

广发金管家弘利债券集合资产管理计划合同变更公告

广发金管家弘利债券集合资产管理计划于 2012 年 8 月 9 日成立。为了持续服务广大投资者，并满足广大投资者的投资需求，根据《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》和中国证监会《关于准予广发金管家弘利债券集合资产管理计划合同变更的回函》

（机构部函[2022]1365 号）要求，以及《广发金管家弘利债券集合资产管理计划资产管理合同》（以下简称《管理合同》）、《广发金管家弘利债券集合资产管理计划说明书》（以下简称《说明书》）和《广发金管家弘利债券集合资产管理计划风险揭示书》（以下简称《风险揭示书》）的约定，广发证券资产管理（广东）有限公司（以下简称“管理人”）作为广发金管家弘利债券集合资产管理计划的管理人，经与托管人中国工商银行股份有限公司协商一致，管理人拟开展广发金管家弘利债券集合资产管理计划（以下简称“本产品”或“本集合计划”）的合同变更工作。

特别提示：

1、征询期安排：本次合同变更的征询期为 2023 年 3 月 6 日至 2023 年 3 月 17 日。为保障投资者权益，管理人设置 2023 年 3 月 6 日至 2023 年 3 月 17 日为临时开放期，仅办理退出业务，不办理申购参与业务。不同意合同变更的投资者可于 2023 年 3 月 6 日至 2023 年 3 月 17 日的交易时间内，通过本集合计划推广机构办理退出事宜。

2、本次变更的正式生效时间为 2023 年 3 月 20 日，因变更后运作方式发生变化，对于在征询期前已申请预约退出、且预约退出日在 2023 年 3 月 20 日之后的投资者份额，将取消预约退出申请，具体请以销售机构的通知为准。投资者可于征询期通过本集合计划推广机构办理退出事宜，或于变更生效后本集合计划的运作期到期日（首次办理赎回的时间为 2023 年 6 月 20 日）提出赎回申请。其中对于 2023 年 3 月 3 日新递交至管理人且预约退出日在 2023 年 3 月 20 日之后的预约退出申请，管理人取消申请后因系统数据传输因素，部分投资者于征询期第二日起（2023 年 3 月 7 日）方可办理退出。

3、本次合同变更后的产品风险等级未发生变化，为较低风险，其预期风险与预期收益水平低于股票型基金、股票型集合计划、混合型基金和混合型集合计划，高于货币市场基金。投资范围、投资比例、投资策略等投资相关条款有变化，敬请投资者仔细阅读本公告及变更后的法律文本。

4、本集合计划合同变更后，广发资管弘利 3 个月滚动持有债券型集合资产管理计划设置 A 类份额（代码：872031）和 C 类份额（代码：872032）。A 类份额将收取申购费（申购金额 $M < 100$ 万，0.3%； $100 \text{ 万} \leq M < 500$ 万，0.2%； $M \geq 500$ 万，1000 元/笔），C 类份额设置 0.25%/年的销售服务费；两类份额均不设置业绩报酬计提标准，管理人不计提业绩报酬；管理费由 0.6%/年调整为 0.3%/年，托管费率由 0.08%/年调整为 0.05%/年。

5、本集合计划此次变更生效，未退出的原投资者，其持有的份额将自动转为变更后广发资管弘利 3 个月滚动持有债券型集合资产管理计划 A 类份额（代码：872031），此次份额迁移不收取申购费。变更生效后本集合计划不再按照原份额 273 天的运作周期进行运作，统一以 3 个月为周期进行运作。变更生效后，投资者首次可申请办理赎回的日期为 2023 年 6 月 20 日（因端午节假期，赎回资金将顺延支付），之后每 3 个月为一个运作期，投资者可按照变更后的产品运作方式进行申赎。投资者按照每日集合计划 A 类/C 类份额净值进行申购和赎回，自行承担投资风险。

6、因系统变更和数据迁移的显示时滞，A 类份额（代码：872031）和原份额（代码：87642P）将于本集合计划变更生效后并存，约 3 个交易日后原份额（代码：87642P）将于系统界面下线。显示时滞对投资者并无实质不利影响。

7、本次合同变更征询期间，集合计划不收取业绩报酬和退出费用。

一、 主要变更的文件及内容

（一）《管理合同》的主要变更内容

涉及条款	变更前	变更后
产品名称	广发金管家弘利债券集合资产管理计划	广发资管弘利 3 个月滚动持有债券型集合资产管理计划
集合计划的类别	本集合计划为债券型产品	债券型集合资产管理计划

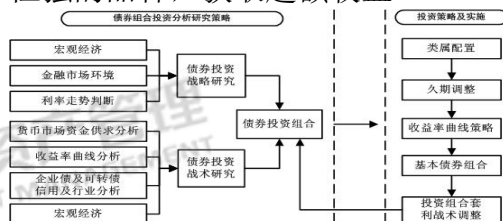
风险收益特征	本集合计划为债券型产品，资产整体的预期收益和风险均较低，其风险收益水平低于股票型产品、混合型产品，高于货币型产品。	本集合计划为债券型集合资产管理计划（大集合产品），其预期风险与预期收益水平低于股票型基金、股票型集合计划、混合型基金和混合型集合计划，高于货币市场基金。
管理期限	不设固定存续期。	本集合计划自本集合合同变更生效日起存续期不得超过 3 年。本集合计划自集合合同生效日起 3 年后，按照中国证监会有关规定执行。
份额类别设置	不分份额	本集合计划根据申购费用、销售服务费收取方式的不同，将集合计划份额分为不同的类别。 A 类份额：投资人申购时收取申购费，但不从本类别资产中计提销售服务费的，为 A 类份额； C 类份额：投资人申购时不收取申购费，而是从本类别资产中计提年费率为 0.25% 的销售服务费的，为 C 类份额； 本集合计划 A 类份额、C 类份额分别设置代码，分别计算并公布各类集合计划份额净值和集合计划份额累计净值。
投资范围	本计划主要投资于国内依法发行的固定收益类金融工具、证券回购、货币市场工具、权证、证券投资基金、资产支持证券（资产支持受益凭证）、权益收益互换、国债期货以及经中国证监会允许计划投资的其他金融工具。 本计划投资的固定收益类金融工具，包括国债、地方政府债、央行票据、金融债券、政策性金融债券、企业债券、公司债券、境外机构在中国发行的以人民币计价的债券、分离交易可转债、可转换债券（含可交换债券）、公开及定向债务融资工具（含短期融资券、超短期融资券、中期票据、PPN、ABN 等在银行间市场交易商协会注册发行的各类债务融资工具）、保证收益及保本浮动收益商业银行理财计	本集合计划的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括债券（国债、地方政府债、政府支持机构债、政府支持债券、央行票据、金融债券（含公开发行的次级债券）、政策性金融债券、企业债券、公司债券、可转换债券（含可分离交易可转债的纯债部分）、可交换债券、证券公司发行的短期公司债券、非金融企业债务融资工具（含短期融资券、超短期融资券、中期票据等在银行间市场交易商协会注册发行的各类债务融资工具））、在全国银行间债券交易市场或证券交易所交易的资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、通知存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、国债期货以

	划、银行存款、同业存单、现金等以及法律法规或中国证监会认可的其他固定收益类投资品种。 委托人同意并授权管理人可以投资于权益收益互换产品，同意并授权管理人代表集合资产管理计划签署《中国证券市场金融衍生品交易主协议》及其《补充协议》。 本集合计划不直接从二级市场买入股票、权证等权益类资产，但可以参与一级市场新股申购或增发新股，并可以持有因可转债转股所形成的股票、因投资可分离债券而产生的权证及其行权产生的股票等。因上述原因持有的股票和权证等资产，本集合计划应在其可交易之日起的 30 个交易日内卖出。	及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。 本集合计划不可以直接买入股票，但可持有因可转换债券或可交换债券转股所形成的股票和因所持股票进行股票配售及派发所形成的股票。因上述原因持有的股票等资产，本集合计划将在其可交易之日起的 20 个交易日内卖出。
投资比例	（1） 固定收益类资产：占计划资产的 0—100%；固定收益类资产包括国债、地方政府债、央行票据、金融债券、政策性金融债券、企业债券、公司债券、境外机构在中国发行的以人民币计价的债券、分离交易可转债、可转换债券（含可交换债券）、资产支持证券（资产支持受益凭证）、公开及定向债务融资工具（含短期融资券、超短期融资券、中期票据、PPN、ABN 等在银行间市场交易商协会注册发行的各类债务融资工具）、债券型基金、保本基金、分级基金的优先级份额、保证收益及保本浮动收益商业银行理财计划、债券逆回购等； （2） 现金类资产：占计划资产的 0—100%，且不低于计划资产净值的 5%；现金类资产包括现金、银行存款、货币市场基金、期限在 1 年内（含 1 年）的国债、期限在 1 年内（含 1 年）的央行票据、期限在 1 年内（含 1 年）的政府债券等； （3） 一级市场申购的股票及其所派发的权证、因可转换公司债券转股形成的股票以及因分离交易的可转换公司债券产生的权证等权益类	本集合计划投资于债券的比例不低于集合计划资产的 80%；投资于可转换债券（含可分离交易的可转债）及可交换债券的投资比例合计不超过集合计划资产的 20%；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，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于集合计划资产净值的 5%，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。 如法律法规或监管机构以后允许集合计划投资其他品种或对投资比例要求发生变更，管理人在履行适当程序后，可以相应调整本集合计划的投资范围和投资比例规定。

