# 平安证券股份有限公司

# 平安证券安赢添利半年滚动持有债券型集合资产管理计划托管协议

管理人：平安证券股份有限公司

托管人：中信银行股份有限公司

# 目录

第一条 托管协议当事人----------3
第二条 托管协议的依据、目的和原则----------4
第三条 托管人对管理人的业务监督和核查----------5
第四条 管理人对托管人的业务核查----------11
第五条 财产保管----------11
第六条 指令的发送、确认和执行----------13
第七条 交易及清算交收安排----------16
第八条 集合计划资产净值计算和会计核算----------18
第九条 集合计划收益分配----------23
第十条 信息披露----------24
第十一条 集合计划费用----------25
第十二条 集合计划份额持有人名册的保管----------27
第十三条 集合计划有关文件和档案的保存----------28
第十四条 管理人和托管人的更换----------28
第十五条 禁止行为----------31
第十六条 托管协议的变更、终止与集合计划财产的清算----------32
第十七条 反商业贿赂条款----------34
第十八条 反虚假宣传条款----------35
第十九条 违约责任----------35
第二十条 争议解决方式----------36
第二十一条 托管协议的效力----------36
第二十二条 托管协议的签订----------37
第二十三条 不可抗力----------37
第二十四条 可分割性----------37
第二十五条 通知与送达----------37

# 平安证券安赢添利半年滚动持有债券型集合资产管理计划托管协议

**管理人：平安证券股份有限公司**

住所：深圳市福田区福田街道益田路5023号平安金融中心B座22-25层。

邮政编码：5180000

电话：95511-8

传真：

法定代表人：何之江

**托管人：中信银行股份有限公司**

住所：北京市朝阳区光华路10号院1号楼6-30层、32-42层

邮政编码：100010

电话：4006800000

传真：010-85230024

法定代表人：李庆萍

**鉴于：**

1．平安证券股份有限公司系一家依照中国法律合法成立并有效存续的股份有限公司，按照相关法律法规的规定具备担任资产管理计划管理人的资格和能力；

2.中信银行股份有限公司系一家依照中国法律合法成立并有效存续的银行，按照相关法律法规的规定具备担任资产管理计划托管人的资格和能力；

3.平安证券股份有限公司拟担任平安证券安赢添利半年滚动持有债券型集合资产管理计划的管理人（以下简称“管理人”），中信银行股份有限公司拟担任平安证券安赢添利半年滚动持有债券型集合资产管理计划的托管人（以下简称“托管人”）；

为明确双方在集合计划托管中的权利、义务及责任，确保集合计划财产的安全，保护份额持有人的合法权益，依据《中华人民共和国民法典》等法律法规以及相关规定，双方本着平等自愿、诚实守信的原则特签订本协议。

**释义：**

除非另有约定，《平安证券安赢添利半年滚动持有债券型集合资产管理计划资产管理合同》(以下简称“资管合同”)中定义的术语在用于本托管协议时应具有相同的含义；若有抵触应以资管合同为准，并依其条款解释。

**第一条 托管协议当事人**

1.1 管理人：

名称：平安证券股份有限公司

住所：深圳市福田区福田街道益田路 5023 号平安金融中心 B 座 22-25 层

法定代表人：何之江

成立时间： 1996 年 07 月 18 日

批准设立机关： 中国证券监督管理委员会

批准设立文号： 证监许可【2011】1239 号

组织形式：股份有限公司

注册资本：138 亿元人民币

经营范围： 证券经纪；证券投资咨询；与证券交易、证券投资活动有关的财务顾问；证券承销与保荐；证券自营；证券资产管理；融资融券；证券投资基金代销；代销金融产品。

存续期间： 持续经营

1.2 托管人：

集合计划托管人：中信银行股份有限公司

住所：北京市朝阳区光华路 10 号院 1 号楼 6-30 层、32-42 层

法定代表人：李庆萍

设立日期：1987 年 4 月 20 日

批准设立机关及批准设立文号：中华人民共和国国务院办公厅国办函[1987]14 号

基金托管业务批准文号：证监基金字[2004]125 号

组织形式：股份有限公司

注册资本：489.35 亿元人民币

存续期间：持续经营

联系电话：4006800000

经营范围：保险兼业代理业务；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；提供保管箱服务；结汇、售汇业务；代理开放式基金业务；办理黄金业务；黄金进出口；开展证券投资基金、企业年金基金、保险资金、合格境外机构投资者托管业务；经国务院银行业监督管理机构批准的其他业务。（企业依法自主选择经营项目，开展经营活动；依法须经批准的项目，经相关部门批准后依批准的内容开展经营活动；不得从事本市产业政策禁止和限制类项目的经营活动。）

**第二条 托管协议的依据、目的和原则**

2.1 托管协议的依据

订立本协议的依据是《中华人民共和国民法典》、《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《公开募集证券投资基金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》”）、《证券投资基金托管业务管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第 7 号〈托管协议的内容与格式〉》、《平安证券安赢添利半年滚动持有债券型集合资产管理计划资产管理合同》及其他有关规定。

2.2 托管协议的目的

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

2.3 托管协议的原则

管理人和托管人本着平等自愿、诚实信用、充分保护份额持有人合法权益的原则，经协商一致，签订本协议。

**第三条 托管人对管理人的业务监督和核查**

3.1 托管人对管理人的投资行为行使监督权

3.1.1 托管人根据有关法律法规的规定和资管合同的约定，对下述集合计划投资范围、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包括具有良好流动性的金融工具，包括：国内依法发行的债券(包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、国债期货、股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票)、信用衍生品以及法律法规或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。

本集合计划各类资产的投资比例范围为： 债券资产的投资比例不低于集合计划资产的 80%；每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本计划所持有现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于计划资产净值的 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。

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。

3.1.2 托管人根据有关法律法规的规定及资管合同的约定对下述投融资比例进行监督：

（1）本计划债券资产的投资比例不低于集合计划资产的 80%；

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

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

（4）管理人管理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，

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）本集合计划投资于信用债主体评级或债项评级或担保人评级不低于 AA（含），且应当遵守下列要求：

1）本集合计划投资于 AAA 信用评级的信用债的比例不低于全部信用债资产的 30%；

2）本集合计划投资于 AA+信用评级的信用债的比例不超过全部信用债资产的 70%；

3）本集合计划投资于 AA 信用评级的信用债的比例不超过全部信用债资产的 20%；

信用评级参照评级机构（中债资信除外）评定的最新债项评级，无债项评级的参照主体评级。

（6）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%；

（7）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%；

（8）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%；

（9）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%；

（10）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；

（11）本集合计划财产参与股票发行申购，所申报的金额不超过本集合计划的总资产，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；

