

# 信达证券股份有限公司

## 信达价值精选一年持有期灵活配置 混合型集合资产管理计划 招募说明书 （更新）

集合计划管理人：信达证券股份有限公司

集合计划托管人：中国建设银行股份有限公司

2022年8月

## 重要提示

信达价值精选一年持有期灵活配置混合型集合资产管理计划由信达满堂红基金优选集合资产管理计划变更而来。信达满堂红基金优选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[2008]26号）、《信达满堂红基金优选集合资产管理计划资产管理合同》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，信达满堂红基金优选集合资产管理计划参照《中华人民共和国证券投资基金法》等公开募集证券投资基金相关法律、行政法规及中国证监会的规定进行变更，并将集合计划名称由原“信达满堂红基金优选集合资产管理计划”变更为“信达价值精选一年持有期灵活配置混合型集合资产管理计划”，变更后的《信达价值精选一年持有期灵活配置混合型集合资产管理计划资产管理合同》自集合计划管理人公告的生效之日起生效，原《信达满堂红基金优选集合资产管理计划资产管理合同》同日起失效。

集合计划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备案，但中国证监会对本集合计划募集的备案，并不表明其对本集合计划的价值和收益作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和集合计划合同等信息披露文件，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。

投资者承诺以真实身份参与集合计划，保证委托资产的来源及用途合法，并阅知本说明书和集合计划合同（包括合同签署条款）全文，了解相关权利、义务

和风险，愿意自行承担投资风险和损失。

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，投资者根据所持有的集合计划份额享受集合计划收益，同时承担相应的投资风险。本集合计划投资中的风险包括：因整体政治、经济、社会等环境因素对证券市场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，由于集合计划份额持有人连续大量赎回集合计划产生的流动性风险，集合计划管理人在集合计划管理实施过程中产生的积极管理风险，本集合计划的特定风险等。

本集合计划投资资产支持证券，资产支持证券是一种债券性质的金融工具。资产支持证券具有一定的价格波动风险、流动性风险、信用风险等风险。本公司将本着谨慎和控制风险的原则进行资产支持证券投资，请集合计划份额持有人关注包括投资资产支持证券可能导致的集合计划净值波动、流动性风险和信用风险在内的各项风险。

本集合计划为混合型集合资产管理计划，风险收益水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场型基金，属于中风险/收益的产品。

本集合计划的过往业绩并不预示其未来表现。集合计划管理人所管理的其他集合计划的业绩并不构成对本集合计划业绩表现的保证。管理人提醒投资者投资的“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。

本集合计划为逐笔计提业绩报酬型产品，且每日披露份额净值为提取业绩报酬前集合计划份额净值。由于赎回或者集合计划终止清算时管理人可能计提业绩报酬，投资者实际赎回/清算份额净值可能低于每日披露的产品份额净值。投资者实际赎回金额/清算金额，以登记机构确认数据为准。

本次更新招募说明书，更新了集合计划管理人高级管理人员信息、投资经理信息、管理人投资决策委员会人员信息、托管人信息及代销机构相关信息，更新内容截止日为2022年8月16日。除非另有说明，本招募说明书（更新）所载其他内容截止日为2022年8月16日，有关财务数据和净值表现截止日为2022年6月30日(财务数据未经会计师事务所审计)。

---

---

## 目 录

一、绪言 .....	1
二、释义 .....	2
三、集合计划管理人 .....	7
四、集合计划托管人 .....	18
五、相关服务机构 .....	21
六、集合计划的历史沿革 .....	26
七、集合计划的存续 .....	26
八、集合计划份额的申购、赎回与转换 .....	27
九、集合计划的投资 .....	39
十、集合计划的投资业绩 .....	50
十一、集合计划的财产 .....	52
十二、集合计划资产估值 .....	53
十三、集合计划的收益分配 .....	60
十四、集合计划的费用与税收 .....	62
十五、集合计划的会计与审计 .....	65
十六、集合计划的信息披露 .....	66
十七、风险揭示 .....	73
十八、集合计划合同的变更、终止与集合计划财产的清算 .....	82
十九、集合计划合同的内容摘要 .....	83
二十、集合计划托管协议的内容摘要 .....	110
二十一、对集合计划份额持有人的服务 .....	123
二十二、其他应披露事项 .....	124
二十三、招募说明书存放及查阅方式 .....	125
二十四、备查文件 .....	125

## 一、绪言

《信达价值精选一年持有期灵活配置混合型集合资产管理计划招募说明书》（以下简称“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》”）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性风险管理规定》”）及其他有关规定以及《信达价值精选一年持有期灵活配置混合型集合资产管理计划资产管理合同》（以下简称“集合计划合同”）编写。

本招募说明书阐述了本集合计划的投资目标、策略、风险、费率等与投资者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本招募说明书。

本集合计划管理人承诺本招募说明书不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，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。集合计划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。

本招募说明书根据本集合计划的集合计划合同编写，并经中国证监会注册。集合计划合同是约定集合计划合同当事人之间基本权利义务的法律文件，其他与本集合计划相关的涉及集合计划合同当事人之间权利义务关系的任何文件或表述，均以集合计划合同为准。集合计划合同的当事人包括集合计划管理人、集合计划托管人和集合计划份额持有人。集合计划投资者自依集合计划合同取得本集合计划份额，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其对集合计划合同的承认和接受。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为必要条件。集合计划合同当事人并按照《基金法》、集合计划合同及其他有关规定享有权利、承担义务。集合计划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。

## 二、释义

在本招募说明书中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

- 1、 集合计划或本集合计划：指信达价值精选一年持有期灵活配置混合型集合资产管理计划
- 2、 集合计划管理人：指信达证券股份有限公司
- 3、 集合计划托管人：指中国建设银行股份有限公司
- 4、 集合计划合同或本合同：指《信达价值精选一年持有期灵活配置混合型集合资产管理计划资产管理合同》及对本合同的任何有效修订和补充
- 5、 托管协议：指集合计划管理人与集合计划托管人就本集合计划签订之《信达价值精选一年持有期灵活配置混合型集合资产管理计划托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充
- 6、 招募说明书：指《信达价值精选一年持有期灵活配置混合型集合资产管理计划招募说明书》及其定期的更新
- 7、 集合计划产品资料概要：指《信达信利一年持有债券型集合资产管理计划产品资料概要》及其更新
- 8、 法律法规：指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、规范性文件、司法解释、行政规章以及其他对集合计划合同当事人有约束力的决定、决议、通知等
- 9、 《基金法》：指 2003 年 10 月 28 日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，经 2012 年 12 月 28 日第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订，自 2013 年 6 月 1 日起实施，并经 2015 年 4 月 24 日第十二届全国人民代表大会常务委员会第十四次会议《全国人民代表大会常务委员会关于修改〈中华人民共和国港口法〉等七部法律的决定》修正的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 10、 《销售办法》：指中国证监会 2013 年 3 月 15 日颁布、同年 6 月 1 日实施的《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 11、 《信息披露办法》：指中国证监会 2019 年 7 月 26 日颁布、同年 9 月 1 日实施的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

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

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

14、中国证监会：指中国证券监督管理委员会

15、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

16、集合计划合同当事人：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，包括集合计划管理人、集合计划托管人和集合计划份额持有人

17、个人投资者：指依据有关法律法规规定可投资于证券投资基金的自然人

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

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

20、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

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

22、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

23、集合计划销售业务：指集合计划管理人或销售机构宣传推介集合计划，发售集合计划份额，办理集合计划份额的申购、赎回、转换、非交易过户、转托

管及定期定额投资等业务。

24、销售机构：指信达证券股份有限公司以及符合《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集合计划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

25、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

26、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

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

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

29、集合计划合同生效日：指根据《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》变更后的《信达价值精选一年持有期灵活配置混合型集合资产管理计划资产管理合同》的生效日

30、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

31、存续期：指集合计划合同生效至终止之间的期限

32、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

33、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

34、T+n日：指自T日起第n个工作日(不包含T日)

35、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

36、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

37、《业务规则》：指本集合计划登记机构办理登记业务的相应规则



38、 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

39、 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规定的条件要求将集合计划份额兑换为现金的行为

40、 集合计划转换：指集合计划份额持有人按照本集合计划合同和集合计划管理人届时有效公告规定的条件，申请将其持有集合计划管理人管理的、某一集合计划的集合计划份额转换为集合计划管理人管理的其他集合计划份额的行为

41、 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

42、 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

43、 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%

44、 元：指人民币元

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

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

47、 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

48、 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

49、 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

50、 指定媒介：指中国证监会指定的用以进行信息披露的全国性报刊及指

定互联网网站（包括集合计划管理人网站、集合计划托管人网站、中国证监会基金电子披露网站）等媒介

51、 **集合计划份额类别：**根据申购、赎回规则、业绩报酬的不同将集合计划份额分为 A 类计划份额和 B 类计划份额，两类份额分别设置代码，并分别计算和公告集合计划份额净值和集合计划份额累计净值

52、 **A 类计划份额：**指对于投资者依据原《信达满堂红基金优选集合资产管理计划资产管理合同》参与集合计划获得的信达满堂红基金优选集合资产管理计划份额，自本资产管理合同生效之日起投资者持有的上述份额全部自动转换为本集合计划 A 类份额。在本集合计划存续期间，A 类计划份额只开放赎回，不开放申购

53、 **B 类计划份额：**指自本资管合同生效之日起，投资者依据本资产管理合同申购获得的集合计划份额。本集合计划对 B 类计划份额设置最短持有期限

54、 **最短持有期限：**指本集合计划对集合计划份额持有人申购持有的 B 类计划份额设置一年的最短持有期限。即对每份申购持有的 B 类计划份额，最短持有期限为自 B 类计划份额申购确认日起（含）至 B 类计划份额申购确认日的一年对日（如不存在该对日或该对日为非工作日的，则顺延至下一工作日）的前一日的期间。在最短持有期限内，B 类计划份额不能赎回；在最短持有期限到期后的下一个工作日起（含），B 类计划份额持有人方可就该计划份额提出赎回申请

55、 **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

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

57、 **不可抗力：**指本合同当事人不能预见、不能避免且不能克服、使集合

计划合同当事人无法全部或部分履行集合计划合同的任何事件,包括但不限于洪水、地震及其他自然灾害、战争、骚乱、火灾、政府征用、没收、恐怖袭击、传染病传播、法律法规变化、突发停电或其他突发事件、证券交易所非正常暂停或停止交易

58、大集合计划：指信达证券股份有限公司设立管理的、投资者人数不受200人限制、受《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》规范的集合资产管理计划

### 三、集合计划管理人

#### （一）集合计划管理人概况

名称：信达证券股份有限公司

住所：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼

办公地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼

设立日期：2007年9月4日

法定代表人：祝瑞敏

客户服务电话：95321

传真：010-63081240

信达证券股份有限公司注册资本为2,918,700,000元，公司股权结构如下：

序号	股东名称	持股数（万股）	持股比例（%）
1	中国信达资产管理股份有限公司	255,140.00	87.42
2	中泰创业投资（深圳）有限公司	14,000.00	4.80
3	中天金投有限公司	6,000.00	2.06
4	武汉昊天光电有限公司	6,000.00	2.06
5	深圳市前海园区运营有限公司	5,000.00	1.71
6	永信国际投资（集团）有限公司	4,000.00	1.37
7	中海信托股份有限公司	1,530.00	0.52
8	中国中材集团有限公司	200.00	0.07
	合计	291,870.00	100.00

#### （二）主要人员情况

## 1、集合计划管理人董事、监事、及其他高级管理人员基本情况

序号	职务	姓名	简历
1	董事长	艾久超	艾久超先生现任本公司董事长，同时担任中国信达资产管理股份有限公司董事会秘书。艾久超先生自1989年6月至1993年4月任职于中国统配煤矿总公司办公厅；自1993年4月至2000年9月于国家煤炭工业部（后改设为国家煤炭工业局）政策法规司与行业管理司历任副处长、处长；自2000年9月加入中国信达资产管理股份有限公司，曾任总裁办公室副主任、总裁办公室副主任（主任级）兼合规管理部总经理、董事会办公室主任，自2016年4月至今担任中国信达资产管理股份有限公司董事会秘书，并于2016年4月至2017年6月间兼任战略发展部（金融风险研究中心）总经理（主任）。自2020年11月起担任本公司董事长。艾久超先生取得了中国矿业大学高级管理人员工商管理硕士学位，具有高级经济师职称。
2	董事、 总 经 理、法 定代 表人	祝瑞敏	祝瑞敏女士现任本公司党委书记、董事、总经理，并兼任信达澳亚基金管理有限公司董事长和信达国际控股有限公司董事会主席、执行董事。祝瑞敏女士自2007年4月至2012年4月任职东兴证券股份有限公司，曾任财务部总经理、公司助理总经理、公司副总经理；自2012年4月至2019年4月任中国银河证券股份有限公司首席财务官；自2019年4月至2020年11月担任本公司党委副书记，自2019年7月起担任本公司董事，自2019年9月起担任本公司总经理，自2019年12月起兼任信达澳亚基金管理有限公司董事长，自2020年11月起担任本公司党委书记，自2021年4月起兼任信达国际控股有限公司董事会主席、执行董事。祝瑞敏女士取得了中国人民大学管理学博士学位，具有高级会计师职称。
3	董事	刘力一	刘力一先生现任本公司董事，同时担任中国信达资产管理股份有限公司业务管理部业务指导处处长。刘力一先生自2006年7月至2007年8月任恩施金源融资担保有限公司会计；2007年9月至2010年6月攻读中南财经政法大学会计学硕士研究生；2010年7月至2011年9月任中国长江三峡集团溪洛渡工程建设部财务会计；2011年10月至2012年8月任恩施金源融资担保有限公司财务经理；2012年9月至2015年6月攻读中国人民大学会计学博士研究生；2015年6月至2015年12月任英大基金管理有限公司风控经理；2016年1月至2016年4月任韬蕴资本集团有限公司风控经理；2016年5月至2018年6月任中国信达资产管理股份有限公司博士后。2018年7月至今，任中国信达资产管理股份有限公司业务管理部业务指导处副处长、高级经理。刘力一先生取得了中国人民大学管理学博士研究生学位，具有中级会计师职称。
4	董事	宋永辉	宋永辉女士现任本公司董事，同时担任中国信达资产管理股份有限公司计划财务部税务管理处处长兼计划财务部综合处处长。宋永辉女士自2001年7月至2003年8月任大庆油田有限责任公司会计；2003年9月至2005年6月在中央财经大

			学攻读会计学硕士研究生；2005年7月至2006年10月任中企国际经贸有限责任公司会计；2006年11月至2009年3月任威乐（中国）水泵系统有限责任公司会计；自2009年4月加入中国信达资产管理股份有限公司，曾任计划财务部管理会计、税务管理处处长、高级经理，并兼任综合处处长；自2021年6月起担任本公司董事。宋永辉女士取得了中央财经大学会计学硕士学位，具有高级会计师职称和中国注册会计师资格。
5	独立董事	张建平	张建平先生现任对外经济贸易大学国际商学院教授、博士生导师、对外经济贸易大学资本市场与投融资研究中心主任，现为本公司独立董事。张建平先生自1991年7月起在对外经济贸易大学国际商学院任教，曾任助教、讲师、副教授、会计与财务管理学系主任、国际商学院副院长。张建平先生目前还担任中国第一重型机械股份有限公司独立董事、深圳世联行集团股份有限公司独立董事、湖南华菱钢铁股份有限公司独立董事、北京万通新发展集团股份有限公司独立董事、北京嘉承金信投资有限公司董事、中远海运控股股份有限公司独立监事。张建平先生曾担任北京大学国发院、上海交通大学、浙江大学、长江商学院、东北财经大学、武汉大学、中南财经大学、北京科技大学和德克萨斯大学（美国）等十多家大学的EMBA“高级财务管理”客座教授，曾获得10项国家级或省部级荣誉和4项校级荣誉，出版（包括合编）16本著作，发表了三十多篇科研论文，主持过两项省部级课题。张建平先生取得了对外经济贸易大学经济学博士学位。
6	独立董事	朱利民	朱利民先生现任本公司独立董事。朱利民先生自1986年7月至1994年8月任职于国家体改委，曾任试点司、综合规划试点司副处长、处长；自1994年9月至1997年8月任国家体改委下属中华企业股份制咨询公司董事、副总经理；自1997年9月至2008年12月任职于中国证监会，曾任稽查局副局长、派出机构工作协调部主任兼投资者教育办公室主任；自2009年1月至2013年10月任中信建投证券有限责任公司（后改制为中信建投证券股份有限公司）合规负责人、监事会主席；自2017年3月起任本公司独立董事。朱利民先生目前还担任航天信息股份有限公司独立董事、华润化学材料科技股份有限公司独立董事、兖矿能源集团股份有限公司（原“兖州煤业股份有限公司”）独立董事、焦点科技股份有限公司董事。朱利民先生取得了中国人民大学经济学硕士学位。
7	独立董事	刘俊勇	刘俊勇先生现任中央财经大学会计学院教授、博士生导师、党委书记和中央财经大学中国管理会计研究与发展中心主任，现为本公司独立董事。刘俊勇先生自1992年7月至1999年9月曾任教于河南财经学院（后更名为河南财经政法大学）会计系；自1999年9月至2005年6月于中国人民大学商学院学习；2005年7月至今，任教于中央财经大学，曾任讲师、副教授、管理会计系主任、管理会计研究所所长、会计学院副院长。刘俊勇先生目前还担任华润三九医药股份有限公司独立

