

合同编号:

国融证券合同[18]第1032号

日信证券长安2号集合资产管理计划  
集合资产管理合同

管理人：国融证券股份有限公司

托管人：渤海银行股份有限公司



## 目 录

第一章 前言 .....	2
第二章 释义 .....	2
第三章 合同当事人 .....	7
第四章 集合计划的基本情况 .....	8
第五章 集合计划的参与和退出 .....	12
第六章 管理人自有资金参与集合计划 .....	20
第七章 集合计划的分级 .....	21
第八章 集合计划的成立 .....	21
第十章 集合计划资产的托管 .....	24
第十一章 集合计划估值 .....	25
第十二章 集合计划的费用 .....	32
第十三章 收益与分配 .....	37
第十四章 投资理念与投资策略 .....	39
第十五章 投资决策与风险控制 .....	41
第十六章 禁止行为 .....	46
第十七章 集合计划的信息披露 .....	47
第十八章 集合计划份额的转让、非交易过户和冻结 .....	50
第十九章 集合计划的展期 .....	51
第二十章 集合计划终止与清算 .....	52
第二十一章 当事人的权利与义务 .....	54
第二十二章 违约责任与争议处理 .....	59
第二十三章 风险揭示 .....	61
第二十四章 合同的成立与生效 .....	66
第二十五章 合同的补充、修改与变更 .....	67
第二十六章 或有事件 .....	68

特别约定：《日信证券长安 2 号集合资产管理计划集合资产管理合同》（以下简称“本合同”）可以电子签名方式签订，管理人、托管人作为本合同签署方，已接受本合同项下的全部条款，并以纸质合同方式签署；委托人（日信证券长安 2 号集合资产管理计划的投资者）作为本合同一方，以电子签名方式签署本合同即表明委托人完全接受本合同项下的全部条款，同时本合同成立。

委托人、管理人、托管人同意遵守《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、集合资产管理计划说明书）、风险揭示书或其他文书的，视为签署本合同、集合资产管理计划说明书、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。

## 第一章 前言

为规范日信证券长安 2 号集合资产管理计划（以下简称“本计划”）运作，明确《日信证券长安 2 号集合资产管理计划集合资产管理合同》（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》、《中华人民共和国电子签名法》、《证券公司监督管理条例》、《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》”）、《证券公司资产管理电子签名合同操作指引》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》（银发〔2018〕106 号，以下简称《指导意见》）、《证券公司客户资产管理业务规范》（以下简称“《业务规范》”）等法律法规和规范性文件的规定，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》、《实施细则》、《指导意见》、本合同及本合同附件《日信证券长安 2 号集合资产管理计划说明书》（以下简称“《说明书》”）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、准确、完整，没有非法汇集他人资金参与本集合计划，并已阅知本合同和《说明书》，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。为保护委托人的利益，管理人郑重提示委托人：在每次参与本集合计划（无论推广期参与还是存续期参与）时，委托人应及时通过原推广机构网点、原推广机构指定网络系统查询参与结果的同时，另行通过管理人网站（[www.grzq.com](http://www.grzq.com)）或份额登记机构网站等方式进行查询确认。

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，不得向合格投资者之外的单位和个人募集资金，不得通过报刊、电台、电视台、互联网等公众传播媒体或者讲座、报告会、分析会等方式向不特定对象宣传推介，禁止通过保本保底、虚假宣传、商业贿赂等不正当竞争手段推广集合计划。

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。

## 第二章 释义

在本合同及《说明书》中，除非文意另有所指，下列词语或简称代表如下含义：

《集合资产管理合同》、本合同、电子签名合同：	指《日信证券长安 2 号集合资产管理计划集合资产管理合同》及其的任何修订和补充。
《管理办法》：	指 2013 年 6 月 26 日经中国证券监督管理委员会公布并自公布之日起实施的《证券公司客户资产管理业务管理办法》。
《实施细则》：	指 2013 年 6 月 26 日经中国证券监督管理委员会公布并自公布之日起实施的《证券公司集合资产管理业务实施细则》。
《指导意见》	指 2018 年 4 月 27 日经中国人民银行、中国银行保险监督管理委员会、中国证券监督管理委员会以及国家外汇管理局公布并自公布之日起实施的《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》。
《公司法》：	指《中华人民共和国公司法》。
《证券法》：	指《中华人民共和国证券法》。
《合同法》：	指《中华人民共和国合同法》。
《电子签名法》：	指《中华人民共和国电子签名法》。
中国：	指中华人民共和国。
法律法规：	指中国现时有效并公布实施的法律、行政法规、行政规章及规范性文件、地方法规、地方规章及规范性文件。
元：	指中国法定货币人民币，单位“元”。
资产管理计划或集合计划或本计划：	指依据《日信证券长安 2 号集合资产管理计划集合资产管理合同》和《日信证券长安 2 号集合资产管理计划说明书》所设立的日信证券长安 2 号集合资产管理计划。

集合资产管理计划说明书或说明书或本说明书:	指《日信证券长安2号集合资产管理计划说明书》。
中国证监会:	指中国证券监督管理委员会。
集合资产管理计划管理人或管理人:	指国融证券股份有限公司。
集合资产管理计划托管人或托管人:	指渤海银行股份有限公司。
推广机构:	指国融证券股份有限公司以及中国证监会认可的与管理人签署相关协议的其他推广机构。
注册登记机构:	中国证券登记结算有限责任公司(简称“中登公司”)或中国证监会认可的注册登记机构。
集合资产管理合同当事人:	指受《集合资产管理合同》约束,根据《集合资产管理合同》享受权利并承担义务的法律主体。
个人委托人:	指依据中华人民共和国有关法律法规及其他有关规定可以投资于集合资产管理计划的自然人投资者。
机构委托人:	指在中国境内合法注册登记或经有权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。
委托人:	指上述委托人(个人委托人和机构委托人)的合称。
集合资产管理计划成立日:	本集合计划将在60个工作日内完成集合计划的推广、设立活动,集合资产管理计划净参与申请额超过人民币3000万元且委托人超过2人,集合资产管理计划管理人可以依据《管理办法》和集合资产管理计划实际参与申请情况决定停止接受集合资产管理计划参与申请,并宣告集合资产管理计划成立的日期。

推广期:	指本集合计划自开始推广到推广完成之间的时间段；管理人应当在开始推广之日起的 60 个工作日内完成推广、设立活动，具体时间见管理人有关公告。
工作日、交易日:	指上海证券交易所和深圳证券交易所的正常交易日。
T 日:	指集合计划推广期申请参与及开放期内投资者申请参与或退出集合计划之日。
T+n 日:	指自 T 日起第 n 个工作日（不包含 T 日）。
参与确认日:	推广期参与：委托人在推广期申请参与本计划，参与申请的最终确认将会在推广结束后的 1 个工作日内进行。 开放期参与：委托人在开放期申请参与本计划，参与申请的最终确认将会在申请提交后的 1 个工作日内进行。
固定管理费核算日	核算集合计划固定管理费之日，每季度末月 20 日，若遇法定节假日、休息日等，顺延。
托管费核算日	核算集合计划托管费之日，每季度末月 20 日，若遇法定节假日、休息日等，顺延。
业绩比较基准变更日	管理人将在集合计划推广公告中公布本集合计划的业绩比较基准。在本集合计划运作期间，管理人可结合市场行情，对集合计划业绩比较基准予以调整，具体以管理人公告为准，原则上不频繁变动。公告当日为业绩比较基准变更日。
收益分配基准日	本集合计划收益分配基准日为本集合计划业绩比较基准变更日，如当年不存在业绩比较基准变更日，则管理人另行公告收益分配基准日进行收益分配。
业绩报酬计提日	本集合计划业绩报酬计提日为本集合计划收益分配基准日、委托人份额退出日和本集合计划终止清算日
封闭期:	本集合计划不设封闭期。
开放期:	存续期每个交易日开放参与和退出，委托人可以办理参与业务和退出业务，但每一笔赎回份额需满足锁定期满 12 个月（含）的条件后才可以预约申请退出。

锁定期:	指委托人持有的每一笔份额在一定时期内不能申请赎回的一段时期。
退出:	指委托人根据本集合资产管理计划规定的条件退出集合计划的行为。
预约退出日	委托人计划退出的前十个工作日(T-10日)。在预约退出日,管理人接收投资者退出本计划的申请。投资者应于T-10日下午4:30前按规定格式向管理人提出退出申请,投资人提出退出申请不符合上述时间要求的,该退出申请无效。
会计年度:	指公历每年1月1日起至当年12月31日为止的期间。
分级	本集合资产管理计划不分级。
集合计划账户:	指由集合计划登记结算机构为每一位集合计划的委托人建立的唯一的账户,记录其全部持有的由该登记结算机构办理登记结算的所有集合计划份额及其变动情况;每个委托人持有的集合计划份额以登记结算机构的记录为准。
集合计划交易账户:	指推广机构为集合计划的每一位委托人建立的账户,记录委托人通过该推广机构买卖所有集合计划份额的变动及结余情况。
集合资产管理计划资产或委托投资资产:	指依据有关法律、法规和委托人的意愿,委托人参与的本集合资产管理计划的资产。
集合资产管理计划业绩比较基准及实际收益:	本集合计划业绩比较基准仅供委托人参考,并不作为管理人向委托人分配本集合计划收益的承诺。委托人所能获得的最终收益以本集合计划实际收益为准,实际收益指集合计划利息收入、投资收益和其他收入扣除相关费用后的余额。
委托人集合资产管理计划账户:	指注册登记机构给委托人开立的用于记录委托人持有本集合资产管理计划份额情况的登记账户。
集合资产管理计划资产总值:	指集合资产管理计划通过发行计划份额方式募集资金,并依法进行有价证券交易等资本市场投资所形成的各类资产的价值总和。

集合资产管理计划资产净值：	指集合资产管理计划资产总值扣除负债后的净资产值。
集合资产管理计划份额净值：	指集合资产管理计划资产净值除以计划总份额。
集合资产管理计划份额面值：	指人民币 1.00 元。
集合资产管理计划资产估值：	指计算评估集合资产管理计划资产和负债的价值，以确定集合资产管理计划资产净值的过程。
不可抗力：	指本集合计划合同当事人不能预见、不能避免并不能克服的客观情况，包括但不限于战争、自然灾害、骚乱、火灾、突发性公共卫生事件、政府征用、没收、法律法规变化或其他突发事件、注册登记机构非正常的暂停或终止业务、证券交易所正常暂停或停止交易、由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误、有关会计政策变化等。

### 第三章 合同当事人

#### 一、委托人

签订《日信证券长安2号集合资产管理计划集合资产管理合同》的投资者即为本合同的委托人。

个人填写：

姓名：\_\_\_\_\_

证件类型：\_\_\_\_\_ 证件号码：\_\_\_\_\_

通信地址：\_\_\_\_\_ 邮政编码：\_\_\_\_\_

联系电话：\_\_\_\_\_ 移动电话：\_\_\_\_\_

电子信箱（必须填写）：\_\_\_\_\_

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：\_\_\_\_\_ 电子信箱（必须填写）：\_\_\_\_\_