	资产：0%~20%，其中因所持股票所派发的权证以及因投资可分离交易债券而产生的权证不超过 3%，不从二级市场买入股票和权证； （4） 证券正回购：融入资金余额不超过计划资产净值的 40%； （5） 在任何交易日日终，持有的买入国债期货合约价值，不得超过计划集合资产净值的 15%；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%； （6） 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，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于计划资产净值的 5%。	
投资策略	通过宏观方面自上而下的分析及债券市场方面自下而上的判断，把握市场利率水平的运行态势，根据债券市场收益率曲线的整体运动方向进行久期选择。在微观方面，基于债券市场的状况，主要采用骑乘、信用及利差策略等投资策略。同时积极参与一级市场新股、债券申购，提高组合预期收益水平。 （1）资产配置策略 通过对宏观经济、市场利率、债券供求、情景分析等因素的前瞻性分析和定量指标跟踪，捕捉不同经济周期及周期更迭中的投资机会，确定固定收益类资产、现金及货币市场工具等大类资产的配置比例。 （2）投资固定收益证券投资策略 在债券组合构建方面，主要将根据对利率走势的预测、债券等级、债券的期限结构、风险结构、品种流动性的高低等因素，主要投资于以下债券： 1) 流动性较好、交投活跃的债券； 2) 有较高当期利息收入的债券； 3) 价格被低估的债券； 4) 收益率高于相应信用等级的债券； 5) 预期信用等级将得到改善、到	1、资产配置策略 通过对宏观经济、市场利率、债券供求、情景分析等因素的前瞻性分析和定量指标跟踪，捕捉不同经济周期及周期更迭中的投资机会，确定固定收益类资产、现金及货币市场工具等大类资产的配置比例。 2、固定收益类资产投资策略 本集合计划将在控制市场风险与流动性风险的前提下，根据对财政政策、货币政策的深入分析以及对宏观经济的持续跟踪，结合不同债券品种的到期收益率、流动性、市场规模等情况，灵活运用久期策略、期限结构配置策略、信用债策略、可转换债券策略等多种投资策略，实施积极主动的组合管理，并根据对债券收益率曲线形态、息差变化的预测，对债券组合进行动态调整。 （1）久期管理策略 本集合计划将基于对影响债券投资的宏观经济状况和货币政策等因素的分析判断，对未来市场的利率变化趋势进行预判，进而主动调整债券资产组合的久期，以达到提高债券组合收益、降低债券组合利率风险的目的。当预期

期收益率预期要下降的债券；

6) 可转换债券是介于股票和债券之间的投资品种，兼具股性和债性的双重特征。本集合计划利用宏观经济变化和上市公司的盈利变化，判断市场的变化趋势，选择不同的行业，再根据可转换债券的特性选择各行业不同的转债品种。本集合计划利用可转换债券的债券底价和到期收益率来判断转债的债性，增强本金投资的安全性；利用可转换债券溢价率来判断转债的股性，在市场出现投资机会时，优先选择股性强的品种，获取超额收益。



图：固定收益证券投资流程图

(3) 权益类品种投资策略

本集合计划可参与一级市场新股申购或增发新股等，包括在新股冻结期限内所发生的送股、配股、权证等权益投资。本集合计划不直接从二级市场买入股票或权证，但因可转债转股所形成的股票及股票派发，因分离交易可转债分离交易的权证等除外。本集合计划对股票等权益类证券的投资比例不超过集合资产的 20%。

我国现行的新股、可转债及可分离债的发行制度为机构投资者发挥资金优势和专业估值优势提供了机会。申购决策主要考虑一、二级市场溢价率，中签率和申购机会成本三个方面。可转债的定价关键是选取合适的定价模型和参数（主要分析波动率、正股价格等），在定价过程中充分考虑对应市场的平均估值水平和近期发行的可转债估值水平，以契合当期的投资环境。

(4) 国债期货投资策略

本集合计划投资国债期货以套期保

收益率曲线下移时，适当提高组合久期，以分享债券市场上涨的收益；当预期收益率曲线上移时，适当降低组合久期，以规避债券市场下跌的风险。

(2) 期限结构配置策略

在确定债券组合的久期之后，本集合计划将通过对收益率曲线的研究，分析和预测收益率曲线可能发生的形状变化。本集合计划除考虑系统性的利率风险对收益率曲线形状的影响外，还将考虑债券市场微观因素对收益率曲线的影响，如历史期限结构、新债发行、回购及市场拆借利率等，进而形成一定阶段内收益率曲线变化趋势的预期，适时采用跟踪收益率曲线的骑乘策略或者基于收益率曲线变化的子弹、杠铃及梯形策略构造组合，并进行动态调整。

3、信用债（含资产支持证券）投资策略

信用债的收益率是在基准收益率基础上加上反映信用风险收益的信用利差。基准收益率主要受宏观经济和政策环境的影响，信用利差的影响因素包括信用债市场整体的信用利差水平和债券发行主体自身的信用变化。基于这两方面的因素，本集合计划将分别采用以下的分析策略：

(1) 基于信用利差曲线策略

分析宏观经济周期、国家政策、信用债市场容量、市场结构、流动性、信用利差的历史统计区间等因素，进而判断当前信用债市场信用利差的合理性、相对投资价值 and 风险，以及信用利差曲线的未来趋势，确定信用债券的配置。

(2) 基于信用债信用分析策略

本集合计划将以内部信用评级为主、外部信用评级为辅，研究债

	值（包括多头套期保值及空头套期保值）为目的。通过对证券市场运行趋势的研究，并充分考虑期货合约的收益性、流动性及风险特征，选取流动性好、交易活跃的期货合约进行资产配置，以达到降低投资组合的交易成本、优化组合风险及流动性管理的目的。	券发行主体的基本面，以确定债券的违约风险和合理的信用利差水平，判断债券的投资价值。本集合计划将重点分析债券发行人所处行业的发展前景、市场竞争地位、财务质量（包括资产负债水平、资产变现能力、偿债能力、运营效率以及现金流质量）等要素，综合评价其信用等级，谨慎选择债券发行人基本面良好、债券条款优惠的信用类债券进行投资。 本集合计划投资信用债（包括资产支持证券，不包括可转换债券及可交换债券，下同）的信用评级应在 AA+级及以上。其中，投资于 AA+级债券的比例合计不超过信用债资产的 50%，投资于 AAA 级债券的比例合计不低于信用债资产的 50%。以上评级为债项评级，本集合计划投资的信用债若无债项评级，其信用评级依照评级机构出具的主体信用评级。短期融资券、超短期融资券等短期信用债的信用评级依照评级机构出具的主体信用评级。评级信息参照资信评级机构发布的最新评级结果。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。 4、证券公司短期公司债券投资策略 本集合计划证券公司短期公司债券的投资策略主要从分析证券行业整体情况、证券公司基本情况入手，包括整个证券行业的发展现状，发展趋势，具体证券公司的经营情况、资产负债情况、现金流情况，从而分析证券公司短期公司债券的违约风险及合理的利差水平，对证券公司短期公司债券进行独立、客观的价值评
--	---	---

		估。 5、回购策略 在有效控制风险情况下，通过合理质押组合中持仓的债券进行正回购，用融回的资金做加杠杆操作，提高组合收益。为提高资金使用效率，在适当时点和相关规定的范围内进行融券回购，以增加组合收益率。 6、国债期货投资策略 本集合计划对国债期货的投资以套期保值为主要目的。结合现货交易市场和期货市场的收益性、流动性等情况，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作，力争获取超额收益。 7、可转换债券（含可交换债券）投资策略 可转换债券（含可交换债券）兼具权益类证券与固定收益类证券的特性，具有抵御下行风险、分享股票价格上涨收益的特点。可转换债券（含可交换债券）的选择结合其债性和股性特征，在对公司基本面和转债条款深入研究的基础上进行估值分析，投资于公司基本面优良、具有较高安全边际和良好流动性的可转换债券（含可交换债券），获取稳健的投资回报。
投资限制和禁止行为	1、投资限制 为维护委托人的合法权益，本集合计划投资禁止从事下列行为： （1）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）将集合计划投资于一家公司发行的证券超过集合计划资产净值的10%； （4）将集合计划投资于一家公司发行的证券超过该证券发行总量的10%；	1、组合限制 集合计划的投资组合应遵循以下限制： （1）本集合计划投资于债券的投资比例不低于集合计划资产的80%；投资于可转换债券（含可分离交易的转债）及可交换债券的投资比例合计不超过集合计划资产的20%； （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，保持不低于集合计划资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。其中现金不包

