

上海国泰君安证券资产管理有限公司

国泰君安君得益三个月持有期混合型基金
中基金(FOF)集合资产管理计划
招募说明书更新

管理人：上海国泰君安证券资产管理有限公司

托管人：交通银行股份有限公司

重要提示

国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)集合资产管理计划(以下简称“本集合计划”或“集合计划”)由国泰君安君得益二号优选基金集合资产管理计划变更而来,国泰君安君得益二号优选基金集合资产管理计划由管理人依照《证券公司客户资产管理业务试行办法》(证监会令第17号)、《证券公司集合资产管理业务实施细则》(证监会公告[2013]28号)、《国泰君安君得益二号优选基金集合资产管理计划管理合同》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”)核准设立。

根据中国证监会于2018年11月30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》(证监会公告〔2018〕39号)的规定,国泰君安君得益二号优选基金集合资产管理计划已完成产品的规范验收并向中国证监会申请合同变更。

经中国证监会批准,自2020年11月16日起,《国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)集合资产管理计划资产管理合同》生效,原《国泰君安君得益二号优选基金集合资产管理计划管理合同》同日起失效。

管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会批准,但中国证监会对国泰君安君得益二号优选基金集合资产管理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。

投资有风险,投资者在投资本集合计划之前,请仔细阅读本集合计划的招募说明书、集合计划合同、集合计划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。

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、社会等环境因素对证券

价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，由于集合计划投资人连续大量赎回集合计划份额产生的流动性风险，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，本集合计划的特定风险等。本集合计划为混合型基金中基金集合资产管理计划，其预期收益和预期风险水平高于货币市场基金、货币型基金中基金、债券型基金、债券型集合资产管理计划，低于股票型基金、股票型集合资产管理计划。

本集合计划可投资于资产支持证券，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。

本集合计划的特定风险详见招募说明书“风险揭示”章节。

本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。管理人提醒投资者投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，集合计划运营状况与集合计划净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责。

本次招募说明书更新仅更新投资经理信息。

目 录

重要提示.....	2
第一部分 绪言.....	1
第二部分 释义.....	2
第三部分 管理人.....	8
第四部分 托管人.....	16
第五部分 相关服务机构.....	20
第六部分 集合计划的历史沿革.....	22
第七部分 集合计划的存续.....	23
第八部分 集合计划份额的申购与赎回.....	24
第九部分 集合计划的投资.....	35
第十部分 集合计划的财产.....	42
第十一部分 集合计划资产估值.....	43
第十二部分 集合计划的收益与分配.....	50
第十三部分 集合计划费用与税收.....	52
第十四部分 集合计划的会计与审计.....	55
第十五部分 集合计划的信息披露.....	56
第十六部分 风险揭示.....	63
第十七部分 集合计划合同的变更、终止与集合计划财产的清算.....	70
第十八部分 集合计划合同的内容摘要.....	72
第十九部分 集合计划托管协议的内容摘要.....	89
第二十部分 对集合计划份额持有人的服务.....	108
第二十一部分 招募说明书的存放及查阅方式.....	109
第二十二部分 备查文件.....	110

第一部分 绪言

《国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)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》”）、《公开募集证券投资基金运作指引第2号——基金中基金指引》、《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《国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)集合资产管理计划资产管理合同》（以下简称“集合计划合同”或“《集合计划合同》”）编写。

本招募说明书阐述了国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)集合资产管理计划的投资目标、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。

本招募说明书依据集合计划合同编写，并经中国证监会批准。集合计划合同是约定集合计划当事人之间权利义务的法律文件。投资者自依集合计划合同取得集合计划份额，即成为集合计划份额持有人和集合计划合同的当事人，其持有集合计划份额的行为本身即表明对集合计划合同的承认和接受，并按照《基金法》、集合计划合同及其它有关规定享有权利，承担义务。

投资者欲了解集合计划份额持有人的权利和义务，应详细查阅集合计划合同。

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、集合资产管理计划：指上海国泰君安证券资产管理有限公司设立管理的投资者人数不受 200 人限制的集合资产管理计划
- 2、集合计划或本集合计划：指国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)集合资产管理计划
- 3、管理人：指上海国泰君安证券资产管理有限公司
- 4、托管人：指交通银行股份有限公司
- 5、集合计划合同、《集合计划合同》：指《国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)集合资产管理计划资产管理合同》及对集合计划合同的任何有效修订和补充
- 6、托管协议：指管理人与托管人就本集合计划签订之《国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)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
- 7、招募说明书或本招募说明书：指《国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)集合资产管理计划招募说明书》及其更新
- 8、集合计划产品资料概要：指《国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)集合资产管理计划集合计划产品资料概要》及其更新
- 9、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集合计划合同当事人有约束力的决定、决议、通知等
- 10、《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
- 11、《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

12、《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

13、《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

14、《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

15、中国证监会：指中国证券监督管理委员会

16、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

17、合同当事人：指受集合计划合同约束，根据集合计划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

18、个人投资者：指依据有关法律法规规定可投资于集合资产管理计划的自然人

19、机构投资者：指依法可以投资集合资产管理计划的、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

20、合格境外机构投资者：指符合相关法律法规规定可以投资于在中国境内依法募集的集合资产管理计划的中国境外的机构投资者

21、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

22、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集合资产管理计划的其他投资人的合称

23、集合计划份额持有人：指依集合计划合同和招募说明书合法取得集合计划份额的投资人

24、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

25、销售机构：指上海国泰君安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

26、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

27、登记机构：指办理登记业务的机构。本集合计划的登记机构为中国证券登记结算有限责任公司

28、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

29、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、赎回等业务而引起的集合计划份额变动及结余情况的账户

30、集合计划合同生效日：指《国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)集合资产管理计划资产管理合同》的生效日，原《国泰君安君得益二号优选基金集合资产管理计划管理合同》同日起失效

31、集合计划合同终止日：指集合计划合同规定的集合计划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

32、存续期：指《国泰君安君得益二号优选基金集合资产管理计划管理合同》生效至集合计划合同终止之间的不定期期限

33、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

34、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

35、T+n日：指自T日起第n个工作日(不包含T日)

36、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

37、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

38、《业务规则》：指中国证券登记结算有限责任公司相关业务规则及其不时做出的修订，是规范管理人所管理的并由中国证券登记结算有限责任公司办理登记业务的集合资产管理计划登记方面的业务规则

39、最短持有期：指本集合计划对每份份额设置 3 个月的最短持有期。在最短持有期到期日之前（不含当日），投资者不能提出赎回申请；最短持有期期满后（含最短持有期到期日当日）投资者可以申请赎回

40、最短持有期起始日：指每份集合计划份额的参与确认日（对于持有国泰君安君得益二号优选基金集合资产管理计划份额至集合计划合同生效日的份额而言）或每份集合计划份额的申购确认日（对申购份额而言）

41、最短持有期到期日：指最短持有期起始日起 3 个月后的对应日，如无对应日或该对应日为非工作日，则顺延至下一工作日

42、申购：指集合计划合同生效后，投资人根据集合计划合同和招募说明书的规定申请购买集合计划份额的行为

43、赎回：指集合计划合同生效后，集合计划份额持有人按集合计划合同和招募说明书规定的条件要求将集合计划份额兑换为现金的行为

44、集合资产管理计划转换：指集合计划份额持有人按照集合计划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、某一集合资产管理计划的份额转换为管理人管理的其他集合资产管理计划份额的行为

45、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

46、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

47、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%

48、元：指人民币元

49、集合计划收益：指集合计划投资所得证券投资基金分红收入、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

50、集合计划资产总值：指集合计划拥有的各类有价证券、证券投资基金、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

51、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

52、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

53、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

54、集合计划份额类别：指本集合计划根据申购费、销售服务费收取方式等不同，将集合计划份额分为不同的类别

55、A 类份额：指在投资者申购时收取申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用，但不从本类别集合计划资产中计提销售服务费的份额类别

56、C 类份额：指在投资者申购时不收取申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用，且从本类别集合计划资产中计提销售服务费的份额类别

57、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

58、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

59、摆动定价机制：指当开放式集合资产管理计划遭遇大额申购赎回时，通过调整集合资产管理计划份额净值的方式，将集合资产管理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资产管理计划份额持有人利益的不利影响，确保投资人的合法权益不受损害并得到公平对待

60、不可抗力：指集合计划合同当事人不能预见、不能避免且不能克服的客

观事件

第三部分 管理人

一、管理人概况

名称：上海国泰君安证券资产管理有限公司（简称：本公司或公司）

住所：上海市黄浦区南苏州路 381 号 409A10 室

设立日期：2010 年 8 月 27 日

法定代表人：江伟

办公地址：上海市东园路 111 号

联系电话：38676999

联系人：胡秀华

注册资本：20 亿元人民币

股权结构：国泰君安证券股份有限公司，持有股份 100%。

二、主要人员情况

1、董事会成员

江伟，女，1969 年 4 月出生，高级管理人员工商管理硕士，中共党员。历任国泰君安证券股份有限公司商城路营业部总经理助理、上海水城路营业部总经理、上海江苏路营业部总经理、上海分公司总经理、国泰君安证券总裁助理、党委委员、经纪业务委员会副总裁、研究与机构业务委员会总裁等职务，现任本公司董事长，国泰君安创新投资有限公司董事长、执行委员会主席、代行总经理职责，国泰君安证券股份有限公司上海分公司总经理。

蒋忆明，男，1963 年 11 月出生，博士。历任君安证券经纪业务部副总经理、资金计划部总经理、财务总监，国泰君安证券总会计师、财务总监；现任国泰君安证券副总裁、营运总监，本公司董事。

喻健，男，1964 年 4 月出生，工商管理硕士。历任航空航天部所属研究所科技部项目主管；国泰证券的证券发行部副经理、发行一处经理以及证券发行部副总经理；国泰君安证券股份有限公司投行部副总经理，企业融资部副总监、总监、总经理，上市办公室主任。现任国泰君安证券股份有限公司董事、董事会秘书、北京代表处首席代表、董事会办公室主任，本公司董事。

2、监事

傅南平，男，1962年10月出生，经济学博士。历任深圳国际信托投资公司证券发行部副总经理，原君安证券投资银行总部副总经理，国泰君安证券投资银行二部总经理、企业融资总部常务董事、副总监、机构客户服务总部副总经理、深圳总部副总经理、深圳分公司副总经理，现任国泰君安证券巡察委员会巡察员，本公司监事。

3、高级管理人员

陶耿，男，1968年1月出生，博士，高级经济师，中共党员。历任中国银行、中国人民银行科员，中国证监会上海监管局机构处主任科员、机构监管二处副处长、基金监管处处长、办公室主任，光大保德信基金管理有限公司总经理。现任本公司总裁。

叶明，男，1976年8月出生，大学本科，中共党员。1995年7月入职原国泰证券，1999年7月加入国泰君安证券，先后担任计划财务部副经理、资金清算总部总经理助理、营运中心副总经理；2010年8月起加入本公司，历任营运总监兼任营运部总经理、董事会秘书、代履职合规总监职责，现任本公司副总裁兼任合规总监、首席风险官、财务负责人。

吴楠，女，1970年12月出生，经济学硕士。1992年7月任职于深圳发展银行，1997年1月加入君安证券，1999年8月加入国泰君安证券，2010年10月进入本公司担任总裁助理兼北京业务部总经理，现任本公司副总裁。

周诗宇，男，1971年出生，大学本科，中共党员。1994年7月加入君安证券，1999年8月加入国泰君安证券，2013年10月进入本公司担任总裁助理兼市场部总经理，现任本公司副总裁。

成飞，男，汉族，1983年9月出生，硕士研究生，中共党员。2006年7月入职国泰君安证券，历任固定收益证券总部研究员、资产管理部投资经理，2010年10月加入本公司，历任固定收益部副总经理、总经理、总裁助理，现任本公司副总裁。

李艳，女，1974年2月出生，硕士研究生，FRM，中共党员。2001年3月入职上海证券有限责任公司，历任证券投资总部高级经理、创新产品总部高级经理、研究所金融工程部负责人、基金评价研究中心副总经理、创新发展总部总经理兼