			董事、深圳市槟城电子有限公司独立董事。刘俊勇先生是财政部管理会计咨询专家、财政部会计名家培养工程入选人、北京市管理会计咨询专家、中国卫生经济学会卫生财会分会副会长。曾主持国家社科基金项目、省部级以及企业横向课题等20余项，翻译或编著《平衡计分卡》《公司业绩评价与激励机制》等著作10余部。刘俊勇先生取得了中国人民大学管理学博士学位，具有中国注册会计师与中国注册资产评估师资格。
8	监事长	张德印	张德印先生现任本公司党委副书记、监事长。张德印先生自1988年9月至1996年6月任中国建设银行山东省分行筹资储蓄处、信用卡业务部职员、主任科员；1996年6月至1998年7月任中国建设银行山东省惠民县支行副行长；1998年7月至1999年9月任中国建设银行山东省分行资产保全部主任科员；1999年9月至2006年6月任中国信达资产管理公司济南办事处，高级副经理、高级经理、部门负责人；2006年6月至2008年8月任中国信达资产管理公司资产处置审核委员会高级经理、处长；2008年8月至2011年6月任中国信达资产管理公司业务审核部总经理助理；2011年6月至2014年1月任中国信达资产管理股份有限公司山东省分公司副总经理；2014年1月至2015年10月任中国信达资产管理股份有限公司法律合规部副总经理；2015年10月至2021年4月任中国信达资产管理股份有限公司业务审核部总经理；2021年4月至今担任本公司党委副书记、监事；2021年5月至今担任本公司监事长。张德印先生取得了山东大学经济学系政治经济学专业学士学位，具有高级经济师职称。
9	监事	刘显忠	刘显忠先生现为本公司监事，现任中海信托党委委员、中海基金管理有限公司董事长。刘显忠先生自1994年5月至2005年6月任中国海洋石油总公司计划财务部国资处资产评估岗职员、主管、信息处长、信息管理经理；2005年7月至2016年10月，历任中海石油（中国）有限公司资本市场管理经理、资本市场处处长兼媒体与公共关系处长、投资者关系部媒体与公共关系处处长；2016年11月至2021年9月，担任中海信托财务总监、党委委员；自2021年9月至今，担任中海信托党委委员、中海基金管理有限公司董事长。自2018年3月起担任本公司监事。刘显忠先生取得中央财政金融学院财政学专业硕士学位，具有高级会计师职称与特许金融分析师资格。
10	职工监事	陆韶瞻	陆韶瞻先生现任本公司职工监事、风险管理部部门总经理。陆韶瞻先生自1997年8月至2007年8月任金谷信托证券营业部负责人；自2007年9月至2015年3月任本公司合规与风险管理部副总经理；自2015年3月至今任本公司风险管理部部门总经理。陆韶瞻先生取得了中国人民大学工商管理硕士学位。
11	职工监事	申苗	申苗女士现任本公司职工监事、稽核审计部副总经理。申苗女士自1994年7月至1998年8月任职于北京证券交易中心

			清算部；自 1998 年 8 月至 2008 年 7 月任金谷信托证券总部财务经理；自 2008 年 8 月起任本公司稽核审计部副总经理。申苗女士取得了中国社会科学院研究生院经济学硕士学位，具有高级会计师职称与注册会计师、国际注册内部审计师资格。
12	职工监事	郑凡轩	郑凡轩女士现任本公司职工监事、法律合规部法律总监。郑凡轩女士自 2005 年 8 月至 2007 年 1 月为北京市铭泰律师事务所律师；自 2007 年 1 月至 2008 年 6 月为北京国枫律师事务所律师；自 2008 年 6 月至 2014 年 5 月为北京市铭泰律师事务所律师，自 2014 年 5 月加入本公司以来，历任法律合规部法务经理、法律总监。郑凡轩女士取得了四川大学法学硕士学位，具有法律职业资格。
13	副总经理	邓强	邓强先生现任本公司副总经理。邓强先生自 1987 年 7 月至 1997 年 7 月任职于中国建设银行，曾任南京市分行职员、总行信托投资公司投资租赁部副总经理、北京建信股份有限公司副总经理、委托业务部副总经理；自 1997 年 7 月至 2007 年 7 月历任新疆宏源信托投资股份有限公司上海证券营业部总经理、宏源证券股份有限公司公司总经理助理兼上海管理总部总经理、公司总经理助理兼华东业务总部总经理；自 2007 年 7 月至 2007 年 9 月任本公司筹备组成员，自 2007 年 9 月以来，曾任本公司总经理助理、副总经理，并曾兼任信达期货董事长，自 2020 年 7 月至 2021 年 4 月任本公司副总经理、首席风险官，自 2021 年 4 月至今任本公司副总经理。邓强先生取得了华中科技大学技术经济专业学士学位。
14	合规总监、首席风险官	吴立光	吴立光先生现任本公司合规总监、首席风险官。吴立光先生自 1993 年 1 月至 1996 年 4 月，曾任国家审计署外资运用审计司副主任科员、主任科员；自 1996 年 4 月至 2009 年 1 月，就职于中国证监会，历任稽查局主任科员、副处长、上市公司监管部副处长、调研员；自 2009 年 1 月加入本公司以来任本公司合规总监，自 2019 年 6 月至 2020 年 7 月、2021 年 4 月至今兼任本公司首席风险官。吴立光先生取得了南开大学世界经济专业博士学位，具有中国注册会计师资格。
15	董事会秘书、总经理助理	商健	商健先生现任本公司董事会秘书、总经理助理，并兼任信达期货董事长。商健先生自 1986 年 7 月至 1993 年 5 月任西安理工大学教师；自 1993 年 5 月至 2002 年 7 月任职于陕西省国际信托投资股份有限公司，历任证券处职员、办公室秘书、董事会办公室副主任、西安高新技术产业开发区证券营业部总经理、上海漕东支路证券营业部总经理、西安东大街证券营业部总经理；自 2002 年 7 月至 2007 年 7 月曾任健桥证券股份有限公司经纪业务总部总经理、公司总裁助理兼经纪业务总部总经理、总稽核。自 2007 年 7 月至 2007 年 9 月任本公司筹备组成员，自 2007 年 9 月加入本公司以来，商健先生先后担任南方运营管理中心职员、东北运营管理中心副总经理、合规与风险管理部副总经理、经纪管理部总经理、合规与风险管理部总经理、风险总监兼法律合规部总经理、证券经纪事业部总经理、

			首席风险官等职务。自 2021 年 10 月至今担任本公司总经理助理，自 2022 年 4 月至今兼任信达期货董事长。商健先生取得了西安理工大学水力发电专业硕士学位。
16	首席信息官、总经理助理	俞仕龙	俞仕龙先生现任本公司首席信息官、总经理助理，并担任信息技术中心、运营管理部、战略客户部部门总经理，以及兼任信达创新执行董事、总经理，信风投资董事长。俞仕龙先生自 2000 年 9 月至 2013 年 7 月于闽发证券股份有限公司（后改为“东兴证券股份有限公司”）任研发部经理；自 2013 年 7 月至 2014 年 2 月于中信建投证券信息技术部任高级副总裁；自 2014 年 2 月至 2019 年 8 月于太平洋证券股份有限公司任 IT 总监；自 2019 年 8 月至今担任本公司信息技术中心部门总经理，自 2020 年 5 月至今担任本公司首席信息官，自 2021 年 1 月至今担任本公司运营管理部总经理，自 2021 年 10 月至今担任本公司总经理助理，自 2021 年 11 月至今担任本公司战略客户部总经理，自 2022 年 2 月至今兼任信达创新执行董事、总经理，自 2022 年 3 月至今兼任信风投资董事长。俞仕龙先生取得了北京交通大学软件工程专业硕士学位。
17	财务总监	张毅	张毅先生现任本公司财务总监、计划财务部总经理，并兼任信达国际执行董事、行政总裁。张毅先生自 2001 年 7 月至 2016 年 9 月任职中国国际金融股份有限公司，曾任财务部经理、风险管理部副总经理、运营支持部执行总经理、综合办公室执行总经理等职务；自 2017 年 1 月至 2018 年 10 月任北京中科金财科技股份有限公司首席风控官；自 2018 年 10 月至 2019 年 6 月任上海百川金智智能科技有限公司执行董事；自 2019 年 9 月至 2020 年 8 月任本公司计划资金部总经理；自 2020 年 8 月至 2020 年 11 月任本公司计划资金部总经理兼财务会计部总经理；自 2020 年 11 月至今任本公司计划财务部总经理；自 2021 年 4 月至今兼任信达国际执行董事、行政总裁；自 2022 年 4 月至今任本公司财务总监。张毅先生取得了清华大学会计学（国际会计）专业管理学学士学位，具有特许注册金融分析师和金融风险管理师资格。

## 2、资产管理业务投资决策委员会成员

主任：俞仕龙，信达证券股份有限公司首席信息官、总经理助理

常务副主任：万颖，信达证券股份有限公司资产管理事业部总经理

常任委员：

徐华，信达证券股份有限公司资产管理事业部固收组负责人

杨珏，信达证券股份有限公司资产管理事业部风控岗

戴岭，信达证券股份有限公司资产管理事业部集团协同团队负责人

王鑫，信达证券股份有限公司资产管理事业部资本市场团队负责人



李敏，信达证券股份有限公司资产管理事业部产品合规组负责人

陈巧玲，信达证券股份有限公司资产管理事业部权益、量化投资总监

庞正，信达证券股份有限公司资产管理事业部投资经理

唐国磊，信达证券股份有限公司资产管理事业部投资经理

专业委员：

李一爽，信达证券股份有限公司研究开发中心固定收益首席分析师

樊继拓，信达证券股份有限公司研究开发中心策略首席分析师

解运亮，信达证券股份有限公司研究开发中心宏观首席分析师

### 3、本集合计划的投资经理

唐国磊，法国巴黎第十一大学物理学博士。2011年6月加入中国国际期货有限公司，历任资产管理部量化分析师、投资经理。2015年6月加入信达证券资产管理事业部，历任量化分析师、投资经理。投资经验较为丰富，曾参与可转债系列、量化对冲系列产品的策略开发和投研工作，在量化投资策略、低风险投资策略方面有较深的研究和投资实践。已取得基金从业资格，且最近三年未被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚。现任信达添利三个月持有期债券型集合资产管理计划投资经理（自2022年1月6日起任职）、信达信利六个月持有期债券型集合资产管理计划的投资经理（自2022年1月6日起任职）、信达价值精选一年持有期灵活配置混合型集合资产管理计划投资经理（自2022年8月16日起任职）、信达睿益鑫享混合型集合资产管理计划（自2022年8月16日起任职）。

历任基金经理：朱振坤，任职时间为2021年3月1日至2022年8月15日；薛宇，任职时间为2021年4月8日至2021年6月21日。

4、上述人员之间不存在近亲属关系。

#### （三）集合计划管理人的职责

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集合计划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、依法接受集合计划托管人的监督；

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资产净值，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、中期和年度集合计划报告；

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 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集合计划托管人、集合计划份额持有人依法召集集合计划份额持有人大会；

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

17、确保需要向集合计划投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出，并且保证投资者能够按照《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集合计划托管人；

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、监督集合计划托管人按法律法规和《集合计划合同》规定履行自己的义务，集合计划托管人违反《集合计划合同》造成集合计划财产损失时，集合计划管理人应为集合计划份额持有人利益向集合计划托管人追偿；

22、当集合计划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、以集合计划管理人名义，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）集合计划管理人承诺

1、本集合计划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、策略及限制等全权处理本集合计划的投资。

2、本集合计划管理人不得从事违反《中华人民共和国证券法》的行为，并建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反《中华人民共和国证券法》行为的发生。

3、本集合计划管理人不得从事违反《基金法》的行为，并建立健全内部控制制度，采取有效措施，保证集合计划财产不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）向集合计划管理人、集合计划托管人出资。

（5）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。

（6）依照法律法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他活动。

法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本集合计划，则本集合计划投资不再受相关限制。

4、本集合计划管理人将加强人员管理，强化职业操守，督促和约束员工遵守国家有关法律、法规及行业规范，诚实信用、勤勉尽责，不从事以下行为：

（1）将其固有财产或者他人财产混同于集合计划财产从事证券投资。

（2）不公平地对待其管理的不同集合计划财产。

（3）利用集合计划财产为集合计划份额持有人以外的第三人牟取利益。

（4）向集合计划份额持有人违规承诺收益或者承担损失。

（5）依照法律、行政法规有关规定，由国务院证券监督管理机构规定禁止的其他行为。

#### 5、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利益。

（2）不利用职务之便为自己、被代理人、被代表人、受雇人或任何其他第三人谋取不当利益。

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

#### （五）集合计划管理人的内部控制制度

集合计划管理人根据全面性原则、有效性原则、独立性原则、相互制约原则、防火墙原则和成本收益原则建立了一套比较完整的内部控制体系。该内部控制体系由一系列业务管理制度及相应的业务处理、控制程序组成，具体包括控制环境、风险评估、控制活动、内部监控等要素。

#### 1、控制环境

良好的控制环境包括科学的公司治理、有效的监督管理、合理的组织结构和有力的控制文化。

（1）公司建立了总经理办公会——资产管理业务投资决策委员会——资产管理事业部——大集合业务部四级决策体系，按照授权原则有效控制风险；

（2）公司各部门之间有明确的授权分工，既互相合作，又互相制衡，形成

了合理的组织架构；

（3）公司坚持稳健经营和规范运作，重视员工的合规守法意识和职业道德培养。

## 2、风险评估

公司各层面和各业务部门在确定各自的目标后，对影响目标实现的风险因素进行分析。对于不可控风险，风险评估的目的是决定是否承担该风险或减少相关业务；对于可控风险，风险评估的目的是分析如何通过制度安排来控制风险程度。风险评估还包括各业务部门对日常工作中新出现的风险进行再评估并完善相应的制度。

## 3、控制活动

公司对投资、会计、技术系统和人力资源等主要业务制定了严格的控制制度。在业务管理制度上，做到了业务流程科学、合理和标准化；在岗位分工上，做到了分工合理、职责明确，不相容的职务、岗位分离设置、相互检查、相互制约。

### （1）投资控制制度

①投资决策与执行相分离。公司资产管理业务投资决策体系为：资产管理业务投资决策委员会——资产管理事业部，资产管理事业部投资经理在授权范围内实施投资策略、调整投资策略并下达投资指令；交易员负责执行投资指令。

②禁止性控制。根据法律、法规和公司相关规定，集合资产管理计划禁止投资受限制的证券并禁止从事受限制的行为。公司资产管理事业部风控岗通过恒生投资交易系统 O3.2 设置风控参数，每日监控。

③多重监控和反馈。公司资产管理事业部交易员对投资经理下达的投资指令进行一线监控；风控岗配合公司风险管理部进行事中、事后监控。在监控过程中如发现异常情况及时反馈并督促调整。

### （2）会计控制制度

①建立了资产管理计划会计核算制度及相应操作流程，确保会计业务有章可循；

②制定了完善的档案保管和资料交接制度。

### （3）技术系统控制制度

为保证技术系统的安全稳定运行，公司在信息系统测试、数据管理、用户及密码管理、资料管理、运维变更、机房管理等方面制定了较为完善的制度。

#### （4）人力资源管理制度

公司建立了科学的职务聘任制度、培训制度、考核制度、薪酬制度等人事管理制度，确保人力资源的有效管理。特别的，公司资产管理事业部就大集合投资经理的考核单独制定了一套绩效考核制度。

#### （5）监察制度

公司设立稽核审计部，负责公司的稽核审计工作；设立法律合规部，负责公司的法律事务。

### 4、内部监控

公司设立了独立于各业务部门的法律合规部和稽核审计部，通过定期或不定期监察，评价公司内部控制制度合理性、完备性和有效性，监督公司各项内部控制制度的执行情况，确保公司各项经营管理活动的有效运行。

### 5、集合计划管理人关于内部控制的声明

- （1）上述管理内部控制的披露真实、准确；
- （2）本公司承诺将根据市场环境的变化及公司的发展不断完善内部控制制度。

## 四、集合计划托管人

### 一、基金托管人情况

#### （一）基本情况

名称：中国建设银行股份有限公司(简称：中国建设银行)

住所：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人：田国立

成立时间：2004 年 09 月 17 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

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]12号

联系人：李申

联系电话：(021)6063 7102

## （二）主要人员情况

中国建设银行总行设资产托管业务部，下设综合处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、全球托管处、养老金托管处、新兴业务处、运营管理处、跨境托管运营处、社保及大客户服务处、托管应用系统支持处、合规监督处等12个职能处室，在安徽合肥设有托管运营中心，在上海设有托管运营中心上海分中心，共有员工300余人。自2007年起，托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计，并已经成为常规化的内控工作手段。

## （三）基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履行托管人的各项职责，切实维护资产持有人的合法权益，为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展，中国建设银行托管资产规模不断扩大，托管业务品种不断增加，已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、(R)QFII、(R)QDII、企业年金、存托业务等产品在内的托管业务体系，是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至2022年1季度末，中国建设银行已托管1203只证券投资基金。中国建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平，赢得了业内的高度认同。截至目前，中国建设银行先后多次被《全球托管人》、《财资》、《环球金融》杂志及《中国基金报》评选为“最佳托管银行”、连续多年荣获中央国债登记结算有限责任公司（中债）“优秀资产托管机构”、银行间市场清算所股份有限公司（上清所）“优秀托管银行”奖项、并在2017、2019、2020、2021年分别荣获《亚洲银行家》颁发的“最佳托管系统实施奖”、“中国年度托管业务科技实施奖”、“中国年度托管银行（大型银行）”以及“中国最佳数字化资产托管银行”奖项。

## 二、基金托管人的内部控制制度

### （一）内部控制目标

作为基金托管人，中国建设银行严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行

业监管规章和本行内有关管理规定，守法经营、规范运作、严格检查，确保业务的稳健运行，保证基金财产的安全完整，确保有关信息的真实、准确、完整、及时，保护基金份额持有人的合法权益。

## （二）内部控制组织结构

中国建设银行设有风险与内控管理委员会，负责全行风险管理与内部控制工作，对托管业务风险控制工作进行检查指导。资产托管业务部配备了专职内控合规人员负责托管业务的内控合规工作，具有独立行使内控合规工作职权和能力。

## （三）内部控制制度及措施

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

## 三、基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

### （一）监督方法

依照《基金法》及其配套法规和基金合同的约定，监督所托管基金的投资运作。利用自行开发的“新一代托管应用监督子系统”，严格按照现行法律法规以及基金合同规定，对基金管理人运作基金的投资比例、投资范围、投资组合等情况进行监督。在日常为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中，对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对各基金费用的提取与开支情况进行检查监督。

### （二）监督流程

1.每工作日按时通过新一代托管应用监督子系统，对各基金投资运作比例控制等情况进行监控，如发现投资异常情况，向基金管理人进行风险提示，与基金管理人进行情况核实，督促其纠正，如有重大异常事项及时报告中国证监会。

2.收到基金管理人的划款指令后，对指令要素等内容进行核查。

3.通过技术或非技术手段发现基金涉嫌违规交易，电话或书面要求基金管理



人进行解释或举证，如有必要将及时报告中国证监会。

## 五、相关服务机构

### （一）销售机构

#### 1、信达证券股份有限公司

住所：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼

办公地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼

设立日期：2007年9月4日

法定代表人：祝瑞敏

客户服务电话：95321

传真：010-63081240

网址：[www.cindasc.com](http://www.cindasc.com)

#### 2、代销机构：

本集合计划B类份额的代销机构包括：

##### （1）浙江同花顺基金销售有限公司

法定代表人：吴强

注册地址：浙江省杭州市文二西路1号903室

邮编：310000

联系人：洪泓

客服电话：952555

传真：0571-88911818-8002

网址：[www.5ifund.com](http://www.5ifund.com)

##### （2）南洋商业银行（中国）有限公司

法定代表人：孙建东

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区浦明路898号13层至16层、18层至20层

邮编：200120

联系人：王晓明

客服电话：400-820-7898

网址：[www.ncbchina.cn](http://www.ncbchina.cn)