	(5) 投资于管理人及与管理人有关联方关系的公司发行的证券的资金超过集合计划资产净值的 7%; (6) 管理人所管理的客户资产(含本集合计划资产)投资于一家公司发行的证券,按证券面值计算,超过该证券发行总量的 10%; (7) 集合计划参与新股,申报的金额超过集合计划的现金总额,或申报的数量超过拟发行股票公司本次发行股票的总量; (8) 法律、法规及有关规定和《集合资产管理合同》约定禁止从事的其他投资。 2、禁止行为 管理人从事集合资产管理业务,不得有下列行为: (1) 向客户作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; (2) 挪用集合计划资产; (3) 募集资金不入账或者其他任何形式的账外经营; (4) 募集资金超过计划说明书约定的规模; (5) 接受单一客户参与资金低于中国证监会规定的最低限额; (6) 使用集合计划资产进行不必要的交易; (7) 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; (8) 超出管理人经营范围从事集合资产管理业务; (9) 法律、行政法规及中国证监会禁止的其他行为。	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) 本管理人管理的全部基金及大集合产品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) 本管理人管理的全部基金及大集合产品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; (10) 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该集合计划资产净值的 15%;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流动性受限资产的投资; (11) 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本集合计划合同约定的投资范围保持一致;
--	---	---

	(12) 本集合计划参与国债期货交易，须遵守以下限制： 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%；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%；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）应当符合本集合合同关于债券投资比例的有关约定；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%； (13) 本集合计划管理人管理的全部开放式基金及大集合产品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%；本集合计划管理人管理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开放式基金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； (14) 本集合计划资产总值不超过集合计划资产净值的 140%； (15) 法律法规及中国证监会规定的和集合合同约定的其他投资限制。 除上述（2）、（10）、（11）情形之外，因证券市场波动、上市公司合并、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。 管理人应当自集合合同生效之日起 6 个月内使集合计划的投资组
--	---

	合比例符合集合合同的有关约定。在上述期间内，本集合计划的投资范围、投资策略应当符合集合合同的约定。托管人对集合计划的投资的监督与检查自本集合合同生效之日起开始。 法律法规或监管部门取消或调整上述限制，如适用于本集合计划，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或按调整后的规定执行。 2、禁止行为 为维护份额持有人的合法权益，集合计划财产不得用于下列投资或者活动： （1）承销证券； （2）违反规定向他人贷款或者提供担保； （3）从事承担无限责任的投资； （4）买卖其他集合资产管理计划份额或基金份额，但是中国证监会另有规定的除外； （5）向其管理人、托管人出资； （6）从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动； （7）法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。 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，并经过三分之二以上的独立董事通过。管理人董事会应至少每半年对关联
--	--

		交易事项进行审查。 法律、行政法规或监管部门取消或变更上述限制规定，如适用于本集合计划，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或以变更后的规定为准。
业绩比较基准		（新增） 本集合计划的业绩比较基准为：中债综合财富（1-3 年）指数收益率*85%+银行活期存款利率（税后）*15%。 本集合计划是债券型集合资产管理计划（大集合产品），设定 3 个月的滚动持有期，投资于债券资产的比例不低于集合计划资产的 80%，采用 85%作为业绩比较基准中债券投资所代表的权重，15%作为现金资产所对应的权重可以较好的反映本集合计划的风险收益特征。 中债综合财富（1-3 年）指数是由中央国债登记结算有限责任公司编制的中债综合指数细分指数之一，旨在反映中短期债券的整体价格和投资回报情况，能较好的反映本集合计划的投资策略，较为科学、合理的评价本集合计划的业绩表现。 如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，在对份额持有人无实质性不利影响的前提下，经与托管人协商一致，本集合计划可在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告，而无需召开份额持有人大会。
运作方式	本集合计划的每笔份额按每 273 天（自然日）为一个封闭运作周期，封闭运作周期内不办理退出业务，每笔份额运作周期结束当日可办理该笔份额的退出业务，遇节假日则顺延至下一个工作日。	契约型开放式 1、每个运作期到期日前，集合计划份额持有人不能提出赎回申请。 对于每份集合计划份额，第一个运作期指集合合同生效日（对集

	对于每笔开放期参与份额的第一个运作周期起始日，指开放日；对于上一运作周期结束日未退出的每笔份额的下一运作期起始日，指该份额上一运作周期起始日之后的 273 天（自然日）的对应日。注册登记在广发证券资产管理（广东）有限公司的份额的第一个运作周期起始日为 2017 年第一次合同变更生效后的首个特别开放期结束次日，特别开放期的具体时间由管理人在管理人网站上予以公告；注册登记在中国证券登记结算有限责任公司的份额的第一个运作周期起始日为 2017 年第一次合同变更生效日。 运作周期结束日为运作周期起始日之后的 273 天（自然日）的对应日，如果该日为节假日则顺延至下一个工作日。	合合同生效日登记在册的份额而言，下同）或集合计划份额申购确认日（对申购份额而言，下同）起（即第一个运作期起始日），至集合合同生效日或集合计划份额申购申请日 3 个月后的月度对日（即第一个运作期到期日。如该对应日为非工作日，或无对应日期，则顺延到下一工作日）止。第二个运作期指第一个运作期到期日的次一日起，至集合合同生效日或集合计划份额申购申请日 6 个月后的月度对日（如该日为非工作日，或无对应日期，则顺延至下一工作日）止。以此类推。 2、每个运作期到期日，集合计划份额持有人可提出赎回申请。每个运作期到期日，集合计划份额持有人可提出赎回申请。如果集合计划份额持有人在当期运作期到期日未申请赎回或赎回被确认失败，则自该运作期到期日下一日起该份额进入下一个运作期。
申购和赎回的开放日及时间	（1）参与的办理时间 每周三为本集合计划的开放日，如果周三为节假日，则顺延到下周周三。投资者在集合计划开放日可以办理参与本集合计划的业务，但份额退出业务仅在该笔份额运作周期结束当日办理。管理人可根据本集合计划运作的实际情况在不损害委托人利益的前提下增加特别开放日或更改上述规定，允许客户在特别开放日参与或退出；特别开放日和新规则需在开始实施前公告生效。具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间。但管理人根据法律法规、中国证监会的要求或本集合资产管理合同的规定公告暂停参与、退出时除外。若出现新的证券交易市场或交易所交易时间改变，管理人可视情况对	1、开放日及开放时间 投资人在开放日办理集合计划份额的申购，对于每份集合计划份额，仅可在该集合计划份额对应的每个运作期的到期日办理集合计划份额的赎回。具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间，但管理人根据法律法规、中国证监会的要求或本集合合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。集合合同生效后，若出现新的证券、期货交易市场、证券、期货交易所交易时间变更或其他特殊情况，管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整，但应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

	营业时间进行相应的调整，并报中国证监会或其派出机构备案。 (2) 退出的办理时间 本集合计划的每笔份额运作周期结束当日可办理该笔份额的退出业务，遇节假日则顺延至下一个工作日。	2、申购、赎回开始日及业务办理时间 管理人可根据实际情况依法决定本集合计划 A 类和 C 类份额开始办理申购的具体日期，具体业务办理时间在申购开始公告中规定。 对于每份集合计划份额，管理人仅在该份额的每个运作期到期日为份额持有人办理赎回。对于每份集合计划份额，第一个运作期指集合合同生效日（对集合合同生效日登记在册的份额而言，下同）或集合计划份额申购确认日（对申购份额而言，下同）起（即第一个运作期起始日），至集合合同生效日或集合计划份额申购申请日 3 个月后的月度对日（即第一个运作期到期日。如该对应日为非工作日，或无对应日期，则顺延到下一工作日）止。第二个运作期指第一个运作期到期日的次一日起，至集合合同生效日或集合计划份额申购申请日 6 个月后的月度对日（如该日为非工作日，或无对应日期，则顺延至下一工作日）止。以此类推。 在确定申购开始与赎回开始时间后，管理人应在申购、赎回开放日前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告申购与赎回的开始时间。 管理人不得在集合合同约定之外的日期或者时间办理份额的申购、赎回或者转换。投资人在集合合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请且登记机构确认接受的，其份额申购、赎回价格为下一开放日该类别份额申购、赎回的价格。
估值方法	(1) a. 上市流通的股票，以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，以最	1、证券交易所上市的有价证券的估值 (1) 交易所上市的有价证券（包

