

---

上海光大证券资产管理有限公司

光大阳光优选一年持有期混合型  
集合资产管理计划  
招募说明书

管理人：上海光大证券资产管理有限公司

托管人：中国工商银行股份有限公司

二〇二〇年九月

## 目录

重要提示.....	2
第一部分 绪言.....	5
第二部分 释义.....	6
第三部分 集合计划管理人.....	13
第四部分 集合计划托管人.....	19
第五部分 相关服务机构.....	23
第六部分 集合计划的历史沿革.....	25
第七部分 集合计划的存续.....	26
第八部分 集合计划份额的申购与赎回.....	27
第九部分 集合计划的投资.....	39
第十部分 集合计划的财产.....	47
第十一部分 集合计划资产估值.....	48
第十二部分 集合计划的收益与分配.....	56
第十三部分 集合计划费用与税收.....	58
第十四部分 集合计划份额的折算.....	63
第十五部分 集合计划的会计与审计.....	64
第十六部分 集合计划的信息披露.....	65
第十七部分 侧袋机制.....	72
第十八部分 风险揭示.....	75
第十九部分 资产管理合同的变更、终止与集合计划财产的清算.....	81
第二十部分 资产管理合同内容摘要.....	83
第二十一部分 托管协议的内容摘要.....	101
第二十二部分 对集合计划份额持有人的服务.....	123
第二十三部分 招募说明书的及查阅方式.....	124
第二十四部分 备查文件.....	125

## 重要提示

本集合计划由光大阳光混合优选（阳光 6 号）集合资产管理计划（以下简称“原集合计划”）变更而来，原集合计划由管理人依照《证券公司客户资产管理业务管理试行办法》、《证券公司集合资产管理业务实施细则（试行）》、《光大阳光混合优选（阳光 6 号）集合资产管理计划合同》及其他有关规定募集，并经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可【2009】980 号文批准。

根据中国证监会于 2018 年 11 月 28 日发布的《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》的规定，本集合计划参照《中华人民共和国证券投资基金法》等公开募集证券投资基金相关法律、行政法规及中国证监会的规定进行变更，并将集合计划名称由原“光大阳光混合优选（阳光 6 号）集合资产管理计划”变更为“光大阳光优选一年持有期混合型集合资产管理计划”，变更后的资产管理合同自集合计划管理人公告的生效之日起生效。

管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。

原集合计划变更为本集合计划经中国证监会批准，但中国证监会对原集合计划变更为本集合计划的批准，并不表明其对本集合计划的投资价值和市场前景做出实质性判断或保证，也不表明投资于本集合计划没有风险。

管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用集合计划资产，但不保证集合计划一定盈利，也不保证最低收益。

投资有风险，投资人申购集合计划时应当认真阅读本招募说明书。集合计划的过往业绩并不预示其未来表现，管理人管理的其他产品资产管理计划的业绩并不构成对本集合计划业绩表现的保证。管理人提醒投资人集合计划投资的“买者自负”原则，在投资人做出投资决策后，集合计划运营状况与集合计划净值变化导致的投资风险，由投资人自行承担。当投资人赎回时，所得或会高于或低于投资人先前所支付的金额。

本集合计划投资于证券市场，集合计划净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者在投资本集合计划前，需充分了解本集合计划的产品特性，并承

担集合计划投资中出现的各类风险，包括：因政治、经济、投资者心理和交易制度等因素的市场风险，管理人在集合计划管理实施过程中产生的集合计划管理风险，流动性风险，本集合计划的特定风险，操作或技术风险、合规性风险、其他风险等。

本集合计划为混合型集合计划，其预期风险和预期收益高于债券型基金、债券型集合计划、货币市场基金和货币型集合资产管理计划，低于股票型基金和股票型集合计划。

资产管理合同生效后，原光大阳光混合优选（阳光 6 号）集合资产管理计划份额变更为 A 类份额。资产管理合同生效后，管理人不办理该类集合计划份额的申购业务，投资者可在本集合计划开放赎回业务后的任一开放日办理赎回业务。

根据申购、赎回规则，管理费率、业绩报酬和销售服务费的不同，本集合计划份额分为 A 类份额、B 类份额和 C 类份额，各类份额净值不同。投资者需要了解，各类集合计划份额类别对应的可供分配收益及赎回成本将有所不同。

本集合计划 B 类或 C 类份额设置锁定持有期，每份 B 类或 C 类份额的锁定持有期为一年，在锁定持有期内不办理赎回业务。锁定持有期到期后进入开放持有期，每份 B 类或 C 类份额自其开放持有期首日起才能办理赎回业务。因此 B 类或 C 类份额的份额持有人面临在锁定持有期内不能赎回资产管理计划份额的风险。

本集合计划投资资产支持证券，资产支持证券具有一定的价格波动风险、流动性风险、信用风险等风险。

本集合计划可投资于股指期货、国债期货。投资股指期货和国债期货存在的风险包括市场风险、市场流动性风险、基差风险、结算流动性风险、保证金风险、信用风险、作业风险等。

本集合计划可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化，选择将部分集合计划资产投资于港股或选择不将集合计划资产投资于港股，集合计划资产并非必然投资港股。

本集合计划资产投资于港股时，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括港股市场股价波动较大

的风险（港股市场实行 T+0 回转交易，且对个股不设涨跌幅限制，港股股价可能表现出比 A 股更为剧烈的股价波动）、汇率风险（汇率波动可能对集合计划的投资收益造成损失）、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险（在内地开市香港休市的情形下，港股通不能正常交易，港股不能及时卖出，可能带来一定的流动性风险）等。

投资者在进行投资决策前，请仔细阅读本集合计划的《招募说明书》、《资产管理合同》、产品资料概要等信息披露文件，全面认识本集合计划的风险收益特征和产品特性，并充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，自主判断集合计划的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险，谨慎做出投资决策，并通过管理人或管理人委托的具有基金销售业务资格的其他销售机构购买集合计划。

---

---

## 第一部分 绪言

《光大阳光优选一年持有期混合型集合资产管理计划招募说明书》（以下简称“招募说明书”或“本招募说明书”）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销售机构监督管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《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》”）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性风险管理规定》”）及其他有关规定以及《光大阳光优选一年持有期混合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”或“《资产管理合同》”）编写。

本招募说明书阐述了光大阳光优选一年持有期混合型集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”或“集合计划”）的投资目标、策略、风险、费率等与投资人投资决策有关的全部必要事项，投资者在做出投资决策前应仔细阅读招募说明书。

管理人承诺本招募说明书不存在任何虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。本集合计划是根据本招募说明书所载明的资料申请销售的。管理人没有委托或授权任何其他人提供未在本招募说明书中载明的信息，或对本招募说明书作任何解释或者说明。

管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用集合计划资产，但不保证集合计划一定盈利，也不保证最低收益。集合计划根据招募说明书所载明资料发行。

本招募说明书依据资产管理合同编写，资产管理合同是约定集合计划当事人之间权利义务的法律文件。如本招募说明书内容与资产管理合同有冲突或不一致之处，均以资产管理合同为准。投资者自依资产管理合同取得集合计划份额，即成为集合计划份额持有人和资产管理合同的当事人，其持有集合计划份额的行为本身即表明对资产管理合同的承认和接受，并按照《基金法》、资产管理合同及其它有关规定享有权利，承担义务。投资人欲了解集合计划份额持有人的权利和义务，应详细查阅资产管理合同。

## 第二部分 释义

在本招募说明书中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

1、集合计划或本集合计划：指光大阳光优选一年持有期混合型集合资产管理计划

2、管理人：指上海光大证券资产管理有限公司

3、托管人：指中国工商银行股份有限公司

4、资产管理合同、《资产管理合同》：指《光大阳光优选一年持有期混合型集合资产管理计划资产管理合同》及对资产管理合同的任何有效修订和补充

5、托管协议：指管理人与托管人就本集合计划签订之《光大阳光优选一年持有期混合型集合资产管理计划托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充

6、招募说明书或本招募说明书：指《光大阳光优选一年持有期混合型集合资产管理计划招募说明书》及其更新

7、产品资料概要：指《光大阳光优选一年持有期混合型集合资产管理计划产品资料概要》及其更新

8、法律法规：指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、规范性文件、司法解释、行政规章以及其他对资产管理合同当事人有约束力的决定、决议、通知等

9、《基金法》：指 2003 年 10 月 28 日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，经 2012 年 12 月 28 日第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订，自 2013 年 6 月 1 日起实施，并经 2015 年 4 月 24 日第十二届全国人民代表大会常务委员会第十四次会议《全国人民代表大会常务委员会关于修改〈中华人民共和国港口法〉等七部法律的决定》修正的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订

10、《销售办法》：指中国证监会 2020 年 8 月 28 日颁布、同年 10 月 1 日实施的《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

11、《信息披露办法》：指中国证监会 2019 年 7 月 26 日颁布、同年 9 月 1 日

实施的,并经 2020 年 3 月 20 日中国证监会《关于修改部分证券期货规章的决定》修正的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

12、《运作办法》:指中国证监会 2014 年 7 月 7 日颁布、同年 8 月 8 日实施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

13、《流动性风险管理规定》:指中国证监会 2017 年 8 月 31 日颁布、同年 10 月 1 日实施的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及颁布机关对其不时做出的修订

14、港股通:指内地投资者委托内地证券公司,经由境内证券交易所设立的证券交易服务公司,向香港联合交易所进行申报,买卖规定范围内的香港联合交易所上市 的股票

15、港股通交易日:指上海证券交易所、深圳证券交易所证券交易服务公司公布的港股通交易日

16、中国证监会:指中国证券监督管理委员会

17、银行业监督管理机构:指中国人民银行和/或中国银行保险监督管理委员会

18、资产管理合同当事人:指受资产管理合同约定,根据资产管理合同享有权利并承担义务的法律主体,包括管理人、托管人和集合计划份额持有人

19、个人投资者:指依据有关法律法规规定可投资于证券投资基金的自然人

20、机构投资者:指依法可以投资证券投资基金的、在中华人民共和国境内合法登记并存续或经有关政府部门批准设立并存续的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织

21、合格境外机构投资者:指符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理 办法》及相关法律法规规定可以投资于在中国境内依法募集的证券投资基金的中国境外的机构投资者

22、人民币合格境外机构投资者:指按照《人民币合格境外机构投资者境内 证券投资试点办法》及相关法律法规规定,运用来自境外的人民币资金进行境内 证券投资的境外法人

23、投资人、投资者:指个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者和



人民币合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人的合称

24、集合计划份额持有人：指依资产管理合同和招募说明书合法取得集合计划份额的投资人

25、集合计划销售业务：指管理人或销售机构宣传推介集合计划，办理集合计划份额的申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务

26、销售机构：指上海光大证券资产管理有限公司以及符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金销售业务资格并与管理人签订了集合计划销售服务协议，办理集合计划销售业务的机构

27、登记业务：指集合计划登记、存管、过户、清算和结算业务，具体内容包括投资人集合计划账户的建立和管理、集合计划份额登记、集合计划销售业务的确认、清算和结算、代理发放红利、建立并保管集合计划份额持有人名册和办理非交易过户等

28、登记机构：指办理登记业务的机构。集合计划的登记机构为中国证券登记结算有限责任公司或接受上海光大证券资产管理有限公司委托代为办理登记业务的机构

29、集合计划账户：指登记机构为投资人开立的、记录其持有的、管理人所管理的集合计划份额余额及其变动情况的账户

30、集合计划交易账户：指销售机构为投资人开立的、记录投资人通过该销售机构办理申购、赎回、转换及转托管等业务而引起的集合计划份额变动及结余情况的账户

31、资产管理合同生效日：《光大阳光优选一年持有期混合型集合资产管理计划资产管理合同》生效之日，《光大阳光混合优选（阳光6号）集合资产管理计划资产管理合同》同日失效

32、资产管理合同终止日：指资产管理合同规定的合同终止事由出现后，集合计划财产清算完毕，清算结果报中国证监会备案并予以公告的日期

33、存续期：指《光大阳光混合优选（阳光6号）集合资产管理计划资产管理合同》生效至《光大阳光优选一年持有期混合型集合资产管理计划资产管理合同》终止之间的期限

- 
- 
- 34、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日
- 35、T日：指销售机构在规定时间受理投资人申购、赎回或其他业务申请的开放日
- 36、T+n日：指自T日起第n个工作日(不包含T日)
- 37、开放日：指为投资人办理集合计划份额申购、赎回或其他业务的工作日（若本集合计划参与港股通交易且该工作日为非港股通交易日时，则管理人可根据实际情况决定本集合计划是否开放申购、赎回及转换等业务，具体以届时提前发布的公告为准）
- 38、开放时间：指开放日集合计划接受申购、赎回或其他交易的时间段
- 39、《业务规则》：指《中国证券登记结算有限责任公司开放式证券投资基金及证券公司集合资产管理计划份额登记及资金结算业务指南》以及中国证券登记结算有限责任公司其他适用于证券投资基金的业务规则及其不时做出的修订
- 40、申购：指资产管理合同生效后，投资人根据资产管理合同和招募说明书的规定申请购买集合计划份额的行为
- 41、赎回：指资产管理合同生效后，集合计划份额持有人按资产管理合同规定的条件要求将集合计划份额兑换为现金的行为
- 42、集合计划转换：指集合计划份额持有人按照资产管理合同和管理人届时有效公告规定的条件，申请将其持有管理人管理的、某一集合计划份额转换为管理人管理的其他集合计划份额的行为
- 43、转托管：指集合计划份额持有人在本集合计划的不同销售机构之间实施的变更所持集合计划份额销售机构的操作
- 44、定期定额投资计划：指投资人通过有关销售机构提出申请，约定每期申购日、扣款金额及扣款方式，由销售机构于每期约定扣款日在投资人指定银行账户内自动完成扣款及受理集合计划申购申请的一种投资方式
- 45、巨额赎回：指本集合计划单个开放日，集合计划净赎回申请(赎回申请份额总数加上集合计划转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及集合计划转换中转入申请份额总数后的余额)超过上一开放日集合计划总份额的10%
- 46、元：指人民币元

47、集合计划收益：指集合计划投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券价差、银行存款利息、已实现的其他合法收入及因运用集合计划财产带来的成本和费用的节约

48、集合计划资产总值：指集合计划拥有的各类有价证券、银行存款本息、集合计划应收申购款及其他资产的价值总和

49、集合计划资产净值：指集合计划资产总值减去集合计划负债后的价值

50、集合计划份额净值：指计算日集合计划资产净值除以计算日集合计划份额总数

51、集合计划资产估值：指计算评估集合计划资产和负债的价值，以确定集合计划资产净值和集合计划份额净值的过程

52、规定媒介：指符合中国证监会规定条件的用以进行信息披露的全国性报刊及《信息披露办法》规定的互联网网站（包括管理人网站、托管人网站、中国证监会基金电子披露网站）等媒介

53、流动性受限资产：指由于法律法规、监管、合同或操作障碍等原因无法以合理价格予以变现的资产，包括但不限于到期日在 10 个交易日以上的逆回购与银行定期存款（含协议约定有条件提前支取的银行存款）、停牌股票、流通受限的新股及非公开发行股票、资产支持证券、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券等

54、摆动定价机制：指当开放式集合计划遭遇大额申购赎回时，通过调整集合计划份额净值的方式，将集合计划调整投资组合的市场冲击成本分配给实际申购、赎回的投资者，从而减少对存量集合计划份额持有人利益的不利影响，确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待

55、不可抗力：指资产管理合同当事人不能预见、不能避免且不能克服，且在资产管理合同由管理人、托管人签署之日后发生的，使资产管理合同当事人无法全部履行或无法部分履行资产管理合同的任何事件，包括但不限于洪水、地震及其他自然灾害、战争、骚乱、火灾、政府征用、没收、法律法规变化、突发停电或其他突发事件、证券交易所非正常暂停或停止交易

56、销售服务费：指从集合计划财产中计提的，用于本集合计划市场推广、销售以及集合计划份额持有人服务的费用

57、集合计划份额类别：指根据申购、赎回规则、管理费率、业绩报酬和销售服务费的不同将本集合计划份额分为 A 类份额、B 类份额和 C 类份额，三类份额分别设置代码，并分别计算和公告集合计划份额净值和集合计划份额累计净值

58、A 类份额：资产管理合同生效后，原光大阳光混合优选（阳光 6 号）集合资产管理计划份额变更为本集合计划的 A 类份额，A 类份额不开放申购，A 类集合计划份额的持有人可在本集合计划开放赎回业务后的任一开放日申请赎回

59、B 类份额：指依据资产管理合同，在投资者申购时收取申购费用，在赎回时收取赎回费，但不从本类别计划资产中计提销售服务费的份额

60、C 类份额：指依据资产管理合同，不收取申购费（按法律法规要求收取的赎回费除外），并从本类别计划资产中计提销售服务费的份额

61、锁定持有期：本集合计划对于 A 类份额，不设置锁定持有期。对于每份 B 类和 C 类份额，锁定持有期指集合计划份额申购确认日（即锁定持有期起始日）起至集合计划份额申购确认日一年后的年度对日的前一日（即锁定持有期到期日）之间的区间，B 类或 C 类份额在锁定持有期内不办理赎回业务。若该年度对日为非工作日或不存在对应日期的，则顺延至下一个工作日

62、开放持有期：对于每份 B 类和 C 类份额，自锁定持有期结束后即进入开放持有期。开放持有期指锁定持有期起始日一年后的年度对日（若该年度对日为非工作日或不存在对应日期的，则顺延至下一个工作日）至资产管理合同终止日。每份 B 类或 C 类份额在开放持有期期间的开放日可以办理赎回业务

63、侧袋机制：指将集合计划投资组合中的特定资产从原有账户分离至一个专门账户进行处置清算，目的在于有效隔离并化解风险，确保投资者得到公平对待，属于流动性风险管理工具。侧袋机制实施期间，原有账户称为主袋账户，专门账户称为侧袋账户

64、特定资产：包括：（一）无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性的资产；（二）按摊余成本计量且计提资产减值准备仍导致资产价值存在重大不确定性的资产；（三）其他资产价值存在重大不确定性的资产



## 第三部分 集合计划管理人

### 一、管理人概况

名称：上海光大证券资产管理有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 799 号 3 号楼 26 层

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 799 号 3 号楼 26 层

法定代表人：熊国兵

成立日期：2012 年 5 月 9 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监许可[2011]1886 号

组织形式：有限责任公司

注册资本：2 亿元人民币

存续期限：持续经营

联系人：陈省好

电话：021-22169999

股权结构：法人独资

### 二、主要人员情况

#### 1、董事会成员

熊国兵先生，董事长。历任光大证券稽核部总经理、风险管理部总经理、公司纪委书记等职。现任光大证券副总裁、上海光大证券资产管理有限公司董事长。

汪沛先生，董事。先后在中国农业银行、富国基金管理有限公司、建信基金管理公司任职，历任债券交易员、基金经理、投资总监等职务。2011 年加入光大证券，现任上海光大证券资产管理有限公司总经理。

朱轶女士，董事。先后就职于交通银行珠海分行、上海证券交易所上市公司监管一部，2017 年加入光证资管，任合规总监兼首席风险官。

常松先生，董事。东南大学科学与工程学博士学位，分管投资与研究，17 年投资研究经历，先后任职于富国基金、尊嘉资管、长信基金，投研及组合管理工作经验丰富，现任光证资管副总经理。

赵奕先生，董事。本科学历，先后就职于深圳市物业集团、光大证券股份有限公司，历任职员、投行业务高级经理、营业部总经理、分公司总经理，现任光

大证券股份有限公司人力资源部专家办公室资深业务经理。

## 2、监事/监事会成员

朱晓芬女士，公司监事。华东政法学院本科学历，先后于大连信托、大通证券、国信证券任职，2012 年加入光大证券股份有限公司，历任场外市场部总经理助理、投行上海二部总经理助理、投行二部总经理助理，2019 年加入光证资管。

## 3、高级管理人员

汪沛先生，总经理。同上。

常松先生，副总经理。同上。

乔震先生，副总经理。毕业于上海交通大学，先后在招商银行总行、华泰柏瑞基金就职。2012 年加入上海光大证券资产管理有限公司，历任产品与创新部副总经理、总经理、公司总经理助理，现任公司副总经理。

詹朋先生，上海财经大学学士 CFA（注册金融分析师）、FRM（金融风险管理师）。先后在上海证券、万家基金、信诚基金、上海东方证券资产管理有限公司任职，有近二十年运营工作经历，并具备十余年运营团队管理经验。2019 年加入光证资管，任运营总监。

朱轶女士，合规总监兼首席风险官。同上。

## 4、本集合计划投资经理

王杭先生，毕业于清华大学，2011 年加入光大证券资产管理总部研究部，任研究员。2012 年加入光证资管，先后任研究员、投资经理助理、投资经理。

## 5、投资决策委员会成员

本公司权益投资决策委员会成员包括：常松先生（公司副总经理）、林朝晖先生（FICC 总监）、李聚华先生（总经理助理兼量化投资部总经理）、丁瑾女士（研究部总经理）、王海涛先生（权益公募投资部总经理）、沈吟女士（多策略投资部副总经理兼 FOF 投资部副总经理）。