(3) 上海天天基金销售有限公司

法定代表人：其实

注册地址：上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼二层

附近公司

邮编：200030

联系人：郭力嘉

客服电话：95021

传真：021-64383798

网址：[www.1234567.com.cn](http://www.1234567.com.cn)

(4) 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

注册地址：深圳市福田区梅林街道梅都社区中康路 136 号深圳新一代产业园  
2 栋 3401

法定代表人：张斌

邮编：518028

联系人：孙博文

客服电话：4001661188

传真：010-83363072

官方网站：<http://www.new-rand.cn>

(5) 京东肯特瑞基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区知春路 76 号（写字楼）1 号楼 4 层 1-7-2

法定代表人：邹保威

联系人：苏湘然

客服电话：400-098-8511

传真：010-89181111

网址：<https://kenterui.jd.com>

(6) 北京汇成基金销售有限公司

注册地址：北京市西城区宣武门外大街甲 1 号 4 层 401-2

法定代表人：王伟刚

邮编：100044

联系人：史春晖

客服电话：400-619-9059

传真：010-62680827

网址：[www.hcfunds.com](http://www.hcfunds.com)

（7）方德保险代理销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区东城区崇文门外 16 号 1 幢 8 层 802

法定代表人：刑耀

联系人：郑宏蕊

客服电话：010-64068617

传真：010-64068776

网址：[www.fdsure.com](http://www.fdsure.com)

（8）大连网金基金销售有限公司

注册地址：辽宁省大连市沙河口区体坛路 22 号诺德大厦 2 层 202 室

法定代表人：樊怀东

邮编：116021

联系人：辛志辉

客服电话：4000-899-100

传真：0411-39027835

网址：[www.yibaijin.com](http://www.yibaijin.com)

（9）广源达信基金销售有限公司

注册地址：北京市西城区新街口外大街 28 号 C 座六层 605 室

法定代表人：齐剑辉

邮编：100088

联系人：杨家明

客服电话：400-616-7531

网址：<https://www.niuniufund.com>

（10）珠海盈米基金销售有限公司

注册地址：珠海市横琴新区环岛东路 3000 号 2719 室

法定代表人：肖雯

邮编：510308

联系人：王宇昕

客服电话：020-89629066

传真：020-89629011

网址：<https://www.yingmi.cn>

（11）济安财富（北京）基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区太阳宫中路16号院1号楼3层307

法定代表人：杨健

邮编：100028

联系人：李海燕

客服电话：010-65309516

传真：010-65330699

网址：[www.jianfortune.com](http://www.jianfortune.com)

（12）北京中植基金销售有限公司

注册地址：北京市北京经济技术开发区宏达北路10号五层5122室

法定代表人：武建华

联系人：孙玉

客服电话：400-8980-618

官方网站：[www.zzfund.com](http://www.zzfund.com)

（13）上海好买基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区东大名路501号6211单元

法定代表人：杨文斌

联系人：邬沁桐

客服电话：400-700-9665

官方网站：[www.howbuy.com](http://www.howbuy.com)

（14）蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

注册地址：浙江省杭州市余杭区五常街道文一西路969号3幢5层599室

法定代表人：王珺

客服电话：95188-8

官方网站：www.fund123.cn

管理人可根据有关法律、法规的要求，选择符合要求的机构代理销售本集合计划，并及时公告。

3、集合计划管理人可根据情况变化增加或者减少销售机构，并另行公告。销售机构可以根据情况增加或者减少其销售城市、网点。

#### （二）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：于文强

客户服务电话：4008-058-058

网址：<http://www.chinaclear.cn>

#### （三）律师事务所

名称：北京市中伦律师事务所

住所：北京市朝阳区金和东路 20 号院正大中心南塔 23-31 层

办公地址：北京市朝阳区金和东路 20 号院正大中心南塔 23-31 层

法定代表人：张学兵

联系电话：010-59572288

传真：010-65681022

联系人：李科峰

经办律师：唐周俊 李科峰

#### （四）审计集合计划财产的会计师事务所

名称：北京兴华会计师事务所（特殊普通合伙）

注册地址：北京市西城区裕民路 18 号 2206 房间

办公地址：北京市西城区裕民路 18 号 2206 房间

执行事务合伙人：张恩军

电话：010-82250666

传真：010-82250851

联系人：卜晓丽

经办注册会计师：吴亦忻、卜晓丽

## 六、集合计划的历史沿革

信达价值精选一年持有期灵活配置混合型集合资产管理计划由信达满堂红基金优选集合资产管理计划变更而来。

信达满堂红基金优选集合资产管理计划为非限定性集合资产管理计划，于2010年7月9日经中国证监会证件会公告证监许可[2010]946号文核准设立，自2010年8月16日起开始募集，于2010年9月15日结束募集工作，并于2010年9月21日成立。

根据《证券公司大集合资产管理业务适用<关于规范金融机构资产管理业务的指导意见>操作指引》，本集合计划参照《基金法》等公开募集证券投资基金相关法律、行政法规及中国证监会的规定进行变更，变更后的集合计划合同自集合计划管理人公告的生效之日起生效。

## 七、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，集合计划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，集合计划管理人应当在10个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他集合计划合并或者终止集合计划合同等，并在6个月内召开集合计划份额持有人大会进行表决。

本集合计划自本集合计划合同变更生效日起存续期不得超过3年。如本合同变更生效之日起3年后，不符合法律法规或中国证监会的要求而须终止本集合计划的，无须召开集合份额持有人大会。

法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。

## 八、集合计划份额的申购、赎回与转换

### （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集合计划管理人在招募说明书或其他相关公告中列明。集合计划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，开放日内具体办理申购、赎回的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，但集合计划管理人根据法律法规、中国证监会的要求或本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、期货交易市场、证券、期货交易所交易时间变更或其他特殊情况，集合计划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》的有关规定在指定媒介上公告。

#### 2、申购、赎回开始日及业务办理时间

集合计划管理人自本集合计划合同生效之日起不超过3个月开始办理B类计划份额的申购，申购开始日在申购开始公告中规定。

集合计划管理人自资产管理合同生效之日起不超过3个月开始办理A类计划份额赎回，具体业务办理时间在赎回开始公告中规定。

本集合计划每份B类份额设定最短持有期限，每份B类份额的最短持有期限为12个月。B类计划份额在最短持有期限到期后的下一个工作日起（含），B类计划份额持有人方可就该计划份额提出赎回申请。如果投资人多次申购本集合计划B类计划份额，则其持有的B类计划份额的赎回开放时间可能不同。由红利再投资而来的B类计划份额不受最短持有期限的限制。

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

集合计划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、赎回或者转换申请且登记机构确认接受的，其集合计划份额申购、赎回价格为下一开放日集合计划份额申购、赎回的价格。

### （三）申购与赎回的原则

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

2、“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

3、当日的申购与赎回申请可以在集合计划管理人规定的时间以内撤销；

4、赎回遵循“先进先出”原则，即按照投资人申购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。

集合计划管理人可在法律法规允许的情况下，对上述原则进行调整。集合计划管理人必须在新规则开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

### （四）申购与赎回的程序

#### 1、申购和赎回的申请方式

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

#### 2、申购和赎回的款项支付

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

集合计划份额持有人递交赎回申请，赎回成立；集合计划份额登记机构确认赎回时，赎回生效。投资者赎回申请生效后，集合计划管理人将指示集合计划托管人于T+7日(包括该日)内支付赎回款项。

如遇证券期货交易所或交易市场数据传输延迟、通讯系统故障、银行交换系统故障或其他非集合计划管理人及集合计划托管人所能控制的因素影响了业务流程，则赎回款项划付时间相应顺延至上述情形消除后的下一个工作日划往集合计划份额持有人银行账户。



在发生巨额赎回或集合计划合同载明的其他暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形时，款项的支付办法参照本合同有关条款处理。

### 3、申购和赎回申请的确认

集合计划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，本集合计划登记机构在T+1日内对该交易的有效性进行确认。T日提交的有效申请，投资人可在T+2日后(包括该日)到销售机构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（无利息）退还给投资人。

销售机构对申购和赎回申请的受理不代表申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到申请。申购和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，投资者应及时查询并妥善行使合法权利。因投资者怠于行使权利，致使其相关权益受损的，管理人、托管人、销售机构不承担由此造成的损失或不利后果。

#### （五）申购和赎回的数量限制

1、投资者办理本集合计划的申购及赎回业务时，首次申购最低申购金额均为1.00元，追加申购最低申购金额为1.00元。实际操作中，各销售机构在符合上述规定的前提下，可根据情况调高首次申购和追加申购的最低金额，具体以销售机构公布的为准，投资人需遵循销售机构的相关规定。

2、集合计划份额每次赎回申请均不得低于1.00份集合计划份额。集合计划份额持有人赎回时或赎回后保留的集合计划份额余额不足1.00份的，在赎回时需一次全部赎回。在符合法律法规规定的前提下，各销售机构对赎回份额限制有其他规定的，需同时遵循该销售机构的相关规定。

3、集合计划管理人可以规定投资者每个集合计划交易账户的最低集合计划份额余额，具体规定请参见招募说明书或相关公告。

4、单个投资人累计持有的集合计划份额不设上限。

5、当接受申购申请对存量集合计划份额持有人利益构成潜在重大不利影响时，集合计划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。集合计划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。具体见集合计划管理人相关公告。

6、集合计划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的数量限制。集合计划管理人必须在调整前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告并报中国证监会备案。

#### （六）申购费与赎回费

##### 1、申购费

本集合计划 A 类计划份额不开放申购。

本集合计划 B 类计划份额在投资者申购时收取申购费，申购费率随申购金额的增加而递减。开放期投资者可以多次申购本集合计划，申购费率按每笔申购申请单独计算。

B 类计划份额申购费率如下表：

申购金额（M，含申购费）	申购费率（%）
M < 100 万元	1.50%
100 万元 ≤ M < 300 万元	1.00%
300 万元 ≤ M < 500 万元	0.60%
M ≥ 500 万元	收取固定费用 1000 元/笔

申购费用由投资者承担，不列入集合计划财产，主要用于集合计划的市场推广、销售等集合计划募集期间发生的各项费用。

##### 2、赎回费

##### （1）A 类计划份额

本集合计划 A 类计划份额收取赎回费，赎回费率按集合计划份额持有期递减。具体赎回费率如下表所示：

持有时间（N）	赎回费率
N < 7 日	1.5%
7 日 ≤ N < 30 日	0.75%
30 日 ≤ N < 1 年	0.6%
1 年 ≤ N < 2 年	0.4%
2 年 ≤ N < 3 年	0.1%
N ≥ 3 年	0

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

注1：A类计划份额持有时间从登记机构确认投资者持有原信达满堂红基金优选集合资产管理计划份额之日起连续计算。

注2：1年按365日计算。

## （2）B类计划份额

本集合计划对B类计划份额设置一年最短持有期限，B类计划份额在一年最短持有期限后赎回不收取赎回费用。

3、集合计划管理人可以在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不利影响的情况下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》的有关规定在指定媒介上公告。

4、集合计划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集合计划份额持有人利益无实质不利影响的前提下根据市场情况制定集合计划促销计划，针对以特定交易方式（如网上交易、移动客户端交易）等进行集合计划交易的投资者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，集合计划管理人可以适当调低集合计划申购费率。

5、当发生大额申购或赎回情形时，集合计划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。

## （七）申购份额与赎回金额的计算方式

### 1、申购份额的计算

本集合计划B类计划份额申购的有效份额为申购金额除以当日的B类计划份额净值，有效份额单位为份，上述计算结果均按四舍五入，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。

(1) 当申购费用为比例费率时，B 类计划份额申购份额的计算方式如下：

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

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

$$\text{申购份额} = \text{净申购金额} / \text{T 日 B 类计划份额净值}$$

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。

例一：假定申购当日 B 类计划份额净值为 1.2000 元，某投资者申购金额为 10 万元，且该申购申请被全额确认，其对应申购费率为 1.5%，则其可得到的申购份额计算如下：

$$\text{净申购金额} = 100,000 / (1 + 1.5\%) = 98,522.17 \text{ 元}$$

$$\text{申购费用} = 100,000 - 98,522.17 = 1,477.83 \text{ 元}$$

$$\text{申购份额} = 98,522.17 / 1.2000 = 82,101.81 \text{ 份}$$

即投资者投资 100,000.00 元申购 B 类计划份额，假定申购当日 B 类计划份额净值为 1.2000 元，可获得 82,101.81 份 B 类计划份额。

(2) 当申购费用为固定金额时，B 类计划份额申购份额的计算方法如下：

$$\text{申购费用} = \text{固定金额}$$

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

$$\text{申购份额} = \text{净申购金额} / \text{T 日 B 类计划份额净值}$$

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。

例二：假定 T 日 B 类计划份额净值为 1.2000 元，某投资者申购金额为 500 万元，且该申购申请被全额确认，其对应申购费为 1000 元，则其可得到的申购份额计算如下：

$$\text{净申购金额} = 5,000,000 - 1,000 = 4,900,000 \text{ 元}$$

$$\text{申购费用} = 1,000 \text{ 元}$$

$$\text{申购份额} = 4,900,000 / 1.2000 = 4,083,333.33 \text{ 份}$$

即投资者投资 5,000,000.00 元申购 B 类计划份额，假定申购当日 B 类计划份额净值为 1.2000 元，可获得 4,083,333.33 份 B 类计划份额。

## 2、赎回金额的计算

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相应的费用和管理人业绩报酬(若有)，赎回金额单位为元。上述计算结果均按四舍五入，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。

赎回金额为赎回总额扣减赎回费用以及管理人业绩报酬(若有)，其中：

赎回总额=赎回份额×T 日该类集合计划份额净值

赎回费用=(赎回总额-管理人业绩报酬(若有))×赎回费率

赎回金额=赎回总额-赎回费用-管理人业绩报酬(若有)

例三：假定某投资者在 T 日赎回 10,000.00 份 A 类计划份额，持有期限 400 天，该日 A 类计划份额净值为 1.1000 元（推广期认购且期间未分红），对应的赎回费率是 0.3%，则其获得的赎回金额计算如下：

赎回总额=10,000.00×1.1000=11,000.00 元

份额持有期间年化收益率  $R=(1.1000-1.0000) \div 1.0000 \times (365/400)=9.13\%$ ，大于 A 类计划份额的业绩报酬计提基准年化收益率 8%，因此管理人收取业绩报酬

管理人业绩报酬=10,000.00×1.0000×[(1.1000-1.0000)÷1.0000×(365/400)-8%]×20%×(400/365)=24.66 元

赎回费用=(11,000.00-24.66)×0.4%=43.90 元

赎回金额=11,000.00 - 24.66 - 43.90 = 10,931.44 元

即投资者赎回 10,000 份 A 类计划份额，持有时间为 400 日，假设赎回申请当日 A 类计划份额净值是 1.1000 元，投资者推广期认购且期间未分红，则其可得到的赎回金额为 10,931.44 元。

例四：假定某投资者在 T 日赎回 10,000.00 份 B 类计划份额，持有期限 400 天，赎回申请该日 B 类计划份额净值为 1.1000 元，赎回份额对应的申购净值是 1.0200 元，且持有期间未发生分红，则其获得的赎回金额计算如下：

赎回总额=10,000.00×1.1000=11,000.00 元

份额持有期间年化收益率  $R=(1.1000-1.0200) \div 1.0200 \times (365/400)=7.16\%$ ，大于 B 类计划份额业绩报酬计提基准年化收益率 6%，因此管理人收取业绩报酬

管理人业绩报酬=10,000.00×1.0200×[(1.1000-1.0200)÷1.0200×(365/400)-6%]×20%×(400/365)=25.86 元

赎回金额=11,000.00 - 25.86 = 10,974.14 元

即投资者赎回 10,000 份 B 类计划份额，持有时间为 400 日，假设赎回申请当日 B 类计划份额净值是 1.1000 元，赎回份额对应的申购净值是 1.0200 元，且持有期间未发生分红，则其可得到的赎回金额为 10,974.64 元。

例五：假定某投资者在 T 日赎回 10,000.00 份 B 类计划份额，持有期限 400 天，赎回申请该日 B 类计划份额净值为 1.0500 元，赎回份额对应的申购净值是 1.0200 元，且持有期间未发生分红，则其获得的赎回金额计算如下：

赎回总额=10,000.00×1.0500=10,500.00 元

份额持有期间年化收益率  $R=(1.0500-1.0200) \div 1.0200 \times (365/400)=2.68\%$ ，小于 B 类计划份额业绩报酬计提基准年化收益率 6%，因此管理人不收取业绩报酬

赎回金额=10,500.00 元

即投资者赎回 10,000 份 B 类计划份额，持有时间为 400 日，假设赎回申请当日 B 类计划份额净值是 1.0500 元，赎回份额对应的申购净值是 1.0200 元，且持有期间未发生分红，则其可得到的赎回金额为 10,500.00 元。

### 3、集合计划份额净值的计算

本集合计划 A 类和 B 类份额分别设置代码，分别计算和公告各类集合计划份额净值和各类集合计划份额累计净值。

T 日的各类计划份额净值在当日收市后计算，在 T+1 日内公告。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。集合计划各类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，由此产生的误差计入集合计划财产。

#### （八）拒绝或暂停申购的情形

发生下列情况时，集合计划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工作。
- 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。
- 3、证券交易所交易时间非正常停市，导致集合计划管理人无法计算当日集合计划资产净值或无法办理申购业务。
- 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，使集合计划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，经与集合计划托管人协商确认后，集合计划管理人应当暂停接受集合计划申购申请。

7、集合计划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、集合计划管理人、集合计划托管人、销售机构或登记机构的异常情况导致集合计划销售系统、集合计划登记系统等无法正常运行。

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集合计划管理人决定暂停接受投资人申购申请时，集合计划管理人在规定期限内指定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项（无利息）将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，集合计划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，集合计划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、因不可抗力导致集合计划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。

3、证券交易所交易时间非正常停市，导致集合计划管理人无法计算当日集合计划资产净值或者无法办理赎回业务。

4、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。

5、继续接受赎回申请将损害现有集合计划份额持有人利益的情形。

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，经与集合计划托管人协商确认后，集合计划管理人应当延缓支付赎回款项或暂停接受集合计划赎回

申请。

#### 7、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一且集合计划管理人决定暂停赎回或延缓支付赎回款项时，集合计划管理人应在当日报中国证监会备案，已确认的赎回申请，集合计划管理人应足额支付；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。集合计划份额持有人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。在暂停赎回的情况消除时，集合计划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，集合计划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：当集合计划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：当集合计划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，集合计划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）如发生单个开放日内单个集合计划份额持有人申请赎回的集合计划份额超过前一开放日的集合计划总份额的 10%时，本集合计划管理人对该单个集合计划份额持有人持有的赎回申请实施延期办理。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。