近交易日的市价（收盘价）估值； b. 在证券交易所市场流通的债券和权证，按如下估值方式处理： 交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种，选取估值日第三方估值机构提供的相应品种对应的估值净价估值。 交易所上市交易的可转换债券，以估值日收盘价减去可转换债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日可转换债券收盘价减去可转换债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。 c. 封闭式基金按照其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；场内交易的交易型指数基金ETF和上市型开放式基金LOF按照其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值，托管在场外的交易型指数基金ETF和上市型开放式基金LOF按照估值日前一交易日交易型指数基金ETF和上市型开放式基金LOF单位净值估值，估值日前一交易日基金单位净值未公布的，以前最近一个交易日基金份额净值计算，LOF、ETF在场内的，以估值日该证券收盘价估值，该日无交易的，以最近一日收盘价计算。 （2）未上市的股票按以下情况分别处理：配股和增发新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市价估值；首次公开发行的股票，按成本价估值。 （3）非公开发行股票估值方法如下：估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价低于非公开发行股票初始取得成本时，应采用在	括股票等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（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或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格； （2）交易所上市交易或挂牌转让的不含权固定收益品种，选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值； （3）交易所上市交易或挂牌转让的含权固定收益品种，选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价进行估值； （4）交易所上市交易的可转换债券及实行全价交易的可交换债券，以估值日收盘价减去收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日收盘价减去收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。交易所上市交易的实行净价交易的可交换债券，以估值日收盘价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日收盘价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格； （5）交易所上市不存在活跃市场的有价证券以及交易所上市的资
--	---

证券交易所上市交易的同一股票的市价作为估值日该非公开发行股票 的市价； 估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价高于非公开发行股票 的初始取得成本时，应按下列公式 确定估值日该非公开发行股票的价值： $FV = C + (P - C) \times \frac{D_l - D_r}{D_l}$ 其中：FV 为估值日该非公开发行股票 的价值；C为该非公开发行股票 的初始取得成本；P为估值日在证券交 易所上市交易的同一股票的市价； D_l 为该非公开发行股票锁定期所含 的交易天数；D_r 为估值日剩余锁定期，即估值日至锁定期结束所含的 交易天数（不含估值日当天）。 （4）配股权证，从配股除权日起到 配股确认日止，按收盘价高于配股 价的差额估值；如果收盘价低于配 股价，则估值增值额为零。 （5）银行间债券的估值采用中央国 债登记结算有限责任公司提供的中 债收益率曲线估值价格计算。 （6）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。 （7）开放式证券投资基金以估值日 前一日开放式基金单位净值估值。 货币市场基金按成本估值，每天按 前一开放日万份收益计提收益，估 值日无交易的，按最近交易日基金 单位净值估值。 （7）银行存款以成本列示，按商定 利率在实际持有期间内逐日计提利 息。 （8）国债期货合约，一般以估值当 日结算价进行估值，估值当日无结 算价的，且最近交易日后经济环境 未发生重大变化的，采用最近交易 日结算价估值。估值变动直接计入	产支持证券品种，选取估值日第 三方估值机构提供的相应品种对 应的估值净价估值。若第三方估 值机构无估值数据，则采用在当 前情况下适用，并且有足够可利用 数据和其他信息支持的估值技术 确定其公允价值； （6）对在交易所市场发行未上市 或未挂牌转让的债券，对存在活 跃市场的情况下，应以活跃市场 上未经调整的报价作为估值日的 公允价值；对于活跃市场报价未 能代表估值日公允价值的情况 下，应对市场报价进行调整以确 认估值日的公允价值；对于不存 在市场活动或市场活动很少的情 况下，则采用在当前情况下适 用，并且有足够可利用数据和其 他信息支持的估值技术确定其公 允价值。 2、处于未上市期间的有价证券应 区分如下情况处理： （1）送股、转增股、配股和公开 增发的新股，按估值日在证券交 易所挂牌的同一股票的估值方法 估值；该日无交易的，以最近一 日的市价（收盘价）估值； （2）首次公开发行未上市的股 票、债券，采用在当前情况下适 用，并且有足够可利用数据和其 他信息支持的估值技术确定其公 允价值； （3）在发行时明确一定期限限售 期的股票，包括但不限于非公开 发行股票、首次公开发行股票时 公司股东公开发售股份、通过大 宗交易取得的带限售期的股票 等，不包括停牌、新发行未上 市、回购交易中的质押券等流通 受限股票，按监管机构或行业协 会有关规定确定公允价值。 3、对全国银行间市场上不含权的 固定收益品种，按照第三方估值 机构提供的相应品种当日的估值
---	---

	当天的投资收益。 (9) 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。 如有新增事项或变更事项，按国家有关最新规定估值。管理人应于新规定实施后及时在管理人网站和/或推广网点通告委托人。 (10) 暂停估值的情形：集合计划投资所涉及的证券交易所遇法定节假日或因其它原因暂停营业时或因其它任何不可抗力致使集合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，集合管理人必须按规定完成估值工作。 保证收益及保本浮动收益商业银行理财计划需与托管人就账户开立、资金划拨及保管、估值办法等事项协商并达成一致意见后方可投资。	净价估值。对银行间市场上含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价估值。对银行间市场未上市，且第三方估值机构未提供估值价格的债券，采用在当前情况下适用，并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定其公允价值。 4、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。 5、国债期货合约一般以估值当日结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。 6、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。 7、同业存单的估值方法 同业存单按估值日第三方估值机构提供的估值净价估值；选定的第三方估值机构未提供估值价格的，采用在当前情况下适用，并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定其公允价值。 8、如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，管理人可根据具体情况与托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。 9、当发生大额申购或赎回情形时，管理人可以采用摆动定价机制，以确保集合计划估值的公平性。 10、相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。 如管理人或托管人发现集合计划
--	---	--

		估值违反集合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份额持有人利益时，应立即通知对方，共同查明原因，双方协商解决。 根据有关法律法规，集合计划资产净值计算和集合计划会计核算的义务由管理人承担。本集合计划的集合计划会计责任方由管理人担任，因此，就与本集合计划有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照管理人对集合计划资产净值的计算结果对外予以公布。
产品费用	(1) 管理人的管理费 管理人的管理费按资产净值的 0.6% 年费率计提。 在通常情况下，管理费按前一日资产净值的 0.6% 年费率计提。计算方法如下： $H = E \times 0.6\% \div \text{当年天数}$ 其中：H 为每日应计提的管理费，E 为前一日资产净值。 管理费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。每月初 5 个工作日内从集合资产账户内支付。若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。 (2) 托管人的托管费 托管人的托管费按资产净值的 0.08% 年费率计提。 在通常情况下，托管费按前一日资产净值的 0.08% 年费率计提。计算方法如下： $H = E \times 0.08\% \div \text{当年天数}$ H 为每日应计提的托管费，E 为前一日资产净值。 托管费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。每月初 5 个工作日内从集合资产账户内支付。若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。 (3) 业绩报酬费	1、管理人的管理费 本集合计划的管理费年费率为 0.3%。本集合计划的管理费按前一日集合计划资产净值的 0.3% 年费率计提。管理费的计算方法如下： $H = E \times 0.3\% \div 365$ H 为每日应计提的管理费 E 为前一日的集合计划资产净值 集合计划管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经管理人与托管人双方核对无误后，托管人按照与管理人协商一致的方式，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。 2、托管人的托管费 本集合计划的托管费按前一日集合计划资产净值的 0.05% 年费率计提。托管费的计算方法如下： $H = E \times 0.05\% \div 365$ H 为每日应计提的托管费 E 为前一日的集合计划资产净值 集合计划托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支

	当运作周期结束时，管理人根据委托人持有份额年化收益率（R）提取业绩报酬。 业绩报酬计算方式： <table border="1" data-bbox="424 356 866 611"> <tr> <th>收 益 率</th><th>计 提 比例</th><th>业绩报酬计算 公式</th></tr> <tr> <td>$R < r_i$</td><td>0</td><td>$D=0$</td></tr> <tr> <td>$r_i \leq R$</td><td>50%</td><td>$D=K \times (R-r_i) \times 50\% \times \text{持有天数}/365$</td></tr> </table> 其中：R为委托人持有期年化收益率，$R = \frac{A-B}{C} \times 365 / \text{持有天数} \times 100\%$ A=本运作周期结束日单位资产累计净值 B=上一运作周期结束日单位资产累计净值 C=上一运作周期结束日单位资产净值 D=业绩报酬 $K = \text{本运作周期结束日份额数} \times \text{上一运作周期结束日单位资产净值}$ 若委托人持有份额无上一运作周期结束日，则为该份额的本运作周期起始日。 r_i为每个运作周期的业绩报酬计提标准，$r_i = \text{中国人民银行公布的一年期定期存款基准利率} + \text{超额利差}$，$r_i$和超额利差在每个开放日前公告确定，超额利差由管理人根据市场状况确定和调整。 业绩报酬于每个运作周期结束后计算，或有计提和支付。管理人根据应计提的业绩报酬金额和运作周期结束日单位资产净值，通过减少委托人份额的方式，收取管理人的业绩报酬份额，管理人在收取当日赎回相应的份额。 管理人的业绩报酬的计算和复核工作由管理人完成。 提示：管理人通过减少委托人份额的方式收取业绩报酬，将导致委托人持有份额的减少，而集合计划单位资产累计净值和单位资产净	收 益 率	计 提 比例	业绩报酬计算 公式	$R < r_i$	0	$D=0$	$r_i \leq R$	50%	$D=K \times (R-r_i) \times 50\% \times \text{持有天数}/365$	付，经管理人与托管人双方核对无误后，托管人按照与管理人协商一致的方式，于次月前 5 个工作日内从集合计划财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。 3、销售服务费 销售服务费可用于本集合计划市场推广、销售以及份额持有人服务等各项费用。A 类份额不收取销售服务费，C 类份额的销售服务费年费率为 0.25%。各类集合计划份额的销售服务费计提的计算公式如下： $H = E \times \text{年销售服务费率} \div 365$ H 为每日该类集合计划份额应计提的销售服务费 E 为前一日该类集合计划份额的集合计划资产净值 集合计划销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。经管理人与托管人双方核对无误后，托管人按照与管理人协商一致的方式，于次月前 5 个工作日内从集合计划财产中一次性支付。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延至最近可支付日支付。
收 益 率	计 提 比例	业绩报酬计算 公式									
$R < r_i$	0	$D=0$									
$r_i \leq R$	50%	$D=K \times (R-r_i) \times 50\% \times \text{持有天数}/365$									