（12）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；

（13）管理人管理的全部公开募集性质的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%；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公开募集性质的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；

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

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

（16）集合计划资产总值不得超过集合计划资产净值的 140%；

（17）本集合计划参与国债期货投资，应遵循下列限制：

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

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

3）本集合计划所持有的债券（不含到期日在一年以内的政府债券）市值和买入、卖出国债期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合资管合同关于债券投资比例的有关约定；

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

（18）本计划不持有具有信用保护卖方属性的信用衍生品，不持有合约类信用衍生品；

（19）本计划持有的信用衍生品名义本金不得超过本计划中所对应受保护债券面值的 100%；

（20）本计划投资于同一信用保护卖方的各类信用衍生品名义本金合计不得超过计划资产净值的 10%；

（21）法律法规及中国证监会规定的和资管合同约定的其他投资限制。

除上述第（2）、（10）、（14）、（15）项情形之外，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。

管理人应当自资管合同生效之日起 6 个月内使集合计划的投资组合比例符合资管合同的有关约定。在上述期间内，本集合计划的投资范围、投资策略应当符合

资管合同的约定。托管人对集合计划的投资的监督与检查自资管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。

3.1.3托管人根据有关法律法规的规定及资管合同的约定对下述投资禁止行为进行监督：

根据法律法规的规定及资管合同的约定，本集合计划禁止从事下列行为：

（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，但法律法规或中国证监会另有规定的除外；

（5）向集合计划管理人、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其他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的原则，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资管合同进行变更，该变更无须召开集合计划份额持有人大会审议。

3.1.4托管人依据有关法律法规的规定和资管合同的约定对于关联投资限制进行监督：

根据法律法规有关从事关联交易的规定，管理人和托管人应事先相互提供与本

机构有控股关系的股东或与本机构有其他重大利害关系的公司名单及其更新，加盖公章并书面提交，并确保所提供名单的真实性、完整性、全面性。名单变更后变更方应及时发送对方，被告知方于 2 个工作日内进行回函确认已知名单的变更。名单变更时间以被告知方回函确认的时间为准。如果托管人在运作中严格遵循了监督流程，管理人仍违规进行交易，并造成集合计划资产损失的，由管理人承担责任，托管人不承担任何损失和责任。

若托管人发现管理人与关联方进行法律法规禁止集合计划从事的交易时，托管人应及时提醒并协助管理人采取必要措施阻止该交易的发生，若托管人采取必要措施后仍无法阻止该交易发生时，托管人有权向中国证监会报告，由此造成的损失和责任由管理人承担。对于交易所场内已成交的违规交易，托管人应按相关法律法规和交易所规则的规定进行结算，同时向中国证监会报告，托管人不承担由此造成的损失和责任。

3.1.5托管人依据有关法律法规的规定和资管合同的约定对管理人参与银行间债券市场进行监督：托管人根据有关法律法规的规定及资管合同的约定，对管理人选择存款银行进行监督：

3.1.6投资银行定期存款的，管理人应根据法律法规的规定及资管合同的约定，选择符合条件的存款银行，并向托管人提供存款银行协议，托管人应据以对集合计划银行存款的交易对手是否符合有关规定进行监督。

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，保护份额持有人的合法权益。

（3）托管人应加强对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。

3.2 托管人对管理人业务进行监督和核查的有关措施：

3.2.1 托管人应根据有关法律法规的规定及资管合同的约定，对集合计划资产净值计算、份额净值计算、应收资金到账、费用开支及收入确定、收益分配、相关信息披露、宣传推介材料中登载业绩表现数据等进行监督和核查。

3.2.2 托管人发现管理人的投资运作及其他运作违反《基金法》、资管合同、本托管协议及其他有关规定时，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在下一个工作日及时核对，并以书面形式向托管人发出回函，进行解释或举证。

3.2.3 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，托管人应报告中国证监会。

3.2.4 托管人发现管理人的投资指令违反关法律法规规定或者违反资管合同约定的，应当拒绝执行，立即通知管理人。

3.2.5 托管人发现管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反资管合同约定的，应当立即通知管理人，并及时向中国证监会报告，管理人应依法承担相应责任。

3.2.6 管理人应积极配合和协助托管人的监督和核查，必须在规定时间内答复托管人并改正，就托管人的合理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。

3.2.7 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。

3.2.8 管理人无正当理由，拒绝、阻挠托管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。

3.2.9 管理人应遵守中华人民共和国反洗钱法律法规，不参与涉嫌洗钱、恐怖融资、扩散融资等违法犯罪活动；主动配合托管人客户身份识别与尽职调查，提供真实、准确、完整客户资料，遵守托管人反洗钱与反恐怖融资相关管理规定。对具备合理理由怀疑涉嫌洗钱、恐怖融资的客户，托管人将按照中国人民银行反洗钱监

管规定采取必要管控措施。

**第四条 管理人对托管人的业务核查**

4.1 管理人对托管人履行托管职责情况进行核查，核查事项包括但不限于托管人安全保管集合计划财产、开设集合计划财产的资金账户和证券账户等投资所需的其他账户、复核管理人计算的集合计划资产净值和份额净值、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。

4.2 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、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》、资管合同、本托管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确认并以书面形式向管理人发出回函。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，并予协助配合。托管人对管理人通知的违规事项未能在限期内纠正或未在合理期限内确认的，管理人应报告中国证监会。管理人有义务要求托管人赔偿集合计划因此所遭受的损失。

4.3 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和银行业监督管理机构，同时通知托管人限期纠正。

4.4 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。

4.5 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。

**第五条 财产保管**

5.1 集合计划财产保管的原则

5.1.1 集合计划财产应独立于管理人、托管人的固有财产。

5.1.2 托管人应安全保管集合计划财产。除依据法律法规规定、资管合同和本托管协议约定及管理人的正当指令外，不得自行运用、处分、分配集合计划的任何

财产。

5.1.3托管人按照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的其他账户。

5.1.4托管人对所托管的不同集合计划财产分别设置账户，与托管人的其他业务和其他集合计划或基金的托管业务实行严格的分账管理，确保集合计划财产的完整与独立。

5.1.5托管人根据管理人的指令，按照资管合同和本协议的约定保管集合计划财产，如有特殊情况双方可另行协商解决。

5.1.6除依据法律法规和资管合同的规定外，托管人不得委托第三人托管集合计划资产。

5.2集合计划的银行账户的开立和管理

5.2.1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账户，并根据管理人合法合规的指令办理资金收付。