（4）暂停赎回：连续 2 日以上(含本数)发生巨额赎回，如集合计划管理人认为有必要，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，并应当在指定媒介上进行公告。

### 3、巨额赎回的公告

当发生上述巨额赎回并延期办理时，集合计划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，并在 2 日内在指定媒介上刊登公告。

#### （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，集合计划管理人应在规定期限内指定媒介上刊登暂停公告。

2、如发生暂停的时间为 1 日，集合计划管理人应于重新开放日，在指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 个开放日的集合计划份额净值。

3、若暂停时间超过 1 日，则集合计划管理人可以根据暂停申购或赎回的时间，最迟于重新开放日在指定媒介上刊登重新开放申购或赎回的公告；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）集合计划转换

集合计划管理人可以根据相关法律法规以及本集合计划合同的规定决定开办本集合计划与集合计划管理人管理的其他集合计划之间的转换业务，集合计划转换可以收取一定的转换费，相关规则由集合计划管理人届时根据相关法律法规及本集合计划合同的规定制定并公告，并提前告知集合计划托管人与相关机构。

## （十三）集合计划的非交易过户

集合计划的非交易过户是指集合计划登记机构受理继承、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集合计划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集合计划登记机构的规定办理，并按集合计划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

集合计划管理人可以为投资人办理定期定额投资计划，具体规则由集合计划管理人另行规定。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集合计划管理人在相关公告或更新的招募说明书中所规定的定期定额投资计划最低申购金额。

## （十六）集合计划的冻结和解冻

集合计划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，集合计划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。集合计划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集合计划管理人公告的业务规则办理集合计划份额转让业务。

（十八）集合计划管理人可在法律法规允许的范围内，在不影响集合计划份额持有人实质利益的前提下，根据市场情况对上述申购和赎回的安排进行补充和调整并提前公告。

## 九、集合计划的投资

### （一）投资目标

在严格控制组合风险并保持良好流动性的前提下，通过专业化研究分析，力争实现集合计划资产的长期稳定增值。

### （二）投资范围

#### 1、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，包括中国境内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票，本集合计划不投资非公开发行股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券等）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、股指期货、现金等以及法律法规或中国证监会认可的其他投资品种（但须符合中国证监会相关规定）。本集合计划将根据法律法规的规定参与融资融券业务中的融资业务。

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。

集合计划的投资组合比例为：股票投资占集合计划资产的比例为 0%-95%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于集合计划资产净值的 5%，其中现金不包括结算

备付金、存出保证金和应收申购款等。

如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金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

本集合计划采用定性分析与定量分析相结合的分析框架，自上而下灵活配置大类资产，自下而上精选投资标的，在控制风险的前提下集中资金进行优质证券的投资管理，同时进行高效的流动性管理，力争获得超过业绩比较基准的收益。

#### 1、资产配置策略

采用定性分析与定量分析相结合的分析方法进行股票资产与债券资产配置。分析因素包括宏观经济运行状况、市场资金供求及流动性状况、股票与债券的相对投资价值、市场交易与投资者情绪及行为等，同时考虑各类资产的风险水平，在股票与债券等资产类别之间进行动态资产配置。力求实现资产的长期稳定增值，从而有效提高不同市场状况下集合计划的整体收益水平。

#### 2、股票市场投资策略

股票投资主要遵循“自下而上”的个股投资策略，利用管理人投资研究团队的资源，对企业内在价值进行深入细致的分析，挖掘出价格低估、质地优秀、成长性良好的上市公司股票进行投资。

管理人会根据公开信息和一些假设推理初筛重点研究的标的，围绕这些公司，研究团队将展开深入的研究和调研工作，包括产业链上下游、行业竞争对手和产业专家，以此来验证推理假设是否正确。管理人重点关注公司商业模式、未来几年的盈利、股价的估值水平。其中商业模式包括竞争态势、行业地位、竞争力、进入和退出壁垒、管理团队的品格和能力。

管理人将会持续跟踪一批优秀的公司，评估这些公司的内在价值，等待股价处于安全边际较大的情况下，择机买入持有。管理人将会持续比较重点跟踪标的的价格，比较各个投资标的的机会成本，力争选取确定性更大，获利空间更大的投资机会。

本集合计划投资股票时，根据市场整体估值水平评估系统性风险，根据个股估值水平（中证 800 指数的市净率 P/B）决定股票资产的投资比例。当中证 800 指数的市净率 P/B 位于历史 90 分位及以上时，股票总仓位为 0 至 40%；当中证 800 指数的市净率 P/B 位于历史 90 分位以下和历史 75 分位及以上时，股票总仓

位为 20%至 60%；当中证 800 指数的市净率 P/B 位于历史 75 分位以下和历史 25 分位以上时，股票总仓位为 35%至 80%；当中证 800 指数的市净率 P/B 位于历史 25 分位及以下时，股票总仓位为 50%至 95%。

### 3、债券的投资策略

本集合计划债券投资侧重于保持债券组合的高流动性，并通过市场时机选择、收益率曲线交易、信用风险配置等积极的投资策略提高债券组合的收益水平。主要投资策略及参考指标包括：

#### （1）流动性指标

债券流动性对资产组合管理有重大影响，流动性与资产组合风险负相关，其产生的交易成本会减少资产组合的回报。本集合计划选择流动性好、成交活跃的债券作为主要债券投资对象。

#### （2）委托年限

本集合计划债券投资组合持续期应控制在委托年限以内。根据管理者对市场利率走势的预期，可以对债券投资组合持续期进行主动调整：若预期利率上升，可以适度降低债券组合持续期；若预期利率下降，可以适度提高债券组合持续期。

#### （3）收益率曲线变化

在持续期确定的基础上，充分把握收益率曲线的非平行移动，选择哑铃型、子弹型等组合：当收益率曲线变平时，哑铃型组合表现较好；当收益率曲线变陡时，子弹型组合表现较好。

#### （4）信用风险配置

对国债、政策性金融债和高评级企业债等进行重点投资，严格控制低评级信用债的投资规模和持仓时间，严格控制债券投资的信用风险。当经济增长加快或复苏时，信用利差将缩窄，较低信用评级的债券受益，此时应降低资产组合的平均信用评级；当经济增长缓慢或衰退时，信用利差将扩大，较高信用评级的债券受益，此时应提高资产组合的平均信用评级。

### 4、可转换债券投资策略

本集合计划可转换债券资产投资策略为：选取平衡型的转债品种，要求发行企业基本面良好，同时通过对发行人转股意愿的分析，把握获利机会。在进行可转换债券投资时，首先以债性作为依托进行选择，利用对股票的判断选择可转换债券可以接受的转股溢价率。因为可转换债券具有的债性，可以有较好的抗跌性，

同时股价上涨和转股价下调会增加可转换债券的股性，使可转换债券有较好的收益。通过分析大股东转动力，选取转股价下修可能性大的标的进行投资。此外，为获得较高的超额收益，在把握行业周期性特征的同时选择具有明显行业竞争优势的龙头企业，重点关注和发掘这些企业发行的转债。

### 5、资产支持证券投资策略

本集合计划将选择相对价值低估的资产支持证券类属或个券进行投资，并通过期限和品种的分散投资降低组合投资资产支持证券的信用风险、提前偿付风险、利率风险和流动性风险等。同时，依靠纪律化的投资流程和一体化的风险预算机制控制并提高投资组合的风险调整收益。

### 6、股指期货投资策略

本集合计划投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，选择流动性好、交易活跃的期货合约，并根据对证券市场和期货市场运行趋势的研判，以及对股指期货合约的估值定价，与股票现货资产进行匹配，实现多头或空头的套期保值操作，由此获得股票组合产生的超额收益。本集合计划在运用股指期货时，将充分考虑股指期货的流动性及风险收益特征，对冲系统性风险以及特殊情况下的流动性风险，以改善投资组合的风险收益特性。

### 7、融资业务的投资策略

本集合计划将根据相关法律法规的规定参与融资业务。本集合计划参与融资业务，将综合考虑融资成本、保证金比例、冲抵保证金证券折算率、信用资质等条选择合适的交易对手方。同时，在保障集合计划投资组合充足流动性以及有效控制融资杠杆风险的前提下，确定融资比例。

#### （四）投资限制

##### 1、组合限制

集合计划的投资组合应遵循以下限制：

- （1） 本集合计划股票投资占集合计划资产的比例为 0%-95%；
- （2） 每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于集合计划资产净值的 5%，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）本集合计划管理人管理的全部大集合计划持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；

（5）本集合计划投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过集合计划资产净值的 10%；

（6）本集合计划持有的全部资产支持证券，其市值不得超过集合计划资产净值的 20%；

（7）本集合计划持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；

（8）本集合计划管理人管理的全部大集合计划投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；

（9）本集合计划应投资于信用级别评级为 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；

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

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

（12）本集合计划管理人管理的全部开放式大集合计划持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；本集合计划管理人管理的全部资产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%；

（13）本集合计划主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过该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集合计划管理人之外的因素致使集合计划不符合该比例限制的，集合计划管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

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

范围保持一致；

（15）本集合计划参与融资的，每个交易日日终，本集合计划持有的融资买入股票与其他有价证券市值之和，不得超过集合计划资产净值的 95%；

（16）本集合计划资产总值不超过集合计划资产净值的 140%；

（17）本集合计划参与股指期货交易需遵守下列规定：

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

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

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

4) 本集合计划在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日集合计划资产净值的 20%；

5) 本集合计划所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合集合计划合同关于股票投资比例的有关规定；

（18）法律法规及中国证监会规定的和《集合计划合同》约定的其他投资限制。

除上述（2）、（9）、（13）、（14）情形之外，因证券市场波动、上市公司合并、集合计划规模变动等集合计划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，集合计划管理人应当在 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。

集合计划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。集合计划托管人对集合计划的投资的监督与检查自本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，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，自动适用更新后的法律



法规或监管规定。

## 2、禁止行为

为维护集合计划份额持有人的合法权益，集合计划财产不得用于下列投资或者活动：

- （1）承销证券；
- （2）违反规定向他人贷款或者提供担保；
- （3）从事承担无限责任的投资；
- （4）向其集合计划管理人、集合计划托管人出资；
- （5）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；
- （6）买卖基金份额或其他集合计划份额，但中国证监会另有规定的除外；
- （7）法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

集合计划管理人运用集合计划财产买卖集合计划管理人、集合计划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集合计划托管人的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交集合计划管理人董事会审议。集合计划管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

法律法规或监管部门变更或取消上述限制，如适用于本集合计划，则本集合计划投资不再受相关限制，自动适用更新后的法律法规或监管规定，且不需要召开集合计划份额持有人大会。

### （五）业绩比较基准

本集合计划的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×50%+中债总财富指数收益率×50%

沪深 300 指数对股票市场具有较强的代表性，适合作为本集合计划股票部分的业绩比较基准。中债总财富指数能够反映债券市场总体走势，适合作为本集合计划固定收益部分的业绩比较基准。此外，本集合计划还参考预期的大类资产平均配置比例设置了业绩比较基准的权重。

如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适合用于本集合计划的业绩基准时，本集合计划经管理人和托管人协商一致，可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告，而无需召开集合计划份额持有人大会。

#### （六）风险收益特征

本集合计划为混合型集合资产管理计划，风险收益水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场型基金，属于中风险/收益的产品。

#### 七、集合计划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、集合计划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。

#### 八、基金投资组合报告

本集合计划管理人的董事会及董事保证所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

本集合计划的托管人——中国建设银行股份有限公司根据本集合计划合同规定复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截至 2022 年 6 月 30 日。

##### 1、报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	36,764,877.75	59.61
	其中：股票	36,764,877.75	59.61
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	7,071,444.94	11.46
	其中：债券	7,071,444.94	11.46
	资产支持证券	-	-

4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	12,502,857.00	20.27
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	4,484,153.80	7.27
8	其他资产	857,130.37	1.39
9	合计	61,680,463.86	100.00

## 2、报告期末按行业分类的股票投资组合

### (1) 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	2,542,420.00	4.38
B	采矿业	-	-
C	制造业	21,173,957.75	36.45
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	1,529,000.00	2.63
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,522,500.00	2.62
J	金融业	1,899,000.00	3.27
K	房地产业	7,896,100.00	13.59
L	租赁和商务服务业	201,900.00	0.35
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-

Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	36,764,877.75	63.29

(2) 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本集合计划本报告期末未持有港股通投资股票。

3、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明

细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600299	安迪苏	430,000	4,119,400.00	7.09
2	000002	万科A	200,000	4,100,000.00	7.06
3	000651	格力电器	120,000	4,046,400.00	6.97
4	688299	长阳科技	204,482	3,731,796.50	6.42
5	605007	五洲特纸	179,300	3,485,592.00	6.00
6	002714	牧原股份	46,000	2,542,420.00	4.38
7	000560	我爱我家	700,000	2,016,000.00	3.47
8	300575	中旗股份	95,550	1,930,110.00	3.32
9	600036	招商银行	45,000	1,899,000.00	3.27
10	601155	新城控股	70,000	1,780,100.00	3.06

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	3,057,147.95	5.26
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	4,014,296.99	6.91
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-

10	合计	7,071,444.94	12.17
----	----	--------------	-------

5、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量 (张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
1	019658	21国债10	30,000	3,057,147.95	5.26
2	132020	19蓝星EB	20,000	2,261,021.92	3.89
3	110063	鹰19转债	15,500	1,753,275.07	3.02

6、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本集合计划本报告期末未持有资产支持证券。

7、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本集合计划本报告期末未持有贵金属。

8、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本集合计划本报告期末未持有权证。

9、报告期末本集合计划投资的股指期货交易情况说明

(1) 报告期末本集合计划投资的股指期货持仓和损益明细

本集合计划本报告期末未持有股指期货。

(2) 本集合计划投资股指期货的投资政策

本集合计划投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，选择流动性好、交易活跃的期货合约，并根据对证券市场和期货市场运行趋势的研判，以及对股指期货合约的估值定价，与股票现货资产进行匹配，实现多头或空头的套期保值操作，由此获得股票组合产生的超额收益。本集合计划在运用股指期货时，将充分考虑股指期货的流动性及风险收益特征，对冲系统性风险以及特殊情况下的流动性风险，以改善投资组合的风险收益特性。

10、报告期末本集合计划投资的国债期货交易情况说明

(1) 本集合计划国债期货投资政策

国债期货不属于本集合计划的投资范围，故此项不适用。

(2) 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

国债期货不属于本集合计划的投资范围，故此项不适用。

(3) 本期国债期货投资评价

国债期货不属于本集合计划的投资范围，故此项不适用。

11、投资组合报告附注

(1) 本集合计划投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

否。

(2) 本集合计划投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

否。

(3) 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	40,312.47
2	应收证券清算款	816,718.05
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	99.85
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	857,130.37

(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
1	132020	19蓝星EB	2,261,021.92	3.89
2	110063	鹰19转债	1,753,275.07	3.02

(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本集合计划本报告期末未持有流通受限股票。

(6) 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能存在尾差。

## 十、集合计划的投资业绩

集合计划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基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。集合计划的过往业绩不代表未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本集合计划的招募说明书。

本集合计划合同生效日为于 2021 年 3 月 1 日，数据截止日期为 2022 年 6

月 30 日。

### 1、集合计划份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

信达价值精选 A 净值表现

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2021.03.01-2021.12.31	8.49%	0.51%	-0.74%	0.55%	9.23%	-0.04%
2022.01.01-2022.06.30	-3.29%	1.00%	-3.69%	0.73%	0.40%	0.27%
自基金合同生效起至今	4.92%	0.72%	-4.41%	0.62%	9.33%	0.10%

信达价值精选 B 净值表现

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2021.03.08-2021.12.31	8.53%	0.52%	-0.17%	0.54%	8.70%	-0.02%
2022.01.01-2022.06.30	-3.29%	1.00%	-3.69%	0.73%	0.40%	0.27%
自基金合同生效起至今	4.97%	0.73%	-3.86%	0.61%	8.83%	0.12%

注：信达价值精选 B 类份额实际起始日期为 2021 年 3 月 8 日。

### 2、自集合计划合同生效以来集合计划累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

信达价值精选A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2021年03月01日-2022年06月30日)



信达价值精选B累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2021年03月08日-2022年06月30日)



注：信达价值精选 B 类份额实际起始日期为 2021 年 3 月 8 日。

## 十一、集合计划的财产

### (一) 集合计划资产总值



集合计划资产总值是指购买的各类证券及票据价值、银行存款本息和集合计划应收的申购集合计划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

集合计划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集合计划管理人、集合计划托管人、集合计划销售机构和集合计划登记机构自有的财产账户以及其他集合计划财产账户相独立。

#### （四）集合计划财产的保管和处分

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

集合计划管理人、集合计划托管人因依法解散、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。集合计划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；集合计划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。

## 十二、集合计划资产估值

#### （一）估值日

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

#### （二）估值对象

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

#### （三）估值原则

集合计划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。

1、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。

与上述投资品种形同，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，集合计划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。

2、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。

3、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、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。交易所上市实行全价交易的债券（可转债除外），选取第三方估值机构提供的估值全价减去估值全价中所含的债券（税后）应收利息得到的净价进行估值；

（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；在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值；

（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、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

（1）送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的估值方法估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值；

（2）首次公开发行未上市的股票和债券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

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

3、对全国银行间市场上不含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值。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、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、本集合计划投资同业存单，采用估值日第三方估值机构提供的估值价格数据进行估值；选定的第三方估值机构未提供估值价格的，按成本估值。

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

8、如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，集合计划管理人可根据具体情况与集合计划托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

9、当发生大额申购或赎回情形时，集合计划管理人可以采用摆动定价机制，以确保集合计划估值的公平性。摆动定价机制的相关原理与操作方法应当遵守法律法规及行业自律规范，并在招募说明书更新或相关公告中列示。

10、相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

如集合计划管理人或集合计划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集合计划管理人承担。本集合计划的集合计划会计责任方由集合计划管理人担任，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見，按照集合计划管理人对集合计划资产净值的计算结果对外予以公布。

#### （五）估值程序

1、**各类**集合计划份额净值是按照每个工作日闭市后，**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。集合计划管理人可以设立大额赎回情形下的净值精度应急调整机制。国家另有规定的，从其规定。

集合计划管理人应每个工作日计算集合计划资产净值及**各类**集合计划份额净值，并按规定公告。

2、集合计划管理人应每个工作日对集合计划资产估值。但集合计划管理人根据法律法规或本合同的规定暂停估值时除外。集合计划管理人每个工作日对集合计划资产估值后，将集合计划份额净值结果发送集合计划托管人，经集合计划托管人复核无误后，由集合计划管理人对外公布。