基金评价研究中心总经理，2015年9月加入本公司担任综合管理部总经理，现任本公司董事会秘书。

庄严，男，1971年8月出生，大学本科。1990年9月起历任中国银行上海分行会计员；中国工商银行总行信托投资公司上海证券总部交易员、办公室主任助理、主任；中国银河证券有限责任公司上海总部行政部经理；亚洲证券有限公司公司总裁办副主任、资产管理总部副总经理、总经理；国海富兰克林基金管理有限公司渠道总监兼零售业务部总经理；泰信基金管理有限公司市场总监兼市场部总经理、营销部总经理；光大保德信基金管理有限公司副CMO等；2016年9月起加入本公司担任基金管理部总经理、总裁助理兼机构金融部总经理，现任本公司总裁助理。

朱晓力，男，1965年4月出生，工商管理硕士，中共党员。1993年3月起历任上海国际信托有限公司证券部技术主管、营业部副经理；上海证券有限责任公司信息技术总部总经理、电子商务总部总经理；2016年3月起加入本公司担任信息技术部总经理，现任本公司首席信息官。

4、本集合计划的投资经理

李少君，CFA、FRM，中国人民大学博士。现任上海国泰君安证券资产管理有限公司投资研究院院长、组合投资部总经理，负责研究及组合投资业务。曾供职于中国工商银行总行；民生证券研究院，历任研究业务部总经理、首席策略分析师；国泰君安证券研究所，历任副所长、全球首席策略分析师、总量团队负责人。

高琛，华东理工大学工商管理硕士，10年证券从业经历。曾任上海证券基金评价分析师、金融实验室负责人，国泰君安资产管理业务委员会执行办董事。现任上海国泰君安证券资产管理有限公司组合投资部投资经理，主要负责公募基金评价及FOF投资研究工作。

5、公募投资决策委员会成员

陶耿，公募投资决策委员会主任委员，现任本公司总裁。

成飞，公募投资决策委员会副主任委员，现任本公司副总裁。

李少君，公募投资决策委员会委员，现任本公司投资研究院院长。

张骏，公募投资决策委员会委员，现任本公司基金投资部总经理。

王红莲，公募投资决策委员会委员，现任本公司风险管理部总经理。

6、上述人员之间不存在近亲属关系。

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、办理集合计划备案手续；

3、自《集合计划合同》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》、《集合计划合同》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《集合计划合同》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》、《集合计划合同》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》、《集合计划合同》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《集合计划合同》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》、《集合计划合同》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不低于法律法规规定的最低期限；

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《集合计划合同》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条件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《集合计划合同》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《集合计划合同》规定履行自己的义务，托管人违反《集合计划合同》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《集合计划合同》约定的其他义务。

四、管理人承诺

1、管理人将根据集合计划合同的规定，按照招募说明书列明的投资目标、理念、策略及限制等全权处理本集合计划的投资。

2、管理人严格遵守《中华人民共和国证券法》、《基金法》、《信息披露办法》、

《运作办法》、《销售办法》及有关法律法规，建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止以下行为发生：

- （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）不公平地对待管理人管理的不同集合资产管理计划财产；
- （3）利用集合计划财产或者职务之便为集合计划份额持有人以外的第三人牟取利益；
- （4）向集合计划份额持有人违规承诺收益或者承担损失；
- （5）侵占、挪用集合计划财产；
- （6）泄露因职务便利获取的未公开信息、利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；
- （7）玩忽职守，不按照规定履行职责；
- （8）法律法规或中国证监会禁止的其他行为。

3、集合计划投资经理承诺

- （1）依照有关法律、法规和集合计划合同的规定，本着谨慎的原则为集合计划份额持有人谋取最大利益；
- （2）不能利用职务之便为自己、受雇人或任何第三者谋取利益；
- （3）不违反现行有效的有关法律法规、规章、集合计划合同和中国证监会的有关规定，不泄露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明示、暗示他人从事相关的交易活动；
- （4）不协助、接受委托或以其它任何形式为其它组织或个人进行证券交易；
- （5）不从事损害集合计划资产和集合计划份额持有人利益的证券交易及其他活动。

五、管理人的内部控制制度

1、内部控制制度概述

为保障公司及其所开展的资产管理业务规范运作，有效防范、规避和化解各类风险，最大限度地保护利益相关者及公司的合法权益，管理人建立了科学合理、控制严密、运行高效的内部控制制度。

内部控制制度是对公司章程规定的内控原则的细化和展开,是公司各项基本管理制度的纲要和总揽,贯穿公司运营的所有环节,其内容包括公司内控目标、内控原则、控制环境、内控措施等。

2、内部控制目标

(1) 确保公司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,实现公司资产管理业务的持续、稳定、健康发展。

(3) 建立行之有效的风险控制系统,保障公司资产及客户资产的安全完整,维护公司股东的合法权益,并最大限度地保护投资人的合法权益。

(4) 确保公司业务记录、财务信息和其它信息真实、准确、完整、及时。

(5) 保证公司内部规章制度的贯彻执行,提高公司经营效益。

3、内部控制原则

(1) 健全性原则。内部控制机制应当做到事前、事中、事后控制相统一;覆盖公司各个部门和各级岗位,渗透到决策、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,建立合理的内部控制程序,维护内控制度的有效执行。

(3) 独立性原则。公司各部门和岗位职责应当保持相对独立,公司对受托资产、自有资产、其他资产的管理运作必须分离;公司设立法律合规部及风险管理部,承担内部控制监督检查职能,对各部门、岗位进行流程监控和风险管理。

(4) 相互制约原则。内部部门和岗位的设置必须权责分明、相互制衡;前台业务运作与后台管理支持适当分离。

(5) 成本效益原则。公司内部控制与公司业务范围、经营规模、风险状况相适应,运用科学化的经营管理方法,以合理的成本实现内部控制目标。

4、控制环境

内部控制环境主要包括公司经营理念与风险意识、治理结构、组织架构与决策程序、内部控制体系、员工的诚信和道德价值观、人力资源政策等。

5、内控措施

公司建立科学严密的风险控制评估体系,通过定期与不定期风险评估,对公

司内外部风险进行识别、评估和分析，发现风险来源和类型，针对不同的风险由相关部门提出相应的风险控制方案，及时防范和化解风险。

控制活动主要包括：授权控制、内幕交易控制、关联交易控制和法律风险控制等。内部控制的主要内容包括：市场开发业务控制、投资管理业务控制、信息披露控制、信息技术系统控制、会计系统控制和人力资源控制等。

6、管理人关于内部控制的声明

- （1）管理人确知建立、实施和维持内部控制制度是管理人的责任；
- （2）上述关于内部控制的披露真实、准确；
- （3）管理人承诺将根据市场环境的变化及管理人业务的发展不断完善内部控制制度。

第四部分 托管人

一、托管人情况

(一) 托管人概况

托管人为交通银行股份有限公司，基本信息如下：

名称：交通银行股份有限公司（简称：交通银行）

住所：中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 号

邮政编码：200336

法定代表人：任德奇

成立时间：1987 年 3 月 30 日

批准设立机关和批准设立文号：国务院国发(1986)字第 81 号文和中国人民银行银发〔1987〕40 号文

组织形式：股份有限公司（上市，国有控股）

注册资本：742.63 亿元人民币

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]25 号

联系人：陆志俊

联系电话：95559

交通银行始建于 1908 年，是中国历史最悠久的银行之一，也是近代中国的发钞行之一。1987 年重新组建后的交通银行正式对外营业，成为中国第一家全国性的国有股份制商业银行，总部设在上海。2005 年 6 月交通银行在香港联合交易所挂牌上市，2007 年 5 月在上海证券交易所挂牌上市。交通银行连续 12 年跻身《财富》(FORTUNE)世界 500 强，营业收入排名第 162 位；列《银行家》(The Banker)杂志全球千家大银行一级资本排名第 11 位。

截至 2020 年 6 月 30 日，交通银行资产总额为人民币 10.67 万亿元。2020 年 1-6 月，交通银行实现净利润(归属于母公司股东)人民币 365.05 亿元。

交通银行总行设资产托管业务中心（下文简称“托管中心”）。现有员工具有多年基金、证券和银行的从业经验，具备基金从业资格，以及经济师、会计师、

工程师和律师等中高级专业技术职称，员工的学历层次较高，专业分布合理，职业技能优良，职业道德素质过硬，是一支诚实勤勉、积极进取、开拓创新、奋发向上的资产托管从业人员队伍。

（二）主要人员情况

任德奇先生，董事长、执行董事，高级经济师。

任先生 2020 年 1 月起任本行董事长（其中：2019 年 12 月至 2020 年 7 月代为履行行长职责）、执行董事，2018 年 8 月至 2020 年 1 月任本行副董事长（其中：2019 年 4 月至 2020 年 1 月代为履行董事长职责）、执行董事，2018 年 8 月至 2019 年 12 月任本行行长；2016 年 12 月至 2018 年 6 月任中国银行执行董事、副行长，其中：2015 年 10 月至 2018 年 6 月兼任中银香港（控股）有限公司非执行董事，2016 年 9 月至 2018 年 6 月兼任中国银行上海人民币交易业务总部总裁；2014 年 7 月至 2016 年 11 月任中国银行副行长，2003 年 8 月至 2014 年 5 月历任中国建设银行信贷审批部副总经理、风险监控部总经理、授信管理部总经理、湖北省分行行长、风险管理部总经理；1988 年 7 月至 2003 年 8 月先后在中国建设银行岳阳长岭支行、岳阳市中心支行、岳阳分行，中国建设银行信贷管理委员会办公室、信贷风险管理部工作。任先生 1988 年于清华大学获工学硕士学位。

袁庆伟女士，资产托管业务中心总裁，高级经济师。

袁女士 2015 年 8 月起任本行资产托管业务中心总裁；2007 年 12 月至 2015 年 8 月，历任本行资产托管部总经理助理、副总经理，本行资产托管业务中心副总裁；1999 年 12 月至 2007 年 12 月，历任本行乌鲁木齐分行财务会计部副科长、科长、处长助理、副处长，会计结算部高级经理。袁女士 1992 年毕业于中国石油大学计算机科学系，获得学士学位，2005 年于新疆财经学院获硕士学位。

（三）基金托管业务经营情况

截至 2020 年 6 月 30 日，交通银行共托管证券投资基金 478 只。此外，交通银行还托管了基金公司特定客户资产管理计划、证券公司客户资产管理计划、银行理财产品、信托计划、私募投资基金、保险资金、全国社保基金、养老保障管理基金、企业年金基金、职业年金基金、QFII 证券投资资产、RQFII 证券投资资产、QDII 证券投资资产、RQDII 证券投资资产、QDIE 资金、QDLP 资金和 QFLP 资金等产品。

二、托管人的内部控制制度

（一）内部控制目标

交通银行严格遵守国家法律法规、行业规章及行内相关管理规定，加强内部管理，托管中心业务制度健全并确保贯彻执行各项规章制度，通过对各种风险的识别、评估、控制及缓释，有效地实现对各项业务的风险管控，确保业务稳健运行，保护基金持有人的合法权益。

（二）内部控制原则

1、合法性原则：托管中心制定的各项制度符合国家法律法规及监管机构的监管要求，并贯穿于托管业务经营管理活动始终。

2、全面性原则：托管中心建立各二级部自我监控和风险合规部风险管控的内部控制机制，覆盖各项业务、各个部门和各级人员，并渗透到决策、执行、监督、反馈等各个经营环节，建立全面的风险管理监督机制。

3、独立性原则：托管中心独立负责受托基金资产的保管，保证基金资产与交通银行的自有资产相互独立，对不同的受托基金资产分别设置账户，独立核算，分账管理。

4、制衡性原则：托管中心贯彻适当授权、相互制约的原则，从组织架构的设置上确保各二级部和各岗位权责分明、相互制约，并通过有效的相互制衡措施消除内部控制中的盲点。

5、有效性原则：托管中心在岗位、业务二级部和风险合规部三级内控管理模式的基础上，形成科学合理的内部控制决策机制、执行机制和监督机制，通过行之有效的控制流程、控制措施，建立合理的内控程序，保障各项内控管理目标被有效执行。