其他：\_\_\_\_\_

#### 二、管理人

名称：国融证券股份有限公司（以下简称“国融证券”）

法定代表人：张智河

联系地址：北京市西城区闹市口大街1号长安兴融中心西楼11层

联系电话：010-83991537

传真：010-83991818

联系人：赵廷美

#### 三、托管人

名称：渤海银行股份有限公司

法定代表人：李伏安

注册地址：天津市河东区海河东路 218 号

邮政编码：30012

联系电话：022-58555979

传真：022-58314791

联系人：牛林

## 第四章 集合计划的基本情况

### 一、名称与类型

名称：日信证券长安 2 号集合资产管理计划

类型：固定收益类产品；私募产品，仅面向风险承受能力 C3 及以上等级的合格投资者进行推广

### 二、规模、投资范围、投资组合比例（含固定收益各类资产的配置比例）

#### （一）目标规模及人数限制

推广期及存续期规模上限均为 50 亿份，单个客户首次参与金额不低于 100 万元人民币，客户数不超过 200 户。如因监管条款变动，适合本集合计划的首次认购起点金额发生改变，变更后的首次参与起点金额将以管理人公告为准。

#### （二）投资范围和投资组合比例（含固定收益各类资产的配置比例）

本集合计划具体投资范围和投资组合比例如下：

##### 1、投资范围

债券：在银行间市场和交易所市场交易的国债、央行票据、各类金融债（含政策性金融债、次级债、混合资本债、二级资本债、证券公司债、证券公司次级债券、非银行金融机构债等）、地方政府债、企业债、公司债（包括在证券交易所及机构间私募产品报价与服务系统发行的非公开发行公司债等）、项目收益债、可转换债券、可交换债券、可分离交易债券、短期融资券、超短期融资券、中期票据、资产支持证券、资产支持受益凭证、永续债、同业存单以及非公开定向债务融资工具（PPN）以及其他债券。

货币市场工具类：包括现金、货币市场基金、银行存款、债券回购。

其他类产品：债券型基金、分级基金 A 级、混合类基金、指数类基金、券商收益凭证、商业银行理财计划等。

金融衍生工具：国债期货（仅限于套期保值）。

如投资超出上述投资范围的其他金融产品，须各方协商一致并按照合同变更流程对产品合同进行修改。

## 2、投资比例和固定收益各类资产的配置比例

债券、现金、银行存款、货币市场基金、债券逆回购投资等固定收益类资产合计占资产总值的 80-100%

国债期货（仅限于套期保值）、债券型基金、分级基金 A 级、混合类基金、指数类基金、券商收益凭证、商业银行理财计划等合计占资产总值的 0-20%。

本集合计划投资于存款、债券等债权类资产的比例不低于 80%，非因管理人主观因素导致突破比例限制的，管理人应当在流动性受限资产可出售、可转让或者恢复交易的 15 个交易日内调整至符合前述比例。

本产品的总资产不得超过该产品净资产的 200%。

本集合计划投资组合在固定收益各类资产上的配置比例，将严格遵守相关法律法规的规定：

- (1) 短期融资券的债项评级为 A-1 级；
- (2) 信用债的主体或者债项评级为 AA（含）及以上；
- (3) 投资于单只债券的数量不超过该债券发行总额的 20%且不得超过计划净值的 40%；
- (4) 债券正回购：融入资金余额不超过计划资产净值的 40%；
- (5) 法律法规、中国证监会以及本合同规定的其他投资限制。

本集合计划自成立之日或投资范围变更起三个月内使集合资产管理计划的投资组合比例符合资产组合设计要求。

委托人在此同意授权管理人可以将集合计划的资产投资于管理人及与管理人有关联关系的公司发行的证券或承销期内承销的证券。在发生上述所列投资证券事项时，管理人按照法律法规及中国证监会的有关规定，应当将交易结果告知托管人，同时向证券交易所报告，通过资产管理季度报告向委托人披露。

如因证券市场波动、证券发行人合并、或产品开放申赎等非管理人主观因素导致本集合计划在上述（1）-（5）固定收益各类资产上的配置比例被动超标，管理人应在超标发生之日起在具备交易条件的 30 个交易日内将配置比例调整至许可范围内。如遇限售期等原因导致交易条件不具备，则上述期限自动顺延，具体顺延时间由管理人确定。

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

### 三、管理期限

本集合计划不设固定存续期限，若出现集合资产管理合同约定的终止情形时，终止本集合计划，并实施清算。

### 四、封闭期、开放期、锁定期：

(一) 封闭期：本集合计划不设封闭期。

(二) 开放期：存续期每个交易日开放参与和退出，委托人可以办理参与业务和退出业务，但每一笔赎回份额需满足锁定期满 12 个月（含）的条件后才可以预约申请退出。

(三) 锁定期：本集合计划锁定期为每一笔份额确认后的 12 个月（含）。自份额确认之日起每满 12 个月之对应日为锁定期到期日，如遇节假日顺延至下一交易日。

### 五、集合计划每份额面值

1.00 元。

### 六、初次参与本集合计划的最低金额

首次参与的最低金额为人民币 100 万元。在推广期或开放期追加参与资金的最低金额为人民币 10,000 元。如因监管条款变动，适合本集合计划的首次认购起点金额发生改变，变更后的首次参与起点金额将以管理人公告为准。

### 七、集合计划的风险收益特征及适合推广对象

本集合计划属于 R3 风险等级的证券投资产品，适合推广对象为风险承受能力 C3 及以上等级的合格投资者。合格投资者的标准详见本合同第 5 章集合计划的参与和退出。

### 八、推广机构及推广方式

(一) 推广机构：国融证券股份有限公司以及中国证监会认可的与管理人签署相关协议的其他推广机构。

(二) 推广方式：

管理人、推广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置备于推广机构营业场所。本集合计划应当面向合格投资者非公开推广，合格投资

者累计不得超过 200 人。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，引导客户审慎做出投资决定。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、中国证监会电子化信息披露平台或者中国证监会认可的其他信息披露平台，客观准确披露集合计划备案信息、风险收益特征、投诉电话等，使客户详尽了解本集合计划的特性、风险等情况及客户的权利、义务，但不得向合格投资者之外的单位和个人募集资金，不得通过报刊、电台、电视台、互联网等公众传播媒体或者讲座、报告会、分析会等方式向不特定对象宣传推介。

#### 九、本集合计划的各项费用

(一) 参与费用：0%；

(二) 退出费用：0%（违约退出情形下的退出费率由本合同另行约定）；

(三) 管理费：本产品管理费包含固定管理费和业绩报酬：

1、固定管理费率为 0.60%/年；

2、业绩报酬的计算方式：详见本合同第 12 章集合计划的费用。

(四) 托管费：0.03%/年。

(五) 其他费用：证券交易费用、审计费、信息披露费、律师费、银行结算费用、开户费、转托管费等交易费详见本合同第十二章集合计划的费用之约定。

## 第五章 集合计划的参与和退出

### 一、集合计划的参与

#### (一) 参与的时间

##### 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

存续期，本集合计划成立日起，每个工作日为开放申购日，委托人可以办理参与业务。

#### (二) 参与原则

##### 1、投资者资格要求

适合推广对象为风险承受能力 C3 及以上等级的合格投资者。

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。

如因监管条款变动，适合本集合计划的合格投资者认定条件发生改变，变更后的合格投资者认定条件将以管理人公告为准。

2、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。

3、本集合计划采用电子签名合同的方式签署，委托人在各销售网点，签署电子合同。电子合同在管理人、托管人、委托人三方完成签署，且委托人按合同约定将参与资金划入指定账户并经注册登记机构确认有效后成立。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。委托人保证其所提供的信息及资料真实、准

确、完整，否则应当承担由此造成的一切后果。

4、“金额参与”原则，即参与以金额申请。本集合计划的单个委托人首次参与最低金额为 100 万元人民币，追加参与的最低金额为人民币 1 万元。

5、本集合计划在推广期参与采用“已知价”原则，即以集合计划面值参与。

6、本集合计划在开放申购日参与采用“未知价”原则，即以参与日集合计划的单位净值参与。

7、委托人的参与资金在集合计划成立之前所产生的利息折成集合计划份额的，该份额归委托人所有，参与资金的利息以注册登记机构的记录结果为准。

8、委托人在开放申购日内可以多次参与本集合计划，已经受理的参与申请只能在当日交易时间结束之前撤销。

9、本集合计划在存续期内，若开放日当日的参与申请全部确认后使得本集合计划的总份额超过 50 亿份或客户数超过 200 户的，则对该开放日有效参与申请采用“金额优先+金额同等情况下时间优先”的原则给予部分确认，未确认部分的参与款项退还给委托人。

### （三）参与程序

#### 1、参与程序和确认

(1) 投资者按推广机构指定营业网点的具体安排，在推广期/开放期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，构成本合同的有效组成部分；

(4) 投资者参与申请确认后，其参与申请和参与资金不得撤销；

(5) 投资者存续期参与的，投资者于 T 日提交参与申请后，可以 T+2 日后在办理参与的营业网点查询参与确认情况。投资者推广期参与的，可于计划成立后 2 个工作日内到办理参与的营业网点查询参与确认情况。

#### 2、参与的注册登记

投资者参与成功后，注册登记机构在 T+1 日为委托人登记权益并办理注册登记手

续。

### 3、暂停参与的情形

如出现如下情形，集合计划管理人可以拒绝或暂停集合计划委托人的参与申请：

- (1) 战争、自然灾害等不可抗力的原因导致集合计划无法正常运行；
  - (2) 管理人认为本集合计划出现或可能出现超额募集情况或客户数超过 200 户等不符合本合同约定；
  - (3) 证券交易场所在交易时间非正常停市，导致无法计算当日的集合计划资产净值；
  - (4) 管理人认为集合计划资产规模过大，可能对集合计划业绩产生负面影响，从而损害现有集合计划委托人的利益；
  - (5) 集合计划管理人、集合计划托管人或注册登记机构的技术保障或人员支持等不充分；
  - (6) 推广机构对委托人资金来源表示疑虑，委托人不能提供充分证明的；
  - (7) 集合计划管理人认为会有损于现有集合计划委托人利益；
  - (8) 法律法规规定或中国证监会认定的其它可暂停参与的情形。
- 发生上述(1)到(5)、(7)、(8)项暂停参与情形时，集合计划管理人应当在管理人网站公告委托人。

### (四) 参与费及参与份额的计算

#### 1、参与费率

本集合计划参与费用为 0。

#### 2、参与份额的计算方法：

(1) 推广期参与份额的计算： $\text{参与份额} = (\text{参与金额} + \text{推广期利息}) / \text{集合计划份额面值}$ 。参与份数保留小数点后两位，小数点后第三位四舍五入。