5.2.2集合计划银行账户的开立和使用，限于满足开展本集合计划业务的需要。托管人和管理人不得假借本集合计划的名义开立任何其他银行账户；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。

5.2.3集合计划银行账户的开立和管理应符合有关法律法规以及银行业监督管理机构的有关规定。

5.3集合计划证券账户与证券交易资金账户的开设和管理：

5.3.1托管人以集合计划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上海分公司/深圳分公司开设证券账户。

5.3.2托管人以集合计划托管人的名义在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司开立证券交易资金账户，用于证券清算。

5.3.3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。

5.4债券托管账户的开立和管理

资管合同生效后，管理人负责以集合计划的名义申请并取得进入全国银行间同

业拆借市场的交易资格，并代表集合计划进行交易；托管人负责以集合计划的名义在中央国债登记结算有限责任公司和银行间市场清算所股份有限公司开设银行间债券市场债券托管账户，并由托管人负责集合计划的债券的后台匹配及资金的清算。

5.5 其他账户的开设和管理

在本托管协议生效之后，本集合计划被允许从事符合法律法规规定和资管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，由管理人协助托管人根据有关法律法规的规定和资管合同的约定，开立有关账户。该账户按有关规则使用并管理。

5.6 集合计划财产投资的有关实物证券、银行定期存款存单等有价凭证的保管

集合计划财产投资的有关实物证券由托管人存放于托管人的保管库；其中实物证券也可存入中央国债登记结算有限责任公司、中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司、银行间市场清算所股份有限公司或票据营业中心的代保管库。实物证券的购买和转让，由托管人根据管理人的指令办理。属于托管人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的证券不承担保管责任。

5.7 与集合计划财产有关的重大合同的保管

与集合计划财产有关的重大合同的签署，由管理人负责。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应由托管人、管理人保管。管理人在代表集合计划签署与集合计划有关的重大合同时应保证集合计划一方持有两份以上的正本原件，以便管理人和托管人至少各持有一份正本的原件。管理人在合同签署后 30 个工作日内通过专人送达、挂号邮寄等安全方式将合同送达托管人处。合同应存放于管理人和托管人各自文件保管部门 15 年以上，法律法规或监管规则另有规定的，从其规定。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公章的合同传真件，未经双方协商或未在合同约定范围内，合同原件不得转移，由管理人保管。

**第六条 指令的发送、确认和执行**

6.1 管理人对发送指令人员的书面授权

管理人应向托管人提供预留印鉴和被授权人签字样本，事先书面通知（以下简称“授权通知”）托管人有权发送指令的人员名单，注明相应的交易权限，并规定管理人向托管人发送指令时托管人确认有权发送人员身份的方法。托管人在收到授权通知当日回函向管理人确认。管理人在收到托管人的确认回函之后，授权通知生效。管理人和托管人对授权文件负有保密义务，其内容不得向被授权人及相关操作人员以外的任何人泄露，法律法规另有规定或有权机关另有要求的除外。

6.2 指令的内容

指令是管理人在运用集合计划资产时，向托管人发出的资金划拨及其他款项支付的指令。管理人发给托管人的指令应写明款项事由、支付时间、到账时间、金额、账户等，加盖预留印鉴并由被授权人签字或盖章。

6.3 指令的发送、确认和执行的时间和程序

6.3.1 指令由“授权通知”确定的有权发送人（以下简称“被授权人”）代表管理人用传真、邮件的方式或其他托管人和管理人书面确认过的方式向托管人发送。管理人有义务在发送指令后及时与托管人进行确认，因管理人未能及时与托管人进行指令确认，致使资金未能及时到账所造成的损失不由托管人承担。托管人依照“授权通知”规定的方法确认指令有效后，方可执行指令。对于被授权人发出的指令，管理人不得否认其效力。管理人应按照《基金法》、有关法律法规和资管合同的规定，在其合法的经营权限和交易权限内发送划款指令，被授权人应按照其授权权限发送划款指令。管理人在发送指令时，应为托管人留出执行指令所必需的时间为 2 小时。由管理人原因造成的指令传输不及时、未能留出足够划款所需时间，托管人不承担资金未能及时到账所造成的损失。

6.3.2 托管人不负责审查管理人发送指令同时提交的其他文件资料的合法性、真实性、完整性和有效性，管理人应保证上述文件资料合法、真实、完整和有效。如因管理人提供的上述文件不合法、不真实、不完整或失去效力而影响托管人的审核或给任何第三人带来损失，托管人不承担任何形式的责任。

6.3.3 托管人应指定专人接收管理人的指令，预先通知管理人其名单，并与管理人商定指令发送和接收方式。托管人收到管理人发送的指令后，应立即审慎验证有关内容及印鉴和签名，复核无误后应在规定期限内执行，不得延误。

6.3.4 管理人向托管人下达指令时，应确保集合计划银行账户有足够的资金余额，对管理人在没有充足资金的情况下向托管人发出的指令，托管人可不予执行，并立即通知管理人，托管人不承担因为不执行该指令而造成损失的责任。

6.3.5 管理人应将同业市场国债交易通知单加盖预留印鉴后传真给托管人。

6.4 管理人发送错误指令的情形和处理程序

6.4.1 管理人发送错误指令的情形包括指令违反相关法律法规或资管合同、指令发送人员无权或超越权限发送指令及交割信息错误，指令中重要信息模糊不清或不全等。

6.4.2 托管人在履行监督职能时，发现管理人的指令错误时，有权拒绝执行，并及时通知管理人改正。

6.5 托管人依照法律法规暂缓、拒绝执行指令的情形和处理程序

托管人发现管理人发送的指令违反《基金法》、资管合同、本协议或有关法规的有关规定，有权视情况暂缓或不予执行，并应及时以书面形式通知管理人纠正，托管人不承担任何损失和责任。对管理人更正并重新发送后的指令经托管人核对确认后方能执行。

6.6 托管人未按照管理人指令执行的处理方法

托管人由于自身原因造成未按照或者未及时按照管理人发送的符合法律法规规定以及资管合同约定的指令执行，给份额持有人或集合计划财产造成损失的，应负赔偿责任。除此之外，托管人对于执行管理人的指令所造成的损失不承担任何责任