6、效益性原则：托管中心内部控制与基金托管规模、业务范围和业务运作环节的风险控制要求相适应，尽量降低经营运作成本，以合理的控制成本实现最佳的内部控制目标。

（三）内部控制制度及措施

根据《基金法》、《中华人民共和国商业银行法》、《商业银行资产托管业务指引》等法律法规，托管中心制定了一整套严密、完整的证券投资基金托管管理规章制度，确保基金托管业务运行的规范、安全、高效，包括《交通银行资产托管

业务管理办法》、《交通银行资产托管业务风险管理办法》、《交通银行资产托管业务系统建设管理办法》、《交通银行资产托管部信息披露制度》、《交通银行资产托管业务商业秘密管理规定》、《交通银行资产托管业务从业人员行为规范》、《交通银行资产托管业务档案管理暂行办法》等，并根据市场变化和基金业务的发展不断加以完善。做到业务分工科学合理，技术系统管理规范，业务管理制度健全，核心作业区实行封闭管理，落实各项安全隔离措施，相关信息披露由专人负责。

托管中心通过对基金托管业务各环节的事前揭示、事中控制和事后检查措施实现全流程、全链条的风险管理，聘请国际著名会计师事务所对基金托管业务运行进行国际标准的内部控制评审。

三、托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序

交通银行作为托管人，根据《基金法》、《运作办法》和有关证券法规的规定，对基金的投资对象、基金资产的投资组合比例、基金资产的核算、基金资产净值的计算、管理人报酬的计提和支付、托管人报酬的计提和支付、基金的申购资金的到账与赎回资金的划付、基金收益分配等行为的合法性、合规性进行监督和核查。

交通银行作为托管人，发现管理人有违反《基金法》、《运作办法》等有关证券法规和《集合计划合同》的行为，及时通知管理人予以纠正，管理人收到通知后及时核对确认并进行调整。交通银行有权对通知事项进行复查，督促管理人改正。管理人对交通银行通知的违规事项未能及时纠正的，交通银行有权报告中国证监会。

交通银行作为托管人，发现管理人有重大违规行为，有权立即报告中国证监会，同时通知管理人限期纠正。

第五部分 相关服务机构

一、集合计划销售机构

1、直销机构

(1) 上海国泰君安证券资产管理有限公司

名称：上海国泰君安证券资产管理有限公司

住所：上海市黄浦区南苏州路 381 号 409A10 室

设立日期：2010 年 8 月 27 日

注册资本：20 亿元人民币

法定代表人：江伟

办公地址：上海市东园路 111 号

联系电话：021-38676999

联系人：甘珉

2、其他销售机构：

(1) 交通银行股份有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区银城中路188号

法定代表人：任德奇

电话：95559

网址：www.bankcomm.com

(2) 国泰君安证券股份有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区商城路618号

法定代表人：贺青

客户服务电话：95521

网址：www.gtja.com

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，管理人新增或变更本集合计划的销售机构时，将按照《信息披露办法》进行公告。

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
办公地址：北京市西城区太平桥大街17号
法定代表人：周明
电话：010-50938888
传真：010-50938828
联系人：张喆

三、出具法律意见的律师事务所

名称：上海市通力律师事务所
住所：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：韩炯
电话：021-31358666
传真：021-31358600
联系人：陆奇
经办律师：黎明、陆奇

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）
注册地址：北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼16层
办公地点：上海市浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心50楼
执行事务合伙人：毛鞍宁
电话：021-22286046
传真：021-22280527
联系人：丁鹏飞
经办注册会计师：丁鹏飞、李斐

第六部分 集合计划的历史沿革

国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)集合资产管理计划由国泰君安君得益二号优选基金集合资产管理计划变更而来。

国泰君安君得益二号优选基金集合资产管理计划为非限定性集合资产管理计划，于 2011 年 3 月 30 日经中国证监会证监许可〔2011〕466 号文核准设立，自 2011 年 4 月 25 日起开始募集并于 2011 年 5 月 31 日结束募集，于 2011 年 6 月 7 日成立。

根据中国证监会于 2018 年 11 月 30 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》（证监会公告〔2018〕39 号）的规定，国泰君安君得益二号优选基金集合资产管理计划已完成产品的规范验收并向中国证监会申请合同变更。

经中国证监会批准，自 2020 年 11 月 16 日起，《国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)集合资产管理计划资产管理合同》生效，原《国泰君安君得益二号优选基金集合资产管理计划管理合同》同日起失效。

第七部分 集合计划的存续

集合计划合同生效后，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 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、与其他集合资产管理计划合并或者终止集合计划合同等，并在 6 个月内召集集合计划份额持有人大会进行表决。

法律法规或监管部门另有规定时，从其规定。

第八部分 集合计划份额的申购与赎回

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他相关公告中列明。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。

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，但管理人根据法律法规、中国证监会的要求或集合计划合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。

集合计划合同生效后，若出现新的证券交易市场、证券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

管理人自集合计划合同生效之日起不超过3个月开始办理申购，具体业务办理时间在申购开始公告中规定。

管理人自集合计划合同生效之日起不超过3个月起开始办理赎回，具体业务办理时间在赎回开始公告中规定。在最短持有期到期日后（含当日），集合计划份额持有人可就该份额提出赎回申请。如果投资人多次申购本集合计划，则其持有的每一份计划份额的最短持有期到期日可能不同。

在确定申购开始与赎回开始时间后，管理人应在申购、赎回开放日前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告申购与赎回的开始时间。

管理人不得在集合计划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。投资人在集合计划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，该申购、赎回价格为下一开放日该类集合计划份额申购、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的该类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，即按照投资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的情况下，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；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；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+10日(包括该日)内支付赎回款项。遇证券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他非管理人及托管人所能控制的因素影响业务处理流程时，赎回款项顺延至上述情形消除后的下一个工作日划出。在发生巨额赎回或集合计划合同载明的延缓支付赎回款项的情形时，款项的支付办法参照集合计划合同有关条款处理。

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+3日内对该交易的有效性进行确认。T日提交的有效申请，投资人应在T+4日后(包括该日)及时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。

集合计划销售机构对申购、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、投资人单笔申购的最低金额为 1 元，具体规定请参见更新的招募说明书或相关公告。

2、投资者可将其账户中持有的全部或部分份额赎回，持有人在销售机构赎回时，每次赎回申请不得低于 1 份。持有人赎回时或赎回后在销售机构（网点）保留的份额余额不足 1 份的，在赎回时需一次全部赎回。

3、管理人可以规定单个投资人累计持有的集合计划份额上限，具体请参见相关公告。

4、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。

5、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

（1）投资人申购 A 类集合计划份额时，需交纳申购费用，A 类份额申购费率按照申购金额递减，即申购金额越大，所适用的申购费率越低。C 类份额不收取申购费。

投资者可以多次申购本集合计划，申购费率按单笔分别计算。具体申购费率如下表所示：

单笔申购金额（含申购费，M）	A 类份额的申购费率
$M < 100$ 万元	1.20%
$100 \text{ 万元} \leq M < 200 \text{ 万元}$	1.00%

200 万元 $\leq$ M<500 万元	0.30%
M $\geq$ 500 万	每笔 1000 元

(2) A 类份额申购费用由申购 A 类份额的投资人承担, 不列入集合计划财产, 主要用于本集合计划的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

2、赎回费

本集合计划的赎回费在集合计划份额持有人赎回集合计划份额时收取。集合计划份额的赎回费率按照持有时间递减, 即集合计划份额持有时间越长, 所适用的赎回费率越低。具体赎回费率如下表所示:

持有期限 (N)	A 类份额的赎回费率	C 类份额的赎回费率
N<7 日	1.50%	1.50%
7 日 $\leq$ N<365 日	0.50%	0.50%
365 日 $\leq$ N<730 日	0.25%	0.25%
N $\geq$ 730 日	0	0

本集合计划对持续持有期少于 30 日的投资人收取的赎回费, 将全额计入集合计划财产; 对持续持有期大于等于 30 日少于 90 日的投资人, 将赎回费总额的 75% 计入集合计划财产; 对持续持有期大于等于 90 日但少于 180 日的投资人, 将赎回费总额的 50% 计入集合计划财产。对持续持有期大于等于 180 日的投资人, 将赎回费总额的 25% 计入集合计划财产。未归入集合计划财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。

3、管理人可以在集合计划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。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。

5、管理人可以在不违反法律法规规定及集合计划合同约定且对存量集合计划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集合计划促销计划, 定期或不定期地开展集合计划促销活动。在集合计划促销活动期间, 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销售费用。

七、申购份额、赎回金额的计算方式

1、申购份额的计算

当投资者选择申购本集合计划份额时，申购份额的计算方法如下：

（1）申购费用适用比例费率时：

净申购金额 = 申购金额 / (1 + 申购费率)

申购费用 = 申购金额 - 净申购金额

申购份额 = 净申购金额 / 申购当日 A 类集合计划份额净值

（2）申购费用为固定金额时：

申购费用 = 固定金额

净申购金额 = 申购金额 - 申购费用

申购份额 = 净申购金额 / 申购当日 A 类集合计划份额净值

申购的有效份额为净申购金额除以当日的 A 类集合计划份额净值，有效份额单位为份，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：某投资者投资 5 万元申购本集合计划，则对应的申购费率为 1.20%，假设申购当日 A 类集合计划份额净值为 1.0500 元，则可得到的申购份额为：

净申购金额 = $50,000 / (1 + 1.20\%) = 49,407.11$ 元

申购费用 = $50,000 - 49,407.11 = 592.89$ 元

申购份额 = $49,407.11 / 1.0500 = 47,054.39$ 份

即：投资者投资 5 万元申购本集合计划，假设申购当日 A 类集合计划份额净值为 1.0500 元，则其可得到 47,054.39 份的 A 类集合计划份额。

例：某投资者投资 550 万元申购本集合计划，则其对应的申购费用为 1,000 元，假设申购当日 A 类集合计划份额净值为 1.0500 元，则其可得到的集合计划份额的份数计算如下：

申购费用 = 1,000.00 元

净申购金额 = $5,500,000 - 1,000 = 5,499,000.00$ 元

申购份额 = $5,499,000 / 1.0500 = 5,237,142.86$ 份

即：投资人投资 550 万元申购本集合计划，假设申购当日 A 类集合计划份额净值为 1.0500 元，则其可得到 5,237,142.86 份 A 类集合计划份额。

2、赎回金额的计算

本集合计划的赎回采用“份额赎回”方式，赎回价格以 T 日的该类集合计划份额净值为基准进行计算，本集合计划的赎回金额为赎回总额扣减赎回费用。

当投资者赎回集合计划份额时，赎回金额的计算方法如下：

赎回总额=赎回份额×赎回当日该类集合计划份额净值

赎回费用=赎回总额×赎回费率

赎回金额=赎回总额－赎回费用

赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日该类集合计划份额净值并扣除其他相应的费用，赎回金额单位为元。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：某持有人赎回 5 万份本集合计划 C 类份额，持有期为 731 日，则对应的赎回费率为 0，假设赎回当日 C 类集合计划份额净值为 1.0500 元，则可得到的赎回金额为：

赎回总金额=50,000×1.0500=52,500.00 元

赎回费用=52,500.00×0=0 元

净赎回金额=52,500.00－0=52,500.00 元

即：持有人赎回 5 万份本集合计划份额，持有期为 731 日，假设赎回当日 C 类集合计划份额净值为 1.0500 元，则其可得到 52,500.00 元。

3、集合计划份额净值计算

T 日某类集合计划份额净值=T 日该类集合计划资产净值/T 日发行在外的该集合计划份额总数。

本集合计划份额净值的计算，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 T+3 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、发生集合计划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申购申请。

3、证券交易所交易时间非正常停市或休市，或本集合计划所持有的占相当比例的被投资基金暂停估值，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、占相当比例的被投资基金拒绝或暂停申购、暂停上市或二级市场交易停牌。

9、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 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，被拒绝部分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、发生集合计划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、证券交易所交易时间非正常停市或休市，或本集合计划所持有的基金暂停估值，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份额持有人利益的情形时，管理人可暂停接受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、占相当比例的被投资基金暂停赎回、暂停上市或二级市场交易停牌。