	值保持不变。	
--	--------	--

(二) 《说明书》的主要变更内容（参照合同同步变更的内容除外）涉及条款

	变更前	变更后								
产 品 名 称	广发金管家弘利债券集合资产管理计划	广发资管弘利 3 个月滚动持有债券型集合资产管理计划								
申 购 金 额 的 限 制	对于在申请日首次参与的委托人，首次参与金额不得低于 50,000 元，追加参与的最低金额为人民币 1000 元。开放日内可多次参与，累计参与金额不设上限，管理人公告限制最高参与规模的除外。	首次申购本集合计划 A 类和 C 类份额的最低金额为 1 元人民币（含申购费），追加申购各类份额最低金额为 1 元人民币（含申购费）。投资者当期分配的集合计划收益转购份额时，不受最低申购金额的限制。管理人可根据市场情况，调整本集合计划首次申购的最低金额。投资者可多次申购，对单个投资者的累计持有份额设上限限制，不得出现接受某个投资者申购申请后导致其份额超过集合计划总份额 50% 以上的情形。								
赎 回 份 额 的 限 制	委托人退出时按份额退出集合计划，委托人可申请将其持有的部分或全部集合计划单位退出。若委托人持有的某笔份额少于 1,000 份，则管理人有权对该笔份额做强制退出处理。退出支付金额计量单位为人民币元，按四舍五入法保留到小数点后两位，由此误差产生的损失由集合计划资产承担，产生的收益归集合计划资产所有。	在每个运作期到期日，投资人可将其持有的全部或部分该日到期的集合计划份额赎回。份额持有人在销售机构赎回时，每次对本集合计划的赎回申请不得低于 0 份份额。本集合计划份额持有人每个交易账户的最低份额余额为 0 份。在符合法律法规规定的前提下，各销售机构对赎回份额限制有其他规定的，需同时遵循该销售机构的相关规定。								
参 与 费 率	委托人开放期参与本集合计划参与费用为0。	本集合计划A类份额的申购费用由投资人承担，不列入集合计划财产。本集合计划C类份额不收取申购费用。因红利自动再投资而产生的集合计划份额，不收取相应的申购费用。 A类份额申购费： <table><tr><td>申购金额（M）</td><td>适用申购费率</td></tr><tr><td>M<100 万</td><td>0.3%</td></tr><tr><td>100 万≤M<500 万</td><td>0.2%</td></tr><tr><td>M≥500 万</td><td>1000 元/笔</td></tr></table>	申购金额（M）	适用申购费率	M<100 万	0.3%	100 万≤M<500 万	0.2%	M≥500 万	1000 元/笔
申购金额（M）	适用申购费率									
M<100 万	0.3%									
100 万≤M<500 万	0.2%									
M≥500 万	1000 元/笔									

退 出 费 率	本集合计划退出费率为0。	本集合计划对于每份集合计划份额设定 3 个月的滚动持有期，投资人每笔转让买入/申购的集合计划份额需至少持有满三个月，在三个月持有期内不能提出赎回申请。投资人持有满三个月后赎回，不收取赎回费。
风 险 揭 示	委托人投资于本集合计划的主要可能风险如下： （1）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、产业政策等国家宏观经济政策的变化对资本市场产生一定的影响，导致市场价格波动，影响集合资产管理计划的收益而产生的风险。 2) 经济周期风险 经济运行具有周期性的特点，受其影响，集合资产管理计划的收益水平也会随之发生变化，从而产生风险。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 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，使集合资产管理计划收益水平随之发生变化，从而产生风险。 4) 上市公司经营风险 上市公司的经营好坏受多种因素影响，如管理能力、财务状况、市场前景、行业竞争、人员素质等，这些都会导致企业的盈利发	1、市场风险 市场风险是指投资品种的价格因受经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素影响而引起的波动，导致收益水平变化，产生风险。市场风险主要包括： （1）政策风险 货币政策、财政政策、产业政策和证券市场监管政策等国家政策的变化对证券市场产生一定的影响，可能导致证券价格波动，从而影响收益。 （2）经济周期风险 证券市场受宏观经济运行的影响，而经济运行具有周期性的特点，而周期性的经济运行周期表现将对证券市场的收益水平产生影响，从而对收益产生影响。 （3）利率风险 利率风险是指由于利率变动而导致的资产价格和资产利息的损益。利率波动会直接影响企业的融资成本和利润水平，导致证券市场的价格和收益率的变动，使集合计划资产管理业务收益水平随之发生变化，从而产生风险。 （4）上市公司经营风险 上市公司的经营状况受多种因素影响，如市场、技术、竞争、管理、财务因素等都会导致公司盈利发生变化，从而导致集合计划投资收益变化。 （5）衍生品风险 金融衍生产品具有杠杆效应且价格波动剧烈，会放大收益或损失，在某些情况下甚至会导致投资亏损高于初始投资金额。

生变化。如果集合计划所投资的上市公司（主要来源为新股申购、可转债转股等）经营不善，其股票价格可能下跌，或者能够用于分配的利润减少，使集合计划投资收益下降。虽然集合计划可以通过投资多样化来分散这种非系统风险，但不能完全规避。 5) 权证风险 权证具有价格波动剧烈，可能会放大收益或损失，在某些情况下甚至会导致投资亏损高于初始投资金额。 6) 购买力风险 集合资产管理计划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，从而使集合资产管理计划的实际收益下降。 7) 再投资风险 再投资风险反映了利率下降对固定收益证券利息收入再投资收益的影响，这与利率上升所带来的价格风险（即利率风险）互为消长。 (2) 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，会影响其对信息的占有和对经济形势、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。同时集合资产计划的净值先涨后跌，委托人存在退出或者集合计划终止时，净值没有增长但管理人已经在此之前提取了业绩报酬的风险。 (3) 流动性风险 集合资产管理计划不能迅速转变成现金，或者转变成现金会对资产价格造成重大不利影响的风险。流动性风险按照其来源可以	(6) 购买力风险 投资者的利润将主要通过现金形式来分配，而现金可能因为通货膨胀的影响而导致购买力下降，从而使投资者的实际收益下降。 (7) 信用风险 集合计划所投资债券的发行人如出现违约、无法支付到期本息，或由于债券发行人信用等级降低导致债券价格下降，将造成集合计划资产损失。 (8) 其他风险 管理人在投资债券或进行债券回购业务中，可能面临债券投资的市场风险或债券回购交收违约后结算公司对质押券处置的风险。 2、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。 3、流动性风险 (1) 流动性风险评估 本集合计划为债券型集合资产管理计划（大集合产品），主要投资于债券、货币市场工具等，一般情况下，这些资产市场流动性较好。但本集合计划投资于上述资产时，仍存在以下流动性风险：一是管理人建仓而进行组合调整时，可能由于特定投资标的流动性相对不足而无法按预期的价格将债券或其他资产买进或卖出；二是为应付投资者的赎回，本集合计划被迫以不适当的价格卖出债券或其他资产。两者均可能使集合计划净值受到不利影响。 (2) 巨额赎回情形下的流动性风险管理措施 当本集合计划发生巨额赎回时，管
---	---