6.7 更换被授权人的程序

管理人撤换被授权人员或改变被授权人员的权限，必须提前至少 1 个交易日，使用传真向托管人发出由管理人签字和盖章的被授权人变更通知，同时电话通知托管人，托管人收到变更通知当日将回函书面传真管理人并通过电话向管理人确认。被授权人变更通知，自管理人收到托管人以传真形式发出的回函确认时开始生效。管理人在此后 5 日内将被授权人变更通知的正本送交托管人。被授权人变更通知的正本应与传真内容一致，若有不一致的，以托管人收到的传真件为准。管理人更换被授权人通知生效后，对于已被撤换的人员无权发送的指令，或被改变授权人员超

权限发送的指令，管理人不承担责任。

**第七条 交易及清算交收安排**

7.1 选择代理证券、期货买卖的证券经营机构

7.1.1 管理人应制定选择代理证券、期货买卖的证券经营机构的标准和程序。管理人负责选择代理本集合计划证券买卖的证券经营机构，使用其交易单元作为集合计划的专用交易单元。管理人和被选中的证券经营机构签订委托协议（如需），由管理人提前通知托管人，并在法定信息披露公告中披露有关内容。交易单元保证金由被选中的证券经营机构支付。

管理人负责选择代理本计划国债期货交易的期货经营机构，并与其签订期货经纪合同（如需），其他事宜根据法律法规、资管合同的相关规定执行，若无明确规定的，可参照有关证券买卖、证券经营机构选择的规则执行。

7.1.2 管理人应及时将集合计划专用交易单元号、佣金费率等基本信息以及变更情况及时以书面形式通知托管人。

7.2 集合计划投资证券后的清算交收安排

7.2.1 管理人和托管人在清算和交收中的责任

管理人与托管人应根据有关法律法规及相关业务规则，签订《证券交易资金结算协议》，用以具体明确管理人与托管人在证券交易资金结算业务中的责任。

对管理人的资金划拨指令，托管人在复核无误后应在规定期限内执行，不得无故延误。

本集合计划投资于证券发生的所有场内、场外交易的资金清算交割，全部由托管人负责办理。

本集合计划证券投资的清算交割，由托管人通过中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司及清算代理银行办理。

交易及清算交收安排中管理人应为托管人预留 2 个小时的指令处理时间，15:00 之后收到的指令，托管人尽力负责但不承诺指令支付成功。如果因托管人原

因在清算和交收中造成集合计划财产的损失，应由托管人负责赔偿集合计划的损失；如果因为管理人违反法律法规的规定进行证券投资或违反双方签订的《证券交易资金结算协议》而造成集合计划投资清算困难和风险的，托管人发现后应立即通知管理人，由管理人负责解决，由此给集合计划造成的损失由管理人承担。

7.2.2 集合计划出现超买或超卖的责任认定及处理程序

托管人在履行监督职能时，如果发现集合计划投资证券过程中出现超买或超卖现象，应立即提醒管理人，由管理人负责解决，由此给集合计划造成的损失由管理人承担。

7.2.3 集合计划无法按时支付证券清算款的责任认定及处理程序

管理人应确保托管人在执行管理人发送的指令时，有足够的头寸进行交收。集合计划的资金头寸不足时，托管人有权拒绝管理人发送的划款指令。管理人在发送划款指令时应充分考虑托管人的划款处理所需的合理时间。如由于管理人的原因导致无法按时支付证券清算款，由此给集合计划造成的损失由管理人承担。

在集合计划资金头寸充足的情况下，托管人对管理人符合法律法规、资管合同、本托管协议的指令不得拖延或拒绝执行。如由于托管人的原因导致集合计划无法按时支付证券清算款，由此给集合计划造成的损失由托管人承担。

7.3 资金、证券账目及交易记录的核对

7.3.1 管理人与托管人按日进行交易记录的核对。每日对外披露集合计划份额净值之前，必须保证当天所有实际交易记录与集合计划会计账簿上的交易记录完全一致。如果实际交易记录与会计账簿记录不一致，造成集合计划会计核算不完整或不真实，由此导致的损失由责任方承担。

7.3.2 对集合计划的资金账目，由相关各方每日对账一次，确保相关各方账账相符。对集合计划证券账目，由相关各方每日进行对账。对实物券账目，每月月末由相关各方进行账实核对。对交易记录，由相关各方每日对账一次。

7.4 申购、赎回、转换开放式集合计划的资金清算、数据传递及托管协议当事

人的责任

7.4.1 托管协议当事人在集合计划的申购赎回、转换中的责任

集合计划投资人可通过管理人或其委托的销售机构的销售网点进行申购和赎回申请，份额申购、赎回的确认、清算由管理人或其委托的登记机构负责。托管人负责接收并确认资金的到账情况，以及依照管理人的投资指令来划付赎回款项。

7.4.2 集合计划的数据传递

管理人委托中国证券登记结算有限责任公司办理本集合计划的登记业务，由其向托管人传送本集合计划的申购、赎回、转换的数据。相关数据双方各自按有关规定保存。如因各种原因，该系统无法正常发送，双方可协商解决处理方式。

7.4.3 集合计划的资金清算

集合计划托管账户与“集合计划清算账户”间的资金结算遵循“全额清算、净额交收”的原则，每日按照托管账户应收资金与应付资金的差额来确定托管账户净应收额或净应付额，以此确定资金交收额。

如果当日集合计划为净应付款，托管人应根据管理人的指令在 T 日（T 日指交收当前工作日）中午 12:00 前进行划付。对于未准时划付的资金，管理人应及时通知托管人划付。因托管专户没有足够的资金，导致托管人不能按时拨付，托管人应及时通知管理人。

**第八条 集合计划资产净值计算和会计核算**

8.1 集合计划资产净值的计算、复核的时间和程序

8.1.1 集合计划资产净值是指集合计划资产总值减去负债后的净资产值。某一类别份额净值是指计算日某一类别集合计划资产净值除以当日该类集合计划份额总份额后的数值。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，由此产生的误差计入集合计划财产。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。国家另有规定或资管合同另有约定的，从其规定。

8.1.2 管理人应每工作日对集合计划资产估值，但管理人根据法律法规或资管

合同的规定暂停估值时除外。估值原则应符合资管合同、《证券投资基金会计核算业务指引》及其他法律、法规的规定。集合计划资产净值和份额净值由管理人负责计算，托管人复核。管理人应于每个工作日交易结束后计算当日的集合计划份额净值并以双方认可的方式发送给托管人。托管人对净值计算结果复核后以双方认可的方式发送给管理人，由管理人对集合计划净值予以公布。

8.1.3 根据《基金法》，管理人计算并公告集合计划净值信息，托管人复核、审查管理人计算的集合计划净值信息。因此，本集合计划的会计责任方是管理人，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信息的计算结果对外予以公布。