8、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，按集合计划合同的相关条款处理。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) 在出现巨额赎回时,对于单个集合计划份额持有人当日超过上一开放日集合计划总份额 20%以上的赎回申请,管理人可以对超过的部分全部进行延期办理,具体措施如下:延期的赎回申请将自动与下一个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。如该单个集合计划份额持有人在提交赎回申请时未作明确选择,未能赎回部分作自动延期赎回处理。对于此类持有人未超过上述比例的部分,管理人有权根据前述“(1) 全额赎回”或“(2) 部分延期赎回”的方式与其他持有人的赎回申请一并办理。但是,如此类持有人在提交赎回申请时选择取消赎回,则其当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。

(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、传真或者招募说明书规定的其他方式在 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,并于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、若暂停时间超过1日，则管理人可以根据《信息披露办法》的有关规定，最迟于重新开放申购或赎回日，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；也可以根据实际情况在暂停公告中明确重新开放申购或赎回的时间，届时不再另行发布重新开放的公告。

十二、集合资产管理计划转换

管理人可以根据相关法律法规以及集合计划合同的规定决定开办本集合计划与管理人管理的其他集合资产管理计划之间的转换业务，集合资产管理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集合计划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，集合计划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、集合计划份额的冻结和解冻

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。

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、如相关法律法规允许管理人办理其他集合计划业务,管理人将制定和实施相应的业务规则。

第九部分 集合计划的投资

一、投资目标

在控制风险的前提下,通过优选基金积极把握基金市场的投资机会,力求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,包括经中国证监会核准或注册的公开募集证券投资基金(包括 QDII 基金和香港互认基金)、国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板以及其他中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、证券公司短期公司债券、可转换债券(含可分离交易可转债)、可交换债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债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、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单、货币市场工具以及中国证监会允许集合计划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资产管理计划投资其他品种,管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

集合计划的投资组合比例为:投资于中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金的资产比例不低于集合计划资产的 80%,其中,股票、股票型基金、混合型基金(权益类资产比例不低于 60%)合计占集合计划资产的比例为 60%-95%,投资于货币市场基金的资产占集合计划资产的比例不高于 15%;本集合计划应当保持不低于集合计划资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券;其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如法律法规或中国证监会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

1、资产配置策略

本集合计划采取积极的资产配置策略,通过宏观策略研究,对相关资产类别的预期收益进行动态跟踪,精选基金品种,构建有超额收益能力的基金组合。同

时通过有效地风险管理，降低业绩的波动性，获得稳定而持续的投资收益。

2、基金投资策略

(1) 开放式基金投资策略

本集合计划以权益类基金为重点投资方向，在开放式基金的投资选择上，更倾向于挑选中长期主动管理能力得到验证的优质基金产品进行配置。在具体选择维度上分为基金公司、基金经理、基金产品三个方向，进行定量和定性的合理分析，筛选出超额收益稳定的基金产品进入组合配置。

1) 在基金公司维度，主要考虑的因素有：基金公司的股东背景、公司治理、核心管理团队的综合素质和稳定性、基金经理与投研团队的综合素质和稳定性、公司管理的资产规模和盈利能力、管理层的管理风格、投资决策程序的科学性和执行度、公司风险控制制度健全性和执行力度、公司基金的类型和收益情况、公司基金交叉持股情况、基金公司产品创新能力及客户服务水平等。评价方式主要来自于实地调研、公司刊物和公开信息。

2) 基金经理维度，对基金经理的从业经验、业绩表现、风险控制、业绩归因、风格特征等多个层面全方位地进行分析，定量和定性相结合，并通过持续跟踪保持更新。该体系从多种维度对基金经理的风格特征加以剖析，包括但不限于：组合构建思路、选股偏好、擅长投资领域、投资集中度、换手率情况等。

3) 基金产品维度，重点考量首先根据基金的历史业绩情况，挑选出业绩持续优秀的基金，根据基金的风险收益特征，构建合适的基金投资组合。通过风险收益综合评价方法挖掘持续稳定的基金品种，主要包括选股能力、择时能力、风险控制能力等指标。

(2) 场内 ETF 等基金投资策略

场内 ETF 等基金评价中更多考虑业绩持续性和市场因素的影响。通过对基金规模、流动性、跟踪误差、交易成本，以及 ETF 所跟踪指数的综合评价挑选适合的 ETF 投资标的，再根据市场波动因素的变化在适当时机完成基金的买入或卖出操作。

3、股票的投资策略

通过分析宏观经济、产业政策和行业景气程度，以证监会行业分类标准为基础，挑选出增长前景持续向好的行业或周期景气复苏或上升的行业。通过定性和

定量分析精选个股。定量分析使用的指标包括成长指标、价值指标和盈利指标，针对不同行业采取相应的估值方法；定性分析对精选公司进行“波特五力模型”分析，结合行业估值模型进行数量化的辅助投资决策。

4、债券的投资策略

本集合计划将采取久期偏离、收益率曲线配置和类属配置、无风险套利、杠杆策略和个券选择策略等投资策略，发现、确认并利用市场失衡实现组合增值。在综合考虑流动性、市场分割、息票率、税赋特点、提前偿还和赎回等因素的基础上，评估债券投资价值，选择定价合理或者价值被低估的债券构建投资组合，并根据市场变化情况对组合进行优化。

5、资产支持证券等品种投资策略

资产支持证券包括资产抵押贷款支持证券（ABS）、住房抵押贷款支持证券（MBS）等，其定价受多种因素影响，包括市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率等。本集合计划将深入分析上述基本面因素，并辅助数量化定价模型，评估其内在价值。

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）本集合计划投资于中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金的资产比例不低于集合计划资产的 80%，其中，股票、股票型基金、混合型基金（权益类资产比例不低于 60%）合计占集合计划资产的比例为 60%-95%，投资于货币市场基金的资产占集合计划资产的比例不高于 15%；

（2）本集合计划持有单只基金，其市值不高于本集合计划资产净值的 20%，且不持有其他基金中基金；

（3）本集合计划应当保持不低于集合计划资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券；其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

（4）本集合计划管理人管理的全部基金中基金持有单只证券投资基金的比例不超过该被投资证券投资基金净资产的 20%，被投资证券投资基金净资产规模以最近定期报告披露的规模为准；

(5) 本集合计划不得持有具有复杂、衍生品性质的基金份额，包括分级基金和中国证监会认定的其他基金份额；

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

(7) 本集合计划管理人管理的全部集合资产管理计划持有一家公司发行的证券（不含证券投资基金），不超过该证券的 10%；

(8) 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%；

(9) 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%；

(10) 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%；

(11) 本集合计划管理人管理的全部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%；

(12) 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。集合计划持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；

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

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

(15) 本集合计划投资的基金的运作期限应当不少于 1 年，最近定期报告披露的基金净资产应当不低于 1 亿元；

(16) 本集合计划投资于封闭运作基金、定期开放基金等流通受限基金的比例不超过本集合计划资产净值的 10%；

(17) 本集合计划的集合计划资产总值不得超过集合计划资产净值的 140%；

(18) 本集合计划主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过集合计划

资产净值的 15%。因证券市场波动、上市公司股票停牌、集合计划规模变动等管理人之外的因素致使集合计划不符合本条规定比例限制的,管理人不得主动新增流动性受限资产的投资;

(19) 本集合计划管理人管理的全部开放式集合资产管理计划(包括开放式集合资产管理计划以及处于开放期的定期开放集合资产管理计划)持有一家上市公司发行的可流通股票,不得超过该上市公司可流通股票的 15%;本集合计划管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票,不得超过该上市公司可流通股票的 30%;

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

(21) 法律法规及中国证监会规定的其他投资限制。

因证券市场波动、集合计划规模变动等管理人之外的因素致使集合计划投资不符合上述第(2)、(4)项的,管理人应当在 20 个交易日内进行调整;对于除第(2)、(3)、(4)、(12)、(18)、(20)项外的其他比例限制,因证券市场波动、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。法律法规另有规定,从其规定。

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

法律法规或监管部门取消上述限制,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。

2、本集合计划投资于股票、债券等金融工具的,投资品种和比例应当符合本集合计划的投资目标和投资策略。

3、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) 买卖其他集合资产管理计划份额或基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；
 - (5) 向其管理人、托管人出资；
 - (6) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
 - (7) 持有具有复杂、衍生品性质的基金份额，包括分级基金和中国证监会认定的其他基金份额，但中国证监会认可或批准的特殊基金中基金除外；
 - (8) 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，并经过三分之二以上的独立董事通过。管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

法律、行政法规或监管部门取消上述禁止行为规定或从事关联交易的条件和要求，本集合计划可不受相关限制。法律法规或监管部门对上述禁止行为规定或从事关联交易的条件和要求进行变更的，本集合计划可以变更后的规定为准。经与托管人协商一致，管理人可依据法律法规或监管部门规定直接对集合计划合同进行变更，该变更无须召开集合计划份额持有人大会审议。

五、业绩比较基准

本集合计划采用业绩比较基准： $\text{中证偏股型基金指数收益率} \times 80\% + \text{中债综合（全价）指数收益率} \times 20\%$ 。

本集合计划不低于 80% 的资产投资于公开募集证券投资基金，中证偏股型基金指数选取内地市场所有股票型基金以及混合型基金中以股票为主要投资对象的基金作为样本，采用净值规模加权，以较好的反映所有偏股型开放式证券投资基金的整体走势。

中债综合（全价）指数由中央国债登记结算有限公司编制，旨在综合反映债券全市场整体价格和投资回报情况，是具有代表性的债券市场指数。

选用以上业绩比较基准可以有效评估本集合计划投资组合业绩，反映本集合计划的风格特点。

如果指数编制单位停止计算编制该指数或更改指数名称，或今后法律法规发生变化，或有更适当的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，本管理人可依据维护集合计划份额持有人合法权益的原则，经履行适当程序，调整业绩比较基准并及时公告。

六、风险收益特征

本集合计划为混合型基金中基金集合资产管理计划，其预期收益和预期风险水平高于货币市场基金、货币型基金中基金、债券型基金、债券型集合资产管理计划，低于股票型基金、股票型集合资产管理计划。

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、授权代理人或任何存在利害关系的第三人牟取任何不当利益。

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、证券投资基金及票据价值、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、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《集合计划合同》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

集合计划所拥有的证券投资基金份额、股票、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集合计划资产净值的影响在 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、对于未在交易所上市的证券投资基金的估值

(1) 本集合计划投资的境内非货币市场基金，按所投资基金估值日的份额净值估值。

(2) 本集合计划投资的境内货币市场基金，按所投资基金前一估值日后至估值日期间（含节假日）的万份收益计提估值日基金收益；如所投资基金披露份额净值，则按所投资基金的基金管理人披露的估值日份额净值进行估值。

2、对于在交易所上市的证券投资基金的估值

(1) 本集合计划投资的交易型开放式指数基金（ETF），按所投资基金估值日的收盘价估值。

(2) 本集合计划投资的境内上市开放式基金（LOF），按所投资基金估值日的份额净值估值。

(3) 本集合计划投资的境内上市定期开放式基金、封闭式基金，按所投资基金估值日的收盘价估值。

(4) 本集合计划投资的境内上市交易型货币市场基金，如所投资基金披露份额净值，则按所投资基金估值日的份额净值估值；如所投资基金披露万份（百份）收益，则按所投资基金前一估值日后至估值日期间（含节假日）的万份（百份）收益计提估值日基金收益。

3、对于证券投资基金特殊情况的估值处理

如遇所投资的证券投资基金不公布基金份额净值、进行折算或拆分、估值日无交易等特殊情况，管理人根据以下原则进行估值：

(1) 以所投资基金的份额净值估值的，若所投资基金与本集合计划估值频率一致但未公布估值日基金份额净值，按其最近公布的份额净值为基础估值。

(2) 以所投资基金的收盘价估值的，若估值日无交易，且最近交易日后市场环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后市场环境发生了重大变化的，可使用最新的份额净值为基础或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，确定公允价值。