## 三、管理人的职责

1、依法募集资金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理集合计划份额的申购、赎回和登记事宜；

2、办理资产管理合同变更申请；

- 3、对所管理的不同集合计划资产分别管理、分别记账，进行证券投资；
- 4、按照《资产管理合同》的约定确定集合计划收益分配方案，及时向集合计划份额持有人分配集合计划收益；
- 5、进行集合计划会计核算并编制集合计划财务会计报告；
- 6、编制季度报告、中期报告和年度报告；
- 7、计算并公告集合计划净值信息，确定集合计划份额申购、赎回价格；
- 8、办理与集合计划资产管理业务活动有关的信息披露事项；
- 9、召集集合计划份额持有人大会；
- 10、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；
- 11、以管理人名义，代表集合计划份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
- 12、法律法规及中国证监会规定的和《资产管理合同》约定的其他职责。

#### 四、管理人承诺

- 1、管理人将根据资产管理合同的规定，按照招募说明书列明的投资目标、策略及限制全权处理本集合计划的投资。
- 2、管理人不得从事违反《中华人民共和国证券法》（以下简称“《证券法》”）、《基金法》、《销售办法》、《运作办法》、《信息披露办法》及其他有关法律法规的行为，并建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反《证券法》及其他有关法律法规行为的发生。
- 3、管理人不得从事下列违反《基金法》的行为，并建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止法律法规规定的禁止行为的发生：
  - （1）将其固有财产或者他人财产混同于集合计划财产从事证券投资；
  - （2）不公平地对待其管理的不同集合计划财产；
  - （3）利用集合计划财产为集合计划份额持有人以外的第三人谋取利益；
  - （4）向集合计划份额持有人违规承诺收益或者承担损失；
  - （5）法律法规或中国证监会禁止的其他行为。
- 4、管理人将加强人员管理，强化职业操守，督促和约束员工遵守国家有关法律、法规及行业规范，诚实信用、勤勉尽责，不从事以下行为：
  - （1）越权或违规经营；



- 
- 
- (2) 违反资产管理合同或托管协议；
  - (3) 故意损害集合计划份额持有人或其他相关机构的合法权益；
  - (4) 在向中国证监会报送的材料中弄虚作假；
  - (5) 拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管；
  - (6) 玩忽职守、滥用职权，不按照规定履行职责；
  - (7) 违反现行有效的有关法律、法规、规章、资产管理合同和中国证监会的有关规定，泄漏在任职期间知悉的有关证券、集合计划的商业秘密，尚未依法公开的集合计划投资内容、集合计划投资计划等信息，或利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；
  - (8) 违反证券交易场所业务规则，利用对敲、倒仓等手段操纵市场价格，扰乱市场秩序；
  - (9) 贬损同行，以抬高自己；
  - (10) 以不正当手段谋求业务发展；
  - (11) 有悖社会公德，损害证券投资人员形象；
  - (12) 在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分；
  - (13) 其他法律、行政法规以及中国证监会禁止的行为。

5、管理人承诺严格遵守资产管理合同的规定，并承诺建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反资产管理合同行为的发生。

6、管理人承诺不从事其他法规规定禁止从事的行为。

#### 五、集合计划投资经理承诺

1、依照有关法律法规和资产管理合同的规定，本着谨慎的原则为集合计划份额持有人谋取最大利益；

2、不利用职务之便为自己、代理人、代表人、受雇人或任何其它第三人谋取不当利益；

3、不泄漏在任职期间知悉的有关证券、集合计划的商业秘密、尚未依法公开的集合计划投资内容、集合计划投资计划等信息；

4、不以任何形式为其它组织或个人进行证券交易。

#### 五、管理人的内部控制制度

管理人结合自身具体情况，建立了科学合理、控制严密、运行高效的内部控

制体系，并制定了科学完善的内部控制制度。

### 1、内部控制目标

(1) 保证管理人经营运作严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，自觉形成守法经营、规范运作的经营思想和经营理念。

(2) 防范和化解经营风险，提高经营管理效益，确保经营业务的稳健运行和客户委托资产的安全完整，实现管理人的持续、稳定、健康发展。

(3) 确保持有人资产管理产品、财务和其他信息真实、准确、完整、及时。

### 2、内部控制原则

(1) 健全性原则：内部控制应当包括管理人的各项业务、各个部门或机构和各级人员，并涵盖到决策、执行、监督、反馈等各个环节。

(2) 有效性原则：通过科学的内控手段和方法，建立合理的内控程序，维护内控制度的有效执行。

(3) 独立性原则：管理人各机构、部门和岗位职责应当保持相对独立，管理人资产管理客户委托资产、自有资产的运作应当分离。

(4) 相互制约原则：管理人内部部门和岗位的设置应当权责分明、相互制衡。

(5) 成本效益原则：管理人运用科学化的经营管理方法降低运作成本，提高经济效益，以合理的控制成本达到最佳的内部控制效果。

### 3、内部控制内容

#### (1) 投资管理业务控制

公司应当自觉遵守国家有关法律法规，按照资产管理业务的性质和特点严格制定管理规章、操作流程和岗位手册，明确揭示不同业务可能存在的风险点并采取控制措施。针对投资研究业务，管理人制定了严密的研究工作业务流程，建立了证券池管理制度，并在充分研究的基础上建立和维护证券池；对于投资决策业务，管理人制定了各类资产投资管理制度，明确界定投资权限与投资限制，保证投资决策严格遵守法律法规的有关规定，符合资产管理合同所规定的要求，同时建立了投资风险评估与管理制度以及投资管理业绩评价体系；对于交易业务，管理人实行集中交易与防火墙制度，建立了交易监测系统、预警系统和交易反馈系统。

## （2）信息披露控制

管理人通过完善信息披露制度，确保投资者及时完整地了解资产管理产品信息。管理人按照法律、法规和中国证监会有关规定，建立了信息披露管理制度，指定了专岗负责信息披露工作，进行信息的组织、审核和发布，并将定期对信息披露进行检查和评价，保证公开披露的信息真实、准确、完整。

## （3）信息技术系统控制

管理人根据国家法律法规的要求，遵循安全性、实用性、可操作性原则，制定了信息系统的管理制度。管理人计算机机房、设备、网络等硬件要求符合有关标准，设备运行和维护整个过程实施明确的责任管理，严格划分业务操作、技术维护等方面的职责。管理人制定了严格的授权制度、岗位责任制度、门禁制度、内外网分离制度等管理措施，确保系统安全运行。

## （4）会计系统控制

管理人依据国家有关法律、法规制订产品会计核算制度、公司财务制度、估值会计工作操作流程和估值会计岗位工作手册，并针对各个风险控制点建立严密的会计系统控制。公司建立严格的成本控制和业绩考核制度，强化会计的事前、事中和事后监督。公司以单个资产管理产品为会计核算主体，独立建账、独立核算，保证不同资产管理产品之间在名册登记、账户设置、资金划拨、账簿记录等方面相互独立。

## （5）内部稽核控制

管理人通过建立独立的合规管理制度，确保内部控制的有效性。管理人设合规负责人，合规负责人可以根据履职需要参加或列席管理人召开的有关会议，调阅相关档案，就内部控制制度的执行情况独立地履行检查、评价、报告、建议职能。另外，公司设立合规监察部门，配备充足合格的稽核监察人员，强化内部检查制度，通过定期或不定期检查内部控制制度的执行情况，确保公司各项经营管理活动的有效运行。

## 4、管理人关于内部控制制度的声明

- （1）管理人承诺以上关于内部控制制度的披露真实、准确；
- （2）管理人承诺根据市场变化和业务发展不断完善内部控制。

---

---

## 第四部分 集合计划托管人

### 一、基本情况

名称：中国工商银行股份有限公司（以下简称“工商银行”）

住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

成立日期：1984 年 1 月 1 日

批准设立机关和批准设立文号：国务院《关于中国人民银行专门行使中央银行职能的决定》（国发[1983]146 号）

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币 35640625.7089 万元

法定代表人：陈四清

基金托管业务批准文号：中国证监会和中国人民银行证监基字[1998]3 号

投资与托管业务部总经理：李勇

电话：010-66105799

传真：010-66105769

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

### 二、托管业务部部门及主要人员情况

中国工商银行总行资产托管部作为全行资产托管业务的主管部门，负责托管业务组织管理、托管营运与分行指导支持，可为客户提供一站式托管服务。部门职责包括负责业务组织管理、业务营销、客户服务、托管营运，负责托管业务的法律合规事务、风险管理、内部控制，负责开展托管系统研发及测试，负责对全行托管业务人员进行培训，负责指导各分行托管业务的营销、营运等。资产托管部下设十三个处，分别是综合管理处、社保基金托管处、证券投资基金处、委托资产一处、委托资产二处、全球资产托管处、产品与系统开发处、信息与增值服务处、监督与风险管理处、营运一处、营运二处、营运三处、业务外包中心，根据处室职责功能划分为市场营销、支持保障、业务营运三大团队。各级分行资产托管部门在总行资产托管部统一领导下依据总行对分行的授权开展托管业务的市场营销、托管营运及综合化服务。

截至 2019 年 12 月，中国工商银行资产托管部共有员工 208 人，平均年龄

33 岁，95%以上员工拥有大学本科以上学历，高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

资产托管部总经理李勇，男，经济学博士，高级经济师。曾工作于国家计委地区经济司、国家信息中心经济预测部，1995 年开始历任中国工商银行业务部处长、德国法兰克福分行信贷部经理、投资银行部总经理、黑龙江省分行党委书记、行长，具有丰富的资产托管、银行信贷、投资银行经验。

### 三、证券投资基金托管情况

作为中国大陆托管服务的先行者，中国工商银行自 1998 年在国内首家提供托管服务以来，秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨，依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队，严格履行资产托管人职责，为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务，展现优异的市场形象和影响力。中国工商银行建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、基本养老保险、企业年金基金、QFII 资产、QDII 资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII 专户资产、ESCROW 等门类齐全的托管产品体系，同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至 2019 年 12 月，中国工商银行共托管证券投资基金 1031 只。自 2003 年以来，中国工商银行连续十六年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的 69 项最佳托管银行大奖，是获得奖项最多的国内托管银行，优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

### 四、托管业务的内部控制制度

中国工商银行托管业务制定了一套健全的管理制度，并通过严密的风险管理组织架构、按照国际标准不断完善的风险管理制度和独立的稽核监督机制，切实履行托管人职责，有效防范和化解业务风险，从而确保受托资产的安全完整，最大限度地维护投资人的利益，促进托管业务的稳健发展。

#### 1、内部控制目标

作为证券托管人，中国工商银行严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和行内有关管理规定，守法经营、规范运作、严格监察，确保业务的稳健运行，保证基金财产的安全完整，确保有关信息的真实、准确、完整、及时，保护证券份额持有人的合法权益。

## 2、内部控制组织结构

中国工商银行设有风险与内控管理委员会，负责全行风险管理与内部控制工作，对托管业务风险控制工作进行检查指导。托管业务部专门设置内部风险控制处室，配备专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作，具有独立行使监督稽核的工作职权和能力。

## 3、内部控制制度及措施

中国工商银行托管业务部具备系统、完善的制度控制体系，建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程，可以保证托管业务的规范操作和顺利进行；业务人员具备从业资格；业务管理严格实行复核、审核、检查制度，授权工作实行集中控制，业务印章按规程保管、存放、使用，账户资料严格保管，制约机制严格有效；业务操作区专门设置，封闭管理，实施音像监控；业务信息由专职信息披露人员负责，防止泄密；业务实现自动化操作，防止人为事故的发生，技术系统完整、独立。

## 五、托管人对管理人运作集合计划进行监督的方法和程序

中国工商银行制定《中国工商银行资产托管交易监督管理办法》、《中国工商银行资产托管交易监督业务指引》，规范总分行交易监督工作的职责分工、业务流程等具体内容，为交易监督业务提供了基础的制度保障。工商银行资产托管部设置监督与风险管理处，其中交易监督团队共有监督经理十人，负责对总行托管资产的监督业务，以及对各托管分部监督工作的管理与指导。工商银行设置了专门负责监督托管资产投资运作的交易监督岗位，通过完备、强大的交易监督系统，在事前、事中、事后进行全程监督，采取系统自动监控和人工监督相结合的多重手段，及时、准确的评估和监督投资运作。

中国工商银行通过在交易前的协议签订、流程控制等方面，进行事前监督；对于可以实施有效控制的指令，工商银行逐笔审核，实施事中监督；对于已经生效的指令，工商银行在交易确认并估值完成后实施事后监督。全程监控违规行

为，保持对托管资产监督的持续性。

中国工商银行采取系统自动监控与人工监督相结合的方式，对管理人的投资运作行为进行监督，严格防范风险。在识别出投资管理人违规行为后，工商银行会依据违规行为所处的不同阶段和不同类型，采取有针对性的违规处理流程。

## 第五部分 相关服务机构

### 一、集合计划销售机构

#### 1、直销机构：上海光大证券资产管理有限公司

名称：上海光大证券资产管理有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 799 号 3 号楼 26 层

法定代表人：熊国兵

成立日期：2012 年 5 月 9 号

注册资本：2 亿元人民币

存续期限：持续经营

电话：021-22169999

#### 2、其他销售机构

管理人可根据有关法律法规的要求，选择其他符合要求的销售机构销售本集合计划，管理人增减或变更本集合计划的销售机构时，并在管理人网站公示。

### 二、集合计划登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

住所：北京市西城区太平桥大街 17 号

法定代表人：周明

### 三、律师事务所与经办律师：

名称：上海市通力律师事务所

注册地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

办公地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

负责人：俞卫锋

联系电话：021-31358666

传真：021-31358600

联系人：丁媛

经办律师：黎明、丁媛



#### 四、审计集合计划财产的会计师事务所

名称：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：中国北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 16 层

办公地址：中国北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 16 层

执行事务合伙人：毛鞍宁

联系电话：010-58153000

传真：010-85188298

联系人：王自清

经办注册会计师：赵英、王自清

---

---

## 第六部分 集合计划的历史沿革

本集合计划由光大阳光混合优选（阳光 6 号）集合资产管理计划（以下简称“原集合计划”）变更而来。

原集合计划为非限定性集合资产管理计划，自 2009 年 11 月 16 日起开始募集并于 2009 年 12 月 15 日结束募集，于 2009 年 12 月 28 日成立。中国证监会对原集合计划出具了批准文件《关于核准光大证券股份有限公司设立光大阳光混合优选（阳光 6 号）集合资产管理计划的批复》（证监许可【2009】980 号）。根据中国证监会《关于核准光大证券股份有限公司设立证券资产管理子公司的批复》（证监许可[2011]1886 号），上海光大证券资产管理有限公司于 2012 年 5 月 9 日正式成立。原集合资产管理计划的管理人由“光大证券股份有限公司”变更为“上海光大证券资产管理有限公司”。

根据中国证监会于 2018 年 11 月 28 日发布的《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》的规定，本集合计划参照《中华人民共和国证券投资基金法》等公开募集证券投资基金相关法律、行政法规及中国证监会的规定进行变更，并将集合计划名称由原“光大阳光混合优选（阳光 6 号）集合资产管理计划”变更为“光大阳光优选一年持有期混合型集合资产管理计划”，变更后的资产管理合同自管理人公告的生效之日起生效。

## 第七部分 集合计划的存续

《资产管理合同》生效后，连续 20 个工作日出现集合计划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，管理人应当在定期报告中予以披露；连续 60 个工作日出现前述情形的，管理人应当在 10 个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如持续运作、转换运作方式、与其他集合计划合并或者终止资产管理合同等，并在 6 个月内召开集合计划份额持有人大会进行表决。

法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。

## 第八部分 集合计划份额的申购与赎回

管理人仅办理 B 类、C 类份额在每个开放日的申购和赎回业务，但对每份 B 类、C 类份额设置一年锁定持有期，锁定持有期内不办理赎回业务。A 类份额只在每个开放日开放赎回，不开放申购。

### 一、申购和赎回场所

本集合计划的申购与赎回将通过销售机构进行。具体的销售机构将由管理人在招募说明书或其网站列明。管理人可根据情况变更或增减销售机构，并在管理人网站公示。集合计划投资者应当在销售机构办理集合计划销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理集合计划份额的申购与赎回。

若管理人或其指定的销售机构开通电话、传真或网上等交易方式，投资人可以通过上述方式进行集合计划份额的申购与赎回。具体办法由管理人或指定的销售机构另行公告。

### 二、申购和赎回的开放日及时间

#### 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和赎回，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（若本集合计划参与港股通交易且该工作日为非港股通交易日时，则管理人可根据实际情况决定本集合计划是否开放申购、赎回及转换等业务，具体以届时提前发布的公告为准）。但管理人根据法律法规、中国证监会的要求或资产管理合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。开放日的具体业务办理时间在届时相关公告中载明。

资产管理合同生效后，若出现新的证券/期货市场、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。

#### 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。

原集合计划份额在资产管理合同生效后变更为 A 类份额。资产管理合同生效后，管理人不办理该类份额的申购业务，红利再投资份额除外。对 A 类份额不设置锁定持有期，可在本集合计划开放赎回业务后的任一开放日办理赎回业务。

本集合计划 B 类或 C 类份额的锁定持有期到期日后，管理人开始办理 B 类或 C 类份额的赎回业务。对于每份 B 类或 C 类份额，自其开放持有期首日起才能办理赎回业务，由红利再投资而来的 B 类或 C 类份额不受锁定持有期的限制。

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。管理人不得在资产管理合同约定之外的日期或者时间办理集合计划份额的申购、赎回或者转换。投资人在资产管理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，其集合计划份额申购、赎回价格为下一开放日集合计划份额申购、赎回的价格。

### 三、申购与赎回的原则

1、“未知价”原则，即申购、赎回价格以申请当日收市后计算的集合计划份额净值为基准进行计算；

2、“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

3、当日的申购与赎回申请可以在管理人规定的时间以内撤销；

4、赎回遵循“先进先出”原则，即按照份额持有人持有集合计划份额登记日期的先后次序进行顺序赎回；

5、办理申购、赎回业务时，应当遵循集合计划份额持有人利益优先原则，确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待。

管理人可在法律法规允许且对份额持有人无实质性不利影响的前提下，对上述原则进行调整。管理人必须在新规则开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

### 四、申购与赎回的程序

#### 1、申购和赎回的申请方式

投资人必须根据销售机构规定的程序，在开放日的具体业务办理时间内提出申购或赎回的申请。

#### 2、申购和赎回的款项支付

投资人申购集合计划份额时，必须全额交付申购款项，投资人交付申购款项，申购成立；集合计划份额登记机构确认集合计划份额时，申购生效。

集合计划份额持有人递交赎回申请，赎回成立；集合计划份额登记机构确认

赎回时，赎回生效。投资者赎回申请生效后，管理人将在 T+7 日（包括该日）内支付赎回款项。在发生巨额赎回或资产管理合同载明的其他暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形时，款项的支付办法参照资产管理合同有关条款处理。遇证券/期货交易所或交易市场数据传输延迟、通讯系统故障、银行数据交换系统故障或其它非管理人及非托管人所能控制的因素影响业务处理流程时，赎回款项顺延至前述因素消失日的下一个工作日划出。

### 3、申购和赎回申请的确认

管理人应以交易时间结束前受理有效申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日（T 日），在正常情况下，登记机构在 T+1 日内对该交易的有效性进行确认。T 日提交的有效申请，投资人可在 T+2 日后（包括该日）到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。若申购不成功，则申购款项退还给投资人。管理人可以在法律法规允许的范围内，对上述业务办理时间进行调整，并提前公告。

销售机构对申购、赎回申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到申购、赎回申请。申购、赎回的确认以登记机构的确认结果为准。对于申请的确认情况，投资人应及时查询并妥善行使合法权利。

## 五、申购和赎回的数量限制

### 1、申购金额的限制

管理人不办理 A 类集合计划份额的申购业务，只开放赎回业务。

管理人仅办理 B 类、C 类集合计划份额的申购业务。

投资人单笔申购的最低金额为【10】元（含申购费）。各销售机构对本集合计划最低申购金额及交易级差有其他规定的，以各销售机构的业务规定为准。

### 2、赎回份额的限制

集合计划份额持有人可将其全部或部分集合计划份额赎回。单笔赎回申请最低份额为【1】份，若某集合计划份额持有人赎回时在销售机构保留的集合计划份额不足【10】份，则该次赎回时必须一起赎回。

3、本集合计划不对投资人每个交易账户的最低集合计划份额余额进行限制，但各销售机构对交易账户最低份额余额有其他规定的，以各销售机构的业务规定为准。

4、本集合计划不对单个投资人累计持有的集合计划份额上限进行限制。法律法规或中国证监会另有规定的除外。

5、当接受申购申请对存量集合计划份额持有人利益构成潜在重大不利影响时，管理人应当采取设定单一投资者申购金额上限或集合计划单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停集合计划申购等措施，切实保护存量集合计划份额持有人的合法权益。管理人基于投资运作与风险控制的需要，可采取上述措施对集合计划规模予以控制。具体见管理人相关公告。