8.2 集合计划资产估值方法

8.2.1 估值对象

集合计划所拥有的债券、股票、国债期货合约、信用衍生品和银行存款本息、其他投资等资产及负债。

8.2.2 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，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。

（2）首次公开发行未上市的债券、股票，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）同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

（5）存款的估值方法

持有的银行定期存款或通知存款以本金列示，按协议或合同利率逐日确认利息收入。

（6）同业存单的估值方法

同业存单按估值日第三方估值机构提供的估值净价估值；选定的第三方估值机构未提供估值价格的，按成本估值。

（7）本集合计划投资国债期货，一般以估值当日结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。

（8）信用衍生品估值方法

信用衍生品按照第三方估值机构提供的当日估值价格进行估值，但管理人依法应当承担的估值责任不因委托而免除。

选定的第三方估值机构未提供估值价格的，依照有关法律法规及企业会计准则的要求采用合理估值技术确定其公允价值。

（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资管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信息的计算结果对外予以公布。

8.3 估值差错处理

8.3.1 因集合计划估值错误给投资人造成损失的应先由管理人承担，管理人对不应由其承担的责任，有权向过错人追偿。

8.3.2 当管理人计算的集合计划资产净值、份额净值已由托管人复核确认后公告的，由此造成的投资人或集合计划的损失，应根据法律法规的规定对投资人或集合计划支付赔偿金，就实际向投资人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和托管费率的比例各自承担相应的责任。

8.3.3 由于一方当事人提供的信息错误，另一方当事人在采取了必要合理的措施后仍不能发现该错误，进而导致集合计划资产净值、份额净值计算错误造成投资人或集合计划的损失，以及由此造成以后交易日集合计划资产净值、份额净值计算顺延错误而引起的投资人或集合计划的损失，由提供错误信息的当事人一方负责赔偿。

8.3.4 由于不可抗力，或证券、期货交易所、证券经纪机构、期货公司及登记结算公司发送的数据错误等，管理人和托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，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。

8.3.5 当管理人计算的集合计划资产净值与托管人的计算结果不一致时，相关各方应本着勤勉尽责的态度重新计算核对，如果最后仍无法达成一致，应以管理人的计算结果为准对外公布，由此造成的损失由管理人承担赔偿责任，托管人不负赔

偿责任。

8.4 集合计划账册的建立

8.4.1 管理人和托管人在资管合同生效后，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。

8.4.2 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资产净值的计算和公告的，以管理人的账册为准。

8.5 集合计划定期报告的编制和复核

8.5.1 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。

8.5.2 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，将年度报告登载于规定网站上，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。

8.5.3《资管合同》生效后，集合计划招募说明书、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，更新招募说明书、产品资料概要，并登载在规定网站上，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。基招募说明书、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。

8.5.4 管理人应及时完成报表编制，将有关报表提供托管人复核；托管人应当在收到报告之日起 2 个工作日内完成月度报表的复核；在收到报告之日起 7 个工作日内完成集合计划季度报告的复核；在收到报告之日起 20 日内完成集合计划中期报告的复核；在收到报告之日起 30 日内完成集合计划年度报告的复核。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，调整以国家有关规定为准。

8.5.5 核对无误后，托管人在管理人提供的报告上加盖业务印鉴或者出具加盖托管业务部门公章的复核意见书，相关各方各自留存一份。

8.5.6 托管人在对财务会计报告、季度、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时提示。

8.6 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，集合计划应当暂停估值；

（4）法律法规、中国证监会和资管合同认定的其他情形。

**第九条 集合计划收益分配**

9.1 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。

9.2 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。

9.3 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，具体分配方案以公告为准；

（2）本集合计划收益分配方式为：现金分红；

（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）由于本计划各份额类别收取的销售服务费不同，各份额类别对应的可供

分配利润将有所不同。本计划同一类别的每一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。

9.4 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。

9.5 收益分配的时间和程序

9.5.1 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。

9.5.2 在收益分配方案公布后，管理人依据具体方案的规定就支付的现金红利向托管人发送划款指令，托管人按照管理人的指令及时进行分红资金的划付。

9.5.3 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

**第十条 信息披露**

10.1 保密义务

10.1.1 除按照《基金法》、《信息披露办法》、《流动性风险管理规定》、资管合同及中国证监会关于信息披露的有关规定进行披露以外，管理人和托管人对集合计划运作中产生的信息以及从对方获得的业务信息应恪守保密的义务。管理人与托管人对集合计划的任何信息，除法律法规规定之外，不得在其公开披露之前，先行对任何第三方披露。但是，如下情况不应视为管理人或托管人违反保密义务：

（1）非因管理人和托管人的原因导致保密信息被披露、泄露或公开；

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

10.2 管理人和托管人在信息披露中的职责和信息披露程序

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

10.2.2 本集合计划信息披露的文件主要包括招募说明书、产品资料概要、资管合同、托管协议、资管合同生效公告、净值信息、份额申购、赎回价格、定期报告（包括年度报告、中期报告和季度报告）、临时报告、澄清公告、清算报告、份

额持有人大会决议、投资资产支持证券、国债期货、信用衍生品的信息披露以及中国证监会规定的其他信息。

10.2.3 托管人应当按照相关法律法规、中国证监会的规定和《资管合同》的约定，对管理人编制的集合计划资产净值、份额净值、份额申购赎回价格、定期报告、更新的招募说明书、产品资料概要、清算报告等相关集合计划信息进行复核、审查，并向管理人出具书面文件或者盖章确认。

10.2.4 年度报告中的财务报告部分，经符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所审计后，方可披露。

10.2.5 管理人应当在中国证监会规定的时间内，将应予披露的集合计划信息通过中国证监会规定媒介披露。根据法律法规应由托管人公开披露的信息，托管人将通过中国证监会规定媒介公开披露。

10.2.6 予以披露的信息文本，存放在管理人和托管人处，投资人可以免费查阅。在支付工本费后可在合理时间获得上述文件的复制件或复印件。管理人和托管人应保证文本的内容与所公告的内容完全一致。

10.3 暂停或延迟信息披露的情形

（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）不可抗力；

（3）法律法规、资管合同或中国证监会规定的情况。

10.4 托管人报告

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

## 第十一条 集合计划费用

11.1 集合计划管理费的计提比例和计提方法

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

H＝E×管理费年费率÷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

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

11.2 集合计划托管费的计提比例和计提方法

本集合计划的托管费按前一日集合计划资产净值的 0.05%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