(3) 若所投资基金前一估值日至估值日期间发生分红除权、折算或拆分，管理人将根据份额净值或收盘价、单位基金份额分红金额、折算拆分比例、持仓

份额等因素合理确定公允价值。

4、证券交易所上市的有价证券（不含证券投资基金）的估值

（1）交易所上市的有价证券，以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

（2）交易所上市交易或挂牌转让的不含权固定收益品种，选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值；

（3）交易所上市交易或挂牌转让的含权固定收益品种，选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价进行估值；

（4）交易所上市交易的可转换债券以每日收盘价作为估值全价；

（5）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。交易所市场挂牌转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值；

（6）对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券，对存在活跃市场的情况下，应以活跃市场上未经调整的报价作为估值日的公允价值；对于活跃市场报价未能代表估值日公允价值的情况下，应对市场报价进行调整以确认估值日的公允价值；对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下，应采用估值技术确定其公允价值。

5、处于未上市期间的有价证券（不含证券投资基金）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）在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

6、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。

7、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。

8、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。

9、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。

10、当发生大额申购或赎回情形时，管理人可以采用摆动定价机制，以确保集合计划估值的公平性。

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集合计划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。

根据有关法律法规，集合计划资产净值计算和集合计划会计核算的义务由管理人承担。本集合计划的集合计划会计责任方由管理人担任，因此，就与本集合计划有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照管理人对集合计划净值的计算结果对外予以公布。由此给集合计划份额持有人和集合计划造成损失以及因该交易日集合计划资产净值计算顺延错误而引起损失的，托管人不承担赔偿责任。

五、估值程序

1、各类集合计划份额净值是按照每个估值日闭市后，该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。国家另有规定的，从其规定。

管理人每个估值日计算集合计划资产净值及各类集合计划份额净值，并按法律法规规定和集合计划合同约定进行公告。

2、管理人应每个估值日对集合计划资产估值。但管理人根据法律法规或集合计划合同的规定暂停估值时除外。管理人每个估值日对集合计划资产估值后，将集合计划资产净值和各类集合计划份额净值结果发送托管人，经托管人复核无误后，由管理人按法律法规规定和集合计划合同约定对外公布。

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。

集合计划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。

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、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) 错误偏差达到或超过集合计划份额净值的 0.25% 时, 管理人应当通报托管人并报中国证监会备案; 错误偏差达到或超过集合计划份额净值的 0.5% 时, 管理人应当公告, 并报中国证监会备案。

(3) 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。

七、暂停估值的情形

1、集合计划投资所涉及的证券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，管理人应当暂停估值；

4、占相当比例的被投资基金暂停估值时；

5、中国证监会和集合计划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各类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。管理人应于每个估值日计算集合计划资产净值和各类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，由管理人按法律法规规定及集合计划合同约定对集合计划净值予以公布。

九、特殊情况的处理

1、管理人或托管人按集合计划合同约定的估值方法第 9 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，或由于证券交易所、登记结算公司等机构发送的数据错误等原因，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，但未能发现错误的，由此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、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。

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所投资证券投资基金的分红收入、股息、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。

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，本集合计划可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若《集合计划合同》生效不满3个月可不进行收益分配；

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的集合计划份额进行再投资；若投资者不选择，本集合计划默认的收益分配方式是现金分红；通过红利再投资所得集合计划份额的最短持有期起始日与该份额最短持有期起始日相同；

3、集合计划收益分配后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、同一类别每一集合计划份额享有同等分配权；

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

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、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日内在指定媒介公告。

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,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。

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、管理人的管理费；
- 2、托管人的托管费；
- 3、C类份额的销售服务费；
- 4、《集合计划合同》生效后与集合计划相关的信息披露费用；
- 5、《集合计划合同》生效后与集合计划相关的会计师费、律师费、诉讼费和仲裁费等；
- 6、集合计划份额持有人大会费用；
- 7、集合计划的证券交易费用；
- 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、集合计划投资证券投资基金份额产生的费用（包括但不限于申购费、赎回费等），但法律法规禁止从集合计划财产中列支的除外；
- 11、按照国家有关规定和《集合计划合同》约定，可以在集合计划财产中列支的其他费用。

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

本集合计划的管理费按前一日集合计划资产净值的0.80%年费率计提，但本集合计划投资于管理人所管理的其他集合资产管理计划的部分不收取管理费。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.80\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的集合计划管理费

E为前一日的集合计划资产净值中扣除本集合计划持有的管理人自身管理的其他集合资产管理计划部分（若为负数，则取0）

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

2、托管人的托管费

本集合计划的托管费按前一日集合计划资产净值的 0.22% 的年费率计提，但本集合计划投资于托管人所托管的其他集合资产管理计划和公开募集证券投资基金的部分不收取托管费。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.22\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的集合计划托管费

E 为前一日的集合计划资产净值中扣除本集合计划持有的托管人自身托管的其他集合资产管理计划和公开募集证券投资基金部分（若为负数，则取 0）

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

3、C 类份额的销售服务费

本集合计划 A 类份额不收取销售服务费，C 类份额的销售服务费年费率为 0.40%，销售服务费按前一日 C 类份额的集合计划资产净值的 0.40% 年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类份额前一日的集合计划资产净值

销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由管理人向托管人发送销售服务费划款指令，托管人复核后于次月前 5 个工作日内从集合计划财产中一次性划出，经管理人分别支付给各个销售机构。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

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、《集合计划合同》生效前的相关费用；

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。

管理人运用集合计划财产申购自身管理的其他集合资产管理计划的（ETF除外），应当通过直销渠道申购且不得收取申购费、赎回费（按照相关法规、招募说明书约定应当收取并计入集合计划财产的赎回费用除外）、销售服务费等销售费用。

四、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。

第十四部分 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。

第十五部分 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》、《集合计划合同》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、行政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《集合计划合同》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）招募说明书、《集合计划合同》、托管协议、集合计划产品资料概要

1、《集合计划合同》是界定《集合计划合同》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、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。《集合计划合同》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。《集合计划合同》终止的，管理人不再更新招募说明书。

3、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、集合计划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。《集合计划合同》生效后，集合计划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集合计划产品资料概要，并登载在规定网站及销售机构网站或营业网点；集合计划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，管理人不再更新集合计划产品资料概要。

管理人应将招募说明书提示性公告和《集合计划合同》提示性公告登载在规定报刊上，将招募说明书、集合计划产品资料概要、《集合计划合同》和托管协议登载在规定网站上，并将集合计划产品资料概要登载在销售机构网站或营业网点；托管人应当同时将《集合计划合同》、托管协议登载在规定网站上。

（二）《集合计划合同》生效公告

管理人应当在规定媒介上登载《集合计划合同》生效公告。

（三）集合计划净值信息

《集合计划合同》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后的第3个工作日,通过规定网站、集合计划份额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后的第3个工作日,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《集合计划合同》、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销售机构网站或营业网点查阅或者复制前述信息资料。

(五) 定期报告,包括年度报告、中期报告和季度报告

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。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。

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。

(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、《集合计划合同》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、管理人的分管资产管理业务的高级管理人员、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、涉及集合资产管理计划管理业务、集合计划财产、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、集合计划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、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、集合计划份额净值估值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的和集合计划合同约定的其他事项。

（七）澄清公告

在《集合计划合同》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的，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）投资证券投资基金的信息披露

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）等文件中披露所持有基金以下相关情况：

1、投资政策、持仓情况、损益情况、净值披露时间等；

2、交易及持有基金产生的费用，包括申购费、赎回费、销售服务费、管理费、托管费等；

3、持有的基金发生的重大影响事件，如转换运作方式、与其他基金合并、终止基金合同以及召开基金份额持有人大会等；

4、集合计划投资于管理人以及管理人关联方所管理基金或集合资产管理计划的情况；

管理人应在定期报告中披露本集合计划参与基金的基金份额持有人大会的表决意见。

（十）投资资产支持证券信息披露

管理人应在年度报告及中期报告中披露集合计划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。

管理人应在季度报告中披露集合计划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。

(十一) 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《集合计划合同》的约定，对管理人编制的集合计划资产净值、各类集合计划份额净值、集合计划份额申购赎回价格、定期报告、更新的招募说明书、集合计划清算报告等公开披露的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、托管人应当在规定媒介中选择一家披露本集合计划信息。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《集合计划合同》终止后不低于法律法规规定的最低期限。

管理人、托管人除按法律法规要求披露信息外，也可着眼于为投资者决策提供有用信息的角度，在保证公平对待投资者、不误导投资者、不影响集合计划正常投资操作的前提下，自主提升信息披露服务的质量。具体要求应当符合中国证监会及自律规则的相关规定。前述自主披露如产生信息披露费用，该费用不得从

集合计划财产中列支。

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。

第十六部分 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）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，影响着企业的融资成本和利润。集合计划投资于债券和股票，其收益水平可能会受到利率变化的影响。

（4）再投资风险。债券、票据偿付本息后以及回购到期后可能由于市场利率的下降面临资金再投资的收益率低于原来利率，由此本集合计划面临再投资风险。

（5）信用风险。债券发行人不能按期还本付息或回购交易中交易对手在回购到期履行交割责任时，不能偿还全部或部分证券或价款，都可能使本集合计划面临信用风险。

（6）上市公司经营风险。上市公司的经营状况受多种因素的影响，如管理能力、行业竞争、市场前景、技术更新、新产品研究开发等都会导致公司盈利发生变化。如果集合计划所投资的上市公司经营不善，其债券价格可能下跌，或者能够用于分配的利润减少，使集合计划投资收益下降。虽然集合计划可以通过投资多样化来分散这种非系统风险，但不能完全避免。

（7）购买力风险。集合计划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。

(8) 债券回购风险。债券回购为提升整体集合计划组合收益提供了可能,但也存在一定的风险。债券回购的主要风险包括信用风险、投资风险及波动性加大的风险,其中,信用风险指回购交易中交易对手在回购到期时,不能偿还全部或部分证券或价款,造成集合计划净值损失的风险;投资风险是指在进行回购操作时,回购利率大于债券投资收益而导致的风险以及由于回购操作导致投资总量放大,致使整个组合风险放大的风险;而波动性加大的风险是指在进行回购操作时,在对集合计划组合收益进行放大的同时,也对集合计划组合的波动性(标准差)进行了放大,即集合计划组合的风险将会加大。回购比例越高,风险暴露程度也就越高,对集合计划净值造成损失的可能性也就越大。

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,可能会由于特定投资标的流动性相对不足而无法按预期的价格将股票或债券买进或卖出;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股票或债券。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

本集合计划对每份集合计划份额设置 3 个月的最短持有期。在最短持有期到期日(不含该日)前,集合计划份额持有人不能提出赎回申请。在最短持有期到期日(含该日)后,集合计划份额持有人可提出赎回申请。

为切实保护存量份额持有人的合法权益,遵循份额持有人利益优先的原则,管理人将合理控制集合计划份额持有人集中度,审慎确认申购、赎回业务申请,包括但不限于:

1) 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。

2) 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。

3) 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。

本集合计划申购、赎回安排详见集合计划合同“第六部分 集合计划份额的申购与赎回”章节及本招募说明书“第八部分 集合计划份额的申购与赎回”章节。

(2) 拟投资资产的流动性风险评估

本集合计划主要投资对象为具有良好流动性的金融工具,包括经中国证监会核准或注册的公开募集证券投资基金(包括 QDII 基金和香港互认基金)、国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板以及其他中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、证券公司短期公司债券、可转换债券(含可分离交易可转债)、可交换债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债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、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单、货币市场工具以及中国证监会允许集合计划投资的其他金融工具,但须符合中国证监会相关规定;同时,本集合计划基于分散投资的原则在行业和个券方面未有高集中度的特征,综合评估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

根据《流动性风险规定》的相关要求,管理人对本集合计划实施流动性风险管理,并针对性制定流动性风险管理措施,尽量避免或减小因发生流动性风险而导致的投资者损失,最大程度的降低巨额赎回情形下的可能出现的流动性风险。