6、管理人可在法律法规允许的情况下，调整上述规定申购金额和赎回份额等数量限制。管理人必须在调整前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

## 六、申购和赎回的价格、费用及其用途

### 1、申购费用

管理人仅办理 B 类份额、C 类份额的申购业务，C 类份额不收取申购费。

本集合计划 B 类份额的申购费率如下：

申购金额（P）	申购费率
P<100 万元	1.5%
100 万元≤P<500 万元	1.2%
500 万元≤P<1000 万元	0.8%
P≥1000 万元	1000 元/笔

### 2、赎回费用

#### （1）A类份额

A 类份额的赎回费率具体如下：

赎回申请份额持有时间（Y）	赎回费率
Y<7 日	1.50%
7 日≤Y<30 日	0.75%
30 日≤Y<365 日	0.5%
365 日≤Y<730 日	0.2%
Y≥730 日	0

A 类份额的赎回费用由赎回 A 类份额的集合计划份额持有人承担，在集合计划份额持有人赎回集合计划份额时收取。对持续持有期少于 30 日的投资人收取的赎回费全额计入集合计划财产；对持续持有期不少于 30 日但少于 3 个月的投资人收取的赎回费总额的 75% 计入集合计划财产；对持续持有期不少于 3 个月但少于 6 个月的投资人收取的赎回费总额的 50% 计入集合计划财产；对持续持有期不少于 6 个月的投资人收取的赎回费总额的 25% 计入集合计划财产。

注：A 类份额持有时间从登记机构确认投资人持有原光大阳光混合优选（阳光 6 号）集合资产管理计划的份额期限连续计算。

(2) B 类、C 类份额

每份 B 类、C 类份额设置一年锁定持有期，锁定持有期内不办理赎回业务。

B 类、C 类份额的赎回费率具体如下：

赎回申请份额持有时间（Y）	赎回费率
365 日 ≤ Y < 730 日	0.2%
Y ≥ 730 日	0

B 类、C 类计划份额的赎回费用由赎回 B 类、C 类计划份额的集合计划份额持有人承担，在集合计划份额持有人赎回集合计划份额时收取。对持续持有期不少于 6 个月的投资人收取的赎回费总额的 25% 计入集合计划财产。

3、管理人可以在资产管理合同约定的范围内调整费率或收费方式，并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

4、当本集合计划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。摆动定价机制具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律规则的规定，具体见管理人届时的相关公告。

5、管理人可以在不违反法律法规规定及资产管理合同约定且对份额持有人利益无实质性不利影响的情形下根据市场情况制定促销计划，定期或不定期地开展促销活动。在促销活动期间，按相关监管部门要求履行必要手续后，管理人可以适当调低集合计划的销售费率。

七、申购份额和赎回金额的计算

1、申购份额的计算



管理人仅办理 B 类、C 类份额的申购业务，C 类份额不收取申购费。

本集合计划申购采用金额申购的方式。集合计划的申购金额包括申购费用和净申购金额。

(1) 申购费用适用比例费率时，申购份额的计算方法如下：

$$\text{净申购金额} = \text{申购金额} / (1 + \text{申购费率})$$

$$\text{申购费用} = \text{申购金额} - \text{净申购金额}$$

$$\text{申购份额} = \text{净申购金额} / \text{T 日集合计划份额净值}$$

(2) 申购费用适用固定金额时，申购份额的计算方法如下：

$$\text{申购费用} = \text{固定金额}$$

$$\text{净申购金额} = \text{申购金额} - \text{申购费用}$$

$$\text{申购份额} = \text{净申购金额} / \text{T 日集合计划份额净值}$$

上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后 2 位，由此产生的收益或损失由集合计划财产承担。

例：某投资人投资 10,000.00 元申购本集合计划 B 类份额，对应费率为 1.50%，假设申购当日该类集合计划份额净值为 1.1590 元，则其可得到的申购份额为：

$$\text{净申购金额} = 10,000.00 / (1 + 1.50\%) = 9,852.22 \text{ 元}$$

$$\text{申购费用} = 10,000.00 - 9,852.22 = 147.78 \text{ 元}$$

$$\text{申购份额} = 9,852.22 / 1.1590 = 8,500.62 \text{ 份}$$

投资人投资 10,000.00 元申购本集合计划 B 类份额，假设申购当日该类集合计划份额净值为 1.1590 元，则可得到 8,500.62 份 B 类份额。

## 2、赎回金额的计算

赎回金额的计算方法如下：

赎回总金额 = 赎回份额 × T 日该类集合计划份额净值 - 应计提的业绩报酬  
(如有)

$$\text{赎回费用} = \text{赎回总金额} \times \text{相应的赎回费率}$$

净赎回金额 = 赎回总金额 - 赎回费用  
上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后 2 位，由此产生的收益或损失由集合计划财产承担。

例：某投资人赎回 10,000 份 A 类集合计划份额，持有时间为 735 日，对应的赎回费率为 0%，假设赎回当日 A 类集合计划份额净值为 1.2500 元，且该投资

人该笔集合计划份额未产生业绩报酬，则其获得的赎回金额计算如下：

$$\text{赎回总金额} = 10,000.00 \times 1.2500 - 0 = 12,500.00 \text{ 元}$$

$$\text{赎回费用} = 12,500.00 \times 0 = 0 \text{ 元}$$

$$\text{净赎回金额} = 12,500.00 - 0 = 12,500.00 \text{ 元}$$

即投资人赎回 10,000 份 A 类集合计划份额，持有时间为 735 日，假设赎回当日 A 类集合计划份额净值为 1.2500 元，该投资人该笔集合计划份额未产生业绩报酬，则可得到赎回金额 12,500.00 元。

3、本集合计划各类份额净值的计算，保留到小数点后 4 位，小数点后第 5 位四舍五入，由此产生的收益或损失由集合计划财产承担。T 日的各类集合计划份额净值在当天收市后计算，并在 T+1 日内公告。遇特殊情况，经履行适当程序，可以适当延迟计算或公告。

#### 八、拒绝或暂停申购的情形

发生下列情况时，管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请：

- 1、因不可抗力导致集合计划无法正常运作。
- 2、发生资产管理合同规定的暂停集合计划资产估值情况时，管理人可暂停或拒绝接受投资人的申购申请。
- 3、证券/期货交易所交易时间非正常停市或者港股通临时停市，导致管理人无法计算当日集合计划资产净值。
- 4、接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有集合计划份额持有人利益时。
- 5、集合计划资产规模过大，使管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对集合计划业绩产生负面影响，或发生其他损害现有集合计划份额持有人利益的情形。
- 6、当前一估值日集合计划资产净值 50% 以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与托管人协商确认后，管理人应当暂停接受集合计划申购申请。
- 7、管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有集合计划份额的比例达到或者超过 50%，或者变相规避 50% 集中度的情形。
- 8、港股通交易每日额度不足。

9、管理人、托管人、销售机构或登记机构因技术故障或异常情况导致销售系统或登记系统或会计系统无法正常运行。

10、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述第 1、2、3、5、6、8、9、10 项暂停申购情形之一且管理人决定暂停接受投资人申购申请时，管理人应当根据有关规定在规定媒介上刊登暂停申购公告。发生上述第 7 项情形时，管理人可以采取比例确认等方式对该投资人的申购申请进行限制，管理人有权拒绝该等全部或者部分申购申请。如果投资人的申购申请被全部或部分拒绝，被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，管理人应及时恢复申购业务的办理。

九、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

发生下列情形时，管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项：

1、因不可抗力导致管理人不能支付赎回款项。

2、发生资产管理合同规定的暂停集合计划资产估值情况时，管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项。

3、证券/期货交易所交易时间非正常停市或者港股通临时停市，导致管理人无法计算当日集合计划资产净值。

4、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。

5、发生继续接受赎回申请将损害现有集合计划份额持有人利益的情形时，管理人可暂停接受集合计划份额持有人的赎回申请。

6、当前一估值日集合计划资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与托管人协商确认后，管理人应当延缓支付赎回款项或暂停接受集合计划赎回申请。

7、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一且管理人决定暂停赎回或延缓支付赎回款项时，管理人应在当日报中国证监会备案，已确认的赎回申请，管理人应足额支付；如暂时不能足额支付，应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分可延期支付。若出现上述第 4 项所述情形，按资产管理合同的相关条款处理。集合计划份额持有人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。在暂停赎回的情况消除时，管理人应及时恢复赎回业务的办理并

公告。

## 十、巨额赎回的情形及处理方式

### 1、巨额赎回的认定

若本集合计划单个开放日内的集合计划份额净赎回申请(赎回申请份额总数加上集合计划转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及集合计划转换中转入申请份额总数后的余额)超过前一开放日的集合计划总份额的 10%，即认为是发生了巨额赎回。

### 2、巨额赎回的处理方式

当集合计划出现巨额赎回时，管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。

(1) 全额赎回：当管理人认为有能力支付投资人的全部赎回申请时，按正常赎回程序执行。

(2) 部分延期赎回：当管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对集合计划资产净值造成较大波动时，管理人在当日接受赎回比例不低于上一开放日集合计划总份额的 10% 的前提下，可对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；对于未能赎回部分，投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的该类集合计划份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。

(3) 在发生巨额赎回时，如发生单个开放日内单个集合计划份额持有人申请赎回的集合计划份额超过前一开放日的集合计划总份额的 20% 时，管理人有权先行对该单个集合计划份额持有人超出前一开放日集合计划总份额 20% 以上的部分赎回申请实施延期办理，管理人只接受其集合计划总份额 20% 以内(含 20%) 部分作为当日有效赎回申请，而对该单个集合计划份额持有人 20% 以内(含 20%) 的赎回申请与当日其他投资者的赎回申请按前述“(1) 全额赎回”或“(2) 部分

延期赎回”条款处理。

(4) 暂停赎回：连续 2 个开放日以上(含本数)发生巨额赎回，如管理人认为有必要，可暂停接受集合计划的赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过 20 个工作日，并应当在规定媒介上进行公告。

### 3、巨额赎回的公告

当发生上述巨额赎回并延期办理时，管理人应当通过邮寄、传真或者管理人网站等其他方式在 3 个交易日内通知集合计划份额持有人，说明有关处理方法，并在两日内在规定媒介上刊登公告。

## 十一、暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

1、发生上述暂停申购或赎回情况的，管理人应在规定期限内在规定媒介上刊登暂停公告。

2、如发生暂停的时间为 1 日，管理人应于重新开放日，在规定媒介上刊登集合计划重新开放申购或赎回公告，并公布最近 1 个开放日的各类集合计划份额净值。

3、如发生暂停的时间超过 1 日但少于 2 周（含 2 周），暂停结束，和计划重新开放申购或赎回时，管理人应提前 2 日在规定媒介上刊登集合计划重新开放申购或赎回公告，并公告最近 1 个开放日的各类集合计划份额净值。

4、如发生暂停的时间超过 2 周，暂停期间，管理人应每 2 周至少刊登暂停公告 1 次。暂停结束，集合计划重新开放申购或赎回时，管理人应提前 2 日在规定媒介上连续刊登集合计划重新开放申购或赎回公告，并公告最近 1 个开放日的各类集合计划份额净值。

## 十二、集合计划转换

管理人可以根据相关法律法规以及资产管理合同的规定决定开办本集合计划份额与管理人管理的其他集合计划份额之间的转换业务，集合计划转换可以收取一定的转换费，相关规则由管理人届时根据相关法律法规及资产管理合同的规定制定并公告，并提前告知托管人与相关机构。

## 十三、集合计划的非交易过户

集合计划的非交易过户是指登记机构受理继承、捐赠和司法强制执行等情形而产生的非交易过户以及登记机构认可、符合法律法规的其它非交易过户。无论

在上述何种情况下，接受划转的主体必须是依法可以持有本集合计划份额的投资人。

继承是指集合计划份额持有人死亡，其持有的集合计划份额由其合法的继承人继承；捐赠指集合计划份额持有人将其合法持有的集合计划份额捐赠给福利性质的基金会或社会团体；司法强制执行是指司法机构依据生效司法文书将集合计划份额持有人持有的集合计划份额强制划转给其他自然人、法人或其他组织。办理非交易过户必须提供登记机构要求提供的相关资料，对于符合条件的非交易过户申请按登记机构的规定办理，并按登记机构规定的标准收费。

#### 十四、集合计划的转托管

集合计划份额持有人可办理已持有集合计划份额在不同销售机构之间的转托管，销售机构可以按照规定的标准收取转托管费。

#### 十五、定期定额投资计划

管理人可以为投资人办理定期定额投资计划，具体规则由管理人另行规定。投资人在办理定期定额投资计划时可自行约定每期扣款金额，每期扣款金额必须不低于管理人在相关公告或更新的招募说明书中所规定的定期定额投资计划最低申购金额。

#### 十六、集合计划的冻结和解冻与质押

登记机构只受理国家有权机关依法要求的集合计划份额的冻结与解冻，以及登记机构认可、符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻。集合计划账户或集合计划份额被冻结的，被冻结部分产生的权益一并冻结，被冻结部分份额仍然参与收益分配与支付，法律法规另有规定的除外。

如相关法律法规允许管理人办理集合计划份额的质押业务或其他集合计划业务，管理人将制定和实施相应的业务规则。

#### 十七、集合计划份额的转让

在法律法规允许且条件具备的情况下，管理人可受理集合计划份额持有人通过中国证监会认可的交易场所或者交易方式进行份额转让的申请并由登记机构办理集合计划份额的过户登记。管理人拟受理集合计划份额转让业务的，将提前公告，集合计划份额持有人应根据管理人公告的业务规则办理集合计划份额转让业务。

#### 十八、实施侧袋机制期间本集合计划的申购与赎回

本集合计划实施侧袋机制的，本集合计划的申购和赎回安排详见招募说明书“侧袋机制”部分的规定。

---

---

## 第九部分 集合计划的投资

### 一、投资目标

在深入研究，控制和分散投资组合风险的前提下，实现集合计划资产的长期稳健增值。

### 二、投资范围

本集合计划的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（含主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准或同意注册上市的股票）、港股通标的股票、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、政府支持债券、地方政府债券、可交换债券、可转换债券（含分离交易可转债的纯债部分）及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、股指期货、国债期货以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。

本集合计划的投资组合比例为：股票资产占集合计划资产的比例为 60%~95%（其中投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%）；每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金以及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%，前述现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。

如果法律法规或监管机构变更投资品种的投资比例限制，管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

### 三、投资策略

#### （一）资产配置策略

本集合计划通过定性与定量研究相结合的方法，确定投资组合中权益类资产和固定收益类资产的配置比例。本集合计划通过动态跟踪海内外主要经济体的 GDP、CPI、利率等宏观经济指标，以及估值水平、盈利预期、流动性、投资者



心态等市场指标，确定未来市场变动趋势。本集合计划通过全面评估上述各种关键指标的变动趋势，对股票、债券等大类资产的风险和收益特征进行预测。根据上述定性和定量指标的分析结果，运用资产配置优化模型，在目标收益条件下，追求风险最小化目标，最终确定大类资产投资权重，实现资产合理配置。

## （二）权益类品种的投资策略

### 1、行业配置策略

本集合计划通过综合比较商业模式、产业生命周期、成长性和估值的匹配度等因素，在全市场优选行业；并通过量化分析的手段，综合考虑经济意义、商业逻辑和策略实操性，建立宏观指标与行业超额收益之间具有内在逻辑的映射关系，以此作为行业配置收益增强的辅助策略。

### 2、股票投资策略

#### （1）股票组合的构建

本集合计划首先通过行业发展前景及竞争格局考察、公司竞争力分析、公司可持续成长潜力评估及投资吸引力评估等四个层面的综合比较初步筛选出投资备选股票。然后，以全球市场为参照，通过对经济发展阶段、行业发展阶段和前景、公司综合竞争能力的逐层分解，形成对公司的相对估值判断。最后，由研究员通过调研、财务分析及量化估值等方法，筛选出质地优良、盈利持续增长、估值具备吸引力和市场预期持续改善的公司构建股票投资组合。

#### （2）港股通股票投资策略

本集合计划将通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港股票市场，不使用合格境内机构投资者(QDII)境外投资额度进行境外投资。本集合计划将关注在港股市场上市、具有行业代表性和核心竞争力的优质公司，关注港股市场在行业结构、估值、AH股折溢价、股息率等方面具有吸引力的投资标的。

## （三）固定收益类品种投资策略

在债券投资方面，本集合计划可投资于国债、金融债、企业债和可转换债券等债券品种。本计划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、不同品种流动性的高低等因素，构造债券组合。

## （四）资产支持证券投资策略

本集合计划将重点对市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿

还率、风险补偿收益和市场流动性等影响资产支持证券价值的因素进行分析，并辅助采用定价模型，评估资产支持证券的相对投资价值并做出相应的投资决策。

#### （五）衍生品投资策略

##### 1、股指期货投资策略

管理人可运用股指期货，以提高投资效率更好地达到本集合计划的投资目标。本集合计划在股指期货投资中将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。

##### 2、国债期货的投资策略

本集合计划投资国债期货以套期保值为目的，国债期货空头的合约价值主要与债券组合的多头价值相对应。管理人通过动态管理国债期货合约数量，以获取相应债券组合的超额收益。

#### 四、投资限制

##### 1、组合限制

集合计划的投资组合应遵循以下限制：

（1）本集合计划股票资产占集合计划资产的比例为 60%~95%（其中投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%）；

（2）每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本集合计划保留的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（同一家公司在内地和香港同时上市的 A+H 股合并计算），其市值不超过集合计划资产净值的 10%；

（4）管理人管理的全部公开募集性质的集合计划持有一家公司发行的证券（同一家公司在内地和香港同时上市的 A+H 股合并计算），不超过该证券的 10%，完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的集合计划品种可以不受此条款规定的比例限制；

（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公开募集性质的集合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信用评级为 **BBB** 以上（含 **BBB**）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；

(10) 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；

(11) 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；

(12) 本管理人管理的全部公开募集性质的开放式集合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集合计划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；

(13) 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本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；

(14) 本集合计划开展逆回购交易的，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；

(15) 本集合计划投资于股指期货的投资限制如下：

1) 本集合计划在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过集合计划资产净值的 10%；

2) 本集合计划在任何交易日日终，持有的买入股指期货和国债期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过集合计划资产净值的 95%，其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；

3) 本集合计划在任何交易日日终，持有的卖出股指期货合约价值不得超过集合计划持有的股票总市值的 20%；

4) 本集合计划所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合资产管理合同关于股票投资比例的有关约定；

5) 本集合计划在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指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 20%；

(16)本集合计划投资于国债期货的投资限制如下：

1) 本集合计划在任何交易日日终，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) 本集合计划在任何交易日日终，持有的买入股指期货和国债期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过集合计划资产净值的 95%。其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；

3) 本集合计划在任何交易日日终，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%；

4) 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）应当符合资产管理合同关于债券投资比例的有关约定；

5) 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%；

(17)本集合计划资产总值不超过集合计划资产净值的 140%；

(18)法律法规及中国证监会规定的和《资产管理合同》约定的其他投资限制。

除上述（2）、（9）、（13）、（14）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、投资策略应当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。

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以调整后的规定为准。

## 2、禁止行为

为维护集合计划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。

如法律、行政法规或监管部门取消或调整上述禁止性规定，则管理人在履行适当程序后，本集合计划不受上述规定的限制或以调整后的规定为准。

## 五、业绩比较基准

本集合计划的业绩比较基准为：中证 800 指数收益率×60%+中债综合指数收益率×20%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×20%。

选择该业绩比较基准，是基于以下因素：

(1) 中证 800 指数是由中证指数有限公司编制，其成份股是由中证 500 和沪深 300 成份股一起构成，可以综合反映沪深证券市场内大中小市值公司的整体状况，具有良好的市场代表性和市场影响力；

(2) 中债综合指数是中央国债登记结算有限责任公司编制的反映境内人民币债券市场价格走势情况的宽基指数。该指数的样本主要包括国债、政策性银行债券、商业银行债券、中期票据、短期融资券、企业债、公司债等；

(3) 中证港股通综合指数选取符合港股通资格的普通股作为样本股，以反映港股通范围内上市公司的整体状况和走势。

基于本集合计划的投资范围和投资比例，选用上述业绩比较基准能够真实、客观地反映本集合计划的风险收益特征。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，或者是市场上出现更加适合用于本集合计划的业绩基准的指数时，则管理人可与托管人协商一致并按照监管部门要求履行适当程序后，调整或变更本集合计划的业绩比较基准并及时公告，无需召开集合计划份额持有人大会。

## 六、风险收益特征

本集合计划为混合型集合计划，其预期风险和预期收益高于债券型基金、债券型集合计划、货币市场基金和货币型集合资产管理计划，低于股票型基金和股票型集合计划。

本集合计划除了投资 A 股外，还可根据法律法规规定投资香港联合交易所上市的股票。除了需要承担与境内集合计划类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本集合计划还面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