H＝E×托管费年费率÷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

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

11.3 销售服务费的计提比例和计提方法

本计划 A 类及 D 类计划份额不收取销售服务费，B 类计划份额的销售服务费年费率为 0.3%，C 类计划份额的销售服务费年费率为 0.1%。本计划销售服务费主要用于本计划份额持有人服务等各项费用。销售服务费按前一日 B 类或 C 类计划份额资产净值的年费率计提。计算方法如下：

H＝E×销售服务费年费率÷当年天数

H 为每日应计提的 B 类或 C 类计划份额销售服务费

E 为前一日的 B 类或 C 类计划份额的资产净值

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

11.4 为集合计划财产及运作所开立账户的开户费和维护费、证券/期货交易费用、资管合同生效后与集合计划相关的信息披露费用、份额持有人大会费用、资管合同生效后与集合计划相关的会计师费、律师费、仲裁费和诉讼费、集合计划的银行划款费用等根据有关法律法规、资管合同及相应协议的规定，由托管人按管理人的划款指令并根据费用实际支出金额支付，列入或摊入当期集合计划费用。

11.5 不列入集合计划费用的项目：

管理人与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，以及处理与集合计划运作无关的事项发生的费用等不列入集合计划费用。资管合同生效前所发生的信息披露费、律师费、验资费和会计师费以及其他费用不从集合计划财产中支付。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也不列入集合计划费用。

11.6 集合计划的税收

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。

对于集合计划份额持有人必须自行缴纳的税收，由集合计划份额持有人自行负责，管理人和托管人不承担代扣代缴或纳税的义务

11.7 集合计划管理费和托管费的调整：

在不对集合计划份额持有人权益产生实质性不利影响的情况下，管理人和托管人协商一致且在履行适当程序后，可按照集合计划发展情况，并根据法律法规规定和资管合同约定酌情调整集合计划管理费率、托管费率等相关费率。

管理人必须于新的费率实施日前依照《信息披露办法》的规定在规定媒介上公告。

11.8 如果托管人发现管理人违反有关法律法规的有关规定和资管合同、本协议的约定，从集合计划财产中列支费用，有权要求管理人做出书面解释，如果托管人认为管理人无正当或合理的理由，可以拒绝支付。

## 第十二条 集合计划份额持有人名册的保管

12.1 管理人和托管人须分别妥善保管的集合计划份额持有人名册，份额持有人名册的内容必须包括份额持有人的名称和持有的集合计划份额。

12.2基份额持有人名册由集合计划的登记机构根据管理人的指令编制和保管，管理人和托管人应按照目前相关规则分别保管份额持有人名册。保管方式可以采用电子或文档的形式。保管期限为 15 年，法律法规或监管规则另有规定的，从其规定。

12.3管理人应当及时向托管人定期或不定期提交下列日期的份额持有人名册。份额持有人名册的内容必须包括份额持有人的名称和持有的集合计划份额。托管人可以采用电子或文档的形式妥善保管份额持有人名册，保存期限为 15 年。托管人不得将所保管的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。法律法规或监管规则另有规定的，从其规定。

12.4 若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，应按有关法规规定各自承担相应的责任。

**第十三条 集合计划有关文件和档案的保存**

13.1 管理人、托管人按各自职责完整保存原始凭证、记账凭证、集合计划账册、交易记录和重要合同等，保存期限不少于 15 年，对相关信息负有保密义务，但司法强制检查情形及法律法规规定的其他情形除外。其中，管理人应保存集合计划财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料，托管人应保存集合计划托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料。

13.2 管理人签署重大合同文本后，应及时将合同文本正本送达托管人处。管理人应及时将与本集合计划账务处理、资金划拨等有关的合同、协议传真给托管人。

13.3 管理人或托管人变更后，未变更的一方有义务协助接任人接受集合计划的有关文件。

**第十四条 管理人和托管人的更换**

14.1 管理人的更换

14.1.1 管理人的更换条件

有下列情形之一的，管理人职责终止：

（1）被依法取消集合计划管理资格；

（2）依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产；

（3）被份额持有人大会解任；

（4）法律法规及中国证监会规定的和资管合同规定的其他情形。

14.1.2 管理人的更换程序

更换管理人必须依照如下程序进行：

（1）提名：新任管理人由托管人或由单独或合计持有 10%以上（含 10%）集合计划份额的持有人提名；

（2）决议：份额持有人大会在管理人职责终止后 6 个月内对被提名的管理人形成决议，该决议需经参加大会的份额持有人所持表决权的 2/3 以上（含 2/3）表决通过，决议自表决通过之日起生效；

（3）临时管理人：新任管理人产生之前，由中国证监会指定临时管理人；

（4）备案：份额持有人大会更换管理人的决议须报中国证监会备案；

（5）公告：管理人更换后，由托管人在更换管理人的份额持有人大会决议生效后 2 日内在规定媒介公告；

（6）交接：管理人职责终止的，管理人应妥善保管集合计划管理业务资料，及时向临时管理人或新任管理人办理集合计划管理业务的移交手续，临时管理人或新任管理人应及时接收，临时管理人或新任管理人应与托管人核对集合计划资产总值和净值；

（7）审计：管理人职责终止的，应当按照法律法规规定聘请会计师事务所对集合计划财产进行审计，并将审计结果予以公告，同时报中国证监会备案，审计费由集合计划财产承担；

（8）集合计划名称变更：管理人更换后，如果原任或新任管理人要求，应按其要求替换或删除集合计划名称中与原管理人有关的名称字样。

14.2 托管人的更换

14.2.1 托管人的更换条件：

有下列情形之一的，托管人职责终止：

（1）被依法取消集合计划托管资格；

（2）依法解散、被依法撤销或者被依法宣布破产；

（3）被份额持有人大会解任；

（4）法律法规及中国证监会规定的和资管合同规定的其他情形。

14.2.2 托管人的更换程序

（1）提名：新任托管人由管理人或由单独或合计持有 10%以上（含 10%）集合计划份额的份额持有人提名；

（2）决议：份额持有人大会在托管人职责终止后 6 个月内对被提名的托管人形成决议，该决议需经参加大会的份额持有人所持表决权的 2/3 以上（含 2/3）表决通过，决议自表决通过之日起生效；