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) 在出现巨额赎回时，对于单个集合计划份额持有人当日超过上一开放日集合计划总份额 20%以上的赎回申请，管理人可以对超过的部分全部进行延期办理，具体措施如下：延期的赎回申请将自动与下一个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。如该单个集合计划份额持有人在提交赎回申请时未作明确选择，未能赎回部分作自动延期赎回处理。对于此类持有人未超过上述比例的部分，管理人有权根据前述“1) 全额赎回”或“2) 部分延期赎回”的方式与其他持有人的赎回申请一并办理。但是，如此类持有人在提交赎回申请时选择取消赎回，则其当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。

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。

本集合计划巨额赎回安排详见集合计划合同“第六部分 集合计划份额的申购与赎回”章节及本招募说明书“第八部分 集合计划份额的申购与赎回”章节。

(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集合计划合同的规定，谨慎选取暂停接受赎回申请、延缓支付赎回款项、延期办理巨额赎回申请、收取短期赎回费、暂停集合计划估值、摆动定价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，管理人将密切关注市场资金动向，提前调整投资和头寸安排，尽可能的避免出现不得不实施上述流动性风险管理工具的流动性风险，将对投资者可能出现的潜在影响降至最低。

4、本集合计划特有风险

本集合计划为混合型基金中基金集合资产管理计划，其预期收益和预期风险水平高于货币市场基金、货币型基金中基金、债券型基金、债券型集合资产管理计划，低于股票型基金、股票型集合资产管理计划。

(1) FOF 投资风险

本集合计划投资于中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金的资产比例不低于集合计划资产的 80%，其中，股票、股票型基金、混合型基金（权益类资产比例不低于 60%）合计占集合计划资产的比例为 60%-95%，投资于货币市场基金的资产占集合计划资产的比例不高于 15%；管理人将发挥专业研究优势，加强对市场、上市公司基本面和固定收益类产品的深入研究，持续优化组合配置，以控制特定风险。

本集合计划是主动管理型产品，在挑选基金等投资品种的过程中，管理人的专业技能、研究能力及投资管理水平直接影响到其对信息的占有、分析和对经济形势、证券价格走势的判断，进而影响集合计划的投资收益水平。

管理人在构建 FOF 投资组合的时候，对基金的选择在很大的程度上依靠了基金的历史业绩表现。但是基金的过往业绩往往不能代表基金未来的表现，所以可能引起一定的风险。

(2) 最短持有期限内不能赎回集合计划份额的风险

本集合计划对每份集合计划份额设置 3 个月的最短持有期。在最短持有期到

期日（不含该日）前，集合计划份额持有人不能提出赎回申请。在最短持有期到期日（含该日）后，集合计划份额持有人可提出赎回申请。投资者存在流动性风险。因此，集合计划份额持有人面临在最短持有期限届满前不能赎回的风险。

（3）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）流通受限证券的风险

本集合计划可投流通受限证券，因此本集合计划可能由于持有流通受限证券而面临流动性风险以及流通受限期间内证券价格大幅下跌的风险。

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集合计划管理公司、登记机构、销售机构、证券/期货交易所、证券/期货登记结算机构等等。

6、合规性风险

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计划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；

（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) 对主要业务人员如集合计划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、集合计划其他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。

二、声明

1、本集合计划未经任何一级政府、机构及部门担保。集合计划投资者自愿投资于本集合计划, 须自行承担投资风险。

2、除管理人直接办理本集合计划的销售外, 本集合计划还通过管理人委托的其他集合计划销售机构销售, 但是, 集合计划资产并不是销售机构的存款或负债, 也没有经集合计划销售机构担保收益, 销售机构并不能保证其收益或本金安全。

第十七部分 集合计划合同的变更、终止与集合计划财产的清算

一、《集合计划合同》的变更

1、变更集合计划合同涉及法律法规规定或集合计划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集合计划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《集合计划合同》变更的集合计划份额持有人大会决议自生效后方可执行，并自决议生效后两日内在规定媒介公告。

二、《集合计划合同》的终止事由

有下列情形之一的，经履行相关程序后，《集合计划合同》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、《集合计划合同》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《集合计划合同》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、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、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)《集合计划合同》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；

(2) 对集合计划财产和债权债务进行清理和确认；

(3) 对集合计划财产进行估值和变现;

(4) 制作清算报告;

(5) 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;

(6) 将清算报告报中国证监会备案并公告;

(7) 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, 清算期限可相应顺延。

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不低于法律法规规定的最低期限。

第十八部分 集合计划合同的内容摘要

一、集合计划份额持有人、管理人及托管人的权利义务

(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《集合计划合同》生效之日起，根据法律法规和《集合计划合同》独立运用并管理集合计划财产；

(3) 依照《集合计划合同》收取集合计划管理费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《集合计划合同》及有关法律、法规规定监督托管人，如认为托管人违反了《集合计划合同》及国家有关法律、法规规定，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登记机构办理集合计划登记业务并获得《集合计划合同》规定的费用；

(10) 依据《集合计划合同》及有关法律、法规规定决定集合计划收益的分配方案；

(11) 在《集合计划合同》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；代表本集合计划份额持有人的利益，参与所持有基金的份额持有人大会，并在遵循本集合计划份额持有人利益优先原则的前提下行使相关投票权利；

(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《集合计划合同》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) 办理集合计划备案手续；

(3) 自《集合计划合同》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》、《集合计划合同》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《集合计划合同》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》、《集合计划合同》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》、《集合计划合同》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《集合计划合同》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》、《集合计划合同》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不低于法律法规规定的最低期限；

(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《集合计划合同》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条件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《集合计划合同》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《集合计划合同》规定履行自己的义务，托管人违反《集合计划合同》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《集合计划合同》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《集合计划合同》生效之日起, 依法律法规和《集合计划合同》的规定安全保管集合计划财产;

(2) 依《集合计划合同》约定获得集合计划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《集合计划合同》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集合计划投资者的利益;

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

(5) 提议召开或召集集合计划份额持有人大会;

(6) 在管理人更换时, 提名新的管理人;

(7) 法律法规及中国证监会规定的和《集合计划合同》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》、《集合计划合同》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和证券账户等投资所需账户, 按照《集合计划合同》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》、《集合计划合同》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, 但向审计、法律等外部专业顾问提供的情况除外;

(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《集合计划合同》的规定进行; 如果管理人有未执行《集合计划合同》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不低于法律法规规定的最低期限;

(12) 从管理人或其委托的登记机构处接收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》、《集合计划合同》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《集合计划合同》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《集合计划合同》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《集合计划合同》规定履行自己的义务，管理人因违反《集合计划合同》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议；

(22) 法律法规及中国证监会规定的和《集合计划合同》约定的其他义务。

(三) 集合计划份额持有人

集合计划投资者持有本集合计划份额的行为即视为对《集合计划合同》的承认和接受，集合计划投资者自依据《集合计划合同》取得集合计划份额，即成为本集合计划份额持有人和《集合计划合同》的当事人，直至其不再持有本集合计划的集合计划份额。集合计划份额持有人作为《集合计划合同》当事人并不以在《集合计划合同》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《集合计划合同》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《集合计划合同》、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《集合计划合同》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《集合计划合同》终止的有限责任；
- (6) 不从事任何有损集合计划及其他《集合计划合同》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议；
- (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《集合计划合同》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不设日常机构。在本集合计划存续期内，根据本集合计划的运作需要，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《集合计划合同》另有约定的除外：

- (1) 终止《集合计划合同》；
- (2) 更换管理人；
- (3) 更换托管人；
- (4) 转换集合计划运作方式；
- (5) 提高管理人、托管人的报酬标准；
- (6) 变更集合计划类别；

- (7) 本集合计划与其他集合资产管理计划的合并;
- (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%)集合计划份额的集合计划份额持有人(以管理人或托管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) 对本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、《集合计划合同》或中国证监会规定的其它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《集合计划合同》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) 法律法规要求增加或调整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、管理人/托管人的报酬标准或变更收费方式;
- (3) 因相应的法律法规发生变动而应当对《集合计划合同》进行修改;
- (4) 对《集合计划合同》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《集合计划合同》当事人权利义务关系发生变化;
- (5) 按照法律法规和《集合计划合同》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《集合计划合同》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%）的集合计划份额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%）的集合计划份额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%）的集合计划份额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%）的集合计划份额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集合计划份额持有人持有集合计划份额的凭证及集合计划份额持有人的代理投票授权委托证明符合法律法规、《集合计划合同》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集合计划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集合计划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《集合计划合同》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）召集人按集合计划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）集合计划份额的集合计划份额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集合计划份额持有人持有集合计划份额的凭证及集合计划份额持有人的代理投票授权委托书证明符合法律法规、《集合计划合同》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《集合计划合同》的重大修改、决定终止《集合计划合同》、更换管理人、更换托管人、与其他集合资产管理计划合并、法律法规及《集合计划合同》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、集合计划份额持有人姓名（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《集合计划合同》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《集合计划合同》、本集合计划与其他集合资产管理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）管理人代表本集合计划出席本集合计划投资的基金的基金份额持有人大会并参与表决的特别约定

本集合计划持有的基金召开基金份额持有人大会时，管理人应当代表其集合计划份额持有人的利益，参与所持有基金的基金份额持有人大会，并在遵循本集合计划份额持有人利益优先原则的前提下行使相关投票权利。管理人需将表决意见事先征求托管人的意见，并将表决意见在定期报告中予以披露。

法律法规对于本集合计划参与本集合计划持有的基金召开基金份额持有人大会的程序或要求另有规定的，从其规定。

（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的部分，如将来法律法规修改导致相关

内容被取消或变更的，管理人与托管人协商一致并提前公告后，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、集合计划合同的终止事由、程序与集合计划资产的清算

（一）《集合计划合同》的变更

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

（二）《集合计划合同》的终止事由

有下列情形之一的，经履行相关程序后，《集合计划合同》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、《集合计划合同》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《集合计划合同》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、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、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）《集合计划合同》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；

(2) 对集合计划财产和债权债务进行清理和确认；

(3) 对集合计划财产进行估值和变现；

(4) 制作清算报告；

(5) 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；

(6) 将清算报告报中国证监会备案并公告；

(7) 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，清算期限可相应顺延。

(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不低于法律法规规定的最低期限。

四、争议解决方式

各方当事人同意，因《集合计划合同》而产生的或与《集合计划合同》有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，任何一方可将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会上海分会并按其仲裁规则进行仲裁。

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

《集合计划合同》受中国法律（为集合计划合同之目的，不包括香港特别行政区、澳门特别行政区和台湾地区法律）管辖。

五、集合计划合同的存放地及投资者取得方式

《集合计划合同》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。

第十九部分 集合计划托管协议的内容摘要

一、托管协议当事人

(一) 管理人

名称：上海国泰君安证券资产管理有限公司

住所：上海市黄浦区南苏州路381号409A10室

法定代表人：江伟

成立时间：2010年8月27日

批准设立机关：中国证监会

批准设立文号：证监许可【2010】631号

注册资本：人民币20亿元

组织形式：有限责任公司

存续期间：永久存续

(二) 托管人

名称：交通银行股份有限公司（简称：交通银行）

住所：中国（上海）自由贸易试验区银城中路188号（邮政编码：200120）

办公地址：上海市长宁区仙霞路18号（邮政编码：200336）

法定代表人：任德奇

成立时间：1987年3月30日

批准设立机关及批准设立文号：国务院国发(1986)字第81号文和中国人民银行银发〔1987〕40号文

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字〔1998〕25号

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项业务；提供保管箱服务；经国务院银行业监督管理机构批准的其他业务；经营结汇、售汇业务。

注册资本：742.63亿元人民币

组织形式：股份有限公司

存续期间：持续经营

二、托管人与管理人之间的业务监督、核查

托管人对管理人的业务监督和核查

1. 托管人根据有关法律法规的规定及《集合计划合同》和本协议的约定，对集合计划的投资范围、投资对象进行监督。

本集合计划的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括经中国证监会核准或注册的公开募集证券投资基金（包括QDII基金和香港互认基金）、国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板以及其他中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、证券公司短期公司债券、可转换债券（含可分离交易可转债）、可交换债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债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、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具以及中国证监会允许集合计划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资产管理计划投资其他品种，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《集合计划合同》和本协议的约定，对集合计划投资、融资比例进行监督。