#### （六）估值错误的处理

集合计划管理人和集合计划托管人将采取必要、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**任一**类集合计划份额净值小数点后4位以内（含第4位）发生估值错误时，视为集合计划份额净值错误。

本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，如果由于集合计划管理人或集合计划托管人、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。

（5）估值差错责任方拒绝进行赔偿时，如果因集合计划托管人原因造成集合计划财产损失时，集合计划管理人应为集合计划的利益向集合计划托管人追偿。除集合计划管理人和集合计划托管人之外的第三方造成集合计划资产的损失，并拒绝进行赔偿时，由集合计划管理人负责向差错责任方追偿。

（6）如果出现估值差错的当事人未按规定对受损方进行赔偿，并且依据法律、行政法规、《集合计划合同》或其他规定，集合计划管理人自行或依据法院判决、仲裁裁决对受损方承担了赔偿责任，则集合计划管理人有权向出现过错的当事人进行追索，并有权要求其赔偿或补偿由此发生的费用和遭受的损失。

（7）按法律法规规定的其他原则处理估值差错。

### 3、估值错误处理程序

估值错误被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

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

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

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

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

### 4、集合计划份额净值估值错误处理的方法如下：

(1) 集合计划份额净值计算出现错误时，集合计划管理人应当立即予以纠正，通报集合计划托管人，并采取合理的措施防止损失进一步扩大。

(2) 错误偏差达到**该类**集合计划份额净值的 0.25%时，集合计划管理人应当通报集合计划托管人并报中国证监会备案；错误偏差达到**该类**集合计划份额净值的 0.5%时，集合计划管理人应当公告，并报中国证监会备案。

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

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

②若管理人计算的各类集合计划份额净值已由托管人复核确认后公告，由此给集合计划份额持有人造成损失的，应根据法律法规的规定对投资者或集合计划支付赔偿金，就实际向投资者或集合计划支付的赔偿金额，管理人与托管人按照过错程度各自承担相应的责任。

③如管理人和托管人对各类集合计划份额净值的计算结果，虽然经过多次重新计算和核对，仍不能达成一致时，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，由管理人负责赔付。

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

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

#### (七) 暂停估值的情形

1、集合计划投资所涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

2、因不可抗力致使集合计划管理人、集合计划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，经与集合计划托管人协商确认后，集合计划管理人应当暂停估值；

4、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

用于集合计划信息披露的集合计划资产净值和各类集合计划份额净值由集合计划管理人负责计算，集合计划托管人负责进行复核。集合计划管理人应于每个开放日交易结束后计算当日的集合计划资产净值和各类集合计划份额净值并发送给集合计划托管人。集合计划托管人对净值计算结果复核确认后发送给集合计划管理人，由集合计划管理人对集合计划净值予以公布。

#### （九）特殊情形的处理

1、集合计划管理人或集合计划托管人按估值方法的第 7 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、由于证券、期货交易所及其登记结算公司发送的数据错误，或由于其他不可抗力原因，集合计划管理人和集合计划托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误的，由此造成的集合计划资产估值差错，集合计划管理人和集合计划托管人免除赔偿责任。但集合计划管理人、集合计划托管人应当积极采取必要的措施消除或减轻由此造成的影响。

## 十三、集合计划的收益分配

### （一）集合计划利润的构成

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

### （二）集合计划可供分配利润

集合计划可供分配利润指截至收益分配基准日集合计划未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。



### （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**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；

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

4、集合计划**同一类别**的每一集合计划份额享有同等分配权；

5、集合计划可供分配利润为正的情况下，方可进行收益分配；

6、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在不影响投资者利益的情况下，集合计划管理人可在法律法规允许的前提下酌情调整以上集合计划收益分配原则，此项调整不需要召开集合计划份额持有人大会，但应于变更实施日前在指定媒介和集合计划管理人网站公告。

### （四）收益分配方案

集合计划收益分配方案中应载明截止收益分配基准日的可供分配利润、集合计划收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。

### （五）收益分配方案的确定、公告与实施

本集合计划收益分配方案由集合计划管理人拟定，并由集合计划托管人复核，在2日内在指定媒介公告并报中国证监会备案。

集合计划红利发放日距离收益分配基准日（即可供分配利润计算截止日）的时间不得超过15个工作日。

### （六）集合计划收益分配中发生的费用

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

## 十四、集合计划的费用与税收

### （一）集合计划费用的种类

- 1、 集合计划管理人的管理费；
- 2、 集合计划托管人的托管费；
- 3、 业绩报酬
- 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；
- 6、 集合计划份额持有人大会费用；
- 7、 集合计划的证券、期货交易费用；
- 8、 集合计划的银行汇划费用；
- 9、 集合计划的开户费用和账户维护费用；
- 10、 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、集合计划管理人的管理费

本集合计划的管理费按前一日集合计划资产净值的 0.6%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.6\% \div \text{当年天数}$$

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

集合计划管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由管理人向托管人发送管理费划款指令，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集合计划管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

#### 2、集合计划托管人的托管费

本集合计划的托管费按前一日集合计划资产净值的 0.1%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$

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

集合计划托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由管理人向托管人发送托管费划款指令，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、业绩报酬

本集合计划采用逐笔计提法提取业绩报酬，在本集合计划委托人赎回确认日和计划终止日，管理人将根据委托人的期间年化收益率（R），对 A 类计划份额期间年化收益率超过 8% 以上部分按照 20% 的比例收取管理人业绩报酬（以下简称“业绩报酬”），对 B 类计划份额期间年化收益率超过 6% 以上部分按照 20% 的比例收取业绩报酬。因涉及相关数据，业绩报酬的计算和复核工作由管理人完成，相关信息以注册登记机构计算结果为准。托管人不承担复核责任。因法律法规、监管政策调整而需要修订业绩报酬计提基准和计提比例的，无需召开集合计划份额持有人大会。

#### （1）业绩报酬计提原则

①按委托人每笔申购份额分别计算期间年化收益率并计提业绩报酬。

②在符合业绩报酬计提条件时，在本集合计划委托人赎回确认日或计划终止日计提业绩报酬。

③在委托人赎回或计划终止时，业绩报酬按委托人赎回份额或计划终止时持有份额计算。如赎回份额为一笔申购份额的一部分，则将该赎回份额单独核算业绩报酬，而该笔申购的剩余部分不受影响。

#### （2）业绩报酬计提方法

业绩报酬计提基准日为本集合计划的赎回申请日和计划终止日。业绩报酬计提日为本集合计划委托人赎回确认日或计划终止日。业绩报酬的计提，以上一个发生业绩报酬计提的业绩报酬计提基准日（以下简称“上一个业绩报酬计提基准日”，如委托人该笔份额未发生业绩报酬计提，推广期认购的，以本集合计划成立日为上一个业绩报酬计提基准日，存续期内申购的，以申购当日为上一个业绩报酬计提基准日，下同）至本次业绩报酬计提基准日的期间为基准。委托人赎回时，按照“先进先出”法，分别计算每一笔申购份额应收的管理人业绩报酬。因取值精度原因，实际业绩报酬计提结果以注册登记机构计提结果为准。

## ①期间年化收益率计算

$$\text{期间年化收益率 } R = [(P_1 - P_0) \div P_0^x] \times (365 \div T)$$

$P_1$  = 委托人本次业绩报酬计提基准日的份额累计净值

$P_0$  = 委托人上一个业绩报酬计提基准日的份额累计净值

$P_0^x$  = 委托人上一个业绩报酬计提基准日的份额净值

$T$  = 委托人上一个业绩报酬计提日（含）到本次业绩报酬计提日（不含）的天数

## ②业绩报酬的计算方法

管理人根据期间年化收益率对 A 类计划份额收益超过 8% 以上部分按照 20% 的比例收取业绩报酬；对 B 类计划份额收益超过 6% 以上部分按照 20% 的比例收取业绩报酬。具体计算方式如下：

A 类计划份额期间 年化收益率	收取比例	业绩报酬计算公式
$R \leq 8\%$	0	$E=0$
$8\% < R$	20%	$E=N \times P_0^x \times (R-8\%) \times (T \div 365) \times 20\%$
B 类计划份额期间 年化收益率	收取比例	业绩报酬计算公式
$R \leq 6\%$	0	$E=0$
$6\% < R$	20%	$E=N \times P_0^x \times (R-6\%) \times (T \div 365) \times 20\%$

$E$  = 该笔申购对应的管理人业绩报酬

$N$  = 委托人该笔申购在上一个业绩报酬计提日的份额数

③将所有申购笔数的管理人业绩报酬加总，得到总的管理人业绩报酬（ $\Sigma E$ ）。

$$\Sigma E = E_1 + E_2 + E_3 + \dots + E_n$$

其中的  $n$  为所对应的申购笔数。

## （3）业绩报酬的支付

业绩报酬由管理人依据上述公式计算，在业绩报酬计提日从赎回款中计提，

由赎回款承担。管理人在计提当日向托管人发送业绩报酬计提金额，托管人据此从当日应付赎回款中计提应付管理人业绩报酬。若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延，业绩报酬以管理人提供的数据为准。业绩报酬由托管人根据管理人指令支付给管理人。

上述“一、集合计划费用的种类”中第4—10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，由集合计划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、集合计划管理人和集合计划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、集合计划管理人和集合计划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。

### （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，集合计划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。

## 十五、集合计划的会计与审计

### （一）集合计划会计政策

- 1、集合计划管理人为本集合计划的集合计划会计责任方；
- 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；集合计划首次募集的会计年度按如下原则：如果《集合计划合同》生效少于2个月，可以并入下一个会计年度；
- 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、集合计划管理人及集合计划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、集合计划托管人每月与集合计划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、集合计划管理人聘请与集合计划管理人、集合计划托管人相互独立的具有证券、期货从业资格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，应事先征得集合计划管理人同意。
- 3、集合计划管理人认为有充足理由更换会计师事务所，须通报集合计划托管人。更换会计师事务所需在 2 日内在指定媒介公告。

## 十六、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。相关法律法规关于信息披露的披露内容、披露方式、登载媒介、报备方式等规定发生变化时，本集合计划从其最新规定。

#### 二、信息披露义务人

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

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

本集合计划信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内，将应予披露的集合计划信息通过中国证监会指定的媒介和集合计划管理人、集合计划托管人的互联网网站（以下简称“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、诋毁其他集合计划管理人、集合计划托管人或者集合计划销售机构；
- 5、登载任何自然人、法人或者非法人组织的祝贺性、恭维性或推荐性的文字；
- 6、中国证监会禁止的其他行为。

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

本集合计划公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。

#### 五、公开披露的集合计划信息

公开披露的集合计划信息包括：

（一）集合计划招募说明书、《集合计划合同》、集合计划托管协议、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、集合计划招募说明书应当最大限度地披露影响集合计划投资者决策的全部事项，说明集合计划申购和赎回安排、集合计划投资、集合计划产品特性、风险揭示、信息披露及集合计划份额持有人服务等内容。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，集合计划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指定网站上；集合计划招募说明书其他信息发生变更的，集合计划管理人至少每年更新一次。集合计划终止运作的，集合计划管理人不再更新集合计划招募说明书。

3、集合计划托管协议是界定集合计划托管人和集合计划管理人在集合计划

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集合计划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，集合计划管理人应当在三个工作日内，更新集合计划产品资料概要，并登载在指定网站及集合计划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，集合计划管理人至少每年更新一次。集合计划终止运作的，集合计划管理人不再更新集合计划产品资料概要。

5、集合计划管理人应及时将集合计划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指定报刊上，将集合计划份额发售公告、集合计划招募说明书、集合计划产品资料概要、《集合计划合同》和集合计划托管协议登载在指定网站上，并将集合计划产品资料概要登载在集合计划销售机构网站或营业网点；集合计划托管人应当同时将集合计划合同、集合计划托管协议登载在网站上。

#### （二）集合计划生效公告

集合计划管理人应当在集合计划合同生效的次日在指定报刊和指定网站上登载集合计划合同生效公告。

#### （三）集合计划净值信息

资产管理合同生效后，在开始办理集合计划份额申购或者赎回前，集合计划管理人应当至少每周在指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，集合计划管理人应当在不晚于每个开放日的次日，通过指定网站、集合计划销售机构网站或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。

集合计划管理人应当在不晚于半年度和年度最后一日的次日，在指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

集合计划管理人应当在《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集合计划销售机构网站或营业网点查阅或者复制前述信息资料。

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



## 合计划季度报告

集合计划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，并将年度报告正文登载于指定网站上，并将年度报告提示性公告登载在指定报刊上。集合计划年度报告中的财务会计报告应当经过具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计。

集合计划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，将中期报告正文登载在指定网站上，并将中期报告提示性公告登载在指定报刊上。

集合计划管理人应当在每个季度结束之日起 15 个工作日内，编制完成集合计划季度报告，将季度报告正文登载在指定网站上，并将季度报告提示性公告登载在指定报刊上。

《集合计划合同》生效不足 2 个月的，集合计划管理人可以不编制当期季度报告、中期报告或者年度报告。

集合计划定期报告在公开披露的第 2 个工作日，分别报中国证监会和集合计划管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。报备应当采用电子文本或书面报告方式。

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，集合计划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。

集合计划管理人应当在集合计划年度报告和中期报告中披露集合计划组合资产情况及其流动性风险分析等。

集合计划管理人应当在集合计划年度报告、中期报告和季度报告等定期报告文件中披露业绩报酬收取情况，包括业绩报酬提取总金额、分层提取比例等的相关内容。

## （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，登载在指定报刊和指定网站上。

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、 延长集合计划合同期限；
- 4、 转换集合计划运作方式、集合计划合并；
- 5、 更换集合计划管理人、集合计划托管人、集合计划份额登记机构，集合计划改聘会计师事务所；
- 6、 集合计划管理人委托集合计划服务机构代为办理集合计划的份额登记、核算、估值等事项，集合计划托管人委托基金服务机构代为办理集合计划的核算、估值、复核等事项；
- 7、 集合计划管理人、集合计划托管人的法定名称、住所发生变更；
- 8、 集合计划管理人变更持有百分之五以上股权的股东、集合计划管理人的实际控制人变更；
- 9、 集合计划管理人高级管理人员、投资经理和集合计划托管人专门基金托管部门负责人发生变动；
- 10、 集合计划管理人的董事在最近 12 个月内变更超过百分之五十集合计划管理人、集合计划托管人专门基金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；
- 11、 涉及集合计划财产、集合计划管理业务、集合计划托管业务的诉讼或仲裁；
- 12、 集合计划管理人或其高级管理人员、投资经理因集合计划管理业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚，集合计划托管人或其专门基金托管部门负责人因集合计划托管业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚；
- 13、 集合计划管理人运用集合计划财产买卖集合计划管理人、集合计划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，中国证监会另有规定的情形除外；
- 14、 集合计划收益分配事项；

15、管理费、托管费、申购费、赎回费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；

16、任一**类**集合计划份额净值计价错误达集合计划份额净值百分之零点五；

17、本集合计划开始办理申购、赎回；

18、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；

19、本集合计划发生巨额赎回并延期办理；

20、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；

21、调整集合计划份额类别的设置；

22、集合计划管理人采用摆动定价机制进行估值；

23、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其他事项。

#### （七）澄清公告

在集合计划合同期限内，任何公共媒体中出现的或者在市场上流传的消息可能对集合计划份额价格产生误导性影响或者引起较大波动，以及可能损害集合计划份额持有人权益的，相关信息披露义务人知悉后应当立即对该消息进行公开澄清，并将有关情况立即报告中国证监会、集合计划上市交易的证券交易所。

#### （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）清算报告

集合计划合同终止的，集合计划管理人应当依法组织基金财产清算小组对集合计划财产进行清算并作出清算报告。清算报告应当经过具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计，并由律师事务所出具法律意见书。集合计划财产清算小组应当将清算报告登载在指定网站上，并将清算报告提示性公告登载在指定报刊上。

#### （十）投资资产支持证券相关公告

集合计划管理人应在集合计划年报及中期报告中披露其持有的资产支持证

券总额、资产支持证券市值占集合计划净资产的比例和报告期内所有的资产支持证券明细。

集合计划管理人应在集合计划季度报告中披露其持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占集合计划净资产的比例和报告期末按市值占集合计划净资产比例大小排序的前 10 名资产支持证券明细。

#### （十一）投资股指期货信息披露

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

#### （十二）中国证监会规定的其他信息。

### 六、信息披露事务管理

集合计划管理人、集合计划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。

集合计划管理人、集合计划托管人应加强对未公开披露集合计划信息的管控，并建立集合计划敏感信息知情人登记制度。集合计划管理人、集合计划托管人及相关从业人员不得泄露未公开披露的集合计划信息。

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。

集合计划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，对集合计划管理人编制的集合计划资产净值、集合计划份额净值、集合计划份额申购赎回对价、集合计划定期报告、更新的招募说明书、集合计划产品资料概要、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，并向集合计划管理人进行书面或电子确认。

集合计划管理人、集合计划托管人应当在指定媒介中选择一家披露本集合计划信息。集合计划管理人、集合计划托管人应当向中国证监会集合计划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。

为强化投资者保护，提升信息披露服务质量，集合计划管理人应当按照中国

证监会规定向投资者及时提供对其投资决策有重大影响的信息，集合计划销售机构应当按照中国证监会规定做好相关信息传递工作。

集合计划管理人、集合计划托管人除依法在指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指定媒介披露信息，并且在不同媒介上披露同一信息的内容应当一致。

集合计划管理人、集合计划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。

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 10 年。

#### 七、信息披露文件的存放与查阅

依法必须披露的信息发布后，集合计划管理人、集合计划托管人应当按照相关法律法规规定将信息置备于公司住所、集合计划上市交易的证券交易所，供社会公众查阅、复制。

#### 八、暂停或延迟信息披露的情形

当出现下述情况时，集合计划管理人和集合计划托管人可暂停或延迟披露本集合计划的相关信息：

（一）不可抗力或其他情形致集合计划管理人和集合计划托管人无法准确评估集合计划资产价值时；

（二）发生集合计划合同约定的暂停估值的情形；

（三）法律法规、集合计划合同或中国证监会规定的情况。

## 十七、风险揭示

（一）投资于本集合计划的主要风险

### 1、市场风险

市场风险是指投资品种的价格因受经济因素、政治因素、投资心理和交易制

度等各种因素影响而引起的波动，导致收益水平变化，产生风险。市场风险主要包括：

（1）政策风险

货币政策、财政政策、产业政策等国家宏观经济政策的变化对资本市场产生一定的影响，导致市场价格波动，影响集合资产管理计划的收益而产生风险。

（2）经济周期风险

经济运行具有周期性的特点，受其影响，集合资产管理计划的收益水平也会随之发生变化，从而产生风险。

（3）信用风险

集合计划在交易过程中发生交收违约，或者集合计划所投资债券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，或由于债券发行人信用质量降低导致债券价格下降，或者债券回购交易到期时交易对手方不能履行付款或结算义务等，造成集合计划资产损失的风险。