## 七、管理人代表集合计划行使股东或债权人权利的处理原则及方法

1、管理人按照国家有关规定代表集合计划独立行使股东或债权人权利，保护集合计划份额持有人的利益；

2、不谋求对上市公司的控股；

3、有利于集合计划财产的安全与增值；

4、不通过关联交易为自身、雇员、授权代表或任何存在利害关系的第三人

牟取任何不当利益。

#### 八、侧袋机制的实施和投资运作安排

当集合计划持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，根据最大限度保护集合计划份额持有人利益的原则，管理人经与托管人协商一致，并咨询会计师事务所意见后，可以依照法律法规及资产管理合同的约定启用侧袋机制。

侧袋机制实施期间，本部分约定的投资组合比例、投资策略、组合限制、业绩比较基准、风险收益特征等约定仅适用于主袋账户。

侧袋账户的实施条件、实施程序、运作安排、投资安排、特定资产的处置变现和支付等对投资者权益有重大影响的事项详见招募说明书“侧袋机制”部分的规定。

---

---

## 第十部分 集合计划的财产

### 一、集合计划资产总值

集合计划资产总值是指购买的各类证券及票据价值、银行存款本息和集合计划应收的申购款以及其他投资所形成的价值总和。

### 二、集合计划资产净值

集合计划资产净值是指集合计划资产总值减去集合计划负债后的价值。

### 三、集合计划财产的账户

托管人根据相关法律法规、规范性文件为本集合计划开立资金账户、证券账户以及投资所需的其他专用账户。开立的集合计划专用账户与管理人、托管人、集合计划销售机构和集合计划登记机构自有的财产账户以及其他集合计划财产账户相独立。

### 四、集合计划财产的保管和处分

本集合计划财产独立于管理人、托管人和集合计划销售机构的财产，并由托管人保管。管理人、托管人、集合计划登记机构和集合计划销售机构以其自有的财产承担其自身的法律责任，其债权人不得对本集合计划财产行使请求冻结、扣押或其他权利。除依法律法规和《资产管理合同》的规定处分外，集合计划财产不得被处分。

管理人、托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，集合计划财产不属于其清算财产。管理人管理运作集合计划财产所产生的债权，不得与其固有资产产生的债务相互抵销；管理人管理运作不同集合计划的集合计划财产所产生的债权债务不得相互抵销。非因集合计划财产本身承担的债务，不得对集合计划财产强制执行。



---

---

## 第十一部分 集合计划资产估值

### 一、估值日

本集合计划的估值日为本集合计划相关的证券交易场所的交易日以及国家法律法规规定需要对外披露集合计划净值的非交易日。

### 二、估值对象

集合计划所拥有的股票、股指期货合约、国债期货合约、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。

### 三、估值原则

管理人在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，应符合《企业会计准则》、监管部门有关规定。

（一）对存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的投资品种，在估值日有报价的，除会计准则规定的例外情况外，应将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量。估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，管理人不应考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

（二）对不存在活跃市场的投资品种，应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公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

（三）如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，使潜在估值调整对前一估值日的资产净值的影响在 0.25% 以上的，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 四、估值方法

##### 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对应的当日估值净价估值；

(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) 对在交易所市场上市交易的可转换债券，选取每日收盘价作为估值全价；

(5) 在交易所上市并以全价交易的债券以每日收盘价作为估值全价；

(6) 交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。交易所上市的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

##### 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和债券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值；

(3) 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进行估值；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，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，则采用估值技术确定公允价值；

(4) 流通受限的股票，包括非公开发行股票、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。对于含投资人回售权的固定收益品种，回售登记期截止日（含当日）后未行使回售权的按照长待偿期所对应的价格进行估值。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，在发行利率与二级市场利率不存在明显差异，未上市期间市场利率没有发生大的变动的情况下，按成本估值。

4、同一债券或股票同时在两个或两个以上市场交易的，按债券或股票所处的市场分别估值。

5、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，按成本估值。

6、股指期货合约、国债期货合约一般以估值当日结算价进行估值，估值日无结算价的，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。

7、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。

8、当本集合计划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，并需履行相关信息披露义务。

9、估值计算中涉及外币对人民币汇率的，将依据下列信息提供机构所提供的汇率为基准：估值当日中国人民银行或其授权机构公布的人民币汇率中间价为准。

10、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。

11、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资产管理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集合计划份额持有人利益时，应立即通知对方，共同查明原因，双方协商解决。

根据《基金法》，管理人计算集合计划资产净值，托管人复核管理人计算的集合计划资产净值。集合计划净值信息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。

## 五、估值程序

1、本集合计划不同类别份额将分别计算份额净值。计算公式为：

$$T \text{ 日某类集合计划份额净值} = T \text{ 日该类集合计划份额的资产净值} / T \text{ 日该类集合计划份额余额总数。}$$

集合计划份额净值是按照每个工作日闭市后，集合计划资产净值除以当日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。

管理人于每个工作日计算集合计划资产净值及各类集合计划份额的份额净值，并按规定公告。如遇特殊情况，经履行适当程序，可以适当延迟计算或公告。本集合计划各类份额净值未扣除管理人业绩报酬，不同时间参与的份额因申购时份额净值不同，持有期不同，对应的业绩报酬金额不同，赎回时应承担的业绩报酬金额也不同，实际赎回金额以登记机构确认数据为准。

2、管理人应每个工作日对集合计划资产估值。但管理人根据法律法规或资产管理合同的规定暂停估值时除外。管理人每个工作日对集合计划资产估值后，将集合计划各类份额净值结果发送托管人，经托管人复核无误后，由管理人按规定对外公布。

## 六、估值错误的处理

管理人和托管人将采取必要、适当、合理的措施确保集合计划资产估值的准确性、及时性。当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，视为集合计划份额净值错误。

资产管理合同的当事人应按照以下约定处理：

## 1、估值错误类型

本集合计划运作过程中，如果由于管理人或托管人、或登记机构、或销售机构、或投资人自身的过错造成估值错误，导致其他当事人遭受损失的，过错的责任人应当对由于该估值错误遭受损失当事人(“受损方”)的直接损失按下述“估值错误处理原则”给予赔偿，承担赔偿责任。

上述估值错误的主要类型包括但不限于：资料申报差错、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，若系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投资人的交易资料灭失或被错误处理或造成其他错误等，因不可抗力原因出现估值错误的当事人不对其他当事人承担赔偿责任，但因该估值错误取得不当得利的当事人仍应负有返还不当得利的义务。

## 2、估值错误处理原则

(1) 估值错误已发生，但尚未给当事人造成损失时，估值错误责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正估值错误发生的费用由估值错误责任方承担；由于估值错误责任方未及时更正已产生的估值错误，给当事人造成损失的，由估值错误责任方对直接损失承担赔偿责任；若估值错误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，则其应当承担相应赔偿责任。估值错误责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认，确保估值错误已得到更正。

(2) 估值错误的责任方对有关当事人的直接损失负责，不对间接损失负责，并且仅对估值错误的有关直接当事人负责，不对第三方负责。

(3) 因估值错误而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但估值错误责任方仍应对估值错误负责。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(“受损方”)，则估值错误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交付不当得利的权利；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估值错误责任方。

(4) 估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

### 3、估值错误处理程序

估值错误被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

(1) 查明估值错误发生的原因，列明所有的当事人，并根据估值错误发生的原因确定估值错误的责任方；

(2) 根据估值错误处理原则或当事人协商的方法对因估值错误造成的损失进行评估；

(3) 根据估值错误处理原则或当事人协商的方法由估值错误的责任方进行更正和赔偿损失；

(4) 根据估值错误处理的方法，需要修改集合计划登记机构交易数据的，由集合计划登记机构进行更正，并就估值错误的更正向有关当事人进行确认。

### 4、集合计划份额净值估值错误处理的方法如下：

(1) 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。

(2) 错误偏差达到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。

(3) 当集合计划份额净值计算差错给集合计划财产和份额持有人造成损失需要进行赔偿时，管理人和托管人应根据实际情况界定双方承担的责任，经确认后按以下条款进行赔偿：

①集合计划的会计责任方由管理人担任，与本集合计划有关的会计问题，如经双方在平等基础上充分讨论后，尚不能达成一致时，按管理人的建议执行，由此给份额持有人和集合计划财产造成的损失，由管理人负责赔付。

②若管理人计算的集合计划份额净值已由托管人复核确认后公告，由此给份额持有人造成损失的，应根据法律法规的规定对投资者或集合计划支付赔偿金，就实际向投资者或集合计划支付的赔偿金额，管理人与托管人按照固定管理费率和托管费率的比例各自承担相应的责任。

③如管理人和托管人对集合计划份额净值的计算结果，虽然多次重新计算和核对或对管理人采用的估值方法，尚不能达成一致时，为避免不能按时公布集合

计划份额净值的情形，以管理人的计算结果对外公布，由此给份额持有人和集合计划造成的损失，由管理人负责赔付。

④由于管理人提供的信息错误（包括但不限于集合计划申购或赎回金额等），进而导致集合计划份额净值计算错误而引起的份额持有人和集合计划财产的损失，由管理人负责赔付。

（4）管理人和托管人由于各自技术系统设置而产生的净值计算尾差，以管理人计算结果为准。

（5）前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。如果行业另有通行做法，管理人和托管人应本着平等和保护份额持有人利益的原则进行协商处理。

#### 七、暂停估值的情形

1、集合计划投资所涉及的证券、期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

2、因不可抗力致使管理人、托管人无法准确评估集合计划资产价值时；

3、当特定资产占前一估值日集合计划资产净值 50% 以上的，经与托管人协商确认后，管理人应当暂停估值；

4、法律法规、中国证监会和资产管理合同认定的其它情形。

#### 八、集合计划净值的确认

集合计划资产净值和集合计划份额净值由管理人负责计算，托管人负责进行复核。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集合计划份额净值并发送给托管人。托管人对净值计算结果复核确认后发送给管理人，由管理人对集合计划净值予以公布。

#### 九、特殊情形的处理

1、管理人、托管人按估值方法的第 10 项进行估值时，所造成的误差不作为集合计划资产估值错误处理。

2、由于不可抗力原因，或由于证券/期货交易所、证券/期货经纪机构及登记结算公司等第三方机构发送的数据错误，或国家会计政策变更、市场规则变更等，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。

#### 十、实施侧袋机制期间的集合计划资产估值

本集合计划实施侧袋机制的，应根据本部分的约定对主袋账户资产进行估值并披露主袋账户的集合计划净值信息，暂停披露侧袋账户份额净值。



---

---

## 第十二部分 集合计划的收益与分配

### 一、集合计划利润的构成

集合计划利润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、集合计划可供分配利润

集合计划可供分配利润指截至收益分配基准日集合计划未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。本集合计划的同一类别的每份集合计划份额享有同等分配权，由于本集合计划各类集合计划份额收取管理费的情况不同，各集合计划份额类别对应的可供分配利润将有所不同。

### 三、集合计划收益分配原则

- 1、在符合有关集合计划分红条件的前提下，本集合计划可进行收益分配；
- 2、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；每位份额持有人获得的分红收益金额或再投资份额保留小数点后两位，第三位四舍五入；

选择采取现金分配的，在该红利发放之日起 7 个工作日内，将现金红利划转到份额持有人的交易账户；选择采取红利再投资方式的，分红资金按分红除息日各类集合计划份额的单位净值转成相应的集合计划份额；

- 3、集合计划收益分配后各类集合计划份额净值不能低于面值；即集合计划收益分配基准日的各类集合计划份额净值减去每单位集合计划份额收益分配金额后不能低于面值；

4、本集合计划的同一类别的每份集合计划份额享有同等分配权，由于本集合计划各类集合计划份额收取管理费的情况不同，各集合计划份额类别对应的可供分配利润将有所不同；

- 5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

### 四、收益分配方案

集合计划收益分配方案中应载明截止收益分配基准日的可供分配利润、集

合计划收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。

#### 五、收益分配方案的确定、公告与实施

本集合计划收益分配方案由管理人拟定，并由托管人复核，在 2 日内在规  
定媒介公告。

#### 六、集合计划收益分配中发生的费用

集合计划收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。  
当投资者的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，集  
合计划登记机构可将集合计划份额持有人的现金红利自动转为相应类别的集合  
计划份额。红利再投资的计算方法，依照《业务规则》执行。

#### 七、实施侧袋机制期间的收益分配

本集合计划实施侧袋机制的，侧袋账户不进行收益分配。

---

---

## 第十三部分 集合计划费用与税收

### 一、集合计划费用的种类

- 1、管理人的固定管理费和业绩报酬；
- 2、托管人的托管费；
- 3、销售服务费；
- 4、《资产管理合同》生效后与集合计划相关的信息披露费用；
- 5、《资产管理合同》生效后与集合计划相关的会计师费、律师费、诉讼费和仲裁费；
- 6、集合计划份额持有人大会费用；
- 7、集合计划的证券、期货交易费用；
- 8、集合计划的银行汇划费用；
- 9、集合计划的开户费用、账户维护费用；
- 10、因投资港股通标的股票而产生的各项合理费用；
- 11、按照国家有关规定和《资产管理合同》约定，可以在集合计划财产中列支的其他费用。

本集合计划终止清算时所发生费用，按实际支出额从集合计划财产总值中扣除。

### 二、集合计划费用计提方法、计提标准和支付方式

#### 1、管理人的管理费

##### (1) 本集合计划的固定管理费

不同类别份额的固定管理费分别计算，从相应类别份额的资产净值中扣除。

A类份额的固定年管理费率为0.8%

B类、C类份额的固定年管理费率为0.6%

本集合计划的固定管理费计算方法如下：

$G = E \times \text{相应类别份额的固定年管理费率} \div \text{当年天数}$

G为该类集合计划份额每日应计提的管理费

E为该类集合计划份额前一日资产净值

集合计划固定管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经管理人

与托管人核对一致后，由托管人按照与管理人协商一致的方式，于次月前 5 个工作日内按照指定的账户路径从集合计划财产中支付给管理人。若遇法定节假日、公休日或战争、自然灾害等不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

## （2）管理人的业绩报酬

业绩报酬计提原则：

①按集合计划份额持有人每笔认/申购份额分别计算年化收益率并计提业绩报酬。

②在集合计划份额持有人赎回所有持有的集合计划份额（含转换出）或集合计划终止时，管理人对符合业绩报酬提取条件的计划份额计提业绩报酬。

③在集合计划份额持有人赎回（含转换出）确认日和集合计划终止时提取业绩报酬的，业绩报酬按该笔赎回（含转换出）的份额或集合计划终止时持有份额计算，从赎回资金或清算资金中扣除。

④赎回计划份额日计提业绩报酬时，按“先进先出”的原则，计算赎回计划份额应计提的业绩报酬。

### 1) A 类份额业绩报酬计提的方法：

A 类份额的年化收益率的计算公式如下：

$$R = \frac{P_1^* - P_0^*}{P_0} \times \frac{365}{D}$$

$R$  为该类别该笔份额年化收益率；

$P_1^*$  为该类别该笔份额业绩报酬计提日的计划份额累计净值；

$P_0^*$  为该类别该笔份额上一业绩报酬计提日的计划份额累计净值；

$P_0$  为该类别该笔份额上一业绩报酬计提日的计划份额净值；

$D$  为上一业绩报酬计提日到本次业绩报酬计提日的间隔天数。

对于不存在上一个业绩报酬计提日的份额，上一业绩报酬计提日对应为该份额认/申购时的注册登记日。

A 类份额年化收益率  $R \leq 5\%$  时，管理人不收取业绩报酬。

A 类份额年化收益率  $R > 5\%$  时，管理人收取持有期收益率超过 5% 以上部分

的 18% 作为业绩报酬。

A 类份额管理人业绩报酬计提公式如下：

年化收益率 (R)	计提比例	业绩报酬 (I)
$R \leq 5\%$	0	0
$R > 5\%$	18%	$I = (R - 5\%) \times 18\% \times P_0 \times F \times \frac{D}{365}$

其中：F 为 A 类该笔份额的份数。

(2) B 类、C 类份额业绩报酬计提的方法：

各类份额的年化收益率的计算公式如下：

$$R = \frac{P_1^* - P_0^*}{P_0} \times \frac{365}{D}$$

R 为该类别该笔份额年化收益率；

$P_1^*$  为该类别该笔份额业绩报酬计提日的计划份额累计净值；

$P_0^*$  为该类别该笔份额申购日的计划份额累计净值；

$P_0$  为该类别该笔份额申购日的计划份额净值；

D 为该类别该笔份额申购日与赎回日或计划合同终止日的间隔天数

B 类、C 类份额年化收益率  $R \leq 6\%$  时，管理人不收取业绩报酬。

B 类、C 类份额年化收益率  $R > 6\%$  时，管理人收取持有期收益率超过 6% 以上部分的 20% 作为业绩报酬。

B 类、C 类份额管理人业绩报酬计提公式如下：

年化收益率 (R)	计提比例	业绩报酬 (I)
$R \leq 6\%$	0	0
$R > 6\%$	20%	$I = (R - 6\%) \times 20\% \times P_0 \times F \times \frac{D}{365}$

上述计算过程中因系统计算精度产生的收益或损失由集合计划财产承担。

其中：F 为 B 类、C 类该笔份额的份数。

(3) 业绩报酬的支付

业绩报酬计提结束后，从赎回资金或清算资金中扣除。

管理人特别声明：业绩报酬计提基准不是保证收益率。集合计划份额持有人确认并充分了解，本集合计划相关的业绩报酬计提基准仅供管理人计算提取业绩报酬使用，不构成管理人、托管人对集合计划财产本金及收益状况的任何预测、承诺或担保。投资有风险，集合计划份额持有人面临无法取得相应收益甚至损失本金的风险。

## 2、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 0.2%年费率计提，计算方法如下：

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

T 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，经管理人与托管人核对一致后，由托管人按照与管理人协商一致的方式，于次月前 5 个工作日内按照指定的账户路径从集合计划财产中支付给托管人。若遇法定节假日、公休日或战争、自然灾害等不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

## 3、销售服务费

销售服务费用于本集合计划市场推广、销售以及集合计划份额持有人服务的费用。本集合计划 A、B 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【0.8】%。C 类份额的销售服务费按前一日 C 类份额的集合计划资产净值的【0.8】%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{销售服务费年费率} \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类份额前一日集合计划资产净值

销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经管理人与托管人核对一致后，由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、公休日或不可抗力等，支付日期顺延。

4、上述“一、集合计划费用的种类”中第 4—11 项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由托管人从集合计划财产中支

付。

### 三、不列入集合计划费用的项目

下列费用不列入集合计划费用：

1、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财产的损失；

2、管理人和托管人处理与集合计划运作无关的事项发生的费用；

3、《资产管理合同》生效前的相关费用，根据《光大阳光混合优选（阳光6号）集合资产管理计划资产管理合同》的约定执行；

4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入集合计划费用的项目。

### 四、费用调整

管理人和托管人协商一致后，可根据本集合计划发展情况调整固定管理费率、托管费率、业绩报酬的计提标准及计提比例。

调高固定管理费率、托管费率、业绩报酬的计提比例或调低业绩报酬的计提标准的，须召开份额持有人大会审议；调低固定管理费率、托管费率、业绩报酬的计提比例或调高业绩报酬的计提标准的，无须召开份额持有人大会。管理人调整固定管理费、托管费、业绩报酬的计提标准及计提比例，需于调整实施前书面告知托管人。

管理人必须于新的费率实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

### 五、集合计划税收

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。集合计划财产投资的相关税收，由集合计划份额持有人承担，管理人或者其他扣缴义务人按照国家有关税收征收的规定代扣代缴。

### 六、实施侧袋机制期间的集合计划费用

本集合计划实施侧袋机制的，与侧袋账户有关的费用可以从侧袋账户中列支，但应待侧袋账户资产变现后方可列支，有关费用可酌情收取或减免，但不得收取管理费和业绩报酬，详见招募说明书“侧袋机制”部分的规定。

## 第十四部分 集合计划份额的折算

### 一、集合计划份额折算基准日

在《资产管理合同》生效日或管理人决定的其他日期，管理人可根据市场情况确定折算基准日。

### 二、集合计划份额折算对象

份额折算基准日登记在册的本集合计划份额。

### 三、份额折算频率

不定期。

### 四、集合计划份额折算方式

管理人对本集合计划份额的折算方式，具体见管理人届时发布的相关公告。

### 五、集合计划份额折算期间的集合计划业务办理

为保证集合计划份额折算期间本集合计划的平稳运作，管理人可暂停本集合计划份额的申购或赎回等相关业务，具体见管理人届时发布的相关公告。

### 六、份额折算的公告

管理人应按照《信息披露办法》的规定在规定媒介公告，并报中国证监会备案。



## 第十五部分 集合计划的会计与审计

### 一、集合计划会计政策

- 1、管理人为本集合计划的会计责任方；
- 2、集合计划的会计年度为公历年度的1月1日至12月31日；
- 3、集合计划核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位；
- 4、会计制度执行国家有关会计制度；
- 5、本集合计划独立建账、独立核算；
- 6、管理人及托管人各自保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关规定编制集合计划会计报表；
- 7、托管人每月与管理人就集合计划的会计核算、报表编制等进行核对并以书面方式确认。