（3）临时托管人：新任托管人产生之前，由中国证监会指定临时托管人；

（4）备案：份额持有人大会更换托管人的决议须报中国证监会备案；

（5）公告：托管人更换后，由管理人在更换托管人的份额持有人大会决议生效后 2 日内在规定媒介公告；

（6）交接：托管人职责终止的，应当妥善保管集合计划财产和托管业务资料，及时办理集合计划财产和托管业务的移交手续，临时托管人或新任托管人应当及时接收，临时托管人或新任托管人应与管理人核对集合计划资产总值和净值；

（7）审计：托管人职责终止的，应当按照法律法规规定聘请会计师事务所对集合计划财产进行审计，并将审计结果予以公告，同时报中国证监会备案。审计费由集合计划财产承担。

14.3 管理人与托管人同时更换

14.3.1 提名：如果管理人和托管人同时更换，由单独或合计持有集合计划总份额 10%以上（含 10%）的持有人提名新的管理人和托管人。

14.3.2 管理人和托管人的更换分别按上述程序进行。

14.3.3 公告：新任管理人和新任托管人应在更换管理人和托管人的份额持有人大会决议生效后 2 日内在规定媒介上联合公告。

14.4 管理人更换的特殊程序

当管理人根据相关法律法规的规定，以独资或者控股方式成立具有独立法人资格的从事资产管理业务的子公司时，在管理人和托管人协商一致的基础上，管理人有权将资管合同中管理人的全部权利和义务转让给前述从事资产管理业务的子公

司，本集合计划的管理人变更为前述从事资产管理业务的子公司。前述变更事项无需召开集合计划份额持有人大会审议。

14.5 新任或临时管理人接受集合计划管理业务或新任或临时托管人接受集合计划财产和托管业务前，原管理人或原托管人应依据法律法规和资管合同的规定继续履行相关职责，并保证不对份额持有人的利益造成损害。原管理人或原托管人在继续履行相关职责期间，仍有权按照资管合同的规定收取管理费或托管费。

14.6 本部分关于管理人、托管人更换条件和程序的约定，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，管理人与托管人协商一致并提前公告后，可直接对相应内容进行修改和调整，无需召开份额持有人大会审议。

**第十五条 禁止行为**

15.1 本协议当事人禁止从事的行为，包括但不限于：

15.1.1 管理人、托管人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。

15.1.2 管理人不公平地对待其管理的不同集合计划财产，托管人不公平地对待其托管的不同集合计划财产。

15.1.3 管理人、托管人利用集合计划财产为份额持有人以外的第三人牟取利益。

15.1.4 管理人、托管人向份额持有人违规承诺收益或者承担损失。

15.1.5 管理人、托管人对他人泄漏集合计划运作和管理过程中任何尚未按法律法规规定的方式公开披露的信息。

15.1.6 管理人在没有充足资金的情况下向托管人发出投资指令和赎回、分红资金的划拨指令，或违规向托管人发出指令。

15.1.7 管理人、托管人在行政上、财务上不独立，其高级管理人员和其他从业人员相互兼职。

15.1.8 托管人私自动用或处分集合计划财产，根据管理人的合法指令、资管合同或托管协议的规定进行处分的除外。

15.1.9 集合计划财产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，但法律法规或中国证监会另有规定的除外；

（5）向集合计划管理人、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。

15.1.10 法律法规或监管部门取消或变更上述禁止性规定，如适用于本集合计划，管理人在履行适当程序后，可不受上述规定的限制或按变更后的规定执行。

**第十六条 托管协议的变更、终止与集合计划财产的清算**

16.1 托管协议的变更与终止

16.1.1 托管协议的变更程序

本协议双方当事人经协商一致，可以对协议的内容进行变更。变更后的托管协议，其内容不得与资管合同的规定有任何冲突。本托管协议的变更报中国证监会注册或备案。

16.1.2 托管协议终止的情形

发生以下情况，本托管协议终止：

（1）资管合同终止；

（2）集合计划托管人解散、依法被撤销、破产或由其他托管人接管集合计划资产；

（3）集合计划管理人解散、依法被撤销、破产或由其他管理人接管管理权；

（4）发生法律法规或资管合同规定的终止事项。

16.2 集合计划财产的清算

16.2.1 集合计划财产清算小组：

（1）自出现资管合同终止事由之日起 30 个工作日内成立集合计划财产清算小

组，管理人组织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）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。财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

（3）在集合计划财产清算过程中，管理人和托管人应各自履行职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行资管合同和本托管协议规定的义务，维护份额持有人的合法权益。

（4）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。

16.2.2 集合计划财产清算程序

资管合同终止，应当按法律法规和资管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）资管合同终止情形出现时，由财产清算小组统一接管集合计划财产；

（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，清算期限相应顺延。

16.2.3 清算费用

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

16.2.4 集合计划财产按下列顺序清偿：

（1）支付清算费用；

（2）交纳所欠税款；

（3）清偿集合计划债务；

（4）对集合计划剩余财产进行分配。

集合计划财产未按前款（1）—（3）项规定清偿前，不分配给份额持有人。

16.2.5 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；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，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。

16.2.6 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 15 年以上。

**第十七条 反商业贿赂条款**

17.1 管理人及托管人都清楚并愿意严格遵守中华人民共和国反商业贿赂的法律规定，双方都清楚任何形式的贿赂和贪渎行为都将触犯法律，并将受到法律的严惩。

17.2 管理人或托管人均不得向对方或对方经办人或其他相关人员索要、收受、提供、给予合同约定外的任何利益，包括但不限于明扣、暗扣、现金、购物卡、实物、有价证券、旅游或其他非物质性利益等，但如该等利益属于行业惯例或通常做法，则须在合同中明示。

17.3 管理人严格禁止经办人员的任何商业贿赂行为。经办人发生本条 17.2 款所列示的任何一种行为，都是违反管理人公司制度的，都将受到管理人公司制度和国家法律的惩处。

17.4 管理人郑重提示：管理人反对托管人或托管人经办人员为了本协议之目的与本协议以外的任何第三方发生 17.2 款所列示的任何一种行为，该等行为都是违反国家法律的行为，并将受到国家法律的惩处。