（4）利率风险。利率风险是指由于利率变动而导致的资产价格和资产利息的损益。利率波动会直接影响企业的融资成本和利润水平，导致证券市场的价格和收益率的变动，使集合资产管理计划收益水平随之发生变化，从而产生风险。

（5）债券市场流动性风险。由于银行间债券市场深度和宽度相对较低，交易相对较不活跃，可能增大银行间债券变现难度，从而影响集合计划资产变现能力的风险；

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

（7）上市公司经营风险。上市公司的经营状况受多种因素影响，如市场、技术、竞争、管理、财务等都会导致公司盈利状况发生变化。如集合资产管理计划所投资的上市公司经营不善，与其相关的证券价格可能下跌，或者能够用于分配的利润减少，从而使集合资产管理计划投资收益下降。

（8）衍生品风险：金融衍生产品具有杠杆效应且价格波动剧烈，会放大收益或损失，在某些情况下甚至会导致投资亏损高于初始投资金额。

（9）购买力风险：集合资产管理计划的利润将主要通过现金形式来分配，而现金可能因为通货膨胀的影响而导致购买力下降，从而使集合资产管理计划的

实际收益下降。

（10）再投资风险：固定收益品种获得的本息收入或者回购到期的资金，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收益率，从而对本计划产生再投资风险。

（11）新股价格波动风险。本集合计划可投资于新股申购，本集合计划所投资新股价格波动将对集合计划收益率产生影响；

（12）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

集合计划运作过程中由于集合计划投资策略、人为因素、管理系统设置不当造成操作失误或公司内部失控而可能产生的损失。管理风险包括：

（1）决策风险：指集合计划投资的投资策略制定、投资决策执行和投资绩效监督检查过程中，由于决策失误而给集合计划资产造成的可能的损失；

（2）操作风险：指集合计划投资决策执行中，由于投资指令不明晰、交易操作失误等人为因素而可能导致的损失；

（3）技术风险：是指公司管理信息系统设置不当等因素而可能造成的损失。

## 3、流动性风险

在集合计划赎回交易过程中，可能会发生巨额赎回的情形。巨额赎回可能会产生集合计划仓位调整的困难，导致流动性风险，甚至影响集合计划份额净值。

### （1）集合计划申购、赎回安排

投资人具体请参见集合计划合同“集合计划份额的申购与赎回”和本招募说明书“、集合计划份额的申购、赎回与转换”，详细了解本集合计划的申购以及

赎回安排。

在本集合计划发生流动性风险时，集合计划管理人可以综合利用备用的流动性风险管理工具以减少或应对集合计划的流动性风险，投资者可能面临赎回申请被暂停接受或延期办理、赎回款项被延缓支付、被收取短期赎回费、集合计划估值被暂停、集合计划采用摆动定价等风险。投资者应该了解自身的流动性偏好，并评估是否与本集合计划的流动性风险匹配。

### （2）拟投资市场、行业及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，包括中国境内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票，本集合计划不投资非公开发行股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券等）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、现金等以及法律法规或中国证监会认可的其他投资品种（但须符合中国证监会相关规定）。

一般情况下本集合计划拟投资的资产类别具有较好的流动性，但是在特殊市场环境下本集合计划仍有可能出现流动性不足的情形。本集合计划将严格控制投资于流动受限资产和不存在活跃市场需要采用估值技术确定公允价值的投资品种的比例。本集合计划管理人还将根据历史经验和现实条件，制定出现金持有量的上下限计划，在该限制范围内进行现金比例调控或现金与证券的转化。同时，本集合计划管理人会进行标的的分散化投资并结合对各类标的资产的预期流动性合理进行资产配置，以防范流动性风险。

### （3）巨额赎回情形下的流动性风险管理措施

根据《流动性风险管理规定》的相关规定，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，尽量避免或减少因发生流动性风险而导致的投资者损失。当集合计划发生巨额赎回时，集合计划管理人根据实际情况进行流动性评估，确认是否可以支付所有的赎回款项。当发现现金类资产不足以支付赎回款项时，集合计划管理人会在充分评估集合计划组合资产变现能力、投资比例变动与集合计划单位份额净值波动的基础上，审慎接受、确认赎回



申请。具体措施详见本招募说明书“集合计划份额的申购、赎回与转换”章节中“十、巨额赎回的认定及处理方式”的相关规定。

（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情形时，集合计划管理人将以保障投资者合法权益为前提，严格按照法律法规及资产管理合同的规定，审慎选取如下流动性风险管理工作作为辅助措施：

#### ①暂停接受赎回申请

投资人具体请参见招募说明书“第八部分、集合计划份额的申购与赎回”中的“八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形”和“九、巨额赎回的情形及处理方式”，详细了解本集合计划暂停接受赎回申请的情形及程序。

在此情形下，投资人的部分或全部赎回申请可能被拒绝，同时投资人完成集合计划赎回时的集合计划份额净值可能与其提交赎回申请时的集合计划份额净值不同。

#### ②延期办理巨额赎回申请

如果集合计划发生巨额赎回，在单个集合计划份额持有人赎回申请超过集合计划总份额 10%以上的情形下，集合计划管理人可以延期办理赎回申请。

在此情形下，投资人的部分赎回申请可能将被延期办理，同时投资人完成集合计划赎回时的集合计划份额净值可能与其提交赎回申请时的集合计划份额净值不同。

#### ③延缓支付赎回款项

投资人具体请参见集合计划合同“集合计划份额的申购与赎回”中的“八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形”和“九、巨额赎回的情形及处理方式”，详细了解本集合计划延缓支付赎回款项的情形及程序。

在此情形下，投资人接收赎回款项的时间将可能比一般正常情形下有所延迟。

#### ④暂停集合计划估值

投资人具体请参见集合计划合同“集合计划资产估值”中的“六、暂停估值的情形”，详细了解本集合计划暂停估值的情形及程序。

在此情形下，投资人没有可供参考的集合计划份额净值，同时赎回申请可能

被延期办理或被暂停接受，或被延缓支付赎回款项。

对于各类流动性风险管理工具的使用，集合计划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测评和评估，使用前经过内部审评程序并与集合计划托管人协商一致。

#### ⑤摆动定价

当本集合计划发生大申购或大额赎回情形时，集合计划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。当集合计划采用摆动定价时，投资者申购或赎回集合计划份额时的集合计划份额净值，将会根据投资组合的市场冲击成本而进行调整，使得市场的冲击成本能够分配给实际申购、赎回的投资者，从而减少对存量集合计划份额持有人利益的不利影响，确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待。

#### ⑥中国证监会认定的其他措施。

### 4、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。

### 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投资者的利益受到影响。这种技术风险可能来自集合计划管理公司、登记结算机构、销售机构、证券交易所、证券登记结算机构等。

根据证券交易资金前端风险控制相关业务规则，中登公司和交易所对交易参与人的证券交易资金进行前端额度控制，由于执行、调整、暂停该控制，或该控制出现异常等，可能影响交易的正常进行或者导致投资者人的利益受到影响。

### 6、政策变更风险

因相关法律法规或监管机构政策修改等集合计划管理人无法控制的因素的变化，使集合计划或投资者利益受到影响的风险，例如，监管机构集合计划估值

政策的修改导致集合计划估值方法的调整而引起集合计划净值波动的风险、相关法规的修改导致集合计划投资范围变化集合计划管理人为调整投资组合而引起集合计划净值波动的风险等。

## 7、其他风险

战争、自然灾害等不可抗力因素的出现，将会严重影响证券市场的运行，可能导致集合计划资产的损失。金融市场危机、行业竞争、代理机构违约等超出集合计划管理人自身直接控制能力之外的风险，可能导致集合计划或者集合计划份额持有人利益受损。

## 8、本集合计划特有的风险

（1）本集合计划股票资产占集合计划资产的比例范围为 0-95%，因此股票市场的变化将影响到集合计划业绩表现，集合计划净值表现因此可能受到影响。本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。

### （2）资产支持证券投资风险

1) 流动性风险：即证券的流动性下降从而给证券持有人带来损失（如证券不能卖出或贬值出售等）的可能性。

2) 证券提前赎回风险：若某些交易赋予 SPV 在资产支持证券发行后一定期限内以一定价格向投资者收购部分或全部证券的权利，则在市场条件许可的情况下，SPV 有可能行使这一权利从而使投资者受到不利影响。

3) 再投资风险：指证券因某种原因被提前清偿，投资者不得不将证券提前偿付资金再做其他投资时面临的再投资收益率低于证券收益率导致投资者不能实现其参与证券化交易所预计的投资收益目标的可能性。

4) SPV 违约风险：在以债务工具（债券、票据等）作为证券化交易载体，也即交易所发行的证券系债权凭证的情况下，SPV 系投资者的债务人，其应就证券的本息偿付对投资者负责。

### （3）投资股指期货的风险

1) 基差风险。标的股票指数价格与股指期货价格之间的价差被称为基差。在股指期货交易中因基差波动的不确定性而导致的风险被称为基差风险。

2) 合约品种差异造成的风险。合约品种差异造成的风险，是指类似的合约

品种，在相同因素的影响下，价格变动不同。表现为两种情况：1）价格变动的方向相反；2）价格变动的幅度不同。类似合约品种的价格，在相同因素作用下变动幅度上的差异，也构成了合约品种差异的风险。

3) 标的物风险。股指期货交易中，标的物风险是由于投资组合与股指期货的标的指数的结构不完全一致，导致投资组合特定风险无法完全锁定所带来的风险。

4) 衍生品模型风险。本基金在构建股指期货组合时，可能借助模型进行期货合约的选择。由于模型设计、资本市场的剧烈波动或不可抗力，按模型结果调整股指期货合约或者持仓比例也可能将给本基金的收益带来影响。

#### （4）投资科创板股票的风险

本基金可根据投资策略需要或市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于科创板股票或选择不将基金资产投资于科创板股票，基金资产并非必然投资于科创板股票。投资科创板股票存在的风险包括但不限于：

1) 退市风险：科创板退市制度较主板更为严格，退市时间更短，退市速度更快；退市情形更多，新增市值低于规定标准、上市公司信息披露或者运作存在重大缺陷导致退市的情形；执行标准更严，明显丧失持续经营能力，仅依赖与主业无关的贸易或者不具备商业实质的关联交易维持收入的上市公司可能会被退市；且不再设置暂停上市、恢复上市和重新上市环节，上市公司退市风险更大。

2) 市场风险：科创板股票集中来自新一代信息技术、高端装备、新材料、新能源、节能环保及生物医药等高新技术和战略新兴产业领域。大多数企业为初创型公司，企业未来盈利、现金流、估值均存在不确定性，与传统二级市场投资存在差异，整体投资难度加大，科创板股票市场风险加大。

3) 流动性风险：由于科创板股票投资门槛高，整体板块流动性可能弱于 A 股其他板块，且机构投资者可能在特定阶段对科创板个股形成一致性预期，将会造成较大的流动性风险。对于参与科创板新股网下申购中签的获配账户，将通过摇号抽签方式确定一定的比例进行锁定，锁定期间获配的股份无法进行交易，存在一定程度的流动性风险。

4) 投资集中的风险：科创板为新设板块，初期可投标的较少，投资者容易集中投资于少量个股，市场可能存在高集中度状况，整体存在集中度风险。

5) 系统性风险：因科创板上市企业均为科技创新成长型，其商业模式、盈利风险、业绩波动等特征较为相似，基本难以通过分散投资降低投资风险，若股票价格同向波动，将引起基金净值较大波动。

6) 股价波动风险：因科创板企业普遍具有技术新、前景不确定、业绩波动大、风险高等特征，市场可比公司较少，传统估值方法可能不适用，发行定价难度较大。科创板股票竞价交易设置较宽的涨跌幅限制。首次公开发行上市的科创板股票，上市后的前 5 个交易日不设涨跌幅限制，第 6 个交易日开始涨跌幅限制在正负 20%以内。因此，导致科创板股票上市后可能存在股价波动较大的风险。

7) 政策风险：国家对高新技术产业扶持力度的变化会对科创板企业带来较大影响，国际经济形势变化对战略新兴产业及科创板股票也会带来政策影响。

### **9、本集合计划法律文件风险收益特征表述与销售机构集合计划风险评价可能不一致的风险**

本集合计划法律文件投资章节有关风险收益特征的表述是基于投资范围、投资比例、证券市场普遍规律等做出的概述性描述，代表了一般市场情况下本集合计划的长期风险收益特征。销售机构(包括管理人代销机构和其他销售机构)根据相关法律法规对本集合计划进行风险评价，不同的销售机构采用的评价方法也不同，因此销售机构的风险等级评价与集合计划法律文件中风险收益特征的表述可能存在不同，投资人在购买本集合计划时需按照销售机构的要求完成风险承受能力与产品风险之间的匹配检验。

#### **(二) 声明**

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

2、除集合计划管理人直接办理本集合计划的销售外，本集合计划还通过代销机构销售，但是，本集合计划并不是代销机构的存款或负债，也没有经代销机构担保或者背书，代销机构并不能保证其收益或本金安全。

集合计划管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用集合计划资产，但不保证本集合计划一定盈利，也不保证最低收益。本集合计划的过往业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现。集合计划管理人提醒投资人集合计划投资的“买者自负”原则，在做出投资决策后，集合计划运营状况与集合计划净值

变化引致的投资风险，由投资人自行承担。

## 十八、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，由集合计划管理人和集合计划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，自决议生效后两日内在指定媒介公告。

### （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、集合计划管理人、集合计划托管人职责终止，在 6 个月内没有新集合计划管理人、新集合计划托管人承接的；
- 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，集合计划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集合计划管理人或临时集合计划管理人、集合计划托管人、具有从事证券、期货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具有证券、期货相关业务资格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。

#### （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集合计划托管人保存15年以上。

## 十九、集合计划合同的内容摘要

第一部分 集合计划份额持有人、集合计划管理人和集合计划托管人的权利、义

## 务

### 一、集合计划管理人

#### （一）集合计划管理人简况

名称：信达证券股份有限公司

住所：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼

法定代表人：祝瑞敏

设立日期：2007年9月4日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监机构字[2007]52号

组织形式：股份有限公司

注册资本：2,918,700,000元人民币

存续期限：持续经营

联系电话：010-63080940

#### （二）集合计划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，集合计划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、法规规定监督集合计划托管人，如认为集合计划托管人违反了《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）在集合计划托管人更换时，提名新的集合计划托管人；

（8）选择、更换集合计划销售机构，对集合计划销售机构的相关行为进行监督和处理；

（9）担任或委托其他符合条件的机构担任集合计划登记机构办理集合计划



登记业务并获得《集合计划合同》规定的费用；

（10）依据《集合计划合同》及有关法律的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；

（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）以集合计划管理人的名义，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，集合计划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发售、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集合计划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）依法接受集合计划托管人的监督；

（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资产净值，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、中期和年度集合计划报告；

（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集合计划托管人、集合计划份额持有人依法召集集合计划份额持有人大会；

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

（17）确保需要向集合计划投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出，并且保证投资者能够按照《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集合计划托管人；

（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）监督集合计划托管人按法律法规和《集合计划合同》规定履行自己的义务，集合计划托管人违反《集合计划合同》造成集合计划财产损失时，集合计

划管理人应为集合计划份额持有人利益向集合计划托管人追偿；

（22）当集合计划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）以集合计划管理人名义，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、集合计划托管人

### （一）集合计划托管人简况

名称：中国建设银行股份有限公司(简称：中国建设银行)

住所：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人：田国立

成立时间：2004 年 09 月 17 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

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]12 号

联系人：田青

联系电话：(010)67595096

### （二）集合计划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，集合计划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）监督集合计划管理人对本集合计划的投资运作，如发现集合计划管理

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）在集合计划管理人更换时，提名新的集合计划管理人；

（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，集合计划托管人的义务包括但不限于：

（1）以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管集合计划财产；

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

（3）建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，确保集合计划财产的安全，保证其托管的集合计划财产与集合计划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）保管由集合计划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，根据集合计划管理人的投资指令，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；

（8）复核、审查集合计划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，说明集合计划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；如果集合计划管理人有未执行《集合计划合同》规定的行为，还应当说明集合计划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 15 年以上；

（12）从集合计划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集合计划管理人核对；

（14）依据集合计划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》的规定监督集合计划管理人的投资运作；

（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监管机构，并通知集合计划管理人；

（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）按规定监督集合计划管理人按法律法规和《集合计划合同》规定履行自己的义务，集合计划管理人因违反《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集合计划管理人追偿；

（21）执行生效的集合计划份额持有人大会的决定；

（22）法律法规及中国证监会规定的和《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》取得的集合计划份额，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）监督集合计划管理人的投资运作；
- （8）对集合计划管理人、集合计划托管人、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》；
- （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定；

(8) 返还在集合计划交易过程中因任何原因获得的不当得利；

(9) 法律法规及中国证监会规定的和《集合计划合同》约定的其他义务。

## 第二部分 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。若将来法律法规对集合计划份额持有人大会另有规定的，以届时有效的法律法规为准。

本集合计划份额持有人大会未设日常机构，如今后设立集合计划份额持有人大会的日常机构，按照相关法律法规的要求执行。

### 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，法律法规、中国证监会或《集合计划合同》另有规定的除外：

(1) 终止《集合计划合同》，集合计划合同另有约定的除外；

(2) 更换集合计划管理人；

(3) 更换集合计划托管人；

(4) 转换集合计划运作方式；

(5) 调整集合计划管理人、集合计划托管人的报酬标准；

(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) 集合计划管理人或集合计划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（以集合计划管理人收到提议当日的集合计划份额计算，下同）就同一事项书面要求召开集合计划份额持有人大会；

(12) 对集合计划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他应当召开集合计划份额持有人大会的事项。

2、在法律法规规定和《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，以下情况可由集合计划管理人和集合计划托管人协商后修改，不需召开集合计划份额持有人大会：

(1) 法律法规要求增加的集合计划费用的收取；

(2) 在法律法规和《集合计划合同》规定的范围内调整本集合计划的申购费率、调低赎回费率或变更收费方式；

(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) 在法律法规和本集合计划合同规定的范围内，在对现有集合计划份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，集合计划管理人、登记机构、代销机构调整有关申购、赎回、转换、收益分配、非交易过户、转托管等业务的规则。

(6) 在不违反法律法规且对现有集合计划份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，集合计划推出新业务或服务。