### 二、集合计划的年度审计

- 1、管理人聘请与管理人、托管人相互独立的符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所及其注册会计师对本集合计划的年度财务报表进行审计。
- 2、会计师事务所更换经办注册会计师，应事先征得管理人同意。
- 3、管理人认为有充足理由更换会计师事务所，须通报托管人。更换会计师事务所需在2日内在规定媒介公告。

---

---

## 第十六部分 集合计划的信息披露

一、本集合计划的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《流动性风险管理规定》、《资产管理合同》及其他有关规定。

### 二、信息披露义务人

本集合计划信息披露义务人包括管理人、托管人、召集集合计划份额持有人大会的集合计划份额持有人等法律法规和中国证监会规定的自然人、法人和非法人组织。

本集合计划信息披露义务人以保护集合计划份额持有人利益为根本出发点，按照法律法规和中国证监会的规定披露集合计划信息，并保证所披露信息的真实性、准确性、完整性、及时性、简明性和易得性。

本集合计划信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内，将应予披露的集合计划信息通过符合中国证监会规定条件的全国性报刊（以下简称“规定报刊”）及《信息披露办法》规定的互联网网站（以下简称“规定网站”）等媒介披露，并保证集合计划投资者能够按照《资产管理合同》约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。

三、本集合计划信息披露义务人承诺公开披露的集合计划信息，不得有下列行为：

- 1、虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏；
- 2、对证券投资业绩进行预测；
- 3、违规承诺收益或者承担损失；
- 4、诋毁其他管理人、托管人或者集合计划销售机构；
- 5、登载任何自然人、法人和非法人组织的祝贺性、恭维性或推荐性的文字；
- 6、中国证监会禁止的其他行为。

四、本集合计划公开披露的信息应采用中文文本。如同时采用外文文本的，集合计划信息披露义务人应保证不同文本的内容一致。不同文本之间发生歧义的，以中文文本为准。

本集合计划公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。

## 五、公开披露的集合计划信息

公开披露的集合计划信息包括：

（一）集合计划招募说明书、《资产管理合同》、集合计划托管协议、产品资料概要

1、《资产管理合同》是界定《资产管理合同》当事人的各项权利、义务关系，明确集合计划份额持有人大会召开的规则及具体程序，说明集合计划产品的特性等涉及集合计划投资者重大利益的事项的法律文件。

2、集合计划招募说明书应当最大限度地披露影响集合计划投资者决策的全部事项，说明集合计划申购和赎回安排、集合计划投资、集合计划产品特性、风险揭示、信息披露及集合计划份额持有人服务等内容。《资产管理合同》生效后，集合计划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，更新集合计划招募说明书并登载在规定网站上；集合计划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。集合计划终止运作的，管理人不再更新集合计划招募说明书。

3、集合计划托管协议是界定托管人和管理人在集合计划财产保管及集合计划运作监督等活动中的权利、义务关系的法律文件。

4、产品资料概要是招募说明书的摘要文件，用于向投资者提供简明的集合计划概要信息。《资产管理合同》生效后，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集合计划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，管理人不再更新产品资料概要。

本集合计划变更经中国证监会批准后，管理人将集合计划招募说明书提示性公告和《资产管理合同》提示性公告登载在规定报刊上，将集合计划招募说明书、产品资料概要、《资产管理合同》和集合计划托管协议登载在规定网站上；托管人应当同时将《资产管理合同》、集合计划托管协议登载在网站上。

（二）《资产管理合同》生效公告

管理人应当在规定媒介上登载《资产管理合同》生效公告。

（三）集合计划净值信息

《资产管理合同》生效后，在开始办理集合计划份额申购或者赎回前，管理

人应当至少每周在规定网站披露一次各类集合计划份额净值和集合计划份额累计净值。

在开始办理集合计划份额申购或者赎回后，管理人应当在不晚于每个开放日的次日，通过规定网站、集合计划销售机构网站或者营业网点披露开放日的各类集合计划份额净值和集合计划份额累计净值。

管理人应当在不晚于半年度和年度最后一日的次日，在规定网站披露半年度和年度最后一日的各类集合计划份额净值和集合计划份额累计净值。

#### （四）集合计划份额申购、赎回价格

管理人应当在《资产管理合同》、招募说明书等信息披露文件上载明集合计划份额申购、赎回价格的计算方式及有关申购、赎回费率，并保证投资者能够在集合计划销售机构网站或营业网点查阅或者复制前述信息资料。

（五）集合计划定期报告，包括集合计划年度报告、集合计划中期报告和集合计划季度报告

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。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。

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。

《资产管理合同》生效不足 2 个月的，管理人可以不编制当期季度报告、中期报告或者年度报告。

如报告期内出现单一投资者持有集合计划份额达到或超过集合计划总份额 20% 的情形，为保障其他投资者的权益，管理人至少应当在定期报告“影响投资者决策的其他重要信息”项下披露该投资者的类别、报告期末持有份额及占比、报告期内持有份额变化情况及本集合计划的特有风险，中国证监会认定的特殊情形除外。

管理人应当在集合计划年度报告和中期报告中披露集合计划组合资产情况

及其流动性风险分析等。

管理人应当在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告文件中披露业绩报酬收取情况，包括业绩报酬提取的总金额、分层提取比例等。

#### （六）临时报告

本集合计划发生重大事件，有关信息披露义务人应当在 2 日内编制临时报告书，并登载在规定报刊和规定网站上。

前款所称重大事件，是指可能对集合计划份额持有人权益或者集合计划份额的价格产生重大影响的下列事件：

- 1、集合计划份额持有人大会的召开及决定的事项；
- 2、《资产管理合同》终止、集合计划清算；
- 3、转换集合计划运作方式、集合计划合并；
- 4、更换管理人、托管人、集合计划份额登记机构，集合计划改聘会计师事务所；
- 5、管理人委托服务机构代为办理集合计划的份额登记、核算、估值等事项，托管人委托服务机构代为办理集合计划的核算、估值、复核等事项；
- 6、管理人、托管人的法定名称、住所发生变更；
- 7、管理人变更持有百分之五以上股权的股东、管理人的实际控制人变更；
- 8、管理人的高级管理人员、集合计划投资经理和托管人专门托管部门负责人发生变动；
- 9、管理人的董事在最近 12 个月内变更超过百分之五十，管理人、托管人专门托管部门的主要业务人员在最近 12 个月内变动超过百分之三十；
- 10、涉及集合计划财产、集合计划管理业务、集合计划托管业务的诉讼或仲裁；
- 11、管理人或其高级管理人员、投资经理因集合计划管理业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚，托管人或其专门托管部门负责人因托管业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚；
- 12、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事项，但中国证监会另有规定的除外；

- 
- 13、集合计划收益分配事项；
  - 14、管理费、业绩报酬、托管费、销售服务费、申购费、赎回费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；
  - 15、集合计划份额净值计价错误达集合计划份额净值百分之零点五；
  - 16、本集合计划开始办理申购、赎回；
  - 17、本集合计划发生巨额赎回并延期办理；
  - 18、本集合计划连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项；
  - 19、本集合计划暂停接受申购、赎回申请或重新接受申购、赎回申请；
  - 20、发生涉及集合计划申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时；
  - 21、管理人采用摆动定价机制进行估值；
  - 22、集合计划调整份额类别设置；
  - 23、本集合计划实施集合计划份额折算；
  - 24、集合计划信息披露义务人认为可能对集合计划份额持有人权益或者集合计划份额的价格产生重大影响的其他事项或中国证监会规定和资产管理合同约定的其他事项。

#### （七）澄清公告

在《资产管理合同》存续期限内，任何公共媒介中出现的或者在市场上流传的消息可能对集合计划份额价格产生误导性影响或者引起较大波动，以及可能损害集合计划份额持有人权益的，相关信息披露义务人知悉后应当立即对该消息进行公开澄清，并将有关情况立即报告中国证监会。

#### （八）集合计划份额持有人大会决议

集合计划份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会备案，并予以公告。

#### （九）投资资产支持证券的信息披露

管理人在集合计划年度报告、中期报告中披露其持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占集合计划净资产的比例和报告期内所有的资产支持证券明细。管理人在集合计划季度报告中披露其持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占集合计划净资产的比例和报告期末按市值占集合计划净资产比例大小

排序的前 10 名资产支持证券明细。

（十）投资港股通标的股票信息披露

若本集合计划投资港股通标的股票，管理人应当在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露本集合计划投资港股通标的股票的相关情况。

（十一）投资股指期货、国债期货的信息披露

管理人应在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露股指期货、国债期货交易情况，包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标等，并充分揭示股指期货、国债期货交易对集合计划总体风险的影响以及是否符合既定的投资政策和投资目标等。

（十二）管理人应在集合计划投资非公开发行股票后两个交易日内，在中国证监会规定媒介披露所投资非公开发行股票的名称、数量、总成本、账面价值，以及总成本和账面价值占集合计划资产净值的比例、锁定期等信息。

（十三）实施侧袋机制期间的信息披露

本集合计划实施侧袋机制的，相关信息披露义务人应当根据法律法规、资产管理合同和招募说明书的规定进行信息披露，详见招募说明书“侧袋机制”部分的规定。

（十四）中国证监会规定的其他信息。

## 六、信息披露事务管理

管理人、托管人应当建立健全信息披露管理制度，指定专门部门及高级管理人员负责管理信息披露事务。

集合计划信息披露义务人公开披露集合计划信息，应当符合中国证监会相关集合计划信息披露内容与格式准则等法规的规定。

托管人应当按照相关法律法规、中国证监会的规定和《资产管理合同》的约定，对管理人编制的集合计划资产净值、集合计划份额净值、集合计划份额申购赎回价格、集合计划定期报告、更新的招募说明书、产品资料概要、集合计划清算报告等相关集合计划信息进行复核、审查，并向管理人进行书面或电子确认。

管理人、托管人应当在规定报刊中选择披露信息的报刊。管理人、托管人应当向中国证监会基金电子披露网站报送拟披露的集合计划信息，并保证相关报送

信息的真实、准确、完整、及时。

管理人、托管人除依法在规定媒介上披露信息外，还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。

为集合计划信息披露义务人公开披露的集合计划信息出具审计报告、法律意见书的专业机构，应当制作工作底稿，并将相关档案至少保存到《资产管理合同》终止后 10 年。

#### 七、信息披露文件的存放与查阅

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。

#### 八、暂停或延迟信息披露的情形

当出现下述情况时，管理人和托管人可暂停或延迟披露集合计划相关信息：

- 1、不可抗力；
- 2、集合计划投资所涉及的证券/期货市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；
- 3、法律法规、《资产管理合同》或中国证监会规定的其他情况。



## 第十七部分 侧袋机制

### 一、侧袋机制的实施条件

当集合计划持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时,根据最大限度保护集合计划份额持有人利益的原则,管理人经与托管人协商一致,并咨询会计师事务所意见后,可以依照法律法规及资产管理合同的约定启用侧袋机制。

管理人应当在启用侧袋机制后及时发布临时公告,并在五个工作日内聘请侧袋机制启用日发表意见且符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所进行审计并披露专项审计意见。

### 二、实施侧袋机制期间集合计划份额的申购与赎回

1、启用侧袋机制当日,登记机构以集合计划份额持有人的原有账户份额为基础,确认相应侧袋账户集合计划份额持有人名册和份额;当日收到的申购申请,按照启用侧袋机制后的主袋账户份额办理;当日收到的赎回申请,仅办理主袋账户的赎回申请并支付赎回款项。

2、实施侧袋机制期间,管理人不办理侧袋账户份额的申购、赎回和转换;同时,管理人按照资产管理合同和招募说明书的约定办理主袋账户份额的赎回,并根据主袋账户运作情况确定是否暂停申购。

3、除管理人应按照主袋账户的份额净值办理主袋账户份额的申购和赎回外,本招募说明书“集合计划份额的申购与赎回”部分的申购、赎回规定适用于主袋账户份额。巨额赎回按照单个开放日内主袋账户份额净赎回申请超过前一开放日主袋账户总份额的 10% 认定。

### 三、实施侧袋机制期间的集合计划投资

侧袋机制实施期间,招募说明书“集合计划的投资”部分约定的投资组合比例、投资策略、组合限制、业绩比较基准、风险收益特征等约定仅适用于主袋账户。管理人计算各项投资运作指标和集合计划业绩指标时仅需考虑主袋账户资产。

管理人原则上应当在侧袋机制启用后 20 个交易日内完成对主袋账户投资组合的调整,因资产流动性受限等中国证监会规定的情形除外。

管理人不得在侧袋账户中进行除特定资产处置变现以外的其他投资操作。

### 四、实施侧袋机制期间的集合计划估值

本集合计划实施侧袋机制的,管理人和托管人应对主袋账户资产进行估值并

披露主袋账户的集合计划净值信息，暂停披露侧袋账户份额净值。侧袋账户的会计核算应符合《企业会计准则》的相关要求。

#### 五、实施侧袋账户期间的集合计划费用

1、本集合计划实施侧袋机制的，管理费和托管费按主袋账户集合计划资产净值作为基数计提。

2、与侧袋账户有关的费用可从侧袋账户中列支，但应待侧袋账户资产变现后方可列支，有关费用可酌情收取或减免，但不得收取管理费和业绩报酬。

#### 六、侧袋账户中特定资产的处置变现和支付

特定资产以可出售、可转让、恢复交易等方式恢复流动性后，管理人应当按照集合计划份额持有人利益最大化原则，采取将特定资产予以处置变现等方式，及时向侧袋账户份额持有人支付对应变现款项。

侧袋机制实施期间，无论侧袋账户资产是否全部完成变现，管理人都应当及时向侧袋账户全部份额持有人支付已变现部分对应的款项。若侧袋账户资产无法一次性完成处置变现，管理人在每次处置变现后均应按照相关法律法规要求及时发布临时公告。

侧袋账户资产全部完成变现并终止侧袋机制后，管理人应及时聘请符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所进行审计并披露专项审计意见。

#### 七、侧袋机制的信息披露

##### 1、临时公告

在启用侧袋机制、处置特定资产、终止侧袋机制以及发生其他可能对投资者利益产生重大影响的事项后管理人应及时发布临时公告。

##### 2、集合计划净值信息

管理人应按照招募说明书“集合计划的信息披露”部分规定的集合计划净值信息披露方式和频率披露主袋账户份额的集合计划份额净值和集合计划份额累计净值。实施侧袋机制期间本集合计划暂停披露侧袋账户份额净值和累计净值。

##### 3、定期报告

侧袋机制实施期间，管理人应当在集合计划定期报告中披露报告期内侧袋账户相关信息，集合计划定期报告中的集合计划会计报表仅需针对主袋账户进行编制。会计师事务所对集合计划年度报告进行审计时，应对报告期内集合计划侧袋

机制运行相关的会计核算和年度报告披露等发表审计意见。

---

---

## 第十八部分 风险揭示

### 一、投资本集合计划的风险

#### 1、市场风险

本集合计划主要投资于证券市场，而证券市场价格因受到经济因素、政治因素、投资者心理和交易制度等各种因素的影响而产生波动，从而导致集合计划收益水平发生变化，产生风险。主要的风险因素包括：

(1) 政策风险。因财政政策、货币政策、产业政策、地区发展政策等国家宏观政策发生变化，导致市场价格波动，影响集合计划收益而产生风险。

(2) 经济周期风险。证券市场是国民经济的晴雨表，随着经济运行的周期性变化，证券市场的收益水平也呈周期性变化，集合计划投资的收益水平也会随之变化，从而产生风险。

(3) 信用风险。主要是指债务人的违约风险，若债务人经营不善，资不抵债，债权人可能会损失掉大部分的投资，这主要体现在企业债中。

(4) 利率风险。金融市场利率的波动会导致证券市场价格和收益率的变动。利率直接影响着债券的价格和收益率，集合计划投资于债券，其收益水平会受到利率变化的影响。

(5) 购买力风险。份额持有人收益将主要通过现金形式来分配，而现金可能因为通货膨胀因素而使其购买力下降，从而使集合计划的实际收益下降。

(6) 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。

(7) 再投资风险。再投资风险反映了利率下降对债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(即前面所提到的利率风险)互为消长。具体为当利率下降时，集合计划从投资的债券所得的利息收入进行再投资时，将获得与之前相比较少的收益率。

#### 2、管理风险

在集合计划管理运作过程中，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以及对经济形势、证券价格走势的判断，从而影响集合计划收益水平。

管理人和托管人的管理手段和管理技术等因素的变化也会影响集合计划收益水平。

### 3、流动性风险

集合计划的流动性风险主要表现在两方面：一是管理人建仓时或为实现投资收益而进行组合调整时，可能会由于个券的市场流动性相对不足而无法按预期的价格将债券买进或卖出；二是为应付投资者的赎回，当个券的流动性较差时，管理人被迫在不适当的价格大量抛售债券。两者均可能使集合计划净值受到不利影响。

#### (1) 集合计划申购、赎回安排

本集合计划开放日为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日，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（若本集合计划参与港股通交易且该工作日为非港股通交易日时，则管理人可根据实际情况决定本集合计划是否开放申购、赎回及转换等业务，具体以届时提前发布的公告为准），但管理人根据法律法规、中国证监会的要求或资产管理合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。根据法规，当极端情况下需要暂停集合计划资产估值等情况时，管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请。所以投资者可能面临集合计划暂停申购及赎回的风险。此外，在本集合计划发生巨额赎回情形时，集合计划份额持有人还可能面临延期赎回或暂停赎回的风险。

#### (2) 投资市场、行业及资产的流动性风险评估

本集合计划股票资产占集合计划资产的比例为 60%~95%（其中投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%）。主要投资于具有良好流动性的股票，一般不主动投资于流动性差或流通受限的股票。股票的市场价格受到经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素的影响，虽然可以通过投资组合多样化来分散非系统风险，但不能完全规避。管理人将综合评估，使在正常市场环境下本集合计划的流动性风险适中。

#### (3) 巨额赎回情形下的流动性风险管理措施

集合计划出现巨额赎回情形下，管理人可以根据集合计划当时的资产组合状况或巨额赎回份额占比情况决定全部赎回或部分延期赎回。集合计划出现连续巨额赎回情形的，管理人可以暂停赎回，对于已经接受的赎回申请，可以延缓支付

赎回款项。同时，如本集合计划单个集合计划份额持有人在单个开放日申请赎回集合计划份额超过集合计划总份额一定比例以上的，管理人有权对其赎回申请实施部分延期办理。

(4) 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  
在市场大幅波动、流动性枯竭等极端情况下发生无法应对投资者巨额赎回的情形时，管理人将以保障投资者合法权益为前提，严格按照法律法规及资产管理合同的规定，谨慎选取延期办理巨额赎回申请、暂停接受赎回申请、延缓支付赎回款项、收取短期赎回费、暂停集合计划估值、摆动定价、实施侧袋机制等流动性风险管理工具作为辅助措施。对于各类流动性风险管理工具的使用，管理人将依照严格审批、审慎决策的原则，及时有效地对风险进行监测和评估，使用前经过内部审批程序并与托管人协商一致。在实际运用各类流动性风险管理工具时，投资者的赎回申请、赎回款项支付等可能受到相应影响，管理人将严格依照法律法规及资产管理合同的约定进行操作，全面保障投资者的合法权益。

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集合计划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持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，集合计划份额持有人可能因此面临损失。

实施侧袋机制期间，因本集合计划不披露侧袋账户份额的净值，即便管理人在集合计划定期报告中披露报告期末特定资产可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，因此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。

启用侧袋机制后，管理人计算各项投资运作指标和集合计划业绩指标时仅需考虑主袋账户资产，集合计划业绩指标应当以主袋账户资产为基准，因此本集合

计划披露的业绩指标不能反映特定资产的真实价值及变化情况。

#### 4、本集合计划特定风险

(1) 资产管理合同生效后，原光大阳光混合优选（阳光 6 号）集合资产管理计划份额变更为 A 类份额。资产管理合同生效后，管理人不办理该类集合计划份额的申购业务，投资者可在本集合计划开放赎回业务后的任一开放日办理赎回业务。本集合计划 B 类或 C 类份额设置锁定持有期，每份 B 类或 C 类份额的锁定持有期为一年，在锁定持有期内不办理赎回业务。锁定持有期到期后进入开放持有期，每份 B 类或 C 类份额自其开放持有期首日起才能办理赎回业务。因此 B 类或 C 类份额的份额持有人面临在锁定持有期内不能赎回资产管理计划份额的风险。