17.5 如因一方或一方经办人违反本条 17.2、17.2、17.4 款之规定，给对方造成损失的，应承担损害赔偿责任。

17.6 本条所称“其他相关人员”是指管理人及托管人经办人以外的与协议有直接或间接利益关系的人员，包括但不仅限于协议经办人的亲友。

**第十八条 反虚假宣传条款**

管理人、托管人双方均清楚并愿意严格遵守中华人民共和国《著作权法》、《商标法》、《专利法》、《反不正当竞争法》等知识产权类、民法典及广告法等相关法律的规定，双方均有权就本协议所约定事项以约定方式在约定范围内进行真实、合理的使用或宣传，但不得涉及协议所约定的保密内容。为避免商标侵权及不当宣传等风险的发生，双方均同意，在使用对方的商标、品牌、企业名称等进行宣传前，均须获得对方事先的书面认可，否则，不得进行此类使用或宣传。双方在此承诺，会积极响应对方提出的就合作事项的合理使用或宣传申请。双方均承认，未经对方事先书面同意而利用其商标、品牌及企业名称等进行商业宣传；虚构合作事项；夸大合作范围、内容、效果、规模、程度等，均属对本协议的违反，并可能因虚假宣传构成不正当竞争，守约方或被侵权人将保留追究相应法律责任的权利。

**第十九条 违约责任**

19.1 如果管理人或托管人不履行本托管协议或者履行本托管协议不符合约定的，应当承担违约责任。

19.2 因托管协议当事人违约给集合计划财产或者份额持有人造成损害的，应当分别对各自的行为依法承担赔偿责任，因共同行为给集合计划财产或者份额持有人造成损害的，应当承担连带赔偿责任。但是发生下列情况，当事人免责：

（1）不可抗力；

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

（3）管理人由于按照资管合同规定的投资原则投资或不投资而造成的损失等。

19.3 如果由于本协议一方当事人（以下简称“违约方”）的违约行为给集合计划财产或投资人造成损失，另一方当事人（以下简称“守约方”）有权利并且有义务代表集合计划对违约方进行追偿；如果由于违约方的违约行为导致守约方赔偿了该集合计划财产或投资人所遭受的损失，则守约方有权向违约方追索，违约方应赔偿和补偿守约方由此发生的所有成本、费用和支出，以及由此遭受的损失。

19.4 当事人一方违约，非违约方当事人在职责范围内有义务及时采取必要的措施，防止损失的扩大。没有采取适当措施致使损失进一步扩大的，不得就扩大的损失要求赔偿。非违约方因防止损失扩大而支出的合理费用由违约方承担。

19.5 违约行为虽已发生，但本托管协议能够继续履行的，在最大限度地保护份额持有人利益的前提下，管理人和托管人应当继续履行本协议。

19.6 由于管理人、托管人不可控制的因素导致业务出现差错，管理人和托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现错误的，由此造成集合计划财产或投资人损失，管理人和托管人免除赔偿责任。但是管理人和托管人应积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。

19.7 本协议所指损失均为直接损失。

**第二十条 争议解决方式**

因履行本协议发生的争议，由各方协商解决，协商不成的，任何一方均有权将争议提交管理人所在地有管辖权法院进行诉讼解决。争议处理期间，本协议当事人应恪守各自的职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行资管合同和本协议规定的义务，维护集合计划份额持有人的合法权益。

本协议受中国法律管辖。

**第二十一条 托管协议的效力**

20.1 管理人在向中国证监会申请变更平安证券稳健资本一号集合资产管理计划时提交的托管协议草案，应经托管协议当事人盖章以及双方法定代表人或授权代理人签字或盖章，协议当事人双方可能不时根据中国证监会的意见修改托管协议草案。托管协议以中国证监会批准的文本为正式文本。

20.2 本托管协议自协议签订之日起成立，自资管合同生效之日起生效。本托管协议的有效期自其生效之日起至该集合计划财产清算结果报中国证监会备案并公告之日止。

20.3 本托管协议自生效之日起对托管协议当事人具有同等的法律约束力。

20.4 本托管协议正本一式六份，除上报有关监管机构两份外，管理人和托管人分别持有两份，每份具有同等的法律效力。

**第二十二条 托管协议的签订**

22.1 本托管协议经管理人和托管人认可后，由该双方当事人在本托管协议上盖章，并由各自的法定代表人或授权代理人签字或盖章，并注明本托管协议的签订地点和签订日期。

**第二十三条 不可抗力**

23.1 如果本协议任何一方因受不可抗力事件影响而未能履行其在本协议下的全部或部分义务，该义务的履行在不可抗力事件妨碍其履行期间应予中止。

23.2 声称受到不可抗力事件影响的一方应尽可能在最短的时间内通过书面形式将不可抗力事件的发生通知其他当事人，并及时向其他当事人提供关于此种不可抗力事件的适当证据。声称不可抗力事件导致其对本协议的履行在客观上成为不可能或不实际的一方，有责任尽一切合理的努力消除或减轻此等不可抗力事件的影响。

23.3 不可抗力事件发生时，各方应立即通过友好协商决定如何执行本协议。不可抗力事件或其影响终止或消除后，各方须立即恢复履行各自在本协议项下的各项义务。

23.4 本条所述的不可抗力事件是指不能预见、不能避免并不能克服的客观情况。

**第二十四条 可分割性**

24.1 如果本协议任何约定依现行法律被确定为无效或无法实施，本协议的其他条款将继续有效。此种情况下，各方将积极协商以达成有效的约定，且该有效约定应尽可能接近原规定和本协议相应的精神和宗旨。

**第二十五条 通知与送达**

25.1 除本协议另有约定外，按本协议约定由任何一方发给其他方的正式通知或者书面通讯，应以挂号邮寄、图文传真、快递或者其他通讯形式发出，送至各方通知地址。

25.2 本协议各方的通知地址如下：

管理人：【平安证券】股份有限公司

联系人：【刁安然】

通信地址：【深圳市福田区益田路 5033 号平安金融中心南塔 23 层】

电话：【0755-36307490】

传真：【】

托管人：中信银行股份有限公司

联系人：【陈莹】

通信地址：【深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场 2 期北座 8 层】

电话：【0755-23962117】

传真：【010-58810930】

25.3 如采用挂号邮寄方式，上述文件或通知在投邮后第 4 日，即视为送达；如采用快递方式，上述文件或通知在投邮后第 2 日，即视为送达；如采用图文传真方式，发送成功回执所示之日，即视为送达。

25.4 如果联系方式之任何一项发生变更，相关方应在变更后 7 日内将更改后的联系方式按本条的约定书面通知对方。此后，本条约定的文件或通知应按变更后的联系方式送达，如相关方未能及时通知的，由此引发的全部不利后果由责任方承担。

（本页无正文，为《平安证券安赢添利半年滚动持有债券型集合资产管理计划托管协议》签署页）

管理人：平安证券股份有限公司（盖章）

法定代表人或授权代表（签字或盖章）：

托管人：中信银行股份有限公司（盖章）

法定代表人或授权代表（签字或盖章）：

签订地：

签订日期：　　年　　月　　日