(7) 集合计划管理人更换为本集合计划管理人独资或控股设立的子公司；

(8) 本集合计划因不符合法律法规或中国证监会的要求而须终止；

(9) 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集合计划管理人召集；

2、集合计划管理人未按规定召集或不能召开时，由集合计划托管人召集；

3、集合计划托管人认为有必要召开集合计划份额持有人大会的，应当向集合计划管理人提出书面提议。集合计划管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知集合计划托管人。集合计划管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；集合计划管理人决定不召集，集合计划



托管人仍认为有必要召开的，应当由集合计划托管人自行召集，并自出具书面决定之日起 60 日内召开并告知集合计划管理人，集合计划管理人应当配合。

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，应当向集合计划管理人提出书面提议。集合计划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集合计划托管人。集合计划管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；集合计划管理人决定不召集，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，应当向集合计划托管人提出书面提议。集合计划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集合计划管理人；集合计划托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开。并告知集合计划管理人，集合计划管理人应当配合。

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，而集合计划管理人、集合计划托管人都不召集的，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，集合计划管理人、集合计划托管人应当配合，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，在指定媒介公告。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、如召集人为集合计划管理人，还应另行书面通知集合计划托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为集合计划托管人，则应另行书面通知集合计划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，则应另行书面通知集合计划管理人和集合计划托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督。集合计划管理人或集合计划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，现场开会时集合计划管理人和集合计划托管人的授权代表应当列席集合计划份额持有人大会，集合计划管理人或集合计划托管人不派代表列席的，不影响表决效力。现场开会同时符合以下条件时，可以进行集合计划份额持有人大会议程：

(1) 亲自出席会议者持有集合计划份额的凭证、受托出席会议者出具的委托人持有集合计划份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、《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集合计划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。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集合计划托管人（如果集合计划托管人为召集人，则为集合计划管理人）到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。会议召集人在集合计划托管人（如果集合计划托管人为召集人，则为集合计划管理人）和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取集合计划份额持有人的书面表决意见；集合计划托管人或集合计划管理人经通知不参加收取书面表决意见的，不影响表决效力；

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

（4）上述第（3）项中直接出具书面意见的集合计划份额持有人或受托代表他人出具书面意见的代理人，同时提交的持有集合计划份额的凭证、受托出具书面意见的代理人出具的委托人持有集合计划份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、《集合计划合同》和会议通知的规定，并与集合计划登记注册机构记录相符；

（5）会议通知公布前报中国证监会备案。

3、在不与法律法规冲突的前提下，本集合计划亦可采用网络、电话、短信等其他非现场方式或者以非现场方式与现场方式结合的方式召开集合计划份额持有人大会，会议程序比照现场开会和通讯方式开会的程序进行。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授权他人代为出席会议并表决的，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》、更换集合计划管理人、更换集合计划托管人、与其他集合计划合并、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。大会主持人为集合计划管理人授权出席会议的代表，在集合计划管理人授权代表未能主持大会的情况下，由集合计划托管人授权其出席会议的代表主持；如果集合计划管理人授权代表和集合计划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。集合计划管理人和集合计划托管人拒不出席或主持集合计划份额持有人大会，不影响集合计划份额持有人大会作出的决议的效力。

会议召集人应当制作出席会议人员的签名册。签名册载明参加会议人员姓名

（或单位名称）、身份证明文件号码、持有或代表有表决权的集合计划份额、委托人姓名（或单位名称）和联系方式等事项。

## （2）通讯开会

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

## 六、表决

集合计划份额持有人所持每份集合计划份额有一票表决权。

集合计划份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

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

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

集合计划份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

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

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

在上述规则的前提下，具体规则以召集人发布的集合资产管理计划份额持有人大会通知为准。

## 七、计票

### 1、现场开会

（1）如大会由集合计划管理人或集合计划托管人召集，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集合计划管理人或集合计划托管人召集，但是集合计划管理人或集合计划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。集合计划管理人或集合计划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，集合计划管理人或集合计划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集合计划托管人授权代表（若由集合计划托管人召集，则为集合计划管理人授权代表）的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。集合计划管理人或集合计划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日内在指定媒介上公告。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。

集合计划管理人、集合计划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、集合计划管理人、集合计划托管人均有约束力。

九、本部分关于集合计划份额持有人大会召开事由、召开条件、议事程序、表决条件等规定，凡是直接引用法律法规或监管规则的部分，如将来法律法规或监管规则修改导致相关内容被取消或变更的，集合计划管理人经与集合计划托管人协商一致报监管机关并提前公告后，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。

### 第三部分 集合计划收益分配原则、执行方式

#### 一、集合计划利润的构成

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

#### 二、集合计划可供分配利润

集合计划可供分配利润指截至收益分配基准日集合计划未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

#### 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**集合计划份额进行再投资；本集合计划对集合计划持有人因申购产生的份额和红利再投资转化的份额，均设置一年的最短持有期限；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；

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

4、本集合计划**同一类别**的每一集合计划份额享有同等分配权；

5、集合计划可供分配利润为正的情况下，方可进行收益分配；

6、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在不影响投资者利益的情况下，集合计划管理人可在法律法规允许的前提下酌情调整以上集合计划收益分配原则，此项调整不需要召开集合计划份额持有人大会，但应于变更实施日前在指定媒介和集合计划管理人网站公告。

#### 四、收益分配方案

集合计划收益分配方案中应载明截止收益分配基准日的可供分配利润、集合计划收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。

#### 五、收益分配方案的确定、公告与实施

本集合计划收益分配方案由集合计划管理人拟定，并由集合计划托管人复核，在 2 日内在指定媒介公告。

集合计划红利发放日距离收益分配基准日（即可供分配利润计算截止日）的时间不得超过 15 个工作日。

#### 六、集合计划收益分配中发生的费用

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

### 第四部分 与集合计划财产管理、运用有关费用的提取、支付方式与比例

#### 一、集合计划费用的种类

- 1、集合计划管理人的管理费；
- 2、集合计划托管人的托管费；
- 3、业绩报酬
- 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；
- 6、集合计划份额持有人大会费用；
- 7、集合计划的证券、期货交易费用；
- 8、集合计划的银行汇划费用；
- 9、集合计划的开户费用和账户维护费用；
- 10、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、集合计划管理人的管理费

本集合计划的管理费按前一日集合计划资产净值的 0.6% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.6\% \div \text{当年天数}$$

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

集合计划管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由管理人向托管人发送管理费划款指令，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集合计划管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

### 2、集合计划托管人的托管费

本集合计划的托管费按前一日集合计划资产净值的 0.1% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$

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

集合计划托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由管理人向托管人发送托管费划款指令，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、业绩报酬

本集合计划采用逐笔计提法提取业绩报酬，在本集合计划委托人赎回确认日和计划终止日，管理人将根据委托人的期间年化收益率（R），对 A 类计划份额期间年化收益率超过 8% 以上部分按照 20% 的比例收取管理人业绩报酬（以下简称“业绩报酬”），对 B 类计划份额期间年化收益率超过 6% 以上部分按照 20% 的比例收取业绩报酬。因涉及相关数据，业绩报酬的计算和复核工作由管理人完成，相关信息以注册登记机构计算结果为准。托管人不承担复核责任。因法律法规、监管政策调整而需要修订业绩报酬计提基准和计提比例的，无需召开集合计划份额持有人大会。

### （1）业绩报酬计提原则

①按委托人每笔申购份额分别计算期间年化收益率并计提业绩报酬。

②在符合业绩报酬计提条件时，在本集合计划委托人赎回确认日或计划终止日计提业绩报酬。

③在委托人赎回或计划终止时，业绩报酬按委托人赎回份额或计划终止时持有份额计算。如赎回份额为一笔申购份额的一部分，则将该赎回份额单独核算业绩报酬，而该笔申购的剩余部分不受影响。

### （2）业绩报酬计提方法

业绩报酬计提基准日为本集合计划的赎回申请日和计划终止日。业绩报酬计提日为本集合计划委托人赎回确认日或计划终止日。业绩报酬的计提，以上一个发生业绩报酬计提的业绩报酬计提基准日（以下简称“上一个业绩报酬计提基准日”，如委托人该笔份额未发生业绩报酬计提，推广期认购的，以本集合计划成立日为上一个业绩报酬计提基准日，存续期内申购的，以申购当日为上一个业绩报酬计提基准日，下同）至本次业绩报酬计提基准日的期间为基准。委托人赎回时，按照“先进先出”法，分别计算每一笔申购份额应收的管理人业绩报酬。

#### ①期间年化收益率计算

$$\text{期间年化收益率 } R = [(P_1 - P_0) \div P_0^x] \times (365 \div T)$$

$P_1$  = 委托人本次业绩报酬计提基准日的份额累计净值

$P_0$  = 委托人上一个业绩报酬计提基准日的份额累计净值

$P_0^x$  = 委托人上一个业绩报酬计提基准日的份额净值

$T$  = 委托人上一个业绩报酬计提日（含）到本次业绩报酬计提日（不含）的天数

#### ②业绩报酬的计算方法

管理人根据期间年化收益率对 A 类计划份额期间年化收益率超过 8% 以上部分按照 20% 的比例收取业绩报酬；对 B 类计划份额期间年化收益率超过 6% 以上部分按照 20% 的比例收取业绩报酬。具体计算方式如下：

A 类计划份额期间 年化收益率	收取比例	业绩报酬计算公式
$R \leq 8\%$	0	$E=0$

$8\% < R$	20%	$E = N \times P_{0x} \times (R - 8\%) \times (T \div 365) \times 20\%$
B类计划份额期间 年化收益率	收取比例	业绩报酬计算公式
$R \leq 6\%$	0	$E = 0$
$6\% < R$	20%	$E = N \times P_0^x \times (R - 6\%) \times (T \div 365) \times 20\%$

$E =$  该笔申购对应的管理人业绩报酬

$N =$  委托人该笔申购在上一个业绩报酬计提日的份额数

③将所有申购笔数的管理人业绩报酬加总，得到总的管理人业绩报酬（ $\Sigma E$ ）。

$$\Sigma E = E_1 + E_2 + E_3 + \dots + E_n$$

其中的  $n$  为所对应的申购笔数。

### （3）业绩报酬的支付

业绩报酬由管理人依据上述公式计算，在业绩报酬计提日从赎回款中计提，由赎回款承担。管理人在计提当日向托管人发送业绩报酬计提金额，托管人据此从当日应付赎回款中计提应付管理人业绩报酬。若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延，业绩报酬以管理人提供的数据为准。业绩报酬由托管人根据管理人指令支付给管理人。上述“一、集合计划费用的种类”中第4—10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，由集合计划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、集合计划管理人和集合计划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、集合计划管理人和集合计划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。

#### 四、集合计划税收

本集合计划运作过程中涉及的各项纳税主体，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，集合计划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。

### 第五部分 集合计划财产的投资方向和投资限制

#### 一、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，包括中国境内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票，本集合计划不投资非公开发行股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券等）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、股指期货、现金等以及法律法规或中国证监会认可的其他投资品种（但须符合中国证监会相关规定）。本集合计划将根据法律法规的规定参与融资融券业务中的融资业务。

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。

集合计划的投资组合比例为：股票投资占集合计划资产的比例为0%-95%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于集合计划资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。

如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金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。

#### 二、投资限制

##### 1、组合限制

集合计划的投资组合应遵循以下限制：

- (1) 本集合计划股票投资占集合计划资产的比例为0%-95%；

(2) 每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于集合计划资产净值的 5%，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上市公司发行的证券，其市值不超过集合计划资产净值的 10%；

(4) 本集合计划管理人管理的全部大集合计划持有一家上市公司发行的证券，不超过该证券的 10%；

(5) 本集合计划投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过集合计划资产净值的 10%；

(6) 本集合计划持有的全部资产支持证券，其市值不得超过集合计划资产净值的 20%；

(7) 本集合计划持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；

(8) 本集合计划管理人管理的全部大集合计划投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；

(9) 本集合计划应投资于信用级别评级为 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；

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

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

(12) 本集合计划管理人管理的全部开放式大集合计划持有一家上市公司发行的可流通股股票，不得超过该上市公司可流通股股票的 15%；本集合计划管理人管理的全部资产组合持有一家上市公司发行的可流通股股票，不得超过该上市公司可流通股股票的 30%；

(13) 本集合计划主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过该集合

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集合计划管理人之外的因素致使集合计划不符合该比例限制的，集合计划管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

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

（15）本集合计划参与融资的，每个交易日日终，本集合计划持有的融资买入股票与其他有价证券市值之和，不得超过集合计划资产净值的 95%；

（16）本集合计划资产总值不超过集合计划资产净值的 140%；

（17）本集合计划参与股指期货交易需遵守下列规定：

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

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

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

4) 本集合计划在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日集合计划资产净值的 20%；

5) 本集合计划所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合集合计划合同关于股票投资比例的有关规定；

（18）法律法规及中国证监会规定的和《集合计划合同》约定的其他投资限制。

除上述（2）、（9）、（13）、（14）情形之外，因证券市场波动、上市公司合并、集合计划规模变动等集合计划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，集合计划管理人应当在 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。

集合计划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

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。集合计划托管人对集合计划的投资的监督与检查自本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，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，自动适用更新后的法律法规或监管规定。

## 2、禁止行为

为维护集合计划份额持有人的合法权益，集合计划财产不得用于下列投资或者活动：

- （1）承销证券；
- （2）违反规定向他人贷款或者提供担保；
- （3）从事承担无限责任的投资；
- （4）向其集合计划管理人、集合计划托管人出资；
- （5）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；
- （6）买卖其他基金份额，但中国证监会另有规定的除外；
- （7）法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

集合计划管理人运用集合计划财产买卖集合计划管理人、集合计划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集合计划托管人的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交集合计划管理人董事会审议。管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

法律法规或监管部门变更或取消上述限制，如适用于本集合计划，则本集合计划投资不再受相关限制，自动适用更新后的法律法规或监管规定，且不需要召开集合计划份额持有人大会。

## 第六部分 集合计划资产净值的计算方式和公告方式

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。

资产管理合同生效后，在开始办理集合计划份额申购或者赎回前，集合计划

管理人应当至少每周在指定网站披露一次**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，集合计划管理人应当在不晚于每个开放日的次日，通过指定网站、集合计划销售机构网站或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。

集合计划管理人应当在不晚于半年度和年度最后一日的次日，在指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。

## 第七部分 集合计划合同解除和终止的事由、程序以及集合计划财产清算方式

### 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，由集合计划管理人和集合计划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，自决议生效后两日内在指定媒介公告。

### 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、集合计划管理人、集合计划托管人职责终止，在 6 个月内没有新集合计划管理人、新集合计划托管人承接的；
- 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，集合计划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集合计划管



理人或临时集合计划管理人、集合计划托管人、具有从事证券、期货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具有证券、期货相关业务资格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。

#### 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集合计划托管人保存 15 年以上。

### 第八部分 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，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地在北京。

仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力，仲裁费用由败诉方承担。除争议所涉内容之外，本集合计划合同的其他部分应当由本集合计划合同当事人继续履行。争议处理期间，集合计划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》受中国法律管辖。

### 第九部分 集合计划合同存放地和投资者取得集合计划合同的方式

《集合计划合同》正本一式六份，除上报有关监管机构一式两份外，集合计划管理人持有三份，集合计划托管人持有一份，每份具有同等的法律效力。

《集合计划合同》可印制成册，供投资者在集合计划管理人、集合计划托管人、销售机构的办公场所和营业场所查阅。

## 二十、集合计划托管协议的内容摘要

### 一、托管协议当事人

#### （一）集合计划管理人

名称：信达证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

办公地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

邮政编码：100031

法定代表人：祝瑞敏

成立日期：2007年9月4日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监机构字[2007]52号

组织形式：股份有限公司

注册资本：2,918,700,000元人民币

存续期限：持续经营

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;代销金融产品;证券投资基金销售。(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。)

## （二）集合计划托管人

名称：中国建设银行股份有限公司(简称：中国建设银行)

住所：北京市西城区金融大街25号

办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼

法定代表人：田国立

成立时间：2004年09月17日

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

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]12号

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期、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；代理收付款项及代理保险业务；提供保管箱服务；经中国银行业监督管理机构等监管部门批准的其他业务。

## 二、集合计划托管人对集合计划管理人的业务监督和核查

（一）托管人根据有关法律法规的规定及《集合计划合同》的约定，对集合计划投资范围、投资比例进行监督。《集合计划合同》明确约定集合计划投资风格或证券选择标准的，管理人应按照托管人要求的格式提供投资品种池，以便托

管人运用相关技术系统，对集合计划实际投资是否符合《集合计划合同》关于证券选择标准的约定进行监督，对存在疑义的事项进行核查。

本集合计划的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括中国境内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票，本集合计划不投资非公开发行股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券等）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、股指期货、现金等以及法律法规或中国证监会认可的其他投资品种（但须符合中国证监会相关规定）。本集合计划将根据法律法规的规定参与融资融券业务中的融资业务。

本集合计划的投资组合比例为：股票投资占集合计划资产的比例为0%-95%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于集合计划资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。

如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金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。

（二）托管人根据有关法律法规的规定及《集合计划合同》的约定，对集合计划投资比例进行监督。托管人按下述比例和调整期限进行监督：

- （1） 本集合计划股票投资占集合计划资产的比例为0%-95%；
- （2） 每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于集合计划资产净值的5%，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） 本集合计划管理人管理且由本集合计划托管人托管的全部大集合计划持有一家公司发行的证券，不超过该证券的10%；
- （5） 本集合计划投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过集合计划资产净值的10%；

（6）本集合计划持有的全部资产支持证券，其市值不得超过集合计划资产净值的 20%；

（7）本集合计划持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；

（8）本集合计划管理人管理且由本集合计划托管人托管的全部大集合计划投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；

（9）本集合计划应投资于信用级别评级为 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；

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

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

（12）本集合计划管理人管理且由本集合计划托管人托管的全部开放式大集合计划持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；本集合计划管理人管理且由本集合计划托管人托管的全部资产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%；

（13）本集合计划主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过该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集合计划管理人之外的因素致使集合计划不符合该比例限制的，集合计划管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

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

（15）本集合计划参与融资的，每个交易日日终，本集合计划持有的融资买入股票与其他有价证券市值之和，不得超过集合计划资产净值的 95%；

(16) 本集合计划资产总值不超过集合计划资产净值的 140%；

(17) 本集合计划参与股指期货交易需遵守下列规定：

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

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

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

4) 本集合计划在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日集合计划资产净值的 20%；

5) 本集合计划所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合集合计划合同关于股票投资比例的有关规定；

(18) 法律法规及中国证监会规定的和《集合计划合同》约定的其他投资限制。

除上述（2）、（9）、（13）、（14）情形之外，因证券市场波动、上市公司合并、集合计划规模变动等集合计划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，集合计划管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。