(2) 本集合计划为混合型集合计划，其预期风险和预期收益高于债券型基金、债券型集合计划、货币市场基金和货币型集合资产管理计划，低于股票型基金和股票型集合计划。

#### (3) 资产支持证券的投资风险

本集合计划投资资产支持证券，资产支持证券具有一定的价格波动风险、流动性风险、信用风险等风险。价格波动风险指的是市场利率波动会导致资产支持证券的收益率和价格波动。流动性风险指的是受资产支持证券市场规模及交易活跃程度的影响，资产支持证券可能无法在同一价格水平上进行较大数量的买入或卖出，存在一定的流动性风险。信用风险指的集合计划所投资的资产支持证券之债务人出现违约，或在交易过程中发生交收违约，或由于资产支持证券信用质量降低导致证券价格下降，造成集合计划财产损失。

#### (4) 港股投资风险

本集合计划可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化，选择将部分集合计划资产投资于港股或选择不将集合计划资产投资于港股，集合计划资产并非必然投资港股。

本集合计划资产投资于港股时，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括港股市场股价波动较大的风险（港股市场实行 T+0 回转交易，且对个股不设涨跌幅限制，港股股价可能表现出比 A 股更为剧烈的股价波动）、汇率风险（汇率波动可能对集合计划的投资

收益造成损失)、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险(在内地开市香港休市的情形下,港股通不能正常交易,港股不能及时卖出,可能带来一定的流动性风险)等。

#### (5) 股指期货、国债期货投资风险

本集合计划可投资于股指期货、国债期货等金融衍生品。投资股指期货、国债期货主要存在以下风险:

市场风险:定义为由于投资标的物价格变动而产生的衍生品的价格波动;

市场流动性风险:当衍生品合约无法及时变现所带来的风险;

基差风险:定义为衍生品市场价格与连动之标的价格不一致所产生的风险;

结算流动性风险:定义为当基金之保证金部位不足而无法交易衍生品,或因指数波动导致保证金低于维持保证金而必须追缴保证金的风险;

保证金风险:是指由于无法及时筹措资金满足建立或者维持衍生品合约头寸所要求的保证金而带来的风险。

信用风险:定义为交易对手不愿或无法履行契约之风险;

作业风险:定义为因交易过程、交易系统、人员疏失、或其他不可预期事件所导致的损失。

#### 5、操作或技术风险

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

在开放式集合计划的各种交易行为或者后台运作中,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集合计划份额持有人的利益受到影响。这种技术风险可能来自管理人公司、登记机构、销售机构、证券交易所、证券登记结算机构等。

#### 6、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资产管理合同有关规定的风险。

#### 7、其他风险

(1) 因技术因素而产生的风险,如电脑系统不可靠产生的风险;



(2) 因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；

(3) 因人为因素而产生的风险，如内幕交易、欺诈等行为产生的风险；

(4) 对主要业务人员如投资经理的依赖而可能产生的风险；

(5) 因战争、自然灾害等不可抗力导致的管理人、销售机构等机构无法正常工作，从而影响集合计划的申购、赎回按正常时限完成的风险。

## 第十九部分 资产管理合同的变更、终止与集合计划财产的清算

### 一、《资产管理合同》的变更

1、变更资产管理合同涉及法律法规规定或资产管理合同约定应经集合计划份额持有人大会决议通过的事项的，应召开集合计划份额持有人大会决议通过。对于法律法规规定和资产管理合同约定可不经集合计划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。

2、关于《资产管理合同》变更的集合计划份额持有人大会决议自生效后方可执行，自决议生效后两日内在规定媒介公告。

### 二、《资产管理合同》的终止事由

有下列情形之一的，经履行相关程序后，《资产管理合同》应当终止：

- 1、集合计划份额持有人大会决定终止的；
- 2、管理人、托管人职责终止，在6个月内没有新管理人、新托管人承接的；
- 3、《资产管理合同》约定的其他情形；
- 4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

### 三、集合计划财产的清算

1、集合计划财产清算小组：自出现《资产管理合同》终止事由之日起30个工作日内成立清算小组，管理人组织集合计划财产清算小组并在中国证监会的监督下进行集合计划清算。

2、集合计划财产清算小组组成：集合计划财产清算小组成员由管理人、托管人、符合《中华人民共和国证券法》规定的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。集合计划财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

3、集合计划财产清算小组职责：集合计划财产清算小组负责集合计划财产的保管、清理、估价、变现和分配。集合计划财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。

#### 4、集合计划财产清算程序：

- (1)《资产管理合同》终止情形出现后，发布财产清算公告；
- (2)《资产管理合同》终止情形出现时，由集合计划财产清算小组统一接管集合计划；

- (3) 对集合计划财产和债权债务进行清理和确认；
- (4) 对集合计划财产进行估值和变现；
- (5) 制作清算报告；
- (6) 聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- (7) 将清算报告报中国证监会备案并公告；
- (8) 对集合计划剩余财产进行分配。

5、集合计划财产清算的期限为 6 个月，但因本集合计划所持证券的流动性受到限制而不能及时变现的，管理人可针对该部分未能变现证券制定二次清算方案，该方案应经托管人认可，并通过管理人网站进行披露。管理人应根据二次清算方案的规定，对该部分流通受限证券在可流通变现后进行二次或多次清算，并将变现后的资产按照份额持有人拥有份额的比例，以货币形式全部分配给份额持有人。

#### 四、清算费用

清算费用是指集合计划财产清算小组在进行集合计划清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由集合计划财产清算小组优先从集合计划财产中支付。

#### 五、集合计划财产清算剩余资产的分配

依据集合计划财产清算的分配方案，将集合计划财产清算后的全部剩余资产扣除集合计划财产清算费用、交纳所欠税款并清偿集合计划债务后，按集合计划份额持有人持有的集合计划份额比例进行分配。

#### 六、集合计划财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；集合计划财产清算报告经符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。集合计划财产清算公告于集合计划财产清算报告报中国证监会备案后 5 个工作日内由集合计划财产清算小组进行公告，集合计划财产清算小组应当将清算报告登载在规定网站上，并将清算报告提示性公告登载在规定报刊上。

#### 七、集合计划财产清算账册及文件的保存

集合计划财产清算账册及有关文件由托管人保存 20 年以上。

## 第二十部分 资产管理合同内容摘要

### 一、集合计划份额持有人、管理人及托管人的权利与义务

#### (一) 管理人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，管理人的权利包括但不限于：

- (1) 依法募集资金；
- (2) 自《资产管理合同》生效之日起，根据法律法规和《资产管理合同》独立运用并管理集合计划财产；
- (3) 依照《资产管理合同》收取集合计划管理费、业绩报酬以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；
- (4) 销售集合计划份额；
- (5) 按照规定召集集合计划份额持有人大会；
- (6) 依据《资产管理合同》及有关法律的规定监督托管人，如认为托管人违反了《资产管理合同》及国家有关法律的规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护集合计划投资者的利益；
- (7) 在托管人更换时，提名新的托管人；
- (8) 选择、更换集合计划销售机构，对集合计划销售机构的相关行为进行监督和处理；
- (9) 担任或委托其他符合条件的机构担任集合计划登记机构办理集合计划登记业务并获得《资产管理合同》规定的费用；
- (10) 依据《资产管理合同》及有关法律的规定决定集合计划收益的分配方案；
- (11) 在《资产管理合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请；
- (12) 依照法律法规为集合计划的利益对被投资公司行使股东权利，为集合计划的利益行使因集合计划财产投资于证券所产生的权利；
- (13) 在法律法规允许的前提下，为集合计划的利益依法为集合计划进行融资；
- (14) 以管理人的名义，代表集合计划份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；

(15) 选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商或其他为集合计划提供服务的外部机构；

(16) 在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关集合计划申购、赎回、转换和非交易过户的业务规则；

(17) 法律法规及中国证监会规定的和《资产管理合同》约定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，管理人的义务包括但不限于：

(1) 依法募集资金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理集合计划份额的申购、赎回和登记事宜；

(2) 办理资产管理合同变更申请；

(3) 自《资产管理合同》生效之日起，以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用集合计划财产；

(4) 配备足够的具有专业资格的人员进行集合计划投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作集合计划财产；

(5) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的集合计划财产和管理人的财产相互独立，对所管理的不同集合计划分别管理，分别记账，进行证券投资；

(6) 除依据《基金法》、《资产管理合同》及其他有关规定外，不得利用集合计划财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作集合计划财产；

(7) 依法接受托管人的监督；

(8) 采取适当合理的措施使计算集合计划份额申购、赎回和注销价格的方法符合《资产管理合同》等法律文件的规定，按有关规定计算并公告集合计划净值信息，确定集合计划份额申购、赎回的价格；

(9) 进行集合计划会计核算并编制集合计划财务会计报告；

(10) 编制季度报告、中期报告和年度报告；

(11) 严格按照《基金法》、《资产管理合同》及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；

(12) 保守集合计划商业秘密，不泄露集合计划投资计划、投资意向等。除《基金法》、《资产管理合同》及其他有关规定另有规定外，在集合计划信息公开

披露前应予保密，不向他人泄露；

(13) 按《资产管理合同》的约定确定集合计划收益分配方案，及时向集合计划份额持有人分配集合计划收益；

(14) 按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

(15) 依据《基金法》、《资产管理合同》及其他有关规定召集集合计划份额持有人大会或配合托管人、集合计划份额持有人依法召集集合计划份额持有人大会；

(16) 按规定保存集合计划财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料 15 年以上；

(17) 确保需要向集合计划投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出，并且保证投资者能够按照《资产管理合同》规定的时间和方式，随时查阅到与集合计划有关的公开资料，并在支付合理成本的前提下得到有关资料的复印件；

(18) 组织并参加集合计划财产清算小组，参与集合计划财产的保管、清理、估价、变现和分配；

(19) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会并通知托管人；

(20) 因违反《资产管理合同》导致集合计划财产的损失或损害集合计划份额持有人合法权益时，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

(21) 监督托管人按法律法规和《资产管理合同》规定履行自己的义务，托管人违反《资产管理合同》造成集合计划财产损失时，管理人应为集合计划份额持有人利益向托管人追偿；

(22) 当管理人将其义务委托第三方处理时，应当对第三方处理有关集合计划事务的行为承担责任；

(23) 以管理人名义，代表集合计划份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为；

(24) 执行生效的集合计划份额持有人大会的决议；

(25) 建立并保存集合计划份额持有人名册；

(26) 法律法规及中国证监会规定的和《资产管理合同》约定的其他义务。

(二) 托管人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，托管人的权利包括但不限于：

(1) 自《资产管理合同》生效之日起，依法律法规和《资产管理合同》的规定安全保管集合计划财产；

(2) 依《资产管理合同》约定获得托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他费用；

(3) 监督管理人对本集合计划的投资运作，如发现管理人有违反《资产管理合同》及国家法律法规行为，对集合计划财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应呈报中国证监会，并采取必要措施保护投资者的利益；

(4) 根据相关市场规则，为集合计划开设证券账户等投资所需账户、为集合计划办理证券、期货交易资金清算；

(5) 以本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开设银行间债券托管账户；

(6) 提议召开或召集集合计划份额持有人大会；

(7) 在管理人更换时，提名新的管理人；

(8) 法律法规及中国证监会规定的和《资产管理合同》约定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，托管人的义务包括但不限于：

(1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管集合计划财产；

(2) 设立专门的集合计划托管部门，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉集合计划托管业务的专职人员，负责集合计划财产托管事宜；

(3) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，确保集合计划财产的安全，保证其托管的集合计划财产与托管人自有财产以及不同的集合计划财产相互独立；对所托管的不同的集合计划分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同集合计划之间在账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；

(4) 除依据《基金法》、《资产管理合同》及其他有关规定外，不得利用集合计划财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管集合计划财产；

(5) 保管由管理人代表集合计划签订的与集合计划有关的重大合同及有关

凭证；

(6) 按规定开设集合计划财产的资金账户、证券账户、期货结算账户等投资所需账户，按照《资产管理合同》的约定，根据管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；

(7) 保守集合计划商业秘密，除《基金法》、《资产管理合同》及其他有关规定另有规定外，在集合计划信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露；

(8) 复核、审查管理人计算的集合计划资产净值、集合计划份额净值、集合计划份额申购、赎回价格；

(9) 办理与集合计划托管业务活动有关的信息披露事项；

(10) 对集合计划财务会计报告、季度报告、中期报告和年度报告出具意见，说明管理人在各重要方面的运作是否严格按照《资产管理合同》的规定进行；如果管理人有未执行《资产管理合同》规定的行为，还应当说明托管人是否采取了适当的措施；

(11) 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 20 年以上；

(12) 建立并保存集合计划份额持有人名册；

(13) 按规定制作相关账册并与管理人核对；

(14) 依据管理人的指令或有关规定向集合计划份额持有人支付集合计划收益和赎回款项；

(15) 依据《基金法》、《资产管理合同》及其他有关规定，召集集合计划份额持有人大会或配合管理人、集合计划份额持有人依法召集集合计划份额持有人大会；

(16) 按照法律法规和《资产管理合同》的规定监督管理人的投资运作；

(17) 参加集合计划财产清算小组，参与集合计划财产的保管、清理、估价、变现和分配；

(18) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会和银行业监督管理机构，并通知管理人；

(19) 因违反《资产管理合同》导致集合计划财产损失时，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；



(20) 按规定监督管理人按法律法规和《资产管理合同》规定履行自己的义务，管理人因违反《资产管理合同》造成集合计划财产损失时，应为集合计划份额持有人利益向管理人追偿；

(21) 执行生效的集合计划份额持有人大会的决定；

(22) 法律法规及中国证监会规定的和《资产管理合同》约定的其他义务。

### (三) 集合计划份额持有人的权利与义务

投资者持有本集合计划份额的行为即视为对《资产管理合同》的承认和接受，投资者自依据《资产管理合同》取得集合计划份额，即成为本集合计划份额持有人和《资产管理合同》的当事人，直至其不再持有本集合计划的份额。集合计划份额持有人作为《资产管理合同》当事人并不以在《资产管理合同》上书面签章或签字为必要条件。

同一类别每份集合计划份额具有同等的合法权益。

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，集合计划份额持有人的权利包括但不限于：

(1) 分享集合计划财产收益；

(2) 参与分配清算后的剩余集合计划财产；

(3) 依法转让或者申请赎回其持有的集合计划份额；

(4) 按照规定要求召开集合计划份额持有人大会或者召集集合计划份额持有人大会；

(5) 出席或者委派代表出席集合计划份额持有人大会，对集合计划份额持有人大会审议事项行使表决权；

(6) 查阅或者复制公开披露的集合计划信息资料；

(7) 监督管理人的投资运作；

(8) 对管理人、托管人、集合计划服务机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁；

(9) 法律法规及中国证监会规定的和《资产管理合同》约定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，集合计划份额持有人的义务包括但不限于：

(1) 认真阅读并遵守《资产管理合同》、招募说明书等信息披露文件；

(2) 了解所投资集合计划产品，了解自身风险承受能力，自主判断集合计划的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险；

(3) 关注集合计划信息披露，及时行使权利和履行义务；

(4) 交纳集合计划申购款项及法律法规和《资产管理合同》所规定的费用；

(5) 在其持有的集合计划份额范围内，承担集合计划亏损或者《资产管理合同》终止的有限责任；

(6) 不从事任何有损集合计划及其他《资产管理合同》当事人合法权益的活动；

(7) 执行生效的集合计划份额持有人大会的决定；

(8) 返还在集合计划交易过程中因任何原因获得的不当得利；

(9) 法律法规及中国证监会规定的和《资产管理合同》约定的其他义务。

## 二、集合计划份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

集合计划份额持有人大会由集合计划份额持有人组成，集合计划份额持有人的合法授权代表有权代表集合计划份额持有人出席会议并表决。集合计划份额持有人持有的每一集合计划份额拥有平等的投票权。

本集合计划份额持有人大会未设立日常机构。在本集合计划存续期内，根据本集合计划的运作需要，集合计划份额持有人大会可以设立日常机构，日常机构的设立与运作应当根据相关法律法规和中国证监会的规定进行。

### (一) 召开事由

1、当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开集合计划份额持有人大会，但法律法规另有规定或本合同另有约定的除外：

(1) 终止《资产管理合同》（因不符合法律法规或中国证监会的要求而须终止本集合计划的除外）；

(2) 更换管理人；

(3) 更换托管人；

(4) 转换集合计划运作方式；

(5) 调整固定管理费率、托管费率、业绩报酬的计提比例或调低业绩报酬

的计提标准的、提高销售服务费，根据法律法规或监管部门同意调整该等报酬的除外；

(6) 变更集合计划类别；

(7) 本集合计划与其他集合计划的合并；

(8) 变更集合计划投资目标、范围或策略；

(9) 变更集合计划份额持有人大会程序；

(10) 管理人或托管人要求召开集合计划份额持有人大会；

(11) 单独或合计持有本集合计划总份额 10%以上（含 10%）集合计划份额的持有人（以管理人收到提议当日的集合计划份额计算，下同）就同一事项书面要求召开集合计划份额持有人大会；

(12) 对《资产管理合同》当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；

(13) 法律法规、《资产管理合同》或中国证监会规定的其他应当召开集合计划份额持有人大会的事项。

2、在法律法规规定和《资产管理合同》约定的范围内且对集合计划份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，以下情况可由管理人和托管人协商后修改，不需召开集合计划份额持有人大会：

(1) 法律法规要求增加的集合计划费用的收取；

(2) 调整本集合计划的申购费率、调低赎回费率、调低销售服务费或变更收费方式，增加、减少或调整集合计划份额类别设置及对集合计划份额分类办法、规则进行调整；

(3) 因相应的法律法规发生变动而应当对《资产管理合同》进行修改；

(4) 对《资产管理合同》的修改对集合计划份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及《资产管理合同》当事人权利义务关系发生重大变化；

(5) 集合计划推出新业务或服务；

(6) 管理人、登记机构、销售机构调整有关集合计划申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务的规则；

(7) 公募基金业绩报酬相关法律法规发布后，本合同约定的业绩报酬相关条款根据法律法规进行调整的；

(8) 按照法律法规和《资产管理合同》规定不需召开集合计划份额持有人

大会的其他情形。

(二) 会议召集人及召集方式

1、除法律法规规定或《资产管理合同》另有约定外，集合计划份额持有人大会由管理人召集；

2、管理人未按规定召集或不能召开时，由托管人召集；

3、托管人认为有必要召开集合计划份额持有人大会的，应当向管理人提出书面提议。管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知托管人。管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；管理人决定不召集，托管人仍认为有必要召开的，应当由托管人自行召集，并自出具书面决定之日起 60 日内召开并告知管理人，管理人应当配合。

4、代表集合计划份额 10%以上（含 10%）的持有人就同一事项书面要求召开集合计划份额持有人大会，应当向管理人提出书面提议。管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的集合计划份额持有人代表和托管人。管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；管理人决定不召集，代表集合计划份额 10%以上（含 10%）的持有人仍认为有必要召开的，应当向托管人提出书面提议。托管人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的集合计划份额持有人代表和管理人；托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开。并告知管理人，管理人应当配合。

5、代表集合计划份额 10%以上（含 10%）的持有人就同一事项要求召开集合计划份额持有人大会，而管理人、托管人都不召集的，单独或合计代表集合计划份额 10%以上（含 10%）的持有人有权自行召集，并至少提前 30 日报中国证监会备案。集合计划份额持有人依法自行召集集合计划份额持有人大会的，管理人、托管人应当配合，不得阻碍、干扰。

6、集合计划份额持有人会议的召集人负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

(三) 召开集合计划份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

1、召开集合计划份额持有人大会，召集人应于会议召开前 30 日，在规定媒介公告。集合计划份额持有人大会通知应至少载明以下内容：

- (1) 会议召开的时间、地点和会议形式；
- (2) 会议拟审议的事项、议事程序和表决方式；
- (3) 有权出席集合计划份额持有人大会的集合计划份额持有人的权益登记日；
- (4) 授权委托证明的内容要求（包括但不限于代理人身份，代理权限和代理有效期限等）、送达时间和地点；
- (5) 会务常设联系人姓名及联系电话；
- (6) 出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；
- (7) 召集人需要通知的其他事项。

2、采取通讯开会方式并进行表决的情况下，由会议召集人决定在会议通知中说明本次集合计划份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表决意见寄交的截止时间和收取方式。

3、如召集人为管理人，还应另行书面通知托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为托管人，则应另行书面通知管理人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为集合计划份额持有人，则应另行书面通知管理人和托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督。管理人或托管人拒不派代表对书面表决意见的计票进行监督的，不影响表决意见的计票效力。

#### (四) 集合计划份额持有人出席会议的方式

集合计划份额持有人大会可通过现场开会方式、通讯开会方式或法律法规、监管机构允许的其他方式召开，会议的召开方式由会议召集人确定。

1、现场开会。由集合计划份额持有人本人出席或以代理投票授权委托证明委派代表出席，现场开会时管理人和托管人的授权代表应当列席集合计划份额持有人大会，管理人或托管人不派代表列席的，不影响表决效力。现场开会同时符合以下条件时，可以进行集合计划份额持有人大会议程：