根据《集合计划合同》的约定，本集合计划投资组合比例应符合以下规定：

（1）本集合计划投资于中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金的资产比例不低于集合计划资产的80%，其中，股票、股票型基金、混合型基金（权益类资产比例不低于60%）合计占集合计划资产的比例为60%-95%，投资于货币市场基金的资产占集合计划资产的比例不高于15%；

（2）本集合计划持有单只基金，其市值不高于本集合计划资产净值的20%，且不持有其他基金中基金；

(3) 本集合计划应当保持不低于集合计划资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券；其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

(4) 本集合计划管理人管理的全部基金中基金持有单只证券投资基金的比例不超过该被投资证券投资基金净资产的20%，被投资证券投资基金净资产规模以最近定期报告披露的规模为准；

(5) 本集合计划不得持有具有复杂、衍生品性质的基金份额，包括分级基金和中国证监会认定的其他基金份额；

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

(7) 本集合计划管理人管理的全部集合资产管理计划持有一家公司发行的证券（不含证券投资基金），不超过该证券的10%；

(8) 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%；

(9) 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%；

(10) 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%；

(11) 本集合计划管理人管理的全部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%；

(12) 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。集合计划持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起3个月内予以全部卖出；

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

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

(15) 本集合计划投资的基金的运作期限应当不少于1年，最近定期报告披

露的基金净资产应当不低于1亿元；

(16) 本集合计划投资于封闭运作基金、定期开放基金等流通受限基金的比例不超过本集合计划资产净值的10%；

(17) 本集合计划的集合计划资产总值不得超过集合计划资产净值的140%；

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

(19) 本集合计划管理人管理的全部开放式集合资产管理计划(包括开放式集合资产管理计划以及处于开放期的定期开放集合资产管理计划)持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的15%；本集合计划管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的30%；

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

(21) 法律法规及中国证监会规定的其他投资限制。

因证券市场波动、集合计划规模变动等管理人之外的因素致使集合计划投资不符合上述第(2)、(4)项的，管理人应当在20个交易日内进行调整；对于除第(2)、(3)、(4)、(12)、(18)、(20)项外的其他比例限制，因证券市场波动、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。法律法规另有规定，从其规定。

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

法律法规或监管部门取消上述限制，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。

3. 托管人根据有关法律法规的规定及集合计划合同和本协议的约定，对集合计划投资禁止行为进行监督。集合计划财产不得用于下列投资或者活动。

- (1) 承销证券；
- (2) 违反规定向他人贷款或者提供担保；
- (3) 从事承担无限责任的投资；
- (4) 买卖其他集合资产管理计划份额或基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；
- (5) 向其管理人、托管人出资；
- (6) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- (7) 持有具有复杂、衍生品性质的基金份额，包括分级基金和中国证监会认定的其他基金份额，但中国证监会认可或批准的特殊基金中基金除外；
- (8) 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，并经过三分之二以上的独立董事通过。管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

在集合计划合同生效后2个工作日内，管理人和托管人应相互提供与本机构有控股关系的股东或者与本机构有其他重大利害关系的公司名单，以上名单发生变化的，应及时予以更新并通知对方。

如法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制。

4. 托管人根据有关法律法规的规定及集合计划合同和本协议的约定，对管理人参与银行间债券市场进行监督。

(1) 托管人依据有关法律法规的规定和《集合计划合同》的约定对于管理人参与银行间市场交易时面临的交易对手资信风险进行监督。

管理人向托管人提供符合法律法规及行业标准的银行间市场交易对手的名

单。托管人在收到名单后2个工作日内电话或回函确认收到该名单。管理人应定期和不定期对银行间市场现券及回购交易对手的名单进行更新。托管人在收到名单后2个工作日内电话或书面回函确认，新名单自托管人确认当日生效。新名单生效前已与本次剔除的交易对手所进行但尚未结算的交易，仍应按照协议进行结算。

(2) 管理人参与银行间市场交易时，有责任控制交易对手的资信风险，由于交易对手资信风险引起的损失，管理人应当负责向相关责任人追偿。

5. 托管人根据有关法律法规的规定及集合计划合同和本协议的约定，对管理人银行存款业务进行监督。

本集合计划投资银行存款应符合如下规定：

(1) 管理人、托管人应当与存款银行建立定期对账机制，确保集合计划银行存款业务账目及核算的真实、准确。

(2) 管理人与托管人应根据相关规定，就本集合计划银行存款业务另行签订书面协议，明确双方在相关协议签署、账户开设与管理、投资指令传达与执行、资金划拨、账目核对、到期兑付、文件保管以及存款证实书的开立、传递、保管等流程中的权利、义务和职责，以确保集合计划财产的安全，保护集合计划份额持有人的合法权益。

(3) 托管人应加强对集合计划银行存款业务的监督与核查，严格审查、复核相关协议、账户资料、投资指令、存款证实书等有关文件，切实履行托管职责。

(4) 管理人与托管人在开展集合计划存款业务时，应严格遵守《基金法》、《运作办法》等有关法律法规，以及国家有关账户管理、利率管理、支付结算等的各项规定。

6. 托管人对集合计划投资流通受限证券的监督

(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) 流通受限证券，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)管理人应在集合计划首次投资流通受限证券前,向托管人提供经管理人董事会批准的有关集合计划投资流通受限证券的投资决策流程、风险控制制度。集合计划投资非公开发行股票,管理人还应提供管理人董事会批准的流动性风险处置预案。上述资料应包括但不限于集合计划投资流通受限证券的投资额度和投资比例控制情况。管理人应至少于首次执行投资指令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。托管人应在收到上述资料后两个工作日内,以书面或其他双方认可的方式确认收到上述资料。

(4)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,包括但不限于拟发行证券主体的中国证监会批准文件、发行证券数量、发行价格、锁定期,集合计划拟认购的数量、价格、总成本、总成本占集合计划资产净值的比例、已持有流通受限证券市值占资产净值的比例、资金划付时间等。管理人应保证上述信息的真实、完整,并应至少于拟执行投资指令前两个工作日将上述信息书面发至托管人,保证托管人有足够的时间进行审核。

(5)托管人应对管理人提供的有关书面信息进行审核,托管人认为上述资料可能导致集合计划投资出现风险的,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。如果托管人切实履行监督职责,则不承担任何责任。

7. 托管人根据法律法规的规定及《集合计划合同》和本协议的约定,对集合计划投资其他方面进行监督。

(二) 托管人应根据有关法律法规的规定及集合计划合同的约定,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认、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。如果管理人未经托管人的审核擅自将不实的业绩表现数据印制在宣传推介材料上,则托管人对此不承担任何责任,并有权在发现后报告中国证监会。

(三) 管理人应积极配合和协助托管人的监督和核查，在规定时间内答复并改正，就托管人的疑义进行解释或举证。对托管人按照法规要求需向中国证监会报送监督报告的，管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

托管人发现管理人的投资指令或实际投资运作违反《基金法》及其他有关法规、《集合计划合同》和本协议规定的行为，应及时以书面形式通知管理人限期纠正，管理人收到通知后应及时核对，并以电话或书面形式向托管人反馈，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在限期内，托管人有权随时对通知事项进行复查，督促管理人改正。管理人对托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，托管人有权报告中国证监会。

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，同时通知管理人在限期内纠正。

托管人发现管理人的指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反《集合计划合同》约定的，应当拒绝执行，立即通知管理人，并有权向中国证监会报告。

托管人发现管理人依据交易程序已经生效的指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反《集合计划合同》约定的，应当立即通知管理人，并有权向中国证监会报告。

管理人对托管人的业务核查

根据《基金法》及其他有关法规、《集合计划合同》和本协议规定，管理人对托管人履行托管职责的情况进行核查，核查事项包括但不限于托管人是否安全保管集合计划财产、开立集合计划财产的资金账户和证券账户及债券托管账户，是否及时、准确复核管理人计算的集合计划资产净值和各类集合计划份额净值，是否根据管理人指令办理清算交收，是否按照法规规定和《集合计划合同》规定进行相关信息披露和监督集合计划投资运作等行为。

管理人定期和不定期地对托管人保管的集合计划资产进行核查。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，在规定时间内答复并改正。

管理人发现托管人未对集合计划资产实行分账管理、擅自挪用集合计划资产、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》、《集合计划合同》、本协议及其他有关规定的，应及时以书面形式通知托管人在限期内纠正，托管人收到通知后应及时核对并以书面形式对管理人发出回函。在限期内，管理人有权随时对通知事项进行复查，督促托管人改正。托管人对管理人通知的违规事项未能在限期内纠正的，管理人应报告中国证监会。对管理人按照法规要求需向中国证监会报送监督报告的，托管人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

管理人发现托管人有重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时通知托管人在限期内纠正。

三、集合计划财产的保管

（一）集合计划财产保管的原则

1. 托管人应安全保管集合计划财产，未经管理人的指令，不得自行运用、处分、分配集合计划的任何资产。
2. 集合计划财产应独立于管理人、托管人的固有财产。
3. 托管人按照规定开立集合计划财产的资金账户、证券账户和债券托管账户等投资所需账户。
4. 托管人对所托管的不同集合计划财产分别设置账户，确保集合计划财产的完整和独立。
5. 对于因为集合计划投资产生的应收资产和集合计划申购过程中产生的应收资产，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，到账日集合计划资产没有到达集合计划银行存款账户的，托管人应及时通知管理人采取措施进行催收。由此给集合计划造成损失的，管理人应负责向有关当事人追偿集合计划的损失。托管人对此不承担任何责任。

（二）集合计划的银行存款账户的开立和管理

1. 托管人应负责本集合计划银行存款账户的开立和管理。
2. 托管人以本集合计划的名义在其营业机构开立集合计划的银行存款账户，并根据管理人合法合规的指令办理资金收付。本集合计划的银行预留印鉴由托管人保管和使用。
3. 本集合计划银行存款账户的开立和使用，限于满足开展本集合计划业务的

需要。托管人和管理人不得假借本集合计划的名义开立其他任何银行存款账户；亦不得使用集合计划的任何银行存款账户进行本集合计划业务以外的活动。

4. 托管人可以通过申请开通本集合计划银行账户的企业网上银行业务进行资金支付，并使用交通银行企业网上银行（简称“交通银行网银”）办理托管资产的资金结算汇划业务。

5. 集合计划银行存款账户的管理应符合银行业监督管理机构的有关规定。

（三）集合计划证券交收账户、资金交收账户的开立和管理

托管人以托管人和本集合计划联名的方式在中国证券登记结算有限责任公司开立证券账户。

集合计划证券账户的开立和使用，限于满足开展本集合计划业务的需要。托管人和管理人不得出借和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。

管理人不得对集合计划证券交收账户、资金交收账户进行证券的超卖或超买。

证券账户资产的管理和运用由管理人负责。

托管人以托管人的名义在中国证券登记结算有限责任公司开立结算备付金账户即资金交收账户，用于证券交易资金的结算。托管人以本集合计划的名义在托管人处开立集合计划的证券交易资金结算的二级结算备付金账户。

（四）债券托管账户的开立和管理

1. 集合计划合同生效后，管理人负责向中国人民银行进行报备，由托管人在备案通过后在中央国债登记结算有限责任公司及银行间市场清算所股份有限公司以本集合计划的名义开立债券托管账户，并由托管人负责集合计划的债券及资金的清算。管理人负责申请集合计划进入全国银行间同业拆借市场进行交易，由管理人在中国外汇交易中心开设同业拆借市场交易账户。

2. 管理人代表集合计划签订全国银行间债券市场债券回购主协议，协议正本由管理人保存。

（五）基金账户的开立和管理

管理人在销售机构以本集合计划名义开立基金账户，管理人在基金销售机构预留的基金赎回款项和现金分红款项的指定收款账户应是本集合计划的银行存

款账户。托管人提供必要的协助。

管理人应在基金账户开立完成后以书面形式向托管人提供基金账户信息，并定期提供对账单等书面资料。管理人应向托管人提供所持仓基金的公司网站的登录用户和密码，用于下载基金交易确认数据和查询基金持仓数据。