#### (2) 存续期参与份额的计算：

$\text{参与份额} = \text{参与金额} / \text{集合计划份额净值}$ 。

参与份数保留小数点后两位，小数点后第三位四舍五入。

本集合计划管理人在存续期内可使用“金额优先+金额同等情况下时间优先”方法对集合计划参与总规模实行限量控制。

## （五）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，参与资金的利息以注册登记机构的记录结果为准。

## 二、集合计划的退出

本计划实施预约退出机制。

### （一）预约退出

本集合计划存续期内，管理人按照委托人提交的预约退出申请，为其办理份额退出。

本计划预约退出日为委托人计划退出的前十个工作日(T-10 日)。在预约退出日，管理人接收投资者退出本计划的申请。投资者应于 T-10 日下午 4:30 前按规定格式向管理人提出退出申请且申请退出的份额需要持有期满 12 个月，投资人提出退出申请不符合上述时间及持有期限要求的，该退出申请无效。

### （二）退出的原则

- 1、“未知价”原则，以退出申请受理日（T 日）的份额单位净值进行退出金额计算；
- 2、“份额退出”原则，即退出以份额申请；
- 3、“先进先出”原则，即对委托人在该推广机构参与的集合计划份额进行退出处理时，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、当日的退出申请可以且只能在当日交易时间结束之前撤销；
- 5、除非巨额退出，退出一般不受限制；
- 6、若某笔退出导致该委托人在某推广机构持有的份额少于 100 万份，则管理人有权要求该委托人余额部分一起退出。

### （三）退出的程序和确认

#### 1、退出申请的提出

预约制退出，委托人应于预约退出日下午 4:30 前按规定格式向管理人提出退出申请。

#### 2、退出申请的确认

管理人及注册登记机构在退出日的下一工作日（T+1 日）对退出交易的有效性进

行确认，委托人通常可在 T+2 日到网点查询退出的确认情况。

#### （四）退出款项划付

若注册登记机构确认委托人退出申请成功，退出款项于 T+2 日内从托管账户中划出。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。

#### （五）退出费及退出份额的计算

##### 1、退出费用及收取方式

本集合计划无退出费用。（违约退出情形下的退出费率和退出费用计算方式由本合同另行约定）

##### 2、退出金额的计算方法

本集合计划退出时以退出申请受理日（T 日）对应份额的份额净值作为计价基准进行退出金额计算。退出金额的计算公式如下：

退出金额 = T 日对应份额的份额净值 × 退出份额 - 业绩报酬（如有，详见本合同第 12 章集合计划的费用。）

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。

#### （六）单个委托人大额退出的认定、申请和处理方式

本集合计划无单个委托人大额退出安排。

#### （七）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）超过上一工作日集合计划总份额数的 15% 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集合计划总份额 15% 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。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，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。

暂停退出：连续两个或以上开放日发生巨额退出的，管理人可以暂停接受退出申请，已经接受的退出申请可以延缓支付退出款项。暂停和延缓期限不得超过 20 个工作日，但遇不可抗力等特殊情况下不受上述时限的限制。

管理人可以根据集合计划运作的实际情况在不损害委托人利益的前提下更改上述退出安排。本集合计划退出安排的更改将遵循本合同变更的相关程序。

### 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。

#### （八）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行；
- 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、法律、行政法规和中国证监会认定的其他情形或其他在说明书、资产管理合同中已载明且中国证监会无异议的特殊情形。

#### （九）违约退出的情形及处理

##### 1、违约退出的认定

委托人如在本集合计划的存续期间退出申请份额未满 12 个月锁定期退出本集合计划，为委托人违约，属于违约退出。

##### 2、违约退出的处理

###### （1）违约退出的程序

委托人违约退出的，需向管理人提供书面违约退出申请文件。管理人审核同意后，由本计划注册登记机构直接办理或由推广机构代为办理违约退出申请。委托人违约退

出的具体程序以及办理违约退出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》和《说明书》的前提下，以管理人的具体规定为准。委托人违约退出的具体份额以注册登记机构的确认结果为准。

#### (2) 违约退出的价格

违约退出的价格为管理人审核同意后、注册登记机构或推广机构正式受理违约退出申请当日的计划份额净值。

#### (3) 业绩报酬的计提

详见本合同第 12 章集合计划的费用。

#### (4) 违约退出费用的计算

委托人违约退出的，应支付净退出金额(扣除应计提的业绩报酬后的实际退出金额)的 1%作为违约退出费用，违约退出费用全额归入集合计划财产，于违约退出时一次性支付。

违约退出费用的具体计算公式如下：

违约退出费用=(违约退出的份额×违约退出的价格—应计提的业绩报酬(如有))

× 违约退出费率

违约退出时，委托人实际取得的退出金额的计算公式如下：

实际取得的退出金额=违约退出的份额×违约退出的价格—应计提的业绩报酬(如有)—违约退出费用

上述涉及违约退出金额的计算结果均保留到小数点后两位，小数点后第三位四舍五入，由此产生的差额部分计入集合计划资产损益。

### 3、违约退出的原则

(1) 不得违反法律、行政法规和中国证券监督管理委员会的相关规定；

(2) 不得违反集合资产管理计划合同中的相关约定；

(3) 不得损害其他份额持有人的利益，不得损害剩余的集合计划的资产权益；

(4) 违约退出业务必须经集合资产管理计划的持有人申请，经管理人内部审核通过后方可予以办理。管理人经审核后认为违约退出业务可能存在违反法律法规、监管政策以及本合同约定的，有权拒绝办理。

4、本合同关于违约退出条款的约定不代表委托人退出申请份额一定可以未满 12

个月的锁定期退出本集合计划，在违约退出违背法律法规、监管政策和本合同约定、损害其他份额持有人的利益、损害剩余集合计划的资产权益以及其他管理人认为不适宜办理违约退出的情形下，管理人均有权拒绝办理委托人的违约退出申请。

### 三、提前终止条款

集合资产管理计划管理人可提前终止本集合计划。本集合计划管理人实施提前终止本集合计划的原因包括但不限于：国家金融政策出现重大调整；证券市场、投资标的出现重大变化并影响到本集合计划的正常运作以及本集合计划管理人规定的其他原因。管理人应于提前终止前一日公告。

## 第六章 管理人自有资金参与集合计划

### 一、自有资金参与、退出的条件、程序

管理人可以以自有资金参与本集合计划，自有资金参与本集合计划的持有期限不低于 6 个月。自有资金参与、退出的条件和程序同一般委托人。

### 二、推广期和存续期参与集合计划的金额和比例

管理人自有资金参与本集合计划的金额具体以管理人公告为准，但自有资金参与本集合计划份额比例不得超过本计划总份额的 15%。

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，管理人应在 5 个工作日内办理超出份额的退出程序。

为解决流动性风险，在不存在利益冲突并遵守合同约定的前提下，管理人参与的自有资金参与、退出不受上述比例、持有期等限制。

### 三、收益分配和责任承担方式

管理人自有资金参与份额与其他委托人持有计划份额享有同等参与收益分配的权利。

管理人自有资金参与份额不对其他委托人承担保本保收益责任。

### 四、风险揭示和信息披露

本集合计划管理人以自有资金参与本集合计划，将同一般委托人自行承担因投资本集合计划带来的投资风险。

管理人自有资金参与、退出时应当提前 5 个工作日通知托管人并以临时公告的形式通过管理人的网站（[www.grzq.com](http://www.grzq.com)）、推广代销机构网站或网点、或其他途径和方式及时向客户披露。

## 第七章 集合计划的分级

本集合计划不设分级安排。

## 第八章 集合计划的成立

### 一、集合计划成立的条件和日期

#### (一) 成立的条件

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）以上且不超过 200 人，并经管理人聘请的具有证券相关业务资格的会计师事务所对集合计划进行验资并出具验资报告后，管理人宣布本集合计划成立。

#### (二) 集合计划的成立时间

本集合计划成立的时间为计划管理人根据《管理办法》及相关法规规定发布集合计划成立公告的日期。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募集专户，不得动用。

### 二、集合计划设立失败

集合计划推广期结束，发生下列情形之一的，集合计划设立失败，管理人承担集合计划的全部推广费用，并将已认购资金在推广期结束后 30 个工作日内退还集合计划委托人，认购资金产生的利息自推广期结束之日起至下一个结息日后的五个工作日内退还集合计划委托人，各方互不承担其他责任。利息金额以本集合计划注册登记机构的记录为准。

(一) 未满足集合计划成立条件；

(二) 推广期内发生使本集合计划无法设立的不可抗力事件。

### 三、集合计划开始运作的条件和日期

#### (一) 条件

自集合计划宣布成立即符合开始运作的条件。

#### (二) 日期

本集合计划自成立之日起开始运作。

#### 四、集合计划资产的管理方式和管理权限

##### (一) 管理方式

本集合计划资产由管理人管理并由托管人托管，并独立于管理人及托管人的资产及其管理、托管的其他资产。

##### (二) 管理权限

本集合计划由管理人管理。

## 第九章 集合计划账户与资产

### 一、集合计划账户的开立

托管人为本集合计划开立资金账户及其他相关账户。资金账户名称应当为“日信证券长安 2 号集合资产管理计划”，证券账户名称：“日信证券-渤海银行股份有限公司-长安 2 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]

资金账户（即托管账户）信息如下：

户名：日信证券长安 2 号集合资产管理计划

账号：3000806052000600

开户行：渤海银行北京分行营业部

管理人委托中国证券登记结算有限责任公司担任本集合计划的注册登记机构，并承担相应受托责任。注册登记机构为委托人开立集合计划账户，用于记录委托人持有的本集合资产管理计划份额。

### 二、集合计划资产的构成

（一）银行存款和应计利息；

（二）债券类产品、货币基金、债券基金等集合计划投资所形成的各类有价证券及其分红、收益或应收利息、应收红利。具体种类由投资范围约定；

（三）结算备付金及其应计利息；

（四）应收证券交易清算款；

（五）应收参与款；

（六）交易保证金及其应计利息；

（七）其他应收的款项、根据有关规定缴纳的保证金等其他资产。

### 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、托管人及注册登记机构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不得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》、《实施细则》、《集合资产管理合同》、《集合计划说明书》及其他有关规定处分外，集合计划资产不得被处分。

## 第十章 集合计划资产的托管

本集合计划资产以交付商业银行托管方式托管，托管银行为渤海银行股份有限公司，并签署托管协议。

委托人签署本合同的行为本身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的了解，并接受本合同约定的托管职责和范围。

托管人的托管职责以托管协议的约定为准，如本合同、集合计划说明书与托管协议冲突，相关约定以托管协议为准。

## 第十一章 集合计划估值

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、集合计划各项应收款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

集合计划单位净值指集合计划资产净值除以集合计划的份额总数所得的数值。

### （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

集合计划所拥有的债券、基金和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产。

### （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。对于债券类投资品种的估值应依据中国证券业协会基金估值工作小组的指导意见及指导价格估值。

#### 1、债券估值方法

(1) 同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

(2) 在证券交易所市场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；对于无法取到收盘价的交易所债券，按照成本价估值。

(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；对于无法取到收盘价的交易所债券，按照成本价估值。

(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) 在对银行间市场的固定收益品种估值时，应主要依据第三方估值机构公布的收益率曲线及估值价格。