分为： 1) 市场整体流动性相对不足。证券市场的流动性受到市场行情、投资群体等诸多因素的影响，在某些时期成交活跃，流动性好；而在另一些时期，可能成交稀少，流动性差。在市场流动性相对不足时，交易变现有可能增加变现成本，对集合资产管理计划造成不利影响。 2) 证券市场中流动性不均匀，存在个股和个券流动性风险。由于流动性存在差异，即使在市场流动性比较好的情况下，一些个股和个券的流动性可能仍然比较差，从而使得集合资产管理计划在进行个股和个券操作时，可能难以按计划买入或卖出相应的数量，或买入卖出行为对个股和个券价格产生比较大的影响，增加个股和个券的建仓成本或变现成本。 3) 集合资产管理计划中的资产不能应付可能出现的投资者巨额退出或大额退出的风险。在集合资产管理计划开放期间，可能会发生巨额退出或大额退出的情形，巨额退出或大额退出可能会产生本集合计划仓位调整的困难，导致流动性风险，甚至影响本集合计划份额净值。 (4) 信用风险 信用风险是指发行人是否能够实现发行时的承诺，按时足额还本付息的风险，或者交易对手未能按时履约的风险。 1) 交易品种的信用风险：投资于公司债券、可转换债券等固定收益类产品，存在着发行人不能按时足额还本付息的风险；此外，当发行人信用评级降低时，集合资产管理计划所投资的债券可能面临价格下跌风险。 2) 交易对手的信用风险：交易	理人可以根据集合计划当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎回；在出现单个份额持有人的净赎回申请超过集合计划总份额 10% 的赎回申请情形下，全部确认其他赎回申请人的赎回申请（即净赎回申请不超过集合计划总份额 10% 的单个份额持有人的赎回申请）后，管理人可以在集合计划当日接受赎回比例不低于上一工作日集合计划总份额的 10% 的前提下，在仍可接受赎回申请的范围内对该赎回申请人的赎回申请予以确认，未予确认的赎回申请延期办理。具体情形、程序见招募说明书“份额的申购、赎回”“巨额赎回的情形及处理方式”。 发生上述情形时，投资人面临无法全部赎回或无法及时获得赎回资金的风险。在本集合计划暂停或延期办理投资者赎回申请的情况下，投资者未能赎回的集合计划份额还将面临净值波动的风险。 (3) 除巨额赎回情形外实施备用的流动性风险管理工具的情形、程序及对投资者的潜在影响 除巨额赎回情形外，本集合计划备用流动性风险管理工具包括但不限于暂停接受赎回申请、延缓支付赎回款项、暂停集合计划估值、摆动定价、侧袋机制以及证监会认定的其他措施。 暂停接受赎回申请、延缓支付赎回款项等工具的情形、程序见招募说明书“份额的申购、赎回”之“拒绝或暂停申购的情形”、“暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形”的相关规定。若本集合计划暂停赎回申请，投资者在暂停赎回期间将无法赎回其持有的集合计划份额。若本集合计划延缓支付赎回款项，赎回款支付时间将后延，可能对投资者的资金安排带来不利影响。 暂停集合计划估值的情形、程序见
--	--

对手未能履行合约，或在交易期间未如约支付已借出证券产生的所有股息、利息和分红，将使集合资产管理计划面临交易对手的信用风险。 （5）管理人因停业、解散、撤销、破产，或者被中国证监会撤销相关业务许可等原因不能履行职责，可能给委托人带来一定的风险。 （6）强制退出风险 1）若委托人持有的某笔份额少于1,000份，则管理人有权对该笔份额做强制退出处理。因此委托人持有的单笔份额少于1,000份，有被强制退出的风险。 2）因产品注册登记机构变更，截至原产品注册登记机构终止服务之日，委托人仍未主动退出登记在原注册登记机构的份额，管理人有权对该部分份额做强制退出处理，因此委托人有被强制退出的风险。 （7）合同变更风险 集合资产管理合同（以下简称“合同”）签署后，有可能因法律、法规、规章、中国证监会的规定、证券登记结算机构业务规则、证券交易所交易规则以及其他原因进行修订或者变更。委托人存在不同意变更合同的条款又没在规定的时间内退出，视同同意合同变更的风险。 （8）本产品可能存在委托人参与本金损失的风险 1）本产品不保证本金和/或收益不受损失，证券市场波动等因素导致本产品持有的投资组合出现价格波动，可能导致委托人参与本金出现亏损。 2）由于管理人的投资知识、经验、判断和决策能力、投资技能等存在的局限性，其可能存在对市场信息的获取不全、对	招募说明书“集合计划资产的估值”之“暂停估值的情形”的相关规定。若本集合计划暂停估值，一方面投资者将无法知晓本集合计划的份额净值，另一方面集合计划将延缓支付赎回款项或暂停接受投资者的申购赎回申请，延缓支付赎回款项可能影响投资者的资金安排，暂停接受集合计划申购赎回申请将导致投资者无法申购或赎回本集合计划。 采用摆动定价机制的情形、程序见招募说明书“集合计划资产的估值”之“估值方法”的相关规定。若本集合计划采取摆动定价机制，投资者申购集合计划获得的申购份额及赎回集合计划获得的赎回金额均可能受到不利影响。 4、实施侧袋机制对投资者的影响 侧袋机制是一种流动性风险管理工具，是将特定资产分离至专门的侧袋账户进行处置清算，并以处置变现后的款项向份额持有人进行支付，目的在于有效隔离并化解风险，但集合计划启用侧袋机制后，侧袋账户份额将停止披露集合计划份额净值，并不得办理申购、赎回和转换，仅主袋账户份额正常开放赎回，因此启用侧袋机制时持有集合计划份额的持有人将在启用侧袋机制后同时拥有主袋账户份额和侧袋账户份额，侧袋账户份额不能赎回，其对应特定资产的变现时间具有不确定性，最终变现价格也具有不确定性并且有可能大幅低于启用侧袋机制时的特定资产的估值，份额持有人可能因此面临损失。 实施侧袋机制期间，管理人计算各项投资运作指标和集合计划业绩指标时以主袋账户资产为基准，不反映侧袋账户特定资产的真实价值及变化情况。本集合计划不披露侧袋账户份额的净值，即便管理人在定期报告中披露报告期末特定资产可
---	--

经济形势、金融市场价格走势的判断失误或对投资工具使用不当等情况，以上因素可能导致委托人参与本金出现损失。 （9）因管理人的业务或者经营状况发生变化，存在可能导致委托人参与本金亏损的风险 管理人自身的经营状况发生不利变化，出现了业务萎缩，关键人员流失、财务状况出现亏损等情况，导致管理人无法有效的对产品进行投资管理和运作，可能导致委托人参与本金或原始本金出现损失。 （10）因管理人的业务或者经营状况发生变化，存在可能影响客户判断的风险 管理人自身的经营状况发生不利变化，出现了业务萎缩，关键人员流失、财务状况出现亏损等情况，客户由于没有及时了解和掌握以上信息，可能导致客户没有对自己所持有产品的后续投资策略做出准确的判断。 （11）本产品存在以下限制委托人权利行使期限或者可解除合同期限等内容 本产品存在巨额赎回条款，当产品触发巨额赎回条款时，按照本合同该条款的约定，客户可能存在延迟收到赎回款项的情况。 （12）本集合计划特有的风险 1) 收益不确定风险 本集合计划为债券型产品，资产整体的预期收益和风险均较低，其风险收益水平低于股票型产品、混合型产品，高于货币型产品。 2) 流动性风险 在存续期内，本集合计划以273天（自然日）为一个封闭运作周期，封闭运作周期内不接受该笔份额的退出业务申请，运作周期结束当日可办理该笔份额的退出	变现净值或净值区间的，也不作为特定资产最终变现价格的承诺，对于特定资产的公允价值和最终变现价格，管理人不承担任何保证和承诺的责任。 管理人将根据主袋账户运作情况合理确定申购政策，因此实施侧袋机制后主袋账户份额存在暂停申购的可能。 5、管理人因停业、解散、撤销、破产，或者被中国证监会撤销相关业务许可等原因不能履行职责的风险 管理人因停业、解散、撤销、破产，或者被中国证监会撤销相关业务许可等原因不能履行职责，可能导致委托资产的损失，从而带来风险。 6、本集合计划特有风险 （1）本集合计划达到一定规模时，管理人有权停止申购。投资者可能面临因上述原因而无法申购本集合计划的风险。 （2）本集合计划存续期间，连续60个工作日出现份额持有人数量不满200人或者集合计划资产净值低于5000万元情形的，投资者可能面临集合计划因上述原因转换运作方式、与其他集合计划合并或者终止集合合同的风险。 （3）对于法律法规规定和集合合同约定可不经份额持有人大会决议通过的事项，由管理人和托管人同意后变更并公告，并报中国证监会备案。投资者可能面临由于上述原因发生合同变更的风险。 （4）变更集合合同涉及法律法规规定或集合合同约定应经份额持有人大会决议通过的事项的，应召开份额持有人大会决议通过。部分投资者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，从而存在风险。
---	---