（六）集合计划投资银行存款账户的开立和管理

存款账户必须以集合计划名义开立，账户名称为集合计划名称，存款账户开户文件上加盖预留印鉴（须包括托管人印章）及管理人公章。

本集合计划投资银行存款时，管理人应当与存款银行签订具体存款协议/存款确认单据，明确存款的类型、期限、利率、金额、账号、对账方式、支取方式、存款到期指定收款账户等细则。

为防范特殊情况下的流动性风险，存款协议中应当约定提前支取条款。

（七）其他账户的开立和管理

若中国证监会或其他监管机构在本托管协议订立日之后允许集合计划从事其他投资品种的投资业务，涉及相关账户的开立、使用的，由管理人协助托管人根据有关法律法规的规定和《集合计划合同》的约定，开立有关账户。该账户按有关规则使用并管理。

（八）集合计划财产投资的有关实物证券、银行存款定期存单等有价凭证的保管

实物证券由托管人存放于托管人的保管库。实物证券的购买和转让，由托管人根据管理人的指令办理。托管人对由托管人以外机构实际有效控制的本集合计划资产不承担保管责任。

银行存款定期存单等有价凭证由托管人负责保管。

托管人负责对存款证实书进行保管，不负责存款证实书真伪的辨别，不承担存款证实书对应存款的本金及收益的安全保管责任。

（九）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有关的重大合同的原件分别由托管人、管理人保管，相关业务程序另有限制除外。除本协议另有规定外，管理人在代集合计划签署与集合计划有关的重大合同时，应尽可能保证持有二份以上的正本，以便管理人和托管人至少各持有一份正本的原件，管理人应及时将正本送

达托管人处。合同的保管期限按照国家有关规定执行。

对于无法取得二份以上的正本的，管理人应向托管人提供加盖授权业务章的合同传真件，未经双方协商或未在合同约定范围内，合同原件不得转移。

四、集合计划资产净值计算与复核

（一）集合计划资产净值及集合计划份额净值的计算与复核

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。

管理人应每个估值日对集合计划资产估值。估值原则应符合《集合计划合同》、《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》及其他法律、法规的规定。集合计划资产净值和各类集合计划份额净值由管理人负责计算，托管人复核。管理人应于每个估值日交易结束后计算当日的集合计划资产净值和各类集合计划份额净值，以约定方式发送给托管人。托管人对净值计算结果复核后，将复核结果反馈给管理人，由管理人对集合计划净值予以公布。

本集合计划按以下方法估值：

1、对于未在交易所上市的证券投资基金的估值

（1）本集合计划投资的境内非货币市场基金，按所投资基金估值日的份额净值估值。

（2）本集合计划投资的境内货币市场基金，按所投资基金前一估值日后至估值日期间（含节假日）的万份收益计提估值日基金收益；如所投资基金披露份额净值，则按所投资基金的基金管理人披露的估值日份额净值进行估值。

2、对于在交易所上市的证券投资基金的估值

（1）本集合计划投资的交易型开放式指数基金（ETF），按所投资基金估值日的收盘价估值。

（2）本集合计划投资的境内上市开放式基金（LOF），按所投资基金估值日的份额净值估值。

（3）本集合计划投资的境内上市定期开放式基金、封闭式基金，按所投资基金估值日的收盘价估值。

（4）本集合计划投资的境内上市交易型货币市场基金，如所投资基金披露

份额净值，则按所投资基金估值日的份额净值估值；如所投资基金披露万份（百份）收益，则按所投资基金前一估值日后至估值日期间（含节假日）的万份（百份）收益计提估值日基金收益。

3、对于证券投资基金特殊情况的估值处理

如遇所投资的证券投资基金不公布基金份额净值、进行折算或拆分、估值日无交易等特殊情况，管理人根据以下原则进行估值：

（1）以所投资基金的份额净值估值的，若所投资基金与本集合计划估值频率一致但未公布估值日基金份额净值，按其最近公布的份额净值为基础估值。

（2）以所投资基金的收盘价估值的，若估值日无交易，且最近交易日后市场环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后市场环境发生了重大变化的，可使用最新的份额净值为基础或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，确定公允价值。

（3）若所投资基金前一估值日至估值日期间发生分红除权、折算或拆分，管理人将根据份额净值或收盘价、单位基金份额分红金额、折算拆分比例、持仓份额等因素合理确定公允价值。

4、证券交易所上市的有价证券（不含证券投资基金）的估值

（1）交易所上市的有价证券，以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

（2）交易所上市交易或挂牌转让的不含权固定收益品种，选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值；

（3）交易所上市交易或挂牌转让的含权固定收益品种，选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价进行估值；

（4）交易所上市交易的可转换债券以每日收盘价作为估值全价；

（5）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。交易所市场挂牌转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值；

(6) 对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券，对存在活跃市场的情况下，应以活跃市场上未经调整的报价作为估值日的公允价值；对于活跃市场报价未能代表估值日公允价值的情况下，应对市场报价进行调整以确认估值日的公允价值；对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下，应采用估值技术确定其公允价值。

5、处于未上市期间的有价证券（不含证券投资基金）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) 在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

6、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。

7、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。

8、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。

9、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。

10、当发生大额申购或赎回情形时，管理人可以采用摆动定价机制，以确保集合计划估值的公平性。

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集合计划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。

根据有关法律法规，集合计划资产净值计算和集合计划会计核算的义务由管理人承担。本集合计划的集合计划会计责任方由管理人担任，因此，就与本集合计划有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照管理人对集合计划净值的计算结果对外予以公布。由此给集合计划份额持有人和集合计划造成损失以及因该交易日集合计划资产净值计算顺延错误而引起损失的，托管人不承担赔偿责任。

（二）净值差错处理

当发生净值计算错误时，由管理人负责处理，由此给集合计划份额持有人和集合计划造成损失的，由管理人对集合计划份额持有人或者集合计划先行支付赔偿金。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. 如采用本协议第八章“集合计划资产净值及集合计划份额净值的计算与复核”中估值方法的第1—8、10、11进行处理时，若管理人净值计算出错，托管人在复核过程中没有发现，且造成集合计划份额持有人损失的，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，由管理人与托管人按照管理费率 and 托管费率的比例各自承担相应的责任；

2. 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，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，由此给集合计划份额持有人和集合计划造成的损失以及因该交易日集合计划资产净值计算顺延错误而引起的损失，由管理人负责赔付，托管人不负赔偿责任；

3. 管理人、托管人按集合计划合同约定的估值方法第9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。

针对净值差错处理，如果法律法规或证监会有新的规定，则按新的规定执行；

如果行业有通行做法，在不违背法律法规且不损害投资者利益的前提下，双方应本着平等和保护集合计划份额持有人利益的原则重新协商确定处理原则。

（三）集合计划会计制度

按国家有关部门制定的会计制度执行。

（四）集合计划账册的建立

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

（五）会计数据和财务指标的核对

双方应每个交易日核对账目，如发现双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，确保核对一致。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资产净值的计算和公告的，以管理人的账册为准。

（六）集合计划定期报告的编制和复核

集合计划财务报表由管理人和托管人每月分别独立编制。月度报表的编制，应于每月终了后5个工作日内完成。定期报告文件应按中国证监会的要求公告。季度报表的编制，应于每季度终了后15个工作日内完成。中期报告在会计年度前6个月结束后的两个月内公告；年度报告在会计年度结束后三个月内公告。

管理人在月初3个工作日内完成上年度报表的编制，经盖章后，以约定方式将有关报表提供托管人；托管人收到后在2个工作日内进行复核，并将复核结果及时书面或双方约定的其他方式通知管理人。对于季度报告、中期报告、年度报告等定期报告，管理人和托管人应在上述监管部门规定的时间内完成编制、复核及公告。托管人在复核过程中，发现双方的报表存在不符时，管理人和托管人应共同查明原因，进行调整，调整以双方认可的账务处理方式为准。如果管理人与托管人不能于应当发布公告之日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证监会备案。

托管人在对财务报表、季度报告、中期报告或年度报告复核完毕后，可以出具复核确认书（盖章）或以其他双方约定的方式确认，以备有权机构对相关文件审核检查。

五、集合计划份额持有人名册的登记与保管

管理人可委托登记机构登记和保管集合计划份额持有人名册。集合计划份额持有人名册的内容包括但不限于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，包括权益登记日的集合计划份额持有人名册、集合计划份额持有人大会登记日的集合计划份额持有人名册、每年最后一个交易日的集合计划份额持有人名册，由登记机构负责编制和保管，并对集合计划份额持有人名册的真实性、完整性和准确性负责。

管理人应根据托管人的要求定期和不定期向托管人提供集合计划份额持有人名册。

(一) 管理人于《集合计划合同》生效日及《集合计划合同》终止日后10个工作日内向托管人提供由登记机构编制的集合计划份额持有人名册；

(二) 管理人于集合计划份额持有人大会权益登记日后5个工作日内向托管人提供由登记机构编制的集合计划份额持有人名册；

(三) 管理人于每年最后一个交易日后10个工作日内向托管人提供由登记机构编制的集合计划份额持有人名册；

(四) 除上述约定时间外，如果确因业务需要，托管人与管理人商议一致后，由管理人向托管人提供由登记机构编制的集合计划份额持有人名册。

托管人以电子版形式妥善保管集合计划份额持有人名册，并定期刻成光盘备份，保存期限为不低于法律法规规定的最低期限。托管人不得将所保管的集合计划份额持有人名册用于托管业务以外的其他用途，并应遵守保密义务。若管理人或托管人由于自身原因无法妥善保管集合计划份额持有人名册，应按有关法规规定各自承担相应的责任。

六、争议解决方式

各方当事人同意，因《集合计划合同》而产生的或与《集合计划合同》有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，任何一方可将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会上海分会并按其仲裁规则进行仲裁。

争议处理期间，本托管协议当事人应恪守各自的职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行集合计划合同规定的义务，维护集合计划份额持有人的合法权益。

托管协议受中国法律（为托管协议之目的，不包括香港特别行政区、澳门特别行政区和台湾地区法律）管辖。

七、托管协议的修改与终止

（一）托管协议的变更

本协议双方当事人经协商一致，可以对协议进行修改。修改后的新协议，其内容不得与《集合计划合同》的规定有任何冲突。修改后的新协议，应报中国证监会备案。

（二）托管协议的终止

1. 《集合计划合同》终止；
2. 托管人解散、依法被撤销、破产，被依法取消基金托管资格或因其他事由造成其他托管人接管集合计划财产；
3. 管理人解散、依法被撤销、破产，被依法取消基金管理资格或因其他事由造成其他管理人接管基金管理权。
4. 发生《基金法》、《销售办法》、《运作办法》或其他法律法规规定的终止事项。

（三）集合计划财产的清算

1. 集合计划财产清算小组：自出现《集合计划合同》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。

（1）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、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、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。

（2）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。

2. 集合计划财产清算程序：

(1) 《集合计划合同》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；

(2) 对集合计划财产和债权债务进行清理和确认；

(3) 对集合计划财产进行估值和变现；

(4) 制作清算报告；

(5) 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；

(6) 将清算报告报中国证监会备案并公告；

(7) 对集合计划剩余财产进行分配。

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，清算期限可相应顺延。

3. 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。

4. 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。

5. 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。

6. 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不低于法律法规规定的最低期限。

第二十部分 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）资料寄送

1、集合计划投资者对账单：

管理人每季度结束后通过电子邮件或其他方式向集合计划份额持有人提供对账单信息，对账单内容应包括集合计划份额持有人持有集合计划份额的数量及净值，参与、退出明细，收益分配等情况。

2、其他相关的信息资料。

（二）联系方式

上海国泰君安证券资产管理有限公司客服电话：95521

网址：www.gtjazg.com

第二十一部分 招募说明书的存放及查阅方式

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。

第二十二部分 备查文件

(一)中国证监会准予国泰君安君得益二号优选基金集合资产管理计划变更为国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)集合资产管理计划的文件

(二)国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)集合资产管理计划资产管理合同

(三)国泰君安君得益三个月持有期混合型基金中基金(FOF)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和其他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。

上海国泰君安证券资产管理有限公司

二〇二〇年十一月