理人、托管人过错造成的意外事故。

（三）一方当事人违反本协议，给另一方当事人造成损失的，应承担赔偿责任。

（四）因不可抗力不能履行本协议的，根据不可抗力的影响，违约方部分或全部免除责任，但法律另有规定的除外。当事人迟延履行后发生不可抗力的，不能免除责任。

（五）当事人一方违约，另一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。

（六）违约行为虽已发生，但本协议能够继续履行的，在最大限度地保护集合计划份额持有人利益的前提下，管理人和托管人应当继续履行本协议。

（七）为明确责任，在不影响本协议本条其他规定的普遍适用性的前提下，管理人和托管人对由于如下行为造成的损失的责任承担问题，明确如下：

- 1、由于下达违法、违规的指令所导致的责任，由管理人承担；
- 2、指令下达人员在授权通知载明的权限范围内下达的指令所导致的责任，由管理人承担，即使该人员下达指令并没有获得管理人的实际授权（例如管理人在撤销或变更授权权限后未能及时通知托管人）；
- 3、托管人未对指令上签名和印鉴与预留签字样本和预留印鉴进行表面真实性审核，导致托管人执行了应当无效的指令，管理人与托管人应根据各自过错程度承担责任；
- 4、属于托管人实际有效控制下的集合计划财产（包括实物证券）在托管人保管期间的损坏、灭失，由此产生的责任应由该托管人承担；
- 5、管理人应承担对其应收取的管理费数额计算错误的责任。如果托管人复核后同意管理人的计算结果，则托管人也应承担未正确履行复核义务的相应责任；
- 6、管理人应承担对托管人应收取的托管费数额计算错误的责任。如果托管人复核后同意管理人的计算结果，则托管人也应承担未正确履行复核义务的相应责任；
- 7、由于管理人或托管人原因导致本集合计划不能依据中国证券登记结算有限责任公司的业务规则及时清算的，由责任方承担由此给集合计划财产、集合计划份额持有人及受损害方造成的直接损失，若由于双方原因导致本集合计划不能依据中国证券登记结算有限责任公司的业务规则及时清算的，双方应按照各自的过错程度对造成的直接损失合理分担责任；
- 8、在资金交收日，集合计划资金账户资金首先用于除新股申购以外的其他资金交收义务，交收完成后资金余额方可用于新股申购。如果因此资金不足造成新股申购失败或者新股申购不足，托管人不承担任何责任。如集合计划份额持有人因此提出赔偿要求，相关法律责任和损失由管理人承担。

十八、适用法律与争议解决方式

（一）本协议适用中华人民共和国法律（为本协议之目的，不包括香港特别行政区、澳门特别行政区和台湾地区法律）并从其解释。

（二）因履行本协议发生的争议，由双方协商解决，协商不成的，任何一方均有权将争议提交管理人所在地有管辖权法院进行诉讼解决。

争议处理期间，双方当事人应恪守各自的职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行资产管理合同和本协议规定的义务，维护集合计划份额持有人的合法权益。

（三）除争议所涉的内容之外，本协议的当事人仍应履行本协议的其他规定。

十九、托管协议的效力

（一）集合计划托管协议草案应经托管协议双方当事人的法定代表人或授权签字人签字并加盖公章，协议当事人双方根据中国证监会的意见修改托管协议草案。托管协议以中国证监会批准的文本为正式文本。

（二）本协议自资产管理合同生效之日起生效。本协议的有效期自其生效之日起至集合计划财产清算结果报中国证监会备案并公告之日止。

（三）本协议自生效之日起对双方当事人具有同等的法律约束力。

（四）本协议正本一式陆份，管理人及托管人各执贰份，其余报有关监管机构或管理人留存备查，每份具有同等的法律效力。

二十、托管协议的签订

见签署页。

（以下无正文）

（本页为《国海证券安盈债券型集合资产管理计划托管协议（草案）》签署页，无正文）

托管人：中国银行股份有限公司

法定代表人或授权签字人（签字/章）：

签订日：

签订地：北京

管理人：国海证券股份有限公司

法定代表人或授权签字人（签字/章）：

签订日：2022 年 1 月 14 日

签订地：南宁