(6) 债券计息资产按照约定利率在持有期内逐日计提应收利息，债券计息方式按税前计息。

## 2、投资证券投资基金的估值方法

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

(2) 持有的场外基金（包括封闭式基金、上市开放式基金（LOF）等），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) 持有的交易所基金（包括封闭式基金、上市开放式基金（LOF）等），按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考监管机构或行业协会有关规定，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值；

(4) 在任何情况下，资产管理人如采用本项第(1)–(3)项规定的方法对委托财产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果资产管理人认为按本项第(1)–(3)项规定的方法对委托财产进行估值不能客观反映其公允价值的，资产管理人可根据具体情况，并与资产托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

### 3、存款和债券回购的估值方法

持有的银行存款和债券回购以本金列示，按协议或实际利率逐日确认利息收入。如提前支取或利率发生变化，管理人及时进行账务调整。

### 4、国债期货估值方法

国债期货按估值日的结算价估值；估值日无结算价的，以最近交易日的结算价估值。

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。对于上述估值方法未列明的新增投资品种，由管理人与托管人协商一致后进行估值。

如有新增事项或变更事项，按国家有关最新规定估值。

## (八) 估值程序

集合计划的日常估值由管理人进行，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，将估值结果加盖业务章后以书面形式报送托管人，集合计划托管人进行复核，托管人接收数据的邮箱为：BHTGDZZX@CBHB.COM.CN。托管人复核无误后签章返回给管理人。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，由管理人承担责任，托管人不承担责任。

由于证券交易所、注册登记机构发送的数据错误或其他不可抗力等原因造成估值错误的，管理人和托管人免于承担责任。

## (九) 估值错误与遗漏的处理方式：

管理人和托管人应采取必要、适当、合理的措施确保资产估值的准确性和及时性。当份额计价出现错误时，管理人应当立即予以纠正，并采取合理的措施防止损失进一

步扩大，托管人应给予必要的配合。

因份额净值错误给投资人造成损失的，合同各方应当按照各自过错程度承担赔偿责任，赔偿范围以投资人直接经济损失为限。

1、资产管理人计算的委托资产净值已由资产托管人复核确认，但因资产估值错误给资产委托人造成损失的，由资产管理人与资产托管人按照管理费和托管费的比例各自承担相应的责任。

2、如资产管理人和资产托管人对委托资产净值的计算结果，虽然多次重新计算和核对尚不能达成一致时，为避免不能按时披露委托资产净值的情形，以资产管理人的计算结果对外披露，由此给资产委托人和委托财产造成的损失，资产托管人予以免责。

3、由于一方当事人提供的信息错误，另一方当事人在采取了必要合理的措施后仍不能发现该错误，进而导致委托资产净值计算错误造成资产委托人的损失，以及由此造成以后交易日委托资产净值计算顺延错误而引起的资产委托人的损失，由提供错误信息的当事人一方负责赔偿。

4、由于证券交易所及其注册登记公司发送的数据错误，或由于其他不可抗力原因，资产管理人和资产托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误的，由此造成的委托财产估值错误，资产管理人和资产托管人可以免除赔偿责任。但资产管理人和资产托管人应当积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。

前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，按其规定处理。

#### （十）差错处理

##### 1、差错类型

本计划运作过程中，如果由于管理人、托管人、注册登记机构、或代理销售机构、或委托人自身的过错造成差错，导致其他当事人遭受损失的，过错的责任人应当对由于该差错遭受损失的当事人（“受损方”）按下述“差错处理原则”给予赔偿并承担赔偿责任。

上述差错的主要类型包括但不限于：资料备案差错、数据传输差错、数据计算差错、系统故障差错、下达指令差错等；对于因技术原因引起的差错，若因同行业现有

技术水平无法预见、无法避免、无法抗拒，则属不可抗力，按照下述规定执行。

由于不可抗力原因造成委托人的交易资料灭失或被错误处理或造成其他差错，因不可抗力原因出现差错的当事人不对其他当事人承担赔偿责任，但因该差错取得不当得利的当事人仍应负有返还不当得利的义务。

## 2、差错处理原则

(1) 差错已发生，但尚未给当事人造成损失时，差错责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正差错发生的费用由差错责任方承担；由于差错责任方未及时更正已产生的差错，给当事人造成损失的由差错责任方承担；若差错责任方已经积极协调，并且有协助义务的当事人有足够的时间进行更正而未更正，则差错责任方与有协助义务的当事人应当分别承担相应的责任，但不限于赔偿、责任声明等。差错责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认，确保差错已得到更正；

(2) 差错的责任方对可能导致有关当事人的直接经济损失负责，不对间接损失负责，并且仅对差错的有关直接当事人负责，不对第三方负责；

(3) 因差错而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但差错责任方仍应对差错负责，如果由于获得不当得利的当事人不返还或不全部返还不当得利造成其他当事人的利益损失，则差错责任方应赔偿受损方的损失，并在其支付的赔偿金额的范围内对获得不当得利的当事人享有要求返还不当得利的权利及要求获得不当得利的当事人承担因不返还或不全部返还不当得利造成的损失；如果获得不当得利的当事人已经将此部分不当得利返还给受损方，则受损方应当将其已经获得的赔偿额加上已经获得的不当得利返还的总和超过其实际损失的差额部分支付给差错责任方；

(4) 差错调整采用尽量恢复至假设未发生差错的正确情形的方式；

(5) 差错责任方拒绝进行赔偿时，如果因管理人过错造成集合资产管理计划财产损失时，托管人应为集合资产管理计划的利益向管理人追偿，如果因托管人过错造成集合资产管理计划财产损失时，管理人应为集合资产管理计划的利益向托管人追偿。

除管理人和托管人之外的第三方造成集合资产管理计划资产的损失，并拒绝进行赔偿时，由管理人负责向差错方追偿，托管人应当给予必要的配合和协助；

(6) 如果出现差错的当事人未按规定对受损方进行赔偿，并且依据法律法规、本合同或其他规定，管理人自行或依据法院判决、仲裁裁决对受损方承担了赔偿责任，

则管理人有权向出现过错的当事人进行追索，并有权要求其赔偿或补偿由此发生的费用和遭受的损失，托管人应当给予必要的配合和协助：

(7) 按法律法规规定的其他原则处理差错。

### 3、差错处理程序

差错被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

(1) 查明差错发生的原因，列明所有的当事人，并根据差错发生的原因确定差错的责任方；

(2) 根据差错处理原则或当事人协商的方法对因差错造成的损失进行评估；

(3) 根据差错处理原则或当事人协商的方法由差错的责任方进行更正和赔偿损失；

(4) 根据差错处理的方法，需要修改注册登记机构的交易数据的，由注册登记机构进行更正，并就差错的更正向有关当事人进行说明。

#### (十一) 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。

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。

#### (十一) 暂停披露净值的情形

1、与本计划投资有关的证券交易场所遇法定节假日或因其他原因停市时。

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

#### (十二) 特殊情形的处理

由于本计划所投资的各个市场及其登记结算机构发送的数据错误，或由于其他不

可抗力原因，管理人和托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误的或即使发现错误但因前述原因无法纠正，由此造成的集合资产管理计划资产计价错误，管理人和托管人免除赔偿责任。但管理人和托管人应当积极采取必要的措施消除或减少由此造成的影响。

由于注册登记机构发送的数据有误，处理方法等同于交易数据错误的处理方法。由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误，有关会计制度变化、管理人或托管人托管业务系统出现重大故障或由于其他不可抗力原因，管理人和托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误或即使发现错误但因前述原因无法纠正而造成的份额净值计算错误，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消除或减少由此造成的影响。

## 第十二章 集合计划的费用

### 一、集合计划费用计提方法、计提标准和支付方式

#### (一) 管理费

本集合计划应向管理人支付管理费，管理费包括固定管理费和业绩报酬。

##### 1、固定管理费

固定管理费以前一日的集合计划资产净值为基数，按 0.6%/年的固定管理费率逐日核算，按季支付。计算方法如下：

每日应计提的固定管理费金额= $E \times 0.6\% / 365$ ；

E 为前一日集合计划资产净值。

管理人的固定管理费由管理人于每个固定管理费核算日向托管人发送划款指令，由托管人依据管理人划款指令从本集合计划资产中支付，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。如第一个固定管理费核算日距集合计划成立之日不足三个月，则当期不进行费用划付，累计至下一个固定管理费核算日一并支付。

##### 2、业绩报酬

###### (1) 业绩报酬提取原则：

1) 按单一份额业绩报酬核算期内计算的年化收益率参考业绩比较基准计提业绩报酬。

2) 符合业绩报酬计提条件时，在本集合计划收益分配基准日、委托人份额退出日和本集合计划终止清算日计提业绩报酬。

3) 集合计划收益分配基准日和集合计划终止清算日符合业绩报酬计提条件的，管理人先计提业绩报酬，再向委托人分配收益或剩余资金。在委托人份额退出日符合业绩报酬计提条件的，管理人应先将委托人申请退出的份额所对应的业绩报酬从退出金额中扣除后，再向委托人分配退出款。

###### (2) 业绩报酬的计提方式

本集合计划业绩报酬计提日为本集合计划收益分配基准日、委托人份额退出日和本集合计划终止清算日，本集合计划将针对单一份额分别确认其业绩报酬核算期。业

绩报酬核算期是指针对单一份额在前一个业绩报酬计提日或单一份额确认日孰后（以下简称：上一业绩报酬计提日；如上一业绩报酬计提日不存在，则为本集合计划成立日或委托人申购日）至本次业绩报酬计提日期间。

管理人根据单个业绩报酬核算期的单一份额实际年化收益率（R）情况计提业绩报酬（H），委托人所持有份额以认（申）购时间的不同分别进行业绩报酬的核算和计提，具体计提规则如下：

实际年化收益率（R）	计提比例	业绩报酬（H）计提规则
$R \leq s$	0	$H=0$
$R > s$	80%	$H=(R-s)*80%*C*N/365$

$$R = (P_1 - P_0) / P_0 * (365/N) * 100\%$$

其中：

R为单个业绩报酬核算期的单一份额实际年化收益率；

$P_1$ 为业绩报酬计提日的集合计划单位累计净值；

$P_0$ 为上一业绩报酬计提日（若无上一业绩报酬计提日的，则为集合计划成立日或委托人申购日）集合计划的单位累计净值；

N为单个业绩报酬核算期内单一份额持有期的天数；

C=上一业绩报酬计提日产品单位净值（若无上一业绩报酬计提日，则为认（申）购时的集合计划单位净值）\*确认份额数；

s为业绩比较基准。管理人将在集合计划推广公告中公布本集合计划的业绩比较基准。在本集合计划运作期间，管理人可结合市场行情，对集合计划业绩比较基准予以调整，具体以管理人公告为准，原则上不频繁变动。公告当日为业绩比较基准变更日，变更后的业绩比较基准自变更公告后的下一个工作日（如遇节假日顺延）开始生效。

本集合计划业绩比较基准，仅作为管理人提取业绩报酬的依据，并非管理人向委托人作出保本保收益的承诺，若本产品出现赎回困难，管理人不得以任何形式垫付。在本集合计划资产出现极端损失的情况下，委托人可能面临无法取得收益乃至无法取得投资本金的风险。