业务，遇节假日则顺延至下一个工作日，在此期间内，客户不得赎回本产品。 3) 参与国债期货的风险 ①国债期货交易采用保证金交易方式，潜在损失可能成倍放大，具有杠杆性风险。②国债期货合约到期时，如本集合计划仍持有未平仓合约，交易所将按照交割结算价将本集合计划持有的合约进行现金交割，本集合计划存在无法继续持有到期合约的可能，具有到期日风险。国债期货合约采取实物交割方式，如本集合计划未能在规定期限内如数交付可交割国债或者未能在规定期限内如数缴纳交割贷款，将构成交割违约，交易所将收取相应的惩罚性违约金。③如本集合计划参与交割不符合交易所或者期货公司相关业务规定，期货公司有权不接受本集合计划的交割申请或对本集合计划的未平仓合约强行平仓，由此产生的费用和结果将由集合计划承担。④使用国债期货对冲市场风险的过程中，委托财产可能因为国债期货合约与合约标的价格波动不一致而面临期现基差风险。在需要将期货合约展期时，合约平仓时的价格与下一个新合约开仓时的价格之差也存在不确定性，面临跨期基差风险。 (13) 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等。 2) 操作风险。管理人、托管人、证券交易所、证券登记结算机构等在业务操作过程中，因操	(5) 滚动持有运作方式的风险 1) 每个运作期到期日前，集合计划份额持有人不能赎回集合计划份额的风险 对于每份集合计划份额，管理人仅在该份额的每个运作期到期日为份额持有人办理赎回，在非运作期到期日，管理人不能为份额持有人办理赎回，且本集合计划不上市交易，份额持有人面临流动性风险。 2) 运作期到期日，份额持有人未申请赎回或赎回被确认失败，到期的集合计划份额自动进入下一个运作期风险 如果份额持有人在每份份额的当期运作期到期日未申请赎回或赎回被确认失败，则该份额将在该运作期到期后自动进入下一个运作期。在下一个运作期到期日前，份额持有人不能赎回份额，份额持有人持有的份额将面临滚动运作的风险。 3) 每份集合计划份额每个实际运作期可能长于或短于3个月的风险 本集合计划名称为广发资管弘利3个月滚动持有债券型集合资产管理计划，但是考虑到周末、法定节假日等非工作日原因，每份份额的每个实际运作期期限或有不同，可能长于或短于3个月。 投资者应当在熟悉并了解本集合计划运作规则的基础上，结合自身投资目标、投资期限等情况审慎作出投资决策，及时行使赎回权利。本集合计划的运作期和申购赎回安排请参见招募说明书第八部分的相关约定。 (6) 投资于资产支持证券的风险 本集合计划可投资于资产支持证券。 1) 与基础资产相关的风险。主要包括特定原始权益人破产风险、现金流预测风险等风险。 2) 与资产支持证券相关的风险。主要包括资产支持证券信用增级措
--	--

	作失误或违反操作规程而引起的风险，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。 3) 合规风险。指集合计划管理或运作过程中，违反国家法律、法规的规定，或者违反《资产管理合同》有关规定的风险。 4) 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。	施相关风险、利率风险、流动性风险、评级风险等风险。 3) 与 SPV 管理相关的风险。主要包括 SPV 管理人违约违规风险、托管人违约违规风险、账户管理风险、资产服务机构违规等风险。 4) 其他风险。主要包括政策和法律风险、税收风险、发生不可抗力事件的风险、技术风险和操作风险。 (7) 投资于国债期货的风险 国债期货的投资可能面临市场风险、基差风险、流动性风险。市场风险是因期货市场价格波动使所持有的期货合约价值发生变化的风险。基差风险是期货市场的特有风险之一，是指由于期货与现货间的价差的波动，影响套期保值或套利效果，使之发生意外损益的风险。流动性风险可分为两类：一类为流通量风险，是指期货合约无法及时以所希望的价格建立或了结头寸的风险，此类风险往往是由市场缺乏广度或深度导致的；另一类为资金量风险，是指资金量无法满足保证金要求，使得所持有的头寸面临被强制平仓的风险。 (8) 本集合计划为债券型集合资产管理计划，投资范围包括可转换债券，需要承担可转换债券市场的流动性风险、债券价格受所对应股票价格波动影响而波动的风险以及在转股期或换股期不能转股或换股的风险等。 7、本集合计划投资范围包括证券公司发行的短期公司债券，由于证券公司短期公司债券非公开发行和交易，且限制投资者数量上限，潜在流动性风险相对较大。若发行主体信用质量恶化或投资者大量赎回需要变现资产时，受流动性所限，本集合计划可能无法卖出所持有的证券公司短期公司债券，由此可能给本集合计划净值带来不利影响或
--	---	---

		损失。 8、合规性风险 指集合计划管理或运作过程中，违反国家法律、法规的规定，或者集合计划投资违反法规及《集合合同》有关规定的风险以及大集合产品政策调整的风险。 9、其他风险 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。
《管理合同》中变更的内容，若《说明书》中包含，亦同步进行变更。		

二、合同变更的征询期安排及生效时间

根据《广发金管家弘利债券集合资产管理计划管理合同》的约定，我司拟在征询本集合计划投资者意见的基础上按照相关规定的要求对本产品进行变更，具体如下：

1、征询期安排：本次合同变更的征询期为 2023 年 3 月 6 日至 2023 年 3 月 17 日。为保障投资者权益，管理人设置 2023 年 3 月 6 日至 2023 年 3 月 17 日为临时开放期，仅办理退出业务，不办理申购参与业务。不同意合同变更的投资者可于 2023 年 3 月 6 日至 2023 年 3 月 17 日的交易时间内，通过本集合计划推广机构办理退出事宜。

1.1 本次征询期间投资者申请退出的份额，T 日的退出申请，退出款将按照原合同约定于 T+5 日内划至投资者账户。

1.2 本次合同变更征询期间，集合计划不收取业绩报酬和退出费用。

2、变更投票和合同变更征询函：本次合同变更，管理人设置了投票环节和合同变更征询函，投资者可选择参与投票或书面签署合同变更征询函（二选一即可）。本次投票和合同变更征询仅作为管理人进行客户服务工作的依据，并非合同变更表决投票。

变更投票：投资者可通过管理人网站参与投票（www.gfam.com.cn 路径：“我的资产管理” - “产品投票”）。

变更征询函：投资者可书面签署《广发金管家弘利债券集合资产管理计划合同变更征询函》回执并提交至本集合计划销售机构。

投票选项：1) 不同意变更，且委托管理人办理全部份额退出；2) 不同意变更，且自行办理退出；如未在开放期内自行办理退出，则同意变更；3) 同意变更。

2.1 选择【不同意变更，且委托管理人办理全部份额退出】的投资者，由管理人于 2023 年 3 月 17 日统一办理该类投资者的全部份额退出，且以该日日终的单位净值进行确认。

2.2 选择【不同意变更，且自行办理退出；如未在开放期内自行办理退出，则同意变更】的投资者，请自行在征询期内提出退出申请。如未在上述征询期内申请办理本集合计划的退出，根据《管理合同》第 24 节第 1 条的约定，则投资者以其行为表明同意本次合同变更。

2.3 选择【同意变更】，且未在征询期内退出本集合计划的投资者，即同意本次合同变更的内容。

2.4 未进行投票，且未在征询期内退出本集合计划的投资者，根据《管理合同》第 24 节第 1 条的约定，则投资者以其行为表明同意本次合同变更。

2.5 上述明确同意或者以其行为表明同意变更的投资者，其份额将继续保留至合同变更生效，并按照变更后的合同运作。

3、本次变更的正式生效时间为 2023 年 3 月 20 日，届时管理人将在公司网站公告本集合计划合同变更生效事宜。

4、本集合计划此次变更生效，未退出的原投资者，其持有的份额将自动转为变更后广发资管弘利 3 个月滚动持有债券型集合资产管理计划 A 类份额（代码：872031）。

5、变更生效后，本集合计划 A 类份额（代码：872031）首次办理赎回的时间为 2023 年 6 月 20 日（因端午节假期，赎回资金将顺延支付）。管理人可根据实际情况依法决定本集合计划 A 类（代码：872031）和 C 类（代码：872032）份额开始办理申购的具体日期，具体业务办理时间在申购开始公告中规定。本集合计划变更生效后的运作方式为：

5.1 每个运作期到期日前，集合计划份额持有人不能提出赎回申请。对于每份集合计划份额，第一个运作期指集合合同生效日（对集合合同生效日登记在册的份额而言，下同）或集合计划份额申购确认日（对申购份额而言，下同）起（即第一个运作期起始日），至集合合同生效日或集合计划份额申购申

请日 3 个月后的月度对日（即第一个运作期到期日。如该对应日为非工作日，或无对应日期，则顺延到下一工作日）止。第二个运作期指第一个运作期到期日的次一日起，至集合合同生效日或集合计划份额申购申请日 6 个月后的月度对日（如该日为非工作日，或无对应日期，则顺延至下一工作日）止。以此类推。