(1) 亲自出席会议者持有集合计划份额的凭证、受托出席会议者出具的委托人持有集合计划份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、《资产管理合同》和会议通知的规定，并且持有集合计划份额的凭证与管理人持有的登记资料相符；

(2) 经核对，汇总到会者出示的在权益登记日持有集合计划份额的凭证显

示,有效的集合计划份额不少于本集合计划在权益登记日集合计划总份额的二分之一(含二分之一)。若到会者在权益登记日代表的有效的集合计划份额少于本集合计划在权益登记日集合计划总份额的二分之一,召集人可以在原公告的集合计划份额持有人大会召开时间的3个月以后、6个月以内,就原定审议事项重新召集集合计划份额持有人大会。重新召集的集合计划份额持有人大会到会者在权益登记日代表的有效的集合计划份额应不少于本集合计划在权益登记日集合计划总份额的三分之一(含三分之一)。

2、通讯开会。通讯开会系指集合计划份额持有人将其对表决事项的投票以书面形式或资产管理合同约定的其他方式在表决截止日以前送达至召集人指定的地址或系统。通讯开会应以书面方式或资产管理合同约定的其他方式进行表决。

在同时符合以下条件时,通讯开会的方式视为有效:

(1)会议召集人按《资产管理合同》约定公布会议通知后,在2个工作日内连续公布相关提示性公告;

(2)召集人按资产管理合同约定通知托管人(如果托管人为召集人,则为管理人)到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。会议召集人在托管人(如果托管人为召集人,则为管理人)和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取集合计划份额持有人的书面表决意见;托管人或管理人经通知不参加收取书面表决意见的,不影响表决效力;

(3)本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的,集合计划份额持有人所持有的集合计划份额不小于在权益登记日集合计划总份额的二分之一(含二分之一);若本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见集合计划份额持有人所持有的集合计划份额小于在权益登记日集合计划总份额的二分之一,召集人可以在原公告的集合计划份额持有人大会召开时间的3个月以后、6个月以内,就原定审议事项重新召集集合计划份额持有人大会。重新召集的集合计划份额持有人大会应当有代表三分之一以上(含三分之一)集合计划份额的持有人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见;

(4)上述第(3)项中直接出具书面意见的集合计划份额持有人或受托代表他人出具书面意见的代理人,同时提交的持有集合计划份额的凭证、受托出具书面意见的代理人出具的委托人持有集合计划份额的凭证及委托人的代理投票授

权委托证明符合法律法规、《资产管理合同》和会议通知的规定，并与集合计划登记机构记录相符；

3、在不与法律法规冲突的前提下，集合计划份额持有人大会亦可采用网络、电话、短信等其他非现场方式或者以现场方式与非现场方式相结合的方式召开，会议程序比照现场开会和通讯开会的程序进行。集合计划份额持有人可以采用书面、网络、电话、短信或其他方式进行表决，具体方式由会议召集人确定并在会议通知中列明。

4、在不与法律法规冲突的前提下，集合计划份额持有人可采用其他书面或非书面方式授权他人代为出席集合计划份额持有人大会并行使表决权，授权方式可以采用书面、网络、电话、短信或其他方式，具体方式在会议通知中列明。

#### （五）议事内容与程序

##### 1、议事内容及提案权

议事内容为关系集合计划份额持有人利益的重大事项，如《资产管理合同》的重大修改、决定终止《资产管理合同》、更换管理人、更换托管人、与其他集合计划合并、法律法规及《资产管理合同》规定的其他事项以及会议召集人认为需提交集合计划份额持有人大会讨论的其他事项。

集合计划份额持有人大会的召集人发出召集会议的通知后，对原有提案的修改应当在集合计划份额持有人大会召开前及时公告。

集合计划份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

##### 2、议事程序

###### （1）现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照下列第（七）条规定程序确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。大会主持人为管理人授权出席会议的代表，在管理人授权代表未能主持大会的情况下，由托管人授权其出席会议的代表主持；如果管理人授权代表和托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的集合计划份额持有人和代理人所持表决权的 50%以上（含 50%）选举产生一名集合计划份额持有人作为该次集合计划份额持有人大会的主持人。管理人和托管人拒不出席或主持集合计划份额持有人大会，不影响集合计划份额持有人大会作出的决议的效力。

会议召集人应当制作出席会议人员的签名册。签名册载明参加会议人员姓名（或单位名称）、身份证明文件号码、持有或代表有表决权的集合计划份额、委托人姓名（或单位名称）和联系方式等事项。

## （2）通讯开会

在通讯开会的情况下，首先由召集人提前 30 日公布提案，在所通知的表决截止日期后 2 个工作日内在公证机关监督下由召集人统计全部有效表决，在公证机关监督下形成决议。

## （六）表决

集合计划份额持有人所持每份集合计划份额有一票表决权。

集合计划份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

1、一般决议，一般决议须经参加大会的集合计划份额持有人或其代理人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）通过方为有效；除下列第 2 项所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过。

2、特别决议，特别决议应当经参加大会的集合计划份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方可做出。除本合同另有约定外，转换集合计划运作方式、更换管理人或者托管人、终止《资产管理合同》、本集合计划与其他集合计划合并以特别决议通过方为有效。

集合计划份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则提交符合会议通知中规定的确认投资者身份文件的表决视为有效出席的投资者，表面符合会议通知规定的书面表决意见视为有效表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具书面意见的集合计划份额持有人所代表的集合计划份额总数。

集合计划份额持有人大会的各项提案或同一项提案内并列的各项议题应当分开审议、逐项表决。

## （七）计票

### 1、现场开会

（1）如大会由管理人或托管人召集，集合计划份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的集合计划份额持有人和代理人中选举两名集



合计划份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人；如大会由集合计划份额持有人自行召集或大会虽然由管理人或托管人召集，但是管理人或托管人未出席大会的，集合计划份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的集合计划份额持有人中选举三名集合计划份额持有人代表担任监票人。管理人或托管人不出席大会的，不影响计票的效力。

(2) 监票人应当在集合计划份额持有人表决后立即进行清点并由大会主持人当场公布计票结果。

(3) 如果会议主持人或集合计划份额持有人或代理人对于提交的表决结果有怀疑，可以在宣布表决结果后立即对所投票数要求进行重新清点。监票人应当进行重新清点，重新清点以一次为限。重新清点后，大会主持人应当当场公布重新清点结果。

(4) 计票过程应由公证机关予以公证，管理人或托管人拒不出席大会的，不影响计票的效力。

## 2、通讯开会

在通讯开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监督员在托管人授权代表（若由托管人召集，则为管理人授权代表）的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。管理人或托管人拒派代表对书面表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。

### (八) 生效与公告

集合计划份额持有人大会的决议，召集人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会备案。

集合计划份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。

集合计划份额持有人大会决议自生效之日起 2 日内在规定媒介上公告。如果采用通讯方式进行表决，在公告集合计划份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。

管理人、托管人和集合计划份额持有人应当执行生效的集合计划份额持有人大会的决议。生效的集合计划份额持有人大会决议对全体集合计划份额持有人、管理人、托管人均有约束力。

### (九) 实施侧袋机制期间集合计划份额持有人大会的特殊约定

若本集合计划实施侧袋机制，则相关集合计划份额或表决权的比例指主袋份额持有人和侧袋份额持有人分别持有或代表的集合计划份额或表决权符合该等比例，但若相关集合计划份额持有人大会召集和审议事项不涉及侧袋账户的，则仅指主袋份额持有人持有或代表的集合计划份额或表决权符合该等比例：

1、集合计划份额持有人行使提议权、召集权、提名权所需单独或合计代表相关集合计划份额 10%以上（含 10%）；

2、现场开会的到会者在权益登记日代表的集合计划份额不少于本集合计划在权益登记日相关集合计划份额的二分之一（含二分之一）；

3、通讯开会的直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的集合计划份额持有人所持有的集合计划份额不小于在权益登记日相关集合计划份额的二分之一（含二分之一）；

4、在参与集合计划份额持有人大会投票的集合计划份额持有人所持有的集合计划份额小于在权益登记日相关集合计划份额的二分之一、召集人在原公告的集合计划份额持有人大会召开时间的 3 个月以后、6 个月以内就原定审议事项重新召集的集合计划份额持有人大会应当有代表三分之一以上（含三分之一）相关集合计划份额的持有人参与或授权他人参与集合计划份额持有人大会投票；

5、现场开会由出席大会的集合计划份额持有人和代理人所持表决权的 50% 以上（含 50%）选举产生一名集合计划份额持有人作为该次集合计划份额持有人大会的主持人；

6、一般决议须经参加大会的集合计划份额持有人或其代理人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）通过；

7、特别决议应当经参加大会的集合计划份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过。

同一主侧袋账户内的每份集合计划份额具有平等的表决权。

（十）本部分关于集合计划份额持有人大会召开事由、召开条件、议事程序、表决条件等规定，凡是直接引用法律法规或监管规则的部分，如将来法律法规或监管规则修改导致相关内容被取消或变更的，管理人提前公告后，可直接对本部分内容进行修改和调整，无需召开集合计划份额持有人大会审议。

三、资产管理合同的终止事由、程序与集合计划资产的清算

### （一）《资产管理合同》的变更

1、变更资产管理合同涉及法律法规规定或本合同约定应经集合计划份额持有人大会决议通过的事项的，应召开集合计划份额持有人大会决议通过。对于法律法规规定和资产管理合同约定可不经集合计划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。

2、关于《资产管理合同》变更的集合计划份额持有人大会决议自生效后方可执行，自决议生效后两日内在规定媒介公告。

### （二）《资产管理合同》的终止事由

有下列情形之一的，经履行相关程序后，《资产管理合同》应当终止：

- 1、集合计划份额持有人大会决定终止的；
- 2、管理人、托管人职责终止，在6个月内没有新管理人、新托管人承接的；
- 3、《资产管理合同》约定的其他情形；
- 4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

### （三）集合计划财产的清算

1、集合计划财产清算小组：自出现《资产管理合同》终止事由之日起30个工作日内成立清算小组，管理人组织集合计划财产清算小组并在中国证监会的监督下进行集合计划清算。

2、集合计划财产清算小组组成：集合计划财产清算小组成员由管理人、托管人、符合《中华人民共和国证券法》规定的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。集合计划财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

3、集合计划财产清算小组职责：集合计划财产清算小组负责集合计划财产的保管、清理、估价、变现和分配。集合计划财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。

#### 4、集合计划财产清算程序：

- （1）《资产管理合同》终止情形出现后，发布财产清算公告；
- （2）《资产管理合同》终止情形出现时，由集合计划财产清算小组统一接管集合计划；
- （3）对集合计划财产和债权债务进行清理和确认；
- （4）对集合计划财产进行估值和变现；

(5) 制作清算报告；

(6) 聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；

(7) 将清算报告报中国证监会备案并公告；

(8) 对集合计划剩余财产进行分配。

5、集合计划财产清算的期限为6个月，但因本集合计划所持证券的流动性受到限制而不能及时变现的，管理人可针对该部分未能变现证券制定二次清算方案，该方案应经托管人认可，并通过管理人网站进行披露。管理人应根据二次清算方案的规定，对该部分流通受限证券在可流通变现后进行二次或多次清算，并将变现后的资产按照份额持有人拥有份额的比例，以货币形式全部分配给份额持有人。

(四) 清算费用

清算费用是指集合计划财产清算小组在进行集合计划清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由集合计划财产清算小组优先从集合计划财产中支付。

(五) 集合计划财产清算剩余资产的分配

依据集合计划财产清算的分配方案，将集合计划财产清算后的全部剩余资产扣除集合计划财产清算费用、交纳所欠税款并清偿集合计划债务后，按集合计划份额持有人持有的集合计划份额比例进行分配。

(六) 集合计划财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；集合计划财产清算报告经符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。集合计划财产清算公告于集合计划财产清算报告报中国证监会备案后5个工作日内由集合计划财产清算小组进行公告，集合计划财产清算小组应当将清算报告登载在规定网站上，并将清算报告提示性公告登载在规定报刊上。

(七) 集合计划财产清算账册及文件的保存

集合计划财产清算账册及有关文件由托管人保存20年以上。

四、争议解决方式

因履行本合同发生的争议，由当事人协商解决，协商不成的，提交中国国际经济贸易仲裁委员会上海分会，按照该会届时有效的仲裁规则仲裁，仲裁地点为上海。仲裁裁决是终局性的，对各方均有约束力。争议处理期间，相关各方当事人应恪守职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行本合同规定的义务，维护份额持有人的合法权益。

争议处理期间，合同当事人应恪守各自的职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行合同规定的义务，维护份额持有人的合法权益。

《资产管理合同》受中国法律管辖。

#### 五、资产管理合同的存放地及投资者取得方式

1、《资产管理合同》正本一式六份，除上报有关监管机构一式二份外，管理人、托管人各持有二份，每份具有同等的法律效力。

2、《资产管理合同》可印制成册，供投资者在管理人、托管人、销售机构的办公场所和营业场所查阅。

## 第二十一部分 托管协议的内容摘要

### 一、托管协议当事人

#### (一) 管理人

名称：上海光大证券资产管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路799号3号楼26层

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路799号3号楼26层

邮政编码：200040

法定代表人：熊国兵

成立日期：2012年5月9日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会，证监许可[2011]1886号

组织形式：有限责任公司

注册资本：2亿元人民币

存续期间：持续经营

经营范围：证券资产管理

#### (二) 托管人

名称：中国工商银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街55号

邮政编码：100032

法定代表人：陈四清

成立日期：1984年1月1日

批准设立机关和批准设立文号：国务院《关于中国人民银行专门行使中央银行

职能的决定》（国发[1983]146号）

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币34,932,123.46万元

存续期间：持续经营

经营范围：办理人民币存款、贷款、同业拆借业务；国内外结算；办理票据承兑、贴现、转贴现、各类汇兑业务；代理资金清算；提供信用证服务及担保；代理销售业务；代理发行、代理承销、代理兑付政府债券；代收代付业务；代理证券投资基金清算业务（银证转账）；保险代理业务；代理政策性银行、外国政府和国际金融机构贷款业务；保管箱服务；发行金融债券；买卖政府债券、金融债券；证券投资基金、企业年金托管业务；企业年金受托管理服务；年金账户管理服务；开放式基金的注册登记、认购、申购和赎回业务；资信调查、咨询、见证业务；贷款承诺；企业、个人财务顾问服务；组织或参加银团贷款；外汇存款；外汇贷款；外币兑换；出口托收及进口代收；外汇票据承兑和贴现；外汇借款；外汇担保；发行、代理发行、买卖或代理买卖股票以外的外币有价证券；自营、代客外汇买卖；外汇金融衍生业务；银行卡业务；电话银行、网上银行、手机银行业务；办理结汇、售汇业务；经国务院银行业监督管理机构批准的其他业务。

## 二、托管人对管理人的业务监督和核查

### （一）托管人对管理人的投资行为行使监督权

1、托管人根据有关法律法规的规定和《资产管理合同》的约定，对下述投资范围、投资对象进行监督。

本集合计划将投资于以下金融工具：

本集合计划的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（含主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准或同意注册上市的股票）、港股通标的股票、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、政府支持债券、地方政府债券、可交换债券、可转换债券（含分离交易可转债的纯债部分）及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、

股指期货、国债期货以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。

2、托管人根据有关法律法规的规定及《资产管理合同》的约定对下述投融资比例进行监督:

(1) 按法律法规的规定及《资产管理合同》的约定,本集合计划的投资资产配置比例为:

股票资产占集合计划资产的比例为 60%~95% (其中投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%); 每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后,现金以及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%, 前述现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。

(2) 根据法律法规的规定及《资产管理合同》的约定,本集合计划投资组合遵循以下投资限制:

1) 本集合计划股票资产占集合计划资产的比例为 60%~95% (其中投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%);

2) 每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后,本集合计划保留的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(同一家公司在内地和香港同时上市的 A+H 股合并计算),其市值不超过集合计划资产净值的 10%;

4) 管理人管理的且由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(同一家公司在内地和香港同时上市的 A+H 股合并计算),不超过该证券的 10%,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可以不受此条款规定的比例限制;

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) 本管理人管理的且由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信用级别评级为 **BBB** 以上(含 **BBB**) 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;

10) 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;

11) 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;

12) 本管理人管理的且由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股票, 不得超过该上市公司可流通股股票的 15%; 本管理人管理的且由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股票, 不得超过该上市公司可流通股股票的 30%, 完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的开放式集合资产管理计划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;

13) 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本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;

14) 本集合计划开展逆回购交易的, 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;

15) 本集合计划投资于股指期货的投资限制如下:

a.本集合计划在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过集合计划资产净值的 10%；

b.本集合计划在任何交易日日终，持有的买入股指期货和国债期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过集合计划资产净值的 95%，其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；

c.本集合计划在任何交易日日终，持有的卖出股指期货合约价值不得超过集合计划持有的股票总市值的 20%；

d.本集合计划所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合资产管理合同关于股票投资比例的有关约定；

e.本集合计划在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指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 20%；

16) 本集合计划投资于国债期货的投资限制如下：

a.本集合计划在任何交易日日终，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%；

b.本集合计划在任何交易日日终，持有的买入股指期货和国债期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过集合计划资产净值的 95%。其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；

c.本集合计划在任何交易日日终，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%；

d.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）应当符合资产管理合同关于债券投资比例的有关约定；

e.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%；

17) 本集合计划资产总值不超过集合计划资产净值的 140%；

除上述 2)、9)、13)、14) 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。

(3) 对于因法律法规变化导致本集合计划投资范围及投资限制等事项调整的，管理人应提前通知托管人，经托管人书面同意后方可纳入投资监督范围。管理人知晓托管人履行投资监督职责受外部数据来源或系统开发等因素影响，应为托管人系统调整预留所需的合理必要时间。

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应当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。

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以调整后的规定为准。

3、托管人根据有关法律法规的规定及《资产管理合同》的约定对下述投资禁止行为进行监督：

- (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) 买卖其他集合计划份额或基金份额，但中国证监会另有规定的除外；
- (5) 向管理人、托管人出资；

如法律、行政法规或监管部门取消或调整上述禁止性规定，管理人在履行适当程序后，本集合计划可不受上述规定的限制或以调整后的规定为准。

4、托管人依据有关法律法规的规定和《资产管理合同》的约定对于集合计划关联投资限制进行监督。

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。

5、托管人根据以下约定对管理人参与银行间债券市场投资进行监督。

管理人参与银行间市场交易，应按照审慎的风险控制原则评估交易对手资信风险，并自主选择交易对手。托管人发现管理人与银行间市场的丙类会员进行债券交易的，可以通过邮件、电话等双方认可的方式提醒管理人，管理人应及时向托管人提供可行性说明。管理人应确保可行性说明内容真实、准确、完整。托管人不对管理人提供的可行性说明进行实质审查。管理人同意，经提醒后管理人仍执行交易并造成基金资产损失的，托管人不承担责任。

管理人在银行间市场进行现券买卖和回购交易时，以 DVP(券款兑付)的交易结算方式进行交易。

6、托管人对集合计划投资流通受限证券进行监督。

(1) 集合计划投资流通受限证券，应遵守《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》等有关法律法规规定。

(2) 此处的流通受限证券与上文提及的流动性受限资产并不完全一致，包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券，不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。

(3) 在首次投资流通受限证券之前，管理人应当根据中国证监会相关规定制定相关投资决策流程、风险控制等规章制度。管理人应当根据集合计划的投资风格和流动性的需要合理安排流通受限证券的投资比例，并在相关制度中明确具体比例，避免集合计划出现流动性风险。托管人对管理人是否遵守相关制度、流动性风险处置预案以及相关投资额度和比例等的情况进行监督。

集合计划投资流通受限证券前，管理人应向托管人提供符合法律法规要求的有关书面信息，如相关制度、预案、投资额度和比例等。管理人应保证上述信息的真实、完整，并应至少于首次投资流通受限证券之前两个工作日将上述资料书面发至托管人，保证托管人有足够的时间进行审核。

(4) 托管人应按照《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》规定，对管理人是否遵守法律法规进行监督，并审核管理人提供的有

关书面信息。托管人认为上述资料可能导致集合计划出现风险的，有权要求管理人在投资流通受限证券前就该风险的消除或防范措施进行补充书面说明，并保留查看管理人风险管理部门就集合计划投资流通受限证券出具的风险评估报告等备查资料的权利。否则，托管人有权拒绝执行有关指令。因拒绝执行该指令造成集合计划财产损失的，托管人不承担任何责任，并有权报告中国证监会。如管理人和托管人无法达成一致，应及时上报中国证监会请求解决。

#### 7、关于银行存款投资

本集合计划投资银行存款的信用风险主要包括存款银行的信用等级、存款银行的支付能力等涉及到存款银行选择方面的风险。管理人投资银行定期存款应符合相关法律法规约定。管理人在投资银行定期存款的过程中，必须符合资产管理合同就投资品种、投资比例、存款期限等方面的限制。管理人应基于审慎原则评估存款银行信用风险并据此选择存款银行。因管理人违反上述原则给集合计划造成的损失，托管人不承担任何责任，相关损失由管理人先行承担。管理人履行先行赔付责任后，有权要求相关责任人进行赔偿。托管人的职责仅限于督促管理人履行先行赔付责任。