业绩报酬计提日为收益分配基准日和本集合计划终止清算日的，管理人的业绩报酬为全部集合计划份额根据上述约定计算的业绩报酬之和；业绩报酬计提日为委托人

份额退出日的，管理人的业绩报酬为全部退出份额根据上述约定计算的业绩报酬之和。

## （二）托管费

本集合计划应给付托管人托管费，以前一日的集合计划资产净值为基数，按0.03%/年的费率逐日核算，按季支付。计算方法如下：

每日应计提的托管费金额=  $E \times 0.03\% / 365$ ；

E 为前一日集合计划资产净值。

托管人的托管费由管理人于每个托管费核算日向托管人发送划款指令，由托管人依据管理人划款指令从本集合计划资产中支付，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。如第一个托管费核算日距集合计划成立之日不足三个月，则当期不进行费用划付，累计至下一个托管费核算日一并支付。

上述托管费为优惠后最终价格，自本集合计划运作起执行。（优惠前的年托管费率为：0.1%）

与托管费有关的例外条款或限制性条款：无。

托管费应划入以下托管人指定银行账户：

开户银行：渤海银行股份有限公司

账户：托管业务收入过渡户

户名：0008000001262990011550

## （三）与本集合计划相关的审计费、信息披露费和律师费

在存续期间发生的集合计划审计费、信息披露费和律师费，在合理期间内摊销计入集合计划。

本集合计划的年度审计费、信息披露费和律师费，在相应会计期间按直线法在每个自然日内平均摊销。

## （四）按照国家有关规定可以列入的其他费用

银行结算费用、开户费、转托管费、购买债券类产品的交易费用、注册与过户登记人收取的相关费用等集合计划运营过程中发生的相关费用。

1、银行结算费用，一次计入集合计划费用；

2、银行间市场账户维护费，按银行间市场规定的金额，在相应的会计期间一次性

计入费用；

3、开户费、银行账户维护费、银行间交易费、转托管费在发生时一次计入集合计划费用；

4、与集合计划运营有关的其他费用，如果金额较小，或者无法对应到相应会计期间，可以一次进入集合计划费用；如果金额较大，并且可以对应到相应会计期间，应在该会计期间内按直线法摊销。

上述计划费用中第（三）、（四）项费用由管理人根据有关法律法规及相应协议的规定，按费用实际支出金额支付。集合计划发生的银行汇划费和其它银行手续费，按实际发生额由托管人从托管账户中直接扣除，无须由管理人发出划款指令。于银行间及交易所市场进行交易产生的费用由托管人根据《自动支付中央国债登记结算有限责任公司费用授权书》/《自动支付上海清算所费用授权书》/《自动支付证券交易所开户费用授权书》从托管账户进行划付。

## 二、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，不在计划资产中列支。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列入集合计划费用。

其他不列入集合计划费用的具体项目依据中国证监会有关规定执行。

## 三、税收支出

本集合计划运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律法规执行。

鉴于资产管理人为本计划的利益投资、运营委托财产过程中，可能因法律法规、税收政策的要求就增值税应税行为，成为增值税纳税人，并承担相应纳税义务。因此，本集合计划运营过程中由于上述原因发生的增值税及相关附加（包括但不限于教育费、城建税等）等税负，仍由本计划委托财产承担，届时资产管理人与资产托管人可以通过本计划托管账户直接缴付，或划付至资产管理人账户并由资产管理人依据税务部门要求完成税款的申报及缴纳。

## 四、管理费和托管费的费用调整

集合计划管理人和托管人可协商调低集合计划管理费和托管费。管理人必须于新

费率开始实施前3个工作日在指定网站上公告。

## 第十三章 收益与分配

### 一、收益的构成

本集合计划收益指集合计划利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额，集合计划已实现收益指集合计划利润减去公允价值变动收益后的余额。

### 二、可供分配利润

可供分配利润指截至收益分配基准日（即可供分配利润计算截至日）资产负债表中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

各方一致同意实施收益分配时应遵循以下原则：

- （一）每份集合计划份额享有同等收益分配权。
- （二）本集合计划采用现金分红的方式分配收益。

1、如单一份额在该业绩报酬核算期亏损，则需要进行份额缩减，使得份额净值为面值 1.00 元；

2、如单一份额在该业绩报酬核算期内虽有收益但不足业绩比较基准的，则按实际收益率进行收益分配，分配完毕之后调整份额净值为面值 1.00 元；

3、如单一份额在该业绩报酬核算期内收益大于业绩比较基准，则按业绩比较基准分配收益，管理人提取超额部分的 80%作为业绩报酬，余下 20%归份额持有委托人享有，分配完毕之后调整份额净值为面值 1.00 元。

（三）当日申购的集合计划份额自下一个工作日起享有集合计划的分配权益；当日退出的集合计划份额自下一工作日起，不享有集合计划的分配权益。

（四）法律、法规或监管机关另有规定的，从其规定。

### 四、收益分配时间

在符合上述原则和具体收益分配条件的情况下，每年收益分配的次数原则上不少于 1 次。如当年不存在业绩比较基准变更日，收益分配基准日和收益分配日由管理人另行公告。

## 五、收益分配方案

收益分配方案须载明收益范围、净收益、分配对象、分配原则、分配时间、收益分配基准日、分配数额及比例、分配方式等内容。收益分配方案由管理人负责制定，方案的确定需要托管人复核（托管人的复核限于对计划应予分配总额的复核，对单一委托人具体收益不承担复核职责）。

## 六、收益分配对象

分红权益登记日所有参与本集合计划的委托人。

## 七、收益分配中发生的费用

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。

## 第十四章 投资理念与投资策略

### 一、投资目标

本集合计划通过对宏观经济增长、通货膨胀、利率走势和货币政策四个方面的分析和预测，确定经济变量的变动对不同券种收益率、信用趋势和风险的潜在影响。基于各类券种对利率、通胀的反应，制定有效的投资策略，在控制利率风险、信用风险以及流动性风险的基础上，主动构建及调整固定收益投资组合，力争获取平稳收益。

### 二、投资理念

基于对市场和基本面的深刻理解，构建由固定收益类证券组成的现货投资组合，力争实现资产净值的增长，同时兼顾资产的安全性。

### 三、投资策略

#### （一）债券投资策略：

#### 1、久期偏离策略

基于对未来利率水平的预测，对组合的期限和品种进行合理配置，将市场利率变化对于债券组合的影响控制在一定范围内。在预期利率进入上升周期时段，通过缩短组合久期来达到降利率风险的目的。在预期利率进入下降周期时段，通过拉长组合久期来达到增厚收益的目的。

#### 2、收益率曲线配置策略

在组合剩余期限确定的基础上，根据对收益率曲线形状变化的预测，在长期、中期和短期债券间进行配置，以从长、中、短期债券的相对价格变化中获利。

#### 3、类别选择策略

在固定收益品种板块配置时，将依据流动性管理的要求，来确定不同的类属配置。具体表现为：信用债板块收益率高，但流动性弱，而利率产品收益率低，但流动性强。因此，在债券整体配置上应当考虑信用债的获利能力和利率产品流动性，实现平衡综合配置。

#### 4、相对价值策略

相对价值策略包括研究国债与金融债之间的信用利差、交易所与银行间的市场利

差等。金融债与国债的利差由税收因素形成，利差的大小主要受市场资金供给充裕程度决定，资金供给越紧张上述利差将越大。交易所与银行间的联动性随着市场改革势必渐渐加强，两市场之间的利差能够提供一些增值机会。

#### 5、个券选择策略

考虑到集合计划的流动性和收益要求，在配置固定收益证券时，将依照成交频率、成交频率波动率、月度平均成交金额、每日平均成交金额等指标，选择具有良好流动性和获利能力的个券进行投资。

#### （二）国债期货投资策略

产品进行国债期货投资时，将根据风险管理原则，以风险对冲、套期保值为主要目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对债券市场和期货市场运行趋势的研究，结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行操作，运用国债期货对冲系统性风险，以达到降低投资组合的整体风险的目的。

## 第十五章 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：

（一）《管理办法》、《细则》、《指导意见》、《规范》、《集合资产管理合同》、《说明书》等有关法律性文件。

（二）宏观经济发展态势、微观经济运行环境和证券市场走势。这是本计划投资决策的基础。

（三）投资对象收益和风险的配比关系。在充分权衡投资对象的收益和风险的前提下做出投资决策，是本计划维护委托人利益的重要保障。针对本计划的特点，在衡量投资收益与风险之间的配比关系时，以追求委托人的本金安全为第一要旨，在此基础上为委托人争取较高的收益。

### 二、集合计划的投资程序

#### （一）投资决策程序

管理人资产管理业务投资决策体系由管理人投资决策委员会、投资主办人二级体系组成。管理人投资决策委员会是管理人资产管理业务的最高决策机构，负责确定以下事项：

- 1、定期评估公司资产管理业务的风险；
- 2、研究决定各投资主办人的任免、授权与授权的更改；
- 3、研究决定各项资产管理产品的资产配置策略或交易策略；
- 4、审议投资主办人提交的月度产品投资报告和月度风险评估报告；
- 5、审议投资主办人的季度、年度管理报告；
- 6、审批债券库和策略库的建立方法和程序，审议债券库和策略库的建立和调整方案。投资主办人是资产管理业务具体项目的直接管理人，在公司授权范围内进行投资管理。

#### （二）投资交易程序

管理人设置独立的交易室，投资主办人下达的投资指令通过交易室实施。交易室

接到投资主办人的投资指令后，根据有关规定对投资指令的合规性、合理性和有效性进行检查，确保投资指令在合法、合规的前提下得到高效的执行。

### （三）预警平仓线

本集合计划设置预警线与止损线，单位净值 $\leq 0.9500$ 时，正回购融资余额不超过资产净值20%；单位净值 $\leq 0.9000$ 时，资产变现，待全部资产变现后产品终止。

### （四）投资风险的监控与绩效评估

由专人定期对集合计划资产进行定性和定量相结合的风险、绩效评估，并向公司投资决策委员会和风险控制部门提供报告，供投资决策委员会、风险控制部门和投资主办人随时了解投资组合承担的风险水平，检验既定的投资策略。绩效评估能够确认投资组合是否实现了投资预期、组合收益的来源及投资策略成功与否，投资主办人可据以检讨投资策略，进而调整投资组合。主要评估内容如下：

- 1、投资组合的资产配置：分类统计投资组合中各类资产的配置情况，并检查是否符合资源配置策略和集合计划本身的要求。
- 2、投资收益贡献分析：分类统计投资组合中各类资产的收益构成及收益贡献并将实际投资品种与基准进行横向比较。
- 3、动态评估投资组合中各证券的风险和收益水平，并给出调整建议。

## 三、风险控制原则

（一）全面性原则。风险控制覆盖资产管理业务的各个环节、各个岗位和各风险点，并渗透到决策、执行、监督、反馈等各个经营管理环节，杜绝制度盲点。公司采取决策层、经营层、操作层三个层面的风险控制架构。公司风险控制实行在开展业务过程中的自我风险控制和稽核与风险控制部独立开展的事前、事中、事后的风险控制。