5.2 每个运作期到期日，集合计划份额持有人可提出赎回申请。每个运作期到期日，集合计划份额持有人可提出赎回申请。如果集合计划份额持有人在当期运作期到期日未申请赎回或赎回被确认失败，则自该运作期到期日下一日起该份额进入下一个运作期。

6、本集合计划正式变更生效前，如出现重大事项影响本集合计划投资者利益，管理人有权暂停变更征询或延迟正式变更生效时间。

6.1 重大事项包括：

1) 市场剧烈波动导致本计划持仓的资产价值出现重大变化，继续征询可能损害投资者利益；

2) 因管理人、托管人、证券交易所、证券登记结算机构的技术系统故障或者差错，影响交易的正常进行交易或者导致投资者的利益受到影响；

3) 战争、自然灾害等不可抗力的原因导致集合计划无法正常运转；

4) 其他管理人认为有必要暂停变更征询或延迟正式变更生效时间的情形。

6.2 管理人在上述重大事项发生两个交易日内进行公告，披露相关情形及对本集合计划造成的具体影响，并告知投资者后续的处理方案。

三、重要提示

1、管理人提请投资者注意，本集合计划变更后产品运作方式、申购赎回、投资、费用、信息披露等方面都发生了较大变化，请投资者务必仔细阅读本公告和变更后的法律文件，《广发资管弘利 3 个月滚动持有债券型集合资产管理计划资产管理合同》、《广发资管弘利 3 个月滚动持有债券型集合资产管理计划招募说明书》和《广发资管弘利 3 个月滚动持有债券型集合资产管理计划托管协议》等法律文件已与本公告同时在管理人网站披露。

2、请投资者详细阅读本公告所述的合同变更投票规则，若投资者未在开放期内自行办理赎回或委托管理人退出的，均视为同意本次合同变更，其份额将继续保留至合同变更生效，并按照变更后的合同运作。

3、本次合同变更生效后，投资者在开放日办理集合计划份额的申购，对于每份集合计划份额，仅可在该集合计划份额对应的每个运作期的到期日办理集合计划份额的赎回。具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间，但管理人根据法律法规、中国证监会的要求或本集合合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。

4、如有疑问，敬请致电或登录管理人网站了解相关情况，咨询电话：95575，公司网站：www.gfam.com.cn。

附件：广发金管家弘利债券集合资产管理计划合同变更征询函

特此公告。

广发证券资产管理（广东）有限公司

2023年3月1日

附件：广发金管家弘利债券集合资产管理计划合同变更征询函

尊敬的投资者：

根据广发金管家弘利债券集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”）资产管理合同约定及相关规定的要求，我司作为管理人拟在征询本集合计划投资者意见的基础上，对本集合计划的合同进行变更。管理人已就合同变更事宜与本集合计划托管人中国工商银行股份有限公司协商并征得了托管人同意。

管理人提请投资者注意，本集合计划变更后名称为“广发资管弘利 3 个月滚动持有债券型集合资产管理计划”。本集合计划变更后产品运作方式、申购赎回、投资、费用、信息披露等方面都发生了较大变化，请投资者务必仔细阅读合同变更公告和变更后的法律文件。

特别提示：

1、选择【不同意变更，且委托管理人办理全部份额退出】的投资者，由管理人于 2023 年 3 月 17 日统一办理该类投资者的全部份额退出，且以该日日终的单位净值进行确认。

2、选择【不同意变更，且自行办理退出；如未在开放期内自行办理退出，则同意变更】的投资者，请自行在征询期内提出退出申请。如未在征询期内申请办理本集合计划的退出，根据《管理合同》第 24 节第 1 条的约定，则投资者以其行为表明同意本次合同变更。

3、选择【同意变更】，且未在征询期内退出本集合计划的投资者，即同意本次合同变更的内容。

4、未进行投票，且未在征询期内退出本集合计划的投资者，根据《管理合同》第 24 节第 1 条的约定，则投资者以其行为表明同意本次合同变更。

5、上述明确同意或者以其行为表明同意变更的投资者，其份额将继续保留至合同变更生效，并按照变更后的合同运作。

6、征询期安排：本次合同变更的征询期为 2023 年 3 月 6 日至 2023 年 3 月 17 日。为保障投资者权益，管理人设置 2023 年 3 月 6 日至 2023 年 3 月 17 日为临时开放期，仅办理退出业务，不办理申购参与业务。不同意合同变更的投资者可于 2023 年 3 月 6 日至 2023 年 3 月 17 日的交易时间内，通过本集合计划推广机构办理退出事宜。

7、本次变更的正式生效时间为 2023 年 3 月 20 日，因变更后运作方式发生变化，对于在征询期前已申请预约退出、且预约退出日在 2023 年 3 月 20 日之后的投资者份额，将取消预约退出申请，具体请以销售机构的通知为准。投资者可于征询期通过本集合计划推广机构办理退出事宜，或于变更生效后本集合计划的运作期到期日（首次办理赎回的时间为 2023 年 6 月 20 日）提出赎回申请。其中对于 2023 年 3 月 3 日新递交至管理人且预约退出日在 2023 年 3 月 20 日之后的预约退出申请，管理人取消申请后因系统数据传输因素，部分投资者于征询期第二日起（2023 年 3 月 7 日）方可办理退出。

8、本次合同变更后的产品风险等级未发生变化，为较低风险，其预期风险与预期收益水平低于股票型基金、股票型集合计划、混合型基金和混合型集合计划，高于货币市场基金。投资范围、投资比例、投资策略等投资相关条款有变化，敬请投资者仔细阅读本公告及变更后的法律文本。

9、本集合计划合同变更后，广发资管弘利 3 个月滚动持有债券型集合资产管理计划设置 A 类份额（代码：872031）和 C 类份额（代码：872032）。A 类份额将收取申购费（申购金额 $M < 100$ 万，0.3%； $100 \text{ 万} \leq M < 500$ 万，0.2%； $M \geq 500$ 万，1000 元/笔），C 类份额设置 0.25%/年的销售服务费；两类份额均不设置业绩报酬计提标准，管理人不计提业绩报酬；管理费由 0.6%/年调整为 0.3%/年，托管费率由 0.08%/年调整为 0.05%/年。

10、本集合计划此次变更生效，未退出的原投资者，其持有的份额将自动转为变更后广发资管弘利 3 个月滚动持有债券型集合资产管理计划 A 类份额（代码：872031），此次份额迁移不收取申购费。变更生效后本集合计划不再按照原份额 273 天的运作周期进行运作，统一以 3 个月为周期进行运作。变更生效后，投资者首次可申请办理赎回的日期为 2023 年 6 月 20 日（因端午节假期，赎回资金将顺延支付），之后每 3 个月为一个运作期，投资者可按照变更后的产品运作方式进行申赎。投资者按照每日集合计划 A 类/C 类份额净值进行申购和赎回，自行承担投资风险。

11、因系统变更和数据迁移的显示时滞，A 类份额（代码：872031）和原份额（代码：87642P）将于本集合计划变更生效后并存，约 3 个交易日后原份额（代码：87642P）将于系统界面下线。显示时滞对投资者并无实质不利影响。

12、本次合同变更征询期间，集合计划不收取业绩报酬和退出费用。

13、变更生效后，管理人可根据实际情况依法决定本集合计划 A 类（代码：872031）和 C 类（代码：872032）份额开始办理申购的具体日期，具体业务办理时间在申购开始公告中规定。本集合计划变更生效后的运作方式为：

13.1 每个运作期到期日前，集合计划份额持有人不能提出赎回申请。对于每份集合计划份额，第一个运作期指集合合同生效日（对集合合同生效日登记在册的份额而言，下同）或集合计划份额申购确认日（对申购份额而言，下同）起（即第一个运作期起始日），至集合合同生效日或集合计划份额申购申请日 3 个月后的月度对日（即第一个运作期到期日。如该对应日为非工作日，或无对应日期，则顺延到下一工作日）止。第二个运作期指第一个运作期到期日的次一日起，至集合合同生效日或集合计划份额申购申请日 6 个月后的月度对日（如该日为非工作日，或无对应日期，则顺延至下一工作日）止。以此类推。

13.2 每个运作期到期日，集合计划份额持有人可提出赎回申请。每个运作期到期日，集合计划份额持有人可提出赎回申请。如果集合计划份额持有人在当期运作期到期日未申请赎回或赎回被确认失败，则自该运作期到期日下一日起该份额进入下一个运作期。

回执

本投资者已阅知《广发金管家弘利债券集合资产管理计划合同变更征询函》，对广发金管家弘利债券集合资产管理计划合同变更事宜作出如下勾选：

☐ 不同意变更，且委托管理人办理全部份额退出。详细信息：

申请人：

身份证号：

所属销售机构网点：

☐ 不同意变更，且自行办理退出；如未在开放期内自行办理退出，则同意变更

☐ 同意变更

申请人签字：

（承诺为本人签字）

日期：

销售机构盖章：