(二) 托管人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、集合计划宣传推介材料中登载集合计划业绩表现数据等进行监督和核查。

(三) 托管人发现管理人的投资运作及其他运作违反《基金法》、资产管理合同和本托管协议的规定，应及时以书面方式通知管理人限期纠正。

管理人应积极配合和协助托管人的监督和核查。管理人收到书面通知后应在下一工作日前及时核对并以书面形式给托管人发出回函，就托管人的疑义进行解释或举证，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内，托管人有权随时对通知事项进行复查，督促管理人改正。管理人对托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，托管人应报告中国证监会。托管人应当监督管理人赔偿因其违反《资产管理合同》而致使投资者遭受的损失。

对于依据交易程序尚未成交的且托管人在交易前能够监控的投资指令，托管人发现该投资指令违反相关法律法规规定或者违反《资产管理合同》约定的，应

当拒绝执行，立即通知管理人，并向中国证监会报告。

对于必须于估值完成后方可获知的监控指标或依据交易程序已经成交的投资指令，托管人发现该投资指令违反法律法规或者违反《资产管理合同》约定的，应当立即通知管理人，并报告中国证监会。

（四）管理人有义务配合和协助托管人依照法律法规、资产管理合同和本托管协议对集合计划的监督和核查。

对托管人发出的书面提示，管理人应在规定时间内答复并改正，或就托管人的疑义进行解释或举证；对托管人按照法律法规要求需向中国证监会报送集合计划监督报告的事项，管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

（五）托管人发现管理人有重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时通知管理人限期纠正。

管理人无正当理由，拒绝、阻挠托管人根据本托管协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍托管人进行有效监督，情节严重或经托管人提出警告仍不改正的，托管人应报告中国证监会。

### 三、管理人对托管人的业务核查

（一）管理人对托管人履行托管职责情况进行核查，核查事项包括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、证券账户、期货结算账户以及投资所需的其他账户、复核管理人计算的集合计划资产净值和集合计划各类份额净值、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、无故未执行或无故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《基金法》、资产管理合同、本协议及其他有关规定时，管理人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给管理人发出回函。在上述规定期限内，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。

（三）管理人发现托管人有重大违规行为，应及时报告中国证监会和银行业

监督管理机构，同时通知托管人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。

托管人无正当理由，拒绝、阻挠管理人根据本协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍管理人进行有效监督，情节严重或经管理人提出警告仍不改正的，管理人应报告中国证监会。

#### 四、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；
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、期货结算账户以及投资所需的其他专用账户；
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. 对于因为集合计划申购、投资产生的应收资产，应由管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知托管人，到账日集合计划财产没有到达托管账户的，托管人应及时通知管理人采取措施进行催收。由此给集合计划财产造成损失的，管理人应负责向有关当事人追偿集合计划财产的损失，托管人对此不承担责任；
6. 除依据法律法规和资产管理合同的规定外，托管人不得委托第三人托管集合计划财产。

##### （二）集合计划托管专户的开立和管理

1. 托管人应负责本集合计划的银行账户的开设和管理。托管人以托管人的名义在其营业机构开设集合计划托管专户，保管集合计划的银行存款，并根据管理人的符合本协议约定的有效指令办理资金收付。该账户的开设和管理由托管人承担。本集合计划的一切货币收支活动，均需通过集合计划托管专户进行。

2. 集合计划托管专户的开立和使用，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任何其他银行账户；亦不得使用集合计划的任何账户进行本集合计划业务以外的活动。

3. 集合计划托管专户的开立和管理应符合《人民币银行结算账户管理办法》、《现金管理暂行条例》、《人民币利率管理规定》、《利率管理暂行规定》、《支付结算办法》以及银行业监督管理机构的其他有关规定。

### （三）集合计划证券账户的开立和管理

1. 托管人以托管人与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. 集合计划证券账户的开立和使用，仅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未经对方同意擅自转让集合计划的任何证券账户，亦不得使用集合计划的任何账户进行本集合计划业务以外的活动。

### （四）银行间债券托管专户的开设和管理

资产管理合同生效后，管理人负责以本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，并代表本集合计划进行交易；托管人负责以本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开设银行间债券市场债券托管账户，并由托管人代表集合计划进行银行间市场债券后台匹配及资金的清算。管理人和托管人共同代表本集合计划签订全国银行间债券市场债券回购主协议，托管人保管协议正本，管理人保存协议副本。

### （五）其他账户的开立和管理

在本托管协议签订日之后，本集合计划被允许从事符合法律法规规定和《资产管理合同》约定的其他投资品种的投资业务时，如果涉及相关账户的开设和使用，由管理人与托管人根据有关法律法规的规定和《资产管理合同》的约定，开立有关账户。该账户按有关规则使用并管理。

### （六）集合计划财产投资的有关实物证券、银行定期存款等有价凭证的保管

集合计划财产投资的有关实物证券等有价凭证由托管人存放于托管人的保管库。实物证券等有价凭证的购买和转让，由托管人根据管理人的指令办理。属于托管人实际有效控制下的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托管人承担。托管人对托管人以外机构实际有效控制或保管的证券不承担保管责任。

### （七）与集合计划财产有关的重大合同的保管

由管理人代表集合计划签署的、与集合计划财产有关的重大合同的原件分别由管理人、托管人保管。除本协议另有规定外，管理人代表集合计划签署的与集合计划财产有关的重大合同包括但不限于集合计划年度审计合同、集合计划信息披露协议及集合计划投资业务中产生的重大合同，管理人应保证管理人和托管人



至少各持有一份正本的原件。管理人应在重大合同签署后 5 个工作日内通过专人送达、挂号邮寄等安全方式将合同原件送达托管人。管理人重大合同的保管期限为资产管理合同终止后 15 年，托管人重大合同的保管期限为资产管理合同终止后 20 年。

## 五、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、复核与完成的时间及程序

#### 1. 集合计划资产净值

集合计划资产净值是指集合计划资产总值减去负债后的价值。

某一类别集合计划份额净值是按照每个工作日闭市后，某类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。

管理人每个工作日计算集合计划资产净值及各类集合计划份额净值，经托管人复核，按规定公告。如遇特殊情况，经履行适当程序，可以适当延迟计算或公告。

#### 2. 复核程序

管理人每工作日对集合计划资产进行估值后，将集合计划各类份额净值结果发送托管人，经托管人复核无误后，由管理人按规定对外公布。

### （二）集合计划资产估值方法和特殊情形的处理

#### 1. 估值对象

集合计划所拥有的股票、股指期货合约、国债期货合约、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。

#### 2. 估值方法

##### （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对应的当日估值净价估值；

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) 对在交易所市场上市交易的可转换债券，选取每日收盘价作为估值全价；

5) 在交易所上市并以全价交易的债券以每日收盘价作为估值全价；

6) 交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。交易所上市的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

(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和债券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值；

3) 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进行估值；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，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，则采用估值技术确定公允价值；

4) 流通受限的股票，包括非公开发行股票、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。对于含投资人回售权的固定收益品种，回售登记期截止日（含当日）后未行使回售权的按照长待偿期所对应的价格进行估值。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，在发行利率与二级市场利率不存在明显差异，未上市期间市场利率没有发生大的变动的情况下，按成本估值。

(4) 同一债券或股票同时在两个或两个以上市场交易的，按债券或股票所处的市场分别估值。

(5) 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，按成本估值。

(6) 股指期货合约、国债期货合约一般以估值当日结算价进行估值，估值日无结算价的，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。

(7) 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。

(8) 当本集合计划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，并需履行相关信息披露义务。

(9) 估值计算中涉及外币对人民币汇率的，将依据下列信息提供机构所提供的汇率为基准：估值当日中国人民银行或其授权机构公布的人民币汇率中间价为准。

(10) 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。

(11) 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资产管理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集合计划份额持有人利益时，应立即通知对方，共同查明原因，双方协商解决。

根据《基金法》，管理人计算集合计划资产净值，托管人复核管理人计算的集合计划资产净值。集合计划净值信息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。

### 3. 特殊情形的处理

1) 管理人、托管人按估值方法的第(10)项进行估值时,所造成的误差不作为集合计划资产估值错误处理。

2) 由于不可抗力原因,或由于证券/期货交易所、证券/期货经纪机构及登记结算公司等第三方机构发送的数据错误,或国家会计政策变更、市场规则变更等,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轻由此造成的影响。

#### 4、集合计划份额折算基准日

在资产管理合同生效日或管理人决定的其他日期,管理人可根据市场情况确定折算基准日。

#### 5、集合计划份额折算对象

份额折算基准日登记在册的本集合计划份额。

#### 6、份额折算频率

不定期。

#### 7、集合计划份额折算方式

管理人对本集合计划份额的折算方式,具体见管理人届时发布的相关公告。

### (三) 集合计划份额净值错误的处理方式

当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,视为集合计划份额净值错误。

本协议的当事人应按照以下约定处理:

#### 1、估值错误类型

本集合计划运作过程中,如果由于管理人或托管人、或登记机构、或销售机构、或投资人自身的过错造成估值错误,导致其他当事人遭受损失的,过错的责任人应当对由于该估值错误遭受损失当事人(“受损方”)的直接损失按下述“估值错误处理原则”给予赔偿,承担赔偿责任。

上述估值错误的主要类型包括但不限于:资料申报差错、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,若系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投资人的交易资料灭失或被错误处理或造成其他错误等，因不可抗力原因出现估值错误的当事人不对其他当事人承担赔偿责任，但因该估值错误取得不当得利的当事人仍应负有返还不当得利的义务。

## 2、估值错误处理原则

(1) 估值错误已发生，但尚未给当事人造成损失时，估值错误责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正估值错误发生的费用由估值错误责任方承担；由于估值错误责任方未及时更正已产生的估值错误，给当事人造成损失的，由估值错误责任方对直接损失承担赔偿责任；若估值错误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，则其应当承担相应赔偿责任。估值错误责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认，确保估值错误已得到更正。

(2) 估值错误的责任方对有关当事人的直接损失负责，不对间接损失负责，并且仅对估值错误的有关直接当事人负责，不对第三方负责。

(3) 因估值错误而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但估值错误责任方仍应对估值错误负责。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（“受损方”），则估值错误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交付不当得利的权利；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估值错误责任方。

(4) 估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

## 3、估值错误处理程序

估值错误被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

(1) 查明估值错误发生的原因，列明所有的当事人，并根据估值错误发生的原因确定估值错误的责任方；

(2) 根据估值错误处理原则或当事人协商的方法对因估值错误造成的损失进行评估；

(3) 根据估值错误处理原则或当事人协商的方法由估值错误的责任方进行更正和赔偿损失；

(4) 根据估值错误处理的方法，需要修改登记机构交易数据的，由登记机构进行更正，并就估值错误的更正向有关当事人进行确认。

4、份额净值估值错误处理的方法如下：

(1) 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。

(2) 错误偏差达到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。

(3) 当集合计划份额净值计算差错给集合计划和份额持有人造成损失需要进行赔偿时，管理人和托管人应根据实际情况界定双方承担的责任，经确认后按以下条款进行赔偿：

①本集合计划的会计责任方由管理人担任，与集合计划有关的会计问题，如经双方在平等基础上充分讨论后，尚不能达成一致时，按管理人的建议执行，由此给份额持有人和集合计划财产造成的损失，由管理人负责赔付。

②若管理人计算的集合计划份额净值已由托管人复核确认后公告，由此给份额持有人造成损失的，应根据法律法规的规定对投资者或集合计划支付赔偿金额，就实际向投资者或集合计划支付的赔偿金额，管理人与托管人按照固定管理费率 and 托管费率的比例各自承担相应的责任。

③如管理人和托管人对份额净值的计算结果，虽然多次重新计算和核对或对管理人采用的估值方法，尚不能达成一致时，为避免不能按时公布份额净值的情形，以管理人的计算结果对外公布，由此给份额持有人和集合计划造成的损失，由管理人负责赔付。

④由于管理人提供的信息错误(包括但不限于集合计划申购或赎回金额等)，进而导致份额净值计算错误而引起的份额持有人和集合计划财产的损失，由管理人负责赔付。

(4) 管理人和托管人由于各自技术系统设置而产生的净值计算尾差，以管理人计算结果为准。

(5) 前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。如果行业另有通行做法，管理人和托管人应本着平等和保护份额持有人利益的原则进行

协商处理。

(四) 暂停估值与公告集合计划份额净值的情形

1. 集合计划投资所涉及的证券、期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

2. 因不可抗力致使管理人、托管人无法准确评估集合计划资产价值时；

3. 当特定资产占前一估值日集合计划资产净值 50%以上的，经与托管人协商确认后，管理人应当暂停估值；

4. 法律法规、中国证监会和资产管理合同认定的其它情形。

(五) 集合计划会计制度

按国家有关部门规定的会计制度执行。

(六) 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，应按照相关各方约定的同一记账方法和会计处理原则，分别独立地设置、登录和保管本集合计划的全套账册，对相关各方各自的账册定期进行核对，互相监督，以保证集合计划资产的安全。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。

经对账发现相关各方的账目存在不符的，管理人和托管人必须及时查明原因并纠正，保证相关各方平行登录的账册记录完全相符。若当日核对不符，暂时无法查找到错账的原因而影响到集合计划净值信息的计算和公告的，以管理人的账册为准。

(七) 集合计划财务报表与报告的编制和复核

1. 财务报表的编制

集合计划财务报表由管理人和托管人每月分别独立编制。

2. 报表复核

托管人在收到管理人编制的集合计划财务报表后，进行独立的复核。核对不符时，应及时通知管理人共同查出原因，进行调整，调整以相关各方认可的账务处理方式为准。核对无误后，托管人在管理人提供的报告上加盖托管业务章的复核意见书，相关各方各自留存一份。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。

### 3. 财务报表的编制与复核时间安排

#### (1) 报表的编制

在《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。集合计划终止运作的，管理人不再更新招募说明书。管理人应当在每月结束后 5 个工作日内完成月度报表的编制；在季度结束之日起 15 个工作日内完成集合计划季度报告的编制并公告；在上半年结束之日起两个月内完成集合计划中期报告的编制并公告；在每年结束之日起三个月内完成集合计划年度报告的编制并公告。托管人在对财务会计报告、季度报告、中期报告或年度报告复核完毕后，需盖章确认或出具相应的复核确认书，以备有权机构对相关文件审核。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。

### 六、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。登记机构的保管期限自集合计划账户销户之日起不得少于 20 年。

管理人应当按照托管人要求及时向托管人提交下列日期的份额持有人名册：《资产管理合同》生效日、《资产管理合同》终止日、份额持有人大会权益登记日、每年 6 月 30 日、每年 12 月 31 日的份额持有人名册。托管人与管理人分别保管集合计划份额持有人名册，保管方式可以采用电子或文档的形式，管理人保存期不少于 15 年，托管人保存期不少于 20 年。如管理人或托管人由于自身原因无法妥善保管份额持有人名册，则按相关法规规定各自承担相应的责任。

托管人以电子版形式妥善保管份额持有人名册，并定期刻成光盘备份。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。

### 七、争议解决方式

双方当事人同意，因本协议而产生的或与本协议有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，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上海



分会，按照该会届时有效的仲裁规则仲裁，仲裁地点为上海。仲裁裁决是终局性的，对双方均有约束力。争议处理期间，双方当事人应恪守管理人和托管人职责，各自继续忠实、勤勉、尽责地履行资产管理合同和本托管协议规定的义务，维护集合计划份额持有人的合法权益。

本协议受中国法律管辖。

## 八、托管协议的变更、终止与集合计划财产的清算

### （一）托管协议的变更程序

本协议双方当事人经协商一致，可以对协议进行修改。修改后的新协议，其内容不得与资产管理合同的规定有任何冲突。集合计划托管协议的变更报中国证监会备案。

### （二）集合计划托管协议终止的情形

- 1、《资产管理合同》终止；
- 2、托管人解散、依法被撤销、破产或有其他托管人接管集合计划资产；
- 3、管理人解散、依法被撤销、破产或有其他管理人接管集合计划管理权；
- 4、相关法律法规、中国证监会规定的其他情况，或《资产管理合同》约定的终止事项。

### （三）集合计划财产的清算

#### 1. 集合计划财产清算小组

（1）自出现资产管理合同终止事由之日起 30 个工作日内成立清算小组，管理人组织集合计划财产清算小组并在中国证监会的监督下进行集合计划清算。

（2）集合计划财产清算小组成员由管理人、托管人、符合《中华人民共和国证券法》规定的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。集合计划财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

（3）在财产清算小组接管集合计划财产之前，管理人和托管人应按照《资产管理合同》和本托管协议的规定继续履行保护集合计划财产安全的职责。

（4）集合计划财产清算小组负责集合计划财产的保管、清理、估价、变现和分配。集合计划财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。

#### 2. 集合计划财产清算程序

资产管理合同终止，应当按法律法规和资产管理合同的有关规定对集合计划

财产进行清算。集合计划财产清算程序主要包括：

- (1) 《资产管理合同》终止情形出现后，发布财产清算公告；
- (2) 《资产管理合同》终止情形出现时，由集合计划财产清算小组统一接管集合计划；
- (3) 对集合计划财产和债权债务进行清理和确认；
- (4) 对集合计划财产进行估值和变现；
- (5) 制作清算报告；
- (6) 聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- (7) 将清算报告报中国证监会备案并公告；
- (8) 对集合计划剩余财产进行分配。

3. 集合计划财产清算的期限为 6 个月，但因本集合计划所持证券的流动性受到限制而不能及时变现的，管理人可针对该部分未能变现证券制定二次清算方案，该方案应经托管人认可，并通过管理人网站进行披露。管理人应根据二次清算方案的规定，对该部分流通受限证券在可流通变现后进行二次或多次清算，并将变现后的资产按照份额持有人拥有份额的比例，以货币形式全部分配给份额持有人。

#### 4. 清算费用

清算费用是指集合计划财产清算小组在进行集合计划清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由集合计划财产清算小组优先从集合计划财产中支付。

#### 5. 集合计划财产清算剩余资产的分配：

依据财产清算的分配方案，将集合计划财产清算后的全部剩余资产扣除财产清算费用、交纳所欠税款并清偿集合计划债务后，按集合计划份额持有人持有的集合计划份额比例进行分配。

#### 6. 集合计划财产清算的公告

集合计划财产清算公告于集合计划财产清算报告报中国证监会备案后 5 个工作日内由集合计划财产清算小组公告，集合计划财产清算小组应当将清算报告登载在规定网站上，并将清算报告提示性公告登载在规定报刊上；清算过程中的有关重大事项须及时公告；集合计划财产清算报告经符合《中华人民共和国证券

法》规定的会计师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，由集合计划财产清算小组报中国证监会备案并公告。

7. 集合计划财产清算账册及文件的保存

集合计划财产清算账册及有关文件由托管人保存 20 年以上。

---

---

## 第二十二部分 对集合计划份额持有人的服务

管理人承诺为集合计划份额持有人提供一系列的服务。管理人将根据集合计划份额持有人的需要和市场的变化，增加或变更服务项目。主要服务内容如下：

### 一、客户服务专线

- 1、理财咨询：人工理财咨询、账户查询、投资人个人资料完善等。
- 2、全天候的 7×24 小时电话自助查询（集合计划净值、账户信息等）。

### 二、客户投诉及建议受理服务

投资人可以通过电话、信函、电邮等方式提出咨询、建议、投诉等需求，管理人将尽快给予回复，并在处理进程中随时给予跟踪反馈。

### 三、联系管理人

- 1、网址：<http://www.ebscn-am.com>
- 2、电子邮箱：[gdyg@ebscn.com](mailto:gdyg@ebscn.com)
- 3、客户服务热线：95525
- 4、管理人办公地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 799 号 3 号楼 26 层

四、如本招募说明书存在任何您/贵机构无法理解的内容，请通过上述方式联系管理人。请确保投资前，您/贵机构已经全面理解了本招募说明书。

## 第二十三部分 招募说明书的及查阅方式

本招募说明书存放在管理人和销售机构的办公场所和营业场所，投资者可免费查阅。在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

## 第二十四部分 备查文件

- 一、中国证监会准予光大阳光混合优选（阳光 6 号）集合资产管理计划变更的文件
- 二、光大阳光优选一年持有期混合型集合资产管理计划资产管理合同
- 三、光大阳光优选一年持有期混合型集合资产管理计划托管协议
- 四、法律意见书
- 五、管理人业务资格批件、营业执照
- 六、托管人业务资格批件、营业执照
- 七、中国证监会要求的其他文件

上述备查文件存放在管理人、托管人和销售机构的办公场所和营业场所，投资者可在办公时间免费查阅。在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复印件。

上海光大证券资产管理有限公司

2020 年 9 月 9 日