（二）有效性原则。资产管理业务的内部控制制度、业务规章和指令必须合法合规，且具有高度的权威性，任何人不得拥有超越制度或违反规章的权力。资产管理业务的开展要有章必循，违章必究；风险控制的信息实现有效传递与反馈。

（三）审慎性原则。资产管理业务部门设置、业务开展和业务流程的设计充分考虑防范风险。

（四）相互制约原则。资产管理事业部岗位设置做到权责分明、相互牵制，实现相互制衡。

（五）连续性原则。风险控制制度连续一致地执行，随着公司经营战略、方针

等内部环境的变化和国家法律、法规、市场等外部环境的变化，不断运用量化指标与模型技术，使风险控制工作更具科学性与可操作性，适应发展需要。

(六) 集体决策原则。公司风险控制决策实行民主化的集体决策，形成科学的决策机制与决策程序。

#### 四、风险控制流程

(一) 制定风险控制目标与标准。根据公司经营环境、业务战略和公司承受风险的能力提出风险控制目标，确定风险承受标准。

(二) 风险识别。资产管理事业部和各部门对运作过程中的各种风险信息进行分析、识别；风险管理部从公司风险控制角度对公司系统内风险进行识别。

(三) 风险评估。采用定性或定量的方法对经识别的风险进行衡量与评估，预测每一种风险发生的概率与后果的严重性，并对风险进行优先排序。

(四) 风险报告。资产管理事业部和各部门将发现的风险上报风险管理部；风险管理部就风险情况出具风险报告，上报公司经营管理层、董事会。

(五) 采取控制措施。在风险识别和评估的基础上，针对不同的风险，根据其性质、特征与风险度制定具体处理方案，采用不同的管理策略、控制措施减少风险发生，将风险水平控制在可承受的范围內。

(六) 检查、反馈和制度更新。合规审计部、风险管理部定期或不定期对资产管理业务风险控制执行情况进行全面或专项检查，资产管理事业部及时反馈风险控制效果；风险管理部对风险控制执行的效果进行评估，测定实际效果与预期效果之间的偏差，及时调整风险控制方案。

#### 五、风险控制方案

管理人在开展资产管理业务中，将强化投资决策程序，加强内部控制，主要包括事前、事中、事后控制三方面：

##### (一) 事前控制

在集合计划运作前期，针对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：建立完善的资产管理业务风险控制组织架构；确定明确的期初资产配置方案，对集合计划资产配置风险收益进行模拟测算；通过严格的分级授权管理制度对投资主办行为进行约束等。

## （二）事中控制

集合计划运作期间，根据风险收益特征，进行针对性的风险控制措施，包括：依据市场状况调整资产配置；风险管理部定期或不定期对资产管理业务进行检查、监控，进一步研究、跟踪各种风险控制的新技术、新工具，利用风险控制模型对主要风险进行有效管理；定期召开集合计划资产风险收益评估会，评估运作状况；严格执行集合计划各类资产投资比例方案等。

## （三）事后控制

若在集合计划存续期间，发生风险事件，管理人将对风险事件进行归因分析和评价，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改，防止未来类似事件再次发生。

# 六、风险控制具体措施

## （一）交易业务的风险控制

建立专门的交易部和集中交易制度，投资指令通过交易部完成；应建立交易监测系统、预警系统和交易反馈系统，完善相关的安全设施；交易部应对交易指令进行审核，建立公平的交易分配制度；交易记录应完善，并及时进行反馈、核对并存档保管；同时应建立科学的投资交易绩效评价体系。

## （二）会计核算的风险控制

管理人根据法律法规及业务的要求建立会计制度，并根据风险控制点建立严密的会计系统，对于不同集合计划独立建账，独立核算；管理人通过复核制度、凭证制度、合理的估值方法和估值程序等会计措施真实、完整、及时地记载每一笔业务并正确进行会计核算和业务核算。同时还建立会计档案保管制度，确保档案真实完整。

## （三）信息披露

管理人建立了完善的信息披露制度，保证公开披露的信息真实、准确、完整。管理人应设立信息披露负责人，并建立相应的程序进行信息的收集、组织、审核和发布工作，以此加强对信息的审查核对，使所公布的信息符合法律法规的规定，同时加强对信息披露的检查和评价，对存在的问题及时提出改进办法。

# 七、全程风险管理控制

## （一）建立风险控制构架，完善风险控制制度和体系。

在制度管理方面，除了公司的基本制度和内控规范外，针对资产管理业务还系统地制定了投资管理、交易、风险控制、产品开发、客户服务和营运管理等制度，对资产管理业务的投资决策体系、投资管理流程、权限管理、交易工作流程、可投资证券库的建立及维护程序、产品开发程序、客户服务机制等都做出了具体的规定。

（二）在组织构架方面，将市场营销、投资管理、交易执行、综合支持、风险管理等予以内部岗位分设，通过职能分离形成制衡，并设立了独立的风控岗位加强风险监管。

## 第十六章 禁止行为

本集合计划的禁止行为包括：

- 1、承销证券；
- 2、违反规定向他人贷款或提供担保；
- 3、从事承担无限责任的投资；
- 4、利用资产管理计划资产为资产管理计划委托人之外的任何第三方谋取不正当利益、进行利益输送
- 5、从事内幕交易、操纵证券价格及其他不正当的证券交易活动；
- 6、从事本合同约定投资范围以外的投资活动；
- 7、直接或间接投资法律法规和国家政策禁止进行债权投资的行业和领域；
- 8、为其他金融机构的资产管理产品提供规避投资范围、杠杆约束等监管要求的通道服务；
- 9、法律法规、中国证监会以及本合同规定禁止从事的其他行为。

## 第十七章 集合计划的信息披露

### 一、披露形式

本集合计划将严格按照《管理办法》、《实施细则》、《指导意见》、《集合资产管理合同》、《说明书》及其他有关规定进行信息披露。集合计划的信息披露事项将在管理人官方网站上公告。

### 二、定期报告

定期报告包括集合计划单位净值报告、集合计划的资产管理季度（年度）报告、资产托管季度（年度）报告和年度审计报告。

#### （一）集合计划单位净值报告。

资产管理人在每个估值日对集合计划进行估值，并通过管理人网站披露经过托管人复核的上一交易日的集合计划资产净值和单位净值。

管理人网站：[www.grzq.com](http://www.grzq.com)

#### （二）集合计划的资产管理季度报告和托管季度报告。

管理人、托管人在每季度分别向委托人提供一次准确、完整的季度资产管理报告和季度资产托管报告，对报告期内集合计划资产的配置状况、价值变动情况、重大关联交易做出说明。上述报告应于每季度结束之日起 15 个工作日内通过管理人网站通告，并按照规定向相关监管机构报备。集合计划成立不足 2 个月时，管理人、托管人可以不编制当季的季度报告。集合计划终止当季，管理人、托管人可以不编制当季的季度报告。

#### （三）集合计划的资产管理年度报告和托管年度报告

管理人、托管人在每年度分别向委托人提供一次准确、完整的年度资产管理报告和年度资产托管报告，对报告期内集合计划资产的配置状况、价值变动情况、重大关联交易做出说明。上述报告应于每个会计年度截止日后 3 个月内通过管理人网站通告，并按照规定向相关监管机构报备。集合计划成立不足 2 个月时，管理人、托管人可以不编制当期的年度报告。集合计划终止当年，管理人、托管人可以不编制当年的年度报告。

#### （四）年度审计报告

管理人应当聘请具有证券相关业务资格的会计师事务所对本集合资产管理计划的运营情况进行年度审计,并在每年度结束之日起3个月内将审计报告提供给托管人,通过管理人网站向委托人提供,并按照规定向相关监管机构报备。

#### (五) 对账单

管理人仅在委托人提出申请时通过书面或电子邮件等方式向委托人提供对账单信息,对账单内容包括集合计划产品特性,投资风险提示,委托人持有计划份额的数量及净值,计划的差异性、风险、参与明细及收益分配等情况。委托人有义务向管理人提供准确的电子邮件地址,使管理人能够寄送电子对账单。

### 三、临时报告

集合计划存续期间,发生对集合计划持续运营、委托人利益、资产净值产生重大影响的事件,管理人应当以管理人网站公告方式及时向委托人披露。临时报告的情形包括但不限于:

(一) 集合计划运作过程中,负责集合资产管理业务的高级管理人员或投资主办人员发生变更,或出现其他可能对集合计划的持续运作产生重大影响的事项;

(二) 暂停受理或者重新开始受理参与申请;

(三) 集合计划终止和清算;

(四) 集合计划存续期满并展期;

(五) 合同的补充、修改与变更;

(六) 与集合计划有关的重大诉讼、仲裁事项;

(七) 负责本集合计划的代理推广机构发生变更;

(八) 集合计划投资于管理人及与管理人有关关联方关系的公司发行的证券;

(九) 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;

(十) 管理人、托管人因解散、破产、撤销等原因不能履行相应职责。

(十一) 其他管理人认为的重大事项。

### 四、重大事项披露和披露方式

本集合计划的信息披露将严格按《管理办法》、《实施细则》、《指导意见》、《集合资产管理合同》及其他有关规定进行。集合计划的信息披露事项将以下列方式进行披露。

(一) 管理人网站信息披露集合资产管理合同、本说明书、其他备查文件、相关报告等有关集合计划的信息，将在集合计划管理人网站上披露，委托人可随时查阅。

(二) 管理人、托管人、推广机构指定营业网点查询

资产管理合同、本说明书、其他备查文件、相关报告等文件以电子方式置备于集合计划管理人、集合计划托管人和集合计划推广机构的营业场所，供委托人查阅。对委托人按上述方式所查阅的文件，集合计划管理人和集合计划推广机构保证其内容与所披露的内容完全一致。

(三) 资产管理客服电话

本集合计划披露的有关集合计划的信息，委托人可以通过国融证券资产管理客服电话（95385）查询。

## 五、信息披露文件的存放与查阅

本集合计划的定期公告与报告、临时公告与报告以电子方式存放在管理人网站，委托人可随时登陆查阅。

## 第十八章 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，管理人、代理推广机构的客户之间可以通过中证报价系统等中国证监会认可的交易平台转让集合计划份额，但转让后委托人持有集合计划份额不得少于100万份，委托人合计不超过200人。受让方应符合合格投资者资格，受让方首次参与集合计划，应先与管理人、托管人签订集合资产管理合同。

### 二、集合计划的非交易过户

非交易过户是指不采用参与、退出等集合计划交易方式，将一定数量的集合计划份额按照一定规则从某一委托人集合计划账户转移到另一委托人集合计划账户的行为。

注册登记机构只受理继承、捐赠以及其他形式财产分割或转移等情况下的非交易过户。具体业务规则以注册登记机构业务规则为准。

委托人办理因上述原因引起的非交易过户须提供注册登记机构要求的相关证明文件等材料到注册登记机构处办理。对于符合条件的非交易过户申请自申请受理日起2个月内办理，并按注册登记机构规定的标准收费。