管理人应当自集合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本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，自动适用更新后的法律法规或监管规定。

（三）托管人根据有关法律法规的规定及《集合计划合同》的约定，对本托管协议第十五条第九款集合计划投资禁止行为通过事后监督方式进行监督。

管理人运用集合计划财产买卖管理人、托管人及其控股股东、实际控制人或

者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合集合计划的投资目标和投资策略，遵循集合计划份额持有人利益优先的原则，防范利益冲突，相关交易必须事先得到托管人的同意，并履行信息披露义务。

（四）托管人根据有关法律法规的规定及《集合计划合同》的约定，对管理人参与银行间债券市场进行监督。管理人应在集合计划投资运作之前向托管人提供符合法律法规及行业标准的、经慎重选择的、本集合计划适用的银行间债券市场交易对手名单，并约定各交易对手所适用的交易结算方式。管理人应严格按照交易对手名单的范围在银行间债券市场选择交易对手。托管人监督管理人是否按事前提提供的银行间债券市场交易对手名单进行交易。管理人可以每半年对银行间债券市场交易对手名单及结算方式进行更新，新名单确定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。如管理人根据市场情况需要临时调整银行间债券市场交易对手名单及结算方式的，应向托管人说明理由，并在与交易对手发生交易前3个工作日内与托管人协商解决。

管理人负责对交易对手的资信控制，按银行间债券市场的交易规则进行交易，并负责解决因交易对手不履行合同而造成的纠纷及损失，托管人不承担由此造成的任何法律责任及损失。若未履约的交易对手在托管人与管理人确定的时间前仍未承担违约责任及其他相关法律责任的，管理人可以对相应损失先行予以承担，然后再向相关交易对手追偿。托管人则根据银行间债券市场成交单对合同履行情况进行监督。如托管人事后发现管理人没有按照事先约定的交易对手或交易方式进行交易时，托管人应及时提醒管理人，托管人不承担由此造成的任何损失和责任。

（五）托管人根据有关法律法规的规定及《集合计划合同》的约定，对集合计划财产净值计算、集合计划份额净值计算、应收资金到账、集合计划费用开支及收入确定、集合计划收益分配、相关信息披露、集合计划宣传推介材料中登载集合计划业绩表现数据等进行监督和核查。

（六）托管人发现管理人的上述事项及投资指令或实际投资运作违反法律法

规、《集合计划合同》和本托管协议的规定，应及时以电话提醒或书面提示等方式通知管理人限期纠正。管理人应积极配合和协助托管人的监督和核查。管理人收到书面通知后应在下一工作日前及时核对并以书面形式给托管人发出回函，就托管人的疑义进行解释或举证，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内，托管人有权随时对通知事项进行复查，督促管理人改正。管理人对托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，托管人应报告中国证监会。

（七）管理人有关义务配合和协助托管人依照法律法规、《集合计划合同》和本托管协议对集合计划业务执行核查。对托管人发出的书面提示，管理人应在规定时间内答复并改正，或就托管人的疑义进行解释或举证；对托管人按照法律法规、《集合计划合同》和本托管协议的要求需向中国证监会报送集合计划监督报告的事项，管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

（八）若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，由此造成的损失由管理人承担。

（九）托管人发现管理人有重大违规行为，应及时报告中国证监会，同时通知管理人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。管理人无正当理由，拒绝、阻挠对方根据本托管协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督，情节严重或经托管人提出警告仍不改正的，托管人应报告中国证监会。

### 三、集合计划管理人对集合计划托管人的业务核查

（一）管理人对托管人履行托管职责情况进行核查，核查事项包括托管人安全保管集合计划财产、开设集合计划财产的资金账户和证券账户、复核管理人计算的集合计划财产净值和集合计划份额净值、根据管理人指令办理清算交收、相关信息披露和监督集合计划投资运作等行为。

（二）管理人发现托管人擅自挪用集合计划财产、未对集合计划财产实行分账管理、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时，应及时以书面形式通知托管人限期纠正。托管人收到通知后应及时核对并以书面形式给管理人发出回函，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内，管理人有权随时对通知事项进行复查，督促托管人改正。托管人应积极配合管理人的核查行为，包括但不限于：提交相关资料以供管理人核查托管财产的完整性和真实性，在规定时间内答复管理人并改正。

（三）管理人发现托管人有重大违规行为，应及时报告中国证监会，同时通知托管人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。托管人无正当理由，拒绝、阻挠对方根据本协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督，情节严重或经管理人提出警告仍不改正的，管理人应报告中国证监会。

#### 四、集合计划财产的保管

##### （一）集合计划财产保管的原则

1. 集合计划财产应独立于管理人、托管人的固有财产。
2. 托管人应安全保管集合计划财产。
3. 托管人按照规定开设集合计划财产的资金账户和证券账户。
4. 托管人对所托管的不同集合计划财产分别设置账户，确保集合计划财产的完整与独立。
5. 托管人按照《集合计划合同》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。托管人未经管理人的指令，不得自行运用、处分、分配本集合计划的任何资产（不包含托管人依据中国证券登记结算有限责任公司结算数据完成场内交易交收、开户银行或交易/登记结算机构扣收交易费、结算费和账户维护费等费用）。
6. 对于因为集合计划投资产生的应收资产，应由管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知托管人，到账日集合计划财产没有到达集合计划账户的，托管人应及时通知管理人采取措施进行催收。由此给集合计划财产造成损失的，管理人应负责向有关当事人追偿集合计划财产的损失，托管人对此不承担任何责任。
7. 除依据法律法规和《集合计划合同》的规定外，托管人不得委托第三人托管集合计划财产。

##### （二）集合计划募集期间及募集资金的验资

1. 集合计划募集期间募集的资金应存于集合计划在中国证券登记结算有限责任公司开立的专门账户。

2. 集合计划募集期满或停止募集时，募集的集合计划份额总额、集合计划募集金额、集合计划份额持有人人数符合《基金法》、《运作办法》等有关规定后，管理人应将属于集合计划财产的全部资金划入托管人开立的集合计划银行账户，同时在规定时间内，聘请具有从事证券相关业务资格的会计师事务所进行验资，出具验资报告。出具的验资报告由参加验资的 2 名或 2 名以上中国注册会计师签字方为有效。

3. 若集合计划募集期限届满，未能达到《集合计划合同》生效的条件，由管理人按规定办理退款等事宜。

### （三）集合计划银行账户的开立和管理

1. 托管人可以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。本集合计划的银行预留印鉴由托管人保管和使用。

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。

3. 集合计划银行账户的开立和管理应符合银行业监督管理机构的有关规定。

4. 在符合法律法规规定的条件下，托管人可以通过托管人专用账户办理集合计划财产支付。

5. 管理人应于托管产品到期后及时完成收益兑付、费用结清及其他应收应付款项资金划转，在委托资产/投资者赎回款全部划出后的 10 个工作日内向托管人发出销户申请。

### （四）集合计划证券账户和结算备付金账户的开立和管理

1. 托管人在中国证券登记结算有限责任公司为集合计划开立托管人与集合计划联名的证券账户。

2. 集合计划证券账户的开立和使用，仅限于满足开展本集合计划业务的需要。托管人和管理人不得出借或未经对方同意擅自转让集合计划的任何证券账户，亦不得使用集合计划的任何账户进行本集合计划业务以外的活动。

3. 集合计划证券账户的开立和证券账户卡的保管由托管人负责，账户资产的

管理和运用由管理人负责。

证券账户开户费由管理人先行垫付，待托管产品启始运营后，管理人可向托管人发送划款指令，将代垫开户费从本集合计划托管资金账户中扣还管理人。

4. 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，并代表所托管的集合计划完成与中国证券登记结算有限责任公司的一级法人清算工作，管理人应予以积极协助。结算备付金、结算保证金、交收资金等的收取按照中国证券登记结算有限责任公司的规定以及管理人与托管人签署的《托管银行证券资金结算协议》执行。

5. 账户注销时，由管理人依据中国证券登记结算公司相关规定，委托有交易关系的证券公司负责办理。销户完成后，管理人需将相关证明提供至托管人。账户注销期间如需托管人提供配合的，托管人应予以配合。

6. 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本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，若无相关规定，则托管人比照上述关于账户开立、使用的规定执行。

#### **（五）债券托管专户的开设和管理**

《集合计划合同》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；托管人根据中国人民银行、银行间市场登记结算机构的有关规定，在银行间市场登记结算机构开立债券托管账户，持有人账户和资金结算账户，并代表集合计划进行银行间市场债券的结算。管理人和托管人共同代表集合计划签订全国银行间债券市场债券回购主协议。

#### **（六）其他账户的开立和管理**

1. 本集合计划在开始进行期货投资之前，应与托管人、期货公司三方一同就期货开户、清算、估值、交收等事宜另行签署《期货投资托管操作三方备忘录》。

2. 在本托管协议订立日之后，本集合计划被允许从事符合法律法规规定和《集合计划合同》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《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。

3. 法律法规等有关规定对相关账户的开立和管理另有规定的，从其规定办理。

### （七）集合计划财产投资的有关有价凭证等的保管

集合计划财产投资的有关实物证券、银行存款开户证实书等有价凭证由托管人存放于托管人的保管库，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/北京分公司、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，保管凭证由托管人持有。实物证券、银行定期存款证实书等有价凭证的购买和转让，按管理人和托管人双方约定办理。托管人对由托管人以外机构实际有效控制或保管的资产不承担任何责任。

### （八）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、与集合计划财产有关的重大合同的原件分别由管理人、托管人保管。除本协议另有规定外，管理人代表集合计划签署的与集合计划财产有关的重大合同包括但不限于集合计划年度审计合同、集合计划信息披露协议及集合计划投资业务中产生的重大合同，管理人应保证管理人和托管人至少各持有一份正本的原件。管理人应在重大合同签署后及时以加密方式将重大合同传真给托管人，并在三十个工作日内将正本送达托管人处。重大合同的保管期限为《集合计划合同》终止后 15 年。

## 五、集合计划资产净值计算与复核

### （一）集合计划资产净值的计算、复核与完成的时间及程序

1. 集合计划财产净值是指集合计划财产总值减去负债后的金额。集合计划份额净值是按照每个交易日闭市后，集合计划财产净值除以当日集合计划份额的余额数量计算，精确到 0.0001 元，小数点后第五位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

每个交易日计算集合计划财产净值及集合计划份额净值，并按《集合计划合同》约定的频率进行公告。

2. 管理人应每交易日对集合计划财产估值。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。管理人每个交易日对集合计划财产估值后，将集合计划份额净值结果发送托管人，经托管人复核无误后，由管理人对外公布。

### （二）集合计划资产的估值

集合计划管理人及集合计划托管人应当按照《集合计划合同》的约定进行估

值。

### （三）集合计划份额净值错误的处理方式

集合计划管理人及集合计划托管人应当按照《集合计划合同》的约定处理份额净值错误。

### （四）暂停估值与公告集合计划份额净值的情形

1. 集合计划投资所涉及的证券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财产价值时；

3. 当前一估值日集合计划财产净值 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，经与托管人协商一致的；

4. 占集合计划相当比例的投资品种的估值出现重大转变，而管理人为保障投资人的利益，已决定延迟估值；如果出现管理人认为属于紧急事故的任何情况，导致管理人不能出售或评估集合计划财产时；

5. 中国证监会和《集合计划合同》认定的其他情形。

### （五）集合计划会计制度

按国家有关部门规定的会计制度执行。

### （六）集合计划账册的建立

管理人进行集合计划会计核算并编制集合计划财务会计报告。管理人独立地设置、记录和保管本集合计划的全套账册。若管理人和托管人对会计处理方法存在分歧，应以管理人的处理方法为准。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财产净值的计算和公告的，以管理人的账册为准。

### （七）集合计划财务报表与报告的编制和复核

#### 1. 财务报表的编制

集合计划财务报表由管理人编制，托管人复核。

#### 2. 报表复核

托管人在收到管理人编制的集合计划财务报表后，进行独立的复核。核对不符时，应及时通知管理人共同查出原因，进行调整，直至双方数据完全一致。

#### 3. 财务报表的编制与复核时间安排

##### （1）报表的编制

管理人应当在每月结束后 5 个工作日内完成月度报表的编制；在每个季度结束之日起 15 个工作日内完成集合计划季度报告的编制；在上半年结束之日起 2 个月内完成集合计划中期报告的编制；在每年结束之日起 3 个月内完成集合计划年度报告的编制。集合计划年度报告的财务会计报告应当经过审计。《集合计划合同》生效不足两个月的，管理人可以不编制当期季度报告、中期报告或者年度报告。

#### (2) 报表的复核

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。

管理人应留足充分的时间，便于托管人复核相关报表及报告。

(八) 管理人应在编制季度报告、中期报告或者年度报告之前及时向托管人提供集合计划业绩比较基准的基础数据和编制结果。

### 六、集合计划份额持有人名册的保管

集合计划份额持有人名册至少应包括集合计划份额持有人的名称、证件号码和持有的集合计划份额。集合计划份额持有人名册由集合计划登记机构根据集合计划管理人的指令编制和保管，集合计划管理人和集合计划托管人应分别保管集合计划份额持有人名册，保存期不少于 15 年。如不能妥善保管，则按相关法律法规承担责任。

在集合计划托管人要求或编制半年报和年报前，集合计划管理人应将有关资料送交集合计划托管人，不得无故拒绝或延误提供，并保证其的真实性、准确性和完整性。集合计划管理人和集合计划托管人不得将所保管的集合计划份额持有人名册用于集合计划托管业务以外的其他用途，并应遵守保密义务。

### 七、争议解决方式

因本协议产生或与之相关的争议，双方当事人应通过协商、调解解决，协商、调解不能解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，仲裁地点为北京市，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

争议处理期间，双方当事人应恪守管理人和托管人职责，各自继续忠实、勤勉、尽责地履行《集合计划合同》和本托管协议规定的义务，维护集合计划份额持有人的合法权益。

本协议受中国法律管辖。

## 二十一、对集合计划份额持有人的服务

对本集合计划份额持有人的服务主要由集合计划管理人和销售机构提供。

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

### （一）资料发送

#### 1、集合计划交易对账单

集合计划管理人根据持有人账单订制情况向账单期内发生交易或账单期末仍持有本公司集合计划份额的集合计划份额持有人定期或不定期发送对账单，但由于集合计划份额持有人在本公司未详实填写或更新客户资料（含姓名、手机号码、电子邮箱、邮寄地址、邮政编码等）导致集合计划管理人无法送出的除外。

#### 2、其他相关的信息资料

指随集合计划交易对账单不定期发送的集合计划资讯材料，如集合计划新产品或新服务的相关材料、客户服务问答等。

### （二）电子邮件及短信服务

投资者在申请开立集合计划账户时如预留准确的电子邮箱地址、手机号码，将不定期通过邮件、短信形式获得市场资讯、产品信息、公司动态等服务提示。

### （三）呼叫中心

提供呼叫中心服务，人工电话服务时间为每个交易日 8：30~17：00。客户服务电话：95321

### （四）在线服务

通过本公司网站，投资者可获得如下服务：

#### 1、查询服务

投资者可登录本公司网站查询集合计划账户情况、更改个人信息、订制个性

化服务。

## 2、在线客服

投资者可点击本公司网站“在线客服”，进行咨询。每个交易日在线客服人工服务时间为 8：30~17：00。

## 3、资讯服务

投资者可通过本公司网站获取集合计划和集合计划管理人各类信息，包括集合计划法律文件、集合计划管理人最新动态、热点问题等。

公司网址：[www.cindasc.com](http://www.cindasc.com)

## （五）客户投诉和建议处理

投资者可以通过集合计划管理人提供的呼叫中心人工电话、在线客服、书信、电子邮件、传真等渠道对集合计划管理人和销售机构所提供的服务进行投诉或提出建议。投资者还可以通过代销机构的服务电话对该代销机构提供的服务进行投诉或提出建议。

## 二十二、其他应披露事项

1、本集合计划管理人、托管人目前无重大诉讼事项。

2、其他重要公告事项：

公告事项	披露日期
信达证券股份有限公司基金行业高级管理人员变更公告	2021年8月20日
信达证券股份有限公司关于信达价值精选一年持有期灵活配置混合型集合资产管理计划增加上海好买基金销售有限公司为代销机构的公告	2021年12月30日
信达证券股份有限公司关于旗下参照公募基金运作的大集合资产管理计划执行新金融工具相关会计准则的公告	2022年1月5日
信达证券股份有限公司关于信达价值精选一年持有期灵活配置混合型集合资产管理计划增加北京中植基金销售有限公司为代销机构的公告	2022年3月23日
信达证券股份有限公司关于旗下参照公募基金运作的大集合资产管理计划产品风险等级划分结果的公告	2022年3月30日
信达证券股份有限公司关于旗下参照公募基金运作的大集	2022年3月31日



合资产管理计划 2021 年年度报告提示性公告	
关于信达证券股份有限公司旗下参照公募基金运作的大集合资产管理计划新增蚂蚁(杭州)基金销售有限公司为销售机构的公告	2022 年 4 月 11 日
信达证券股份有限公司资产管理业务分管领导变更公告	2022 年 4 月 20 日
信达证券股份有限公司关于旗下参照公募基金运作的大集合资产管理计划 2022 年第一季度报告的提示性公告	2022 年 4 月 22 日
信达证券股份有限公司关于终止北京植信基金销售有限公司办理相关销售业务的公告	2022 年 5 月 13 日
信达证券股份有限公司关于旗下参照公募基金运作的大集合资产管理计划产品风险等级划分结果的公告的更正公告	2022 年 7 月 7 日
信达证券股份有限公司关于旗下参照公募基金运作的大集合资产管理计划产品风险等级划分结果(2022 年二季度)的公告	2022 年 7 月 8 日
信达证券股份有限公司关于旗下参照公募基金运作的大集合资产管理计划 2022 年第二季度报告的提示性公告	2022 年 7 月 21 日

## 二十三、招募说明书存放及查阅方式

本集合计划招募说明书公布后，分别置备于集合计划管理人、集合计划托管人和集合计划代销机构的住所，投资者可免费查阅。投资者在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复印件。

## 二十四、备查文件

### （一）备查文件目录

1、中国证监会准予注册信达价值精选一年持有期灵活配置混合型集合资产管理计划的文件。

2、《信达价值精选一年持有期灵活配置混合型集合资产管理计划资产管理合同》。

3、《信达价值精选一年持有期灵活配置混合型集合资产管理计划托管协议》。

- 4、法律意见书。
- 5、集合计划管理人业务资格批件、营业执照。
- 6、集合计划托管人业务资格批件、营业执照。

（二）存放地点

备查文件存放于集合计划管理人和/或集合计划托管人处。

（三）查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅备查文件。在支付工本费后，可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

信达证券股份有限公司

2022年8月