### 三、其他情形

集合计划份额冻结、解冻的业务，由注册登记机构办理。

集合计划注册登记机构只受理国家有关机关依法要求的集合计划份额的冻结与解冻以及注册登记机构认可的其他情况的集合计划份额的冻结与解冻。

当集合计划份额处于冻结状态时，集合计划注册登记机构或其他相关机构有权拒绝集合计划份额的非交易过户等业务的申请。

## 第十九章 集合计划的展期

本集合计划不设置展期安排。

## 第二十章 集合计划终止与清算

### 一、集合计划的终止

有下列情形之一的，集合计划应当终止：

（一）管理人因重大违法、违规行为，被中国证监会取消业务资格的；

（二）托管人因重大违法、违规行为，被监管机构取消业务资格而管理人未在30个工作日内与新的托管人签订托管协议的；

（三）管理人因停业、解散、破产、撤销等原因不能履行相应职责的；

（四）托管人因解散、破产、撤销等原因不能履行相应职责时，管理人未在30个工作日内与新的托管人签订托管协议的；

（五）存续期内，集合计划委托人少于2人；

（六）战争、自然灾害等不可抗力事故的发生导致本集合计划不能存续；

（七）无法以合同约定的方式和价格买入标的债券；

（八）法律、法规规定或中国证监会规定的其他情况。

### 二、集合计划提前终止

如本集合计划备案未获通过或是其他非主观因素导致本集合计划无法存续运作，管理人有权提前终止本集合计划，集合计划终止日以管理人公告为准。

由于上述原因使得集合计划提前终止的，管理人需将已认购资金在终止日后10个工作日内退还给委托人，并将该部分资金于集合计划成立日至终止日期间产生的利息在终止日后30个工作日内退还给委托人，各方互不承担其他责任。产品成立之后，如管理人未对资金进行任何操作，则资金利息按照活期存款利率计息；如管理人有对资金进行配置操作，则资金利息按成立日之后的实际收益率支付给委托人。

### 三、集合计划的清算

（一）自集合计划终止之日起5个工作日内成立集合计划清算小组，集合计划清算小组按照监管机构的相关规定进行集合计划清算；

（二）清算过程中有关重大事项应当及时公布；

（三）清算结束后5个工作日内，管理人和托管人应当在扣除清算费用、管理费、

托管费等费用后，如1) 集合计划未付收益  $\geq$  份额持有期业绩比较基准收益，则按照份额持有期业绩比较基准以现金分红的方式分配收益和超额收益（如有），同时归还委托人份额本金；2)  $0 <$  集合计划未付收益  $<$  份额持有期业绩比较基准收益，则按照份额持有期实际收益率分配收益并归还委托人份额本金；3) 集合计划未付收益  $\leq 0$ ，则将集合计划剩余资产按照委托人持有的份额比例以现金分红的方式分配给委托人。

（四）清算结束后15个工作日内由集合计划清算小组在管理人网站公布清算结果：

（五）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，该方案应经集合计划托管人认可，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，并将变现后的资产扣除相关费用后按照委托人拥有份额的比例或者集合资产管理合同的约定，以现金全部分配给委托人，并注销集合计划专用资金账户以及其他相关账户。在进行二次清算的变现过程中，变现的资金以现金保存，不得再进行投资。

## 第二十一章 当事人的权利与义务

### 一、委托人的权利和义务

#### (一) 委托人的权利

- 1、取得集合计划收益；
- 2、通过管理人网站查询等方式知悉有关集合计划投资运作的信息，包括集合计划的资产配置、投资比例、损益状况等；
- 3、按照本合同及《集合计划说明书》的约定，参与集合计划；
- 4、按持有份额取得集合计划清算后的剩余资产；
- 5、因管理人、托管人过错导致合法权益受到损害的，有权得到赔偿；
- 6、法律、行政法规、中国证监会的有关规定及本合同、《集合计划说明书》约定的其他权利。

#### (二) 委托人的义务

- 1、委托人应认真阅读本合同及《集合计划说明书》，并保证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；
- 2、按照本合同及《集合计划说明书》约定划付委托资金，承担本合同约定管理费、托管费及其他费用和税费；
- 3、按本合同及《集合计划说明书》约定承担集合计划可能的投资损失；
- 4、不得违规转让其所拥有的计划份额；
- 5、法律、行政法规、中国证监会的有关规定及本合同、《集合计划说明书》约定的其他义务；
- 6、有义务向管理人提供电子邮件地址，使管理人能够开展寄送电子对账单服务；
- 7、委托人在本合同约定的期间内不得退出本集合计划；
- 8、委托人按照本合同约定的退出方式退出本集合计划。

### 二、管理人的权利和义务

#### (一) 管理人的权利

- 1、根据本合同及《集合计划说明书》的约定，独立运作集合计划的资产；
- 2、根据本合同及《集合计划说明书》的约定，收取管理费等费用；

- 3、按照本合同及《集合计划说明书》的约定，停止办理集合计划的参与；
- 4、根据本合同及《集合计划说明书》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、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、如发现托管人违反法律、行政法规和中国证监会的规定，或者违反托管协议的，管理人有权报告监管机构并更换托管人；
- 9、法律、行政法规、中国证监会有关规定及本合同、《集合计划说明书》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，履行诚实信用、谨慎勤勉的义务，依法募集资金，办理产品份额的发售和登记事宜（适用于本机构直销产品时）；办理产品的登记备案手续；为委托人服务，以专业技能管理集合计划的资产，依法保护委托人的财产权益；

2、建立健全内部风险控制、财务管理及人事管理等制度；

3、根据中国证监会有关规定、本合同、《集合计划说明书》和托管协议的约定，接受托管人的监督；

4、管理人负责集合资产管理计划资产净值估值等会计核算业务，确定申购、赎回价格，编制集合资产管理计划财务报告，并接受托管人的复核；

5、按规定出具资产管理报告，保证委托人能够及时了解有关集合计划资产投资组合、资产净值、费用与投资收益等信息，办理与受托财产管理业务活动有关的信息披露事项；

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或相关司法部门、监管机构另有要求的除外）；

7、按照本合同及《集合计划说明书》约定确定收益分配方案，及时向委托人分配集合计划的收益；

8、依法对托管人的行为进行监督，如发现托管人违反法律、行政法规和中国证

监会的规定，或者违反托管协议的，应当予以制止，并及时报告管理人住所地中国证监会派出机构及中国证券业协会；

9、按照有关法律、行政法规、中国证监会有关规定及《集合计划说明书》的约定，指定注册登记机构办理集合计划的开户登记事务及其他与注册登记相关的手续；

10、按照法律、行政法规、中国证监会有关规定和本合同及《说明书》的约定，及时向退出集合计划的委托人支付退出款项；

11、按相关法律法规妥善保存与集合计划有关的合同、协议、推广文件、交易记录、会计账册等文件、资料和数据；

12、在集合计划到期或因其他原因终止时，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；

13、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；

14、因管理人违反合同导致集合计划财产损失或损害委托人合法权益时，在本集合计划资产范围内承担赔偿责任；

15、因托管人违反合同导致集合计划财产损失或损害委托人合法权益时，以管理人名义代表委托人利益向托管人追偿；

16、聘请具有证券相关业务资格的会计师事务所对本集合计划的运营情况进行专项审计，集合计划审计报告应当在每年度结束之日起3个月内，按照规定向相关监管机构报备，同时向委托人和托管人披露；

17、在与关联方发生交易行为时，保证对关联方及非关联方公平对待；

18、在兑付受托资金及收益时，管理人应当保证受托资金及收益返回委托人的原账户、同名账户或者合同约定的受益人账户。

19、法律、行政法规、中国证监会有关规定及本合同约定的其他义务。

### 三、 托管人的权利和义务

#### (一) 托管人的权利

1、依法托管集合计划的资产；

2、按照本合同、《集合计划说明书》和托管协议的约定收取托管费；

3、查询管理人集合计划的经营运作；

4、监督管理人集合计划的经营运作，发现管理人的划款指令违反法律法规、中国证监会的有关规定或者本合同和托管协议约定的，要求其改正；未能改正的，应当拒绝执行；

5、法律法规、中国证监会有关规定及本合同、《托管协议》约定的其他权利。

## (二) 托管人的义务

1、依法为集合计划开立专门的资金账户、证券账户、基金账户等相关账户；

2、非依法律、行政法规和中国证监会有关规定或合同约定，不得擅自用或处分集合计划资产，但是托管人不负责保管已划款托管账户的委托资金，以及处于托管人实际控制之外的其他委托财产；

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

4、安全保管集合计划资产，执行管理人的投资或者清算指令，负责办理集合计划名下的资金往来；

5、定期核对资产管理业务资产情况；

6、监督管理人集合计划的经营运作，发现管理人的划款指令违反法律法规、中国证监会的有关规定和本合同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，并及时报告管理人住所地中国证监会派出机构及中国证券投资基金业协会；托管人不承担因管理人指令错误导致托管人依据管理人指令作出的操作所产生的后果。

7、复核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、资料和数据，但保存期限不少于本集合计划的存续期限；

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、因托管人过错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，协助委托人向管理人追偿；

15、法律法规、中国证监会有关规定及本合同、《托管协议》约定的其他义务。

## 第二十二章 违约责任与争议处理

### 一、违约责任

(一) 管理人、托管人在履行各自职责的过程中，违反法律、行政法规的规定或者本合同约定，给本集合计划财产或者委托人造成损害的，应当分别对各自的行为依法承担赔偿责任；因共同行为给本集合计划财产或者委托人造成损害的，应当按照各自的过错比例分别承担各自应负的赔偿责任。但是发生下列情况的，当事人免责：

#### 1、不可抗力

不可抗力是指本合同当事人无法预见、无法克服或无法避免，且在本合同生效之后发生的，使本合同当事人无法全部或部分履行本合同的任何事件，包括但不限于战争、自然灾害、骚乱、火灾、突发性公共卫生事件、政府征用、没收、法律法规变化或其他突发事件、注册登记机构非正常的暂停或终止业务、证券交易所正常暂停或停止交易、由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误、有关会计政策变化等。

一方因不可抗力不能履行本合同时，应及时通知另一方，并在合理期限内提供受到不可抗力影响的证明，同时采取适当措施防止集合计划财产损失扩大。任何一方当事人迟延履行合同义务后，发生了上述不可抗力事件致使合同当事人无法全部或部分履行本合同，该方不能减轻或免除相应责任。

2、管理人和/或托管人按照当时有效的法律法规或中国证监会的规定作为或不作为而造成的损失等；

3、管理人由于按照合同规定的投资原则行使或不行使其投资权而造成的损失等；

4、在本集合计划运作过程中，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。

(二) 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。

(三) 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。

(四) 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。

(五) 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。

(六) 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。

## 二、争议的处理

因履行本合同发生的争议，由协议签订各方协商解决，协商不成的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会仲裁，仲裁地点为北京。本合同适用中华人民共和国法律，并依据其解释。仲裁裁决是终局的，对仲裁各方当事人均具有约束力。争议处理期间，双方当事人应恪守计划管理人和计划托管人职责，各自继续忠实、勤勉、尽责地履行集合资产管理合同和本托管协议规定的义务，维护集合计划委托人的合法权益。

## 第二十三章 风险揭示

委托人投资于本集合计划可能面临以下风险，有可能因下述风险导致委托人本金或收益损失。管理人承诺以诚实信用，谨慎勤勉的原则管理和运用集合计划资产，管理人制定并执行相应的内部控制制度和风险管理制度，以降低风险发生的概率。但这些制度和办法不能完全防止风险出现的可能，管理人不保证本集合计划一定盈利，也不保证最低收益。本集合计划面临的风险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：

(一)政策风险。货币政策、财政政策、产业政策、地区发展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，影响集合资产管理计划收益而产生风险。

(二)经济周期风险。经济运行具有周期性的特点，受其影响，集合计划资产管理业务的收益水平也会随之发生变化，从而产生风险。

(三)购买力风险。本集合计划投资的目的是使集合计划资产保值增值，如果发生通货膨胀，集合计划投资于证券所获得的收益可能会被通货膨胀抵消，从而影响集合计划资产的保值增值。

(四)再投资风险。由于金融市场利率下降造成的无法通过再投资而实现预期收益的风险。

### 二、流动性风险

本集合计划在存续期间，可能会发生个别偶然事件，导致集合计划资产变现困难，从而产生流动性风险，甚至影响本集合计划单位净值。

### 三、投资管理风险

管理人在管理本集合计划，做出投资决定的时候，会运用其投资技能和风险分析方法，但是这些技能和办法不能保证一定会达到预期的结果。

### 四、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《集合资产管理合同》有关规定的风险。

## 五、操作风险

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所引致的风险，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。

## 六、信用风险

本集合计划投资范围包括债券类产品和现金管理类产品。如果本集合计划配置资产所涉及的相关债务主体到期未能履行付息、还款义务，或者本集合计划配置信用类债券因为面临重大的损失而被止损，该集合计划的本金面临部分或者全部损失。

## 七、合同变更风险

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。管理人将通过网站公告方式征求委托人合同变更征询意见，委托人应以电子邮件或其他书面形式向管理人回复意见。管理人将在公告的同时，安排并同时公告临时开放期。委托人不同意变更的，应在临时开放期内退出集合计划；委托人回复意见明确表示不同意变更的，但又未在临时开放期内退出计划的，则由管理人安排在此开放期最后一个开放日的次日（遇节假日顺延）强制退出集合计划，按当日的单位净值将退出款项支付给委托人。未回复意见，也未在临时开放期内退出集合计划的，视为同意合同变更。

## 八、电子合同签约风险

本集合计划采用经中国证券登记结算责任有限公司等中国证监会认可的机构验证的电子合同签约方式，同所有网上交易一样存在操作的风险。

## 九、份额转让风险

本集合计划成立后，管理人可以按照规定申请份额转让事宜。份额转让交易平台可以是证券交易所，也可以是中国证监会认可的其他交易平台。委托人通过交易平台转让份额的价格与集合计划份额净值可能不一致。

## 十、特有风险提示

（一）锁定期委托人流动性风险。锁定期本产品无法办理退出造成对委托人无法

退出的流动性风险。

(二) 本集合计划在募集期，鉴于市场风险或本产品募集资金数额未达到最低募集规模等原因，本集合计划有可能出现募集失败的风险。

### (三) 基金的业绩风险

所投资的证券投资基金由于其管理人的投资失误，造成业绩下降，也会影响到集合计划的收益率。

### (四) 债券的市场风险

本产品作为固定收益类产品，存在的投资风险包括但不限于投资债券面临的：

#### 1、交易品种的信用风险

投资于公司债券等债券类产品，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，计划所投资的债券可能面临价格下跌风险。

#### 2、债券收益率曲线风险

债券收益率曲线风险是指与收益率曲线非平行移动有关的风险，单一的久期指标并不能充分反映这一风险的存在。

#### 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，使本计划收益水平随之发生变化，从而产生风险。

#### 4、汇率风险

货币汇率的变动是指货币对外价值的上下波动,包括货币贬值和货币升值。汇率变动会导致债券市场的价格和收益率的变动,进而影响证券市场的波动,从而产生风险。

### (五) 模型风险

量化投资策略依赖各种量化投资模型，因为模型不能完全刻画市场运行中的真实状况，模型在测算、评估时存在误差（历史表现不保证未来表现），模型中的参数估计存在误差，或者市场条件突然发生改变等因素，数量模型的可靠性将对投资组合的收益产生影响。

### (六) 对账单送达风险

本集合计划向提出需要的委托人提供电子对账单，委托人应向管理人提供正确、有效的电子邮件地址，电子对账单自管理人系统发出即视为送达。管理人向委托人通过电子邮件方式提供相关信息服务，电子邮件自管理人系统发出即视为送达。可能存在由于委托人提供的信息不准确、系统故障等原因，而不能有效接收电子对账单、电子邮件。

#### （七）国债期货、利率互换等衍生品风险

金融衍生品具有杠杠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。

#### （八）备案失败风险

本集合计划设立成功后五个工作日内将进行中基协备案申请，可能存在备案不通过的风险，即协会对本集合计划的合同条款审批不通过，导致产品备案失败而无法运作存续的情况。

### 十一、其他风险

（一）计划管理人、托管人因重大违法、违规行为，被中国证监会取消业务资格等而导致本集合计划终止的风险；

（二）计划管理人、托管人因停业、解散、破产、撤销等原因不能履行相应职责导致本集合计划终止的风险；

（三）突发偶然事件的风险：指超出集合计划管理人自身直接控制能力之外的风险，可能导致集合计划或集合计划委托人利益受损。

其中“突发偶然事件”指任何无法预见、不能避免、无法克服的事件或因素，包括但不限于以下情形：

- 1、集合计划终止时，所投资资产无法变现的情形；
- 2、相关法律法规的变更，直接影响集合计划运行；
- 3、无法预测或无法控制的系统故障、设备故障、通讯故障。

（四）管理人操作或者技术风险、电力故障等都可能对本集合计划的资产净值造成不利影响；

（五）因集合计划业务快速发展而在制度建设、人员配备、内控制度建立等方面不完善而产生的风险；

(六) 因人为因素而产生的风险，如内幕交易、欺诈行为等产生的风险；

(七) 对主要业务人员如投资主办人的依赖而可能产生的风险；

(八) 因业务竞争压力而可能产生的风险；

(九) 金融市场危机、行业竞争、代理商违约、托管银行违约等超出集合计划管理人自身直接控制能力外的风险可能导致集合计划或者集合计划委托人利益受损；

(十) 战争、自然灾害等不可抗力因素的出现，将会严重影响证券市场的运行，可能导致集合计划资产的损失。

(十一) 委托人部分退出集合计划份额时，如该笔退出完成后，委托人在该推广机构剩余的集合计划份额低于 100 万份时，则管理人有权将该委托人在该推广机构的全部份额退还给委托人。

## 十二、特别风险提示：

(一) 本集合计划业绩比较基准收益率仅供投资者参考，并不是管理人向客户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。本集合计划份额可能出现净值损失，投资风险由委托人自行承担。

(二) 委托人签署本合同，即表示同意管理人将本集合计划资产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或承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易，管理人将遵循客户优先原则，在发生上述所列投资证券事项时，管理人按照法律法规及中国证监会的有关规定，应当将交易结果告知托管人，同时向相关机构报备，并通过资产管理季度报告向委托人披露。

(三) 投资特殊品种的风险，如投资永续债的信用风险、提前赎回风险、利率风险、流动性风险等；投资可转债的股价波动风险、利息损失风险、提前赎回风险、转换风险；投资可交换债的正股价格波动风险、发行人信用风险、流动性风险、道德风险等。

## 第二十四章 合同的成立与生效

### 一、合同的成立与生效

本合同经管理人、托管人和委托人签署后成立。委托人为机构的，本合同经委托人、管理人和托管人加盖公章或合同专用章以及各方法定代表人（负责人）或授权代理人签字或盖章之日起成立；委托人为自然人的，本合同经委托人本人签字、管理人和托管人加盖公章或合同专用章以及双方法定代表人或授权代表签字或盖章之日起成立。（以电子签名方式签署的除外）

本合同成立后，同时满足以下条件时生效：

- （一）委托人参与资金实际交付并经注册登记机构确认获得计划份额。
- （二）符合法律法规及本合同的规定。

### 二、合同的组成

《日信证券长安2号集合资产管理计划说明书》、委托人与管理人签署的其他协议、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是本合同不可分割的一部分。

本合同正本一式捌份，管理人、托管人各执贰份，其余肆份按照有关部门的要求备案，均具同等法律效力。

## 第二十五章 合同的补充、修改与变更

一、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而应予变更的，自该修订生效之日起，本合同相关内容及条款按该修订进行变更，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集合计划说明书与新的法律法规或有关政策不一致的内容进行更新或修改，更新或修改的内容不得违反法律法规和中国证监会的有关规定，更新或修改的内容在管理人网站公告满5个工作日后生效。

二、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。管理人将通过网站公告方式征求委托人合同变更征询意见，委托人应以电子邮件或其他书面形式向管理人回复意见。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。

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：管理人将在公告的同时，安排并同时公告临时开放期。委托人不同意变更的，可以在临时开放期内退出集合计划；委托人回复意见明确表示不同意变更的，但又未在临时开放期内退出计划的，则由管理人安排在此开放期最后一个开放日的次日（遇节假日顺延）强制退出集合计划，按当日的单位净值将退出款项支付给委托人。未回复意见，也未在临时开放期内退出集合计划的，视为同意合同变更。

三、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。

四、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。

## 第二十六章 或有事件

本合同所称的或有事件是指，根据相关法律法规的规定，管理人可能以独资或者控股方式成立具有独立法人资格的从事资产管理业务的公司。

委托人在此同意，如果或有事件发生，在管理人与托管人协商一致的基础上，管理人有权将本合同中由管理人享有的权利和由管理人承担的义务转让给上一条所述的从事资产管理业务的公司，并无须就此项变更和委托人另行签订专项协议。但在转让前管理人应以信息披露的形式通告委托人。管理人保障委托人退出本计划的权利，并在届时的通告中对相关事项作出合理安排。

管理人应当保证受让人具备开展此项业务的相关资格，并向托管人提供监管机构相关批复文件复印件。

管理人应按照监管机构的要求办理转让手续。

本合同优惠措施：免除托管业务企业网银汇划手续费，该优惠措施起止期间与本合同期限相同。

托管人咨询（投诉）的联系方式，可采用电话、电子邮件等方式进行咨询或投诉，电话：022-58555979，电子邮箱：lin.niu@cbhb.com.cn

（本页以下无正文）

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者取得最低收益；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，应由法定代表人或者其授权代表签署。

委托人（签字）：

（盖章）：

管理人：国融证券股份有限公司（盖章）

法定代表人/授权代表：



托管人：渤海银行股份有限公司（盖章）

法定代表人/授权代表：



签订日期：2018年6月5日

